

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	大连豆一 主力合约收盘价(元/吨)	6,223.00	+46.00↑	豆二 主力合约收盘价(元/吨)	4,949.00	+26↑
	大连豆一 9-1价差(元/吨)	461	+16.00↑			
	大连豆一 持仓量(手)	97,001.00	+2838↑	大连豆二 持仓量(手)	27,910.00	-923↓
	大连豆粕主力合约收盘价(元/吨)	4,063.00	+54.00↑	大连豆油 主力合约收盘价(元/吨)	9,934.00	+10↑
	大连豆粕 9-1价差(元/吨)	347.00	+23.00↑	大连豆油 9-1价差(元/吨)	310.00	-18↓
	大连豆粕 持仓量(手)	669,533	-41349↓	大连豆油 持仓量(手)	179,430.00	-14834↓
	豆一前20名净持仓(手)	11,822	+171.00↑	豆二前20名净持仓(手)	-3,042	+629↑
	豆粕前20名净持仓(手)	-8,879	+5665.00↑	豆油前20名净持仓(手)	21,821	+8823↑
	大连豆一 仓单(张)	5463	0.00	大连豆二 仓单(张)	#N/A	#N/A
	大连豆粕 仓单 (张)	8550	0.00	大连豆油 仓单 (张)	11276	0.00
CBOT大豆主力结算价(美分/蒲式耳)	1,428.75	+28.75↑	CBOT豆粕主力结算价(美元/短吨)	410.20	+11.10↑	
CBOT 豆油主力结算价 (美分/磅)	64.62	+0.30↑				
现货价格	国产大豆现货价格(元/吨)	5,980.00	0.00	豆油价格 (日照) (元/吨)	10,570.00	0.00
	南美大豆到港成本(元/吨)	5,156.03	-0.18↓	豆油价格 (张家港) (元/吨)	10,600.00	+20↑
	美豆到港成本(元/吨)	6,471.40	-0.31↓	豆油价格 (湛江) (元/吨)	10,400.00	0.00
	豆粕价格 (张家港) (元/吨)	4190	0.00			
	国产大豆主力合约基差(元/吨)	-243	-46.00↓	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	676.00	+42↑
张家港豆粕主力合约基差(元/吨)	233	+29.00↑				
上游情况	美豆产量 (月, 百万吨)	122.61	-3.67↓	美豆期末库存 (月, 百万吨)	6.26	-1.35↓
	巴西产量 (月, 百万吨)	126	0.00	巴西期末库存 (月, 百万吨)	22.46	+0.6↑
	美豆优良率 (周, %)	60%	+1.00↑	巴西豆收获进度 (周, %)	99.4%	0.0000
	阿根廷豆收割进度 (周, %)	100.00%	+1.000↑	美豆出口检验量 (周, 千蒲式耳)	32011	+10057↑
	美豆出口销售量 (周, 万吨)	527605	+132211↑	巴西出口 (月, 万吨)	739.3	-40.1↓
产业情况	油厂大豆库存 (周, 万吨)	691.29	+5.36↑	油厂豆粕库存 (周, 万吨)	82.35	+12.6↑
	油厂豆油库存 (周, 万吨)	67.95	-3.40↓	油厂开工率 (周, %)	57.65%	-2.94%
	油厂压榨量 (周, 万吨)	165.87	-8.44↓	大豆进口数量 (月, 万吨)	788.3	-37↓
	大豆进口预告9月 (月, 万吨)	610		大豆进口预告10月 (月, 万吨)	720	
	棕榈油 (广东) (元/吨)	10,400.00	+50.00↑	菜油 (福建) (元/吨)	12,670.00	+20↑
	豆棕价差 (元/吨)	250.00	-30.00↓	菜豆价差 (元/吨)	2,070.00	0.00
	菜粕 (江苏) (元/吨)	3,400.00	0.00	油厂豆粕成交量 (周, 吨)	768,900	+153700↑
	豆粕与菜粕价差 (元/吨)	850.00	+30.00↑	油厂豆油成交量 (周, 吨)	121,450	+83370↑
	国产豆 (黑龙江) 压榨利润(日,元/吨)	-553.15	+38.55↑	进口大豆压榨利润 (江苏) (日,元/吨)	-313.05	+39↑
下游情况	中国大豆消费量(年, 百万吨)	115.59	+8.87↑	中国豆油食品用量(年, 千万吨)	17700	+950↑
	生猪价格 (周, 元/千克)	21.3	0.00	生猪养殖利润 (周, 元/头)	813.12	-16↓
	鸡禽养殖利润 (周, 元/羽)	16.72	-9.29↓	饲料月度产量 (月, 吨)	26896000	+1190000↑
	生猪存栏量 (月, 万头)	43057	#N/A	能繁母猪存栏量 (月, 万头)	4277	+85↑
国内国际产区天气						
期权市场	豆粕期货平值看涨期权波动率 (%)	21.56		豆粕期货平值看跌期权波动率 (%)	21.5	
	豆粕平值期权20日历史波动率 (%)	23.94		豆粕平值期权60日历史波动率 (%)	22.82	
行业消息	<p>1据美国农业部 (USDA) 周二凌晨公布的每周作物生长报告, 截至8月7日当周, 美国大豆生长优良率为59%, 市场预期为59%, 此前一周为60%, 去年同期为60%; 开花率为89%, 此前一周为79%, 去年同期为90%, 五年均值为88%; 结荚率为61%, 此前一周为44%, 去年同期为70%, 五年均值为66%。</p> <p>2美国农业部发布的出口检验周报显示, 上周美国大豆出口检验量较一周前增长45.81%, 比去年同期提高655.24%。截至2022年8月4日的一周, 美国大豆出口检验量为867,504吨, 上周为594,958吨, 去年同期为114,865吨。</p>					



更多资讯请关注!

上周东北部分产区价格略上调0.01-0.02元/斤，豆一期货七连阳加之购销双向拍卖溢价全部成交对产区心态有一定的支撑。东北产区大豆余粮已比较有限，多数贸易商也基本无库存，走货情况稍显一般，大豆价格窄幅调整。上周南方大豆价格基本维持稳定，走货不畅，各地基层余粮也已有限。盘面来看，豆一前高处有一定的压力，目前有所震荡。



更多观点请咨询!

观点总结：
豆一

据美国农业部（USDA）周二凌晨公布的每周作物生长报告，截至8月7日当周，美国大豆生长优良率为59%，市场预期为59%，此前一周为60%，去年同期为60%；开花率为89%，此前一周为79%，去年同期为90%，五年均值为88%；结荚率为61%，此前一周为44%，去年同期为70%，五年均值为66%。美豆种植优良率小幅回落，限制美豆的产量。盘面来看，豆二维持震荡，暂时维持震荡的观点。

观点总结：
豆二

天气预报显示，未来6-10日美国大豆主产区气温普遍高于正常水平，降雨量大多低于正常值。当前正值美豆生长关键期，美豆市场保持天气市运行特征，潜在不利天气仍支撑市场抗跌。美国农业部将于8月12日公布新的月度供需报告，市场在关注美豆产量指标的同时，也在关注美豆播种面积是否会较6月底预估水平上调。从豆粕基本面来看，据Mysteel农产品对全国主要地区的50家饲料企业样本调查显示，截止到2022年8月5日当周（第31周），国内饲料企业豆粕库存天数（物理库存天数）为9.42天，较上一周增加0.35天，增幅3.67%。伴随着国内大豆到港下降，大豆库存也在逐步降低中，传导至豆粕价格易涨难跌态势，油厂开始预售下半年基差头寸，饲料企业逐步小幅增加头寸。美豆市场围绕天气大幅震荡，豆粕库存下降而成本增加，油厂顺势提高豆粕报价。盘面来看，美豆天气炒作无法持续发力导致行情不够连贯，国内粕类市场在成本和预期变化下跟随波动。暂时观望。

观点总结：
豆粕

天气预报显示，未来6-10日美国大豆主产区气温普遍高于正常水平，降雨量大多低于正常值。当前正值美豆生长关键期，美豆市场保持天气市运行特征，潜在不利天气仍支撑市场抗跌。美国农业部将于8月12日公布新的月度供需报告，市场在关注美豆产量指标的同时，也在关注美豆播种面积是否会较6月底预估水平上调。从油脂基本面来看，上周国内大豆压榨量降至168万吨，豆油产出有所减少，但由于终端提货缓慢，豆油库存仍小幅下降。监测显示，上周国内主要油厂豆油商业库存为81万吨，比上周减少2万吨，比上月同期减少10万吨，比上年同期减少10万吨。预计本周大豆压榨量重新增至175万吨以上，豆油产出增加，库存将小幅攀升。但8-9月份国内大豆供应偏紧，豆油库存增幅不大。另外，棕榈油方面，产地买船意愿较好，但是到港不及预期，棕榈油国内短期供应仍处在偏紧的状态，支撑短期的价格。盘面来看，豆油持续减仓，临近交割，空头有主动离场的迹象。

观点总结：
豆油

重点关注 周二国家粮油信息中心豆粕库存 周三国家粮油信息中心豆油库存 周五USDA美豆出口销售情况

数据来源第三方，观点仅供参考。市场有风险，投资需谨慎!