**残差波动率择时期货结果**

按照文献说明，加入了手续费、分类止损步骤。

初始资金为10W元，每次只买卖一手。结果见下文：

窗口参数为开仓计算20、残差计算5

止损参数为2.5%、1.5%

主程序为M\_futures.m







