**022.TowL**

**022\_TowL**

**022\_TowL**

**策略设计**

(2017-11-23)

编写者: XX

**保密资料**

**(核心技术 泄密追责)**

武汉金恒汇投资管理有限公司

#### 填写规范

1. 字体、字号、行缩进格式必须与模板相同；

2. 策略无目录相应内容的，应删除目录；

3. 策略编写需要，而模板缺少的目录，可增加到相应位置；

4. “原理”部分,仅帮助开发人员增加对策略的理解,不作为编写依据；

5. “策略逻辑”部分,为开发人员编写策略的依据；

6. 文中“方括号”为填写替换区域,如: “[品种名称]”,可替换为“股指期货”；

7. 创建文档后,如果因逻辑发生变化而产生的修改,应记入“修改覆历”，并在正文中进行格式标记；

#### 修改覆历

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **修改内容** | **修改者** | **修改日期** | **发布日期** | **标记** |
| 1 | 创建 | 熊雄 | 2017-11-23 |  | 标记 |
|  |  |  |  |  | [标记] |
|  |  |  |  |  | [标记] |
|  |  |  |  |  | [标记] |
|  |  |  |  |  | [标记] |

#### 参考文档

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **序号** | **名称** | **内容** |
| 1 |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

#### 一、概述

##### 原理

定义上涨趋势为：高点上移，低点上移，收盘价上移；

定义下跌趋势为：高点下移，低点下移，收盘价下移；

通过KD指标来计算自适应通道，通过自适应通道来判断涨跌。

##### 适用范围

**周期适用范围**

1-10分钟

**行情适用范围**

单边趋势,宽幅无规则震荡等

**品种适用范围**

IF,其他

#### 二、策略逻辑

##### 2.1 参数定义

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **参数名称** | **数值类型** | **说明** |
| 1 | Vlength | numeric | 成交量周期 |
| 2 | SlopeLength | numeric | 计算斜率周期 |
| 3 | range | numeric | 斜率阀值 |
| 4 | len | numeric | 通道周期 |
| 5 | AtrRange （默认0-类似无效） | numeric | ATR阀值 |
| 6 | R | numeric | 进场斜率阀值 |
| 7 | ADDratio | numeric | 加仓幅度 |
| 8 | ExitTime | numeric | 离场时间 |

##### 2.2 风险管理

每次开仓手数 = lots\*100000/C[1];

##### 2.3 指标算法

2.3.1 成交量均线指标

Smoothfator=Summation(Vol[1],Vlength)/AverageFC(openint[1],Vlength); # opening 持仓量

preBarMiPrice = c[1];（分钟close）

preBaramount = preBarMiPrice \* vol[1];

preBarvolL = Summation( vol[1],Vlength);(分钟成交量)

preBaramountL = Summation(preBaramount,Vlength);

MaTodayL = preBaramountL / preBarvolL;

2.3.2 斜率指标

slope = (MatodayL-MatodayL[SlopeLength])/SlopeLength \* 100;

SDvalue= L[1]- MAtodayL;

LDvalue= MatodayL- H[1];

realopenD=openD; （日线开盘价）

realCLoseD=CLoseD; （日线收盘价）

If(Lowest(SDvalue,SlopeLength)>0&&realopenD[1]/realCLoseD[1]>0.96&&Slope>Range) SFlag=1;

Else If (Lowest(LDvalue,SlopeLength)>0&&realopenD[1]/realCLoseD[1]<1.04&&Slope<0-Range) Sflag=-1; (Sflag--时间序列)

2.3.3 通道计算

HH1= highest(H[1], len); (H:high)

LL1= lowest(L[1],len); (L:low)

If(H[len+1]>HH1&&H[len+1]>HH1[len+1]) RealH=H[len+1]---时间序列;

If(L[len+1]<LL1&&L[len+1]<LL1[len+1]) RealL=L[len+1];

##### 2.4 开仓控制

2.4.1 开仓

多仓（看多）：1. 当MP <= 0. &&c[2]<=MaTodayL[1]&& slope[1]>R&&ATR[2]/C[2]\*100>AtrRange&& Sflag[1]==1&&L[1]< RealL[1]时,选择时间价值最高的认沽期权以Data1.open价卖出（direction=-1）

空仓：（看空） 2. 当MP >= 0. && c[2]>=MaTodayL[1]&& slope[1]<0-R &&ATR[2]/C[2]\*100>AtrRange&& Sflag[1]==-1&&H[1]> RealH[1]时，选择时间价值最高的认购期权以Data1.open价卖出（direction=-1）；

2.4.2 加仓

多加仓：1.当(MP == 1 &&L[1] <LastEntryPrice-Addratio/100\*C[1])时,选择时间价值最高的认沽期权以Data1.open价卖出；

空加仓： 1.当(MP ==-1 && H>LastEntryPrice+Addratio/100\*C[1])时,选择时间价值最高的认购期权以Data1.open价卖出；

2.4.4 反手

允许反手

##### 2.5 平仓规则

2.5.1 固定止损

2.5.2 跟踪止损

2.5.3 固定止盈

设置保本

2.5.4 离场

多单离场：

1.摆动离场： 当(H [1]> RealH) 所有认沽期权以其open价离场；

空单离场：

1.摆动离场： 当(L [1]<RealL[1]) 所有认购期权以其open价离场；

##### 2.6 过滤规则