



章 劼 编著

金融投资 模拟交易实训



上海财经大学出版社



教育部
推荐教材

金融投资 模拟交易实训

· 全国金融专业学位研究生
· 全国金融专业学位研究生
· 全国金融专业学位研究生
· 全国金融专业学位研究生
· 全国金融专业学位研究生

金融投资
模拟交易实训

财经模拟课堂
投资理财系列

金融投资模拟交易实训

章 劼 编著

 上海财经大学出版社

图书在版编目(CIP)数据

金融投资模拟交易实训/章劼编著. —上海:上海财经大学出版社, 2004. 9
(财经模拟课堂、投资理财系列)

ISBN 7-81098-217-6/F · 195

I. 金… II. 章… III. 金融投资-模拟-证券交易 IV. F830.59

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2004)第 083736 号

- ☐ 策 划 何苏湘
- ☐ 责任编辑 任 可
- ☐ 封面设计 周卫民

JINRONG TOUZI MONI JIAOYI SHIXUN
金融投资模拟交易实训
章 劼 编著

上海财经大学出版社出版发行
(上海市武东路 321 号乙 邮编 200434)

网 址: <http://www.sufep.com>

电子邮箱: webmaster@sufep.com

全国新华书店经销

上海市印刷七厂一分厂印刷装订

2004 年 9 月第 1 版 2004 年 9 月第 1 次印刷

850mm×1168mm 1/16 15.25 印张 390 千字

印数: 0 001—4 000 定价: 24.00 元

前 言

金融投资市场是一个非常具有吸引力的市场。在金融投资市场内,投资工具五花八门、日新月异,除传统的股票、债券、期货和外汇市场外,新兴工具越来越多,如股票指数期货、期权、黄金交易等,任何一种市场或投资工具都是利之所在。

人人都想成为市场的胜利者,但胜利不是毫无代价而获得的,没有一套完整的金融投资分析方法,在瞬息万变的金融投资市场想成为成功人物恐怕只是奢望。要成功就必须熟悉和钻研金融投资交易技术。

《金融投资模拟交易实训》正是学习和钻研股票、期货和外汇等金融投资很好的教材。本教材分上编和下编,上编介绍了金融投资模拟交易系统及实训的基础知识;下编介绍了股票、期货和外汇三种金融投资工具的模拟交易,以及它们的投资技巧。

进入 21 世纪,一切都走向了专业化。通过《金融投资模拟交易实训》的学习,你可提升自己金融投资技巧的水平,使你在惊涛骇浪的金融投资市场里,获得巨大的成功。

因为我们在实训过程中使用的是世华财讯模拟交易系统,所以在本书的编写中,得到了世华财讯公司的大力支持。上海财经大学出版社副编审何苏湘女士为本书的编写、出版做了大量辛勤的工作,给予了极大的耐心指导与鼓励。同时上海金融学院现代教育中心的老师对本书的编写也给予了很大的帮助,在此,一并向他们表示由衷的感谢。

由于时间仓促,水平有限,书中难免有不当之处,敬请读者批评指正。

编者

2004 年 8 月

目 录

前言	(1)
----------	-----

上 编

1 金融投资模拟交易简介	(3)
1.1 模拟交易界面及常用术语简介	(3)
1.2 模拟交易系统图形快速操作	(4)
1.3 常用页面操作	(11)
1.4 商品报价窗口	(14)
1.5 K线图窗口	(19)
1.6 其他图表窗口简介	(23)
1.7 新闻资讯信息	(25)
附1 快捷键列表	(27)
附2 国内期货交易所商品代码表	(28)
2 金融投资模拟交易操作	(29)
2.1 系统操作及菜单介绍	(29)
2.2 报价窗口	(42)
2.3 时间图	(58)
2.4 Tick图	(62)
2.5 分价图	(65)
2.6 图表分析	(68)
2.7 单商品报价	(81)
2.8 分时价量表	(83)
2.9 分价表	(85)
2.10 新闻资讯	(86)
2.11 背景资料	(87)
2.12 公式管理	(88)
3 金融投资模拟交易技术指标	(97)
3.1 大盘腾落指数(ADL)	(97)
3.2 大盘涨跌比率(ADR)	(98)
3.3 震动升降指标(ASI)	(98)
3.4 乖离率指标(BIAS)	(99)
3.5 布林线(Bollinger Bands)	(100)

3.6	情绪指标(BRAR)	(100)
3.7	成本均线(CBJX)	(101)
3.8	顺势指标(CCI)	(101)
3.9	佳庆指标(CHAikin)	(102)
3.10	能量指标(CR)	(103)
3.11	平均线差(DMA)	(104)
3.12	动向指数(DMI)	(104)
3.13	简易波动指标(EMV)	(105)
3.14	指数平均数(EXPMA)	(106)
3.15	随机指标(KDJ)	(106)
3.16	平滑异同移动平均线(MACD)	(107)
3.17	梅斯线(MASS)	(108)
3.18	动量指标(MTM)	(109)
3.19	移动平均线(MA)	(110)
3.20	大盘超买超卖(OBOS)	(112)
3.21	成交量净额(OBV)	(113)
3.22	震荡量指标(OSC)	(113)
3.23	点数图(OX)	(114)
3.24	平均成本线(PJCB)	(115)
3.25	平均每笔成交指标(PJMBCJ)	(115)
3.26	平均盈亏指标(PJYK)	(115)
3.27	心理线(PSY)	(115)
3.28	超买超卖(ROC)	(116)
3.29	相对强度指标(RS)	(117)
3.30	相对强弱指数(RSI)	(117)
3.31	停损指标(SAR)	(118)
3.32	慢速KD指标(Slowed KD)	(119)
3.33	指数点成交值(TAPI)	(120)
3.34	宝塔线指标(TWR)	(120)
3.35	成交量变异率(VR)	(121)
3.36	威廉指数(W%R)	(121)
3.37	威廉变异离散量(WVAD)	(122)

下 编

4	股票模拟交易	(125)
4.1	登录与主界面	(125)
4.2	功能介绍	(126)
4.3	撤单:撤销当日未成交委托	(128)
4.4	委托查询:查询下单委托记录	(129)
4.5	资金变动:查看资金变动情况	(130)
4.6	成交查询	(130)

4.7	交易状态:查看持股和委托状态.....	(131)
4.8	排行榜:查看交易成绩排行前 10 位	(131)
4.9	首页:修改登录密码和个人信息.....	(132)
4.10	看盘技巧.....	(133)
5	期货模拟交易	(145)
5.1	登录与主界面	(145)
5.2	功能介绍	(146)
5.3	撤单:撤销当日未成交委托.....	(148)
5.4	委托查询:查询下单委托记录.....	(149)
5.5	资金变动:查看资金变动情况.....	(149)
5.6	成交查询	(150)
5.7	交易状态:查看持仓和委托状态.....	(150)
5.8	排行榜:查看交易成绩排行前 10 位	(151)
5.9	首页:修改登录密码和个人信息.....	(151)
5.10	期货合约简介.....	(152)
6	外汇模拟交易	(200)
6.1	登录与主界面	(200)
6.2	功能介绍	(201)
6.3	外汇投资知识	(212)
	参考文献及网站.....	(235)

上 编

- 金融投资模拟交易简介
- 金融投资模拟交易操作
- 金融投资模拟交易技术指标

1 金融投资模拟交易简介

1.1 模拟交易界面及常用术语简介

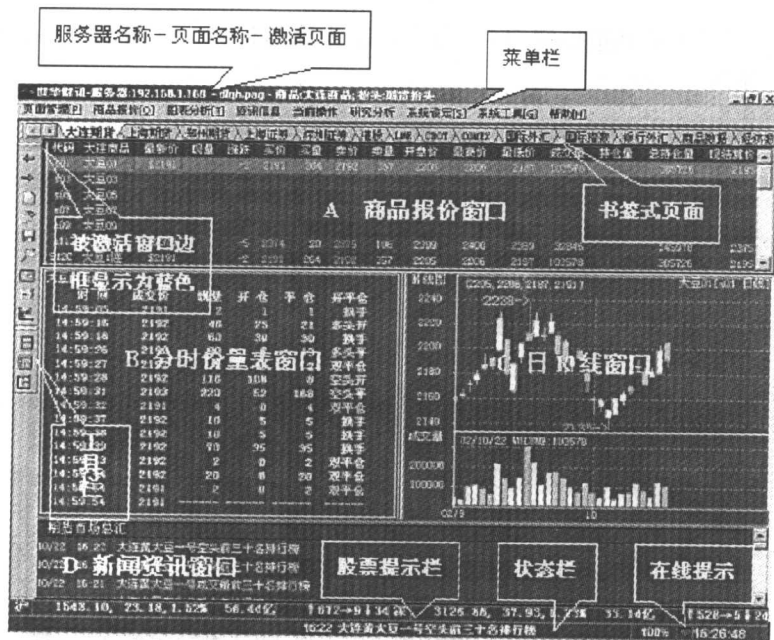


图 1-1

1. 窗口:显示商品信息的最小单位。如图 1-1 所示,世华财经系统包括商品报价窗口、分时价量表窗口、K 线图窗口、资讯窗口等。
2. 书签式页面:由一个或多个窗口组成,显示商品信息。可根据个人习惯或喜好设计、保存、调用页面(如图 1-1 所示,“大连期货”页面由商品报价窗口、分时价量表窗口、日 K 线窗口及新闻资讯窗口组成)。
3. 激活当前窗口:用鼠标左键点击某一窗口,使之处于激活状态(如图 1-1 所示,商品报价窗口边框被激活)。
4. 图表:是指将行情数据进行记录、运算,并且以图形或表格的方式显示出来。
5. 工具栏:各种快捷图标并列,组成工具栏。
6. 股票状态栏:显示沪市、深市大盘最新价、涨跌及成交量等实时信息。
7. 命令栏:直接敲击键盘输入商品代码或拼音首字母迅速调用商品信息(注:本系统命令栏在不使用情况下不显示)。

1.2 模拟交易系统图形快速操作

1.2.1 系统缺省页面

初次进入系统将进入系统缺省页面——“大连期货”(如图 1-1 所示)。该页面由商品报价窗口、分时价量表窗口、日 K 线窗口及新闻资讯窗口组成,显示商品的实时走势及详细成交明细。

1.2.2 切换商品

激活图 1-1 中 A 商品报价窗口,在命令栏输入商品代码。如激活窗口为新闻资讯窗口不显示命令栏(见图 1-2)。

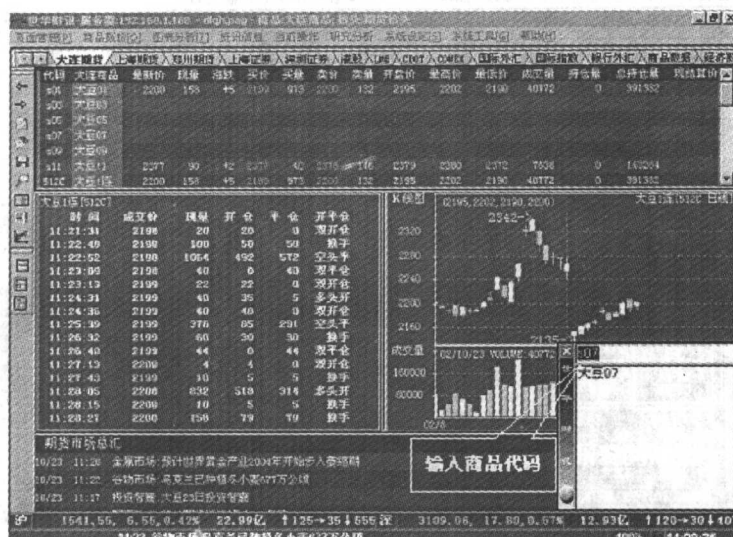


图 1-2

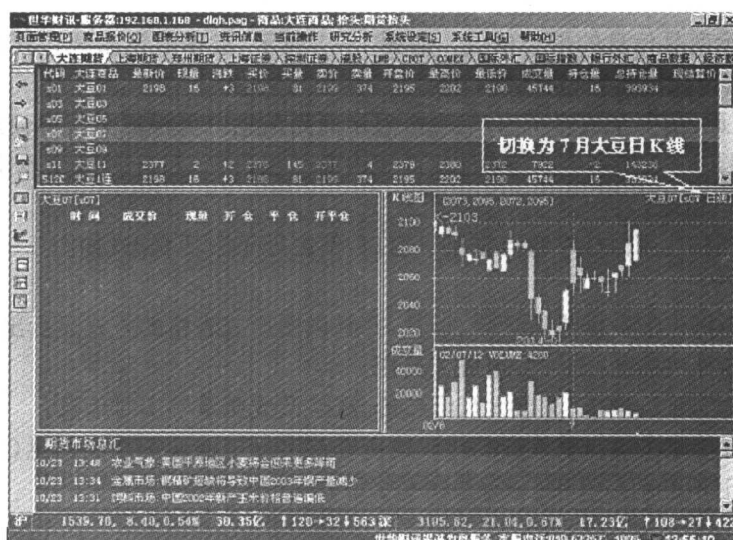


图 1-3

⊙ 以大连 7 月大豆 S07 为例,在命令栏中输入“S07”,如图 1-2 所示。

输入商品代码并 **Enter**,所需商品的 K 线图显示(如图 1-2 所示)。

⊙ 在图 1-3,回车后,S07 商品信息显示在当前页面。

1.2.3 在系统缺省页面中调用 K 线图

1.2.3.1 调用 K 线

⊙ 图 1-4,激活“大连期货”页面中分时价量表窗口,单击主菜单 **图表分析**,弹出下拉菜单。



图 1-4

⊙ 图 1-5,在弹出的菜单中,单击 **K 线图**,则激活窗口调出该商品的 K 线图(在 K 线图窗口中可通过移动鼠标查看 K 线图的详细数据)。

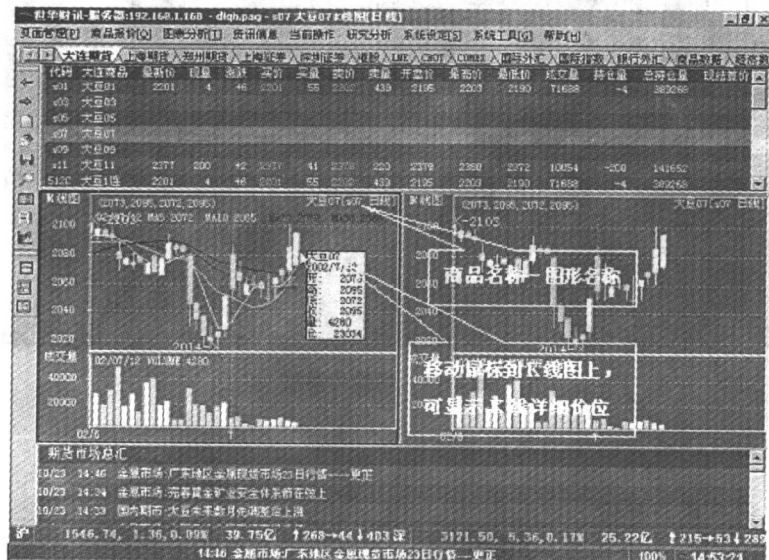


图 1-5

1.2.3.2 切换时间单位

显示商品不同时间单位的 K 线图。世华财讯系统中缺省包括 1、5、10、15、30、60 分钟图及日线、周线、月线图,并可设定任意时间单位的 K 线图显示。

单击鼠标右键,弹出下拉菜单,如图 1-6 所示。

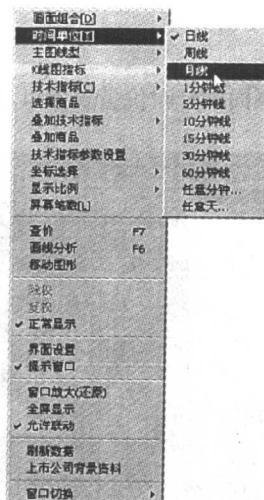


图 1-6 弹出下拉菜单

在下拉菜单中,单击**月线**,激活窗口显示该品种的月线,如图 1-7 所示。

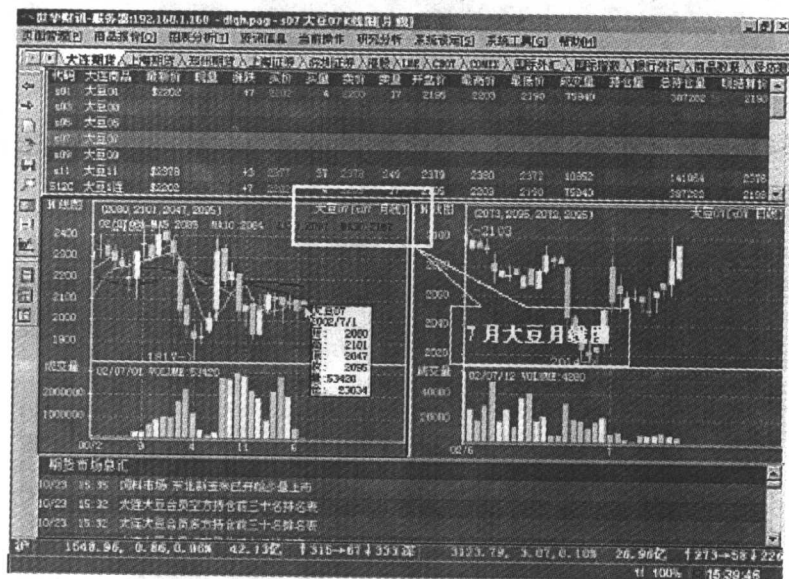


图 1-7 切换为月线

1.2.4 在系统缺省页面中调用商品报价

1.2.4.1 调用商品报价

激活 K 线图窗口,单击主菜单**商品报价**→在弹出的菜单中选择所需调用的商品类别,调用所需商品(如图 1-8 所示)。



图 1-8

⊙ 图 1-8,激活窗口 A,单击主菜单中**商品报价**→在弹出的菜单中选择**国内股票**→在弹出的第二级菜单中,选择**全部指数和股票**。

⊙ 图 1-9,单击菜单中**全部指数和股票**,窗口 A 中切换为国内所有股票和指数报价画面。

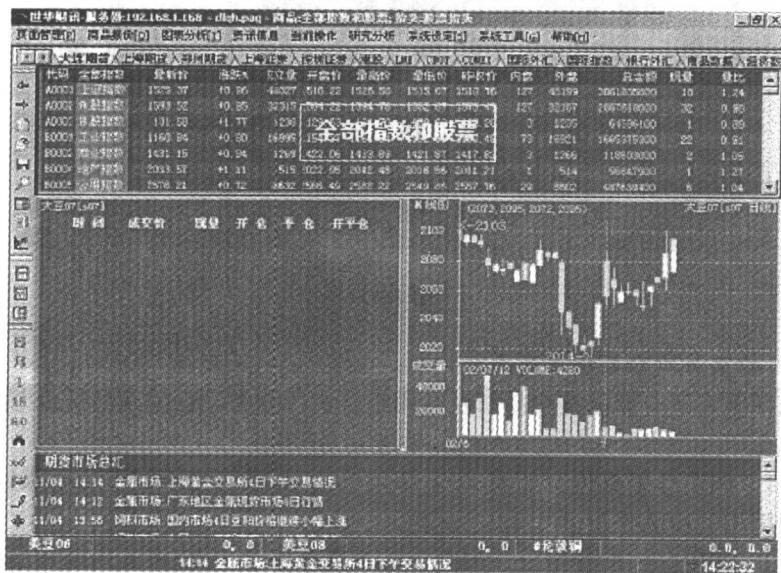


图 1-9

1.2.4.2 报价窗口中调用其他商品类别报价显示
操作方法同 1.2.4.1,见下例。

⊙ 图 1-10,激活窗口 A,单击主菜单中**商品报价**→在弹出的菜单中选择**国内期货**→在弹出的第二级菜单中,选择**国内全部商品**。

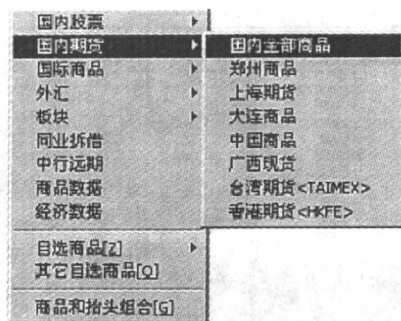


图 1-10

⊙ 图 1-11,单击菜单中**国内全部商品**,窗口 A 中切换为国内所有期货及现货市场商品报价。



图 1-11

1.2.4.3 按交易所分类调用商品组合

世华财经系统将所有商品按交易所及常用组合进行分类,通过“商品报价”菜单调用,调用方法同 1.2.4.1。

1.2.4.3.1 调用股票报价。如图 1-8 中菜单所示,系统将不同市场股票分类,可直接点击分类名称调用相关商品报价。

1.2.4.3.2 调用国内期货报价。如图 1-10 菜单所示,系统将国内期货品种按交易所分类,可直接点击分类名称调用相关商品报价。

1.2.4.3.3 国际商品菜单。如图 1-12 菜单所示,系统将国际金融市场各交易所列表,可直接点击交易所名称调用相关商品报价。

1.2.4.3.4 个人外汇菜单。如图 1-13 菜单所示,系统将国内汇市行情按各银行报价分类,可直接点击银行名称调用相关外汇报价。

1.2.4.4 排行榜

通过点击鼠标,对报价画面的商品组合按所选抬头进行排序。

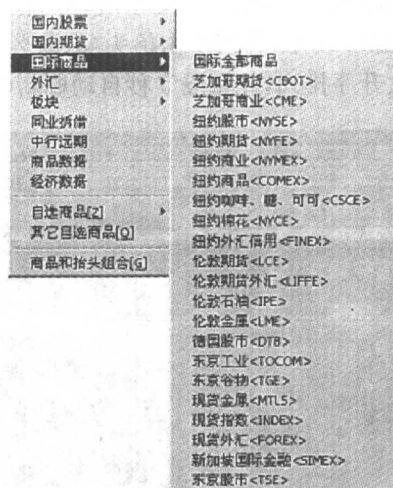


图 1-12

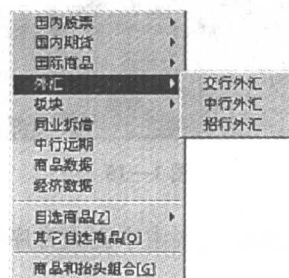


图 1-13

1.2.4.4.1 在图 1-9 窗口 A 中,单击抬头“涨跌%”,则系统将报价窗口中所有商品对抬头“涨跌”进行由大到小降序排列,并每隔 5 秒自动刷新(如图 1-14 所示)。



图 1-14