

新纪元期货程序化交易日报 20120920

模型品种:

长宏一号

长宏二号

说明:

长宏系列目标品种为商品组合,包含以下品种:沪铜、沪锌、螺纹钢、沪胶、郑糖、郑棉、豆粕、豆油、塑料、PTA等品种。1.1版本展示期间各品种开仓固定开仓1手不追加,1.2之后版本根据各品种保证金不等单次开仓固定手数。

长宏系列设计理念是:以新纪元分水岭为基础跟踪行情波动重心,过滤本交易理念认为不具备趋势性操作价值的震荡行情,在价格突破过滤带时建仓,交易理念本身包含止盈止损规则,以获取趋势性行情盈利为目标。

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

高岩

从业资格: F0249001

联系电话: 010-84261653

电子邮件:

gaoyan@neweraqh.com.cn

地址:

北京市东城区东四十条68号

平安发展大厦407室

模型名称：长宏一号、长宏二号（商品组合）

模型分类：中短线、趋势型

目前版本：长宏一号1.3，长宏二号1.2（1.2较1.1版本主要升级了各品种资金量配比问题，以沪铜一手占用的保证金为基准，其余单手保证金占用较小的品种一次固定开多手向其配齐；1.3较1.2版本调整了品种范围及运行周期；目前运行的品种包括：铜、锌、螺纹、橡胶、白糖、棉花、豆粕、豆油、玉米、LLDPE、PTA，统一运行在15分钟周期）。

产品说明：

“长宏”程序化交易系列模型以新纪元分水岭为基础跟踪行情波动重心，过滤本交易理念认为不具备趋势性操作价值的震荡行情，在价格突破过滤带时建仓，交易理念本身包含止盈止损规则，以获取趋势性行情盈利为目标；是推荐运行于15分钟、30分钟、1小时等周期的中短线趋势性交易模型。

本模型目运行在投资家平台上。

长宏一号历史测试效果（MyTrader2009）：

| | 盈利率（%） | 胜率（%） | 最大回撤（%） | 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 |
|-----|--------|-------|---------|----------|---|
| 螺纹钢 | 102.2 | 46 | 10 | 测试 方法 | 收盘价上穿过滤带做多，下穿过滤带做空，以分水岭为止盈止损线 |
| 橡胶 | 200.72 | 43.97 | 10 | | |
| 铜 | 251.89 | 43.8 | 9 | 测试 周期 | 1小时 |
| 豆油 | 161.2 | 43.75 | 12 | | |
| 白糖 | 44.2 | 36.86 | 21 | 测试 时间 | 2006年3月31日-2012年4月11日 2009年3月27日-2012年4月11日 (螺纹钢) |
| 大豆 | 75.72 | 41.1 | 23 | | |
| 豆粕 | 73.52 | 40.85 | 15 | | |
| 棉花 | 157.49 | 46.89 | 8 | | |
| 塑料 | 148.68 | 39.88 | 12 | | |
| PTA | 134.83 | 43.22 | 13 | | |
| 锌 | 141.28 | 37 | 18 | | |

长宏二号历史测试效果（MyTrader2009）：

| | 盈利率（%） | 胜率（%） | 最大回撤（%） | 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 |
|-----|--------|-------|---------|----------|---|
| 螺纹钢 | 127.6 | 50 | 13 | 测试 方法 | 收盘价上穿过滤带做多，下穿过滤带做空，以过滤带边界反手参照 |
| 橡胶 | 162.81 | 37.65 | 25 | | |
| 铜 | 192.47 | 43.82 | 22 | 测试 周期 | 1小时 |
| 豆油 | 170.63 | 42.47 | 26 | | |
| 白糖 | 97.26 | 36.67 | 11 | 测试 时间 | 2006年3月31日-2012年4月11日 2009年3月27日-2012年4月11日 (螺纹钢) |
| 大豆 | 93.56 | 36.41 | 27 | | |
| 豆粕 | 91.2 | 45 | 17 | | |
| 棉花 | 168.18 | 42.54 | 13 | | |
| 塑料 | 203.57 | 49.09 | 17 | | |
| PTA | 146.44 | 42.03 | 20 | | |
| 锌 | 86.74 | 34.46 | 22 | | |

模型运行展示

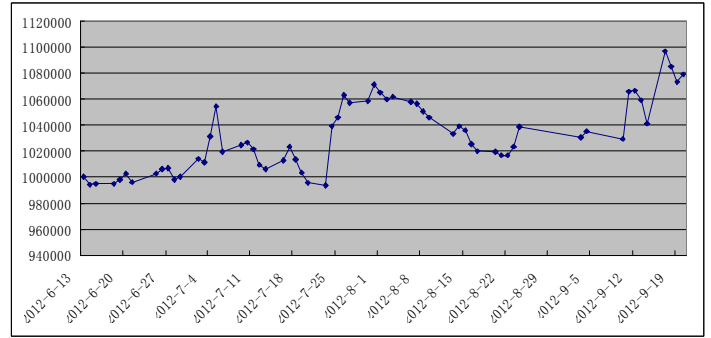
长宏一号:

模型展示第二阶段从2012年6月13日开始, 展示期初始权益1, 000, 000;
截至2012年9月20日, 浮动盈利65580元, 总资产1078990元。

图表1: 交易明细

| 序 | 商品 | 买/卖 | 开/平 | 价格 | 数量 | 盈利 | 成交时间 |
|-----|---------|-----|-----|-------|----|-------|----------------|
| 728 | PTA1301 | 卖 | 平 | 7718 | 3 | | 14:30:02 09/20 |
| 727 | 玉米1301 | 买 | 开 | 2370 | 10 | | 13:30:13 09/20 |
| 726 | 沪铜1211 | 卖 | 开 | 59790 | 1 | | 10:45:14 09/20 |
| 725 | 沪铜1211 | 卖 | 平 | 59740 | 1 | | 10:30:20 09/20 |
| 724 | 沪铜1211 | 买 | 开 | 60160 | 1 | -2100 | 09:15:03 09/20 |
| 723 | 沪铜1211 | 卖 | 平 | 60020 | 1 | | 09:00:11 09/20 |

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 |
|--------|----|-------|----|-----|--------|-------|
| 橡胶1301 | 1 | 21825 | 1 | 买 | 20550 | 34920 |
| 沪铜1301 | 1 | 54970 | 1 | 买 | 21700 | 43976 |
| 塑料1301 | 6 | 9975 | 6 | 买 | 21150 | 47880 |
| 沪锌1211 | 4 | 14785 | 4 | 买 | 13500 | 47312 |
| 豆粕1301 | 8 | 4270 | 8 | 买 | -18640 | 54656 |
| 豆油1301 | 3 | 10058 | 3 | 卖 | 6240 | 48279 |
| 郑棉1301 | 2 | 19695 | 2 | 买 | 850 | 31512 |
| 白糖1301 | 4 | 5388 | 4 | 卖 | -1520 | 34483 |
| 沪铜1211 | 1 | 59790 | 1 | 卖 | 1950 | 47832 |
| 玉米1301 | 10 | 2370 | 10 | 买 | -200 | 37920 |

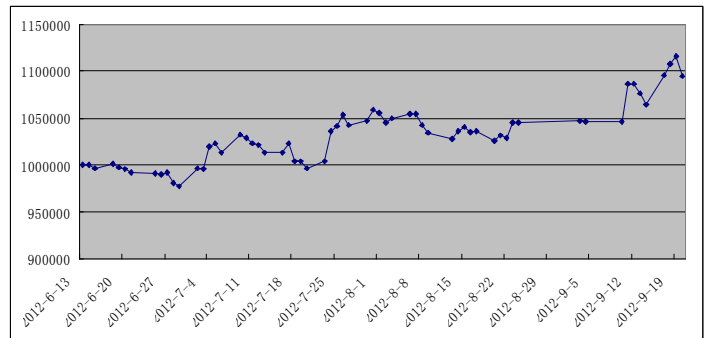
长宏二号:

模型展示从2012年6月13日开始, 展示期初始权益1, 000, 000;
截至2012年9月20日, 浮动盈利34000元, 总资产1095204元。

图表4: 交易明细

| 序 | 商品 | 买/卖 | 开/平 | 价格 | 数量 | 盈利 | 成交时间 |
|-----|---------|-----|-----|-------|----|----|----------------|
| 484 | 沪铜1211 | 卖 | 开 | 59800 | 1 | | 10:46:57 09/20 |
| 483 | 沪铜1211 | 卖 | 平 | 59790 | 1 | | 10:45:14 09/20 |
| 482 | 橡胶1301 | 卖 | 开 | 24020 | 1 | | 10:30:16 09/20 |
| 481 | 螺纹钢1301 | 卖 | 开 | 3527 | 5 | | 10:30:12 09/20 |
| 480 | 橡胶1301 | 卖 | 平 | 24030 | 1 | | 10:30:10 09/20 |
| 479 | 螺纹钢1301 | 卖 | 平 | 3527 | 5 | | 10:30:09 09/20 |
| 478 | 沪锌1211 | 卖 | 开 | 15600 | 4 | | 09:16:29 09/20 |
| 477 | 沪锌1211 | 卖 | 平 | 15600 | 4 | | 09:16:19 09/20 |
| 476 | 塑料1301 | 卖 | 开 | 10740 | 6 | | 09:15:03 09/20 |
| 475 | 塑料1301 | 卖 | 平 | 10740 | 6 | | 09:15:03 09/20 |
| 474 | 玉米1301 | 买 | 开 | 2359 | 10 | | 09:15:03 09/20 |
| 473 | 玉米1301 | 买 | 平 | 2359 | 10 | | 09:15:01 09/20 |

图表5: 资金权益变化曲线图



图表6: 持仓情况

| 商品 | 数量 | 均价 | 可平 | 买/卖 | 盈亏 | 保证金 |
|---------|----|-------|----|-----|-------|-------|
| 豆粕1301 | 8 | 4188 | 8 | 卖 | 12080 | 53607 |
| 白糖1301 | 4 | 5459 | 4 | 买 | -1320 | 34938 |
| 郑棉1301 | 2 | 19565 | 2 | 买 | 2150 | 31304 |
| 豆油1301 | 3 | 10058 | 3 | 卖 | 6240 | 48279 |
| PTA1301 | 3 | 7968 | 3 | 卖 | 3750 | 19123 |
| 玉米1301 | 10 | 2359 | 10 | 买 | 900 | 37744 |
| 塑料1301 | 6 | 10740 | 6 | 卖 | 1800 | 51552 |
| 沪锌1211 | 4 | 15600 | 4 | 卖 | 2800 | 49920 |
| 螺纹钢1301 | 5 | 3527 | 5 | 卖 | 2200 | 28216 |
| 橡胶1301 | 1 | 24020 | 1 | 卖 | 1400 | 38432 |
| 沪铜1211 | 1 | 59800 | 1 | 卖 | 2000 | 47840 |

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：重庆市江北区观音桥朗晴广场 B 塔 8-2、8-3 号

电话：023-67917658

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>