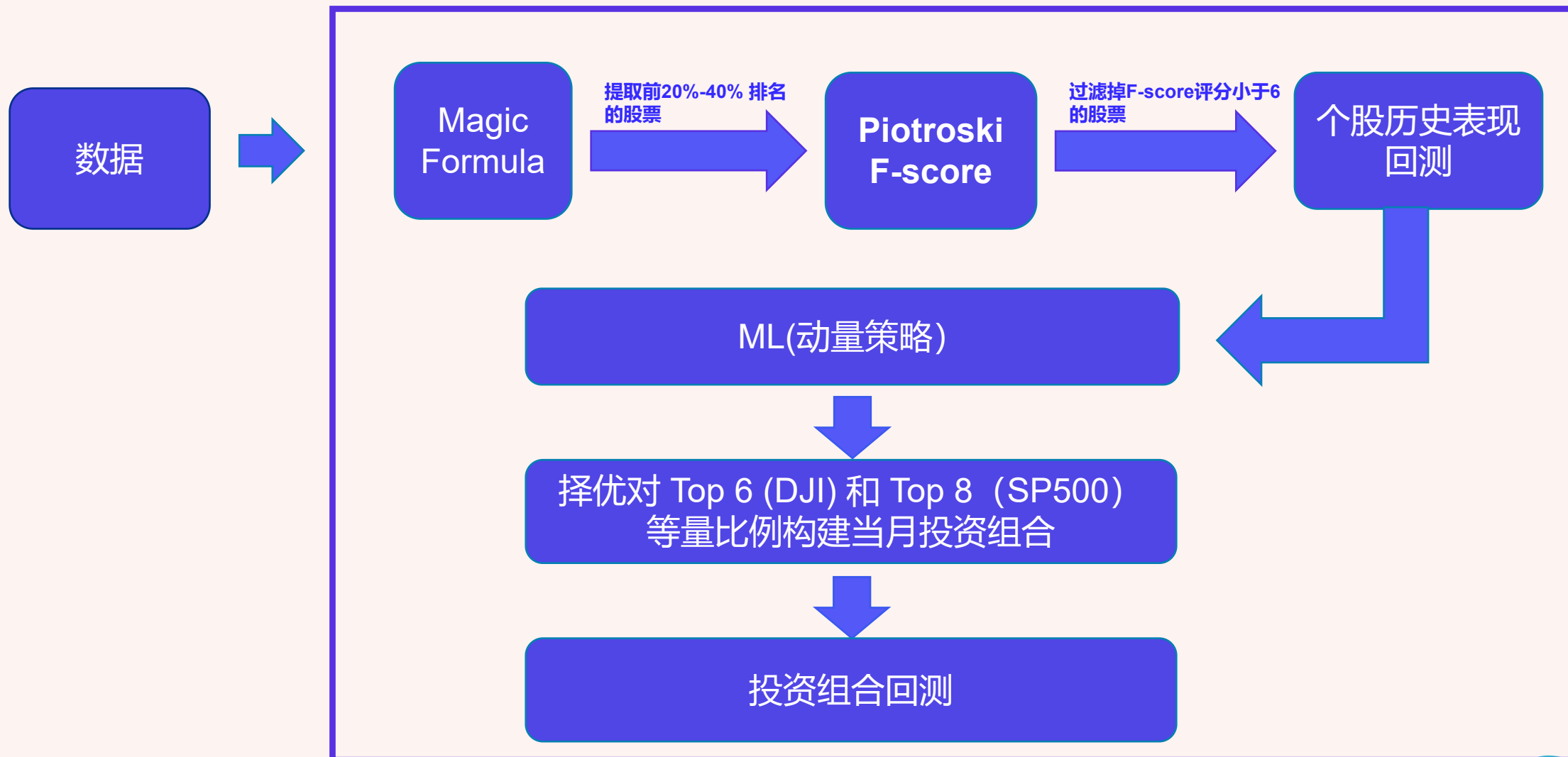


量化交易策略

# 模型的构架及思路

# 量化交易策略

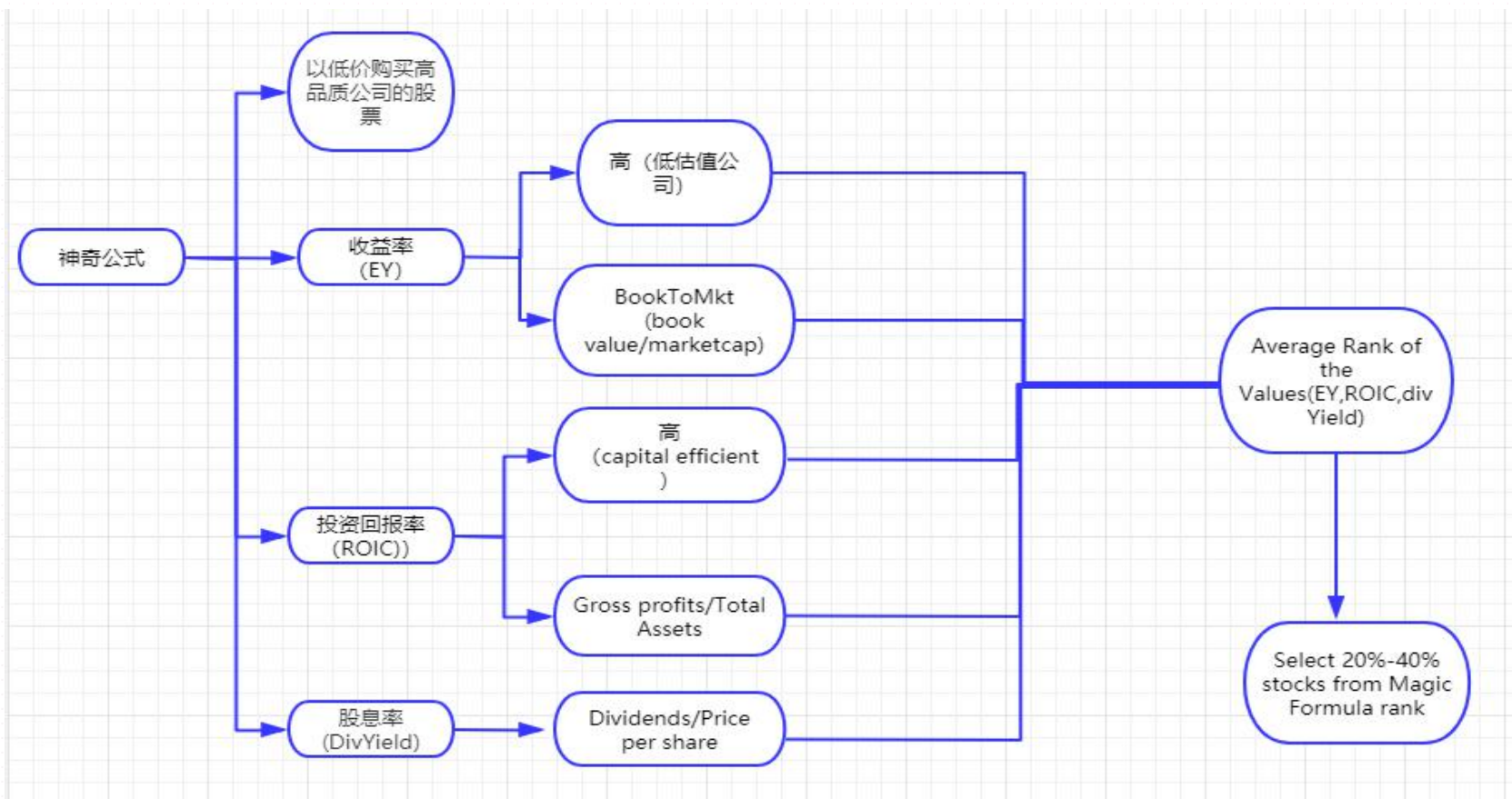


# Magic Formula(神奇公式)

神奇公式  
模型



Joel Greenblatt The little book That beats the market

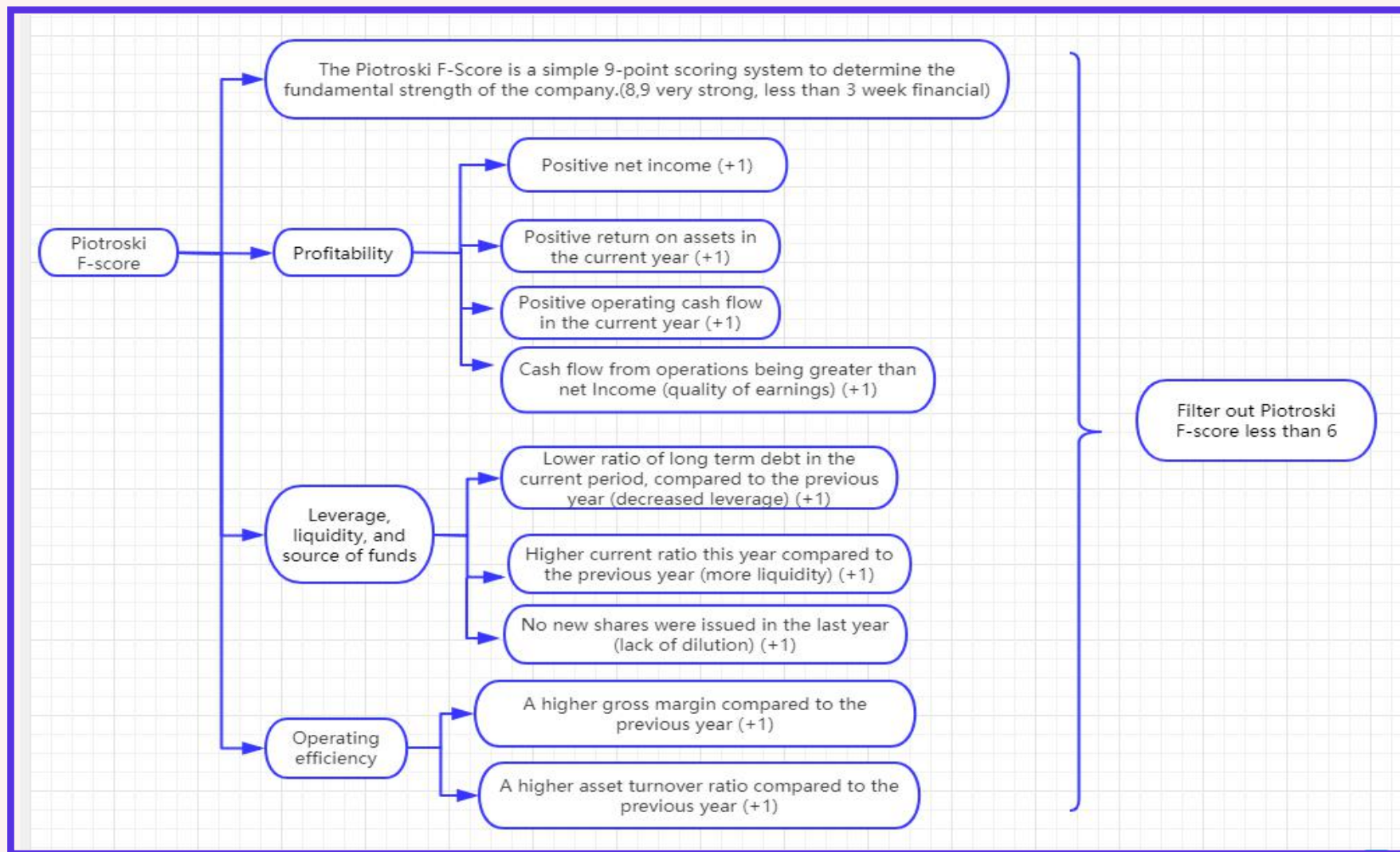


# 进行 Piotroski F-score 评分

神奇公式  
模型



Piotroski  
F-score

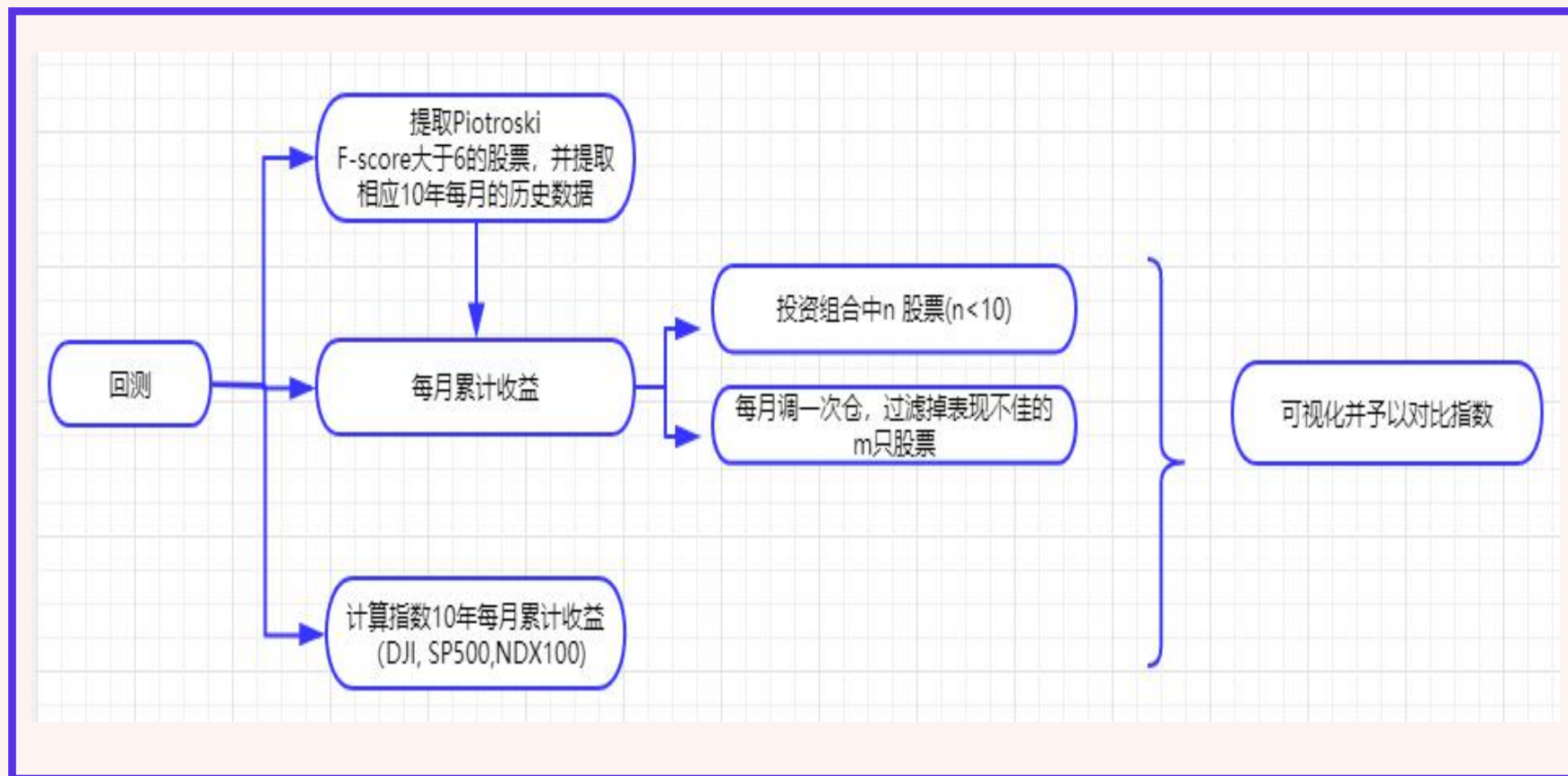


# 量化交易策略

历史数据回测



投资组合构建



\*.n代表股票池中选择个股的数量

\*.m代表表现不佳股票数量



# 量化交易策略

## 总结

### 优化后量化模型

- 道琼30 表现最佳
- 波动率小稳定的股票
- 适合长期投资并持续获得股息（道指股池）的低税投资策略

