Python版本号:3.6.8

策略逻辑：

抛物线转向指标（ParabolicSAR）是一个识别趋势的停止和逆转的指标。通常情况下，抛物线SAR在图表中以虚线的形式出现，要么在价格上方，要么在价格下方。当价格处于上升趋势时，SAR曲线将位于价格下方。当价格处于下降趋势时，SAR曲线将上升到价格上方。抛物线SAR总是被认为是价格势头的阻力的象征。当SAR曲线和价格曲线交叉的时候，就是交易订单被执行的时候。

SARn+1=SARn+α（EP-SARn），EP极值点表示在某个上升趋势对应的最高值，或某个下降趋势对应的最低值，α表示加速系数，一般为0.02，即每当一个新的EP被识别出后，系数增加0.02，因此一般设立一个加速系数的最大限制为0.2。

代码模型概要：

1、计算parabolic\_SAR曲线，如果下一期的SAR值在本期或前一期的价格范围内（或超出），SAR必须设置为最接近的价格界限。例如，如果处于上升趋势中，计算新的SAR值，如果其结果超过今天或昨天的最低价格，则必须将其设置为等于该下边界。

如果下一期的SAR值在下一期的价格范围内（或超出），那么新的趋势方向就会发出信号。然后SAR必须换边。

2、确定交易信号，SAR在价格的下方时认为价格处于上升趋势，确定多头，反之则清空仓位，并进行前后差分保证交易方转换来确定信号。

参考代码及原理出处：

<https://github.com/je-suis-tm/quant-trading#8-parabolic-sar>