

豆类油脂早报

2020年11月10日					
信达期货CINDA FUTURE		联系人:	张秀峰	投资咨询号:	Z0011152
		电话:	0571-28132638	邮箱:	zhangxiufeng@cindasc.com
外盘报价		2020/11/6	2020/11/9	涨跌	涨跌幅度
	美豆	1100.5	1104.8	4.25	0.4%
	美豆粕	383.6	384.8	1.20	0.3%
	美豆油	35.5	35.5	0.02	0.1%
	马棕榈油(指数)	3175.0	3227.0	52.00	1.6%
现货价格	大豆	3780	3780	0.00	0.0%
	豆粕	3320	3300	(20.00)	-0.6%
	豆油	7980	7950	(30.00)	-0.4%
	棕榈油	6880	6820	(60.00)	-0.9%
	菜粕	2410	2560	150.00	6.2%
	菜油	10470	10210	(260.00)	-2.5%
	玉米	2490	2480	(10.00)	-0.4%
现货基差		2020/11/6	2020/11/9	涨跌	正常区间
	豆粕	171	97	(74.00)	(-100, 400)
	豆油	1176	562	(614.00)	(-400, 100)
	棕榈油	1038	436	(602.00)	(-400, 400)
	菜粕	-161	50	211.00	(-100, 300)
	菜油	708	656	(52.00)	(-300, 700)
进口价格	交货月	11月	12月	1月	1月盘面进口利润
	大豆(美西)	3640	3643	/	
	大豆(巴西)	3685	3703	3520	
	棕榈油(印尼)	6227	6146	5920	464
	菜籽油(加拿大)	8322	8322	8322	1232
大豆压榨利润		1月	5月	9月	
	盘面压榨利润	28.14	-106.89	(154.82)	
	现货压榨利润	-	-0.80	(0.80)	(-350, 300)
套利价差		2020/11/6	2020/11/9	变化	正常区间
	现货Y-P	1100	1130	30.00	(-150, 148)
	现货M-RM	910	740	(170.00)	(-150, 149)
	Y01-Y05	386	314	(72.00)	(-150, 150)
	P01-P05	360	310	(50.00)	(-300, 100)
	O101-O105	639	657	18.00	(-200, 100)
	M01-M05	110	98	(12.00)	(-200, 100)
	RM01-RM05	-10	-29	(19.00)	(-100, 100)
	Y-P01	984	1004	20.00	(500, 1500)
	Y-P09	962	1006	44.00	(500, 1500)
	M-RM01	687	693	6.00	(500, 1000)
库存(万吨)	M-RM09	578	581	3.00	(400, 1000)
		上周	本周	变化	正常区间
	大豆	806.00	799.00	(7.00)	(150, 700)
	豆粕	88.99	92.15	3.16	(40, 120)
	豆油	127.16	133.09	5.93	(90, 160)
仓单(张)	棕榈油	43.30	39.40	(3.90)	(30, 100)
		2020/11/6	2020/11/9	变化	
	大豆	1026	1026	0.00	
	豆粕	26644	30347	3703.00	
	豆油	17037	16503	(534.00)	
	棕榈油	1150	1150	0.00	
	菜粕	983	841	(142.00)	
期权	菜油	1350	1350	0.00	
	玉米	53763	54646	883.00	
	合约代码	隐含波动率		历史波动率(60天)	
持仓建议	2101-P-3000.DC	0.1652		18.19	
	2101-C-3500.DC	0.2210		18.19	
	美国大豆	美豆突破1100美分大关，USDA最新周报显示，美豆需求强劲，但是南美降雨增加，巴西播种速度加快。短线美豆将保持强势，中长期仍看好。			
持仓建议	粕类	美豆持续上涨，提升进口成本，短线豆粕价格保持震荡偏强，生猪存栏持续恢复，保持逢回调买入豆粕2105思路不变。			
	油脂	昨夜辉瑞疫苗消息公布，原油大涨，SPPOMA称马棕10月产量环比降9.74%，同期出口环比增4.32%-5.58%，豆油库存小幅上升，油脂基本面良好，同时市场继续期待印尼出口附加税大幅调增，加上全球通胀预期难消，油脂将保持震荡偏强，逢低做多为主。			
报告中的信息均来源于公开可获得的资料，信达期货有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证。					