

商品持仓日报 CTA Daily Report

一. 商品组合模拟盘 3:

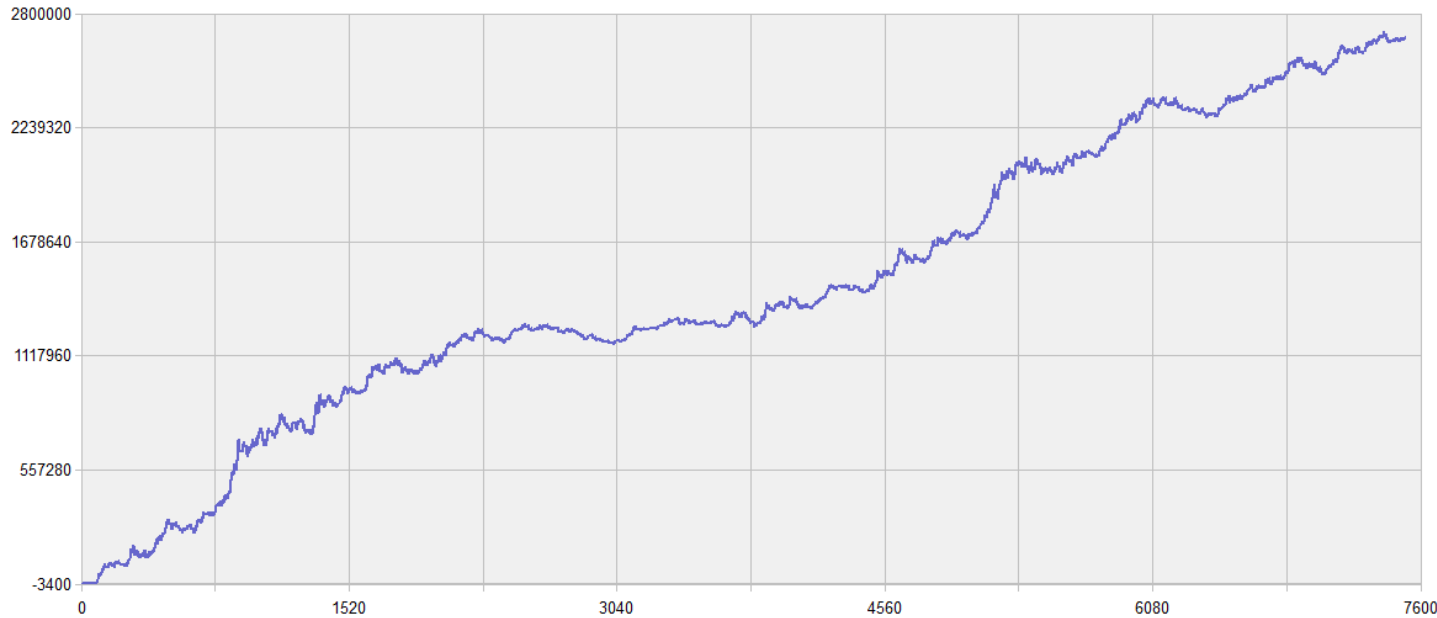
帐户	昨日结存	浮动盈亏	平仓盈亏	动态权益	可用资金	多空比率	杠杆率	持仓市值	持仓保证金	冻结资金	手续费	风险
🐟 fish0916	7745841.04	-27767.80	0.00	7718073.24	6963330.26	0.88	0.88	67986...	754742.98	0.00	0.00	9.78%

帐户	商品	总持仓	均价	现价	浮动盈亏	净市值	杠杆率	买持仓	买均价	买盈亏	今买量	多头市值	卖持仓	卖均价	卖盈亏	今卖量	空头市值
🐟 fish0916	al1905	6	13860	13870	300.00	416100	0.05	6	13860	300.00	0	416100	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	bu1906	12	3446	3448	240.00	413760	0.05	12	3446	240.00	0	413760	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	ni1906	6	101140	102270	6780.00	613620	0.08	6	101140	6780.00	0	613620	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	rb1910	12	3821	3780	-4920.00	453600	0.06	12	3821	-4920.00	0	453600	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	ru1909	6	11940	11685	-15300.00	701100	0.09	6	11940	-15300.00	0	701100	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	zn1906	6	22485	22095	-11700.00	662850	0.09	6	22485	-11700.00	0	662850	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	j1909	6	2046.0	2061.0	8994.55	1236600	0.16	6	2046.0	8994.55	0	1236600	0	0.0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	p1909	12	4685	4644	-4872.35	557280	0.07	12	4685	-4872.35	0	557280	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	CF1909	6	16065	15910	-4650.00	477300	0.06	6	16065	-4650.00	0	477300	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	SR1909	6	5371	5378	420.00	322680	0.04	6	5371	420.00	0	322680	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	TA1909	18	6388	6342	-4140.00	570780	0.07	18	6388	-4140.00	0	570780	0	0	-0.00	0	0
🐟 fish0916	ZC1905	6	619.8	621.6	1080.00	372960	0.05	6	619.8	1080.00	0	372960	0	0.0	-0.00	0	0
🏠 全部帐户	汇总(12)	102			-27767.80	6798630	0.88	102		-27767.80	0	6798630	0		0.00	0	0

二. 商品组合模拟盘净值走势 3:

说明：模拟盘初始资金 1000 万，跟踪 28 个商品，平均持仓周期 5.6 天
模拟盘平均开仓比例约为 11%，历史平均年化收益 28%，最大回撤 10%

交易盈亏曲线图(详细)



商品持仓日报 CTA Daily Report

三、商品组合模拟盘 2:

昨日结存	浮动盈亏	平仓盈亏	动态权益	可用资金	净杠杆	杠杆率	持仓保证金	持仓市值	下单冻结	手续费
52,190,992.93	-9,810.00	-40,680.00	52,140,354.25	48,036,327.26	-0.010	0.870	4,113,836.99	45,367,060.00	0.00	148.68

账户	合约	总持仓	净杠杆	杠杆率	均价	现价	浮动盈亏
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	SM905	-45	-0.032	0.032	7,500.00	7,410.00	20,250.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	ag1906	-43	-0.044	0.044	3,532.00	3,531.00	645.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	TF1906	-11	-0.208	0.208	98.63	98.53	11,000.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	T1906	-6	-0.111	0.111	96.35	96.17	10,800.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	IC1904	-1	-0.022	0.022	5,636.80	5,759.20	-24,480.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	IF1904	-1	-0.024	0.024	3,954.20	4,093.00	-41,640.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	IH1904	2	0.035	0.035	2,941.00	3,031.40	54,240.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	cu1905	9	0.043	0.043	49,460.00	49,450.00	-450.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	i1909	11	0.013	0.013	653.50	632.50	-23,100.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	bu1906	23	0.015	0.015	3,446.00	3,448.00	460.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	CF909	31	0.047	0.047	16,065.00	15,910.00	-24,025.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	ZC905	32	0.038	0.038	619.80	621.60	5,760.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	pp1909	35	0.029	0.029	8,777.00	8,713.00	-11,200.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	rb1910	35	0.025	0.025	3,821.00	3,780.00	-14,350.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	SR909	41	0.042	0.042	5,371.00	5,378.00	2,870.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	al1905	41	0.055	0.055	13,860.00	13,870.00	2,050.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	m1909	74	0.037	0.037	2,619.00	2,635.00	11,840.00
R)TBNJ[ZR2019@ZR2019]	c1909	136	0.050	0.050	1,905.00	1,912.00	9,520.00

四、商品组合模拟盘净值走势 2:

说明：模拟盘初始资金 5000 万，跟踪 20 个商品，3 个股指，2 个国债，平均持仓周期 17 天
模拟盘平均开仓比例约为 7.5%，历史平均年化收益 10%，最大回撤 5%。

