

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.qhrib.com.cn 参赛选手交流群: 290890876

赛事点评

用风险衡量策略系统组合

周四,上证指数小幅跳空高开低走,尾盘下探日内低点2126.25点后,收于2127.79点,日内跌幅0.95%。受此影响,股指期货主力合约1312较前一交易日结算价高开12.4点后振荡下行,日内波动区间为40.6点,波动幅度为1.72%,期价重心持续下移,触底信号有待观察。

商品期货整体表现依旧偏弱。农产品方面,仅鸡蛋期货出现大幅波动,主力合约JD1405放量下挫,跌破4000点整数支撑,日内跌幅高达2.85%,后续关注在消息刺激下此轮跌势的持久性。工业品方面,橡胶期货下行趋势未改,当日跌幅1.24%,尾盘收于19000一线上方,需密切关注该支撑位。此外,白银期货虽处于振荡走势,但其波动性较强且日内趋势明显,日内量化交易仍存在较好的介入机会。

之前提到进出,通过买与卖系统能够让我们在市场上获利和亏损,但是一个系统还要包含以下几点,且交易系统的核心关键在于资金管理以及纪律的心态。

资金管理对于一般是陌生的,我想大多数刚入行的交易员也不会在此领域的重要性,反而在乎的是完美的进场与出场,即追求所谓低买高卖,但在现实中这种操作机会和方式不可能常常出现。

一个完整的系统真正的问题在于资金管理,资金管理不仅仅决定了你现在可以交易的部位有多少,也决定你每笔交易所承担的风险,还会决定你目前是否需要交易,简单来说是你的钱不够交易又或者你是面临风险太大而不能交易。

但完整的资金管理需要一套流程去掌控,要先思考的是:第一,策略连续最大亏损。第二,整体投资组合风险不要超过20%。有多少钱,去做多少事,用风险去控管你的系统。

程序 交易团队

TOP50 排行榜

Table with columns: 排名, 赢亏账号, 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

行情(12月19日)

上海期货交易所主力合约行情

Table with 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)

郑州商品交易所主力合约行情

Table with 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)

商品现货参考报价(单位:元/吨)

Table with columns: 品名, 规格, 产地/品牌, 集贸市场, 报价, 涨跌

主力合约排行榜

Table with columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 涨跌幅

上海期货交易所各品种日间均价

Table with columns: 合约, 加权日均价, 较前一交易日, 加权日均价, 较前一交易日

易盛农产品期货价格指数(郑商所)

Table with columns: 指数名称, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 涨跌, 成交量

中国金融期货交易所行情

Table with columns: 合约名称, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 结算价, 涨跌

跌幅榜

Table with columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 涨跌幅

上期所有色金属期货价格指

Table with columns: 指数名称, 最新价, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 涨跌幅, 持仓量, 持仓参考

各品种持仓及仓单变动

Table with columns: 品种, 持仓, 仓单, 持仓变化, 仓单变化, 持仓参考

成交榜

Table with columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 成交量

大连商品交易所主力合约行情

Table with 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)

增仓榜

Table with columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 日持仓

减仓榜

Table with columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 日持仓

注:持仓数据来源于持仓排名前20会员,上期所、中金所品种持仓为持仓合约。