



索罗斯都要用的 MetaTrader 4

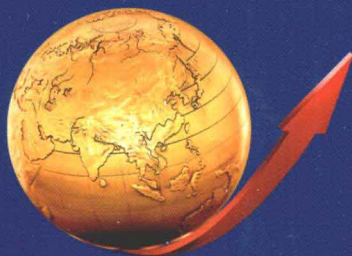
【黄金交易术】

HUANG JIN JIAO YI SHU

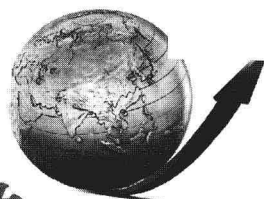
进阶篇

Dave C 老易 周宏恩 著

您若想对黄金市场有系统、深入的了解，或者想进入国际杠杆黄金现货交易，本书将是您在自动化智能交易领域不可或缺的重要参考宝典。



中国经济出版社
CHINA ECONOMIC PUBLISHING HOUSE



索罗斯都要用的 *MetaTrader 4*

【黄金交易术】

进阶篇 HUANG JIN JIAO YI SHU

Dave C 老易 周宏恩 著



中国经济出版社
CHINA ECONOMIC PUBLISHING HOUSE

图书在版编目 (CIP) 数据

索罗斯都要用的黄金交易术 (进阶篇) / Dave C, 老易, 周宏恩著.

北京: 中国经济出版社, 2013. 6

ISBN 978 - 7 - 5136 - 2473 - 2

I. ①索… II. ①D… ②老… ③周… III. ①黄金市场—投资—基本知识

IV. ①F830. 94

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2013) 第 076911 号

责任编辑 张玲玲

责任审读 霍宏涛

责任印制 张江虹

封面设计 然则创意

出版发行 中国经济出版社

印刷者 北京市昌平区新兴胶印厂

经销者 各地新华书店

开 本 710mm × 1000mm 1/16

印 张 22. 5

字 数 341 千字

版 次 2013 年 6 月第 1 版

印 次 2013 年 6 月第 1 次

书 号 ISBN 978 - 7 - 5136 - 2473 - 2/F · 9727

定 价 45. 00 元

中国经济出版社 网址 www.economyph.com 社址 北京市西城区百万庄北街 3 号 邮编 100037

本版图书如存在印装质量问题, 请与本社发行中心联系调换 (联系电话: 010 - 68319116)

版权所有 盗版必究 (举报电话: 010 - 68359418 010 - 68319282)

国家版权局反盗版举报中心 (举报电话: 12390)

服务热线: 010 - 68344225 88386794



专 业 知 识
理 性 思 维
智 慧 头 脑

自序

除了众所皆知的欧债危机、美国的财政悬崖危机,以及各个国家的量化宽松政策先后主导着市场,对于究竟市场将走向何方,仍然没有定论。目前,最关键的就是美国的财政悬崖问题。如果美国无法跨越财政悬崖,美国和全球经济可能被拖入二次衰退的深渊。美国出现财政悬崖成为目前威胁美国乃至全球经济的最大不确定性的风险。展望2013年,各国央行量化宽松政策仍持续上演,货币的流通量增加,不管是贵金属还是大宗物资的价格都会受到影响,在这样的影响之下势必会引发全球性通胀。环环相扣之下,2013年的黄金市场仍然大有可为。

我们过去出版的两本黄金程序交易丛书(《索罗斯都要用的黄金交易术(基础篇)》《索罗斯都要用的黄金交易术(实战篇)》)相信已给读者带来不少收益,读者对于黄金市场和EA已经有了更多的认识 and 了解。本书内容丰富,除了给予读者一些练习题和实用的程序语法之外,还提供了更多的交易策略和丰富的相关信息。不管您是老读者还是刚接触这本书的新投资人,相信本书绝对能为您开创程序交易的新局面,对于程序交易也能更为得心应手。

作者群

于华盛顿首府 Riverhouse III

第一章	黄金分析方向	001
CHAPTER1		
	1.1 驱使黄金价格的要点 / 001	
	1.2 展望黄金市场 / 004	
第二章	控单模板	007
CHAPTER2		
	2.1 名词定义 / 007	
	2.2 控单模板程序源码 / 010	
第三章	控单方法	025
CHAPTER3		
	3.1 流程控制 / 025	
	3.2 订单操作 / 027	
	3.2.1 繁忙等待函数 / 027	
	3.2.2 清仓方法 / 028	
	3.2.3 移动止损方法 / 029	
	3.3 有效交易时间段函数 / 031	
	3.4 限制 EA 有效期限 / 032	
	3.5 密码认证 / 033	
	3.6 持仓单的精确识别 / 033	



第四章 交易信号 035

CHAPTER4

- 4.1 不同时间周期取值 / 036
- 4.2 自定义指标取值 / 038
 - 4.2.1 自定义指标保存的位置 / 038
 - 4.2.2 在主图中调入自定义指标 / 038
 - 4.2.3 在程序中调用自定义指标 / 040
- 4.3 判断指标交叉函数 / 043
- 4.4 控制有效交易时间函数 / 045
- 4.5 多指标信号叠加 / 047
- 4.6 一个标准的模板范例 / 047

第五章 屏幕标注 051

CHAPTER5

- 5.1 直接显示 / 052
- 5.2 建立“对象”概念 / 056
- 5.3 显示特殊符号 / 057
- 5.4 屏幕定位显示卷标模块 / 061
- 5.5 K线定位显示文本模块 / 063
- 5.6 K线两点间连线模块 / 065
- 5.7 水平线、垂直线模块 / 068

第六章 单位转换 071

CHAPTER6

- 6.1 开仓量整形 / 071
- 6.2 金额转手数 / 074
- 6.3 订单利润转点数 / 076
- 6.4 按资金比例计算开仓量 / 078

第七章 K线形态 082

CHAPTER7

- 7.1 K线形态定义及函数调用 / 082
- 7.2 范例:计算高低区间 / 085

第八章	常用工具	089
CHAPTER8	8.1 交易平台基本信息 / 089	
	8.2 持仓单状态 / 093	
	8.3 历史交易回顾 / 098	
	8.4 各大交易所交易时间 / 107	
	8.5 提取字符串中的数字 / 119	
第九章	EA 之路	122
CHAPTER9	9.1 奇怪的现象很正常 / 122	
	9.2 正常的现象很奇怪 / 123	
	9.3 EA 是工具 / 124	
	9.4 不是什么人都适合程序设计 / 124	
	9.5 测试题 / 125	
第十章	EA 实训课程	127
CHAPTER10	10.1 查看基本信息 / 127	
	10.1.1 课程目标 / 127	
	10.1.2 实训内容 / 127	
	10.1.3 参考数据 / 128	
	10.1.4 思考题 / 129	
	10.2 蜡烛时间及序列 / 130	
	10.2.1 课程目标 / 130	
	10.2.2 实训内容 / 130	
	10.2.3 参考数据 / 130	
	10.2.4 思考题 / 130	
	10.3 开仓与平仓 / 131	
	10.3.1 课程目标 / 131	
	10.3.2 实训内容 / 131	
	10.3.3 参考数据 / 131	
	10.3.4 思考题 / 134	

- 10.4 移动止损 / 134
 - 10.4.1 课程目标 / 134
 - 10.4.2 实训内容 / 134
 - 10.4.3 参考数据 / 134
 - 10.4.4 思考题 / 136
- 10.5 多订单识别 / 136
 - 10.5.1 课程目标 / 136
 - 10.5.2 实训内容 / 137
 - 10.5.3 参考数据 / 137
 - 10.5.4 思考题 / 137
- 10.6 历史订单及持仓单统计 / 138
 - 10.6.1 课程目标 / 138
 - 10.6.2 实训内容 / 138
 - 10.6.3 参考数据 / 138
 - 10.6.4 思考题 / 139
- 10.7 图形化显示交易指标 / 139
 - 10.7.1 课程目标 / 139
 - 10.7.2 实训内容 / 140
 - 10.7.3 参考数据 / 140
 - 10.7.4 思考题 / 140
- 10.8 十字星蜡烛连线指标 / 140
 - 10.8.1 课程目标 / 140
 - 10.8.2 实训内容 / 140
 - 10.8.3 参考数据 / 141
 - 10.8.4 思考题 / 142
- 10.9 资金流向指标 / 142
 - 10.9.1 课程目标 / 142
 - 10.9.2 实训内容 / 142
 - 10.9.3 参考数据 / 143
 - 10.9.4 思考题 / 143

	10.10 网格对冲交易 / 144	
	10.10.1 课程目标 / 144	
	10.10.2 实训内容 / 144	
	10.10.3 思考题 / 145	
第十一章	订单交易规则	146
CHAPTER11	11.1 Ask 和 Bid / 146	
	11.2 建仓平仓规则 / 146	
	11.3 订单注释 / 149	
	11.4 订单特征码 / 149	
第十二章	网格交易	150
CHAPTER12	12.1 基本模型 / 150	
	12.2 移动网格 / 151	
	12.3 实用对策 / 178	
	12.3.1 收网和弃网 / 178	
	12.3.2 非对称网格 / 179	
	12.3.3 动态网格 / 179	
	12.3.4 均线回归网格 / 179	
	12.3.5 渔网技术指标 / 180	
	12.3.6 B 网和 S 网 / 181	
	12.4 对策综述 / 181	
第十三章	指标共振策略	182
CHAPTER13	13.1 均线指标共振 / 182	
	13.2 叠加布尔指标 / 183	
	13.3 指标共振方法 / 183	
	13.4 自定义共振指标 / 185	
	13.5 共振指标操盘策略 / 192	
	13.6 操盘 EA / 193	

	13.6.1 多单源码 / 194
	13.6.2 空单源码 / 222
	13.7 总结 / 251
第十四章	海龟交易法则 252
CHAPTER14	
14.1	为“海龟”正名 / 252
14.2	海龟法则概览 / 252
14.2.1	市场:买卖什么 / 253
14.2.2	头寸:买卖多少 / 253
14.2.3	入市:何时买卖 / 253
14.2.4	止损:何时认亏 / 253
14.2.5	盈利:何时止盈 / 254
14.2.6	控盘策略:如何买卖 / 254
14.3	海龟法则精髓 / 254
14.3.1	资金管理 / 254
14.3.2	入市策略 / 258
14.3.3	止损策略 / 261
14.3.4	盈利策略 / 262
14.3.5	控盘策略 / 262
14.4	海龟范例源码 / 263
第十五章	对冲交易 288
CHAPTER15	
15.1	对冲交易与对冲基金 / 288
15.2	对冲交易操作方法 / 290
15.2.1	对冲操作的保证金与开仓量配比 / 290
15.2.2	价格跌至重要支撑位或可能突破重要 阻力位附近时同时的建仓 / 291
15.2.3	价格升破重要阻力位时的建仓 / 291
15.2.4	价格升至重要阻力位时的拆仓 / 291
15.2.5	价格运行至重要时间点时的拆仓 / 292

	15.2.6 对冲止损设置技巧 / 292	
15.3	对冲交易范例 / 292	
	15.3.1 策略描述 / 292	
	15.3.2 范例源码 / 293	
	15.3.3 测试报告 / 314	
	15.3.4 测试总结 / 334	
第十六章	网络资源	335
CHAPTER16	16.1 财经日历 / 335	
	16.2 云交易 / 338	
	16.3 总结 / 344	



黄金分析方向

在前两本书中(即《索罗斯都要用的黄金交易术(基础篇)》《索罗斯都要用的黄金交易术(实战篇)》)我们提到的黄金分析,除了简单扼要地介绍黄金商品外,对该商品的价格影响要素也做出了分类。在本书中,再深入讲解投资者进入黄金市场前更该了解的几个面向。

买卖黄金成败的最重要的因素取决于投资者如何正确判断价格走势。或许读者在此会认为这句话是套套理论(Tautology),但此话却隐含着极大的投资哲学。在金融市场上,商品价格分析包括两个方面:一是基本分析;二是技术分析。在本章,我们着重于基本分析的介绍,而技术分析方面在基础篇和实战篇中已经给你方向了。

1.1 驱使黄金价格的要点

驱动金融市场的因素只有两个字:供需。对于黄金商品来说,供需分为三个面向:一是实际供需(如:工业需求、食品需求);二是投资供需;三是国家官方的黄金储备。在这三点的基础之上,我们同时也要注意对各国经济指标和主要大国的经济政策方针,以及行业发展状况等的分析。我们以下提到的几点,通常最先驱使黄金价格做出反应。

(1) 经济因素(石油)

石油的价格最能反映全球经济状况,因为该商品的需求来自于各行各



业,因此当世界经济好的时候,对石油的需求将会随之使其价格上升。石油的价格上升使得各类工业成本升高,驱使商品价涨,再演变成物价指数的飙升,环环相扣之下带来通货膨胀。所谓通货膨胀,则代表着货币贬值,因此市场上的投资者会购买能够保值的贵金属,继而使得黄金价格上涨。由上述的逻辑推演,我们可以说油价与金价呈现正相关。当然,严格来说,良性或区域性通胀对于黄金价格并不会产生影响,那只是人们的预期心理,但投资者需注意;恶性或全球性通胀导致黄金价格先行做出反应。(图 1-1 中我们使用布兰特原油(Brent Curde)的原因为:该商品在欧洲北海生产在西欧提炼,并在伦敦国际原油交易所交易;它适合于提炼汽油、柴油与喷射燃油。其价格反映全球原油供需状态。此外,从非洲、中东运往西方的原油都按照该商品定价;俄罗斯、尼日利亚乃至中东和亚洲其他地区的原油生产商也以它作为参考指标。另外,我们使用 SPDR 黄金 ETF 来和布兰特原油比较。ETF 为全球最大,其持有黄金的增减备受市场投资者所关注。)



图 1-1 SPDR 黄金 ETF 和布兰特原油价格走势(近三年)

(2) 外汇因素(美元)

美元走势和黄金息息相关,过去美联储(FED)执行量化宽松政策(QE)并使美国利率下跌,美元的走势疲软,驱使黄金价格上扬。因为目前市场金价以美元来计价。从过去 FED 执行 QE1 - QE3 可以明显看出,该货币政策行为驱使黄金上涨;QE1 从 2008 年 11 月开始至 2010 年 6 月、QE2 从 2010

年11月开始至2011年6月、QE3则是从2012年9月开始。从这些区间我们可以看出,美元指数的下跌给予了黄金强势上涨力道。



图 1-2 SPRD 黄金 ETF 和美元指数走势 (近三年)

(3) 总体经济问题

过去一年,欧洲蒙受债务问题困扰,欧洲央行以大动作来化解危机;美国联准会也施行第3次QE;其他主要G8国家像是日本或英国央行也进行宽松政策。全球主要央行施行的宽松政策,让该国货币贬值,也导致通货膨胀,这些都助长了黄金价格。所以,在此我们建议投资者多观察全球景气和主要经济体的货币政策,这些都左右着黄金的价格。

(4) 各国央行黄金储备

从世界黄金协会(World Gold Council, WGC)2012年9月公布的消息来看,截至目前,全球黄金储备量共计31359吨。美国黄金储备量最大,为8133.5吨。其次为德国(3395.5吨),国际货币基金组织(IMF)(2814吨),意大利、法国、中国(共1054.1吨)等。我们在本书系“实战篇”中提到,因为欧债问题导致全球经济下滑,并且QE的启动使得美元价跌;所以不管是墨西哥、俄国、韩国一些新兴国家,或是黄金储备率较低的国家,过去以来都在持续购买黄金来进行储备。各国央行在2012年上半年历史性地购入254吨黄金,若该趋势持续,则全年购金量将创20世纪60年代初以来的高点。对

于金融系统及全球经济的担忧令各国央行减持美元及欧元,持续购入黄金。国家黄金储备抛售或者是买进,都会对黄金市场带来影响。

(5) 其他

黄金价格仍然受着市场终端消费者或工业需求的影响,投资者仍需注意其他影响黄金价格的因素。例如:季节问题、源头供给、终端消费需求或者是国际政治问题等因素。我们就季节因素来细说,过去黄金交易的淡季多集中在每年夏天,而旺季大多在第4季到隔年第1季。而一些特定国家节日也会影响黄金需求,例如:印度4月或5月的 Akshaya Thrithiya 节,或者是11月的排灯节,这些节日都为该地购买黄金的重要节日。印度与中国对黄金消费需求超过全球总需求50%以上。从过去的资料来看,2002年至2010年,黄金价格在印度排灯节至次年中国春节前约有一成的上涨。而从政治因素来看,不管是战争还是国与国的对峙,这些都会导致市场紧张,驱使黄金价格上涨。

我们上述所提到的几点都是影响黄金价格的敏感因素。当然,黄金市场变幻莫测,除了这些要点之外,仍有终端工业或民间需求、开采者的成本考虑、全球黄金储量状况、突发事件等问题,这些问题仍可能影响到黄金价格走势。我们在此提供的是判断价格的大方向,最终策略仍要依靠投资者自己决定,这个策略你可完全依照自己认为重要的讯息来加以应用。

投资学习是模仿,但绝不是照本宣科,也无法一步登天。照本宣科的结果会导致你邯郸学步,无所适从。一个成功的投资者会不断训练自己的判断力和决断力,再搭配适合自己的 MT4 程序,不断地修正,一步一步稳健地进行,绝对可以提高你在市场上的投资胜率。

1.2 展望黄金市场

(1) 市场供给和需求情况

黄金价格的波动受市场供给和需求因素的影响,2012年11月世界黄金协会(WGC)表示,预计2013年黄金需求强劲,贵金属将延续十多年来的多头行情,原因是中国和印度的黄金需求将持续增加。目前,世界第二大经济

体中国正逐渐复苏,这使得 2013 年中国黄金需求较 2012 年将有所增长。另外,欧美国家的宽松货币政策,仍会使得全球金融不稳定,驱使黄金避险价值升高、各国央行的储备不断增加。

(2) 全球经济发展现状

过去一年来,全球主要发达国家的经济成长趋缓甚至下滑。不管是欧洲、日本或是美国的经济问题仍会影响开发中国家。所以,欧元区债务问题持续拖延、美国的财政悬崖或债务上限问题,都使得欧洲和美国陷入经济成长泥淖,这使得美国 2012 年 GDP 的增长不到 2%,欧洲方面更是惨不忍睹,多数国家失业率高居不下。这些都进一步使得开发中国家面临经济问题,因为主要消费大国的经济问题影响了消费需求;过去新兴国家 GDP 年成长都在 8% 左右,但反观 2012 年却只有 5% 左右。对于 2013 年来说,全球性的衰退是否会到来,仍是投资者心中的疑虑。或许 2013 年全球经济仍持续复苏,但力道仍然薄弱。

(3) 外汇市场的影响

如前面所言,美元对黄金价格具有一定的影响力,随着美国经济好坏而左右黄金价格走势。美国经济发展稳定,黄金价格则趋弱;美国经济发展充满疑虑,黄金价格则出现强势。另外,2012 年 FED(美国联邦储备)进行了第三次量化宽松政策(QE3),为了复苏经济和振兴劳工市场,而利率方面仍然维持近于零。但 QE3 不同于前两次,因为 QE3 没有明确的终止期限(没有设定规模力道)。对于美国来说是否会面临着和日本一样的情况,这是令国际投资者担心的事情。过去日本失落的 10 年,国内经济持续低迷,该政府持续维持低利率 0~0.1%,并多次进行量化宽松政策,但是经济仍然没有好转;低利、人民和企业仍然持续储蓄,保守面对,使得市场信心不足,再多的宽松政策都无法救赎,这也就是所谓的“流动性陷阱”(Liquidity Trap)。现在,对于国际热钱来说,目前面临着进退两难局面,因为美国经济的不确定性,加上国际态势动荡,所以多数资金都会转往黄金市场避险。

(4) 国际间的政治角力

2012 年美国大选已结束,奥巴马获得以连任,而奥巴马获连任之后将更