



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)	2,719.00	+15.00↑	玉米淀粉9月合约收盘价(日, 元/吨)	3,118.00	+29.00↑
	玉米9-1价差(日, 元/吨)	-18.00	0.00	玉米淀粉9-11价差(日, 元/吨)	3.00	+11.00↑
	玉米持仓量(日, 手)	1,137,144.00	-23749.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	191,760.00	-4787.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-42,043.00	+2723.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	13,736.00	-374.00↓
	玉米仓单(日, 张)	164,190.00	-591.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	16,977.00	-838.00↓
	淀粉玉米9月价差(CS-C)	399.00	+14.00↑			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	607.00	-16.25↓	美玉米持仓量(日, 手)	552,455.00	+13668.00↑
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	328,102.00	-52067.00↓			
现货市场	玉米锦州港收购价:水14%(日, 元/吨)	2,800.00	-10.00↓	玉米淀粉现价: 吉林四平(日, 元/吨)	3,350.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,868.63	-5.41↓	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,460.00	0.00
	广东港口价(美湾9月)	2,917.28	-25.79↓	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,380.00	-40.00↓
	广东港口价(美湾7月)	3,154.67	+31.58↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	232.00	-29.00↓
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	81.00	-25.00↓	玉米淀粉与玉米价差(山东, 日, 元/吨)	410.00	0.00
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	3,119.44	+2.77↑	玉米淀粉与木薯淀粉价差(周, 元/吨)	-703.00	+21.00↑
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	250.81	+8.18↑	玉米淀粉与30面粉价差(日, 元/吨)	-423.00	+10.00↑
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	33.06	0.00	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	367.30	0.00
	巴西玉米种植面积预估(月, 万公顷)	22.70	0.00	巴西玉米产量预估(月, 百万吨)	126.00	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)	55.00	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)	271.00	0.00
	美国玉米生长优良率(周, %)	67.00	-3.00↓	美国玉米吐丝率(周, %)	4.00	+4.00↑
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	125.30	-4.80↓	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	447.30	-16.00↓
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	358.10	-4.10↓	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	112.40	+0.30↑
	5月玉米进口量(月, 万吨)	208.00	-13.00↓	淀粉出口量(月, 万吨)	5.48	+2.73↑
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	27,017.00	+4624.00↑	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, %)	91.00	+4.00↑	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)	-67.28	+25.79↑	理论进口利润(美湾7月)	-304.67	-31.58↓
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,352.00	+103.00↑	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	40.00	-2.00↓
	样本饲企玉米库存天数(周, 天)	34.08	-3.04↓	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	118.00	+3.00↑
	酒精企业开机率(周, %)	61.83	-1.17↓	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-48.00	-7.00↓
	周度玉米消费量(周, 万吨)	104.70	-0.80↓	淀粉企业开机率(周, %)	56.13	-3.13↓
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	13.66		玉米平值看跌期权波动率(%)	12.89	
	标的20日历史波动率(%)	15.22	0.00	标的60日历史波动率(%)	14.18	+0.06↑
行业消息	1、巴西谷物出口商协会(ANEC)表示, 2022年6月份巴西玉米出口量预计为168.3万吨, 低于一周前预估的175.8万吨; 2、美国农户商业网络(FBN)发布的2022年美国种植面积调查报告显示, 尽管北部平原的春播工作因天气问题而耽搁, 但是明尼苏达州、威斯康星州和俄亥俄州的玉米种植面积增加, 可能有助于将全国玉米种植规模推高至9040万英亩, 高于美国农业部3月31日预测的8949万英亩。					
观点总结 玉米	美联储激进加息, 欧美乃至全球经济面临衰退, 商品市场悲观情绪持续释放, 叠加美国中西部种植区降雨概率增加, 且美农报告显示, 美玉米种植面积和季度谷物库存均高于分析师预期, 美玉米再度承压。国内方面, 南北港口库存不断累积, 市场心态疲弱, 饲料企业进入观望状态, 提货也仅限刚需补库, 现货价格小幅走弱。不过, 传言稻谷拍卖暂停, 8月份根据出库情况再考虑重启, 底价或小幅调整, 利好玉米市场, 且受乌克兰玉米出口受阻影响, 近来进口量将继续低于去年同期, 缓解国内市场供应压力。盘面来看, 受外盘走弱影响, 近期玉米大幅下跌, 关注2700附近支撑情况。					更多资讯请关注!  更多观点请咨询!
观点总结 玉米淀粉	据Mysteel调查数据显示, 截至6月29日玉米淀粉企业淀粉库存总量112.4万吨, 较上周增加0.3万吨, 增幅0.27%, 月增幅0.27%; 年同比增幅11.02%, 库存压力较大, 且天气渐热, 下游造纸、及发酵等行业需求较为疲软, 企业普遍新签订单数量较少, 目前主要执行前期订单。企业目前为促进成交, 实际价格皆可商谈。同时, 在原料玉米看弱的情绪中, 淀粉价格难有表现。盘面来看, 淀粉期价随玉米继续回落, 暂且观望。					
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					