

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)	2,808.00	+15.00↑	玉米淀粉9月合约收盘价(日, 元/吨)	3,139.00	+7.00↑
	玉米9-1价差(日, 元/吨)	131.00	+5.00↑	玉米淀粉9-11价差(日, 元/吨)	65.00	-6.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	397,965.00	-52071.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	116,328.00	-4375.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-175,621.00	-18281.00↓	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-24,090.00	+818.00↑
	玉米仓单(日, 张)	40,248.00	-3112.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	0.00	0.00
	淀粉玉米9月价差(CS-C)	331.00	-8.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	499.25	+1.25↑	美玉米持仓量(日, 手)	596,526.00	+4979.00↑
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)	2,889.76	+4.51↑	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,460.00	+30.00↑
	广东港口价(巴西10月)	2,304.05	+16.69↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,400.00	+10.00↑
	广东港口价(巴西9月)	2,222.73	+17.97↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	111.00	-7.00↓
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	-8.00	-15.00↓	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)	2,839.44	+6.11↑	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)	-50.32	+1.60↑			
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, %)	58.00	-3.00↓	美玉米优良率(周, %)	57.00	+2.00↑
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	56.00	-2.90↓	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)	94.80	+2.00↑
	6月玉米进口量(月, 万吨)	184.00	+18.00↑	淀粉出口量(月, 吨)	157.68	-13.14↓
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	313.00	-712.00↓	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, %)	0.00	0.00	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10月)	635.95	+23.31↑	理论进口利润(巴西9月)	717.27	+22.03↑
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)	-14.00	+7.00↑
	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)	2.00	+14.00↑
	酒精企业开机率(周, %)	47.66	-0.37↓	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-80.00	-3.00↓
	周度玉米消费量(周, 万吨)	109.11	+1.88↑	淀粉企业开机率(周, %)	54.21	+4.08↑
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	12.46		玉米平值看跌期权波动率(%)	12.39	
	标的20日历史波动率(%)	11.24	+0.02↑	标的60日历史波动率(%)	11.41	0.00

行业消息 1、乌克兰高级农业官员周二表示, 乌克兰2023年的谷物产量可能达到5000万至5500万吨, 而2022年为5300万吨;

2、分析师和美国农场主表示, 今年美国玉米收成可能创下历史第二高点, 因为7月的降雨有利于玉米度过关键生长期, 抵消了生长季节初期的干燥炎热天气的不利影响。



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, 截止8月6日当周, 美玉米优良率为57%, 高于市场预期的56%, 前一周为55%, 上年同期为58%。美玉米优良率回升, 市场回吐前期升水, 美玉米大幅走弱, 施压国内市场氛围。国内方面, 东北产区余粮减少、各渠道库存偏低, 青黄不接下持粮主体的挺价惜售, 受到连续降雨天影响, 粮源的流通受阻, 外运难度大, 新季玉米产量存担忧情绪, 支撑玉米价格。华北黄淮产区陈玉米销售已至尾声, 供应趋紧, 部分持粮主体看涨惜售, 深加工企业观望氛围较浓, 根据需求及到货量, 谨慎调涨价格。总的来看, 国内主产区新作进入定产阶段, 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, 且稻谷拍卖溢价较高, 带动国内盘面继续走强, 暂且观望。



更多观点请咨询!

观点总结 玉米淀粉 山东地区部分检修企业恢复生产, 开机率回升, 供应压力凸显, 企业库存压力加大, 截至8月9日, 全国玉米淀粉企业淀粉库存总量94.8万吨, 较上周增加2万吨, 增幅2.16%, 月增幅 6.28%; 年同比降幅16.11%。不过, 受台风天气影响, 原料市场看多预期增强, 玉米淀粉企业挺价心态较为明显, 现货价格止降回升。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, 12日USDA月度报告