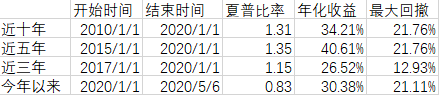
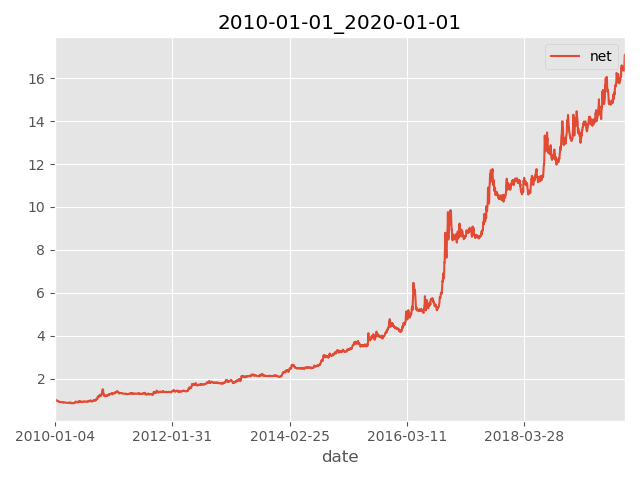
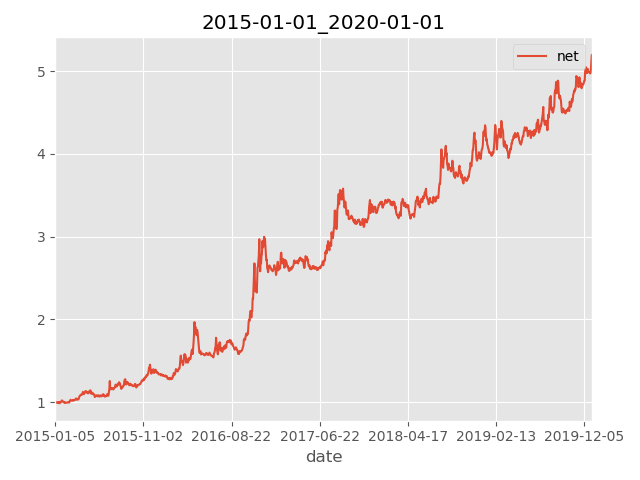
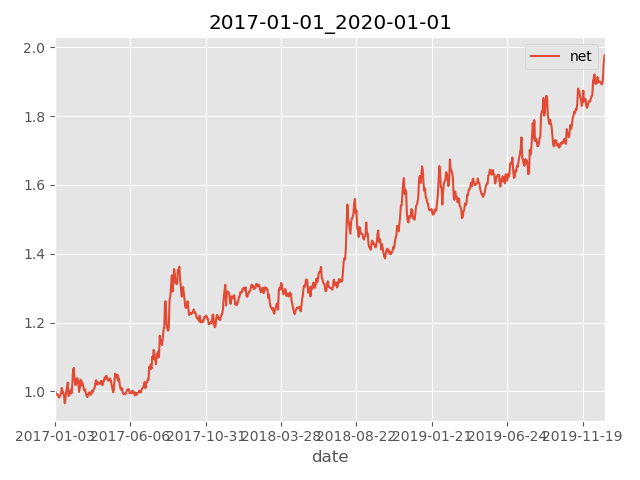
策略简介及结果汇总

## CTA三个策略等权组合

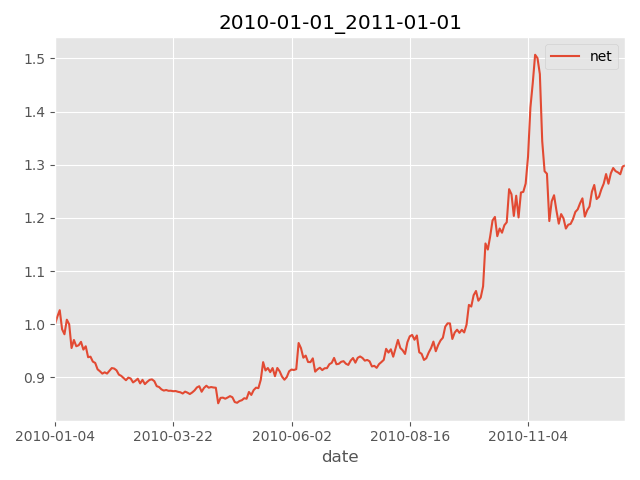
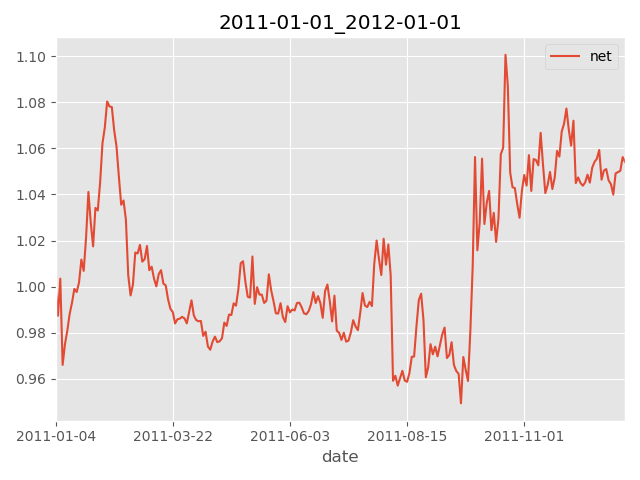
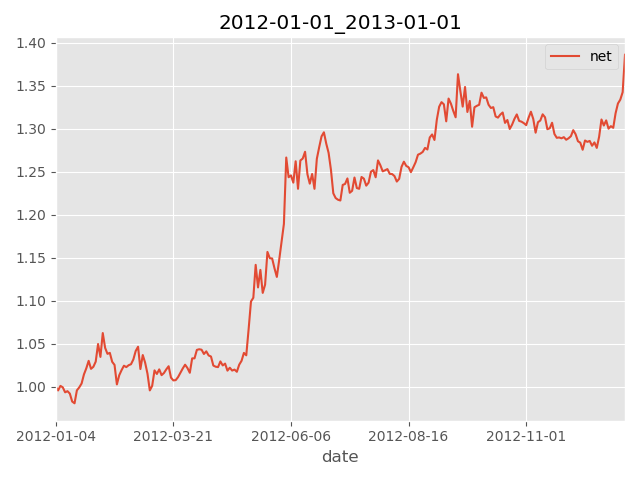
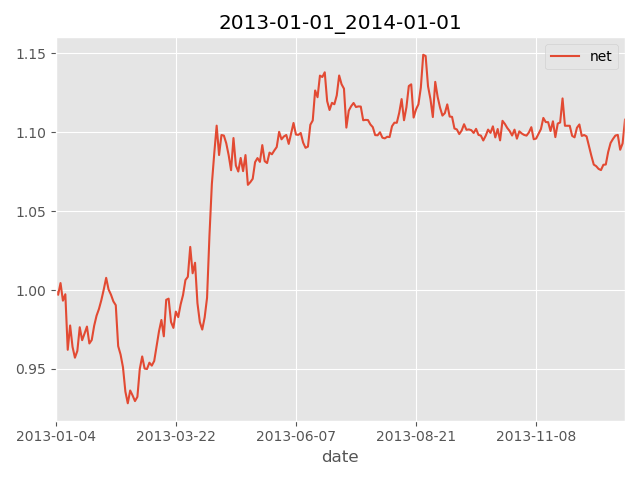
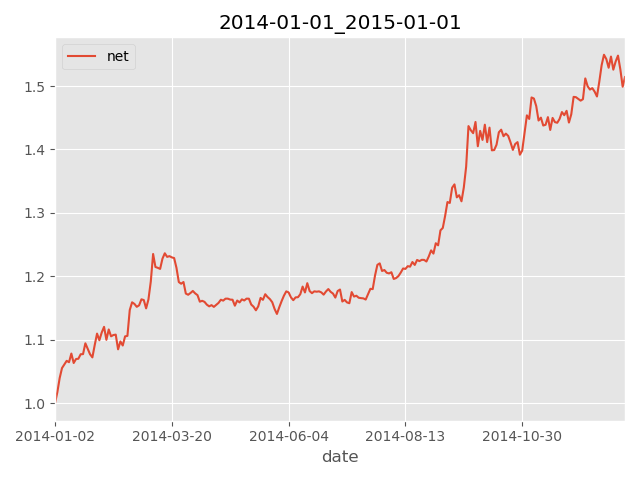
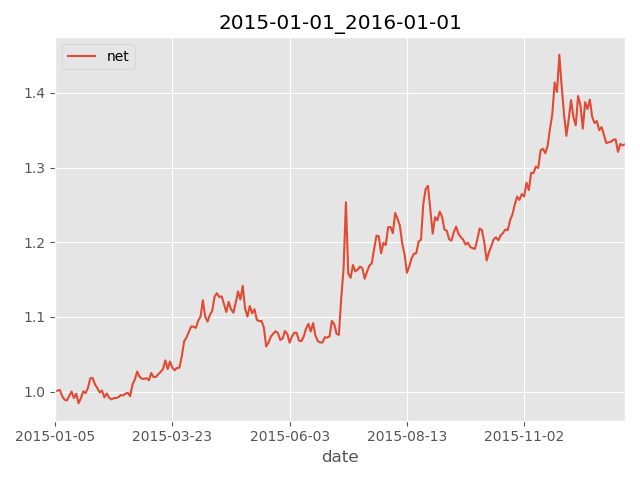
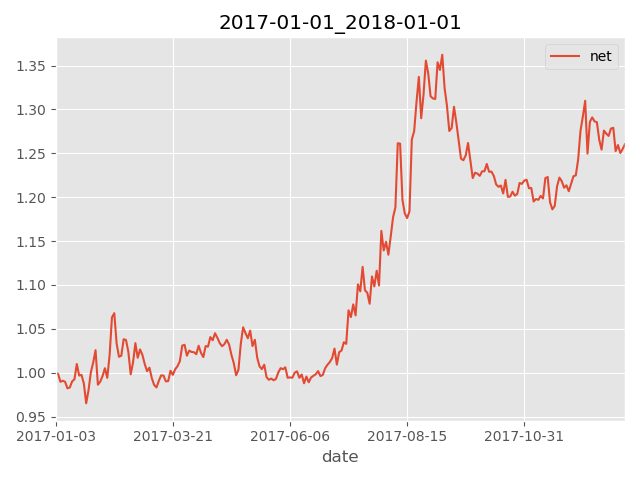
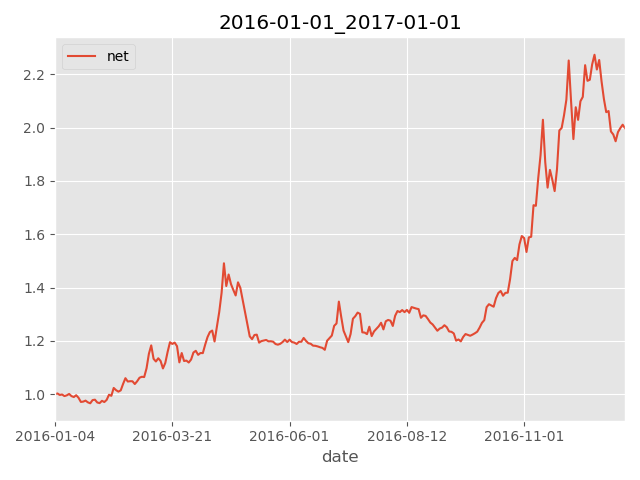
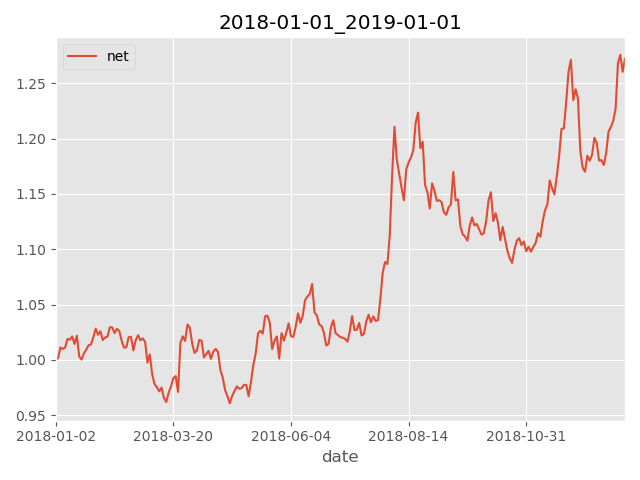
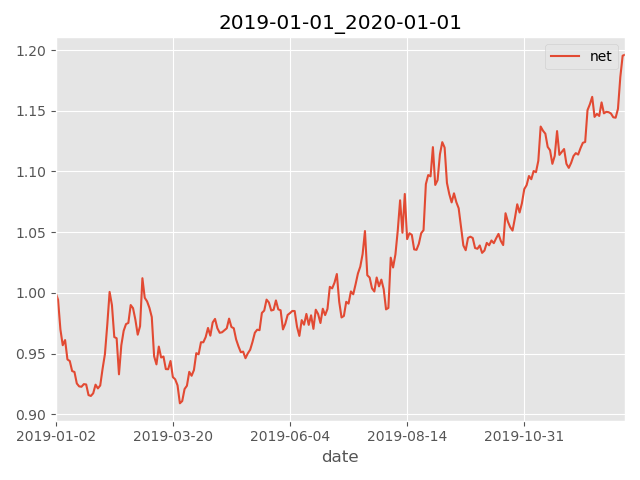
策略包括：CTA-momentum、CTA-YMJH、CTA-OCM



### 资金曲线

### 不同年份资金曲线

## MOMENTUM动能策略

**CTA-MOMENTUM策略介绍**

策略逻辑：基于日收益率长短期指数加权移动平均线进行动量趋势跟踪

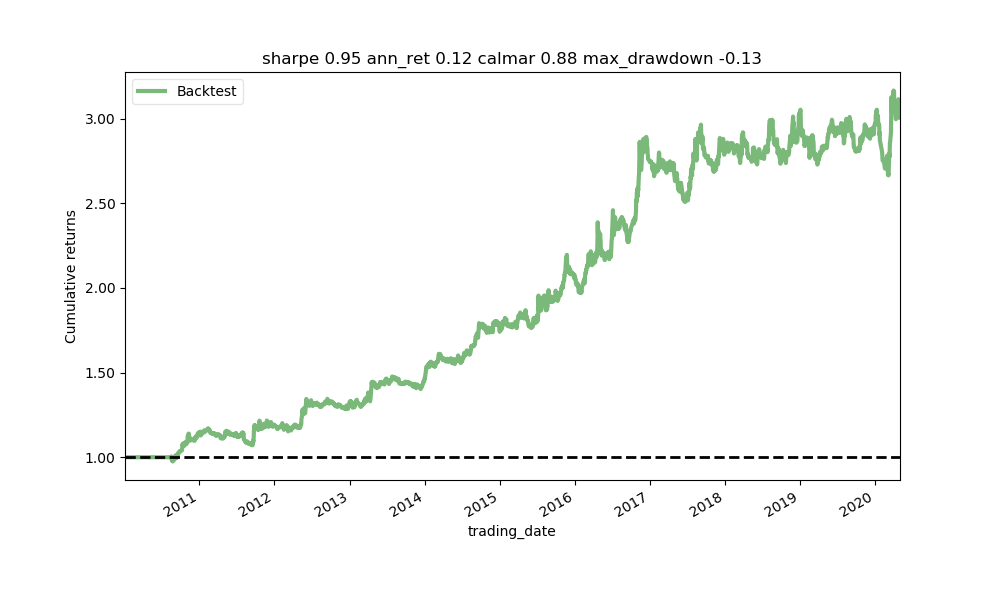
1. 计算动量趋势X：日收益率的短期指数加权移动平均线-长期指数加权移动平均线；
2. 对X进行一系列标准化处理得每日交易仓位S

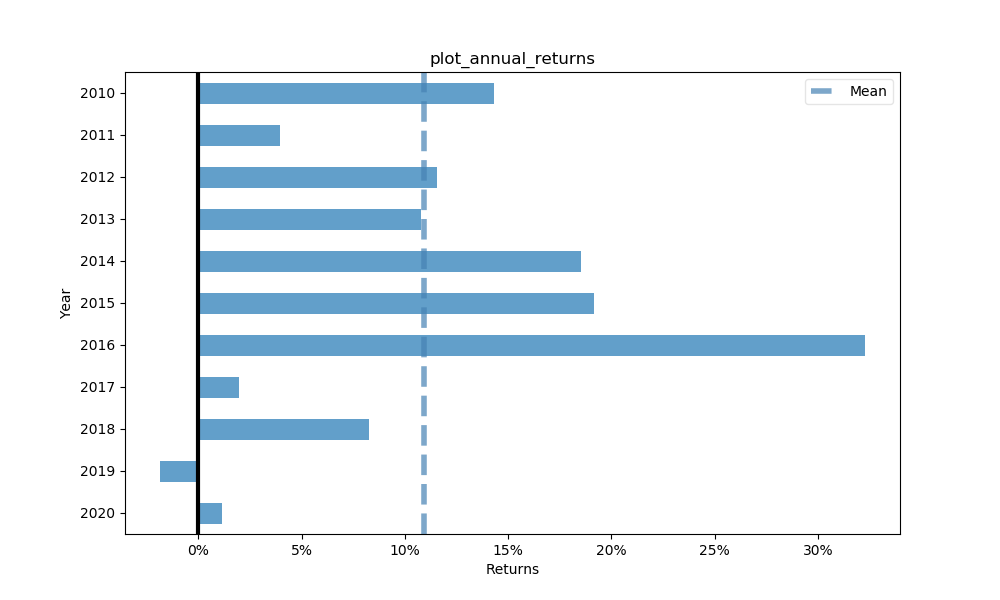
频率：日间

**模型结果汇总**

包含所有可交易品种的组合曲线

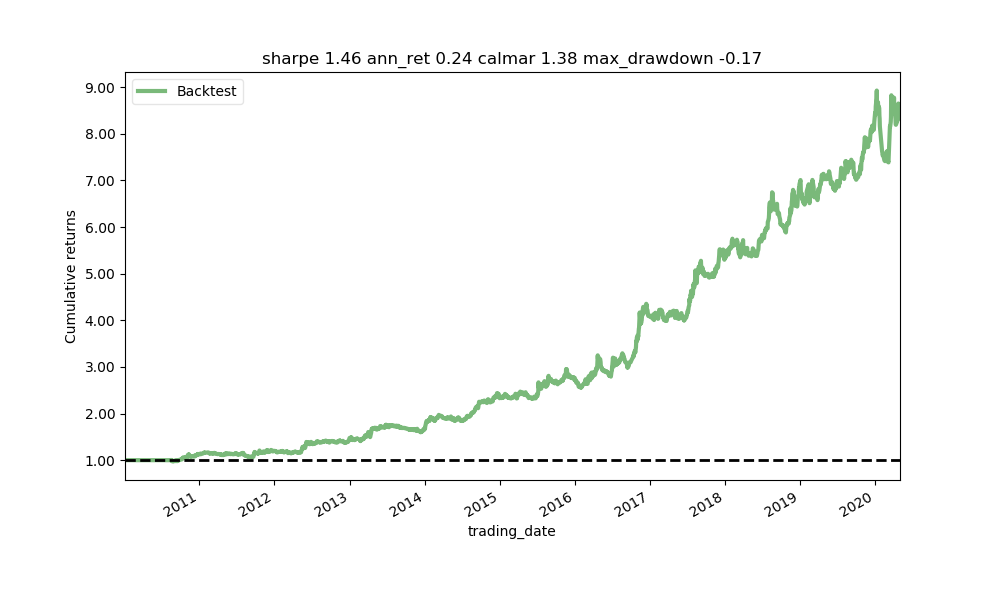
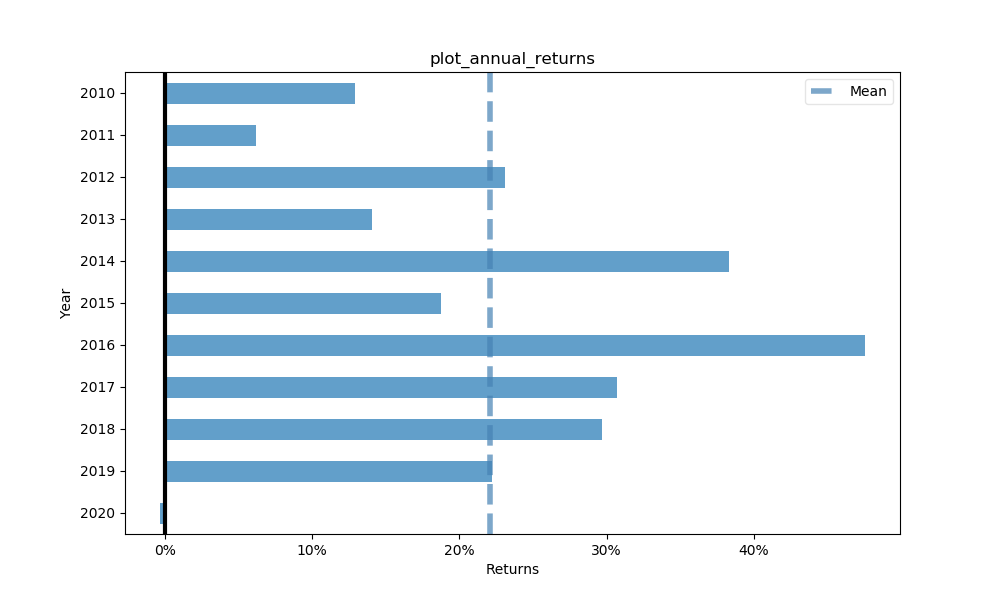
交易品种(45)：

C\_CS\_A\_M\_Y\_P\_OI\_B\_RM\_L\_V\_PP\_TA\_RU\_BU\_MA\_SC\_FU\_AL\_ZN\_CU\_PB\_NI\_SN\_J\_JM\_I\_RB\_HC\_ZC\_FG\_SF\_SM\_IF\_IH\_IC\_T\_TF\_AG\_AU\_JD\_AP\_CJ\_CF\_SR 



取夏普>0.2的可交易品种（23种）的组合曲线

交易品种：J\_HC\_RB\_I\_NI\_TF\_SM\_AL\_RU\_MA\_SR\_P\_TA\_T\_SC\_IF\_Y\_FU\_IH\_AG\_PB

## 一目均衡

**CTA-YMJH策略介绍**

核心逻辑：经过长期观察一目均衡系统中的各个指标与K线走势的关系，基于一目均衡系统中的转换线和基线的金死叉进行自动化交易。

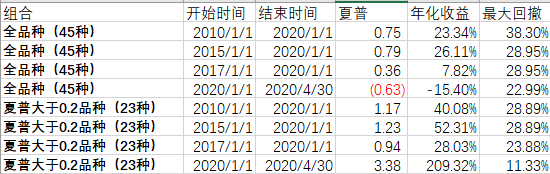
转换线金叉基线，做多；

转换线死叉基线，做空。

频率：日间

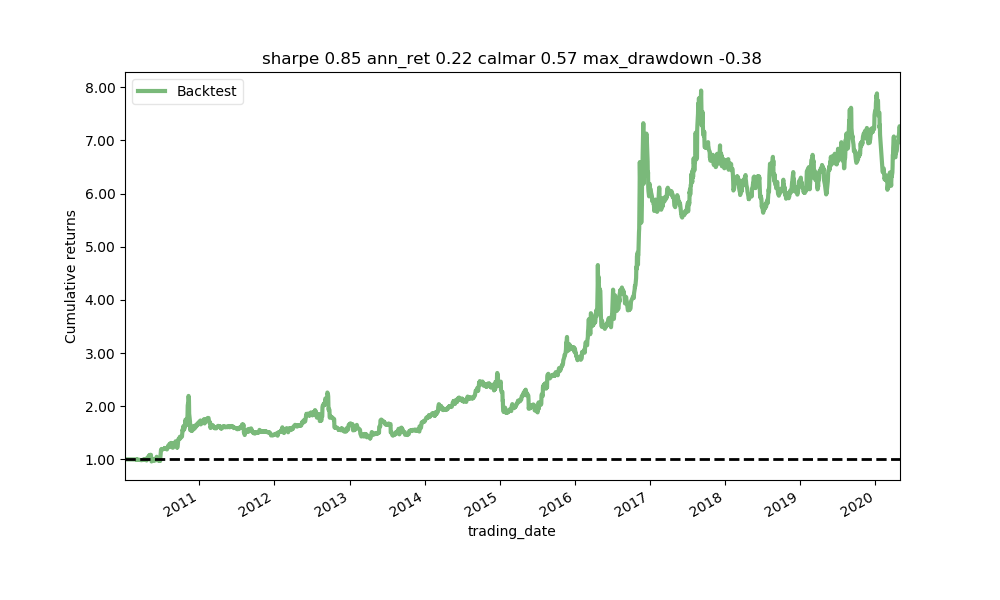
优点：简单有效（仅包含两个参数）、适用范围广

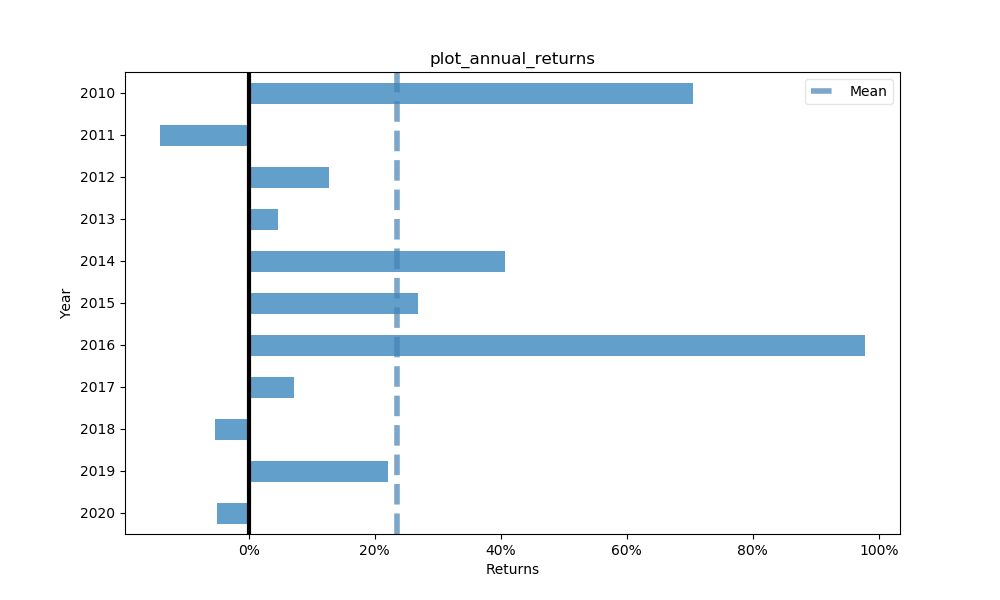
**模型结果汇总**



包含所有可交易品种的组合曲线

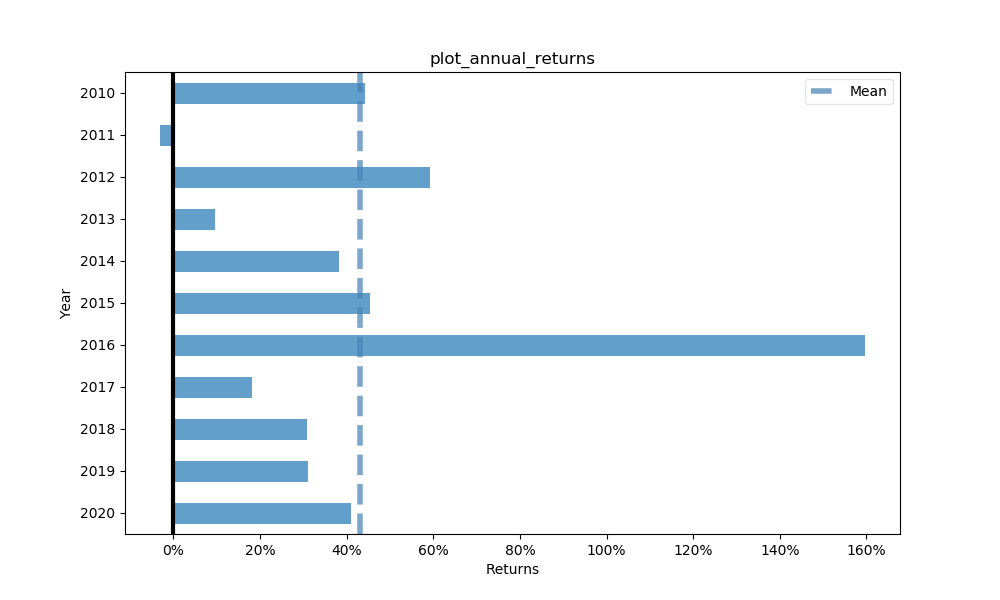
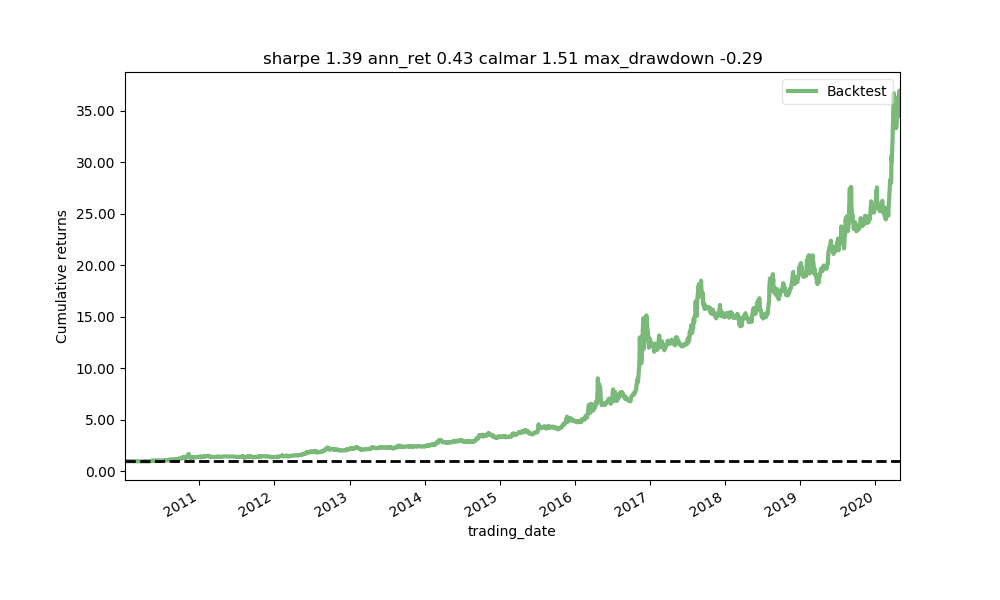
交易品种(45)：

C\_CS\_A\_M\_Y\_P\_OI\_B\_RM\_L\_V\_PP\_TA\_RU\_BU\_MA\_SC\_FU\_AL\_ZN\_CU\_PB\_NI\_SN\_J\_JM\_I\_RB\_HC\_ZC\_FG\_SF\_SM\_IF\_IH\_IC\_T\_TF\_AG\_AU\_JD\_AP\_CJ\_CF\_SR 



取夏普>0.2的可交易品种（23种）的组合曲线

交易品种：AP\_HC\_J\_TA\_SC\_I\_RU\_TF\_RB\_ZC\_M\_MA\_AU\_AG\_NI\_C\_CU\_V\_BU\_SF\_PB\_A\_T



## TCS策略

**TCS策略介绍**

**核心逻辑：**

收盘价向上突破通道上轨，做多；

收盘价向下突破通道下轨，做空。

通道定义：

每日波动：每日价格涨跌；

中轨：收盘价移动均线；

上轨：中轨加上一定比例的每日波动均值；

下轨：中轨减去一定比例的每日波动均值

频率：日间

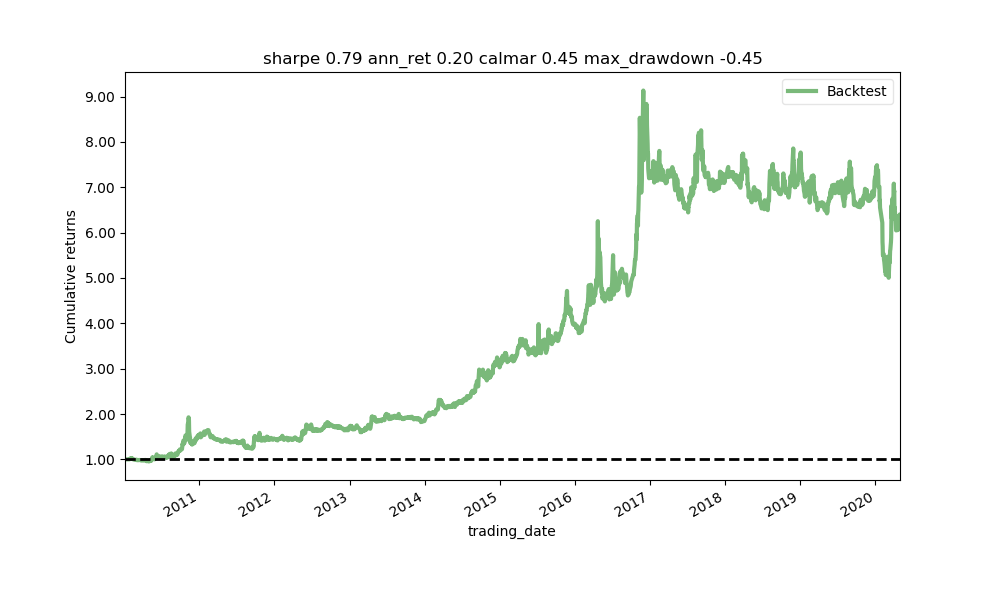
优点：简单有效（仅包含两个参数）、适用范围广

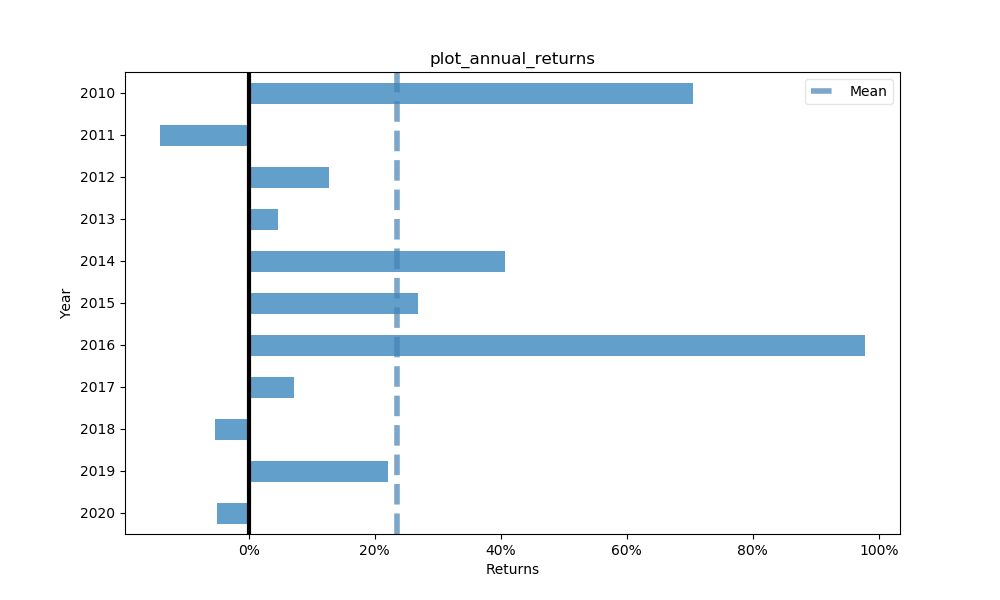
**模型结果汇总**



包含所有可交易品种的组合曲线

交易品种(45)：

C\_CS\_A\_B\_M\_RM\_Y\_P\_OI\_L\_V\_PP\_TA\_RU\_BU\_MA\_SC\_FU\_AL\_ZN\_CU\_PB\_NI\_SN\_J\_JM\_I\_RB\_HC\_ZC\_FG\_SF\_SM\_SP\_IF\_IH\_IC\_T\_TF\_AG\_AU\_CF\_SR\_JD\_AP\_CJ 



取夏普>0.2的可交易品种（23种）的组合曲线

交易品种：SC\_J\_TA\_I\_MA\_RU\_ZC\_P\_SF\_CF\_NI\_TF\_IF\_SM\_PB\_T\_SR\_AL\_BU\_AU\_AP\_FU\_C

