

## 龙虎榜股票池+alpha 择时策略

一个股票能否赚钱，在于背后是否有资金量的支持。上龙虎榜的频率越高，背后关注的机构和团队也就越高，资金交易也就活跃，套利的空间也就越大。

举一个例子，武汉凡谷最近一年 59 次涨停，金力永磁一年 102 次上龙虎榜，以 A 股一年 250 天交易天数来算，这些股票平均两三天，四五天的时间就出现一次涨停或上龙虎榜。拿一个简单的策略来说，在价格低迷的时候，买入这些股票，等这些股票再次涨停卖出，就可以获得至少 10% 以上的收益。

一个股票登龙虎榜的频率越高，也说明庄家的高抛低吸的周期也越短。时间成本也是影响投资的一个重要成本。两种股票收益率一样，这时候就要看哪只股票投资时间短来决定最优股票。很显然，登龙虎榜的频率越高的股票更具有时间成本优势。

### 策略一. 统计涨停板股票+量价背离因子

1. 首先剔除 ST 股票，每天利用收盘价把最近一年的股票涨停信息统计下来，把涨停数量较多的设置为每天的股票池，这是一个动态变化的股票池。

涨停公式:  $x = 1 \text{ if } \frac{\text{closePrice}(t)}{\text{closePrice}(t-1)} > 1.098 \text{ else } 0$

2. 量价背离定义

买点公式:

$\text{np.corrcoef}(\text{closePrice}, \text{volume}, \text{ddof} = 1)[0][1] < k1 \text{ and } (a = 1 \text{ if } \text{closePrice} < \text{startPrice} \text{ else } 0)$

卖点公式:

$\text{np.corrcoef}(\text{closePrice}, \text{volume}, \text{ddof} = 1)[0][1] < k2 \text{ and } (a = 1 \text{ if } \text{closePrice} > \text{startPrice} \text{ else } 0)$

k1 和 k2 是一个设置相关性数大小的临界点

### 策略二. 统计涨停板股票+成交量异常因子

1. 首先剔除 ST 股票，每天利用收盘价把最近一年的股票涨停信息统计下来，把涨停数量较多的设置为每天的股票池，这是一个动态变化的股票池。

涨停公式:  $x = 1 \text{ if } \frac{\text{closePrice}(t)}{\text{closePrice}(t-1)} > 1.098 \text{ else } 0$

2. 成交量异常变化因子定义:

买点公式:

$\frac{\text{volume}[t]}{\text{mean}(\text{volume}[0:t-1])} > k1 \text{ and } (a = 1 \text{ if } \text{closePrice} < \text{startPrice} \text{ else } 0)$

卖点公式:

$\frac{\text{volume}[t]}{\text{mean}(\text{volume}[0:t-1])} < k2 \text{ and } (a = 1 \text{ if } \text{closePrice} > \text{startPrice} \text{ else } 0)$

k1 和 k2 是一个设置异常值大小的临界点

### 策略三. 统计涨停板股票+量幅背离因子

1. 首先剔除 ST 股票，每天利用收盘价把最近一年的股票涨停信息统计下来，把涨停数量较多的设置为每天的股票池，这是一个动态变化的股票池。

涨停公式:  $x = 1 \text{ if } \frac{\text{closePrice}(t)}{\text{closePrice}(t-1)} > 1.098 \text{ else } 0$

2. 成交量异常变化因子定义:

幅度公式:  $\text{Range}(t) = (\text{closePrice}(t) - \text{closePrice}(t-1)) / \text{closePrice}(t-1)$

买点公式:

$\text{np.corrcoef}(\text{range}, \text{volume}, \text{ddof} = 1)[0][1] < k1 \text{ and } (a = 1 \text{ if } \text{closePrice} < \text{startPrice} \text{ else } 0)$

卖点公式:

$\text{np.corrcoef}(\text{range}, \text{volume}, \text{ddof} = 1)[0][1] < k2 \text{ and } (a = 1 \text{ if } \text{closePrice} > \text{startPrice} \text{ else } 0)$

k1 和 k2 是一个设置相关性数大小的临界点

### 策略四. 跌停板股票+量价背离因子

1. 首先剔除 ST 股票，一个股票前一天出现跌停，跌停价也就是说前一天的最低价，那么第二天的最高价大于前一天的最低价概率极大。
2. 买点前一天临近收盘的时候，卖点根据卖点公式选择第二天价格回升时卖出:

卖点公式:  $\text{np.corrcoef}(\text{closePrice}, \text{volume}, \text{ddof} = 1)[0][1] < k \text{ and } (a = 1 \text{ if } \text{closePrice} > \text{startPrice} \text{ else } 0)$