关于因子的记录、文献、相关的内容等。不需要看原来的研报即可得到因子关键信息

# 1、bp-账面市值比

计算方式为股票的净资产/股票市值，反映了股票的估值水平。一般而言账面市值比高说明市场对股票的前景并不看好。

描述文献：<https://www.zhihu.com/question/359240049>

# 2、bp（账面市值比）三年分位数

逻辑同1，增加了公司相对自身维度的比较

# 3、ep-季度盈市率

市盈率的倒数，总体而言代表公司的便宜程度

# 4、季度盈市率一年分位数

同2、横向比较同一支股票的估值或者价格水平

# 5、sp-季度销市率

主营业务收入和市值的比值，反映了投资变现的水平

# 6、季度销市率一年分位数

同2、4，横向对比同一公司的销市率水平

# 7、季度资产周转率

公司的收入和资产总额的比值，反应了销售速度，资产流动性。

# 8、季度毛利率

毛利和收入比，反映了公司的毛利水平

# 9、季度ROA

公司的资产回报率，净利润和总资产的比值。

# 10、季度ROE

公司的净资产回报率，净利润和净资产的比值，反应股东收回投资的速度

# 11、季度净利润同比增长

公司季度净利润的同比增长率

# 12、季度营收同比增长

公司季度营业收入的同比增长率

# 13、季度ROE同比增长

公司季度ROE的同比增长率

# 14、标准化预期外盈利

当前季度净利润-( 去年同期单季净利润+过去 8 个季度单季净利润同比增长均值)/过去 8个季度的单季度净利润同比增长值的标准差

# 15、标准化预期外收入

当前季度营收-(去年同期单季营收+过去8个季度单季营收同比增长均值)/过去 8个季度的单季度营收同比增长值的标准差

# 16、股息率

最近年度分红/当前市值

# 17、业绩预告精确度

|单季度业绩预告上限-单季度业绩预告下限|/((单季度业绩预告上限|+|单季度业绩预告下限|)/2)\*(-1)

# 18、1个月换手率与均价的相关性

过去 20个交易日股票换手率与均价的相关系数

# 19、1个月日均换手

过去20个交易日换手率均值

# 20、1个月换手率波动

过去20个交易日换手率标准差

# 21、1个月非流动性冲击

过去20个交易日日收益率绝对值与日成交量之比的均值

# 22、Fama-French 三因子1月残差波动率

过去20个交易日的日收益对 Fama-French 三因子回归的残差的标准差

# 23、1月特异度

1- 过去20个交易日的日收益对 Fama-French 三因子回归的 R 方

# 24、1个月超额收益率波动

过去 20个交易日超额收益率标准差

# 25、一年动量

过去一年收益率累加-过去一个月收益率累加

# 26、1个月反转

过去 20个交易日收益率累加

# 27、市值

对数市值