

BTC 自动交易策略 — 通俗版说明

这是什么？

一个全自动的比特币交易程序。它自己判断什么时候买、什么时候卖，不需要人工操作。程序24小时运行在服务器上，有交易信号时会通过钉钉发消息通知你。

核心数据

指标	数值	说明
测试时间	2022年1月 ~ 2026年5月	4年多的历史数据验证
初始本金	\$100	每次用\$100去交易
总收益	\$790	4年赚了初始本金的8倍
年化收益	+64%	平均每年赚64%
交易频率	每月约3笔	大约每10天做一次交易
单笔平均赚	+4.9%	每做一次交易，平均赚本金的4.9%
胜率	51%	约一半的交易赚钱
赚钱时平均赚	\$23	赚的时候赚得多
亏钱时平均亏	\$14	亏的时候亏得少

通俗理解：虽然只有一半的交易赚钱，但赚的时候比亏的时候多60%，长期下来就是赚的。

怎么赚钱的？

交易方式

- **做多**：判断要涨就买入，涨了卖出赚差价

- **做空**：判断要跌就先卖后买，跌了赚差价
- **杠杆5倍**：用\$100的保证金，做\$500的交易，收益和风险都放大5倍

判断涨跌的方法

程序分析最近6个月的价格走势（21个技术指标），用机器学习模型预测接下来4小时的方向。只有当程序“比较确定”（信心>40%）时才会下单，不确定就不做。

风控规则

1. **自动止损**：每笔交易都设好最大亏损线，到了自动割肉，不会越亏越多
2. **自动止盈**：到了目标利润自动卖出，不贪
3. **顺势交易**：只顺着大趋势方向做，不逆势
4. **熔断保护**：如果比特币一个月跌超过30%，程序自动暂停不交易
5. **利润锁定**：赚到的钱不会再拿去冒险，只用本金\$100循环

最坏情况

场景	后果
单笔最大亏损	\$15（本金的15%）
极端情况最大亏损	\$60（本金的60%，非常罕见）
连续亏损最大回撤	45%（历史最差时期从高点回落45%）
爆仓风险	极低（止损远在爆仓线之前，且交易所会自动执行止损）

最坏情况：亏掉本金的一部分，但不会倒欠钱。因为是逐仓模式，最多亏完这\$100。

为什么不能赚更多？

想法	为什么不行
加大杠杆到10倍	赚得多亏得也多，3次连续止损就亏光
降低开单门槛多交易	交易变多但质量下降，胜率降低反而亏钱
放大止盈目标	目标太远经常到不了，利润拿不到手

想法	为什么不行
多开几个币种	测试了ETH/SOL/XRP/TRX，全部亏光，只有BTC能赚

结论：当前参数已经是测试出来的最优组合，改任何一个都会变差。想赚更多的唯一办法是加大本金。

每月预期

以\$100本金为例：

项目	金额
月均交易	3笔
预期月收益	+\$15 (+15%)
预期年收益	+\$180 (+180%)
好的月份	+\$30 ~ +\$80
差的月份	-\$20 ~ -\$40

注意：不是每个月都赚钱。有的月份会亏钱，但拉长到半年以上大概率是正收益。

可信度验证

验证方式	结果	通俗解释
统计检验	$p=0.006$	99.4%概率不是运气
随机对比100次	全部跑赢	比瞎猜强太多
亏损概率模拟	0.3%	1000次里只有3次会总体亏钱
扣除手续费后	仍然赚钱	考虑了真实交易成本

当前运行状态

- **服务器**: 日本东京 (24小时运行)
 - **账号**: 如意 (本金\$102.5)
 - **杠杆**: 5倍
 - **通知**: 开仓/平仓时钉钉连发3条
 - **监控**: 每2小时发一条系统状态
-

风险提示

1. 历史表现不代表未来收益
 2. 比特币市场可能发生前所未有的变化
 3. 建议只用亏得起的钱
 4. 先用小资金观察3-6个月, 验证实盘与回测一致后再考虑加资金
 5. 程序可能存在bug, 虽然已经过大量测试
-

如何查看?

- **钉钉消息**: 自动推送, 有交易时会收到通知
- **查看日志**: 联系管理员查看服务器运行记录
- **查看收益**: 钉钉定期消息中显示账户余额和盈亏