

# 程序化交易系统 在投资中的运用



新湖期货

1

系统平台简介

2

特色功能简介

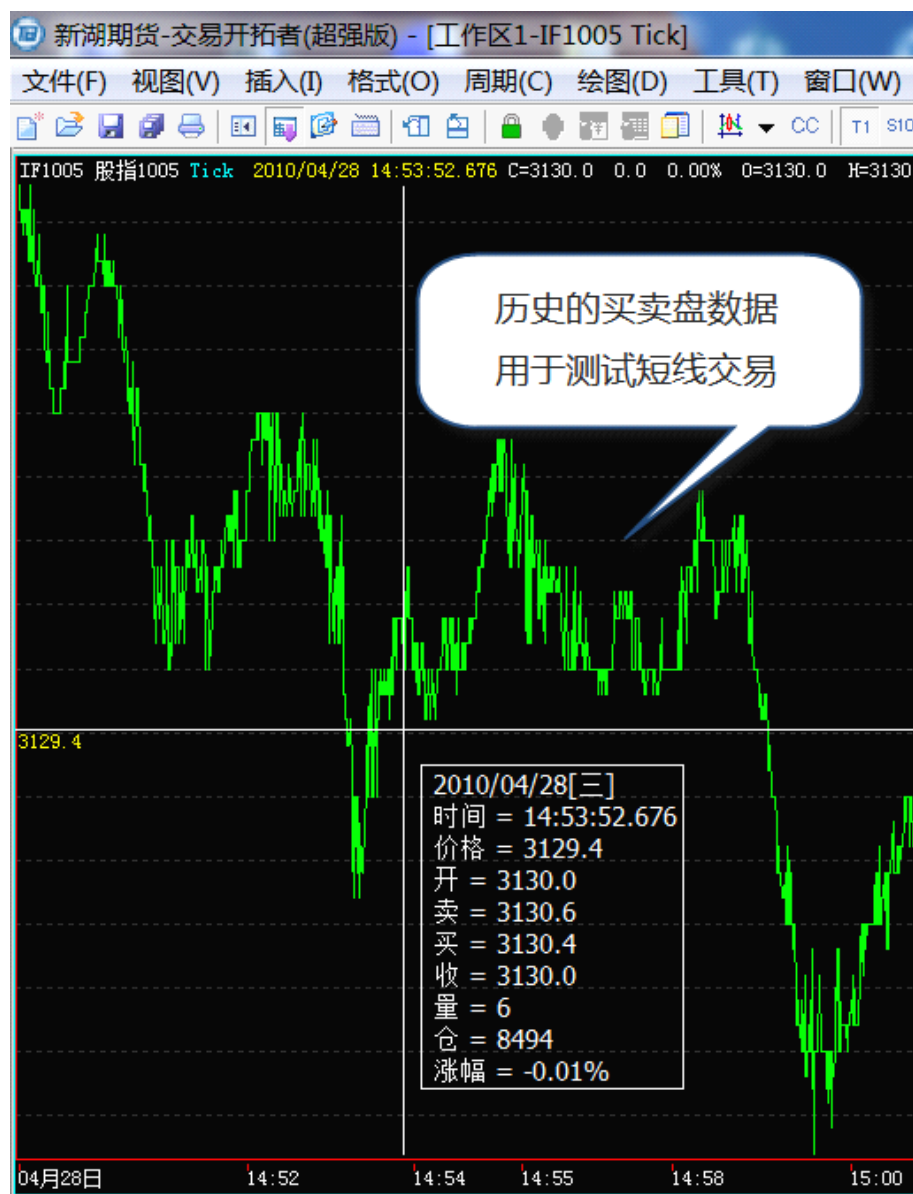
3

公式系统简介

- ❖ 针对期货市场设计的行情分析及交易软件，是行情分析、多功能下单、系统交易的完美结合
- ❖ 吸取国外多个优秀金融交易软件(比如TradeStation、MetaTrader等)的优点
- ❖ 以交易为核心，所有的功能都围绕交易而开发
- ❖ 股指与股票的套利功能正在开发中

- ❖ 行情、交易速度快
- ❖ 特有的TICK数据
- ❖ 便捷的行情报价组合
- ❖ 易于分析的指数数据
- ❖ 丰富的下单、平仓、撤单方式
- ❖ 强大的程序化交易功能

# 具有历史买卖盘的TICK数据



# 便捷的行情报价组合



# 易于分析的指数数据

新潮期货-交易开拓者(超强版) - [工作区1-行情报价]

文件(F) 视图(V) 窗口(W) 帮助(H)

行情报价

视窗模块	简称	代码	现价	涨跌	涨幅%	现手	总手	持仓量
行情报价	1 股指指数	IF000	3153.5	-2.3	-0.07	14	120929	11469
分时图	2 沪铜指数	cu000	58670	-1887	-3.12	0	438254	358812
超级图表	3 橡胶指数	ru000	23514	-385	-1.61	2	997814	238362
	4 豆粕指数	m9000	2906	-19	-0.65	2	919126	1446132

简称	代码	现价	涨跌	涨幅%	现手	总手	持仓量
1 股指连续	IF888	-	-	-	0	0	0
2 沪铜连续	cu888	-	-	-	0	0	233006
3 橡胶连续	ru888	-	-	-	0	0	241664
4 豆粕连续	m9888	-	-	-	0	0	1028116

- ❖ 灵活的多种下单方式
- ❖ 便捷的多种平仓方式
- ❖ 方便的多种撤单方式
- ❖ 交易助手解决后顾之忧
- ❖ 半程序化的策略易
- ❖ 程序化交易让收益放大



# 开平仓工具-交易师1

交易师

帐户: xhqh0001 (xhqh0001)@模拟柜台

商品: 中国金融期货交易所 IF1005

开平: 开仓  止损 3146.8  20

投保: 投机  获利 3146.8  20

数量: 1 当前持仓:-4 (1/5)

操作: 即时执行

即时执行

价格: 3146.8  使用叫买/卖价  偏移点数: 2

**Ask** 3147.0/1 **↑** 3446.0

**Bid** 3146.8/56 **↓** 2819.6

暂不提交, 保存为预埋单  下单后不关闭窗体

**买入** **卖出**

IF1005 股指1005 Tick 2010/04/29 09:23:51.754 ...

3148.4
3148.2
3148.0
3147.8
3147.6
3147.4
3147.2
3147.0
3146.8
3146.6
3146.4
3146.2
3146.0
3145.8
3145.6
3145.4
3145.2
3145.0

04月29日 09:20 09:22 09:23

# 开平仓工具-交易师2

交易师

帐户: xhqh0001 (xhqh0001)@模拟柜台

商品: 中国金融期货交易所 IF1005

开平: 开仓  止损 3151.0  20

投保: 投机  获利 3151.0  20

数量: 1 当前持仓: -5(0/5)

操作: 触发单交易

触发单交易

类型: 买入

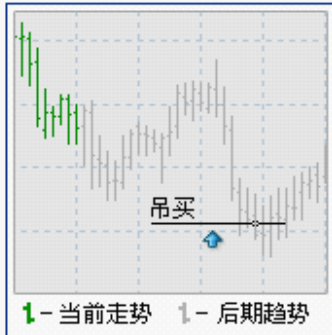
过期:  2010-04-29 23:59

触发价格: 3151.0

执行价格: 0

注: 执行价格设置为0时, 自动取触发时叫买/卖价为委托价格。

**挂单**



1- 当前走势 1- 后期趋势

IF1005 股指1005 Tick 2010/04/29 09:37:46.754...



04月29日 09:35 09:37

# 开平仓工具-快车道



新湖期货-交易开拓者(专业版)

文件(F) 查看(V) 交易(T) 帮助(H)

帐户登录 
  快车道 
  帐户管理 
  我的键盘 
  窗体切换 
  固定坐标 
  倒置坐标 
  商品选择 
  字段选择 
  交易师 
  批量下单 
  预埋单 
  套金宝 
  价差下单

请选择要进行交易的帐户:

- 所有帐户
- xhqh0001 [1]
- xhqh0002 [2]
- xhqh0003 [3]
- xhqh0004 [4]

当前商品: IF1005 - 股指1005

数量:   倍数

价格:   使用叫买/卖价

偏移点数:

成交后自动生成止赢单  跳

自动开平   保值

一键下单  下单需要进行确认

简称	代码	现价	涨跌	涨幅%	现手	总手	持仓量	买价
1 股指1005	IF1005	3129.0	7.2	0.23	0	128530	7386	3128.0
2 股指1006	IF1006	3172.0	7.6	0.24	0	4316	1191	3172.0
3 股指1009	IF1009	3255.0	12.4	0.38	0	383	302	3252.0
4 股指1012	IF1012	3339.0	10.6	0.32	0	562	428	3337.0

多帐户交易倍数设置(点击倍数列可直接修改值)

帐户	交...	交易商名	倍数
xhqh0001	10100	模拟柜台	1
xhqh0002	10100	模拟柜台	2
xhqh0003	10100	模拟柜台	3
xhqh0004	10100	模拟柜台	4

# 开平仓工具-批量下单

批量下单

请选择要进行交易的帐户:

- 所有帐户
  - xhqh0001 [1]
  - xhqh0002 [2]
  - xhqh0003 [3]
  - xhqh0004 [4]

请选择要进行交易的商品:

中国金融期货交易所 IF1005

设置

开平:   平仓反手

投保:

止损

获利

数量:   手

操作:

即时执行

价格:   使用叫买/卖价  偏移点数:

<b>Ask</b>	<b>3140.0/12</b>	<b>↑</b>	<b>3433.8</b>
<b>Bid</b>	<b>3139.0/3</b>	<b>↓</b>	<b>2809.8</b>

下单需要进行确认  下单后不关闭窗体

# 开平仓工具-批量程序化下单

交易指令设置

简称	名称	类型	参数	显示
ICHIMUKO	一目均衡表	交易指令	7, 22	开

设置(P)...  
删除(D)  
显示讯号  
上移(U)  
下移(D)

启动自动策略交易系统

单帐户:   下单不需要用户确认

多帐户:

# 开平仓工具-预埋单

预埋单

当前预托单信息

帐户: xhqh0001 (xhqh0001)@模拟柜 买入

商品: 中国金融期货交易所 IF1005

开平: 开仓  止损 3107.0

投保: 投机  获利 3107.0

数量: 1  叫买/卖价 3200.0

热键: Ctrl + 1  下单后从列表中删除

添加(A) 修改(M) 删除(D) 保存(O) 取消(C) 发送(S)

预埋单列表:  全部选中 >>

帐户	商品信息	类型	价格	数量	热键
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0001	IF1005(股指1005)	买入	市价	1	Ctrl+0
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0001	IF1005(股指1005)	买入	3200.0	1	Ctrl+1

- ❖ 套灵宝
- ❖ 价差下单
- ❖ 多品种的价差技术分析
- ❖ 价差的程序化交易

# 价差下单-套金宝-跨期套利

套金宝

帐户A: xhqh0001 (xhqh0001)@模拟柜台  
帐户B: xhqh0002 (xhqh0002)@模拟柜台  
帐户C: xhqh0001 (xhqh0001)@模拟柜台

参数设置

商品A:	中国金融期货交易	1	IF1005	1
商品B:	中国金融期货交易	1	IF1006	1
商品C:	大连商品交易所	1	a1005	1

单笔数量: 1      最大仓位: 5  
多头仓位: 0      空头仓位: 0  
下单价格偏移: 2 跳  
 启动分步建仓, 间距为: 0 元, 每步 1 单位

价差设置

<input checked="" type="checkbox"/> 多头开仓	-100000	-41.0
<input checked="" type="checkbox"/> 多头平仓	100000	-43.0
<input checked="" type="checkbox"/> 空头开仓	100000	-43.0
<input checked="" type="checkbox"/> 空头平仓	-100000	-41.0

下单需要进行确认      **启动**



# 价差下单-套金宝-蝶式套利

套金宝

帐户A: xhqh0001(xhqh0001)@模拟柜台

帐户B: xhqh0002(xhqh0002)@模拟柜台

帐户C: xhqh0003(xhqh0003)@模拟柜台

参数设置

商品A:	中国金融期货交易	2	IF1005	2	\$
商品B:	中国金融期货交易	1	IF1006	1	\$
商品C:	中国金融期货交易	1	IF1009	1	\$

单笔数量: 1      最大仓位: 100

多头仓位: 0      空头仓位: 0

下单价格偏移: 2 跳

启动分步建仓, 间距为: 0 元, 每步 1 单位

价差设置

<input checked="" type="checkbox"/> 多头开仓	-100000	-177.0
<input checked="" type="checkbox"/> 多头平仓	100000	-180.0
<input checked="" type="checkbox"/> 空头开仓	100000	-180.0
<input checked="" type="checkbox"/> 空头平仓	-100000	-177.0

下单需要进行确认

**启动**

# 价差下单-套灵宝-迁仓

套灵宝

帐户A: xhqh0001(xhqh0001)@模拟柜台

帐户B: xhqh0002(xhqh0002)@模拟柜台

帐户C: xhqh0001(xhqh0001)@模拟柜台

参数设置

商品A: 中国金融期货交易 1 IF1005 2

商品B: 中国金融期货交易 1 IF1006 2

商品C: 大连商品交易所 1 a1005 1

单笔数量: 1 最大仓位: 100

多头仓位: 0 空头仓位: 0

下单价格偏移: 3 跳

启动分步建仓, 间距为: 0 元, 每步 1 单位

价差设置

<input checked="" type="checkbox"/> 多头开仓	-100000	-40.2
<input checked="" type="checkbox"/> 多头平仓	100000	-42.8
<input checked="" type="checkbox"/> 空头开仓	100000	-42.8
<input checked="" type="checkbox"/> 空头平仓	-100000	-40.2

下单需要进行确认

**启动**

# 价差下单-手动下单

价差下单

请选择要进行交易的帐户:

- 所有帐户
  - xhqh0001
  - xhqh0002
  - xhqh0003
  - xhqh0004

设置

平仓

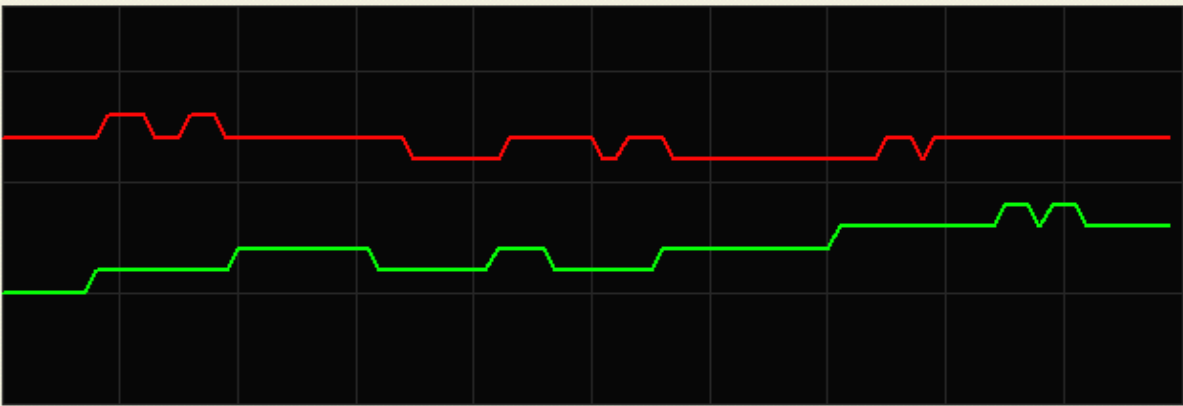
商品A: 中国金融期货交易 1 IF1005 1

商品B: 中国金融期货交易 1 IF1009 1

商品C: 上海期货交易所 1 al1004 1

交易数量: 1 下单价格偏移: 1 跳

Ask -123.0/1    Bid -127.0/1    -127.0/0.96



第一次需数量确认  
 下单需要进行确认

买入    卖出

# 价差的技术分析



# 平仓-平仓触发单

帐户管理 - 多头平仓触发单[IF1005@xhqh0001]

过期:  2010-05-04 23:59

多头持仓: 2

平仓数量: 1

触发价格: 3300.0

执行价格: 3290.0

**Ask** 3090.0/12

**Bid** 3089.0/2

挂单



1- 当前走势 1- 后期趋势

帐户管理 - 空头平仓触发单[IF1005@xhqh0001]

过期:  2010-05-04 23:59

空头持仓: 2

平仓数量: 1

触发价格: 2800.0

执行价格: 0.0

**Ask** 3086.0/18

**Bid** 3086.0/3

挂单



1- 当前走势 1- 后期趋势

# 平仓-快速平仓

帐户管理 - 快速平仓[IF1005@xhqh0001]

价格: 3155.0  使用叫买/卖价  偏移点数: 1

Ask	3155.0/20	↑	3446.0
Bid	3154.8/2	↓	2819.6

多头持仓: 1 空头持仓: 5  
平多数量: 1 平空数量: 5

# 平仓-多账户平仓

交易师

帐户: xhqh0001 (xhqh0001)@模拟柜台

商品: 中国金融期货交易所 IF1005

开平: 开仓  止损 3153.4  20

投保: 投机  获利 3153.4  20

数量: 1 当前持仓:-4(1/5)

操作: 平仓(市价)

平仓(市价)

帐户	持...	多均价	持...	空均价
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0001	1	3154.4	5	3146.1
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0002	0	0.0	10	3146.1
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0003	0	0.0	15	3146.1
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0004	0	3147.0	20	3146.1

全  多  空

IF1005 股指1005 Tick 2010/04/29 09:41:40.223...

04月29日 09:40 09:41

# 平仓—键全平

一键全平

帐户选择:

- 所有帐户
  - xhqh0001 (xhqh0001)
  - xhqh0002 (xhqh0002)
  - xhqh0003 (xhqh0003)
  - xhqh0004 (xhqh0004)

商品选择:

- 所有商品
  - IF1005
  - IF1006

持仓列表:

帐户	商品	持多仓	多均价	持空仓	空均价
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0001	IF1005	1	3077.6	0	3086.4
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0002	IF1005	1	3077.6	0	2781.0
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0003	IF1006	0	0.0	1	3117.4
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0004	IF1006	0	0.0	1	3117.4

委托价偏移: 1  平多仓  平空仓

**平仓**

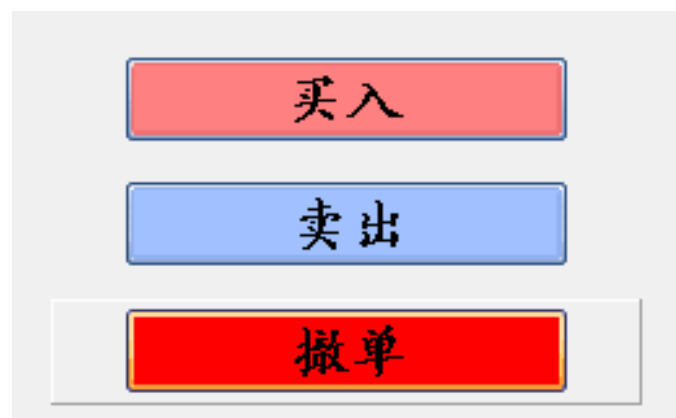


# 撤单-快速撤单

The screenshot shows a trading software interface. At the top, there is a red button labeled "撤单" (Cancel Order). Below it, a confirmation dialog box is open with the text: "您要对帐户[xhqh0001]下的[28322]委托单进行快速撤单?" (Do you want to quickly cancel the order [28322] under account [xhqh0001]?). The dialog has two buttons: "是(Y)" (Yes) and "否(N)" (No). In the background, a price chart is visible with a price of 3115.0 and a time range from 10:30 to 11:00. Below the chart is a table with the following data:

帐户	合同号	商品	类型	状态	数量	价格	时间	成交数量
xhqh0001	28322	IF1006	买入	已报	1	2818.0	2010-05-04 11:02:47	0

# 撤单-一键全撤



# 撤单-一键全撤

一键全撤

帐户选择:

- 所有帐户
  - xhqh0001 (xhqh0001)
  - xhqh0002 (xhqh0002)
  - xhqh0003 (xhqh0003)
  - xhqh0004 (xhqh0004)

商品选择:

- 所有商品
  - IF1005
  - IF1006

持仓列表:

帐户	商品	合同号	数量	价格	买卖	开平
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0001	IF1005	28290	1	2781.0	买入	开仓
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0001	IF1006	28284	1	2818.0	买入	开仓
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0002	IF1005	28289	1	2781.0	买入	开仓
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0002	IF1006	28285	1	2818.0	买入	开仓
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0003	IF1006	28280	1	3444.0	卖出	开仓
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0003	IF1005	28259	1	2781.0	买入	开仓
<input checked="" type="checkbox"/> xhqh0004	IF1005	28261	1	3398.6	卖出	开仓

撤买单  撤卖单  撤开仓  撤平仓

**撤单**

交易助手[未成交单处理]

**撤单设置**

不成交即撤单:委托成功后1秒不成交即发送撤单指令

延时撤单:委托成功后  秒不成交即发送撤单指令

价位撤单:成交价偏离  点即发送撤单指令

**撤单成功后续处理设置**

无操作

重发委托,重发价格按以下选项设置:

按最新的买卖盘价格  并偏移  跳

按原委托价格偏移  跳

按当日涨跌停价格,以保证成交(慎用)

**监控帐户**

所有帐户

- xhqh0001 (xhqh0001)
- xhqh0002 (xhqh0002)
- xhqh0003 (xhqh0003)
- xhqh0004 (xhqh0004)

**监控范围**

监控开仓的委托单  监控平仓的委托单  监控非TB委托单

仅对以下范围内商品有效  排除以下范围内的商品

注: 1. 一跳指一个最小变动单位;  
2. 交易助手在客户端运行,并只能对交易开拓者发送的委托单进行监控。

策略易
— □ ×

**通用设置**

交易帐户: xhqh0001 (xhqh0001)@模拟柜

交易商品: 中国金融期货交易 IF1005

启动时间: 2010-05-04 09:30:47

单笔数量: 2 委托间隔: 5 秒

最大仓位: 100 下单偏移: 3 跳

**风险控制**

平仓基准价格: 第一笔开仓价格

启动止损 20 跳

启动止赢 0 跳

当盈利>= 20 跳时启动跟踪止损

按回落百分比 50 %

**开仓设置**

当最新价 >= 3150 时追买建仓

启动开仓区间限定 3200

启动盘口单量限定 3

公式开仓条件:  条件相与  条件相或

条件1 M1\_MA1 > M1\_MA2

条件2 > -1

条件3 > -1

**平仓设置**

当最新价 >= 0.0 时吊卖平仓

启动定时平仓 2010-05-04 15:05:47

启动盘口单量限定 0

公式平仓条件:  条件相与  条件相或

条件1 > -1

条件2 > -1

条件3 > -1

**状态监控**

当前头寸: 0 盈利峰值价: 0.0

开仓均价: 0.0 第一笔开仓价: 0.0

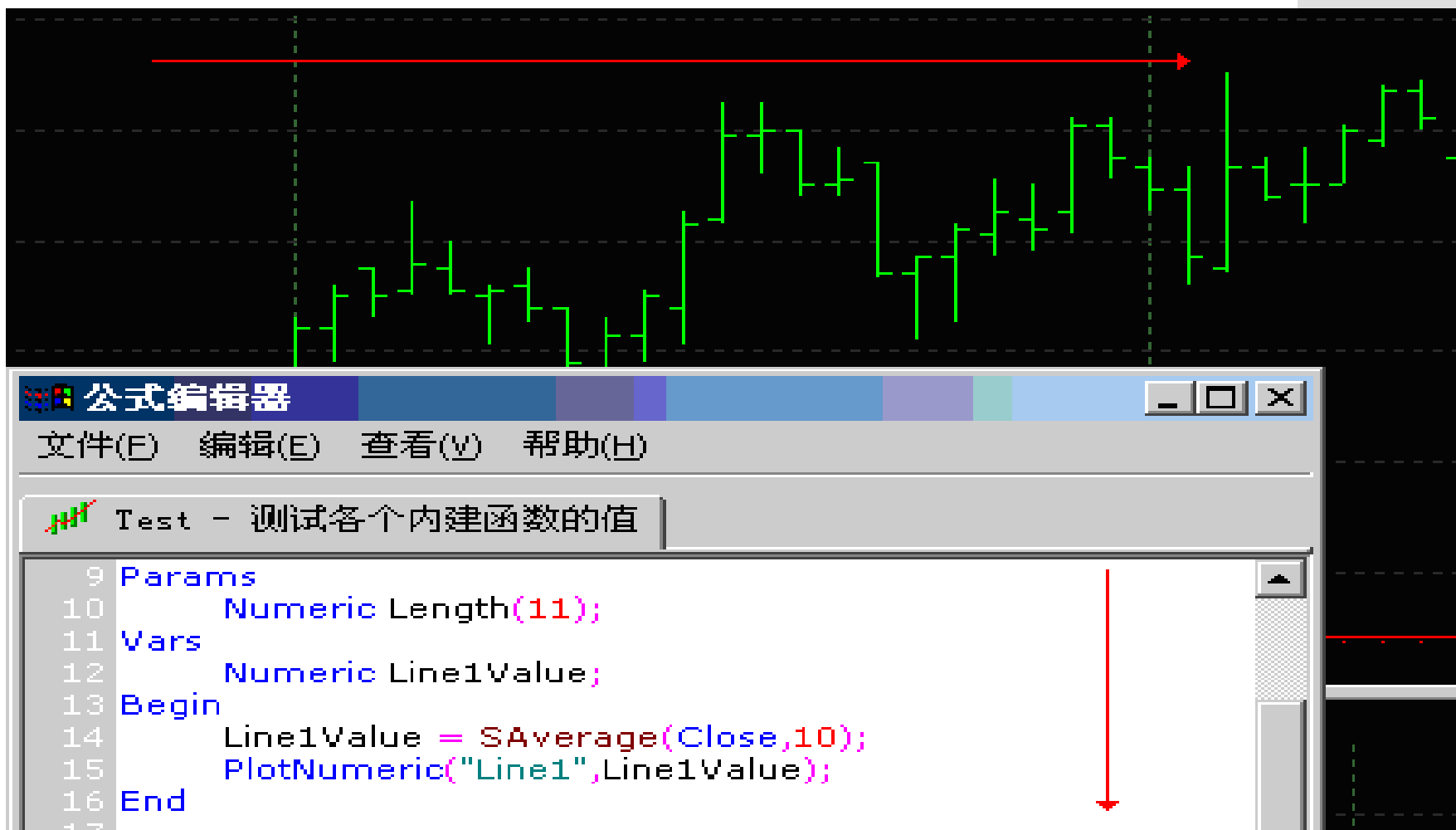
统计信息: 累计:0 更新 重置开仓标志

Ask 3109.2/5
Bid 3107.0/2

启动

- ❖ TBL(TradeBlazer Language) 简明易懂
- ❖ 支持复合语句-IF语句和FOR,WHILE语句
- ❖ 提供300多个内置函数
- ❖ 提供A\_XXXX函数，可实时获取当前交易帐户的帐户信息，并能对叠加商品进行发单和撤单
- ❖ 提供50个全局变量，用于控制超短线交易
- ❖ 内置数据库，实现方便的数据交换
- ❖ 技术指标源代码公开，便于技术指标算法的修改和创新
- ❖ 独有的图表化、多维度的交易模型测试分析报告，及参数优化功能

# 公式的运行机制



## Params

```
Numeric FastLength(12);  
Numeric SlowLength(26);  
Numeric MACDLength(9);
```

## Vars

```
NumericSeries MACDValue;  
Numeric AvgMACD;  
Numeric MACDDiff;
```

## Begin

```
MACDValue = XAverage(Close, FastLength) - XAverage(Close, SlowLength);  
AvgMACD = XAverage(MACDValue, MACDLength);  
MACDDiff = MACDValue - AvgMACD;  
PlotNumeric("MACD", MACDValue);  
PlotNumeric("MACDAvg", AvgMACD);  
If (MACDDiff >= 0)  
    PlotNumeric("MACDDiff", MACDDiff, Red);  
Else  
    PlotNumeric("MACDDiff", MACDDiff, Green);  
PlotNumeric("零线", 0);
```

## End

公式参数段，用Params  
宣告参数代码段的开始

公式变量段，用Params  
宣告变量代码段的开

公式脚本段，用Begin  
和End宣告代码的起始  
和结束，一般技术指标  
输出一条线用  
PlotNumeric函数



# 参数优化

交易指令参数优化[IF1005 - 1分钟]

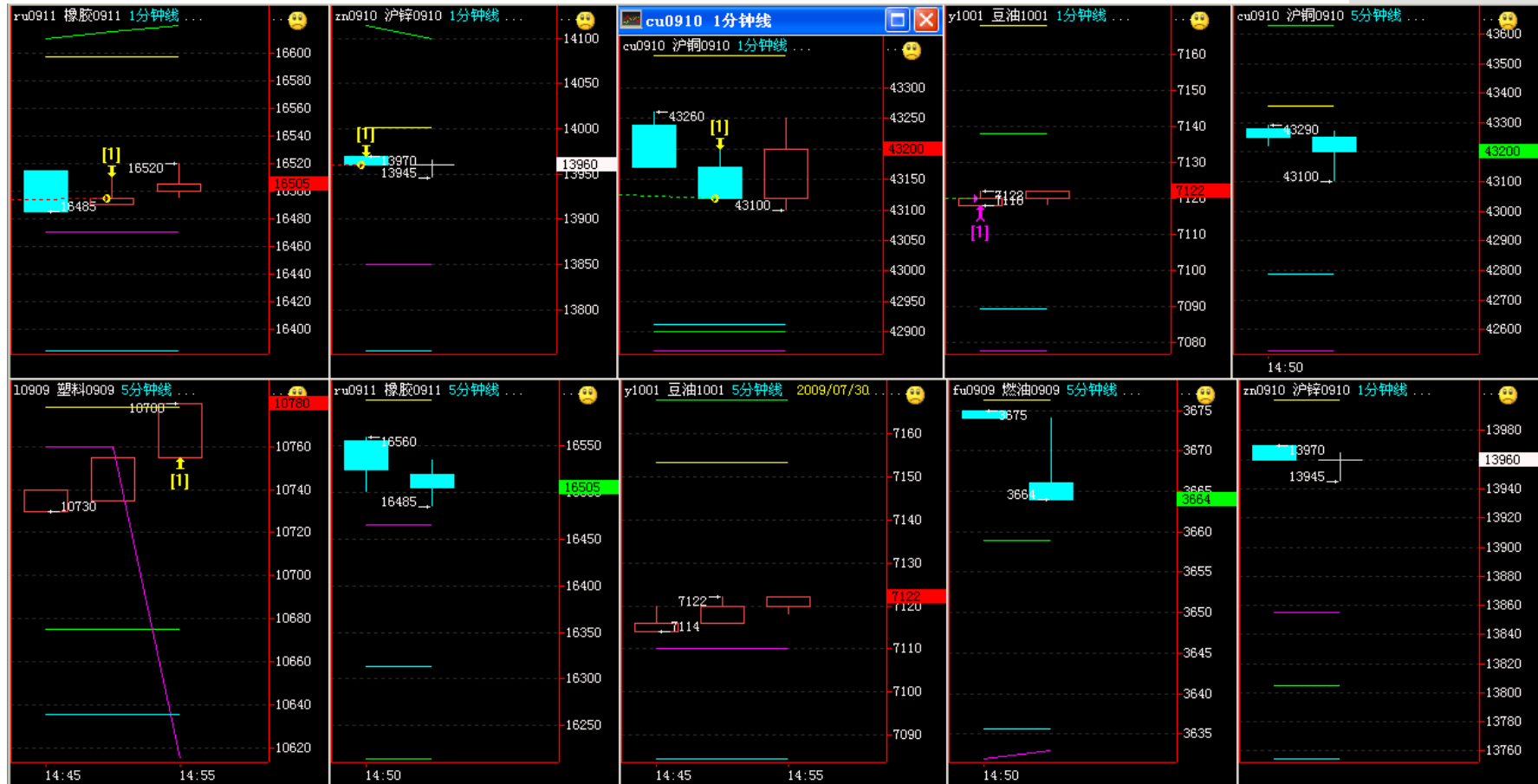


#	001_MA_1_NextOpen:Leng△	净利润	总盈利	总亏损	交易次数	盈利率	盈利次数	亏损次数	最大盈利	最大亏损
31	15.00	-14169.85	241715.52	-255885.37	351	26.21	92	259	17505.11	-7992.3
29	16.00	5451.52	242666.59	-237215.08	325	28.31	92	233	17260.11	-7692.27
30	17.00	5102.93	242782.35	-237679.42	341	25.81	88	253	19840.37	-7692.27
28	18.00	19655.08	242213.24	-222558.16	313	25.88	81	232	19240.31	-7692.27
23	19.00	34004.27	247826.19	-213821.92	294	24.83	73	221	19240.31	-7692.27
15	20.00	50192.89	248779.69	-198586.8	264	26.14	69	195	19240.31	-7692.27
16	21.00	48422.95	247546.07	-199123.12	254	25.98	66	188	25365.9	-7692.27
17	22.00	48052	241999.97	-193947.97	248	25.4	63	185	22545.62	-7692.27
19	23.00	40054.49	228419.8	-188365.31	248	25.81	64	184	22545.62	-8354.02
20	24.00	34816.06	228041.61	-193225.55	250	24.4	61	189	22545.62	-8354.02
9	25.00	57666.27	230225.14	-172558.87	214	28.5	61	153	22545.62	-8354.02
3	26.00	65543.31	231149.49	-165606.18	202	28.71	58	144	22545.62	-8354.02
5	27.00	64879.77	218239.03	-153359.26	196	27.55	54	142	22545.62	-8354.02
4	28.00	65374.67	221898.16	-156523.48	196	26.02	51	145	22895.78	-8354.02

# 使用指数测试的长线系统——数据叠加



# 多周期、多系统、多品种的组合



客户的特殊需求可以功能定制

- ❖ 深刻认识价格走势的本质
- ❖ 预先检验策略，大大节省交易成本
- ❖ 减少人为的选择性记忆
- ❖ 有效控制风险，放大收益
- ❖ 克服心理弱点

1

均线突破系统

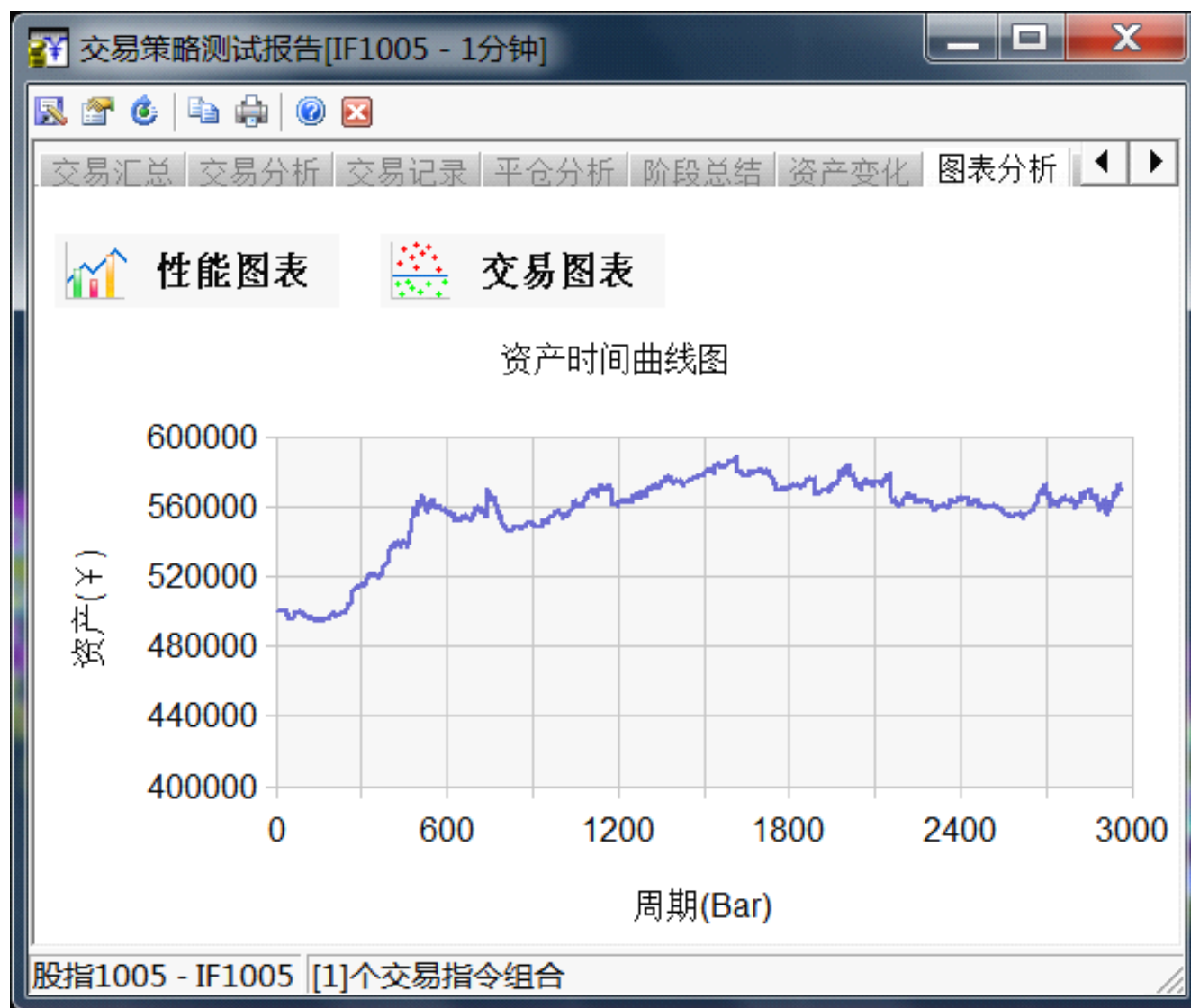
2

MACD交叉系统

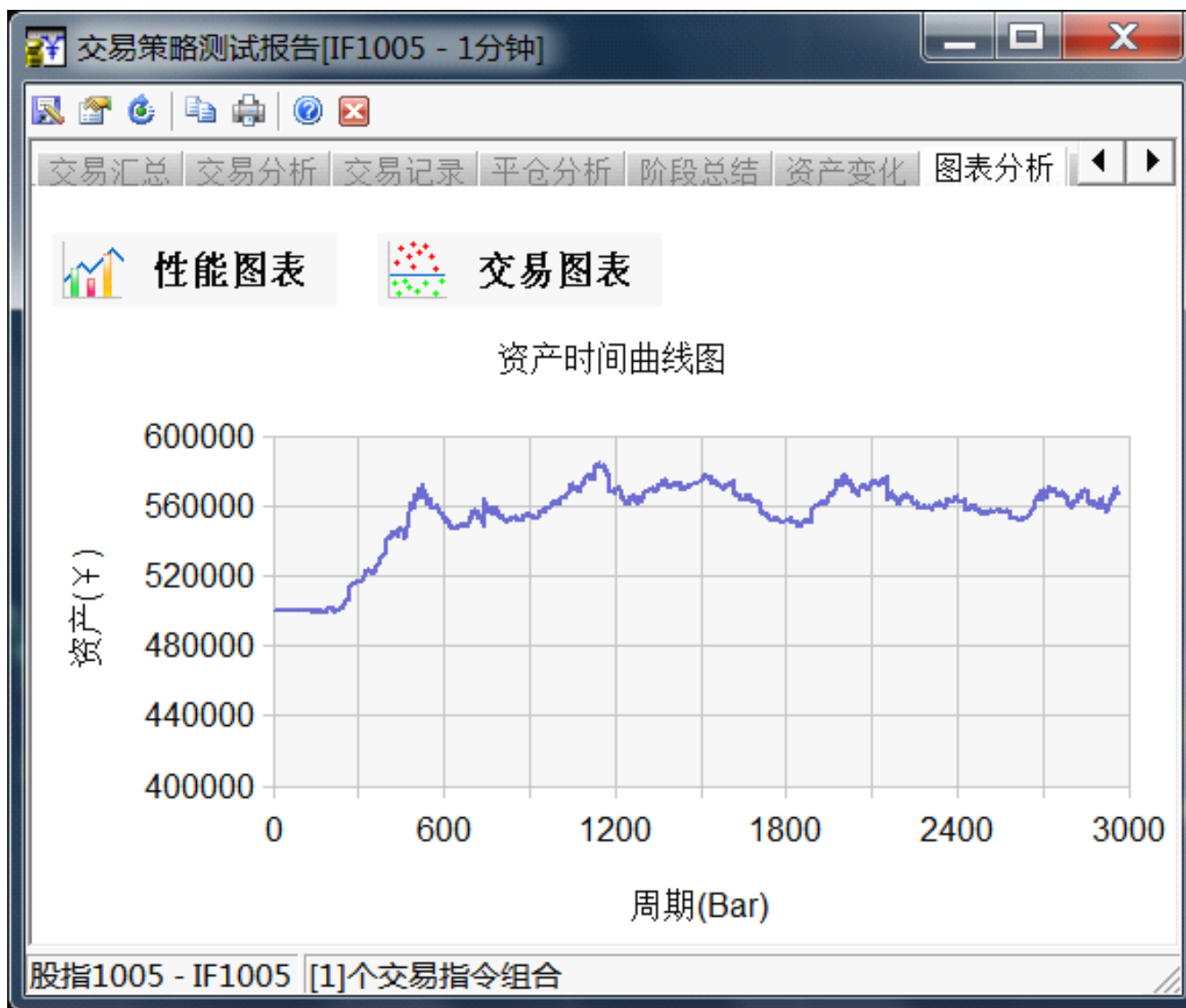
3

肯特纳通道系统

# 均线突破系统：单均线突破



# 均线突破系统：双均线交叉





# MACD交叉系统



- ❖ 中线是 $(High + Low + Close)/3$  的10周期均线
- ❖ 上下轨是从均线上下各偏移2个atr
- ❖ 突破上下轨则进行操作
- ❖ 操作的头寸是：若突破上轨做多，则操作的手数是 若此时价格跌到此时下轨，则最多允许损失整个权益的5%
- ❖ 做空类似

# 肯特纳通道系统：主体代码



```
Begin
  Price = (High + Low + Close)/3;
  MidLine = AverageFC(Price,Length);
  Shift = NumATRs * Average(TrueRange,Length);
  UpperBand = MidLine + Shift;
  LowerBand = MidLine - Shift;
  TotalEquity = CurrentCapital()+
Abs(CurrentContracts()*Close*ContractUnit()*BigPointValue()*MarginRatio());
  KeltnerUnits = (TotalEquity*RiskRatio/100)
/(2*Shift*ContractUnit()*BigPointValue());
  KeltnerUnits = IntPart(KeltnerUnits);
  If(MarketPosition != 1 && CrossOver(High,UpperBand) && KeltnerUnits >=
1)
  {
    Buy(KeltnerUnits,NextOpen,True);
  }
  If(MarketPosition != -1 && CrossUnder(Low,LowerBand) && KeltnerUnits
>= 1)
  {
    SellShort(KeltnerUnits,NextOpen,True);
  }
End
```

# 肯特纳通道系统测试结果



# 优势达成目标





### 免责声明

文章、资料及相关图片，其版权均由原作者或原刊载媒介拥有。若版权原作者或原刊载媒介不同意本网站免费使用上述资料，请及时通知我们，将其删除。公司对这些信息的准确性和完整性不做任何保证。以上内容仅供参考，不构成投资建议，投资者据此操作，风险自担。