策略逻辑：

变动率指标，英文简称ROC，是一种特点极其鲜明的能量类指标。它是通过把当天的价格和确定的某一天的价格去比较，最终得到确定的价格变化速度，从而知道影响股票价格变化的动力大小，是一种适用于中短线的技术分析指标。

波动率指标：收盘价涨幅的时间序列，对波动率取倒数，因为波动率越低越好

市盈率指标：某种股票每股市价与每股盈利的比率，是最常用来评估股价水平是否合理的指标之一，是很具参考价值的股市指针。

ROE指标：净资产收益率指标，也成为股东权益回报率，是企业净利润和平均股东权益形成的百分比。净资产收益率等于净利润除以净资产。净资产收益率越高，说明公司的盈利就更多，投资带来的收益也会更高，前景更加明朗。

代码模型及简要：

1、导入股票月度数据，并加入EP和ROE指标

2、设置策略，设置好各个因子的计算周期，直接通过股票月度数据的来循环计算各个因子指标，在每个横截面上计算各个因子按照从高到低的股票综合排名，对每个rank进行求和，然后对综合值再进行排序，选取前仓位数的股票，并进行相应的剔除。

3、回测

参考代码及原理出处：

<https://github.com/QuantWorld2022/backtrader/blob/master/Backtrader%E5%B8%B8%E8%A7%81%E6%A1%88%E4%BE%8B.ipynb>