利用自己的7个数据模拟构造宏观因子

结果如IC所示，一号主成分在511010国债和513100纳指暴露为负，前者-0.13后者-0.1左右。在159920恒生指数暴露度为0.74，510300暴露度为0.56，159934黄金暴露度为0.12

二号主成分在黄金暴露度为-0.72，国债为-0.23，恒指为-0.3，最高暴露度在510500处。