
高级量化交易技术

闫涛
科技有限公司
北京 2021.05.08
fyt7589}@qq.com

第零篇深度学习

第 1 章行情数据处理

Abstract

在本章中我们将通过 AKshare 库，获取 A 股分钟级行情数据，并将其进行预处理，变为深度学习可用的数据集。

1 行情数据处理概述

1.1 获取原始行情数据

我们首先通过 `apps.fmts.ds.akshare_data_source.AkshareDataSource` 获取原始的行情数据，-将其保存到 csv 文件中。如果存在该 csv 文件，则直接从该文件中读出数据并返回。数据格式为：

```
1 .....
2 [ '2021-08-17 14:55:00', 30.339999999999996, 30.339999999999996,
   30.339999999999996, 30.339999999999996, 200.0]
3 [ '', 30.339999999999996, 30.339999999999996, 30.339999999999996,
   30.339999999999996, 200.0]
4 .....
```

Listing 1: 行情数据格式

1.2 我

我们以收盘价为例，收盘价的折线图如下所示：

2 附录 X