

目 录

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（一）	2
优秀交易系统的最大特征：量化.....	2
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（二）	4
交易策略的选择标准：获利预期，成功率，触发频率.....	4
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（三）	6
多个交易策略之间的配合原则：互补.....	6
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（四）	8
我的币市交易系统之概述.....	8
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（五）	11
我的币市交易系统之趋势.....	11
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（六）	15
我的币市交易系统之结构.....	15
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（七）	18
我的币市交易系统之周期和序列.....	18
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（八）	21
我的币市交易系统之其他指标.....	21
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（九）	23
我的币市交易系统之仓位管理.....	23
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十）	25
我的币市交易系统之易与难.....	25

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十一）	27
番外篇之一：数字货币有未来吗？	27
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十二）	28
番外篇之二：如何看待币市消息面？	28
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十三）	29
番外篇之三：为什么反对用杠杆？	29
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十四）	31
番外篇之四：为何不建议重仓一只币？	31
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十五）	32
番外篇之五：如何看待 V 形反转？	32
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十六）	33
番外篇之六：币市可以拿长线吗？	33
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十七）	34
番外篇之七：短线或超短线可以玩吗？	34
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十八）	35
番外篇之八：预测和操作需要统一吗？	35
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十九）	35
番外篇之九：如何熬过逆风期？	36
从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（二十）	37
番外篇之十：熊市可以不用看盘吗？	37

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（一）

优秀交易系统的最大特征：量化

1、优秀的交易系统必须具备一样东西：量化标准。“马上有一波大行情”不是，得包含多长时间多大幅度；“再跌点就可以买”不是，得包含跌几个点就买；“在别人恐惧时进场”更不是，得包含什么时候几点几分才恐惧、多少点位进场。。。诸如此类。量化标准得是可以明确执行的指令，不能有一点含糊其辞。

2、比如之前我微博经常提到的币市三大铁律：严格止损制度，不重仓一只币，不加杠杆。其中前两条都不算是量化标准。“严格止损”，得包含多少点就必须止损，如果再具体的话就得一条条写清楚到可以简单执行；“不重仓一只币”，得包含多重叫重，五成还是七成。若要建立交易系统，这些东西都必须量化。

3、为何很多交易标准难以执行？因为没有被量化。一旦交易标准无法被量化，就容易向情绪化交易倾斜。交易系统有两个最大的目的：追求长期整体高期望值和把情绪关进制度的笼子。所以，没有被量化的标准不是好标准，哪怕它们看起来很好。有了“量化”的思维，再去面对各种交易策略，心中就有了一杆秤。

4、交易中为什么容易恐慌？恐慌源于对未来的不确定。如果有了量化标准，在交易之前就清楚：涨了、横盘、跌了分别怎么操作？每天盯着交易系统看看第二天的这三个方向分别的策略。如此，何来恐慌？按部就班即可。交易就像流水线操作工人的机械化劳作一样，而不

是一场场扣人心弦、惊心动魄的冒险游戏。

5、挑选交易策略进入交易系统的过程，“量化思维”可以过滤掉很多看起来很牛逼但事实上毫无实战价值的交易策略。要确保挑选进来的策略，全都是可以触发明确交易指令的，这样才能发挥“系统”的作用，抑制情绪对交易的影响。就像西蒙斯的大奖章基金那样，系统建立后绝大多数情况都是由机器完成交易。

6、下一篇谈谈关于交易策略的选择标准。我要做的，不仅是跟大家分享我自己的交易系统，还要一步步讲解交易系统是怎样建立的。这样，大家就可以自己动手、丰衣足食，并不一定要照搬我的交易系统。说不定在这里，哪天会突然冒出一个金融天才，未来能成就一番伟业。那我也算有知遇点拨之德，善莫大焉。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（二）

交易策略的选择标准：获利预期，成功率，触发频率

1、挑选交易策略进入交易系统，这一步是最困难的，之前说过，世上策略千千万，到底应该选哪些？不应该选哪些呢？经过“量化思维”的筛选，剩下的具备量化标准的指标和策略依旧多如牛毛。要把这么多指标和策略回溯到过去几十年的行情中去，最后才能得出该指标的优劣、能否加入系统。工作量大得惊人。

2、这样巨量的回溯统计工作，有没有捷径呢？很可惜，没有！顶多也就是一部分指标和策略，可以用软件来跑一跑，更多的还是得自己手动统计。在我过去的二十一年职业投资生涯中，大量时间就是花在这件事情上。世界很公平，没有平白无故的成功。如果你不愿意花时间在研究上，那就得一直花学费在市场上。

3、经济学上有“不可能三角”：货币自主权、汇率稳定、资本自由流动；投资上有“不可能三角”：高收益、低风险、高流动性。交易系统领域，我也独创了一个“指标不可能三角”：获利预期高，成功率高，触发频率高。换句话说就是，市场上不存在同时满足这三个条件的指标或者策略。人有三高，指标没有。

4、选择交易策略的第一个标准是：获利预期。前面说过建立交易系统的第一个目的，直白地说就是以稳定地赚钱、赚大钱。但若某个指标触发后，每次成功的时候只能赚取很少的利润，尽管每次失败的时候亏的不多，那么它就不能算是一个优秀的指标和策略，至少不能

当成系统中最主要和最重要的指标和策略。

5、也就是说，我认为交易系统中最主要的指标和策略，最好是那种一旦成功就能赚到大钱的策略。当然，如果你能找到那种尽管每次赚的利润很少，但成功率极高且触发极为频繁的指标和策略，也很屌。很遗憾多年来我没找到，成功率和触发频率很难兼容。但是有人找到了，就是上章提到的西蒙斯的壁虎式投资。

6、所以，总有些天才让人嫉妒得咬牙切齿，嫉妒之余也得承认，我们就是普通人。既然对于99.99%的人来说，成功率和触发频率无法兼容，那就只剩下一条路：让“获利预期”成为主导，剩下的基因缺陷想办法通过其他策略来弥补。说到这里，大家应该能明白，那些自称在交易市场能一招鲜吃遍天的家伙，99.99%是胡扯。

7、下一篇谈谈关于多个交易策略的配合问题。大家有问题可以在推特主贴下留言，我有时看到就会回复，尽量不要给我发私信。这样我们就一个问题的公开探讨，也能给其他朋友带去一些新的启发。推特还在摸索中，尤其是这个评论回复的地方和微博完全不一样。所以，有些评论没有回复的话，还请大家见谅！

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（三）

多个交易策略之间的配合原则：互补

1、如果一个指标或策略，就算获利预期不错、成功率也不错，但是触发频率太低的话，便会浪费太多等待的时间，平均收益率算下来也不会令人满意。面对这种兼容了“获利预期”和“成功率”的指标或策略，可遇不可求，只能作为后备策略备用，不能作为日常工具。遇到了就搞一把，遇不到也不影响日常交易。

2、所以，最重要的指标或策略，要同时满足“获利预期”和“触发频率”。这一点之前很多人无法理解。抽丝剥茧写到这里，大家应该能明白其中的道理。那么根据上一章讲到“指标不可能三角”理论，能同时满足这两点的指标和策略，它的“成功率”一定是很低。那就一定需要其他指标或策略来配合补足短板。

3、策略之间的配合原则是：互补。既然主策略在“成功率”上有缺陷，那么就要找到那种“成功率高”的指标来弥补主策略的短板。要留意，用“弥补”来形容可能不太精确，我更喜欢用“接力”这个词来给副指标进行精确定位。大家可能现在无法理解，等后面的章节我用自己的交易系统来举例，就会非常清楚。

4、交易是门科学，也是一门艺术。对于交易系统来说，它的艺术性体现在如何把各种策略在K线走势上进行有效、高效地融合。如果你的交易系统是由一个主策略和多个副策略组成，那如何进行有效、高效地融合呢？答案是：仓位权重。写好了仓位权重剧本，最终落到

买卖操作上，我们自己当一台机器人就好了。

5、总结来说一句话：我们要找到那个能同时满足“获利预期高”和“触发频率高”的主指标策略，然后找到其他“成功率高”的副指标策略来为其接力，并安排好各自指标策略的仓位权重，并在这一点上进行长期不断地微调和优化。看到这里是不是觉得建立交易系统没那么难？就像一把密码锁，难易就在一瞬间。

6、从下一篇开始进入我自己交易系统的分享章节。再次提醒，我并不认为我自己的系统就是最优的，只是给大家一个基本的参考，让很多朋友能交易生涯第一次真真切切地看到交易系统是什么样子的。由于每个人的基本面不同，理论上，不同类型的投资者应该建立不同的交易系统，原理相同，表象有所差异而已。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（四）

我的币市交易系统之概述

1、一个人的交易可能杂乱无章、毫无规律可言，但是一大群人的交易就会形成秩序，在某些特殊的时刻形成规律。而指标和策略，就是为探明和摸清这些秩序和规律而诞生。从使用者的角度来说，没有太大必要去搞清楚这背后的深层次逻辑，而只需要搞清楚：指标和策略在某些特殊时刻，是否真正具有概率优势。

2、不同交易市场，因为参与方的整体性差异，会导致指标和策略在不同市场之间移植的时候出现水土不服，这时候就需要做修正优化。比如托马斯迪马克的 TD 序列，13 最合适美股市场，而移植到 A 股就变成 9 最优；比如比尔威廉姆的一致性获利法，移植到 A 股就需要在 MACD 上进行参数调整，才能较大程度发挥作用。

3、我的币市交易系统里，所有的指标和策略都是从 A 股中移植而来。有一些比较适用，或者说虽然不太适用但回溯和调整起来都很容易，则不需要花太多的时间就优化好了；另外还有一些，不太适用或者我还不确定适不适用的，调整起来就很麻烦，工作量很大，需要大量的时间精力去做交易回溯和参数调整优化。

4、比如，结构形成后影响的周期，A 股的话是 24 个周期最优，那币市呢？A 股是 4 小时交易，币市是 24 小时不间断交易，那结构影响还是 24 个周期吗？如果不是，如何优化？比如序列，A 股是 9，而移植到币市却成功率比 A 股差太多，如何调整？等等这些，都需要

做交易回溯，通过统计得出具备概率优势的数值。

5、老粉都知道，我的主战场是股票和期货，炒币只是娱乐，所以没什么精力和动力去做太复杂的指标回溯统计和优化。写这个教程呢，一是做个阶段性总结，给朋友们一点借鉴。二是告知那些有志于币市交易、愿意在此方向深度挖掘的朋友这个具体方向，说不定就有人能自己优化好一些指标策略，那就很哇塞了。

6、我自己交易系统的指标，由三部分组成。1，趋势和结构；2，周期和序列；3，其他指标。只有趋势和结构，有仓位权重。操作上的所有动作，都由它们来决定，且趋势为主，结构为辅。周期和序列是对趋势和结构的精细化辅佐，不能单独使用。其他指标要么进一步辅佐主要指标，要么作为极端行情的备用。

7、严格来说，交易系统应该分为三个版本。1.0 版本是只按照一个指标操作。比如开推特的第二篇赚 6 倍多的交易回溯。这种只用一种策略就能大幅盈利的情况，在股市中几乎不可能。之所以在币市可以实现，是因为币市的震荡期比股市短、单边幅度比股市大。老粉应该耳朵都听出茧了，这就是我转行炒币的原因。

8、2.0 版本，就是在 1.0 主策略的基础上，再加入多个指标为其辅助的交易系统。也就是我现在正在分享的交易系统。3.0 版本就是在 2.0 的基础上，加入了个人对市场走势经验的修正，最主要的修正，体现在仓位管理上，在尊重系统指标的前提下，对仓位进行重新规划。就像西蒙斯的量化交易，也会偶尔出现人工干预。

9、比如说，一轮大牛市过后的一段时间，就算重新站上趋势，2.0 版本的标准就是满仓，

而 3.0 可能只进底仓，后面如果走稳再找买点加。因为牛市后的调整止跌站上趋势，按照经验判断，要么是震荡小幅反弹，要么是下跌中继，出现继续 V 新高的概率不大，所以就算站上趋势也只能小仓位进场。这样的例子并不少。

10、可惜的是，3.0 版本和个人能力、交易经验高度相关，对心态控制、交易娴熟度等专业素养的要求很高，完全不具备复制性。这也是为什么微博很多人说看了几年都学不会的原因。所以在这里，我要分享的是多数人能学会的 2.0 版本。同时，好消息是 3.0 版本最终取得的成绩并不会比 2.0 高太多。应付币市，2.0 足够了。

11、普通人得练好剑谱先成为高手，不然上了战场就是死路一条，高手百炼成钢变成宗师之后，剑锋所指便是谱，从心所欲不逾矩。好了！教程终于要开始进入正题了，下一章开始讲我的币市交易系统之趋势。这是我整个交易系统的灵魂。应好几个粉丝朋友的要求，我会附图说明，以便让大家能有个更直观的感受。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（五）

我的币市交易系统之趋势

1、趋势分为趋势线和趋势通道。趋势线是用行情软件自带的画线工具，通过手动连接各个高点与高点、低点与低点之间的连线所形成，需要具备一定的基础知识和经验，对新手可能不太友好。因为这么多年来，我认为是很简单的东西，照样有大量的朋友觉得看不懂不会弄。

如下图，就是我经常在微博上发布的趋势线。



2、这几年在公众号、微博里，画了太多太多的趋势线，也零星作过多次讲解，篇幅有限，这里就不再展开详细讲。如果有需要，可以买书自己学，这个属于最基本的知识，是那种只要你愿意花一点点时间，就一定能学会的技能。后面也一样，那些最基础、易分辨、无门槛的知识，我就不展开讲，只讲重点和精华。

3、趋势通道，则是以各种均线为底层逻辑，在交易软件中嵌入调整优化好参数后的通道代

码，由软件自动生成，一次性直观地反映当下所处在的行情阶段，不管市面上怎么称呼它，精确地说，我更喜欢叫它多空通道。这个指标对新手比较友好，因为它可以量化到具体点位，相比于趋势线，不需要考虑画线的能力。



4、为什么大家看我微博从来不发趋势通道呢？原因很简单，这玩意不是我的，我是在别人的源代码基础上进行修改后，嵌入数字货币行情软件、调整参数后使用的。所以大家也不用问找我要这个源代码的问题，只能自己想办法。为了尊重原创，至少我会做到不主动传播。当然，这事不困难，如果用心一定找得到。

5、尽管趋势线和趋势通道在逻辑和细节上有差异，但多年前我就做过两者的交易回溯统计，最后在很多标的物上的表现差不多，几乎可以说的不相上下。比如，春节期间比特币在趋势线上出现了买点信号，随后趋势通道也触发了买点信号。而每次等到趋势线破位的时候，趋势通道也差不多的时间会触发卖出信号。

6、最终体现在整体盈亏上，两者的使用效果会差不多。那么具体到交易系统的选择上，当

然两者都可以使用。有画线功底的，就用趋势线，则不用借助其他软件工具；有一定软件代码编程能力的，就用趋势通道，一劳永逸、省心省力。对我个人而言还是更喜欢趋势线，尽管最终收益可能没区别，但是成就感更大。

7、之前那张赚6倍多的交易回溯表，就是按趋势通道做无脑买卖得出的成绩。策略简单得令人发指：站上通道全仓买入；跌破通道全仓卖出。是不是粗糙得一塌糊涂？！趋势最大的优势在于：永不踏空，永不套牢。之前我说只要牛市来就一定抓得住，还有人喷我吹牛逼。只要做到这最简单的一点，牛逼就是现实。

1	时间	开仓资金	买入价格	卖出价格	盈亏	收益率	平仓结余
2	20.4.6-4.15	10000	7323.9	6621.24	-959.4	-9.60%	9040.59
3	20.4.18-6.26	9040.59	7248.6	9162.21	2386.69	26.40%	11427.28
4	20.7.8-9.3	11427.28	9436.06	10140.85	853.52	7.46%	12280.79
5	20.9.19-9.21	12280.79	11080.68	10417.22	-735.32	-5.99%	11545.47
6	20.10.8-21.4.19	11545.47	10925.57	55633.14	47244.2	509%	58789.67
7	21.4.30-5.4	58789.67	57694.27	53200	-4579.6	-7.79%	54210.01
8	21.5.5-5.12	54210	57436.11	49631.31	-7366.41	-13.59%	46843.59
9	21.7.25-9.10	46843.59	35381.02	44850.91	12537.9	26.77%	59381.49
10	21.9.15-9.20	59381.49	48121.41	43015.62	-6300.51	-10.61%	53080.98
11	21.10.1-11.18	53080.98	48141.61	56891.62	9647.77	18.18%	62728.75
12	22.2.6-	62728.75	42380.87				

8、要知道，站上趋势通道后，并不是每次都能开启大牛市，甚至成功率很低很低，但是每次大牛市都是从站上趋势通道后开启的，无一例外。同时，跌破趋势通道后，也并不是每次都开启杀跌模式，成功率也很低很低，但是每次大熊市都是从跌破趋势通道后开启的。趋势通道策略，可以保护我们不犯原则性错误。

9、什么叫原则性错误？就是踏空主升浪，死扛主跌浪。“趋势通道”一次性解决了两个最大的问题。不管行情是暴涨还是暴跌，暴涨的主升浪，一定甩不掉你，暴跌的主跌浪，也一

定套不住你。这些特性，从交易回溯表上，也看得很清楚：赚最多的一笔交易一口气涨了 5 倍多，而亏最多的一笔交易只亏了 13 个点。

10、尽管单单这一个指标就能在币市取得不错的成绩，但还远远不够。因为它太粗糙不够细腻，有天生的缺陷：成功率太低。在震荡期磨损太严重，但是为了等到那一次大牛市，又不得不忍受磨损。在“成功率”这点上，交易回溯表的数据令人沮丧：仅 10%。尽管如此，我依旧认为它是币市投资最佳策略，没有之一。

11、四年前刚入圈，我就发文认为趋势投资是币市最佳策略，现在这个观点还更加笃定。所以，趋势指标当之无愧成为我交易系统的唯一主指标，地位更加牢固。同时，趋势过于粗狂，傻傻地全仓干、全仓斩，还十次只成功一次，显然不太尽如人意。有没有其他指标能一定程度地弥补一下，让趋势变得细腻一些呢？

12、答案是：有的。从成百上千个指标策略中，我选中了“结构”。下一章，讲我的币市交易系统之结构。“结构”是我交易系统中的唯一副指标，也承担了不小的仓位权重。如果说交易系统只能选 2 个指标的话，那就是趋势和结构。又或是你比较赶时间，没耐心看完所有的教程，那么最后看看下一章，也可以了。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（六）

我的币市交易系统之结构

1、大多数行情的演化都会经过萌芽、发展、鼎盛、衰竭、转势的过程。如果说“趋势”是典型的右侧交易，是在转势之后的跟进。那么“结构”就是典型的左侧交易，它是对速度的一种势能定性，是从鼎盛到衰退的一种量化标准。我们对“结构”进行跟踪研究，是为了抓住转势的临界点，更加细腻地为趋势服务。

2、结构形成之前，必先出现一种状态：钝化。钝化是结构形成的必经之路。那什么是钝化？直白点说，就是没有表现出应该表现的状态，出现了不同步。当价格创新低，MACD的DIF值不新低，且负脚线出现2根则判定钝化。当钝化发生之后，出现DIF拐头的那一刻，结构就此形成。钝化是种状态，结构形成是一个时刻。

3、结构分为底部结构和顶部结构。上节是以底部结构为例，反之则为顶部结构。两波同向行情中间至少要有两个以上的反向角线来隔开，通过观察动能上的变化，来跟踪判断速度从鼎盛走向衰退的拐点。必须注意的是，所有价格都要以周期收盘价为准，只有周期走完后，收盘价才能写死，相应的指标值也会写死。

4、结构理论，适用于不同的时间周期。大到日线、周线，小到15分钟线、1分钟线。不同的周期对应不同级别，周期的级别越大，结构形成后产生的力度和影响时间也越大，大周期牵制小周期，小周期服从大周期。如果出现“周期共振”，也就是多个周期都出现结构形

成，那么力度和影响时间会更高，并不多见。

5、从量化标准的角度来讲，“趋势通道”的交易标准一目了然，每天的通道上下轨价格肉眼可见；“结构”的交易标准也很清楚，就是钝化后 DIF 拐头、结构形成的那一刻。前两个月做过一次比特币一年的结构分析，一年来，日线级别底部结构出现过一次，顶部结构出现过两次，分别精准对应最低点和两个最高点。（图）

6、像这样 100%成功率的情况，绝非常态。并不是每次重要的高点和低点，都会伴随结构的形成，也并不是每次形成结构后都能促成趋势的反转。只是说，当结构形成之时，才有了交易上的概率优势。如果最终结构失败，市场走了小概率方向，就得及时纠错。交易的本质就是在大概率的地方下注，并防范小概率风险。

7、那么，如何纠错？市场有时候在结构（底部或顶部）形成后，也可能消失，消失后继续钝化，然后再次形成新的结构，如此拉锯。但是，记住一点：在结构形成时买进的仓位，如果市场走了小概率反方向，那么就要纠错（止损或者重新买回），纠错的量化标准是：钝化消失。也就是 DIF 值低于（或高于）前锋值。

8、单按“趋势通道”来操作，还能赚大钱，因为币市震荡期短单边幅度大。但单按“结构”来操作，我认为效果会差很多。尽管它成功率比较高，但日线级别的触发频率很低，若用更小级别周期，效果又会差很多。更重要的是，“结构”只提供了买入（卖出）的量化标准+纠错的量化标准，并没有形成交易闭环。

9、比如你在一个底部结构买进，但它并没有卖出的标准，因为并不是每个高点都会出现顶部结构。很可能你持仓等来的不是顶部结构，而是回调之后的另一个底部结构。请问你该咋整？又会掉入情绪化交易的陷阱。所以，不仅买得有量化标准，卖也得有量化标准。买卖都有法可依，才能称为成熟稳定的交易系统。

10、所以“结构”的特性很鲜明，单独使用无法发挥它最大的作用，只有配合“趋势”使用，才能扬长避短，实现 $1+1>2$ 的效果。“趋势”和“结构”在我看来，就是天作之合。它们奠定了交易系统的基石，剩下的仅仅是在它们基础上，加入仓位管理策略和其他指标的辅助。下一篇讲：我的币市交易系统之周期和序列。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（七）

我的币市交易系统之周期和序列

1、周期就是时间周期。大致分为 1 分钟、5 分钟、15 分钟、30 分钟、60 分钟、4 小时、日线、周线、月线、年线。。。之前好像提过，绝大多数指标和策略，同样适用于不同的周期，为什么要跟踪研究不同的时间周期呢？就是为了尽量搞清楚当下的行情，大环境、小环境、微观环境，正在发生一些什么样的事情。

2、我认为跟踪研究时间周期，最重要的意义在于：很多情况下的低点，会伴随某个小级别周期的买点触发。比如，有时候日线级别的结构并没有形成，而 60 分钟的结构却形成了。

“结构”是有仓位权重的，显然这个 60 分钟的结构也可以具备操作性。但如果你不去跟踪研究各个周期的当下结构情况，就很容易错过。

3、我们最希望看到的一种情况是：在某个时刻，各个周期都出现结构，这叫“周期共振”，这是令人兴奋的迹象，会比单个周期触发结构的成功率和力度要大很多。但这种情况，可遇不可求。大周期结构对应的行情反转力度大，小周期结构对应的行情反转力度小，不同周期下的趋势和结构情况，构成了买卖依据。

4、之前说过“结构”是左侧指标，得结合趋势来使用，单独使用的意义不大。“结构”最大的意义在于：借助结构产生的转势力度，助力 K 线突破趋势。所以“接力”这个词是不是更恰当？问题是，日线等大周期的结构触发频率太低，这时候就需要从更小周期寻找机会，

尽管小周期的力度和影响时间不如大周期。

5、如果价格距离趋势很近，那么任何周期形成的结构，都可能最终形成趋势上的突破；如果价格距离趋势有点远呢？可能小周期的结构最终形成不了突破，但是大周期的结构却可以；如果价格距离趋势特别远呢？可能任何周期的结构都无法形成突破。但是“结构”的出现，就是买入的标准，又不得不买。怎么破？

6、对这个比较复杂的问题，我的答案是：精细化的仓位管理。“复杂的事情简单化，简单的事情标准化，标准的事情流程化”，啥叫简单化？就是一条一条列出可能出现的情况。啥叫标准化？就是针对一条一条简单的情况，做出应对条款。啥叫流程化？就是遇到哪种情况，就无条件地像机器人那样去按条款去做。

7、“仓位管理”会在后面章节单独详聊。如果说这个 2.0 交易系统中存在唯一没有精确量化的东西，就是：价格距离趋势“远近”的判定标准。这个判断虽然对我来说很简单，但我也想尽量量化这个东东，不过实在没办法，这个与交易市场不同、交易经验不同相关。也不用担心，就算做不到精准，对结果影响不大。

8、关于时间周期的选择，这个得看各人喜好和实际情况。包括前天有人问画线的周期如何选择，也是同样的问题。一般我会用日线为主要周期，更小一点级别周期来辅助，一般不考虑 30 分钟以下的周期，这样平时也不用太耗精力。这样的周期配合，只需要偶尔看看，有时候几天不看也行，特殊节点盯一下盘即可。

9、如果炒币是副业且完全没时间盯盘，选周线甚至月线为主周期做长线，用日线等小一点级别的周期来辅助，可能一年都不用交易一次；如果用分钟级别为主要周期的话，比如30分钟，15分钟，5分钟，那就是超短线，需要连续盯盘，对交易执行力要求也会更高一些，适合职业选手，我偶尔精力允许也会玩一玩。

10、序列，是个头疼的问题。炒币几年来，我还一直没有花时间精力去优化这个指标。虽然“序列”在股市中的表现很优秀，但我也没有给它一点点仓位权重。也就是说，不管它再怎么准，都不能以它的触发标准来指导任何仓位的买卖操作，因为它除了没有形成交易闭环之外还有个致命缺陷：单边行情中表现很差。（序列图）

11、具体来说，“序列”因为程式设计的底层逻辑缺陷，导致它在单边行情中表现较差，一旦失败，就会犯卖太早或买太早的错误，加上它的纠错机制并没有统计学上的概率优势。这是趋势投资中的大忌，不能容忍。在此，我并不想关于序列讲太多，因为：它移植到币市来，整体成功率更让人失望，得下功夫优化。

12、如果优化得好，能达到股市那样的准确率，那么它就是“结构”的好帮手。它的最大意义在于：辅助判断结构的形成。尤其是在钝化状态，如果出现“序列”的触发信号，那么结构形成的概率会大增。我大概是没这个动力再花时间去优化它了，没有它对交易系统的整体性也没太大影响。有兴趣的朋友倒可试试。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（八）

我的币市交易系统之其他指标

1、很多新手问我，需要学哪些技术分析？看哪些相关书籍？对这个问题我的回答是：先多多益善。结果很多人的确很努力，看了大量书籍，学了大量技术，却也依旧炒不好这个币。应该是：先多多益善，然后形成系统，再多多益善。很多人却忽略了这个过程，永远在多多益善中不得其法，最终怀疑技术的有效性。

2、第一个多多益善，是得丰富自己的知识储备。第二个多多益善，是用更多的技术来辅助交易系统。所以当你感觉“懂了很多技术，却依旧炒不好这个币”、遇到瓶颈无法突破的时候，就到了该建立属于自己交易系统的时候了。接下来，聊聊为什么对于交易系统的“其他指标”得是“多多益善”、其意义在哪里。

3、K线的运行自有其内在规律，没人能全方位参透，各类技术分析也只是为了试图参透某一部分，各有长短。就像盲人摸象一样，各有说辞。但如果你把尽可能多的“盲人”都抓过来问清楚，最后做做画像拼图，是不是对于“大象长啥样”清晰多了呢？仅靠邓超一个人的描述，“美人鱼”可能就长得稀奇古怪了。

4、“多多益善”的意义在于：虽然它们并不影响仓位权重，好像人畜无害、可有可无的样子，但它们的存在能帮助你建立更加完善的交易系统，以及交易系统不断迭代升级优化的储备。如果储备不够多、研究不够深，系统便会永远僵固在那里，失去了迭代升级的可能性。

从高手晋升为宗师，这是必须经过的阶段。

5、比如经过长期跟踪深入研究，你愈发认为某个指标在某个特殊时刻具备很高的概率优势，你完全可以把它加入到权重指标，重组一下仓位策略。不一定要按我交易系统的一二从来安排，世上没有完美的交易系统，适合自己的就是最好的。只要能科学选择、严格执行、具备迭代能力，迟早会成为优秀的交易系统。

6、写到这里，估计又会有人说能不能直接再多发一些指标呢？没办法，市场上充斥着大量不愿意深入学习、深入思考的人。其实在金融圈我已经算是很懒的了，和我有点私交的国内几个证券业大佬，哪个不是学富五车还继续保持昂扬的学习热情呢！看到他们我就会感慨，比你牛逼的人还比你勤奋，是多么的无奈。

7、好了，其实本章应该算是所有十章里最不重要的一章，是为了保证“交易系统”的完整性而写。就算没它们的存在，目前的交易系统应付币市也是绰绰有余的。下一章就很重要了，讲讲精细化仓位管理。有句话叫：脱离了仓位的交易系统就是耍流氓。接下来分享我自己交易系统的仓位管理，希望对大家有启发。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（九）

我的币市交易系统之仓位管理

1、前面说过，每个人的风格不同、理念不同、逻辑不同、所选周期不同、资金量不同、风险承受度不同，原则上所建立的交易系统也会不同，就算交易系统里所选的指标和策略都一样，可能因为这些差异而仓位策略也不尽相同。所以我只分享我自己的交易系统，包括这一章的仓位策略。意在给大家带去一些启发。

2、这一章最为简单，无非就是把“复杂的事情简单化”，但是意义还是很重大的。仓位划分合不合理不是最重要的，量化工作做还是不做、执行还是不执行，才是最重要的。微博上也提过一两次，我的仓位权重，只由趋势和结构来决定：趋势决定 10 成仓，结构最多决定 4 成仓。这是基本原则，所有细化由此开始。

3、趋势分为趋势下和趋势上。趋势下，原则上空仓；趋势上，原则上满仓。趋势上的底部结构没有意义，因为满仓买无可买；趋势下的顶部结构也没有意义，因为空仓卖无可卖。如果出现趋势下的底部结构或趋势上的顶部结构，则最多可买卖 4 成仓位。也就是说，趋势上最少保留 6 成仓，趋势下最多买进 4 成仓。

4、结构决定的这 4 成仓位权重之分配，有两个要素：时间周期和距离趋势的远近。短周期形成结构（如 60 分钟级别结构）+距离远，1 成仓。短周期形成结构（如 60 分钟级别结构）+距离近，2 成仓。长周期形成结构（如日线级别结构）+距离远，3 成仓。长周期形成结

构（如日线级别结构）+距离近，4 成仓。

5、之前的章节提过，2.0 交易系统中存在唯一没有精确量化的东西，就是：价格距离趋势“远近”的判定标准。当时为什么又说就算做不到精准，对结果影响不大呢？看到这里应该明白了吧，就算判断不对远和近，在仓位上的差距也就 1 成而已，等后期趋势指标触发后，仓位很快也就趋于一致了，最终的差异很小。

6、有种特殊情况得注意：当趋势指标刚触发的时候，如果这时恰好又形成了钝化、结构触发概率很大，就得多多等等。不以趋势为标准，要临时切换成以钝化消失为标准。这么做的目的是为了将交易做得更加细腻，避免大概率出现的磨损。这种情况出现的概率极低，一般出现在震荡期。一旦出现，帮助还是很大的。

7、临时切换的逻辑是：距离趋势极近，如果一旦结构形成，重新回到原趋势是有概率优势的。如果成功，可以规避不少点位的磨损；就算结构形成失败、钝化消失，再进行操作，多付出的代价也很小，何况成功的概率高于失败的概率。两者相衡，最优策略就是临时切换标准。注意：仓位标准还是按趋势的标准来。

8、如果能把交易中所有可能会出现的情形，都在仓位管理上进行——量化，每天都知道第二天的交易标准以及对应的仓位策略，什么情况买或卖？买几成？卖几成？那么，交易还算是一件很困难、很复杂的事情吗？通过完善健全的交易系统，把我们自己变成一台无情的交易机器。最终，时间会给我们丰厚的回报。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十）

我的币市交易系统之易与难

1、布拉德皮特曾主演过系列片《十一罗汉》、《十二罗汉》、《十三罗汉》，讲的是找到一群身怀各种绝技的人，组建一个团队，最终达成普通人无法想象的高难度目标。如果知识面不够广，可能压根都不知道应该找哪些人；如果对这些了解得不够深入，也压根不知道这些人合不合适、能不能胜任各自的工作。

2、一旦找到并建好这样的团队，后面的事情就变得相对简单很多。是的，你应该知道我说的不仅仅是那部电影。建立交易系统也是一样，这个建立过程很艰辛，不过一旦建立起来，后面的事情也会简单很多。之前面对交易，是随意的、随机的、情绪波动极大的，有了系统之后，最大的变化是：人会感觉非常踏实。

3、这种踏实感来自于交易系统把你 90% 的情绪，通过精细量化的制度关进了笼子。从此，你的每一笔买卖、每一成仓位的安排，都有理有据。交易也从一件对个人能力要求极高的事，变成了机械化的按部就班，这就是交易系统给你的赋能。从此，你将不再经受市场各种风吹草动的蛊惑，不再承受贪婪和恐惧的折磨。

4、那种双脚踩在大地上的厚重感和踏实感，是没有交易系统的人无法体会到的。一旦拥有，你会前所未有的感受到：原来，交易能如此简单！难道不是吗？以我的系统为例，只需耐心等待趋势和结构触发之时，参照仓位管理细则——对应操作即可。不要以为那些华尔街大神

的操作有多神秘，日常工作也平淡无奇。

5、同样的成果，放到不同人手上，最终效果天差地别。原因在于：这些是经过深度学习和思考后的产物，还是道听途说的拿来主义，还是根本就不相信、就像这几天偶尔有杠精对这个教程嗤之以鼻。正如《教父》中所言：花半秒钟就看透事物本质的人，和花一辈子都看不清事物本质的人，注定是截然不同的命运。

6、哪怕所有东西都一样，如果没有进行深入学习和思考，执行起来便会大打折扣，一旦操作变形，系统即刻崩塌。因为没有完美的交易系统，任何系统都存在逆风期。如果顺风顺水倒还没啥差别，一旦长期处在逆风期，信念的力量就成了最重要的法宝。毕竟在真实交易中，你还得需要自己来对抗那 10% 的情绪残余。

7，就像之前那张回溯表所记载的历程一样，运气不好的话，可能是得先做亏 10 次交易，最终才能等到的那一次精彩绝伦的大成功。问题是有多少人能坚持到最后？我可以带你走到 90 步，但是最后这 10 步，还得你自己一步步来走，毕竟账户是自己的，你得亲自面对最后的这一道屏障。走过之后，才是真正的大光明。

8、至此，系统教程算是完成了。篇幅问题很多内容我讲的不具体，但重点都讲到了，课后大家可以自己找资料针对性学习。接下来计划针对一些交易问题，附上十篇交易系统的番外篇，敬请关注。最后，送给大家一句我很喜欢的话作为教程的结尾，与君共勉：stay hungry , stay foolish!（求知若饥，虚心若愚！）

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十一）

番外篇之一：数字货币有未来吗？

这好像是个已经被证明过的问题。我接触币圈有点晚，是在 17 年夏天，随后开了公众号和微博。

当时的市场环境风雨飘摇，我便写了一篇文章，就是这个标题。很高兴，当年的所有预判，几年后都变成了现实。

那时我最重要的判断是：符合人性+财富效应+全球性，定能不惧风雨、羽化成龙。

几年光景，光币安一个交易所的成交量，就是大 A 核心资产沪深 300 的几倍，这个速度让我瞠目结舌之余，更多的是感慨：我果然没有选错战场。

当年投入一千万转行炒币，我心想就算亏完也不会太心疼，没想到 5 年后，我数字货币的资产居然能占到总资产的一半。

所以，币市现在成为了我股市之外的另一个主战场。

未来呢？我认为币市会成为全球主要交投市场之一。

现在规模还远远没到饱和，等这个交易市场的一切制度开始健全，那些不接受或者反对的地区，也会开始慢慢接纳。

数字货币市场的下一个目标是：全民化。也即是说，在不远的未来，炒币将会是一种全民投资，你身边将会很难找到不炒币的人。

我期待着这一天！

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十二）

番外篇之二：如何看待币市消息面？

如何看待币市消息面？

不仅是币市，包括股市等任何交易市场，盘面都会受到消息面影响。所以很多人对消息面的变化很敏感、趋之若鹜，以期借此获得收益或规避风险。讲真，如果真的能提前收到消息的话，会很炫酷，简直吊炸天！搞对了的话，赚钱跟捡钱没啥区别。之所以心存幻想，是因为的确有人玩得很溜。

就像前年 A 股，创业板 20cm 股如日中天的时候，有天突然盘中暴跌，有些从涨 20% 直接打到跌 20%，懵逼了，不知道发生啥事，结果盘后新华社发文打击绩差股，啧啧！如果你能像盘中大资金那样提前知道这个消息，一天 40%！问题是，你以为你是谁？消息会第一时间出现在你的耳朵里？要清醒认识到，我们就是普通人。

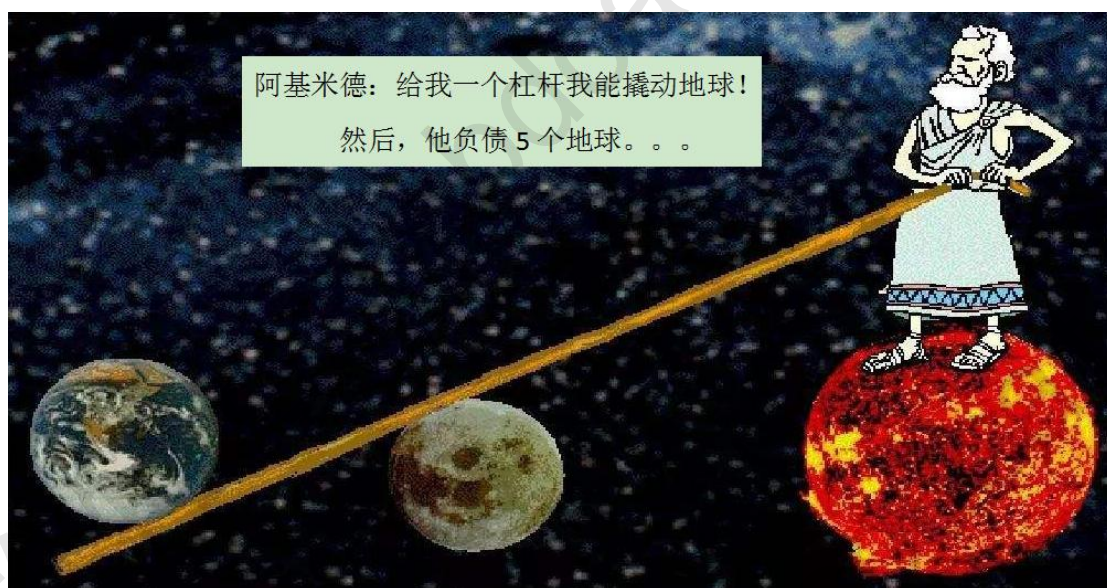
按经验来说，股市的小消息只影响开盘半小时，像疫情这种爆炸性全球事件也只影响一两天而已。何况是连续交易的币市呢？影响的时间更短，盘面迟早还是回到原来趋势中。我没这个能力提前知道消息，所以对消息面选择无视。毕竟，任何消息最终都会反映到盘面来，盯好盘面做好应对策略即可，没啥大不了。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十三）

番外篇之三：为什么反对用杠杆？

为什么反对用杠杆？

从最早的公众号到微博，再到现在的推特，这几年来我无数次说过：反对上杠杆，反对做合约。我自己也以身作则，在币市中从不加杠杆。几千位朋友跟我一路走来，用杠杆后到现在还能取得不错成绩的人寥寥无几；爆仓破产的人却数不胜数。九死一生都是对杠杆这条不归路比较美好的描述了。



从交易的角度来说，在没有等到那一笔大成功的交易之前，得长时间忍受逆风期的交易磨损，可能是前十笔交易先亏 50%，然后再一笔交易赚 10 倍，最终获得 5 倍的收益。如果用了杠杆呢？情况就不同了。杠杆会放大收益的同时放大亏损，可能你根本支撑不到那次辉煌的

交易出现，本金就所剩无几，最终倒在黎明前。

从人性的角度来说，交易市场本来就放大了人性的弱点，杠杆再加，人性弱点又呈几何倍数增长，最终会极大程度地反噬本来已经建好的交易系统。既能加杠杆又能长期坚守交易原则的人，极为罕见。这样人还能在市场实现长期稳定盈利，几乎不可能。牛逼如美国 LTCM 做波动极小的品种都能破产，何况币市的你我。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十四）

番外篇之四：为何不建议重仓一只币？

为何不建议重仓一只币？

除大饼和姨太之外，我不建议重仓其他币，单只最多投 1/5 到 1/3 的仓位。也就是说，满仓的话至少得持有 3 只以上的币。

很多人问过我，分仓后几只币涨跌幅加起来和只拿一只币，对账户的盈亏贡献不是一样的吗？那分仓有啥意义？极度看好某只币，能否重仓甚至满仓呢？

我的回答是：不能。

分仓，是为了防范小概率的极端风险。

股市都经常出现黑天鹅，偌大的上市公司，说造假就造假，说暴雷就暴雷，股价说崩就崩。

何况更加凶险的币市？

只要你一直在这个市场中交易，偶然就会变成必然，总有一天会遇到你一买进就暴雷的品种。

如果你的交易习惯是重仓甚至满仓单个品种，那么迟早会遇到黑天鹅。

分仓的意义在于：就算遇到极端的暴雷情况，本金也不至于遭受重大损失。

一只币如果投入 1/3 的仓位，哪怕突然有天被腰斩，账户整体只亏 15 个点，完全在可以承受的范围內。

当然，有人可能会调侃：鸡蛋放在不同篮子，结果车翻了。那是天亡币市，非战之罪。我们要做的，仅仅是把我们能掌控的事情，做到极致。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十五）

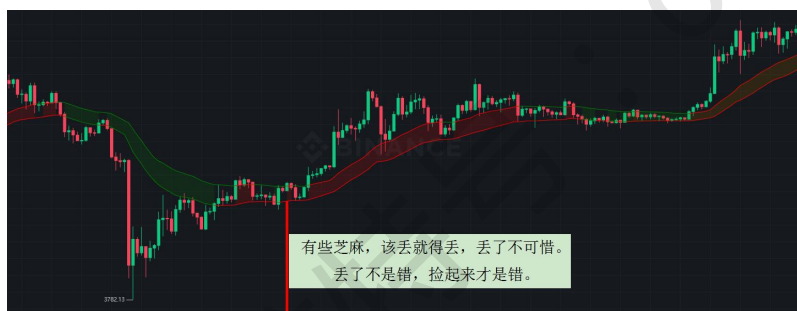
番外篇之五：如何看待 V 形反转？

我曾说：大多数行情的演化都会经过萌芽、发展、鼎盛、衰竭、转势的过程。那么，还有极少的极端行情就没有经过这个阶段，便是 V 形反转。

V 形反转，俗称尖底和尖顶。就是从大跌直接开始大涨，或从大涨直接开始大跌，中间没有缓冲和过渡。虽不太常见，但还是存在。我们不应该无视。

任何交易系统都无法精确地应对所有的行情，只能遵循大数原则。很显然，以“趋势”加“结构”为主导的交易系统，是建立在“平衡”的基础上，毕竟平衡的行情转换才是市场的主旋律，就像一年有四季交替、花木有生长盛衰。而 V 形反转很显然是例外，“结构”虽是左侧指标，但也拿它毫无办法。那如何应对？

答案是：无视 V 转，趋势防守。虽然结构抓不住 V 转的最佳点很可惜，但还有趋势来护航。不管怎么 V，最终若是大行情总会突破趋势。等它发展到趋势指标触发，按趋势的交易标准来做就行。比特币最近的 V 转出现在 20 年 3 月 13 号。结构抓不到，趋势来护航，可以让我们不犯原则性错误：丢了芝麻后又丢了西瓜。



从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十六）

番外篇之六：币市可以拿长线吗？

币市可以拿长线吗？

股市中我经常说：谁认为价值投资就是拿长线，我就认为谁不懂投资。这句话拿到币市中来，更加合适。

2018 年我提出，如果一定要拿长线就只能拿比特币，同时号召那些没精力和没能力看盘的朋友在熊市中定投。我自认能力有限，眼中只有比特币是有价值的，值得长期持有。最多加一个以太坊。

股市中绝大多数人没有深入的调研能力，何况币市呢？在没有深度调研以及估值体系的情况下，如果长期持有其他币，那就和赌运气没啥区别。

在投资的漫漫长路中，如果交易风格就是拿长线，谁也不能保证你每次选的币都是未来的价值币，万一看走眼了呢？对 10 次没太大意义，盈亏同源，错一次就是万劫不复。

而币圈，我敢说 99% 的人无法对某个币进行深度调研，也无法对它进行有效的估值，至少我没有这个能力。大多数拿成了长线的人，大概初中并不是想做长线，而是深套后的被迫死扛，指望着奇迹的发生。

这种一味地毫无标准地长线持有、一旦被深套就躺平装死，是一种对本金不负责任的麻木行为，绝不是价值投资。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十七）

番外篇之七：短线或超短线可以玩吗？

短线或超短线可以玩吗？

我的答案是：可以，但不适合大多数人。

市场有许多做量化交易很优秀的公司，都是高频交易，包括收益率几十年来碾压巴菲特的大神西蒙斯的基金，就是这样，每次操作的平均持有时间不过一两天；

很多顶级操盘手自己的操作也是如此，在瞬息万变的市场中能捕捉到稍瞬即逝的交易机会。

问题是，你行吗？没有金刚钻，别揽瓷器活。

做短线，需要完善度极高的交易系统、极高的交易素养和极丰富的交易经验。在此基础上，哪怕你还残存 1% 的情绪，都不行。

为什么很多人喜欢做短线呢？因为它契合了人性。大脑对未来的奖赏敏感度不高，它需要及时反馈，所以指挥你的基因对高频交易产生愉悦感。

所以，如果立志一定要成为短线高手的话，就得在这几个方面下苦功，并不是一朝一夕就能达成。

从建立交易系统到每次能严格执行、并心如止水。把自己变成一台无情的交易机器，是最基本的前提。

而长线中线短线的切换，无非就是交易时间周期的长短选择不同而已。切换过去不难，切换后还能镇定自若，才难。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十八）

番外篇之八：预测和操作需要统一吗？

预测和操作需要统一吗？

我的答案是：不仅不需要，而且还毫无关系。

我也经常预测，当然时対时错。相信几乎所有交易者都做过预测。但菜鸟和高手不同之处在于：如果预测失败，该怎么办。

菜鸟一旦预测失败，便顺势躺平。他们是以预测或情绪为交易依据。这是不健康的。买卖标准绝不能建立在预测的基础上。

虽然对市场的预测，也是基于对概率的感知判断，但它上升不到可以指导操作的层面。操作应该以交易系统的交易信号为准，而不能跟随预测。

如果我坚信比特币这一波能涨到一万，可它涨到 7 千就掉头，并触发了交易系统的卖出信号，怎么办？先收起梦想卖出再说，继续耐心等待下次的买入信号，形成交易闭环。

你一定会遇到那种可遇不可求的完美交易：交易系统买卖点的触发和之前的预测惊人地一致，同时买卖点又神奇地还是市场的相对底部和顶部区域。

你自己要明白，这种成功并不是预测的功劳，因为操作和预测没有关系，就算有关系，也是预测达到了操作的标准，才操作。我们只是一台操作机器，哪要什么神仙？！

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（十九）

番外篇之九：如何熬过逆风期？

如何熬过逆风期？

任何交易系统或交易模式，都有顺风期和逆风期。顺风期还好，逆风期比较难熬，很多人倒在了这里。毕竟如果连亏十几笔，不是每个人都熬得过去。

当然，那些没有交易系统、全靠情绪交易的人，是涨也慌、跌也慌，最终被割出局也正常。

熬不熬得过逆风期，取决于两个东西：深度思考+信念。

这两者相辅相成，如果你对交易系统是经过深度思考之后，认为可以完全相信它的有效性和稳定性，那你的信念也更加坚定，自然能帮你再多坚持久一些。

就像掷硬币赌正反，就算连续掷出十次正面，你应该都能坚信：下次出反面的概率依旧有50%。

因为你很容易就能悟透这个简单的“交易系统”，自然会坚定信念。

另外，逆风期是打磨交易系统的最佳时期。顺风顺水时没人愿意改变，只有痛苦才会倒逼改革。

很多年前我在 A 股的一段至暗时刻，就做了一次交易系统的重大调整：仓位策略。做大盘趋势之下的次级行情只能轻仓玩，因为行情持续时间和成功率都要差很多。

深度思考、坚持信念，熬过一次逆风期，才算成为高手。

从菜鸟到高手：手把手教你建立币市交易系统（二十）

番外篇之十：熊市可以不用看盘吗？

熊市可以不用看盘吗？

如果实在没时间精力看盘，交易模式只是定投或者拿长线。那不仅熊市不用看，牛市也不用看，就像持有房子那样持币，无可厚非。

但如果立志成为交易高手，那么每天盯盘就是一件必须要做的日常工作。不仅是牛市，熊市更加得每天盯盘。因为熊市中交易周期更短、对交易系统的考验更大。

有句话叫：耐不住寂寞，守不住繁华。

如果在低潮的时候没有贴近市场，或因随意交易而亏掉了本金，那么就极可能在未来牛市中错失买点，无法将利润最大化。

如果现在远离市场，想在市场走牛前回来，然后提前布局狠赚一笔，这叫痴心妄想。熊市没有打磨好交易系统，牛市凭什么赚大钱？！

至少我没这个本事。

熊市用来播种，牛市用来收获。很多人搞反了，熊市拂袖而去，牛市来了才开始播种，牛市一走完，开始被别人收获。

这几年币圈媒体的人气聚散就很能说明问题：行情一好门庭若市；行情一差门可罗雀。很少有人能在漫漫熊市中还能坚持每天学习思考、每天盯盘复盘。在这点上老天很公平，成功属于这群少数人。