

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)	2,607.00	0.00	玉米淀粉9月合约收盘价(日, 元/吨)	2,932.00	-10.00↓
	玉米9-1价差(日, 元/吨)	81.00	-1.00↓	玉米淀粉9-11价差(日, 元/吨)	92.00	-3.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	763,561.00	+26963.00↑	玉米淀粉持仓量(日, 手)	64,453.00	-10805.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	3,000.00	+8862.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-11,697.00	+4156.00↑
	玉米仓单(日, 张)	50,878.00	0.00	玉米淀粉仓单(日, 张)	4,016.00	0.00
	淀粉玉米7月价差(CS-C)	325.00	-10.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	611.50	-5.75↓	美玉米持仓量(日, 手)	324,757.00	-26005.00↓
	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)	2,650.00	-30.00↓	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)	2,775.06	+4.90↑	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,200.00	0.00
	广东港口价(美湾7月)	2,541.19	-6.90↓	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,230.00	+10.00↑
	广东港口价(美湾9月)	2,390.53	+15.06↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	218.00	+10.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	43.00	-30.00↓	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)	2,760.00	-3.33↓	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)	-15.06	-8.23↓			
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, %)	72.00	-1.00↓	美玉米优良率(周, %)	61.00	-3.00↓
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	82.80	+19.10↑	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)	85.50	-3.50↓
	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)	153,317.00	-34940.00↓	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, %)	18.00	-1.00↓	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)	399.47	-25.06↓	理论进口利润(美湾7月)	248.81	-3.10↓
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	0.00
	酒精企业开机率(周, %)	55.41	+0.47↑	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-148.00	-6.00↓
	周度玉米消费量(周, 万吨)	111.85	+1.95↑	淀粉企业开机率(周, %)	52.72	+0.13↑
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	12.54		玉米平值看跌期权波动率(%)	12.54	
	标的20日历史波动率(%)	13.73	+0.01↑	标的60日历史波动率(%)	13.58	0.00
行业消息	<p>1、俄罗斯总统普京表示, 俄罗斯在考虑退出黑海谷物协议, 因为西方国家欺骗了莫斯科, 没有履行让俄罗斯农产品进入世界市场的承诺;</p> <p>2、尽管巴西农户本月开始收获产量庞大的第二季玉米, 但是政府数据显示巴西玉米出口步伐依然缓慢, 因为目前陈季玉米供应耗罄, 而港口仍在集中精力出口大豆。</p>				<p>更多资讯请关注!</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, 截至2023年6月11日当周, 美国玉米优良率为61%, 低于市场预期的62%, 前一周为64%, 上年同期为72%。美玉米优良率再度降低, 天气忧虑升温, 市场情绪略有回暖。国内方面, 基层种植户忙于麦收, 持粮主体入库成本较高, 低价走货积极性偏差。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, 继部分饲料企业使用芽麦之后, 部分酒精厂陆续挂牌收购芽麦, 冲击玉米市场。不过, 终端企业库存低位, 加工企业及饲料企业存刚性补库需求, 对玉米价格形成支撑。同时, 价格下跌至新季成本附近, 底部支撑增加。盘面来看, 玉米窄幅震荡, 短期暂且观望。</p>				<p>更多观点请咨询!</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14日玉米淀粉企业淀粉库存总量85.5万吨, 较上周下降3.5万吨, 降幅3.88%, 月降幅11.07%; 年同比降幅23.34%。另外, 近期玉米市场价格有所回升, 成本端氛围有所回暖。不过, 现货市场竞争氛围明显, 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, 淀粉随玉米波动, 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>					