

## 玉米：多头加注极端天气 期货增仓上涨

冯子悦 fengzy@jsfco.com 期货从业资格号：F03111391 投资咨询从业证书号：Z0018581

### 一、行情信息

| 金石期货 JINSHI FUTURES |          | 玉米每日数据追踪 |        |         |         |       |        |
|---------------------|----------|----------|--------|---------|---------|-------|--------|
| 指标                  |          | 截至       | 单位     | 今日      | 昨日      | 涨跌    | 涨跌幅    |
| 期货                  | DCE玉米：01 | 8月9日     | 元/吨    | 2677.00 | 2667.00 | 10.00 | 0.37%  |
|                     | DCE玉米：05 | 8月9日     | 元/吨    | 2677.00 | 2677.00 | 0.00  | 0.00%  |
|                     | DCE玉米：09 | 8月9日     | 元/吨    | 2808.00 | 2793.00 | 15.00 | 0.54%  |
|                     | CBOT玉米主  | 8月8日     | 美分/蒲式耳 | 499.25  | 498.00  | 1.25  | 0.25%  |
|                     | CBOT小麦主  | 8月8日     | 美分/蒲式耳 | 654.75  | 657.25  | -2.50 | -0.38% |
| 现货                  | 玉米：鲢鱼圈   | 8月9日     | 元/吨    | 2850.00 | 2830.00 | 20.00 | 0.71%  |
|                     | 玉米：CIF   | 8月9日     | 元/吨    | 2356.71 | 2345.78 | 10.93 | 0.47%  |
|                     | 小麦：全国均价  | 8月9日     | 元/吨    | 2839.44 | 2833.33 | 6.11  | 0.22%  |
| 价差                  | 玉米基差     | 8月9日     | 元/吨    | 42.00   | 37.00   | 5.00  | -      |
|                     | 玉米小麦价差   | 8月9日     | 元/吨    | 10.56   | -3.33   | 13.89 | -      |
|                     | 内外玉米价差   | 8月9日     | 元/吨    | 493.29  | 484.22  | 9.07  | -      |

数据来源：Wind、金石期货研究所

### 二、宏观及行业要闻

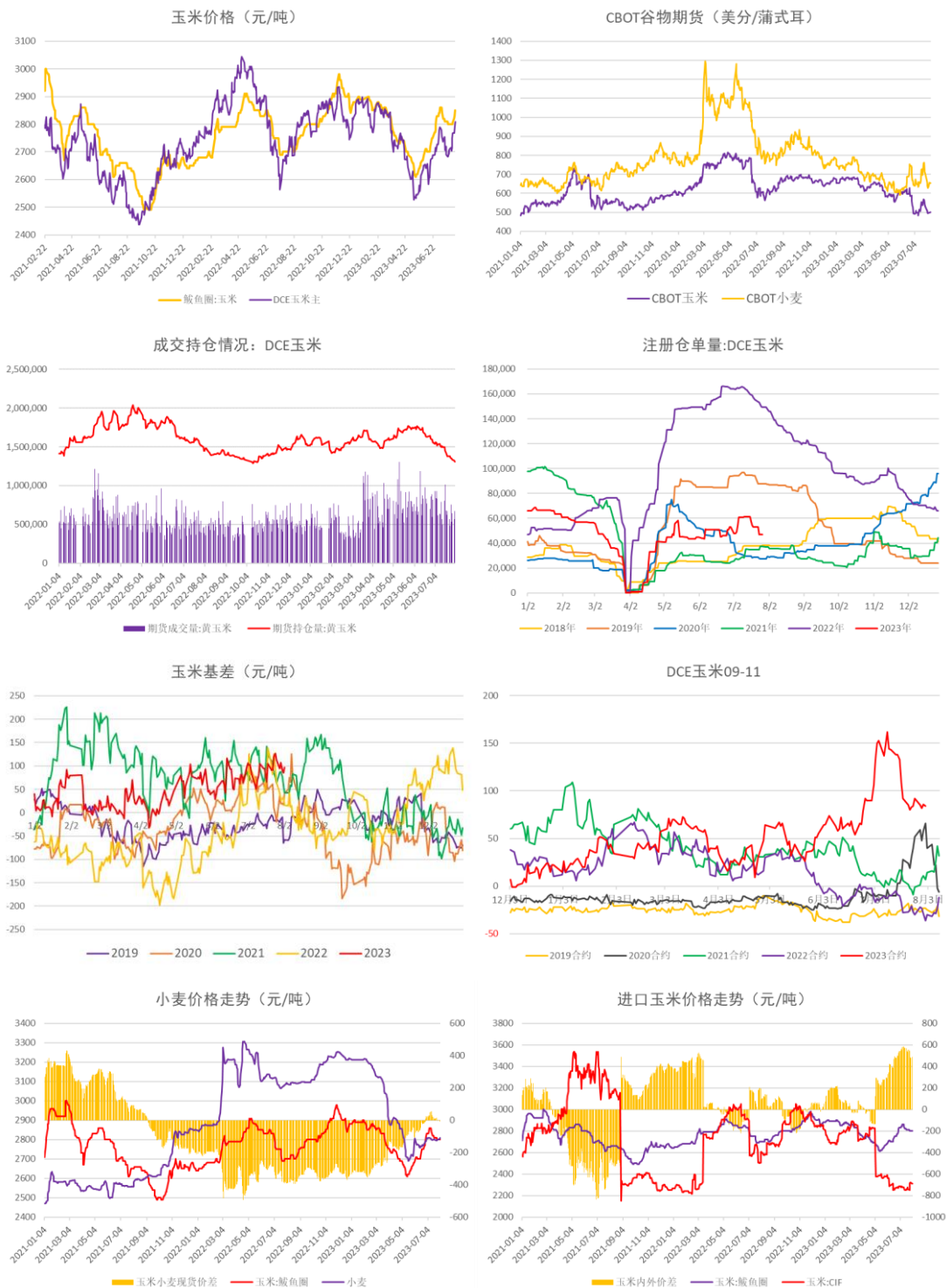
1、2023年7月份，全国居民消费价格同比下降0.3%。其他七大类价格环比六涨一降。其中，教育文化娱乐、交通通信、其他用品及服务价格分别上涨1.3%、1.2%和0.9%，生活用品及服务、居住、医疗保健价格分别上涨0.6%、0.1%和0.1%；衣着价格下降0.3%。工业生产者出厂价格中，生产资料价格下降5.5%。

2、8日，记者从省水文水资源中心获悉，根据气象预测，第6号台风“卡努”将影响黑龙江省，预计10日至12日将有一次较大降雨过程。受此影响，黑龙江省多条河流或将发生超警戒水位洪水。

3、巴西谷物出口商协会ANEC称，巴西8月份的玉米出口量估计在780万吨-980万吨之间，有望达到该月份的记录最高水平。去年同期出口量接近700万吨。

4、美国谷物分析师和农户表示，2023/24年度美国玉米收成可能创下纪录第二高位，因七月份的降雨引领作物度过了关键的生长阶段，抵消了初期的干燥天气及夏季高温影响。

### 三、数据图表（数据来源：Wind、金石期货研究所）



### 四、分析展望

芝加哥期货交易所（CBOT）玉米期货周二小幅收涨，暂时缺乏题材引领，投资者在 8 月供需报告发布前选择离场观望。国内方面，东北地区上周受台风影响多地降雨较多，玉米外运运输受限，粮源多在本地流通，受饲用稻谷拍卖影响，下游市场观望氛围较浓，部分贸易商持粮待价售。北方港口购销清淡，在收贸易主体不多，下游询价少，玉米库存维持低位，

贸易商挺价情绪仍较浓。南方港口由于生猪存栏高位，但持续亏损，叠加小麦、芽麦等替代强劲，玉米饲用需求存减弱预期。现阶段玉米库存持续偏紧，但谷物替代充足且价格优势明显，东北地区强降雨将威胁长杆作物，预计期价短期内将偏强运行。

### 关注金石期货微信公众号



金石期货公众号



金石期货投资咨询部公众号

### 免责条款

本报告中的信息均来源于已公开的资料，尽管我们相信报告中资料来源的可靠性，但我们对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。也不保证我公司所做出的意见和建议不会发生任何的变更，在任何情况下，我公司报告中的信息和所表达的意见和建议以及所载的数据、工具及材料均不能作为您所进行期货买卖的绝对依据。由于报告在编写时融入了该分析师个人的观点和见解以及分析方法，如与金石期货公司发布的其他信息有不一致及有不同的结论，未免发生疑问，本报告所载的观点并不代表了金石期货公司的立场，所以请谨慎参考。我公司不承担因根据本报告所进行期货买卖操作而导致的任何形式的损失。

另外，本报告所载资料、意见及推测只是反映金石期货公司在本报告所载明的日期的判断，可随时修改，毋需提前通知。未经金石期货公司允许批准，本报告内容不得以任何范式传送、复印或派发此报告的材料、内容或复印本予以任何其他人，或投入商业使用。如遵循原文本意的引用、刊发，需注明出处“金石期货有限公司”，并保留我公司的一切权利。