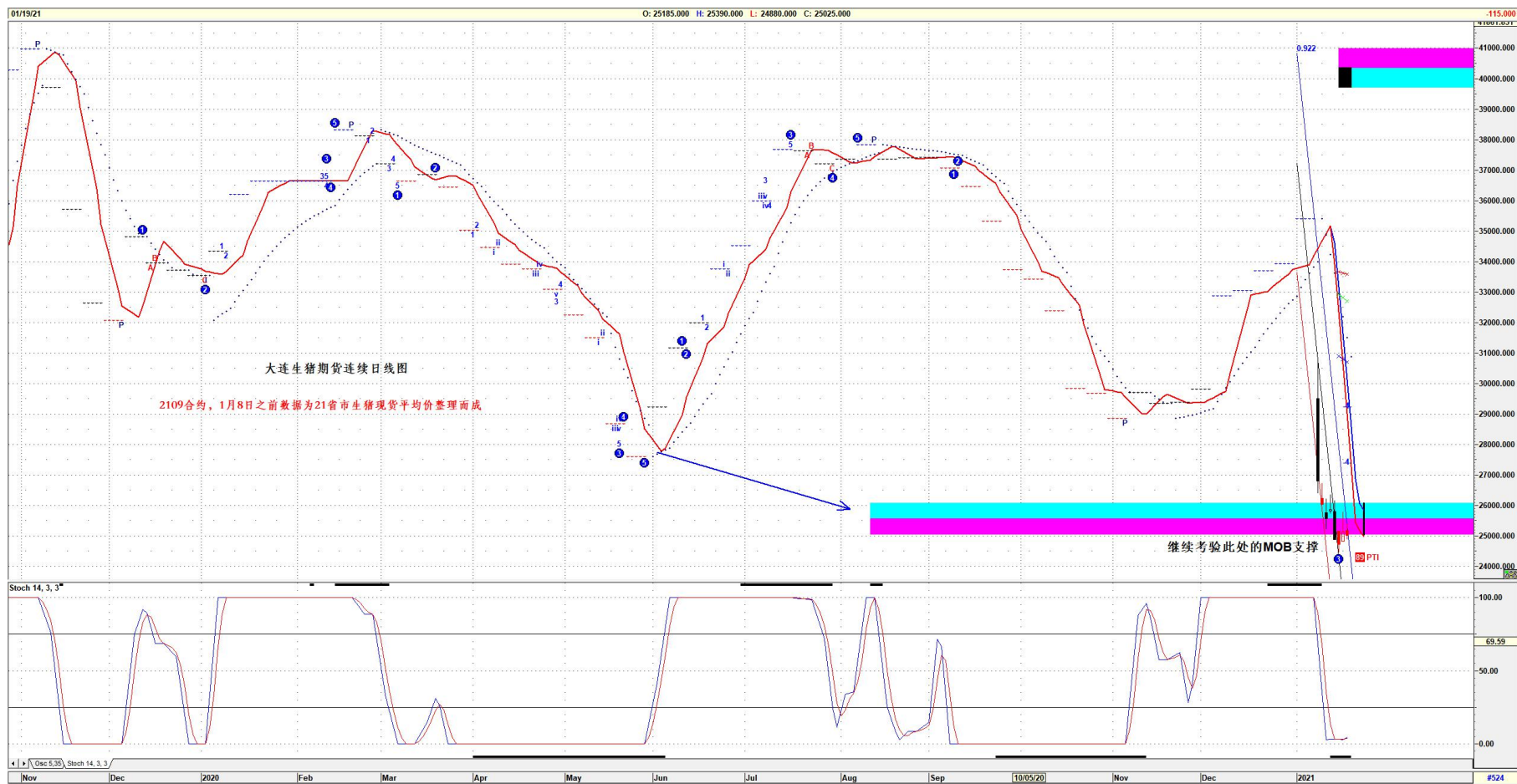


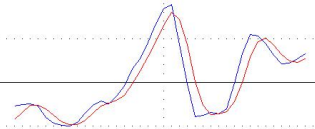
大连生猪期货系统化交易报告（20210119）



大连生猪期货连续小时图 (2109合约)



Stoch 14, 3, 3



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

四、 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
				01/18/ 10: 00	B	25330	2	-8080			
01/18/11:30	B	25300	1								60M 出现多头信号
				01/18/15: 00	S	25140	1	-2560			60M 出现多头平仓信号
01/19/14: 00	S	24950	1						25025	-1200	60M 出现空头信号

五、 最新持仓：空头 1 手

六、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
2021/1/15	499508.84	0	0	499508.84	17280	516788.84
2021/1/18	499508.84	364.61	-10640	488504.23		488504.23
2021/1/19	488504.23	119.76	0	488384.47	-1200	487184.47

七、 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)		
2021/1/19	250255	空	空++++	空	空	空头平仓 25334	空头平仓 28588
						多头开仓 25344	多头开仓 30877
2021/1/18	25140	无	空++++	空	空	空头开仓 24728	空头平仓 30130
						多头开仓 25780	多头开仓 31504
2021/1/15	24725	空	空++++	空	空	空头平仓 25180	空头平仓 31640
						多头开仓 25616	多头开仓 32192
2021/1/14	24890	空	空++++	空	空	空头平仓 26053	空头平仓 33173
						多头开仓 26200	多头开仓 32947
2021/1/13	25870	无	空++++	空	空	空头开仓 25710	空头平仓 34622
						多头开仓 26276	多头开仓 33632