

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)	5,599.00	-18.0↓	郑糖期货合约 9-1价差 (元/吨)	47.00	+47↑
	郑糖主力持仓量 (手)	211,832.00	-35043.0↓	郑糖期货仓单 (手)	33679	-47↓
	郑糖期货前20名净持仓 (手)	-33,664.00	+1561.0↑			
	ICE美糖10月合约收盘价 (美分/磅)	18.05	+0.1↑	ICE美糖10月合约持仓量 (手)	332,253.00	0.00
现货市场	CFTC美糖非商业净持仓 (周, 手)	34438	-29665.0↓			
	一级白糖广西南宁现货价格 (元/吨)	5,820.00	0.0	进口巴西糖配额内 (15%) 价格 (元/吨)	4,839.00	+7.0↑
	一级白糖云南昆明现货价格 (元/吨)	5,725.00	-25↓	进口巴西糖配额外 (50%) 价格 (元/吨)	6,160.00	+7.0↑
	一级白糖广西柳州现货价格 (元/吨)	5,790.00	-20↓	进口泰国糖配额内 (15%) 价格 (元/吨)	5,078.00	+9.0↑
上游情况	郑糖2209合约基差 (元/吨)	191.00	-25↓	进口泰国糖配额外 (50%) 价格 (元/吨)	6,472.00	+13.0↑
	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	0.00	全国食糖产销率 (月, %)	70.80	+7.9↑
	全国食糖销量累计值 (月, 万吨)	677.00	+76.0↑	云南糖销量累计值 (月, 万吨)	109.26	+11.6↑
	广西糖销量累计值 (月, 万吨)	419.30	+38.2↑	食糖新增工业库存 (月, 万吨)	279.00	-73.0↓
	进口巴西糖配额内 (15%) 利润 (元/吨)	848.00	+15.0↑	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)	-473.00	+12.0↑	巴西糖出口量 (月, 万吨)	288.43	+52.4↑
	进口泰国糖配额内 (15%) 利润 (元/吨)	-88.00	+66.0↑	巴西中南部制糖比 (半月, %)	43.53	+1.0↑
	进口泰国糖配额外 (50%) 利润 (元/吨)	-785.00	+9.0↑			
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(%)	12.5	+0.27↑	白糖期货平值看跌期权波动率 (%)	12.36	+0.21↑
行业消息	白糖平值期权20日历史波动率 (%)	13.22	-0.17↓	白糖平值期权60日历史波动率 (%)	10.09	-0.02↓
	1.国内天气情况, 未来4天, 南海及西北太平洋热带扰动趋于活跃, 可能有1~2个台风生成, 上旬后期将给我国南部海区及华南沿海地区带来较大风雨天气。 2. 据美国商品期货交易委员会数据显示, 截至2022年8月2日, 非商业原糖期货净多持仓为34438手, 较前一周减少29665手, 多头持仓为182484手, 较前一周增加711手; 空头持仓为148046手, 较前一周增加30376手, 非商业原糖净多持仓减持超2万手, 且处于2020年6月以来低位, 空头持仓大增, 空头气氛加速提升。					
观点总结	巴西7月份出口食糖288.43万吨, 同比增加16.8%, 7月巴西糖出口量增加明显, 支撑国际糖市, 但从中长期看全球食糖供需转过剩, 后市糖价重心仍有下移的可能性。国内糖市: 近日部分产区产销数据公布, 7月云南、广西销糖数据低于预期, 其中广西糖单月销量处于近五年偏低水平, 使得市场对中秋旺季备货预期产生落空, 加之目前两大主产区工业库存合计在277万吨附近, 偏高于去年同期水平, 市场供应有所转松局势。操作上, 建议郑糖2209合约短期在5500-5750元/吨区间高抛低吸。					
提示关注	12日 次日4:30 CFTC持仓					

数据来源第三方 (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!