

# Aberration 靠趋势赚钱

- 中长线的交易系统，属于趋势追踪型策略
- 它的交易频率一般是每年交易某一品种3-4次，60%的时间都持仓，平均每笔交易持仓60天。
- 该策略的开平仓策略是这样的：首先利用35日移动平均线和35日内收盘价的标准差，得出上中下三条轨道，当上一个Bar的收盘价上穿了上轨的时候开多，下穿了下轨的时候开空，下穿了中轨的时候平掉多头，上穿了中轨的时候平掉空头。

该策略的思想很简单，就是利用移动平均线和标准差设置通道，然后随时判断是否突破了通道，从而捕捉到趋势。而当趋势逐渐减弱的时候，由于中轨会先趋于缓和，因此当K线反向穿过中轨的时候，就可以认为趋势已经结束，止盈出场。而如果有趋势的误判，在K线反向穿过中轨的时候，也可以及时止损。

- 首先计算该品种过去N日收盘价的算术平均 $MA(close)$ 作为中轨(MID)，以收盘价的标准差 $std(close)$ 作为波动性的衡量，计算上轨 $MID+mstd(close)$ 以及下轨 $MID-mstd(close)$ 。当价格突破上轨时做多，当价格回到中轨时平仓；反之，当价格突破下轨时做空，当价格回到中轨时平仓。
- 1、上下轨的确定：

Aberration由三条通道线组成，其中中轨为一定周期的移动平均线（AveMa），上下轨为中轨的基础上上下加减一定的价格标准差（StdValue），也就是我们熟知的布林线，系统构造十分简洁优美。

具体计算过程如下：

- (1) 计算中轨： $AveMa = Average(Close[1], Length)$ ;
- (2) 计算标准差： $StdValue = StandardDev(Close[1], Length)$ ;
- (3) 计算上轨： $UpperBand = AveMa + StdDevUpStdValue$ ;（StdDevUp为上轨参数）
- (4) 计算下轨： $LowerBand = AveMa - StdDevDnStdValue$ ;（StdDevDn为下轨参数）

2、买卖条件：

多头：收盘价格突破上轨做多开仓，跌破中轨离场；

空头：收盘价格跌破下轨做空开仓，突破中轨离场。