**S回测结果**

**一、环境参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 时间起始 | 2012-01-01 |
| 时间终止 | 2013-12-31 |
| 股票池 | 000300.SH |
| 中性化 | 全市场 |
| 信号衰减天数 | 10 |
| 截尾 | 50.0% |
| 最高仓位 | 10.0% |
| 换仓时间 | 早盘换仓 |

**二、s公式:**

%% s的入口% 注1：设置为nan，强制空仓（设置0未必空仓，因为还要中性化）

% 注2：code是保留字，是000001.SZ

% 注3：时间通过下标实现，如果要看日期，

% dateArr(i)形同'2014-09-14'

% dateNumArr(i)形同 735839

% 注4, col 是保留字

% 注5，其他保留字对照Main15\_basicData看：

% open, close, high, low, avg (向前复权）

% openRT, closeRT, highRT, lowRT, avgRT（不复权）

% volume, amount, change, retrn（不是return）

% retrn2, tradable

% 注6，经常用到的函数在mv类中，如 mv.avg

% --------------------------------------

% 程刚，140915

% 程刚，141001，加入后处理

%% 用于写各种ｓ

% a = mv.stddev( log(1+retrn2),5);

% b = mv.stddev(log(1+retrn2),50);

% s = a-b;

%% alpha = ma(close, 20) - ma(close, 5)

s = mv.avg(close,20) - mv.avg(close,5);

%% 评级策略

% s = (descendRatingNum - ascendRatingNum)./( rating.^4 );

% tmp = 0.1+ descendRatingNum - ascendRatingNum;

% s = sign(tmp).\* power(abs(tmp),1/2)./( rating.^1);

%

% s = 1./rating.^10;

% s = 1./rating.^10 .\* power( ratingNum, 1/2);

%% ROE, EPS 策略

% s = roeDeducted .\* epsDiluted;

% s = roeDeducted .\* revenueYoy ;

% s2 = mv.avg(close,20) - mv.avg(close,5);

% s = s .\* s2;

%% sum\_i(close,20)

% for i = 1:20

% sum = sum + close(t -i );

% end

%% INF是不应该出现的

s(s==Inf) =nan;

s(s==-Inf) = nan;

**三、图**

