

```
[3]: pd.to_datetime('2021-01-01') + pd.tseries.offsets.MonthBegin(-1)
```

```
[3]: Timestamp('2020-12-01 00:00:00')
```

```
[1]: 1 %%backtest
2 # from datetime import datetime
3
4 start = '2024-06-01'
5 end = '2025-03-31'
6 universe = StockUniverse('ZZ800')
7 # 沪深300: 由上海和深圳证券交易所中市值大、流动性好的300只股票组成, 综合反映中国A股市场上市股票价格的整体表现。
8 # 中证500: 由全部A股中剔除沪深300指数成份股及总市值排名前300名的股票后, 总市值排名靠前的500只股票组成, 综合反映中国A股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。
9 # 中证800: 中证800指数由中证500和沪深300指数成份股组成, 综合反映中国A股市场大中小市值公司的股票价格表现。
10 benchmark = 'HS300'
11 freq = 'd'
12 refresh_rate = Monthly(-1)
13
14 accounts = {
15     'stock_account': AccountConfig(account_type='security', capital_base=1e6)
16 }
17
18
19 def initialize(context):
20     pass
21
22
23 def handle_data(context):
24     current_universe = context.get_universe(asset_type='stock', exclude_halt=True)
25     today = context.current_date
26     # print(today)
27     if today.strftime('%d') == '01':
28         prev_month_begin = today + pd.tseries.offsets.MonthBegin(-1)
29     else:
30         prev_month_begin = today + pd.tseries.offsets.MonthBegin(-2)
31     # print('prev_month_begin:', prev_month_begin)
32     try:
33         factor_exposure = get_data_cube(symbol=current_universe,
34                                         field=['d6dk9218qq.size2025', 'd6dk9218qq.rev2025', 'd6dk9218qq.bm2025',
35                                                'd6dk9218qq.illiq2025', 'd6dk9218qq.ivol2025'],
36                                         start=prev_month_begin, end=today,
37                                         style='ast').to_frame().reset_index()
38     except AttributeError:
39         factor_exposure = pd.DataFrame()
40     # print(factor_exposure)
41     if factor_exposure.shape[0] == 0:
42         pass
43     else:
44         factor_exposure.rename(columns={'major': 'date', 'minor': 'sec_id',
45                                         'd6dk9218qq.size2025': 'size',
46                                         'd6dk9218qq.bm2025': 'bm',
47                                         'd6dk9218qq.rev2025': 'rev',
48                                         'd6dk9218qq.illiq2025': 'illiq',
49                                         'd6dk9218qq.ivol2025': 'ivol'}, inplace=True)
50     # print(factor_exposure)
51     # print(factor_exposure['date'].unique()[-1])
52     factor_exposure = factor_exposure[factor_exposure['date'] == factor_exposure['date'].unique()[-1]]
53     ##### Intersection #####
54     stocks_set = {}
55     # stocks_set['rev'] = set(factor_exposure.sort_values('rev', ascending=True)['sec_id'].iloc[0:200].tolist())
56     # stocks_set['size'] = set(factor_exposure.sort_values('size', ascending=True)['sec_id'].iloc[0:200].tolist())
57     stocks_set['illiq'] = set(factor_exposure.sort_values('illiq', ascending=False)['sec_id'].iloc[0:200].tolist())
58     stocks_set['ivol'] = set(factor_exposure.sort_values('ivol', ascending=True)['sec_id'].iloc[0:200].tolist())
59     # stocks_set['bm'] = set(factor_exposure.sort_values('bm', ascending=False)['sec_id'].iloc[0:200].tolist())
60     buy_list = set.intersection(
61         # stocks_set['rev'],
62         # stocks_set['size'],
63         stocks_set['illiq'],
64         stocks_set['ivol'],
65         # stocks_set['bm']
66     )
67     buy_list = list(buy_list)
68     ##### Scoring #####
69     # factor_exposure['rev_rank'] = factor_exposure['rev'].rank()
70     # factor_exposure['size_rank'] = factor_exposure['size'].rank()
71     # factor_exposure['illiq_rank'] = factor_exposure['illiq'].rank(ascending=False)
72     # factor_exposure['ivol_rank'] = factor_exposure['ivol'].rank()
73     # factor_exposure['bm_rank'] = factor_exposure['bm'].rank(ascending=False)
74     # factor_exposure['rank_sum'] = factor_exposure['illiq_rank']
75     #     factor_exposure['rev_rank'] + \
76     #     factor_exposure['ivol_rank']
77     #     factor_exposure['size_rank'] + \
78     #     factor_exposure['bm_rank']
79     # factor_exposure.sort_values('rank_sum', inplace=True)
80     # factor_exposure.reset_index(drop=True, inplace=True)
81     # print(factor_exposure)
82     # nstocks = factor_exposure.shape[0]
83     # buy_list = list(factor_exposure['sec_id'].iloc[0:20])
84
85     stock_account = context.get_account('stock_account')
86     current_positions = stock_account.get_positions(exclude_halt=True)
87
88     for stock in current_positions:
89         if stock not in buy_list:
90             stock_account.order_to(stock, 0)
91     if len(buy_list) == 0:
92         pass
93     else:
94         for stock in buy_list:
95             stock_account.order_pct_to(stock, 1/len(buy_list))
96
```

^

回测完成, 耗时35.281 秒

年化收益率

30.3%

收益波动率

基准年化收益率

10.8%

信息比率

阿尔法

19.7%

最大回撤

贝塔

0.98

跟踪误差时间

夏普比率

1.13

年化换手率



```
[ 2 ]: 1 # #查看调仓记录
      2 show_order(start,end)
```

stock\_account  查询日期: 2024-06-28  至 2025-03-31 

导出EXCEL

资产代码	资产名称	业务类型	订单类型	委托价格	成交均价	委托数量	成交数量	成交金额	委托时间	成交时间	交易费用	订单状态
000539	粤电力A	卖出	市价单	市价	4.55	5,200	5,200	23,660.00	2025-03-31	2025-03-31	47.32	全部成交 <span>①</span>
600361	创新新材	卖出	市价单	市价	4.16	6,000	6,000	24,960.00	2025-03-31	2025-03-31	49.92	全部成交 <span>①</span>
601106	中国一重	卖出	市价单	市价	2.83	8,500	8,500	24,055.00	2025-03-31	2025-03-31	48.11	全部成交 <span>①</span>
001203	大中矿业	卖出	市价单	市价	8.64	2,700	2,700	23,328.00	2025-03-31	2025-03-31	46.66	全部成交 <span>①</span>
601061	中信金属	卖出	市价单	市价	7.77	3,200	3,200	24,864.00	2025-03-31	2025-03-31	49.73	全部成交 <span>①</span>
002690	美亚光电	卖出	市价单	市价	17.04	1,600	1,600	27,264.00	2025-03-31	2025-03-31	54.53	全部成交 <span>①</span>
600959	江苏有线	卖出	市价单	市价	3.41	7,000	7,000	23,870.00	2025-03-31	2025-03-31	47.74	全部成交 <span>①</span>
3000	联水源	卖出	市价单	市价	4.82	4,800	4,800	23,136.00	2025-03-31	2025-03-31	46.27	全部成交 <span>①</span>

每页20条，共 796 条 < 

2 3 4 5 ... 40

 > 

20 条/页

 跳至  页

```
[ 3 ]: 1 # #查看持仓记录
      2 show_position(start,end)
```

stock\_account  查询日期: 2025-03-31 

导出EXCEL

资产代码	资产名称	公允价格	持仓数量	可用数量	持仓市值	累计盈亏	持仓权重	摊薄成本
600928	西安银行	3.51	7,900	6,700	27,729.00	1655.26	2.24%	3.30
600925	苏能股份	5.18	5,300	4,700	27,454.00	881.78	2.22%	5.01
002608	江苏国信	7.63	3,600	3,200	27,468.00	809.37	2.22%	7.41
300140	节能环保	5.85	4,600	3,800	26,910.00	169.28	2.17%	5.81
000800	一汽解放	8.09	3,400	2,800	27,506.00	343.87	2.22%	7.99
000537	中绿电	8.48	3,200	2,800	27,136.00	-83.19	2.19%	8.51
600007	中国国贸	23.00	1,200	1,000	27,600.00	-319.89	2.23%	23.27
601568	北元集团	4.01	6,800	5,700	27,268.00	-527.77	2.20%	4.09
600995	南网储能	9.55	2,800	2,400	26,740.00	-687.40	2.16%	9.80
000937	冀中能源	5.87	4,700	4,000	27,589.00	45.48	2.23%	5.86
600867	通化东宝	7.57	3,600	3,100	27,252.00	-40.27	2.20%	7.58
600000	浦发银行	5.55	5,000	4,500	27,750.00	155.15	2.20%	5.55

每页20条，共 46 条 < 

2 3

 > 

20 条/页

 跳至  页