

## 说明

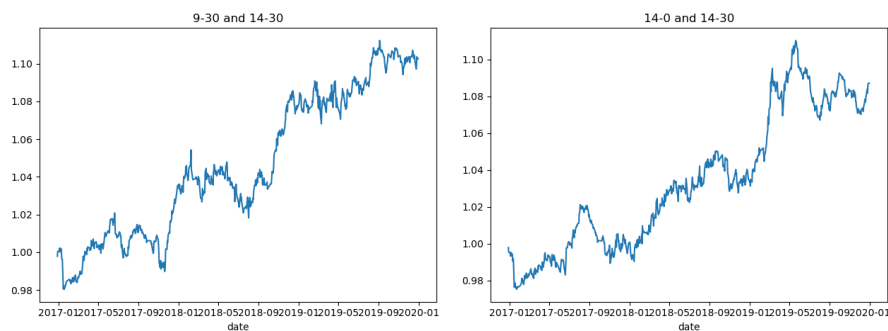
## 代码结构



其中，data文件夹放提供的的数据。

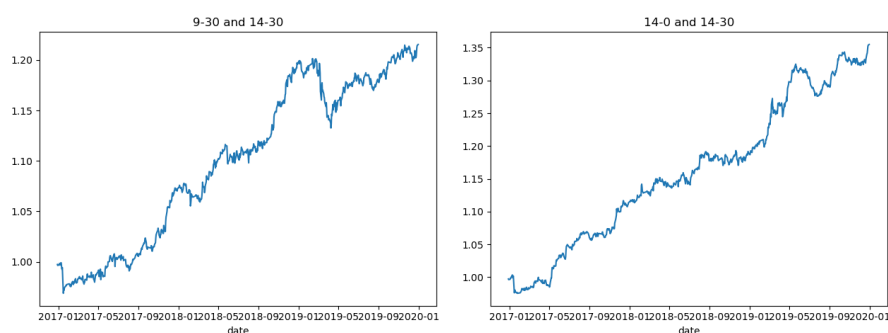
## Half\_hour.py文件

其中，第30行修改不同的指数。以300指数为例。



上面两张图分别对应了研报中的图20与图24。

中证500 对应图21， 25



有轻微差别，但是基本复现了研报内容。

研报中有一个明显的问题，策略与收益图不对应。具体见研报的第九页。根据一些实验结果，应该是研报策略文字的笔误，以研报的图片title为准。

## Half\_hour\_update.py文件

其中，37行 可以更改选择的指数，除了图之外，程序会显操作的方法。

```
{('9-30', '10-0'): -1.0, ('10-0', '11-0'): 1.0, ('10-30', '13-0'): -1.0, ('9-30', '13-30'): -1.0, ('13-30', '14-0'): 1.0}
```

('9-30','10-0'): -1.0：代表 根据 9：30 到10：00的涨跌情况，对10：00到 10:30区间进行操作。-1代表反向操作，即前面时间段为涨，则后面时间段做空。

对原始研报做了三方面改进

1. 选择三年相关性符号没有发生变换小时数，以增加稳定性。
2. 在稳定的条件下，多种信号选择相关性最大的信号。
3. 对相关性进行的排除，增加了阈值判断。

改进之后的策略收益：（图分别对应300与500两种指数改进后结果）

