

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)	3,765.00	+18.00↑	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	9,276.00	+1.00↑
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	601.00	+33.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	138.00	-21.00↓
	菜粕持仓量(日, 手)	292,534.00	-7863.00↓	菜油持仓量(日, 手)	138,505.00	-12742.00↓
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	12,891.00	-3101.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-22,505.00	-7191.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	1,300.00	+1300.00↑	菜油仓单(日, 张)	42.00	0.00
	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	797.50	+16.60↑	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	5,878.00	+8.00↑
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,960.00	+20.00↑	江苏菜油价格(日, 元/吨)	9,450.00	0.00
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	5,597.93	+106.88↑	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	13,622.18	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)	2.39	-0.01↓
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	195.00	+2.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	174.00	-1.00↓
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	8,410.00	-70.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,040.00	+70.00↑
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	7,580.00	-30.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,870.00	+30.00↑
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,550.00	+90.00↑	与菜粕价差(日, 元/吨)	590.00	+70.00↑
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)	-420.00	-96.00↓
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	25.10	+9.20↑	进口油菜籽开机率(周, %)	11.07	-15.12↓
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)	31.39	+0.12↑
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	1.70	-0.64↓	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	9.98	+1.38↑
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	1.56	-0.99↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	4.10	-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(%)	24.39		菜粕平值看跌期权波动率(%)	24.14	
	标的20日历史波动率(%)	21.29	+0.02↑	标的60日历史波动率(%)	27.35	-0.02↓
	菜油平值看涨期权波动率(%)	20.76		菜油平值看跌期权波动率(%)	21.78	
	标的20日历史波动率(%)	21.29	-0.37↓	标的60日历史波动率(%)	26.31	-0.43↓
行业消息	1、周五洲际交易所(ICE)的加拿大油菜籽期货市场收盘上涨,其中基准期约收高0.9%,长周末前交易商调整仓位。截止收盘,11月期约收高16.60加元,报收797.50加元/吨;1月期约收高15.70加元,报收799.90加元/吨;3月期约收高14加元,报收799.60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,豆菜粕现货价差跌至偏低水平,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,受豆粕供应预期收紧提振,菜粕期价有所走强,整体维持高位震荡。					 更多资讯请关注!
观点总结 菜油	萨斯喀彻温省的作物周报显示,截至7月31日的一周里,全省大部分地区依然干燥。自4月1日以来,全国的降雨量只有200毫米或更低。油菜籽优良率为35%,与一周前持平。加籽产量存下调预期,支撑加籽市场价格。不过,大草原的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。且美豆作物天气预期有所转好,炒作情绪放缓,施压美豆价格回降。拖内国内油脂市场走势。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,近期菜油高位回落,减仓现象较为明显,短期暂且观望。					 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					