自定义指数

一、简介

易得程序化提供了强大的自定义指数功能,您可以指定成分股,创建出等权、等额、 流通盘权重等 13 种类型的指数。支持指数各种历史数据的刷新计算(包括日线、分钟 线、分时线等),还能在盘中根据实时行情实时计算出指数的最新价格走势,如同交易 所播出的指数一样。

自定义指数的历史数据计算依赖于所有成分股的历史数据,在计算时要保证成分股 历史数据的完整。指数盘中实时行情的计算需要成分股的全推行情,建议开通使用易得 全推行情服务。

易得自定义指数专业性高,具有计算结果精准、运算速度快、操作流畅、功能强大的特点,是易得程序化的核心功能之一,并由此衍生出自定义板块指数、选股指数、篮子指数、套利指数、发布指数等一系列指数服务体系。在后面的章节中都会为您逐个详细讲解,下面我们先来看看板块的自定义指数如何实现吧。

二、调出自定义指数

调出自定义指数有多种方法,常用的有三种:

1、通过主菜单"工具"-"自定义指数"。

т(<u>А)</u>	具(0) 交易(1)	策略(S) 版面	(P) 多显
据	板块自选股份	管理	板▼
	数据管理		涨跌
ЗR	画线管理		-0
R	标记管理		- C
R	高频扩展统计	十管理	C
P	自完义周期		C
	自定义指数		C
ЗR	数据下载		-C
ЗR	2.79	0.72%	C
3R	9.69	3.97%	C

2、在管理面板的板块树中通过选中板块的右键菜单"创建板块指数"快速创建该

板块的指数。

管理面板(单	击左边框开关)	×
常用		~
自选		
自选 吗	「単行」	
	新建自选	
自选	删除自选	
一自选	修改名称及属性	
□□□□	设为默认自选	
指数	从常用标签删除	
一上证	设为常用板块	
~深证 易得	添加品种	
板块	粘贴添加品种	
选股	清空品种	
「協子	导出文本	
	导入文本	
板坊	构建篮子	
> 行业	创建板块指数	
>地	按名称排序	-
> 系	查找	
シ 新た天		*
公式 板块		4 ۵

3、在动态显示牌中选中多个品种,通过右键菜单"新建自定义指数"快速创建选中品种作为成分股的板块指数。

2	688206	概伦电子 R	后语 (Back)	(-)	0.45	-0.65%
3	688798	艾为电子 R			1.55	-0.12%
4	605588	冠石科技	新建自定义指数		0.61	-0.18%
5	688728	格科微 R	新建套利指数		1.23	0.00%
6	688766	普冉股份 R	批重新建套利指数		1.09	-0.11%
7	301050	雷电微力 R	打开		1.52	-0.04%
8	688711	宏微科技 R	F10基本资料		1.93	0.02%
9	688107	安路科技 R	复制数据		0.67	.0.17%
10	688049	炬芯科技 R	外部资本	Ś	0.90	0.02%
11	688110	东芯股份 R			1.39	0.07%
12	000670	*ST盈方	当則贝加人常用标签	Incert		
10	002040	HEAL FRAME OF	加入新作用范围	insert	1 20	0.000/

三、自定义函数的设置

第	3	页
×1.+	_	~ •

〕 新	一般自定义指	数					– 🗆 X
指数(指数: 基准(基准)	代码 BK000 各称 指数B 日期 2017/ 指数 1000	03 K0003 1/1	 指数: ● 跟 ● 跟 ● 跟 ● 跟 ● 自 	交易时间段 随市场 5 随品种 (定义	H上海证券交易所 2 自定义时间段设置	~ 	刷新频率 1 秒一次 新股上市 31 天计指 价格小数位数 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2
指数	类型 等权		 	成分股 0块	3 家加品种 删除品种		 □ 停牌品种仍计入 □ 使用历史股本计算 □ 未计指时也计量 □ 使用原始价格计算
序 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12 13	代码 002049 002077 002079 002156 002156 002371 002409 003026 300046 300046 300053 300077 300139	名 紫大苏康通华北雅中台欧国晓称 黑妝团电微科华科科股特战科微份碍子电技创技技份 术技	权重 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024	权值 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	股本 - - - - - - - - - - - - - - - - - - -		 ■基期之前不显示 □上下景线 50 %调整 ✓上下景线跟随指定品种 SZ399107 □计指满足公式 □计指满足公式
14 15 16 17 18 19 20 21 22 22	300133 300223 300327 300373 300456 300458 300458 3006493 300604 300613 300623	K+T = 100 mm m	2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024 2.439024	1 1 1 1 1 1 1 1 1			

在调出自定义指数的主界面后,我们可以看到易得自定义指数含有丰富的设计选项。

1、基础设置区

指数代码: 板块指数必须以 BK 打头的 6 位长度代码组成。

- 指数名称:设置指数名称。
- 基准日期:设定指数的基准日期。

基准指数:设定指数在基准日期的收盘价。如果基准日期休市,设定为基准日 上一个交易日的收盘价。

指数类型: 设定等权、等额、流通值等 13 种指数类型, 在下一节详细介绍。

2、交易时间段设置区

可以设定指数的**交易时间段**,比如沪深A股的交易时间段是上午9:30-11:30,下午13:00-15:00。指数将根据交易时间段生成对应时间的分时线和分钟线数据。

跟随市场:是指该指数的交易时间段跟选择的市场的交易时间段一样。一般成分股全为沪深A股的,选择跟随上交所市场即可。

跟随品种:是指该指数的交易时间段跟选择的品种的交易时间段一样。比如期货AG 白银的交易时间段为:21:00-02:30、9:00-10:15、10:30-11:30、13:30-15:00。 自定义时间段:见下图您可以自定义该指数的交易时间段。

开始	结束	开盘集合竞价分钟数: 15	
09:00	11:00		
4:00	16:00	交易时间段	
		开始结束	
		9:00:00 🗘 11:00:00	:
		增加修改删除	
		上移下移	
		确定取消	

3、指数成分股设置区

您可以设定某一个板块作为指数的成分股,也可以通过"添加品种"自由设置 成分股。

4、选项设置区

刷新频率:是指该指数在盘中实时行情刷新的频率,单位为秒,也可以设定为小数。比如每 0.5 秒刷新一次。

新股上市 N 天计指:是指新股上市多少天以后才开始计入指数。

价格小数位数: 设定指数的价格精度。

盘中实时刷新:是否需要在盘中实时计算刷新指数。

停牌品种仍计入:是否将当日停牌品种计入当日指数计算。

使用历史股本计算:在计算自流值、流通值、A市值3种类型指数的历史数据时,使用对应历史时间的流通盘数据计算。否则使用最新的流通盘数据计算。

未计指时也计量:比如停牌品种不计入指数计算时,是否将该品种停牌前最近时间的成交量和成交额计入指数的成交量和成交额。

使用原始价格计算:指数历史数据默认使用成分股**前复权**数据进行计算,如果 勾选该选项将使用未除权数据计算。 基期之前不显示:勾选了该选项后,将不计算在基准日期之前的历史数据。

上下影线调整百分比: 计算指数历史数据时,将K线的上下影线按百分比的比例缩短,减少因历史K线最高最低价带来的上下影线数据失真。

上下影线跟随指定品种:指定一个品种代码,在计算指数历史数据时,将指数的上下影线按指定品种代码的对应历史时间的 K 线上下影线同比例计算。另一个减少上下影线数据失真的办法。

计指满足公式: 跟上面的新股上市 N 天计指类似。这里是指成分股满足指定公式表达式条件方开始计入指数计算。例如需要成分股满足上市 10 天并且非一字涨停方才计指的写法: barpos>=10 and h <> l;

计算公式,仅限日线数据周期 选择函数 选择公式	测试	确定
		取消

5、成分股列表区

列出所有成分股以及相关权重数据。

- 权重:是指各个成分股在指数中所占的权重值。
- 权值:是指各个成分股在指数中参与权重计算的实际值。
- 股本:是指各个成分股的股本。仅在股本类指数类型有效。

例如:在自流值类型的指数中,各成分股的股本是指流通盘;在总市值类型指数中,股本是总股本。权值等于其股本*最新价。权重等于各成分股的权值除以所 有成分股权值的总和。

四、自定义函数的类型

1. 等权

每只成分股的权重相等,按涨幅的几何平均数计算。

2. 等额

每只成分股的权重相等,按涨幅的算术平均数计算。

3. 等量

设定每只成分股的股本相等,按价格之和的涨幅计算。也可以理解为每只成 分股等数量买入,价格越高权重也就越高。 4. 自流值

以每只成分股的流通盘作为权重,按加权价格之和的涨幅计算。

5. 流通值

同上,以每只成分股的流通盘作为权重,按加权价格之和的涨幅计算。

6. A 市值

同上,以每只成分股的流通盘作为权重,按加权价格之和的涨幅计算。

7. 总市值

以每只成分股的总股本作为权重,按加权价格之和的涨幅计算。

8. 量指

以每只成分股的成交量作为权重,按加权价格之和与权重之和的比值计算。

9. 仓指

以每只成分股的持仓量作为权重,按加权价格之和与权重之和的比值计算。 适合于期货品种。

10. 额指

以每只成分股的成交额作为权重,按加权价格之和与权重之和的比值计算。

- 基期额指
 以每只成分股基期的成交额作为权重,按加权价格之和与基期加权价格之和
 的比值计算。
- 12. 基期等额 每只成分股的权重相等,按与基期价格涨幅的算术平均数计算。
- 13. 自定义

以每只成分股的自定义股本指计算的权重,按加权价格之和的涨幅计算。

五、自定义函数的数据刷新

创建好板块指数后,在动态显示牌的"指数"栏目中选中"板块指数"分类,即可 列出所有的自定义板块指数列表。

Ale	基码	出行情	扩展行情 🛛	介段统计 指标统计	│ 模板 ▼					
常用	•		代码	名称	最近	涨幅	涨跌	量比	涨速	ł
	Œ	9 1	BK0001	指数BK0001	1411 51	1 34%	18	68 1.17	-0.02%	
自进	Œ	2	BK0002	指数BK00	后退 (Back)		>	57 0.95	-0.01%	
125	Œ	3	BKEEEE	指数BK0	刷新自定义指数	:	1	所选历史日线·	+当日分时	
沪深/坦					新建自定义指数 修改指数定义 删除自定义指数	[所选历史日线 所选当日分时 所选历史1分钟	哦	
11数/ 15					新建套利指数 批量新建套利指	数		所选历史5分钟 所选所有周期	残	
仮块 / 期货 / 基<					打开 F10基本资料 复制数据 外部资讯 标记证券		>	全部历史日线- 全部历史日线 全部当日分时 全部历史1分钟 全部历史5分钟	+当日分时 哦 哦	
金 债券					从常用标签删除 加入默认自选股 加入默认板块 加入自选股板块	当前页面 : 	Insert	王即所有周期		
		()) (表头恢复默认 表头栏目设置	Refer = 7 Le shal			11	
		L证指数	()涂证指数)	易得指数 ▲ 板块	指到 选股指数	「监子指数」	- 套利指数 2	友仲指数 👘		

选中一只自定义指数后,打开右键菜单。"刷新自定义指数"菜单下包含刷新各种 历史数据类型的菜单按钮。

注意,历史数据计算依赖于各成分股的历史数据,请保证本地数据的完整性,如果 数据不全请提前通过"数据下载"功能补全数据。

在右键菜单中,我们还可以通过"修改指数定义"菜单按钮对指数的设置进行修改。 通过"删除自定指数"菜单按钮可以删除该自定义指数。

数据刷新后,即可在分析图形中看到该自定义指数的各种类型数据,如同普通个股 一样操作。



六、板块指数盘中自动实时刷新

只要您在板块指数的设置中勾选了"盘中实时刷新"选项,在盘中就会自动按照设

定的刷新频率进行实时指数计算。

如果您修改了指数的成分股或者指数配置,盘中实时刷新都会为您重新加载新配置。 注意,盘中实时刷新需要有全部成分股的全推行情数据,否则数据缺失将会影响指 数计算结果。

七、批量创建板块指数

通过管理面板的板块树,在自选或者板块的分组节点打开右键菜单,通过"批量创 建板块指数"按钮,我们可以快速地批量创建该分组下所有的自选或者板块的自定义指 数。



打开批量新建自定义指数,我们看到列表中列出该分组下所有的板块和对应的指数。 您可以通过起始代码设置这些指数的开始代码,并按递增的方式展开。

这里的各种选项设置会应用于批量创建的所有指数。

易得程序化交易系统 V3.0 www.ydmf.net

) 批	量新建自定	义指数				- 🗆 X	
記始(七码 ВКООС	13 - 指数交易		(0003 指数交易时间段			刷新频率 1 秒一次
指数	S称 指数B	K0007)跟随市场	SH 上海证券交易所	~	新股上市 31 天计指	
基准日	日期 2017/	1/1)跟随品种)白 空 ♡	白中公时间段语罢			
基准排	旨数 1000			日准入时间收收量		□ 盔甲头时刷新 □ 停牌品种仍计入	
指数线	类型 等权	~				 □ 使用历史股本计算 □ 未计指时也计量 □ 使用原始价格计算 	
序	代码	名称			^	□基期之前不显示	
1	BK0003	W2般零售[白]				□上下影线 50 %调整	
2	BK0004	W2专业工程[自]				✓ 上下緊結跟随指完品种	
3	BK0005	W2专业零售[自]				57300107	
4	BK0006	W2专用设备[自]				52555107	
5	BK0007	W2中药II[自]				□ 计指满足公式	
6	BK0008	W2互联网传媒[自]					
7	BK0009	W2仪器仪表II[自]					
8	BK0010	W2保险II[自]					
9	BK0011	W2元件II[自]					
10	BK0012	W2光学光电子[自]					
11	BK0013	W2公交II[自]				设大理的人	
12	BK0014	W2其他交运设备II[自]				EX.Z Data WY	
13	BK0015	W2其他休闲服务II[自]					
14	BK0016	W2其他建材II[自]					
15	BK0017	W2其他电子II[自]					
16	BK0018	W2其他轻工制造II[自]				冊郞余	
1/	BK0019	W2其他采掘町自」					
18	BK0020	WZ农业综合业目				74-5-	
19	BK0021	W2农产品加工L自」				铺定	
20	BK0022	WZz加物保健LL目					
21	BK0023	WZ包装印刷II[目]				取消	
22	BK0024	WZ化字制品[目]			~		