

因子代码	因子名称	因子计算公式
vol_std_1M	1个月波动率	过去1个月（日收益率）的标准差
vol_std_3M	3个月波动率	过去3个月（日收益率）的标准差
vol_std_6M	6个月波动率	过去6个月（日收益率）的标准差
vol_down_std_1M	1个月下行波动率	过去1个月（调整日收益率）的标准差，其中，调整日收益率指涨跌幅小于0的日收益率
vol_down_std_3M	3个月下行波动率	过去3个月（调整日收益率）的标准差，其中，调整日收益率指涨跌幅小于0的日收益率
vol_down_std_6M	6个月下行波动率	过去6个月（调整日收益率）的标准差，其中，调整日收益率指涨跌幅小于0的日收益率
vol_up_std_1M	1个月上行波动率	过去1个月（调整日收益率）的标准差，其中，调整日收益率指涨跌幅大于0的日收益率
vol_up_std_3M	3个月上行波动率	过去3个月（调整日收益率）的标准差，其中，调整日收益率指涨跌幅大于0的日收益率
vol_up_std_6M	6个月上行波动率	过去6个月（调整日收益率）的标准差，其中，调整日收益率指涨跌幅大于0的日收益率
vol_highlow_avg_1M	1个月日内振幅	过去1个月（最高价/最低价）的均值
vol_highlow_avg_3M	3个月日内振幅	过去3个月（最高价/最低价）的均值
vol_highlow_avg_6M	6个月日内振幅	过去6个月（最高价/最低价）的均值
vol_highlow_std_1M	1个月日内振幅标准差	过去1个月（最高价/最低价）的标准差
vol_highlow_std_3M	3个月日内振幅标准差	过去3个月（最高价/最低价）的标准差
vol_highlow_std_6M	6个月日内振幅标准差	过去6个月（最高价/最低价）的标准差
vol_upshadow_avg_1M	1个月上影线均值	标准化上影线因子过去1个月的均值；其中，标准化上影线=（最高价-max(开盘价，收盘价)）/最高价
vol_upshadow_avg_3M	3个月上影线均值	标准化上影线因子过去3个月的均值；其中，标准化上影线=（最高价-max(开盘价，收盘价)）/最高价
vol_upshadow_avg_6M	6个月上影线均值	标准化上影线因子过去6个月的均值；其中，标准化上影线=（最高价-max(开盘价，收盘价)）/最高价
vol_upshadow_std_1M	1个月上影线标准差	标准化上影线因子过去1个月的标准差；其中，标准化上影线=（最高价-max(开盘价，收盘价)）/最高价
vol_upshadow_std_3M	3个月上影线标准差	标准化上影线因子过去3个月的标准差；其中，标准化上影线=（最高价-max(开盘价，收盘价)）/最高价
vol_upshadow_std_6M	6个月上影线标准差	标准化上影线因子过去6个月的标准差；其中，标准化上影线=（最高价-max(开盘价，收盘价)）/最高价
vol_downshadow_avg_1M	1个月下影线均值	标准化下影线因子过去1个月的均值；其中，标准化下影线=（min(开盘价，收盘价)-最低价）/最低价
vol_downshadow_avg_3M	3个月下影线均值	标准化下影线因子过去3个月的均值；其中，标准化下影线=（min(开盘价，收盘价)-最低价）/最低价
vol_downshadow_avg_6M	6个月下影线均值	标准化下影线因子过去6个月的均值；其中，标准化下影线=（min(开盘价，收盘价)-最低价）/最低价
vol_downshadow_std_1M	1个月下影线标准差	标准化下影线因子过去1个月的标准差；其中，标准化下影线=（min(开盘价，收盘价)-最低价）/最低价
vol_downshadow_std_3M	3个月下影线标准差	标准化下影线因子过去3个月的标准差；其中，标准化下影线=（min(开盘价，收盘价)-最低价）/最低价
vol_downshadow_std_6M	6个月下影线标准差	标准化下影线因子过去6个月的标准差；其中，标准化下影线=（min(开盘价，收盘价)-最低价）/最低价

因子代码	因子名称	因子计算公式
liq_turn_avg_1M	1个月换手率	1个月换手率的均值
liq_turn_avg_3M	3个月换手率	3个月换手率的均值
liq_turn_avg_6M	6个月换手率	6个月换手率的均值
liq_turn_std_1M	1个月换手率标准差	1个月换手率的标准差
liq_turn_std_3M	3个月换手率标准差	3个月换手率的标准差
liq_turn_std_6M	6个月换手率标准差	6个月换手率的标准差
liq_vstd_1M	1个月成交波动比	1个月成交额/过去1个月收益率标准差
liq_vstd_3M	3个月成交波动比	3个月成交额/过去3个月收益率标准差
liq_vstd_6M	6个月成交波动比	6个月成交额/过去6个月收益率标准差
liq_amihud_avg_1M	1个月Amihud非流动因子	过去1个月(日收益率 /成交额)的平均值
liq_amihud_avg_3M	3个月Amihud非流动因子	过去3个月(日收益率 /成交额)的平均值
liq_amihud_avg_6M	6个月Amihud非流动因子	过去6个月(日收益率 /成交额)的平均值
liq_amihud_std_1M	1个月Amihud非流动因子标准差	过去1个月(日收益率 /成交额)的标准差
liq_amihud_std_3M	3个月Amihud非流动因子标准差	过去3个月(日收益率 /成交额)的标准差
liq_amihud_std_6M	6个月Amihud非流动因子标准差	过去6个月(日收益率 /成交额)的标准差
liq_shortcut_avg_1M	1个月最短路径非流动因子	过去1个月(日K线最短路径/成交额)的平均值；日K线最短路径=2*(最高价-最低价)- 开盘价-收盘价
liq_shortcut_avg_3M	3个月最短路径非流动因子	过去3个月(日K线最短路径/成交额)的平均值；日K线最短路径=2*(最高价-最低价)- 开盘价-收盘价
liq_shortcut_avg_6M	6个月最短路径非流动因子	过去6个月(日K线最短路径/成交额)的平均值；日K线最短路径=2*(最高价-最低价)- 开盘价-收盘价
liq_shortcut_std_1M	1个月最短路径非流动因子标准差	过去1个月(日K线最短路径/成交额)的标准差；日K线最短路径=2*(最高价-最低价)- 开盘价-收盘价
liq_shortcut_std_3M	3个月最短路径非流动因子标准差	过去3个月(日K线最短路径/成交额)的标准差；日K线最短路径=2*(最高价-最低价)- 开盘价-收盘价
liq_shortcut_std_6M	6个月最短路径非流动因子标准差	过去6个月(日K线最短路径/成交额)的标准差；日K线最短路径=2*(最高价-最低价)- 开盘价-收盘价

因子代码	因子名称	因子计算公式
mmt_normal_M	1个月收益率	过去1个月的收益率
mmt_normal_A	1年收益率	过去12个月的收益率-过去1个月收益率
mmt_avg_M	相对均价的1个月收益率	当期收盘价 / 过去20个交易日均价
mmt_avg_A	相对均价的1年收益率	1个月前的收盘价 / 过去1年的均价
mmt_intraday_M	1个月日内动量	过去一个月的日内涨跌幅之和
mmt_intraday_A	1年日内动量	过去一年的日内涨跌幅之和-过去一个月日内涨跌幅之和
mmt_overnight_M	1个月隔夜动量	过去1个月内，隔夜涨跌幅之和
mmt_overnight_A	1年隔夜动量	过去一年的隔夜涨跌幅之和-过去一个月隔夜涨跌幅之和
mmt_off_limit_A	1年去涨跌停动量	除去涨跌停状态外，过去1年的收盘涨跌幅 - 过去1个月的收盘涨跌幅
mmt_off_limit_M	1个月去涨跌停动量	除去涨跌停状态外，过去1个月的收盘涨跌幅
mmt_range_M	1个月振幅调整动量	过去1个月内，振幅大的前20%的收盘收益率 - 振幅小的后20%的收盘收益率
mmt_range_A	1年振幅调整动量	过去1年内，振幅大的前20%的收盘收益率 - 振幅小的后20%的收盘收益率
mmt_route_M	1个月路径调整动量	过去1个月内收益率 / 过去1个月内日度涨跌幅绝对值之和
mmt_route_A	1年路径调整动量	过去1年内收益率 / 过去1年内日度涨跌幅绝对值之和
mmt_discrete_M	1个月信息离散度动量	过去1个月内，上涨天数占比-下跌天数占比
mmt_discrete_A	1年信息离散度动量	过去1年内，上涨天数占比-下跌天数占比
mmt_sec_rank_M	1个月横截面rank动量	每日计算个股日收益在横截面的排名，取过去20个交易日排名均值
mmt_sec_rank_A	1年横截面rank动量	每日计算个股日收益在横截面的排名，取过去1年排名均值
mmt_time_rank_M	1个月时序rank动量	每日计算个股价格在时序（1年内）的排名，取过去20个交易日排名均值
mmt_report_overnight	业绩公告前隔夜动量	最近一个业绩公告日的前一个月的隔夜收益率之和
mmt_report_jump	业绩跳开动量	最近一个业绩公告日的下一交易日隔夜超额收益率
mmt_report_period	业绩期动量	业绩公告前一交易日至最后一交易日
mmt_highest_days_A	近1年最高价日期距今的天数	过去1年最高价出现的日期距离当前日期的天数

因子代码	因子名称	因子计算公式
act_buy_prop	主动买入占比因子	过去20个交易日（净流入金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
act_buy_shift_dist	主动买入的位移路程比因子	过去20个交易日（净流入金额）之和 / 过去20个交易日 净流入金额 之和
act_buy_prop_xl	超大单主动买入占比因子	过去20个交易日（超大单主动买入金额-超大单主动卖出金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
act_buy_shift_dist_xl	超大单主动买入的位移路程比因子	过去20个交易日（超大单主动买入金额-超大单主动卖出金额）之和 / 过去20个交易日 超大单主动买入金额-超大单主动卖出金额 之和
act_buy_prop_l	大单主动买入占比因子	过去20个交易日（大单主动买入金额-大单主动卖出金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
act_buy_shift_dist_l	大单主动买入的位移路程比因子	过去20个交易日（大单主动买入金额-大单主动卖出金额）之和 / 过去20个交易日 大单主动买入金额-大单主动卖出金额 之和
act_buy_prop_m	中单主动买入占比因子	过去20个交易日（中单主动买入金额-中单主动卖出金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
act_buy_shift_dist_m	中单主动买入的位移路程比因子	过去20个交易日（中单主动买入金额-中单主动卖出金额）之和 / 过去20个交易日 中单主动买入金额-中单主动卖出金额 之和
act_buy_prop_s	小单主动买入占比因子	过去20个交易日（小单主动买入金额-小单主动卖出金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
act_buy_shift_dist_s	小单主动买入的位移路程比因子	过去20个交易日（小单主动买入金额-小单主动卖出金额）之和 / 过去20个交易日 小单主动买入金额-小单主动卖出金额 之和
buy_prop_xl	超大单买入占比因子	过去20个交易日（超大单买入金额-超大单卖出金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
buy_shift_dist_xl	超大单买入的位移路程比因子	过去20个交易日（超大单买入金额-超大单卖出金额）之和 / 过去20个交易日 超大单主动买入金额-超大单主动卖出金额 之和
buy_prop_l	大单买入占比因子	过去20个交易日（大单买入金额-大单卖出金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
buy_shift_dist_l	大单买入的位移路程比因子	过去20个交易日（大单买入金额-大单卖出金额）之和 / 过去20个交易日 大单主动买入金额-大单主动卖出金额 之和
buy_prop_m	中单买入占比因子	过去20个交易日（中单买入金额-中单卖出金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
buy_shift_dist_m	中单买入的位移路程比因子	过去20个交易日（中单买入金额-中单卖出金额）之和 / 过去20个交易日 中单主动买入金额-中单主动卖出金额 之和
buy_prop_s	小单买入占比因子	过去20个交易日（小单买入金额-小单卖出金额）之和 / 过去20个交易日成交额之和
buy_shift_dist_s	小单买入的位移路程比因子	过去20个交易日（小单买入金额-小单卖出金额）之和 / 过去20个交易日 小单主动买入金额-小单主动卖出金额 之和
inflow_prop_open	开盘资金流入金额占比因子	过去20个交易日（开盘资金流入金额 / 当日成交额）的平均数
inflow_shift_dist_open	开盘资金流入金额的位移路程比因子	过去20个交易日（开盘资金流入金额）之和 / 过去20个交易日 开盘资金流入金额 之和
inflow_rate_open	开盘资金流入率因子	过去20个交易日开盘资金流入率的平均数
amount_prop_open	开盘成交额占比因子	过去20个交易日（开盘成交额 / 当日成交额）的平均数
inflow_prop_open_l	大单开盘资金流入金额占比因子	过去20个交易日（大单开盘资金流入金额 / 当日成交额）的平均数
inflow_rate_open_l	大单开盘资金流入率因子	过去20个交易日大单开盘资金流入率的平均数
inflow_shift_dist_open_l	大单开盘资金流入金额的位移路程比因子	过去20个交易日（大单开盘资金流入金额）之和 / 过去20个交易日 大单开盘资金流入金额 之和
inflow_prop_close	尾盘资金流入金额占比因子	过去20个交易日（尾盘资金流入金额 / 当日成交额）的平均数
inflow_shift_dist_close	尾盘资金流入金额的位移路程比因子	过去20个交易日（尾盘资金流入金额）之和 / 过去20个交易日 尾盘资金流入金额 之和
inflow_rate_close	尾盘资金流入率因子	过去20个交易日尾盘资金流入率的平均数
amount_prop_close	尾盘成交额占比因子	过去20个交易日（尾盘成交额 / 当日成交额）的平均数
inflow_prop_close_l	大单尾盘资金流入金额占比因子	过去20个交易日（大单尾盘资金流入金额 / 当日成交额）的平均数
inflow_rate_close_l	大单尾盘资金流入率因子	过去20个交易日大单尾盘资金流入率的平均数
inflow_shift_dist_close_l	大单尾盘资金流入金额的位移路程比因子	过去20个交易日（大单尾盘资金流入金额）之和 / 过去20个交易日 大单尾盘资金流入金额 之和

因子代码	因子名称	因子计算公式
distribution_ret_avg	筹码平均收益因子	各筹码收益率的平均数
distribution_ret_std	筹码标准差因子	各筹码收益率的标准差
distribution_ret_skew	筹码偏度因子	各筹码收益率的偏度统计量
distribution_ret_kurt	筹码峰度因子	各筹码收益率从的峰度统计量
distribution_max_prob_ret	最大筹码收益率因子	占比最大的筹码区间的收益率
distribution_bal	盈亏平衡筹码占比因子	-2%至2%收益率的筹码占比
distribution_profit_l	大幅盈利筹码占比因子	10%以上收益率的筹码占比
distribution_profit_s	小幅盈利筹码占比因子	2%至10%收益率的筹码占比
distribution_loss_s	小幅亏损筹码占比因子	-2%至-10%收益率的筹码占比
distribution_loss_l	大幅亏损筹码占比因子	-10%以下收益率的筹码占比

因子代码	因子名称	因子计算公式
corr_price_turn_1M	换手率与价格相关性因子（量价同步）	过去20个交易日，t日换手率与t日价格的相关系数
corr_price_turn_post_1M	换手率与价格相关性因子（量领先一期）	过去20个交易日，t日换手率与t+1日价格的相关系数
corr_price_turn_prior_1M	换手率与价格相关性因子（价领先一期）	过去20个交易日，t日换手率与t-1日价格的相关系数
corr_ret_turn_1M	换手率与收益率相关性因子（量价同步）	过去20个交易日，t日换手率与t日收益率的相关系数
corr_ret_turn_post_1M	换手率与收益率相关性因子（量领先一期）	过去20个交易日，t日换手率与t+1日收益率的相关系数
corr_ret_turn_prior_1M	换手率与收益率相关性因子（价领先一期）	过去20个交易日，t日换手率与t-1日收益率的相关系数
corr_ret_turnd_1M	换手率变动与收益率相关性因子（量价同步）	过去20个交易日，t日换手率的变动与t日收益率的相关系数
corr_ret_turnd_post_1M	换手率变动与收益率相关性因子（量领先一期）	过去20个交易日，t日换手率的变动与t+1日收益率的相关系数
corr_ret_turnd_prior_1M	换手率变动与收益率相关性因子（价领先一期）	过去20个交易日，t日换手率的变动与t-1日收益率的相关系数