Keltner择时策略

基本逻辑

前K（5）日最高价的均值作为当日上轨，前K（5）日最低价的均值作为当日下轨。分析日内分钟线，当当前价格突破上轨时买入，跌破下轨时卖出。

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，当最新价小于下轨时，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；当最新价小于下轨且有持仓时，以最新价全部卖出。

回测结果截图







