


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	期货收盘价(活跃合约):黄大豆1号(日,元/吨)	5590	53↑	期货收盘价(活跃合约):黄大豆2号(日,元/吨)	5280	-32↓
	期货持仓量(活跃合约):黄大豆1号(日,手)	147381	-13632↓	期货持仓量(活跃合约):黄大豆2号(日,手)	27111	-1017↓
	期货主力合约收盘价:豆粕(日,元/吨)	4260	9↑	期货主力合约收盘价:豆油(日,元/吨)	9298	-200↓
	主力合约持仓量:豆粕(日,手)	1645489	-11340↓	主力合约持仓量:豆油(日,手)	424356	-4517↓
	豆粕1-5价差(日,元/吨)	468	-21↓	豆油1-5价差(日,元/吨)	562	6↑
	期货前20名持仓:净买单量:豆一(日,手)	10988	-252↓	期货前20名持仓:净买单量:豆二(日,手)	967	1567↑
	期货前20名持仓:净买单量:豆粕(日,手)	-65739	9444↑	期货前20名持仓:净买单量:豆油(日,手)	-27310	-5207↓
	注册仓单量:豆一(日,手)	9856	0	注册仓单量:豆二(日,手)	0	0
	注册仓单量:豆粕(日,手)	20272	0	注册仓单量:豆油(日,手)	12626	0
	期货结算价(活跃合约):CBOT大豆(日,美分/蒲)	1446.5	-3.75↓	期货结算价(活跃合约):CBOT豆粕(日,美分/蒲)	419.3	0.3↑
期货结算价(活跃合约):CBOT豆油(日,美分/蒲)	75.03	-1.3↓				
现货价格	国产大豆现货价格(元/吨)	5600	0	豆油价格(日照)(元/吨)	10210	-210↓
	豆油价格(张家港)(元/吨)	10350	-180↓	豆油价格(湛江)(元/吨)	10200	-210↓
	豆粕价格(张家港)(元/吨)	5740	10↑	国产大豆主力合约基差(元/吨)	10	-53↓
	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	1052	20↑	张家港豆粕主力合约基差(元/吨)	1480	1↑
	美湾大豆进口成本(日,元/吨)	5629	-126↓	巴西大豆进口成本(日,元/吨)	5633	-126↓
上游情况	大豆:产量:美国(年,百万吨)	117.38	-1.78↓	大豆:期末库存:美国(年,百万吨)	5.44	0
	大豆:产量:巴西(年,百万吨)	152	3↑	大豆:期末库存:巴西(年,百万吨)	31.31	1.95↑
	美豆优良率(周,%)	57	0	检验量:大豆:当周值(周,千蒲式耳)	95613	630↑
	大豆:本周出口:当周值(周,吨)	2651827	-96788↓	巴西出口(月,万吨)	368.9	-159.6↓
产业情况	港口库存:进口大豆(日,吨)	5929650	87900↑	库存量:豆粕:全国(周,万吨)	18.91	-3.82↓
	港口库存:豆油:全国(日,万吨)	57	-0.7↓	进口数量:大豆:当月值(月,万吨)	771.5	54.9↑
	油厂开工率(周,%)	52.75	-5.55↓	油厂压榨量(周,万吨)	151.77	-15.97↓
	现货价:棕榈油(24度):广东(日,元/吨)	8570	-100↓	出厂价:四级菜油:福建:厦门(日,元/吨)	14040	-10↓
	豆棕价差(日,元/吨)	1780	-80↓	菜豆价差(日,元/吨)	3690	170↑
	现货价:平均价:菜粕(日,元/吨)	4048.42	-20↓	豆菜粕价差(日,元/吨)	1691.58	30↑
	油厂豆粕成交量(周,吨)	934900	-356400↓	油厂豆油成交量(周,吨)	105300	-3550↓
	压榨利润:国产大豆:黑龙江(日,元/吨)	549.8	2.55↑	压榨利润:进口大豆:江苏(日,元/吨)	860.8	-22.8↓
下游情况	大豆:国内消费总计:中国(年,百万吨)	108.72	-4.02↓	豆油:食品用量:中国(年,千吨)	17400	-225↓
	价格:生猪(外三元):北京:大兴(日,元/公斤)	24.95	-1↓	生猪养殖预期盈利(周,元/头)	1042.47	-88.55↓
	产量:饲料:当月值(月,吨)	29965000	3053000↑	产量:饲料:猪饲料:当月值(月,万吨)	1067	84↑
	生猪存栏(月,万头)	44394	1337↑	生猪存栏:能繁母猪(月,万头)	4362	38↑
期权市场	平值看涨期权隐含波动率:豆粕(日,%)	25.26	-0.04↓	平值看跌期权隐含波动率:豆粕(日,%)	25.36	-0.14↓
	历史波动率:20日:豆粕(日,%)	20.44	-0.5↓	历史波动率:60日:豆粕(日,%)	28.3	-0.07↓
行业消息	<p>1.据USDA公布的每周作物生长报告称,截至11月6日当周,美国大豆收割率为94%,符合此前预期的94%,前一周为88%,去年同期为86%,五年均值为86%。</p> <p>2.据USDA最新公布的周度出口检验报告显示,截至11月3日当周,美国大豆出口检验量为259.11万吨,高于此前市场预期的150-250万吨,周环比小幅增加0.49万吨;其中,对中国大陆的大豆出口检验量为184.05万吨,占出口检验总量的71.03%。</p> <p>3.DATAGRO发布的首份2022/23年度巴西大豆作物调查显示,巴西正在播种的大豆面积将达到4348万公顷,比7月份发布的播种意向预测数据高出46万公顷。巴西大豆产量达到创纪录的1.5258亿吨,略高于7月份预测的1.5182亿吨。</p>					



更多资讯请关注!

观点总结：豆一	<p>从基本面来看，今年大豆油料扩种效果显著，黑龙江大豆产量创历史新高，农村农业部在10月报告中预计2022年国产大豆种植面积和产量将同比增加18%以上，新豆增产预期强烈，新豆价格承压高开低走。此外，各地新作质量存在两极分化，优质优价现象明显。不过受疫情影响，产区大豆出货偏慢。从需求端来看，农户惜售叠加消费需求疲软，市场购销氛围一般；中储粮近期下调大豆收购价格，令原本趋于企稳的盘面再度承压回落。盘面来看，豆一2301合约修复本周跌幅，MACD指标绿柱继续缩小，不过在增产的压力下，预计短期内豆一以震荡偏弱运行为主，建议逢高沽空。</p>	 <p>更多观点请咨询!</p>
观点总结：豆二	<p>美豆收割提前进入尾声，市场焦点转向出口进度及南美播种生长情况。据USDA最新公布的周度出口检验报告显示，截至11月3日当周，美国大豆出口检验量为259.11万吨，高于此前市场预期的150-250万吨；此外，民间出口商报告向中国出口销售13.87万吨大豆，美豆出口有所恢复支撑盘面上行。南美大豆方面，DATAGRO发布的首份2022/23年度巴西大豆作物调查显示，巴西正在播种的大豆面积将达到4348万公顷，产量将达到创纪录的1.5258亿吨，巴西大豆丰产预期加强，不过仍需持续关注拉尼娜现象，目前阿根廷受降雨不足影响，大豆播种进度远不及上年同期，市场对阿根廷大豆播种开局有所担忧。从国内来看，由于前期美国内河运输受阻和巴西暴动，据海关数据显示，中国10月大豆进口量环比减少19%至413.6万吨，为2014年以来同期最低水平；不过美豆出口商正积极寻找替代港口，预计大豆到港节奏不会出现明显滞后。盘面来看，豆二2212合约震荡收跌，不过受系统均线支撑明显，预计短期内豆二维持高位震荡，建议暂时观望。</p>	
观点总结：豆粕	<p>美豆收割提前进入尾声，市场焦点转向出口进度及南美播种生长情况。据USDA最新公布的周度出口检验报告显示，截至11月3日当周，美国大豆出口检验量为259.11万吨，高于此前市场预期的150-250万吨；此外，民间出口商报告向中国出口销售13.87万吨大豆，美豆出口有所恢复支撑盘面上行。南美大豆方面，DATAGRO发布的首份2022/23年度巴西大豆作物调查显示，巴西正在播种的大豆面积将达到4348万公顷，产量将达到创纪录的1.5258亿吨，巴西大豆丰产预期加强，不过仍需持续关注拉尼娜现象，目前阿根廷受降雨不足影响，大豆播种进度远不及上年同期，市场对阿根廷大豆播种开局有所担忧。从豆粕基本面来看，截至11月4日，豆粕库存为18.91万吨，较上周减少3.82万吨，减幅16.81%，同比去年减少40.77万吨，减幅68.31%。中国10月大豆进口量环比减少19%，原料库存持续偏紧，油厂开机率受限，上周压榨量再度下滑，不过由于近期粕类高价导致各地成交持续缩量，在进口大豆到港之后，粕类库存或将迎来转折点。盘面来看，偏紧库存和高基差提振买盘情绪，豆粕2301合约继续上涨，待USDA公布月度报告提供进一步指引，预计短期内豆粕维持高位震荡行情，建议暂时观望。</p>	
观点总结：豆油	<p>油脂方面，俄罗斯宣布恢复黑海运量协议，谷物和油脂的供应担忧得到缓解；美联储11月再度加息，宏观积极衰退对于金融属性和国际联动性更强的油脂市场施压更重，油脂价格有所回落。从国内基本面来看，监测显示，截至11月8日，豆油港口库存57.0万吨，比上周同期减少0.7万吨，月环比减少8.75万吨，比上年同期减少17.6万吨。原料偏紧导致大豆压榨受限，豆油产出减少，下游提货正常，豆油库存继续下调。此外，在美豆出口受运河水位偏低限制的影响下，国内进口大豆到港节奏放缓，据海关数据显示，10月中国进口食用植物油74.3万吨，1-10月累积进口442.8万吨，同比减少50.2%，不过由于疫情防控严重影响国内油脂需求，供需偏紧的提振作用有所削弱。盘面来看，受累于原油价格大幅跌落，豆油2301合约承压下行，一小时MACD指标绿柱不断扩大，由于国内需求存在不确定性，预计短期内豆油维持震荡行情，建议暂时观望。</p>	
重点关注	周一我的农产品网豆粕库存，周一USDA美豆出口检验情况，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！