六、偷价行为

**所谓偷价行为是指在开平仓的时候使用了当时已不存在的进出场条件**。比如，程序化交易模型策略规定，如果最高价大于某个固定价位即以开盘价买入。如此虽然信号不会闪烁，但是最高价大于某个价位时，价格已经高于开盘价一定距离了，这时用开盘价买入是做不到的。但是在用历史数据进行模型测试时，图表上是有买入信号存在的。

有一些偷价行为很隐蔽，还是以最高价大于某个固定价格买入策略为例，如果用此策略作为模型进场买入信号，看起来没有什么问题。但如果行情出现一开盘就跳空高于固定价格的情形，模型就不可能再以这个固定价格买到了。

此时，程序化交易模型的交易策略应改为，用开盘价与固定价格之中的最大值作为买入价格，如此就能避免偷价行为的发生。 信号闪烁与偷价行为对短线交易模型的影响是致命性的，投资者一定要对模型信号的真伪加以甄别。

使用未来数据不用花费任何精力就可以轻松获得表面上非常高的成功率，但发出的买卖信号在实际操作中毫无价值，是一种交易欺骗行为，在实战中给投资者带来的惨痛损失和后果往往不堪设想。

其实许多交易问题也和程序化交易软件有一定关系，最近看到家上市券商推出了个量化交易软件好像是叫一创量化通，可以免费下载使用，还给专门配套了个视频量化学习网站叫啥一创量化汇的，第一感觉配套服务什么的还蛮不错，对量化、程序化交易感兴趣的可以前去百度搜一搜了解下。以上便是笔者在平时在做程序化交易时常遇到的信号闪烁和偷价行为两个问题，整理出来和大家分享一下，想一起学习交流的朋友也可以加下50174430这个QQ群。