

2013年1月9日 星期三

【操作建议】

一、套利组合

1、正向可交割跨期套利

| 套利组合 | | | | 建仓 价差 | 套利成本 (元/吨) | 持仓周期 | 操作 建议 | 保底收益 | |
|------|----|------|----|----------|---------------|------|----------|------|----|
| 期货合约 | 方向 | 期货合约 | 方向 | | | | | 未年化 | 年化 |
| | | | | | | | | | |

【注】收益均不计资金利息成本

2、不可交割跨期套利

| 套利组合 | | | | 价差/ 比价 | 目标 区间 | 建议操 作区间 | 盈亏 | 操作建议 |
|---------|----|---------|----|-----------|----------|------------|----|------|
| 期货合约 | 方向 | 期货合约 | 方向 | | | | | |
| 豆粕 1305 | 卖 | 豆粕 1309 | 买 | 77 | | 55 | 0 | 建仓 |
| 白糖 1305 | 买 | 白糖 1309 | 卖 | 19 | | 35 | 0 | 建仓 |

【注】非无风险

3、跨品种套利

| 套利组合 | | | | 价差/ 比价 | 目标 区间 | 建议操 作区间 | 盈亏 | 操作建议 |
|------|----|------|----|-----------|----------|------------|----|------|
| 期货合约 | 方向 | 期货合约 | 方向 | | | | | |
| | | | | | | | | |

【注】非无风险

二、对冲组合

| 对冲组合 | | | | | | 手数 比 | 操作建议 |
|------|---------|------|-------|------|------------|---------|------|
| 期货合约 | 方向 | 建仓区间 | 目标区间 | 止损区间 | 盈亏 | | |
| 1 | 棉花 1305 | 买 | 19005 | | 根据资金 止损 | 220 | 平仓 |
| | 玉米 1305 | 卖 | 2443 | | | -52 | |
| 2 | | | | | | | |
| | | | | | | | |

【注】风险较大，审慎选择，盘中价格再后续报告中以开仓当日开盘价与收盘价中间价计算。

【注】

以上所有组合中：

价差均为近月合约减远月合约，比价为所列组合前者比后者；

除非特殊说明，收益率未扣除资金成本、未年化；

手机 一五五五七一七一五五一
QQ 一四七六六一一六九
九一三九八二五二一

免责声明

本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，也不保证本公司作出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述期货买卖的出价或询价。在任何情况下，我公司不就本报告中的任何内容对任何投资作出任何形式的担保。本报告版权归浙江大地期货经纪有限公司所有。未获得浙江大地期货经纪有限公司事先书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“浙江大地期货经纪有限公司”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。