化工品套利跟踪20180108

信达期货 CINDA FUTURES

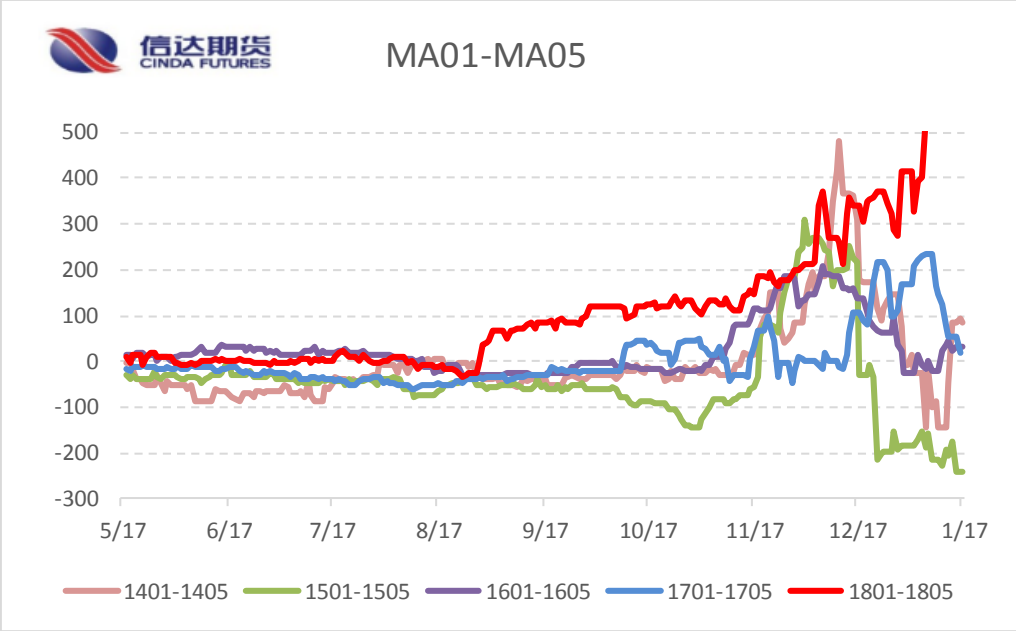
联系人：王存响　　联系人：吕洁

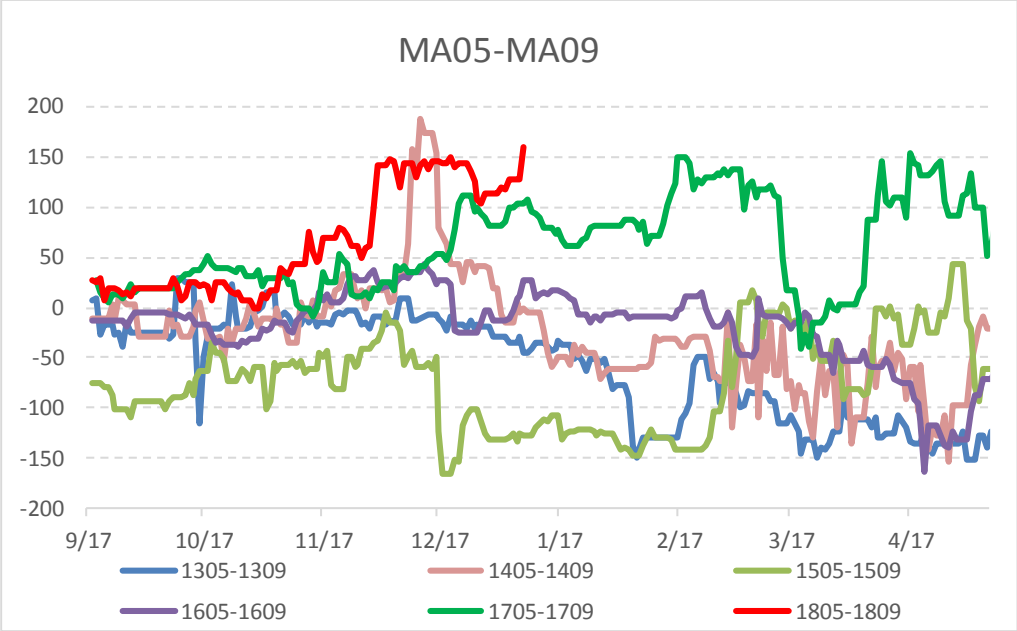
邮箱：wangcunxiang@cindasc.com　　投资咨询编号：Z0002739

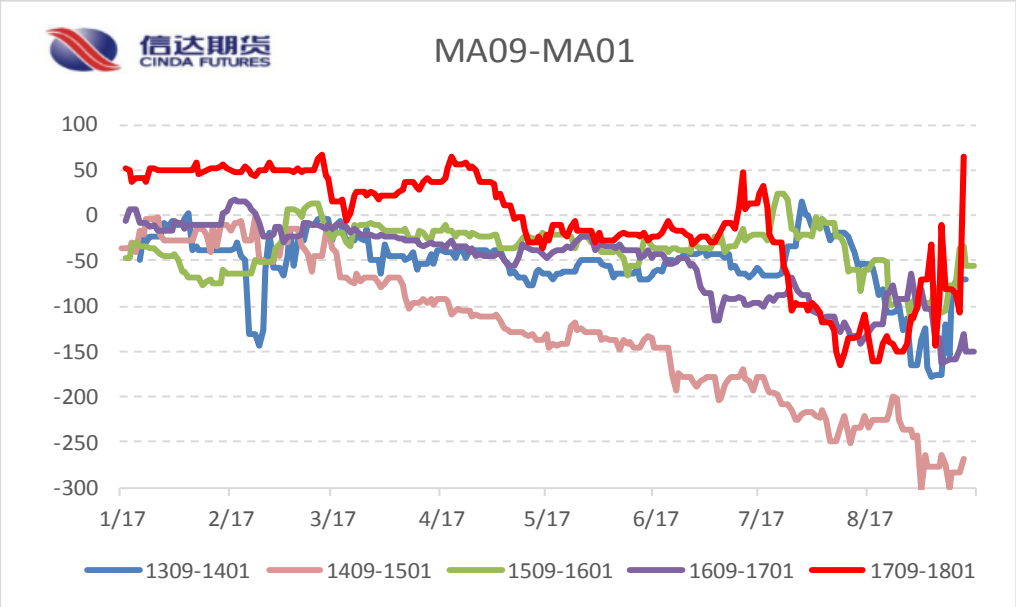
电话：0571-28132632　　电话：0571-28132578

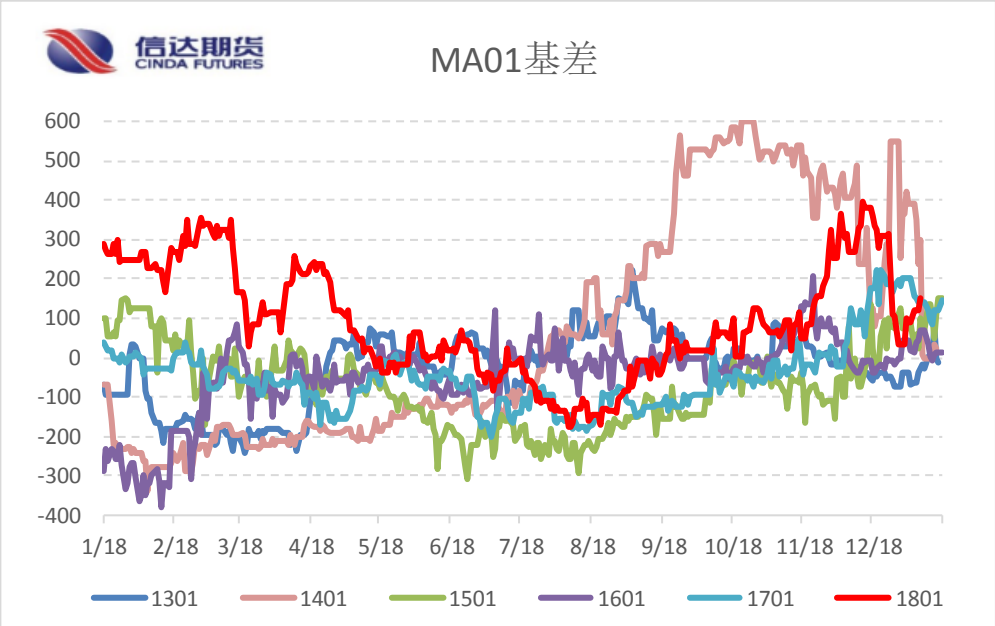
策略类型		策略组合	上一交易日	今日收盘	正常区间	操作建议
跨期	甲醇	MA1801-MA1805	538	557	[-200,200]	观望
		MA1805-MA1809	128	160	[-200,100]	等待反套机会，入场点位180，止损220
		1801基差	118	151	[-200,200]	-
	PTA	TA1801-TA1805	58	76	[-200,200]	观望
		TA1805-TA1809	-4	8	[-220,100]	观望
		1801基差	167	136	[-160，140]	-
	LLDPE	LL1801-LL1805	-215	-170	[-200,400]	观望
		LL1805-LL1809	195	170	[-200,600]	观望
		1801基差	140	135	[-300,1000]	-
	PP	PP1801-PP1805	-238	-180	[-200,400]	观望
		PP1805-PP1809	104	110	[-200,400]	观望
		1801基差	130	76	[-500,1000]	-
	RU	RU1801-RU1805	-460	-475	[-600,800]	观望
		RU1805-RU1809	-335	-330	[-2000,500]	观望
		1801基差(老胶)	-1630	-1600	[-3000,1000]	-
跨品种	PP&MA	PP1801-3*MA1801	-1116	-1298	[-200,2000]	观望
		PP1805-3*MA1805	736	553	[-300,2000]	关注利润修复机会
		PP1809-3*MA1809	1016	923	[200,2000]	-
	LL&PP	LL1801-PP1801	410	441	[-200,2000]	观望
		LL1805-PP1805	467	431	[0,2000]	价差做缩，800入场
		LL1809-PP1809	376	371	[0,2000]	-

跨期套利跟踪：甲醇

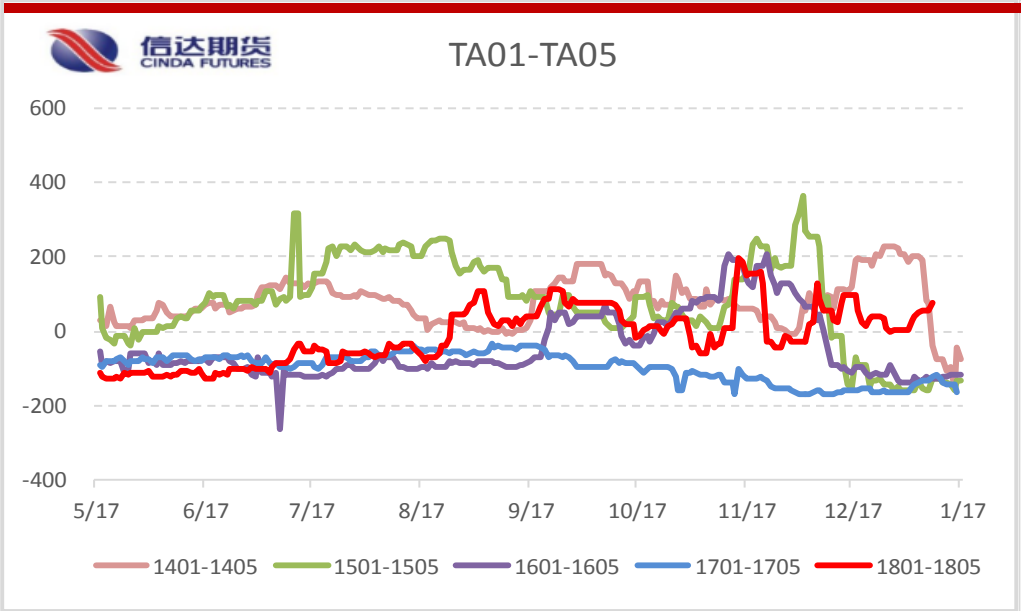

信达期货 CINDA FUTURES
MA01-MA05
500
400
300
200
100
0
-100
-200
-300
5/17
6/17
7/17
8/17
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
1401-1405
1501-1505
1601-1605
1701-1705
1801-1805

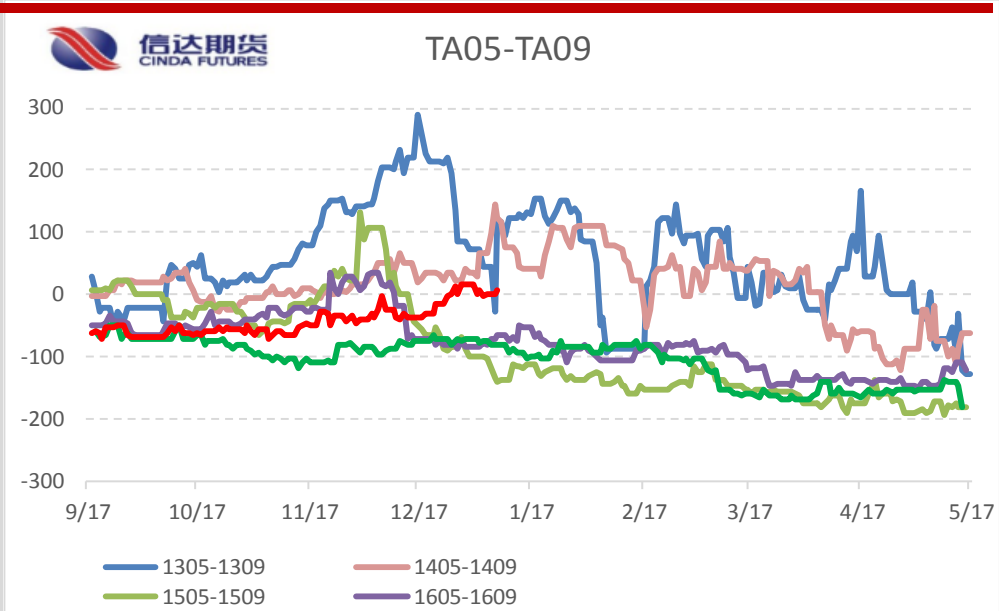

MA05-MA09
200
150
100
50
0
-50
-100
-150
-200
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
2/17
3/17
4/17
1305-1309
1405-1409
1505-1509
1605-1609
1705-1709
1805-1809

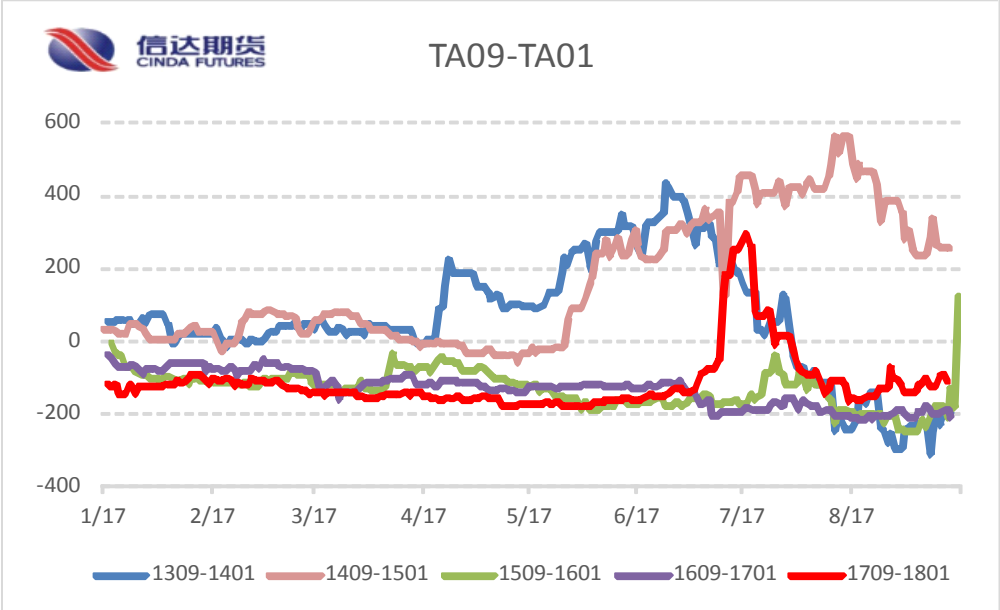

信达期货 CINDA FUTURES
MA09-MA01
100
50
0
-50
-100
-150
-200
-250
-300
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
6/17
7/17
8/17
1309-1401
1409-1501
1509-1601
1609-1701
1709-1801

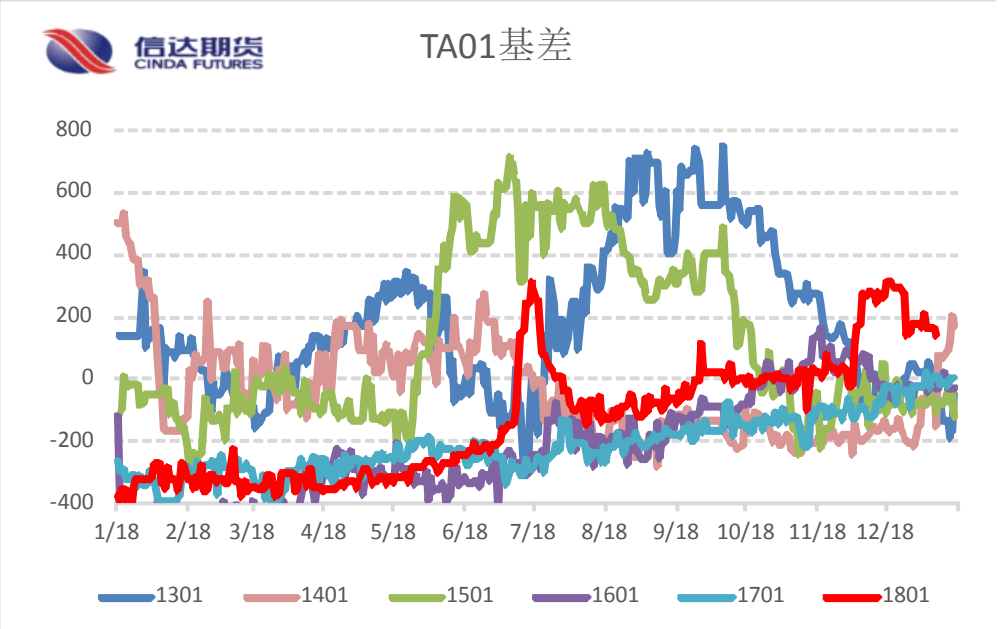

信达期货 CINDA FUTURES
MA01基差
600
500
400
300
200
100
0
-100
-200
-300
-400
1/18
2/18
3/18
4/18
5/18
6/18
7/18
8/18
9/18
10/18
11/18
12/18
1301
1401
1501
1601
1701
1801

跨期套利跟踪：PTA

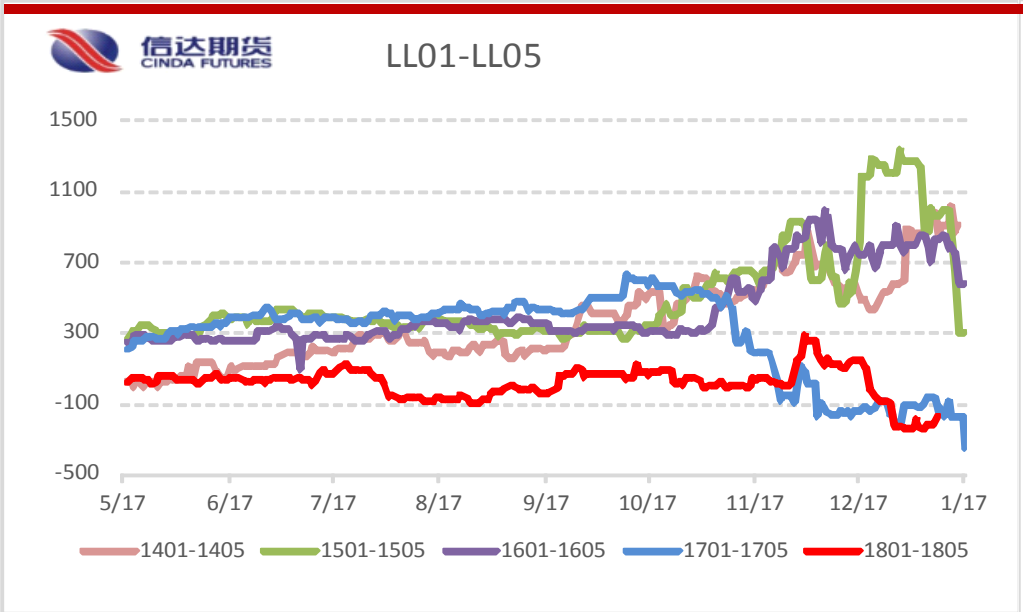

信达期货 CINDA FUTURES
TA01-TA05
600
400
200
0
-200
-400
5/17
6/17
7/17
8/17
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
1401-1405
1501-1505
1601-1605
1701-1705
1801-1805

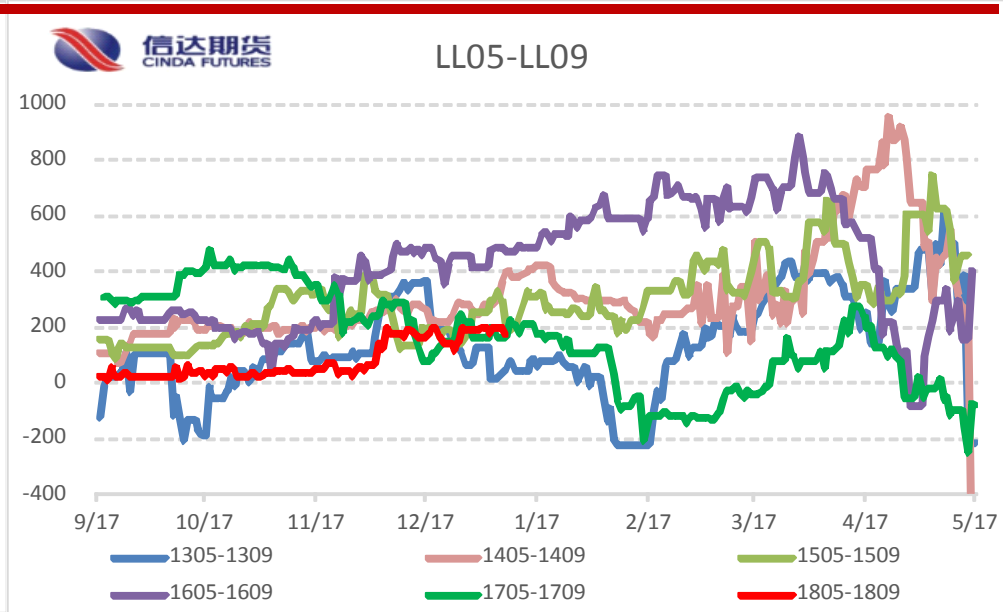

信达期货 CINDA FUTURES
TA05-TA09
300
200
100
0
-100
-200
-300
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
1305-1309
1405-1409
1505-1509
1605-1609

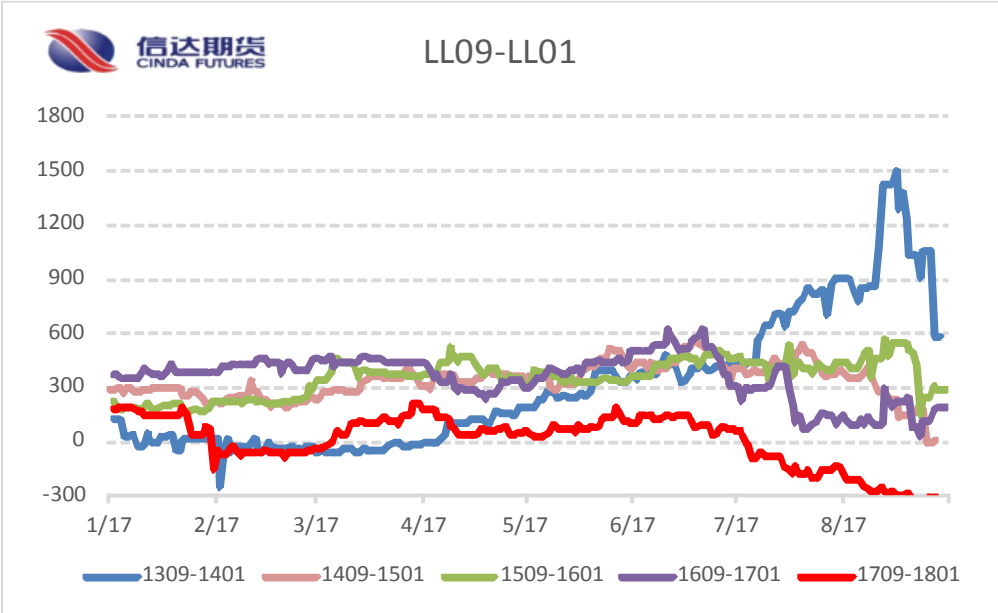

信达期货 CINDA FUTURES
TA09-TA01
600
400
200
0
-200
-400
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
6/17
7/17
8/17
1309-1401
1409-1501
1509-1601
1609-1701
1709-1801

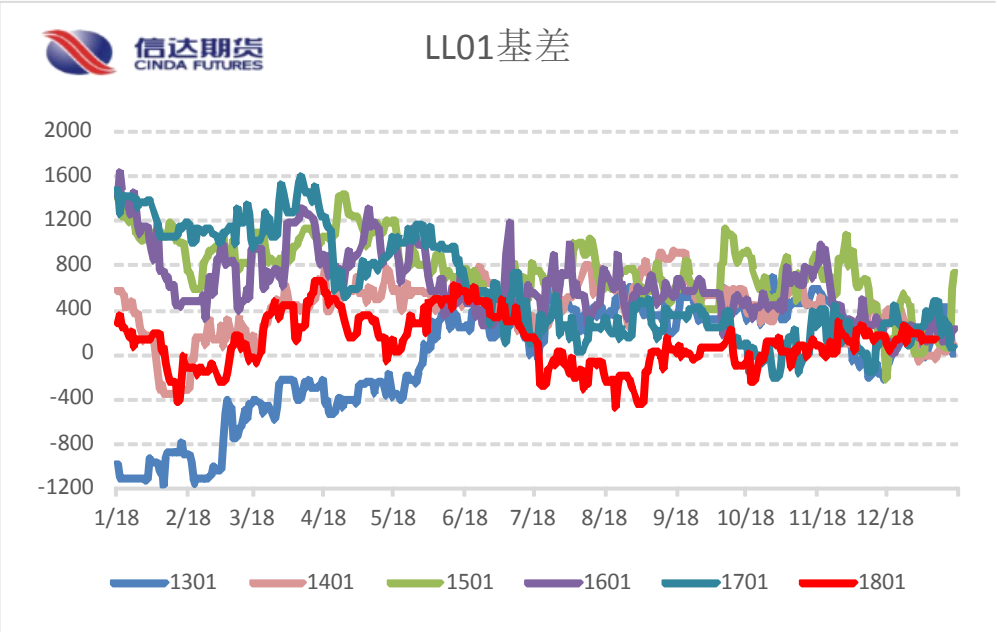

信达期货 CINDA FUTURES
TA01基差
800
600
400
200
0
-200
-400
1/18
2/18
3/18
4/18
5/18
6/18
7/18
8/18
9/18
10/18
11/18
12/18
1301
1401
1501
1601
1701
1801

跨期套利跟踪：LL

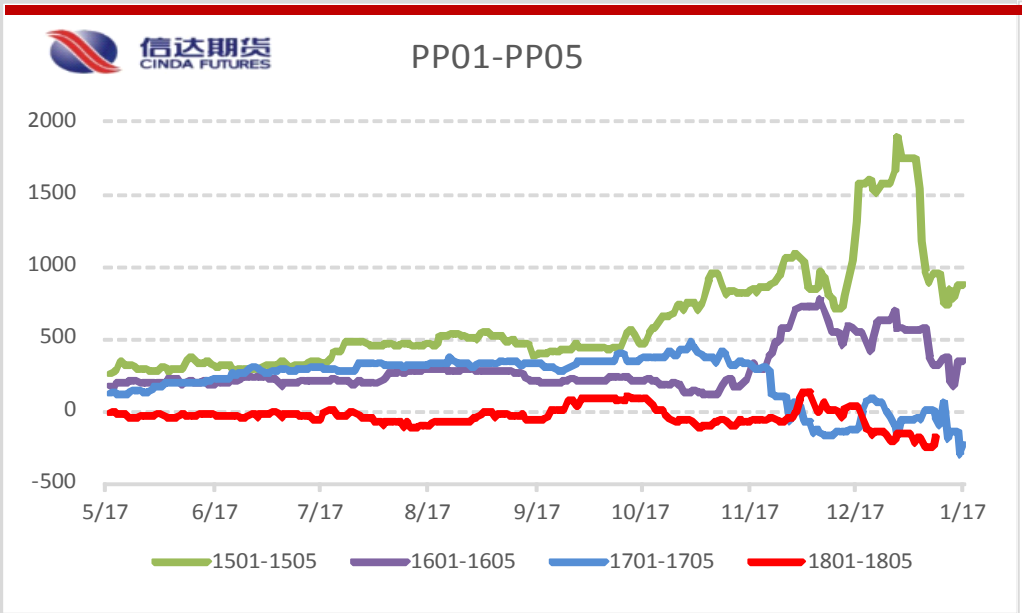

信达期货 CINDA FUTURES
LL01-LL05
1500
1100
700
300
-100
-500
5/17
6/17
7/17
8/17
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
1401-1405
1501-1505
1601-1605
1701-1705
1801-1805

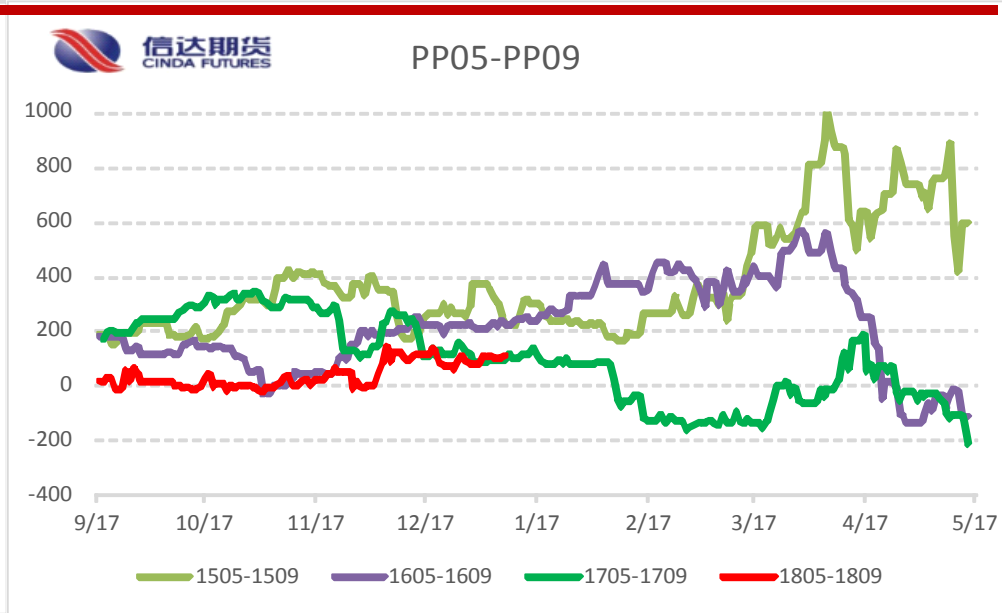

信达期货 CINDA FUTURES
LL05-LL09
1000
800
600
400
200
0
-200
-400
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
1305-1309
1405-1409
1505-1509
1605-1609
1705-1709
1805-1809

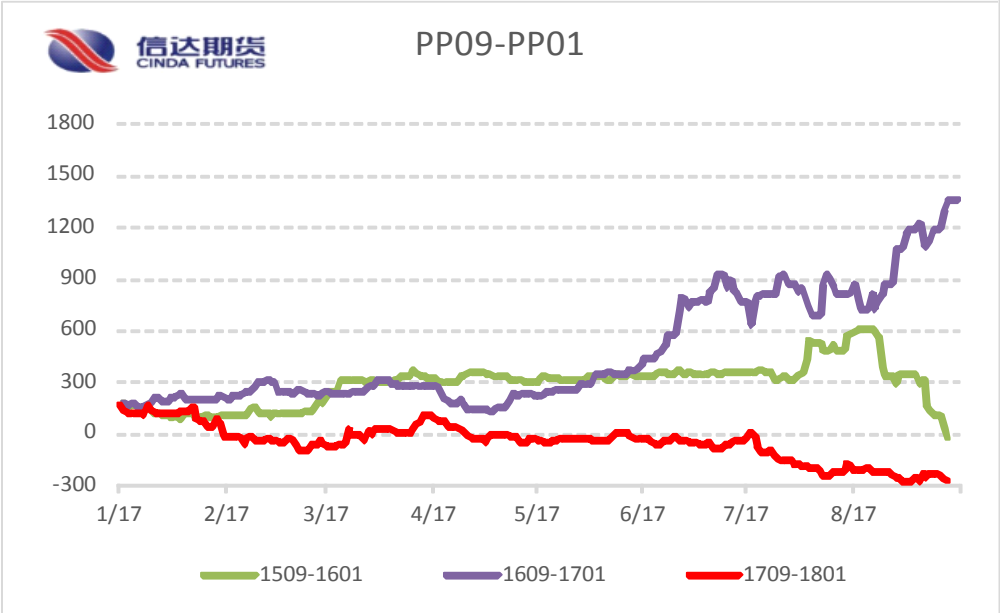

信达期货 CINDA FUTURES
LL09-LL01
1800
1500
1200
900
600
300
0
-300
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
6/17
7/17
8/17
1309-1401
1409-1501
1509-1601
1609-1701
1709-1801

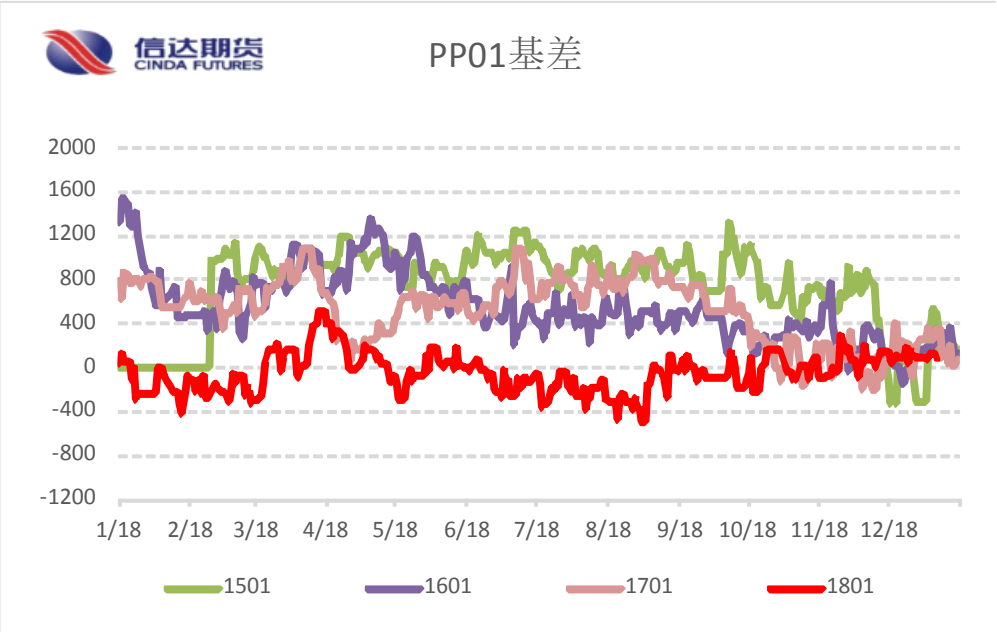

信达期货 CINDA FUTURES
LL01基差
2000
1600
1200
800
400
0
-400
-800
-1200
1/18
2/18
3/18
4/18
5/18
6/18
7/18
8/18
9/18
10/18
11/18
12/18
1301
1401
1501
1601
1701
1801

跨期套利跟踪：PP

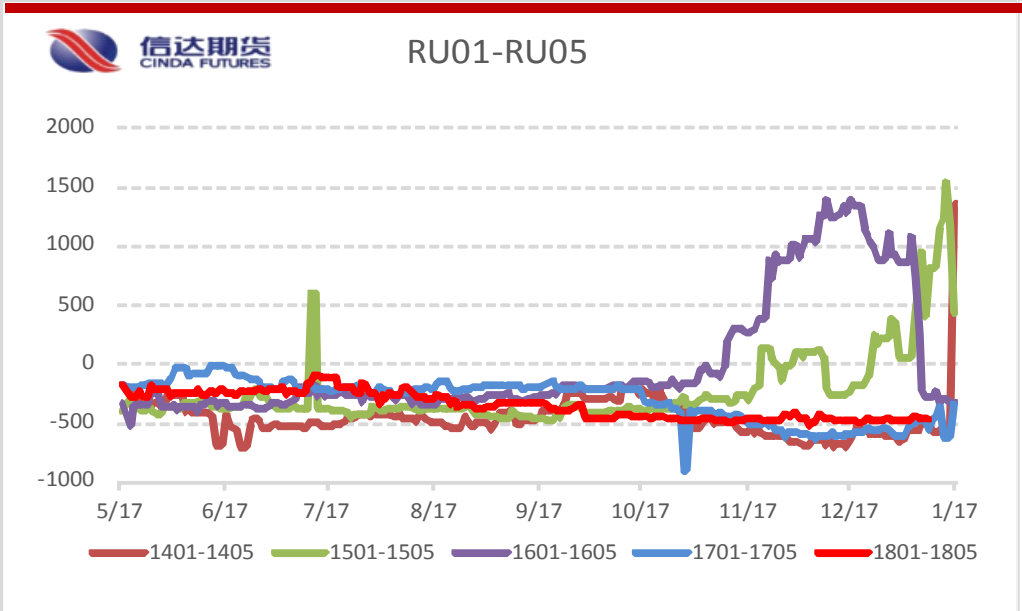

信达期货 CINDA FUTURES
PP01-PP05
2000
1500
1000
500
0
-500
5/17
6/17
7/17
8/17
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
1501-1505
1601-1605
1701-1705
1801-1805

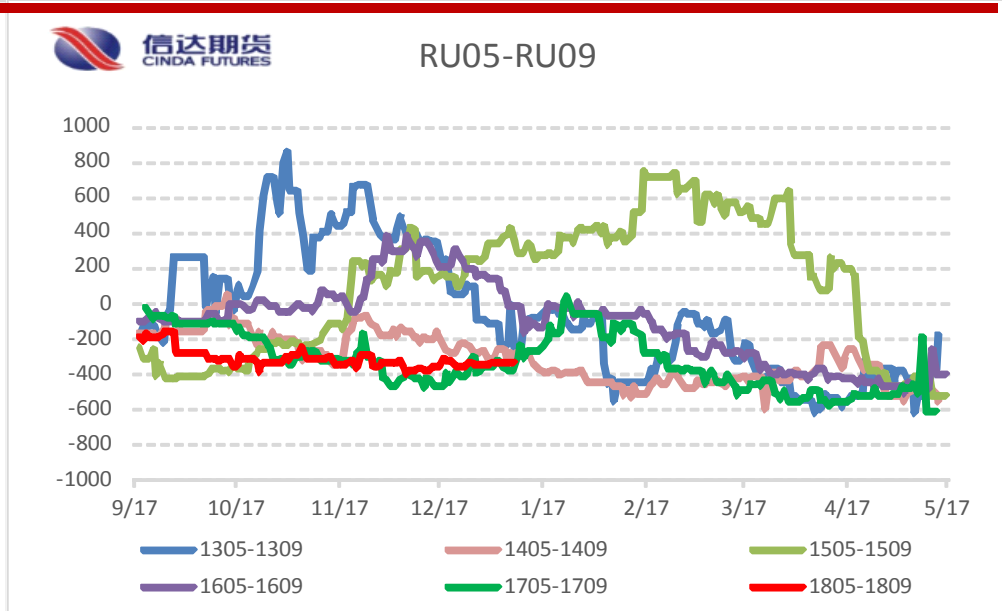

信达期货 CINDA FUTURES
PP05-PP09
1000
800
600
400
200
0
-200
-400
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
1505-1509
1605-1609
1705-1709
1805-1809

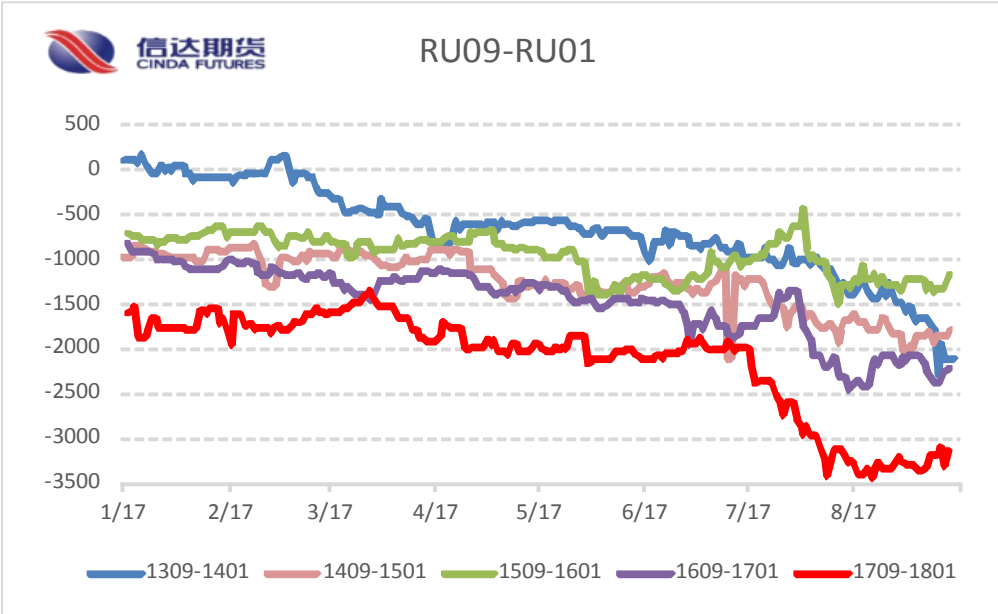

信达期货 CINDA FUTURES
PP09-PP01
1800
1500
1200
900
600
300
0
-300
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
6/17
7/17
8/17
1509-1601
1609-1701
1709-1801

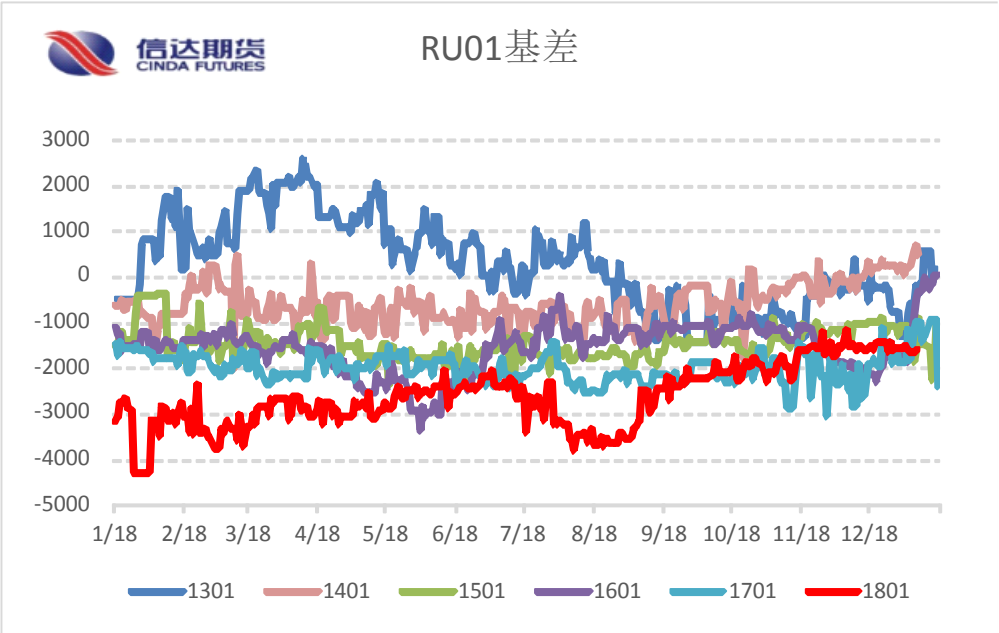

信达期货 CINDA FUTURES
PP01基差
2000
1600
1200
800
400
0
-400
-800
-1200
1/18
2/18
3/18
4/18
5/18
6/18
7/18
8/18
9/18
10/18
11/18
12/18
1501
1601
1701
1801

跨期套利跟踪：橡胶

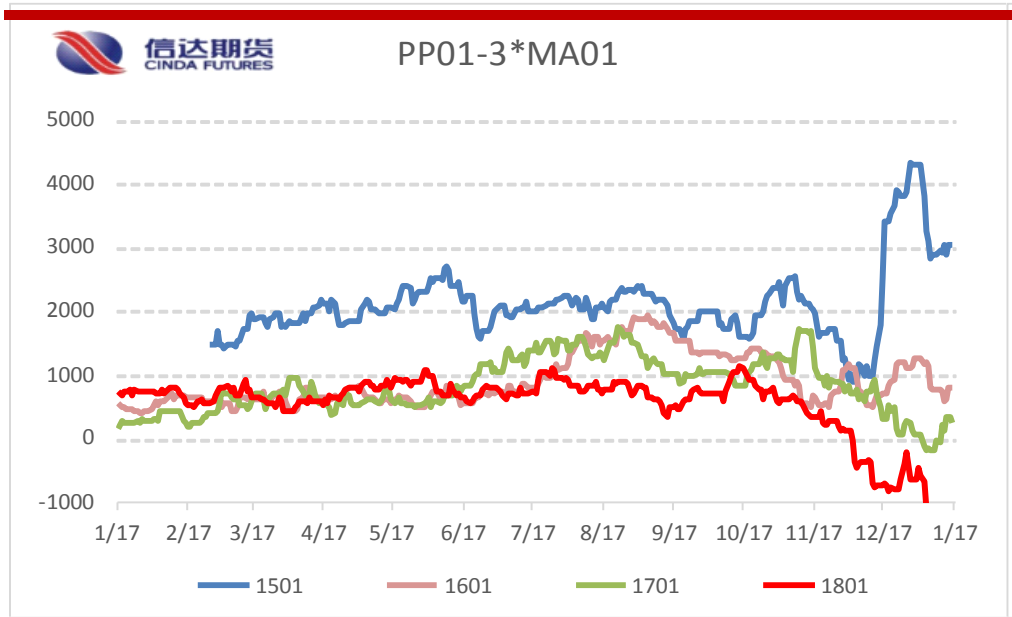

信达期货 CINDA FUTURES
RU01-RU05
2000
1500
1000
500
0
-500
-1000
5/17
6/17
7/17
8/17
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
1401-1405
1501-1505
1601-1605
1701-1705
1801-1805

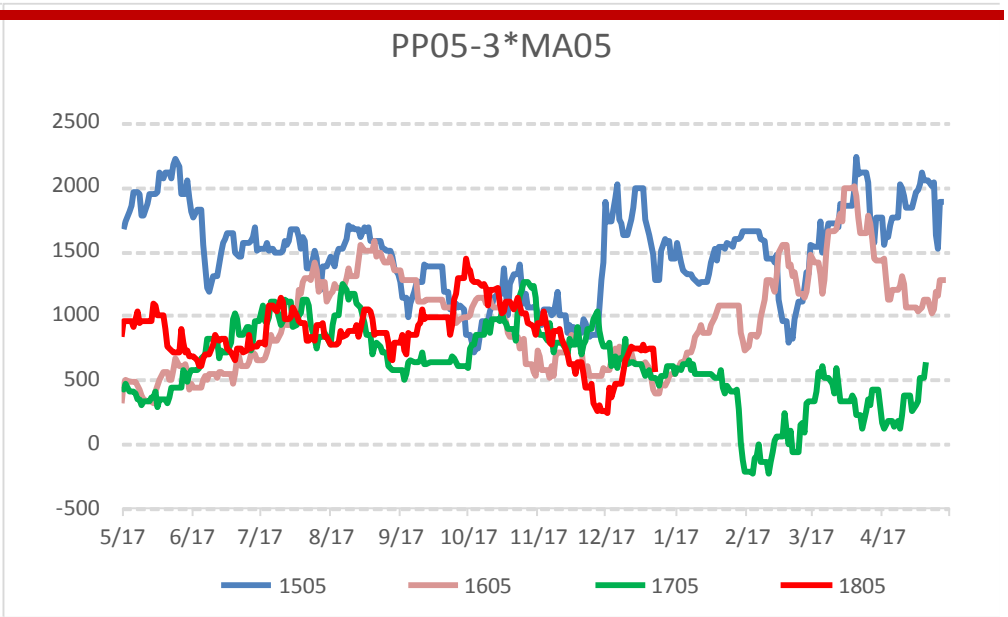

信达期货 CINDA FUTURES
RU05-RU09
1000
800
600
400
200
0
-200
-400
-600
-800
-1000
9/17
10/17
11/17
12/17
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
1305-1309
1405-1409
1505-1509
1605-1609
1705-1709
1805-1809

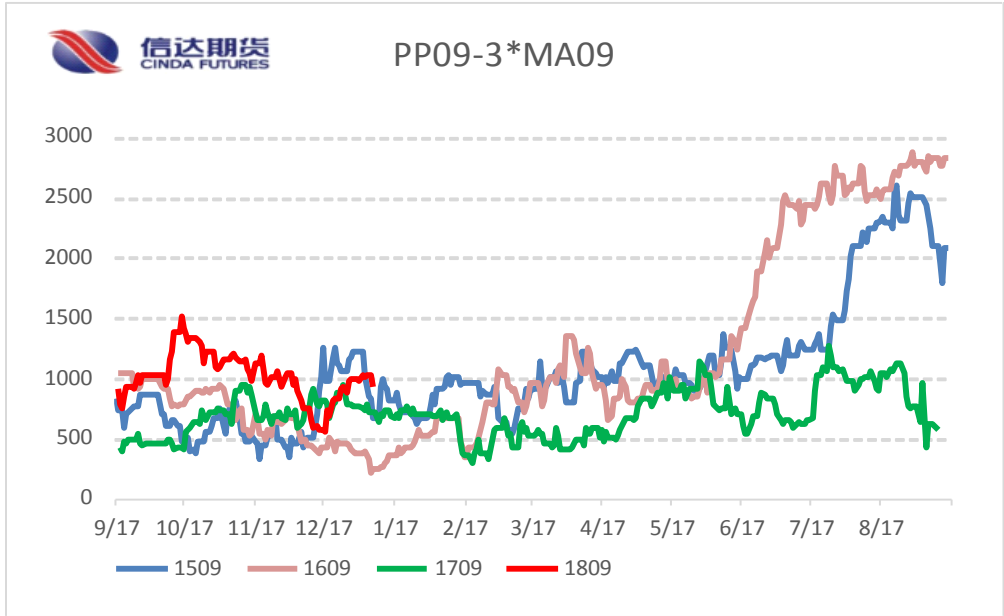

信达期货 CINDA FUTURES
RU09-RU01
500
0
-500
-1000
-1500
-2000
-2500
-3000
-3500
1/17
2/17
3/17
4/17
5/17
6/17
7/17
8/17
1309-1401
1409-1501
1509-1601
1609-1701
1709-1801

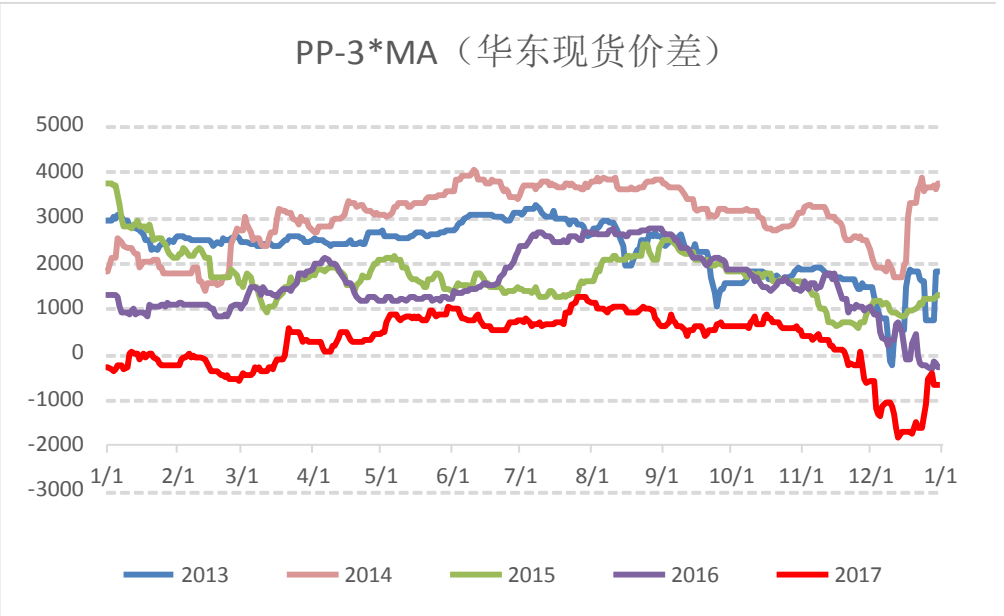

信达期货 CINDA FUTURES
RU01基差
3000
2000
1000
0
-1000
-2000
-3000
-4000
-5000
1/18
2/18
3/18
4/18
5/18
6/18
7/18
8/18
9/18
10/18
11/18
12/18
1301
1401
1501
1601
1701
1801

跨品种套利跟踪：PP-3*MA

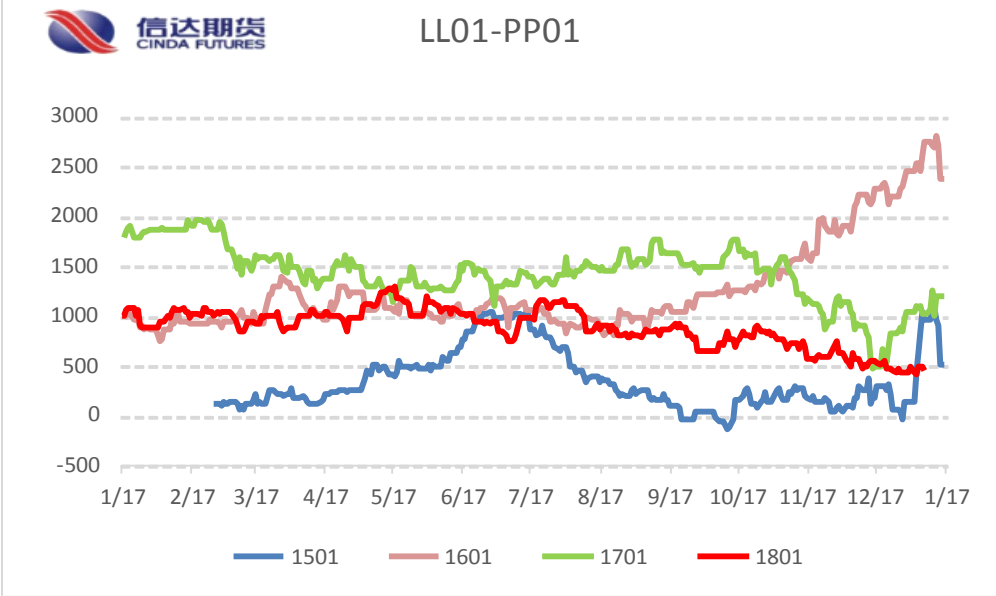


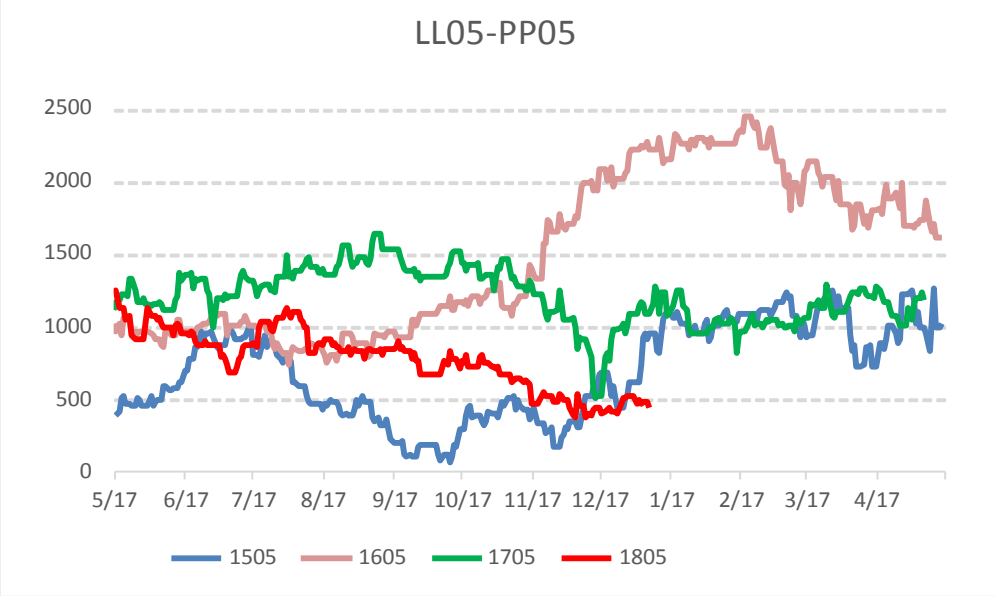


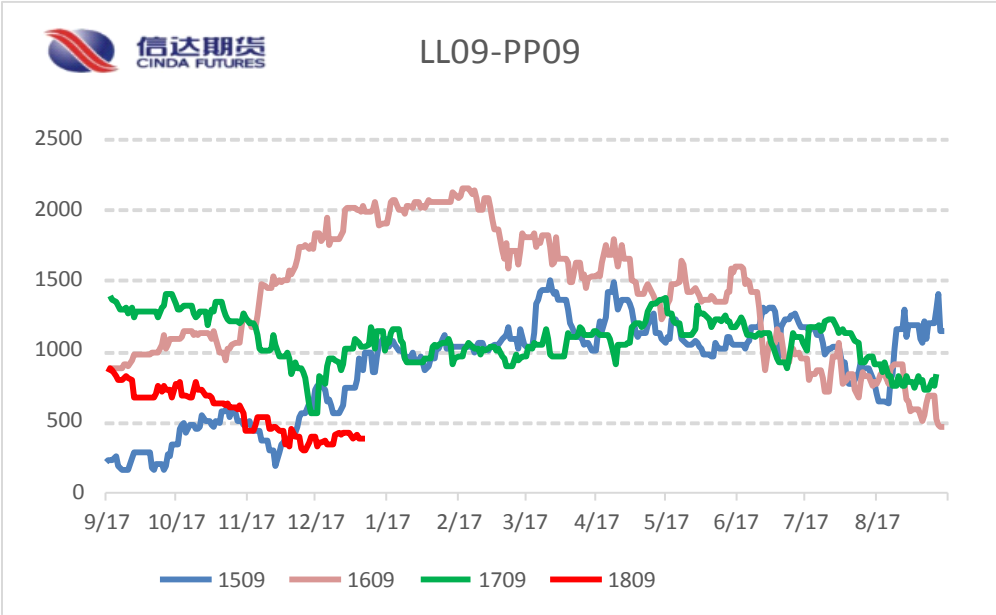


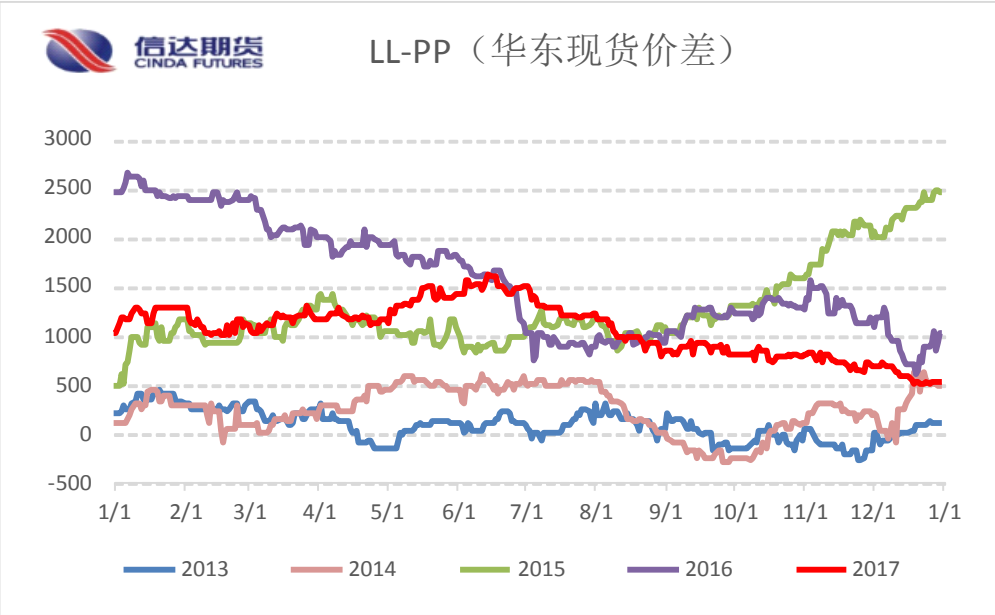


跨品种套利跟踪：LL-PP









公司简介

信达期货有限公司是专营国内期货经纪业务的有限责任公司，系经中国证券监督管理委员会批准成立，核发《期货经纪业务许可证》，浙江省工商行政管理局核准登记注册（注册号 330000000014832），由信达证券股份有限公司全资控股，注册资本 5 亿元人民币，是国内规范化、信誉高的大型期货经纪公司之一。公司全新改版后的新网站 www.cindaqh.com 将以更快捷、更丰富的信息竭诚为您的交易提供最优的服务。

公司总部设在杭州，下设浙江金华分公司、北京营业部、上海营业部、沈阳营业部、哈尔滨营业部、大连营业部、石家庄营业部、广州营业部、深圳营业部、浙江乐清营业部、浙江富阳营业部、浙江台州营业部、浙江义乌营业部、浙江温州营业部、浙江宁波营业部、浙江绍兴营业部、浙江临安营业部 17 家分支机构，公司将以合理的地域布局和快捷的网络系统竭诚为各地期货投资者服务。

雄厚金融央企背景

信达证券股份有限公司是于 2007 年 9 月成立的国内 AMC 系第一家证券公司，法定代表人张志刚。公司具有中国证监会核准的综合类证券业务资格，现注册资本为 25.687 亿元人民币，拥有 81 家营业部，2 家分公司，全资控股信达期货有限公司。

信达证券的主要出资人及控股股东是中国信达资产管理股份有限公司。中国信达资产管理股份有限公司的前身是中国信达资产管理公司，成立于 1999 年 4 月 19 日，是经国务院批准，为化解金融风险，支持国企改革，由财政部独家出资 100 亿元注册成立的第一家金融资产管理公司。2010 年 6 月，在大型金融资产管理公司中，中国信达率先进行股份制改造，2012 年 4 月，首家引进战略投资者，注册资本 365.57 亿元人民币。2013 年 12 月 12 日，中国信达在香港联交所主板挂牌上市，成为首家登陆国际资本市场的中国金融资产管理公司。

全国分支机构

●金华分公司　浙江省金华市中山路 331 号海洋大厦 8 楼 801-810　（咨询电话：0579-82328735）

●台州分公司　台州市路桥区银安街 679 号耀江广场商务楼 501-510 室　（咨询电话：0576-82921160）

●北京营业部　北京市朝阳区和平街东土城路 12 号院 3 号楼怡和阳光大厦 C 座 1606 室　（咨询电话：010-64101771）

●上海营业部　上海市静安区北京西路 1399 号信达大厦 11 楼 E 座　（咨询电话：021-50819373）

●广州营业部　广州市天河区体育西路 189 号 20A2　（咨询电话：020-28862306）

●沈阳营业部　沈阳市皇姑区黑龙江街 25 号 4 层　（咨询电话：024-31061919）

●哈尔滨营业部 黑龙江省哈尔滨市南岗区长江路 157 号盟科汇 A 座 503 室　（咨询电话：0451-87222486）

●石家庄营业部 河北省石家庄市平安南大街 30 号万隆大厦 5 层 （咨询电话：0311-89691998）

●大连营业部　辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 2408 房间
（咨询电话：0411-84807776）

●乐清营业部　温州市乐清市双雁路 432 号七楼　（咨询电话：0577-27857766）

●富阳营业部　浙江省杭州市富阳区富春街道江滨西大道 57 号 1002 室　（咨询电话：0571-23255888）

●义乌营业部　浙江省义乌市宾王路 158 号 6 楼　（咨询电话：0579-85400021）

●温州营业部　浙江省温州市鹿城区车站大道京龙大厦 1 幢十一层 1 号　（咨询电话：0577-88881881）

●宁波营业部　宁波市江东区姚隘路 792 号东城国际 212-217 室　（咨询电话：0574-28839998）

●绍兴营业部　绍兴市凤林西路 300 号环宇大厦 1402、1403　（咨询电话：0575-88122652）

●临安营业部　浙江省临安市钱王大街 392 号钱王商务大厦 8 楼　（咨询电话：0571-63708006）

●深圳营业部　深圳市福田区福田街道深南大道 4001 号时代金融中心 4 楼 402-2　（咨询电话：0755-83739096）

重要声明

报告中的信息均来源于公开可获得的资料，信达期货有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。

本报告不构成个人投资建议，也没有考虑到个别客户特殊的投资目标、财政状况或需要。

客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定情况。未经信达期货有限公司授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播本报告的行为均可能承担法律责任。

期市有风险，入市需谨慎。