

金元期货早参考 (2015/08/13)

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至 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, 6 月纺织业增加值同比增长 8.1%, 1-6 月同比增长 7.1%, 增幅回落 2.9 个百分点。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&iisend=0
IF1508	加仓持空	1, 政府强势出台救市政策未能扭转期指颓势, 7.27 中国 A 股市场再次上演千股跌停震撼场景, 其中上证指数创近八年来最大单日跌幅。2, 技术上, 指数结束调整, 再次走弱, 多头信心开始瓦解, 空方力量再次占据主导。3, 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。4, 8 月 11、12 日在岸人民币对美元大幅贬值 1700 个基点, 盘中一度创下 6.4485 的低点, 虽然央行经济学家解读为一次性调整, 但由此或引起资金加速外流, 对市场流动性构成一定利空影响。5, 技术上, 上证指数持续缩量上行, 但短期形态构成二次筑底格局, 谨防放量拉升。
RU1601	加仓持空	1, 现货价格延续下滑局面。2, 青岛保税区库存企稳反弹。3, 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。4, 原油跌势拖累丁二烯价格, 合成胶成本坍塌, 替代价差扩大。5, 近期交易所仓单明显增加。6, 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）

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	13050 元/吨	200 手	12445 元/吨	615000
IF1508	卖	3650 点	1 手	3977.4 点	-81720
RU1601	卖	12100 元/吨	50 手	12140 元/吨	-105000

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、出入场点，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。