

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	菜粕主力合约收盘价(日, 元/吨)	3,655.00	-79.00↓	菜油主力合约收盘价(日, 元/吨)	14,224.00	+132.00↑
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	602.00	-36.00↓	菜油9-1价差(日, 元/吨)	438.00	+46.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	191,736.00	+7427.00↑	菜油持仓量(日, 手)	167,542.00	+4615.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-3,766.00	-2459.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-935.00	-2632.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	3,151.00	-10.00↓	菜油仓单(日, 张)	0.00	0.00
现货市场	ICE油菜籽7月合约收盘价(加元/吨)	1,123.70	+14.90↑	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,800.00	+4.00↑
	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,830.00	-20.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	14,730.00	+110.00↑
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	8,457.11	+105.48↑	进口菜油价格(广东, 日, 元/吨)	14,200.00	0.00
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	7,100.00	+100.00↑	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.85	+0.05↑
替代品现货 价格	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	175.00	+59.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	506.00	-22.00↓
	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	12,740.00	+80.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	1,990.00	+30.00↑
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	16,110.00	+100.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	-1,380.00	+10.00↑
上游情况	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,250.00	-10.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	420.00	+10.00↑
	加拿大油菜籽产量预估(月, 万吨)	2,000.00	+740.00↑	我国油菜籽产量预估(月, 万吨)	1,470.00	+70.00↑
	油菜籽进口量(月, 万吨)	7.89	-3.67↓	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-943.80	0.00
产业情况	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	20.50	-2.50↓	进口油菜籽开机率(周, %)	11.31	+7.69↑
	颗粒菜粕进口量(月, 万吨)	18.99	+2.31↑	菜籽油进口量(月, 万吨)	7.00	-2.00↓
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	12.30	+1.40↑	菜籽油华东库存(周, 万吨)	21.80	+0.88↑
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	5.25	+1.02↑	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	3.1	-0.25↓
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	21.57	-2.02↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	2.00	0.00
下游情况	菜粕提货量(周, 万吨)	0.23	+0.08↑	菜油提货量(周, 万吨)	3.25	+1.54↑
	水产饲料产量(月, 吨)	190.00	+5.00↑	餐饮收入(4月, 亿元)	2,608.90	-326.40↓
	饲料总产量(月, 吨)	2,249.00	-87.00↓	食用植物油产量(4月, 万吨)	359.40	-45.50↓
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	28.19		菜粕平值看跌期权波动率(%)	27.23	
	标的20日历史波动率(%)	25.47	-0.60↓	标的60日历史波动率(%)	33.67	-2.09↓
行业消息	1、：周一洲际交易所 (ICE) 加拿大油菜籽期货市场收盘上涨，从近期的低点反弹。截至收盘，7月期约收高14.90加元，报收1123.70加元/吨；11月期约收高3.30加元，报收1042.60加元/吨；1月期约收高3.10加元，报收1047加元/吨。 2、					
观点总结 菜粕	由于加籽春播进展加快，而出口需求放慢，对油菜籽价格构成压力。且美豆种植速度快速提升，缓解市场对种植偏慢的担忧，美豆高位回落。不过，加籽进口价格仍然大幅高于国内市场价，且天气影响仍作用于美豆，增加粕类波动幅度。国内方面，油厂压榨量偏低，可交割菜粕较少，支撑菜粕市场。不过，我国油菜籽即将步入收获季，菜粕供应有望增加。且菜粕进口持续处于同期较高水平，弥补国内油厂压榨产出减少量。另外，近来菜粕下游提货不积极，库存有所回升，且豆粕库存持续增加，蛋白粕压力加大。盘面来看，菜粕维持震荡趋势，暂且观望。					
观点总结 菜油	由于加籽春播进展加快，而出口需求放慢，对油菜籽价格构成压力。不过，加籽进口价格仍然大幅高于国内市场价。且印尼棕榈油出口恢复进度低于市场预期，马棕MPOB月度报告发布前，市场预期利好，全球油脂供应短缺现象短期内仍无法有效改善。同时，欧盟对俄罗斯石油制裁方面有明显突破，原油走强提振油脂市场。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国内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2022年第22周，沿海地区主要油厂菜籽压榨量为2.5万吨，本周开机率11.31%，油厂开机率持续处于最低水平，菜油产出有限。同时，三大油脂进口数量均大幅下降，目前低库存现状是国内油脂市场高位运行的重要支撑。盘面来看，菜油期价仍处于偏强震荡趋势，偏多思路对待。					
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, 6月11日00:00点USDA月度供需报告					

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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!