

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   |
|-------------------------------|---|-----------|-----------|---------------------|-----------|--|
| 期货盘面                          | 大连生猪 主力合约收盘价 (元/吨)  | 15,720.00 | +105.00↑  | 大连生猪03-05价差 (元/吨)   | -1640     | -155.00↓   |
|                               | 大连生猪 持仓量 (手)  | 46,276.00 | -565.00↓  | 大连生猪 仓单 (手)         | 0         | -345↓  |
|                               | 大连生猪 前20名净持仓 (手)  | -9,296.00 | +375.00↑  |                     |           |  |
| 现货价格                          | 河南省(驻马店) (元/吨)  | 15,200.00 | -400.00↓  | 吉林省(四平) (元/吨)       | 14,800.00 | +200.00↑   |
|                               | 广东省(云浮) (元/吨)   | 15,800.00 | -1000.00↓ | 生猪主力基差(驻马店) (元/吨)   | -520.00   |  |
| 上游情况                          | 生猪存栏量(月) (万头)   | 0.00      | 0.00      | 能繁母猪存栏量(月) (万头)     | 4379      | +17.00↑  |
| 产业情况                          | CPI (月, %)  | 1.60      | -0.50↓    | 豆粕价格(张家港) (元/吨)     | 4,680.00  | -20.00↓  |
|                               | 玉米价格(锦州港) (元/吨)   | 2,860.00  | -10.0↓    | 大商所猪饲料成本指数          | 1179.57   | +4.91↑   |
|                               | 生猪饲料价格 (周, 元/公斤)  | 3.68      | -0.01↓    | 饲料产量 (元, 吨)         | 28565000  | -34000↓  |
|                               | 22省平均生猪价格 (周, 元/千克)   | 16.97     | -3.27↓    | 22省平均仔猪价格 (周, 元/千克) | 39.52     | -4.26↓   |
|                               | 22省平均猪肉价格 (周, 元/千克)   | 27.22     | -3.40↓    | 二元能繁母猪价格 (周, 元/头)   | 1588.71   | -11.96↓  |
|                               | 22省猪粮比价 (周)   | 5.77      | -1.07↓    | 外购仔猪养殖利润 (周, 元/头)   | -175.97   | +39.65↑  |
|                               | 自繁自养养殖利润 (周, 元/头)   | -44.3     | +22.45↑   | 禽类养殖利润 (周, 元/羽)     | 16.72     | -9.29↓   |
|                               | 猪肉进口量 (月, 万吨)   | 18        | +2.00↑    | 冻肉收抛储情况 (抛, 万吨)     | 0.00      | 0.00   |
|                               | 白条鸡 (周, 元/公斤)   | 16.00     | -0.70↓    | 生猪与白条鸡价差 (周, 元/公斤)  | 0.97      | -2.57↓   |
| 下游情况                          | 生猪定点屠宰企业屠宰量(月, 万头)  | 2,269.00  | +172.00↑  | 社零售总额·餐饮收入(月, 亿元)   | 4435      | +335.60↑   |
| 行业消息                          | 1. 据农业农村部监测, 2022年12月19日—12月25日, 全国规模以上生猪定点屠宰企业生猪平均收购价格为19.33元/公斤, 环比下降9.6%, 同比上涨8.5%。白条肉平均出厂价格为25.66元/公斤, 环比下降8.8%, 同比上涨8.6%。<br>2. 据国家发改委价格监测中心和卓创资讯联合监测, 2022年12月28日全国生猪出场价格为18.99元/千克, 环比下跌0.94%, 主要批发市场玉米价格为2.96元/千克, 猪粮比价为6.42, 较12月21日下跌0.16%。 |           |           |                     |           |  |
| 观点总结                          | 价格上来看, 外三元生猪价格偏弱运行。供应端来看, 养殖端出栏窗口期不足半月, 供应压力有待释放, 集团场出栏增加, 散户出栏也较为积极, 生猪供给或将进一步宽松。需求端来看, 元旦过后, 需求惯性回落, 加上疫情处于高峰期, 居民消费情绪黯淡, 需求缺乏有效提振。总体来看, 市场情绪较为悲观, 供需宽松, 预计猪价偏弱调整。盘面上, 生猪2303合约偏强震荡, 收涨0.51%。操作上, 建议空单轻仓持有, 止损参考15900元/吨。                           |           |           |                     |           |  |
| 重点关注                          | 中国畜牧网公布的猪粮比价、收抛储情况  |           |           |                     |           |  |
| 数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎! |   |           |           |                     |           | 备注: LH: 生猪   |
|                               |   |           |           |                     |           | 更多资讯请关注!   |
|                               |   |           |           |                     |           | <br> |