

2026 学硕《量化投资》，专硕《金融数据分析》作业 2

请用 Python 完成以下题目。作业请用.ipynb 编写并转换成 HTML 文档格式提交至助教于谨豪邮箱：2213609@mail.nankai.edu.cn

命名格式：姓名-2-quant

截止日期：2026 年 4 月 28 日

1. 不同行业可能有不同的分化走势。应当如何构建行业因子？查阅资料（请列出主要参考文献）、自选数据并做出分析。
2. 从优矿中选择你感兴趣的几个因子，做分组、FM 回归分析，并在回测系统中回测。