

《程序化交易:策略开发与应用》

图书基本信息

书名：《程序化交易:策略开发与应用》

13位ISBN编号：9787513635250

出版时间：2015-3

作者：深圳开拓者科技有限公司

页数：443

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.com

《程序化交易:策略开发与应用》

内容概要

全书分为上、下两篇。上篇以交易开拓者（TB）软件为例，从软件的操作使用和交易系统构建两个方面进行深入细致的解析，介绍了：软件的使用准备，普通交易者、程序化交易者、套利交易者使用软件的方法，TB公式语法基础，用户函数和公式应用的编写，测试和评估以及部分常用公式的分析。下篇是大量实盘策略的示例，对策略的逻辑一一详细分析。不仅有源代码及注释，还有对策略的点评。此外，将各项测试评估指标的计算公式、函数速查等内容列为附录。

书籍目录

- 第一章 软件介绍与使用准备 1
 - 一、TB软件介绍 1
 - 二、使用准备 4
 - 三、软件主要界面 10
- 第二章 使用TB软件——普通交易者 13
 - 一、使用交易师 13
 - 二、使用批量下单 17
 - 三、使用快捷操作 20
- 第三章 使用TB软件——程序自动化交易者 24
 - 一、单个合约应用公式 24
 - 二、商品委托映射应用 26
 - 三、监控器 30
 - 四、交易助手 32
- 第四章 使用TB软件——套利交易者 36
 - 一、使用套金宝 36
 - 二、使用价差下单 39
- 第五章 TB公式——初识公式 41
 - 一、TradeBlazer公式体系（简称TB公式）简介 41
 - 二、新建公式 41
 - 三、公式加密 47
 - 四、公式的导入与导出 47
- 第六章 TB公式——语法基础（一） 52
 - 一、TB编码 52
 - 二、语言基础 53
- 第七章 TB公式——语法基础（二） 65
 - 一、分支语句 65
 - 二、循环语句 70
- 第八章 TB公式——用户函数 76
 - 一、什么是用户函数 76
 - 二、用户函数的类型 76
 - 三、TB软件中用户函数使用规则： 77
 - 四、函数的编写 77
 - 五、用户函数的调用 78
- 第九章 TB公式——公式应用 81
 - 一、技术分析类 81
 - 二、交易策略类 88
- 第十章 TB公式——测试与评估 98
 - 一、TB平台策略回测模式 98
 - 二、测试报告详细解读 105
- 第十一章 TB公式——公式进阶（一） 110
 - 案例一：止盈止损 110
 - 案例二：跟踪止损 112
 - 案例三：加仓减仓 115
 - 案例四：多品种交易 117
 - 案例五：收盘平仓 118
- 第十二章 TB公式——公式进阶（二） 120
 - 案例一：集合竞价数据过滤 120

《程序化交易:策略开发与应用》

- 案例二：A函数下单、撤单以及全局变量操作 122
- 案例三：跨周期、数据库读写 125
- 案例四：平仓延迟反手 128
- 下篇实盘策略集锦 131
- 基于均线交叉与通道突破相结合的交易系统（Moving Average Cross Over） 132
- 基于均线和K线形态的高低点突破系统（Escalator Trading System） 138
- 基于置换均线的二次穿越突破系统（Double Your Fun） 141
- 基于加权价的支撑阻力线突破系统（Red Rover） 146
- 基于市场强弱指标和动量的通道突破系统（Superman） 149
- 基于商品价差的通道突破系统（Spread Channel Breakout） 154
- 基于凯特纳通道的交易系统（Keltner Channel） 157
- 基于平移布林通道的系统（Displaced Boll） 161
- 基于平移的高低点均值通道与K线中值突破的系统（Average Channel Range Leader） 164
- 基于平移通道的交易系统（No Hurry System） 167
- 基于用波动加权后的WOBV的交易系统（OBV Revisited） 169
- 基于开收盘价格间的相对关系变化进行判断的交易系统（Open—Close Histogram） 173
- 基于指数移动均线交易系统（Three Exponential Moving Average Crossover Trade System）
- 基于初始交易范围突破交易系统（Trading Range Breakout） 179
- 基于价格通道突破交易系统（Going in Style） 183
- 基于价格与均线的相关差交易系统（Reference Deviation System） 186
- 基于均线的阻力线支撑线交易系统（Moving Average Support / Resistance） 188
- 基于均线与动能的交易系统（Swinger） 194
- 基于DMI中ADX的震荡交易系统（Traffic Jam） 197
- 基于收盘价与之前k线高低进行打分的交易系统（Trend Score） 205
- 基于k线建立箱体基于突破进行系统交易（In the Zone） 210
- 四均线交易系统（Four Set of MA Crossover System） 216
- 基于ADX及EMA的交易系统（ADX and MA Channel System） 219
- 基于MACD判断的交易系统（First Pull Back System） 228
- 成交量加权动量交易系统（Volume Weighted Momentum System） 233
- 基于价格区间突破的交易系统（Jail Break System） 235
- 金肯特纳交易策略（King Keltner） 238
- 布林强盗交易策略（BollingerBandit） 240
- 动态突破交易策略（Dynamic Break Out） 243
- 幽灵交易者交易策略（Ghost Trader） 246
- 恒温器交易策略（Thermostat） 250
- （附录） 257
- 附录一：计算公式 257
- 交易策略性能测试报告 257
- 交易策略参数优化报告 258
- 附录二：函数速查手册 260

《程序化交易:策略开发与应用》

精彩短评

- 1、 软件使用手册
- 2、 期货
- 3、 手册性质
- 4、 完全就是把论坛上的东西复制打印出来卖。

《程序化交易:策略开发与应用》

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:www.tushu111.com