

新纪元期指“宏利”1号程序化交易日报 20120517

模型品种:

宏利1号

说明:

宏利系列模型以市场运行普遍规律为基本，判断市场运行方向，把握市场主线波动。本系列模型属于中、长线交易模型，容忍隔夜跳空风险。适用品种包括股指、橡胶、PTA 等多个品种。

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

陈小林

从业资格: F0247440

联系电话: 0516-83831179

电子邮件:

chenxiaolin80@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: 宏利1号
模型分类: 短期趋势
目前版本: 1.1

产品说明:

宏利系列模型以市场运行普遍规律为基本, 判断市场运行方向, 把握市场主线波动。本本系列模型属于中、长线交易模型, 容忍隔夜跳空风险。适用品种包括股指、橡胶、PTA 等多个品种。

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: 2011/3/4-2012/5/7 手续费标准: 万分之0.6 滑点: 0点
期末权益: 1240154 交易次数: 184
胜率: 48.04% 平均盈利/平均亏损: 11943/5287
盈亏比: 2.26 最大回撤: 9.58万

模型收益率曲线

初始资金 995868 元, 起始日期: 2012年5月8日 截止 2012年5月17日, 总权益: 1015743 元

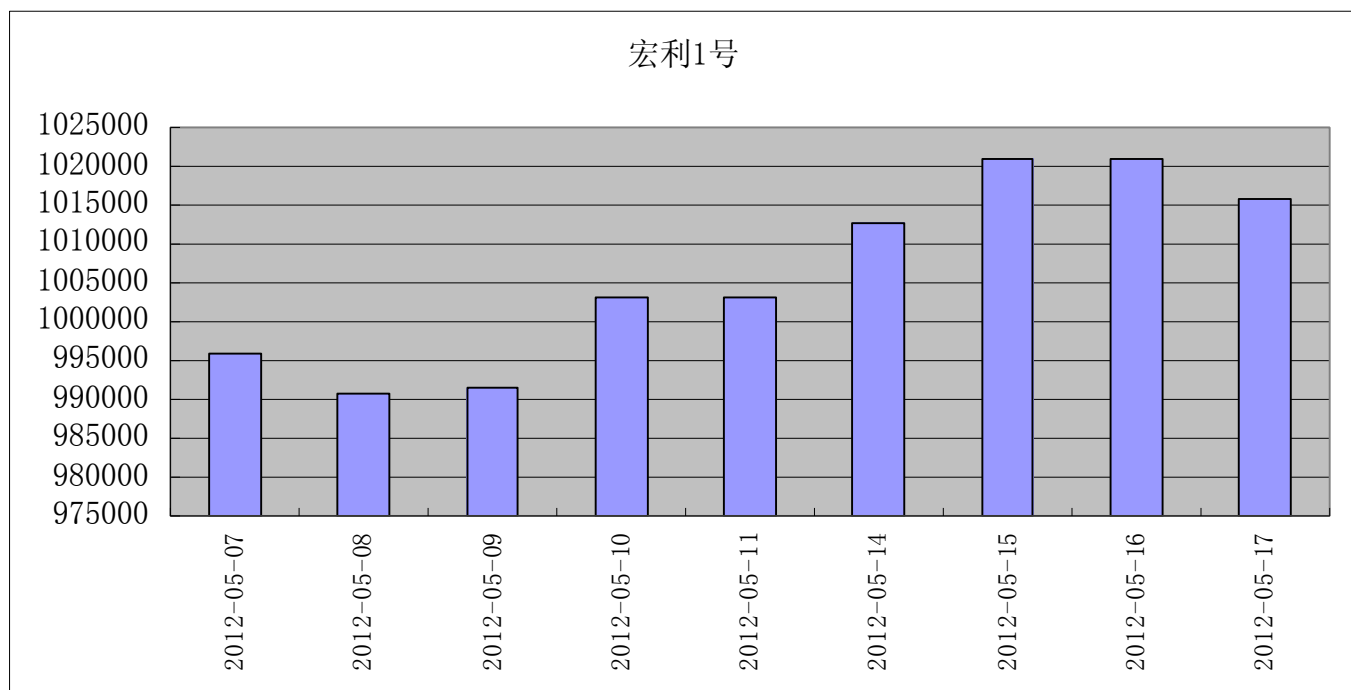
图表 1: 交易痕迹



图表 2: 交易情况

序	商品	买/卖	开/平	价格	数量	盈利	成交时间
32	IF1205	买	开	2598.2	1		13:39:37 05/17
31	IF1205	买	平	2598.2	1		13:39:26 05/17
30	IF1206	买	开	2600	1		13:21:18 05/17
29	IF1206	买	平	2599.8	1		13:21:16 05/17
28	IF1206	卖	开	2578.4	1	-6420	09:15:10 05/17
27	IF1205	卖	开	2704.6	1	31920	09:58:05 05/08

图表3: 资金权益变化曲线图 (平仓后)



图表4: 持仓情况

商品	数量	均价	可平	买/卖	盈亏	保证金
IF1206	1	2600	1	买	2280	117001
IF1205	1	2598.2	1	买	1500	116920

点评: 今天模型在股指1205和1206合约并行 (明日1205合约结束运行), 之前5月8日所开空单1手今日平仓并反手, 平仓盈利31920元, 目前持有多单一手, 浮盈1500元; 1206合约日内先空后多, 空头平仓亏损6420元, 目前持有多头1手, 浮盈2280元; 累计平仓盈亏为21000元, 合计持仓浮盈3780元. 亏损和单笔亏损幅度在正常单日控制幅度之内, 未发生异常。

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>