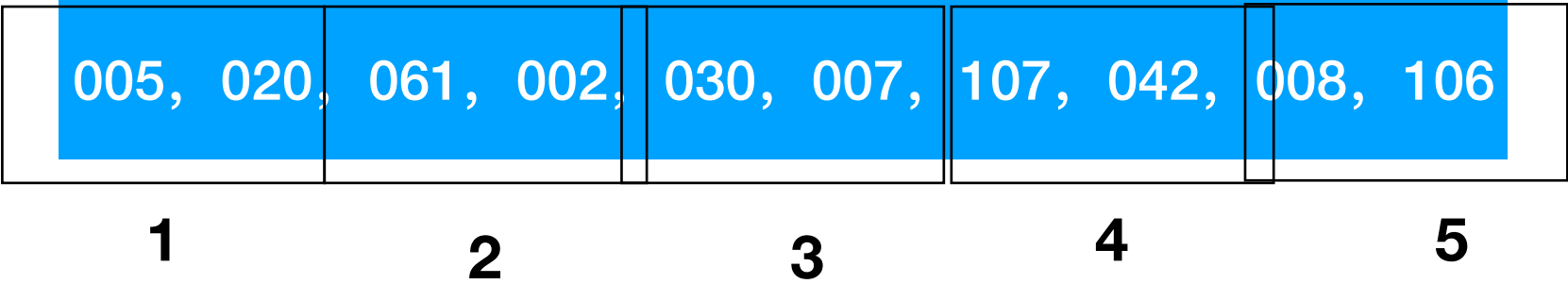


因子权重

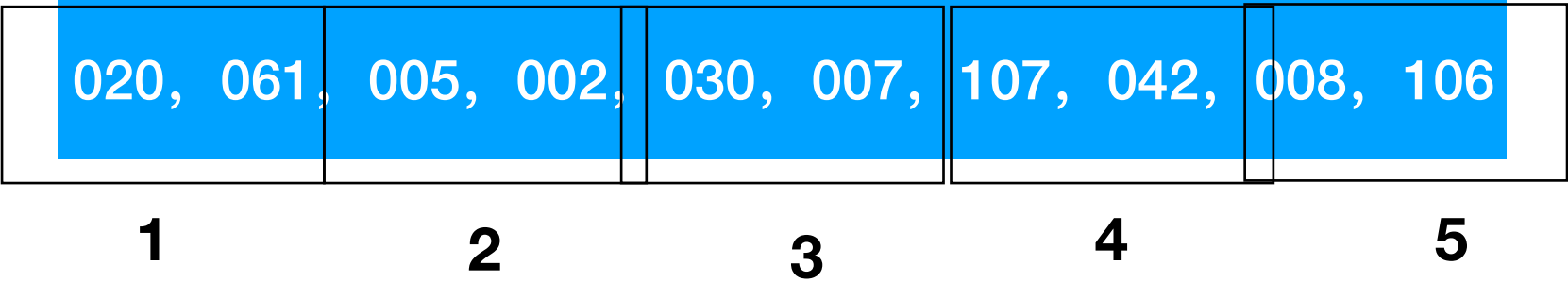
002, 030, 005, 020, 061, 042, 008, 007, 107, 106

因子 升序	因子值越小越好，市值-market_cap、市盈率-pe_ratio、市净率-pb_ratio
因子 降序	因子值越大越好，ROIC-return_on_invested_capital、inc_revenue-营业总收入 和 inc_profit_before_tax-利润增长率

市值因子：



ROIC：



020: 1+1=2

005: 3

20, 20

回归法：每个因子也有权重

特征值	目标值
4, 29	5, 30
因子1, 因子2, 因子3, 因子4	收益率
	每个月最后一个交易日

(300, 9) (9, 1)

历史数据（训练）、回测 测试数据

[[23,34,45,56,7,78,9,8,34]] 相加求和 得出和 结果

[-0.01864979, -0.04537212, -0.18487143, -0.06092573, 0.18599453,-0.02088234,
0.03341527, 0.91743347, -0.8066782]