Contents

[策略名称 1](#_Toc80198208)

[因子有效性分析 1](#_Toc80198209)

[策略简介 2](#_Toc80198210)

[数据来源 2](#_Toc80198211)

[策略回测 2](#_Toc80198212)

[样本内选股 3](#_Toc80198213)

[部分代码展示 3](#_Toc80198214)

[样本外部分选股 6](#_Toc80198215)

[手动量化实盘操作指导 6](#_Toc80198216)

[展示方式 6](#_Toc80198217)

[策略选股公布方式： 6](#_Toc80198218)

[收益率公布方式: 6](#_Toc80198219)

[策略全部代码 7](#_Toc80198220)

# 策略名称

被动型量化策略之：被动型资金流选股-周频换仓

# 因子有效性分析

略

# 策略简介

通过统计短期内主力资金流动情况，以申万一级行业分类作为划分标准，挑选出意向时间段内的资金流净流入最大的k个行业，并从k个行业中挑选出短期内资金净流入排名靠前的n支个股，组成由k\*n支股票组成的股票池，然后在k\*n支股票中选取历史资金流shape ratio排名前5/10的股票，挑选最终5支/10支股票作为股票组合。

# 数据来源

Tushare 数据库（蓝楹会研究部、技术部内购）

# 策略回测

回测区间：20181009 – 20210714

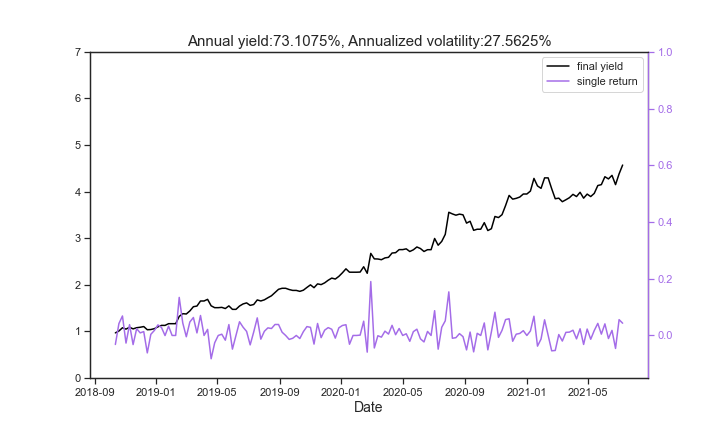
涵盖沪深股票数量：2301只（截至20210714）

回测方法：收益率矩阵相乘

参数选取：k = 5, n = 5

Sharp ratio选股位置参数：[1, 6, 20, 21, 19, 23, 18, 25, 22, 13]

回测收益率图



# 样本内选股

详见share\_code.csv

# 部分代码展示

策略回测代码

def pd\_ret(pro,codes,start\_date,end\_date,cols):

    price\_buy = pro.daily(ts\_code=codes, trade\_date=start\_date)[cols]

    price\_sell = pro.daily(ts\_code=codes, trade\_date=end\_date)[cols]

    ret = price\_buy.merge(price\_sell,on='ts\_code',how = 'inner')

    ret['earning'] = ret['close\_y'] - ret['close\_x']

    ret['earning\_pct'] = ret['close\_y']/ret['close\_x']-1

    return ret,price\_buy

def earning\_one(price\_buy,ret):

    # 按照每股1手买入

    weight = price\_buy['close']/price\_buy['close'].sum()

    weight = weight.to\_numpy().reshape(-1,1)

    # 计算收益

    ret\_pct = ret['earning\_pct'].to\_numpy().reshape(-1,1)

    earning = np.dot(weight.T,ret\_pct)

    return earning[0][0]

def earning\_equal(ret):

    # 同权重

    weight = np.ones((len(ret),1))/len(ret)

    # 计算收益

    ret\_pct = ret['earning\_pct'].to\_numpy().reshape(-1,1)

    earning = np.dot(weight.T,ret\_pct)

    return earning[0][0]

cols = ['ts\_code','trade\_date','close']

return\_all = pd.DataFrame()

for i,day in enumerate(share\_code.columns):

    codes = share\_code.iloc[:,i].str.cat(sep=',')

    start\_date = pd.to\_datetime(share\_code.columns[i]).strftime("%Y%m%d")

    end\_date = (pd.to\_datetime(share\_code.columns[i])+pd.Timedelta(value=1,unit='W')).strftime("%Y%m%d")

    price\_buy = pro.daily(ts\_code=codes, trade\_date=start\_date)[cols]

    price\_sell = pro.daily(ts\_code=codes, trade\_date=end\_date)[cols]

#     调节接口，避免暂停

    time.sleep(1)

#     循环计算日收益

    days = np.arange(pd.to\_datetime(start\_date),pd.to\_datetime(end\_date), dtype='datetime64[D]')

    date = []

    ret\_daily = []

    for j in range(len(days)-1):

        s\_date = pd.to\_datetime(days[j]).strftime('%Y%m%d')

        e\_date = pd.to\_datetime(days[j+1]).strftime('%Y%m%d')

        ret,price\_buy = pd\_ret(pro,codes,s\_date,e\_date,cols)

#     调节接口，避免暂停

        time.sleep(1)

        if ret.empty:

            pass

        else:

            earning = earning\_equal(ret)  # 相同权重

#             earning = earning\_one(price\_buy,ret)   #每股均1手

            date.append(s\_date)

            ret\_daily.append(earning)

    daily\_ret = pd.DataFrame(date,columns=['date'])

    daily\_ret['daily\_pct'] = ret\_daily

    return\_all = pd.concat([return\_all,daily\_ret])

    print(day)

return\_all.to\_csv('return\_all.csv')

return\_all.head(50)

return\_all = return\_all.reset\_index(drop=True)

acc\_ret = [1]

for i in range(len(return\_all)):

    a = (float(return\_all['daily\_pct'][i])+1)\*acc\_ret[-1]

    acc\_ret.append(a)

return\_all['acc\_ret'] = acc\_ret[1:]

return\_all['date'] = pd.to\_datetime(return\_all['date'])

return\_all = return\_all.set\_index('date',drop=True)

plt.figure(figsize=(15,10))

plt.plot(return\_all['acc\_ret'])

plt.show()

# 样本外部分选股

20210802-20210808

隆基股份、徐工机械、科顺股份、伟星新材、北新建材、立讯精密、金域医学、昭衍新药、迈瑞医疗、恒瑞医药

# 手动量化实盘操作指导

操作方法：同花顺 - “组合买入/卖出”

操作细节：在每周一开盘前，将选出来的股票新建为单独的一个组合，正式开盘前1分钟（不建议在集合竞价时进行交易）进行组合市价委托（不建议限价委托）挂单买入。利用沪深交易规则，“组合买入”将按照“买一价”进行自动建仓。在每周五闭市最后5分钟内，进行组合市价委托卖出操作，清空仓位。

# 展示方式

## 策略选股公布方式：

对普通会员：每周一晚上公布量化策略选股5或者10支股票（延迟一天）

对高级会员（每月1-2$订阅费用）：每周日晚上8点前以微信群的方式公布量化策略选股

## 收益率公布方式:

由量化组负责，技术部辅佐，每周六运行完代码之后，更新至excel。

Excel文件暂时未做，形式未定

# 策略全部代码

策略选股代码

详见《资金跟踪策略选股\_cholian\_20210805\_part3(无api)》

策略回测代码

略