

统计套利系列产品

金钢对冲二号

产品说明： 基于螺纹钢焦炭的价差规律性波动，运用计量学原理建立模型，形成对冲型产品；
模拟参数： 初始资金¥100 万元，资金占用比例约 60%，保证金收取 10%，手续费 5 元/手

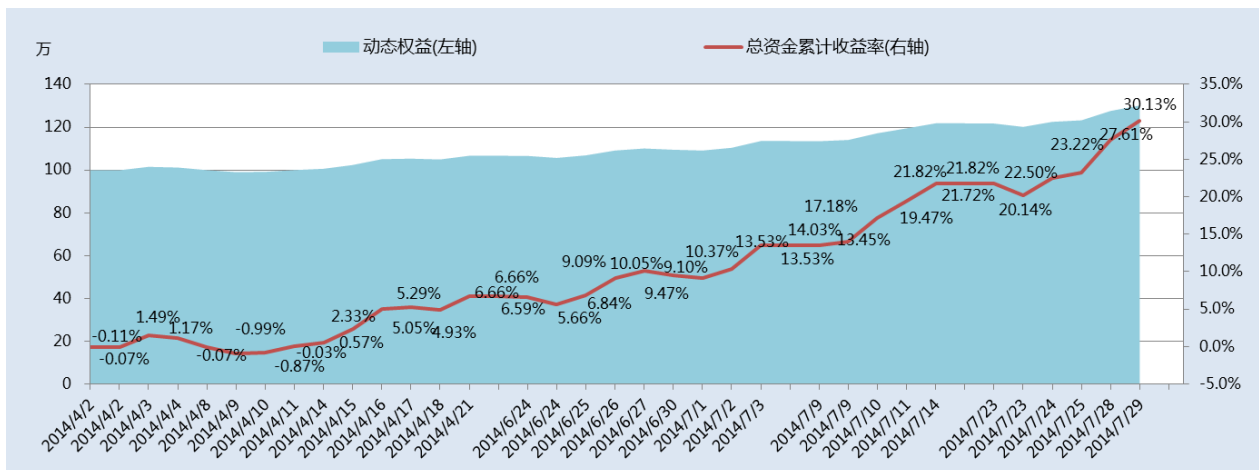
最新交易情况：

平仓日期：2014-7-29
平仓均价：(RB1501) 3103; (J1501) 1140
当前交易状态：获利平仓

开仓日期：2014-7-23
开仓均价：(RB1501) 3036; (J1501) 1128
建仓结构：多螺纹（170 手）+空焦炭（24 手）

截至 2014-07-25 盈亏情况：

最新盈亏：¥83,160 元
最新权益：¥1,301,340 元
总资金累计收益率：30.13%



免责声明：

本报告由东吴期货制作及发布。报告是基于本公司认为可靠的且目前已公开的信息撰写，本公司力求但不保证该信息的准确性和完整性，所表述的意见并不构成对任何人的投资建议，投资者需自行承担风险。未经本公司事先书面授权，不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节、修改等其它用途。期市有风险，投资需谨慎！