

一个向上的垂直数据，甚至涨停板，总会给参与带来不少的喜悦，也因此，对涨停板数据进行处理是算法建立不可或缺的功课。

浏览评论区网友们留给我的作业，是做算法工作的日常，请看留言：

评论区的留言

网友的想法是：涨停板（实体涨停，T字涨停，一字涨停

）后的三天之内，涨停板的最低价被下破，之后，又在三天之内，实体涨停的开盘价被收回，T字涨停的最低价被收回，一字涨停的前一天收盘价被收回，建立数据筛选的算法。

思路步骤

1. 对三类涨停板进行分类量化定义；
2. 应用FIND函数，先下破最低价；
3. 后应用BARSLAST与CROSS函数组合，上破三类涨停板各自的对应数据位；
4. 取三类涨停板位置“等于”6，是本算法的点睛之处，最后合并计算，完成数据筛选算法。

算法建立

1. 对三类涨停板进行分类量化定义：

三类涨停板的量化定义

STB:=C=H AND C/O>=1.05 AND C/REF(C,1)>=1.098;

YZB:=O=H AND H=L AND L=C AND C=O AND C/REF(C,1)>=1.098;

TZB:=O=H AND H=C AND C=O AND L=1.098 ;

DRAWICON(STB,L,38);

DRAWICON(YZB,L,38);

DRAWICON(TZB,L,38);

STBW:=CONST(BARSLAST(STB));

STBO:IF(STBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=7,CONST(REF(O,STBW)),DRAWNULL);

STBL:IF(STBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=7,CONST(REF(L,STBW)),DRAWNULL);

YZBW:=CONST(BARSLAST(YZB));

YZBQC:IF(YZBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=8,CONST(REF(C,YZBW+1)),DRAWNULL);

YZBL:IF(YZBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=7,CONST(REF(L,YZBW)),DRAWNULL);

TZBW:=CONST(BARSLAST(TZB));

TZBL:IF(TZBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=7,CONST(REF(L,TZBW)),DRAWNULL);

数据筛选

1.实体涨停板的数据筛选

STBW:=CONST(BARSLAST(C=H AND C/O>=1.05 AND C/REF(C,1)>=1.098));

STBO:=IF(STBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=7,CONST(REF(O,STBW)),DRAWNULL);

STBL:=IF(STBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=7,CONST(REF(L,STBW)),DRAWNULL);

STBW=6 AND CONST(FINDLOW(C,3,3,1))<STBL AND
CONST(BARSLAST(CROSS(C,STBO)))<=2;

2.T字涨停板的数据筛选

TZBW:=CONST(BARSLAST(O=H AND H=C AND C=O AND L=1.098));

TZBL:=IF(TZBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=7,CONST(REF(L,TZBW)),DRAWNULL);

TZBW=6 AND CONST(FINDLOW(C,3,3,1))<TZBL AND
CONST(BARSLAST(CROSS(C,TZBL)))<=2;

3.一字涨停板的数据筛选

YZBW:=CONST(BARSLAST(O=H AND H=L AND L=C AND C=O AND
C/REF(C,1)>=1.098));

YZBQC:=IF(YZBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=8,CONST(REF(C,YZBW+1)),DRAWNULL);

YZBL:=IF(YZBW=6 AND
CURRBARSCOUNT<=7,CONST(REF(L,YZBW)),DRAWNULL);

YZBW=6 AND CONST(FINDLOW(C,3,3,1))<YZBL AND
CONST(BARSLAST(CROSS(C,YZBQC)))<=2;

附：涨停板数据筛选算法的完整代码

市场条件:=FINANCE(3)=4 OR (DATE>1200822 AND FINANCE(3)=3);

涨停板:CLOSE>=IF(市场条件,ZTPRICE(REF(CLOSE,1),0.2),ZTPRICE(REF(CLOSE,
1),0.1));

计算创造价值，分享助你成功。文中代码均可运行。

江丰鱼的文章只在今日头条首发；未经授权禁止引用或者转载。