

## 高频网格标的选择（附基金）



Q管家聊量化交易  
聪明人，少讲空话，多做计划！微信基中宝你关注了吗？

创作声明：包含投资理财内容

2 人赞同了该文章

跌痛了，才感觉，回测一瞬间，现实是钝刀。

也好，痛更能引人深思，不断进步，韭菜变镰刀。

我们知道，传统的网格交易，需要选择W走势良好的品种，最好如红利ETF最近一年的走势。

如下图所示，跟手工画的一般标准，数了一下，有五个波峰、五个波谷，平均两个月就有一个周期。



但是，这样标准的W走势标的，越来越稀缺，找到了就跟挖到金矿一样。还别说，前海开源金银珠宝混合基金，网友挖到的，W走势还真不错。

所以，为了适应范围广，我们的网格计划不断升级，直到8.0变成了智能网格，甚至连行业ETF都可以包含。

那么，对于高频网格，比如网格幅度为0.5%，应该选择什么标的好呢，是不是也可以选用行业ETF呢？

这几个月，用华宝智投的网格交易、自己编写的ptrade黄金分割网格交易，选择了证券ETF、医药ETF、平安银行、游戏ETF等进行了实践，心有感触，觉得标的应满足下面几个条件为好。

### 一、长期振幅不大

把回撤可控放在第一位，主要还是资金压力问题。

我计算了一下，如果最大回撤是30%，中线开始买入的话，还有20%的跌幅，如果每个网格粒度是0.5%，则需要准备40份资金待命，40份呀，要是用中概互联的话，算都不敢算。

还有，就算运气好，买入马上就一路上涨，则是面临着没有份额卖，早早就卖飞。

卖飞后，如果后续涨得少，心情还不错，要是遇到疯涨的行业ETF，则后悔不已，会为自己以后的错误决策留下祸根。

所以，高频网格应优先选择长期振幅不大的品种，跌了有钱补，涨了全部卖完也划算。能提高资金利用率，还能充分利用时间周期，不至于干坐等风来。

这样基金的选择，我一般用基金KPI分析，选择三年内最大回撤不超过30%的基金。只是有点麻烦，需要每只去查看。



### 二、短期活跃

以回撤标了上 会下 的 市场 振幅 的 少 不 会 上 上

赞同 2 添加评论 分享 喜欢 收藏 申请转载



当天的振幅大，高频网格是很爽，但对比长期资金压力大，只能作罢。

若有一种机制或杠杆，可以放大当天的振幅，而长期幅度不变，那就太好了。

回到现实，同样一个品种，不同时期的活跃程度不一样，选择在其活跃时期做网格，效果更佳。

短期活跃指标的衡量，可以观察量能、最近实际的振幅，简单有效，这些炒过股的都清楚。

### 三、成交量大

要是在场内做自动交易，无论是ETF、还是LOF基金，应选择成交量大的。

这个道理很简单，因为是自动交易，遇到有价无市时，容易踩坑，特别是容易挂空单。

### 四、均线以下+短线横盘开启计划

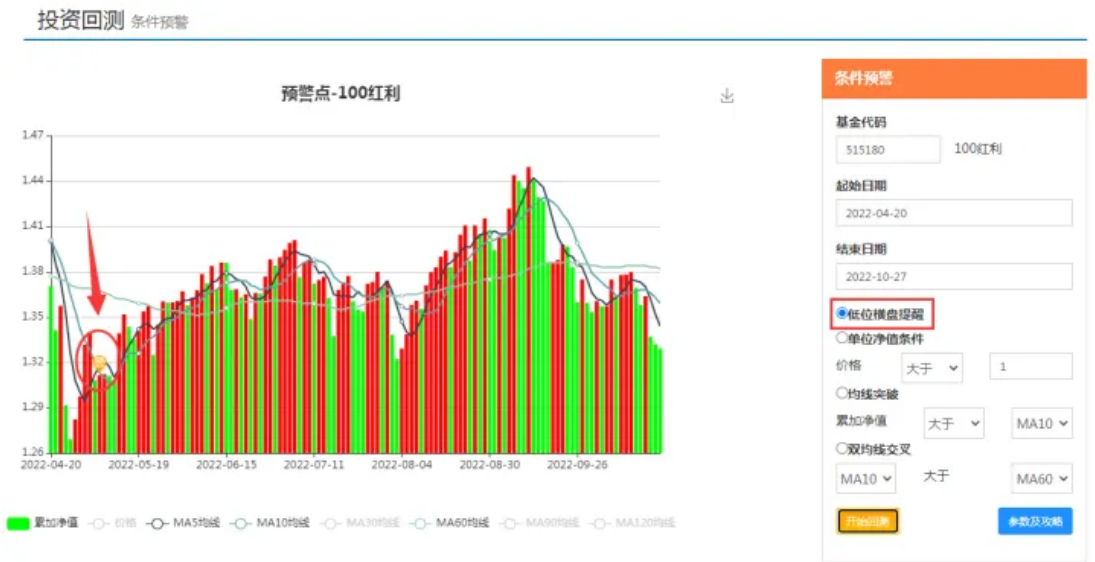
无论是高频网格、还是智能网格，开启计划的核心思路都一样，尽量架炮！

网络计划之猛将 -- 炮

mp.weixin.qq.com/s/2hfhG2FzIsVzRKGuZq...

高频网格本来就是薅羊毛，没有机会宁愿不上。

比如，对于本来就震荡良好的基金，选择60均线以下，进入低位横盘就差不多可以开启计划了。



当然，还可以参考估值、可翻倍定投等条件，谨慎一点，没有错。

### 五、网格策略实施

思路有了，怎么落到实处呢？

高频网格因为粒度小，一天的震荡可能有好几次交易机会，所以，尽量选择自动交易，这样也可以减少人为操劳。

最简单的，可以采用华宝智投的网格交易，参数配置选择回落卖出，这样弹性会更好。

如，网格粒度配置为1%，回落0.5%，这样每卖出一份至少可以赚0.5%。

取消

新建网格交易条件单

网络交易 红利ETF易方达 1.188 +0.17%

涨跌类型	按百分比	差价
上涨...	+1%	+ 回落卖出
回落...卖出	-0.5%	+
下跌...	-1%	+ 拐点买入
反弹...买入	+0.5%	+

在实际应用中，最好用不平衡设置，把上涨幅度设置得比下跌幅度大一点，以免亏损卖出。

遗憾的是，用华宝智投，回落值不能动态变化。

用ptrade自己编写量化，则灵活很多，但有难度，一般人嫌麻烦。

思想可参考：

自动网格交易尝试 - PTrade黄金网格

mp.weixin.qq.com/s/hDmcXY1GurHjRMrL...

上面两种策略都是场内自动交易，如果场外基金，在基金平台购买的话，可以采用机计划里面的网格计划、智能网格，把网格粒度幅度设置得小一些，如：1%，可以一定程度上实现高频网格的功能。

如下面的回测，虽然阶段趋势是下跌的，但还获得了不错的收益，这就是高频网格获得的阿尔法超额收益。

×

智能网格回测

...

网格粒度

当上涨

1

%，则卖出

当下跌

-1

%，则买入

高于网格上限，且回落

3

%

☐ 黄金分割回调值

，则卖出N份

低于网格下限，且反弹

3

%

☐ 黄金分割反弹值

，则买入N份

开始回测

参数及攻略



核心指标统计	
指标名称	指标值
持有天数	364 天 (2021-10-28 至 2022-10-27)
最大成本	14000 元
累计收益	753 元
平均投入资金	9815 元
投入资金收益率	7.67%
投入资金年化收益率	7.69%

最后总结一下：

- 1、高频网格选择：长期振幅不大 + 短期活跃 + 成交量大 + 低位入场
- 2、适合标准网格、高频网格的基金举例

这些基金回撤都不大。

红利ETF(515180)

黄金ETF（518880）

前海开源金银珠宝混合C(002207)

其次，宽指基金，可以阶段性考虑。

死了那条心吧，让高频远离变态行业！

- 3、文中的工具截图来自公众号机计划，用的是基金分析模块。



定盈计划回测

翻倍定投回测

网格计划回测

智能网格回测

火箭计划回测

智能计划回测

恒定市值回测

二八轮动回测

我的牛基

特熊特牛

动态平衡回测

均线智投回测

预警回测

趋势定投回测

低相关性互补

均线分析

翻倍基金

W式基金

横盘分析

工具箱

收益对比

KPI分析

比赛排名

基金KPI分析：基金分析 ->基金KPI分析

智能网格回测：基金分析 ->智能网格回测

发布于 2022-11-01 19:59

- 高频交易
- 网格交易
- 红利基金

写下你的评论...

还没有评论，发表第一个评论吧

文章被以下专栏收录

基中宝

一个足以陪伴你一辈子的基金理财工具~

推荐阅读

利用开源pride\_pppar 进行高频单点定位计算教程

由于前一阵受一师兄拜托，需要解算5个测站站点时间序列，daily 解可以在NGL（内华达大地测量实验室）下载，同时NG了也提供了5min解，但不完整，有的站不包括在内。很巧，这几个站就不在。…

Gamit... 发表于童话镇里的...

线性调频（LFM）信号仿真分析

线性调频（LFM）信号是指瞬时频率随时间成线性变化的信号。（设振幅归一化，初始相位为零）。线性调频信号也称为鸟声（Chirp）信号，因为其频谱带宽落于可听范围，听着像鸟声，所以又称Chir…

mini

从小白开始搭出一个三相异步电机SVPWM调速仿真系统（七…

上一节模型就搭完了，上一节是反park变换和SVPWM调制。反park变换和SVPWM调制一般simulink看波形用Scope，记录一下Scope的设置，最后记录一下波形的观测，可以找出之前做好的标签观察波形…

和wt一起快乐学习

“类EMD”算法分解后要怎样使用（2）——高频、低频、…

Mr.看海 发表于与信号处理...

▲ 赞同 2

▼

● 添加评论

🔗 分享

❤ 喜欢

★ 收藏

📄 申请转载

...