

关于大创项目

由于我个人的工作失误以及准备留学深造，大创中期后还没有找大家来谈谈项目。目前我已经在之前中期模型的基础上做了很多工作上的改进了，也成功地进行了实时回测。

当前我们的目标主要是做出基于**LSTM的时序滑窗预测框架**，这个由我来负责，大家不用操心。另外，我们同时也需要去测试其它的**各类算法、因子、时间跨度、数据，并且进行记录。**

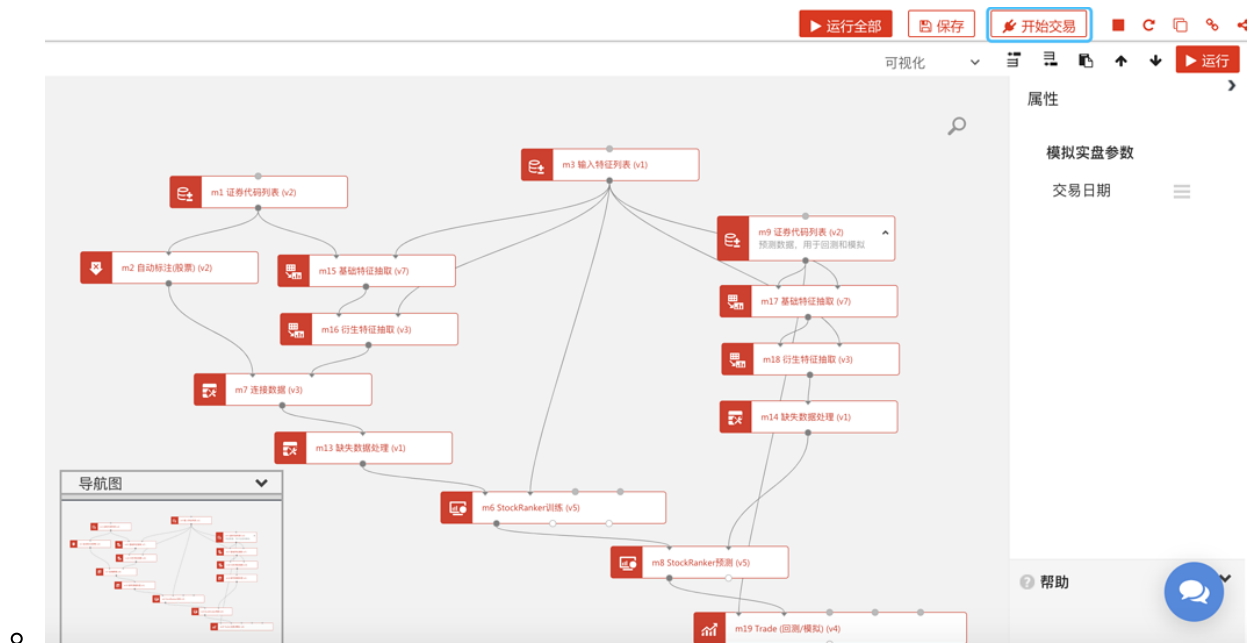
考虑目前上手joinquant（聚宽）的难度还是偏大，我又另找了一个平台**Bigquant**（宽邦）。这个平台相对于聚宽要轻松简单许多，基本数据、模型的设置不需要任何代码操作，只需要根据教程，在可视化界面上连接即可。验证、回测等操作也比较容易。

目前希望大家尽量在**开学前两周熟悉这个平台的使用**，达到能够**构建基本预测模型的程度**，并且清楚其中的量化交易原理。后续我将安排一些实验让大家完成。我计划在**10月中旬**结束整个项目的实验阶段，开始进行报告撰写，**11月进行答辩。**

BigQuant 教程

资源

- 视频：[8步上手策略构建](#)
 - 了解基本策略构建方法和步骤



- 能够在该方法的基础上拓展
 - 更换因子
 - 改变时间范围
 - 改变训练集和测试集
 - 更换训练模型
 - 数据处理
 - ...
- 详细教程：[宽客教程](#)
 - 因子筛选

- 数据构建
- 数据预处理
- 数据标注
- 策略构建
- 模型学习
- ...
- 初步要求
 - 尝试

要求

- 看完BigQuant教程
- 测试因子、筛选好的因子
- 训练、回测时间范围（尽量在近几年回测）
- 基本模型
 - 筛选优秀模型、记录较好的实验结果