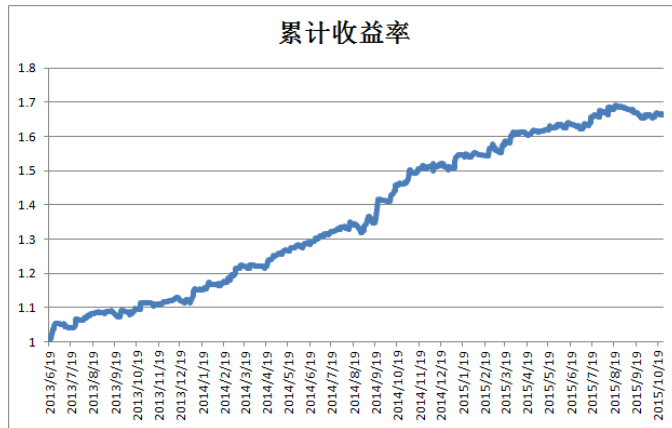


## 【股指数据挖掘类组合策略】

图1：股指数据挖掘类组合收益表现



投资理念：

通过使用数据挖掘，时间序列建模等数理统计的方法找到市场潜在规律，以此构建稳定模型。同时多品种，多策略类型，多时间框架组合，显著提高策略组合收益风险比。

## 【量化选股对冲策略产品】

图3：量化选股对冲策略收益表现

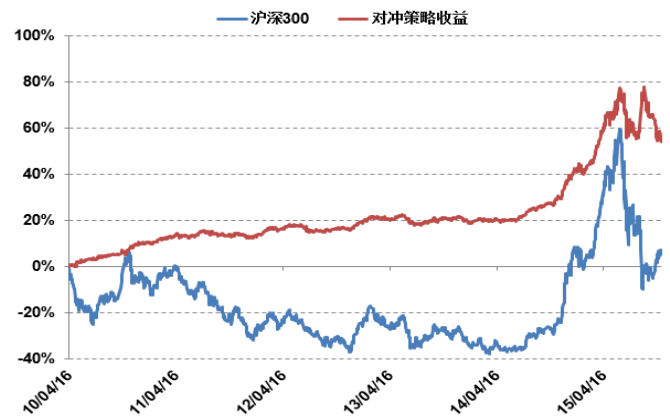


投资理念：

通过量化形态及多因子模型，选取市场最优的1%的个股形成组合，通过股指期货对冲系统性风险，获得个

## 【股指期现对冲策略产品】

图2：优化配置期现对冲策略收益表现



投资理念：

通过在不同的市场行情中获得稳定的超额收益。采用动态优化配置策略模型买入沪深300指数成份股，以实现现货指数增强，再通过股指期货对冲系统性风险，从而获得稳健收益的投资策略。

产品中心  
联系电话：021-5058 8969

#### 申银万国期货有限公司

地址：上海东方路 800 号宝安大厦 8 楼  
邮编：200122  
电话：021 5058 3880  
传真：021 5058 8822

## 法律声明

本报告的信息均来源于公开资料，本公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。我们力求报告内容的客观、公正，但文中的观点、结论和建议仅供参考，报告中的信息或意见并不构成所述品种的买卖出价，投资者据此做出的任何投资决策与本公司无关。

本报告的版权归本公司所有。本公司对本报告保留一切权利，未经本公司书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为申银万国期货，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。