

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)	2,770.00	-57.00↓	菜油01合约收盘价(日, 元/吨)	10,849.00	-260.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	648.00	+35.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	769.00	+85.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	353,980.00	+10270.00↑	菜油持仓量(日, 手)	128,076.00	+6183.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-10,556.00	-6483.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-2,307.00	+792.00↑
	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)	815.60	+2.20↑	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,470.00	+1.00↑
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,540.00	0.00	江苏菜油价格(日, 元/吨)	12,630.00	-50.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,658.83	0.00	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	13,815.74	-249.96↓
	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)	3.57	-0.04↓
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	770.00	+57.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	1,781.00	+210.00↑
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	10,430.00	-160.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	2,200.00	+110.00↑
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	10,260.00	-190.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	2,370.00	+140.00↑
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,280.00	0.00	与菜粕价差(日, 元/吨)	740.00	0.00
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)	10.00	+152.00↑
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	13.40	-3.61↓	进口油菜籽开机率(周, %)	15.36	-5.87↓
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	0.00
	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)	20.11	+1.84↑	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.70	+0.10↑
	菜粕提货量(周, 万吨)	1.77	-0.60↓	菜油提货量(周, 万吨)	1.78	+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)	3,694.20	-71.50↓
	饲料总产量(月, 吨)	256.00	+124.00↑	食用植物油产量(月, 万吨)	384.00	-13.90↓
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	26.90		菜粕平值看跌期权波动率(%)	26.20	
	标的20日历史波动率(%)	27.56	+1.14↑	标的60日历史波动率(%)	45.66	+0.03↑
行业消息	1、周三洲际交易所(ICE)的加拿大油菜籽期货市场收盘略微上涨, 当天大盘呈现区间振荡态势。截至收盘, 11月期约收高2.20加元, 报收815.60加元/吨; 1月期约收高2.10加元, 报收824.40加元/吨; 3月期约收高3.90加元, 报收831.20加元/吨。 2、				 <p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结 菜粕	截止目前加拿大产区天气相对良好, 且天气炒作时间缩短, 新作产量预计在2000万吨的正常水平, 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。同时, 预报显示未来6-10日美国大豆主产区降雨量有望高于常值, 利于美豆生长条件的改善, 美豆价格承压。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, 菜粕走势较为震荡, 暂且观望。				 <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结 菜油	截止目前加拿大产区天气相对良好, 且天气炒作时间缩短, 新作产量预计在2000万吨的正常水平, 对油菜籽价格有所牵制。同时, 马来棕榈处于增产季, 叠加印尼加速出口, 使得马棕库存处于累积状态。另外, 自8月1日以来离开乌克兰的船只数量达到24艘, 随着乌克兰油籽离港, 油脂供应有所增加。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, 油菜籽及菜籽油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。另外, 大豆到港量偏低, 豆油产出有限, 支撑国内油脂市场价格。不过, 随着印尼出口节奏加快, 预计本月将有数船进口棕榈油陆续到港, 改善国内进口植物油不足状态, 且原油价格下跌, 以及国内经济数据疲软, 央行出人意料的降低关键贷款利率, 市场氛围较为悲观。盘面来看, 菜油期价再度下跌, 暂且观望或短线顺势交易为主。					
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					