

撰写人: 王翠冰 从业资格证号: 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	菜粕主力合约收盘价(日, 元/吨)	2,936.00	-47.00↓	菜油主力合约收盘价(日, 元/吨)	12,176.00	-46.00↓
	菜粕1-5价差(日, 元/吨)	74.00	+5.00↑	菜油1-5价差(日, 元/吨)	304.00	+20.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	484,351.00	-51918.00↓	菜油持仓量(日, 手)	216,998.00	+502.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	8,153.00	-9485.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	39,886.00	+815.00↑
	菜粕仓单(日, 张)	800.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	1,355.00	0.00
现货市场	ICE油菜籽3月合约收盘价(加元/吨)	1,003.70	0.00	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	5,898.00	+23.00↑
	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	2,990.00	-10.00↓	国产菜油价格(江苏, 日, 元/吨)	12,790.00	+100.00↑
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	7,113.00	-6.00↓	进口菜油价格(广东, 日, 元/吨)	12,700.00	0.00
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,200.00	-100.00↓	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	4.28	+0.05↑
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	54.00	+37.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	614.00	+146.00↑
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	9,740.00	+120.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	3,050.00	-20.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	9,560.00	+40.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	2,860.00	+60.00↑
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	3,540.00	-40.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	550.00	-30.00↓
上游情况	加拿大油菜籽产量预估(月, 万吨)	1,260.00	-40.00↓	我国油菜籽产量预估(月, 万吨)	1,400.00	0.00
	油菜籽进口量(月, 吨)	168,301.93	-106709.07↓	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-293.40	+0.40↑
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	25.10	+5.20↑	进口油菜籽开机率(周, %)	31.67	+1.81↑
产业情况	颗粒菜粕进口量(月, 吨)	154416.76	-30844.56↓	菜籽油进口量(月, 万吨)	10.00	+2.00↑
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	3.50	-0.20↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	23.07	-2.74↓
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	4.80	+1.00↑	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	5.95	+0.65↑
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	8.49	+2.48↑	菜籽油广西库存(周, 万吨)	4.30	0.00
	菜粕提货量(周, 万吨)	3.6	+1.30↑	菜油提货量(周, 万吨)	38.90	+35.80↑
下游情况	水产饲料产量(月, 吨)	144.00	-89.00↓	餐饮收入(月, 亿元)	4,843.10	+382.80↑
	饲料总产量(月, 吨)	2,457.00	-63.00↓	食用植物油产量(月, 万吨)	488.50	+67.40↑
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	21.45	+0.73↑	菜粕平值看跌期权波动率(%)	20.81	+0.43↑
	标的20日历史波动率(%)	25.14	+1.14↑	标的60日历史波动率(%)	24.74	+0.22↑

行业消息
 1、上周五, 洲际交易所(ICE)加拿大的油菜籽期货市场休市。
 2、加拿大谷物理事会数据显示, 截至2021年12月19日的一周, 加拿大国内的油菜籽用量为17.97万吨, 与一周前的17.96万吨一致。当周加拿大油菜籽出口量为16.43万吨, 略微低于一周前的16.96万吨。



更多资讯请关注!

观点总结 菜粕
 南美地区出现拉尼娜现象带来的干旱天气持续升温增加阿根廷和巴西部分地区大豆减产风险, 但目前尚不能确定南美大豆会否最终减产, 此前机构对南美大豆产量的评估偏高导致市场对利多题材更为敏感, 蛋白粕市场成本支撑力度增强。菜粕基本面方面, 加拿大农业及农业食品部在最新出台的12月份供需报告中维持油菜籽期末库存预测数据不变, 仍为50万吨, 油菜籽供应依然紧张, 加籽价格持续偏高, 成本支撑较强, 提振菜粕价格。不过, 菜粕需求淡季, 库存继续增加, 据Mysteel调研显示, 截止到2021年12月24日, 沿海地区菜粕库存为5.3万吨, 环比上周增加0.5万吨, 整体处于近三年来最高水平, 供需皆弱的局面未改, 主要跟随美豆及豆粕运行。盘面上看, 菜粕期价高位回落, 关注2900支撑情况。



更多观点请咨询!

观点总结 菜油
 加拿大农业及农业食品部在最新出台的12月份供需报告中维持油菜籽期末库存预测数据不变, 仍为50万吨, 油菜籽供应紧张, 需求需要调配, 支持油菜籽价格。印度政府宣布下调精炼棕榈油进口关税自此前的17.5%下调至12.5%, 有印度官员评估, 此举有望使印度植物油月进口量增加四倍, 此外, 原油止跌回升, 均提振油脂市场走强。菜油基本面方面, 在油菜籽供应趋紧预期支撑下, 进口价格持续偏高, 成本支撑力度较强, 给菜油价格偏强运行提供有利支撑。国内三大油脂库存整体处于低位, 外部市场供应炒作持续发酵, 春节前国内油脂需求旺盛, 油厂挺油动力大幅提升。不过, 油厂压榨回升, 菜油消费及消化能力较往年同期水平较差, 出货速度一般, 据Mysteel调研显示, 截止到2021年12月24日, 沿海地区主要油厂菜油库存为5.95万吨, 较上周增加0.65万吨。总的来看, 新冠疫情仍是扰动大宗商品乃至整个金融市场的重要因素。盘面上看, 菜油高位震荡收高, 短线顺势参与为主。

重点关注

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!

备注: RS: 菜籽 RM: 菜粕 OI: 菜油