

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)	2,811.00	-41.00↓	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	11,983.00	+184.00↑
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	634.00	+20.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	891.00	-44.00↓
	菜粕持仓量(日, 手)	295,389.00	-10282.00↓	菜油持仓量(日, 手)	108,455.00	+1137.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-8,230.00	+3599.00↑	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-5,614.00	+5547.00↑
	菜粕仓单(日, 张)	955.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	168.00	0.00
现货市场	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	850.20	+6.90↑	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,552.00	+98.00↑
	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,580.00	-30.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	13,030.00	+120.00↑
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,742.38	+20.99↑	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	13,426.01	+411.83↑
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,900.00	-140.00↓	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.64	+0.06↑
替代品现货价格	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	769.00	+11.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	1,047.00	-64.00↓
	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	10,480.00	+230.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	2,550.00	-110.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	10,300.00	+200.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	2,730.00	-80.00↓
上游情况	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,240.00	-40.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	660.00	-10.00↓
	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)	5.40	-7.63↓	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-326.00	-154.00↓
产业情况	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	22.00	-2.00↓	进口油菜籽开机率(周, %)	8.51	-1.28↓
	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	-5.00↓
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	14.90	-0.30↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	16.60	+0.15↑
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	3.96	-0.69↓	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	0.55	-0.04↓
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	20.70	-4.80↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.50	0.00
下游情况	菜粕提货量(周, 万吨)	2.13	-0.60↓	菜油提货量(周, 万吨)	6.49	+5.36↑
	水产饲料产量(月, 吨)	252.00	+62.00↑	餐饮收入(月, 亿元)	3,765.70	+753.40↑
	饲料总产量(月, 吨)	2,332.00	-20.00↓	食用植物油产量(月, 万吨)	397.90	-8.20↓
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	28.42		菜粕平值看跌期权波动率(%)	29.20	
	标的20日历史波动率(%)	33.31	-0.42↓	标的60日历史波动率(%)	45.81	-0.33↓
行业消息	1、周五洲际交易所 (ICE) 的加拿大油菜籽期货市场收盘上涨, 当天大盘呈现牛皮振荡态势。截至收盘, 11月期约收高6.90加元, 报收850.20加元/吨; 1月期约收高7.10加元, 报收860加元/吨; 3月期约收高6.30加元, 报收866.90加元/吨。 2、					
观点总结 菜粕	加拿大西部大草原地区天气条件相对良好, 有助于油菜籽作物生长, 加籽新季供应预期增加的概率大幅增强, 对油菜籽价格有所牵制。同时, 市场普遍预测, USDA将在8月报告中上调美豆面积预估。不过, 美豆生长关键期, 产区持续性的高温天气将令美豆单产小幅下调, 升水预期仍存, 对美豆价格有所支撑。美豆保持天气市运行特征。国内市场方面, 6月油菜籽进口总量仅5.4万吨, 进口菜籽压榨持续偏低, 菜粕产出较少, 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。且库存水平仍然处于同期高位。盘面来看, 菜粕徘徊于2800附近, 暂且观望。					
观点总结 菜油	加拿大西部大草原地区天气条件相对良好, 有助于油菜籽作物生长, 加籽新季供应预期增加的概率大幅增强, 对油菜籽价格有所牵制。同时, 印尼将出口配额进一步放宽至九倍, 并下调出口税, 进一步打压棕榈油市场。且美国农业部将于8月12日公布月度供需报告, 此前市场预期美国大豆播种面积可能较6月底的预测值上调, 对油脂市场预期利空。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, 沿海地区菜油库存处于近年来最低位, 库存压力较小。总的来看, 在新季加籽上市前, 国内菜油供应持续低于往年同期, 支撑菜油走势强于其它油脂。盘面来看, 棕榈油大幅反弹, 带动菜油震荡收涨, 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					

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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!