

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)	3,606.00	-77.00↓	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	9,383.00	-281.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	497.00	+23.00↑	菜油9-1价差(日, 元/吨)	159.00	-6.00↓
	菜粕持仓量(日, 手)	351,130.00	-42518.00↓	菜油持仓量(日, 手)	217,741.00	-6311.00↓
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	-6,164.00	-23150.00↓	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-17,612.00	-11039.00↓
	菜粕仓单(日, 张)	0.00	0.00	菜油仓单(日, 张)	591.00	0.00
	ICE油菜籽11月合约收盘价(加元/吨)	809.10	-14.40↓	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	5,860.00	+3.00↑
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,880.00	-50.00↓	江苏菜油价格(日, 元/吨)	9,620.00	-160.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	5,692.18	-125.73↓	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	13,917.59	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)	2.48	-0.01↓
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	274.00	+27.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	237.00	+121.00↑
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	8,340.00	-100.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,280.00	-60.00↓
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	7,560.00	-100.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	2,060.00	-60.00↓
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,400.00	-50.00↓	与菜粕价差(日, 元/吨)	520.00	0.00
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)	-510.00	-28.00↓
	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)	3.48		菜油提货量(周, 万吨)	4.11	
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,584.00	+73.00↑	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(%)	28.30		菜粕平值看跌期权波动率(%)	28.35	
	标的20日历史波动率(%)	22.37	-9.94↓	标的60日历史波动率(%)	27.77	-0.23↓
	菜油平值看涨期权波动率(%)	22.71		菜油平值看跌期权波动率(%)	22.69	
	标的20日历史波动率(%)	21.93	-5.96↓	标的60日历史波动率(%)	26.61	+0.79↑
行业消息	1、周五洲际交易所(ICE)油菜籽期货市场收盘下跌,其中基准期约收低1.80%,因为商品市场全线下挫。截止收盘,11月期约收低14.40加元,报收809.10加元/吨;1月期约收低14.10加元,报收811.70加元/吨;3月期约收低12.80加元,报收812加元/吨。					
观点总结 菜粕	近日随着美国中西部作物带中远期天气形势转好,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。美豆高位回落,或将拖累国内粕价。国内菜粕市场而言,加拿大港口工人短暂罢工,菜籽装运略有迟滞,8-9月船期的菜籽到港将会存在拖延,继续限制菜粕供应量。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。同时,加籽价格相对偏强,菜粕成本支撑增强,对菜粕价格有所利好。不过,豆粕替代优势显现,减弱菜粕需求。盘面来看,菜粕继续减仓回落,高位震荡加剧				 更多资讯请关注! 更多观点请咨询!	
观点总结 菜油	加拿大草原的地区出现一些零星阵雨,本周天气可能趋于干燥。8月仍是菜籽生长关键期,萨斯喀彻温政府表示,由于天气干燥且气温高升,许多地区的油菜籽产量前景下降,支撑油菜籽价格。美豆作物天气预期有所转好,炒作情绪放缓,施压美豆市场,油籽市场同步受累。国内菜油方面,加拿大港口工人短暂罢工,菜籽装运略有迟滞,8-9月船期的菜籽到港将会存在拖延,油厂开机率受限,供应压力明显减弱,菜油库存压力减弱。同时,加籽单产调降预期较强,加籽价格相对偏强,成本传导下,对菜油价格有所利好。盘面来看,菜油大幅走弱,多头有获利了结迹象,短期震荡加剧。					
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					