

新纪元期指北斗系列程序化交易日报 2014年05月22日

模型品种：北斗系列程序化策略组合

“天璇” V3.0股指3分钟周期隔夜

“天权” V3.0股指5分钟周期日内

说明：

“北斗”程序化交易系列模型，取义于市场趋势波动所闪现出来的交易机会，在每日开盘瞬间或者日内趋势呈现时立即给出当日交易点位。适用于国内金融、商品期货交易，使用1分钟，3分钟，5分钟，15分钟，30分钟交易周期，本系统采取平仓反手交易和短时无仓并存的交易方式，适用于具有一定资金规模的中短线交易者。

欢迎投资者交流策略，提出策略定制化要求

新纪元期货研究所

量化投资事业部

联系电话：

0516-83831139

电子邮件：

1303693655@qq.com

地址：江苏徐州市淮海东路

153号新纪元期货大厦

模型名称: 北斗系列 “天璇” “天权” 股指程序化策略
模型分类: 3分钟周期隔夜 5分钟周期隔夜
目前版本: v3.0

历史测试效果 (交易开拓者):

初始资金: 100万 仓位: 固定开仓 两个策略各一手
测试时间: 2010/4/16-2013/10/14 手续费标准: 万分之1 滑点: 0.2点
期末权益: 4437888.8 交易次数: 4063 次
胜率: 48.98% 平均盈利/平均亏损: 5413/3394
盈亏比: 1.59 最大回撤: 3.2%

初始资金 100 万, 起始日期: 2010年4月16日 截止 2013年10月15日, 总盈利: 3735215.8
总权益: 4735215.8元。

模型历史收益率曲线

交易盈亏曲线图



一 今日模型交易情况:

交易信号图:

三分钟策略



五分钟策略



二 今日成交情况:

| | | | | | |
|-------|-----------|--------|------|----|-----------|
| 三分钟策略 | 股指 IF1406 | 09点45分 | 买入平仓 | 1手 | 价位 2127.0 |
| | 股指 IF1406 | 09点57分 | 买入开仓 | 1手 | 价位 2131.0 |
| | 股指 IF1406 | 14点42分 | 卖出平仓 | 1手 | 价位 2118.0 |
| | 股指 IF1406 | 14点54分 | 卖出开仓 | 1手 | 价位 2112.8 |

| | | | | | |
|-------|-----------|--------|------|----|-----------|
| 五分钟策略 | 股指 IF1406 | 09点50分 | 卖出开仓 | 1手 | 价位 2128.6 |
| | 股指 IF1406 | 10点00分 | 买入平仓 | 1手 | 价位 2144.6 |
| | 股指 IF1406 | 10点00分 | 买入开仓 | 1手 | 价位 2144.6 |
| | 股指 IF1406 | 11点00分 | 卖出平仓 | 1手 | 价位 2134.4 |
| | 股指 IF1406 | 11点00分 | 卖出开仓 | 1手 | 价位 2134.4 |
| | 股指 IF1406 | 13点15分 | 买入平仓 | 1手 | 价位 2137.6 |
| | 股指 IF1406 | 13点15分 | 买入开仓 | 1手 | 价位 2137.6 |
| | 股指 IF1406 | 13点35分 | 卖出平仓 | 1手 | 价位 2127.6 |
| | 股指 IF1406 | 13点35分 | 卖出开仓 | 1手 | 价位 2127.6 |
| | 股指 IF1406 | 15点10分 | 买入平仓 | 1手 | 价位 2112.6 |

三 今日盈亏情况:

三分钟策略 平仓盈亏 -6720 持仓盈亏 +120

五分钟策略 平仓盈亏 -5280

今日持仓情况:

三分钟策略 IF1406 空单 1手 价位 2112.8

五分钟策略 日内策略 无持仓

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

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

北京东四十条营业部

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：南京市玄武区珠江路 63-1 号南京交通大厦 9 楼 5-11 房

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：苏州工业园区苏州大道西 2 号 1 幢国际大厦 602-604

电话：0512-69560998 69560988

无锡营业部

地址：无锡市南长区槐古豪庭 15 号 7 楼 (214000)

电话：0510 - 82827006

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：浙江省杭州市绍兴路 168 号和平大厦 1406-1410 室

电话：0571-85817186

上海浦东南路营业部

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：重庆市江北区观音桥朗晴广场B塔8-2、8-3号

电话：023-67917658

南通营业部

地址：南通市环城西路 16 号 6 层 603-2、604 室

电话：0513-55880598

全国统一客服电话：0516-83831111 83835555 欢迎访问我们的网站：<http://www.neweraqh.com.cn>