工作周报

1. 工作内容及进度：

* 根据CNE5文档，编写计算Beta，Momentum，Liquid等10个指标的程序；
  + - 前9个指标已经编写完成，进行了初步测试，其中有6个指标可以对绝大多数股票计算获取到值，另外3个指标因为相关财务数据滞后的原因，支持完成指标运算获取数据的股票很少；
    - 第10个指标----Non-Linear Size，文档介绍中没有给出具体计算公式，描述也不够确切，暂时不太明白其具体以意思；
    - 编写程序计算所有上市公司行业归属（以证监会对各个上市公司分类为准），计算结果最终形式：{3087x1 cell} {18x1 cell} [3087x18 double] ； 第一个元胞为所有股票代码，第二个元胞为被分成的18个行业名称，第三个元胞每一行对应这一个股票的行业归属值，格式为:000100….0, 010….000.
  + 学习研究“国泰君安”数量化专题之五十七期报告；
    - 结合公司白板描述，基本整理出该研究策略的大体结构框架；
    - 需要根据CNE5中的指标运算，根据公式r=Xf+u; 其中X矩阵为三维矩阵，通过CNE5指标计算获得， f、u为二维矩阵，通过多元线性回归获得；r为二维矩阵，通过计算股票价格获取；
    - 获取矩阵x，∆和F；
    - 通过Rp/σ极大值求解，得出投资组合权重w；

1. 下周计划:
   * 根据策略算法实现，修改CNE5指标代码，集成优化算法；
   * 开始编写策略框架；
2. 其他：
   * 编写策略难点主要：报告中策略涉及的细节；Rp/σ极大值求解暂时还没有想到好的算法；
   * 考基金从业资格证书，我看了一下内容挺多，如果直接报考三月份预约考试，时间比较紧张，如果可能我想最好能报考4月份的统考，时间充裕些，更有把握些；
   * 建议：公司内部搭建小型服务器，将一些交易统计规律及类似结果放在平台上（如每周每月不同交易日不同股票涨跌规律及相关性等），供交易参考，加强相互交流学习；