

*Z-World*

段武杰

February 26, 2015

## 1 4 小时 MACD 交易策略

- 多重时间框架, 使用 1 小时, 4 小时和日图 3 重时间段.
- **货币对选择:** 通过日图来判断市场趋势方向, 比较不同货币选择趋势最为明显的货币对.
- **趋势:** 通过日图 200 均线判断趋势方向, 如果价格低于 200 均线, 则趋势是向下的, 如果价格高于 200 均线, 则趋势是向上的.
- **方向:** 使用 4 小时 MACD 坡度来判断方向坡度越大说明趋势越强, 通过 4 小时 MACD 坡度过滤出可靠的信号, 判断出方向.
- **进场位置:** 判断出方向后, 根据 RSI 在合适的位置开方向一致的仓位.
- **出场位置:** 止盈有多个位置, 根据 8EMA, 21EMA, 89EMA 以及 200SMA 来设定出场位, 89EMA 是个重要位置, 当接近 89EMA 关闭%80 的仓位, 当到达 200EMA 关闭所有仓位
- 暂时观望也是种策略
- [交易记录](#)

## 2 资金管理

攻守之道, 在于先立于不败之地而后求胜! 存己才能灭敌!

假设你拥有 10000 美元, 你亏掉了其中了 5000 美元。那么你的亏损占整个账户的多少百分比呢? 答案是%50. 非常简单的一个问题。现在你需要增长多少百分比才能回到原来的 10000 美元呢? 现在不是%50 了, 你需要增长%100 才能

回到以前的 10000 美元了。这个例子告诉我们亏损是很容易的，但是赚钱确实困难的。

你损失的越多，则你要返回你的原始资本所需要作出的努力越大！从另一个侧面来讲，也就是你面临的困难将更大！

- **风险回报比**: 控制在 1:2 到 1:3 之间
- **原则 1**: 每次加仓前必须要求已经开立的头寸处于盈利的情况下才能加仓
- **原则 2**: 坚持递减仓量的加仓方式。每次的加仓量都不应该大于前面的开仓仓量
- **原则 3**: 根据交易波段的长短控制加仓次数，连续加仓次数一般不超过 3 次
- **重要原则**: 每单最大损失只能是账户的 %3, 每个月的损失不超过整个账户的 %10
- **开仓部位计算**

### 3 EA 策略

- 一个 EA 包括趋势判断，方向判断，位置判断，仓位管理。
- 方向判断包括买入点的判断和卖出点的判断。
- 趋势判断：趋势包括长期趋势，中期趋势和短期趋势。
- 通过 200 日 SMA 均线来判断长期趋势。

经济数据分析

## 4 CRB 指数

反映的是美国商品价格的总体波动，能使机构和个人投资者利用指数交易而获得商品价格综合变动带来的获利机会。

在分析数据时应当从数据本身进行分析，即从原数据分析，不能使用别人消化过后的观点！

汇率是由外汇的供求关系决定的，以下是影响汇率的主要因素：

- 利率
- 经济活动水平
- 非投机资本流
- 投机资本流
- 贸易平衡
- 政府预算
- 地缘政治事件

## 5 利率

- **存款利率 (Deposit interest rate)**: 个人或企业将钱存入银行，银行所需付出的货币价格！
- **借款利率 (Lending interest rate)**: 银行将钱借给个人或企业，个人或企业所需付出的货币价格！

- **真实利率 (Real interest rate):** 去除通货膨胀后的利率。

## 6 经济活动水平

## 7 非投机资本流

## 8 投机资本流

## 9 贸易平衡

## 10 政府预算

## 11 美国经济数据分析

### 11.1 利率

贷款利率从 08 年金融危机以来从 5.1 跌至 3.3 并连续 4 年内保持在 3.3，降低借款利率的原因是美联储想

[美国真实利率](#), 从 2011 年到现在来看，美国的真实利率在逐步增加，这样今天调高利率的可能性也可能会增大

### 11.2 通货膨胀率

通货膨胀的相关数据一般反应了总体物价水平的上升速度。通货膨胀会造成购买力下降，所以调控通货膨胀非常重要。通常来说通胀率上升标志着该经济发展的过快，而通胀率下降标志着经济急剧萎缩。

- 消费者物价指数 (CPI)

- 通货膨胀率计算公式

$$InflationRate = \frac{CurrentCPI - BaseCPI}{BaseCPI} * 100\%$$

### 11.3 就业率

在一个经济体中就业率越高说明经济状况越良好这个指标和利率一样是个关键指标

- 非农就业人口，上个月新增的非农就业机会
- 失业率：正在积极寻找工作而尚未获得工作职位的人所占的比例

就业人口从 2008 年的负值，就业人数开始逐步增加，这两年每个月的非农就业人口趋于稳定，说明美国经济在往好的方面发展！

失业率：从 2008 年 2009 年增加，从 2011 年 2015 年开始减少，说明美国经济在往好的方面发展！

### 11.4 GDP 国内生产总值

#### GDP

GDP 是在某一既定时期一个国家内生产的所有最终物品与劳务的市场价值，美国的 GDP 增长率是相对于 2005 年的 GDP 来说的！

经济增长的相关数据展示了经济体的经济发展程度，国家经济通常有 3 个发展方向：一是发展，二是停滞，三是收缩，经济体在不断发展时，该经济的各个方面都运作良好，并实现盈利性增长。如果经济体总是处于停滞或者收缩状态，其货币会遭受打击，走势疲软！疲软你懂的！

经济增长的情况主要表现在国内生产总值中！

### 11.5 国际贸易收支

### 11.6 海外投资

### 11.7 消费信心

## 12 加拿大经济数据分析

[加拿大真实利率](#)

## 13 欧盟区经济数据分析

## 14 澳大利亚数据分析

## 15 反身性尝试

- 如何判断一个国家的经济好坏!



## 16 Pro to do

- 每天保持整洁
- 考上驾照
- 我生于贫穷，但不能死于贫穷!
- 穷，是说你口袋里面有多少和你心里面有多少。
- 人的一切痛苦，本质上都是对自己的无能的愤怒!
- 做个更好的人!
- 床是哪来睡觉的人!
- 索罗斯有一个良好的生活习惯!
- 索罗斯很懂经济学，金融学，银行学
- 先做模拟外汇，等能够稳定盈利了再，实盘
- 让自己的资金滚动起来
- 招行账单日是每月 3 号, 如果要达到最长免息就得在账单日后 1 天消费，也就是每月的 4 号，这样到下个月的 21 号还款!
-