

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)	2,721.00	-14.00↓	玉米淀粉5月合约收盘价(日, 元/吨)	3,208.00	-24.00↓
	玉米5-9价差(日, 元/吨)	2.00	-2.00↓	玉米淀粉5-9价差(日, 元/吨)	-53.00	-9.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	1,084,994.00	-2505.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	127,525.00	+2323.00↑
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-180,066.00	-4767.00↓	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-6,732.00	-19.00↓
	玉米仓单(日, 张)	51,083.00	0.00	玉米淀粉仓单(日, 张)	3,107.00	+98.00↑
	淀粉玉米5月价差(CS-C)	487.00	-10.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	598.00	+11.25↑	美玉米活跃合约持仓量(日, 手)	645,791.00	-22625.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	407,492.00	-37989.00↓			
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)	3,150.00	+20.00↑
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,730.20	-0.39↓	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)	2,465.57	+22.09↑	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)	2,490.42	+35.20↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	-58.00	+44.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	-101.00	+14.00↑	玉米淀粉与玉米价差(山东, 日, 元/吨)	450.00	+10.00↑
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,873.33	+0.55↑	玉米淀粉与木薯淀粉价差(日, 元/吨)	-920.00	+20.00↑
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	143.13	+0.94↑	玉米淀粉与30面粉价差(日, 元/吨)	-296.00	-3.00↓
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	34.56	+0.13↑	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	383.94	+1.35↑
	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)	115.00	-3.00↓
	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, 百万吨)	54.00	-0.50↓
	我国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	43.32	0.00	我国玉米产量预估(月, 百万吨)	272.55	0.00
	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)	140.80	+17.60↑	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	554.60	+29.30↑
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	291.00	+3.00↑	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)	100,678.00	+32467.00↑	非转基因进口玉米拍卖量(半周, 吨)	5,599.00	+5599.00↑
	转基因进口玉米拍卖成交率(半周, %)	41.00	+6.00↑	非转基因进口玉米拍卖成交率(半周, %)	100.00	+100.00↑
	理论进口利润(美湾5月)	314.43	-22.09↓	理论进口利润(美湾3月)	289.58	-35.20↓
	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
下游情况	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)	116.70	-4.00↓	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(%)	11.01	+0.64↑	玉米平值看跌期权波动率(%)	10.63	-0.29↓
	标的20日历史波动率(%)	10.44	+0.14↑	标的60日历史波动率(%)	12.16	+0.07↑

行业消息

1、布宜诺斯艾利斯谷物交易所(BAGE)发布的周度报告称, 截至2022年1月12日的一周, 阿根廷2021/22年度玉米播种进度为86.4%, 比一周前高出9.1%, 但是仍然比去年同期低了4.5%;
2、美国农业部发布的单日出口销售报告称, 私人出口商报告对墨西哥地销售100,422吨美国玉米, 在2021/22年度交货。

观点总结

玉米方面: 汤加火山喷发, 有可能导致拉尼娜减弱或提前结束, 有助于提振南美玉米产预期量, 天气升水预期减弱, 且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, 近期持续增仓震荡走高, 走势有所转强, 关注前高2750位置压力。

重点关注

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调查数据显示, 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, 关注3100位置压力位。

我的农产品网玉米售粮进度



更多观点请咨询!