

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	郑糖主力合约收盘价 (元/吨)	5,763.00	-17.0↓	郑糖期货合约 9-1价差 (元/吨)	-110.00	+9↑
	郑糖主力持仓量 (手)	401,791.00	+6244.0↑	郑糖期货仓单 (手)	40568	-168↓
	郑糖期货前20名净持仓 (手)	-20,247.00	+4635.0↑			
	ICE美糖10月合约收盘价 (美分/磅)	18.62	-0.1↓	ICE美糖10月合约持仓量 (手)	312,047.00	0.00
现货市场	CFTC美糖非商业净持仓 (周, 手)	105869	+22357.0↑			
	一级白糖广西南宁现货价格 (元/吨)	5,870.00	-10↓	进口巴西糖配额内 (15%) 价格 (元/吨)	5,289.00	+71.0↑
	一级白糖云南昆明现货价格 (元/吨)	5,790.00	-20↓	进口巴西糖配额外 (50%) 价格 (元/吨)	6,747.00	+31.0↑
	一级白糖广西柳州现货价格 (元/吨)	5,890.00	0.0	进口泰国糖配额内 (15%) 价格 (元/吨)	5,429.00	+215.0↑
上游情况	郑糖2209合约基差 (元/吨)	107.00	-11↓	进口泰国糖配额外 (50%) 价格 (元/吨)	6,929.00	+282.0↑
	全国糖料播种面积 (年, 千公顷)	1,460.00	-108.0↓	广西甘蔗收购价 (年, 元/吨)	490.00	0.0
	21/22全国食糖产量预估 (年, 万吨)	1,000.00	-66.0↓			
产业情况	全国食糖产量累计值 (月, 万吨)	956.00	+4.0↑	全国食糖产销率 (月, %)	62.87	+6.5↑
	全国食糖销量累计值 (月, 万吨)	601.00	+157.6↑	云南糖销量累计值 (月, 万吨)	116.62	+12.0↑
	广西糖销量累计值 (月, 万吨)	381.07	+44.6↑	食糖新增工业库存 (月, 万吨)	355.00	-60.4↓
	进口巴西糖配额内 (15%) 利润 (元/吨)	531.00	-41.0↓	进口糖数量 (月, 万吨)	14.00	-12.0↓
下游情况	进口巴西糖配额外 (50%) 利润 (元/吨)	-927.00	-63.0↓	巴西糖出口量 (月, 万吨)	236.00	+78.0↑
	进口泰国糖配额内 (15%) 利润 (元/吨)	66.00	-11.0↓	巴西中南部制糖比 (半月, %)	42.54	+3.1↑
	进口泰国糖配额外 (50%) 利润 (元/吨)	-1,109.00	-63.0↓			
期权市场	成品糖产量 (月, 万吨)	72.40	+47.2↑	软饮料产量值 (月, 万吨)	1410.10	+1828.0↑
	白糖期货平值看涨期权波动率(%)	11.71	-0.57↓	白糖期货平值看跌期权波动率 (%)	10.34	-0.87↓
	白糖平值期权20日历史波动率 (%)	8.90	-0.04↓	白糖平值期权60日历史波动率 (%)	9.59	+0.12↑
行业消息	1.国内天气情况, 22-23日, 西北地区东部、四川盆地、黄淮、华北南部、内蒙古东部、东北地区等地部分地区有中到大雨, 陕西南部、四川盆地东部、河南、山东等地部分地区有暴雨, 局地大暴雨, 部分地区伴有短时强降水, 局地有雷暴大风等强对流天气。 2. 据美国商品期货交易委员会数据显示, 截至2022年7月12日, 非商业原糖期货净多持仓为105869手, 较前一周增加22357手, 多头持仓为188691手, 较前一周减少2699手; 空头持仓为82822手, 较前一周减少25056手, 非商业原糖净多持仓结束六周减持, 本周净多头持仓增持超2万手, 目空头减仓超2万手, 多头气氛开始提升。					
观点总结	市场机构StoeX预计本年度全球食糖短缺10万吨, 在一定程度上支撑国际糖价。国内糖市: 截至2022年6月底, 本制糖期全国共生产食糖956万吨(上榨季同期产糖1067万吨), 累计销售食糖601万吨, 产销率62.87%, 略低于上年同期的64.05%。截止目前全国食糖产糖量仍低于去年, 本年度食糖供应减少基本成定局。当前国内气温升温加快, 夏季冷饮料需求明显增加, 叠加今年中秋节相对往年提前, 贸易商及食品企业大致已开启备货需求。需要关注美联储加息及原油价格下跌的利空与巴西下半月食糖压榨同比减少的利多相互抵消作用。操作上, 建议郑糖2209合约短期暂且在5700-5890元/吨区间高抛低吸。					
提示关注	22日 次日4:30 CFTC持仓					

数据来源第三方 (同花顺、wind), 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!