

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)	2,914.00	-32.00↓	菜油01合约收盘价(日, 元/吨)	10,732.00	+21.00↑
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	-2,914.00	-3580.00↓	菜油9-1价差(日, 元/吨)	1,923.00	+350.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	381,825.00	-1574.00↓	菜油持仓量(日, 手)	155,230.00	-3066.00↓
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-10,705.00	+1605.00↑	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	6,556.00	-1624.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	1,317.00	-170.00↓	菜油仓单(日, 张)	2,318.00	+1068.00↑
	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	817.10	0.00	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,350.00	0.00
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,540.00	-20.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	12,580.00	-20.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	0.00	-5915.64↓	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	13,528.51	-643.90↓
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	0.00	-7060.00↓	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.55	+0.01↑
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	626.00	+12.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	1,848.00	-41.00↓
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	10,420.00	0.00	与菜油价差(日, 元/吨)	2,160.00	-20.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	8,690.00	-90.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	3,890.00	+70.00↑
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,560.00	-10.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	1,020.00	+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)	9.80	+4.40↑	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-63.00	+36.00↑
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	11.97	-2.73↓	进口油菜籽开机率(周, %)	11.62	+5.66↑
产业情况	颗粒菜粕进口量(月, 万吨)	16.86	-4.22↓	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)	12.00	-1.00↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	9.85	-1.35↓
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	2.66	-0.39↓	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	1.19	+0.10↑
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	13.20	-0.29↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.80	0.00
	菜粕提货量(周, 万吨)	2.2	+0.06↑	菜油提货量(周, 万吨)	1.59	+0.19↑
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)	2,458.00	+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(%)	26.57		菜粕平值看跌期权波动率(%)	25.06	
	标的20日历史波动率(%)	27.71	+0.22↑	标的60日历史波动率(%)	45.46	+0.01↑
	菜油平值看涨期权波动率(%)	27.19		菜油平值看跌期权波动率(%)	26.67	
	标的20日历史波动率(%)	34.72	+0.09↑	标的60日历史波动率(%)	35.74	-0.03↓
行业消息	1、周一洲际交易所 (ICE) 的加拿大油菜籽期货休市。 2、					
观点总结 菜粕	德国汉堡的分析机构油世界称, 2022/23年度全球油菜籽产量将会达到创纪录的7440万吨, 比8月份的预测值高出90万吨。如果新的产量预期成为现实, 将会比2021/22年度的产量提高近800万吨, 对国际油菜籽价格有所牵制。同时, Pro Farmer预计美豆产量将略高于USDA预期, 且美豆收割前天气状况较为良好, 美豆价格承压, 国内粕类受其牵制。国内方面, 油菜籽进口量持续偏低, 菜粕产出有限, 且目前仍是水产养殖旺季, 菜粕刚性需求仍在, 对菜粕价格有所支撑。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。豆粕来看, 三季度大豆进口到港量低于往年同期, 产出水平受限, 而近期下游提货速度加快, 豆粕库存快速下降, 支撑粕类市场价格。盘面来看, 菜粕期价高开低走, 短期有望维持震荡, 暂且观望。			更多资讯请关注!  更多观点请咨询!		
观点总结 菜油	德国汉堡的分析机构油世界称, 2022/23年度全球油菜籽产量将会达到创纪录的7440万吨, 比8月份的预测值高出90万吨。如果新的产量预期成为现实, 将会比2021/22年度的产量提高近800万吨, 对国际油菜籽价格有所牵制。同时, 马来西亚棕榈油局(MPOB)发布8月份供需报告前, 一项调查显示, 马来西亚8月底的棕榈油库存可能较上月增加14.5%至203万吨, 利空油脂价格。另外, 宏观经济忧虑打压下, 油脂整体走势偏弱。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, 国内疫情有所抬头, 需求受到抑制, 且随着印尼出口节奏加快, 后期棕榈油陆续到港, 改善国内进口植物油不足状态。盘面来看, 菜油小幅反弹, 不过在宏观经济影响下, 反弹高度预期有限。					
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					

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