

# 量化投资 Using R

## 前言

罗智超 (ROKIA.ORG)

## Contents

联系方式	2
注意事项	2
课程将给你什么?	2
课程教材	2
辅助阅读材料	2
前修知识	2
推荐网站	3
推荐软件	3
推荐电脑	3
数据准备的重要性	3
数据分析的重要性	4
数据分析的流程	4
数据分析如烹小鲜	4
数据分析的三项基本技能	7
数据分析的问题类型	7
数据的来源	7
数据载体	7
真实数据	7
Dirty Data	7
辛普森悖论	8
数据可视化	9
感受 R 语言的魅力	9
为什么是 useR?	13
Advance R	13
关于 R 的前世今生的几篇文章	13
SAS 和 R 的比较分析	13
R 的学习曲线为什么陡峭	13
如何学习 R	13
如何寻找帮助	14
课后练习	14
每周“大牛”	14

## 联系方式

- 姓名: 罗智超 (Rokia.org)
- Email&QQ: 1814347@qq.com
- 课件 : rokia.org
- Git : Mygit
- 课程辅助资料 : 网盘地址提取密码: mxfs

## 注意事项

- 为兴趣、热情而不是为考试而学习
- 将手机关闭或者调整成静音状态
- 尽量坐在前排, 如果你想学习

## 课程将给你什么?

- 一起度过一学期**痛并快乐**的学习时光
- 增强你的简历
- 增强你的动手处理和分析金融数据的能力

## 课程教材

- R In Action, Data Analysis and Graphics with R by Robert I. Kabacoff
- The Art of R Programming by Norman Matloff
- ggplot2: Elegant Graphics for Data Analysis by Hadley Wickham
- 应用时间序列分析——R 软件陪同 by 吴喜之、刘苗
- 统计建模与 R 软件 by 薛毅陈立萍

## 辅助阅读材料

- Statistics: From Data to Evidence by Xizhi WU
- Statistics: With the application of R by Xizhi WU
- Data Manipulation With R by Phil Spector
- An Introduction to R by Bill Venables & David Smith
- R for Programmers by Norman Matloff
- The Lady Tasting Tea show Statistics Revolutionized Science in the Twentieth Century

## 前修知识

- 金融学原理
- 统计学原理
- 计算机一、二级

- 热爱编程
- 喜欢烹饪

## 推荐网站

- <http://www.rokia.org/>
- <http://www.r-project.org/>
- <http://www.rstudio.com/>
- <http://library.xmu.edu.cn/>
- <http://www.pinggu.org/>
- <http://COS.NAME/>
- <http://Coursera.org/>
- <http://www.jstatsoft.org/>
- <http://www.r-bloggers.com/>
- <http://www.stackoverflow.com/>
- <http://51qiangda.com/>
- <http://ctex.org/>
- <http://www.kaggle.com/>
- <http://www.kdnuggets.com/>
- <http://en.savefrom.net/>

## 推荐软件

- Adobe Acrobat Professional
- CNKI E-Learning
- CTEX
- GIT
- RStudio/R
- UltraEdit
- Wind

## 推荐电脑

MacBook Pro

## 数据准备的重要性

Preparing data for analysis using R whitepaper

## 数据分析的重要性

- 几乎所有科学研究都要涉及数据分析
- 几乎所有文章发表都需要涉及数据分析
- 熟练掌握数据分析技能会使你在工作学习中成为“香馍馍”
- 养成数据分析思维

## 数据分析的流程

- Define the question
- Define the ideal data set
- Determine what data you can access
- Obtain the data
- Clean the data
- Exploratory data analysis
- Statistical prediction/modeling
- Interpret results
- Challenge results
- Synthesize/write up results
- Create reproducible code

## 数据分析如烹小鲜

Step	Data Analysis	Cooking
1	Data, Software, Model	Raw Material, Kitchenware, cookbook
2	Define the research question	Decide which dish to eat
3	Collect Data	Shopping
4	Data Cleaning	Cleaning
5	Data Preparation	Chopping
6	Modeling with theory and data	Cooking with cookbook
7	Hypothesis Test	Taste
8	Report	Decoration

数据分析与烹饪最主要的差别是煮完菜要洗碗

如果对烹饪不感兴趣的童鞋可以欣赏这部纪录片



Figure 1: 小野二郎

如果觉得厨师颜值不够可以欣赏下面这部电影，包括主题曲



Figure 2: 《陪安东尼度过漫长岁月》

## 数据分析的三项基本技能

- 数据操作能力
- 统计、数据挖掘、机器学习编程及绘图能力
- 统计、数据挖掘、机器学习理论及业务理解能力

## 数据分析的问题类型

- 描述 ( Descriptive )
- 探索 ( Exploratory )
- 推断 ( Inferential )
- 预测 ( Predict )
- 因果 ( Casual )
- 机理 ( Mechanistic )

## 数据的来源

- 普查
- 抽样调查
- 试验设计

## 数据载体

- Tab-delimited text
- Comma-separated text
- Excel file
- JSON File
- HTML/XML file
- Database

## 真实数据

- “脏”数据
- 格式不规范
  - 缺失值
  - 错误数据
  - 异常值
    - 格式不规范

## Dirty Data

	A	B	C	D	E	F	G	H	I
1	Qualifications by Year Level and Gender								
2					National				
3					Year 11		Year 12		Year 13
4	Qualificat	Gender							
5									
6	National Certificate of Educational Achievement								
7	NCEA (Level 1)								
8		Male			5,929		6,427		5,170
9		Female			0		60		38
10	NCEA (Level 2)								
11		Male			194		5,395		5,027
12		Female			0		58		38
13	NCEA (Level 3)								
14		Male			2		128		3,276
15		Female			0		0		36
16									

Figure 3: DirtyData1

## 辛普森悖论

- 辛普森悖论 (Simpson's Paradox) 亦有人译为辛普森诡论，为英国统计学家 E.H. 辛普森 (E.H.Simpson) 于 1951 年提出的悖论，即在某个条件下的两组数据，分别讨论时都会满足某种性质，可是一旦合并考虑，却可能导致相反的结论。
- 辛普森悖论就像是欲比赛 100 场篮球以总胜率评价好坏，于是有人专找高手挑战 20 场而胜 1 场，另外 80 场找平手挑战而胜 40 场，结果胜率 41%，另一人则专挑高手挑战 80 场而胜 8 场，而剩下 20 场平手打个全胜，结果胜率为 28%，比 41% 小很多，但仔细观察挑战对象，后者明显较有实力。简单的将分组资料相加汇总，是不一定能反映真实情况的。





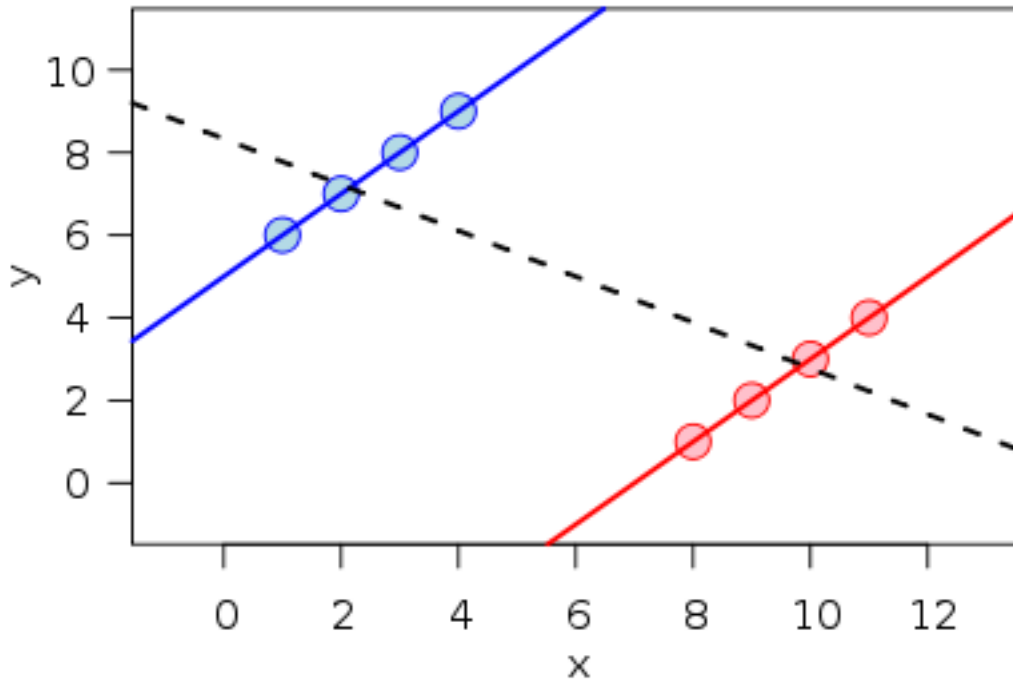


Figure 5: Simpson's Paradox Graphic

```
##      x1      x2      x3      x4      y1      y2      y3      y4
## 9.000000 9.000000 9.000000 9.000000 7.500909 7.500909 7.500000 7.500909
```

Anscombe Data Variance

```
##      x1      x2      x3      x4      y1      y2      y3
## 11.000000 11.000000 11.000000 11.000000 4.127269 4.127629 4.122620
##      y4
## 4.123249
```

Anscombe Data Plot

## Monty Hall

三门问题 (Monty Hall Problem) 亦称为蒙提霍尔问题、蒙特霍问题或蒙提霍尔悖论。大致出自美国的电视游戏节目 Let's Make a Deal。问题名字来自该节目的主持人蒙提·霍尔 (Monty Hall)。参赛者会看见三扇关闭了的门，其中一扇的后面有一辆汽车，选中后面有车的那扇门可赢得该汽车，另外两扇门后面则各藏有一只山羊。当参赛者选定了一扇门，但未去开启它的时候，节目主持人开启剩下两扇门的其中一扇，露出一只山羊。主持人其后会问参赛者要不要换另一扇仍然关上的门。问题是：换另一扇门会增加参赛者赢得汽车的机会率？

```
MontyHall<-function(Dselect,Dchange){
  Dcar<-sample(1:3,1)
  ##print(Dcar)
  if (Dcar==Dselect & Dchange==0) return(1)
  else if (Dcar!=Dselect & Dchange==0) return(0)
  else if (Dcar==Dselect & Dchange==1) return(0)
  else return(1)
}
```

```
MontySim<-function(n,Dchange){
```

# Anscombe's 4 Regression data sets

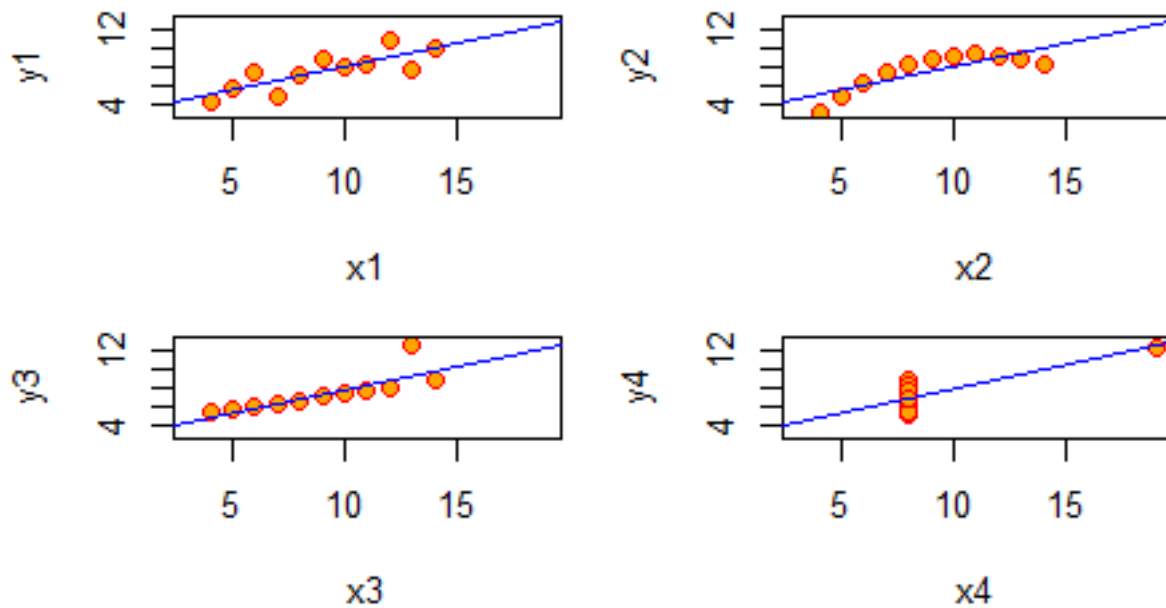


Figure 6: Anscombe Data Plot

```
win<-0
for(i in 1:n){
  Dselect<-sample(1:3,1)
  win<-win+MontyHall(Dselect,Dchange)
}
pwin<-win/n
return(pwin)
}

MontySim(100000,0)
MontySim(100000,1)
```

事实上不换门的话，赢得汽车的几率是  $1/3$ 。换门的话，赢得汽车的几率是  $2/3$ 。因为，当你从三扇门中选了门 1 后，这扇门后面有奖的几率是  $1/3$ ，另两扇门是  $2/3$ 。但接下来主持人给了你一个线索。如果奖品在门 2 后，主持人将会打开门 3；如果奖品在门 3 后，他会打开门 2。所以如果你改选的话，只要奖品在门 2 或门 3 后你就会赢，两种情况你都会赢！但是如果你不改选，只有当奖品在门 1 后你才会赢。

## Kendall 相关系数

```
##Kendall's 相关计算
## 方法一

udcorr<-function(x,y) mean(sign(diff(x))==sign(diff(y)))
```

## 批量处理外部文件

- 方法一：保存成独立文件
- 方法二：保存成 list

## 方法一

```
fileName <- dir("data/csv")
scode<-substr(fileName,1,6)
nfile<-length(fileName)

for(i in 1:nfile){
  assign(paste("s",scode[i], sep=""),read.csv(fileName[i],header=TRUE))
}
```

## 方法二

```
fileName <- dir("D:/tempdata/csv")
cls <- c("character","character","character",
        "numeric","numeric","numeric","numeric")
stocklist<- lapply(fileName,function(x) read.csv(x,header=TRUE,colClasses=cls,
        stringsAsFactors=F))
allstcok<- do.call(rbind,stocklist)
```

## 关于性能

```
## Create the data frame
col1 <- runif (12^5, 0, 2)
col2 <- rnorm (12^5, 0, 2)
col3 <- rpois (12^5, 3)
col4 <- rchisq (12^5, 2)
df <- data.frame (col1, col2, col3, col4)

## 未经优化
system.time(
{
  for (i in 1:nrow(df)){
    if (df[i,1]+df[i,2]+df[i,3]+df[i,4]>4) {df[i,5]<- "greatthan4"}
    else {df[,5]<- "lessthan4"}
  }
}
)

## 优化
system.time(
{
  want = which(rowSums(df) > 4)
  output = rep("less than 4", times = nrow(df))
  output[want] = "greater than 4"
}
)

##Rcpp
```

## 为什么是 useR?

- S 语言的理念, 用它的发明者 John Chambers 的话说就是 “to turn ideas into software, quickly and faithfully
- John Chambers 是这样对 R 语言定义的
- An interface to computational procedures of many kinds;
- Interactive, hands-on in real time;
- Functional in its model of programming;
- Object-oriented, “everything is an object”;
- Modular, built from standardized pieces;
- Collaborative, a world-wide, open-source effort.

## Advance R

R 语言有 20 多岁了。它包含近 80 万行代码 (约 45% 的 C 语言代码、19% 的 R 代码和 17% 的 Fortran 代码)。只有 R 核心团队的成员 (简称 R-core), 才能改变基础 R 语言。目前 R-core 有 20 个成员 (<http://www.r-project.org/contributors.html>), 但是只有 6 个成员在日常开发中是活跃的。R-core 中没有一个人全职工作在 R 语言上。

## 关于 R 的前世今生的几篇文章

- 刘思圉, R You Ready?——大数据时代下优雅、卓越的统计分析及绘图环境
- 谢益辉, 郑冰 (2008). R 语言的历史背景、发展历程和现状. 1st China R Conference

## SAS 和 R 的比较分析

- 谢益辉在统计之都的这篇文章后面的评论记录了 SAS 和 R 用户的一场口水战
- 胡江堂有两篇Think SAS(二)Think SAS(二)值得读读

## R 的学习曲线为什么陡峭

- 数据类型丰富
- 语法灵活、选择太多
- 需要一定编程基础
- 真正陡峭的是后面的统计知识基本功 ( 因为它的诞生本身就是用于统计研究 )

## 如何学习 R

- 热爱编写代码
- 多动手写代码
- 多看别人代码

## 如何寻找帮助

- R 帮助文档
- [stackoverflow.com](https://stackoverflow.com)
- [stats.stackexchange.com/](https://stats.stackexchange.com/)
- [google/baidu](https://google/baidu)

## 课后练习

- 评估下自己的 R 语言水平测验
- 登陆 QQ 群
- 安装课程要求的软件
- 下载课件及相关教材

## 每周“大牛”

- Sir R.A.Fisher ( 1890 ~ 1962 ), 全名 Ronald Aylmer Fisher, 生于伦敦, 卒于 Adelaide ( 澳洲 )。英国统计与遗传学家, 现代统计科学的奠基人之一, 并对达尔文进化论作了基础澄清的工作。
- Fisher 以天文学学士毕业于剑桥大学, 也因对天文观测误差的分析, 使他开始探讨统计的问题。毕业后几年, 他曾到加拿大务农, 工作于投资公司, 也当过私立学校的老师。并在 1915, 1918 发表两篇重要文章, 前者探讨相关系数的分布; 后者证明遗传上的连续变异, 可用许多遵守孟德尔律的基因变异所叠加来解释。他一生在统计和生物的研究兴趣与才华, 已经清楚地表现出来。
- 1919 年他拒绝在 K. Pearson 下工作, 任职于 Rothamsted 农业实验场。他负责的主要工作是植物播殖实验的设计, 希望透过尽量少的时间、成本与工作量, 得到尽量多的有用资讯; 另外是要整理该实验场 60 年来累积的实验资料。Fisher 在这里发展他的变异数分析理论, 研究假说测试, 并且提出实验设计的随机化原则, 使得科学试验可以同时进行多参数之检测, 并减少样本偏差。
- 他在 1925 所著《研究工作者的统计方法》影响力超过半世纪, 遍及全世界。而他在 Rothamsted 的工作结晶, 同时也表现在为达尔文演化论澄清迷雾的巨著《天择的遗传理论》(1930) 中, 说明孟德尔的遗传定律与达尔文的理论并不像当时部份学者认为的互相矛盾, 而是相辅相成的。并且认为演化的驱动力主要来自选择的因素远重于突变的因素。这本著作将统计分析的方法带入演化论的研究。为解释现代生物学的核心理论打下坚实的基础。也因这本著作, Fisher 1933 年获得伦敦大学的职位, 从事 RH 血型的研究。
- 1943 至 1957 年他回剑桥大学任教, 1952 年受封爵士, 1956 年出版《统计方法与科学推演》, 最后三年, 则在澳洲为国协科技研究组织 (CSTRO) 工作, 并卒于任上。