

新纪元期货程序化交易——期指“闪耀”系列介绍及统计检验

模型品种:

闪耀系列——2.1版、4.1版、5.1版

说明:

“闪耀”程序化交易系列，取义于市场异常波动所闪现出来的交易机会，应用于沪深 300 指数期货的日内交易，使用 15 分钟、5 分钟图表，收盘前自动离场，适用于具有一定资金规模的短线交易者，不同版本之间主要是离场策略的差别，不代表优劣差别，可综合或独立使用。

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

“闪耀”系列系统介绍及统计检验展示

一、 系统介绍

“闪耀”程序化交易系列，取义于市场异常波动所闪现出来的交易机会。应用于沪深 300 指数期货的日内交易，使用 15 分钟、5 分钟图表，收盘前自动离场，适用于具有一定资金规模的短线交易者，不同版本之间主要是离场策略的差别，不代表优劣差别，可综合或独立使用。

经过统计检验，沪深 300 股指期货蕴含较多的短线机会，虽然相较于橡胶等商品，其日内各级别（比如 1 日、1 小时或 5 分钟等等）的绝对波动性并不算最大，但考虑到交易成本、最小波动价位的因素，其可利用的波动更多，例如股指的最小波动价位为 0.2 点，按照股指日波动 50 个点计算，波动行程为 250(50/0.2)，而橡胶最小波动价位为 5 元，按照主力合约日波动 600 元计算，波动行程只有 120(600/5)，不足股指期货的二分之一。这客观上为我们提供了较多的短线交易条件。

其次，股指期货上市时间相对较短，股票现货市场的 T+1 交易、融资融券制度不成熟等等因素造成其有效性较低，价格发现较为迟缓，机会相对更多也更稳定，“闪耀”系列正是利用股指期货其中一些统计性规律所开发的一款程序化交易模型。通过后面对比可以发现，其总体表现异常稳定，收益水平相对较高，风险可控程度很高。

需要说明的时，应用过程中，每日把模型加载到主力合约以及切换到当时的主力合约是手工完成的，日内交易完全自动，交易过程中不要运行其他程序，以免造成不必要的资源或程序冲突，最好有人工监控，以免掉线、死机等造成损失。

以下是“闪耀”模型统计在**股指期货主力合约**上检验结果汇总。

15 分钟 K 线图（初始资金 50 万）:

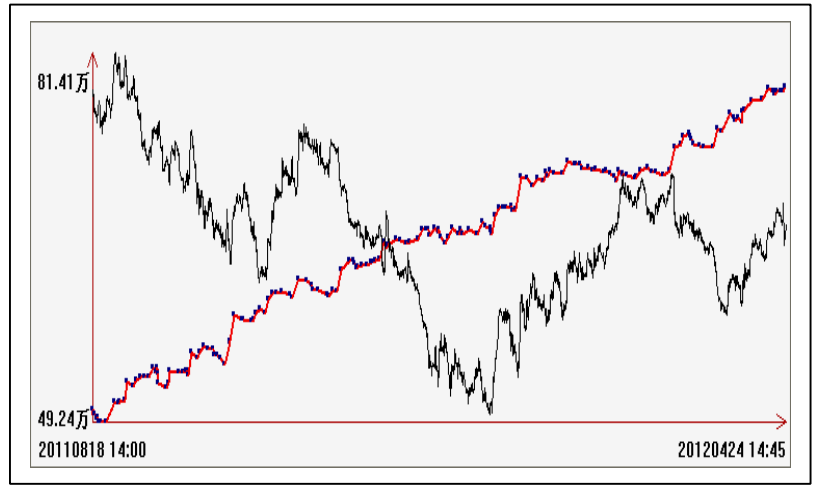
版本/策略	测试时间	盈利	胜率	盈亏比	最大回撤	交易次数
2.1 /双向	2011/8/17-2012/4/26	62.83%	54.49%	1.85	3.58%	178
2.1 /只多	2011/8/17-2012/4/26	30.64%	47.52%	2.07	4.44%	101
2.1 /只空	2011/8/17-2012/4/26	24.80%	56.67%	1.51	4.50%	90
4.1 /双向	2011/8/17-2012/4/26	65.64%	54.59%	1.98	3.36%	185
4.1 /只多	2011/8/17-2012/4/26	33.68%	50.96%	2.06	4.65%	104
4.1 /只空	2011/8/17-2012/4/26	22.93%	52.75%	1.74	3.84%	91
5.1 /双向	2011/8/17-2012/4/26	65.92%	54.70%	1.95	3.15%	181
5.1 /只多	2011/8/17-2012/4/26	35.56%	50.50%	2.10	4.03%	101
5.1 /只空	2011/8/17-2012/4/26	21.66%	52.75%	1.68	4.90%	91

备注：“盈亏比”按照每笔平均收益/平均亏损计算。

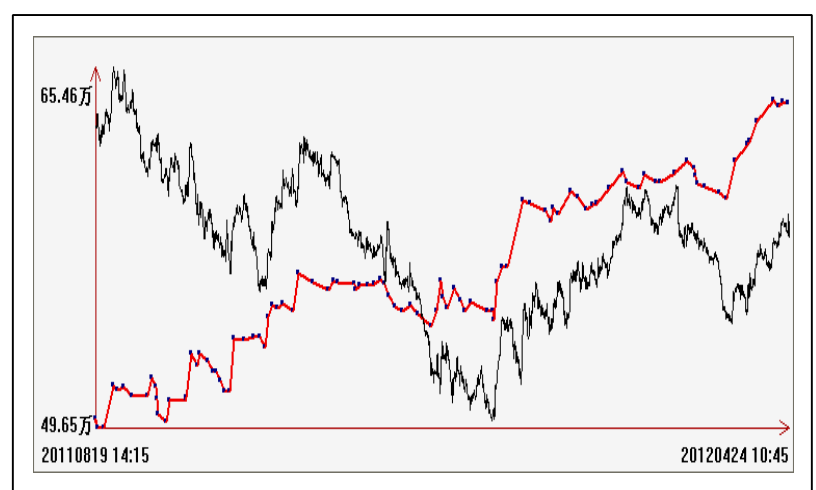
二、 统计检验展示

股指期货 15 分钟

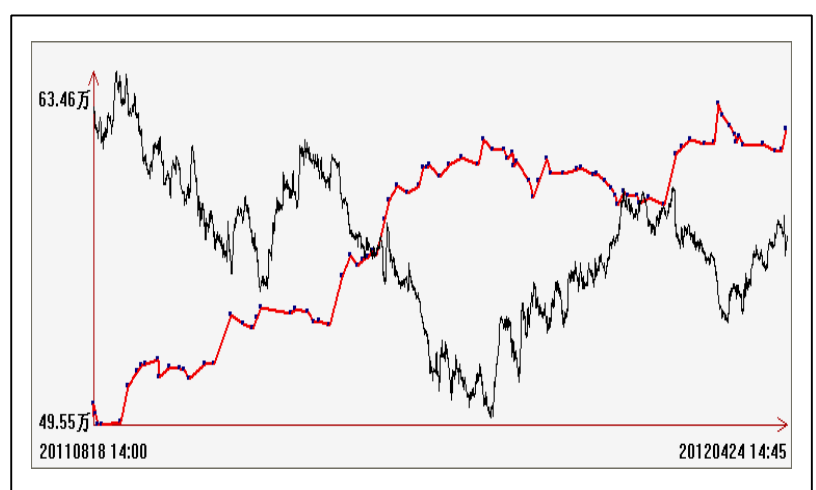
闪耀 2.1 /双向	
测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	814140
最大回撤	3.58%
最大连续亏损次数	5
盈利率	62.83%
胜率	54.49%
平均盈利/平均亏损	4876/2634
总交易次数	178
总手续费/单手续费	16598/0.06%



闪耀 2.1 /只多不空	
测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	653183
最大回撤	4.44%
最大连续亏损次数	14
盈利率	30.64%
胜率	47.52%
平均盈利/平均亏损	6557/3167
总交易次数	101
总手续费/单手续费	9416/0.06%

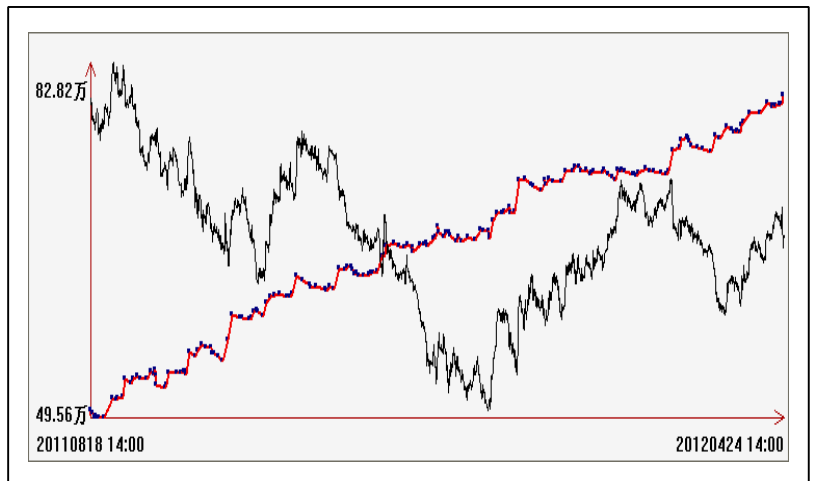


闪耀 2.1 /只空不多	
测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	623989
最大回撤	4.50%
最大连续亏损次数	4
盈利率	24.80%
胜率	56.67%
平均盈利/平均亏损	4645/3067
总交易次数	90
总手续费/单手续费	8380/0.06%



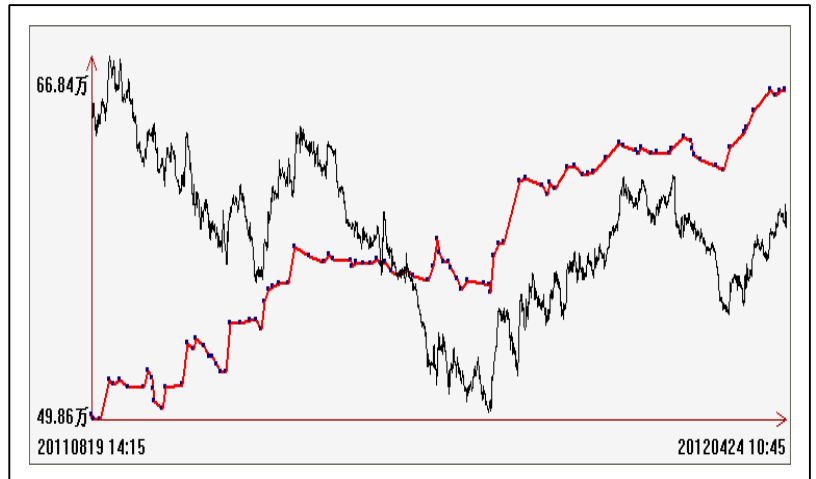
闪耀 4.1 / 双向

测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	828194
最大回撤	3.36%
最大连续亏损次数	6
盈利率	65.64%
胜率	54.59%
平均盈利/平均亏损	4578/2313
总交易次数	185
总手续费/单手手续费	17250/0.06%



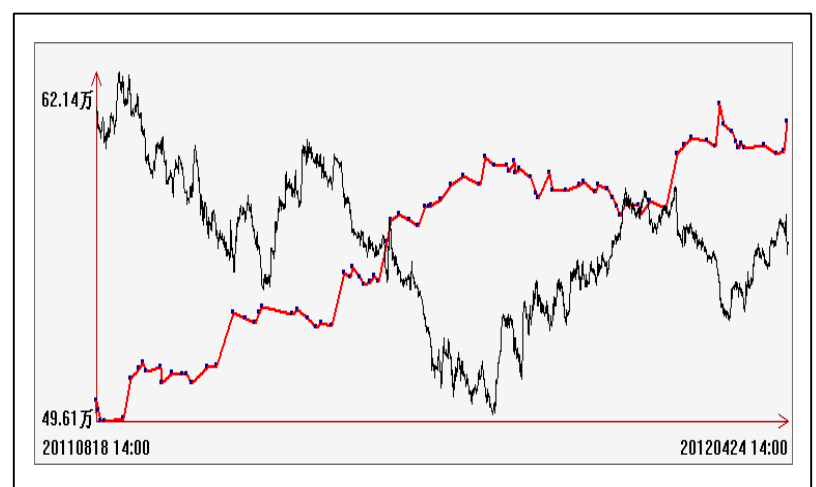
闪耀 4.1 / 只多不空

测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	668384
最大回撤	4.65%
最大连续亏损次数	6
盈利率	33.68%
胜率	50.96%
平均盈利/平均亏损	5598/2723
总交易次数	104
总手续费/单手手续费	9694/0.06%



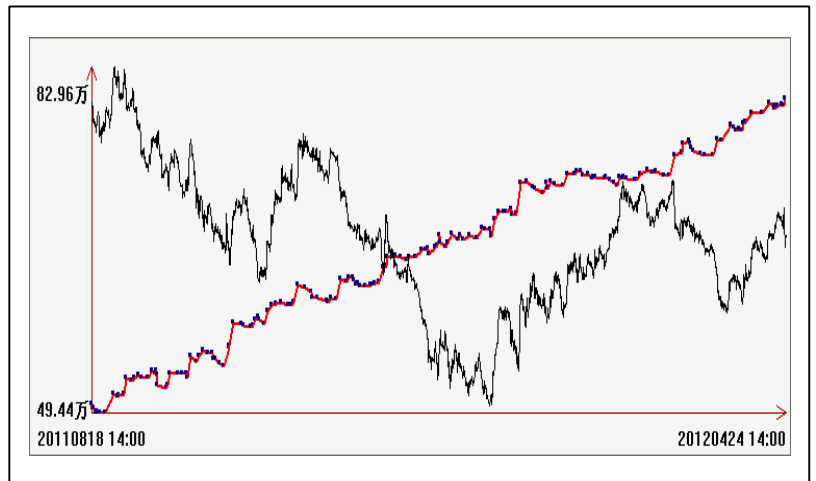
闪耀 4.1 / 只空不多

测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	614671
最大回撤	3.84%
最大连续亏损次数	4
盈利率	22.93%
胜率	52.75%
平均盈利/平均亏损	4724/2720
总交易次数	91
总手续费/单手手续费	8476/0.06%



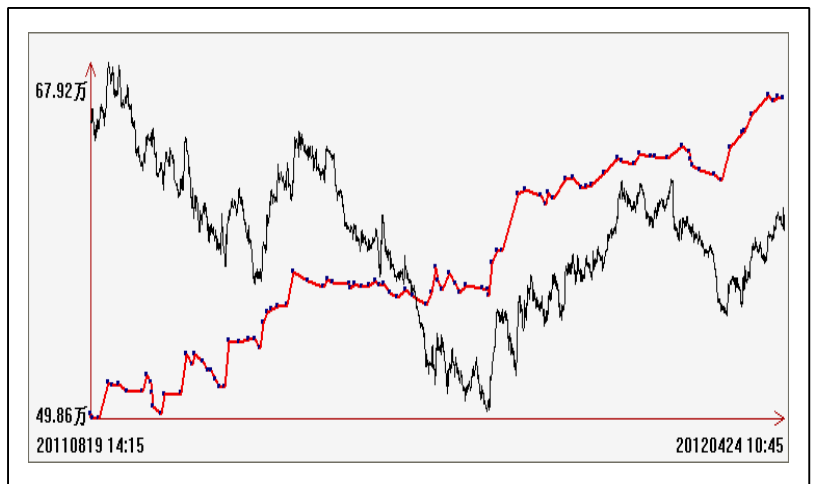
闪耀 5.1 / 双向

测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	829580
最大回撤	3.15%
最大连续亏损次数	5
盈利率	65.92%
胜率	54.70%
平均盈利/平均亏损	4728/2428
总交易次数	181
总手续费/单手续费	16883/0.06%



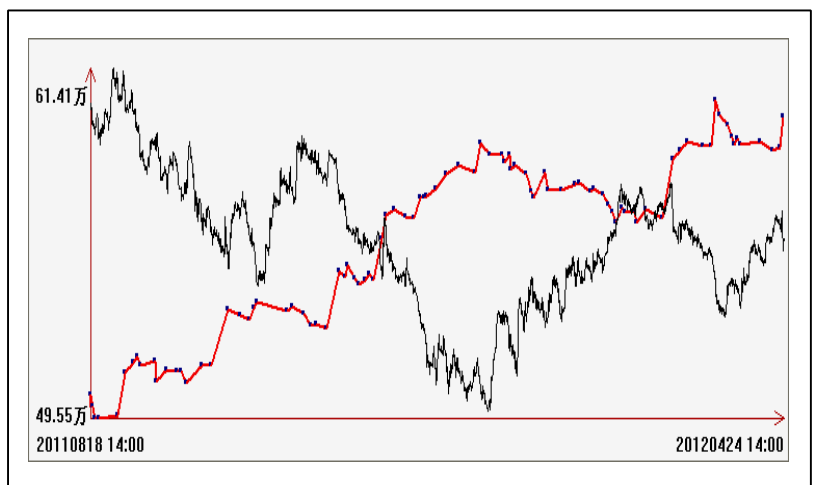
闪耀 5.1 / 只多不空

测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	677781
最大回撤	4.03%
最大连续亏损次数	6
盈利率	35.56%
胜率	50.50%
平均盈利/平均亏损	6058/2881
总交易次数	101
总手续费/单手续费	9417/0.06%



闪耀 5.1 / 只空不多

测试日期	2011/8/17-2012/4/26
初始资金	500000
最终权益	608280
最大回撤	4.90%
最大连续亏损次数	4
盈利率	21.66%
胜率	52.75%
平均盈利/平均亏损	4683/2794
总交易次数	91
总手续费/单手续费	8476/0.06%



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>