

# 智能证券投资 实验 报告

实验名称：实验四：具体实施

姓名：赵伟

学号：180110507

学院：计算机科学与技术学院

专业：计算机类

## 一、 问题阐述

1. 复习单因子选股、多因子选股。熟悉并尝试智能投选、知识图谱等辅助择股工具
2. 通过评测诊断模块查看择行以及择股得分，自己的择行、择股得分和水平如何？

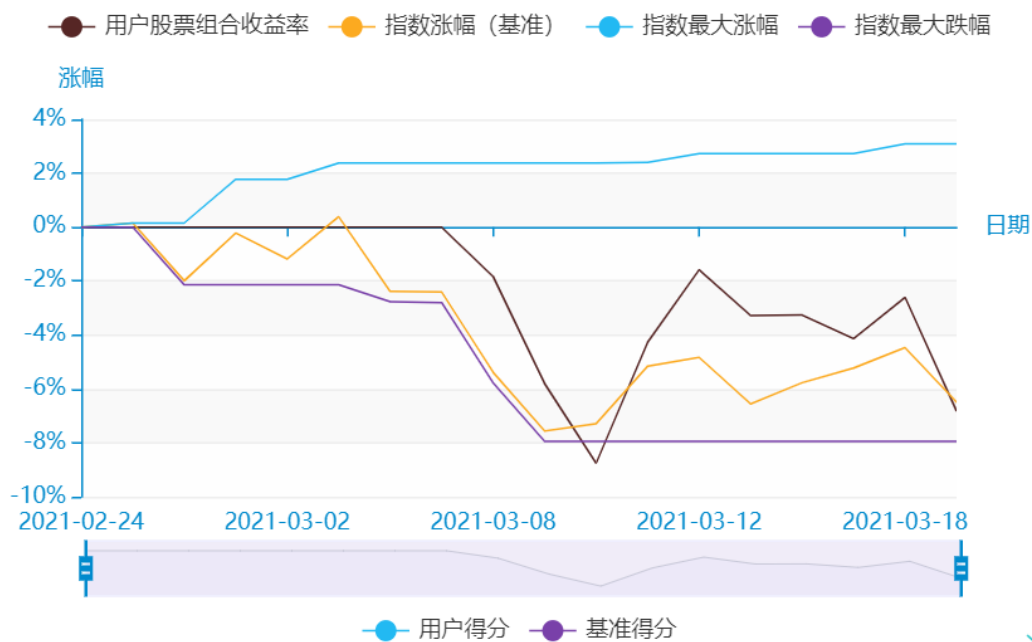
总体得分：由于个人选择和调仓导致总体得分低。



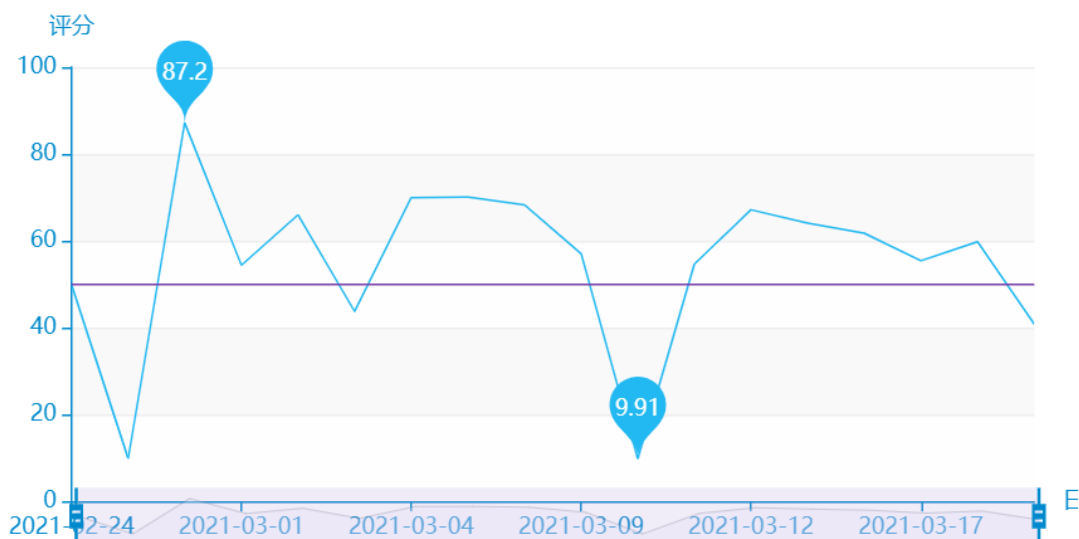
个人选择（择股）水平较差，收益率基准基本随着大盘波动，在 3.5 日一路暴跌到 3.9，随后上升一些后，又在 3.18 日下跌。

查看

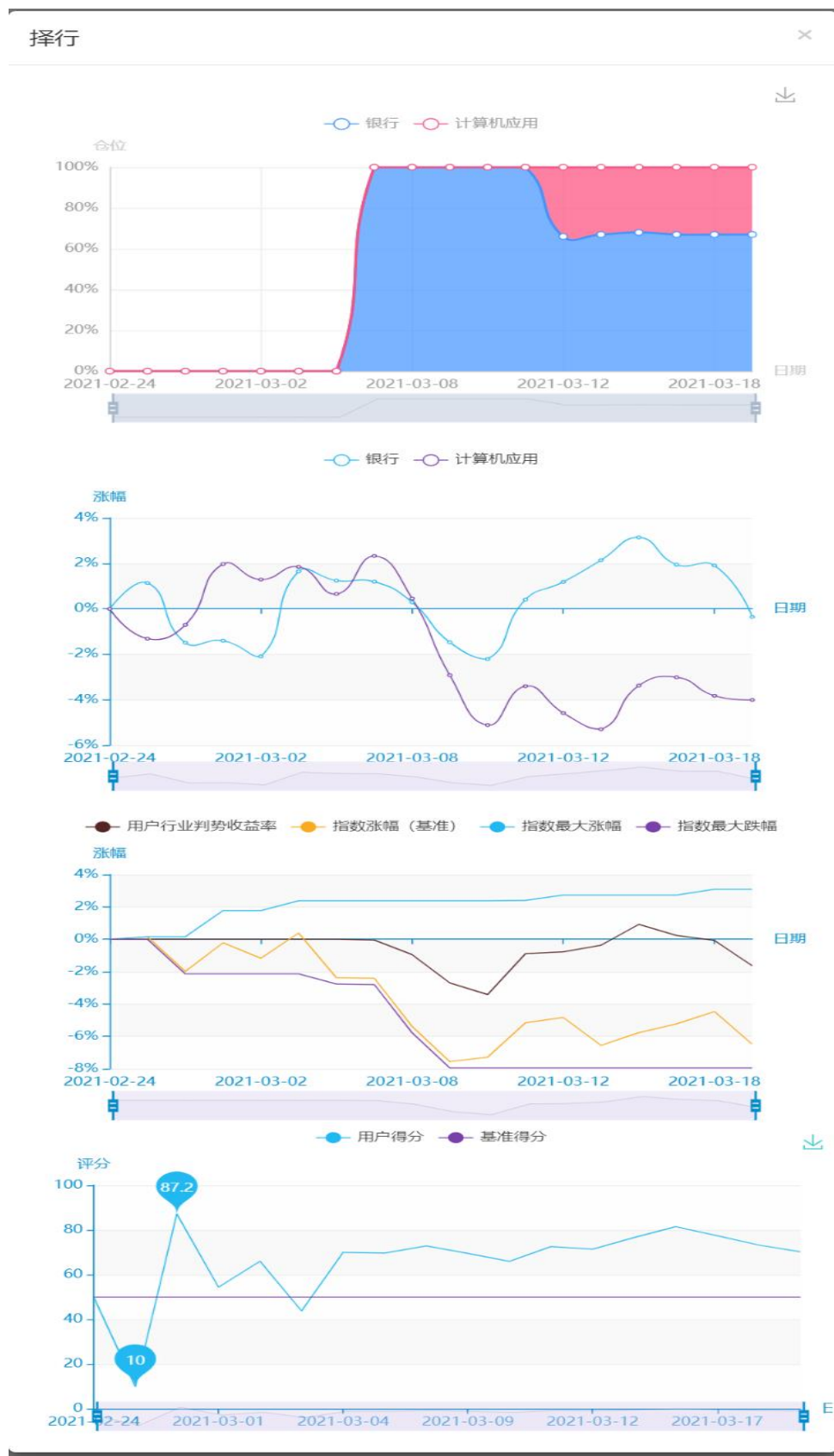
×



↓



择行水平一般，主要选了银行和计算机两个领域，计算机应用在 3.5 日后表现不佳，反而银行一直表现比较稳定。



### 3. 从对自身评价的角度，根据自身的历史持仓计算自开始日期至当日的择行、择股得分并和系统进行对比，要求给出基本的计算过程或计算思路。

择股得分计算：

#### 1. 计算涨幅

用户股票收益率：-6.82%

指数涨幅：-6.49%

指数最大涨幅：3.09%

指数最大跌幅：-7.95%

#### 2. 指数对应法计算得分

由于全买股票，所以  $B_s = -6.49\%$

因为 用户股票收益率小于  $B_s$ ，所以映射区间为 10-50

计算公式为：  $-1.64 / -6.49 \quad 3.09$

$$\text{Score} = (-6.82\% + 7.95\%) / (-6.49\% + 7.95\%) * 40 + 10 = 40.96$$

和系统一致

● 个体选择（择股）

40.96分

较差

择行得分计算：

#### 1. 由公式：

指数涨幅  $pc_{ij}$ ，则投资者收益率  $YS_i$  为类别仓位\*类别指数涨幅对  $k$  个类求和，公式为

$$YS_i = \sum_{j=1}^k c_{ij} \times pc_{ij}$$

在指定时间投资者收益率  $YS$  对所含  $n$  个时间粒度收益率的汇总计算公式为：

$$Y_s = \prod_{i=1}^n (1 + y_{s_i}) - 1$$

2. 计算如下:

$$Y_s = -1.64\% \quad B_s = -6.49\%$$

$Y_s > B_s$  所以映射到 50-90

$$Score = \frac{Y_s - B_s}{P_{\max} - B_s} * 40 + 50$$

所以由指数对应法

$$Score = (-1.64\% + -6.49\%) / (3.09\% + 7.95\%) * 40 + 50 = 70.25$$

● 群体判断 (择行)

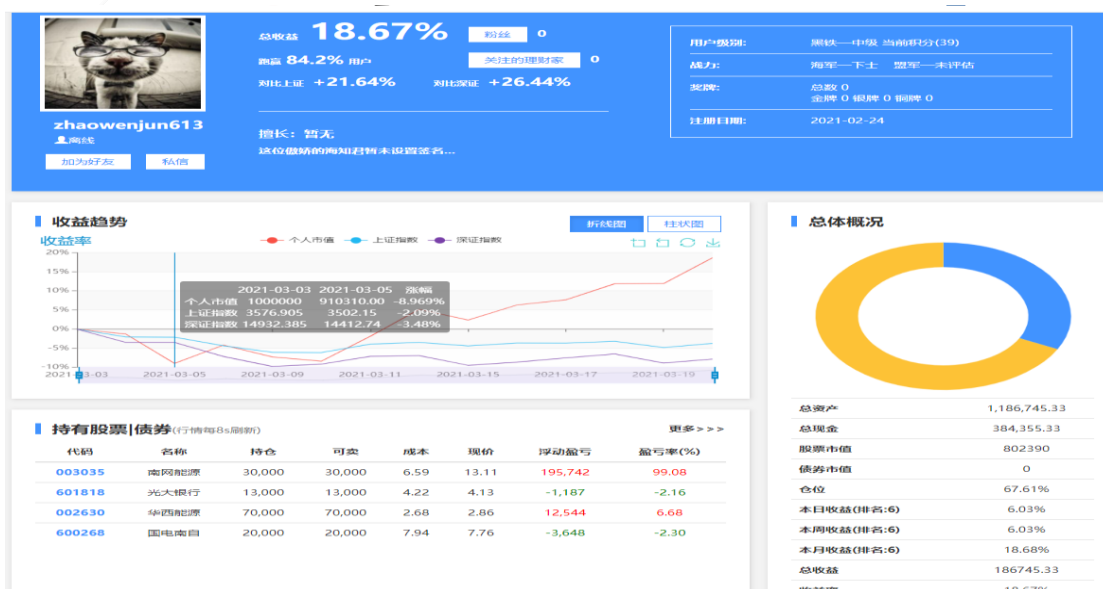
70.25分

查看

与系统一致

4. 从和其他人对标的角度, 结合模拟投资排行榜的择股得分、收益情况以及对应的持仓情况, 当前班级中谁的择股表现“较好”? 给出你的看法并说明原因。

我认为赵文郡同学的择股表现“较好”, 重仓了南网能源, 单只收入盈利 99%。



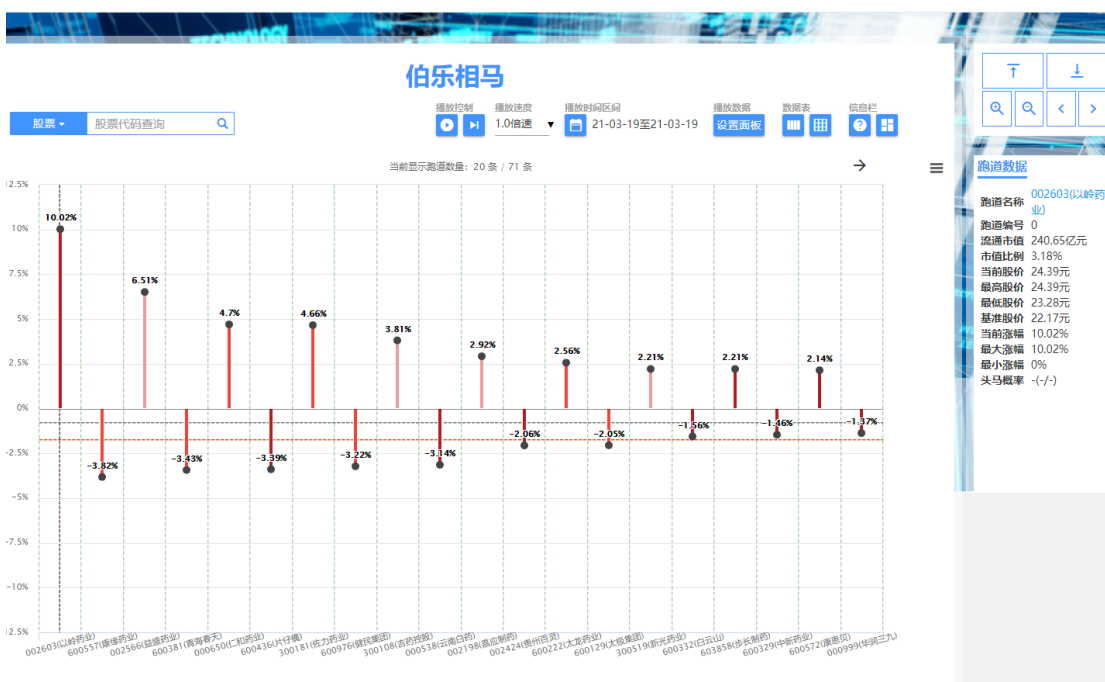
## 5. 熟悉伯乐相马各模块、按钮以及界面对应的功能，操作并回答下述问题：

- ① 自顶向下，给出自己关注的 3 个板块在模拟投资比赛期间的领涨、领跌群体及下属成员；

中药：

领涨：以岭药业

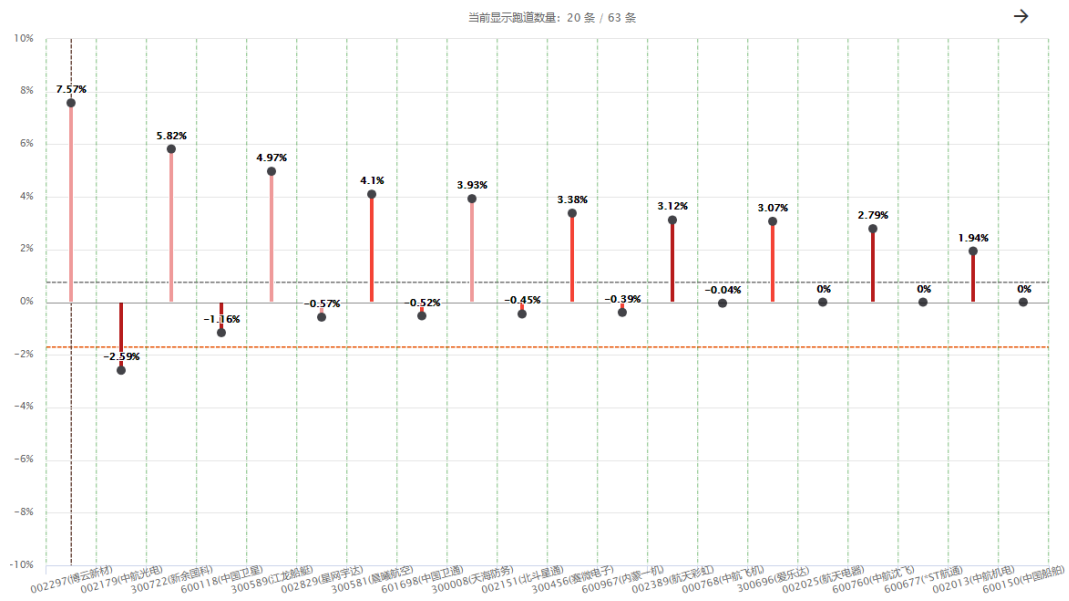
领跌：康缘药业



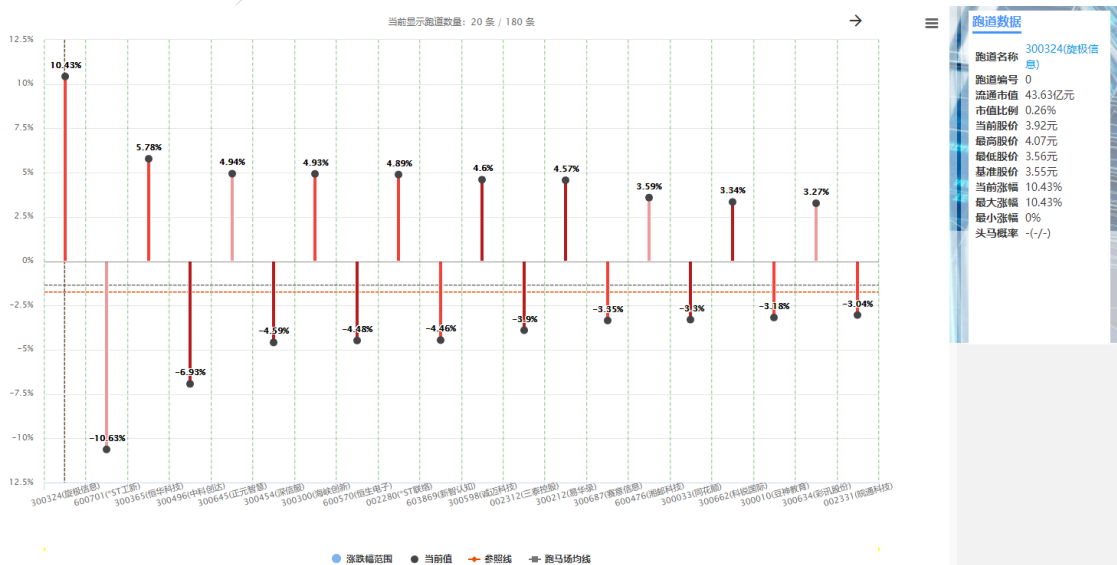
国防军工：

领涨：博云新材

领跌：中航光电

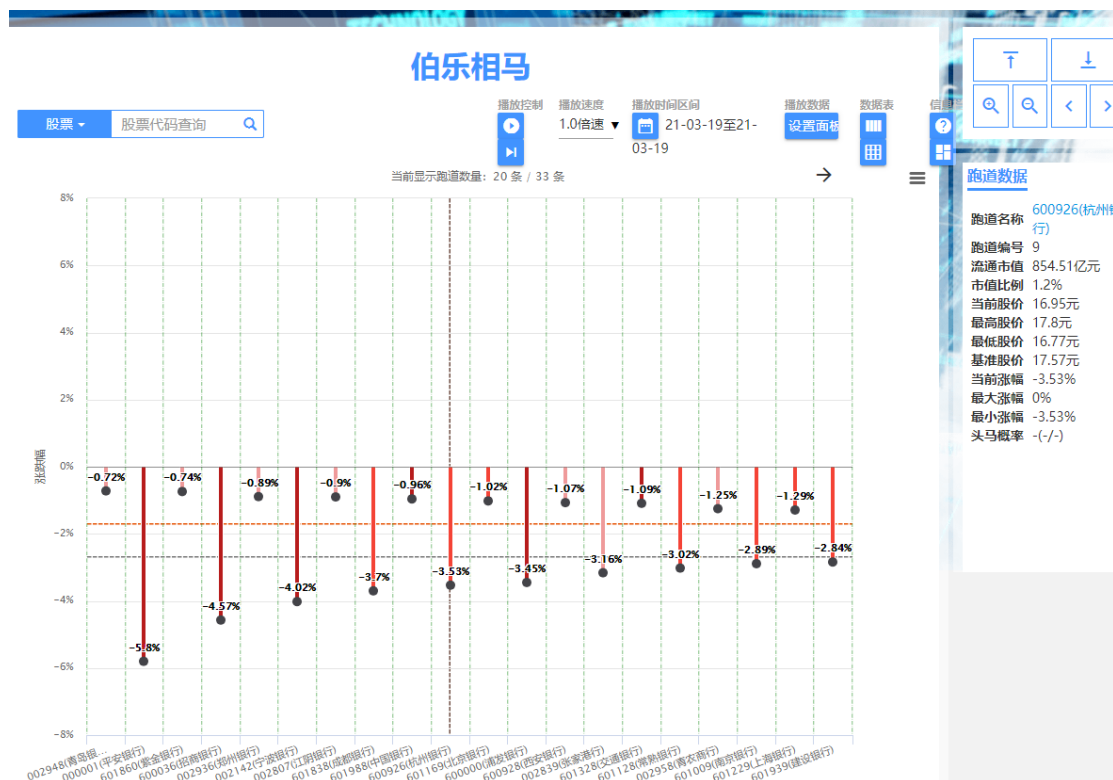


计算机应用：领涨：旋极科技 领跌：\*ST 工新





② 自底向上，根据自己的持仓分析“最好”的 1 支或 2 支股票，所属的上属群体在市场中的表现



银行板块，基本亏损严重。

6. 对于伯乐相马模块，你认为它有哪些优点，以及有哪些需要改进的地方

伯乐相马模块可以查看行业趋势，有利于自顶向下、自底向上分析股票行业，如果可以点击图像，然后跳转详情就更好了。