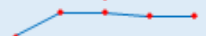
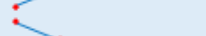


化工套利跟踪

研究发展中心能化团队

2021年1月12日

套利建议

化工套利跟踪									
 信达期货 CINDA FUTURES		联系人：韩冰冰			联系人：杨思佳				
		投资咨询号：Z0015510			从业资格号：F3059668				
					电话：0571-28132638				
策略组合		20日前 12月14日	10日前 12月28日	5日前 1月5日	昨日 1月11日	今日 1月12日	近一个月走势图	建议	
跨期	MA9-MA1	86	-81	-111	-86	-86		关注5-9正套	
	MA1-MA5	-81	48	44	29	29			
	MA5-MA9	-5	33	67	57	57			
	TA9-TA1	242	234	222	208	202		观望	
	TA1-TA5	-122	-120	-116	-116	-114			
	TA5-TA9	-120	-114	-106	-92	-88			
	L9-L1	-50	-40	-95	-165	-65		关注5-9正套	
	L1-L5	0	15	70	160	40			
	L5-L9	50	25	25	5	25			
	PP9-PP1	-103	-14	-127	-184	-117		关注5-9正套	
	PP1-PP5	9	5	104	173	101			
	PP5-PP9	94	9	23	11	16			
	V9-V1	-425	-85	15	45	50		关注5-9正套	
	V1-V5	355	55	-60	-60	-55			
	V5-V9	70	30	45	15	5			
跨品种	BU9-BU12	364	-52	-82	-48	-68		观望	
	BU12-BU6	364	-52	-82	-48	-68			
	BU6-BU9	-86	-116	-114	-116	-100			
	PP-3MA 1月	1272	747	719	828	668		观望	
	PP-3MA 5月	1020	886	747	829	831			
	PP-3MA 9月	911	976	925	920	971			
	L-PP 1月	-504	-380	-319	-333	-358		多L空P	
	L-PP 5月	-495	-390	-285	-320	-297			
	L-PP 9月	-451	-406	-287	-314	-306			

基差数据跟踪

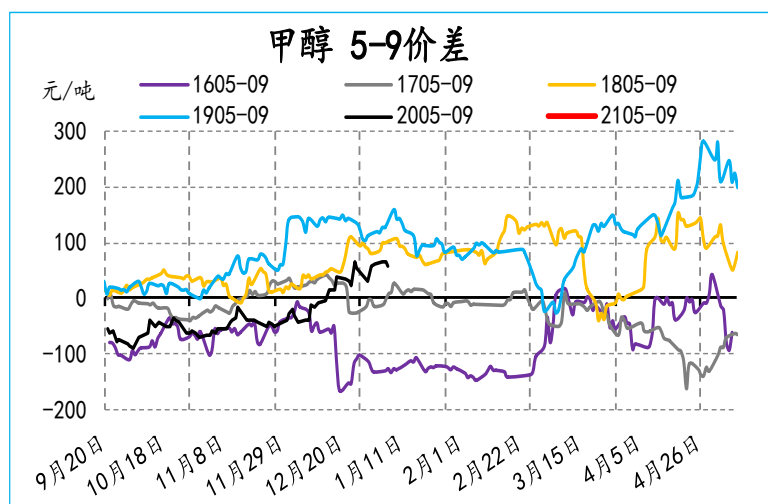
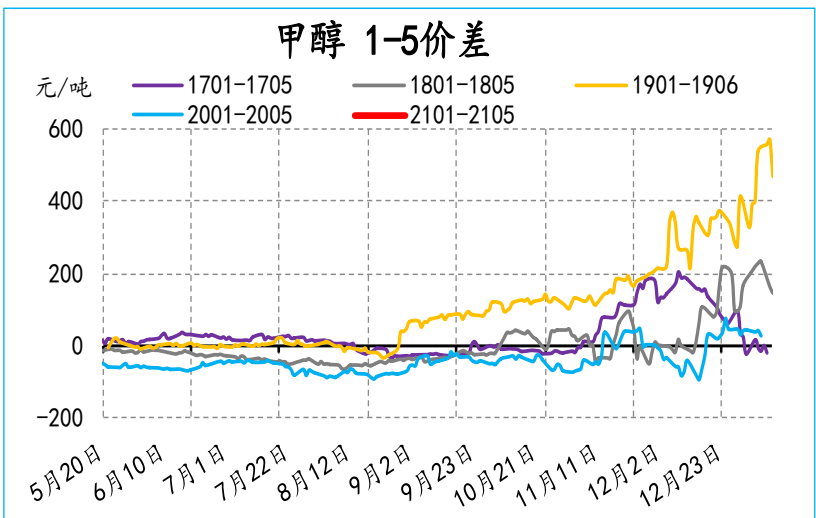
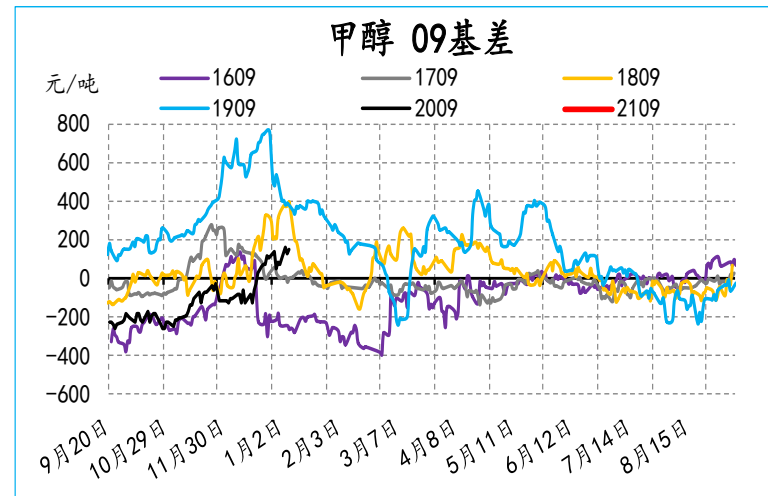
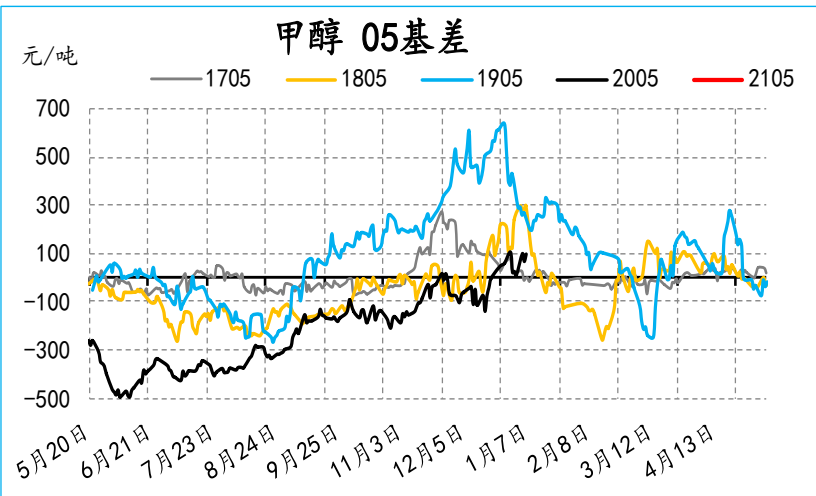
2021年01月12日期现结构图								4
品种	现货价	涨跌	近十日走	主力基差	涨跌	近十日走	基差率	价差结构
甲醇	2485	0.00		55.00	-23.00		2.3%	
EG	4450	50.00		90.00	50.00		2.1%	
PVC	7000	-50.00		30.00	-140.00		0.4%	
PP	7950	0.00		-8.00	25.00		-0.1%	
PE	7550	0.00		-50.00	50.00		-0.7%	
PTA	3774	34.00		-76.00	-22.00		-2.0%	

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1月。

套利跟踪：甲醇

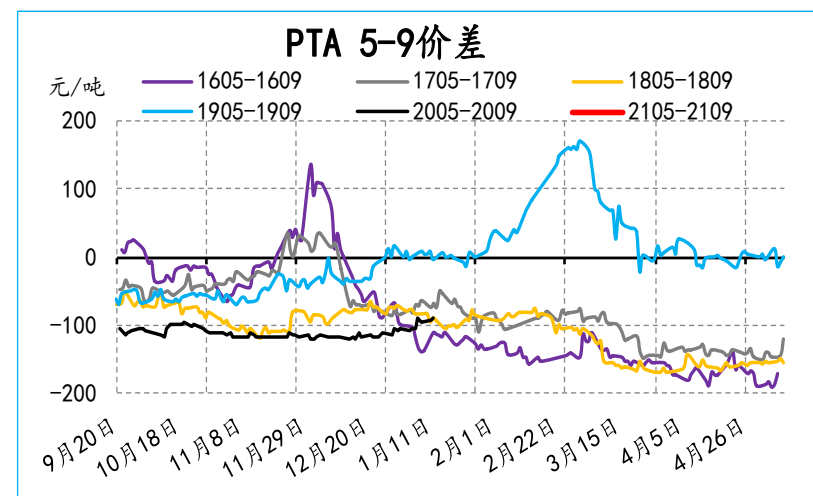
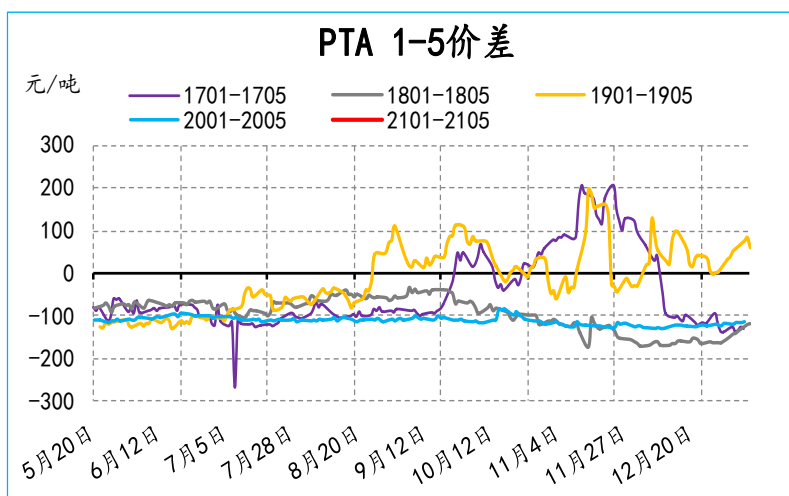
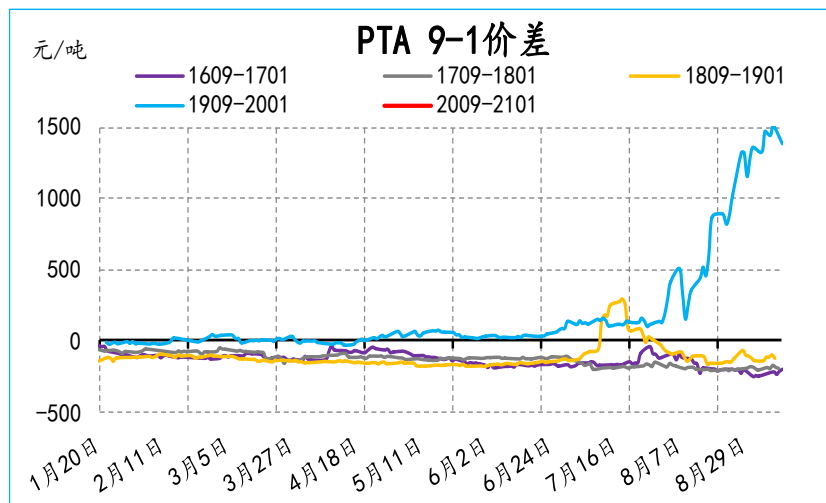
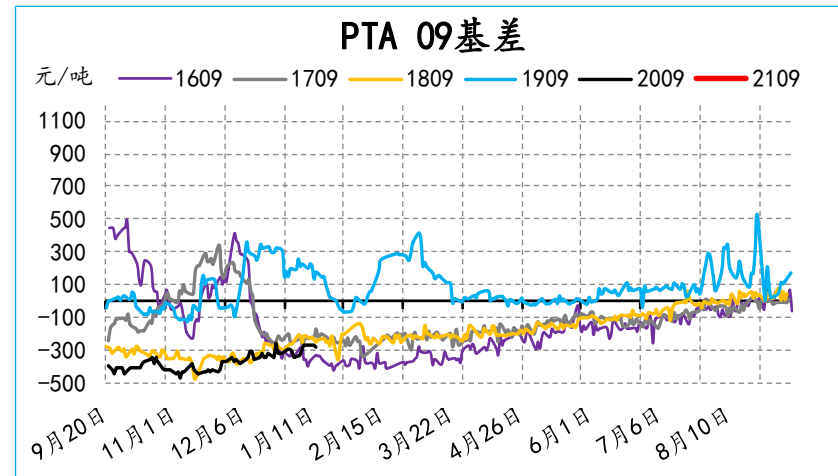
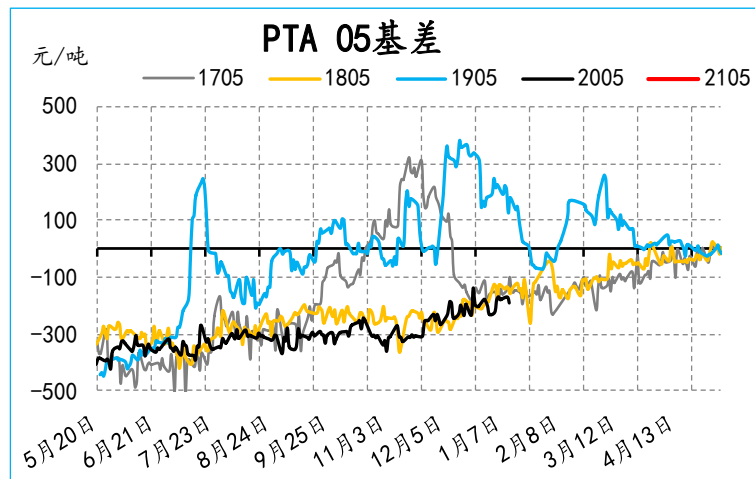
2021年01月12日基差图					
类别	代码	品种	现货价格	主力基差	幅度
1.00	4.00	PP	7950	93	1.2%
1.00	3.00	PE	7550	(10)	-0.1%
1.00	2.00	PTA	3774	(190)	-4.8%
1.00	5.00	PVC	7000	(25)	-0.4%
1.00	21.00	EG	4450	34	0.8%
1.00	6.00	沥青	2500	(242)	-8.8%
1.00	1.00	甲醇	2485	143	6.1%
1.00	7.00	橡胶	0	(14155)	-100.0%

2021年01月12日基差图					
类别	代码	品种	现货价格	主力基差	幅度
1.00	4.00	PP	7950	93	1.2%
1.00	3.00	PE	7550	(10)	-0.1%
1.00	2.00	PTA	3774	(190)	-4.8%
1.00	5.00	PVC	7000	(25)	-0.4%
1.00	21.00	EG	4450	34	0.8%
1.00	6.00	沥青	2500	(242)	-8.8%
1.00	1.00	甲醇	2485	143	6.1%
1.00	7.00	橡胶	0	(14155)	-100.0%

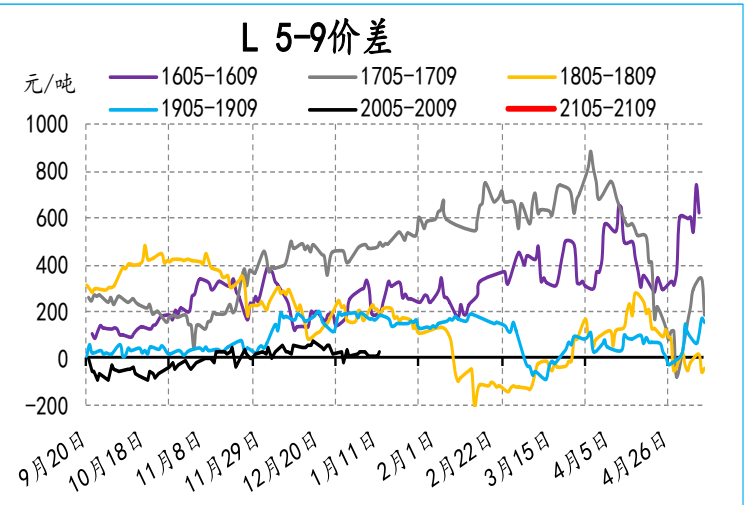
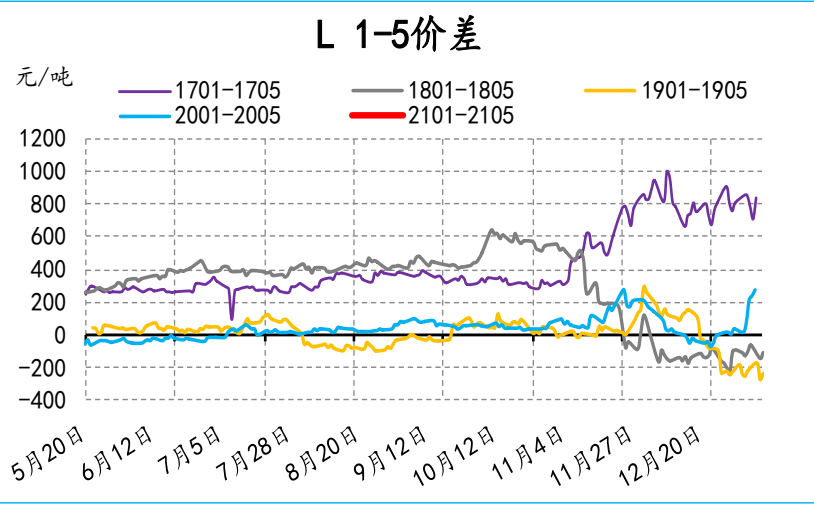
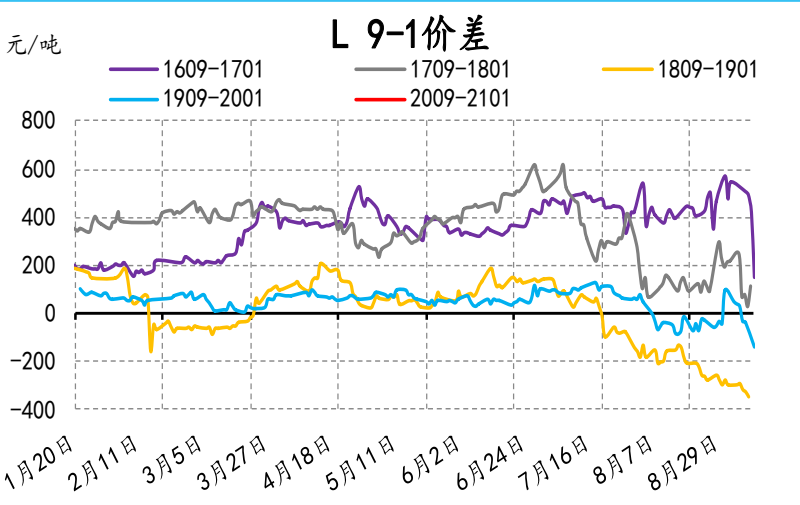
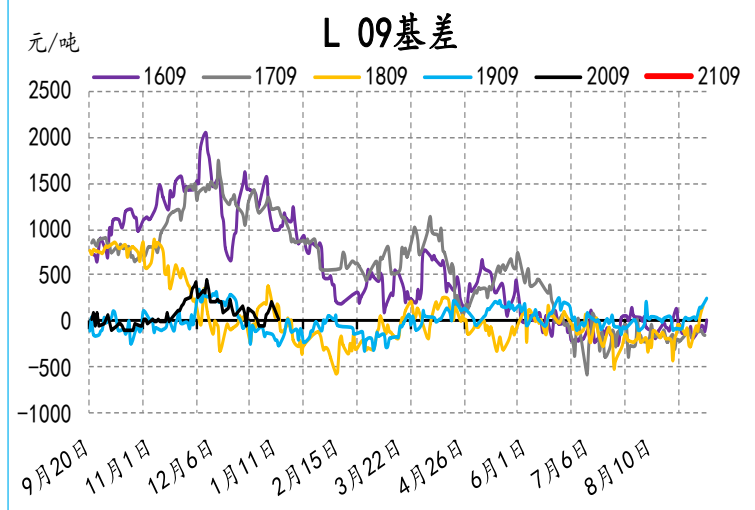
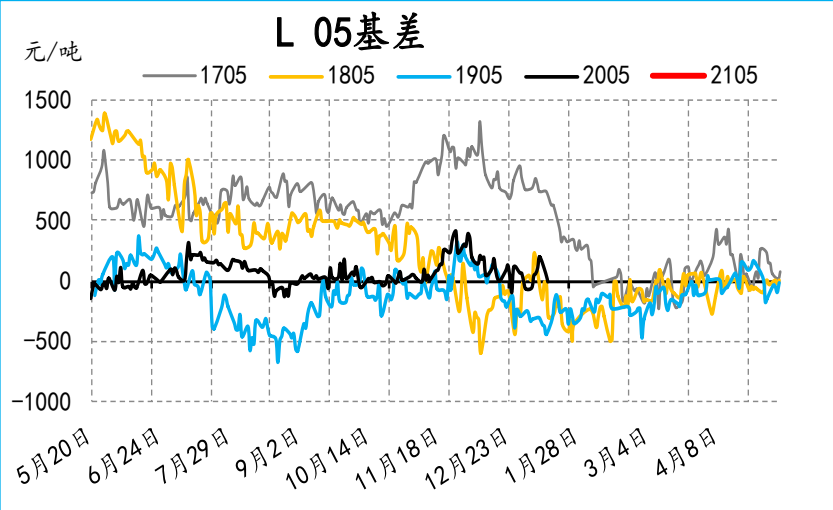
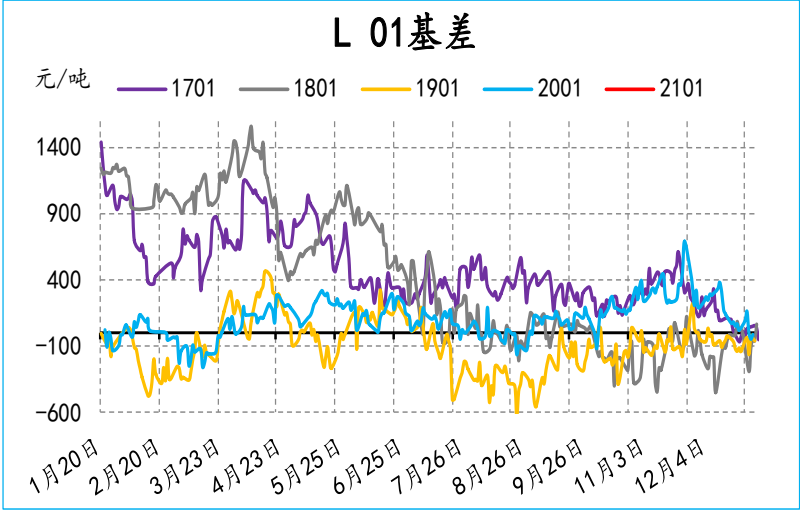


套利跟踪：PTA

2021年01月12日基差图					
类别	代码	品种	现货价格	主力基差	幅度
1.00	4.00	PP	7950	93	1.2%
1.00	3.00	PE	7550	(10)	-0.1%
1.00	2.00	PTA	3774	(190)	-4.8%
1.00	5.00	PVC	7000	(25)	-0.4%
1.00	21.00	EG	4450	34	0.8%
1.00	6.00	沥青	2500	(242)	-8.8%
1.00	1.00	甲醇	2485	143	6.1%
1.00	7.00	橡胶	0	(14155)	-100.0%

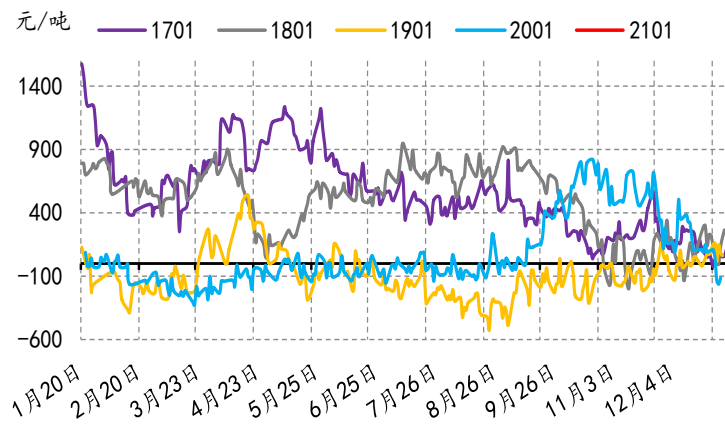


套利跟踪：PE

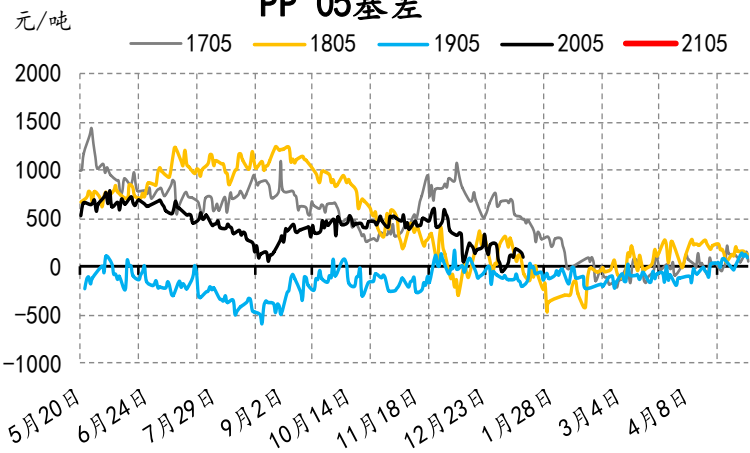


套利跟踪：PP

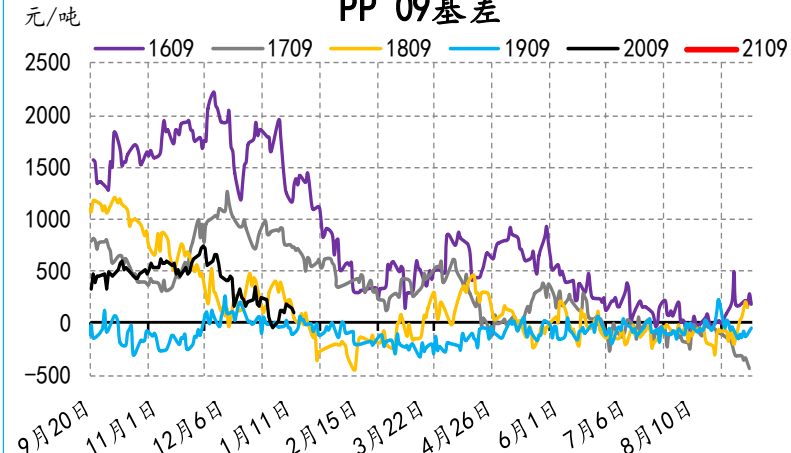
PP 01基差



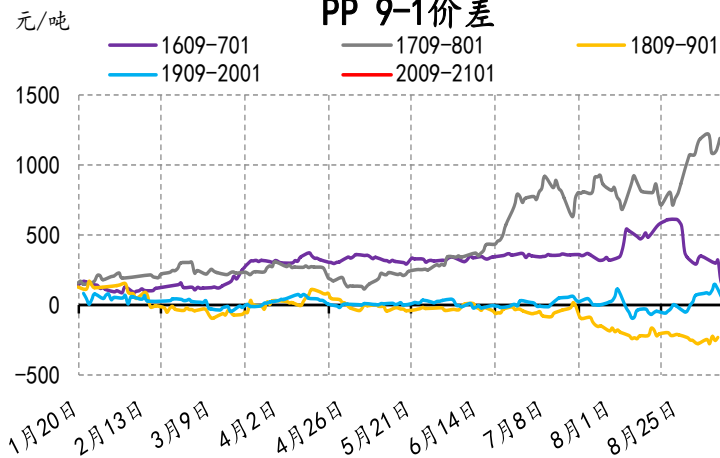
PP 05基差



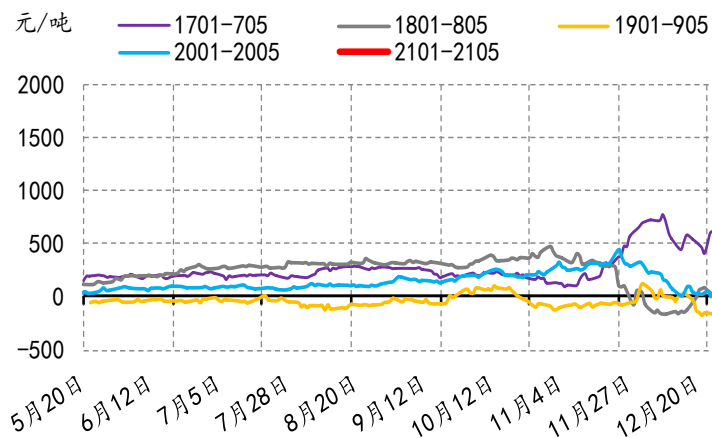
PP 09基差



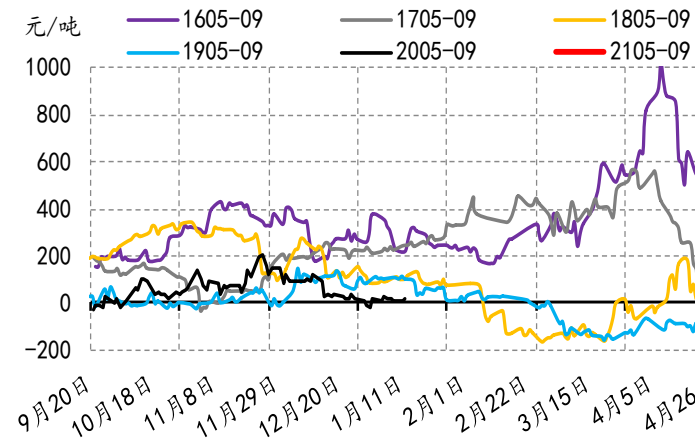
PP 9-1价差



PP 1-5价差

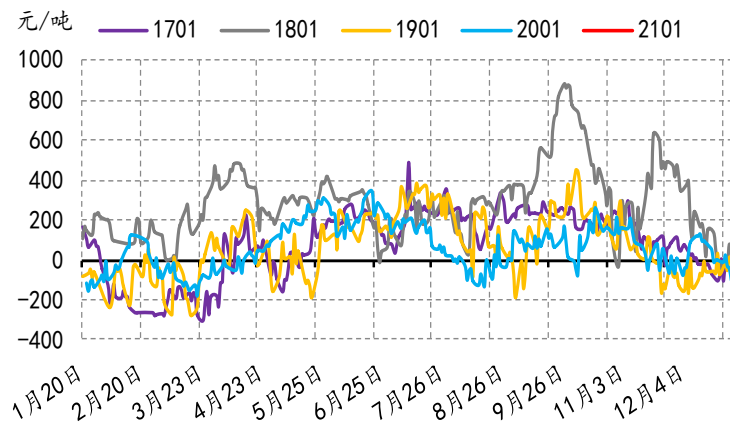


PP 5-9价差

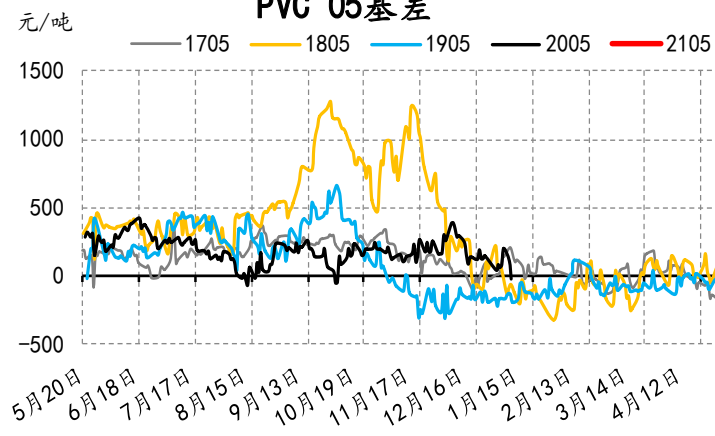


套利跟踪: PVC

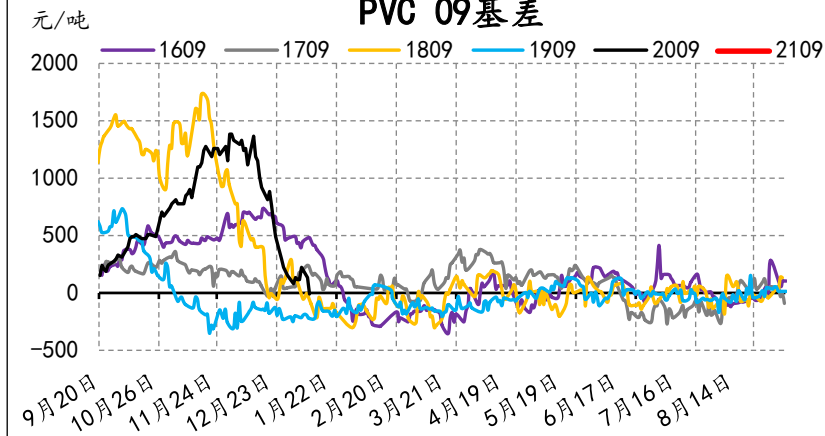
PVC 01基差



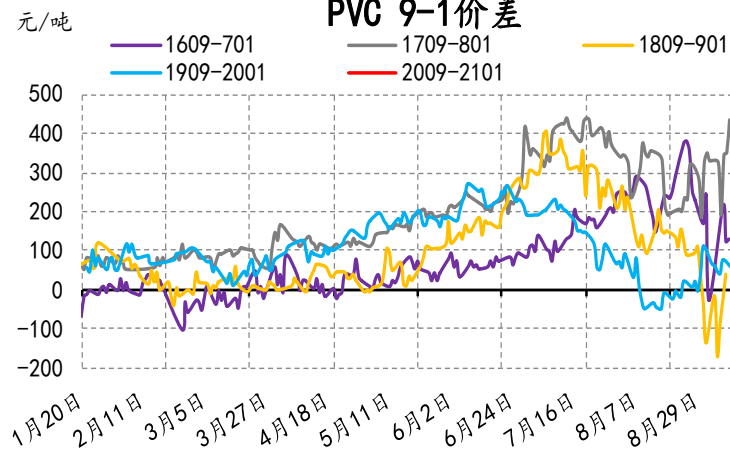
PVC 05基差



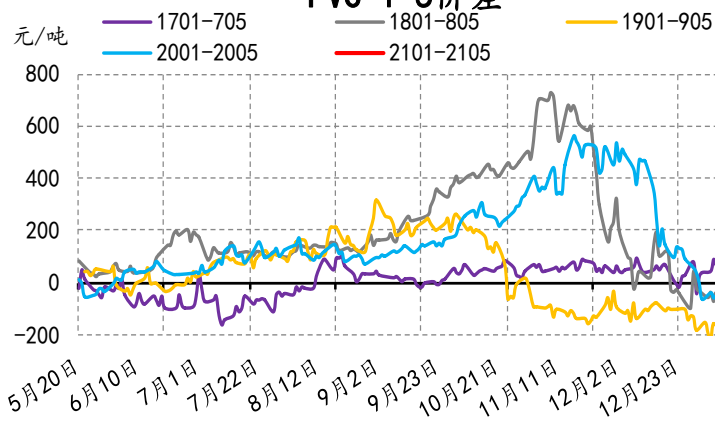
PVC 09基差



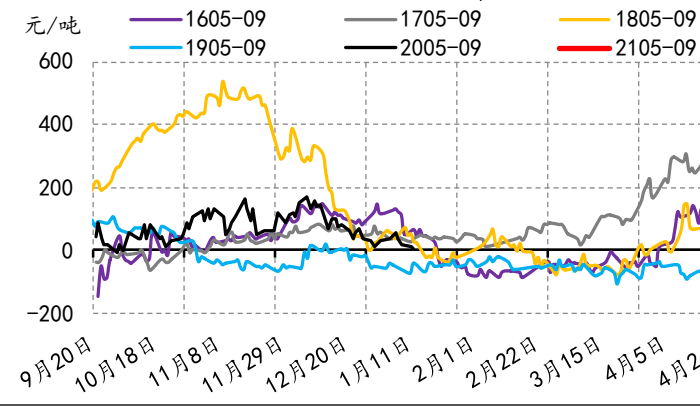
PVC 9-1价差



PVC 1-5价差



PVC 5-9价差

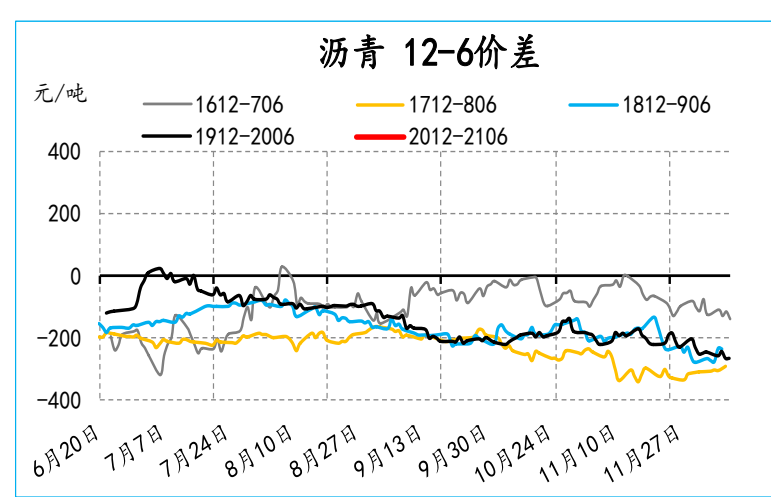
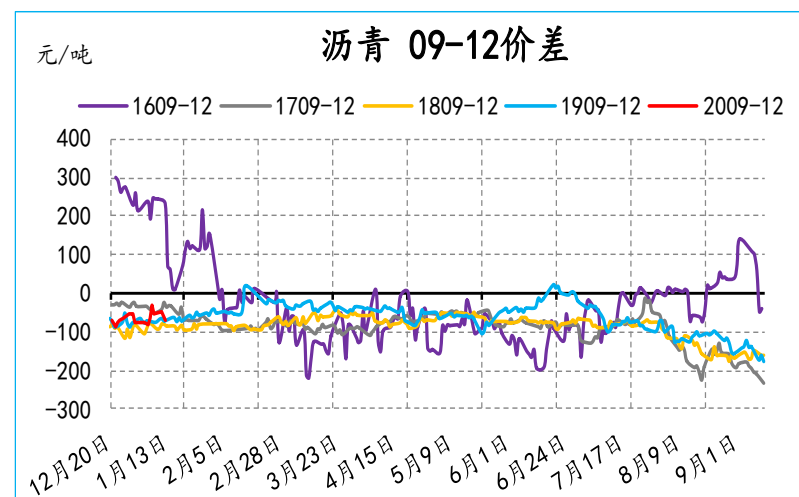
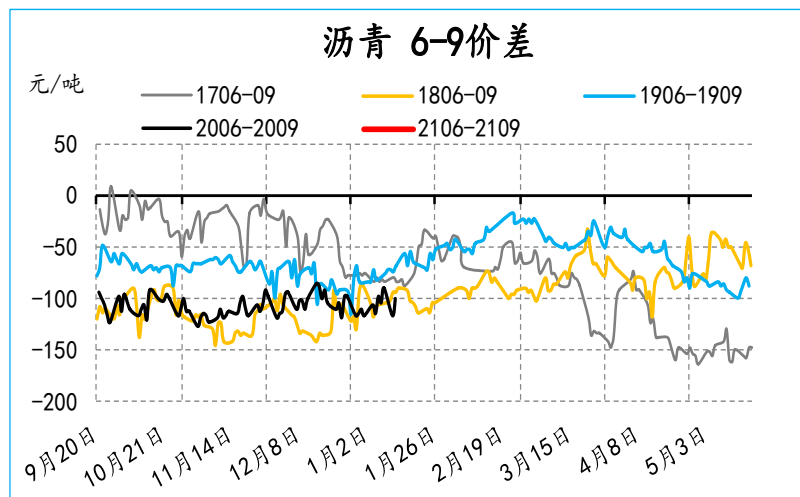
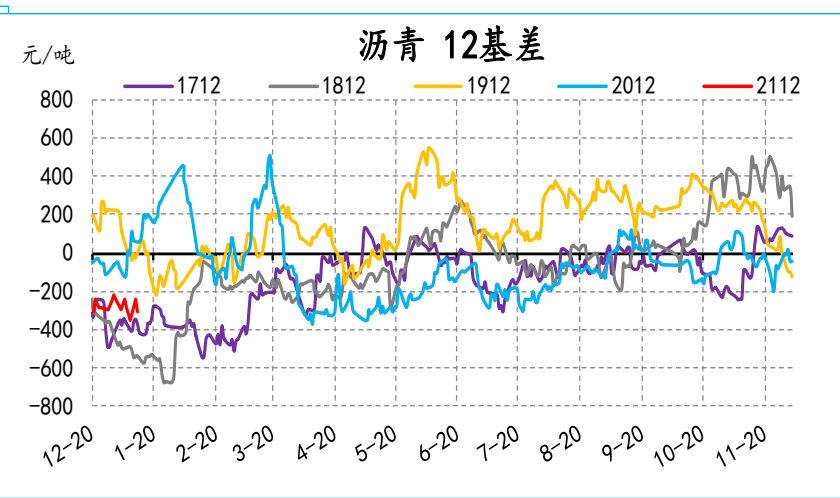
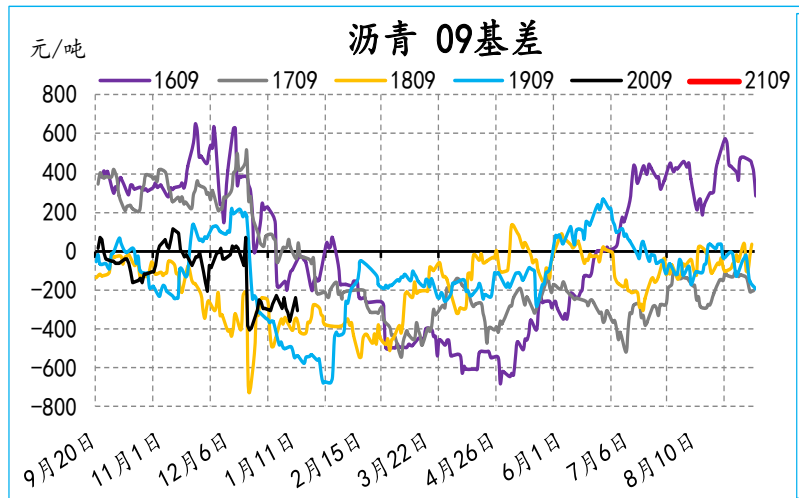
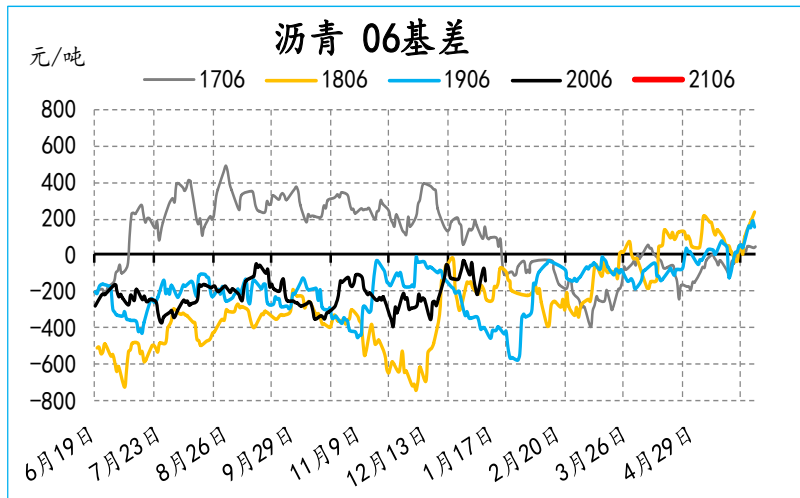


套利跟踪：沥青

信达期货能化组交流群，即将成立啦！

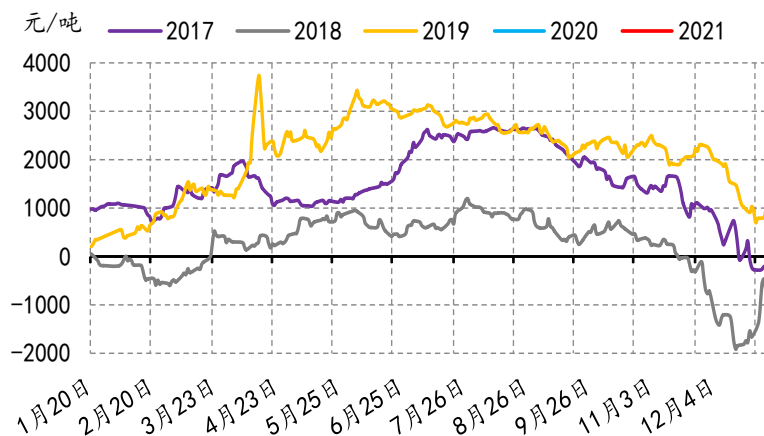
快向“能化小精灵”申请吧！

微信号：hanbb360

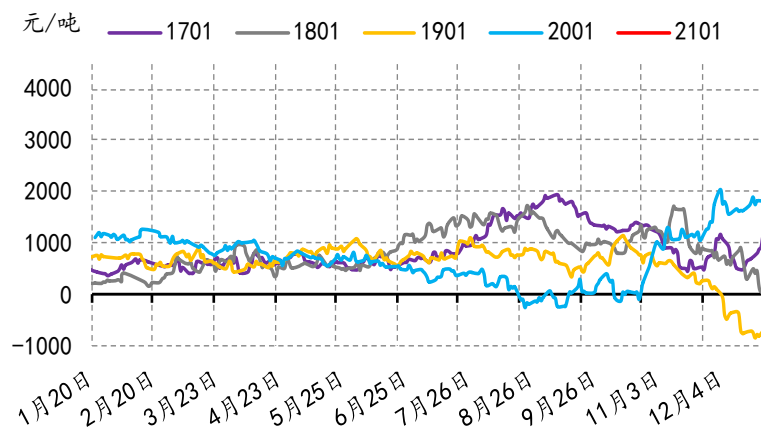


跨品种：PP-3MA

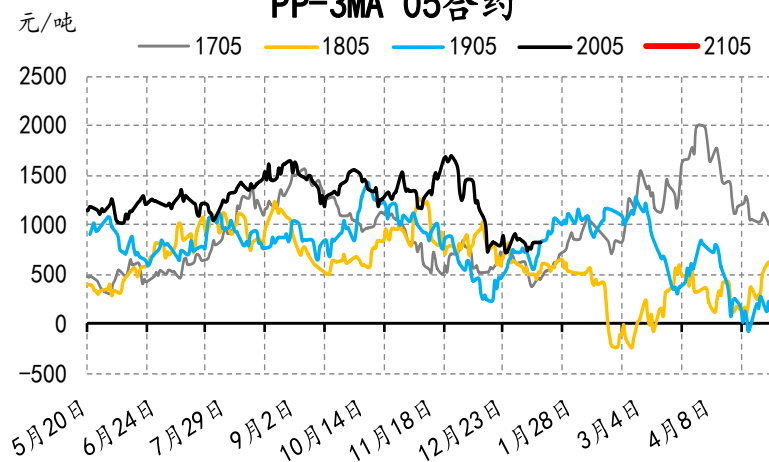
PP-3MA 现货



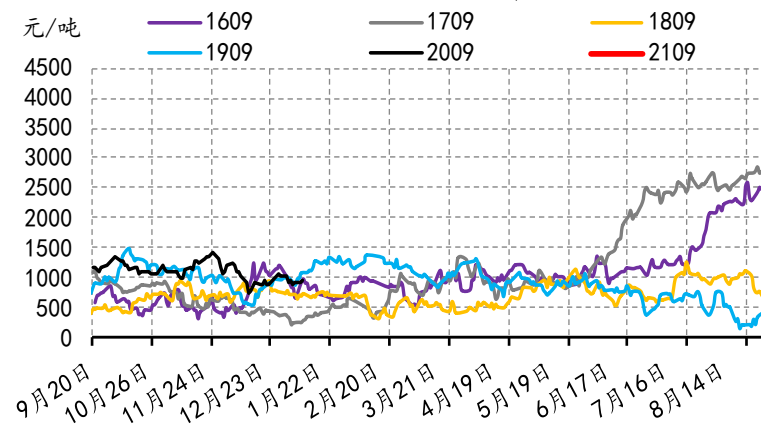
PP-3MA 01合约



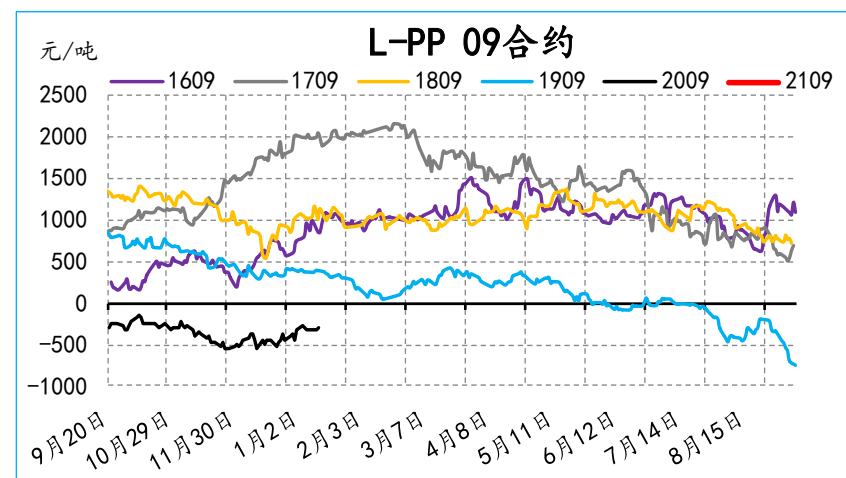
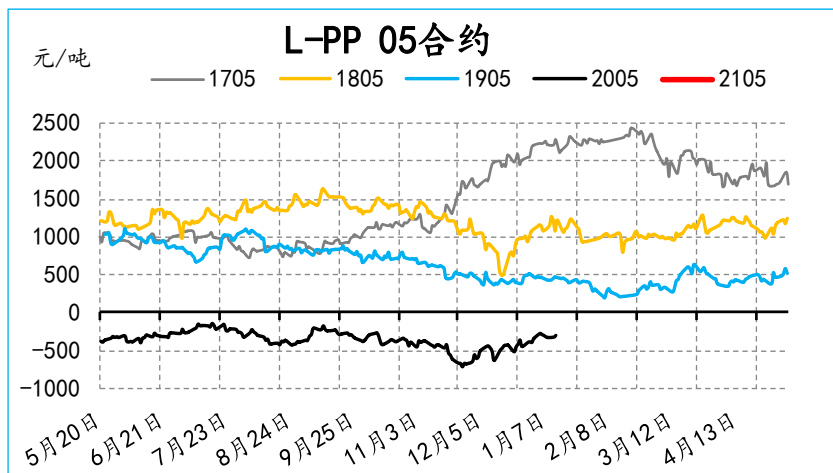
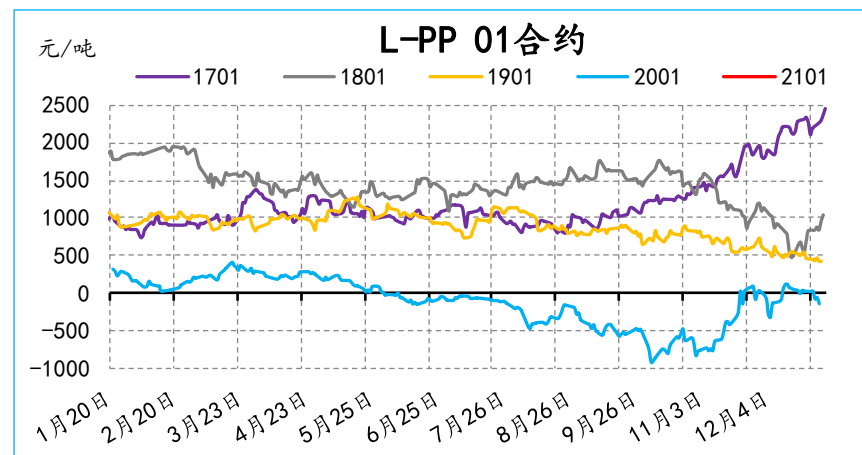
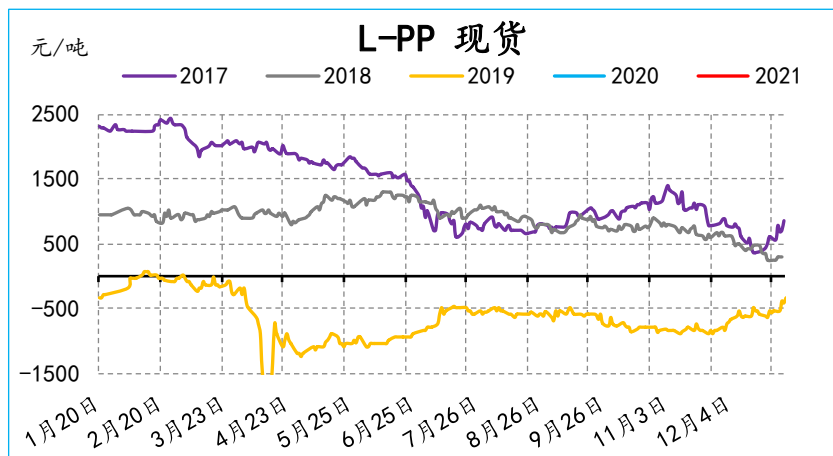
PP-3MA 05合约



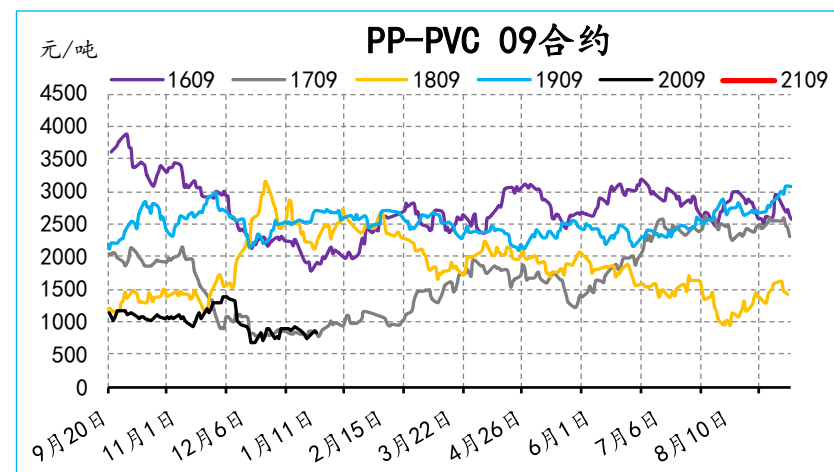
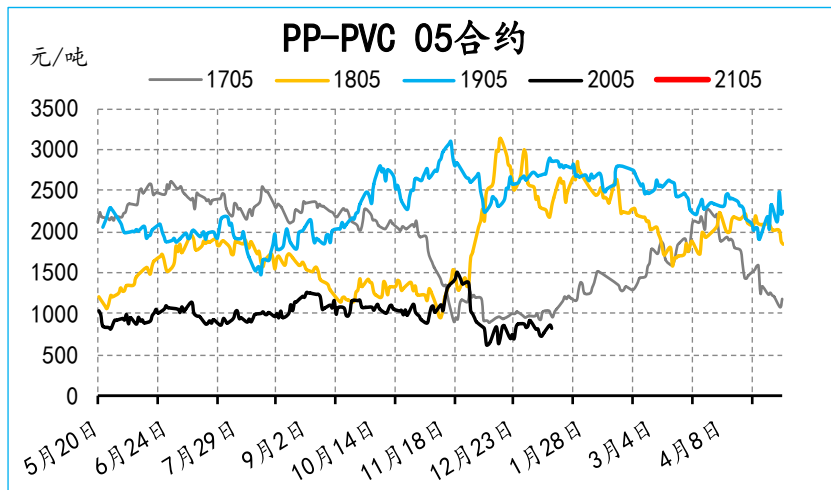
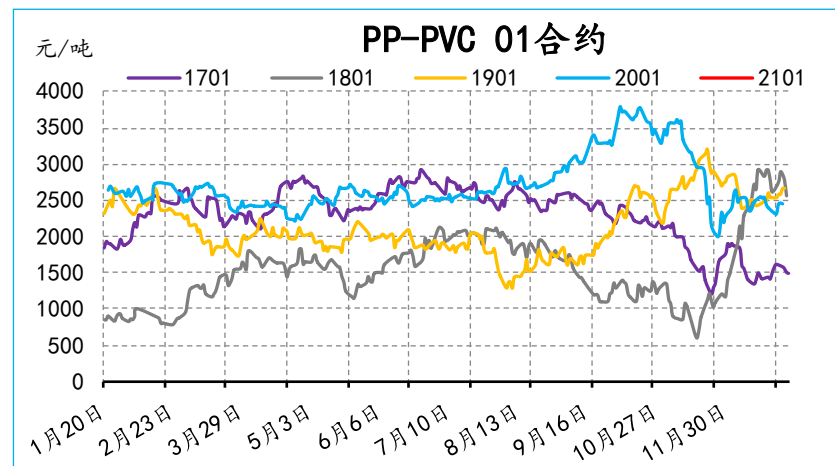
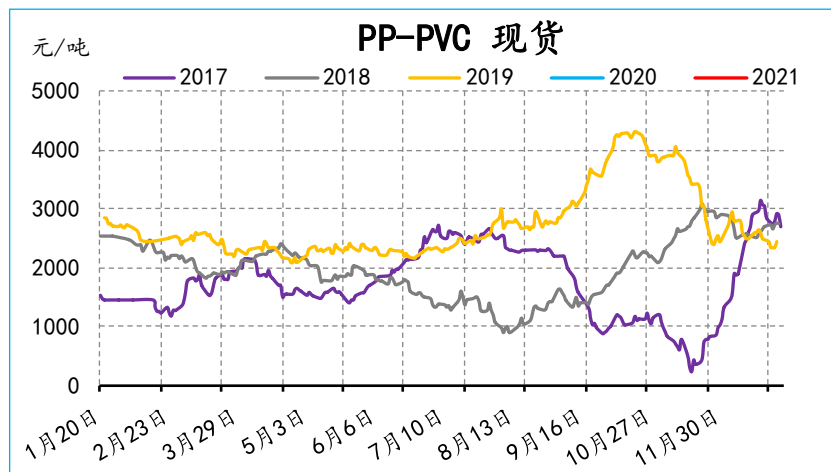
PP-3MA 09合约



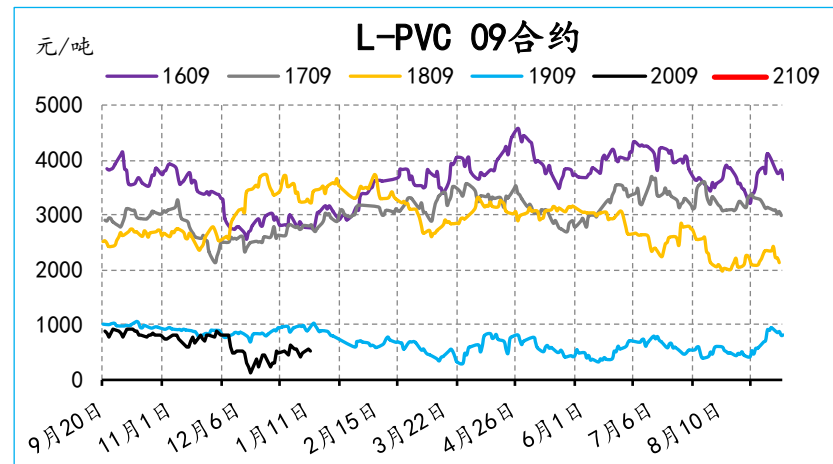
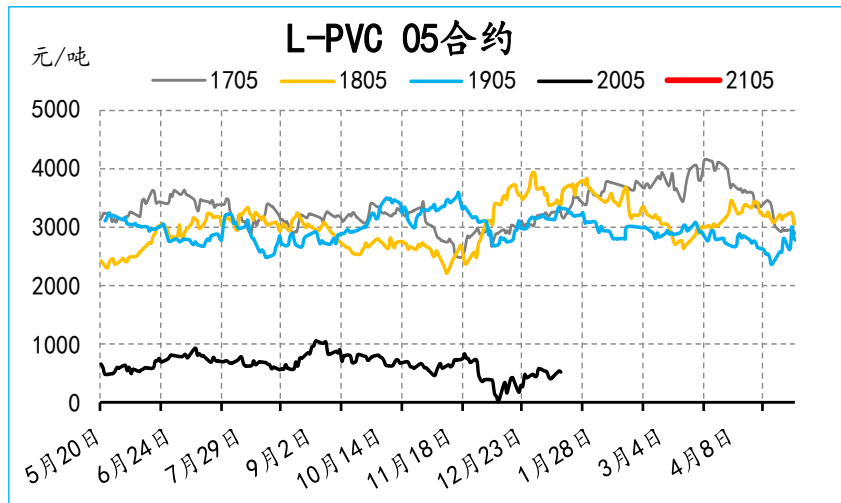
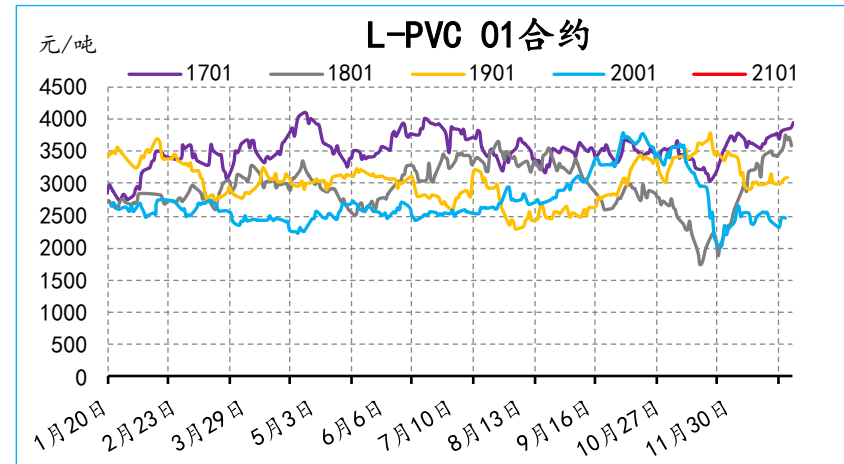
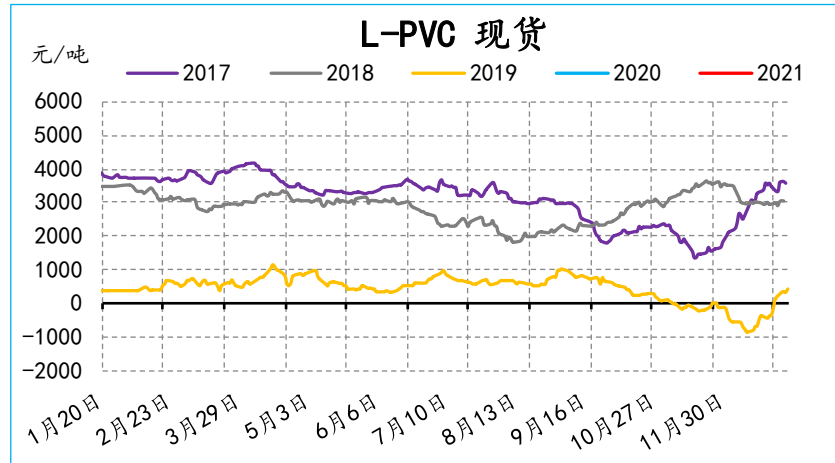
跨品种：塑料-PP



跨品种：PP-PVC



跨品种：塑料-PVC



联系人：

韩冰冰

投资咨询资格编号：Z0015510

杨思佳

执业编号：F3059668

电话：0571-28132528

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。