|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  |  |  |
| 价格动量因子  价格用mp.last  对于上涨段，下跌段也是对应的 | * 窗口的长度 | 从上涨段起始点到当前的时间长度 |
| Midprice实现涨跌幅 | 从上涨段起始点到当前mp的涨幅  mp.diff()/mp0 |
| mp的涨速 | 从上涨段起始点到当前mp轨迹的斜率 mp.chg\_rate() |
| 流畅度 | [distance](javascript:;) = mp.diff(1).abs().sum(n) 从起点到当前每个数据点价格变化的绝对值之和  dif = mp.diff(n).abs() 从起点到当前的价格变化  dif / [distance](javascript:;) |
| mp加速度 | mp.chg\_rate().chg\_rate() |
| 离最近一次mp上涨的时长 | 距离最近一次mp>mp.shift(1)的数据点个数 |
| 离mp最高点位置的时长 | 从上涨段起始点到当前这个区间的最高点位置到当前的数据点个数 |
| 离mp最高点价格的幅度 | 当前价格除以从上涨段起始点到当前这个区间的最高点价格mp.max mp/mp.max |
|  |  |
|  |  |  |