

## 金元期货早参考 ( 2016/5/6 )

撰写：岳晓南

品种	交易计划	解析
I1609	持空	1, 铁矿石过剩情况依旧严峻。2, 供给侧改革将是主导钢铁行业的最重要的政策, 减少钢铁供给必然导致铁矿石需求下降。3, 短期宏观政策层面针对钢铁去产能及房地产去库存政策促使热钱炒作黑色系, 但随着贸易商补库存即将告一段落, 铁矿石价格面临回落风险较大。4, 经过连续暴涨, 铁矿高位石高位聚集风险, 铁矿现货价格过山车式暴涨暴跌。显示铁矿价格高位承受较大压力, 并且也不符合基本面情况。5, 唐山园博会导致唐山钢厂限产 50%产能。详见 <a href="http://www.jyqh.cn/info_view.jsp?infoid=23970&amp;subid=19&amp;isend=0">http://www.jyqh.cn/info_view.jsp?infoid=23970&amp;subid=19&amp;isend=0</a>
JD1609	买入开仓	1, 7、8 月份没有合约, 天气炎热, 可用于交割的鸡蛋仅仅 9 月份能够提供哈夫值大于 72 的鸡蛋, 可交割数量较少, 是天然的逼空合约。2, 9 月份价格明显高于其他月份, 逼空行情较为明显。3, 持仓量逐步放大。

# 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）
JD1609	买	开	4080 元/500KG	1000 手	-

## 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）
I1609	卖	424.5 元/吨	200 手	423 元/吨	240000
JD1609	买	4080 元/500KG	1000 手	4063 元/500KG	-210000

## 基金走势：



尊敬的期货投资者：

您好，2015年3月推出“朗赢模拟基金”以来，一年时间，取得了超越400%的收益率，获得众多期货投资者的好评。现公司咨询部计划推行朗赢团队咨询服务业务，服务方式多样化，资金规模不限。有意向参与的投资者可与岳晓南取得联系。联系电话：0898-66552032，13648644126。

### 【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。