

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---日内波动.ipynb

使用1min交易数据计算股票的日内5min收益率的波动率, 获得daily_return_vol.parquet

代码整理: 反转因子.ipynb

计算UMR反转因子并进行回测

backtesting.py

中性化、IC计算、IC画图、分组回测的相关函数。

反转相关因子 结果整理.pdf

与反转相关的因子的回测结果的汇总。

其他

关于ret_vol_UMR_daily因子回测结果在【代码整理: 反转因子.ipynb】与【反转相关因子 结果整理.pdf】中的差异说明:

反转相关因子 结果整理.pdf 在计算的时候同时计算了其他因子, 在进行merge操作时丢弃了一些行。这影响了后续的rolling sum计算, 使得最终结果与单独计算ret_vol_UMR_daily因子时有所不同。