策略验证

下文所有结果左边为原始信号结果，右边为信号反转后结果

1 VPIN 动量均线策略

（1）按照文献中方法计算 只比均线，cdf只处在日均VPIN的31-85分位



（2）按照文献中方法计算 只比均线，cdf只处在日均 log VPIN的31-85分位



（3）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 cdf只处在日均VPIN的31-85分位



（4）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 cdf只处在日均VPIN的5-95分位



（5）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 VPIN只处在日均VPIN的31-85分位



2 VPIN反转动量策略

（1）按照文献中方法计算 只比均线，cdf只处在日均VPIN的29分位



（2）按照文献中方法计算 只比均线，log cdf只处在日均VPIN的29分位



（3）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 cdf只处在日均VPIN的29分位



（4）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 cdf只处在日均VPIN的40分位



（5）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 VPIN只处在日均VPIN的29分位



3 反转共振策略

（1）按照文献中方法计算 只比均线，cdf只处在日均VPIN的31-85\29分位



（2）按照文献中方法计算 只比均线，log cdf只处在日均VPIN的31-85\29分位



（3）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 cdf只处在日均VPIN的31-85\29分位



（4）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 cdf只处在日均VPIN的5-95\40分位



（5）更改文献中选股方式，使用上穿代替高于，下穿代替低于 VPIN只处在日均VPIN的31-85\29分位

