

撰写人: 王翠冰 从业资格号: 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)	3,732.00	-33.00↓	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	9,186.00	-90.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	601.00	0.00	菜油9-1价差(日, 元/吨)	164.00	+26.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	259,788.00	-32746.00↓	菜油持仓量(日, 手)	133,225.00	-5280.00↓
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	14,619.00	+1728.00↑	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-27,272.00	-4767.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	1,607.00	+307.00↑	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	0.00	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	5,851.00	-27.00↓
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,930.00	-30.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	9,380.00	-70.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	5,606.45	+8.52↑	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	13,825.71	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	+0.00↑
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	198.00	+3.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	194.00	+20.00↑
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	8,350.00	-60.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,030.00	-10.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	7,430.00	-150.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,950.00	+80.00↑
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,550.00	0.00	与菜粕价差(日, 元/吨)	620.00	+30.00↑
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)	-372.00	+48.00↑
	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)	2.81		菜油提货量(周, 万吨)	2.12	
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(%)	23.19		菜粕平值看跌期权波动率(%)	23.21	
	标的20日历史波动率(%)	21.58	+0.29↑	标的60日历史波动率(%)	27.25	-0.10↓
	菜油平值看涨期权波动率(%)	21.40		菜油平值看跌期权波动率(%)	21.17	
	标的20日历史波动率(%)	21.13	-0.16↓	标的60日历史波动率(%)	26.32	+0.01↑
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。					
观点总结 菜粕	<p>美国天气预报显示8月初天气转凉且降雨增加, 美国农业部周度作物生长报告显示, 截止8月6日当周, 美豆优良率为54%, 高于市场预期的53%, 前一周为52%, 上年同期为59%。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, 拖累国内粕价。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, 国内粕价表现明显强于外盘, 菜粕整体维持高位震荡。</p>				<p>更多资讯请关注!</p>  <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结 菜油	<p>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。在8月10日马来西亚棕榈油局 (MPOB) 公布月报前, 一项调查显示, 马来西亚7月棕榈油库存可能升至五个月高点。外盘油脂走势偏弱, 拖累国内油脂市场。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, 国内三大植物油库存总量保持增长态势, 且前期炒作情绪下降, 拖累油脂集体回落。盘面来看, 菜油继续回落, 短期走势偏弱。</p>					
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					