



[返回主题列表](#)

(/community?fromPost=775)

【研究】 量化选股——多因子模型

 (/user/d975b9103aa2dae30c383146e6020b0e)


陈小米。
发布于2016-03-09 回复 93 浏览 31171  235
(/user/d975b9103aa2dae30c383146e6020b0e)

见研究。

很长一串没有折叠起来的输出，是因为运算量比较大，中间打印了一下。

请自行忽略。。。

话说貌似好的策略可以赚零花钱。。所以大概只有我还在发研究贴了。。。

分享到： 微信  微博 (0)  雪球
0



欢迎关注：**神秘的宽客们**

量化研究，量化学习资料
神策alpha信号每日播报
更多精彩，等你发现

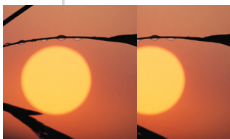
3E%8B.ipynb¬ebookReport=/research/users/20883955875/share2/5380302bc598be0bd4e1dc0cc7240bb3_new.html&postId=775)

 收起

【研究】 量化选股——多因子模型

by 陈小米。

喜欢做一名宽客，是因为可以自己掌握命运。 ——丁鹏



(/user/d975b9103aa2dae30c383146e6020b0e)
陈小米陈小米ser(d975b9103aa2dae30c383146e6020b0e)

【研究】研究H-6网模
探析资金流股价
资金流模型模型
多因子模型模型
【研究】研究量化选

[查看更多](#) /com(

userId=d975b9103aa2dae30c383146e6020b0e

感谢作者




向导式策略生成器

无需编程，1分钟生成策略

立即体验

(/algorithm/index/wizard?f=community&m=ad)

评论




(/user/534bc264d42b91280e38e069102f6c2e)

天大hero (/user/534bc264d42b91280e38e069102f6c2e)

搞研究的都是大神 像我等炒股是韭菜 编程连业余都算不上的只能膜拜了 $O(n_n)O$

2016-03-09




(/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)

我想我是风 (/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)

先点赞!!!

2016-03-12




(/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)

我想我是风 (/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)

很有意思，静等下回研究报告。另外10个因子都是基本面的因子，我先学习一下，再把波动率因子加入试一下。看看能不能优化。


2016-03-12

 (/user/9eb156885cf6b7314d8534d630dad77b)

Gyro (/user/9eb156885cf6b7314d8534d630dad77b)

赞!

2016-03-12

 (/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)

我想我是风 (/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)


```
def caculate_port_monthly_return(port,startdate,enddate,nextdate,CMV):
close1 = get_price(port, startdate, enddate, 'daily', ['close'])
close2 = get_price(port, enddate, nextdate, 'daily',['close'])
weighted_m_return = ((close2['close'].ix[0,:]/close1['close'].ix[0,:]-1)*CMV).sum()/(CMV.ix[port].sum())
```

weighted_m_return =
(close['close'].ix[-1,:]/close['close'].ix[0,:]-1).mean()

return weighted_m_return

???????把3月1号与2月1号比? 3月2号与2月2号比?


2016-03-15

 (/user/d975b9103aa2dae30c383146e6020b0e)

陈小米。 (/user/d975b9103aa2dae30c383146e6020b0e)

非也。这段做的是计算1个月的收益率，用当月第1个交易日收盘价除以上个月第1个交易日收盘价。
get_price很逗比的是取出来的只有交易日的数据。假设20150101-20150201，取出来可能close[0]是20150103，close[-1]是20150127。缺失的时间是非交易日。
因为自造的时间序列是按每个月1号这么来的，所以取了2个月的数据，用后一个月的第一个交易日比前一个月第一个交易日的价格，求得当月收益率。


2016-03-16

 (/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)

我想我是风 (/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)

嗯，看到了，就是觉得写得好奇怪。

2016-03-16

 (/user/3c8010d7839b531b714fc304688772c6)

icelaugh (/user/41547834f6c3a4ae4b0534859a5f09d9)

赞一个~兄弟是职业quant还是业余爱好啊。。

2016-03-16



(/user/7a11d32da800f2b88f77caabcf6d27d5)

Agic Deng (/user/7a11d32da800f2b88f77caabcf6d27d5)

天津大学的吗? z

2016-03-16



(/user/534bc264d42b91280e38e069102f6c2e)

天大hero (/user/534bc264d42b91280e38e069102f6c2e)

呵呵 不是 取天大是因为以前上网取名字老是重复 就把自己喜欢的一句话”天地为尊 有容乃大“简写注册 就一直沿用下来了

2016-03-16



(/user/9eb156885cf6b7314d8534d630dad77b)

Gyro (/user/9eb156885cf6b7314d8534d630dad77b)

支持!

2016-03-18



(/user/edd9afd6edf1b7097edc32c9ebd65b0d)

isme (/user/edd9afd6edf1b7097edc32c9ebd65b0d)

请问，在实际中每月初取所有因子数值这里，财务表只是一个季度出一次，这些因子数值在哪里查询@陈小米

2016-03-22



(/user/db948de33bc2e862b5f8f16443394c2b)

村里的操盘手 (/user/db948de33bc2e862b5f8f16443394c2b)

@天大hero 天大!

2016-04-01



(/user/db948de33bc2e862b5f8f16443394c2b)

村里的操盘手 (/user/db948de33bc2e862b5f8f16443394c2b)

@天大hero 有容（貌）奶大!

2016-04-01



(/user/8d606c39f2742a9251d892d293229448)

```
for fac in factors:
    score = fdf[fac].order()
    port1 = list(score.index)[: len(score)/5]
    port2 = list(score.index)[ len(score)/5+1: 2*len(score)/5]
    port3 = list(score.index)[ 2*len(score)/5+1: -2*len(score)/5]
    port4 = list(score.index)[ -2*len(score)/5+1: -len(score)/5]
    port5 = list(score.index)[ -len(score)/5+1: ]
```

这样等分似乎会漏掉几支股票吧？

2016-04-05

1 (/post/775)	2 (/post/775?page=2)	3 (/post/775?page=3)	4 (/post/775?page=4)	5 (/post/775?page=5)	下一页 (/post/775?page=2)
尾页 (/post/775?page=5)					

您尚未登录，请 [登录 \(/user/login/index?redirect=/post/775\)](/user/login/index?redirect=/post/775) 或者 [注册 \(/user/register/index\)](/user/register/index) 聚宽发表回复。

关于

数据

帮助