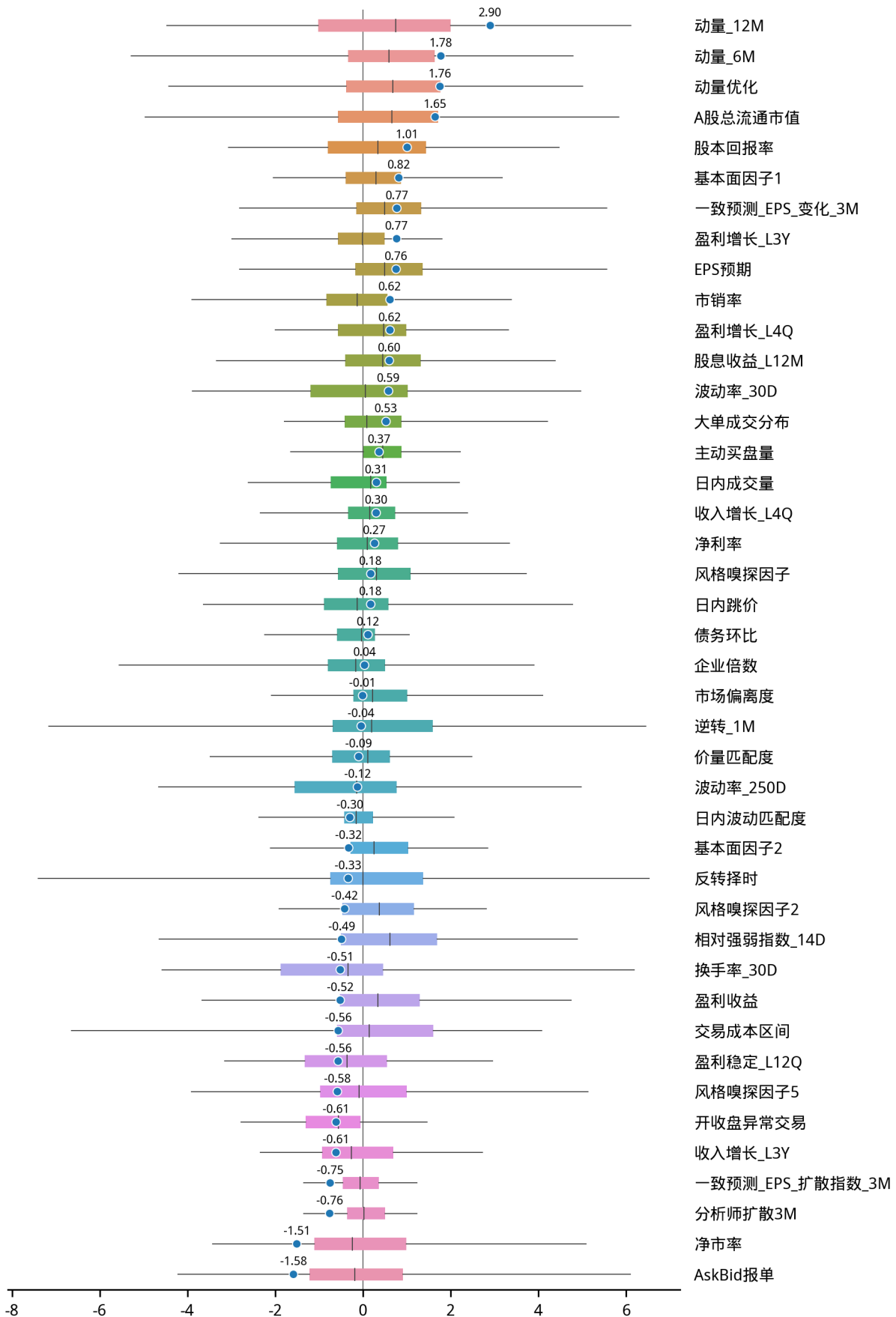


第一指数因子周度报告

2018/09/28

因子收益率分布

因子收益率定义为中证800中该因子暴露值最大的20%股票的平均收益率减去暴露值最小的20%股票的平均收益率的差值，以百分数表示本周因子收益率与过去52周内的极值、四分位数和中位数间的关系。



本周因子相关性矩阵

因子相关性定义为在中证800成分股中，两个因子截面值的相关系数。该矩阵中，颜色越深代表相关性越强，暖色为正相关，冷色为负相关。

