

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		
	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	1、油脂整体氛围回暖，涨幅较大。	
	均价	4760	5688	2、马来西亚棕榈油产量进入增产期，出口需求有所改善。	
	价差	928		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
2018/8/6	y1805	多	20	4760				4760	20	214760	375600.00	37.40%	1004326.00	21.38%	1.004326	
	y1901	空	20	5688			5688	20								
2018/8/7	y1808	多	20	4760				4760	20	215800	378800.00	37.72%	1004327.00	21.49%	1.004327	
	y1901	空	20	5688			5688	20								
2018/8/8	y1805	多	20	4760				4760	20	216320	377600.00	37.60%	1004328.00	21.54%	1.004328	
	y1901	空	20	5688			5688	20								
2018/8/9	y1809	多	20	4760				4760	20	217240	378800.00	37.72%	1004329.00	21.63%	1.004329	
	y1901	空	20	5688			5688	20								
2018/8/10	y1809	多	20	4760				4760	20	217320	370800.00	36.92%	1004330.00	21.64%	1.00433	
	p1809	空	20	5688			5688	20								