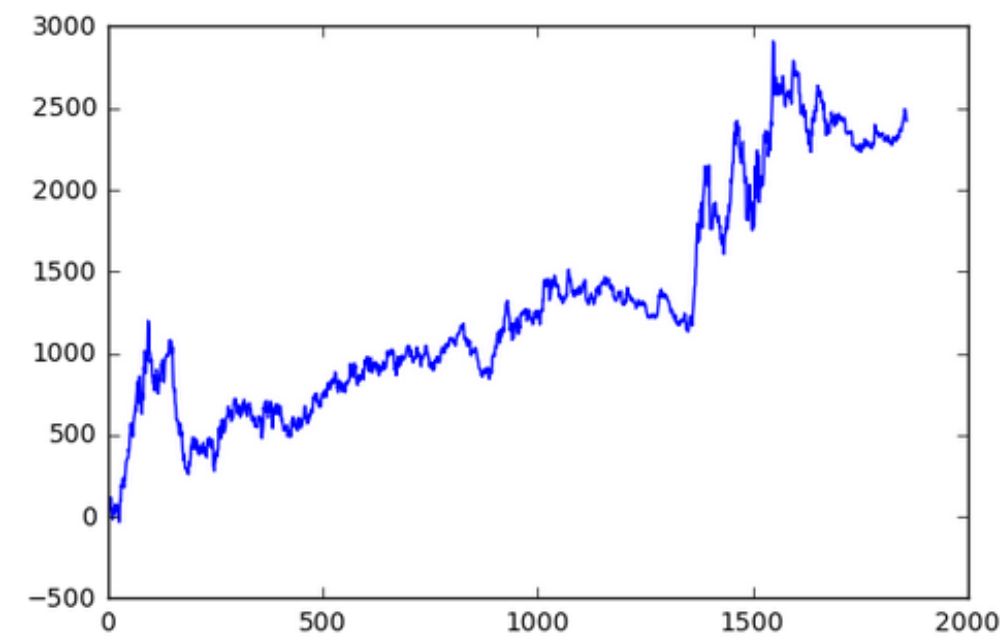


上证 50 指数

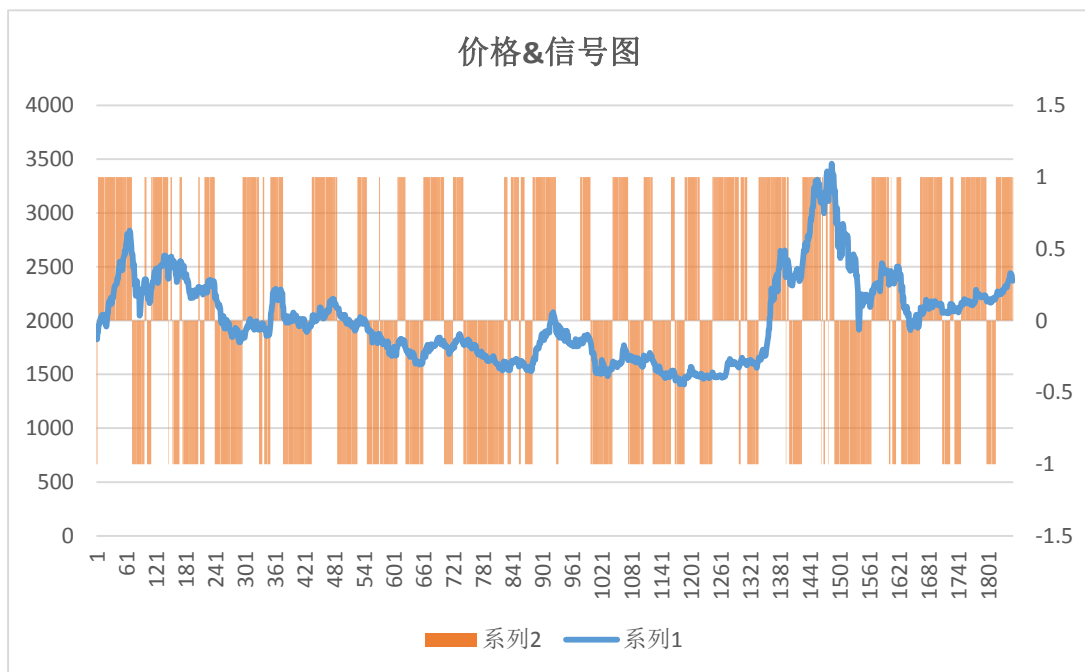
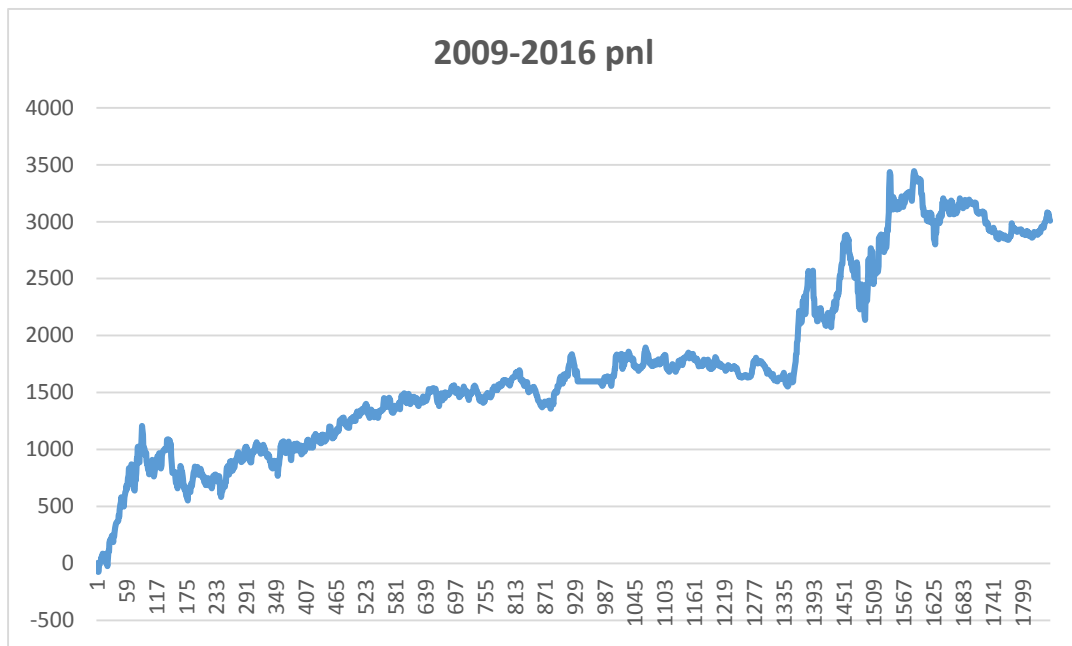
参数设置

Alpha	差分阈值	止损
0.052426	1.976498	-55.9417

Python 回测结果



30 50 81 0.37037037037  
平均盈利： 183.211553333  
平均亏损： 64.432952  
平均盈利/平均亏损： 2.84344497103

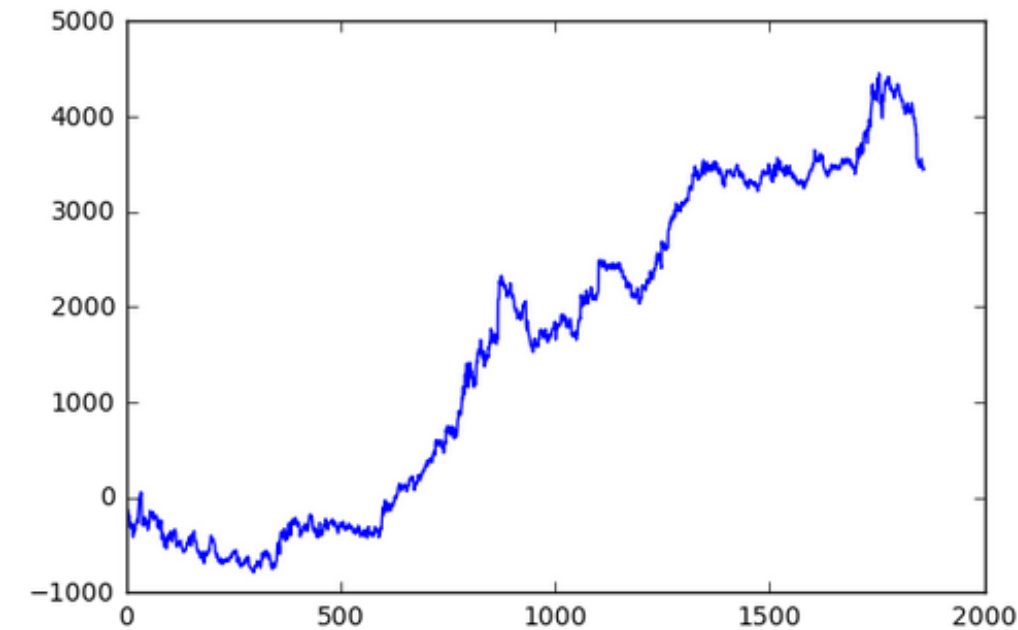


豆粕期货合约

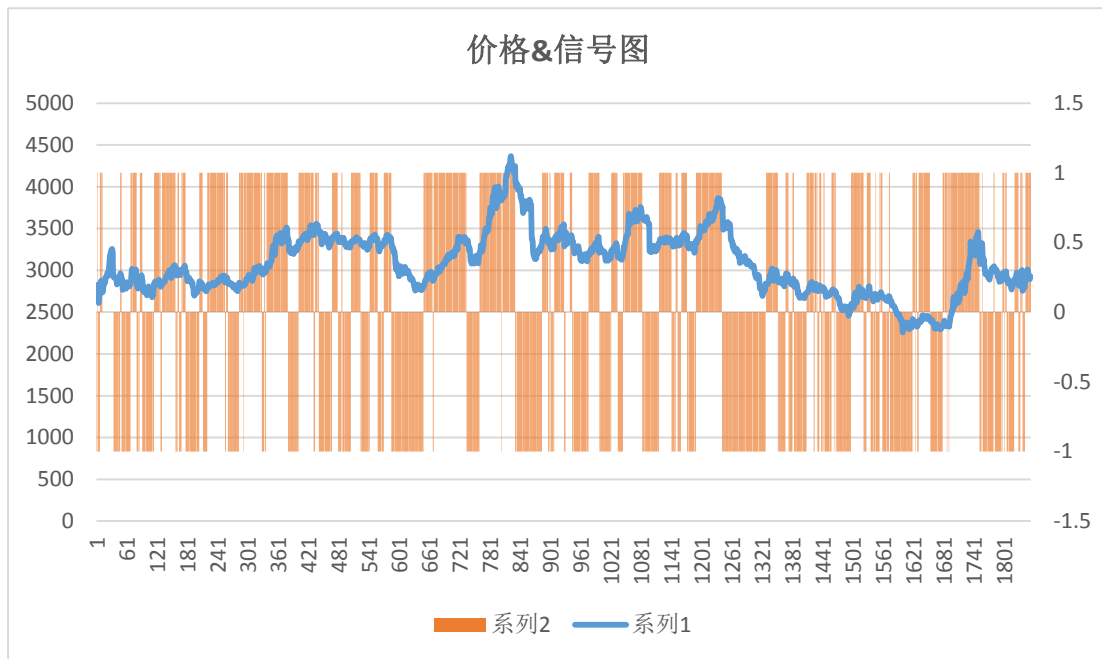
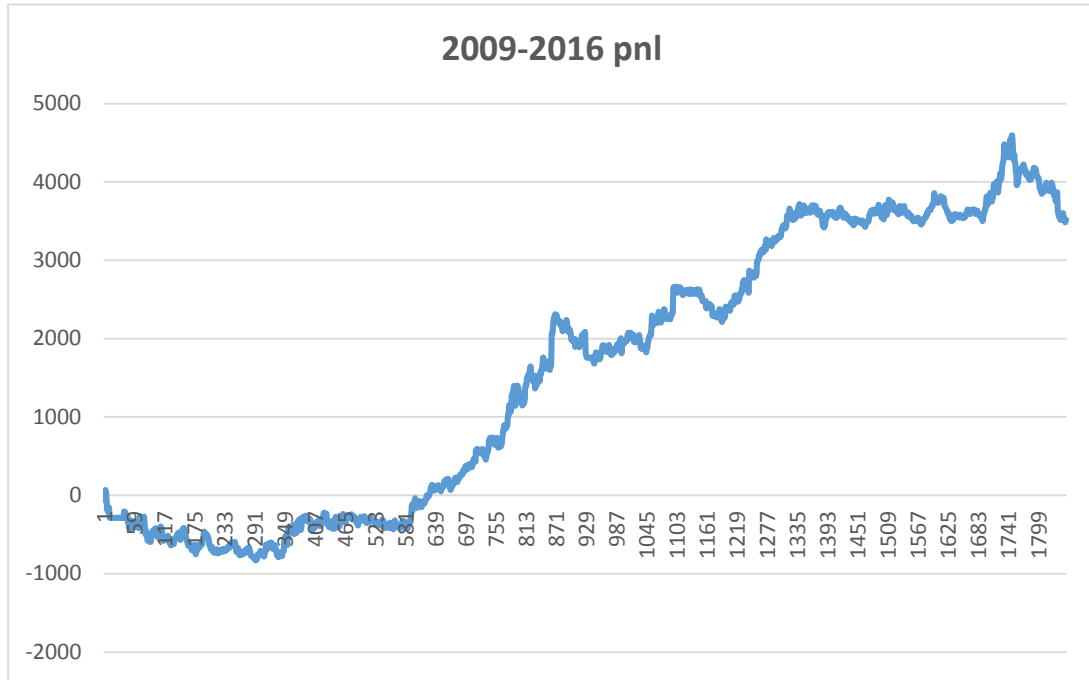
参数设置

Alpha	差分阈值	止损
0.058093	0.140077883908561	-64.2483

Python 回测结果



42 96 139 0.302158273381  
平均盈利: 190.738095238  
平均亏损: 47.5  
平均盈利/平均亏损: 4.01553884712

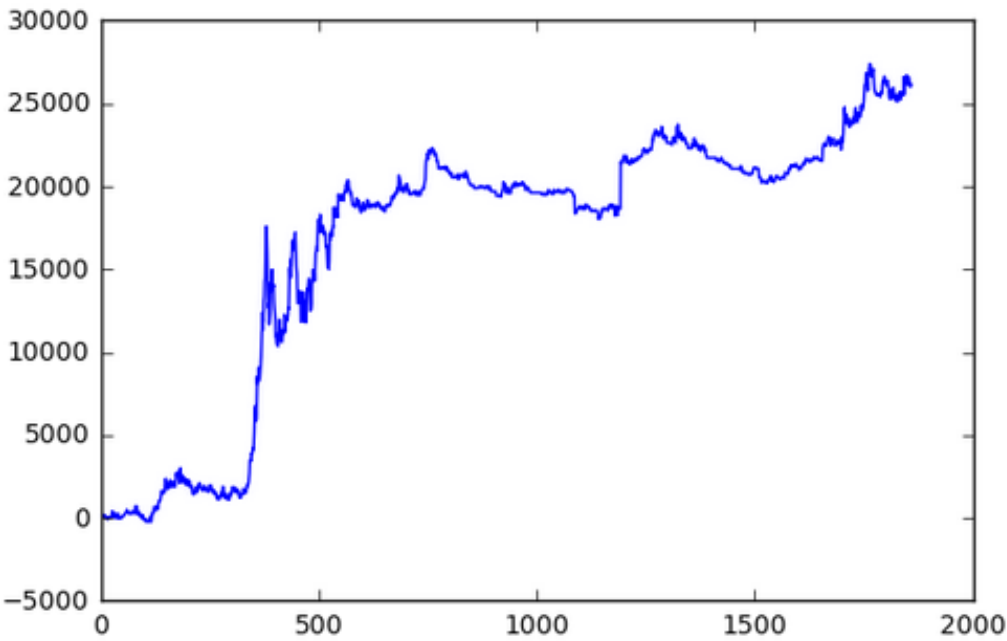


郑棉期货合约

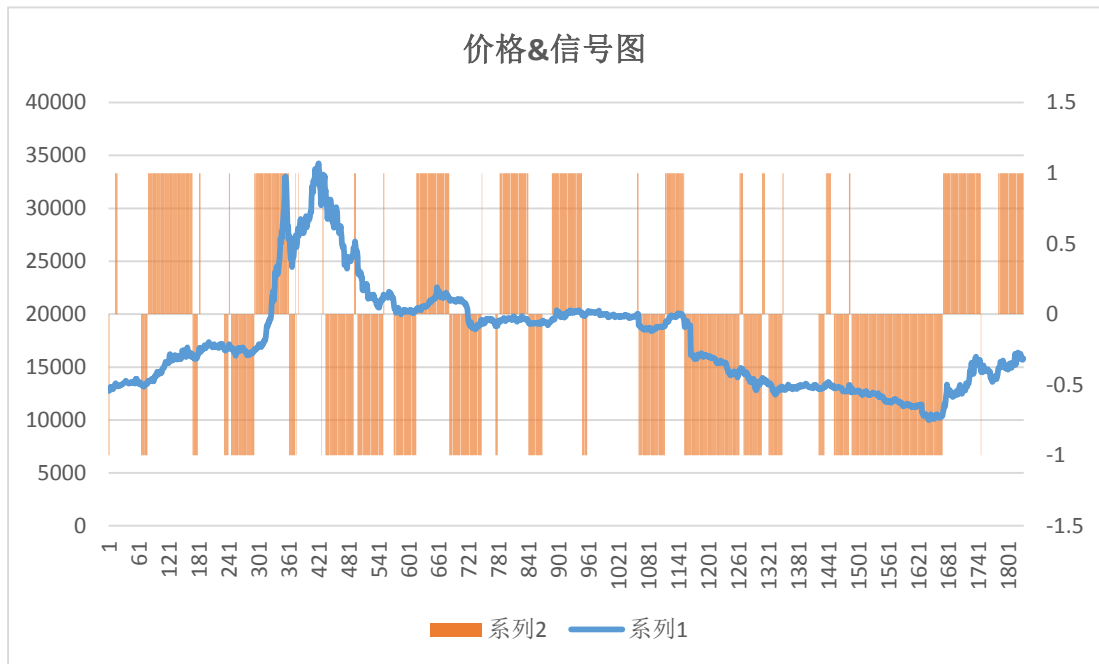
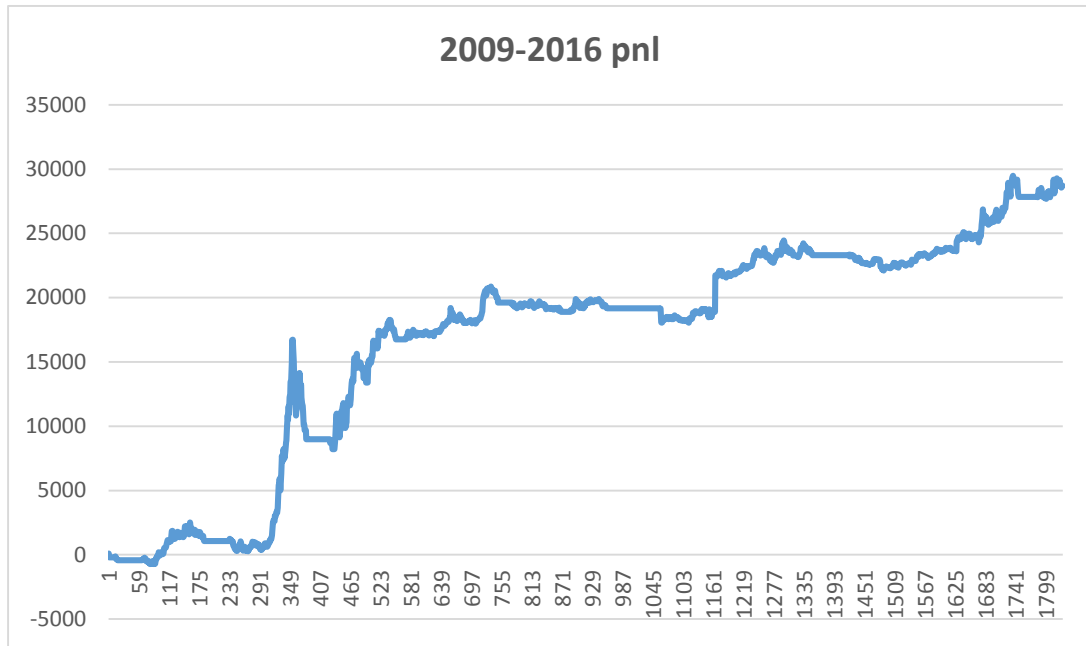
参数设置

Alpha	差分阈值	止损
0.04194	13.85761	-185.695

Python 回测结果



17 39 57 0.298245614035  
平均盈利： 2237.94117647  
平均亏损： 326.923076923  
平均盈利/平均亏损： 6.84546712803

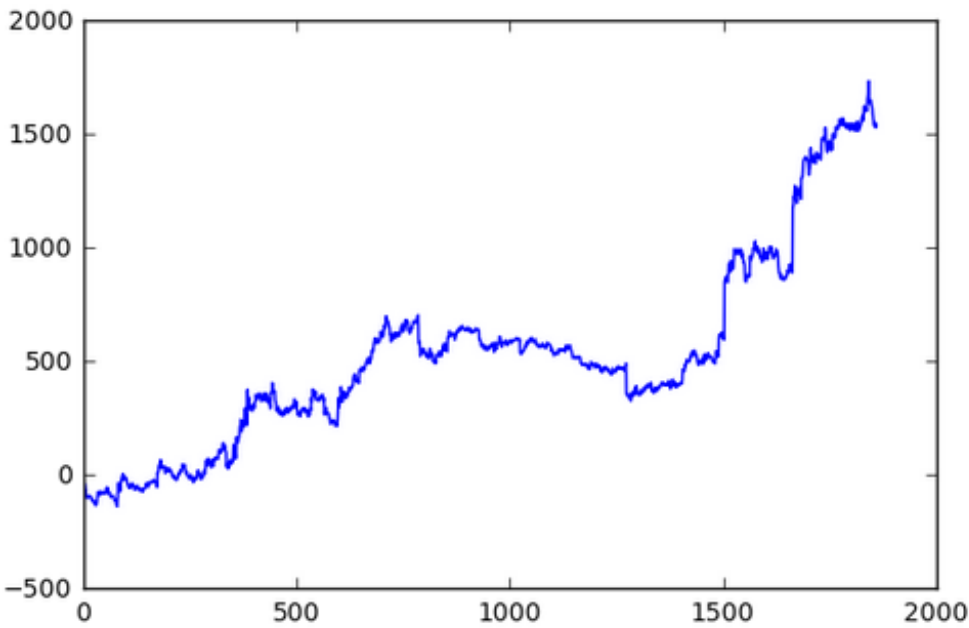


玉米期货合约

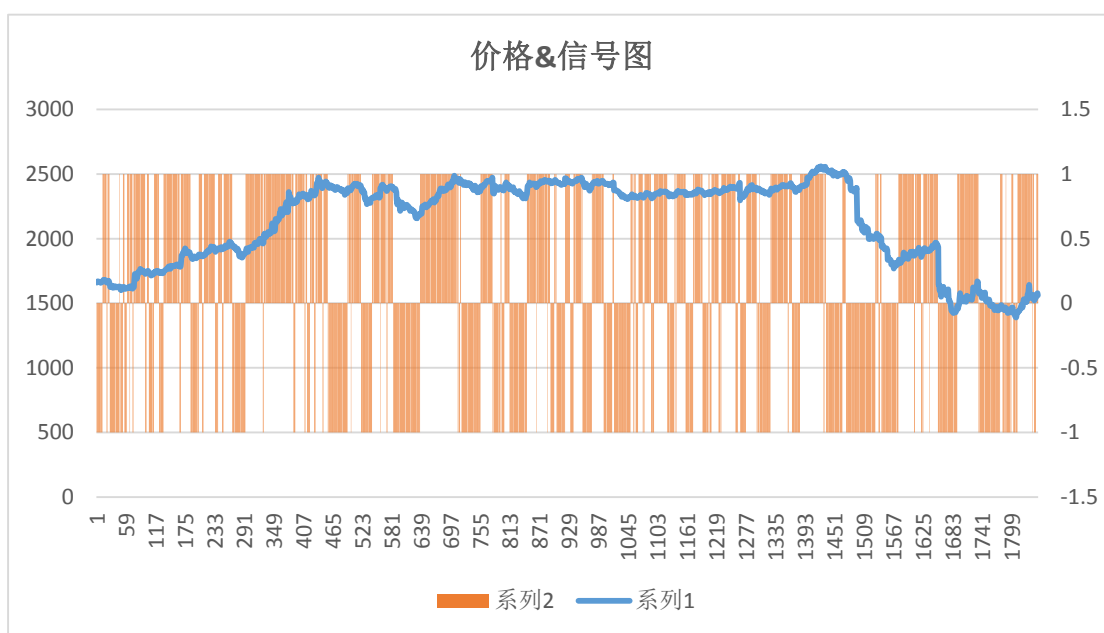
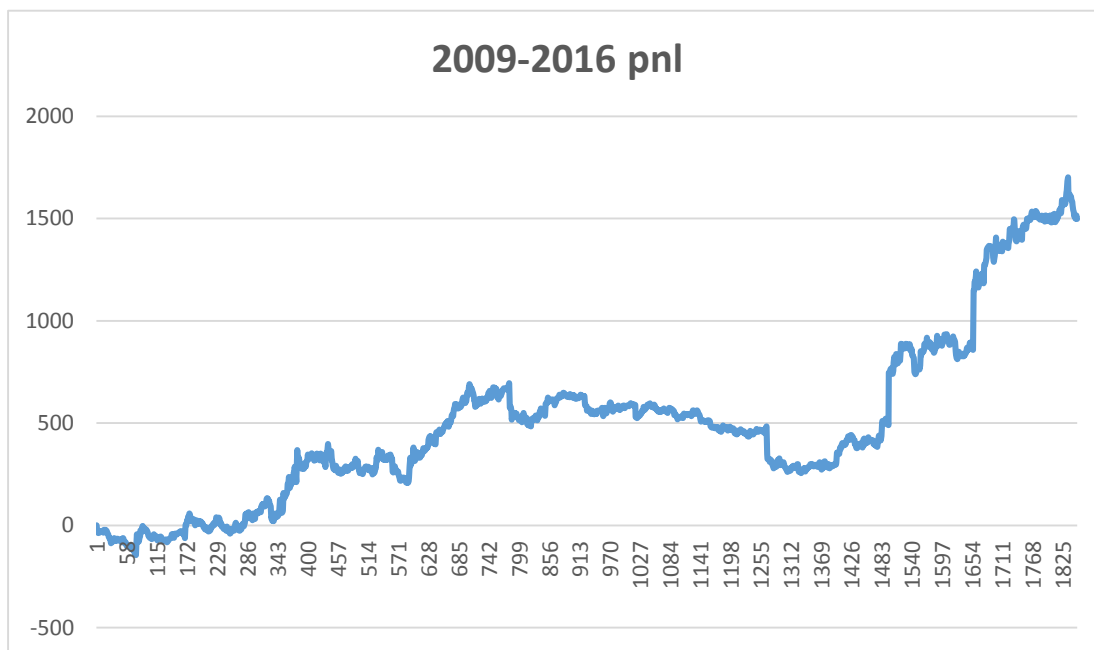
参数设置

Alpha	差分阈值	止损
0.067391	0	-79.8494811204463

Python 回测结果



48 98 147 0.326530612245  
平均盈利： 68.1875  
平均亏损： 17.7448979592  
平均盈利/平均亏损： 3.84265382404



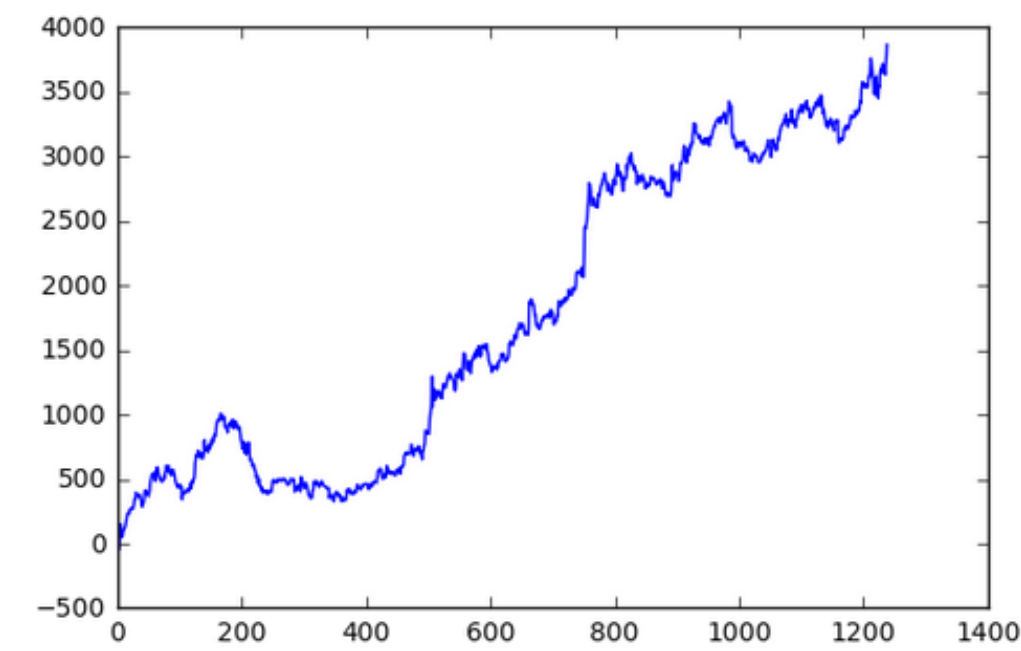


甲醇期货合约

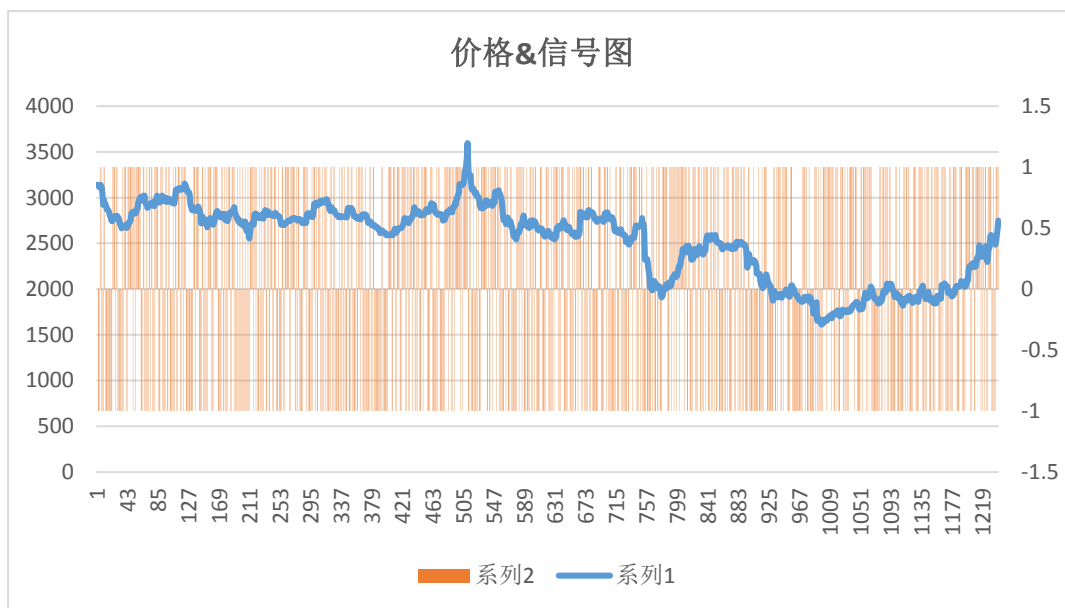
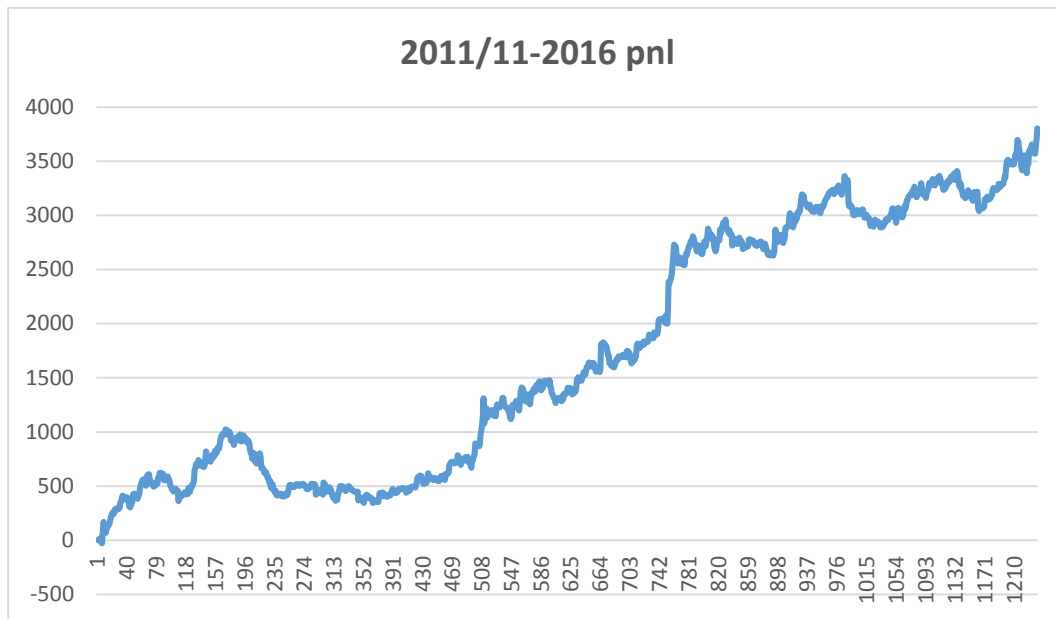
参数设置

Alpha	差分阈值	止损
1.09026	2.235941	-268.802

Python 回测结果



191 286 478 0.399581589958  
平均盈利： 55.5654450262  
平均亏损： 24.4055944056  
平均盈利/平均亏损： 2.27675032629

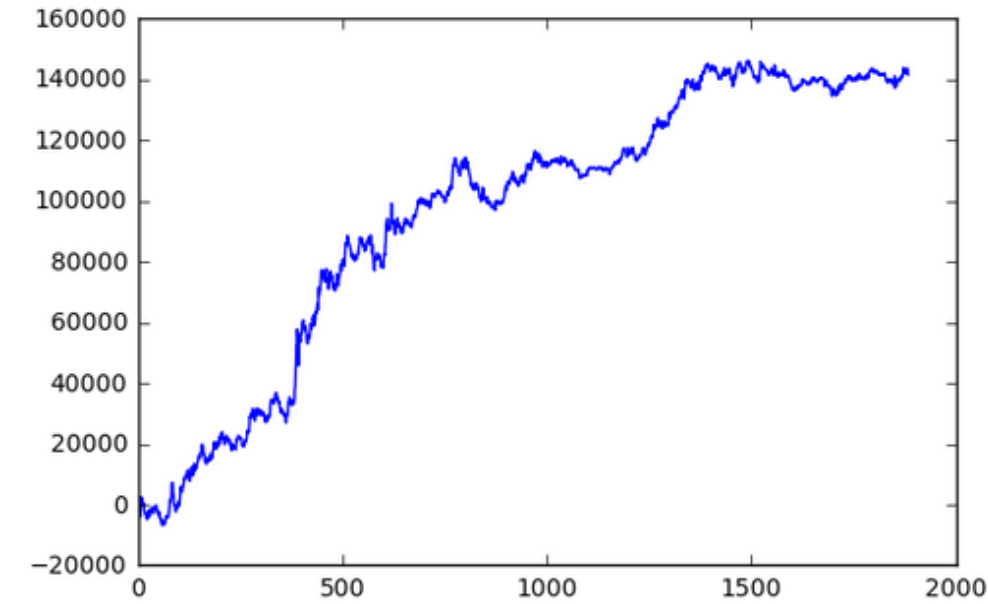


PTA 期货合约

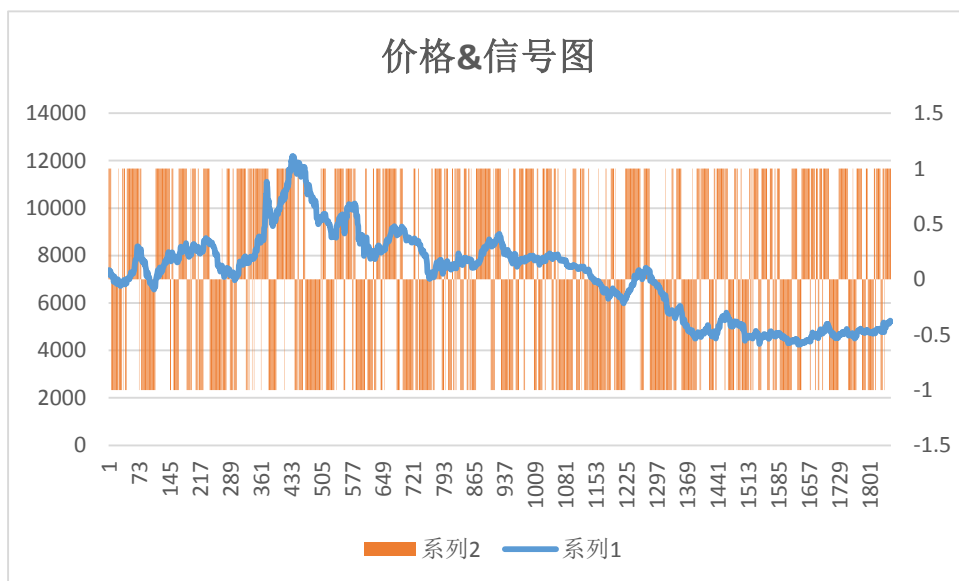
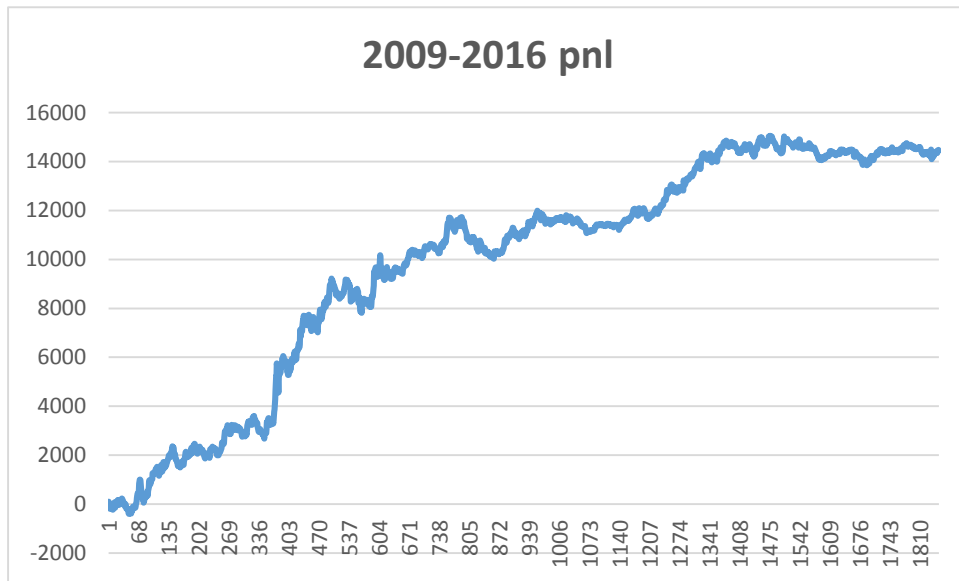
参数设置

Alpha	差分阈值	止损
0.115103	0.289597	-188.279

Python 回测结果



80 141 222 0.36036036036  
平均盈利： 3481.0  
平均亏损： 970.212765957  
平均盈利/平均亏损： 3.58787280702

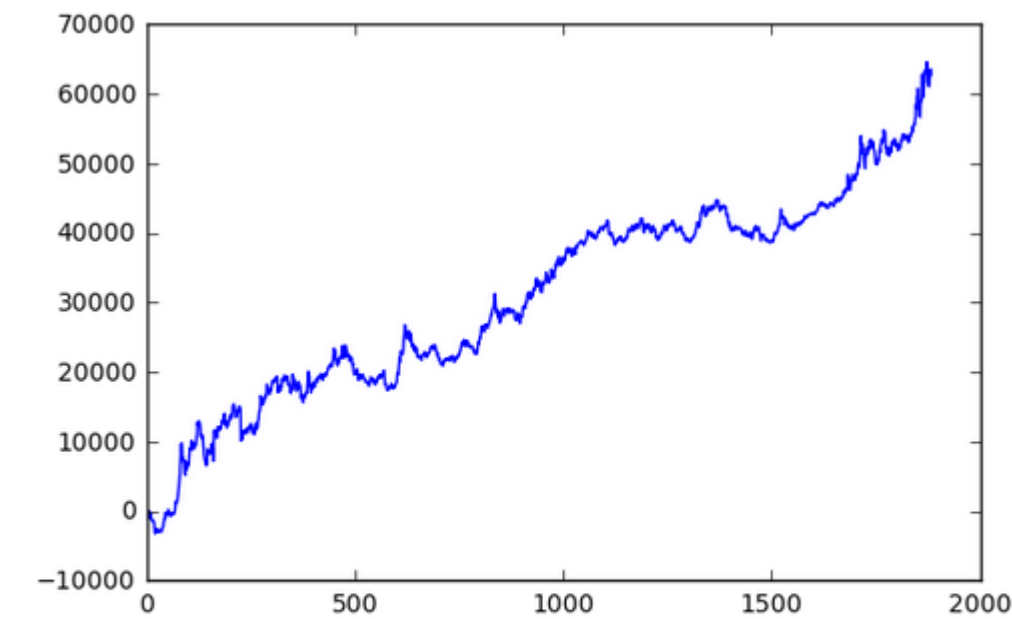


螺纹钢期货合约

参数设置

Alpha	差分阈值	止损
0.052426	1.976498	-229.713

Python 回测结果



33 37 71 0.464788732394  
平均盈利： 2733.93939394  
平均亏损： 785.135135135  
平均盈利/平均亏损： 3.48212590622

