

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29(星期四)

| 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 | 空单止损(-120)  | 1.27-1.28   | 观望   |        |       |
| 郑糖 1505        | 55.56% | 4.0  | 多单止盈(2250)  | 1.20-1.28   | 观望   |        |       |
| 国债 1503        | 69.57% | 1.68 | 多单止盈(590)   | 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   |        |       |
| <b>沪铝 1503</b> | 71.43% | 2.44 | 空单止盈(1915)  | 1.05-1.15   | 多持   | 1.29   | 12870 |
| 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 | 空单止盈(7565)  | 1.13-1.28   | 多持   | 1.28   | 110.2 |
| 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 | 空单止盈(1810)  | 12.31-1.26  | 观望   |        |       |
| 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   | 空持   | 1.27   | 8115  |
| 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  | 72.73% | 4.85 | 空单止损 ( -230 ) | 1.14-1.15  | 空持   | 1.26   | 7205  |
| 螺纹钢 1505 | 60.71% | 2.82 | 空单止盈 ( 120 )  | 1.12-1.29  | 多持   | 1.29   | 2510  |
| 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。

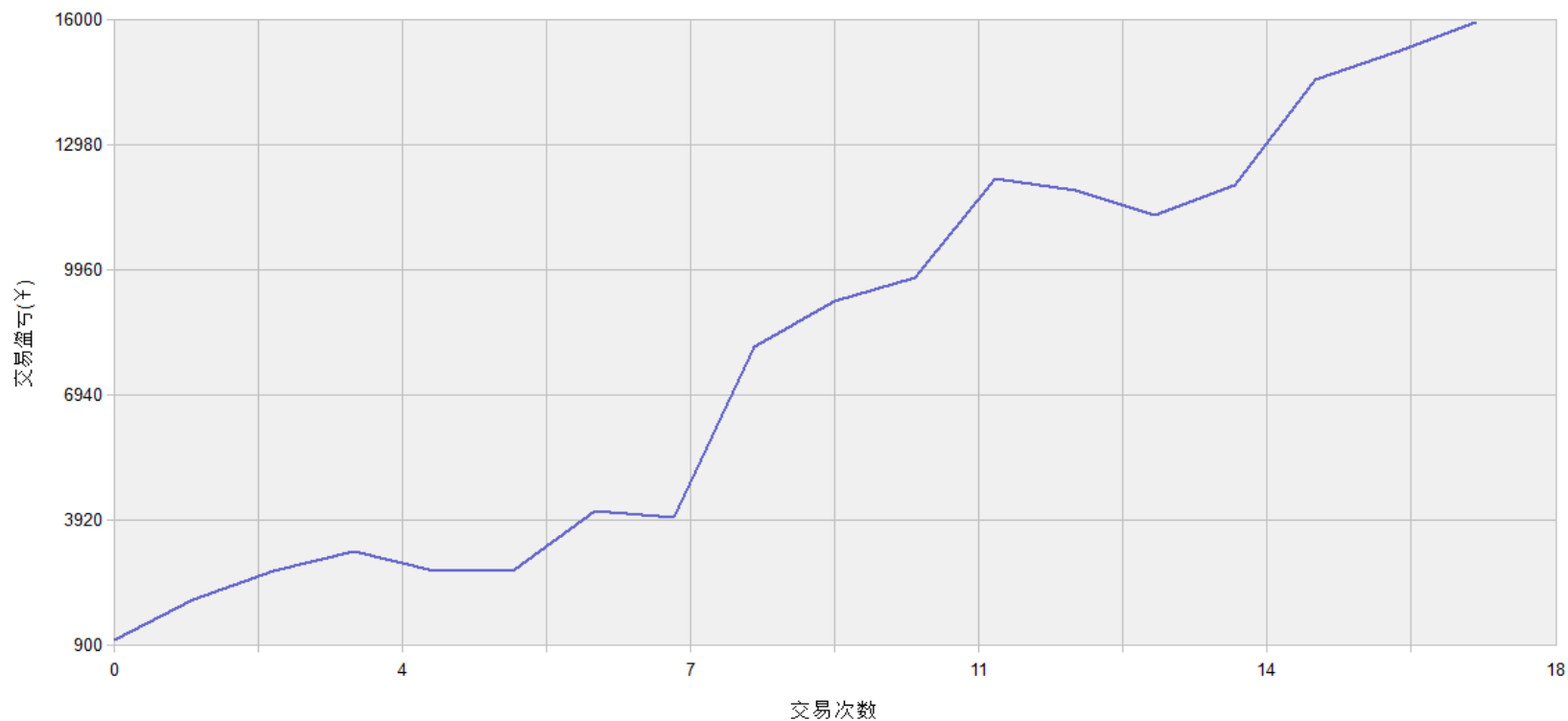
净盈亏：总盈亏 - 手续费。（精确到个位数）

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。

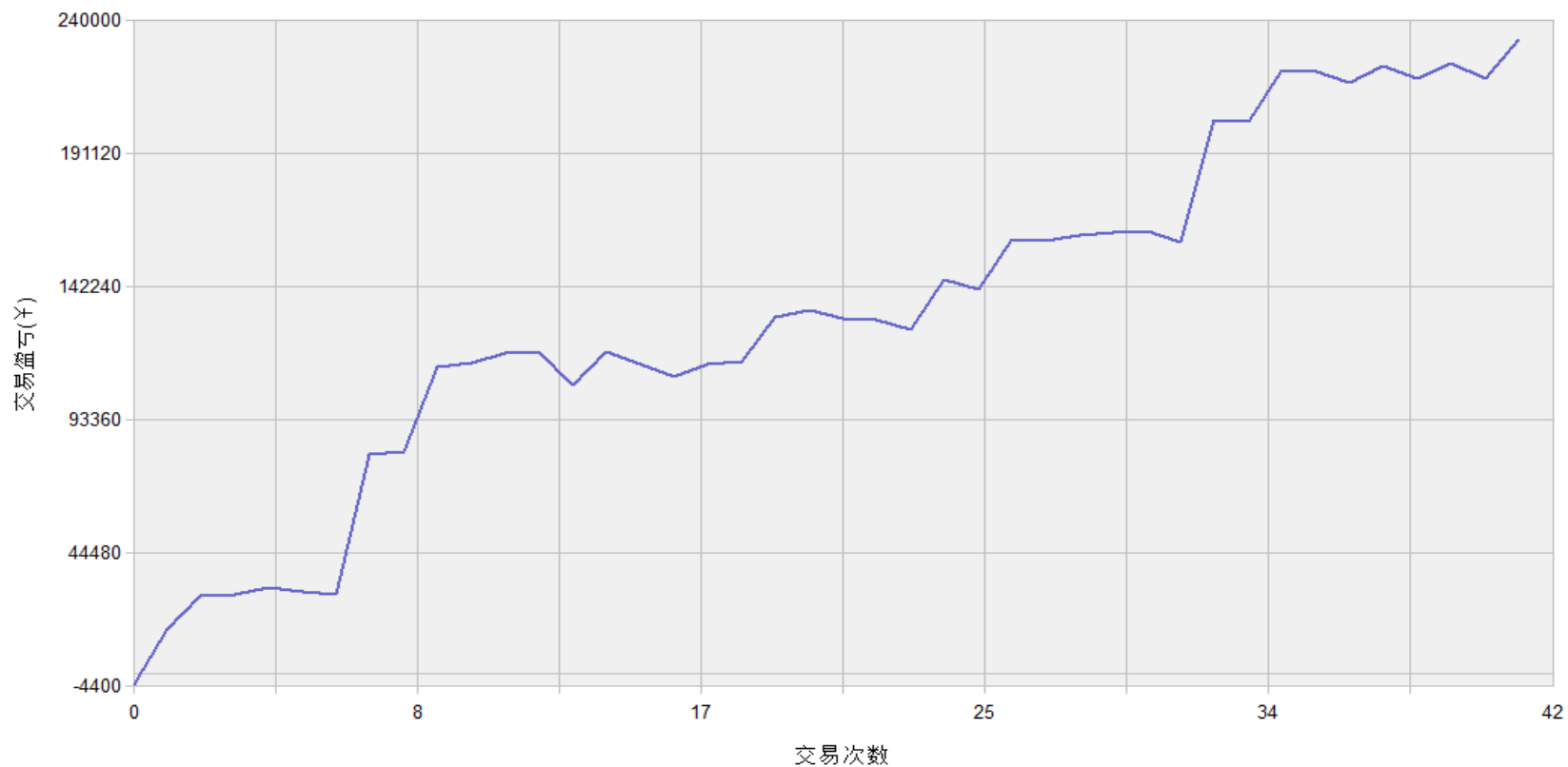
交易盈亏曲线图



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。

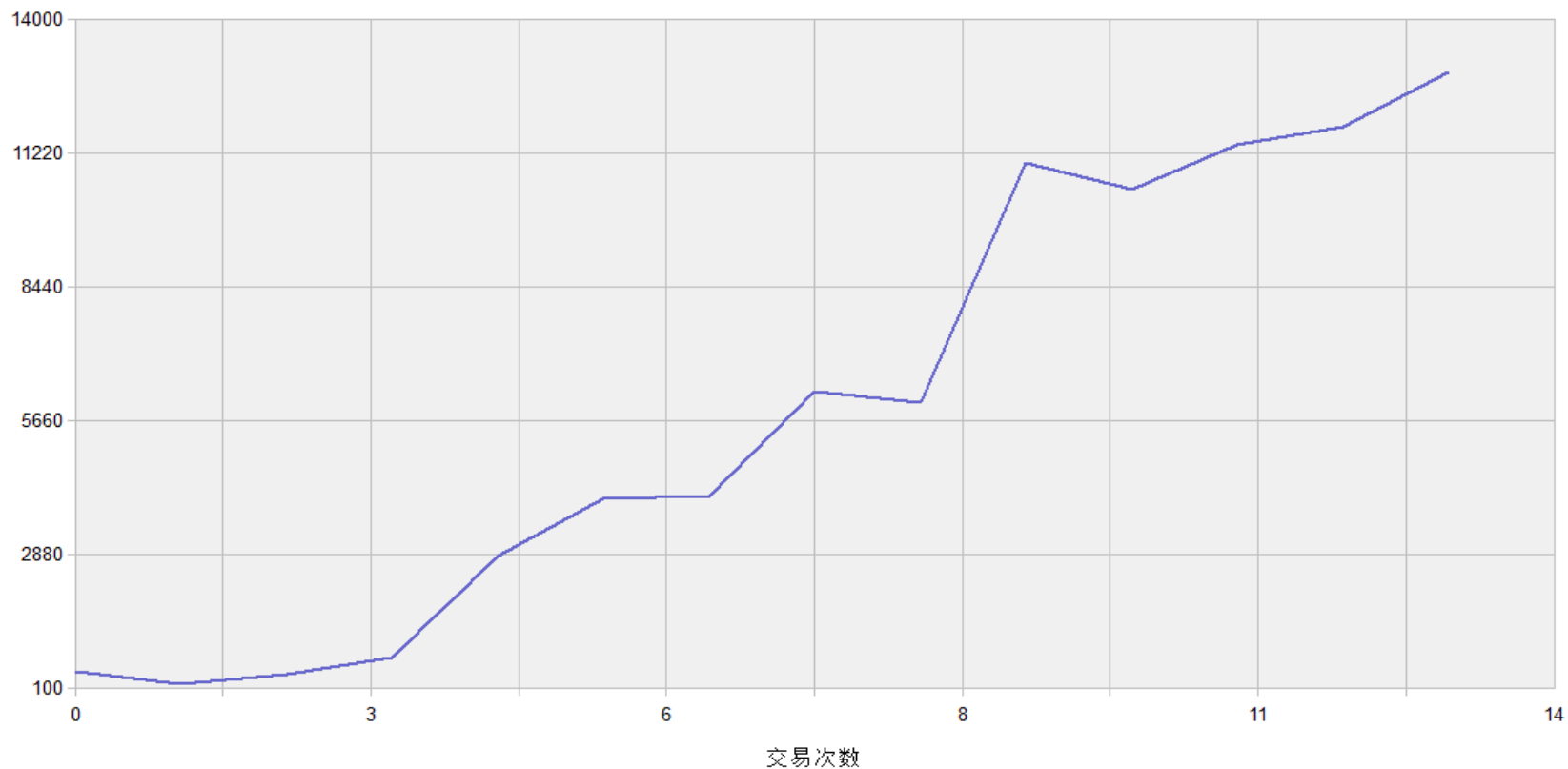
交易盈亏曲线图



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。

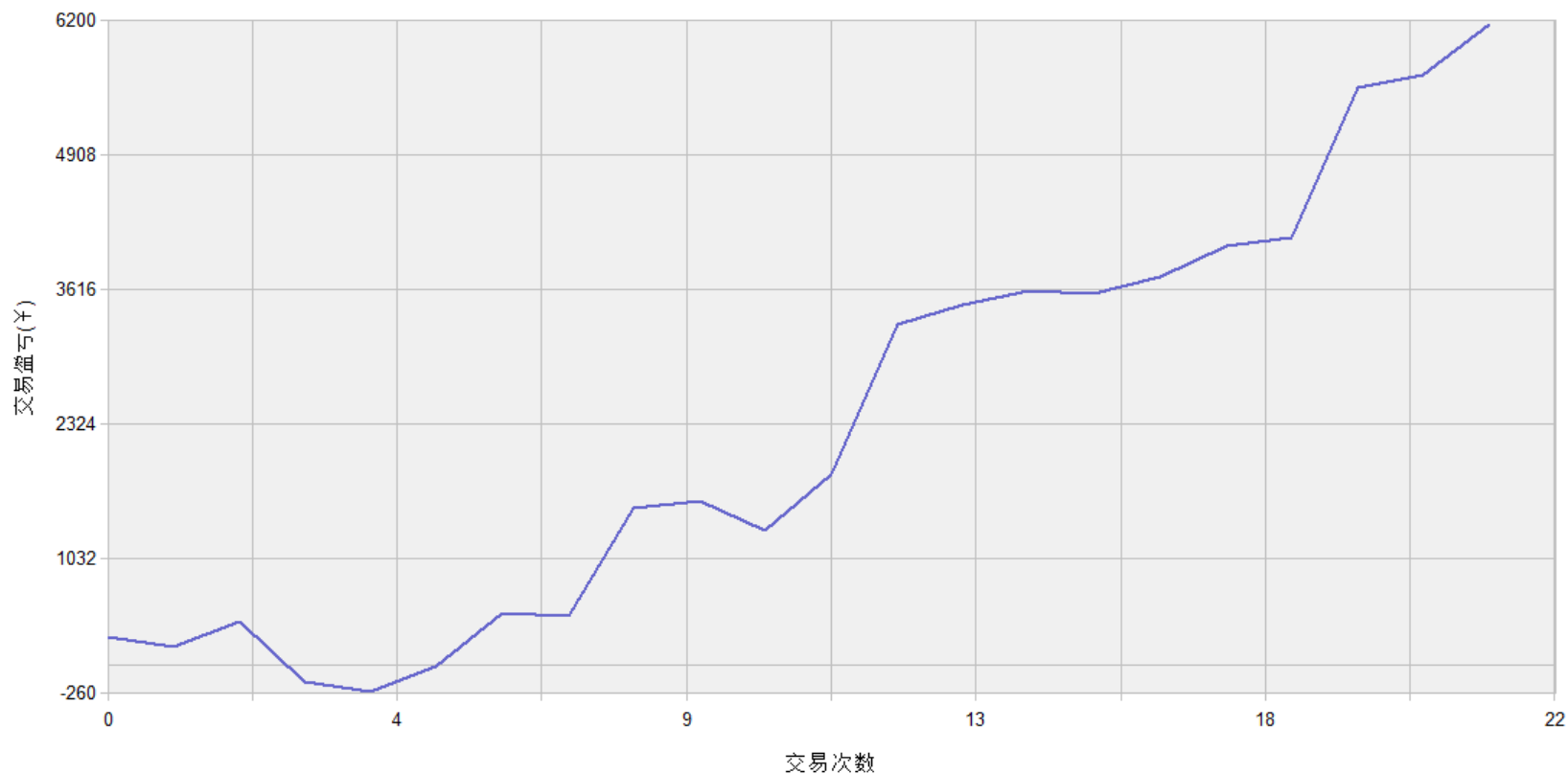
交易盈亏曲线图



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。