

【广发金工】"投资计算器系列"之四"量化择时工具"

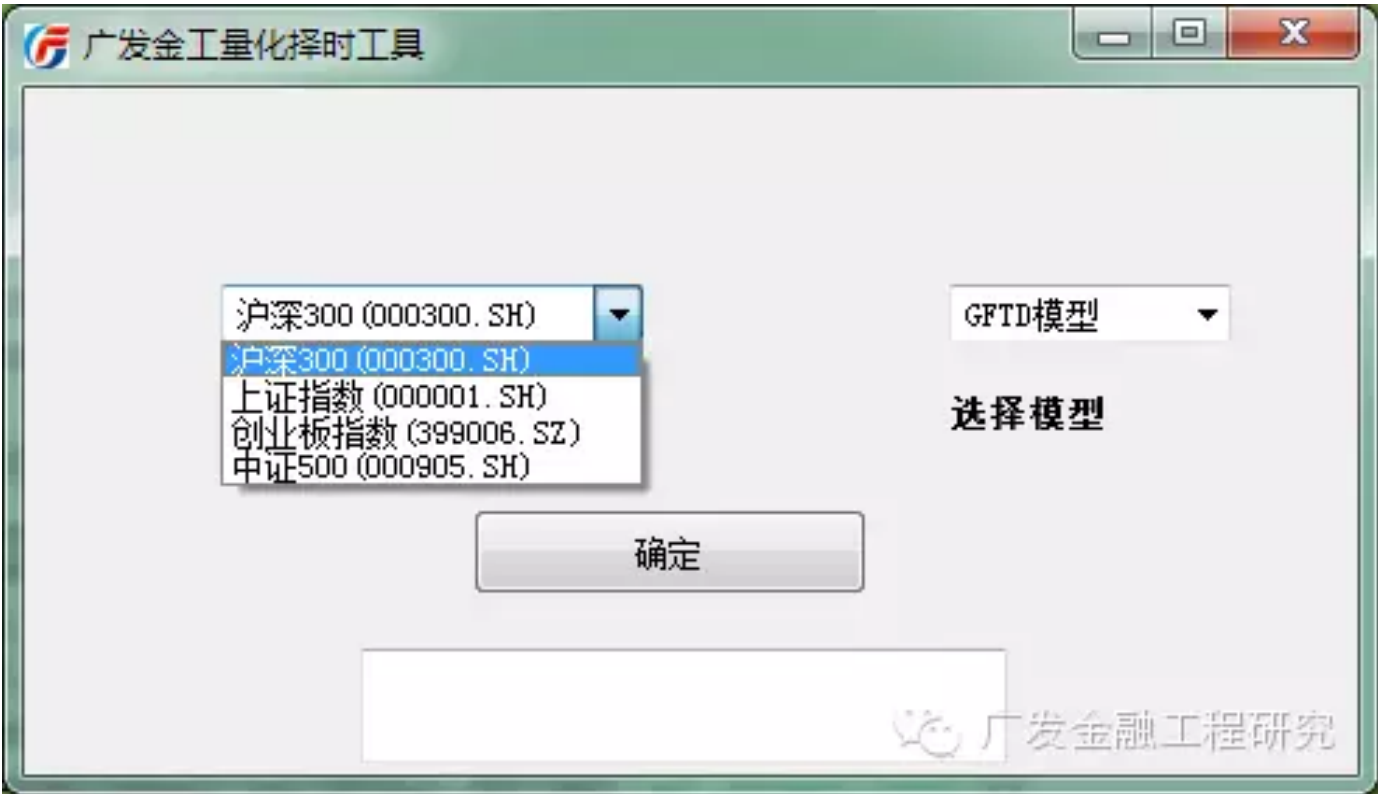
2016-05-03 陈原文 广发金融工程研究



广发金工团队一直致力于量化择时等领域的研究，相继推出了GFTD、LLT、希尔伯特变换、加权FFT等一系列择时模型，这些择时模型在我们的择时网站上(<http://218.19.190.27/>)都有实时的跟踪。为了能够让机构投资者更好地运用广发金工团队的量化择时研究成果，广发金工团队将这些量化择时模型开发成了软件——量化择时工具(Python版本以及Excel版本)，供机构投资者本地实时、方便地查看择时结果，同时广发金工团队后续还会继续将一系列的研究成果本地化，方便机构投资者更好地使用。

目前量化择时工具支持GFTD模型、LLT模型在上证指数、沪深300、创业板指、中证500指数上的量化择时判断。

Python版本：



广发金工量化择时工具

沪深300 (000300. SH)

GFTD模型

选择指数

选择模型

确定

000300. SH指数当前TD模型方向为：看多

Excel版本：

量化择时系统

选择指数

上证指数 (000001. SH)

选择模型：

LLT模型

当前模型观点：

000001. SH当前LLT模型方向为：看平

使用说明：选择后指数以及模型后，点击确定按钮，输出最新的模型择时观点

量化择时系统

选择指数

上证指数 (000001. SH)

选择模型：

LLT模型

确定

当前模型观点：

000001. SH当前LLT模型方向为：看平

使用说明：选择后指数以及模型后，点击确定按钮，输出最新的模型择时观点

量化择时系统	
选择指数	上证指数 (000001.SH)
选择模型:	LLT模型
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px 20px; display: inline-block; background-color: #f0f0f0;">确定</div>	
<div style="border: 1px solid black; padding: 2px;"> 当前模型观点: 000001.SH当前LLT模型方向为: 看平 </div>	
使用说明: 选择后指数以及模型后, 点击确定按钮, 输出最新的模型择时观点	

广发金融工程研究

量化择时工具下载链接:

python版本及Excel版本下载链接: <http://pan.baidu.com/s/1miITBsc> (欢迎邮件或微信索取下载密码)

择时系列报告下载网盘:

链接: <http://pan.baidu.com/s/1c2qJEtM>

多因子平台下载链接:

链接: <http://pan.baidu.com/s/1i3oYe1J> (欢迎邮件或微信索取下载密码)

多因子系列报告下载网盘:

链接: <http://pan.baidu.com/s/1Di1VS> 密码: evwf

大数据工具下载链接:

链接: <http://pan.baidu.com/s/1gdqC1lr> 密码: colf

大数据系列报告下载链接:

链接: <http://pan.baidu.com/s/1kVERV3h>

筹码分布工具下载链接:

链接: <http://pan.baidu.com/s/1o7KAT6a> 密码: c5fp

国债期货监测工具下载链接:

链接: <http://pan.baidu.com/s/1nuZ6vZb>

缺口分布生成器下载链接:

链接: <http://pan.baidu.com/s/1boH9QgB>

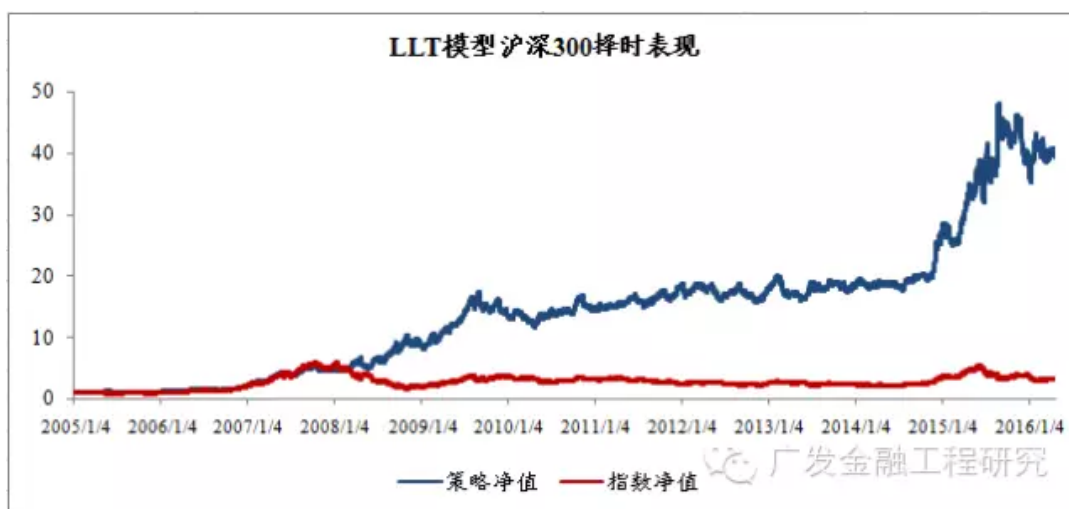
附择时模型原理及历史择时表现

历史择时表现

GFTD模型沪深300择时表现



LLT模型沪深300择时表现



择时模型原理

GFTD模型原理

买入信号的发出需要2个条件:

- (1) 买入启动完成
- (2) 买入计数达到4

买入启动:

市场上连续出现4根K线, 每根K线 (记为T) 的收盘价比T-4的K线收盘价低

买入计数:

- a. 收盘价大于或等于之前第2根K线最高价
- b. 最高价大于之前第1根K线的最高价
- c. 收盘价大于之前第1个计数的收盘价

卖出信号的发出需要2个条件:

- (1) 卖出启动完成
- (2) 卖出计数达到4

卖出启动:

市场上连续出现4根K线，每根K线（记为T）的收盘价比T-4的K线收盘价高
卖出计数：

- 收盘价小于或等于之前第2根K线最低价
- 最低价小于之前第1根K线的最低价
- 收盘价小于之前第1个计数的收盘价

LLT模型原理

$$LLT(T) = (\alpha - \alpha^2 / 4) * price(T) + (\alpha^2 / 2) * price(T - 1) \\ - (\alpha - 3\alpha^2 / 4) * price(T - 2) + 2(1 - \alpha) * LLT(T - 1) - (1 - \alpha)^2 * LLT(T - 2)$$

唯一参数 α 表征的是当前价格与历史价格之间的权重