

估值因子	EP	净利润(TTM)/总市值
	EPcut	扣非后净利润(TTM)/总市值
	BP	净资产/总市值
	SP	营业收入(TTM)/总市值
	NCFP	净现金流(TTM)/总市值
	OCFP	经营性现金流(TTM)/总市值
	DP	近 12 个月现金红利(按除息日计)/总市值
	G/PE	净利润(TTM)同比增长率/PE(TTM)
成长因子	Sales_G_q	营业收入(最新财报, YTD)同比增长率
	Profit_G_q	净利润(最新财报, YTD)同比增长率
	OCF_G_q	经营性现金流(最新财报, YTD)同比增长率
	ROE_G_q	ROE(最新财报, YTD)同比增长率
财务质量	ROE_q	ROE(最新财报, YTD)
	ROE_ttm	ROE(最新财报, TTM)
	ROA_q	ROA(最新财报, YTD)
	ROA_ttm	ROE(最新财报, TTM)
	grossprofitmargin_q	毛利率(最新财报, YTD)
	grossprofitmargin_ttm	毛利率(最新财报, TTM)
	profitmargin_q	扣非后净利润率(最新财报, YTD)
	profitmargin_ttm	扣非后净利润率(最新财报, TTM)
	assetturnover_q	资产周转率(最新财报, YTD)
	assetturnover_ttm	资产周转率(最新财报, TTM)
	operationcashflowratio_q	经营性现金流/净利润(最新财报, YTD)
	operationcashflowratio_ttm	经营性现金流/净利润(最新财报, TTM)
杠杆因子	financial_leverage	总资产/净资产
	debtequityratio	非流动资产/净资产
	cashratio	现金比率
	currentratio	流动比率
市值	ln_capital	总市值取对数
动量反转	HALpha	个股 60 个月收益与上证综指回归的截距项
	return_1m	个股最近 1 个月收益率
	return_3m	个股最近 3 个月收益率
	return_6m	个股最近 6 个月收益率
	return_12m	个股最近 12 个月收益率
	wgt_return_1m	个股近 1 个月内“每日换手率*每日收益率”的算术平均值
	wgt_return_3m	个股近 3 个月内“每日换手率*每日收益率”的算术平均值
	wgt_return_6m	个股近 6 个月内“每日换手率*每日收益率”的算术平均值
	wgt_return_12m	个股近 12 个月内“每日换手率*每日收益率”的算术平均值

	exp_wgt_return_1m	个股最近 1 个月 “每日换手率*exp(-x_1/N/4)*每日收益率)” 的算术平均值，x_1 为该日距离截面日的交易日个数
	exp_wgt_return_3m	个股最近 3 个月 “每日换手率*exp(-x_1/N/4)*每日收益率)” 的算术平均值，x_1 为该日距离截面日的交易日个数
	exp_wgt_return_6m	个股最近 6 个月 “每日换手率*exp(-x_1/N/4)*每日收益率)” 的算术平均值，x_1 为该日距离截面日的交易日个数
	exp_wgt_return_12m	个股最近 12 个月 “每日换手率*exp(-x_1/N/4)*每日收益率)” 的算术平均值，x_1 为该日距离截面日的交易日个数
	std_FF3factor_1m	特质波动率：个股最近 1 个月内用日频收益率对 Fama French 三因子回归的残差的标准差
	std_FF3factor_3m	特质波动率：个股最近 3 个月内用日频收益率对 Fama French 三因子回归的残差的标准差
	std_FF3factor_6m	特质波动率：个股最近 6 个月内用日频收益率对 Fama French 三因子回归的残差的标准差
	std_FF3factor_12m	特质波动率：个股最近 12 个月内用日频收益率对 Fama French 三因子回归的残差的标准差
	std_1m	个股最近 1 个月的日收益标准差
	std_3m	个股最近 3 个月的日收益标准差
	std_6m	个股最近 6 个月的日收益标准差
	std_12m	个股最近 12 个月的日收益标准差
股价	ln_price	股价取对数
beta	beta	个股前 60 个月的收益与上证综指回归的 beta
换手率	turn_1m	最近 1 个月日均换手率（剔除停牌、涨跌停）
	turn_3m	最近 3 个月日均换手率（剔除停牌、涨跌停）
	turn_6m	最近 6 个月日均换手率（剔除停牌、涨跌停）
	turn_12m	最近 12 个月日均换手率（剔除停牌、涨跌停）
	bias_turn_1m	个股最近 1 个月日均换手率除以最近 2 年日均换手率再减 1（剔除停牌、涨跌停）
	bias_turn_3m	个股最近 3 个月日均换手率除以最近 2 年日均换手率再减 1（剔除停牌、涨跌停）
	bias_turn_6m	个股最近 6 个月日均换手率除以最近 2 年日均换手率再减 1（剔除停牌、涨跌停）
	bias_turn_12m	个股最近 12 个月日均换手率除以最近 2 年日均换手率再减 1（剔除停牌、涨跌停）

	bias_turn_12m	个股最近 12 个月日均换手率除以最近 2 年日均换手率再减 1（剔除停牌、涨跌停）
情绪	rating_average	wind 评级的平均值
	rating_change	wind 评级：（上调家数-下调家数）/总家数
	rating_targetprice	wind 一直目标价/现价-1
股东	holder_avgpctchange	户均持股比例同比增长率
技术指标	macd	30 日 MACD
	dea	15 日 DEA
	dif	10 日 DIF
	rsi	20 日 RSI
	psy	20 日 PSY
	bias	20 日 BIAS