

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)	3,969.00	+21.00↑	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	9,174.00	-13.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	683.00	+8.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	202.00	+35.00↑
	菜粕持仓量(日, 手)	426,477.00	+261659.00↑	菜油持仓量(日, 手)	70,144.00	-10807.00↓
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	43,239.00	+14452.00↑	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-20,952.00	+3286.00↑
	菜粕仓单(日, 张)	1,607.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	522.00	0.00
	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	777.40	+6.60↑	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,109.00	-53.00↓
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	4,000.00	-10.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	9,300.00	0.00
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	5,761.67	+61.07↑	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	12,607.89	0.00
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,540.00	0.00	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	2.33	+0.01↑
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	31.00	-31.00↓	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	126.00	+13.00↑
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	8,650.00	+40.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	650.00	-40.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	7,650.00	+100.00↑	与菜油价差(日, 元/吨)	1,650.00	-100.00↓
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,660.00	+10.00↑	与菜粕价差(日, 元/吨)	660.00	+20.00↑
上游情况	加拿大油菜籽产量预估(月, 万吨)	1,900.00	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)	-256.00	0.00
	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)	29.54	-1.85↓
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	1.50	-0.20↓	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	9.23	-0.75↓
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	0.10	-1.55↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	4.60	+0.50↑
	菜粕提货量(周, 万吨)	3.28		菜油提货量(周, 万吨)	2.78	
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,629.00	-35.00↓	餐饮收入(月, 亿元)	4,277.00	-94.00↓
				食用植物油产量(月, 万吨)	420.10	0.00
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(%)	23.99	
	标的20日历史波动率(%)	21.65	-0.80↓	标的60日历史波动率(%)	26.90	-0.05↓
	菜油平值看涨期权波动率(%)	20.65		菜油平值看跌期权波动率(%)	20.60	
	标的20日历史波动率(%)	20.44	-0.01↓	标的60日历史波动率(%)	24.61	-1.74↓
行业消息	1、周二洲际交易所(ICE)的加拿大油菜籽期货市场连续第二个交易日上涨, 其中基准期约收高0.9%, 突破了200日均线。截至收盘, 11月期约收高6.60加元, 报收777.40加元/吨; 1月期约收高7.10加元, 报收783.50加元/吨; 3月期约收高7.60加元, 报收786.70加元/吨。					
观点总结 菜粕	USDA报告显示, 美国2023/24年度大豆产量预估为42.05亿蒲式耳, 单产预估为每英亩50.9蒲式耳, 年末库存下调至2.45亿蒲式耳, 报告公布前市场预期单产为每英亩51.3蒲式耳, 产量为42.46亿蒲式耳。美豆产量和单产下调低于市场预期, 对美豆市场有所利好。不过, 美国中西部地区天气条件改善, USDA在作物生长报告中称, 截止2023年8月13日当周, 美豆优良率为59%, 高于市场预期的55%, 前一周为54%, 上年同期为58%, 继续施压美豆价格。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。豆粕来看, 8-10月进口大豆到港逐步下滑, 且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, 受国内豆粕供应预期收紧提振, 国内粕价表现明显强于外盘, 菜粕走势继续偏强。					 更多资讯请关注!
观点总结 菜油	今年加拿大大草原的天气持续炎热干燥, 预计大部分油菜籽的单产将低于正常水平, 支撑加籽市场价格。不过, 美豆作物天气预期持续向好, 施压美豆价格回降, 拖累油菜籽市场走势。棕榈方面, 最新公布的出口数据显示马棕出口强劲, 提振马棕价格上涨, 提振国内油脂走势。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, 不过, 下游消费支撑较弱, 库存回落幅度相对有限。同时, 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, 近期菜油高位回落。盘面来看, 受棕榈走强提振, 菜油期价小幅收涨。					 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					