1. 概述

用 增广的 预测目标，基于 增广的 输入特征，形成 新的 alpha 计算公式。

1. Alpha交易原理

用Alpha打分机制，进行排名。 永远持有 排名前x名 的股票，以t0/t1的交易策略，每一天进行一次交易。

比如 第一天排名 是 A B C, 第二天前三名 是 B C D，则卖出A买入D。

1. 输入特征增广

现有的 Alpha只有 前一个交易日的 开盘价、收盘价、最高价、最低价、交易量。

2.1 增广交易特征

将 前x 个交易日， 交易情况 容纳进来.

2.2 增广财务特征

将 资产负债表的 部分特征 容纳近来。

1. 预测目标增广

综合考虑 单日收益、回撤可能性（后续下跌的可能性）、趋势一致性（后续不会有趋势的大规模起伏）、进一段时间 暴跌的可能性（单股） 等等，风险 和 收益 的综合考量。

只要 是合理的，任何 综合考量的组合 都可以作为合理的目标。

需要注意的是，是否 预测目标线性组合的增广，会导致 alpha的计算公式也只是线性的变化（这是不行的）。

4. Alpha动态增强

将现有的 alpha 作为输入特征，得到新的Alpha。

如果新的Alpha比 现有的 Alpha池子强，就 把 新的Alpha加进来。

Alpha池子的容量保持一致（只保持 100个alpha）。