

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)	5,716.00	-61.0↓	郑糖期货合约 9-1价差 (元/吨)	32.00	-22↓
	郑糖主力持仓量 (手)	287,532.00	-17478.0↓	郑糖期货仓单 (手)	35557	-1023↓
	郑糖期货前20名净持仓 (手)	-13,283.00	-14278.0↓			
	ICE美糖10月合约收盘价 (美分/磅)	17.52	-0.1↓	ICE美糖10月合约持仓量 (手)	329,125.00	0.00
现货市场	CFTC美糖非商业净持仓 (周, 手)	64103	-63059.0↓			
	一级白糖广西南宁现货价格 (元/吨)	5,840.00	0.0	进口巴西糖配额内 (15%) 价格 (元/吨)	4,757.00	-4.0↓
	一级白糖云南昆明现货价格 (元/吨)	5,770.00	-55↓	进口巴西糖配额外 (50%) 价格 (元/吨)	6,053.00	-4.0↓
	一级白糖广西柳州现货价格 (元/吨)	5,830.00	-10↓	进口泰国糖配额内 (15%) 价格 (元/吨)	4,979.00	+18.0↑
上游情况	郑糖2209合约基差 (元/吨)	114.00	+51↑	进口泰国糖配额外 (50%) 价格 (元/吨)	6,342.00	+23.0↑
	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	+4.0↑	全国食糖产销率 (月, %)	62.87	+6.5↑
	全国食糖销量累计值 (月, 万吨)	601.00	+157.6↑	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)	381.07	+44.6↑	食糖新增工业库存 (月, 万吨)	355.00	-60.4↓
	进口巴西糖配额内 (15%) 利润 (元/吨)	983.00	+9.0↑	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)	-313.00	+9.0↑	巴西糖出口量 (月, 万吨)	236.00	+78.0↑
	进口泰国糖配额内 (15%) 利润 (元/吨)	388.00	+16.0↑	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)	-602.00	-18.0↓			
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(%)	17.58	+5.25↑	白糖期货平值看跌期权波动率 (%)	12.20	+0.98↑
行业消息	白糖平值期权20日历史波动率 (%)	12.67	+0.34↑	白糖平值期权60日历史波动率 (%)	10.31	+0.24↑
	1.国内天气情况, 未来5天, 内蒙古中部、山西北部、京津冀、东北地区、山东、苏皖北部、江南西部和南部、华南、四川、云南、贵州南部、西藏南部等地累计降雨量有30~60毫米, 部分地区有70~150毫米; 上述地区降水量较常年同期偏多或接近常年, 我国其余大部地区降水偏少。 2. 截至2022年7月26日, 非商业原糖期货净多持仓为64103手, 较前一周减少63059手, 多头持仓为181773手, 较前一周减少10257手; 空头持仓为117670手, 较前一周增加52802手, 非商业原糖净多持仓首度减持超6万手, 且接近净持仓的一半, 空头持仓大增, 空头气氛加速提升。					
观点总结	国内糖市: 截止目前全国食糖产糖量仍低于去年, 本年度食糖供应减少基本成定局。加之中秋备货需求开启, 加之国内外糖价差有所缩窄, 对国内白糖现货价格支撑作用增强。不过近日部分产区产销数据公布, 截至2022年7月31日, 云南省累计销糖 109.26万吨, 同比减少30.91万吨。7月份单月销糖 11.59万吨, 同比减少11.96万吨。本年度云南产糖量同比减少, 但7月份云南省单月销糖量处于历年相对低位, 本月销糖数据欠佳。操作上, 建议郑糖2209合约短期在5620-5900元/吨区间高抛低吸。					
	提示关注	5日 次日4:30 CFTC持仓				

数据来源第三方 (同花顺、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!