

撰写人: 许方莉 从业资格号: F3073708 投资咨询从业证书号: Z0017638

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	菜粕01合约收盘价(日, 元/吨)	2,688.00	-79.00↓	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	10,554.00	-529.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	589.00	+25.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	409.00	-69.00↓
	菜粕持仓量(日, 手)	225,219.00	+8014.00↑	菜油持仓量(日, 手)	117,517.00	-3145.00↓
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	10,104.00	-6891.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-13,544.00	-3356.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	1,828.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	219.00	+219.00↑
	ICE油菜籽7月合约收盘价(加元/吨)	828.60	-18.20↓	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,344.00	-146.00↓
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,420.00	-50.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	11,280.00	-750.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,398.98	-178.34↓	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	12,216.99	-1873.85↓
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,900.00	0.00	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.30	-0.17↓
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	732.00	+29.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	726.00	-221.00↓
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	9,500.00	-550.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,780.00	-200.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	9,390.00	-630.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,890.00	-120.00↓
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	3,980.00	-40.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	560.00	+10.00↑
上游情况	加拿大油菜籽产量预估(月, 万吨)	2,000.00	0.00	我国油菜籽产量预估(月, 万吨)	1,470.00	0.00
	油菜籽进口量(月, 万吨)	13.03	+5.14↑	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-298.00	-132.00↓
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	15.20	-3.40↓	进口油菜籽开机率(周, %)	4.07	-11.31↓
产业情况	颗粒菜粕进口量(月, 万吨)	24.23	+5.24↑	菜籽油进口量(月, 万吨)	12.00	+5.00↑
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	11.00	-0.40↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	19.00	+0.86↑
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	5.44	-0.65↓	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	0.9	-0.26↓
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	25.50	-2.08↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.55	-0.25↓
	菜粕提货量(周, 万吨)	1.03	+1.07↑	菜油提货量(周, 万吨)	0.02	-0.49↓
下游情况	水产饲料产量(月, 吨)	252.00	+62.00↑	餐饮收入(月, 亿元)	3,012.30	+403.40↑
	饲料总产量(月, 吨)	2,352.00	+103.00↑	食用植物油产量(月, 万吨)	406.10	+46.70↑
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	30.09		菜粕平值看跌期权波动率(%)	34.52	
	标的20日历史波动率(%)	62.65	-1.95↓	标的60日历史波动率(%)	44.83	+0.11↑
行业消息	1、周二洲际交易所(ICE)加拿大油菜籽期货市场收盘大幅下跌,其中基准期约收低2.15%,因为商品市场及金融市场上风险厌恶情绪占据上风,令油菜籽价格承压。截至收盘,11月期约收低18.20加元,报收828.60加元/吨;1月期约收低17.40加元,报收836.40加元/吨;3月期约收低16.70加元,报收843.90加元/吨。 2、				 <p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结 菜粕	加拿大统计局发布的最新报告显示,2022年加拿大油菜籽播种面积为2140万英亩,高于原先预测的2090万英亩,也高于分析师预估的2130万英亩,同时,预报显示7月初加拿大大草原天气条件有利,加籽再度承压。且金融市场仍承受美国加息及全球经济衰退预期的压力。国内方面,进口菜籽压榨再度减少,菜粕库存小幅回落,不过下游采购仍不积极,库存水平仍然处于同期高位,且国内大豆短期供应充足,油厂开机率尚可,豆粕库存持续增加,蛋白粕整体库存压力加大。盘面来看,受全球经济衰退担忧打压,菜粕早盘大幅下挫,不过午后空头止盈离场推动期价有所反弹,近期波动较大。整体仍处于空头趋势,注意控制节奏。				 <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结 菜油	加拿大统计局发布的最新报告显示,2022年加拿大油菜籽播种面积为2140万英亩,高于原先预测的2090万英亩,也高于分析师预估的2130万英亩,同时,预报显示7月初加拿大大草原天气条件有利,加籽再度承压。同时,印尼为加速棕榈油出口,宣布自7月1日起,将企业的最高出口配额从国内销售量的五倍提高到七倍,库存压力正在重塑远期全球油脂市场的供需格局,继续施压油脂市场。另外,金融市场仍承受美国加息及全球经济衰退预期的压力。国内市场方面,疫情影响下,菜油需求明显弱于往年同期,且国内菜籽上市导致菜油价格受到一定压制。但是今年国内新籽收购价格高昂,且油厂开机率持续处于最低水平,菜油产出有限,而下游提货情况尚可,沿海地区菜油库存继续下降,库存压力较小。盘面来看,在外盘持续偏弱影响下,菜油一度跌停,不过午后空头止盈推动期价有所反弹,近期盘面波动较大,整体市场氛围仍然较弱,暂且观望。					
重点关注	周一我的农产品网油菜籽开机率及各地区菜油粕库存量					