

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)	2,867.00	-27.00↓	菜油01合约收盘价(日, 元/吨)	11,017.00	-68.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	593.00	+15.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	1,680.00	+15.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	366,146.00	-6994.00↓	菜油持仓量(日, 手)	155,364.00	+4578.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-11,804.00	-905.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	7,030.00	+6925.00↑
	菜粕仓单(日, 张)	1,575.00	-110.00↓	菜油仓单(日, 张)	0.00	0.00
现货市场	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	838.50	-17.30↓	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,477.00	-132.00↓
	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,540.00	-50.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	12,870.00	-610.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,240.85	-335.04↓	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	14,159.76	+227.24↑
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	7,060.00	0.00	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.64	-0.12↓
替代品现货价格	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	673.00	-23.00↓	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	1,853.00	-542.00↓
	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	10,760.00	-140.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	2,110.00	-470.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	9,600.00	-50.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	3,270.00	-560.00↓
上游情况	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,420.00	-50.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	880.00	0.00
	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)	9.80	+4.40↑	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-255.00	-219.00↓
产业情况	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	14.70	+4.60↑	进口油菜籽开机率(周, %)	5.96	-8.08↓
	颗粒菜粕进口量(月, 万吨)	16.86	-4.22↓	菜籽油进口量(月, 万吨)	7.00	0.00
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	13.00	-0.60↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	11.20	-0.97↓
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	3.05	-0.82↓	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	1.09	-0.44↓
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	13.49	-2.55↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.80	-0.10↓
下游情况	菜粕提货量(周, 万吨)	2.14	+0.84↑	菜油提货量(周, 万吨)	1.40	+0.46↑
	水产饲料产量(月, 吨)	344.00	+92.00↑	餐饮收入(月, 亿元)	3,694.20	-71.50↓
	饲料总产量(月, 吨)	2,458.00	+124.00↑	食用植物油产量(月, 万吨)	384.00	-13.90↓
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	25.35		菜粕平值看跌期权波动率(%)	27.65	
	标的20日历史波动率(%)	31.40	-0.32↓	标的60日历史波动率(%)	46.55	-0.12↓
	菜油平值看涨期权波动率(%)	25.81		菜油平值看跌期权波动率(%)	25.54	
	标的20日历史波动率(%)	33.35	-0.30↓	标的60日历史波动率(%)	34.98	-0.11↓
行业消息	1、周一洲际交易所(ICE)的加拿大油菜籽期货市场收盘下跌, 其中基准期约收低2%, 因为加拿大统计局发布的产量数据偏空。截至收盘, 11月期约收低17.30加元, 报收838.50加元/吨;1月期约收低17.50加元, 报收845.80加元/吨;3月期约收低17.10加元, 报收851.50加元/吨。 2、					
观点总结 菜粕	加拿大统计局使用计算机模型, 预计2022/23年度加拿大油菜籽产量为1950万吨, 位于市场预期范围的中间, 将是三年来的最高水平, 对油菜籽价格有所牵制。同时, Pro Farmer预计美豆产量将略高于USDA预期, 且美豆收割前天气状况较为良好, 美豆价格承压, 国内粕类或跟随回落。国内方面, 油菜籽进口量持续偏低, 菜粕产出有限, 且目前仍是水产养殖旺季, 菜粕刚性需求仍在, 对菜粕价格有所支撑。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。豆粕来看, 三季度大豆进口到港量低于往年同期, 产出水平受限, 而近期下游提货速度加快, 豆粕库存快速下降, 支撑粕类市场价格。盘面来看, 受美豆下跌影响, 菜粕期价上涨至高位后, 获利了结意愿增加, 使得价格有所回落。					 更多资讯请关注! 更多观点请咨询!
观点总结 菜油	加拿大统计局使用计算机模型, 预计2022/23年度加拿大油菜籽产量为1950万吨, 位于市场预期范围的中间, 将是三年来的最高水平, 对油菜籽价格有所牵制。同时, 为促进棕榈油出口缓解库存压力, 印尼政府将免征棕榈油出口专项税的政策期限延长至10月31日, 马来西亚棕榈油仍面临较大出口竞争压力。不过, 印尼棕榈油偏空的消息逐步被市场消化, 市场氛围有所回暖, 同时原油价格回暖, 继续支撑油脂市场。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, 且三大油脂的整体库存仍然处于同期最低位。另外, 大豆到港量偏低, 豆油产出有限, 支撑国内油脂市场价格。不过, 随着印尼出口节奏加快, 后期棕榈油陆续到港, 改善国内进口植物油不足状态。盘面来看, 在短期供应偏紧提振下, 支撑菜油现货价格, 期价维持震荡。					
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