

新纪元期货程序化交易日报 20120801

模型品种：

十面埋伏（商品组合）

追风系列 1.1（股指）

短线系列 TBK 1.2

宏利系列

商品组合1号

说明：

十面埋伏为商品组合，包含以下品种：郑棉、白糖、PTA、沪锌、塑料、强麦、豆油、沪铜、菜油、豆粕、豆一以及棕榈油。各品种之间的手数配比由波动幅度计算所得。

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：

zlkevintop@126.com

地址：江苏徐州市淮海东路

153号新纪元期货大厦

欢迎投资者交流策略，提出策略定制化要求

模型名称：十面埋伏（商品组合）
模型分类：中线、趋势型
目前版本：1.1

产品说明：

十面埋伏程序化交易系统以新纪元综合金融平台特有的趋势性分水岭为蓝本编制而成的交易系统。分水岭能较好的揭示出多种品种的趋势，其综合表现效果要好于均线。同时，配以周期优选和品种优选，实现资金管理思想，把握期货市场的投资机会，获得趋势盈利。

本模型目运行在投资家平台上。

历史测试效果（MyTrader2009）：

| | 橡胶 | 郑棉 | PTA | 螺纹 | 塑料 | 白糖 | 豆油 | 沪铜 | 均值 | 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 |
|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|------|-----------------------------------|
| 分水岭 | 254.42 | 85.07 | 253.22 | 66.33 | 304.12 | 8.18 | 49.36 | 191.72 | 151.553 | 测试方法 | 收盘价向上穿越分水岭（均线）做多，收盘价向下穿越分水岭（均线）做空 |
| 65 均线 | 153.74 | 77.67 | 91.24 | 106.73 | 112.37 | -37.26 | 78.25 | 147.62 | 91.295 | 测试周期 | 30分钟 |
| 51 均线 | 139.51 | 141.45 | 173.86 | 105.96 | 54.97 | -47.95 | 79.12 | 145.29 | 99.02625 | 测试时间 | 2011年1月24日-11月23日 |
| 34 均线 | 336.05 | 78.79 | 227.33 | 130.69 | 236.32 | 36.7 | 78.48 | 226.87 | 168.904 | | |
| 21 均线 | 273.43 | 96.57 | 207.64 | 85.08 | 209.17 | -50.17 | 13.41 | 154.85 | 123.7475 | | |
| 13 均线 | 289.95 | 97.74 | 155.04 | 112.25 | 36.43 | -40.31 | -58.81 | 135.56 | 90.98125 | | |

模型运行收益率曲线

模型展示从2012年5月7日开始，展示期初初始权益803250；截至2012年8月1日，资金权益941612元，相对期初收益率17.23%。

图表1：交易痕迹

| 商品 | 价格 | 数量 | 买/卖 | 开/平 | 状态 | 委托时间 | 已成 |
|--------|-------|----|-----|-----|------|----------------|----|
| 沪铜1301 | 54600 | 1 | 卖 | 开 | 完全成交 | 14:31:39 08/01 | 1 |
| 沪铜1301 | 54650 | 1 | 卖 | 平 | 完全成交 | 14:30:47 08/01 | 1 |
| 塑料1301 | 9710 | 5 | 卖 | 开 | 完全成交 | 14:30:35 08/01 | 5 |
| 郑棉1301 | 19025 | 2 | 买 | 开 | 完全成交 | 14:30:04 08/01 | 2 |
| 郑棉1301 | 19025 | 2 | 买 | 平 | 完全成交 | 14:30:03 08/01 | 2 |
| 塑料1301 | 9710 | 10 | 卖 | 平 | 完全成交 | 14:30:02 08/01 | 10 |
| 郑棉1301 | 19000 | 2 | 买 | 开 | 完全成交 | 14:00:06 08/01 | 2 |
| 郑棉1301 | 19000 | 2 | 买 | 平 | 完全成交 | 14:00:03 08/01 | 2 |
| 沪铜1301 | 54710 | 1 | 买 | 开 | 完全成交 | 11:01:03 08/01 | 1 |
| 塑料1301 | 9760 | 5 | 买 | 开 | 完全成交 | 11:00:41 08/01 | 5 |
| 沪铜1301 | 54750 | 1 | 买 | 平 | 完全成交 | 11:00:40 08/01 | 1 |
| 塑料1301 | 9760 | 5 | 买 | 开 | 完全成交 | 11:00:33 08/01 | 5 |
| 郑棉1301 | 19030 | 2 | 买 | 开 | 完全成交 | 11:00:21 08/01 | 2 |
| 沪铜1301 | 19030 | 2 | 买 | 平 | 完全成交 | 11:00:17 08/01 | 2 |
| 塑料1301 | 9755 | 5 | 买 | 平 | 完全成交 | 11:00:01 08/01 | 5 |
| 白糖1301 | 5401 | 1 | 买 | 开 | 完全成交 | 10:30:14 08/01 | 1 |
| 白糖1301 | 5400 | 1 | 买 | 平 | 完全成交 | 10:30:12 08/01 | 1 |
| 白糖1301 | 5376 | 1 | 买 | 开 | 完全成交 | 10:00:15 08/01 | 1 |

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 |
|---------|----|-------|----|-----|-------|--------|
| 棕榈1301 | 14 | 7738 | 14 | 买 | 16240 | 108333 |
| 菜油1301 | 3 | 10090 | 3 | 买 | 3300 | 30270 |
| 棕榈1305 | 14 | 7872 | 14 | 买 | 17920 | 110209 |
| 豆一1301 | 6 | 4703 | 6 | 买 | 1680 | 28218 |
| 豆粕1301 | 10 | 3889 | 10 | 买 | 8500 | 38890 |
| PTA1305 | 8 | 7448 | 8 | 买 | 2480 | 29792 |

| 商品 | 数量 | 均价 | 可平 | 买/卖 | 盈亏 | 保证金 |
|--------|----|--------|----|-----|-------|--------|
| 豆油1301 | 12 | 9562.5 | 12 | 买 | 900 | 114751 |
| 沪铜1301 | 1 | 14870 | 1 | 卖 | 150 | 7335 |
| 强麦1301 | 13 | 2499 | 13 | 买 | -1820 | 64975 |
| 白糖1301 | 1 | 5401 | 1 | 买 | 440 | 5401 |
| 郑棉1301 | 2 | 19025 | 2 | 买 | -50 | 19025 |
| 塑料1301 | 5 | 9710 | 5 | 卖 | 500 | 24275 |
| 沪铜1301 | 1 | 54600 | 1 | 卖 | -550 | 27300 |

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>