

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	菜粕09合约收盘价(日, 元/吨)	3,737.00	+66.00↑	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	9,199.00	-190.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	602.00	+73.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	130.00	+2.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	325,232.00	+3644.00↑	菜油持仓量(日, 手)	172,196.00	-8367.00↓
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	12,655.00	+14423.00↑	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-18,611.00	-3058.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	0.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	42.00	-479.00↓
	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	774.00	-5.10↓	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	5,848.00	-18.00↓
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,930.00	0.00	江苏菜油价格(日, 元/吨)	9,450.00	-230.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	5,467.07	-51.49↓	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	13,592.07	0.00
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,600.00	0.00	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	2.40	-0.06↓
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	193.00	-66.00↓	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	251.00	-40.00↓
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	8,480.00	-40.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	970.00	-190.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	7,610.00	-70.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,840.00	-160.00↓
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,460.00	-20.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	530.00	-20.00↓
上游情况	加拿大油菜籽产量预估(月, 万吨)	2,030.00	0.00	我国油菜籽产量预估(月, 万吨)	1,540.00	0.00
	油菜籽进口量(月, 万吨)	60.31	+0.42↑	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-316.00	-9.00↓
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	15.90	-1.60↓	进口油菜籽开机率(周, %)	26.19	+8.10↑
产业情况	颗粒菜粕进口量(月, 万吨)	19.95	-0.60↓	菜籽油进口量(月, 万吨)	17.00	-14.00↓
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	0.00	0.00	菜籽油华东库存(周, 万吨)	31.27	+1.23↑
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	2.34	+1.14↑	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	8.6	+0.80↑
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	2.55	+0.64↑	菜籽油广西库存(周, 万吨)	4.20	-0.10↓
	菜粕提货量(周, 万吨)	4.06		菜油提货量(周, 万吨)	3.88	
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,629.00	-35.00↓	餐饮收入(月, 亿元)	4,371.00	+301.00↑
				食用植物油产量(月, 万吨)	420.10	+7.70↑
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	23.61		菜粕平值看跌期权波动率(%)	25.21	
	标的20日历史波动率(%)	21.35	-0.83↓	标的60日历史波动率(%)	27.73	+0.16↑
	菜油平值看涨期权波动率(%)	20.90		菜油平值看跌期权波动率(%)	21.34	
	标的20日历史波动率(%)	21.80	+0.08↑	标的60日历史波动率(%)	26.71	+0.29↑
行业消息	1、周三洲际交易所(ICE)的加拿大油菜籽期货市场连续第五个交易日下跌, 其中基准期约收低0.70%, 因为油菜籽单产潜力改善, 最终用户的需求匮乏。截止收盘, 11月期约收低5.10加元, 报收774加元/吨; 1月期约收低5.60加元, 报收778.30加元/吨; 3月期约收低5加元, 报收780.90加元/吨。					
观点总结 菜粕	美国天气预报显示8月初天气转凉且降雨增加, 市场对美豆单产下调的担忧减弱, 美豆市场出现自高位回吐天气升水现象, 或将拖累国内粕价。不过, 美国农业部周度作物生长报告显示, 截止7月30日当周, 美豆优良率为52%, 低于市场预期的53%, 前一周为54%, 上年同期为60%。美豆优良率持续偏低, 对美豆仍有支撑。国内菜粕市场而言, 菜籽进口到港大幅减少, 将限制菜粕供应量。且菜粕处于需求旺季, 需求终端采购持续向好, 榨企库存偏低, 支撑菜粕价格。不过, 豆粕替代优势显现, 减弱菜粕需求。豆粕来看, 近期巴西港口排期时间延长, 进口大豆到港预期下滑, 且传闻海关对进口大豆的检验检疫收紧, 进厂速度变慢, 限制豆粕供应量, 利好粕价。盘面来看, 今日菜粕大幅收涨, 整体维持高位震荡。					 更多资讯请关注!
观点总结 菜油	宏观方面, 惠誉下调美国信用评级, 国内商品市场普跌, 油脂金融属性较强, 同步跟跌。虽然大草原的一些地区仍然较为干燥, 但是许多地区在过去一周里获得了降水, 缓解市场对油菜籽作物状况的担忧。曼尼托巴省的最新周报显示, 该省大部分油菜籽生长状况良好。大幅回吐前期天气升水预期, 加籽价格连续回降。其它油籽方面, 马棕出口数据强劲支撑棕榈油价格, 不过, 美豆作物天气预期有所转好, 炒作情绪放缓, 施压美豆市场。国内菜油方面, 进口菜籽到港大幅减少, 油厂开机率受限, 菜油供应压力明显减弱, 库存高位回落。不过, 油厂压榨量走高, 豆油需求增量不及供应, 周库存持续上升。另外, 加籽高位回落, 成本支撑减弱, 拖累菜油价格。盘面来看, 菜油大幅走低, 减仓现象较为明显, 短期走势偏弱。					 更多观点请咨询!
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					