Range Break择时策略

基本逻辑

分析中证500成分股的分钟线数据。在策略执行前一交易日，买入50%的仓位作为底仓，以便变相实现T+0。首先计算前一交易日的振幅=昨日最高价-昨日最低价，当日上轨=开盘价+k\*昨日振幅，下轨=开盘价-k\*昨日振幅。当最新价突破上轨时做多，最新价跌破下轨时做空，在当日收盘前5分钟平仓。

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，并计算个股票前一交易日的振幅。

开盘后每分钟：

在9点30时，对于中证500外的有底仓的股票，以最新价直接清仓。然后计算每只股可用资金（所有可用资金/（500-满仓股数量），由于开盘时股票全都只有底仓，所以满仓股数量为全部底仓股票数量的一半）。用每只股可用资金的50%为新纳入中证500的股票建立底仓。获取股票池股票的开盘价，根据昨日振幅计算出每只股的上下轨。

9:30至14:55，当股票最新价突破其上轨且只有底仓时，以底仓数量做多该股；当股票最新价跌破其下轨时且只有底仓时，以底仓数量做空该股。

14:55时，以股票底仓数量平掉空头和多头仓位，恢复到底仓数量。

回测结果截图





