Rbreaker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。首先根据昨日的最高价、最低价、收盘价，计算出6条信号轨道Bbreak, Ssetup, Senter, Benter, Bsetup, Sbreak。开盘后，根据当日的最高点和最低点对Senter和Benter进行调整，调整后为up\_line和dn\_line。当日内最新价突破最上轨Bbreak和最下轨Sbreak时，分别做多和做空；当日内最高价处于Bbreak与Ssetup之间，且最新价跌破up\_line时，平多或做空；当日内最低价处于Sbreak与Bsetup之间，且最新价突破dn\_line时，平空或做多。收盘时平仓，恢复底仓。

该策略的特点在于结合了突破和反转。

算法

一、 每日开盘前：

1. 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。
2. 获取昨日价格数据high, low, close，计算轨道线。其中k1，k2，k3为三个参数，分别设为0.35，0.07，0.25。

Ssetup = high + k1 \* (close – low)

Senter = (1 + k2) / 2 \* (high + low) – k2 \* low

Benter = (1 + k2) / 2 \* (high + low) – k2 \* high

Bsetup = low – k1 \* (high – close)

Bbreak = Ssetup + k3 \* (Ssetup – Bsetup)

Sbreak = Bsetup – k3 \* (Ssetup – Bsetup)

二、 开盘后每分钟：

1. 9点30分

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。获取当前最高价max\_high和最低价min\_low。

1. 9点30分到14点55分

获取当前分钟最高价high和最低价low，根据上一分钟获得的max\_high和min\_low，计算新的max\_high = max(high, max\_high)和min\_low = min(low, min\_low)。然后调整Senter和Benter，up\_line = Senter + (max\_high – Ssetup) / div，dn\_line = Benter – (Bsetup – min\_low) / div。其中div时一个参数，设定为3。

上突破：最新价大于Bbreak

下突破：最新价小鱼Sbreak

向下反转：日内最高价大于Ssetup但小于Bbreak，最新价小于up\_line

向上反转：内日最低价小鱼Bsetup但大于Sbreak，最新价大于dn\_line

对于只有底仓且当日未交易过的股票，出现上突破和向上反转信号时，以底仓数量做多；

对于已经做空的股票，出现向上反转信号时，买入底仓数量平空；

对于已经做多的股票，出现向下反转信号时，卖出底仓数量平多。

1. 14点55分

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







