# 研究过程

## bigquant使用方法

1. 设定股票池和日期
2. 输入特征
3. 标注label（比如五日收益的排名，分成20分）

## Alphalens 研究因子

首先研究单个因子的有效性。然后组合多个因子的有效性。

Tears

1. 统计分位数plot\_quantile\_statistics\_table(factor\_data)
2. 因子收益分析create\_returns\_tear\_sheet
3. IC分析create\_information\_tear\_sheet，分析不同时间因子是否一致有效
4. 换手率分析create\_turnover\_tear\_sheet
5. 事件研究create\_event\_returns\_tear\_sheet
6. create\_returns\_tear\_sheet

performance

1. mean\_return\_by\_quantile
2. compute\_mean\_returns\_spread
3. factor\_alpha\_beta 据是capm模型
4. factor\_information\_coefficient ic均值越大越好，方差越小越好。是否符合正态分布
5. 换手率是否稳定，自相关是否较高。

流程：

1. 获取价格数据（并保存下来）

For 因子

* 1. 获取因子数据
  2. Join
  3. 清洗数据
  4. 分析

1. **研究结果**

以下所有的因子都是通过alphalens选择出来的。并且具有线性特质，所以是不是应该

用线性模型，是最好的。

资金流入流出有效果，

Kdj的k和d值有效果。

ta\_macd\_macd\_12\_26\_9\_0，大于0的两天期还可以

ta\_macd\_macdsignal\_12\_26\_9\_0 效果不好。