

研究员：王生

联系方式：68865935

今日数据点评：

今日胶合板和铁矿石波动较大大于 1%且均是下跌。整体大商所市场品种呈下跌态势。

跨期价差来看，棕榈油、豆油、大豆、焦炭、焦煤、铁矿石为远期升水，豆粕、塑料、PP、鸡蛋为远期贴水，其中铁矿石为-4 接近于 0.如果我们认可跨期价差是市场对未来的看法，我们可以考虑空远期贴水的品种，多远期升水的品种。

跨品种价差来看，塑料-PP 价差继续下降在 200 左右，棕榈-豆油价差维持-860 左右，焦炭-铁矿石价差在 470 左右，焦炭-焦油价差维持在 300 左右。

整体上，我们继续看空豆粕、豆油、鸡蛋、PP、L 跨期价差，看多铁矿石、焦煤、焦炭、大豆远期价差；看空焦炭焦油价差、看多焦炭铁矿石价差。

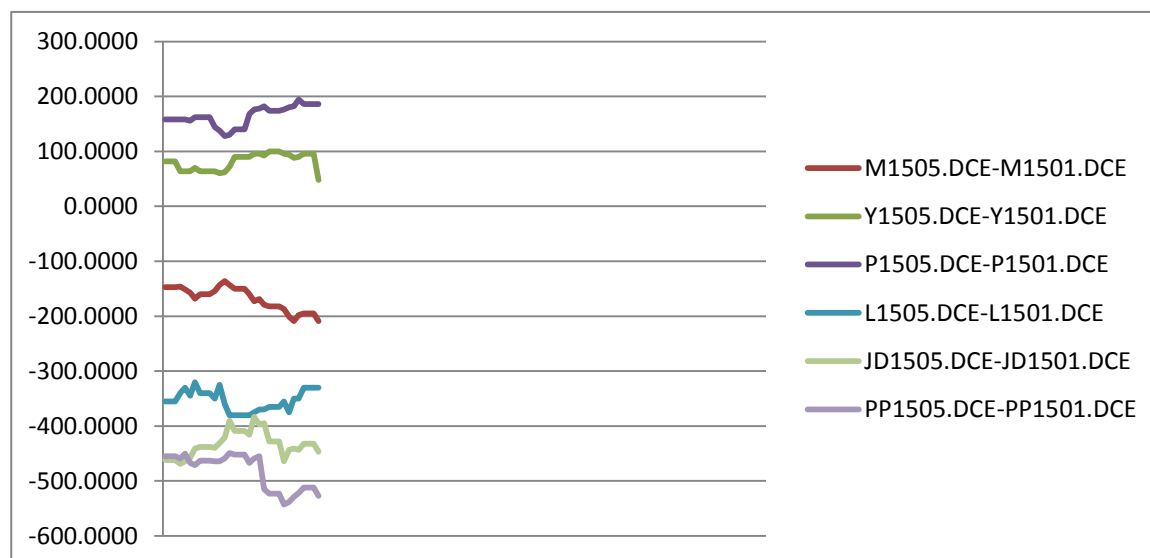
图文 1：煤钢焦期货品种行情

代码	涨跌幅	最新价(最后交易价格)	即时波动情况	趋势情况 1	趋势情况 2
BB1409.DCE	-5.98%	143.90	high Sdt	upMA20	continue
BB1501.DCE	-2.67%	134.80	high Sdt	upMA20	continue
BB1505.DCE	-2.36%	132.15	high Sdt	upMA20	continue
I1501.DCE	-1.12%	620.00	high Sdt	downMA20	continue
I1505.DCE	-1.12%	616.00	high Sdt	downMA20	continue
J1501.DCE	-1.00%	1093.00		upMA20	continue

Y1501.DCE	-0.96%	6010.00		upMA20	CHANGE
Y1505.DCE	-0.88%	6106.00		upMA20	continue
FB1505.DCE	-0.76%	58.55		downMA20	continue
P1505.DCE	-0.71%	5348.00		downMA20	continue
P1501.DCE	-0.69%	5156.00		downMA20	continue
J1505.DCE	-0.61%	1148.00		downMA20	continue
FB1501.DCE	-0.42%	59.25		downMA20	continue

来源：wind、文华财经

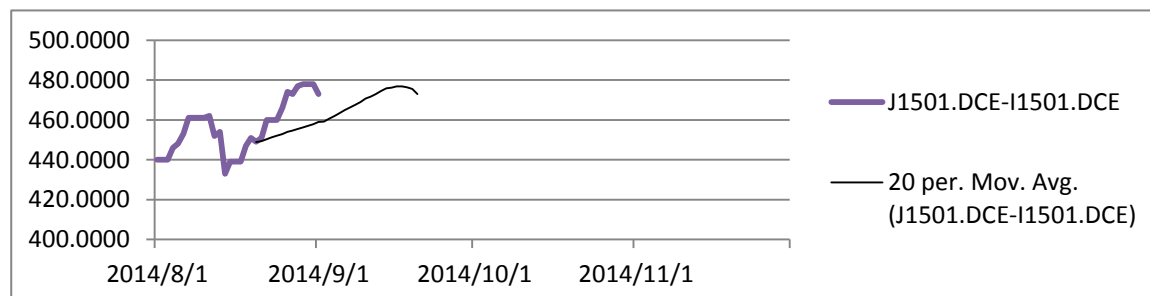
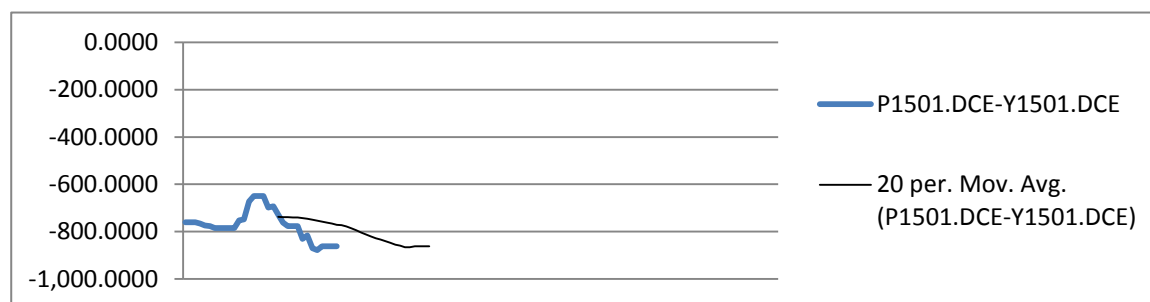
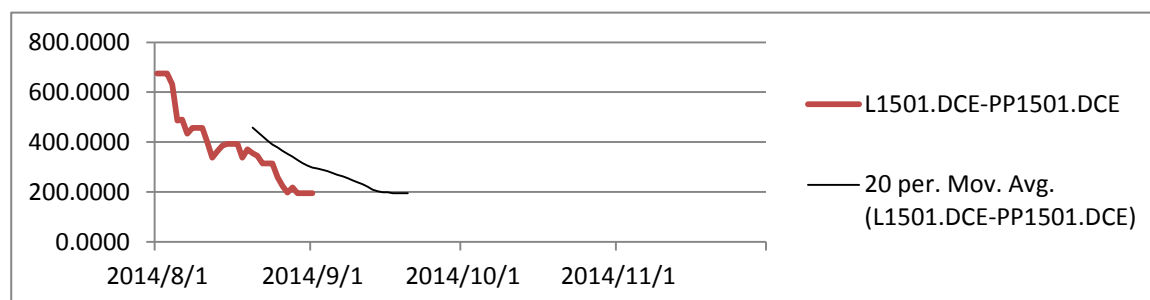
图文 2：跨期价差

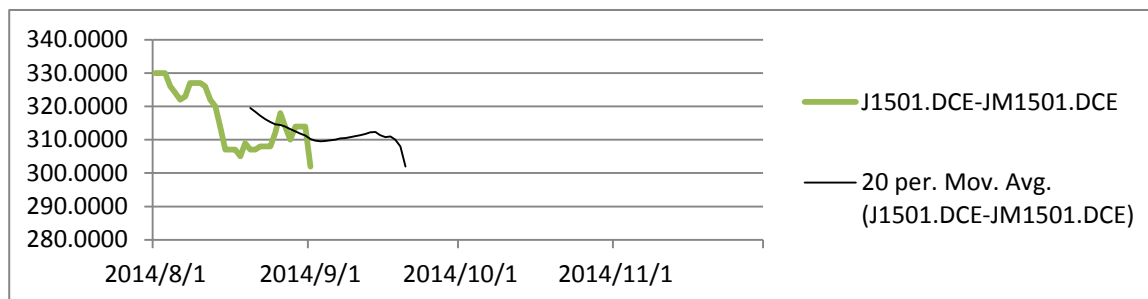




来源: wind、文华财经

图文 3: 跨品种价差





来源：wind、文华财经

免责声明：本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。本报告版权归通联期货研究发展中心所有。未获得通联期货研究发展中心书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“通联期货发展研究中心”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。