

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)	6,094.00	-96.00↓	豆二 主力合约收盘价(元/吨)	4,946.00	+7↑
	大连豆一 9-1价差(元/吨)	358	-65.00↓			
	大连豆一 持仓量(手)	83,733.00	-12379↓	大连豆二 持仓量(手)	23,238.00	-741↓
	大连豆粕主力合约收盘价(元/吨)	3,675.00	-11.00↓	大连豆油 主力合约收盘价(元/吨)	9,974.00	+6↑
	大连豆粕 9-1价差(元/吨)	394.00	+23.00↑	大连豆油 9-1价差(元/吨)	366.00	+58↑
	大连豆粕 持仓量(手)	1,016,934	-18563↓	大连豆油 持仓量(手)	135,328.00	-14824↓
	豆一前20名净持仓(手)	13,267	+1230.00↑	豆二前20名净持仓(手)	-2,144	+449↑
	豆粕前20名净持仓(手)	-1,676	+6553.00↑	豆油前20名净持仓(手)	14,809	+1172↑
	大连豆一 仓单(张)	5413	0.00	大连豆二 仓单(张)	#N/A	#N/A
	大连豆粕 仓单 (张)	16725	0.00	大连豆油 仓单 (张)	11276	0.00
CBOT大豆主力结算价(美分/蒲式耳)	1,412.25	-42.00↓	CBOT豆粕主力结算价(美元/短吨)	405.10	-12.80↓	
CBOT 豆油主力结算价 (美分/磅)	66.99	-0.98↓				
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)	10,560.00	-120↓
	南美大豆到港成本(元/吨)	5,229.97	-59.26↓	豆油价格 (张家港) (元/吨)	10,600.00	-70↓
	美豆到港成本(元/吨)	6,540.90	-75.74↓	豆油价格 (湛江) (元/吨)	10,470.00	-80↓
	豆粕价格 (张家港) (元/吨)	4190	0.00			
	国产大豆主力合约基差(元/吨)	-34	+96.00↑	张家港豆油主力合约基差(元/吨)	632.00	+116↑
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)	27475	-4678↓
	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)	691.36	+6.31↑	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	0.00	菜油 (福建) (元/吨)	12,850.00	-300↓
	豆棕价差 (元/吨)	-50.00	-140.00↓	菜豆价差 (元/吨)	2,250.00	-230↓
	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)	830.00	0.00	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)	-634.95	-15.25↓	进口大豆压榨利润 (江苏) (日,元/吨)	-346.75	-16↓
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)	21.2	-0.20↓	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 (%)	20.25		豆粕期货平值看跌期权波动率 (%)	20.29	
	豆粕平值期权20日历史波动率 (%)	39.08		豆粕平值期权60日历史波动率 (%)	29.13	
行业消息	<p>1美国农业部公布的作物生长报告显示, 截止8月14日当周, 美豆优良率为58%, 符合市场预期, 去年同期为57%;大豆开花率为93%, 去年同期为94%, 五年均值为93%;大豆结荚率为74%, 去年同期为80%, 五年均值为77%。 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减少14.6%, 但是比去年同期提高167.4%。截至2022年8月11日的一周, 美国大豆出口检验量为744,571吨, 上周为871,345吨, 去年同期为278,420吨。</p>					



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

美国农业部公布的作物生长报告显示，截止8月14日当周，美豆优良率为58%，符合市场预期，去年同期为57%;大豆开花率为93%，去年同期为94%，五年均值为93%;大豆结荚率为74%，去年同期为80%，五年均值为77%。当前正值美豆结荚和鼓粒的关键生长阶段，随着天气窗口逐渐收窄，美豆市场很难掀起大级别的天气炒作行情。盘面来看，豆二下跌后震荡上行，暂时维持震荡观点。

观点总结:
豆二

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8800万亩，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，豆粕追随美豆走弱，在美豆天气炒作时间窗口逐渐缩窄的背景下，后期豆粕可炒作的空间有限，暂时观望。

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8800万亩，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，印尼政府宣布，将修改其国内市场义务要求，该国敲定8月16-31日毛棕榈油参考价为900.52美元/吨，高于本月上半月的每吨872.27美元。此举有助于缓解此前马棕出口面临的压力。盘面来看，豆油继续移仓，短期供应偏紧的情况，继续支撑油脂的价格。

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!