

《A 题附件》

附件一：板块说明

常见板块分类可采用如下分类。

化工品	甲醇、塑料、PTA、沪胶、玻璃、沥青、PVC、PP、胶合板、纤板
金属	黄金、白银、沪铜、沪锌、沪铝、沪铅、沪镍、沪锡、螺纹
农产品	豆粕、强麦、菜油、玉米、豆油、棕榈油、白糖、豆一、早稻、粳、稻、晚稻、菜粕、棉花、鸡蛋、淀粉
黑色系	焦炭、焦煤、铁矿石、螺纹钢
油类	豆油、菜籽油、棕榈油、菜油

参赛者也可以自定义板块来进行分析。

附件二：获取所有商品期货的主力合约代码与市场（已在《A 题赛题说明》中提到）

使用 `traderGetCodeList` 函数，获取商品期货上市品种的交易市场与交易代码，比如：

```
A=traderGetCodeList('SHFE000');
```

```
B=traderGetCodeList('CZCE000');
```

```
C=traderGetCodeList('DCE000');
```

A 代表获取的上海商品期货交易所的所有主力合约

B 代表获取的郑州商品期货交易所的所有主力合约

C 代表获取的大连商品期货交易所的所有主力合约

A 中的内容如下：

字段	abc Market	abc Code	abc Name	BlockName	Weight
1	'shfe'	'ag0000'	'ag0000'	□	0
2	'shfe'	'al0000'	'al0000'	□	0
3	'shfe'	'au0000'	'au0000'	□	0
4	'shfe'	'bu0000'	'bu0000'	□	0
5	'shfe'	'cu0000'	'cu0000'	□	0
6	'shfe'	'fu0000'	'fu0000'	□	0
7	'shfe'	'hc0000'	'hc0000'	□	0
8	'shfe'	'ni0000'	'ni0000'	□	0
9	'shfe'	'pb0000'	'pb0000'	□	0
10	'shfe'	'rb0000'	'rb0000'	□	0
11	'shfe'	'ru0000'	'ru0000'	□	0
12	'shfe'	'sn0000'	'sn0000'	□	0
13	'shfe'	'wr0000'	'wr0000'	□	0
14	'shfe'	'zn0000'	'zn0000'	□	0

B 中的内容如下：

字段	abc Market	abc Code	abc Name	BlockName	Weight
1	'czce'	'CF000'	'CF000'	□	0
2	'czce'	'FG000'	'FG000'	□	0
3	'czce'	'JR000'	'JR000'	□	0
4	'czce'	'LR000'	'LR000'	□	0
5	'czce'	'MA000'	'MA000'	□	0
6	'czce'	'OI000'	'OI000'	□	0
7	'czce'	'PM000'	'PM000'	□	0
8	'czce'	'RI000'	'RI000'	□	0
9	'czce'	'RM000'	'RM000'	□	0
10	'czce'	'RS000'	'RS000'	□	0
11	'czce'	'SF000'	'SF000'	□	0
12	'czce'	'SM000'	'SM000'	□	0
13	'czce'	'SR000'	'SR000'	□	0
14	'czce'	'TA000'	'TA000'	□	0
15	'czce'	'WH000'	'WH000'	□	0
16	'czce'	'ZC000'	'ZC000'	□	0
17					

C 中的内容如下：

字段	abc Market	abc Code	abc Name	BlockName	Weight
1	'dce'	'a0000'	'a0000'		0
2	'dce'	'b0000'	'b0000'		0
3	'dce'	'bb0000'	'bb0000'		0
4	'dce'	'c0000'	'c0000'		0
5	'dce'	'cs0000'	'cs0000'		0
6	'dce'	'fb0000'	'fb0000'		0
7	'dce'	'i0000'	'i0000'		0
8	'dce'	'j0000'	'j0000'		0
9	'dce'	'jd0000'	'jd0000'		0
10	'dce'	'jm0000'	'jm0000'		0
11	'dce'	'l0000'	'l0000'		0
12	'dce'	'm0000'	'm0000'		0
13	'dce'	'p0000'	'p0000'		0
14	'dce'	'pp0000'	'pp0000'		0
15	'dce'	'v0000'	'v0000'		0
16	'dce'	'y0000'	'y0000'		0

其中输出结果中 Market 字段表示交易所代码，字符串型；Code 字段表示具体合约的代码，比如 ‘ag0000’ 表示沪银的主力合约。由 Market 和 Code 字段共同决定了交易合约。取数据可以根据这两个特征来决定。

安装 Auto-trader pro 之后在 matlab 中输入：help traderGetCodeList 即可以看到该函数的使用说明。

（注：对于上海期货交易所与大连期货交易所的主力合约后面有四个 0，郑州商品交易所只有三个 0。）

附件三：获取所有商品期货某主力合约的数据（已在《A 题赛题赛题说明》中提到）

从上面的输出的主力合约代码与市场之后，取某一个合约一段时间的数据，可以使用 traderGetKData 函数。

比如想获取郑州商品交易所白糖期货主力合约从 2011 年 1 月 1 日到 2012 年 1 月 1 日的所有 1 分钟数据。

```
[time,open,high,low,close,volume,turnover,openinterest]=traderGetKData('CZCE',
'SR000','min',1,20110101,20120101,false,'NA');
```

在 Workspace 中可以查看到数据提取的结果：

Name ▲	Value
close	54705x1 double
high	54705x1 double
low	54705x1 double
open	54705x1 double
openinterest	54705x1 double
time	54705x1 double
turnover	54705x1 double
volume	54705x1 double

可点击打开以查看具体的数据：

	1	2	3	4	5
1	7.1970e+03				
2	7.2230e+03				
3	7.2200e+03				
4	7.2140e+03				
5	7.2150e+03				
6	7.2270e+03				
7	7.2230e+03				
8	7.2160e+03				
9	7.2160e+03				
10	7.2090e+03				
11	7.2080e+03				
12	7.2050e+03				
13	7.1980e+03				
14	7.1950e+03				
15	7.1990e+03				
16	7.1950e+03				
17	7.1950e+03				

如需要同时提取多个标的的数据，可建立一个结构体如下：

```
targetList(1).Market=' CZCE' ;
```

```
targetList(1).Code=' SR000' ;
```

```
targetList(2).Market=' SHFE' ;
```

```
targetList(2).Code=' cu0000' ;
```

对结构体循环调用 traderGetKData 即可。

如

```
for i=1:length(targetList)
```

```
[time, open, high, low, close, volume, turnover, openinterest]=traderGetKData(targetLi
```

```
st(1).Market, targetList(1).Code, 'min', 1, 20110101, 20120101, false, 'NA');
```

(此处可根据获得的数据做一些相应的计算)

```
end
```

安装 Auto-trader pro 之后在 matlab 中输入: `help traderGetKData` 即可以看到该函数的使用说明。

注: 不同标的的交易时间段不一样, 直接拼接成矩阵会遇到矩阵维度不一样的问题。