

程序化交易策略简介

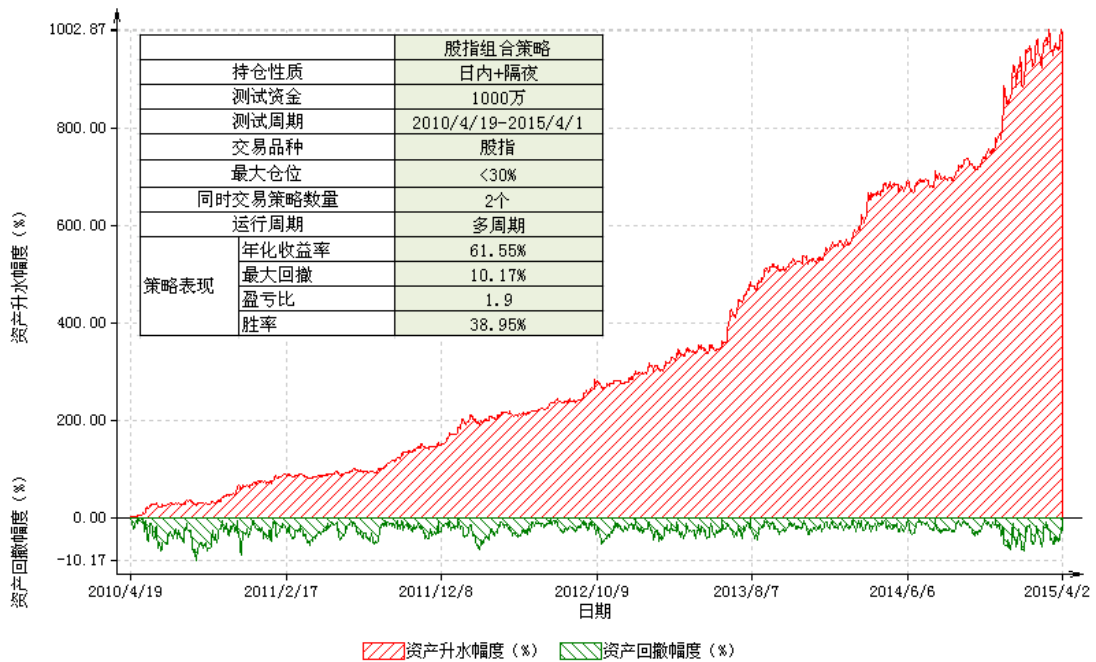
南华期货研究所深圳分所 赵鹏涛

通过对多种指标的量化统计和对 K 线形态的量化识别，对行情进行识别归类，一旦行情能被量化识别出来，交易便会有有的放矢，就能做到比较好的效果。本策略依据此方法，在股指和螺纹钢中进行交易效果测试。采取多策略多周期的方法，以使资金曲线平滑连续。

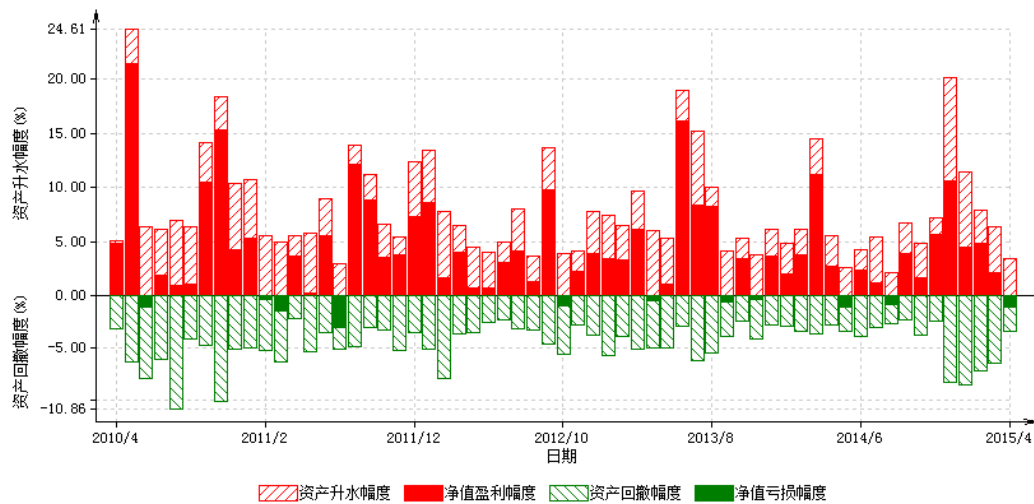
一. 股指交易系统:

本策略由两个子策略组合而成，以股指为交易对象，分别为日内趋势策略和隔夜趋势策略，周期为 1 分钟和 5 分钟。测试采用 1000 万起始资金，动态仓位管理，最大仓位不超过当时总市值 30%。测试时间 2010/4/19-2015/4/1。

1. 资金曲线及测试效果:



2. 月度收益表现:



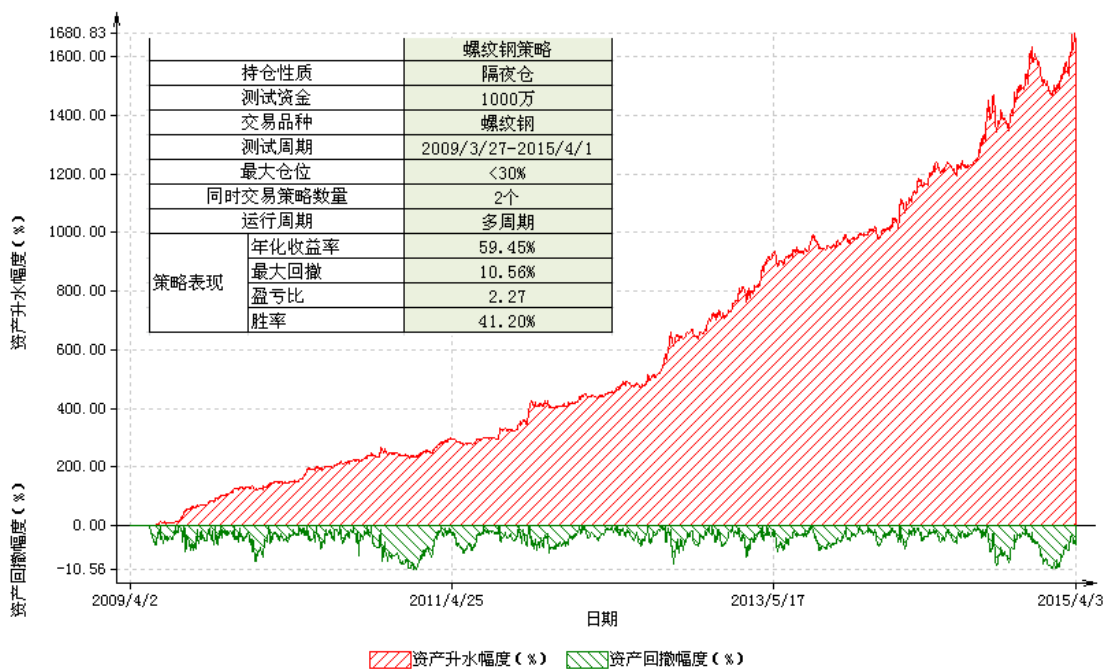
3. 年度收益表现

时间段	净利润	收益率	总盈利	总亏损	盈利因子	盈亏比	胜率	交易次数
2010年	7198490.00	71.98%	33631432.00	-26432942.00	1.27	2.12	37.54%	1537
2011年	9687139.00	56.33%	47819180.00	-38132024.00	1.25	2.04	38.06%	2010
2012年	12239180.00	45.52%	63693688.00	-51454500.00	1.24	1.94	38.97%	1999
2013年	25215888.00	64.45%	129456792.00	-104240904.00	1.24	1.90	39.50%	2172
2014年	32685080.00	50.80%	184491200.00	-151806128.00	1.22	1.79	40.45%	2067
2015年	10873464.00	11.21%	96132024.00	-85258552.00	1.13	1.81	38.40%	625

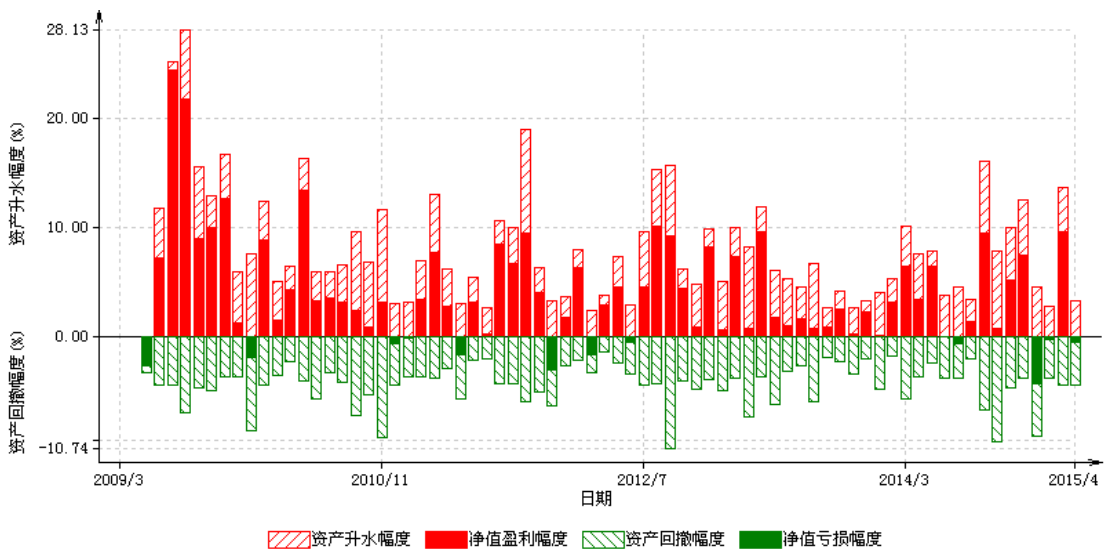
二. 螺纹钢交易系统:

本策略以螺纹钢为交易对象，由两个子策略组合而成，都为隔夜趋势策略，周期为5分钟和30分钟。测试采用1000万起始资金，动态仓位管理，最大仓位不超过当时总市值30%。测试时间2009/3/27-2015/4/1。

1. 资金曲线及测试效果:



2. 月度收益表现



3. 年度收益表现

时间段	净利润	收益率	总盈利	总亏损	盈利因子	盈亏比	胜率	交易次数
2009年	1167481.63	116.75%	1850750.00	-683266.38	2.71	3.27	45.30%	181
2010年	1021870.69	47.15%	3102694.00	-2080823.13	1.49	2.09	41.69%	319
2011年	1611648.75	50.53%	4021329.75	-2409681.00	1.67	2.21	43.08%	325
2012年	2736665.00	57.00%	6025250.50	-3288585.25	1.83	2.83	39.32%	323
2013年	2956132.50	39.22%	8380849.00	-5424717.00	1.54	2.12	42.18%	339
2014年	5548002.00	52.87%	13617366.00	-8069363.50	1.69	2.53	40.00%	360
2015年	581774.38	3.63%	5024966.00	-4443191.50	1.13	1.96	36.57%	175