中证500

重仓股300

根据基金发布的季度持仓情况

100亿-3000亿之间

模型：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 中文名 | 英文名 |  |
| 市值 | F1 |  |
| 第一月涨幅 | F2 |  |
| 第二月涨幅 | F3 |  |
| 第三月涨幅 | F4 |  |
| 此季度最大涨幅 | F5 |  |
| 此季度最小跌幅 | F6 |  |
| 前二季度持仓占比 | F7 |  |
| 前一季度持仓占比 | F8 |  |
| 此前季度持仓占比 | F9 |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

SVM模型情况：

1、标签多分类的情况下，得分比较少：

2、

标签1：

下一个季度的前两个月的最大涨幅：

|  |  |
| --- | --- |
| 标准选项 | 编码值 |
| 跑赢大盘1% | 1 |
| 跑赢大盘2% | 2 |
| 跑平大盘 | 0 |
| 跑输大盘-1% | -1 |
| 跑输大盘-2% | -2 |
|  |  |

结论：

适合判断当前季度是否跑赢大盘，成功率可以达到70%，估计优化下可以达到90%