

一、程序化交易信号



注：2 个策略同时运行，每次做 1 手，目前仍按照股指正常运行跟踪。

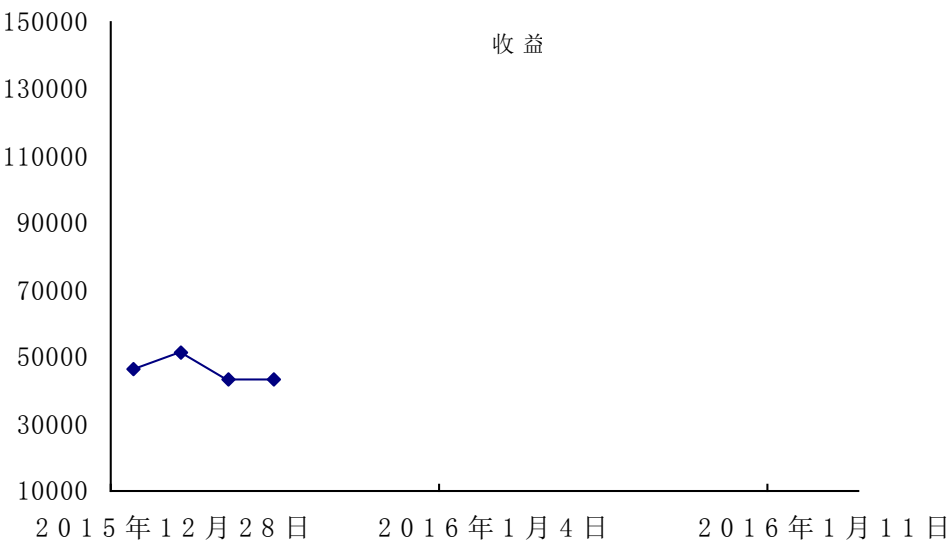
二、交易记录及收益

多头	IF1601	2015/12/31 09:49	3725.8	2015/12/31 11:04	3702.2	1	167.13	(7247.13)
空头	IF1601	2015/12/31 11:13	3690.8	2015/12/31 13:31	3681.0	1	165.87	2774.13
空头	IF1601	2015/12/31 13:01	3673.8	2015/12/31 15:14	3658.2	1	164.97	4515.03

今日盈利：42.0

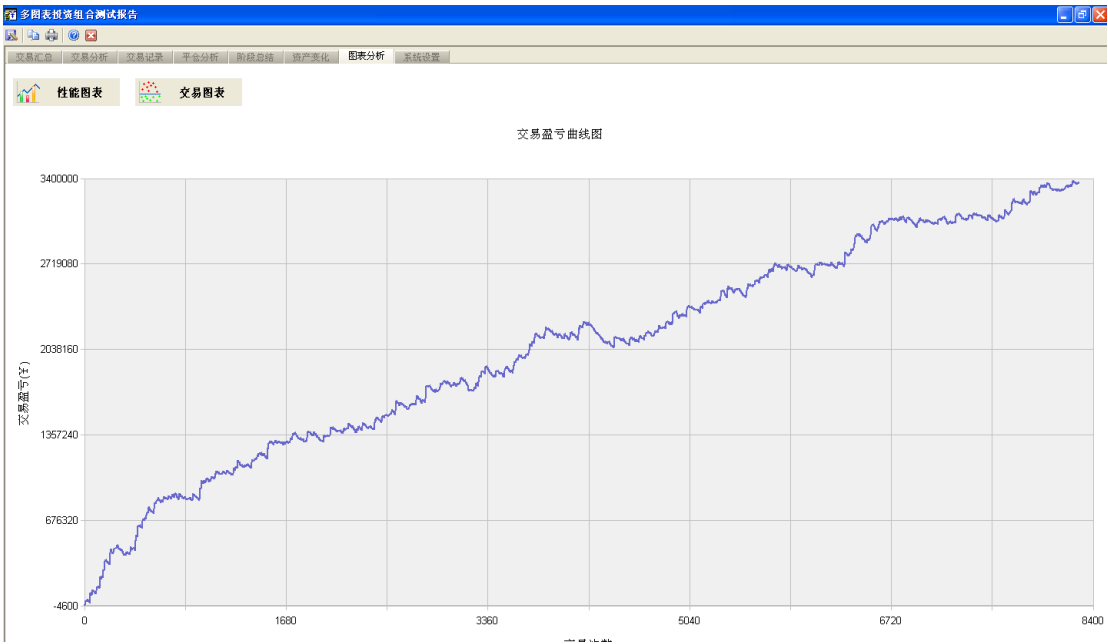
日期	收益				
十二月					
12月28日	46284.7				
12月29日	4767.8				
12月30日	-7638.7				
12月31日	42.0				

三、程序化收益曲线



【历史表现】

历史资金收益曲线 (2010.4.16 - 2015.7.18)



免责条款：

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，也没有考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告仅向特定客户传送，未经研究所授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播的行为均可能承担法律责任。

网络金融服务团