

东吴期货研究所

宏观与金融工程组

宋彬彬 0512-62938290

期市有风险，投资需谨慎

 研究所办公地址：
 上海市-黄浦区西藏南路
 1208号6楼

 苏州市-工业园区星阳街5
 号东吴证券大厦8楼

快手必读——程序化日报

2015年01月23日(星期五)

品种	历史胜率	盈亏比	交易记录(净盈亏)	前期持仓时间	现有持仓	信号出现时间	开仓价格
PTA 1505	75%	3.84	空单止盈(468)	1.06-1.15	观望		
郑棉 1505	50%	4.6	空单止盈(115)	12.16-12.25	多持	1.20	13125
玻璃 1506	57.14%	2.73	多单止盈(50)	12.29-1.12	空持	1.12	940
股指 1501	60.47%	4.70	多单止损(-2569)	12.06-12.07	观望		
菜籽油 1505	53.8%	2.47	多单止损(-1350)	1.09-1.13	观望		
菜粕 1505	52.63%	2.55	空单止盈(630)	1.14-1.21	观望		
甲醇 1506	80%	9.78	空单止盈(930)	1.12-1.14	观望		
郑糖 1505	55.56%	4.0	多单止盈(150)	1.08-1.14	多持	1.20	4806
国债 1503	69.57%	1.68	多单止盈(1290)	1.20-1.21	观望		
豆一 1505	54.55%	2.03	多单止损(-10)	12.04-12.16	空持	1.05	4491
白银 1506	66.67%	4.07	多单止盈(3080)	1.16-1.22	观望		
沪铝 1503	71.43%	2.44	空单止盈(1915)	1.05-1.15	观望		
黄金 1506	47.62%	3.59	空单止损(-1060)	12.16-12.31	多持	12.31	242.9
胶合板 1502	78.57%	3.68	多单止盈(1115)	11.12-11.20	空持	1.13	125.35
沪铜 1503	55.56%	2.94	多单止损(-3560)	12.10-12.16	空持	12.16	45920
铁矿石 1505	60.0%	5.89	多单止盈(990)	12.29-1.12	空持	1.12	495
焦炭 1505	60%	3.04	空单止赢(-990)	12.10-12.30	空持	1.22	1038
鸡蛋 1505	69.23%	2.86	多单止损(-890)	12.17-12.19	空持	12.31	4414
焦煤 1505	80%	4.83	多单止损(-1870)	10.9-10.17	空持	10.17	781
塑料 1505	70.97%	1.86	空单止损(-135)	1.12-1.14	观望		
豆粕 1505	55.56%	1.64	空单止盈(940)	1.14-1.21	观望		
棕榈油 1505	45.45%	2.8	空单止盈(750)	1.16-1.20	空持	1.23	4896

品种	历史胜率	盈亏比	交易记录 (净盈亏)	前期持仓时间	现有持仓	信号出现时间	开仓价格
沪铅 1502	54.55%	2.62	多单止盈 (3340)	7.25-7.30	空持	7.30	15105
PP 1505	87.5%	4.37	空单止损 (-230)	1.14-1.15	观望		
螺纹钢 1505	60.71%	2.82	多单止损 (-530)	12.30-1.12	空持	1.12	2523
橡胶 1505	61.90%	6.29	空单止盈 (740)	1.13-1.21	观望		
PVC 1505	73.91%	2.5	空单止盈 (140)	1.19-1.23	观望		
豆油 1505	52.94%	3.49	多单止损 (-770)	12.31-1.14	空持	1.20	5600

注意点与说明：

历史胜率：历史胜率通过对品种指数近 2 年（2013——2014）的历史回测，统计开仓后盈利和亏损的比例，得出获胜的概率。

盈亏比：平均盈利/平均亏损，盈亏比越高说明在承担相同亏损下的盈利越高。

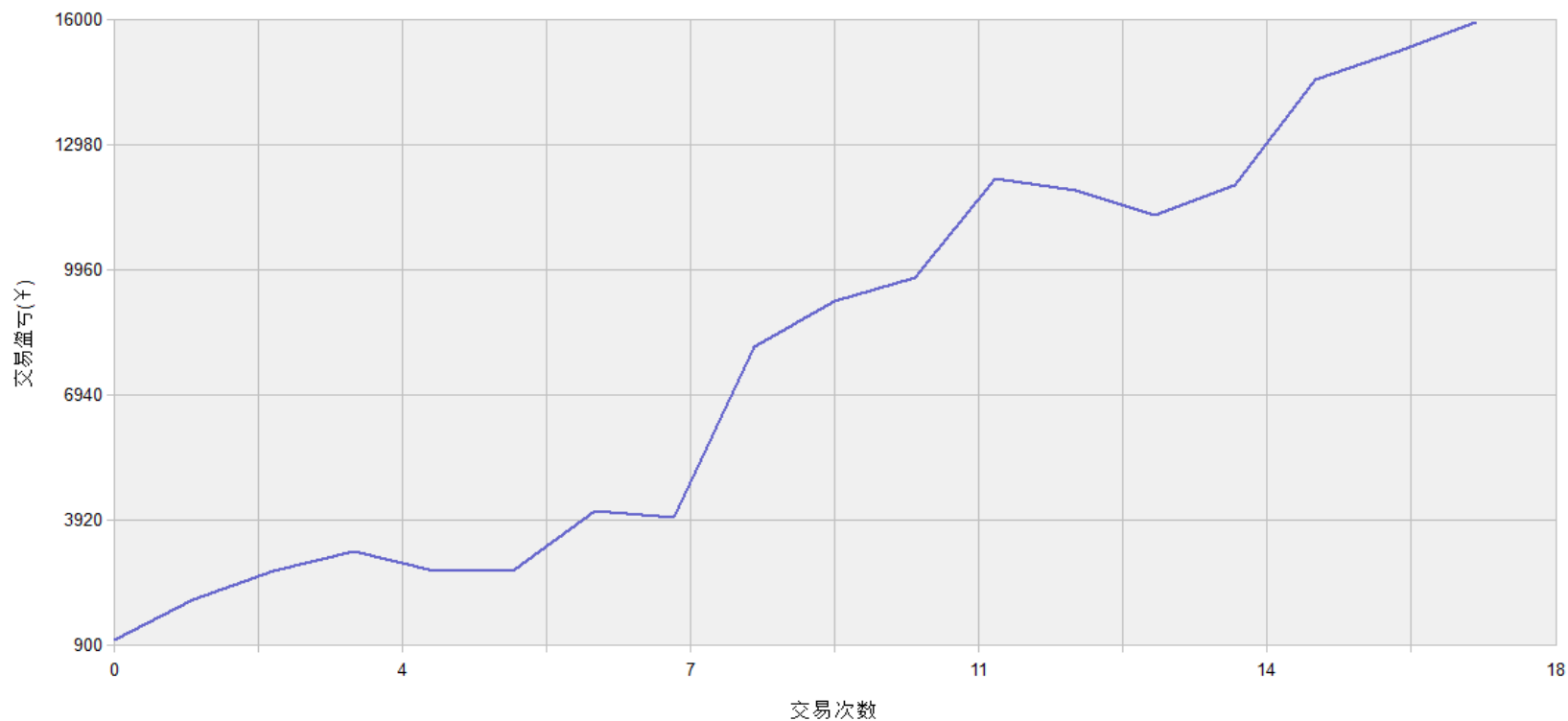
净盈亏：总盈亏 - 手续费。（精确到个位数）

该策略为带均线过滤通道突破系统，盘中观察周期为 15 分钟 K 线，适合趋势行情的把握。建议投资者可以参考提示的持仓方向和开仓时间顺势建仓。日报在收盘后发送，可能会有所滞后，投资者可在上述开仓信号的基础上，在开盘后选择点位入场。本策略采取移动止损、突破止损反手开仓的方式，具体为当价格回落一定比例时止损或者回落止盈、当价格反向突破上轨并且满足一定的过滤条件时止损。建议投资者根据上面的方法结合自己的实际情况设置好止损。红色标记的品种是当天有仓位变化的期货品种。后续我组会开发更多的趋势和反转，形态等指标策略给投资者。

历史回测收益图表：

1、PTA 连续合约历史回测收益图。

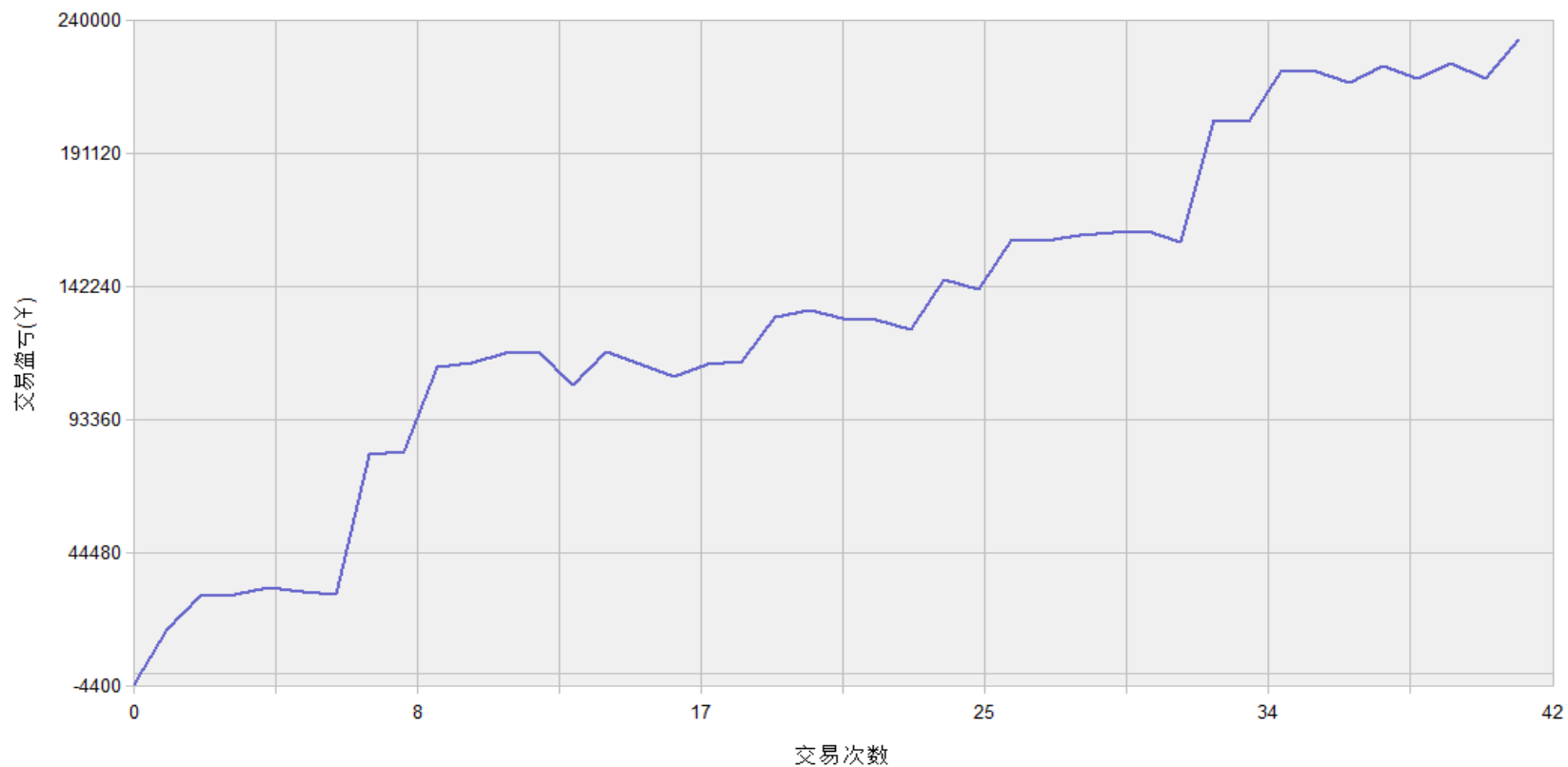
交易盈亏曲线图



图中为 PTA 连续合约 2013.1.1 至今在 1 日 K 线上的历史回测收益曲线，每次交易一手，没有加仓减仓操作。止损位价格回落 2% 止赢(止损)出场。

2、股指期货连续合约历史回测收益图。

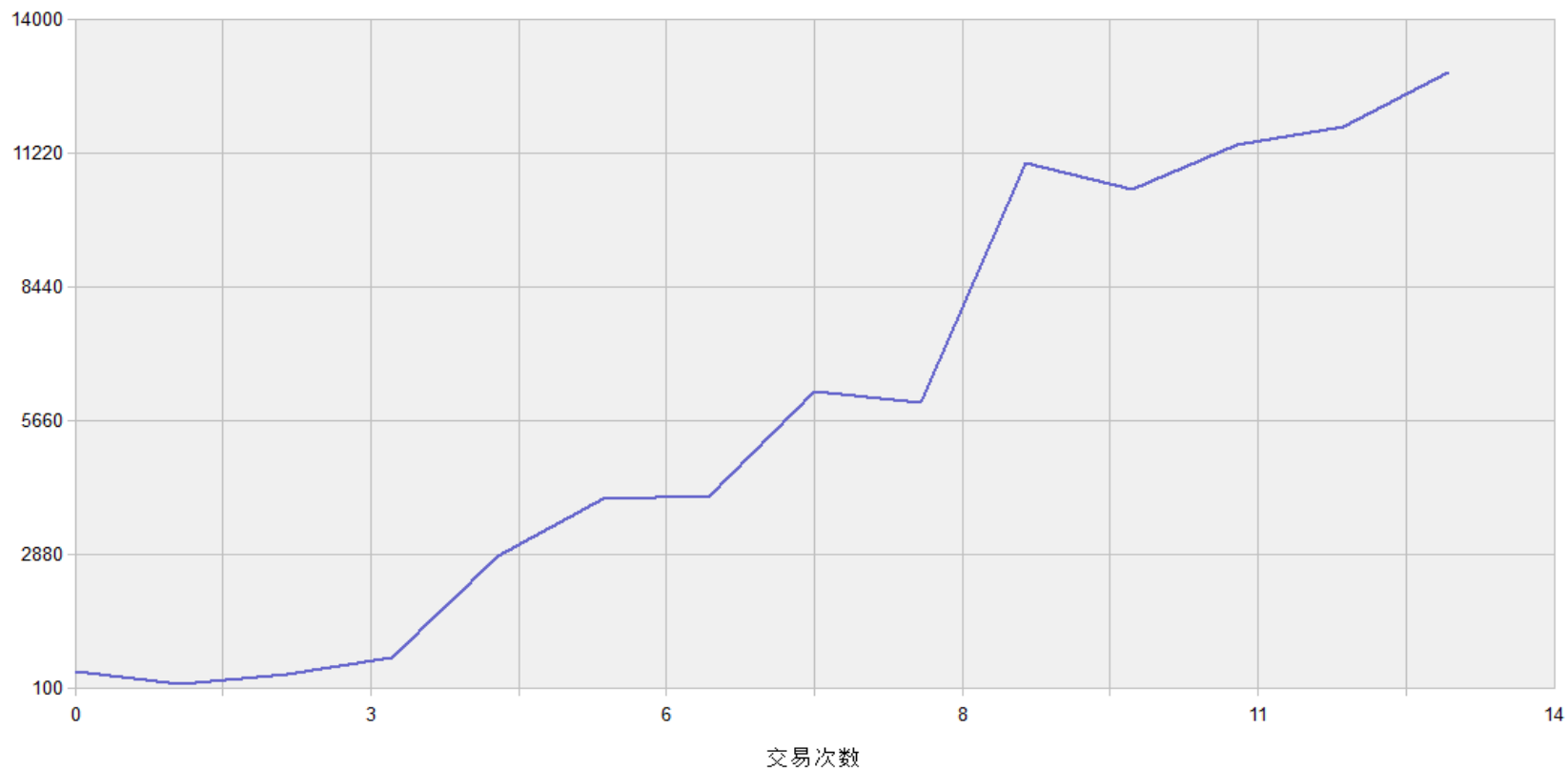
交易盈亏曲线图



图中为股指期货连续合约 2013.1.1 日至今 1 日 K 线的历史回测收益图，同样每次交易 1 手，没有加减仓操作。采用价格回落 1% 止赢（止损）离场。

3、胶合板指数合约历史回测收益图。

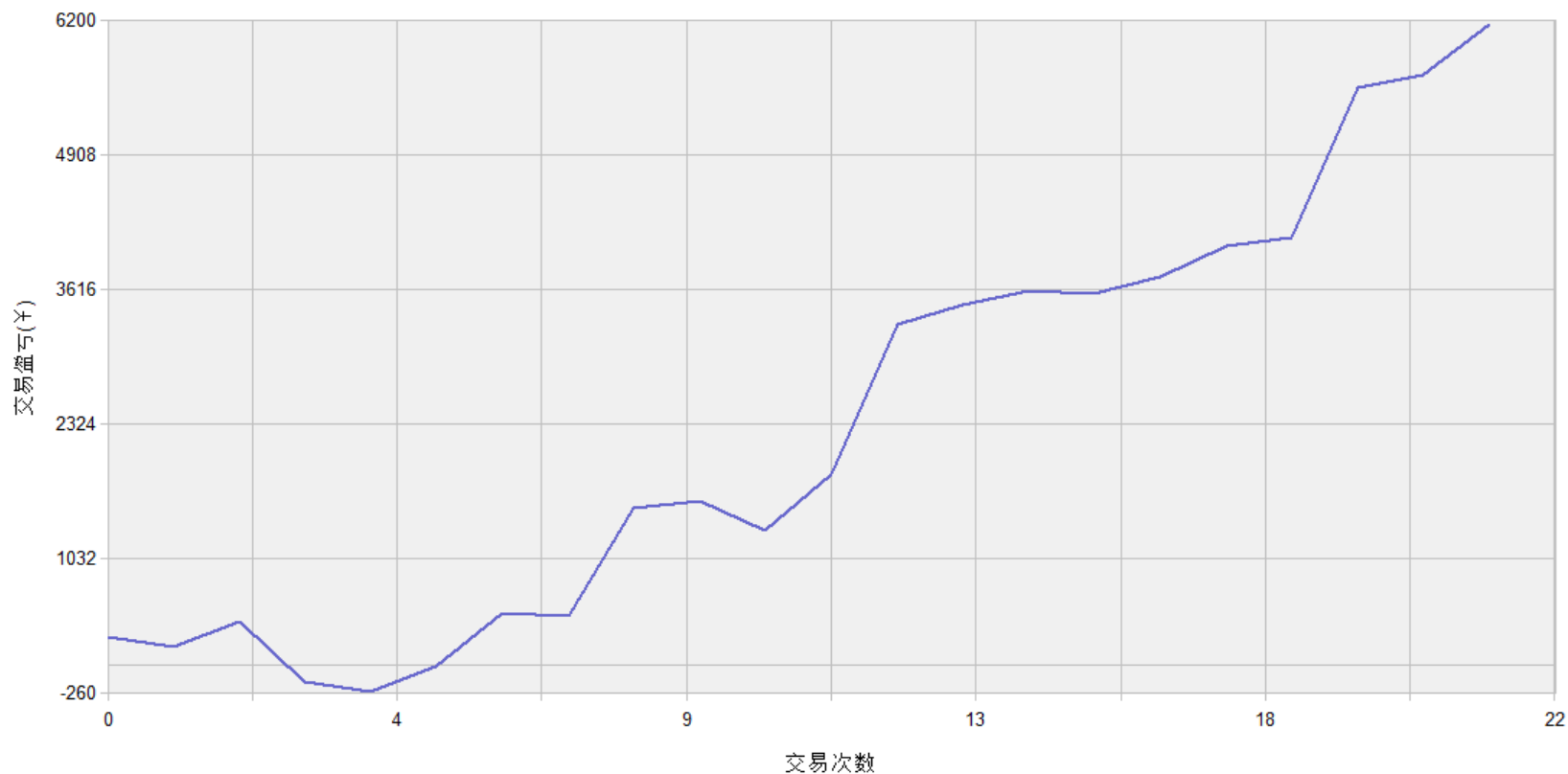
交易盈亏曲线图



图中为胶合板指数合约 2013.1.1 日至今 1 日 K 线的历史回测收益图，同样每次交易 1 手，没有加减仓操作。采用价格回落 1% 止赢（止损）离场。

4、PVC 指数合约历史回测收益图。

交易盈亏曲线图



图中为 PVC 指数合约 2013.1.1 日至今 1 日 K 线的历史回测收益图，同样每次交易 1 手，没有加减仓操作。采用价格回落 1.5% 止赢（止损）离场。

免责声明：

本报告由东吴期货制作及发布。报告是基于本公司认为可靠的且目前已公开的信息撰写，本公司力求但不保证该信息的准确性和完整性，所表述的意见并不构成对任何人的投资建议，投资者需自行承担风险。未经本公司事先书面授权，不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节、修改、及用于其它用途。期货市场有风险，投资需谨慎。