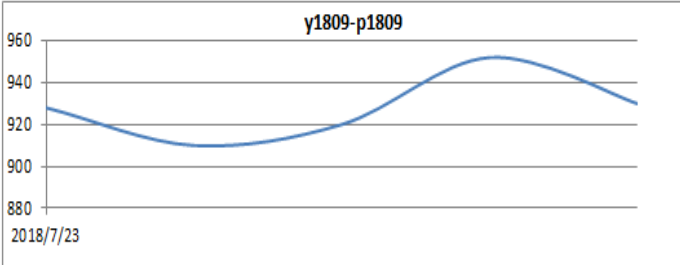


农产品套利策略

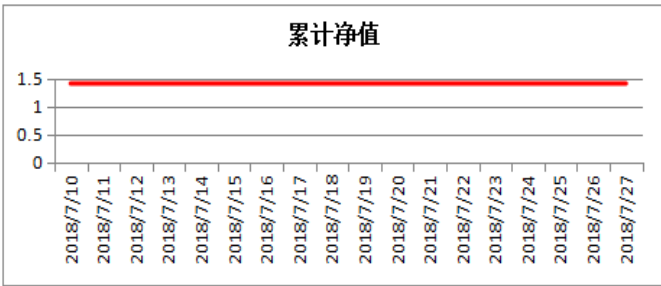
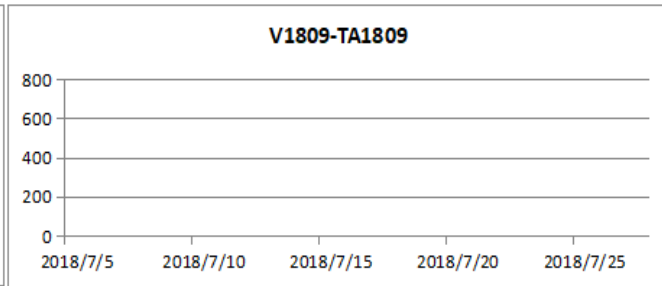
1、策略名称：豆油棕榈油价差 初始资金：100万元

交易计划	标的合约	p1901	y1901	累计净值  y1809-p1809 	
	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			
持仓	数量（手）	20	20	交易逻辑	
	均价	4760	5688		1、豆油需求进入消费淡季，库存降幅减缓。
	价差	928			2、马来西亚棕榈油产量进入增产期，出口需求明显改善。
				3、国内进口棕油价格出现上涨。	

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
2018/7/23	p1901	多	20	4760				4760	20	208960	371200.00	27.07%	1371200.00	15.24%	1.3712	
	y1901	空	20	5688				5688	20							
2018/7/24	p1901	多	20	4760				4760	20	209400	367600.00	26.88%	1367600.00	15.31%	1.3676	
	y1901	空	20	5688				5688	20							
2018/7/25	p1901	多	20	4760				4760	20	209280	369600.00	26.99%	1369600.00	15.28%	1.3696	
	y1901	空	20	5688				5688	20							
2018/7/26	p1901	多	20	4760				4760	20	211120	376000.00	27.33%	1376000.00	15.34%	1.376	
	y1901	空	20	5688				5688	20							
2018/7/27	p1901	多	20	4760				4760	20	212600	371600.00	27.09%	1371600.00	15.50%	1.3716	
	y1901	空	20	5688				5688	20							

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	交易逻辑			1、沙特阿拉伯能源部长周三发布声明称，由于两艘超大型油轮（VLCC）遭到也门什叶派胡塞叛军袭击，因此暂停了红海的石油运输。 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、开多PTA多单与空PVC的组合。												
	数量（手）	10	10													
	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				1413150.00			
	V1809	空	10	6995				6995	10	#REF!	0.00	0.00%	1413150.00	#REF!	1.41315	