

MultiCharts

程式交易實戰應用

港股期指專書 ▶▶▶

新手如何在12個小時內

學懂用MultiCharts

背熟MultiCharts 13個基本語法

配合10個練習立即學懂

- 用MultiCharts自製
Zero Lag Macd「零滯後MACD」
- 期指盤路分析（獨家交易竅門）
- 熟練最新版本MultiCharts 12連接
任何證券行Auto Trade

麥振威 著
C.M. HO

作者簡介

麥振威

投身投資行業逾20年，2003年至今曾撰寫廿多本財經書籍，過往著作包括《MACD港股實戰應用法則》、《程式交易（上冊）——即市香港期指AmiBroker應用》、《全職操盤》、《尾市黃金十分鐘》、《保歷加通道——港股應用法》等。2014年開始舉辦程式交易課程，教授MultiCharts與AmiBroker應用及編寫交易策略。

C.M. Ho

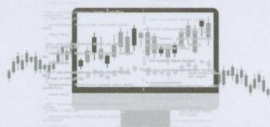
2014年合著《全職操盤》一書，對程式交易有深刻認識，並協助教授程式交易課程。

MultiCharts

程式交易實戰應用

港股期指專書 ▶▶▶





MultiCharts 程式交易實戰應用（港股期指專書）

撰寫這書時，偶爾看看書局的網頁，原來由 2003 年至今筆者已寫了 29 本財經書籍，而這本已是第 30 本。回想最初的港股及期指市場與現在相比確實有很大的變化。近年程式交易越來越流行，筆者在 2005 年的個人書籍中已提及過，最初以 Tradestation 比較流行，後來在港也興起 Metastock，到現時最多人使用的便是 MultiChart 及 AmiBroker。

筆者在大約七年前開始教授程式交易，當時在香港真正做用程式做交易的人其實不多，網上的資源也很少，大家學習時也是參考台灣的資源，而做交易時，也是只能把程式連接至 Interactive Broker，我們是第一個教授如何將 AmiBroker 連接至本港證券行常用的 SP Trader 進行交易，其後我們也是第一個再研究出將 MultiCharts 12（目前最新版本）連接至本港任何一家證券行。

後來「富途牛牛」的出現，由於提供了免費的股票實時報價，以及交易免佣金，不少人也向筆者詢問能否透過「富途牛牛」進行 Auto Trade，答案是可以的！現在我們最新的程式交易課程中，內容便包括了教授學員如何將程式連接至「富途牛牛」拿取實時股票數據、歷史數據，及進行全自動交易。

程式交易的發展越來越快，在香港也越來成熟，日後也會更加流行，將來只要有方便的交易方法及技術，我們也會研究出來，撰寫新書與大家分享，有興趣深入研究的，也可在我們的課程中學習得到。

麥振威

5年前有幸與麥振威先生編著《全職操盤——輕鬆學懂全自動程式交易工具 Program Trading》一書，講述如何使用 AmiBroker 進行分析，後來更成為 Quants Training 課程助教，教導大家如何透過 AmiBroker 連去 SPTrader 進行 Auto Trade，在此感激麥振威先生給予筆者這個機會。

在筆者眼中，AmiBroker 跟 MultiCharts 都是一套好好的分析軟件，當然用那一種都沒有所謂，因為程式交易的重心從來是個策略，跟軟件沒有太大關係。那為甚麼筆者寫完 AmiBroker 還要寫這本 MultiCharts 的入門書呢？因為筆者發覺太多人對 MultiCharts 有興趣了，MultiCharts 在香港、台灣等地的知名度遠勝 AmiBroker，而 MultiCharts 有設有中文券商版，更方便大家連交所屬證券行進行 Auto Trade。

在這本書中，筆者會由淺入深，一步一步由安裝、匯入數據、圖表使用、編寫及測試策略等，教導讀者使用 MultiCharts 的各大功能，讀者如依足本書的教導，就能夠掌握 MultiCharts 大部分功能了。

程式交易從來都不容易，而你以前以為無敵的交易策略往往在 Backtest 後就發覺完全不行，找尋一個贏錢又穩定的交易策略永遠都是一條漫長的道路，筆者衷心希望讀者們都能夠找到一個適合自己的交易策略。

C.M. Ho



第一部分：何謂 Quants

何謂 Quants ?	10
用 20 萬翻到 16 億的天才散戶	14
MultiCharts 的發展歷史	18
MultiCharts 可連接任何證券行進行全自動交易	22
MultiCharts 與 AmiBroker 比較	26
新手如何在 12 個小時內學懂用 MultiCharts	29
最新版 MultiCharts 12 可零佣金 Auto Trade	33

第二部分：MultiCharts 的基本應用

MultiCharts 介紹及安裝	38
從 Yahoo、Google 匯入股票數據	43
從 SP Trader 匯入期指實時數據	52
如何匯入文字檔的歷史數據	60
基本圖表功能使用	64

第三部分：PowerLanguage

MultiCharts PowerLanguage Function 介紹	74
PowerLanguage Editor 的三大種類：	
Functions, Indicators 及 Signal	76
利用 PowerLanguage 自行編寫技術指標	86

利用 PowerLanguage 編寫交易策略	98
如何用 MultiCharts 測試 (Backtest) 交易策略成效	107
如何 Backtest 期指交易策略	117
如何利用 MultiCharts 優化你的交易策略	126
如何把 MultiCharts Program 放上雲端	130

第四部分：MultiCharts 基本語法

一) PowerLanguage 中的標點符號	142
二) PowerLanguage 的基本「格式」	144
三) PowerLanguage 的常用字	149
四) 限價單與好倉或淡倉	151
五) 止賺及止蝕	154
六) 上日的高低價	157
七) 移動平均線	162
八) 相對強弱指標 (RSI)	165
九) 移動平均線 (MACD)	168
十) 保歷加通道 (Bollinger Band)	171
十一) 隨機指數 (STC)	174
十二) 真實波動幅度均值 (Average True Range, ATR)	178
十三) 分注入市寫法	182



第五部分：MultiCharts 實戰練習

練習一)	保歷加通道與 RSI 混合策略	190
練習二)	兩組保歷加通道混合策略	195
練習三)	EMA、SMA 及 BANDWIDTH 混合策略	199
練習四)	期指突破首 15 分鐘高低價策略	204
練習五)	STC 的超賣訊號	209
練習六)	逢周五下午三點後入市的寫法	212
練習七)	平均趨向指數 ADX 的應用策略	216
練習八)	期指加注入市寫法	223
練習九)	低位「溝貨」寫法	230
練習十)	MACD 及保歷加通道配合 TEMA 策略	238

第六部分：交易技術篇

多重 Time Frame 交易策略不適合即市交易	246
如何用 MultiCharts 自行製作	
Zero Lag Macd 「零滯後 MACD」	252
期指盤路分析（獨家交易竅門）	262
如何運用「Pin Bar」選股	276
Multicharts 程式交易課程及期指盤路分析課程介紹	282
MultiCharts 有關的實用網頁介紹	292

GroupDesc::ElementDesc el

std::string sp_name = it

std::string spritename =

el.type = boost::lexical_

el.type = boost::lexical_

el.type = boost::lexical_

assigned layer = 0;

if (item->Attribute("layer"

{

layer = boost::lexical_

}

el.name_name_ = sp_name;

el.name_spriteName_ = sprite

return 0;

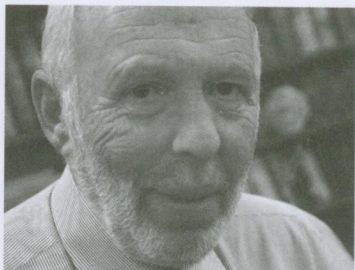


第一部分 何謂Quants



何謂 Quants ？

Quant 的全名為 Quantitative Analyst，中文譯名就是量化交易分析師。這名字的興起已有十多年，不過開始受較多人關注應是 2008 年美國次按危機，不少從事量化交易的基金出現虧損，而大眾也開始注意到原來從事量化交易的利潤竟是天文數字，動輒數十、數百億美元，美國次按危機雖令他們虧損，但很快他們又再利用程式賺取驚人的回報。



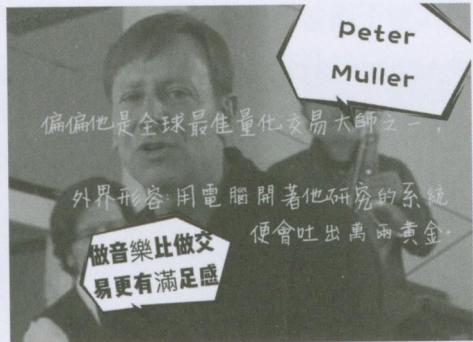
Quant 就是利用電腦程式分析風險並預測市場走向，釐訂不同的交易策略，全球著名的 Quants 包括了大獎章基金創辦人西蒙斯（James Simon）、摩根士丹尼的彼德米勒（Peter Muller）、格里芬（Kenneth C. Griffin）等。

但其實只要有決心，一般的散戶也可以成為 Quants，即使交易策略未必如這些大型基金般複雜，但你也可以設計你的交易策略，讓程式來替你自動執行，降低人性的風險，同時得到統計上的優勢。

或許你會說，他們擁有的「資源」比一般人多，自然較容易在市場賺錢，至少在設計交易策略時也有更多的支援。若大家看看彼德米勒及格里芬的成名故事，應會明白，其實你也做得到！

先說說彼德米勒，有趣的是他喜歡音樂比交易更多，不過令他成名的卻是交易的技巧，最初加入摩根士丹尼，就是一個只有兩個人的小部門負責交易公司的自營資金，能配合他們的資源也絕對不會比一般散戶多出多少。

初期他一直也想不到任何能賺錢的策略，他回憶當時的環境：「那時候想到一個能賺一點錢的策略，我們便要慶祝，但所謂的慶祝也只是拿一些紙杯來喝一些平價的香賓……」



曾經摩根士丹尼給他最後一個月的期限，仍想不到賺錢的策略替公司獲利，那他便要「執包袱」離開，不過當時的彼德米勒彷彿突然明白了市場上的一些事情，把最初認為不可行的交易策略重新整理起來，然後再利用程式抽取有價值的部分，結果便找到確實能獲利的策略。直至後勒，摩根士丹尼總部的人總是說，彼德米勒設計出來的交易系統，讓人彷彿覺得只要開著電腦，然後讓系統自動執行，自然便會吐出萬兩黃金！