

银河启睿策略中心使用手册（对客版）

1 银河策略中心介绍

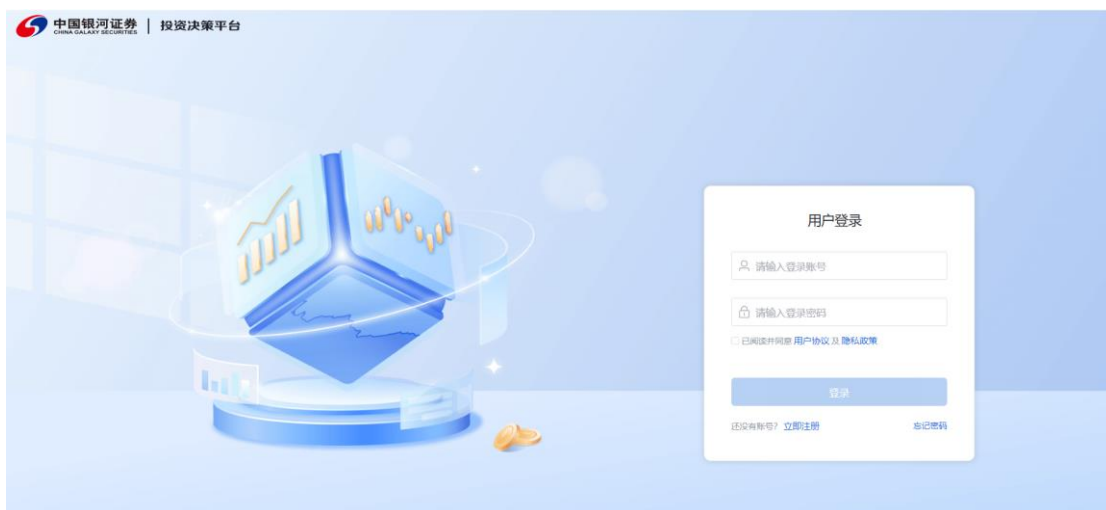
银河策略中心是为满足高净值个人和机构投资者对投资研究和决策的需求而搭建的专业投资平台。它包括数据服务、因子开发、策略开发、策略回测、仿真实盘和投后分析等全链条功能。

目前一期已完成数据因子服务。

2 功能说明

2.1 用户登录

客户开通账号后，使用登录账号和密码进行登录



2.2 因子研究

因子研究功能包括因子创建、因子检测、因子入库、因子发布、发布审核、因子跟踪等全流程管理。

2.2.1 因子创建

从菜单栏中点击【因子创建】，展示用户创建的处于【草稿】或【已检测】状态的因子。支持新建因子、因子删除、已检测因子的报告查看、提交入库和编辑。



2.2.2.1 新建因子

点击【新建因子】按钮，在弹出窗口输入因子名称，选择因子编程语言以及因子模板进行因子初步创建。因子名称有唯一性，不能重复。



2.2.2.2 编辑因子

从因子创建列表中，通过点击【因子名称】或者点击【查看报告】按钮可以对因子信息进行编辑。



2.2.2.3 因子检测

在因子详情页可以设置因子检测参数，并通过点击【检测】按钮进行因子检测。检测进度会实时展示，并可通过点击【检测结果】按钮查看检测结果。

因子代码

```
1 # 请替换 无需 import
2 # import pandas as pd
3 # import numpy as np
4 # import talib as ta
5 # 基于swardfish的封装
6 def psy(close, ndays:'t:param'=12):
7     up_days = close - close.shift(1) > 0
8     return up_days.rolling(ndays).sum()/ndays
```

因子检测中...

参数设置

股票池: 沪深300

组合构建: 多空头组合

起始日期: 2021-11-01

截止日期: 2024-11-01

业绩基准: 沪深300

组合数: 5

因子方向: 升序

因子检测中...

白噪声

持仓周期: 1日

检测进度

停止检测

91.56%

时间	记录
2024-11-01 13:24:38	开始, 阶段: 6-获取因子依赖数据
2024-11-01 13:24:38	结束, 阶段: 5-公式生产
2024-11-01 13:24:38	开始, 阶段: 5-公式生产
2024-11-01 13:24:38	结束, 阶段: 4-参数映射

检测结果页:

< 返回

因子详情 检测结果

因子名称: gidtest1 | 更新时间: 2024-11-01 13:30:08.000 | 因子作者: gidtest | 股票池: 000300.SH | 基准: 000300.SH | 结果导出

0.11%

-7.03%

-5.22%

2.39%

-7.61%

-11.28%

-0.71

0.10%

昨日收益

累计收益

年化收益

超额年化收益

基准年化收益

最大回撤

夏普比率

换手率

-0.3153

0.0081

0.0103

0.0277

0.037

最新IC

最新RankIC

IC均值

RankICIR均值

IR均值

收益率分析

组合累计收益



参数详情

2.2.2.4 提交入库

已经完成检测的因子，可以通过点击【提交入库】按钮将因子提交到我的因子列表中。

因子创建

因子名称: | 因子状态: 请选择因子状态 | 因子类别: 请选择因子类别 | |

<input type="checkbox"/>	因子名称	执行模式	编程语言	因子类别	因子状态	更新时间	因子描述	操作
<input type="checkbox"/>	gidtest1	离线	python		已检测	2024-11-01 13:18:01.569		<input type="button" value="查看报告"/> <input type="button" value="提交入库"/> <input type="button" value="删除"/>

2.2.3 我的因子

我的因子列表展示用户已通过检测并提交入库的因子，可用于发布给其他人使用。

我的因子

因子名称

因子状态

因子类别

查询

重置

批量删除

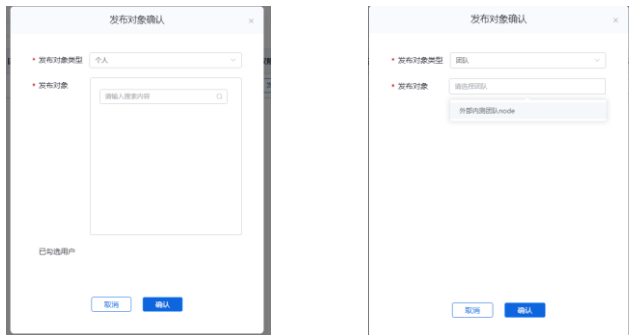
刷新

<input type="checkbox"/>	因子名称	执行模式	编程语言	因子类别	因子状态	更新时间	因子描述	权限操作	因子操作
<input type="checkbox"/>	psRatio	离线	python		已入库	2024-10-29 16:56:34.487		<div>发布</div> <div>撤销权限</div> <div>发布记录</div>	<div>下架</div> <div>删除</div>

我的因子列表中的因子内容不可编辑，点击因子名称可查看详情和进行因子检测。

2.2.3.1 因子发布

想分享因子给其他人使用，可点击【发布】按钮进行选择。发布对象可为同团队的个人或用户所在的团队。



因子发布后，需要有管理员权限的团队人员进行发布审核，如果审核通过，被发布者就可以使用该因子了。

2.2.3.2 撤销权限

对于已发布的因子，因子作者可申请撤销权限。点击【撤销权限】按钮，对已发布的个人或团队进行权限撤销的申请。



申请撤销权限后，需要有管理员权限的团队人员进行撤销审核，如果审核通过，被发布者将无法继续使用该因子。

因子的全部权限处理流程可通过【发布记录】查看。

2.2.3.3 因子下架

当因子权限只属于作者一人时，因子作者可点击【下架】按钮将因子下架，此时因子无法再进行发布分享。对于已下架的因子，作者有权将其从因子列表中删除。

2.2.4 因子库

因子库列表展示客户拥有使用权限的全部因子，包括个人创建已检测的因子、他人发布分享的因子、银河特色因子和平台公共因子。因子库中的因子可进行跟踪，通过点击【跟踪】按钮设置跟踪参数，并在跟踪列表中查看每天最新的因子跟踪数据。

跟踪参数设置

股票池

沪深300

组合构建

多空头组合

起始日期

2021-11-01

截止日期

2026-11-01

业绩基准

沪深300

分组数

5

因子方向

升序

因子周期

日频

调仓周期

1

日

取消

确认

2.2.5 发布审核

仅管理员权限的客户能查看发布审核列表，发布审核和撤销权限审核均在此列表进行。

发布审核

因子名称

作者

审核状态

请选择审核状态

查询

重置

刷新

<input type="checkbox"/>	因子名称	执行模式	编程语言	因子类别	因子作者	审核状态	操作范围	操作类型	操作对象	提	操作
<input type="checkbox"/>	gsxcal	离线	python	价量	gidtest	申请	个人	撤销	usertest1	20	审核
<input type="checkbox"/>	gsxcal	离线	python	价量	gidtest	申请	团队	分享	测试团队	20	审核
<input type="checkbox"/>	pe	离线	python		gidtest	申请	个人	分享	usertest2	20	审核
<input type="checkbox"/>	pe	离线	python		gidtest	申请	团队	分享	测试团队	20	审核
<input type="checkbox"/>	pe	离线	python		gidtest	申请	团队	分享	测试团队	20	审核
<input type="checkbox"/>	testfact2				gidtest	申请	团队	分享	测试团队	20	审核
<input type="checkbox"/>	testPe	离线	python		gidtest	申请	个人	分享	usertest1	20	审核
<input type="checkbox"/>	testPe	离线	python		gidtest	申请	个人	分享	usertest2	20	审核
<input type="checkbox"/>	成交量比率(volume_ratio)	离线	python		gidtest	申请	个人	分享	usertest2	20	审核

点击【审核】按钮，在弹出窗口填写审核结果和意见。

因子发布审核

审核通过

审核拒绝

审核意见

请输入审核意见

取消

确认

点击因子名称可查看因子详情与最近一次的检测结果。点击审核状态可查看该因子的审核流程。

审核记录				
审核流程				
操作时间	节点	操作对象	操作人	审核意见
2024-10-15 10:59:36.028	提交	测试团队	gidtest	-
2024-10-15 10:59:36.028	通过	测试团队	gidtest	通过

2.2.6 因子跟踪

因子跟踪列表展示用户设置的每天实时计算并推送最新结果的因子列表,方便用户长期跟踪因子表现,以确定因子的有效性。

因子名称

股票池 ☒ 沪深300 ☐ 中证500 ☐ 中证1000 ☐ 中证全指

组合构建 ☐ 纯多头组合 ☐ 多空组合

业绩基准 ☐ 沪深300 ☐ 中证500 ☐ 中证1000

分组数 ☐ 5组 ☐ 10组

调仓周期 ☐ 1日 ☐ 5日 ☐ 10日 ☐ 20日

因子方向 ☐ 降序 ☐ 升序

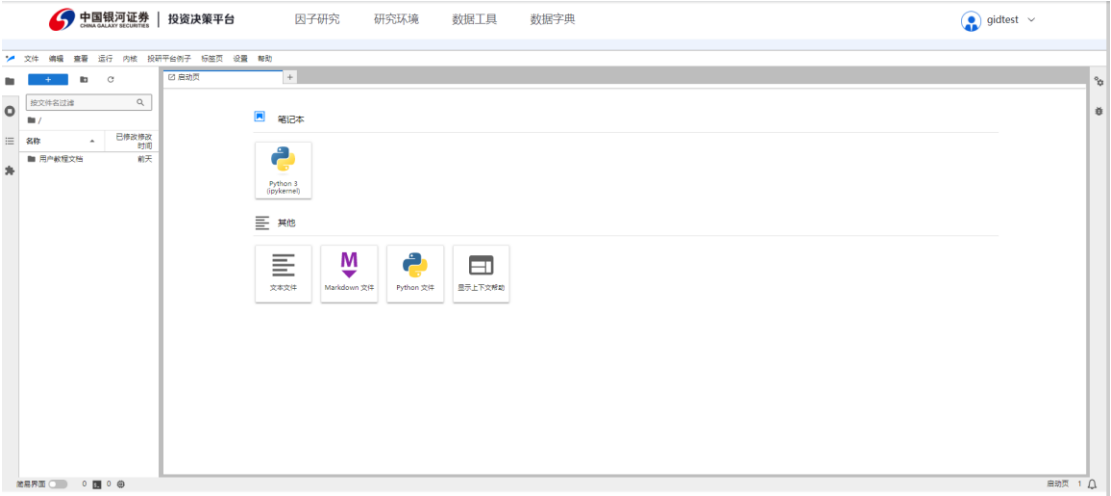
☐ 查询 ☐ 重置

批量删除

<input type="checkbox"/>	因子名称	作者	跟踪状态	运行状态	昨日收益	累计收益	近1周收益	近1月收益	近3月收益	操作
<input type="checkbox"/>	gidtest1	gidtest	运行中	未执行	-	-	-	-	-	<div>停止删除</div>

2.3 研究环境

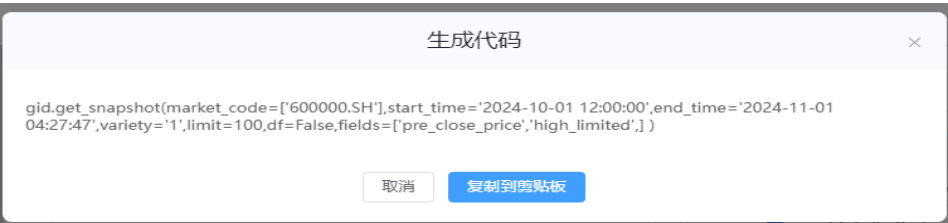
策略中心提供在线版的 Jupyter 研究环境,已预装获取数据和因子服务的 SDK 供客户使用。



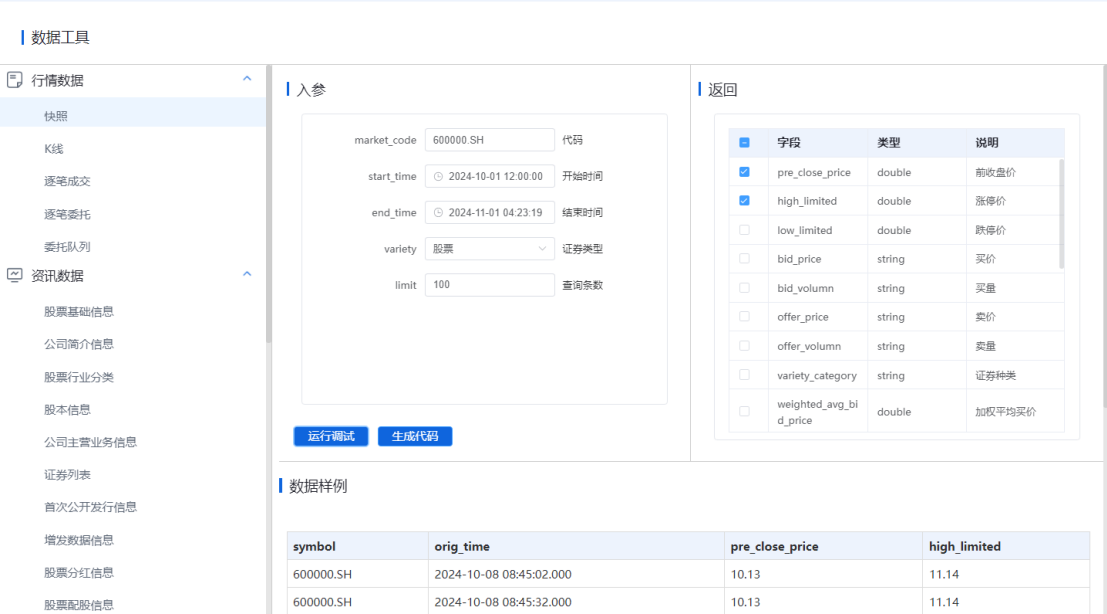
2.4 数据工具

数据工具是一个可视化的数据获取工具, 用户可通过界面输入数据参数和勾选返回内容的方式进行数据获取。

选择【生成代码】可动态生成可执行的 Python 语句, 可直接复制到 Python 环境中执行。



选择【运行调试】可直接获取并展示数据内容。



2.5 数据字典

数据字典页面展示每个数据接口所需的输入参数和说明、输入内容和说明、接口示例和数据样例, 供客户快速使用数据接口服务。

数据字典

行情数据

快照

K线

逐笔成交

逐笔委托

委托队列

资讯数据

股票基础信息

公司简介信息

股票行业分类

股本信息

公司主营业务信息

证券列表

首次公开发行信息

增发数据信息

股票分红信息

股票配股信息

快照

输入参数

名称	必选	描述
market_code	Y	标的名称,格式如['600000.SH', '600004.SH']
start_time	Y	查询开始时间, 格式如2024-01-01 09:30:00, 或者2024-01-01
end_time	Y	查询结束时间, 格式如2024-01-01 09:30:00, 或者2024-01-01
variety	Y	证券类型, 默认None, 表示全部, variety='stock' 表示返回股票类型
skip_suspended	N	是否跳过停牌, 默认True, 表示跳过停牌

输出参数

字段	类型	说明
total_offer_volumn	double	总卖出成交量
total_bid_volumn	double	总买入成交量
total_volumn_trade	double	总成交量
total_value_trade	double	总成交金额
last_price	double	最新价
num_trades	double	成交笔数

数据字典

行情数据

快照

K线

逐笔成交

逐笔委托

委托队列

资讯数据

股票基础信息

公司简介信息

股票行业分类

股本信息

公司主营业务信息

证券列表

首次公开发行信息

增发数据信息

股票分红信息

股票配股信息

market_code

string

证券代码

接口示例

```
data_code_msg = gid_get_snapshot(market_code=['000001.SZ'], start_time='2024-08-01 08:30:00', end_time='2024-08-02 08:30:00')
```

数据样例

pre_close_price	open_price	high_price	low_price	last_price	bid_price	bid_volume	offer_price	offer_volume	num_trades	total
10.27	10.25	10.32	10.17	10.26	[10.25, 10.24, 10.23, 10.22, 10.21, 10.2, 10.19, 10.18, 10.17, 10.16]	[287100, 351100, 370200, 336400, 274500, 578600, 212900, 678600, 788200, 536000]	[10.26, 10.27, 10.28, 10.29, 10.3, 10.31, 10.32, 10.33, 10.34, 10.35]	[6900, 303100, 620800, 289500, 619900, 889200, 1195300, 910800, 1346740, 1321100]	28352	5053
10.27	10.25	10.32	10.17	10.26	[10.25, 10.24, 10.23, 10.22, 10.21, 10.2, 10.19, 10.18, 10.17, 10.16]	[287100, 351100, 370200, 336400, 274500, 578600, 212900, 678600, 788200, 536000]	[10.26, 10.27, 10.28, 10.29, 10.3, 10.31, 10.32, 10.33, 10.34, 10.35]	[6900, 303100, 620800, 289500, 619900, 889200, 1195300, 910800, 1346740, 1321100]	28352	5053
					[10.25, 10.24, 10.23, 10.22, 10.21, 10.2, 10.19, 10.18, 10.17, 10.16]	[287100, 351100, 370200, 336400, 274500, 578600, 212900, 678600, 788200, 536000]	[10.26, 10.27, 10.28, 10.29, 10.3, 10.31, 10.32, 10.33, 10.34, 10.35]	[6900, 303100, 620800, 289500, 619900, 889200, 1195300, 910800, 1346740, 1321100]		