

交易系统建立方案



交易者：lion 莱恩



1 交易系统理念核心

前提：本交易系统的建立基于纯技术分析

交易者投资理念：市场是比较专业的一个领域，本身账户的年收益率与你的方法和资金管理有关系，本质是交易者拿风险去搏击收益。本系统的目的是以合理的风险去博取可观的收益，优化的目的是不断的降低风险，收益由市场决定。

交易品种结构：欧元

交易周期：中短线

交易者投资优势：资金管理，风险控制，交易心理

策略优势：数学期望 > 0

交易系统的参数

性格

兴趣

市场敏锐度

风险承受力

综合判断力

系统
数学期望 > 0

胜率
15分钟周期胜率
30分钟周期胜率
1小时周期胜率
4小时周期胜率
日线周期胜率
周线周期胜率

盈亏比
待测
待测
待测
待测
待测
待测

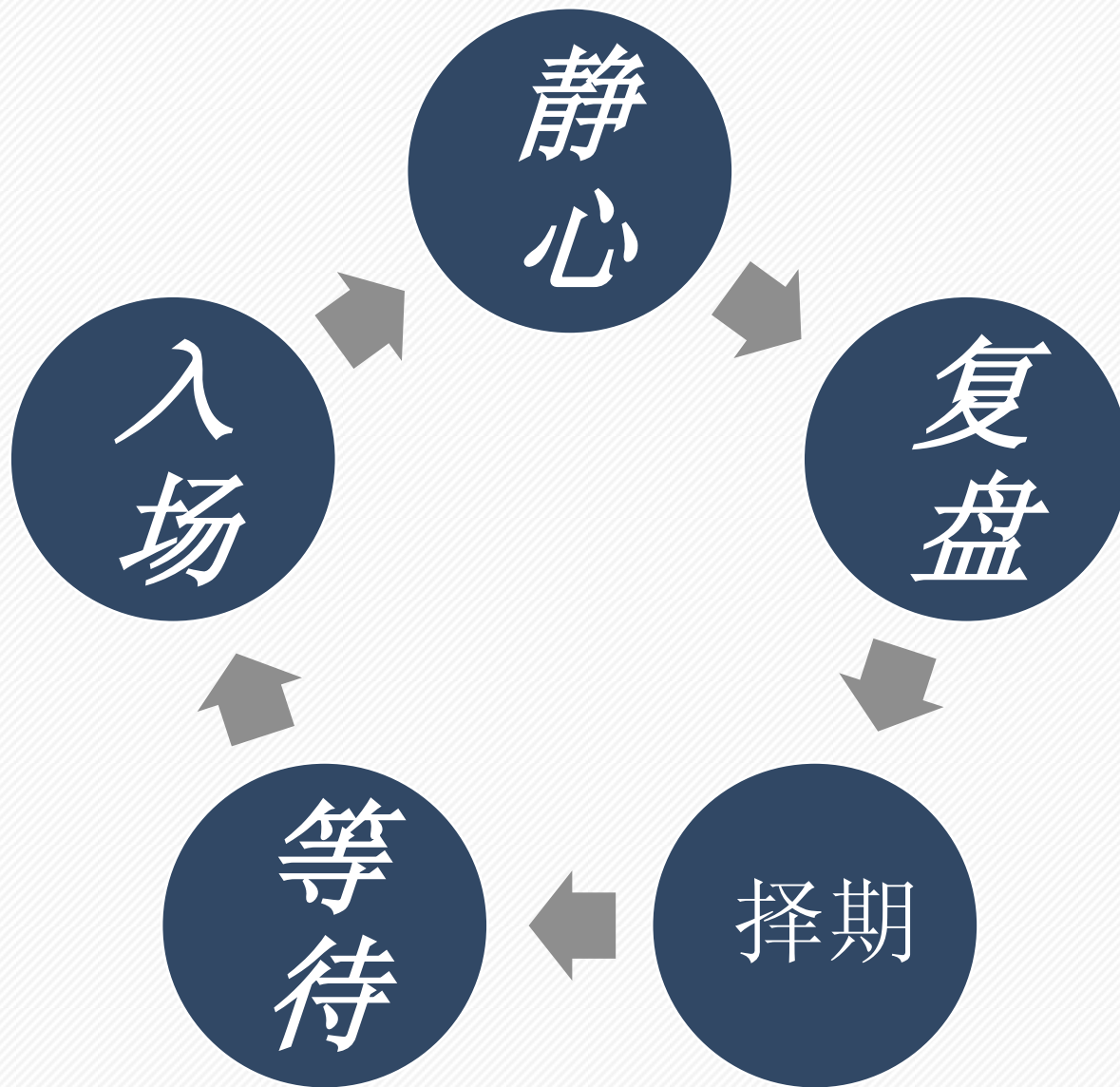


1 交易系统理念核心

2 交易策略制度

入场准备

- 1、归纳不同周期趋势
- 2、回顾昨日走势



入场策略



开仓策略



开仓方式



开仓头寸

持仓策略

1

何时加仓

2

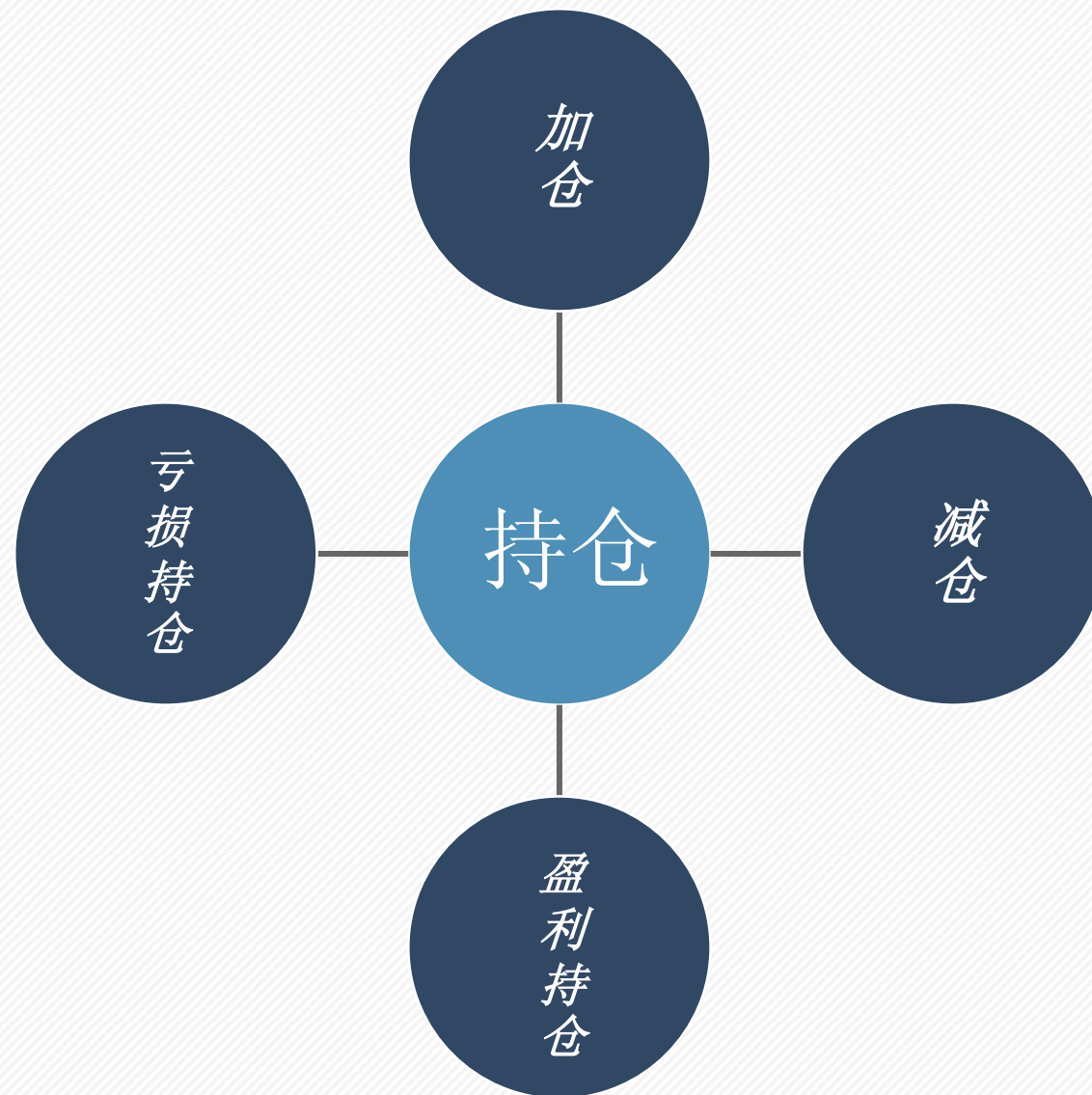
何时减仓

3

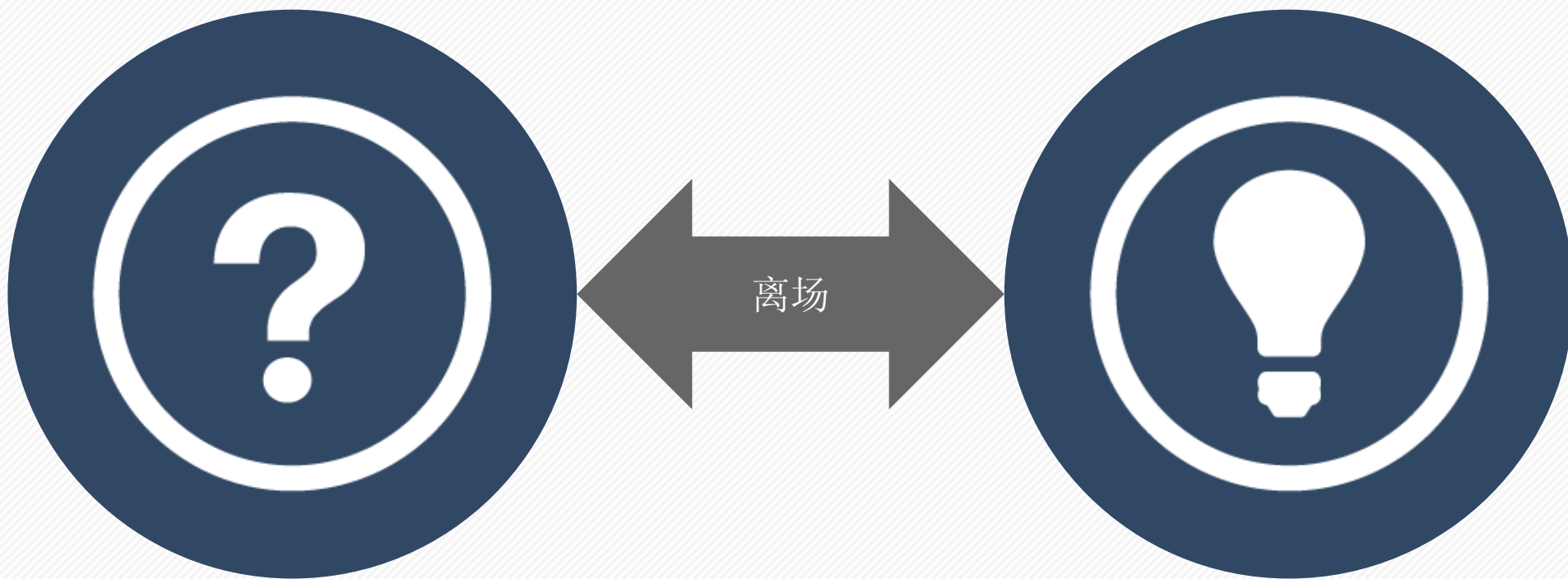
盈利情况下的持仓

4

亏损情况下的持仓



离场策略



盈利情况下离场原则
如何判断结构稳定性盈利

亏损情况下离场原则
如何判断交易失败



1 交易系统理念核心

2 交易系统策略制定

3 系统的资管和风控

资金管理

最大回撤比例：20%

单日最大回撤比例

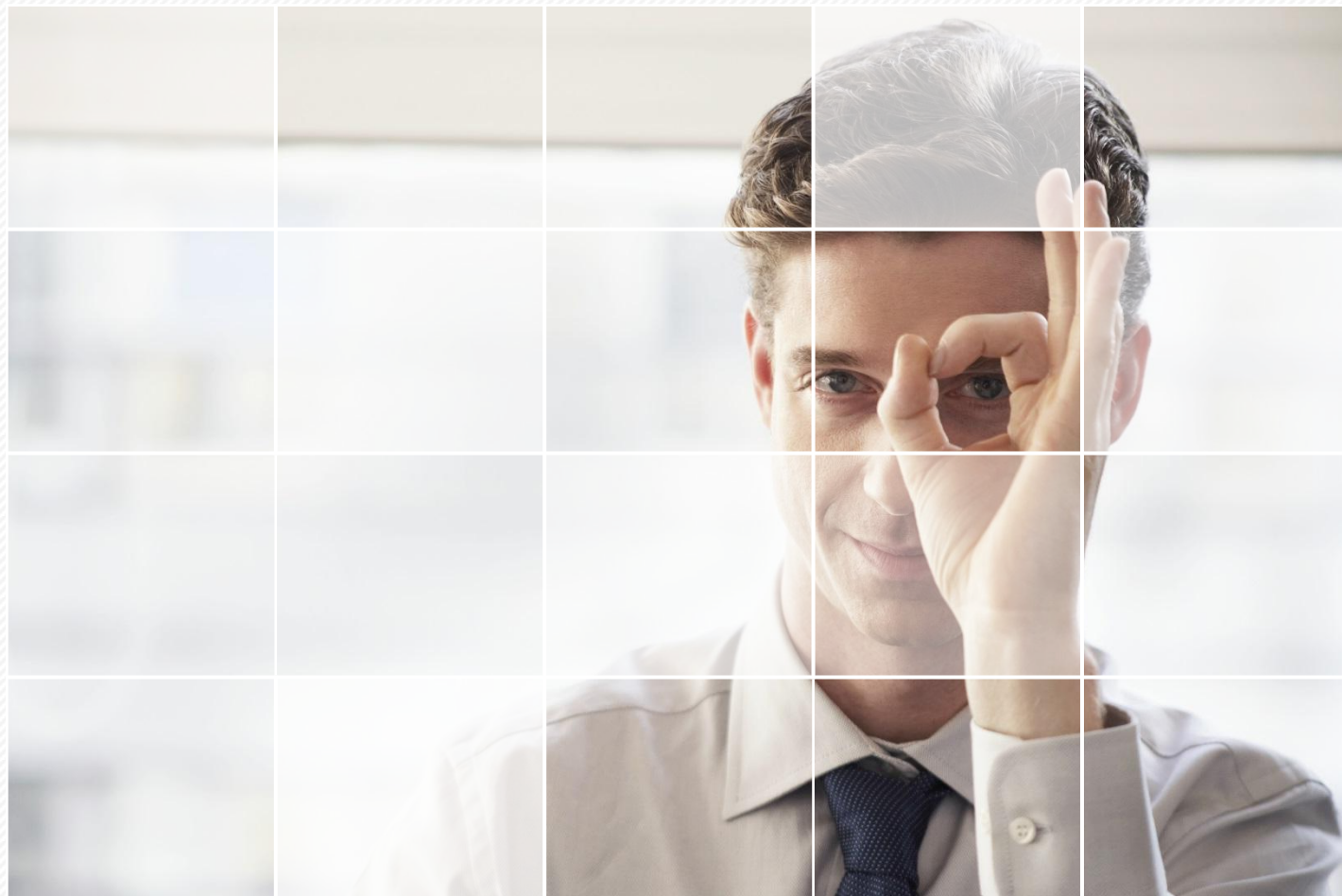
使用实际杠杆

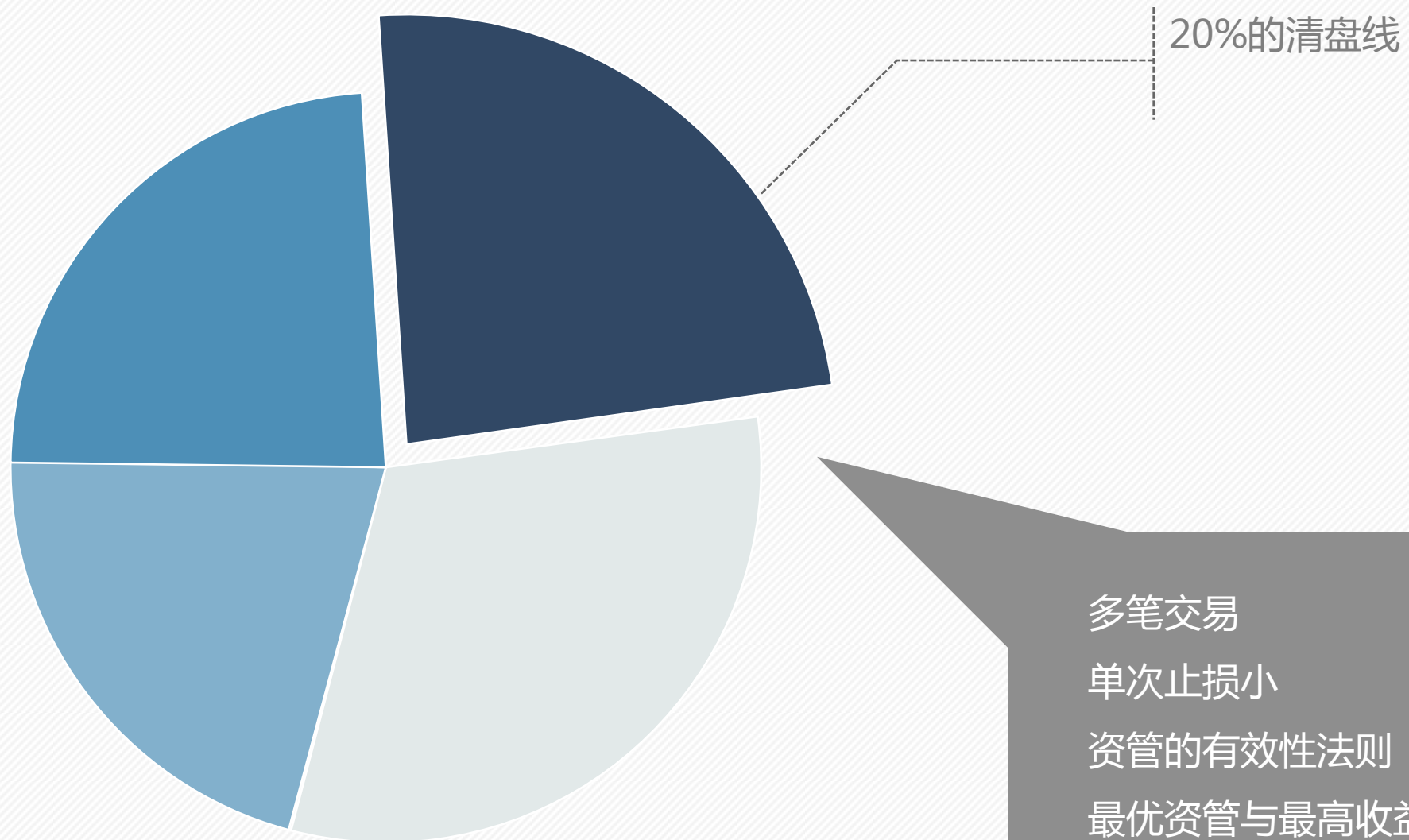
最大持仓数

最大持仓头寸

交易频率（日，周，月，年）

资金性止损和技术性止损





多笔交易
单次止损小
资管的有效性法则
最优资管与最高收益的契合
点

风控措施

市场出现非人力因素，如何处理？

当市场结构变化以后，如何修正自己的交易计划？

交易者自身周边环境因素



资金安全性

认可的交易通道



交易安全性

安全的交易环境



市场安全性

流动性充足的市场



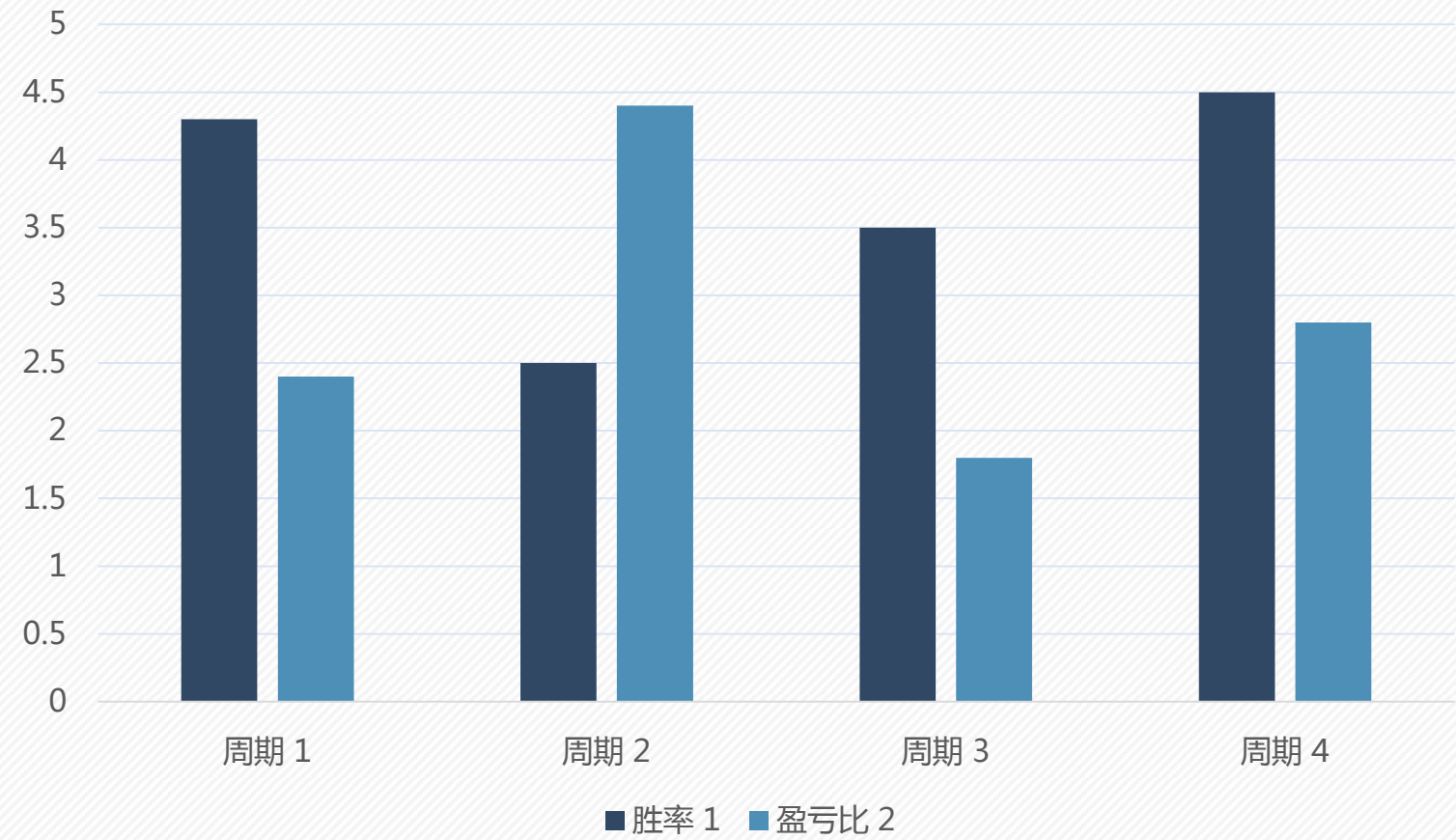
1 交易系统的理念核心

2 交易系统的策略制定

3 系统的资管与风控

4 系统的检测和优化

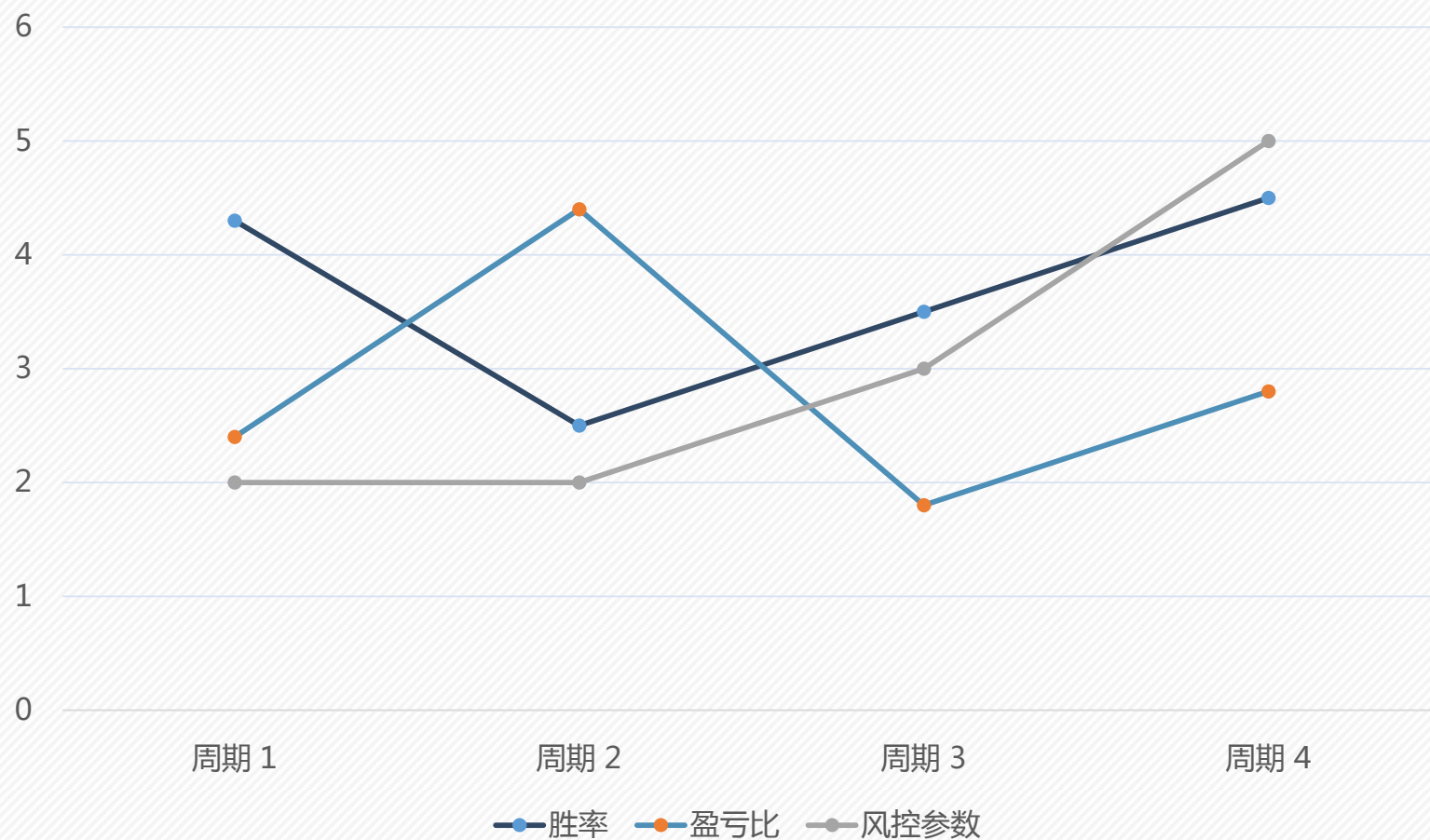
例：系统各周期盈亏比与胜率表现



数据检验方法

- 历史数据检验
- 周期性检验
- 随机检验

例：系统不同风控参数下的表现

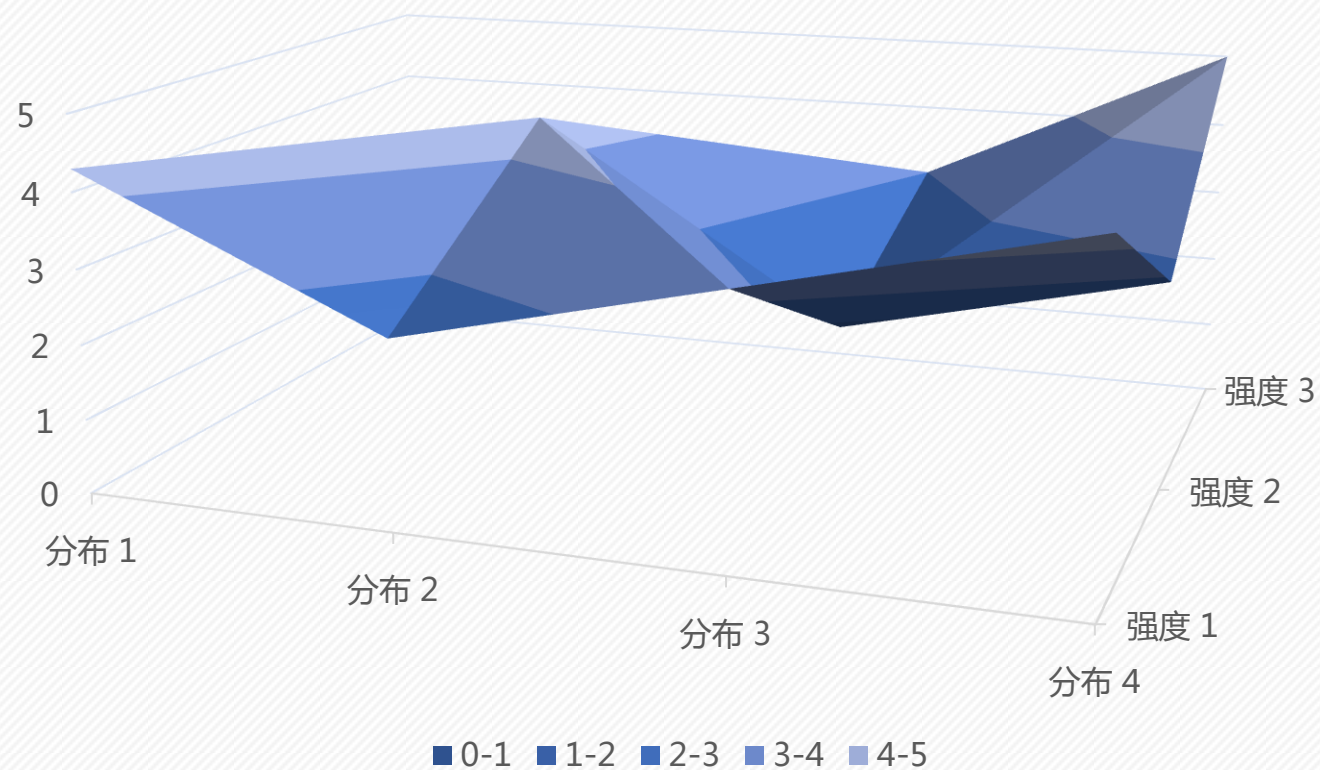


风控参数检验

条件：不同风控参数

求证：胜率和盈亏比的变化

噪音控制



噪音控制及优化

回测噪音区域

寻找系统噪音特征

过滤噪音



1 系统建立时间为10天

2 具体策略与交易者探讨

3 方式为在线会议语音

4 交易者满意，合作愉快



THANKS!



Design : lion