**策略数据质量评估办法（第一版）**

选取策略样本（参考 excel: Quality\_Performance\_Final\_4Study.xls）

1. 设计算法确认策略样本是日净值，还是周净值**（目前没有算法）**；
2. 将策略按日净值，周净值进行分群；
3. 在日净值群和周净值群，分别计算每个策略的：
   1. 起始日期（Col D）
   2. 终止日期（Col E）
   3. 实际观察数（Col F）（数据样本实际有的日期数）
   4. 间隔日期数（Col G）（根据起始和终止日期，计算起始日期之间的日期数（如果日净值群，就是天数；如果周净值群，就是周数））
   5. 标杆观察数（Col I）（根据起始和终止日期，计算起始日期之间沪深300指数的交易日期数（在日净值群里，就是天数；如果周净值群，就是周数））
   6. Ratio（实际观察数/标杆观察数）
   7. Volatility（日（周）波动）
   8. Win\_Ratio（日（周）胜率）