

牛熊市试验报告 II：添加特征

邱明轩*

08, 11, 2016

1 Result

模型：Logistic Regression分类器 + L1范数 + L2范数

目前使用了月度的指标，可以理解为每月最后一个交易日的指标，所以也是稀疏的（每月一次）的日指标。

实验一：

特征：成交额(*amt*)，换手率(*turn*)，涨跌幅(*pctchg*)，*ttmPE* 四个特征。

F1准确率: 0.6127 (0.0999)

实验二：

特征：实验一特征 + PB + PE/PB，共六个特征。

F1准确率: 0.6232 (0.1141)

实验三：

特征：实验二特征 + 当季度归母净利 + 当季度归母权益 + 当季度ROE，共九个特征。（其中2016年二季度使用了一季度的数据）

F1准确率: 0.6315 (0.0840)

实验四：

特征：实验二特征 + 前一季度归母净利 + 前一季度归母权益 + 前一季度ROE，共九个特征。（当季无法获取当季roe等指标，所以使用了前一季度指标）

F1准确率: 0.6312 (0.1164)

实验五：

特征：实验四特征 + 票据转贴利率 + 人民币名义有效汇率

F1准确率: 0.6366 (0.1073)

* email: mingxuandi@163.com