

知乎

从容不迫的ETF策略：十年回测，够稳



从容不迫的ETF策略：十年回测，够稳

金牛量化笔记

专注于人工智能、AIGC技术研究。喜欢天马行空的故事。

关注他

3 人赞同了该文章 >

从容不迫的ETF轮动策略：年化21%的低频交易方案

从容不迫的ETF轮动策略：优化后年化28%的低频交易方案

对前两篇的策略进行进一步的升级优化，支持十年回测，总体成绩稳步向上，如下图：

关于作者



金牛量化笔记

专注于人工智能、AI

回答

23

文章

25

关注他

发

▲ 赞同 3 ▼

● 添加评论

🔗 分享

♥ 喜欢

★ 收藏

📄 申请转载

...

知乎

从容不迫的ETF策略：十年回测，够稳



策略核心原理

通过四个关键维度对主流ETF进行综合评估:

1. **1.趋势因子+(50%)**  
计算25日对数收益率的线性回归R²值，识别长期趋势强度
2. **2.动量因子+(20%)**  
结合5日与10日价格变化率(ROC)，捕捉短期动能
3. **3.成交量因子+(30%)**  
通过5日/18日均量比判断资金活跃度
4. **4.动量加速度因子 (10%)**  
通过近期动量因子的加速度，捕捉近期动量加速度更快的标的

知乎

从容不迫的ETF策略：十年回测，够稳

√x

数学公式

动量（相对变化率）

$$M_t = \frac{P_t}{P_{t-n}} - 1$$

动量加速度

$$A_t = M_t - M_{t-1}$$

$$A_t = \left( \frac{P_t}{P_{t-n}} - 1 \right) - \left( \frac{P_{t-1}}{P_{t-1-n}} - 1 \right)$$

$$A_t = \frac{P_t}{P_{t-n}} - \frac{P_{t-1}}{P_{t-1-n}}$$

量化意义

加速度为正表示动量在增强，市场情绪加速变化；为负表示动量在减弱，市场情绪变化减速。

学习实践建议

1.
2. **模拟验证：**用历史数据回测1个月
2.
3. **持续跟踪：**
- 每月检视因子有效性

• 每季调整ETF池

获取完整策略

本策略已发布在知识星球，**知识星球会员可免费领取完整代码**。加入星球您将获得：

1.
1. 本策略完整可执行代码
2.
2. 定期策略更新与讨论

知乎

从容不迫的ETF策略：十年回测，够稳

4.
4. 更多优质量化策略分享

风险提示

1.
1. 本文展示的策略回测结果基于历史数据，仅供学习，不代表未来表现
2.
2. 量化交易存在一定风险，请根据自身情况谨慎决策
3.
3. 本文为作者个人研究成果，不构成任何投资建议
4.
4. 实际交易需考虑滑点、手续费等成本因素

市场有风险，投资需谨慎。建议在充分理解策略逻辑和风险特征的基础上，使用模拟账户进行充分测试后再投入实盘交易。

有一个胜率很高的模型，就可以赚钱吗？

驯服“必然的失败”：量化投资中墨菲定律的防御哲学

发布于 2025-06-21 04:41 · 北京



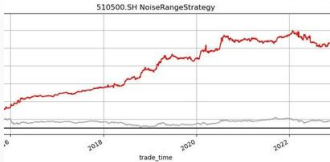
理性发言，友善互动



还没有评论，发表第一个评论吧

知乎

从容不迫的ETF策略：十年回测，够稳



研报复现 | 另类ETF交易策略：  
日内动量

QuantML

ETF全天候策略过拟合了吗？

上周写了一篇《每年躺赚20%的策略--ETF全天候策略》，没想到反响还挺热烈，2天时间阅读量就已经突破10w+了。虽然这篇文章有点标题党的成分，但是里面的内容其实还是很干的，其中一些观点也...

趋势那道光... 发表于期货实盘日...

持仓										建仓									
20.00%	30.00%	40.00%	50.00%	60.00%	70.00%	80.00%	90.00%	100.00%		20.00%	30.00%	40.00%	50.00%	60.00%	70.00%	80.00%	90.00%	100.00%	
12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%
12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%	12.50%
40%																			
p=1.7																			
持仓	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例	持仓比例
9.843	91.61%	88.12%	80200	90200	75146														
4.167	91.61%	88.12%	20500	17876	73855														
4.589	91.61%	88.12%	20500	17876	73855														
3.207	79.30%	67.42%	5466.667	3685	11319														

无敌ETF战法（二）etf交易策略与仓位控制

ETF无敌战法