

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)	2,768.00	-7.00↓	玉米淀粉5月合约收盘价(日, 元/吨)	3,272.00	-30.00↓
	玉米5-9价差(日, 元/吨)	-6.00	-8.00↓	玉米淀粉5-9价差(日, 元/吨)	-32.00	-11.00↓
	玉米持仓量(日, 手)	1,216,769.00	-9631.00↓	玉米淀粉持仓量(日, 手)	124,320.00	-17566.00↓
	玉米前20名净持仓(日, 手)	-228,309.00	+6364.00↑	玉米淀粉前20名净持仓(日, 手)	-26,371.00	-904.00↓
	玉米仓单(日, 张)	50,783.00	0.00	玉米淀粉仓单(日, 张)	4,607.00	0.00
	淀粉玉米5月价差(CS-C)	504.00	-23.00↓			
	美玉米活跃合约收盘价(美分/蒲式耳)	626.25	+7.00↑	美玉米活跃合约持仓量(日, 手)	630,115.00	+1334.00↑
美玉米非商业净持仓(周, 手)	388,138.00	-19354.00↓				
现货市场	玉米锦州港收购价:水15%(日, 元/吨)	2,640.00	0.00	玉米淀粉现价: 吉林四平(日, 元/吨)	3,150.00	0.00
	玉米全国均价(日, 元/吨)	2,725.10	-0.39↓	玉米淀粉现价: 河北邢台(日, 元/吨)	3,160.00	0.00
	广东港口价(美湾5月)	2,501.12	+17.95↑	玉米淀粉现价: 山东潍坊(日, 元/吨)	3,300.00	0.00
	广东港口价(美湾3月)	2,550.82	+19.33↑	玉米淀粉主力合约基差(日, 元/吨)	-122.00	+30.00↑
	玉米主力合约基差(日, 元/吨)	-128.00	+7.00↑	玉米淀粉与玉米价差(山东, 日, 元/吨)	450.00	+5.00↑
替代品现货价格	小麦: 全国均价(日, 元/吨)	2,873.89	0.00	玉米淀粉与木薯淀粉价差(日, 元/吨)	-870.00	0.00
	小麦与玉米现货价差(日, 元/吨)	148.79	+0.39↑	玉米淀粉与30面粉价差(日, 元/吨)	-272.00	+7.00↑
上游情况	美国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	34.56	+0.13↑	美国玉米产量预估(月, 百万吨)	383.94	+1.35↑
	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, 百万吨)	115.00	-3.00↓
	阿根廷玉米种植面积预估(月, 万公顷)	6.80	0.00	阿根廷玉米产量预估(月, 百万吨)	54.00	-0.50↓
	我国玉米种植面积预估(月, 万公顷)	43.32	0.00	我国玉米产量预估(月, 百万吨)	272.55	0.00
	我国主产区玉米销售进度(周, %)	53.00	+2.00↑			
产业情况	玉米南方港口(内+外)库存(周, 万吨)	110.70	-31.10↓	深加工企业玉米库存总量(周, 万吨)	569.70	+0.03↑
	玉米北方港口库存(周, 万吨)	292.00	+5.00↑	淀粉主要企业库存(周, 万吨)	89.50	+2.60↑
	12月玉米进口量(月, 万吨)	133.00	+54.00↑	12月淀粉出口量(月, 万吨)	1.05	-0.40↓
	转基因进口玉米拍卖量(半周, 吨)	76,560.00	+27909.00↑	非转基因进口玉米拍卖量(半周, 吨)	0.00	0.00
	转基因进口玉米拍卖成交率(半周, %)	75.00	+52.00↑	非转基因进口玉米拍卖成交率(半周, %)	0.00	0.00
	理论进口利润(美湾5月)	318.88	-17.95↓	理论进口利润(美湾3月)	269.18	-19.33↓
下游情况	饲料总产量(月, 吨)	2,457.00	-63.00↓	淀粉加工利润: 吉林(日, 元/吨)	-38	0.00
	玉米酒精加工利润: 全国(日, 元/吨)	3.72	0.00	淀粉加工利润: 河北(日, 元/吨)	-110	0.00
	酒精企业开机率(周, %)	72.55	+1.44↑	淀粉加工利润: 山东(日, 元/吨)	-131	+35.00↑
	周度玉米消费量(周, 万吨)	116.90	+0.50↑	淀粉企业开机率(周, %)	64.16	-0.22↓
期权市场	玉米平值看涨期权波动率(%)	11.32	+0.12↑	玉米平值看跌期权波动率(%)	10.81	-0.59↓
	标的20日历史波动率(%)	10.21	-0.31↓	标的60日历史波动率(%)	11.12	-0.06↓
行业消息	<p>1、根据Mysteel玉米团队对全国7个省份, 59个地市最新调查数据显示, 截至1月27日, 全国玉米主要产区售粮进度为53%, 较上周增加2%, 较去年同期偏慢16%;</p> <p>2、根据Mysteel玉米团队对全国12个地区, 96家主要玉米深加工厂家的最新调查数据显示, 2022年第4周, 截止1月26日加工企业玉米库存总量569.7万吨, 较上周增加0.05%。</p>					
观点总结	<p>玉米方面: 截止1月21日巴西首季玉米收获进度为14%, 较上周大幅推进7%, 收割进度加快, 且乌克兰谷物出口增量明显, 均有望挤占美玉米市场份额。不过, 周度出口检验优于预期, 且天气炒作仍未结束, 升水预期仍存。另外, 俄罗斯和乌克兰之间的紧张局势不断升级, 可能干扰黑海地区粮食出口, 乌克兰玉米出口受限。国内方面, 玉米需求终端及贸易商春节前备货收尾, 市场交易量将大幅下降, 市场逐步进入春节歇业阶段。且新粮上市进度持续偏慢, 预期节后存在集中上量风险。不过, 种植户挺价惜售情绪较浓, 且小麦价格继续偏强, 给予玉米价格底部支撑。盘面来看, 玉米维持震荡上涨趋势, 节前暂时观望为主。</p> <p>淀粉方面: 国内深加工淀粉产量稳定, 供应相对充足, 且节前备货基本结束, 物流陆续停止发运, 各产区库存小幅增加。据Mysteel调查数据显示, 截至1月26日, 玉米淀粉企业淀粉库存总量89.5万吨, 较上周增加2.6万吨, 增幅2.93%, 月环比增幅0.45%; 年同比增幅15.27%, 整体处于历史同期最高水平, 淀粉现货价格受其拖累。不过, 深加工利润逐步下降, 加工企业继而转入亏损, 部分工厂开机率降低, 产量下降。盘面来看, 淀粉处于反弹势, 维持偏多思路对待。</p>					
重点关注						



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!