

金元期货早参考 (2015/03/27)

撰写：岳晓南

品种	交易计划	解析
CF1509	空单坚定持有，止损 14000，止盈依据库存变化而定。	1, 棉花库存 1200w 吨，绝对数额巨大，去库存压力巨大。2, 棉花下游消费低迷。3, 技术上均线系统呈空头排列。
3TA1509-2L1509	TA 空单耐心持有，L 适行情波动适度增减。止盈依现货市场表现而定。	1, 26 日交易所 TA 仓单再增 2239 张至 76723 张，库存压力显现，期货价格优势凸显。2, 下游整体采购有限，产销率延续低位。3, 扩容后 5 月多头接货，抛 9 月概率较大。4, L 技术上形成多头突破缺口形态形成，强势特征较为明显。5, 也门战事出现，为规避原油炒作风险，L 对冲 TA 风险。
IF1504	空单谨慎持有，止损 4025，止盈 3750。	1, 近期资本市场资金充裕，股指做多热情高涨，强势特征较为明显，但近期股指高位剧烈震荡，成交量维持高位运作。建议股指逢高 谨慎试空 。2, 持有 300ETF 的客户可做对应防守策略。

金元期货模拟基金

基金名称：朗赢进取基金

基金简介：朗赢进取基金，初始资金三百万，初始运作日期 2015 年 3 月 3 日。本基金以“基本面投资为主、技术面投资为辅”，建立多标的、分散化投资，盘中以具体情况适时调整资金头寸，力求投资风险有效降低，资金利用率最优化。

昨日成交汇总：

合约	买/卖	开/平	成交价	成交手数	平仓盈亏（元）
IF1509	买	平	3900 点	1	15000
IF1509	卖	开	3920 点	1	-
L1509	买	开	9680 元/吨	100	-

今日持仓汇总：

合约	买/卖	持仓均价	持仓手数	今日结算价	持仓盈亏（元）
CF1509	卖	13380.8 元/吨	150 手	13200 元/吨	128100
TA1509	卖	4823.333 元/吨	300 手	4896 元/吨	-112000
L1509	买	9610 元/吨	200 手	9635 元/吨	65000
IF1504	卖	3935 点	2 手	3940.8 点	600

基金走势：



【免责声明】

- 本策略以基本面分析作为交易方向的依据，是在对现有公开资料的分析后作出的，如未来基本面发生较大的变化，本策略将作相应调整。
- 本策略提及的数据只作理论计算，投资者应当根据实际市场状况调整投资计划、入场点，同时数据并不代表本策略对期货投资作任何获利保证。
- 本策略所做分析仅代表金元期货有限公司研发团队及分析师个人观点，尽量客观评述和预测市场走势，仅供投资者做入市参考，不做决策依据。本公司及个人不承担依据本报告书交易所导致的任何损失。