

## 利用信息协变量和错误发现率构建基金组合

### 代码部分

0.data\_pre.py: 自定义计算信息协变量和 ffdr 公式

1. get\_fund\_data from api.ipynb : 从同花顺获取股票回报率和信息协变量计算所需数据

2. calculate information covariate.ipynb : 计算滚动信息协变量数据

3. ffdr.R: ffdr 筛选过程

4. strategy and its performance.ipynb: 策略构建及其表现

### 数据部分—原始数据

csmar 文件夹: 国泰安数据 Carhart FF 模型相关数据

net\_value 文件夹: 从同花顺 api 获取股票回报率

date\_scale 文件夹: 从同花顺 api 获取 fund size 和 fund flow 计算所需 数据

### 数据部分—计算所得数据

cov 文件夹: 计算所得的信息协变量

ffdr 文件夹: ffdr 筛选所得的熟练基金代码