

Raw data 相关

market_data & industry获取.ipynb

处理日频市场原数据, 计算收益率, 获得processed_market_data.parquet

处理中信一级行业分类, 获得industry.parquet

主体部分

EPS DST代码整理.ipynb

主体文件, 计算EPS, DST, PRM, Sector_neu, EPS_zscore, DST_zscore, PRM_zscore, Sector_neu_zscore因子, 做因子回测

RPE(市盈率倒数) DST 代码整理.ipynb

主体文件, 计算RPE, DST, PRM, Sector_neu, RPE_zscore, DST_zscore, PRM_zscore, Sector_neu_zscore因子

可比公司 EPS-互相中性化.ipynb

主体文件, EPS相关因子的两两互相中性化

可比公司 RPE-互相中性化.ipynb

主体文件, RPE相关因子的两两互相中性化

backtesting.py

中性化、IC计算、IC画图、分组回测的相关函数。

回测结果+互相中性化结果整理.pdf

回测结果以及因子互相中性化结果的汇总。