

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)	6,190.00	-32.00↓	豆二 主力合约收盘价(元/吨)	4,939.00	-104↓
	大连豆一 9-1价差(元/吨)	423	-23.00↓			
	大连豆一 持仓量(手)	96,112.00	-6713↓	大连豆二 持仓量(手)	23,979.00	-3985↓
	大连豆粕主力合约收盘价(元/吨)	3,686.00	-75.00↓	大连豆油 主力合约收盘价(元/吨)	9,968.00	-186↓
	大连豆粕 9-1价差(元/吨)	371.00	+19.00↑	大连豆油 9-1价差(元/吨)	308.00	+34↑
	大连豆粕 持仓量(手)	1,035,497	-11484↓	大连豆油 持仓量(手)	150,152.00	-13595↓
	豆一前20名净持仓(手)	12,037	+96.00↑	豆二前20名净持仓(手)	-2,593	+781↑
	豆粕前20名净持仓(手)	-8,229	+9370.00↑	豆油前20名净持仓(手)	13,637	-7474↓
	大连豆一 仓单(张)	5413	-50.00↓	大连豆二 仓单(张)	#N/A	#N/A
	大连豆粕 仓单 (张)	16725	+4725.00↑	大连豆油 仓单 (张)	11276	0.00
	CBOT大豆主力结算价(美分/蒲式耳)	1,454.25	+5.75↑	CBOT豆粕主力结算价(美元/短吨)	417.90	+5.50↑
	CBOT 豆油主力结算价 (美分/磅)	67.97	+0.35↑			
现货价格	国产大豆现货价格(元/吨)	6,060.00	0.00	豆油价格 (日照) (元/吨)	10,680.00	+60↑
	南美大豆到港成本(元/吨)	5,249.33	+75.43↑	豆油价格 (张家港) (元/吨)	10,670.00	+50↑
	美豆到港成本(元/吨)	6,607.31	+95.51↑	豆油价格 (湛江) (元/吨)	10,550.00	+70↑
	豆粕价格 (张家港) (元/吨)	4190	0.00			
	国产大豆主力合约基差(元/吨)	#N/A	#N/A	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	516.00	-98↓
	张家港豆粕主力合约基差(元/吨)	233	+29.00↑			
上游情况	美豆产量 (月, 百万吨)	123.3	+0.69↑	美豆期末库存 (月, 百万吨)	6.66	+0.40↑
	巴西产量 (月, 百万吨)	126	0.00	巴西期末库存 (月, 百万吨)	22.71	+0.3↑
	美豆优良率 (周, %)	60%	+1.00↑	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)	32011	+10057↑
	美豆出口销售量 (周, 万吨)	894474	+366869↑	巴西出口 (月, 万吨)	739.3	-40.1↓
产业情况	油厂大豆库存 (周, 万吨)	691.17	-0.21↓	油厂豆粕库存 (周, 万吨)	82.35	+12.6↑
	油厂豆油库存 (周, 万吨)	67.95	-3.40↓	油厂开工率 (周, %)	57.66%	0.01%
	油厂压榨量 (周, 万吨)	165.89	+0.02↑	大豆进口数量 (月, 万吨)	788.3	-37↓
	大豆进口预告9月 (月, 万吨)	610		大豆进口预告10月 (月, 万吨)	720	
	棕榈油 (广东) (元/吨)	10,650.00	+70.00↑	菜油 (福建) (元/吨)	13,150.00	+350↑
	豆棕价差 (元/吨)	90.00	+10.00↑	菜豆价差 (元/吨)	2,480.00	+300↑
	菜粕 (江苏) (元/吨)	3,400.00	0.00	油厂豆粕成交量 (周, 吨)	464,400	-304500↓
	豆粕与菜粕价差 (元/吨)	880.00	-10.00↓	油厂豆油成交量 (周, 吨)	193,500	+72050↑
	国产豆 (黑龙江) 压榨利润(日,元/吨)	-617.05	-55.85↓	进口大豆压榨利润 (江苏) (日,元/吨)	-328.95	+8↑
下游情况	中国大豆消费量(年, 百万吨)	115.59	+8.87↑	中国豆油食品用量(年, 千万吨)	17600	+850↑
	生猪价格 (周, 元/千克)	21.4	+0.10↑	生猪养殖利润 (周, 元/头)	797.63	-15↓
	鸡禽养殖利润 (周, 元/羽)	16.72	-9.29↓	饲料月度产量 (月, 吨)	26896000	+1190000↑
	生猪存栏量 (月, 万头)	43057	#N/A	能繁母猪存栏量 (月, 万头)	4277	+85↑
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 (%)	21.09		豆粕期货平值看跌期权波动率 (%)	20.75	
	豆粕平值期权20日历史波动率 (%)	39.4		豆粕平值期权60日历史波动率 (%)	29.15	
行业消息	1美国农业部8月份供需报告显示, 2022/23年度美国大豆单产调高到51.9蒲/英亩, 高于7月份预估的51.5蒲/英亩, 也高于上年的51.4蒲/英亩。大豆播种面积则调低到8800万英亩, 低于7月份使用的8830万英亩。收获面积也相应下调了30万英亩。即将在一个月后收获的2022/23年度美国大豆产量预计为45.31亿蒲, 高于7月份预测的45.05亿蒲, 也高于上年的44.35亿蒲。					
	2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增长45.81%, 比去年同期提高655.24%。截至2022年8月4日的一周, 美国大豆出口检验量为867,504吨, 上周为594,958吨, 去年同期为114,865吨。					



更多资讯请关注!

东北主产区天气条件保持良好，整体利于大豆作物生长。产区大豆现货供需稳定，多地价格保持坚挺，优质优价较明显。另外，因东北大颗粒高蛋白货源有限，上周价格仍出现上涨，商品大豆价格暂维持稳定。安徽、河南大豆价格上周无调整，湖北豆上市量增加，价格略有下滑。盘面来看，豆一前高处有一定的压力，目前有所震荡。



更多观点请咨询!

观点总结：
豆一

观点总结：
豆二

据美国农业部（USDA）周二凌晨公布的每周作物生长报告，截至8月7日当周，美国大豆生长优良率为59%，市场预期为59%，此前一周为60%，去年同期为60%；开花率为89%，此前一周为79%，去年同期为90%，五年均值为88%；结荚率为61%，此前一周为44%，去年同期为70%，五年均值为66%。美豆种植优良率小幅回落，限制美豆的产量。盘面来看，豆二维持震荡，暂时维持震荡的观点。

观点总结：
豆粕

美国农业部周五公布8月供需报告，本次报告中多项数据超出报告前市场预期。其中，美国农业部确认2022年美豆播种面积为8800英亩，较上月下调30万英亩，报告前市场曾预期美豆播种面积会被上调；最新报告中显示2022年美豆单产不降反升，由上月预估的51.5蒲式耳/英亩调高到51.9蒲式耳/英亩，美豆产量预估值由上月的1.2261亿吨上调到1.233亿吨。报告总体偏空。天气因素对产量的影响有限。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8月12日当周（第32周），国内饲料企业豆粕库存天数（物理库存天数）为9.18天，较上一周减少0.24天，减幅2.66%。目前油厂对9-10月船期进口大豆的采购量不到五成，豆粕库存恢复缓慢且处于下降周期，对豆粕价格有所支撑。盘面来看，豆粕走弱，且后期受天气因素扰动的时间越来越短，豆粕预计维持震荡，暂时观望。

观点总结：
豆油

美国农业部周五公布8月供需报告，本次报告中多项数据超出报告前市场预期。其中，美国农业部确认2022年美豆播种面积为8800英亩，较上月下调30万英亩，报告前市场曾预期美豆播种面积会被上调；最新报告中显示2022年美豆单产不降反升，由上月预估的51.5蒲式耳/英亩调高到51.9蒲式耳/英亩，美豆产量预估值由上月的1.2261亿吨上调到1.233亿吨。报告总体偏空。天气因素对产量的影响有限。从油脂基本面来看，监测显示，上周国内主要油厂豆油商业库存为81万吨，比上周减少2万吨，比上月同期减少10万吨，比上年同期减少10万吨。预计本周大豆压榨量重新增至175万吨以上，豆油产出增加，库存将小幅攀升。但8-9月份国内大豆供应偏紧，豆油库存增幅不大。另外，棕榈油方面，马棕的出口表现良好，加上印尼方面最新公布的库存数据没有继续抬升，市场对印尼库存的炒作有所降温。国内方面，总体到船量依然有限，限制国内油脂的库存水平。盘面来看，豆油继续移仓，短期消息面偏多影响，继续支撑豆油的价格。

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!