**均线缠绕趋势系统指标说明**

**版本V1.2 2017.12.20**

# 辅助指标

1. 季节性

历史上当日后20日均价和前20日均价的比较胜率(金属数据用LME03)

1. 基差升贴水

现货数据用中午部门发的数据; 期价用中午收盘价

(后面尝试用纠正过的基差数据,待研究)

1. KDJ
2. 顶背离定义: close[0]>close[-1] and k < d
3. 金叉定义: k[0]>d[0] and k[-1[<d[-1]

# 主要指标

1. 日线趋势

计算三组均线,不同品种根据回测结果确定参数

三组均线定义为ms, mm, ml (短，中，长),cl 表示收盘价

计算均线的时候最新交易日的数据会重复计算一次，相对于加权平均

* 均线判定准则 (以多头为例)

1. 小时线趋势

涉及三条线: cl, h5, h60

* 上穿定义: cl>h60 & h5>h60 & h5[-1]<h60[-1]

1. 反抽

反抽指进入日线趋势(cl>ml & ms>ml)后一段时间后回撤(反弹或者回调)接近中均线或者长均线,这时可以观察是否是一个好的入场点; 前提是日线趋势未破坏，如果趋势没了，不存在反抽加仓，而是等待反转

* 反抽参数: 1)回撤系数: 1% ; 2)cl与均线的距离再0.5%之内算是接近

# 操作判定

1. 进入日线趋势

* 入场

当前交易日首次进入日线趋势级别

* 离场(止损)

1. cl < h60
2. 退出趋势
3. 反抽到中均线

* 入场

反抽接近中均线

* 离场(止损)

突破相应均线

1. 反抽到长均线

* 入场

反抽接近长均线

* 离场(止损)

突破相应均线

# 入场仓位

根据入场信号类别定，初步信号1>信号2>信号3