

前不久和某位投资者闲聊，他情绪低沉、茫然不知所措，最近的一笔交易导致本金大幅回撤。

我对他的情况很了解，期货上不是没赚过钱。初入市场时，由于行情单边下跌，且站对了方向，他很快收获了“第一桶金”，也体验了一把期货快速造富的刺激。之后，各种小短线也是偶有斩获。

他说，那个时候，除了现货，还可以做做交易，挺充实的！

可是不知道从什么时候开始，交易成了件郁闷事。从第三者的角度看，这一切可能始于某次做反行情导致的惨败。

想想吧，拿几千块钱就买了好几万的商品，价格波动1%，就代表了10%的盈亏，多么刺激！

天使和魔鬼存于一身，一旦判断失误、过量交易，必然惊慌失措，引发情绪失控。

于是，急于捞回亏损。

加杠杆导致的亏损，只能用加杠杆来挽回，否则付出的时间和辛苦将会成倍增加。

可是，失控后行为失据，盲目交易往往导致连续的挫败，最后彻底失望，躲在角落疗伤，再也不问世事。

也难怪总行内人说，  
期货市场，生存比盈利重要，只有控制住了风险，在机会来时，我们才能收获胜利，但这一切的前提，必须在大脑理性受控的前提下才能做到。

看看高速公路的设计就能有所启发，为什么公路两侧会多铺出路边部分？

为什么车道之间会设置分界线，而且车轮一压会发出“喀拉喀拉”的警告声？

为什么车道宽度都留有余量，还有速度限制和前后车距限制？

如果完全理性，我们完全没必要这样浪费，正因为清楚自身的弱点，针对这些不足，我们利用技术手段加以克服。

很多人做了好多几年交易，这笔赚了，那笔亏了，炒作热点始终在变，但交易依据却始终停留在随性而来的感觉上，根本无从谈积累和提高。

而量化交易为投资者的快速成长提供了最佳“舞台”。

通过观察历史上有效的交易策略，寻找灵感；阅读各个领域的书籍，提炼思路；然后经过历史交易数据的验证，改进完善；最后，再用未来的行情去测试，去伪存真。

这个流程走一遍，很多本以为赚钱的策略就被零成本排除了，不仅昂贵的“学费”降低了，更是节省了宝贵的时间成本。

因此，我们始终能看到自己能力的提高。从交易哲学上，从量化能力上，这种有路径可依的正反馈，也是量化交易者最大的乐趣。

### 3、交易系统

所谓交易系统，就是一整套分析看待行情的方法。如何选择品种，什么情况下单，什么时候出场，账户资金管理，增减仓的时机等等。有了交易系统，在这个市场我们就有据可依，至少不会慌乱。