

菜籽系产业链日报

2022/1/19

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 环比 数据指标 最新 环比. 最新 +27.00↑菜油主力合约收盘价(日,元/吨) 菜粕主力合约收盘价(日,元/吨) 2,899.00 12,046.00 +135.001 菜粕5-9价差(日,元/吨) **+4.00**↑ 菜油5-9价差(日,元/吨) 633.00 119.00 +33.001 477.067.00 菜粕持仓量(日,手) +12174.00 菜油持仓量(日,手) 191.555.00 **-4483.00** J 期货市场 +16489.001 菜油期货前20名净持仓(日,手) 菜粕期货前20名净持仓(日,手) 11,815.00 19,307.00 -5351.00↓ 菜粕仓单(日,张) 2,495.00 0.00 菜油仓单(日,张) 2,057.00 -100.00↓ ICE油菜籽3月合约收盘价(加元/吨) 964.00 -**11.20**↓ 菜籽主力合约收盘价(日,元/吨) 5.914.00 0.00 江苏南通菜粕价格(日,元/吨) 2,950.00 0.00!国产菜油价格(江苏,日,元/吨) 12,660.00 +150.001 油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨) 7.096.00 **-52.00**↓ 进口菜油价格(广东, 日, 元/吨) 12.700.00 +100.001 现货市场 国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨) 6.200.00 **-60.00**↓油粕比(江苏菜油/菜粕,日) 4.29 +0.051 -27.00¹ 菜油主力合约基差(日,元/吨) 菜粕主力合约基差(日,元/吨) 51.00 614.00 +15.001 江苏南京豆油价格(日,元/吨) 10,150.00 **+110.00**↑!与菜油价差(日,元/吨) 2,510.00 **+40.00**↑ 替代品现货 广东广州棕榈油价格(日,元/吨) 10,670.00 **+220.00**↑ 与菜油价差(日,元/吨) 2,860.00 -70.00↓ 价格 -20.00↓!与菜粕价差(日,元/吨) -20.00¹ 江苏张家港豆粕价格(日,元/吨) 3,550.00 600.00 0.00 我国油菜籽产量预估(月,万吨) 加拿大油菜籽产量预估(月,万吨) 1,260.00 1,400.00 0.00 上游情况 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) -298.80 +110.801 沿海油厂油菜籽库存(周,万吨) **-1.70**↓ 进口油菜籽开机率(周,%) 14.93 -3.85↓ 24.20 颗粒菜粕进口量(月,吨) 154416.76 -30844.56↓İ菜籽油进口量(月, 万吨) 8.00 -2.001 华南地区颗粒菜粕库存(周,万吨) 2.70 -0.55↓菜籽油华东库存(周,万吨) 21.49 +1.101 产业情况 沿海地区菜粕库存(周,万吨) 6.33 **-0.30**↓ 菜籽油沿海库存(周,万吨) 6.6 +0.301 15.91 +7.50↑菜籽油广西库存(周,万吨) 3.80 华东地区颗粒菜粕库存(周,万吨) -0.10J菜粕提货量(周,万吨) 2.45 **-0.21**↓ 菜油提货量(周,万吨) 10.75 **+7.08**↑ 水产饲料产量(月,吨) 144.00 4.841.00 -89.00↓ 餐饮收入(月, 亿元) **-2.10**↓ 下游情况 饲料总产量(月,吨) 2,457.00 **-63.00**↓ 食用植物油产量(月,万吨) 488.50 +67.401 菜粕平值看涨期权波动率(%) 21.69 -0.11↓菜粕平值看跌期权波动率(%) 21.12 -0.27↓ 期权市场 标的20日历史波动率(%) 19.71 **+0.28**[↑] 标的60日历史波动率(%) -0.0811、周二,洲际交易所(ICE)加拿大的油菜籽期货市场收盘互有涨跌,其中近期期约下跌,较远期的期约略微收涨。截 至收盘,3月期约收低11.20加元,报收964加元/吨;5月期约收低8.50加元,报收951.90加元/吨;7月期约收低8.10加 元, 报收924.10加元/吨。 行业消息 2、 再多资讯请关注! 大部分气象预报显示未来一周南美干燥地区至少会出现一些降雨可能改善大豆生长情况,有助于提振南美大豆产预期 量。另外,随着巴西大豆逐步上市,采购重心逐步转移至南美,对美豆出口有所不利。不过,大豆作物前期受损难以 完全改善,后续天气因素对大豆生长的压力仍存。菜粕基本面方面,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,据Mysteel调研显示,截止到2022年1月14日,沿海地区主要油厂 观点总结 菜粕库存为6.33万吨,整体仍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。盘面来看, 菜粕 更多观点请咨询! 在经历两周回落后,今日菜粕期价大幅反弹,不过继续反弹力度有待观察,暂且观望。 加拿大油菜籽供应紧张,需求需要调配,支持油菜籽价格。另外,原油市场走势偏强,以及印尼计划2月启动B40混合生物柴油道路 测试,提振油脂市场。不过,加拿大油菜籽连续七日收低,对国内菜油价格有所拖累。菜油基本面方面,菜油进口利润及菜籽压榨 利润持续倒挂,后续进口菜籽和菜油到港量持续偏低,供应偏紧继续支撑盘面,不过,随着菜油价格持续偏高,豆棕价格优势明 观点总结 显,下游春节备货需求明显弱于往年,继续上行推动力有限。盘面上看,在豆棕走势偏强提振下,菜油期价继续减仓反弹,期价收 菜油 于60日均线附近,关注此位置突破情况。 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