

FQuantToolBoxHelpOnLine

FQuantToolBox: A Data and Backtesting Quant Tool Box based on MATLAB by faruto.

by LiYang_faruto @ [MATLAB技术论坛](#) FQuantStudio

Email:farutoliyang@foxmail.com

Version: V1.4

Last Modified 2015.06.01

History:

- V1.4-2015.06.01(新发布版本)
- V1.3-2015.01.24
- V1.2-2015.01.01
- V1.1-2014.12.18
- V1.0-2014.12.12

本Demo为FQuantToolBox的函数测试帮助文档
FQuantToolBox最新版下载地址： 百度网盘
FQuantToolBox使用交流讨论论坛： MATLAB技术论坛
FQuantToolBox使用交流讨论QQ群：QuantGroup1群[MATLAB] 279908629
作者faruto的联系方式： 微博-faruto , 博客 , 微信公众号-FQuantStudio(欢迎扫码关注)



书籍推荐：



Contents

- [FQuantToolBox是做什么用的？](#)
- [分类数据-全市场交易代码和对应名称（股票、指数）](#)
- [分类数据-沪深两市指数成分股及权重](#)
- [历史数据-股票每日交易明细数据](#)

- 历史数据-股票日线除权数据以及复权因子
- 历史数据-股票前后复权数据生成 (复权函数)
- 历史数据-数据频率转换[重采样]通用函数
- 历史数据-交易所相关指数日线数据
- 历史数据-获取基金数据 (历史净值、基金概况、申购赎回、十大持有人)
- 历史数据-获取基金数据-历史净值
- 历史数据-获取基金数据-基金概况
- 历史数据-获取基金数据-申购赎回
- 历史数据-获取基金数据-十大持有人
- 历史数据-期货合约日线数据
- 历史数据-期货合约每日结算会员成交持仓排名数据
- 实时数据-获取实时分笔数据-针对数据 : 股票、指数、基金 (ETF、分级基金等) 、期货
- 实时数据-单品种-股票实时数据
- 实时数据-单品种-指数实时数据
- 实时数据-单品种-ETF实时数据
- 实时数据-单品种-分级基金实时数据
- 实时数据-单品种-期货品种实时数据
- 实时数据-多品种-实时数据
- 基本面数据-股票个股公司基本信息、证监会分类、所属概念分类
- 基本面数据-股票分红配股信息数据
- 基本面数据-财务数据和三张表数据获取
- 舆情文本数据-上市公司公告文件数据
- 舆情文本数据-上市公司投资者关系信息 (Investor Relations Info) 数据
- 舆情文本数据-百度高级搜索相关数据
- 舆情文本数据-新浪高级搜索相关数据
- 舆情文本数据-股票研报列表、摘要数据
- 辅助函数和工具-MATLAB数据保存成其他格式文件(.csv .xlsx .txt等)通用函数
- 辅助函数和工具-MATLAB发送邮件通用函数
- 辅助函数和工具-绘制K线函数、横轴时间轴设定函数
- 如何构建基于MATLAB的回测系统
- 其他说明
- 基于FQuantToolBox的测试样例:一种简化的截面动量组合测试
- 基于FQuantToolBox的测试样例:一类简单的群体行为择时模型框架及实现测试
- 《量化投资 : 以MATLAB为工具》书籍介绍
- 其他信息

FQuantToolBox是做什么用的 ?

FQuantToolBox定位是个数据和回测工具箱，没有实盘交易相关接口的实现（但未来不排除增加相关功能）。

数据方面，FQuantToolBox数据获取函数完全基于网络的免费数据源（主要为新浪财经、雅虎财经等金融网站），不但可以积累历史数据，也可以进行动态更新，现已实现的数据获取为A股市场的全部股票名称和对应代码（包含已退市股票）、A股市场的股票日线除权数据以及复权因子、A股市场的股票的除权除息信息、A股市场的股票每日交易明细数据（Tick数据）、A股市场的股票财务指标数据、A股市场的股票的三张表（资产负债表、现金流量表、利润表）数据，未来数据方面会增加更多的数据，包括期货数据以及其他金融标的的数据，整体的思想还是完全基于网络获取和更新，完全免费。

基于网络的数据获取的实现方式大体过程就是网络数据网址寻找——> 网址分析——> urlread+正则表达式 数据提取。进行网络数据的抓取，正则表达式是一定会遇到的，MATLAB中有相应的正则表达式函数，有关正则表达式的东西这里不做展开，各位看官需要自行做些功课，FQuantToolBox工具箱的Doc文件夹内有个我重新整理过的《MATALB正则表达式零基础起步教程.doc》文档，可以帮助您学习正则表达式相关的东西。

回测方面，FQuantToolBox工具箱当下提供了一个“如何构建基于MATLAB的回测系统”的demo样例，此部分内容来自我出版的《量化投资 : 以MATLAB为工具》的相关章节，未且回测方面会增添更多的辅助函数和插件，方便您使用MATLAB进行股票以及期货相关策略的回测。

未来FQuantToolBox工具箱每次发布都会提供两个版本，无历史数据版本和有历史数据版本。无历史数据版本仅提供相关函数，你可以在自己本地运行相关脚本来批量获取历史数据；有历史数据版本不但提供相关函数，还提供已经获取好的历史数据（A股市场全部股票股票名称和代码、日线数据、每日交易明细数据、除权除息信息、财务指标数据、三张表数据），节省您获取历史数据的时间，但相应的下载文件也会比较大（尤其股票每日交易明细数据），新的数据更新只需运行相应脚本函数就可以进行全市场最新数据的更新。

分类数据-全市场交易代码和对应名称 (股票、指数)

```
% 获取A股市场的全部股票名称和对应代码 ( 包含已退市股票 )
% 函数名称 : GetStockList_Web.m
% 函数作用 : 获取A股市场的全部股票名称和对应代码 ( 包含已退市股票 )
```

```
% 函数句柄 : [StockList,StockListFull] = GetStockList_Web
% 函数说明 : 从http://quote.eastmoney.com/stocklist.html抓取最新的股票名称和代码列表 , 返回的StockList为股票名称和对应的代码
% 测试样例 :
% [StockList,StockListFull] = GetStockList_Web;
% StockCodeDouble = cell2mat( StockList(:,3) );
% save('StockList','StockList');
% 运行结果 : StockList如下
```

2680x3 cell

	1	2	3
1	'浦发银行'	'sh600000'	600000
2	'邯郸钢铁'	'sh600001'	600001
3	'齐鲁退市'	'sh600002'	600002
4	'ST东北高'	'sh600003'	600003
5	'白云机场'	'sh600004'	600004
6	'武钢股份'	'sh600005'	600005
7	'东风汽车'	'sh600006'	600006
8	'中国国贸'	'sh600007'	600007
9	'首创股份'	'sh600008'	600008
10	'上海机场'	'sh600009'	600009
11	'包钢股份'	'sh600010'	600010
12	'华能国际'	'sh600011'	600011
13	'皖通高速'	'sh600012'	600012
14	'华夏银行'	'sh600015'	600015
15	'民生银行'	'sh600016'	600016
16	'日照港'	'sh600017'	600017
17	'上港集团'	'sh600018'	600018
18	'宝钢股份'	'sh600019'	600019
19	'中原高速'	'sh600020'	600020
20	'上海电力'	'sh600021'	600021
21	'山东钢铁'	'sh600022'	600022
22	'浙能电力'	'sh600023'	600023
23	'中海发展'	'sh600026'	600026
24	'华电国际'	'sh600027'	600027

```
% 获取上海证券交易所和深圳证券交易所相关指数代码和名称列表
% 函数名称 : GetIndexList_Web
% 函数作用 : 获取上海证券交易所和深圳证券交易所相关指数代码和名称列表
% 函数句柄 : [IndexList] = GetIndexList_Web
% 函数说明 : 从相关网络上抓取相关数据。
% 测试样例 :
% [IndexList] = GetIndexList_Web;
% save('IndexList','IndexList');
% 运行结果 : IndexList如下
```

1	2	3
1 '上证指数'	'sh000001'	1
2 'A股指数'	'sh000002'	2
3 'B股指数'	'sh000003'	3
4 '工业指数'	'sh000004'	4
5 '商业指数'	'sh000005'	5
6 '地产指数'	'sh000006'	6
7 '公用指数'	'sh000007'	7
8 '综合指数'	'sh000008'	8
9 '上证380'	'sh000009'	9
10 '上证180'	'sh000010'	10
11 '基金指数'	'sh000011'	11
12 '国债指数'	'sh000012'	12
13 '企债指数'	'sh000013'	13
14 '红利指数'	'sh000015'	15
15 '上证50'	'sh000016'	16
16 '新综指'	'sh000017'	17
17 '180金融'	'sh000018'	18
18 '治理指数'	'sh000019'	19
19 '中型综指'	'sh000020'	20
20 '180治理'	'sh000021'	21
21 '沪公司债'	'sh000022'	22
22 '沪分离债'	'sh000023'	23
23 '180基建'	'sh000025'	25
24 '180资源'	'sh000026'	26
25 '180运输'	'sh000027'	27
26 '180成长'	'sh000028'	28
27 '180价值'	'sh000029'	29
28 '180R成长'	'sh000030'	30
29 '180R价值'	'sh000031'	31
30 '上证能源'	'sh000032'	32
31 '上证材料'	'sh000033'	33
32 '上证工业'	'sh000034'	34
33 '上证可选'	'sh000035'	35
34 '上证消费'	'sh000036'	36
35 '上证医药'	'sh000037'	37

分类数据-沪深两市指数成分股及权重

```
% 封装了一个获取沪深两市指数成分股及权重的类
% 类名 : fGetIndex();
% 属性 : Code:待获取成分股的指数代码 ( 默认为'000300' ) ; isSave:获取成分股后是否保存至本地Excel文件 ( 1-保存 , 0-不保存 ) ( 默认为1 )
% 方法 : [OutputData,dStr] = GetCons()
% 输出OutputData为指数的成分股及权重 ( cell型数据 ) , dStr为数据源更新的最后时间 ( char型数据 )

% 测试样例 :
% 获取沪深300指数成分股
tic;
GetIndex = fGetIndex();

GetIndex.isSave = 1;
GetIndex.Code = '000300';

[OutputData,dStr] = GetIndex.GetCons();
dStr

tic;

% 运行结果 : OutputData如下
```

000300指数成分股数据已保存至./IndexCons/000300成分股(1).xls
dStr =
更新时间 : 20150126

Variables OutputData

OutputData 301x4 cell

	1	2	3	4
1	Code	Name	Name(Eng)	Exchange
2	000001	平安银行	Ping An Ba...	Shenzhen
3	000002	万科A	China Van...	Shenzhen
4	000009	中国宝安	China Bao...	Shenzhen
5	000024	招商地产	China Mer...	Shenzhen
6	000027	深圳能源	Shenzhen ...	Shenzhen
7	000039	中集集团	China Inter...	Shenzhen
8	000060	中金岭南	Shenzhen ...	Shenzhen
9	000061	农产品	Shenzhen ...	Shenzhen
10	000063	中兴通讯	ZTE Corpo...	Shenzhen
11	000069	华侨城A	Shenzhen ...	Shenzhen
12	000100	TCL集团	TCL Corpo...	Shenzhen
13	000156	华数传媒	WASU ME...	Shenzhen
14	000157	中联重科	Zoomlion ...	Shenzhen
15	000166	申万宏源	Shenwan ...	Shenzhen
16	000333	美的集团	Midea Gro...	Shenzhen
17	000338	潍柴动力	Wei Chai P...	Shenzhen
18	000400	许继电气	XJ Electric ...	Shenzhen
19	000401	冀东水泥	Tangshan ...	Shenzhen
20	000402	金融街	Financial S...	Shenzhen
21	000413	东旭光电	Dongxu O...	Shenzhen
22	000423	东阿阿胶	Shandong ...	Shenzhen
23	000425	徐工机械	XCMG Co...	Shenzhen
24	000503	海虹控股	Searainbo...	Shenzhen

```
% 获取创业板指成分股
tic;
GetIndex = fGetIndex();

GetIndex.isSave = 1;
GetIndex.Code = '399006';

[OutputData,dStr] = GetIndex.GetCons();
dStr

tic;

% 运行结果 : OutputData如下
```

399006指数成分股数据已保存至./IndexCons/399006成分股(1).xls
dStr =
更新日期 : 2015-4-1

OutputData

101x4 cell

	1	2	3	4
1	'Code'	'Name'	'Weight'	'Industry'
2	'300001'	'特锐德'	0.4263000...	'工业'
3	'300002'	'神州泰岳'	1.7349000...	'信息技术'
4	'300003'	'乐普医疗'	1.8239000...	'医药卫生'
5	'300004'	'南风股份'	0.5494000...	'工业'
6	'300005'	'探路者'	0.9712000...	'可选消费'
7	'300006'	'莱美药业'	0.5856000...	'医药卫生'
8	'300009'	'安科生物'	0.4943000...	'医药卫生'
9	'300010'	'立思辰'	0.8710000...	'信息技术'
10	'300011'	'鼎汉技术'	0.5655000...	'工业'
11	'300012'	'华测检测'	0.4624000...	'工业'
12	'300014'	'亿纬锂能'	0.4660000...	'信息技术'
13	'300015'	'爱尔眼科'	0.8507000...	'医药卫生'
14	'300017'	'网宿科技'	2.0368000...	'信息技术'
15	'300020'	'银江股份'	0.8851000...	'信息技术'
16	'300024'	'机器人'	2.8402000...	'工业'
17	'300026'	'红日药业'	0.9688000...	'医药卫生'
18	'300027'	'华谊兄弟'	2.8813000...	'可选消费'
19	'300033'	'同花顺'	1.2741000...	'信息技术'
20	'300034'	'钢研高纳'	0.6195000...	'原材料'
21	'300037'	'新宙邦'	0.3580000...	'原材料'
22	'300039'	'上海凯宝'	0.6957000...	'医药卫生'
23	'300043'	'互动娱乐'	0.6975000...	'可选消费'
24	'300045'	'华力创通'	0.4214000...	'工业'

```
% 获取大数据i100指数指成分股
```

```
tic;
GetIndex = fGetIndex();
```

```
GetIndex.isSave = 1;
GetIndex.Code = '399415';
```

```
[OutputData,dStr] = GetIndex.GetCons();
dStr
```

```
tic;
```

```
% 运行结果 : OutputData如下
```

399415指数成分股数据已保存至./IndexCons/399415成分股(1).xls

dStr =

更新时间 : 2015-1-5

	1	2	3	4
1	'Code'	'Name'	'Weight'	'Industry'
2	'000001'	'平安银行'	1.0563000...	'金融地产'
3	'000096'	'广聚能源'	1.0517000...	'能源'
4	'000415'	'渤海租赁'	0.9193000...	'工业'
5	'000418'	'小天鹅A'	1.0178000...	'可选消费'
6	'000421'	'南京中北'	0.9685000...	'工业'
7	'000429'	'粤高速A'	1.0084000...	'工业'
8	'000563'	'陕国投A'	1.0250000...	'金融地产'
9	'000671'	'阳光城'	1.1126000...	'金融地产'
10	'000686'	'东北证券'	1.0860000...	'金融地产'
11	'000712'	'锦龙股份'	0.9949000...	'公用事业'
12	'000728'	'国元证券'	1.0706000...	'金融地产'
13	'000736'	'中房地产'	1.0843000...	'金融地产'
14	'000776'	'广发证券'	1.0605000...	'金融地产'
15	'000783'	'长江证券'	1.0255000...	'金融地产'
16	'000885'	'同力水泥'	1.0089000...	'原材料'
17	'000910'	'大亚科技'	0.9632000...	'原材料'
18	'000916'	'华北高速'	0.9451000...	'工业'
19	'002004'	'华邦颖泰'	0.9927000...	'原材料'
20	'002060'	'粤水电'	0.9583000...	'工业'
21	'002090'	'金智科技'	0.9468000...	'工业'
22	'002100'	'天康生物'	0.9773000...	'主要消费'
23	'002142'	'宁波银行'	1.0246000...	'金融地产'
24	'002206'	'海利得'	0.9720000...	'原材料'

% 默认会保存获取的数据至IndexCons文件夹内

名称

- 000016成分股.xls
- 000300成分股.xls
- 000852成分股.xls
- 000905成分股.xls
- 399005成分股.xls
- 399006成分股.xls
- 399415成分股.xls
- 399416成分股.xls

历史数据-股票每日交易明细数据

```
% 取单只股票某日交易明细数据
% 函数名称 : GetStockTick_Web.m
% 函数作用 : 获取单只股票某日交易明细数据
% 函数句柄 : [StockTick,Header,StatusStr] = GetStockTick_Web(StockCode,BeginDate,SaveFlag)函数说明 : 从
% http://vip.stock.finance.sina.com.cn/quotes_service/view/vMS_tradehistory.php?symbol=sz000562&date=2014-12-05
% 抓取单只股票某日交易明细数据 , 返回的StockTick为股票交易明细数据 , 每列的含义为 :
% 成交时间 成交价 价格变动 成成交量(手) 成交额(元) 性质 ( 买盘 : 1 , 卖盘 : -1 , 中性盘 : 0 )
% 测试样例 :
% StockCode = '000562';
% BeginDate = '20141205';
% [StockTick,Header,StatusStr] = GetStockTick_Web(StockCode,BeginDate);
% 运行结果 : StockTick如下
```

	1	2	3	4	5	6
1	201412050925.020	25.500000...	25.500000...	125129	319078950	1
2	201412050930.020	25.490000...	-0.010000...	42263	107729075	-1
3	201412050930.050	25.480000...	-0.010000...	52546	133887233	0
4	201412050930.080	25.490000...	0.010000...	933	2378217	1
5	201412050930.110	25.310000...	-0.180000...	6483	16408473	-1
6	201412050930.140	25.490000...	0.180000...	10823	27587827	1
7	201412050930.170	25.500000...	0.010000...	8939	22795470	-1
8	201412050930.200	25.500000...	NaN	6594	16814700	-1
9	201412050930.230	25.500000...	NaN	773	1971150	-1
10	201412050930.260	25.500000...	NaN	1267	3230850	-1
11	201412050930.290	25.500000...	NaN	607	1547850	-1
12	201412050930.320	25.500000...	NaN	1299	3312450	-1
13	201412050930.350	25.500000...	NaN	6527	16643850	-1
14	201412050930.380	25.500000...	NaN	931	2374050	-1
15	201412050930.410	25.500000...	NaN	3903	9953262	-1
16	201412050930.440	25.500000...	NaN	629	1603950	-1
17	201412050930.470	25.500000...	NaN	1774	4523700	-1
18	201412050930.500	25.500000...	NaN	525	1338750	-1
19	201412050930.530	25.500000...	NaN	673	1717578	-1
20	201412050930.560	25.500000...	NaN	568	1448400	-1
21	201412050930.590	25.500000...	NaN	1269	3235950	-1
22	201412050931.020	25.500000...	NaN	5121	13058550	-1
23	201412050931.050	25.500000...	NaN	220	561000	-1

```
% 批量获取股票每日交易明细数据并存贮至本地.mat数据
% 函数名称 : SaveStockTick.m
% 函数作用 : 批量获取股票每日交易明细数据并存贮至本地.mat数据
% 函数句柄 : [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockTick(StockList,DateList,PList,CheckFlag)
% 函数说明 : 基于GetStockTick_Web函数 , 批量获取StockList和DateList指定的代码列表、日期列表的交易明细数据并存贮至工具箱下的DataBase\Stock\Tick_mat文件夹内 ,
% 首次获取全市场所有的股票数据会非常费时 , 若已经有历史数据 , 运行SaveStockTick会进行本地数据的更新至最新交易日数据。
% 测试样例 :
% %% 获取股票代码列表测试
% [StockList,StockListFull] = GetStockList_Web;
% StockCodeDouble = cell2mat( StockList(:,3) );
% save('StockList','StockList');
% %% 获取交易明细数据Tick-无并行操作
% [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockTick(StockList);
% 运行结果 :
% 首次运行后就会在本地DataBase\Stock\Tick_mat保存全部A股市场的交易明细数据 , 每个股票一个文件夹。
```

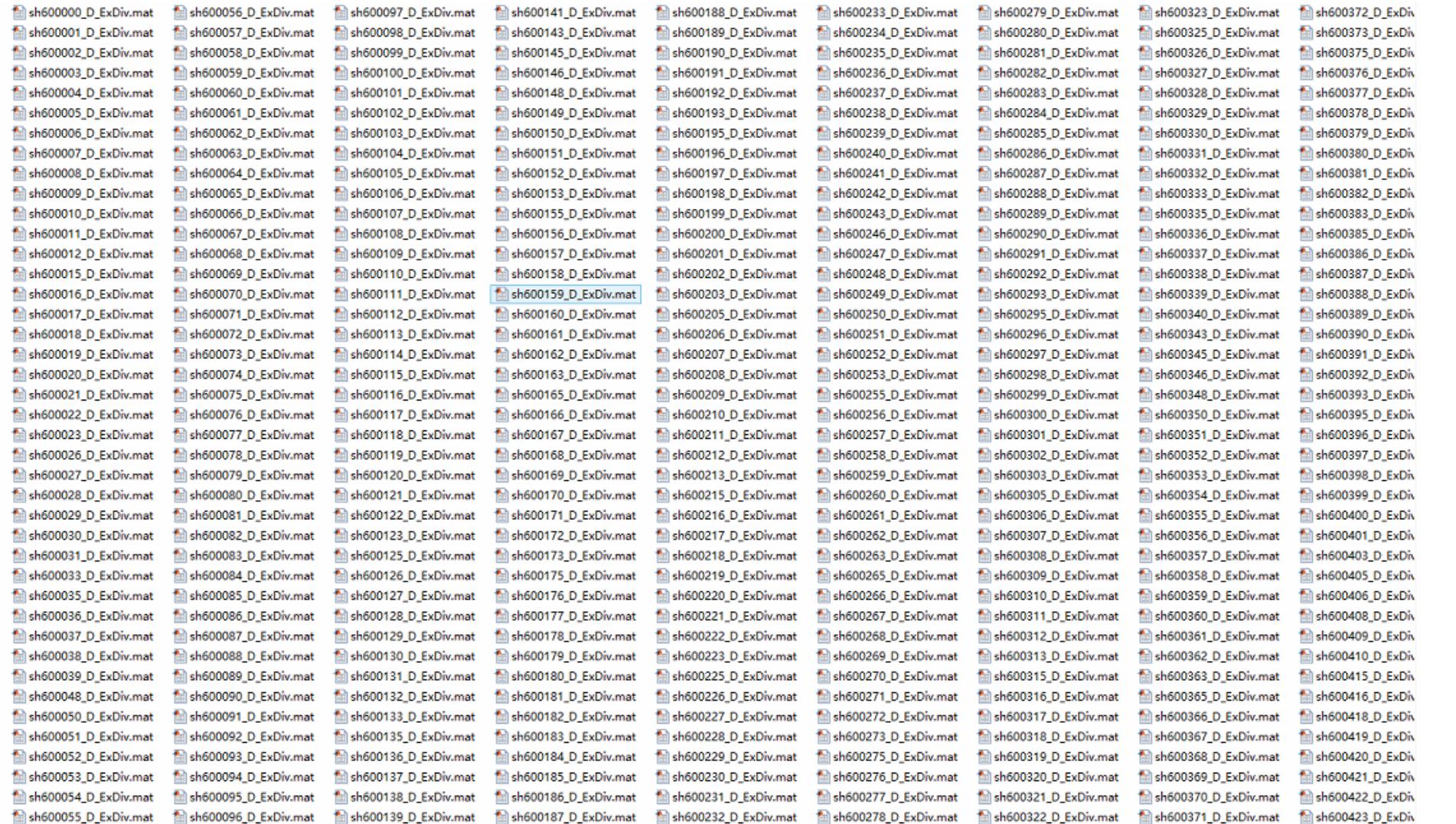
sh600000_Tick sh600057_Tick sh601226_Tick sh601677_Tick sz002256_Tick sz002299_Tick sz300012_Tick
 sh600001_Tick sh600058_Tick sh601231_Tick sh601678_Tick sz002258_Tick sz002300_Tick sz300013_Tick
 sh600002_Tick sh600059_Tick sh601233_Tick sh601688_Tick sz002259_Tick sz002301_Tick sz300014_Tick
 sh600003_Tick sh600060_Tick sh601238_Tick sh601699_Tick sz002260_Tick sz002302_Tick sz300015_Tick
 sh600004_Tick sh600061_Tick sh601258_Tick sh601700_Tick sz002261_Tick sz002303_Tick sz300016_Tick
 sh600005_Tick sh600062_Tick sh601268_Tick sh601717_Tick sz002262_Tick sz002304_Tick sz300017_Tick
 sh600006_Tick sh600063_Tick sh601288_Tick sh601718_Tick sz002263_Tick sz002305_Tick sz300018_Tick
 sh600007_Tick sh600064_Tick sh601299_Tick sh601727_Tick sz002264_Tick sz002306_Tick sz300019_Tick
 sh600008_Tick sh600065_Tick sh601311_Tick sh601766_Tick sz002265_Tick sz002307_Tick sz300020_Tick
 sh600009_Tick sh600066_Tick sh601313_Tick sh601777_Tick sz002266_Tick sz002308_Tick sz300021_Tick
 sh600010_Tick sh600067_Tick sh601318_Tick sh601788_Tick sz002267_Tick sz002309_Tick sz300022_Tick
 sh600011_Tick sh600068_Tick sh601328_Tick sh601789_Tick sz002268_Tick sz002310_Tick sz300023_Tick
 sh600012_Tick sh600069_Tick sh601333_Tick sh601798_Tick sz002269_Tick sz002311_Tick sz300024_Tick
 sh600015_Tick sh600070_Tick sh601336_Tick sh601799_Tick sz002270_Tick sz002312_Tick sz300025_Tick
 sh600016_Tick sh600071_Tick sh601339_Tick sh601800_Tick sz002271_Tick sz002313_Tick sz300026_Tick
 sh600017_Tick sh600072_Tick sh601369_Tick sh601801_Tick sz002272_Tick sz002314_Tick sz300027_Tick
 sh600018_Tick sh600073_Tick sh601377_Tick sh601808_Tick sz002273_Tick sz002315_Tick
 sh600019_Tick sh600074_Tick sh601388_Tick sh601818_Tick sz002274_Tick sz002316_Tick
 sh600020_Tick sh600075_Tick sh601390_Tick sh601857_Tick sz002275_Tick sz002317_Tick
 sh600021_Tick sh600076_Tick sh601398_Tick sh601866_Tick sz002276_Tick sz002318_Tick
 sh600022_Tick sh600077_Tick sh601515_Tick sh601872_Tick sz002277_Tick sz002319_Tick
 sh600023_Tick sh600078_Tick sh601518_Tick sh601877_Tick sz002278_Tick sz002320_Tick
 sh600026_Tick sh600079_Tick sh601519_Tick sh601880_Tick sz002279_Tick sz002321_Tick
 sh600027_Tick sh600080_Tick sh601555_Tick sh601886_Tick sz002280_Tick sz002322_Tick
 sh600028_Tick sh600081_Tick sh601558_Tick sh601888_Tick sz002281_Tick sz002323_Tick
 sh600029_Tick sh600082_Tick sh601566_Tick sz000001_Tick sz002282_Tick sz002324_Tick
 sh600030_Tick sh600083_Tick sh601567_Tick sz000002_Tick sz002283_Tick sz002476_Tick
 sh600031_Tick sh600084_Tick sh601579_Tick sz000562_Tick sz002284_Tick sz002477_Tick
 sh600033_Tick sh600085_Tick sh601588_Tick sz000755_Tick sz002285_Tick sz002478_Tick
 sh600035_Tick sh600086_Tick sh601599_Tick sz000756_Tick sz002286_Tick sz002479_Tick
 sh600036_Tick sh600087_Tick sh601600_Tick sz000757_Tick sz002287_Tick sz002492_Tick
 sh600037_Tick sh600088_Tick sh601601_Tick sz000758_Tick sz002288_Tick sz300001_Tick
 sh600038_Tick sh600089_Tick sh601607_Tick sz000795_Tick sz002289_Tick sz300002_Tick
 sh600039_Tick sh600090_Tick sh601608_Tick sz002247_Tick sz002290_Tick sz300003_Tick
 sh600048_Tick sh600102_Tick sh601616_Tick sz002248_Tick sz002291_Tick sz300004_Tick
 sh600050_Tick sh600778_Tick sh601618_Tick sz002249_Tick sz002292_Tick sz300005_Tick
 sh600051_Tick sh600779_Tick sh601628_Tick sz002250_Tick sz002293_Tick sz300006_Tick
 sh600052_Tick sh600780_Tick sh601633_Tick sz002251_Tick sz002294_Tick sz300007_Tick
 sh600053_Tick sh600781_Tick sh601636_Tick sz002252_Tick sz002295_Tick sz300008_Tick
 sh600054_Tick sh600822_Tick sh601666_Tick sz002253_Tick sz002296_Tick sz300009_Tick
 sh600055_Tick sh601222_Tick sh601668_Tick sz002254_Tick sz002297_Tick sz300010_Tick
 sh600056_Tick sh601225_Tick sh601669_Tick sz002255_Tick sz002298_Tick sz300011_Tick

历史数据-股票日线除权数据以及复权因子

```
% 获取单只股票的日线数据
% 函数名称 : GetStockTSDay_Web.m
% 函数作用 : 获取单只股票的日线数据除权数据以及复权因子 (包含已退市股票)
% 函数句柄 : [StockDataDouble,adjfactor] = GetStockTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate)
% 函数说明 : 从
% http://vip.stock.finance.sina.com.cn/corp/go.php/vMS_FuQuanMarketHistory/stockid/000562.phhtml?year=2014&jidu=4
% 抓取相应股票的后复权数据和复权因子, 然后反推算出最新的除权价格。
% 返回的StockDataDouble为股票除权后的日线数据, 其每列的含义为 :
% 日期 开 高 低 收 量(股) 额(元) 复权因子
% 测试样例 :
% StockCode = '600318';
% BeginDate = '20150101';
% EndDate = datestr(today,'yyyymmdd');
% [StockDataDouble,adjfactor] = GetStockTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);
% 运行结果 : StockDataDouble如下
```

	1	2	3	4	5	6	7	8
68	20141112	15.300000...	15.200000...	15.100000...	15.000000...	14.900000...	14.800000...	14.700000...
69	20141113	15.260000...	16.350000...	15.110000...	16.020000...	211354080	336784051...	8.793000000...
70	20141114	15.610000...	15.850000...	15.350000...	15.480000...	112998888	175727628...	8.793000000...
71	20141117	15.530000...	15.690000...	15.020000...	15.130000...	80460208	123163328...	8.793000000...
72	20141118	15.050000...	15.180000...	14.630000...	14.710000...	70343048	104336736...	8.793000000...
73	20141119	14.710000...	15.220000...	14.710000...	14.840000...	68391120	102329875...	8.793000000...
74	20141120	14.800000...	15.140000...	14.720000...	14.950000...	44798528	670615424	8.793000000...
75	20141121	14.950000...	15.950000...	14.860000...	15.770000...	130447336	201766976...	8.793000000...
76	20141124	16.110000...	16.990000...	15.800000...	16.570000...	210901568	349030809...	8.793000000...
77	20141125	16.460000...	17.150000...	16.240000...	16.650000...	131980248	220361984...	8.793000000...
78	20141126	16.820000...	17.580000...	16.780000...	17.150000...	154127088	264319180...	8.793000000...
79	20141127	17.320000...	17.950000...	16.800000...	17.790000...	187858320	326578406...	8.793000000...
80	20141128	17.680000...	17.870000...	17.230000...	17.560000...	137499760	241460531...	8.793000000...
81	20141201	17.580000...	18.200000...	17.270000...	17.410000...	114920336	203097254...	8.793000000...
82	20141202	17.600000...	19.150000...	17.500000...	19.150000...	133438472	248406451...	8.793000000...
83	20141203	21.070000...	21.070000...	20.710000...	21.070000...	184351552	388207539...	8.793000000...
84	20141204	21.530000...	23.180000...	21.320000...	23.180000...	161363744	362538521...	8.793000000...
85	20141205	25.500000...	25.500000...	24.440000...	25.500000...	168685248	428299392...	8.793000000...
86	20141208	27.670000...	28.050000...	26.230000...	28.050000...	161131456	443406899...	8.793000000...
87	20141209	30	30.860000...	28.500000...	30.500000...	284286784	870632960...	8.793000000...
88								

```
% 批量获取股票除权日线数据并存贮至本地.mat数据
% 函数名称 : SaveStockTSDay.m
% 函数作用 : 批量获取股票除权日线数据并存贮至本地.mat数据 ( 包含已退市股票 )
% 函数句柄 : [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockTSDay(StockList,AdjFlag,XRDFlag)
% 函数说明 : 基于GetStockTSDay_Web函数 , 批量获取StockList指定的代码列表的日线数据并存贮至工具箱下的DataBase\Stock\Day_ExDividend_mat文件夹内 , 首次获取全市场所有的股票数据会比较费时 , 若已经有历史数据 , 运行SaveStockTSDay会进行本地数据的更新至最新交易日数据。
% 测试样例 :
% %% 获取股票代码列表测试
% [StockList,StockListFull] = GetStockList_Web;
% StockCodeDouble = cell2mat( StockList(:,3) );
% save('StockList','StockList');
% %% 股票数据更新-除权除息数据-无并行操作
% AdjFlag = 0;% AdjFlag 0:除权时序数据 1:前复权时序数据 2:后复权时序数据
% XRDFlag = 0;
% [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockTSDay(StockList,AdjFlag,XRDFlag);
% 运行结果 :
% 首次运行后就会在本地DataBase\Stock\Day_ExDividend_mat保存全部A股市场的除权数据 :
```



历史数据-股票前后复权数据生成 (复权函数)

CalculateStockXRD.m由除权数据生成前后复权数据

这里要说明的是一般股票的回测，之所以要计算和生成前复权数据，是因为在股票的回测中，我们一般会使用前复权的数据进行回测，而非除权后的数据，

因为除权后的数据由于分红配股的影响数据有缺口不够连续，会影响相应指标的计算。

测试样例：

```
% % % 获取股票日线 ( 除权除息 ) 数据测试
% StockCode = '600690';
% BeginDate = '20100101';
% EndDate = '20130101';
%
% [StockDataDouble,adjfactor] = GetStockTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);
% % % 进行前复权数据生成
% StockData = StockDataDouble(:,1:end);
% XRD_Data = [];
% AdjFlag = 1;
% [StockDataXRD, factor] = CalculateStockXRD(StockData, XRD_Data, AdjFlag);
% % % 复权价格plot
% scrsz = get(0,'ScreenSize');
% figure('Position',[scrsz(3)*1/4 scrsz(4)*1/6 scrsz(3)*4/5 scrsz(4)*3/4];
%
% AX1 = subplot(211);
% OHLC = StockDataDouble(:,2:5);
% KplotNew(OHLC);
% Dates = StockDataDouble(:,1);
% LabelSet(gca, Dates, [], [], 1);
% str = [StockCode,'除权价格'];
% title(str,'FontWeight','Bold');
%
% AX2 = subplot(212);
% OHLC = StockDataXRD(:,2:5);
```

```
% KplotNew(OHLC);
% Dates = StockDataDouble(:,1);
% LabelSet(gca, Dates, [], [], 1);
% ind = find(StockCodeDouble == str2double(StockCode));
% str = [StockCode,'前复权价格'];
% title(str,'FontWeight','Bold');
%
% linkaxes([AX1, AX2], 'x');
```

% 运行结果：



历史数据-数据频率转换[重采样]通用函数

[更多详细内容请点击这里](#)

```
% 行情数据频率转换[重采样]通用函数
% 类:DataResampleClass
% 这个通用函数我封装成了一个类 ( DataResampleClass ) , 其属性为函数的参数设置 , 可以灵活进行相关参数的设置 , 具体如下 :
% classdef DataResampleClass < handle
% % DataResampleClass
% %by LiYang_faruto
% %Email:farutoliyang@foxmail.com
% %2015/6/1
% %% properties
% properties
% % 降采样还是升采样选择参数
% % 'DownSampling' 'UpSampling'
% DownUpSampling = 'DownSampling';
% % % 采用频率设置参数
% % 'Nmin' 'Nhour' 'Nday' 'Nsecond' 'Nmillisecond'
% % 'Nweek' 'Nmonth' 'Nquarter' 'Nyear' ...
% Fre = '1min';
% % 数据市场代码设置参数 ( 不同市场交易时间不同 )
```

```
% % 'SHSZ' 'CFFEX' ...
% Market = 'SHSZ';
% % 用于产生采样值的方法
% % 'OHLC2OHLC' 'OHLCVA2OHLCVA'
% % 'OHLCVA' 'OHLC'
% % 'first' 'last' 'median' 'max' 'min' 'sum' 'prod'
% HowMethod = 'OHLCVA';
% % 数据缺失时的插值方法以及升采样时的插值方法选择
% % 'ffill' 'bfill' 'nan'
% FillMethod = 'ffill';
% % 在降采样中，各时间段的哪一端是闭合（即包含）的
% % 'right' 'left'
% Closed = 'right';
% % 在降采样中，如何设置采样后的标签，
% % 比如 9:30到9:35之间的这5分钟会被标记为9:30('left')或9:35('right')
% % 'right' 'left'
% Label = 'right';
% % 输入数据的时间轴的数据格式
% % Datenum: MATLAB的datenum格式 ,
% % DateNumber = datenum(2015,5,13,9,30,33)
% % datestr(DateNumber) = '13-May-2015 09:30:33'
% % PureDouble: 比如201505130930.33
% % 'Datenum' 'PureDouble'
% DateFormatInput = 'PureDouble';
% % 输入数据的时间轴的数据格式选择
% % 'Datenum' 'PureDouble'
% DateFormatOutput = 'PureDouble';
%
% % 1 0 Resample后是否作图
% isPlot = 0;
% % For LabelSet函数
% LabelSetStyle = 0;
% XTRot = 55;
% end
% %% properties(Access = protected)
% properties(SetAccess = private, GetAccess = public)
%
% DownUpSampling_ParaList = {'DownSampling';'UpSampling'};
% Freq_ParaList = {'Nmin(s)';'Nhour(s)';'Nday(s)';'Nweek(s)';...
% 'Nmonth(s);Nquarter(s);Nyear(s);[括号中字符输入不输入都行]'};;
% Market_ParaList = {'SHSZ'};
% HowMethod_ParaList = {'OHLC2OHLC';'OHLCVA2OHLCVA'; ...
% 'OHLCVA';'OHLC'; ...
% 'first';'last';'median';'max';'min';'sum';'prod'};
%
% FillMethod_ParaList = {'ffill';'bfill';'nan'};
% Closed_ParaList = {'right';'left'};
% Label_ParaList = {'right';'left'};
% DateFormat_ParaList = {'Datenum';'PureDouble'};
%
% End
%
% ...
% ...
% ...
%
% end
%
% 这个行情数据频率转换[重采样]通用函数可以实现的功能如下：
% 支持证券交易所（上证所、深证所）、期货交易所（中金所、上期所、大商所、郑商所）行情数据频率转换；
% 支持降采样（downsampling），i.e高频率数据转换为低频率数据：tick数据转换为秒级别数据（任意时间切片）、tick数据转换为分钟级别数据（任意时间切片）；
% tick数据转换为其他任意更低级别的数据，分钟数据转换为其他任意更低级别的数据（N小时线、N日线等等），日线数据转换为其他任意更低级别的数据（N周线、N月线、N季线、N年线等等）；
% 支持升采样（upsampling），i.e低频率数据通过插值转换高频率数据。
% 测试样例：
% % Get Tick Data Using FQuantToolBox
StockCode = 'sz002269';

BeginDate = '20150504';
[StockTick,Header,StatusStr] = GetStockTick_Web(StockCode,BeginDate);
D1 = StockTick;

BeginDate = '20150505';
[StockTick,Header,StatusStr] = GetStockTick_Web(StockCode,BeginDate);
D2 = StockTick;

BeginDate = '20150506';
[StockTick,Header,StatusStr] = GetStockTick_Web(StockCode,BeginDate);
D3 = StockTick;
```

```

BeginDate = '20150507';
[StockTick,Header,StatusStr] = GetStockTick_Web(StockCode,BeginDate);
D4 = StockTick;

BeginDate = '20150508';
[StockTick,Header,StatusStr] = GetStockTick_Web(StockCode,BeginDate);
D5 = StockTick;

D = [D1;D2;D3;D4;D5];

% load ResampleTestData.mat
% % DataResampleClass 初始化
DResample = DataResampleClass();
% % 参数设置
    % 'DownSampling' 'UpSampling'
    DResample.DownUpSampling = 'DownSampling';
    % '1min' '5min' ...
    DResample.Fre = '1min';
    % 'SHSZ' 'CFFEX' ...
    DResample.Market = 'SHSZ';
    % 'OHLC2OHLC' 'OHLCVA2OHLCVA'
    % 'OHLCVA' 'OHLC'
    % 'first' 'last' 'median' 'max' 'min' 'sum' 'prod'
    DResample.HowMethod = 'OHLCVA';

    % 'ffill' 'bfill' 'nan'
    DResample.FillMethod = 'ffill';
    % 'right' 'left'
    DResample.Closed = 'right';
    % 'right' 'left'
    DResample.Label = 'right';
    % 'Datenum' 'PureDouble'
    DResample.DateFormatInput = 'PureDouble';
    % 'Datenum' 'PureDouble'
    DResample.DateFormatOutput = 'PureDouble';

% 1 0 Resample后是否作图
DResample.isPlot = 1;
% For LabelSet函数
DResample.LabelSetStyle = 0;
DResample.XTRot = 55;
% % OneDay tick2min
DResample.Fre = '1min';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA';

InputData1 = D1(:,[1 2 4 5]);

OutputData1 = DResample.Resample(InputData1);
% % OneDay 1minTo5min
DResample.Fre = '5min';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA2OHLCVA';

OutputData3 = DResample.Resample(OutputData1);

% % OneDay tick2min
DResample.Fre = '5min';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA';

InputData1 = D1(:,[1 2 4 5]);

OutputData1 = DResample.Resample(InputData1);
% % OneDay tick2day
DResample.Fre = '1day';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA';

InputData1 = D1(:,[1 2 4 5]);

OutputData1 = DResample.Resample(InputData1);

% % MultiDay tick2min
DResample.Fre = '1min';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA';

InputData2 = D(:,[1 2 4 5]);

```

```
OutputData2 = DResample.Resample(InputData2);
% % MultiDay 1minTo5min
DResample.Fre = '5min';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA2OHLCVA';
OutputData4 = DResample.Resample(OutputData2);
% % MultiDay tick2day
DResample.Fre = '1day';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA';

InputData1 = D(:,[1 2 4 5]);

OutputData1 = DResample.Resample(InputData1);
% % Get Index Data Using FQuantToolBox

StockCode = '000001';
% StockCode = '000300';

BeginDate = '20100101';

EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');

[Data] = GetIndexTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);

DateTemp = Data(:,1)*1e4+1500*ones(length(Data),1);
InputData =[DateTemp,Data(:,2:end)];

% % dayToday

DResample.Fre = '3day';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA2OHLCVA';

OutputData1 = DResample.Resample(InputData);

% % dayToweek

DResample.Fre = '1week';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA2OHLCVA';

OutputData1 = DResample.Resample(InputData);
% % dayTomonth

DResample.Fre = '1month';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA2OHLCVA';

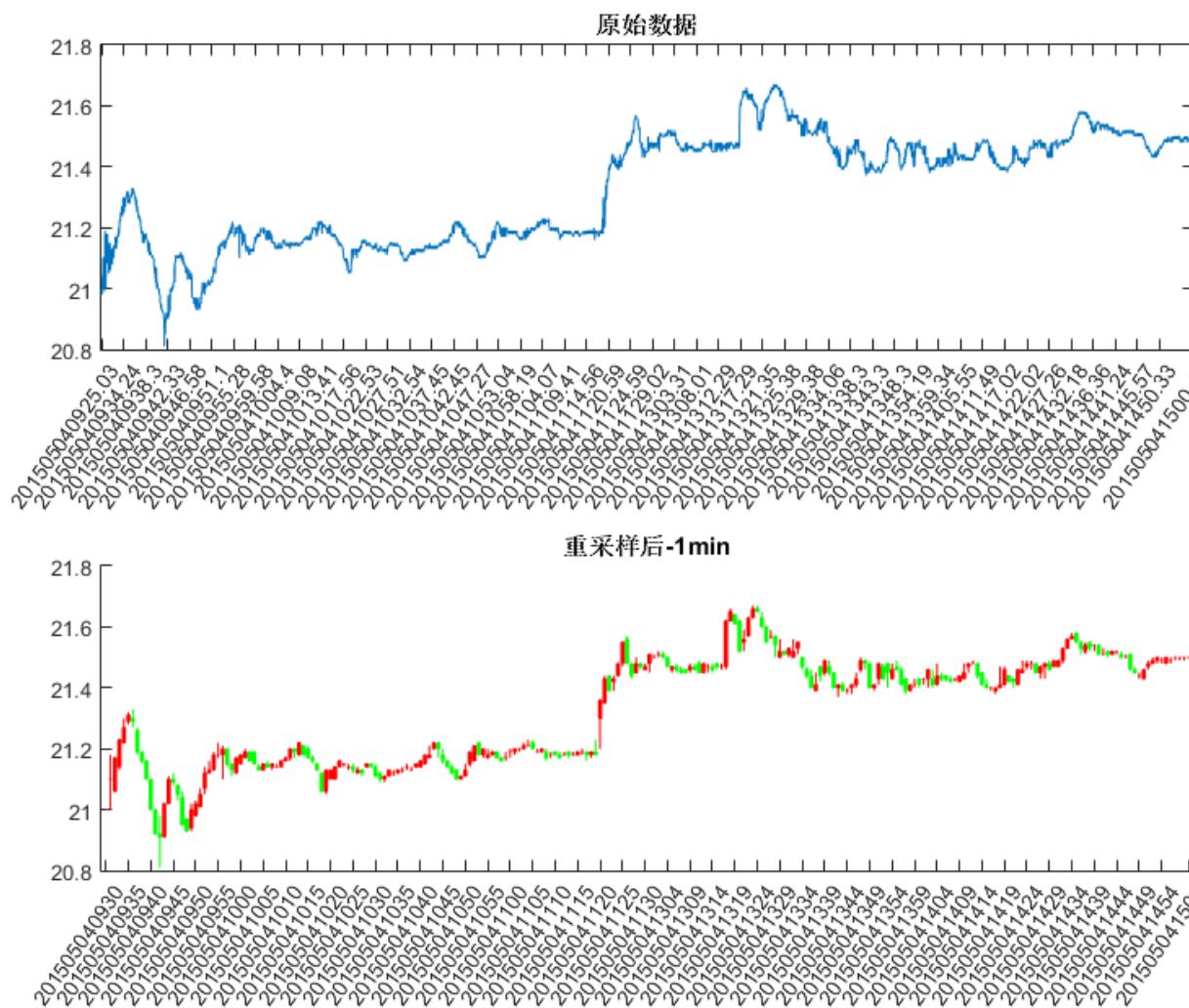
OutputData1 = DResample.Resample(InputData);
% % dayToquarter

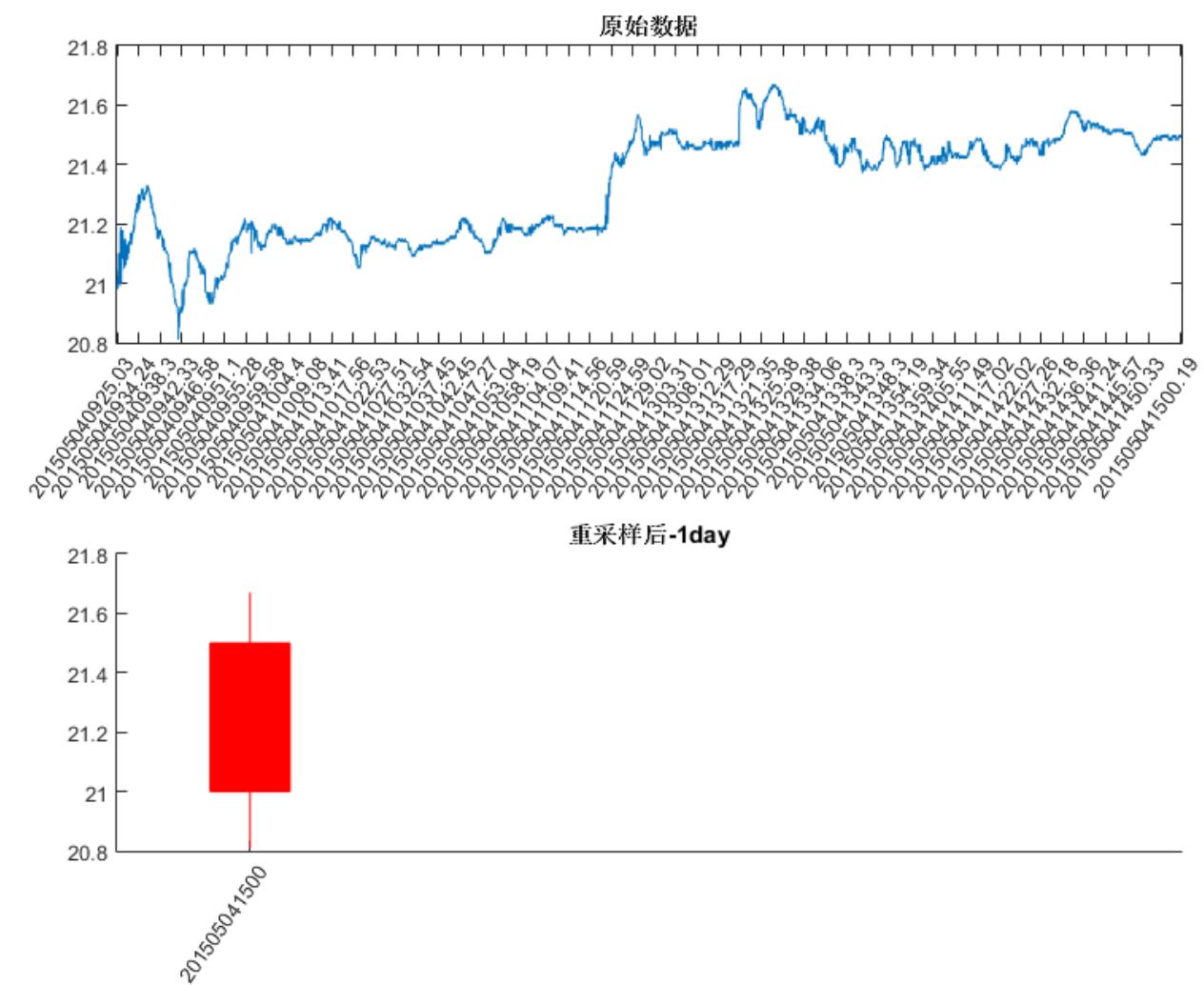
DResample.Fre = '1quarter';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA2OHLCVA';

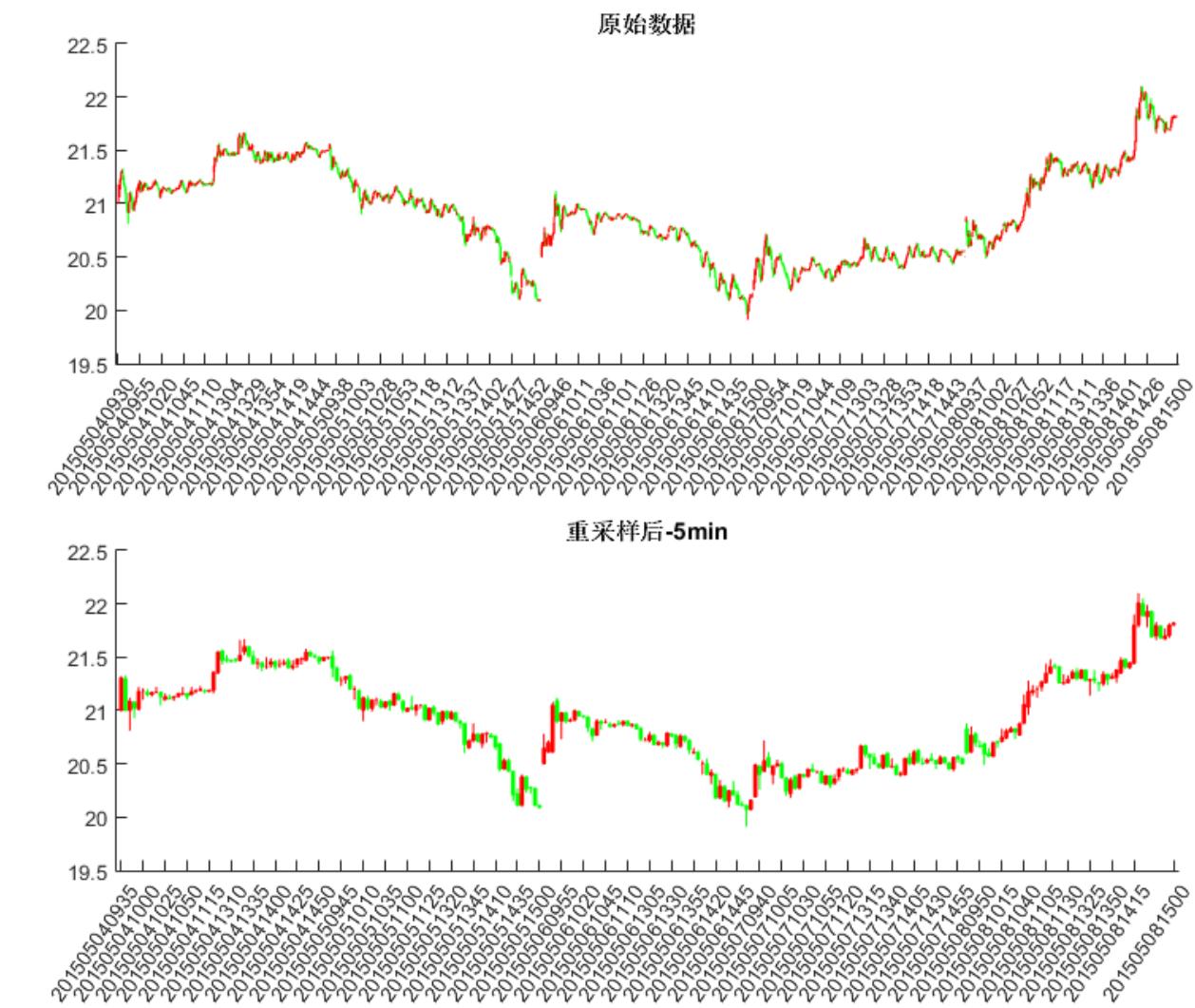
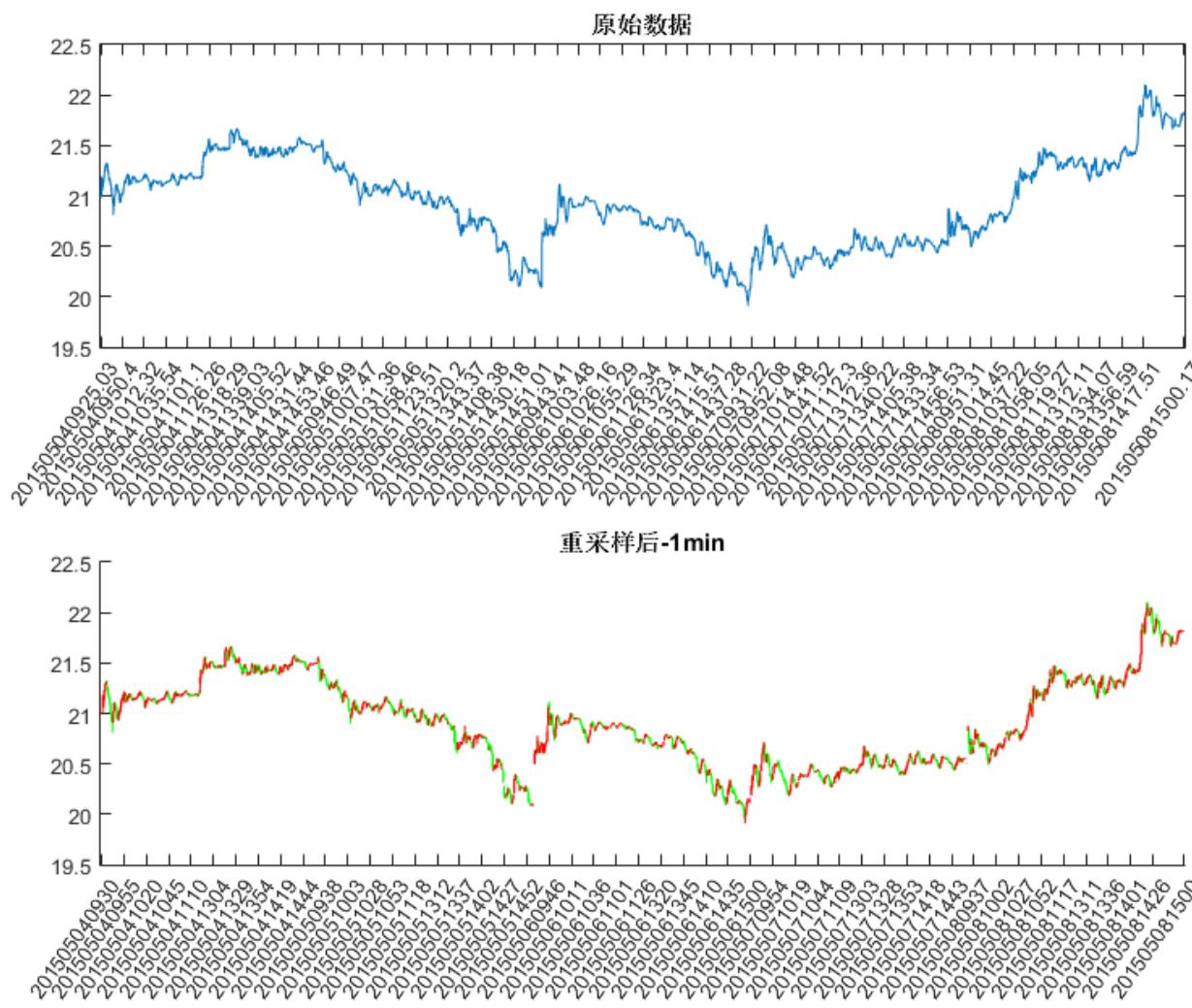
OutputData1 = DResample.Resample(InputData);
% % dayToyear

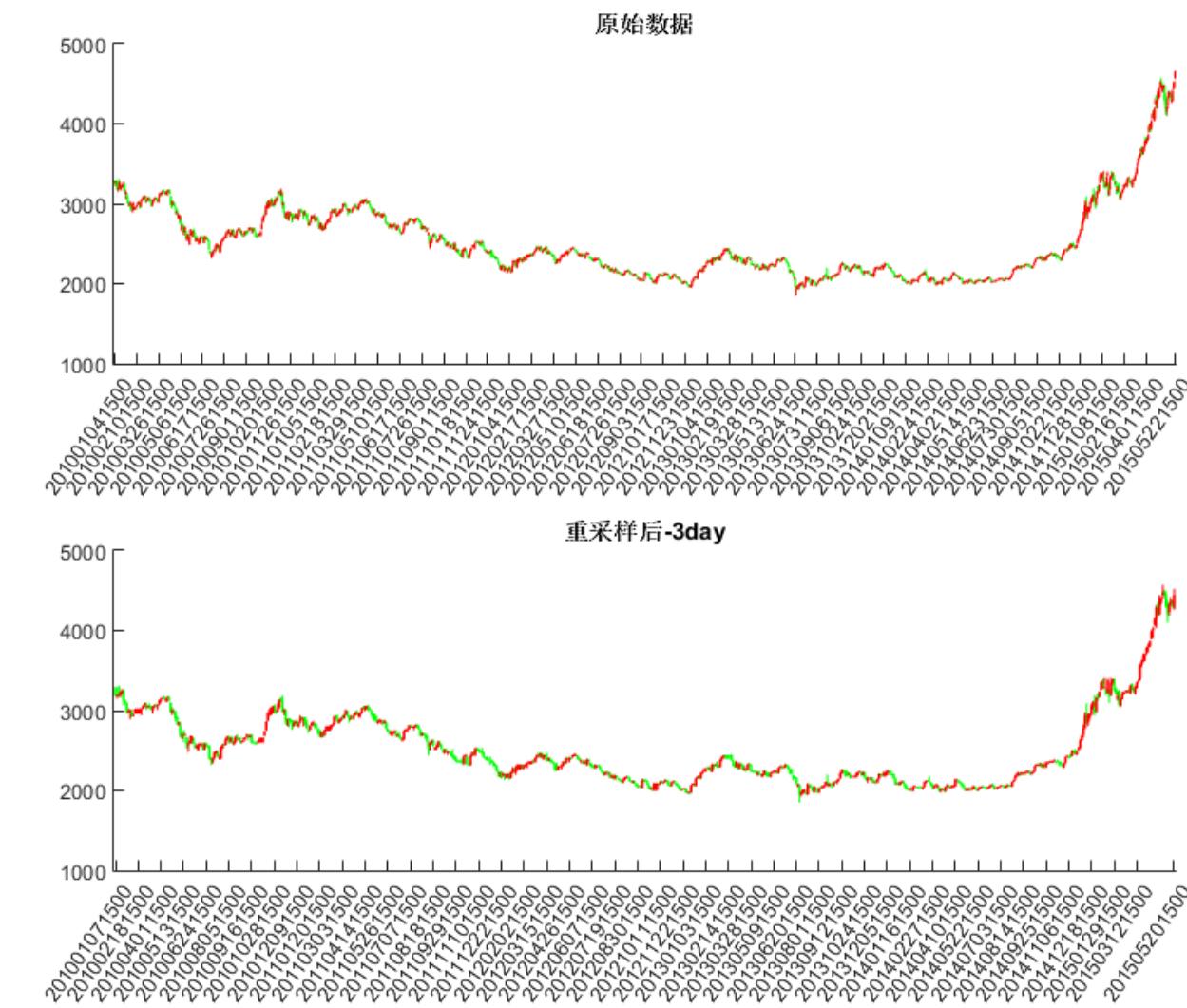
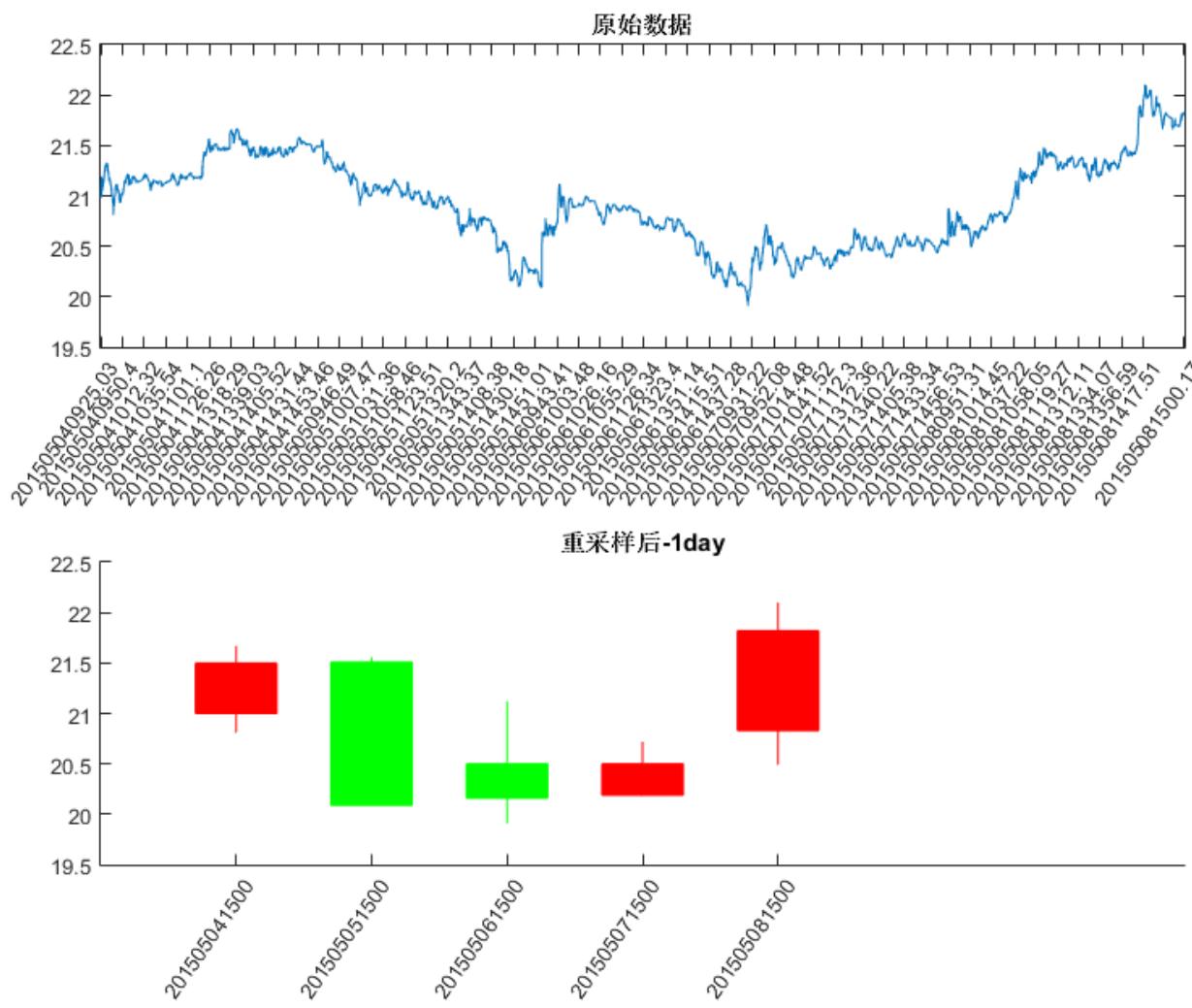
DResample.Fre = '1year';
DResample.HowMethod = 'OHLCVA2OHLCVA';

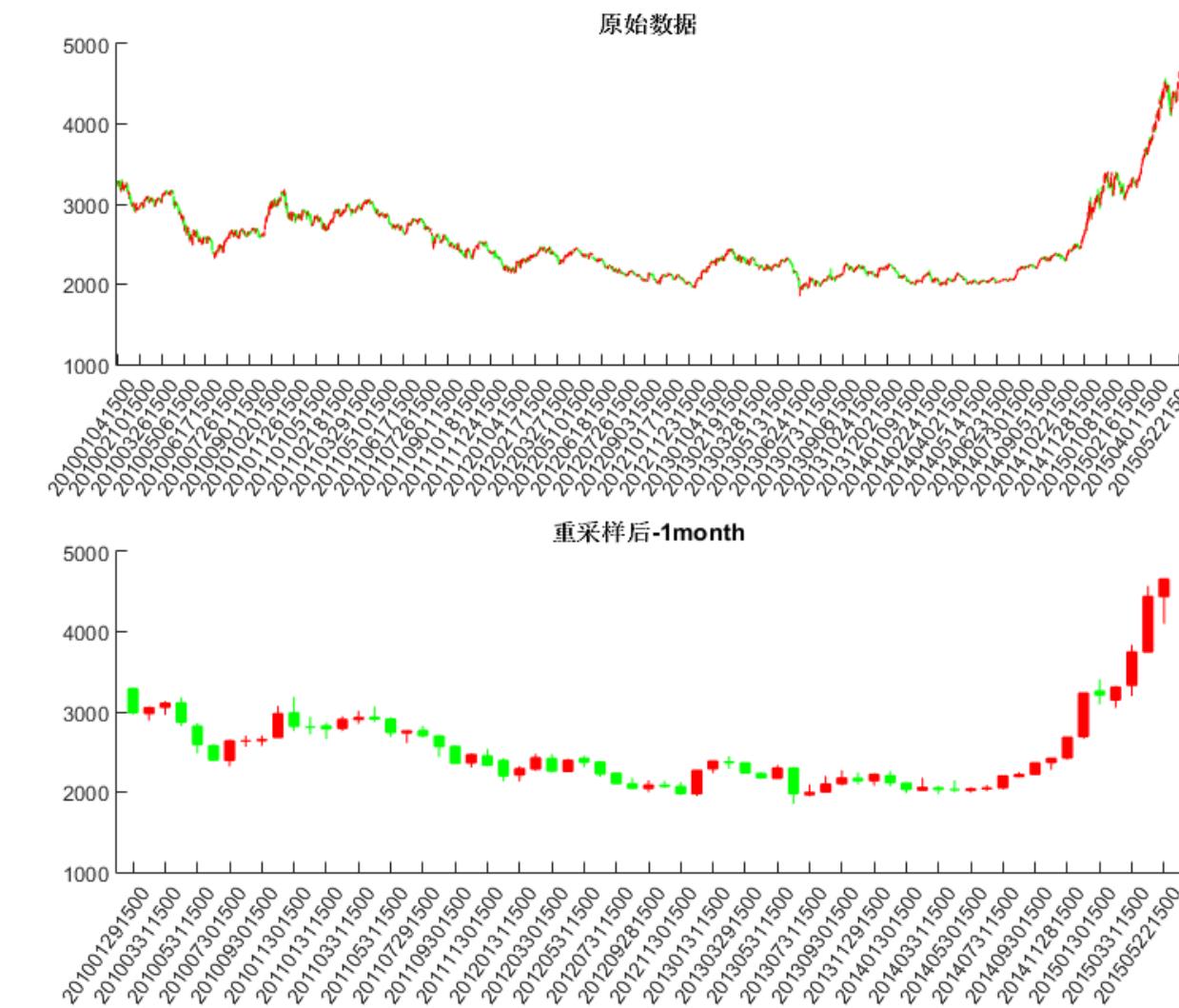
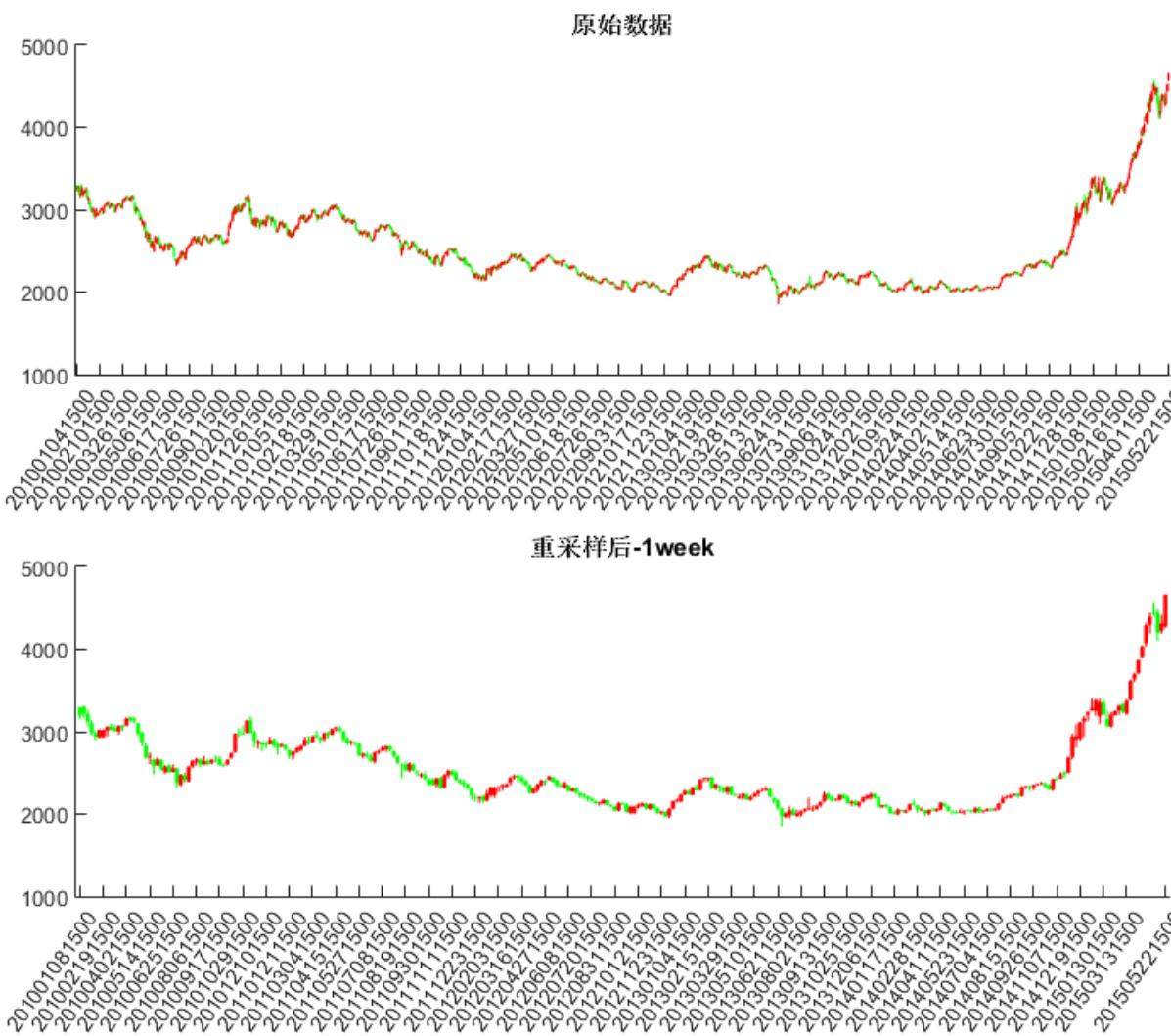
OutputData1 = DResample.Resample(InputData);
```

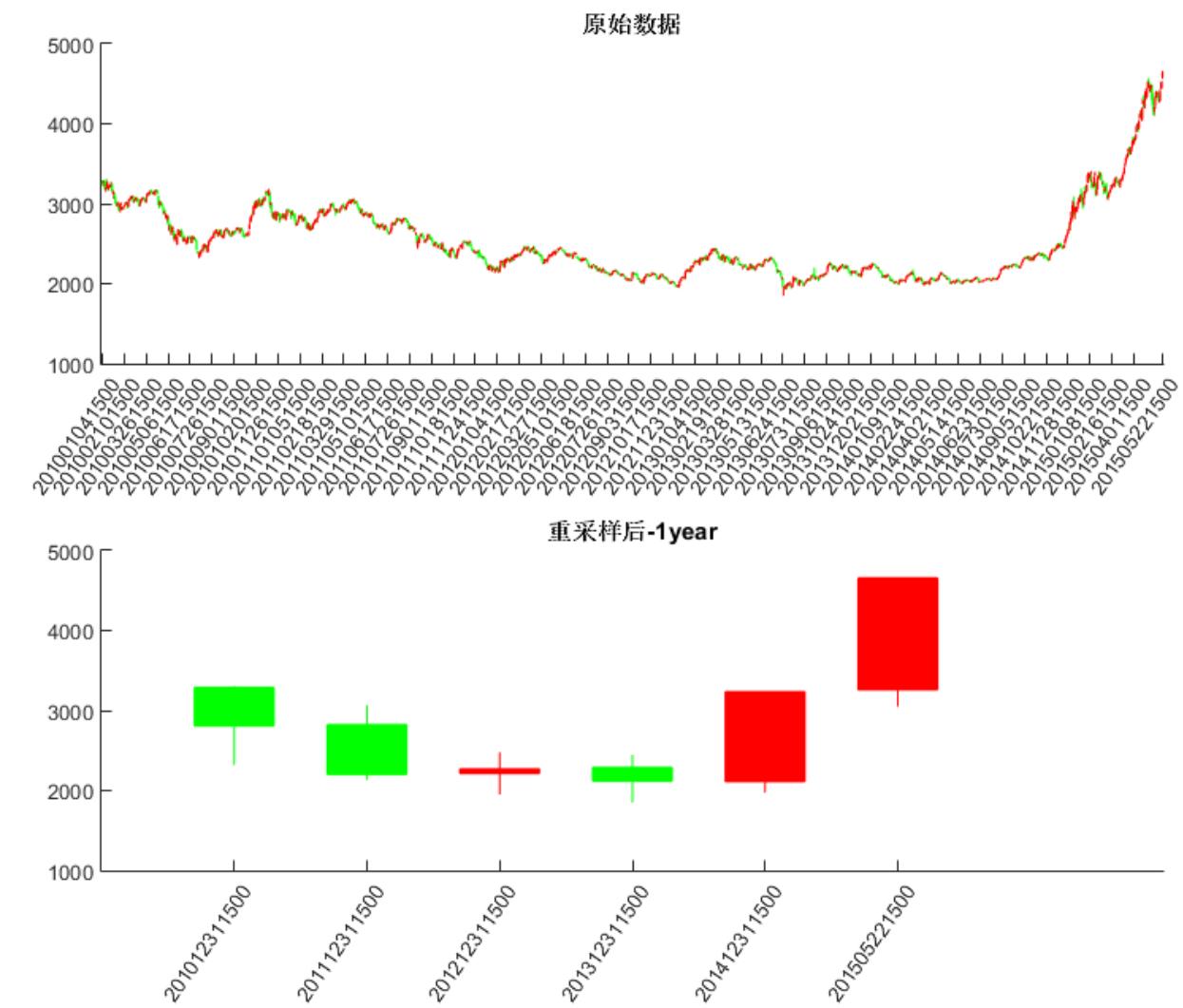
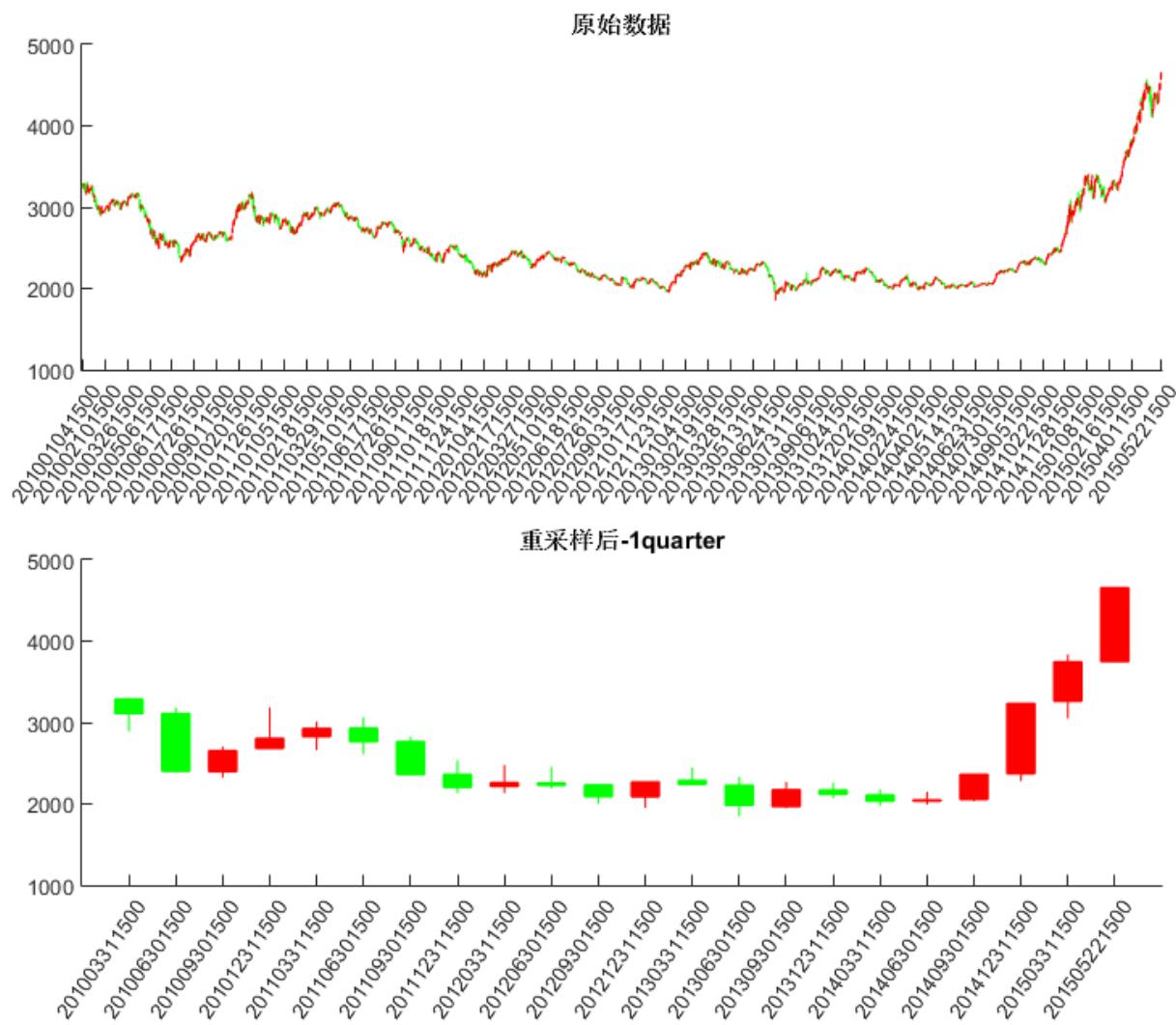












历史数据-交易所相关指数日线数据

```
% 函数名称 : GetIndexTSDay_Web
% 函数作用 : 获取上海证券交易所和深圳证券交易所相关指数日线数据
% 函数句柄 : [Data] = GetIndexTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate )
% 函数说明 : 从相关网络上抓取相关数据。
% 测试样例 :
% %% 获取指数数据
% StockCode = '000001';
% StockCode = '000300';
% BeginDate = '20140101';
% EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');
%
% [Data] = GetIndexTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);

% 运行结果 :
% 运行后返回的Data为StockCode指定的指数的日线数据 (抬头为日期、开、高、低、收、量、额) 如下 :
```

Data X

245x7 double

	1	2	3	4	5	6	7
212	20141114 2569.2110...	2581.9320...	2557.6660...	2581.0930...	165049968...	145409933...	
213	20141117 2613.5130...	2614.0860...	2565.9430...	2567.1010...	158478096...	147724648...	
214	20141118 2565.2730...	2570.2110...	2534.9270...	2541.4160...	142941360...	124246646...	
215	20141119 2538.2330...	2550.5000...	2531.3180...	2537.2230...	122146976...	113031725...	
216	20141120 2528.7800...	2545.4730...	2522.8360...	2537.0990...	106149864...	981455421...	
217	20141121 2537.5380...	2585.3620...	2530.0320...	2583.4550...	151028144...	143750807...	
218	20141124 2614.1600...	2667.6710...	2602.9440...	2649.2580...	279839712...	264974909...	
219	20141125 2650.0850...	2686.0630...	2643.8430...	2685.5610...	222611696...	206879211...	
220	20141126 2695.2830...	2723.3600...	2690.3100...	2723.0180...	243962480...	239333900...	
221	20141127 2737.0300...	2754.4900...	2718.7040...	2754.4900...	265464736...	261164875...	
222	20141128 2753.9250...	2809.5430...	2740.3740...	2808.8190...	375323648...	330256023...	
223	20141201 2825.6110...	2855.3320...	2808.6530...	2819.8120...	365487424...	338833080...	
224	20141202 2807.3380...	2944.5060...	2804.2930...	2923.9400...	361465312...	341185200...	
225	20141203 2936.1240...	3028.2250...	2912.2460...	2967.5490...	466156672...	464857497...	
226	20141204 2975.4030...	3104.8900...	2968.8760...	3104.3510...	426812928...	433875550...	
227	20141205 3143.9680...	3195.7980...	3011.9360...	3124.8850...	524881248...	554362929...	
228	20141208 3108.2720...	3270.8810...	3075.7000...	3252.8810...	484462336...	515773693...	
229	20141209 3233.0970...	3387.8270...	3074.5160...	3106.9130...	632874560...	702150082...	
230	20141210 3120.2120...	3229.0470...	3058.1910...	3221.5460...	425018720...	477300097...	
231	20141211 3185.1610...	3254.4240...	3158.4430...	3183.0120...	367091680...	392944844...	
232	20141212 3182.9230...	3239.4470...	3167.9280...	3193.2270...	301065312...	337817436...	
233	20141215 3176.8290...	3226.2210...	3143.2970...	3217.2280...	290193824...	326668025...	
234	20141216 3221.3580...	3303.4020...	3207.6880...	3303.4020...	358123840...	425665724...	
235	20141217 3325.8200...	3368.1940...	3275.7360...	3360.5980...	448140768...	527748923...	
236	20141218 3359.0900...	3393.7110...	3322.2290...	3345.9270...	355970208...	416260456...	
237	20141219 3345.6290...	3397.1830...	3280.9160...	3383.1670...	411211584...	435516866...	
238	20141222 3396.2510...	3455.2070...	3357.6610...	3394.4810...	549801664...	537021087...	
239	20141223 3358.7980...	3431.7790...	3316.9130...	3324.9240...	369736096...	377227771...	
240	20141224 3332.1460...	3340.3570...	3188.4950...	3230.3850...	317449600...	339475791...	
241	20141225 3254.4800...	3335.7790...	3226.3220...	3335.4190...	309799552...	330128949...	
242	20141226 3343.6400...	3453.3380...	3335.0120...	3445.8390...	384614112...	438838427...	
243	20141229 3502.1830...	3524.2800...	3405.8360...	3455.4550...	425015040...	505004523...	
244	20141230 3450.8140...	3491.8260...	3422.1740...	3457.5540...	328233888...	394607788...	
245	20141231 3462.3890...	3542.3400...	3452.4980...	3533.7050...	345934752...	403710902...	[

```
% 相应的批量数据获取和保存函数为
% [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveIndexTSDay(IndexList)
% 首次运行后就会在本地DataBase\Stock\Index_Day_mat保存全部上海证券交易所和深圳证券交易所相关指数日线数据，如下：
```

sh000001_D.mat	sh000033_D.mat	sh000063_D.mat	sh000103_D.mat	sh000135_D.mat	sh000811_D.mat	sh000846_D.mat	sh000924_D.mat	sh000954_D.mat	sh000984_D.mat	sz3
sh000002_D.mat	sh000034_D.mat	sh000064_D.mat	sh000104_D.mat	sh000136_D.mat	sh000812_D.mat	sh000847_D.mat	sh000925_D.mat	sh000955_D.mat	sh000985_D.mat	sz3
sh000003_D.mat	sh000035_D.mat	sh000065_D.mat	sh000105_D.mat	sh000137_D.mat	sh000813_D.mat	sh000849_D.mat	sh000926_D.mat	sh000956_D.mat	sh000986_D.mat	sz3
sh000004_D.mat	sh000036_D.mat	sh000066_D.mat	sh000106_D.mat	sh000138_D.mat	sh000814_D.mat	sh000850_D.mat	sh000927_D.mat	sh000957_D.mat	sh000987_D.mat	sz3
sh000005_D.mat	sh000037_D.mat	sh000067_D.mat	sh000107_D.mat	sh000139_D.mat	sh000815_D.mat	sh000851_D.mat	sh000928_D.mat	sh000958_D.mat	sh000988_D.mat	sz3
sh000006_D.mat	sh000038_D.mat	sh000068_D.mat	sh000108_D.mat	sh000141_D.mat	sh000816_D.mat	sh000852_D.mat	sh000929_D.mat	sh000959_D.mat	sh000989_D.mat	sz3
sh000007_D.mat	sh000039_D.mat	sh000069_D.mat	sh000109_D.mat	sh000142_D.mat	sh000817_D.mat	sh000855_D.mat	sh000930_D.mat	sh000960_D.mat	sh000990_D.mat	sz3
sh000008_D.mat	sh000040_D.mat	sh000070_D.mat	sh000110_D.mat	sh000145_D.mat	sh000818_D.mat	sh000856_D.mat	sh000931_D.mat	sh000961_D.mat	sh000991_D.mat	sz3
sh000009_D.mat	sh000041_D.mat	sh000071_D.mat	sh000111_D.mat	sh000146_D.mat	sh000819_D.mat	sh000857_D.mat	sh000932_D.mat	sh000962_D.mat	sh000992_D.mat	sz3
sh000010_D.mat	sh000042_D.mat	sh000072_D.mat	sh000112_D.mat	sh000147_D.mat	sh000820_D.mat	sh000858_D.mat	sh000933_D.mat	sh000963_D.mat	sh000993_D.mat	sz3
sh000011_D.mat	sh000043_D.mat	sh000073_D.mat	sh000113_D.mat	sh000148_D.mat	sh000821_D.mat	sh000859_D.mat	sh000934_D.mat	sh000964_D.mat	sh000994_D.mat	sz3
sh000012_D.mat	sh000044_D.mat	sh000074_D.mat	sh000114_D.mat	sh000149_D.mat	sh000822_D.mat	sh000860_D.mat	sh000935_D.mat	sh000965_D.mat	sh000995_D.mat	sz3
sh000013_D.mat	sh000045_D.mat	sh000075_D.mat	sh000115_D.mat	sh000150_D.mat	sh000823_D.mat	sh000861_D.mat	sh000936_D.mat	sh000966_D.mat	sh000996_D.mat	sz3
sh000015_D.mat	sh000046_D.mat	sh000076_D.mat	sh000116_D.mat	sh000151_D.mat	sh000824_D.mat	sh000862_D.mat	sh000937_D.mat	sh000967_D.mat	sh000997_D.mat	sz3
sh000016_D.mat	sh000047_D.mat	sh000077_D.mat	sh000117_D.mat	sh000152_D.mat	sh000825_D.mat	sh000863_D.mat	sh000938_D.mat	sh000968_D.mat	sh000998_D.mat	sz3
sh000017_D.mat	sh000048_D.mat	sh000078_D.mat	sh000118_D.mat	sh000153_D.mat	sh000826_D.mat	sh000864_D.mat	sh000939_D.mat	sh000969_D.mat	sh000999_D.mat	sz3
sh000018_D.mat	sh000049_D.mat	sh000079_D.mat	sh000119_D.mat	sh000155_D.mat	sh000827_D.mat	sh000865_D.mat	sh000940_D.mat	sh000970_D.mat	sz399001_D.mat	sz3
sh000019_D.mat	sh000050_D.mat	sh000090_D.mat	sh000120_D.mat	sh000158_D.mat	sh000828_D.mat	sh000866_D.mat	sh000941_D.mat	sh000971_D.mat	sz399002_D.mat	sz3
sh000020_D.mat	sh000051_D.mat	sh000091_D.mat	sh000121_D.mat	sh000159_D.mat	sh000829_D.mat	sh000867_D.mat	sh000942_D.mat	sh000972_D.mat	sz399003_D.mat	sz3
sh000021_D.mat	sh000052_D.mat	sh000092_D.mat	sh000122_D.mat	sh000160_D.mat	sh000830_D.mat	sh000868_D.mat	sh000943_D.mat	sh000973_D.mat	sz399004_D.mat	sz3
sh000022_D.mat	sh000053_D.mat	sh000093_D.mat	sh000123_D.mat	sh000161_D.mat	sh000831_D.mat	sh000869_D.mat	sh000944_D.mat	sh000974_D.mat	sz399005_D.mat	sz3
sh000023_D.mat	sh000054_D.mat	sh000094_D.mat	sh000125_D.mat	sh000162_D.mat	sh000832_D.mat	sh000870_D.mat	sh000945_D.mat	sh000975_D.mat	sz399006_D.mat	sz3
sh000025_D.mat	sh000055_D.mat	sh000095_D.mat	sh000126_D.mat	sh000163_D.mat	sh000833_D.mat	sh000871_D.mat	sh000946_D.mat	sh000976_D.mat	sz399007_D.mat	sz3
sh000026_D.mat	sh000056_D.mat	sh000096_D.mat	sh000128_D.mat	sh000164_D.mat	sh000834_D.mat	sh000872_D.mat	sh000947_D.mat	sh000977_D.mat	sz399008_D.mat	sz3
sh000027_D.mat	sh000057_D.mat	sh000097_D.mat	sh000129_D.mat	sh000165_D.mat	sh000835_D.mat	sh000873_D.mat	sh000948_D.mat	sh000978_D.mat	sz399009_D.mat	sz3
sh000028_D.mat	sh000058_D.mat	sh000098_D.mat	sh000130_D.mat	sh000166_D.mat	sh000836_D.mat	sh000874_D.mat	sh000949_D.mat	sh000979_D.mat	sz399010_D.mat	sz3
sh000029_D.mat	sh000059_D.mat	sh000099_D.mat	sh000131_D.mat	sh000167_D.mat	sh000837_D.mat	sh000875_D.mat	sh000950_D.mat	sh000980_D.mat	sz399011_D.mat	sz3
sh000030_D.mat	sh000060_D.mat	sh000100_D.mat	sh000132_D.mat	sh000168_D.mat	sh000838_D.mat	sh000876_D.mat	sh000951_D.mat	sh000981_D.mat	sz399012_D.mat	sz3
sh000031_D.mat	sh000061_D.mat	sh000101_D.mat	sh000133_D.mat	sh000169_D.mat	sh000839_D.mat	sh000877_D.mat	sh000952_D.mat	sh000982_D.mat	sz399013_D.mat	sz3
sh000032_D.mat	sh000062_D.mat	sh000102_D.mat	sh000134_D.mat	sh000170_D.mat	sh000840_D.mat	sh000878_D.mat	sh000953_D.mat	sh000983_D.mat	sz399014_D.mat	sz3

历史数据-获取基金数据 (历史净值、基金概况、申购赎回、十大持有人)

```
% 类名 : fGetFund
% 属性 :
% Code 数据代码, 默认为'510050'
% StartDate 起始日期(比如'20150101'), 如果输入为'All', 则获取全部数据
% EndDatae 终止日期(比如'20150501'), 如果输入为'All', 则获取全部数据
% isSave 是否保存获取的数据至本地

% 方法 :
% GetNetValue 获取单位净值和累计净值
% GetFundShareChg 获取申购赎回数据
% GetFundProfile 获取基金概况
% GetFundHolder 获取基金十大持有人数据
```

% 测试样例 :

历史数据-获取基金数据-历史净值

```
GetFund = fGetFund();

GetFund.Code = '510050';
GetFund.StartDate = '20150101';
GetFund.EndDate = datestr(today,'yyyymmdd');
GetFund.isSave = 1;

tic;
[OutputData,Headers] = GetFund.GetNetValue();
toc;

format longG
Headers
OutputData(1:5,:);
disp('... ...');
OutputData(end-5:end,:)
```

510050.OF数据已保存至./DataBaseTemp/Fund/510050.OF_20150101-20150531.xlsx
Elapsed time is 5.407334 seconds.

Headers =

```
'日期' '单位净值(元)' '累计净值(元)'  
ans =  
20150105 2.611 3.436  
20150106 2.589 3.409  
20150107 2.59 3.411  
20150108 2.513 3.319  
20150109 2.522 3.33  
... ...  
ans =  
20150522 3.197 4.129  
20150525 3.292 4.242  
20150526 3.326 4.282  
20150527 3.29 4.239  
20150528 3.08 3.991  
20150529 3.067 3.975
```

历史数据-获取基金数据-基金概况

```
GetFund = fGetFund();  
  
GetFund.Code = '510050';  
GetFund.StartDate = '20150101';  
GetFund.EndDate = datestr(today,'yyyymmdd');  
GetFund.isSave = 1;  
  
tic;  
[OutputData] = GetFund.GetFundProfile();  
toc;  
  
OutputData
```

Elapsed time is 0.318093 seconds.

```
OutputData =  
Column 1  
'基金概况'  
'基金全称'  
'基金简称'  
'成立日期'  
'存续期限(年)'  
'基金总份额(亿份)'  
'基金规模(亿元)'  
'基金管理人'  
'基金经理'  
'基金类型'  
'代销机构'  
'最低参与金额(元)'  
'投资目标'  
'基金比较基准'  
'投资范围'  
'风险收益特征'  
'收益分配原则'  
Column 2
```

```
['上证50交易型开放式指数证券投资基金'  
'华夏上证50ETF'  
'2004/12/30'  
'--'  
'105.266 (2015/3/31)'  
'322.85 (2015/3/31)'  
'华夏基金管理有限公司'  
'方军'  
'股票型'  
'银行(共0家)'
```

```
['紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。'  
'上证50指数'  
'本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。  
'本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证50指数,是股票基金中风险较...' [1x263 char]
```

Columns 3 through 4

```

[] []
[] []
'基金代码'      '510050'
'上市日期'      '--'
'上市地点'      '--'
'上市流通份额(亿份)'  '105.266 (2015/3/31)'
'选股风格'      '大盘' '价值型(2015年1季)'
'基金托管人'    '中国工商银行股份有限公司'
'运作方式'      '开放式'
'二级分类'      '指数型'
'代销机构'      '证券(共34家)'
'最低赎回份额(份)'  []
[] []
[] []
[] []
[] []
[] []

```

历史数据-获取基金数据-申购赎回

```

GetFund = fGetFund();

GetFund.Code = '510050';
GetFund.StartDate = 'All';
GetFund.EndDate = datestr(today,'yyymmdd');
GetFund.isSave = 1;

tic;
[OutputData,Headers] = GetFund.GetFundShareChg();
toc;

format longG
Headers
OutputData(1:5,:);
disp('... ...');
OutputData(end-5:end,:)

```

510050.OF_FundshareChg数据已保存至./DataBaseTemp/Fund/510050.OF_FundshareChg_-(1).xlsx
Elapsed time is 5.368680 seconds.

```

Headers =
'报告期'  '期初总份额(份)'  '期末总份额(份)'  '期间总申购份额(份)'  '期间总赎回份额(份)'

ans =
Columns 1 through 3
20050331      5435330000      6493570000
20050630      6493570000      9012570000
20050630      5435330000      9012570000
20050930      9012570000      6914570000
20051231      6914570000      8111570000
Columns 4 through 5
2584240000      1526000000
4511000000      1992000000
6096000000      3518000000
3325000000      5423000000
5798000000      4601000000
...
ans =
Columns 1 through 3
20140630      13942600000      14128600000
20140630      13485600000      14128600000
20140930      14128600000      11057600000
20141231      11057600000      10155600000
20141231      13485600000      10155600000
20150331      10155600000      10526600000
Columns 4 through 5
4560000000      4374000000
10203000000      9560000000
4180000000      7251000000
17251000000      18153000000
31634000000      34964000000
28537000000      28166000000

```

历史数据-获取基金数据-十大持有人

```
GetFund = fGetFund();
```

```

GetFund.Code = '510050';
GetFund.StartDate = 'All';
GetFund.EndDate = datestr(today,'yyyymmdd');
GetFund.isSave = 1;

tic;
[OutputData,Headers] = GetFund.GetFundHolder();
toc;

OutputData

OutputData{2,1}
tData = OutputData{2,2};
for i = 1:length(tData)
    str = [tData{i,1},',',num2str(tData{i,2}),',',num2str(tData{i,3})];
    disp(str);
end

```

Elapsed time is 18.291642 seconds.

```

OutputData =
'报告期'      '十大持有人'
'2005-02-16'  {11x3 cell}
'2009-12-31'  {11x3 cell}
'2010-06-30'  {11x3 cell}
'2010-12-31'  {11x3 cell}
'2011-06-30'  {11x3 cell}
'2011-12-31'  {11x3 cell}
'2012-06-30'  {11x3 cell}
'2012-12-31'  {11x3 cell}
'2013-06-30'  {11x3 cell}
'2013-12-31'  {11x3 cell}
'2014-06-30'  {11x3 cell}
'2014-12-31'  {11x3 cell}

ans =
2005-02-16
持有人名称 持有份额(份) 占总份额比(%)
华泰证券有限责任公司
224930000 3.5
海通证券股份有限公司
185175000 2.88
中信证券股份有限公司
181062000 2.8139
河南财政证券公司
162200000 2.52
上海东方航空产权经纪公司
154348000 2.4
中国人寿资产管理有限公司(受托股份公司分红账户)
118416000 1.84
东航集团财务有限责任公司
95174100 1.48
长江证券有限责任公司
67451100 1.05
上海申能创业投资有限公司
57771400 0.9
金元证券有限责任公司
50688300 0.79

```

历史数据-期货合约日线数据

```

% 函数名称 : GetFutureDay_Web
% 函数作用 : 获取某日期货合约日线数据
% 函数句柄 :
% [DataCell,StatusOut] = GetFutureDay_Web(DateStr, MarketCode,FuturesCode)
% 函数说明 : 从各期货交易所 , 比如中金所
% http://www.cffex.com.cn/fzjy/mrhq/
% 获取某日所期货合约日线数据。
% DateStr为输入的日期 , 比如DateStr = '20141215';
% MarketCode为交易所代码 , 比如MarketCode = 'CFFEX'; ( SHFE、DCE、CZCE )
% FuturesCode为期货品种代码 , 比如FuturesCode = 'IF';
%
% DataCell为返回的数据
% 测试样例 :
% %% 获取期货某交易所某日数据-中金所-IF
% DateStr = '20141216';

```

```
% MarketCode = 'CFFEX';
% FuturesCode = 'IF';
% [DataCell,StatusOut] = GetFutureDay_Web(DateStr, MarketCode,FuturesCode);
% 运行结果：
% DataCell返回当日的IF的所有合约的日数据，如下
```

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
1	productid	instrumentid	tradingday	openprice	highestprice	lowestprice	closeprice	openinterest	settlement...	presettlem...	volume	turnover
2	IF	IF1412	20141216	3236.2	3332.8	3235.0	3322.8	80765.0	3301.0	3246.8	1287895	1.2656973...
3	IF	IF1501	20141216	3291.6	3390.6	3283.0	3384.0	104753.0	3359.4	3291.6	496487	4.9627841...
4	IF	IF1503	20141216	3331.2	3448.0	3323.0	3441.2	37982.0	3412.2	3331.2	79302	8.0392016...
5	IF	IF1506	20141216	3347.6	3464.0	3342.2	3460.0	15274.0	3426.8	3347.0	23172	2.3595576...

```
% 相应的批量数据获取和保存函数为
% [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveFuturesDay(MarketCode,FutureCode,DateList)首次运行后就会在本地DataBase\Futures下的相应合约代码下的文件夹,
% 比如DataBase\Futures\IF\Day_mat 存贮一个IF_Day.mat文件,保存IF从上市日至今所有合约的日线数据,如下:
```

4513x12 cell

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
1	productid	instrumentid	tradingday	openprice	highestprice	lowestprice	closeprice	openinterest	settlement...	presettlem...	volume	turnover
2	IF	IF1005	20100416	3450.0	3488.0	3413.2	3415.6	2702.0	3431.2	3399.0	48988	5.0538805...
3	IF	IF1006	20100416	3470.0	3517.6	3440.0	3441.6	404.0	3456.2	3399.0	4908	5.1157644...
4	IF	IF1009	20100416	3600.0	3647.8	3505.4	3512.0	182.0	3520.4	3399.0	1730	1.8404976...
5	IF	IF1012	20100416	3618.8	3669.0	3551.2	3557.0	302.0	3565.4	3399.0	2831	3.0426053...
6	IF	IF1005	20100419	3396.0	3398.0	3166.2	3197.4	3954.0	3201.2	3431.2	109733	1.0820641...
7	IF	IF1006	20100419	3420.0	3420.0	3195.2	3218.0	580.0	3223.0	3456.2	8093	8.0415397...
8	IF	IF1009	20100419	3482.2	3482.2	3256.8	3262.0	299.0	3283.6	3520.4	2471	2.5029577...
9	IF	IF1012	20100419	3531.2	3532.0	3308.8	3320.0	287.0	3335.8	3565.4	3315	3.4116119...
10	IF	IF1005	20100420	3209.2	3240.0	3168.8	3214.6	4496.0	3216.6	3201.2	141862	1.3634209...
11	IF	IF1006	20100420	3227.2	3261.0	3198.0	3241.4	615.0	3242.6	3223.0	8005	7.7581114...
12	IF	IF1009	20100420	3268.0	3323.0	3245.2	3292.0	317.0	3292.0	3283.6	1979	1.9487904...
13	IF	IF1012	20100420	3332.2	3370.0	3315.8	3353.0	322.0	3352.2	3335.8	1573	1.5756011...
14	IF	IF1005	20100421	3215.0	3281.2	3208.0	3267.2	5062.0	3266.0	3216.6	114531	1.1126789...
15	IF	IF1006	20100421	3244.2	3307.8	3237.0	3292.8	634.0	3294.0	3242.6	4678	4.5835304...
16	IF	IF1009	20100421	3299.0	3360.4	3276.0	3348.0	260.0	3345.4	3292.0	752	7.4825022...
17	IF	IF1012	20100421	3364.0	3420.0	3351.0	3409.0	363.0	3407.4	3352.2	1062	1.0767371...
18	IF	IF1005	20100422	3260.2	3274.4	3211.0	3236.2	5383.0	3240.0	3266.0	133247	1.2962980...
19	IF	IF1006	20100422	3295.0	3304.2	3244.6	3266.8	653.0	3268.8	3294.0	5281	5.1828640...
20	IF	IF1009	20100422	3345.4	3353.0	3290.2	3316.0	311.0	3320.2	3345.4	932	9.289458E8
21	IF	IF1012	20100422	3404.8	3414.8	3359.4	3387.4	369.0	3388.4	3407.4	847	8.6115654...
22	IF	IF1005	20100423	3241.0	3266.0	3221.0	3221.2	5808.0	3235.6	3240.0	116981	1.1388681...
23	IF	IF1006	20100423	3266.0	3292.6	3254.0	3255.0	720.0	3267.0	3268.0	2607	2.6227200...

% 相应的单独一个合约的日线数据，做一下提取再处理即可，然后可以再进行主力连续合约、次主力连续合约的生成等一系列的期货连续数据的生成和清洗。

历史数据-期货合约每日结算会员成交持仓排名数据

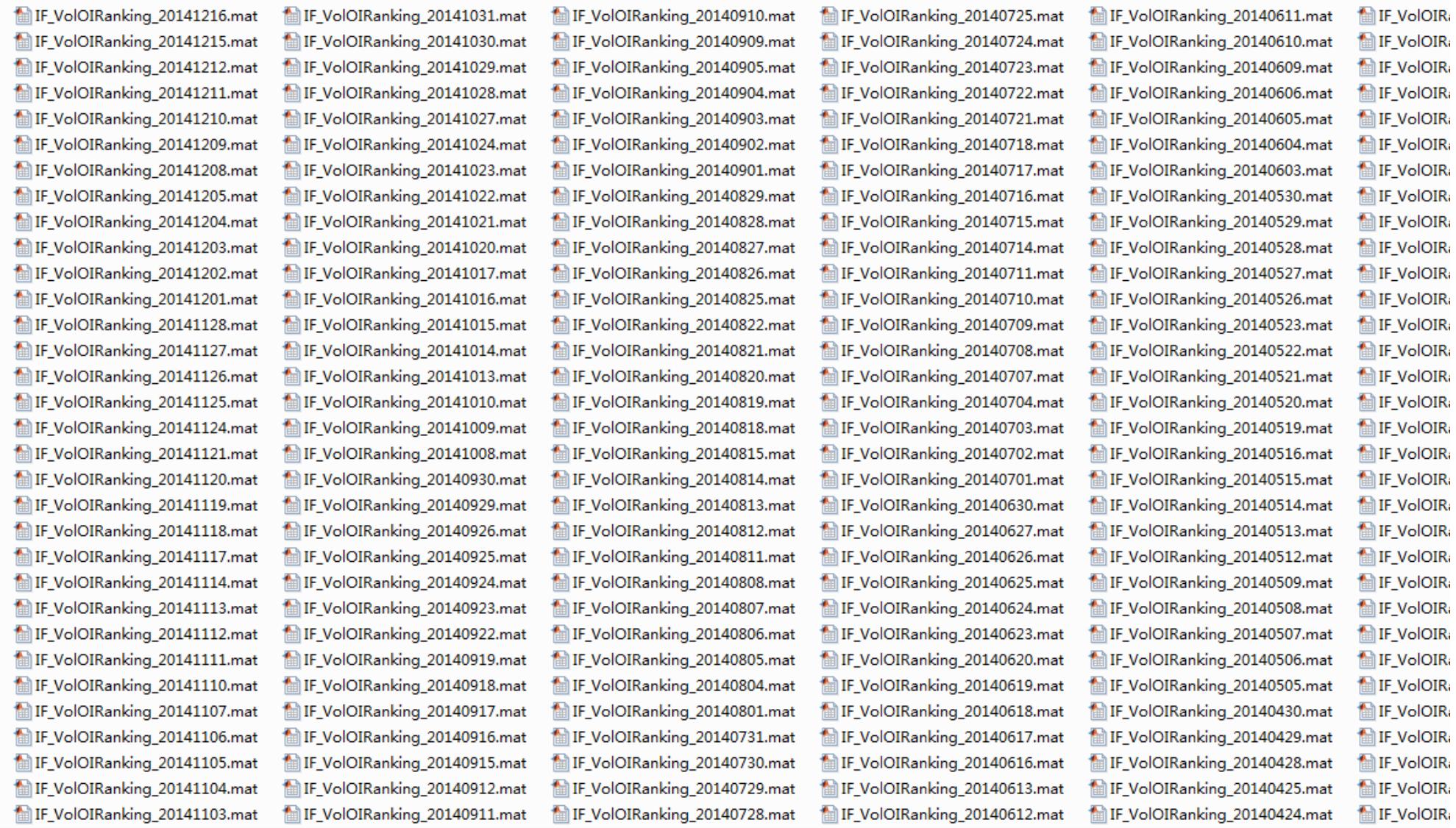
```
% 函数名称：GetFutureVolOIRanking_Web.m
% 函数作用：获取期货合约每日结算会员成交持仓排名数据
% 函数句柄：[DataCell,StatusOut] = GetFutureVolOIRanking_Web(DateStr, FutureCode)
% 函数说明：从各期货交易所，比如中金所
% http://www.cffex.com.cn/fzjy/ccpm/
% 获取期货合约每日结算会员成交持仓排名数据。
% 测试样例：
% %% 获取期货结算会员成交持仓排名数据-IF
% tic
% DateStr = '20141216';
% Futurecode = 'if';
% [DataCell,StatusOut] = GetFutureVolOIRanking_Web(DateStr, Futurecode);
% toc
% 运行结果：
% 运行后DataCell返回当日相关品种各个合约的结算会员成交持仓排名，如下：
```

DataCell{1, 1}									
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1 'IF1412-20141216'	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2 []	'成交量排名'	0	0	'持买单量排名'	0	0	'持卖单量排名'	0	0
3 '名次'	'会员简称'	'成交量'	'比上交易...'	'会员简称'	'持买单量'	'比上交易日...'	'会员简称'	'持卖单量'	'比上交易日增减'
4 1	'海通期货-0...	212313	40162	'中信期货-0018'	7281	-1290	'中信期货-0...	8178	-1974
5 2	'光大期货-0...	133263	16075	'国泰君安-0001'	6823	-2785	'国泰君安-0...	7819	26
6 3	'南华期货-0...	127607	20155	'银河期货-0109'	5279	-662	'银河期货-0...	5357	-1224
7 4	'国泰君安-0...	125261	19645	'方正中期-0167'	4711	-21	'海通期货-0...	5048	-1053
8 5	'兴证期货-0...	105688	15368	'上海东证-0156'	3663	100	'广发期货-0...	4237	-2268
9 6	'华泰长城-0...	103471	12015	'光大期货-0007'	3091	-3152	'华泰长城-0...	3752	-1428
10 7	'申银万国-0...	95958	16058	'海通期货-0133'	3009	-2402	'招商期货-0...	3300	-535
11 8	'中信期货-0...	94598	18394	'华泰长城-0011'	2663	135	'财富期货-0...	3180	-2248
12 9	'招商期货-0...	89453	7196	'兴证期货-0102'	2579	-563	'鲁证期货-0...	3097	-473
13 10	'广发期货-0...	77866	15292	'申银万国-0131'	2502	-176	'南华期货-0...	2916	-977
14 11	'银河期货-0...	65436	14171	'中国国际-0159'	2502	-1533	'兴证期货-0...	2841	-1239
15 12	'上海东证-0...	60189	10862	'中辉期货-0190'	2383	18	'光大期货-0...	2409	-739
16 13	'方正中期-0...	59330	7567	'瑞达期货-0170'	2036	575	'中信建投-0...	2187	-351
17 14	'五矿期货-0...	57330	16007	'北京首创-0112'	2013	-78	'申银万国-0...	2108	-950
18 15	'瑞达期货-0...	54594	13511	'永安期货-0003'	2002	-2839	'方正中期-0...	2025	-649
19 16	'大有期货-0...	54000	17025	'浙商期货-0009'	1971	-1444	'国信期货-0...	1429	-368
20 17	'中信新际-0...	49767	5880	'鲁证期货-0006'	1868	-81	'永安期货-0...	1072	-1160
21 18	'华鑫期货-0...	47923	-3005	'长江期货-0116'	1841	-69	'国金期货-0...	940	-179
22 19	'鲁证期货-0...	41418	1609	'中粮期货-0010'	1736	-671	'金瑞期货-0...	933	-167
23 20	'国投瑞银-0...	40500	10501	'国投瑞银-01501'	1500	100	'上海东证-0...	010	421

DataCell{2, 1}									
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1 'IF1501-20141216'	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2 []	'成交量排名'	0	0	'持买单量排...'	0	0	'持卖单量排...'	0	0
3 '名次'	'会员简称'	'成交量'	'比上交易日...'	'会员简称'	'持买单量'	'比上交易日...'	'会员简称'	'持卖单量'	'比上交易日...'
4 1	'海通期货-0...	124933	75500	'中信期货-0...	13525	2194	'中信期货-0...	16259	1300
5 2	'华西期货-0...	75155	24628	'永安期货-0...	8971	-861	'海通期货-0...	11529	1246
6 3	'中信期货-0...	60424	15473	'海通期货-0...	6613	2049	'广发期货-0...	5991	-890
7 4	'招商期货-0...	45526	21886	'国泰君安-0...	5937	-577	'永安期货-0...	4950	1417
8 5	'国泰君安-0...	44691	23901	'浙商期货-0...	5259	1231	'华泰长城-0...	4549	413
9 6	'南华期货-0...	37018	15355	'光大期货-0...	3771	894	'申银万国-0...	3874	358
10 7	'申银万国-0...	31980	18121	'银河期货-0...	3641	517	'国泰君安-0...	3824	178
11 8	'光大期货-0...	29169	11675	'华泰长城-0...	2781	1719	'财富期货-0...	3787	1908
12 9	'华泰长城-0...	28260	21185	'宝城期货-0...	2500	811	'银河期货-0...	3402	913
13 10	'华鑫期货-0...	26527	13283	'申银万国-0...	2081	1160	'国金期货-0...	3274	35
14 11	'五矿期货-0...	24617	16898	'北京首创-0...	1991	203	'南华期货-0...	3113	702
15 12	'兴证期货-0...	22688	11629	'方正中期-0...	1885	-2599	'光大期货-0...	3085	389
16 13	'新湖期货-0...	22425	9273	'大地期货-0...	1785	93	'上海东证-0...	3040	66
17 14	'银河期货-0...	21340	9700	'中投天琪-0...	1750	1492	'国信期货-0...	2811	275
18 15	'永安期货-0...	19400	8442	'鲁证期货-0...	1685	282	'东吴期货-0...	2311	-23
19 16	'浙商期货-0...	18498	10312	'南华期货-0...	1589	390	'兴证期货-0...	2307	1399
20 17	'方正中期-0...	17771	9997	'锦泰期货-0...	1553	1486	'鲁证期货-0...	2217	302
21 18	'广发期货-0...	17554	9777	'东兴期货-0...	1522	-91	'东海期货-0...	1795	1054
22 19	'上海东证-0...	14788	7898	'一德期货-0...	1515	-501	'五矿期货-0...	1229	448
23 20	'国投瑞银-0...	14549	10449	'中国国贸-0...	1510	212	'国泰君安-0...	1194	100

```
% 相应的批量数据获取和保存函数为
% [SaveLog,DateListOut,ProbList,NewList]
% = SaveFuturesVolOIRankingData(FutureCode,DateList,UpdateFlag)
```

% 首次运行后就会在本地DataBase\Futures下的相应合约代码下的文件夹，比如DataBase\Futures\IF\VolOIRanking
% 存贮一个IF从上市日至今所有合约的结算会员的每日成交持仓排名数据，如下：



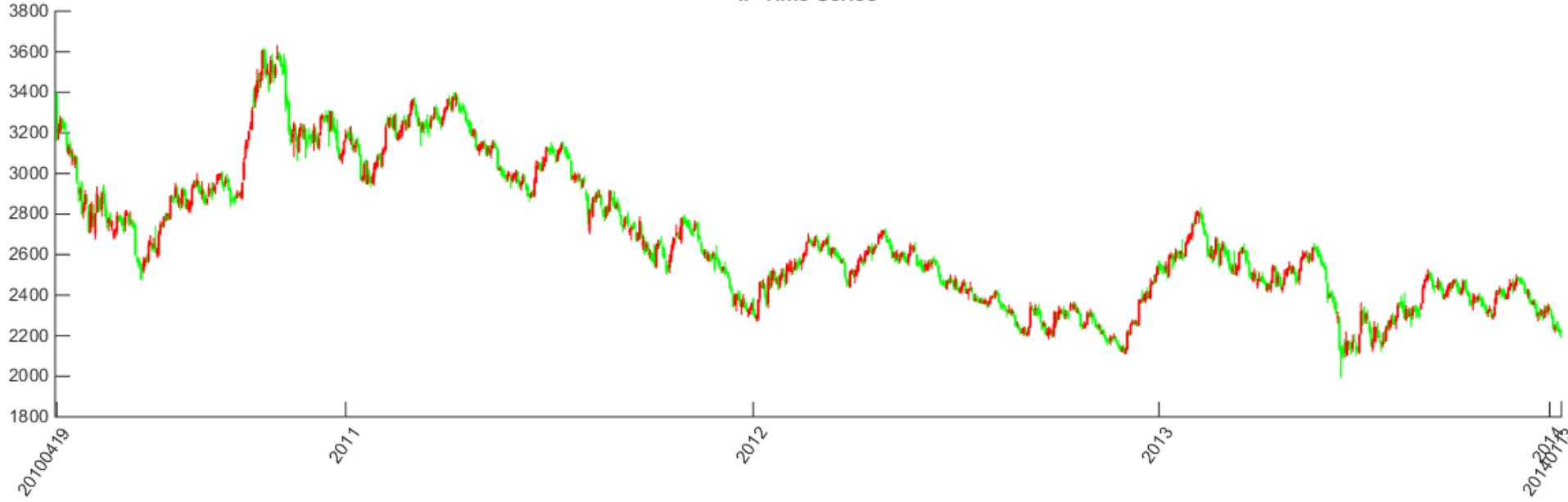
% 对于策略开发，或对这部分数据（期货合约每日结算会员成交持仓排名数据）这里多说一点，基于这部分数据可做的事情还是挺多的，比较有想象空间。使用这部分数据，

% 可以构造某种意义上的投资者情绪指标，一则可以构造开发CTA类策略（IF策略），二则可以用来开发对于HS300的择时策略。

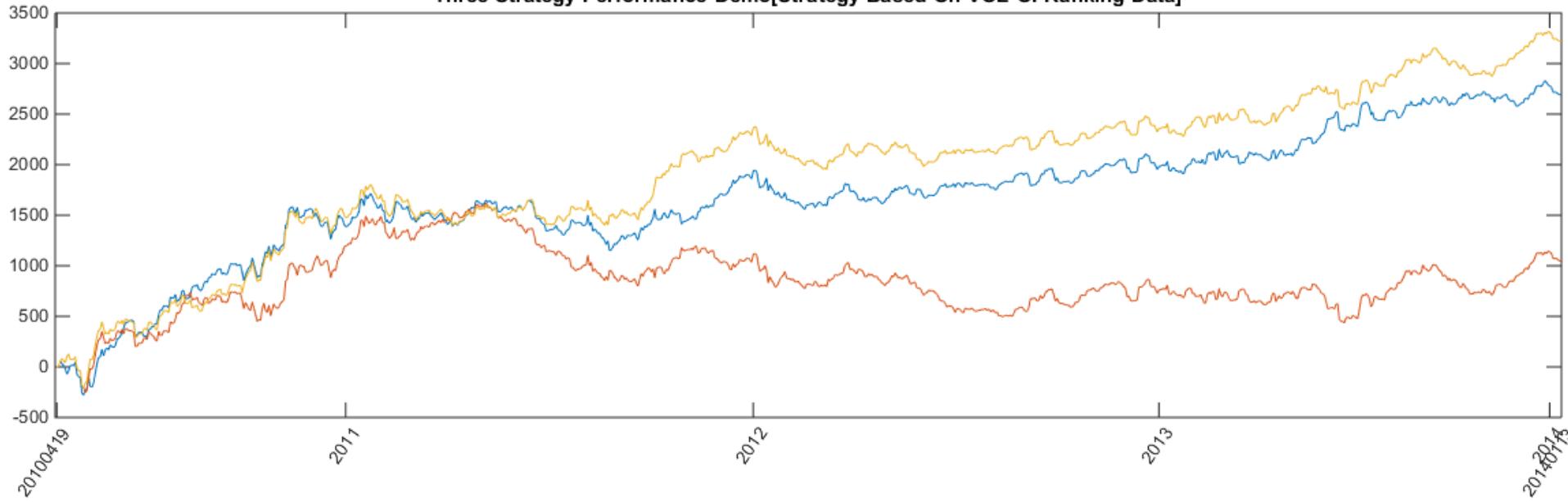
% 基于这部分数据开发的IF策略，会与普通的使用价量开发的策略有异构性，方便提升CTA大组合策略的异构性，平滑整体资金流，

% 下图是我以前做过的基于这部分数据构建的IF策略的一个Demo:

IF Time Series



Three Strategy Performance-Demo[Strategy Based On VOL-OI-Ranking Data]



% 基于这部分数据开发HS300择时策略的前提假设是，期货合约每日结算会员成交持仓排名数据带有某些机构对于未来IF走势的某些预判信息，进而某种程度上影响HS300，
% 也是有一定文章可做的。在此不做过多展开。

实时数据-获取实时分笔数据-针对数据：股票、指数、基金（ETF、分级基金等）、期货

可以获取沪深两市所有股票、所有指数、所有基金（包括ETF、分级基金等）、期货（四大期货交易所）所有品种的实时数据

支持多Ticker同时获取

类名：fGetRTQuotes();

属性：Code:待获取实时数据的代码

方法：DataCell_Output = GetRTQuotes()

% % % 测试样例：

实时数据-单品种-股票实时数据

```
GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
GetRTQuotes.Code = '600036';
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()
```

```
GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:
```

```
Code: '600036'
DataRT =
'招商银行'      '名称'
[ 17.97]  '今开盘'
[ 17.92]  '昨收盘'
[ 18.07]  '当前价'
[ 18.2]   '今最高'
[ 17.45]  '今最低'
[ 18.07]  '竞买价，即“买一”报价'
[ 18.08]  '竞卖价，即“卖一”报价'
[ 261551000] '成交量，单位“股”'
[4689434586] '成交额，单位“元”'
[ 600]   '买一量'
[ 18.07]  '买一价'
[ 135376]  '买二量'
[ 18.05]  '买二价'
[ 800]   '买三量'
[ 18.04]  '买三价'
[ 5100]   '买四量'
[ 18.03]  '买四价'
[ 43200]  '买五量'
[ 18]    '买五价'
[ 900]   '卖一量'
[ 18.08]  '卖一价'
[ 51000]  '卖二量'
[ 18.09]  '卖二价'
[ 54930]  '卖三量'
[ 18.1]   '卖三价'
[ 19000]  '卖四量'
[ 18.11]  '卖四价'
[ 127884]  '卖五量'
[ 18.12]  '卖五价'
'2015-05-29'  '日期'
'15:04:05'    '时间'
```

实时数据-单品种-指数实时数据

```
GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
GetRTQuotes.Code = 'SH000300'
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()

GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
GetRTQuotes.Code = 'sz399415'
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()
```

```
GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:
```

```
Code: 'SH000300'
DataRT =
'沪深300'      '名称'
[ 4839.53]  '今开盘'
[ 4834.007]  '昨收盘'
[ 4840.829]  '当前价'
[ 4924.303]  '今最高'
[ 4665.521]  '今最低'
[ 0]    '竞买价，即“买一”报价'
[ 0]    '竞卖价，即“卖一”报价'
[ 427878859] '成交量，单位“股”'
[636008152610] '成交额，单位“元”'
[ 0]   '买一量'
[ 0]   '买一价'
[ 0]   '买二量'
[ 0]   '买二价'
[ 0]   '买三量'
[ 0]   '买三价'
[ 0]   '买四量'
[ 0]   '买四价'
[ 0]   '买五量'
[ 0]   '买五价'
```

```

[ 0] '卖一量'
[ 0] '卖一价'
[ 0] '卖二量'
[ 0] '卖二价'
[ 0] '卖三量'
[ 0] '卖三价'
[ 0] '卖四量'
[ 0] '卖四价'
[ 0] '买五量'
[ 0] '卖五价'
'2015-05-29' '日期'
'15:04:05' '时间'
GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:

Code: 'sz399415'
DataRT =
'I100' '名称'
[ 8592.104] '今开盘'
[ 8626.166] '昨收盘'
[ 8808.966] '当前价'
[ 8921.541] '今最高'
[ 8272.419] '今最低'
[ 0] '竞买价, 即“买一”报价'
[ 0] '竞卖价, 即“卖一”报价'
[ 1874557478] '成交量, 单位“股”'
[53521350417.68] '成交额, 单位“元”'
[ 0] '买一量'
[ 0] '买一价'
[ 0] '买二量'
[ 0] '买二价'
[ 0] '买三量'
[ 0] '买三价'
[ 0] '买四量'
[ 0] '买四价'
[ 0] '买五量'
[ 0] '买五价'
[ 0] '卖一量'
[ 0] '卖一价'
[ 0] '卖二量'
[ 0] '卖二价'
[ 0] '卖三量'
[ 0] '卖三价'
[ 0] '卖四量'
[ 0] '卖四价'
[ 0] '卖五量'
[ 0] '卖五价'
'2015-05-29' '日期'
'15:05:14' '时间'

```

实时数据-单品种-ETF实时数据

```

GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
GetRTQuotes.Code = '510050'
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()

```

```

GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:

Code: '510050'
DataRT =
'50ETF' '名称'
[ 3.081] '今开盘'
[ 3.079] '昨收盘'
[ 3.066] '当前价'
[ 3.114] '今最高'
[ 2.996] '今最低'
[ 3.065] '竞买价, 即“买一”报价'
[ 3.066] '竞卖价, 即“卖一”报价'
[1868000702] '成交量, 单位“股”'
[5724873763] '成交额, 单位“元”'
[ 323900] '买一量'
[ 3.065] '买一价'
[ 210000] '买二量'
[ 3.064] '买二价'

```

```
[ 78900] '买三量'
[ 3.063] '买三价'
[ 190800] '买四量'
[ 3.062] '买四价'
[ 97100] '买五量'
[ 3.061] '买五价'
[ 180000600] '卖一量'
[ 3.066] '卖一价'
[ 7000] '卖二量'
[ 3.067] '卖二价'
[ 20200] '卖三量'
[ 3.068] '卖三价'
[ 142600] '卖四量'
[ 3.069] '卖四价'
[ 500300] '卖五量'
[ 3.07] '卖五价'
'2015-05-29' '日期'
'15:04:05' '时间'
```

实时数据-单品种-分级基金实时数据

```
GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
GetRTQuotes.Code = '150197'
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()
```

```
GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:
```

```
Code: '150197'
DataRT =
'有色B' '名称'
[ 1.22] '今开盘'
[ 1.246] '昨收盘'
[ 1.216] '当前价'
[ 1.268] '今最高'
[ 1.139] '今最低'
[ 1.216] '竞买价，即“买一”报价'
[ 1.217] '竞卖价，即“卖一”报价'
[ 557998659] '成交量，单位“股”'
[679536459.797] '成交额，单位“元”'
[ 4956665] '买一量'
[ 1.216] '买一价'
[ 1000600] '买二量'
[ 1.215] '买二价'
[ 60100] '买三量'
[ 1.214] '买三价'
[ 175100] '买四量'
[ 1.213] '买四价'
[ 115500] '买五量'
[ 1.212] '买五价'
[ 273500] '卖一量'
[ 1.217] '卖一价'
[ 1283934] '卖二量'
[ 1.218] '卖二价'
[ 390700] '卖三量'
[ 1.219] '卖三价'
[ 1291400] '卖四量'
[ 1.22] '卖四价'
[ 60900] '卖五量'
[ 1.221] '卖五价'
'2015-05-29' '日期'
'15:05:14' '时间'
```

实时数据-单品种-期货品种实时数据

```
GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
GetRTQuotes.Code = 'M0'
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()

GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
GetRTQuotes.Code = 'RB1510'
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()

GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
```

```
GetRTQuotes.Code = 'IF1506'
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()
```

```
GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:
```

```
Code: 'M0'
DataRT =
'豆粕连续'      '名称'
[ 232959]  'Unknown'
[ 2547]  '开盘价'
[ 2558]  '最高价'
[ 2546]  '最低价'
[ 2553]  '昨日收盘价'
[ 2553]  '竞买价，即“买一”报价'
[ 2554]  '竞卖价，即“卖一”报价'
[ 2553]  '最新价，即收盘价'
[ 2554]  '结算价'
[ 2553]  '昨结算'
[   1]  '买量'
[  495]  '卖量'
[ 4330600]  '持仓量'
[ 476872]  '成交量'
'连'          '商品交易所简称'
'豆粕'        '品种名简称'
'2015-05-29'  '日期'
```

```
GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:
```

```
Code: 'RB1510'
DataRT =
'螺纹钢1510'      '名称'
[ 10000]  'Unknown'
[ 2356]  '开盘价'
[ 2367]  '最高价'
[ 2354]  '最低价'
[ 2359]  '昨日收盘价'
[ 2359]  '竞买价，即“买一”报价'
[ 2360]  '竞卖价，即“卖一”报价'
[ 2359]  '最新价，即收盘价'
[ 2361]  '结算价'
[ 2349]  '昨结算'
[  365]  '买量'
[  867]  '卖量'
[ 2504700]  '持仓量'
[ 877198]  '成交量'
'沪'          '商品交易所简称'
'螺纹钢'        '品种名简称'
'2015-05-30'  '日期'
```

```
GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:
```

```
Code: 'IF1506'
DataRT =
'4969.6'        '开盘价'
'5025.0'        '最高价'
'4800.2'        '最低价'
'4897.0'        '昨日收盘价'
'1867516'       '成交量'
'27656400000000'  'Unknown'
'179652'        '持仓量'
'4897.0'        '最新价'
"
"
'5474.4'        []
'4479.2'        []
"
"
'4943.2'        []
'4976.8'        []
'182766'        []
'0'              []
'0'              []
'-'              []
'--'             []
'--'             []
'--'             []
```

```
'--'
'--'
'--'
'--'
'0'
'0'
'--'
'--'
'--'
'--'
'--'
'--'
'--'
'--'
'--'
'--'
'2015-05-29'  '日期'
'15:15:15'     '时间'
```

实时数据-多品种-实时数据

```
GetRTQuotes = fGetRTQuotes();
GetRTQuotes.Code = {'600036';'MO';'IF1506';'150197';'TA0';'RBO';'510050'}
DataRT = GetRTQuotes.GetRTQuotes()
```

```
GetRTQuotes =
fGetRTQuotes with properties:
```

```
Code: {7x1 cell}
DataRT =
{32x2 cell}
{18x2 cell}
{38x2 cell}
{32x2 cell}
{18x2 cell}
{18x2 cell}
{32x2 cell}
```

基本面数据-股票个股公司基本信息、证监会分类、所属概念分类

```
% 函数名称 : GetStockInfo_Web
% 函数作用 : 获取A股市场的全部股票个股公司基本信息、证监会分类、所属概念分类 ( 包含已退市股票 )
% 函数句柄 : [StockInfo] = GetStockInfo_Web(StockCode)
% 函数说明 : 从
% 公司简介 : http://vip.stock.finance.sina.com.cn/corp/go.php/vCI_CorpInfo/stockid/600588.phtml
% 板块信息 :
% http://vip.stock.finance.sina.com.cn/corp/go.php/vCI_CorpOtherInfo/stockid/600588/menu_num/2.phtml
% 抓取个股公司基本信息、证监会分类、所属概念分类 , 返回的StockInfo为一个结构体 , 存储相关信息。
% 测试样例 :
% %% GetStockInfo_Web
% % 获取股票基本信息以及所属行业板块 ( 证监会行业分类 ) 和所属概念板块 ( 新浪财经定义 )
% StockCode = '600588';
% [StockInfo] = GetStockInfo_Web(StockCode);
% 运行结果 :
% 运行后返回的StockInfo为一个结构体 , 存贮信息如下 :
```

字段 ▾	值
CompanyIntro	16x4 cell
IPOdate	20010518
IPOprice	36.6800
IndustrySector	'计算机应用服务业'
ConceptSector_Sina	6x1 cell

% 其中StockInfo.CompanyIntro中存在公司的基本介绍 , 如下 :

StockInfo.CompanyIntro

1	2	3	4
1 '公司名称 : '	'用友软件股份有限公司'	□	□
2 '公司英文名称 : '	'Yonyou Software Co.,Ltd.'	□	□
3 '上市市场 : '	'上海证券交易所'	'上市日期 : '	'2001-05-18'
4 '发行价格 : '	'36.68'	'主承销商 : '	'海通证券股份有限公司'
5 '成立日期 : '	'1999-12-06'	'注册资本 : '	'116466万元'
6 '机构类型 : '	'其它'	'组织形式 : '	'民营相对控股企业'
7 '董事会秘书 : '	'欧阳青'	'公司电话 : '	'010-62436838,010-6243...
8 '董秘电话 : '	'010-62436838'	'公司传真 : '	'010-62436639'
9 '董秘传真 : '	'010-62436639'	'公司电子邮箱 : '	'ir@yonyou.com'
10 '董秘电子邮箱 : '	'ir@yonyou.com'	'公司网址 : '	'http://www.yonyou.com'
11 '邮政编码 : '	'100094'	'信息披露网址 : '	□
12 '证券简称更名历史 : '	'G用友 用友软件'	□	□
13 '注册地址 : '	'北京市海淀区北清路68号'	□	□
14 '办公地址 : '	'北京市海淀区北清路68号'	□	□
15 '公司简介 : '	"'公司是根据《中华人民共和国公...'	□	□
16 '经营范围 : '	"'电子计算机软件、硬件及外部设...'	□	□

% StockInfo.IPOdate、StockInfo.IPOprice是提取出来的上市日期和发行价格信息，您也可以按照自己的需要从StockInfo.CompanyIntro进行提取。

% StockInfo.IndustrySector、StockInfo.ConceptSector_Sina存贮的是证监会的行业分类和个股所属的概念分类。

% 如下：

```
% >> StockInfo.IPOdate
% ans =
% 20010518
% >> StockInfo.IPOprice
% ans =
% 36.6800
% >> StockInfo.IndustrySector
% ans =
% 计算机应用服务业
% >> StockInfo.ConceptSector_Sina
% ans =
% '保险重仓'
% '融资融券'
% 'QFII重仓'
% '股权激励'
% '云计算'
% '国产软件'
```

% 相应的批量数据获取和保存函数为

% [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockInfo(StockList)

% 首次运行后就会在本地DataBase\Stock\StockInfo_mat保存全部A股的公司信息、证监会分类、概念分类，如下：

sh600000_StockInfo.mat	sh600038_StockInfo.mat	sh600079_StockInfo.mat	sh600111_StockInfo.mat	sh600149_StockInfo.mat	sh600184_StockInfo.mat	sh600190_StockInfo.mat
sh600001_StockInfo.mat	sh600039_StockInfo.mat	sh600080_StockInfo.mat	sh600112_StockInfo.mat	sh600150_StockInfo.mat	sh600185_StockInfo.mat	sh600191_StockInfo.mat
sh600002_StockInfo.mat	sh600048_StockInfo.mat	sh600081_StockInfo.mat	sh600113_StockInfo.mat	sh600151_StockInfo.mat	sh600186_StockInfo.mat	sh600192_StockInfo.mat
sh600003_StockInfo.mat	sh600050_StockInfo.mat	sh600082_StockInfo.mat	sh600114_StockInfo.mat	sh600152_StockInfo.mat	sh600187_StockInfo.mat	sh600193_StockInfo.mat
sh600004_StockInfo.mat	sh600051_StockInfo.mat	sh600083_StockInfo.mat	sh600115_StockInfo.mat	sh600153_StockInfo.mat	sh600188_StockInfo.mat	sh600194_StockInfo.mat
sh600005_StockInfo.mat	sh600052_StockInfo.mat	sh600084_StockInfo.mat	sh600116_StockInfo.mat	sh600154_StockInfo.mat	sh600189_StockInfo.mat	sh600195_StockInfo.mat
sh600006_StockInfo.mat	sh600053_StockInfo.mat	sh600085_StockInfo.mat	sh600117_StockInfo.mat	sh600155_StockInfo.mat	sh600190_StockInfo.mat	sh600196_StockInfo.mat
sh600007_StockInfo.mat	sh600054_StockInfo.mat	sh600086_StockInfo.mat	sh600118_StockInfo.mat	sh600156_StockInfo.mat	sh600191_StockInfo.mat	sh600197_StockInfo.mat
sh600008_StockInfo.mat	sh600055_StockInfo.mat	sh600087_StockInfo.mat	sh600119_StockInfo.mat	sh600157_StockInfo.mat	sh600192_StockInfo.mat	sh600198_StockInfo.mat
sh600009_StockInfo.mat	sh600056_StockInfo.mat	sh600088_StockInfo.mat	sh600120_StockInfo.mat	sh600158_StockInfo.mat	sh600193_StockInfo.mat	sh600200_StockInfo.mat
sh600010_StockInfo.mat	sh600057_StockInfo.mat	sh600089_StockInfo.mat	sh600121_StockInfo.mat	sh600159_StockInfo.mat	sh600194_StockInfo.mat	sh600201_StockInfo.mat
sh600011_StockInfo.mat	sh600058_StockInfo.mat	sh600090_StockInfo.mat	sh600122_StockInfo.mat	sh600160_StockInfo.mat	sh600195_StockInfo.mat	sh600202_StockInfo.mat
sh600012_StockInfo.mat	sh600059_StockInfo.mat	sh600091_StockInfo.mat	sh600123_StockInfo.mat	sh600161_StockInfo.mat	sh600196_StockInfo.mat	sh600203_StockInfo.mat
sh600015_StockInfo.mat	sh600060_StockInfo.mat	sh600092_StockInfo.mat	sh600125_StockInfo.mat	sh600163_StockInfo.mat	sh600198_StockInfo.mat	sh600204_StockInfo.mat
sh600016_StockInfo.mat	sh600061_StockInfo.mat	sh600093_StockInfo.mat	sh600126_StockInfo.mat	sh600165_StockInfo.mat	sh600199_StockInfo.mat	sh600205_StockInfo.mat
sh600017_StockInfo.mat	sh600062_StockInfo.mat	sh600094_StockInfo.mat	sh600127_StockInfo.mat	sh600166_StockInfo.mat	sh600200_StockInfo.mat	sh600206_StockInfo.mat
sh600018_StockInfo.mat	sh600063_StockInfo.mat	sh600095_StockInfo.mat	sh600128_StockInfo.mat	sh600167_StockInfo.mat	sh600201_StockInfo.mat	sh600207_StockInfo.mat
sh600019_StockInfo.mat	sh600064_StockInfo.mat	sh600096_StockInfo.mat	sh600129_StockInfo.mat	sh600168_StockInfo.mat	sh600202_StockInfo.mat	sh600208_StockInfo.mat
sh600020_StockInfo.mat	sh600065_StockInfo.mat	sh600097_StockInfo.mat	sh600130_StockInfo.mat	sh600169_StockInfo.mat	sh600203_StockInfo.mat	sh600209_StockInfo.mat
sh600021_StockInfo.mat	sh600066_StockInfo.mat	sh600098_StockInfo.mat	sh600131_StockInfo.mat	sh600170_StockInfo.mat	sh600205_StockInfo.mat	sh600210_StockInfo.mat
sh600022_StockInfo.mat	sh600067_StockInfo.mat	sh600099_StockInfo.mat	sh600132_StockInfo.mat	sh600171_StockInfo.mat	sh600206_StockInfo.mat	sh600211_StockInfo.mat
sh600023_StockInfo.mat	sh600068_StockInfo.mat	sh600100_StockInfo.mat	sh600133_StockInfo.mat	sh600172_StockInfo.mat	sh600207_StockInfo.mat	sh600212_StockInfo.mat
sh600026_StockInfo.mat	sh600069_StockInfo.mat	sh600101_StockInfo.mat	sh600135_StockInfo.mat	sh600173_StockInfo.mat	sh600208_StockInfo.mat	sh600213_StockInfo.mat
sh600027_StockInfo.mat	sh600070_StockInfo.mat	sh600102_StockInfo.mat	sh600136_StockInfo.mat	sh600175_StockInfo.mat	sh600209_StockInfo.mat	sh600214_StockInfo.mat
sh600028_StockInfo.mat	sh600071_StockInfo.mat	sh600103_StockInfo.mat	sh600137_StockInfo.mat	sh600176_StockInfo.mat	sh600210_StockInfo.mat	sh600215_StockInfo.mat
sh600029_StockInfo.mat	sh600072_StockInfo.mat	sh600104_StockInfo.mat	sh600138_StockInfo.mat	sh600177_StockInfo.mat	sh600211_StockInfo.mat	sh600216_StockInfo.mat
sh600030_StockInfo.mat	sh600073_StockInfo.mat	sh600105_StockInfo.mat	sh600139_StockInfo.mat	sh600178_StockInfo.mat	sh600212_StockInfo.mat	sh600217_StockInfo.mat
sh600031_StockInfo.mat	sh600074_StockInfo.mat	sh600106_StockInfo.mat	sh600141_StockInfo.mat	sh600179_StockInfo.mat	sh600213_StockInfo.mat	sh600218_StockInfo.mat
sh600033_StockInfo.mat	sh600075_StockInfo.mat	sh600107_StockInfo.mat	sh600143_StockInfo.mat	sh600180_StockInfo.mat	sh600215_StockInfo.mat	sh600219_StockInfo.mat
sh600035_StockInfo.mat	sh600076_StockInfo.mat	sh600108_StockInfo.mat	sh600145_StockInfo.mat	sh600181_StockInfo.mat	sh600216_StockInfo.mat	sh600220_StockInfo.mat
sh600036_StockInfo.mat	sh600077_StockInfo.mat	sh600109_StockInfo.mat	sh600146_StockInfo.mat	sh600182_StockInfo.mat	sh600217_StockInfo.mat	sh600221_StockInfo.mat
sh600037_StockInfo.mat	sh600078_StockInfo.mat	sh600110_StockInfo.mat	sh600148_StockInfo.mat	sh600183_StockInfo.mat	sh600218_StockInfo.mat	sh600222_StockInfo.mat

基本面数据-股票分红配股信息数据

```
% 函数名称 : GetStockXRD_Web.m
% 函数作用 : 获取股票分红配股信息数据
% 函数句柄 :
% [ Web_XRD_Data , Web_XRD_Cell_1 , Web_XRD_Cell_2 ] = GetStockXRD_Web(StockCode)
% 函数说明 : 从
% http://vip.stock.finance.sina.com.cn/corp/go.php/vISSUE_ShareBonus/stockid/000562.shtml
% 抓取最新的股票名称和代码列表 , 返回的Web_XRD_Data , Web_XRD_Cell_1 , Web_XRD_Cell_2为股票的分红配股信息数据。
% 此函数是在Chandeman ( MATALB技术论坛ID: fosu_cdm ) 曾经编写过的一个函数基础修改而成。
% 测试样例 :

% %% 参数设置
% StockCode_G = '000562'
%
% str = ['全局参数设置完毕 ! '];
% disp(str);
% %% 获取股票除权除息数据
% StockCodeInput = StockCode_G;
%
% [ Web_XRD_Data , Web_XRD_Cell_1 , Web_XRD_Cell_2 ] = GetStockXRD_Web(StockCodeInput);
% Web_XRD_Cell_1;
% Web_XRD_Cell_2;

% 运行结果 :
```

[0] 18x7 cell

1	2	3	4	5	6	7	
1	公告日期	送股(股)	转增(股)	派息(税前...)	除权除息日	股权登记日	红股上市日
2	2014-07-10	0	0	1	2014-07-17	2014-07-16	--
3	2013-06-08	0	10	6	2013-06-19	2013-06-18	--
4	2012-10-17	0	0	1	2012-10-23	2012-10-22	--
5	2012-03-24	0	0	0	--	--	--
6	2011-05-11	0	0	2.63	2011-05-18	2011-05-17	--
7	2010-07-30	0	0	2.75	2010-08-09	2010-08-06	--
8	2009-06-04	0	0	1	2009-06-12	2009-06-11	--
9	2008-05-30	0	0	5.75	2008-06-06	2008-06-05	--
10	2007-05-24	0	0	0.8	2007-05-31	2007-05-30	--
11	2006-04-04	0	0	0	--	--	--
12	2005-06-29	0	0	0	--	--	--
13	2001-07-27	0	0	0.5	2001-08-03	2001-08-02	--
14	2000-06-08	1	0	0	2000-06-14	2000-06-13	2000-06-15
15	1999-07-05	2.5	1.5	0	1999-07-09	1999-07-08	1999-07-13
16	1998-07-11	1.5	3.5	0	1998-07-17	1998-07-16	1998-07-21
17	1997-08-22	1	0	0.8	1997-08-27	1997-08-26	1997-08-29
18	1995-11-24	1	0	1.6	1995-11-29	1995-11-28	1995-12-01

[0] 2x9 cell

1	2	3	4	5	6	7	8	9	
1	公告日期	配股方案(...)	配股价格(...)	基准股本(...)	除权除息日	股权登记日	缴款起始日	缴款终止日	配股上市日
2	1995-11-24	1	3	192500000	1995-11-29	1995-11-28	1995-12-0...	1995-12-14	1995-12-22

% 相应的批量数据获取和保存函数为

% [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockTSDay(StockList,AdjFlag,XRDFlag)

% 此时需令XRDFlag = 1即可批量获取除权除息信息。

% 首次运行后就会在本地DataBase\Stock\XRDdata_mat保存全部A股的除权除息信息数据：

sh600000_XRD.mat	sh600038_XRD.mat	sh600079_XRD.mat	sh600112_XRD.mat	sh600151_XRD.mat	sh600186_XRD.mat	sh600221_XRD.mat	sh60025
sh600001_XRD.mat	sh600039_XRD.mat	sh600080_XRD.mat	sh600113_XRD.mat	sh600152_XRD.mat	sh600187_XRD.mat	sh600222_XRD.mat	sh60025
sh600002_XRD.mat	sh600048_XRD.mat	sh600081_XRD.mat	sh600114_XRD.mat	sh600153_XRD.mat	sh600188_XRD.mat	sh600223_XRD.mat	sh60025
sh600003_XRD.mat	sh600050_XRD.mat	sh600082_XRD.mat	sh600115_XRD.mat	sh600155_XRD.mat	sh600189_XRD.mat	sh600225_XRD.mat	sh60026
sh600004_XRD.mat	sh600051_XRD.mat	sh600084_XRD.mat	sh600116_XRD.mat	sh600156_XRD.mat	sh600190_XRD.mat	sh600226_XRD.mat	sh60026
sh600005_XRD.mat	sh600052_XRD.mat	sh600085_XRD.mat	sh600117_XRD.mat	sh600157_XRD.mat	sh600191_XRD.mat	sh600227_XRD.mat	sh60026
sh600006_XRD.mat	sh600053_XRD.mat	sh600086_XRD.mat	sh600118_XRD.mat	sh600158_XRD.mat	sh600192_XRD.mat	sh600228_XRD.mat	sh60026
sh600007_XRD.mat	sh600054_XRD.mat	sh600087_XRD.mat	sh600119_XRD.mat	sh600159_XRD.mat	sh600193_XRD.mat	sh600229_XRD.mat	sh60026
sh600008_XRD.mat	sh600055_XRD.mat	sh600088_XRD.mat	sh600120_XRD.mat	sh600160_XRD.mat	sh600195_XRD.mat	sh600230_XRD.mat	sh60026
sh600009_XRD.mat	sh600056_XRD.mat	sh600089_XRD.mat	sh600121_XRD.mat	sh600161_XRD.mat	sh600196_XRD.mat	sh600231_XRD.mat	sh60026
sh600010_XRD.mat	sh600057_XRD.mat	sh600090_XRD.mat	sh600122_XRD.mat	sh600162_XRD.mat	sh600197_XRD.mat	sh600232_XRD.mat	sh60026
sh600011_XRD.mat	sh600058_XRD.mat	sh600091_XRD.mat	sh600123_XRD.mat	sh600163_XRD.mat	sh600198_XRD.mat	sh600233_XRD.mat	sh60026
sh600012_XRD.mat	sh600059_XRD.mat	sh600092_XRD.mat	sh600125_XRD.mat	sh600165_XRD.mat	sh600199_XRD.mat	sh600234_XRD.mat	sh60027
sh600015_XRD.mat	sh600060_XRD.mat	sh600093_XRD.mat	sh600126_XRD.mat	sh600166_XRD.mat	sh600200_XRD.mat	sh600235_XRD.mat	sh60027
sh600016_XRD.mat	sh600061_XRD.mat	sh600094_XRD.mat	sh600127_XRD.mat	sh600167_XRD.mat	sh600201_XRD.mat	sh600236_XRD.mat	sh60027
sh600017_XRD.mat	sh600062_XRD.mat	sh600095_XRD.mat	sh600128_XRD.mat	sh600168_XRD.mat	sh600202_XRD.mat	sh600237_XRD.mat	sh60027
sh600018_XRD.mat	sh600063_XRD.mat	sh600096_XRD.mat	sh600129_XRD.mat	sh600169_XRD.mat	sh600203_XRD.mat	sh600238_XRD.mat	sh60027
sh600019_XRD.mat	sh600064_XRD.mat	sh600097_XRD.mat	sh600130_XRD.mat	sh600170_XRD.mat	sh600205_XRD.mat	sh600239_XRD.mat	sh60027
sh600020_XRD.mat	sh600065_XRD.mat	sh600098_XRD.mat	sh600131_XRD.mat	sh600171_XRD.mat	sh600206_XRD.mat	sh600240_XRD.mat	sh60027
sh600021_XRD.mat	sh600066_XRD.mat	sh600099_XRD.mat	sh600132_XRD.mat	sh600172_XRD.mat	sh600207_XRD.mat	sh600241_XRD.mat	sh60027
sh600022_XRD.mat	sh600067_XRD.mat	sh600100_XRD.mat	sh600133_XRD.mat	sh600173_XRD.mat	sh600208_XRD.mat	sh600242_XRD.mat	sh60027
sh600023_XRD.mat	sh600068_XRD.mat	sh600101_XRD.mat	sh600135_XRD.mat	sh600175_XRD.mat	sh600209_XRD.mat	sh600243_XRD.mat	sh60028
sh600026_XRD.mat	sh600069_XRD.mat	sh600102_XRD.mat	sh600136_XRD.mat	sh600176_XRD.mat	sh600210_XRD.mat	sh600246_XRD.mat	sh60028
sh600027_XRD.mat	sh600070_XRD.mat	sh600103_XRD.mat	sh600137_XRD.mat	sh600177_XRD.mat	sh600211_XRD.mat	sh600247_XRD.mat	sh60028
sh600028_XRD.mat	sh600071_XRD.mat	sh600104_XRD.mat	sh600138_XRD.mat	sh600178_XRD.mat	sh600212_XRD.mat	sh600248_XRD.mat	sh60028
sh600029_XRD.mat	sh600072_XRD.mat	sh600105_XRD.mat	sh600139_XRD.mat	sh600179_XRD.mat	sh600213_XRD.mat	sh600249_XRD.mat	sh60028
sh600030_XRD.mat	sh600073_XRD.mat	sh600106_XRD.mat	sh600141_XRD.mat	sh600180_XRD.mat	sh600215_XRD.mat	sh600250_XRD.mat	sh60028
sh600031_XRD.mat	sh600074_XRD.mat	sh600107_XRD.mat	sh600143_XRD.mat	sh600181_XRD.mat	sh600216_XRD.mat	sh600251_XRD.mat	sh60028
sh600033_XRD.mat	sh600075_XRD.mat	sh600108_XRD.mat	sh600145_XRD.mat	sh600182_XRD.mat	sh600217_XRD.mat	sh600252_XRD.mat	sh60028
sh600035_XRD.mat	sh600076_XRD.mat	sh600109_XRD.mat	sh600148_XRD.mat	sh600183_XRD.mat	sh600218_XRD.mat	sh600253_XRD.mat	sh60028
sh600036_XRD.mat	sh600077_XRD.mat	sh600110_XRD.mat	sh600149_XRD.mat	sh600184_XRD.mat	sh600219_XRD.mat	sh600255_XRD.mat	sh60028
sh600037_XRD.mat	sh600078_XRD.mat	sh600111_XRD.mat	sh600150_XRD.mat	sh600185_XRD.mat	sh600220_XRD.mat	sh600256_XRD.mat	sh60029

基本面数据-财务数据和三张表数据获取

```
% GetStockFinIndicators_Web.m函数和GetStock3Sheet_Web.m函数可以获取单只股票的财务数据和三张表数据
% [FIndCell,YearList] = GetStockFinIndicators_Web(StockCode,Year)
% [BalanceSheet,ProfitSheet,CashFlowSheet,YearList] = GetStock3Sheet_Web(StockCode,Year)
% 数据获取后用cell矩阵承装
```

StockFinInd{19, 2}

	1	2	3	4
1 '浦发银行(600000) 财务指标'	[]	[]	[]	
2 '报告日期'	'2014-09-30'	'2014-06-30'	'2014-03-31'	
3 '每股指标'	[]	[]	[]	
4 '摊薄每股收益(元)'	1.8853000...	1.2259000...	0.5794000...	
5 '加权每股收益(元)'	1.8660000...	1.2150000...	0.5740000...	
6 '每股收益_调整后(元)'	1.8660000...	1.2150000...	0.5740000...	
7 '扣除非经常性损益后的每股收益(元)'	1.8520000...	1.2040000...	0.5690000...	
8 '每股净资产_调整前(元)'	12.571300...	11.864800...	11.774600...	
9 '每股净资产_调整后(元)'	12.402000...	11.704000...	11.617000...	
10 '每股经营性现金流(元)'	2.6842000...	-1.628900...	-4.264600...	
11 '每股资本公积金(元)'	3.2508000...	3.1826000...	3.0766000...	
12 '每股未分配利润(元)'	3.5429000...	2.8920000...	3.9535000...	
13 '调整后的每股净资产(元)'	NaN	NaN	NaN	
14 '盈利能力'	[]	[]	[]	
15 '总资产利润率(%)'	0.8888000...	0.5818000...	0.2889000...	
16 '主营业务利润率(%)'	NaN	NaN	NaN	
17 '总资产净利润率(%)'	0.9210000...	0.6009000...	0.2913000...	
18 '成本费用利润率(%)'	171.59590...	171.52960...	157.31860...	
19 '营业利润率(%)'	NaN	NaN	NaN	
20 '主营业务成本率(%)'	NaN	NaN	NaN	
21 '销售净利率(%)'	NaN	NaN	NaN	
22 '股本报酬率(%)'	188.52790...	157.04850...	57.941000...	
23 '净资产报酬率(%)'	14.996700...	13.236500...	4.9208000...	

StockSheet3{11, 2}

	1	2	3	4
1 '浦发银行(600000) 资产负债表 单位 : 万元'	[]	[]	[]	
2 '报表日期'	'2014-09-30'	'2014-06-30'	'2014-03-31'	
3 '资产'	[]	[]	[]	
4 '货币资金'	48957400	50714900	46153900	
5 '其中:'	NaN	NaN	NaN	
6 '存放中央银行款'	NaN	NaN	NaN	
7 '结算准备金'	NaN	NaN	NaN	
8 '贵金属'	292600	504900	322200	
9 '存放同业款项'	14121100	13103300	13854500	
10 '拆出资金'	3228100	3105000	3609500	
11 '其中:拆放同业'	NaN	NaN	NaN	
12 '拆放金融性公司'	NaN	NaN	NaN	
13 '存放联行款项'	NaN	NaN	NaN	
14 '存出投资款'	NaN	NaN	NaN	
15 '衍生金融工具资产'	267600	229600	274100	
16 '交易性金融资产'	3043500	3611800	2659800	
17 '买入返售金融资产'	22328700	37229700	35981800	
18 '贴现'	NaN	NaN	NaN	
19 '进出口押汇'	NaN	NaN	NaN	
20 '应收账款'	NaN	NaN	NaN	
21 '预付账款'	NaN	NaN	NaN	
22 '应收利息'	1496300	1505700	1560000	
23 '发放贷款及垫款'	197173500	189834400	183675600	

```
% 相应的批量数据获取函数为
% [SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockFD(StockList,Opt)
% % Opt 0:获取财务指标 1:获取3张表
% 财务数据存储位置 :
% FQuantToolBox DataBase\Stock\FinancialIndicators_mat
```

% 三张表数据存储位置：
% FQuantToolBox DataBase Stock Sheet3_ma

sh600000_Sheet3.mat	sh600038_Sheet3.mat	sh600079_Sheet3.mat	sh600111_Sheet3.mat	sh600149_Sheet3.mat	sh600184_Sheet3.mat	sh600219_Sheet3.mat
sh600001_Sheet3.mat	sh600039_Sheet3.mat	sh600080_Sheet3.mat	sh600112_Sheet3.mat	sh600150_Sheet3.mat	sh600185_Sheet3.mat	sh600220_Sheet3.mat
sh600002_Sheet3.mat	sh600048_Sheet3.mat	sh600081_Sheet3.mat	sh600113_Sheet3.mat	sh600151_Sheet3.mat	sh600186_Sheet3.mat	sh600221_Sheet3.mat
sh600003_Sheet3.mat	sh600050_Sheet3.mat	sh600082_Sheet3.mat	sh600114_Sheet3.mat	sh600152_Sheet3.mat	sh600187_Sheet3.mat	sh600222_Sheet3.mat
sh600004_Sheet3.mat	sh600051_Sheet3.mat	sh600083_Sheet3.mat	sh600115_Sheet3.mat	sh600153_Sheet3.mat	sh600188_Sheet3.mat	sh600223_Sheet3.mat
sh600005_Sheet3.mat	sh600052_Sheet3.mat	sh600084_Sheet3.mat	sh600116_Sheet3.mat	sh600155_Sheet3.mat	sh600189_Sheet3.mat	sh600225_Sheet3.mat
sh600006_Sheet3.mat	sh600053_Sheet3.mat	sh600085_Sheet3.mat	sh600117_Sheet3.mat	sh600156_Sheet3.mat	sh600190_Sheet3.mat	sh600226_Sheet3.mat
sh600007_Sheet3.mat	sh600054_Sheet3.mat	sh600086_Sheet3.mat	sh600118_Sheet3.mat	sh600157_Sheet3.mat	sh600191_Sheet3.mat	sh600227_Sheet3.mat
sh600008_Sheet3.mat	sh600055_Sheet3.mat	sh600087_Sheet3.mat	sh600119_Sheet3.mat	sh600158_Sheet3.mat	sh600192_Sheet3.mat	sh600228_Sheet3.mat
sh600009_Sheet3.mat	sh600056_Sheet3.mat	sh600088_Sheet3.mat	sh600120_Sheet3.mat	sh600159_Sheet3.mat	sh600193_Sheet3.mat	sh600229_Sheet3.mat
sh600010_Sheet3.mat	sh600057_Sheet3.mat	sh600089_Sheet3.mat	sh600121_Sheet3.mat	sh600160_Sheet3.mat	sh600195_Sheet3.mat	sh600230_Sheet3.mat
sh600011_Sheet3.mat	sh600058_Sheet3.mat	sh600090_Sheet3.mat	sh600122_Sheet3.mat	sh600161_Sheet3.mat	sh600196_Sheet3.mat	sh600231_Sheet3.mat
sh600012_Sheet3.mat	sh600059_Sheet3.mat	sh600091_Sheet3.mat	sh600123_Sheet3.mat	sh600162_Sheet3.mat	sh600197_Sheet3.mat	sh600232_Sheet3.mat
sh600015_Sheet3.mat	sh600060_Sheet3.mat	sh600092_Sheet3.mat	sh600125_Sheet3.mat	sh600163_Sheet3.mat	sh600198_Sheet3.mat	sh600233_Sheet3.mat
sh600016_Sheet3.mat	sh600061_Sheet3.mat	sh600093_Sheet3.mat	sh600126_Sheet3.mat	sh600165_Sheet3.mat	sh600199_Sheet3.mat	sh600234_Sheet3.mat
sh600017_Sheet3.mat	sh600062_Sheet3.mat	sh600094_Sheet3.mat	sh600127_Sheet3.mat	sh600166_Sheet3.mat	sh600200_Sheet3.mat	sh600235_Sheet3.mat
sh600018_Sheet3.mat	sh600063_Sheet3.mat	sh600095_Sheet3.mat	sh600128_Sheet3.mat	sh600167_Sheet3.mat	sh600201_Sheet3.mat	sh600236_Sheet3.mat
sh600019_Sheet3.mat	sh600064_Sheet3.mat	sh600096_Sheet3.mat	sh600129_Sheet3.mat	sh600168_Sheet3.mat	sh600202_Sheet3.mat	sh600237_Sheet3.mat
sh600020_Sheet3.mat	sh600065_Sheet3.mat	sh600097_Sheet3.mat	sh600130_Sheet3.mat	sh600169_Sheet3.mat	sh600203_Sheet3.mat	sh600238_Sheet3.mat
sh600021_Sheet3.mat	sh600066_Sheet3.mat	sh600098_Sheet3.mat	sh600131_Sheet3.mat	sh600170_Sheet3.mat	sh600205_Sheet3.mat	sh600239_Sheet3.mat
sh600022_Sheet3.mat	sh600067_Sheet3.mat	sh600099_Sheet3.mat	sh600132_Sheet3.mat	sh600171_Sheet3.mat	sh600206_Sheet3.mat	sh600240_Sheet3.mat
sh600023_Sheet3.mat	sh600068_Sheet3.mat	sh600100_Sheet3.mat	sh600133_Sheet3.mat	sh600172_Sheet3.mat	sh600207_Sheet3.mat	sh600241_Sheet3.mat
sh600026_Sheet3.mat	sh600069_Sheet3.mat	sh600101_Sheet3.mat	sh600135_Sheet3.mat	sh600173_Sheet3.mat	sh600208_Sheet3.mat	sh600242_Sheet3.mat
sh600027_Sheet3.mat	sh600070_Sheet3.mat	sh600102_Sheet3.mat	sh600136_Sheet3.mat	sh600175_Sheet3.mat	sh600209_Sheet3.mat	sh600243_Sheet3.mat
sh600028_Sheet3.mat	sh600071_Sheet3.mat	sh600103_Sheet3.mat	sh600137_Sheet3.mat	sh600176_Sheet3.mat	sh600210_Sheet3.mat	sh600246_Sheet3.mat
sh600029_Sheet3.mat	sh600072_Sheet3.mat	sh600104_Sheet3.mat	sh600138_Sheet3.mat	sh600177_Sheet3.mat	sh600211_Sheet3.mat	sh600247_Sheet3.mat
sh600030_Sheet3.mat	sh600073_Sheet3.mat	sh600105_Sheet3.mat	sh600139_Sheet3.mat	sh600178_Sheet3.mat	sh600212_Sheet3.mat	sh600248_Sheet3.mat
sh600031_Sheet3.mat	sh600074_Sheet3.mat	sh600106_Sheet3.mat	sh600141_Sheet3.mat	sh600179_Sheet3.mat	sh600213_Sheet3.mat	sh600249_Sheet3.mat
sh600033_Sheet3.mat	sh600075_Sheet3.mat	sh600107_Sheet3.mat	sh600143_Sheet3.mat	sh600180_Sheet3.mat	sh600215_Sheet3.mat	sh600250_Sheet3.mat
sh600035_Sheet3.mat	sh600076_Sheet3.mat	sh600108_Sheet3.mat	sh600145_Sheet3.mat	sh600181_Sheet3.mat	sh600216_Sheet3.mat	sh600251_Sheet3.mat
sh600036_Sheet3.mat	sh600077_Sheet3.mat	sh600109_Sheet3.mat	sh600146_Sheet3.mat	sh600182_Sheet3.mat	sh600217_Sheet3.mat	sh600252_Sheet3.mat
sh600037_Sheet3.mat	sh600078_Sheet3.mat	sh600110_Sheet3.mat	sh600148_Sheet3.mat	sh600183_Sheet3.mat	sh600218_Sheet3.mat	sh600253_Sheet3.mat

舆情文本数据-上市公司公告文件数据

```
% 函数名称 : GetStockNotice_Web
% 函数作用 : 获取上市公司公告文件列表
% 函数句柄 : [NoticeDataCell] = GetStockNotice_Web(StockCode,BeginDate,EndDate)
% 函数说明 : 从相关网络上抓取相关数据。
% 测试样例 :
```

```
% StockCode = '600588';
% BeginDate = '20141001';
% EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');
%
% [NoticeDataCell] = GetStockNotice_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);
```

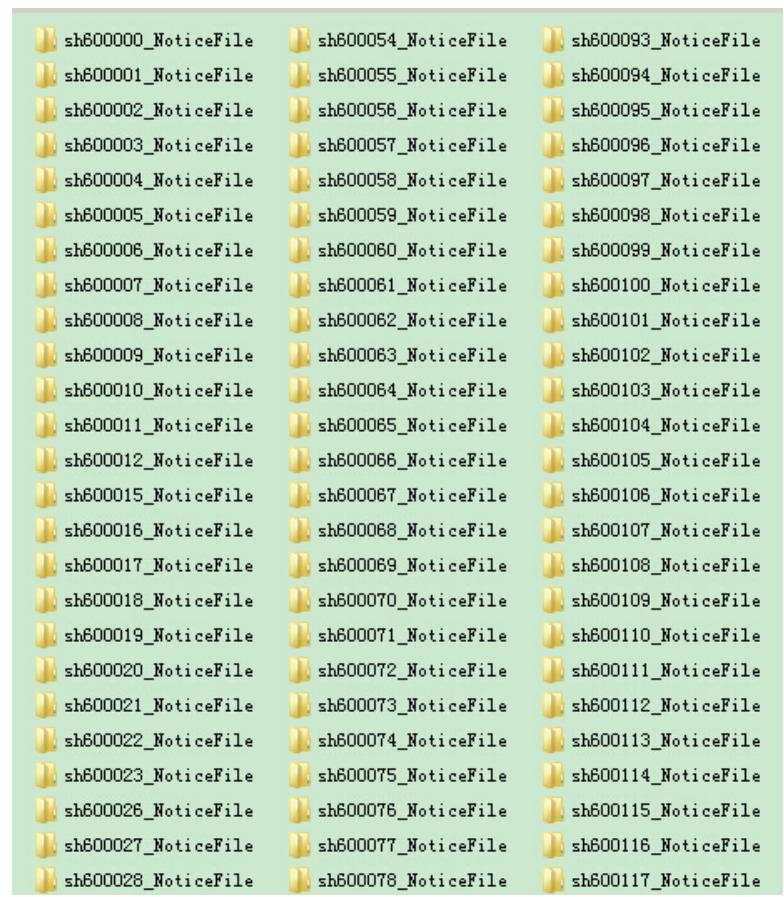
```
% 运行结果 :
% 运行后返回的NoticeDataCell为StockCode指定的股票的公司公告文件列表如下 :
% 保存的内容抬头为股票代码、日期时间、文件名字、公告类型、文件URL、文件大小
```

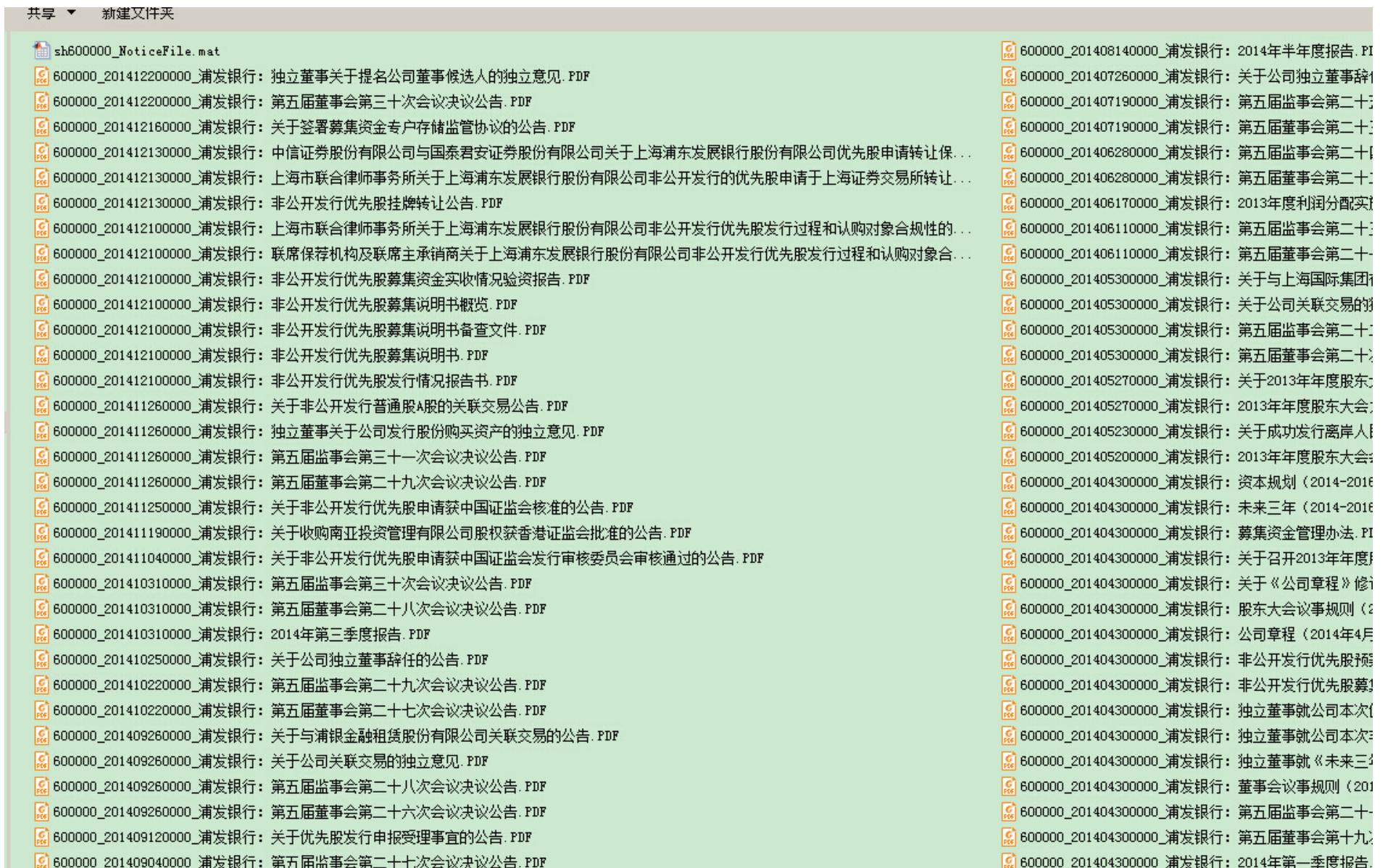
1	2	3	4	5	6
StockCode	DateTime	Title	NoticeType	FileURL	FileSize
1 600588	2014-10-11	用友软件：北京市邦盛律师事务所关于公司股票期权与...	中介机构报告	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-10-11/1200289578.PDF	457K
3 600588	2014-10-11	用友软件：第六届监事会2014年第五次会议决议公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-10-11/1200289577.PDF	107K
4 600588	2014-10-11	用友软件：第六届董事会2014年第五次会议决议公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-10-11/1200289576.PDF	267K
5 600588	2014-10-31	用友软件：2014年第三季度报告	三季度报告	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-10-31/1200357386.PDF	556K
6 600588	2014-10-31	用友软件：北京市邦盛律师事务所关于公司股票期权与...	中介机构报告	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-10-31/1200357385.PDF	319K
7 600588	2014-10-31	用友软件：第六届监事会2014年第六次会议决议公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-10-31/1200357384.PDF	97K
8 600588	2014-10-31	用友软件：第六届董事会2014年第六次会议决议公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-10-31/1200357383.PDF	107K
9 600588	2014-11-06	用友软件：北京市邦盛律师事务所关于用友软件股份有...	中介机构报告	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-06/1200373488.PDF	377K
10 600588	2014-11-06	用友软件：独立董事关于公司授予预留股票期权和限制...	上市公司制度	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-06/1200373490.PDF	100K
11 600588	2014-11-06	用友软件：预留股票期权与限制性股票激励对象名单	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-06/1200373489.PDF	321K
12 600588	2014-11-06	用友软件：关于授予预留股票期权与限制性股票相关事...	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-06/1200373485.PDF	169K
13 600588	2014-11-06	用友软件：关于股权激励计划限制性股票解锁暨上市公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-06/1200373493.PDF	246K
14 600588	2014-11-06	用友软件：第六届监事会2014年第七次会议决议公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-06/1200373487.PDF	98K
15 600588	2014-11-06	用友软件：第六届董事会2014年第七次会议决议公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-06/1200373486.PDF	108K
16 600588	2014-11-18	用友软件：关于公司股东减持公司股份后持股比例低于5...	股权变动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-18/1200399618.PDF	106K
17 600588	2014-11-20	用友软件：重大事项停牌公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-20/1200404121.PDF	87K
18 600588	2014-11-26	用友软件：关于注销已回购的股权激励股份的公告	股权变动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-26/1200417017.PDF	99K
19 600588	2014-11-27	用友软件：关于重大事项继续停牌公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-27/1200419861.PDF	94K
20 600588	2014-12-04	用友软件：非公开发行A股股票预案	增发	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-04/1200438871.PDF	628K
21 600588	2014-12-04	用友软件：第六届董事会2014年第八次会议决议公告	增发	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-04/1200438869.PDF	180K
22 600588	2014-12-04	用友软件：关于召开2014年第二次临时股东大会的通知	股东大会	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-04/1200438870.PDF	191K
23 600588	2014-12-04	用友软件：股东大会议事规则	上市公司制度	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-04/1200438874.PDF	221K
24 600588	2014-12-04	用友软件：公司章程（2014修订）	上市公司制度	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-04/1200438873.PDF	378K
25 600588	2014-12-04	用友软件：关于重大事项复牌公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-04/1200438872.PDF	86K
26 600588	2014-12-04	用友软件：非公开发行A股股票募集资金使用的可行性报告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-04/1200438875.PDF	469K
27 600588	2014-12-16	用友软件：2014年第二次临时股东大会会议资料	股东大会	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-16/1200468814.PDF	1692K
28 600588	2014-12-16	用友软件：第六届董事会2014年第九次会议决议公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-16/1200468756.PDF	113K
29 600588	2014-12-17	用友软件：关于召开2014年第二次临时股东大会的提示...	股东大会	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-17/1200470785.PDF	184K
30 600588	2014-12-20	用友软件：2014年第二次临时股东大会决议公告	股东大会	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-20/1200480118.PDF	127K
31 600588	2014-12-20	用友软件：2014年第二次临时股东大会的法律意见	股东大会	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-20/1200480119.PDF	300K
32 600588	2014-12-25	用友软件：关于召开2015年第一次临时股东大会的通知	股东大会	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-25/1200492863.PDF	166K
33 600588	2014-12-25	用友软件：第六届董事会2014年第十次会议决议公告	其它重大事项	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-12-25/1200492862.PDF	160K

% 相应的批量数据获取和保存函数为

% [FileListCell,SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockNotice(StockList)

% 首次运行后就会在本地DataBase\Stock\StockNotice_file\文件夹内保存全部A股的公司公告文件，每个股票单独一个文件夹，如下：





% 这里多说一点，基于上市公司公告数据，可做的东西还是蛮多的，主要用来开发事件驱动类策略，大体从两个方面：一方面根据公告的粗略分类和发布日期，
 % 进行简单的事件驱动类策略开发（某只股票发布某种定义下的“重要公告”后就持有N天，每T天进行组合调整）；另一方面，如果想要做得更细致，
 % 由于已经保存了上市公司公告的全文，则可以进行上市公司公告全文的文本挖掘，进行将公告的分类进行细致划分，并对公告进行分词处理，
 % 进而开发精细化的基于上市公司公告的事件驱动类策略。

舆情文本数据-上市公司投资者关系信息 (Investor Relations Info) 数据

```
% 函数名称 : GetStockInvestRInfo_Web
% 函数作用 : 获取上市公司投资者关系信息 ( Investor Relations Info ) 列表
% 函数句柄 : [IRDataCell] = GetStockInvestRInfo_Web(StockCode,BeginDate,EndDate)
% 函数说明 : 从相关网络上抓取相关数据。
% 测试样例 :
```

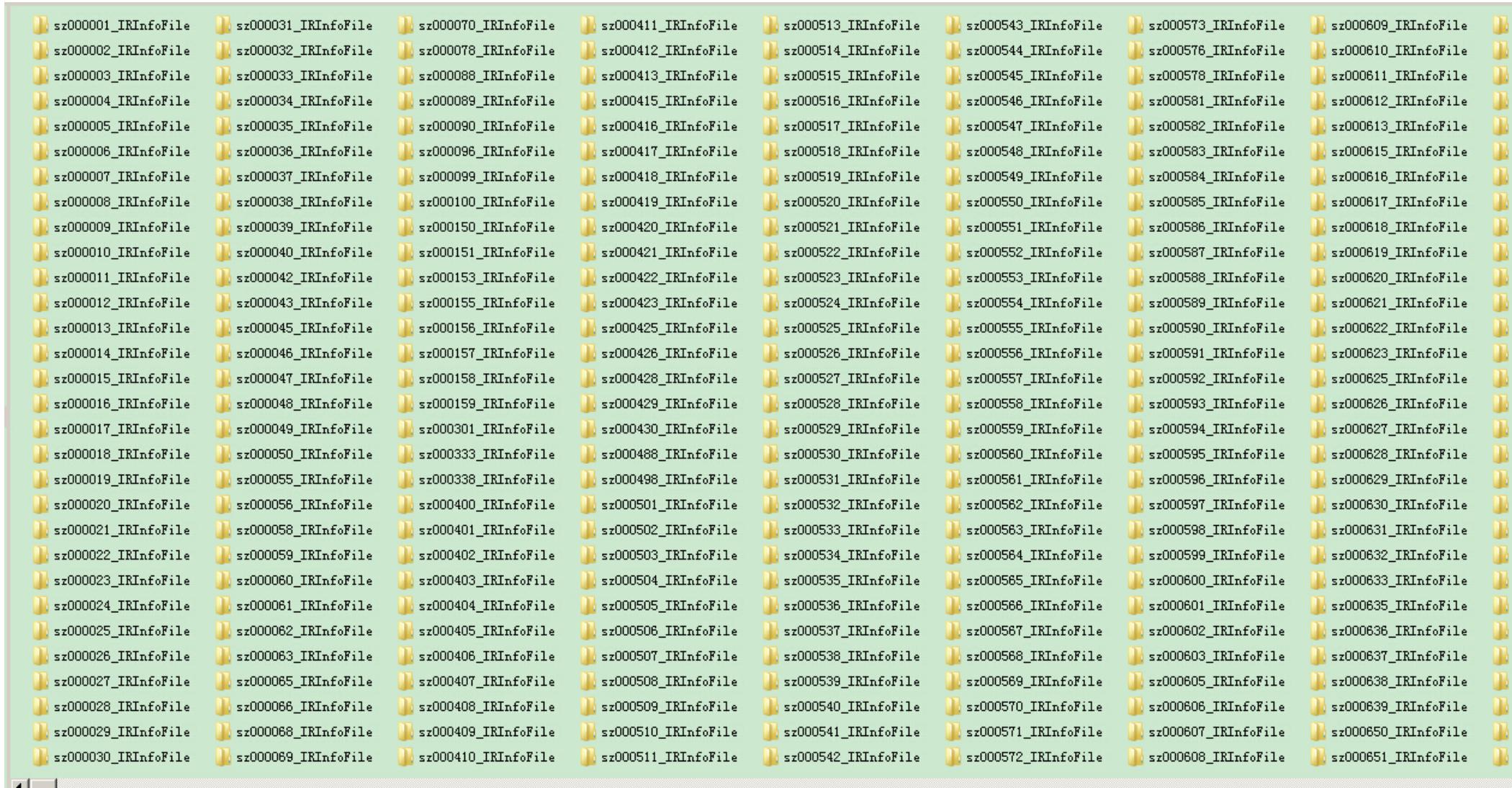
```
% StockCode = '000001';
% BeginDate = '20101001';
% EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');
%
% [IRDataCell] = GetStockInvestRInfo_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);
```

```
% 运行结果 :
% 运行后返回的IRDataCell为StockCode指定的股票的公司投资者关系信息 ( Investor Relations Info ) 列表如下 :
% 保存的内容抬头为股票代码、日期时间、文件名字、公告类型、文件URL、文件大小
```

(I) 23x6 cell

1	2	3	4	5	6
1 StockCode	DateTime	Title	Type	FileURL	FileSize
2 000001	2012-08-21	平安银行: 2012年8月16日投...	业绩说明会、路演活动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2012-08-21/61457098.DOCX?www.cninfo.com.cn	16K
3 000001	2012-11-02	平安银行: 2012年10月26日...	业绩说明会、路演活动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2012-11-02/61755670.DOCX?www.cninfo.com.cn	17K
4 000001	2013-04-10	平安银行: 2013年3月8日投...	业绩说明会、路演活动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2013-04-10/62343443.DOCX?www.cninfo.com.cn	16K
5 000001	2013-07-18	平安银行: 2013年4月26日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2013-07-18/62848063.DOCX?www.cninfo.com.cn	18K
6 000001	2013-07-18	平安银行: 2013年5月23日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2013-07-18/62848069.DOCX?www.cninfo.com.cn	19K
7 000001	2013-07-18	平安银行: 2013年6月20日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2013-07-18/62848070.DOCX?www.cninfo.com.cn	19K
8 000001	2013-08-27	平安银行: 2013年8月23日投...	业绩说明会、路演活动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2013-08-27/63003010.DOCX?www.cninfo.com.cn	18K
9 000001	2013-10-09	平安银行: 2013年9月2日至2...	业绩说明会、路演活动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2013-10-09/63138372.DOCX?www.cninfo.com.cn	18K
10 000001	2013-10-09	平安银行: 2013年9月13日投...	业绩说明会、路演活动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2013-10-09/63138379.DOCX?www.cninfo.com.cn	23K
11 000001	2013-11-07	平安银行: 2013年10月31日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2013-11-07/63246694.DOCX?www.cninfo.com.cn	18K
12 000001	2014-01-07	平安银行: 2013年11月7日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-01-07/63462080.DOCX?www.cninfo.com.cn	20K
13 000001	2014-01-07	平安银行: 2013年12月13日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-01-07/63462081.DOCX?www.cninfo.com.cn	20K
14 000001	2014-03-04	平安银行: 2014年1月8日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-03-04/63635324.DOCX?www.cninfo.com.cn	18K
15 000001	2014-03-04	平安银行: 2014年1月15日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-03-04/63635327.DOCX?www.cninfo.com.cn	19K
16 000001	2014-03-20	平安银行: 2014年3月7日投...	业绩说明会、路演活动	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-03-20/63701227.DOCX?www.cninfo.com.cn	20K
17 000001	2014-08-20	平安银行: 2014年4月25日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-08-20/1200143700.DOCX?www.cninfo.com.cn	23K
18 000001	2014-08-20	平安银行: 2014年5月8日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-08-20/1200143701.DOCX?www.cninfo.com.cn	23K
19 000001	2014-08-20	平安银行: 2014年5月15日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-08-20/1200143702.DOCX?www.cninfo.com.cn	23K
20 000001	2014-08-20	平安银行: 2014年6月11日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-08-20/1200143703.DOCX?www.cninfo.com.cn	22K
21 000001	2014-11-05	平安银行: 2014年8月13日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-05/1200372805.DOCX?www.cninfo.com.cn	23K
22 000001	2014-11-05	平安银行: 2014年9月16日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-05/1200372806.DOCX?www.cninfo.com.cn	24K
23 000001	2014-11-05	平安银行: 2014年9月19日投...	调研活动信息	http://www.cninfo.com.cn//finalpage/2014-11-05/1200372807.DOCX?www.cninfo.com.cn	25K

```
% 相应的批量数据获取和保存函数为
% [IRInfoFileListCell,SaveLog,ProbList,NewList] = SaveStockInvestorRelationsInfo(StockList)
% 首次运行后就会在本地DataBase\Stock\ StockInvestorRelationsInfo_file\文件夹内保存上市公司投资者关系信息 ( Investor Relations Info ) 文件 ,
% 每个股票单独一个文件夹 , 如下 :
```



名称
sz000001_IriInfoFile.mat
000001_201411050000_平安银行：2014年9月19日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201411050000_平安银行：2014年9月16日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201411050000_平安银行：2014年8月13日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201408200000_平安银行：2014年6月11日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201408200000_平安银行：2014年5月15日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201408200000_平安银行：2014年5月8日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201408200000_平安银行：2014年4月25日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201403200000_平安银行：2014年3月7日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201403040000_平安银行：2014年1月15日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201403040000_平安银行：2014年1月8日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201401070000_平安银行：2013年12月13日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201401070000_平安银行：2013年11月7日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201311070000_平安银行：2013年10月31日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201310090000_平安银行：2013年9月13日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201310090000_平安银行：2013年9月2日至2013年9月3日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201308270000_平安银行：2013年8月23日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201307180000_平安银行：2013年6月20日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201307180000_平安银行：2013年5月23日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201307180000_平安银行：2013年4月26日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201304100000_平安银行：2013年3月8日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201211020000_平安银行：2012年10月26日投资者关系活动记录表.DOCX
000001_201208210000_平安银行：2012年8月16日投资者关系活动记录表.DOCX

% 同样的，基于上市公司投资者关系信息 (Investor Relations Info) 数据，与上市公司公告数据一样，可以用来研发事件驱动类策略，可做粗、可做细。

舆情文本数据-百度高级搜索相关数据

```
% 函数名称：BaiduSearchAdvancedNews
% 函数作用：获取百度高级搜索相关内容，可以任意指定个股相关关键词，获取搜索之后的相关词条的时间、来源、URL链接等内容，且可以指定搜索时间段。
% 函数句柄：
% [NewsDataCell]
% = BaiduSearchAdvancedNews(StringIncludeAll,StringIncludeAny,BeginDate,EndDate)
% 函数说明：从相关网络上抓取相关数据。
% 测试样例：

% StockCode = '600588';
% BeginDate = '20141226';
% EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');
%
% StringIncludeAny = [];
% [NewsDataCell] = BaiduSearchAdvancedNews(StockCode,StringIncludeAny,BeginDate,EndDate);
```

% 运行结果：
% 运行后返回的NewsDataCell为StockCode指定的股票的百度全文搜索词条，内容如下：
% 保存的内容抬头为日期时间、Title、来源、URL

1	2	3	4
DateTime	Title	Source	URL
2 2014-12-26 00:00	科陆电子股票分析[第2页]-华股财经	华股财经	http://www.huagu.com/ci/keludianzi/index-4.html
3 2014-12-26 07:29	沪市备忘	华股财经	http://stock.huagu.com/bidu/gkjjy_sh/1412/5918560.html
4 2014-12-26 07:37	股市三大猜想及应对策略:震荡调整是主基调?	网易财经	http://money.163.com/14/1226/07/AECHBV7D00254IU1.html
5 2014-12-26 08:55	12月26日私募内部资料精研	中金在线	http://fund.cnfol.com/simujijin/20141226/19790284.shtml
6 2014-12-26 09:38	周五早间概念掘金 第三批自贸申报筹备工作已经开启	和讯	http://stock.hexun.com/2014-12-26/171807494.html
7 2014-12-26 11:08	新五朵金花绚丽绽放 午后大盘走势分析(2)	南方财富网	http://www.southmoney.com/gupiao/dpxf/201412/245487_2.html
8 2014-12-26 13:45	用友UIC6:国家队入场互联网 再掀变革新浪潮	和讯科技	http://tech.hexun.com/2014-12-26/171814614.html
9 2014-12-26 17:09	12月26日千股千评(沪市)	中国证券网	http://stock.cnstock.com/stock/smkg_szbs/201412/3293365.htm
10 2014-12-26 19:29	经典股票分析软件[第4页]-华股财经	华股财经	http://www.huagu.com/ci/jingdiangupiao/index-2.html
11 2014-12-27 02:59	2014年A股热点回眸 十大投资主题贯穿牛市行情	和讯	http://stock.hexun.com/2014-12-27/171829004.html
12 2014-12-27 10:00	2014年A股投资热点:十大投资主题贯穿牛市行情	南方财富网	http://www.southmoney.com/fenxi/201412/246061.html
13 2014-12-28 00:00	日常消费品:2015年土地确权市场将大爆发 荐6股	和讯网	http://yanbao.stock.hexun.com/dzhy567483.shtml
14 2014-12-29 00:00	用友软件:P2P年终分化 友金所蒸蒸日上	华股财经	http://stock.huagu.com/f10/600588/resreports/1640914.html
15 2014-12-29 00:12	2015重点行业:寻找企业级BAT 三大新兴领域引领新增长	网易新闻	http://news.163.com/14/1229/00/AEJES9A0000014AEE.html
16 2014-12-29 03:42	本周股评家最看好的个股	搜狐证券	http://stock.sohu.com/20141229/n407358857.shtml
17 2014-12-29 04:34	第三批券商金股出炉 数量多达数百只	和讯	http://stock.hexun.com/2014-12-29/171854243.html
18 2014-12-29 11:41	2015年互联网金融的冰与火:监管仍是最大悬念	和讯科技	http://tech.hexun.com/2014-12-29/171874128.html
19 2014-12-29 12:00	《沪股通》上证180半日十大跌幅个股 国寿等3股涨停	经络通	http://www.etnet.com.hk/www/tc/news/categorized_news_detail....
20 2014-12-29 14:06	方正集团董事长魏新:信息技术国产化取得突破性进展	和讯科技	http://tech.hexun.com/2014-12-29/171879488.html
21 2014-12-29 18:05	用友软件:2012年第三季度报告	和讯网	http://download.hexun.com/Txtdata/stock_detail_61732424.shtml
22 2014-12-29 19:03	12月29日千股千评(沪市)	中国证券网	http://stock.cnstock.com/stock/smkg_szbs/201412/3295121.htm
23 2014-12-29 21:08	周二布局哪些股上涨概率高?	和讯	http://stock.hexun.com/2014-12-29/171888058.html
24 2014-12-30 09:16	沪市分红派息备忘(12.30)-沪市配股信息_市场_中金在线	中金在线	http://sc.stock.cnfol.com/hpsxx/20141230/19812327.shtml
25 2014-12-30 11:04	计算机行业周报:农村工作会议定调 2015年土地确权市...	华股财经	http://stock.huagu.com/jgnc/hytz/1412/1042404.html
26 2014-12-30 20:57	造就企业互联网富一代,用友优普推人才招聘计划	和讯科技	http://tech.hexun.com/2014-12-30/171932671.html
27 2014-12-31 00:00	远望谷股票分析[第4页]-华股财经	华股财经	http://www.huagu.com/ci/yuanwanggugu/index-2.html
28 2014-12-31 00:00	证券软件开发[第3页]-华股财经	华股财经	http://www.huagu.com/ci/zhengquanruanjian8344/index-3.html
29 2014-12-31 00:00	信息服务行业[第3页]-华股财经	华股财经	http://www.huagu.com/ci/xinxifuwu/index-3.html
30 2014-12-31 01:32	新常态新责任:专访北京银行董事长闫冰竹	和讯网	http://bank.hexun.com/2014-12-31/171938073.html
31 2014-12-31 03:30	21家券商荐460只明年金股 国投电力脱颖而出	和讯	http://stock.hexun.com/2014-12-31/171938707.html
32 2014-12-31 06:06	40余家A股上市公司涉足P2P	和讯	http://stock.hexun.com/2014-12-31/171943442.html
33 2014-12-31 16:01	节后股市三大猜想及应对策略	中金在线	http://sc.stock.cnfol.com/gushizhibo/20141231/19826063.shtml
34 2014-12-31 16:09	节后A股主力资金猜想:21家券商荐460只明年金股	中商情报网	http://www.askci.com/finance/2014/12/31/161134b5vvv.shtml
35 2015-01-01 11:55	2015年资本市场投资策略 寻找最有价值投资标的	和讯	http://stock.hexun.com/2015-01-01/171982861.html

% 基于这部分数据，就可以开发舆情类策略，可以从两方面入手：
% 一方面，可以基于某一时间段的搜索量的总量和增量的统计，找到相应的热门和冷门股，进行相应策略的构建；
% 另一方面，如果想做得细致一些，由于保存了词条的URL，可以通过词条的URL获取搜索内容的全文内容，然后进行分词处理，给出正负面的打分，构建更加精细化的舆情策略。
%
% 事实上BaiduSearchAdvancedNews函数可以输入任意的关键词进行搜索，而不一定是股票代码，比如，搜索“习大大”相关的内容：
% 测试样例：

```
% %% BaiduSearchAdvancedNews Word Test
% StringIncludeAll = '习近平';
% BeginDate = '20141226';
% EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');
%
% StringIncludeAny = [];
% [NewsDataCell] = BaiduSearchAdvancedNews(StringIncludeAll,StringIncludeAny,BeginDate,EndDate);
```

% 运行结果：

1	2	3	4	5
DateTime	Title	Source	URL	
2 2014-12-26 03:52	习近平主席2014年的外交足迹	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-26/6913109.shtml	
3 2014-12-26 03:54	外国友人眼中的习近平主席·博学广识 富有魅力	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-26/6913110.shtml	
4 2014-12-26 09:18	贵州省党委政研系统学习培训会在贵阳召开	新华网贵州频道	http://www.gz.xinhuanet.com/2014-12/26/c_1113783617.htm	
5 2014-12-26 12:10	《习近平谈治国理政》掀起学“习”热 部分批示...	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-26/6914836.shtml	
6 2014-12-26 16:05	滦平县统一思想扎实开展“学转促”活动	新华网河北频道	http://www.he.xinhuanet.com/zfwq/luanping/news/2014-12/26/c_...	
7 2014-12-26 17:18	报告析中国周边安全面临四挑战 大格局未根本逆转	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gj/2014/12-26/6915982.shtml	
8 2014-12-26 19:11	习近平会见梁振英	中国新闻网	http://www.chinanews.com/shipin/2014/12-26/news535760.shtml	
9 2014-12-26 19:14	习近平会见崔世安	中国新闻网	http://www.chinanews.com/shipin/2014/12-26/news535761.shtml	
10 2014-12-26 20:15	习近平见到北京述职的香港特首梁振英	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-26/6916383.shtml	
11 2014-12-26 20:17	习近平见到北京述职的澳门特首崔世安	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-26/6916385.shtml	
12 2014-12-26 20:27	习近平会见梁振英	中国新闻网	http://www.chinanews.com/tp/hd2011/2014/12-26/458764.shtml	
13 2014-12-27 13:05	云南经济工作会：新常态下打造经济升级版	新华网云南频道	http://www.yn.xinhuanet.com/v/2014-12/27/c_133882076.htm	
14 2014-12-27 18:29	习近平关于特区政制发展“三个有利于”引港媒热议	中国新闻网	http://www.chinanews.com/ga/2014/12-27/6917190.shtml	
15 2014-12-28 03:13	考研政治题多次出现习近平讲话内容	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-28/6917350.shtml	
16 2014-12-28 07:55	江苏省属5市事业单位招录笔试昨日同步联考	新华网江苏频道	http://www.js.xinhuanet.com/2014-12/28/c_1113799888.htm	
17 2014-12-28 10:50	这一年，习近平治国理政干成的“十件大事”	新华网浙江频道	http://www.zj.xinhuanet.com/newscenter/InAndAbroad/2014-12/...	
18 2014-12-28 13:29	习近平出访掀“中国热”：头像登上蒙古邮票(图)	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-28/6917777.shtml	
19 2014-12-28 19:11	习近平签署第十七、第十八号主席令	中国新闻网	http://www.chinanews.com/shipin/2014/12-28/news536097.shtml	
20 2014-12-29 06:35	媒体梳理习近平治国理政的中国智慧	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-29/6918295.shtml	
21 2014-12-29 10:17	广东省人大原副主任曾昭料逝世 习近平悼念	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-29/6919349.shtml	
22 2014-12-29 14:11	全市新提县处级干部培训结束	新华网黑龙江...	http://www.hlj.xinhuanet.com/wq/2014-12/29/c_133885093.htm	
23 2014-12-29 15:23	习近平海外署名文章的风格及特点	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-29/6921040.shtml	
24 2014-12-29 15:41	这一年，习近平治国理政干成的“十件大事”	新华网贵州频道	http://www.gz.xinhuanet.com/2014-12/29/c_1113814402.htm	
25 2014-12-29 16:02	习近平特别代表李源潮将出席巴西总统连任就职仪式	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-29/6921244.shtml	
26 2014-12-29 16:02	习近平：互联网让世界变成地球村	新华网浙江频道	http://www.zj.xinhuanet.com/2014-12/29/c_1113814802.htm	
27 2014-12-29 16:02	习近平发贺词各界反响强烈	新华网浙江频道	http://www.zj.xinhuanet.com/2014-12/29/c_1113815158.htm	
28 2014-12-29 16:58	习近平贺词阐述中国治网理念	新华网浙江频道	http://www.zj.xinhuanet.com/2014-12/29/c_1113815965.htm	
29 2014-12-29 18:06	习近平主持中共中央政治局会议 听取中纪委汇报	中国新闻网	http://www.chinanews.com/gn/2014/12-29/6921657.shtml	
30 2014-12-29 18:06	中央政治局会议：党内决不容忍搞团团伙伙、结党营私、...	新华网	http://news.xinhuanet.com/legal/2014-12/29/c_1113817922.htm	
31 2014-12-29 18:06	中央政治局会议：党内决不容忍搞团团伙伙、结党营私、...	新华网	http://news.xinhuanet.com/lianzheng/2014-12/29/c_1113817922.htm	
32 2014-12-29 19:32	习近平：坚持立德树人思想引领 加强改进高校党建工作	中国新闻网	http://www.chinanews.com/shipin/2014/12-29/news536394.shtml	
33 2014-12-29 22:49	习近平签发命令解放军驻澳门部队政治委员调整	中国新闻网	http://www.chinanews.com/ga/2014/12-29/6921895.shtml	
34 2014-12-30 07:27	坚持立德树人思想引领 加强改进高校党建工作	新华网	http://news.xinhuanet.com/mrdx/2014-12/30/c_133886081.htm	
35 2014-12-30 09:28	李刚：新形势下推进“一国两制”实践的指南	中国新闻网	http://www.chinanews.com/ga/2014/12-30/6922736.shtml	

舆情文本数据-新浪高级搜索相关数据

```
% 函数名称：SinaSearchAdvanced
% 函数作用：获取新浪高级搜索相关内容，可以任意指定个股相关关键词，获取搜索之后的相关词条的时间、来源、URL链接等内容，且可以指定搜索时间段。
% 函数句柄：
% [NewsDataCell]
% = SinaSearchAdvanced(StringIncludeAll,BeginDate,EndDate)
% 函数说明：从相关网络上抓取相关数据。
% 测试样例：

% StringIncludeAll = '600588';
% BeginDate = '20141201';
% EndDate = datestr(today,'yyyy-mm-dd');
%
% [NewsDataCell] = SinaSearchAdvanced(StringIncludeAll,BeginDate,EndDate);

% 运行结果：
% 运行后返回的NewsDataCell为StockCode指定的股票的百度全文搜索词条，内容如下：
% 保存的内容抬头为日期时间、Title、来源、URL
```

0 39x4 cell

1	2	3	4
1	Title	Source	URL
1 DateTime	快讯：降息刺激P2P板块活跃 熊猫烟花涨停	新浪财经	http://finance.sina.com.cn/stock/jsy/20141201/101620964292.shtml
2 2014-12-01 10:16:16	计算机行业:关注智慧城市 企业移动互联网和征信	全景网络	http://finance.sina.com.cn/stock/hyyj/20141201/140720966239.shtml
3 2014-12-01 14:07:00	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌...	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141203/010020979637.shtml
4 2014-12-03 01:00:06	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的“用友...	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141203/010020979804.shtml
5 2014-12-03 01:00:08	上市公司公告(系列)	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141203/030020981462.shtml
6 2014-12-03 03:00:07	SICM解读:用友软件拟定增募资18亿加码主业	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141203/184420988427.shtml
7 2014-12-03 18:44:00	【公司】用友软件拟增募资18亿加码主业	全景网络	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141203/185420988808.shtml
8 2014-12-03 18:54:00	用友软件拟定增募资18亿加码主业	中证网	http://finance.sina.com.cn/stock/s/20141203/192120988579.shtml
9 2014-12-03 19:21:00	用友软件股份有限公司第六届董事会2014年第八次会议...	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/010020989961.shtml
10 2014-12-04 01:00:06	上海证券交易所上市公司	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/010020990040.shtml
11 2014-12-04 01:00:09	公告版位提示	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/010020990043.shtml
12 2014-12-04 01:00:11	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持用友软件...	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/010020990212.shtml
13 2014-12-04 01:00:16	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代...	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/010020990338.shtml
14 2014-12-04 02:50:01	公司新闻	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/025020991525.shtml
15 2014-12-04 02:50:03	今日公告导读	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/025020991607.shtml
16 2014-12-04 02:50:05	用友软件股份有限公司公告(系列)	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/025020991645.shtml
18 2014-12-04 07:50:44	新浪财经早报:12月4日重磅消息汇总	新浪财经	http://finance.sina.com.cn/stock/marketresearch/20141204/075...
19 2014-12-04 15:04:00	明日具备爆发潜力10大金股	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141204/150420997348.shtml
20 2014-12-04 15:55:45	揭秘涨停板:券商集体涨停 领衔权重全面开花	新浪财经	http://finance.sina.com.cn/stock/marketresearch/20141204/155...
21 2014-12-08 11:43:00	早盘游资大单抢筹的前50只个股	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141208/114321021850.shtml
22 2014-12-09 11:40:00	早盘超级资金出逃的前50只个股	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141209/114021031768.shtml
23 2014-12-10 02:10:22	全球竞逐工业4.0领头羊:中国如何实现弯道超车	每日经济新闻	http://finance.sina.com.cn/changjing/cyxw/20141210/0210210369...
24 2014-12-10 02:12:16	掘金工业4.0 长线布局行业龙头	每日经济新闻	http://finance.sina.com.cn/roll/20141210/021221036940.shtml
25 2014-12-11 11:42:00	早盘超级资金增仓的前50只个股	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141211/114221051736.shtml
26 2014-12-11 11:45:00	早盘游资大单抛售的前50只个股	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141211/114521051738.shtml
27 2014-12-11 15:17:00	今日两市超大账户抢筹的50只个股	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141211/151721053074.shtml
28 2014-12-11 15:20:00	今日两市主力重点关注的50只个股	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141211/152021053078.shtml
29 2014-12-12 16:15:00	下周沪深上市公司重大公告及事项早知道(更新中)	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141212/161521063828.shtml
30 2014-12-12 23:57:13	李昌国解盘友金所布局路径	经济观察报	http://finance.sina.com.cn/roll/20141212/235721065938.shtml
31 2014-12-14 15:10:13	穿越涨停之间 (17)	证券市场周刊...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141214/151021072183.shtml
32 2014-12-17 14:30:58	用友软件股份有限公司	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141217/143021098788.shtml
33 2014-12-21 15:32:39	介山:穿越涨停之间 下周推荐中国铝业	证券市场周刊...	http://finance.sina.com.cn/stock/marketresearch/20141221/153...
34 2014-12-25 00:59:58	用友软件股份有限公司第六届董事会2014年第十次会议...	中国证券报-...	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141225/005921157846.shtml
35 2014-12-25 15:20:00	今日两市超大账户抢筹的30只个股	证券时报网	http://finance.sina.com.cn/stock/t/20141225/152021164381.shtml
36 2014-12-25 15:20:00

舆情文本数据-股票研报列表、摘要数据

获取股票研报相关数据

```
% 测试样例 :
% StockCode = '600588';
% BeginDate = '20141001';
% EndDate = datestr(today,'yyyymmdd');
%
% [ReportList] = GetStockReport_Web(StockCode, 'BeginDate', 'EndDate', 'EndDate');
% 运行结果 :
```

ReportList X

0 72x12 cell

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
1	'上传时间'	'股票代码'	'股票名称'	'报告标题'	'推荐评级'	'研报出处'	'报告类型'	'研报作者'	'研报摘要'	'研报大小'	'研报页数'
2	20141008143143.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1096 char'	'25 KB'	'4 页'
3	20141020145443.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1424 char'	'62 KB'	'4 页'
4	20141021143541.0	'600588'	'用友软件'	'宏源证券...'	'买入'	'宏源证券'	'公司调研'	'易欢欢, ...'	'1x776 char'	'40 KB'	'2 页'
5	20141031115508.0	'600588'	'用友软件'	'宏源证券...'	'买入'	'宏源证券'	'公司调研'	'易欢欢, ...'	'1x527 char'	'46 KB'	'3 页'
6	20141031142255.0	'600588'	'用友软件'	'平安证券...'	'强烈推荐'	'平安证券'	'公司调研'	'符健'	'1x1021 char'	'62 KB'	'3 页'
7	20141031150621.0	'600588'	'用友软件'	'中金公司...'	'推荐'	'中金公司'	'公司调研'	'卢婷, 张...'	'1x854 char'	'233 KB'	'6 页'
8	20141031175830.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x894 char'	'15 KB'	'4 页'
9	20141101145504.0	'600588'	'用友软件'	'光大证券...'	'买入'	'光大证券'	'公司调研'	'姜国平, ...'	'1x684 char'	'79 KB'	'5 页'
10	20141103162112.0	'600588'	'用友软件'	'海通证券...'	'增持'	'海通证券'	'公司调研'	'陈美凤, ...'	'1x959 char'	'53 KB'	'3 页'
11	20141104082420.0	'600588'	'用友软件'	'方正证券...'	'推荐'	'方正证券'	'公司调研'	'赵成'	'1x1646 char'	'56 KB'	'4 页'
12	20141110100507.0	'600588'	'用友软件'	'国金证券...'	'增持'	'国金证券'	'公司调研'	'郑宏达'	'1x841 char'	'43 KB'	'5 页'
13	20141110145152.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1026 char'	'19 KB'	'4 页'
14	20141111144025.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'强烈推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1110 char'	'476 KB'	'11 页'
15	20141111154636.0	'600588'	'用友软件'	'光大证券...'	'买入'	'光大证券'	'公司调研'	'姜国平, ...'	'1x725 char'	'72 KB'	'5 页'
16	20141112150056.0	'600588'	'用友软件'	'宏源证券...'	'买入'	'宏源证券'	'公司调研'	'冯达, 易...'	'1x775 char'	'38 KB'	'2 页'
17	20141113115005.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'强烈推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1047 char'	'39 KB'	'9 页'
18	20141117134615.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'强烈推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1124 char'	'36 KB'	'4 页'
19	20141117134622.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'强烈推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1186 char'	'34 KB'	'5 页'
20	20141119084132.0	'600588'	'用友软件'	'联讯证券...'	'增持'	'联讯证券'	'公司调研'	'丁思德'	'1x2398 char'	'56 KB'	'5 页'
21	20141120105539.0	'600588'	'用友软件'	'国金证券...'	'增持'	'国金证券'	'公司调研'	'郑宏达'	'1x697 char'	'21 KB'	'3 页'
22	20141125092923.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1075 char'	'33 KB'	'4 页'
23	20141125094613.0	'600588'	'用友软件'	'中金公司...'	'推荐'	'中金公司'	'公司调研'	'卢婷, 张...'	'1x907 char'	'1,088 KB'	'5 页'
24	20141204085107.0	'600588'	'用友软件'	'长江证券...'	'强烈推荐'	'长江证券'	'公司调研'	'马先文'	'1x1666 char'	'90 KB'	'5 页'
25	20141204094043.0	'600588'	'用友软件'	'中金公司...'	'推荐'	'中金公司'	'公司调研'	'卢婷, 张...'	'1x874 char'	'271 KB'	'8 页'
26	20141204100619.0	'600588'	'用友软件'	'宏源证券...'	'买入'	'宏源证券'	'公司调研'	'冯达, 易...'	'1x739 char'	'25 KB'	'24 页'
27	20141204112048.0	'600588'	'用友软件'	'招商证券...'	'强烈推荐...'	'招商证券'	'公司调研'	'郝彪'	'1x777 char'	'16 KB'	'4 页'
28	20141204112207.0	'600588'	'用友软件'	'国金证券...'	'增持'	'国金证券'	'公司调研'	'郑宏达'	'1x893 char'	'34 KB'	'3 页'
29	20141204142115.0	'600588'	'用友软件'	'光大证券...'	'买入'	'光大证券'	'公司调研'	'姜国平, ...'	'1x766 char'	'36 KB'	'5 页'

辅助函数和工具-MATLAB数据保存成其他格式文件(.csv .xlsx .txt等)通用函数

[Status, Message] = SaveData2File(Data, FileName, ColNamesCell, varargin)

更加详细内容请点击[这里](#)

```
% FQuantToolBox发布后有些网友反应能否将获取的股票等相关数据保存成其他文件格式，当下FQuantToolBox默认的保存格式是.mat文件，可能有的朋友需要存成其他格式(.csv .xlsx .txt等)的文件进行调用，故编写了SaveData2File.m函数，一方面可以结合FQuantToolBox使用，将提取的股票、期货数据保存成您需要的格式，另一方面该函数也可以单独使用，可以将任何MATLAB数据 ( double型 cell型 ) 快速的保存成其他格式文件 ( 现支持保存成{'.txt','.dat','.csv','.xls','.xlsv','.xlsx','.xlsm'}等扩展名的文件 )。
```

```
% % % 获取股票代码列表测试
% [StockList,StockListFull] = GetStockList_Web;
% StockCodeDouble = cell2mat( StockList(:,3) );
% save('StockList','StockList');
%
% % % StockList SaveData2File
% tic;
% Data = StockList;
%
% FileName = 'StockList.csv';
% ColNamesCell = {'股票名称','股票代码','股票代码 ( 纯数字 ) '};
%
% [Status, Message] = SaveData2File(Data, FileName, ColNamesCell);
%
% Data = StockList;
%
% FileName = 'StockList.txt';
% ColNamesCell = {'股票名称','股票代码','股票代码 ( 纯数字 ) '};
```

```
% [Status, Message] = SaveData2File(Data, FileName, ColNamesCell);
% toc;
% % % 获取指数代码列表
%
% [IndexList] = GetIndexList_Web;
%
% save('IndexList','IndexList');
%
% % % IndexList SaveData2File
% tic;
% Data = IndexList;
%
% FileName = 'IndexList.csv';
% ColNamesCell = {'名称','代码','代码（纯数字）'};
%
% [Status, Message] = SaveData2File(Data, FileName, ColNamesCell);
% toc;
% % % 获取股票日线（除权除息）数据测试
%
% StockCode = 'sh600030';
%
% BeginDate = '20130101';
% EndDate = '20150101';
%
% [StockDataDouble,adjfactor] = GetStockTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);
%
% % % StockDataDouble SaveData2File
% tic;
% Data = StockDataDouble;
% FileName = 'StockDataTest.csv';
% % FileName = [];
%
% ColNamesCell = {'日期','开','高','低','收','量','额','复权因子'};
% % ColNamesCell = [];
%
% [Status, Message] = SaveData2File(Data, FileName, ColNamesCell);
% toc;
%
% % % 获取股票财务指标测试
%
% StockCodeInput = '600588';
% StockCodeInput = StockCode_G;
%
% Year = '2014';
% [FIndCell,YearList] = GetStockFinIndicators_Web(StockCodeInput,Year);
% FIndCell
%
% % % FIndCell SaveData2File
% tic;
% Data = FIndCell;
%
% FileName = '财务指标Test.csv';
% ColNamesCell = [];
%
% [Status, Message] = SaveData2File(Data, FileName, ColNamesCell);
% toc;

% 运行结果
% 保存后的其他格式的文件
```



辅助函数和工具-MATLAB发送邮件通用函数

MatlabSendMailGeneral(subject, content, TargetAddress, Attachments, SourceAddress, password)

[更加详细内容请点击这里](#)

```
% 有时候我们会让MATLAB自动定时运行(查看公众号历史消息：定时运行MATLAB程序任务的解决方案)，让后自动发送邮件，发送程序运行的情况，包括是否运行成功，运行耗时等等。
%
```

```
% 下面是一个MATLAB发送邮件通用函数，可以使用其来用MATLAB发送邮件。支持指定发送邮箱和接收邮箱，稍微再写个脚本，还可以支持群发邮件。
```

```
% 可以使用下面的脚本来测试：
```

```
% SourceAddress = '输入自己的邮箱地址'; %自己的邮箱地址
% password = '输入自己邮箱的密码'; %输入自己邮箱的密码
%
% subject = '中文英文123Test';
% content = subject;
%
% TargetAddress = SourceAddress;
%
% MatlabSendMailGeneral(subject, content, TargetAddress, [], SourceAddress, password);
```

辅助函数和工具-绘制K线函数、横轴时间轴设定函数

```
% 绘制K线函数：KplotNew(OHLC)
% 输入OHLC：开高低收 输出K线图形
```

```
% 横轴时间轴设定函数：LabelSet(Ghandle, Dates, TickStep, TickNum, Style, XTRot)
% 输入
% Ghandle：待绘制横轴的图形句柄，一般设置为gca即可
% Dates：横轴时间标签，double型数据，即输入日期格式为double型的，比如20150525
% TickStep：横轴标签间隔设置，设置为空即可，会有进行默认调整
% TickNum：横轴标签数据，设置为空即可，会有进行默认调整
% Style：展示风格选项，
% 0 默认形式
% 1 日线数据-月标签
% 2 日线数据-年标签
% 3 分钟线数据-日标签
% 4 分钟线数据-月标签
% 5 分钟线数据-年标签
%
% 8 自适应调整
% XTRot：横轴标签旋转度数调整，设置为或不输入即可，会有进行默认调整
```

```
% % 测试样例：
```

```
% 获取数据
StockCode = '000869';
BeginDate = '20150101';
EndDate = datestr(today,'yyyyMMdd');
```

```
[StockDataDouble,adjfactor] = GetStockTSDay_Web(StockCode,BeginDate,EndDate);
% 绘制K线
scrsz = get(0,'ScreenSize');
figure('Position',[scrsz(3)*1/4 scrsz(4)*1/6 scrsz(3)*4/5 scrsz(4)]*3/4);
```

```
OHLC = StockDataDouble(:,2:5);
KplotNew(OHLC);
% 横轴时间轴设定
Dates = StockDataDouble(:,1);
Style = 0;
XTRot = [];
LabelSet(gca, Dates, [], [], Style, XTRot);
str = [StockCode,'-K线图'];
title(str,'FontWeight','Bold');
```



如何构建基于MATLAB的回测系统

FQuantToolBox中的“如何构建基于MATLAB的回测系统”文件夹里，提供了一个“如何构建基于MATLAB的回测系统”的demo样例，提供了一个均线回测样例和一个回测模板，此部分内容来自《量化投资：以MATLAB为工具》的相关章节。具体可参看《量化投资：以MATLAB为工具》相关章节。

其他说明

FQuantToolBox工具箱的更新周期，现在暂无明确时间表。未来更新的大致方向就是增添更多金融标的的免费数据获取方式，增添更多的回测辅助函数和样例。

```
% FQuantToolBox工具箱里面共有四个MATLAB脚本文件（什么是脚本文件？不懂MATLAB脚本文件和函数文件的区别？那您需要先做些功课，百度搜索“N分钟学会MATLAB”）：
% Main_GetStockDataTest.m
% Main_GetFuturesDataTest.m
% Main_SaveStockData2LocalTest.m
% Main_SaveFuturesData2Local.m
% 其中，
% Main_GetStockDataTest.m是用来测试FQuantToolBox工具箱里面所有以Get开头的和股票相关的函数，每个测试在Main_GetStockDataTest.m在一个cell里面，
% 方便您来查看相关函数的输入输出。比如：
```

```

%% 获取股票代码列表测试
[StockList, StockListFull] = GetStockList_Web;
StockCodeDouble = cell2mat( StockList(:, 3) );
save('StockList', 'StockList');

%% 参数设置
StockCode_G = '000562';

str = ['全局参数设置完毕!'];
disp(str);

%% GetStockInfo_Web
% 获取股票基本信息以及所属行业板块（证监会行业分类）和所属概念板块（新浪财经定义）

StockCode = '600588';
[StockInfo] = GetStockInfo_Web(StockCode);

%% 获取股票某日交易明细

StockCode = 'sh600000';
StockCode = 'sh600588';
StockCode = StockCode_G;

BeginDate = '20141205';
[StockTick, Header, StatusStr] = GetStockTick_Web(StockCode, BeginDate);

```

% Main_GetFuturesDataTest.m是用来测试FQuantToolBox工具箱里面所有以Get开头的和期货相关的函数，每个测试在Main_GetFuturesDataTest.m在一个cell里面，
% 方便您来查看相关函数的输入输出。比如：

```

%% 获取期货结算会员成交持仓排名数据-IF
tic

DateStr = '20141216';
Futurecode = 'if';

[DataCell, StatusOut] = GetFutureVol0IRanking_Web(DateStr, Futurecode);

toc

%% 获取期货结算会员成交持仓排名数据-TF
tic

DateStr = '20141215';
Futurecode = 'tf';

[DataCell, StatusOut] = GetFutureVol0IRanking_Web(DateStr, Futurecode);

toc

%% 获取期货某交易所某日数据-中金所-IF
tic

DateStr = '20141216';
MarketCode = 'CFFEX';
FuturesCode = 'IF';

[DataCell, StatusOut] = GetFutureDay_Web(DateStr, MarketCode, FuturesCode);

```

% Main_SaveStockData2LocalTest.m是用来测试FQuantToolBox工具箱里面所有以Save开头的和股票相关的函数，用来把网络上相关的数据存贮到本地，
% 每个测试在Main_SaveStockData2LocalTest.m在一个cell里面，方便您来查看相关函数的输入输出，由于全部运行会很耗时，所以每个cell设置了一个run变量，
% 您只需把run设置为1，该cell模块就行运行，run=0时，相应cell模块不会运行。

```

%% 获取股票代码列表
run = 1;
if 1 == run
    try
        [StockList, StockListFull] = GetStockList_Web;
        save('StockList', 'StockList');

        str = ['日期时间: ', datestr(now), ' 更新股票代码列表'];
        fprintf(fid, '%s\n', str);
    catch err
        str = ['日期时间: ', datestr(now), ' 更新股票代码列表失败: ', err.message];
        fprintf(fid, '%s\n', str);
        for i = 1:size(err.stack, 1)
            str = ['FunName: ', err.stack(i).name, ' Line: ', num2str(err.stack(i).line)];
            fprintf(fid, '%s\n', str);
        end
    end
else
    load StockList;
end

%% SaveStockInfo 获取股票基本信息以及所属行业板块（证监会行业分类）和所属概念板块（新浪财经定义）
run = 0;
if 1 == run
    [SaveLog, ProbList, NewList] = SaveStockInfo(StockList);
end

```

% 您或许在Main_SaveStockData2LocalTest.m内会看到一些spmd并行操作模块，如果您对MATLAB并行有了解，那么可以并行批量下载相关数据，否则的话，您忽略该部分代码即可。
%
% Main_SaveFuturesData2Local.m与Main_SaveStockData2LocalTest.m作用类似，只不过Main_SaveFuturesData2Local.m
% 是用来测试FQuantToolBox工具箱里面所有以Save开头的和期货相关的函数，用来把网络上相关的数据存储到本地。

基于FQuantToolBox的测试样例:一种简化的截面动量组合测试

运行函数SimpleMomentumPortfolioTest.m进行测试

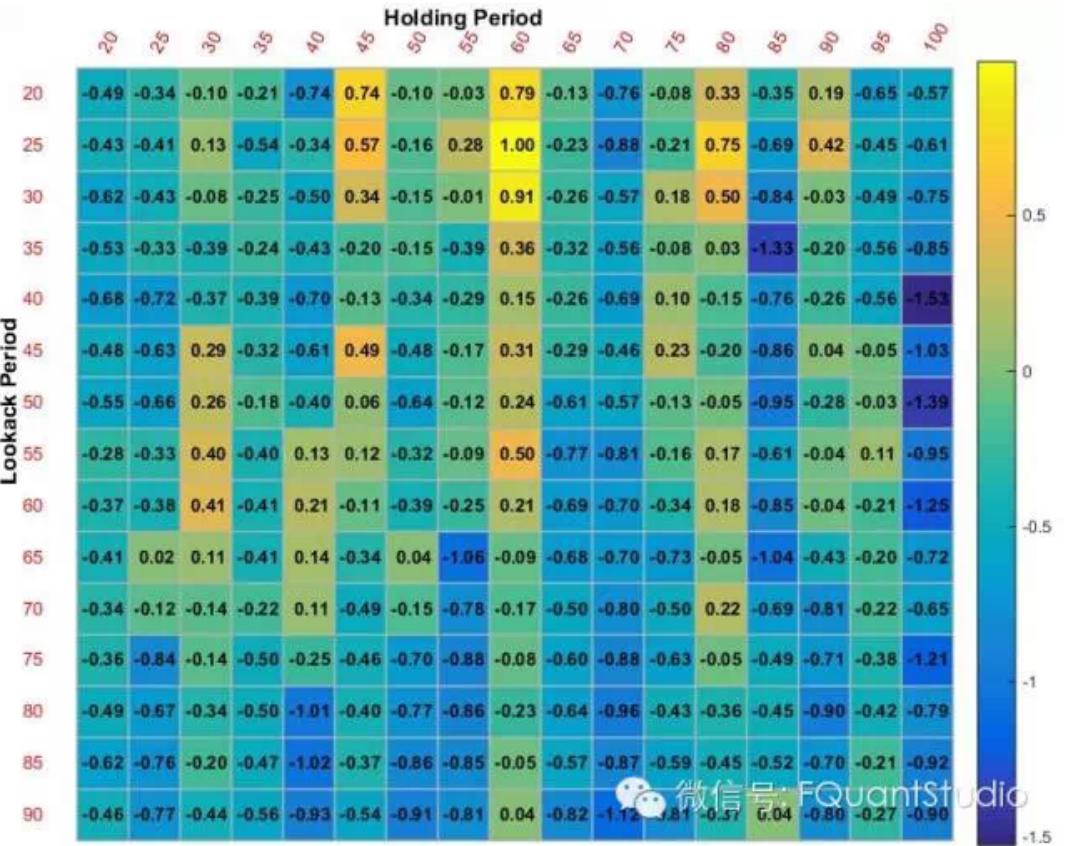
[更加详细内容请点击这里：一种简化的截面动量组合测试](#)

```

% 策略简介：
% 策略比较简单，使用N只股票构建投资组合，计算每只股票的过去LookBack（参数）日的动量，并作标准化处理作为股票权重，持有Holding（参数）日，
% 其中权重允许为负数，即允许做空股票。简要说来就是做过过去表现强势的股票，做空过去表现弱势的股票。
%
% 虽然策略比较简单，但整体的测试流程和框架很明了清晰，对类似策略的回测实现具有参考意义，整体的流程框架为：
%
% 数据获取（基于付费或者免费的数据源）——》
% 数据的时间轴对齐以及缺失数据填充——》
% 子函数编写：特定回顾期的动量计算并作标准化——》
% 子函数编写：给定回顾期和持有期，组合的夏普比例计算——》
% 计算不同回顾期和持有期下组合的夏普比例值——》
% 进行策略参数分布图形展示

% 运行函数SimpleMomentumPortfolioTest.m

```



基于FQuantToolBox的测试样例:一类简单的群体行为择时模型框架及实现测试

[更多详细内容请点击这里](#)

```
% 策略简介：
% 指数的择时模型可以通过对其成分股的行为描述（打分），最后通过某种方式整合到一起（综合打分）来构建。
% 以简单的均线为例，虽然均线很简单，但简单的东西往往最具有生命力，最能有效的描述市场。我们知道均线的模型都具有滞后性，
% 我们可以使用常见的20日均线作用在指数上进行择时，我想效果不会差，但会有一定的滞后性，这没有办法，因为不存在圣杯，
% 但本篇要讨论的是一个基于上面的群体行为择时框架的均线类择时模型。
% 回到上面的模型框架：
% TM(Index) = sf(sTM(Stock_1,Stock_2,...,Stock_N))
```

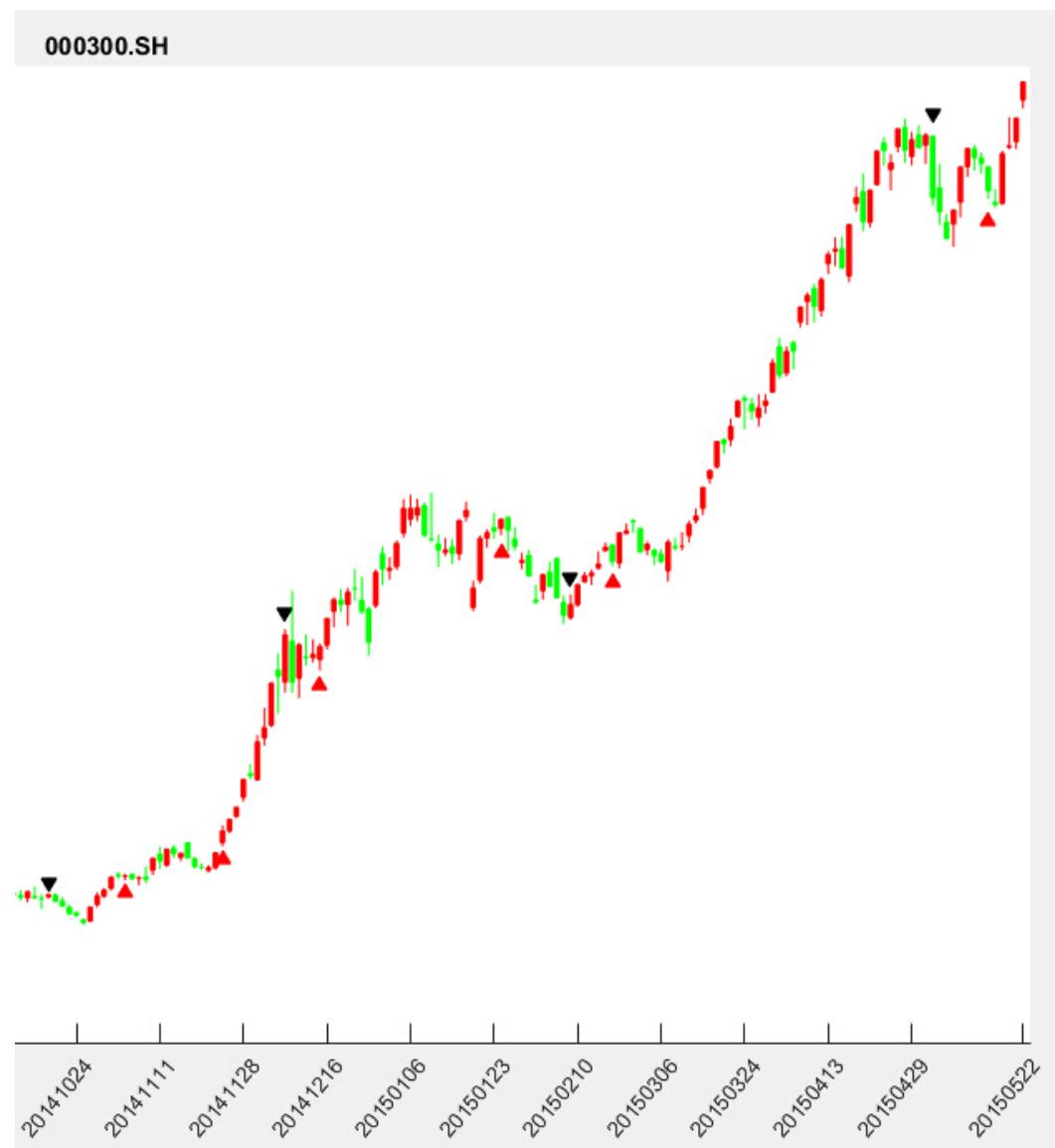
```
% 构建择时模型TM_demo，对于单只个股定义
% sTM(Stock_i)={个股与均线1的相对位置量化描述，个股与均线2的相对位置量化描述}，sf为某种加权平均（线性或非线性），
```

```
% 以下测试基于MATLAB，数据来源为FQuantToolBox和Wind，测试标的为沪深300指数（000300.SH），使用T日之前（T-1日、T-2日，……）的数据来生成信号指导T日交易，
```

```
% 按照择时模型TM_demo生成的择时信号如下：
```

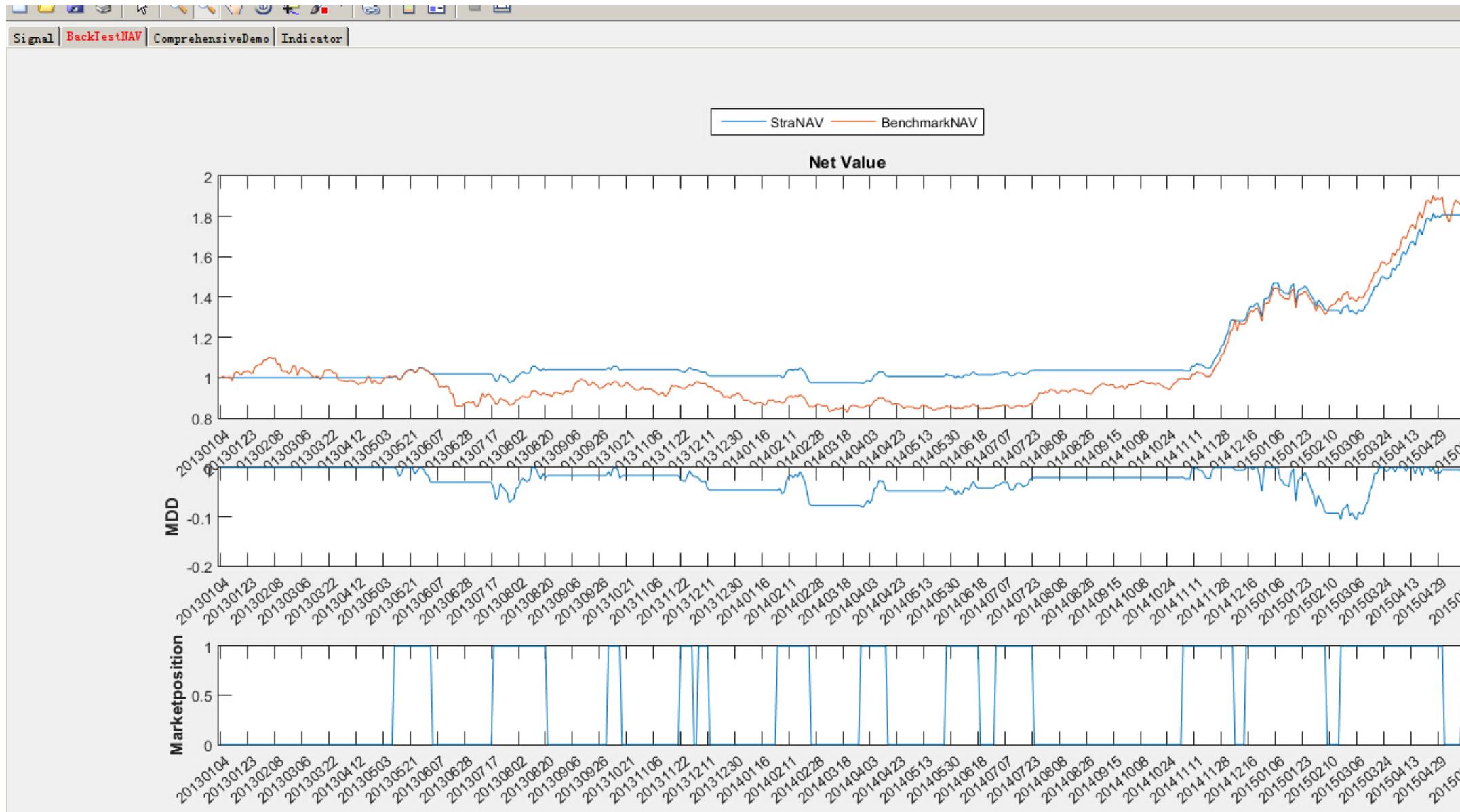


可以看到正如我们料想的那样，群体行为择时模型TM_demo在某些时点可以提前发生买入和卖出信号，但也不是在任何时候都百分之百准确，因为不存在圣杯。再来放到看下2015年近期的信号：



可以看到模型的“运气”还比较不错。

基于上面的择时信号，下面再来系统回测一下，使用T日之前（T-1日、T-2日，……）的数据来生成信号指导T日交易，若有最多信号，则T日开盘买入测试标的，若有做空信号则空仓观望（后面会有做空的测试），测试结果如下：



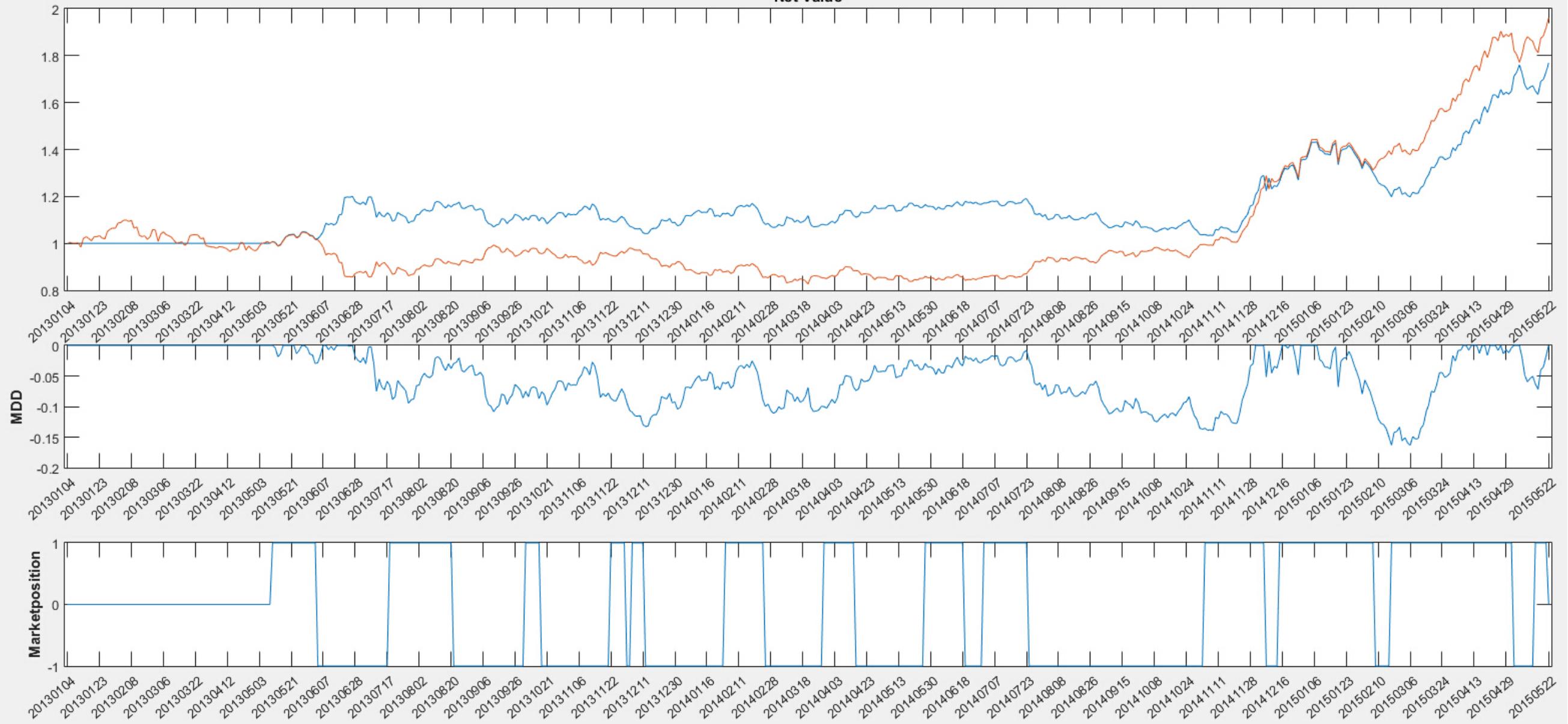


若允许做空，测试结果如下：

[Signal](#) | [BackTestNAV](#) | [ComprehensiveDemo](#) | [Indicator](#)

StraNAV BenchmarkNAV

Net Value





《量化投资：以MATLAB为工具》书籍介绍

《量化投资：以MATLAB为工具》分为基础篇和高级篇两大部分。基础篇部分通过Q&A的方式介绍了MATLAB的主要功能、基本命令、数据处理等内容，使读者对MATLAB有基本的了解。高级篇部分分为14章，包括MATLAB处理优化问题和数据交互、绘制交易图形、构建行情软件和交易模型等内容，通过丰富实例和图形帮助读者理解和运用MATLAB作为量化投资的工具。《量化投资：以MATLAB为工具》的特色在于不仅仅满足理论学习的需要，更帮助读者边学边练，将理论和实践并重。

《量化投资：以MATLAB为工具》适合金融机构的研究人员和从业人员、进行量化投资的交易员、具有统计背景的科研工作者、高等院校相关专业的教师和学生以及对量化投资和 MATLAB感兴趣的人士阅读。

其他信息

这里为一些在线测试demo和在线帮助文档，全部有MATLAB自动publish生成

FQuantToolBox最新版下载地址：[百度网盘](#)

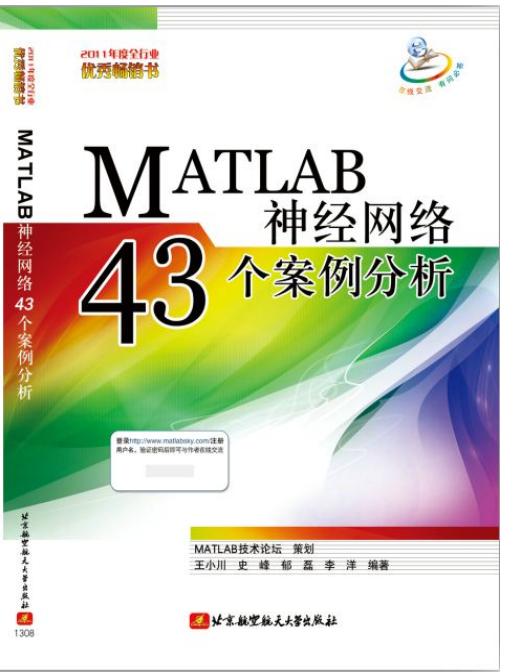
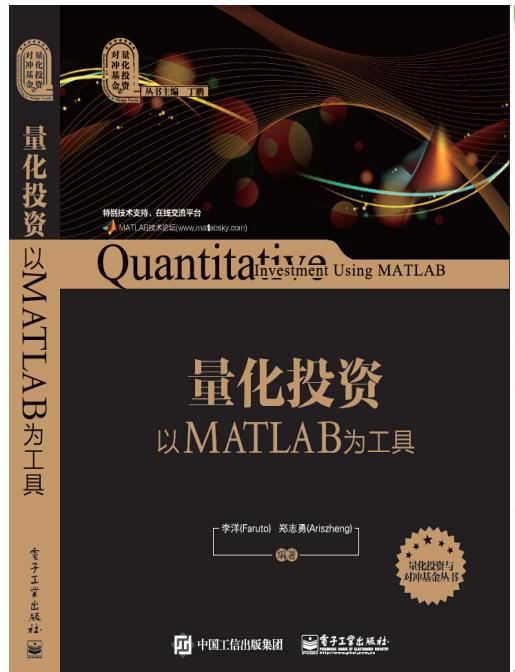
FQuantToolBox使用交流讨论论坛：[MATLAB技术论坛](#)

FQuantToolBox使用交流讨论QQ群：QuantGroup1群[MATLAB] 279908629

作者faruto的联系方式：邮箱-farutoliyang@foxmail.com [微博-faruto](#) 微信公众号-FQuantStudio(欢迎扫码关注)



书籍推荐：



Published with MATLAB® R2015a