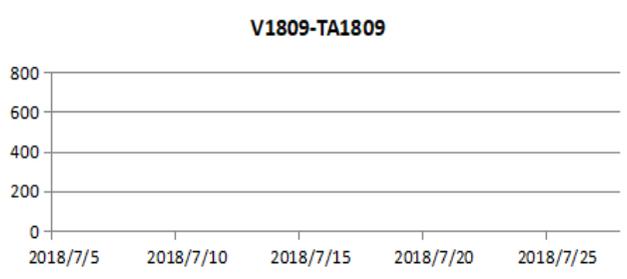


### 化工品套利策略

#### 多PTA空PVC

初始资金：100万元

交易计划	标的合约	PTA1809	v1809	 
	交易方向	多	空	
	初始持仓	5%	5%	
	加减仓位	5%	5%	
	入场区间	<500		
	止损区间	<530		
	止盈区间	>=600		
	策略建议	轻仓低吸		
持仓	数量(手)	10	10	<b>交易逻辑</b> 1、美原油高位震荡，人民币突破6.8后在周末加大了波幅。 2、PTA上游PX与下游纺织口两个市场外向依赖度较高，在原油价格趋高中成本支撑较强，人民币贬值加速，PVC在这一波反弹中趋弱，国内煤价向上调整。 3、持续持有PTA多单与空PVC的组合，PVC突破7000一线如果再强势上涨，平仓此组合。
	均价	6206	6995	
	价差	689		

#### 策略追踪

日期	合约	多空	开仓量	开仓价	平仓量	平仓价	平仓盈亏	持仓均价	总持仓量	保证金	盯市浮盈	浮盈比例	总权益	仓位%	累计净值	止损止盈
2018/7/10													1413150.00	0.00%	1.41315	
2018/7/27	PTA1809	多	10	6206				6206	10	#REF!	0.00	0.00%	1413150.00	#REF!	1.41315	
	V1809	空	10	6995				6995	10							

### 农产品套利策略

策略名称：豆油棕榈油价差 初始资金：100万元

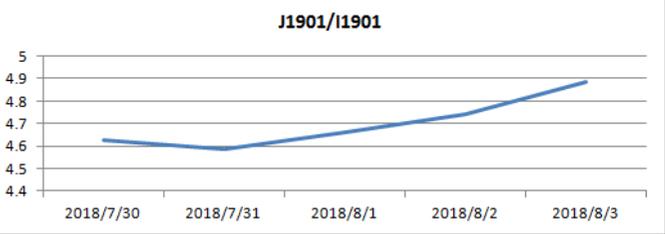
交易计划	标的合约	p1901	y1901	<p>累计净值</p>	<p>y1809-p1809</p>
	交易方向	多	空		
	初始持仓	5%	5%		
	加减仓位	5%	5%		
	入场区间	<950			
	止损区间	>=1050			
	止盈区间	<800			
策略建议	轻仓低吸			交易逻辑	
持仓	数量(手)	20	20		
	均价	4760	5688		
	价差	928			
				1、豆油价格表现坚挺，油厂挺价力度较大。 2、马来西亚棕榈油产量进入增产期，出口需求有所改善。 3、国内豆粕需求放缓，油强粕弱格局显现。	

### 策略追踪

日期	合约	多空	开仓量	开仓价	平仓量	平仓价	平仓盈亏	持仓均价	总持仓量	保证金	盯市浮盈	浮盈比例	总权益	仓位%	累计净值	止损止盈
2018/7/30	p1901	多	20	4760				4760	20	213320	378000.00	37.64%	1004321.00	21.24%	1.004321	
	y1901	空	20	5688			5688	20								
2018/7/31	M1805	多	20	4760				4760	20	213560	384400.00	38.27%	1004322.00	21.26%	1.004322	
	y1901	空	20	5688			5688	20								
2018/8/1	p1901	多	20	5750				4760	20	213000	368400.00	36.68%	1004323.00	21.21%	1.004323	
	y1901	空	20	5034			5688	20								
2018/8/2	y1806	多	20	5750				4760	20	214640	368800.00	36.72%	1004324.00	21.37%	1.004324	
	y1901	空	20	5034			5688	20								
2018/8/3	p1901	多	20	5750				4760	20	213400	371600.00	37.00%	1004325.00	21.25%	1.004325	
	y1901	空	20	5034			5688	20								

### 煤焦钢矿套利策略

1、策略名称：焦炭铁矿石比价 初始资金：100万元

交易计划	标的合约	J1901	I1901		
	交易方向	多	空		
	初始持仓	5%	5%		
	加减仓位	5%	5%		
	入场区间	4.55-4.6			
	止损区间	<4.5			
	止盈区间	>4.9			
策略建议	轻仓低吸		交易逻辑		
持仓	数量(手)	2		9	1、截至7月27日，焦炭港口库存：日照港105万吨，较前周增2万吨；青岛港125万吨，较前周增10万吨；总库存合计289万吨，较上周增9万吨
	均价	2239		488	2、Mysteel 统计全国45个港口铁矿石库存为15365.23万吨，较上周五增13.5万吨；日均疏港总量 274.46 万吨降 4.56万吨。
	价比	4.588114754		3、采暖季环保限产影响焦企生产；钢厂焦炭库存偏低，采购积极性有所好转。比价B线技术向上突破	

### 策略追踪

日期	合约	多空	开仓量	开仓价	平仓量	平仓价	平仓盈亏	持仓均价	总持仓量	保证金	盯市浮盈	浮盈比例	总权益	仓位%	累计净值	止损止盈
2018/7/30	J1901	多								0	0.00	0.00%	1000000.00	0.00%	1	
	I1901	空														
2018/7/31	J1901	多	2	2239				2239	2	88745	-450.00	-0.05%	999550.00	8.88%	0.99955	4.5
	I1901	空	9	488			488	9								
2018/8/1	J1901	多						2239	2	87600	7000.00	0.70%	1007000.00	8.70%	1.007	4.5
	I1901	空					488	9								
2018/8/2	J1901	多						2239	2	88435	14450.00	1.42%	1014450.00	8.72%	1.01445	4.56
	I1901	空					488	9								
2018/8/3	J1901	多						2239	2	91240	29000.00	2.82%	1029000.00	8.87%	1.029	4.6
	I1901	空					488	9								