

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)	2,583.00	-38.00↓	玉米淀粉7月合约收盘价(日, 元/吨)	2,936.00	-29.00↓
	玉米9-1价差(日, 元/吨)	75.00	-12.00↓	玉米淀粉7-9价差(日, 元/吨)	18.00	+4.00↑
	玉米持仓量(日, 手)	711,349.00	+88677.00↑	玉米淀粉持仓量(日, 手)	87,673.00	-25530.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	8,518.00	+17808.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-10,490.00	+2066.00↑
	玉米仓单(日, 张)	50,878.00	-200.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	4,016.00	0.00
	淀粉玉米7月价差(CS-C)	353.00	+9.00↑			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	604.50	-4.50↓	美玉米持仓量(日, 手)	374,973.00	-20451.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	-14,771.00	+5636.00↑			
现货市场	玉米锦州港收购价:水14%(日, 元/吨)	2,680.00	0.00	玉米淀粉现价: 吉林嘉吉(日, 元/吨)	3,150.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,770.75	+2.63↑	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,200.00	+30.00↑
	广东港口价(美湾7月)	2,502.62	-31.49↓	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,220.00	+20.00↑
	广东港口价(美湾9月)	2,311.83	-78.17↓	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	214.00	+29.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	97.00	+38.00↑	山东玉米淀粉与玉米价差(周, 元/吨)	354.00	-2.00↓
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,770.56	-4.44↓	玉米淀粉与木薯淀粉价差(周, 元/吨)	-1,117.00	-24.00↓
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	-0.19	-7.07↓			
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, %)	73.00	0.00	美玉米优良率(周, %)	64.00	-5.00↓
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	63.70	-3.00↓	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	346.10	-33.70↓
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	236.10	+2.60↑	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	89.00	-4.00↓
	4月玉米进口量(月, 万吨)	100.25	-118.90↓	淀粉出口量(月, 吨)	14.44	-19.10↓
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	188,257.00	-21234.00↓	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, %)	19.00	+17.00↑	非转基因进口玉米拍卖成交率(周, %)	0.00	0.00
	理论进口利润(美湾9月)	488.17	+78.17↑	理论进口利润(美湾7月)	297.38	+31.49↑
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)	-34.00	0.00
	样本饲企玉米库存天数(周, 天)	26.56	-0.15↓	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	-81.00	-10.00↓
	酒精企业开机率(周, %)	54.94	+0.62↑	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-142.00	-8.00↓
	周度玉米消费量(周, 万吨)	111.85	+1.95↑	淀粉企业开机率(周, %)	52.59	+2.09↑
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	13.41		玉米平值看跌期权波动率(%)	13.40	
	标的20日历史波动率(%)	13.45	+5.34↑	标的60日历史波动率(%)	13.4	+1.20↑
行业消息	<p>1、乌克兰农业部称, 截至6月8日, 乌克兰农户已经播种560.5万公顷春季作物, 比预期的播种面积545.7万公顷高出3%, 也高于一周前的547.2万公顷;</p> <p>2、罗萨里奥谷物交易所周五表示, 运送大豆和玉米到罗萨里奥港口的卡车数量降至至少22年来的最低水平。</p>					
观点总结 玉米	<p>巴西玉米收割开启, 出口旺季逐步到来, 国际供应压力增加, 且USDA月度报告上调2023/24年度玉米产量及期末库存预估, 玉米价格压力仍存。不过, 美玉米优良率不及预期, 天气忧虑升温, 看空情绪略有回暖。国内方面, 新麦收获已经开始, 贸易商多忙于收购小麦, 对玉米购销积极性不高。且目前国内下游养殖利润持续低位, 饲企维持安全库存随用随采, 深加工企业利润回升刺激开机率提高, 但仍处同期偏低水平, 大部分企业采购需求偏弱。叠加华北黄淮产区短期芽麦大量上市, 饲料企业对芽麦的收购积极性日渐增加, 短期饲企替代规模和比例将会扩大, 冲击玉米市场。不过, 近期小麦价格止跌回升, 且贸易主体挺价惜售情绪有所升温, 直属库持续收购行为, 对玉米的行情有了一定支撑。同时, 价格下跌至新季成本附近, 底部支撑增加。盘面来看, 受USDA报告利空影响, 国内玉米明显走低, 短期暂且观望。</p>					
观点总结 玉米淀粉	<p>玉米淀粉行业继续亏损, 行业开机率明显下滑, 产出压力低于往年同期。近期下游集中提货走货速度加快, 企业库存继续回落, 截至6月7日玉米淀粉企业淀粉库存总量89万吨, 较上周下降4万吨, 降幅4.3%, 月降幅6.71%; 年同比降幅19.6%。另外, 近期小麦价格止跌回升, 提振玉米市场走势, 成本端氛围有所回暖。不过, 现货市场竞价氛围明显, 企业处于被动提价状态, 关注后期下游市场提货情况。盘面来看, 淀粉随玉米冲高回落, 上方压力仍存, 短期暂且观望。</p>					
重点关注	<p>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</p>					



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!