

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。

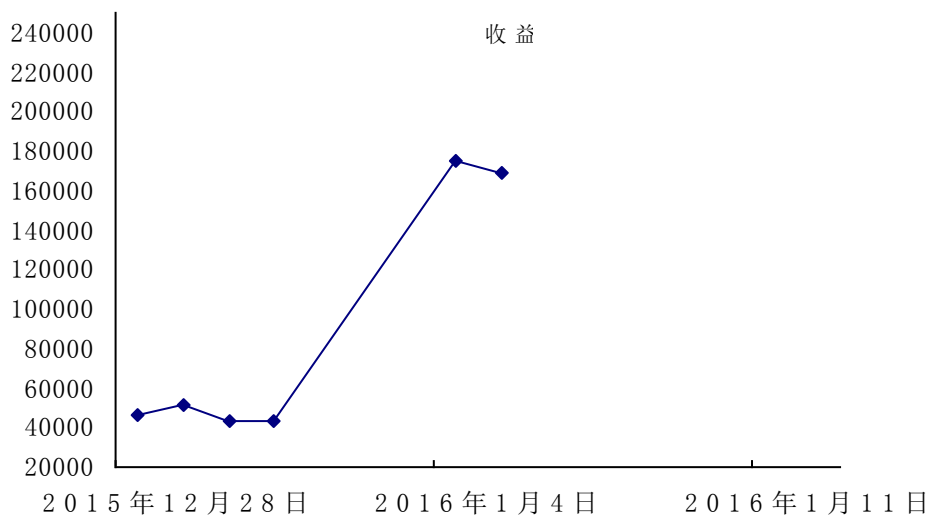
二、交易记录及收益

空头	IF1601	2015/12/31 14:51	3670.0	2016/01/04 13:28	3454.0	1	160.29	64639.71
空头	IF1601	2016/01/05 09:31	3370.2	2016/01/05 09:33	3393.8	1	152.19	(7232.19)
空头	IF1601	2015/12/31 13:01	3673.8	2016/01/05 09:48	3457.0	1	160.44	64879.56
多头	IF1601	2016/01/05 11:01	3466.2	2016/01/05 11:06	3471.8	1	156.15	923.85

今日亏损：-6308.3

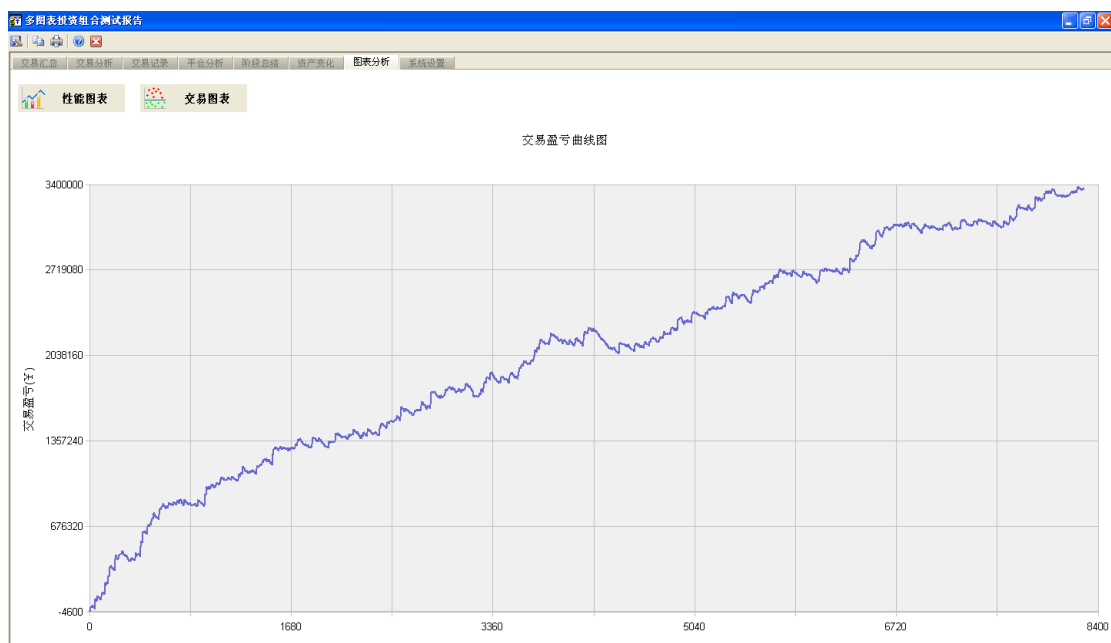
日期	收益				
十二月					
12月28日	46284.7				
12月29日	4767.8				
12月30日	-7638.7				
12月31日	42.0				
2016年一月					
1月4日	131873.9				
1月5日	-6308.3				

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