

TOOLBOX v1.2 使用说明

—谢天谢地源来了，感谢大牛 faruto

(1) 获取上海证券交易所和深圳证券交易所相关指数代码和名称列表

```
%% 获取指数代码列表

[IndexList] = GetIndexList_Web;

save('IndexList','IndexList');
```

(2) 获取上海证券交易所和深圳证券交易所相关指数日线数据

```
%% 获取指数数据 本地 DataBase\Stock\Index_Day_mat

BeginDate = '20150101';

EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');

[SaveLog,ProbList,NewList] = SaveIndexTSDay(IndexList);
```

(3) 获取上市公司公告文件列表数据并保存相应文件至本地 DataBase\Stock\StockNotice_file\

```
[FileListCell,SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockNotice(StockList)
```

(4) 获取上市公司投资者关系信息列表数据并保存相应文件至本地 DataBase\Stock\StockInvestorRelationsInfo_file\

```
[IRInfoFileListCell,SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockInvestorRelationsInfo(StockList)
```

(5) 获取百度高级搜索相关内容

```
StockCode = '600588';

BeginDate = '20141226';

EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');

StringIncludeAny = [];

[NewsDataCell] = BaiduSearchAdvancedNews(StockCode,StringIncludeAny,BeginDate,EndDate);
```

(6) 获取新浪高级搜索相关内容

```
StringIncludeAll = '600588';

BeginDate = '20141201';

EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');

[NewsDataCell] = SinaSearchAdvanced(StringIncludeAll,BeginDate,EndDate);
```

(7) 获取 A 股市场的全部股票名称和对应代码（包含已退市股票）返回 StockList.mat

```
[StockList,StockListFull] = GetStockList_Web;

StockCodeDouble = cell2mat(StockList(:,3));
```

```
save('StockList','StockList');
```

(8) 获取 A 股市场的股票日线除权数据以及复权因子

%% 股票数据更新-除权除息数据-无并行操作 DataBase\Stock\Day_ExDividend_mat

```
AdjFlag = 0;
```

XRDFlag = 1; {令 XRDFlag = 1 即可批量获取获取除权除息信息。DataBase\Stock\XRDData_mat}

```
[SaveLog,ProbList,NewList] =SaveStockTSDay(StockList,AdjFlag,XRDFlag);
```

注意这条命令可能中断，由于网络原因或其它蛋疼原因，不过这都不是事儿，断了之后记录一下 RunIndex 是多少，比如是此图，报错前提示 RunIndex 是 274，然后在后面直接敲

`[SaveLog,ProbList,NewList] =SaveStockTSDay(StockList(274:2725,:),AdjFlag,XRDFlag);`继续即可

假如又断了就按上箭头键，自动重复上个命令，把其中的 274 改为 274+新的 RunIndex 再继续



(9) 获取股票交易明细数据本地 DataBase\Stock\Tick_mat

```
[SaveLog,ProbList,NewList] =SaveStockTick(StockList);
```

(10) 获取股票分红配股信息数据见 8

```
[SaveLog,ProbList,NewList] =SaveStockTSDay(StockList,AdjFlag,XRDFlag)
```

(11) 财务数据 DataBase\Stock\FinancialIndicators_mat 和三张表数据 DataBase\Stock\FinancialIndicators_mat 获取

```
[FindCell,YearList] = GetStockFinIndicators_Web(StockCode,Year)
```

```
[BalanceSheet,ProfitSheet,CashFlowSheet,YearList]= GetStock3Sheet_Web(StockCode,Year)
```

相应的批量数据获取函数为

Opt=0; % Opt 0:获取财务指标 1:获取 3 张表

```
[SaveLog,ProbList,NewList] =SaveStockFD(StockList,Opt)
```

(12) CalculateStockXRD.m 由除权数据生成前后复权数据

```
%% 参数设置
```

```
StockCode_G = '000562'
```

```
str = ['全局参数设置完毕! '];
```

```
disp(str);
```

```
%% 获取股票日线（除权除息）数据测试
```

```
StockCode = StockCode_G;
```

```
BeginDate = '20140101';
```

```
EndDate = '20150101';
```

```
[StockDataDouble,adjfactor] =GetStockTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);
```

```
%% 进行前复权数据生成
```

```
StockData = StockDataDouble(:,1:end);
```

```
XRD_Data = [];
```

```
AdjFlag = 1;
```

```
[StockDataXRD, factor] =CalculateStockXRD(StockData, XRD_Data, AdjFlag);
```

```
%% 复权价格 plot
```

```
scrsz = get(0,'ScreenSize');
```

```
figure('Position',[scrsz(3)*1/4scrsz(4)*1/6 scrsz(3)*4/5 scrsz(4)]*3/4);
```

```
AX1 = subplot(211);
```

```
OHLC = StockDataDouble(:,2:5);
```

```
KplotNew(OHLC);
```

```
Dates = StockDataDouble(:,1);
```

```
LabelSet(gca, Dates, [], [], 1);
```

```
ind = find( StockCodeDouble ==str2double(StockCode) );
```

```
str =[StockList{ind,1}, '-', StockList{ind,2}, '除权价格'];
```

```
title(str,'FontWeight','Bold');
```

```
AX2 = subplot(212);
```

```
OHLC = StockDataXRD(:,2:5);
```

```
KplotNew(OHLC);
```

```
Dates = StockDataDouble(:,1);
```

```
LabelSet(gca, Dates, [], [], 1);
```

```
ind = find( StockCodeDouble ==str2double(StockCode) );
```

```
str =[StockList{ind,1}, '-', StockList{ind,2}, '前复权价格'];
```

```
title(str,'FontWeight','Bold');
```

```
linkaxes([AX1, AX2], 'x');
```

(13) 获取 A 股市场的全部股票个股公司基本信息、证监会分类、所属概念分类（包含已退市股票）本地 DataBase\Stock\StockInfo_mat

```
[SaveLog,ProbList,NewList] =SaveStockInfo(StockList)
```

(14) 获取期货合约日线数据

```
MarketCode = 'CFFEX';
```

```

FuturesCode = 'IF';
DateList=[];
[SaveLog,ProbList,NewList] = SaveFuturesDay(MarketCode,FuturesCode,DateList);
FuturesCode = 'TF';
DateList=[];
[SaveLog,ProbList,NewList] = SaveFuturesDay(MarketCode,FuturesCode,DateList);

```

(15) 获取期货合约每日结算会员成交持仓排名数据本地 DataBase\Futures
 DataBase\Futures\IF\VolOIRanking 存贮一个 IF 从上市日至今所有合约的结算会员的每日成交持仓排名数据

```

[SaveLog,DateListOut,ProbList,NewList]=SaveFuturesVolOIRankingData(FutureCode,DateList,UpdateFlag)

```

(16) 脚本测试

FQuantToolBox 工具箱里面共有四个 MATLAB 脚本文件（什么是脚本文件？不懂 MATLAB 脚本文件和函数文件的区别？那您需要先做些功课，百度搜索“N 分钟学会 MATLAB”）：

Main_GetStockDataTest.m

Main_GetFuturesDataTest.m

Main_SaveStockData2LocalTest.m

Main_SaveFuturesData2Local.m

其中，

Main_GetStockDataTest.m 是用来测试 FQuantToolBox 工具箱里面所有以 Get 开头的和股票相关的函数，每个测试在 Main_GetStockDataTest.m 在一个 cell 里面，方便您来查看相关函数的输入输出。比如：

Main_GetFuturesDataTest.m 是用来测试 FQuantToolBox 工具箱里面所有以 Get 开头的和期货相关的函数，每个测试在 Main_GetFuturesDataTest.m 在一个 cell 里面，方便您来查看相关函数的输入输出。比如：

Main_SaveStockData2LocalTest.m 是用来测试 FQuantToolBox 工具箱里面所有以 Save 开头的和股票相关的函数，用来把网络上相关的数据存贮到本地，每个测试在 Main_SaveStockData2LocalTest.m 在一个 cell 里面，方便您来查看相关函数的输入输出，由于全部运行会很耗时，所以每个 cell 设置了一个 run 变量，您只需把 run 设置为 1，该 cell 模块就行运行，run=0 时，相应 cell 模块不会运行

Main_SaveFuturesData2Local.m 与 Main_SaveStockData2LocalTest.m 作用类似，只不过 Main_SaveFuturesData2Local.m 是用来测试 FQuantToolBox 工具箱里面所有以 Save 开头的和期货相关的函数，用来把网络上相关的数据存贮到本地。

(17)参考文章见三个网页文件



量化数据回测工具箱FQuantToolBox V1_0 by farutoMATLAB 程序化交易（量化投资）MATLAB技术论坛.mht



FQuantToolBox版本更新V1_1-基于MATLAB的量化数据回测工具箱 by farutoMATLAB 程序化交易（量化投资）MATLAB技术论坛.mht



FQuantToolBox版本更新V1_2-基于MATLAB的量化数据回测工具箱 by faruto - MATLAB技术论坛 - Powered by Discuz!_php.mht

网址分别为: <http://www.matlabsky.com/thread-45540-1-1.html>
<http://www.matlabsky.com/thread-45584-1-1.html>
<http://www.matlabsky.com/thread-45744-1-1.html>