**主要程序名称及作用**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | 程序名称 | 作用 |
| 1 | FLS\_strategy.m | 检验不同参数对FLS策略影响 |
| 2 | M\_S\_FLS.m | **FLS策略主程序** |
| 3 | M\_S\_FLS\_manuldata.m | 便于更改数据源的FLS主程序 |
| 4 | M\_S\_cointegration.m | **协整策略主程序** |
| 5 | M\_S\_cointegration\_manuldata.m | 便于更改数据源的协整策略主程序 |
| 6 | M\_anal\_pair\_corr.m | 核查配对数据相关系数，为了和文献对比 |
| 7 | M\_check\_data.m | 民生和北京银行数据，为了和文献对比 |
| 8 | M\_check\_fls.m | 民生和北京银行数据，为了和文献对比，加入FLS结果 |
| 9 | M\_data\_simu.m | 模拟数据结果，参数和文献相同 |
| 10 | M\_get\_data.m | 获取预测者数据 |
| 11 | M\_import\_wind\_data.m | 载入wind数据 |
| 12 | M\_rearrange\_data.m | 数据重新排列 |
| 13 | M\_sta\_values.m | 统计sharp、年化收益率 |
| 14 | cointegration\_strategy.m | 检验不同参数对协整策略影响 |
| 15 | curve\_static.m | 统计参数程序 |
| 16 | fls.m | FLS程序 |
| 17 | fls\_online.m | on-line FLS程序 |
| 18 | fls\_spread.m | 找到相关系数最大的配对数据，并进行on-lineFLS分析 |
| 19 | get\_tril\_val.m | 将相关系数矩阵转化成向量，便于后续排序 |
| 20 | model\_cointegration.m | 建立协整模型 |
| 21 | sta\_get\_position.m | 根据信号，回测 |
| 22 | wgr\_fls.m | FLS程序，功能和16相同 |