

策略 1

预期年化收益：20%-30%

最大风险率：15%

风险收益：风险容忍度中等，收益较高

投资范围：商品期货、股指期货

投资目标：多品种多策略量化交易系统，通过良好的资金分配原则和运用原则，结合完善的风险控制策略，利用各个系统的优势以求在稳定中获取利润。

投资策略：品种数>10，每个品种各有4组策略，阶段性进行品种更换。



		备注
总盈利/总亏损	1.35	
收益率	47.34%	按照净值计算
交易日	406	2012/1/1--最近交易日
平均日收益率	0.12%	日收益率计算
年化收益率	29.39%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	10.35%	按照净值计算
最长回撤时间	72	最长不创新高交易日
收益风险比	2.84	按日收益率计算

策略 2

预期年化收益：20%-30%

最大风险率：15%

风险收益：风险容忍度中等，收益较高

投资范围：商品期货

投资目标：以多种商品期货趋势交易系统为主。通过良好的资金分配原则和运用原则，结合完善的风险控制策略，利用各个系统的优势以求在稳定中获取利润。

投资策略：品种数 5-6，每个品种各有 2 组策略，阶段性进行品种更换。



		备注
总盈利/总亏损	1.46	
收益率	52.64%	按照净值计算
交易日	406	2012/1/1--最近交易日
平均日收益率	0.13%	日收益率计算
年化收益率	32.68%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	8.16%	按照净值计算
最长回撤时间	99	最长不创新高交易日
收益风险比	4.00	按日收益率计算

策略 3

预期年化收益：150%

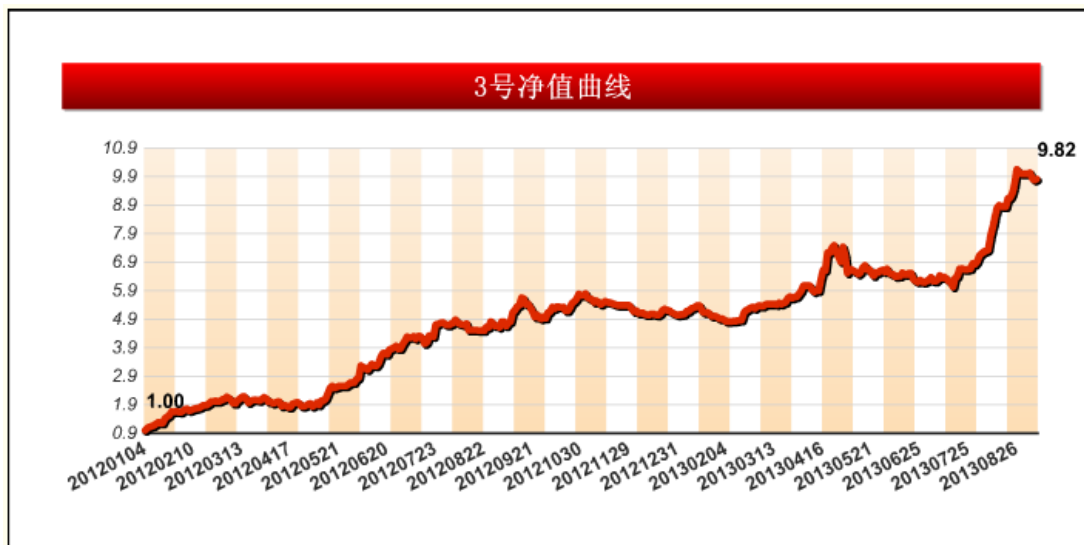
最大风险率：30%

风险收益：风险容忍度偏高，收益高

投资范围：商品期货、股指期货

投资目标：以多策略交易系统为主。通过较为激进的资金分配原则，结合完善的风险控制策略，以求获取较大的利润。

投资策略：品种数 2-3，择时择机主观交易为主，阶段性进行品种更换，仓位较重。



		备注
总盈利/总亏损	1.71	
收益率	881.94%	按照净值计算
交易日	406	2012/1/1--最近交易日
平均日收益率	2.17%	日收益率计算
年化收益率	547.41%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	19.50%	按照净值计算
最长回撤时间	97	最长不创新高交易日
收益风险比	28.08	按日收益率计算

策略 5

预期年化收益：30%

最大风险率：15%

风险收益：风险容忍度中等，收益较高

投资范围：商品期货、股指期货

投资策略：以多种商品期货趋势交易系统为主。通过良好的资金分配原则和运用原则，结合完善的风险控制策略，利用各个系统的优势以求在稳定中获取利润。

投资策略：组合策略，品种择机主观选择，量化信号客观操作。



		备注
总盈利/总亏损	1.79	
收益率	73.37%	按照净值计算
交易日	143	2012/5/8--2012/12/1
平均日收益率	0.51%	日收益率计算
年化收益率	129.29%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	10.54%	按照净值计算
最长回撤时间	40	最长不创新高交易日
收益风险比	12.27	按日收益率计算

策略 6

预期年化收益：50%-60%

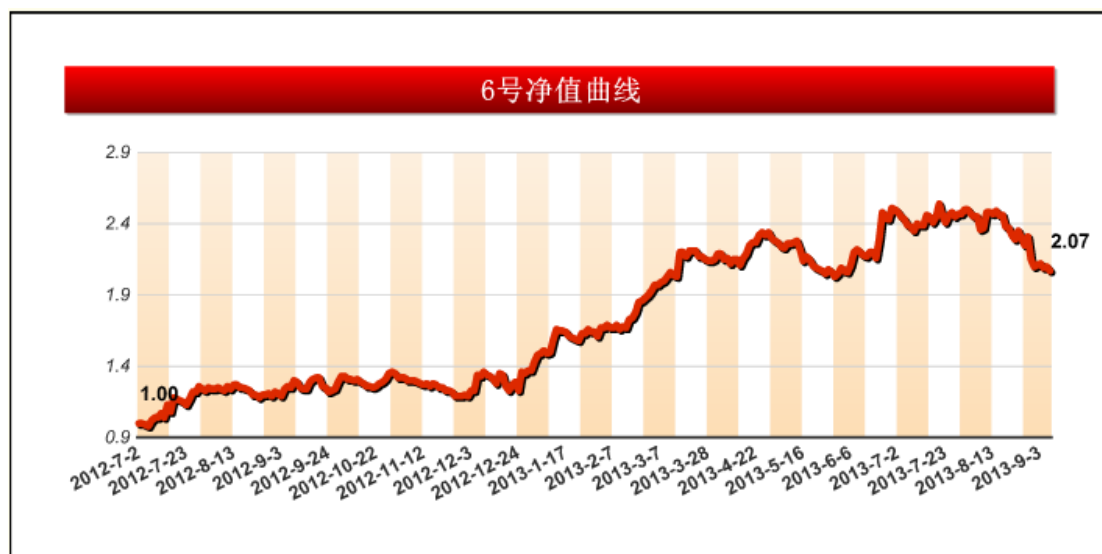
最大风险率：20%

风险收益：风险容忍度中等，收益较高

投资范围：商品期货、股指期货

投资目标：以多种商品期货趋势交易系统以及股指期货日内短线交易为主。通过良好的资金分配原则和运用原则，结合完善的风险控制策略，利用各个系统的优势以求在稳定中获取利润。

投资策略：品种数 10，3 大趋势策略+9 大股指日内短线策略，资金优化配置。



		备注
总盈利/总亏损	1.32	
收益率	106.54%	按照净值计算
交易日	289	2012/7/1--最近交易日
平均日收益率	0.37%	日收益率计算
年化收益率	92.90%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	18.59%	按照净值计算
最长回撤时间	37	最长不创新高交易日
收益风险比	5.00	按日收益率计算

策略 7

预期年化收益：20%-30%

最大风险率：10%

风险收益：风险容忍度中等，收益较高

投资范围：股指期货

投资目标：以股指期货日内短线交易为主。通过良好的资金分配原则和运用原则，结合完善的风险控制策略，利用各个系统的优势以求在稳定中获取利润。



		备注
总盈利/总亏损	1.34	
收益率	6.58%	按照净值计算
交易日	63	2013/6/6--
平均日收益率	0.10%	日收益率计算
年化收益率	26.33%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	5.84%	按照净值计算
最长回撤时间	27	最长不创新高交易日
收益风险比	4.51	按日收益率计算

策略 8

预期年化收益：40%-50%

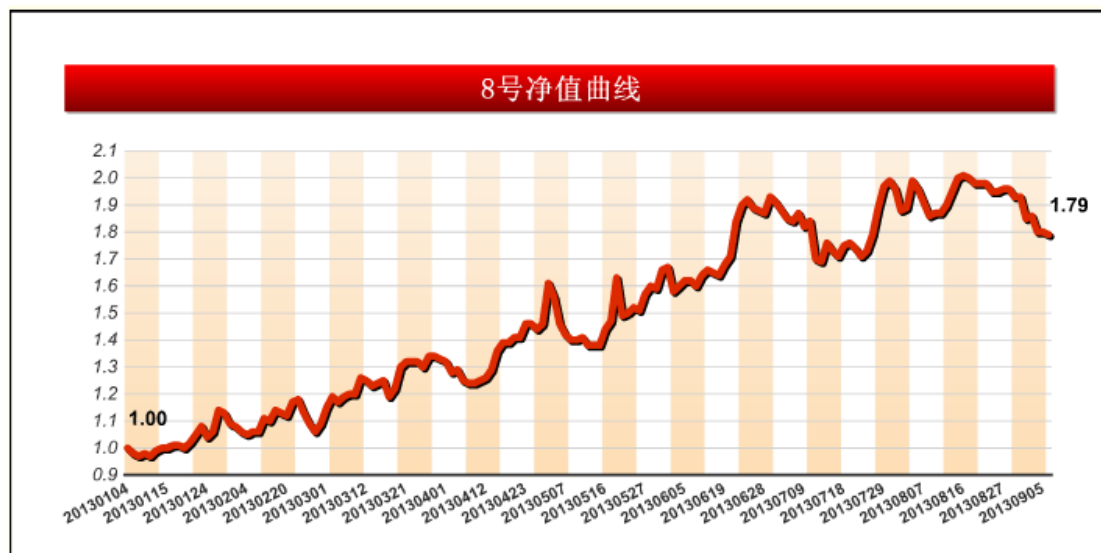
最大风险率：20%

风险收益：风险容忍度中等，收益较高

投资范围：商品期货、股指期货

投资策略：以严谨的基本面研究为基础，在控制风险敞口的前提下，运用量化技术，捕捉市场的套利、对冲投资机会，以及单边投机机会。

投资策略：品种数 2-3，择时择机主观交易为主，阶段性进行品种更换，仓位较重。



		备注
总盈利/总亏损	1.39	
收益率	79.44%	按照净值计算
交易日	163	2013/1/1--最近交易日
平均日收益率	0.49%	日收益率计算
年化收益率	122.81%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	14.74%	按照净值计算
最长回撤时间	28	最长不创新高交易日
收益风险比	8.33	按日收益率计算

