

## 股票如何进行回测|制定了一个策略，比如5日线上穿10日线做多，反之卖出。那么怎么在同花顺或通达信软件上进行回测？-股识吧

### 一、制定了一个策略，比如5日线上穿10日线做多，反之卖出。那么怎么在同花顺或通达信软件上进行回测？

你所问的问题是量化交易的范畴，通达信上可以做到，通达信软件自带程序化交易评测系统，就可以进行回测，公式例子，可以参考通达信里自带的专家交易系统里的策略，策略回测，是非常有用的，但通达信，同花顺在这个方面不太专业建议用一些专业的量化分析平台，回测，优化参数，这里还涉及滑价，过度优化等问题，建议你从学习量化交易入手。

### 二、怎么做选股策略的历史回测

如果，excel肯定是不行的。  
如果仅仅对历史数据的回测，  
大多数情况下excel够用了，而且excel附带的功能还是很强大的。  
现在，好像很多人喜欢搞量化，  
我个人觉得是量化过度了，量化要有严谨的逻辑依据，不要随便设定一些参数就开始拿历史数据回测，然后找个最理想的结果对应的参数集就认为模型是可行了。  
其实，量化最重要的是逻辑推理，要能从理论上论证模型的可行性。  
股市投资不像自然界那么规律，投资是人性是多变的，  
对历史数据回测出来的东西要时刻保持清醒，  
尤其没有严谨推理的东西往往就是坏策略。

### 三、求问各位大神们，有没有可以选股回测的股票软件

展开全部也可以试试新推出的千投量化网址就是拼音全拼

## 四、怎么看股票的缺口和回补。

股票缺口指的是某支股票因为非正常因素促使股票投资者坚决作多或作空，从而使股价远离上日收盘价的现象，K线之间形成的价格不重合区域就是缺口。

。缺口方式 股票缺口分上跳缺口和下跳缺口。

上跳缺口表现形式有一字涨停板，高开高走等；

下跳缺口表现形式有一字跌停板，低开低走等。

缺口分类突破缺口

判断是否为突破缺口，关键看缺口产生时其身后有没有形态做衬托；

其次，再看缺口产生的当日和未来几天的成交量是否能持续放大。

如果是，那么我们初步判定其为突破性缺口。

突破性缺口产生之后，意味着行情将向着产生缺口的方向运行一段时间，股价也将向同一方向延伸较长的距离。

换言之，当我们确定了缺口为突破性质后，应持筹不动，以获取较大的利益。

测量缺口也是功能性缺口一种，亦称中途缺口、逃逸缺口、量度缺口

、中继缺口等等。

顾名思义，此种缺口的出现以为着行情已发展到了中途。

此缺口产生后，行情将加速运行并且短期内不会回补。

我们在确认一个缺口的测量缺口性质时，应特别注意这两个特定：

1.测量缺口出现的位置，远离上一个形态；

在缺口出现的当日，必须有大额的成交量做配合。

通常出现在一个漫长的单边升势当中，并且中途缺口出现后，股价将加速上扬，表现出轻快的上升态势。

竭尽缺口也称力竭缺口。

出现在一段中长期升势或跌势的尾声，此缺口的出现当天或次日，通常伴随着巨幅的成交量和股价的猛烈变动。

判断此种缺口，我们应该首先考虑当时的成交量是不是特别巨大，并预测在未来一段时间内将不可能出现更大的成交量，我们就可以初步判断此缺口将可能成为竭尽性缺口。

假如我们能够配合K线形态及其他技术分析方法，进行综合技术分析，其判断的准确性将大为增加。

此缺口的另一个特点是在几天之内有必补的特性，竭尽性缺口产生后，意味着阶段性大顶的出现，故投资者在确立了此种缺口的性质后，应出清手中的筹码。

## 五、怎么做选股策略的历史回测

展开全部自己设计交易系统，然后选择自己的交易系统进行测试，根据历史数据可以回归测试得出你的交易系统是赢是亏的结果。

## 六、具体的股票回测操作是怎样进行的，可以教教吗？

用5-10年数据回测

## 七、在构建多因子模型之前，如何对单因子效果进行检验

在构建多因子模型之前，如何对单因子效果进行检验？Barra结构化多因子风险模型是目前指数增强和阿尔法对冲基金应用比较广泛的分析工具，在构建多因子模型之前，我们需要寻找到有效的因子。

那么，到底要通过何种方法对单因子进行检验呢？最常用的方法是，我们用目标因子构建一个投资组合进行回测，看回测的结果来验证因子的有效性。

今天，我们以因子“20日相对强弱（RSI）”为例，详细讲解：数据处理在构建投资组合之前，我们首先需要对原始的因子值进行处理：去极值、正交化去极值：是去除数据中的极值，防止出现异常的个股被选入策略股票池，从而导致策略收益表现异常。

目前常用的去极值方法：1、均值方差去极值2、3倍标准差法去极值3、分位数去极值。

在这里我们选用均值方差去极值正交化：因子本身的数值受股票所属行业和股票市值的影响，所以对因子做正交化处理，去除行业 and 市值的影响。

常用方法：回归取残差法构建投资组合选取目标因子：这里我们以“20日相对强弱（RSI）”为例选取样本市场：A股所有股票，去除ST，停牌，上市时间小于3个月确定调仓频率和测试时间窗：5日调仓和10日调仓，从2022年1月1日至2022年1月1日根据因子IC、IR值确定因子排序方式，通过因子值的大小对股票进行排序，挑选排序前20%的股票买入。

按照调仓周期进行换仓。

回测10日IC值：-0.054210日IR值：-0.386910日回测：5日IC值：-0.06085日IR值：-0.43585日回测：结果分析：20日RSI回测10日年化收益27.2%，回测5日年化33.9%。

我们还对4日、8日、14日RSI因子进行检验，发现4日RSI因子的效果较差，8日、14日、20日RSI因子效果相似，比较有效。

## 八、10g的历史数据，如何用matlab来进行回测。

批量转成.mat数据，回测会加快速度。

### 参考文档

[下载：股票如何进行回测.pdf](#)

[《股票从业资格证需要多久》](#)

[《股票锁仓后时间是多久》](#)

[《小盘股票中签后多久上市》](#)

[下载：股票如何进行回测.doc](#)

[更多关于《股票如何进行回测》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/article/33831503.html>