


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)	5571	-7↓	期货收盘价(活跃合约):黄大豆2号(日,元/吨)	5161	-378↓
	期货持仓量(活跃合约):黄大豆1号(日,手)	168620	-11224↓	期货持仓量(活跃合约):黄大豆2号(日,手)	33569	29482↑
	期货主力合约收盘价:豆粕(日,元/吨)	4111	69↑	期货主力合约收盘价:豆油(日,元/吨)	9072	-82↓
	主力合约持仓量:豆粕(日,手)	1649514	7297↑	主力合约持仓量:豆油(日,手)	434959	-12377↓
	豆粕1-5价差(日,元/吨)	494	45↑	豆油1-5价差(日,元/吨)	620	-14↓
	期货前20名持仓:净买单量:豆一(日,手)	6848	-910↓	期货前20名持仓:净买单量:豆二(日,手)	1533	831↑
	期货前20名持仓:净买单量:豆粕(日,手)	-64605	21150↑	期货前20名持仓:净买单量:豆油(日,手)	-12147	7310↑
	注册仓单量:豆一(日,手)	6881	100↑	注册仓单量:豆二(日,手)	0	-300↓
	注册仓单量:豆粕(日,手)	20272	0	注册仓单量:豆油(日,手)	11030	0
	期货结算价(活跃合约):CBOT大豆(日,美分/蒲式耳)	1400.25	6.75↑	期货结算价(活跃合约):CBOT豆粕(日,美分/蒲式耳)	425.4	10↑
期货结算价(活跃合约):CBOT豆油(日,美分/加仑)	71.79	-0.51↓				
现货价格	国产大豆现货价格(元/吨)	5640	0	豆油价格(日照)(元/吨)	10220	-40↓
	豆油价格(张家港)(元/吨)	10350	-100↓	豆油价格(湛江)(元/吨)	10340	-70↓
	豆粕价格(张家港)(元/吨)	5480	30↑	国产大豆主力合约基差(元/吨)	69	7↑
	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	1278	-18↓	张家港豆粕主力合约基差(元/吨)	1369	-39↓
	美湾大豆进口成本(日,元/吨)	5450	-67↓	巴西大豆进口成本(日,元/吨)	5403	0
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)	106598	37138↑
	大豆:本周出口:当周值(周,吨)	2748615	851831↑	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)	6165950	-39800↓	库存量:豆粕:全国(周,万吨)	26.76	-3.7↓
	港口库存:豆油:全国(日,万吨)	58.2	-4↓	进口数量:大豆:当月值(月,万吨)	771.5	54.9↑
	油厂开工率(周,%)	55.82	-1.61↓	油厂压榨量(周,万吨)	160.6	-4.64↓
	现货价:棕榈油(24度):广东(日,元/吨)	8440	100↑	出厂价:四级菜油:福建:厦门(日,元/吨)	13250	0
	豆棕价差(日,元/吨)	1910	-200↓	菜豆价差(日,元/吨)	2900	100↑
	现货价:平均价:菜粕(日,元/吨)	4057.89	0	豆菜粕价差(日,元/吨)	1422.11	30↑
	油厂豆粕成交量(周,吨)	436900	1704200↓	油厂豆油成交量(周,吨)	40750	-257550↓
	压榨利润:国产大豆:黑龙江(日,元/吨)	314.5	-77.3↓	压榨利润:进口大豆:江苏(日,元/吨)	575.8	-64.6↓
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)	27.35	-0.3↓	生猪养殖预期盈利(周,元/头)	1131.02	129.93↑
	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,%)	23.08	0.09↑	平值看跌期权隐含波动率:豆粕(日,%)	23.45	0.46↑
	历史波动率:20日:豆粕(日,%)	19.52	0.66↑	历史波动率:60日:豆粕(日,%)	28.62	0.18↑
行业消息	<p>1.据CFTC周五公布的数据显示,截至10月25日当周,包括对冲基金在内的非商业交易商增持CBOT大豆期货及期权净多头头寸16252手至26882手,投资基金已连续两周在大豆期货及期权市场上增持净多单。</p> <p>2.据Imea公布,截至10月28日,马托格罗索州作为巴西大豆主产区之一,其大豆播种率为83.45%,较上周上升16.51%,高于去年同期83.15%。</p> <p>3.民间出口商报告向中国出口销售126000吨大豆,向西班牙出口销售198000吨大豆,均在2022/23市场年度交付。</p>					



更多资讯请关注!

观点总结：豆一	<p>从基本面来看，东北主产区大豆收割已经结束，各地新作质量存在两极分化，优质优价现象明显。此外，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，新豆收购价格有所走低。成本端，由于地租增幅尤为明显，种植成本有所增加，对价格有一定的支撑。从需求端来看，农户惜售叠加疫情影响消费需求，10月中粮储平均拍卖成交率不足40%，市场购销氛围一般。盘面来看，豆一2301合约承压回落，不过MACD指标绿柱有缩小趋势，成本端和收购价格的支撑作用显现，预计短期内豆一维持低位震荡，建议暂时观望。</p>	 <p>更多观点请咨询!</p>
观点总结：豆二	<p>从美豆基本面来看，美国加速推进大豆收割，收割率达80%，新豆或将提早上市，季节性供应压力使得美豆上行有所承压。不过，美豆近期出口装船量高达274,86万吨，创一年新高，出口数据仍有明显的提振作用。南美豆方面，据Imea公布数据显示，截至10月28日，作为巴西主产区之一的马托格罗索州的大豆播种率为83.45%，较上周上升16.51%，巴西播种进度的推进，使得主流分析机构的产量预期依旧维持在1.5亿吨及以上，南美大豆丰产预期稳定。从国内来看，据海关总署数据显示9月大豆进口量超预期增长，市场预计11月和12月进口大豆到港量将超过1800万吨，将进一步缓解国内大豆供应偏紧局势。盘面来看，豆二2212合约继续下跌，在远期大豆供应宽松预期下，美豆价格上涨的支撑作用削弱，预计短期内豆二以震荡偏弱运行为主，操作上建议逢高沽空，关注40日均线。</p>	
观点总结：豆粕	<p>从美豆基本面来看，美国加速推进大豆收割，收割率达80%，新豆或将提早上市，季节性供应压力使得美豆上行有所承压。不过，美豆近期出口装船量高达274,86万吨，创一年新高，出口数据仍有明显的提振作用。南美豆方面，据Imea公布数据显示，截至10月28日，作为巴西主产区之一的马托格罗索州的大豆播种率为83.45%，较上周上升16.51%，巴西播种进度的推进，使得主流分析机构的产量预期依旧维持在1.5亿吨及以上，南美大豆丰产预期稳定。从豆粕基本面的来看，10月21日，豆粕库存为26.76万吨，较上周减少3.7万吨，减幅12.15%，同比去年减少25.59万吨，减幅48.88%。由于生猪新一轮周期已开启，生猪存栏量增加，养殖利润高企，饲料养殖企业提货积极，豆粕库存继续下滑。不过据海关总署数据显示9月大豆进口量超预期增长，市场预计11月和12月进口大豆到港量将超过1800万吨，将进一步缓解国内大豆供应偏紧局势。盘面来看，受美豆粕和美豆价格上升的提振，豆粕2301合约价格震荡收涨，豆粕近强远弱格局短时间内难以打破，预计短期内豆粕维持高位震荡，建议暂时观望。</p>	
观点总结：豆油	<p>进口豆方面，美豆近期出口装船量高达274,86万吨，创一年新高，出口数据仍有明显的提振作用。不过，在美国加速推进大豆收割以及南美大豆丰产预期加强等利空因素下，美豆价格上方承压。油脂方面，NPOA报告的豆油库存利多消息逐渐被消化，但俄罗斯正式宣布无限期退出黑海运量协议，油脂价格仍具有抗跌性。从国内基本面来看，监测显示，10月25日，豆油港口库存58.2万吨，比上周同期减少4.0万吨，月环比减少3.6万吨，比上年同期减少19.65万吨。不过由于进口大豆和菜籽的陆续到港，叠加棕榈油进口数量的猛增，国内油脂整体库存将进一步改善。盘面上看，受豆油下游成交量偏低和原油价格下跌的影响，豆油2301合约继续下跌回吐10月涨幅，MACD指标转为绿柱，不过由于近期俄乌局势再度恶化，油脂供应担忧犹存，预计短期内豆油以震荡偏弱为主，建议逢高沽空。</p>	
重点关注	周一我的农产品网豆粕库存，周二USDA作物生长报告，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!