

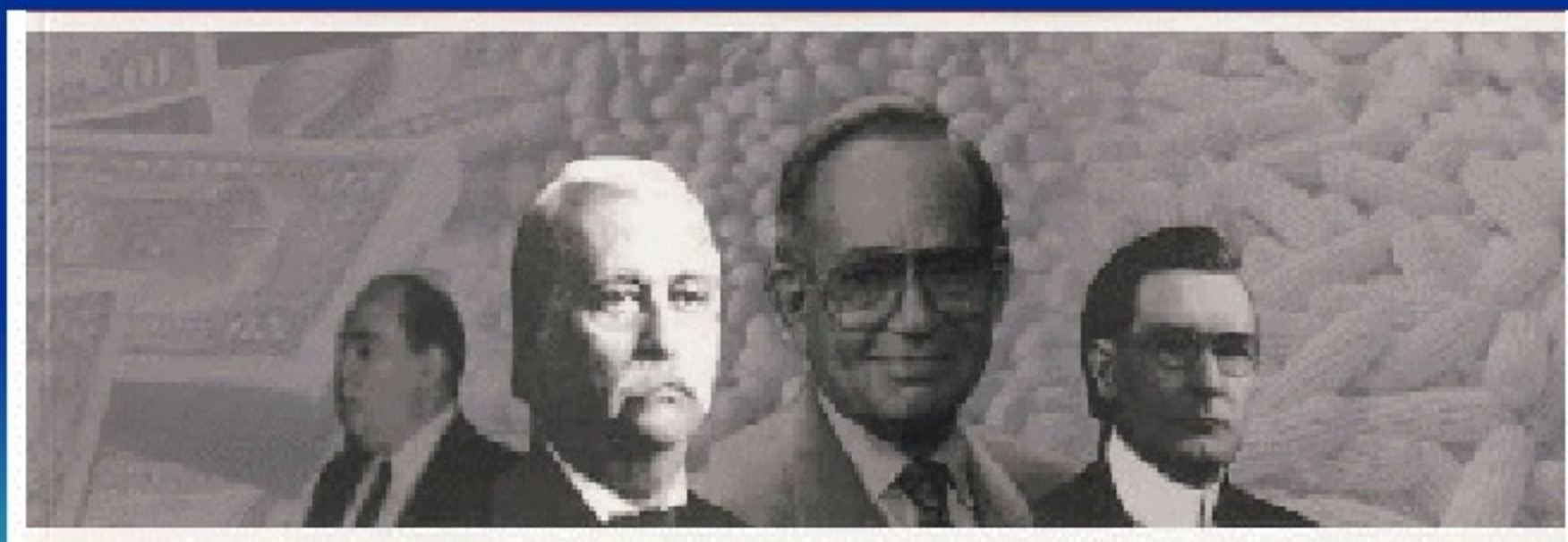
# 多空信号实战系统

## 第一节：以概率理论必然性实现盈利



# 主要内容

- 一、多空信号盈利原理
- 二、核心规则体系
- 三、信号统计表与盈亏分布规律
- 四、进出场点位的简单优化





# 决定盈亏的三个最直接因素

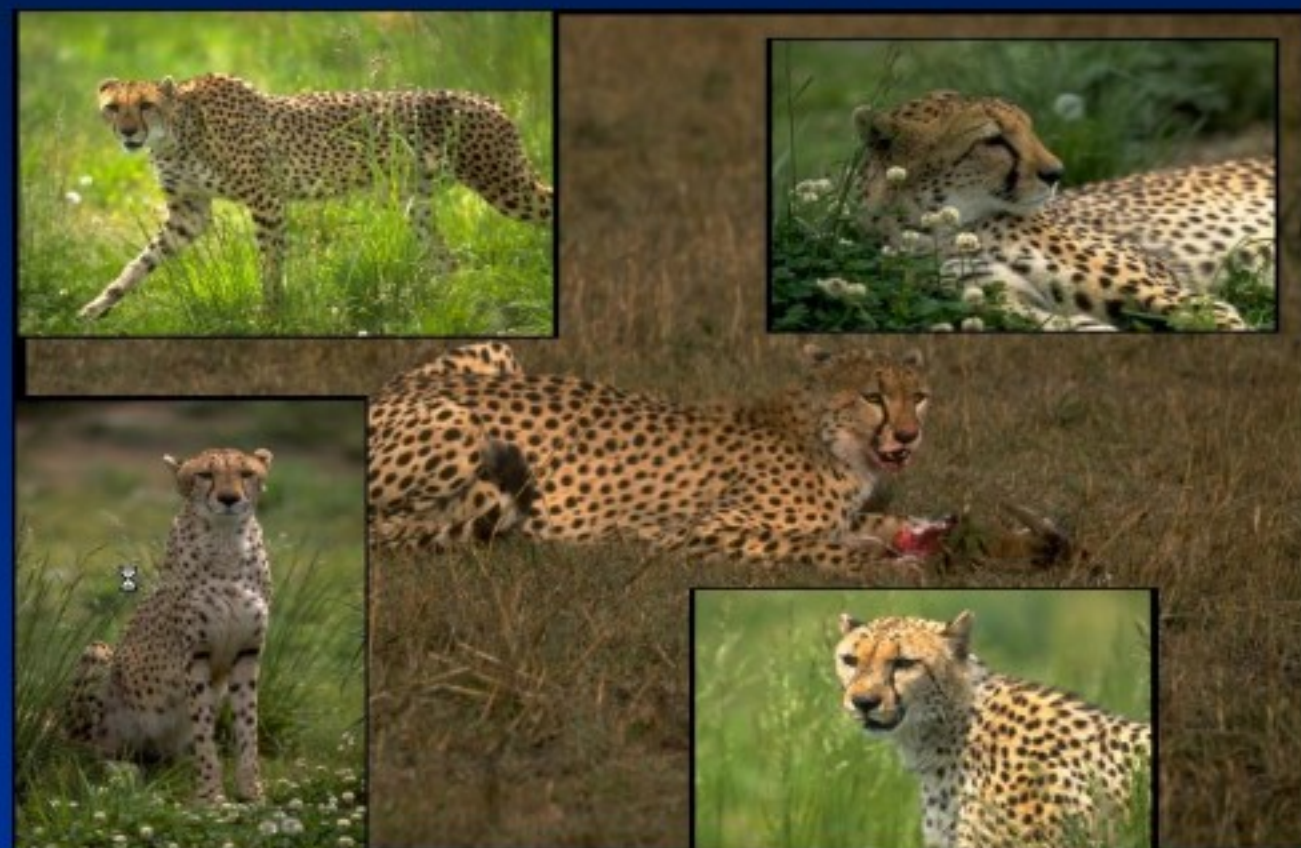
- 1、交易的盈亏次数(成功率)。
- 2、每次交易的盈亏幅度大小（盈亏比）。
- 3、盈利和亏损交易时的单量大小（资金管理）。
- 所有成功的方法和系统在最根本的原理上都是相近的，着力点都要落在以上三个方面。





# 两种最基本的系统设计思想

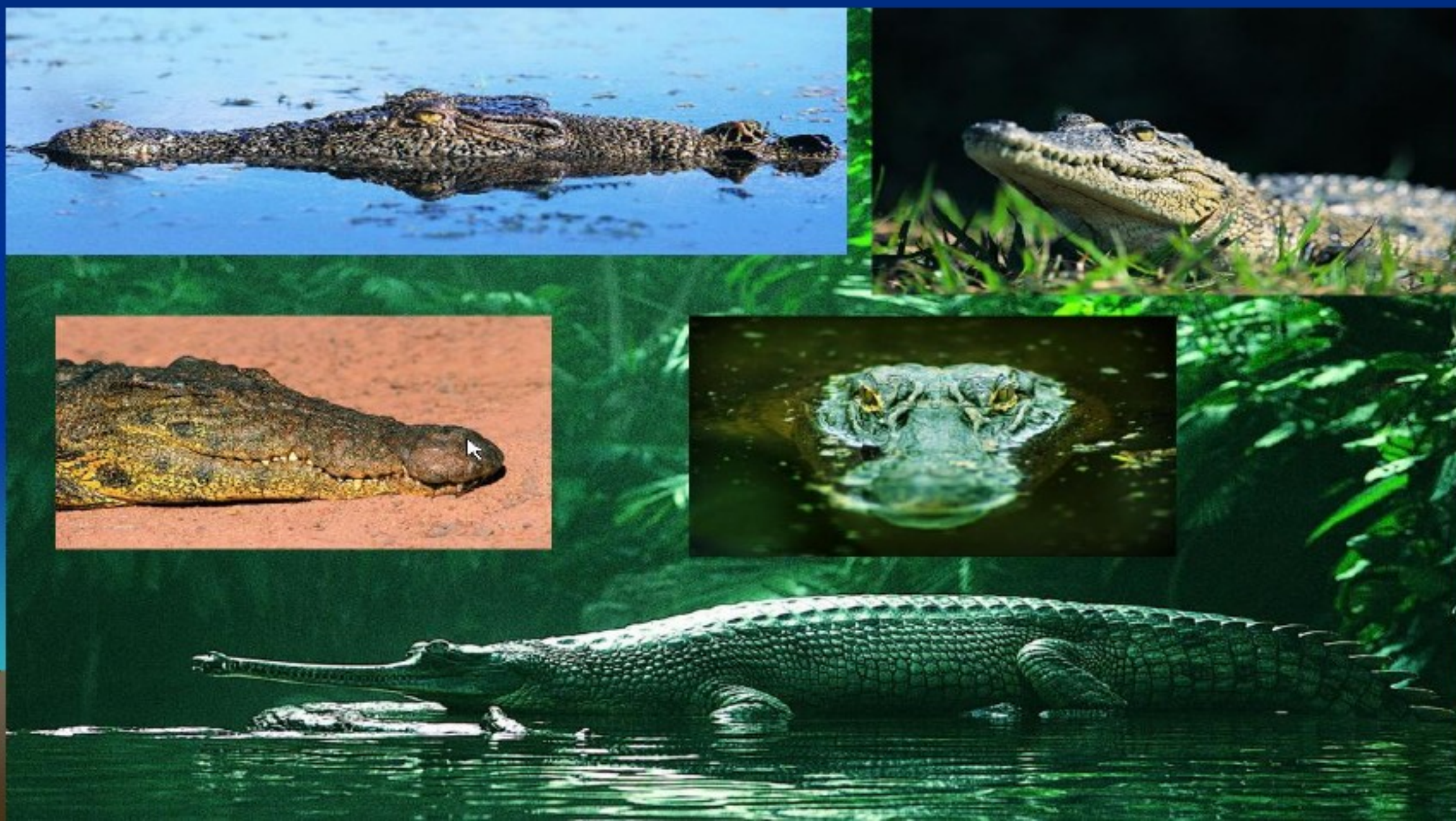
- 一、趋势性交易系统：
  - 目标：抓大放小，通过做到最主要的大波段来盈利。
  - 特点：追涨杀跌，成功率低、盈亏比高。靠盈亏比取胜。
  - 猎豹捕食。
- 二、非趋势性交易系统：
  - 目标：积少成多，通过多次微小利润的积累来盈利。
  - 特点：低买高卖，成功率高、盈亏比低。靠成功率取胜
  - 麻雀啄米





# 两类系统设计思想的共同点

- 1、两类系统设计思想虽然截然相反，但共同点是都强调及时止损。（鳄鱼原则）
- 2、两类系统都希望得到资金管理的支持，实现大单量赚钱，小单量亏钱。





# 多空信号系统盈利原理

- 1、多空信号系统属于典型的趋势性交易系统，以盈亏比取胜；
- 2、以图表周期切换定义不同级别的趋势，操作时从最小级别趋势入手，追求将小趋势做成大趋势，将盈亏比大幅提高；
- 3、盈亏比既定的情况下，将有一个盈亏平衡的成功率底线约束。
- 4、所有品种从统计上都会有各自相对稳定的理论盈亏比和成功率，理论盈亏比和成功率结合既产生系统理论盈亏水平，选择该系统统计上具有较高盈亏比和成功率的品种进行组合投资，系统盈利就会具有理论必然性。
- 5、实际操作中达到理论盈利水平关键在于两点：一是坚守规则进行交易；二是交易次数要足够大，交易样本容量只要足够大，就必然能够达到系统理论应有的盈亏比和成功率。



# 多空信号体系核心规则体系

- 一、系统指标及参数选择
- 二、趋势级别划分依据；
- 三、多空信号产生依据；
- 四、系统运行规则；
- 五、交易单量确定规则



# 指标与参数选择



1、多空信号系统涉及多个图表周期，但所有图表周期选用的指数和参数均相同。

2、系统使用两个基本指标：均线和慢速KD。

（1）均线参数：  
75MA、240MA两条基本均线，特殊情况下参考13MA。

（2）慢速KD指标  
参数：36，5，3，



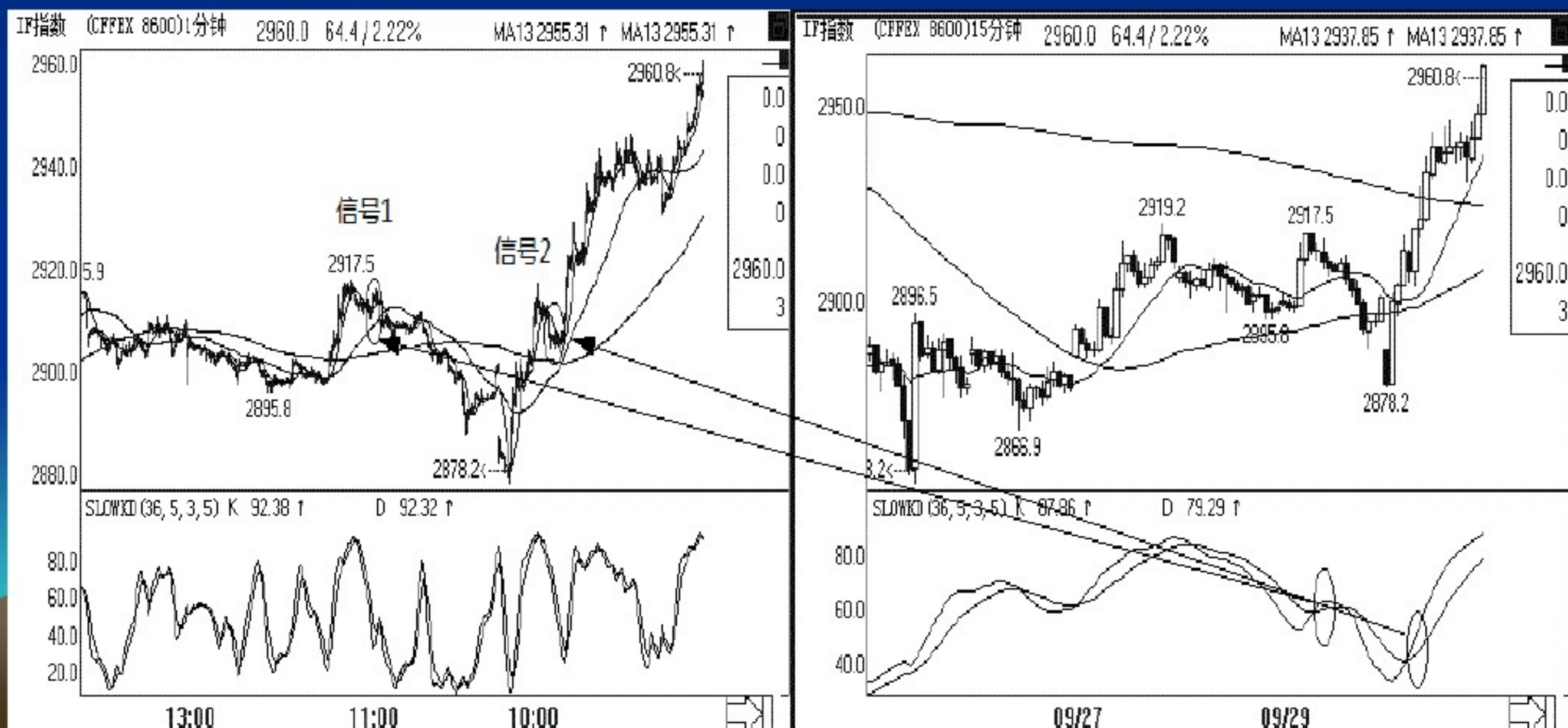
# 交易周期划分

- 每个级别的交易系统都由三个周期的图表搭配对应产生交易信号，分别命名为：基本周期、上级周期、趋势周期。
- 1、短线系统：1分钟（或3分钟）K线图为基础周期、5分钟图为基础周期、15分钟图为基础趋势周期。
- 信号产生：1分钟K线图为基础系统配合15分钟K线图慢速KD指标、参考5分钟图慢速KD指标产生多空信号，并以15分钟均线作为判定“大势”的标准。
- 2、中线波段系统：5分钟K线图为基础周期、15分钟图为基础周期、小时图为基础趋势周期。
- 信号产生：5分钟K线图基础系统配合1小时图K线图慢速KD指标、参考15分钟图慢速KD指标产生多空信号，并以小时图均线级别作为判定“大势”的标准。
- 3、长线趋势系统：15分钟K线图为基础周期、小时图为基础周期、3小时图为基础趋势周期。
- 以15分钟K线图基础系统配合1小时图K线图慢速KD指标、参考15分钟图慢速KD指标产生多空信号，并以小时图均线级别作为判定“大势”的标准。



# 标准多空信号的生成（进场）

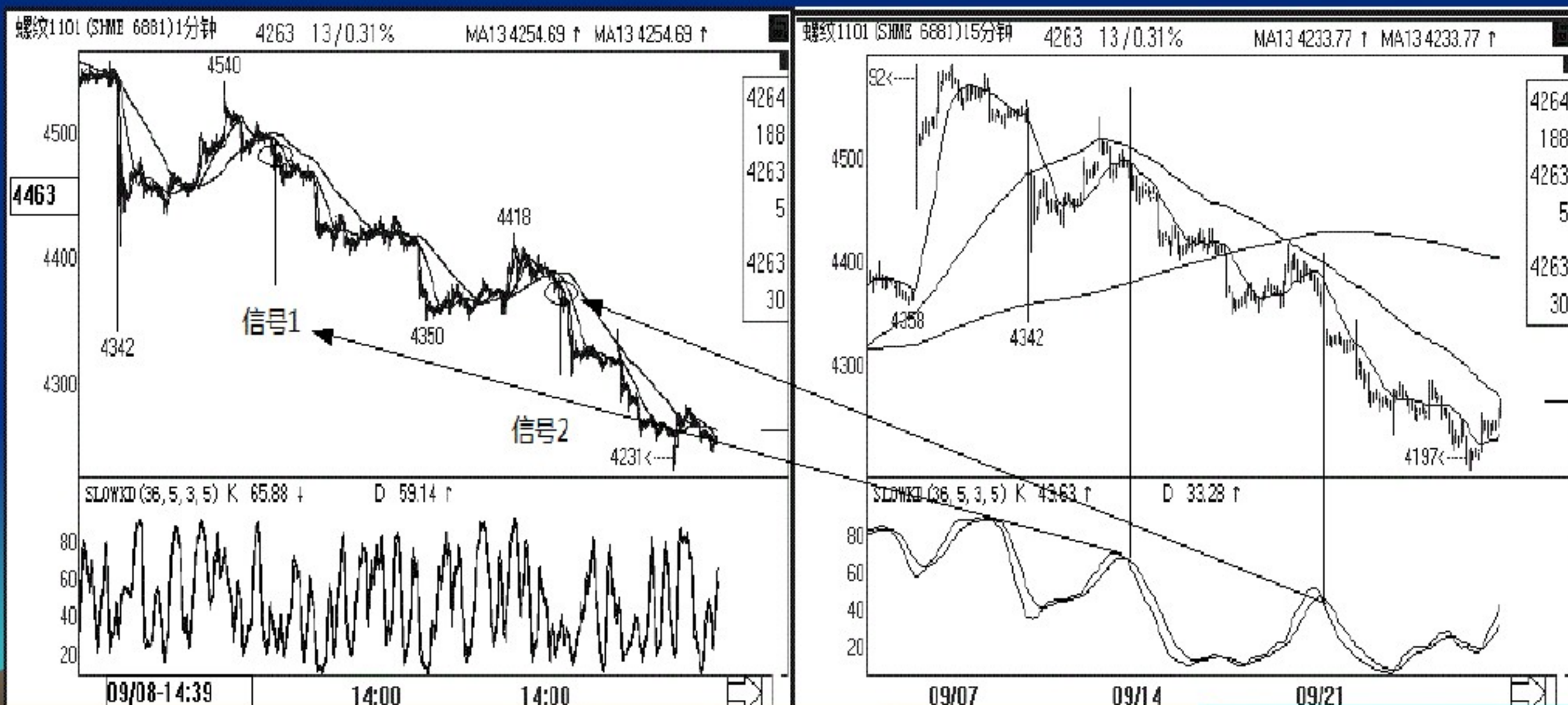
- 1、系统信号涉及“进场、出场”两个环节，遵循严进宽出原则，进场要同时关注均线（或高低点）和慢速KD两个指标，出场只关注均线（或高低点）。
- 2、以基本周期价格穿越75MA、240MA两条基本均线判定短线趋势方向转换，趋势周期慢速KD指标确认，两者共同产生标准多头信号或标准空头信号。





# 顺势信号与逆势信号

- 以趋势周期75MA、240MA两条基本均线确定大势方向，将信号分为顺势信号、逆势信号两类。（价格在两条线之上大势为多头、两条线之下大势为空头，反复穿越大势无趋势）

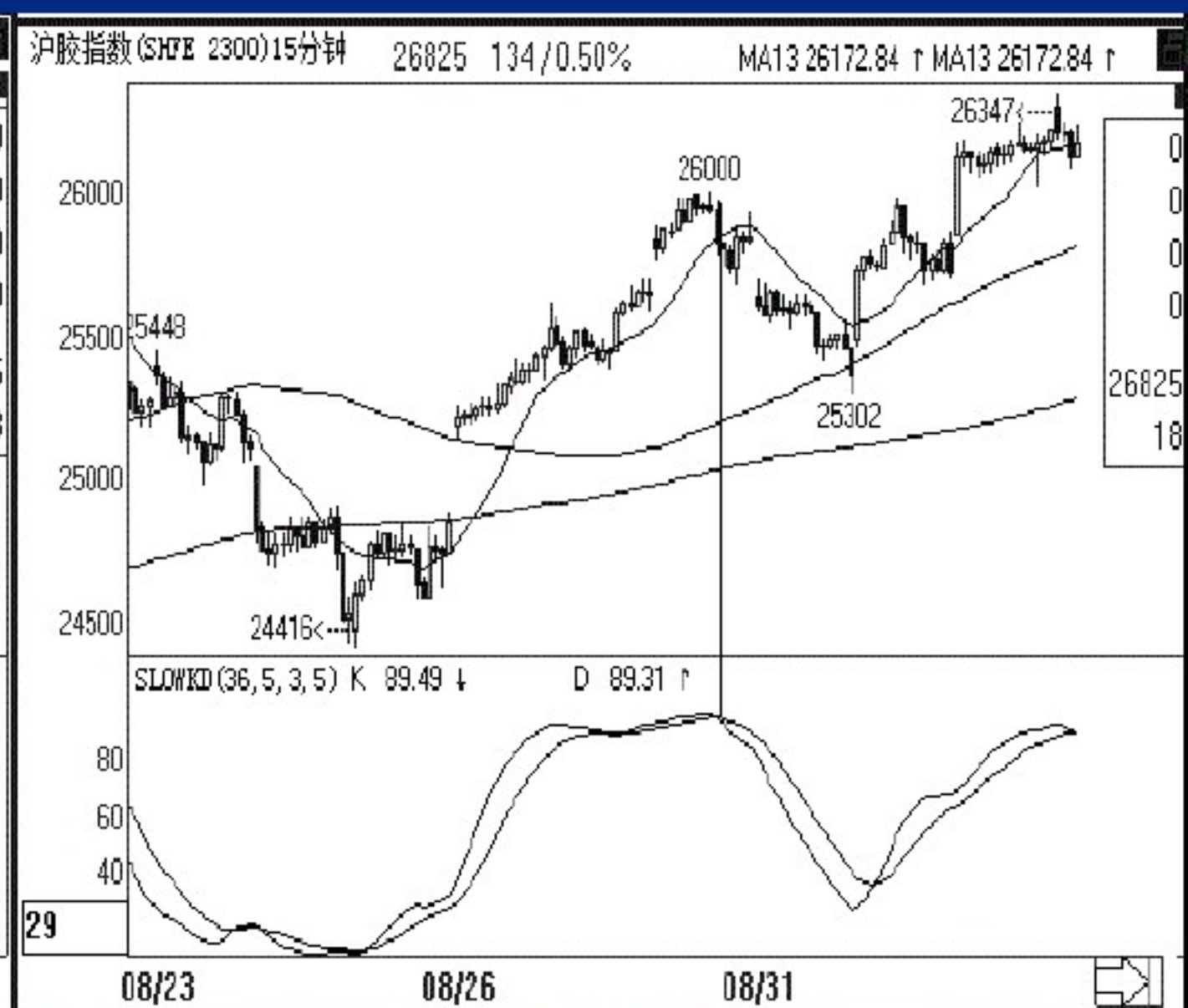
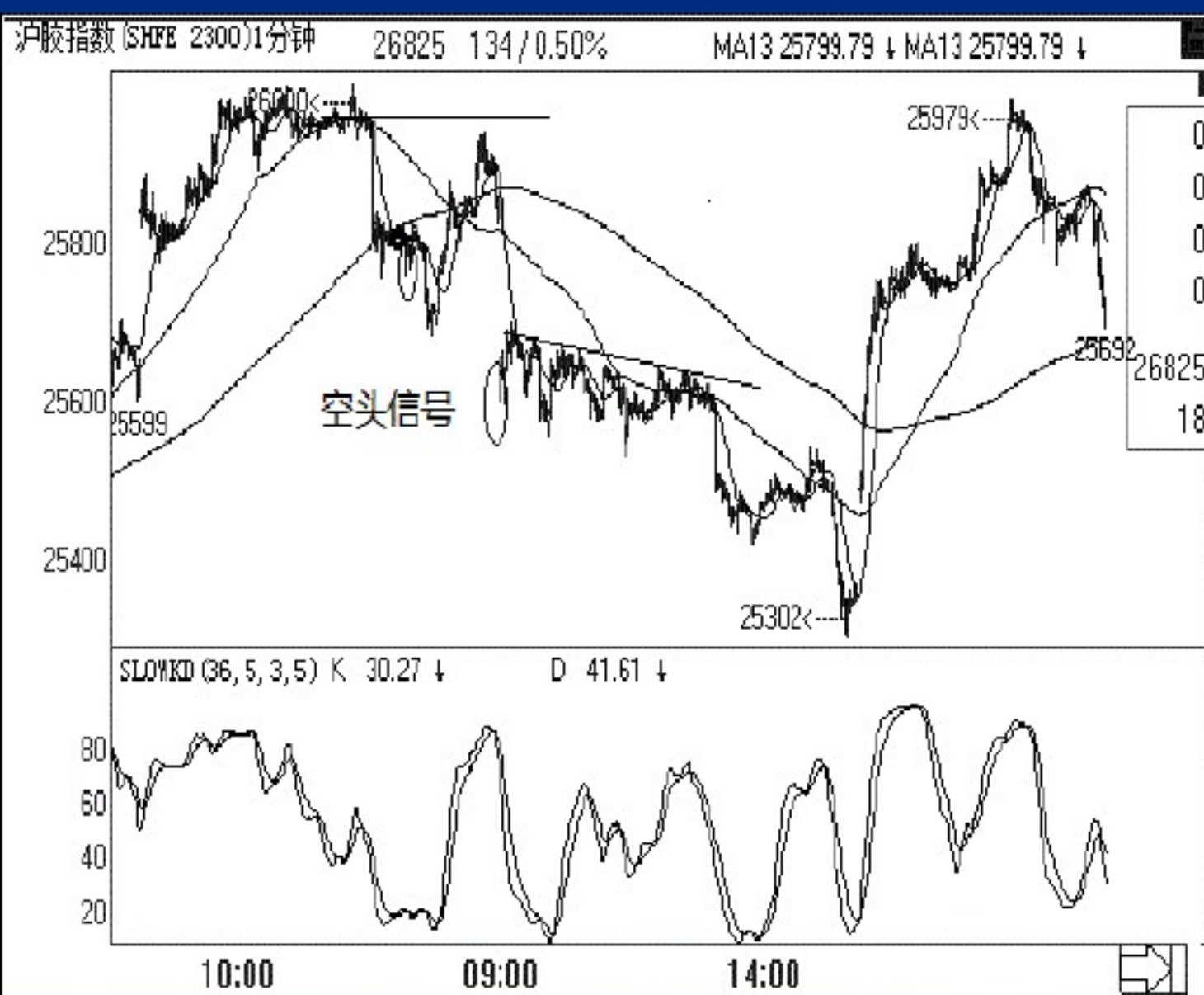




# 标准多空信号的消失（出场）

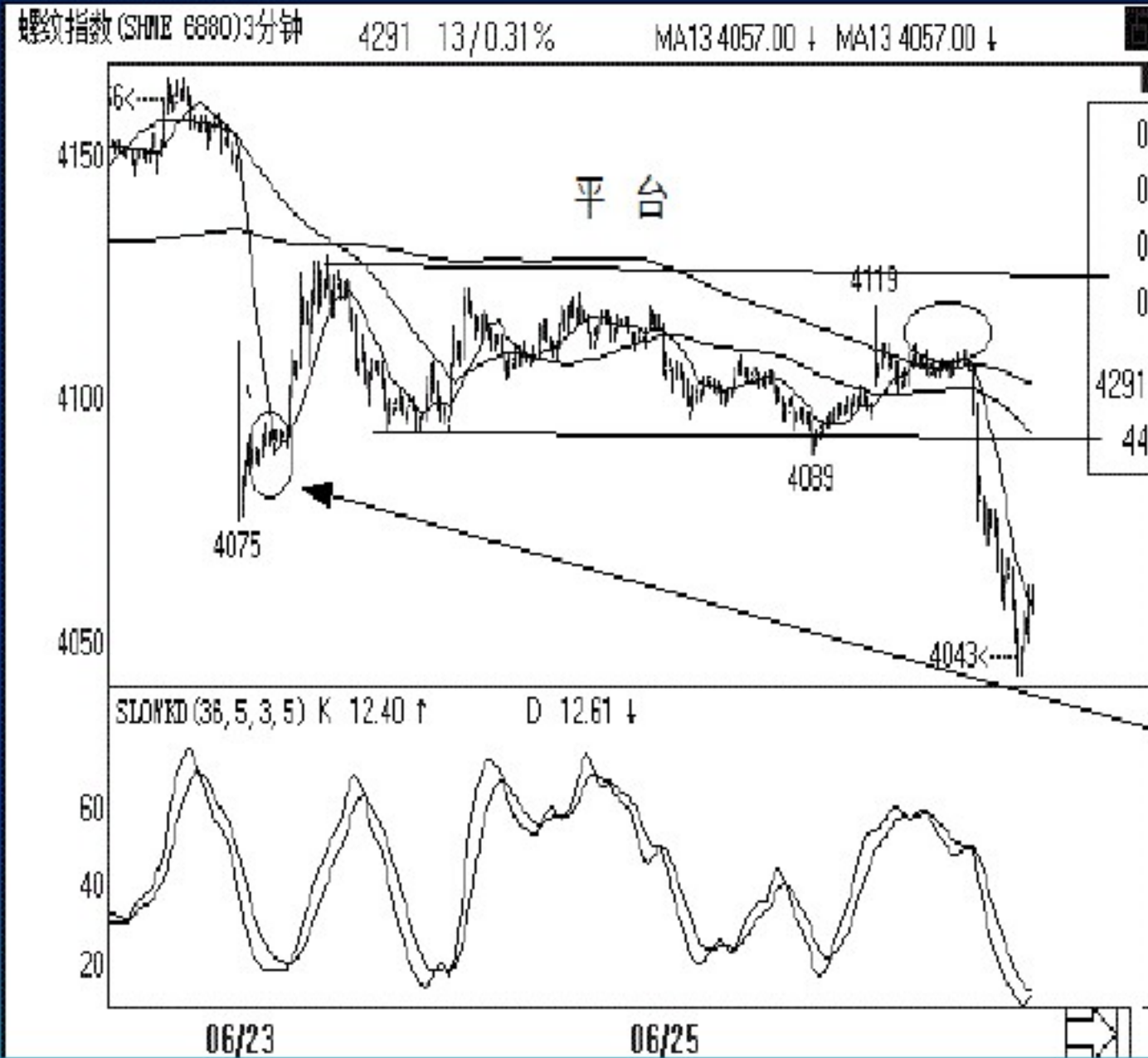
## 止损出场：

- 一、破均线第一时间进场的止损：1分钟图75MA拐头位置止损；
- 二、回抽均线后再破新高（新低），均线止损；
- 三、站稳均线搭平台，平台低点与均线两者最低（最高）者止损





# 平台止损

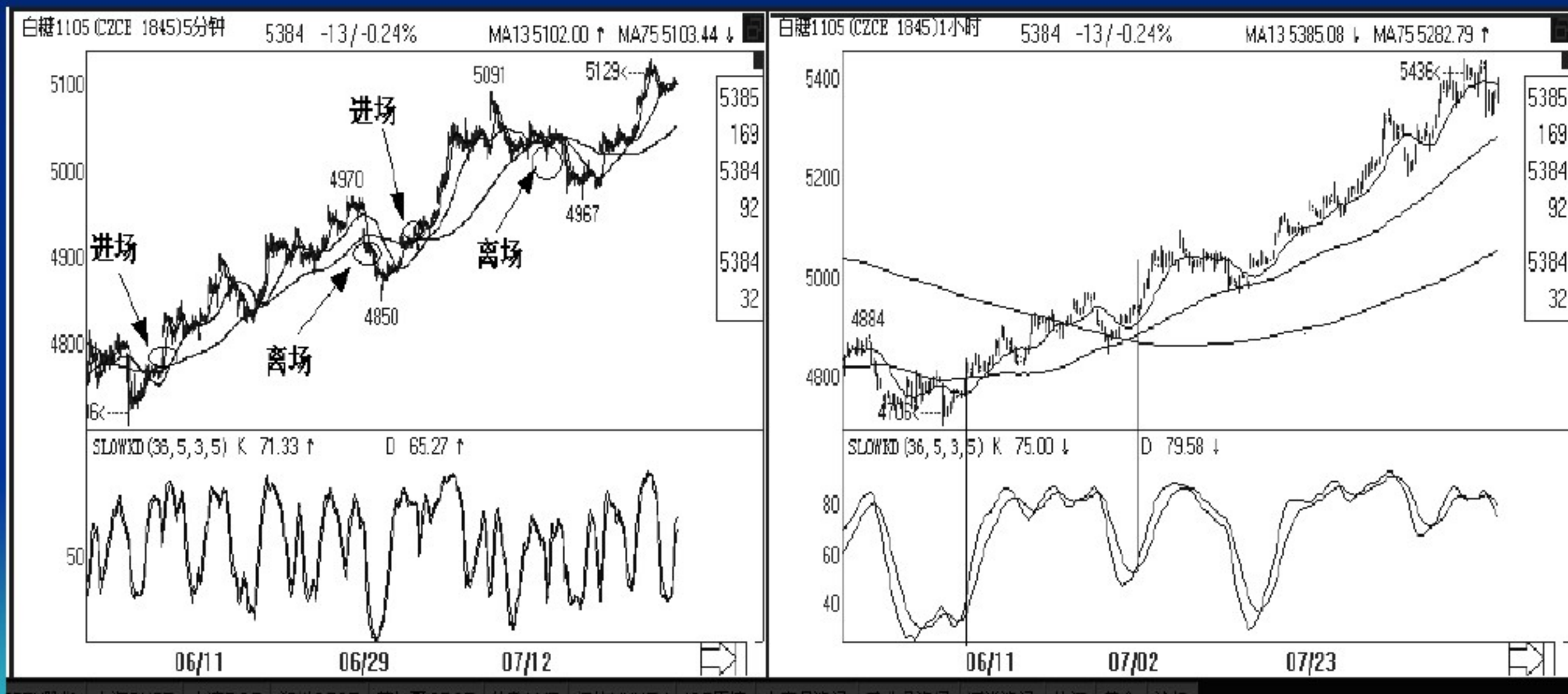




# 标准多空信号的消失（出场）

## 止损出场：止盈出场

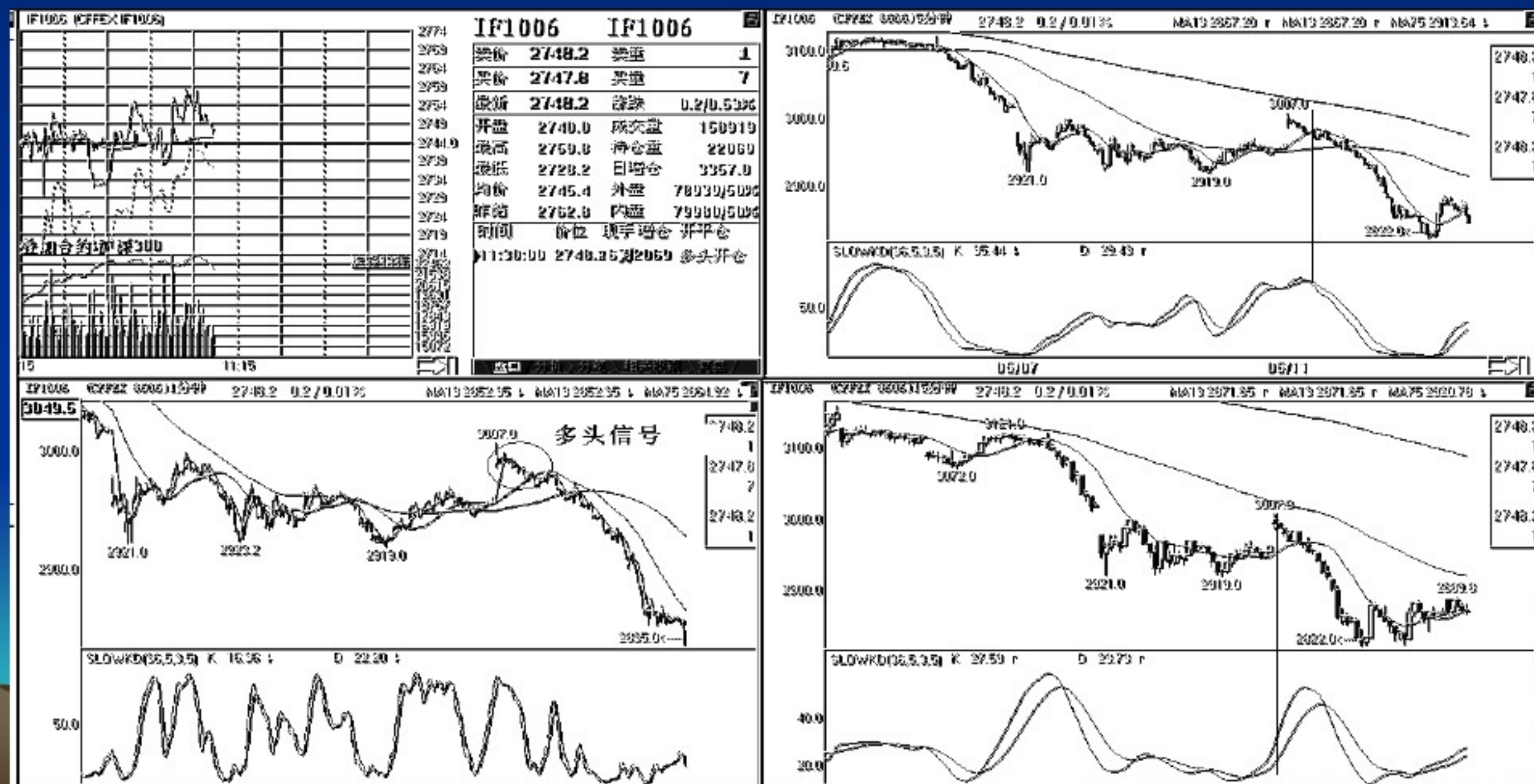
- 一、趋势破坏（基本周期）破均线，止盈出场；
- 二、上级指标否定出场





# 上级指标否定出场

- 1、在逆势信号延续时，若调整未打破上级周期240MA，虽然基本周期（没有反向打破两条均线，但上级周期慢速KD指标顺势交叉，则否定原有逆势信号，逆势单出场。
- 2、只有逆势信号才会有上级指标否定出场。





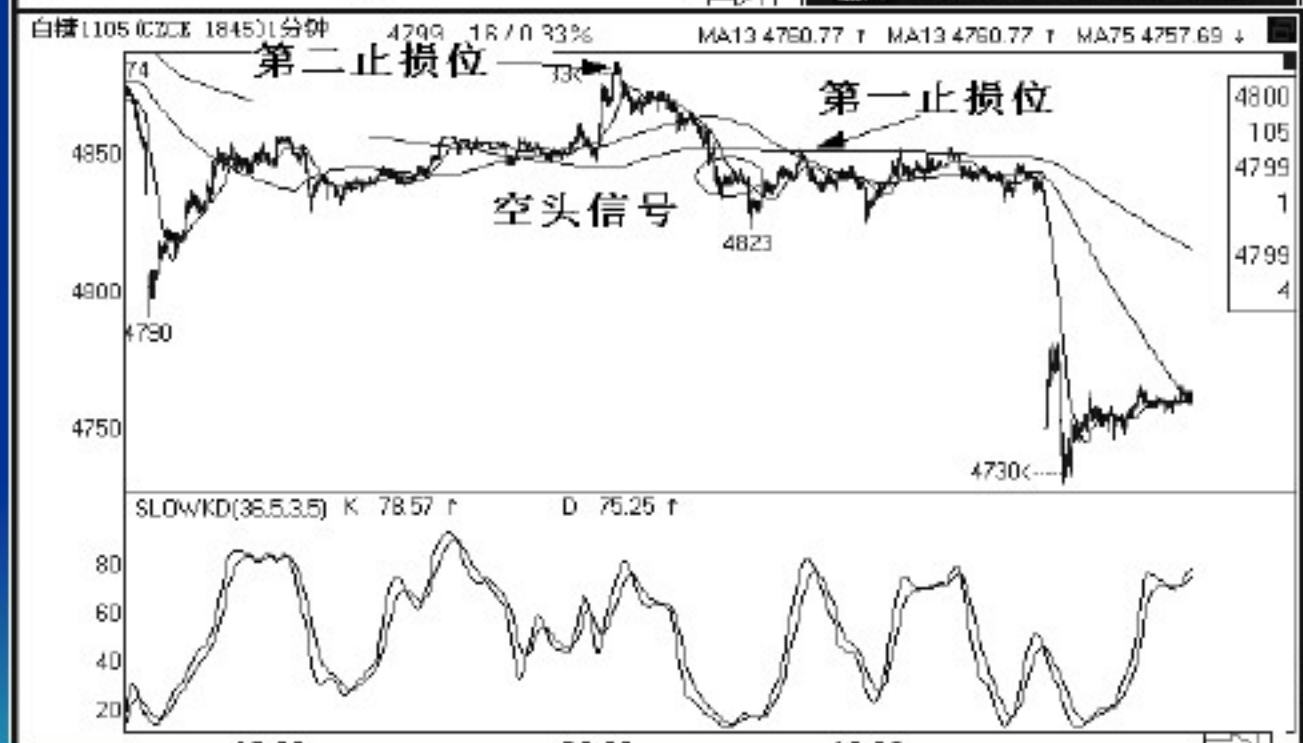
# 非标准多空信号

- 1、逆市信号出现时，上级周期未破两条基本均线情况下，其慢速KD指标反向交叉视为对基本信号的否定（逆市单出场），基本周期价格再破两条基本均线，产生顺势“非标准多空信号”
- 2、非标准多空信号的进场、出场与标准信号相同。
- 3、只有顺势情况下才会产生非标准多空信号
- 4、设定该规则的初衷是为了顺势单被打出场，但中级趋势未破的情况下，能够再及时追进。





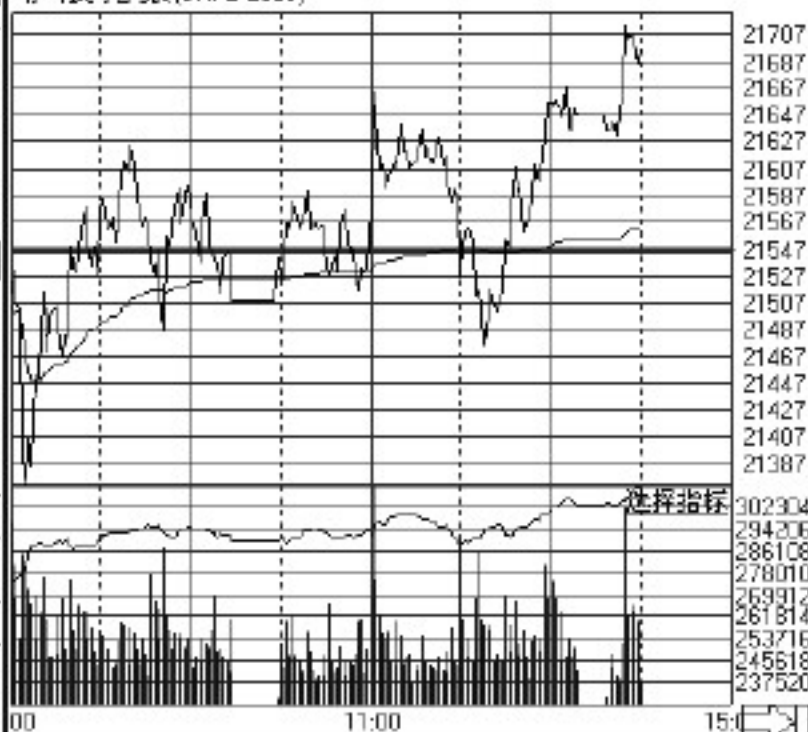
# 非标准空头信号





# 非标准多头信号

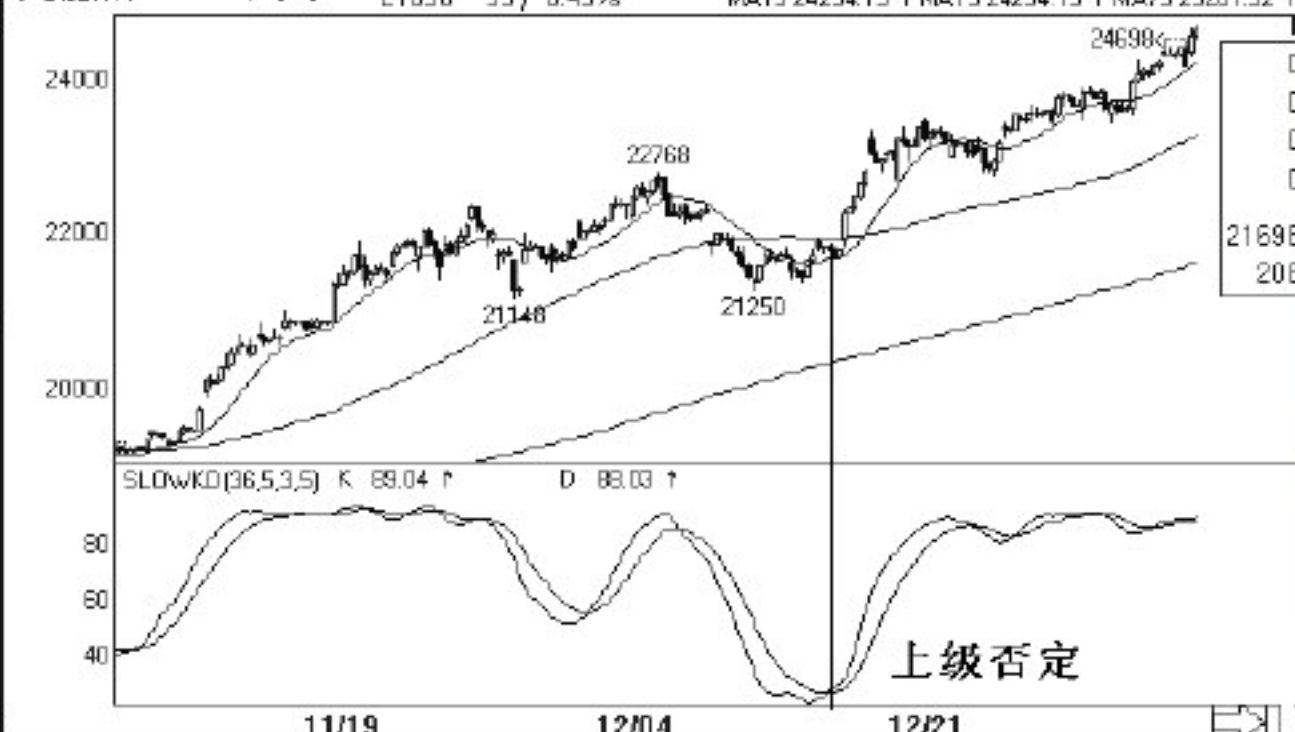
沪股指数(SHFE 2300)



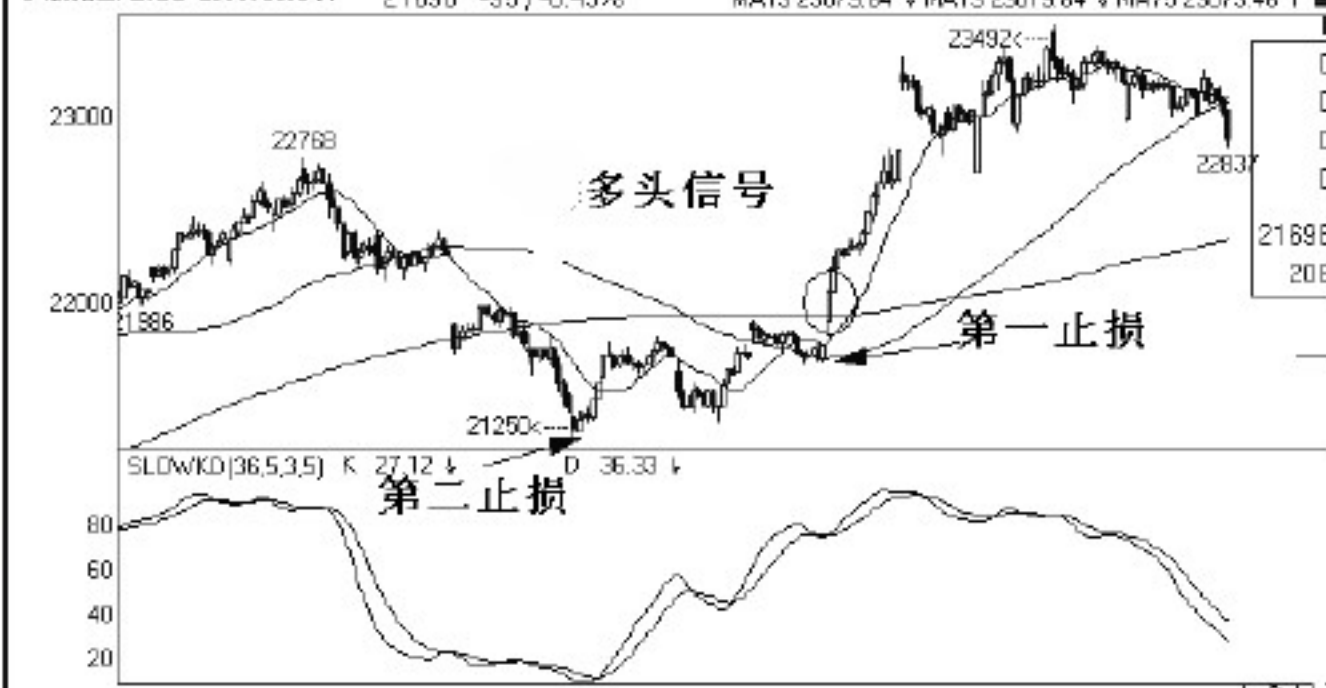
沪股指数 2300

卖价	0	卖量	0
买价	0	买量	0
最新	21698	涨跌	-95/0.87%
开盘	21514	成交量	1857700
最高	21733	持仓量	310402
最低	21361	日增仓	44688
均价	21562	外盘	1857700/100%
昨结	21887	内盘	0/0%
时间	价位	现手	增仓 开平仓
14:30:14	21693	54	-22 多头平仓
14:30:15	21694	174	-92 多头平仓
14:30:16	21694	204	92 空头开仓
14:30:16	21698	2	0 换手
14:30:17	21698	208-200	多头平仓

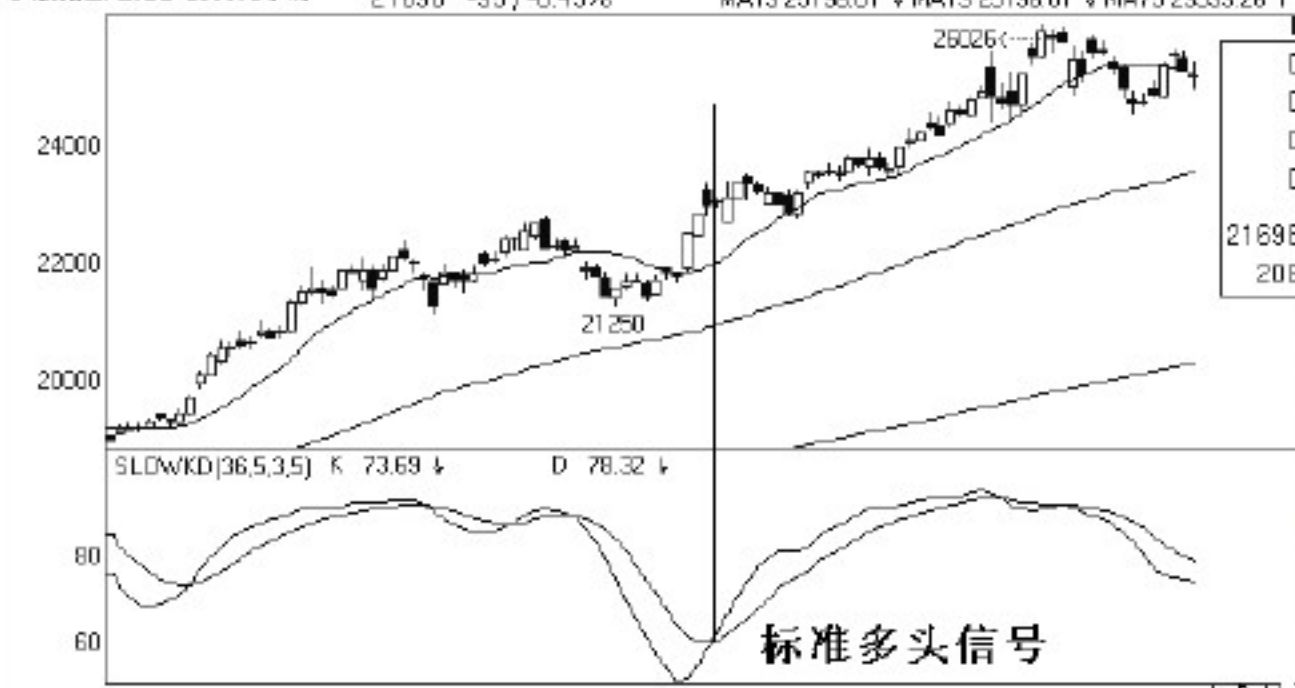
沪股指数(SHFE 2300)1小时



沪股指数(SHFE 2300)15分钟



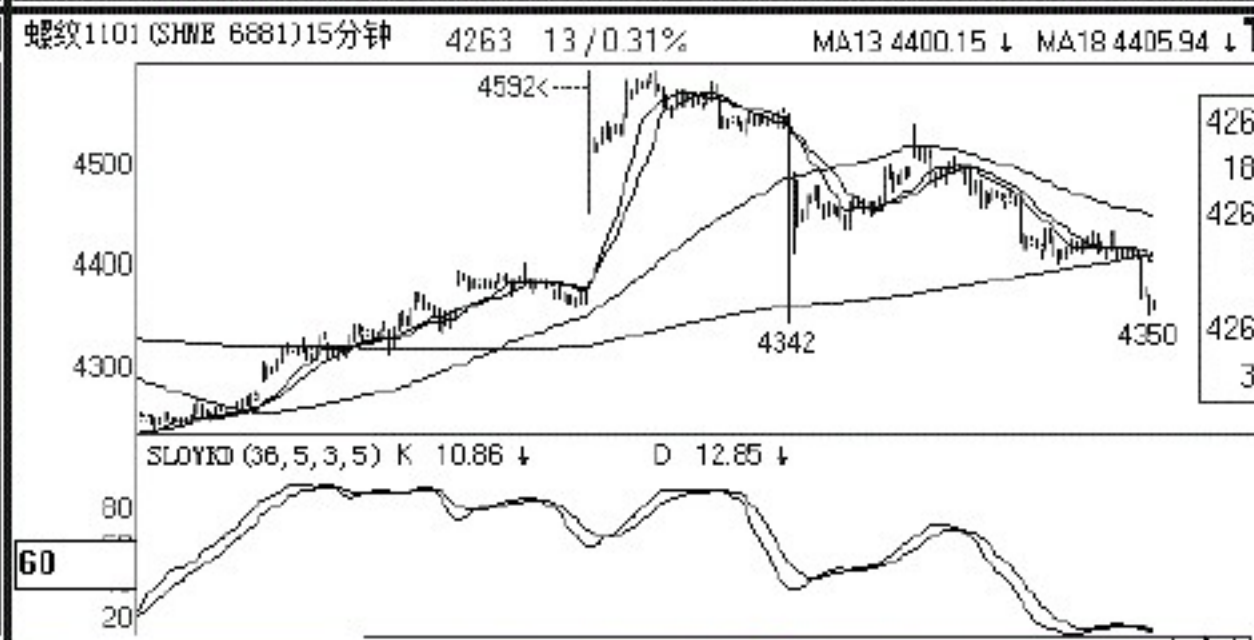
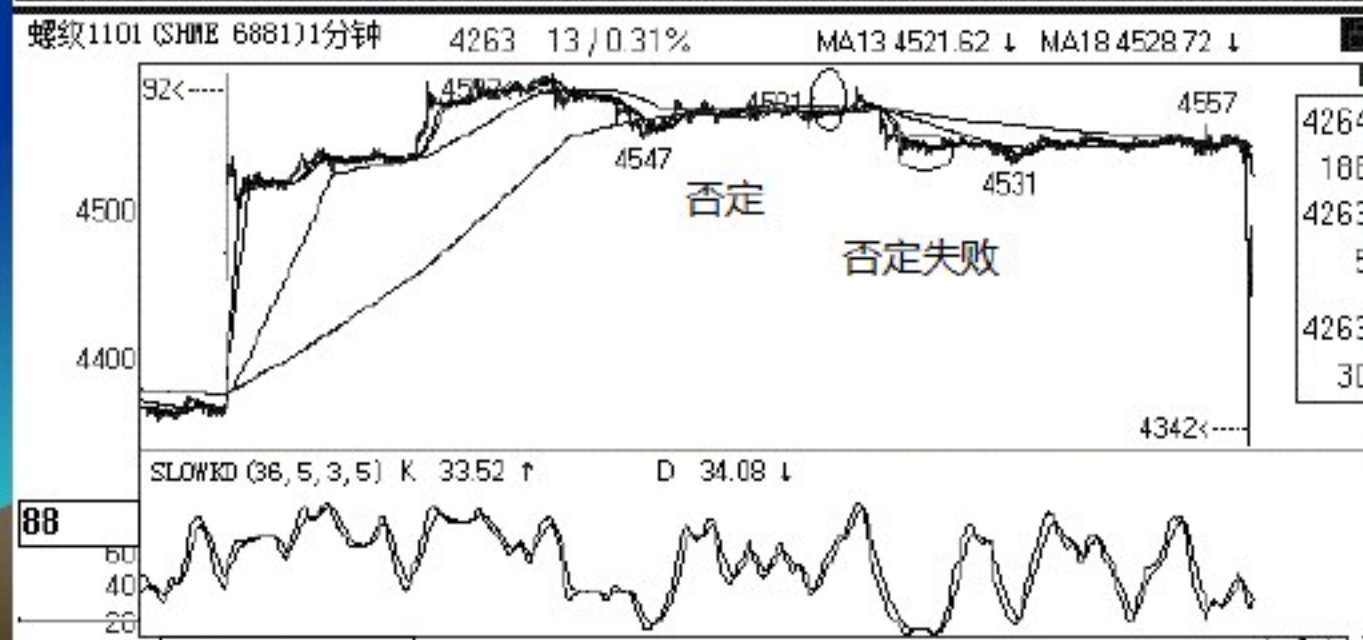
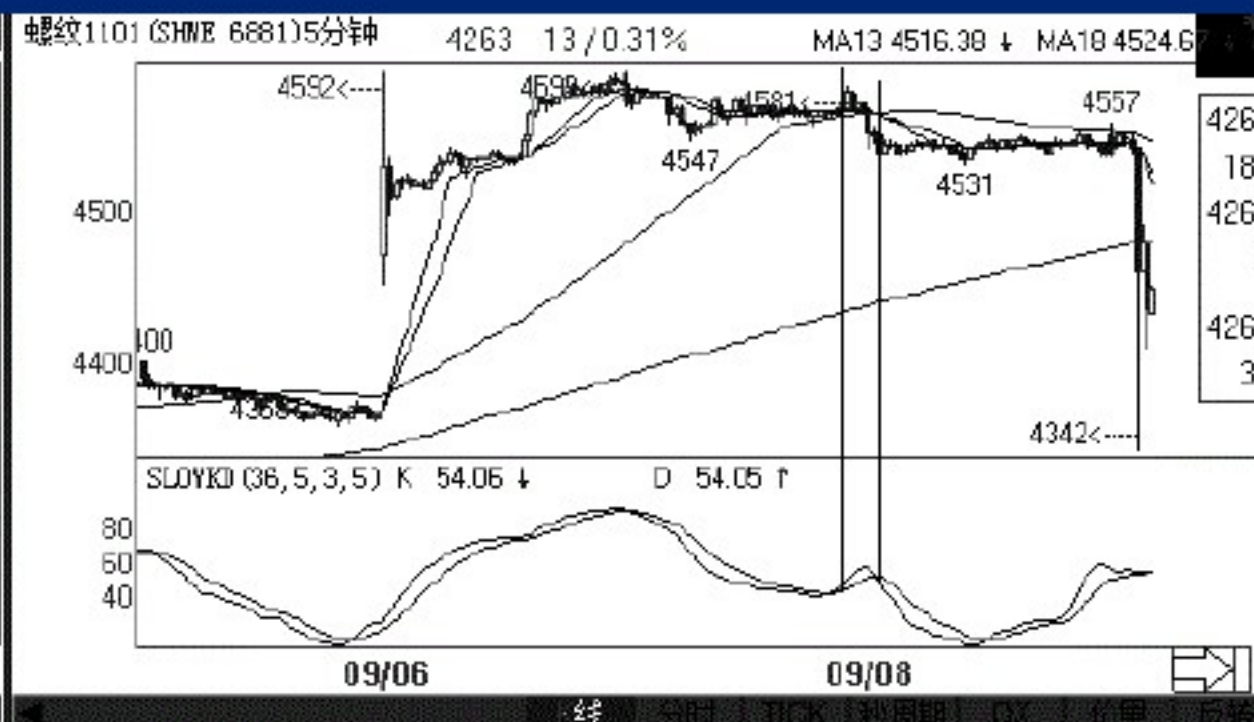
沪股指数(SHFE 2300)30分钟





# 否定之后再进场

- 原逆势信号被否定，或出现非标准进场信号后，要重新逆势进场，应等待上级否定失效。





# 总结： 进场的步骤

- 第一步：先看基本周期（1分钟图）价格有效穿越两条均线的时机（连续三根K线收盘站上 均线）。
- 第二步：判断此次穿越顺势还是逆势，趋势周期（15分钟图）价格在240MA之上大势为多头，反之为空头。
- 一、若为顺势：
  - 看基本周期（1分钟）穿越均线时趋势周期（15分钟）慢速KD是否同方向交叉支持该次穿越。
  - 1、若支持按标准顺势信号进场；
  - 2、若不支持看上级周期（5分钟）均线是否完好（没有被回撤打破）
  - A、若完好，上级周期慢速KD同方向交叉则按非标准顺势信号进场
  - B、若不完好，必须等趋势周期指标交叉确认以标准顺势信号进场；
- 二、若为逆势
  - 只能等趋势周期（15分钟）慢速KD指标确认，生成标准逆势 信号。
- 总结：进场要两个条件同时具备：1、基本周期均线穿越；2、趋势周期与上级周期至少有一个符合条件慢速KD同方向交叉确认。



# 总结：出场的步骤

- 1、基本周期打破趋势（破均线，或破止损位）；
- 2、逆势信号若上级周期（5分钟）趋势完整（均线未被打破），慢速KD指标顺势交叉时原逆势信号被否定出场；
- 总结：以上两个条件只要有一个出现就出场。





# 信号统计表的建立与应用

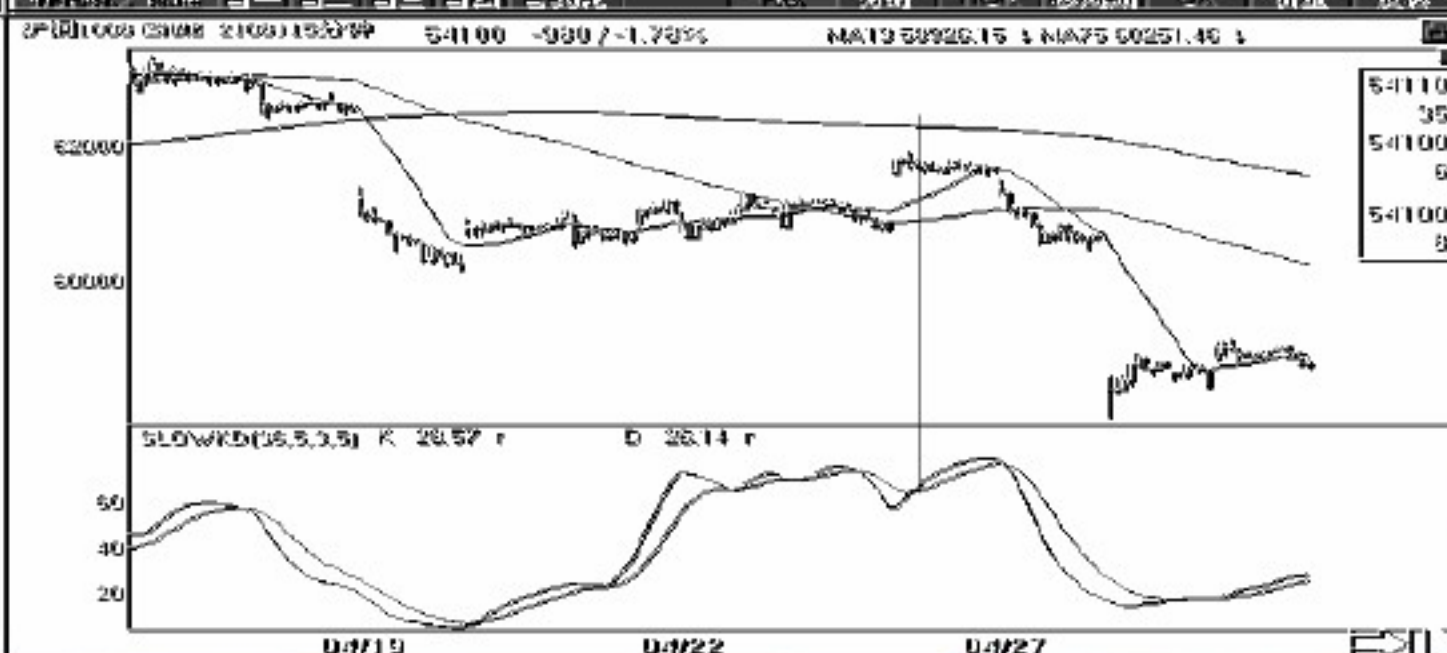
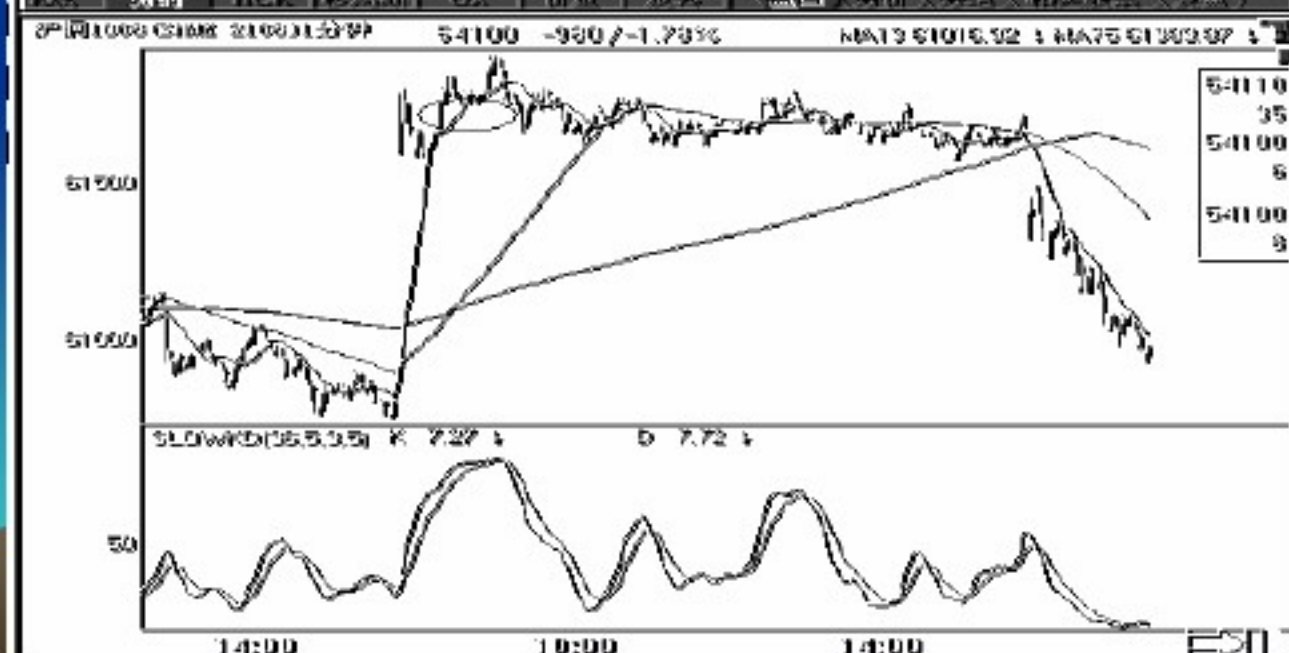
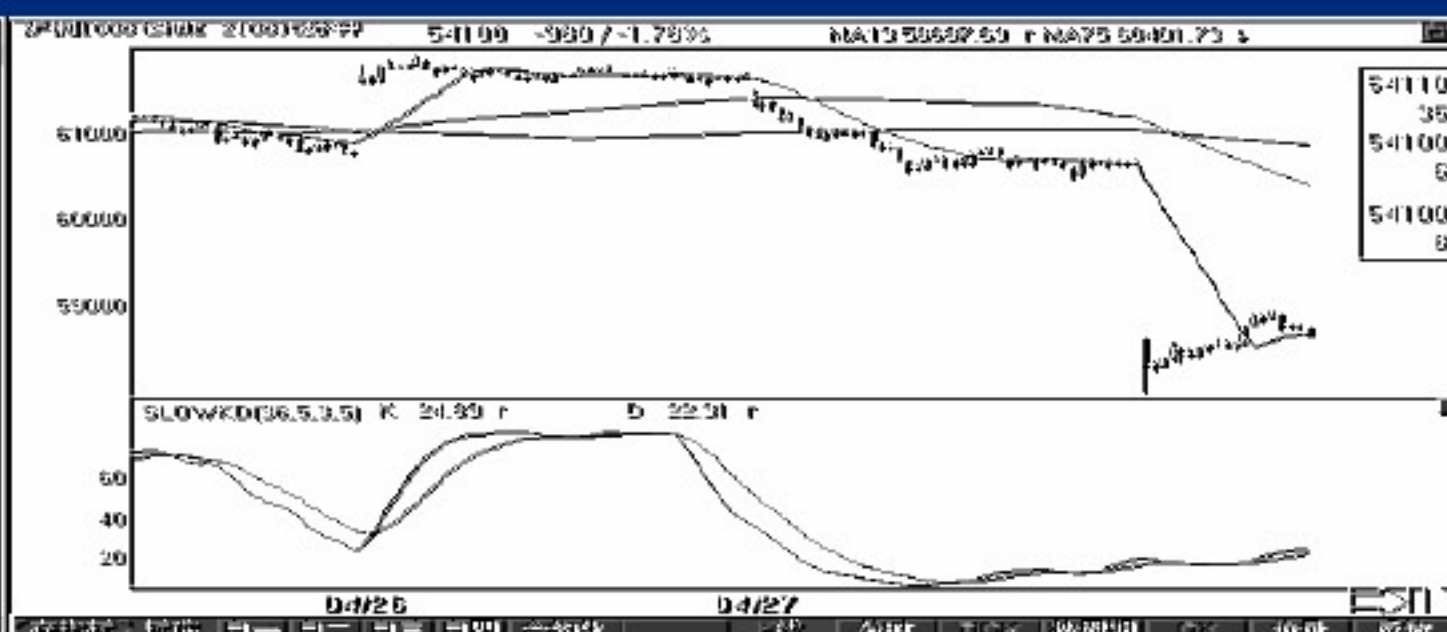
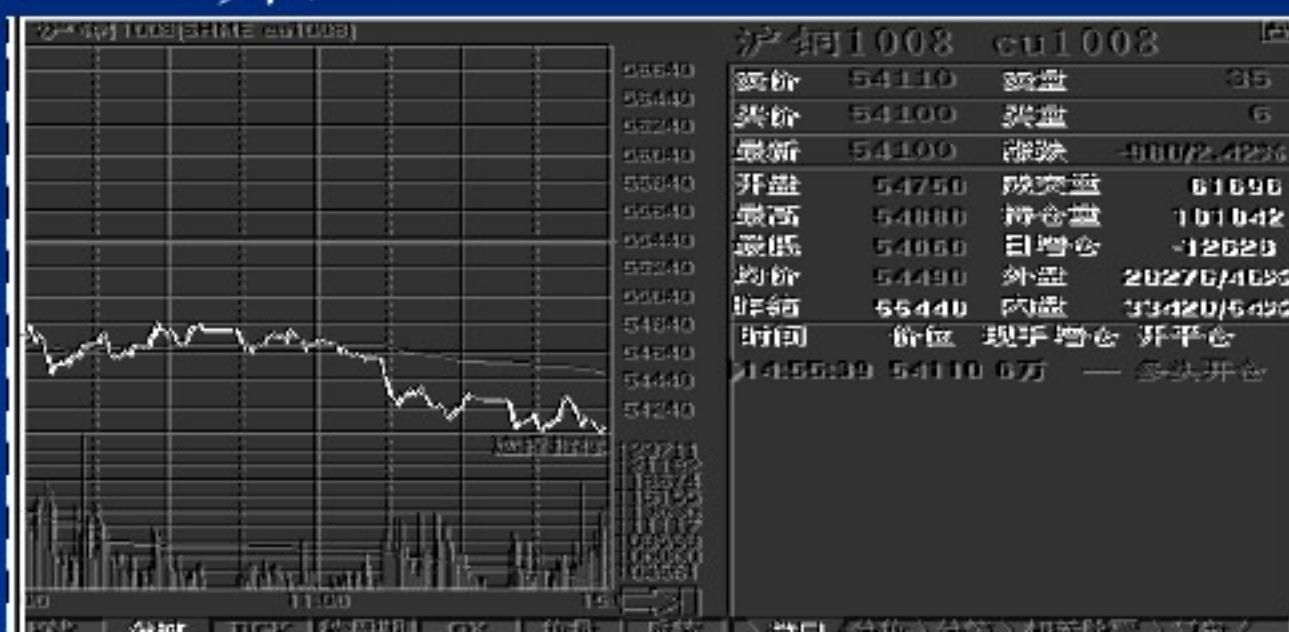
- 一、以EXCIL表形势，连续不间断地机械记录每个品种每个信号的盈亏。
- 二、该表格记录信号不作任何优化，是最基础的盈亏数据。
- 三、短线信号只记录主力合约按时换月，长线信号统计连续指数。
- 四、该表格作用：1、统计各品种各阶段的盈亏表现；2、寻找盈亏分布与转换规律，为资金管理策略提供数据支持；3、寻找各自品种最佳个性化周期应用。

时间	方向	进场价	第一止损	最大盈利	顺势逆势	实际盈亏	隔夜与否	标准与否	小时指标	3小时指标
5. 6: 9: 04	多	57420	540	0	逆	-320	否	是	空	空
5. 6: 11: 07	空	56810	310	2300	顺	800	是	否	空	空
5. 10: 9: 55	多	56120	370	1020	逆	380	是	是	低位转多	空
5. 11: 13: 32	空	56290	400	770	顺	-280	是	是	多	空
5. 12: 11: 20	空	56065	270	465	顺	-265	是	是	多	低位转多
5. 13: 10: 50	多	56400	160	500	逆	40	是	是	多	多
5. 17: 9: 04	空	54980	1700	2860	顺	1710	是	是	中位转空	多
5. 18: 13: 39	多	53270	540	600	逆	-1200	是	是	空	多
5. 19: 10: 46	多	53030	680	620	逆	-80	否	是	空	多



# 大幅跳空或秒杀行情信号简单优化

- 当基本周期以大幅跳空或秒杀行情突破时，多空信号出现通常均线乖离异常大，进场后以13MA作临时止损，降低止损幅度。价格回落至7.5和24.0 MA附近后，再择机介入。





# 信号类型总结

- 1、标准顺势多头信号；
- 2、标准顺势空头信号；
- 3、标准逆势多头信号；
- 4、标准逆势空头信号；
- 5、非标准顺势多头信号；
- 6、非标准顺势空头信号；
- 7、更大周期指标指标信号；



# 谢 谢 大 家！



- 文竹期货团队化交易内部培训教程
  - 2010年10月
  - 期海扬帆      大展宏图
- 文竹专栏: <http://wenzhu.blog.hexun.com>