

数据说明

V2.1

Wednesday, March 14, 2018

目录

数据简介	3
行情数据	3
股票日级别数据	3
股票分钟级别数据	4
股票交易状态数据	4
股票代码列表数据	5
策略交易日期及日期数值化数据.....	5
策略运行结果数据	6

数据简介

- **数据种类：**全 A 股的 **3311** 只股票数据(除去 ST 股票，新股在策略实现过程中识别)
- **数据时间范围：**2016-1-20 到 2017-10-12 的股票分钟级别和日级别的数据

行情数据

股票日级别数据

- **文件路径：**Data\Daily+各股票代码 e.g. Data\Daily\SH600000.mat
- **数据属性**

开盘价	最高价	最低价	收盘价	前收盘价	交易量	涨停价
-----	-----	-----	-----	------	-----	-----

每一个股票日级别数据都是 **420*7** 的 **cdata** 矩阵（420 个交易日）

420x7 double							
	1	2	3	4	5	6	7
1	6.4000	6.4900	6.3100	6.3500	6.4600	24209289	7.1060
2	6.2600	6.4000	6.0500	6.0700	6.3500	21094077	6.9850
3	6.1600	6.1900	6.0100	6.1500	6.0700	17330278	6.6770
4	6.2200	6.3200	6.1600	6.2300	6.1500	17428037	6.7650
5	6.1700	6.7900	6.0700	6.3900	6.2300	63201062	6.8530
6	6.3200	6.3900	5.7700	6.1100	6.3900	42584090	7.0290
7	6.0200	6.2300	5.6600	5.6900	6.1100	29320544	6.7210
8	5.7000	5.9500	5.6400	5.8600	5.6900	24591440	6.2590
9	5.8600	5.9000	5.6300	5.7200	5.8600	17844040	6.4460
10	5.7200	5.9200	5.7100	5.8800	5.7200	20468586	6.2920

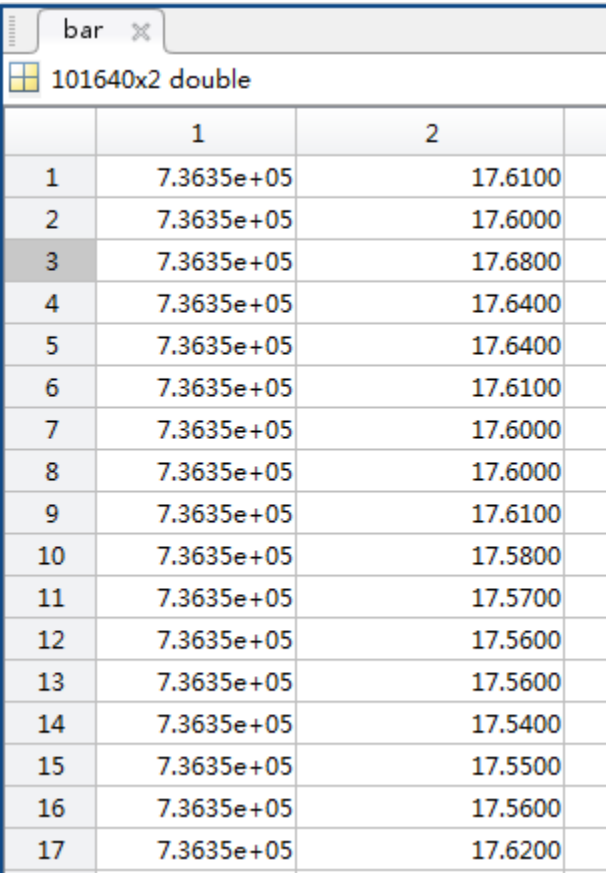
股票分钟级别数据

➤ 文件路径: Data\Bar+各股票代码 e.g. Data\Bar\SH600000.mat

➤ 数据属性

时间（数值化后的时间）	收盘价
-------------	-----

每个股票的分钟级别数据(变量名为 **bar**)可能长度不一样，因为有些股票可能还没有数据，上市之前根本没有数据



	1	2
1	7.3635e+05	17.6100
2	7.3635e+05	17.6000
3	7.3635e+05	17.6800
4	7.3635e+05	17.6400
5	7.3635e+05	17.6400
6	7.3635e+05	17.6100
7	7.3635e+05	17.6000
8	7.3635e+05	17.6000
9	7.3635e+05	17.6100
10	7.3635e+05	17.5800
11	7.3635e+05	17.5700
12	7.3635e+05	17.5600
13	7.3635e+05	17.5600
14	7.3635e+05	17.5400
15	7.3635e+05	17.5500
16	7.3635e+05	17.5600
17	7.3635e+05	17.6200

股票交易状态数据

➤ 数据说明: 股票在每个交易日分为“交易”和“不交易”两种状态，判断股票交易状态是策略实现的一部分，为 3311*420 的 0 和 1 的矩阵（3311 只股票、420 个交易日，1 表示该日为交易日）

➤ 数据文件:

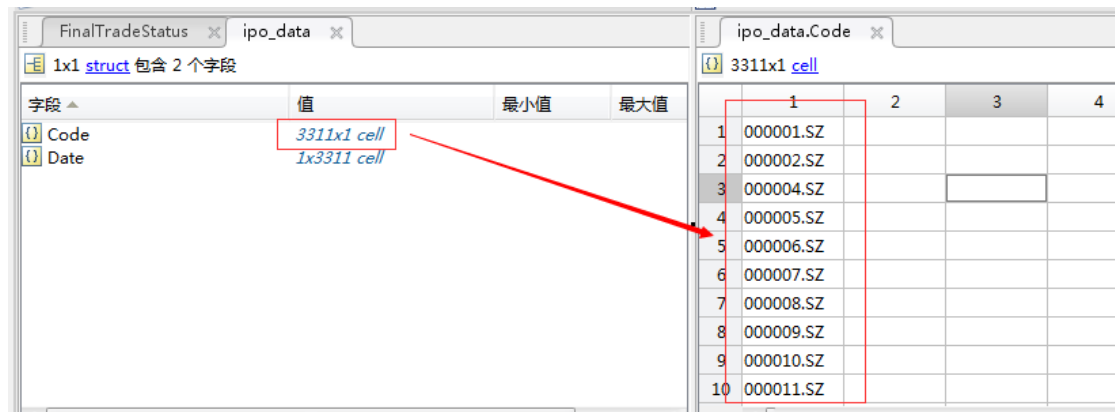
FinalTradeStatus.mat: 最后确认的合法交易日，新股发行 30 个交易日后才为合法交易日的开始（该矩阵由 NewStockTradeDayStatus 和 TradeDayStatus 相乘得到）

NewStockTradeDayStatus.mat: 新股的交易状态的处理

TradeDayStatus.mat: 股票交易状态的矩阵

股票代码列表数据

- **数据说明：**股票代码的矩阵，一共 3311 只股票以及他们的上市日期
包含变量：Code(股票代码列表)和 Date(股票上市日期列表)
- **数据格式**



FinalTradeStatus x ipo_data x

1x1 struct 包含 2 个字段

字段	值	最小值	最大值
Code	3311x1 cell		
Date	1x3311 cell		

ipo_data.Code x

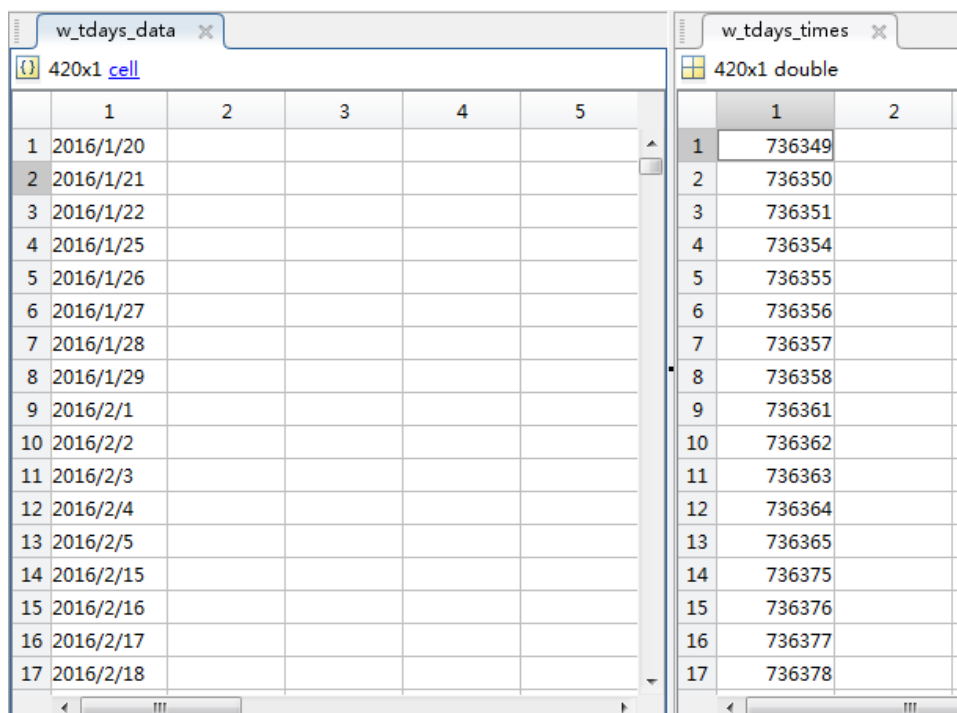
3311x1 cell

	1	2	3	4
1	000001.SZ			
2	000002.SZ			
3	000004.SZ			
4	000005.SZ			
5	000006.SZ			
6	000007.SZ			
7	000008.SZ			
8	000009.SZ			
9	000010.SZ			
10	000011.SZ			

- **存放文件：**StockIPODate.mat

策略交易日期及日期数值化数据

- **数据说明：**便于程序后期日期数据的处理和比较，将交易日期数据转换成数字数据，包含变量：w_tdays_data(字符串)和 w_tdays_times(整数)
- **数据格式**



w_tdays_data x

420x1 cell

	1	2	3	4	5
1	2016/1/20				
2	2016/1/21				
3	2016/1/22				
4	2016/1/25				
5	2016/1/26				
6	2016/1/27				
7	2016/1/28				
8	2016/1/29				
9	2016/2/1				
10	2016/2/2				
11	2016/2/3				
12	2016/2/4				
13	2016/2/5				
14	2016/2/15				
15	2016/2/16				
16	2016/2/17				
17	2016/2/18				

w_tdays_times x

420x1 double

	1	2
1	736349	
2	736350	
3	736351	
4	736354	
5	736355	
6	736356	
7	736357	
8	736358	
9	736361	
10	736362	
11	736363	
12	736364	
13	736365	
14	736375	
15	736376	
16	736377	
17	736378	

- **存放文件：**StrategyPeriod.mat

策略运行结果数据

- **数据说明：**用于保存每一次触发策略所执行的下单和清仓操作的结构体集合，定义为变量 StrategyRec

- **数据结构体**

Code	Datenum	Datestr	Price	Direction
股票代码	时间（数值）	时间（字符串）	成交价格	成交方向

e.g.

字段 ▲	值	最小值	最大值
Code	'000005.SZ'		
Datenum	7.3639e+05	7.3639e+05	7.3639e+05
Datestr	'25-Feb-2016 09:38:00'		
Price	8.7300	8.7300	8.7300
Direction	'long'		

- **存放文件：**StrategyOneRec.mat、StrategyTwoRec.mat