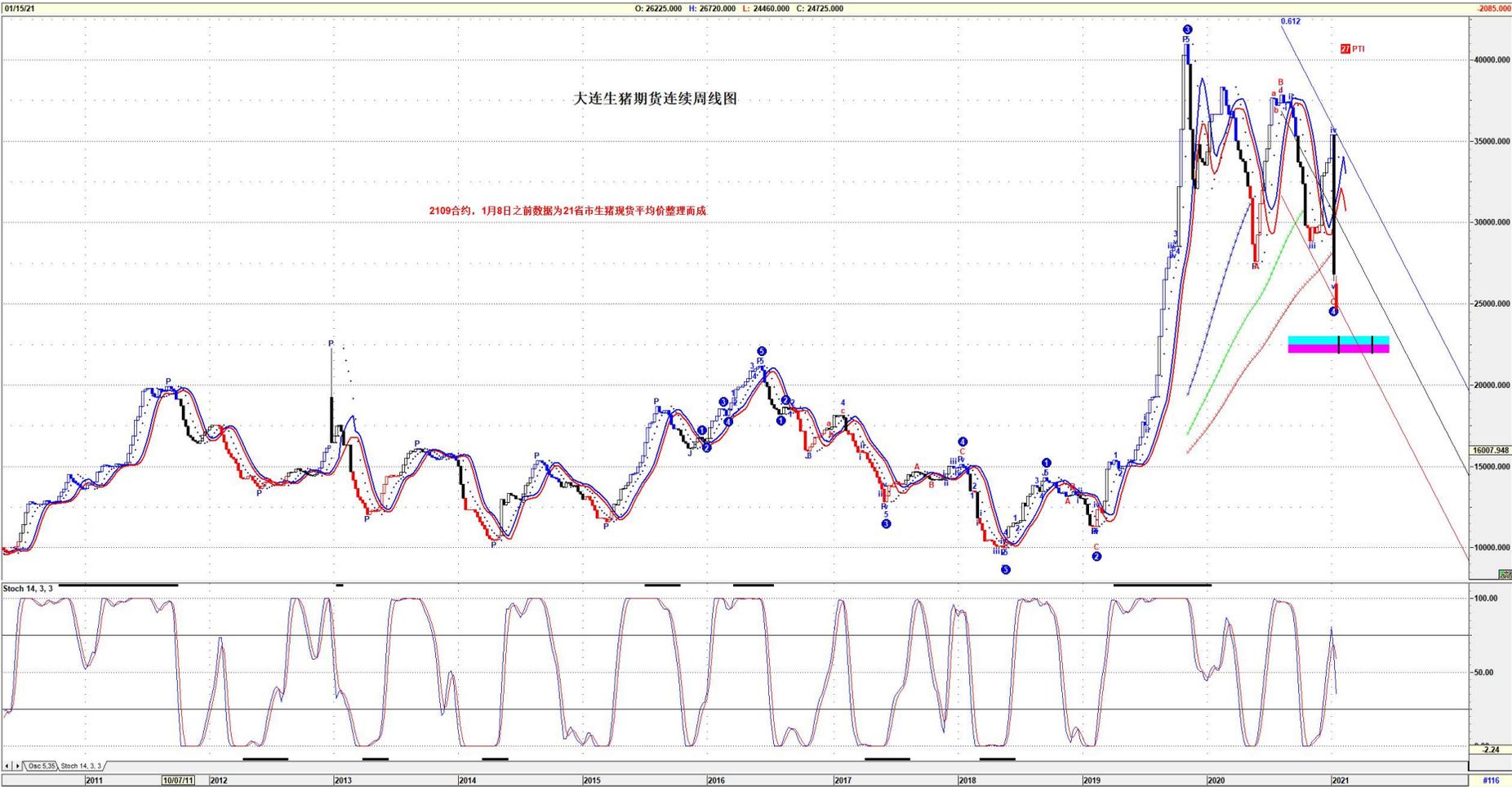


大连生猪期货技术分析报告（20210115）

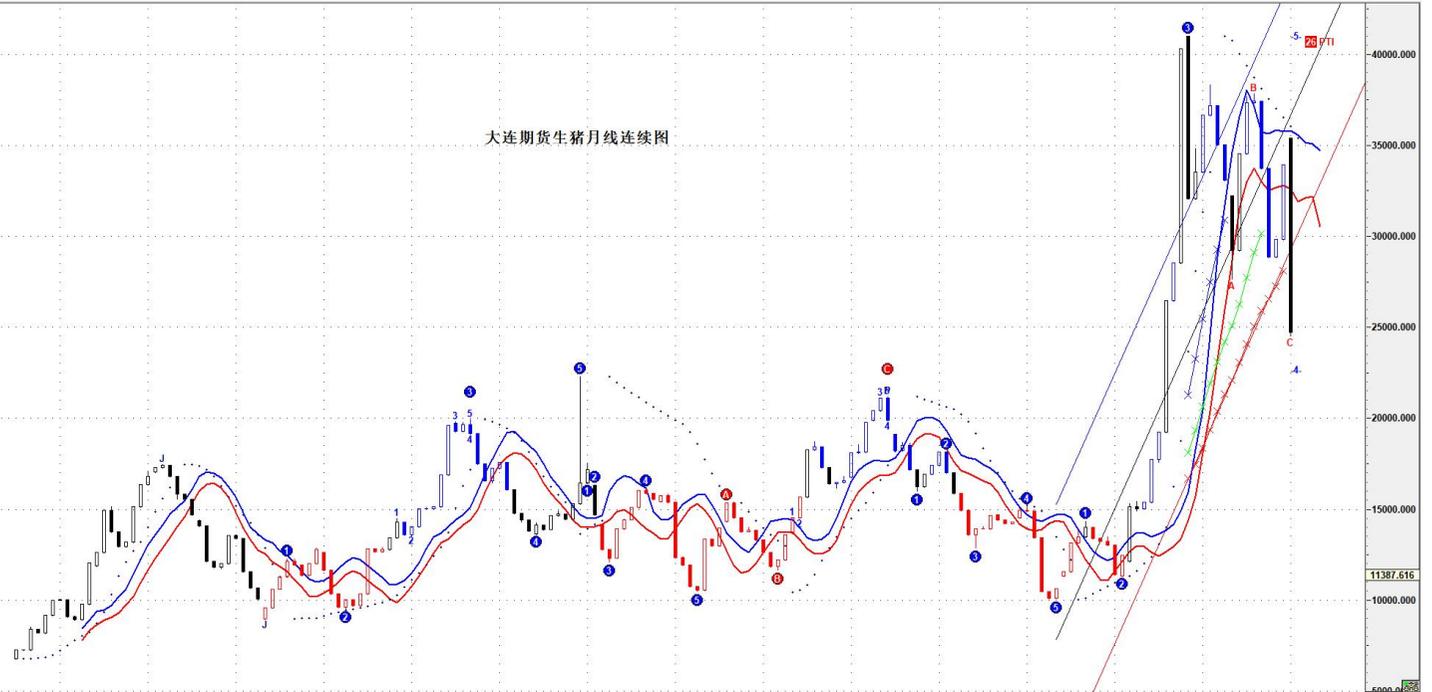


01/29/21

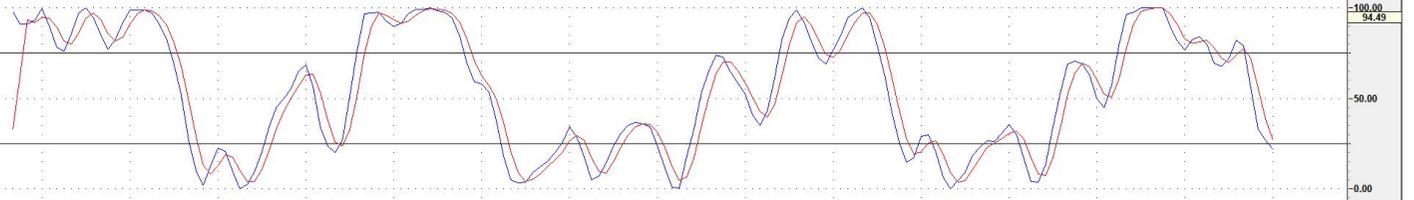
O: 35410.000 H: 35410.000 L: 24460.000 C: 24725.000

-9215.000

大连期货生猪月线连续图



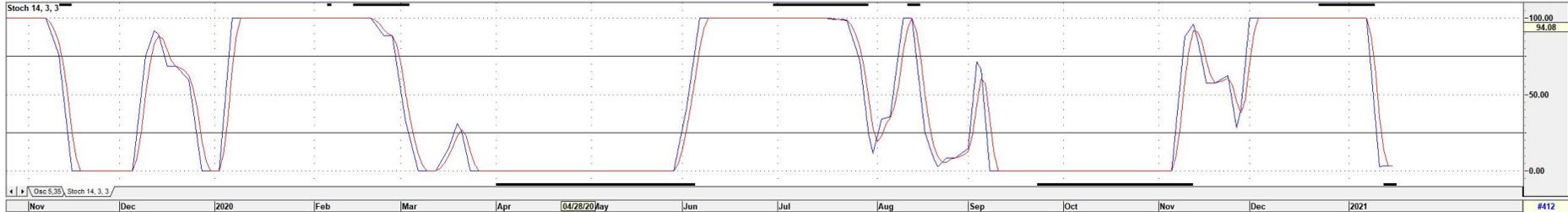
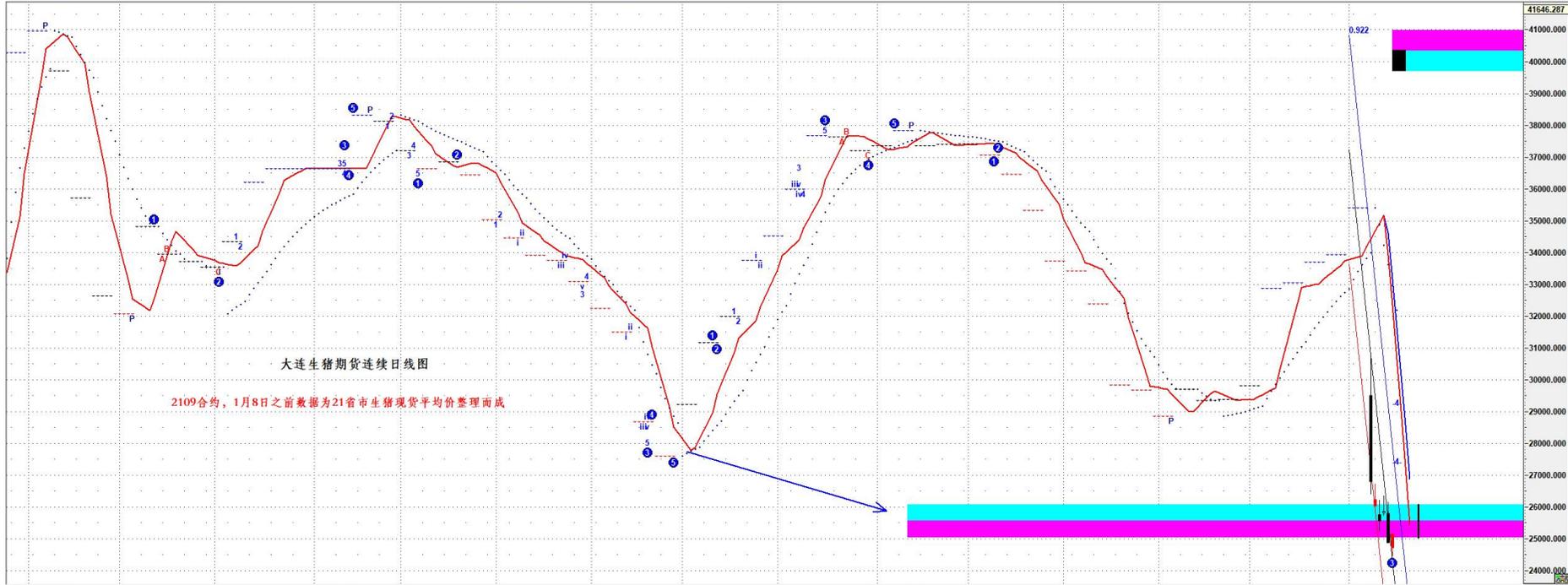
Stoch 14, 3, 3



Stoch 14, 3, 3 / Osc 5.35 /

2007 2008 09/30/08 2009 2010 2011 2012 2013 2014 2015 2016 2017 2018 2019 2020 2021

#27



02/11/00

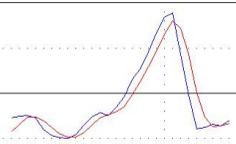
O: 24580.000 H: 25065.000 L: 24575.000 C: 24725.000

+145.000

大连生猪期货连续小时图 (2109合约)



Stoch 14, 3, 3



◀ ▶ ⌂ [Osc 5.38] Stoch 14, 3, 3 /

[08/09/99]

[Feb]

104

大连生猪期货系统化交易报告

一、基本策略：以期货主力合约为交易标的，按照 60M、日线为时间周期框架，遵照系统信号进行交易

二、结算基本信息：1 手=16 吨；保证金比例 15%；手续费比例万分之二，日内万分之四

三、系统模拟交易记录：

开仓日	买卖	价格	数量	平仓日	买卖	价格	数量	平仓盈亏	收盘价	浮动盈亏	原因
01/11 11:00	S	26085	1								60M 信号
				01/12 11:00	B	26085	1	0			60M 信号
01/14 14:00	S	25265	1						24890	6000	60M 信号
01/14/15:00	S	24890	1						24890	0	日线下破 MOB 支撑，且持续空头加码信号

四、最新持仓：空单 2 手

五、生猪期货系统化交易模拟账户每日结算

结算要素：最大持仓 4 手；手续费万分之三；保证金 16%；账户资金按照 18%满仓计算暂定为 50 万

结算日	上日余额	手续费	平仓盈亏	当日余额	持仓盈亏	当日权益
2021/1/8	500000	0	0	500000		500000
2021/1/11	500000	125.21	0	499874.79	880	500754.79
2021/1/12	499874.79	125.21	0	499749.58		499749.58
2021/1/13	499749.58	0	0	499749.58		499749.58
2021/1/14	499749.58	240.74	0	499508.84	6000	505508.84

六、 不同时间周期的系统化多空方向指示（均已收盘时的信号为准）

日期	收盘价	时间框架				次日第一小时 转向信号	次日日线 转向信号
		短期（60M）	中期（日）	长期（周）	超长期（月）		
2021/1/14	24890	空	空++++	空	空	空头平仓 26053 多头开仓 26200	空头平仓 33173 多头开仓 32947
2021/1/13	25870	无	空++++	空	空	空头开仓 25710 多头开仓 26276	空头平仓 34622 多头开仓 33632
2021/1/12	25560	无	空	空	空	空头开仓 25519 多头开仓 26137	空头平仓 35165 多头开仓 34237
2021/1/11	26030	空	空	空	空	空头平仓 26371 多头开仓 27440	空头平仓 34885 多头开仓 34920
2021/1/8	26810	空	空	空	空	暂无	空头平仓 34675 多头开仓 35910