

金元期货早参考 (2015/08/24)

撰写：岳晓南

品种	交易计划	解析
CF1601	坚定持空	1, 2015/16 年度全球库存将下降 2090 万吨, 同比减少 5%, 中国以外地区的库存预计减少 3%至 900 万吨。2, 8 月 17 日, 中国储备棉管理总公司计划挂牌轮出储备棉 50230.59 吨, 实际成交 1775.45 吨, 成交率 3.53%, 全部为 2011 年度国产棉。7 月 10 日至今, 储备棉累计出库成交 49993 吨, 其中国产棉成交 42239.93 吨; 进口棉成交 7753.08 吨。3, 目前国储库仍有大约 1000 万吨库存等待轮储。未来仅凭国内消化库存时间需要 10 年以上。4, 详情见 http://www.jyqh.cn/info_view.jsp?infoid=22681&subid=19&isend=0
IF1509	观望	1, 政治局年中会议对经济下行压力加大和金融风险上升的忧虑明显加重, 这与近期多部位官员对经济“缓中趋稳、稳步向好”的乐观标书形成反差。2, 中国央行称人民币不存在贬值基础, 3%偏差已调整到位。但究竟能否企稳, 还是未知之数, 今年前 7 个月中国外汇储备已经减少 1920 亿美元。商务部发言人称外贸形势比预想更严峻, 人民币或再迎大跌。3, 国务院批复养老金投资股市, 发布《基本养老保险基金投资管理办法》, 办法明确, 投资股票、股票基金、混合基金、股票型养老金产品的比例, 合计不得高于养老基金资产净值的 30%; 参与股指期货、国债期货交易, 只能以套期保值为目的。办法自印发之日起施行。关注养老金入市利好对大盘影响。4, 技术上, 上证指数以 6.15%的大阴强势突破之前盘整格局, 关注 3600 点支撑力度。
RU1601	持空	1, 青岛保税区库存企稳反弹。2, 轮胎厂开工率下降, 下游商用车市场表现低迷, 7 月汽车零售销量创 17 个月新低, 6 月汽车产销六年半来首现双降。3, 原油跌势拖累丁二烯价格, 合成胶成本坍塌, 替代价差扩大。4, 近期交易所仓单明显增加。5, 技术上, RU1601 反弹乏力, 形态较弱。

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）
IF1508	买	平	3645 点	2 手	108000

今日持仓汇总：

合约	买/卖	持仓均价	持仓手数	昨日结算价	持仓盈亏（元）
CF1601	卖	12916.666 元/吨	300 手	12635 元/吨	557500
RU1601	卖	12150 元/吨	100 手	11985 元/吨	115000

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。