

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)	2,780.00	+92.00↑	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	10,356.00	-198.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	588.00	-1.00↓	菜油9-1价差(日, 元/吨)	371.00	-38.00↓
	菜粕持仓量(日, 手)	226,044.00	+825.00↑	菜油持仓量(日, 手)	121,293.00	+3776.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	15,405.00	+5301.00↑	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-10,994.00	+2550.00↑
	菜粕仓单(日, 张)	1,828.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	219.00	0.00
现货市场	ICE油菜籽7月合约收盘价(加元/吨)	825.30	-3.30↓	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,359.00	+15.00↑
	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,470.00	+50.00↑	江苏菜油价格(日, 元/吨)	11,050.00	-230.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,379.42	-19.56↓	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	12,143.83	-73.16↓
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,900.00	0.00	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.18	-0.11↓
替代品现货价格	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	690.00	-42.00↓	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	694.00	-32.00↓
	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	9,430.00	-70.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,620.00	-160.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	9,210.00	-180.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,840.00	-50.00↓
上游情况	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,080.00	+100.00↑	与菜粕价差(日, 元/吨)	610.00	+50.00↑
	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)	-255.00	+43.00↑
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, %)	4.07	-11.31↓
	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)	25.50	-2.08↓	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(%)	29.59		菜粕平值看跌期权波动率(%)	28.27	
	标的20日历史波动率(%)	62.65	0.00	标的60日历史波动率(%)	45.44	0.00
行业消息	1、周三洲际交易所(ICE)加拿大油菜籽期货市场收盘下跌, 其中基准期约收低0.4%, 当天大盘呈现牛皮振荡态势。经过周初的大跌后, 油菜籽市场试图找到底部支撑。截至收盘, 11月期约收低3.30加元, 报收825.30加元/吨; 1月期约收低3.50加元, 报收832.90加元/吨; 3月期约收低3.40加元, 报收840.50加元/吨。 2、					
观点总结 菜粕	加拿大统计局发布的最新报告显示, 2022年加拿大油菜籽播种面积为2140万英亩, 高于早先预测的2090万英亩, 也高于分析师预估的2130万英亩, 同时, 预报显示7月初加拿大大草原天气条件有利, 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, 进口菜籽压榨再度减少, 菜粕库存小幅回落, 不过下游采购仍不积极, 库存水平仍然处于同期高位, 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, 受美豆反弹影响, 菜粕期价止跌反弹。不过, 整体仍处于空头趋势, 近期波动较大, 注意控制节奏。					
观点总结 菜油	加拿大统计局发布的最新报告显示, 2022年加拿大油菜籽播种面积为2140万英亩, 高于早先预测的2090万英亩, 也高于分析师预估的2130万英亩, 同时, 预报显示7月初加拿大大草原天气条件有利, 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, 库存压力正在重塑远期全球油脂市场的供需格局, 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, 沿海地区菜油库存继续下降, 库存压力较小。盘面来看, 菜油继续下挫, 整体市场氛围仍然较弱, 谨防超跌反弹。					
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					



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!