## 股票打板策略实战手册

Tushare、QMT获取数据，BackTrader线下回测。

1. 打板策略

预期建立1000～2000支的股票池，每日抓买10～30支股票，其中1/3～1/2达到涨停，期望当日收益达到0.1%，当日回撤不超过1%。次日预计继续持有1/3股票，卖出2/3股票并继续抓买股票。期望1～2支连板，带来1%收益，其余股票小涨，带来1%收益，次日回撤不超过1%。假如触发风控，即暂停打板。

买策略

一．早盘根据股价涨势，预判可能涨停的股票提前买进

二．追买封板或连板的股票，希望在开板时买进

三．根据集合竞价的虚拟成交价，追买可能开盘涨停的股票

四．根据公司公告、行业新闻和宏观经济数据，预判利好的股票提前买进

五．盘中根据股价涨势，预判可能涨停的股票提前买进

六．跟随进入涨势的板块或题材，提前买进相关板块或题材的股票

持有/卖策略

1. 判断有机会连板，继续持有
2. 判断连板结束，可以卖出
3. 判断转入跌势，立刻止损
4. 符合股票T0交易条件的，可以转入T0股票池

风控策略

1. 买入后未能涨停，反而触达止损线，立刻卖出单支股票
2. 当天整体回撤超过3%，立刻中止打板策略，视情况继续持有、转T0交易、当日清仓、整体清仓
3. 数据获取

基于Tushare数据源

代码：getstock.py，获取日线数据（前复权）

代码：getdaily.py，获取日线数据（普通）

代码：banlist.py，只做沪深主板股票，排除黑名单，建立股票池（总计1878支）

黑名单规则：

1. ST股票
2. 接近退市股票（价格低于5元）
3. 流通市值小于20亿元
4. 市盈率（PE、PE\_TTM）为null，即亏损

代码：showstock.py，计算涨停股票

代码：filter\_stock.py，对股票池，计算涨停股票

代码：filter\_analysis.py，对股票池，作连板统计

代码：daily\_profit.py，统计日线盈亏

1. 分钟线行情

基于QMT数据源

代码：getminute.py，下载分钟线数据，5108个文件

代码：showminute.py，统计所有涨停股票的形态

* bStraight：一字涨停，从开盘就是涨停价
* bOneHit：从未开板，触达涨停价后一直保持
* nStage：首次触达涨停时段，0～7，每半小时算一个时段

bOneHit：封板后一直未开板