

新纪元期货程序化交易日报 20120510

模型品种:

长宏系列

说明:

长宏系列目标品种为商品组合, 包含以下品种: 沪铜、沪胶、大豆、豆粕、豆油、塑料、郑糖、郑棉、PTA等品种。1.1版本展示期间各品种开仓固定开仓1手不追加。

长宏系列设计理念是: 以新纪元分水岭为基础跟踪行情波动重心, 过滤本交易理念认为不具备趋势性操作价值的震荡行情, 在价格突破过滤带时建仓, 交易理念本身包含止盈止损规则, 以获取趋势性行情盈利为目标。

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

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



模型名称: 长宏一号、长宏二号 (商品组合)

模型分类: 中短线、趋势型

目前版本: 1.1

产品说明:

“长宏”程序化交易系列模型以新纪元分水岭为基础跟踪行情波动重心, 过滤本交易理念认为不具备趋势性操作价值的震荡行情, 在价格突破过滤带时建仓, 交易理念本身包含止盈止损规则, 以获取趋势性行情盈利为目标; 是推荐运行于1小时、30分钟等周期上的中线趋势性交易模型。

本模型目运行在投资家平台上。

长宏二号历史测试效果 (MyTrader2009):

	盈利率 (%)	胜率 (%)	最大回撤 (%)	测试结果	表中数字为收益率的百分比, 是与使用资金对比计算所得
螺纹钢	127.6	50	13	测试方法	收盘价上穿过滤带做多, 下穿过滤带做空, 以过滤带边界反手参照
橡胶	162.81	37.65	25		
铜	192.47	43.82	22	测试周期	1小时
豆油	170.63	42.47	26		
白糖	97.26	36.67	11	测试时间	2006年3月31日-2012年4月11日 2009年3月27日-2012年4月11日 (螺纹钢)
大豆	93.56	36.41	27		
豆粕	91.2	45	17		
棉花	168.18	42.54	13		
塑料	203.57	49.09	17		
PTA	146.44	42.03	20		
锌	86.74	34.46	22		

模型运行展示

长宏一号:

模型展示从2012年5月9日开始, 展示期初始权益1, 000, 000;

截至2012年5月10日, 盈利60元, 目前无持仓。

图表 1: 交易痕迹										图表 2: 持仓列表																																																											
<table border="1"> <thead> <tr> <th>序</th> <th>商品</th> <th>买/卖</th> <th>开/平</th> <th>价格</th> <th>数量</th> <th>盈利</th> <th>成交价格</th> <th colspan="2"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>4</td> <td>豆油1209</td> <td>卖</td> <td>平</td> <td>9752</td> <td>1</td> <td></td> <td>14:59:09 05/10</td> <td colspan="2"></td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>豆粕1209</td> <td>买</td> <td>平</td> <td>3378</td> <td>1</td> <td></td> <td>14:59:08 05/10</td> <td colspan="2"></td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>豆油1209</td> <td>买</td> <td>开</td> <td>9740</td> <td>1</td> <td>120</td> <td>14:30:04 05/10</td> <td colspan="2"></td> </tr> <tr> <td>1</td> <td>豆粕1209</td> <td>卖</td> <td>开</td> <td>3372</td> <td>1</td> <td>-60</td> <td>10:00:02 05/09</td> <td colspan="2"></td> </tr> </tbody> </table>										序	商品	买/卖	开/平	价格	数量	盈利	成交价格			4	豆油1209	卖	平	9752	1		14:59:09 05/10			3	豆粕1209	买	平	3378	1		14:59:08 05/10			2	豆油1209	买	开	9740	1	120	14:30:04 05/10			1	豆粕1209	卖	开	3372	1	-60	10:00:02 05/09			<p>目前空仓</p>									
序	商品	买/卖	开/平	价格	数量	盈利	成交价格																																																														
4	豆油1209	卖	平	9752	1		14:59:09 05/10																																																														
3	豆粕1209	买	平	3378	1		14:59:08 05/10																																																														
2	豆油1209	买	开	9740	1	120	14:30:04 05/10																																																														
1	豆粕1209	卖	开	3372	1	-60	10:00:02 05/09																																																														

点评: 昨日开出豆粕空单触及止损位出场; 日内完成买入开仓及卖出平仓, 盈利120。

长宏二号:

模型展示从2012年5月9日开始, 展示期初始权益1, 000, 000;

截至2012年5月10日, 浮动盈利230元, 持有沪铜、豆油多单及白糖空单隔夜。

图表 3: 交易痕迹										图表 4: 持仓列表																																																																																																	
<table border="1"> <thead> <tr> <th>序</th> <th>商品</th> <th>买/卖</th> <th>开/平</th> <th>价格</th> <th>数量</th> <th>盈利</th> <th>成交价格</th> <th colspan="2"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>5</td> <td>豆油1301</td> <td>买</td> <td>开</td> <td>9838</td> <td>1</td> <td></td> <td>14:30:17 05/10</td> <td colspan="2"></td> </tr> <tr> <td>4</td> <td>白糖1301</td> <td>卖</td> <td>开</td> <td>6246</td> <td>1</td> <td></td> <td>14:30:01 05/10</td> <td colspan="2"></td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>豆油1301</td> <td>买</td> <td>平</td> <td>9826</td> <td>1</td> <td></td> <td>14:00:03 05/10</td> <td colspan="2"></td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>沪铜1208</td> <td>买</td> <td>开</td> <td>57780</td> <td>1</td> <td></td> <td>14:00:01 05/10</td> <td colspan="2"></td> </tr> <tr> <td>1</td> <td>豆油1301</td> <td>卖</td> <td>开</td> <td>9766</td> <td>1</td> <td>-600</td> <td>10:00:20 05/10</td> <td colspan="2"></td> </tr> </tbody> </table>										序	商品	买/卖	开/平	价格	数量	盈利	成交价格			5	豆油1301	买	开	9838	1		14:30:17 05/10			4	白糖1301	卖	开	6246	1		14:30:01 05/10			3	豆油1301	买	平	9826	1		14:00:03 05/10			2	沪铜1208	买	开	57780	1		14:00:01 05/10			1	豆油1301	卖	开	9766	1	-600	10:00:20 05/10			<table border="1"> <thead> <tr> <th>商品</th> <th>数量</th> <th>均价</th> <th>可平</th> <th>买/卖</th> <th>盈亏</th> <th>保证金</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>沪铜1208</td> <td>1</td> <td>57780</td> <td>1</td> <td>买</td> <td>-50</td> <td>43335</td> </tr> <tr> <td>白糖1301</td> <td>1</td> <td>6246</td> <td>1</td> <td>卖</td> <td>160</td> <td>9369</td> </tr> <tr> <td>豆油1301</td> <td>1</td> <td>9838</td> <td>1</td> <td>买</td> <td>120</td> <td>14757</td> </tr> </tbody> </table>										商品	数量	均价	可平	买/卖	盈亏	保证金	沪铜1208	1	57780	1	买	-50	43335	白糖1301	1	6246	1	卖	160	9369	豆油1301	1	9838	1	买	120	14757
序	商品	买/卖	开/平	价格	数量	盈利	成交价格																																																																																																				
5	豆油1301	买	开	9838	1		14:30:17 05/10																																																																																																				
4	白糖1301	卖	开	6246	1		14:30:01 05/10																																																																																																				
3	豆油1301	买	平	9826	1		14:00:03 05/10																																																																																																				
2	沪铜1208	买	开	57780	1		14:00:01 05/10																																																																																																				
1	豆油1301	卖	开	9766	1	-600	10:00:20 05/10																																																																																																				
商品	数量	均价	可平	买/卖	盈亏	保证金																																																																																																					
沪铜1208	1	57780	1	买	-50	43335																																																																																																					
白糖1301	1	6246	1	卖	160	9369																																																																																																					
豆油1301	1	9838	1	买	120	14757																																																																																																					

点评: 白糖品种下跌加速, 浮盈持有; 沪铜、豆油有超跌反弹迹象, 持有其多单过夜。

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>