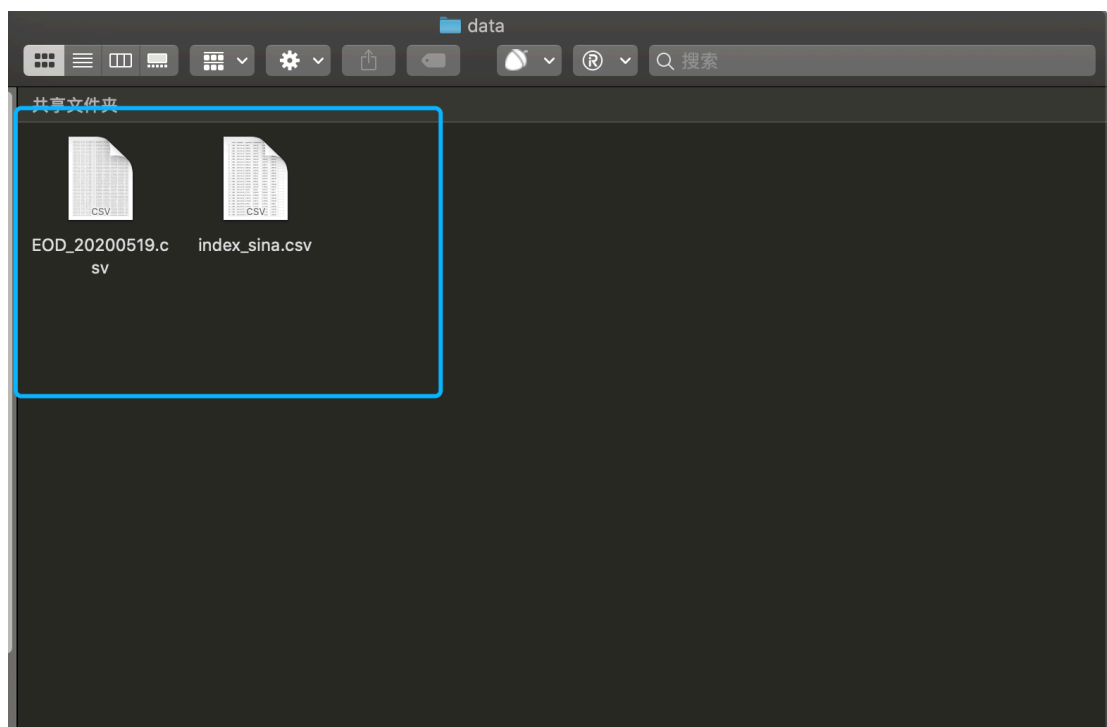


说明

运行顺序：

data\_processing.py -> get\_beta.py -> result.py

data文件夹中放入以下数据



data\_processing.py

对数据进行预处理

1. 去掉上市时间不足股票。
2. 去掉退市股票。
3. 去除低价股票

研报只取100元以上股票，以国家为角度研究，我们以策略角度，选择20元以上股票。

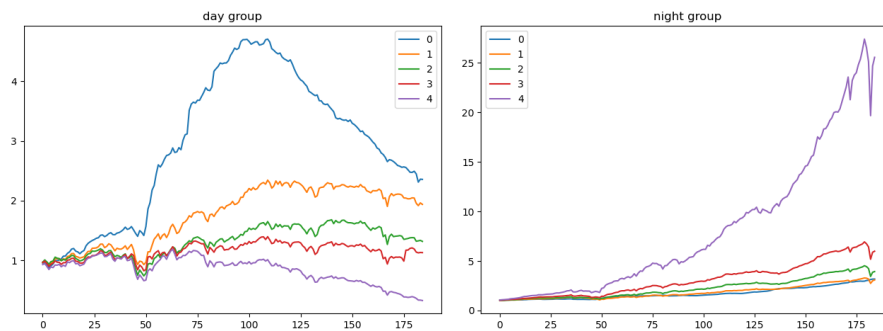
get\_beta.py

计算股票的beta值

result.py

统计根据beta计算得到的策略：

1. 先分组观察夜间与日间的收益与beta关系。



分组明显，beta值在夜间与日间是完全相反的状态。与研报结论一致。据此，提出策略。晚上做多高beta股票，白天反转头寸，做空高beta股票。

