

民生期货策略周报 20180720

煤焦钢矿套利策略

1、策略名称：螺纹钢焦炭比价 初始资金：100万元

交易计划	标的合约	RB1810	J1809
	交易方向	多	空
	初始持仓	5%	5%
	加减仓位	5%	5%
	入场区间	>1.87	
	止损区间	<1.83	
	止盈区间	>2.1	
持仓	策略建议	轻仓低吸	
	数量(手)	11	2
	均价	3788	2012
	价比	1.882703777	

累计净值

RB1810/J1809

交易逻辑

1、据钢铁网统计，截至7月19日，螺纹钢社会库存455.64万吨，环比降1.61万吨，钢厂库存181.09万吨，环比降3.4万吨

2、第四轮焦炭价格下跌陆续执行，市场整体价格累计下跌350元/吨左右，局部跌幅略大。

3、截至7月13日，焦炭港口库存：天津港60万吨，较前一周减3万吨；日照港库存为101万吨，较前一周减7万吨；青岛港118万吨，较前一周减8万吨

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
2018/7/13	RB1810	多						3788	11	84069	16010.00	1.58%	1016010.00	8.27%	1.01601	1.85
	J1809	空						2012	2							
2018/7/16	RB1810	多						3788	11	83568	20800.00	2.03%	1026140.00	8.14%	1.02614	1.9
	J1809	空						2012	2							
2018/7/17	RB1810	多						3788	11	83591	16830.00	1.65%	1022170.00	8.18%	1.02217	1.9
	J1809	空						2012	2							
2018/7/18	RB1810	多						3788	11	83350	19020.00	1.86%	1024360.00	8.14%	1.02436	1.9
	J1809	空						2012	2							
2018/7/19	RB1810	多						3788	11	84013	17450.00	1.71%	1022790.00	8.21%	1.02279	1.9
	J1809	空						2012	2							
2018/7/20	RB1810	多						3788	11	84925	13170.00	1.29%	1018510.00	8.34%	1.01851	1.9
	J1809	空						2012	2							