**项目背景：本次项目我们主要进行量化交易、基本面分析以及全球行业宏观分析，主要是针对中国A股市场量化因子进行数据挖掘，尤其需要用到excel深度功能以及python相关编程知识，实现资产配置模型的挖掘，数据分析以及模型预测。**

**第七周工作任务**

**任务1**

学习简单多因子选股——小市值，思路指引：

所有股票池中，按如下条件筛选，pe<20 ， pb<2 ，ps<5 ， total\_mv<1000000。然后选择排名靠前的10只，等权重分配。数据可来源tushare pro 的免费数据库https://tushare.pro/register?reg=385920

**任务2：**

通过选的几个股票，计算等权重的一篮子股票的组合收益，计算沪深300的收益曲线，通过比较基准。

思路：累计收益初始化0，分别将一篮子股票代码带入，计算单支股票收益率，#等权重配置一篮子股票，计算权重和。

**任务3**

代码整理，通过输出结果进行分析，研究此策略在小市值里面选择结果，策略期大概4-6个月，通过观察收益图分析潜力。