

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)   | 8,120.00   | -362.00↓ | 大连棕榈油 9-1价差 (元/吨)    | 126   | -38.00↓  |
|      | 大连棕榈油 持仓量 (手)  | 293,886.00 | -12140↓  |                      |   |          |
|      | 大连棕榈油 前20名净持仓 (手)  | -59,639    | -25792↓  | 大连棕榈油 仓单 (张)         | 1300  | -30↓     |
|      | 马棕主力收盘价(令吉/吨)  | 4,073.00   | -233.00↓ | NYMEX轻质原油结算价(美元/桶)   | 93.89   | -5↓      |
| 现货价格 | 现货24度 (天津) (元/吨)   | 10,230.00  | -470.00↓ | 马来西亚FOB离岸价 (美元/吨)    | 1,052.00  | -41↓     |
|      | 现货24度 (张家港) (元/吨)  | 10,030.00  | -370.00↓ | 马来西亚CNF到岸价 (美元/吨)    | 1,080.00  | -40↓     |
|      | 现货24度 (广东) (元/吨)   | 9,780.00   | -370.00↓ |                      |   |          |
|      | DCE P 主力合约基差(东莞) (元/吨)   | #N/A       | #N/A     |                      |   |          |
| 上游情况 | 马来棕榈油产量 (月, 吨)   | 1545129    | +84097↑  | 马来棕榈油出口量 (月, 吨)      | 1193861   | -182555↓ |
|      | 马来棕榈油库存 (月, 吨)   | 1655073    | +133247↑ | 马来棕榈油压榨率 (月, %)      | 19.66   | -0.32↓   |
|      | 印尼棕榈油产量 (月, 万吨)  | 341        |          | 印尼棕榈油出口量 (月, 万吨)     | 67.8  |          |
|      | 印尼棕榈油库存 (月, 万吨)  | 723        |          |                      |   |          |
|      | 船运机构SGS前25日出口(5日, 吨)   | 970243     | +245960↑ | 船运机构ITS前25日出口(5日, 吨) | 878879  | +211370↑ |
|      | SPPOMA前20日产量(5日, 吨)  |            | -5.82%   | MPOA7月1-20日产量(5日, 吨) |   | -4.64%   |
|      | 豆油-棕榈油FOB价差(美元/吨)  | 290.85     | +14.09↑  |                      |   |          |
| 产业情况 | 棕榈油港口库存 (周, 万吨)  | 27.6       | -2.20↓   | 马来西亚进口棕榈油利润(日, 元/吨)  | 1,426.15  | -88.34↓  |
|      | 棕榈油进口量 (月, 万吨)   | 7          | -4.00↓   | 豆油库存 (周, 万吨)         | 72.40   | -4.00↓   |
|      | 菜油库存 (周, 万吨)   | 0.55       | -0.04↓   |                      |   |          |
|      | 马来西亚进口成本价(日,元/吨)   | 8,803.85   | -282↓    |                      |   |          |
|      | 豆油 (江苏) (元/吨)  | 10,600.00  | -100.00↓ | 菜油 (江苏) (元/吨)        | 12,650.00   | -200↓    |
|      | 豆棕现货价差 (元/吨)   | 0.00       | -280.00↓ | 菜棕现货价差 (元/吨)         | 2,420.00  | +170↑    |
| 下游情况 | 马来棕榈油食品用量(年,百万吨)   | 835.00     | +35.00↑  | 马来棕榈油工业用量(年,百万吨)     | 2,700.00  | +100↑    |
|      | 印尼棕榈油食品用量(年,百万吨)   | 6,900.00   | +173.00↑ | 印尼棕榈油工业用量(年,百万吨)     | 10,200.00   | +350↑    |
|      | 中国棕榈油食品用量(年,百万吨)   | 4,650.00   | +450.00↑ | 中国棕榈油工业用量(年,百万吨)     | 2,250.00  | +1200↑   |
| 产区天气 |  |            |          |                      |   |          |
| 期权市场 | 棕榈油期货平值看涨期权波动率(%)  | 56.07      |          | 棕榈油期货平值看跌期权波动率(%)    | 57.56   |          |
|      | 棕榈油平值期权20日历史波动率(%)   | 57.87      |          | 棕榈油平值期权60日历史波动率(%)   | 45.81   |          |
| 行业消息 | 1据南部半岛棕榈油压榨商协会 (SPPOMA) 数据显示, 2022年7月1-20日马来西亚棕榈油单产下滑7.55%, 出油率增加0.36%, 产量下降5.82%。<br>2据船运调查机构ITS数据显示, 马来西亚7月1-25日棕榈油出口量为878,879吨, 较6月同期出口的990,958吨下滑11.3%。  |            |          |                      | <br>更多资讯请关注! |          |
| 观点总结 | 从基本面来看, 据南部半岛棕榈油压榨商协会 (SPPOMA) 数据显示, 2022年7月1-20日马来西亚棕榈油单产下滑7.55%, 出油率增加0.36%, 产量下降5.82%。据船运调查机构ITS数据显示, 马来西亚7月1-25日棕榈油出口量为878,879吨, 较6月同期出口的990,958吨下滑11.3%。马棕受劳动力不足的问题的影响, 产量继续下降, 部分抵消了出口继续回落的利空影响。国内基本面来看, 近期棕榈油到港量不大, 库存小幅下降。7月27日, 沿海地区食用棕榈油库存22万吨(加上工棕31万吨), 比上周同期减少2万吨, 月环比增加9万吨, 同比减少8万吨。其中天津6万吨, 江苏张家港6万吨, 广东4万吨。近期国内棕榈油现货供应仍然偏紧, 买船进度偏慢。印尼政府允许出口发运九倍于他们国内销售的数量, 原来是七倍, 压制棕榈油的价格。另外, 印尼方面表示, 将继续下调棕榈油出口税参考价, 进一步打击棕榈油的价格, 盘面来看, 棕榈油高位有所回落, 后期反弹动力仍需关注。 |            |          |                      | <br>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, 5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!