

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	玉米期货活跃合约收盘价(日, 元/吨)	2,705.00	+4.00↓	淀粉期货活跃合约收盘价(日, 元/吨)	3,015.00	-8.00↓
	玉米11-1价差(日, 元/吨)	64.00	-9.00↓	玉米淀粉11-1价差(日, 元/吨)	29.00	-7.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	668,232.00	+8081.00↑	玉米淀粉持仓量(日, 手)	167,627.00	+15009.00↑
	玉米前20名净持仓(日, 手)	135,602.00	+6340.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-12,189.00	-1362.00↓
	玉米仓单(日, 张)	37,698.00	-970.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	0.00	0.00
	淀粉玉米11月价差(CS-C)	310.00	-12.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	486.75	-0.50↓	美玉米持仓量(日, 手)	616,390.00	+13737.00↑
美玉米非商业净持仓(周, 手)	25,727.00	-54347.00↓				
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)	3,300.00	+50.00↑
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,906.00	+1.02↑	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,560.00	0.00
	广东港口价(巴西10月)	2,250.96	+8.03↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,480.00	0.00
	广东港口价(巴西9月)	2,172.31	+10.14↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	285.00	+58.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	95.00	-4.00↓	山东玉米淀粉与玉米价差(周, 元/吨)	340.00	-8.00↓
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,914.72	+11.39↑	玉米淀粉与木薯淀粉价差(周, 元/吨)	-1,240.00	+9.00↑
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	8.72	+10.37↑			
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	34.93	0.00	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	383.83	-5.32↓
	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)	277.00	-3.00↓
	美玉米去年同期优良率(周, %)	57.00	-1.00↓	美玉米优良率(周, %)	59.00	+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)	237.70	-15.00↓
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	147.60	+5.50↑	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)	679.04	-8.03↓	理论进口利润(巴西9月)	757.69	-10.14↓
	饲料总产量(月, 吨)	2,629.00	-35.00↓	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	-18.00	+3.00↑
下游情况	样本饲企玉米库存天数(周, 天)	28.78	-0.24↓	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	6.00	+3.00↑
	酒精企业开机率(周, %)	47.66	-0.37↓	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-41.00	+10.00↑
	周度玉米消费量(周, 万吨)	113.13	+4.03↑	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(%)	12.36		玉米平值看跌期权波动率(%)	12.35	
	标的20日历史波动率(%)	16.13	-1.18↓	标的60日历史波动率(%)	13.85	0.00

行业消息
1、USDA每周作物生长报告显示, 截止2023年8月13日当周, 美玉米优良率升至59%, 高于市场预期的58%, 前一周为57%, 上年同期为57%;
2、截至2023年8月10日的一周, 美国玉米出口检验量为398,269吨, 上周387,973吨, 去年同期为539,336吨。



更多资讯请关注!

观点总结
玉米
USDA月度供需报告显示, 预计2023年美国玉米单产为每英亩175.1蒲, 比上月预期调低了2.4蒲/英亩, 玉米产量预期也调低到151亿蒲, 较7月份调低2.09亿蒲, 产量和单产均下调且低于市场预期。但种植面积增加以及近期天气持续向好, USDA每周作物生长报告显示, 截止2023年8月13日当周, 美玉米优良率升至59%, 高于市场预期的58%, 前一周为57%, 上年同期为57%。继续施压美玉米市场。国内方面, 东北产区8月初局部地区出现强降雨, 北部也出现汛情, 对市场贸易主体心态产生影响, 持粮主体的出货意愿降低, 随着市场流通粮源的增多, 个别企业收购价格小幅下压, 但整体行情维持稳定态势。华北黄淮产区受前台风影响物流运输, 东北粮入关不顺, 本地余粮大多见底, 持粮主体惜售挺价, 深加工厂门到货维持低位水平, 企业补库带动玉米现货价格偏强运行, 但随着现货价格涨至高位, 渠道出货积极性增加, 现货价格开始回落。盘面来看, 前期连续上涨后近期有所回落, 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, 现货价格相对坚挺, 支撑期货市场。盘面来看, 受玉米回落影响, 淀粉同步下跌。

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