

| 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) | 5922 | -49↓ | 期货收盘价(活跃合约):黄大豆2号(日,元/吨) | 5596 | 2↑ | |
| | 期货持仓量(活跃合约):黄大豆1号(日,手) | 69239 | -14651↓ | 期货持仓量(活跃合约):黄大豆2号(日,手) | 33234 | -623↓ | |
| | 期货主力合约收盘价:豆粕(日,元/吨) | 4045 | -48↓ | 期货主力合约收盘价:豆油(日,元/吨) | 9232 | 90↑ | |
| | 主力合约持仓量:豆粕(日,手) | 1494657 | 17748↑ | 主力合约持仓量:豆油(日,手) | 414939 | 14029↑ | |
| | 豆粕1-5价差(日,元/吨) | 419 | -25↓ | 豆油1-5价差(日,元/吨) | 844 | -72↓ | |
| | 期货前20名持仓:净买单量:豆一(日,手) | 9573 | 4002↑ | 期货前20名持仓:净买单量:豆二(日,手) | -365 | 1905↑ | |
| | 期货前20名持仓:净买单量:豆粕(日,手) | -153774 | 7770↑ | 期货前20名持仓:净买单量:豆油(日,手) | -18383 | 13730↑ | |
| | 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 | -17↓ | 注册仓单量:豆油(日,手) | 11536 | 0 | |
| | 期货结算价(活跃合约):CBOT大豆(日,美分/蒲) | 1374 | 7↑ | 期货结算价(活跃合约):CBOT豆粕(日,美分/蒲) | 405.7 | 5↑ | |
| 期货结算价(活跃合约):CBOT豆油(日,美分/蒲) | 66.06 | -0.54↓ | | | | | |
| 现货价格 | 国产大豆现货价格(元/吨) | 5700 | 0 | 豆油价格(日照)(元/吨) | 10620 | 400↑ | |
| | 豆油价格(张家港)(元/吨) | 10700 | 400↑ | 豆油价格(湛江)(元/吨) | 10630 | 500↑ | |
| | 豆粕价格(张家港)(元/吨) | 5350 | -30↓ | 国产大豆主力合约基差(元/吨) | -222 | 49↑ | |
| | 张家港豆油主力合约基差(元/吨) | 1558 | 152↑ | 张家港豆粕主力合约基差(元/吨) | 1305 | 18↑ | |
| | 美湾大豆进口成本(日,元/吨) | 5141 | 6↑ | 巴西大豆进口成本(日,元/吨) | 5386 | 50↑ | |
| 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,%) | 55 | 0 | 检验量:大豆:当周值(周,千蒲式耳) | 21226 | 11723↑ | |
| | 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) | 6339500 | -66000↓ | 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) | 61.8 | -0.45↓ | 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) | 8150 | 230↑ | 出厂价:四级菜油:福建:厦门(日,元/吨) | 13850 | 450↑ | |
| | 豆棕价差(日,元/吨) | 2690 | -90↓ | 菜豆价差(日,元/吨) | 3150 | 50↑ | |
| | 现货价:平均价:菜粕(日,元/吨) | 4217.89 | -22.11↓ | 豆菜粕价差(日,元/吨) | 1132.11 | -7.89↓ | |
| | 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) | 544.45 | -22.25↓ | 压榨利润:进口大豆:江苏(日,元/吨) | 684.35 | -13.15↓ | | |
| 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) | 26.85 | 0.1↑ | 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,%) | 27.55 | -0.47↓ | 平值看跌期权隐含波动率:豆粕(日,%) | 26.67 | -2.37↓ | |
| | 历史波动率:20日:豆粕(日,%) | 23.04 | -0.13↓ | 历史波动率:60日:豆粕(日,%) | 29.37 | -0.02↓ | |
| 行业消息 | <p>1.USDA在每周作物生长报告中公布称,截至10月2日当周,美豆生长优良率为55%,分析师平均预估为55%,之前一周为55%;大豆收割率为22%,分析师平均预估为20%,之前一周为8%。</p> <p>2.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> <p>3.据农业咨询公司Agrural周一发布消息称,巴西大豆种植率约为9.6%,落后于去年同期的10.1%。</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，后期关注中粮储收购新豆情况。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!