

期指 30 分钟周期 CTA 策略

策略主要逻辑：强上涨状态中不做空；强下跌状态中不做多。在非强上涨状态时，超买时的向下破位更容易下跌；在非强下跌状态时，超买状态下的上涨可以追。

一、强趋势状态的判断

在日线周期中，判断强趋势的标准：单日出现大幅上涨或大幅下跌、价格连续多日在均线之上。具体地：

1、前期一段时间出现日涨幅超过 BigBarPercent%的 Bar，则认为强上涨趋势；出现日跌幅低于-BigBarPercent%的 Bar，则认为强下跌趋势，假设出现大 Bar 后，在随后的 DelayDay 个交易日，延续趋势状态。

参数：BigBarPercent(2.5)、DelayDay(2)

2、日线周期，收盘价持续 CountBar 个 Bar 在均线之上，且最后第 CountBar 日的收盘价超过 MA 的 LastDayDiff%的幅度时，确定强上涨趋势；收盘价持续 CountBar 个 Bar 在均线之下，且最后第 CountBar 日的收盘价低于 MA 的 LastDayDiff%的幅度时，确定强下跌趋势。

参数：MALength(5)、CountBar(6)、LastDayDiff(1)

二、短期超买指标和上下轨

在 30 分钟周期，计算两个 KDJ 指标，基于 Length1 和 Length2 两个周期参数，比较两个 KDJ 指标中 J 值的差异 JDiff。

在 30 分钟周期，计算 Length 周期的最高价和最低价形成的上轨 UpperBand 和下轨 LowerBand。

参数：Length1(9)、Length2(6)、Length(4)

三、出入场规则

1、非强下跌状态中，当前 Bar 突破前期上轨 UpperBand，Close[1]>High[2]，JDiff>0 时，平空开多；

2、非强上涨状态中，当前 Bar 跌破前期下轨 LowerBand，Close[1]<Low[2]，JDiff>0 时，平多开空。

3、出场条件：ATR 初始止损+跟踪止盈

4、其他：10 点前不交易

参数：TrailStart1(1)、TrailStop1(80)、ATRK(3);

附：TB 部分代码

Params

Numeric MALength(5);

Numeric CountBar(6);

Numeric LastDayDiff(1);

Numeric BigBarPercent(2.5);

Numeric RestDay(2);

Numeric Length1(9);

Numeric Length2(6);

Numeric Length(4);

Numeric TrailStart1(1);

Numeric TrailStop1(80);

Numeric ATRK(3);

Numeric EntryLots(1);

Vars

BoolSeries StrongUp;

BoolSeries StrongDown;

Bool UpTrend;

Bool DownTrend;

NumericSeries TrendConfirm;

NumericSeries RSV1;

NumericSeries RSV2;

NumericSeries K1;

NumericSeries D1;

NumericSeries J1;

NumericSeries K2;

NumericSeries D2;

NumericSeries J2;

NumericSeries UpperBand;

NumericSeries LowerBand;

NumericSeries JDiff;

BoolSeries TradeTime;

NumericSeries ATRValue;

NumericSeries TempHigh;

NumericSeries TempLow;

Numeric StopLine;

Begin

TrendConfirm=IIF(Date<>Date[1],DayTrendFilter(MALength,CountBar,LastDayDiff,BigBarPercent,RestDay,UpTrend,DownTrend),0);

StrongUp=UpTrend;

StrongDown=DownTrend;

TradeTime=Time>=10/100 && Time<15/100;

RSV1=(High[1]-Lowest(Low[1],Length1))/(Highest(High[1],Length1)-Lowest(Low[1],Length1))*100;

K1=XAverage(RSV1,Length2);

D1=XAverage(K1,Length2);

J1=3*K1-2*D1;

ATRValue=AvgTrueRange(14);

RSV2=(Highest(High[1],Length1)-Low[1])/(Highest(High[1],Length1)-Lowest(Low[1],Length1))*100;

K2=XAverage(RSV2,Length2);

D2=XAverage(K2,Length2);

J2=3*K2-2*D2;

JDiff=J1-J2;

```

UpperBand=Highest(High[1],Length);
LowerBand=Lowest(Low[1],Length);
If(MarketPosition!=1 && JDiff>=0 && High>=UpperBand && Close[1]>=High[2] && TradeTime
&& StrongDown==False)
    Buy(EntryLots,Max(UpperBand,Open));
If(MarketPosition!=-1 && JDiff>=0 && Low<=LowerBand && Close[1]<=Low[2] &&
TradeTime && StrongUp==False)
    SellShort(EntryLots,Min(LowerBand,Open));
TempHigh=Highest(High[1],BarsSinceEntry);
TempLow=Lowest(Low[1],BarsSinceEntry);
If(MarketPosition==1 && BarsSinceEntry>0)
{
    If(TempHigh>LastEntryPrice*(1+TrailStart1*0.01))
    {
        StopLine=TempHigh-(TempHigh-LastEntryPrice)*TrailStop1*0.01;
        If(Low<StopLine)
            Sell(EntryLots,Min(StopLine,Open));
    }
    Else
        If(TempHigh<=LastEntryPrice*(1+TrailStart1*0.01) && TradeTime)
        {
            StopLine=LastEntryPrice-ATR*ATRValue[1];
            If(Low<StopLine)
                Sell(EntryLots,Min(StopLine,Open));
        }
    }
If(MarketPosition==-1 && BarsSinceEntry>0)
{
    If(TempLow<LastEntryPrice*(1-TrailStart1*0.01))
    {
        StopLine=TempLow+(LastEntryPrice-TempLow)*TrailStop1*0.01;
        If(High>StopLine)
            BuyToCover(EntryLots,Max(StopLine,Open));
    }
    Else
        If(TempLow>=LastEntryPrice*(1-TrailStart1*0.01) && TradeTime)
        {
            StopLine=LastEntryPrice+ATR*ATRValue[1];
            If(High>StopLine)
                BuyToCover(EntryLots,Max(StopLine,Open));
        }
    }
}
End

```