



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5月合约收盘价(日, 元/吨)	2,720.00	+24.00↑	玉米淀粉5月合约收盘价(日, 元/吨)	3,192.00	+69.00↑
	玉米5-9价差(日, 元/吨)	-5.00	+7.00↑	玉米淀粉5-9价差(日, 元/吨)	-39.00	+12.00↑
	玉米持仓量(日, 手)	1,048,963.00	+68422.00↑	玉米淀粉持仓量(日, 手)	119,905.00	-11371.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-153,956.00	-15810.00↓	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-4,731.00	-12363.00↓
	玉米仓单(日, 张)	49,983.00	-800.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	0.00	0.00
	淀粉玉米5月价差(CS-C)	472.00	+45.00↑			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	601.00	+1.75↑	美玉米活跃合约持仓量(日, 手)	684,517.00	-15669.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	445,481.00	-12695.00↓			
现货市场	玉米锦州港收购价:水15%(日, 元/吨)	2,620.00	0.00	玉米淀粉现价: 吉林四平(日, 元/吨)	3,130.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,731.18	-2.66↓	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,160.00	0.00
	广东港口价(美湾5月)	2,480.07	-41.36↓	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,320.00	+20.00↑
	广东港口价(美湾3月)	2,492.49	-16.51↓	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	-62.00	-69.00↓
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	-100.00	-24.00↓	玉米淀粉与玉米价差(山东, 日, 元/吨)	440.00	+30.00↑
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,867.22	+6.66↑	玉米淀粉与木薯淀粉价差(日, 元/吨)	-940.00	+20.00↑
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	136.04	+9.32↑	玉米淀粉与30面粉价差(日, 元/吨)	-275.00	-61.00↓
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	34.43	0.00	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	383.00	0.00
	巴西玉米种植面积预估(月, 万公顷)	20.80	0.00	巴西玉米产量预估(月, 百万吨)	118.00	0.00
	阿根廷玉米种植面积预估(月, 万公顷)	6.80	0.00	阿根廷玉米产量预估(月, 万吨)	5,450.00	0.00
	我国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	42.00	0.00	我国玉米产量预估(月, 百万吨)	272.55	-0.45↓
	我国主产区玉米销售进度(周, %)	0.42	+0.04↑			
产业情况	玉米南方港口(内+外)库存(周, 万吨)	110.90	+9.50↑	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	525.30	+81.90↑
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	288.00	+8.00↑	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	90.00	-0.90↓
	11月玉米进口量(月, 万吨)	78.76	+51.56↑	11月淀粉出口量(月, 万吨)	1.09	-0.31↓
	转基因进口玉米拍卖量(半周, 吨)	68,211.00	-26622.00↓	非转基因进口玉米拍卖量(半周, 吨)	0.00	0.00
	转基因进口玉米拍卖成交率(半周, %)	35.00	-4.00↓	非转基因进口玉米拍卖成交率(半周, %)	0.00	0.00
	理论进口利润(美湾5月)	299.93	+28.93↑	理论进口利润(美湾3月)	287.51	+28.94↑
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,457.00	-63.00↓	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	-32	0.00
	玉米酒精加工利润: 全国(日, 元/吨)	20.3	-31.01↓	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	-110	0.00
	酒精企业开机率(周, %)	73.34	+0.50↑	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-127	+38.00↑
	周度玉米消费量(周, 万吨)	120.70	-0.90↓	淀粉企业开机率(周, %)	64.22	-2.91↓
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	10.89	+0.16↑	玉米平值看跌期权波动率(%)	10.71	-0.54↓
	标的20日历史波动率(%)	10.51	+0.55↑	标的60日历史波动率(%)	12.05	-0.05↓
行业消息	1、中国商务部表示将从1月12日开始进行调查, 审查对美国进口DDGS征收反倾销和反补贴关税的有效性, 预计将在2023年1月12日之前结束审查; 2、分析师们预计美国农业部的玉米产量数据为150.69亿蒲, 略高于12月份预估的150.62亿蒲, 玉米单产预计维持不变, 收获面积略微调高10万英亩;					
观点总结	<p>玉米方面: 巴西和阿根廷干旱天气状况仍是目前市场关注的焦点, 支撑美盘玉米期价高位运行。不过, 乌克兰谷物出口增量明显, 有望挤占美玉米市场份额, 且美玉米周度出口销售锐减, 限制美玉米市场价格。国内方面, 新粮上市进度持续偏慢, 根据Mysteel玉米团队对全国7个省份, 59个地市最新调查数据显示, 截至1月6日, 全国玉米主要产区售粮进度为42%, 较上周增加4%, 较去年同期偏慢12%。后续市场总体上量压力较大。不过, 基层种植售粮进度同比偏慢, 但经过长时间的售粮, 潮粮数量已较前期明显减少, 受种植成本高企及看涨心理支配, 基层种植户及贸易商对干粮较为惜售, 深加工企业仍持续补库, 部分中储备也在收购, 一定程度对现货行情有所支撑, 且小麦价格继续偏强, 给予玉米价格底部支撑。盘面来看, 玉米增仓上涨, 走势有所转强, 关注今晚凌晨1:00USDA报告。</p> <p>淀粉方面: 玉米上市压力较大, 成本支撑预期减弱。且国内深加工工厂开机率高, 产量稳定, 供应相对充足。据Mysteel调查显示, 截至1月12日, 玉米淀粉企业淀粉库存总量90.0万吨, 较上周下降0.9万吨, 降幅1.05%, 月环比增幅16.97%; 年同比增幅62.54%, 整体处于历史同期最高水平, 淀粉现货价格受其拖累。不过, 深加工利润逐步下降, 加工企业继而转入亏损, 部分工厂开机率降低, 产量下降, 叠加年前备货需求起量, 订单签订转好, 利好淀粉市场。盘面来看, 淀粉走势随玉米期价有所回升, 暂且观望。</p>					 <p>更多观点请咨询!</p>
重点关注	凌晨1:00美国USDA报告, 周四我的农产品网玉米消耗量及周五中储粮进口玉米拍卖成交情况					