

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

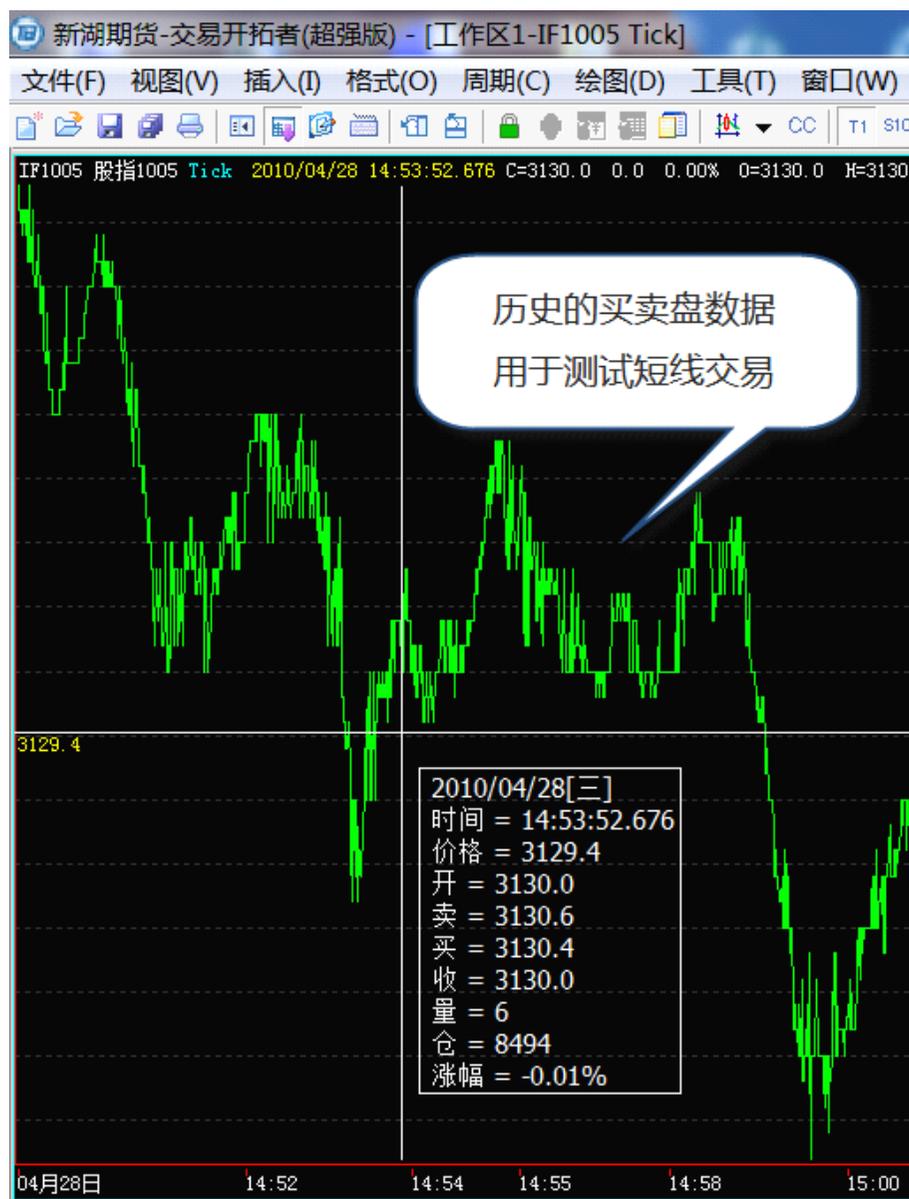
3

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

交易开拓者(超强版) - [工作区0-IF1006 30分钟线]

文件(E) 视图(V) 插入(I) 格式(O) 周期(C) 绘图(D) 工具(T) 窗口(W) 帮助(H)

T1 S10 M1 M5 M15 M30 H1 H4 N1

简称	代码	涨跌C	涨幅C%	现价	涨跌	涨幅%	现手	总手
1 股指1005	IF1005	-5212.0	-63.09	3049.0	-20.4	-0.66	1	26925
2 股指1006	IF1006	1158.0	60.00	3088.0	-22.8	-0.73	0	1396
3 股指1009	IF1009	2844.0	843.92	3181.0	-27.2	-0.85	1	145
4 股指1012	IF1012	2780.0	568.51	3269.0	-21.4	-0.65	0	134

股指1005-分时图 现价 3049.0 盘口明细 0.0 涨跌 -20.4 张跌幅 -0.66%



卖价 3049.0 卖量 7
买价 3049.0 买量 22
委比 51.72% 委差 15
最新 3049.0 均价 -
涨跌 -20.4 昨结 3069.4
总手 26942 开盘 3046.4
涨停 3376.2 跌停 2762.6
现手 17 最高 3057.0
持仓 11679 最低 3040.0
昨仓 8297 仓差 3382
今开 15162 今平 11780
外盘 13278 内盘 13663

时间 价格 现手 增仓 性质
10:03:25 3049.0 1 0 多换
10:03:24 3049.0 12 +3 多开

里仓 成交里 186
11679
10277
1000
186

09:14 11:00 14:00

IF1006 股指1006 30分钟线 ...



MACD (12, 26, 9) MACD -17.30 ...

3186.8
3180.0
3160.0
3140.0
3120.0
3100.0
3088.0
3081.6
-1.14
-17.30

05月04日

工作区0 / 工作区1

交易师 批量下单 套利宝 价差下单 预埋单 策略易 高级 交易助手

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

①	简称	代码 ▾	现价	涨跌	涨幅%	现手	总手	持仓量
1	股指指数	IF000	3153.5	-2.3	-0.07	14	120929	11469
2	沪铜指数	cu000	58670	-1887	-3.12	0	438254	358812
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

①	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

分时图

超级图表

- ❖ 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

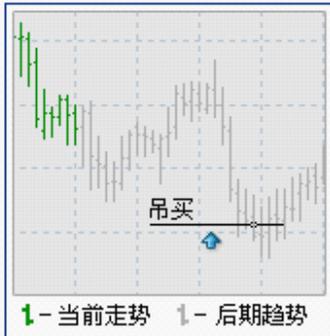
过期: 2010-04-29 23:59

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...



3153.5
3153.0
3152.5
3152.0
3151.6
3151.5
3151.0
3150.5
3150.0
3149.5

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:

Ask	3140.0/12	↑	3433.8
Bid	3139.0/3	↓	2809.8

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

- ❖ 套利宝
- ❖ 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-套金宝-迁仓

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 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

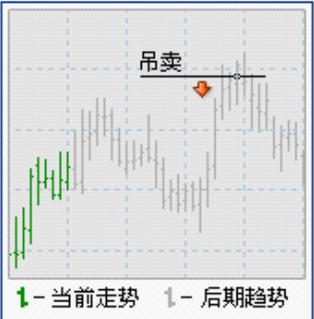
触发价格: 3300.0

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

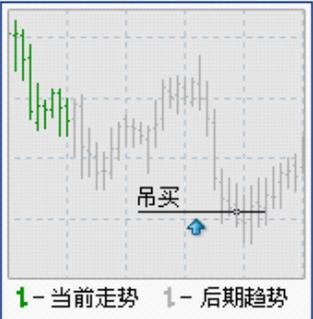
触发价格: 2800.0

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

—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

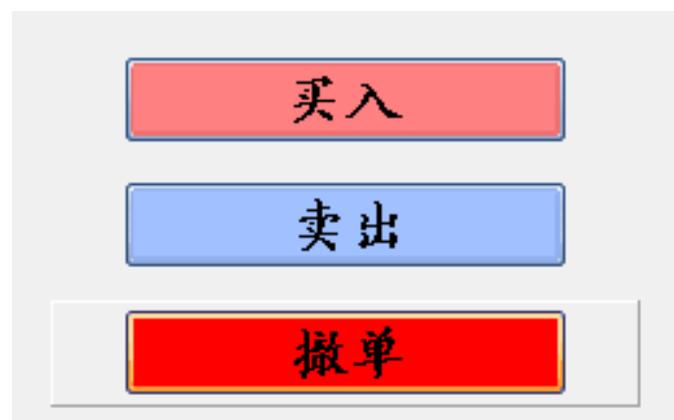
平仓

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 title "确认" (Confirm). The dialog contains a question mark icon and 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]?). At the bottom of the dialog are 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

统计信息: 累计:0 更新 重置开仓标志

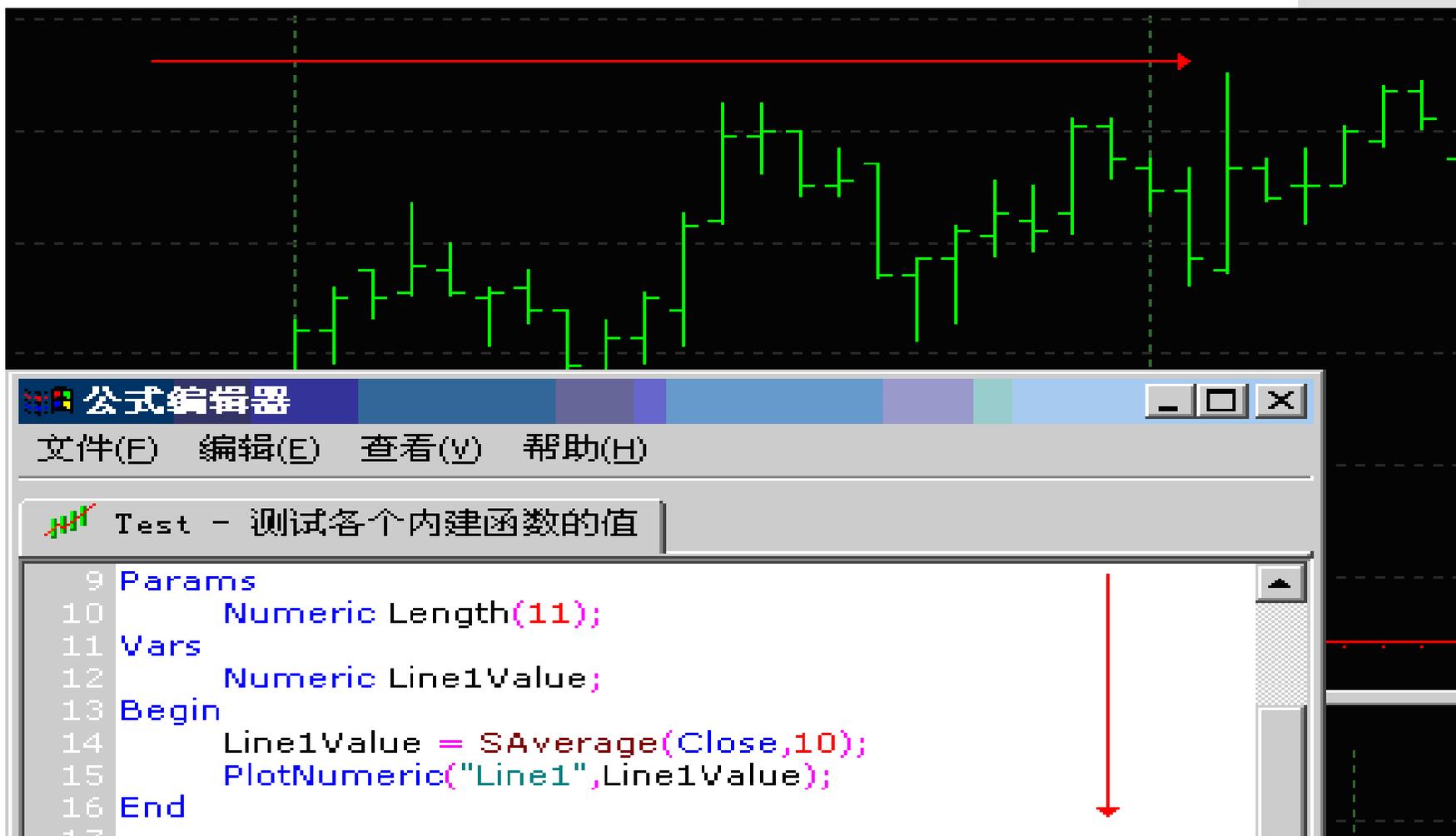
开仓均价: 0.0 第一笔开仓价: 0.0

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。