

Задание

1) Реализовать торговую стратегию – альфу:

- Задать свой Q-фактор
- Написать функцию decay и применить ее к альфе

2) Посчитать и построить график кумулятивного PnL

3) Посчитать turnover, sharpe ratio, доходность по каждому из годов

Работу выполнять строго в присланном шаблоне!

Дедлайн - 23 февраля 23.59.

Присылать на почту **vbaklanova@hse.ru** с темой письма *Фамилия_Имя (если выполняете индивидуально), Фамилия1_Имя1_Фамилия2_Имя2 (если выполняете вдвоем)*. Файл необходимо назвать в формате *Фамилия_Имя.ipynb (если выполняете индивидуально), Фамилия1_Имя1_Фамилия2_Имя2.ipynb (если выполняете вдвоем)*.

Критерии оценивания:

5 баллов получают за реализацию альфы, подсчет ее pnl, отрисовку графика pnl и подсчет turnover, sharpe, доходность по каждому из годов. Дальше баллы прибавляются в зависимости от качества вашей стратегии:

- (+2 балла) получают за альфу с ежегодным turnover < 50% и положительным sharpe за каждый год из 5 лет
- (+3 балла) получают за альфу, у которой в каждом году turnover < 45%, sharpe >= 0.5 и доходность >= 3%
- (+4 балла) получают за альфу, у которой в каждом году turnover < 40%, sharpe >= 1.0 и доходность >= 5%
- (+5 баллов) получают за альфу, у которой в каждом году turnover < 35%, sharpe >= 1.5 и доходность >= 7%.

При наличии нескольких альф баллы получает ровно одна из них (лучшая).

Удачи!