基础篇

1. 从大智慧上熟悉了解指数类ETF和LOF下载历史数据及市值
2. 先挑选沪深300作为回测标的；
3. 策略：用20日均线；

买入信号：当日收阳、收盘价高于20日均线、今日收盘价高于昨日收盘价，今日20日均线也高于昨日20日均线，用最高价买入；

卖出信号：当日收阴、收盘价低于20日均线、今日收盘价低于昨日收盘价，今日20日均线也低于昨日20日均线，用最低价卖出；

1. 回测结论内容：总收益、年化收益率、每年收益率、收益标准差、最大回撤、最长回撤期，盈亏比，胜率，夏普比率；
2. 将策略用于各类指数类标的，产生如上回测结论。
3. 操作步骤：导入数据-设置移动平均线-确定买卖点位和持仓点位

进阶篇

1. 策略优化：研究标的波动率和均线参数选择上的关系，会不会存在波动越大的标的选择越长的均线参数，反之选择波动越小的均线参数，产生更好的效果？

买入信号：同基础篇

卖出信号：同基础篇

1. 加入布林带：布林带的参数选择是否也根据波动率变大而大，反之则小，产生更好的效果？
2. 将进阶的策略优化用于各类指数类标的，看效果是否比基础篇更好

终极篇

1. 实现策略在各个标的间的轮动调仓；
2. 对于头寸的分配是否按昨日市值占比调整每个潜在投资标的的头寸