

目 录

【人工交易】	2
1. 资金管理	2
2. 当前持仓	2
3. 昨日交易	2
4. 投资绩效	3
【程序化交易—MC】	4
1. 资金管理	4
2. 投资绩效	5
【程序化交易—TB】	10
1. 资金管理	10
2. 投资绩效	11

【人工交易】

1. 资金管理

	总持仓占比上限	总持仓保证金	单手保证金	持仓上限
IF 1305	5%	125000	118350	1.1
螺纹钢 1309	5%	125000	3900	32.1
焦炭 1309	5%	125000	17280	7.2
PTA 1309	10%	250000	4860	51.4
玻璃 1309	5%	125000	3900	32.1
玉米 1309	15%	375000	1722	217.8
棕榈油 1309	5%	125000	6950	18.0
豆粕 1309	5%	125000	2961	42.2
橡胶 1309	5%	125000	35100	3.6
铜 1306	5%	125000	35040	3.6
白糖 1309	5%	125000	5600	22.3
豆油 1309	5%	125000	8200	15.2
塑料 1309	5%	125000	5675	22.0
小麦 1309	5%	125000	2600	48.1

2. 当前持仓

合约	方向	开仓均价	收盘价	持仓量	价格%	乘数	保证金率	保证金	持仓比例	浮动盈亏(逐笔)
rb1410	多	3369	3369	40	0.00%	10	11%	148236	4.49%	0.00
me1409	空	2769	2686	12	-3.00%	50	13%	209508	6.35%	49,800.00
sr1501	多	5177	5118	20	-1.14%	10	10%	102360	3.10%	-11,800.00
p1409	多	6074	6112	20	0.63%	10	10%	122240	3.70%	7,600.00
I1409	空	811	812	10	0.12%	100	9%	73080	2.21%	-1,000.00
m1501	多	3299	3295	10	-0.12%	10	9%	29655	0.90%	-400.00

注：表中浮动盈亏是逐笔按收盘价计算

3. 昨日交易

委托号	合约	买卖	开平	成交手数	成交价格	交易编码	席位号	系统号	成交号	成交时间	投保	交易所	币种
717	rb1410	买入	开仓	40	3369	0110000359	sfe	231	1398	14:57:54	投机	上海	人民币
716	rb1410	买入	平仓	40	3368	0110000359	sfe	230	1399	14:58:00	投机	上海	人民币
710	j1409	买入	平仓	8	1267	0110000359	dce	228	1388	14:53:44	投机	大连	人民币
583	IF1404	卖出	平仓	1	2240	00023626	cffex	2030344	1232	14:09:59	投机	中金所	人民币
564	IF1404	买入	开仓	1	2243	00023626	cffex	1926774	1158	13:54:10	投机	中金所	人民币
557	IF1404	卖出	平仓	1	2241	00023626	cffex	1908866	1143	13:52:20	投机	中金所	人民币
504	IF1404	买入	开仓	1	2238.6	00023626	cffex	1814997	1085	13:42:20	投机	中金所	人民币
500	j1409	买入	平今	2	1261	0110000359	dce	169	1076	13:38:08	投机	大连	人民币
476	p1409	卖出	平仓	20	6120	0110000359	dce	166	1042	13:33:41	投机	大连	人民币
124	m1501	买入	开仓	10	3299	0110000359	dce	77	230	09:37:25	投机	大连	人民币
104	p1409	买入	开仓	20	6074	0110000359	dce	68	86	09:30:34	投机	大连	人民币
11	j1409	卖出	开仓	2	1253	0110000359	dce	8	5	09:04:54	投机	大连	人民币

4. 投资绩效

日期	初始资金	帐户权益	平仓盈亏	浮动盈亏	日收益率	总收益率	风险度	手续费	隔夜持仓率	最大回撤
2014/3/31	2610065	3,552,013.91	-26,240.00	73,300.00	1.32%	36.09%	43.97%	619.59	3.58	-26.77%
2014/4/1	2610065	3,564,730.16	5,000.00	7,900.00	0.36%	36.58%	42.21%	183.75	3.69	-26.77%
2014/4/2	2610065	3,513,495.88	-41,000.00	-8,600.00	-1.44%	34.61%	40.37%	1634.28	3.31	-26.77%
2014/4/3	2610065	3,413,378.29	-28,600.00	-70,000.00	-2.85%	30.78%	52.14%	1517.59	4.02	-26.77%
2014/4/4	2610065	3,418,889.67	-13,200.00	19,900.00	0.16%	30.99%	54.96%	1188.62	4.46	-26.77%
2014/4/8	2610065	3,352,792.59	-32,000.00	-33,100.00	-1.93%	28.46%	53.66%	997.08	4.39	-26.77%
2014/4/9	2610065	3,271,846.19	-89,550.00	9,400.00	-2.41%	25.35%	27.15%	796.4	2.37	-26.77%
2014/4/10	2610065	3,291,905.46	-18,400.00	38,700.00	0.61%	26.12%	26.70%	240.73	2.34	-26.77%
2014/4/11	2610065	3,251,590.70	-13,200.00	-26,300.00	-1.22%	24.58%	31.84%	814.76	2.73	-26.77%
2014/4/14	2610065	3,289,718.95	2,900.00	36,000.00	1.17%	26.04%	20.77%	771.75	2.62	-26.77%
2014/4/15	2610065	3,277,394.27				25.57%				-26.77%

注：本日无结算单数据



注：表中浮动盈亏是按模拟交易系统的逐日盯市账单。

【程序化交易—MC】

1. 资金管理

手续费：35 元每笔（MC），合同金额万分之五（TC）

1) HG 模型 资金 100W

HG 同时持仓不超过 4 手，占用保证金比例约 50%；因为很好的设置了止损点位，4 笔单子损失点数共计不超过 5N(N:真实波动范围)，考虑上滑点及手续费共计约 7000 元，占总体资金的 0.7%。

2) Vol 模型 资金 100W

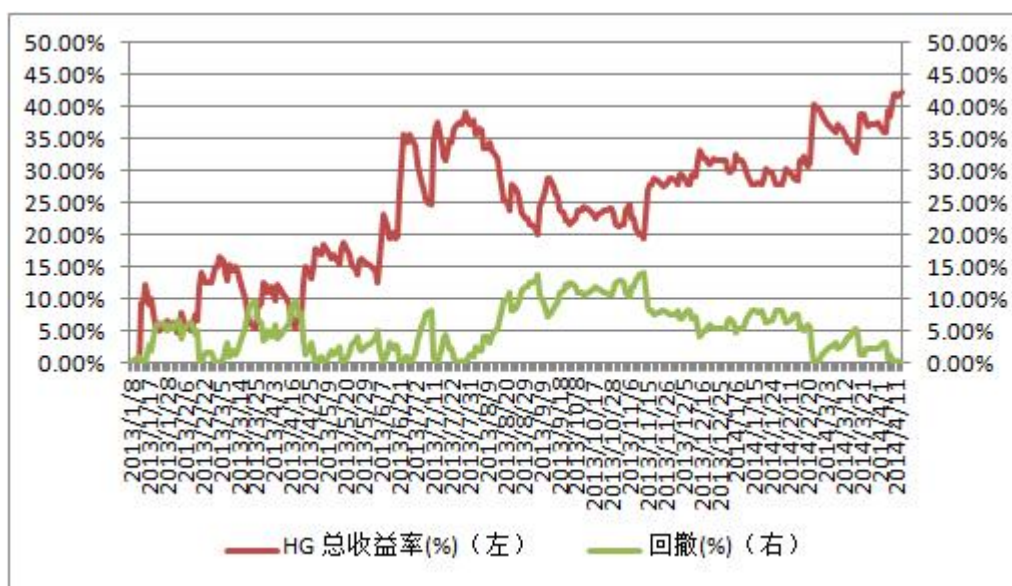
Vol 同时持仓不超过 4 手，占用保证金比例约 50%；止损较小。

跳空风险：当投资者持单过夜，第 2 天跳空的方向和手中单子方向相反，会导致超过平均值的损失。但是但从长时间来看，第 2 天跳空的方向与手中单子方向相同和相反概率基本相同。也就是说损失和收益基本持平。

2. 投资绩效

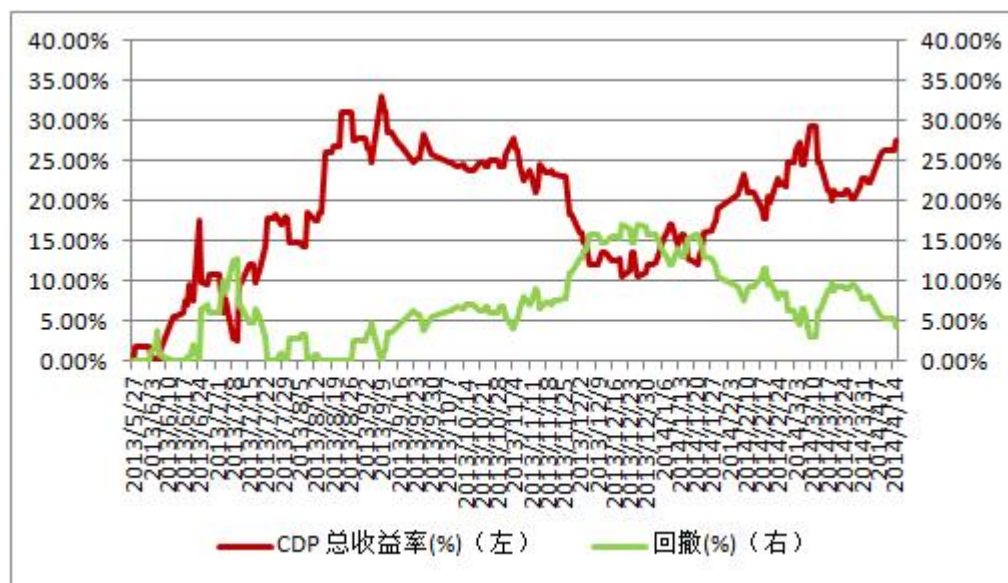
1) HG 模型 (自从 2013.1.8)

HG	初始资金	交易次数	获胜次数	胜率(%)	隔夜仓位	当日浮盈	当日盈亏	盘后资金	手续费	日收益率(%)	HG 总收益率(%)	修正值	账户权益	回撤(%) (右)	回撤值
2014/3/24	1,387,160	0	0	0.00	0	0	0	1,387,160	0.00	0.00	38.72%	0	1,381,783.43	1.17%	-16,360
2014/3/25	1,387,160	8	0	0.00	0	0	-12680	1,374,480	519.56	-0.91	37.45%	-40.44	1,369,143.87	2.07%	-29,040
2014/3/26	1,374,480	3	0	0.00	0	0	-3510	1,370,970	193.20	-0.26	37.10%	-16.8	1,365,650.67	2.32%	-32,550
2014/3/27	1,370,970	17	9	52.94	0	0	2410	1,373,380	1097.53	0.18	37.34%	-92.47	1,368,153.14	2.15%	-30,140
2014/3/28	1,373,380	0	0	0.00	0	0	0	1,373,380	0.00	0.00	37.34%	0	1,368,153.14	2.15%	-30,140
2014/3/31	1,373,380	6	4	66.67	0	0	-1980	1,371,400	386.08	-0.14	37.14%	-33.92	1,366,207.06	2.29%	-32,120
2014/4/1	1,371,400	4	4	100.00	0	0	3020	1,374,420	259.66	0.22	37.44%	-20.34	1,369,247.40	2.07%	-29,100
2014/4/2	1,374,420	3	0	0.00	0	0	-4170	1,370,250	195.73	-0.30	37.03%	-14.27	1,365,091.67	2.37%	-33,270
2014/4/3	1,370,250	14	4	28.57	0	0	-11360	1,358,890	914.93	-0.83	35.89%	-65.07	1,353,796.74	3.18%	-44,630
2014/4/4	1,358,890	8	4	50.00	4	2020	100	1,361,010	520.02	0.16	36.10%	-39.98	1,355,956.72	3.03%	-42,510
2014/4/8	1,361,010	14	8	57.14	0	0	33480	1,394,490	927.30	2.46	39.45%	-52.7	1,389,489.42	0.64%	-9,030
2014/4/9	1,394,490	9	0	0.00	1	0	-8010	1,386,480	608.07	-0.57	38.65%	-21.93	1,381,501.35	1.21%	-17,040
2014/4/10	1,386,480	12	4	33.33	0	0	33060	1,419,540	810.64	2.38	41.95%	-29.36	1,414,590.71	0.00%	0
2014/4/11	1,419,540	0	0	0.00	0	0	0	1,419,540	0.00	0.00	41.95%	0	1,414,590.71	0.00%	0
2014/4/14	1,419,540	2	0	0.00	0	0	-2480	1,417,060	135.78	-0.17	41.71%	-4.22	1,412,114.93	0.17%	-2,480
2014/4/15	1,417,060	12	5	41.67	0	0	6480	1,423,540	807.29	0.46	42.35%	-32.71	1,418,627.64	0.00%	0



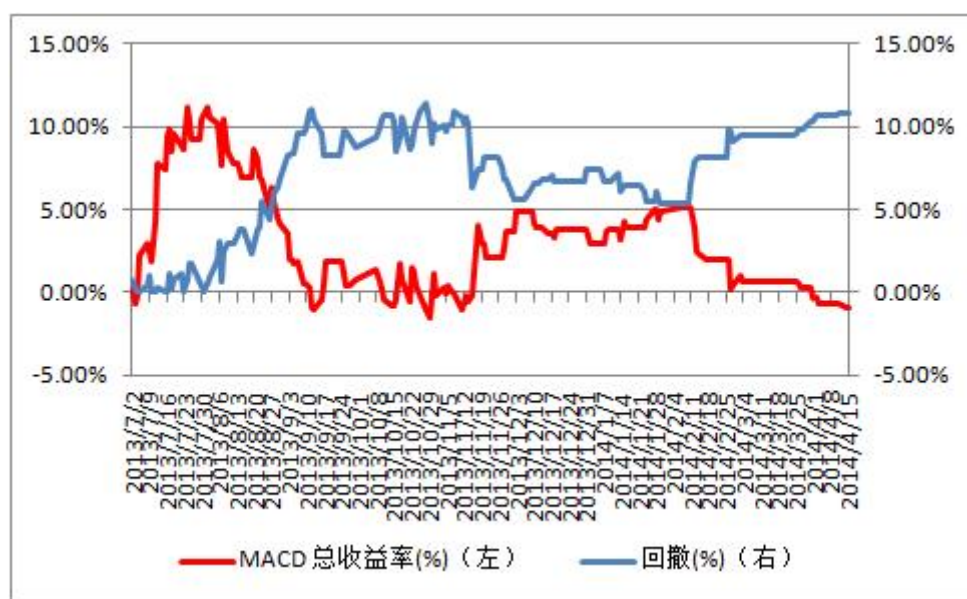
2) CDP 模型 (自从 2013.5.27)

CDP	初始资金	交易次数	获胜次数	胜率(%)	隔夜仓位	当日浮亏	当日盈亏	盘后资金	手续费	日收益率(CDP)	总收益率(%) (修正值)	账户权益	回撤(%) (回撤值)	
2014/3/24	1,207,430	0	0	0.00	0	0	0	1,207,430	0.00	0.00	20.74%	0.00	1,206,186.30	9.31% -123,940
2014/3/25	1,207,430	2	2	100.00	0	0	4900	1,212,330	129.58	0.41	21.23%	-10.42	1,213,096.72	8.94% -119,040
2014/3/26	1,212,330	0	0	0.00	0	0	0	1,212,330	0.00	0.00	21.23%	0.00	1,213,096.72	8.94% -119,040
2014/3/27	1,212,330	13	3	23.08	0	0	-8950	1,203,380	837.11	-0.74	20.34%	-72.89	1,204,219.61	9.61% -127,990
2014/3/28	1,203,380	0	0	0.00	0	0	0	1,203,380	0.00	0.00	20.34%	0.00	1,204,219.61	9.61% -127,990
2014/3/31	1,203,380	4	4	100.00	0	0	13640	1,217,020	257.95	1.13	21.70%	-22.05	1,217,881.66	8.59% -114,350
2014/4/1	1,217,020	4	4	100.00	0	0	9740	1,226,760	259.22	0.80	22.68%	-20.78	1,227,642.44	7.86% -104,610
2014/4/2	1,226,760	4	4	100.00	0	0	1820	1,228,580	260.19	0.15	22.86%	-19.81	1,229,482.25	7.72% -102,790
2014/4/3	1,228,580	6	2	33.33	0	0	-5040	1,223,540	392.35	-0.41	22.35%	-27.65	1,224,469.90	8.10% -107,830
2014/4/4	1,223,540	0	0	0.00	0	0	0	1,223,540	0.00	0.00	22.35%	0.00	1,224,469.90	8.10% -107,830
2014/4/8	1,223,540	4	4	100.00	0	0	32240	1,255,780	267.58	2.63	25.58%	-12.42	1,256,722.32	5.68% -75,590
2014/4/9	1,255,780	3	3	100.00	0	0	4170	1,259,950	201.98	0.33	26.00%	-8.02	1,260,900.34	5.36% -71,420
2014/4/10	1,259,950	4	3	75.00	0	0	2060	1,262,010	272.96	0.16	26.20%	-7.04	1,262,967.38	5.21% -69,360
2014/4/11	1,262,010	0	0	0.00	0	0	0	1,262,010	0.00	0.00	26.20%	0.00	1,262,967.38	5.21% -69,360
2014/4/14	1,262,010	0	0	0.00	0	0	0	1,262,010	0.00	0.00	26.20%	0.00	1,262,967.38	5.21% -69,360
2014/4/15	1,262,010	4	4	100.00	0	0	12920	1,274,930	268.76	1.02	27.49%	-11.24	1,275,898.62	4.24% -56,440
		899	384	42.71					61,961.38					



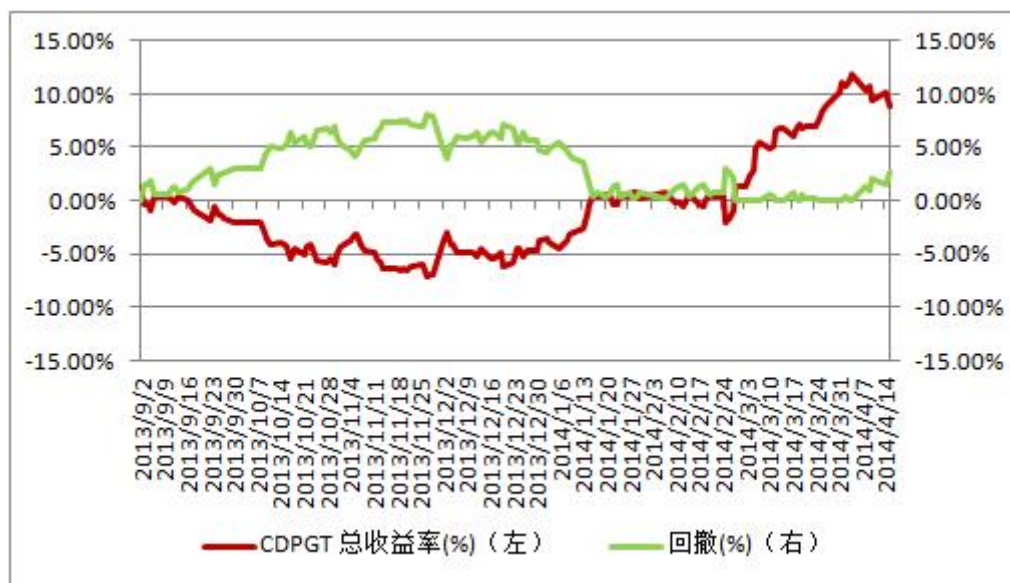
3) MACD 模型 (自从 2013.7.1)

MACD	初始资金	交易次数	获胜次数	胜率(%)	隔夜仓位	当日浮亏	当日盈亏	盘后资金	手续费	日收益率(%)	MACD 总收益率(%)	修正值	账户权益	回撤(%) (回撤值)
2014/3/24	1,006,220	0	0	0.00	0	0	0	1,006,220	0.00	0.00	0.62%	0.00	1,006,284.93	9.47% -105,315
2014/3/25	1,006,220	4	2	50.00	0	0	-820	1,005,400	258.65	-0.08	0.54%	-21.35	1,005,486.28	9.55% -106,135
2014/3/26	1,005,400	2	0	0.00	0	0	-3080	1,002,320	129.66	-0.31	0.23%	-10.34	1,002,416.62	9.83% -109,215
2014/3/27	1,002,320	0	0	0.00	0	0	0	1,002,320	0.00	0.00	0.23%	0.00	1,002,416.62	9.83% -109,215
2014/3/28	1,002,320	0	0	0.00	0	0	0	1,002,320	0.00	0.00	0.23%	0.00	1,002,416.62	9.83% -109,215
2014/3/31	1,002,320	2	0	0.00	0	0	-5300	997,020	129.23	-0.53	-0.30%	-10.77	997,127.39	10.30% -114,515
2014/4/1	997,020	0	0	0.00	0	0	0	997,020	0.00	0.00	-0.30%	0.00	997,127.39	10.30% -114,515
2014/4/2	997,020	2	0	0.00	0	0	-3860	993,160	129.73	-0.39	-0.68%	-10.27	993,277.66	10.65% -118,375
2014/4/3	993,160	0	0	0.00	0	0	0	993,160	0.00	0.00	-0.68%	0.00	993,277.66	10.65% -118,375
2014/4/4	993,160	0	0	0.00	0	0	0	993,160	0.00	0.00	-0.68%	0.00	993,277.66	10.65% -118,375
2014/4/8	993,160	0	0	0.00	0	0	0	993,160	0.00	0.00	-0.68%	0.00	993,277.66	10.65% -118,375
2014/4/9	993,160	0	0	0.00	0	0	0	993,160	0.00	0.00	-0.68%	0.00	993,277.66	10.65% -118,375
2014/4/10	993,160	0	0	0.00	0	0	0	993,160	0.00	0.00	-0.68%	0.00	993,277.66	10.65% -118,375
2014/4/11	993,160	2	1	50.00	0	0	-1940	991,220	136.45	-0.20	-0.88%	-3.55	991,341.21	10.82% -120,315
2014/4/14	991,220	0	0	0.00	0	0	0	991,220	0.00	0.00	-0.88%	0.00	991,341.21	10.82% -120,315
2014/4/15	991,220	0	0	0.00	0	0	0	991,220	0.00	0.00	-0.88%	0.00	991,341.21	10.82% -120,315
		397	134	33.75					27668.79					



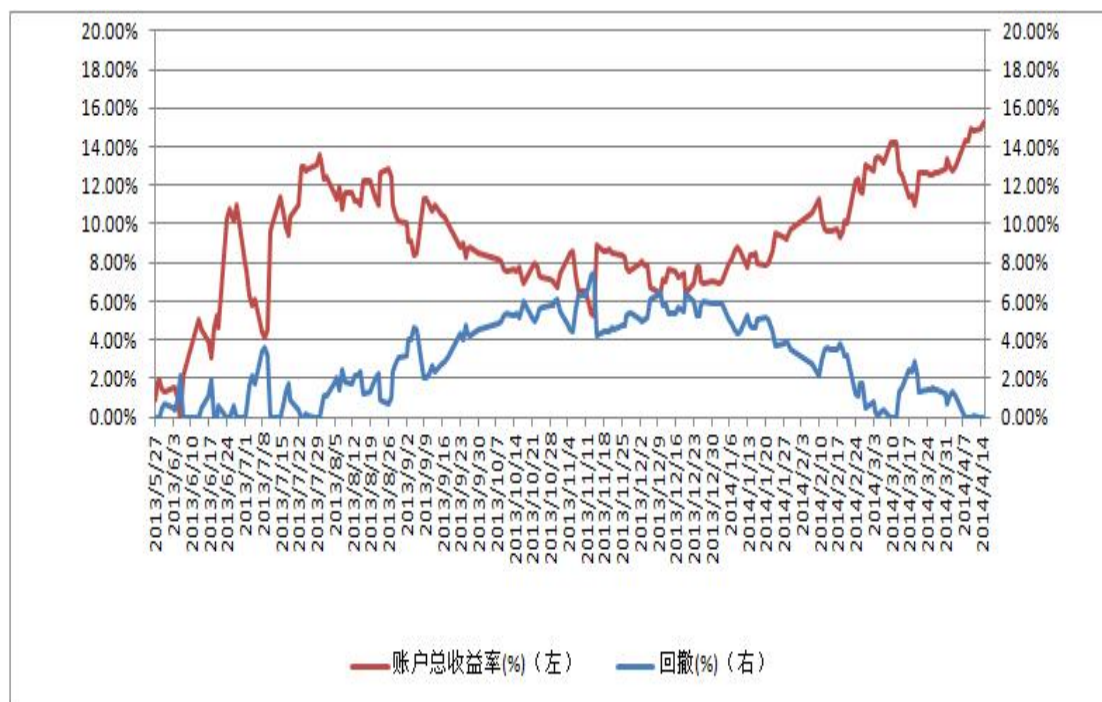
4) CDPGT 模型 (自从 2013.9.2)

CDPGT	初始资金	交易次数	获胜次数	胜率(%)	隔夜仓位	当日浮亏	当日盈亏	盘后资金	手续费	日收益率(CDPGT)	总收益率(%)	修正值	账户权益	回撤(%)	回撤值
2014/3/24	1,069,240	0	0	0.00	0	0	0	1,069,240	0.00	0.00	6.92%	0.00	1,069,230.79	0.28%	-2,960
2014/3/25	1,069,240	3	2	66.67	0	0	8490	1,077,730	193.97	0.79	7.77%	-16.03	1,077,736.82	0.00%	0
2014/3/26	1,077,730	2	2	100.00	0	0	4900	1,082,630	129.28	0.45	8.26%	-10.72	1,082,647.54	0.00%	0
2014/3/27	1,082,630	9	4	44.44	0	0	5850	1,088,480	578.62	0.54	8.85%	-51.38	1,088,548.92	0.00%	0
2014/3/28	1,088,480	1	1	100.00	0	0	3890	1,092,370	64.54	0.36	9.24%	-5.46	1,092,444.38	0.00%	0
2014/3/31	1,092,370	4	3	75.00	0	0	9260	1,101,630	257.62	0.85	10.16%	-22.38	1,101,726.76	0.00%	0
2014/4/1	1,101,630	3	2	66.67	0	0	8850	1,110,480	194.04	0.80	11.05%	-15.96	1,110,592.72	0.00%	0
2014/4/2	1,110,480	1	0	0.00	0	0	-3850	1,106,630	65.06	-0.35	10.66%	-4.94	1,106,747.66	0.35%	-3,850
2014/4/3	1,106,630	4	3	75.00	0	0	5480	1,112,110	260.71	0.50	11.21%	-19.29	1,112,246.95	0.00%	0
2014/4/4	1,112,110	3	2	66.67	0	0	6270	1,118,380	195.55	0.56	11.84%	-14.45	1,118,531.40	0.00%	0
2014/4/8	1,118,380	2	0	0.00	0	0	-15380	1,103,000	132.88	-1.38	10.30%	-7.12	1,103,158.52	1.38%	-15,380
2014/4/9	1,103,000	1	1	100.00	0	0	4790	1,107,790	67.45	0.43	10.78%	-2.55	1,107,951.07	0.95%	-10,590
2014/4/10	1,107,790	4	1	25.00	0	0	-13480	1,094,310	272.02	-1.22	9.43%	-7.98	1,094,479.05	2.15%	-24,070
2014/4/11	1,094,310	1	1	100.00	0	0	1970	1,096,280	68.21	0.18	9.63%	-1.79	1,096,450.84	1.98%	-22,100
2014/4/14	1,096,280	3	2	66.67	0	0	5970	1,102,250	204.38	0.54	10.23%	-5.62	1,102,426.46	1.44%	-16,130
2014/4/15	1,102,250	3	0	0.00	0	0	-14070	1,088,180	202.49	-1.28	8.82%	-7.51	1,088,363.97	2.70%	-30,200
		422	233	55.21					29,356.03						



5) 4 个模型汇总

总账户	初始资金	交易次数	获胜次	胜率(%)	隔夜仓位	当日浮亏	当日盈亏	盘后资金	手续费	日收益	账户总资产	修正值	账户权益	回撤(%) (右)	回撤值
2014/3/24	4,507,320	2	1	50.00	0	0	-2,420	4,504,900	128.93	-0.05	12.62%	-11.07	4,498,169.88	1.41%	-65,340
2014/3/25	4,504,900	20	7	35.00	0	0	-2,480	4,502,420	1,296.12	-0.06	12.56%	-103.88	4,495,793.76	1.46%	-67,820
2014/3/26	4,502,420	8	2	25.00	0	0	-1,760	4,500,660	516.75	-0.04	12.52%	-43.25	4,494,077.01	1.50%	-69,580
2014/3/27	4,500,660	42	17	40.48	0	0	6,060	4,506,720	2,706.78	0.13	12.67%	-233.22	4,500,370.23	1.36%	-63,520
2014/3/28	4,506,720	4	2	50.00	0	0	-820	4,505,900	258.34	-0.02	12.65%	-21.66	4,499,571.89	1.38%	-64,340
2014/3/31	4,505,900	19	11	57.89	0	0	6,650	4,512,550	1,224.53	0.15	12.81%	-105.47	4,506,327.36	1.23%	-57,690
2014/4/1	4,512,550	12	11	91.67	0	0	23,100	4,535,650	777.86	0.51	13.39%	-62.14	4,529,489.50	0.72%	-34,590
2014/4/2	4,535,650	12	4	33.33	0	0	-17,460	4,518,190	780.84	-0.38	12.95%	-59.16	4,512,088.66	1.11%	-52,050
2014/4/3	4,518,190	26	10	38.46	0	0	-9,320	4,508,870	1,698.71	-0.21	12.72%	-121.29	4,502,889.95	1.31%	-61,370
2014/4/4	4,508,870	13	7	53.85	4	2,020	8,690	4,519,560	845.92	0.24	12.99%	-64.08	4,513,664.03	1.07%	-50,660
2014/4/8	4,519,560	23	14	60.87	0	0	52,530	4,572,110	1,525.62	1.16	14.30%	-84.38	4,566,278.41	0.00%	0
2014/4/9	4,572,110	14	5	35.71	1	0	1,120	4,573,230	944.88	0.02	14.33%	-35.12	4,567,433.53	0.00%	0
2014/4/10	4,573,230	23	9	39.13	0	0	22,510	4,595,740	1,559.05	0.49	14.89%	-50.95	4,589,994.48	0.00%	0
2014/4/11	4,595,740	5	3	60.00	0	0	-830	4,594,910	341.17	-0.02	14.87%	-8.83	4,589,173.31	0.02%	-830
2014/4/14	4,594,910	6	3	50.00	0	0	4,260	4,599,170	408.29	0.09	14.98%	-11.71	4,593,445.02	0.00%	0
2014/4/15	4,599,170	20	10	50.00	0	0	12,340	4,611,510	1,345.94	0.27	15.29%	-54.06	4,605,839.08	0.00%	0
		5.253	1.742	33.16					373.625.97						



【程序化交易—TB】

1、资金管理

手续费：成交金额的 0.5%%

KC 模型资金：100w

KC 模型最大持仓为 1 手，占用保证金比例为 12%，KC 采用跟踪出场的方法，一般在记录点位的 8 个点以内，所以每笔交易的最大损失为 2400 元，考虑滑点与手续费，最大损失为 3300 元。KC 模型整体属于较为保守的交易策略，但由于参数指标较为敏感，每天交易次数平均达到 17 笔（一买一卖为一笔），迄今为止，KC 模型的最大回撤为 2.4%。

2、投资绩效

KC 模型(2013.6.4 日起)

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P
	初始资金	交易次数	获胜次数	胜率(%)	隔夜仓位	当日浮亏	当日盈亏	动态权益	可用资金	手续费	日收益率(%)	总收益率(%)	回撤(%)	回撤金额	TB 按万分之0.5收手续费
2014/3/26	1138732.81	2	0	0.00%	1	-420	-300	1137915.74		97.07	-0.07%	11.54%	0.81%	9294.04	
2014/3/27	1137315.74	5	3	60.00%	0	0	12240	1149865.7		230.44	1.05%	12.71%	0.00%	0	
2014/3/28	1149865.3	3	2	66.67%	0	0	-660	1149011.47		193.83	-0.07%	12.62%	0.07%	853.83	
2014/3/31	1149011.47	5	1	20.00%	1	-240	-3840	1144641.29		290.18	-0.38%	12.19%	0.45%	5224.01	
2014/4/1	1144641.29	6	1	16.67%	0	0	-7140	1137016.57		484.72	-0.67%	11.45%	1.12%	12848.7	
2014/4/2	1137016.57	5	1	20.00%	1	720	-5640	1131836.6		259.97	-0.46%	10.94%	1.57%	18028.7	
2014/4/3	1131836.6	3	2	66.67%	0	0	6420	1138093.04		163.56	0.55%	11.55%	1.02%	11772.3	
2014/4/4	1138093.04	4	3	75.00%	1	2040	600	1140505.41		227.63	0.21%	11.79%	0.81%	9359.89	
2014/4/8	1140505.41	8	2	25.00%	1	-60	3780	1143758.56		466.85	0.29%	12.11%	0.53%	6106.74	
2014/4/9	1143758.56	3	3	100.00%	1	420	1800	1145843.88		134.68	0.18%	12.31%	0.35%	4021.42	
2014/4/10	1145843.88	6	2	33.33%	0	0	2340	1147812.62		371.26	0.17%	12.51%	0.18%	2052.68	
2014/4/11	1147812.62	2	1	50.00%	0	0	-1980	1145696.16		136.46	-0.18%	12.30%	0.36%	4169.14	
2014/4/14	1145696.16	1	0	0.00%	1	-720	0	1144942.04		34.12	-0.07%	12.22%	0.43%	4923.26	
2014/4/15	1144942.04	4	3	75.00%	0	0	3960	1148665.72		236.32	0.33%	12.59%	0.10%	1199.58	第三组参数

