

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)	5562	10↑	期货收盘价(活跃合约):黄大豆2号(日,元/吨)	5299	-6↓
	期货持仓量(活跃合约):黄大豆1号(日,手)	151043	6302↑	期货持仓量(活跃合约):黄大豆2号(日,手)	29060	-969↓
	期货主力合约收盘价:豆粕(日,元/吨)	4218	30↑	期货主力合约收盘价:豆油(日,元/吨)	9566	-88↓
	主力合约持仓量:豆粕(日,手)	1629247	-17428↓	主力合约持仓量:豆油(日,手)	439163	-18797↓
	豆粕1-5价差(日,元/吨)	476	15↑	豆油1-5价差(日,元/吨)	614	-50↓
	期货前20名持仓:净买单量:豆一(日,手)	9566	3092↑	期货前20名持仓:净买单量:豆二(日,手)	70	782↑
	期货前20名持仓:净买单量:豆粕(日,手)	-78932	-25133↓	期货前20名持仓:净买单量:豆油(日,手)	-13967	-23680↓
	注册仓单量:豆一(日,手)	9856	1240↑	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)	11626	200↑
现货价格	期货结算价(活跃合约):CBOT大豆(日,元/吨)	1462.25	25.25↑	期货结算价(活跃合约):CBOT豆粕(日,元/吨)	420.4	6.1↑
	期货结算价(活跃合约):CBOT豆油(日,元/吨)	77.17	1.88↑			
	国产大豆现货价格(元/吨)	5640	0	豆油价格(日照)(元/吨)	10540	-60↓
	豆油价格(张家港)(元/吨)	10680	-40↓	豆油价格(湛江)(元/吨)	10560	-120↓
	豆粕价格(张家港)(元/吨)	5690	50↑	国产大豆主力合约基差(元/吨)	78	-10↓
上游情况	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	1114	48↑	张家港豆粕主力合约基差(元/吨)	1472	20↑
	美湾大豆进口成本(日,元/吨)	5670	-84↓	巴西大豆进口成本(日,元/吨)	5124	-93↓
	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↑
产业情况	美豆优良率(周,%)	57	0	检验量:大豆:当周值(周,千蒲式耳)	94983	-11615↓
	大豆:本周出口:当周值(周,吨)	2651827	-96788↓	巴西出口(月,万吨)	368.9	-159.6↓
	港口库存:进口大豆(日,吨)	5790950	-121800↓	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)	57.7	-0.5↓	进口数量:大豆:当月值(月,万吨)	771.5	54.9↑
	油厂开工率(周,%)	58.3	2.48↑	油厂压榨量(周,万吨)	167.74	7.14↑
	现货价:棕榈油(24度):广东(日,元/吨)	8610	-150↓	出厂价:四级菜油:福建:厦门(日,元/吨)	14050	120↑
	豆棕价差(日,元/吨)	2070	110↑	菜豆价差(日,元/吨)	3370	160↑
下游情况	现货价:平均价:菜粕(日,元/吨)	4063.16	-4.21↓	豆菜粕价差(日,元/吨)	1626.84	54.21↑
	油厂豆粕成交量(周,吨)	1291300	854400↑	油厂豆油成交量(周,吨)	108850	68100↑
	压榨利润:国产大豆:黑龙江(日,元/吨)	485	7.85↑	压榨利润:进口大豆:江苏(日,元/吨)	820.8	-32.65↓
	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↓
期权市场	价格:生猪(外三元):北京:大兴(日,元/公斤)	26.55	0	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↑
行业消息	平值看涨期权隐含波动率:豆粕(日,%)	25.3	0.07↑	平值看跌期权隐含波动率:豆粕(日,%)	25.5	-0.24↓
	历史波动率:20日:豆粕(日,%)	20.94	0.08↑	历史波动率:60日:豆粕(日,%)	28.37	-0.75↓
	1.据FAO公布的十月月报显示，粮农组织植物油价格指数10月平均为150.1点，环比下跌1.6%，同比下跌近20%。 2.据CFTC最新公布的数据显示，截至11月1日当周，包括对冲基金在内的非商业交易商增持大豆期货及期权净多头头寸30332手至57214手，此外投机基金在大豆、豆粕和豆油期市上连续三周增持净多单。 3.据StoneX发布的报告称，巴西2022/23年度大豆产量预计将达到创纪录的1.5435亿吨，较10月预估值上调了0.35%；此外，StoneX将大豆出口量预估值下调了400万吨。 4.USDA在每周作物生长报告中公布称，截至10月30日，美国大豆收割率为88%，分析师平均预估为89%，之前一周为80%，去年同期为78%，五年均值为78%。					



更多资讯请关注！



更多观点请咨询！

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，新豆价格承压高位走低。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；中储粮持续进行大豆拍卖，拍卖成交率普遍偏低。盘面来看，豆一2301合约震荡收跌，不过MACD指标绿柱明显缩小，预计短期内豆一维持低位震荡，建议暂时观望。</p>
观点总结：豆二	<p>美豆方面，由于美国加速推进大豆收割、USDA公布的美豆出口检验量和销售量大幅回落等利空因素犹存，美豆价格上方面临较大压力。据StoneX周二发布的报告称，巴西2022/23年度大豆产量预计将达到创纪录的1.5435亿吨，巴西大豆丰产预期再度强化，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。从国内来看，由于美国出口受限和巴西暴动，近期国内进口大豆仍维持偏紧，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，在系统均线的支撑下，豆二2212合约小幅回落，预计短期内豆二以震荡运行为主，建议暂时观望。</p>
观点总结：豆粕	<p>美豆方面，由于美国加速推进大豆收割、USDA公布的美豆出口检验量和销售量大幅回落等利空因素犹存，美豆价格上方面临较大压力。据StoneX周二发布的报告称，巴西2022/23年度大豆产量预计将达到创纪录的1.5435亿吨，巴西大豆丰产预期再度强化，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。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%。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，在现货价格的支撑下，豆粕2301合约继续上涨，在豆粕库存持续偏低与下游需求降温的多空博弈下，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>油脂方面，由于黑海协议仍具有不确定和巴西罢工，食用油供应链担忧仍存在，对油脂价格有一定的支撑；此外能源价格持续上涨，加上美国柴油偏紧，豆油作为生物柴油的题材具有炒作空间，美豆油净多持仓刷新八个月以来高位。从国内基本面来看，监测显示，11月1日，豆油港口库存57.7万吨，比上周同期减少0.5万吨，月环比减少5.9万吨，比上年同期减少18.4万吨。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，豆油库存仍将偏低运行，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，受制于国内需求的不确定，豆油2301合约回吐夜盘涨幅，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！