

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)	2,625.00	-11.00↓	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	11,152.00	+147.00↑
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	600.00	+23.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	816.00	+108.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	305,848.00	+13291.00↑	菜油持仓量(日, 手)	127,431.00	+35.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-3,933.00	-11091.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-3,872.00	-6019.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	0.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	168.00	0.00
	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	802.40	+9.10↑	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,426.00	+31.00↑
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,370.00	+20.00↑	江苏菜油价格(日, 元/吨)	12,380.00	+70.00↑
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,324.56	+10.31↑	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	12,389.81	+283.96↑
	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)	3.67	-0.00↓
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	745.00	+31.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	1,228.00	-77.00↓
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	9,810.00	-50.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	2,570.00	+120.00↑
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	9,310.00	-140.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	3,070.00	+210.00↑
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,060.00	+10.00↑	与菜粕价差(日, 元/吨)	690.00	-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)	5.40	-7.63↓	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	54.00	+124.00↑
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	16.70	-2.15↓	进口油菜籽开机率(周, %)	9.73	+6.34↑
产业情况	颗粒菜粕进口量(月, 万吨)	21.07	-2.74↓	菜籽油进口量(月, 万吨)	7.00	-5.00↓
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	15.20	-0.30↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	16.45	-1.47↓
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	4.90	+0.16↑	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	0.43	-0.22↓
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	23.81	-1.69↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.50	-0.02↓
	菜粕提货量(周, 万吨)	1.35	+0.07↑	菜油提货量(周, 万吨)	1.86	+1.84↑
下游情况	水产饲料产量(月, 吨)	252.00	+62.00↑	餐饮收入(月, 亿元)	3,765.70	+753.40↑
	饲料总产量(月, 吨)	2,352.00	+103.00↑	食用植物油产量(月, 万吨)	397.90	-8.20↓
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	30.69		菜粕平值看跌期权波动率(%)	30.74	
	标的20日历史波动率(%)	66.26	-0.33↓	标的60日历史波动率(%)	45.92	-0.28↓
行业消息	1、周五洲际交易所(ICE)的加拿大油菜籽期货收盘上涨,其中基准期约收高1.15%,因为经过近期价格下跌后,技术面超卖严重,大盘存在调整要求。截至收盘,11月期约收高9.10加元,报收802.40加元/吨;1月期约收高8.90加元,报收810.60加元/吨;3月期约收高9.30加元,报收818.30加元/吨。 2、				<p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结 菜粕	加拿大农业及农业食品部发布的最新供需报告显示,2022/23年度的油菜籽产量为1840万吨,比上月预测值高出45万吨,也远远高于去年的1259.5万吨。加拿大西部大草原地区天气条件相对良好,有助于油菜籽作物生长,加籽新季供应预期增加的概率大幅增强,对油菜籽价格有所牵制。且美豆压榨及出口也表现不佳,拖累美豆价格。不过,美豆优良率持续下滑,且进入天气市,市场对天气升水预期仍存。国内方面,6月油菜籽进口总量仅5.4万吨,进口菜籽压榨持续偏低,菜粕产出较少,不过国内市场通过直接进口菜粕来弥补其供应缺口,菜粕直接进口量持续处于同期高位。且下游采购仍不积极,库存水平仍然处于同期高位。同时,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较大。盘面来看,菜粕冲高回落,收长上影线,短期有望维持偏弱趋势。				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结 菜油	加拿大农业及农业食品部发布的最新供需报告显示,2022/23年度的油菜籽产量为1840万吨,比上月预测值高出45万吨,也远远高于去年的1259.5万吨。加拿大西部大草原地区天气条件相对良好,有助于油菜籽作物生长,加籽新季供应预期增加的概率大幅增强,对油菜籽价格有所牵制。同时,印尼正在考虑取消棕榈油出口的国内销售规定,使得油脂市场再度承压。国内市场方面,疫情影响下,菜油需求明显弱于往年同期。但是今年国内新籽收购价格高昂,且油菜籽及菜籽油进口量持续维持最低水平,菜油供应压力有限,沿海地区菜油库存处于近年来最低位,库存压力较小。盘面来看,菜油市场维持小幅反弹,不过,豆棕走势较弱,对菜油有所拖累,暂且观望或日内交易为主。					
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					