

不做特别说明，均使用对数收益率

Chapter 1

反转策略

1.1 RSI

1.1.1 回测小结

1. 如果是发生一些危机或者全球性灾害的时候，使用 RSI 抄底是不明智的

回测结果

代码	累积收益	交易次数	击中率(%)	代码	累积收益	交易次数	击中率
002027	1.92	67	0.58	002555	1.27	43	0.47
002558	0.84	32	0.34	002602	0.62	52	0.48
002624	1.26	41	0.49	159601	1.06	13	0.54
159611	1.09	5	1.0	159866	1.07	6	0.67
159869	1.32	16	0.5	159915	1.69	44	0.52
159980	0.95	10	0.6	159985	0.99	10	0.6
162411	0.48	44	0.43	510050	0.59	63	0.46
510300	1.73	39	0.64	510500	1.25	39	0.59
510880	0.88	59	0.51	511010	1.01	27	0.44
512000	1.16	28	0.5	512100	1.66	34	0.59
512170	0.89	21	0.24	512400	1.25	26	0.54
512480	0.88	17	0.53	512690	1.07	18	0.5
512800	1.35	18	0.72	513100	1.17	10	0.6
513310	1.1	4	0.75	513330	0.81	21	0.38
513360	0.83	10	0.7	513500	1.37	18	0.83
515220	1.08	4	1.0	515790	1.33	17	0.47
515880	1.2	18	0.72	516160	0.66	22	0.36
518880	1.33	33	0.76	562800	0.98	12	0.42
588000	0.94	21	0.52	600036	1.11	58	0.53
600900	1.31	34	0.5	601138	1.2	14	0.43
601225	0.9	18	0.5	603619	1.29	13	0.77