

商品统计套利周度观测

2019.07.08

期货分析师：徐坚

投资咨询号：Z0013802

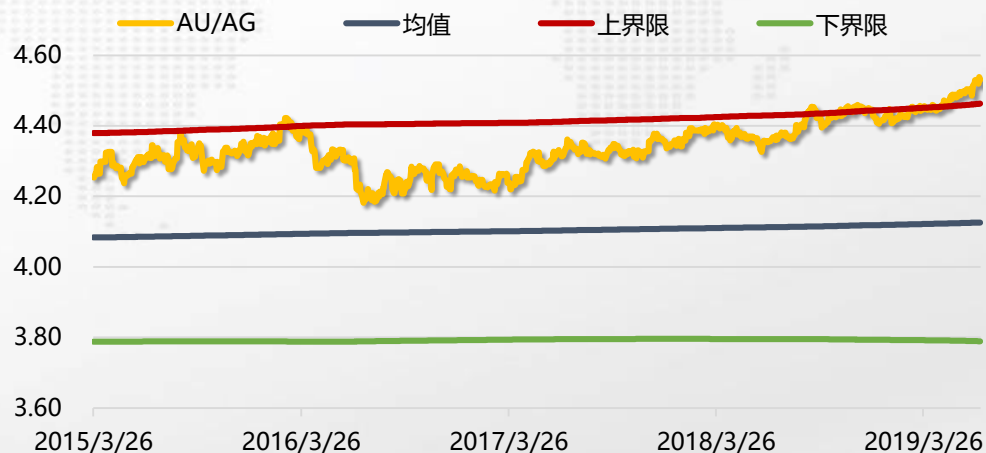
国际商品统计套利周度观测

国内商品统计套利周度观测

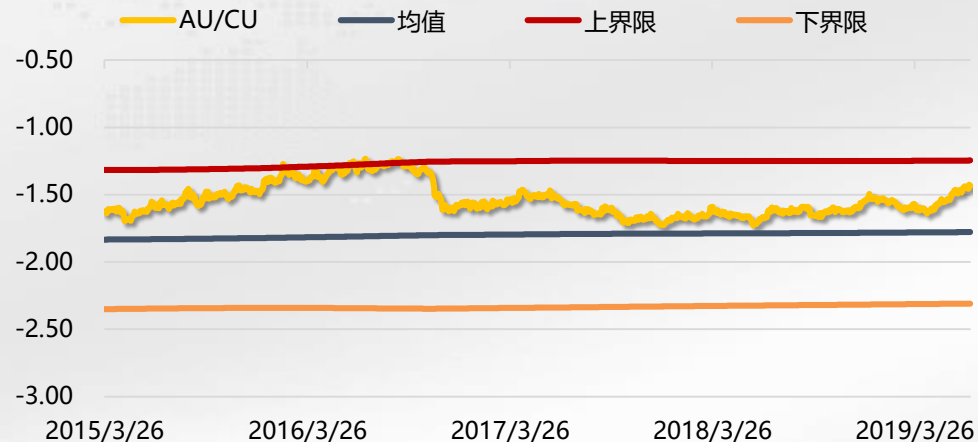
策略建议

国际商品统计套利周度观测

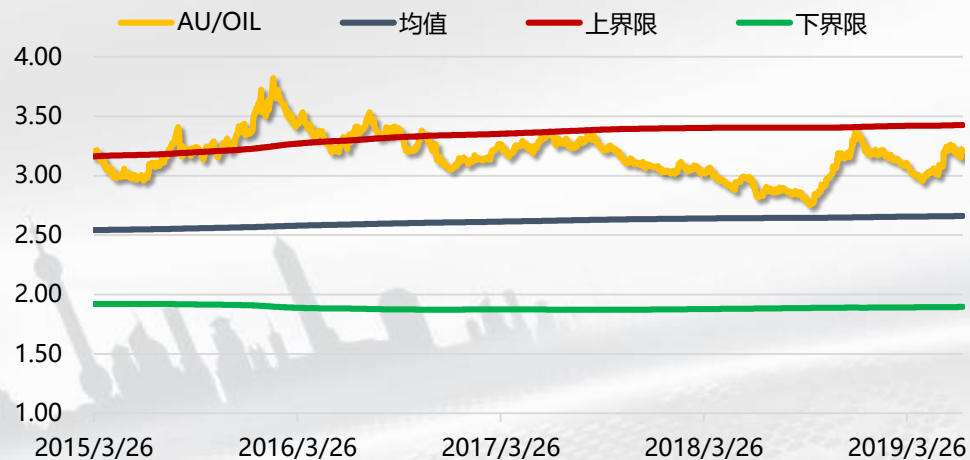
金银价比观测



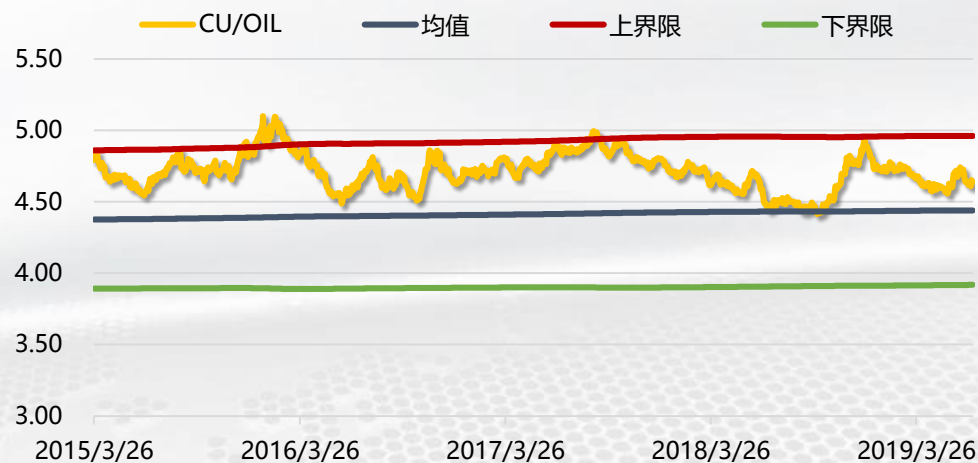
金铜价比观测



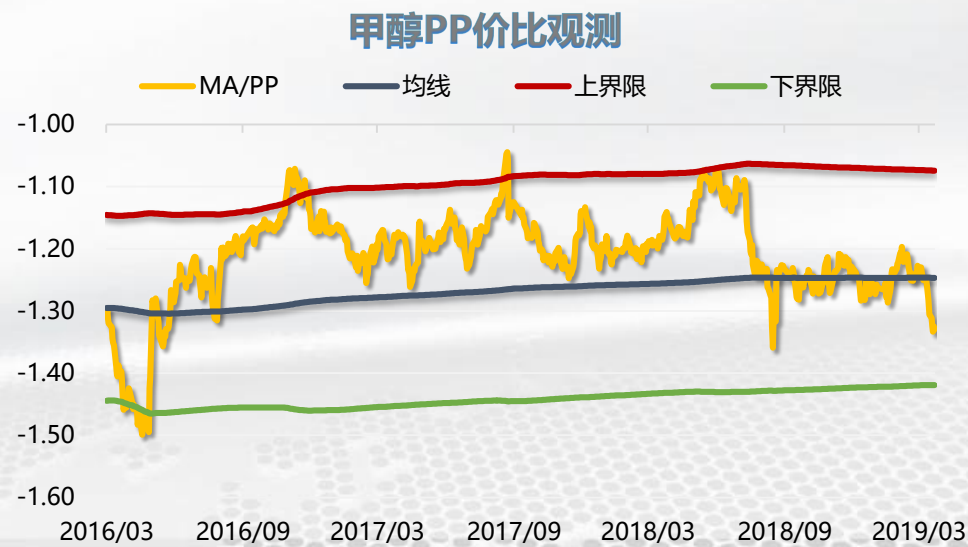
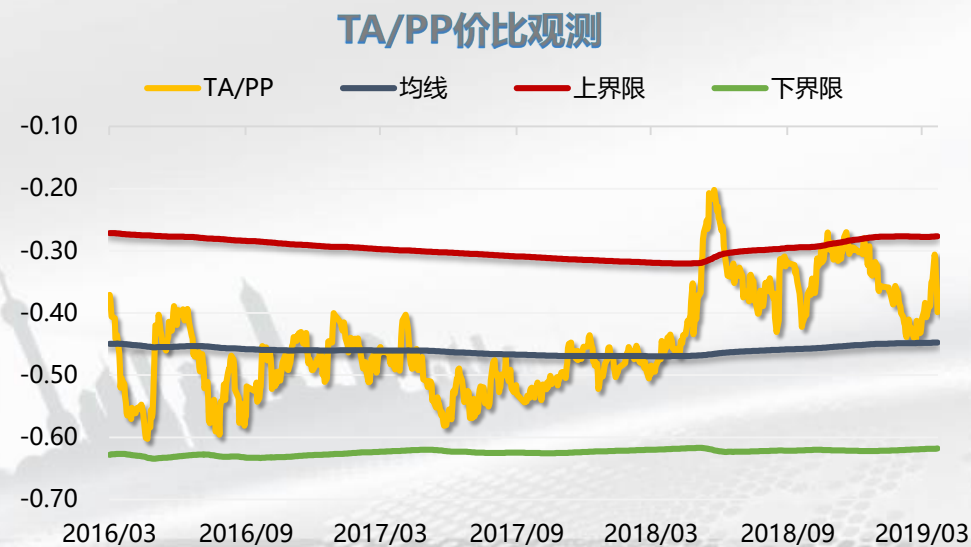
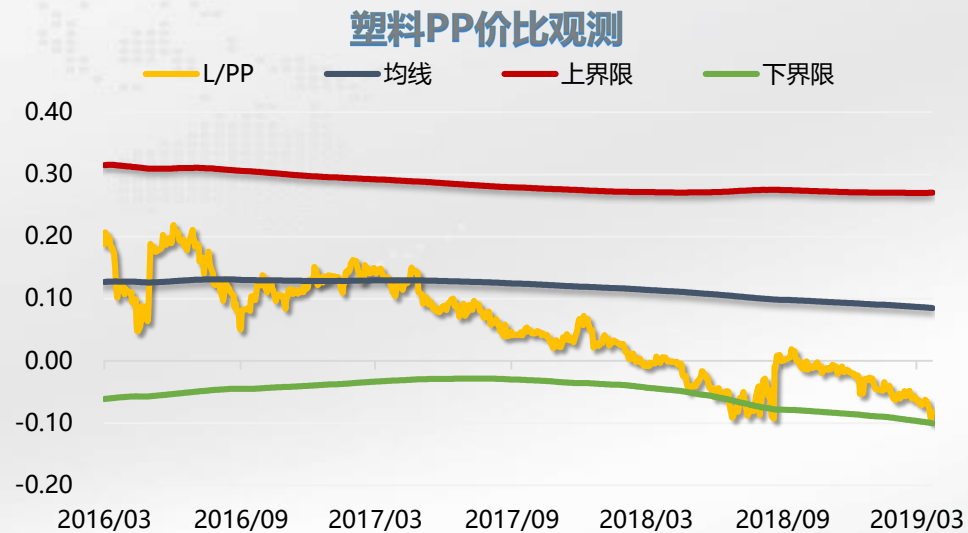
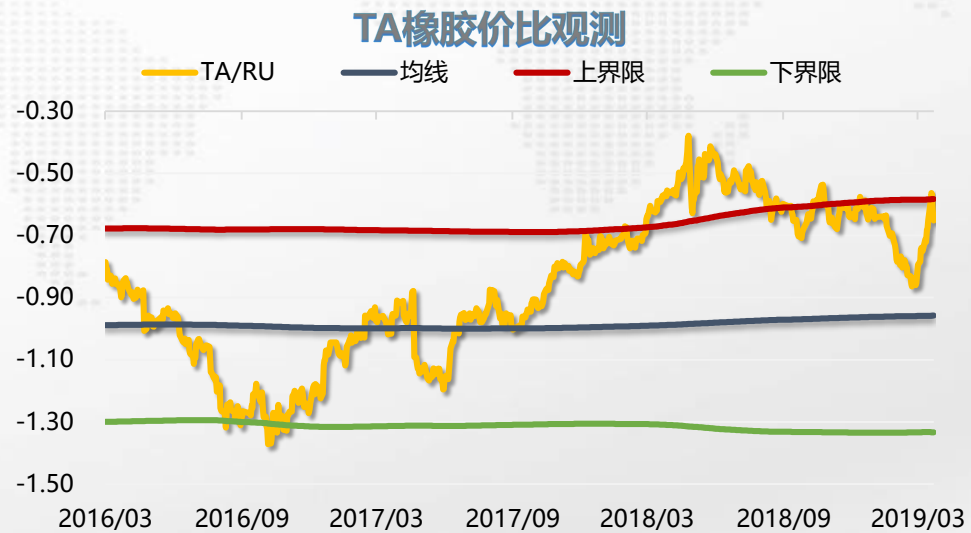
金油价比观测



铜油价比观测

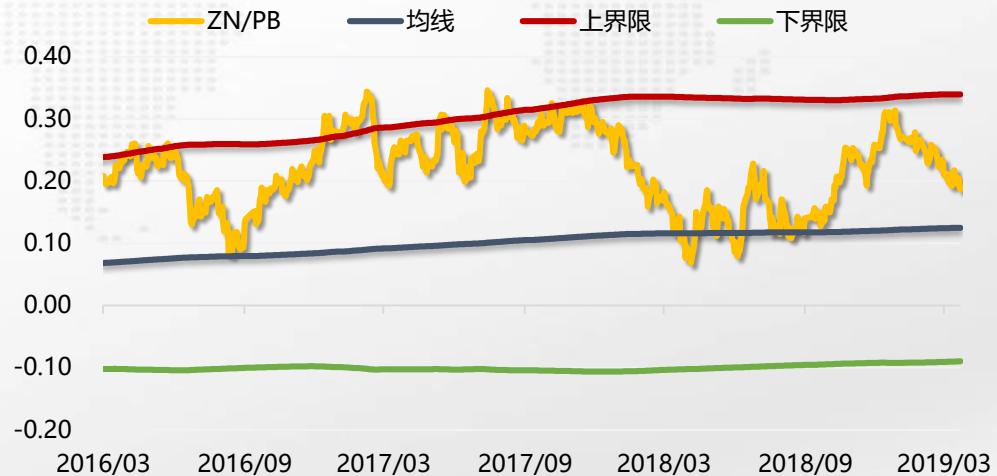


国内商品统计套利周度观测—能源化工

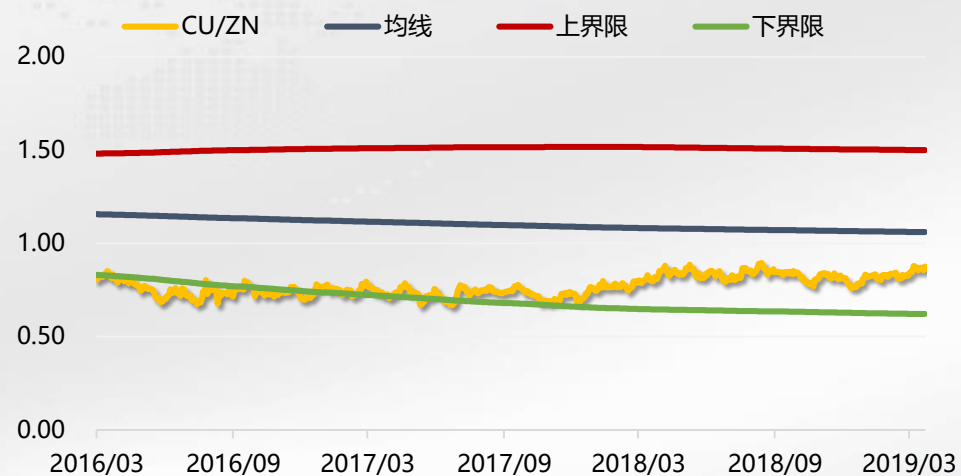


国内商品统计套利周度观测—有色金属

锌铅价比观测



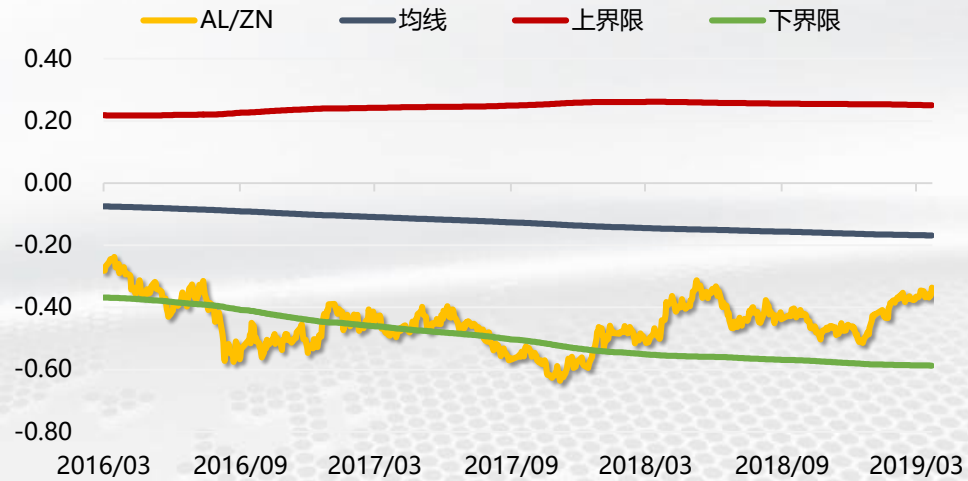
铜锌价比观测



铜镍价比观测

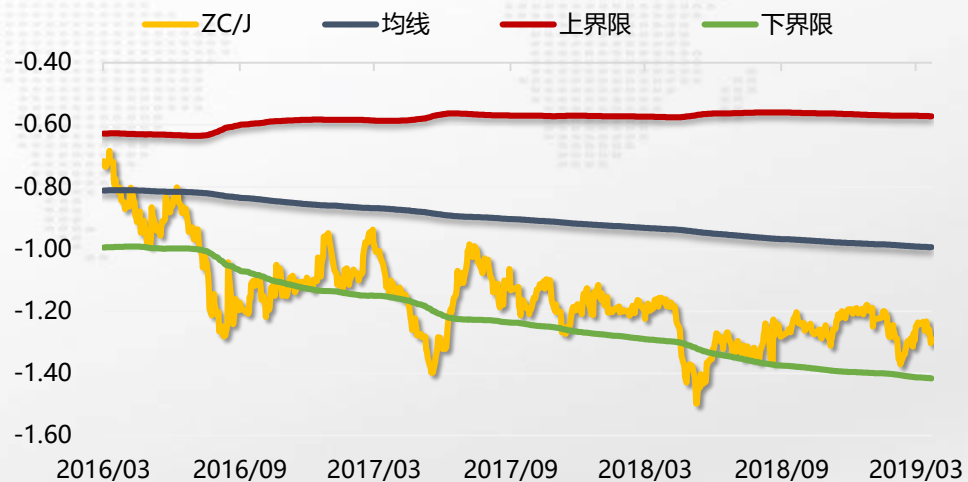


铝锌价比观测

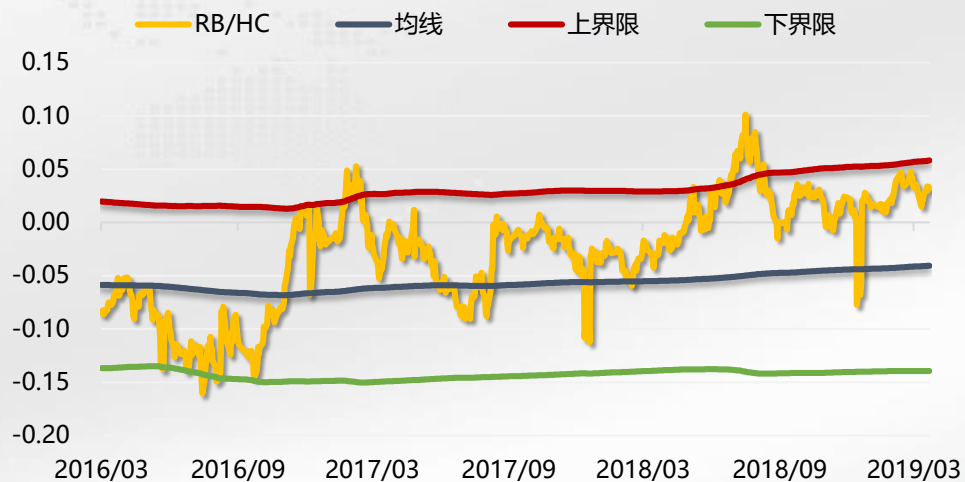


国内商品统计套利周度观测—黑色系

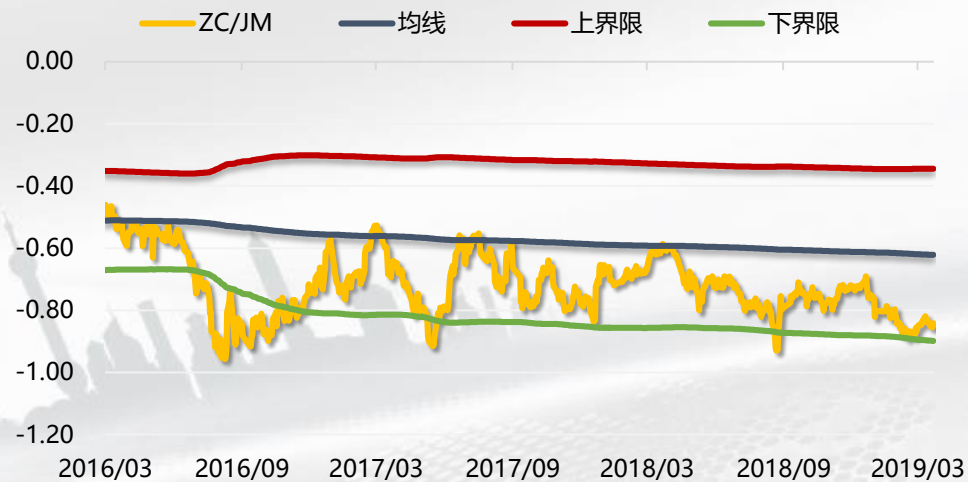
动煤焦炭价比观测



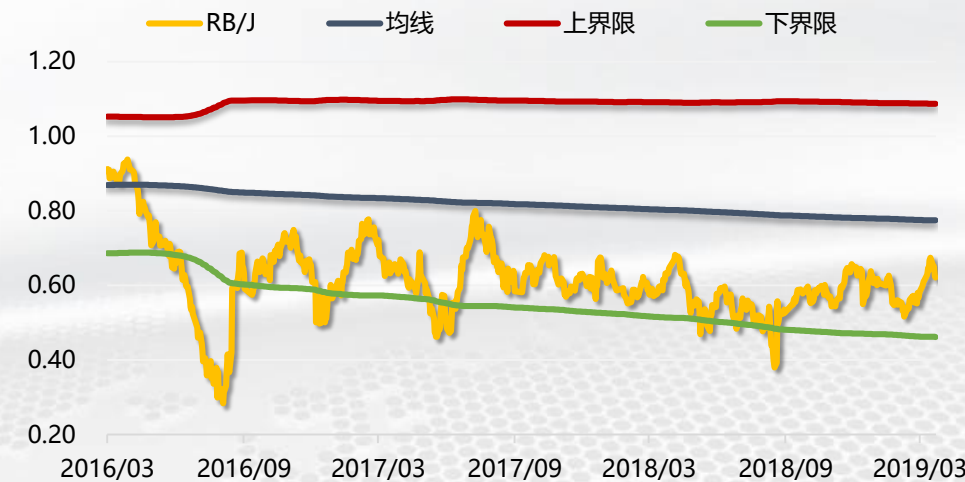
螺纹热卷价比观测



动煤焦煤价比观测

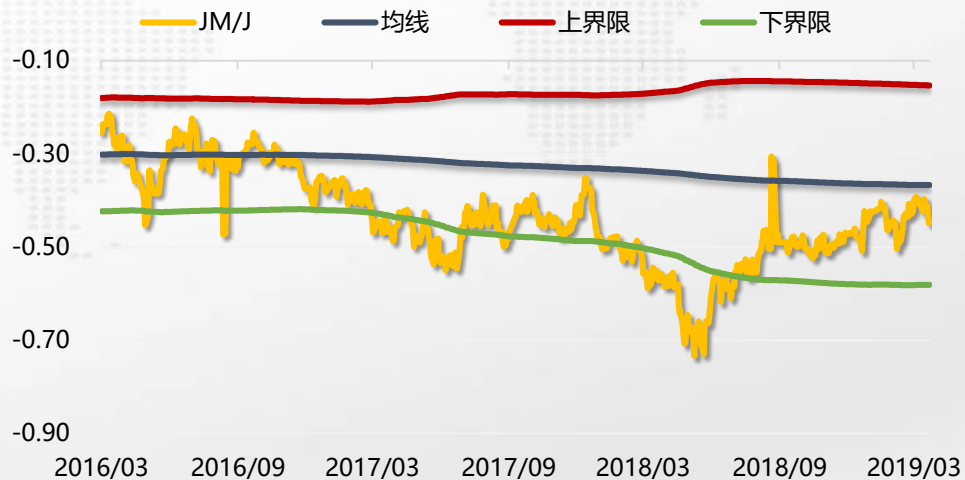


螺纹焦炭价比观测

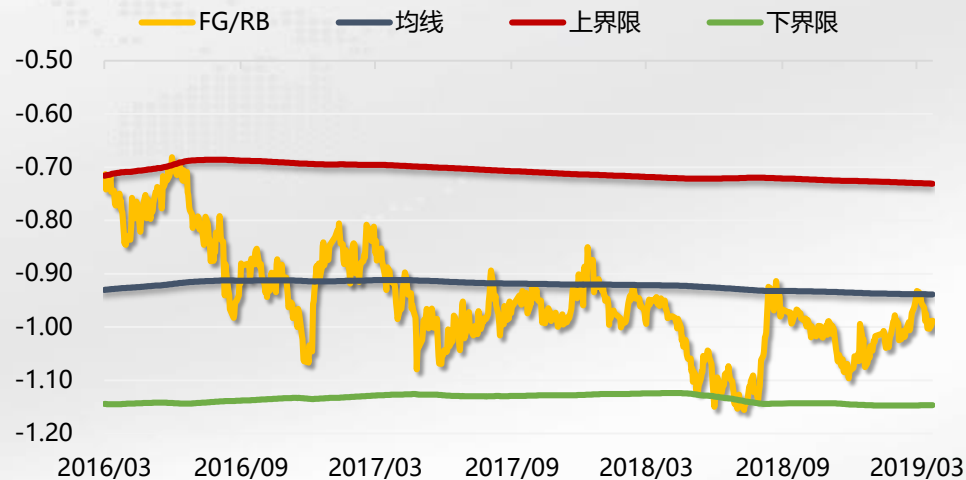


国内商品统计套利周度观测—黑色系

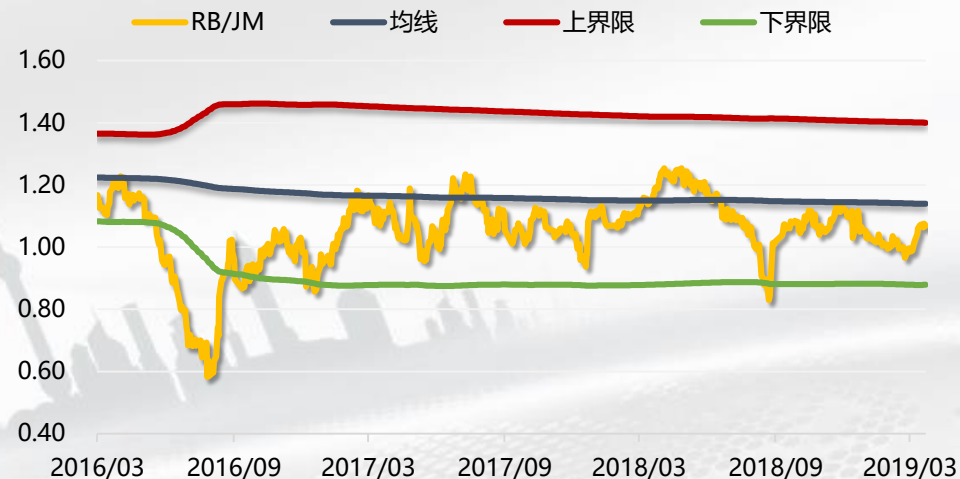
焦煤焦炭价比观测



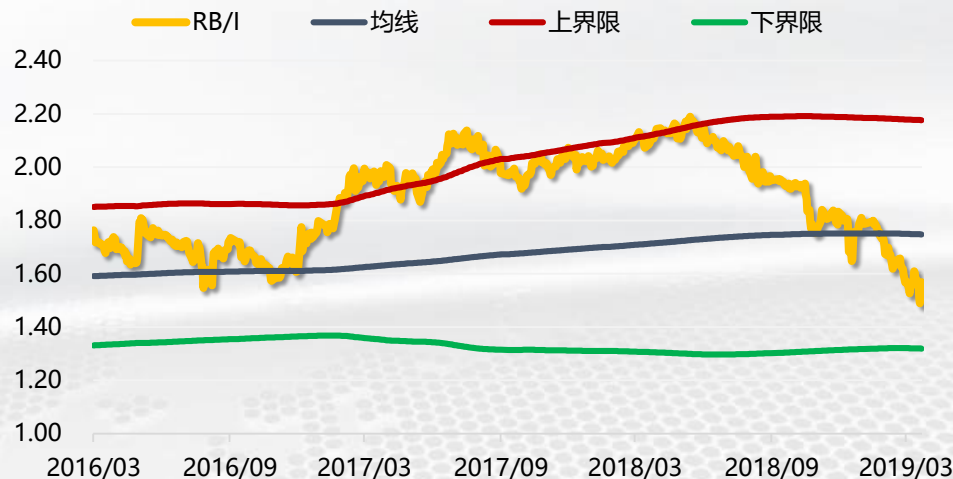
玻璃螺纹价比观测



螺纹焦煤价比观测

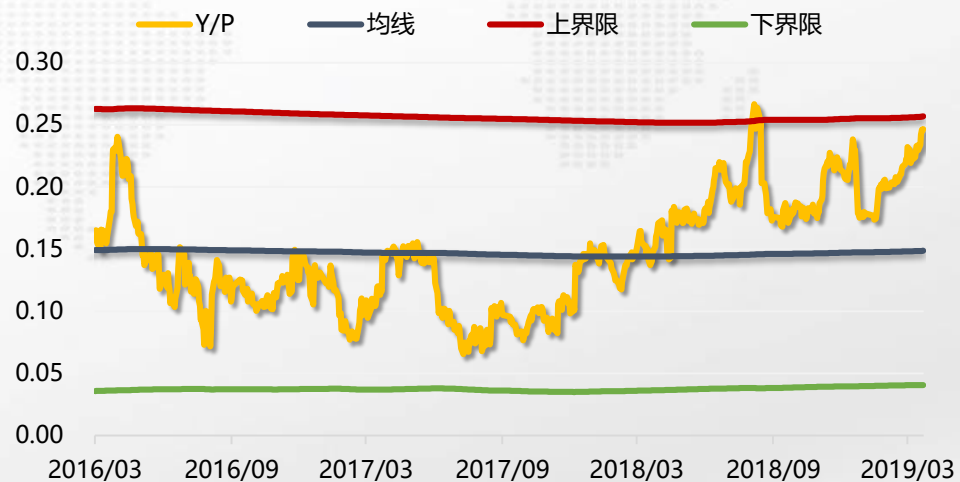


螺纹铁矿价比观测

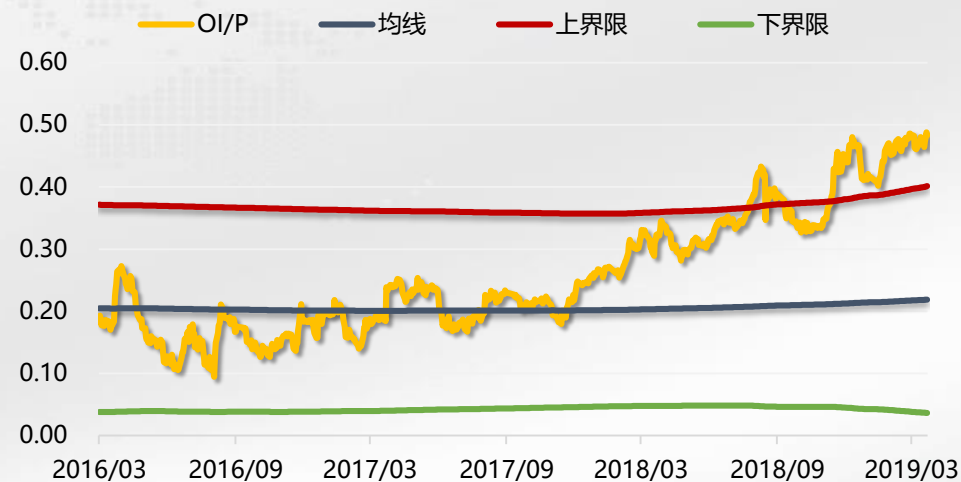


国内商品统计套利周度观测—油脂油料

豆油棕油价比观测



菜油棕油价比观测



豆油菜油价比观测

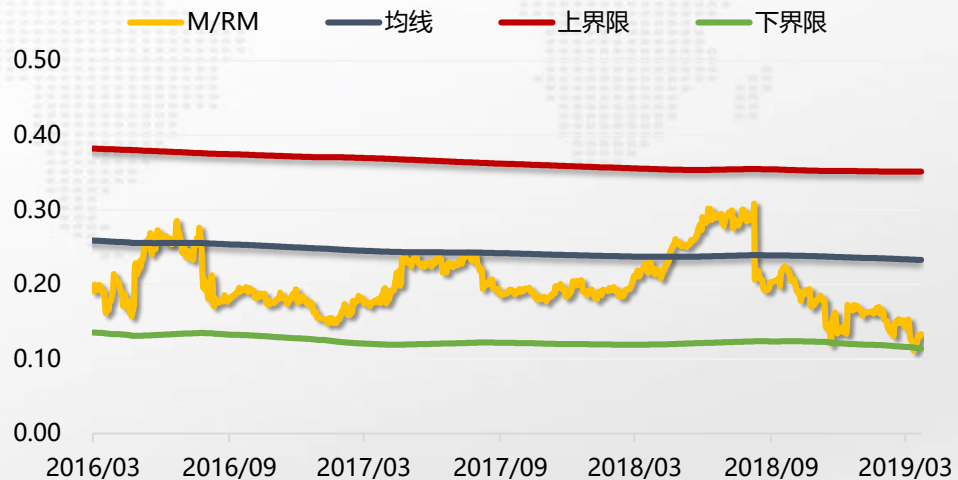


大豆豆粕价比观测

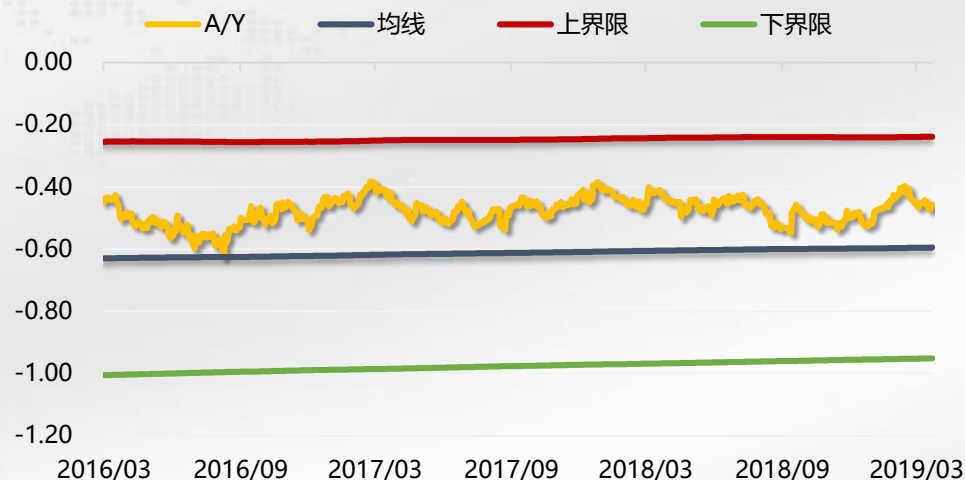


国内商品统计套利周度观测—油脂油料

豆粕菜粕价比观测



大豆豆油价比观测

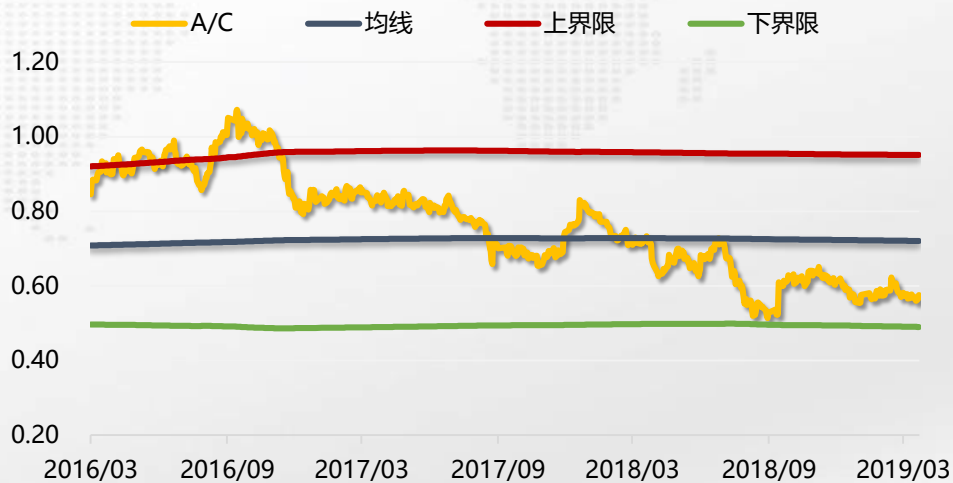


豆粕豆油价比观测



国内商品统计套利周度观测—谷物类

大豆玉米价比观测



玉米淀粉价比观测



策略建议

能源化工

TA相对橡胶价格处于历史高位，预计短期内价比下跌概率偏高，建议构建多橡胶空TA的套利策略；

工业金属

螺纹钢相对焦炭价格处于历史低位，预计短期内价比反弹概率偏高，建议构建多螺纹钢空焦炭的套利策略；

农产品

豆油相对菜油价格处于历史低位，预计短期内价比反弹概率偏高，建议构建多豆油空菜油的套利策略；

免责声明

本报告所载的内容仅作参考之用，不作为或被视为出售或购买期货品种的要约或发出的要约邀请。此报告的内容不构成对任何人的投资建议，而中融汇信不会因接收人收到此报告而视他们为其客户。本报告中的信息均来源于公开可获得资料，中融汇信力求准确可靠，但对信息的准确性及完整性不做任何保证。客户应谨慎考虑本报告中的任何意见和建议，不能依赖此报告以取代自己的独立判断，而中融汇信不对因使用此报告而引起的损失负任何责任。本报告仅反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。本报告所载的观点不代表中融汇信期货有限公司的立场。中融汇信可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。未经中融汇信授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播的行为均可能承担法律责任。



Thank you!