**波峰波谷策略**

* **买入条件：**

同时满足下列条件，则等权重买入

* 条件一：总市值低于200亿（当日？连续40个交易日？）

**（总市值：TQ\_QT\_SKDAILYPRICE.** TOTMKTCAP**）**

* 条件二：在40个交易日内有连续5个交易日内的最大涨幅大于5%，小于50%。
* 条件三：在条件二的最大涨幅出现后，价格从最高点下跌了最大涨幅的30%。

例如一只股票在3天里从1元涨到1.3元，上涨30%。在随后的5天又下跌了0.3\*30%=0.09元，即下跌到1.21元以下

* **卖出条件：**

满足下列任何一个条件则卖出一半，满足了第二个条件则全部卖出

* 条件一：盈利超过10%，例如买入为1.21元，涨到1.21\*1.1=1.232元
* 条件二：涨到买入点和波峰距离的一半，例如买入点为1.21元，则涨到1.21+（1.3-1.21）/2=1.255元。

止损点为5%，即亏损超过5%则全部卖出

最长持有时间为10天，即持有时间达到10天，则无论任何条件，全部卖出

**强势股低吸策略**

* **买入条件：**

同时满足下列条件，则等权重买入

* 条件一：总市值低于200亿
* 条件二：价格高于120日均线，但小于20日均线的1.02倍
* 条件三：最近5个交易日内有连续两个交易日的交易量大于20日平均交易量的两倍
* **卖出条件：**

盈利5%以上卖出一半，盈利10%以上全部卖出

止损点为5%，即亏损超过5%则全部卖出

最长持有时间为10天，即持有时间达到10天，则无论任何条件，全部卖出

两个策略的初始规模为1亿元，从2005年初开始回测。仓位中有现金时，满足条件即等权重买入，当仓位中没有现金时，即使有满足条件的股票也不买入。