

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)	2,694.00	-19.00↓	玉米淀粉1月合约收盘价(日, 元/吨)	3,119.00	+11.00↑
	玉米1-5价差(日, 元/吨)	-46.00	+5.00↑	玉米淀粉1-5价差(日, 元/吨)	10.00	+21.00↑
	玉米持仓量(日, 手)	831,969.00	+62577.00↑	玉米淀粉持仓量(日, 手)	80,739.00	-2555.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-169,768.00	-8466.00↓	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	1,563.00	+1423.00↑
	玉米仓单(日, 张)	28,465.00	-50.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	576.00	0.00
	淀粉玉米1月价差(CS-C)	471.00	+25.00↑			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	587.75	+1.50↑	美玉米活跃合约持仓量(日, 手)	734,596.00	+930.00↑
现货市场	美玉米非商业净持仓(周, 手)	474,354.00	-52536.00↓			
	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)	3,400.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,751.57	-0.86↓	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,420.00	0.00
	配额内到岸完税价(CIF)(日, 元/吨)	2,436.00	+9.00↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,500.00	-50.00↓
	配额外到岸完税价(CIF)(日, 元/吨)	3,014.00	+11.00↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	281.00	-11.00↓
替代品现货价格	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	-74.00	+19.00↑	玉米淀粉与玉米价差(山东, 日, 元/吨)	650.00	+10.00↑
	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,833.89	-1.67↓	玉米淀粉与木薯淀粉价差(日, 元/吨)	-920.00	0.00
上游情况	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	82.32	-0.81↓	玉米淀粉与30面粉价差(日, 元/吨)	29.00	-7.00↓
	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, 亿吨)	3.83	+0.01↑
	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, 亿吨)	1.18	0.00
	阿根廷玉米种植面积预估(月, 万公顷)	6.80	+0.30↑	阿根廷玉米产量预估(月, 万吨)	5,450.00	+150.00↑
产业情况	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, 亿吨)	2.73	0.00
	玉米南方港口(内+外)库存(周, 万吨)	70.90	+5.60↑	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	326.70	+18.60↑
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	241.00	+19.00↑	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	72.30	+3.70↑
	10月玉米进口量(月, 万吨)	130.00	-223.00↓	10月淀粉出口量(月, 万吨)	12.58	+1.40↑
	转基因进口玉米拍卖量(半周, 吨)	155,248.00	+3222.00↑	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, %)	38.00	-19.00↓	非转基因进口玉米拍卖成交率(半周, %)	0.00	0.00
	进口利润: 广东港-26%税(日, 元/吨)	-174.00	-11.00↓	进口利润: 广东港-1%税(日, 元/吨)	404.00	-9.00↓
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,520.00	-107.00↓	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	160	-4.00↓
	玉米酒精加工利润: 全国(日, 元/吨)	66.28	+8.68↑	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	83	-9.00↓
	酒精企业开机率(周, %)	52.65	+2.89↑	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	52	+7.00↑
	周度玉米消费量(周, 万吨)	120.20	+2.80↑	淀粉企业开机率(周, %)	69.81	+0.67↑
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	11.20	-0.59↓	玉米平值看跌期权波动率(%)	10.73	-1.06↓
	标的20日历史波动率(%)	12.48	-0.96↓	标的60日历史波动率(%)	13.79	+0.11↑
行业消息	1、美国农业部周三发布报告称, 私人出口商报告对墨西哥销售1,844,040吨美国玉米, 其中1,089,660吨在2021/22年度交货, 754,380吨在2022/23年度交货; 2、巴西谷物出口商协会(ANEC)表示, 2021年12月份巴西玉米出口量最高可能达到347万吨, 高于11月份的270万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	玉米方面: 美国玉米出口销售量保持良好, 以及乙醇需求强劲, 给美玉米市场提供支撑, 而美玉米基本收割完毕, 卖压增强, 且巴西2021/22年度总产量将达到1.2093亿吨, 略低于10月份预测的1.2125亿吨, 不过比上年的8627万吨增加40%, 丰产预期较强, 对玉米市场有所牵制。国内方面, 企业库存水平整体仍偏低, 企业要备春节假期的库存, 对粮源采购意愿偏强, 同时小麦价格继续偏强也给予玉米价格底部支撑。不过, 主产区部分种植户有变现需求, 惜售心态减弱, 玉米上市量会持续增加, 卖压增强, 且Mysteel玉米团队调研数据显示, 12月3日北方四港玉米库存共计241万吨, 周比增加19万吨; 广东港内贸玉米库存共计23.4万吨, 较上周增加9.3万吨; 外贸库存47.5万吨, 较上周减少3.7万吨。港口库存整体有所增加。对期价有所拖累。盘面来看, 玉米短期走势较为震荡, 关注40日均线支撑情况。 淀粉: 淀粉加工利润持续高位, 企业开机率连续回升, 玉米淀粉产量持续增加, 但下游需求相对低迷, 淀粉库存继续累积, 据Mysteel调查数据显示, 截至12月8日, 玉米淀粉企业淀粉库存总量76.6万吨, 较上周增加4.3万吨, 月环比增幅5.89%, 月环比增幅26.35%; 年同比增幅15.32%, 整体处于历史同期最高水平, 拖累淀粉价格表现。总的来看, 在其库存压力下, 整体较玉米走势偏弱, 暂且观望。					 更多观点请咨询!
重点关注	12月10日凌晨1:00USDA月度供需报告					