


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)	5861	-61↓	期货收盘价(活跃合约):黄大豆2号(日,元/吨)	5745	149↑
	期货持仓量(活跃合约):黄大豆1号(日,手)	50676	-18563↓	期货持仓量(活跃合约):黄大豆2号(日,手)	44329	11095↑
	期货主力合约收盘价:豆粕(日,元/吨)	4076	31↑	期货主力合约收盘价:豆油(日,元/吨)	9396	164↑
	主力合约持仓量:豆粕(日,手)	1521022	26365↑	主力合约持仓量:豆油(日,手)	442611	27672↑
	豆粕1-5价差(日,元/吨)	469	50↑	豆油1-5价差(日,元/吨)	996	152↑
	期货前20名持仓:净买单量:豆一(日,手)	7723	-1850↓	期货前20名持仓:净买单量:豆二(日,手)	760	1125↑
	期货前20名持仓:净买单量:豆粕(日,手)	-144104	9670↑	期货前20名持仓:净买单量:豆油(日,手)	-13525	4858↑
	注册仓单量:豆一(日,手)	6374	0	注册仓单量:豆二(日,手)	0	-200↓
	注册仓单量:豆粕(日,手)	18362	0	注册仓单量:豆油(日,手)	11446	-90↓
	期货结算价(活跃合约):CBOT大豆(日,美分/蒲式耳)	1376.25	2.25↑	期货结算价(活跃合约):CBOT豆粕(日,美分/蒲式耳)	406	0.3↑
	期货结算价(活跃合约):CBOT豆油(日,美分/蒲式耳)	65.47	-0.59↓			
现货价格	国产大豆现货价格(元/吨)	5700	0	豆油价格(日照)(元/吨)	10900	280↑
	豆油价格(张家港)(元/吨)	11050	350↑	豆油价格(湛江)(元/吨)	10830	200↑
	豆粕价格(张家港)(元/吨)	5350	0	国产大豆主力合约基差(元/吨)	-161	61↑
	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	1818	260↑	张家港豆粕主力合约基差(元/吨)	1274	-31↓
	美湾大豆进口成本(日,元/吨)	5367	226↑	巴西大豆进口成本(日,元/吨)	5386	0
上游情况	大豆:产量:美国(年,百万吨)	119.16	-4.14↓	大豆:期末库存:美国(年,百万吨)	5.44	-1.22↓
	大豆:产量:巴西(年,百万吨)	149	0	大豆:期末库存:巴西(年,百万吨)	29.36	-0.5↓
	美豆优良率(周,%)	57	2↑	检验量:大豆:当周值(周,千蒲式耳)	35764	14538↑
	大豆:本周出口:当周值(周,吨)	617547	348339↑	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)	6387400	47900↑	库存量:豆粕:全国(周,万吨)	82.35	12.62↑
	港口库存:豆油:全国(日,万吨)	65.75	3.95↑	进口数量:大豆:当月值(月,万吨)	716.6	-71.7↓
	油厂开工率(周,%)	52.95	-14.49↓	油厂压榨量(周,万吨)	152.35	-41.67↓
	现货价:棕榈油(24度):广东(日,元/吨)	8190	40↑	出厂价:四级菜油:福建:厦门(日,元/吨)	13700	-150↓
	豆棕价差(日,元/吨)	2900	120↑	菜豆价差(日,元/吨)	2650	-500↓
	现货价:平均价:菜粕(日,元/吨)	4239.47	21.58↑	豆菜粕价差(日,元/吨)	1110.53	-21.58↓
	油厂豆粕成交量(周,吨)	29200	-506900↓	油厂豆油成交量(周,吨)	0	-144850↓
	压榨利润:国产大豆:黑龙江(日,元/吨)	559.9	15.45↑	压榨利润:进口大豆:江苏(日,元/吨)	764.15	79.8↑
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)	27.35	0.5↑	生猪养殖预期盈利(周,元/头)	850.48	-17.02↓
	产量:饲料:当月值(月,吨)	26912000	792000↑	产量:饲料:猪饲料:当月值(月,万吨)	1067	84↑
	生猪存栏(月,万头)	43057	657↑	生猪存栏:能繁母猪(月,万头)	4324	25.9↑
期权市场	平值看涨期权隐含波动率:豆粕(日,%)	26.86	-0.69↓	平值看跌期权隐含波动率:豆粕(日,%)	26.96	0.29↑
	历史波动率:20日:豆粕(日,%)	23.44	0.4↑	历史波动率:60日:豆粕(日,%)	29.18	-0.19↓
行业消息	<p>1. USDA在每周作物生长报告中称,截至10月9日当周,美豆生长优良率为57%,市场预期为55%,上周为55%;美豆收割率为44%,市场预期为41%,上周为22%。</p> <p>2. 据农业机构Conab在10月报告中称,巴西2022/23年度大豆产量预计为1.524亿吨,较9月份预估上调200万吨,同比增加约2700万吨;此外市场年度收割面积料为4290万公顷,同比增加140万公顷。</p> <p>3. 据USDA周二公布的周度出口检验报告显示,截至10月6日当周,美国大豆出口检验量为969212吨,符合此前预期的40-125万吨,周环比增加65.6%;其中对中国大陆的大豆出口检验量为690073吨,占出口检验总量的71.2%,较上周增加635297吨。</p> <p>4. USDA公布的季度库存报告显示,截至9月1日,美国大豆库存为2.74亿蒲,较去年同期的2.57亿蒲增加7%,大幅超过市场预期的2.42亿蒲。</p>					



更多资讯请关注!

观点总结：豆一	<p>从基本面来看，东北主产区大豆加速收割，新豆供应持续增加，加之南方各地因天气影响大豆水分偏大，大豆现货价格偏弱运行。此外，在“扩大豆”政策鼓励下，国产大豆增产预期较强，供应压力犹存。成本端，种植成本大幅增加，其中地租增幅尤为明显，对价格有一定的支撑。从需求端来看，受疫情影响，部分大豆制品厂面临倒闭，需求不及预期。国内各级储备拍卖大豆仍较为频繁，显示政策面抑制大豆价格过度上涨，后期关注中粮收购新豆情况。盘面来看，在新豆蛋白普遍偏低和季节性供应压力下，豆一2211合约继续下跌，MACD指标转为绿柱，预计豆一短期内将呈震荡偏弱走势，操作上建议逢高沽空。</p>	 <p>更多观点请咨询！</p>
观点总结：豆二	<p>近日美豆盘面反弹，但由于USDA公布的美豆季度库存大幅超过预期、美豆收割率好于市场预期、中国需求不确定性等利空因素压制，美豆市场回升空间预计有限。此外，目前主流分析机构评估的巴西大豆产量仍保持在1.5亿吨左右，全球大豆远期市场供应宽松格局有所稳固。不过值得关注的是，近期由于南美大豆播种进度受天气影响有所放缓，短期内对美豆价格有所支撑，应持续关注拉尼娜天气。从国内来看，10月大豆进口量预计为两年来最低位，将导致大豆供应偏紧，对价格形成一定支撑，表现强于外盘。盘面来看，豆二2211合约小幅收涨，在美豆价格回升以及国内供需偏紧的提振下，预计豆二短期内走势偏强，操作上建议逢低做多。</p>	
观点总结：豆粕	<p>近日美豆盘面反弹，但由于USDA公布的美豆季度库存大幅超过预期、美豆收割率好于市场预期、中国需求不确定性等利空因素压制，美豆市场回升空间预计有限。此外，目前主流分析机构评估的巴西大豆产量仍保持在1.5亿吨左右，全球大豆远期市场供应宽松格局有所稳固。不过值得关注的是，近期由于南美大豆播种进度受天气影响有所放缓，短期内对美豆价格有所支撑，应持续关注拉尼娜天气。从豆粕基本面来看，10月10日，国内主要油厂豆粕库存34万吨，比上周同期增加1万吨，比上月同期减少17万吨，比上年同期减少26万吨，比过去三年同期均值减少36万吨。由于大豆到港量10月仍将继续下滑，大豆压榨量料有回落；国庆期间家禽价格强势上涨，下游企业需求有所回升，预计豆粕库存仍将维持低位，限制了豆粕盘面的下行空间。盘面来看，豆粕效应因素导致豆粕2301合约短期继续下跌，不过由于现货价格表现坚挺，预计下方空间有限，短期内或以震荡运行为主。</p>	
观点总结：豆油	<p>国庆期间OPEC+宣布减产，增加了油脂工业需求，提振油脂为原料的生物柴油价格，从而带动油脂市场。USDA公布的美豆季度库存大幅超过预期、美豆收割率好于市场预期、中国需求不确定性等问题共同削弱了美豆市场反弹动力，限制回升空间。此外，目前主流分析机构评估的巴西大豆产量仍保持在1.5亿吨左右，全球大豆远期市场供应宽松格局有所稳固。不过值得注意的是，近期由于南美大豆播种进度受天气影响有所放缓，短期内对美豆价格有所支撑，应持续关注拉尼娜天气。从国内基本面来看，监测显示，9月26日，全国主要油厂豆油库存76万吨，与上周同期基本持平，月环比减少1万吨，比上年同期减少9万吨，比近三年同期均值减少42万吨。受大豆到港量减少的影响，大豆压榨量料有回落；不过棕榈油进口量仍相对较多，加上近期国内疫情有所反弹或将影响油脂需求，油脂整体库存料有所增多。盘面来看，豆油2301合约继续收涨，不过仍承压60日均线，在油脂工业需求增加预期与宏观经济衰退忧虑的多空博弈下，预计豆油走势短期内仍以震荡调整为主。</p>	
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！