

雁丰机试题（2025/12）

我们提供 100 支股票 1 天的高频数据，数据下载链接如下：

通过网盘分享的文件：20251209_行情数据.zip

链接：https://pan.baidu.com/s/1XaFJ93yL_zs_a10ZTtkKYw?pwd=fz3j 提取码：fz3j

若您不能下载百度网盘数据，请联系我们通过微信发送您数据。

请使用上述数据，编程计算以下指标：

中文名	FACTOR_NAME	中间步骤计算	信号计算方式
上午&下午成交量比值	VOLUME_RATIO	1. 使用逐笔成交数据：计算每分钟的成交量； 2. 计算上午区间总成交量，时间区间为：[09:25:00, 10:00:00]； 3. 计算下午区间总成交量，时间区间为：[13:00:00, 13:30:00]	1. 分子项：上午区间总成交量 2. 分母项：下午区间总成交量
主动买卖占比	ACT	1、使用逐笔成交数据；每分钟按单号，计算出买单成交额与卖单成交额； 2、将每笔单号成交额按固定数值划分为超大(>1.0e6)，大(2.0e5~1.0e6)，中(4.0e4~2.0e5)，小单(<4.0e4)	1、分子项：大买单+中买单-大卖单-中卖单 2、分母项：大买单+中买单+大卖单+中卖单
主动买卖占比 (大单)	L_ACT	3、每分钟，加总统计出 4*2=8 个值，例如超大买单，大买单，..，超大卖单，..，小卖单	1、分子项：大买单-大卖单 2、分母项：大买单+大卖单
主动买卖占比 (中单)	M_ACT	4、每天，将分钟级别的 8 个值分别进行加总，得到全天的 8 个值	1、分子项：中买单-中卖单 2、分母项：中买单+中卖单
主动买卖占比 (小单)	S_ACT		1、分子项：小买单-小卖单 2、分母项：小买单+小卖单
主动买卖占比 (超大单)	X_ACT		1、分子项：超大买单-超大卖单 2、分母项：超大买单+超大卖单
交易订单占比 (超大单)	XLS_ORDER_RATIO	1、使用逐笔委托数据；每分钟按单号，计算出委托额；	1、分子项：超大单委托额 2、分母项：总委托额
交易订单占比 (大单)	L_ORDER_RATIO	2、将每笔单号委托额按固定数值划分为超大(>1.0e6)，大(2.0e5~1.0e6)，中(4.0e4~2.0e5)，小单(<4.0e4)	1、分子项：大单委托额 2、分母项：总委托额
交易订单占比 (中单)	M_ORDER_RATIO	3、每分钟，加总统计出 4 值：超大单，大单，中单，小单	1、分子项：中单委托额 2、分母项：总委托额
交易订单占比 (小单)	S_ORDER_RATIO	4、每天，将分钟级别的 8 个值分别进行加总，得到全天的 8 个值	1、分子项：小单委托额 2、分母项：总委托额

请将计算结果，写入“factorValue_YF.csv”。该 csv 包含一支股票的计算结果，供您核对程序。您需要将其余 99 支票的结果填入表格。

完成后，请将 csv 和您的代码发送给我们，并告知我们您程序运行总耗时。