


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9月合约收盘价(日, 元/吨)	2,851.00	-45.00↓	玉米淀粉7月合约收盘价(日, 元/吨)	3,132.00	-51.00↓
	玉米9-1价差(日, 元/吨)	-25.00	0.00	玉米淀粉7-9价差(日, 元/吨)	-148.00	+10.00↑
	玉米持仓量(日, 手)	1,369,092.00	+36817.00↑	玉米淀粉持仓量(日, 手)	219,645.00	+19234.00↑
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-129,502.00	+25925.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	2,598.00	-1047.00↓
	玉米仓单(日, 张)	147,517.00	-2000.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	20,898.00	-136.00↓
	淀粉玉米9月价差(CS-C)	429.00	-16.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	763.50	+6.25↑	美玉米持仓量(日, 手)	464,163.00	-38841.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	404,200.00	-23648.00↓			
现货市场	玉米锦州港收购价:水14%(日, 元/吨)	2,825.00	0.00	玉米淀粉现价: 吉林四平(日, 元/吨)	3,350.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,891.76	-2.95↓	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,400.00	0.00
	广东港口价(美湾9月)	3,193.10	+22.51↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,400.00	0.00
	广东港口价(美湾7月)	3,191.07	+28.43↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	218.00	+51.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	-26.00	+45.00↑	玉米淀粉与玉米价差(山东, 日, 元/吨)	435.00	0.00
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	3,119.44	+4.44↑	玉米淀粉与木薯淀粉价差(日, 元/吨)	-940.00	0.00
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	227.68	+7.39↑	玉米淀粉与30面粉价差(日, 元/吨)	-457.00	+3.00↑
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	33.06	-1.50↓	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	367.30	-16.64↓
	巴西玉米种植面积预估(月, 万公顷)	22.70	+1.60↑	巴西玉米产量预估(月, 百万吨)	126.00	+10.00↑
	阿根廷玉米种植面积预估(月, 万公顷)	7.00	0.00	阿根廷玉米产量预估(月, 百万吨)	55.00	+2.00↑
	我国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	43.00	-0.32↓	我国玉米产量预估(月, 百万吨)	271.00	-1.55↓
	我国主产区玉米销售进度(周, %)	96.00	+1.00↑	美国玉米种植进度(周, %)	49.00	+27.00↑
产业情况	玉米南方港口(内+外)库存(周, 万吨)	120.60	-2.30↓	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	503.70	-31.00↓
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	368.40	-4.60↓	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	111.60	+0.90↑
	4月玉米进口量(月, 万吨)	221.00	-20.00↓	4月淀粉出口量(月, 万吨)	2.75	+0.32↑
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	3,250.00	-21254.00↓	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	0.00	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9月)	-273.10	-12.51↓	理论进口利润(美湾7月)	-281.07	-28.43↓
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,249.00	-87.00↓	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	97.00	0.00
	玉米酒精加工利润: 全国(日, 元/吨)	228.48	+0.05↑	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	155.00	0.00
	酒精企业开机率(周, %)	65.56	+3.35↑	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	100.00	-9.00↓
	周度玉米消费量(周, 万吨)	107.90	+1.00↑	淀粉企业开机率(周, %)	59.68	+0.49↑
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	12.00		玉米平值看跌期权波动率(%)	9.24	
	标的20日历史波动率(%)	11.66	+1.12↑	标的60日历史波动率(%)	12.68	+0.41↑
行业消息	1、巴西国家商品供应公司(CONAB)称, 截至6月4日, 占到全国播种面积92%的主产区第二季玉米收割完成3%; 2、澳大利亚农业资源经济科学局(ABARES)发布的季度报告显示, 2022/23年度全球玉米产量可能略低于12亿吨, 同比减少约3%。					
观点总结 玉米	美玉米播种进度快于市场预期, 且乌克兰谷物出口可能重启, 继续施压于玉米市场, 美玉米高位回落。另外, 巴西谷物出口商协会(ANEC)表示, 2022年6月份巴西玉米出口量预计为1,447,000吨, 环比提高32.9%, 同比激增15.2倍, 巴西玉米出口激增, 挤占美玉米市场份额。国内方面, 新季小麦上市将继续打压陈麦价格走跌, 这非常有利于推动小麦饲用用量增加。同时, 陈化稻定向拍卖进入饲用市场的数量也明显充足, 也在持续对打压玉米行情发力。不过, 小麦及其他替代谷物价格仍旧高企, 玉米饲用潜在需求增加。且粮源转移至贸易商手中, 贸易商看涨预期较强, 优质玉米报价维持坚挺。总的来看, 玉米盘面处于回调整理趋势, 不过, 我国玉米市场整体供需仍处于偏紧状态, 09合约可尝试在2850附近轻仓试多, 止损2820。					更多资讯请关注!  更多观点请咨询!
观点总结 玉米淀粉	国内淀粉企业加工利润持续向好, 企业开工积极性较高, 近期开工率逐步增加, 供应较为充足, 且下游市场需求疲软, 新签订单较少, 企业走货速度减慢。据Mysteel调查数据显示, 截至6月8日, 玉米淀粉企业淀粉库存总量111.6万吨, 较上周增加0.9万吨, 增幅0.81%, 月环比降幅4.08%; 年同比增幅12.27%, 淀粉库存止降转升, 压力增加, 牵制淀粉市场价格。不过, 玉米现货价格较为坚挺, 成本端形成较强支撑。盘面上看, 淀粉期价走势弱于玉米, 暂且观望。					
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, 6月11日00:00点USDA月度供需报告					