

撰写人: 王翠冰 从业资格证号: 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	玉米主力9月合约收盘价(日, 元/吨)	2,746.00	-9.00↓	玉米淀粉9月合约收盘价(日, 元/吨)	3,110.00	-23.00↓
	玉米9-1价差(日, 元/吨)	-152.00	-340.00↓	玉米淀粉9-11价差(日, 元/吨)	187.00	-9.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	839,942.00	-17648.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	209,304.00	-15362.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-113,203.00	-12368.00↓	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	177.00	+15.00↑
	玉米仓单(日, 张)	60,877.00	0.00	玉米淀粉仓单(日, 张)	4,490.00	-105.00↓
	淀粉玉米9月价差(CS-C)	364.00	-14.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	501.50	+2.50↑	美玉米持仓量(日, 手)	538,090.00	-3674.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	46,403.00	-67035.00↓			
现货市场	玉米锦州港收购价:水14%(日, 元/吨)	2,800.00	0.00	玉米淀粉现价: 吉林嘉吉(日, 元/吨)	3,250.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,871.96	+4.67↑	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,390.00	0.00
	广东港口价(巴西8月)	2,135.48	+2136.26↑	玉米淀粉现价: 山东淮坊(日, 元/吨)	3,420.00	0.00
	广东港口价(巴西9月)	2,119.81	+2120.64↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	140.00	+23.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	54.00	+9.00↑	山东玉米淀粉与玉米价差(周, 元/吨)	416.00	+36.00↑
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,800.56	-2.22↓	玉米淀粉与木薯淀粉价差(周, 元/吨)	-1,217.00	-11.00↓
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	-71.40	-6.89↓			
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	34.03	0.00	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	387.75	0.00
	巴西玉米种植面积预估(月, 万公顷)	22.90	0.00	巴西玉米产量预估(月, 百万吨)	129.00	0.00
	阿根廷玉米种植面积预估(月, 万公顷)	7.00	0.00	阿根廷玉米产量预估(月, 百万吨)	54.00	0.00
	我国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	43.00	0.00	我国玉米产量预估(月, 百万吨)	280.00	0.00
	美玉米去年同期优良率(周, %)	64.00	0.00	美玉米优良率(周, %)	55.00	+4.00↑
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	75.50	-2.50↓	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	252.30	-20.60↓
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	199.30	-5.60↓	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	86.70	-1.70↓
	5月玉米进口量(月, 万吨)	166.00	+66.00↑	淀粉出口量(月, 吨)	14.44	-19.10↓
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	15,913.00	-35270.00↓	非转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	0.00	0.00
	转基因进口玉米拍卖成交率(周, %)	100.00	+30.00↑	非转基因进口玉米拍卖成交率(周, %)	0.00	0.00
	理论进口利润(巴西8月)	793.74	-10.78↓	理论进口利润(巴西9月)	809.36	-10.83↓
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,584.00	+73.00↑	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	31.00	0.00
	样本饲企玉米库存天数(周, 天)	28.12	+1.06↑	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	32.00	0.00
	酒精企业开机率(周, %)	50.74	-1.11↓	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-49.00	0.00
	周度玉米消费量(周, 万吨)	109.48	-3.83↓	淀粉企业开机率(周, %)	52.51	+0.48↑
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	10.35		玉米平值看跌期权波动率(%)	10.35	
	标的20日历史波动率(%)	9.47	-5.00↓	标的60日历史波动率(%)	12.69	0.00

行业消息
 1、巴西外贸秘书处(Secex)的统计数据显示, 7月份第一周, 巴西出口玉米518,580.7吨。作为参考, 2022年7月份全月巴西玉米出口量为4,119,091.2吨%;
 2、根据华尔街日报对14家机构分析师的调查, 分析师们平均预计美国农业部将玉米单产从181.5蒲/英亩下调至175.8蒲/英亩。



更多资讯请关注!

观点总结 玉米
 近来美国农业产区已经出现了一些相当好的降雨。截止7月9日当周, 美玉米优良率为55%, 高于市场预期的53%, 上年同期为64%。种植面积预期增加, 且优良率逐步改善, 施压玉米市场价格。关注今晚的USDA月度供需报告对产量的调整情况。国内方面, 东北产区受区域粮源价差增加, 部分贸易商有粮源外调, 部分加工企业库存减少, 刚需补库意愿增强, 为了防止低价粮源调出, 本地深加工企业不断提价, 玉米现货价格重心上移。华北黄淮产区玉米价格的不断上涨, 不少主体逢高出货, 市场流通粮源逐渐增多, 但部分持粮主体仍有看涨惜售情绪, 饲料企业补库情绪不佳, 深加工企业产品利润一般, 开工率季节性下滑, 对玉米价格支撑有限。盘面来看, 前期连续上涨后, 近日期价有所回落, 短期有望维持震荡。



更多观点请咨询!

观点总结 玉米淀粉
 由于玉米上货量增加, 玉米收购价格下跌, 导致下游观望情绪较重, 采买积极性不高。部分企业大单成交价格略有松动, 市场情绪偏谨慎。不过, 玉米整体供应偏紧, 个别企业进入季节性检修阶段, 企业开工率降低, 供应减少, 企业库存有所回降, 截至7月5日, 全国玉米淀粉企业淀粉库存总量86.7万吨, 较上周减少1.7万吨, 降幅1.92%, 月降幅2.64%; 年同比降幅22.87%。且短期玉米淀粉价格在原料价格支撑下仍将维持坚挺, 支撑期货市场。关注上游企业减产计划是否落地。盘面来看, 淀粉随玉米波动, 今日继续减仓回落。

重点关注 周四、周五我的农产品网玉米周度消耗和主产区售粮进度以及淀粉库存情况; 今晚USDA供需报告