

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

标准化 剖析多市场

2014年首个交易日,上证指数小幅低开窄幅整理,日内站稳2100点支撑,尾盘收于2109.39点,微跌0.31%。受此影响,股指期货主力合约1401继续站稳均线支撑震荡整理,日内波动幅度仅0.84%。

菜粕期货在2600一线表现尚可,主力合约1405站稳5日均线,尾盘快速上冲,目前期价在2645关口承压。棕榈油跳空高开,日内振荡上行,主力合约1405尾盘收于60日均线下方,近期关注阶段性反弹的持续性。黄金、白银再次强势上冲,表现反复,建议在操作思路尚未明确之前,保持日内量化趋势思路。此外,可跟踪焦煤、焦炭、玻璃、PTA等工业品的下跌走势。

只要抓住市场的惯性就可以知道该品种是否好做,我认为有以下几个判断标准:一是市场长期走势方向如何,二是盘整期间是否小于所有走勢期间的1/3,三是资料时间是否够长,四是交易量是否够大。

长期走势用来判断做多或做空哪个品种获胜的几率较高,盘整期间可以通过简单的每日高低点突破的频率来判断,交易量越大可以使你的滑价相对低和买单更容易成交。

最后一个是资料来源的问题,有些平台可以提供历史资料,但是有很多资料不一定是正确的,要考虑换月造成的价格回测影响,成为一个多市场的交易者在于怎样选择标的和处理资料,一个人是很难做到这些的,我们也是付出了很大努力才做到现在这种规模。

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(1月2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, zinc, lead, tin, gold, silver, etc.

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:其他合约参考行情请参见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 of price indices for various non-ferrous metal futures contracts.

大连商品交易所主力合约行情

Table of Dalian Commodity Exchange main contract prices for commodities like soybean, corn, etc.

郑州商品交易所主力合约行情

Table of Zhengzhou Commodity Exchange main contract prices for commodities like cotton, sugar, etc.

易盛农产品期货价格系列指数(郑商所)

Table of price indices for agricultural futures contracts on the Zhengzhou Commodity Exchange.

中国金融期货交易所行情

Table of price and volume data for financial futures contracts on the China Financial Futures Exchange.

各品种持仓及仓单变动

Table showing changes in open interest and warehouse receipts for various futures contracts.

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名。

商品现货参考报价(单位:元/吨)

Table of commodity spot reference prices for various goods like oil, steel, etc.

主力合约排行榜

Table ranking the most active main contracts by volume.

涨幅榜

Table ranking contracts with the largest percentage price increase.

跌幅榜

Table ranking contracts with the largest percentage price decrease.

成交榜

Table ranking contracts by total trading volume.

增仓榜

Table ranking contracts by increase in open interest.

减仓榜

Table ranking contracts by decrease in open interest.