Stock data table. (stock\_data)

所有上市公司股票信息，是股票的基础信息数据来自新浪财经。通过程序stock\_data.py 程序获得并存入数据库

|  |  |
| --- | --- |
| Code | 股票代码 |
| Name | 股票名称 |
| TOprice | 今日开盘价 |
| YCprice | 昨日收盘价 |
| Cprice | 当前价格 |
| THprice | 今日最高价 |
| TLprice | 今日最低价 |
| DealData | 今日成交金额 |
| DealAmout | 今日成交数量 |
| Date | 数据采集日期 |
| Time | 数据采集时间 |

fund data table(fund\_data)

基金净值信息，通过程序fund\_data\_all.py 程序获得所有基金的净值和总份额

|  |  |
| --- | --- |
| F\_name | 基金名称 |
| F\_net | 基金净值 |
| F\_Tnet | 基金累计净值 |
| B\_D\_net | 前一个交易日净值 |
| F\_date\_net | 基金净值日期 |
| F\_Tamount | 基金总份额 |
| F\_code | 基金代码 |

Fund information table(fund\_informaiton)

基金的管理相关信息

|  |  |
| --- | --- |
| F\_name | 基金简称 |
| F\_code | 基金代码 |
| C\_date | 成立日期 |
| S\_date | 上市日期 |
| K\_years | 存续期限(年) |
| S\_location | 上市地点 |
| F\_Tamount | 基金总份额(亿份) |
| F\_Samount | 上市流通份额(亿份) |
| F\_Tvalues | 基金规模(亿元) |
| Stock\_style | 选股风格 |
| F\_owner | 基金管理人 |
| F\_Dmanager | 基金托管人 |
| F\_manager | 基金经理 |
| OP\_style | 运作方式 |
| F\_type | 基金类型 |
| Sec\_cat | 二级分类 |
| S\_agent1 | 代销机构(银行） |
| S\_agent2 | 代销机构(证劵) |
| Min\_Bvalue | 最低参与金额(元) |
| Min\_Bamount | 最低赎回份额(份) |
| F\_Fmanagement | 基金管理费 |
| F\_Dmanagement | 基金托管费用 |
| F\_Sservice | 销售服务费 |

Top stock table, (top\_stock)

包含所有基金的十大重仓股票信息。通过程序fund\_top\_stock.py 获得所有数据

|  |  |
| --- | --- |
| index\_num | 基金十大重仓股索引 |
| stock\_code | 股票代码 |
| stock\_name | 股票名称 |
| keep\_cur | 持仓市值 |
| percent\_net | 占基金净值比（%） |
| keep\_stock\_amount | 持仓股数 |
| percent\_stock | 占公司总股本比（%） |
| df\_with\_last | 交上期增减（元） |
| keep\_it\_fundamount | 持有该股的基金数目 |

要计算每支基金中的重仓股所占有比率的变化，需要采用下列公式计算

1. 当前总市值 =S(1-len(stock\_top) 重仓股当前持股市值（top\_stock.keep\_cur）/占基金净值比（top\_stock.percent\_net)/len(stock\_top)
2. 新占基金比率 = 股票当前价格 （stock\_data.YCprice ) × 基金持有该股票股数(top\_stock.keep\_stock\_amount)/ 当前总市值

基于以上计算方式，需要先生成源数据表（fund\_source\_cal)用于计算相关数据。该表包括以下字段信息：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| F\_code | 基金名称 | fund\_data |
| F\_net | 公司公布基金净值 | fund\_data |
| F\_date\_net | 基金净值日 | fund\_data |
| F\_Tamount | 公司公布基金总份额 | fund\_data |
| F\_TVal | 公司公布基金总市值 | fund\_information |
| stock\_code | 基金十大重仓股代码 | top\_stock |
| stock\_name | 基金十大重仓股名称 | top\_stock |
| keep\_cur | 基金十大重仓股公司公布市值 | top\_stock |
| keep\_stock\_amount | 基金十大重仓股公司公布持仓数量 | top\_stock |
| percent\_net | 基金十大重仓股公司公布占基金净值比 | top\_stock |
| YCprice | 基金十大重仓股当前收盘价 | stock\_data |
| Date | 股票日期 | stock\_data |
| Code | 股票代码 | stock\_data |
| F\_TCVal | 基金当前总市值 | 计算 |
| per\_net\_new | 基金十大重仓股新占基金净值比 | 计算 |
| S\_Tper\_com | 基金十大重仓股占比综合（公司） | 计算 |
| S\_Tper\_new | 基金十大重仓股占基金净值比(new) | 计算 |

F\_TCVal （基金数据公布日的总市值）计算方式：

用top ten的股票中每支股票总市值（keep\_cur数据公布之日的市值）除以每支股票占基金净值比（percent\_net 数据公布之日值），再将其求平均值

F\_Tamount\_now 基金当前总份额

用基金当前总市值除以基金当前净值

percent\_net\_now计算方式：

假设基金持有每支股票的总数不变，计算当天该股票的总市值（YCprice × keep\_stock\_amount)， 再用该值除以当天的基金总市值得到top\_ten股票在新市值下的重新分配比率。

Percent\_net\_Csum 基金数据公布之日 top-ten股票占基金净值比总和

sum（percent\_net)

percent\_net\_Nsum基金当前top-ten股票占基金净值比总和

sum（percnet\_net\_now)

程序data\_source\_recal.py 用于重整数据为了重新计算per\_net 和其他指标做准备。

程序fund\_recal\_net\_per.py 用于计算相关指标及以后画图准备