

RSI 指标用于定投

一、RSI 计算：使用 TA-lib 库

```
rsi[index] = talib.RSI(price[index], RSI_Duration)
```

其中，

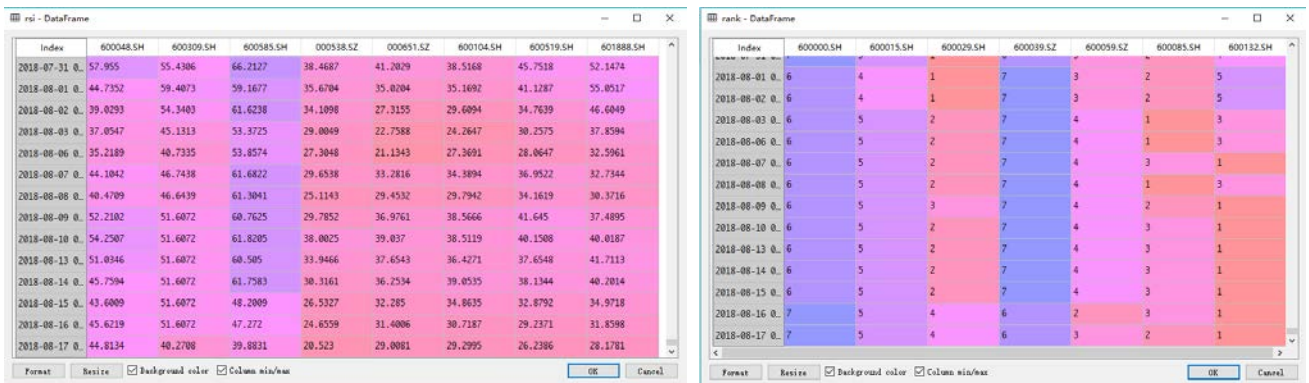
```
RSI_Duration=12
```

```
price 为日频历史价格序列
```

二、RSI 排序

```
rank = rsi.rank(axis=1, ascending=True)
```

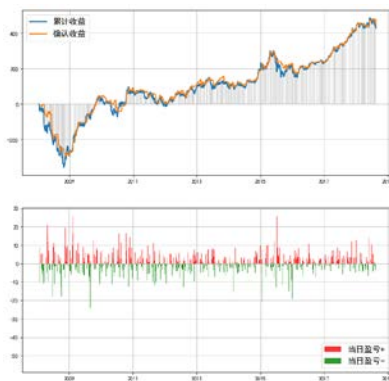
得到的列表如下



- 每一周固定时间点，选择 rsi 值最小（rank 值最小）的 3 个标的。
- 依照公式计算相应权重。
- 根据权重进行调仓。

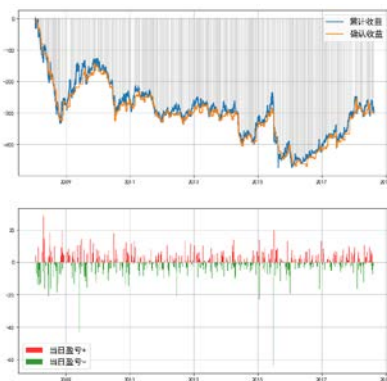
三、其他针对性测试

RSI 取小的（当天数据）

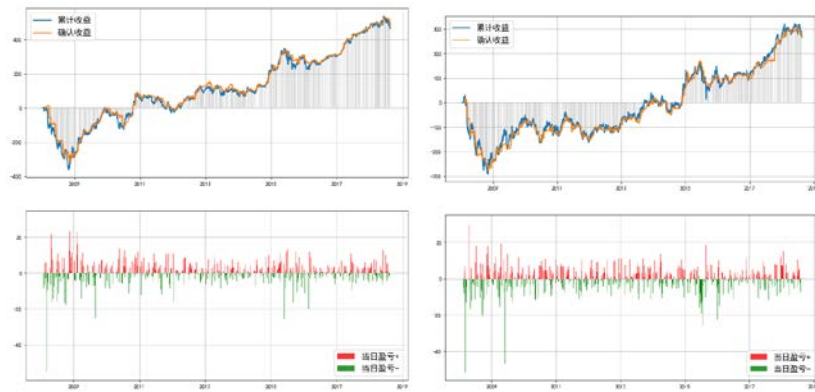


RSI 小的（用 1 天前的数据）

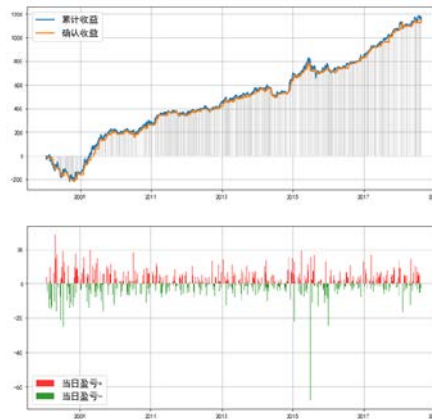
RSI 取大的（当天数据）



RSI 取大的（用 6 天前的数据）



RSI 取大的 (用 1 天后的数据) (之前做的结果) (是错误的)



综上，暂时不能得出 RSI 是正向指标的结论。起初推测原因可能是，目前回测建立在周频调仓上，无法体现出正向 RSI 类似于动量的时效性；但是将调仓时间改为日频后，无论正向反向，用 RSI 做指标效果均不理想。