

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) | 3,356.00 | +29.00↑ | 菜油主力合约收盘价(日, 元/吨) | 11,825.00 | +68.00↑ |
| | 菜粕9-1价差(日, 元/吨) | 571.00 | +18.00↑ | 菜油9-1价差(日, 元/吨) | 430.00 | -140.00↓ |
| | 菜粕持仓量(日, 手) | 153,833.00 | -10700.00↓ | 菜油持仓量(日, 手) | 130,735.00 | -289.00↓ |
| | 菜粕期货前20名净持仓(日, 手) | 4,564.00 | -6808.00↓ | 菜油期货前20名净持仓(日, 手) | -9,562.00 | +5007.00↑ |
| | 菜粕仓单(日, 张) | 2,137.00 | -7.00↓ | 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) | 882.50 | +2.30↑ | 菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨) | 6,554.00 | +79.00↑ |
| | 江苏南通菜粕价格(日, 元/吨) | 3,590.00 | +30.00↑ | 江苏菜油价格(日, 元/吨) | 12,600.00 | -160.00↓ |
| | 油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨) | 6,769.64 | +28.18↑ | 菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨) | 14,356.25 | +308.16↑ |
| | 国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨) | 7,000.00 | 0.00 | 油粕比(江苏菜油/菜粕, 日) | 3.51 | -0.07↓ |
| 替代品现货 价格 | 菜粕主力合约基差(日, 元/吨) | 234.00 | +1.00↑ | 菜油主力合约基差(日, 元/吨) | 775.00 | -228.00↓ |
| | 江苏南京豆油价格(日, 元/吨) | 10,860.00 | +160.00↑ | 与菜油价差(日, 元/吨) | 1,740.00 | -320.00↓ |
| | 广东广州棕榈油价格(日, 元/吨) | 12,670.00 | +190.00↑ | 与菜油价差(日, 元/吨) | -70.00 | -350.00↓ |
| 上游情况 | 江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨) | 4,030.00 | +50.00↑ | 与菜粕价差(日, 元/吨) | 440.00 | +20.00↑ |
| | 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) | 13.03 | +5.14↑ | 油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨) | -26.00 | +69.00↑ |
| 产业情况 | 沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨) | 16.50 | -4.00↓ | 进口油菜籽开机率(周, %) | 13.12 | -4.97↓ |
| | 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) | 11.80 | -0.20↓ | 菜籽油华东库存(周, 万吨) | 18.57 | -1.23↓ |
| | 沿海地区菜粕库存(周, 万吨) | 6.34 | -0.11↓ | 菜籽油沿海库存(周, 万吨) | 1.68 | -0.87↓ |
| | 华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨) | 26.02 | +0.27↑ | 菜籽油广西库存(周, 万吨) | 1.10 | -0.40↓ |
| 下游情况 | 菜粕提货量(周, 万吨) | 2.21 | +3.41↑ | 菜油提货量(周, 万吨) | 1.62 | +1.83↑ |
| | 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(%) | 34.71 | | 菜粕平值看跌期权波动率(%) | 34.47 | |
| | 标的20日历史波动率(%) | 32.51 | -0.50↓ | 标的60日历史波动率(%) | 33.6 | +0.10↑ |
| 行业消息 | 1、周五洲际交易所 (ICE) 加拿大油菜籽期货市场收盘上涨, 其中基准期约收高3%, 因为近期大盘跌势过头, 最终用户逢低吸纳。截至收盘, 7月期约收高2.30加元, 报收882.50加元/吨; 11月期约收高25.5加元, 报收870.20加元/吨; 1月期约收高25.70加元, 报收876.20加元/吨。 2、 | | | | | |
| | | | | | | |
| 观点总结 菜粕 | 加拿大主产区天气改善, 有助于改善油菜籽单产潜力, 令油菜籽作物承压下行, 6月至今加拿大油菜籽下跌近26%。且美豆优良率高于去年同期, 降低市场炒作概率, 限制美豆价格。另外, 全球经济衰退的忧虑导致资金大幅撤离, 近期市场空头氛围骤增。国内方面, 今年菜籽收购价格高开高走, 明显高于往年同期, 给菜粕以成本支撑。不过, 油菜籽进入上市高峰, 菜粕产出有望增加, 而菜粕下游提货不积极, 库存处于回升趋势, 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, 蛋白粕压力加大。盘面来看, 菜粕触底回升, 跌势有所放缓, 不过仍处于空头趋势中, 偏空思路对待。 | | | | | |
| | | | | | | |
| 观点总结 菜油 | 加拿大主产区天气改善, 有助于改善油菜籽单产潜力, 令油菜籽作物承压下行, 6月至今加拿大油菜籽下跌近26%。同时, 印尼加速出口, 而马来西亚棕榈油出口明显放缓, 且产量有所恢复, 棕榈油市场出现恐慌性抛压, 对油脂市场形成压力。另外, 美联储激进加息, 并在最新的货币政策报告中提出或将无条件维持物价稳定, 引发市场对经济衰退的悲观预期, 原油市场高位大幅回落, 拖累油脂市场。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, 而下游提货情况尚可, 沿海地区菜油库存继续下降。盘面来看, 在悲观氛围下, 菜油期价急转直下, 预计仍处于调整态势。 | | | | | |
| | | | | | | |
| 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30日USDA实际种植面积预估 | | | | | |

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!