**013.搅拌机策略**

**013\_Mixer**

**013\_Mixer**

**策略设计**

(2016-6-29)

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 | 2016-6-29 |  | 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 | AtrLength | numeric | Atr周期 |
| 2 | SKlength | numeric | 预备周期 |
| 3 | SKRange | numeric | 趋势过滤阀值 |
| 4 | range | numeric | 入场动量阀值 |
| 5 | TEntryLength | numeric | 入场通道周期 |
| 6 | BarInter | numeric | 震荡标记持续周期 |
| 7 | EntryIvLength | numeric | 离场通道周期 |
| 8 | ADDratio | numeric | 加仓幅度 |
| 9 | 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 面积指标

ATR = Average(TrueRange, ATRLength);

preHiBand = Highest(C[1],SKlength);

preLoBand = lowest(C[1],SKlength);

R1 =Highest(preHiBand,SKlength)-Lowest(preLoBand,SKlength);

R2 =H[1]-L[1];

SumR1 = R1\*SKlength;

sumR2 = Summation(R2,SKlength);

RealR = SumR2/SumR1\*100;

2.3.2 震荡标记

If(RealR[1]>SKRange&&RealR<SKRange)

{

ZDFlag=1;

Bars=CurrentBar;

}

If(CurrentBar-Bars>BarInter)

{

ZDFlag=0;

}

2.3.3 通道计算

EntrySht = Highest(H[1], TEntryLength)\*(1-range/100);

EntryLng = Lowest(L[1], TEntryLength)\*(1+range/100);

EntryLngIv = Highest(H[1], EntryIvLength);

EntryShtIv = Lowest(L[1], EntryIvLength);

##### 2.4 开仓控制

2.4.1 开仓

多仓：1. 当MP <= 0&&ZDFlag==1&&H[1]!=L[1]&&L<EntrySht&& OpenFlag != 1时,多单以Min(EntrySht,Open)入场；

~~空仓： 2. 当MP >= 0&&ZDFlag==1&&H[1]!=L[1]&&H> EntryLng&& OpenFlag != -1时，空单以Max(EntryLng,Open)入场；~~

2.4.2 加仓

多加仓：1.当(MP == 1 &&L <LastEntryPrice-Addratio\*Atr &&ZDFlag==1&& EntryTimes <= AddTimes && OpenFlag == 0)时,多单以Min(LastEntryPrice- Addratio\*Atr,Open)加仓；

~~空加仓： 1.当(MP ==-1 && H> LastEntryPrice+Addratio\*Atr &&ZDFlag==1 && EntryTimes <= AddTimes && OpenFlag == 0)时,空单以Max(LastEntryPrice+ Addratio\*Atr,Open)加仓；~~

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 > EntryLngIv) 多单以Max(Open EntryLngIv)离场；

2.时间离场： 当(Time > ExitTime) 多单以Open离场；

~~空单离场：~~

~~1.摆动离场： 当(L < EntryshtIv) 空单以Min(Open, EntryshtIv)离场；~~

~~2.时间离场： 当(Time > ExitTime) 多单以Open离场；~~

##### 2.6 过滤规则