

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) | 5,963.00 | -35.00↓ | 豆二 主力合约收盘价(元/吨) | 4,867.00 | -50↓ |
| | 大连豆一 9-1价差(元/吨) | 172 | -1.00↓ | | | |
| | 大连豆一 持仓量(手) | 130,753.00 | -1531↓ | 大连豆二 持仓量(手) | 17,436.00 | -132↓ |
| | 大连豆粕主力合约收盘价(元/吨) | 3,881.00 | -16.00↓ | 大连豆油 主力合约收盘价(元/吨) | 10,276.00 | -98↓ |
| | 大连豆粕 9-1价差(元/吨) | 220.00 | -11.00↓ | 大连豆油 9-1价差(元/吨) | 96.00 | -94↓ |
| | 大连豆粕 持仓量(手) | 1,015,563 | -19571↓ | 大连豆油 持仓量(手) | 306,431.00 | -11410↓ |
| | 豆一前20名净持仓(手) | 3,282 | +467.00↑ | 豆二前20名净持仓(手) | 0 | 0.00 |
| | 豆粕前20名净持仓(手) | -138,455 | -1355.00↓ | 豆油前20名净持仓(手) | -8,591 | +4503↑ |
| | 大连豆一 仓单(张) | 11886 | -340.00↓ | 大连豆二 仓单(张) | #N/A | #N/A |
| | 大连豆粕 仓单 (张) | 20821 | 0.00 | 大连豆油 仓单 (张) | 10261 | -10↓ |
| CBOT大豆主力结算价(美分/蒲式耳) | 1,462.50 | +29.75↑ | CBOT豆粕主力结算价(美元/短吨) | 400.20 | +6.00↑ | |
| CBOT 豆油主力结算价 (美分/磅) | 66.76 | +1.08↑ | | | | |
| 现货价格 | 国产大豆现货价格(元/吨) | 5,980.00 | 0.00 | 豆油价格 (日照) (元/吨) | 10,960.00 | +180↑ |
| | 南美大豆到港成本(元/吨) | 5,348.44 | +62.84↑ | 豆油价格 (张家港) (元/吨) | 11,020.00 | +180↑ |
| | 美豆到港成本(元/吨) | 6,812.48 | +315.22↑ | 豆油价格 (湛江) (元/吨) | 10,980.00 | +140↑ |
| | 豆粕价格 (张家港) (元/吨) | 4060 | +30.00↑ | | | |
| | 国产大豆主力合约基差(元/吨) | -18 | -102.00↓ | 张家港豆油主力合约基差(元/吨) | 646.00 | -18↓ |
| 张家港豆粕主力合约基差(元/吨) | 163 | -42.00↓ | | | | |
| 上游情况 | 美豆产量 (月, 百万吨) | 126.28 | 0.00 | 美豆期末库存 (月, 百万吨) | 7.61 | -0.82↓ |
| | 巴西产量 (月, 百万吨) | 139.5 | 0.00 | 巴西期末库存 (月, 百万吨) | 29.4 | +29.4↑ |
| | 美豆优良率 (周, %) | 65% | -3.00↓ | 巴西豆收获进度 (周, %) | 99.4% | 0.0000 |
| | 阿根廷豆收割进度 (周, %) | 100.00% | +1.000↑ | 美豆出口检验量 (周, 千蒲式耳) | 17281 | +1476↑ |
| | 美豆出口销售量 (周, 万吨) | 494055 | -214614↓ | 巴西出口 (月, 万吨) | 941 | -85.1↓ |
| 产业情况 | 油厂大豆库存 (周, 万吨) | 693.01 | -7.25↓ | 油厂豆粕库存 (周, 万吨) | 82.35 | +12.6↑ |
| | 油厂豆油库存 (周, 万吨) | 81.60 | +1.80↑ | 油厂开工率 (周, %) | 62.98% | -2.48% |
| | 油厂压榨量 (周, 万吨) | 181.2 | -7.14↓ | 大豆进口数量 (月, 万吨) | 967 | +159↑ |
| | 大豆进口预告7月 (月, 万吨) | 720 | | 大豆进口预告8月 (月, 万吨) | 690 | |
| | 棕榈油 (广东) (元/吨) | 12,760.00 | +90.00↑ | 菜油 (福建) (元/吨) | 12,400.00 | +200↑ |
| | 豆棕价差 (元/吨) | -1,740.00 | +90.00↑ | 菜豆价差 (元/吨) | 1,380.00 | +20↑ |
| | 菜粕 (江苏) (元/吨) | 3,400.00 | 0.00 | 油厂豆粕成交量 (周, 吨) | 950,700 | -273100↓ |
| | 豆粕与菜粕价差 (元/吨) | 850.00 | -50.00↓ | 油厂豆油成交量 (周, 吨) | 32,200 | -96649↓ |
| | 国产豆 (黑龙江) 压榨利润(日,元/吨) | -657.40 | +35.80↑ | 进口大豆压榨利润 (江苏) (日,元/吨) | -289.25 | +28↑ |
| 下游情况 | 中国大豆消费量(年, 百万吨) | 115.59 | +6.87↑ | 中国豆油食品用量(年, 千万吨) | 17700 | +600↑ |
| | 生猪价格 (周, 元/千克) | 21.05 | +0.70↑ | 生猪养殖利润 (周, 元/头) | 226.97 | +63↑ |
| | 鸡禽养殖利润 (周, 元/羽) | 16.72 | -9.29↓ | 饲料月度产量 (月, 吨) | 25706000 | +1628000↑ |
| | 生猪存栏量 (月, 万头) | #N/A | #N/A | 能繁母猪存栏量 (月, 万头) | 4192 | +15↑ |
| 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 (%) | 24.88 | | 豆粕期货平值看跌期权波动率 (%) | 24.66 | |
| | 豆粕平值期权20日历史波动率 (%) | 25.63 | | 豆粕平值期权60日历史波动率 (%) | 25.59 | |
| 行业消息 | <p>1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提高9.3%, 比去年同期提高321.0%。截至2022年6月23日的一周, 美国大豆出口检验量为468,309吨, 上周为428,322吨, 去年同期为111,250吨。</p> <p>2美国农业部发布的周度作物生长报告显示, 截至6月26日当周, 美国大豆优良率为65%, 低于分析师平均预估的68%, 去年同期为60%。美豆出苗率为91%, 与五年均值持平;美豆开花率为7%, 五年均值为11%。</p> | | | | | |



更多资讯请关注!

东北大豆价格基本稳定，中央储备粮北安直属库大豆重启收购，2021年新季大豆收购入库价3.075元/斤，收购与拍卖同时进行对于稳定市场价格起到一定作用，对大豆行情也有一定“兜底”。南方大豆价格暂时维持稳定，大中小学即将进入暑假，大批食堂需求进一步减弱。南方本周大多数贸易商仍以购销小麦，贸易商上货有限，市场价格基本维持稳定，走货较为平淡。综合来看，虽然有收储的支撑，不过拍卖同时进行。加上需求有回落的预期以及贸易商近期收购小麦为主，均压制豆一的价格。盘面来看，豆一反弹后有所回落，短期可能陷入调整，暂时观望。



更多观点请咨询!

观点总结:
豆一

美国农业部发布的周度作物生长报告显示，截至6月26日当周，美国大豆优良率为65%，低于分析师平均预估的68%，去年同期为60%。美豆出苗率为91%，与五年均值持平；美豆开花率为7%，五年均值为11%。随着美豆进入生长期，天气因素对美豆产量的影响逐渐提高。巴西方面，巴西国家商品供应公司(CONAB)发布的数据显示，截至6月4日，巴西2021/22年度大豆作物收获进度达到99.4%，高于一周前的99.1%，去年同期的收获进度为99.9%。巴西收获进度接近尾声。阿根廷方面，布宜诺斯艾利斯谷物交易所(BAGE)发布的周度报告称，截至2022年6月22日的一周，阿根廷2021/22年度大豆收获100%，比一周前的99%高出1%。阿根廷收获结束，后期关注出口的情况。盘面来看，豆二反弹后小幅回落，短期可能陷入震荡，暂时观望。

观点总结:
豆二

美国农业部将于6月30日发布基于实地调研的作物种植报告。市场各方对6月面积报告关注较高，一旦美国官方数据和市场预估值出现较大偏离，容易造成美豆价格剧烈波动。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6月24日当周（第25周），国内饲料企业豆粕库存天数（物理库存天数）为9.1天，较上一周减少0.45天，减幅4.93%。在现货下跌价格出现大幅下跌后大部分饲料企业以观望为主，采购心态消极，等待企稳信号。目前国内的压榨仍处在高位，油厂的豆粕库存仍较为宽松，在市场出现大跌行情后，买涨不买跌的采购心理有望推动豆粕库存继续上升。国家粮食交易中心定于7月1进行50万吨进口大豆拍卖。储备进口大豆保持每周拍卖一次的拍卖节奏，为国内进口大豆供应提供政策保障。盘面来看，豆粕超跌反弹的动力有所下降，短期或陷入震荡，暂时观望。

观点总结:
豆粕

美国农业部将于6月30日发布基于实地调研的作物种植报告。市场各方对6月面积报告关注较高，一旦美国官方数据和市场预估值出现较大偏离，容易造成美豆价格剧烈波动。从油脂基本面来看，上周国内大豆压榨量略降至181万吨，豆油产出有所减少，但下游贸易商提货速度一般，豆油库存继续上升。监测显示，6月27日，全国主要油厂豆油库存95万吨，比上周同期增加1万吨，月环比增加4万吨，同比增加10万吨，比近三年同期均值减少21万吨。随着生猪养殖利润持续向好，饲料养殖企业豆粕提货积极性增加，支持油厂保持较高开机率，预计本周大豆压榨量将维持在180万吨以上高位，豆油库存延续上升趋势。棕榈油方面，一方面印尼政府表示将调整国内配套销售政策，以便棕榈油企业可以获得更多的出口配额。另一方面，印尼也表示将在7月底对B40车辆进行道路测试。多空因素交织，棕榈油维持震荡。盘面来看，豆油超跌反弹的动力略显不足，前期剩余空单继续以10400为止损继续持有。

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!