

目录

一、简介.....	2
二、研发团队介绍.....	2
三、我们的理念.....	2
1、单一策略的不稳定性，自动化交易策略仅为理想的工具.....	2
2、反散户投资行为的逆袭思维.....	2
3、以趋势策略为盈利点，以震荡策略为平滑工具.....	3
4、专业交易者的策略选择.....	4
四、小优机器人 EA 的多策略组合的方法.....	4
1、趋势策略+震荡策略.....	4
2、多品种.....	4
五、业绩展示.....	5
1、近 2 年收益.....	5
2、小优趋势策略-黄金收益曲线图（0.1 手/1 万美金）.....	7
3、小优趋势策略-镑日收益曲线图（0.1 手/1 万美金）.....	7
4、小优震荡策略-欧美收益曲线图（0.15 手/1 万美金）.....	7
5、小优震荡策略-欧瑞收益曲线图（0.2 手/1 万美金）.....	7
6、小优震荡策略-澳瑞收益曲线图（0.15 手/1 万美金）.....	8
六、补充说明.....	9
1、止损止盈问题.....	9
2、加仓问题.....	9
3、关于点差问题和手数问题.....	9
4、关于回撤和收益率问题.....	9
5、关于人工干预.....	10
七、合作洽谈.....	10

小优机器人 EA

—逆向思维下的组合型 EA

一、简介

小优机器人 EA 是优交易量化技术公司研发的，适用于黄金、镑日、欧美、欧瑞、澳瑞品种的自动化交易系统，能够实现脱离人工的自动买入以及自动卖出，所有决策过程由小优机器人 EA 自动抉择。

二、研发团队介绍

我们的策略编程团队来自于国内外一流大学的硕士、博士，多数策略成员曾为世界五百强企业中高层管理人员。

我们的编程人员精通 Basic 语言& Visual Basic、C++ 语言&C++Builder、JAVA 语言、MQL5 语言等，保障策略的执行的精确性。

三、我们的理念

1、单一策略的不稳定性，自动化交易策略仅为理想的工具

市场上并无所谓的圣杯，一套策略难以适用市场上所有的行情，自动化交易策略仅是理想的工具，具体如何使用应该由人来执行。

趋势策略震荡时会损耗，震荡策略趋势时会大幅度回撤，单一策略很难获得最佳的风险报酬比，很难持久稳定；

唯一正确的做法是，趋势策略用在趋势品种以及行情，震荡策略用在震荡品种以及行情。趋势策略本身能够过滤掉大部分震荡，又能够在来大趋势的时候果断抓住趋势。震荡策略能够在大周期范围内获取高胜率，在趋势来临之际又能够果断止损，不至于大亏。

2、反散户投资行为的逆袭思维

我们一般把零售外汇交易者称之为散户，他们在某些交易行为上具有明显的同质性，我们归纳出两个特点：

A.盈利少量点数就平仓，亏损大量点数却死扛，经常看到的账户都是浮亏，浮盈出现的很少，盈亏比极不合理；

B.亏损之后经常加仓，往往导致亏损时重仓，盈利时轻仓的现象。

散户投资的成功率很低，90%以上的外汇投资散户面临着持续亏损的局面。

小优机器人 EA 的趋势策略，本着逆散户投资行为的姿态，以盈利时重仓，亏损时轻

仓为原则，通过追踪趋势，实现稳定盈利。

3、以趋势策略为盈利点，以震荡策略为平滑工具

外汇交易中，最能够高效带来丰厚利润的是趋势策略，好的趋势策略本身，能够过滤掉一部分震荡行情，又能够抓住大部分趋势走势。

但是由于趋势的不可预测性以及趋势的短暂性特点，一年之中，能够实现大赚的趋势可能只爆发 1-3 次，其他时间账户面临着不断回撤的风险，积少成多，单纯的趋势策略面临长达半年以上的震荡行情也会束手无策，同时，会降低使用者和投资者的信心。

小优机器人 EA 以趋势策略为盈利点，用震荡策略作为资金曲线的平滑工具。

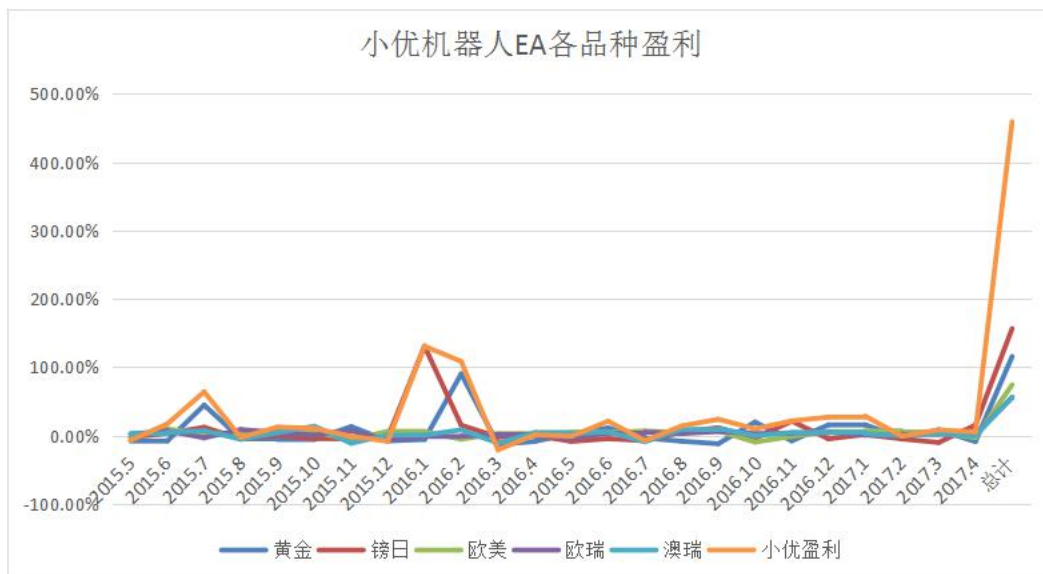
趋势策略本身胜率不会太高，小优机器人趋势策略的胜率仅 36%，主要以盈亏比获取利润。

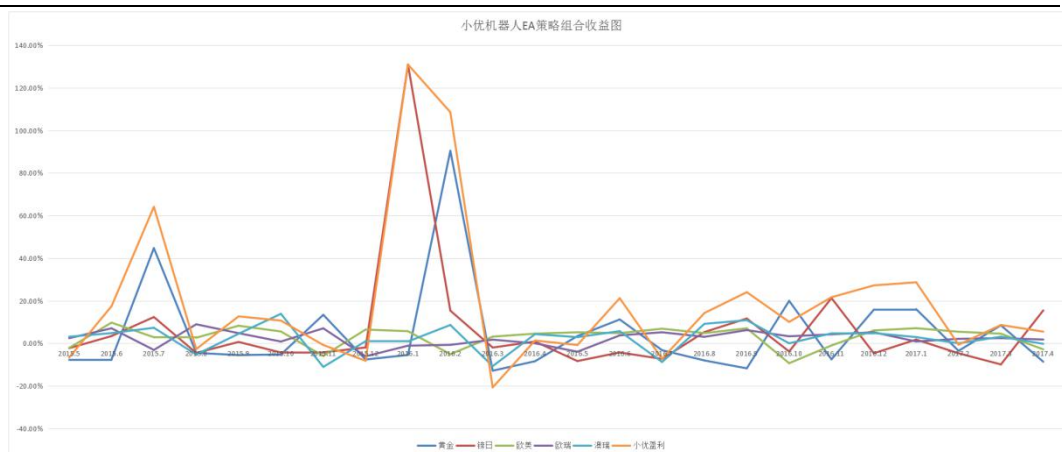
震荡策略只要使用得当，胜率会很高，小优机器人 EA 目前使用的震荡策略，平均胜率能够达到 75%以上。

当市场整体没有趋势时，我们的趋势策略将会小幅度亏损，而震荡策略能够不断稳定的盈利。

当市场出现强趋势时，我们的趋势策略将会大赚，而震荡策略能够保持不亏或者小幅度亏损。

所以，总体下来，趋势表现性不强，账户不亏，趋势表现性强，账户大赚。





4、专业交易者的策略选择

坚决不做网格交易和马丁策略，任何风险不可控的策略都不会采用。

专业交易者的关注点是**风险和规模**，而业余投资者更注重**收益和时间**。

小优机器人 EA 不管震荡策略还是趋势策略，都会带有止损，趋势策略带有止损是为了防止黑天鹅事件，震荡策略带有止损是为了出场。

四、小优机器人 EA 的多策略组合的方法

1、趋势策略+震荡策略

我们的趋势策略挑选近几年趋势表现非常强势的品种：黄金和镑日，这两个品种是目前外汇市场中波动性较大，容易出大趋势的品种。

我们的震荡策略挑选欧美，欧瑞，以及澳瑞。近几年这三个品种在大区间一直震荡，我们的震荡策略在这三个品种中能够实现 75%以上的胜率。

在组合的时候考虑到了不同策略的风格以及不同货币对之间的权重与最优组合。

优 EA 包含一套趋势策略和一套震荡策略，趋势策略：

分别为

小优趋势策略：黄金

小优趋势策略：镑日

小优震荡策略：欧美

小优震荡策略：欧瑞

小优震荡策略：澳瑞

2. 多品种

单一品种在某段时间的运行具有局限性，**多品种能够有效的增强 EA 对行情匹配的广度**

和广度。

优 EA 共计挑选了 5 个品种进行交易

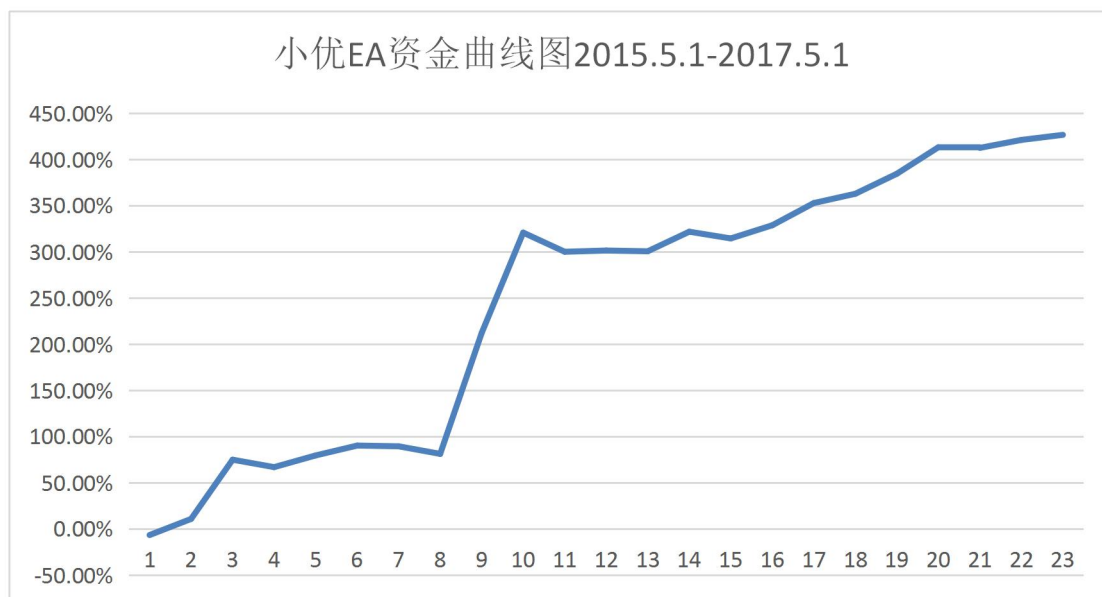
EURUSD
XAUUSD
AUDCHF
EURCHF
GBPJPY

五、业绩展示

1、近 2 年收益

趋势策略大多在短期波动性较强，我们无法保证在短期的盈利状况，但如果以月度为单位，可以获得不错的稳定性。

根据过去的 5 年的历史业绩，每个月获得正盈利的概率为 75%，即每年预期有 9 个月盈利，只有 3 个月亏损，且单月最大亏损为 20%。



小优机器人 EA 月盈亏统计 2015. 5. 1-2017. 5. 1						
	黄金	镑日	欧美	欧瑞	澳瑞	小优盈利
2015. 5	-7. 78%	-2. 29%	-2. 15%	2. 41%	3. 11%	-6. 70%
2015. 6	-7. 56%	3. 42%	9. 73%	7. 07%	4. 79%	17. 45%
2015. 7	44. 74%	12. 35%	2. 86%	-3. 12%	7. 31%	64. 14%
2015. 8	-4. 50%	-4. 52%	2. 62%	8. 95%	-5. 26%	-2. 71%
2015. 9	-5. 53%	0. 65%	8. 27%	4. 77%	4. 49%	12. 65%
2015. 10	-5. 25%	-4. 33%	5. 56%	0. 84%	13. 86%	10. 68%
2015. 11	13. 41%	-4. 24%	-5. 92%	7. 05%	-11. 09%	-0. 79%
2015. 12	-7. 61%	-1. 95%	6. 47%	-6. 12%	1. 00%	-8. 21%
2016. 1	-5. 45%	130. 98%	5. 69%	-1. 10%	0. 87%	130. 99%
2016. 2	90. 48%	15. 36%	-5. 12%	-0. 73%	8. 62%	108. 61%
2016. 3	-12. 87%	-1. 99%	3. 14%	1. 72%	-10. 72%	-20. 72%
2016. 4	-8. 41%	0. 85%	4. 55%	0. 00%	4. 33%	1. 32%
2016. 5	3. 40%	-8. 34%	5. 19%	-3. 95%	2. 90%	-0. 80%
2016. 6	11. 22%	-4. 29%	4. 80%	3. 73%	5. 73%	21. 19%
2016. 7	-3. 24%	-7. 33%	6. 87%	5. 19%	-8. 77%	-7. 28%
2016. 8	-8. 05%	5. 30%	4. 80%	3. 05%	9. 15%	14. 25%
2016. 9	-11. 76%	11. 66%	7. 06%	6. 21%	10. 87%	24. 04%
2016. 10	19. 95%	-3. 84%	-9. 35%	3. 30%	0. 00%	10. 06%
2016. 11	-7. 53%	21. 27%	-1. 00%	4. 23%	4. 69%	21. 66%
2016. 12	15. 81%	-4. 67%	6. 07%	5. 19%	4. 82%	27. 22%
2017. 1	16. 05%	1. 76%	7. 10%	0. 85%	2. 92%	28. 68%
2017. 2	-3. 52%	-4. 68%	5. 45%	2. 11%	0. 00%	-0. 64%
2017. 3	8. 46%	-9. 92%	4. 52%	2. 44%	3. 11%	8. 61%
2017. 4	-8. 65%	15. 45%	-2. 84%	1. 78%	-0. 24%	5. 50%
总计	115. 81%	156. 66%	74. 37%	55. 87%	56. 49%	459. 20%

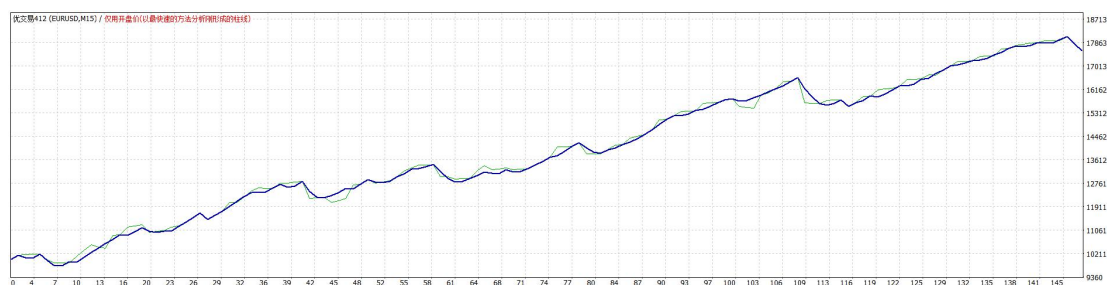
2、小优趋势策略-黄金收益曲线图（0.1 手/1 万美金）



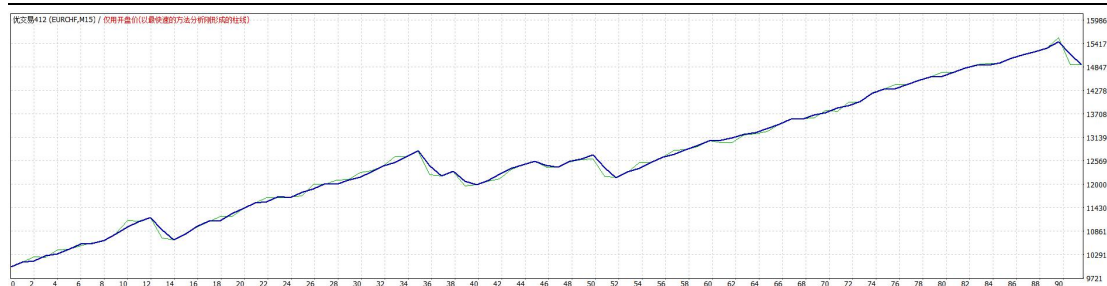
3、小优趋势策略-镑日收益曲线图（0.1 手/1 万美金）



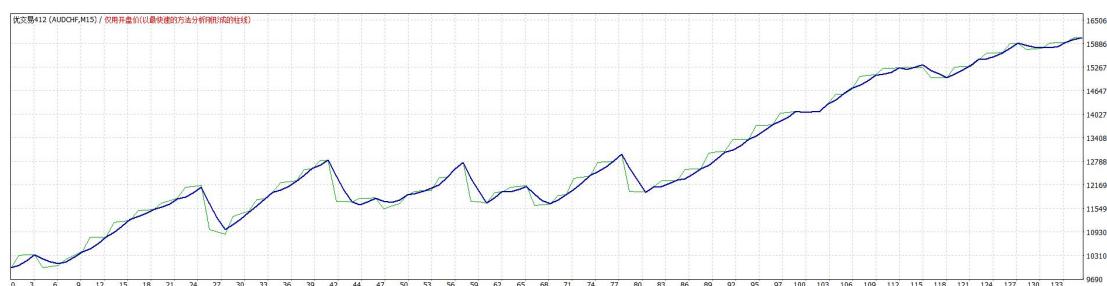
4、小优震荡策略-欧美收益曲线图（0.15 手/1 万美金）



5、小优震荡策略-欧瑞收益曲线图（0.2 手/1 万美金）



6、小优震荡策略-澳瑞收益曲线图（0.15 手/1 万美金）



趋势策略				震荡策略			
日期	黄金	镑日	合计	欧美	欧瑞	澳瑞	合计
2015.5	-7.78%	-2.29%	-10.07%	-2.15%	2.41%	3.11%	3.37%
2015.6	-7.56%	3.42%	-4.14%	9.73%	7.07%	4.79%	21.59%
2015.7	44.74%	12.35%	57.09%	2.86%	-3.12%	7.31%	7.05%
2015.8	-4.50%	-4.52%	-9.02%	2.62%	8.95%	-5.26%	6.31%
2015.9	-5.53%	0.65%	-4.88%	8.27%	4.77%	4.49%	17.53%
2015.10	-5.25%	-4.33%	-9.58%	5.56%	0.84%	13.86%	20.26%
2015.11	13.41%	-4.24%	9.17%	-5.92%	7.05%	-11.09%	-9.96%
2015.12	-7.61%	-1.95%	-9.56%	6.47%	-6.12%	1.00%	1.35%
2016.1	-5.45%	130.98%	125.53%	5.69%	-1.10%	0.87%	5.46%
2016.2	90.48%	15.36%	105.84%	-5.12%	-0.73%	8.62%	2.77%
2016.3	-12.87%	-1.99%	-14.86%	3.14%	1.72%	-10.72%	-5.86%
2016.4	-8.41%	0.85%	-7.56%	4.55%	0.00%	4.33%	8.88%
2016.5	3.40%	-8.34%	-4.94%	5.19%	-3.95%	2.90%	4.14%
2016.6	11.22%	-4.29%	6.93%	4.80%	3.73%	5.73%	14.26%
2016.7	-3.24%	-7.33%	-10.57%	6.87%	5.19%	-8.77%	3.29%

2016. 8	-8.05%	5.30%	-2.75%		4.80%	3.05%	9.15%	17.00%
2016. 9	-11.76%	11.66%	-0.10%		7.06%	6.21%	10.87%	24.14%
2016. 10	19.95%	-3.84%	16.11%		-9.35%	3.30%	0.00%	-6.05%
2016. 11	-7.53%	21.27%	13.74%		-1.00%	4.23%	4.69%	7.92%
2016. 12	15.81%	-4.67%	11.14%		6.07%	5.19%	4.82%	16.08%
2017. 1	16.05%	1.76%	17.81%		7.10%	0.85%	2.92%	10.87%
2017. 2	-3.52%	-4.68%	-8.20%		5.45%	2.11%	0.00%	7.56%
2017. 3	8.46%	-9.92%	-1.46%		4.52%	2.44%	3.11%	10.07%
2017. 4	-8.65%	15.45%	6.80%		-2.84%	1.78%	-0.24%	-1.30%

六、补充说明

1、 止损止盈问题

小优机器人 EA 所有订单都会设置止损，止盈趋势策略不设置，震荡策略设置。小优趋势策略止损位移动止损，随着趋势行情的不断发展，止损价格抄着有利的价位不断移动。

小优震荡策略止损固定，止盈移动止盈。

2、 加仓问题

小优趋势性策略固定加仓比例，顺势加仓，在盈利满足一定条件后才会加仓，加仓次数不限制，一般趋势越大，加仓越多，盈利也会越多。

单品种加仓 10 次以上，基本上能够实现 20% 的盈利。单品种加仓 20 次以上，能够实现 100% 的盈利。

小优震荡策略固定加仓比例，欧瑞在亏损后会加仓，最多加仓 1 次，持仓 2 单。欧美和澳瑞在亏损后加仓，最多加仓 2 次，持仓 3 单，并且每一单都会设置止损。

所以在欧美，欧瑞，澳瑞出现加仓后，请不要担心，这是策略的正常表现，风险可控的情况下适当的加仓，是资管管理和策略的一部分。

3、关于点差问题和手数问题

小优适应性较强，适宜目前 90% 以上的外汇平台，由于小优标准风控 30% 线，1 万美金只有 5 手的交易量，所以对于点差要求并不强，平台的标准点差即可。

4、关于回撤和收益率问题

虽然历史上，小优只有 1 个月出现过一次 20% 的亏损，不过为了谨慎起见，我们将 30% 的风控线作为标准。

30%回撤，最近两年的月收益数据。

超过 10%盈利的月份有 13 个；

超过 20%盈利的月份有 8 个；

超过 50%盈利的月份有 3 个；

超过 100%盈利的月份有 2 个；

以上数据列出的收益，将视为 30%回撤范围内的收益。

我们提供两种风控方案，一种为 30%标准风控，一种为 20%风控。20%风控的仓位和收益将是 30%风控标准的一半。

30%最大回撤，预期 15%/月收益；

20%最大回撤，预期 8%/月收益。

5、 关于人工干预

非重大事件（英国脱欧，美国大选），我们不会干预小优机器人 EA 的入场和出场，一年之中，我们会干预的次数仅 1-5 次，干预的范围包括避开重大事件以及品种的选择。

一款好的策略，应该能够从深度和广度上尽可能的适应行情，过多的人工干预并不可靠，所以，我们只有少量干预。

七、合作洽谈

联系方式：

微信：Lx23456Lx

QQ：185621661