

# 前言

不做特别说明，均使用对数收益率



# Part I

## 趋势

## **Part II**

### **反转**

# Chapter 1

## RSI

### 1.1 回测结果

#### 1.1.1 短暂持股，不做止损止盈

背离

总体上，RSI 背离不好的标的，不会因为持有天数而表现更好。

RSI 水平

Table 1.1: RSI 背离下回测结果，信号出现持有 10 天

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	0.33	180	0.41	002555	4.93	115	0.59
002558	2.86	158	0.56	002602	0.13	127	0.49
002624	4.54	94	0.57	159601	0.68	46	0.33
159611	1.06	13	0.62	159866	1.37	26	0.54
159869	1.37	34	0.56	159915	0.96	116	0.49
159980	0.73	23	0.52	159985	1.22	14	0.79
162411	0.02	131	0.33	510050	0.74	186	0.49
510300	2.32	94	0.57	510500	2.57	76	0.61
510880	2.53	157	0.59	511010	1.01	42	0.48
512000	2.31	74	0.58	512100	0.76	76	0.58
512170	0.47	57	0.37	512400	3.48	77	0.62
512480	0.59	40	0.45	512690	1.22	48	0.44
512800	0.64	52	0.42	513100	2.46	32	0.84
513310	1.55	6	1.0	513330	0.39	55	0.38
513360	2.96	27	0.63	513500	1.54	37	0.73
515220	1.08	10	0.5	515790	0.6	56	0.48
515880	2.12	55	0.58	516160	0.79	66	0.45
518880	1.14	66	0.61	562800	1.44	37	0.65
588000	0.36	55	0.35	600036	2.04	144	0.57
600900	1.61	116	0.59	601138	1.09	38	0.63
601225	1.3	45	0.62	603619	0.58	65	0.58

Table 1.2: RSI 背离下回测结果，信号出现持有 5 天

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	0.48	180	0.48	002555	2.76	115	0.58
002558	1.95	158	0.56	002602	0.74	127	0.5
002624	1.95	94	0.5	159601	0.7	46	0.35
159611	1.14	13	0.62	159866	1.08	26	0.54
159869	1.04	34	0.5	159915	0.93	116	0.49
159980	0.8	23	0.48	159985	1.13	14	0.64
162411	0.08	131	0.32	510050	0.58	186	0.49
510300	2.5	94	0.65	510500	2.52	76	0.63
510880	1.57	157	0.53	511010	1.0	42	0.6
512000	2.24	75	0.63	512100	0.77	76	0.54
512170	0.76	59	0.47	512400	1.89	77	0.57
512480	0.44	40	0.4	512690	1.41	48	0.54
512800	0.96	52	0.54	513100	1.83	32	0.69
513310	1.26	6	1.0	513330	0.52	55	0.45
513360	2.02	27	0.67	513500	0.97	37	0.51
515220	1.07	10	0.5	515790	0.45	56	0.27
515880	1.43	55	0.53	516160	0.75	66	0.44
518880	0.89	66	0.48	562800	1.34	37	0.59
588000	0.48	55	0.36	600036	0.58	144	0.5
600900	1.4	116	0.53	601138	0.7	38	0.45
601225	1.21	45	0.6	603619	0.86	65	0.51

Table 1.3: RSI 水平，持股 10 天

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



## **Part III**

# 模式识别

## Chapter 2

# 反转策略

### 2.1 RSI

#### 2.1.1 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