

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)	2,819.00	+2.00↑	玉米淀粉3月合约收盘价(日, 元/吨)	2,885.00	+22.00↑
	玉米5-9价差(日, 元/吨)	21.00	0.00	玉米淀粉3-5价差(日, 元/吨)	-145.00	+5.00↑
	玉米持仓量(日, 手)	243,754.00	-41121.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	150,511.00	-3887.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	31,801.00	+10518.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-6,604.00	-3755.00↓
	玉米仓单(日, 张)	63,267.00	0.00	玉米淀粉仓单(日, 张)	14,345.00	0.00
	淀粉玉米5月价差(CS-C)	210.00	+14.00↑			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	678.00	+1.00↑	美玉米持仓量(日, 手)	436,303.00	-6985.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	277,369.00	+5496.00↑			
现货市场	玉米锦州港收购价:水14%(日, 元/吨)	2,840.00	0.00	玉米淀粉现价: 吉林嘉吉(日, 元/吨)	3,100.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,918.94	-1.77↓	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,110.00	0.00
	广东港口价(美湾3月)	2,762.49	+11.66↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,200.00	0.00
	广东港口价(美湾5月)	2,744.09	+16.74↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	215.00	-22.00↓
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	21.00	-2.00↓	山东玉米淀粉与玉米价差(周, 元/吨)	270.00	+70.00↑
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	3,213.89	0.00	玉米淀粉与木薯淀粉价差(周, 元/吨)	-608.00	+5.00↑
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	294.95	+1.77↑			
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	32.72	-0.67↓	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	348.75	-5.09↓
	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)	125.00	-1.00↓
	阿根廷玉米种植面积预估(月, 万公顷)	7.00	-0.10↓	阿根廷玉米产量预估(月, 百万吨)	52.00	-3.00↓
	我国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	43.00	+0.07↑	我国玉米产量预估(月, 百万吨)	277.20	+3.20↑
	我国玉米去年同期售粮进度(周, %)	53.00	+1.00↑	国内玉米售粮进度(周, %)	49.00	+1.00↑
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	150.50	+45.80↑	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	378.20	-32.50↓
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	199.20	-5.90↓	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	96.10	+3.20↑
	12月玉米进口量(月, 万吨)	87.00	+13.00↑	淀粉出口量(月, 吨)	278.27	+20.19↑
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	33,935.00	+3651.00↑	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, %)	75.00	-6.00↓	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5月)	245.91	-36.74↓	理论进口利润(美湾3月)	227.51	-31.66↓
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,579.00	-93.00↓	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	-35.00	0.00
	样本饲企玉米库存天数(周, 天)	29.71	-1.44↓	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	11.00	0.00
	酒精企业开机率(周, %)	54.22	-0.15↓	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	14.00	0.00
	周度玉米消费量(周, 万吨)	98.16	+4.58↑	淀粉企业开机率(周, %)	37.55	+5.15↑
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	10.40		玉米平值看跌期权波动率(%)	10.08	
	标的20日历史波动率(%)	11.93	-0.18↓	标的60日历史波动率(%)	10.53	-0.09↓
行业消息	<p>1、咨询公司AgRural周一称, 截至2月2日, 巴西2022/23年度二季玉米种植进度为12%, 高于一周前的5%, 但是低于一年前的24%;</p> <p>2、俄罗斯农业部第一副部长奥克萨纳·卢特女士表示, 2022/23年度的下半年, 即2023年1至6月份期间, 俄罗斯谷物出口量可能达到3000到3500万吨。</p>					
观点总结 玉米	<p>南美阿根廷玉米主产区降雨增加, 改善了玉米作物产量前景, 美盘玉米天气升水预期降低。不过, 巴西二茬玉米播种较慢, 咨询公司AgRural周一称, 截至2月2日, 巴西2022/23年度二季玉米种植进度为12%, 高于一周前的5%, 但是低于一年前的24%, 且美玉米出口销售数据改善, 支撑美玉米价格。未来市场关注的焦点仍将集中于美玉米出口需求和南美天气状况。国内方面, 东北产区基层种植户余粮同比偏高, 渠道库存同比偏低, 元宵节后出粮活动将逐步正常, 部分贸易商也有回笼资金的需求, 新粮上市量逐渐增多, 加工企业也有补库需求, 现货价格小幅走弱。且随着气温升高, 部分粮源储存难度大, 售粮意愿增加, 卖压不断释放。同时, 传闻3月份开始拍卖的水稻拍卖, 拍卖总量1800万吨, 若传闻成真, 那么未来可替代玉米的用量或增加, 对饲用玉米需求有所抑制。盘面来看, 玉米继续减仓回落, 短期有望维持偏弱震荡。</p>					更多资讯请关注!  更多观点请咨询!
观点总结 玉米淀粉	<p>节后深加工开机率逐步提升, 淀粉供应有所增加, 且据Mysteel农产品调查数据显示, 截至2月1日玉米淀粉企业淀粉库存总量96.1万吨, 较上周上升3.8万吨, 增幅4.12%, 处于同期高位。同时, 需求端来看, 目前食品端消费以刚需采购为主, 化工、造纸等行业以消耗前期库存为主, 购销意愿低迷。部分厂家反馈近期下游询价减少, 淀粉成交寡淡。短期来看, 淀粉在高库存弱需求局面下, 跟随玉米偏弱运行为主。</p>					
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					