

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)	2,830.00	-76.00↓	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	12,008.00	-399.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	604.00	+21.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	719.00	-157.00↓
	菜粕持仓量(日, 手)	331,467.00	-1785.00↓	菜油持仓量(日, 手)	75,934.00	-19557.00↓
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-8,644.00	-13784.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-2,432.00	-6002.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	955.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	0.00	0.00
	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	863.00	-3.90↓	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,540.00	+9.00↑
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,540.00	-60.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	13,180.00	-140.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,817.20	-35.71↓	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	14,020.43	+354.52↑
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,900.00	-200.00↓	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.72	+0.02↑
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	710.00	+16.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	1,172.00	+259.00↑
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	10,630.00	+30.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	2,550.00	-170.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	10,650.00	+70.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	2,530.00	-210.00↓
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,280.00	-10.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	740.00	+50.00↑
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)	-222.00	+51.00↑
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	17.01	-4.99↓	进口油菜籽开机率(周, %)	21.23	+12.72↑
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)	14.20	-0.50↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	13.65	-1.65↓
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	5.20	+0.33↑	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	1.71	+0.54↑
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	18.27	-2.43↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.70	+0.10↑
	菜粕提货量(周, 万吨)	2.13	-0.60↓	菜油提货量(周, 万吨)	2.55	+1.42↑
下游情况	水产饲料产量(月, 吨)	344.00	+92.00↑	餐饮收入(月, 亿元)	3,694.00	-71.70↓
	饲料总产量(月, 吨)	256.00	+124.00↑	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(%)	28.03		菜粕平值看跌期权波动率(%)	28.22	
	标的20日历史波动率(%)	30.46	-2.58↓	标的60日历史波动率(%)	46.04	0.00
行业消息	<p>1、周五洲际交易所 (ICE) 的加拿大油菜籽期货收盘温和下跌, 其中基准期约收低0.5%。截至收盘, 11月期约收低3.90加元, 报收863加元/吨; 1月期约收低4加元, 报收871加元/吨; 3月期约收低4.40加元, 报收876.50加元/吨。</p> <p>2、</p>				<p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结 菜粕	<p>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USDA报告将2022/23年度产量上调至45.31亿蒲式耳, 高于上月预估的45.05亿蒲式耳, 而报告发布前分析师普遍预计产量会下调。不过, 美豆生长关键期, 产区持续性的高温天气持续影响作物产量前景, 升水预期仍存。国内方面, 油菜籽进口量持续偏低, 菜粕产出有限, 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。且随着近期开机率回升, 沿海菜粕库存水平再度回升至同期高位, 对菜粕价格有所牵制。盘面来看, 因USDA报告偏空影响下, 菜粕反弹力度有所减弱, 暂且观望。</p>				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结 菜油	<p>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, 虽然马来MPOB报告显示库存增量低于分析师预估, 但印尼加速出口, 仍然使得马棕库存处于累积状态。不过, GAPKI最新公布的数据显示, 印尼6月底库存环比降低7.6%至668万吨, 显著低于预期, 对油脂市场有所支撑。国内市场方面, 油菜籽及菜籽进口量持续维持最低水平, 菜油供应压力有限, 且三大油脂的整体库存仍然处于同期最低位, 支撑国内油脂市场价格。总的来看, 在新季加籽上市前, 国内菜油供应持续低于往年同期, 支撑菜油走势强于其它油脂。盘面来看, 受USDA报告偏空影响, 菜油涨势放缓, 暂且观望或短线顺势交易为主。</p>					
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					