

第七届全国期货实盘赛 量化基金经理选拔赛 联合主办: 期货日报 webstock 文华财经 比赛时间: 2013年12月2日-2014年3月7日 大赛官方网址: http://spds.qhrb.com.cn 参赛选手交流群: 290890876

赛事点评

选品种很重要

周四,上证指数未能站稳2100点,低开低走一路下行,日内跌幅高达1.58%,预计大盘调整格局短期难以结束。受此影响,股指期货主力合约1401昨日一路走低,但期价重心仍在2300点附近,日内跌幅为0.92%。继续关注股指期货在2300一线的走势。

工业品方面,塑料延续周三的反弹势头稳步上行,主力合约1405日内涨幅为1.27%,尾盘收于20日均价附近,若此轮反弹得以延续,上方压力看至11400。农产品方面,“双粕”冲高回落处于高位调整态势,菜粕主力合约1405涨幅为1.34%,豆粕主力合约1405涨幅为0.75%，“双粕”前期高点附近压力仍然较大。新品种方面,“两板”期货上市以来仍未走出明确的趋势性行情,近期可注意下方支撑。

选择什么品种可以不费太多脑筋就能稳定获利呢?个人认为,去寻找债券或是高利息的货币,稳定持有,除了有利息收入外,若能享受到价差上的资本利差更是一件令人开心的事情。

但是这类品种不建议随便放空,因为这相当于借出债券,可能还要支付隔夜利息,若没有很好的放空策略,收益并不理想。

回顾我过去的美债交易,每当价格创出几天新高就做多,这种做法效果还不错,所以选择标的反而比找策略重要。做微做的市场、复杂的策略,不如简单选取标的,买卖简单的ETF也是不错的投资。程序化交易只是让你纪律化,而不是钻研复杂的方程式和统计数据,请想清楚为何要自动化,以及品种的本质会让你在这条路上少走冤枉路。

高程序

交易团队

TOP50 排行榜

Table with 15 columns: 排名, 赢智账号, 当日权益, 昵称, 综合得分, 日收益率, 累计净值, 净值得分, 历史最大回撤, 回撤率得分, 累计净利润, 净利润得分, 胜率, 盈亏比, 手续费和净利润之比, 风险度, 操作指导, 持仓. Lists top 50 trading accounts.

行情(12月26日)

上海期货交易所主力合约行情

Table with 10 columns: 品种, 交割月, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 结算价, 涨跌, 成交量(手), 持仓量(手), 持仓变化(手). Lists Shanghai Futures Exchange main contracts.

郑州商品交易所主力合约行情

Table with 10 columns: 品种, 交割月, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 结算价, 涨跌, 成交量(手), 持仓量(手), 持仓变化(手). Lists Zhengzhou Commodity Exchange main contracts.

商品现货参考报价(单位:元/吨)

Table with 5 columns: 品名, 规格, 产地/品牌, 参考价, 涨跌. Lists commodity spot prices.

主力合约排行榜

Table with 5 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 涨跌幅. Lists top main contracts.

跌幅榜

Table with 5 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 涨跌幅. Lists contracts with largest price drops.

成交榜

Table with 5 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 成交量. Lists contracts with highest volume.

增仓榜

Table with 5 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 日持仓. Lists contracts with highest open interest.

减仓榜

Table with 5 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 日持仓. Lists contracts with highest open interest reduction.

上海期货交易所各品种日间均价

Table with 5 columns: 合约, 加权日均价, 较前一交易日, 较前一交易日, 较前一交易日. Lists daily average prices for Shanghai Futures Exchange.

易盛农产品期货价格指数(郑商所)

Table with 5 columns: 指数名称, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 涨跌. Lists Zhengzhou Commodity Exchange agricultural price indices.

中国金融期货交易所行情

Table with 10 columns: 合约名称, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 结算价, 涨跌, 成交量(手), 持仓量(手), 持仓变化(手). Lists China Financial Futures Exchange main contracts.

各品种持仓及仓单变动

Table with 5 columns: 品种, 持仓量, 仓单量, 持仓量, 仓单量. Lists changes in open interest and warehouse receipts for various commodities.

注:持仓数据来源于持仓排名前20会员,上期所、中金所品种持仓为主力合约。

上期所有色金属期货价格指数

Table with 5 columns: 品种名称, 最新价, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 成交量, 持仓量, 持仓参考. Lists precious metal price indices.

大连商品交易所主力合约行情

Table with 10 columns: 品种, 交割月, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 结算价, 涨跌, 成交量(手), 持仓量(手), 持仓变化(手). Lists Dalian Commodity Exchange main contracts.