

新纪元期货程序化交易——追风一号系统介绍及统计检验展示

模型品种:

追风一号模型

说明:

追风一号模型以顺势交易为主要思路,把握市场运行主线方向,减少震荡行情中的交易频率。本系列模型属于中、短线模型,隔夜持仓。适用品种包括股指、橡胶、螺纹、豆油、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

程序化研究小组

联系电话:

010—84261653

0516—83831179

地址:江苏徐州市淮海东路

153号新纪元期货大厦

追风一号系统介绍及统计检验展示

一、 系统介绍

“追风一号”以顺势交易为主要思路，把握市场运行主线方向，减少震荡行情中的交易频率。本系列模型属于中、短线模型，隔夜持仓。适用品种包括股指、橡胶、螺纹钢、豆油、PTA 等多个品种。模型的设计理念是：顺势而为，抓取波段收益；识别规避震荡行情，减少交易次数，减少盈利回撤幅度。多品种上组合运用效果更佳。

以下是追风一号模型在加权连续合约上的统计检验结果汇总。

追风一号（初始资金同为 50 万，固定 1 手进行测试）

	盈亏比	胜率 (%)	最大回撤 (%)	测试时间	测试周期	推荐度
股指期货	3.33	33.63%	7.60%	2010/6/22-2012/4/26	15 分钟	★★★
螺纹钢	3.58	37.45%	5657	2009/3/27-2012/4/26	30 分钟	★★
橡胶	4.19	34.14%	28600	2010/2/4-2012/4/26	15 分钟	★★★
铜	3.42	37.20%	49400	2008/3/12-2012/4/26	30 分钟	★
豆油	3.15	38.30%	14820	2008/3/19-2012/4/27	30 分钟	★
白糖	3.62	32.46%	5665	2008/3/14-2012/4/27	30 分钟	★
大豆	3.00	32.72%	7050	2008/3/19-2012/4/27	30 分钟	★
豆粕	4.24	34.75%	2938	2008/3/19-2012/4/27	30 分钟	★★
棉花	6.88	29.59%	9227	2008/3/18-2012/4/27	30 分钟	★★
塑料	4.01	32.29%	12939	2008/3/19-2012/4/27	30 分钟	★
PTA	3.81	36.60%	3740	2008/3/18-2012/4/27	30 分钟	★★★
锌	3.40	30.94%	19130	2008/3/18-2012/4/27	30 分钟	★

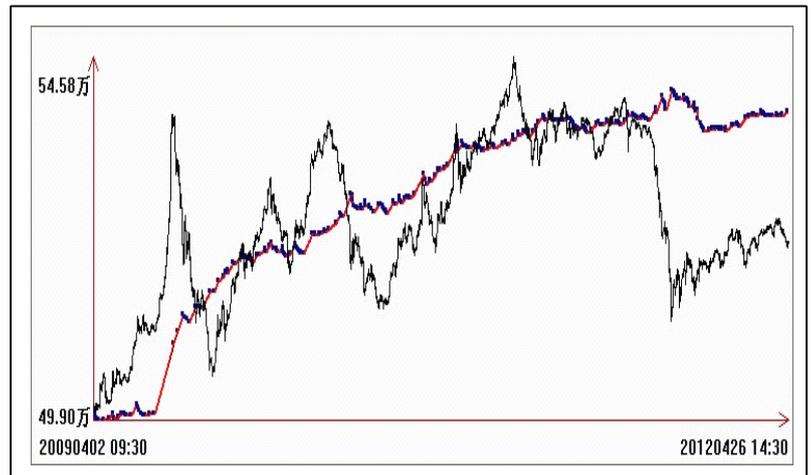
备注：“推荐度”是模型在各品种上的推荐应用程度，★为中性，★★为中度推荐，★★★为优先推荐。

二、 统计检验展示

股指期货 4, 10	
测试日期	2010/6/22-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	1362879
最大回撤	7.6%
最大连续亏损次数	16
盈利率	172.58%
胜率	33.63%
平均盈利/平均亏损	5190/1560
交易次数	782
总手续费/单手续费	82013/0.06%



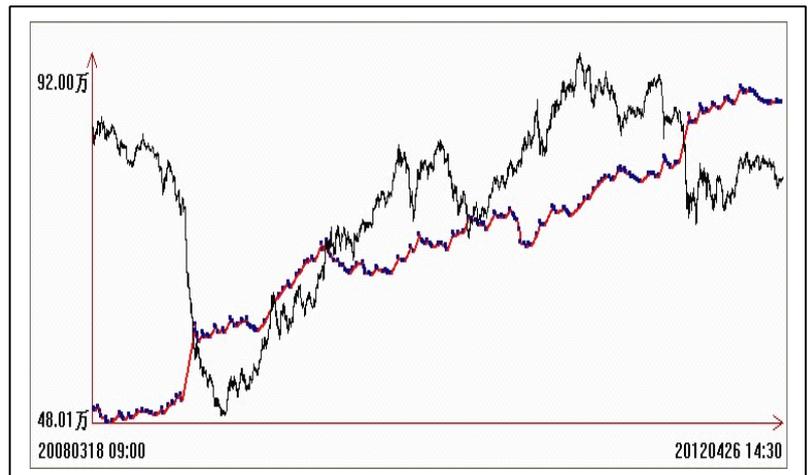
螺纹钢 4, 21	
测试日期	2009/3/27-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	542764
最大回撤	5657
最大连续亏损次数	10
盈利率	8.55%
胜率	37.45%
平均盈利/平均亏损	695/194
交易次数	331
总手续费/单手续费	5296/8



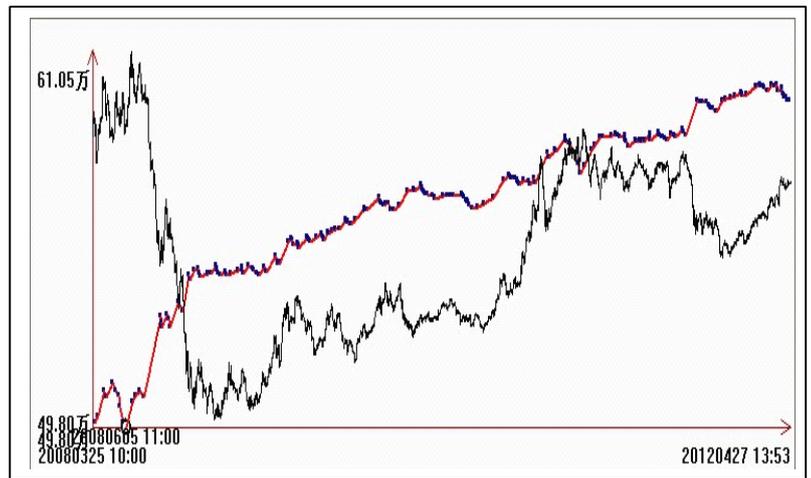
橡胶 12, 39	
测试日期	2010/2/4-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	719670
最大回撤	28600
最大连续亏损次数	10
盈利率	43.93%
胜率	34.14%
平均盈利/平均亏损	4562/1088
交易次数	249
总手续费/单手续费	29880/60



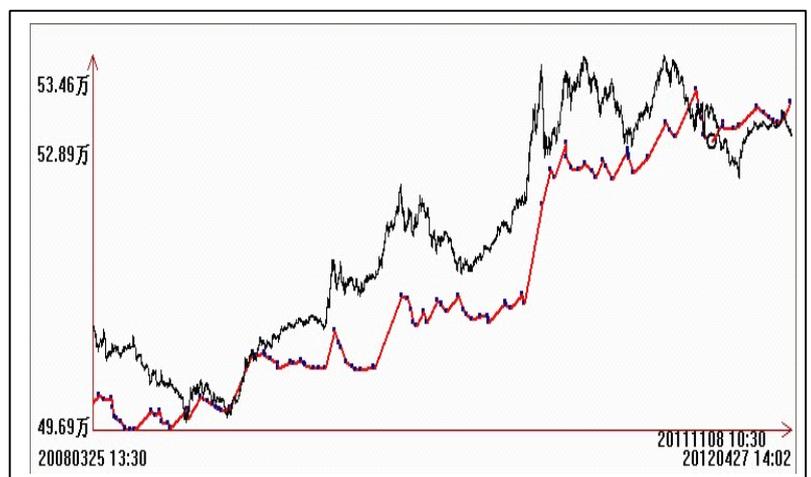
铜 25, 16	
测试日期	2008/3/12-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	899240
最大回撤	49400
最大连续亏损次数	8
盈利率	79.85%
胜率	37.20%
平均盈利/平均亏损	7153/2091
交易次数	250
总手续费/单手手续费	40000/80



豆油 21, 33	
测试日期	2008/3/19-2012/4/27
初始资金	500000
最终权益	605254
最大回撤	14820
最大连续亏损次数	11
盈利率	21.05%
胜率	38.30%
平均盈利/平均亏损	2267/720
交易次数	235
总手续费/单手手续费	3760/8



白糖 56, 49	
测试日期	2008/3/14-2012/4/27
初始资金	500000
最终权益	533287
最大回撤	5665
最大连续亏损次数	6
盈利率	6.66%
胜率	32.46%
平均盈利/平均亏损	2155/596
交易次数	114
总手续费/单手手续费	1824/8



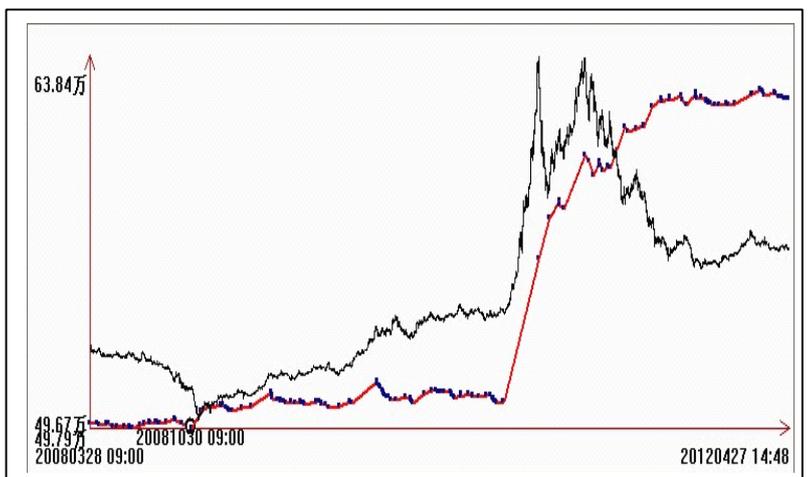
大豆 20, 20	
测试日期	2008/3/19-2012/4/27
初始资金	500000
最终权益	522787
最大回撤	7050
最大连续亏损次数	9
盈利率	4.56%
胜率	32.72%
平均盈利/平均亏损	947/316
交易次数	272
总手续费/单手手续费	3452/8



豆粕 51, 55	
测试日期	2008/3/19-2012/4/27
初始资金	500000
最终权益	529443
最大回撤	2938
最大连续亏损次数	5
盈利率	5.89%
胜率	34.75%
平均盈利/平均亏损	1306/308
交易次数	118
总手续费/单手手续费	1416/6

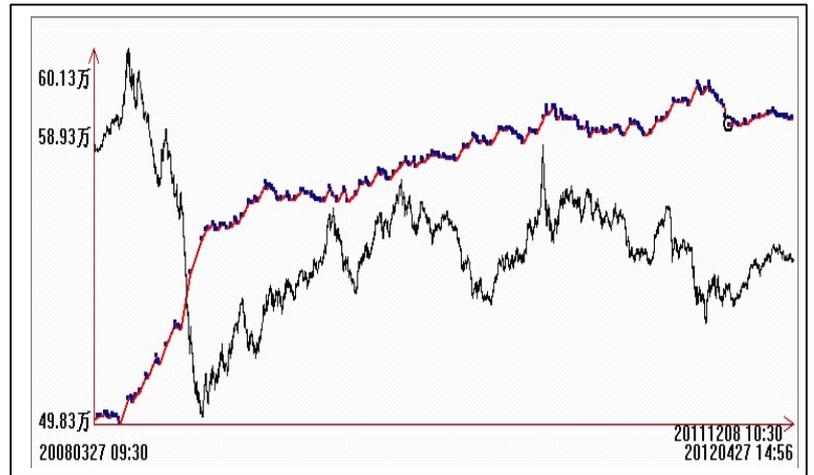


棉花 25, 58	
测试日期	2008/3/18-2012/4/27
初始资金	500000
最终权益	634565
最大回撤	9227
最大连续亏损次数	12
盈利率	26.91%
胜率	29.59%
平均盈利/平均亏损	3855/560
交易次数	169
总手续费/单手手续费	3380/10



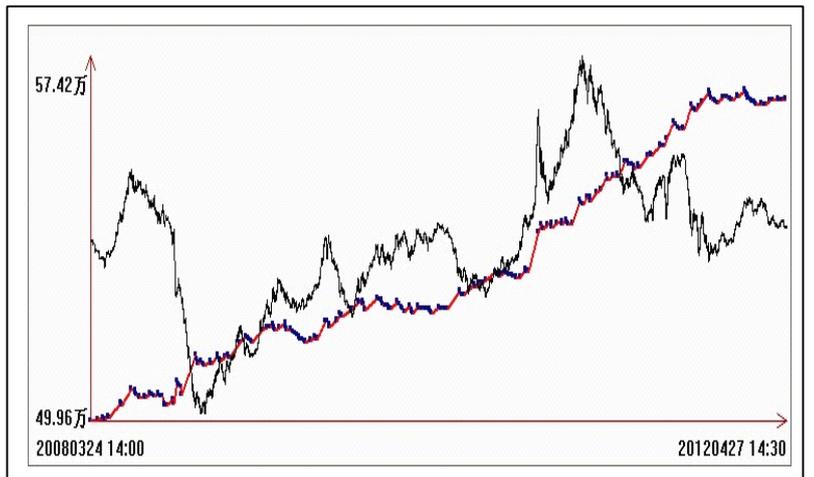
塑料 4, 41

测试日期	2008/3/19-2012/4/27
初始资金	500000
最终权益	591123
最大回撤	12939
最大连续亏损次数	17
盈利率	18.22%
胜率	32.29%
平均盈利/平均亏损	1802/449
交易次数	319
总手续费/单手手续费	91123/8



PTA 11, 34

测试日期	2008/3/18-2012/4/27
初始资金	500000
最终权益	572139
最大回撤	3740
最大连续亏损次数	11
盈利率	14.43%
胜率	36.60%
平均盈利/平均亏损	1351/355
交易次数	265
总手续费/单手手续费	4240/8



锌 11, 23

测试日期	2008/3/18-2012/4/27
初始资金	500000
最终权益	597941
最大回撤	19130
最大连续亏损次数	16
盈利率	19.59%
胜率	30.94%
平均盈利/平均亏损	2626/773
交易次数	362
总手续费/单手手续费	10860/15



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>