



撰写人: 许方莉 从业资格号: 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01合约收盘价(日, 元/吨)	2,721.00	-40.00↓	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	11,990.00	+103.00↑
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	585.00	-4.00↓	菜油9-1价差(日, 元/吨)	888.00	+142.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	281,746.00	+6151.00↑	菜油持仓量(日, 手)	112,650.00	+4610.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-13,519.00	-5674.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-6,853.00	+3697.00↑
	菜粕仓单(日, 张)	542.00	+100.00↑	菜油仓单(日, 张)	168.00	0.00
	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	892.80	0.00	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,631.00	-9.00↓
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,420.00	-40.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	13,210.00	0.00
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,890.72	+18.89↑	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	13,730.80	+467.03↑
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,900.00	-60.00↓	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.86	+0.04↑
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	699.00	0.00	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	1,220.00	-103.00↓
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	10,450.00	-200.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	2,760.00	+200.00↑
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	10,230.00	-370.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	2,980.00	+370.00↑
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,220.00	-30.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	800.00	+10.00↑
上游情况	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)	5.40	-7.63↓	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-447.00	-136.00↓
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	22.00	-2.00↓	进口油菜籽开机率(周, %)	8.51	-1.28↓
产业情况	颗粒菜粕进口量(月, 万吨)	21.07	-2.74↓	菜籽油进口量(月, 万吨)	7.00	-5.00↓
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	14.90	-0.30↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	16.60	+0.15↑
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	3.96	-0.69↓	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	0.55	-0.04↓
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	20.70	-4.80↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.50	0.00
	菜粕提货量(周, 万吨)	2.1	+0.30↑	菜油提货量(周, 万吨)	3.51	+2.99↑
下游情况	水产饲料产量(月, 吨)	252.00	+62.00↑	餐饮收入(月, 亿元)	3,765.70	+753.40↑
	饲料总产量(月, 吨)	2,332.00	-20.00↓	食用植物油产量(月, 万吨)	397.90	-8.20↓
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	29.31		菜粕平值看跌期权波动率(%)	30.80	
	标的20日历史波动率(%)	34.19	+0.38↑	标的60日历史波动率(%)	45.23	-0.17↓

行业消息	1、周一洲际交易所 (ICE) 的加拿大油菜籽期货市场休市。 2、	
观点总结 菜粕	加拿大农业及农业食品部发布的最新供需报告显示, 2022/23年度的油菜籽产量为1840万吨, 比上月预测值高出45万吨, 也远远高于去年的1259.5万吨。加拿大西部大草原地区天气条件相对良好, 有助于油菜籽作物生长, 加籽新季供应预期增加的概率大幅增强, 对油菜籽价格有所牵制。同时, 美豆压榨及出口也表现不佳, 且美豆优良率意外回升至60%, 高于分析师预估值58%, 对美豆价格亦有所牵制。不过, 天气预报显示8月初美国中西部地区将出现炎热天气, 不利于大豆作物的生长, 天气升水预期仍存, 对美豆有所支撑。国内方面, 6月油菜籽进口总量仅5.4万吨, 进口菜籽压榨持续偏低, 菜粕产出较少, 不过国内市场通过直接进口菜粕来弥补其供应缺口, 菜粕直接进口量持续处于同期高位。且库存水平仍然处于同期高位。盘面来看, 受美豆下挫影响, 菜粕低开低走, 暂且观望。	
观点总结 菜油	加拿大农业及农业食品部发布的最新供需报告显示, 2022/23年度的油菜籽产量为1840万吨, 比上月预测值高出45万吨, 也远远高于去年的1259.5万吨。加拿大西部大草原地区天气条件相对良好, 有助于油菜籽作物生长, 加籽新季供应预期增加的概率大幅增强, 对油菜籽价格有所牵制。同时, 印尼将出口配额进一步放宽至九倍, 并下调出口税, 进一步打压棕榈油市场价格。国内市场方面, 油菜籽及菜籽油进口量持续维持最低水平, 菜油供应压力有限, 沿海地区菜油库存处于近年来最低位, 库存压力较小。总的来看, 在新季加籽上市前, 国内菜油供应持续低于往年同期, 支撑菜油走势强于其它油脂。盘面来看, 受外围市场下跌影响, 菜油期价反弹力度有所减弱, 前期多单可择机减仓。	
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	

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