

交易之路是孤独的，除了自己摸索之外，借鉴成功者们的经验也是很有必要的。本账号不定期整理一些高手的交易系统或心得，和大家一起分享交流。

今日分享谈广荣的交易系统。其有十余年投资经验，曾获期货日报量化基金经理选拔赛第三名，获第八届“蓝海密剑”中国对冲基金公开赛“大校”军衔。

一、交易系统概述

程序化交易+主观交易

程序化交易占用80%的资金，主观交易占比20%的资金，主要用于对冲风险或增强收益。

完全用技术分析进行交易。相信K线价格是所有有效信息的真实反映，在当前条件下最有效率的选择，就是通过K线的单一信息来决定交易动作。

程序化交易采用简单的趋势策略：做价格和均线突破。简单的趋势策略可靠，易于维护，也不容易失效。

程序化交易策略的调整时机：

每个月对交易数据的结果进行分析，如果出现市场类似风格的交易者盈利，而自己的策略处于持平甚至亏损状态的情况时，会重新进行策略评估，分析原因，做出对应的调整。

二、交易品种的选择

通过日K线选择波动性和流动性双高的品种，剔除掉波动过低或过高的品种。

（期货）待选品种有20个左右，一个季度进行一次筛选，保持有12个品种在进行实盘交易

三、开仓

做预估有爆发性的行情，这样的行情具有高性价比。

1、多单：以突破图形为主，也会做底背离形态。

2、空单：做双重顶、多重顶形态，用2B准则和多周期共振，也会在头肩的右肩位

置做空。

3、程序化交易：在5分钟K线上找信号，平均月度交易1.5次左右，为日线级别的中线交易。在大级别行情中，最长持仓可达半年。

4、主观交易：在30分钟K线上找信号，一般持仓在5天之内，为短线波段交易。

四、加/减仓

1、多单：金字塔加仓。

2、空单：一次性开足仓位，金字塔减仓。

3、程序化交易：“输缩赢也缩”，即无论盈亏，都缩减仓位。

4、主观交易：“输缩赢冲”，即亏损后，缩减仓位；大幅盈利的情况下，放大仓位。

五、风险管理

特别注重风险管控，交易前，事先先制定交易计划，做好备选方案；交易中，严格遵循计划。

在长假前，如国庆节和春节，会减仓或直接空仓。

在市场整体波动特性不达标的时候，会手动停止所有策略。

六、其它观点

实现盈利的关键点在于交易系统本身是个正期望系统，系统的交易风格要契合执行者的性格特征，同时对系统出现的问题要有正确的诊断，可以及时进行调整和修正。

趋势和震荡是无法提前识别的，行情只有在走出来以后回头看，才能看清楚。程序化交易就是不断试错的过程，从规则上把亏损单做成短线，把盈利单做成长线，自然就能赚到趋势的钱。

主观交易中，重要的盈利单大部分都是通过抄底摸顶实现的，而且持仓周期相对较短，

初始仓位都比较高，但初始止损金额相对较低，基本一个K线走完就保本出场。

遇到了大回撤，资金长时间徘徊不创新高，要耐心地去重复正确的交易动作来突破。

谁也不能否认运气在交易中属于特别重要的因素。

[#财经##股票##期货##投机#](#)

我是@交易之弦

，跟踪财经热点，分享交易心得，欢迎关注，让我们一起感悟交易。

参考资料：《期货英雄8》