蓝目数字因子数据格式定义规范

**www.blueye.info**

**杭州蓝目数字信息技术有限公司**

**2020-12-17**

因子数据采用数据头和数据体组合而成，头部包含了版本号、因子列数、行数、因子名称、品种代码等等。

按时间维度定义

多品种在某个时间点(某分钟、某3分钟、某日...)保存于同一文件。

如下结构体定义了多品种因子包头。

typedef struct

{

char version\_; //版本号

int col\_count\_; //列数量

int symbols\_count\_; //品种代码数量

int current\_time\_; //当前时间

bool is\_valid()

{

if (/\*version\_ == 0 &&\*/

col\_count\_ > 0 && col\_count\_ <= MAX\_COL\_COUNT &&

symbols\_count\_ > 0 &&

current\_time\_ > 0)

return true;

else

return false;

}

}tag\_BLUEYE\_FACTORS\_DATA\_HEADER\_BY\_CODE;

如下结构体定义了多品种在同一时间的列数据体。

typedef struct

{

int exchange\_; //交易所代码，0-深圳， 1-上海。

std::string symbol\_; //品种代码

std::vector<double> col\_values\_; //该品种对应的因子数据。

}tag\_BLUEYE\_SINGLE\_PERIOD\_DATA\_BY\_CODE;

按代码维度定义

一个品种在某个时序下的所有数据保存于同一文件。

typedef struct

{

char version\_; //版本号

int col\_count\_; //列数量

int row\_count\_; //记录(行)数量

int snapshot\_\_mem\_list\_count\_;

int last\_time\_; //最后修改时间

bool is\_valid()

{

if (version\_ == 0 &&

col\_count\_ > 0 && col\_count\_ <= MAX\_COL\_COUNT &&

row\_count\_ > 0 && row\_count\_ <= MAX\_ROW\_COUNT &&

snapshot\_\_mem\_list\_count\_ >= 0 && snapshot\_\_mem\_list\_count\_ <= MAX\_MEM\_LIST\_COUNT)

return true;

else

return false;

}

}tag\_BLUEYE\_FACTORS\_DATA\_HEADER;

列名称

每个列名称为长度20的字符串，如下

|  |  |
| --- | --- |
| **列名** | **长度** |
| Col1 | 20 |
| Col2 | 20 |
| ... ... | 20 |
| Coln | 20 |

数据包体

每个数据为double型,每条记录由“多列+时间”构成。

|  |  |
| --- | --- |
| **数据列列** | **长度** |
| Col\_value1 | double |
| Col\_value2 | double |
| ... ... | double |
| Col\_valuen | Double |
| time | \_\_time32\_t |

因子的服务器配置

目录和命名规范。

因子的前端配置规范

Factors.json

因子的下载配置

通过blueye\_algo.exe下载。

因子的使用

通过blueye\_algo打开某个时间进行品种筛选。

Github网址：https://github.com/blueye-com/blueye\_factors\_api