

联系人：金淑芳

QQ:1539547992

电话：18657781468

新湖-产品

20131115

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	1.31	
收益率	46.90%	按照净值计算
交易日	449	2012/1/1--最近交易日
平均日收益率	0.10%	日收益率计算
年化收益率	26.32%	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	2.54	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	1.33	
收益率	45.12%	按照净值计算
交易日	449	2012/1/1--最近交易日
平均日收益率	0.10%	日收益率计算
年化收益率	25.32%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	9.22%	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	2.75	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	1.75	
收益率	1086.21%	按照净值计算
交易日	449	2012/1/1--最近交易日
平均日收益率	2.42%	日收益率计算
年化收益率	609.63%	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	31.27	按日收益率计算

策略 5

预期年化收益：30%

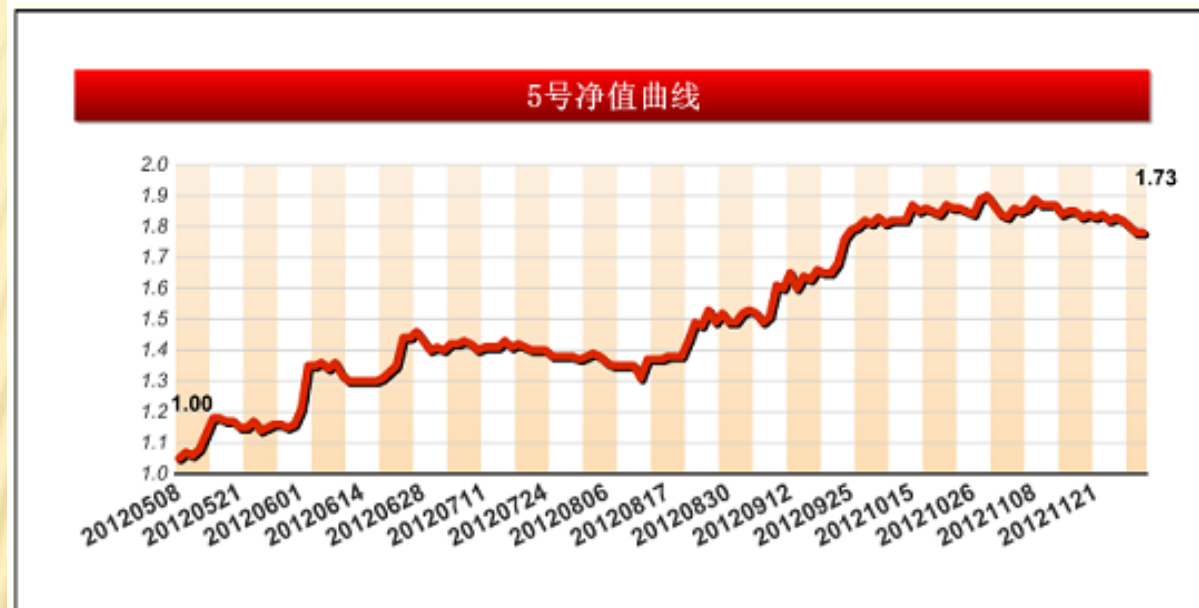
最大风险率：15%

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	1.23	
收益率	88.87%	按照净值计算
交易日	331	2012/7/1--最近交易日
平均日收益率	0.27%	日收益率计算
年化收益率	67.66%	日收益率计算，每年252个交易日
最大回撤	27.59%	按照净值计算
最长回撤时间	77	最长不创新高交易日
收益风险比	2.45	按日收益率计算

策略 7

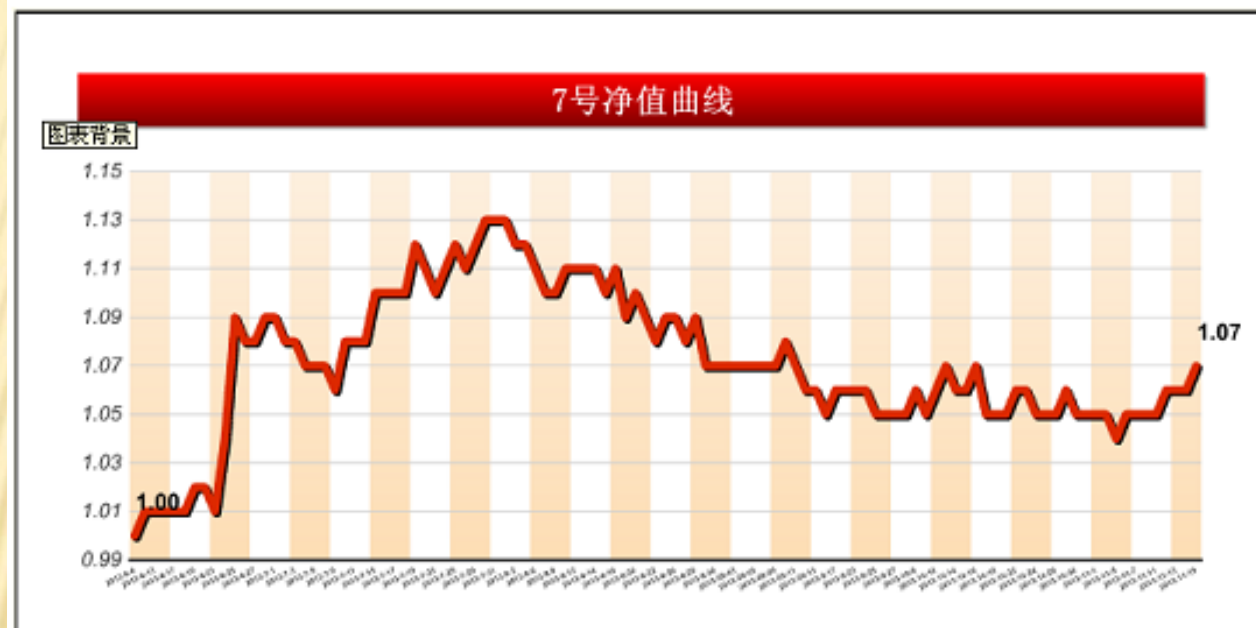
预期年化收益：20%-30%

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。



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	1.48	
收益率	128.88%	按照净值计算
交易日	206	2013/1/1--最近交易日
平均日收益率	0.63%	日收益率计算
年化收益率	157.66%	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	54	最长不创新高交易日
收益风险比	10.70	按日收益率计算

产品性能比较

收益风险比（从优到劣排序）	最长回撤时间（从优到劣排序）
3号 （31.35）	5号 （40）
5号 （12.27）	8号 （54）
8号 （9.99）	1号 （72）
2号 （2.58）	7号 （75）
1号 （2.41）	6号 （82）
6号 （2.32）	3号 （97）
7号 （1.51）	2号 （99）

我们已力求内容的客观公正

谢谢观看