

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) | 6,295.00 | -24.00↓ | 豆二 主力合约收盘价(元/吨) | 5,533.00 | +30↑ |
| | 大连豆一 9-1价差(元/吨) | 227 | +16.00↑ | | | |
| | 大连豆一 持仓量(手) | 109,420.00 | -13369↓ | 大连豆二 持仓量(手) | 31,439.00 | -172↓ |
| | 大连豆粕主力合约收盘价(元/吨) | 4,212.00 | +19.00↑ | 大连豆油 主力合约收盘价(元/吨) | 11,776.00 | +172↑ |
| | 大连豆粕 9-1价差(元/吨) | 267.00 | +2.00↑ | 大连豆油 9-1价差(元/吨) | 472.00 | +50↑ |
| | 大连豆粕 持仓量(手) | 1,334,477 | +6311↑ | 大连豆油 持仓量(手) | 449,441.00 | +20805↑ |
| | 豆一前20名净持仓(手) | -3,667 | +3662.00↑ | 豆二前20名净持仓(手) | -3,183 | -141↓ |
| | 豆粕前20名净持仓(手) | -234,010 | -6520.00↓ | 豆油前20名净持仓(手) | -45 | +9334↑ |
| | 大连豆一 仓单(张) | 13947 | 0.00 | 大连豆二 仓单(张) | #N/A | #N/A |
| | 大连豆粕 仓单 (张) | 11524 | 0.00 | 大连豆油 仓单 (张) | 5205 | 0.00 |
| | CBOT大豆主力结算价(美分/蒲式耳) | 1,732.25 | +5.75↑ | CBOT豆粕主力结算价(美元/短吨) | 432.30 | +4.10↑ |
| | CBOT 豆油主力结算价 (美分/磅) | 79.57 | -0.95↓ | | | |
| 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) | 12,200.00 | -130↓ |
| | 南美大豆到港成本(元/吨) | 5,867.94 | +15.24↑ | 豆油价格 (张家港) (元/吨) | 12,330.00 | -130↓ |
| | 美豆到港成本(元/吨) | 5,901.81 | +15.25↑ | 豆油价格 (湛江) (元/吨) | 12,500.00 | -200↓ |
| | 豆粕价格 (张家港) (元/吨) | 4300 | -10.00↓ | | | |
| | 国产大豆主力合约基差(元/吨) | -315 | +24.00↑ | 张家港豆油主力合约基差(元/吨) | 726.00 | +6↑ |
| | 张家港豆粕主力合约基差(元/吨) | 107 | -3.00↓ | | | |
| 上游情况 | 美豆产量 (月, 百万吨) | 120.71 | 0.00 | 美豆期末库存 (月, 百万吨) | 7.07 | -0.70↓ |
| | 巴西产量 (月, 百万吨) | 125 | -2.00↓ | 巴西期末库存 (月, 百万吨) | 21.61 | +0.6↑ |
| | 美豆播种率 (周, %) | 50% | +20.00↑ | 巴西豆收获进度 (周, %) | 98.1% | +0.80↑ |
| | 阿根廷豆收割进度 (周, %) | 89.90% | +12.300↑ | 美豆出口检验量 (周, 千蒲式耳) | 21246 | -8369↓ |
| | 美豆出口销售量 (周, 万吨) | 539504 | -417649↓ | 巴西出口 (月, 万吨) | 1230 | +602.8↑ |
| 产业情况 | 油厂大豆库存 (周, 万吨) | 703.71 | +1.62↑ | 油厂豆粕库存 (周, 万吨) | 69.73 | +14.8↑ |
| | 油厂豆油库存 (周, 万吨) | 77.55 | 0.00 | 油厂开工率 (周, %) | 65.30% | -1.71% |
| | 油厂压榨量 (周, 万吨) | 187.87 | -4.91↓ | 大豆进口数量 (月, 万吨) | 808 | +173↑ |
| | 大豆进口预告6月 (月, 万吨) | 810 | | 大豆进口预告7月 (月, 万吨) | 720 | |
| | 棕榈油 (广东) (元/吨) | 15,900.00 | -30.00↓ | 菜油 (福建) (元/吨) | 14,350.00 | +50↑ |
| | 豆棕价差 (元/吨) | -3,600.00 | +70.00↑ | 菜豆价差 (元/吨) | 2,020.00 | +180↑ |
| | 菜粕 (江苏) (元/吨) | 3,550.00 | +33.00↑ | 油厂豆粕成交量 (周, 吨) | 2,225,600 | +881300↑ |
| | 豆粕与菜粕价差 (元/吨) | 730.00 | -33.00↓ | 油厂豆油成交量 (周, 吨) | 170,600 | +79450↑ |
| | 国产豆 (黑龙江) 压榨利润(日,元/吨) | -327.00 | -11.55↓ | 进口大豆压榨利润 (江苏) (日,元/吨) | 107.35 | +37↑ |
| | | | | | | |
| 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) | 18050 | +650↑ |
| | 生猪价格 (周, 元/千克) | 16.3 | 0.00 | 生猪养殖利润 (周, 元/头) | 104.1 | +40↑ |
| | 鸡禽养殖利润 (周, 元/羽) | 16.72 | -9.29↓ | 饲料月度产量 (月, 吨) | 24078000 | -2089000↓ |
| | 生猪存栏量 (月, 万头) | 42400 | +147.00↑ | 能繁母猪存栏量 (月, 万头) | 4177.3 | -8↓ |
| 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 (%) | 21.3 | | 豆粕期货平值看跌期权波动率 (%) | 21.3 | |
| | 豆粕平值期权20日历史波动率 (%) | 20.72 | | 豆粕平值期权60日历史波动率 (%) | 26.45 | |
| 行业消息 | <p>1美国农业部公布的每周作物生长报告显示,截至5月22日当周,美国大豆种植率为50%,此一周前为30%,去年同期为73%,五年均值为55%;美豆出苗率为21%,去年同期为38%,五年均值为26%。</p> <p>2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5月25日的一周,阿根廷2021/22年度大豆收获89.9%,比一周前的77.6%高出12.3%。</p> | | | | |  <p>更多资讯请关注!</p> |
| 观点总结: 豆一 | <p>东北大豆价格稳中略偏强运行,中储粮大豆拍卖高溢价全部成交对现货市场形成提振,产区基层余粮已较少,对大豆现货市场也形成支撑。南方大豆价格整体表现偏弱,大豆质量不同价格也有较大差异。一方面为收购小麦腾仓,另一方面目前天气炎热部分小贩大豆出现霉变及发红的情况,大豆质量变差也使得小贩积极卖货。盘面来看,豆一处有所调整,暂时观望。</p> | | | | | |

| | |
|---------------------|--|
| <p>观点总结: 豆二</p> | <p>美国农业部公布的每周作物生长报告显示,截至5月22日当周,美国大豆种植率为50%,此前一周为30%,去年同期为73%,五年均值为55%;美豆出苗率为21%,去年同期为38%,五年均值为26%。美豆播种进度偏慢,支撑美豆的价格。巴西方面,巴西国家商品供应公司(CONAB)周二发布的数据显示,截至5月21日,巴西2021/22年度大豆作物收获进度达到98.1%,高于一周前的96.8%,去年同期的收获进度为99.0%。巴西收获仍在继续,收获进度快于去年水平。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5月25日的一周,阿根廷2021/22年度大豆收获89.9%,比一周前的77.6%高出12.3%。阿根廷收割加快,预计后期上市速度增加。盘面来看,豆二高位震荡,暂时观望。</p> |
| <p>观点总结: 豆粕</p> | <p>美豆近期总体播种进度偏慢,且陈豆的出口情况较好,持续支撑豆类的价格。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5月27日当周(第21周),国内饲料企业豆粕库存天数(物理库存天数)为10.01天,较上一周增加1.4天,增幅14.01%。盘面大幅上涨后,现货被动抬升,饲料企业小幅补库,全国饲料企业库存天数呈现小幅上升的趋势。从油厂的库存来看,近期大豆供应有所宽松,油厂的开工率提升,豆粕产出增加,虽然下游需求也有所增加,但需求不及产量增速,豆粕仍有累库的现象。国家粮食交易中心发布公告,6月1将继续进行50万吨进口大豆拍卖。储备进口大豆保持每周拍卖一次,政策调控压力犹存。盘面来看,豆粕高位整理,不过上行动力仍需观察。</p> |
| <p>观点总结: 豆油</p> | <p>降雨拖延美豆的种植进度,对价格有一定的支撑。美豆近期总体播种进度偏慢,且陈豆的出口情况较好,持续支撑豆类的价格。从油脂基本面来看,监测显示,5月23日,全国主要油厂豆油库存91万吨,比上周同期增加2万吨,月环比增加9万吨,同比增加17万吨,比近三年同期均值减少12万吨。近期大豆到港量庞大,压榨量将维持高位,豆油消费需求仍然偏弱,预计豆油库存仍将保持上升趋势。不过国内疫情有好转的态势,有利于油脂需求的回升。印尼贸易部官员表示,印尼将分配大约100万吨棕榈油用于出口,将优先考虑向已注册参与政府散装食用油项目的企业发放出口许可。印尼各方仍在围绕棕榈油出口展开激烈讨论,在相关技术细节落实到位前,仍无法对国际植物油市场形成有效供给。盘面来看,豆油小幅上涨,暂时观望。</p> |
| <p>重点关注</p> | <p>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</p> |

数据来源第三方,观点仅供参考。市场有风险,投资需谨慎!