

《易·大有》“其德刚健而文明，应乎天而时行，是以元亨”

“元亨” 程序化交易策略实盘指导报告

(2014 年 12 月 17 日)

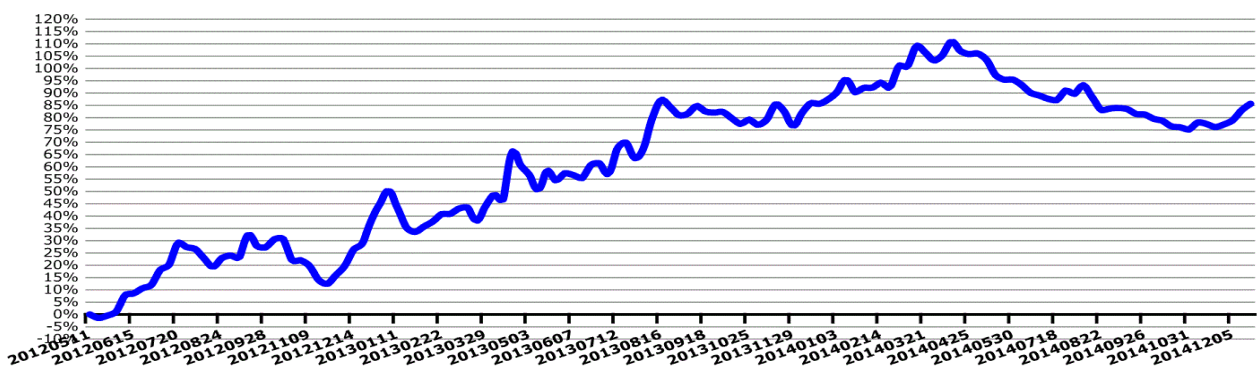
实盘账户：达摩掌 (激进型)

统计起始日期：2012 年 5 月 11 日

| 初始资金 | 中途入金 | 当日权益 | 当日盈利率 | 累积盈利率 | 现有持仓 |
|--------|--------|---------|-------|--------|--------------|
| 200000 | 923994 | 1275196 | 1.74% | 85.62% | 多单：股指 空单： |

注：① 多品种多策略组合。

达摩掌的累积收益曲线
(激进型)



“元亨” 程序化交易策略简介：

“元亨” 程序化交易策略 (以下简称“元亨”) 是国都期货研发的多品种多策略组合型程序化交易策略，该策略历经 3 年多的产品研究和 2 年多的实盘指导，取得了比较理想的成绩，并获得了在 CCTV 证券资讯频道 (166 台) 期货时间节目中的程序化交易展示平台“兵器谱”栏目中长期展示资格，展示账户化名“金刚杵”。

元亨程序化交易策略的基本理念就是“交易资金曲线”。即通过管理资金曲线，在可控风险的基础上实现超额收益。期货交易的核心是风险管理，体现在程序化交易上面就是通过具体的品种、周期、仓位、策略等细节的组合与控制实现对资金曲线的管理。

元亨程序化交易策略总体为趋势跟踪型的组合策略。趋势跟踪型的交易策略是目前国际主流基金普遍采用的交易策略。通过对趋势的跟踪来赚取超额收益，通过不同品种和市场的组合实现对冲风险。