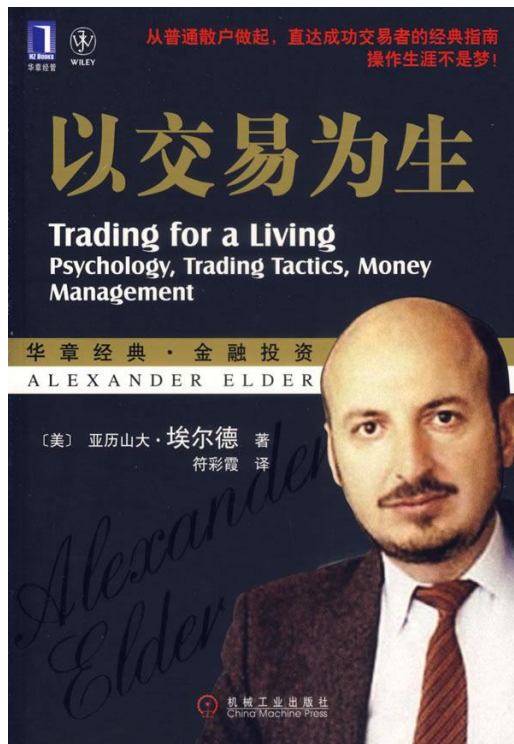




欢迎光临!

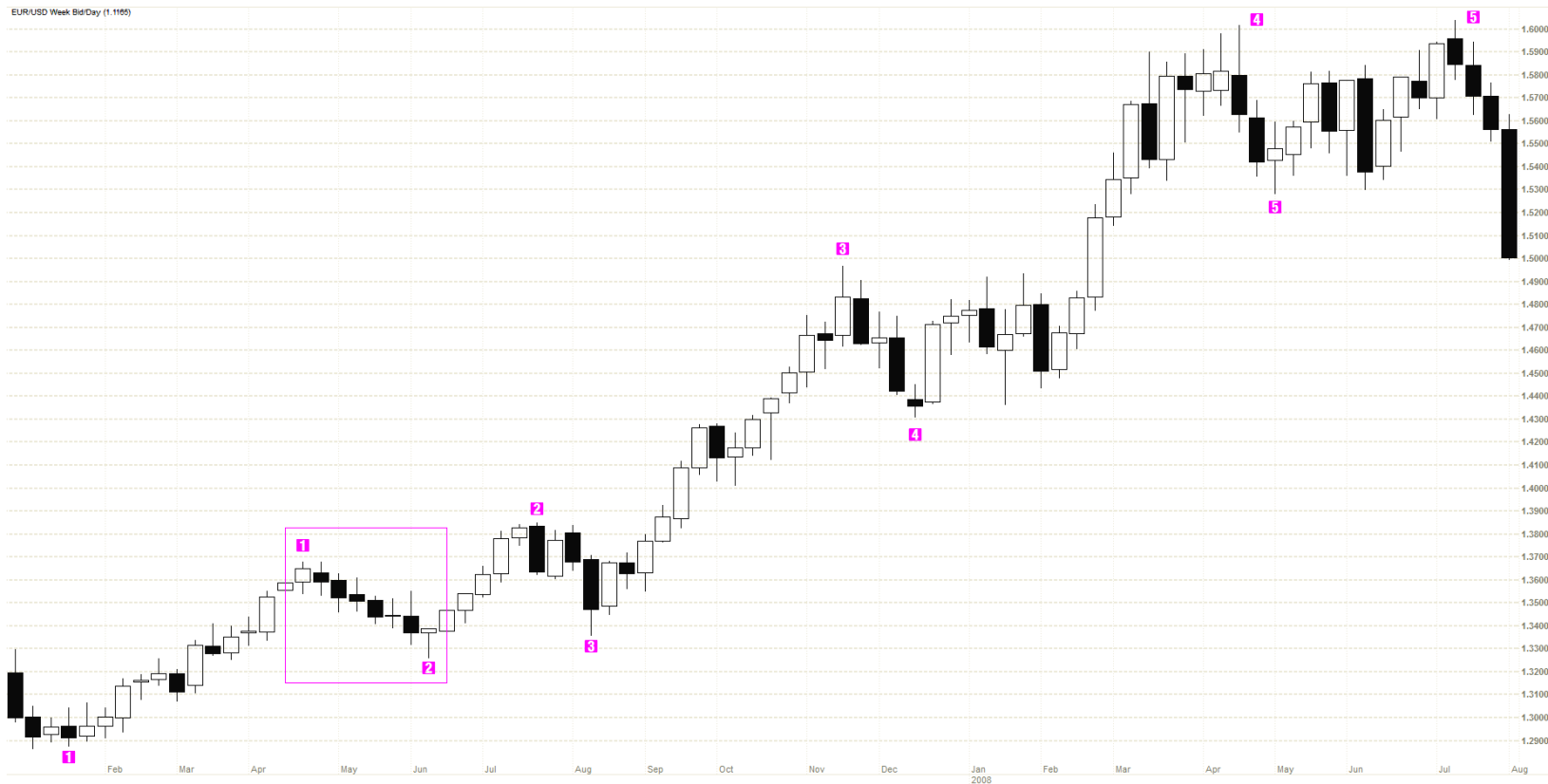
亚历山大·埃尔德 “三重滤网”交易策略



以交易为生。
交易心理，交易策略，资金管理。

- 1. 简要介绍交易策略创造者**
- 2. 不同时间段的趋势方向**
- 3. 技术指标信号冲突**
- 4. 交易策略规则**
 - a) 判断主要趋势方向**
 - b) 判断修正价格运动终结**
 - c) 入场规则**
 - d) 未结头寸管理技术、资金管理**
- 5. 实际操作范例**

第一个问题：趋势方向



不同时段存在不同方向的趋势



1. **趋势指标**: MA, Alligator, Ichimoku, Bollinger Bands, ADX
2. **振荡指标**: Stochastic, RSI, Momentum, CCI, MACD
3. **辅助指标**: Volume, ATR

技术指标信号冲突



- 主要趋势
- 次级趋势（过度趋势）
- 短期趋势

主要趨勢



次级趋势（过度趋势）



短期趨勢



长周期（比中周期大**4-5倍**）

中周期

短周期（比中周期小**4-5倍**）

月线图

周线图

日线图

周线图

日线图

4(6)小时图

1小时

10(15)分钟

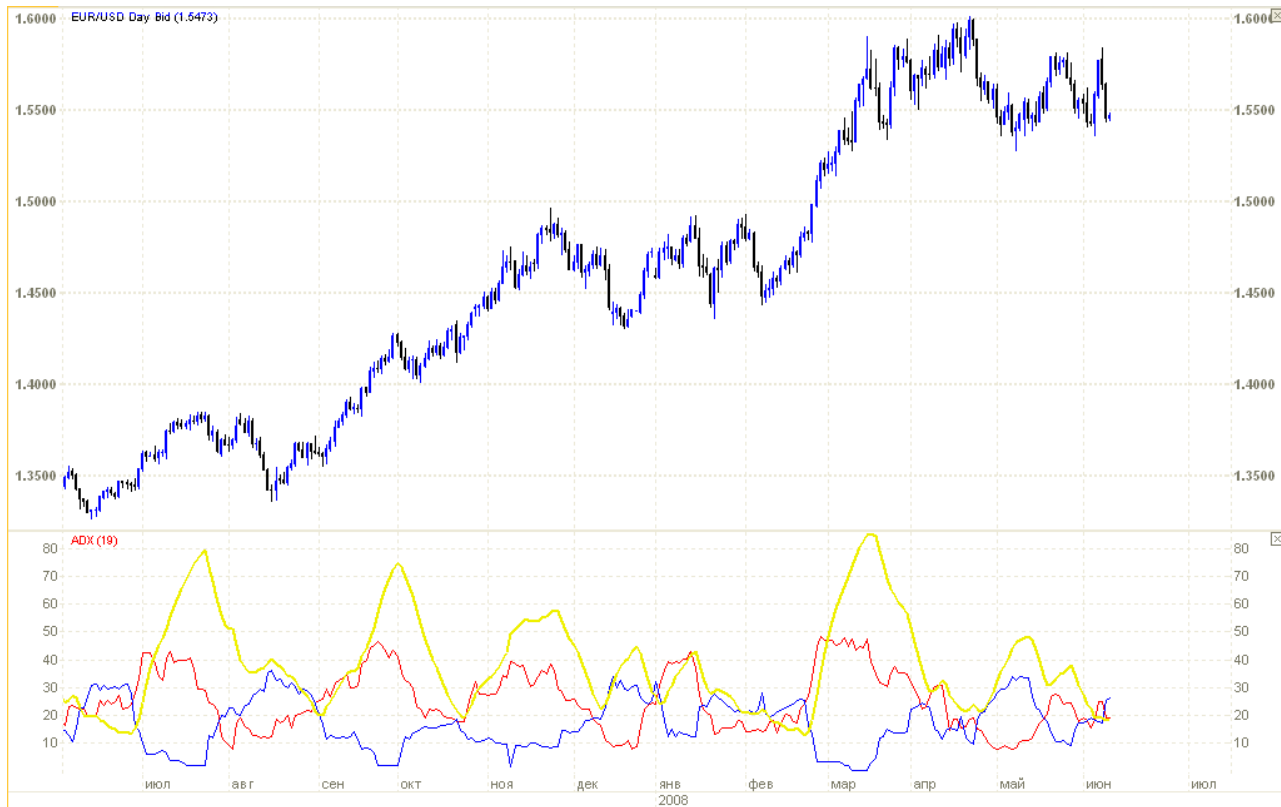
2(3)分钟

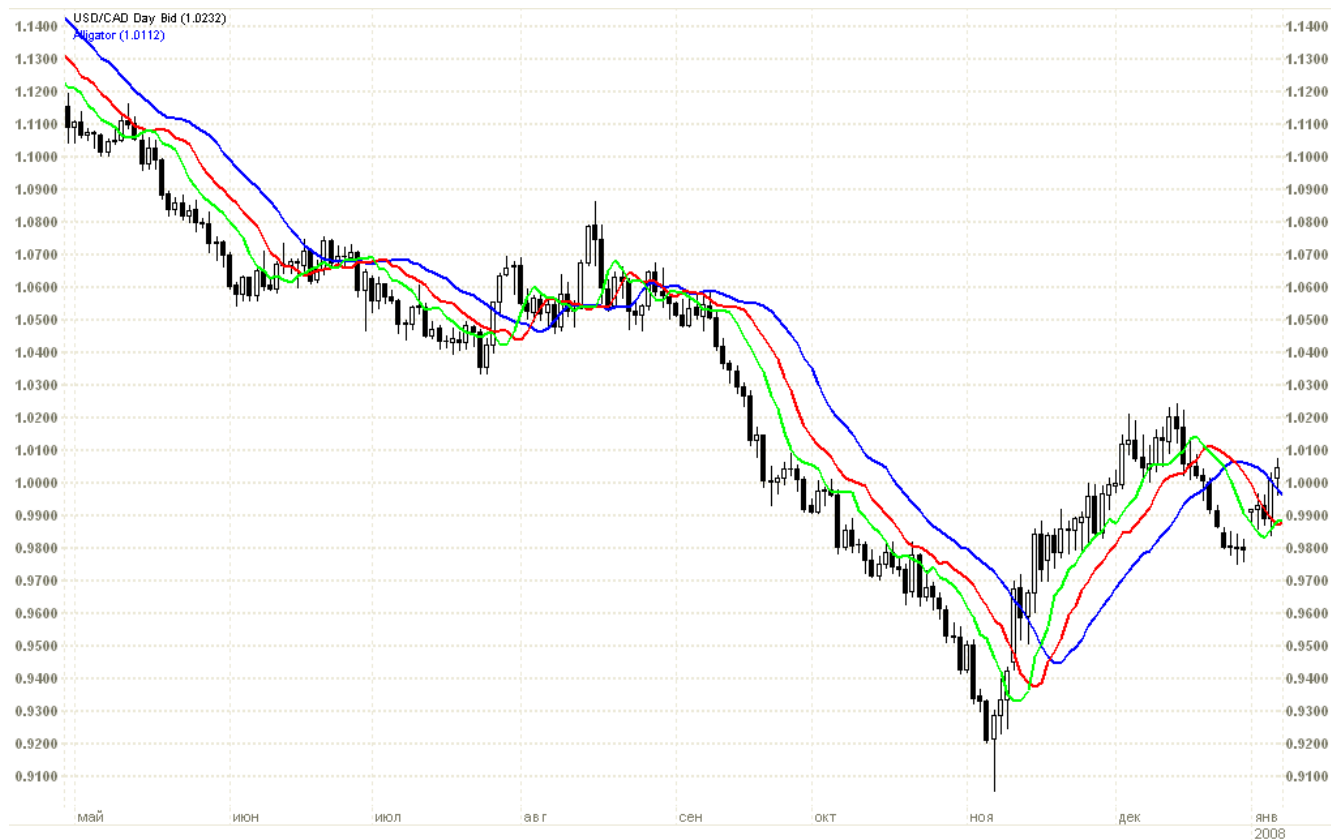
判断长周期趋势方向

移动平均线 (MA)

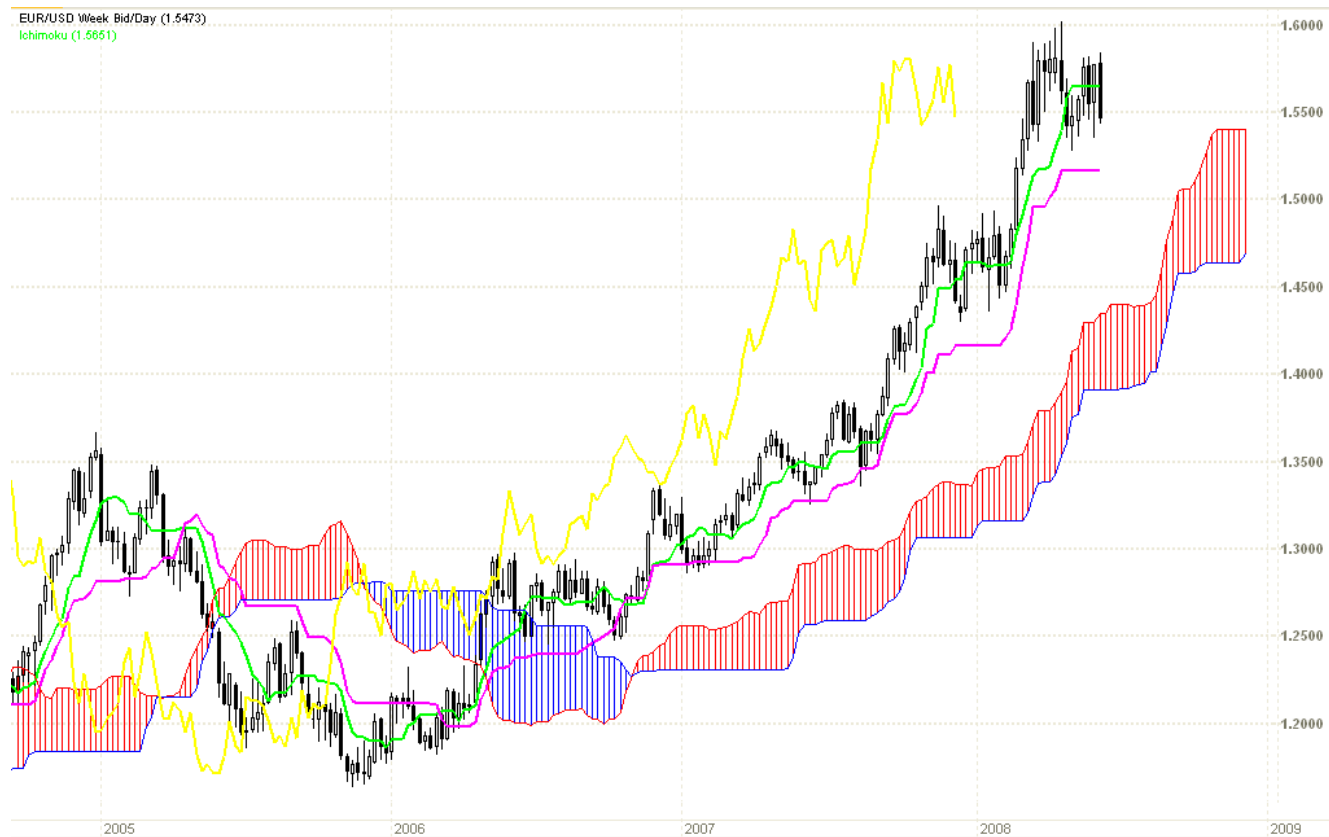


ADX 指标

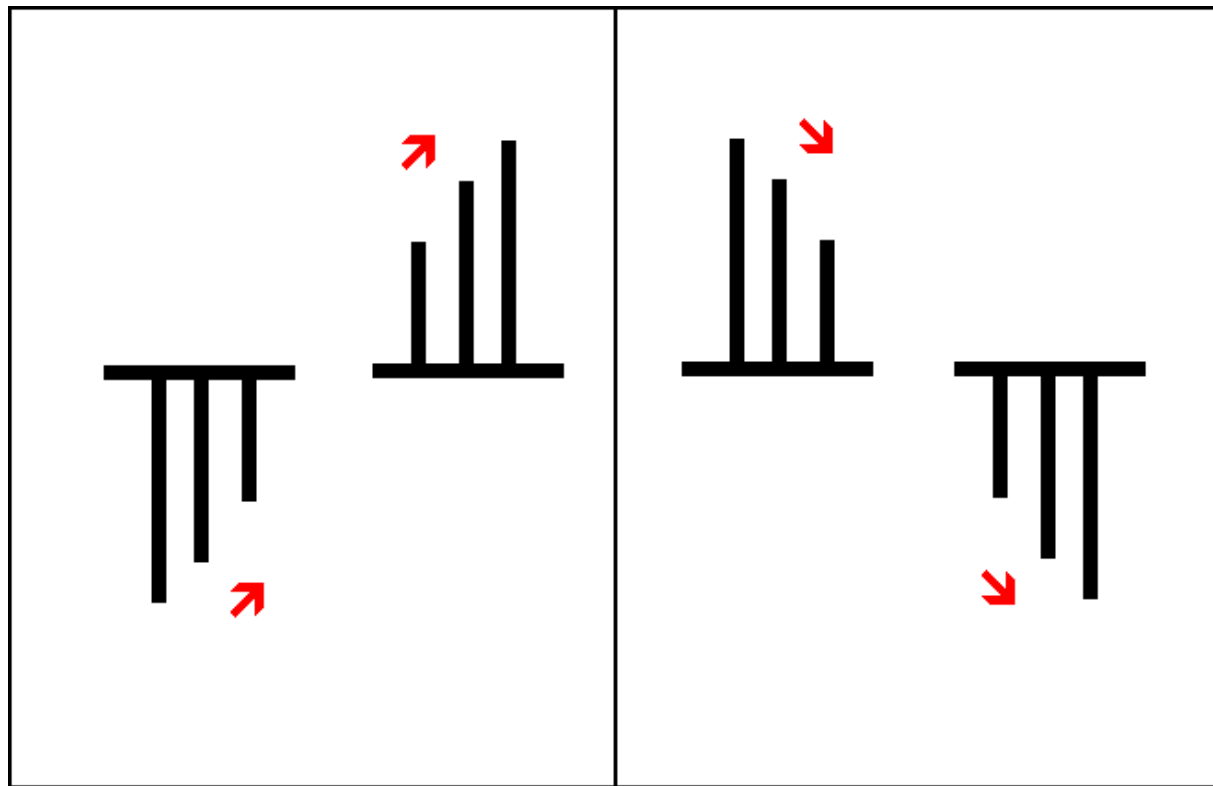




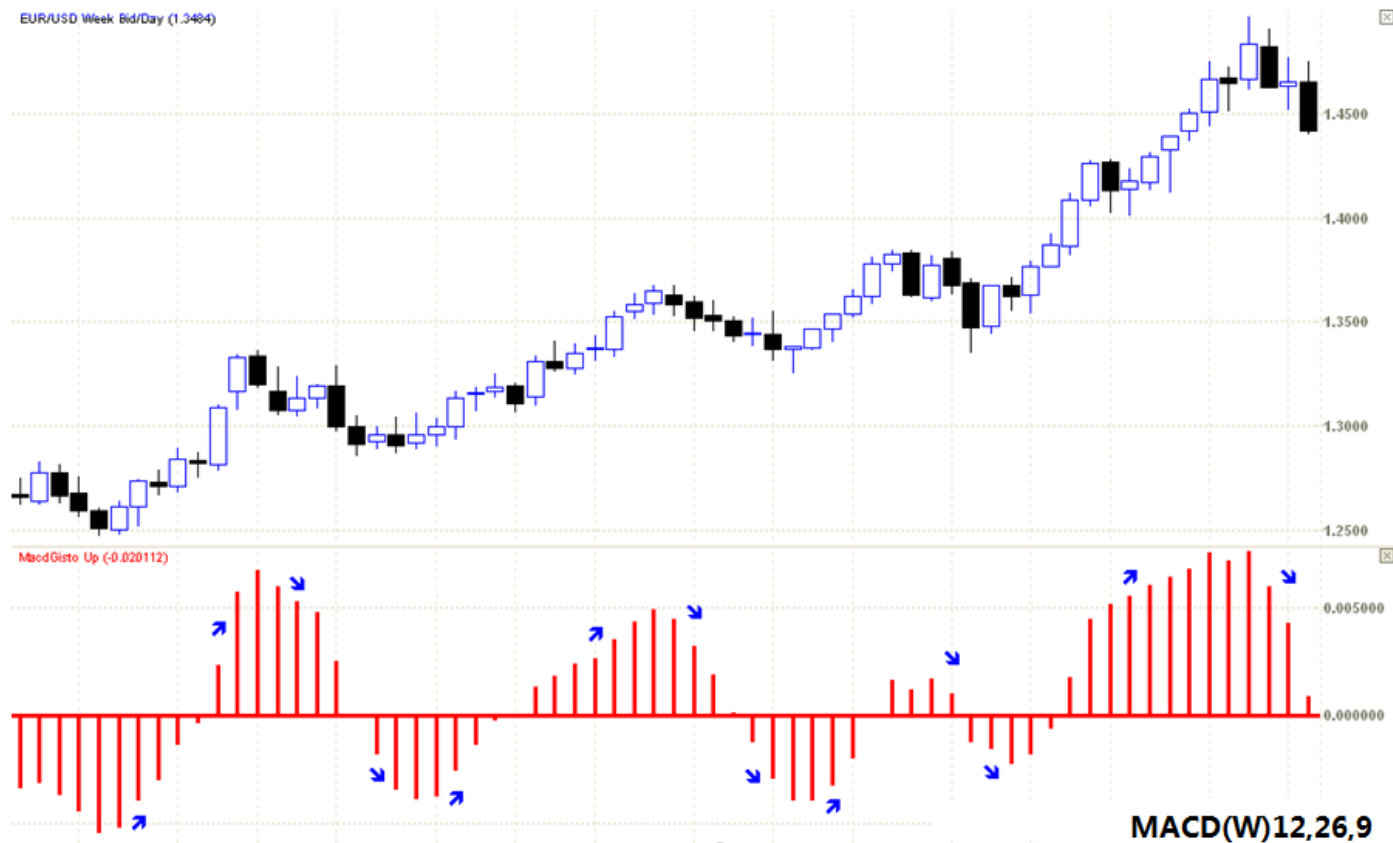
云图指标（一目均衡图）



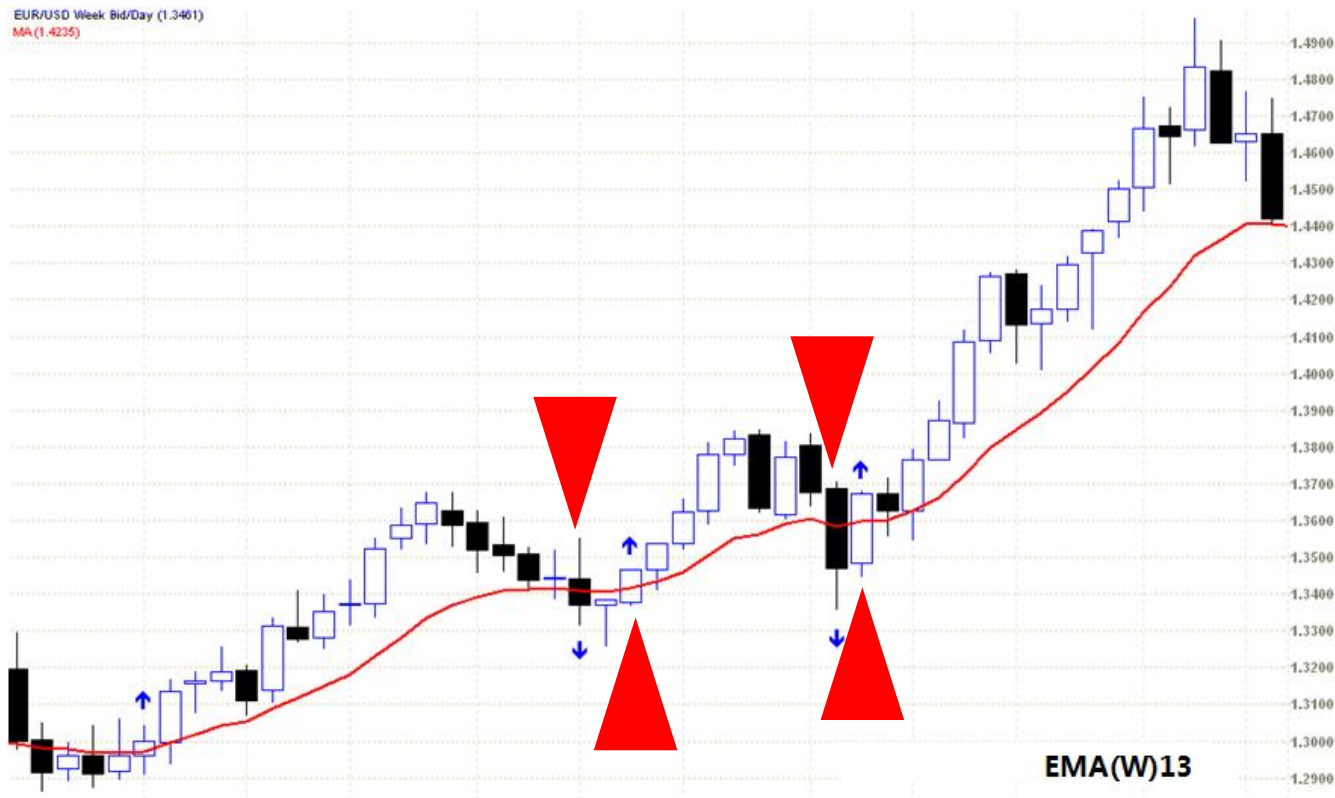
亚·埃尔德方法：判断长周期趋势方向



判断长周期趋势方向



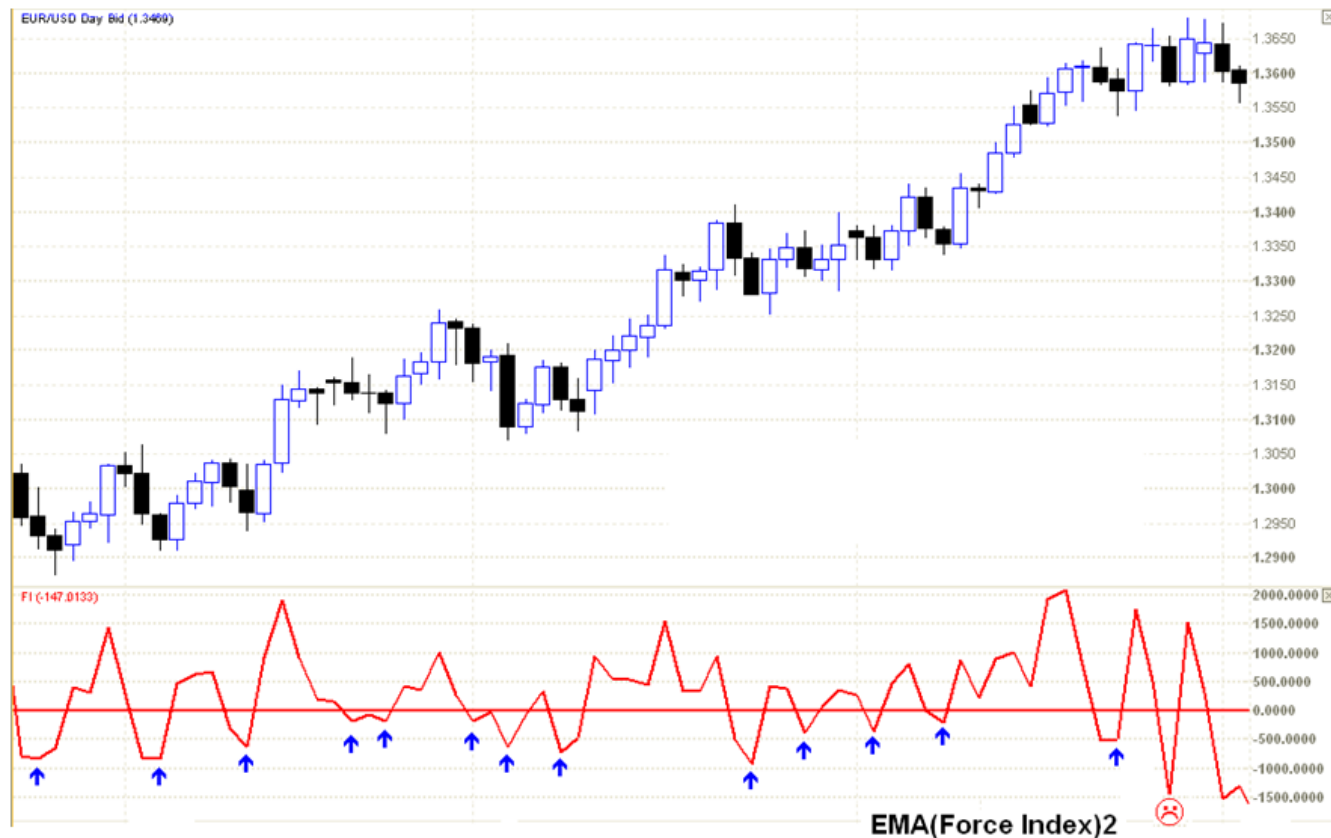
判断长周期趋势方向



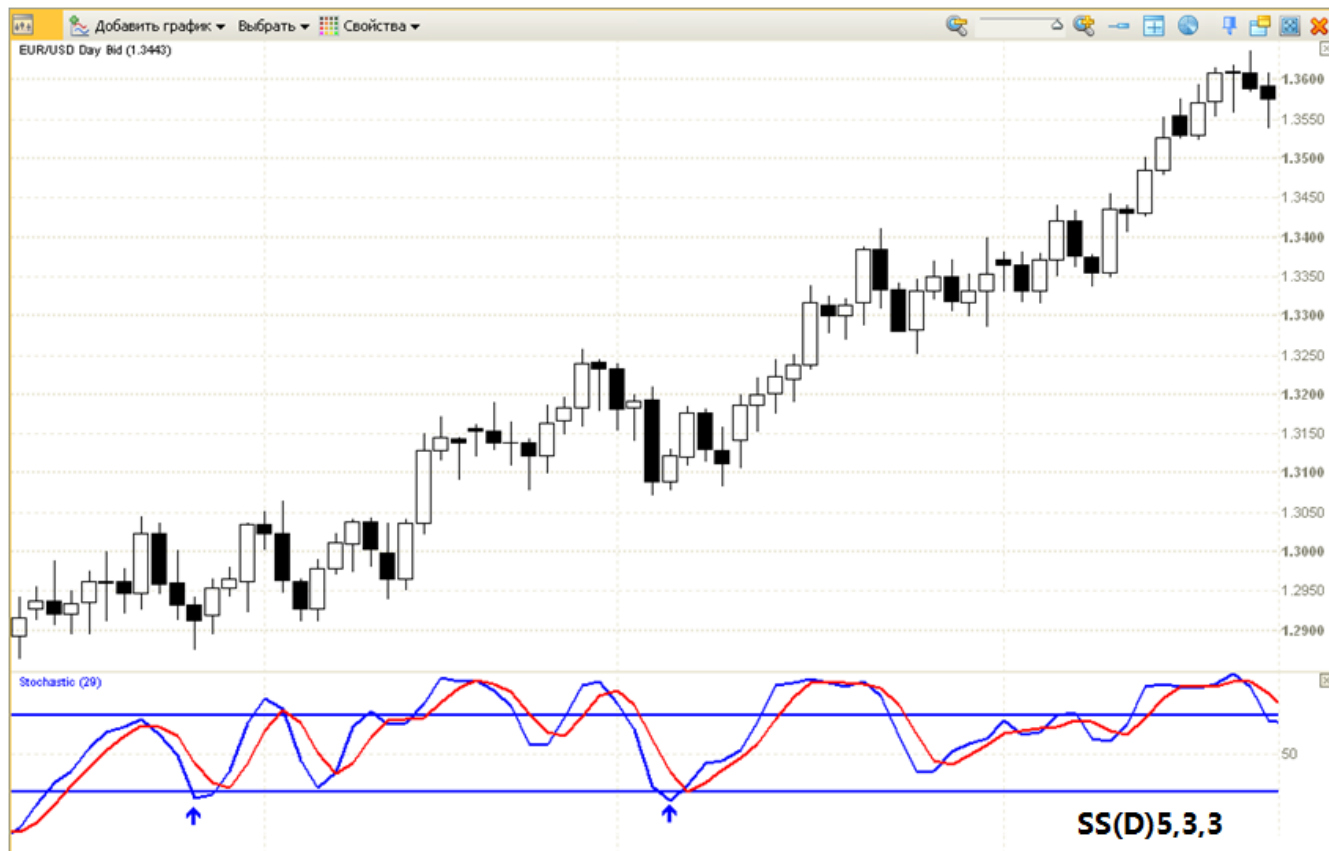
判断
中周期修正价格运动
终结

$$\text{力量指数}[t] = \text{成交量}[t] * (\text{收盘价}[t] - \text{收盘价}[t-1])$$

亚·埃尔德方法：力量指数



判断中周期修正价格运动终结

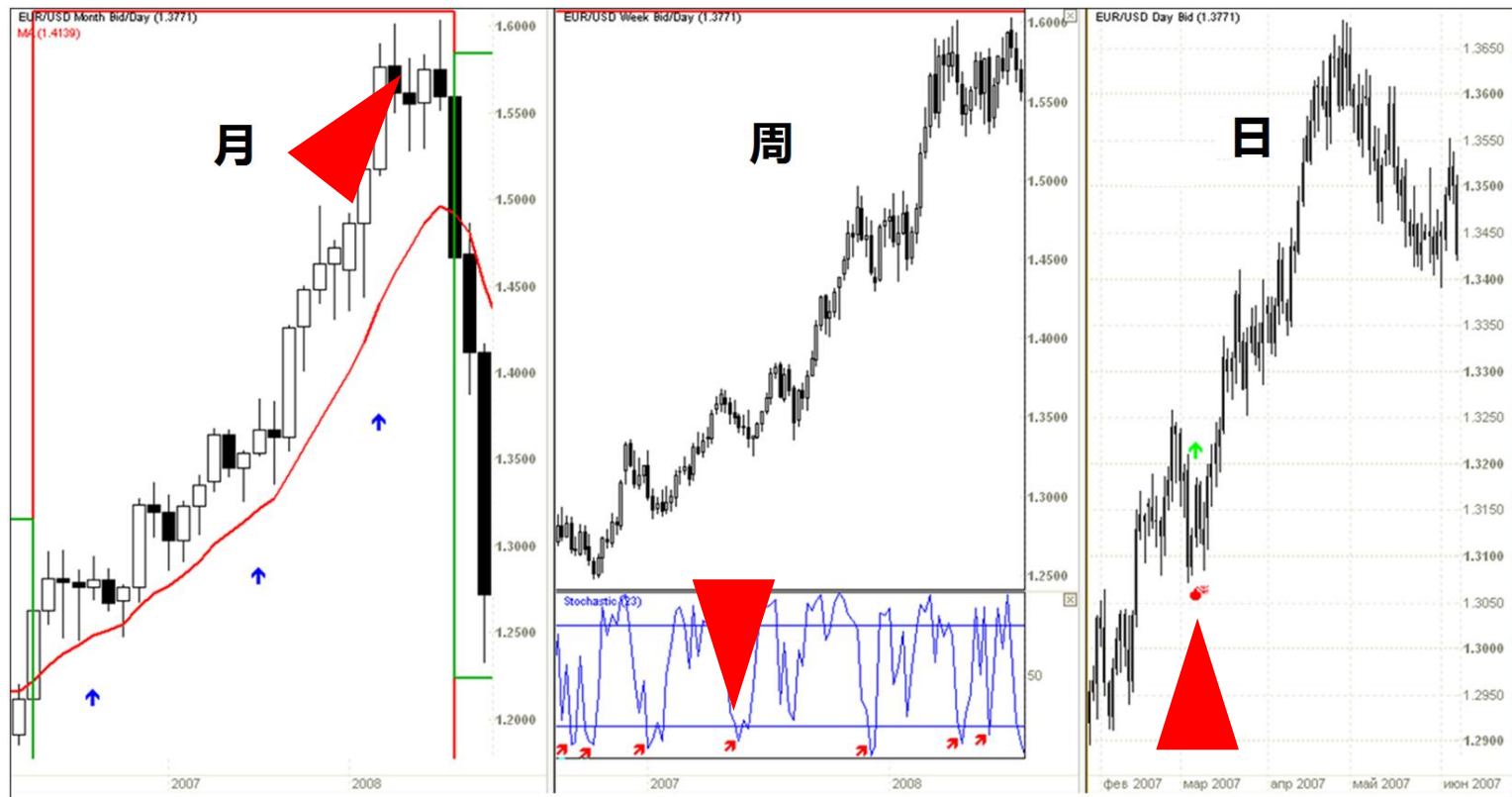


判断中周期修正价格运动终结

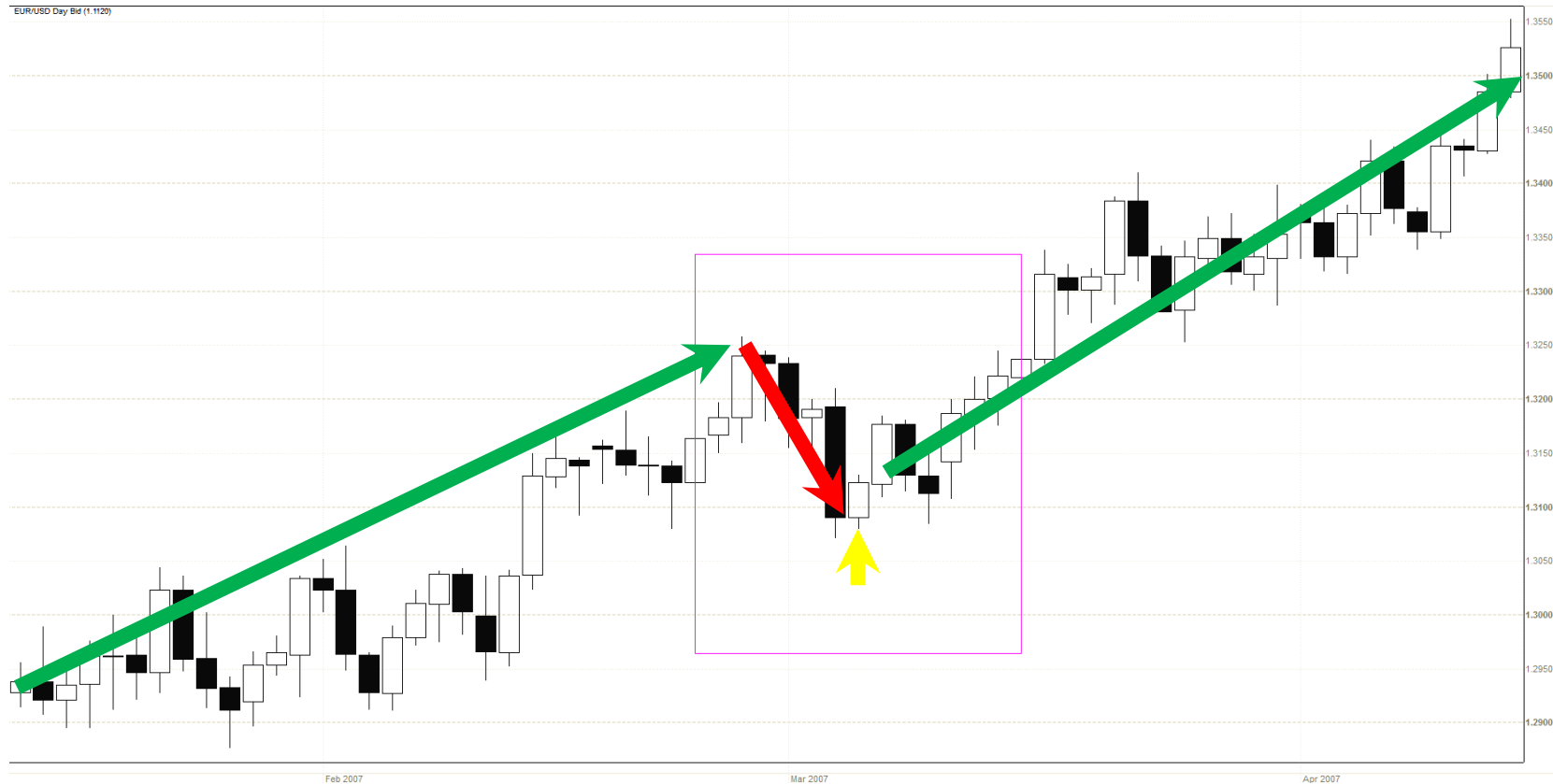


建立头寸规则

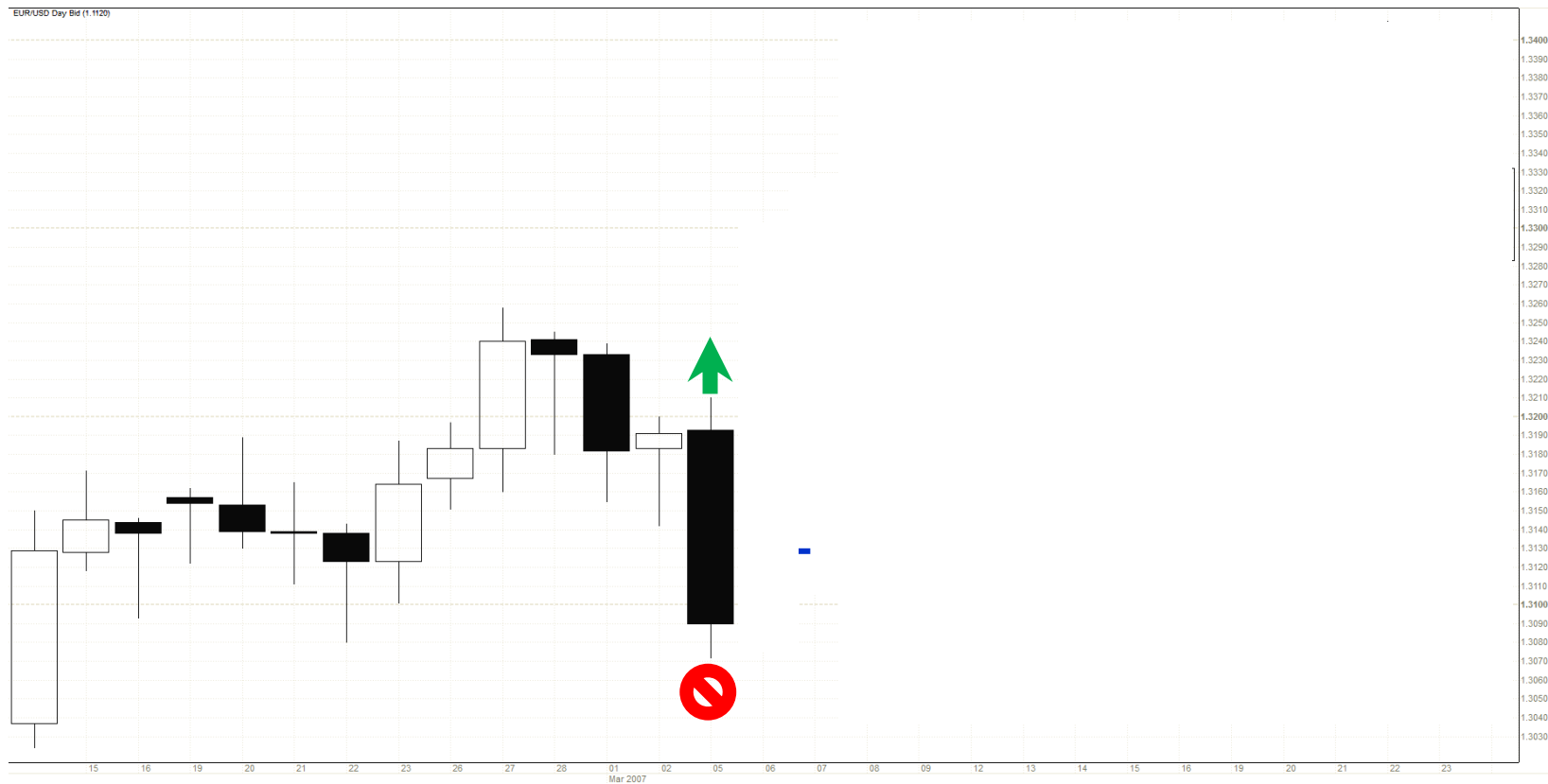
“三重滤网”交易策略



建立头寸条件



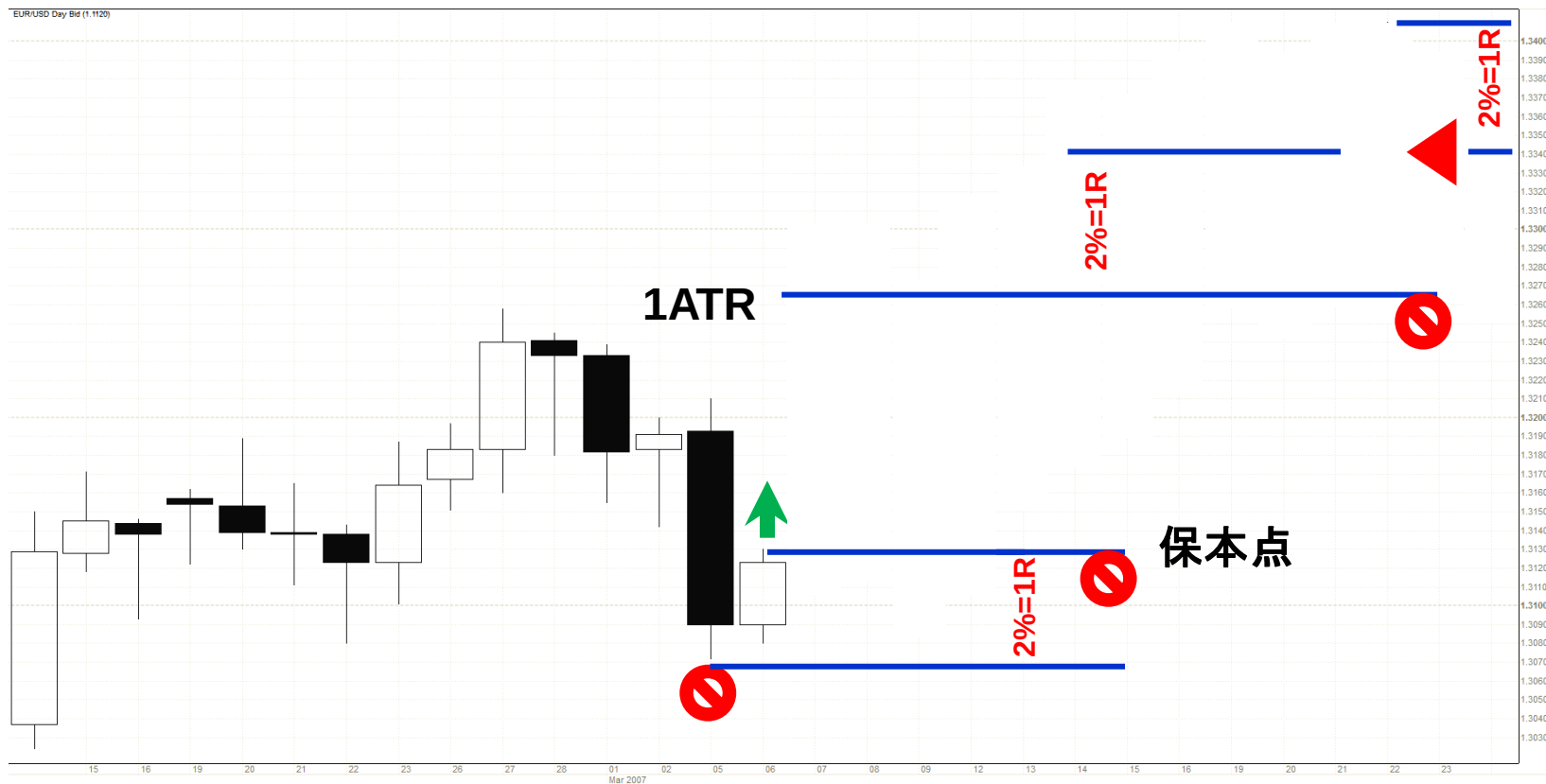
操作顺序



未结头寸管理

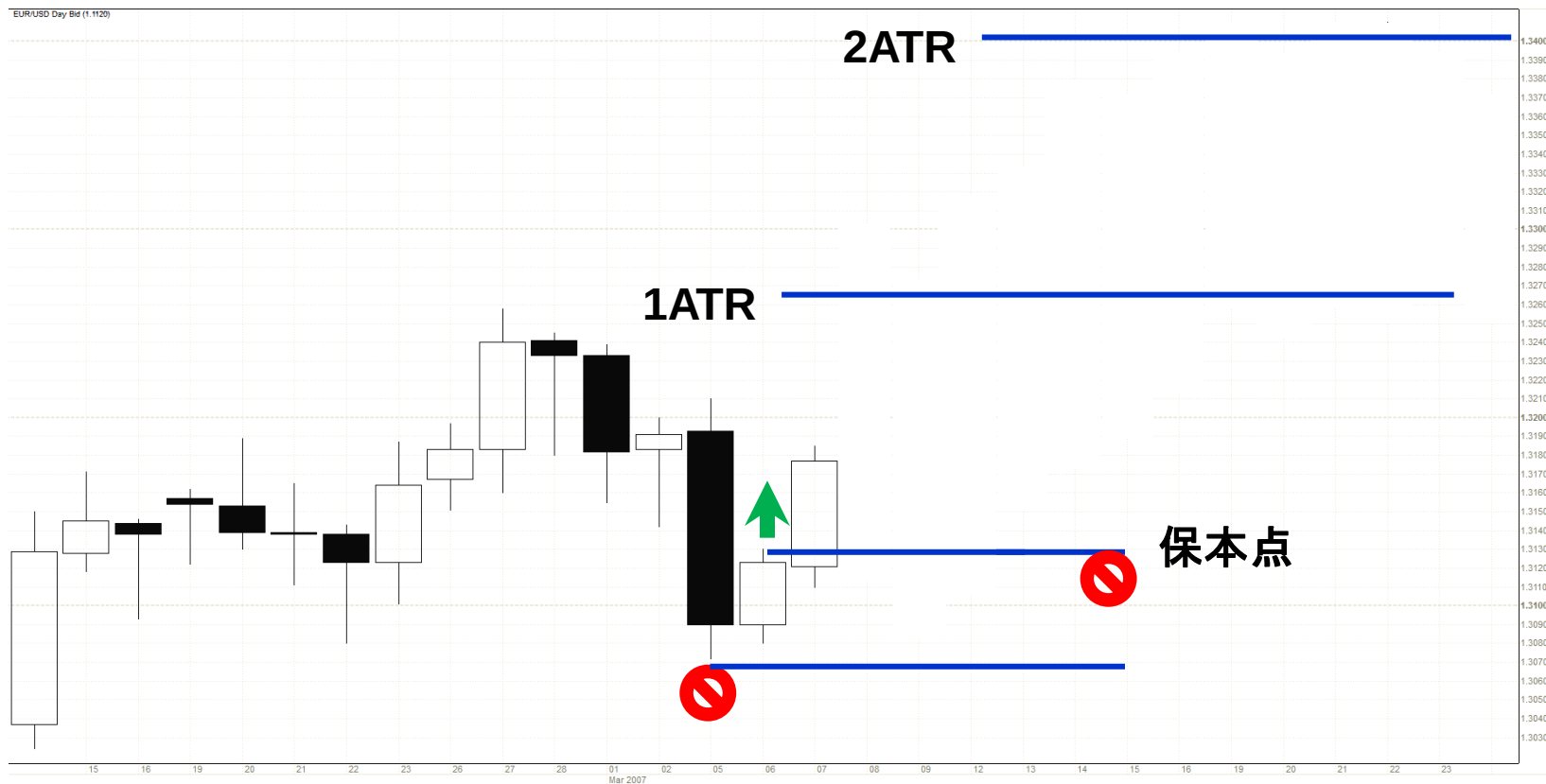
1. 开仓后设定止损订单
2. 价格从入场点向有利方向运动的距离达到**1ATR**后将止损订单移动到保本点
3. 追踪止损风险极限不应超过账户余额的**2%**
4. 大周期趋势方向改变前继续持有头寸

头寸管理方法（保守性）



1. 开仓后设定止损订单
2. 价格从入场点向有利方向运动的距离达到**1ATR**后将止损订单移动到保本点
3. 价格达到**2ATR**目标后开始保护未兑现利润的**50%**
4. 中周期图上出现新交易信号后增加头寸大小
5. 根据中周期图产生的信号进行获利（超买/超卖）

头寸管理方法（积极性）



总结

“三重滤网”策略交易信号

周图趋势	日图趋势	操作	订单
上升	上升	等待	无订单
上升	下跌	买入	追踪 Buy Stop订单
下跌	下跌	等待	无
下跌	上升	卖出	追踪 Sell Stop订单

“三重滤网”策略 (范例 #1)

❖ 第一个屏幕: 月线图

(判断趋势方向: 多/空/观望)

技术指标: **EMA(M) 13**

❖ 第二个屏幕: 周线图

(判断次级趋势终结)

技术指标: **SS(W)4,1,1(20/80)**

❖ 第三个屏幕: 日线图或周线图

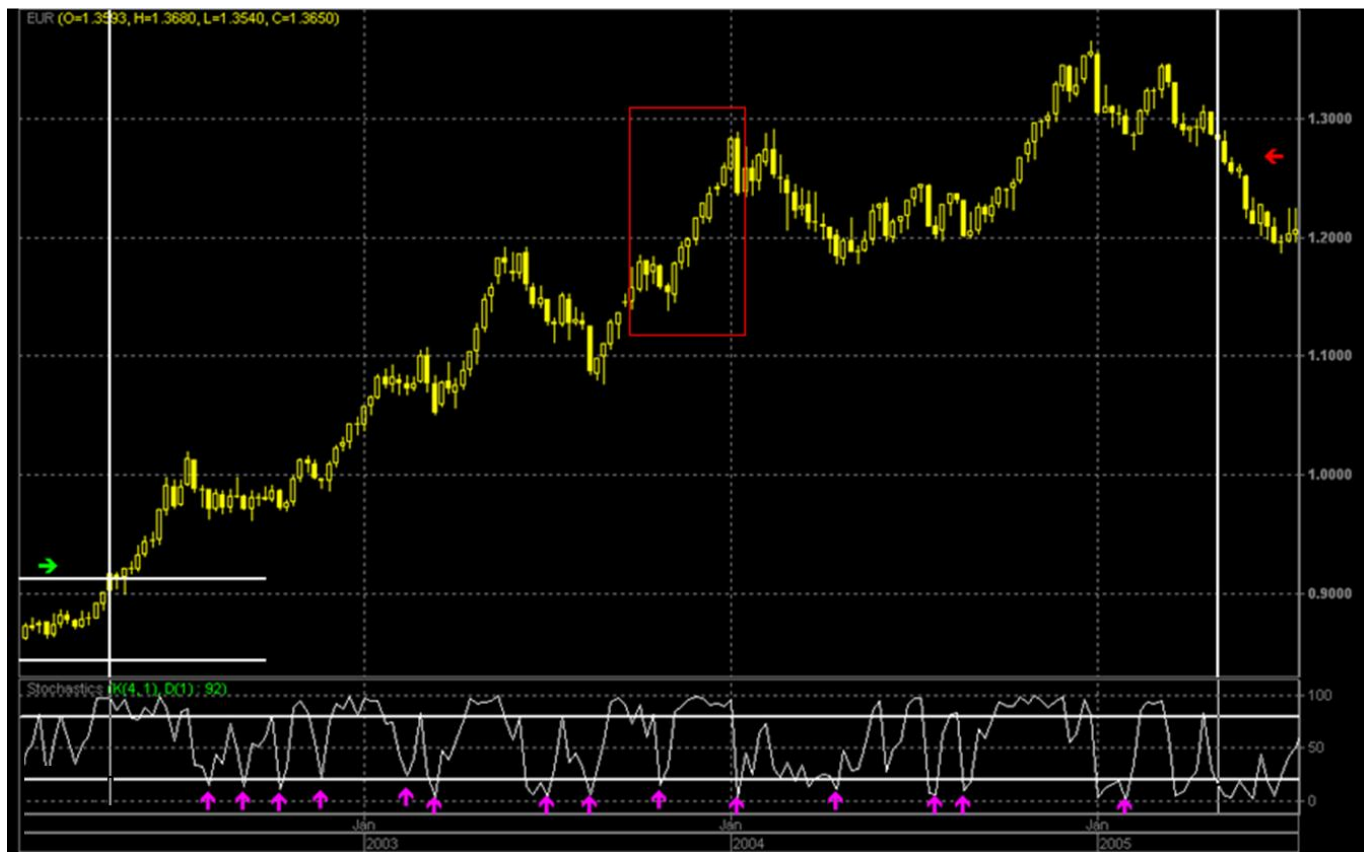
(借助于追踪**BuyStop/SellStop**订单进行入场)

技术指标: 无

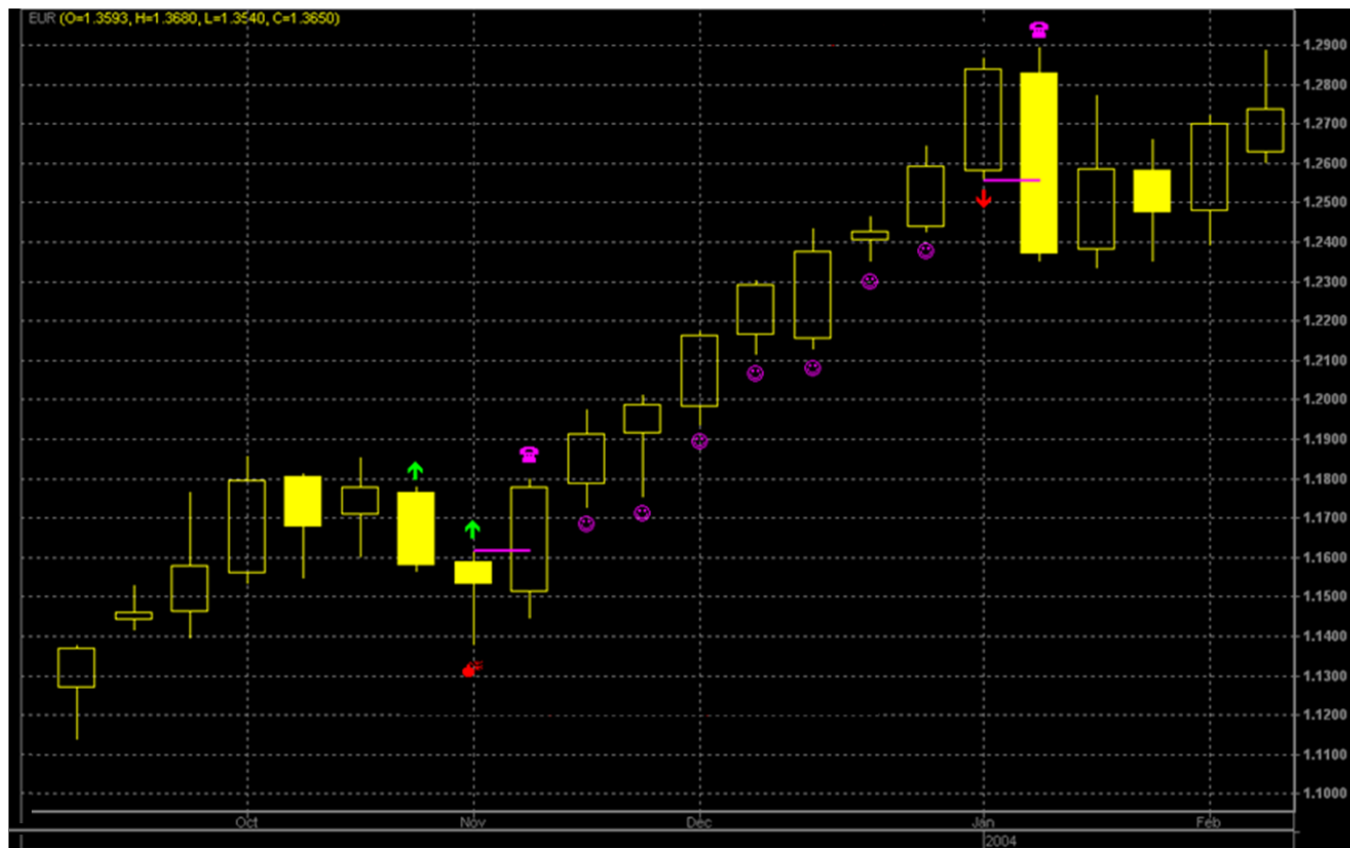
“三重滤网”策略 (大周期 #1)



“三重滤网”策略 (中周期 #2)



“三重滤网”策略 (中周期 #3)



“三重滤网”策略 (范例 #2)

❖ 第一个屏幕: 周线图

(判断趋势方向: 多/空/观望)

技术指标: **EMA(W)13**

❖ 第二个屏幕: 日线图

(判断次级趋势终结)

技术指标: **SS(D)5,3,3(20/80)**

❖ 第三个屏幕: 6小时或日线图

(借助于追踪**BuyStop/SellStop**订单进行入场)

技术指标: 无



感谢收看!