



黑色套利跟踪 2018/10/11

联系人：盛佳峰

联系人：张鹏程

投资咨询号：Z0013489

执业资格证号：F3034110

电话：0571-28132639

电话：0571-28132639

邮箱：525108901@qq.com

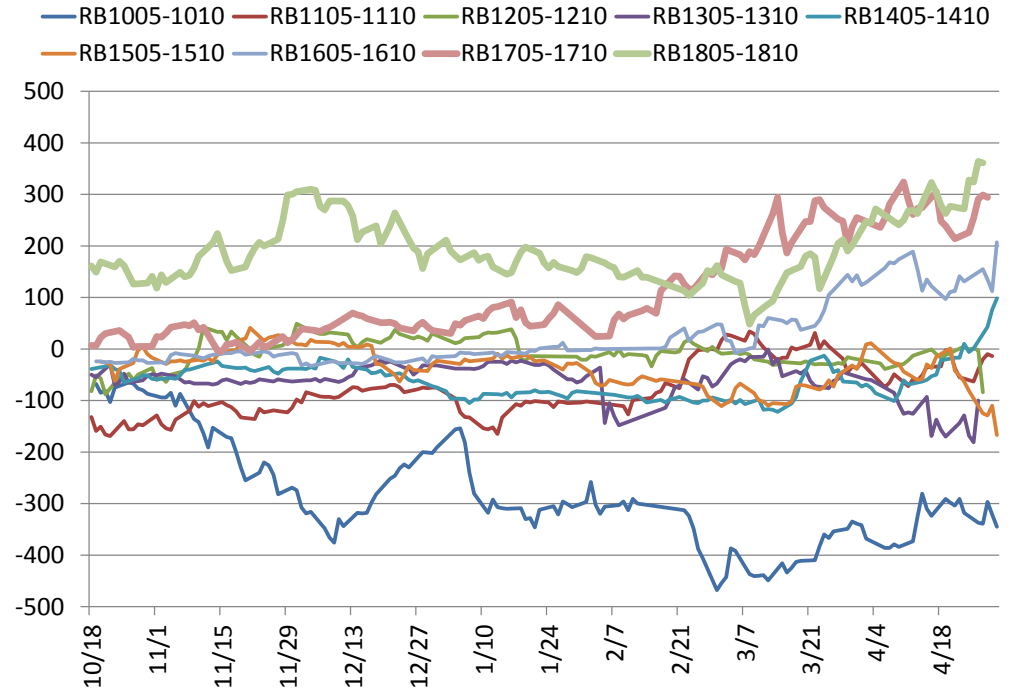
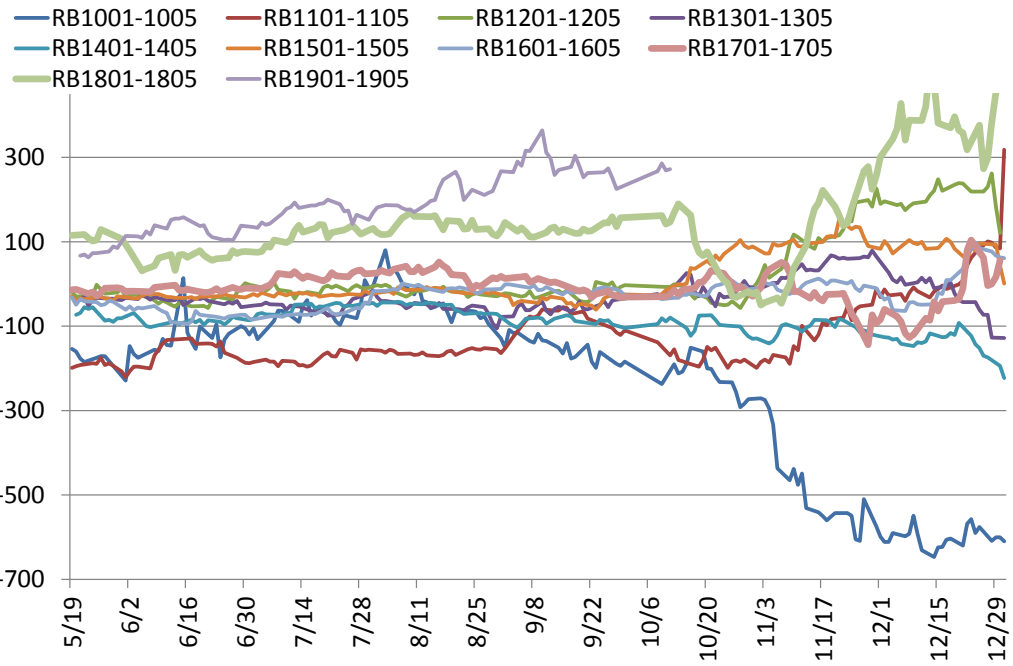
邮箱：3120376565@qq.com

| 策略类型 | | 策略组合 | 配比 | 昨日收盘 | 今日收盘 | 历史区间 | 操作建议 |
|------|---------------|---------------|-------|--------|----------------|-----------------|------------------------------|
| 跨期 | RB | RB1901-RB1905 | 1:1 | 269 | 272 | [-647, 604] | 观望 |
| | | RB1905-RB1810 | 1:1 | -969 | -896 | [-468, 817] | 观望 |
| | | RB1810-RB1901 | 1:1 | 700 | 624 | [-405, 623] | 正套减持 |
| | HC | HC1901-HC1905 | 1:1 | 194 | 194 | [-425, 347] | 观望 |
| | | HC1905-HC1810 | 1:1 | -555 | -550 | [-186, 454] | 观望 |
| | | HC1810-HC1901 | 1:1 | 361 | 356 | [-116, 410] | 正套减持 |
| | I | I1901-I1905 | 1:1 | 2.5 | 3.0 | [-70, 130.5] | 观望 |
| | | I1905-I1809 | 1:1 | -2.5 | -1.5 | [-24.5, 125] | 观望 |
| | | I1809-I1901 | 1:1 | 0.0 | -1.5 | [-32, 86.5] | 观望 |
| | J | J1901-J1905 | 1:1 | 141.5 | -1.5 | [-265, 702] | 观望 |
| | | J1905-J1809 | 1:1 | 74.5 | 72.5 | [-199, 487.5] | 观望 |
| | | J1809-J1901 | 1:1 | -216.0 | -223.5 | [-228, 267.5] | 观望 |
| | JM | JM1901-JM1905 | 1:1 | 79.5 | 88.5 | [-89, 443] | 观望 |
| | | JM1905-JM1809 | 1:1 | -79.0 | -82.5 | [-168.5, 323.5] | 观望 |
| | | JM1809-JM1901 | 1:1 | -0.5 | -6.0 | [-288.5, 122] | 观望 |
| ZC | ZC1901-ZC1905 | 1:1 | 42.6 | 40.2 | [-21, 122.2] | 观望 | |
| | ZC1905-ZC1809 | 1:1 | 16.2 | 15.8 | [-39.2, 107] | 观望 | |
| | ZC1809-ZC1901 | 1:1 | -58.8 | -56.0 | [-121.8, 51.4] | 观望 | |
| 跨品种 | 卷螺价差 | HC1901-RB1901 | 1:1 | -116 | -147 | [-32, 636] | 01卷螺价差持有（成本-73，止损-140，目标100） |
| | | HC1905-RB1905 | 1:1 | -41 | -69 | [-214, 447] | 观望 |
| | | HC1810-RB1810 | 1:1 | -455 | -415 | [-172, 548] | 观望 |
| | | 现货HC-RB | | -390 | -390 | [-580, 660] | - |
| | 螺矿比 | RB1901/I1901 | 2:1 | 7.8738 | 7.9296 | [4.24, 7.74] | 做多的01螺矿比到达8，止损 |
| | | RB1905/I1905 | 2:1 | 7.3873 | 7.4415 | [3.73, 7.80] | 观望 |
| | | RB1810/I1809 | 2:1 | 9.2330 | 9.1765 | [3.86, 7.45] | 观望 |
| | | 现货RB/I | | #N/A | #N/A | [3.33, 8.02] | - |
| | 煤焦比 | J1901/JM1901 | 2:5 | 1.8031 | 1.7966 | [1.10, 1.73] | 观望 |
| | | J1905/JM1905 | 2:5 | 1.8045 | 1.8028 | [1.13, 1.71] | 观望 |
| | | J1809/JM1809 | 2:5 | 1.6453 | 1.6402 | [1.16, 1.91] | 观望 |
| | | | | | | | |

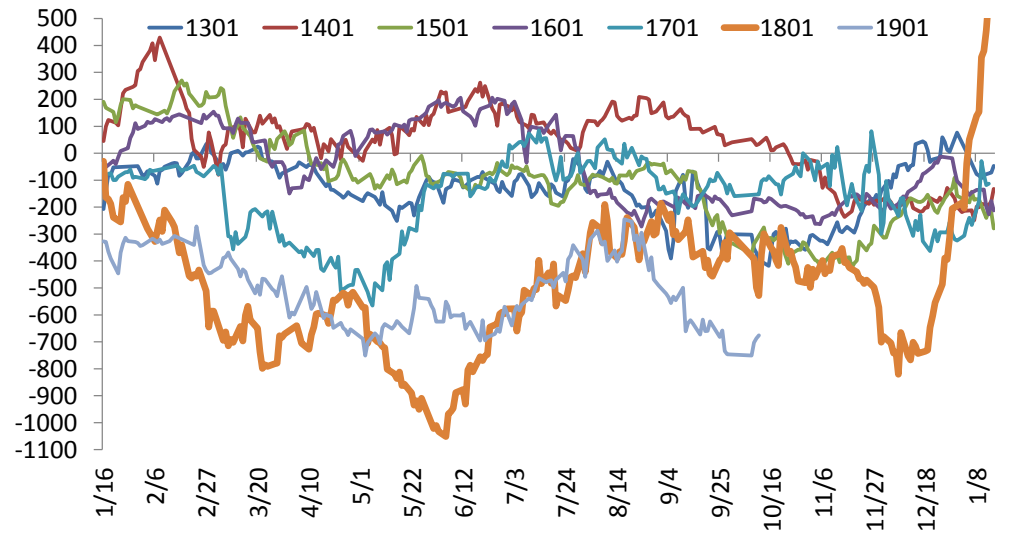
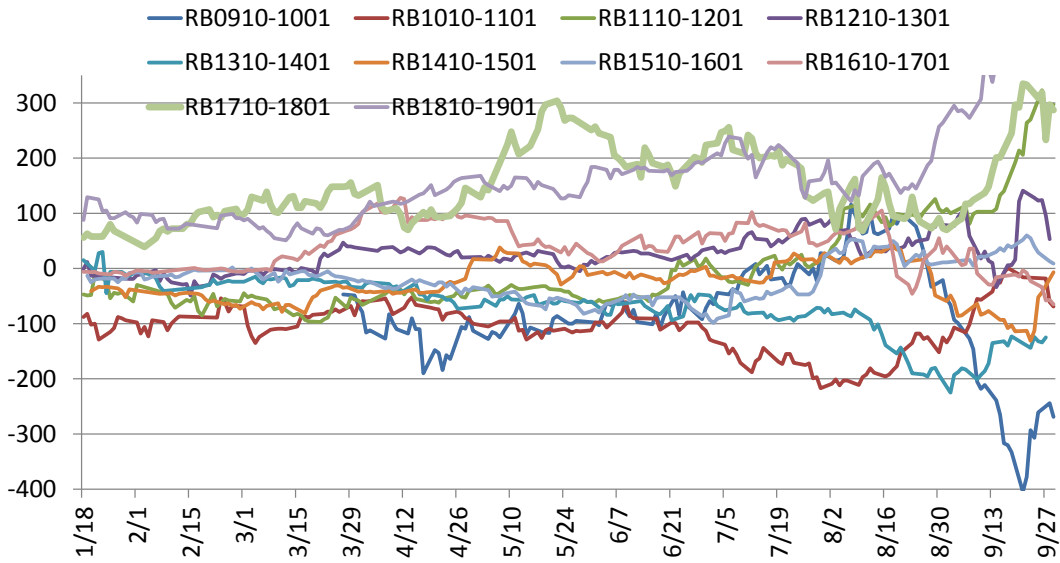
黑色基差跟踪

| | | 期货实时 | 现货当日 | 期现价差 | 偏离幅度 |
|-------|------------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 螺纹期现 | RB1901-现货 | 4056.0 | 4732.0 | -676.0 | -14.28% |
| | RB1905-现货 | 3784.0 | 4732.0 | -948.0 | -20.03% |
| | RB1810-现货 | 4680.0 | 4732.0 | -52.0 | -1.10% |
| 热轧期现 | HC1901-现货 | 3909.0 | 4200.0 | -291.0 | -6.93% |
| | HC1905-现货 | 3715.0 | 4200.0 | -485.0 | -11.55% |
| | HC1810-现货 | 4265.0 | 4200.0 | 65.0 | 1.55% |
| 铁矿期现 | I1901-现货 | 511.5 | 583.6 | -72.1 | -12.35% |
| | I1905-现货 | 508.5 | 583.6 | -75.1 | -12.87% |
| | I1809-现货 | 510.0 | 583.6 | -73.6 | -12.61% |
| 焦炭期现 | J1901-现货 | 2455.0 | 2600.0 | -145.0 | -5.58% |
| | J1905-现货 | 2,304.0 | 2600.0 | -296.0 | -11.38% |
| | J1809-现货 | 2,231.5 | 2600.0 | -368.5 | -14.17% |
| 焦煤期现 | JM1901-现货 | 1366.5 | 1400.0 | -33.5 | -2.39% |
| | JM1905-现货 | 1,278.0 | 1400.0 | -122.0 | -8.71% |
| | JM1809-现货 | 1,360.5 | 1400.0 | -39.5 | -2.82% |
| 动力煤期现 | ZC1901-现货 | 660.0 | 647.0 | 13.0 | 2.01% |
| | ZC1905-现货 | 619.8 | 647.0 | -27.2 | -4.20% |
| | ZC1809-现货 | 604.0 | 647.0 | -43.0 | -6.65% |

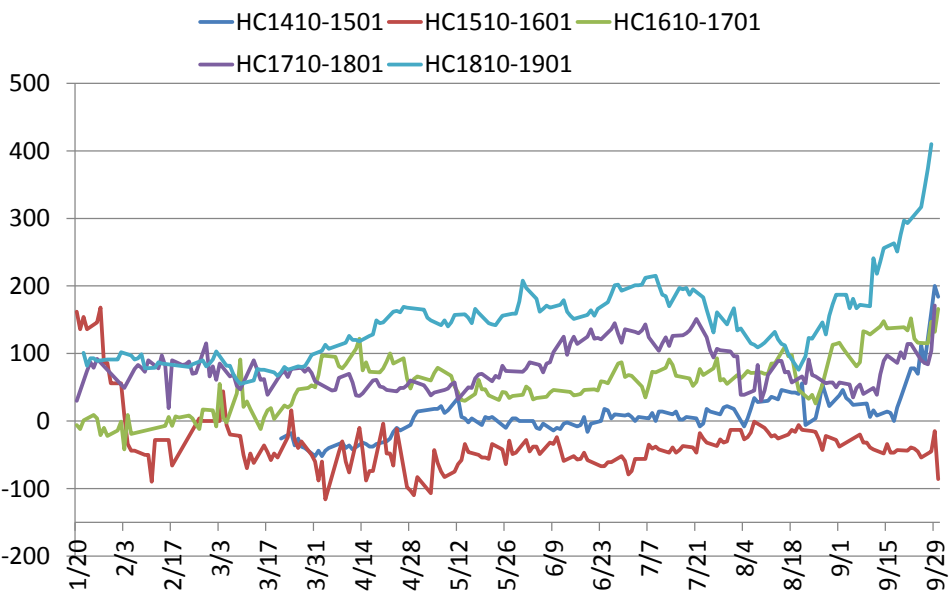
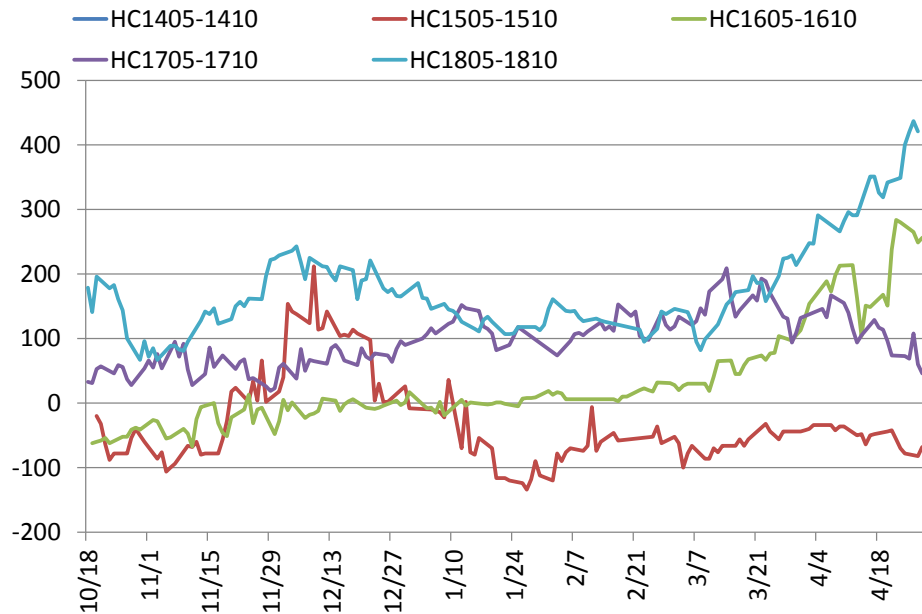
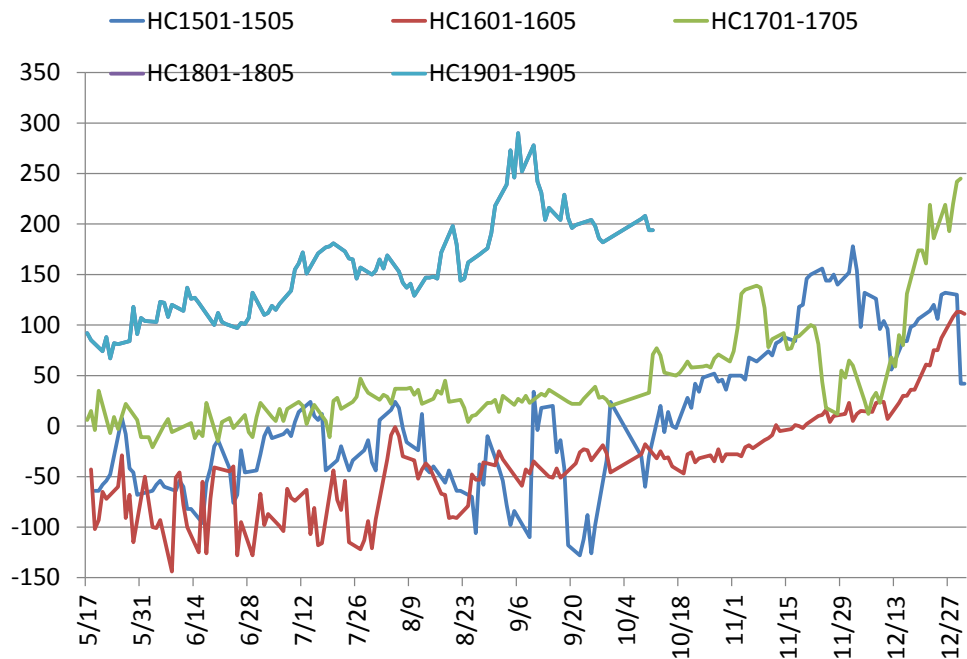
跨期套利跟踪：螺纹钢



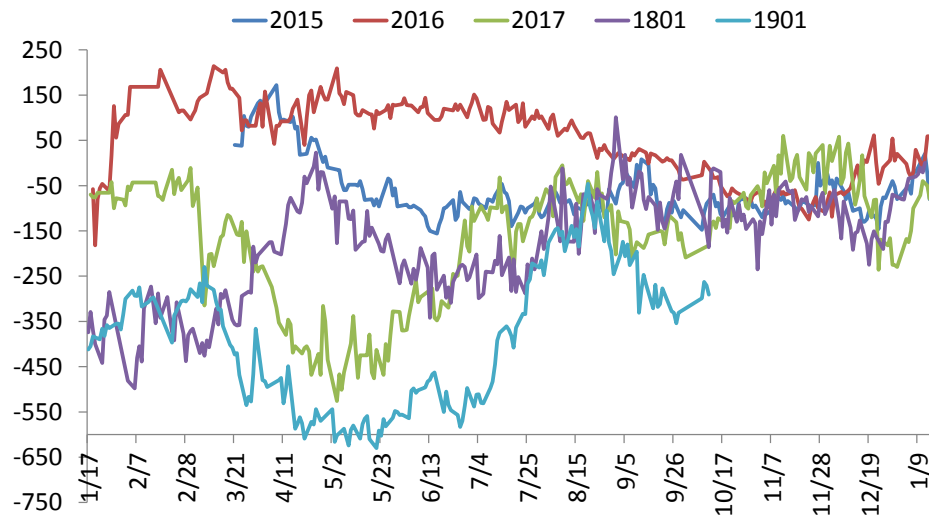
RB01期现价差



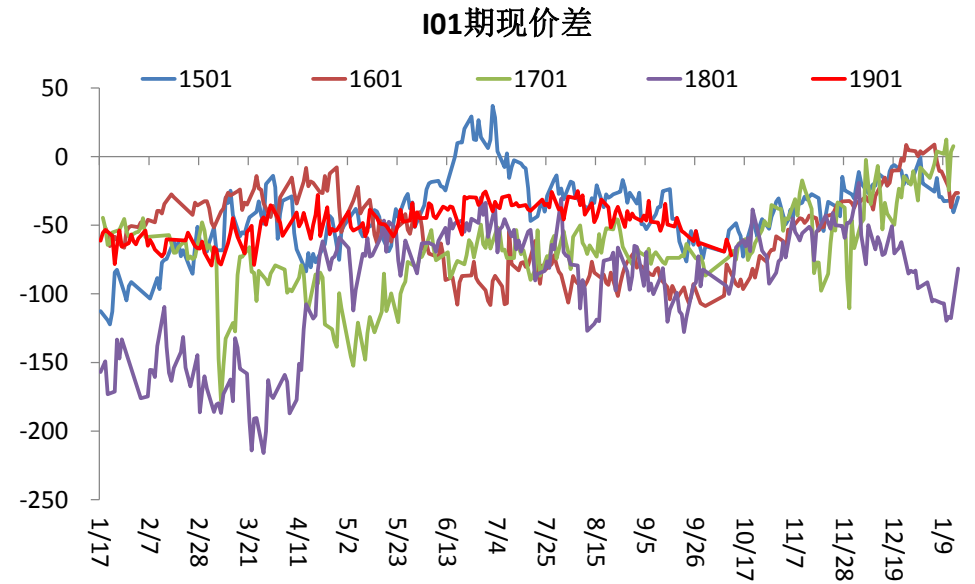
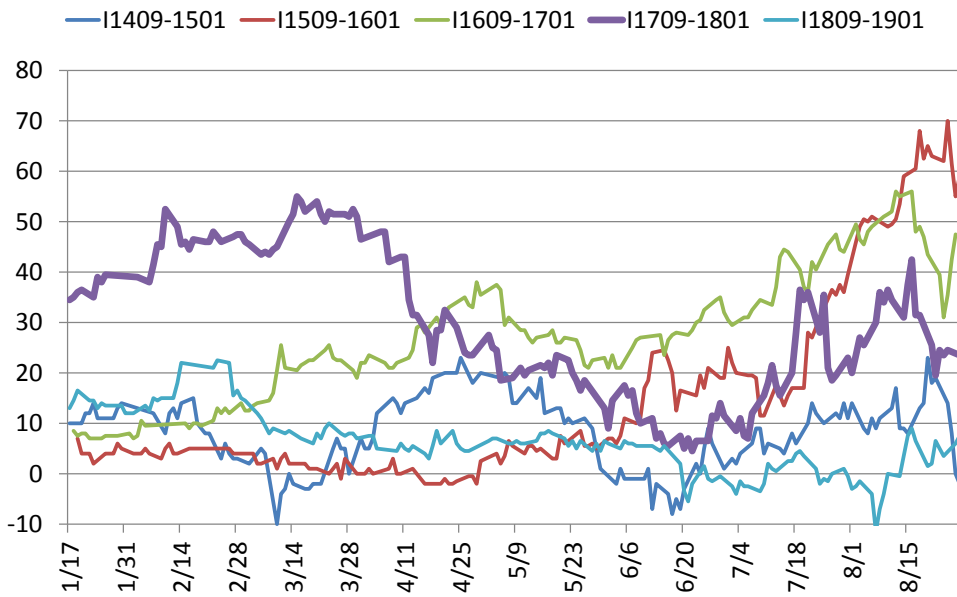
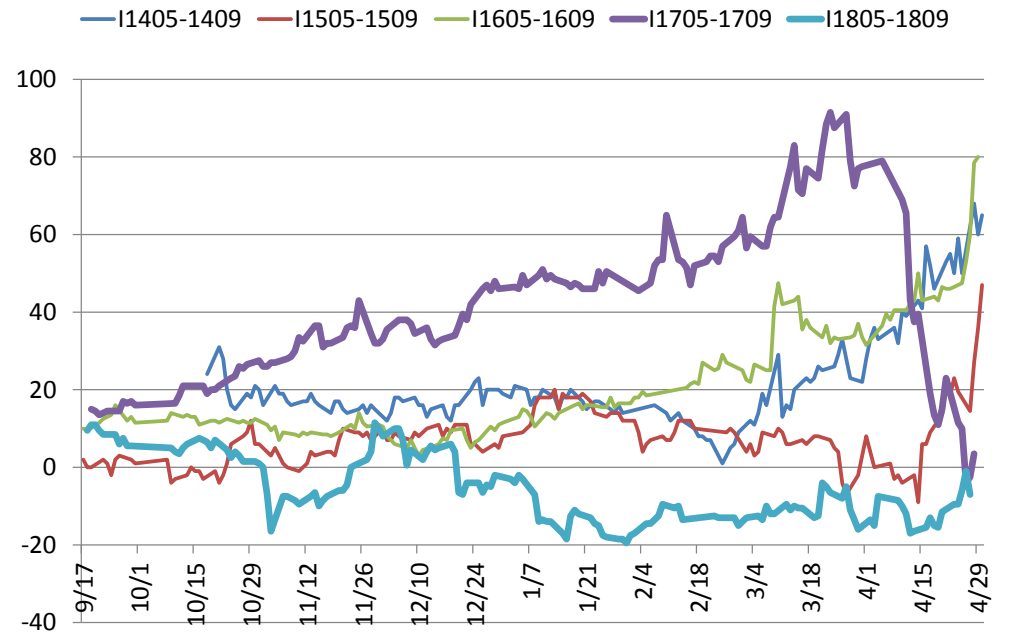
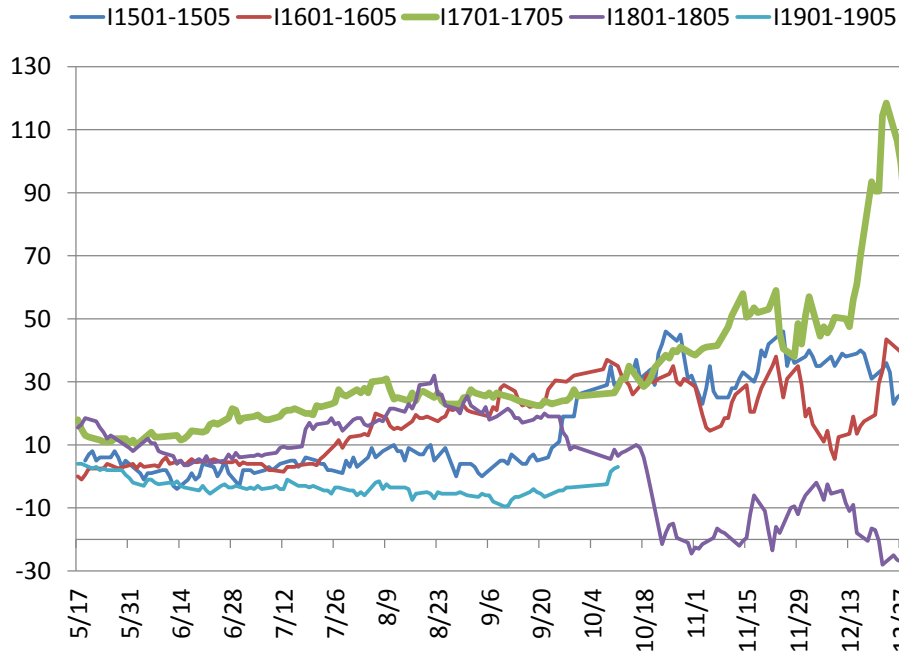
跨期套利跟踪：热卷



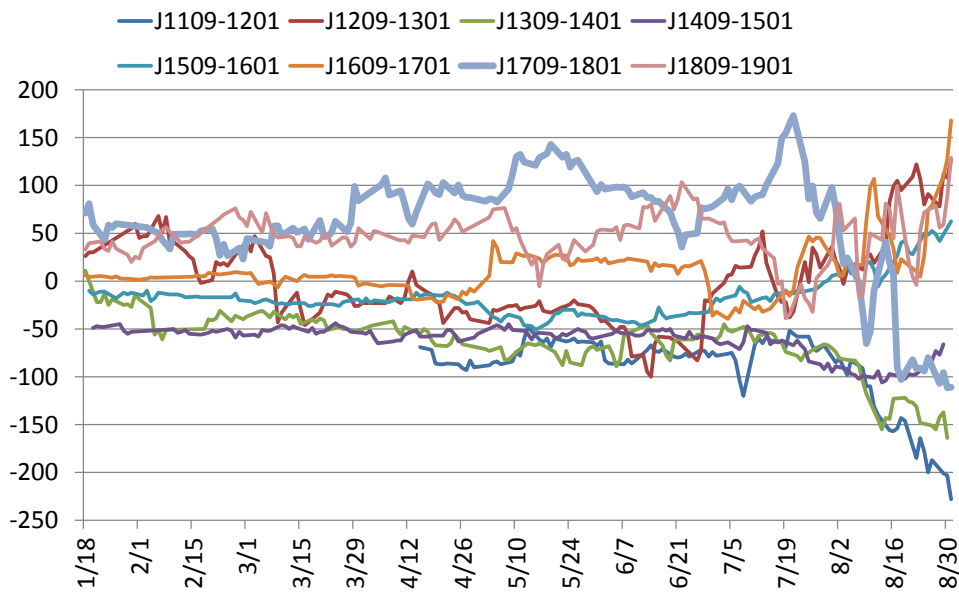
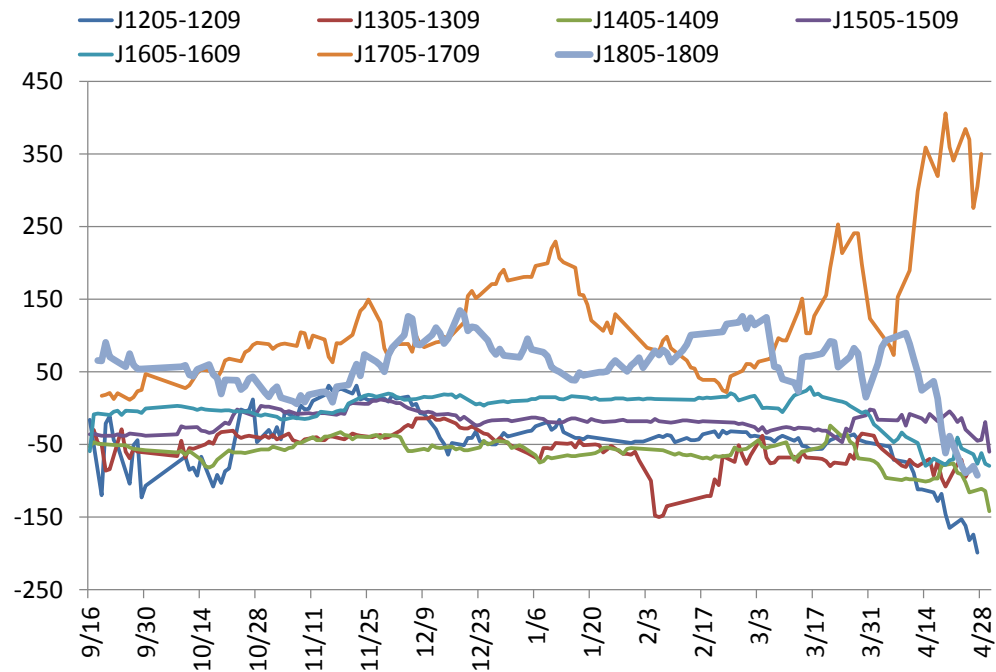
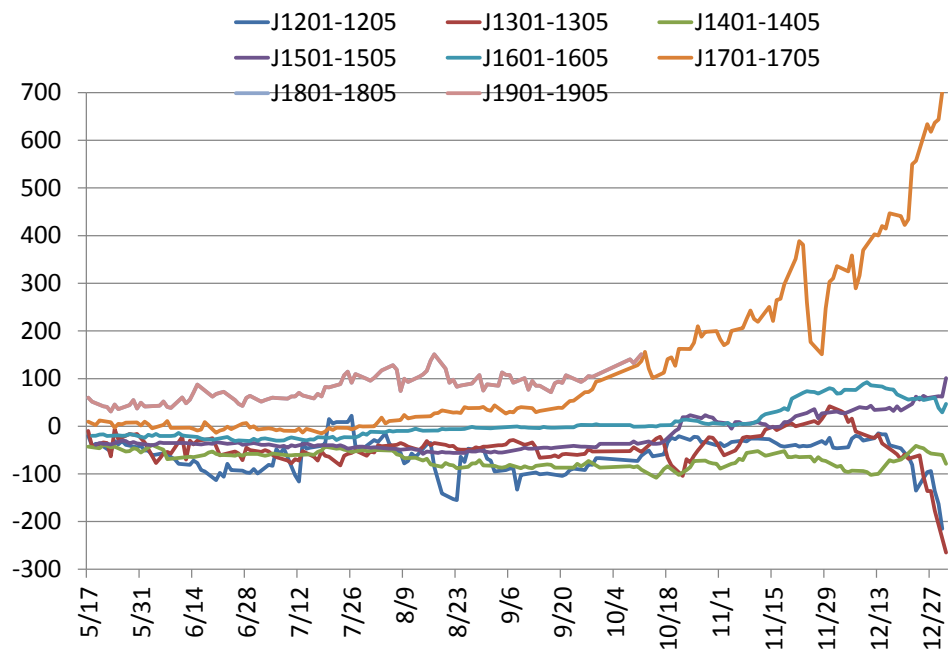
HC01期现价差



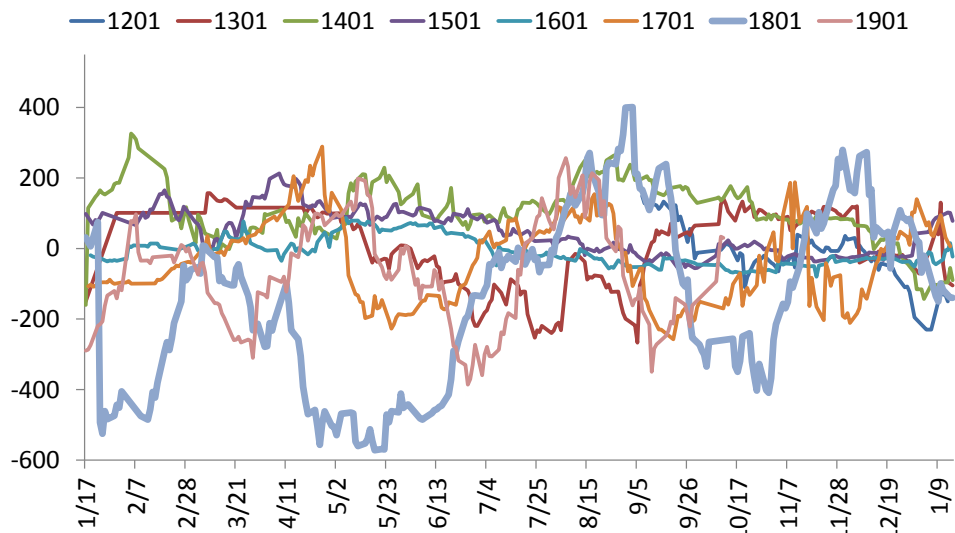
跨期套利跟踪：铁矿石



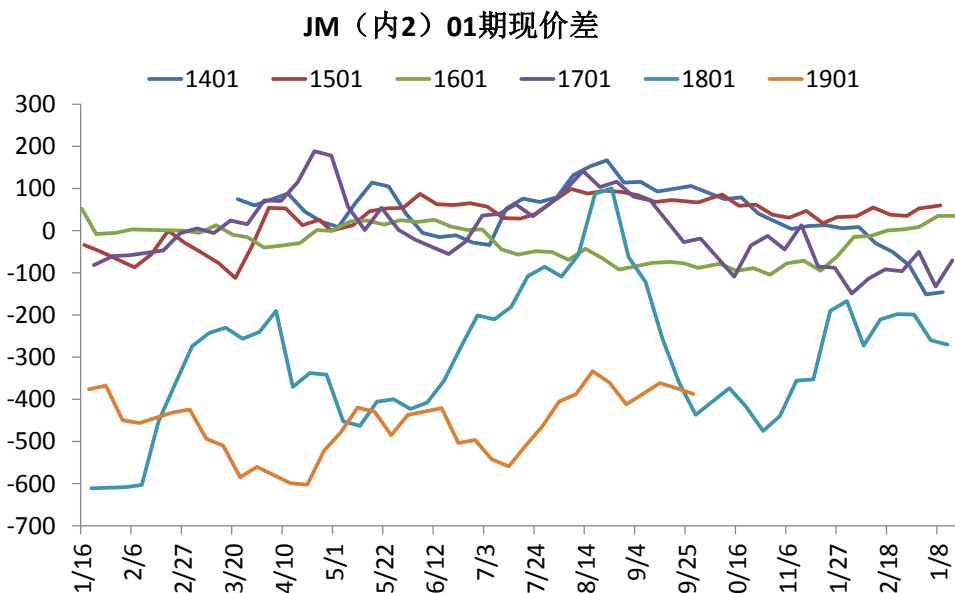
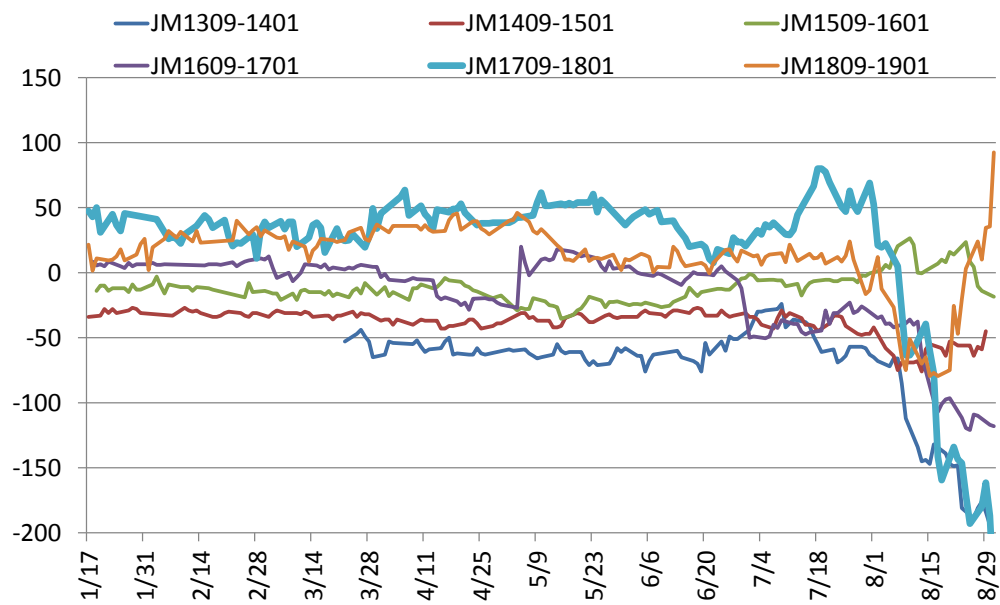
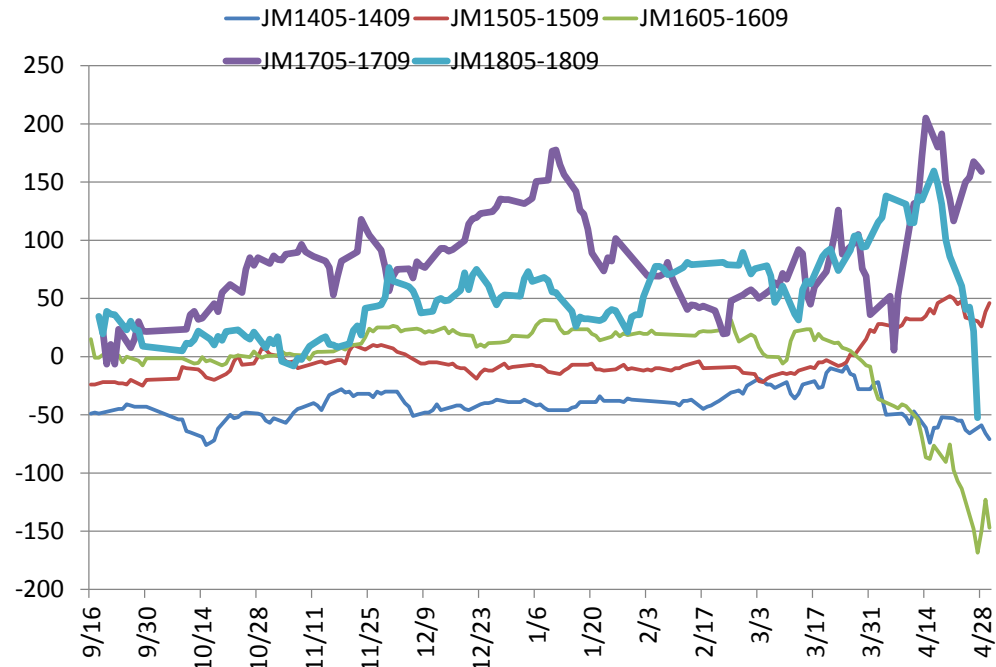
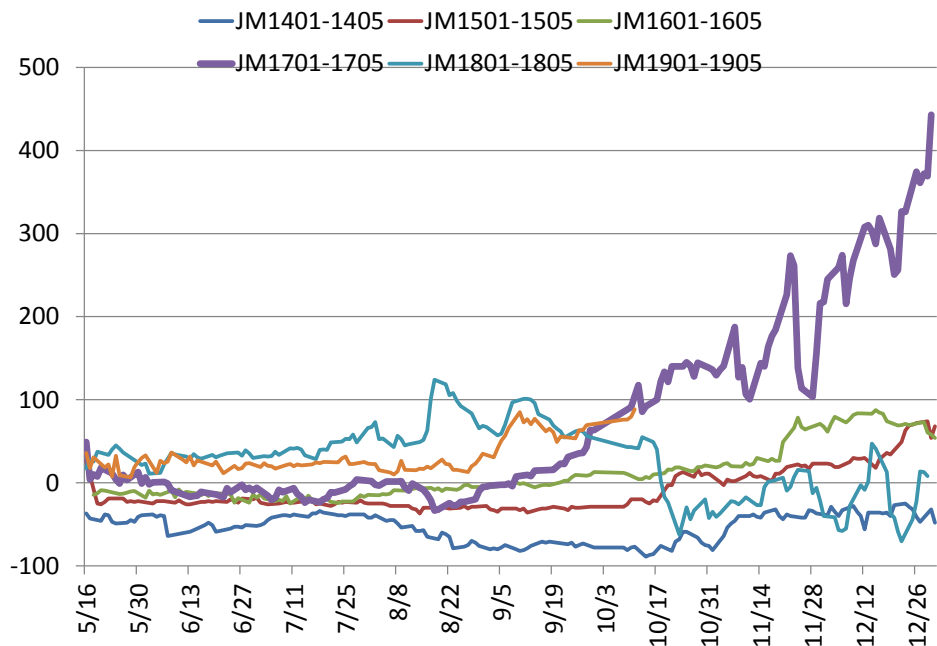
跨期套利跟踪：焦炭



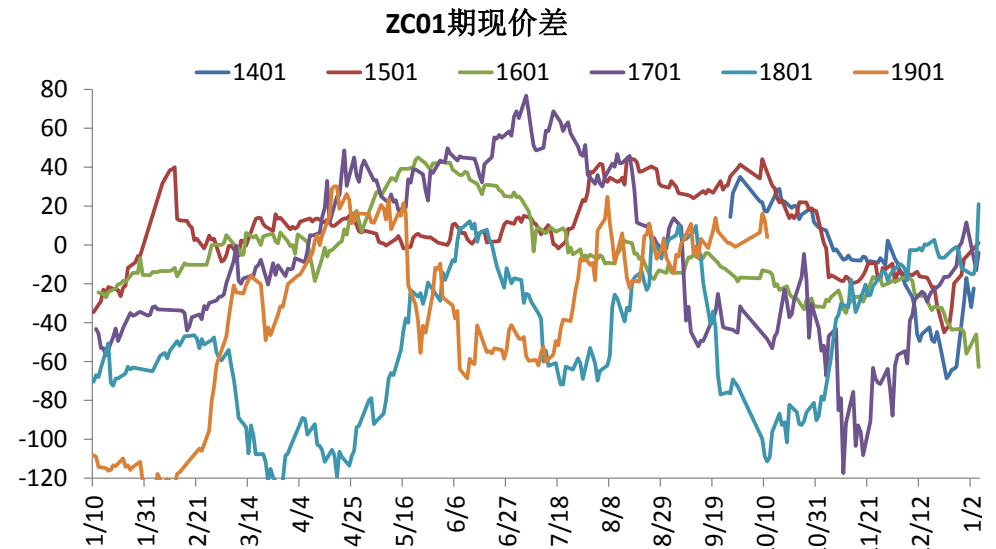
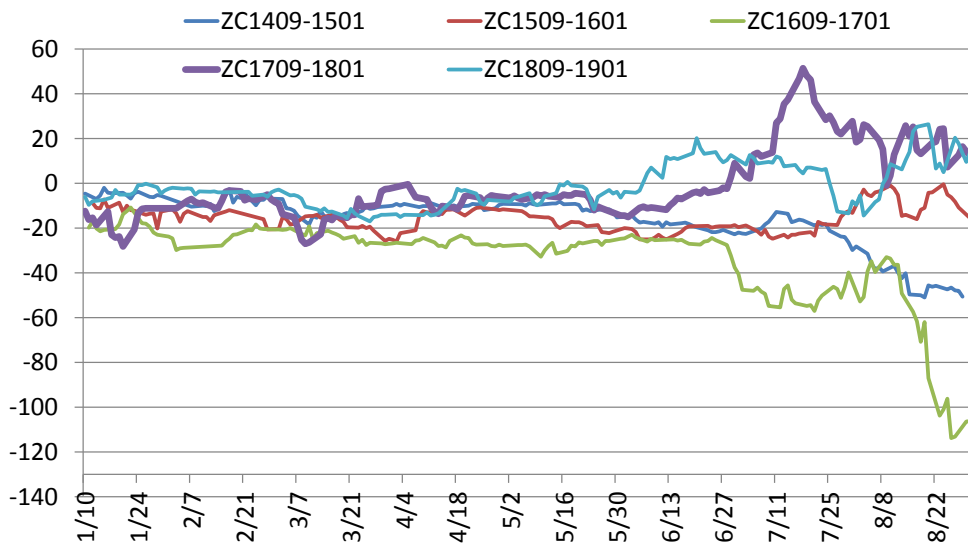
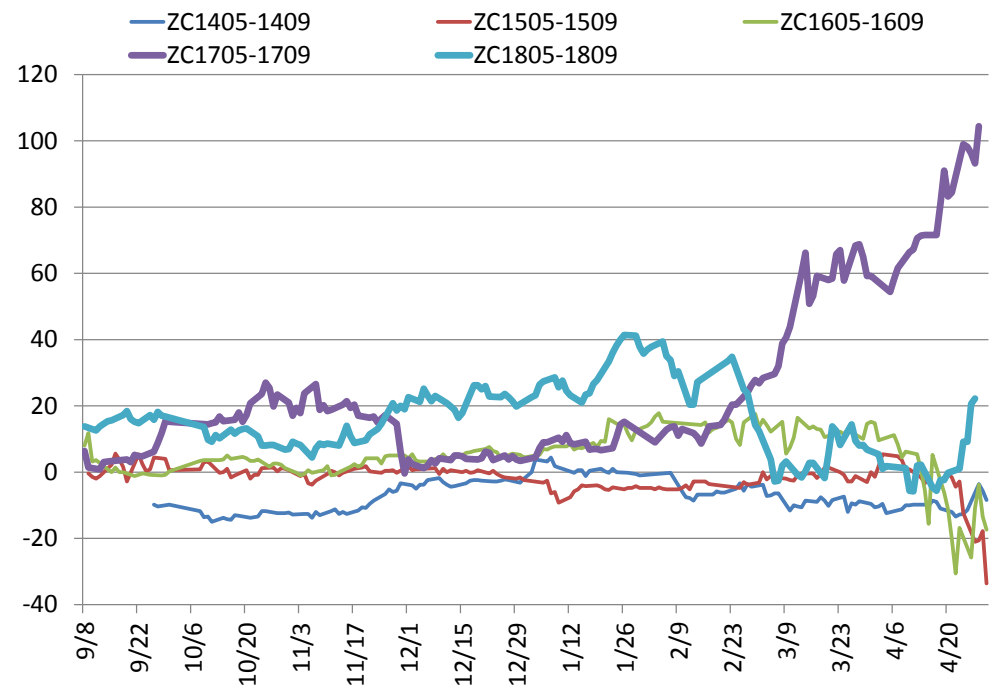
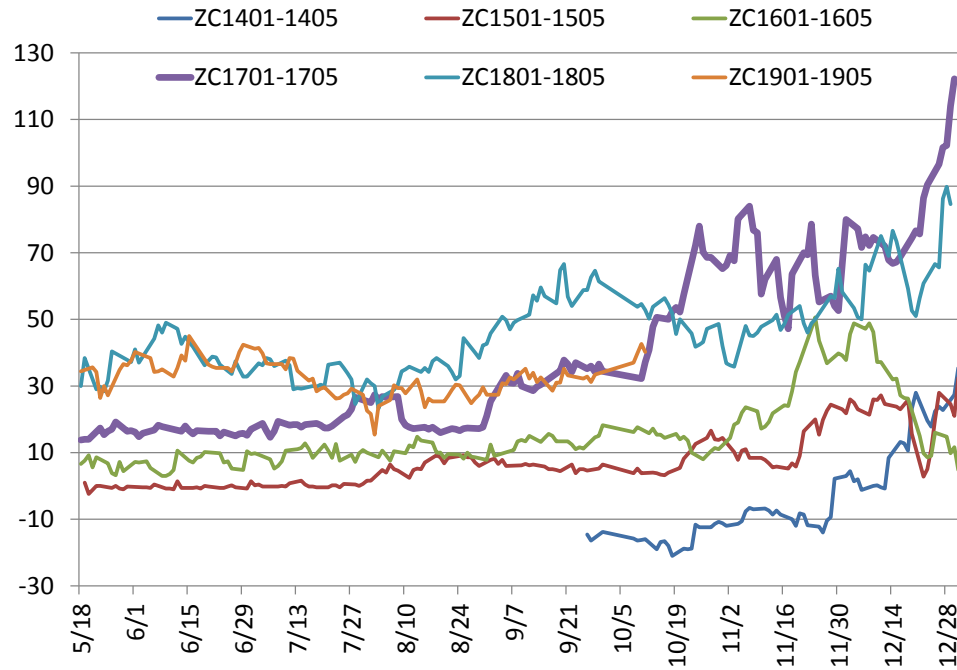
J01期现价差



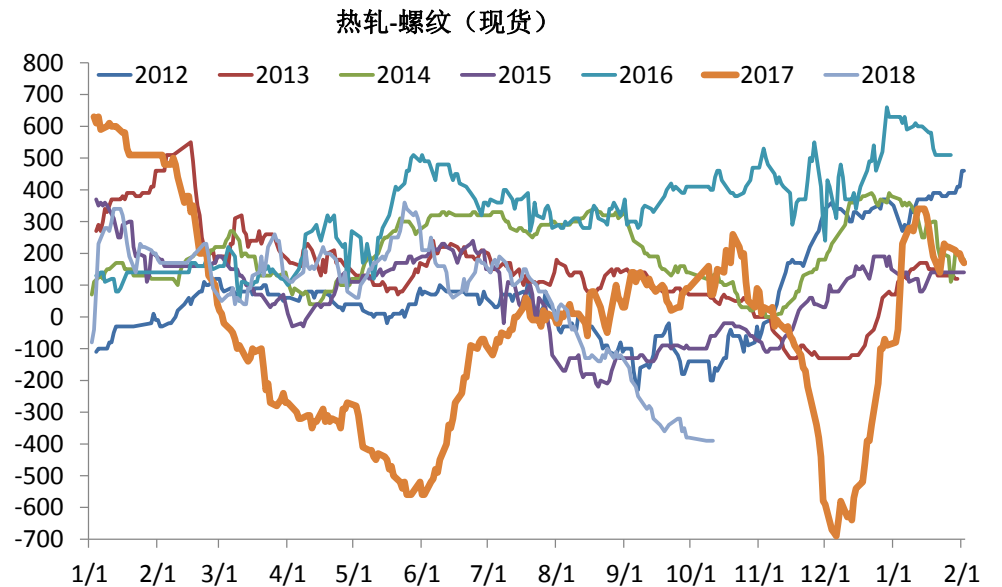
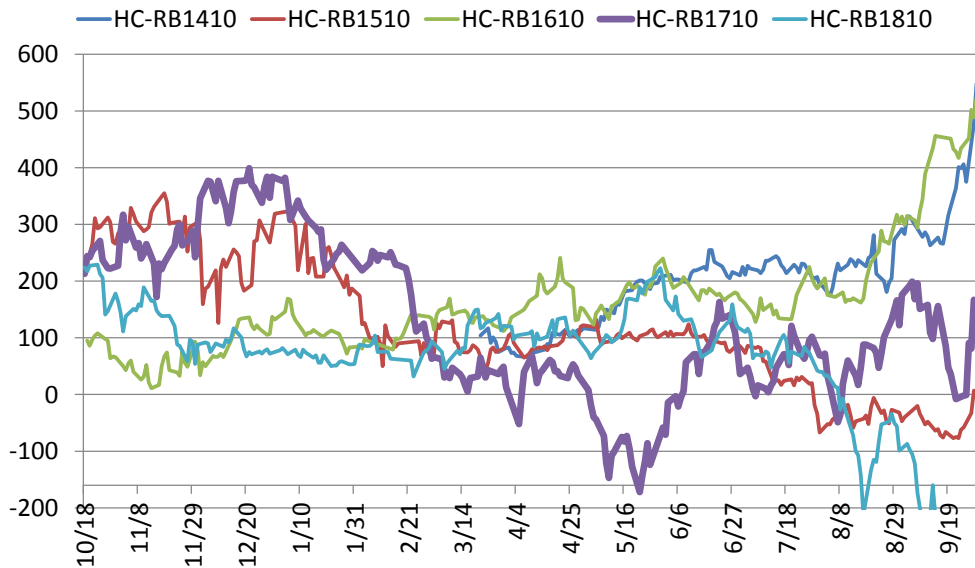
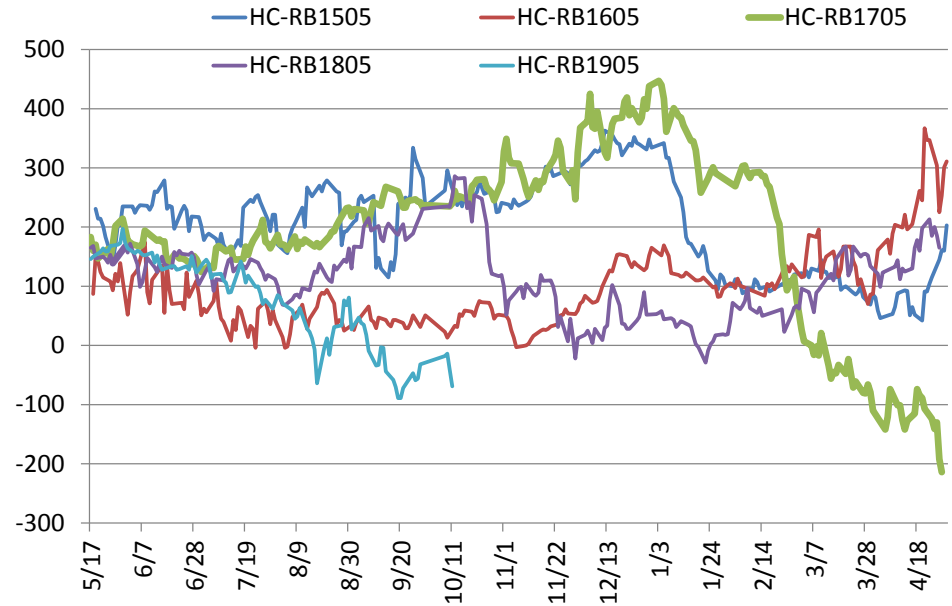
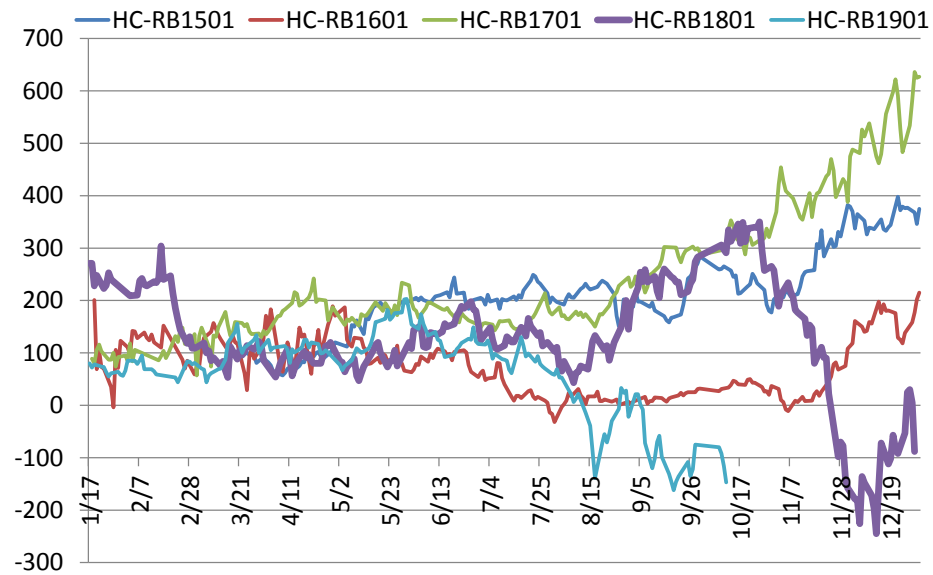
跨期套利跟踪：焦煤



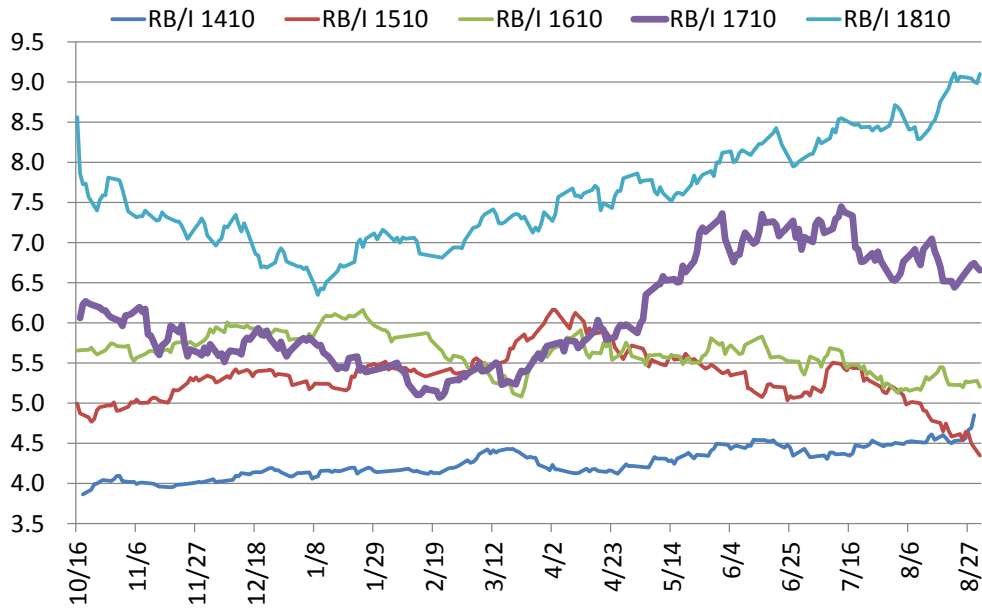
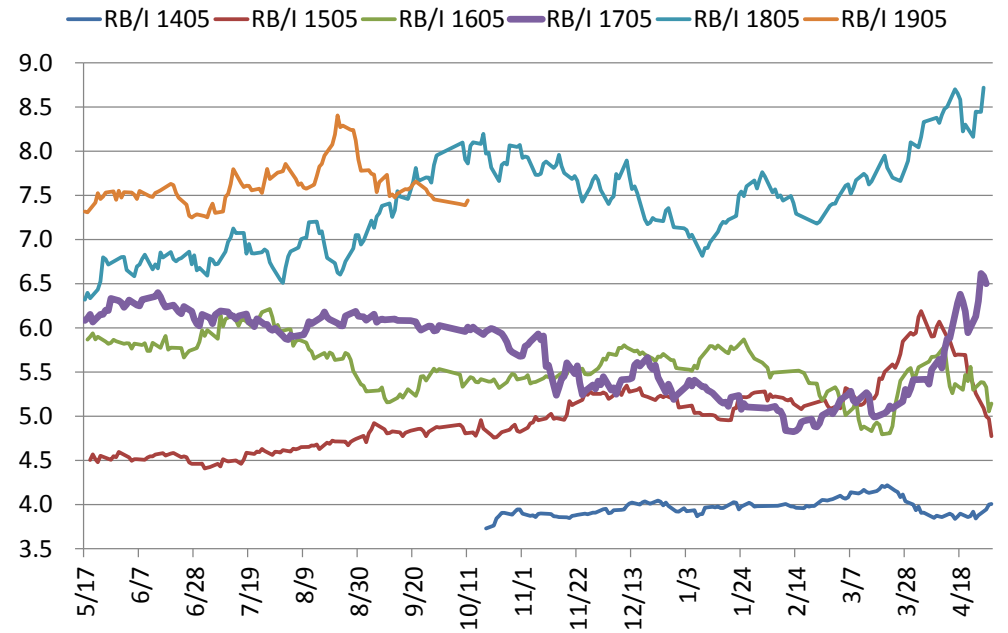
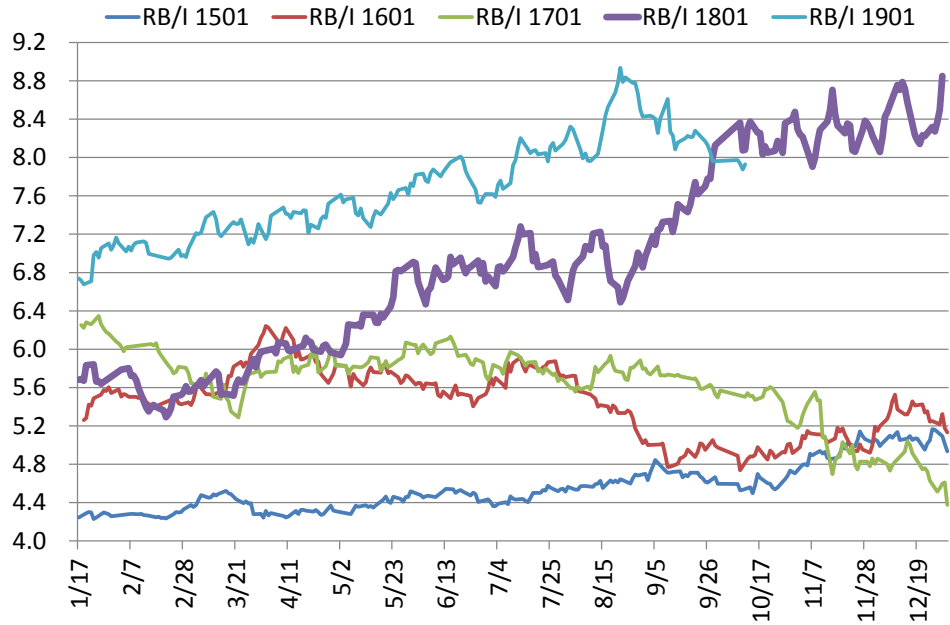
跨期套利跟踪：动力煤



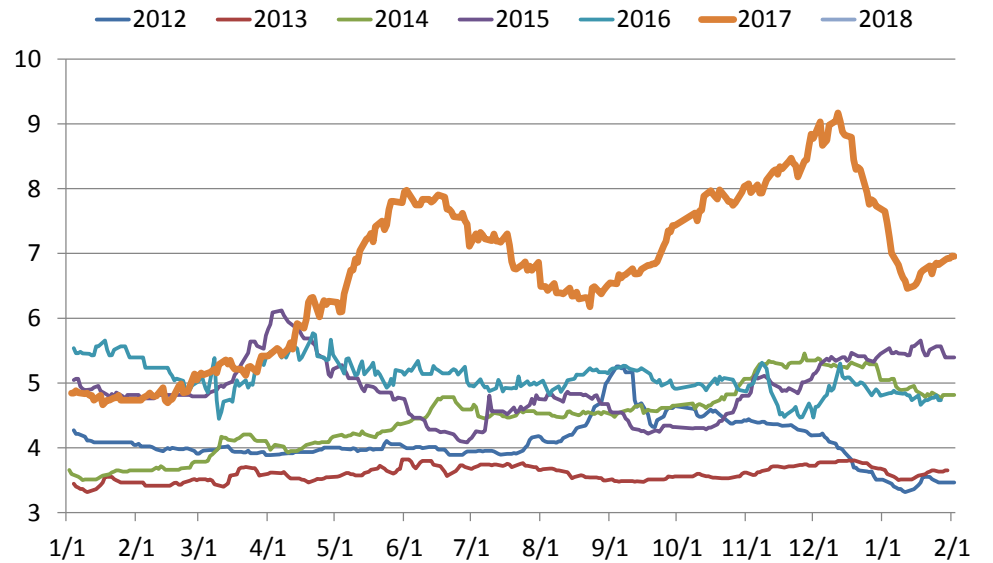
跨期套利跟踪：HC-RB



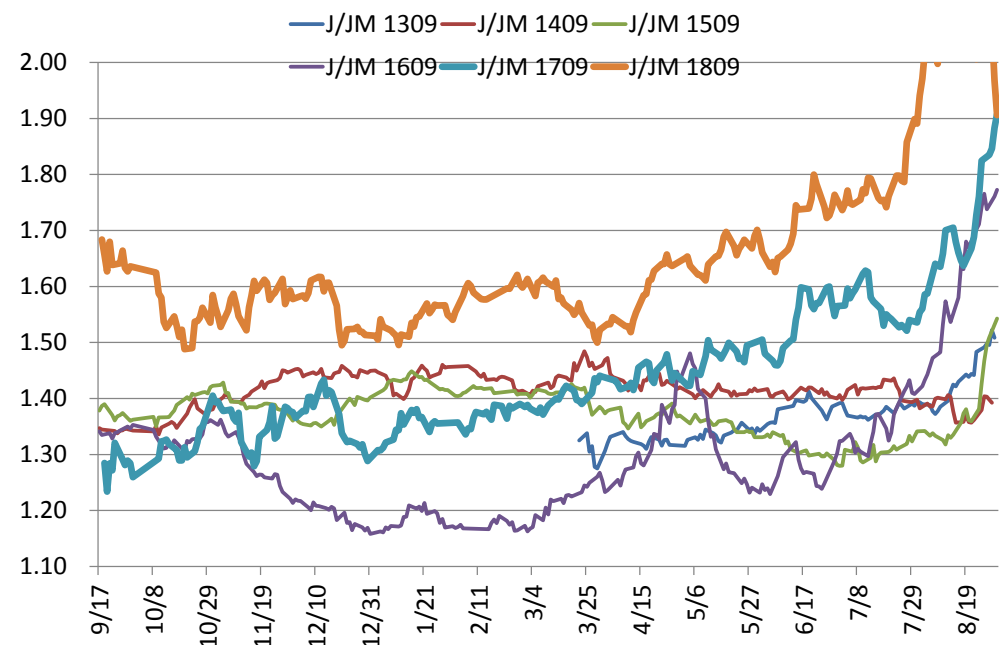
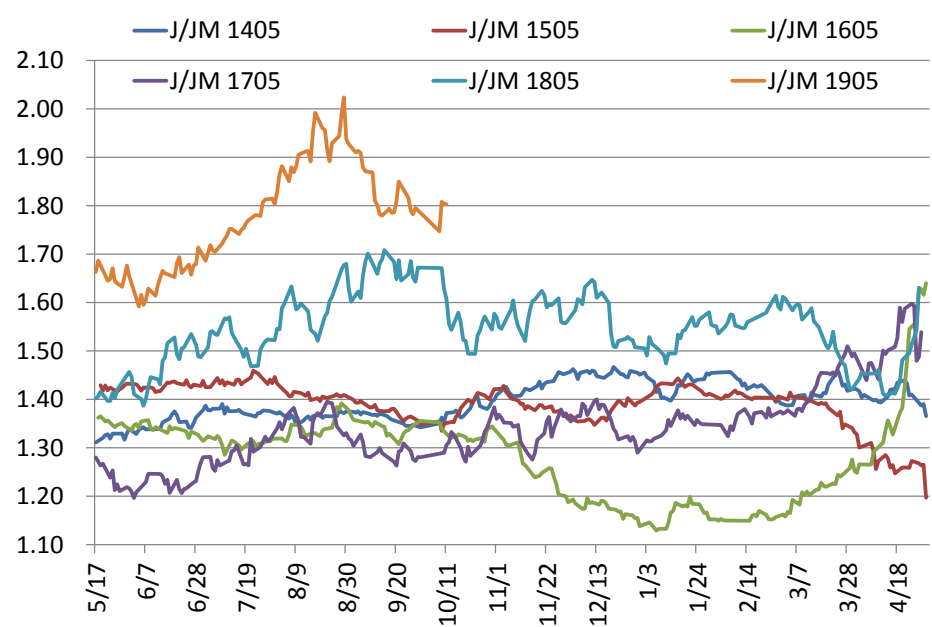
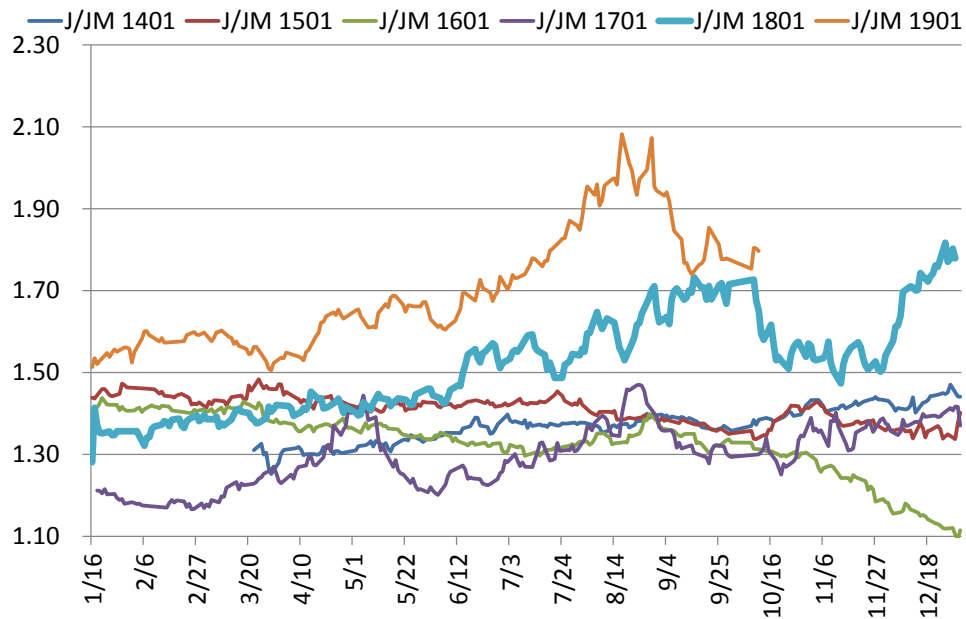
跨期套利跟踪：RB/I



螺纹/铁矿石 (现货)



跨期套利跟踪: J/JM



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 18 家分支机构：包括深圳、金华、台州 3 家分公司，以及上海、北京、广州、大连、沈阳、哈尔滨、石家庄、乐清、富阳、温州、宁波、绍兴、临安、萧山、余杭 15 家营业部，公司将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是经国务院批准，由财政部采取独家发起的方式，将原中国信达资产管理公司整体改制而成立，注册资本 362.57 亿元人民币。

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。

信达资产拥有全牌照金融服务平台



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: 0579-82300876)
- 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)
- 深圳分公司 深圳市福田区福田街道福安社区民田路 171 号新华保险大厦 2305A (咨询电话: 0755-83739066)
- 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: 021-58307723)
- 广州营业部 广州市天河区体育西路 189 号 20A2 (咨询电话: 020-89814589)
- 沈阳营业部 沈阳市皇姑区黑龙江街 25 号 4 层 (咨询电话: 024-31061955)
- 哈尔滨营业部 黑龙江省哈尔滨南岗集中区长江路 157 号欧倍德中心 4 层 18 号 (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: 0311-89691960)
- 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: 0577-27868777)
- 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)
- 温州营业部 浙江省温州市鹿城区锦绣路 1067 号置信中心 1 幢 616 室 (咨询电话: 0577-88128810)
- 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: 0574-28839988)
- 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: 0571-63708180)
- 萧山营业部 浙江省杭州市萧山区北干街道金城路 358 号蓝爵国际中心 5 幢 3903-2 室(咨询电话: 0571-82752636)
- 余杭营业部 浙江省杭州市余杭区南苑街道永安大厦 1702-2 室 (咨询电话: 0571-88797516)

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、财务状况或需要。

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。