

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	玉米主力合约收盘价(日, 元/吨)	2,643.00	-18.00↓	玉米淀粉主力合约收盘价(日, 元/吨)	3,085.00	-55.00↓
	玉米1-5价差(日, 元/吨)	-41.00	0.00	玉米淀粉1-5价差(日, 元/吨)	-2.00	-2.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	398,827.00	-49468.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	94,247.00	-1454.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	10,024.00	+13175.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	1,863.00	+6017.00↑
	玉米仓单(日, 张)	35,465.00	-50.00↓	玉米淀粉仓单(日, 张)	576.00	0.00
	淀粉玉米价差(CS-C)	442.00	-37.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	585.00	+8.00↑	美玉米活跃合约持仓量(日, 手)	729,324.00	-2569.00↓
	美玉米非商业净持仓(周, 手)	474,354.00	-52536.00↓			
现货市场	玉米锦州港收购价:水15%(日, 元/吨)	2,620.00	0.00	玉米淀粉现价: 吉林四平(日, 元/吨)	3,500.00	0.00
	玉米全国平均价(日, 元/吨)	2,753.53	-2.23↓	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,520.00	0.00
	配额内到岸完税价(CIF)(日, 元/吨)	2,412.00	+37.00↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,550.00	-30.00↓
	配额外到岸完税价(CIF)(日, 元/吨)	2,984.00	+46.00↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	415.00	+55.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	-23.00	+18.00↑	玉米淀粉-二等玉米价差(日, 元/吨)	743.00	-5.00↓
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,836.67	-1.66↓	玉米淀粉与木薯淀粉价差(日, 元/吨)	-930.00	-30.00↓
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	83.14	+0.57↑	玉米淀粉与30面粉价差(日, 元/吨)	-76.00	-10.00↓
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	34.43	0.00	美国玉米产量预估(月, 亿吨)	3.83	+0.01↑
	巴西玉米种植面积预估(月, 万公顷)	20.80	0.00	巴西玉米产量预估(月, 亿吨)	1.18	0.00
	阿根廷玉米种植面积预估(月, 万公顷)	6.80	+0.30↑	阿根廷玉米产量预估(月, 万吨)	5,450.00	+150.00↑
	我国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	42.00	0.00	我国玉米产量预估(月, 亿吨)	2.73	0.00
产业情况	玉米南方港口(内+外)库存(周, 万吨)	65.30	+17.30↑	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	308.10	+4.00↑
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	222.00	-6.00↓	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	72.30	+3.70↑
	10月玉米进口量(月, 万吨)	130.00	-223.00↓	10月淀粉出口量(月, 万吨)	12.58	+1.40↑
	转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	152,026.00	+31904.00↑	非转基因进口玉米拍卖量(周, 吨)	24,710.00	-17066.00↓
	转基因进口玉米拍卖成交率(周, %)	57.00	-3.00↓	非转基因进口玉米拍卖成交量(周, %)	100.00	+48.00↑
	进口利润: 广东港-26%税(日, 元/吨)	-124.00	-46.00↓	进口利润: 广东港-1%税(日, 元/吨)	448.00	-36.00↓
	饲料总产量(月, 吨)	2,520.00	-107.00↓	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	22	-95.00↓
下游情况	玉米酒精加工利润: 全国(日, 元/吨)	54.48	-11.64↓	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	19	-7.00↓
	酒精企业开机率(周, %)	52.65	+2.89↑	淀粉企业开机率(周, %)	69.14	+1.36↑
	周度玉米消费量(周, 万吨)	120.20	+2.80↑			
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	12.18	-0.54↓	玉米平值看跌期权波动率(%)	11.22	-0.37↓
	标的20日历史波动率(%)	11.89	-0.03↓	标的60日历史波动率(%)	13.43	-0.08↓
行业消息	<p>1、布宜诺斯艾利斯谷物交易所(BAGE)发布的周度报告称, 本年度阿根廷玉米播种面积为730万公顷。截至2021年12月1日的一周, 阿根廷2021/2年度玉米播种进度为31.1%, 比一周前的30%高出1.1%, 但是比去年同期低了3.9%。</p> <p>2、</p>				<p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结	<p>玉米方面: 美国玉米出口销售量保持良好, 以及乙醇需求强劲, 给美玉米市场提供支撑, 而美玉米基本收割完毕, 卖压增强, 且巴西首茬玉米播种情况良好, 丰产预期较强, 阿根廷玉米种植面积预期增加至730万公顷, 产量预估将触及创纪录的5500万吨, 对玉米市场有所牵制。国内方面, 深加工企业玉米加工量持续增加, 且玉米库存较低, 补库意愿仍存。同时, 中储粮12月3日进口玉米(转基因)竞价销售成交率57%, 市场采购热情依旧较好, 提振玉米市场氛围。不过, 国内气温持续回暖, 部分产地新玉米有返潮霉变的风险, 主产区基层种植户出售积极性较高, 新粮上量较多, 卖压逐步增加。盘面来看, 玉米主力合约移至05, 增仓下跌, 关注40日均线支撑情况。</p> <p>淀粉: 淀粉加工利润持续高位, 企业开机率连续回升, 加之淀粉价格较高, 下游需求转弱, 企业整体库存继续累积, 据Mysteel调查数据显示, 截至12月1日, 玉米淀粉企业淀粉库存总量72.3万吨, 较上周增加3.7万吨, 月环比增幅5.41%, 月环比增幅26.42%; 年同比增幅9.23%, 整体处于历史同期最高水平, 拖累淀粉现货价格继续回落, 期价亦受其拖累。总的来看, 在其库存压力下, 整体较玉米走势偏弱, 暂且观望。</p>				<p>更多观点请咨询!</p>	
重点关注	12月7日中储粮进口玉米拍卖成交情况, 12月9日USDA月度供需报告					