

用户行为分析系统

用户交易标签和指标设计文档

编写人	马天翼
审核人	
编写时间	2018 年 1 月 15 日
版本	0.5
最后修改时间	2018 年 3 月 5 日
修改人	马天翼，雷浩
备注	<p>2018 年 1 月 18 日：加入交易指标数据仓库设计，清洗逻辑设计和接口设计</p> <p>2018 年 1 月 19 日：修改 T01 截图和表结构</p> <p>2018 年 1 月 23 日：修改 T01，H05 表结构，H05 接口定义，添加 T05 转账资产分布表结构和接口定义</p> <p>2018 年 2 月 8 日：修改 T03 表结构和接口定义，添加持仓类型</p> <p>2018 年 3 月 5 日：更新数据仓库表结构定义</p>

目录

一、数据仓库表结构和 ETL 定义.....	1
1. 客户维度表 dim_oth_customer.....	1
2. 时间维度表 dim_oth_date.....	1
3. 产品维度表 dim_biz_on_board_product.....	2
4. 参考指数维度表 dim_biz_index_ds.....	5
5. FT01 用户交易资产盈亏事实表 dws_ord_asset_profit_ds.....	5
6. FT02 持仓事实表 dwb_ord_hold_ds.....	7
7. FT03 持仓事实表日汇总 dws_ord_hold_day_ds.....	8
8. FT04 场内交易事实表 dwb_ord_on_board_ds.....	8
9. FT05 场内交易日汇总事实表 dws_ord_on_board_day_ds.....	9
10. FT06 持仓序列事实表 dwb_ord_hold_seq_ds.....	10
二、标签表结构定义.....	11
1. 用户属性标签表 dws_user_attribute_label.....	11
2. 用户偏好标签 dws_user_preference_label.....	12
三、用户交易、偏好标签计算定义.....	15
1. LU1, 2, 3, 6, 7, 8, 9, 10 用户属性标签.....	15
2. LU4 近七日账户最大金额.....	17
3. LU5 近七日盈亏合计.....	17
4. LT1 近七日累计佣金.....	18
5. LT2 持仓股票.....	18
6. LT3 股票仓位.....	18
7. LT4 持股个数.....	19
8. LT5 平均持股天数（粒度：持股周期）.....	19
9. LT6 月操作成功率（粒度：卖出交易）.....	19
10. LT7 月收益率（粒度：资产账户）.....	20
11. LT8 持股偏好（股本规模，基金投资类型）.....	20
12. LT9 账户风险偏好 && LB19 风险偏好.....	21
13. LT10 近七日交易的股票.....	21
14. LT11 近七日收益率.....	22
15. LT12 总收益率.....	22
16. LT13 账户总盈亏.....	23
17. LT14 持仓股票盈亏比（以当前日期每笔用户持仓记录为粒度）.....	23
18. LT15 上证 50 成分股仓位.....	23
19. LT16 沪深 300 成分股仓位.....	24
20. LT17 中证 500 成分股仓位.....	24
21. LT18 创业板个股仓位.....	24
22. LT19 ST 股仓位.....	25
23. LT20 历史账户最大金额.....	25
24. LT21 近七日账户净转入金额.....	25
25. LP1 近七日最关注的三只个股.....	26
26. LP2 近七日最关注的三个行业.....	26
27. LP3 近七日最关注的三个概念.....	27

28. LP4 近七日最关注的三个指数.....	27
29. LP5 近七日最关注的三个基金.....	28
30. LP6 自选股标的偏好.....	28
31. LP7 自选股市场偏好.....	28
32. LP8 自选股价格偏好.....	29
33. LP9 自选股波动偏好.....	29
34. LP10 自选股风险偏好分数.....	29
四、用户能力标签定义.....	30
1. 盈利能力标签定义.....	30
1.1 LB1 年化收益率(粒度：账户资产).....	30
1.2 LB2 超额收益率(粒度：账户资产).....	30
1.3 LB3 期望收益率(粒度：账户卖出交易).....	31
1.4 LB4 夏普比率(粒度：账户资产).....	31
1.5 LB5 盈利持续性(粒度：账户卖出交易).....	31
1.6 LB6 盈利能力评价(粒度：账户资产).....	32
2. 稳定性能力标签定义.....	32
2.1 LB7 波动率(粒度：账户资产).....	32
2.2 LB8 最大回撤(粒度：账户资产).....	32
2.3 LB9 稳定性评价(粒度：账户资产).....	33
3. 选股能力标签定义.....	33
3.1 LB10 选股绝对胜率(粒度：持仓周期).....	33
3.2 LB11 盈亏金额比(粒度：卖出交易).....	33
3.3 LB12 总笔数.....	34
3.4 LB13 选股能力评价.....	34
4. 择时能力标签定义.....	34
4.1 LB14 择时绝对胜率（粒度：持仓周期）.....	34
4.2 LB15 买点时机（粒度：持仓周期）.....	35
4.3 LB16 止损时机（粒度：持仓周期）.....	35
4.4 LB17 止盈时机（粒度：持仓周期）.....	35
4.5 LB18 择时能力评价.....	36
5. 抗风险能力标签定义.....	36
5.1 LB19 风险偏好(粒度：购买交易).....	36
5.2 LB20 财务能力(粒度：资产账户).....	37
5.3 LB21 投资经验.....	37
5.4 LB22 平均超额仓位（粒度：持仓周期）.....	37
5.5 LB23 风险-超额收益率(粒度：资产账户).....	38
5.6 LB24 风险承受能力评价.....	38
6. 风控能力标签.....	39
6.1 LB25 最大回撤.....	39
6.2 LB26 夏普比率.....	39
6.3 LB27 风控能力评价.....	39
7. LB28 总评价.....	39
五、交易指标表清洗，指标计算及接口定义.....	40
1. A01 账户总资产.....	40

DIM01 资产类指标分段定义表 dim_oth_segment_asset (对应 cbas_dim_oth_segment_asset 表).....	40
SUM01 账户总资产分布周汇总 dws_ord_asset_stat_week (对应 cbas_sum_asset_stat_week 表以用户群为粒度).....	40
dws_ord_asset_stat_acc_week (对应 cbas_sum_asset_stat_acc_week 表以资金账户为粒度).....	41
SUM02 账户总资产分布月汇总 dws_ord_asset_stat_month (对应 cbas_sum_asset_stat_month 表以群组为粒度).....	42
dws_ord_asset_stat_acc_month (对应 cbas_sum_asset_stat_acc_month 表以资金账户为粒度).....	43
2. A02 账户可用资金.....	46
3. A03 盈亏分布 (持仓周期)	46
SUM03 盈利次数比人数分布事实表 dws_ord_profit_stat_week (对应 cbas_sum_profit_stat_week 以群组为粒度).....	47
dws_ord_profit_stat_acc_week (对应 cbas_sum_profit_stat_acc_week, 以资金账户为粒度).....	47
SUM04 盈利统计事实表 dws_ord_profit_stat_month (对应 cbas_sum_profit_stat_month, 以群组为粒度).....	48
dws_ord_profit_stat_acc_month (对应 cbas_sum_profit_stat_acc_month, 以资金账户为粒度).....	48
4. A04 当前佣金分布.....	51
5. C 客户类型分布.....	52
SUM05 客户类型分布事实表 dws_oth_customer_stat_ds (对应 cbas_sum_customer_stat_ds, 以群组为粒度).....	52
dws_oth_customer_stat_acc_ds (对应 cbas_sum_customer_stat_acc_ds, 以资金账户为粒度).....	52
6. H01 客户持仓产品偏好.....	54
SUM06 持仓偏好周汇总事实表.....	55
dws_ord_hold_preference_week (对应 cbas_sum_hold_preference_week 以群组为粒度).....	55
dws_ord_hold_preference_acc_week (对应 cbas_sum_hold_preference_acc_week 以资金账户为粒度).....	55
SUM07 持仓偏好月汇总事实表.....	55
dws_ord_hold_preference_month (对应 cbas_sum_hold_preference_month 以群组为粒度).....	55
dws_ord_hold_preference_acc_month (对应 cbas_sum_hold_preference_acc_month 以资金账户为粒度).....	56
7. H02 各产品持仓仓位人数分布.....	58
SUM08 持仓仓位人数周汇总事实表.....	59
dws_ord_hold_position_week (对应 cbas_sum_hold_position_week 以群组为粒度).....	59
dws_ord_hold_position_acc_week (对应 cbas_sum_hold_position_acc_week 以资金账户为粒度).....	59
SUM09 持仓仓位人数月汇总事实表.....	60
dws_ord_hold_position_month (对应 cbas_sum_hold_position_month 以群组为粒度).....	60
dws_ord_hold_position_acc_month (对应 cbas_sum_hold_position_acc_month 以资金账户为粒度).....	60
8. H03 产品持仓种类个数人数分布.....	62

SUM10 持仓种类人数周汇总事实表.....	62
dws_ord_hold_type_week (对应 cbas_sum_hold_type_week 以群组为粒度).....	62
dws_ord_hold_type_acc_week (对应 cbas_sum_hold_type_acc_week 以资金账户为粒度).....	63
SUM11 持仓种类人数周汇总事实表.....	63
dws_ord_hold_type_month (对应 cbas_sum_hold_type_month 以群组为粒度).....	63
dws_ord_hold_type_acc_month (对应 cbas_sum_hold_type_acc_month 以资金账户为粒度).....	63
9. H04 持仓产品盈亏人数分布（按持仓周期统计）	65
SUM12 持仓种类盈亏人数分布周汇总事实表.....	66
dws_ord_hold_profit_week (对应 cbas_sum_hold_profit_week 以群组为粒度).....	66
dws_ord_hold_profit_acc_week (对应 cbas_sum_hold_profit_acc_week 以资金账户为粒度).....	66
SUM13 持仓种类盈亏人数分布月汇总事实表.....	67
dws_ord_hold_profit_month(对应 cbas_sum_hold_profit_month 以群组为粒度).....	67
dws_ord_hold_profit_acc_month(对应 cbas_sum_hold_profit_acc_month 以资金账户为粒度).....	67
10. H05 产品销售量（或用场内交易表统计）	69
SUM14 产品销售日汇总事实表.....	69
dws_ord_product_sale_week(对应 cbas_sum_product_sale_week 以群组为粒度).....	69
dws_ord_product_sale_acc_week(对应 cbas_sum_product_sale_acc_week 以资金账户为粒度).....	70
dws_ord_product_sale_month(对应 cbas_sum_product_sale_month 以群组为粒度).....	70
dws_ord_product_sale_acc_month(对应 cbas_sum_product_sale_acc_month 以群组为粒度).....	70
11. T01 平均持仓个数人数分布.....	72
SUM15 产品持仓个数人数分布周汇总.....	72
dws_ord_hold_num_week (对应 cbas_sum_hold_num_week 以分组粒度).....	72
dws_ord_hold_num_acc_week (对应 cbas_sum_hold_num_acc_week 以资金账户粒度).....	73
SUM16 产品持仓个数人数分布月汇总.....	73
dws_ord_hold_num_month(对应 cbas_sum_hold_num_month 以分组粒度).....	73
dws_ord_hold_num_acc_month(对应 cbas_sum_hold_num_acc_month 以资金账户粒度).....	73
12. T02 客户盈利成功率（持仓周期）	75
SUM17 盈利成功率分布周汇总（持仓周期）	75
dws_ord_hold_profit_rate_week(对应 cbas_sum_hold_profit_rate_week 以用户群组为粒度).....	75
dws_ord_hold_profit_rate_acc_week(对应 cbas_sum_hold_profit_rate_acc_week 以资金账户为粒度).....	75
SUM18 盈利成功率分布月汇总（持仓周期）	76
dws_ord_hold_profit_rate_month(对应 cbas_sum_hold_profit_rate_month 以用户群组为粒度).....	76
dws_ord_hold_profit_rate_acc_month(对应 cbas_sum_hold_profit_rate_acc_month 以资金账户为粒度).....	76
13. T03 持仓时间（持仓周期）	78
SUM18 平均持仓周期分布周汇总.....	79
dws_ord_avg_hold_week(对应 cbas_sum_avg_hold_week 以用户群组为粒度).....	79

dws_ord_avg_hold_acc_week(对应 cbas_sum_hold_avg_hold_acc_week 以资金账户为粒度).....	79
SUM19 平均持仓周期分布月汇总.....	79
dws_ord_avg_hold_month(对应 cbas_sum_avg_hold_month 以用户群组为粒度).....	79
dws_ord_avg_hold_acc_month(对应 cbas_sum_avg_hold_acc_month 以资金账户为粒度).....	80
14. T04 购买风险偏好.....	81
SUM20 购买风险偏好周汇总.....	82
dws_ord_risk_week(对应 cbas_sum_risk_week 以用户群组为粒度).....	82
dws_ord_risk_acc_week(对应 cbas_sum_risk_acc_week 以资金账户为粒度).....	82
SUM21 平均持仓周期分布月汇总.....	83
dws_ord_risk_month(对应 cbas_sum_risk_month 以用户群组为粒度).....	83
dws_ord_risk_acc_month(对应 cbas_sum_risk_acc_month 以资金账户为粒度).....	83
15. T05 转账资产分布.....	85
SUM22 转账资产分布周汇总.....	85
dws_ord_cap_in_week(对应 cbas_sum_cap_in_week 以用户群组为粒度).....	85
dws_ord_cap_in_acc_week(对应 cbas_sum_cap_in_acc_week 以资金账户为粒度).....	85
SUM23 转账资产分布月汇总.....	86
dws_ord_cap_in_month(对应 cbas_sum_cap_in_month 以用户群组为粒度).....	86
dws_ord_cap_in_month(对应 cbas_sum_cap_in_month 以资金账户为粒度).....	86

一、数据仓库表结构和 ETL 定义

1. 客户维度表 dim_oth_customer

清洗粒度资金账户 ID，一个资金账户 ID 一条记录

字段	类型	说明
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合客户编号，ASSET_ACCT_INFO_H.Intg_Cust_Id
cust_id	VARCHAR(80)	客户原始账号，ASSET_ACCT_INFO_H.Cust_Id
account_id	VARCHAR(80)	资金账户 ID，ASSET_ACCT_INFO_H.Fund_Acct
customer_type	CHAR(4)	客户类型：ASSET_ACCT_INFO_H.Acct_Type
p_date	DATE	分区字段 YYYYMMDD

ETL 逻辑：取 ASSET_ACCT_INFO_H 资金账户信息表中唯一的账户类型为普通账户（acct_type='0'）的资金账号信息（Fund_Acct），若源表资金帐号 Fund_Acct 记录有重复，按 start_dt 取最近的一条。

customer_type 数据字典：

枚举值	描述
0	普通资金账户
1	信用资金账户
2	个股期权资金账户
3	综合交易账户（OTC）

2. 时间维度表 dim_oth_date

字段	类型	说明
date_id	INT	日期 ID
datevalue	VARCHAR(80)	日期名称
year	INT	年
quarter	INT	季度
month	INT	月
week	INT	周
yearandweek	VARCHAR(6)	年+周（如 201734）
dayofweek	INT	星期几
day	INT	天数

3. 产品维度表 dim_biz_on_board_product

字段	类型	说明
product_id	VARCHAR(80)	产品编号 prod_id
product_type	CHAR(4)	产品类型
product_name	VARCHAR(80)	产品名称
product_code	CHAR(8)	证券代码（股票，基金）
stock_scale	CHAR(4)	股本规模分类数据字典：0010-小盘股，0020-中盘股，0030-大盘股，0040-超大盘股，0000-未知
market	CHAR(4)	市场分类数据字典：0010-ST 股（*ST），0020-创业板（创业板），0050-上证 50（上证 50），0300-不包括在上证 50 的沪深 300 股票（沪深 300），0500-中证 500，0000-未知
price_type	CHAR(4)	价格分类数据字典：0010-低价股，0020-中高股，0030-高价股
risk_type	CHAR(4)	风险分类数据字典：0010-激进型，0020-稳健型，0030-保守型
block	VARCHAR(80)	概念板块名称
field	VARCHAR(80)	行业板块名称
seven_day_rise	DECIMAL(28,4)	七日内振幅
open_price	DECIMAL(16,2)	当日开盘价
close_price	DECIMAL(16,2)	当日收盘价
rise	DECIMAL(16,2)	当日收盘涨幅
p_date	DATE	分区字段 YYYYMMDD

ETL 逻辑：取持仓表 T98_ASSET_POS_ACCT 和场内交易明细表 T98_ON_BOARD_MATCH_DTL 中产品类别 Secu_Cate_Cd 为股基的 ID，名称和证券代码（证券代码通过 prod_id 解析后六位），并通过证券代码和名称查询行情主站中股票数据，洗出股本规模分类，市场分类，价格分类，风险分类，概念、行业名称代码，七日内振幅，当日开盘价，收盘价，收盘时涨幅。分类逻辑定义如下：

股本规模 stock_scale 分段定义：

定义：按照流通市值从大到小排序，市值的累加至所有流通市值合计的50%的时候，为超大盘股；50%到70%的时候为大盘股；70%到90%时为中盘股；90%到100%时为小盘股。中小盘股是中盘股和小盘股的合计。

累计占比(A)	股本规模
$0 < A \leq 50\%$	超大盘股
$50\% < A \leq 70\%$	大盘股
$70\% < A \leq 90\%$	中盘股
$90\% < A \leq 100\%$	小盘股
$70\% < A \leq 100\%$	中小盘股

股票价位 price_type 分段定义：

- 当日收盘价<10: 低价股

- 当日收盘价 ≥ 10 && < 20 : 中低价股
- 当日收盘价 ≥ 20 && < 30 : 中价股
- 当日收盘价 ≥ 30 : 高价股

风险类型通过统计股票近七个交易日的区间日均振幅来确定，风险类型 risk_type 分段定义如下：

- 近 7 个交易日的区间日均振幅 $> 3.5\%$ ：激进型
- 近 7 个交易日的区间日均振幅 > 1.5 && $\leq 3.5\%$ ：稳健型
- 近 7 个交易日的区间日均振幅 > 0 && $\leq 1.5\%$ ：保守型

其中近七个交易日日均振幅=每天振幅之和 / 7

product_type 数据字典：

枚举值	描述
A00	集合理财
B00	国债现货
B01	国债回购
B10	企债现货
B11	企债回购
B12	中小企业私募债
B20	公司债现货
B21	公司债回购
B30	可转债
B31	可交换公司债券
B32	可分离转债
B33	中小企业可交换私募债
B40	买断式回购
B41	非政策性金融债
B42	政策性金融债
B43	次级债
B44	金融债
B51	短期融资券
B52	超级短期融资券
B61	资产支持证券
B71	中期票据
B72	公司债
B73	企债
B81	其它
B90	央行票据
B91	地方政府债
B92	同业存单
B98	收益凭证
B99	债券

D99	衍生品
F00	ETF
F10	封闭式基金
F20	公募基金
F21	资管产品
F22	资管现金产品
F23	货币基金
F24	私募基金
F60	银行理财
F70	OTC 产品
H00	期货
H10	认购期权
H11	认沽期权
I00	指数
R01	利率产品
R02	利率互换产品
R99	外汇
S00	主板 A 股
S01	主板 B 股
S02	B 转 H
S03	公开优先股
S04	非公开优先股
S10	中小板 A 股
S11	中小板 B 股
S20	两网公司及退市公司 A 股
S21	两网公司及退市公司 B 股
S22	挂牌公司股票
S23	股权激励期权
S30	创业板 A 股
S31	创业板 B 股
S32	港股通-股票
S33	港股通-权证
S34	港股通-债券
S35	港股通-信托
S99	股票
W00	权证
X01	信用费率产品-融资
X02	信用费率产品-融券
X03	信用费率产品-私用转融资
X04	信用费率产品-私用转融券
Z00	非交易业务（发行、权益分配）
Z01	非交易业务-配股

Z02	非交易业务-增发
Z03	非交易业务-配债

4. 参考指数维度表 dim_biz_index_ds

以指数为粒度，记录指数每天涨跌幅，开盘价，收盘价等信息（共 514 个指数）

字段	类型	说明	ETL 来源
index_code	VARCHAR(80)	指数代码	取行情主站相应指数代码，如沪深 300，中证 500 等
index_name	VARCHAR(80)	指数名称	指数名称
open_price	BIGDECIMAL(26, 4)	开盘价	取行情主站相应指数开盘价
close_price	BIGDECIMAL(26, 4)	收盘价	取行情主站相应指数收盘价
rise	BIGDECIMAL(26, 4)	涨跌幅	取行情主站相应指数当日涨跌幅
p_date	DATE	数据更新日期	

5. FT01 用户交易资产盈亏事实表 dws_ord_asset_profit_ds

按天汇总交易统计，以账户 account_id 为粒度，每个 account_id 一天一条，表总行数与 dim_oth_customer 数量相等。

字段	类型	说明	ETL 定义
trans_amount	DECIMAL(26,4)	所有交易金额加和	SUM(ON_BOARD_MATCH_DTL.Match_Amt_Rmb)
total_cost	DECIMAL(26,4)	成本总额	total_cost = SUM(ON_BOARD_MATCH_DTL.Match_Qtty x last_ref_cost) last_ref_cost: 持仓表对应持仓的最后一条的参考成本 (ASSET_POS_ACCT Ref_Cost)
profit	DECIMAL(26,4)	场内交易日毛利	profit = dws_ord_asset_profit_ds.trans_amount - dws_ord_asset_profit_ds.total_cost
com_fee	DECIMAL(26,4)	总净佣金	用户今日交易净佣金总和 SUM(ON_BOARD_MATCH_DTL.Net_Comm_Rmb)
other_fee	DECIMAL(26,4)	费用总和	用户今日交易费用总和 SUM(Total_fee) Total_fee=Comm_Fee_Rmb+Stamp_Tax+Tran_Fee+Trade_org_Tran_Fee+Brokerage_Fee+Ovhd_Expns_Fee+TRANST_FEE+Risk_Fee+Clear_Fee+Trade_Form_Fee+Agent_Fee+Trade_Sys_Use_Fee+Other_Fee

			(来自 ON_BOARD_MATCH_DTL)
net_profit	DECIMAL(26,4)	场内股基交易日净利	通过以上股基交易推出的日净利 net_profit=日毛利 profit - 总费用 other_fee
net_profit_acc	DECIMAL(26,4)	账户资产日净利	通过账户资产反推的账户资产日净利 net_profit_acc=今日去除转入的净资产 net_asset_without_income (今日净资产 net_asset - 今日净转入 net_income - 今日净 转入份额 net_income_share) - 前一个记 录日 net_asset_without_income 注: net_profit_acc >= net_profit
day_profit_rate	DECIMAL(26,4)	账户资产日净利率	net_profit_acc / 前一个记录日 net_asset_without_income * 100%
net_asset	DECIMAL(26,4)	账户日净资产	ASSET_ACCT_INFO.Net_Asset
net_income	DECIMAL(26,4)	账户日净转入资金	net_income=SUM(income_amount) 其中 income_amount=SUM(Profit_Cap_In) + SUM(Profit_Cap_Out), 注: 此处相加是 因为源表中 Profit_Cap_Out 为负数 Profit_Cap_In, Profit_Cap_Out 来自表 T98_CUST_ACCT_TRADE
net_income_share	DECIMAL(26,4)	账户日净转入市值	net_income_share=SUM(income_share) 其中 income_share=SUM(Profit_Mrkt_In)+SUM(Profit_Mrkt_Out), 注: 此处相加是因为源 表中 Profit_Mrkt_Out 为负数 Profit_Mrkt_In, Profit_Mrkt_Out 来自表 T98_CUST_ACCT_TRADE
net_asset_without_income	DECIMAL(26,4)	去除当日转入的净资产	net_asset_without_income = net_asset-net_income-net_income_share
fisl_asset	DECIMAL(26,4)	融资融券资产	FISL_D_STAT_INFO Total_Asset
fisl_net_income	DECIMAL(26,4)	融资融券净转入	FISL_D_STAT_INFO Net_In_Asset
cap_balance	DECIMAL(26,4)	当天账户现金余额	ASSET_ACCT_INFO Cap_Bal
fisl_balance	DECIMAL(26,4)	当天账户融资融券 账户资金余额	FISL_D_STAT_INFO Cap_Bal
fi_balance	DECIMAL(26,4)	融资余额	FISL_D_STAT_INFO Fi_Bal
sl_balance	DECIMAL(26,4)	融券余额	FISL_D_STAT_INFO Sl_Bal
fisl_value	DECIMAL(26,4)	融资融券证券市值	FISL_D_STAT_INFO Secu_Mrkt_Val
a_net_fee	DECIMAL(26,4)	A 股当天净佣金	CUST_ACCT_TRADE A_Stock_Net_Comm
b_net_fee	DECIMAL(26,4)	B 股当天净佣金	CUST_ACCT_TRADE B_Stock_Net_Comm
fund_net_fee	DECIMAL(26,4)	基金当天净佣金	CUST_ACCT_TRADE F_Stock_Net_Comm
bond_net_fee	DECIMAL(26,4)	债券当天净佣金	CUST_ACCT_TRADE Bond_Net_Comm
buyback_net_fee	DECIMAL(26,4)	回购当天净佣金	CUST_ACCT_TRADE Buyback_Match_Net_Comm
total_net_fee	DECIMAL(26,4)	账户当天总净佣金	CUST_ACCT_TRADE Total_Net_Comm

stock_fund_value	DECIMAL(26,4)	股票基金市值	ASSET_ACCT_INFO Stk_And_Fund_Mrkt_Val
bond_value	DECIMAL(26,4)	债券市值	ASSET_ACCT_INFO Bond_Mrkt_Val
out_market_value	DECIMAL(26,4)	场外市值	ASSET_ACCT_INFO Otc_Mrkt_Val
impawn_value	DECIMAL(26,4)	质押市值	ASSET_ACCT_INFO Impawn_Mrkt_Val
option_market_value	DECIMAL(26,4)	衍生品市值	ASSET_ACCT_INFO Option_Mrkt_Val
security_value	DECIMAL(26,4)	证券市值	ASSET_ACCT_INFO Secu_Mrkt_Val
a_amount	DECIMAL(26,4)	A 股日交易量	CUST_ACCT_TRADE A_Stock_Amt
b_amount	DECIMAL(26,4)	B 股日交易量	CUST_ACCT_TRADE B_Stock_Amt
fund_amount	DECIMAL(26,4)	基金日交易量	CUST_ACCT_TRADE F_Stock_Amt
bond_amount	DECIMAL(26,4)	债券日交易量	CUST_ACCT_TRADE Bond_Amt
buyback_amount	DECIMAL(26,4)	回购日交易量	CUST_ACCT_TRADE Buyback_Match_Amt
total_amount	DECIMAL(26,4)	账户总交易量	CUST_ACCT_TRADE Total_Amt
seven_day_first_day_asset	DECIMAL(26,4)	七日前净资产	七个自然日内第一个数据日期的净资产 net_asset
month_first_day_asset	DECIMAL(26,4)	一个月前净资产	30 个自然日内第一个数据日期的净资产 net_asset
seven_day_interval_income	DECIMAL(26,4)	七日内净转入	七个自然日所有数据日期内的净转入加和 SUM(net_income + net_income_share)
month_interval_net_income	DECIMAL(26,4)	一个月内净转入	30 个自然日内所有数据日期内净转入加和 SUM(net_income + net_income_share)
total_asset	DECIMAL(26,4)	总资产	ods_asset_acct_info.total_asset
net_cap_in	DECIMAL(26,4)	净资产转入	
cust_id	VARCHAR(80)	用户 ID	ON_BOARD_MATCH_DTL Cust_Cd
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合用户 ID	ON_BOARD_MATCH_DTL INTG_Cust_Id
account_id	VARCHAR(80)	证券账户 ID	ON_BOARD_MATCH_DTL Asset_Acct
p_date	INT / VARCHAR	日期	分区字段 YYYYMMDD

6. FT02 持仓事实表 dwb_ord_hold_ds

字段	类型	说明	ETL 来源
ID	long	事实表 ID	自增
hold_value	DECIMAL(26,4)	该产品持仓市值	Secu_Mrkt_Val_Rmb 来自 ASSET_POS_ACCT
quantity	DECIMAL(26,4)	该产品持仓数量	Pos_Qtty 来自 ASSET_POS_ACCT
ref_cost	DECIMAL(26,4)	参考成本（价）	Ref_Cost 来自 ASSET_POS_ACCT
ref_profit	DECIMAL(26,4)	参考盈亏	ref_Prft_And_Loss 来自 ASSET_POS_ACCT
cust_id	VARCHAR(80)	用户 ID	取 ON_BOARD_MATCH_DTL 的 Cust_Cd
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合用户 ID	取 ON_BOARD_MATCH_DTL 的 INTG_Cust_Id

account_id	VARCHAR(80)	证券账户 ID	T98_ASSET_POS_ACCT Asset_Acct
p_date	VARCHAR	日期	分区字段 YYYYMMDD
product_id	VARCHAR(60)	持仓产品编号	取 ASSET_POS_ACCT 的 Prod_Id
type	CHAR(4)	产品类型	股票、基金、理财等 ASSET_POS_ACCT Prod_Type_Cd

7. FT03 持仓事实表日汇总 dwb_ord_hold_day_ds

以（资金帐号，产品类型）为粒度清洗，每条为一个资金帐号在一个证券产品类型下持仓统计的日汇总（目前只汇总股票和基金）。

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_num	INT	持仓证券产品个数	hold_num=COUNT DISTINCT dwb_ord_hold_ds.product_id group by dwb_ord_hold_ds.type
hold_amount	DECIMAL(26,4)	类型总持仓金额	total_amount=SUM (dwb_ord_hold_ds. hold_value) group by dwb_ord_hold_ds.type
hold_profit	DECIMAL(26,4)	股票持仓当日参考盈亏	SUM(dwb_ord_hold_ds.ref_profit)
cap_balance	DECIMAL(26,4)	当日账户现金余额	
cust_id	VARCHAR(80)	用户 ID	dwb_ord_hold_ds.cust_id
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合用户 ID	dwb_ord_hold_ds.intg_cust_id
account_id	VARCHAR(80)	证券账户 ID	dwb_ord_hold_ds.account_id
p_date	DATE	日期	分区字段 YYYYMMDD
type	CHAR(4)	证券产品类型	dwb_ord_hold_ds.type

ETL 逻辑：通过持仓明细事实表 dwb_ord_hold_ds 按产品类型统计账户持仓产品个数，金额和盈亏

8. FT04 场内交易事实表 dwb_ord_on_board_ds

字段	类型	说明	ETL 来源
security_code	VARCHAR(8)	证券代码	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL.Secu_Cd
security_name	VARCHAR(20)	证券名称	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL.Secu_Name
amount	DECIMAL(26,4)	交易金额	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL.Match_Amt_Rmb
quantity	DECIMAL(26,0)	今日该次交易数量	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL.Match_Qtty
com_fee	DECIMAL(16,2)	净佣金	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL.Net_Comm_Rmb
other_fee	DECIMAL(16,2)	所有佣金和其他费用	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL comm_fee_rmb+stamp_tax+tran_fee+trade_org_tr

			an_fee+brokerage_fee+ovhd_expns_fee+transt_fee+risk_fee+clear_fee+trade_form_fee+agent_fee+trade_sys_use_fee+other_fee
price	DECIMAL(16,2)	成交价	price = amount / quantity
cost_price	DECIMAL(16,2)	成本价	1. 若交易类型 tran_type 为买入（0B），成本价 cost_price=成交价 price 2. 若交易类型 tran_type 为卖出（0S），成本价 cost_price=dwb_ord_hold_ds 中对应持仓最新的一条参考成本除以数量 (dwb_ord_hold_ds.ref_cost / dwb_ord_hold_ds.quantity)
ref_cost	DECIMAL(16,2)	参考成本金额	1. 若 tran_type 为买入（0B），参考成本 ref_cost=成交金额 amount 2. 若 tran_type 为卖出（0S），ref_cost=卖出股票当天 dws_ord_hold_ds 中对应持仓最新参考成本金额 ref_cost
profit	DECIMAL(26,4)	该笔盈利	1. 若 tran_type 为买入（0B），profit=（dim_biz_on_board_product 中对应股票收盘价 - cost_price）* quantity 2. 若 tran_type 为卖出（0S），profit=amount-cost_price * quantity-other_fee
risk_flag	INT	追涨行为标记	若满足【交易类型 tran_type 为买入（0B）&& 买入价格（cost_price - dim_biz_on_board_product 中当日开盘价 open_price）/ dim_biz_on_board_product > 0.05】则视为该笔交易为追涨行为，置 1，否则置 0
cust_id	VARCHAR(80)	用户 ID	取 T98_ON_BOARD_MATCH_DTL 的 cust_cd
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合用户 ID	取 T98_ON_BOARD_MATCH_DTL 的 intg_cust_id
account_id	VARCHAR(80)	证券账户 ID	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL 的 ASSET_ACCT
p_date	INT / VARCHAR	日期	分区字段 YYYYMMDD
product_id	VARCHAR(60)	持仓产品编号	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL 的 prod_id
type	CHAR(4)	产品类型	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL secu_cate_cd
tran_type	CHAR(4)	交易行为代码	T98_ON_BOARD_MATCH_DTL std_trade_act_cd

ETL 逻辑：通过源表 T98_ON_BOARD_MATCH_DTL 清洗当日交易明细

9. FT05 场内交易日汇总事实表 dws_ord_on_board_day_ds

该表以账户为粒度，统计该账户每日交易指标

字段	类型	说明	ETL 来源
----	----	----	--------

risk_num	INT	追涨买入数量	dwb_ord_on_board 中 risk_flag=1 的交易数量
stock_buy_num	INT	股票买入笔数	dwb_ord_on_board 中 type 为股票且 tran_type 为买入的交易笔数
stock_sell_num	INT	股票卖出笔数	dwb_ord_on_board 中 type 为股票且 tran_type 为卖出的交易笔数
stock_sell_profit_num	INT	股票卖出盈利笔数	dwb_ord_on_board 中 type 为股票&&tran_type 为卖出&&profit > 0 的交易笔数
stock_sell_loss_num	INT	股票卖出亏损笔数	dwb_ord_on_board 中 type 为股票&&tran_type 为卖出&&profit < 0 的交易笔数
total_profit	DECIMAL(26,4)	当日交易盈亏金额	dwb_ord_on_board 中 tran_type 为卖出的 SUM(profit)
total_loss_cost	DECIMAL(26,4)	当日亏损交易总成本	dwb_ord_on_board SUM(【type 为股票&&tran_type 为卖出&&profit < 0】对应交易的 ref_cost)
total_profit_cost	DECIMAL(26,4)	当日盈利交易总成本	dwb_ord_on_board SUM(【type 为股票&&tran_type 为卖出&&profit > 0】对应交易的 ref_cost)
fund_buy_num	INT	基金买入笔数	dwb_ord_on_board 中 type 为基金且 tran_type 为买入的交易笔数
fund_sell_num	INT	基金卖出笔数	dwb_ord_on_board 中 type 为基金且 tran_type 为卖出的交易笔数
total_num	INT	总交易笔数	dwb_ord_on_board 中当天交易总笔数
cust_id	VARCHAR(80)	用户 ID	取 dim_oth_customer 的 cust_id
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合用户 ID	取 dim_oth_customer 的 intg_cust_id
account_id	VARCHAR(80)	证券账户 ID	取 dim_oth_customer 的 account_id
p_date	DATE	日期	分区字段 YYYYMMDD

10. FT06 持仓序列事实表 dwb_ord_hold_seq_ds

以账户一支股票的持仓周期为粒度，记录持仓天数，开始结束日期等信息。

这里定义一次持仓周期为该支股票持仓第一次卖空（quantity=0）的日期作为结束日期，若当天之后再买入，算作下一轮持仓周期。该表为全量表，每日更新一次。

字段	类型	说明	ETL 来源
security_code	VARCHAR(6)	股票代码	取 dwb_ord_hold_ds 的 product_id 对应的 dim_biz_on_board_product 中的股票代码
security_name	VARCHAR(20)	股票名称	取 dwb_ord_hold_ds 的 product_id 对应的 dim_biz_on_board_product 中的股票名称
start_date	DATE	持仓开始时间	dwb_ord_hold_ds.p_date
end_date	DATE	持仓结束时间	dwb_ord_on_board_ds.p_date，若持股周期（quantity > 0）未完，则为空
quantity	INT	持股数量	昨日持仓明细表该笔持仓的数量 dwb_ord_hold_ds.quantity - 今日场内交易明细

			dwb_dwb_ord_on_board_ds 中 tran_type='0S' 的对应股票交易的 quantity
hold_days	INT	持股天数	end_date - start_date 的天数，若 end_date 为空，则为今天日期-start_date 的天数
profit	BIGDECIMAL(26, 4)	持仓盈利	对应 dwb_ord_hold_ds 持仓的最新一条 profit
ref_cost	BIGDECIMAL(26, 4)	持仓成本	对应 dwb_ord_hold_ds 持仓的最新一条 ref_cost
profit_num	INT	该笔持仓周期内的盈利天数	统计 dwb_ord_hold_ds 持仓周期内该持仓的 profit > 0 的天数
loss_num	INT	该笔持仓周期内的亏损天数	统计 dwb_ord_hold_ds 持仓周期内该持仓的 profit < 0 的天数
cust_id	VARCHAR(80)	用户 ID	取 dwb_ord_hold_ds 的 cust_cd
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合用户 ID	取 dwb_ord_hold_ds 的 intg_cust_id
account_id	VARCHAR(80)	证券账户 ID	取 dwb_ord_hold_ds 的 account_id
product_id	VARCHAR(60)	持仓产品编号	取 dwb_ord_hold_ds 的 product_id
p_date	DATE	数据更新日期	

二、标签表结构定义

1. 用户属性标签表 dws_user_attribute_label

字段	类型	说明
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合客户编号
account_id	VARCHAR(80)	证券账户
account_name	VARCHAR(80)	账户名称
gender	CHAR(4)	性别
age	INT	年龄
ctime	STRING	开户时间
seven_max_amount	DECIMAL(26,4)	近七日账户最大金额
seven_profit_loss	DECIMAL(26,4)	近七日盈亏合计
education	VARCHAR(16)	学历
career	CHAR(4)	职业
field	VARCHAR(12)	行业类别代码
address	VARCHAR(256)	证件地址
contact_address	VARCHAR(256)	联系地址
is_value	INT	价值客户标识
is_effect	INT	有效客户标识
p_date	DATE	数据更新日期

2. 用户偏好标签 dws_user_preference_label

字段	类型	说明
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合客户编号
account_id	VARCHAR(80)	证券账户
seven_day_com_fee	DECIMAL(26,4)	近七日累计佣金
hold_stock	STRING	持仓股票
stock_position	DECIMAL(26,4)	股票仓位
hold_stock_num	INT	持股个数
avg_hold_days	DECIMAL(26,4)	平均持天数
month_success_rate	DECIMAL(26,4)	月成功率
month_profit_rate	DECIMAL(26,4)	月收益率
hold_preference	STRING	持股偏好
fund_hold_preference	STRING	基金投资类型偏好
account_risk_preference	STRING	账户风险偏好
seven_days_stock	STRING	近七日交易的股票
seven_days_profit_rate	DECIMAL(26,4)	近七日收益率
total_profit_rate	DECIMAL(26,4)	总收益率
total_profit	DECIMAL(26,4)	总盈亏
hold_profit_loss_ratio	DECIMAL(26,4)	持仓盈亏比
shangzheng50	DECIMAL(26,4)	上证 50 成分股仓位
hushen300	DECIMAL(26,4)	沪深 300 成分股仓位
zhongzheng500	DECIMAL(26,4)	中证 500 成分股仓位
chuangye	DECIMAL(26,4)	创业板个股仓位
st	DECIMAL(26,4)	ST 股仓位
total_max_amount	DECIMAL(26,4)	历史账户最大金额
seven_days_income	DECIMAL(26,4)	近七日账户净转入金额
p_date	DATE	数据更新日期

3. 用户知识标签 dws_user_knowledge_label

字段	类型	说明
intg_cust_id	VARCHAR(80)	整合客户编号
account_id	VARCHAR(80)	证券账户
p_date	DATE	数据日期
seven_days_stock	STRING	近七日最关注的三只个股
seven_days_field	STRING	近七日最关注的三个行业
seven_days_block	STRING	近七日最关注的三个概念
seven_days_index	STRING	近七日最关注的三个指数
seven_days_fund	STRING	近七日最关注的三个基金
stock_preference	STRING	自选股标的偏好
market_preference	STRING	自选股市场偏好
price_preference	STRING	自选股价格偏好

movement_preference	STRING	自选股波动偏好
risk_preference	STRING	自选风险偏好分数
financial_score	DECIMAL(26,4)	资金实力分数
edu_background_score	INT	背景学历分数

4. 盈利能力事实表 dws_ord_profit_ability_ds

字段	类型	说明
account_id	VARCHAR(80)	证券账户
p_date	DATE	数据日期
year_profit_rate	DECIMAL(26,4)	年化收益率
year_profit_rate_score	DECIMAL(26,4)	年化收益率归一化相对评分
year_profit_rate_rank	DECIMAL(26,4)	年化收益率排名比
excess_profit_rate	DECIMAL(26,4)	超额收益率
excess_profit_rate_score	DECIMAL(26,4)	超额收益率归一化相对评分
excess_profit_rate_rank	DECIMAL(26,4)	期望收益率排名比
exp_profit_rate	DECIMAL(26,4)	期望收益率
exp_profit_rate_score	DECIMAL(26,4)	期望收益率归一化相对评分
exp_profit_rate_rank	DECIMAL(26,4)	期望收益率排名比
sharp_ratio	DECIMAL(26,4)	夏普比率
sharp_ratio_score	DECIMAL(26,4)	夏普比率归一化排名比
sharp_ratio_rank	DECIMAL(26,4)	夏普比率排名比
seq_profit_num	DECIMAL(26,4)	持续盈利笔数
seq_loss_num	DECIMAL(26,4)	持续亏损笔数
profit_persist_score	DECIMAL(26,4)	盈利持续性分数
profit_persist_rank	DECIMAL(26,4)	盈利持续性归一化排名比
profit_score	DECIMAL(26,4)	盈利能力评价
profit_rank	INT	账户盈利能力排名

5. 用户选股能力事实表 dws_ord_ability_selection_ds

字段	类型	说明
account_id	VARCHAR(80)	证券账户
p_date	DATE	数据日期
absolute_odds	DECIMAL(26,4)	选股绝对胜率
absolute_odds_score	DECIMAL(26,4)	选股绝对胜率相对分数
absolute_odds_rank	DECIMAL(26,4)	选股绝对胜率排名比
profit_loss_ratio	DECIMAL(26,4)	盈亏比
profit_loss_ratio_score	DECIMAL(26,4)	盈亏比相对分数
profit_loss_ratio_rank	DECIMAL(26,4)	盈亏比相对排名比
total_num	INT	总笔数
total_num_score	DECIMAL(26,4)	总比数相对分数
total_num_rank	DECIMAL(26,4)	总比数相对排名比
buy_num	INT	总购买笔数
buy_num_score	DECIMAL(26,4)	总购买笔数相对分数

buy_num_rank	DECIMAL(26,4)	总购买笔数相对排名比
sell_num	INT	总卖出笔数
sell_num_score	DECIMAL(26,4)	总卖出笔数相对分数
sell_num_rank	DECIMAL(26,4)	总卖出笔数相对排名比
selection_ability_score	DECIMAL(26,4)	选股能力评分
selection_ability_rank	INT	账户选股能力评分

6. 用户稳定性事实表 dws_ord_ability_stability_ds

字段	类型	说明
account_id	VARCHAR(80)	证券账户
p_date	DATE	数据日期
volatility	DECIMAL(26,4)	波动率
volatility_score	DECIMAL(26,4)	波动率相对分数
volatility_rank	DECIMAL(26,4)	波动率排名比
drawdown	DECIMAL(26,4)	最大回撤
drawdown_score	DECIMAL(26,4)	最大回撤相对分数
drawdown_rank	DECIMAL(26,4)	最大回撤排名比
stability_score	DECIMAL(26,4)	稳定性评价
stability_rank	INT	账户稳定性排名

7. 择时能力事实表 dws_ord_ability_timing_ds

字段	类型	说明
account_id	VARCHAR(80)	证券账户
p_date	DATE	数据日期
absolute_timing_rate	DECIMAL(26,4)	择时绝对胜率
absolute_timing_rate_score	DECIMAL(26,4)	择时绝对胜率相对分数
absolute_timing_rate_rank	DECIMAL(26,4)	择时绝对胜率相对排名
buy_time	DECIMAL(26,4)	买点时机
buy_time_score	DECIMAL(26,4)	买点时机相对分数
buy_time_score_rank	DECIMAL(26,4)	买点时机相对排名
stop_loss_time	DECIMAL(26,4)	止损时机
stop_loss_time_score	DECIMAL(26,4)	止损时机相对分数
stop_loss_time_score_rank	DECIMAL(26,4)	止损时机相对排名
stop_profit_time	DECIMAL(26,4)	止盈时机
stop_profit_time_score	DECIMAL(26,4)	止盈时机相对分数
stop_profit_time_rank	DECIMAL(26,4)	止盈时机相对排名
timing_ability_score	DECIMAL(26,4)	择时能力评价
timing_ability_rank	INT	择时能力排名

8. 风险承受能力事实表 dws_ord_ability_risk_tolerance_ds

字段	类型	说明
account_id	VARCHAR(80)	证券账户
p_date	DATE	数据日期

risk_preference	DECIMAL(26,4)	风险偏好
risk_preference_score	DECIMAL(26,4)	风险偏好分数
risk_preference_rank	DECIMAL(26,4)	风险偏好排名
financial_capacity	DECIMAL(26,4)	财务能力
financial_capacity_score	DECIMAL(26,4)	财务能力得分
financial_capacity_rank	DECIMAL(26,4)	财务能力排名比
investment_exp	DECIMAL(26,4)	投资经验
investment_exp_score	DECIMAL(26,4)	投资经验得分
investment_exp_rank	DECIMAL(26,4)	投资经验排名比
avg_excess_position	DECIMAL(26,4)	平均超额仓位
avg_excess_position_score	DECIMAL(26,4)	平均超额仓位得分
avg_excess_position_rank	DECIMAL(26,4)	平均超额仓位排名比
risk_excess_profit	DECIMAL(26,4)	风险-超额收益
risk_excess_profit_score	DECIMAL(26,4)	风险-超额收益得分
risk_excess_profit_rank	DECIMAL(26,4)	风险-超额收益排名比
risk_tolerance_score	DECIMAL(26,4)	风险承受能力评价
risk_tolerance_rank	INT	风险承受能力排名
overall_score	DECIMAL(26,4)	能力总得分
overall_rank	DECIMAL(26,4)	能力总排名比

三、用户交易、偏好标签计算定义

1. LU1, 2, 3, 6, 7, 8, 9, 10 用户属性标签

计算涉及数据仓库表: T98_CUST_BASE_INFO

标签计算方法:

开户日期: open_acct_dt

性别: gender_cd, 0-男, 1-女, 2-其他

年龄: birthday, 根据出生日期计算出年龄

学历: edu_degree

职业: career_type_desc

行业: ind_type_cd

户籍地: native_place, 解析至市

常住地: cert_addr, 解析至市

输出标签字段:

dws_user_attribute_label.gender, age, ctime, education, career, field, address, contact_address

edu_degree 数据字典:

枚举值	描述
0	博士
1	硕士

2	本科
3	大专
4	中专
5	高中
6	初中以下
Z	其它

ind_type_cd 行业代码数据字典：

- 0 能源
- 1 原材料
- 10 服装业
- 2 初级产品工业
- 3 投资品工业
- 4 耐用消费品制造
- 5 医疗卫生
- 6 经常性消费品工业
- 7 贸易和零售
- 8 社会服务业
- 9 交通运输和仓储业
- A 金融业
- A01 农、林、牧、渔业
- A02 采掘业
- A03 食品、饮料
- A04 木材、家具
- A05 造纸、印刷
- A06 石油、化学、塑胶、塑料
- A07 电子
- A08 金属、非金属
- A09 机械、设备、仪表
- A10 电力、煤气及水的生产和供应业
- A11 建筑业
- A12 制造业
- A13 传播与文化产业
- A14 教育、文化艺术及广播电影电视业
- A15 国家机关、政党机关和社会团体
- A16 地质勘查业、水利管理业
- A17 批发和零售贸易、餐饮业
- A18 卫生、体育和社会福利业
- A19 科学研究和综合技术服务业
- A20 纺织业
- B 房地产
- C 信息技术业
- D 公用事业
- E 综合类

F 娱乐服务业
G 彩票业
H 进出口贸易业
I 废品收购业
J 拍卖业
K 黄金业
L 珠宝等贵重物品
M 慈善团体或非赢利组织
N 典当
Z 其他

2. LU4 近七日账户最大金额

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法: $MAX(\text{七天内账户净资产 } net_asset)$

标签名称定义:

- 七日最大余额 1 万以下
- 七日最大余额 1-5 万
- 七日最大余额 5-10 万
- 七日最大余额 10-20 万
- 七日最大余额 20-50 万
- 七日最大余额 50-100 万
- 七日最大余额 100 万+

输出标签字段: dws_user_attribute_label.seven_max_amount

3. LU5 近七日盈亏合计

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法:

近七日盈亏: 根据用户统计当日净资产 net_asset -七日前的净资产 net_asset -7 日内净流入金额总和 ($SUM(net_income)$)-7 日内净流入市值总和 ($SUM(net_income_share)$)

标签名称定义:

- 近七日亏损 5 万以上
- 累计亏损 3-5 万
- 累计亏损 0-3 万
- 累计盈利 0-3 万
- 累计盈利 3-5 万
- 累计盈利 5 万以上

输出标签字段: dws_user_attribute_label.seven_profit_loss

4. LT1 近七日累计佣金

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法:

近七日累计佣金= $SUM(com_fee)$

标签名称定义:

- 七日累计佣金<100
- 七日累计佣金 100-300
- 七日累计佣金 300-900
- 七日累计佣金 900-1500
- 七日累计佣金 1500-2100
- 七日累计佣金 2100-3000
- 七日累计佣金>3000

输出标签字段: dwb_user_preference_label.seven_day_com_fee

5. LT2 持仓股票

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_ds

标签计算方法:

取最近 N 支 type 为股票 (type like 'S%') 的 product_id, quantity, ref_cost, 通过 product_id 解析出后六位证券代码 product_code, 再通过与 dim_biz_on_board_product 连接获取对应 product_name, 默认 N=3

输出标签字段: dwb_user_preference_label.hold_stock, 形式为股票名称字符串, 用“\$”号分隔, 如: “华东医药\$华锋股份\$一心堂”

6. LT3 股票仓位

计算涉及数据仓库表: dws_ord_hold_day, dws_ord_asset_profit_day

标签计算方法:

股票仓位 = $dws_ord_hold_day.hold_amount / (dws_ord_hold_day.hold_amount + dws_ord_hold_day.cap_balance)$

标签名称定义:

- 0 ($hold_amount=0$): 空仓
- 0-0.3: 轻仓位
- 0.3-0.6: 中仓位
- 0.6-0.95: 重仓
- 0.95-1 (或 $cap_balance=0$): 满仓

输出标签字段: dwb_user_preference_label.stock_position

7. LT4 持股个数

计算涉及数据仓库表: dws_ord_hold_day

标签计算方法:

取当天 type 为股票(S%)的 dws_ord_hold_day.hold_num

标签名称定义:

- 0: 无持股
- 1-3: 持股数 1-3
- 4-8: 持股数 4-8
- >8: 持股数 8+

输出标签字段: dwb_user_preference_label.hold_stock_num

8. LT5 平均持股天数（粒度：持股周期）

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_seq_ds

标签计算方法:

平均每持股周期天数=AVG (hold_days)，未结束持股也计算在内

标签名称定义:

- 平均>=60 天: 偏好长线
- 平均>=30 天 && 平均<60 天: 偏好中线
- 平均<30 天: 偏好短线

输出标签字段: dws_user_preference_label.avg_hold_days

9. LT6 月操作成功率（粒度：卖出交易）

计算涉及数据仓库表: dws_ord_on_board_day_ds

标签计算方法:

月成功率=30 天内 $SUM (stock_sell_profit_num) / SUM (stock_sell_num)$ ，若 stock_sell_num 为 0 则成功率为 0

标签名称定义:

- 月成功率排名前 10%: 月成功率高
- 月成功率排名前 10%-40%: 月成功率较高
- 月成功率排名前 40%-60%: 月成功率中
- 月成功率排名前 60%-80%: 月成功率较低
- 月成功率排名 80%以后: 月成功率低

输出标签字段: dwb_user_preference_label.month_success_rate

10. LT7 月收益率（粒度：资产账户）

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法：

月收益率=（用户统计当日净资产 net_asset -30 天前的第一个数据日期的净资产 net_asset -30 天内净流入金额总和（ $SUM(net_income)$ ）-30 天内净流入市值总和（ $SUM(net_income_share)$ ））/ 30 天前到当天的第一个数据日期的净资产 net_asset ，其中流入不计算第一天流入，计算最后一天流入。

标签名称定义：

- 月亏损 80%以上
- 月亏损 50-80%
- 月亏损 20-50%
- 月亏损 0-20%
- 月盈利 0-20%
- 月盈利 20-50%
- 月盈利 50-80%
- 月盈利 80%以上

输出标签字段：dwb_user_preference_label.month_profit_rate

11. LT8 持股偏好（股本规模，基金投资类型）

计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_ds

标签计算方法：

持股股本规模偏好=一个月内持仓事实表中的股票市值加和按股本规模种类分组 $SUM(hold_value)$ group by stock_scale，若满足股本规模种类的持股市值 / 一个月内股票类持仓市值总额（30 天内数据分区 dwb_ord_hold_ds 种 $SUM(hold_value)$ ） > 0.7，就取哪种股本规模，若结果无持股市值种类占比超过 0.7，则无明确偏好。

基金投资类型偏好=一个月内持仓事实表中的基金市值加和按股本规模种类分组 $SUM(hold_value)$ group by stock_scale，若满足基金投资类型的持股市值 / 一个月内基金类持仓市值总额（30 天内数据分区 dwb_ord_hold_ds 种 $SUM(hold_value)$ ） > 0.7，就取哪种投资类型，若结果无占比超过 0.7，则无明确偏好。

标签名称定义：

- 小盘股总市值占比>0.7：偏好小盘股
- 中盘股总市值占比>0.7：偏好中盘股
- 大盘股总市值占比>0.7：偏好大盘股
- 若超大盘股市值占比>0.7：偏好超大盘

基金投资类型标签名称定义：

- 小盘型总市值占比>0.7：偏好小盘型
- 中盘型总市值占比>0.7：偏好中盘型
- 大盘型总市值占比>0.7：偏好大盘型

输出标签字段：

dwb_user_preference_label.hold_preference, dwb_user_preference_label.fund_hold_preference

hold_preference 持股偏好数据字典：

- 0 没有偏好
- 1 偏好小盘
- 2 偏好中盘
- 3 偏好大盘
- 4 偏好超大盘

fund_hold_preference 持股偏好数据字典：

- 0 没有偏好
- 1 偏好小盘
- 2 偏好中小
- 3 偏好中盘

12. LT9 账户风险偏好 && LB19 风险偏好

计算涉及数据仓库表：dws_ord_on_board_day_ds

标签计算方法：

追涨购买占比=一个月内追涨购买次数 $SUM(dws_ord_on_board_day_ds.risk_num)$ / 一个月内总购买次数 $SUM(dws_ord_on_board_day_ds.stock_buy_num)$ ，根据百分比划分账户风险偏好

标签名称定义：

- 追涨购买占比 ≥ 0.7 ：激进型
- 追涨购买占比 ≥ 0.4 && 追涨购买占比 < 0.7 ：平衡型
- 追涨购买占比 < 0.4 ：保守型

输出标签字段：dws_user_preference_label.account_risk_preference,
dws_ord_ability_risk_ds.risk_preference

13. LT10 近七日交易的股票

计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_ds, dim_biz_on_board_product

标签计算方法：

取近 dwb_ord_hold_ds 七天 type 为股票的产品 product_id，并从 dim_biz_on_board_product 取 product_code，在按用户将 product_code 用\$拼接
例如 603738\$300548\$600491

输出标签字段: dws_ord_profit_ability_ds.seven_days_stock

14. LT11 近七日收益率

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法:

近七日收益率= (用户统计当日净资产 net_asset -7 天前的第一条数据日期的净资产 net_asset -7 天内净流入金额总和 ($SUM(net_income)$) -7 天内净流入市值总和 ($SUM(net_income_share)$)) / 7 天前的第一条数据日期的净资产 net_asset , 其中流入不计算第一天流入, 计算最后一天流入。

标签名称定义:

- 周亏损 80%以上
- 周亏损 50-80%
- 周亏损 20-50%
- 周亏损 0-20%
- 周盈利 0-20%
- 周盈利 20-50%
- 周盈利 50-80%
- 周盈利 80%以上

输出标签字段: dwb_user_preference_label.seven_days_profit_rate

15. LT12 总收益率

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法:

总收益率= (用户统计当日净资产 net_asset -dws_ord_asset_profit_ds 第一个数据日期净资产 net_asset -统计天数内净流入金额总和 ($SUM(net_income)$) -统计天数内净流入市值总和 ($SUM(net_income_share)$)) / 第一个数据日期的净资产 net_asset , 其中流入不计算第一天流入, 计算最后一天流入。

标签名称定义:

- 总亏损 80%以上
- 总亏损 50-80%
- 总亏损 20-50%
- 总亏损 0-20%
- 总盈利 0-20%
- 总盈利 20-50%
- 总盈利 50-80%
- 总盈利 80%以上

输出标签字段: dwb_user_preference_label.total_profit_rate

16. LT13 账户总盈亏

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法:

总盈亏金额=用户统计当日净资产 *net_asset*-事实表第一天净资产 *net_asset*-统计天数内净流入金额总和(*SUM(net_income)*)-统计天数内净流入市值总和(*SUM(net_income_share)*), 其中流入不计算第一天流入, 计算最后一天流入。

标签名称定义:

- 总亏损 100 万以上
- 总亏损 50-100 万
- 总亏损 10-50 万
- 总亏损 0-10 万
- 总盈利 0-10 万
- 总盈利 10-50 万
- 总盈利 50-100 万
- 总盈利 100 万以上

输出标签字段: dwb_user_preference_label.total_profit

17. LT14 持仓股票盈亏比(以当前日期每笔用户持仓记录为粒度)

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_ds

标签计算方法:

总盈利: 满足【(当前日期持仓类型为股票的 (type like 'S%')) && (最新参考盈利 *ref_profit*>0)】的持仓记录种的 *ref_profit* 之和

总亏损: 满足【(当前日期持仓类型为股票的 (type like 'S%')) && (最新参考盈利 *ref_profit*<0)】的持仓记录种的 *ref_profit* 之和

持仓盈亏比=总盈利/总亏损

标签名称定义:

- 0: 无
- 0-0.5: 大部分持股亏损
- 0.5-0.75: 部分持股亏损
- 0.75-1: 少量持股亏损
- 1+: 大部分持股盈利

输出标签字段: dwb_user_preference_label.hold_profit_loss_ratio

18. LT15 上证 50 成分股仓位

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_ds, dws_ord_hold_day

标签计算方法:

当前日期用户持仓类型为股票（type like ‘S%’）的并且对应 dim_biz_on_board_product 表中股票 market 为上证 50 的持仓市值 *hold_value* / 持仓日汇总表 dws_ord_hold_day 中的当日总股票持仓 hold_amount

标签名称定义：

- 0-0.7：无
- 0.7+：重仓上证 50

输出标签字段 dwb_user_preference_label.shangzheng50

19. LT16 沪深 300 成分股仓位

计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_ds, dws_ord_hold_day

标签计算方法：

当前日期用户持仓类型为股票（type like ‘S%’）的并且对应 dim_biz_on_board_product 表中股票 market 为沪深 300 的持仓市值 *hold_value* / 持仓日汇总表 dws_ord_hold_day 中的当日总股票持仓 hold_amount

标签名称定义：

- 0-0.7：无
- 0.7+：重仓沪深 300

输出标签字段 dwb_user_preference_label.hushen300

20. LT17 中证 500 成分股仓位

计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_ds, dws_ord_hold_day

标签计算方法：

当前日期用户持仓类型为股票（type like ‘S%’）的并且对应 dim_biz_on_board_product 表中股票 market 为中证 500 的持仓市值 *hold_value* / 持仓日汇总表 dws_ord_hold_day 中的当日总股票持仓 hold_amount

标签名称定义：

- 0-0.7：无
- 0.7+：重仓中证 500

输出标签字段：dwb_user_preference_label.zhongzheng500

21. LT18 创业板个股仓位

计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_ds, dws_ord_hold_day

标签计算方法：

当前日期用户持仓类型为股票（type like ‘S%’）的并且对应 dim_biz_on_board_product 表中股票 market 为创业板的持仓市值 *hold_value* / 持仓日汇总表 dws_ord_hold_day 中的当

日总股票持仓 hold_amount

标签名称定义:

- 0-0.7: 无
- 0.7+: 重仓创业板

输出标签字段: dwb_user_preference_label.chuangye

22. LT19 ST 股仓位

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_ds, dws_ord_hold_day_ds

标签计算方法:

当前日期用户持仓类型为股票 (type like 'S%') 的并且对应 dim_biz_on_board_product 表中股票 market 为 ST 股的持仓市值 hold_value / 持仓日汇总表 dws_ord_hold_day 中的当日总股票持仓 hold_amount

标签名称定义:

- 0-0.7: 无
- 0.7+: 重仓 ST 股

输出标签字段: dwb_user_preference_label.st

23. LT20 历史账户最大金额

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法: MAX(账户 net_asset)

注: 为增量计算方便, 每日更新一张临时表, 记录当前最大净资产, 今天的数据来之后, 增量更新最大历史净资产金额

标签名称定义:

- 最大金额 1 万以下
- 最大金额 1-5 万
- 最大金额 5-10 万
- 最大金额 10-20 万
- 最大金额 20-50 万
- 最大金额 50-100 万
- 最大金额 100 万+

输出标签字段: dwb_user_preference_label.total_max_amount

24. LT21 近七日账户净转入金额

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法: 近七日 SUM(net_income+net_income_share)

标签名称定义：

- 净转入 1 万以内
- 净转入 1-5 万
- 净转入 5-10 万
- 净转入 10-50 万
- 净转入 50-100 万
- 净转入 100 万+
- 无
- 净转出 1 万以内
- 净转出 1-5 万
- 净转出 5-10 万
- 净转出 10-50 万
- 净转出 50-100 万
- 净转出 100 万+

输出标签字段：dwb_user_preference_label.seven_days_income

25. LP1 近七日最关注的三只个股

计算涉及数据仓库表：dwb_act_eventdata_stock_ds（行为分析埋点数据仓库表），dwd_act_eventdata_ds（行为分析埋点数据仓库表），dwb_act_user_account_last_dd（行为分析埋点数据仓库表）

标签计算方法：

根据前端埋点数据中的 dwd_act_eventdata_ds 中的 event 字段筛选出用户点击的股票，将 dwd_act_eventdata_ds.product_id(join) dwb_act_user_account_last_dd.product_id 中对应的 account，在将关联查询出来的 account 和对应的用户浏览股票数据写入到 dwb_act_eventdata_stock_ds，在通过 dwb_act_eventdata_stock_ds 中筛选近七日用户浏览股票次数，股票名称，股票代码，股票类型， 账户 ID

根据 where(stock_type = 0).selectExpr("row_number() over(partition by account_id , stock_code order by visit_num desc) as rank ").where("rank < 4").drop("rank");筛选出浏览次数排名前三的股票名称

标签名称定义：

- 近七日最关注的三只个股

输出标签字段：dwb_user_knowledge_label.seven_days_stock

26. LP2 近七日最关注的三个行业

计算涉及数据仓库表：dim_biz_on_board_product

标签计算方法：

根据 LP1 统计出中间结果， where(stock_type = 0).selectExpr("account_id","stock_code","visit_num") 中 stock.code join 产品维度表 dim_biz_on_board_product，获取对应股票的概念，查询出中间结果 account_id, stock_code,

visit_num,field,根据查询的结果将 field 字符串进行解析,存入到集合中,根据每支股票浏览次数,追加概念的次数。统计出前行业。

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.seven_days_field

27. LP3 近七日最关注的三个概念

计算涉及数据仓库表: dim_biz_on_board_product

标签计算方法:

根据 LP1 统计出中间结果, where(stock_type = 0).selectExpr("account_id","stock_code","visit_num") 中 stock.code join 产品维度表 dim_biz_on_board_product, 获取对应股票的概念, 查询出中间结果 account_id, stock_code, visit_num,block,根据查询的结果将 block 字符串进行解析,存入到集合中,根据每支股票浏览次数,追加概念的次数。统计出前三个概念。

标签名称定义:

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.seven_days_block

28. LP4 近七日最关注的三个指数

计算涉及数据仓库表: (行为分析)dwd_act_eventdata_ds, (行为分析)dim_oth_event, (行为分析) dwb_act_user_account_last_dd

标签计算方法:

指数如下

"002009003","上证指数"
"002009004","深证指数"
"002009005","创业指数"
"002009006","沪深 300 指数"
"002009007","上证 50 指数"
"002009008","中证 500 指数"
"002009009","中小板指数"
"002009010","上证 180 指数"
"002009011","上证 380 指数"

根据 dwd_act_eventdata_ds 与 dim_oth_event, 筛选出近 7 日

dwd_act_eventdata_ds.event_id = dim_oth_event.event_id and dim_oth_event.

event_identifie = 002009011 等其他指数代码, 查询得到 dim_act_eventdate_ds.

deviceid, sum(a1.number),以及指数代码。最后筛选出排名前三的指数

标签名称定义:

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.seven_days_index

29. LP5 近七日最关注的三个基金

计算涉及数据仓库表: dim_biz_on_board_product

标签计算方法:

根据 LP1 where(stock_type = 4).selectExpr("row_number() over(partition by account_id , stock_code order by visit_num desc) as rank ").where("rank < 4")筛选出浏览次数排名前三的基金名称

标签名称定义:

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.seven_days_fund

30. LP6 自选股标的偏好

计算涉及数据仓库表: dim_biz_on_board_product

标签计算方法:

根据 LP1 查询中间结果 where(stock_type = 2).selectExpr("stock_code join 产品维度表 dim_biz_on_board_product, 获取对应股票的市场分类字段 stock_scale, account_id 统计小盘, 中盘, 大盘, 超大盘 等各自选股数量, 取数量最大的为偏好 (返回对应枚举值, 如“0010”)。

标签名称定义:

- 自选股小盘数量最大: 偏好小盘
- 自选股中盘数量最大: 偏好中盘
- 自选股大盘数量最大: 偏好大盘
- 自选股超大盘: 偏好超大盘

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.stock_preference

31. LP7 自选股市场偏好

计算涉及数据仓库表: dim_biz_on_board_product

标签计算方法:

根据 LP1 查询中间结果 where(stock_type = 2).selectExpr("stock_code join 产品维度表 dim_biz_on_board_product, 获取对应股票的市场分类字段 market, 并 count() group by market, account_id 统计上证 A 股, 深圳 A 股, 中小板, 创业板等各自选股数量, 取数量最大的为偏好 (返回对应枚举值, 如“0010”)。若最大的分类有数量相等的, 无明显偏好。

标签名称定义:

- 自选股上证 A 股数量最大: 偏好上证 A 股
- 自选股深证 A 股数量最大: 偏好深证 A 股
- 自选股中小板数量最大: 偏好中小板
- 自选股创业板数量最大: 偏好创业板

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.market_preference

32. LP8 自选股价格偏好

计算涉及数据仓库表: dim_biz_on_board_product

标签计算方法:

根据 LP1 查询中间结果 where(stock_type = 2).selectExpr("*") stock_code join 产品维度表 dim_biz_on_board_product, 获取对应股票的市场分类字段 price_type, 并 count() group by price_type, account_id 统计当前自选股中高价股, 中价股, 低价股等各自选股数量, 取数量最大的为偏好 (返回对应枚举值, 如“0010”)。若最大的分类有数量相等的, 无明显偏好。

标签名称定义:

- 低价股数量最大: 偏好低价股
- 中价股数量最大: 偏好中价股
- 高价股数量最大: 偏好高价股

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.price_preference

33. LP9 自选股波动偏好

计算涉及数据仓库表: dim_biz_on_board_product

标签计算方法:

根据 LP1 查询中间结果 where(stock_type = 2).selectExpr("*") stock_code join 产品维度表 dim_biz_on_board_product, 获取对应股票的市场分类字段 risk_type, 并 count() group by risk_type, account_id 统计当前自选股中激进型, 稳健型, 保守型股票数量, 取数量最大的为偏好 (返回对应枚举值, 如“0010”)。若最大的分类有数量相等的, 无明显偏好。

标签名称定义:

- 激进型的自选股数量最多: 自选股偏好-激进型
- 稳健型的自选股数量最多: 自选股偏好-稳健型
- 保守型的自选股数量最多: 自选股偏好-保守型

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.movement_preference

34. LP10 自选股风险偏好分数

计算涉及数据仓库表:

标签计算方法:

计算公式 (当前偏好值 - 最小偏好值) / (最大偏好值 - 当前偏好值)

当前偏好包括为, 自选股标偏好, 自选价格偏好, 自选市场偏好, 自选波动偏好

分别计算出当前值, 最小值, 最大值进行计算, 计算公式如下:

(当前值 - 最小值) / (最大值 - 当前值) 依次计算上面四个的值当做分数, 根据 account_id 进行 join 在加权平均

标签名称定义: 通过筛选界面指定

输出标签字段: dwb_user_knowledge_label.risk_preference

四、用户能力标签定义

1. 盈利能力标签定义

1.1 LB1 年化收益率(粒度：账户资产)

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法：

$$\frac{(\text{net_asset} - \text{区间净转入 SUM}(\text{net_income} + \text{net_income_share}) - \text{区间期初总资产 net_asset}) / \text{区间期初总资产 net_asset}}{(n / 365)} \times 100\%$$

标签名称定义：

- 收益率 0-10%（近期/中期/长期-低收益率）
- 收益率 10-20%（近期/中期/长期-中收益率）
- 收益率 20-50%（近期/中期/长期-高收益率）
- 收益率 50%以上（近期/中期/长期-超高收益率）
- 其他：无

输出标签字段：dws_ord_profit_ability_ds.year_profit_rate

1.2 LB2 超额收益率(粒度：账户资产)

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_ds, dwb_ord_index_ds

标签计算方法：n 天时间区间内净资产收益率-n 天时间区间内沪深 300 涨幅，n 可取 30 天（简单理解就是用户跑赢了沪深 300 百分之多少）

$$\frac{(\text{dws_ord_asset_profit_ds.net_asset} - \text{区间净转入 SUM}(\text{dws_ord_asset_profit_ds.net_income} + \text{dws_ord_asset_profit_ds.net_income_share}) - \text{区间期初净资产 dws_ord_asset_profit_ds.net_asset}) / n}{\text{天前到现在的时间区间内的第一条净资产记录 dws_ord_asset_profit_ds.net_asset} / (n / 365)} \times 100\% - \frac{(\text{dwb_ord_index_ds 中最近一条的沪深 300 收盘价 close_price} - n \text{ 天前第一条沪深 300 收盘价 close_price}) / n}{\text{天前第一条沪深 300 收盘价 close_price}} \times 100\%$$

标签名称定义：

- 收益率 0-10%（近期/中期/长期-低收益率）
- 收益率 10-20%（近期/中期/长期-中收益率）
- 收益率 20-50%（近期/中期/长期-高收益率）
- 收益率 50%以上（近期/中期/长期-超高收益率）
- 其他：无

输出标签字段: dws_ord_profit_ability_ds.excess_profit_rate

1.3 LB3 期望收益率(粒度: 账户卖出交易)

计算涉及数据仓库表: dws_ord_on_board_day_ds

总收益率的数学期望 = 胜率 * 盈亏比 + 胜率 -1

其中

胜率=盈利卖出交易的次数 / 总卖出交易次数 * 100% = $\text{SUM}(\text{stock_sell_profit_num}) / \text{SUM}(\text{stock_sell_num}) * 100\%$

盈亏比=平均每笔盈利卖出交易的盈利金额 / 平均每笔亏损卖出交易的亏损金额 * 100% = $(\text{SUM}(\text{total_profit} > 0) / \text{SUM}(\text{stock_sell_profit_num})) / |(\text{SUM}(\text{total_profit} < 0) / \text{SUM}(\text{stock_sell_loss_num}))|$

标签名称定义: 待定

输出标签字段: dws_ord_profit_ability_ds.exp_profit_rate

1.4 LB4 夏普比率(粒度: 账户资产)

计算涉及数据仓库表:

标签计算方法:

$\text{sharp_ratio} = \frac{(\text{dws_ord_profit_ability_ds.year_profit_rate} - 0.03)}{\text{dws_ord_ability_stability_ds.volatility}}$

标签名称定义: 待定

输出标签字段: dws_ord_profit_ability_ds.sharp_ratio

1.5 LB5 盈利持续性(粒度: 账户卖出交易)

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_on_board_ds

标签计算方法:

dwb_ord_on_board_ds 中按用户 account_id 分组排列 30 个自然天内交易卖出记录(需满足【交易类型 tran_type='OS' && profit!=0】), 取每个账户交易队列的最大连续正 profit 数(seq_profit_num)和负 profit 数(seq_loss_num)。

标签名称定义:

连续盈利>=3 次: 连续盈利

连续亏损>=3 次: 连续亏损

输出标签字段: dws_ord_profit_ability_ds.seq_profit_num,
dws_ord_profit_ability_ds.seq_loss_num

1.6 LB6 盈利能力评价(粒度：账户资产)

标签计算方法：

LB1,2,3,5（值越大越好）分别按（当前 LB 值-全体用户中最小的 LB 值）* 相应指标权重 / （全体账户中最大的 LB 值 - 全体账户中最小的 LB 值）计算出归一化的相对值，LB4 按（MAX LB 值- 当前 LB 值）* 相应指标权重 / MAX LB 值计算出归一化的相对值，并加权平均 LB1-5 的相对值，得出每个账户的盈利能力总分，再从大到小进行排名。

标签名称定义：待定

输出标签字段：dws_ord_profit_ability_ds.profit_score, dws_ord_profit_ability_ds.profit_ranking

2. 稳定性能力标签定义

2.1 LB7 波动率(粒度：账户资产)

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法：

收益年化波动率 $\text{volatility} = n \text{ 天内每日净收益率标准差 } \text{stddev}(\text{每日净收益 } \text{net_profit_acc} / \text{前日净资产 } \text{net_asset}) * \text{sqrt}(\text{年交易日数量})$ ，其中 $n \leq \text{一年交易日数量}$ （365 个自然日内的数据分区数量）

标签名称定义：

- 波动率 0-10%（近期/中期/长期-稳健）
- 波动率 10-20%（近期/中期/长期-中幅波动）
- 波动率 20-50%（近期/中期/长期-大幅波动）
- 波动率 50%以上（近期/中期/长期-巨幅波动）

输出标签字段：dws_ord_ability_stability_ds.volatility

2.2 LB8 最大回撤(粒度：账户资产)

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法：

统计 N 天前到当前日期之间的用户账户资产最大回撤率【 $\text{drawdown} = \text{MAX}((n \text{ 天内每一天 } (D_i, i \text{ from } n \text{ 天前到今天}) \text{ 的账户净资产 } \text{net_asset_without_income} - D_i \text{ 之后最小的净资产 } \text{net_asset_without_income}) \text{ as } D_i \text{ 天后的回撤} / D_i \text{ 当天的净资产 } \text{net_asset_without_income})$ 】，其中 $n \leq \text{一年交易日数量}$ （365 个自然日内的数据分区数量）

标签名称定义：

- 回撤率 0-10%（近期/中期/长期-抗风险能力强）
- 回撤率 10-20%（近期/中期/长期-抗风险能力中）
- 回撤率 20%以上（近期/中期/长期-抗风险能力低）

输出标签字段: dws_ord_ability_stability_ds.drawdown

2.3 LB9 稳定性评价(粒度: 账户资产)

标签计算方法:

LB7, 8 按 (MAX LB 值- 当前 LB 值) * 相应指标权重 / MAX LB 值计算出归一化的相对值, 并加权平均 LB7, LB8 的相对值, 得出每个账户的稳定性能力总分, 再从大到小进行排名。

标签名称定义: 待定

输出标签字段: dws_ord_ability_stability_ds.stability_score,
dws_ord_ability_stability_ds.stability_ranking

3. 选股能力标签定义

3.1 LB10 选股绝对胜率(粒度: 持仓周期)

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_seq_ds, dwb_ord_index_ds

标签计算方法:

绝对胜率=场内交易表 dwb_ord_hold_seq_ds 中持仓记录中满足【 ((profit / ref_cost * 100% - dwb_ord_index_ds 中沪深 300 在 dwb_ord_hold_seq_ds.start_date 到 end_date (若 end_date 为空, 则为当前日期) 区间的涨幅) > 0) && (dwb_ord_hold_seq_ds 中 profit_num > loss_num) 】的持仓笔数 / dwb_ord_hold_seq_ds 中该账户持仓周期总条目数量。胜率计算之后, 计算账户排名百分比。

标签名称定义:

- 胜率排名前 10%: 选股绝对胜率高
- 胜率排名前 10%-40%: 选股绝对胜率较高
- 胜率排名前 40%-60%: 选股绝对胜率中
- 胜率排名前 60%-80%: 选股绝对胜率较低
- 胜率排名 80%以后: 选股绝对胜率低

输出标签字段: dws_ability_profit_label.absolute_odds

3.2 LB11 盈亏金额比(粒度: 卖出交易)

计算涉及数据仓库表: dws_ord_on_board_day_ds

标签计算方法:

用户平均交易盈亏金额比=30 天内($SUM(total_profit > 0) / SUM(stock_sell_profit_num)$) / ($|SUM(total_profit < 0)| / SUM(stock_sell_loss_num)$)

标签名称定义：

- 名称待定

输出标签字段：dws_ord_ability_timing_ds.absolute_timing_rate

3.3 LB12 总笔数

计算涉及数据仓库表：dws_ord_on_board_day_ds

标签计算方法：

总买笔数 dws_ord_on_board_day_ds.stock_buy_num,

总卖笔数 dws_ord_on_board_day_ds.stock_sell_num

标签名称定义：

- 名称待定

输出标签字段：dws_ability_selection_ds.buy_num, dws_ability_selection_ds.sell_num

3.4 LB13 选股能力评价

标签计算方法：

LB10,11,12（值越大越好）分别按（当前 LB 值-全体用户中最小的 LB 值）* 相应指标权重 / （全体账户中最大的 LB 值 - 全体账户中最小的 LB 值）计算出归一化的相对值,并加权平均 LB10-12 的相对值，得出每个账户的选股能力总分，再从大到小进行排名。

标签名称定义：待定

输出标签字段：

dws_ability_selection_ds.selection_ability_score,

dws_ability_selection_ds.selection_ability_ranking

4. 择时能力标签定义

4.1 LB14 择时绝对胜率（粒度：持仓周期）

计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_seq_ds, dwb_ord_index_ds

标签计算方法：

择时绝对胜率=所有 dwb_ord_hold_seq_ds 中满足条件【（（30 天后价格或按持仓周期结束时的 profit / ref_cost * 100% - 沪深 300 指数 30 天内或在 dwb_ord_hold_seq_ds.start_date 到 end_date（若 end_date 为空，则为当前日期）区间的涨幅）> 0）&&（dwb_ord_hold_seq_ds 中 profit_num > loss_num）】的持仓笔数 / dwb_ord_hold_seq_ds 中该账户持仓周期总条目数量。胜率计算之后，计算账户排名百分比。

注：若用户在 30 天内卖出，LB14 等同于标签 LB10

标签名称定义：

- 胜率排名前 10%：择时胜率高

- 胜率排名前 10%-40%: 择时胜率较高
- 胜率排名前 40%-60%: 择时胜率中
- 胜率排名前 60%-80%: 择时胜率较低
- 胜率排名 80%以后: 择时胜率低

输出标签字段: dws_ord_ability_timing_ds.absolute_timing_rate

4.2 LB15 买点时机（粒度：持仓周期）

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_seq_ds, dwb_ord_index_ds

标签计算方法:

买点收益=30 天后价格或按持仓周期结束时的 $\text{profit} / \text{ref_cost} * 100\%$ - 沪深 300 指数 30 天内或在 dwb_ord_hold_seq_ds.start_date 到 end_date（若 end_date 为空，则为当前日期）区间的涨幅。

标签名称定义胜率:

- 买点时机排名前 10%: 买点收益高
- 买点时机排名前 10%-40%: 买点收益较高
- 买点时机排名前 40%-60%: 买点收益中
- 买点时机排名前 60%-80%: 买点收益较低
- 买点时机排名 80%以后: 买点收益低

输出标签字段: dws_ord_ability_timing_ds.buy_time

4.3 LB16 止损时机（粒度：持仓周期）

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_seq_ds, dim_biz_on_board_product

标签计算方法:

计算止损交易占比=止损笔数/亏损笔数

止 损 笔 数 : (dwb_ord_hold_seq_ds.profit < 0) && 7 日 后 该 只 股 票
dim_biz_on_board_product.rise < -0.03 的笔数

亏损笔数: (dwb_ord_hold_seq_ds.profit < 0)的总笔数

标签名称定义:

- 止损时机排名前 10%: 止损能力强
- 止损时机排名前 10%-40%: 止损能力较强
- 止损时机排名前 40%-60%: 止损能力中
- 止损时机排名前 60%-80%: 止损能力较低
- 止损时机排名 80%以后: 止损能力低

输出标签字段: dws_ord_ability_timing_ds.stop_loss_time

4.4 LB17 止盈时机（粒度：持仓周期）

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_seq_ds, dim_biz_on_board_product

标签计算方法:

止盈交易占比=止盈笔数/盈利笔数

止盈笔数: (dwb_ord_hold_seq_ds.profit > 0) && 7 日后该只股票
dim_biz_on_board_product.rise < 0 的笔数

盈利笔数: (dwb_ord_hold_seq_ds.profit > 0)的总笔数

标签名称定义:

- 止盈时机排名前 10%: 止盈能力强
- 止盈时机排名前 10%-40%: 止盈能力较强
- 止盈时机排名前 40%-60%: 止盈能力中
- 止盈时机排名前 60%-80%: 止盈能力较低
- 止盈时机排名 80%以后: 止盈能力低

输出标签字段: dws_ord_ability_timing_ds.stop_profit_time

4.5 LB18 择时能力评价

标签计算方法:

LB14-17 (值越大越好) 分别按 (当前 LB 值-全体用户中最小的 LB 值) * 相应指标权重 /
(全体账户中最大的 LB 值 - 全体账户中最小的 LB 值) 计算出归一化的相对值,并加权平
均 LB14-17 的相对值, 得出每个账户的择时能力总分, 再从大到小进行排名。

标签名称定义: 待定

输出标签字段:

dws_ord_ability_timing_ds.timing_ability_score,
dws_ord_ability_timing_ds.timing_ability_ranking

5. 抗风险能力标签定义

5.1 LB19 风险偏好(粒度: 购买交易)

计算涉及数据仓库表: dws_ord_on_board_day_ds

标签计算方法:

追涨购买占比=一个月内追涨购买次数 $SUM(dws_ord_on_board_day_ds.risk_num)$ / 一个月内
总购买次数 $SUM(dws_ord_on_board_day_ds.stock_buy_num) * 100\%$

标签名称定义:

- 追涨购买占比 ≥ 0.7 : 激进型
- 追涨购买占比 ≥ 0.4 && 追涨购买占比 < 0.7 : 平衡型
- 追涨购买占比 < 0.4 : 保守型

输出标签字段: dws_ord_ability_risk_ds.risk_preference

5.2 LB20 财务能力(粒度：资产账户)

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_ds

标签计算方法：

近一月账户平均日净资产= $SUM(30 \text{ 个自然日内 } net_asset) / 30 \text{ 个自然日内的数据分区数}$
(交易日数量)

标签名称定义：

- 平均金额 1 万以下：待定
- 平均金额 1-5 万：待定
- 平均金额 5-10 万：待定
- 平均金额 10-20 万：待定
- 平均金额 20-50 万：待定
- 平均金额 50-100 万：待定
- 平均金额 100 万+：待定

输出标签字段：dws_ord_profit_ability_ds.financial_capacity

5.3 LB21 投资经验

计算涉及数据仓库表：dws_ord_user_attributes_ds

标签计算方法：

(当前时间 - 开户时间 ctime)的月数，不足一月按一个月算

标签名称定义：待定

- ≤6 个月：待定
- 7-12 个月：待定
- 13-36 个月：待定
- 36-120 个月：待定
- 120 个月+：待定

输出标签字段：dws_ord_profit_ability_ds.investment_exp

5.4 LB22 平均超额仓位（粒度：持仓周期）

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_ds, dws_ord_on_board_day_ds

标签计算方法：

平均超额仓位 = 近一月平均账户持仓仓位 - 建议仓位

近一月账户平均持仓仓位 = 账户三十个自然日内的交易日中 $SUM(\text{股基市值 } stock_fund_value) / SUM(\text{净资产 } net_asset)$

建议仓位：三十自然日内的交易日中， $(\text{盈亏比} * (1 + \text{胜率}) - 1) / (\text{盈亏比} * \text{平均止损幅度})$

其中， $\text{盈亏比} = \text{平均每笔盈利卖出交易的盈利金额} / \text{平均每笔亏损卖出交易的亏损金额} * 100\% = (SUM(\text{total_profit} > 0) / SUM(\text{stock_sell_profit_num})) / |(SUM(\text{total_profit} < 0) / SUM(\text{stock_sell_loss_num}))|$

$\text{胜率} = \text{盈利卖出交易的次数} / \text{总卖出交易次数} * 100\% = SUM$

$(\text{stock_sell_profit_num}) / \text{SUM}(\text{stock_sell_num}) * 100\%$

平均止损幅度 = 亏损卖出交易的平均亏损幅度 $\text{SUM}(\text{total_profit} < 0) / \text{SUM}(\text{【total_profit} < 0\text{】交易对应的 total_loss_cost}) * 100\%$

标签名称定义：待定

输出标签字段：dws_ord_profit_ability_ds.avg_excess_position

5.5 LB23 风险-超额收益率(粒度：资产账户)

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_ds, dwb_ord_index_ds

标签计算方法：n 天时间区间内净资产收益率-n 天时间区间内沪深 300 涨幅，n 可取 30 天（简单理解就是用户跑赢了沪深 300 百分之多少）

$$\frac{(\text{dws_ord_asset_profit_ds.net_asset} - \text{区间净转入 SUM}(\text{dws_ord_asset_profit_ds.net_income} + \text{dws_ord_asset_profit_ds.net_income_share}) - \text{区间期初净资产 dws_ord_asset_profit_ds.net_asset}) / \text{n 天前到现在的时间区间内的第一条净资产记录 dws_ord_asset_profit_ds.net_asset}) / (\text{n} / 365) \times 100\% - ((\text{dwb_ord_index_ds 中最近一条的沪深 300 收盘价 close_price} - \text{n 天前第一条沪深 300 收盘价 close_price}) / \text{n 天前第一条沪深 300 收盘价 close_price}) \times 100\%}{}$$

标签名称定义：

收益率 0-10%（近期/中期/长期-低收益率）

收益率 10-20%（近期/中期/长期-中收益率）

收益率 20-50%（近期/中期/长期-高收益率）

收益率 50%以上（近期/中期/长期-超高收益率）

其他：无

输出标签字段：dws_ord_ability_risk_tolerance_ds.risk_excess_profit

5.6 LB24 风险承受能力评价

标签计算方法：

LB19-23（值越大越好）分别按（当前 LB 值-全体用户中最小的 LB 值）* 相应指标权重 / （全体账户中最大的 LB 值 - 全体账户中最小的 LB 值）计算出归一化的相对值,并加权平均 LB19-23 的相对值，得出每个账户的风险承受能力总分，再从大到小进行排名。

标签名称定义：待定

输出标签字段：

dws_ord_ability_risk_tolerance_ds.risk_tolerance_score,

dws_ord_ability_risk_tolerance_ds.risk_tolerance_ranking

6. 风控能力标签

6.1 LB25 最大回撤

同 LB8

6.2 LB26 夏普比率

同 LB4

6.3 LB27 风控能力评价

标签计算方法：

LB25,26（值越小越好）按（MAX LB 值- 当前 LB 值）* 相应指标权重 / MAX LB 值计算出归一化的相对值，并加权平均 LB25, LB26 的相对值，得出每个账户的抗风险能力总分，再从大到小进行排名。

标签名称定义：待定

输出标签字段：

dws_ord_ability_risk_dss.risk_score,
dws_ord_ability_risk_ds.risk_ranking

7. LB28 总评价

标签计算方法：

LB6 + 9 + 13 + 18 + 24 + 27 的 score 做加权平均（值越大越好）按（当前总体评价值-全体用户中最小的总体评价值） / （全体账户中最大的总体评价值 - 全体账户中最小的总体评价值）计算出归一化的相对值，再从大到小进行排名。

标签名称定义：待定

五、交易指标表清洗，指标计算及接口定义

1. A01 账户总资产

DIM01 资产类指标分段定义表 dim_oth_segment_asset (对应 cbas_dim_oth_segment_asset 表)

字段	类型	说明	ETL 来源
segment_sk	INT	表 ID	自增
segment_name	VARCHAR(128)	分段名称	自定义
start_value	BIGDECIMAL	分段左边界	自定义
end_value	BIGDECIMAL	分段右边界	自定义
start_date	DATE	分段时间范围 左边界	自定义，默认 0001-01-01
end_date	DATE	分段时间范围 右边界	自定义，默认 9999-12-31

SUM01 账户总资产分布周汇总 dws_ord_asset_stat_week (对应 cbas_sum_asset_stat_week 表以用户群为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
asset_stat_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dws_ord_asset_profit_day 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_asset_profit_day 中对应类型的各类型市值与资产值在 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk
numbers	INT	分段统计数量	各资产分类在各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
type	STRING	资产市值分类	0.汇总：（0_1 总资产 total_asset, 0_2 汇总净资产 net_asset），1. 股基市值 stock_fund_value, 2. 两融（2_1 融资余额 fi_balance, 2_2 融券余额 sl_balance, 2_3 两融资产 fisl_asset, 2_4 两融市值 fisl_value） 3. 现金 cap_balance, 4. 债券市值 bond_value, 5. 质押市值 impawn_value 6. 衍生品市值 option_market_value 7. 场外市值 out_market_value 8. A 股净佣金 a_net_fee, 9. B 股净佣金 b_net_fee, 10. 基金净佣金 fund_net_fee, 11. 债券净佣金 bond_net_fee, 12. 回购净佣金 buyback_net_fee, 13. 汇总净佣金

			total_net_fee
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_asset_stat_acc_week (对应 cbas_sum_asset_stat_acc_week 表以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
asset_stat_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dws_ord_asset_profit_day 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_asset_profit_day 中对应类型的各类型市值与资产值在 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk
numbers	INT	分段统计数量	各资产分类在各分段下的不重复账户数量
type	STRING	资产市值分类	0.汇总：（0_1 总资产 total_asset, 0_2 汇总净资产 net_asset），1. 股基市值 stock_fund_value, 2. 两融（2_1 融资余额 fi_balance, 2_2 融券余额 sl_balance, 2_3 两融资产 fisl_asset, 2_4 两融市值 fisl_value） 3. 现金 cap_balance, 4. 债券市值 bond_value, 6. 质押市值 impawn_value 6. 衍生品市值 option_market_value 7. 场外市值 out_market_value 8. A 股净佣金 a_net_fee, 9. B 股净佣金 b_net_fee, 10. 基金净佣金 fund_net_fee, 11. 债券净佣金 bond_net_fee, 12. 回购净佣金 buyback_net_fee, 13. 汇总净佣金 total_net_fee
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#清洗逻辑：

计算涉及数据仓库表：dws_ord_asset_profit_day, dim_oth_segment_asset, dim_oth_date, dwb_act_user_account_last_dd (账户-最后登录设备对应表), dwb_act_user_group_relation_dd (用户-群组对应表)

维度：周，月，资产市值类型（汇总总资产，汇总净资产，股基，两融，现金，债券）

指标表清洗方法：

各资产分类在各分段下的不重复账户数量，资产分类以每周每月最后一天的资产数据为准。

1. 获取 dim_oth_date 中每周最后一天的 datevalue, 及那一天对应的 yearandweek

2. 获取资产表中每周最后一天(通过 p_date 与 1 中 datevalue 比对)的不同资产和市值

total_asset as asset_value, '0_1' as type

union all

net_asset as asset_value, '0_2' as type

union all

stock_fund_value as asset_value, '1' as type

```
union all
fi_balance as asset_value, '2_1' as type
union all
```

...

1. 获取分段 ID segment_sk: 根据 asset_value 查询出 dim_oth_segment_asset 中对应的 segment_sk
2. 获取周维度 ID yearandweek: join dim_oth_date 获取 p_date 对应 yearandweek
3. 获取 account_id 对应群组 (标签分组) ID group_id: 先 join dwb_act_user_account_last_dd 获取 account_id 对应最后登录的设备 ID, 再根据设备 ID Join dwb_act_user_group_relation_dd 获取对应的群组 ID
4. 统计 COUNT(DISTINCT account_id) group by group_id, type, yearandweek, segment_sk

SUM02 账户总资产分布月汇总 dws_ord_asset_stat_month (对应 cbas_sum_asset_stat_month 表以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
asset_stat_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	月维度 ID	dws_ord_asset_profit_day 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_asset_profit_day 中对应类型的各类型市值与资产值在 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk
numbers	INT	分段统计数量	各资产分类在各分段下的不重复账户数量
type	STRING	资产市值分类	0. 汇总: (0_1 总资产 total_asset, 0_2 汇总净资产 net_asset), 1. 股基市值 stock_fund_value, 2. 两融 (2_1 融资余额 fi_balance, 2_2 融券余额 sl_balance, 2_3 两融资产 fisl_asset, 2_4 两融市值 fisl_value) 3. 现金 cap_balance, 4. 债券市值 bond_value, 7. 质押市值 impawn_value 6. 衍生品市值 option_market_value 7. 场外市值 out_market_value 8. A 股净佣金 a_net_fee, 9. B 股净佣金 b_net_fee, 10. 基金净佣金 fund_net_fee, 11. 债券净佣金 bond_net_fee, 12. 回购净佣金 buyback_net_fee, 13. 汇总净佣金 total_net_fee
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_asset_stat_acc_month (对应 cbas_sum_asset_stat_acc_month 表以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
asset_stat_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	月维度 ID	dws_ord_asset_profit_day 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_asset_profit_day 中对应类型的各类型市值与资产值在 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk
numbers	INT	分段统计数量	各资产分类在各分段下的不重复账户数量
type	STRING	资产市值分类	0.汇总：（0_1 总资产 total_asset, 0_2 汇总净资产 net_asset），1. 股基市值 stock_fund_value, 2. 两融（2_1 融资余额 fi_balance, 2_2 融券余额 sl_balance, 2_3 两融资产 fisl_asset, 2_4 两融市值 fisl_value） 3. 现金 cap_balance, 4. 债券市值 bond_value, 8. 质押市值 impawn_value 6. 衍生品市值 option_market_value 7. 场外市值 out_market_value 8. A 股净佣金 a_net_fee, 9. B 股净佣金 b_net_fee, 10. 基金净佣金 fund_net_fee, 11. 债券净佣金 bond_net_fee, 12. 回购净佣金 buyback_net_fee, 13. 汇总净佣金 total_net_fee
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#清洗逻辑:

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_day, dim_oth_segment_asset, dim_oth_date, dwb_act_user_account_last_dd (账户-最后登录设备对应表), dwb_act_user_group_relation_dd (用户-群组对应表)

维度: 周, 月, 资产市值类型 (汇总总资产, 汇总净资产, 股基, 两融, 现金, 债券)

指标表清洗方法:

3. 获取资产表中每月最后一天(通过 p_date 与 1 中 datevalue 比对)的不同资产和市值

1. 获取资产表中的不同资产和市值

total_asset as asset_value, '0_1' as type

union

net_asset as asset_value, '0_2' as type

union

stock_fund_value as asset_value, '1' as type

union

fi_balance as asset_value, '2_1' as type

Union

...

2. 获取分段 ID segment_sk：根据 asset_value 查询出 dim_oth_segment_asset 中对应的 segment_sk
3. 获取月维度 yearandmonth: join dim_oth_date 获取 p_date 对应 yearandmonth
4. 获取 account_id 对应群组（标签分组）ID group_id: 先 join dwb_act_user_account_last_dd 获取 account_id 对应最后登录的设备 ID, 再根据设备 ID Join dwb_act_user_group_relation_dd 获取对应的群组 ID
5. 统计 COUNT(DISTINCT account_id) group by group_id, type, yearandmonth, segment_sk



#接口定义

账户资产分布

功能说明:

获取不同种类账户的资产和净资产分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getAssetReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串（根据 dateType 判断），如“201701”，“201734”		

accountType	选填	String	账户类型 id
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月
groupId	选填	String	群组 id

返回json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "asset": [
      {
        "segmentSk": "100",
        "segmentName": "2 万以内",
        "percentage": "5.00%",
        "numbers": "1378765"
      },
      {
        "segmentSk": "101",
        "segmentName": "2 万-10 万",
        "percentage": "16.21%",
        "numbers": "1654125"
      },
      .....
    ],
    "netAsset": [
      {
        "segmentSk": "100",
        "segmentName": "2 万以内",
        "percentage": "13.46%",
        "numbers": "1892039"
      },
      .....
    ]
  }
}
```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
asset	List	总资产金额分布列表

netAsset	List	净资产金额分布列表
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比
numbers	String	分段数

2. A02 账户可用资金



清洗逻辑和接口定义同“账户资产分布”，dws_ord_asset_stat_month, dws_ord_asset_stat_week 中分别取 type 为 “3”（现金余额），“2_1”和“2_2”（融资融券余额）。

3. A03 盈亏分布（持仓周期）

注：该指标目前只能计算股票和账户汇总的盈利

字段	类型	说明	ETL 来源
profit_stat_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	月维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应盈利持仓周期次数 / 亏损的持仓周期次数对应

			dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 > 0】对应“1+”分段, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 = 0（无交易）】对应“无交易”分段
type	VARCHAR	盈利类型	目前默认 0: 股票持仓周期, 1: 基金持仓周期
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM03 盈利次数比人数分布事实表 dws_ord_profit_stat_week (对应 cbas_sum_profit_stat_week 以群组为粒度)

dws_ord_profit_stat_acc_week (对应 cbas_sum_profit_stat_acc_week, 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
profit_stat_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	月维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应盈利持仓周期次数 / 亏损的持仓周期次数对应 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 > 0】对应“1+”分段, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 = 0（无交易）】对应“无交易”分段
type	VARCHAR	盈利类型	目前默认 0: 股票持仓周期, 1: 基金持仓周期
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#清洗逻辑:

计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_seq_ds 持仓周期序列事实表, dim_oth_segment_asset 分段定义表, dim_oth_date, dwb_act_user_account_last_dd (账户-最后登录设备对应表), dwb_act_user_group_relation_dd (用户-群组对应表), dim_oth_date (日期维度表)。

维度: 周, 月, 类型 (目前仅支持股票持仓周期)

指标表清洗方法:

1. dwb_ord_hold_seq_ds 中对应盈利持仓周期次数 / 亏损的持仓周期次数对应 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 > 0】对应“1+”分段, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 = 0 (无交易)】对应“无交易”分段
2. 获取周维度 yearandweek: join dim_oth_date 获取 p_date 对应 yearandweek
3. 获取 account_id 对应群组 (标签分组) ID group_id: 先 join dwb_act_user_account_last_dd 获取 account_id 对应最后登录的设备 ID, 再根据设备 ID Join dwb_act_user_group_relation_dd 获取对应的群组 ID
4. 统计 COUNT(DISTINCT account_id) group by group_id, type, yearandmonth, segment_sk

SUM04 盈利统计事实表 dws_ord_profit_stat_month (对应 cbas_sum_profit_stat_month, 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
profit_stat_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	月维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应盈利持仓周期次数 / 亏损的持仓周期次数对应 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 > 0】对应“1+”分段, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 = 0 (无交易)】对应“无交易”分段
type	VARCHAR	盈利类型	目前默认 0: 股票持仓周期, 1: 基金持仓周期
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_profit_stat_acc_month (对应 cbas_sum_profit_stat_acc_month, 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
profit_stat_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	月维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应盈利持仓周期次数 / 亏损的持仓周期次数对应 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 > 0】对应“1+”分段, 若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周

			期次数 = 0（无交易）】对应“无交易”分段
type	VARCHAR	盈利类型	目前默认 0：股票持仓周期，1：基金持仓周期
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#清洗逻辑：

计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_seq_ds 持仓周期序列事实表，dim_oth_segment_asset 分段定义表，dim_oth_date，dwb_act_user_account_last_dd（账户-最后登录设备对应表），dwb_act_user_group_relation_dd（用户-群组对应表），dim_oth_date（日期维度表）

维度：周，月，类型（目前仅支持股票持仓周期）

指标表清洗方法：

5. dwb_ord_hold_seq_ds 中对应盈利持仓周期次数 / 亏损的持仓周期次数对应 dim_oth_segment_asset 中对应的分段 segment_sk，若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 > 0】对应“1+”分段，若【亏损的持仓周期次数=0 AND 盈利的持仓周期次数 = 0（无交易）】对应“无交易”分段
6. 获取月维度 yearandmonth: join dim_oth_date 获取 p_date 对应 yearandmonth
7. 获取 account_id 对应群组（标签分组）ID group_id: 先 join dwb_act_user_account_last_dd 获取 account_id 对应最后登录的设备 ID, 再根据设备 ID Join dwb_act_user_group_relation_dd 获取对应的群组 ID
8. 统计 COUNT(DISTINCT account_id) group by group_id, type, yearandmonth, segment_sk



#接口定义

账户盈亏比分布

功能说明:

获取账户盈亏比分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getAssetProfitReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串(根据 dateType 判断)，如“201701”，“201734”		
accountType	选填	String	交易类型 id (0: 股票, 1: 基金)		
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月		
groupId	选填	String	群组 id		

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "stockProfit": [
      {
        "segmentSk": "110",
        "segmentName": "-1 以下",
        "percentage": "5.00%",
        "numbers": "1378765"
      },
      {
        "segmentSk": "111",
        "segmentName": "2 以上",
        "percentage": "16.21%",
        "numbers": "1654125"
      }
    ],
    .....
  ],
  "fundProfit": [
    {
      "segmentSk": "112",
      "segmentName": "1-2",
```



```

        "percentage": "13.46%",
        "numbers": "1892039"
    },
    .....
]
}
}

```

返回参数:

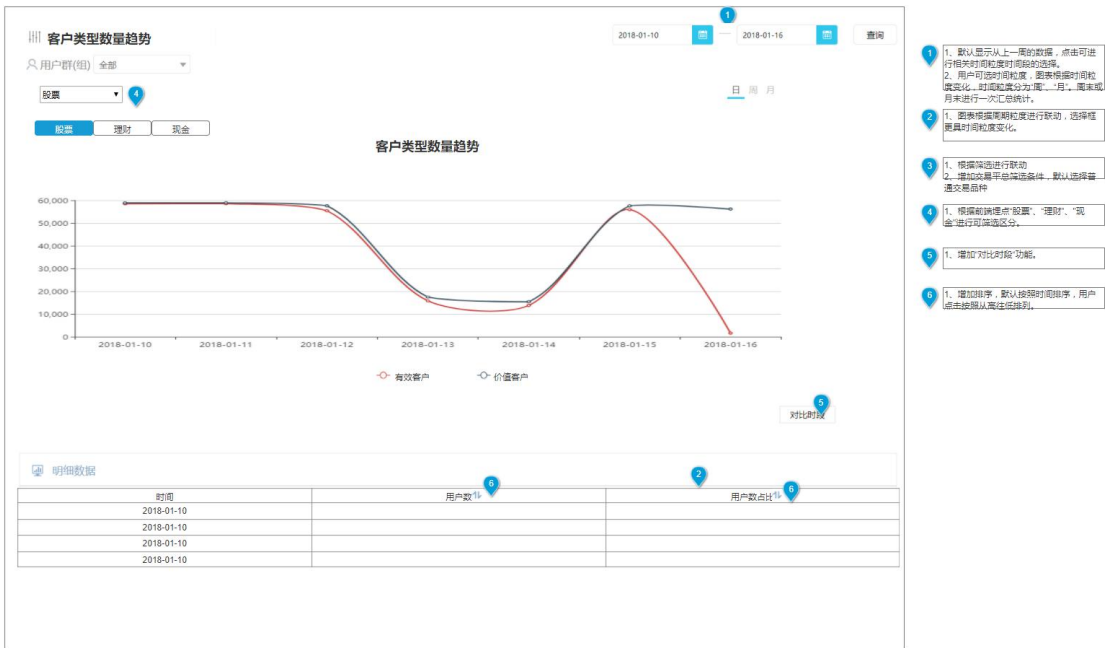
返回参数类型		
参数名	类型	说明
stockProfit	List	股票盈利比分布列表
fundProfit	List	基金盈利比分布列表
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比
numbers	String	分段统计人数

4. A04 当前佣金分布



清洗逻辑和接口定义同“账户资产分布”，dws_ord_asset_stat_month, dws_ord_asset_stat_week 中分别取 type 为 8. A 股净佣金 a_net_fee, 9. B 股净佣金 b_net_fee, 10. 基金净佣金 fund_net_fee, 11. 债券净佣金 bond_net_fee, 12. 回购净佣金 buyback_net_fee, 13. 汇总净佣金 total_net_fee

5. C 客户类型分布



SUM05 客户类型分布事实表 dws_oth_customer_stat_ds (对应 cbas_sum_customer_stat_ds,以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
customer_stat_id	LONG	表 ID	自增
date_sk	INT	月维度 ID	dws_ord_asset_profit_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.date_sk
type	VARCHAR	客户分类	0: 其他, 1: 股票, 2: 理财, 3: 现金
numbers	INT	每日统计数量	每日各类型客户数量
value_type	INT	客户价值分类	0: 其他, 1: 有效客户, 2: 价值客户
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_oth_customer_stat_acc_ds (对应 cbas_sum_customer_stat_acc_ds,以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
customer_stat_id	LONG	表 ID	自增
date_sk	INT	月维度 ID	dws_ord_asset_profit_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.date_sk
type	VARCHAR	客户分类	0: 其他, 1: 股票, 2: 理财, 3: 现金
numbers	INT	每日统计数量	每日各类型客户数量

value_type	INT	客户价值分类	0: 其他, 1: 有效客户, 2: 价值客户
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#清洗逻辑:

维度: 时间日周月, 客户分类

计算涉及数据仓库表: dws_ord_asset_profit_ds, dim_oth_customer, dim_oth_date

指标表清洗方法:

股票客户: 统计股基市值超过总资产 50% 的人数 = COUNT (stock_fund_value / net_asset >= 0.5)

理财客户: 统计理财市值超过总资产 50% 的人数 = COUNT ((bond_value + out_market_value + impawn_value + option_market_value) / net_asset >= 0.5)

现金客户: 统计现金余额超过总资产 50% 的人数 = COUNT (cap_balance / net_asset >= 0.5)

#接口定义

获取客户分类分布

功能说明:

获取客户价值和客户分类分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getCustomerStatReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
fromDate	必填	Long	开始时间 单位天, 精确到 ms 时间戳, Exp: 2017-10-16 对应时间戳 1508083200000		
toDate	必填	Long	结束时间 单位天, 精确到 ms 时间戳, Exp: 2017-10-16 对应时间戳 1508083200000		
accountType	选填	String	账户类型 id, 1: 股票, 2: 理财, 3: 现金		
groupId	选填	String	群组 id		

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "value": [
```

```

{
    "dateName": "2017-08-12",
    "percentage": "5.00%",
    "numbers": "1378765"
},
{
    "dateName": "2017-08-13",
    "percentage": "5.00%",
    "numbers": "1378765"
},
.....
],
"effect": [
{
    "dateName": "2017-08-13",
    "percentage": "5.00%",
    "numbers": "1378765"
},
.....
]
}
}

```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
value	List	价值客户分布列表
effect	List	有效客户分布列表
dateName	String	日期
percentage	String	百分比
numbers	String	当日统计人数

6. H01 客户持仓产品偏好

计算涉及数据仓库表: dwb_user_preference_label, dim_oth_date, dim_oth_segment_asset

维度: 周, 月, **股票基金**

指标计算方法: dwb_user_preference_label 中按 hold_preference 值分组统计数量, 其中 0: 无明显偏好, 1: 小盘股, 2: 中盘股, 3: 大盘股, 4: 超大盘股

基金持仓偏好 fund_hold_preference 按基金投资类型划分, 其中 0: 无明显偏好, 1: 大盘型, 2: 中盘型, 3: 小盘型

SUM06 持仓偏好周汇总事实表

dws_ord_hold_preference_week (对应 cbas_sum_hold_preference_week 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dwb_user_preference_label 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_user_preference_label 中对应 hold_preference(type=0)或 fund_hold_preference (type=1) 枚举值对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	目前默认 0: 股票, 1: 基金
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_preference_acc_week (对应 cbas_sum_hold_preference_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dwb_user_preference_label 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_user_preference_label 中对应 hold_preference(type=0)或 fund_hold_preference (type=1) 枚举值对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	目前默认 0: 股票, 1: 基金
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM07 持仓偏好月汇总事实表

dws_ord_hold_preference_month (对应 cbas_sum_hold_preference_month 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	月维度 ID	dwb_user_preference_label 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_user_preference_label 中对应 hold_preference(type=0)或 fund_hold_preference (type=1) 枚举值对应的分段 ID

type	VARCHAR	持仓类型	目前默认 0：股票，1：基金
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_preference_acc_month (对应 cbas_sum_hold_preference_acc_month 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	月维度 ID	dwb_user_preference_label 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_user_preference_label 中对应 hold_preference(type=0)或 fund_hold_preference (type=1) 枚举值对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	目前默认 0：股票，1：基金
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD



#接口定义

获取持仓产品偏好

功能说明:

获取不同种类账户的资产和净资产分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getHoldPreferenceReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串(根据 dateType 判断), 如“201701”, “201734”		
holdType	选填	String	持仓类型 ID (0: 股票, 1: 基金)		
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月		
groupId	选填	String	群组 ID		

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "stock": [
      {
        "segmentSk": "100",
        "segmentName": "小盘股",
        "percentage": "5.00%",
        "numbers": "1378765"
      },
      {
        "segmentSk": "101",
        "segmentName": "中盘股",
        "percentage": "16.21%",
        "numbers": "1654125"
      },
      .....
    ],
    "fund": [
      {
        "segmentSk": "120",
        "segmentName": "大盘型",
        "percentage": "13.46%",
        "numbers": "1892039"
```

```

    },
    .....
  ]
}

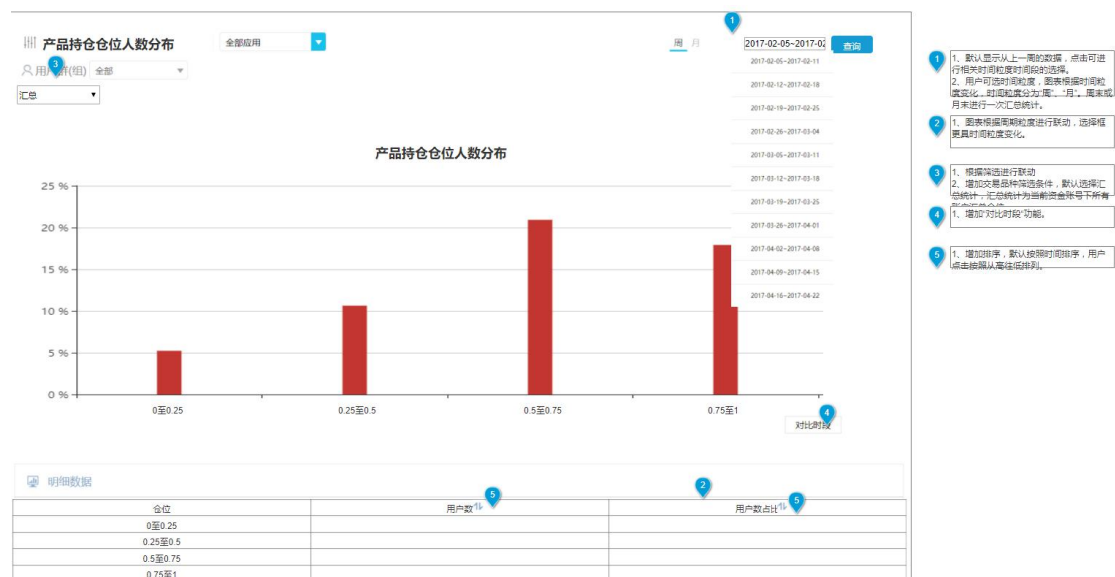
}

```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
stock	List	股票持仓偏好分布列表
fund	List	基金持仓偏好分布列表
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比
numbers	String	分段数

7. H02 各产品持仓仓位人数分布



计算涉及数据仓库表: dws_ord_hold_day_ds, dim_oth_date, dim_oth_segment_asset

维度: 周, 月, 证券类型 type

指标计算方法: 周月最后一天 dws_ord_hold_day_ds 中按 type 分组统计 hold_amount / 当日 dws_ord_asset_profit_ds.net_asset 在各分段区间人数, 其中分组 type 要做合并处理, 处理如下表:

细分类型枚举值	合并类型	类型名称
---------	------	------

SXX	1	股票
F00, F10, F20, F23, F24	2	基金
BXX	3	债券
XXX	4	两融
D99	5	衍生品
F21, F22	6	资管
所有类型	0	汇总

SUM08 持仓仓位人数周汇总事实表

dws_ord_hold_position_week (对应 cbas_sum_hold_position_week 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dws_ord_hold_day_ds.p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_hold_day_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_position_acc_week(对应 cbas_sum_hold_position_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dws_ord_hold_day_ds.p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_hold_day_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM09 持仓仓位人数月汇总事实表

dws_ord_hold_position_month (对应 cbas_sum_hold_position_month 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dws_ord_hold_day_ds.p_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_hold_day_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_position_acc_month (对应 cbas_sum_hold_position_acc_month 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dws_ord_hold_day_ds.p_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_hold_day_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

获取产品类型持仓仓位的人数分布

功能说明:

获取不同种类持仓产品数量的人数分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getHoldPositionReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		

date	必填	String	年月字符串或年周字符串（根据 dateType 判断），如“201701”，“201734”
holdType	选填	String	持仓类型枚举值（1 股票，2 基金，3 债券，4 两融，5 衍生品，6 资管，0 汇总）
dateType	必填	Int	0: 周，1: 月
groupId	选填	String	群组 ID

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "holdPosition": [
      {
        "segmentSk": "100",
        "segmentName": "0-0.25",
        "percentage": "5.00%",
        "numbers": "1378765"
      },
      {
        "segmentSk": "101",
        "segmentName": "0.25-0.5",
        "percentage": "16.21%",
        "numbers": "1654125"
      },
      .....
    ]
  }
}
```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
holdPosition	List	持仓仓位分布列表
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比

numbers	String	分段数
---------	--------	-----

8. H03 产品持仓种类个数人数分布



计算涉及数据仓库表: dws_ord_hold_day_ds, dim_oth_date, dim_oth_segment_asset

维度: 周, 月, 证券类型 type

指标计算方法: 周月最后一天 dws_ord_hold_day_ds 中按 type 分组统计人数, 其中分组 type 要做合并处理, 处理为如下表:

细分类型枚举值	合并类型	类型名称
SXX	1	股票
F00, F10, F20, F23, F24	2	基金
BXX	3	债券
XXX	4	两融
D99	5	衍生品
F21, F22	6	资管
所有类型	0	汇总

SUM10 持仓种类人数周汇总事实表

dws_ord_hold_type_week (对应 cbas_sum_hold_type_week 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
----	----	----	--------

hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dws_ord_hold_day_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_hold_day_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_type_acc_week (对应 cbas_sum_hold_type_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dws_ord_hold_day_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_hold_day_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM11 持仓种类人数周汇总事实表

dws_ord_hold_type_month (对应 cbas_sum_hold_type_month 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_user_preference_label 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_hold_day_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_type_acc_month (对应 cbas_sum_hold_type_acc_month 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
----	----	----	--------

hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_user_preference_label 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dws_ord_hold_day_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

获取产品类型持仓个数的人数分布

功能说明:

获取不同种类持仓产品数量的人数分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getHoldNumReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串(根据 dateType 判断), 如 “201701”, “201734”		
holdType	选填	String	持仓类型枚举值 (1 股票, 2 基金, 3 债券, 4 两融, 5 衍生品, 6 资管, 0 汇总)		
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月		
groupId	选填	String	群组 ID		

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "hold": [
      {
        "segmentSk": "100",
        "segmentName": "1-3",
        "percentage": "5.00%",
```

```

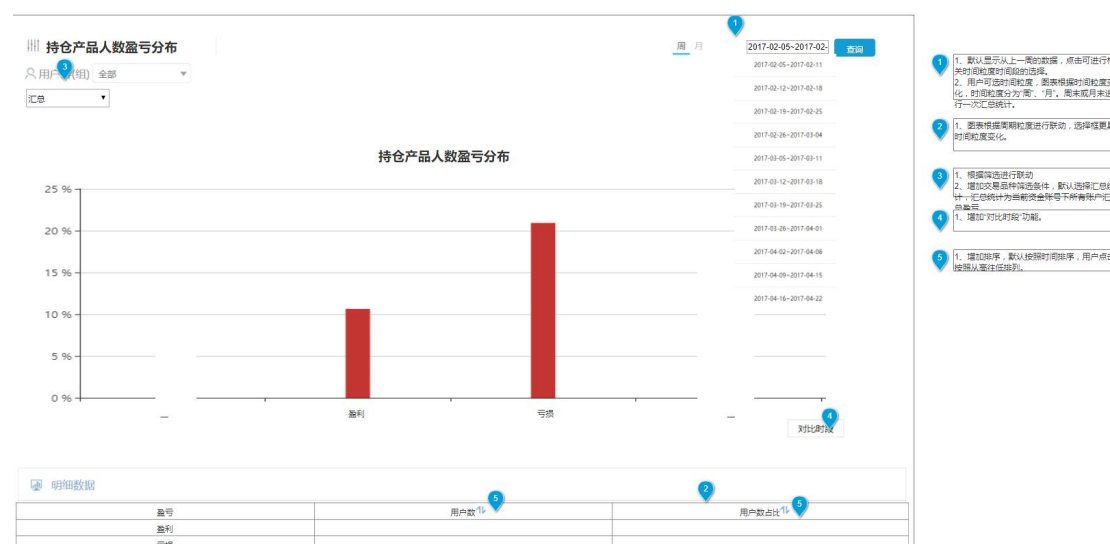
        "numbers":"1378765"
    },
    {
        "segmentSk":"101",
        "segmentName":"4-5",
        "percentage":"16.21%",
        "numbers":"1654125"
    },
    .....
}
}

```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
hold	List	持仓分布列表
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比
numbers	String	分段数

9. H04 持仓产品盈亏人数分布（按持仓周期统计）



计算涉及数据仓库表: dwb_ord_hold_seq_ds, dim_oth_date, dim_oth_segment_asset,
 维度: 周, 月, 证券类型 type
 指标计算方法: dwb_ord_hold_seq_ds 中 end_date 在指定周月范围内, 按 type 分组统计

SUM(profit)>0 和<0 的人数，其中分组 type 要做合并处理，处理为如下表：

细分类别枚举值	合并类型	类型名称
SXX	1	股票
F00, F10, F20, F23, F24	2	基金
BXX	3	债券
XXX	4	两融
D99	5	衍生品
F21, F22	6	资管
所有类型	0	汇总

SUM12 持仓种类盈亏人数分布周汇总事实表

dws_ord_hold_profit_week (对应 cbas_sum_hold_profit_week 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_profit_acc_week (对应 cbas_sum_hold_profit_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM13 持仓种类盈亏人数分布月汇总事实表

dws_ord_hold_profit_month(对应 cbas_sum_hold_profit_month 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_profit_acc_month(对应 cbas_sum_hold_profit_acc_month 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

获取产品类型持仓盈亏人数分布

功能说明:

获取不同种类持仓产品盈亏人数分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getHoldProfitReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		

date	必填	String	年月字符串或年周字符串（根据 dateType 判断），如“201701”，“201734”
holdType	选填	String	持仓类型枚举值（1 股票，2 基金，3 债券，4 两融，5 衍生品，6 资管，0 汇总）
dateType	必填	Int	0: 周，1: 月
groupId	选填	String	群组 ID

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "holdProfit": [
      {
        "segmentSk": "100",
        "segmentName": "盈利",
        "percentage": "5.00%",
        "numbers": "1378765"
      },
      {
        "segmentSk": "101",
        "segmentName": "亏损",
        "percentage": "16.21%",
        "numbers": "1654125"
      }
    ],
    .....
  }
}
```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
holdProfit	List	持仓盈亏分布
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比

numbers	String	分段数
---------	--------	-----

10. H05 产品销售量（或用场内交易表统计）



计算涉及数据仓库表: dwb_ord_on_board_ds, dim_oth_date, dim_oth_segment_asset

维度: 周, 月

指标计算方法: dwb_ord_on_board_ds 中在指定周月范围内 SUM(tran_type='0B' 的 amount)

group by type, 其中分组 type 先要做一步合并处理, 处理为如下表定义:

细分类型枚举值	合并类型	类型名称
AX, C0	1	股票
EX, JX, LX, TX	2	基金
ZX	3	债券
所有类型	0	汇总
G0,#_XX,H0,FX		

SUM14 产品销售日汇总事实表

dws_ord_product_sale_week(对应 cbas_sum_product_sale_week 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
sale_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	VARCHAR	日维度 ID	dwb_ord_on_board_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek

type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
amount	BigDecimal	统计金额	当日成交总金额
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_product_sale_acc_week(对应 cbas_sum_product_sale_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
sale_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	VARCHAR	日维度 ID	dwb_ord_on_board_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
amount	BigDecimal	统计金额	当日成交总金额
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_product_sale_month(对应 cbas_sum_product_sale_month 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
sale_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	VARCHAR	日维度 ID	dwb_ord_on_board_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
amount	BigDecimal	统计金额	当日成交总金额
group_id	INT	群组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_product_sale_acc_month(对应 cbas_sum_product_sale_acc_month 以群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
sale_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	VARCHAR	日维度 ID	dwb_ord_on_board_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
type	VARCHAR	持仓类型	见上表合并类型
amount	BigDecimal	统计金额	当日成交总金额
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

获取产品销售分类统计

功能说明:

获取产品销售分类统计

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getProductSaleReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串(根据 dateType 判断), 如 “201701”, “201734”		
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月		
groupId	选填	String	群组 ID		

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "sale": [
      {
        "segmentName": "股票",
        "percentage": "5.00%",
        "numbers": "1378765.76"
      },
      {
        "segmentName": "基金",
        "percentage": "16.21%",
        "numbers": "1654125.23"
      },
      .....
    ]
  }
}
```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
sale	List	销售分布列表
segmentName	String	产品类型名称

dws_ord_hold_num_acc_week (对应 cbas_sum_hold_num_acc_week 以资金账户粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek,
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM16 产品持仓个数人数分布月汇总

dws_ord_hold_num_month(对应 cbas_sum_hold_num_month 以分组粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
groupId	INT	分组 ID	
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_num_acc_month(对应 cbas_sum_hold_num_acc_month 以资金账户粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 中对应 type 分组计数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

请求参数:

请求参数说明

请求 URL	/cbas/report/asset/getHoldNumReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串（根据 dateType 判断），如“201701”，“201734”		
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月		
groupId	选填	String	群组 ID		

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "holdNum": [
      {
        "segmentSk": "100",
        "segmentName": "1-3",
        "percentage": "5.00%",
        "numbers": "1378765"
      },
      {
        "segmentSk": "101",
        "segmentName": "4-5",
        "percentage": "16.21%",
        "numbers": "1654125"
      },
      .....
    ]
  }
}
```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
holdNum	List	持仓个数分布列表
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比
numbers	String	分段数

12.T02 客户盈利成功率（持仓周期）



计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_seq_ds, dim_oth_date, dim_oth_segment_asset,
维度：周，月，群组
指标计算方法：dwb_ord_hold_seq_ds 中 end_date 在指定周月范围内，统计 SUM(profit) >0 的记录数 / 总记录数，再对应分段统计的人数。

SUM17 盈利成功率分布周汇总（持仓周期）

dws_ord_hold_profit_rate_week(对应 cbas_sum_hold_profit_rate_week 以用户群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_profit_rate_acc_week(对应 cbas_sum_hold_profit_rate_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
----	----	----	--------

hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	月维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM18 盈利成功率分布月汇总（持仓周期）

dws_ord_hold_profit_rate_month(对应 cbas_sum_hold_profit_rate_month 以用户群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_hold_profit_rate_acc_month(对应 cbas_sum_hold_profit_rate_acc_month 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

获取持仓盈亏成功率人数分布

功能说明:

获取持仓盈亏成功率人数分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getHoldProfitRateReport.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串(根据 dateType 判断), 如 “201701”, “201734”		
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月		
groupId	选填	String	群组 ID		

返回 json 示例:

```
{
    "flag": 0,
    "msg": "ok",
    "data": {
        "holdProfitRate": [
            {
                "segmentSk": "100",
                "segmentName": "0 至 0.25",
                "percentage": "5.00%",
                "numbers": "1378765"
            },
            {
                "segmentSk": "101",
                "segmentName": "0.25 至 0.5",
                "percentage": "16.21%",
                "numbers": "1654125"
            },
            .....
        ]
    }
}
```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
holdProfitRate	List	持仓盈亏成功率分布
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称

percentage	String	百分比
numbers	String	分段统计数

13.T03 持仓时间（持仓周期）

维度：周月，群组

指标计算方法：统计周/月时间内 dwb_ord_hold_seq_ds 表中 end_date 在周月范围内的记录，计算这些的记录平均天数 $AVG(start_date - end_date)$ ，再统计天数对应分段的用户数



计算涉及数据仓库表：dwb_ord_hold_seq_ds, dim_oth_date, dim_oth_segment_asset,

维度：周，月，群组，持仓类型

指标计算方法：dwb_ord_hold_seq_ds 中 end_date 在指定周月范围内，统计 $SUM(profit) > 0$ 的记录数 / 总记录数，再对应分段统计的人数。

细分类型枚举值	合并类型	类型名称
SXX	1	股票
F00, F10, F20, F23, F24	2	基金
BXX	3	债券
XXX	4	两融
D99	5	衍生品
F21, F22	6	资管
所有类型	0	汇总

SUM18 平均持仓周期分布周汇总

dws_ord_avg_hold_week(对应 cbas_sum_avg_hold_week 以用户群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
type	INT	持仓类型	0: 汇总, 1: 股票, 2: 基金, 3: 债券, 4: 两融, 5: 衍生品, 6: 资管
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_avg_hold_acc_week(对应 cbas_sum_hold_avg_hold_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	月维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
type	INT	持仓类型	0: 汇总, 1: 股票, 2: 基金, 3: 债券, 4: 两融, 5: 衍生品, 6: 资管
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM19 平均持仓周期分布月汇总

dws_ord_avg_hold_month(对应 cbas_sum_avg_hold_month 以用户群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
type	INT	持仓类型	0: 汇总, 1: 股票, 2: 基金, 3: 债券, 4: 两融, 5: 衍生品, 6: 资管
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_avg_hold_acc_month(对应 cbas_sum_avg_hold_acc_month 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
type	INT	持仓类型	0: 汇总, 1: 股票, 2: 基金, 3: 债券, 4: 两融, 5: 衍生品, 6: 资管
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

获取平均持仓时间分布

功能说明:

获取平均持仓时间分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getAvgHoldTime.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串(根据 dateType 判断), 如 “201701”, “201734”		
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月		
holdType	选填	String	持仓类型枚举值 (1 股票, 2 基金, 3 债券, 4 两融, 5 衍生品, 6 资管, 0 汇总), 默认 0		
groupId	选填	String	群组 ID		

返回 json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
```

```

    "data": {
      "avgHoldDays": [
        {
          "segmentSk": "100",
          "segmentName": "0-3 天",
          "percentage": "5.00%",
          "numbers": "1378765"
        },
        {
          "segmentSk": "101",
          "segmentName": "3-5 天",
          "percentage": "16.21%",
          "numbers": "1654125"
        },
        .....
      ]
    }
  }
}

```

返回参数:

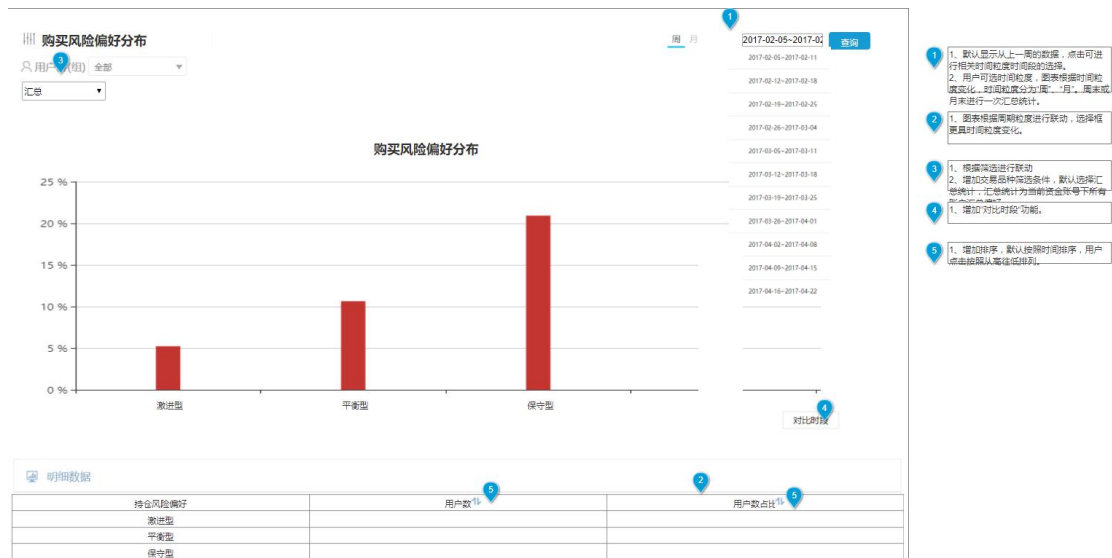
返回参数类型		
参数名	类型	说明
avgHoldDays	List	平均持仓天数分布
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比
numbers	String	分段数

14.T04 购买风险偏好

维度：周月

指标计算方法：

区间内 $SUM(risk_num) / SUM(stock_buy_num)$ 并分段



SUM20 购买风险偏好周汇总

dws_ord_risk_week(对应 cbas_sum_risk_week 以用户群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_risk_acc_week(对应 cbas_sum_risk_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	月维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM21 平均持仓周期分布月汇总

dws_ord_risk_month(对应 cbas_sum_risk_month 以用户群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_risk_acc_month(对应 cbas_sum_risk_acc_month 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dwb_ord_hold_seq_ds 对应 end_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	盈利成功率人数对应的分段 ID
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

风险偏好分布

功能说明:

获取风险偏好分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getRiskPreference.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串(根据 dateType 判断), 如		

			“201701”，“201734”
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月
groupId	选填	String	群组 ID

返回json 示例:

```
{
  "flag": 0,
  "msg": "ok",
  "data": {
    "risk": [
      {
        "segmentSk": "100",
        "segmentName": "激进型",
        "percentage": "5.00%",
        "numbers": "1378765"
      },
      {
        "segmentSk": "101",
        "segmentName": "平衡型",
        "percentage": "16.21%",
        "numbers": "1654125"
      },
      .....
    ]
  }
}
```

返回参数:

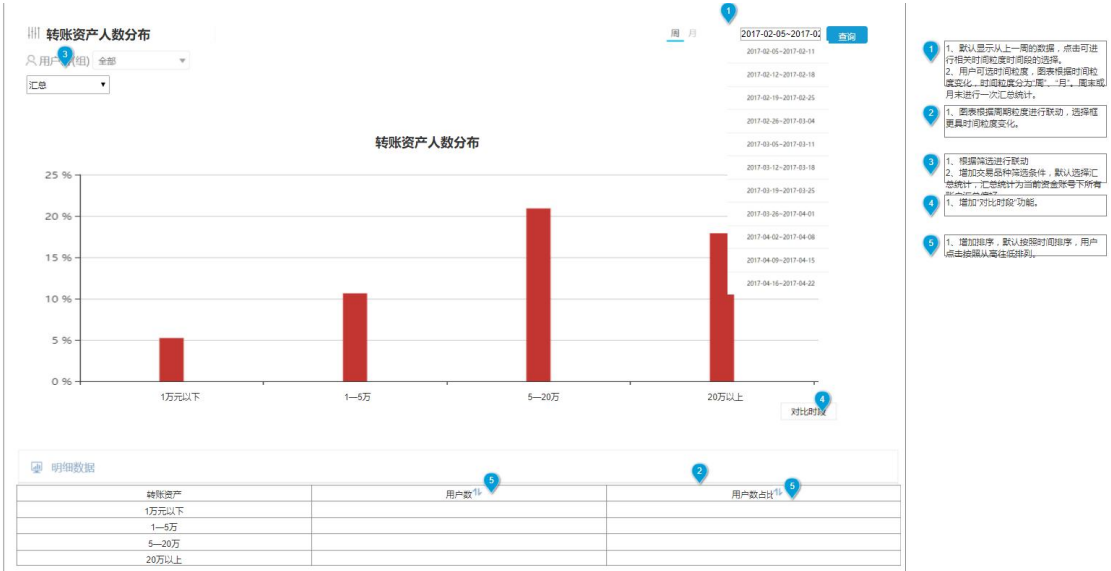
返回参数类型		
参数名	类型	说明
risk	List	风险偏好类型分布列表
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比
numbers	String	分段数

15.T05 转账资产分布

维度：周月

指标计算方法：

区间内 SUM(汇总 net_income 或净转入 net_cap_in 或净转出 net_cap_out)并分段



SUM22 转账资产分布周汇总

dws_ord_cap_in_week(对应 cbas_sum_cap_in_week 以用户群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	周维度 ID	dws_ord_asset_profit_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	不同转账类型下转账金额 SUM 值分段
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账号数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
cap_type	INT	转账类型	0: 汇总（净转入-净转出），1: 净转入，2: 净转出
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_cap_in_acc_week(对应 cbas_sum_cap_in_acc_week 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandweek	INT	月维度 ID	dws_ord_asset_profit_ds 对应 p_date 对应的

			dim_oth_date.yearandweek
segment_sk	INT	对应分段 ID	不同转账类型下转账金额 SUM 值分段
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
cap_type	INT	转账类型	0: 汇总（净转入-净转出），1: 净转入，2: 净转出
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

SUM23 转账资产分布月汇总

dws_ord_cap_in_month(对应 cbas_sum_cap_in_month 以用户群组为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dws_ord_asset_profit_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	不同转账类型下转账金额 SUM 值分段
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
group_id	INT	群组 ID	群组表中对应 ID
cap_type	INT	转账类型	0: 汇总（净转入-净转出），1: 净转入，2: 净转出
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

dws_ord_cap_in_month(对应 cbas_sum_cap_in_month 以资金账户为粒度)

字段	类型	说明	ETL 来源
hold_id	LONG	表 ID	自增
yearandmonth	INT	周维度 ID	dws_ord_asset_profit_ds 对应 p_date 对应的 dim_oth_date.yearandmonth
segment_sk	INT	对应分段 ID	不同转账类型下转账金额 SUM 值分段
numbers	INT	分段统计数量	各分段下的不重复账户数量
cap_type	INT	转账类型	0: 汇总（净转入-净转出），1: 净转入，2: 净转出
p_date	DATE	数据更新日期	YYYYMMDD

#接口定义

转账资产分布

功能说明:

获取转账资产分布

请求参数:

请求参数说明					
请求 URL	/cbas/report/asset/getCapInOut.do	请求类型	GET	请求类型	json
参数名	是否可选	类型	说明		
date	必填	String	年月字符串或年周字符串(根据 dateType 判断), 如 “201701”, “201734”		
dateType	必填	Int	0: 周, 1: 月		
type	必填	Int	0: 汇总(净转入-净转出), 1: 净转入, 2: 净转出		
groupId	选填	String	群组 ID		

返回 json 示例:

```
{
    "flag": 0,
    "msg": "ok",
    "data": {
        "netIncome": [
            {
                "segmentSk": "100",
                "segmentName": "1 万元以下",
                "percentage": "5.00%",
                "numbers": "1378765"
            },
            {
                "segmentSk": "101",
                "segmentName": "1 万-5 万",
                "percentage": "16.21%",
                "numbers": "1654125"
            }
        ],
        .....
    ],
    "netCapIn": [
        {
            "segmentSk": "100",
            "segmentName": "1 万元以下",
            "percentage": "5.00%",
            "numbers": "1378765"
        },
    ],
}
```

```

{
    "segmentSk":"101",
    "segmentName":"1 万-5 万",
    "percentage":"16.21%",
    "numbers":"1654125"
},
.....
],
"netCapOut":[
{
    "segmentSk":"100",
    "segmentName":"1 万元以下",
    "percentage":"5.00%",
    "numbers":"1378765"
},
{
    "segmentSk":"101",
    "segmentName":"1 万-5 万",
    "percentage":"16.21%",
    "numbers":"1654125"
},
.....
]
}
}

```

返回参数:

返回参数类型		
参数名	类型	说明
netIncome	List	汇总转账分布列表
netCapIn	List	净转入分布列表
netCapOut	List	净转出分布列表
segmentSk	String	分段 sk
segmentName	String	分段名称
percentage	String	百分比
numbers	String	分段数

