1. **策略：**
2. **选股策略**

当前只考虑静态选股

1. 总市值大于30小于300
2. 买入前两天到达的涨幅（（买入前两天的收盘最高价-买入当日收盘价）/买入当日收盘）小于10 – 对应代码中的值policy3
3. 买入前五天涨幅大于4小于8
4. 收盘价与前30天包括选股当天的最高收盘价差值比例（前22个交易日收盘最高价-当天收盘价/前22个交易日最高价）<0.03 – 对应代码中的值policy1
5. 上市时间>9个月
6. 选股当天成交量大于昨日成交量\*1 --对应代码中的值policy2
7. 选股当天换手率>2
8. 固定十大股东占比>50
9. 选股当天收盘价格在4-40之间
10. 非st股票
11. （前22个交易日的最高价 – 前22个交易日的最低价）/前22个交易日的最低价 < 0.18
12. **买入策略（需要选股当天均价）**

|  |
| --- |
| **普通策略**：  （此处的30天最高价都是指30天收盘最高价） |
| 1. 高开 ①若开盘价高于昨日收盘\*1.0，等到市价回调至≤昨日收盘\*1.0 (此为可调节参数，ub\_p)，执行买入，   分为两种可能，一是高于昨日收盘\*1.0，等回调到昨日收盘\*1.0买入，  一种是开盘低于昨日收盘\*1.0，直接开盘买入（这种在这个参数情况下是不可能的。）   1. 平开。直接开盘价买入。 |
|  |
|  |
| 1. 低开，④若开盘价低开，市价≥0.96 (此为可调节参数，lb\_p)\*30天最高价，等到市价达到   min{昨日均价,昨日收盘}或30天最高价，执行买入，若是开盘低于min{昨日均价,昨日收盘}，直接买入 |
| ⑤低开，市价＜0.96\*30天最高价，等到市价达到  max{昨日均价，昨日收盘，0.96 (此为可调节参数，para\_c)\*30天最高价}时，执行买入 |
| 1. 其他不触发买入情况 |

**预警机制（增加动态增长情况和禁忌操作）：**

min\_stock\_num初始化为5

遇到**前一个交易日收益[每支股的（收盘-买入价格）/买入价格的平均值] <0且连续两个交易日选出股票数<=5则进入警戒状态**, （eg: 11日的收益<0， 12/13号选股数<5则13号进入警戒状态）但是如果遇到选出的股票数大于min\_stock\_num时，则买入当天跳出警戒状态，**min\_stock\_num重新初始化为5**，

状态

**禁忌操作**：就是如果是当天 由选股数量由警戒状态变为非警戒状态 则当天 不会重新进入警戒状态

**警戒状态：**当选出股票数<min\_stock\_num时，直接不买入

**高级预警机制：**

**在基本预警机制的基础上，如果连续两天的利润之和<-5%则进入高级预警状态，进入高级预警状态之后模拟买入，遇到模拟利润大于0（这时候基本预警机制还是存在的，即每一天先判断是否符合基本预警机制，如果signal=0才属于模拟的时候）的时候跳出高级预警状态，跳出高级预警之后的三天内遇到选出股数小于8模拟操作，不进行真实购买（这是仍要判断是否符合基本的预警机制）。**

**即我们的高级预警机制是以基本预警机制为基础的，同时即使处在高级预警状态或者其延长期，我们仍要判断是否符合基本预警。**

1. **卖出策略**

动态卖出策略

1. 当天开盘涨停 保留 不卖出
2. 针对每种情况计算一个当时的上界和下界，当先触碰到哪个值就以该值卖出，如果一直在上下界中波动，则**10：00**卖出

下面是上下界的计算策略：*bp-买入价格 op-开盘价 ub-上界 lb-下界*

1. 当总市值小于100时（这一部分其实没用到,我们直接筛选掉了总市值小于80的股票）：

如果op>=bp:

lb = max(bp, (op+(-0.003)\*bp))

ub = min((bp+0.08\*bp),(op+0.04\*bp))

如果op<bp:

lb = op+(-0.004)\*bp

ub = max(bp,(op+0.05\*bp))

1. **当总市值大于等于100时 -- 现在的卖出策略按这个来的没有考虑市值**

如果op>=bp:

lb = max(bp, (op+(-0.001 即 a\_up100)\*bp))

ub = min((bp+0.082 即 c\*bp),(op+0.07 即 b\_up100\*bp), (cp+0.082 即 c\*cp))

如果op<bp:

lb = op+(-0.001 即 a\_up100)\*bp

ub = max(bp,(op+0.07 即 b\_up100\*bp))

1. **资金分配策略：**

**均等分配：**

每天的本金平均分配给选入的股，（每支股不论股价差异，投资相同的金额）如果该股并没有被买入，则相当于那一份资金保留不动，利润为0

**价格限制：（暂不考虑）**

每一支股最多投入10万，如果按均等分配超出10万元，那每支股投入十万，剩余的本金保留不动，相当于利润为0

## 参数

top10sh\_list = [i for i in range(20,80,10)] #十大股东占比

tr\_list = [j/10.0 for j in range(20,41)] #换手率

policy1\_list = [i/100.0 for i in range(1,7)] #('30\_close\_highest'-'close1')/'close1' 收盘价与前30天（其实只有22天交易日）包括选股当天的最高收盘价差值比例

cp\_down\_list = [i for i in range(2,6)] #前五天涨幅下限-changepercent

policy2\_list = [j/10 for j in range(17,21)] # code\_df['vol1']/code\_df['vol2'] 昨日成交量/前日成交量 即对应策略中“选股当天成交量大于昨日成交量\*1”

cp\_up\_list = [j for j in range(18,23)] #前五天涨幅上限-changepercent -对应策略中“买入前五天涨幅大于4小于8”

totals1\_down\_list = [i for i in range(90,130)] #总市值下限

price\_down\_list = [i for i in range(3,8)] #昨日收盘价格下限

price\_up\_list = [i for i in range(40,51)] #昨日收盘价格上限

totals1\_up\_list = [1000,1100,950,980,970,960,1200] #总市值上限

policy3\_list = [i/10.0 for i in range(160,200)] #买入前两天到达的涨幅（（最高-收盘）/收盘）

#卖出的条件的参数

#100以上的

a\_up1001\_list = [-i/1000 for i in range(1,2)]   #卖出当天低开较多

a\_up1002\_list = [-i/1000 for i in range(1,6)]    #卖出当天低开较少

b\_up100\_list = [j/100.0 for j in range(3,8)]

#100以下的

a\_down100 = -0.004

b\_down100 = 0.05

#固有标准

c\_list = [i/1000.0 for i in range(80,86)]

#单价小于30时的变换参数

d\_price = 1.05

#决定买入价格的参数

qu\_num\_list = [i/100.0 for i in range(96,100)]

mulh\_num\_list = [i/100.0 for i in range(96,100)]

settle\_num\_list = [i/100.0 for i in range(100,105)]

sell\_minute\_list = [615,600,630,645,660]

#股票支数限制参数

min\_stock\_num\_list = [i for i in range(5,16)]

#股票金额

max\_stock\_pay = 20

#固定无关参数

a\_down100 = -0.004

b\_down100 = 0.05

para1 = 0

para2 = 0

para\_col = [policy1\_list,policy2\_list,policy3\_list,tr\_list,cp\_up\_list,cp\_down\_list,top10sh\_list,totals1\_down\_list,totals1\_up\_list,price\_up\_list,price\_down\_list,a\_up1001\_list,a\_up1002\_list,b\_up100\_list,c\_list,qu\_num\_list,mulh\_num\_list,settle\_num\_list,min\_stock\_num\_list,sell\_minute\_list]

para\_good = [0.03,1,10,2,8,4,50,30,300,40,4,-0.001,-0.001,0.07, 0.082,0.96,0.96,1,5,600]