## 文件说明

**\_\_init\_\_.py:高频因子类**

其中BaseFactor、BaseFactorWithDB、TradeFactorDemo为原代码，HTradeFactorDemo为我的代码。

高频因子一般不会用到跨日的数据。故首先算出每日的日度因子，再算月度因子（也可以是周频或者带衰减的日度因子）

1，日度因子：

dailyData:根据频率导入该天的本地数据或者线上数据

计算日度因子

保存日度因子（dailyFactor）

2，月度因子：

导入lagdays区间的日度因子

截面标准化

统计方法：平均值、标准差、平均值/标准差、累乘

这个类完成了导入日度因子，截面标准化，并对区间内的日度因子进行统计方法。以此为模板的因子只用加入初始化\_\_init\_\_和计算日内因子的函数getDailyData即可。

值得注意的是，类比factorSymbo，该类加入了dailyFactorSymbol，会将日度因子保存在path（D:\\Data）+dailyfactor+dailyFactorSymbol文件夹中。

目的是不同lagdays、不同统计方法、不同参数的因子能够复用日度数据。

**factorZoo.py 因子列表**

其中的path（D:\\Data）定义了存储日频因子的地址

该部分略去，保留一个因子作为示例。