Correlation heatmap of all factors

												- 1.00
Mkt-RF	1	-0.29	-0.63	-0.37	-0.51	-0.05	-0.58	-0.39	-0.48	-0.04		1.00
SMB	-0.29	1	-0.05	-0.34	-0.03	0.08	-0.02	-0.25	-0.13	0.08		- 0.75
HML	-0.63	-0.05	1	0.36	0.72	0.06	0.65	0.13	0.79	0.04		– 0.50
RMW	-0.37	-0.34	0.36	1	0.29	0.06	0.57	0.72	0.26	0.03		– 0.25
СМА	-0.51	-0.03	0.72	0.29	1	0.08	0.49	0.15	0.58	0.04		0.00
MOM	-0.05	0.08	0.06	0.06	0.08	1	0.19	0.14	-0.42	0.94		- 0.00
ВаВ	-0.58	-0.02	0.65	0.57	0.49	0.19	1	0.46	0.41	0.19		- −0.25
QMJ	-0.39	-0.25	0.13	0.72	0.15	0.14	0.46	1	0.02	0.15		- -0.50
HML_Devil	-0.48	-0.13	0.79	0.26	0.58	-0.42	0.41	0.02	1	-0.46		– –0.75
UMD	-0.04	0.08	0.04	0.03	0.04	0.94	0.19	0.15	-0.46	1		4.00
	Mkt-RF	SMB	HML	RMW	CMA	MOM	BaB	QMJ	ML_Devil	OMD	•	- -1.00