

新纪元期货程序化交易日报 20121105

模型品种:

十面埋伏 (商品组合)

追风系列 1.1 (股指)

短线系列 TBK 1.2

宏利系列

商品组合1号

说明:

追风系列设计理念是:顺势而为,抓取波段收益;识别规避震荡行情,减少交易次数,减少盈利回撤幅度。可用于股指期货 15分钟 K 线短线交易。

新纪元期货研究所

张雷

从业资格: F0264563

联系电话: 0516-83831179

电子邮件:

zikevintop@126.com

地址: 江苏徐州市淮海东路
153号新纪元期货大厦

欢迎投资者交流策略, 提出策略定制化要求

模型名称: 追风壹号(股指)
模型分类: 短线、趋势型
目前版本: 1.1

产品说明:

本产品是追风系列策略模型之一, 可用于股指期货15分钟K线短线交易。

模型的设计理念是: 顺势而为, 抓取波段收益; 识别规避震荡行情, 减少交易次数, 减少盈利回撤幅度。本模型目前已在投资家、文华MyTrader2009、WH3及TB、金字塔多个平台上实现。

历史测试效果 (MyTrader2009):

初始资金: 100万仓位: 固定开仓1手

测试时间: 2010年6月7日-2012年4月16日 手续费标准: 万分之一 滑点: 1点(300元)

期末权益: 148.6万(年化126%) 交易次数: 607

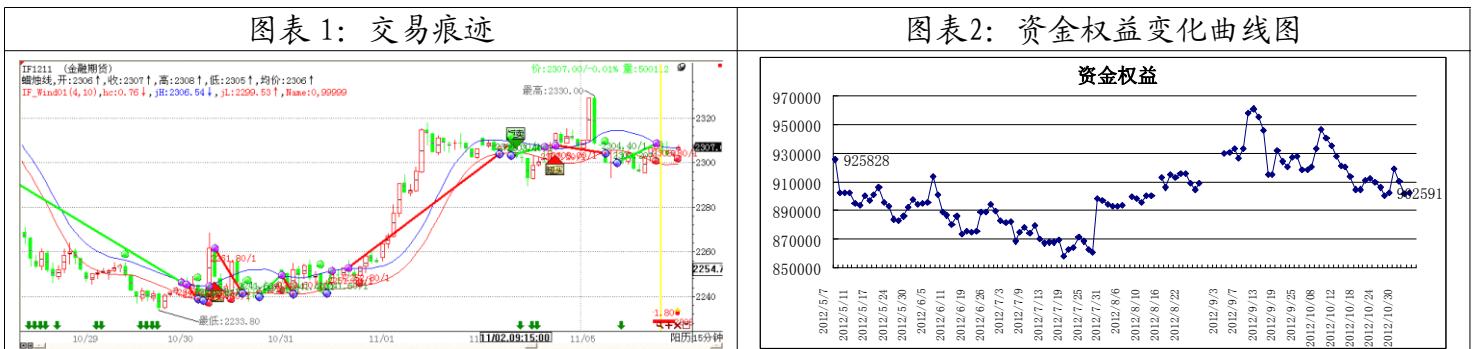
胜率: 32.29% 每手平均盈亏: 800

盈亏比: 2.93 最大连续亏损: -70471

模型运行收益率曲线

模型展示从2012年5月7日开始, 展示期初始权益925858;

截至2012年11月5日, 资金权益911927元, 相对期初收益率-1.5%。



图表3: 交易情况

| 商品 | 价格 | 数量 | 买/卖 | 开/平 | 状态 | 委托时间 | 已成 |
|--------|--------|----|-----|-----|------|----------------|----|
| IF1211 | 2308.8 | 1 | 买 | 开 | 完全成交 | 14:14:59 11/05 | 1 |
| IF1211 | 2308.6 | 1 | 买 | 平 | 完全成交 | 14:04:20 11/05 | 1 |
| IF1211 | 2300.2 | 1 | 卖 | 开 | 完全成交 | 10:45:04 11/05 | 1 |
| IF1211 | 2304.4 | 1 | 卖 | 平 | 完全成交 | 10:21:00 11/05 | 1 |

图表4: 持仓情况

| 商品 | 数量 | 均价 | 可平 | 买/卖 | 盈亏 | 保证金 |
|--------|----|--------|----|-----|------|--------|
| IF1211 | 1 | 2308.8 | 1 | 买 | -540 | 110823 |

免责声明

本报告的信息来源于已公开的资料，我们力求但不保证这些信息的准确性、完整性或可靠性。报告内容仅供参考，报告中的信息或所表达观点不构成期货交易依据，新纪元期货有限公司不对因使用本报告的内容而引致的损失承担任何责任。投资者不应将本报告为作出投资决策的惟一参考因素，亦不应认为本报告可以取代自己的判断。在决定投资前，如有需要，投资者务必向咨询期货研究员并谨慎决策。

本报告旨在发送给新纪元期货有限公司的特定客户及其他专业人士。报告版权仅为新纪元期货有限公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用发布，需注明出处为新纪元期货有限公司，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

新纪元期货有限公司对于本免责声明条款具有修改权和最终解释权。

联系我们

新纪元期货总部

地址：江苏省徐州市淮海东路153号新纪元期货大厦

电话：0516-83831105 83831109

北京营业部

地址：北京市东城区东四十条 68 号平安发展大厦 407 室

电话：010-84261653

南京营业部

地址：南京市北门桥路 10 号 04 栋 3 楼

电话：025-84787997 84787998 84787999

广州营业部

地址：广州市越秀区东风东路 703 号粤剧院文化大楼 11 层

电话：020-87750882 87750827 87750826

苏州营业部

地址：苏州园区苏华路 2 号国际大厦六层

电话：0512-69560998 69560988

常州营业部

地址：江苏省常州市武进区延政中路 2 号世贸中心 B 栋 2008

电话：0519-88059972 0519-88059978

杭州营业部

地址：浙江省杭州市上城区江城路 889 号香榭商务大厦 7-E、F

电话：0571-56282606 0571-56282608

上海营业部

地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号 1905 室

电话：021-61017393

重庆营业部

地址：重庆市江北区西环路 8 号 B 幢 8-2、8-3、8-3A 号房

电话：023-67900698 023-67109158

全国统一客服电话：0516-83831105 83831109 欢迎访问我们的网站：<http://www.neweraqh.com.cn>