

Week 7-8: 交易策略与回测成果

在传统的机器学习股票日收益率预测课题中，大多数预测模型的应用方法都是根据预测的收益率决定当日是否买入或者卖出，所有的交易操作都在但日内短线完成。

我们想要构建一个思路类似网格策略的交易策略，跟踪自己买入的每一个仓位并存储，计算每个仓位累计的收益率。并且基于以下数据之间的对比决定买入和卖出行为：

- 实时的日收益率与预测收益率之间的差值
- 每一个持仓的实际累计收益率，下一天的预测收益率对当前实际累计收益率的影响
- 对所有仓位的总加权累计收益率设定一个止盈和止损的阈值
- 波动率到达一定程度时的特殊行为

你需要参考更多基于网格策略、趋势跟随策略的资料构建出自己的交易策略，并使用[Zipline](#)对NVDA、AMD和INTC进行回测，进一步调整模型参数和策略细节，最后提交一篇你自己的报告，描述你的特征工程方案、模型细节、交易策略以及回测结果。