**数据及代码说明**

1. **数据来源说明：**

本策略研究所使用的数据源自聚宽平台。聚宽平台提供了免费的金融数据接口，并拥有一套较为完整的因子库。此外，该平台还提供了在线编程和策略运行的环境。基于这些优势，我们选择了聚宽平台作为数据来源。

1. **代码说明：**

代码1：基础的多因子指数增强模型构建的核心代码。

代码2：包含用于筛选和优化因子的相关代码，旨在提升模型表现。

代码3：展示了在因子优化后，多因子指数增强模型的实现代码。

代码4：用于获取第1、3个代码文件中的回测因子。

1. **代码文件使用说明：**

首先，将四个代码文件导入聚宽平台的研究环境中。先运行第1个文件，输出'result\_df.csv'后在聚宽平台策略列表界面新建一个策略，复制第4个文件中的代码粘贴至左侧代码栏，然后点击右上角运行回测。回测运行结束后将网址的backtestId复制，替换第1个文件第52个代码块的get\_backtest()函数参数，这样就能将第一个策略的回测结果在.ipynb文件中生成回测图了。后面第二个策略会生成'result1\_df.csv'，第三个优化版策略会重新生成'result\_df.csv'，操作方法同上。









