

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

重点关注 焦煤焦炭下跌空间

本周一,上证指数小幅高开,围绕2100一线窄幅整理,尾盘收于2097.53点,当日跌幅0.18%,重心略有上移。受此影响,股指期货主力合约IF1401高开走低,但日内企稳于5日均线之上,期价重心变动不大,日内跌幅仅0.02%。近期投资者可继续关注股指的调整筑底行情。

农产品方面,“双粕”出现同步大幅下挫行情,菜粕主力合约RM1405早盘在2620高位窄幅整理,尾盘随着资金大量离场期价重回2600下方,当日跌幅仅0.43%,建议投资者关注该合约本周在2600一线的表现。而豆粕主力合约M1405午后出现假突破行情,其后期价迅速回落至整理区间内,日内跌幅0.39%。工业品整体保持较大跌幅,“双板”、焦煤、焦炭、螺纹钢、郑煤、橡胶7个品种主力合约下跌均超过1%,其中“煤一焦一钢”再次集体破位延续下行走势,后市应重点关注焦煤、焦炭的下跌空间。

2013年即将结束,笔者回测检验了今年的期指走势,上半年行情很好做,下半年有好几个月让人找不到方向,估计有很多投资者选择了离场观望或者是重新修改、优化自己的策略。

整体上看,笔者认为,对于市场的盘整行情投资者可以有多种方法进行应对,上面提到的两种都是可行方案。不论在何种市场中,盘整行情总是会出现的,而大多数人都想避开盘整走势,因此设计了很多指标或者是过滤机制来过滤盘整。但是盘整在市场中是随机事件,因为市场不可能一直以趋势的方式运行,而要预测随机事件是一件不大容易的事情。因此,笔者不会过度拘泥于要开发出能过滤盘整的系统,因为不断地修改策略和添加过多的过滤条件很容易让人陷入完美主义的误区。如果投资者能够不被期指市场的盘整行情所困惑,就会有很多新的投资机会可以选择。

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

行情(12月30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)

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)

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

主力合约排行榜

Table with 6 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 涨跌幅

跌幅榜

Table with 6 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 涨跌幅

成交榜

Table with 6 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 成交量

增仓榜

Table with 6 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 日持仓

减仓榜

Table with 6 columns: 合约名称, 开盘, 最高, 最低, 最新, 日持仓

上海期货交易所各品种日间均价

Table with 6 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

注:其他合约参考报价请登录上海期货交易所网站查询。

上期所有色金属期货价格指数

Table with 6 columns: 指数名称, 最新价, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 涨跌幅

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)

易盛农产品期货价格系列指数(郑商所)

Table with 6 columns: 指数名称, 开盘价, 最高价, 最低价, 收盘价, 涨跌幅

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)

各品种持仓及仓单变动

Table with 6 columns: 品种, 持仓量, 仓单量, 持仓量, 仓单量, 持仓量

注:持仓数据来源于持仓仓单前20会员,上期所、中金所品种持仓为持仓合约。