1. 将线性回归推广到全部产品， 从17年开始回测， sharpe=0.2795
2. 将特征拓展到10个（使用前10天的数据去预测第11天的数据）， 每次建模使用20天窗口内的数据。sharpe=0.2474
3. 使用正则化
   1. L1正则 sharpe =0.7405
   2. L2正则sharpe=0.7387
   3. L1+L2 sharpe=0.7404
4. 换用SVR算法 sharpe=0.4470
5. bagging ensembling
   1. RF, sharpe = 0.1567
6. Boosting ensembling
   1. AdaBoost, sharpe=0.2367
   2. GBDT, sharpe=0.2162
   3. XGBoost, sharpe=0.7798
7. Deep learning
   1. MLP, sharpe=0.55, epoch=100, lr=1e-2, 3Lyrs