

**快手必读——能源化工板块套利跟踪**

2017年8月14日(星期一)

| 类型    | 策略组合            | 价差    | 变化  | 市场方向及趋势  | 建议   |
|-------|-----------------|-------|-----|----------|------|
| LLDPE | L1709-L1801     | -150  | +5  | 正向市场价差缩小 | 多9空1 |
|       | L1801-L1805     | -95   | -15 | 正向市场价差缩小 | ——   |
| PP    | PP1709-PP1801   | -222  | +3  | 正向市场价差缩小 | 多9空1 |
|       | PP1801-PP1805   | -98   | +7  | 正向市场价差缩小 | ——   |
| PVC   | V1709-V1801     | 160   | +65 | 反向市场价差扩大 | 多9空1 |
|       | V1801-V1805     | 105   | -5  | 反向市场价差缩小 | ——   |
| PTA   | TA1709-TA1801   | -106  | +4  | 正向市场价差缩小 | ——   |
|       | TA1801-TA1805   | -44   | -10 | 正向市场价差缩小 | ——   |
| MA    | MA1709-MA1801   | -132  | +2  | 正向市场价差缩小 | 多9空1 |
|       | MA1801-MA1805   | -10   | -4  | 正向市场价差缩小 | ——   |
| 天然橡胶  | RU1709-RU1801   | -3185 | -75 | 正向市场价差缩小 | ——   |
|       | RU1801-RU1805   | -300  | -20 | 正向市场价差扩大 | ——   |
| 沥青    | BU1709-BU1712   | -122  | -10 | 正向市场价差扩大 | ——   |
|       | BU1712-BU1806   | -114  | +18 | 正向市场价差缩小 | ——   |
| PP-MA | PP1709-3*MA1709 | 1042  | +38 | 价差缩小     | ——   |
|       | PP1801-3*MA1801 | 868   | +41 | 价差缩小     | ——   |
| L-PP  | L1709-PP1709    | 940   | +29 | 价差缩小     | ——   |
|       | L1801-PP1801    | 868   | +27 | 价差缩小     | ——   |
|       | L1801-PP1709    | 1090  | +24 | 价差缩小     | ——   |
| L-PVC | L1709-V1709     | 2015  | -25 | 价差缩小     | ——   |
|       | L1801-V1801     | 2325  | +35 | 价差缩小     | ——   |

跨期

跨品种

东吴期货研究所

能源化工品组

王庭富

从业资格号：F3034640

wangtf@dwqh88.com

研究所办公地址：

 上海市黄浦区西藏南路  
 1208号6楼

 苏州市工业园区星阳街  
 5号东吴证券大厦8楼

公司微信服务

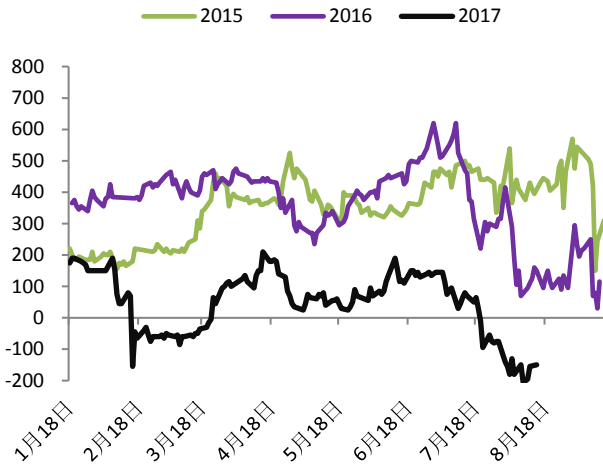


期市有风险，投资需谨慎

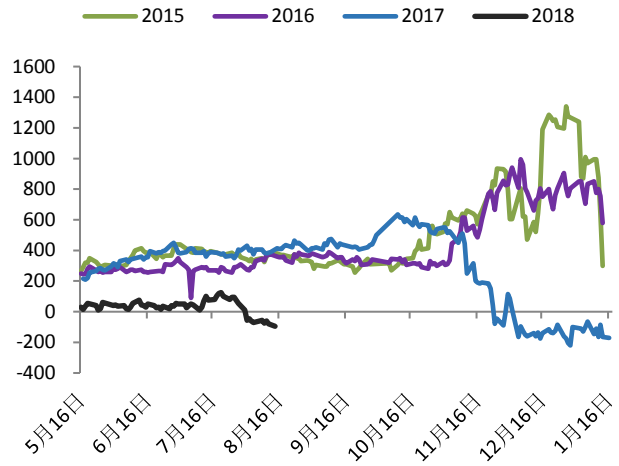
一、能化板块跨期套利

LLDPE :

塑料9-1月间价差

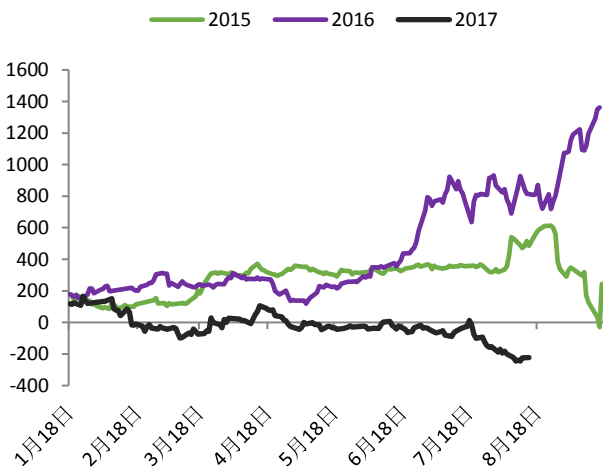


塑料1-5月间价差

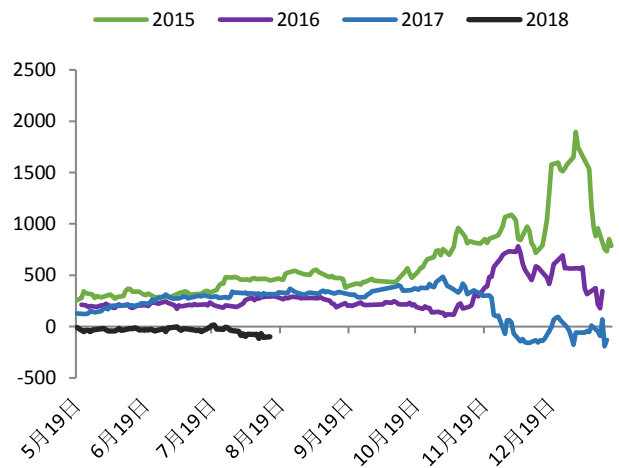


PP :

聚丙烯9-1月间价差

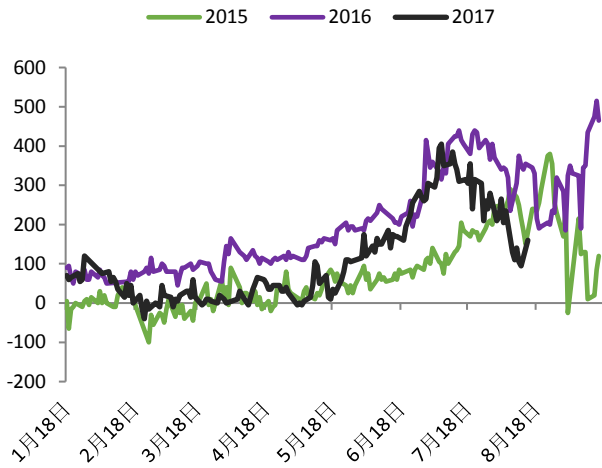


聚丙烯1-5月间价差

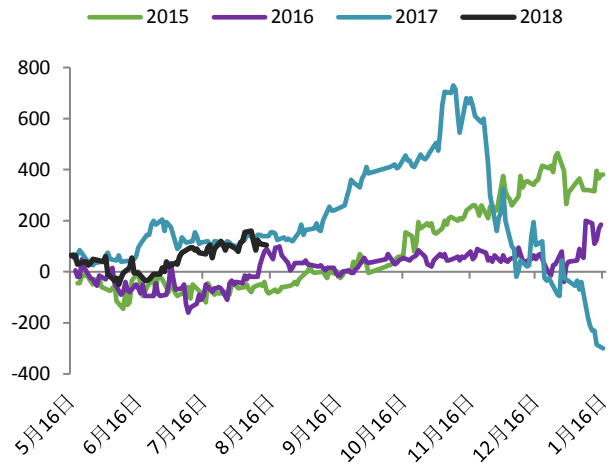


PVC :

PVC 9-1月间价差

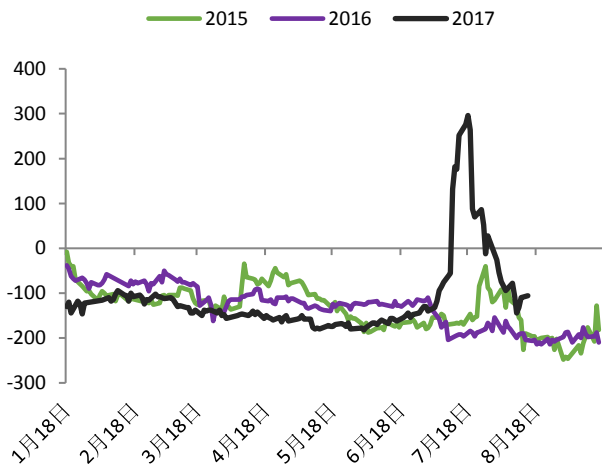


PVC 1-5月间价差

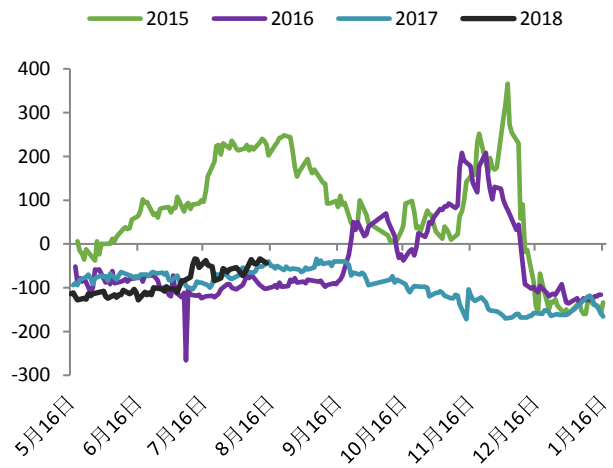


PTA :

PTA 9-1月间价差

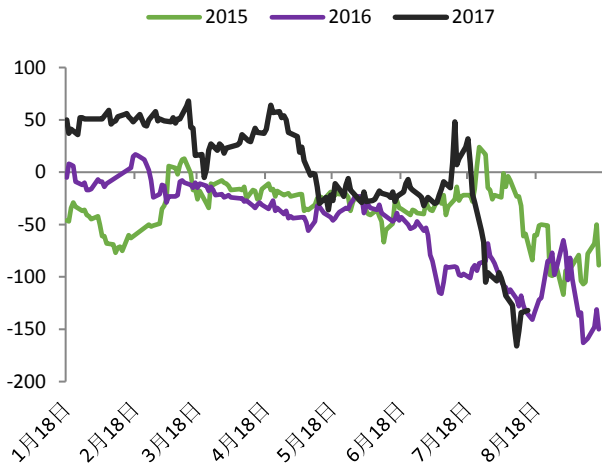


PTA 1-5月价差季节性

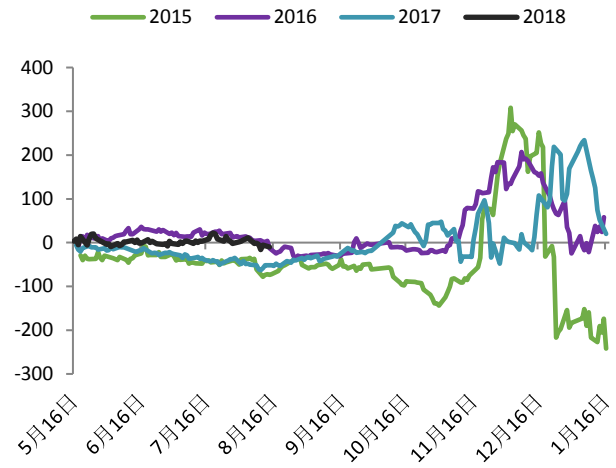


甲醇：

甲醇9-1月间价差

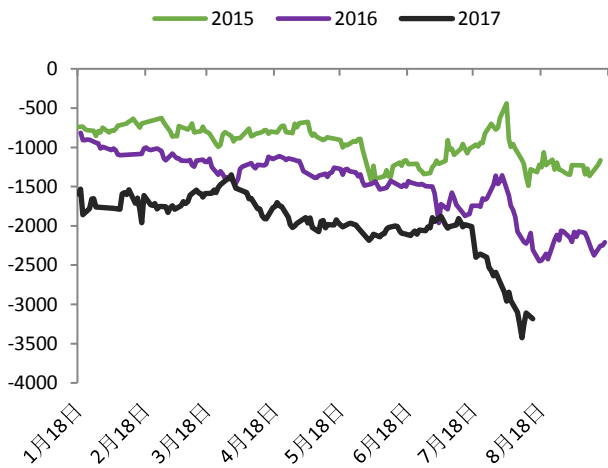


甲醇1-5月价差

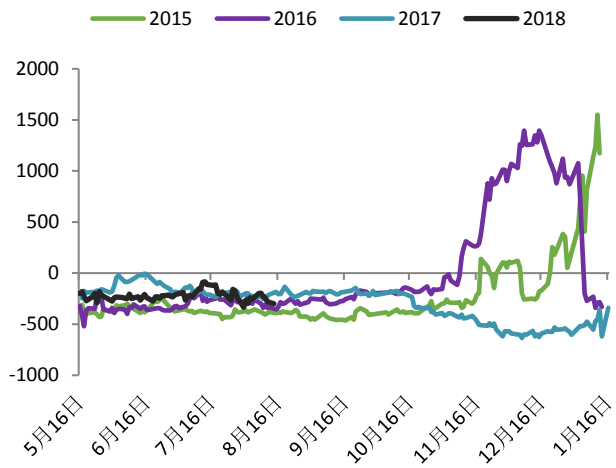


天然橡胶：

天然橡胶9-1月间价差

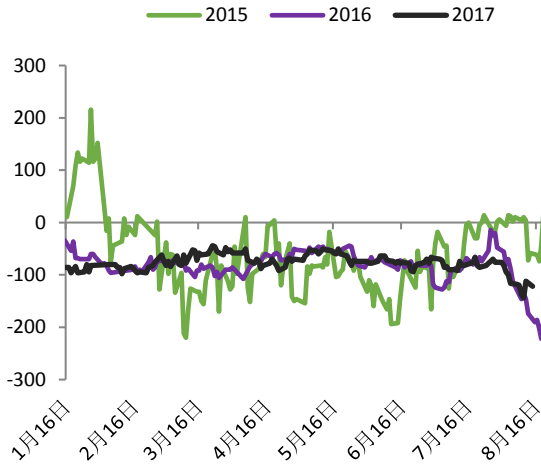


天然橡胶1-5月间价差

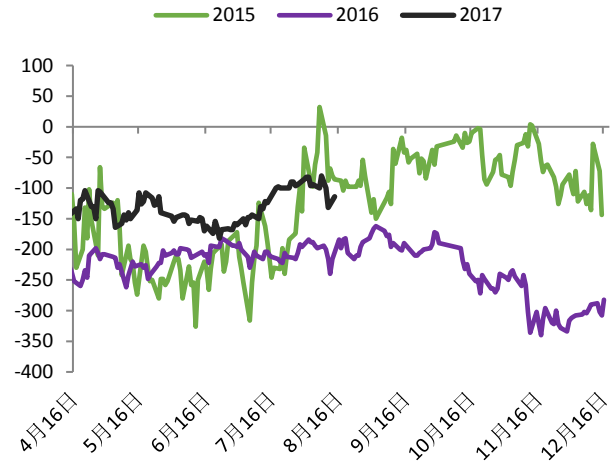


沥青：

沥青9-12月间价差



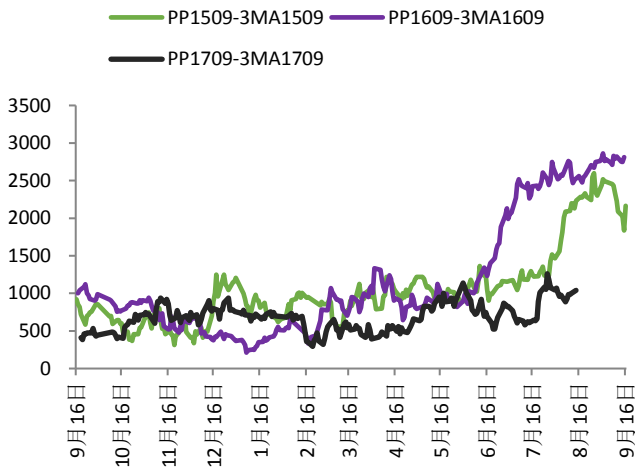
沥青12-6月间价差



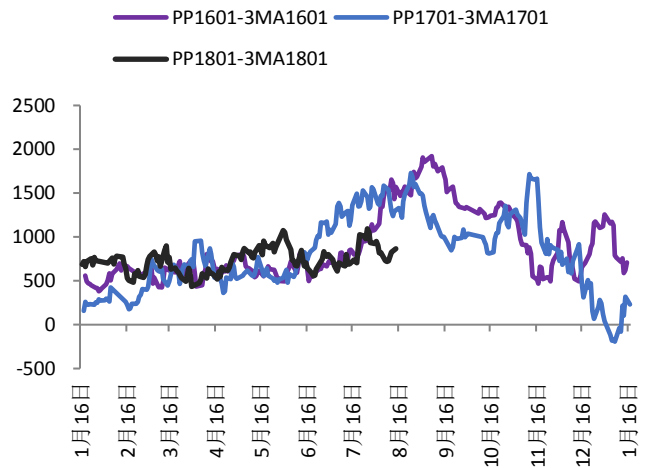
## 二、能化板块跨品种套利

聚丙烯-甲醇：

PP09-3\*MA09

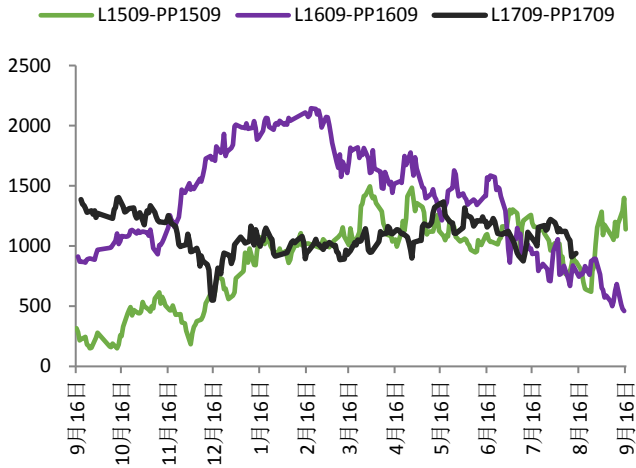


PP01-3\*MA01

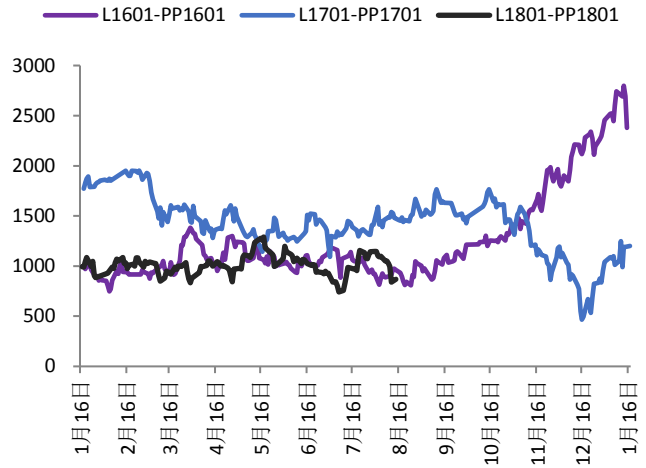


塑料-聚丙烯：

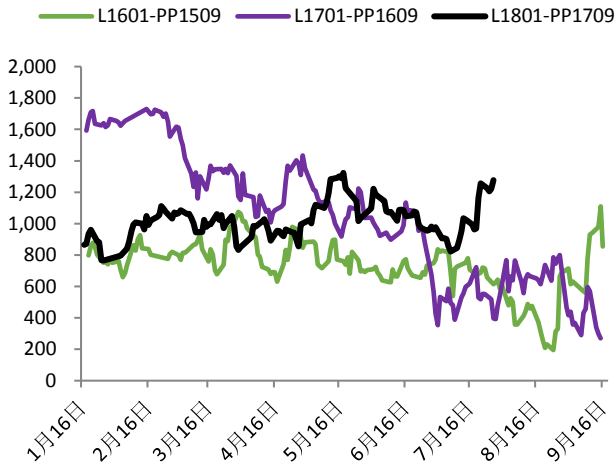
L09-PP09



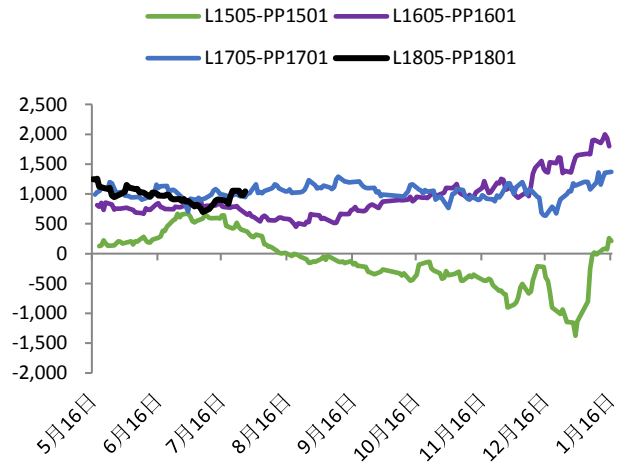
L01-PP01



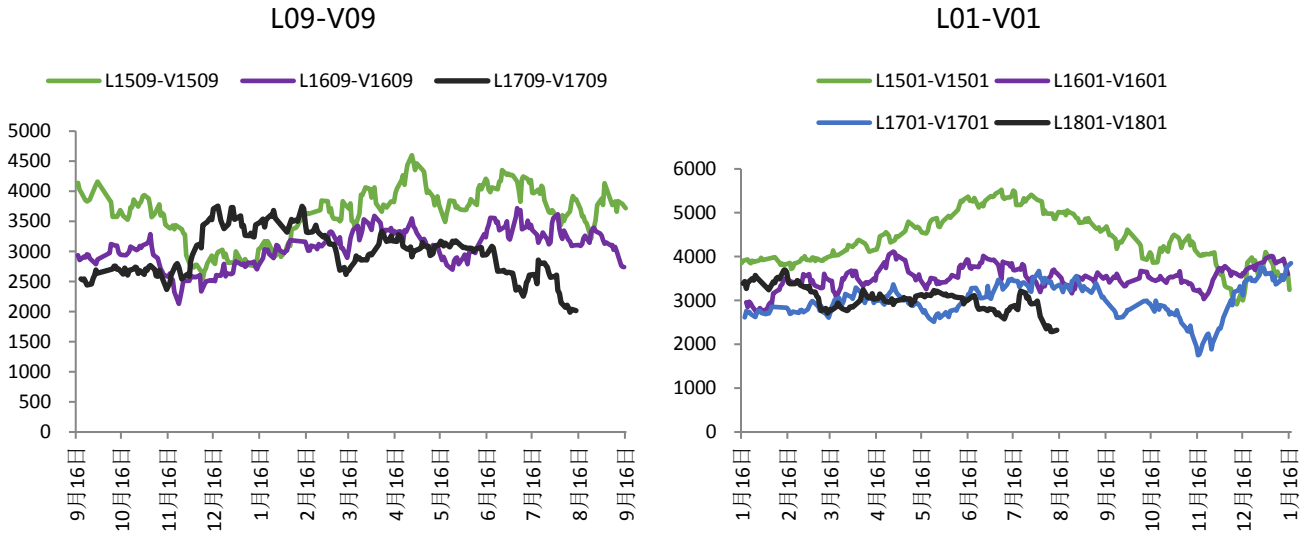
L01-PP09



L05-PP01



塑料-PVC :



免责声明 :

本报告由东吴期货制作及发布。报告是基于本公司认为可靠的且目前已公开的信息撰写，本公司力求但不保证该信息的准确性和完整性，所表述的意见并不构成对任何人的投资建议，投资者需自行承担风险。未经本公司事先书面授权，不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节、修改、及用于其它用途。

期市有风险，入市需谨慎。