

艾琳心法

抓住大波段的奥秘

艾琳歆于 2010 年 6 月开帖，8 月开始使用一个一致化的简单系统操作，至 2011 年 6 月，盈利 200% 左右。现将其系统试用文字表述如下（个人认为所有人的系统均应如此表述出来，部分内容可以缺项）。

一、策略（系统之君）

- 1、操作对象：股指期货主力合约
- 2、操作周期：日内
- 3、操作目标：抓大放小，力争抓住所有日内单边行情（发生概率约 33%），过滤掉震荡行情，实现帐户权益稳定增长。

二、规则（系统之帅）

- 1、开仓：每天最多两次。首仓于上午 10 时至 10 时 30 分之间开仓，方向为当日有较大可能发生单边行情的方向，仓位 50%（从一手发展至 4 手）。如首仓失利，第二仓于 11 时至下午 1 时 30 分开仓，内容同上。
- 2、止损：每日每手不超过 20 点，一般为 10 点止损。如获利超过 10 点，则将止损位置移至开仓位（即平推）。
- 3、持仓：无增减仓位、无轮动。
- 4、止盈：无

5、平仓：下午 3 时至收盘的 15 分钟内，以所能选择的最佳 1 分 K 线平仓。

三、技术（系统之将）

1、首仓方向和点位选择：

先分析周线、日线级别趋势，以日线级别顺势操作为主，在关键支撑阻力位置或顺势涨跌幅度过大时逆势操作。初步选定方向后，观察开盘后 30 分至 40 分的多空竞争力度，如与自己初选方向的反向运动力度不大，就最终确定初选方向，并于 10 时至 10 时 30 分选择反方向关键 1 分 K 线（最好是开盘后的次高点或次低点）开仓。

2、次仓方向和点位选择：暂时没有看出来。基本是确认反向破位了即反手，反向运动无爆发力的话，走稳后按原方向开仓。

四、资金（系统之卒）

1、仓位管理：仓位不超过 50%，日最大损失不超过总金额的 1.5%。

2、复利操作：是

3、资金曲线管理：无。目前未发现因资金曲线回调而减少仓位或因资金曲线增长过快而减少操作的情况。

不管哪种模式下的收益我都不怀疑。因为期货是杠杆交易任何奇迹都有可能发生，如果遇到日内大行情翻倍都是有可能的，所以不讨论这个。

我也没统计过艾琳歆的胜率，但从资金回撤幅度上估算，一定是在 50% 以上。如果不算隔夜以外亏损，艾琳歆的资金回撤幅度应该不超过 10%，甚至不超过 5%。就按她自己所说 2010 年按月结算月月都是盈利的。

就这几个月的单月统计上来看，1 手盈利至少也在 6 万以上，也就是动用资金的 50% 以上，最多甚至达到 120%。

而按月结算没有资金回撤，这种资金曲线也许是最完美的！

既然是完美的资金收益曲线，那胜率上肯定是超出常人的。
(难道 状态不佳，就不会有连亏的时候？)

概率：“ 止损 38.7%，平推 19.5%，止盈 41.8% ”

假设这个是艾琳歆真实的胜率统计，那么平推 19.5% 必须算做正确的单子。“胜率”这个词可能在平推的问题上有争议，那就用“判断方向”这个词好了，平推的单子第一时间在方向上的判断是正确的，只是利润被回吐而已，但不伤害本金。

如果说“平推”不算胜率，胜率也不重要。

举几个例子，用几个整数百分比推断（手续费忽略不计）：

一 止损 40% 平推 20% 止盈 40% (赔率 1: 1 打平 赔率 1: 2 盈利)

二 止损 50% 平推 25% 止盈 25% (赔率 1: 2 打平 赔率 1: 3 盈利)

三 止损 60% 平推 20% 止盈 20% (赔率 1: 3 打平 赔率 1: 4 盈利)

四 止损 60% 平推 25% 止盈 15% (赔率 1: 4 打平 赔率 1: 5 盈利)

五 止损 75% 平推 10% 止盈 15% (赔率 1: 5 打平 赔率 1: 6 盈利)

第一种情况下 稳赚不赔!

第二种情况下保本

第三种情况下亏损

第四种情况下暴仓

第五种情况下 衰神 (这个大多数人应该达不到! 但也不是不可能! 但第二、三、四种情况应该是大多数人的业绩, 算上平推胜率都是在 40% 以上这个也比较贴近大多数人的真实胜率水平!)

(赔率越高, 胜率也就越低, 赔率和胜率成反比, 也就是说抓到的 1: 6 大行情的概率要比 1: 2 小行情的概率低得多!) (注: 胜率和盈亏比属于鱼和熊掌不可兼得的, 我们需要在两者之间寻找到一个适合自己的平衡点。)

40% 的“方向判断准确率”应该大多数人都能做到!

但平推+止盈=60%+的“方向判断准确率”应该大多数人都做不到!

交易, 唯一的追求就是价差。

这本质跟菜场卖菜的阿姨做的事情是一样的。

一件简单的事情，为什么非要搞得那么复杂，你非要过着苦行僧的生活？

未来的行情谁也无法预测，你唯一用到的东西就是规则，一致性的交易规则，它让你站在这场概率游戏的大数一侧。

什么思想，什么理念，什么哲学，那些是分析师用过糊弄交易者的语录罢了。

真正的交易者，只关心两件事：1、我开仓后行情证明我对了怎么办；2、我开仓后行情证明我错了怎么办；

盈利不是靠你预测行情的胜率来获取的，而是依赖“你做错的时候你尽可能少亏，你做对的时候你尽可能多赚”，这就是 trader（交易者）和分析师的最大差别。

##开仓后行情证明正确，持单，若获利超过 10 点，止损平推。##

##开仓后行情证明错了，10 个点止损走人。##

什么时候大盘方向明朗？任何时候都不明朗。

任何时候的行情都是拿自己的筹码赌出来的，ww w.x
iarj.com 尽管很多朋友从来不认为自己在赌，如果当你的筹码是有利的时，你就要尽可能让贪婪的欲望放大，否则，你承担了巨大的风险却得不到同样巨大的利润。

只有收盘后才知道是震荡或单边，交易中如果要去考虑这些问题，很多时候会让自己不知所措。

不符合我的行情的时候，我尽可能少亏，符合我的行情的时候我尽可能多赚，我从来不奢望任何行情都能赚到钱。

有时候交易事实就是在赌博，用确定代价赌不确定的利润，谁也不知道明天会怎么走，只不过当致命的风险远离的时候，未来值得一睹。

没有特别的心情，我的交易非常简单：主观经验式的开仓+控制交易次数，然后就是持有盈利单，没有太多技术性的理论。

任何时候，持有盈利单都是最安全的交易行为。

你可以控制亏损，但无法决定盈利，盈利需要行情，有时候还需要点运气。

看了大家的讨论，我不知道该说什么，其实从技术角度来说，我的交易简单到幼稚，没有大家想的那么复杂。如果我有什么做得很好的地方，那可能就是我知道什么时候该休息，并且我一定会这么做，比如现在，我最应该做的事情就是关掉电脑出去逛

街，而不是企图把亏损的部分赚回来。

任何开仓都逃离不了时间积累的经验辅助，独立客观的开仓信号根本就不存在。（80%的规则+20%的灵活）

我从来就不认为开仓在交易中占据多大的作用，只有追求微利的炒单才追求开仓，波段交易过于注重开仓会得不偿失，会损失更多的机会。

交易是一件经常自相矛盾的事情，所以基于逻辑上追求的对错并不一定会有预期的结果。

这个世界上最白痴的人就是那种自以为发现了别人不能发现的真相的人，想想也挺可怜的。

自我感觉距离“真相”越近，其实真相距离自己越来越远。

我从来不奢望平在最高或者最低点。

没有人希望利润回撤，但这是交易的一部分，我已经很习惯了。

亏损一侧是自己可以控制的，盈利则需要行情的支持，不符合

自己行情的时候就尽量控制亏损，等待符合自己的行情狠赚一笔，没有别的办法，我从来不会追求完美的交易，我的结算周期是月，不是天，任何时候我都不会让自己陷入被动。

很多交易者的交易策略从短线来看是非常完美的，几天就可能翻倍，但缺乏可持续的盈利空间，我认识一个做上海做期货的，经常见到他跟我说今天又赚了百分之几十明天又赚了多少钱，可是一年后他的资金权益却没有见成长。

任何交易模式你都要考虑到这种策略放在一个比较长的周期内是不是能实现资金权益的增长，而不是拿孤立的几个交易日来支撑自己。

我也不知道怎么处理，我不会为特定的行情调整自己的方法，唯一的办法就是坚守自己的规则，管它行情怎么走，守住自己的底线。

并不是所有行情都应该盈利。

我一直没有找到特别好多止盈策略，所以只要盈利一般都是持有到收盘，但不代表这是最好的办法，只是目前我认为它最适合我。

唯一能做的就是坚守自己的底线和处理单子的一致性原则，盈利并不是自己能决定的，有时候需要运气，这就是交易的魅力所在。

持有的单子在原价被止损了，没有该不该，或者对不对，这就是交易，任何时候没有亏钱你就应该庆幸！退一步讲，这几天的震荡行情，如果我当初平掉后每天再做，结果不会比现在好多少。

一个交易做得很好的前辈说过，在任何时候只要不让资金走势出现大幅回撤，同时在自己的周期内敞开盈利，市场迟早会奖励你的，可能并不是在这一次。

很多人之所以在整体上无法实现资金的增加，其中一个关键就在于他无法承受浮盈的回撤，其实浮盈根本不是你的利润。

所谓一致性就是你在任何时候都按照自己的规则做，行情和外界对你毫无干扰，除非出现了规则内大幅度的亏损。

事后诸葛地多说一句，一致性的定义就是只要你坚持自己的，不被别人和行情所左右，市场就迟早会奖励的。

交易的世界里，本来就没有肯定和否定的事情。

一个成熟的交易者不会认为交易有独到的秘诀，即使最赚钱的交易策略也早就是公开的，烂大街的。

能抵御无时不在的诱惑而恪守自己的信仰是赢家和输家的唯一区别，其它的没有任何秘诀。

我有个朋友，她跟我学期货，跟我一起做单，我的交易策略全部告诉她，我开仓时她也跟，我的交易对她是完全透明的，但是一段时间下来她的账户接近暴仓。

因为她总是诱惑无处不在的行情里迷失自己，忍受不住策略里浮盈的回撤，忍不住想多空通吃。

这就是交易，不要总以为赚钱的人有什么独门秘籍关着门数钱，这个市场存在了上百年，任何可行或不可行的盈利方法早就被研究透的，你再也找不出任何哪怕一丁点前人没有探究到的东西，所以不要认为你有什么新发现，那更多时候是自我编织的陷阱。