

滴水对冲 EA

前言:

货币对冲一直是策略研究的重点领域，如何做到最科学的对冲方式，这直接影响着策略的盈利能力和稳定性。



(2016.8.1-2017.8.28 黄金与美日走势比较)

对冲品种的选择:

滴水对冲 EA 只交易美日和黄金，美元与黄金长期来看是呈现负相关走势。日元与黄金因为同具避险属性，所以一定程度上呈现正相关走势。

这个关系中，美日应与黄金呈现相背的走势。

黄金涨，美日跌。黄金跌，美日涨。

大周期来看，这个关系吻合度达到 90% 以上。

品种	性质	稳定期关系	地缘政治期关系
日元	避险货币	与黄金相同	与黄金相同
美元	避险货币	与相反	与黄金相同
黄金	避险货币	与日元相同 与美元相反	与日元相同 与美元相同

方向的选择:

短线来看，黄金的变化要比美日要快，大行情和突发行情往往由黄金主导。

在稳定期关系，以黄金为主要方向，往往利用短线波动黄金较快出场。

在地缘政治紧张期关系，以黄金为主要方向，能够更好的抓住此类突发行情。

所以一段趋势内，只会有一个方向的订单。

日

周

月份

自定义

XAUUSD, buy 0.20 1286.38 → 1287.71	2017.08.21 09:30:02 26.60
USDJPY, buy 0.26 109.067 → 108.812	2017.08.21 12:10:04 -60.93
XAUUSD, buy 0.20 1287.74 → 1291.86	2017.08.21 12:10:04 82.40
USDJPY, buy 0.26 108.910 → 108.991	2017.08.21 16:40:19 19.32
XAUUSD, buy 0.20 1291.23 → 1291.37	2017.08.21 16:40:19 2.80
USDJPY, buy 0.26 109.000 → 109.091	2017.08.21 23:30:58 21.69
XAUUSD, buy 0.20 1291.53 → 1290.87	2017.08.21 23:30:58 -13.20
USDJPY, buy 0.26 109.205 → 109.330	2017.08.22 03:08:24 29.73
XAUUSD, buy 0.20 1290.13 → 1287.17	2017.08.22 03:08:25 -59.20
USDJPY, buy 0.39 109.306 → 109.331	2017.08.22 09:36:47 8.92
XAUUSD, buy 0.30 1286.11 → 1287.17	2017.08.22 09:36:48 31.80
USDJPY, buy 0.26 109.254 → 109.307	2017.08.22 16:24:30 12.61
XAUUSD, buy 0.20	2017.08.22 16:24:31



行情



图表



交易



历史



设置

仓位比例的确定:

美日和黄金的每天波动的点数是不一样的, 黄金的波动值整体要比美日的波动值较大。这个时候我们用量能公式确定美日和黄金的一段时间内的波动比例, 这样可以计算出下 1 手黄金, 相应的需要下多少手美日。

USDJPY/XAUUSD
USDJPY的里能为:0.75
XAUUSD的里能为:1.04
当前2货币量能指数:1.38

(上图表示, 下 1 手黄金, 需要下 1.38 手美日)

计算出的量能指数将是个变量, 会根据黄金和美日的量能, 来自适应的变化仓位参数。

入场时机的确定:

黄金和美日波动的快慢, 我们用波动率来统计。

黄金和美日波动的速率比较, 我们用偏离率来衡量。

偏离率等于 0, 代表黄金与美日亦步亦趋, 一步不离。

偏离率 > 0.4, 代表黄金相对于日元, 要涨的快。

偏离率 < -0.4, 代表黄金相对于日元, 要跌的快。

USDJPY/XAUUSD
USDJPY的波动率为:0.43
XAUUSD的波动率为:-0.07
当前2货币偏离指数: 0.36

品种/类型	偏离率 > 0.4	偏离率 < -0.4	-0.4 < 偏离率 < 0.4
多单	入场		出场条件之一
空单		入场	出场条件之一

各类行情的适用率:

行情分类	匹配度	仓位预计
美日主导的趋势	60%	3 组订单
黄金主导的趋势	100%	1 组订单
窄幅震荡	100%	1 组订单
宽幅震荡	80%	2 组订单

风控机制和仓位选择:

滴水对冲 EA 属于对冲类 EA, 所以无法设置每一单的止损。不过我们并不会抛弃风控体制, 在参数设置时, 我们加入了综合止损, 根据我们的预期收益, 综合止损可设置为 10% 或 20%。

并且最多加仓次数为 2 次, 即有且同时存在 3 组对冲订单, 加仓比例为 1.5。

账户资金	仓位	最大回撤	预期收益
1 万美金	0.2	20%	8%/月
5000 美金	0.1	20%	8%/月
3000 美金	0.06	20%	8%/月
1000 美金	0.02	20%	8%/月

联系方式:

优交易官网: yufu110.com

优交易官方微信号: [utrader](#) (优交易金融)

技术指导微信: [Lion4787](#)