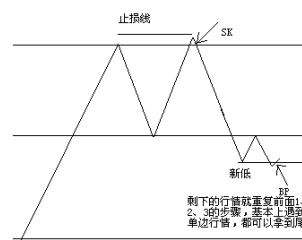
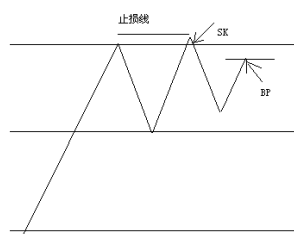
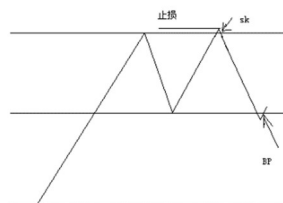
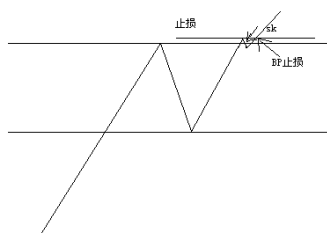


## 关于日内波段交易 china\_aJ

如果你不能独立思考，只是一味模仿，你永远不会成功，因为每个人交易的心理成熟度和素质是不同的；作为交易者，如果只是一味附和，不具备独立性，你还是选择离开市场，找份稳定点的工作；耳听为虚，眼见为实，何况是在网络上，所以请大家别相信任何人，也别相信我，各位期友只需在意帖子里的话，然后仔细品品，如果对自己交易有益就吸收，然后找出自己的东西。我开这个贴就是不希望期友走上错误的交易之路，记住下面的话：“如果做日内交易波段，如果你没有考虑不同品种的不同时间的不同波幅，也就是如果做日内波段交易没考虑到时间，说什么都白搭。”这句话是引子，如果这句话理解不了，说了方法也白搭，所以等大家理解了再弹日内波段交易。

关于日内波段，其实我想说的话还是满多的，今天有时间先写一点我的经验，大家消化一下，如果大家有什么不理解的或有不同意见的或有不同方法的，都可以留言交流，我就以做多说明，做空方法一样的。1、我的日内波段就是找水平支撑压力（插一句：我从不相信非水平压力，个人觉得例如趋势线等都是分析师盘后分析用的），之所以选择水平支撑压力，我的理由就是，最近的高低点是代表当时多头拉升或空头杀跌最大的力量，在那个位置或许有托盘，或许主力意愿停止，下面我就以做空说明，做多方法一样的。2、关于开仓，我的经验就是在最近高低点附近观察是否有压单或者有大量的多头平仓出现，这些都意味多头暂时停止，我会在这个时候开空。这里有另外一个问题，就是如果当天开盘在昨日收盘区间内，那么就以昨日最近高低点为依据，如果是大幅跳空，我就等待今日最近高低点形成，等待是必须得学习的。3、关于平仓，要说的比较多，花费时间，我画图，大家可以去理解，理解了才是你自己的。4、当然，还有很多盘中细节，一时我语言也很难表达。优化处理你所持有的头寸.这话我听过好几次，能不能具体一点的解说一下[/quote] 优化处理所持有的头寸，那几幅图表达的很清楚，用文字解释，就是 1：入场后方向返了，触发止损；2，入场后方向对了，可赚的幅度不够，这时要允许市场有波动，市场不可能按你想的走的那么准确，所以在赚的幅度不够的情况下，继续选择守止损；3、入场方向对了，赚的幅度还可以（超过了回撤或反弹的 50%，即出现了相对前一上涨或下跌的深度反弹 或回撤），这时就不能让持有头寸变为亏损了额，4、要止盈位（前个支撑或压力，水平的），在此位置如果出现停顿，则平仓，如果能量够强，一般都会直接击穿水平 S/R，而不会停顿的。



优化处理你所持有的头寸.这话我听过好几次，能不能具体一点的解说一下[/quote] 优化处理所持有的头寸，那几幅图表达的很清楚，用文字解释，就是 1：入场后方向返了，触发止损；2，入场后方向对了，可赚的幅度不够，这时要允许市场有波动，市场不可能按你想的走的那么准确，所以在赚的幅度不够的情况下，继续选择守止损；3、入场方向对了，赚的幅度还可以（超过了回撤或反弹的 50%，即出现了相对前一上涨或下跌的深度反弹 或回撤），这时就不能让持有头寸变为亏损了额，4、要止盈位（前个支撑或压力，水平的），在此位置如果出现停顿，则平仓，如果能量够强，一般都会直接击穿水平 S/R，而不会停顿的。

再说一个细节，你要观察最近高低点的幅度，幅度如何判断，譬如如果是 40 点的幅度，那么  $40/4=10$ ，如果高点时 50，低点是 10，那么 40-50 区间将是我所谓的空单开仓区间，当满足条件我会开空，如果在这个区间没有迅速入场，我就放弃掉，譬如你反应迟钝或犹豫不决，结果价格到了 30，而最近的支撑是 10，而我止损要放在 50 上方，那么这笔交易我就会放弃。不知道大家可理解了。

{昨天有幸参加了交易员大会的高频论坛，听了何老大，烟神，王凯大哥，以及孟老师，程智斌和张晓良两位大哥的分享，受益匪浅。他们的手法各异，基本上涵盖了短线交易的各种形态。我也努力的记笔记，本想着直接发我的笔记

照片，发现自己的字确实太丑，还是用文字的方式总结一下吧。

首先从何老大说起，何老大开场便说，自己许久不做短线，目前套利为主，但短线天王毕竟不是浪得虚名，他用了很简单的一句话就解释了很多人都说不好听的盘感。他说，盘感这东西就像是我第一次见一个陌生人对我笑，而我不明白他的意思。但是当我熟悉他了之后，他对我笑，我就知道他在表达什么。这就是盘感。还有关于一些时间节点的问题，比如在做短线的时候，开盘盘口比较乱，方向不明确，要仓位轻一些，进出频率快一些，收盘之前的几分钟，出方向的可能性会大一些，这时候可以稍微仓位重一些，做顺势的单子。关于短线怎么出场这个问题，要根据一些品种的特性来定出场，要了解品种的性格。还有关于目前手续费的提高，其实是挑战也是机会，手续费的提高意味着你的竞争对手少了，很多行情跑的会比以前流畅（这个看法烟神在之后的实盘分享里也同样提出了相同的观点，可见英雄所见略同）

然后是王凯大哥的分享。1，短线的精髓在于进场点和止损。2，做高频，短线，要有自己与众不同的东西。3，止损是为了不亏钱，但更重要的是进场点，好的进场点是为了赚钱。4，要明确注意开盘价，有时候找不到方向的时候，大不了就在均线之上做多，均线之下做空。

孟德稳老师的分享。孟老师的很多话都如教科书般的准确，而且很通俗易懂，我边听边记边想，有些零碎，囫圇吞枣的分享给大家

1，做短线要有大格局，这里的大格局是说一天的格局，在大的格局里，找确定性，短线入手。

2，做交易，心态要平稳

3，交易系统，适合自己的才是最好

4，做成功的都是最简单的东西

5，做短线，执行力和细节要做好

6 关于心态的控制问题，人毕竟是肉长的，有时候心态不稳的时候，要靠外力限制自己不稳定的状态，要有打断不稳定心态的办法，比如连错几笔之后强迫自己去厕所...

7，不稳定的心态有三点，第一，过量交易。第二，希望一笔单子把亏损扳回来，结果越做越差劲。第三，错误的单子不止损。

8，如何应对不稳定的心态，第一，缩预期，第二，缩单量，第三，缩频率。

9，关于短线中开平仓的节奏。行情越快，涨的或跌的越高，就要平仓越快。

10, 亏损的单子不加仓, 盈利才加仓。

11, 在震荡的小区间里, 量能减少, 要少交易。

关于烟神的分享, 说实话, 我真的很佩服吴哥。他做的 PPT, 简直可以算得上是炒单的教科书了, 里面的四个大项, 对于炒单的优势劣势的解读, 对入场点出场点的判断, 还有实盘的展示, 以及对未来的发展方向, 都说的非常好。里面的内容非常多, 我没记住所有的东西, 等吴哥有时间亲自和大家分享一下吧!

程智斌, 程老师的分享, 1, 分时图交易 2, 短平快的手法 3, 以均线定方向 (1 天) 顺势交易

张晓良, 张老师的分享。1, 以单量大取胜, 每天只交易十几个回合。2, 反预期操作, 比如美豆预期要减产, 势必会在减产这个消息出之前上涨, 但是消息出来之后, 算是预期出尽, 可以反向操作, 去做空。

以上就是高频论坛几位高手的分享。我一直在做笔记, 有朋友也对我提了几个问题, 我没经历过这么大的场面, 有些懵, 估计说话也显得很紧张, 自惭形秽。顺带着我也总结一下自己对高频的一些理解吧。

目前以我和 mile, 珍惜, 星期八, 我们四个人一起的操作思路, 1 在上涨或者下跌时候的抄底摸顶, 必须要有放量配合。1 分钟 K 入手。2 对前高前低的顺势突破, 一般以一天或最近几天的高点低点为参考, 有点像动量突破的手法。3, 强势行情中的顺势, 比如在快速行情中的追单, 比如一波强势上涨之后的下跌, 跌到某一个价位下不去了, 然后在这个价位做多。4, 以上所有的手法都是基于 0-3 以内的止损。其实我们也就这三板斧, 也没有大家想象中这么神秘。仅此而已。}交易从根本上说, 需要解决三个最主要的问题, 然后钱就会像潮水般涌来

## 1.周期问题

趋势交易者必解决的首要问题, 周期问题说白了就是从大处着眼, 从小处入手的问题。如何顺应大势? 顺多大的势? 又如何顺大势逆小势? .....解决了这个问题就对趋势的方向和节奏有了底, 这是第一步。

## 2.工具问题

也就是规则的载体, 是交易系统的组成部分。可以是某个指标或者一些形态或者关键点位等等。主要用来过滤行情, 找出入场时机。工具的要求一定要固定、一致性。还要求简洁明了, 越简单越好, 简单到轻易不会违背更好。

3.修心问题

也可以说是心态。很多人否定这个问题，但这个问题是客观存在的。因为你是所做所为都是由心而起的，心不静的时候，所有的规则都会抛之脑后。修心的目的就是发现自己心态不对的时候，能及时纠正自己。心态平和了才能把本来明白的事情做好。人都是情绪动物，超越不了自我就难过此关，就会时不时的犯错，就谈不上稳定。。

交易说白了只需要解决这三个问题。解决的意思并非知道或者明白。这三个问题每一个都可以说有九重境界，很多人都明白但做不好，要么是有细节明白的不彻底，要么就是体会到的境界不够高。能明白到九重境界就能做到九重，这中间不知道要经过多少次的反复磨练，经历多少次的痛苦才能慢慢升级。但除此之外没有选择，这是成长的代价，是必然的过程。

<div>K 均方向</div> <div>K 均位置</div> <div>均线族</div>	<div>力度</div> <div>速度</div> <div>流畅度</div>	<div>密集区</div> <div>高低点</div> <div>重要均线</div>
势	力	阻
<div>顺势：顺大、本势<sup>1</sup></div> <div>蓄势：箱、楔、直<sup>2</sup></div> <div>泻势：突、跳、反<sup>3</sup></div>	<div>力量对比质变而崩溃</div> <div>简单为强, 复杂为弱</div> <div>简单结构, 规律节奏</div>	<div>有无阻力</div> <div>阻力距离</div> <div>阻力大小</div>

注 1：顺势包括顺大势(大盘走势)、顺本势(本品种大势)，主要看大中小周期 K 线与均线的方向、K 线与均线的位置关系(排列)等。  
注 2：蓄势包括均线族高度粘合(形成箱体或楔形)、均线族高度发散(形成垂直式涨跌)，其本质为成本高度接近或成本高度发散。  
注 3：泻势包括顺势突破箱体与楔形、顺势或逆势直接跳空远离箱体与楔形、顺势垂直式涨跌尖端反向快速移动。

# 《China\_aj 精华帖合辑 I》

制作：百忍成金

第一章.....	贴张 2010 年资金权益图
第二章.....	交易理念随笔
第三章.....	说点 K 线的问题
第四章.....	关于日内波段交易

## 第一章 贴张 2010 年资金权益图

1、日内交易

2、一天只做一笔，到止损位止损，没到止损位就持有到收盘

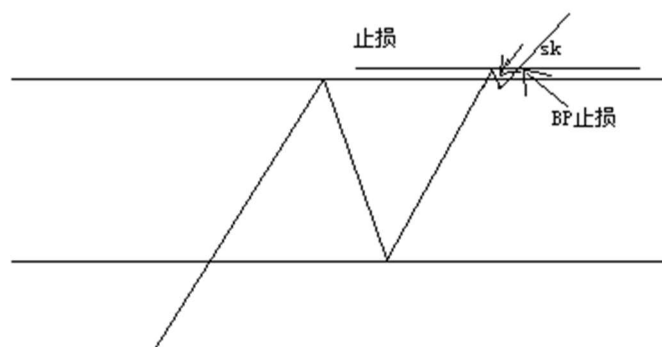
我开这个贴就是不希望期友走上错误的交易之路，记住下面的话：  
“如果做日内交易波段，如果你没有考虑不同品种的不同时间的不同波幅，也就是如果做日内波段交易没考虑到时间，说什么都白搭。”  
这句话是引子，如果这句话理解不了，说了方法也白搭，所以等大家理解了再弹日内波段交易。

关于日内波段，其实我想说的话还是满多的，今天有时间先写一点我的经验，大家消化一下，如果大家有什么不理解的或有不同意见的或有不同方法的，都可以留言交流，我就以做多说明，做空方法一样的。

1、我的日内波段就是找水平支撑压力（插一句：我从不相信非水平压力，个人觉得例如趋势线等都是分析师盘后分析用的），之所以选择水平支撑压力，我的理由就是，最近的高低点是代表当时多头拉升或空头杀跌最大的力量，在那个位置或许有托盘，或许主力意愿停止，下面我就以做空说明，做多方法一样的。

2、关于开仓，我的经验就是在最近高低点附近观察是否有压单或者有大量的多头平仓出现，这些都意味多头暂时停止，我会在这个时候开空。这里有另外一个问题，就是如果当天开盘在昨日收盘区间内，那么就以昨日最近高低点为依据，如果是大幅跳空，我就等待今日最近高低点形成，等待是必须得学习的。

3、关于平仓，要说的比较多，花费时间，我画图，大家可以去理解，理解了才是你自己的。



## 谈下交易策略保密的重要性

最近很多期友给我信息，大部分都是想了解我的天胶交易策略的细节，我很无奈，不是我不愿意告诉你们，而是如果把整个策略的细节全盘告诉你，最终受伤害的是我们彼此，期货市场和赌场一样，是个有抽水存在的零和博弈，我们每个人的交易策略的制定是针对市场其他参与者的，也就意味着其他参与者都是自己的博弈对手，你的交易策略是建立在对其他人交易行为了解的基础之上，如果其他交易者的交易行为有变化，哪怕只有一个人，也会影响到你交易策略，因为你建立交易策略的基础和对象的行为发生了变化，这是因果关系，也是蝴蝶效应的一种，这也就是如果交易策略全部完整公开后，策略会失灵的原因，所以我很诚恳地提醒大家，要找到自己的交易策略，然后默默地执行。

我那个裸单的帖子，目的说的很清楚，就是为了让很多普通的期友明白，追求稳健盈利的关键在于执行力和资金管理，不是说交易策略不重要，只是交易策略相对容易制定而已，我只是想传递一种正确的交易理念。

测试了白糖 2011.1 月到现在的数据（纯手工测试）



交易思路：10：00-10：05 按照价格在分时线上下方定多空，寻找合适切入点，止损 10 个点，赢利单则拿到收盘前平仓，或者赢利单回成本区平推，全天一笔交易。

测试结果：白糖月盈利率 19%，胜率在 25-30%，盈亏比 6：1，最大连续亏损日 6 天，最大亏损加滑点等计每笔 13 点，约一手连续 6 天亏损 1000 元。

资金量：1 手白糖保证金 9000 元，加最大亏损 1000 元，加上 2000 作为亏损先期钱，这样亏损 2400 元，资金权益只下降 20%，计一手白糖需要资金 12400 元

按照月赢利 19%的，日均一次交易次数，这套模型是否可执行，请 china\_Aj 及各位指导一二，谢谢！

答：看了下，以下几个问题如果解决，策略可以用：

1、什么叫适合的开仓点位；

2、盈利多少平推？

3，胜率 30%以上最好。

上面三点如果你都是量化的，那么才有统计的可能，这样你统计的结果是可以依据的。

还有一点，最大连续亏损不是连续亏损日，最大连续亏损是在权益创新高前的最大回撤。

支持！aj 对我的最大启发就是可以手动测试系统，以前一想到系统交易，软件测试就感觉是很遥远的事。而且，我个人觉得，严格的手动测试更能给系统交易者信心。经常看看有人亮出软件测出的系统收益率高的吓人。但是感觉测试者自己对这个结果也是毫无信心，只是一测而已。再请教下 aj:以前的 k 线数据要哪些渠道得到？专业数据公司么？尤其是 1 年内的 1 分钟 k 线数据。

答：可以单独下载个金字塔软件，把里面的数据下载周期设置下，便可以找到更多的数据。我也是最近才发现金字塔这点的确很好。

“期货市场和赌场一样，是个有抽水存在的零和博弈，我们每个人的交易策略的制定是针对市场其他参与者的，也就意味着其他参与者都是自己的博弈对手，你的交易策略是建立在对其他人的交易行为了解的基础之上，如果其他交易者的交易行为有变化，哪怕只有一个人，也会影响到你交易策略，因为你建立交易策略的基础和对象的行为发生了变化，这是因果关系，也是蝴蝶效应的一种，这也就是如果交易策略全部完整公开后，策略会失灵的原因，所以我很诚恳地提醒大家，要找到自己的交易策略，然后默默地执行。”