

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

好的故事 需要有完整的结构

上周五,上证指数低开振荡,期间上冲2200点后整理回落,日内跌幅0.31%。股指期货主力合约IF1312重心继续下移,早盘下探日内低点后快速反弹至2400一线整理,波动区间43点,波动幅度为1.78%,近期应密切关注2400点的支撑情况。

上周末商品期货普遍走低,农产品方面,油脂类同步跳空低开,破位格局明显,菜籽油主力合约O11405跌幅2.60%,豆油主力合约Y1405跌幅2.52%,棕榈油主力合约P1405跌幅2.89%。若破位后跌势具备持续性,则下方目标位在9月末的低点附近。工业品方面,焦煤、焦炭同样走出明显的破位下跌行情,可关注“煤—焦—钢”的联动情况。贵金属方面,上海白银在周边市场影响下低开低走,主力合约AG1406日内跌幅高达4.23%,且前期4300一线压力明显,后市反弹力度应该有限。

今天和大家探讨一下系统的形成。刚接触程序化交易时,总会认为一个系统可能需要复杂的数学模型来构建,可能要包含各种特殊情况,甚至是有可能会通过比如神秘的费波纳契数列去猜测市场未来是否会止跌反弹等等。

这样的想法其实只是涉及到了建立一个交易系统的最低基础部分,我在这里想告诉各位的,是一个好的策略不是只有何时和如何进场那么简单。大多数的交易者总是误以为程序交易就是找出好的买点和卖点,但我想告诉各位的,一个好的策略除了判断进场之外,还需要把其他很多重要的细节纳入考虑范围,这样才能形成一个完整的系统。

近期我会把程序化交易的轮廓一步步描绘出来,让各位快速了解到底什么是量化交易系统模型。并且会对每个部分做简单描述,让读者了解自己的逻辑结构和重要性。我认为建立一个完整的交易系统有四大支柱:进场、出场、资金管理和市场。一个成功的交易者务必要全部理解这些要素,就像一个好的故事需要一个好的故事结构一样,好的系统也是如此。

交易系统

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, 历史最大回撤率, 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13日)

上海期货交易所主力合约行情

Table of Shanghai Futures Exchange main contract prices for various commodities like copper, aluminum, zinc, lead, tin, gold, silver, rubber, cotton, oil, and grain.

上海期货交易所各品种日间均价

Table of daily average prices for various futures contracts on the Shanghai Futures Exchange.

注:其他合约参考价格请登录上海期货交易所网站查询。

上期所有有色金属价格指数

Table of metal price indices for the previous period.

大连商品交易所主力合约行情

Table of Dalian Commodity Exchange main contract prices for various commodities like soybean, corn, wheat, and oil.

郑州商品交易所主力合约行情

Table of Zhengzhou Commodity Exchange main contract prices for various commodities like cotton, sugar, and oil.

易盛农产品期货价格系列指数(郑商所)

Table of Eisinger agricultural futures price series indices for Zhengzhou Commodity Exchange.

中国金融期货交易所行情

Table of China Financial Futures Exchange prices for various financial instruments like interest rate and index futures.

注:持仓数据来源于持仓排名前20会员,上期所、中金所品种持仓数据为持仓合约。

商品现货参考报价(单位:元/吨)

Table of commodity spot reference prices for various goods like steel, oil, and other commodities.

Table of commodity spot reference prices for various goods like steel, oil, and other commodities.

Table of commodity spot reference prices for various goods like steel, oil, and other commodities.

Table of commodity spot reference prices for various goods like steel, oil, and other commodities.

主力合约排行榜

跌幅榜

Table of top contracts by volume and top contracts by price drop.

成交榜

Table of top contracts by trading volume.

持仓榜

Table of top contracts by open interest.

增仓榜

Table of top contracts by increase in open interest.

减仓榜

Table of top contracts by decrease in open interest.