

撰写人: 许方莉 从业资格证号: 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) | 2,769.00 | -65.00↓ | 菜油09合约收盘价(日, 元/吨) | 11,573.00 | -77.00↓ | | | |
| | 菜粕9-1价差(日, 元/吨) | 569.00 | +15.00↑ | 菜油9-1价差(日, 元/吨) | 489.00 | -25.00↓ | | | |
| | 菜粕持仓量(日, 手) | 208,419.00 | +778.00↑ | 菜油持仓量(日, 手) | 116,204.00 | -4070.00↓ | | | |
| | 菜粕期货前20名净持仓(日, 手) | 14,421.00 | +28357.00↑ | 菜油期货前20名净持仓(日, 手) | -10,839.00 | -3675.00↓ | | | |
| | 菜粕仓单(日, 张) | 2,011.00 | -44.00↓ | 菜油仓单(日, 张) | 0.00 | 0.00 | | | |
| 现货市场 | ICE油菜籽7月合约收盘价(加元/吨) | 878.50 | 0.00 | 菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨) | 6,572.00 | +112.00↑ | | | |
| | 江苏南通菜粕价格(日, 元/吨) | 3,470.00 | -100.00↓ | 江苏菜油价格(日, 元/吨) | 12,240.00 | -180.00↓ | | | |
| | 油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨) | 6,765.15 | -1.51↓ | 菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨) | 14,438.42 | 0.00 | | | |
| | 国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨) | 6,900.00 | -20.00↓ | 油粕比(江苏菜油/菜粕, 日) | 3.53 | +0.05↑ | | | |
| 替代品现货价格 | 菜粕主力合约基差(日, 元/吨) | 701.00 | -35.00↓ | 菜油主力合约基差(日, 元/吨) | 667.00 | -103.00↓ | | | |
| | 江苏南京豆油价格(日, 元/吨) | 10,300.00 | -170.00↓ | 与菜油价差(日, 元/吨) | 1,940.00 | -10.00↓ | | | |
| | 广东广州棕榈油价格(日, 元/吨) | 10,120.00 | -130.00↓ | 与菜油价差(日, 元/吨) | 2,120.00 | -50.00↓ | | | |
| 上游情况 | 江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨) | 4,000.00 | -80.00↓ | 与菜粕价差(日, 元/吨) | 530.00 | +20.00↑ | | | |
| | 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) | 13.03 | +5.14↑ | 油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨) | -26.00 | +69.00↑ | | | |
| 产业情况 | 沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨) | 15.20 | -3.40↓ | 进口油菜籽开机率(周, %) | 15.38 | +2.26↑ | | | |
| | 颗粒菜粕进口量(月, 万吨) | 24.23 | +5.24↑ | 菜籽油进口量(月, 万吨) | 12.00 | +5.00↑ | | | |
| | 华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨) | 11.00 | -0.40↓ | 菜籽油华东库存(周, 万吨) | 19.00 | +0.86↑ | | | |
| | 沿海地区菜粕库存(周, 万吨) | 5.44 | -0.65↓ | 菜籽油沿海库存(周, 万吨) | 0.9 | -0.26↓ | | | |
| | 华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨) | 27.58 | +1.56↑ | 菜籽油广西库存(周, 万吨) | 0.55 | -0.25↓ | | | |
| 下游情况 | 菜粕提货量(周, 万吨) | 1.03 | +1.07↑ | 菜油提货量(周, 万吨) | 0.02 | -0.49↓ | | | |
| | 水产饲料产量(月, 吨) | 252.00 | +62.00↑ | 餐饮收入(月, 亿元) | 3,012.30 | +403.40↑ | | | |
| | 饲料总产量(月, 吨) | 2,352.00 | +103.00↑ | 食用植物油产量(月, 万吨) | 406.10 | +46.70↑ | | | |
| 期权市场 | 菜粕平值看涨期权波动率(%) | 25.76 | | 菜粕平值看跌期权波动率(%) | 22.45 | | | | |
| | 标的20日历史波动率(%) | 64.46 | -0.35↓ | 标的60日历史波动率(%) | 44.81 | -1.27↓ | | | |
| 行业消息 | 1、周五洲际交易所 (ICE) 加拿大油菜籽期货休市。 2、 | | |  更多资讯请关注！ | | | | | |
| 观点总结 菜粕 | 加拿大统计局将于7月5日20:30公布加拿大作物种植面积预估, 分析师预估, 加拿大2022年油菜籽种植面积料为2130万英亩, 高于加拿大统计局4月预估值2090万英亩, 加籽再度承压。且金融市场仍承受美国加息及全球经济衰退预期的压力。国内方面, 今年菜籽收购价格明显高于往年同期, 给菜粕以成本支撑。不过, 油菜籽进入上市高峰, 菜粕产出有望增加, 而菜粕下游提货不积极, 库存处于回升趋势, 且国内大豆短期供应充足, 油厂开机率尚可, 豆粕库存持续增加, 蛋白粕整体库存压力加大。盘面来看, 菜粕期价持续偏弱, 短期仍有走弱倾向。 | | | | | | | | |
| 观点总结 菜油 | 加拿大统计局将于7月5日20:30公布加拿大作物种植面积预估, 分析师预估, 加拿大2022年油菜籽种植面积料为2130万英亩, 高于加拿大统计局4月预估值2090万英亩, 加籽再度承压。同时, 印尼为加速棕榈油出口, 宣布自7月1日起, 将企业的最高出口配额从国内销售量的五倍提高到七倍, 继续施压油脂市场。另外, 金融市场仍承受美国加息及全球经济衰退预期的压力。国内市场方面, 疫情影响下, 菜油需求明显弱于往年同期, 且国内菜籽上市导致菜油价格受到一定压制。但是今年国内新籽收购价格高昂, 且油厂开机率持续处于最低水平, 菜油产出有限, 而下游提货情况尚可, 沿海地区菜油库存继续下降, 库存压力较小。盘面来看, 在外盘持续偏弱影响下, 菜油再度下跌, 市场氛围仍然较弱, 暂且观望。 | | | | | | | | |
| 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, 7月5日加拿大统计局种植面积预估 | | | | | | | | |