

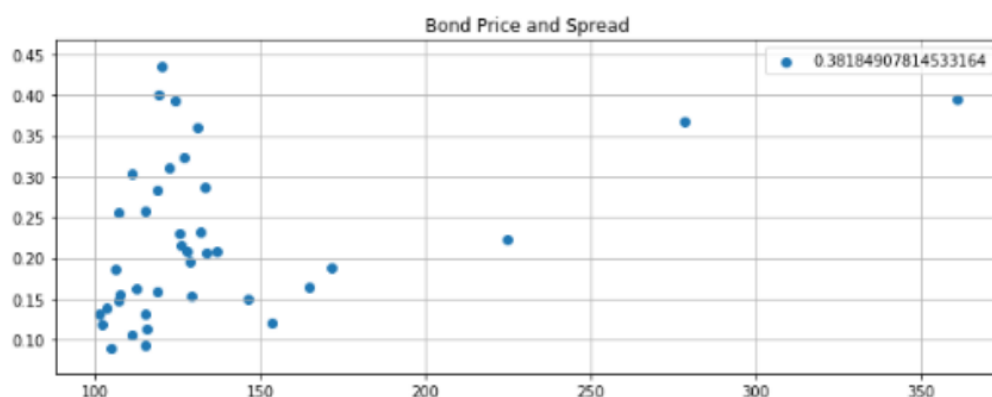
# 量价处理注意事项

统计分析时，符合分析本意的情况下，尽量把交易量（vol）和盘口宽度（Spread）等与价格有关的数据转换成交易额（Val）和Spread Ratio。

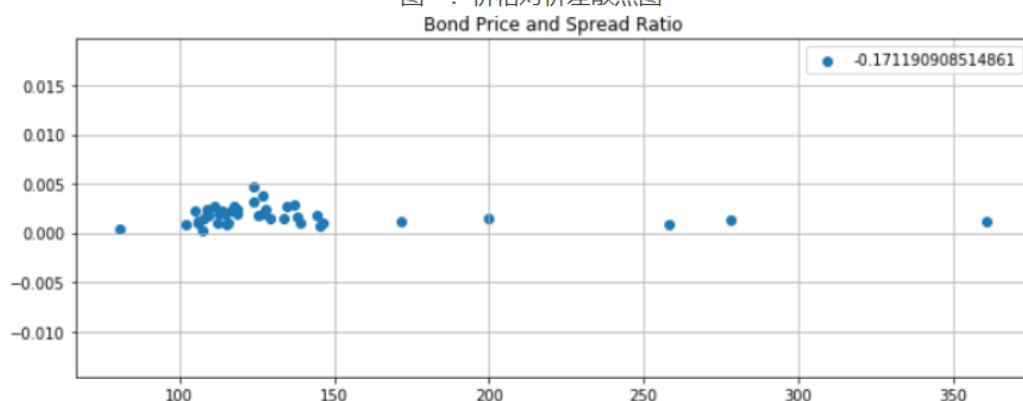
因为对一笔交易来说，当票面价值差距很大的时候，我们更关心的是交易金额，而不是交易量，这种情况下的交易金额更能反映出交易者的交易意愿。同理在交易的过程中，所关心的盘口价差成本也是与价格相关的，所以计算的应该是价差率而不是价差。

例如：

以价格对平均价差和平均价差率做散点图



图一：价格对价差散点图



图二：价格对价差率散点图

从这个图2可以清楚得出价差成本（0.000~0.005），图一中提供的信息不是非常直观，不显著的正相关关系无法体现不同价格区间和可转债的价差的关系。