

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)	2,767.00	0.00	玉米淀粉9月合约收盘价(日, 元/吨)	3,100.00	+18.00↑
	玉米9-1价差(日, 元/吨)	115.00	-17.00↓	玉米淀粉9-11价差(日, 元/吨)	78.00	-24.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	469,459.00	-62508.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	124,999.00	+3395.00↑
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-122,354.00	0.00	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-19,373.00	0.00
	玉米仓单(日, 张)	43,360.00	-586.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	0.00	0.00
	淀粉玉米9月价差(CS-C)	333.00	+18.00↑			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	497.50	+2.75↑	美玉米持仓量(日, 手)	590,256.00	-4862.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	80,074.00	+9598.00↑			
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)	2,874.86	+3.33↑	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)	2,120.94	+13.19↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,390.00	+10.00↑
	广东港口价(巴西9月)	2,089.86	+13.27↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	150.00	-18.00↓
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	33.00	0.00	山东玉米淀粉与玉米价差(周, 元/吨)	348.00	+38.00↑
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,825.00	+11.11↑	玉米淀粉与木薯淀粉价差(周, 元/吨)	-1,249.00	-5.00↓
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	-49.86	+7.78↑			
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	34.93	+0.90↑	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	389.15	+1.40↑
	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, %)	61.00	0.00	美玉米优良率(周, %)	55.00	-2.00↓
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	58.90	-9.80↓	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	252.70	+4.10↑
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	142.10	-9.70↓	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	92.80	-0.70↓
	6月玉米进口量(月, 万吨)	184.00	+18.00↑	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)	769.06	+6.81↑	理论进口利润(巴西9月)	800.14	+706.73↑
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,629.00	-35.00↓	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	-21.00	-36.00↓
	样本饲企玉米库存天数(周, 天)	29.02	-0.10↓	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	-12.00	-2.00↓
	酒精企业开机率(周, %)	48.03	-0.05↓	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-64.00	-3.00↓
	周度玉米消费量(周, 万吨)	109.11	+1.88↑	淀粉企业开机率(周, %)	50.13	-0.45↓
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	12.58		玉米平值看跌期权波动率(%)	12.41	
	标的20日历史波动率(%)	11.20	-0.05↓	标的60日历史波动率(%)	11.32	-0.53↓

行业消息
1、欧盟委员会的谷物贸易数据显示, 截至7月9日, 2023/24年度(始于7月1日)欧盟27国谷物进口量为1,768,353吨, 比2022/23年度减少13%;
2、布宜诺斯艾利斯谷物交易所(BAGE)称, 截至8月2日当周, 2022/23年度阿根廷玉米收获进度为72.6%, 高于一周前的68.4%。



更多资讯请关注!

观点总结
玉米
天气预报显示8月初天气转凉且降雨增加, 施压美玉米市场, 美玉米大幅走弱, 拖累国内市场氛围。不过, 截止7月30日当周, 美玉米优良率为55%, 低于市场预期的56%, 前一周为57%, 上年同期为61%。美玉米生长优良率低于预期, 对美玉米市场仍有支撑。国内方面, 东北产区上周受台风影响多地降雨较多, 玉米外运运输受限, 粮源多在本地流通, 受饲用稻谷拍卖影响, 下游市场观望氛围较浓, 部分贸易商持粮待价售, 但深加工企业受加工利润亏损影响不愿提价收购。华北黄淮产区陈粮供应维持偏紧的状态, 余粮不断减少, 上周部分区域遭遇强降雨引发洪涝灾害, 新作减产预期上升, 持粮主体售粮积极性不高, 加工企业厂门到货偏低, 收购价窄幅偏强震荡。总的来看, 台风带来的强降雨对国内玉米产量存减产预期, 使得天气炒作因素增强, 带动盘面有所走强, 暂且观望。



更多观点请咨询!

观点总结
玉米淀粉
气温较高下游需求偏弱, 且目前下游采购积极性不高, 企业为争取订单适度下调成交价格。同时, 企业库存压力仍存, 截至8月2日, 全国玉米淀粉企业淀粉库存总量92.8万吨, 较上周下降0.7万吨, 降幅0.75%, 月增幅 5.04%; 年同比降幅20.41%。现阶段基本面相对偏弱。不过, 企业减产计划实施下, 企业开机率略有回降, 供应压力有所回降。且生产成本高企, 同样支撑玉米淀粉市场价格。盘面来看, 受玉米收高提振, 淀粉同步走强, 暂且观望。

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