

新纪元期货程序化交易——长宏系列系统介绍及统计检验展示

模型品种:

长宏一号模型

长宏二号模型

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1小时、30分钟等周期上的中线趋势性交易模型。

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

长宏系列系统介绍及统计检验展示

一、 系统介绍

“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1小时、30分钟等周期上的中线趋势性交易模型。

以下是长宏一号、长宏二号模型统计检验结果汇总。

长宏一号

	盈利率 (%)	胜率 (%)	最大回撤 (%)	测试时间	测试周期	推荐度
螺纹钢	102.2	46	10	09.3.27-12.4.11	1小时	★★★
橡胶	200.72	43.97	10	06.3.31-12.4.11	1小时	★★
铜	251.89	43.8	9	06.3.31-12.4.11	1小时	★★★
豆油	161.2	43.75	12	06.3.31-12.4.11	1小时	★★★
白糖	44.2	36.86	21	06.3.31-12.4.11	1小时	★★
大豆	75.72	41.1	23	06.3.31-12.4.11	1小时	★
豆粕	73.52	40.85	15	06.3.31-12.4.11	1小时	★
棉花	157.49	46.89	8	06.3.31-12.4.11	1小时	★★★
塑料	148.68	39.88	12	06.3.31-12.4.11	1小时	★★
PTA	134.83	43.22	13	06.3.31-12.4.11	1小时	★★
锌	141.28	37	18	06.3.31-12.4.11	1小时	★★

长宏二号

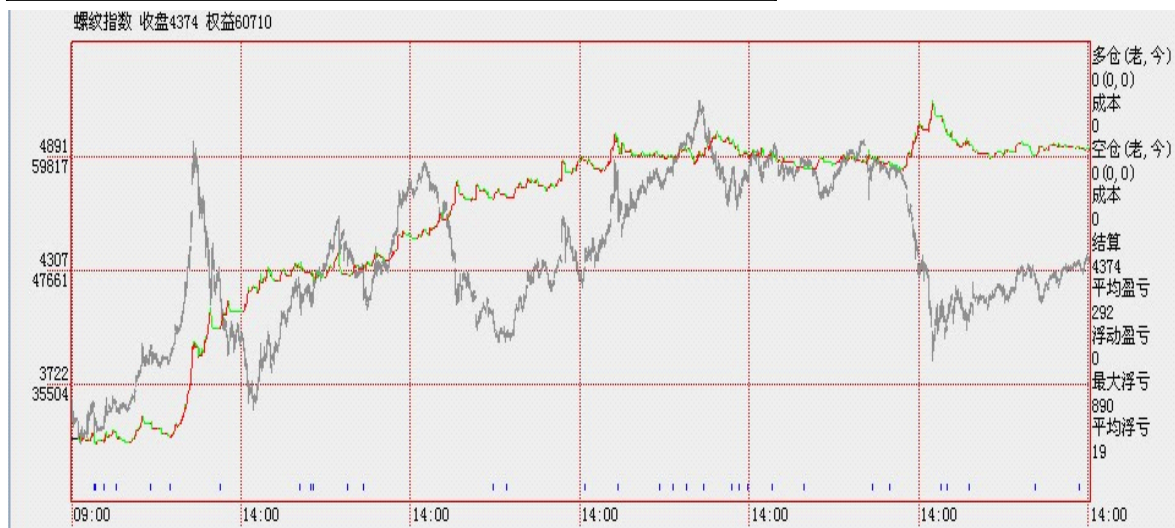
	盈利率 (%)	胜率 (%)	最大回撤 (%)	测试时间	测试周期	推荐度
螺纹钢	127.6	50	13	09.3.27-12.4.11	1小时	★★★
橡胶	162.81	37.65	25	06.3.31-12.4.11	1小时	★
铜	192.47	43.82	22	06.3.31-12.4.11	1小时	★★
豆油	170.63	42.47	26	06.3.31-12.4.11	1小时	★★★
白糖	97.26	38.67	11	06.3.31-12.4.11	1小时	★★
大豆	93.56	38.41	27	06.3.31-12.4.11	1小时	★
豆粕	91.2	45	17	06.3.31-12.4.11	1小时	★
棉花	168.18	42.54	13	06.3.31-12.4.11	1小时	★★★
塑料	203.57	49.09	17	06.3.31-12.4.11	1小时	★★★
PTA	146.44	42.03	20	06.3.31-12.4.11	1小时	★★
锌	86.74	34.46	22	06.3.31-12.4.11	1小时	★

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

长宏一号

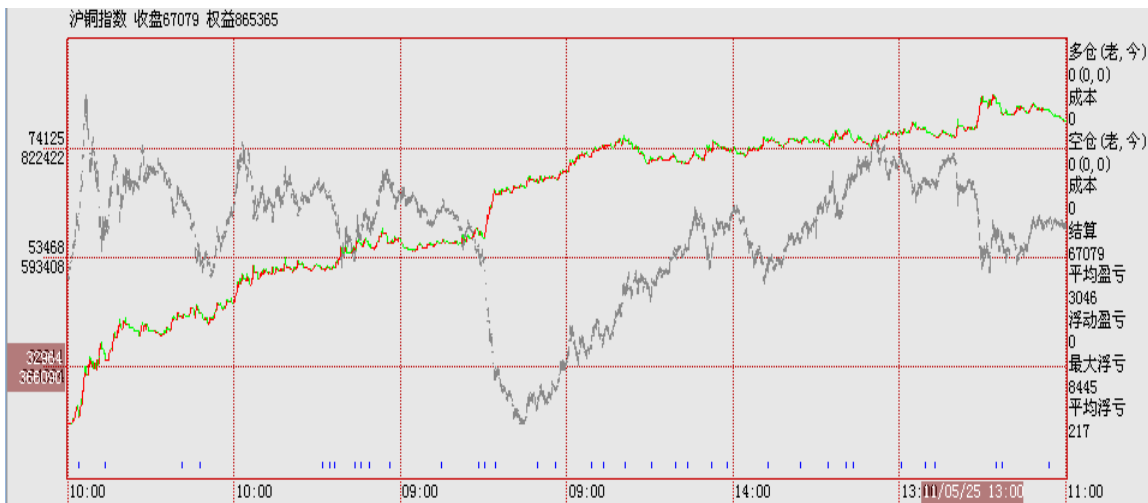
螺纹钢	
测试日期	2009.3.27-2012.4.11
初始资金	30000
最终权益	60660
最大回撤	6210/10%
最大连续亏损次数	5
盈利率	102.20%
胜率	46%
平均盈利/平均亏损	2.79
指令总数	210
总手续费/单手手续费	4200/20



橡胶	
测试日期	2006.3.31-2012.4.11
初始资金	110000
最终权益	330790
最大回撤	27315/10%
最大连续亏损次数	6
盈利率	200.72%
胜率	43.97%
平均盈利/平均亏损	2.25
指令总数	464
总手续费/单手手续费	32480/70

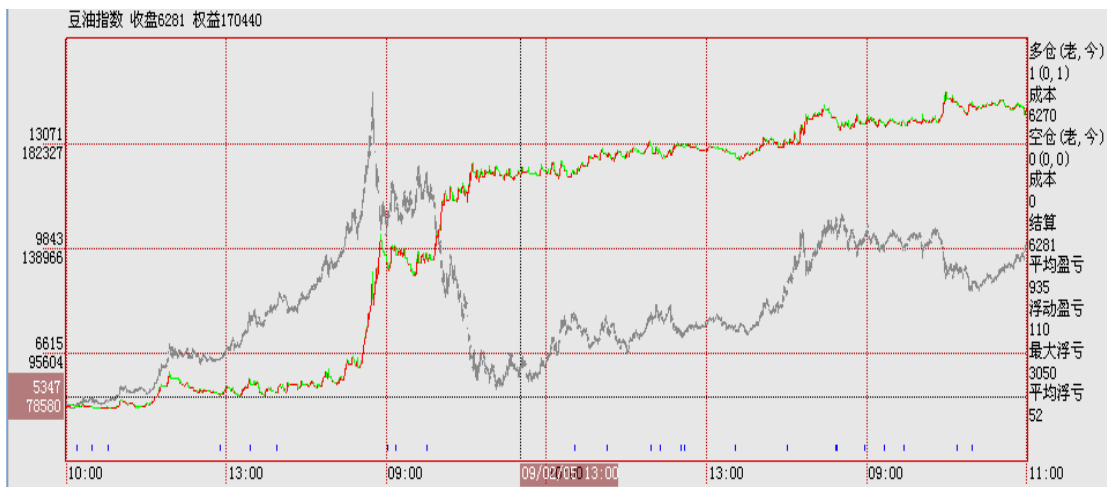


铜	
测试日期	2006.3.31-2012.4.11
初始资金	250000
最终权益	879730
最大回撤	58270/9%
最大连续亏损次数	8
盈利率	251.89%
胜率	43.80%
平均盈利/平均亏损	2.51
开仓数量	484
总手续费/单手手续费	72600/150



豆油

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	75000
最终权益	195900
最大回撤	16570/12%
最大连续亏损次数	8
盈利率	161.20%
胜率	43.75%
平均盈利/平均亏损	2.43
开仓数量	448
总手续费/单手手续费	8960/20



白糖

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	50000
最终权益	72100
最大回撤	17370/21%
最大连续亏损次数	8
盈利率	44.20%
胜率	36.86%
平均盈利/平均亏损	2.19
开仓数量	472
总手续费/单手手续费	9440/20



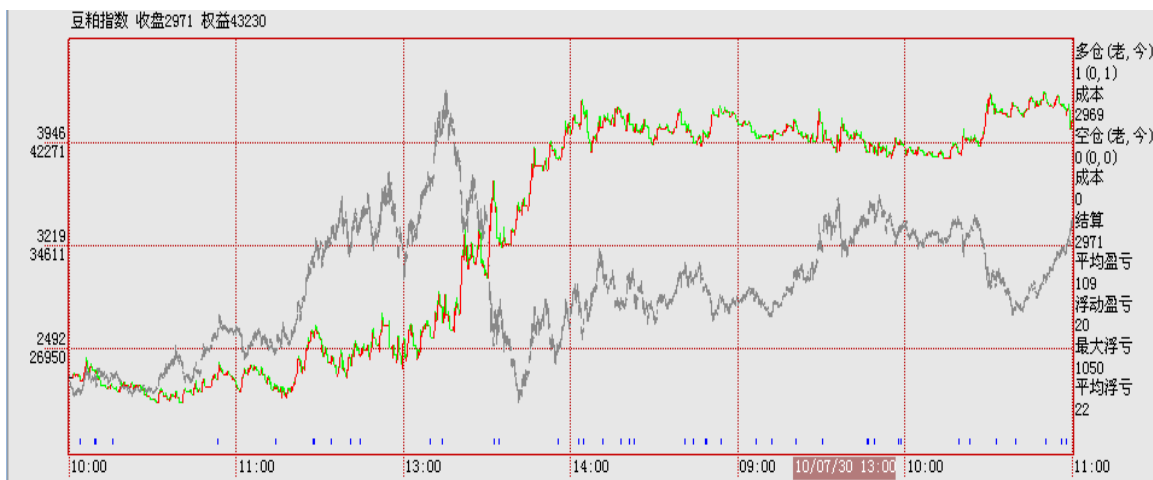
大豆

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	25000
最终权益	43930
最大回撤	10970/23%
最大连续亏损次数	10
盈利率	75.72%
胜率	41.10%
平均盈利/平均亏损	1.93
开仓数量	472
总手续费/单手手续费	9440/20



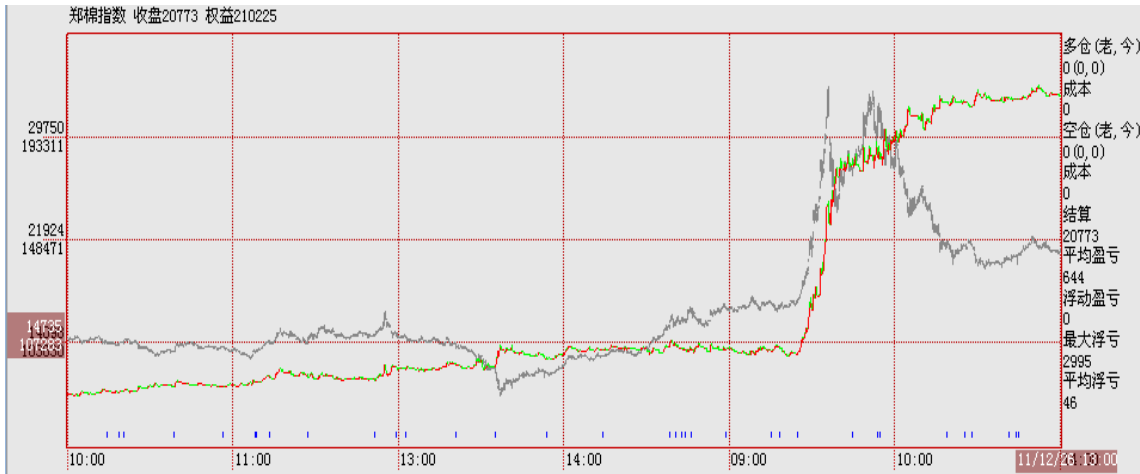
豆粕

测试日期	2006.3.31-2012.4.11
初始资金	25000
最终权益	43380
最大回撤	5030/15%
最大连续亏损次数	6
盈利率	73.52%
胜率	40.85%
平均盈利/平均亏损	1.97
开仓数量	570
总手续费/单手手续费	9400/20

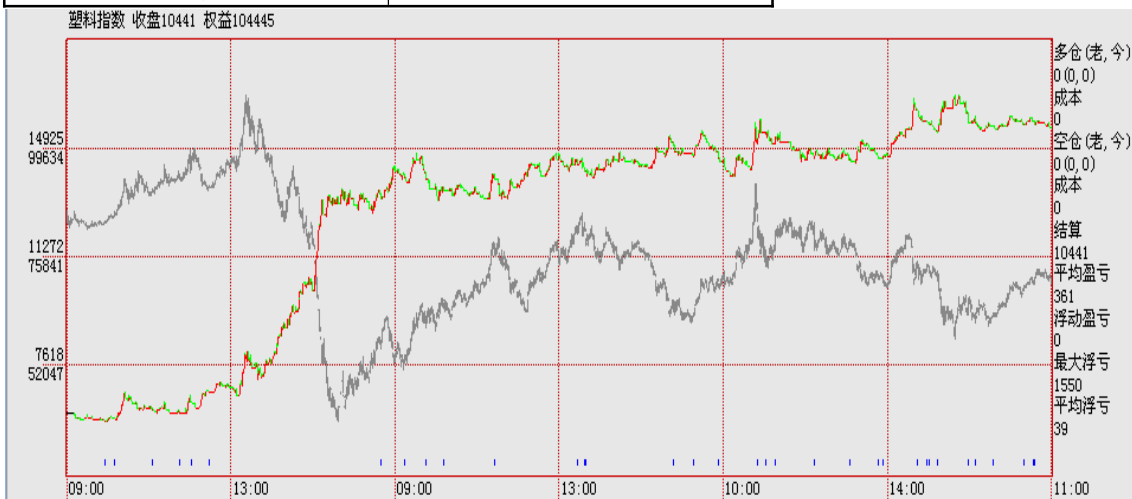


棉花

测试日期	2006.3.31-2012.4.11
初始资金	82000
最终权益	211145
最大回撤	11175/8%
最大连续亏损次数	6
盈利率	157.49%
胜率	46.89%
平均盈利/平均亏损	2.63
开仓数量	418
总手续费/单手手续费	8360/20

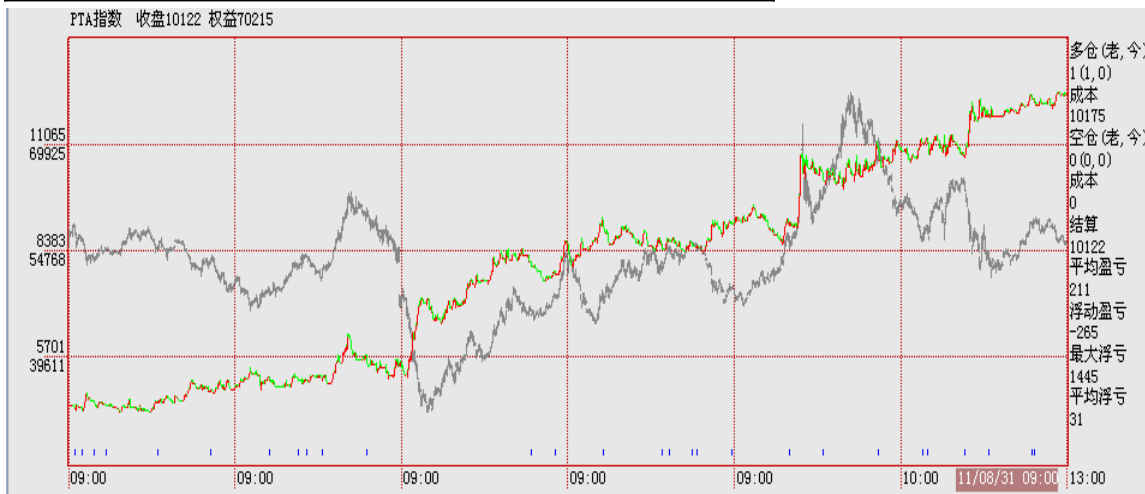


塑料	
测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	42000
最终权益	104445
最大回撤	10475/12%
最大连续亏损次数	9
盈利率	148.68%
胜率	39.88%
平均盈利/平均亏损	2.56
开仓数量	346
总手续费/单手手续费	6920/20



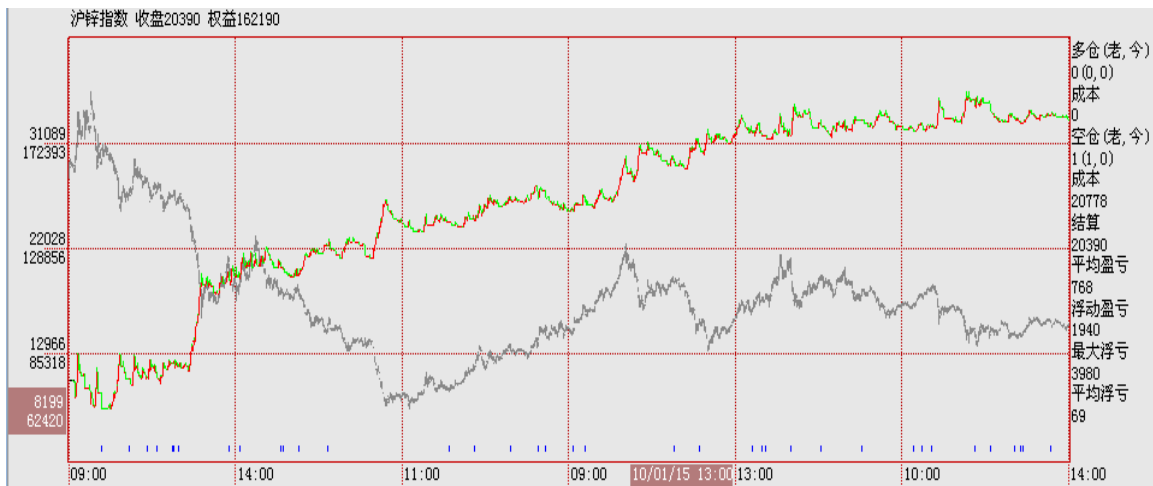
PTA

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	33000
最终权益	77495
最大回撤	6425/13%
最大连续亏损次数	9
盈利率	134. 83%
胜率	43. 22%
平均盈利/平均亏损	2. 26
开仓数量	398
总手续费/单手手续费	7960/20



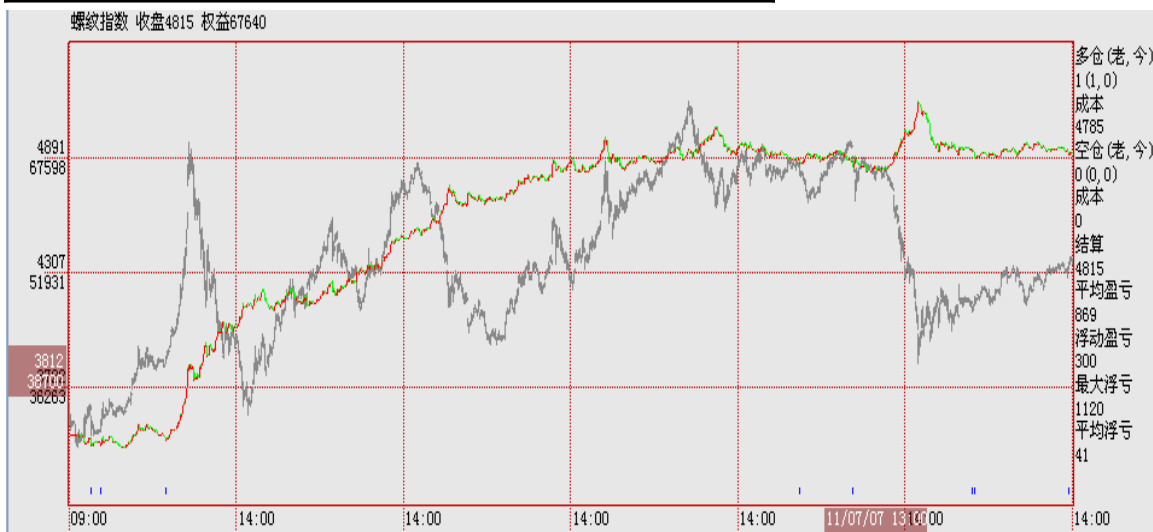
锌

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	75000
最终权益	180960
最大回撤	23515/18%
最大连续亏损次数	8
盈利率	141. 28%
胜率	37%
平均盈利/平均亏损	2. 63
开仓数量	400
总手续费/单手手续费	20000/50



长宏二号

螺纹钢	
测试日期	2009.3.27-2012.4.11
初始资金	30000
最终权益	68280
最大回撤	7810/13%
最大连续亏损次数	6
盈利率	127.60%
胜率	50%
平均盈利/平均亏损	2.74
指令总数	128
总手续费/单手手续费	2560/20



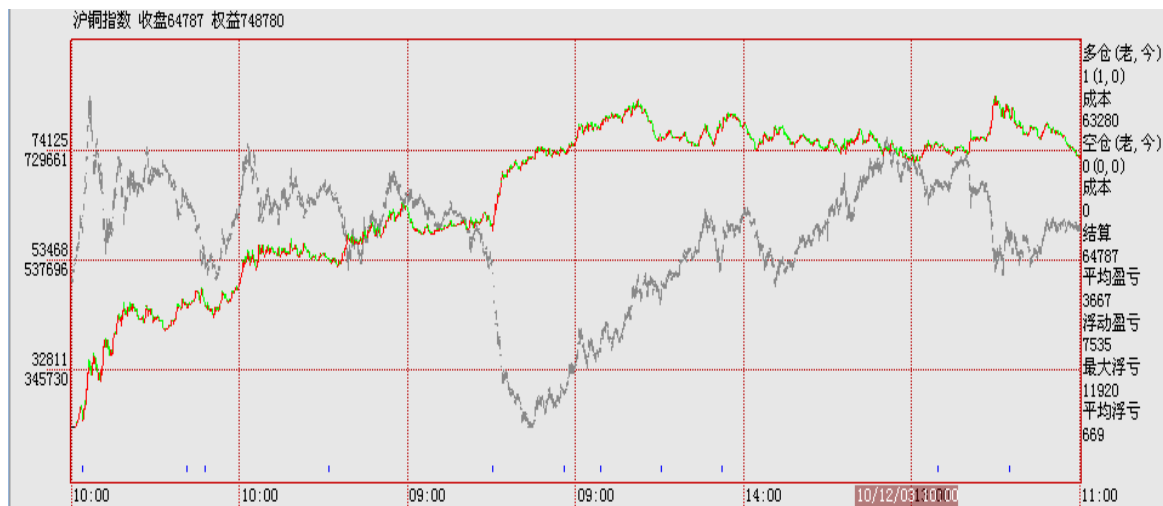
橡胶

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	110000
最终权益	289095
最大回撤	53935/25%
最大连续亏损次数	6
盈利率	162.81%
胜率	37.65%
平均盈利/平均亏损	2.51
指令总数	324
总手续费/单手手续费	22680/70



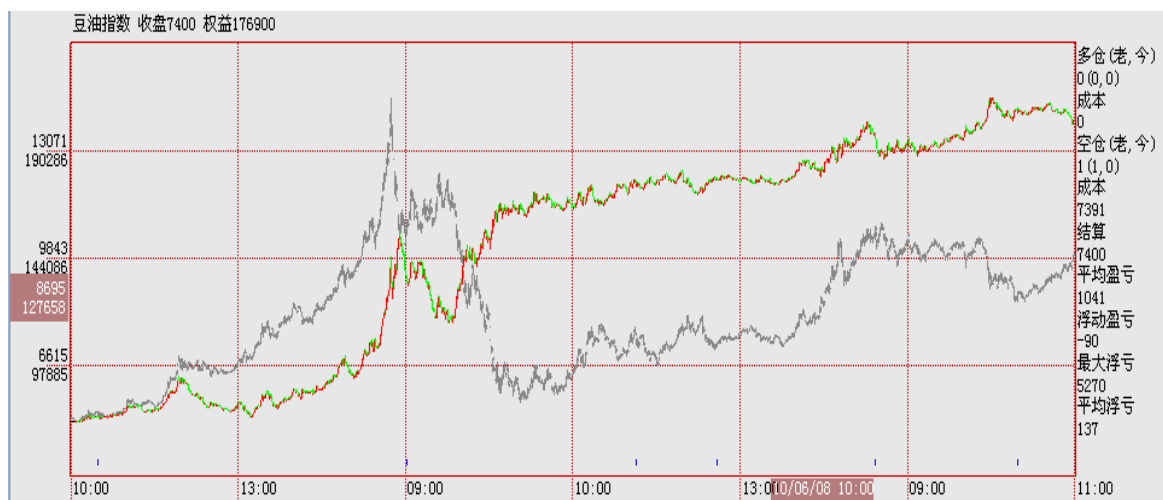
铜

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	250000
最终权益	731170
最大回撤	111135/22%
最大连续亏损次数	8
盈利率	192.47%
胜率	43.82%
平均盈利/平均亏损	2.1
开仓数量	356
总手续费/单手手续费	53400/150



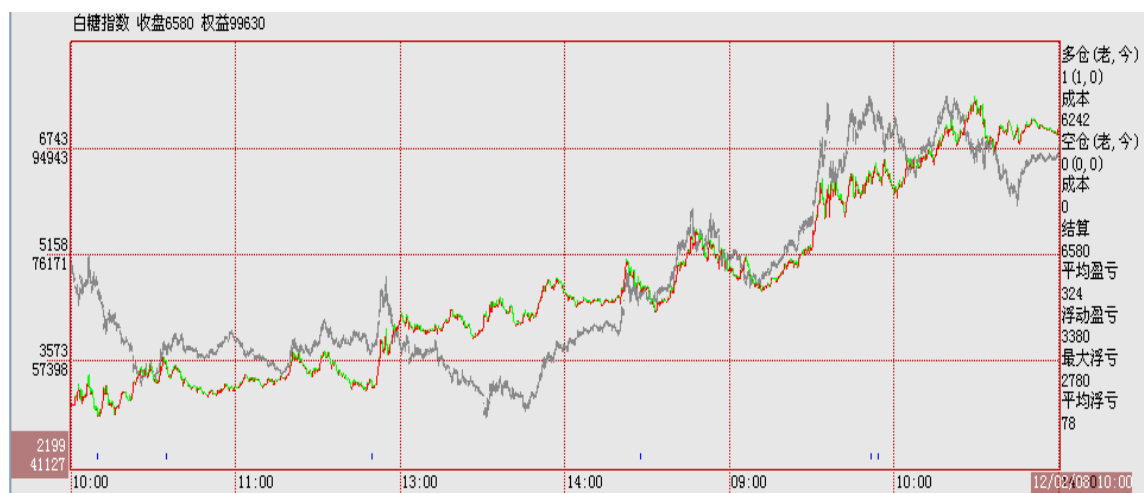
豆油

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	75000
最终权益	202970
最大回撤	38700/26%
最大连续亏损次数	6
盈利率	170.63%
胜率	42.47%
平均盈利/平均亏损	2.56
开仓数量	292
总手续费/单手手续费	5840/20



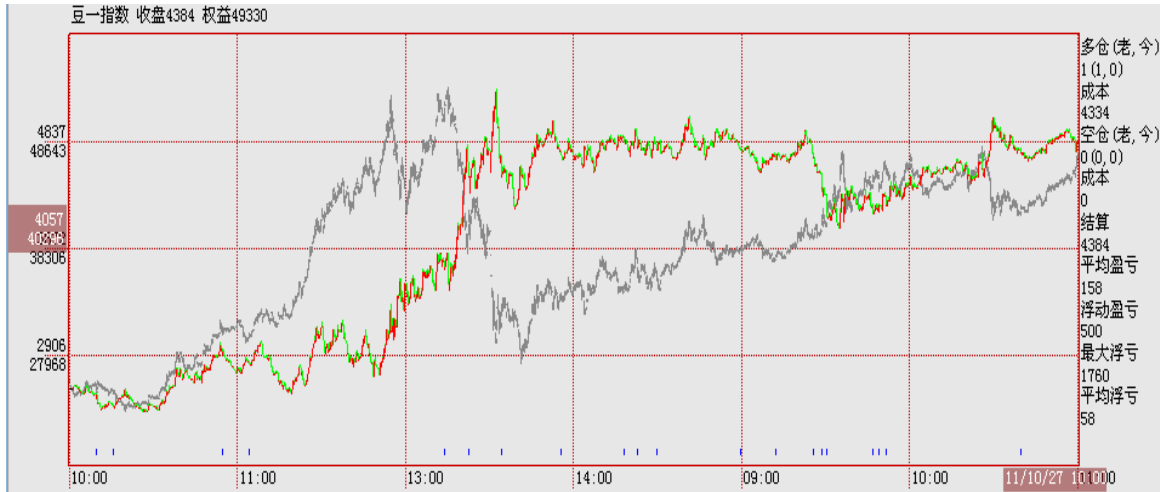
白糖

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	50000
最终权益	98630
最大回撤	10870/11%
最大连续亏损次数	7
盈利率	97.26%
胜率	38.67%
平均盈利/平均亏损	1.58
开仓数量	300
总手续费/单手手续费	6000/20



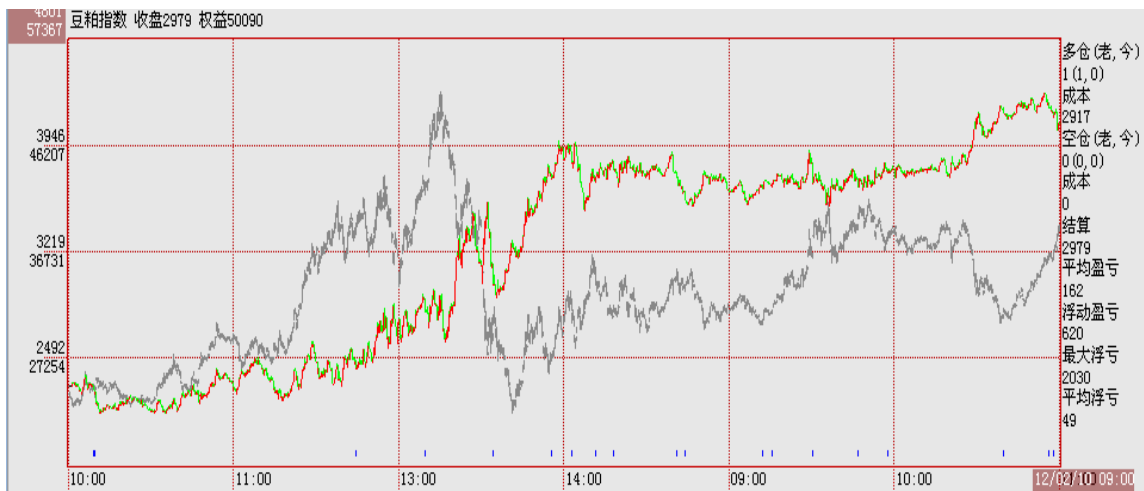
大豆

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	25000
最终权益	48390
最大回撤	13500/27%
最大连续亏损次数	9
盈利率	93.56%
胜率	38.41%
平均盈利/平均亏损	2.25
开仓数量	358
总手续费/单手手续费	6560/20



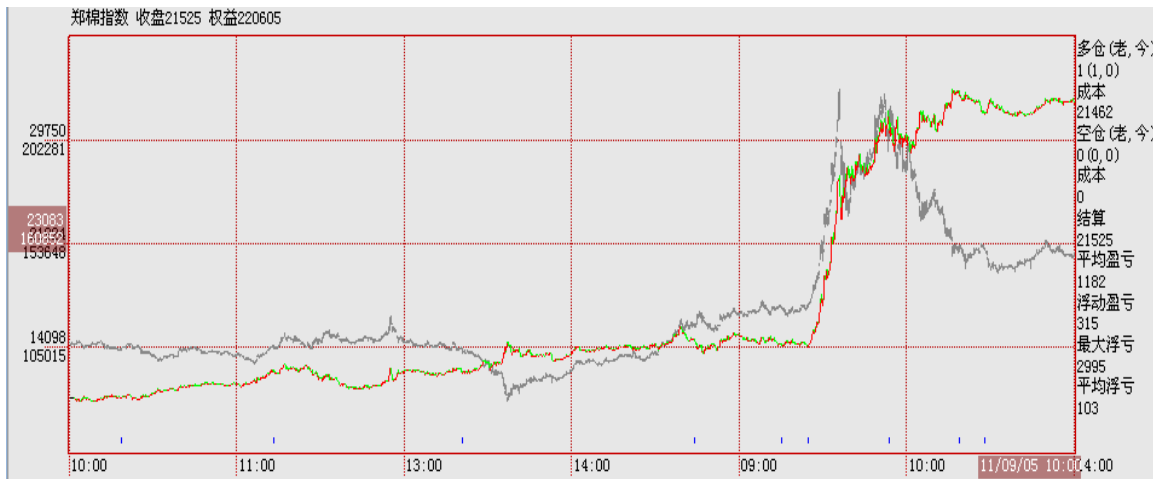
豆粕

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	25000
最终权益	47800
最大回撤	8600/17%
最大连续亏损次数	8
盈利率	91.20%
胜率	45%
平均盈利/平均亏损	1.73
开仓数量	320
总手续费/单手手续费	6400/20



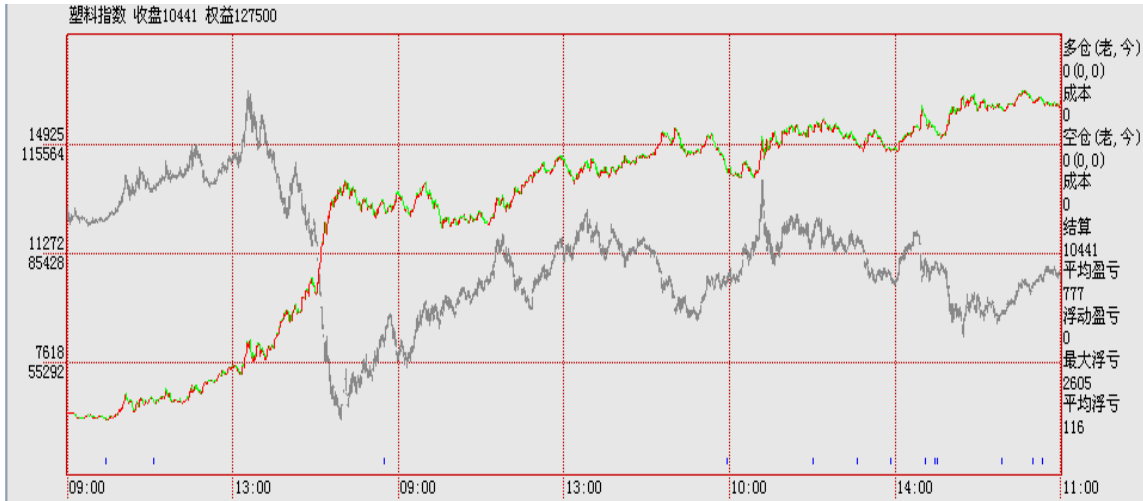
棉花

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	82000
最终权益	219910
最大回撤	20500/13%
最大连续亏损次数	6
盈利率	168.18%
胜率	42.54%
平均盈利/平均亏损	3.49
开仓数量	268
总手续费/单手手续费	5360/20

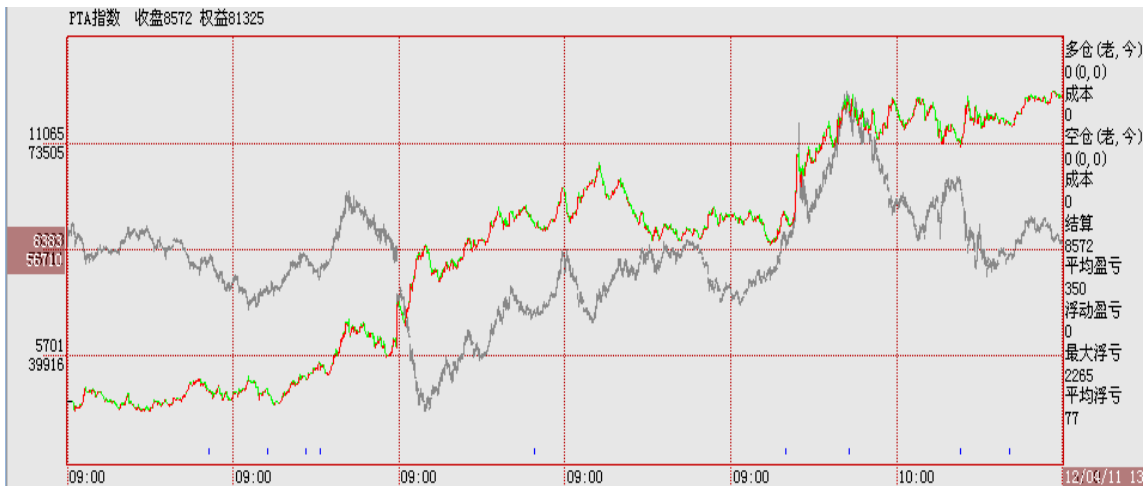


塑料

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	42000
最终权益	127500
最大回撤	13955/17%
最大连续亏损次数	7
盈利率	203.57%
胜率	49.09%
平均盈利/平均亏损	2.12
开仓数量	220
总手续费/单手手续费	4400/20

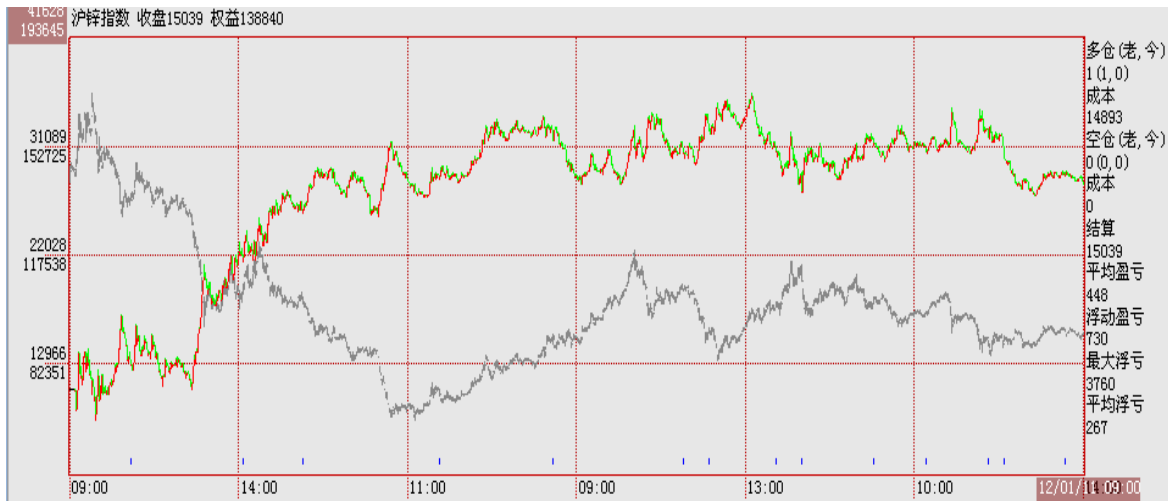


PTA	
测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	33000
最终权益	81325
最大回撤	12905/20%
最大连续亏损次数	5
盈利率	146.44%
胜率	42.03%
平均盈利/平均亏损	2.23
开仓数量	276
总手续费/单手手续费	5520/20



锌

测试日期	2006. 3. 31-2012. 4. 11
初始资金	75000
最终权益	140055
最大回撤	33480/22%
最大连续亏损次数	7
盈利率	86. 74%
胜率	34. 46%
平均盈利/平均亏损	2. 42
开仓数量	296
总手续费/单手手续费	14800/50



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>