



【第 7 期】

2014 年 8 月 15 日

编辑：张维超

023-86769678

zhangweichao@csc.com.cn

中信建投程序化交易产品——“胜势” 产品跟踪报告

【产品简介】

中信建投期货程序化交易产品-“胜势”，是基于中信建投期货研究发展部多年来在趋势分析中的技术经验，再结合近两年市场行情变化新特点而设计的期货投资工具。该产品逻辑简单，信号明确（图中信号具体含义详见本报告最后一页），投资者理解容易，操作简单。

【产品特点】

- 该产品主要通过一定方法识别价格趋势，并跟随该趋势进行投机交易。该产品和其他趋势类产品一样，在震荡市中容易亏损，在趋势行情中能取得较大盈利。
- 该产品对资金量有限制，为了避免冲击成本过大，该产品理想资金规模为 100-500 万。
- 该产品偏保守，单品种仓位控制在 20%以内。
- 收益稳定：该产品在所有产品上测试，年化收益率均超过 15%。
- 风险可控：该产品在所有期货品种上测试（各品种具体参数有一定区别），最大回撤均在 20%以内。



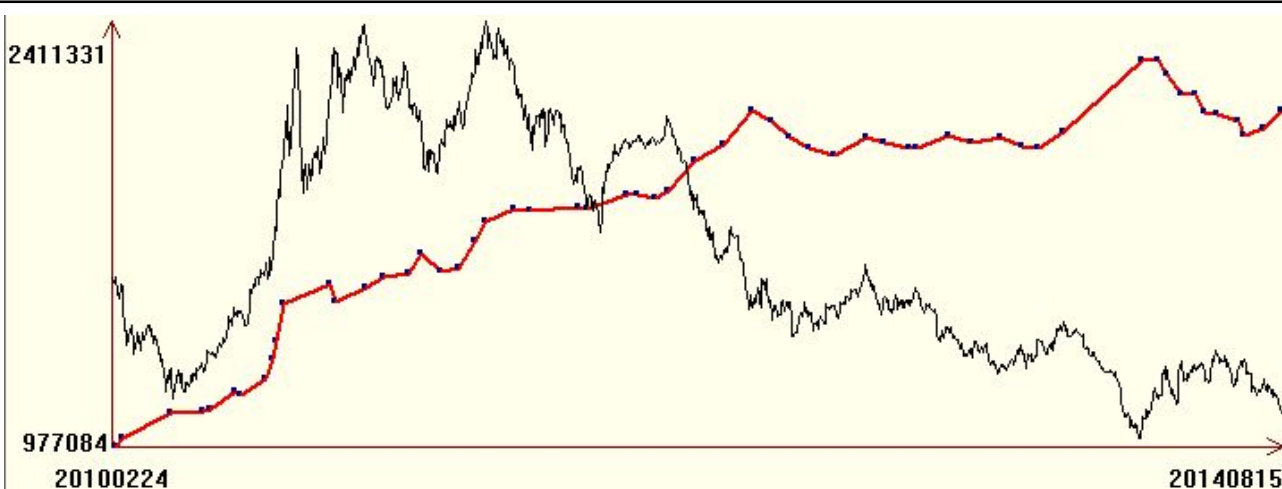
白糖指数日线交易模型

参 数 设 置	期初资金	仓位	保证金比例	手续费	滑点
	1000,000	15%	13%	8 元	3
业 绩 表 现	测试时间起点	总交易次数	胜率	累积收益	资金最大回撤
	2010-1-1	112	59.65%	122.45%	7.3%

信号图



资金曲线 (红线代表资金曲线)

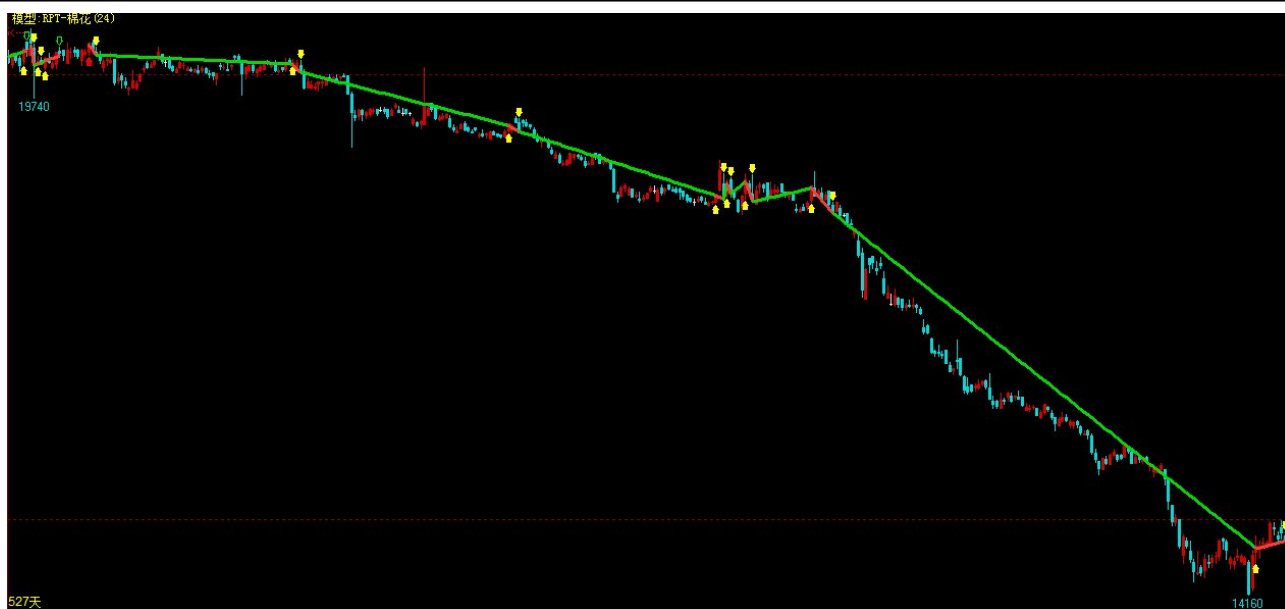




棉花指数日线交易模型

参 数 设 置	期初资金	仓位	保证金比例	手续费	滑点
	1000,000	15%	13%	12 元	3
业 绩 表 现	测试时间起点	总交易次数	胜率	累积收益	资金最大回撤
	2010-1-1	173	44.14%	237.47%	4.67%

信号图



资金曲线（红线代表资金曲线）





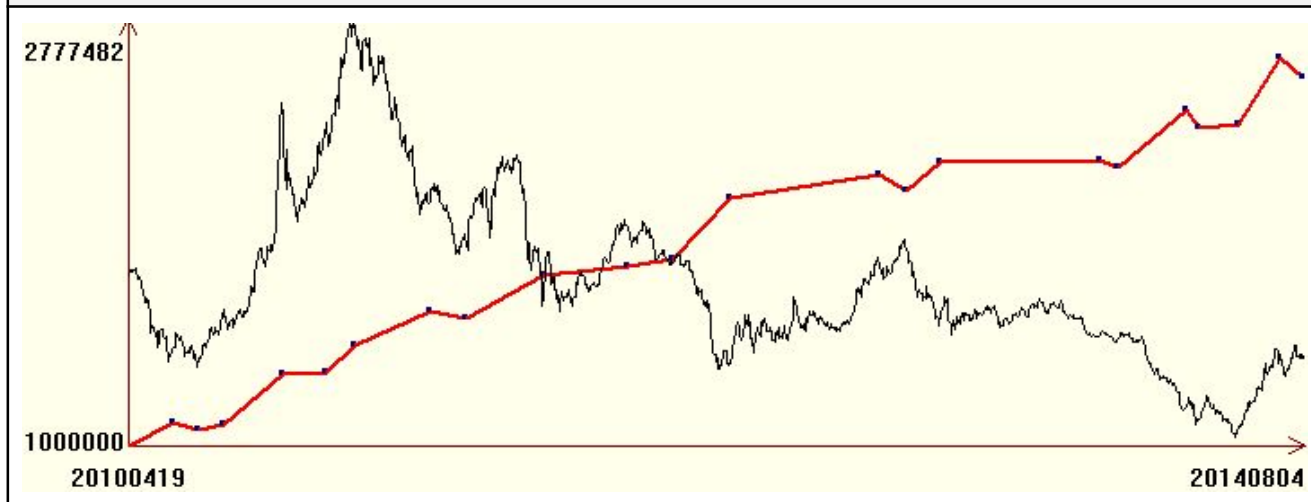
PTA 指数日线交易模型 1

参 数 设 置	期初资金	仓位	保证金比例	手续费	滑点
	1000,000	15%	13%	8 元	3
业 绩 表 现	测试时间起点	总交易次数	胜率	累积收益	资金最大回撤
	2010-1-1	44	72.73%	168.56%	3.04%

信号图



资金曲线（红线代表资金曲线）





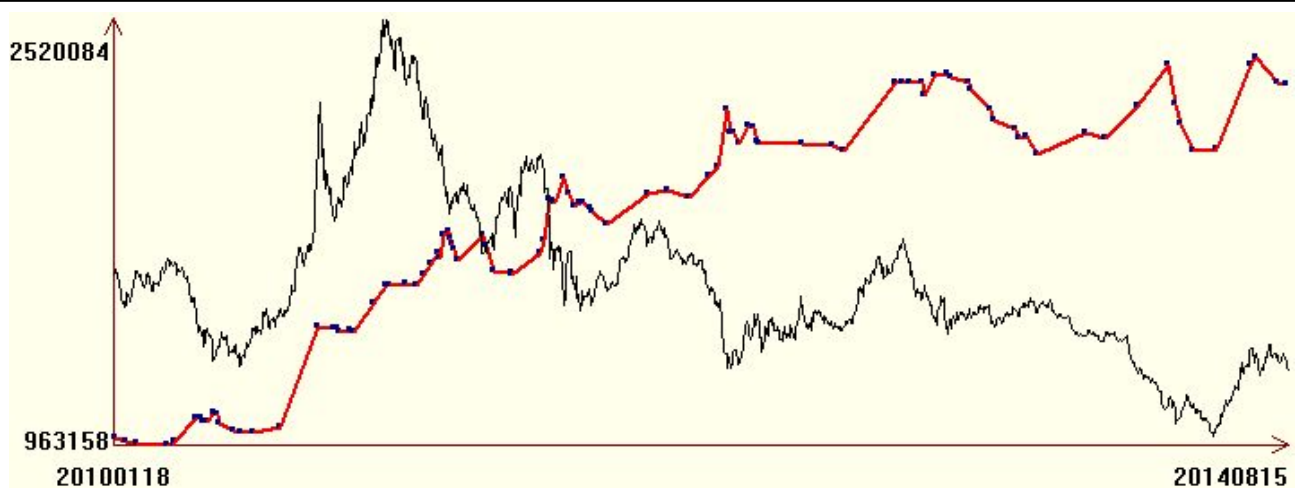
PTA 指数日线交易模型 2

参 数 设 置	期初资金	仓位	保证金比例	手续费	滑点
	1000,000	15%	13%	8 元	3
业 绩 表 现	测试时间起点	总交易次数	胜率	累积收益	资金最大回撤
	2010-1-1	190	45.00%	141.45%	7.91%

信号图



资金曲线（红线代表资金曲线）





豆粕指数日线交易模型

参 数 设 置	期初资金	仓位	保证金比例	手续费	滑点
	1000,000	15%	11%	7 元	3
业 绩 表 现	测试时间起点	总交易次数	胜率	累积收益	资金最大回撤
	2010-1-1	141	44.59%	90.32%	17.52%

信号图



资金曲线 (红线代表资金曲线)





螺纹钢指数 3 小时交易模型

参 数 设 置	期初资金	仓位	保证金比例	手续费	滑点
	1000,000	15%	14%	0.0275%	3
业 绩 表 现	测试时间起点	总交易次数	胜率	累积收益	资金最大回撤
	2010-1-1	59	44.07%	138.98%	7.05%

信号图



资金曲线（红线代表资金曲线）





橡胶指数日线交易模型

参 数 设 置	期初资金	仓位	保证金比例	手续费	滑点
	1000,000	15%	14%	0.0275%	3
业 绩 表 现	测试时间起点	总交易次数	胜率	累积收益	资金最大回撤
	2010-1-1	67	51.43%	84.92%	6.28%

信号图



资金曲线（红线代表资金曲线）





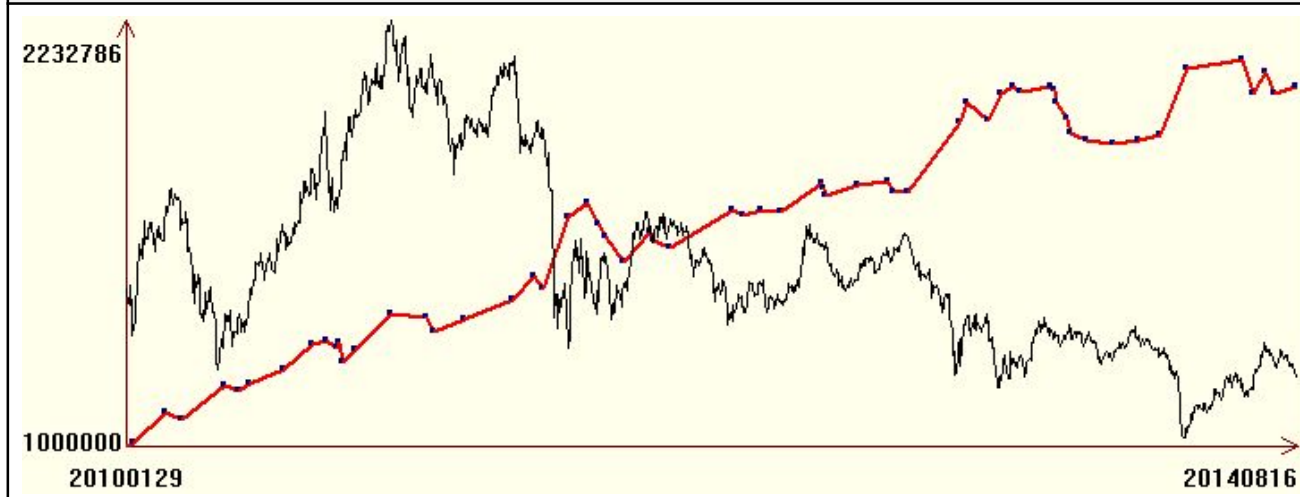
铜指数日线交易模型

参 数 设 置	期初资金	仓位	保证金比例	手续费	滑点
	1000,000	15%	14%	0.024%	3
业 绩 表 现	测试时间起点	总交易次数	胜率	累积收益	资金最大回撤
	2010-1-1	85	53.33%	114.83%	10.82%

信号图



资金曲线（红线代表资金曲线）





【信号注释】

	买入开仓(开多)
	买入平仓(平空)
	卖出开仓(开空)
	卖出平仓(平多)
	买平后买开新仓(平空加反手)
	卖平后卖开新仓(平多加反手)



联系我们

中信建投期货总部

重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼

电话：023-86769605

上海世纪大道营业部

地址：上海市浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 808-811 单元 8 楼 808-811 单元

电话：021-68763048

长沙营业部

地址：长沙市芙蓉区五一大道 800 号中隆国际大厦 903 号

电话：0731-82681681

南昌营业部

地址：江西南昌市西湖区八一大道 96 号华龙国际大厦 1303-1305

电话：0791-82082701

廊坊营业部

地址：廊坊市广阳区金光道 66 号圣泰财富中心 1 号楼 4 层西侧 4010、4012、4013、4015、4017

电话：0316-2326908

漳州营业部

地址：福建省漳州市芗城区南昌路华联商厦七楼

电话：0596-6161566

合肥营业部

地址：安徽省合肥市包河区马鞍山路 130 号万达广场 6 号楼 1903、1904、1905 室电话：0551-2876855

西安营业部

地址：西安市高新区科技路 38 号林凯国际大厦 1604, 05 室

电话：029-68500977

北京营业部

地址：北京市东城区朝阳门北大街 6 号首创大厦 207 室

电话：010-85282866

宁波营业部

地址：浙江省宁波市江东区朝晖路 17 号

邮编：315040

电话：0574-89071681

济南营业部

地址：济南市泺源大街 150 号中信广场 606 室

电话：0531-85180636

大连营业部

地址：大连市沙河口区会展路 129 号期货大厦 2904、2905 室

电话：0411-84806305

郑州营业部

地址：郑州市未来大道 69 号未来大厦 2211、2205 房

电话：0371-65612356

广州营业部

地址：广州市越秀区东风中路 410-412 号时代地产中心 704A、705-06 房

电话：020-28325288

重庆龙山一路营业部

地址：重庆市渝北区冉家坝龙山一路扬子江商务中心 10-2

电话：023-88502020

成都营业部

地址：成都武侯区科华北路 62 号力宝大厦南楼 1802, 1803

电话：028-62818701

深圳营业部

地址：深圳市福田区深南大道和泰然大道交汇处绿景纪元大厦 NEO A 栋 11 楼 I 单元

电话：0755-33378759

杭州营业部

地址：杭州庆春路 137 号华都大厦 811, 812

电话：0571-87079379

上海漕溪北路营业部

地址：上海市徐汇区漕溪北路 331 号中金国际广场 A 座 9 层 B 室

电话：021-33973869



重要声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，中信建投期货力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，也没有考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。

全国统一客服电话：400-8877-780

网址：www.cfc108.com