

新纪元期货程序化交易日报 20120516

模型品种:

长宏一号

长宏二号

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30分钟、1小时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。

长宏一号历史测试效果 (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	102.2	46	10	测试方法	收盘价上穿过滤带做多, 下穿过滤带做空, 以分水岭为止盈止损线
橡胶	200.72	43.97	10		
铜	251.89	43.8	9	测试周期	1小时
豆油	161.2	43.75	12		
白糖	44.2	36.86	21	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	75.72	41.1	23		
豆粕	73.52	40.85	15		
棉花	157.49	46.89	8		
塑料	148.68	39.88	12		
PTA	134.83	43.22	13		
锌	141.28	37	18		

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	37.85	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	38.67	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	38.41	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

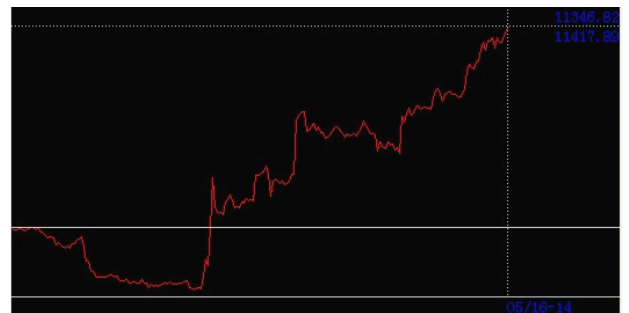
长宏一号:

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16日, 浮盈14225元。

图表1: 交易痕迹

序	商品	买/卖	开/平	价格	数量	盈利	成交时间
9	沪铜1208	卖	开	57420	1		09:30:00 05/14
8	豆粕1301	卖	开	3224	1		14:00:01 05/11
7	塑料1209	卖	开	9915	1		09:30:14 05/11
6	沪铜1208	卖	平	57350	1		09:30:01 05/11
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	-2150	14:00:01 05/10
1	豆油1301	卖	开	9766	1	-600	10:00:20 05/10

图表2: 资金权益变化曲线图



图表3: 持仓情况

商品	数量	均价	可平	买/卖	盈亏	保证金
白糖1301	1	6246	1	卖	2440	9369
豆油1301	1	9838	1	买	-4620	14757
塑料1209	1	9915	1	卖	1325	7436
豆粕1301	1	3224	1	卖	1430	4836
沪铜1208	1	57420	1	卖	13650	43065

点评: 因1.1版本按每个品种固定一手运行, 日内无新建仓位, 前期空单浮盈持有。

长宏二号:

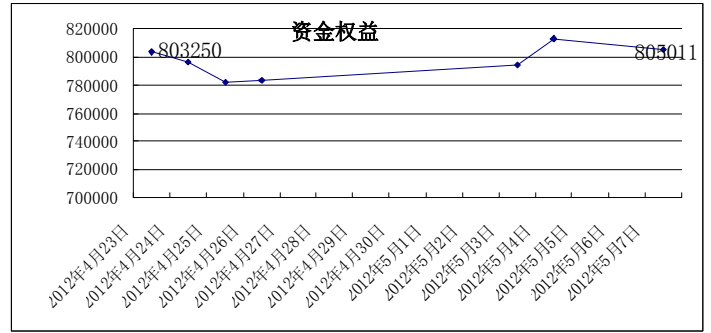
模型展示从2012年5月9日开始, 展示期初始权益1, 000, 000;

截至2012年5月16日, 总权益101004元, 暂无持仓。

图表4: 交易痕迹

序	商品	买/卖	开/平	价格	数量	盈利	成交时间
999	沪铜1208	卖	开	57990	1		14:30:18 05/08
998	沪铜1208	卖	平	57980	1		14:30:10 05/08
997	沪铜1208	买	开	58070	1	-450	14:02:37 05/08
996	沪铜1208	买	平	58080	1		14:00:29 05/08
995	豆粕1209	卖	开	3414	10		13:30:02 05/08
994	豆粕1209	卖	平	3413	10		13:30:01 05/08
993	豆粕1209	买	开	3415	10	-200	10:30:12 05/08
992	豆粕1209	买	平	3415	10		10:30:01 05/08
991	白糖1209	卖	开	6532	1		10:00:11 05/08
990	白糖1209	卖	开	6532	1		10:00:06 05/08
989	白糖1209	卖	平	6532	1		10:00:03 05/08
988	菜油1209	买	开	10604	3		09:30:59 05/08
987	菜油1209	买	平	10604	3		09:30:35 05/08
986	白糖1209	买	开	6553	1	-210	09:30:11 05/08
985	白糖1209	买	平	6553	1		09:30:09 05/08

图表5: 资金权益变化曲线图



图表6: 持仓情况

商品	数量	均价	可平	买/卖	盈亏	保证金
棕榈1209	14	8854	14	卖	38080	185935
沪锌1206	1	15445	1	买	-400	11584
豆一1209	6	4543	6	卖	4260	40887
强麦1209	13	2521	13	卖	6370	49160
豆油1209	3	9876	3	卖	4920	44442
沪锌1208	1	15645	1	卖	900	11734

商品	数量	均价	可平	买/卖	盈亏	保证金
PTA1209	8	6490	8	卖	880	50940
郑棉1209	2	20905	2	卖	1200	31358
菜油1209	3	10604	3	买	-120	23859
白糖1209	2	6532	2	卖	400	19596
豆粕1209	10	3414	10	卖	1300	51210
沪铜1208	1	57990	1	卖	650	43493

点评: 日内大宗商品下跌共振, 昨日开出的沪铜多单止损离场, 塑料、豆粕满足开空条件, 目前持有白糖等四个品种的空单, 其中白糖、塑料浮盈, 豆油、豆粕浮亏。

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>