

如何使用Excel绘制砖型图Renko Charts

 不写代码
用EXCEL做量化投资.

1 人赞同了该文章

上一篇文章介绍了砖型图Renko Charts。

砖型图Renko Charts相对于K线，剔除了各种噪音，且只有红和绿两种形态（0,1），非常适合机器学习，进行量化分析，从而发现规律，作出策略。

现在还没找到哪个股票软件或平台，提供这种工具。

鉴于目前国内相应的策略还较少，值得进一步做量化研究。

今天尝试了用Excel实现，方式跟网格交易策略差不多。下面是具体的方法。

假设砖块大小为E2单元格=5元。在名称管理器中定义为Brick=E2。

需要6列来实现

- 第一列：日期，从1月1日开始-
- 第二列：收盘价。假定1月1日为100元(B5)，之后采用随机函数Rand生成价格
函数公式为：

第二日价格B6=ROUND(B5+10*(RAND()-0.5), 2)

- 第三列：计算上一日的Renko价格
按照Renko价格的定义，逻辑是：
如上一日收盘价为99，变动小于5，则Renko价格仍为100；
 - 如收盘价为93，则Renko价格为95
 - 如收盘价为100-109之间，则Renko价格仍为100；（因为第一个方块本身高度就有5）
 - 如收盘价为114，则Renko价格为110

公式直接采用IF或IFS逻辑嵌套函数，是最简单的方法，但比较罗嗦。

我用了更简单的公式，即用LOOKUP函数，返回第五列前一日的最后一个数字。

第N日的Renko价格为

第2日的的Renko价格C6=LOOKUP(9.999999999999999E+307, E\$5:E5)
向下自动填充
第10日的Renko价格C14=LOOKUP(9.999999999999999E+307, E\$5:E13)

其中9.999999999999999E+307代表无穷大，即在EXCEL中可以录入的最大数字。

- 第4-6列：为{砖块日期，砖块价格，UP/DOWN}，定义为一组数组。
直接采用IF函数：只有当天的Renko价格有变化才返回，无变化不返回

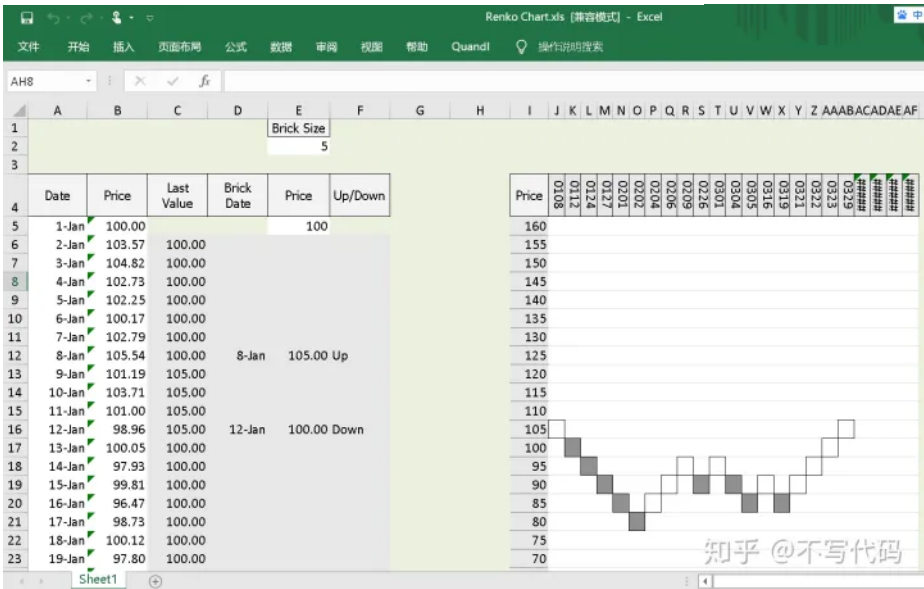
第二日{D6,E6,F6}为：
{=IF(B6<=C6-Brick, CHOOSE({1,2,3}, A6, C6-Brick, "Down"), IF(B6>=C6+Brick, CHOOSE({1,2,3}, A6, C6+Brick, "Up"), C6)}, {=IF(B6<=C6-Brick, CHOOSE({1,2,3}, A6, C6-Brick, "Down"), IF(B6>=C6+Brick, CHOOSE({1,2,3}, A6, C6+Brick, "Up"), C6)}, {=IF(B6<=C6-Brick, CHOOSE({1,2,3}, A6, C6-Brick, "Down"), IF(B6>=C6+Brick, CHOOSE({1,2,3}, A6, C6+Brick, "Up"), C6)}}

分别返回日期A6，砖块价格C6+brick, UP/DOWN

brick为E2单元格定义的砖块大小5

然后绘制表格。

具体结果如下：



XLS文件模板可以在百度网盘中获取。
链接: pan.baidu.com/s/1ehDdeT...
提取码: 2ah4

欢迎关注我的专栏：Excel做量化

编辑于 2019-11-10 16:18

Excel 图表绘制

股市指标

量化

写下你的评论...

1 条评论

默认 最新



Jessica

这个图应该怎么画呢？
2021-01-20

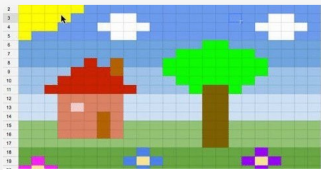
赞

文章被以下专栏收录



Excel做量化投资

推荐阅读



我承认，我只会用Excel画图

米妮

发表于在Goog...

excel图表功能：如何用 Smartart做组织架构图

关于工作效率一直是职场白领热议的话题，聪明的人每天都会思考如何才能提高工作效率，让自己的每一分钟花的更有价值。用好excel能节省95%的时间，如果不了解函数、功能、模板那么你只能花...

部落窝教育

发表于offic...

职场Excel：手把手教你如何建和美化图表

一图胜千言。说到图表，想必很：人都被网上酷炫的图表震惊过。如下面这样的可视化图表，看起来，很高大上有没有。但是，拆开来，就是由一个个基础图表而来的。所以可不要小瞧了基...

猴子

发表于猴子数据