

统计套利系列产品

金钢对冲二号

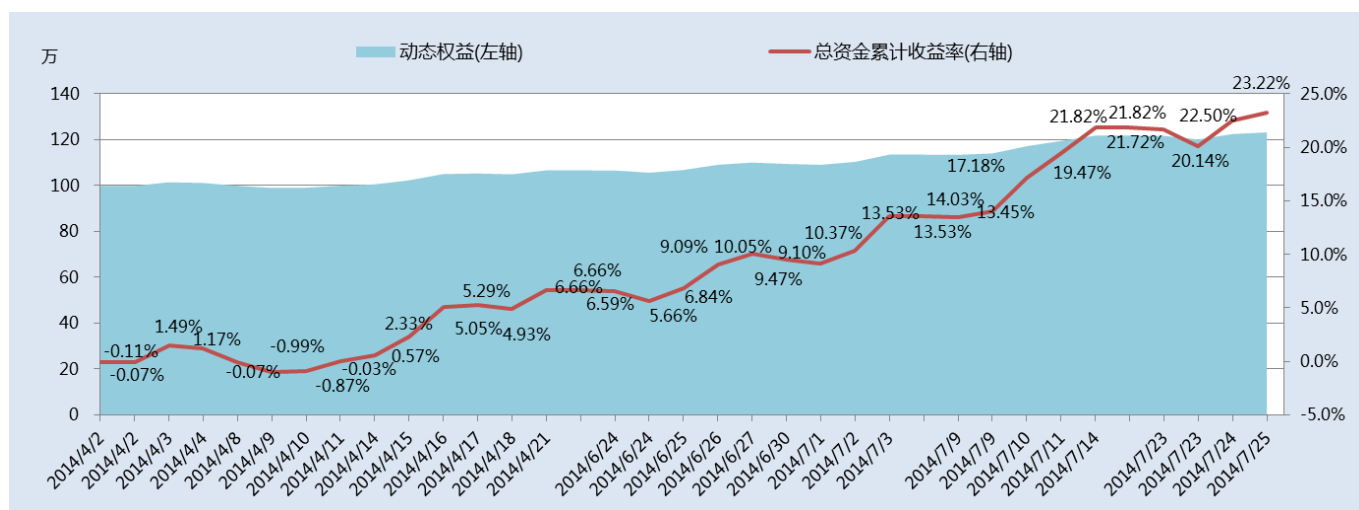
产品说明： 基于螺纹钢焦炭的价差规律性波动，运用计量学原理建立模型，形成对冲型产品；
模拟参数： 初始资金¥100万元，资金占用比例约60%，保证金收取10%，手续费5元/手

最新交易情况：

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）
 当前交易状态：持仓

截至 2014-07-25 盈亏情况：

最新浮动盈亏：¥14,030元（按当前结算价）
 最新动态权益：¥1,232,210元
 总资金累计收益率：23.22%



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！