



# 【商品期货智能交易系统】

Expert Advisor

百度“期权论坛”下载上万份期权PDF


[www.optbbs.com](http://www.optbbs.com)



# 目录

## 商品期货智能交易系统

03	程序化交易的目的	1
09	如何开始你的程序化	2
13	交易	3
16	分享EA系统设计理念	4
	风险及风险控制措施	



PART **1**

---

# 程序化交易的目的

————→  
**START**

# 三个原因让我们爱上她：

- 帮我们干掉交易中的贪婪与恐惧。（交易中最难的部分）
- 帮你从纠结的交易中解脱出来，让你获得时间上的自由。
- 把优秀的操盘手（你自己）分成N份，放到各个品种各个周期里去找到你自己最喜欢的交易图形或者买卖点，并且24小时严格执行！

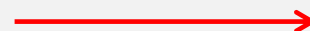
# 她会比我们做得更漂亮：



PART 2

---

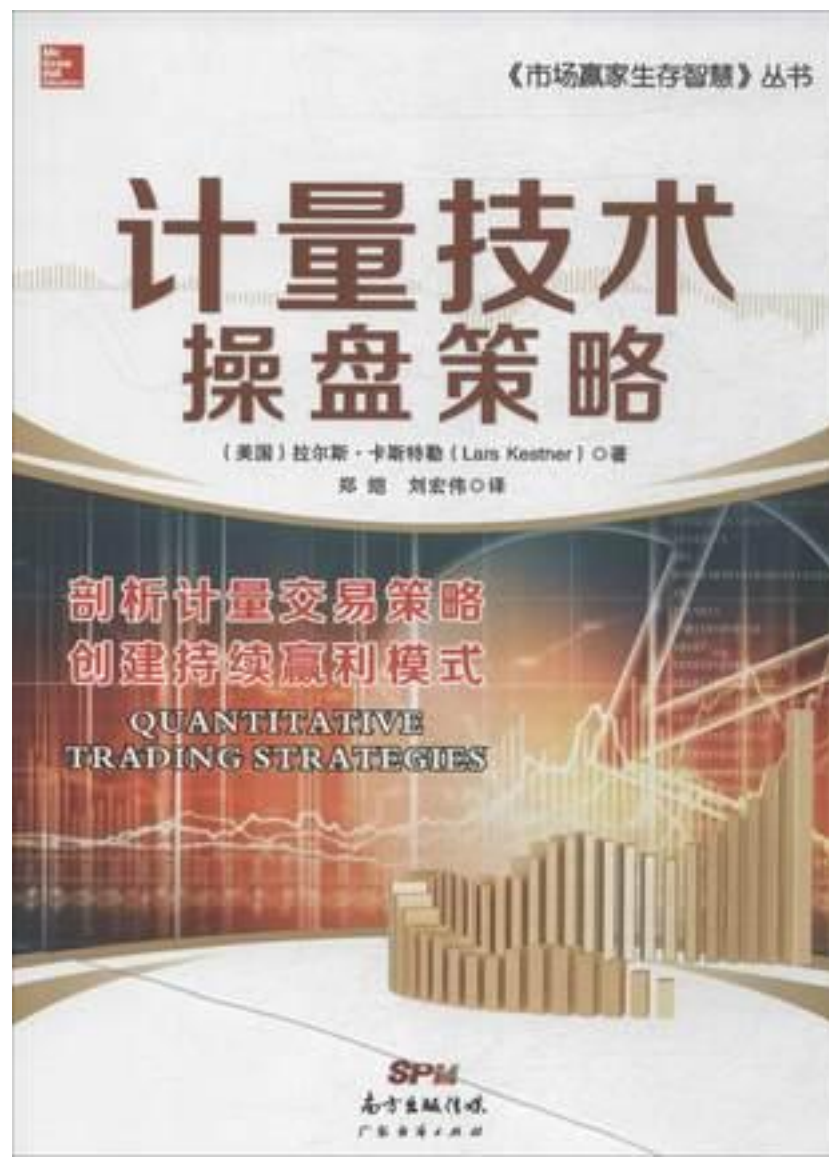
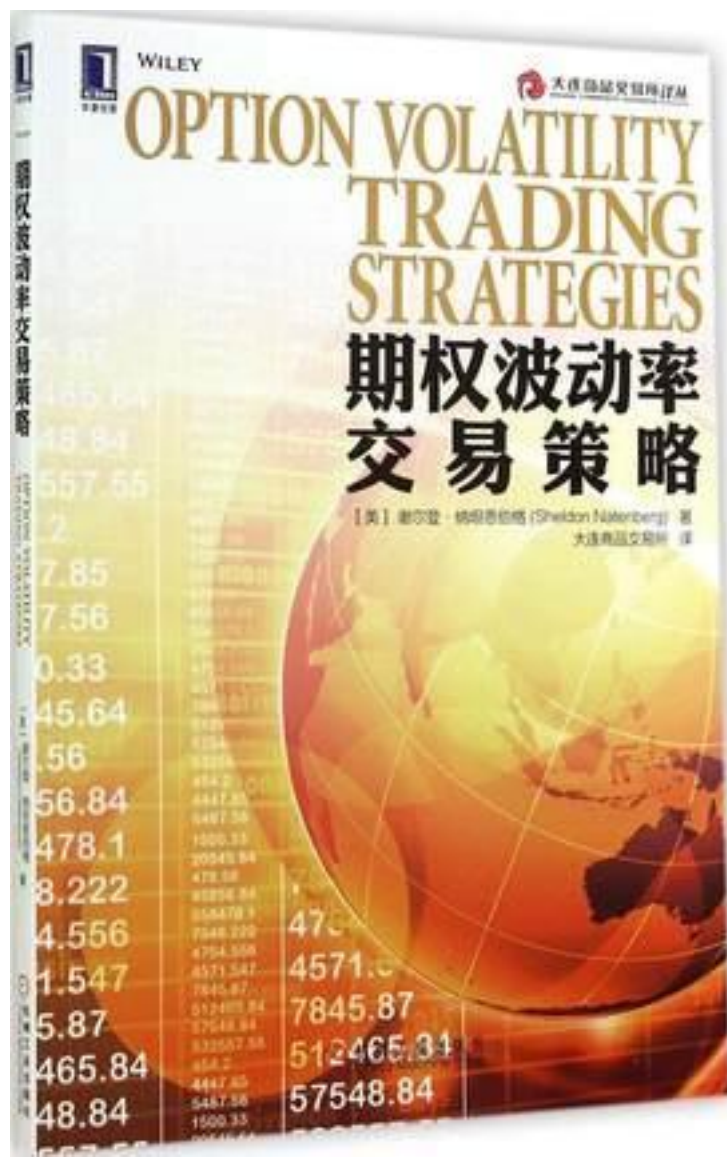
# 如何开始你自己的： 程 序 化 交 易



START



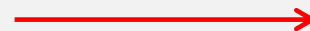
# 程序化交易书籍推荐：



PART 3

---

# E A 系统设计理念



START



## EA系统设计理念

- 2014年先后在MagicQuant平台上设计和实施了“橡胶日内交易系统”、“橡胶波动率交易系统”、“焦炭跨期套利交易系统”、“交易复制跟单系统”、“区间突破组合交易系统”等。
- 不追求短期暴利，不做耀眼的流星只做健康的寿星。通过一致的资金管理原则，严控交易风险；通过程序化交易的方式，最小化人为操作影响，昼夜捕捉市场交易机会，最大程度保障取得稳定盈利。

# 区间突破下单+ATR过滤:

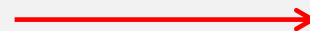


PART

4

---

# 风险控制理念与措施



START

## 主要风险

- 1、系统交易策略属于趋势交易，当市场处于震荡无趋势的时期会引发反复止损；在市场波动率异常高的情况下，策略在长周期会被频繁打至止损位，消耗掉短周期上的盈利，若长周期上开仓更为频繁，会导致净值的回撤。
- 2、交易品种间存在关联品种，同时又受市场整体风险的影响，在缺乏对冲机制的情况下，这种叠加影响会加剧资金曲线的波动。

# 风险控制措施

- **止损措施**——绝对损失控制、无利润收盘离场
- **分散风险**——配置尽量多的交易品种，减小单个品种不理想市况对于账户的影响，即使在某品种上遭遇黑天鹅事件，损失也在可接受范围内。
- **回撤控制**——单次交易最大回撤为2%，20个品种同时交易并且同时全部止损（极小概率），以上事件连续发生6-10次（最少需要20个交易日），账户净值将回撤20%。
- **风险回避**——长假到来时，通过分析市场基本面情况，选择性降低仓位，降低节日价格波动风险。在人为判断市场震荡无明朗方向的时期，将降低交易仓位。
- **注：在历史回测的2000个交易日内中，100万资金最大回撤值为19万，年度收益率为53.66%**

PART 3

---

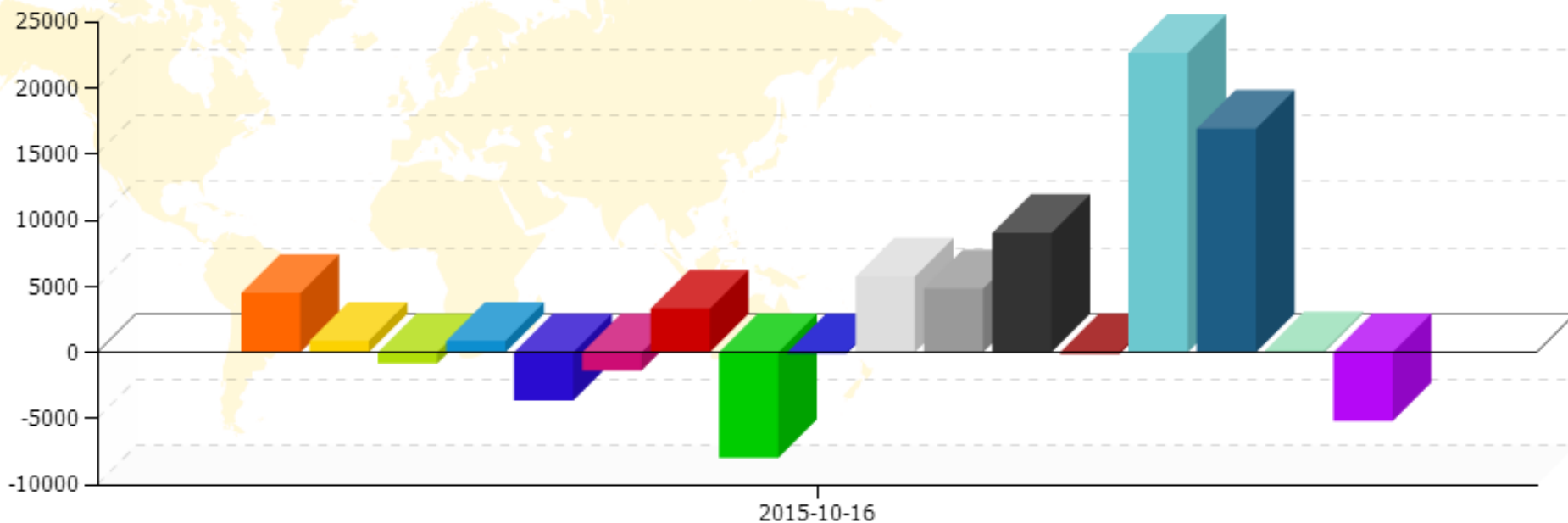
# 交易系统业绩展示

—————→  
START



# 17个交易品种

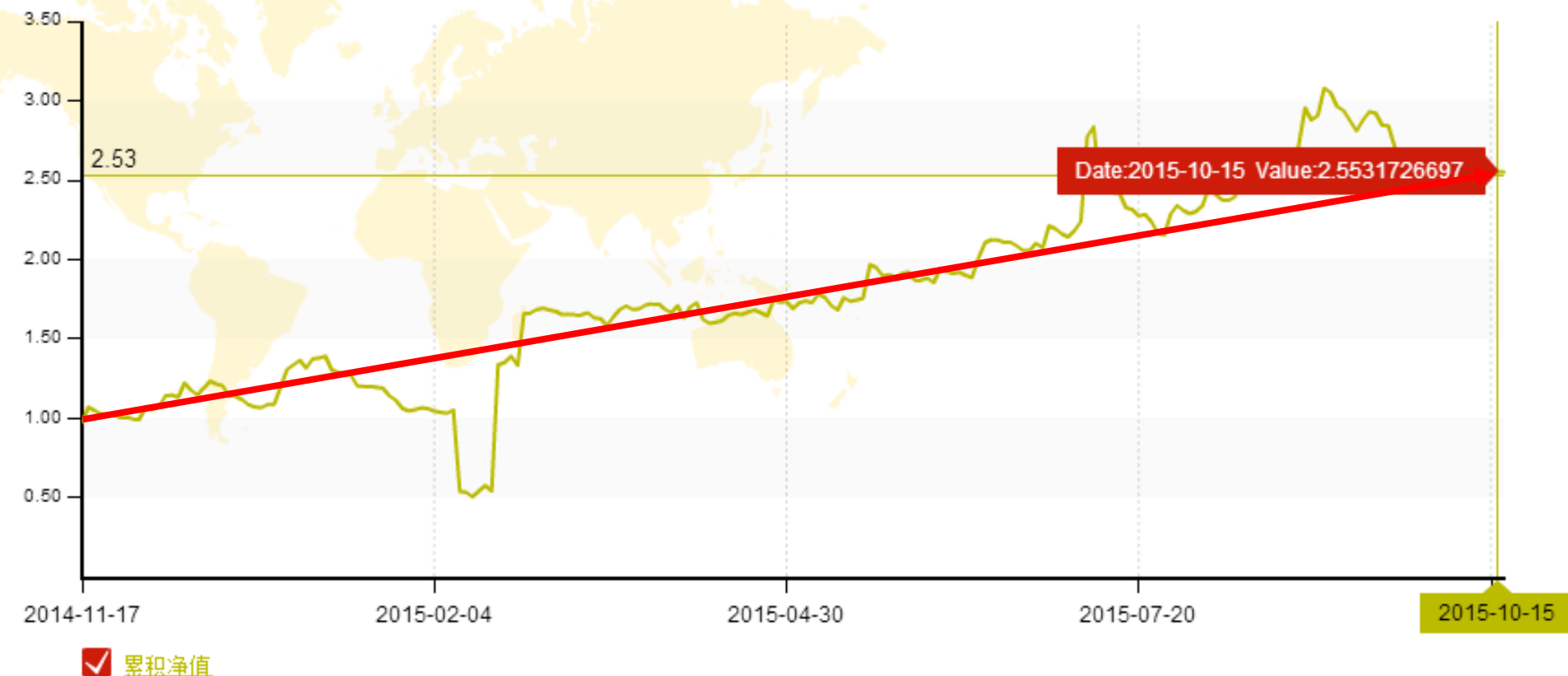
【零四二九】各品种投资盈亏柱状图



- |     |     |     |    |    |     |    |    |    |    |
|-----|-----|-----|----|----|-----|----|----|----|----|
| 白银  | 沥青  | 郑棉  | 焦炭 | 鸡蛋 | 豆粕  | 甲醇 | 沪镍 | 菜油 | 棕榈 |
| 聚丙烯 | 螺纹钢 | 菜籽粕 | 橡胶 | 白糖 | PTA | 豆油 |    |    |    |

2014年11月17日→2015年10月15日  
净值：1→2.55 累计收益率155%

【零四二九】累积净值曲线图





TB公式

帮助与链接

testFor1Year

ru888 3分钟

ru888 橡胶连续 3分钟 2015/10/27 14:57 C=10805 -115 -1.05% O=10855 H=10855 L=10800 ToD\_DayTrade8\_Pivot



10月27日

10月28日

10月29日

10月30日

10月31日

11月03日

11月04日

11月05日

testFor1Year

闪电下单

交易师

批量下单

套利宝

价差下单

本地触发单

策略易

监控器

组合报告

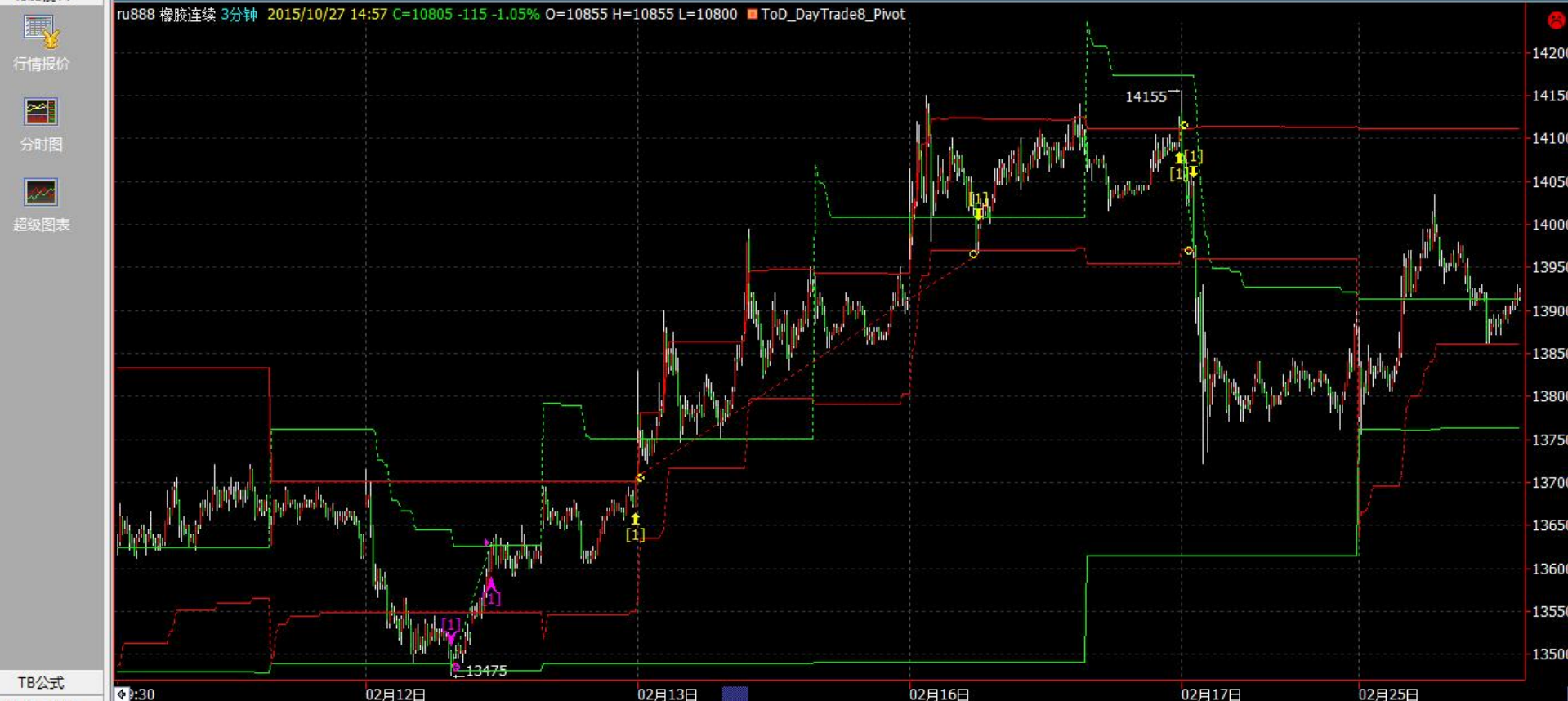
高级功能

交易助手

允许自动

交易帐户

系统





功能模块

行情报价

分时图

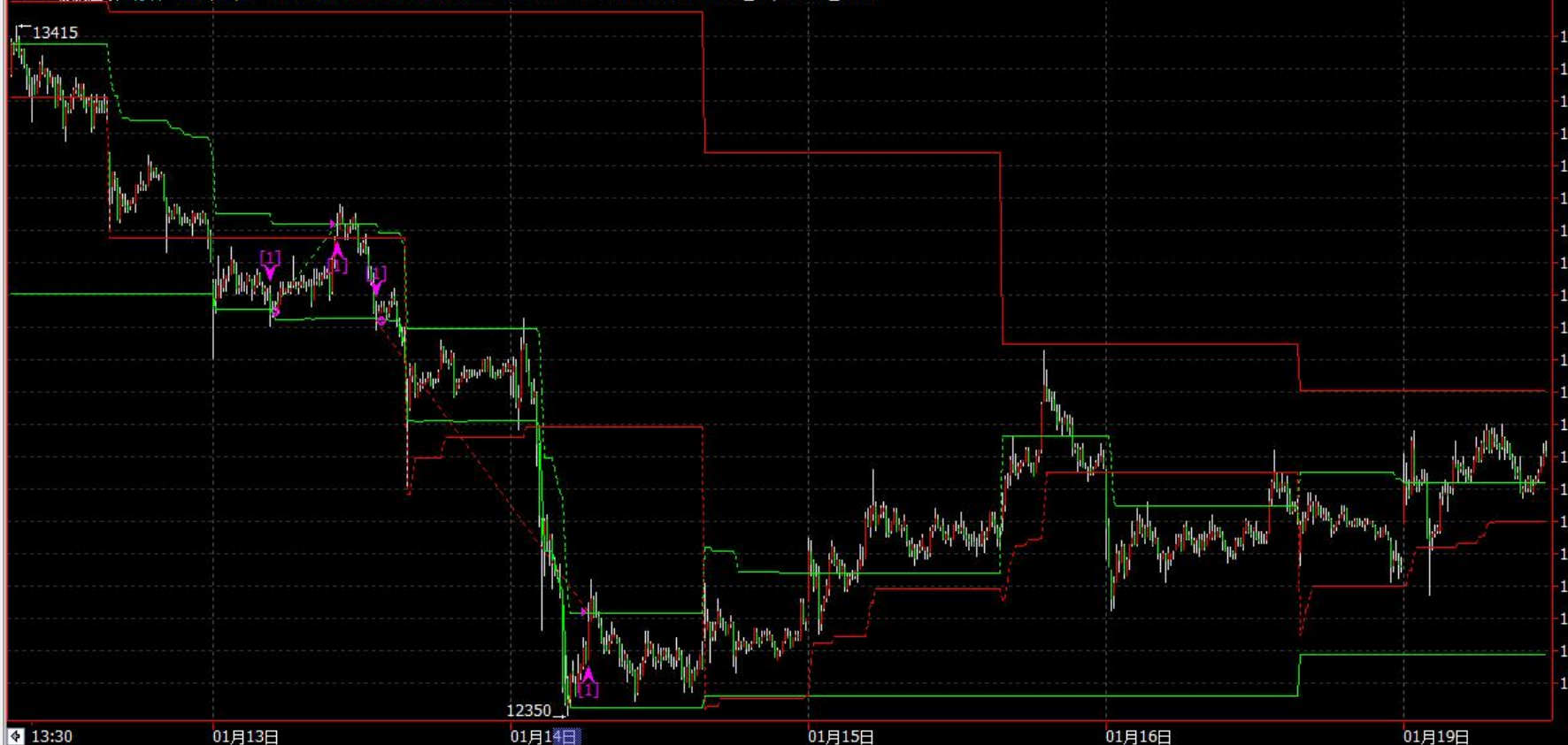
超级图表

TB公式

帮助与链接

ru888 3分钟

ru888 橡胶连续 3分钟 2015/10/27 14:57 C=10805 -115 -1.05% O=10855 H=10855 L=10800 ToD\_DayTrade8\_Pivot



闪电下单

交易师

批量下单

套利宝

价差下单

本地触发单

策略易

监控器

组合报告

高级功能

交易助手

允许自动

交易帐户

系统



# 系统交易策略---“区间突破组合交易系统”

- **趋势交易**：持续跟踪标的的走势，突破发生时迅速入场，行情逆转时离场，采取**绝对损失控制**、**无利润收盘离场**等措施保障本金安全。
- 策略亮点：**不使用滞后线性指标**，只使用极少量的可调变量，极大降低策略过度优化带来的风险。
- 策略贴合市场本质，具有强适用性和生命力，**可部署的期货品种达将近20只**，资金容量可达千万级别。
- **回测测试过去2000个交易日表现良好稳定，预期年化收益达50%以上**

THE  
END