

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)	2,789.00	+9.00↑	玉米淀粉9月合约收盘价(日, 元/吨)	3,167.00	+5.00↑
	玉米9-1价差(日, 元/吨)	-154.00	-360.00↓	玉米淀粉9-11价差(日, 元/吨)	187.00	-6.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	889,956.00	-11966.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	227,971.00	-4966.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-122,043.00	+15164.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-4,261.00	+1572.00↑
	玉米仓单(日, 张)	47,876.00	0.00	玉米淀粉仓单(日, 张)	4,932.00	0.00
	淀粉玉米9月价差(CS-C)	378.00	-4.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	494.25	+1.00↑	美玉米持仓量(日, 手)	520,409.00	0.00
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	113,438.00	-5335.00↓			
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)	2,856.98	+1.57↑	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,350.00	0.00
	广东港口价(巴西8月)	2,146.46	+0.52↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,400.00	+20.00↑
	广东港口价(巴西9月)	2,127.62	+0.44↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	83.00	-5.00↓
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	11.00	-9.00↓	山东玉米淀粉与玉米价差(周, 元/吨)	380.00	+10.00↑
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,809.44	-0.56↓	玉米淀粉与木薯淀粉价差(周, 元/吨)	-1,206.00	-28.00↓
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	-47.54	-2.13↓			
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, %)	64.00	-3.00↓	美玉米优良率(周, %)	51.00	+1.00↑
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	75.50	-2.50↓	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	272.90	-34.30↓
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	199.30	-5.60↓	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	86.70	-1.70↓
	5月玉米进口量(月, 万吨)	166.00	+66.00↑	淀粉出口量(月, 吨)	14.44	-19.10↓
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	51,183.00	-60605.00↓	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, %)	70.00	+15.00↑	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)	793.54	-0.52↓	理论进口利润(巴西9月)	812.38	-0.44↓
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)	48.00	+35.00↑
	样本饲企玉米库存天数(周, 天)	27.06	+1.00↑	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	35.00	+11.00↑
	酒精企业开机率(周, %)	50.74	-1.11↓	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-57.00	-13.00↓
	周度玉米消费量(周, 万吨)	109.48	-3.83↓	淀粉企业开机率(周, %)	52.03	-3.74↓
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	11.86		玉米平值看跌期权波动率(%)	12.55	
	标的20日历史波动率(%)	13.76	-0.29↓	标的60日历史波动率(%)	12.87	-0.02↓
行业消息	1、巴西谷物出口商协会(ANEC)表示, 2023年7月份巴西玉米出口量估计为634.5万吨, 比6月份的出口量猛增416%, 比去年同期的563万吨高出12.7%;					
	2、巴西马托格罗索州农业经济研究所(IMEA)称, 2022/23年度马托格罗索州的玉米产量估计达到创纪录的5010万吨, 高于6月初预测的4900万吨, 也将比上年增加14.4%, 因为单产良好。					
观点总结	USDA预计, 美国2023年玉米种植面积为9409.6万英亩, 高于市场预期的9185.3万英亩, 且较3月预测值高200多万英亩。且近期降雨对玉米优良率略有改善, 截至2023年7月02日当周, 美国玉米优良率为51%, 一如市场预期的51%, 前一周为50%, 上年同期为64%。不过, 优良率仍处于近年来最低位, 且截止6月1日, 美玉米库存为41.06亿蒲式耳, 较上年同期下降6%, 低于分析师预估的42.55亿蒲式耳。库存数据相对利好。国内方面, 东北产区基层玉米粮源较少, 持粮主体看涨情绪较浓, 加之政策粮拍卖成交情况较好, 溢价较多, 对市场氛围有所提振。华北黄淮产区深加工玉米库存明显下降, 多数企业玉米库存不足一个月, 在新粮上市之前用量粮缺口仍大, 深加工企业后续采购需求较大。现货价格继续走强, 提振期货市场。不过, 随着小麦替代、进口替代、定向稻谷或将投放以及拍卖粮补充市场供给, 将抑制玉米价格进一步上涨的空间。总的来看, 现货价格表现较好, 支撑国内玉米走势强于外盘。关注天气对新季玉米产量的影响。					
	市场价格维持高位, 新签订单数量较少, 不过, 玉米整体供应偏紧, 个别企业进入季节性检修阶段, 企业开工率降低, 供应减少, 企业库存有所回降, 截至7月5日, 全国玉米淀粉企业淀粉库存总量86.7万吨, 较上周减少1.7万吨, 降幅1.92%, 月降幅2.64%; 年同比降幅22.87%。且近期玉米市场价格回升明显, 成本端氛围回暖, 支撑淀粉现货价格继续走高。盘面来看, 淀粉随玉米波动, 短期氛围偏强。					
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					



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!