**关于Stg 指数点位的计算方法：**

1. 成分股品种

Strtrd\_cfg，所含字段变量为：

SecuCode,Cur\_TradingDay,updatetime,Ltg,preLtg,pre\_cp,net0

1. 计算时间

在updatetime的下一个时间交易日（通常是Cur\_TradingDay，但Cur\_TradingDay偶偶会出错，因为无法提前确认交易所节假日安排表。所以Cur\_TradingDay仅供参考）

3、计算的频率

从9：25-15：10分钟，每分钟间隔查询最新价格，计算一次open\_price,close\_price。若受条件限制，可以放宽5分钟计算一次（丢失部分精确度）。考虑条件，以5分钟为例：

[9：25-9:30)为第一个5分钟，标记为930

[9:30-9:35)为第二个5分钟，标记为935，以此类推

其中上午收盘和下午收盘的5分钟，特殊一点:

盘收盘最后一个5分钟时间为[11:25-12)，标记为1125

下午收市最后一个5分钟为[14:55-15:15)，标记为1455

，早盘开盘、收盘，午盘收盘时间延迟，是为了防止数据丢失问题。

1. 时间的对齐方式

分别已上海、深圳交易所的时间为准。每只品种尽可能取准各自时间段的起始价格。

1. Strtrd\_cfg成分股的选择方法

精确的方法，必须剔除下一个交易日停牌的品种。由于实际调价限制，暂时假定Strtrd\_cfg列表中的品种全部开盘，不停牌。

1. 点位的计算方法:

（1）首先计算初始除数：

Pretmap = sum(pre\_cp\*preLtg) ，即分别计算stg\_cfg列表中每个品种的pre\_cp和preLtg的乘数，再全部汇总求和。

（2）对stg\_cfg列表中每个品种下一个交易日实盘的open\_price,close\_price,以及Ltg，分别求乘数Open\_price\*Ltg,close\_price\*Ltg,然后统计所有品种各乘数的累计值（汇总求和），由此计算出Stg指数的点位的open，close价格

Open = sum(open\_price\*Ltg)/Pretmap\*net0

Close = sum(close\_price\*Ltg)/Pretmap\*net0

(3)记录下该时间段的stg指数点位的开盘价，收盘价，以及对应的时间元组，

(open,close,dt)，逐一计算并添加，形成以下格式的CSV文件：

范例：

Code,open,close,dt

Stg, 1.100, 1.200, 2307290930

1. 关于数据的填充问题

如果Stgtrd\_cfg中的某个品种在下一个交易日实际上是停牌的，没有实盘价格，默认采用该品种最后一个收盘价pre\_cp进行填充，即每个5分钟k线的open\_price,close\_price,都是pre\_cp.

如果某个品种没有停牌，但没有开盘价，或者当天某个时间段没有推动价格，那么采用最近可获取的close\_price进行填充