

2020/12/15

农产品套利跟踪



信达期货
CINDA FUTURES

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	2020/12/14	2020/12/15	正常区间
跨品种	豆油/豆粕	Y2101/M2101	2.64	2.61	[1.8, 2.7]
		Y2105/M2105	2.41	2.40	[1.8, 2.7]
		Y2009/M2009	2.24	2.24	[1.8, 2.6]
		Y现货/M现货	2.58	2.58	[1.6, 2.5]
	菜油/菜粕	OI2101/RM2101	3.88	3.89	[2.5, 3.5]
		OI2105/RM2105	3.63	3.66	[2.5, 3.2]
		OI2009/RM2009	3.44	3.47	[2.3, 3.2]
		OI现货/RM现货	4.13	4.19	[2.3, 4.3]
	菜油-豆油	OI2101-Y2101	1600	1648	[0, 1000]
		OI2105-Y2105	1721	1787	[0, 1200]
		OI2009-Y2009	1714	1772	[0, 1200]
		OI现货-Y现货	2112	2201	[0, 1500]
	豆油-棕榈油	Y2101-P2101	1066	1054	[500, 1500]
		Y2105-P2105	862	878	[500, 1500]
		Y2009-P2009	934	930	[500, 1500]
		Y现货-P现货	1070	1050	[200, 1500]
	菜油-棕榈油	OI2101-P2101	2666	2702	[800, 2000]
		OI2105-P2105	2583	2665	[700, 2000]
		OI2009-P2009	2648	2702	[700, 2000]
		OI现货-P现货	3182	3251	[500, 3000]
	豆粕-菜粕	M2101-RM2101	564	574	[500, 1000]
		M2105-RM005	572	583	[400, 1000]
		M2009-RM2009	604	604	[400, 1000]
		M现货-RM现货	625	640	[400, 1500]

策略类型		策略组合	2020/12/14	2020/12/15	正常区间
跨期	豆粕	M2101-M2105	-66	-62	[0, 400]
		M2105-M2009	-56	-48	[-100, 200]
		M2009-M2101	122	110	[-100, 300]
		主力合约基差	-103	-91	[-200, 600]
	菜粕	RM2101-RM2105	-58	-53	[-100, 100]
		RM2105-RM2009	-24	-27	[-50, 150]
		RM2009-RM2101	82	80	[0, 350]
		主力合约基差	-24	-27	[0, 600]
	豆油	Y2101-Y2105	526	506	[-150, 150]
		Y2105-Y2009	396	378	[-250, 50]
		Y2009-Y2101	-922	-884	[-200, 0]
		主力合约基差	1012	1020	[-400, 150]
	棕榈油	P2101-P2105	322	330	[-300, 100]
		P2105-P2009	468	430	[-300, 200]
		P2009-P2101	-790	-760	[-200, 200]
		主力合约基差	726	750	[-500, 500]
	菜油	OI2101-OI2105	405	367	[-200, 100]
		O2105-OI2009	403	393	[-300, 200]
		OI2009-OI2101	-808	-760	[-200, 500]
		主力合约基差	1260	1299	[-100, 1000]
	玉米	C2101-C2105	-64	-58	[-100, 100]
		C2105-C2009	-20	-22	[-100, 150]
		C2009-C2101	84	80	[-100, 250]
		主力合约基差	22	19	[-100, 400]
	白糖	SR2101-SR2105	34	21	[-150, 200]
		SR2105-SR2009	-42	-41	[-150, 200]
		SR2009-SR2101	8	20	[-300, 250]
		主力合约基差	39	22	[-300, 500]
	棉花	CF2101-CF2105	-165	-150	[-1000, 1000]
		CF2105-CF2009	-190	-195	[1000, 2000]
		CF2009-CF2101	355	345	[-1000, 1000]
		主力合约基差	-374	-173	[0, 2000]

--

操作建议
观望
观望
观望
-
观望
观望
观望
-
观望
-
观望
-
观望
观望
观望
-
观望
观望
观望
-
观望
观望
观望
-

