

三币种非对称套利（EURUSDJPY）（EURUSDAUD）（EURUSDCAD） （EURUSDCHF）（EURUSDGBP）MT5 操作说明

以三币种非对称套利（EURUSDJPY）为例

一、三币种非对称套利原理

三币种对冲非平衡套利是在三角套利的基础上的拓展与延续。三角套利作为一种比较常见的套利方式，不少投资人在外汇交易中都有用到过。三角套利是基于交叉汇率实现的，它是三角套利的基础，所谓交叉汇率，是指用一种非美元的货币表示另一种非美元货币的价格。如某个外汇市场上美元/日元=142.840，欧元/美元=1.00435，欧元/日元=143.375，当（美元/日元）×（欧元/美元）不等于（欧元/日元）时，这就为三角套利提供了可能。


然而，严格的三角套利由于点差、滑点、隔夜利息、手续费等原因，并不能获利。

如果在以上的三个货币对上增加不平衡系数，打破这种对称性，便有了获利的可能性。

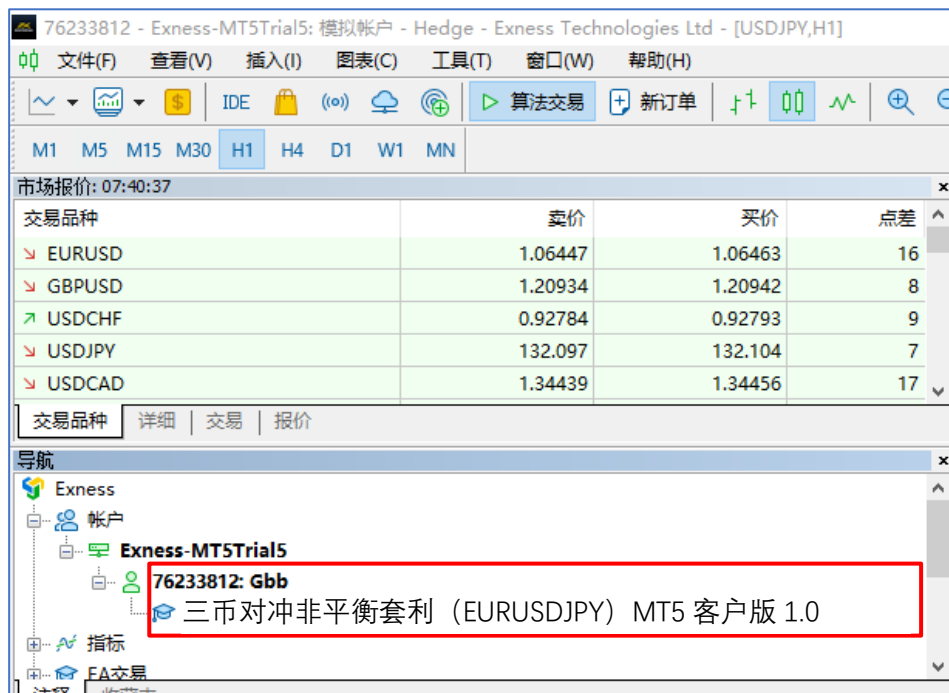
如：同时下单

- 1、sell A 手 eurUSD,
- 2、sell B 手 usdJPY,
- 3、buy C 手 eurJPY,
- 4、A、B、C 系数通过计算获得。

二、三币种非对称套利（EUR-USD-JPY）智能交易系统操作步骤

1、下载并安装软件  exness5setup（MT5），也可用交易商提供的 MetaTrade5 软件；


2、在 Exness-MT5 软件注册模拟账户或真实账户；




3、在安装的目录下找到 MQL5 文件夹→Experts 文件夹；

本地磁盘 (E:) > Exness交易平台		
名称	修改日期	类型
Bases	2022-11-29 1:45	文件夹
Config	2023-1-7 15:15	文件夹
logs	2023-1-7 0:01	文件夹
MQL5	2022-11-22 19:54	文件夹
Profiles	2022-11-22 18:25	文件夹

本地磁盘 (E:) > Exness交易平台 > MQL5		
名称	修改日期	类型
Experts	2023-1-7 15:39	文件夹
Files	2023-1-5 23:38	文件夹
Images	2022-11-22 18:25	文件夹

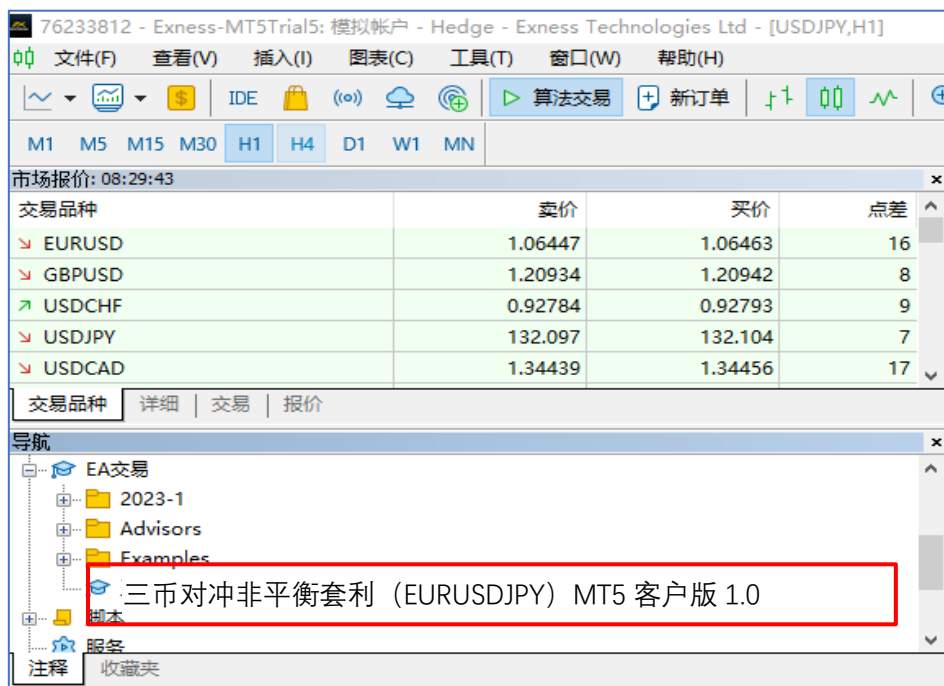
4、将文件 “三币对冲非平衡套利 (EURUSDJPY) MT5 客户版 1.0

(三币对冲非平衡套利 (EURUSDJPY) MT5 客户版 1.0)” 复制到 Experts 文件夹内；最好在电脑上搜索 “Experts”，如搜索到几个 Experts 文件夹，可将以上文件复制到每个 Experts 文件夹；

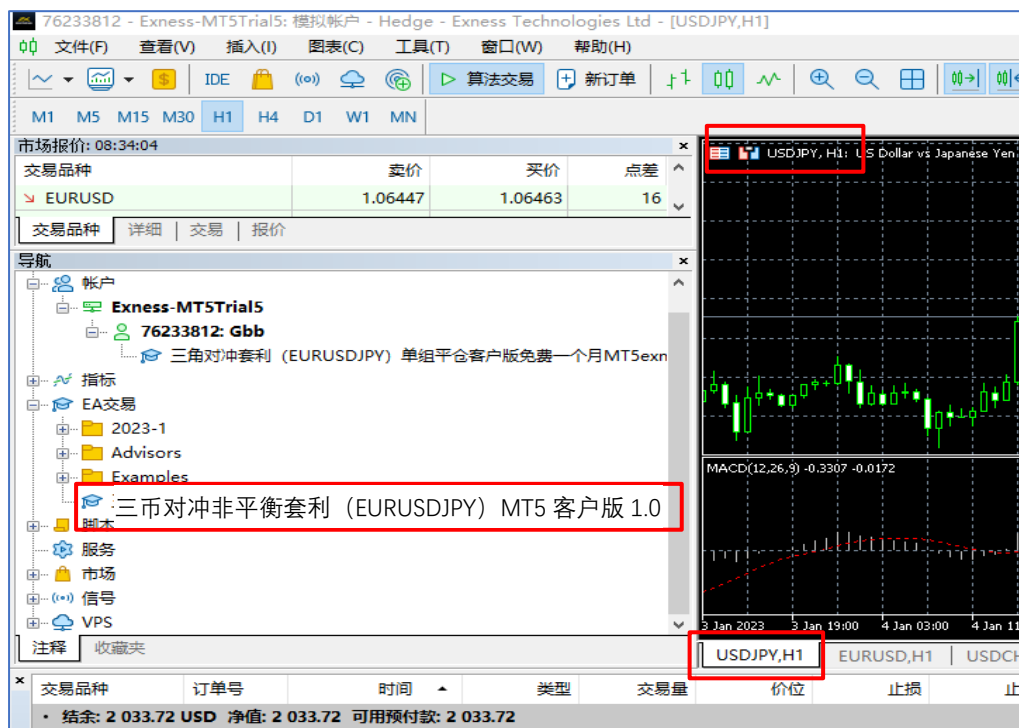
> 本地磁盘 (E:) > Exness交易平台 > MQL5 > Experts	
名称	
2023-1	
Advisors	
Examples	
 三币对冲非平衡套利 (EURUSDJPY) MT5 客户版 1.0	
5	

5、打开 Exness-MT5 软件，在软件导航界面，点击 “导航→EA 交易”，“右键→刷新”，这时就会看到“三币对冲非平衡套利(EURUSDJPY)MT5 客户版 1.0.ex5”；

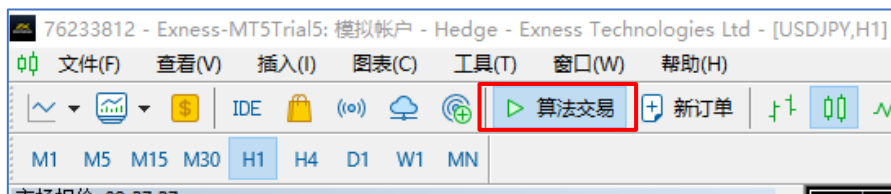
QQ 群：外汇 MT4MT5EA-野狼法则 234932101，也可私聊 QQ478819883.



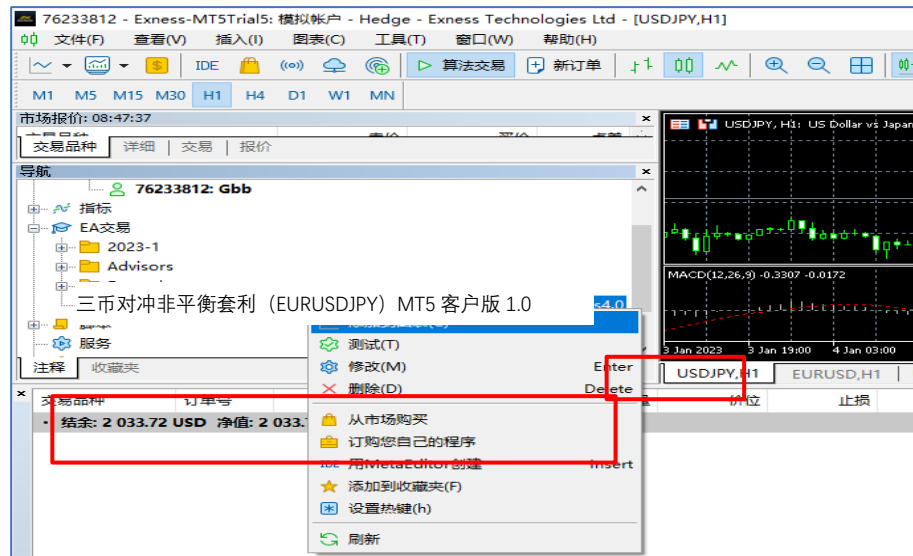
6、将 USD/JPY 货币对作为当前界面；



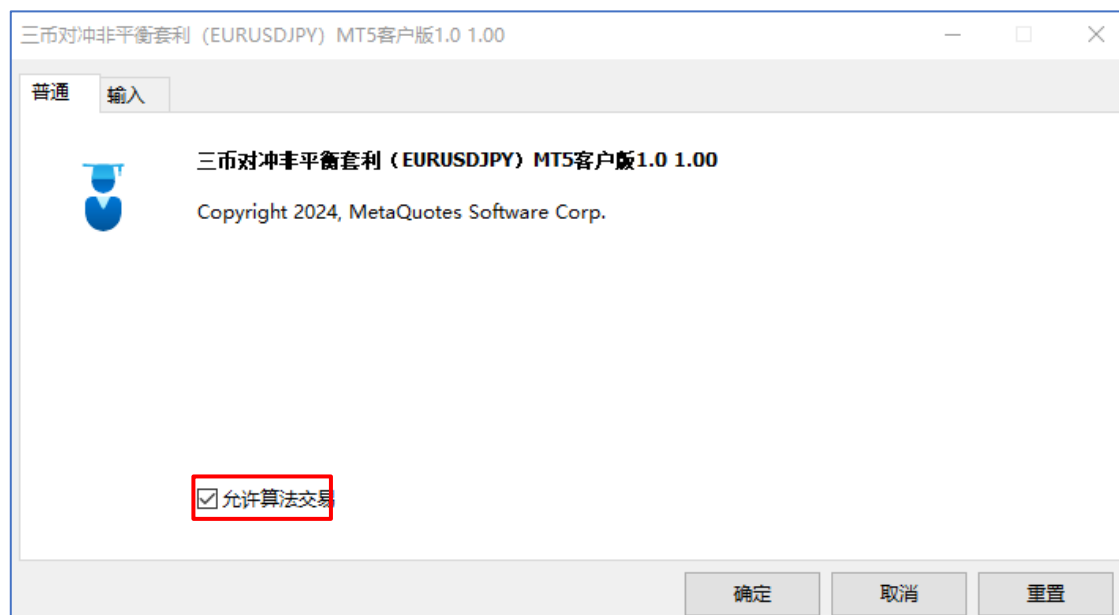
7、点击打开算法交易；



8、在“导航→EA 交易→三币对冲非平衡套利（EURUSDJPY）MT5 客户版 1.0”中；选中“三币对冲非平衡套利（EURUSDJPY）MT5 客户版 1.0”，右键→添加到 USD/JPY 货币对图表上；



9、在弹出的对话框中进行设置，“普通”→“允许自动交易”，“输入”→“可变”“值”，“值”可以按照说明修改；



QQ 群：外汇 MT4MT5EA-野狼法则 234932101，也可私聊 QQ478819883.

三币对冲非平衡套利 (EURUSDJPY) MT5客户版1.0 1.00

普通 输入

可变	值
01 输入你的交易账户	76534150
ab 交易平台的EURUSD货币对 (注意大小写及...	EURUSD
ab 交易平台的USDJPY货币对 (注意大小写及...	USDJPY
ab 交易平台的EURJPY货币对 (注意大小写及下...	EURJPY
1/2 总体盈利比例 (1%~2%)	0.01
1/2 总体亏损比例 (30%~60%)	0.9
01 三个币种Buy-Buy-Sell方向开单 (1-开单, 0...	1
01 三个币种Sell-Sell-Buy方向开单 (1-开单, 0...	1
01 设置点差最大值, 高于此值, 不开单	100
1/2 设置三币种价差最大值 (0~400)	300.0
1/2 设置三币种价差最小值 (0~-400)	-300.0
1/2 基本仓位 (手) (如账户资金10000美元, ...	0.2
01 BBS订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12
01 SSB订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12
01 设置每组间隔 (秒)	0
1/2 eurUSD订单不平衡系数 (1.02~1.05, 默认...	1.0
1/2 usdJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1...	1.0
1/2 eurJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1...	1.0
01 参数F, 平台每手手续费。若无手续费, 设置...	6
01 参数N, 单组三币种盈利值=N×F	1
1/2 参数M, 单组三币种亏损值=M×F	100.0
01 参数L, 预付款维持率。低于此值 (1:500杠...	300
01 是否继续前次交易, 0-否, 1-是	1
01 历史数据回测(或不必要数据写入):0, 实盘及模...	1

载入(L) 保存(S)

确定 取消 重置

加载成功后可在 USD/JPY 货币对图表显示如下：



在“专家”选项卡可查到如下记录：

时间	来源	消息
• 2024.07.25 23:57:46.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	账户： 59318832， 初始账户余额： 0.0
• 2024.07.25 23:57:46.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	账户59318832正确！
• 2024.07.25 23:57:46.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	当前日期： 2024.07.25 15:57:49
• 2024.07.25 23:57:46.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	软件购买日期： 2024.07.22 00:00:00
• 2024.07.25 23:57:46.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	软件有效期为： 27天
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	ASK or BID数据获取不成功
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	Ask_EUR_USD=1.08599
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	Bid_EUR_USD=1.08592
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	Ask_USD_JPY=154.003
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	Bid_USD_JPY=153.996
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	Ask_EUR_JPY=167.244
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	Bid_EUR_JPY=167.227
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	readstr:SanJiaoGroup_comment
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	readstr:AllCloseVolume_N
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	readstr:init_acc_bal
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	readstr:init_acc_equity
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	readstr:0
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	readstr:0.0
• 2024.07.25 23:57:49.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	readstr:3268.76

交易 | 敞口 | 历史 | 新闻 99 | 邮箱 10 | 经济日历 | 公司 | 预警 | 文章 | 代码库 | **专家** | 日志

时间	来源	消息
• 2024.07.26 00:01:34.7...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	readstr:0.0
• 2024.07.26 00:01:34.7...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	ReadFile_my_comment: 0 , 0.0 , 0.0 , 0.0
• 2024.07.26 00:01:34.7...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	ReadFile_my_comment OK
• 2024.07.26 00:01:34.7...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	初始化中。。。 暂停5秒！
• 2024.07.26 00:01:39.7...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	No.: 1
• 2024.07.26 00:01:40.0...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	No.: 2
• 2024.07.26 00:01:40.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	No.: 3
• 2024.07.26 00:01:40.6...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	No.: 4
• 2024.07.26 00:01:40.7...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	No.: 5
• 2024.07.26 00:01:40.8...	三币对冲非平衡套利 (EURUS...	No.: 6

出现以上信息，即为软件加载成功！

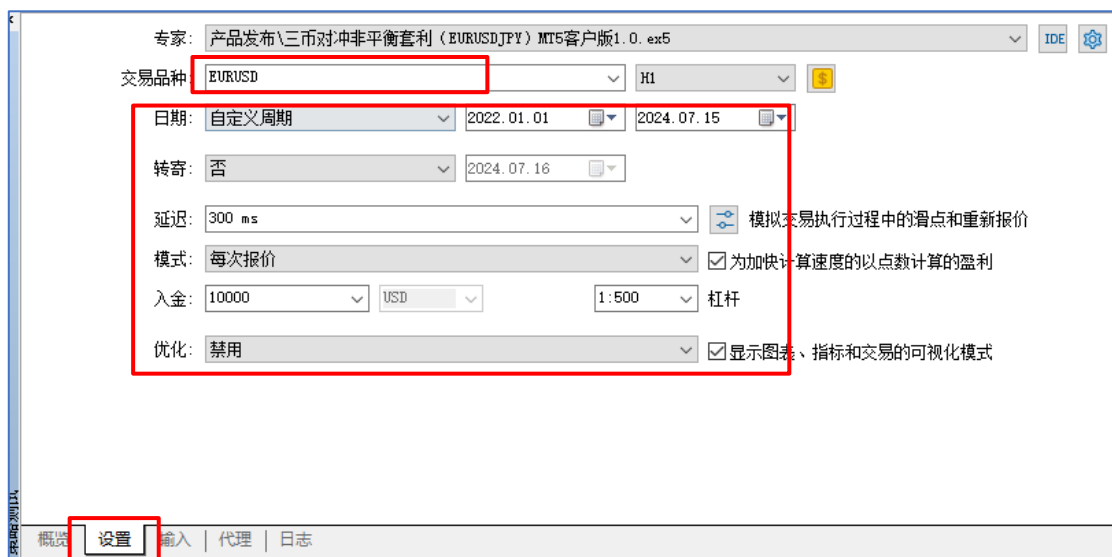
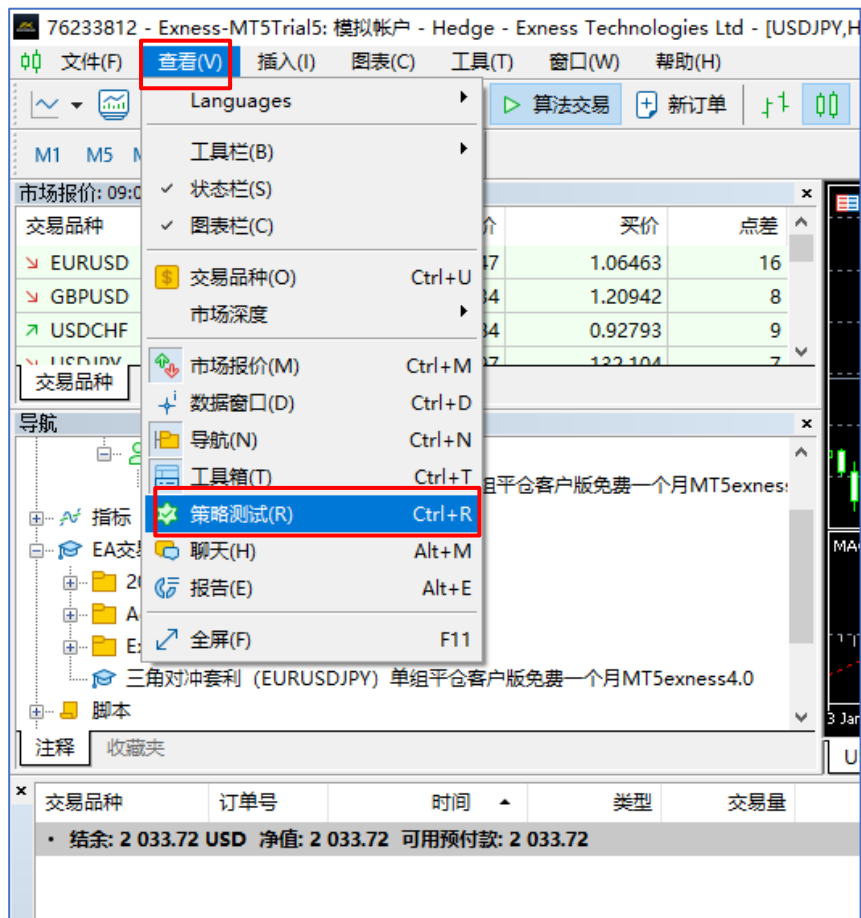
之后的运行记录会出现 No： 1， No： 2， No： 3. ...

三、注意事项

- 1、账户运行最好在 VPS 或云服务器上，以减少交易时间。
- 2、不同的交易商所采用的货币对名称不同，如欧美币种，有 EURUSD、EURUSDs、EURUSDp 等不同的方式。具体应用时可修改程序。

四、历史数据测试结果

1、MT5 软件菜单中，“查看”→“策略测试”→“设置”→“开始”



QQ 群：外汇 MT4MT5EA-野狼法则 234932101，也可私聊 QQ478819883.

选择品种...

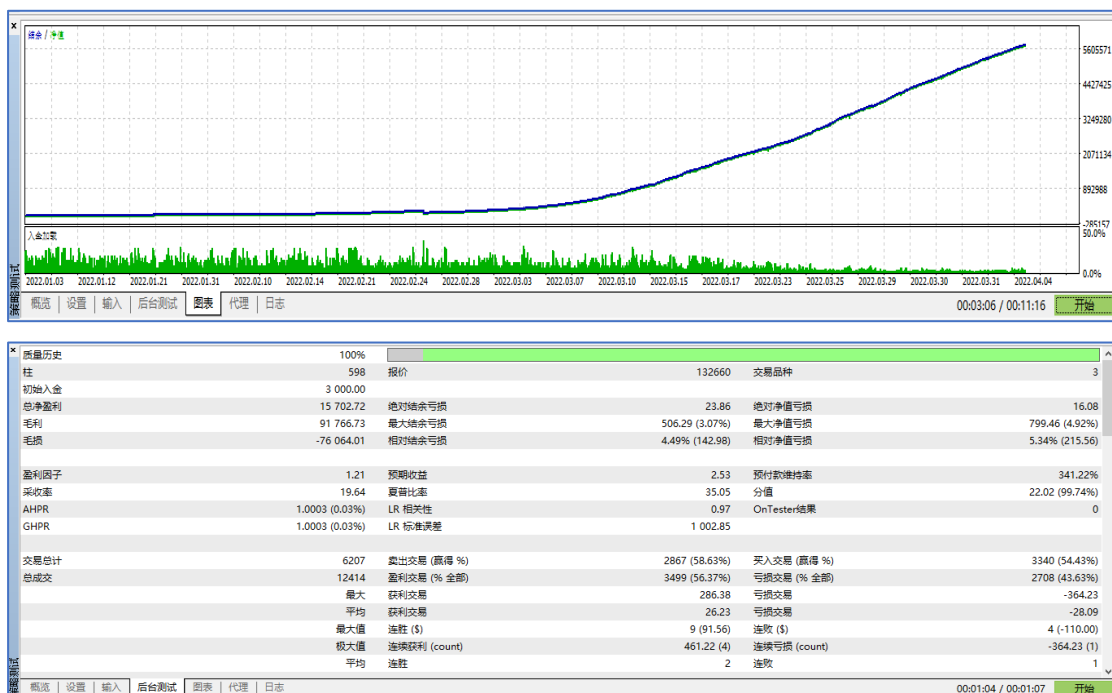
可变	值	开始
<input checked="" type="checkbox"/> 输入你的交易账户	59318832	76534150
<input checked="" type="checkbox"/> 交易平台的EURUSD货币对 (注意大小写及下标)	EURUSD	
<input checked="" type="checkbox"/> 交易平台的USDJPY货币对 (注意大小写及下标)	USDJPY	
<input checked="" type="checkbox"/> 交易平台的EURJPY货币对 (注意大小写及下标)	EURJPY	
<input checked="" type="checkbox"/> 总体盈利比例 (1%~2%)	0.01	
<input checked="" type="checkbox"/> 总体亏损比例 (30%~60%)	0.9	
<input checked="" type="checkbox"/> 三个币种Buy-Buy-Sell方向开单 (1-开单, 0-关闭)	1	
<input checked="" type="checkbox"/> 三个币种Sell-Sell-Buy方向开单 (1-开单, 0-关闭)	1	
<input checked="" type="checkbox"/> 设置点差最大值, 高于此值, 不开单	100	
<input checked="" type="checkbox"/> 设置三币种价差最大值 (0~400)	300.0	
<input checked="" type="checkbox"/> 设置三币种价差最小值 (0~400)	-300.0	
<input checked="" type="checkbox"/> 基本仓位 (手) (如账户资金10000美元, 某币种每次开仓0.2手)	0.2	0.2
<input checked="" type="checkbox"/> BBS订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12	12
<input checked="" type="checkbox"/> SSB订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12	12
<input checked="" type="checkbox"/> 设置每组间隔 (秒)	0	0
<input checked="" type="checkbox"/> eurUSD订单不平衡系数 (1.02~1.05, 默认1.00)	1.0	1.0
<input checked="" type="checkbox"/> usdJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1.00)	1.0	1.0
<input checked="" type="checkbox"/> eurJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1.00)	1.0	1.0
<input checked="" type="checkbox"/> 参数F, 平台每手手续费。若无手续费, 设置为6	6	6
<input checked="" type="checkbox"/> 参数N, 单组三币种盈利值=N×F	1	1
<input checked="" type="checkbox"/> 参数M, 单组三币种亏损值=M×F	100.0	100.0

概览 | 设置 | **输入** | 代理 | 日志

开始

载入
保存
保存版本
默认
自动排列
网格
开始单独测试

2、查看测试结果



QQ 群：外汇 MT4MT5EA-野狼法则 234932101，也可私聊 QQ478819883.

五、《三币种非对称套利（EURUSDJPY）MT5》参数说明

三币种对冲非平衡套利 (EURUSDJPY) MT5客户版1.0 1.00

普通 输入

可变	值
01 输入你的交易账户	76534150
ab 交易平台的EURUSD货币对 (注意大小写及下标)	EURUSD
ab 交易平台的USDJPY货币对 (注意大小写及下标)	USDJPY
ab 交易平台的EURJPY货币对 (注意大小写及下标)	EURJPY
1/2 总体盈利比例 (1%~2%)	0.01
1/2 总体亏损比例 (30%~60%)	0.9
01 三个币种Buy-Buy-Sell方向开单 (1-开单, 0-关闭)	1
01 三个币种Sell-Sell-Buy方向开单 (1-开单, 0-关闭)	1
01 设置点差最大值, 高于此值, 不开单	100
1/2 设置三币种价差最大值 (0~400)	300.0
1/2 设置三币种价差最小值 (0~-400)	-300.0
1/2 基本仓位 (手) (如账户资金10000美元, 某币种每次开仓0.2手)	0.2
01 BBS订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12
01 SSB订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12
01 设置每组间隔 (秒)	0
1/2 eurUSD订单不平衡系数 (1.02~1.05, 默认1.00)	1.0
1/2 usdJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1.00)	1.0
1/2 eurJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1.00)	1.0
01 参数F, 平台每手手续费。若无手续费, 设置为6	6
01 参数N, 单组三币种盈利值=N×F	1
1/2 参数M, 单组三币种亏损值=M×F	100.0
01 参数L, 预付款维持率。低于此值 (1:500杠杆) 程序不下单	300
01 是否继续前次交易, 0-否, 1-是	1
01 历史数据回测(或不必要数据写入):0, 实盘及模拟盘数据写入: 1	1

输入所加载的账户

Buy-Buy-Sell 方向为:
buy EURUSD
buy USDJPY
sell EURJPY

Sell-Sell- Buy 方向为:
sell EURUSD
sell USDJPY
buy EURJPY

三币对冲非平衡套利 (EURUSDJPY) MT5客户版1.0 1.00

普通 输入

可变	值
01 输入你的交易账户	76534150
ab 交易平台的EURUSD货币对 (注意大小写及下标)	EURUSD
ab 交易平台的USDJPY货币对 (注意大小写及下标)	USDJPY
ab 交易平台的EURJPY货币对 (注意大小写及下标)	EURJPY
1/2 总体盈利比例 (1%~2%)	0.01
1/2 总体亏损比例 (30%~60%)	0.9
01 三个币种Buy-Buy-Sell方向开单 (1-开单, 0-关闭)	1
01 三个币种Sell-Sell-Buy方向开单 (1-开单, 0-关闭)	1
01 设置点差最大值, 高于此值, 不开单	100
1/2 设置三币种价差最大值 (0~400)	100
1/2 设置三币种价差最小值 (0~-400)	-300.0
1/2 基本仓位 (手) (如账户资金10000美元, 某币种每次开仓0.2手)	0.2
01 BBS订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12
01 SSB订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12
01 设置每组间隔 (秒)	0
1/2 eurUSD订单不平衡系数 (1.02~1.05, 默认1.00)	1.0
1/2 usdJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1.00)	1.0
1/2 eurJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1.00)	1.0
01 参数F, 平台每手手续费。若无手续费, 设置为6	6
01 参数N, 单组三币种盈利值= $N \times F$	1
1/2 参数M, 单组三币种亏损值= $M \times F$	100.0
01 参数L, 预付款维持率。低于此值 (1:500杠杆) 程序不下单	300
01 是否继续前次交易, 0-否, 1-是	1
01 历史数据回测(或不必要数据写入):0, 实盘及模拟盘数据写入: 1	1

< >

由于市场原因, 或者经济数据发布前, 币种的点差有时候会变的很大, 此时不便交易, 因此点差大于设计值 (如 100), 认为市场异常, 程序不开单。

程序检测市场价的价差, 当价差达到设计值, 开始下单。有固定手续费建议值 ± 500 , 若无, 建议值 ± 300

程序会自动根据账户资金设置仓位, 如资金 10000, 则每单仓位大约为 0.2 手左右

Buy-Buy-Sell 方向和 Sell-Sell-Buy 方向总订单数

三币对冲非平衡套利 (EURUSDJPY) MT5客户版1.0 1.00

普通 输入

可变	值
01 输入你的交易账户	76534150
ab 交易平台的EURUSD货币对 (注意大小写及下标)	EURUSD
ab 交易平台的USDJPY货币对 (注意大小写及下标)	USDJPY
ab 交易平台的EURJPY货币对 (注意大小写及下标)	EURJPY
1/2 总体盈利比例 (1%~2%)	0.01
1/2 总体亏损比例 (30%~60%)	0.9
01 三个币种Buy-Buy-Sell方向开单 (1-开单, 0-关闭)	1
01 三个币种Sell-Sell-Buy方向开单 (1-开单, 0-关闭)	1
01 设置点差最大值, 高于此值, 不开单	100
1/2 设置三币种价差最大值 (0~400)	300.0
1/2 设置三币种价差最小值 (0~-400)	-300.0
1/2 基本仓位 (手) (如账户资金10000美元, 某币种每次开仓0.2手)	0.2
01 BBS订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12
01 SSB订单总数控制 (个) (为3的倍数)	12
01 设置每组间隔 (秒)	0
1/2 eurUSD订单不平衡系数 (1.02~1.05, 默认1.00)	1.0
1/2 usdJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1.00)	1.0
1/2 eurJPY订单不平衡系数 (0.98~0.95, 默认1.00)	1.0
01 参数F, 平台每手手续费。若无手续费, 设置为0	
01 参数N, 单组三币种盈利值= $N \times F$	
1/2 参数M, 单组三币种亏损值= $M \times F$	100.0
01 参数L, 预付款维持率。低于此值 (1:500杠杆) 程序不下单	300
01 是否继续前次交易, 0-否, 1-是	1
01 历史数据回测(或不必要数据写入):0, 实盘及模拟盘数据写入: 1	1

此值为放大价差波动利润参数, 可采用 1.1, 0.9, 0.8

订单注释编号相同的为一组, 每组平仓获利值, 可设置为手续费的倍数

此值为 1:500 杠杆条件下, 程序下单的最低预付款维持率

第二次加载程序, 需要获得前一次数据, 一般设置为 1-是

为历史数据回测设置