智能组合代码说明

1. 运行所有程序之前，建立本地数据库。SQL建表代码已附在最后
2. getData（只需运行一次）
   1. 利用WindAPI下载各指数（包括恒生指数）收盘价，保存与.\Data\Assetindexnav.csv，回测使用
   2. 读取备选基金.\Data\fundselect.xlsx，写入数据库
   3. 关联组合和基准，写入数据库
3. BL\_main：实际使用的资产配置。调仓日在每季度第二个月的第一个交易日。生成历史配置本地保存在.\Data\allocation.csv，并写入数据库
4. Backtest.py：调用数据库的资产配置进行回测
5. BL\_main\_index：纯指数的资产配置。调仓日在每季度第二个月的第一个交易日。生成历史配置保存在.\Data\allocation\_index.csv
6. Backtest\_index.py：调用指数资产配置文件进行回测。

注：

1. 本司没买港股指数数据，故实际资产配置将用基金000071.OF（华夏恒生ETF联接（人民币））的复权净值代替恒生指数的收盘价。
2. 一般文件开头需要改工作路径

附 数据表结构

CREATE TABLE `stg\_fund\_info` (

`id` BIGINT(20) NOT NULL AUTO\_INCREMENT COMMENT '主键ID',

`class` VARCHAR(10) NOT NULL COMMENT '资产类别',

`fund\_code` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '基金代码',

`fund\_name` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '基金简称',

`create\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '创建时间',

`update\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '更新时间',

PRIMARY KEY (`id`))

COMMENT='备选基金信息'

COLLATE='utf8\_general\_ci'

ENGINE=InnoDB;

CREATE TABLE `stg\_portfolio\_info` (

`id` BIGINT(20) NOT NULL AUTO\_INCREMENT COMMENT '主键ID',

`create\_date` VARCHAR(8) NOT NULL COMMENT '建仓日期',

`code` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '组合代码',

`fund\_list` VARCHAR(400) NOT NULL COMMENT '基金配置列表',

`type` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '代码类型（1：策略组合；2：基准组合）',

`change\_reason` VARCHAR(200) NOT NULL COMMENT '调仓原因',

`status` TINYINT(2) UNSIGNED NULL DEFAULT NULL COMMENT '状态 (0-正常；1-待授权；2-已拒绝)',

`create\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '创建时间',

`update\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '更新时间',

PRIMARY KEY (`id`))

COMMENT='组合信息'

COLLATE='utf8\_general\_ci'

ENGINE=InnoDB;

CREATE TABLE `stg\_portfolio\_info\_more` (

`id` BIGINT(20) NOT NULL AUTO\_INCREMENT COMMENT '主键ID',

`create\_date` VARCHAR(8) NOT NULL COMMENT '建仓日期',

`code` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '组合代码',

`fund\_list` VARCHAR(400) NOT NULL COMMENT '基金配置列表',

`type` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '代码类型（1：策略组合；2：基准组合）',

`change\_reason` VARCHAR(200) NOT NULL COMMENT '调仓原因',

`status` TINYINT(2) UNSIGNED NULL DEFAULT NULL COMMENT '状态 (0-正常；1-待授权；2-已拒绝)',

`create\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '创建时间',

`update\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '更新时间',

PRIMARY KEY (`id`))

COMMENT='组合信息'

COLLATE='utf8\_general\_ci'

ENGINE=InnoDB;

CREATE TABLE `stg\_portfolio\_detail\_info` (

`id` BIGINT(20) NOT NULL AUTO\_INCREMENT COMMENT '主键ID',

`code` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '组合代码',

`refer\_base` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '业绩基准',

`buy\_amount\_min` DECIMAL(20,2) NOT NULL COMMENT '最小购买金额',

`risk\_level` VARCHAR(5) NOT NULL COMMENT '风险等级',

`description` VARCHAR(200) NOT NULL COMMENT '组合描述',

`create\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '创建时间',

`update\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '更新时间',

PRIMARY KEY (`id`)

)

COMMENT='组合详细信息'

COLLATE='utf8\_general\_ci'

ENGINE=InnoDB

;

CREATE TABLE `stg\_nav\_info` (

`id` BIGINT(20) NOT NULL AUTO\_INCREMENT COMMENT '主键ID',

`trade\_date` VARCHAR(8) NOT NULL COMMENT '建仓日期',

`code` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '组合代码',

`portfolio\_nav` DECIMAL(20,4) NOT NULL COMMENT '组合净值',

`create\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '创建时间',

`update\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '更新时间',

PRIMARY KEY (`id`))

COMMENT='组合净值'

COLLATE='utf8\_general\_ci'

ENGINE=InnoDB;

CREATE TABLE `stg\_fundstg\_nav\_info\_info` (

`id` BIGINT(20) NOT NULL AUTO\_INCREMENT COMMENT '主键ID',

`class` VARCHAR(10) NOT NULL COMMENT '资产类别',

`fund\_name` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '基金',

`fund\_name\_sub` VARCHAR(20) NOT NULL COMMENT '同公司货币基金',

`create\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '创建时间',

`update\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '更新时间',

PRIMARY KEY (`id`))

COMMENT='备选基金信息'

COLLATE='utf8\_general\_ci'

ENGINE=InnoDB;

CREATE TABLE `stg\_timing` (

`id` BIGINT(20) NOT NULL AUTO\_INCREMENT COMMENT '主键ID',

`create\_date` VARCHAR(8) NOT NULL COMMENT '建仓日期',

`class` VARCHAR(10) NOT NULL COMMENT '资产类别',

`timing\_signal` VARCHAR(10) NOT NULL COMMENT '择时信号',

`create\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '创建时间',

`update\_time` DATETIME NOT NULL COMMENT '更新时间',

PRIMARY KEY (`id`))

COMMENT='每日择时信号'

COLLATE='utf8\_general\_ci'

ENGINE=InnoDB;