

说明

参数说明

Regret_Minimize 类 中参数 K 代表遗忘系数，值越大，说明越不容易遗忘。

程序运行过程：

```
K = 0.8  遗忘系数-自定义

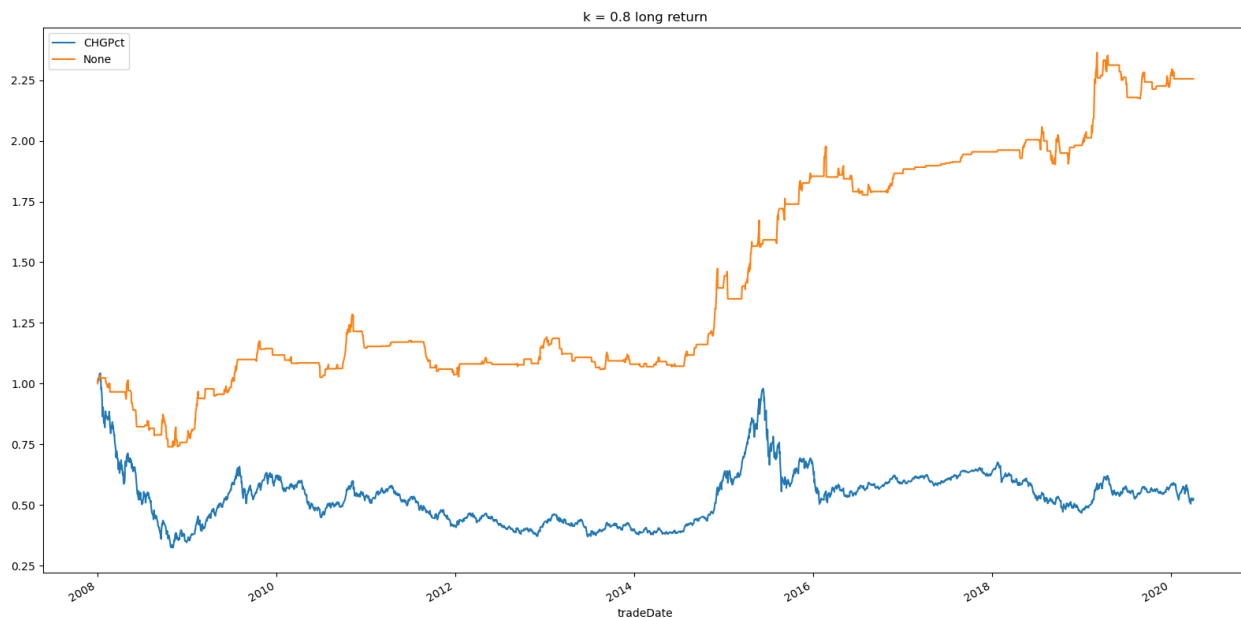
pre_pt = df['closeIndex'].iloc[:-1].values
pt = df['closeIndex'].iloc[1:].values

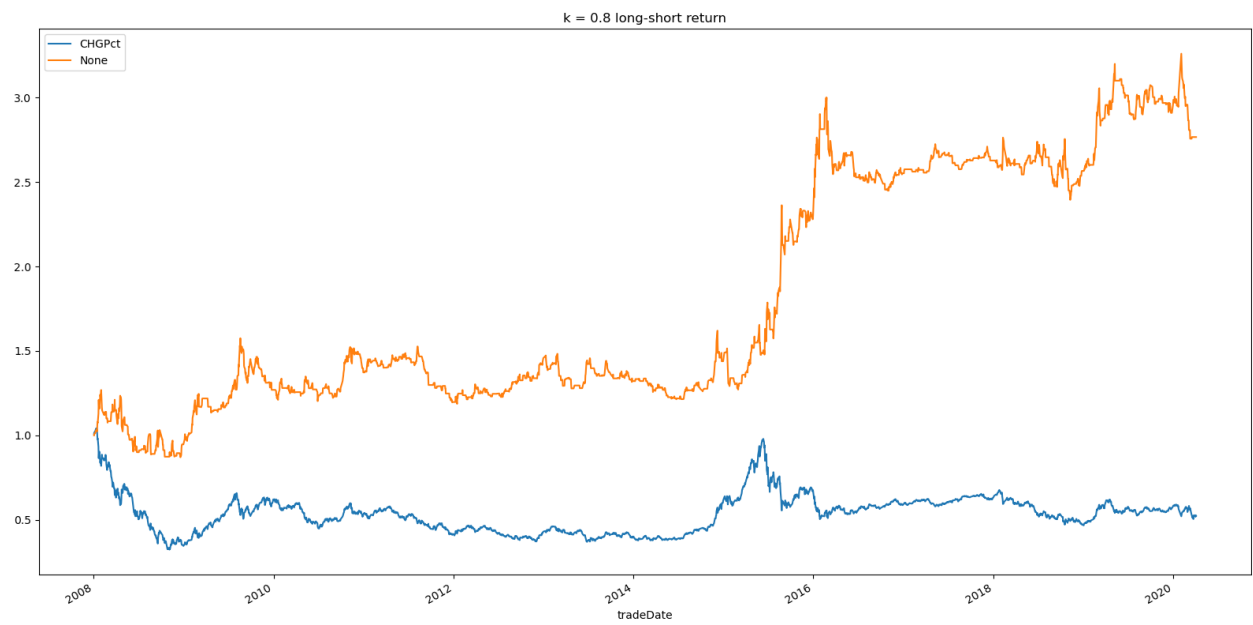
model = Regret_Minimize(K)  定义与拟合模型
model.fit(pt, pre_pt)

res_df = df.iloc[1:].loc[:, ['closeIndex', 'CHGPct']]
res_df['alpha_long'] = model.alpha_long
res_df['alpha_short'] = model.alpha_short
res_df['alpha_long'] = res_df['alpha_long'].shift(1)
res_df['alpha_short'] = res_df['alpha_short'].shift(1)  记录模型给出的信号
                                                         信号滞后，即当天给出信号。
                                                         下一天才能获得收益。

(res_df['CHGPct'] + 1).cumprod().plot(figsize=(16, 8))
(res_df['CHGPct'] * (res_df['alpha_long'] > 0.55).astype(int) + 1).cumprod().plot(figsize=(16, 8))
plt.title(u'k = %s long return'%K)
plt.legend()
plt.show()
```

运行结果解释：





蓝线表示基准情况，即上证指数的累积收益。橙线表示策略的累积收益。

long表示只做多的情况下与基准的表现差异。

long-short表示多空情况下，策略与基准的表现差异。