

# 技术分析策略回测 9.0

吴宇☐

2020-02-12

## 目录

<b>1</b>	<b>回测</b>	<b>2</b>
<b>2</b>	<b>市场报告</b>	<b>2</b>
2.1	月 K 表现 . . . . .	2
2.2	周 K 表现 . . . . .	3
2.3	日 K 表现 . . . . .	4
<b>3</b>	<b>SP500 报告</b>	<b>5</b>
3.1	月 K 表现 . . . . .	5
3.2	周 K 表现 . . . . .	5
3.3	日 K 表现 . . . . .	6
<b>4</b>	<b>ETF 报告</b>	<b>6</b>
4.1	ETF 月 K 表现 . . . . .	6
4.2	ETF 周 K 表现 . . . . .	7
4.3	ETF 日 K 表现 . . . . .	7
<b>5</b>	<b>单一股报告</b>	<b>8</b>
5.1	月 K 报告 . . . . .	8
5.2	周 K 报告 . . . . .	9
5.3	日 K 报告 . . . . .	10

## 1 回测

1. 该策略为纯技术分析，已包括了手续费、印花税和滑点。
2. 使用了从 2010-01-01 到 2019-12-31 的十年市场的历史数据进行策略回测。
3. 使用了中国、香港、美国的股票和 ETF 进行回测。
4. 该策略仅为理论情形，不代表实盘情况，只具备研究意义。

## 2 市场报告

### 2.1 月 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
9.62	4.97	QQQ
2.34	1.47	TLt
14.15	0.72	GDX
7.28	4.18	^IXIC
4.96	3.01	^GSPC
4.33	2.83	^DJI
8.52	2.77	^RUT
28.47	10.70	AAPL
9.39	2.19	MMM
8.37	3.42	ABT
7.87	2.40	ABBV
480.39	21.54	ABMD
13.55	5.14	ACN
44.35	9.34	600519.SS
55.52	3.45	000002.SZ
10.70	1.36	159901.SZ
12.72	0.76	600019.SS
3.44	0.45	601857.SS
3.64	0.89	0941.HK

margin_compound	market_compound	stock
19.69	2.27	2328.HK
797.58	6.38	0241.HK
18.78	1.21	0215.HK
71.17	4.16	sum
10.16	2.80	median

## 2.2 周 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
15.86	4.60	QQQ
3.43	1.53	TLt
258.84	0.60	GDX
12.98	3.89	^IXIC
7.96	2.82	^GSPC
7.09	2.68	^DJI
17.30	2.59	^RUT
170.80	9.69	AAPL
17.46	2.10	MMM
18.15	3.30	ABT
17.21	2.57	ABBV
26168.44	19.92	ABMD
32.95	4.93	ACN
300.07	9.62	600519.SS
429.12	3.13	000002.SZ
46.22	1.27	159901.SZ
32.54	0.64	600019.SS
8.70	0.43	601857.SS
9.25	0.89	0941.HK
128.78	2.08	2328.HK
36621.21	7.50	0241.HK
53.74	1.15	0215.HK

margin_compound	market_compound	stock
2926.28	4.00	sum
25.34	2.63	median

### 2.3 日 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
0.66	4.57	QQQ
0.04	1.52	TLt
136.56	0.62	GDx
0.52	3.88	^IXIC
0.48	2.84	^GSPC
0.67	2.69	^DJI
5.52	2.60	^RUT
30.00	9.54	AAPL
0.36	2.12	MMM
1.79	3.32	ABT
20.53	2.52	ABBV
40920.65	19.14	ABMD
2.52	5.01	ACN
411.80	9.29	600519.SS
1224.05	2.98	000002.SZ
63.06	1.24	159901.SZ
60.50	0.61	600019.SS
2.51	0.43	601857.SS
0.40	0.91	0941.HK
72.47	2.32	2328.HK
4825972.25	10.62	0241.HK
25.48	1.17	0215.HK
221316.04	4.09	sum
13.03	2.64	median

### 3 SP500 报告

#### 3.1 月 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
10.00	2.51	MO
115.55	14.73	AMZN
6.80	3.01	AEE
214.67	5.40	AAL
6.69	2.73	AEP
10.63	3.31	AXP
16.49	2.12	AIG
11.49	5.41	AMT
9.30	5.64	AWK
22.83	4.36	AMP
9.16	3.12	ABC
39.42	4.76	sum
10.63	3.31	median

#### 3.2 周 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
19.02	2.49	MO
168.61	14.21	AMZN
11.96	2.81	AEE
20565.82	5.40	AAL
10.43	2.67	AEP
32.76	2.96	AXP
117.33	1.78	AIG
37.21	5.17	AMT
24.24	5.34	AWK
109.97	3.98	AMP
43.19	3.25	ABC

margin_compound	market_compound	stock
1921.87	4.55	sum
37.21	3.25	median

### 3.3 日 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
1.35	2.52	MO
99.43	13.79	AMZN
2.45	2.76	AEE
159151.65	5.93	AAL
1.18	2.69	AEP
3.94	3.04	AXP
44.44	1.71	AIG
4.82	5.27	AMT
3.88	5.43	AWK
32.67	4.16	AMP
11.20	3.14	ABC
14487.00	4.59	sum
4.82	3.14	median

## 4 ETF 报告

### 4.1 ETF 月 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
NaN	1.27	510900.SS
NaN	1.55	159920.SZ
3.91	3.20	513100.SS
2.19	2.18	513500.SS
1.15	1.08	159954.SZ

margin_compound	market_compound	stock
1.80	1.17	513030.SS
NaN	1.74	sum
NA	1.41	median

## 4.2 ETF 周 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
6.55	1.27	510900.SS
4.81	1.55	159920.SZ
4.29	3.20	513100.SS
2.61	2.11	513500.SS
1.55	1.03	159954.SZ
1.92	1.10	513030.SS
3.62	1.71	sum
3.45	1.41	median

## 4.3 ETF 日 K 表现

margin_compound	market_compound	stock
0.89	1.18	510900.SS
0.48	1.50	159920.SZ
0.33	3.22	513100.SS
0.35	2.16	513500.SS
0.93	1.04	159954.SZ
0.33	1.11	513030.SS
0.55	1.70	sum
0.42	1.34	median

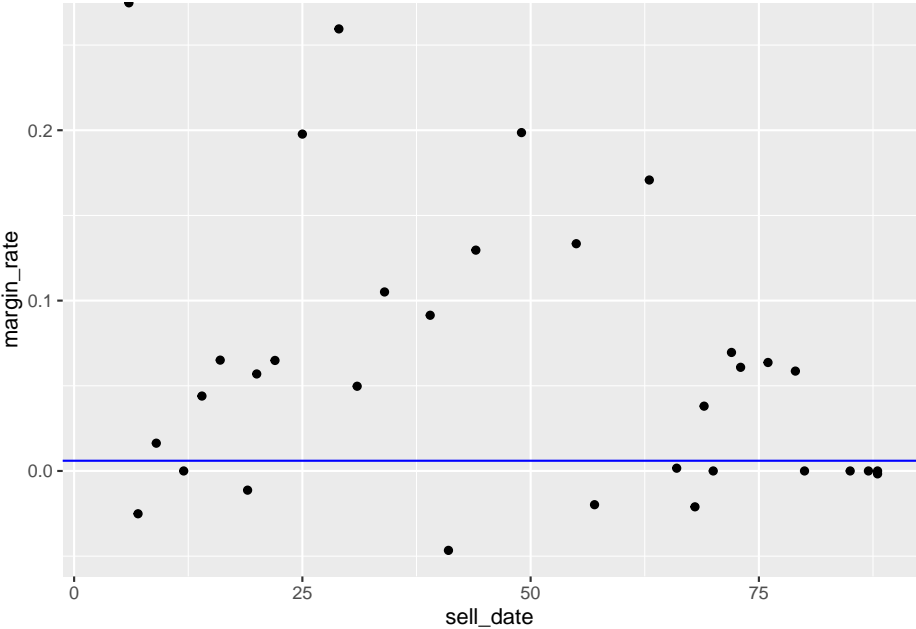
5 单一股报告

5.1 月 K 报告

Summary of margin

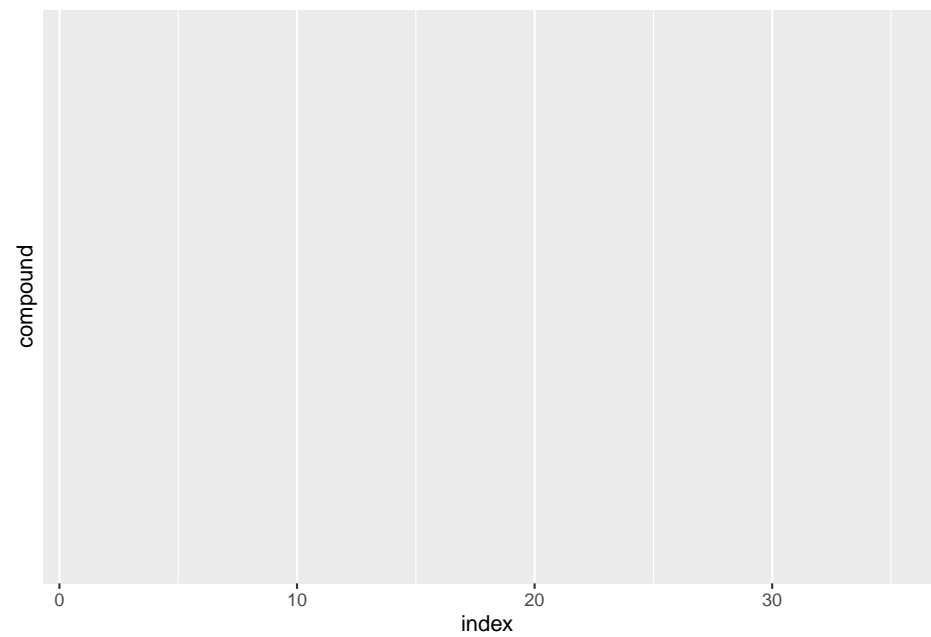
margin_compound	market_compound
NaN	1.27

Plot of margin



Compound



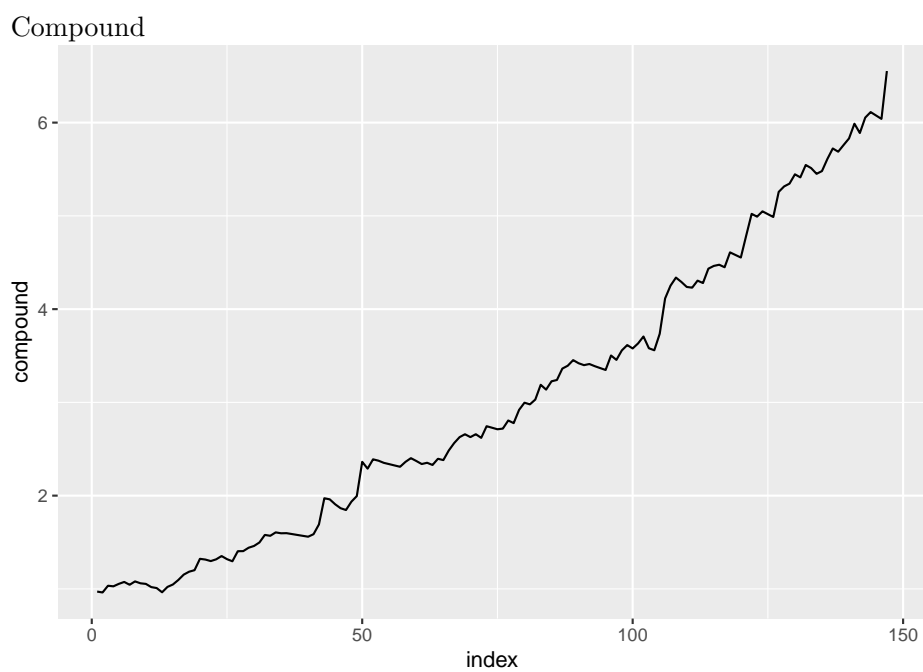
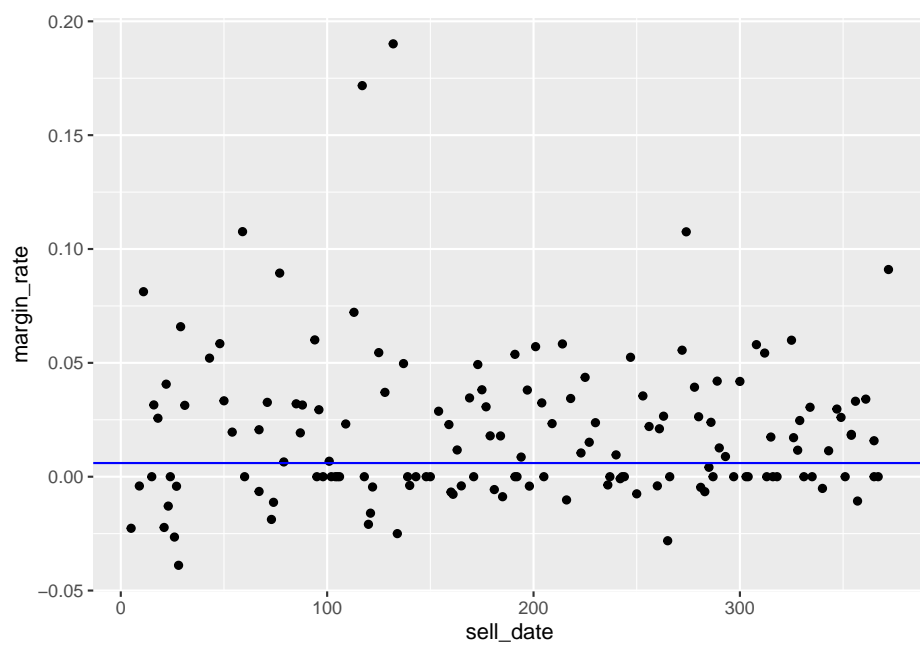


5.2 周 K 报告

Summary of margin

margin_compound	market_compound
6.55	1.27

Plot of margin

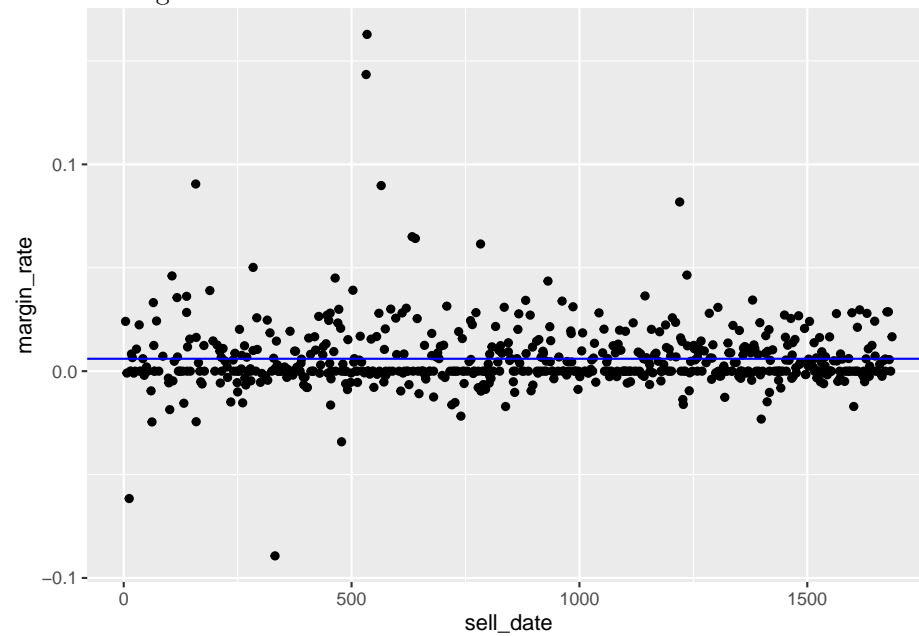


### 5.3 日 K 报告

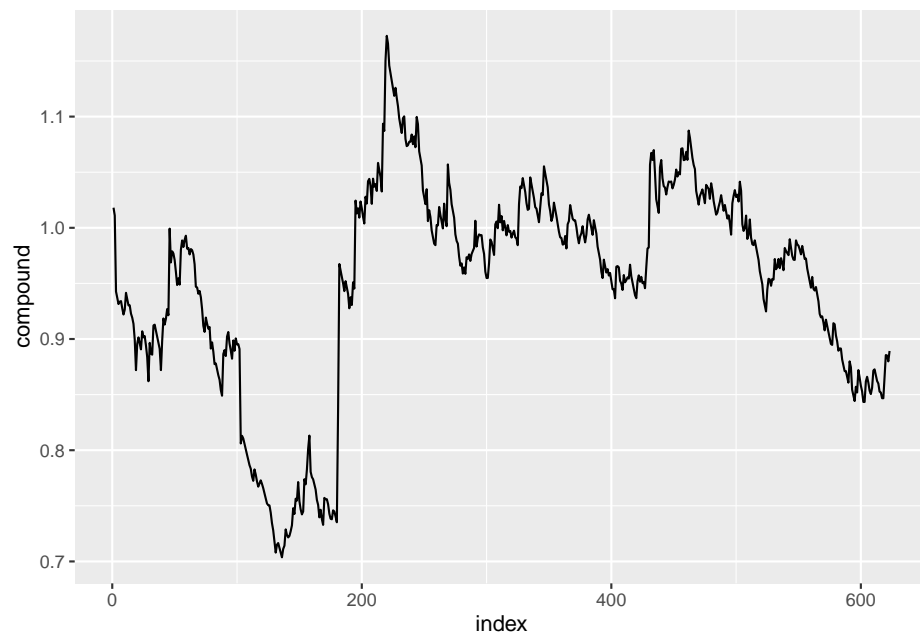
Summary of margin

margin_compound	market_compound
0.89	1.18

Plot of margin



Compound



Buy and Sell points

