

“日内盈”示范账户

产品说明:

“日内盈”是平安期货产品小组推出的系列产品之一，本产品以期货交易策略系统化研究为基础，通过量化测算与研究员逻辑与合理性检验，形成程序化交易模型。通过操作机会盘中推荐，以及模型的定期修正检验，为目标客户提供全面的交易服务。在长期回测和实盘跟踪过程中，该产品均有上佳表现。正式对外发布产品始于2011年10月24日，在交易中我们即时向客户发布交易信号提示，交易结果则在收盘之后通过平安网站公布。

示范账户最新交易记录：2012-01-19， 盈利 4.28 %。

累计交易记录：19次交易，累计盈利 25.94 %，胜率 63.16 %。

一、产品理念

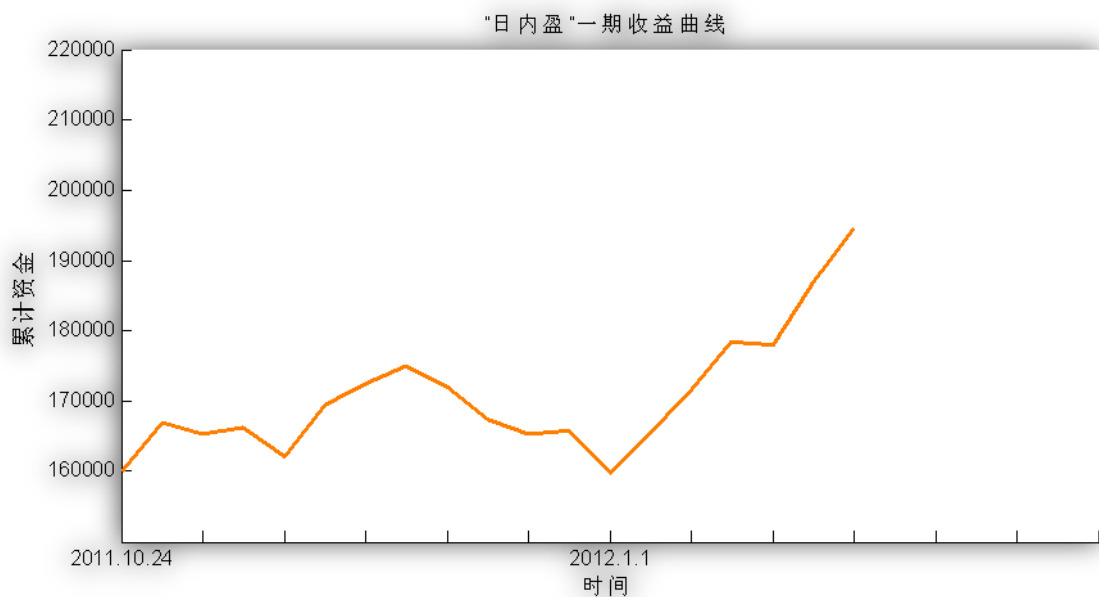
以量化分析为基础，加上资深研究员的逻辑与合理性检验，形成多种日内交易策略。在风险控制的情况下按照既定策略进行交易，通过追逐大概率的交易机会，为高端客户提供简单直接的理财服务，以促进客户资产的长期稳定增值为最终目标。

二、产品特点

- 1、具体操作建议均建立在模型发出信号的基础上，避免人性因素困扰；
- 2、每次操作设定止损位，严格控制单次最大亏损度；
- 3、以日内交易为主，避免隔夜跳空风险；
- 4、交易频率低，以大概率盈利机会为目标。

- 5、择流动性好的合约操作，保证流动性；
- 6、交易模型的定期修正与退出机制，追随市场风格的变化；
- 7、策略的多元化，通过策略的多元化平滑产品系统风险。

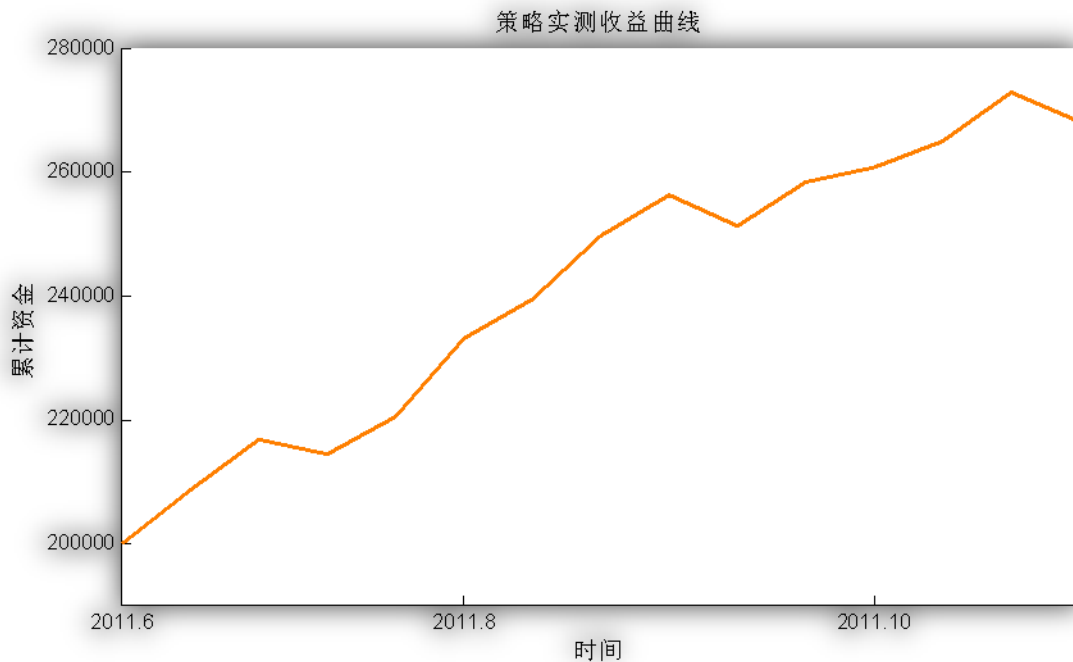
三、“日内盈”一期（2011.10.24 起）



“日内盈”一期交易结果	
交易区间	2011.10.24 -
交易准则	日内交易
期初/期末资金	16万 / 20.1万
累计收益率	25.94 %
交易次数	19次
交易胜率	63.16%
平均单次收益	2184.15
最大单次损失	-5974.61
最大连续损失	-9545.21
保证金/手续费	17%，1.5/万

日期	合约代码	开仓方向	开仓时间	开仓价格	平仓时间	平仓价格	手数	手续费	交易盈亏	期末资金	累计收益率
1023										160000.00	
1024	IF1111	多	1322	2572.2	1338	2595.8	1	232.56	6847.44	166847.44	4.28%
1025	-	多	1315	2621.8	1415	2617.4	1	235.76	-1555.76	165291.68	3.31%
1026		多	1305	2673.6	1405	2677.6	1	240.80	959.20	166250.87	3.91%
1101	-	多	1019	2729.8	1119	2716.6	1	245.09	-4205.09	162045.78	1.28%
1102	-	多	1417	2717.6	1425	2743.2	1	245.74	7434.26	169480.05	5.93%
1116	IF1112	空	1121	2700	1351	2689.2	1	242.51	2997.49	172477.53	7.80%
1130	-	空	1104	2551.2	1334	2542.4	1	229.21	2410.79	174888.32	9.31%
1201	-	多	1044	2630	1314	2620.8	1	236.29	-2996.29	171892.04	7.43%
1215	IF1201	空	1344	2361.6	1356	2375.8	1	213.18	-4473.18	167418.85	4.64%
1216	-	多	1432	2400.2	1510	2394	1	215.74	-2075.74	165343.11	3.34%
1221	-	空	1438	2357.2	1510	2354.8	1	212.04	507.96	165851.07	3.66%
1223	-	多	1125	2394.2	1311	2374	1	214.61	-5974.61	159876.46	-0.08%
2012年											
0104	-	空	1401	2328.6	1501	2309.2	1	208.70	5611.30	165487.76	3.43%
0109	-	多	1040	2335.2	1113	2356.2	1	211.11	6088.89	171576.65	7.24%
0110	-	多	1309	2419.2	1333	2443	1	218.8	6921.20	178497.85	11.56%
0113	-	空	1125	2402.4	1355	2403.4	1	216.26	-516.26	177981.59	11.24%
0117	-	多	1321	2403.6	1343	2434.6	1	217.72	9082.28	187063.87	16.91%
0118	IF1202	空	1401	2457.6	1448	2431.6	1	220.01	7579.99	194643.85	21.65%
0119	-	多	1010	2488.8	1037	2512.4	1	225.05	6854.95	201498.80	25.94%

四、策略实测结果（2011.6.1 - 2011.10.20）



策略实测结果	
实测区间	2011.6.1 - 2011.10.21
交易准则	日内交易
期初/期末资金	20万 / 26.8万
累计收益率	34.06%
交易次数	14次
交易胜率	78.57%
平均单次收益	4865.21
最大单次损失	-5041.65
最大连续损失	-5041.65
保证金/手续费	17%，1.5/万

日期	合约代码	开仓方向	开仓时间	开仓价格	平仓时间	平仓价格	手数	手续费	交易盈亏	期末资金	累计收益率
0601										200000	
0623	IF1107	多	1431	2944.2	1440	2973.4	1	266.29	8493.71	208493.71	4.25%
0624	-	多	1120	3011.8	1322	3039.8	1	272.32	8127.68	216621.39	8.31%
0630	-	多	1044	3070.2	1314	3063.8	1	276.03	-2196.03	214425.36	7.21%
0725	IF1108	空	1354	2994	1454	2972.8	1	268.51	6091.49	220516.85	10.26%
0808	-	空	1055	2834.8	1102	2792.6	1	253.23	12406.77	232923.62	16.46%
0809	-	多	1301	2778.6	1401	2801.2	1	251.09	6528.91	239452.53	19.73%
0811	-	多	1019	2836.4	1047	2871.2	1	256.84	10183.16	249635.68	24.82%
0825	IF1109	多	1128	2867.8	1358	2890.4	1	259.12	6520.88	256156.57	28.08%
0914	-	空	1338	2677	1357	2693	1	241.65	-5041.65	251114.92	25.56%
0921	IF1110	多	1122	2742.4	1126	2767.4	1	247.94	7252.06	258366.97	29.18%
0922	-	空	1440	2692.2	1510	2683.4	1	241.90	2398.10	260765.07	30.38%
1011	-	空	1111	2581.4	1341	2567	1	231.68	4088.32	264853.39	32.43%
1012	-	多	1013	2583.2	1024	2610.6	1	233.72	7986.28	272839.67	36.42%
1020	-	空	1352	2511	1427	2526	1	226.67	-4726.67	268113.01	34.06%

五、策略历史回测结果（2010.4.16 - 2011.5.31）



策略回测结果	
回测区间	2010.4.16 - 2011.5.31
交易准则	日内交易
期初/期末资金	20万 / 43.6万
累计收益率	117.95%
交易次数	77次
交易胜率	67.53%
平均单次收益	3063.74
最大单次损失	-8901.49
最大连续损失	-24035.43
保证金/手续费	17%, 1.5/万

风险提示:

期货市场是一个风险无时不在的市场。您在进行交易时存在赢利的可能，也存在亏损的风险。请您务必对此有清醒的认识，认真考虑是否进行证券，期货交易。市场有风险，投资需谨慎。

免责条款:

此报告旨在发给平安期货有限公司（以下简称“平安期货”）的特定客户及其他专业人士。未经平安期货事先书面明文批准，不得更改或以任何方式传送、复印或派发此报告的材料、内容及其复印本予任何其它人。

平安期货可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。本报告及该等报告反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。报告所载资料、意见及推测仅反映分析员于发出此报告日期当日的判断，可随时更改。此报告所指的期货、期权和证券价格、价值及收入可跌可升。为免生疑问，此报告所载观点并不代表平安期货有限公司的立场。

平安期货有限公司2011版权所有。保留一切权利。

中国平安 PINGAN

平安期货有限公司

地址：深圳市福田区中心区福华三路88号时代财富大厦26楼

客服：400 8888 933

电话：0755-8378 8578

传真：0755-8378 5241

邮编：518031

网址：<http://futures.pingan.com>