

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)	5596	121	期货收盘价(活跃合约):黄大豆2号(日,元/吨)	5337	-11
	期货持仓量(活跃合约):黄大豆1号(日,手)	146278	3641	期货持仓量(活跃合约):黄大豆2号(日,手)	32295	-14311
	期货主力合约收盘价:豆粕(日,元/吨)	4210	91	期货主力合约收盘价:豆油(日,元/吨)	9560	321
	主力合约持仓量:豆粕(日,手)	1686084	-381331	主力合约持仓量:豆油(日,手)	439553	114311
	豆粕1-5价差(日,元/吨)	476	-111	豆油1-5价差(日,元/吨)	628	61
	期货前20名持仓:净买单量:豆一(日,手)	9603	55251	期货前20名持仓:净买单量:豆二(日,手)	-773	4631
	期货前20名持仓:净买单量:豆粕(日,手)	-25359	25451	期货前20名持仓:净买单量:豆油(日,手)	4073	41521
	注册仓单量:豆一(日,手)	7116	1851	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)	11426	3961
	期货结算价(活跃合约):CBOT大豆(日,美分/蒲)	1454	6.251	期货结算价(活跃合约):CBOT豆粕(日,美分/蒲)	424.5	-0.31
期货结算价(活跃合约):CBOT豆油(日,美分/蒲)	75.61	2.241				
现货价格	国产大豆现货价格(元/吨)	5640	0	豆油价格(日照)(元/吨)	10640	3201
	豆油价格(张家港)(元/吨)	10820	3601	豆油价格(湛江)(元/吨)	10820	3501
	豆粕价格(张家港)(元/吨)	5600	-301	国产大豆主力合约基差(元/吨)	44	-121
	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	1292	1541	张家港豆粕主力合约基差(元/吨)	1390	-391
	美湾大豆进口成本(日,元/吨)	5755	1231	巴西大豆进口成本(日,元/吨)	5228	1161
上游情况	大豆:产量:美国(年,百万吨)	117.38	-1.781	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	31	大豆:期末库存:巴西(年,百万吨)	31.31	1.951
	美豆优良率(周,%)	57	0	检验量:大豆:当周值(周,千蒲式耳)	94983	-116151
	大豆:本周出口:当周值(周,吨)	2748615	8518311	巴西出口(月,万吨)	368.9	-159.61
产业情况	港口库存:进口大豆(日,吨)	5873800	-167501	库存量:豆粕:全国(周,万吨)	22.73	4.031
	港口库存:豆油:全国(日,万吨)	57.7	-0.51	进口数量:大豆:当月值(月,万吨)	771.5	54.91
	油厂开工率(周,%)	58.3	2.481	油厂压榨量(周,万吨)	167.74	7.141
	现货价:棕榈油(24度):广东(日,元/吨)	8820	1001	出厂价:四级菜油:福建:厦门(日,元/吨)	13750	3501
	豆棕价差(日,元/吨)	2100	1701	菜豆价差(日,元/吨)	2930	-101
	现货价:平均价:菜粕(日,元/吨)	4084.21	-38.421	豆菜粕价差(日,元/吨)	1515.79	8.421
	油厂豆粕成交量(周,吨)	1291300	8544001	油厂豆油成交量(周,吨)	108850	681001
压榨利润:国产大豆:黑龙江(日,元/吨)	477.15	-56.351	压榨利润:进口大豆:江苏(日,元/吨)	853.45	0	
下游情况	大豆:国内消费总计:中国(年,百万吨)	108.72	-4.021	豆油:食品用量:中国(年,千吨)	17400	-2251
	价格:生猪(外三元):北京:大兴(日,元/公斤)	26.4	0.751	生猪养殖预期盈利(周,元/头)	1131.02	129.931
	产量:饲料:当月值(月,吨)	29965000	30530001	产量:饲料:猪饲料:当月值(月,万吨)	1067	841
生猪存栏(月,万头)	44394	13371	生猪存栏:能繁母猪(月,万头)	4362	381	
期权市场	平值看涨期权隐含波动率:豆粕(日,%)	24.93	-0.461	平值看跌期权隐含波动率:豆粕(日,%)	24.64	-1.681
	历史波动率:20日:豆粕(日,%)	21.13	-1.041	历史波动率:60日:豆粕(日,%)	29.13	0
行业消息	<p>1.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,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。</p> <p>2.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%。</p> <p>3.USDA周一公布的周度出口检验报告显示,截至10月27日,美国大豆出口检验量为257.41万吨,此前市场预期为120-265万吨。其中对中国大陆的大豆出口检验量为207.67万吨,占出口检验总量的80.67%。</p>					



更多资讯请关注!

观点总结：豆一	<p>从基本面来看，我国秋粮收获接近尾声，各地新作质量存在两极分化。此外，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，新豆收购价格有所走低。不过受疫情影响，东北和南方产区大豆出货均偏慢。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，11月1日竞价销售成交率仅为9%。盘面来看，豆一2301合约震荡收跌，不过MACD指标绿柱明显缩小，下方买盘支撑明显，预计短期内豆一维持低位震荡，建议暂时观望。</p>	 <p>更多观点请咨询!</p>
观点总结：豆二	<p>国际方面，俄乌局势重新谈判后计划逐步恢复黑海谷物出口，前期利多消息逐步消化。美豆方面，受低中西部低水位影响，USDA公布最新大豆出口检验量为257.4万吨，较上周291.9万吨有所回落；此外美国主产区加速推进美豆收割，收割率创同期新高达88%，季节性供应压力使得美豆上行有所承压。南美豆方面，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，较10月预估值上调了0.35%，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。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，跟随美豆运行，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>国际方面，俄乌局势重新谈判后计划逐步恢复黑海谷物出口，前期利多消息逐步消化。美豆方面，受低中西部低水位影响，USDA公布最新大豆出口检验量为257.4万吨，较上周291.9万吨有所回落；此外美国主产区加速推进美豆收割，收割率创同期新高达88%，季节性供应压力使得美豆上行有所承压。南美豆方面，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，较10月预估值上调了0.35%，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。从豆粕基本面来看，10月28日，豆粕库存为22.73万吨，较上周减少4.03万吨，减幅15.06%，同比去年减少27.97万吨，减幅55.17%。由于生猪新一轮周期已开启，生猪存栏量增加，养殖利润高企，饲料养殖企业提货积极，此外由于美豆出口受限，国内进口大豆到港节奏放缓。豆粕库存将继续下滑。此外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，豆粕2301合约跌幅较夜盘收窄，在豆粕库存消耗严重与油脂强势反弹的多空博弈下，预计短期内豆粕以震荡略偏强走势为主，操作上建议轻仓做多。</p>	
观点总结：豆油	<p>油脂方面，俄乌局势重新谈判后计划逐步恢复黑海谷物出口，前期利多消息逐步消化，不过由于黑海协议仍具有不确定性和巴西罢工，食用油供应链担忧仍存在，对油脂价格有一定的支撑。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。上周大豆压榨量回升，豆油产出增加，不过下游提货正常，豆油库存小幅下调。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，在低库存和油脂供应担忧的提振下，豆油2301合约继续上涨，不过由于疫情影响油脂需求与油脂供应担忧等多空因素交织，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！