

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)	6,088.00	-2.00↓	豆二 主力合约收盘价(元/吨)	4,932.00	-46↓
	大连豆一 9-1价差(元/吨)	360	+6.00↑			
	大连豆一 持仓量(手)	74,341.00	-2458↓	大连豆二 持仓量(手)	21,703.00	-3166↓
	大连豆粕主力合约收盘价(元/吨)	3,639.00	-16.00↓	大连豆油 主力合约收盘价(元/吨)	9,466.00	-582↓
	大连豆粕 9-1价差(元/吨)	438.00	+21.00↑	大连豆油 9-1价差(元/吨)	392.00	+24↑
	大连豆粕 持仓量(手)	1,024,112	-2666↓	大连豆油 持仓量(手)	290,731.00	+166250↑
	豆一前20名净持仓(手)	12,554	+864.00↑	豆二前20名净持仓(手)	-1,964	+626↑
	豆粕前20名净持仓(手)	161	+10000.00↑	豆油前20名净持仓(手)	10,855	-4582↓
	大连豆一 仓单(张)	5343	-70.00↓	大连豆二 仓单(张)	#N/A	#N/A
	大连豆粕 仓单 (张)	16665	-40.00↓	大连豆油 仓单 (张)	11276	0.00
CBOT大豆主力结算价(美分/蒲式耳)	1,390.00	+9.00↑	CBOT豆粕主力结算价(美元/短吨)	400.60	+4.50↑	
CBOT 豆油主力结算价 (美分/磅)	65.60	-0.46↓				
现货价格	国产大豆现货价格(元/吨)	6,060.00	0.00	豆油价格 (日照) (元/吨)	10,670.00	+70↑
	南美大豆到港成本(元/吨)	5,129.55	-100.42↓	豆油价格 (张家港) (元/吨)	10,700.00	+80↑
	美豆到港成本(元/吨)	6,413.82	-127.08↓	豆油价格 (湛江) (元/吨)	10,560.00	+70↑
	豆粕价格 (张家港) (元/吨)	4190	0.00			
	国产大豆主力合约基差(元/吨)	-28	+2.00↑	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	652.00	+6↑
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)	123.3	+0.69↑	美豆期末库存 (月, 百万吨)	6.66	+0.40↑
	巴西产量 (月, 百万吨)	126	0.00	巴西期末库存 (月, 百万吨)	22.71	+0.3↑
	美豆优良率 (周, %)	58%	-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%	+1.0001↑	美豆出口检验量 (周, 千蒲式耳)	27475	-4678↓
	美豆出口销售量 (周, 万吨)	894474	+366869↑	巴西出口 (月, 万吨)	739.3	-40.1↓
产业情况	油厂大豆库存 (周, 万吨)	680.76	-10.60↓	油厂豆粕库存 (周, 万吨)	82.35	+12.6↑
	油厂豆油库存 (周, 万吨)	63.20	-4.75↓	油厂开工率 (周, %)	57.66%	0.01%
	油厂压榨量 (周, 万吨)	165.89	+0.02↑	大豆进口数量 (月, 万吨)	788	-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)	10,260.00	-190.00↓	菜油 (福建) (元/吨)	12,700.00	+50↑
	豆棕价差 (元/吨)	250.00	+280.00↑	菜豆价差 (元/吨)	2,000.00	-30↓
	菜粕 (江苏) (元/吨)	3,400.00	0.00	油厂豆粕成交量 (周, 吨)	464,400	-304500↓
	豆粕与菜粕价差 (元/吨)	880.00	0.00	油厂豆油成交量 (周, 吨)	193,500	+72050↑
	国产豆 (黑龙江) 压榨利润(日,元/吨)	-647.65	-12.70↓	进口大豆压榨利润 (江苏) (日,元/吨)	-361.25	-15↓
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)	17600	+850↑
	生猪价格 (周, 元/千克)	21.6	+0.30↑	生猪养殖利润 (周, 元/头)	797.63	-15↓
	鸡禽养殖利润 (周, 元/羽)	16.72	-9.29↓	饲料月度产量 (月, 吨)	26120000	-776000↓
	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 (%)	20.7		豆粕期货平值看跌期权波动率 (%)	20.27	
	豆粕平值期权20日历史波动率 (%)	38.34		豆粕平值期权60日历史波动率 (%)	28.85	
行业消息	<p>1美国农业部公布的作物生长报告显示, 截止8月14日当周, 美豆优良率为58%, 符合市场预期, 去年同期为57%;大豆开花率为93%, 去年同期为94%, 五年均值为93%;大豆结荚率为74%, 去年同期为80%, 五年均值为77%。</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减少14.6%, 但是比去年同期提高167.4%。截至2022年8月11日的一周, 美国大豆出口检验量为744,571吨, 上周为871,345吨, 去年同期为278,420吨。</p>					



更多资讯请关注!

东北主产区天气条件保持良好，整体利于大豆作物生长。产区大豆现货供需稳定，多地价格保持坚挺，优质优价较明显。另外，因东北大颗粒高蛋白货源有限，上周价格仍出现上涨，商品大豆价格暂维持稳定。安徽、河南大豆价格上周无调整，湖北豆上市量增加，价格略有下滑。盘面来看，豆一略有企稳的迹象，暂时观望。



更多观点请咨询!

观点总结：
豆一

美国农业部公布的作物生长报告显示，截止8月14日当周，美豆优良率为58%，符合市场预期，去年同期为57%；大豆开花率为93%，去年同期为94%，五年均值为93%；大豆结荚率为74%，去年同期为80%，五年均值为77%。当前正值美豆结荚和鼓粒的关键生长阶段，随着天气窗口逐渐收窄，美豆市场很难掀起大级别的天气炒作行情。盘面来看，豆二维持震荡，暂时维持震荡观点。

观点总结：
豆二

天气预报显示，美豆种植区将迎来有利降雨，限制美豆的价格。另外，巴西大豆将于9月份进入播种季，市场预期南美大豆将大幅增产，全球大豆远期供应格局更为宽松。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12日当周（第32周），国内饲料企业豆粕库存天数（物理库存天数）为9.18天，较上一周减少0.24天，减幅2.66%。目前油厂对9-10月船期进口大豆的采购量不到五成，豆粕库存恢复缓慢且处于下降周期，对豆粕价格有所支撑。盘面来看，豆粕维持震荡，在美豆天气炒作时间窗口逐渐缩窄的背景下，后期豆粕可炒作的空间有限，暂时观望。

观点总结：
豆粕

天气预报显示，美豆种植区将迎来有利降雨，限制美豆的价格。另外，巴西大豆将于9月份进入播种季，市场预期南美大豆将大幅增产，全球大豆远期供应格局更为宽松。从油脂基本面来看，上周国内大豆压榨量不及预期，下游贸易商提货速度保持平稳，豆油库存继续下降。监测显示，8月15日，全国主要油厂豆油库存77万吨，比上周同期减少4万吨，月环比减少12万吨，比上年同期减少13万吨，比近三年同期均值减少40万吨。近期大豆压榨量将维持偏低水平，豆油需求尚可，预计豆油库存将保持低位。近期受中秋节的提振，提货表现较好，加上8月到港量有限，豆油产量受限，限制豆油价格的回落。盘面来看，豆油小幅走弱，不过短期供应偏紧的情况，继续支撑油脂的价格。

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!