

撰写人: 王翠冰 从业资格号: F3030669 投资咨询从业证书号: Z0015587

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	大连棕榈油 主力合约收盘价(元/吨)	8,628.00	-22.00↓	大连棕榈油 9-1价差 (元/吨)	162	-24.00↓
	大连棕榈油 持仓量 (手)	147,628.00	-25722↓			
	大连棕榈油 前20名净持仓 (手)	-38,480	-2476↓	大连棕榈油 仓单 (张)	1312	0.00
	马棕主力收盘价(令吉/吨)	4,168.00	+55.00↑	NYMEX轻质原油结算价(美元/桶)	86.53	-3↓
现货价格	现货24度 (天津) (元/吨)	10,450.00	-470.00↓	马来西亚FOB离岸价 (美元/吨)	1,062.50	+3↑
	现货24度 (张家港) (元/吨)	10,100.00	-150.00↓	马来西亚CNF到岸价 (美元/吨)	1,090.00	+2↑
	现货24度 (广东) (元/吨)	9,850.00	-250.00↓			
	DCE P 主力合约基差(东莞) (元/吨)	#N/A	#N/A			
上游情况	马来棕榈油产量 (月, 吨)	1573560	+28457↑	马来棕榈油出口量 (月, 吨)	1321870	+127942↑
	马来棕榈油库存 (月, 吨)	1772794	+126963↑	马来棕榈油压榨率 (月, %)	19.86	+0.20↑
	印尼棕榈油产量 (月, 万吨)	362		印尼棕榈油出口量 (月, 万吨)	233.4	
	印尼棕榈油库存 (月, 万吨)	668				
	船运机构SGS前25日出口(5日, 吨)	#N/A	#N/A	船运机构ITS前25日出口(5日, 吨)	533050	+168140↑
	SPPOMA前10日产量(5日, 吨)		12.63%	MPOA7月1-20日产量(5日, 吨)		-4.64%
豆油-棕榈油FOB价差(美元/吨)	346.12	+60.00↑				
产业情况	棕榈油港口库存 (周, 万吨)	27.6	-2.20↓	马来西亚进口棕榈油利润(日, 元/吨)	1,552.85	-189.27↓
	棕榈油进口量 (月, 万吨)	7	-4.00↓	豆油库存 (周, 万吨)	63.20	-4.75↓
	菜油库存 (周, 万吨)	1.71	+0.54↑			
	马来西亚进口成本价(日, 元/吨)	8,897.15	-11↓			
	豆油 (江苏) (元/吨)	10,620.00	+20.00↑	菜油 (江苏) (元/吨)	12,650.00	-200↓
	豆棕现货价差 (元/吨)	-30.00	+20.00↑	菜棕现货价差 (元/吨)	2,200.00	0.00
下游情况	马来棕榈油食品用量(年, 百万吨)	835.00	+35.00↑	马来棕榈油工业用量(年, 百万吨)	2,700.00	+100↑
	印尼棕榈油食品用量(年, 百万吨)	6,900.00	+250.00↑	印尼棕榈油工业用量(年, 百万吨)	10,200.00	+350↑
	中国棕榈油食品用量(年, 百万吨)	4,650.00	+650.00↑	中国棕榈油工业用量(年, 百万吨)	2,250.00	+1200↑
产区天气						
期权市场	棕榈油期货平值看涨期权波动率(%)	33.41		棕榈油期货平值看跌期权波动率(%)	35.87	
	棕榈油平值期权20日历史波动率(%)	46.21		棕榈油平值期权60日历史波动率(%)	47.90	
行业消息	<p>1南部半岛棕榈油压榨商协会(SPPOMA)最新发布的数据显示, 2022年8月1-10日马来西亚油棕鲜果串单产较上月同期上升15.42%, 出油率减少0.53%, 棕榈油产量增加12.63%。</p> <p>2据船运调查机构ITS数据显示, 马来西亚8月1-10日棕榈油出口量为364910吨, 较7月同期出口的330310吨增长10.5%。</p>				<p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结	<p>从基本面来看, 南部半岛棕榈油压榨商协会(SPPOMA)最新发布的数据显示, 2022年8月1-10日马来西亚油棕鲜果串单产较上月同期上升15.42%, 出油率减少0.53%, 棕榈油产量增加12.63%。据船运调查机构ITS数据显示, 马来西亚8月1-10日棕榈油出口量为364910吨, 较7月同期出口的330310吨增长10.5%。马棕8月初的产量有所恢复, 出口虽然有所恢复, 不过持续性仍需关注。国内基本面来看, 7月份以来随着马盘价格下跌, 国内采购不断增加, 但由于船运紧张, 不断有船期延迟到港, 实际到港量仍偏少, 国内棕榈油库存继续下滑。8月10日, 沿海地区食用棕榈油库存17万吨(加上工棕25万吨), 比上周同期减少1万吨, 月环比增加4万吨, 同比减少12万吨。其中天津6万吨, 江苏张家港6万吨, 广东3万吨。国内棕榈油库存处于低位, 现货供应仍然偏紧。印尼运力受限, 限制棕榈油的到港量。不过近期有消息称印尼的运力有所恢复, 后期随着到港量的增加, 棕榈油供应偏紧的情况或有所好转。印尼政府宣布, 将修改其国内市场义务要求, 该国敲定8月16-31日毛棕榈油参考价为900.52美元/吨, 高于本月上半月的每吨872.27美元。此举有助于缓解此前马棕出口面临的压力。盘面来看, 棕榈油维持震荡, 短期供应偏紧的背景下, 继续支撑油脂的价格。</p>				<p>更多观点请咨询!</p>	
重点关注	周四中国粮油信息中心公布棕榈油库存情况, 20日ITS&SGS公布马来棕榈油出口情况					

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!