

# 国都好望角策略展示

---国都研发中心·金融小组

## 投资理念:

本策略投资风格偏重宏观对冲策略。

宏观经济分析的落脚点可以归结为 GDP、汇率、利率、就业和整体价格水平。这几个变量的动态逻辑关系勾勒出商业周期的阶段和下一步演化的不同结果及其概率。因此可以形成股指期货和国债期货的投资框架。

即基于对宏观经济的判断，可以进一步延伸到主要产业所处的行业周期，进而寻找与之相关度最高的大宗商品。

通过资金在金融期货、工业品、农产品之间的合理配置，降低组合的波动和整体风险。

## 净值走势:



## 当前持仓:

| 合约      | 方向 | 开仓均价  | 持仓量 |
|---------|----|-------|-----|
| rb1410  | 空  | 3253  | 40  |
| me1409  | 空  | 2658  | 12  |
| p1409   | 多  | 6126  | 60  |
| I1409   | 空  | 811   | 10  |
| m1501   | 多  | 3328  | 40  |
| j1409   | 空  | 1204  | 16  |
| pta1409 | 空  | 6354  | 50  |
| ru1409  | 空  | 14118 | 15  |
| sr1501  | 多  | 5208  | 40  |