

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

计算---日内换手率波动计算.ipynb

使用1min交易数据计算股票的日内换手率波动率, 将每日时间段分为早盘, 中间盘和尾盘。

换手率-日内换手率 代码整理.ipynb

计算尾盘UTD因子并做回测

backtesting.py

中性化、IC计算、IC画图、分组回测的相关函数。

换手率相关因子 结果整理.pdf

与换手率相关的因子的回测结果的汇总。