


| 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):(日,元/吨) | 2588 | -40 | 玉米淀粉期货收盘价(活跃合约):(日,元/吨) | 2931 | 2 |
| | 玉米月间价差(11-1)(日,元/吨) | 44 | -5 | 玉米淀粉月间价差(11-1)(日,元/吨) | 73 | 24 |
| | 期货持仓量(活跃合约):黄玉米(日,手) | 272875 | -1080 | 期货持仓量(活跃合约):玉米淀粉(日,手) | 148801 | -3545 |
| | 期货前20名持仓:净买单量:玉米(日,手) | -2264 | 12597 | 期货前20名持仓:净买单量:玉米淀粉(日,手) | -11404 | -1961 |
| | 注册仓单量:黄玉米(日,手) | 18400 | -1040 | 注册仓单量:玉米淀粉(日,手) | 2611 | -170 |
| | 主力合约CS-C价差(日,元/吨) | 311 | 6 | | | |
| 外盘市场 | 期货收盘价(活跃合约):CBOT玉米(日,美分/蒲式耳) | 492.5 | -3.75 | CBOT:玉米:总持仓(周,张) | 1367904 | 28297 |
| | CBOT:玉米:非商业净多头持仓:持仓数量(周,张) | -107544 | 10996 | | | |
| 现货市场 | 现货价:玉米:均价(日,元/吨) | 2805.41 | -16.67 | 出厂报价:玉米淀粉:长春(日,元/吨) | 3200 | 0 |
| | 平仓价:玉米:锦州港(日,元/吨) | 2660 | -20 | 出厂报价:玉米淀粉:潍坊(日,元/吨) | 3350 | 0 |
| | 进口玉米:到岸完税价格(CIF)(日,元/吨) | 2363.37 | 1.01 | 出厂报价:玉米淀粉:石家庄(日,元/吨) | 3250 | 0 |
| | 进口玉米:国际运费(日,美元/吨) | 50 | 0 | 玉米淀粉主力合约基差 | 269 | NAN |
| | 玉米主力合约基差 | 217.41 | NAN | 山东淀粉与玉米价差(周,元/吨) | 442 | 2 |
| 替代品现货价格 | 现货价:均价:小麦(日,元/吨) | 3050.56 | 0 | 木薯淀粉与玉米淀粉价差(周,元/吨) | 1412 | -25 |
| | 现货价:玉米:均价(日,元/吨) | 245.15 | 16.67 | 玉米淀粉与30粉价差(日,元/吨) | -282 | 0 |
| 上游情况 | 玉米:预测年度:产量:美国(月,百万吨) | 384.42 | 0.59 | 播种面积:预测年度:玉米:美国(月,百万公顷) | 35.25 | 0.32 |
| | 玉米:预测年度:产量:巴西(月,百万吨) | 129 | 0 | 播种面积:预测年度:玉米:巴西(月,百万公顷) | 22.9 | 0 |
| | 玉米:预测年度:产量:阿根廷(月,百万吨) | 54 | 0 | 播种面积:预测年度:玉米:阿根廷(月,百万公顷) | 7 | 0 |
| | 玉米:预测年度:产量:中国(月,百万吨) | 277 | 0 | 播种面积:预测年度:玉米:中国(月,百万公顷) | 43 | 0 |
| | 玉米:预测年度:产量:乌克兰(月,百万吨) | 28 | 0.5 | | | |
| 产业情况 | 玉米:库存:南方港口(周,万吨) | 15 | -6 | 深加工玉米库存量(周,万吨) | 274.2 | 18.2 |
| | 玉米:库存:北方港口(周,万吨) | 75 | -25 | 淀粉企业周度库存(周,万吨) | 67.2 | -2.6 |
| | 进口数量:玉米:当月值(月,万吨) | 120 | -48 | 出口数量:玉米淀粉:当月值(月,吨) | 232.99 | 59.6 |
| | 进口玉米计划拍卖数量(周,吨) | 290145 | -117919 | 进口玉米拍卖成交率(周,%) | 1.01 | -5.3 |
| 下游情况 | 产量:饲料:当月值(月,万吨) | 2750.9 | 88.8 | 玉米淀粉加工利润:山东(日,元/吨) | 39 | 34 |
| | 样本饲料玉米库存天数(周,天) | 27.71 | -0.25 | 玉米淀粉加工利润:河北(日,元/吨) | 119 | 60 |
| | 深加工玉米消费量(周,万吨) | 118.36 | -8.16 | 玉米淀粉加工利润:吉林(日,元/吨) | 35 | 79 |
| | 酒精企业开机率(周,%) | 58.74 | -4.09 | 淀粉企业开机率(周,%) | 46.46 | -8.74 |
| 期权市场 | 历史波动率:20日:玉米(日,%) | 12.3 | 0.88 | 历史波动率:60日:玉米(日,%) | 12.13 | 0.37 |
| | 平值看涨期权隐含波动率:玉米(日,%) | 11.53 | -0.62 | 平值看跌期权隐含波动率:玉米(日,%) | 11.54 | -0.62 |
| 行业消息 | <p>1、布宜诺斯艾利斯谷物交易所(BAGE)称,截至10月4日当周,2023/24年度阿根廷玉米播种进度为13.9%,高于一周前的7.3%,比过去五年均值落后7.5%。2、联合国粮农组织(FAO)发布的世界谷物供需简报显示,2023/24年度全球谷物产量为28.19亿吨,略高于此前估计的28.15亿吨,比2022年高出约0.9%。</p> | | | | <p>更多资讯请关注!</p> | |

| | | |
|-----------|---|---|
| 观点总结 (玉米) | <p>美国农业部(USDA)公布季度库存报告显示,截止9月1日美国玉米库存为13.61亿蒲式耳,较去年同期下降1%,且低于此前市场预估为14.29亿蒲式耳,报告数据利多,使得美玉米上涨。国内方面,东北地区新粮单产整体提升,基层种植户售粮整体较为积极,新玉米持续上市,市场供应整体宽松。烘干塔和贸易商收购为主,出粮利润良好,暂无存粮计划。深加工多数开秤收购新季玉米,整体控制收购节奏,随收随用,个别深加工有意少量建库。华北黄淮产区玉米价格大幅走低,基层新粮收购价下降,基层种植户售粮情绪减弱,市场玉米流通减少,压价情绪转弱,跌势有所放缓。整体而言,在新粮上市压力下,现货市场表现较弱。盘面来看,在现货价格偏弱影响下,期价再度下探。不过,对于2401合约而言,盘面价格接近成本位附近,继续下跌空间或将有限,激进者可尝试在2550附近轻仓试多。</p> |  |
| 观点总结 (淀粉) | <p>在集中上量压力下,玉米收购价弱势下行,淀粉成本支撑减弱,节日期间现货价格同步下滑。不过,节日期间整体走货相对良好,部分企业甚至出现出货排队的情况,且节前企业库存天数普遍偏低,节后下游企业又存在有刚需补库的需求,对淀粉市场价格有所支撑,继续下跌空间相对有限。盘面来看,受玉米走弱拖累,淀粉同步下跌。对于2401合约激进者可尝试在2850附近轻仓试多。</p> | |
| 重点关注 | <p>周四、周五我的农产品网玉米周度消耗以及淀粉库存情况</p> | |

更多观点请咨询!

数据来源第三方,观点仅供参考。市场有风险,投资需谨慎!

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101
 助理研究员: 谢程琪 期货从业资格号F03117498

免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料,瑞达期货股份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,据此投资,责任自负。本报告不构成个人投资建议,客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有,未经书面许可,任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发,需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院,且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。