

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	大连棕榈油 主力合约收盘价(元/吨)	7,840.00	0.00	大连棕榈油5-9价差 (元/吨)	-6	+10.00↑
	大连棕榈油 持仓量 (手)	525,853.00	-15373↓			
	大连棕榈油 前20名净持仓 (手)	-58,943	+1232↑	大连棕榈油 仓单 (张)	6531	0.00
	马棕主力收盘价(令吉/吨)	3,868.00	+71.00↑	NYMEX轻质原油结算价(美元/桶)	79.48	-1↓
现货价格	现货24度 (天津) (元/吨)	7,770.00	-470.00↓	马来西亚FOB离岸价 (美元/吨)	945.00	+15↑
	现货24度 (张家港) (元/吨)	7,810.00	0.00	马来西亚CNF到岸价 (美元/吨)	972.00	+15↑
	现货24度 (广东) (元/吨)	7,860.00	0.00			
	DCE P 主力合约基差(东莞) (元/吨)	-70.00	0.00			
上游情况	马来棕榈油产量 (月, 吨)	1618853	-61888↓	马来棕榈油出口量 (月, 吨)	1468448	-52881↓
	马来棕榈油库存 (月, 吨)	2194809	-93662↓	马来棕榈油压榨率 (月, %)	19.55	-0.21↓
	印尼棕榈油产量 (月, 万吨)	455		印尼棕榈油出口量 (月, 万吨)	303	
	印尼棕榈油库存 (月, 万吨)	338				
	船运机构SGS前15日出口(5日, 吨)	453771	-28.500%	船运机构ITS前15日出口(5日, 吨)	409731	-36.9%
	SPPOMA前5日产量(5日, 吨)		-15.25%	MPOA12月1-31日产量(5日, 吨)		-4.42%
	豆油-棕榈油FOB价差(美元/吨)	241.54	+5.74↑			
产业情况	棕榈油港口库存 (周, 万吨)	104.05	+0.90↑	马来西亚进口棕榈油利润(日, 元/吨)	-147.53	-120.30↓
	棕榈油进口量 (月, 万吨)	43	-27.00↓	豆油库存 (周, 万吨)	55.95	-0.10↓
	菜油库存 (周, 万吨)	1.52	+0.05↑			
	马来西亚进口成本价(日,元/吨)	7,917.53	+120↑			
	豆油 (江苏) (元/吨)	9,580.00	+20.00↑	菜油 (江苏) (元/吨)	11,680.00	-50↓
	豆棕现货价差 (元/吨)	1,810.00	+20.00↑	菜棕现货价差 (元/吨)	3,910.00	-50↓
下游情况	马来棕榈油食品用量(年,百万吨)	845.00	+35.00↑	马来棕榈油工业用量(年,百万吨)	2,700.00	+277↑
	印尼棕榈油食品用量(年,百万吨)	6,900.00	+250.00↑	印尼棕榈油工业用量(年,百万吨)	10,700.00	+700↑
	中国棕榈油食品用量(年,百万吨)	4,750.00	+650.00↑	中国棕榈油工业用量(年,百万吨)	2,200.00	+1150↑
产区天气						
期权市场	棕榈油期货平值看涨期权波动率(%)	30.95		棕榈油期货平值看跌期权波动率(%)	30.14	
	棕榈油平值期权20日历史波动率(%)	26.95		棕榈油平值期权60日历史波动率(%)	31.12	

行业消息

1. 印尼贸易部长表示, 该国计划在6月前推出毛棕榈油基准价格。
2. 2022年12月, 中国棕榈油进口量为43万吨, 同比减少2.3%。全年棕榈油进口量总计为341万吨, 同比下滑26.8%



更多资讯请关注!

观点总结

从基本面来看, 马来西亚棕油局 MPOB) 最新数据显示, 截至12月底马来西亚棕榈油库存为219万吨, 环比下降4.09%, 略高于预期的217万吨。库存依然偏高, 报告影响中性偏空。另外, 从高频的出口数据来看, 根据船运调查机构ITS公布的数据显示, 马来西亚1月1-15日棕榈油出口量为409731吨, 较12月1-15日出口的649782吨减少36.9%。马棕出口表现不佳, 加之印度或提高关税引发市场需求担忧, 也在一定程度上拖累棕榈油的价格。国内方面, 1月11日, 沿海地区食用棕榈油库存 78 万吨 (加上工棕 94 万吨), 周环比减少 4 万吨, 月环比减少 5 万吨, 同比增加 35万吨。其中天津 14 万吨, 江苏张家港 28 万吨, 广东 22 万吨。国内成交一般但提货尚可, 叠加到船减少, 国内棕榈油库存连续第二周下降, 转入去库存阶段。不过, 近期人民币大幅升值, 导致进口成本下降, 对棕榈油的价格有所打击。盘面来看, 棕榈油期价企稳小幅上涨, 不过需求不振对棕榈油的打击较大, 可能延长库存消化的周期, 限制棕榈油反弹空间。



更多观点请咨询!

重点关注

周四中国粮油信息中心公布棕榈油库存情况, 20日ITS&SGS公布马来棕榈油出口情况

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!