

撰写人: 许方莉 从业资格号: 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
	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↑
现货市场	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↓
	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↓
替代品现货价格	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↓
	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↑
上游情况	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↑
	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↓
产业情况	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↓
	菜粕提货量(周, 万吨)	1.03	+1.07↑	菜油提货量(周, 万吨)	0.02	-0.49↓
下游情况	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，高于原先预测的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，高于原先预测的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					

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