

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)	2,843.00	+7.00↑	玉米淀粉5月合约收盘价(日, 元/吨)	3,100.00	-7.00↓
	玉米5-9价差(日, 元/吨)	39.00	+5.00↑	玉米淀粉5-7价差(日, 元/吨)	-6.00	+6.00↑
	玉米持仓量(日, 手)	647,189.00	+6071.00↑	玉米淀粉持仓量(日, 手)	173,038.00	-601.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-2,643.00	-6254.00↓	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-19,230.00	-2835.00↓
	玉米仓单(日, 张)	36,286.00	-2427.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	7,468.00	-300.00↓
	淀粉玉米5月价差(CS-C)	257.00	-14.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	634.75	+2.75↑	美玉米持仓量(日, 手)	502,447.00	-840.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	103,272.00	-39859.00↓			
现货市场	玉米锦州港收购价:水14%(日, 元/吨)	2,790.00	0.00	玉米淀粉现价: 吉林嘉吉(日, 元/吨)	3,200.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,884.94	-1.65↓	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,150.00	0.00
	广东港口价(美湾7月)	2,622.51	+0.27↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,280.00	0.00
	广东港口价(美湾5月)	2,674.73	+6.16↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	100.00	+7.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	-53.00	-7.00↓	山东玉米淀粉与玉米价差(周, 元/吨)	314.00	+66.00↑
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	3,086.11	-23.33↓	玉米淀粉与木薯淀粉价差(周, 元/吨)	-586.00	+45.00↑
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	201.17	-21.68↓			
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	32.05	0.00	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	348.75	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)	125.00	0.00
	阿根廷玉米种植面积预估(月, 万公顷)	6.70	0.00	阿根廷玉米产量预估(月, 百万吨)	40.00	-7.00↓
	我国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	43.07	0.00	我国玉米产量预估(月, 百万吨)	277.20	0.00
	我国玉米去年同期售粮进度(周, %)	76.00	+4.00↑	国内玉米售粮进度(周, %)	77.00	+5.00↑
产业情况	玉米广东港口(内+外)库存(周, 万吨)	169.30	-2.70↓	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	605.50	+73.90↑
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	278.60	+27.70↑	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	98.50	-1.20↓
	2月玉米进口量(月, 万吨)	309.00	+85.00↑	淀粉出口量(月, 吨)	278.27	+20.19↑
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	11,790.00	-16152.00↓	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, %)	100.00	+29.00↑	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)	261.24	-0.19↓	理论进口利润(美湾7月)	307.49	-0.27↓
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,918.70	+62.20↑	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	-123.00	-13.00↓
	样本饲企玉米库存天数(周, 天)	32.88	+0.61↑	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	-115.00	-14.00↓
	酒精企业开机率(周, %)	64.28	+1.08↑	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-131.00	-19.00↓
	周度玉米消费量(周, 万吨)	133.02	-0.55↓	淀粉企业开机率(周, %)	60.11	-1.96↓
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	8.44		玉米平值看跌期权波动率(%)	8.44	
	标的20日历史波动率(%)	6.71	-0.04↓	标的60日历史波动率(%)	10.45	-0.15↓
行业消息	1、中国2023年2月份玉米进口309万吨, 同比增60%; 2、布宜诺斯艾利斯谷物交易所(BAGE)称, 2022/23年度阿根廷玉米产量调低到3600万吨, 低于上周刚刚调低后的产量3750万吨, 也远远低于最初预期的4100万吨, 比2021/22年度的5200万吨降低1600万吨或30.8%。					 更多资讯请关注!
观点总结 玉米	进口玉米成本明显低于国内市场, 进口采购美国玉米订单大幅增加, 上周美国出口商对华累计销售211万吨陈季玉米, 增加国内市场供应, 且美国银行业危机持续发酵, 全球经济忧虑大幅升温, 拖累商品市场氛围。不过, 商品经纪和分析公司Allendale Inc.周三公布的年度调查显示, 美国农户预计2023年将种植9041.4万英亩玉米, 低于美国农业部展望论坛预测的9100万英亩。利空忧虑略有缓解。国内方面, 潮粮销售进入尾声, 基层余粮不断被消耗, 粮源逐步向贸易环节转移, 持粮主体惜售挺价情绪趋浓, 企业建库积极性增加, 玉米现货价格逐步企稳。传言定向稻谷拍卖延至5月份开始, 短期供压减弱。今年政策导向仍倾向于扩大豆, 国内玉米市场产不足需局面将延续, 且中储粮轮入玉米增多, 市场底部支撑较强。盘面来看, 国内市场走势明显强于外盘, 不过, 宏观氛围偏弱影响下, 玉米上方压力较大, 难有好的表现。					 更多观点请咨询!
观点总结 玉米淀粉	华北区域大多数厂库偏紧, 挺价心态明显。另外, 副产品价格持续下跌, 利润亏损严重, 工厂积极挺价主产品, 近期淀粉现货价格略有走强, 提振期货市场走势。但企业开机率保持高位, 淀粉产出同步增加, 据Mysteel农产品调查数据显示, 截至3月15日玉米淀粉企业淀粉库存总量96.8万吨, 较上周下降1.7万吨, 降幅1.73%, 月降幅1.58%; 年同比降幅13.34%, 库存压力仍存。且新签订单情况并不乐观, 现货高价难以持续维持, 短期市场多空博弈。盘面来看, 受现货走强提振, 近期淀粉期货走势略强于玉米。					
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					