

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)	2,959.00	+60.00↑	菜油主力合约收盘价(日, 元/吨)	12,270.00	+224.00↑
	菜粕5-9价差(日, 元/吨)	121.00	+2.00↑	菜油5-9价差(日, 元/吨)	647.00	+14.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	474,449.00	-2618.00↓	菜油持仓量(日, 手)	199,800.00	+8245.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	15,565.00	+3750.00↑	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	16,722.00	-2585.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	1,505.00	-990.00↓	菜油仓单(日, 张)	1,921.00	-136.00↓
现货市场	ICE油菜籽3月合约收盘价(加元/吨)	1,000.70	+36.70↑	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	5,961.00	+47.00↑
	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,050.00	+100.00↑	国产菜油价格(江苏, 日, 元/吨)	12,850.00	+190.00↑
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	7,255.00	+159.00↑	进口菜油价格(广东, 日, 元/吨)	12,800.00	+100.00↑
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,200.00	0.00	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	4.21	-0.08↓
替代品现货价格	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	91.00	+40.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	580.00	-34.00↓
	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	10,210.00	+60.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	2,640.00	+130.00↑
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	10,690.00	+20.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	2,860.00	+170.00↑
上游情况	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	3,600.00	+50.00↑	与菜粕价差(日, 元/吨)	550.00	-50.00↓
	加拿大油菜籽产量预估(月, 万吨)	1,260.00	0.00	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)	-376.60	-77.80↓
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	24.20	-1.70↓	进口油菜籽开机率(周, %)	14.93	-3.85↓
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)	8.00	-2.00↓
	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	+1.10↑
	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	+0.30↑
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	15.91	+7.50↑	菜籽油广西库存(周, 万吨)	3.80	-0.10↓
	菜粕提货量(周, 万吨)	2.45	-0.21↓	菜油提货量(周, 万吨)	10.75	+7.08↑
下游情况	水产饲料产量(月, 吨)	144.00	-89.00↓	餐饮收入(月, 亿元)	4,841.10	-2.00↓
	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(%)	22.38	+0.69↑	菜粕平值看跌期权波动率(%)	21.72	+0.60↑
	标的20日历史波动率(%)	20.99	+1.28↑	标的60日历史波动率(%)	24.06	+0.30↑
行业消息	<p>1、周三, 洲际交易所 (ICE) 加拿大的油菜籽期货市场收盘大幅上涨, 其中近日期约涨幅最大, 达到3.8%。经过近几天的获利平仓抛售后, 投机基金再度入市做多。截至收盘, 3月期约收高36.70加元, 报收1000.70加元/吨; 5月期约收高29.10加元, 报收981加元/吨; 7月期约收高21.70加元, 报收945.80加元/吨。</p> <p>2、</p>					<p>更多资讯请关注!</p>
观点总结 菜粕	<p>随着巴西大豆逐步上市, 采购重心逐步转移至南美, 对大豆出口有所不利。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, 在美豆走强提振下, 菜粕期价继续反弹, 暂且观望。</p>					
观点总结 菜油	<p>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, 以及继印尼即将启动B40计划提升棕榈油的生物燃料需求后, 印尼贸易部表示, 为抑制食用油价格上涨, 将起草棕榈油出口限制计划。此举可能导致部分国际买家转向购买马来西亚棕榈油, 从而加剧马来西亚棕榈油供应紧张局面, 提振油脂市场偏强运行。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, 豆棕价格优势明显, 下游春节备货需求明显弱于往年, 总体来看, 菜油自身基本面上行推动力有限, 主要随豆棕盘面运行。盘面上看, 在豆棕走势偏强提振下, 菜油期价突破均线压力, 走势有所转强, 关注前高压力位。</p>					
重点关注	下周一我的农产品网菜籽压榨及菜油粕库存情况					