

第6届中国R语言会议 (上海)

quantstrat包： R中的量化投资之路

@邓一硕

2013年11月03日

quantstrat包：R中的量化投资之路

1

量化投资与R语言

2

quantstrat

quantstrat包：R中的量化投资之路

1

量化投资与R语言

2

quantstrat







采用一些量化手段、通常是指构建计量经济模型和统计模型对金融和经济数据进行挖掘，从而形成可获得超额收益的投资方式。



特点：

- 1、应用大量概率和统计学知识
- 2、更加模型化
- 3、涉及大量编程
- 4、有时没有经济或金融逻辑支撑



昵图网 www.nipic.com

NO:20091206165230068130





误解：

- 1、量化=高频
- 2、量化=套利
- 3、量化=自动交易
- 4、量化=必然盈利



步骤:

- 1、获取市场数据
- 2、生成策略
- 3、策略回测
- 4、执行策略



步骤：

- 1、构建指标
- 2、构建信号
- 3、确定交易规则
- 4、生成策略



步骤：

- 1、收益率
- 2、波动率
- 3、最大回撤
- 4、sharp比率



步骤:

- 1、获取市场数据
- 2、生成策略
- 3、策略回测
- 4、执行策略

quantmod

quantstrat

quantstrat/PerformanceAnalytics

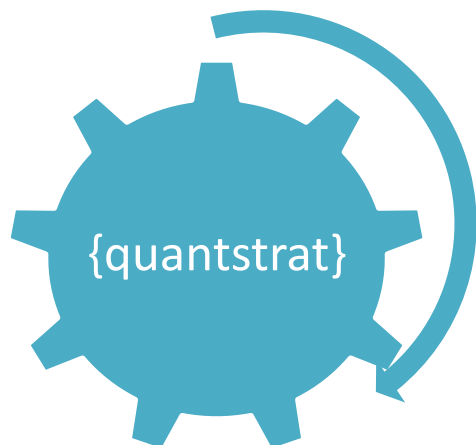
quantstrat包：R中的量化投资之路

1

量化投资与R语言

2

quantstrat



作者： Peter Carl, Brian G. Peterson,
Joshua Ulrich, Jan Humme

作用： 开发和回测策略



步骤:

- 1、构建指标----`add.indicator`
- 2、构建信号----`add.signal`
- 3、确定交易规则----`add.rule`
- 4、生成策略----`applyStrategy`



例子1: Quantitative Trading Strategies in R
(Part 1 of 3)

例子2: Quantitative Trading Strategies in R(Part
2 of 3)



网站: <http://yishuo.org>

微博: [@邓一硕](#)