

目 录

1. 概述.....	5
2. 随机森林多因子模型的建立与运行结果	5
2.1 因子提取.....	5
2.2 数据前期处理.....	9
2.3 模型建立	10
3. 回测结果.....	11
3.1 针对沪深 300 的选股模型	11
3.2 针对中证 500 股票的选股模型	14
3.3 针对全体 A 股的选股模型	18
4. 总结与未来研究方向展望	21

