

基于资本求利特征的量化程序之二：

突破与抄底的定义程序

一、逻辑基础：

1、熙熙攘攘皆为利往，交易应直指人心，同样的，量化程序也应直指人心。（各种套利交易则不在此列）。

2、从严谨的角度考虑，只有可量化的程序才是可信赖的。市面较多的定义不可量化，信号多属于“未来函数”，建议慎用，切勿迷信。

3、推动价格变化的因素可归纳为一个词：利益！

那么，市面的指标与市场各方面的“利益”有何关联？比如 MACD 的算法与“利益”有何关系？起码是没有直接联系的。BOLL 与“利益”有何关系？CCI 与“利益”有何关系？……，显然，都没有直接关系。

反过来想，既然都没有关联，哪些是有关联的？各个指标如何分类？

4、本量化程序均试图贴近资本求利的特征。因势单力薄，故寻求合作，或寻找志同道合的朋友。本量化程序可以改作 AI 程序的因子，也可提供完整的交易程序，联系方式见后文。本定义程序基于大智慧语言，贴近资金求利的本质，逻辑严密，可适用于股票期货或其他类似标的。

5、如果您对本定义程序感兴趣，请您联系索取程序文件。可视情况提供原码，共同进步。

二、随机的交易系统与“？交易系统”的关系：

有些交易系统是堆砌一些因子，各种交集或者利用 AI 系统学习这一堆因子，给出一个含有较大随机性的结论。该系统既无法分析结论的逻辑，也不利改进因子，是混沌的世界，不利于交易方法的精进。

三、突破定义的内容表述：

1、市面上常见的突破定义：一般意义的突破是超过某个价格的高点，这个突破定义是成立的。但深入的想，这样的突破定义与后期的走势是否真的紧密联系……？

2、本文的突破定义的要点是——突破了什么？

突破定义：突破即收割，突破某个价格点，使对方陷于亏损状况。要求被突破的一波段属于空头强势。

市面上的突破定义，没有计算被突破的前一波段的多空属性，脱离了资本求利的特征。

四、突破定义程序的简单图示如下。



图 4-1



图 4-2

五、抄底定义的内容表述：

1、抄底定义的要点：抄谁的底？

基于资本博弈的逻辑，特提出一个抄底定义方法。

抄底定义：空头强势之后，在空头的盈亏边缘买入做多，即为抄底。截断空头的获利，作趋势反转的第一批力量。此时可能趋势仍未反转，所以抄底是有风险的。

六、抄底的简单图示如下：

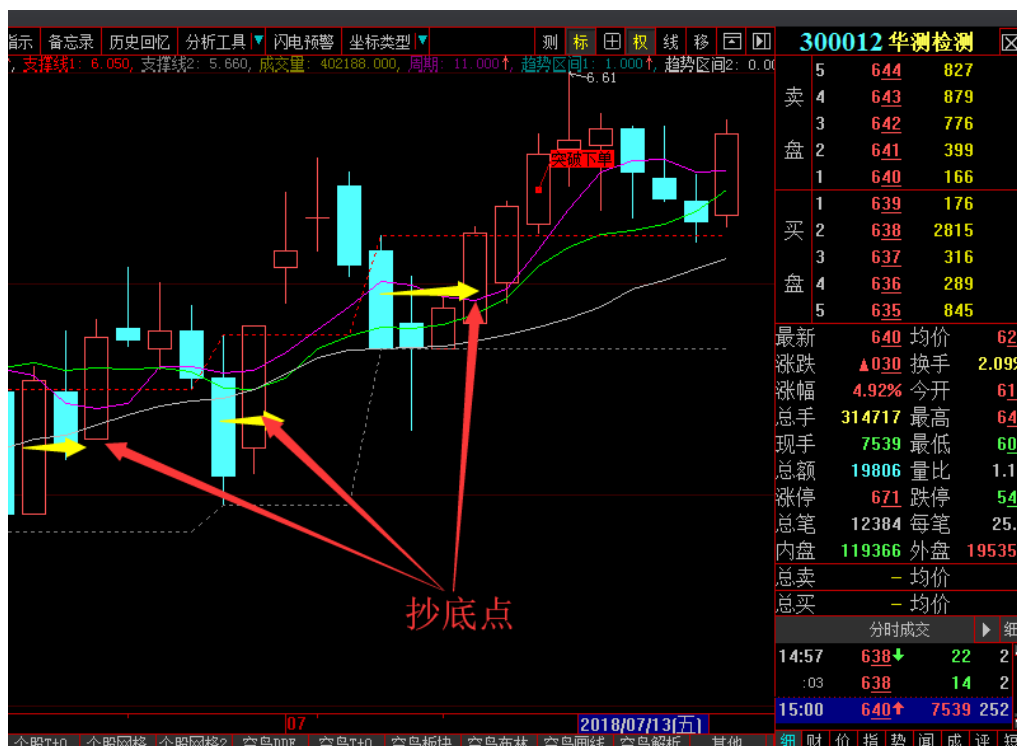


图 6-1：抄小底



图 6-2：抄大底



图 6-3: 充分换手，不是抄底。

图示说明：可预估一个值来界定充分换手，比如换手率为 $(5 \times \text{流通盘})$ 为充分换手。充分换手之后，革命了改朝换代了，市场的参与者完全更新了一次，则不存在“谁抄底谁的底”了。

六、期待与您合作。既使不能合作，如果您对本定义程序感兴趣，请您联系索取程序文件。可视情况提供原码，以共同进步。