

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 |
| | 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↓ |
| 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, 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↑ |
| | 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 |
| 产业情况 | 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。 | | | | | |
| 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。 | | | | | |
| 重点关注 | 12月10日凌晨1:00 USDA月度供需报告 | | | | | |



更多观点请咨询!