

新的方法：

采用两种不同参数的 RSI 线。RSI fast 的参数是 5 个 bar,RSI slow 的参数仍然是 30 个 bar。
当 RSI slow 指示的仓位 pos 在(0.05,0.5)之间时，认为市场总体没有大趋势：采用 RSI fast 指示的仓位 pos。

当 RSI slow 指示的仓位 pos 为 1 时，对 RSI fast 指示的仓位保持警惕：当 RSI fast 仓位<0.3 时，认为市场暂时回调，采用 RSI fast 指示的仓位 pos。

收益率：相比之前，没有明显变动。



	收益率	HS300收益率	累计收益率	最大回撤	收益回撤比	最大回撤发生时间段
2008.01 - 2008.12	-15.80%	-66.25%	-15.80%	-17.76%	-0.89	2008.03.03 - 2008.11.27
2009.01 - 2009.12	76.48%	89.90%	48.59%	-11.66%	6.56	2009.02.23 - 2009.03.16
2010.01 - 2010.12	18.73%	-11.51%	76.43%	-12.47%	1.50	2010.04.12 - 2010.07.16
2011.01 - 2011.12	-8.98%	-26.46%	60.58%	-12.19%	-0.74	2011.03.08 - 2011.12.29
2012.01 - 2012.12	-4.34%	9.75%	53.61%	-15.30%	-0.28	2012.03.13 - 2012.11.29
2013.01 - 2013.12	10.40%	-7.70%	69.58%	-8.31%	1.25	2013.05.27 - 2013.08.19
2014.01 - 2014.12	70.73%	52.19%	189.52%	-8.69%	8.14	2014.02.19 - 2014.06.26
2015.01 - 2015.12	63.29%	2.46%	372.76%	-22.77%	2.78	2015.06.12 - 2015.10.08
2016.01 - 2016.12	-7.22%	-4.58%	338.62%	-12.22%	-0.59	2016.01.06 - 2016.05.31
2017.01 - 2017.12	20.43%	20.60%	428.25%	-4.97%	4.11	2017.08.08 - 2017.08.25
2018.01 - 2018.10	-11.45%	-18.01%	367.79%	-15.79%	-0.72	2018.01.26 - 2018.10.25

与之前的对比发现，区别主要是 09 年和 15 年收益增加，同时 16 年和 17 年亏损增加。
可以认为，这种情况是采用 RSI fast 以后不可避免的风险增加。

每日换手率 25.38%
年化换手率 6346.16%

换手倍数：

2008-12-31 69.488836
2009-12-31 54.184428
2010-12-31 56.929370
2011-12-31 70.591727

2012-12-31	80.642938
2013-12-31	58.018272
2014-12-31	56.720323
2015-12-31	52.674950
2016-12-31	60.154514
2017-12-31	46.230277
2018-12-31	62.741608

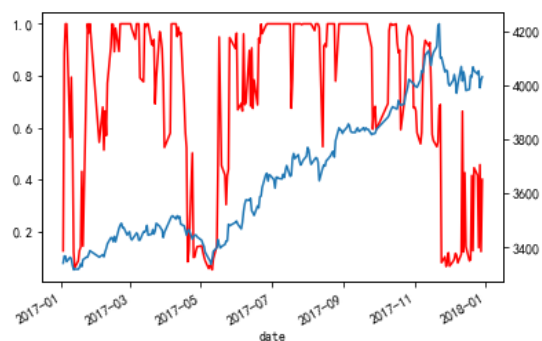
由于在特定情况下，采用了 RSI fast 指示的仓位，而 RSI fast 变动比较敏感。所以策略换手率有明显提升。

具体来看，还是有很多时候的换手率是“无用功”。

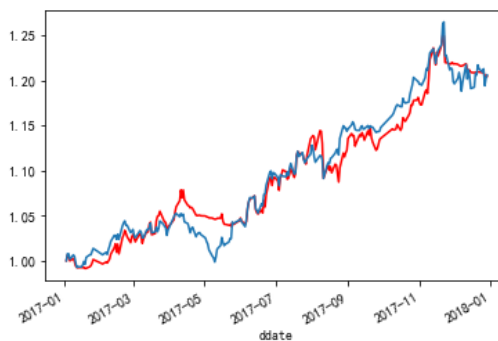
例如下图（仓位），存在很多短时间内减仓又加仓的情况。

2017 年：（红线为策略）

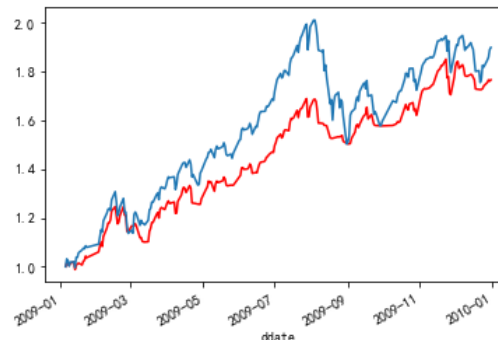
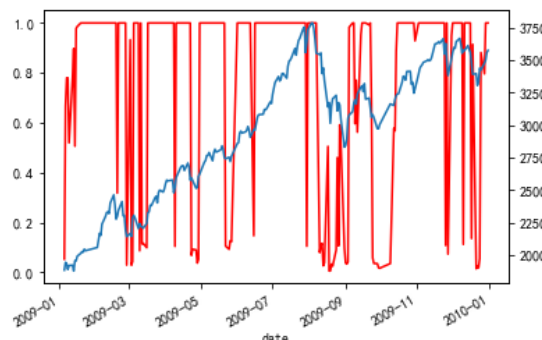
仓位



收益



2009 年：



2012 年：（亏损，收益不及标的）

