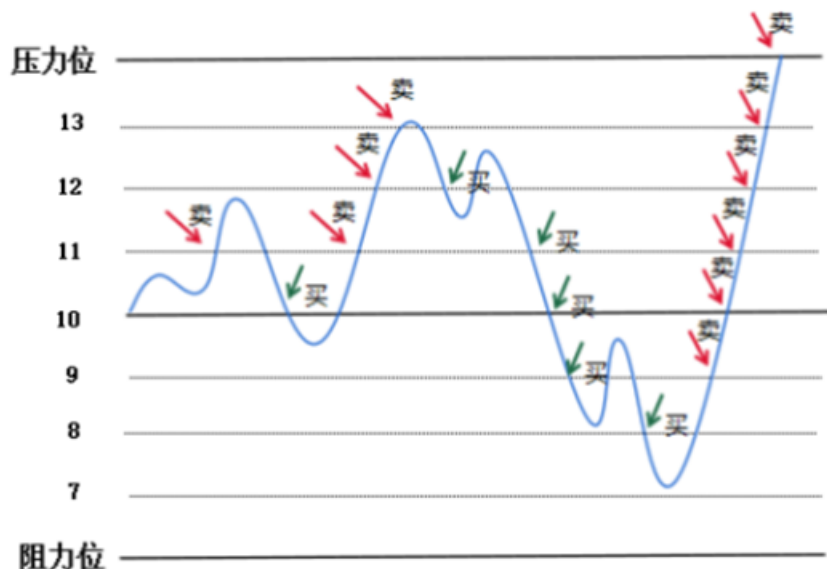


网格策略

1. 简介

网格交易依靠行情波动，在每一次震荡形成的上下价差区间里进行低买高卖，通过反复操作降低持仓成本，在高点卖出获利，它的本质总结起来就是十六个字：**低买高卖，高频规律，积小为大，穿越震荡。**



2. 适用场景

震荡市场。若是趋势性很强的市场，比如一直上涨，那就会一直开仓，造成很大的风险敞口。

3. 策略构建细节

3.1 确定中枢价格

- 前日收盘价
- 当日开盘价

3.2 确定网格条数

- 网格个数
 - 首先设置6个网格
- 网格间距
 - $0.02 \times \text{价格中枢}$

3.3 生成信号条件

生成信号条件：

- 网格区域向上突破，生成买入信号
- 网格区域向下突破，生成卖出信号

3.4 交易机制

买卖价格：现价 \pm 滑点

买卖手数：1手

设置每日平仓，不留敞口

4. 策略实施

- 回测时间：20230307 - 20230407



- 网格数量及间距设置：

网格间距	网格数量	年化收益率 (%)	胜率 (%)	最大回撤 (%)	交易次数
0.05	4	8.109	43.478	0.639	127
0.05	6	-4.096	34.783	0.480	84
0.05	8	13.840	43.478	0.569	189
0.05 * 2	8	-1.554	39.130	0.459	153
0.05 * 1 / 2	8	-3.289	39.130	0.589	113

5. 策略调整

设置了一个止损条件，当持仓等于3时，以市价全部平仓