

# 清华大学

## 培训大纲

**日期：**2024 年 4 月 19 日

**时间：**14:00-15:30

**培训讲师：**陈戎，万得培训讲师

## 培训内容速览

本次培训内容将以案例的方式，介绍如何通过 Wind 金融终端构建个性化的股票投资组合，并进行回测分析。

Part1：多维度提取股票指标，自定义分析报表

Part2：设置个性化条件，筛选股票组合

Part3：构建投资策略进行回测分析

## 培训内容

### Part1：多维度提取股票指标，并进行自定义报表分析

#### 1.1 股票数据浏览器 EDE：“三选一提”要领

(1) 股票数据浏览器，可以帮助您在不同的区域范围内，根据不同的指标进行筛选和搜索、提取数据，免去在度娘上花费大量时间去查找过时或者来源不实的数据信息。

您可以通过首页-股票-多维数据-数据浏览器 EDE 进入，或是通过键盘精灵：快捷键 EDE，按 enter 键快速进入股票数据浏览器界面。



## (2) 操作口诀：“三选一提”

选范围、选指标、选参数、提取数据。其中：选择范围和指标，既可以通过指标树进行查找，也支持在各自快速检索框进行中文全称、拼音简称和英文简称的检索。

④ 提数据 →

② 选指标 →

① 选范围 →

工具栏

③ 选参数

✓ 操作步骤:三选一提

- (3) 若需将不同行业分类范围添加至同一 sheet 对比，可在上方勾选“添加板块到当前页”
- 若需保持默认参数，可在上方勾选“添加指标到当前页”
- 若需统一修改所添加指标的各类参数，可在上方点击“修改参数”

## 1.2 自定义分析报表：整体/分组统计、筛选、时序图

您可以通过上方菜单栏中的“整体统计”、“分组统计”、“筛选”及“时序图”等对报表数据进行自定义分析

## 1.3 构建自定义板块、自定义指标

### 1.3.1 构建自定义板块

您可以通过点击上方菜单栏“自定义板块” / 快捷键 F7 或 O7 进入板块管理功能

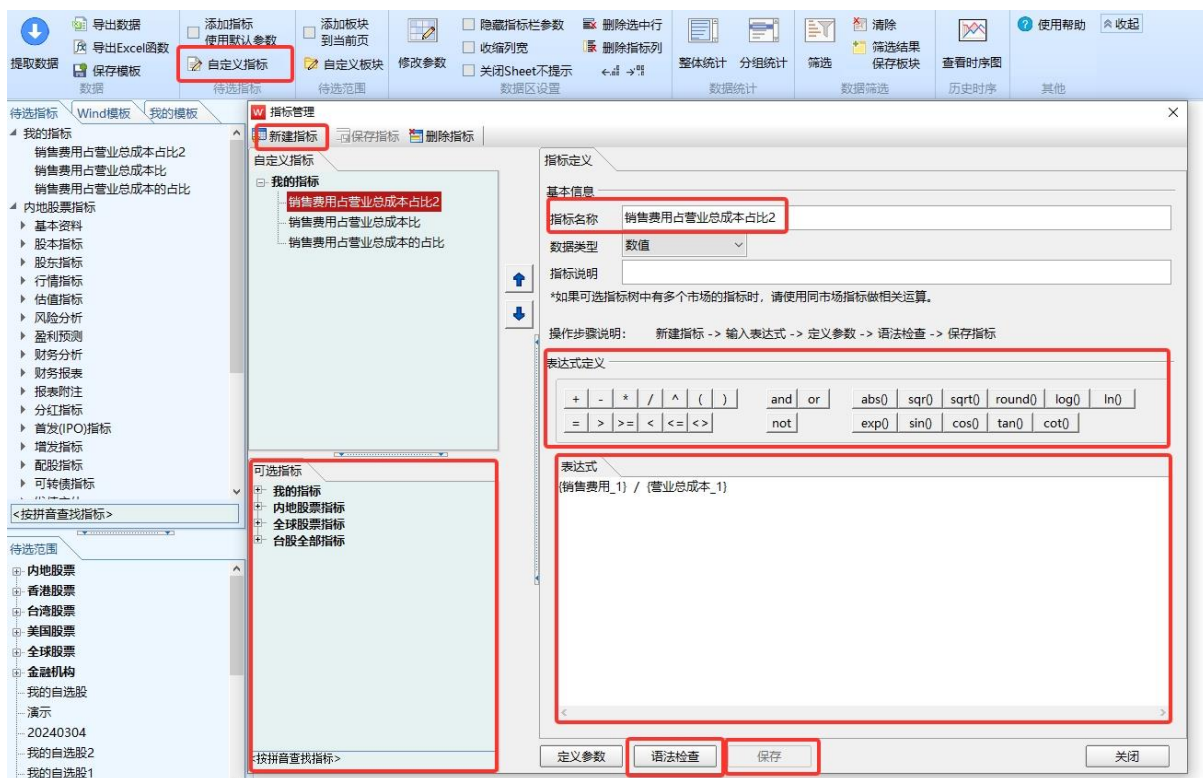
- (1) 右下角快速添加证券
- (2) 手工选择/板块运算 添加板块成分
- (3) 更多导入：粘贴导入/文件导入/从其他软件导入



### 1.3.2 构建自定义指标

您可以通过点击上方菜单栏“自定义指标”功能，构建自定义指标

新建指标—输入指标名称—左下角选择基础指标—选择运算符号—构建表达式—语法检查—保存



## 1.4 保存模板、导出数据、Excel 函数

若您下次还需要使用该模板，可以通过左上方菜单栏“保存模板”，下次即可直接在“我的模板”中打开使用，为您大大提高了使用效率；

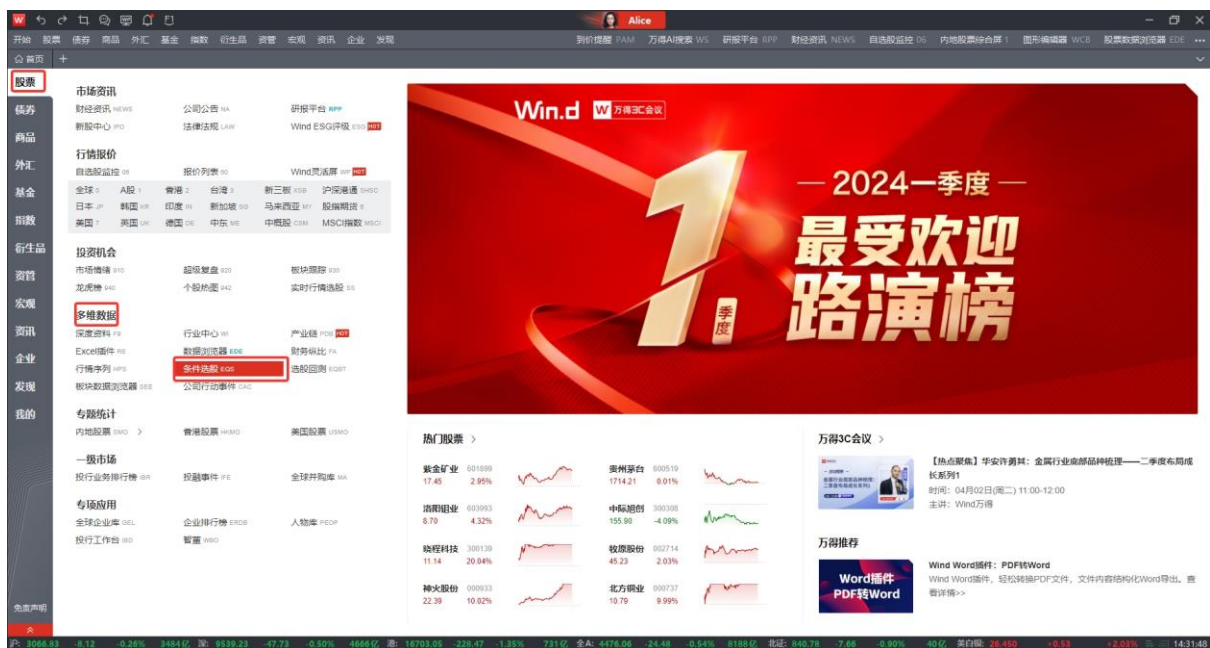
若您需要将所提取的数据进行导出，可以通过左上方菜单栏“导出数据”和“导出 Excel 函数”实现；“导出数据”可获得一份纯数据的表格，“导出 Excel 函数”可获得一份自动更新的数据报表。

## Part2：设置个性化条件，筛选股票组合

### 2.1 条件选股 EQS：基本介绍

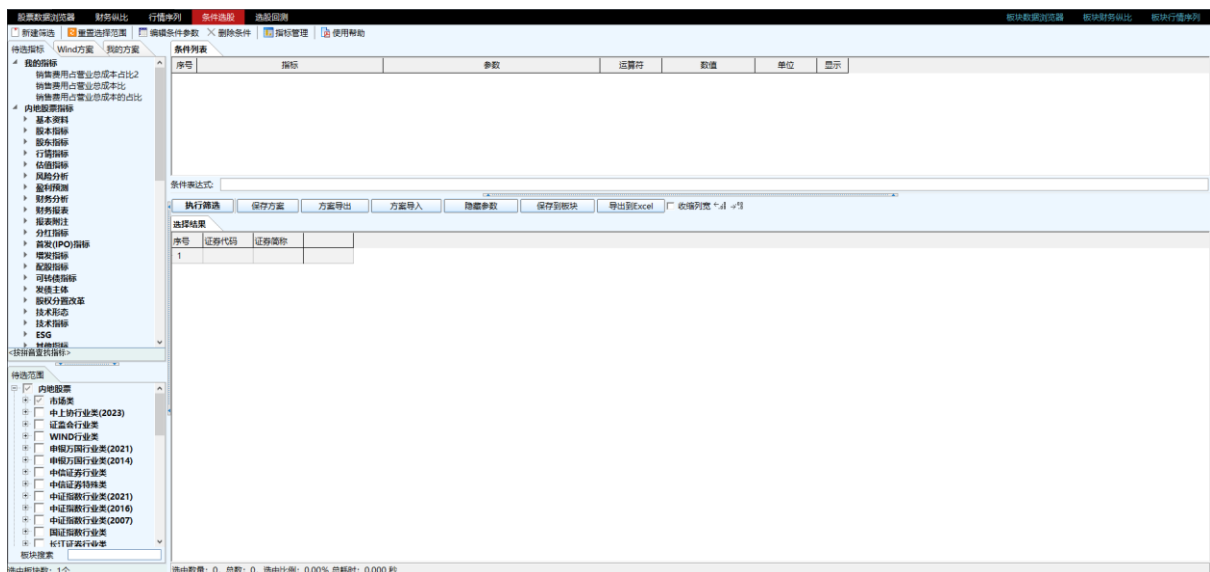
条件选股模块是强大的智能选股搜索引擎，可以对系统或自定义板块中的指标进行参数设置，筛选出符合条件的股票品种。

您可以通过点击首页—股票—多维数据—条件选股进入，或是键盘精灵：输入 EQS 进入。



### 2.1.1 选择范围、选择指标、设置参数

例如，我们想要查找市盈率在 0-20 之间，经营范围包含新能源，近两年净利润>0 且连续增长，并且 2022 年净利润相比 2021 年净利润增速大于 30% 的公司；我们可以在待选范围中选择“全部 A 股”，待选指标中选择“市盈率”“经营范围”“净利润”，设置指标参数。



### 2.1.2 设置条件列表、执行筛选

对于复杂的案例，您可以在条件表达式中进行编辑，当鼠标靠近条件表达式区域，系统提示可以运用加减乘除进行灵活运算，还可以运用括号控制优先权。

例如，本案例中，可以在条件表达式中输入：#1 and #2 and #3 and #4>#5>0 and #4/#5>1.3



## Part3：构建投资策略并进行回测分析

### 3.1 选股回测 EQBT：策略构建

量化选股回测为您提供了一套便捷化、轻量化的选股回测解决方案，可以在短时间内将您对市场  
的看法转化为投资策略，并通过 EQBT 完成回测。

您可以通过首页—资管—投资研究—选股回测进入，也可以通过键盘精灵：EQBT 快捷键进入。

在右上角点击新建策略，可以构建个性化策略方案。

#### 3.1.1 选股模块

创建策略的第一步是确定股票池，为您提供了常用股票池和自定义股票池两种选项。在选定基础  
股票池后，根据需要设定选股条件，这里为您提供了四种逻辑运算符，丰富您构成选股的逻辑。  
设置好后，可以在右上方点击“查看选股”了解详情。

The screenshot displays the '选股' (Stock Selection) module of the EQBT system. It features a sidebar on the left with navigation links. The main interface is divided into several functional areas: 1. '股票池' (Stock Pool) section at the top, allowing users to select from '常用股票池' (Common Stock Pool) or '自定义股票池' (Custom Stock Pool) with various filters like market, industry, and region. 2. '选股因子' (Selection Factors) section, which includes a table for defining selection conditions using logical operators. 3. '评分' (Scoring) section, which allows for defining scoring factors and models. 4. '回测选项' (Backtest Options) section at the bottom, where users can set the backtest period, start/end dates, and other parameters. The bottom of the screen shows a real-time market data ticker with various financial indicators.

#### 3.1.2 评分模块

选股模块选定了股票池，但是您不一定会将全部的备选股票纳入组合，所以您可以通过对备选股  
票的评分及排序，确定最后的策略组合构成。

评分模型分为排序以及评分两种，选定模型之后，您可以像添加选股因子一样添加评分因子。评  
分因子共有三个参数，分别为日期、偏好以及权重。设置好评分因子后，可以在入选规则中设置

备选股票入选数量等。最后，可以在右上方点击“查看评分”了解详情。

### 3.1.3 回测选项

当我们确定了选股以及评分的入选规则后，就进入了最后一步：确定回测选项。在左侧确定开始和结束日期，在右侧交易配置中确定调仓的具体参数。最后，点击下方保存并开始回测，填写方案名称及描述。

## 3.2 选股回测 EQBT：结果分析

在策略构建完成后，您可以通过左侧浏览该策略的汇报结果以及相关分析数据，所有数据及图形均支持导出。

### 3.2.1 绩效分析

绩效分析模块分为收益概览、收益统计、月历效应、业绩归因。



### 3.2.2 持仓分析

持仓分析模块分为交易详情、历史持仓、行业分析。

全市场价值选股

回溯区间: 2013.09.30 - 2018.09.28 | 业绩基准: 沪深300 | 基准行业分类: WIND一级行业

新建策略 | 查看策略 | 导出数据 | 帮助文档

选股结果

- 绩效分析
- 收益概览
- 收益统计
- 月历效应
- 业绩归因

持仓分析

- 交易详情
- 历史持仓
- 行业分析

策略列表

- 全市场价值选股 [选]
- 模板1
- 测试1 [PMS]

日期	证券代码	证券简称	买入数量	买入价格	调整类型	卖出数量	卖出价格	调整类型
2018-07-02								
2018-04-02								
15:00:00	603899.SH	晨光文具	1,111	30.72	建仓			
15:00:00	603660.SH	苏州科达				474	37.84	清仓
15:00:00	603658.SH	安图生物				290	58.58	减仓
15:00:00	603338.SH	浙江鼎力				336	67.44	清仓
15:00:00	603288.SH	海天味业				1,869	55.98	减仓
15:00:00	603239.SH	浙江仙通				514	16.55	清仓
15:00:00	603025.SH	大豪科技				862	32.08	清仓
15:00:00	601012.SH	隆基股份	2,409	34.04	建仓			
15:00:00	600633.SH	新数文化				2,473	13.62	清仓
15:00:00	600519.SH	贵州茅台	1,517	680.06	建仓			
15:00:00	600477.SH	杭萧钢构				2,611	9.41	清仓
15:00:00	600338.SH	西药转债				1,240	32.12	清仓
15:00:00	600276.SH	恒瑞医药				5,351	84.87	清仓
15:00:00	600201.SH	生物股份				1,708	26.65	清仓
15:00:00	300415.SZ	伊之密				820	15.50	清仓
15:00:00	300357.SZ	凯美生物	195	61.40	建仓			
15:00:00	300015.SZ	爱尔眼科				2,890	40.35	清仓
15:00:00	002677.SZ	浙江美大	780	17.43	建仓			
15:00:00	002555.SZ	三七互娱				4,081	18.62	清仓
15:00:00	002466.SZ	天齐锂业	1,379	57.99	建仓			
15:00:00	002460.SZ	赣锋锂业	895	73.86	建仓			
15:00:00	002236.SZ	大华股份	3,502	24.40	建仓			
15:00:00	002120.SZ	韵达股份				2,312	47.84	清仓