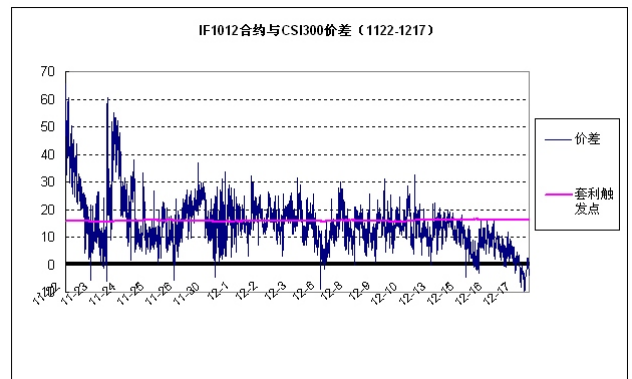
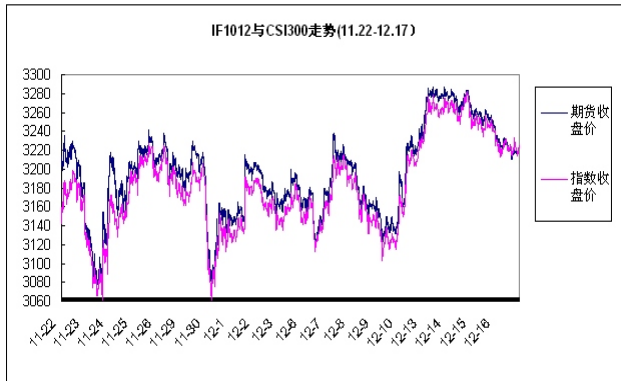


中投“平衡收益”产品月报

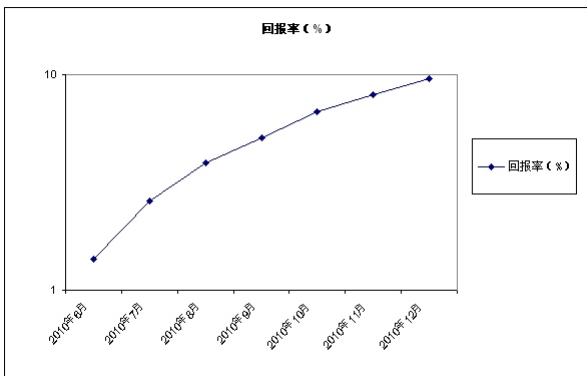
每月股指套利投资报告

◆ 本月综述 市场机会频繁套利回报丰厚

自IF1012合约于11月22日成为主力合约后，该合约与沪深300指数的正向套利空间呈现常见的先高后低的走势。根据分钟数据计算，全月平均价差为14.53，最高价差为65.53，最高单次套利收益空间为2.08%。在右下图中，我们看到除最后一周外，前三周都频繁出现套利机会。月套利收益达1.8%。



◆ 产品表现



◆ 产品简介

中投证券金融衍生品部凭借多年的衍生品研究和交易经验，于2010年6月率先推出股指期货期现套利投资顾问服务。

根据目前的市场条件，我们为客户提供本金安全性最高的现货全复制组合策略。这种策略保证了现货组合和沪深300指数的高度相关性，跟踪误差极小，确保套利组合的收益不受市场波动风险的影响。

我公司自主研发的程序化交易系统，采用高级编程语言开发，系统稳定高效，可实现300只股票在1.5秒内完成下单，为客户抓住稍纵即逝的套利机会提供前沿的系统支持。

中国建银投资证券有限责任公司

地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18-21层

网址：www.cjis.cn

电话：86-0755-82026739

中投证券核心客户部

黎万意:13631538260

liwany@cjis.cn

法律申明：本报告版权归中国建银投资证券有限责任公司（以下简称“中投证券”）所有，未获得中投证券书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。报告中的内容和意见仅供参考，并不构成投资的依据。投资者应根据个人投资目标，财务状况和需求来判断是否使用本报告所载内容和信息，独立作出投资决策并自行承担相应风险，我公司及其雇员不对据此而引起的任何直接或间接损失负任何责任。

内部资料，免费交流