1. **参数**

**0:policy1\_list 策略1** 前22个交易日收盘最高价-当天收盘价/前22个交易日收盘最高价）< policy1

**1:policy2\_list 策略2** 选股当天成交量大于昨日成交量\* policy2

**2-policy3\_list 策略3 （**买入前两天的收盘最高价- 买入前两天开盘最低价）/买入前两天开盘最低价）小于policy3

**3:tr\_list 换手率**

**4:cp\_up\_list 买入前五天涨幅上限**

**5:cp\_down\_list 买入前五天涨幅下限**

**6:top10sh\_list 固定十大股东占比**

**7:totals1\_list**

**8:totals1\_up\_list**

**9:price\_up\_list 昨日收盘价格上限**

**10:price\_down\_list 昨日收盘价格下限**

**11:a\_up1001\_list**

**12:a\_up1002\_list**

**13:b\_up100\_list**

**14:c\_list**

**15:qu\_num\_list**

**16:mulh\_num\_list**

**17:settle\_num\_list**

**18:min\_stock\_num\_list**

**19:sell\_minute\_list**

1. **策略：**
2. **选股策略**

**股票属性**

**0:datetime 日期**

**1:code 股票代码**

**2:totals1 总市值**

**3:policy3 策略3（**买入前两天的收盘最高价-买入前两天开盘最低价）/买入前两天开盘最低价）上界

**4:open 开盘价**

**5:high 最高价**

**6:mean\_value4\_before**

**7:policy1策略1** 前22个交易日收盘最高价-当天收盘价/当天收盘价 上界

**8:policy2策略2** 选股当天成交量/昨日成交量 下界

**9:tr\_before 昨日换手率**

**10:settlement 昨日收盘**

**11:30\_close\_highest 前30天（即**前22个交易日）收盘最高价

**12:mean\_value2\_hl\_before 昨日均价**

**13:low 最低价**

**14:top10sh 十大股东占比**

**15:after\_sign**

**16:day\_tomo 明天**

**17:day\_aftertomo 后天**

**18:cp\_sum**

**19:cq\_sign**

**20:mean\_value\_oc\_before**

**21:close 收盘价**

当前只考虑静态选股

1. 总市值大于30 totals1小于300 totals1\_up
2. 买入前两天到达的涨幅policy3\_list（（买入前两天的收盘最高价-买入前两天开盘最低价）/买入前两天开盘最低价）小于10 policy3 – 对应代码中的值policy3
3. 买入前五天涨幅大于4cp\_down小于8cp\_up—应该包含当前日期的（选股当天）
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个交易日收盘最高价）<0.03 policy1 – 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 policy2 --对应代码中的值policy2
7. 选股当天换手率 tr\_list>2%
8. 固定十大股东占比 top10sh\_list>50
9. 选股当天收盘价格在4-40之间price\_down-price\_up
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- h\_l\_diff
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）policy1？ |
| 1. 高开 ①若开盘价高于昨日收盘\*1.0，等到市价（zqy：只要最低价满足就可执行买入）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]-policy4\_std，   等到市价【zqy:只要最低价满足就可买入】达到min{昨日均价,昨日收盘}-policy\_4\_value时，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}-policy\_5\_value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**

**卖出策略跟买入价格和卖出当天的开盘价有关系**

动态卖出策略

1. 当天开盘涨停 保留 不卖出—zqy：等下一日再卖出
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（最后卖出）

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