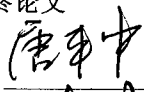
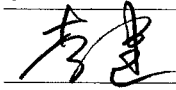
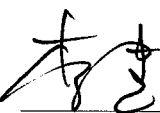


综合论文训练记录表

学生姓名	陈炜艺	学号	2010011352	班级	计科 00
论文题目	配对交易——相对价值套利的算法实现与实验分析				
主要内容以及进度安排	<p>主要内容：论文分析一种短期套利策略——配对交易 (pairs trading)，简言之即寻找历史价格走势相似的股票，当价差 (spread) 足够宽时卖空走势偏高同时买入走势偏低的股票。该论文目的是引入计算机算法进行实验（程序语言为 Python）构造一个最高历史收益的配对交易策略。同时证明逆势回报有一部分来自人们对公司新闻信息的过激反应，而非价格回归模型的长期相对均衡。</p> <p>进度安排：前八周进行开发 (Developer)，后八周进行量化分析 (Quant)</p> <ul style="list-style-type: none"> • 第一周：建立 QSTK 开发环境与熟悉 QSTK • 第二周：投资组合评估与优化的 Python 库建立 • 第三周：事件分析 (Event Study) 库的建立 • 第四周：市场模拟 (Market Simulation) 库的建立 • 第五周：时间分析库与市场模拟库的连接 • 第六—八周：财务指标 (Financial Indicator) 库的建立、连接和测试 • 第九—十周：配对交易数学模型的建立与实现 • 第十一—十三周：利用后台库对配对交易策略进行实验以及分析疑问 • 第十四—十六周：根据实验结果撰写最优策略报告和最终论文 <div style="text-align: right; margin-top: 20px;"> 指导教师签字：  考核组组长签字：  <div style="margin-top: 10px;">2016 年 3 月 26 日</div> </div>				
中期考核意见	<p style="font-size: 1.2em; text-align: center;">论文选题新颖、中期进展顺利</p> <div style="text-align: right; margin-top: 20px;"> 考核组组长签字：  <div style="margin-top: 10px;">2016 年 4 月 26 日</div> </div>				