

《易·大有》“其德刚健而文明，应乎天而时行，是以元亨”

## “元亨” 程序化交易策略实盘指导报告

(2014 年 12 月 16 日)

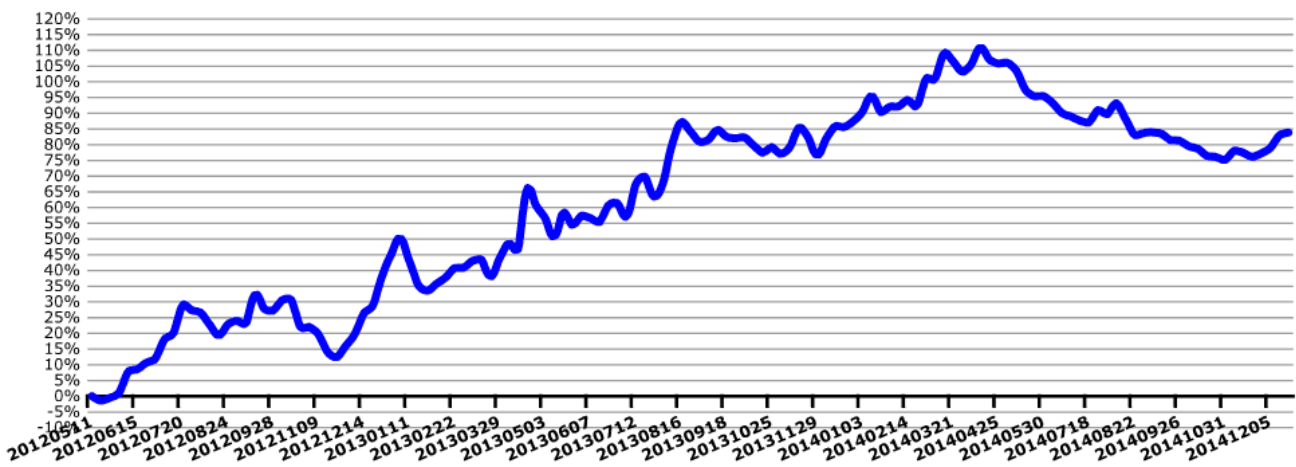
实盘账户：达摩掌 (激进型)

统计起始日期：2012 年 5 月 11 日

| 初始资金   | 中途入金   | 当日权益       | 当日盈利率 | 累积盈利率  | 现有持仓          |
|--------|--------|------------|-------|--------|---------------|
| 200000 | 923994 | 1255350.76 | 0.74% | 83.88% | 多单: 股指<br>空单: |

注：① 多品种多策略组合。

### 达摩掌的累积收益曲线 (激进型)



#### “元亨” 程序化交易策略简介：

“元亨” 程序化交易策略 (以下简称“元亨”) 是国都期货研发的多品种多策略组合型程序化交易策略，该策略历经 3 年多的产品研究和 2 年多的实盘指导，取得了比较理想的成绩，并获得了在 CCTV 证券资讯频道 (166 台) 期货时间节目中的程序化交易展示平台“兵器谱”栏目中长期展示资格，展示账户化名“金刚杵”。

元亨程序化交易策略的基本理念就是“交易资金曲线”。即通过管理资金曲线，在可控风险的基础上实现超额收益。期货交易的核心是风险管理，体现在程序化交易上面就是通过具体的品种、周期、仓位、策略等细节的组合与控制实现对资金曲线的管理。

元亨程序化交易策略总体为趋势跟踪型的组合策略。趋势跟踪型的交易策略是目前国际主流基金普遍采用的交易策略。通过对趋势的跟踪来赚取超额收益，通过不同品种和市场的组合实现对冲风险。

免责声明:

如果您对本报告有任何意见或建议，请致信于国都信箱(tzzx@guodu.cc)，欢迎您及时告诉我们您对本刊的任何想法！

本刊所有信息均建立在可靠的资料来源基础上。我们力求能为您提供精确的数据，客观的分析和全面的观点。但我们必须声明，对所有信息可能导致的任何损失概不负责。

本报告并不提供量身定制的投资建议。报告的撰写并未虑及读者的具体财务状况及目标。国都期货研究团队建议投资者应独立评估特定的投资和战略，并鼓励投资者征求专业财务顾问的意见。具体的投资或战略是否恰当取决于投资者自身的状况和目标。

版权声明：(c) 本报告版权为国都期货有限公司所有。本刊所含文字、数据和图表未经国都期货有限公司书面许可，任何人不得以电子、机械、影印、录音或其他任何形式复制、传播或存储于任何检索系统。未经许可，复制本刊任何内容皆属违反版权法行为，可能将受到法律起诉，并承担与之相关的所有损失赔偿和法律费用。

涉及版权的所有问题请垂询：010-84183008/3009。