

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30(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 | 空持 | 1.30 | 2117 |
| 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 | | |
| 沪铝 1503 | 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 | 多单止盈(12140) | 12.31-1.30 | 空持 | 1.30 | 255.05 |
| 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 | 空单止盈(-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。

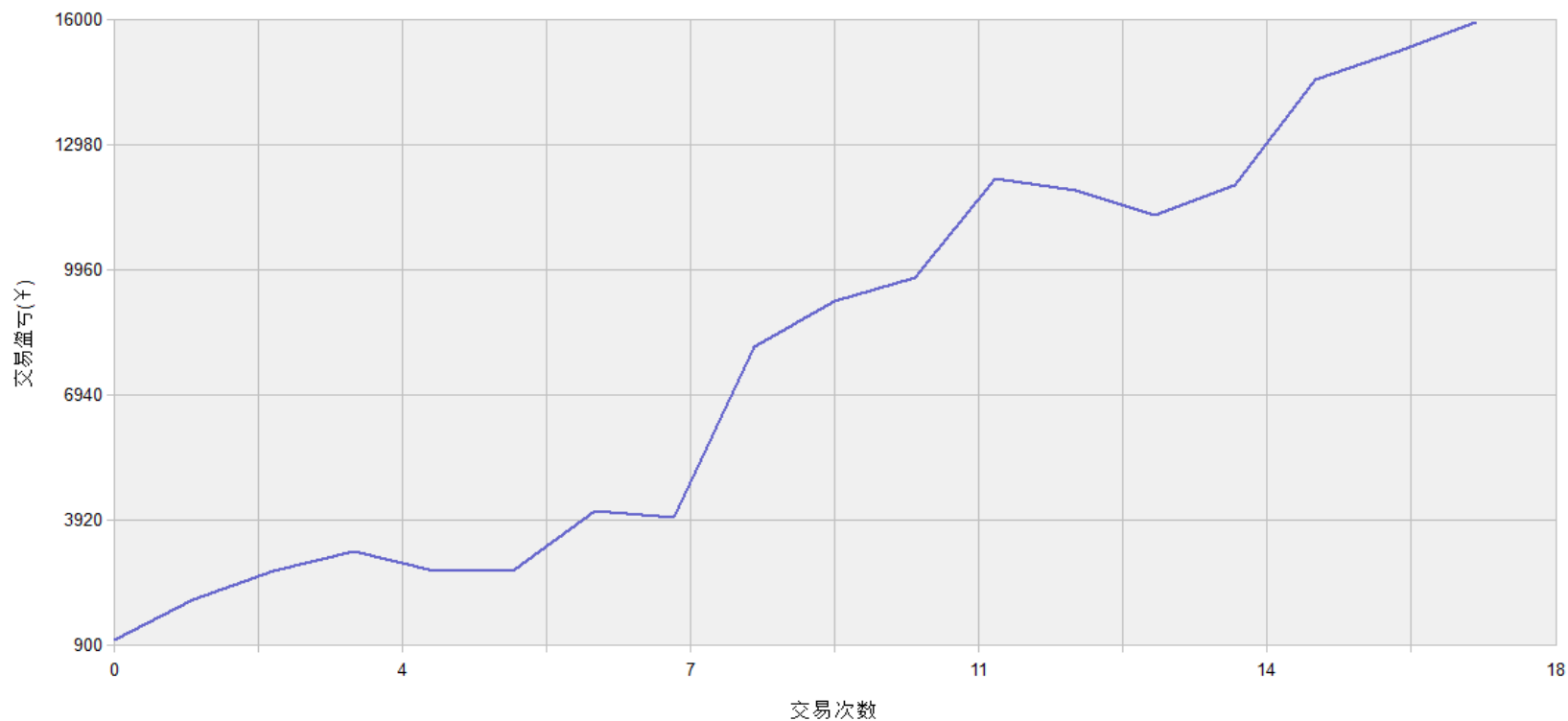
净盈亏：总盈亏 - 手续费。（精确到个位数）

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。

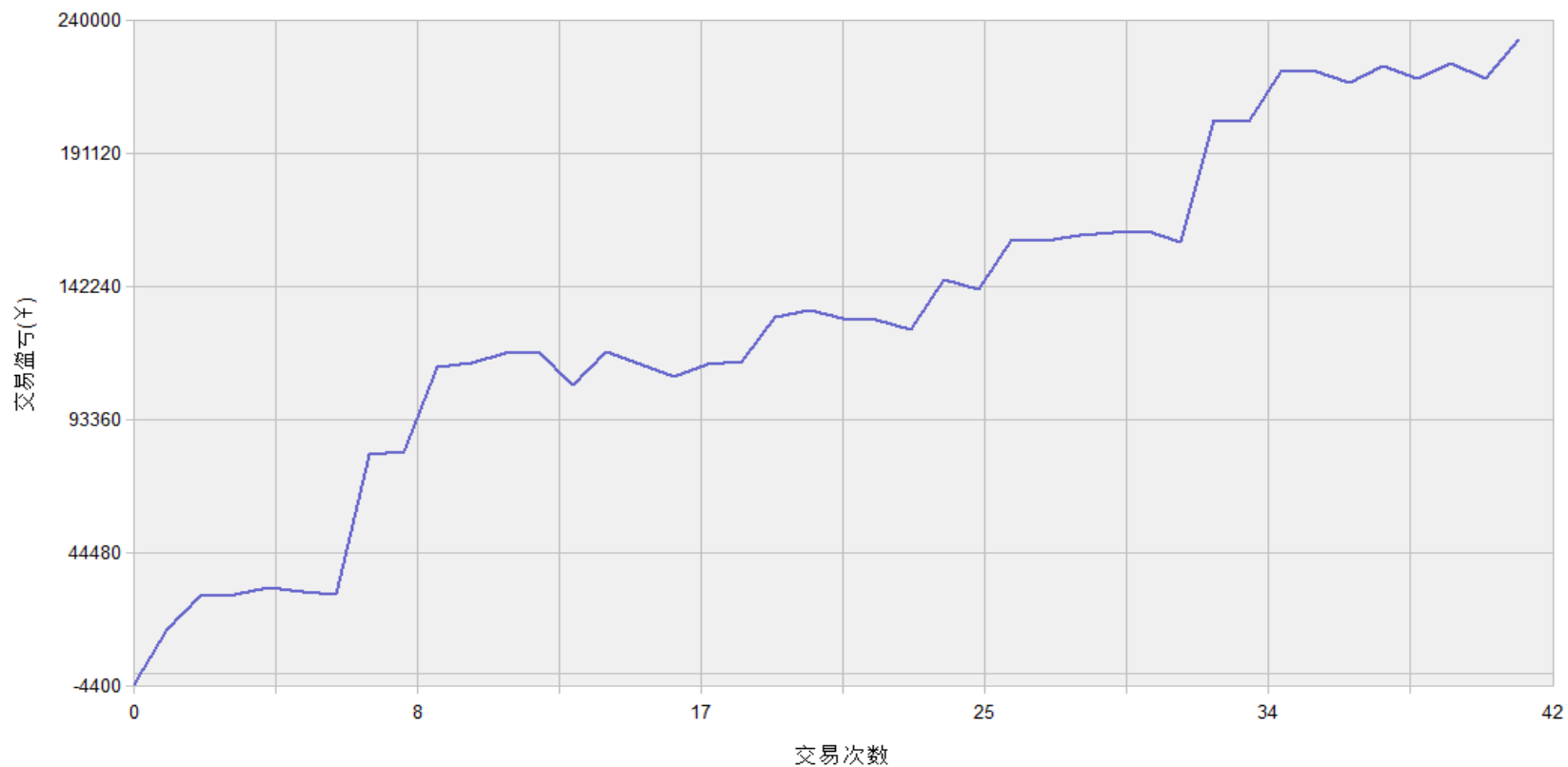
交易盈亏曲线图



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。

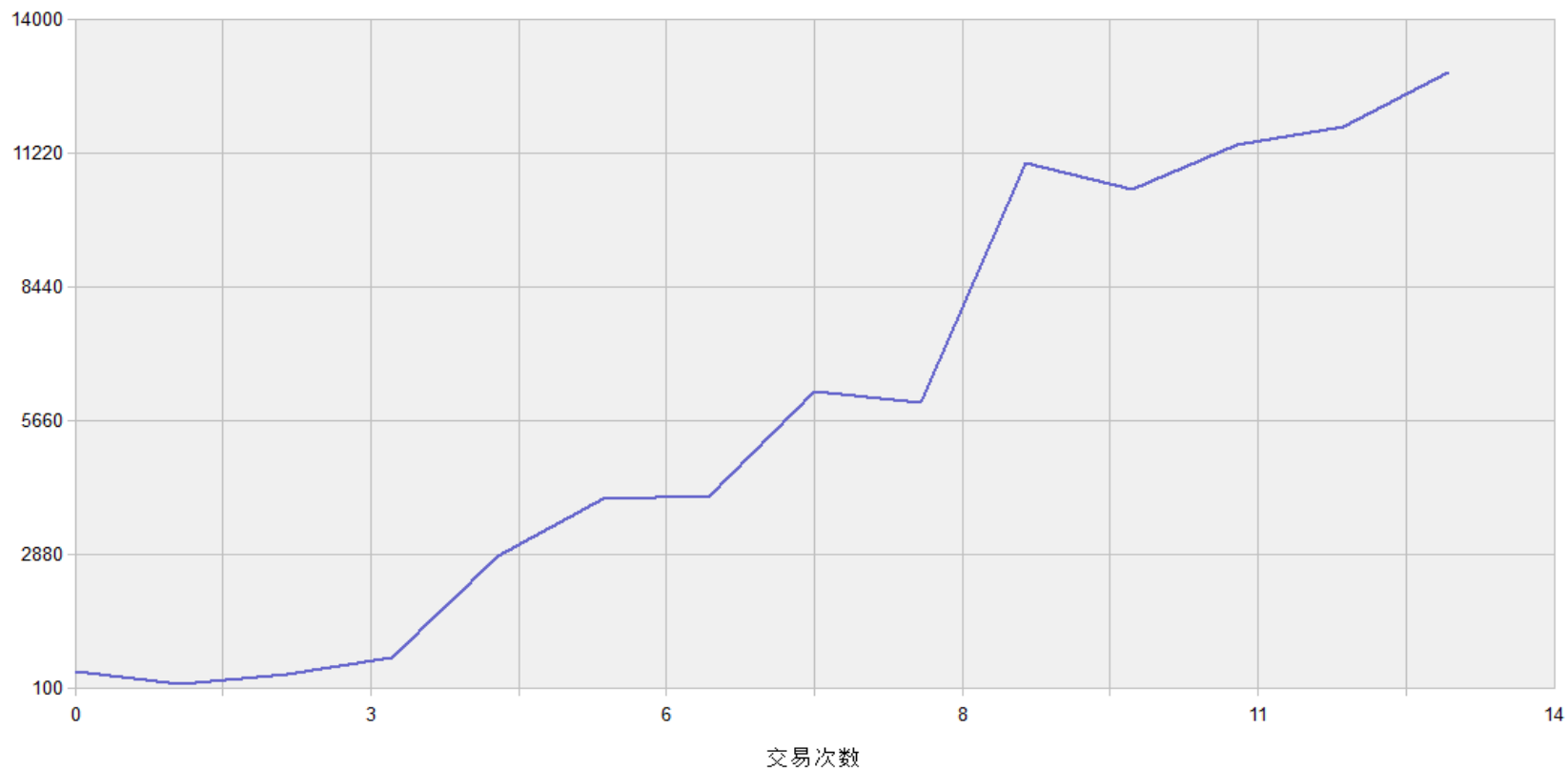
交易盈亏曲线图



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。

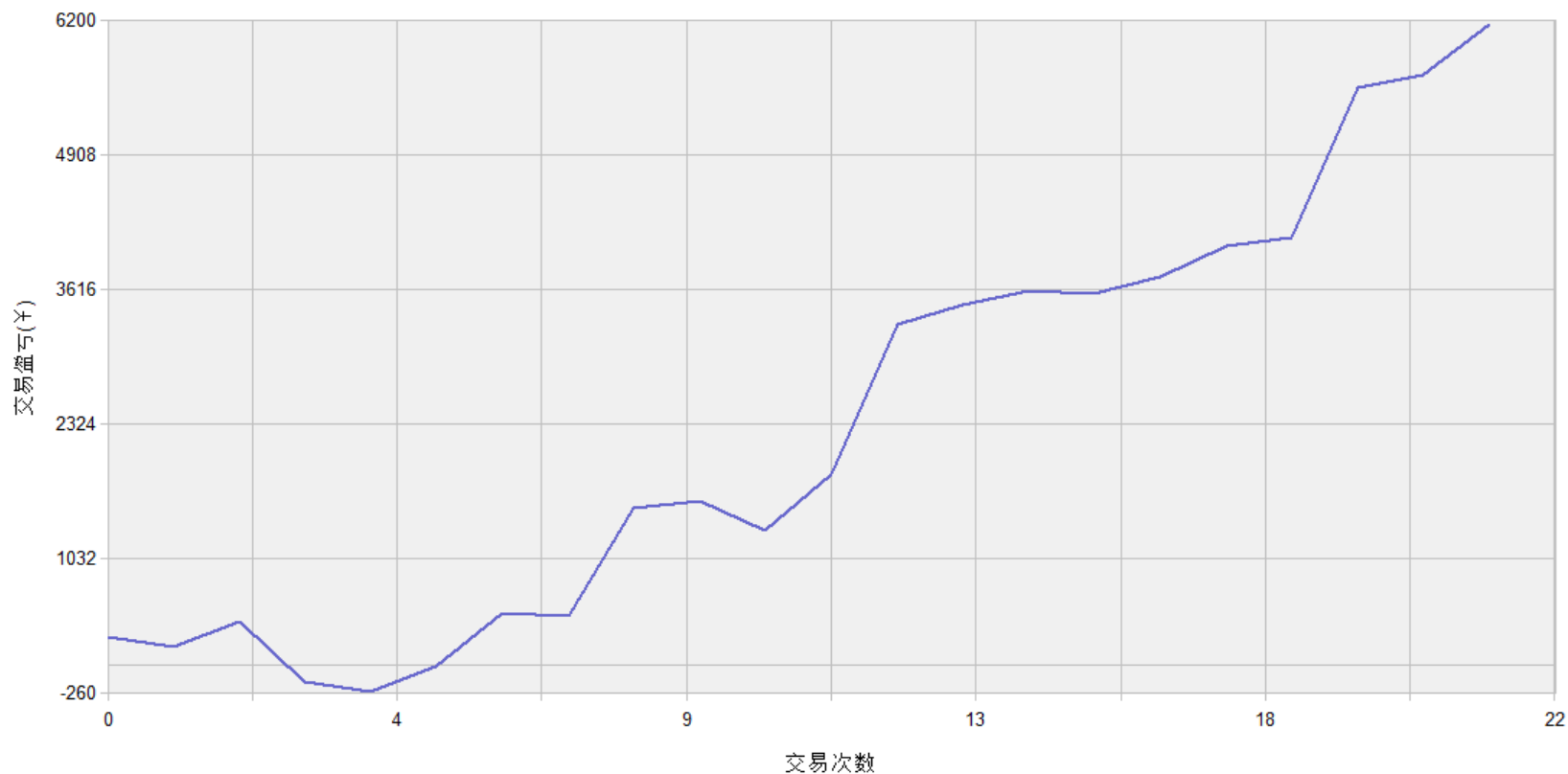
交易盈亏曲线图



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。