

民生期货策略周报 20180713

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	累计净值 V1809-TA1809
	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	交易逻辑 1、原油价格在创出新高75.27美元/桶后暂时力量减弱，美总统要求OPEC降油价，亚洲进口原油进本6月在75美元一线，调整概率大 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，汇率因素影响较大，PVC在这一波反弹中趋弱，国内煤价向下调整，显现强者更强弱者更弱的小特征。 3、在上周四行情有可能转变时建立此组合，本周二PTA涨势趋弱总体有赢利的情況下平仓。
	均价	5864	6810	
	价差	946		

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
2018/6/29													1411150.00	0.00%	1.41115	
2018/7/5	PTA1809 V1809	多 空	10 10	5864 6810				5864 6810	10 10	#REF!	1068800.00	43.10%	2479950.00	#REF!	2.47995	
2018/7/10	PTA1809 V1809	多 空			10 10	5934 6840	3500 -1500			0	0.00		1413150.00	0.00%	1.41315	

1、策略名称：豆粕棕榈油价差 初始资金：100万元

策略追蹤[illegible]

1、策略名称：螺纹钢焦炭比价 初始资金：100万元

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
2018/7/6	J1809	空						2012	2	61790	-580.00	-0.00%	999420.00	8.16%	0.99942	1.83
2018/7/9	RB1810	多						3788	11	82750	820.00	0.08%	1000820.00	8.27%	1.00082	1.83
	J1809	空					2012	2								
2018/7/10	RB1810	多						3788	11	83002	5340.00	0.53%	1005340.00	8.26%	1.00534	1.85
	J1809	空					2012	2								
2018/7/11	RB1810	多						3788	11	83159	7510.00	0.75%	1007510.00	8.25%	1.00751	1.85
	J1809	空					2012	2								
2018/7/12	RB1810	多						3788	11	85126	9180.00	0.91%	1009180.00	8.44%	1.00918	1.85
	J1809	空					2012	2								
2018/7/13	RB1810	多						3788	11	84069	16010.00	1.58%	1016010.00	8.27%	1.01601	1.85
	J1809	空					2012	2								