

WEEK1项目选题说明文档

1. 策略研究方向选题

选题 1：商品期货趋势类策略，日线级别低频策略。

难度指数：★★★★

■ 选题说明和要求：

- 1) 策略实现：完全用 Python 实现，代码要求符合《Python 策略代码写法规范》。
- 2) 策略信号指标：可参考《Trading System And Methods》Chapter 6-13。
- 3) 策略测试标的和品种：商品期货合约，具体测试内容如下：
 - 单品种测试：要求选择PTA，可使用连续合约。暂时可不用考虑标的的实际可交易性（如连续合约）、合约换月等实际交易细节。回测起始时间自 2010/1/1 至今。
 - 全品种测试：要求对策略研究_《商品期货数据》中的36个活跃品种进行全品种测试。
- 4) 数据要求：单品种测试，必须使用 `causis_api`；全品种测试数据可从网盘链接“WEEK1_商品期货数据”提取。
- 5) 报告要求：
 - 使用指定报告模板（详见 AM 投研文档），必须严格按照模板要求，分析撰写内容包含策略思想，指标计算，交易方式描述，模拟仓位信号图，仓位管理方法（如有），敏感性分析。
 - 报告相关图例（模拟仓位信号图，敏感性分析热力图 etc），要求使用 Python 实现。
 - 格式排版等报告可阅读性要求符合《投研报告撰写规范》。

■ 本选题考察目标：

- 6) 工作完成度，是指从数据处理-策略构建-回测-策略分析-报告撰写这一整套策略研究流程是否完整；
- 7) 对所实现的工作内容、过程和结果是否有深度思考和理解。

■ 报告中必须包含的内容：

- 1) 买入/卖出信号模拟图；
- 2) 仓位模拟图；
- 3) PNL 曲线图；
- 4) 策略性能指标表：包含夏普，卡玛，年化收益，最大回撤，波动率，最大回撤时间，最大回撤修复时间；
- 5) 参数敏感性分析热力图。



选题 2：商品期货套利类策略，日线级别低频策略。

难度指数：★★★★★

■ 选题说明和要求：

- 1) 策略实现：完全用 Python 实现，代码要求符合《Python 策略代码写法规范》。
- 2) 策略信号指标：可参考《Trading System And Methods》Chapter 6-13。
- 3) 策略测试标的和品种：商品期货合约，具体测试内容如下：
 - 配对品种测试：如选择实现跨期套利策略类型，配对品种可不限于螺纹钢、TA等，但需要描述清楚配对选择逻辑。**注意：配对品种为同一品种的远期近期合约。**
- 4) 数据要求：单品种测试，必须使用 `causis_api`；全品种测试数据可从网盘链接“WEEK1_商品期货数据”提取。
- 5) 报告要求：
 - 使用指定报告模板（详见 AM 投研文档），必须严格按照模板要求，分析撰写内容包含策略思想，指标计算，交易方式描述，模拟仓位信号图，仓位管理方法（如有），敏感性分析。
 - 报告相关图例（模拟仓位信号图，敏感性分析热力图 etc），要求使用 Python 实现。
 - 格式排版等报告可阅读性要求符合《投研报告撰写规范》。

■ 本选题考察目标：

- 1) 工作完成度，是指从数据处理-策略构建-回测-策略分析-报告撰写这一整套策略研究流程是否完整；
- 2) 对所实现的工作内容、过程和结果是否有深度思考和理解。

■ 报告中必须包含的内容：

- 1) 买入/卖出信号模拟图（包含价差构造方式）；
- 2) 仓位模拟图；
- 3) PNL 曲线图；
- 4) 策略性能指标表：包含夏普，卡玛，年化收益，最大回撤，波动率，最大回撤时间，最大回撤修复时间；
- 5) 参数敏感性分析热力图。



2. 其他说明

- 1) 电子版资料：《Trading System And Methods》请在网盘链接“WEEK1_投研资料”中查找。
- 2) 选题范围：策略研究方向请在选题1、选题2中任选其一。
- 3) WEEK1 安排：
 - 周一上午9:30, WEEK1 开题会。开题日如遇节假日延期, 则提交日和汇报日同步顺延。
 - 周五下午16:00, WEEK1 关门时间: 需要按照投研文档《策略提交》流程说明要求, 在AM上完成策略提交:
 - 提交: 投研报告.pdf, python 策略代码.txt (策略代码仅限.txt格式提交, 不允许使用.py以及压缩包格式)。上述两项均按要求完成提交, 并通过路演考核, 方认为通过WEEK1。
 - 周五晚 19:00, WEEK1 视频路演&答辩, 15 分钟/人 (10分钟汇报+5分钟答辩), 路演汇报时屏幕共享提交的选题报告即可, 无需额外准备ppt。
 - 周一至周四每日18:30进行直播答疑、分享、互动, 请准时参会。
- 4) 其他提示
 - 请仔细查阅投研工作手册相关内容, 请每日关注“更新日志”中文档更新情况。
 - 提交时间以 AM 系统提交时间戳为准, 超时即认为WEEK1不通过。
 - 策略实现、AM 权限、策略提交过程中遇到技术性问题, 可在微信群中反馈。

