布林带择时策略

基本逻辑

前K（10）日收盘价的均值作为中轨，前K日收盘价标准差作为波动指标，上轨=中轨+N\*标准差，下轨=中轨-N\*标准差。分析日内分钟线，当最新价突破上轨时买入，跌破中轨时卖出。

算法

每日开盘前：获得中证500成分股，以及由于成分股更换，一部分被踢出中证500成分股的，但之前有持仓的股票；获取当日股票的停牌信息，筛选出中证500可交易的股票以及中证500外的可交易的股票，加总为当日股票池；订阅股票池股票，并计算当日上下轨。

开盘后每分钟：提出当日已经有过交易的股票，获得还可交易的股票。对于中证500外的股票，当最新价小于中轨时，以最新价全部卖出。对于中证500内的股票，首先计算没有仓位的成分股的可用资金（所有可用资金/（500-有仓位的股票数量）），当最新价大于上轨且没有持仓时，在可用资金范围内以最新价尽可能多地买入；当最新价小于中轨且有持仓时，以最新价全部卖出。

回测结果截图





