

彭博云课堂

金字塔决策交易系统——海龟交易策略解读





辩论主题：

伟大的交易员是天生造就的，还是后天培养的？

目录

CONTENTS

01 海龟系统原理介绍

02 海龟交易策略的实现

03 海龟系统的疑问



公式测试系统 - 组合测试报告

[上传测评报告至策略共享中心](#)[测评选项设置](#)[对比其他策略](#)[重新刷新](#)[导出报告](#)[切换到简易报告](#)[背景品种](#)[测评报告使用说明](#)

策略分析

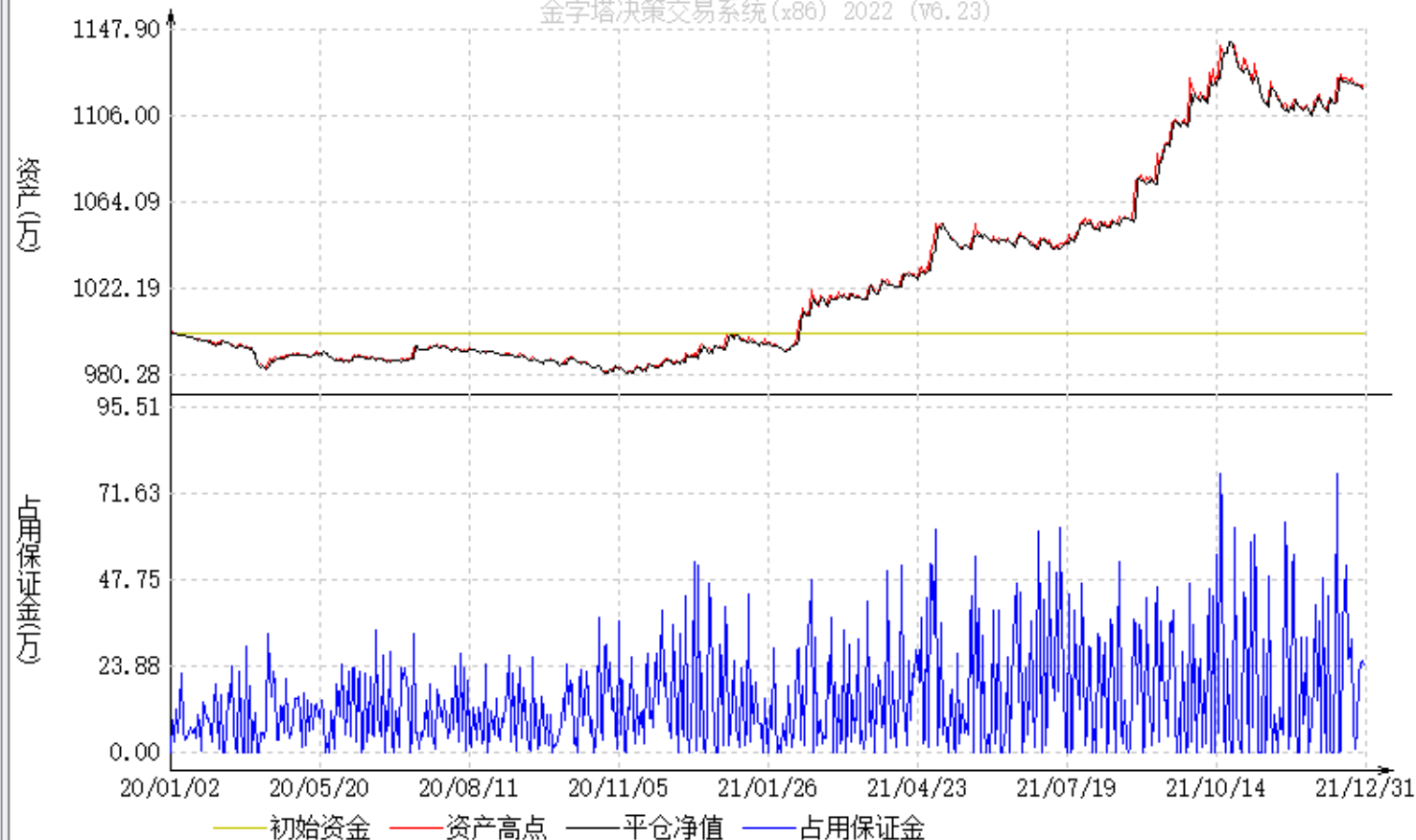
[总体概要](#)[收益风险分析](#)[时间仓位分析](#)[资产曲线](#)[资产及水下\(回撤\)曲线](#)[资产升水及回撤曲线](#)[资产升水及回撤幅度曲线](#)

交易分析

[交易明细](#)[交易总体分析](#)[连续盈亏分析](#)[离群交易](#)[最大浮盈浮亏](#)[平仓收益曲线](#)[平仓收益曲线及回撤](#)[多头平仓收益及回撤](#)[空头平仓收益及回撤](#)[平仓盈亏散点图](#)[有效盈亏率散点图](#)[平仓盈亏分布图](#)[最大浮盈散点图](#)[最大浮盈 - 平仓盈亏柱形图](#)[最大浮盈 - 平仓盈亏散点图](#)[最大浮亏散点图](#)[最大浮亏 - 平仓盈亏柱形图](#)

资产曲线

金字塔决策交易系统(x86) 2022 (v6.23)



01

海龟系统原理介绍

开仓条件：突破短周期**20**上轨，建立多仓。头寸是一个**海龟单位**。

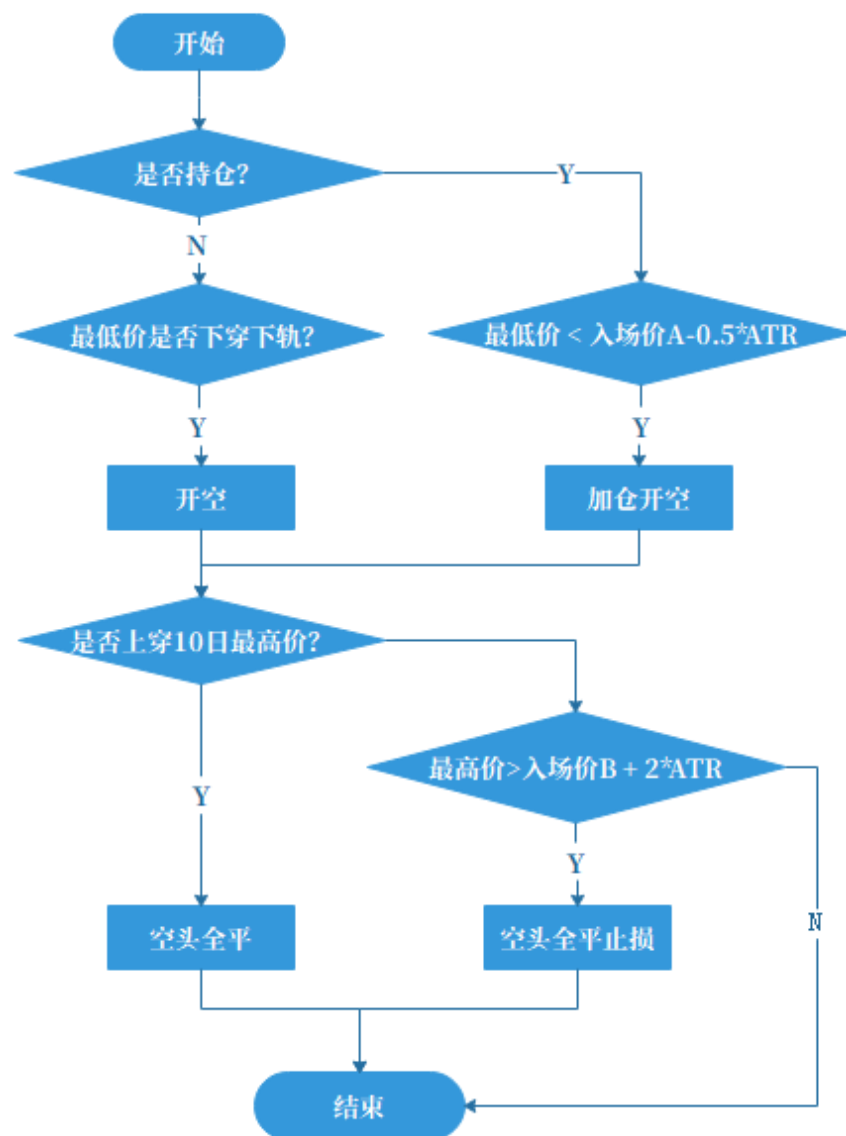
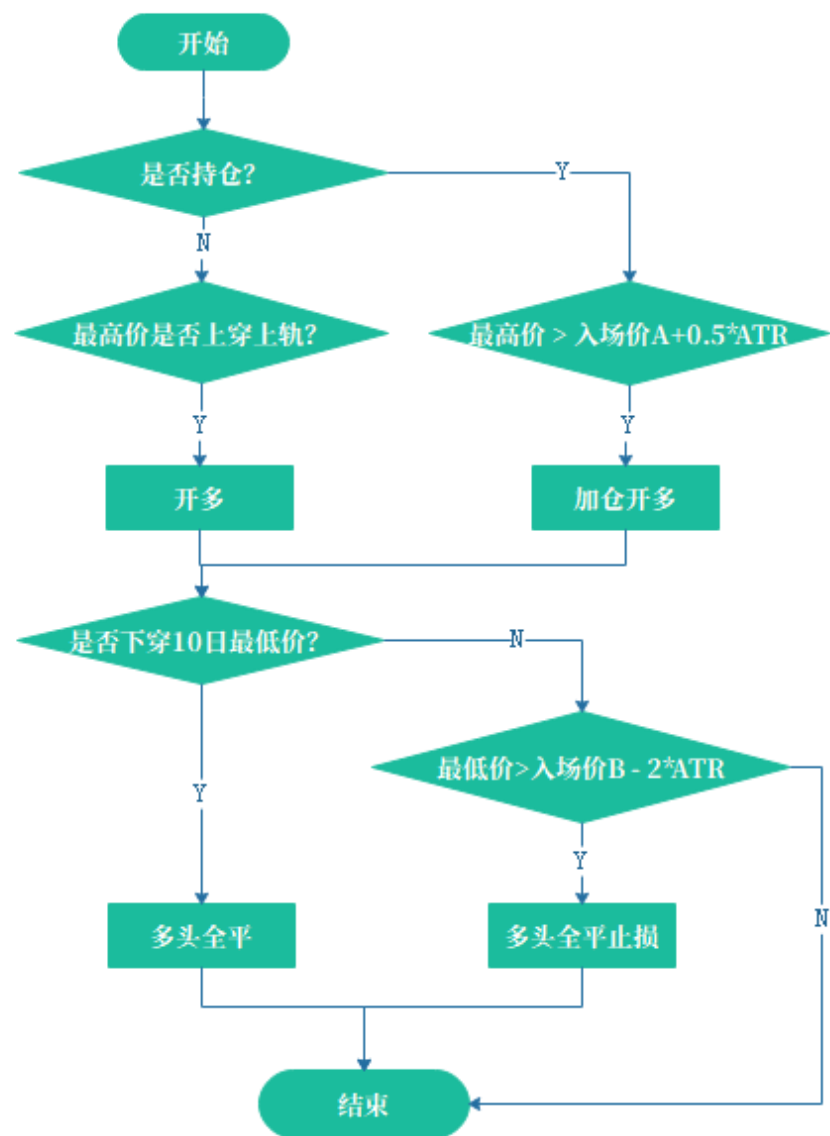
突破短周期**20**下轨，建立空仓。

网格加仓：网格间距为**0.5倍ATR**

止损条件：价格回撤距离最后一次加仓**2倍ATR**，全平止损。

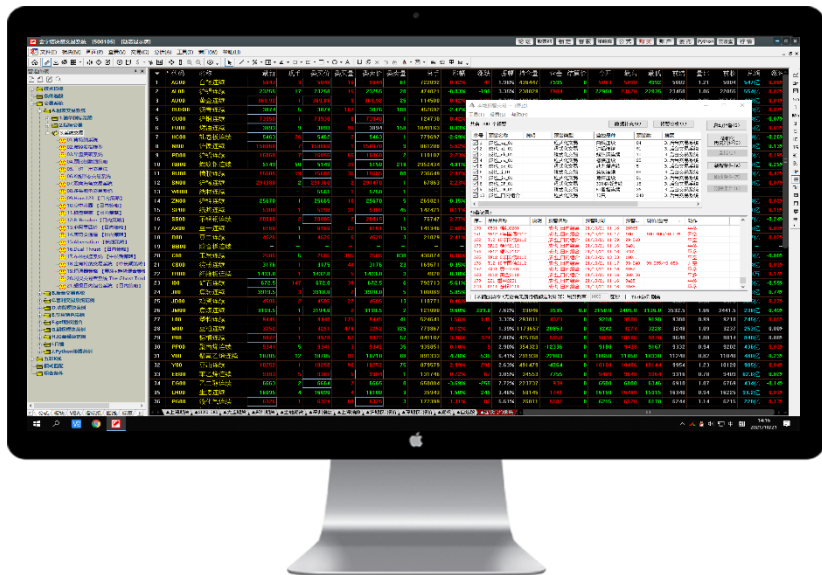
平仓条件：回撤**平仓通道**。

特殊：如果上次平仓是**突破平仓出场**，那么下次开仓使用长周期**55**轨道作为开仓条件



02

海龟交易的具体实现



☑ 头寸管理

☑ 开仓条件

☑ 资金管理---加仓模块

☑ 风险管理---止损平仓

☑ 离场条件

一个海龟单位=账户资产的1% / (ATR*1张合约波动一个单位的价值)

//计算ATR的值

```
TR1 := MAX(MAX((HIGH-LOW), ABS(REF(CLOSE, 1)-HIGH)), ABS(REF(CLOSE, 1)-LOW)); //真实波幅  
ATR := MA(TR1, N); //波幅的N日指数移动平均，一般为20日价格波动的平均范围
```

TR是真实波幅，是单个**K**线上的真实波动量：

TR等于“最高价-最低价”和“最高价-昨收”和“昨收-最低价”，这**3**个值的最大值。

ATR是一个简单有效，且非常实用的波动率度量指标。

一个海龟单位=账户资产的1% / (ATR*1张合约波动一个单位的价值)

//计算头寸

TC:=(账户资产*0.01) / (ATR*Multiplier);

TurtleUnits:=MAX(Round(ABS(TC)),1); //对小数取整

Multiplier 品种的合约乘数

Round 四舍五入取整

海龟的入场规则——唐安奇通道 (20和55周期)



海龟通过使用唐奇安通道，拥有明确的入场条件：

在向上突破**20日**（或**55日**）最高点的下一刻买入开仓，
在向下突破**20日**（或**55日**）最低点的下一刻卖出开仓。

//开多条件：突破短周期20上轨

If High>H20 and BARPOS>20 and holding=0 then

begin

MyEnterprice:=IF(Open>H20+mindiff, Open, H20+mindiff); //开盘跳空处理

Buy(1, TurtleUnits,Limitr, MyEnterprice);

PreEnterprice:=MyEnterprice; //记录上一次开仓价，加仓判断用

KCATR:=ATR; //开多仓后，记录第一次开仓时的ATR值

JCSwitch:=1; //开多仓后，加仓开关开启

end

//突破**短周期20**下轨，开空

If Low<L20 and BARPOS>20 and holding=0 then

begin

MyEnterprice:=IF(Open<L20-mindiff, Open, L20-mindiff); //开盘跳空处理

Buyshort(1, TurtleUnits,Limitr, MyEnterprice);

PreEnterprice:=MyEnterprice; //记录开仓价

KCATR:=ATR; //开空仓后，记录开仓时的**ATR**值

JKCSwitch:=1; //开多仓后，加空仓开关开启

end

//第一次加仓:

If High > =PreEnterprice+0.5*KCATR and JCSwitch=1 then

begin

MyEnterprice:=IF(Open>PreEnterprice+0.5*KCATR, Open, PreEnterprice+0.5*KCATR);

Buy(1, TurtleUnits,Limitr, MyEnterprice);

PreEnterprice:=MyEnterprice; //记录上一次开仓价

JCSwitch:=2; //加一次仓后，允许加第二次仓

end

//第二次加仓:

If High \geq PreEnterprice+0.5*KCATR and JCSwitch=2 and ~~enterbars~~ \geq 1 then

begin

MyEnterprice:=IF(Open \geq PreEnterprice+0.5*KCATR, Open, PreEnterprice+0.5*KCATR);

Buy(1, TurtleUnits,Limitr, MyEnterprice);

PreEnterprice:=MyEnterprice; //记录上一次开仓价

JCSwitch:=3; //第二次加仓后, 允许第三次加仓

end

//第三次加仓:

If High \geq PreEnterprice+0.5*KCATR and JCSwitch=3 then

begin

MyEnterprice:=IF(Open>PreEnterprice+0.5*KCATR, Open, PreEnterprice+0.5*KCATR);

Buy(1, TurtleUnits,Limitr, MyEnterprice);

PreEnterprice:=MyEnterprice; //记录上一次开仓价

JCSwitch:=0; //第三次加仓后, 关闭加仓开关

end

//止损条件：开多仓入场价减去**2倍ATR**以下，全平止损

If Low<= PreEnterprice-2*KCATR and enterbars>1 and holding>0 then

begin

MyExitprice:=IF(Open<PreEnterprice-2*KCATR, Open, PreEnterprice-2*KCATR);

sell(1, holding,Limitr, MyExitprice);

JCSwitch:=0; //止损后，关闭加仓开关

end

//平仓条件：向下突破10日最低价，全平离场

```
H10:=REF(HHV(HIGH,10),1); //离场轨道  
L10:=REF(LLV(LOW,10),1); //离场轨道
```

//平仓条件：向下突破10日最低价，全平离场，打开长周期进场开关

```
If Low<L10 and enterbars>1 and holding>0 then  
begin  
    MyExitprice:=IF(Open<L10-MINDIFF,Open,L10-MINDIFF);  
    sell(1,holding,Limitr,MyExitprice);  
    JCSwitch:=0; //平仓后，关闭加仓开关  
    LongSwitch:=1; //打开长周期进场开关  
end
```

//开多条件：突破长周期55上轨-----**High>长周期上轨 and 持仓=0**

If High>H55 and BARPOS>55 and holding=0 and LongSwitch=1 then

begin

MyEnterprice:=IF(Open>H55+mindiff, Open, H55+mindiff);

Buy(, TurtleUnits,Limitr, MyEnterprice);

PreEnterprice:=MyEnterprice; //记录上一次开仓价，加仓判断用

KCATR:=ATR; //开多仓后，记录第一次开仓时的ATR值

JCSwitch:=1; //开多仓后，加仓开关开启

end

03

海龟系统的常见疑问

(1) 资金量少：如何选品种&调整头寸

一个海龟单位=账户资产的**0.5%** / (**ATR*1张合约波动一个单位的价值**)

100万 合约手数:(100万*0.005) / (ATR*Multiplier);

上期所：螺纹钢**5**手 燃油**4**手 纸浆**4**手 黄金**2**手 铜**1**手

大商所：玉米**13**手 液化气**2**手 豆油**2**手 矿石**2**手 焦煤**1**手

郑商所：甲醇**8**手 玻璃**6**手 纯碱**3**手 棉花**2**手

中金所：**10**年国债**2**手

(2) 入场开仓：唐奇安通道突破、均线突破

(3) 离场平仓：用追踪止盈还是原始离场条件

THANKS



谢 谢 聆 听

投资有风险 入市需谨慎