

第一个策略 做空的动量策略

根据前面的趋势分析，我们可以很容易地得出结论，系列 1/2/3/10 都是向下的趋势。然后我们可以逐一比较价格的变化，然后得出结论，系列 10 有较大的跌幅。所以，对于这种情况，我们采取的是做空策略。我们把序列 10 作为采用这种动量策略的例子。并把 400-1000 天作为这个策略的样本。在没有添加指标的情况下，这个序列被测试为空头。

从图表中的利润可以告诉我们。在我们能减少最大跌幅之前，做空并不是一个合适的方式。首先，我们将相对强弱指数（RSI）引入我们的策略，利用 RSI 帮助我们识别价格行为的强度。当 RSI 高于 75 时被认为是超买，当它低于 25。如果需要，这些传统水平也可以调整，以更好地适应证券。例如，如果一个证券反复达到 75 的超买水平，你可能需要将该水平调整为 95。在一个强劲的趋势中，RSI 可能会在很长一段时期内保持超买或超卖很长一段时间。

总的来说，我们可以结合相应的简单移动平均线（SMA）来分析市场的状态。当价格高于其 20 期 SMA 时，是市场看涨的信号，等待价格回落触及 20-SMA。一旦触及 20-SMA 线，看 RSI 是否跌破 50 并开始回升，确认下跌趋势的减弱。相对而言，当低于其 20 期均线时，市场被认为是看跌的。现在是时候等待价格一旦触及 20-SMA 线，看看 RSI 是否达到 50 以上。一旦触及 20-SMA 线，看看 RSI 是否已经达到 50 以上并开始向下移动，以确认确认上升趋势的减弱和熊市的进入。因此，我们使用 RSI 指标和其对应的 SMA 来定位熊市。

我们的策略中得到了移动平均收敛分歧（MACD）指标，这个指标也是一个趋势指标，它有两条线和一个柱状图。在 MACD 中，我们使用 EMA 进行趋势预测。MACD 线是长期 EMA（26 期收盘价）和短期 EMA（12 期收盘价）之差，而信号线是 MACD 的 9 天 EMA。柱状图是 MACD 线和信号线之间的差值。当柱状图为正数时，市场就会看涨，反之亦然。

无论是 RSI 还是 MACD 都不能确保市场 100%看跌，所以我们避免在上涨日做空。我们在策略中加入了 25 天收盘 EMA 线和 10 天收盘 EMA 线，以进一步降低风险。当短期 EMA 线穿过长期 EMA 线下方时，这意味着最近的价格趋势是向下的，我们可以在这种日子里做空。

在这一步之前，我们将只考虑这个系列的空方，因为趋势非常明显，而且下降趋势占主导地位。但是仍然有一些上涨的日子，我们可以采取相反的立场，因为没有人可以确定这个系列在第二个数据期间不会上涨。之后我们结合 RSI 和 MACD 来追踪牛市，并保持空头条件不变。

第二个策略

1. 追踪价格, 如果股票再上涨区间 (透过 MACD 决定, 如果 MACD 为正就代表在上涨区间) 那上方位就设置高于 10 日均线 2 个标准差, 下方位就设置高于 10 日平均线 1.3 个标准差, 如果高于上方位就做空, 低于下方位就做多, 直到回到 10 日均线才平仓。
2. 追踪价格, 如果股票在下行区间 (一样透过 MACD 决定, 如果 MACD 为负就代表在下行区间) 那上方位就设置高于 10 日平均线的 1.3 个标准差, 下方位就设置高于平均线 2 个标准差, 如果高于上方 (10 日均线 + 1.3 个 10 日标准差) 位就做空, 低于下方位 (10 日均线 - 2 个 10 日标准差) 就做多, 直到回到 10 日均线才平仓。