

“套市盈”示范账户

产品说明:

“套市盈”是平安期货产品小组推出的系列产品之一，本产品结合期货品种基本面研究、量化统计研究、交易策略研究，通过产品小组决策流程，制定出交易方案。通过模拟账户的演示，对定向客户进行操作机会盘中推荐，为目标客户提供全面的交易服务。在盘中交我们即时向客户通过网络、短信等方式发布交易信号提示，交易结果则在收盘之后通过平安网站公布。

示范账户更新至：2011-01-17

累计交易记录：12次交易

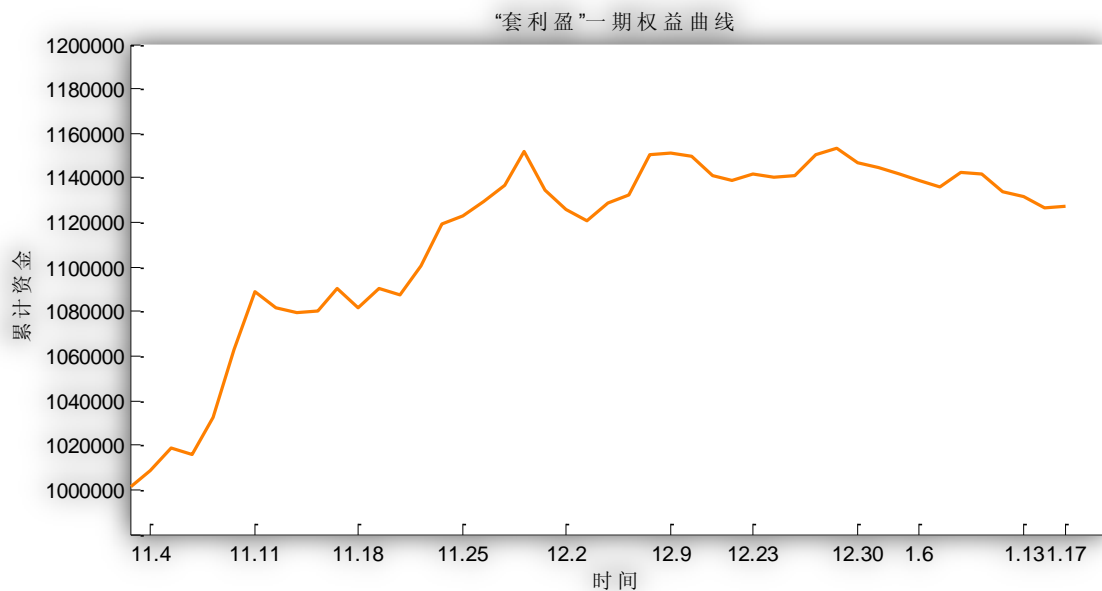
一、产品理念

结合期货品种基本面研究、量化统计研究、交易策略研究，通过产品小组决策流程，制定出交易方案。在风险控制的情况下按照交易方案进行交易，通过追逐大概率的套利机会，为高端客户提供简单直接的增值服务，以促进客户资产的长期稳定增值为最终目标。

二、产品特点

- 1、只进行对冲交易，避免单边风险；
- 2、每次操作设定止损位，严格控制最大亏损；
- 3、交易频率低，以追逐大概率套利机会为目标；
- 4、量化统计、基本面分析，决策系统相辅相成；
- 5、交易品种多元化，规避品种系统风险。

三、“套利盈”收益曲线（2011.11.3起）



“套利盈”一期交易统计	
交易区间	2011.11.3 –
交易准则	对冲交易
期初/期末资金	100 万/112.75 万
累计收益率	12.75%
交易次数	12 次

交易记录:

序号	日期	合约代码	开/平	交易	交易价格	开/平	开/平	手数	手续费	浮动盈亏	平仓盈亏	总仓位
			仓方向	时间		仓价差	仓比价					
1	11.3	Y1209	开空	10:41	9294	1259	1.16	25	500	/	102500	--
		P1209	开多	10:41	8035			25	375			
	12.13	Y1209	空平	9:40	8754	842	1.11	25	500			
		P1209	多平	9:40	7912			25	375			
2	11.9	Y1209	开空	9:10	9318	1150	1.14	13	260	/	39130	--
		P1209	开多	9:10	8168			13	195			
	12.13	Y1209	空平	9:40	8754	842	1.11	13	260			
		P1209	多平	9:40	7912			13	195			
3	11.28	Y1209	开空	9:15	8762	/	3.135	5	100	/	200	--
		M1209	开多	9:15	2795			15	225			
	12.13	Y1209	空平	9:40	8754	/	3.129	5	100			
		M1209	多平	10:05	2798			15	225			
4	11.28	A1209	开空	9:17	4242	/	1.516	10	200	/	-1050	--
		M1209	开多	9:17	2798			15	225			
	12.13	A1209	空平	10:05	4244	/	1.517	10	200			
		M1209	多平	10:05	2798			15	225			
5	12.22	m1209	开多	9:16	2870	627	/	12	180	/	-3240	
		c1209	开空	9:20	2243			12	144			
	1.16	m1209	平空	9:28	2878	600	/	12	180			
		c1209	平多	9:28	2278			12	144			
6	12.22	m1209	开多	9:16	2870	/	1.28	10	150	/	-3400	
		c1209	开空	9:20	2243			12	144			
	1.16	m1209	平空	9:28	2870	/	1.28	10	150			
		c1209	平多	9:28	2243			12	144			
7	12.22	ws1205	开多	9:19	2336	153.2	/	6	60	/	-940	
		c1205	开空	9:21	2234			6	72			
		ws1209	开多	9:21	2473			4	40			
		c1209	开空	9:20	2243			4	48			
	1.16	ws1205	平空	9:20	2345	/	143.80	6	60			
		c1205	平多	9:27	2270			6	72			
		ws1209	平空	9:17	2490			4	40			
		c1209	平多	9:28	2243			4	48			
8	12.28	p1209	开空	9:03	7962	8	/	2	30		-720	
		p1205	开多	9:03	7954			2	30			
	1.16	p1209	平多	9:30	7918	44	/	2	30			
		p1205	平空	9:30	7874			2	30			
9	12.29	WS1205	开多	9:21	2374	-119	/	8	80		-5040	

	1.5	ER1205	开空	9:21	2493	-182	/	8	64		
		WS1205	平空	9:39	2367			8	80		
		ER1205	平多	9:39	2549			8	64		
10	12.29	p1209	开空	14:35	7984	22	/	2	30	-440	
		p1205	开多	14:35	7962			2	30		
	1.9	p1209	平空	9:30	7918	44	/	2	30		
		p1205	平多	9:30	7874			2	30		
11	1.10	p1209	开空	10:36	8206	-914	/	4	60	2000	
		y1209	开多	10:36	9120			4	80		
	1.16	p1209	平多	9:30	7918	-964	/	4	60		
		y1209	平空	9:28	8882			4	80		
12	1.17	IF1206	开多	14:59	2516.2	9.2	/	1	150.972	1320	27%
		IF1203	开空	14:59	2507			1	150.42		

附：手续费标准

交易所	品种	手续费	交易所	品种	手续费
上海	铝 al (5T)	15	大连	黄大豆 a (10T)	15
	黄金 au (1000g)	100		黄豆 2 号 b (10T)	15
	铜 cu (5T)	万分之 4		玉米 c (10T)	12
	燃料油 fu	万分之 1.5		冶金焦炭 j (100T)	万分之 3
	铅 pb (25T)	万分之 3		聚乙烯 l (5T)	25
	螺纹钢 rb (10T)	万分之 3		豆粕 m (10T)	15
	橡胶 ru (5T)	万分之 3		棕榈油 p (10T)	15
	线材 wr (10T)	万分之 3		聚氯乙烯 v (5T)	25
	锌 zn (5T)	40		豆油 y (10T)	20
郑州	棉一号 CF (5T)	25	郑州	TA (5T)	15
	早籼稻 ER (10T)	8		强麦 WS (10T)	10
	菜籽油 RO (5T)	15		硬麦 WT (10T)	10
	白砂糖 SR (10T)	15	中金	沪深 300 股指	万分之 2

风险提示:

期货市场是一个风险无时不在的市场。您在进行交易时存在赢利的可能，也存在亏损的风险。请您务必对此有清醒的认识，认真考虑是否进行证券，期货交易。市场有风险，投资需谨慎。

免责条款:

此报告旨在发给平安期货有限公司（以下简称“平安期货”）的特定客户及其他专业人士。未经平安期货事先书面明文批准，不得更改或以任何方式传送、复印或派发此报告的材料、内容及其复印本予任何其它人。

平安期货可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。本报告及该等报告反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。报告所载资料、意见及推测仅反映分析员于发出此报告日期当日的判断，可随时更改。此报告所指的期货、期权和证券价格、价值及收入可跌可升。为免生疑问，此报告所载观点并不代表平安期货有限公司的立场。

平安期货有限公司2011版权所有。保留一切权利。

中国平安 PINGAN

平安期货有限公司

地址：深圳市福田区中心区福华三路88号时代财富大厦26楼

客服：400 8888 933

电话：0755-8378 8578

传真：0755-8378 5241

邮编：518031

网址：<http://futures.pingan.com>