**股指期货操作策略（第三稿）**

**一、基本解释**

01：均线定义

1、均线是指与“上证指数（000001）”对应的“zj” 数据所形成的均线，他们的走向是制定多空方向的基本依据；

2、均线分为：当天（深蓝色）； 2 天（白色）； 3 天（红色）； 10 天（绿线）

02：市场定义

1、10天均线为标准，当10天均线向上时，表明目前处于多方市场；当均线向下时，表明处于空方市场；

2、市场方向并不是做多或做空的依据，而是选取“多空线”的依据，而“多空线”才是实际操作的多空指导线。

03：多空线

1、在不同的阶段，选取不同的均线作为多空方向的依据，在同一个时期内，只能有一条均线作为“多空线”；

2、目前可选择的多空线定义为：2天均线和10天均线；

3、原则上当选定一条“多空线”后，不能进行和“多空线”反向的操作。（发生背离和蓝线原则时可以例外）；

4、任何时候都必须明确“多空线”的定义。且必须天天加以标识，并记录天数；

5、2 天均线只用于空方市场以及多方市场的结尾（潜在的拐点）； 10 天均线只用于多方市场的开始以及中部阶段。

04：均线走平

1. 当“多空线”两天之间的差额小于一定金额的时候，可以认为没有出现“多空转向信号”，这同样适用于其他均线。

05：满仓定义

1、满仓分为“过夜仓位”和“盘中仓位”，以“资金风险率”为标准，可以分别为“盘中”和“过夜”仓位设定不同的数值。

06：背离原则

1、背离是指当天行情走势包括涨跌幅度和大户买卖力度的对比，他们的情况发生了不一致。

2、背离的发生是提前判断行情走向的重要依据。

3、当发生背离时，实际操作可以和“多空线”的方向相反，但是，持仓时间原则上不超过两天。

4、对于怎样对“背离”进行解读，将在另外一片文章中予以详细定义。

07：波段原则

1、为坚持波段操作，不管多空情况，原则上要保留一手。

08：纠错原则

1、不管因为什么原因，若发生了帐户现状和当天的策略不一致的时候，第二个工作日必须立即予以纠正。

09：操作原则

1、每天必须在9：15之前发出当天的操作策略，若有具体操作时，操作必须在开盘后5分钟之内完成。

2、在盘中可以做 T+0 操作，但是，原则上做单边方向，且方向和我们的“多空线”的方向一致，先开仓，后平仓。

3、在3：00以后，将收到的实时数据进行运算，若结果出现各种信号，可以在3：15期指收盘前做出动作。

10：蓝线原则

1、当深蓝色当天线连续同方向运行超过若干个工作日后，发生较大力度的反向运行时，第二天必须减仓并反向操作。

11：能量原则

1、大户在买入或抛出筹码的时候，一般具有连续性，这种连续性的行为我们定义成：能量；

2、当这个能量耗尽时，行情的走势就像一搜失去动力的小船，会随波逐流，而消息面和技术面是造成“波”的原因；

3、这个“波”可能只有一天或两天，也可能是一个大波段的开始，这个需要根据以后的大户行为予以判断；

4、当能量耗尽时，“多空线”并不会发生转变，而行情的波动可能达到几十点，因而为规避这个风险，特作“能量指标”

5、当能量指标出现能量耗尽信号时，必须要考虑做减仓和平仓处理；

6、当背离信号和能量信号同时出现时，优先考虑背离信号，当蓝线原则出现时，能量耗尽信号往往同时出现。

7、能量信号的应用偏重于在空方市场。

8、当能量耗尽以后，又同方向释放能量时，要谨慎对待，这个有点像人死之前的灵光返照，往往是短暂的行为。

12：数据原则

1. 当没有收到数据时，空仓的继续休息，有仓位的无条件平仓，等待数据出现再做决断。

**二、策略设定**

01：多空线：当10天均线第一天向上时，该均线即自动成为当前的“多空线”，当运行超过10天以后，可以将2天均线设置成“多空线”

02：满仓值：过夜仓位目前设定为《 30%；盘中仓位设定为：《 50%

03：蓝线值：连续运行 5 个工作日以上；当日资金额达到 6 个亿以上。

04：能量值：16-18 以下。（5 个工作日以上开始计算）

05：翻转值：》1 个亿