



关于价格跳空，通过展示一些定量数据，为你指引一个方向



SAM, PowerUpGammas



我们谈论的跳空定义如下：

- 开盘价格大于前一根 Bar 收盘价 = Gap Up
- 开盘价格小于前一根 Bar 收盘价 = Gap Down
- 跳空还有其他定义方式，这毫无关系





如果大盘开盘跳空 $n\%$...

- **\$SPY 近90%以上的跳空程度绝对值都集中在 $[0, 1.5\%]$**
- **How about setting on stratification and explore some stats?**
 - 便历过往23年 \$SPY 数据 (时至 28th Feb 2023)
 - Gap Down, Gap Up, Gap Percent, Subsequent move (Reversal / Con't)



Here is Some Fun Stuff...

		Gap Percent					
		0.2%	0.4%	0.6%	0.8%	1.0%	1.2%
普通 Gap Down	Reversal	52%	50%	49%	51%	50%	50%
	Continuation	47%	50%	51%	49%	50%	50%
普通 Gap Up	Reversal	46%	44%	40%	40%	38%	37%
	Continuation	54%	55%	59%	59%	62%	63%

- 现在加入一个条件



Here is Fun Stuff...

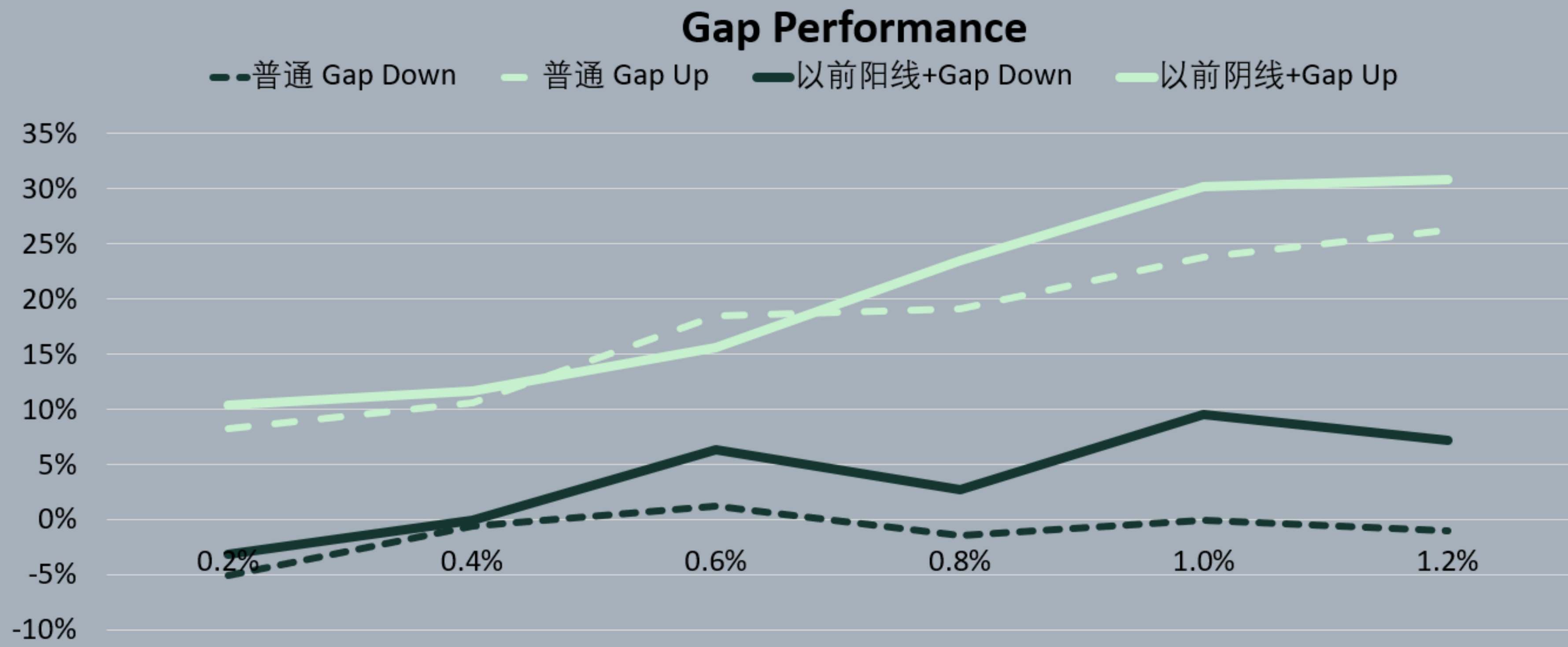
		Gap Percent					
		0.2%	0.4%	0.6%	0.8%	1.0%	1.2%
普通 Gap Down	Reversal	52%	50%	49%	51%	50%	50%
	Continuation	47%	50%	51%	49%	50%	50%
普通 Gap Up	Reversal	46%	44%	40%	40%	38%	37%
	Continuation	54%	55%	59%	59%	62%	63%
以前阳线+Gap Down	Reversal	51%	50%	47%	49%	45%	46%
	Continuation	48%	50%	53%	51%	55%	54%
以前阴线+Gap Up	Reversal	44%	44%	42%	38%	34%	34%
	Continuation	55%	56%	57%	61%	64%	65%

Diff.	Gap Percent					
	0.2%	0.4%	0.6%	0.8%	1.0%	1.2%
普通 Gap Down	-5%	-1%	1%	-1%	0%	-1%
以前阳线+Gap Down	-3%	0%	6%	3%	10%	7%
普通 Gap Up	8%	11%	19%	19%	24%	26%
以前阴线+Gap Up	10%	12%	16%	24%	30%	31%



Here is **Fun** Stuff...

	Gap Percent					
Diff.	0.2%	0.4%	0.6%	0.8%	1.0%	1.2%
普通 Gap Down	-5%	-1%	1%	-1%	0%	-1%
以前阳线+Gap Down	-3%	0%	6%	3%	10%	7%
普通 Gap Up	8%	11%	19%	19%	24%	26%
以前阴线+Gap Up	10%	12%	16%	24%	30%	31%



Source: PowerUpGammas



What's the Point...

- 逻辑通顺的问题，但却是错误的道路
- 交易中最要的是：Probability Consistency Manage Risk

I cannot help you think. This is something in your brain. I can only tell you the reality



Q&A February 23, 2023 at 02:51

写定制代码实际上难以实现，我只懂Pythoner 语言，其他的代码我是写不出来的，另一种方法是提供定制需求的每日数据，这涉及代码，但解决的问题是自动化，定制一人一数据也是巨大的重复性工作，但不想在这样考虑写定制代码的这类问题，感觉这对大部分人都很难，或者有没有考虑跟别人合作开发这一块。

在交易学习中，能不能出一套课程把这一块串起来，比如从少懂，感觉很多东西串不起来，不知道先做什么。

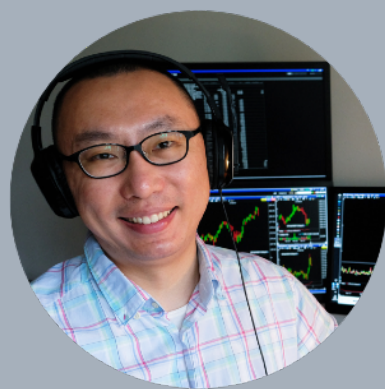
我现在有个很困惑的问题，有没有什么工具或者是什么方法能精确度高一些的判断反转。（比如2023年1月6日开始的那波拉伸，2月15日开始的那波下跌）我总是判断的不那么准确，方向总是做反。请Sam指导。

FREE TUTORIAL



LET'S CHECK SOME GAPS

WWW.POWERUPGAMMAS.COM



我们给你的不是一堆结论，而是逻辑；
不仅告诉你表面事实，而是强调背后原理。
你接受的一切信息，将构成你的思维方式；
不成体系的知识，将最终遗忘。



进入PowerUpGammas School

