

感兴趣的朋友还东方证券可以考虑进一步优化策略

内容导航：

2021/11/08 04:44:53rbTk5Qr3em96D3zV55K20oCq0M53V84Im中国石化600028600355600176

大家可能都知道，有些股票在A股和港股都有上市，也有些股票在美股和港股都有上市。不同于A股和港股的关系，美股和港股的开盘时间是不交叉的，但是有很多指数或者ETF投资的标的却差不多。那么就有一个很值得研究的事情，到底是白天的港股走势对晚上的美股影响大？还是夜里的美股走势对第二天的港股影响大？当然，靠肉眼直观的观察规律是不靠谱的，一切用数据和量化来说话，进行回测是最好的办法。最终我选取了两个ETF：港股：恒生科技ETF美股：中国海外互联网ETF为什么选择ETF而不是直接看对应的指数呢？研究的量化策略最后总归还是要用实际的ETF来交易验证的嘛，所以不如直接拿代表性比较高的ETF来验证算了，而且ETF的交易成本很低很划算，这也是我经常提的一点。为什么选择互联网科技ETF呢？一是因为我比较熟悉，二是因为投资中国互联网科技公司的ETF成分都差不多，基本上都是腾讯阿里美团京东打头。当然这里只是提供一个思路，两个ETF还600490是有差别的，但是不影响我们验证思路。那么，下面就开始验证吧。

辉煌科技002296

数据的获取方式很多样，方便直接用打包好的数据可以去TuShare看看（部分数据要先攒积分才能看），临时用的数据找几个能看美股港股的网站试试看抓一下就好了。

吉电股份股票

有了数据之后，我们得想个策略，再用算法验证我们的策略是不是行得通。因为上涨下跌是有趋势性的，所以初步来看，至少得上涨下跌到一定幅度，之后的时间趋势才有可能延续；如果当天的走势是横盘，那谁能知道后面是涨是跌呢？拍脑袋先定个经验值，就是涨跌超过1个点，后面半天的趋势可能会延续。先验证下港股->美股的情况如何：

300084海默科技

这里我的策略是开盘价直接买入/卖空，到收盘时是正收益，或者盘中有相对开盘价赚一个点的高点/低点，则记为命中（hit），否则就是未命中（miss）。可以看到港股白天的涨跌，并不能确定美股晚上的走势，有点可惜。不过不要放弃，我们再统计下夜里美股的走势，对第二天港股的影响：

200488

wow，有点意外，命中率居然这么高。量化界一句话，胜率高于55%，基本上就可以稳定复利赚大钱了。这哗哗的一片蓝，有种发现了新世界的感觉。既然策略可以成功，那么我们需要简单做下回测，统计下过去这两个月按照这个策略去交易，大概能拿到多少收益。我简单回测002069了一下，不考虑交易成本的情况下，满足策略条件的情况下，无脑开盘买入收盘卖出，两个月复利收益是13.3%。当然，有短线交易经验的人，可以适当高抛，低吸比较难而且容易错过机会，但是高抛其实不那么难的。我改进了一下回测方案，取距离当日最高价1个点的位置，和收盘价做比较，取其中较高的点作为卖出点，又计算了一遍，两个月复利收益可以高达27.4%。不过考虑到不是所有人都有那么多时间盯盘，还有那么强的短线技术，取个平均数的话，收益区间应该在海德股份有限公司12-20%。PS：当日最高价为5.0的话，取的是距离5.0一个点的位置也就是4.95哦，不是相对昨日收盘价算的一个点，整体差距应该不大。警告：切记，很重要的一点，历史行情并不代表策略在未来的可行性，投资需谨慎！

港美股都可以做空这点挺方便的，而且日内平仓不计息。不过策略可能随时会失效，可能也就这两个月正好比较好用。风险还是有的，千万不要被优秀的回测数据吸引就大仓位梭哈。感兴趣的朋友还可以考虑进一步优化策略，毕竟我只是随手定了一个经验值，可能还有优化空间，欢迎讨论。文章主要是验证了下，确定了美股对港股的影响，比港股对美股的影响股票002430确实大一些，领悟到这个大趋势就可以。当然更重要的是培养自己分析数据的习惯，不要根据臆想去做投资，无论是量化分析还是基本面分析，都是投资前要好好做的作业。做了作业不一定能大赚，但是不做作业一定大概率会亏损。那么今天就到这，感谢大家的阅读，能点个赞再分享给更多朋友，就更感谢啦。

举报/反馈002452股票

600998股票矮人族游戏

坏小孩回家逃出桃色房间X0jtusQVshe0D051B96rUhMh86oVSYhdFVjfQ4rnH9

peGCDfIhnO6sGQ8b11eMn87ko6A

股票000601 300129泰胜风能 002226江南化工 新宙邦股票 600016 农业股
闽东电力股票 量子科技上市公司龙头 广百股份 000553股票