

金元期货早参考 (2015/10/12)

撰写：岳晓南

品种	交易计划	解析
CF1601	持空	1, 2015年8月, 我国纺织品服装出口额为288.28亿美元, 环比上升5.78%, 同比下降5.58%。2014年9月-2015年8月, 我国纺织品服装出口额累计为2895.87亿美元, 同比减少49.29亿美元, 同比下降1.67%。2, 新疆2015年度棉花目标价格补贴改革试点工作实施方案调整“直补”方案, 自此, 新疆大部分地区将按照交售量对棉农进行补贴。 目标价格由2014年19800元/吨降为19100元/吨。3, 新棉开始上市量增加, 纺企需求继续疲软。4, 政策优惠下, 国内棉纺产业刮起“新疆风”, 众多知名纺织企业迁移新疆, 未来新疆棉花将在疆内消耗的实际情况将对棉花需求格局产生较大影响。 5, 2014/15年度国内棉花期末库存减少3.3万吨至1404.3万吨, 期末库存消费比为184.95%, 较上月提高0.7个百分点。 详情见 http://www.jyqh.cn/info_view.jsp?infoid=22681&subid=19&isend=0
RU1601	持空	1, 青岛保税区橡胶持续流入。2, 8月, 汽车产销156.97万辆和166.45万辆, 环比分别增长3.41%和2.98%, 同比下降8.44%和2.98%。1-8月, 汽车产销1518.24万辆和1501.72万辆, 同比分别下降0.24%和持平。中汽协副秘书长称, 中国今年汽车销量很可能负增长。3, 中国8月天胶进口量同比增65%, 合成胶增17%。4, 中国汽车流通协会网站公告称, 9月库存预警指数为55.7%, 处于警戒线50%以上, 比上月上升7.0个百分点。
BU1512	逢低做多	1, 中国各项经济数据都有不同程度回落的背景下, 铁路公路等基础设施建设已成为目前我国经济稳增长的重要抓手。从8月的宏观数据看, 基建投资是制造业、房地产、基础设施三大投资领域中唯一贡献率上升的领域。今年1—8月, 基础设施投资增长18.4%, 对整体投资的贡献率达27.7%, 同期上升5.7%。2, 三四季度为基建批复密集期, 公路路桥等项目频频落地。3, 在当前经济情形下, 随着房地产投资、工业投资增速持续下滑, 为托底经济, 相关的投资“组合拳”将不断打出, 发改委批复基建投资也将是稳增长的重要力量。4, 基差率在25%左右, 近期有望缩小。5, 原油走势对目前盘面形成一定支撑, 同时对冲橡胶风险。

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）

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	12195 元/吨	1037500
RU1601	卖	11625 元/吨	100 手	11610 元/吨	-230000
BU1512	买	2380 元/吨	500 手	2420 元/吨	410000

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。