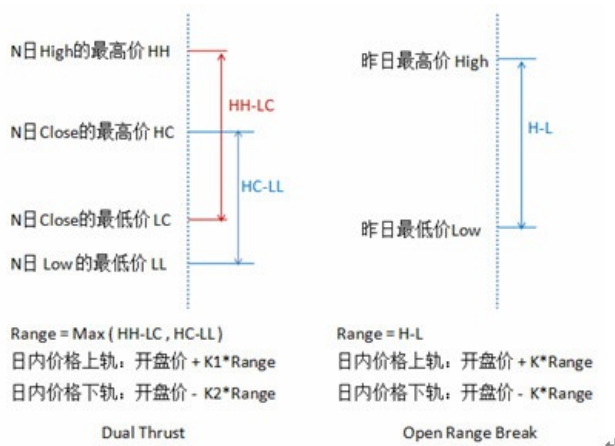
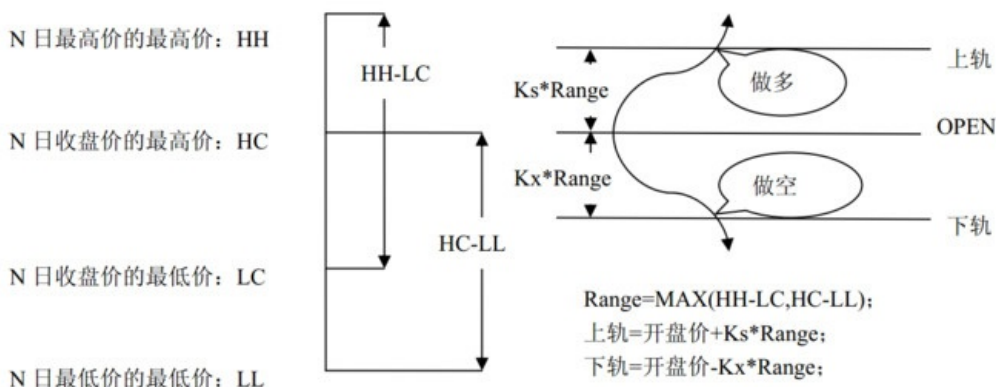


Dual Thrust



- Dual Thrust是一个趋势跟踪系统，由Michael Chalek在20世纪80年代开发，曾被Future Thruth杂志评为最赚钱的策略之一。Dual Thrust系统具有简单易用、适用度广的特点，其思路简单、参数很少，配合不同的参数、止盈止损和仓位管理，可以为投资者带来长期稳定的收益，被投资者广泛应用于股票、货币、贵金属、债券、能源及股指期货市场等。
- 它的逻辑原型是较为常见的日内交易策略之一开盘区间突破策略，以今日开盘价加减一定比例的昨日振幅，确定上下轨。日内突破上轨时平空做多，突破下轨时平多做空。
- 没有明确止损。这个系统是反转系统，也就是说，如果在价格超过（开盘+触发值）时手头有一口空单，则买入两手。同理，如果在价格低于（开盘-触发值）时手上有一口多单，则卖出两手。



- Dual Thrust在开盘区间突破策略上进行了相关改进:

- 1、在范围（range）的设置上，引入前N日的四个价位，使得一定时期内的范围相对稳定，可以适用于日间的趋势跟踪；
- 2、Dual Thrust对于多头和空头的触发条件，考虑了非对称的幅度，做多和做空参考的Range可以选择不同的周期数，也可以通过参数K1和K2来确定。当K1时，多头相对容易被触发, 当K1>K2时，空头相对容易被触发。