跨期数据跟踪

化工跨期套利跟踪

信达期货 CINDA FUTURES

联系人：陈敏华
投资咨询号：Z0012670

联系人：韩冰冰
从业资格号：F3047762
电话：0571-28132638

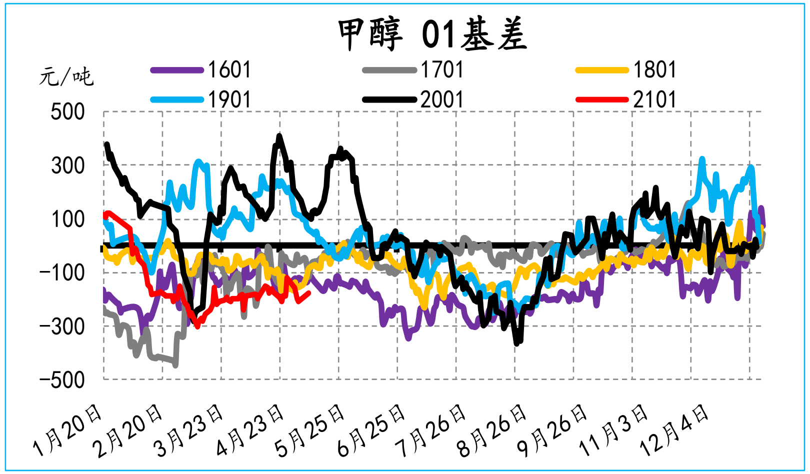
策略组合		20日前 4月2日	10日前 4月17日	5日前 4月24日	昨日 4月30日	今日 5月6日	近一个月走势图	建议
跨期	MA9-MA1		-85	-98	-95	-100		
	MA5-MA9	-98	-89	-31	-70	-12		
	TA9-TA1		-134	-158	-158	-148		
	TA5-TA9	-114	-118	-106	-106	-108		
	L9-L1		-20	0	-5	0		
	L5-L9	5	60	55	40	40		
	PP9-PP1		123	144	153	161		
	PP5-PP9	114	430	399	514	558		
	V9-V1		25	15	25	45		
	V5-V9	20	20	35	55	-20		
	BU9-BU12	-96	-112	-158	-122	-98		
	BU6-BU9	-116	-140	-176	-174	-164		
	RU9-RU1		-1360	-1440	-1430	-1400		
	RU5-RU9	-275	-280	-305	-305	-340		

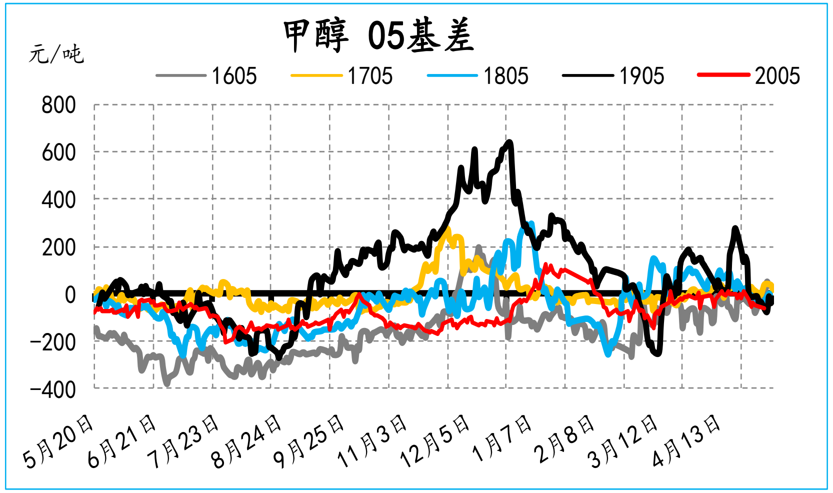
基差数据跟踪

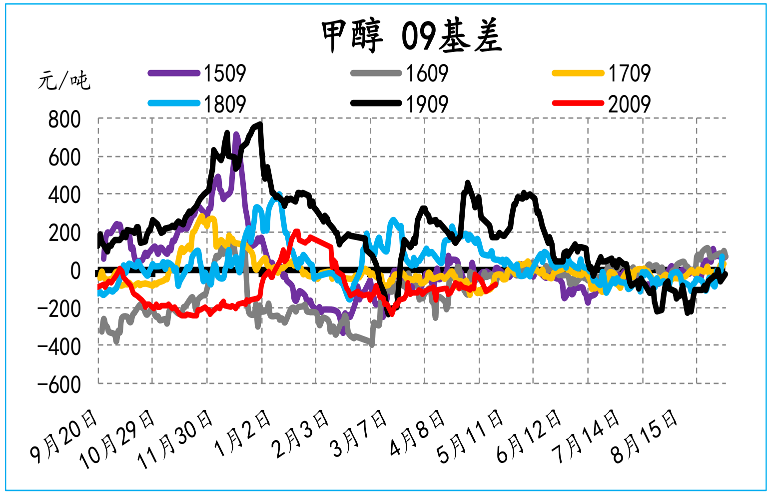
2020年05月06日期现结构图								4
品种	现货价	涨跌	近十日走	主力基差	涨跌	近十日走	基差率	价差结
PP	7550	150.00		398.00	-2.00		5.6%	
PE	6450	250.00		0.00	-20.00		0.0%	
PVC	5500	150.00		-180.00	-45.00		-3.2%	
甲醇	1710	40.00		-75.00	27.00		-4.2%	
EG	3529	74.00		-168.00	42.00		-4.5%	
PTA	3326	106.00		-174.00	24.00		-5.0%	

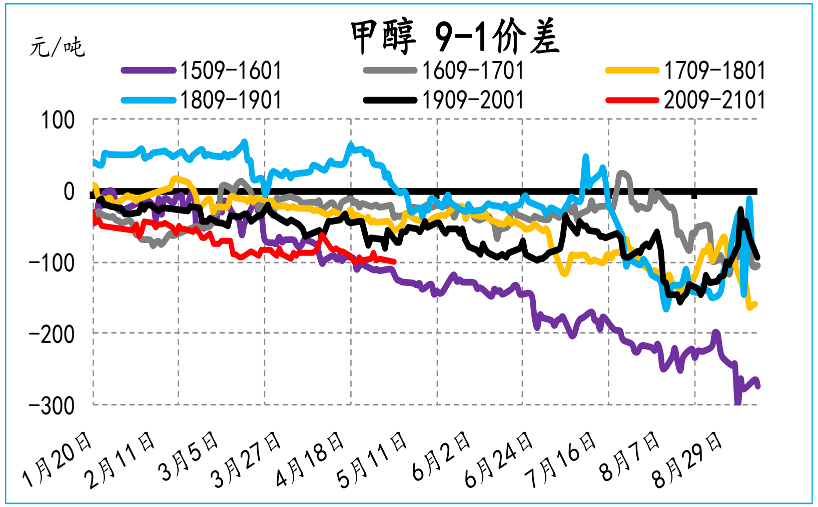
注1：主力基差=现货-主力合约；基差率=（现货价格-期货主力）/期货主力；
注2：价差结构指现货、近月、次近月和远月合约的价格结构，其中红色为现货价格；
注3：主力合约为9月。

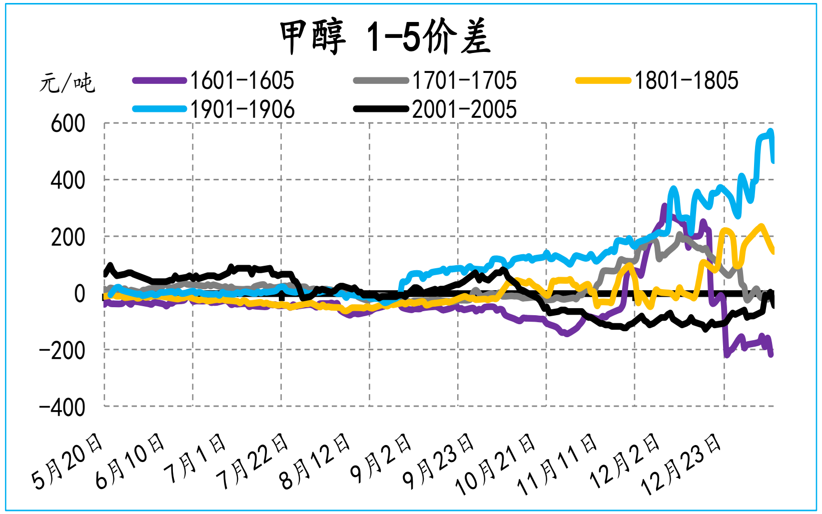
套利跟踪：甲醇

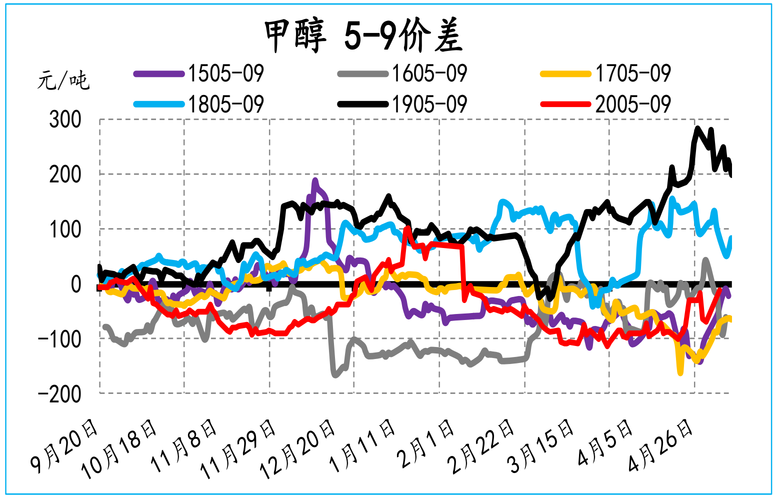

甲醇 01基差
元/吨
1601
1701
1801
1901
2001
2101
500
300
100
-100
-300
-500
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日


甲醇 05基差
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
800
600
400
200
0
-200
-400
5月20日
6月21日
7月23日
8月24日
9月25日
11月3日
12月5日
1月7日
2月8日
3月12日
4月13日

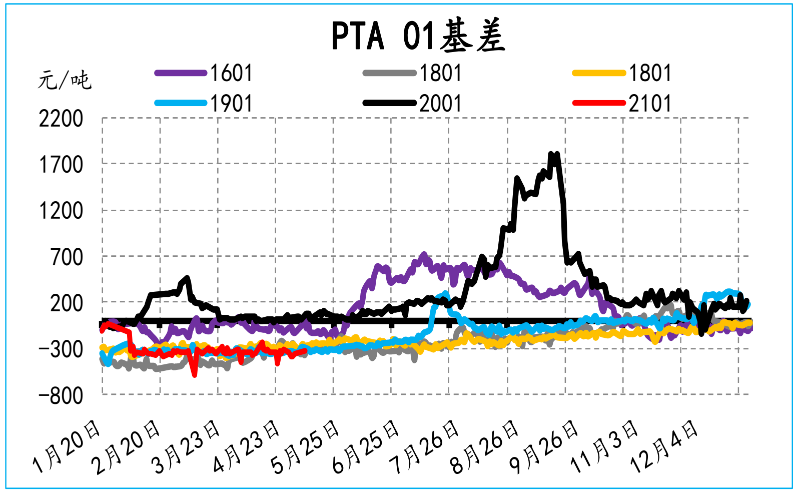

甲醇 09基差
元/吨
1509
1609
1709
1809
1909
2009
800
600
400
200
0
-200
-400
-600
9月20日
10月29日
11月30日
1月2日
2月3日
3月7日
4月8日
5月11日
6月12日
7月14日
8月15日

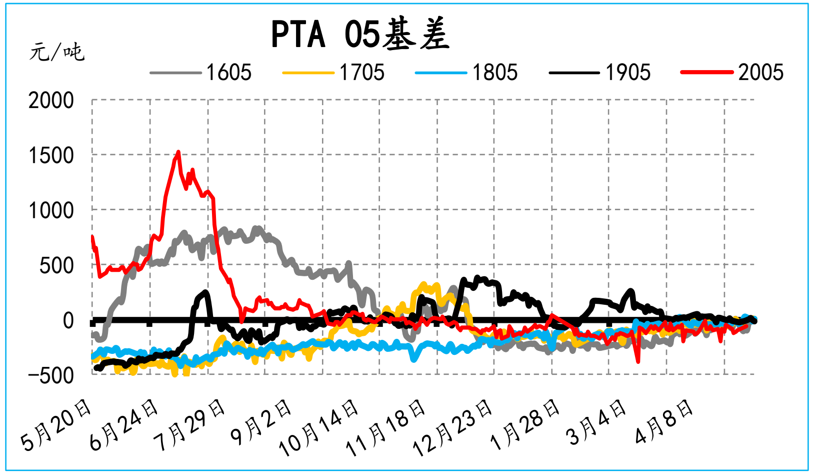

甲醇 9-1价差
元/吨
1509-1601
1609-1701
1709-1801
1809-1901
1909-2001
2009-2101
100
0
-100
-200
-300
1月20日
2月11日
3月5日
3月27日
4月18日
5月11日
6月2日
6月24日
7月16日
8月7日
8月29日

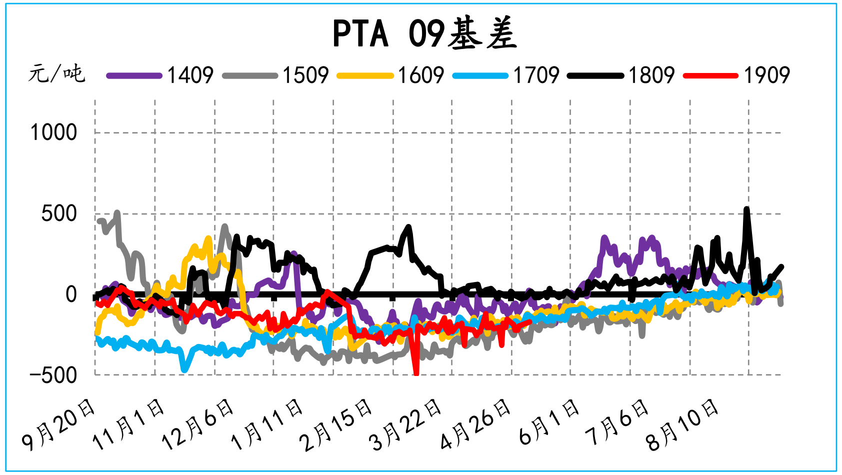

甲醇 1-5价差
元/吨
1601-1605
1701-1705
1801-1805
1901-1906
2001-2005
600
400
200
0
-200
-400
5月20日
6月10日
7月1日
7月22日
8月12日
9月2日
9月23日
10月21日
11月11日
12月2日
12月23日

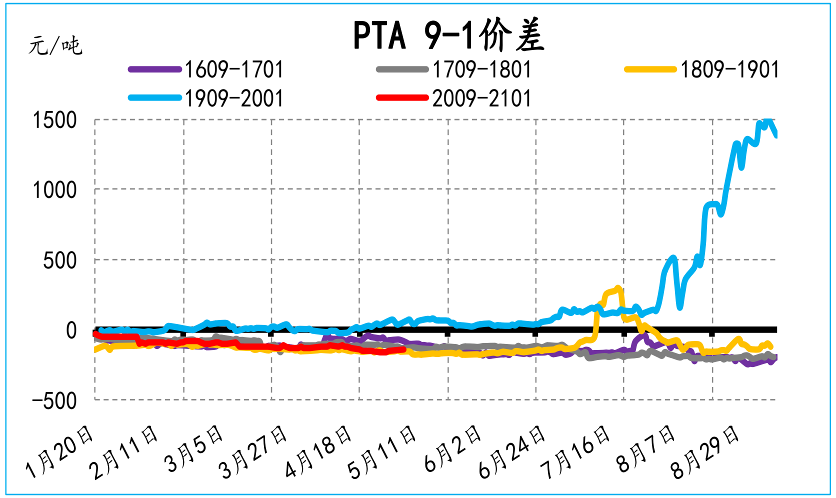

甲醇 5-9价差
元/吨
1505-09
1605-09
1705-09
1805-09
1905-09
2005-09
300
200
100
0
-100
-200
9月20日
10月18日
11月8日
11月29日
12月20日
1月11日
2月1日
2月22日
3月15日
4月5日
4月26日

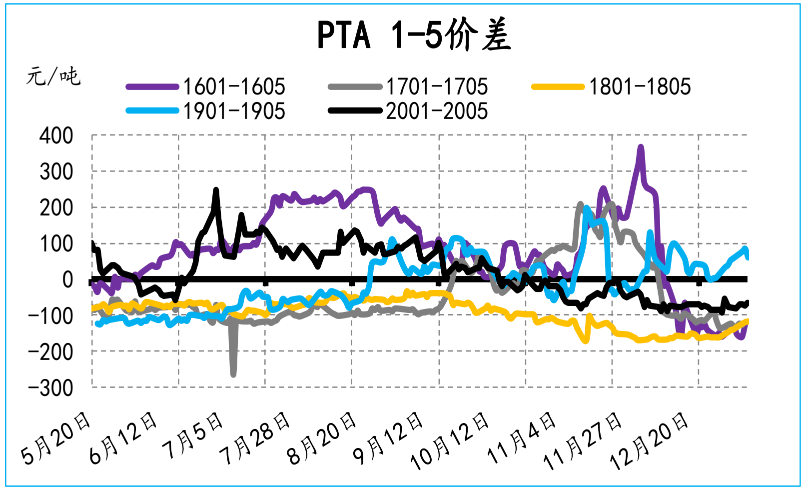
套利跟踪：PTA

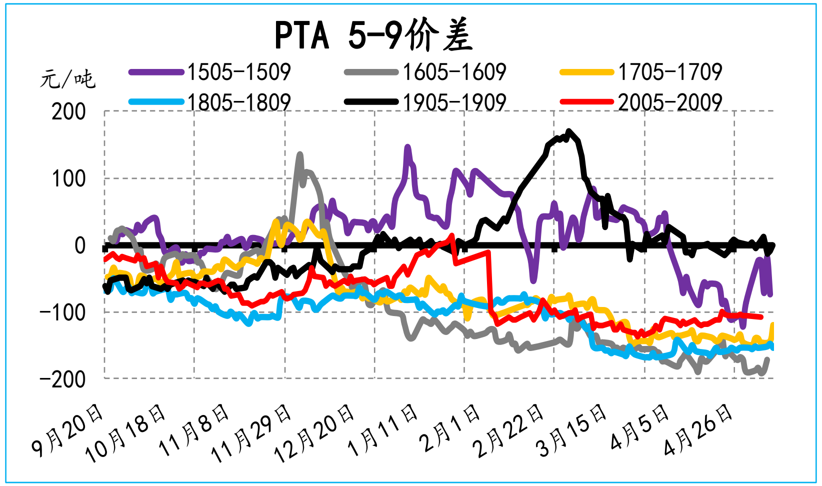

PTA 01基差
元/吨
1601
1801
1801
1901
2001
2101
2200
1700
1200
700
200
-300
-800
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日


PTA 05基差
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
2000
1500
1000
500
0
-500
5月20日
6月24日
7月29日
9月2日
10月14日
11月18日
12月23日
1月28日
3月4日
4月8日

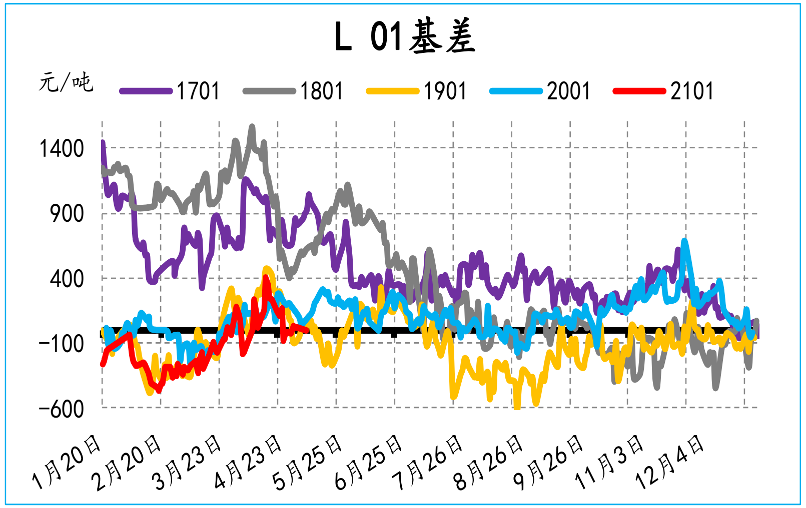

PTA 09基差
元/吨
1409
1509
1609
1709
1809
1909
1000
500
0
-500
9月20日
11月1日
12月6日
1月11日
2月15日
3月22日
4月26日
6月1日
7月6日
8月10日

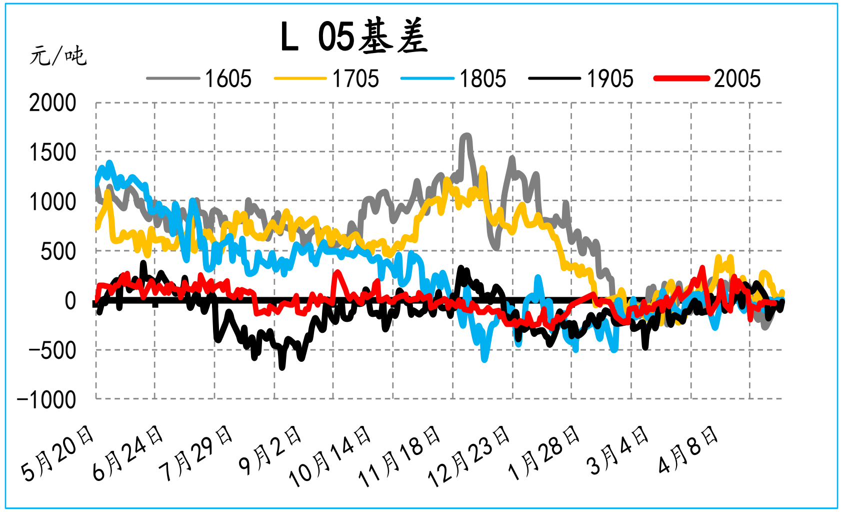

PTA 9-1价差
元/吨
1609-1701
1709-1801
1809-1901
1909-2001
2009-2101
1500
1000
500
0
-500
1月20日
2月11日
3月5日
3月27日
4月18日
5月11日
6月2日
6月24日
7月16日
8月7日
8月29日

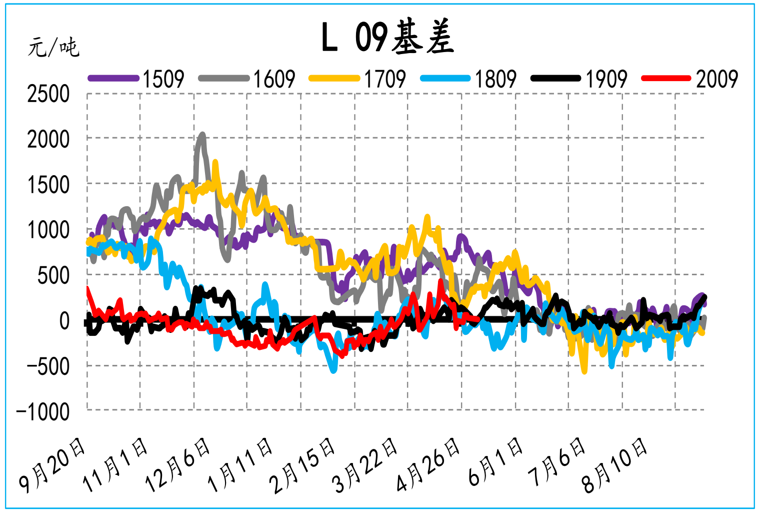

PTA 1-5价差
元/吨
1601-1605
1701-1705
1801-1805
1901-1905
2001-2005
400
300
200
100
0
-100
-200
-300
5月20日
6月12日
7月5日
7月28日
8月20日
9月12日
10月12日
11月4日
11月27日
12月20日

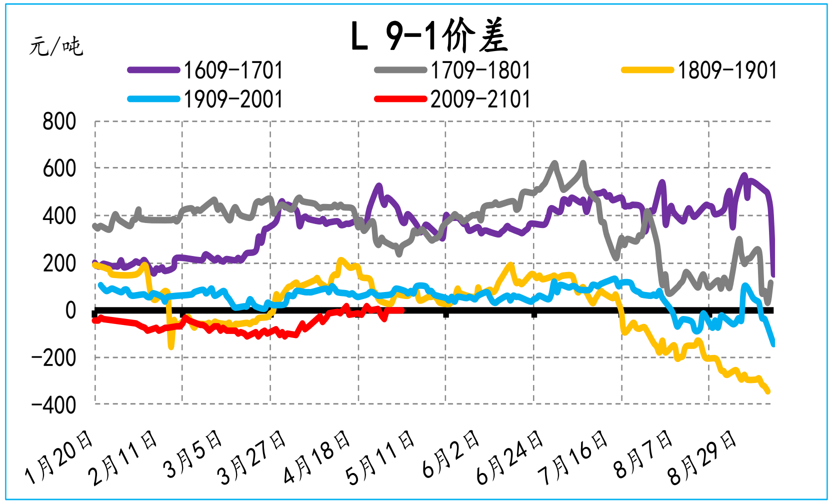

PTA 5-9价差
元/吨
1505-1509
1605-1609
1705-1709
1805-1809
1905-1909
2005-2009
200
100
0
-100
-200
9月20日
10月18日
11月8日
11月29日
12月20日
1月11日
2月1日
2月22日
3月15日
4月5日
4月26日

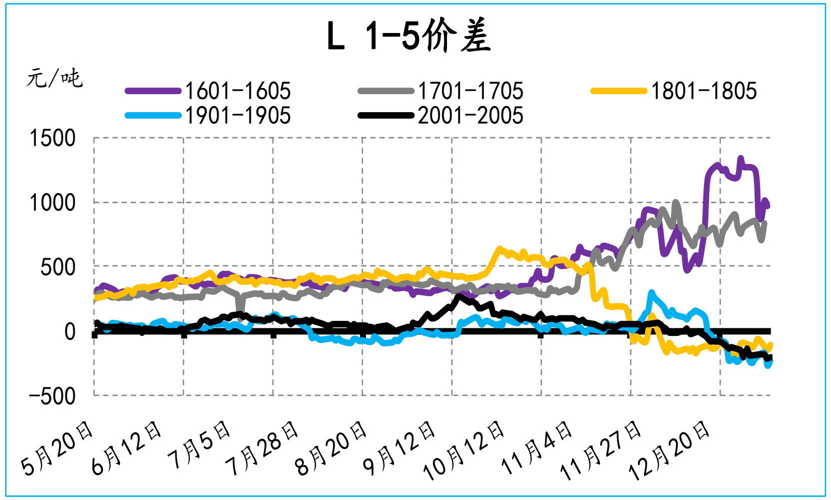
套利跟踪： PE

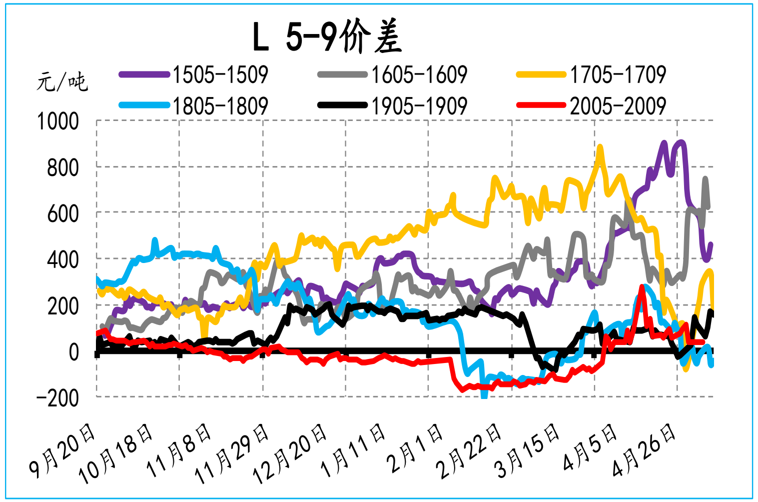

L 01基差
元/吨
1701
1801
1901
2001
2101
1400
900
400
-100
-600
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日


L 05基差
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
2000
1500
1000
500
0
-500
-1000
5月20日
6月24日
7月29日
9月2日
10月14日
11月18日
12月23日
1月28日
3月4日
4月8日

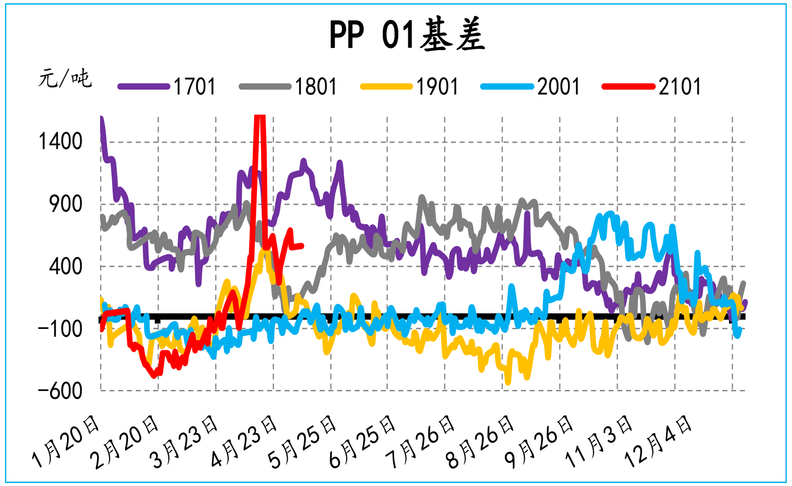

L 09基差
元/吨
1509
1609
1709
1809
1909
2009
2500
2000
1500
1000
500
0
-500
-1000
9月20日
11月1日
12月6日
1月11日
2月15日
3月22日
4月26日
6月1日
7月6日
8月10日

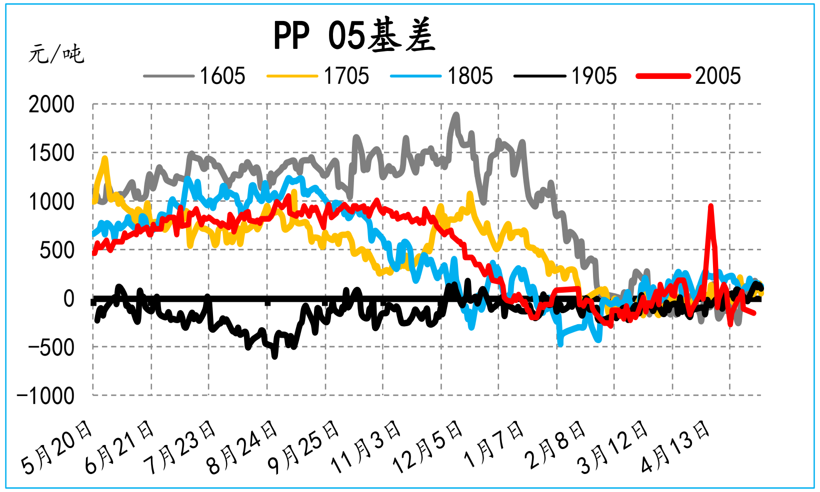

L 9-1价差
元/吨
1609-1701
1709-1801
1809-1901
1909-2001
2009-2101
800
600
400
200
0
-200
-400
1月20日
2月11日
3月5日
3月27日
4月18日
5月11日
6月2日
6月24日
7月16日
8月7日
8月29日

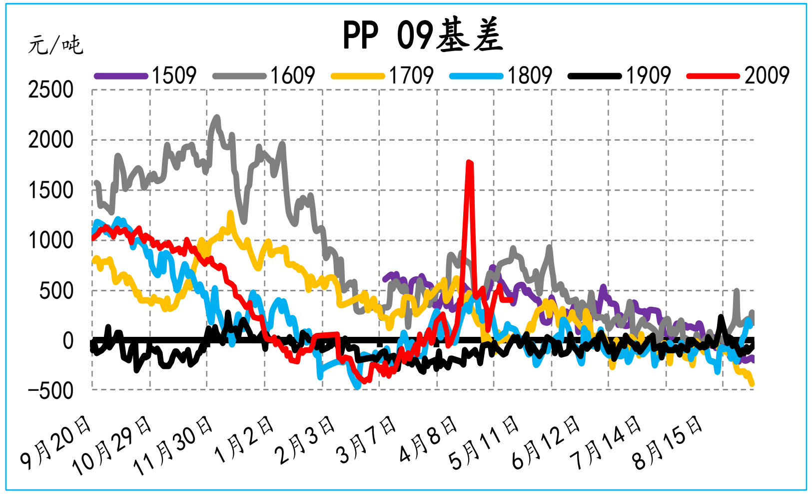

L 1-5价差
元/吨
1601-1605
1701-1705
1801-1805
1901-1905
2001-2005
1500
1000
500
0
-500
5月20日
6月12日
7月5日
7月28日
8月20日
9月12日
10月12日
11月4日
11月27日
12月20日

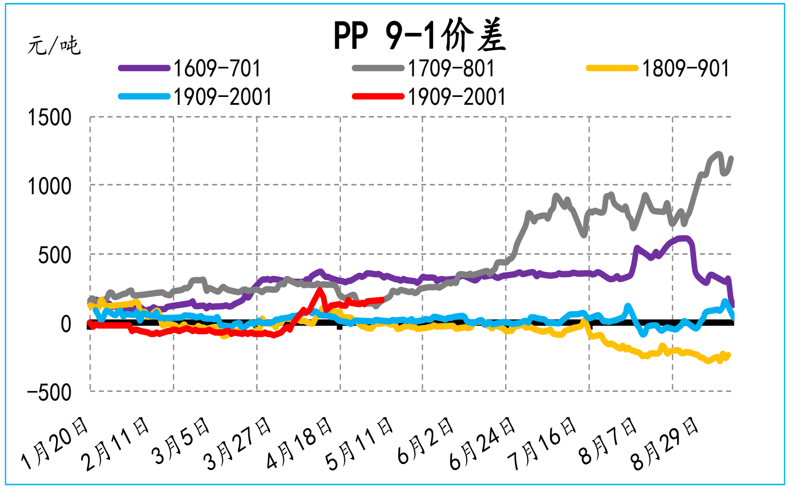

L 5-9价差
元/吨
1505-1509
1605-1609
1705-1709
1805-1809
1905-1909
2005-2009
1000
800
600
400
200
0
-200
9月20日
10月18日
11月8日
11月29日
12月20日
1月11日
2月1日
2月22日
3月15日
4月5日
4月26日

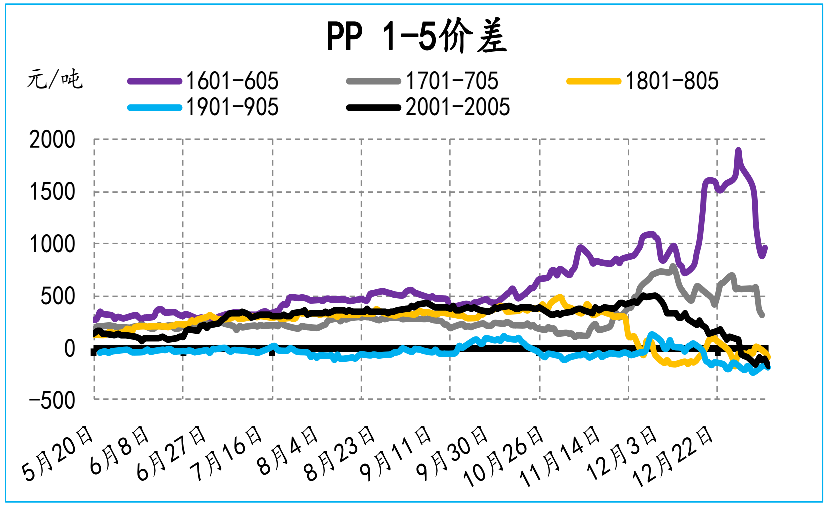
套利跟踪： PP

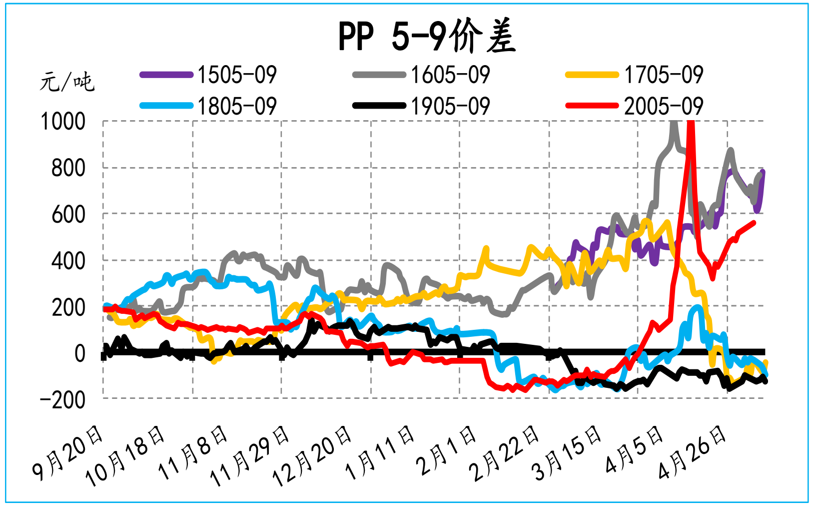

PP 01基差
元/吨
1701
1801
1901
2001
2101
1400
900
400
-100
-600
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日


PP 05基差
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
2000
1500
1000
500
0
-500
-1000
5月20日
6月21日
7月23日
8月24日
9月25日
11月3日
12月5日
1月7日
2月8日
3月12日
4月13日

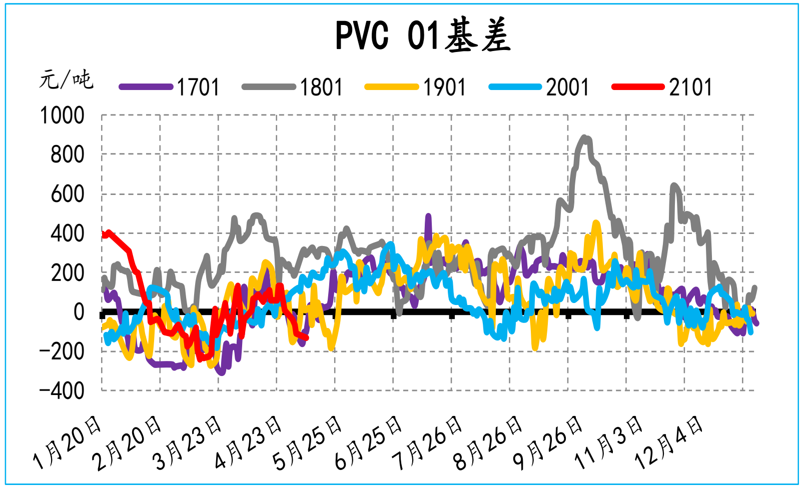

PP 09基差
元/吨
1509
1609
1709
1809
1909
2009
2500
2000
1500
1000
500
0
-500
9月20日
10月29日
11月30日
1月2日
2月3日
3月7日
4月8日
5月11日
6月12日
7月14日
8月15日

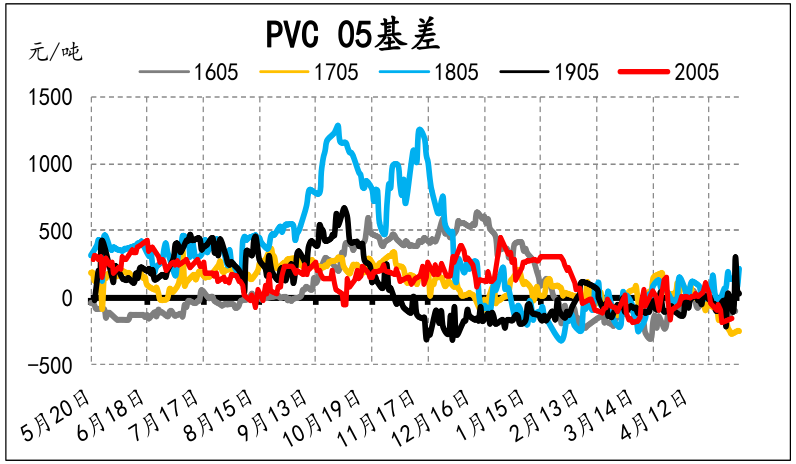

PP 9-1价差
元/吨
1609-701
1709-801
1809-901
1909-2001
1909-2001
1500
1000
500
0
-500
1月20日
2月11日
3月5日
3月27日
4月18日
5月11日
6月2日
6月24日
7月16日
8月7日
8月29日

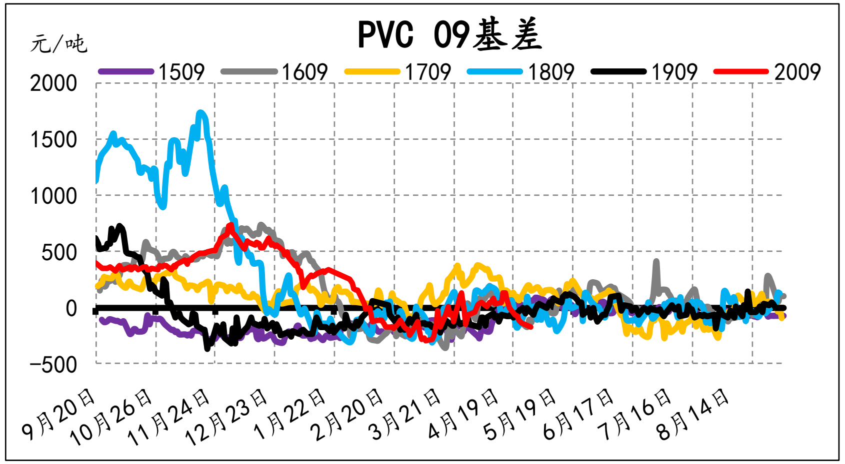

PP 1-5价差
元/吨
1601-605
1701-705
1801-805
1901-905
2001-2005
2000
1500
1000
500
0
-500
5月20日
6月8日
6月27日
7月16日
8月4日
8月23日
9月11日
9月30日
10月26日
11月14日
12月3日
12月22日

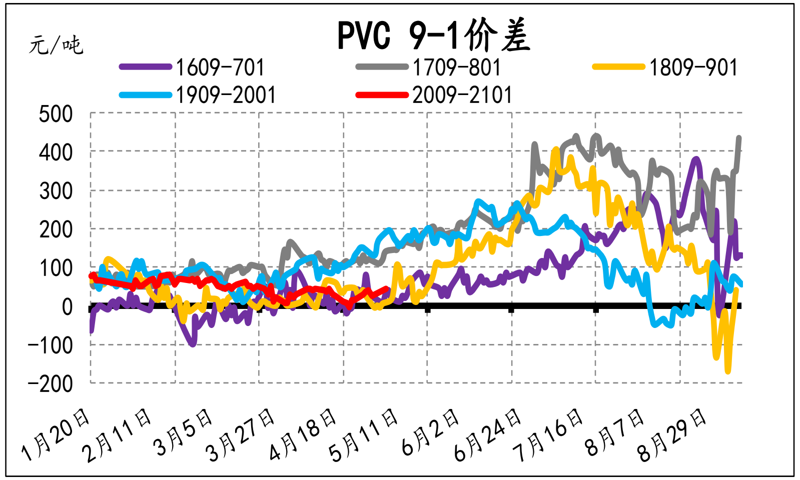

PP 5-9价差
元/吨
1505-09
1605-09
1705-09
1805-09
1905-09
2005-09
1000
800
600
400
200
0
-200
9月20日
10月18日
11月8日
11月29日
12月20日
1月11日
2月1日
2月22日
3月15日
4月5日
4月26日

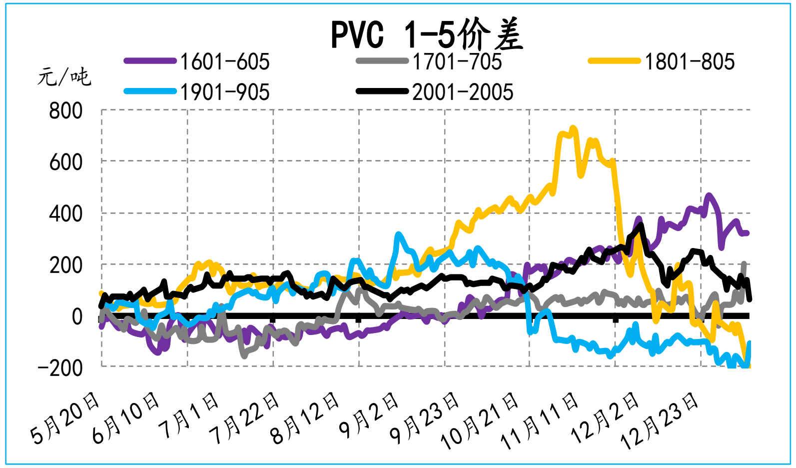
套利跟踪： PVC

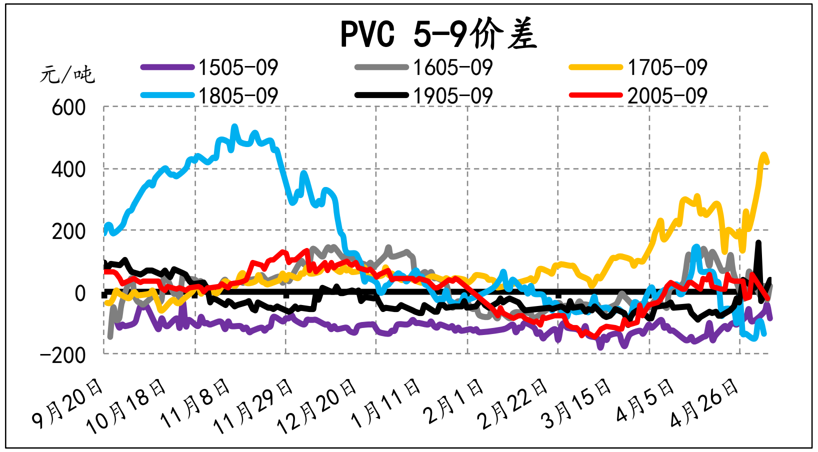

PVC 01基差
元/吨
1701
1801
1901
2001
2101
1000
800
600
400
200
0
-200
-400
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日


PVC 05基差
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
1500
1000
500
0
-500
5月20日
6月18日
7月17日
8月15日
9月13日
10月19日
11月17日
12月16日
1月15日
2月13日
3月14日
4月12日


PVC 09基差
元/吨
1509
1609
1709
1809
1909
2009
2000
1500
1000
500
0
-500
9月20日
10月26日
11月24日
12月23日
1月22日
2月20日
3月21日
4月19日
5月19日
6月17日
7月16日
8月14日

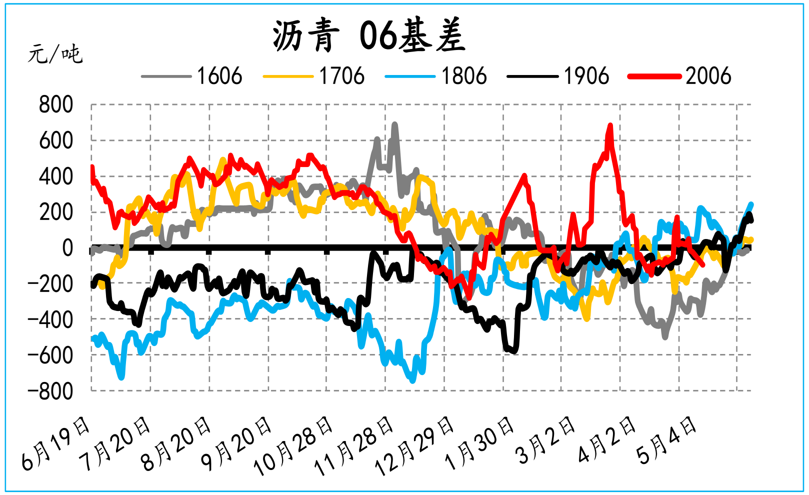

PVC 9-1价差
元/吨
1609-701
1709-801
1809-901
1909-2001
2009-2101
500
400
300
200
100
0
-100
-200
1月20日
2月11日
3月5日
3月27日
4月18日
5月11日
6月2日
6月24日
7月16日
8月7日
8月29日

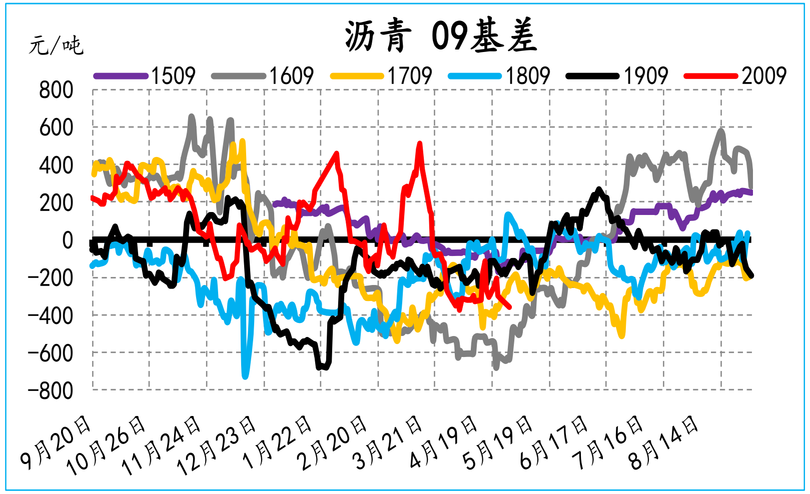

PVC 1-5价差
元/吨
1601-605
1701-705
1801-805
1901-905
2001-2005
800
600
400
200
0
-200
5月20日
6月10日
7月1日
7月22日
8月12日
9月2日
9月23日
10月21日
11月11日
12月2日
12月23日

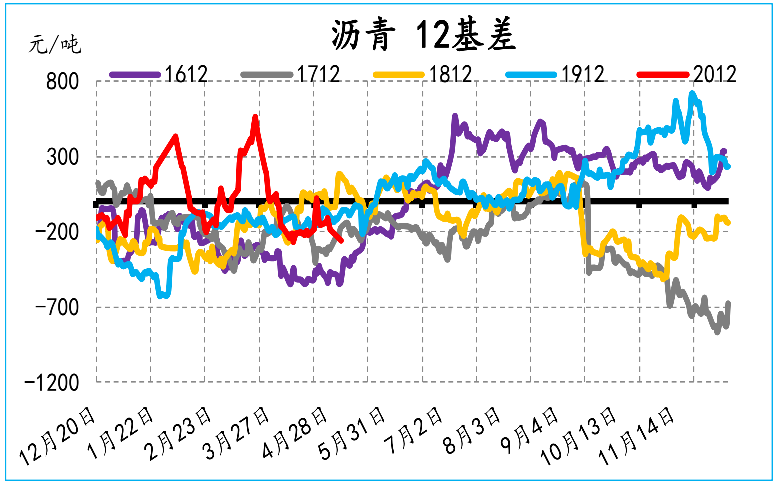

PVC 5-9价差
元/吨
1505-09
1605-09
1705-09
1805-09
1905-09
2005-09
600
400
200
0
-200
9月20日
10月18日
11月8日
11月29日
12月20日
1月11日
2月1日
2月22日
3月15日
4月5日
4月26日

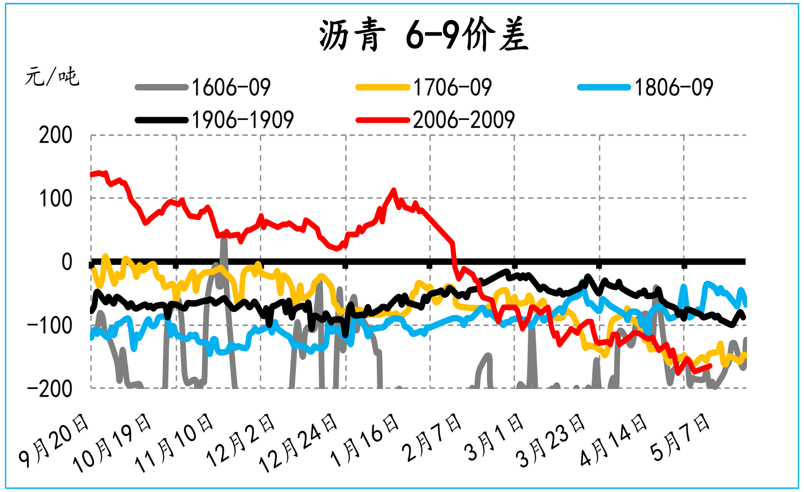
套利跟踪：沥青

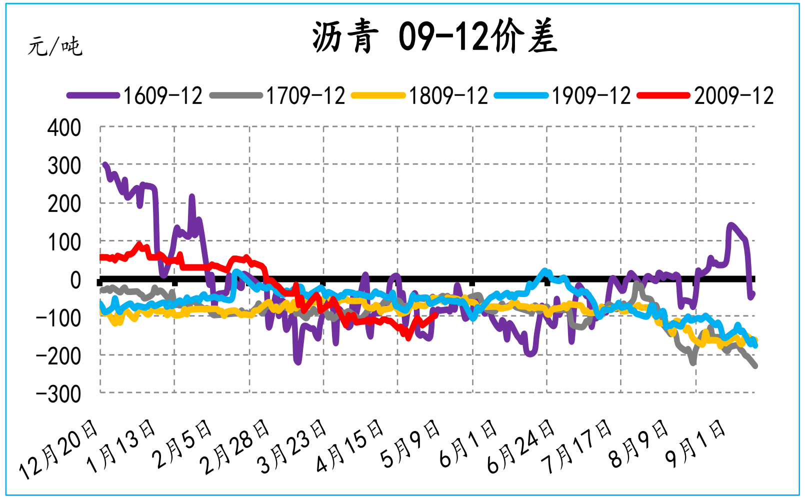
信达期货能化组交流群，即将成立啦！
快向“能化小精灵”申请吧！
微信号：hanbb360

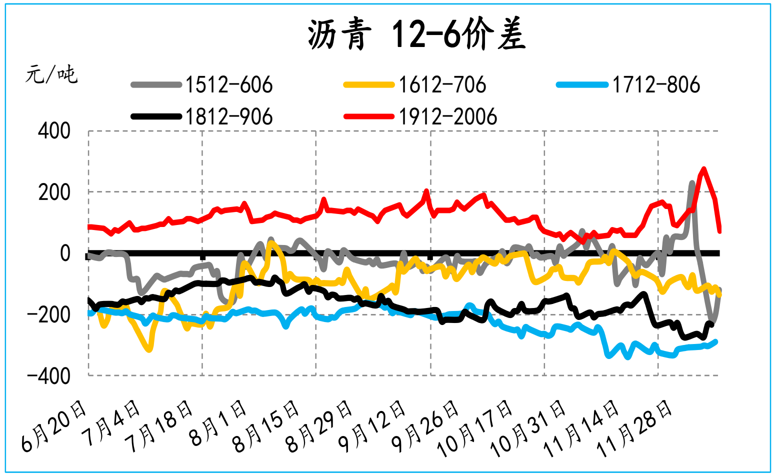




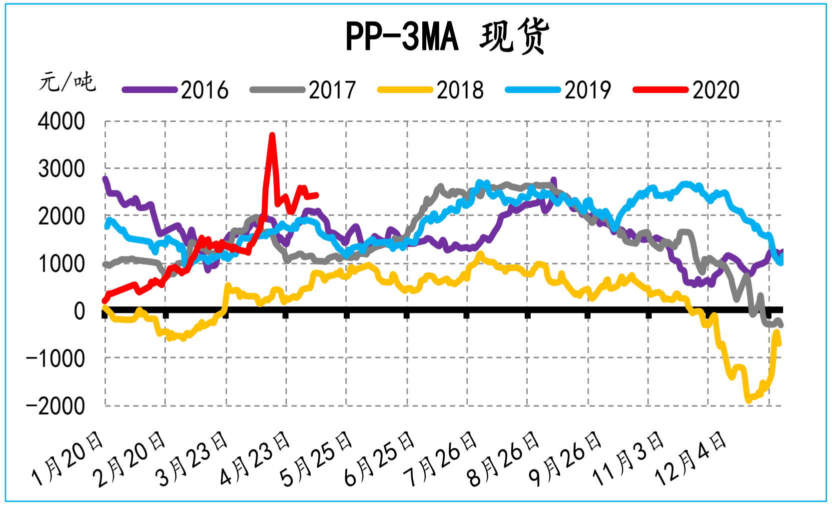




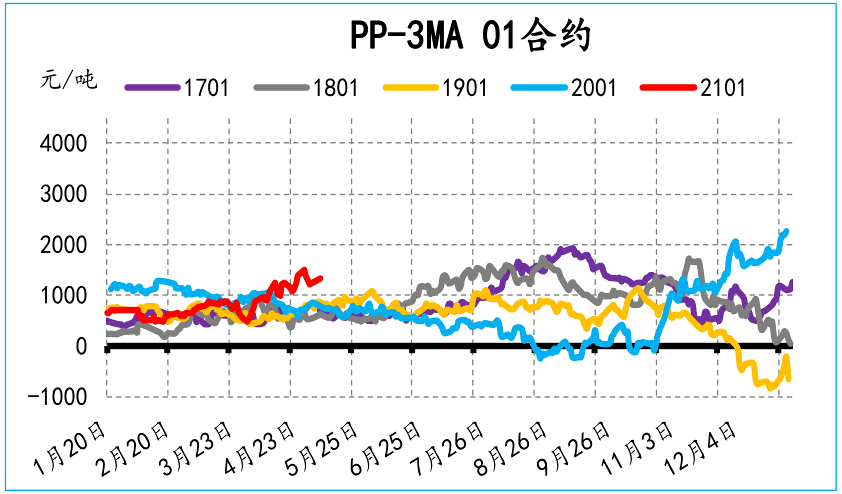




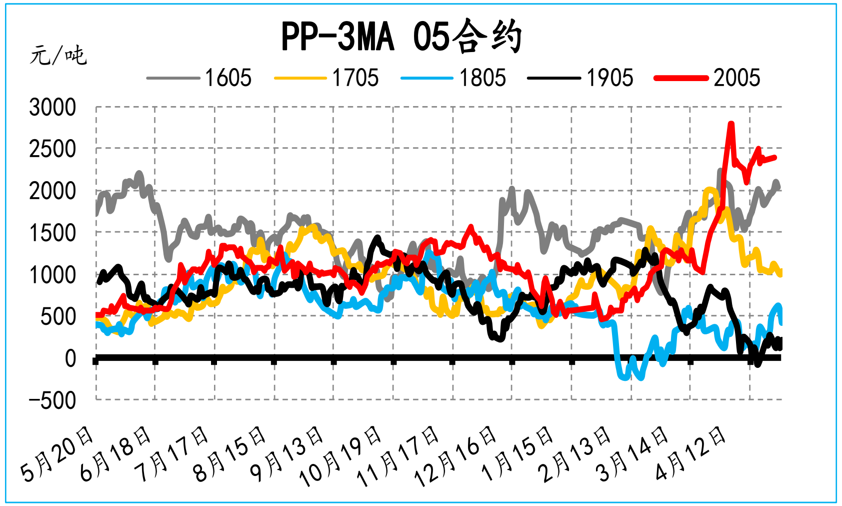
跨品种：PP-3MA



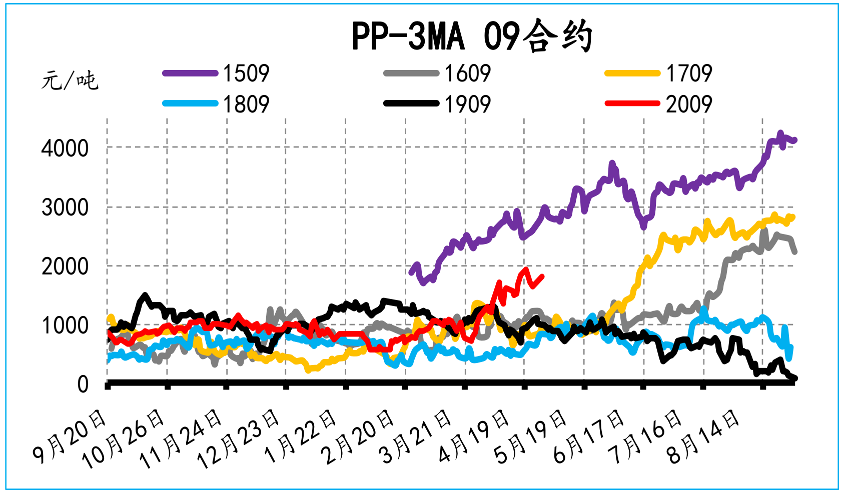
PP-3MA 现货
元/吨
2016
2017
2018
2019
2020
4000
3000
2000
1000
0
-1000
-2000
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日



PP-3MA 01合约
元/吨
1701
1801
1901
2001
2101
4000
3000
2000
1000
0
-1000
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日

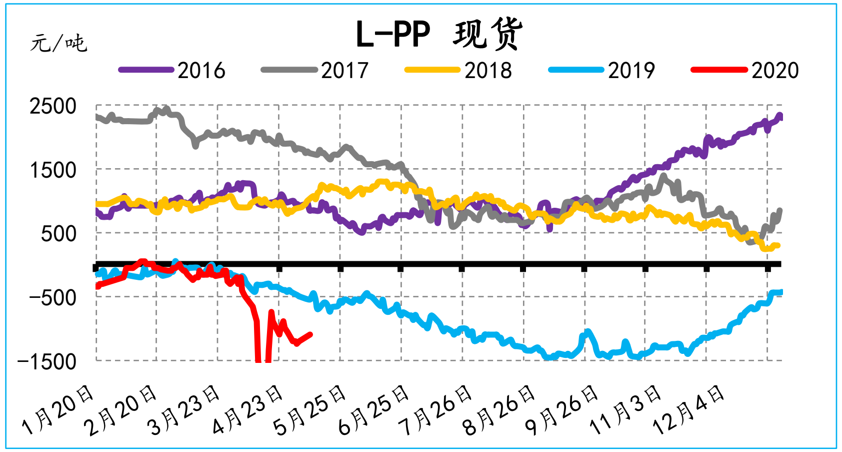


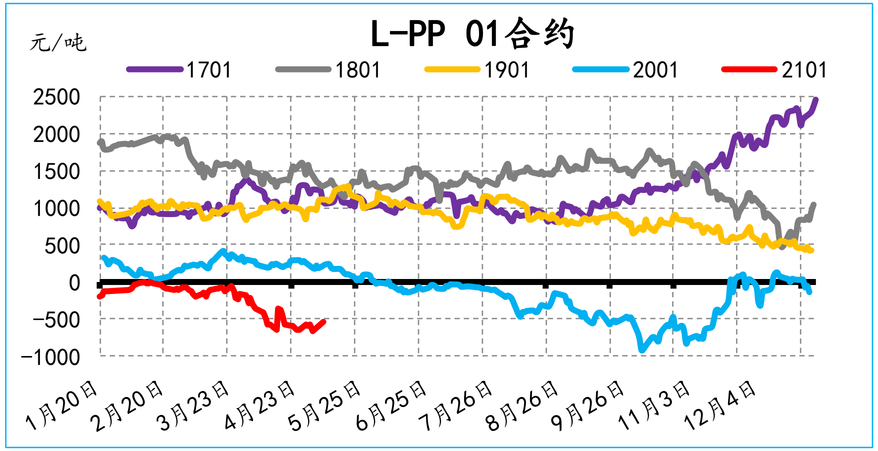
PP-3MA 05合约
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
3000
2500
2000
1500
1000
500
0
-500
5月20日
6月18日
7月17日
8月15日
9月13日
10月19日
11月17日
12月16日
1月15日
2月13日
3月14日
4月12日

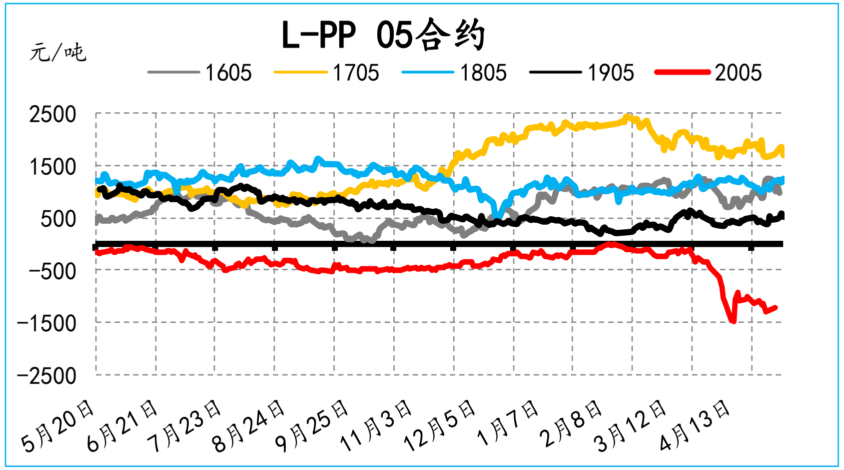


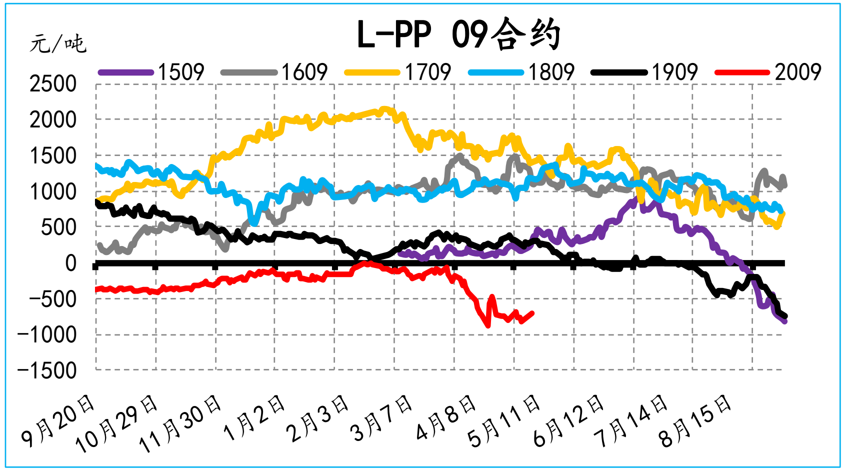
PP-3MA 09合约
元/吨
1509
1609
1709
1809
1909
2009
4000
3000
2000
1000
0
9月20日
10月26日
11月24日
12月23日
1月22日
2月20日
3月21日
4月19日
5月19日
6月17日
7月16日
8月14日

跨品种：塑料-PP

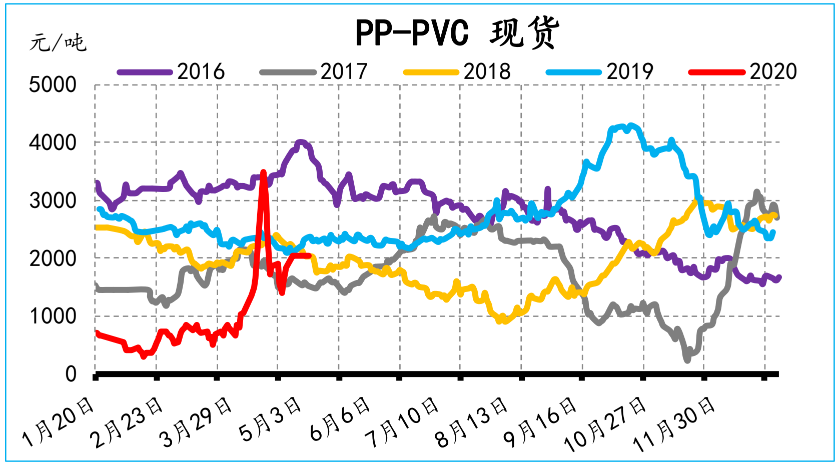

L-PP 现货
元/吨
2016
2017
2018
2019
2020
2500
1500
500
-500
-1500
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日

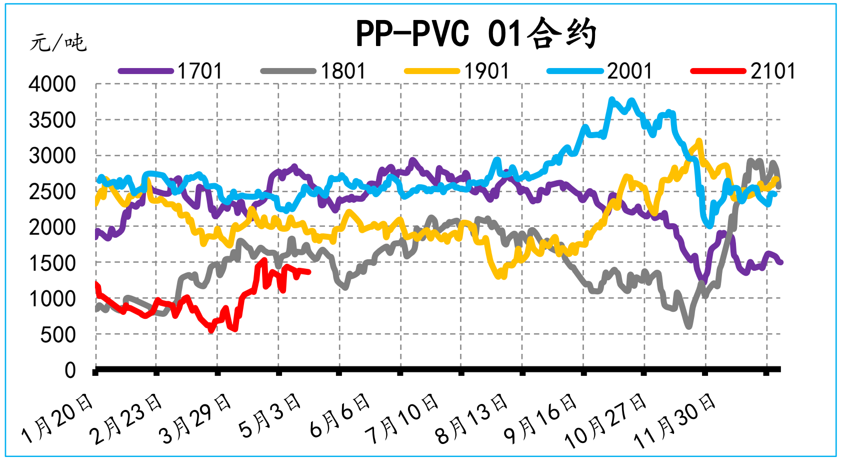

L-PP 01合约
元/吨
1701
1801
1901
2001
2101
2500
2000
1500
1000
500
0
-500
-1000
1月20日
2月20日
3月23日
4月23日
5月25日
6月25日
7月26日
8月26日
9月26日
11月3日
12月4日

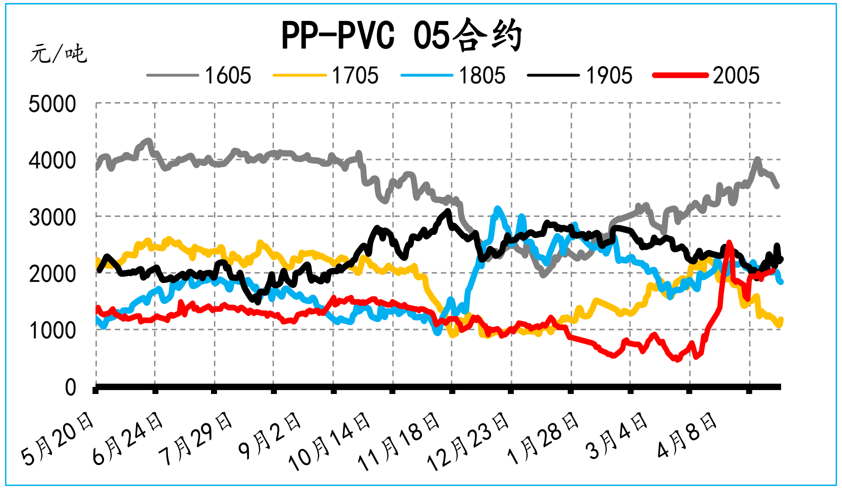

L-PP 05合约
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
2500
1500
500
-500
-1500
-2500
5月20日
6月21日
7月23日
8月24日
9月25日
11月3日
12月5日
1月7日
2月8日
3月12日
4月13日

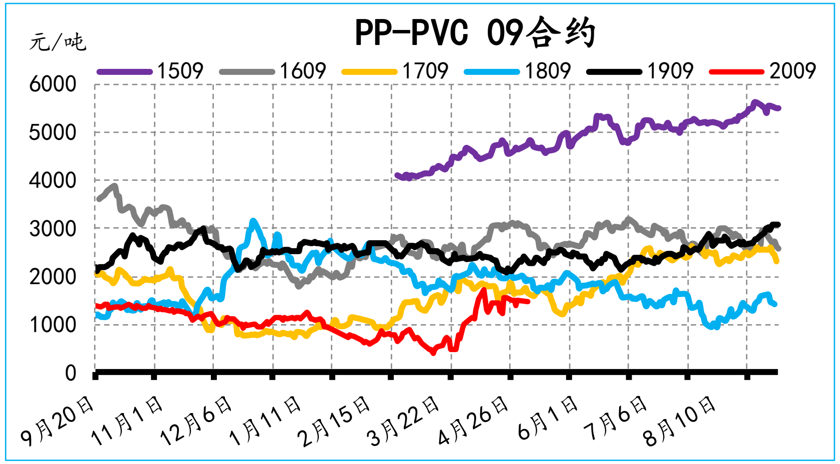

L-PP 09合约
元/吨
1509
1609
1709
1809
1909
2009
2500
2000
1500
1000
500
0
-500
-1000
-1500
9月20日
10月29日
11月30日
1月2日
2月3日
3月7日
4月8日
5月11日
6月12日
7月14日
8月15日

跨品种：PP-PVC

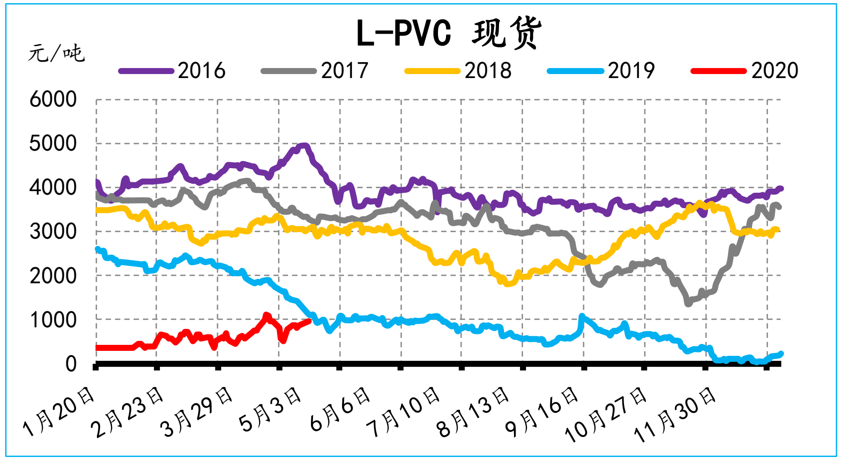

PP-PVC 现货
元/吨
2016
2017
2018
2019
2020
5000
4000
3000
2000
1000
0
1月20日
2月23日
3月29日
5月3日
6月6日
7月10日
8月13日
9月16日
10月27日
11月30日

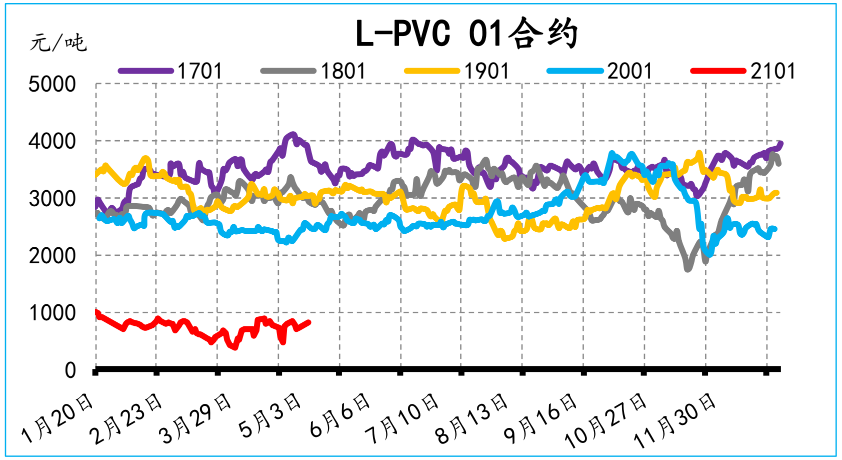

PP-PVC 01合约
元/吨
1701
1801
1901
2001
2101
4000
3500
3000
2500
2000
1500
1000
500
0
1月20日
2月23日
3月29日
5月3日
6月6日
7月10日
8月13日
9月16日
10月27日
11月30日

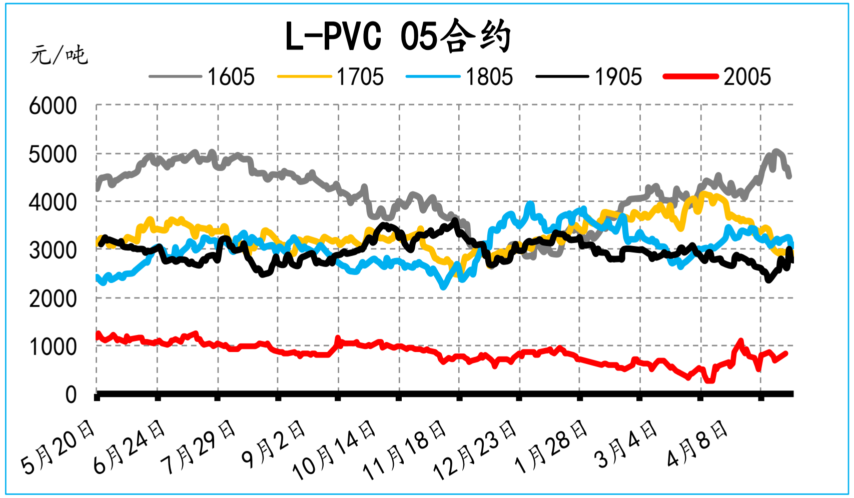

PP-PVC 05合约
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
5000
4000
3000
2000
1000
0
5月20日
6月24日
7月29日
9月2日
10月14日
11月18日
12月23日
1月28日
3月4日
4月8日

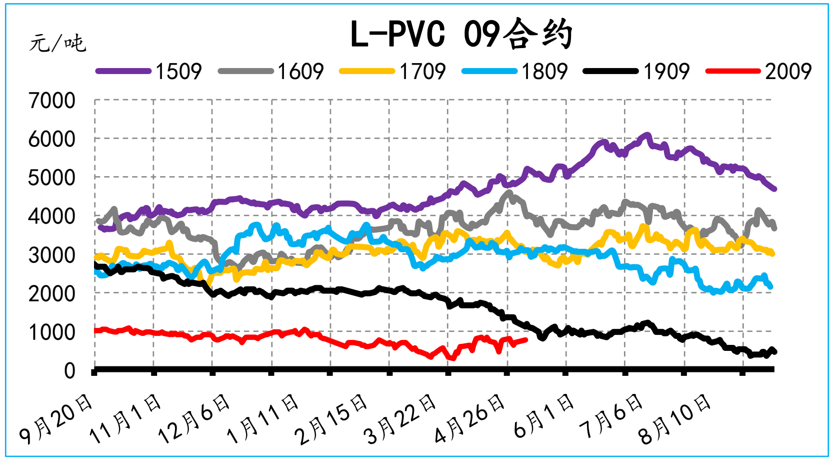

PP-PVC 09合约
元/吨
1509
1609
1709
1809
1909
2009
6000
5000
4000
3000
2000
1000
0
9月20日
11月1日
12月6日
1月11日
2月15日
3月22日
4月26日
6月1日
7月6日
8月10日

跨品种：塑料-PVC


L-PVC 现货
元/吨
2016
2017
2018
2019
2020
6000
5000
4000
3000
2000
1000
0
1月20日
2月23日
3月29日
5月3日
6月6日
7月10日
8月13日
9月16日
10月27日
11月30日


L-PVC 01合约
元/吨
1701
1801
1901
2001
2101
5000
4000
3000
2000
1000
0
1月20日
2月23日
3月29日
5月3日
6月6日
7月10日
8月13日
9月16日
10月27日
11月30日


L-PVC 05合约
元/吨
1605
1705
1805
1905
2005
6000
5000
4000
3000
2000
1000
0
5月20日
6月24日
7月29日
9月2日
10月14日
11月18日
12月23日
1月28日
3月4日
4月8日


L-PVC 09合约
元/吨
1509
1609
1709
1809
1909
2009
7000
6000
5000
4000
3000
2000
1000
0
9月20日
11月1日
12月6日
1月11日
2月15日
3月22日
4月26日
6月1日
7月6日
8月10日

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。