

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05合约收盘价(日, 元/吨) | 2,988.00 | -31.00↓ | 菜油05合约收盘价(日, 元/吨) | 8,778.00 | -240.00↓ | | | |
| | 菜粕5-9价差(日, 元/吨) | -40.00 | -3.00↓ | 菜油5-9价差(日, 元/吨) | -63.00 | +9.00↑ | | | |
| | 菜粕持仓量(日, 手) | 393,219.00 | -8509.00↓ | 菜油持仓量(日, 手) | 297,661.00 | -3676.00↓ | | | |
| | 菜粕期货前20名净持仓(日, 手) | -46,539.00 | +886.00↑ | 菜油期货前20名净持仓(日, 手) | -47,014.00 | +6439.00↑ | | | |
| | 菜粕仓单(日, 张) | 460.00 | 0.00 | 菜油仓单(日, 张) | 2,779.00 | 0.00 | | | |
| 现货市场 | ICE油菜籽5月合约收盘价(加元/吨) | 751.00 | -6.60↓ | 菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨) | 5,963.00 | +5.00↑ | | | |
| | 江苏南通菜粕价格(日, 元/吨) | 3,300.00 | -10.00↓ | 江苏菜油价格(日, 元/吨) | 9,450.00 | -300.00↓ | | | |
| | 油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨) | 5,311.16 | -63.14↓ | 菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨) | 11,350.60 | +80.25↑ | | | |
| | 国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨) | 7,440.00 | -60.00↓ | 油粕比(江苏菜油/菜粕, 日) | 2.86 | -0.08↓ | | | |
| 替代品现货价格 | 菜粕主力合约基差(日, 元/吨) | 312.00 | +21.00↑ | 菜油主力合约基差(日, 元/吨) | 672.00 | -60.00↓ | | | |
| | 江苏南京豆油价格(日, 元/吨) | 8,910.00 | -270.00↓ | 与菜油价差(日, 元/吨) | 540.00 | -30.00↓ | | | |
| | 广东广州棕榈油价格(日, 元/吨) | 7,810.00 | -90.00↓ | 与菜油价差(日, 元/吨) | 1,640.00 | -210.00↓ | | | |
| 上游情况 | 江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨) | 4,140.00 | -80.00↓ | 与菜粕价差(日, 元/吨) | 840.00 | -70.00↓ | | | |
| | 加拿大油菜籽产量预估(月, 万吨) | 1,900.00 | 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) | 54.49 | +6.82↑ | 油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨) | -68.00 | +32.00↑ | | | |
| 产业情况 | 沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨) | 41.80 | +6.90↑ | 进口油菜籽开机率(周, %) | 24.84 | -12.70↓ | | | |
| | 颗粒菜粕进口量(月, 万吨) | 22.14 | +13.42↑ | 菜籽油进口量(月, 万吨) | 12.00 | -2.00↓ | | | |
| | 华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨) | 0.00 | 0.00 | 菜籽油华东库存(周, 万吨) | 17.28 | -0.96↓ | | | |
| | 沿海地区菜粕库存(周, 万吨) | 5.75 | -0.12↓ | 菜籽油沿海库存(周, 万吨) | 2.98 | -0.26↓ | | | |
| | 华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨) | 0.68 | -0.22↓ | 菜籽油广西库存(周, 万吨) | 1.70 | +0.20↑ | | | |
| 下游情况 | 菜粕提货量(周, 万吨) | 4.77 | | 菜油提货量(周, 万吨) | 5.55 | | | | |
| | 饲料总产量(月, 吨) | 2,579.00 | -93.00↓ | 餐饮收入(月, 亿元) | 4,157.00 | -278.00↓ | | | |
| | | | | 食用植物油产量(月, 万吨) | 522.80 | +62.70↑ | | | |
| 期权市场 | 菜粕平值看涨期权波动率(%) | 18.34 | | 菜粕平值看跌期权波动率(%) | 18.34 | | | | |
| | 标的20日历史波动率(%) | 12.08 | +0.30↑ | 标的60日历史波动率(%) | 16.91 | -0.21↓ | | | |
| | 菜油平值看涨期权波动率(%) | 25.58 | | 菜油平值看跌期权波动率(%) | 24.01 | | | | |
| | 标的20日历史波动率(%) | 19.22 | +0.65↑ | 标的60日历史波动率(%) | 23.15 | +0.46↑ | | | |
| 行业消息 | 1、周三洲际交易所 (ICE) 的加拿大油菜籽期货连续第九个交易日下跌, 其中基准期约收低0.9%, 因外部市场走低带来压力。截至收盘, 5月期约收低6.60加元, 报收751加元/吨; 7月期约收低7.50加元, 报收747.60加元/吨; 11月期约收低6.50加元, 报收729.40加元/吨。 | | |  更多资讯请关注! | | | | | |
| 观点总结 菜粕 | 布宜诺斯艾利斯谷物交易所 (BAGE) 称, 截至3月8日的一周, 过去七天的高温干燥天气导致大豆单产以及可收获面积进一步受损。不过, 巴西大豆产量维持绝对高位, 且随着巴西收割持续推进, 出口需求转向南美, 限制国际大豆价格涨势。同时, 分析机构艾伦代尔公司发布的年度调查显示, 美国农民在2023年将种植8776.8万英亩大豆, 高于美国农业部在2月份年度展望论坛上所预测的8750万英亩, 也高于2022年的大豆种植面积8745万英亩。另外, 美国银行倒闭, 引发全球经济忧虑大幅升温, 宏观氛围转弱, 拖累全球商品市场整体走势。菜粕方面, 据我的农产品网船期数据预估3月油菜籽进口到港预估达95万吨, 菜籽供应相对充裕, 油厂开机率大幅回升, 菜粕产出大幅增加。不过, 随着温度回升, 南方水产养殖将逐步启动, 且豆菜粕价差较大, 菜粕替代优势凸显, 增加菜粕需求预期, 提振菜粕期价走势。总的来看, 近期受宏观氛围影响, 菜粕走势继续偏弱, 短期维持偏空思路。 | | |  更多观点请咨询! | | | | | |
| 观点总结 菜油 | 美国农业部在3月份供需报告中仍预计加拿大油菜籽产量为1900万吨, 同时将全球油菜籽产量预估上调了1.44%, 约为8631万吨, 国际油菜籽高位承压。且澳大利亚油菜籽丰收, 将对加拿大的出口构成有力的竞争。同时宏观氛围不佳, 叠加原油市场下跌, 拖累油脂同步下跌。不过, 强降水和洪水影响马棕产量, 马来西亚棕榈油局 (MPOB) 公布的数据显示, 马来西亚2月末棕榈油库存较前月下滑6.56%, 至212万吨。同时, 高频数据显示, 马棕1-15日出口继续大幅增加, 利好油脂市场。国内市场方面, 据我的农产品网船期数据预估3月油菜籽进口到港预估达95万吨, 油厂有望维持较高的开机率, 菜油供应相对充裕。且菜油储备轮出, 市场供给充裕, 打压菜油价格。总的来看, 菜油基本面相对较弱。盘面来看, 近期菜油持续走低, 短期有望偏弱运行。 | | | | | | | | |
| 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 | | | | | | | | |