

## 农产品套利跟踪 20210916



联系人：张秀峰

投资咨询编号：Z0011152

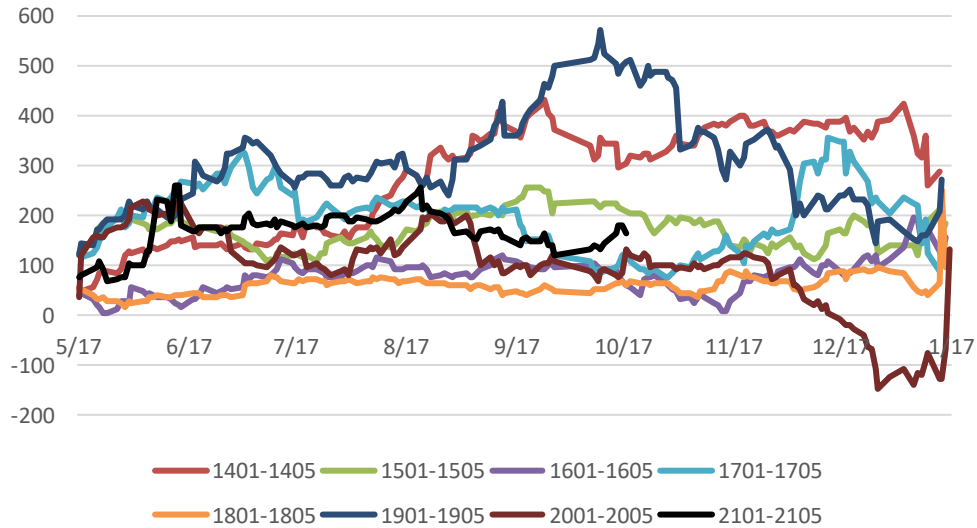
电话：0571-28132638

策略类型		策略组合	2020/9/15	2020/9/16	正常区间	操作建议
跨品种	豆油/豆粕	Y2101/M2101	2.24	2.30	[1.8,2.7]	观望
		Y2105/M2105	2.31	2.36	[1.8,2.7]	观望
		Y2109/M2109	2.25	2.29	[1.8,2.6]	观望
		Y 现货/M 现货	2.25	2.28	[1.6,2.5]	-
	菜油/菜粕	OI2101/RM2101	3.60	3.67	[2.5,3.5]	观望
		OI2105/RM2105	3.41	3.46	[2.5,3.2]	观望
		OI2109/RM2109	3.35	3.40	[2.3,3.2]	观望
		OI 现货/RM 现货	3.87	3.97	[2.3,4.3]	-
	菜油-豆油	OI2101-Y2101	1827	1752	[0,1000]	观望
		OI2105-Y2105	1546	1484	[0,1200]	-
		OI2109-Y2109	1510	1467	[0,1200]	观望
		OI 现货-Y 现货	2528	2583	[0,1500]	-
	豆油-棕榈油	Y2101-P2101	892	918	[500,1500]	观望
		Y2105-P2105	870	894	[500,1500]	观望
		Y2109-P2109	842	866	[500,1500]	观望
		Y 现货-P 现货	430	410	[200,1500]	-
	菜油-棕榈油	OI2101-P2101	2719	2670	[800,2000]	观望
		OI2105-P2105	2416	2378	[700,2000]	观望
		OI2009-P2109	2352	2333	[700,2000]	观望
		OI 现货-P 现货	2958	2993	[500,3000]	-
	豆粕-菜粕	M2101-RM2101	673	667	[500,1000]	观望
		M2105-RM005	491	492	[400,1000]	观望
		M2109-RM2109	524	523	[400,1000]	观望
		M 现货-RM 现货	603	611	[400,1500]	-

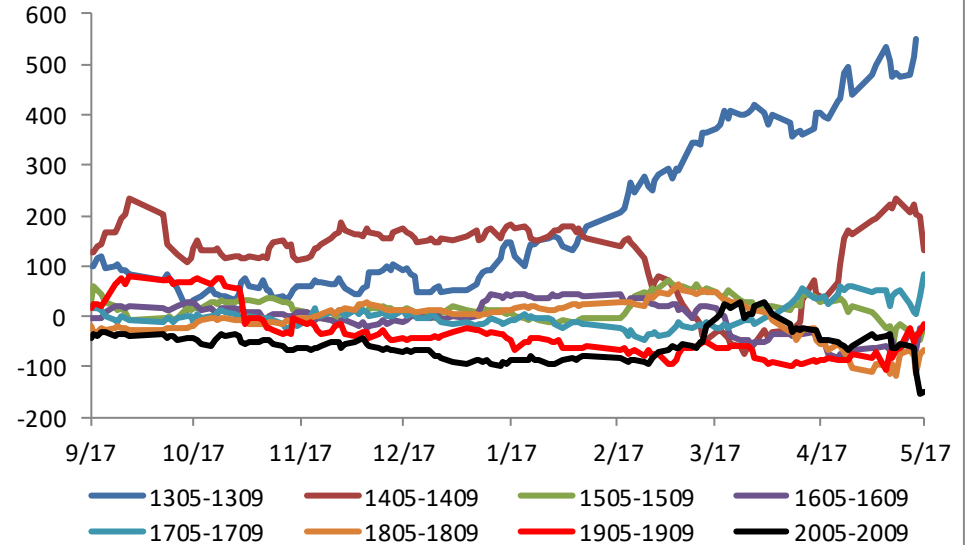
策略类型		策略组合	2020/9/15	2020/9/16	正常区间	操作建议
跨期	豆粕	M2101-M2105	181	165	[0,400]	观望
		M2105-M2109	-38	-40	[-100,200]	观望
		M2109-M2101	-143	-125	[-100,300]	观望
		主力合约基差	57	51	[-200,600]	-
	菜粕	RM2101-RM2105	-1	-10	[-100,100]	观望
		RM2105-RM2109	-5	-9	[-50,150]	观望
		RM2109-RM2101	6	19	[0,350]	观望
		主力合约基差	78	63	[0,600]	-
	豆油	Y2101-Y2105	178	188	[-150,150]	观望
		Y2105-Y2109	88	108	[-250,50]	观望
		Y2109-Y2101	-266	-296	[-200,0]	观望
		主力合约基差	318	276	[-400,150]	-
	棕榈油	P2101-P2105	156	164	[-300,100]	观望
		P2105-P2109	60	80	[-300,200]	观望
		P2109-P2101	-216	-244	[-200,200]	观望
		主力合约基差	580	582	[-500,500]	-
	菜油	OI2101-OI2105	459	456	[-200,100]	观望
		O2105-OI2109	124	125	[-300,200]	观望
		OI2109-OI2101	-583	-581	[-200,500]	观望
		主力合约基差	1186	1242	[-100,1000]	-
	玉米	C2101-C2105	-39	-41	[-100,100]	观望
		C2105-C2109	-38	-35	[-100,150]	观望
		C2109-C2101	77	76	[-100,250]	观望
		主力合约基差	-179	-186	[-100,400]	-
	白糖	SR2101-SR2105	67	64	[-150,200]	观望
		SR2105-SR2109	-15	-17	[-150,200]	观望
		SR2109-SR2101	-52	-47	[-300,250]	观望
		主力合约基差	262	284	[-300,500]	-
棉花	CF2101-CF2105	-340	-350	[-1000,1000]	观望	
	CF2105-CF2109	-360	-355	[1000,2000]	观望	
	CF2109-CF2101	700	705	[-1000,1000]	观望	
	主力合约基差	-818	-722	[0,2000]	-	

# 跨期套利跟踪：M

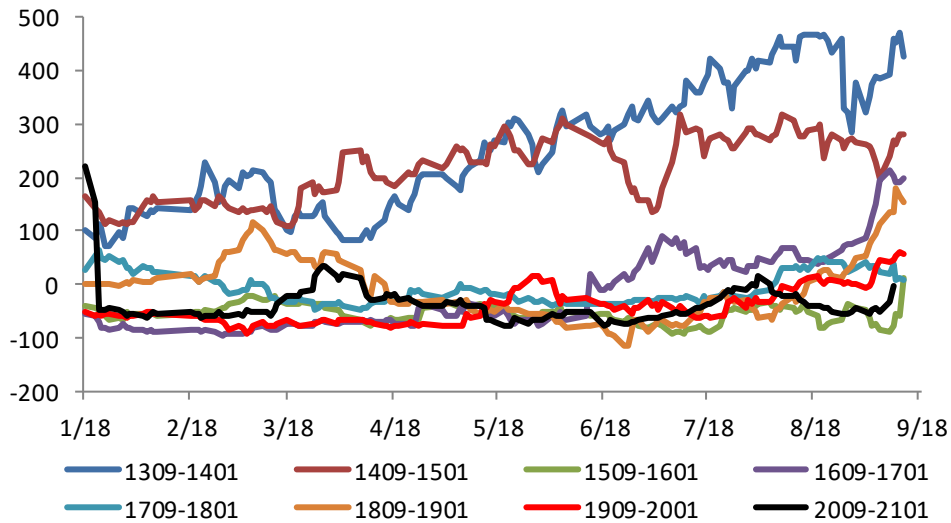
## M01-M05



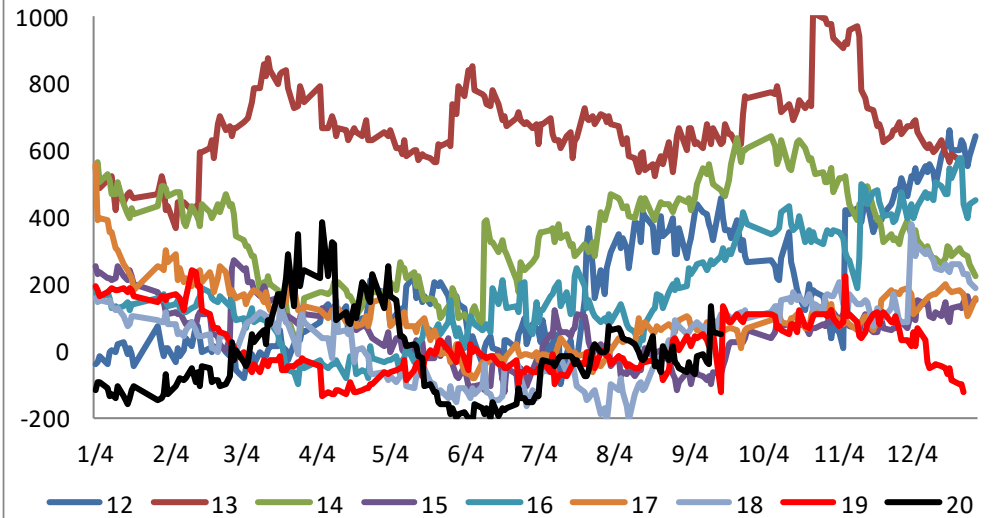
## M05-M09



## M09-M01

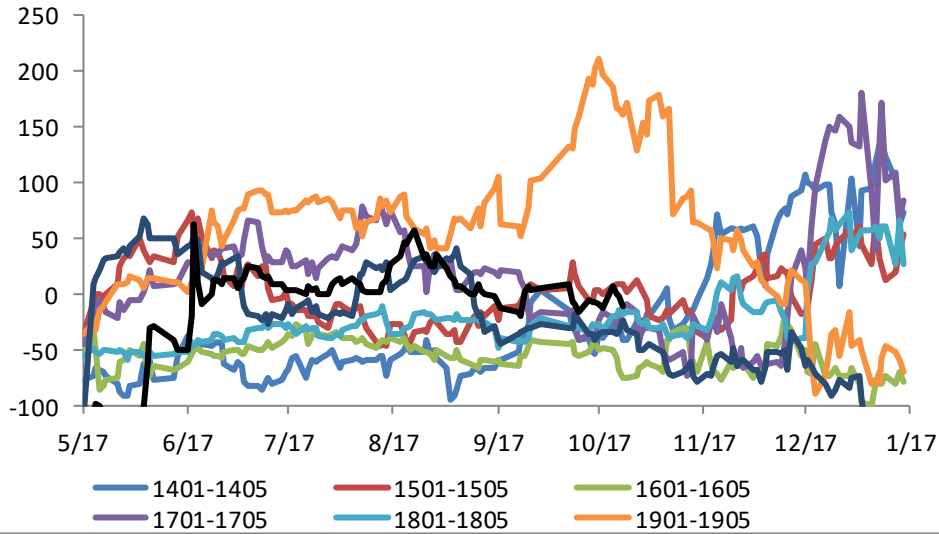


## 豆粕主力合约基差

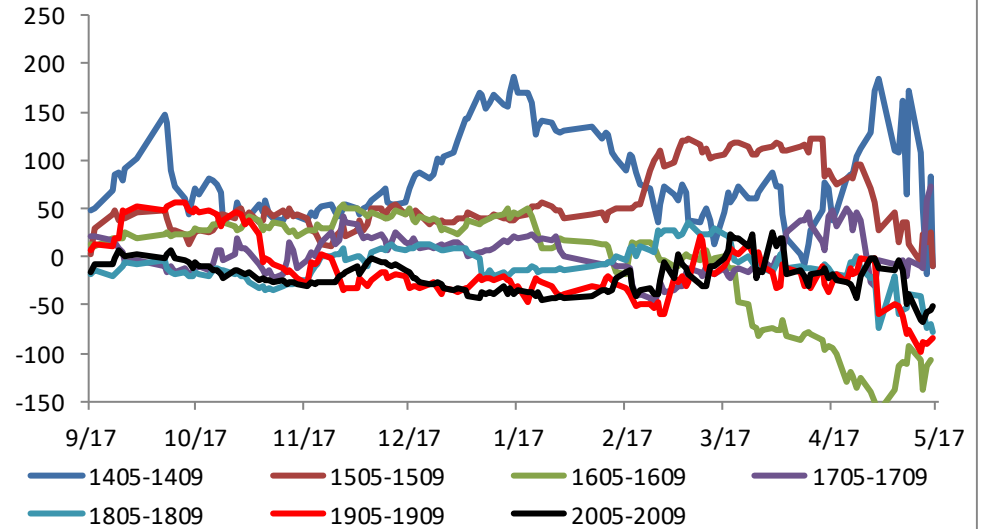


# 跨期套利跟踪：RM

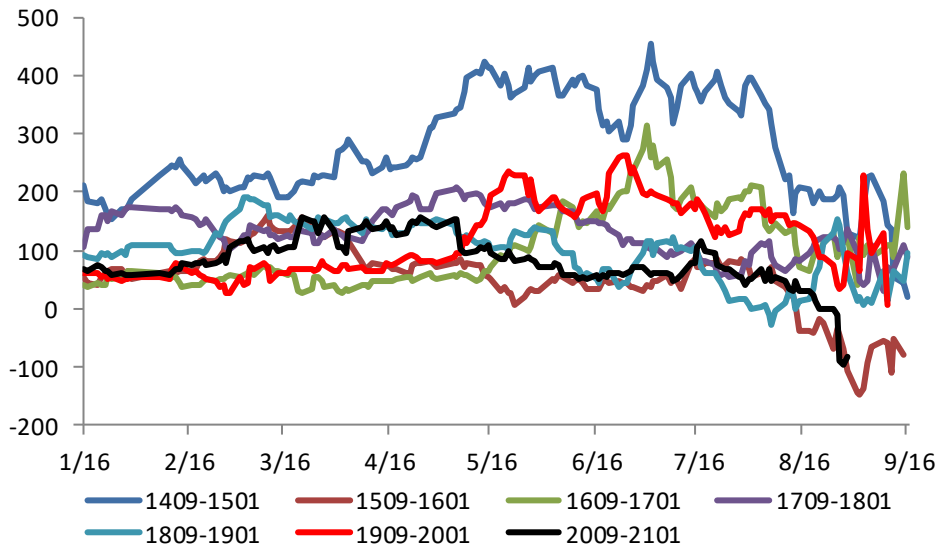
## RM01-RM05



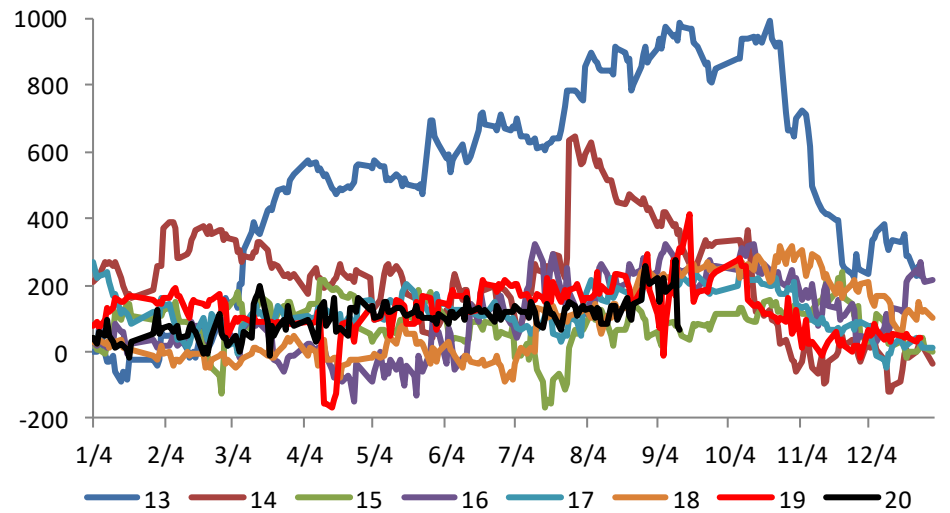
## RM05-RM09



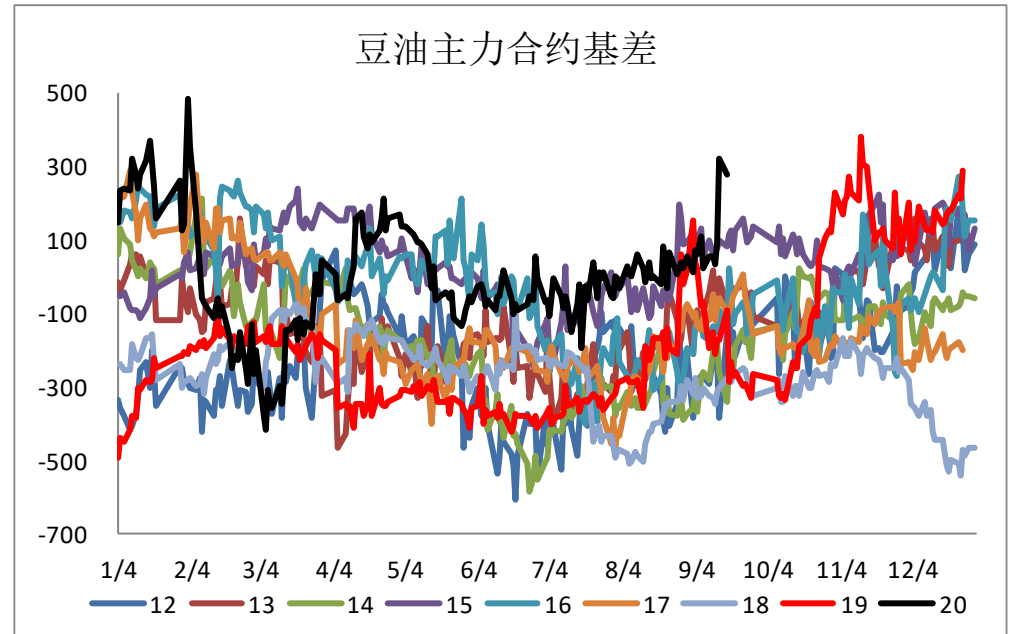
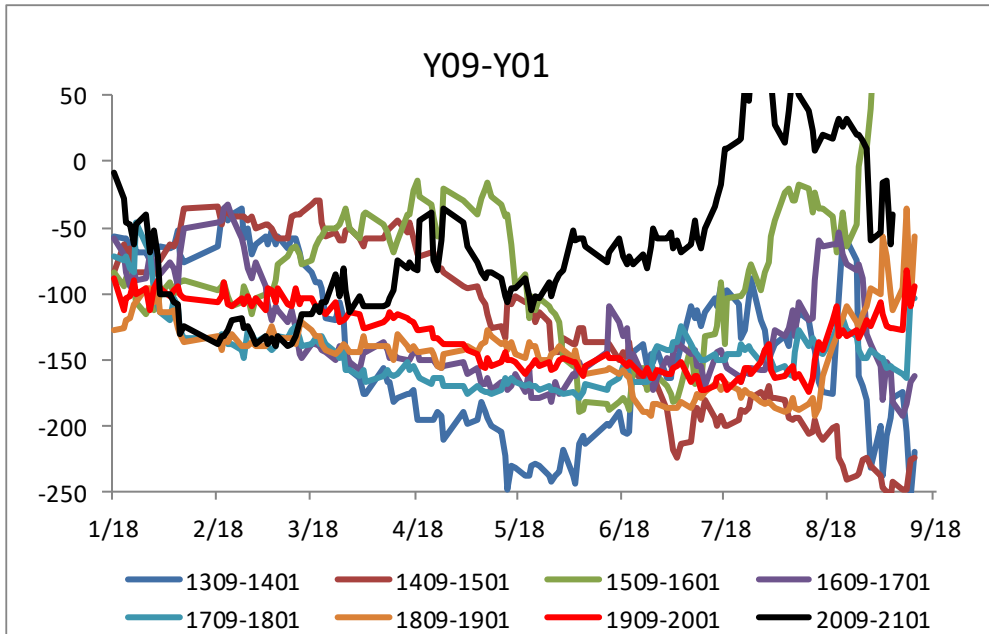
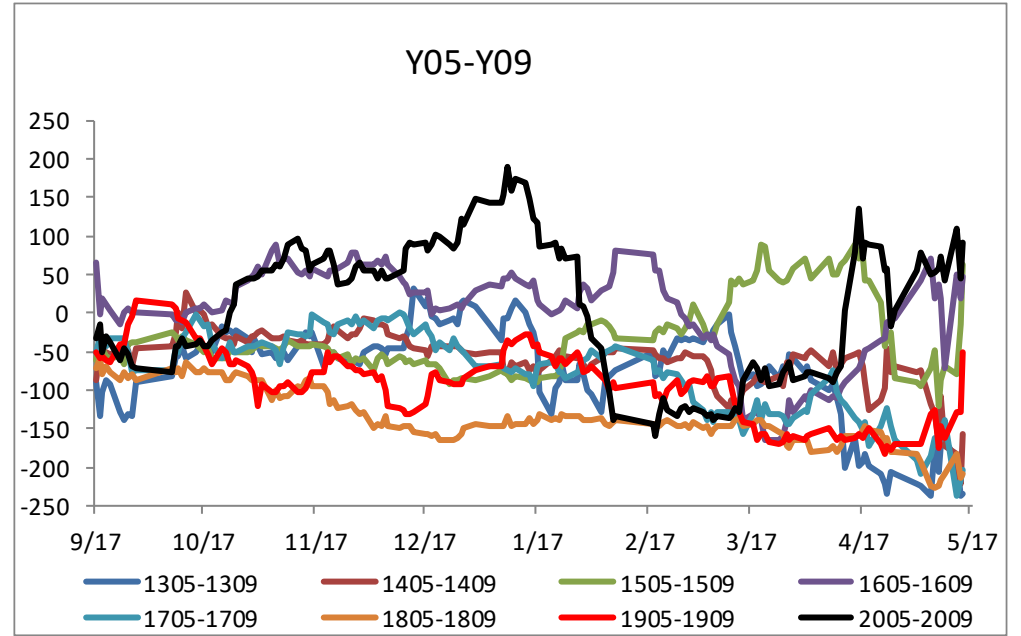
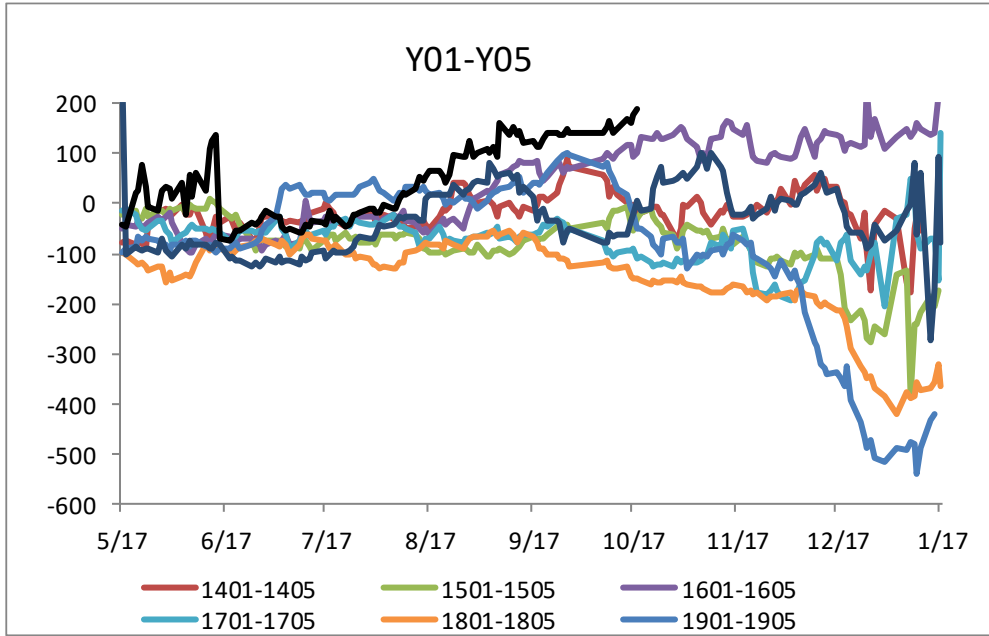
## RM09-RM01



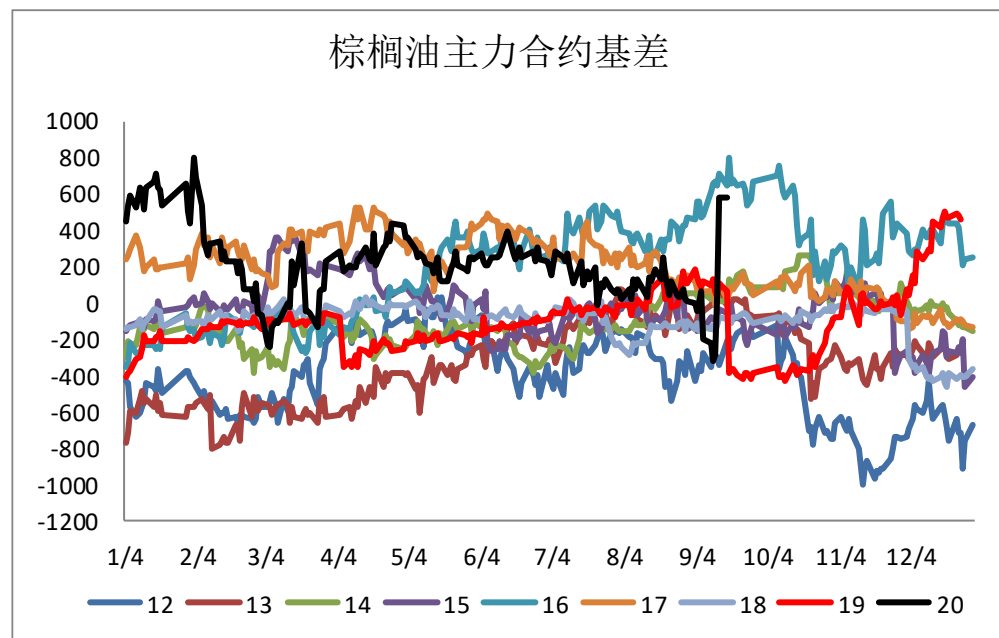
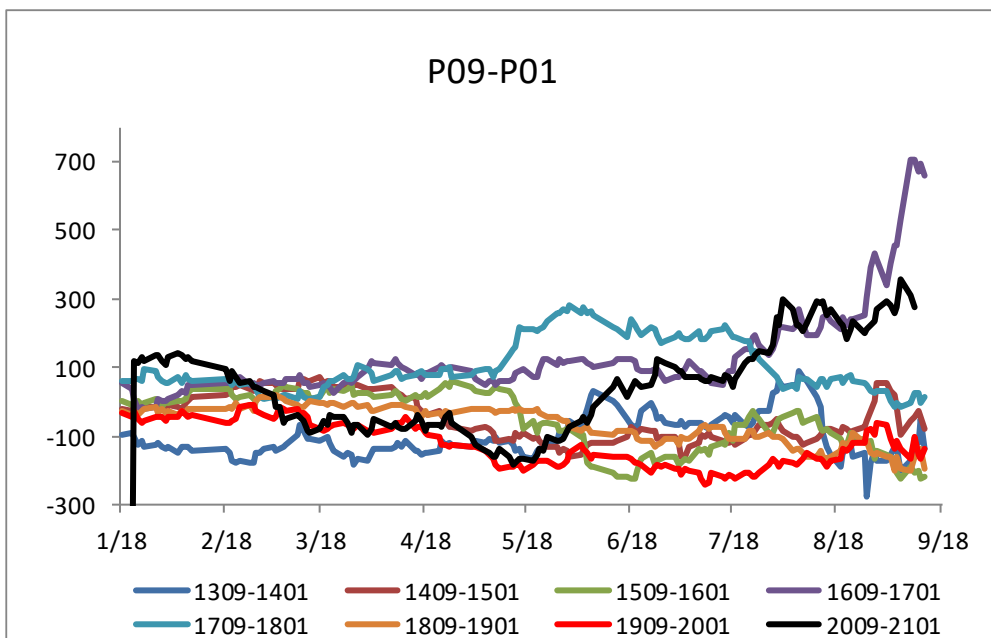
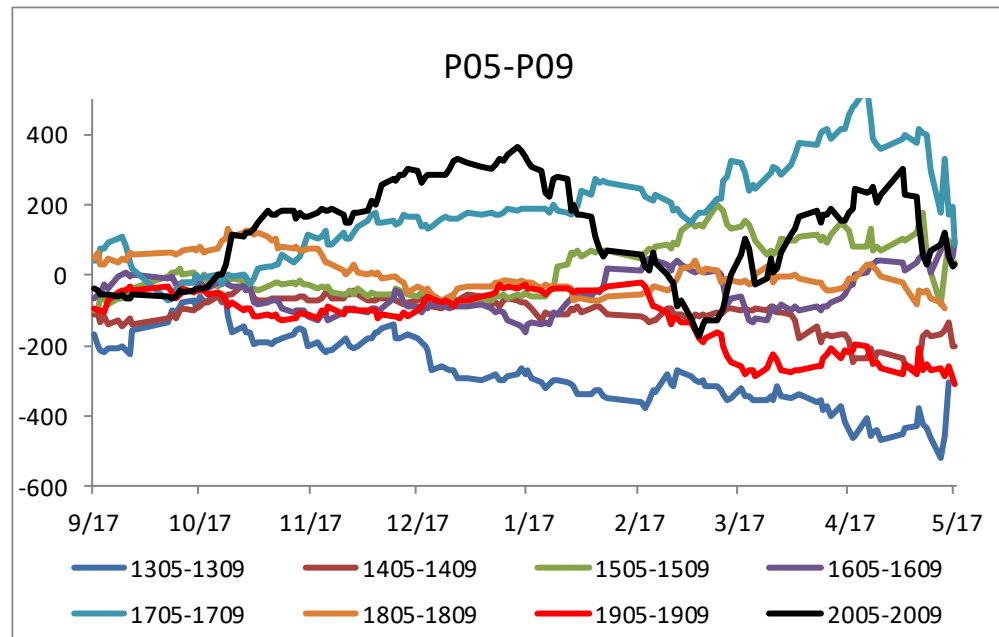
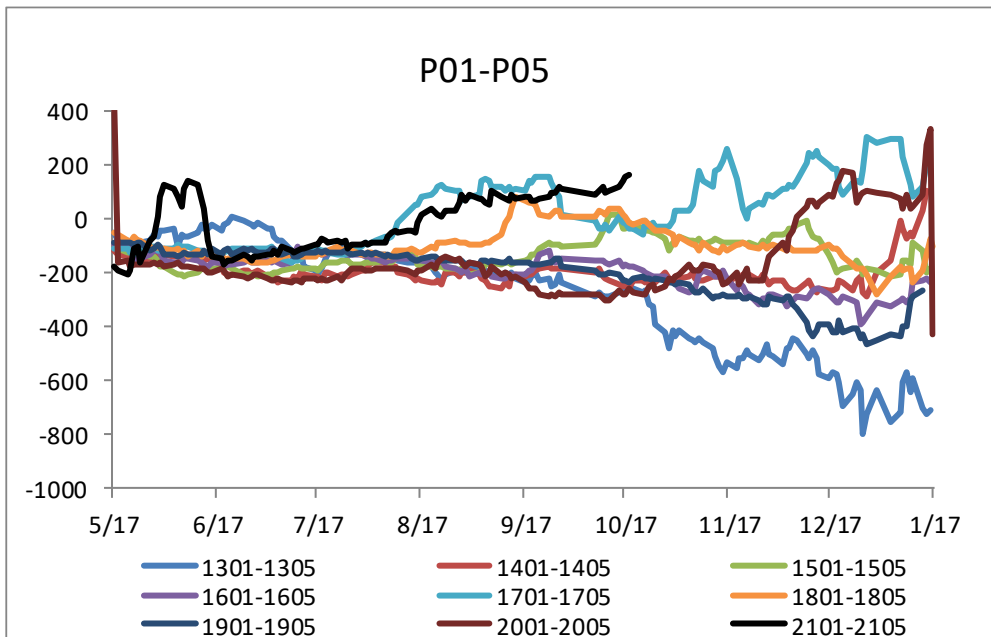
## 菜粕主力合约基差



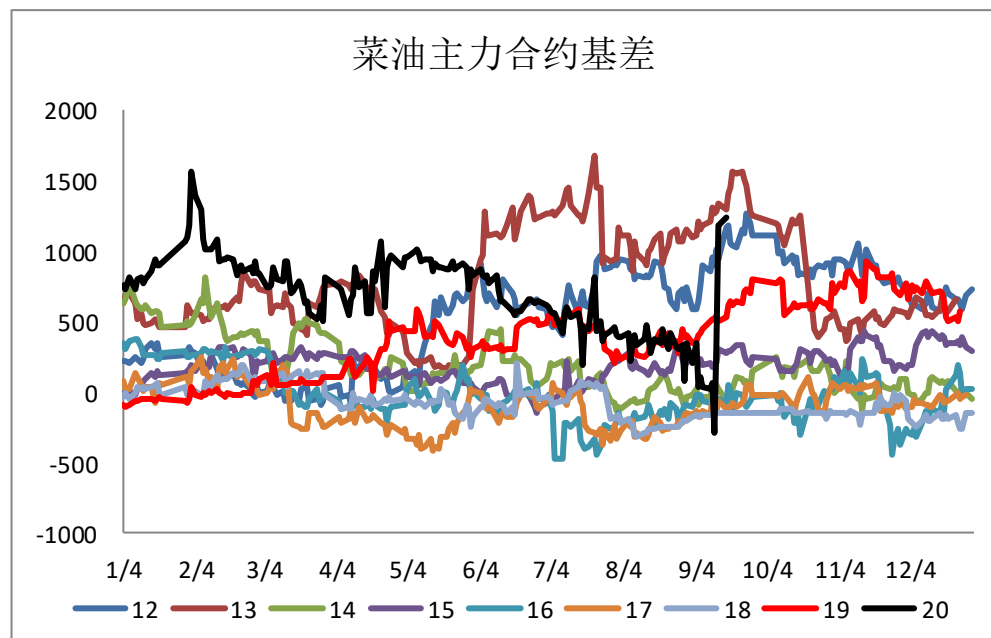
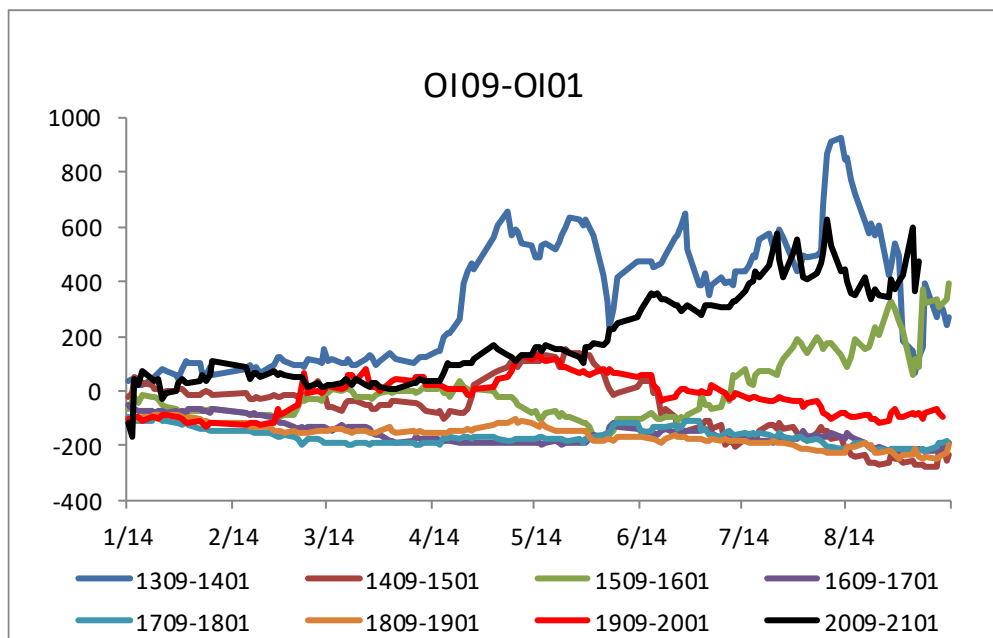
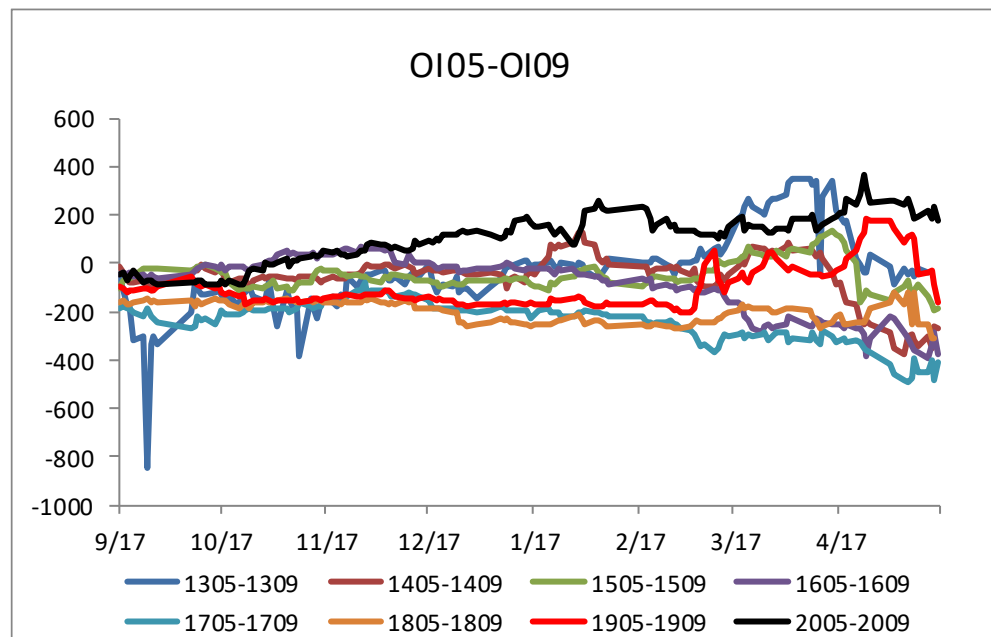
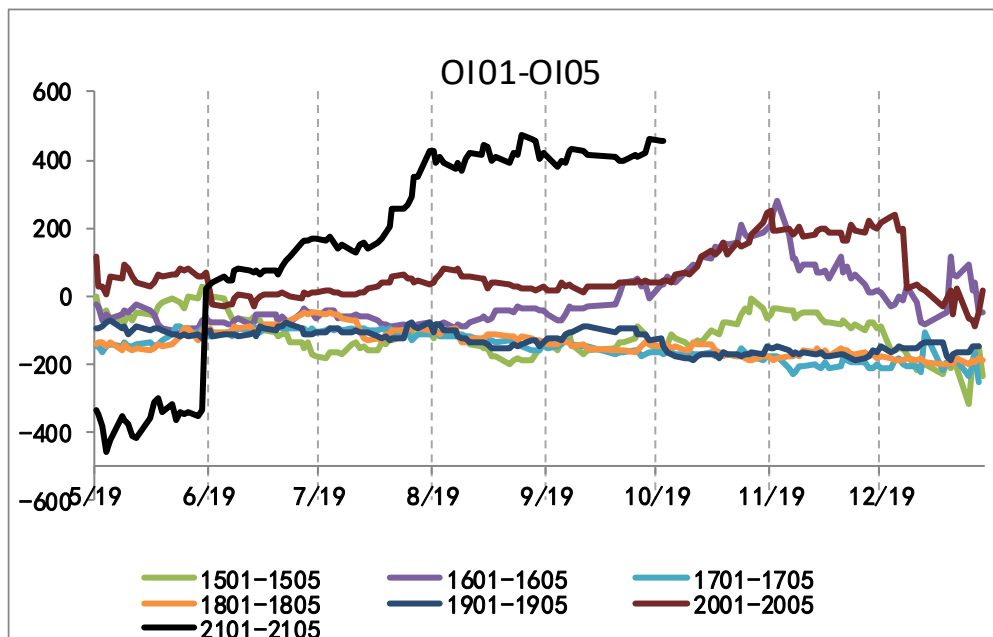
# 跨期套利跟踪：Y



# 跨期套利跟踪：P

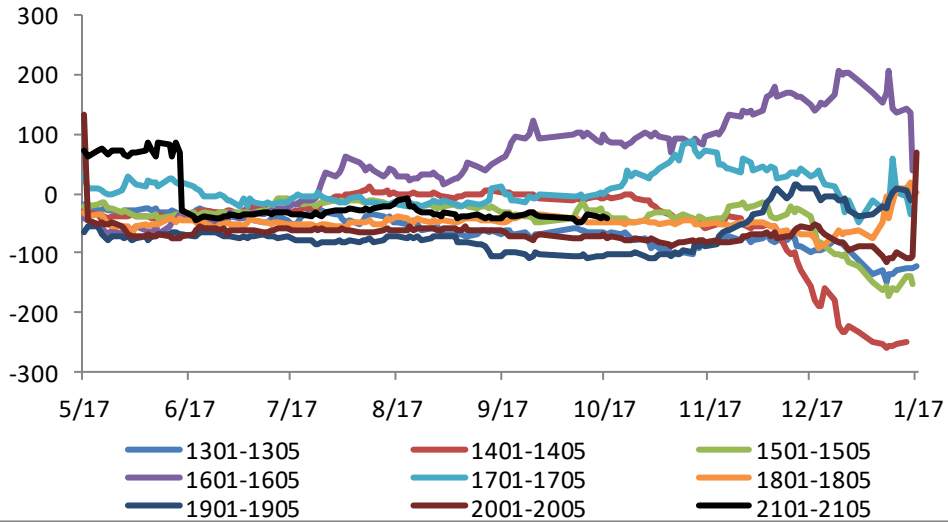


# 跨期套利跟踪：OI

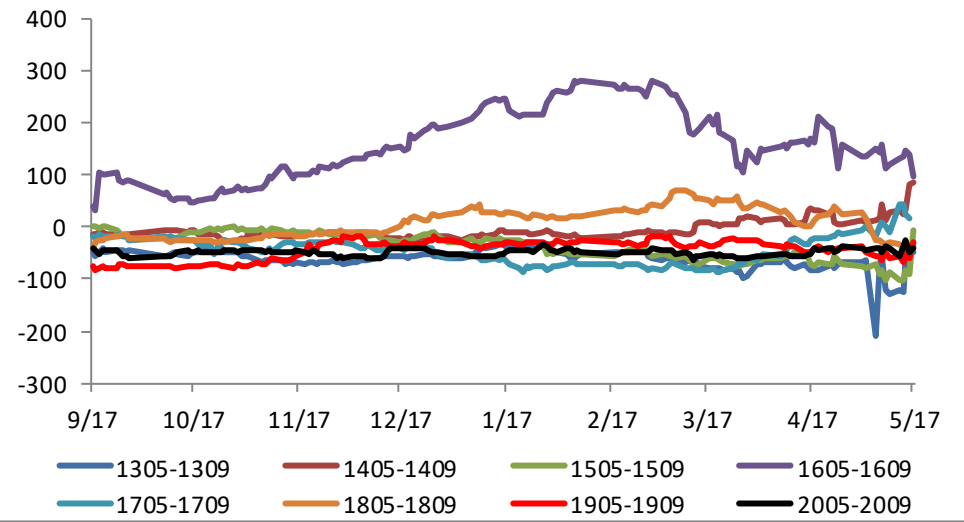


# 跨期套利跟踪：C

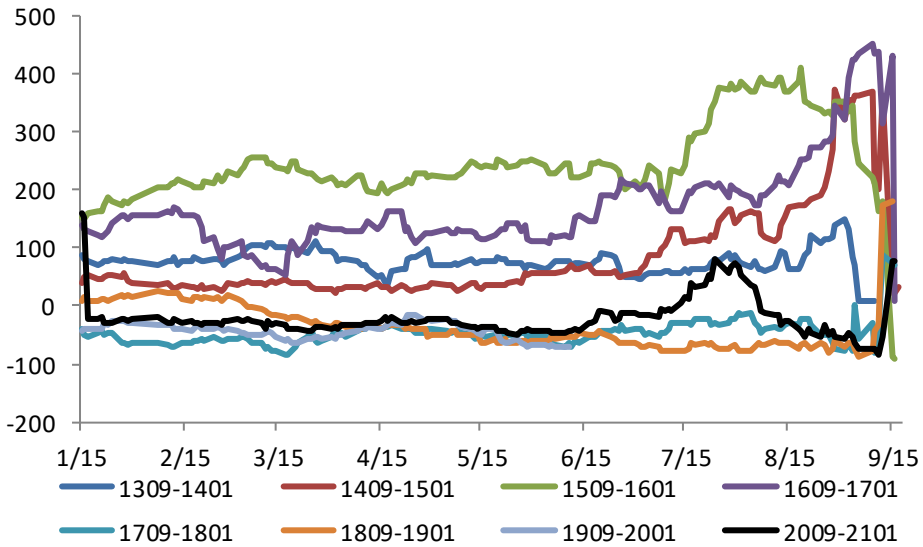
## C01-C05



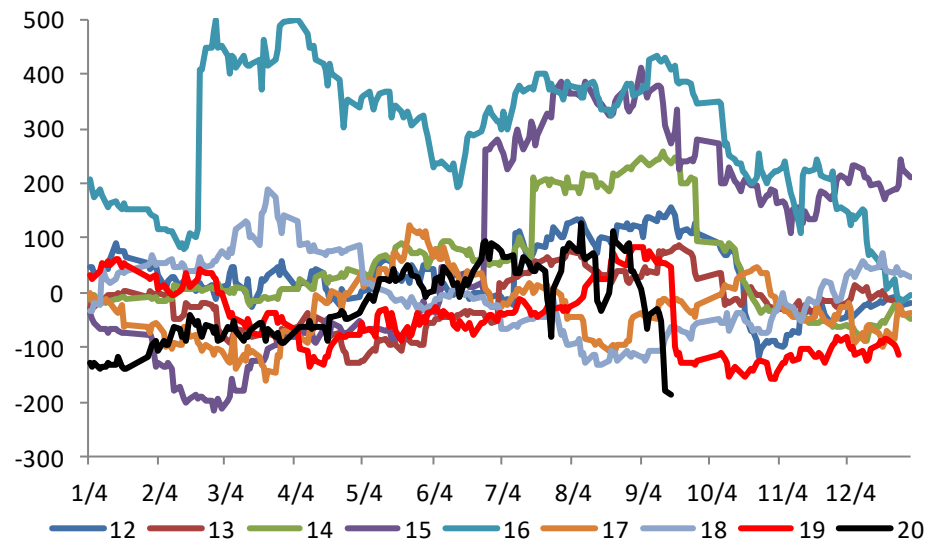
## C05-C09



## C09 - C01



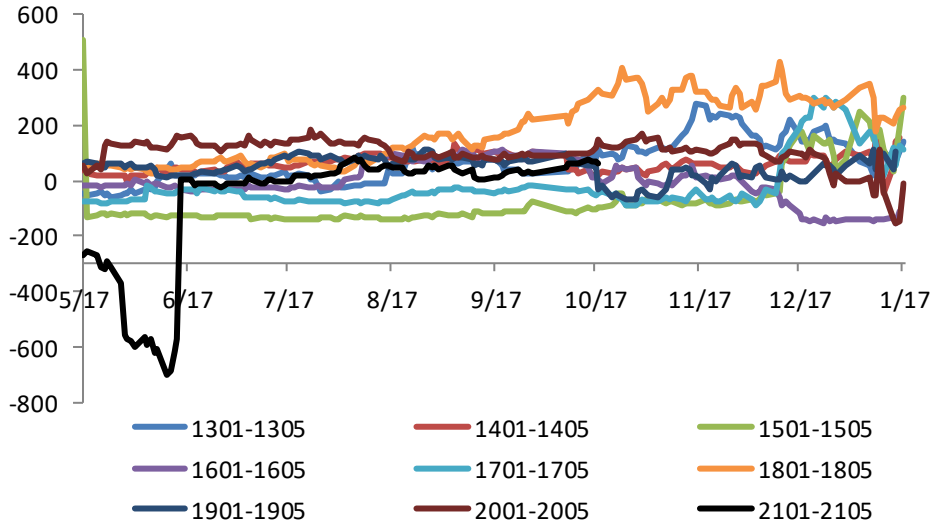
## 玉米主力合约基差



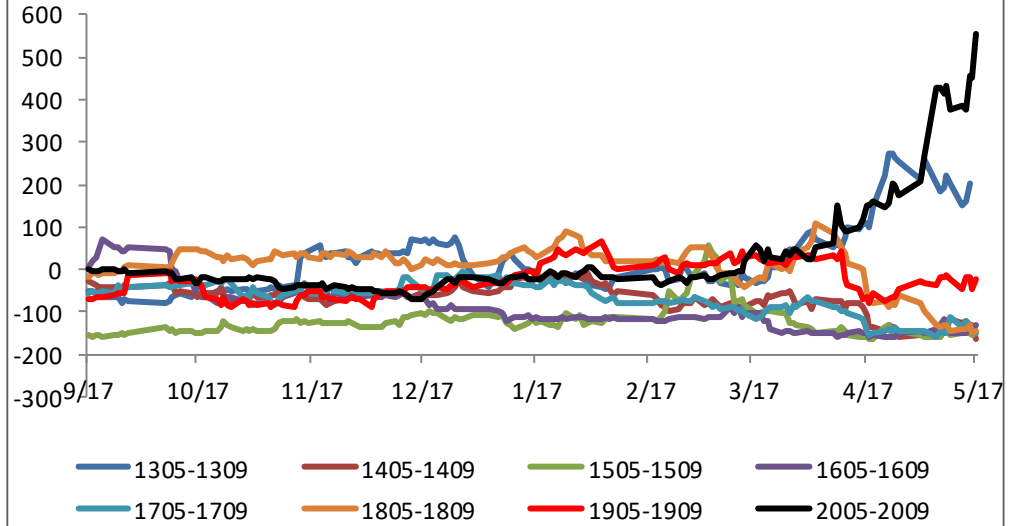


# 跨期套利跟踪：SR

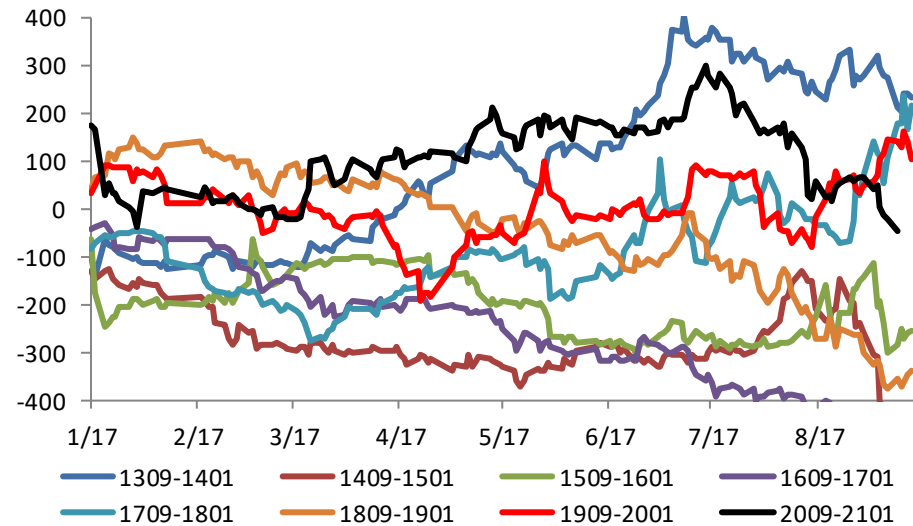
## SR01-SR05



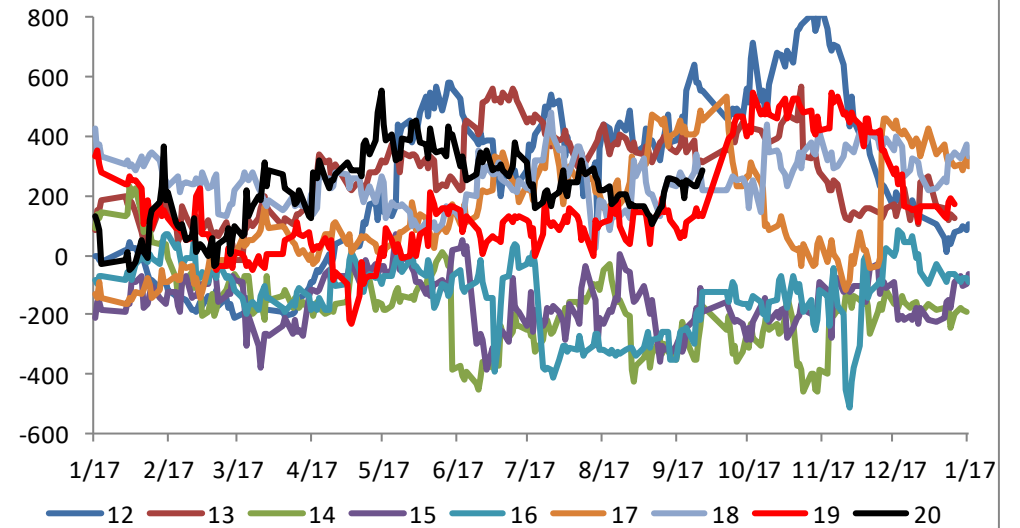
## SR05-SR09



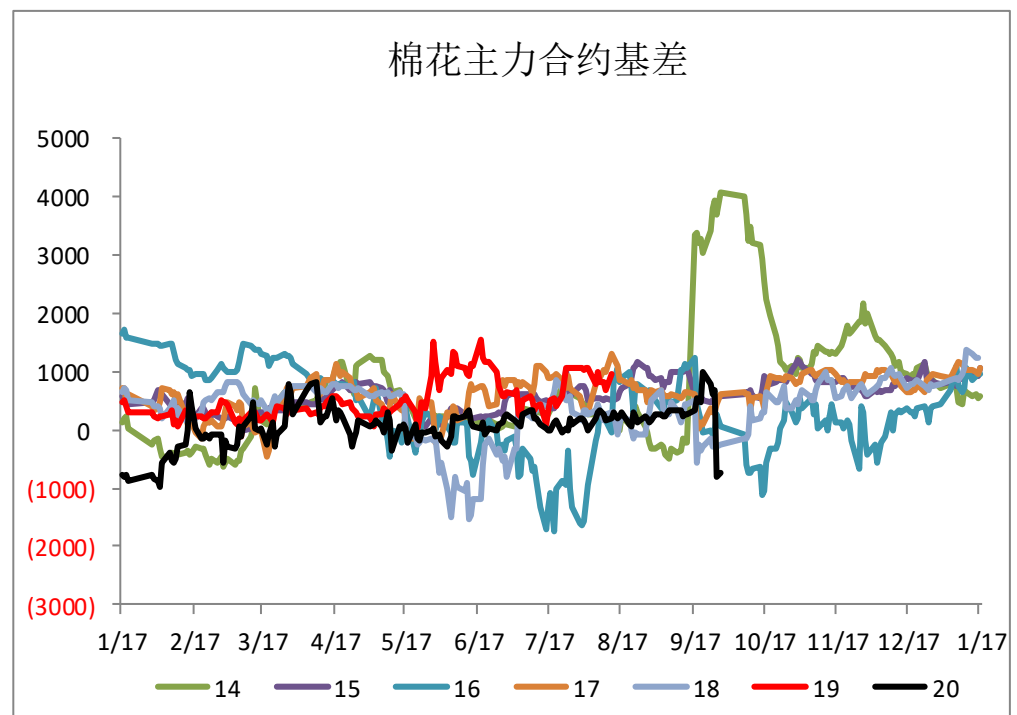
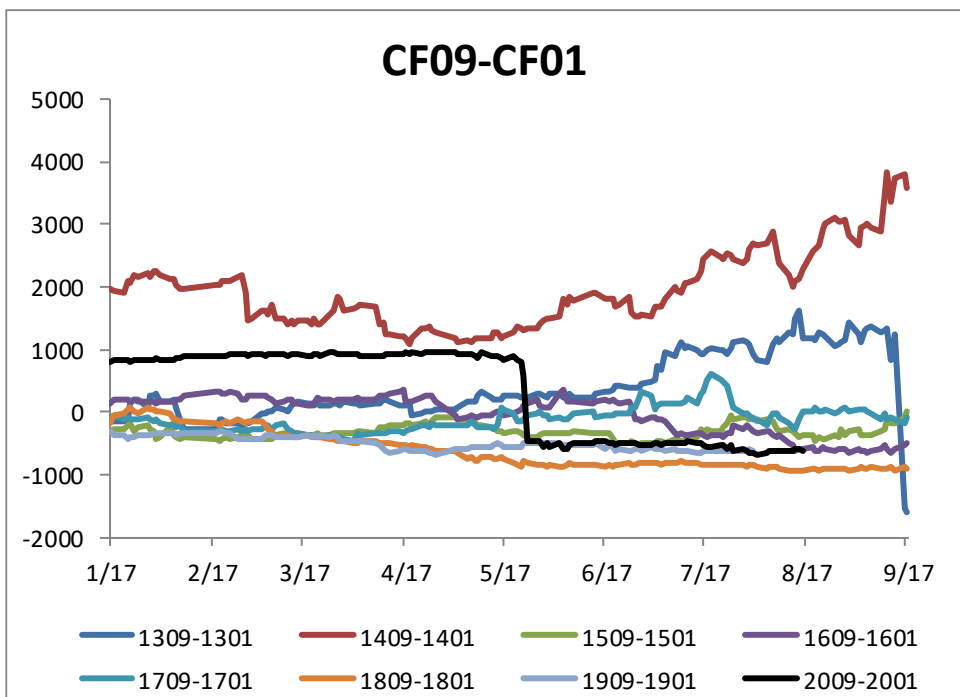
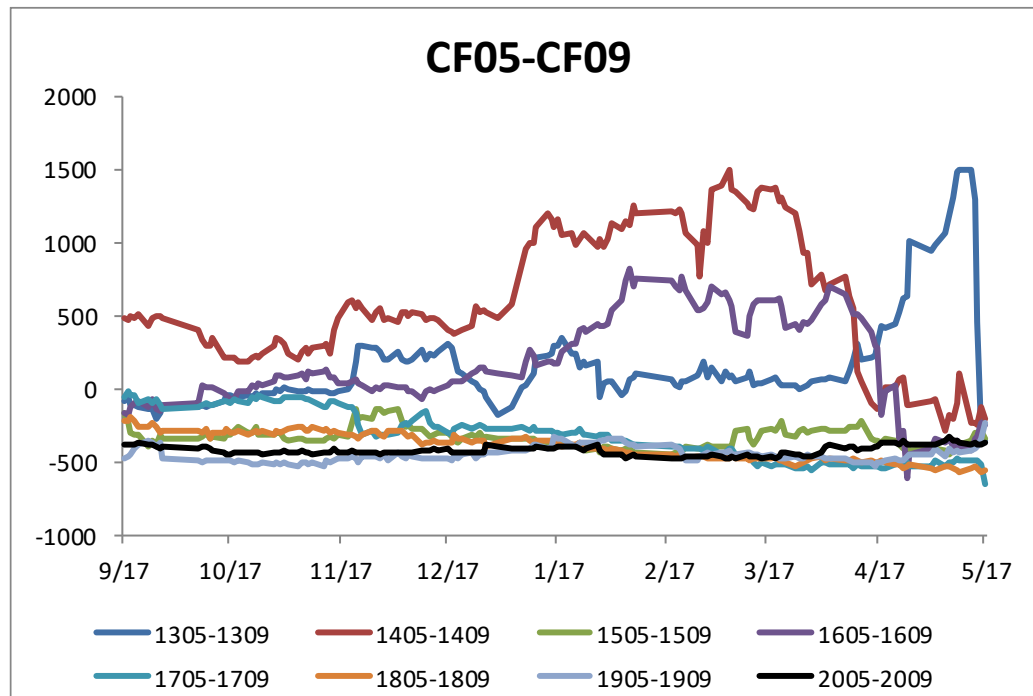
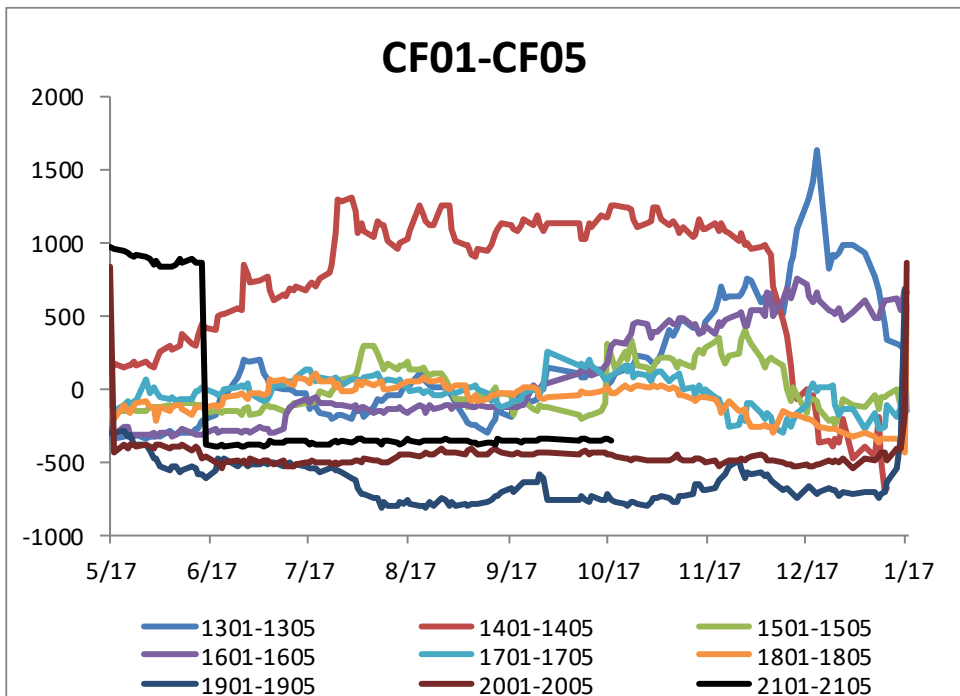
## SR09 - SR01



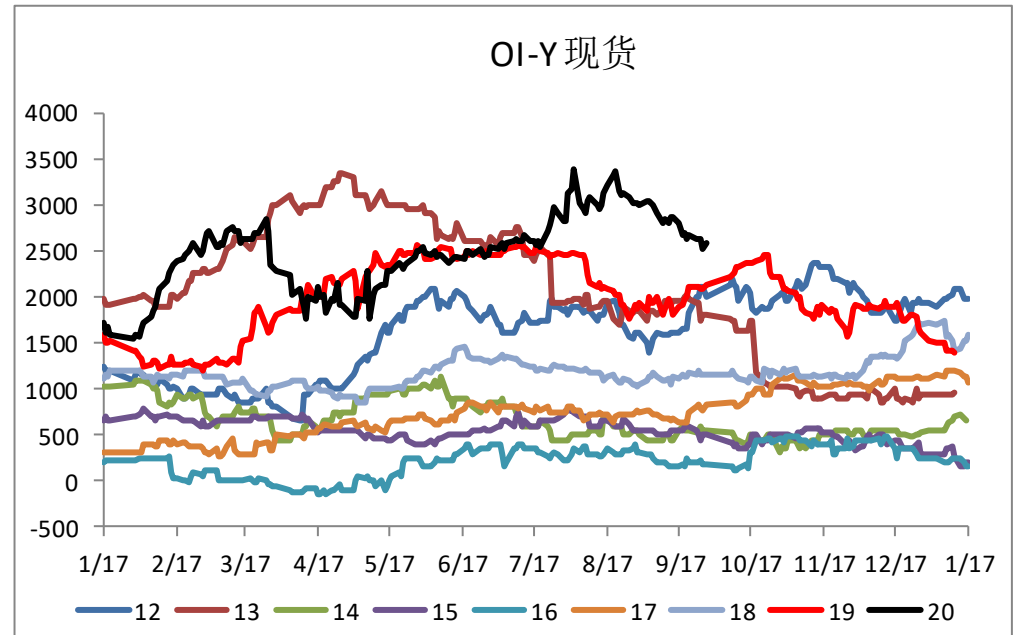
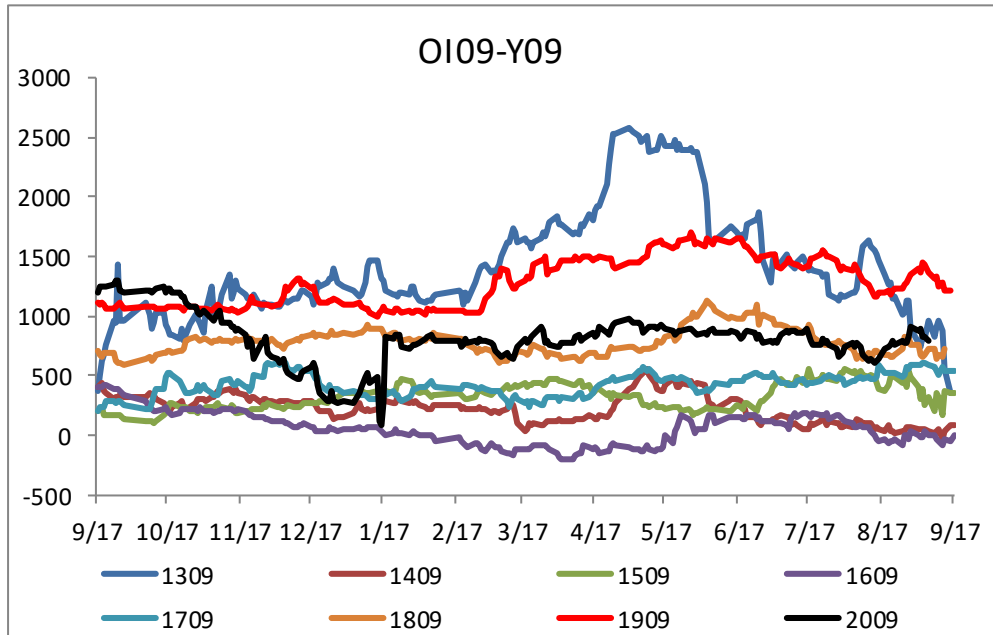
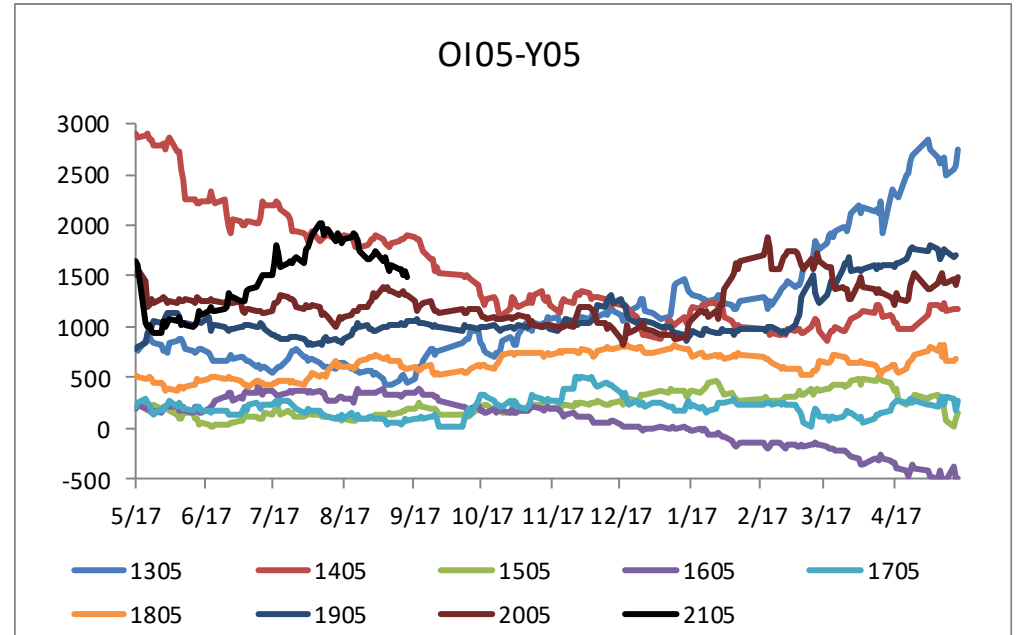
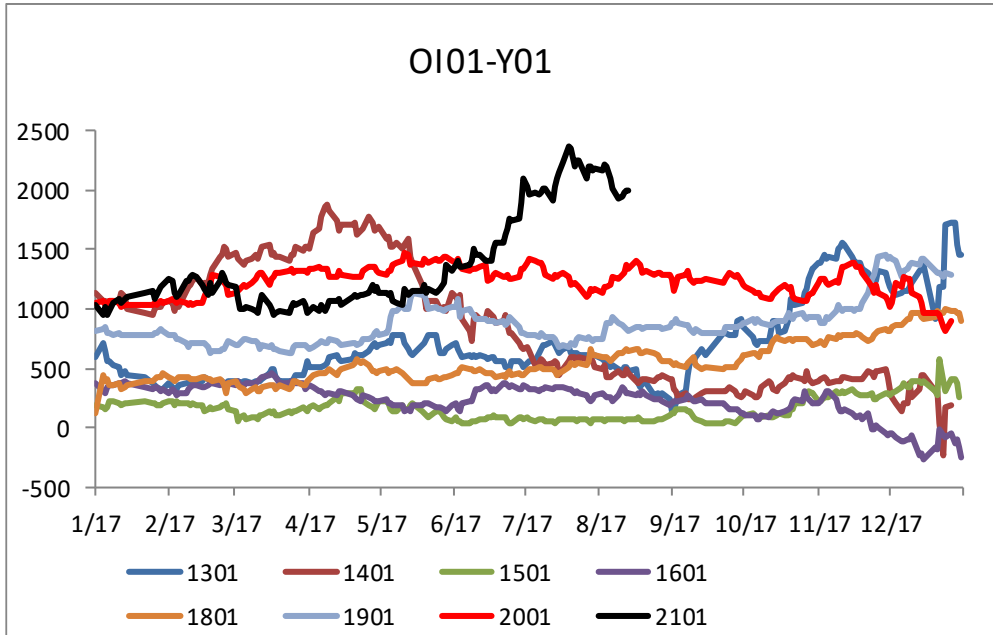
## 白糖主力合约基差



# 跨期套利跟踪：CF

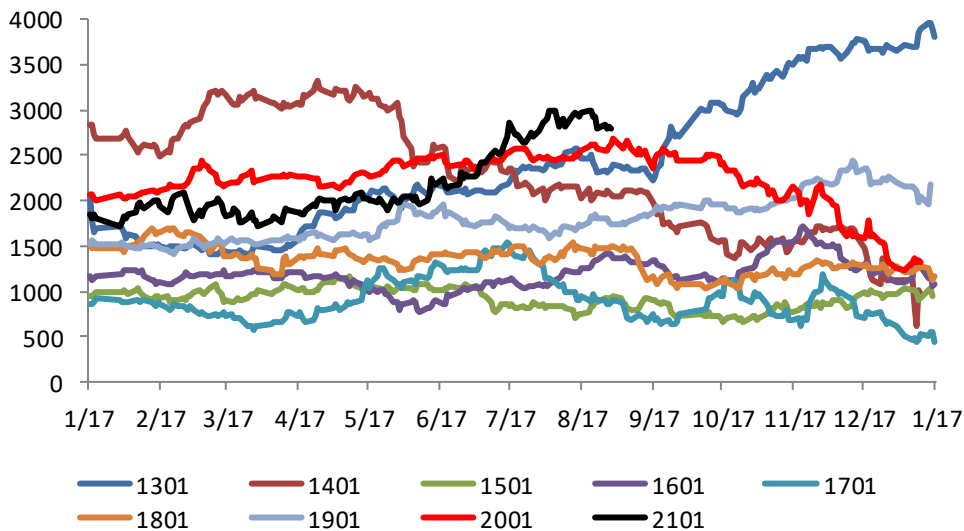


# 跨品种套利跟踪：OI-Y

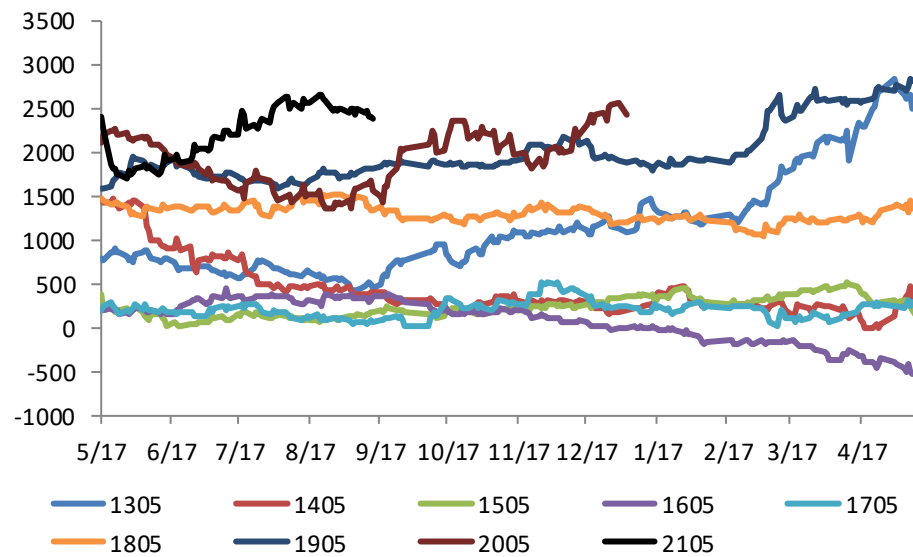


# 跨品种套利跟踪: OI-P

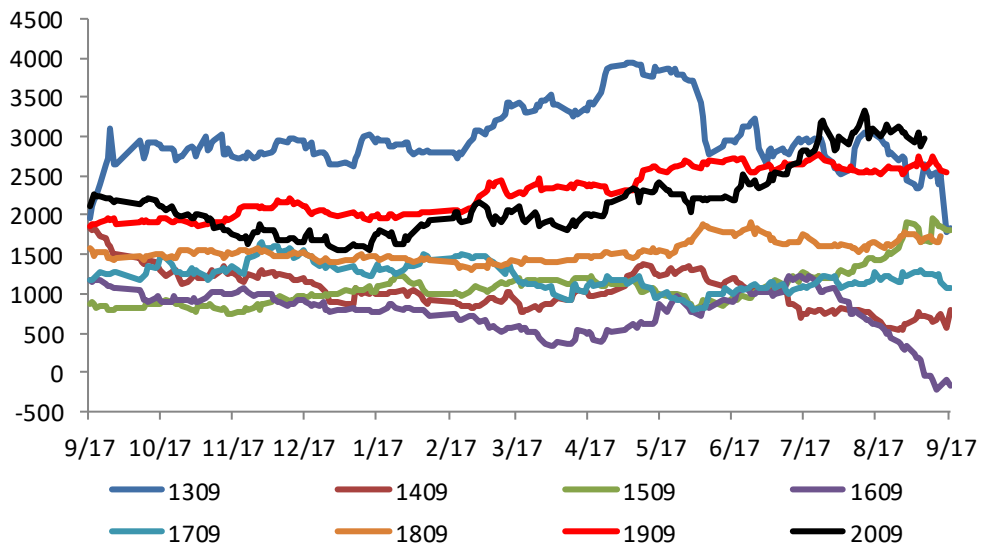
## OI01-P01



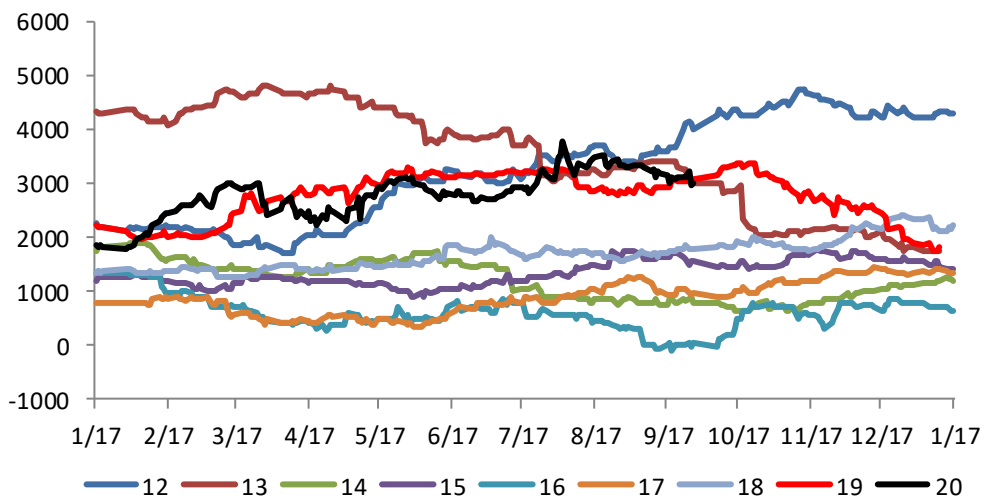
## OI05-P05



## OI09-P09

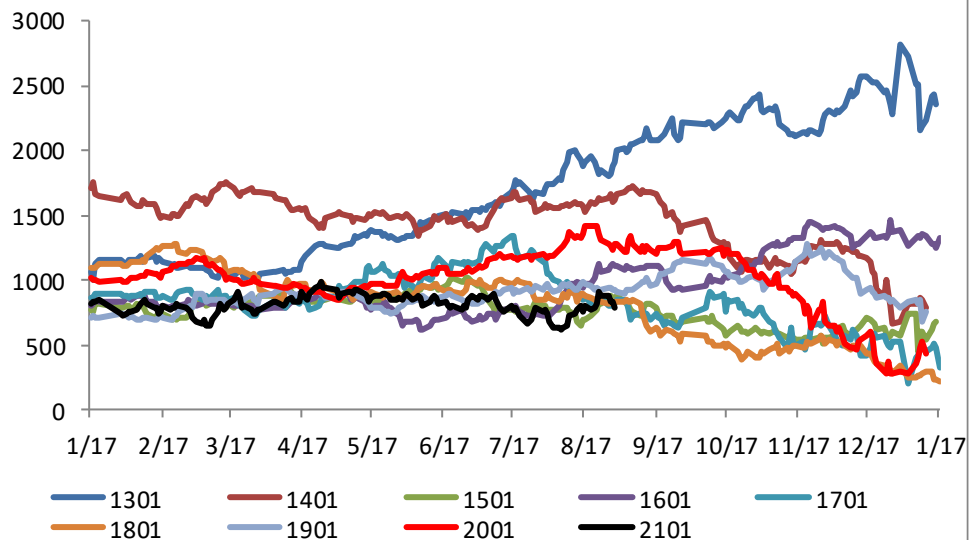


## OI-P现货

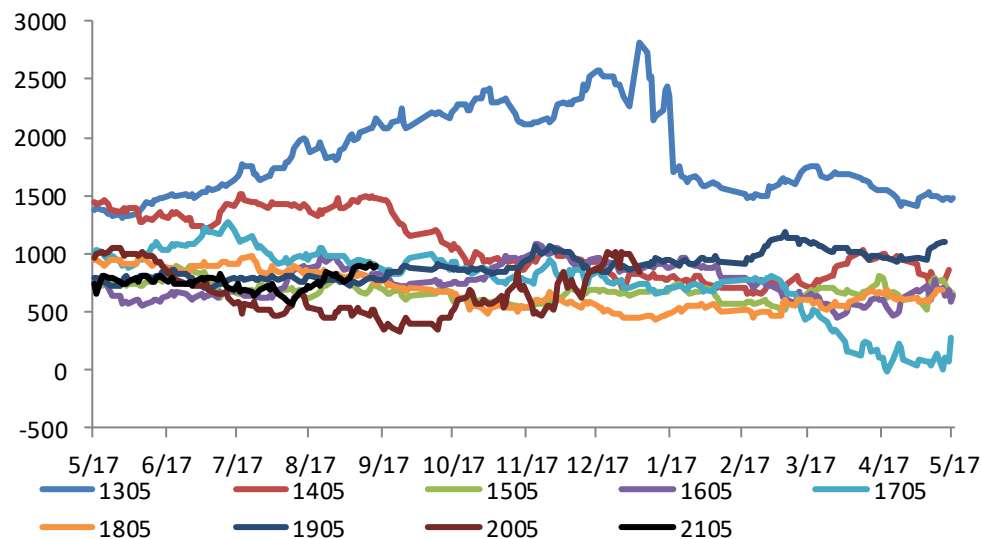


# 跨品种套利跟踪：Y-P

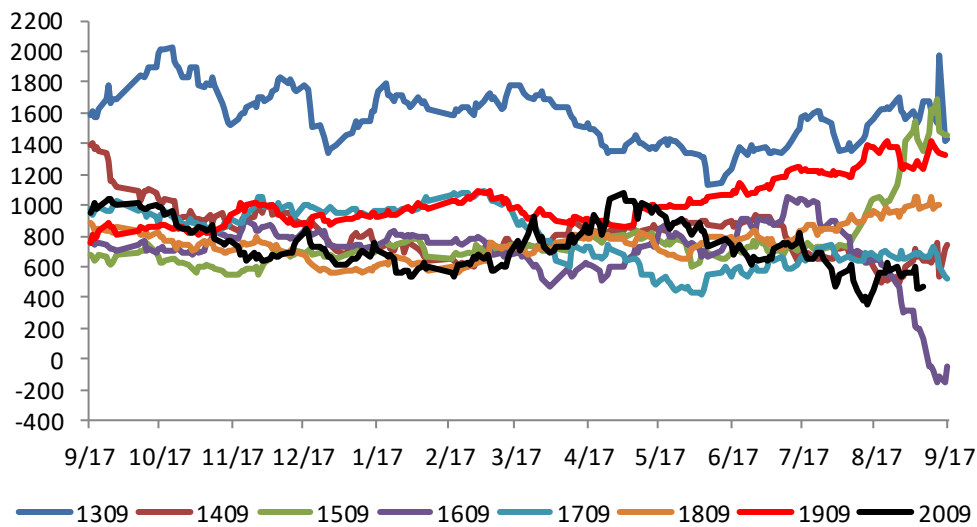
## Y01-P01



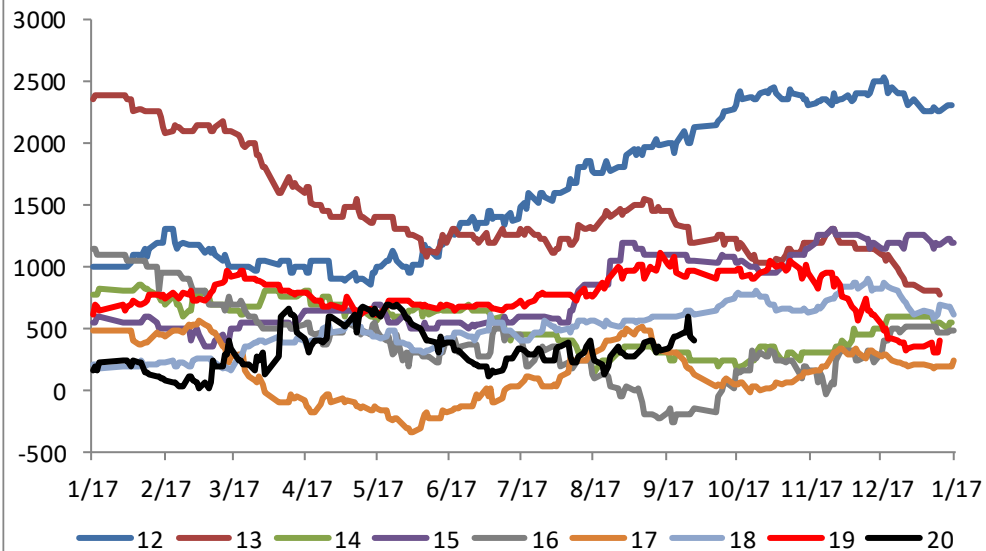
## Y05-P05



## Y09-P09

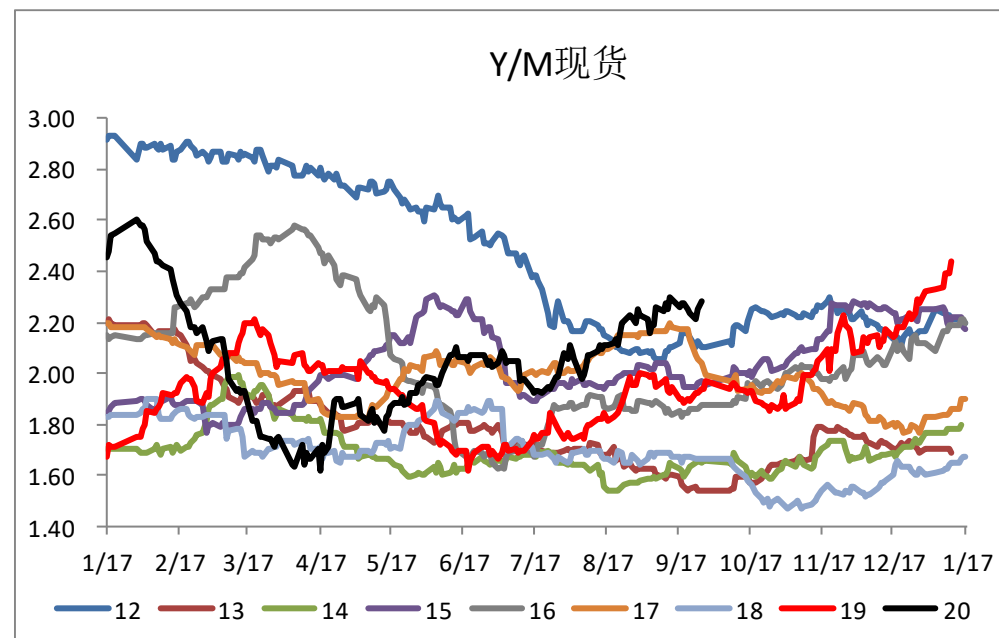
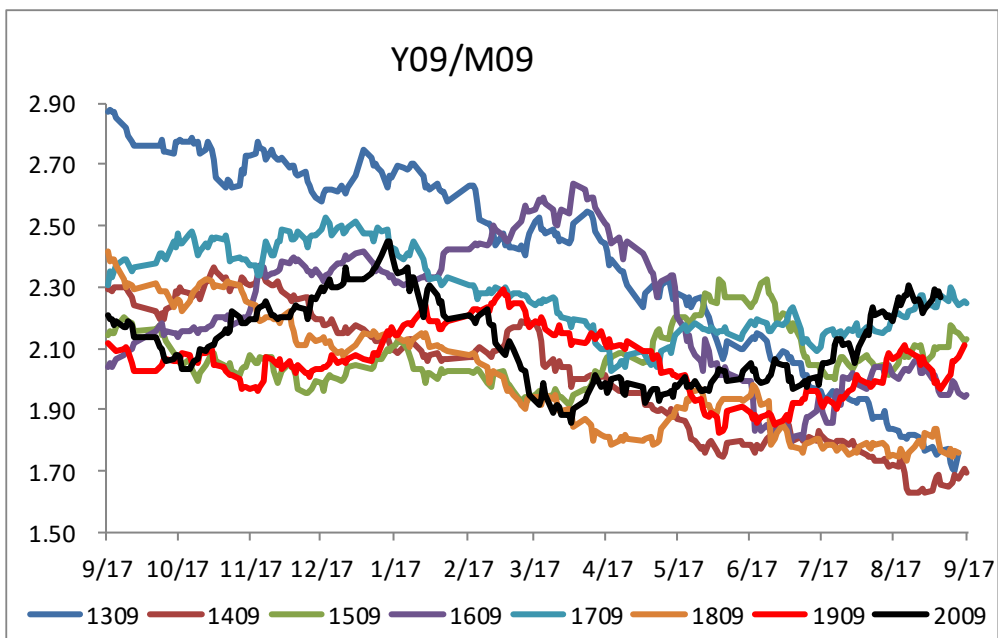
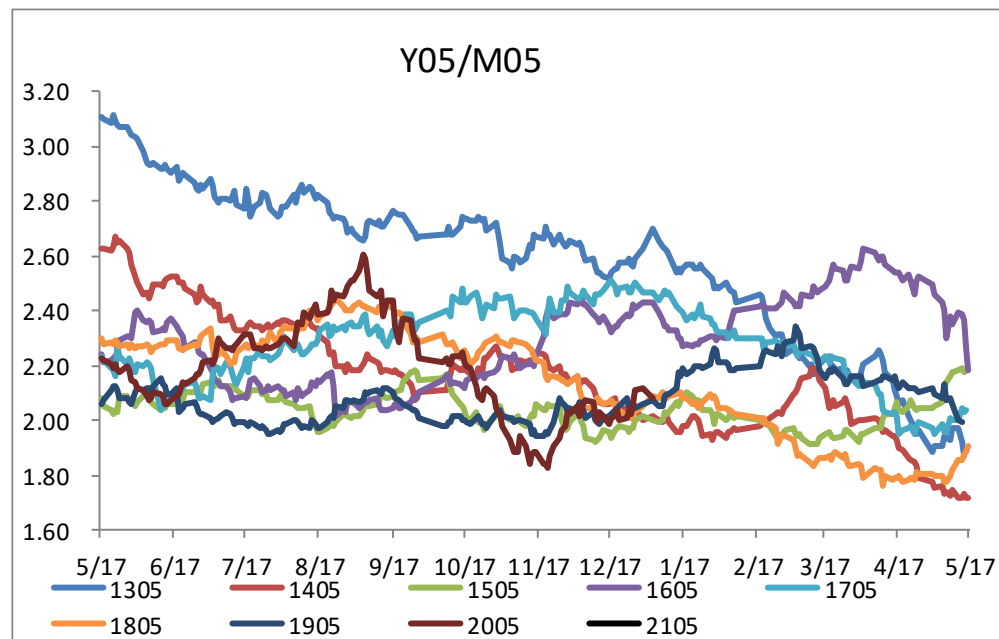
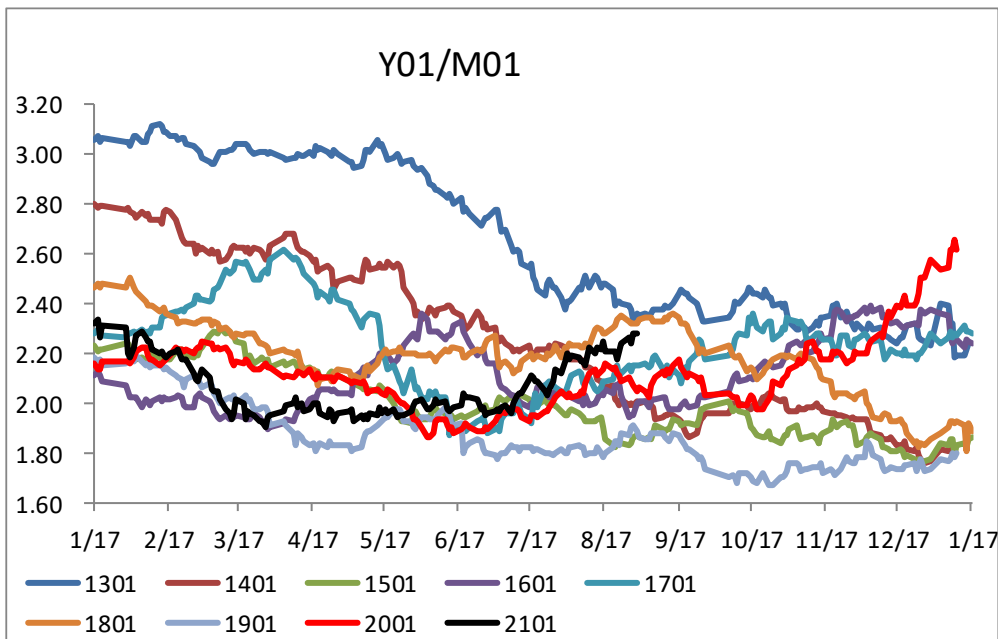


## Y-P现货

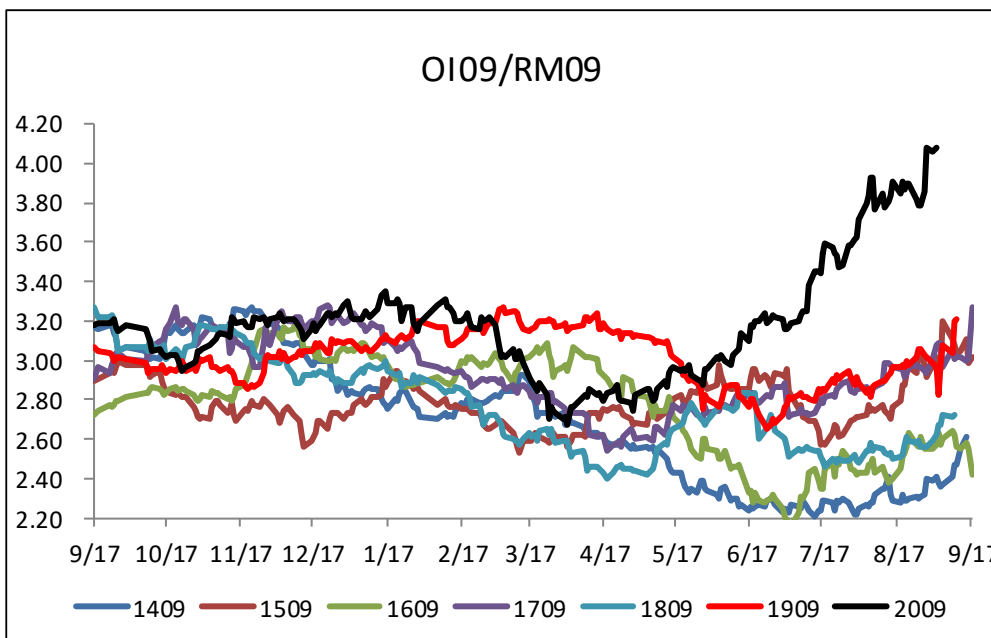
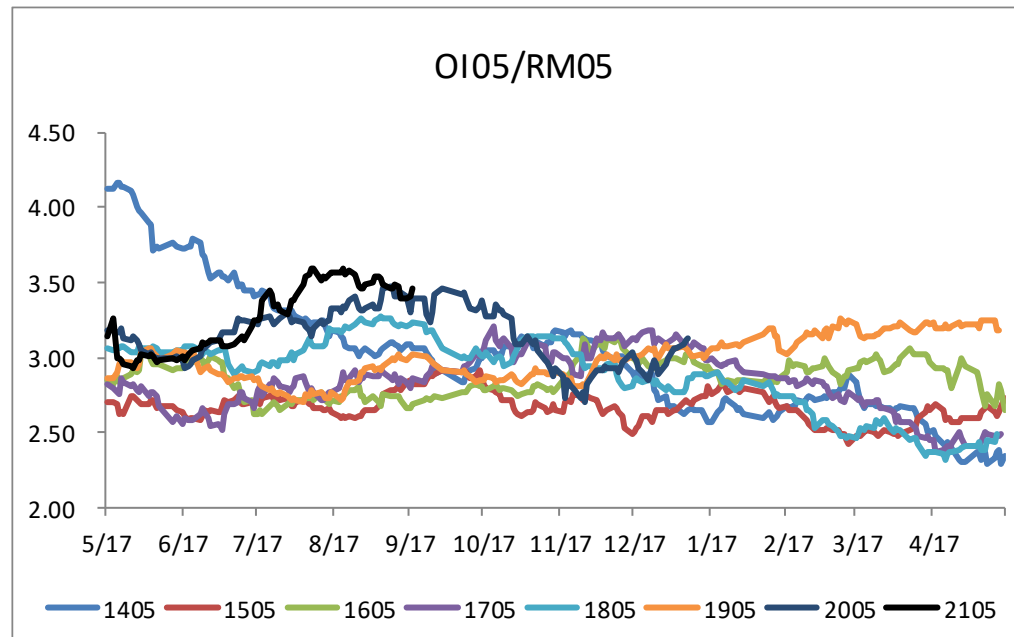
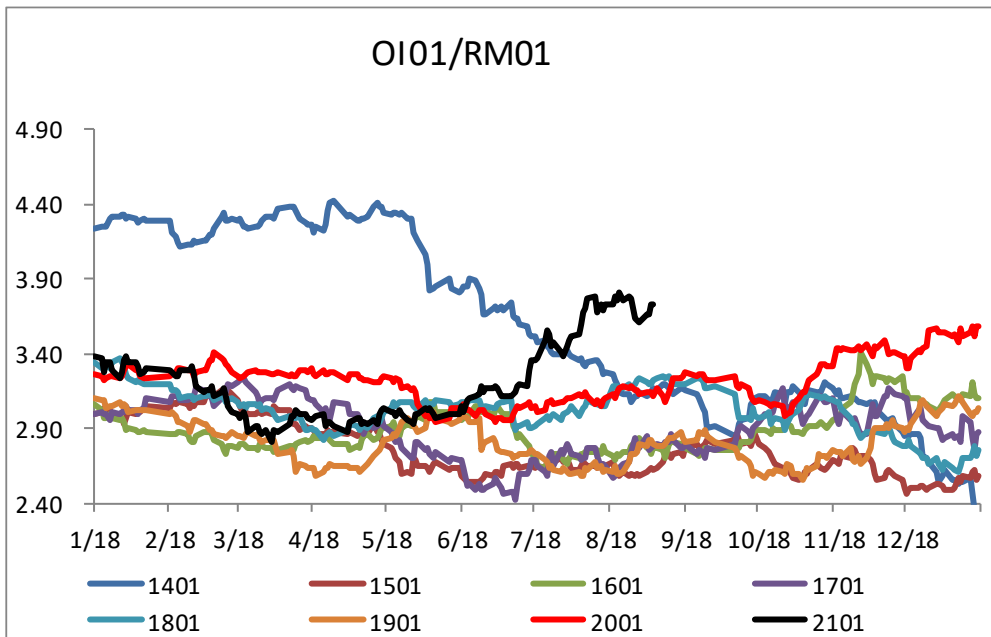


# 跨品种套利跟踪：Y/M

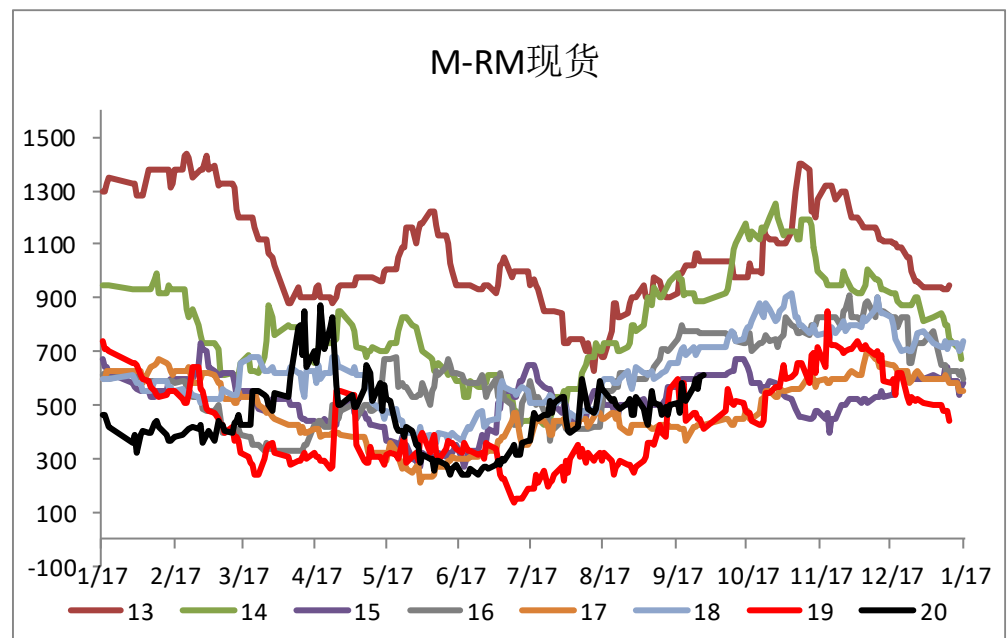
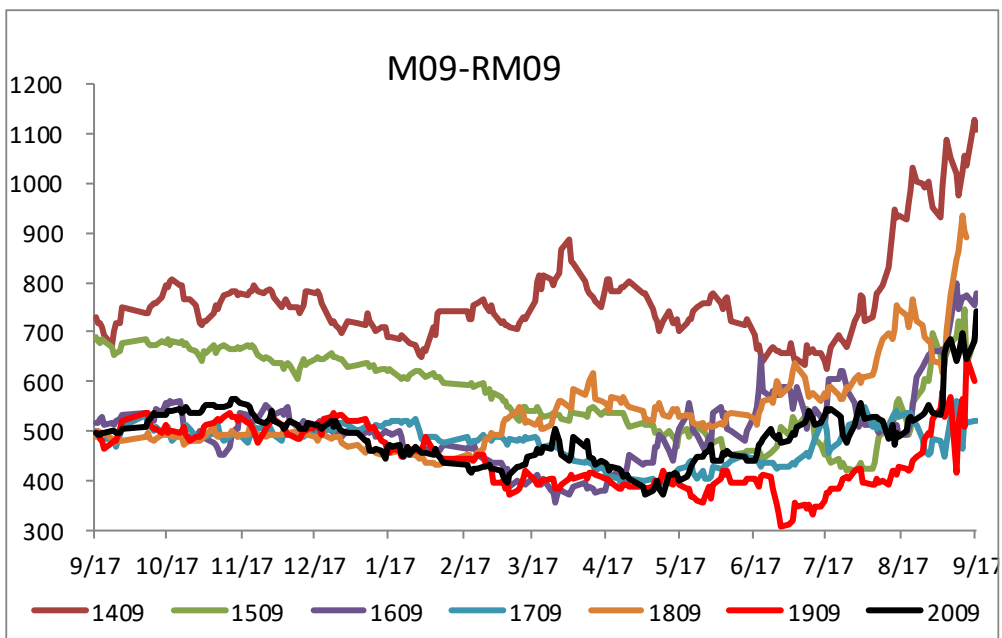
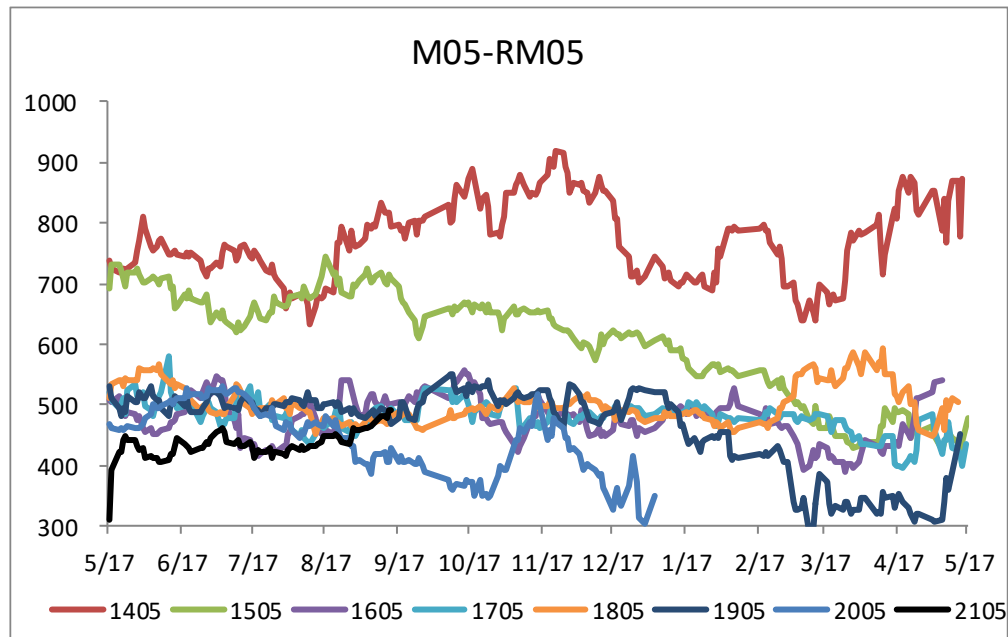
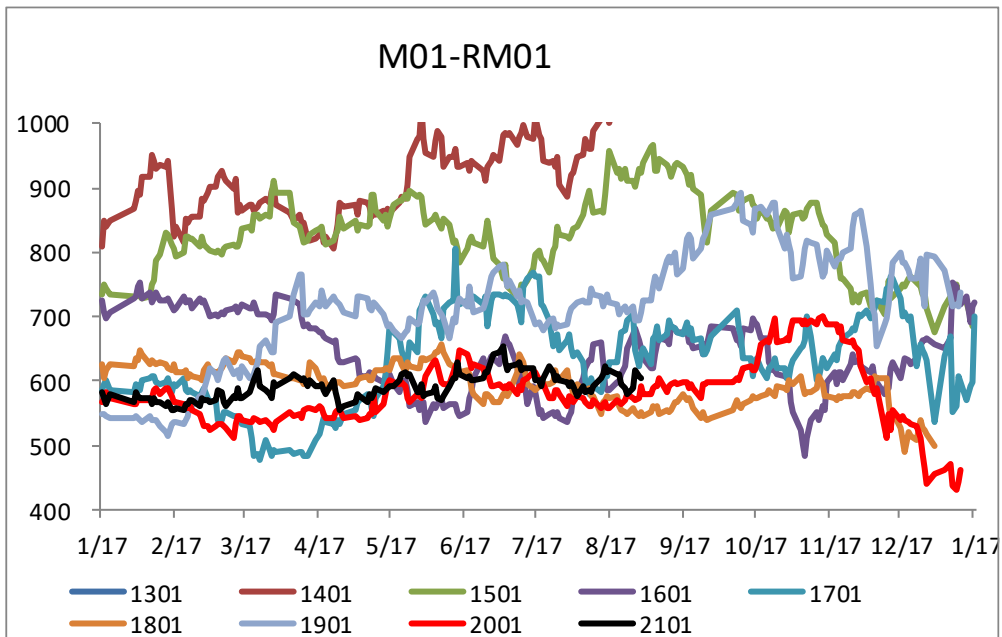
Y/M



# 跨品种套利跟踪: OI/RM



# 跨品种套利跟踪：M-RM





## 【信达期货简介】

信达期货有限公司是专营国内期货业务的有限责任公司，系经中国证券监督管理委员会核发《经营期货业务许可证》，浙江省工商行政管理局核准登记注册（统一社会信用代码：913300001000226378，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、信誉高的大型期货公司之一。公司全新改版后的新网站 [www.cindaqh.com](http://www.cindaqh.com) 将以更快捷、更丰富的信息竭诚为您提供最优的服务。公司总部设在杭州，下设 18 家分支机构：包括深圳、金华、台州、苏州、四川、福建、宁波 7 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、临安、萧山 11 家营业部，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】



分公司	金华	浙江省金华市中山路 331 号海洋大厦 8 楼 801-810	0579-82300876
	台州	浙江省台州市路桥区路北街道双水路 669 号华能国际 10-2 室	0576-82921160
	深圳	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	0755-83739066
	苏州	苏州工业园区星桂街 33 号凤凰国际大厦 2311 室	0512-62732060
	四川	成都市青羊区横小南街 8 号 1 栋 1 单元 15 层 21 号、22 号、23 号	028-85597078
	福建	厦门市思明区湖滨南路 357-359 号海晟国际大厦 11 层 1101 单元	0592-5150160
	宁波	浙江省宁波市鄞州区姚隘路 796 号 9 楼 9-3-2、9-4 室	0574-28839988
营业部	北京	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	010-64101771
	上海	上海市静安区北京西路 1399 号信达大厦 11 楼 E 座	021-58307723
	广州	广州市天河区体育西路 189 号 20A2	020-89814589
	沈阳	沈阳市皇姑区黑龙江街 25 号 4 层	024-31061955
	哈尔滨	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	0451-87222486
	石家庄	河北省石家庄市平安南大街 30 号万隆大厦 5 层	0311-89691960
	大连	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 2408 房间	0411-84807776
	乐清	浙江省温州市乐清市城东街道旭阳路 6688 号总部经济园 2 幢 803-1 室	0577-27868777
	富阳	浙江省杭州市富阳区富春街道江滨西大道 57 号 1002 室	0571-23255888
	临安	浙江省临安市钱王大街 392 号钱王商务大厦 8 楼	0571-63708180
	萧山	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	0571-82752636

## 【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。期市有风险，入市需谨慎。
- 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。