

Come and Have MeronPon

一、Meeting Documents 【From the 4th】

1. 多因子策略

- 选股
- 多因子：日频 + 择时 **【换手率】**
- 股票池：大板块
- 交易频率：月底，季度，半年
- Qestion Remained
 - 是否要空仓

2. 下一阶段任务

- 确定因子，大板块，交易频率
- 数据获取
 - 时间：2005-01-01 - 2019-12-31
 - 获取因子值对应的原始数据，给出加工计算公式
- 因子识别以及有效性检验
 - 对所有因子，细分因子做检测 **【已经确定股票池】**。
 - 筛选出最终使用的多因子，检验结果。
 - **最终反馈结果在report中。**
- 具体策略代码的实现
 - code
 - Strategy
 - Back Test
 - code 组的同学可以学习调用相关的库以及 python 策略

时间线

二、Problem to be solved

PS: 我觉得的我们的重心在两点模型的构建和因子的获取

PS: 大家记得收集资料和标记自己看过的内容, 方便同学整理

- 感觉数据库的搭建出现了一点问题, 正在解决
 - 关于模型的构建尚不是很清楚, 不知道怎么打分, 打分的模型有没有详细的画面
 - 因为我对因子的提取不是很上心, 所以我还在研究因子因子怎么获取
 - 最好能把因子的数据直接告诉我
 - 还有洗数据还有因子缺失值的问题没有解决
-

三、Research Report

- link: <https://shimo.im/docs/8qdRk6hxyrdcWx3T>
 - 大家尽可能快点写, 感觉时间不太够用了
 - 然后写的时候注意做好提纲和分类, 考虑下一级标题, 二级标题什么的, 方便最后的整理
 - 加油!
-

四、Reference List

1.关于多因子模型的pdf资料

- 《1_多因子模型的基石--单因子有效性检验》
- 《5_剔除行业、风格因素后的大类因子检验——因子选股系列研究之五》

2.talib 相关的文件

- <https://www.bookstack.cn/read/talib-zh/README.md>
- <https://juejin.im/post/6844903934977376264>

3.pyechart 数据可视化相关的

- <https://pyecharts.readthedocs.io/zh/latest/zh-cn/README/>
- <https://github.com/pyecharts/pyecharts>
- <https://cloud.tencent.com/developer/article/1388001>
- <https://gallery.pyecharts.org/#/README>

4.关于量化交易的代码框架资料

- <https://mp.weixin.qq.com/s/nCih0rdlyjTV35bOYcDu1w> 【Python实现量价形态选股】
- https://mp.weixin.qq.com/s/lguEpW9bT8NdnPIV_lYlNg 【使用pyfinance进行证券收益分析】
-

5.关于MySQL数据库的构建与服务器云端存储

- <https://www.jianshu.com/p/28f59950a310> 【MySQL数据库服务器搭建】
- <https://luoxin1992.github.io/2017/01/01/install-mysql-server/> 【搭建MySQL服务器】

6.关于优化提升与机器学习的算法改进

- <https://cloud.tencent.com/developer/article/1540683>
- <https://bigquant.com/community/t/topic/162091>
- <https://bigquant.com/community/t/topic/110508>
- <https://xgboost.readthedocs.io/en/latest/> 【XGBoost】
- <https://www.cnblogs.com/wj-1314/p/9402324.html> 【Python机器学习笔记：XgBoost算法】

Addition

- 我们做完project我请大家吃菠萝包吧！
- 快来和我一起吃菠萝包！



- 呜呜呜！快没有了！



还有很多哦 多吃点吧