

畅销系列 投资首选



理财学院

炒期货

实战入门 | 超值 | 视频版

李晓波 周峰 编著

造就100000册

专家团队精心编写



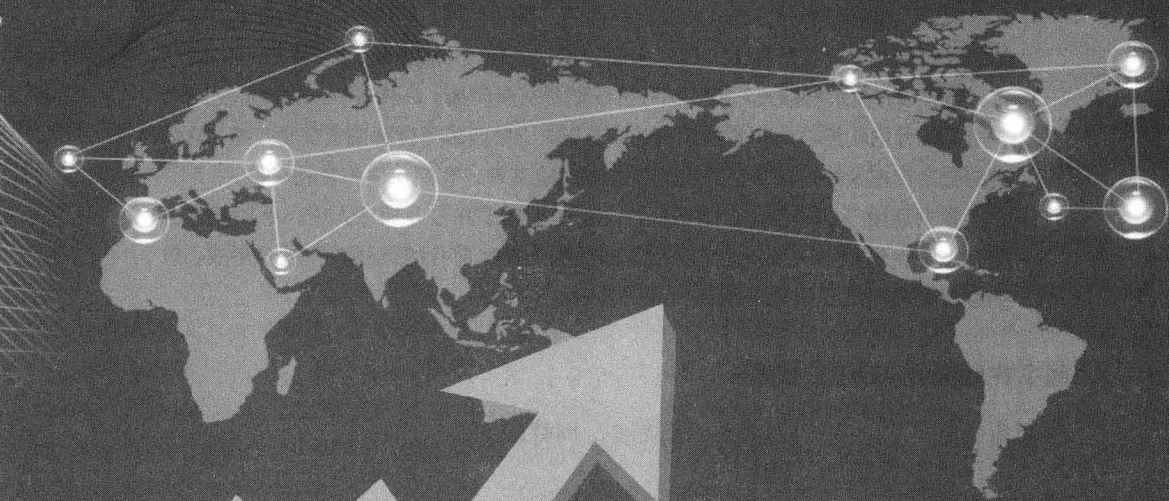
超值赠送——

88分钟炒期货教学视频
238分钟股指期货和黄金交易教学视频
渤海商品交易所博易大师软件

——投资讨论与学习支持——

投资讨论QQ群: 169029408
呱呱视频课堂呱呱号: 429314
学习网站: <http://www.sd-autd.com>

中国铁道出版社
CHINA RAILWAY PUBLISHING HOUSE



理财学院

炒期货

实战入门 | 超值 | 视频版

李晓波 周峰 编著



中国铁道出版社
CHINA RAILWAY PUBLISHING HOUSE

内 容 简 介

本书分四部分，第一部分讲解期货交易成功的基础，即期货基础知识、期货交易流程、期货行情分析软件和交易软件的下载与使用、期民交易成功理念。第二部分讲解期货交易分析技术，即基本面分析、各种技术面分析，如 K 线、K 线形态、趋势线、技术指标等。第三部分讲解期货交易实战，具体讲解三大商品交易所各交易品种的实战技巧和股指期货的实战技巧。第四部分讲解期货交易策略，具体讲解交易管理策略、期货交易实战策略和风险管理、套期保值和套利交易。

本书适用于新老期民、中小散户、职业操盘手和专业期评人士，更加适合那些有志于在这个充满风险、充满寂寞的征程上默默前行的征战者和屡败屡战、愈挫愈奋并最终战胜失败、战胜自我的勇者。

图书在版编目（CIP）数据

炒期货实战入门：超值视频版/李晓波，周峰编著
北京：中国铁道出版社，2014.1
（理财学院）
ISBN 978-7-113-17338-8

I. ①炒… II. ①李… ②周… III. ①期货交易—基本知识 IV. ①F830.9

中国版本图书馆 CIP 数据核字（2013）第 215062 号

书 名：理财学院：炒期货实战入门（超值视频版）
作 者：李晓波 周 峰 编著

策 划：武文斌
责任编辑：张 丹
编辑助理：吴伟丽

读者热线电话：010-63560056
封面设计：多宝格
责任印制：赵星辰

出版发行：中国铁道出版社（北京市西城区右安门西街 8 号 邮政编码：100054）
印 刷：三河市华业印装厂
版 次：2014 年 1 月第 1 版 2014 年 1 月第 1 次印刷
开 本：700mm×1000mm 1/16 印张：23 字数：449 千
书 号：ISBN 978-7-113-17338-8
定 价：45.00 元（附赠光盘）

版权所有 侵权必究

凡购买铁道版图书，如有印制质量问题，请与本社读者服务部联系调换。电话：（010）51873174

打击盗版举报电话：（010）51873659



在金钱遍地，充满魔力、机会的期货市场中，由于利益的驱动使投资者对市场的认识陷于一种非理性状态，从而屡犯错误。然而期市没有记忆，因此同类的错误总是不断地沉渣泛起，让人明知故犯，步入深渊。所以期民一定要认清期市的本质，认识到期市只有赢家和输家，弄清期市操作中的通病，理解市场基本的教义，并以此为戒。

为什么要写这本书

现在，市面上关于期货的书不算多，大多是基础类的，真正有关实战类的书很少，并且实战类的书多数讲解不够全面，剖析不够深入，并且没有讲解中小资金每年翻番的操作技巧，以及期市中真正的“收益越大，风险越小”的实战操作模式。

另外，本书作者在投资生涯的前期，也曾走过很长时间的弯路，也曾几度陷入经济危机和心理危机，也曾怀疑市场上有无走出绝境、走向成功的方法。作者经过长时间的总结，得出结论：事实证明成功并不遥远，财富就在身边，以上就是本书写作的目的。

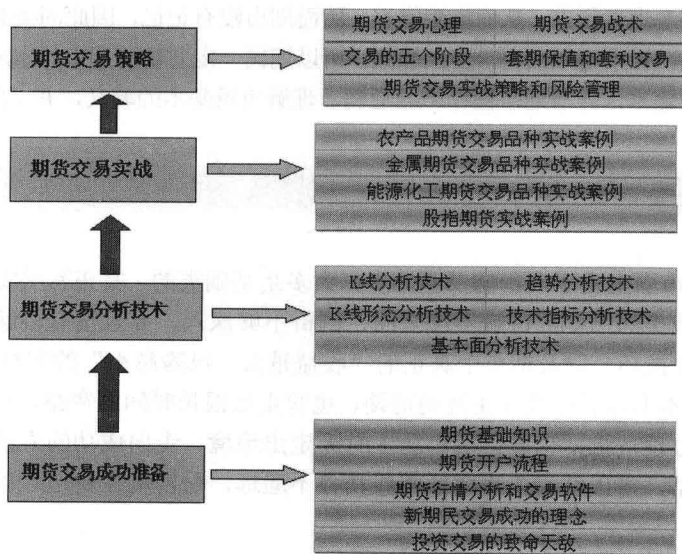
本书结构

本书共 14 章，具体章节安排如下：

- 第 1~3 章：讲解新期民入市要准备的各项知识，主要有期货基础知识、商品期货、金融期货、期货开户流程、期货行情分析软件、期货交易软件、新期民交易成功的理念等。
- 第 4~7 章：讲解期市分析方法，即基本面分析技术、K 线分析技术、趋势分析技术、技术指标分析技术。
- 第 8~10 章：讲解农产品、金属、能源化工期货交易品种实战案例。
- 第 11 章：讲解股指期货基础知识及实战案例。
- 第 12~13 章：讲解新期民交易的五个阶段、期货交易心理、期货交易战术、超短线交易实战策略、中短线交易实战策略、期货交易风险案例分析等。
- 第 14 章：讲解套期保值和套利交易。

学习体系

全书共分4部分，分别讲解期货交易成功准备（第1~3章）、期货交易分析技术（第4~7章）、期货交易实战（第8~11章）、期货交易策略篇（第12~14章），具体如下图所示。



本书特色

本书的特色归纳如下：

1. 实用性：本书首先着眼于炒期实战应用，然后再探讨深层次的技巧问题。
2. 详尽的例子：本书都附有大量的例子，每个例子都是作者精心选择的，通过这些例子介绍知识点。只要反复练习，能够举一反三，就可以真正掌握操盘技巧，从而学以致用。
3. 全面性：本书包含了期货的所有知识，包括期货基础知识、期货交易的流程、期货行情分析软件的下载与使用、期货交易软件的下载与使用、基本面分析技术、K线分析技术、趋势分析技术、技术指标分析技术、农产品期货交易品种实战案例、金属期货交易品种实战案例、能源化工期货交易品种实战案例、股指期货实战案例、交易管理策略、期货交易实战策略和风险管理、套期保值和套利交易。

► 本书适合的读者

本书适用于新老期民、中小散户、职业操盘手和专业期评人士，更加适合那些有志于在这个充满风险、充满寂寞的征程上默默前行的征战者和屡败屡战、愈挫愈奋并最终战胜失败、战胜自我的勇者。

► 创作团队

本书由李晓波、周峰编写，下面人员对本书的编写提出过宝贵意见并参与了部分编写工作，他们是陆佳、张振东、王真、王征、周贤超、杨延勇、解翠、王荣芳、李岩、周科峰、陈勇、孟庆国、赵秀园、吕雷、孙更新、于超、栾洪东、尹吉泰、纪欣欣、王萍萍、高云、李永杰、盛艳秀。

由于时间仓促，加之编者知识有限，书中的缺点和不足之处在所难免，敬请读者批评指正。

编者
2013年9月



目录

第 1 章 新期民快速入门

1.1 初识期货.....	2
1.1.1 期货交易的由来	2
1.1.2 什么是期货交易	4
1.1.3 什么是期货合约	4
1.1.4 期货交易与现货交易的区别	5
1.1.5 期货交易与远期交易的区别	6
1.1.6 期货交易的基本特征	7
1.1.7 期货的类型.....	8
1.2 商品期货.....	9
1.2.1 什么是商品期货	9
1.2.2 商品期货市场的功能	10
1.2.3 我国商品期货市场的发展	10
1.3 金融期货.....	11
1.3.1 什么是金融期货	11
1.3.2 金融期货的特点	12
1.3.3 金融期货与商品期货的区别	13
1.3.4 金融期货中的主要投资品种——股指期货	14
1.4 期货市场结构.....	15
1.4.1 投资者.....	16
1.4.2 期货交易所.....	17
1.4.3 期货公司.....	20
1.4.4 期货监管机构	20
1.4.5 期货行业自律机构	22



第2章 初入期市

2.1 你必须了解的期货交易流程	25
2.2 期货开户流程	25
2.2.1 商品期货开户	25
2.2.2 股指期货开户	26
2.3 期货行情分析软件	26
2.3.1 文华行情软件的下载与安装	27
2.3.2 文华行情软件的基本使用	29
2.4 期货交易软件	32
2.4.1 期货交易软件的下载和安装	32
2.4.2 期货交易软件的登录和银期转账	34
2.4.3 期货合约的买卖操作技巧	37
2.5 期货合约交易注意事项	41

第3章 新期民交易成功的理念

3.1 成功期民应具备的条件	44
3.1.1 管理好自己的情绪	44
3.1.2 良好的交易心态	45
3.1.3 对交易及学习的疯狂热忱与专注	46
3.1.4 高胜算的赢利模式	47
3.1.5 耐心是投资成功的法宝	48
3.1.6 遵守并执行纪律	48
3.2 成功期民的思维习惯	49
3.2.1 绝不幻想	49
3.2.2 绝不满仓	50
3.2.3 甘于孤独	50
3.3 正确投资的行为习惯	50
3.4 投资交易的致命天敌	51
3.4.1 过量交易	52
3.4.2 过度交易	52
3.4.3 冲动性交易	53
3.4.4 保守性交易和自负性交易	53
3.4.5 报复性交易和激进性交易	54



3.4.6 怯懦性交易和侥幸性交易	54
3.4.7 预测性交易	55

> 第4章 期市分析技术概述

4.1 初识期市分析技术	57
4.1.1 基本面分析概述	57
4.1.2 技术分析概述	57
4.2 基本面分析	57
4.2.1 期货商品供给分析	58
4.2.2 期货商品需求分析	59
4.2.3 经济波动周期	60
4.2.4 金融货币因素	62
4.2.5 政治、政策因素	63
4.3 技术分析	63
4.3.1 技术分析的理论基础	63
4.3.2 技术分析的优缺点	65
4.3.3 技术分析与出入市时机的选择	66
4.3.4 技术分析的反面意见	67
4.3.5 技术分析应用注意事项	69

> 第5章 K线分析技术

5.1 初识K线	71
5.1.1 K线的组成	71
5.1.2 K线应用注意事项	72
5.2 单根K线	73
5.2.1 强势K线	73
5.2.2 较强势K线	74
5.2.3 弱强势K线	74
5.2.4 无势K线	74
5.2.5 单根K线应用技巧	75
5.3 K线反转形态	77
5.3.1 反转形态及其基本要领	77
5.3.2 头肩形反转形态	79





5.3.3	其他头肩形反转形态	81
5.3.4	三重顶和三重底	83
5.3.5	双重顶和双重底	84
5.3.6	圆顶和圆底	87
5.3.7	V 形反转形态	88
5.4	K 线持续形态	90
5.4.1	三角形持续形态	90
5.4.2	旗形持续形态	94
5.4.3	矩形持续形态	94

➤ 第 6 章 趋势分析技术

6.1	趋势概述	97
6.1.1	什么是趋势	97
6.1.2	趋势的方向	97
6.1.3	趋势的类型	98
6.2	支撑和压力	99
6.2.1	利用支撑和压力进一步认识趋势	100
6.2.2	支撑和压力角色的互换	100
6.2.3	支撑和压力的心理原因	101
6.2.4	其他的支撑和压力	101
6.3	趋势线	102
6.3.1	绘制趋势线	102
6.3.2	趋势线的应用技巧	105
6.3.3	趋势线应用注意事项	106
6.4	扇形线	107
6.5	通道线	108
6.6	黄金分割的应用	111

➤ 第 7 章 技术指标分析技术

7.1	技术指标概述	114
7.1.1	什么是技术指标	114
7.1.2	技术指标的分类	114
7.1.3	技术指标的应用法则	115



7.1.4	技术指标的本质	115
7.1.5	技术指标法同其他技术分析方法的关系	116
7.2	移动平均线	116
7.2.1	移动平均线的定义与设置	116
7.2.2	移动平均线的特性	118
7.2.3	移动平均线的背离	118
7.2.4	单根移动平均线的应用	119
7.2.5	多根移动平均线的应用	123
7.3	随机指标 KDJ	124
7.3.1	KDJ 指标概述	124
7.3.2	KDJ 应用注意事项	125
7.3.3	KDJ 应用要则	126
7.3.4	KDJ 实战应用经验	127
7.4	MACD 指标	128
7.4.1	MACD 指标概述	128
7.4.2	MACD 实战技巧	128
7.4.3	MACD 与 KDJ 的综合应用	131
7.5	技术指标应用注意事项	132

➤ 第 8 章 农产品期货交易品种实战案例

8.1	棉花期货合约实战案例	134
8.1.1	棉花品种概况	134
8.1.2	棉花供给与需求	135
8.1.3	棉花标准合约	136
8.1.4	影响棉花价格变动的因素	137
8.1.5	查看棉花行情及评论信息	138
8.1.6	棉花实战交易案例	140
8.2	白糖期货合约实战案例	142
8.2.1	白糖品种概况	142
8.2.2	白糖供给与需求	142
8.2.3	白糖标准合约	143
8.2.4	影响白糖价格变动的因素	145
8.2.5	查看白糖行情及评论信息	147
8.2.6	白糖实战交易案例	148
8.3	玉米期货合约实战案例	150





8.3.1	玉米品种概况	151
8.3.2	玉米供给与需求	151
8.3.3	玉米标准合约	153
8.3.4	影响玉米价格变动的因素及信息查询	154
8.3.5	玉米实战交易案例	156
8.4	大豆期货合约实战案例	158
8.4.1	大豆品种概况	158
8.4.2	大豆供给与需求	159
8.4.3	大豆标准合约	160
8.4.4	影响大豆价格变动的因素及信息查询	162
8.4.5	大豆实战交易案例	163
8.5	豆粕期货合约实战案例	164
8.5.1	豆粕品种概况	165
8.5.2	豆粕供给与需求	165
8.5.3	豆粕标准合约	167
8.5.4	影响豆粕价格变动的因素	168
8.5.5	豆粕实战交易案例	170
8.6	豆油期货合约实战案例	171
8.6.1	豆油品种概况	171
8.6.2	豆油供给与需求	172
8.6.3	豆油标准合约	172
8.6.4	影响豆油价格变动的因素	174
8.6.5	豆油实战交易案例	175
8.7	小麦期货合约实战案例	177
8.7.1	小麦品种概况	177
8.7.2	小麦供给与需求	178
8.7.3	小麦标准合约	179
8.7.4	影响小麦价格变动的因素及信息查询	181
8.7.5	小麦实战交易案例	183
8.8	早籼稻期货合约实战案例	185
8.8.1	早籼稻品种概况	185
8.8.2	早籼稻供给与需求	186
8.8.3	早籼稻标准合约	187
8.8.4	影响籼稻价格变动的因素	188
8.8.5	早籼稻实战交易案例	191
8.9	郑油期货合约实战案例	192



8.9.1 郑油品种概况	192
8.9.2 郑油供给与需求	192
8.9.3 郑油标准合约	193
8.9.4 影响郑油价格变动的因素及信息查询	195
8.9.5 菜籽油实战交易案例	198
8.10 棕榈油期货合约实战案例	199
8.10.1 棕榈油品种概况	199
8.10.2 棕榈油供给与需求	199
8.10.3 棕榈油标准合约	201
8.10.4 影响棕榈油价格变动的因素及信息查询	202
8.10.5 棕榈油实战交易案例	203

> 第9章 金属期货交易品种实战案例

9.1 铜期货合约实战案例	206
9.1.1 铜品种概况	206
9.1.2 铜供给与需求	206
9.1.3 铜标准合约	207
9.1.4 影响铜价格变动的因素	208
9.1.5 查看铜行情及评论信息	210
9.1.6 铜实战交易案例	211
9.2 铝期货合约实战案例	213
9.2.1 铝品种概况	213
9.2.2 铝供给与需求	214
9.2.3 铝标准合约	214
9.2.4 影响铝价格变动的因素	216
9.2.5 铝实战交易案例	218
9.3 锌期货合约实战案例	219
9.3.1 锌品种概况	219
9.3.2 锌供给与需求	220
9.3.3 锌标准合约	221
9.3.4 影响锌价格变动的因素	223
9.3.5 锌实战交易案例	224
9.4 铅期货合约应用实战	226
9.4.1 初识铅	226
9.4.2 铅的用途	227





9.4.3	铅标准合约	227
9.4.4	查看铅期货行情	227
9.4.5	影响铅价格变动的因素	228
9.4.6	铅期货实战交易实例	229
9.5	钢材期货合约实战案例	231
9.5.1	钢材品种概况	231
9.5.2	钢材供给与需求	232
9.5.3	钢材标准合约	233
9.5.4	影响钢材价格变动的因素	235
9.5.5	钢材实战交易案例	236
9.6	黄金期货合约实战案例	237
9.6.1	黄金品种概况	238
9.6.2	黄金供给与需求	239
9.6.3	黄金标准合约	240
9.6.4	影响黄金价格变动的因素	242
9.6.5	黄金实战交易案例	244
9.7	白银期货合约应用实战	246
9.7.1	初识白银	246
9.7.2	白银的用途	246
9.7.3	白银的供求关系	247
9.7.4	白银标准合约	248
9.7.5	查看白银期货行情和相关新闻信息	249
9.7.6	影响白银价格变动的因素	250
9.7.7	白银期货实战交易实例	253

第 10 章 能源化工期货交易品种实战案例

10.1	燃料油期货合约实战案例	257
10.1.1	燃料油品种概况	257
10.1.2	燃料油供给与需求	257
10.1.3	燃料油标准合约	258
10.1.4	影响燃料油价格变动的因素	260
10.1.5	查看燃料油行情及评论信息	262
10.1.6	燃料油实战交易案例	262
10.2	橡胶期货合约实战案例	265
10.2.1	橡胶品种概况	265



10.2.2	橡胶供给与需求	266
10.2.3	橡胶标准合约	267
10.2.4	影响橡胶价格变动的因素	268
10.2.5	查看橡胶行情及评论信息	270
10.2.6	橡胶实战交易案例	271
10.3	PTA 期货合约实战案例	273
10.3.1	PTA 品种概况	273
10.3.2	PTA 供给与需求	274
10.3.3	PTA 标准合约	275
10.3.4	影响 PTA 价格变动的因素	277
10.3.5	PTA 实战交易案例	279
10.4	PVC 期货合约实战案例	280
10.4.1	PVC 品种概况	280
10.4.2	PVC 供给与需求	280
10.4.3	PVC 标准合约	281
10.4.4	影响 PVC 价格变动的因素	283
10.4.5	PVC 实战交易案例	284
10.5	塑料期货合约实战案例	285
10.5.1	塑料品种概况	285
10.5.2	塑料供给与需求	286
10.5.3	塑料标准合约	287
10.5.4	影响塑料价格变动的因素	288
10.5.5	塑料实战交易案例	291
10.6	焦炭期货合约实战案例	292
10.6.1	焦炭品种概况	292
10.6.2	焦炭供给与需求	292
10.6.3	焦炭标准合约	293
10.6.4	影响焦炭价格变动的因素	295
10.6.5	焦炭实战交易案例	296

➤ 第 11 章 股指期货实战案例

11.1	股指期货合约	299
11.1.1	交易时间与交易方式	299
11.1.2	交割方式和最后结算价格	299
11.1.3	合约规模与保证金水平	299





11.1.4	每日价格波动限幅和熔断机制.....	300
11.1.5	最小波动价位与手续费.....	300
11.1.6	沪深 300 股指期货推出对股市的影响	300
11.1.7	沪深 300 股指期货推出对基金的影响	301
11.2	影响股指期货的因素.....	301
11.3	股指期货操作三大要务.....	302
11.3.1	关注权重股的走势.....	302
11.3.2	做足收市功课.....	302
11.3.3	遵守纪律、控制风险.....	303
11.4	股指期货交易中投资者应当注意的事项.....	303
11.5	股指期货合约实战案例.....	303

第 12 章 交易管理策略

12.1	新期民交易的五个阶段	307
12.1.1	无知阶段.....	307
12.1.2	盲目求胜阶段	307
12.1.3	潜心研究阶段	308
12.1.4	稳定赢利阶段	308
12.1.5	无为而为阶段	309
12.2	计划你的交易，交易你的计划	309
12.2.1	机会品种的胜算分析	309
12.2.2	进场计划.....	310
12.2.3	随机应对策略	310
12.2.4	出局的策略.....	311
12.2.5	纪律执行保障	311
12.3	江恩的 24 条守则.....	311
12.4	期货交易心理.....	313
12.4.1	市场人气决定涨跌	313
12.4.2	学会不按牌理出牌	314
12.4.3	不正常表现是好机会	314
12.4.4	大多数人犯错误	315
12.4.5	与大众心理反其道而行	315
12.4.6	物极必反、否极泰来	316
12.4.7	不要天天在市场打滚	317
12.4.8	为什么常炒必输	317



12.5 期货交易战术.....	318
12.5.1 金字塔式加码	318
12.5.2 累进战术的应用	319
12.5.3 平均价战术不可乱用	319
12.5.4 反转战术的运用	320
12.5.5 做反转要慎重	320
12.5.6 把握输少赢多的机会	321
12.5.7 清淡的月份不要做	322
12.5.8 君子不立危墙之下	322
12.5.9 合约要及时换月	323
12.5.10 要把握抛空机会	324
12.5.11 不要主观设想顶和底.....	324
12.5.12 规避赚钱变亏钱	325
12.5.13 不要点太多火头	325
12.6 善于利用信息.....	326
12.6.1 要有灵敏的嗅觉	326
12.6.2 应做就去做.....	326
12.6.3 慎重考虑新闻反应	327
12.6.4 善用消息作决策	328

➤ 第 13 章 期货交易实战策略和风险管理

13.1 超短线交易实战策略	330
13.1.1 炒单型的日内超短线交易	330
13.1.2 即时盘中突破做盘	330
13.1.3 超短线交易的纪律要求	332
13.2 中短线交易实战策略	333
13.2.1 中短线介入时机	333
13.2.2 中短线资金管理	334
13.3 期货交易风险案例分析	335
13.3.1 关于投资者适当性标准风险	336
13.3.2 关于对代理人的风险防范	336
13.3.3 关于密码泄露风险	336
13.3.4 关于强行平仓风险	337
13.3.5 关于如何甄选期货公司	337
13.3.6 投资者有义务了解账户情况	338

