



红塔证券
HONGTA SECURITIES

红塔证券时空量化专业交易系统

用户手册

二零一九年十月

目录

1. 资讯动态	- 1 -
1.1. 资讯动态.....	- 1 -
1.1.1. 策略库.....	- 1 -
1.1.2. 产品概览.....	- 1 -
1.1.3. AI T+0 券单.....	- 2 -
1.1.4. 主要指数.....	- 2 -
1.1.5. 告警.....	- 3 -
1.1.6. TODO	- 4 -
2. 实盘交易	- 6 -
2.1. 产品.....	- 6 -
2.1.1. 产品列表.....	- 6 -
2.1.2. 产品详情.....	- 6 -
2.1.3. 组合列表（解券锁券）.....	- 9 -
2.1.4. 组合列表（期权盯市）.....	- 12 -
2.2. 交易.....	- 13 -
2.2.1. 股票交易-普通交易.....	- 13 -
2.2.2. 股票交易-算法交易.....	- 14 -
2.2.3. 融资融券.....	- 17 -
2.2.4. 期货交易-普通交易.....	- 17 -
2.2.5. 期货交易-算法交易.....	- 18 -
2.2.6. 期权交易.....	- 18 -
2.2.7. 组合交易-普通交易.....	- 19 -
2.2.8. 组合交易-算法交易.....	- 20 -
2.3. 策略.....	- 23 -
2.3.1. 概览.....	- 25 -
2.3.2. 策略监控.....	- 25 -
2.3.3. 统计套利.....	- 26 -
2.3.4. 投资组合.....	- 27 -
2.3.5. 仓位.....	- 27 -
2.3.6. 组合列表.....	- 28 -
2.3.7. 订单状态.....	- 28 -
2.3.8. 完结订单.....	- 28 -
2.3.9. 收益.....	- 29 -
2.3.10. 行情.....	- 29 -
2.3.11. 日志.....	- 30 -
2.4. 风控.....	- 31 -
3. 模拟交易	- 32 -
3.1. 产品.....	- 32 -
3.2. 交易.....	- 32 -
3.3. 策略.....	- 32 -
3.4. 回测.....	- 33 -
3.5. 回测报表.....	- 33 -
3.5.1. 概览.....	- 33 -

3.5.2 功能介绍.....	- 34 -
3.5.3 其他说明.....	- 35 -
4. 智能预测.....	- 36 -
4.1. 风险因子收益.....	- 36 -
4.2. 风险因子分析.....	- 37 -
5. 行情分析.....	- 38 -
5.1. 价差分析.....	- 38 -
5.2. ALPHA&基差.....	- 40 -
5.3. 集中行情.....	- 41 -
6. 篮子管理.....	- 42 -
6.1. 篮子管理.....	- 42 -
7. 报表管理.....	- 45 -
8. 证券信息.....	- 46 -
8.1. 证券信息.....	- 46 -
8.1.1. 概览.....	- 46 -
8.1.2. 公司信息.....	- 47 -
8.1.3. K线图.....	- 47 -
8.1.4. 市场信息.....	- 48 -
8.1.5. 关键指标.....	- 48 -
8.1.6. 合约简介.....	- 48 -
8.1.7. 标准合约.....	- 48 -
9. 个人中心.....	- 49 -
10. 设置.....	- 50 -
11. 日志.....	- 51 -
12. 退出.....	- 52 -

1. 资讯动态

成功登录红塔证券时空量化专业交易系统（下面统称为“系统”）后，可看到首页展示界面。首页模块共有七个部分，分别是：策略库、产品概览、AI T+0 券单、主要指数、告警、TODO。

1.1. 资讯动态

1.1.1. 策略库

策略库包括“TWAP、篮子交易、统计套利、期权套利、做市交易、跨期套利、大宗交易和手工交易”八大策略。选择要使用的策略，选中后右击“启动”，策略模块呈现蓝色则启动成功，点击模块即可进入策略交易监控界面。



注：可右击启动和停止。

1.1.2. 产品概览

账户下的产品均可在“产品概览”模块下查看有关产品“当日盈亏、浮动盈亏、敞口比例、风险度”的情况。



注：图中数据不代表真实数据。

1.1.3. AI T+0 券单

该模块展示 AI T+0 高收益券单，是 alpha 团队根据 AI T+0 策略进行回测，并把高收益的券单按回测年化收益率以降序的方式展示近 2000 只股票。用户只需输入要做 T+0 交易的证券代码，回车后选中并点击【前往建策略】，即可跳转至模拟交易模块创建 AI T+0 策略。

AI T+0券单					
证券代码搜索			前往建策略		
#	证券代码	证券名称	市值	回测年化收益率 ▾	日平均交易次数
1	601113	华鼎股份	7,625,093,567.64	135.42%	6
2	603861	白云电器	4,026,702,073.68	89.28%	2
3	300695	兆丰股份	3,249,204,321.00	87.52%	1
4	000687	华讯方舟	5,800,129,170.34	85.81%	15
5	000400	许继电气	7,824,619,917.84	70.54%	1
6	600116	三峡水利	6,643,206,808.38	64.78%	1
7	002187	广百股份	2,688,017,158.80	61.82%	1
8	600182	S 佳通	5,463,800,000.00	57.16%	1
9	002108	沧州明珠	4,863,480,002.57	55.55%	2
10	002691	冀凯股份	2,091,000,000.00	54.53%	16
11	000757	浩物股份	2,638,527,130.28	51.94%	2
12	002756	永兴特钢	4,701,600,000.00	50.77%	4
13	300700	岱勒新材	2,041,872,000.00	48.01%	76
14	002485	希努尔	3,661,120,000.00	47.32%	2
15	603488	展鹏科技	1,625,560,980.00	46.63%	6
16	002620	瑞和股份	2,055,960,900.00	44.61%	2
17	000719	中原传媒	6,875,929,193.28	44.38%	1

注意：只有当底仓中要做 T+0 交易的股票在券单中才可以进行 AI T+0 交易的操作。

1.1.4. 主要指数

该模块展示上证指数、深证指数以及中证 500 等七个指数的现价、涨跌价、涨跌幅、成交量和成交金额，数据根据行情实时更新。双击某一指数，进入该指数的分时图。



注：主要指数的数据接实时行情，随行情的变化而变化，当没有行情时，请求历史数据。非交易时间内展示当前最后一条数据。

1.1.5. 告警

告警模块用以展示策略使用中存在的错误而弹出的警告，对告警的内容和处理的现状及时间都有显示。当告警信息改变的时候通过推送回来的数据进行实时更改。

告警 严重成度：一般、警告、严重、致命 只显示未处理和正在处理中的告警信息

来源	内容	严重程度	状态	时间
3	33	致命	未处理	15:44:11
1	交拉链拉里啦啦啦啦啦啦啦啦里...	一般	未处理	15:40:57
1	行情处理有问题	警告	处理中	2018-01-22
1	拉拉链拉里啦啦	一般	未处理	2018-01-22

告警消息 ID，具体对应关系由后台定

按时间由近及远排列
当天的告警显示成 hh:mm:ss
非当天的展示成 yyyy-mm-dd 的形式

注：图中数据不代表真实数据。

1.1.6. TODO

TODO 模块的实质性功能是创建计划，用户可根据需要在该模块下创建事件，模块支持对计划的修改和删除。

TODO 输入事件内容 点击添加按钮或者键盘回车完成添加

事件5 添加

红色表示未完成且已过期（过期仍可继续完成）

TODO内容	计划完成时间	操作
<input type="checkbox"/> 事件1	2018-04-05	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input checked="" type="checkbox"/> 事件2	2018-04-26	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/> 事件3	2018-04-26	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/> 事件4	2018-04-26	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/> 事件5	2018-04-26	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>

灰色表示已完成

点击勾选标记完成，并且在当日之后不再显示

点击修改时间内容或时间

点击删除



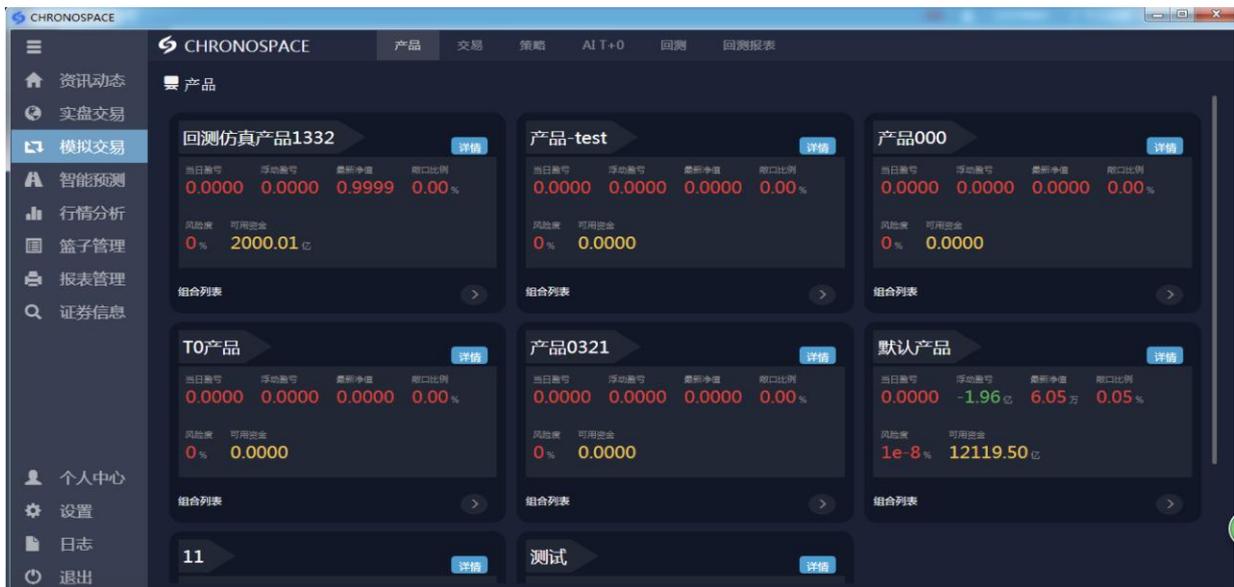
- (1) 分为输入部分和列表部分。可以对列表进行增、删、改。
- (2) 颜色展示：已完成（包括已过期和未过期）展示灰色；未完成（未过期展示白色，已过期展示红色）。

2. 实盘交易

2.1. 产品

2.1.1. 产品列表

模块用于展示账户下所有产品的相关信息，可对产品情况进行概览。主要内容包括产品名称、当日盈亏、浮动盈亏、最新净值、敞口比例、风险度、可用资金、组合列表及其相关操作。



2.1.2. 产品详情

界面布局支持自定义操作，可通过拖拽重新布局并在关闭界面后保存，也可重置为默认布局。



产品详情包含九个板块：资金账户、仓位、订单状态、完结订单、资金、交易账户、

bookview 交易、净值曲线、日志。各个板块概览如下：

资金账户：

资金账户ID	账户类型	币种	资金余额	交易可用金额	总保证金	买保证金	卖保证金	总手续费	持仓盈亏	平仓盈亏
1000003	普通股票账户	人民币	9,990,381,956,361.62	9,990,381,956,361.62	0	0	0	0	0	0
1000004	期货账户	人民币	9,999,987,986,906.48	9,999,987,986,906.48	0	0	0	0	-7,068,537.8355	0

完结订单：

订单ID	UKEY	证券代码	证券名称	委托价格	委托量	委托时间	买/卖	订单状态	成交价格	成交量	成交时间	订单类型
1516774359	1114243	000525.SZ	红太阳	236400	100	14:10:48:973	买	全部成交	23630000	100	14:10:48:973	普通订单
1516774480	1114114	000002.SZ	万科A	411200	100	14:13:34:758	买	全部成交	41120000	100	14:13:34:758	普通订单
1516774413	1114124	000012.SZ	南玻A	90500	100	14:11:42:640	买	全部成交	90500000	100	14:11:42:640	普通订单
1516774483	1114114	000002.SZ	万科A	410600	100	14:18:17:564	买	全部成交	41030000	100	14:18:17:564	普通订单

仓位：

UKEY	证券代码	持仓量	可卖量	在途量	持仓成本	今开仓量	类型
1114678	002059.SZ	10000	10000	0	75,231	0	多仓
1114520	000877.SZ	10000	10000	0	116,800	0	多仓
1114566	000931.SZ	10000	10000	0	69,700	0	多仓
1114241	000523.SZ	5000	5000	0	41,050	0	多仓
1114193	000403.SZ	6700	6700	0	210,331	0	多仓

资金：

资金			
资金余额：	交易可用金额：	交易冻结金额：	外部资产总价值：
融资负债：	融券负债：	可用融资余额：	费用：
平仓盈亏：	持仓浮盈：	盯市平仓盈亏：	盯市浮盈：
股票市值：	期货总市值：	股票账户可用资金：	期货账户可用资金：
总保证金：	买保证金：	卖保证金：	
股指期货总合约价值：	商品期货总合约价值：	股票及股指期货总敞口：	商品期货合约轧差：

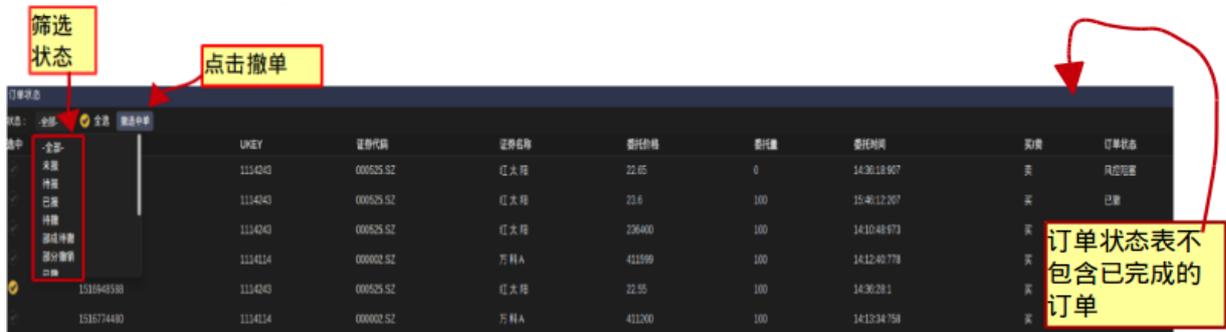
交易账户：

资金账户名称	市场ID	对冲标志	交易编码	交易账户名称	币种	通道id	创建者	创建时间	状态
周燕妮-股票账户	1	投机	123456	周燕妮-股票-深圳	人民币	5	19999	2017-12-07	不可用
周燕妮-股票账户	2	投机	123456	周燕妮-股票-上海	人民币	5	19999	2017-12-07	不可用
周燕妮-期货账户	4	投机	123456	周燕妮-期货-上期所	人民币	5	19999	2017-12-11	不可用
周燕妮-期货账户	3	投机	123456	周燕妮-期货-中期所	人民币	5	19999	2017-12-11	不可用
周燕妮-期货账户	5	投机	123456	周燕妮-期货-郑商所	人民币	5	19999	2017-12-11	不可用

日志（展示当前页面的错误日志）：

#	时间	内容
1	17:37:09.608	订单ID = 1519897029,消息 = 订单(账户)信息补全失败!

订单状态板块有筛选功能，通过选中不同的状态订单，筛出符合条件的数据；撤单功能，通过选中相应的订单点击撤单。



净值展示当前产品的净值，并随推送回来的值的变化而变化，属于一个动态更新的数据。



bookview 行情交易页面不仅具有行情展示的功能，且可在该页面进行产品下单：

挂买量	价格	挂卖量
	22.7400	300
	22.7300	800
	22.7200	4000
	22.7200	1400
	22.7200	1600
	22.6800	2400
	22.6700	5900
	22.6600	900
	22.6500	30400
	22.6400	1500
21099	22.6200	
800	22.6100	
77800	22.6000	
34900	22.5800	
	22.5700	
	22.5600	
12500	22.5500	
2800	22.5300	

产品下单是直接下在交易账户上。通过双击 bookview 第一列和第二列的下 10 行是买交易；双击第三列和第二列的上 10 条进行卖交易。关闭页面保存输入发证券代码，在下次进入页面的时候证券代码输入框展示上次输入的代码值。

下单操作（以买单为例）：

（1）输入相应的证券代码。展示行情，如下图：

行情		
证券代码: 000001.SZ		
时间戳: 2018/01/23 11:05:12		
挂买量	价格	挂卖量
	14.8100	33893
	14.8000	131526
17500	14.7900	
50800	14.7800	
220000	14.7700	
216600	14.7600	

（2）双击 bookview 的左侧“L”型区域，出现交易界面，用户可选择相应的资金账户、交易方向，然后点击提交进行下单。

持仓量
可卖量

交易量
✕

账户: 1000003

方向: 买

证券名称: 平安银行

UKEY: 1114113

价格: 14.7700

数量:

关闭
提交

注：股票的买卖量必须为整数。若交易失败，在 log 板块会出现错误日志。

2.1.3. 组合列表（解券锁券）

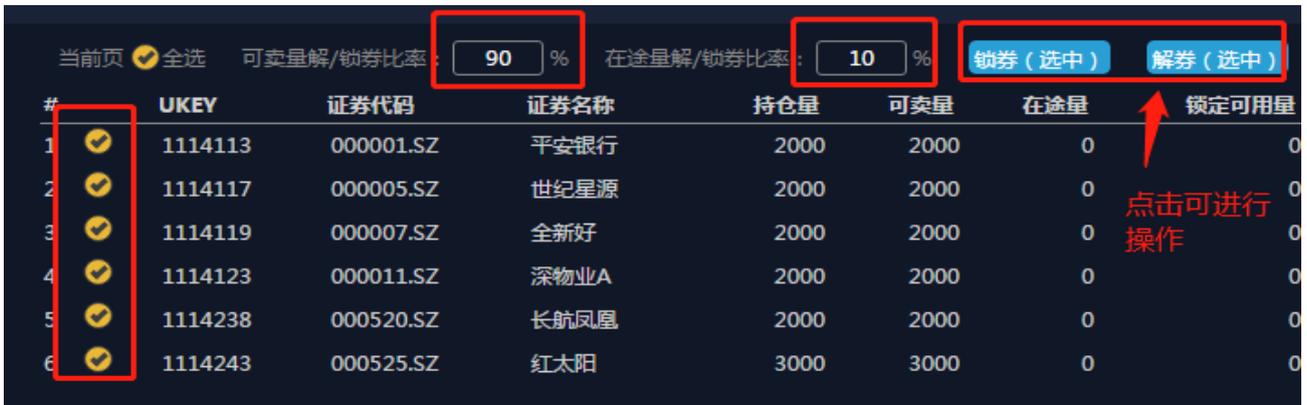
点击其中一个组合的解券锁券按钮，界面如下：



- (1) 该窗口可进行拖动, 窗口大小的可改变, 按 Esc 可关闭;
- (2) 点击页面下方的分页按钮可进行分页或跳转操作;
- (3) 该模块包含的功能有:
 - ① 解、锁单条持仓;



② 批量解、锁多条持仓；



③ 解、锁当前组合下的所有持仓。



(4) 解/锁单条持仓的操作：

- ① 点击单条的最后面的操作按钮（解/锁券）
- ② 弹出对话框，可在对话框输入要解/锁的可用/在途数量
- ③ 然后点击确定进行解/锁券，或者点击取消，取消操作。
- ④ 输入不合规数字时有错误弹窗提示。

(5) 批量解/锁多条持仓的操作：

- ① 点击当前页全选按钮，可将当前页的所有仓位都选中，点击其中某条持仓最前面的选框，可对总的选框进行反选；
- ② 然后输入要锁的每条持仓的可卖量/在途量的百分比；
- ③ 点击【锁券（选中）】【解券（选中）】按钮进行批量的解/锁券；
- ④ 当未选中任何持仓或者是输入的百分比不合规时，有错误弹框提示。

(6) 解/锁组合下所有持仓的操作：

- ① 输入要锁的每条持仓的可卖量/在途量的百分比；
- ② 点击【锁券（全部）】【解券（全部）】按钮进行解/锁改组合下的所有持仓；
- ③ 当输入的百分比不合规时，有错误弹框提示。

2.1.4. 组合列表（期权盯市）

期权持仓主要包含了 Delta、Gamma、Vega、Theta 等期权信息。其中客户盯市盈亏的背景色预警是黄色，强平是红色。

点击其中一个组合的期权持仓按钮，界面如下：



股票持仓和期权持仓的汇总信息

证券代码	证券名称	Delta	Gamma	Vega	Theta			
000001.SZ	平安银行	15411.7607	55030.3149	1375.7428	-434.7454			
持仓类型		持仓量	最新价					
股票持仓		2000.00	10.0000					
持仓类型		Delta	Gamma	Vega	Theta	持仓量	最新价	客户盯市盈亏
期权持仓		15770.0007	54846.2336	1356.8808	-419.7804	1000000.040	10.0000	0
期权持仓		-2358.2400	184.0813	18.8620	-14.9650	3000.000	10.0000	-21000
000005.SZ	世纪星源	-8486.0800	1714.2834	17.1695	0.0000			
持仓类型		持仓量	最新价					
股票持仓		2000.00	3.2000					
持仓类型		Delta	Gamma	Vega	Theta	持仓量	最新价	客户盯市盈亏
期权持仓		-10486.0800	1714.2834	17.1695	0.0000	12000.000	3.2000	9600.00
000007.SZ	全新好	-1758970.00...	91557.0155	34667.4211	-46985.2480			
持仓类型		持仓量	最新价					
股票持仓		2000.00	13.7500					
持仓类型		Delta	Gamma	Vega	Theta	持仓量	最新价	客户盯市盈亏
期权持仓		-1760970.00...	91557.0155	34667.4211	-46985.2480	3000000.000	13.7500	-44550000

点击第一列证券代码可以展开/收缩该标的的股票持仓和期权持仓

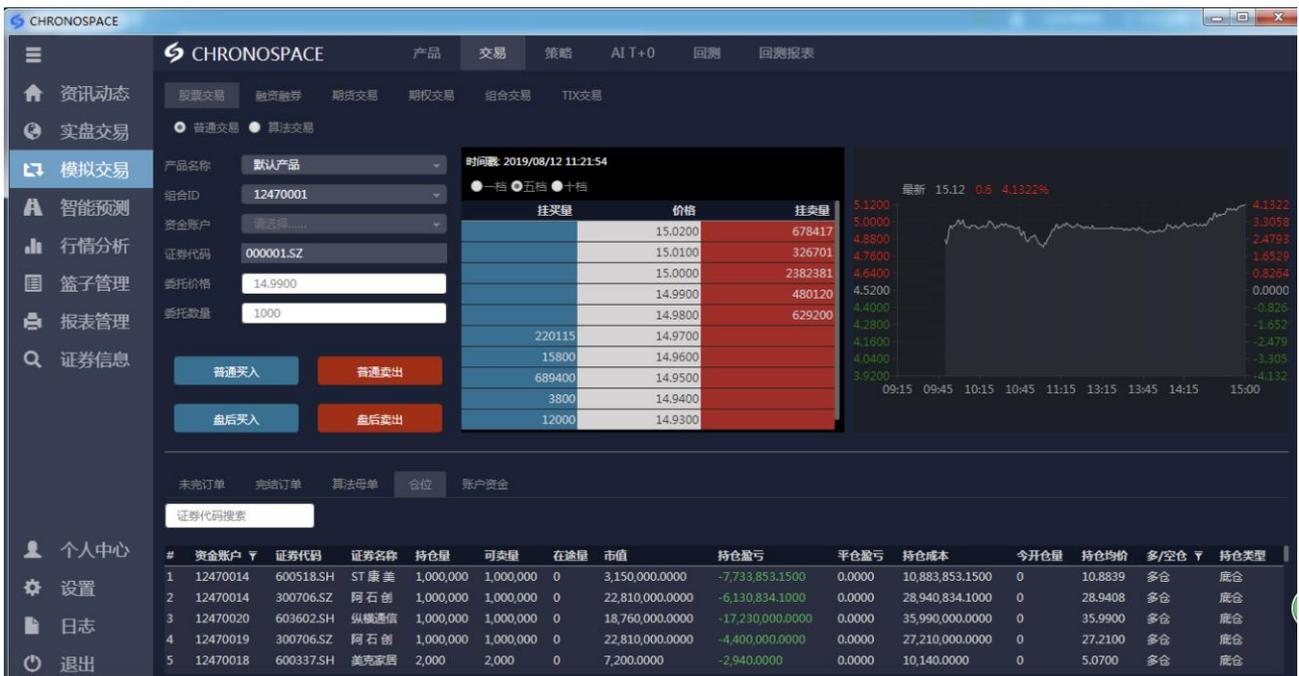
第 1 页 共 1 页 跳转到第 页

- (1) 该窗口可进行拖动，窗口大小可改变，按 Esc 可关闭；期权盯市有行向滚动条可拉动。
- (2) 点击页面下方的分页按钮，可进行分页、跳转的操作。
- (3) 以标的进行分类，其中每个标的的汇总信息是由股票持仓和期权持仓组成。
- (4) 股票持仓展示了仓位类型、持仓量、最新价的信息。

2.2. 交易

在交易板块，主要分普通交易和算法交易两大类。算法交易中算法类型包括“G-TWAP、G-VWAP、G-Percent、G-PxInline、G-Sniper、G-DMA”六种。

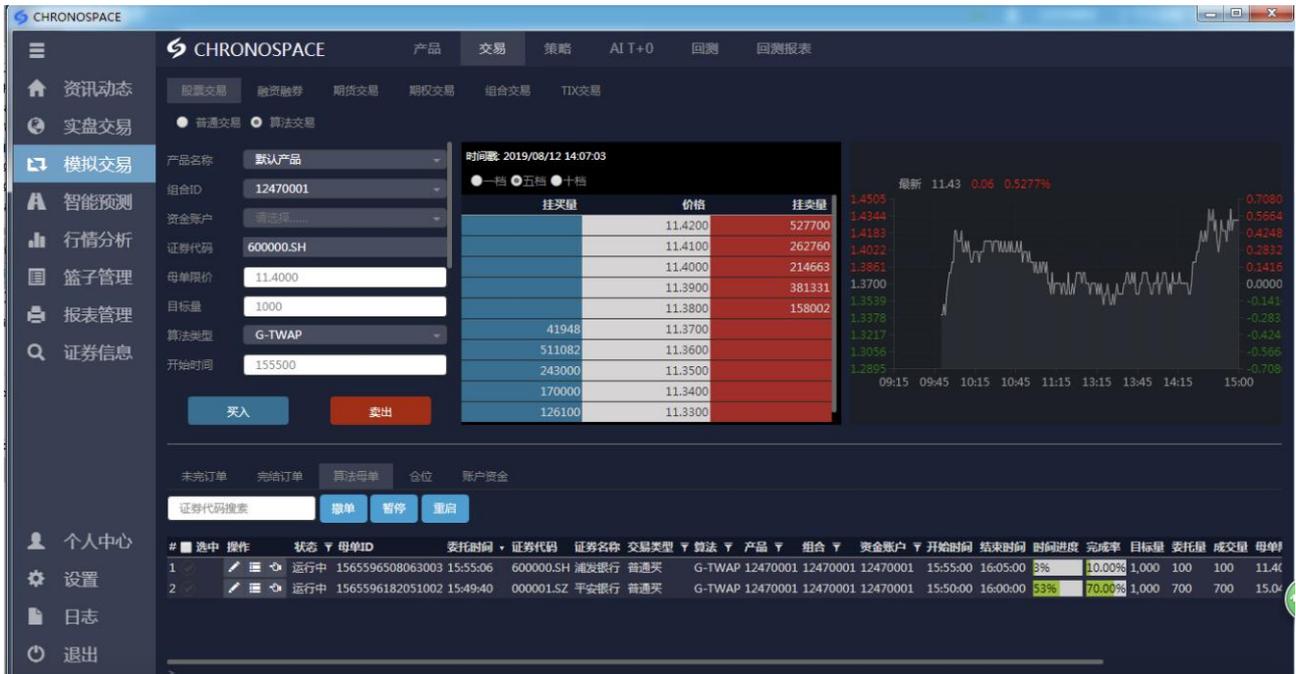
2.2.1. 股票交易-普通交易



股票普通交易具体操作步骤如下：

- (1) 选择产品名称，过滤出该产品下的组合和资金账户
- (2) 组合 ID、资金账户只需选其一即可下单，如都选择了将通过该组合下的该资金账户下单
- (3) 输入证券代码，右侧展示该只股票的档位行情和分时图，可双击档位价格将该价格自动填充至 [委托价格] 输入框
- (4) 输入委托数量
- (5) 买入、卖出的未完结订单展示在 [未完结订单]，已完结订单展示在 [已完结订单]
- (6) 未完结订单支持批量勾选撤单
- (7) 订单列表支持证券代码模糊搜索，可勾选展示策略订单
- (8) 支持主板市场证券和科创板股票买卖，其中盘后买入和盘后卖出为科创板盘后固定价格买卖

2.2.2. 股票交易-算法交易



股票算法交易具体步骤如下：

(1) 输入母单限价、目标量，选择算法类型：G-TWAP、G-VWAP、G-Percent、G-PxInline、G-Sniper、G-DMA

- G-TWAP：时间加权平均算法，在指定的时间间隔内，按照时间平均下单的算法。旨在使市场影响最小化的同时提供一个平均执行价格
- G-VWAP：成交量加权平均价格算法，在指定的时间间隔内，结合历史交易量分布及当天交易情况进行下单的算法。旨在使市场影响最小化的同时提供一个接近市场按成交量加权的均价
- G-Percent：交易量百分比算法，按照固定百分比进行下单的算法。交易期间，若市场交易量放大则放大这段时间内的下单成交量，反之降低下单的成交量
- G-PxInline：价格跟踪算法，当市场价格相对于参考价格处于有利时，放大这段时间内的下单成交量，当市场价格不利时，降低这段时间内的下单的成交量
- G-Sniper：盘口捕捉算法，在市场价格进入期望价格内时，即时捕捉市场上出现的流动性
- G-DMA：快速执行算法，尽可能快速成交的同时降低市场价格的冲击

(2) 输入算法的[开始时间]、[执行时间]、[结束时间]，只需输入其中两个，即可自动算出另一个值。

注意：开始时间不能早于当前时间超过 10 分钟

(3) 交易风格当前共有五类：保守，较保守，正常，较激进，激进。其中保守、较保守、正常的单子会主动进行挂单，激进、较激进主要是打单，不会主动挂单

(4) 市场占比：市场占比表示策略成交占市场成交的百分比，对于 G-Percent 策略，此参数是目标值，对于其他策略，该参数是最大值。非必填，不填代表不限制

(5) 相对限价：对手方最优/本方最优/昨盘价/最新价/到达价格/市场成交均价。

注意：如输入相对限价则必须要选择[浮动类型]以及输入[浮动值]

- (6) 浮动类型包括：价格最小变动单位、基点（万分之一）、元。选择[元]时，可输入小数，其他为整数
- (7) 相对限价是母单限价外提供的实时限价方式，可通过基准价（对手放最优/本方最优/昨收盘/最新价/到达价格/市场成交均价）、浮动类型和浮动值计算控制每笔算法子单的委托报价上限。对于买单：相对限价=基准价 + 浮动类型 * 浮动值；对于卖单：相对限价=基准价 - 浮动类型 * 浮动值
- (8) 股票交易-算法交易产生的算法订单展示在[算法母单]。其中，完成率=成交量/目标量；市场参与率：成交量占市场成交量的比例
- (9) 算法母单状态包括：运行中、已完成、已撤销、待取消、已拒绝、已暂停、待处理、已过期、待更新

状态	释义
运行中	母单正在拆单交易中
已暂停	母单暂停拆单，可重启将母单变为运行中
已撤销	母单已被撤销
待取消	进行撤销操作后还未撤销成功时
已拒绝	如证券停牌、开始时间晚于收盘时间，开始时间早于当前时间超过 10 分钟等
待处理	下单未收到消息回报时
待更新	调整算法参数还未生效时
已过期	母单设置的结束时间已小于现在时间，该母单将过期
已完成	目标量被 100%成交

- (10) 可勾选未完结的母单进行撤销/暂停操作，对暂停的母单进行重启操作
- (11) 可对运行中、已暂停、待取消、待处理、待更新的算法单进行参数调整和人工干预

调整参数 ✕

证券代码 000001.SZ
 证券名称 平安银行
 买卖方向 买
 目标量 1000
 完成量 0
 剩余量 1000
 母单限价
 算法类型 G-TWAP
 开始时间
 执行时间
 结束时间
 交易风格 正常
 市场占比
 相对限价 对手方最优
 浮动类型 价格最小变动单位
 浮动值

取消 确定

(12) 参数调整

人工干预 ✕

证券代码 000001.SZ
 证券名称 平安银行
 买卖方向 买
 未委托数量 1000
 委托价格
 委托数量
 忽略母单限价 重设

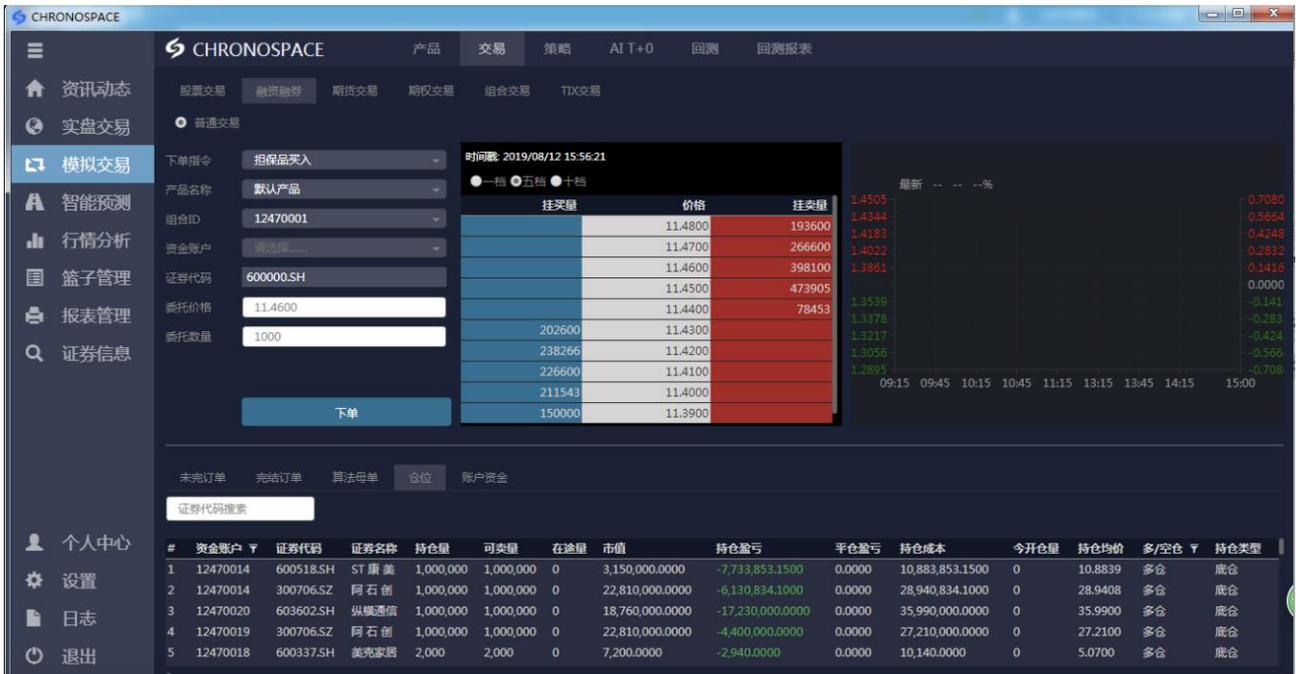
取消 确定

(19) 人工干预

- (20) 忽略母单限价：如勾选了[忽略母单限价]，则按照委托价格下单；如未勾选，则需受[母单限价]限制，如方向为买入时，委托价格不能超过母单限价；如方向为卖出时，委托价格不能低于母单限价
- (21) 重设：勾选后，人工干预下单成功后，剩余的数量将会马上重新计算进行拆单
- (22) 查看子单：可勾选未完订单进行撤单

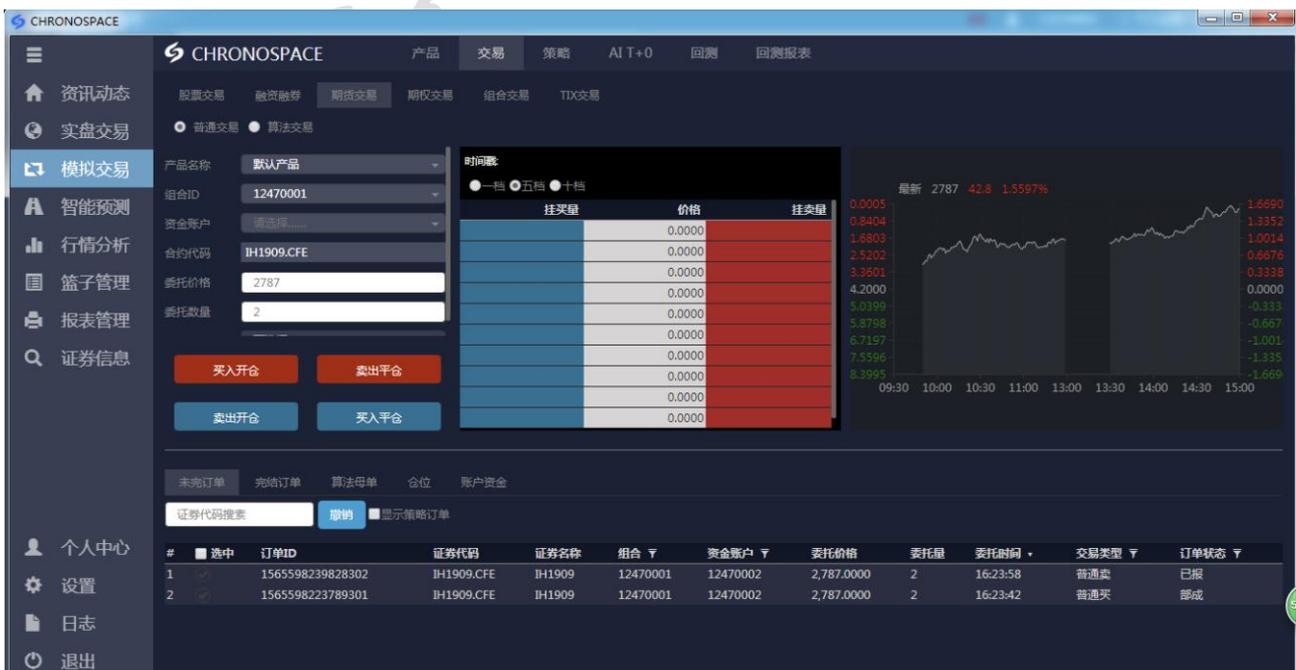
#	选中	子单ID	委托时间	委托数量	委托价格	成交数量	成交价格	状态	人工干预
1	<input type="checkbox"/>	1088129600	11:26:36	200	7.2700	200	7.2500	已匹配	--
2	<input type="checkbox"/>	4233016798	11:25:21	300	7.2400	300	7.2200	已匹配	--
3	<input type="checkbox"/>	2988279727	11:28:26	300	7.2600	300	7.2400	已匹配	--
4	<input type="checkbox"/>	3282966729	11:24:26	200	7.2400	200	7.2200	已匹配	--
5	<input type="checkbox"/>	4192579884	11:29:47	200	7.2500	200	7.2300	已匹配	--
6	<input type="checkbox"/>	1432846597	11:22:41	200	7.2400	200	7.2200	已匹配	--
7	<input type="checkbox"/>	2038379666	11:27:31	200	7.2700	200	7.2500	已匹配	--
8	<input type="checkbox"/>	630660459	11:13:02	200	7.2200	200	7.2200	已匹配	--
9	<input type="checkbox"/>	2383156669	11:23:36	200	7.2500	200	7.2300	已匹配	--
10	<input type="checkbox"/>	1578063565	11:18:26	200	7.2500	200	7.2300	已匹配	--
11	<input type="checkbox"/>	3877783754	11:20:56	200	7.2500	200	7.2300	已匹配	--
12	<input type="checkbox"/>	1073330529	11:13:46	200	7.2100	0	0.0000	未匹配	--
13	<input type="checkbox"/>	2172800599	11:14:56	200	7.2500	200	7.2300	已匹配	--
14	<input type="checkbox"/>	532938531	11:21:51	200	7.2500	200	7.2300	已匹配	--
15	<input type="checkbox"/>	337773687	11:20:06	200	7.2600	200	7.2400	已匹配	--
16	<input type="checkbox"/>	408799831	11:29:36	100	7.2500	100	7.2300	已匹配	--
17	<input type="checkbox"/>	3122820668	11:15:51	200	7.2500	200	7.2300	已匹配	--
18	<input type="checkbox"/>	4022940725	11:16:41	200	7.2600	200	7.2400	已匹配	--
19	<input type="checkbox"/>	628153492	11:17:31	200	7.2500	200	7.2300	已匹配	--
20	<input type="checkbox"/>	2477683621	11:19:16	200	7.2600	200	7.2400	已匹配	--

2.2.3. 融资融券



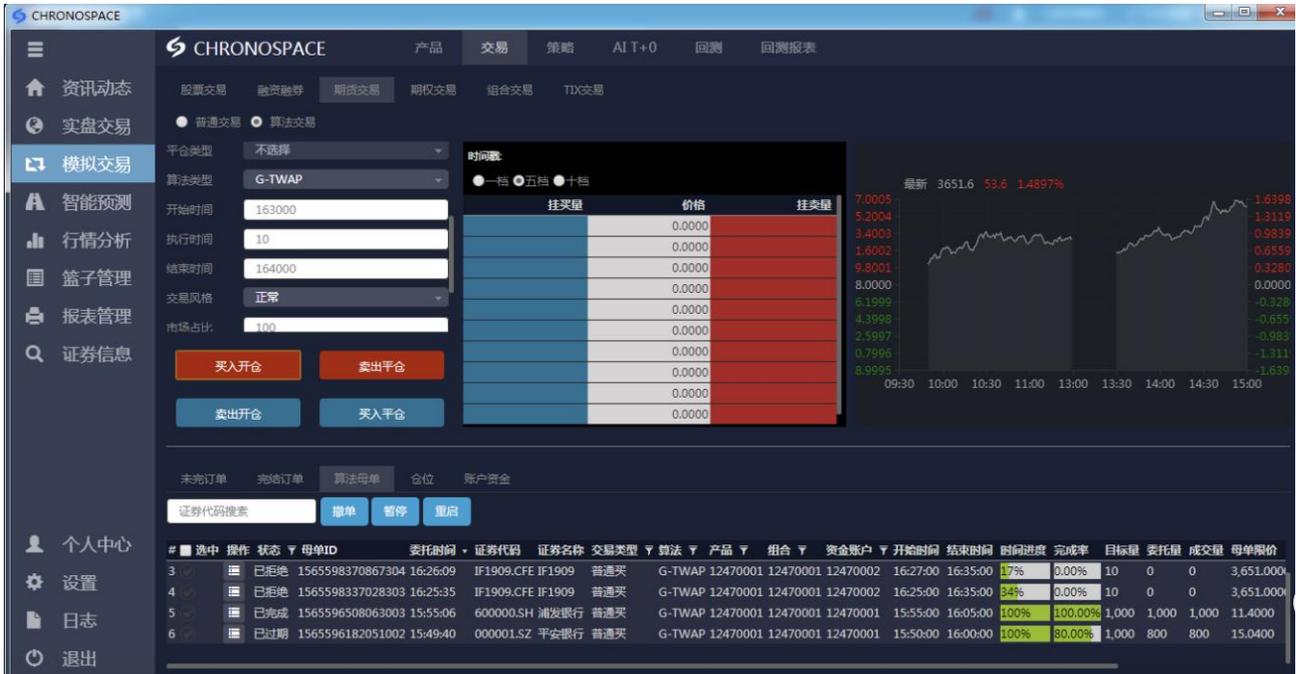
- (1) 融资融券支持主板市场两融标的和科创板股票交易
- (2) 支持的下单指令包括：担保品买入、担保品卖出、融资买入、融券卖出(预约)、融券卖出(市场券)、买券还券、买券还券(预约券)、买券还券(市场券)、融券还券、融券还券(预约券)、融券还券(市场券)、卖券还款、现金还款

2.2.4. 期货交易-普通交易



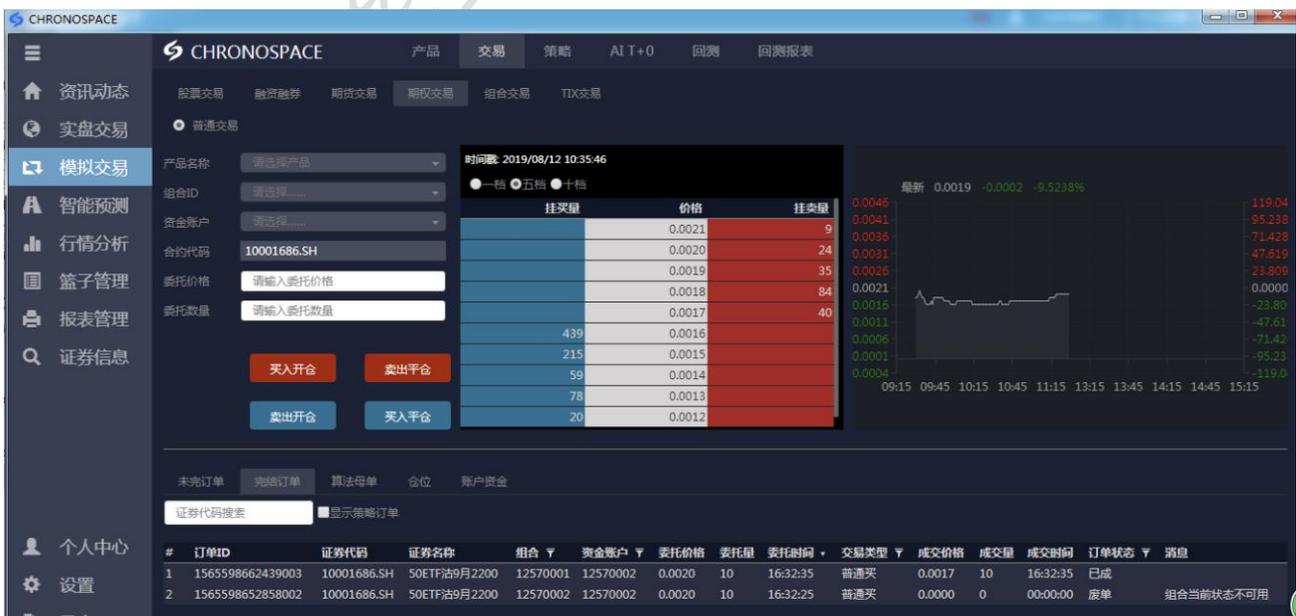
- (1) 期货交易支持买入开仓、卖出平仓、卖出开仓、买入平仓四个指令
- (2) 平仓类型：平今、平昨。支持上期所期货合约选择平仓类型

2.2.5. 期货交易-算法交易



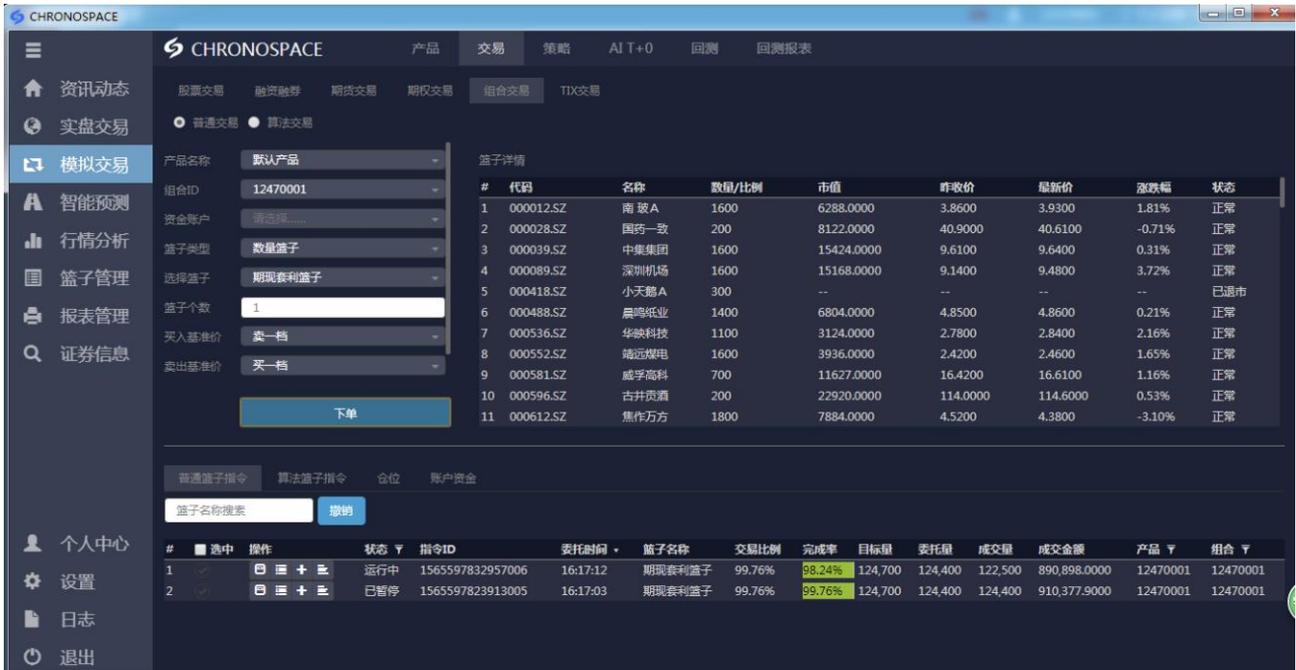
- (1) 期货交易的算法交易参数与股票交易的算法参数一致，具体使用及设置请参照股票算法交易。
- (2) 母单状态、调整算法参数以及人工干预的逻辑也与股票交易的算法交易一致

2.2.6. 期权交易



期权交易现只支持普通交易，支持的交易指令包括：买入开仓、卖出平仓、卖出开仓、买入平仓。

2.2.7. 组合交易-普通交易



- (1) 篮子类型支持数量篮子、权重篮子。可输入[篮子个数]成倍放大数量篮子标的的目标量，数量为正时为买入，为负时为卖出。对于权重篮子，可通过填写篮子总金额放大篮子标的的目标量，目标量=篮子总金额*比例/最新价
- (2) 设置买入/卖出基准价，抓取档位行情价格对每只标的的进行下单
- (3) 可设置初始交易比例对篮子分批下单，如设置 50%，则只下该篮子目标量的 50%，后续可进行补单
- (4) 篮子支持从本地和篮子管理两处导入，导入的篮子将在右边篮子详情列表展示
- (5) 普通交易的篮子下单展示在[普通篮子指令]
- (6) 点击[撤销]可将整个篮子撤销掉
- (7) [指令状态]与[子单状态]说明如下表：

状态	指令	子单
运行中	完成率非100%，且未被撤销时	完成率非100%，且未被撤销时，且完成率小于交易比例
已完成	完成率为100%	完成率为100%
已撤销	指令被撤销	指令被撤销，指令下的所有子单都将被撤销
已暂停	交易比例小于100%，且交易比例=完成率	交易比例小于100%，且交易比例=完成率

- (8) 对于运行中、已暂停状态的篮子指令可进行添加标的的操作
- (9) 查看子单：



#	选中	操作	状态	委托时间	证券代码	证券名称	买卖方向	交易比例	完成率	目标量	委托量	挂单量	成交量	成交均价	成交金额
1	<input checked="" type="checkbox"/>		暂停	11:00:33	300088.SZ	长信科技	买	50.00%	50.00%	3000	1500	0	1500	4.94	7,410.00
2	<input checked="" type="checkbox"/>		暂停	11:00:33	300002.SZ	神州泰岳	买	50.00%	50.00%	1800	900	0	900	3.61	3,249.00
3	<input checked="" type="checkbox"/>		运行中	11:00:33	600094.SH	大名城	买	50.00%	1.00%	2800	1400	1400	0	0.00	0.00
4	<input checked="" type="checkbox"/>		暂停	11:00:33	300113.SZ	顺网科技	买	50.00%	50.00%	600	300	0	300	14.88	4,464.00
5	<input checked="" type="checkbox"/>		暂停	11:00:33	600060.SH	海信电器	买	50.00%	50.00%	1200	600	0	600	8.58	5,148.00
6	<input checked="" type="checkbox"/>		暂停	11:00:33	600056.SH	中国医药	买	50.00%	50.00%	800	400	0	400	14.20	5,680.00
7	<input checked="" type="checkbox"/>		暂停	11:00:33	000990.SZ	诚志股份	买	50.00%	50.00%	400	200	0	200	12.93	2,586.00
8	<input checked="" type="checkbox"/>		暂停	11:00:33	000050.SZ	深天马A	买	50.00%	50.00%	1400	700	0	700	10.75	7,525.00
9	<input checked="" type="checkbox"/>		暂停	11:00:33	000049.SZ	德赛电池	买	50.00%	50.00%	200	100	0	100	29.36	2,936.00
10	<input checked="" type="checkbox"/>		完成	11:00:33	000028.SZ	国药一致	买	100.00%	100.00%	100	100	0	100	45.53	4,553.00

- (10) 可勾选子单进行撤单操作，也可勾选子单，设置买卖档位和交易比例进行补单，设置的交易比例需大于之前设置的交易比例，否则不生效
- (11) 可对运行中、已暂停状态的子单修改目标量，[新目标量]需大于[已委托数量]

2.2.8. 组合交易-算法交易



#	代码	名称	数量/比例	市值	昨收价	最新价	涨跌幅	状态
1	000012.SZ	南玻A	1600	6256.0000	3.8600	3.9100	1.30%	正常
2	000028.SZ	国药一致	200	8080.0000	40.9000	40.4000	-1.22%	正常
3	000039.SZ	中集集团	1600	15344.0000	9.6100	9.5900	-0.21%	正常
4	000089.SZ	深圳机场	1600	15024.0000	9.1400	9.3900	2.74%	正常
5	000418.SZ	小天鹅A	300	--	--	--	--	已退市
6	000488.SZ	晨鸣纸业	1400	6776.0000	4.8500	4.8400	-0.21%	正常
7	000536.SZ	华录科技	1100	3069.0000	2.7800	2.7900	0.36%	正常
8	000552.SZ	储运煤电	1600	3920.0000	2.4200	2.4500	1.24%	正常
9	000581.SZ	威孚高科	700	11585.0000	16.4200	16.5500	0.79%	正常
10	000596.SZ	古井贡酒	200	22714.0000	114.0000	113.5700	-0.38%	正常
11	000612.SZ	焦作万方	1800	7776.0000	4.5200	4.3200	-4.42%	正常

- (1) 组合交易-算法交易的订单展示在[算法篮子指令]

(2) [指令状态]与[子单状态]应对关系如下表:

状态	指令	子单
运行中	完成率非100%，且未被撤销、未过期时	完成率非100%，且未被撤销、未被暂停时
已完成	完成率为100%	完成率为100%
已撤销	指令被撤销	指令被撤销，指令下的所有子单都将被撤销
已暂停	指令暂停	指令暂停，子单都暂停；单只子单被重启，指令变为运行中
已过期	结束时间已小于现在时间	指令过期，子单都过期

- (3) 可对运行中、已暂停的指令进行撤销；可对运行中的指令进行暂停；可对暂停的指令进行重启
- (4) 另外，篮子子单状态说明如下：其中已完成、已撤销、已过期的完结指令不可修改指令参数和添加标的

状态	释义
运行中	母单正在拆单交易中
已暂停	母单暂停拆单，可重启将母单变为运行中
已撤销	母单已被撤销
待取消	进行撤销操作后还未撤销成功时
已拒绝	如证券停牌、开始时间晚于收盘时间，开始时间早于当前时间超过 10 分钟等
待处理	下单未收到消息回报时
待更新	调整算法参数还未生效时
已过期	母单设置的结束时间已小于现在时间，该母单将过期
已完成	目标量被 100%成交

调整参数 ✕

指令ID 1541756798730014

篮子名称 篮子.csv

买入基准价 买一档

卖出基准价 卖一档

算法类型 G-TWAP

开始时间 180000

执行时间 30

结束时间 183000

交易风格 正常

市场占比 10

相对限价 对手方最优

浮动类型 价格最小变动单位

浮动值 0

取消
确定

(16) 修改指令参数:

添加标的 ✕

指令ID 001

篮子名称 篮子001

算法 G-TWAP

证券代码 请输入证券代码

买卖方向 买入

目标量 请输入目标量

取消
确定

(17) 添加标的:

(18) 查看子单:

#	状态	操作	订单ID	委托时间	证券代码	证券名称	买卖方向	完成率	目标量	委托量	成交量	成交金额	成交均价	市场参与率
1	运行中	🔍	1541746308557092	14:51:48	300297.SZ	蓝盾股份	买	12.50%	800	100	100	544.00	5.44	2.00%
2	运行中	🔍	1541746308544025	14:51:48	600079.SH	人福医药	买	0.00%	1700	300	0	0.00	0.00	0.00%
3	运行中	🔍	1541746308545031	14:51:48	600286.SH	安诚财险	买	0.00%	600	100	0	0.00	0.00	0.00%
4	运行中	🔍	1541746308539690	14:51:48	300174.SZ	阳光电源	买	0.00%	1500	300	0	0.00	0.00	0.00%
5	运行中	🔍	1541746308542035	14:51:48	000887.SZ	莱钢置业	买	0.00%	4200	800	0	0.00	0.00	0.00%
6	运行中	🔍	1541746308557094	14:51:48	002769.SZ	兴福材料	买	33.33%	300	100	100	2,070.00	20.70	2.00%
7	运行中	🔍	1541746308555982	14:51:48	002400.SZ	省广集团	买	0.00%	3200	600	0	0.00	0.00	0.00%
8	运行中	🔍	1541746308549051	14:51:48	600657.SH	信达地产	买	0.00%	1200	300	0	0.00	0.00	0.00%
9	运行中	🔍	1541746308556086	14:51:48	601717.SH	祁连山	买	0.00%	1300	300	0	0.00	0.00	0.00%
10	运行中	🔍	1541746308543019	14:51:48	000806.SZ	顺河生物	买	0.00%	1600	300	0	0.00	0.00	0.00%
11	运行中	🔍	1541746308544026	14:51:48	600141.SH	兴发集团	买	20.00%	500	100	100	1,139.00	11.39	0.00%
12	运行中	🔍	1541746308555085	14:51:48	002439.SZ	麒麟置业	买	0.00%	700	100	0	0.00	0.00	0.00%
13	运行中	🔍	1541746308555083	14:51:48	002428.SZ	云南锡业	买	0.00%	800	100	0	0.00	0.00	0.00%
14	运行中	🔍	1541746308555081	14:51:48	002410.SZ	广聚达	买	0.00%	800	100	0	0.00	0.00	0.00%
15	运行中	🔍	1541746308555079	14:51:48	002288.SZ	沃顿股份	买	33.33%	300	100	100	2,641.00	26.41	4.00%
16	运行中	🔍	1541746308557097	14:51:48	002586.SH	海兴电力	买	0.00%	200	100	0	0.00	0.00	0.00%
17	运行中	🔍	1541746308555086	14:51:48	002249.SZ	大洋电机	买	0.00%	1900	300	0	0.00	0.00	0.00%
18	运行中	🔍	1541746308554078	14:51:48	002375.SZ	蓝盾股份	买	0.00%	1300	300	0	0.00	0.00	0.00%

(19) 除已完成、已撤销、已拒绝、已过期状态外，其他都可进行撤单、修改目标量、人工干预下单的操作

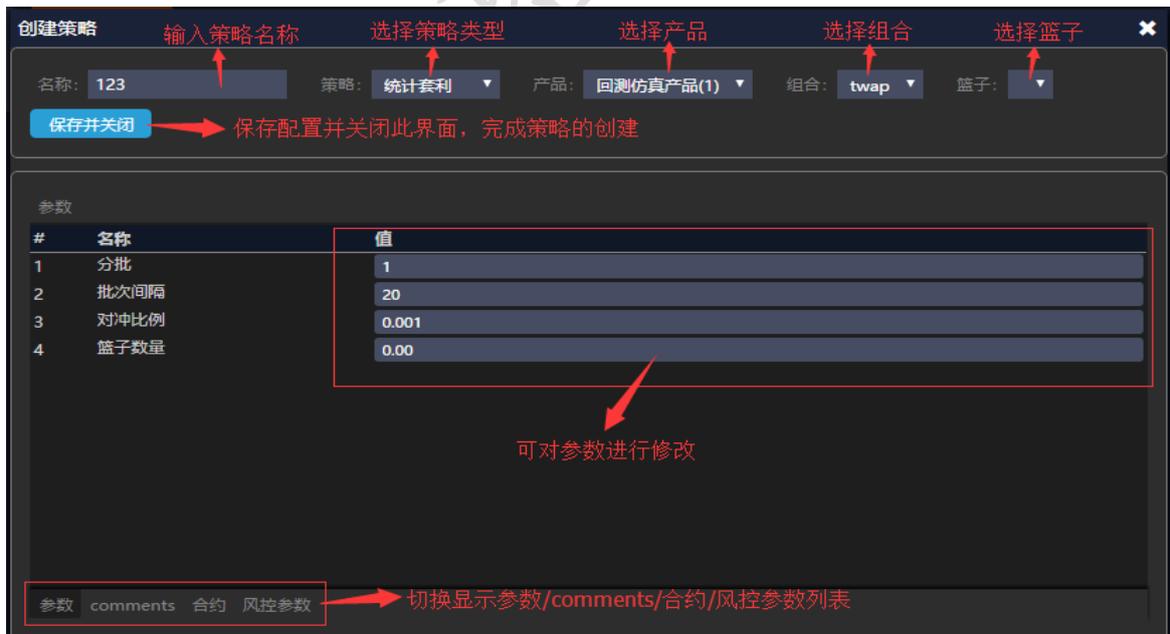
(20) 修改目标量: [新目标量]需大于[已委托数量]

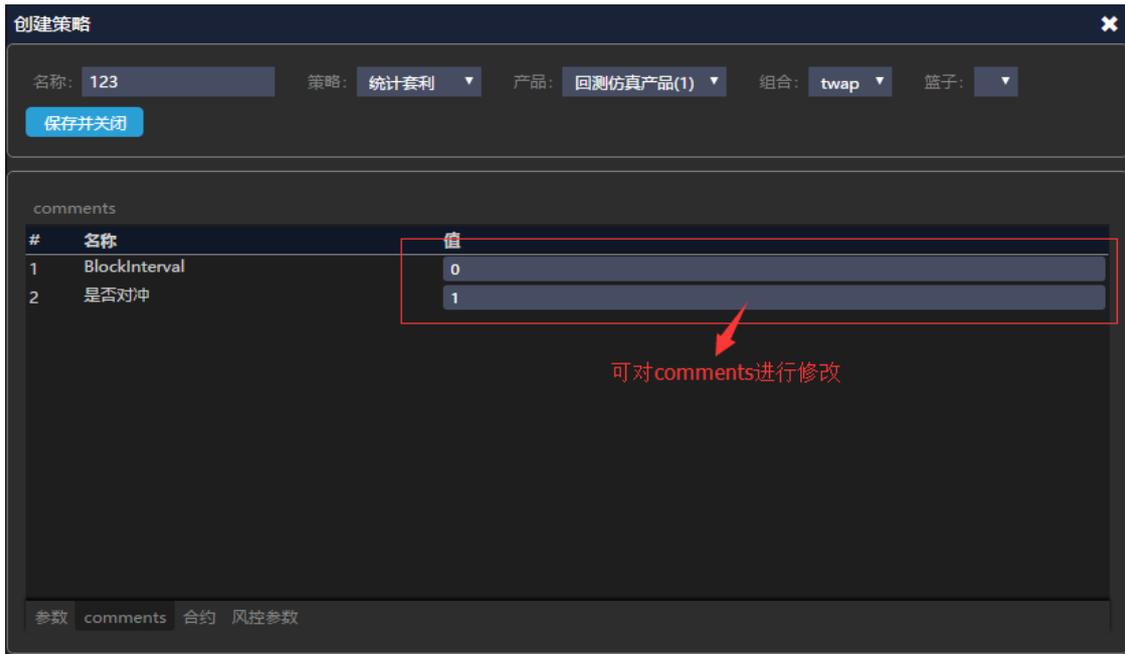
2.3. 策略

在策略板块，用户可进行对“统计套利、跨期套利、手工交易、篮子交易、做市交易、大宗交易、期现套利、TWAP 篮子交易”八大策略的创建和使用。

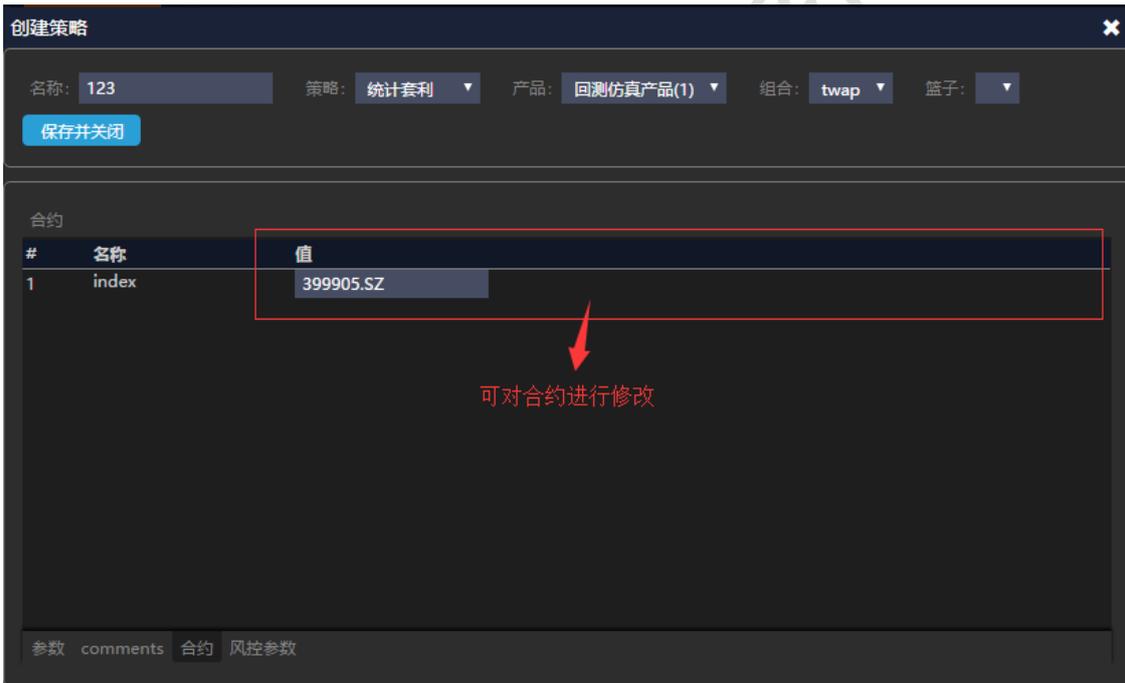


创建策略界面：

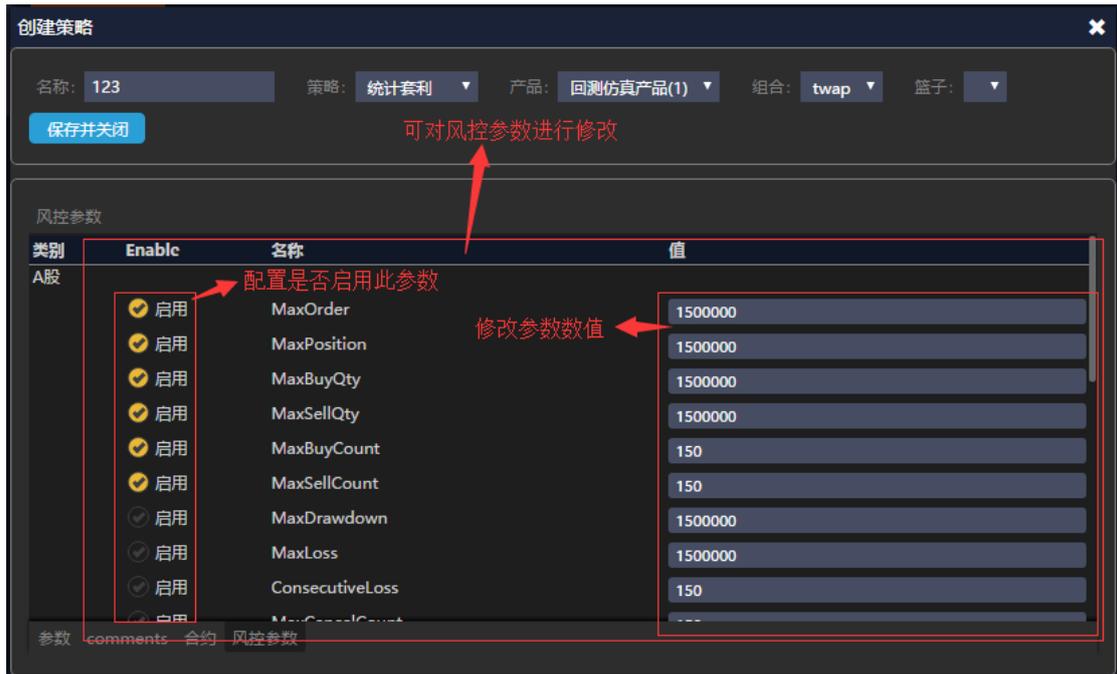




对合约进行修改

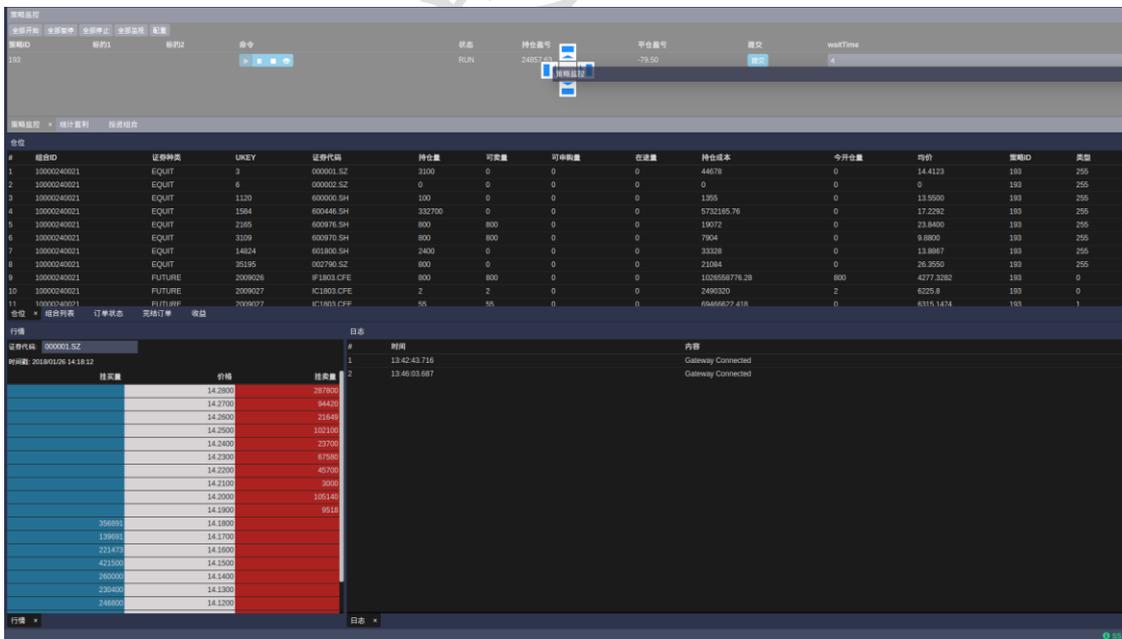


对风控参数进行修改，选择是否启用参数



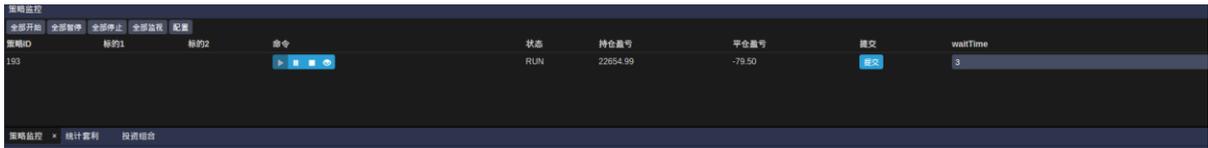
2.3.1. 概览

共有 10 个 Tab，分别是策略监控、统计套利、投资组合、仓位、组合列表、订单状态、完结订单、收益、行情、日志。界面布局可自由拖动，每个 tab 也可以配置增加或删除（窗口菜单中可进行配置）。



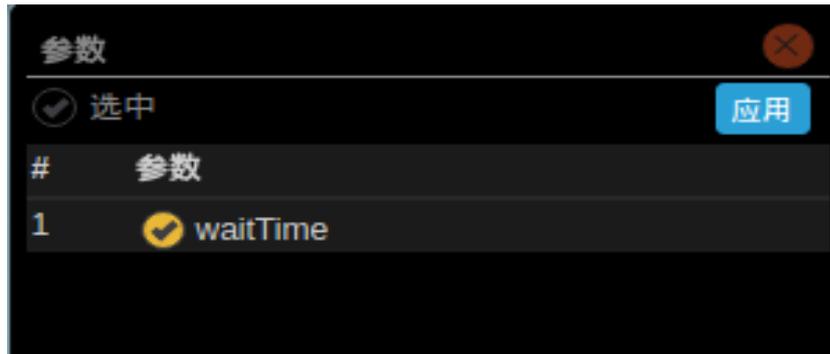
2.3.2. 策略监控

可进行策略的开始、暂停、停止、监视的操作，以及对策略参数进行配置和查看。

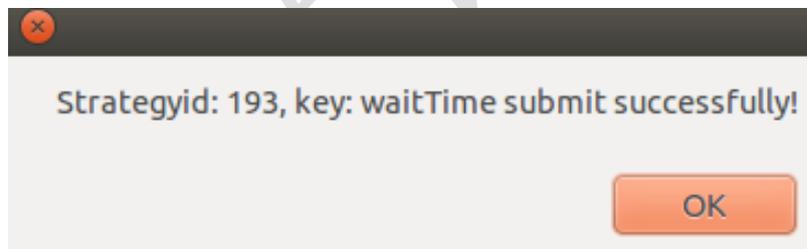


(1) 全部开始、全部暂停、全部停止、全部监视四个按钮可对列表中所有策略统一操作，也可用蓝色播放器按钮对其中一个策略单独进行开始、暂停、停止、监视操作。

(2) 配置按钮可配置哪些参数可显示，勾选或取消勾选后点击应用即可生效。



(3) 策略参数可进行修改，在参数输入框（仅适用于可修改的参数）修改后点击提交完成。



2.3.3. 统计套利

统计套利信息。

#	证券名称	InnerCode	换手率	仓位	交易量	金额	策略ID	差值	证券代码
---	------	-----------	-----	----	-----	----	------	----	------

点击表格的表头对应字段可进行排序。

2.3.4. 投资组合



选中	证券代码	证券名称	初始仓位	目标仓位	当前仓位	总委托量	已成交量	成交进度	挂单量	单笔委托量	送单	撤单	补单	状态	昨收	最新价	买入量	买入价	卖出量	卖出价	买入均价	卖出均价	初始持仓
<input checked="" type="checkbox"/>	603225.SH	新凤鸣	100	200	100	100	0	0.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	11.1800	11.1800	0	11.1800	0	11.1800	0.0000	0.0000	11.18
<input checked="" type="checkbox"/>	600996.SH	贵广网络	300	500	300	200	0	0.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	8.5300	8.5300	0	8.5300	0	8.5300	0.0000	0.0000	25.59
<input checked="" type="checkbox"/>	603556.SH	海兴电力	200	200	200	0	0	100.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	14.3900	14.3900	0	14.3900	0	14.3900	0.0000	0.0000	28.78
<input checked="" type="checkbox"/>	603868.SH	飞科电器	100	100	100	0	0	100.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	35.9400	35.9400	0	35.9400	0	35.9400	0.0000	0.0000	35.94
<input checked="" type="checkbox"/>	603993.SH	浩阳铝业	1,700	0	1,700	-1,700	0	0.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	3.8400	3.8400	0	3.8400	0	3.8400	0.0000	0.0000	65.28
<input checked="" type="checkbox"/>	601231.SH	环旭电子	700	1,400	700	700	0	0.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	11.5900	11.5900	0	11.5900	0	11.5900	0.0000	0.0000	81.15
<input checked="" type="checkbox"/>	601928.SH	凤凰传媒	700	1,300	700	600	0	0.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	7.6900	7.6900	0	7.6900	0	7.6900	0.0000	0.0000	53.15
<input checked="" type="checkbox"/>	601717.SH	郑煤机	700	1,300	700	600	0	0.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	5.7600	5.7600	0	5.7600	0	5.7600	0.0000	0.0000	40.32
<input checked="" type="checkbox"/>	601578.SH	迪化股份	800	1,500	800	700	0	0.00%	0	0	送单	撤单	补单	正常	5.7100	5.7100	0	5.7100	0	5.7100	0.0000	0.0000	45.68

- 选择交易类型：分目标仓位和增量仓位。如目标仓位大于初始仓位，则为买单；反之，则为卖单。如选择增量仓位则按照篮子每只标的数量进行下单，数量为正则为买单，为负则为卖单
- 策略需在监视状态下导入篮子
- 可设置买卖档位和偏移量
- 可设置一个交易比例，一键勾选全部买单或卖单，点击【送选中单】按钮进行下单，也可单独勾选某几只标的进行下单
- 可批量勾选标的，点击【撤选中单】进行批量撤单
- 如每只标的成交进度不一致，可勾选标的，设置总进度，点击【补选中单】进行进度补齐
- 对单只标的，可填写单笔委托量，点击【送单】按钮，进行下单。可点击【撤单】按钮，对单只标的进行撤单，也可设置总进度，点击【补单】按钮对单只票进行补单
- 通过设置交易比例或总进度，其委托量可能不为整手，如计算的股票发单数量尾数小于 50 则会被舍去，如大于或等于 50 则会算作 100 股，但期货必须大于或等于 1，否则将被舍去

2.3.5. 仓位

仓位信息。



#	组合ID	证券种类	UKEY	证券代码	持仓量	可卖量	可申购量	在途量	持仓成本	今开仓位	均价	策略ID	类型
1	10000240021	EQUIT	3	000001.SZ	3100	0	0	0	44678	0	14.4123	193	255
2	10000240021	EQUIT	6	000002.SZ	0	0	0	0	0	0	0	193	255
3	10000240021	EQUIT	1120	600000.SH	100	0	0	0	1.355	0	13.5500	193	255
4	10000240021	EQUIT	1584	600446.SH	332700	0	0	0	5732165.76	0	17.2292	193	255
5	10000240021	EQUIT	2185	600976.SH	800	800	0	0	13072	0	23.8400	193	255
6	10000240021	EQUIT	3109	600970.SH	800	800	0	0	7954	0	9.8800	193	255
7	10000240021	EQUIT	14824	601300.SH	2400	0	0	0	33226	0	13.8867	193	255
8	10000240021	EQUIT	35195	002790.SZ	800	0	0	0	21084	0	26.3550	193	255
9	10000240021	FUTURE	2039026	IF1903.CFE	800	800	0	0	1038558776.28	800	4277.2382	193	0
10	10000240021	FUTURE	2039027	IC1903.CFE	2	2	0	0	2490820	2	6255.8	193	0
11	10000240021	衍生品	7039027	IC1903.CFF	55	55	0	0	60466657.418	0	6315.1474	193	1

- 点击表格的表头对应字段可进行排序
- 双击表格进入下单界面（下单界面说明见“行情”Tab），相应参数会自动填入

下单界面列表中。

2.3.6. 组合列表

组合列表。

组合ID	证券类型	总资金	可用资金	冻结资金	日期	币种	上海	深圳	买冻结资金	卖冻结资金	买保证金	卖保证金	总保证金	费用	持仓盈亏	平仓盈亏
10000240021	EQUIT	4237644.0602	4237644.0602	0	20180124	48	0	4237644.0602								
10000240021	FUTURE	9924480.82	9924480.82	0	20180124	48	0	9924480.82	0	0	0	0	0	0	-69118912.512	0

组合列表下，显示所有组合下证券类型、总资金以及费用和持仓盈亏等数据。

2.3.7. 订单状态

订单状态列表。

#	选中	订单ID	UKEY	证券代码	证券名称	策略	组合ID	委托价格	委托量	委托时间	买/卖	订单状态
1	<input type="checkbox"/>	193000007	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6364.4	1	10:18:23	Buy	10.买单
2	<input type="checkbox"/>	193000004	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6317.4	1	09:48:49	Buy	10.买单
3	<input type="checkbox"/>	193000130	1884	600446.SH	金证股份	193	10000240021	17.09	10	11:07:23	Buy	10.买单
4	<input type="checkbox"/>	193000106	1884	600446.SH	金证股份	193	10000240021	17.28	1000000	14:10:02	Buy	10.买单
5	<input type="checkbox"/>	193000088	1884	600446.SH	金证股份	193	10000240021	17.25	1000000	14:08:53	Buy	10.买单
6	<input type="checkbox"/>	193000081	1884	600446.SH	金证股份	193	10000240021	30	100000000	14:04:34	Buy	10.买单

- (1) 点击表格的表头对应字段可进行排序
- (2) 点击状态下拉框可筛选订单状态
- (3) 点击全选可选中所有订单，也可在表格中进行勾选
- (4) 点击撤选中单按钮可对选中的订单进行撤单

2.3.8. 完结订单

已完结的订单列表。

#	订单ID	UKEY	证券代码	证券名称	策略	组合ID	委托价格	委托量	委托时间	买/卖	订单状态	成交价格	成交量	成交时间	订单类型
1	193000040	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6334.6	5	15:38:12	Buy	9.已成	6334.04	5	15:59:07	Active
2	193000043	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6337.4	5	15:38:45	Buy	9.已成	6337.36	5	15:57:56	Active
3	193000031	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6325.6	5	14:25:20	Buy	9.已成	6323.92	5	14:31:42	Passive
4	193000034	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6327.2	5	14:26:45	Buy	9.已成	6326.84	5	14:31:14	Passive
5	193000037	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6333.8	5	14:27:10	Buy	9.已成	6331.48	5	14:29:03	Active
6	193000028	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6315	72	14:06:38	Sell	9.已成	6315.4357	72	14:09:03	Active
7	193000025	2009027	IC1803.CFE	IC1803	193	10000240021	6310	8	14:04:57	Sell	9.已成	6312.5499	8	14:06:47	Active
8	193000013	3109	600970.SH	中材国际	193	10000240021	9.92	800	13:48:39	Buy	9.已成	9.88	800	13:50:28	UNKNOWN
9	193000010	2165	600976.SH	健民集团	193	10000240021	23.9	800	13:33:13	Buy	9.已成	23.84	800	13:35:02	UNKNOWN
10	193000017	7637	600976.SH	健民集团	193	10000240021	17.04	100	14:35:49	Buy	7.已成	0	0	14:36:37	UNKNOWN

- (1) 点击表格的表头对应字段可进行排序
- (2) 点击状态下拉框可筛选订单状态

2.3.9. 收益

收益信息。点击查询按钮可手动更新收益列表。

#	UKEY	证券代码	组合ID	策略	买入均价	卖出均价	持仓量	交易量	对冲交易手续费	总手续费	上笔费用	持仓盈亏	今持仓盈亏	总盈亏	持仓	今持仓	昨收价	市场价	净值
1	3	000001.SZ	10000240021	193	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	14.8	14.23	0
2	1584	600446.SH	10000240021	193	17.2292	0	-20423.8934	0	0	728.0534	23.0853	0	-20423.8934	-20423.8934	0	332700	15.76	17.17	0
3	6	000002.SZ	10000240021	193	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	39.42	40.32	0
4	2155	600978.SH	10000240021	193	23.84	0	325.6698	0	0	2.2302	2.2302	0	325.6698	325.6698	0	800	23.7	24.25	0
5	1130	600009.SH	10000240021	193	13.95	0	-7.1765	0	0	0.1765	0.1765	0	-7.1765	-7.1765	0	100	13.94	13.48	0
6	3109	600970.SH	10000240021	193	9.88	0	822.8938	0	0	1.1062	1.1062	0	822.8938	822.8938	0	800	9.83	10.91	0
7	2009026	IF1803.CFE	10000240021	193	0	0	23712000	0	0	0	0	23712000	0	23712000	800	0	4312	4490	0
8	14824	601800.SH	10000240021	193	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	14.43	14.65	0
9	2009027	IC1803.CFE	10000240021	193	6330.728	6315.1474	-671376.1051	-79502.7023	1899.7023	3357.2074	32.051	65760	-737136.1051	-750878.8074	2	-55	6208.2	6382	0
10	36196	001700.CZ	10000240021	193	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	16.91	16.75	0

2.3.10. 行情

level2 行情（表格数据说明见[产品详情](#)的 bookview 行情交易页面）。

挂买量	价格	挂卖量
	14.3200	476409
	14.3100	304700
	14.3000	534600
	14.2900	193100
	14.2800	326020
	14.2700	107500
	14.2600	102700
	14.2500	74540
	14.2400	160461
	14.2300	28309
85891	14.2200	
66642	14.2100	
122374	14.2000	
373382	14.1900	
259191	14.1800	
125200	14.1700	
166791	14.1600	

(1) 证券代码输入框输入万得代码或者拼音首字母，在下拉框中点击或者回车选择

Trade Panel

组合ID: 10000240021

策略: 193

方向: 卖

证券名称: 000005.SZ

UKey: 17

价格: 4.2800

数量:

(2) 双击表格进行下单

下单可对组合 ID、策略、买卖方向、证券名称、ukey、价格、数量进行手动选择或者

输入，点击提交按钮完成下单或者关闭按钮取消本次下单。下单后可在订单状态或完结订单中找到对应状态的订单。若下单失败，可在日志中查看失败信息。（注意：若 **ukey** 与证券名称不对应则最终以 **ukey** 为准；**ukey**、价格、数量皆不能为空且必须是合法数字）

2.3.11. 日志

#	时间	内容
1	14:21:48.795	Gateway Connected
2	14:38:20.339	errorid=-15, errmsg=TcpClient::HandleRead: localaddress=172.24.50.10 localport=55021 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 End of file
3	14:49:02.088	errorid=-15, errmsg=TcpClient::HandleRead: localaddress=172.24.50.10 localport=34478 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 End of file
4	14:54:09.654	errorid=-15, errmsg=TcpClient::HandleRead: localaddress=172.24.50.10 localport=60676 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 End of file
5	14:54:14.666	errorid=-13, errmsg=TcpClient::HandleConnect: localaddress=172.24.50.10 localport=60676 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 Connection refused
6	14:56:22.808	errorid=-15, errmsg=TcpClient::HandleRead: localaddress=172.24.50.10 localport=45160 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 End of file
7	15:40:23.520	errorid=-15, errmsg=TcpClient::HandleRead: localaddress=172.24.50.10 localport=50383 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 End of file
8	15:40:28.528	errorid=-13, errmsg=TcpClient::HandleConnect: localaddress=172.24.50.10 localport=50383 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 Connection refused
9	15:40:33.533	errorid=-13, errmsg=TcpClient::HandleConnect: localaddress=172.24.50.10 localport=50383 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 Connection refused
10	15:40:38.538	errorid=-13, errmsg=TcpClient::HandleConnect: localaddress=172.24.50.10 localport=50383 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 Connection refused
11	15:40:43.548	errorid=-13, errmsg=TcpClient::HandleConnect: localaddress=172.24.50.10 localport=50383 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 Connection refused
12	15:40:48.551	errorid=-13, errmsg=TcpClient::HandleConnect: localaddress=172.24.50.10 localport=50383 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 Connection refused
13	15:40:53.560	errorid=-13, errmsg=TcpClient::HandleConnect: localaddress=172.24.50.10 localport=50383 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 Connection refused
14	15:40:58.567	errorid=-13, errmsg=TcpClient::HandleConnect: localaddress=172.24.50.10 localport=50383 remoteaddress=172.24.50.2 remoteport=9200 Connection refused

连接状态，错误信息（标红）等信息。



2.4. 风控

风控表格有五个，分别为风控预警表格、账户/产品/策略组合风控表格、市场/板块风控表格、品种风控表格、标的风控表格。

风控预警表格在页面顶部，此表格展示的数据为所有账户下和所有产品下达到预警的风控，预警的判断标准是使用值（即当前值）大于阈值的风控。该表格下部分字段的意义：

类型，指该风控属于账户、产品、策略里的某一类风控。

分类，所有风控按市场和板块、标的、品种，以及非这三种风控其他所有风控这种方式进行分类，取值为“标的”、“品种”、“市场/板块”、“ ”（为空）这四种值。

类目，该字段为分类字段的二级分类，当分类为“品种”、“市场/板块”时，类目为该分类下的具体值，当分类为“标的”时，类目为 ukey 的值，当分类为空时，类目也为空。

禁用，指该风控是否启用，取值为“禁用”、“启用”。



CHRONOS 产品 策略 风控

风控预警

#	类型	分类	类目	ID	风控名称	预警值	阈值	当前	状态	触发时间
[Table content is partially obscured by a watermark]										

点击展开或缩小表格

账户

#	风控名称	当前值	阈值	触发方式	状态
1000005					
1000006					

点击选择其中一个账户（产品/策略组合），更新右侧4个表格（切换至对应风控）

市场/板块

#	市场（板块）	风控名称	当前值	阈值	触发方式	状态
[Table content is partially obscured]						

品种

#	品种	风控名称	当前值	阈值	触发方式	状态
[Table content is partially obscured]						

标的

#	UKEY	风控名称	当前值	阈值	触发方式	状态
[Table content is partially obscured]						

切换显示账户、产品、策略组合列表

3. 模拟交易

3.1. 产品

产品、产品详情界面、解券锁券、期权盯市均与实盘交易板块的相同，点击查看实盘交易板块下对应的产品说明和介绍。

3.2. 交易

交易与实盘交易功能一致

3.3. 策略

仿真策略/仿真策略交易界面说明见实盘交易的策略。

相比实盘策略，对已创建的策略点击右键进行操作时，除启动/停止/修改/删除操作外，增加了共享和调整资金功能。

共享，是把当前使用的策略共享给其他用户 ID。



修改资金，是对现货账户和期货账户的资金进行调整。



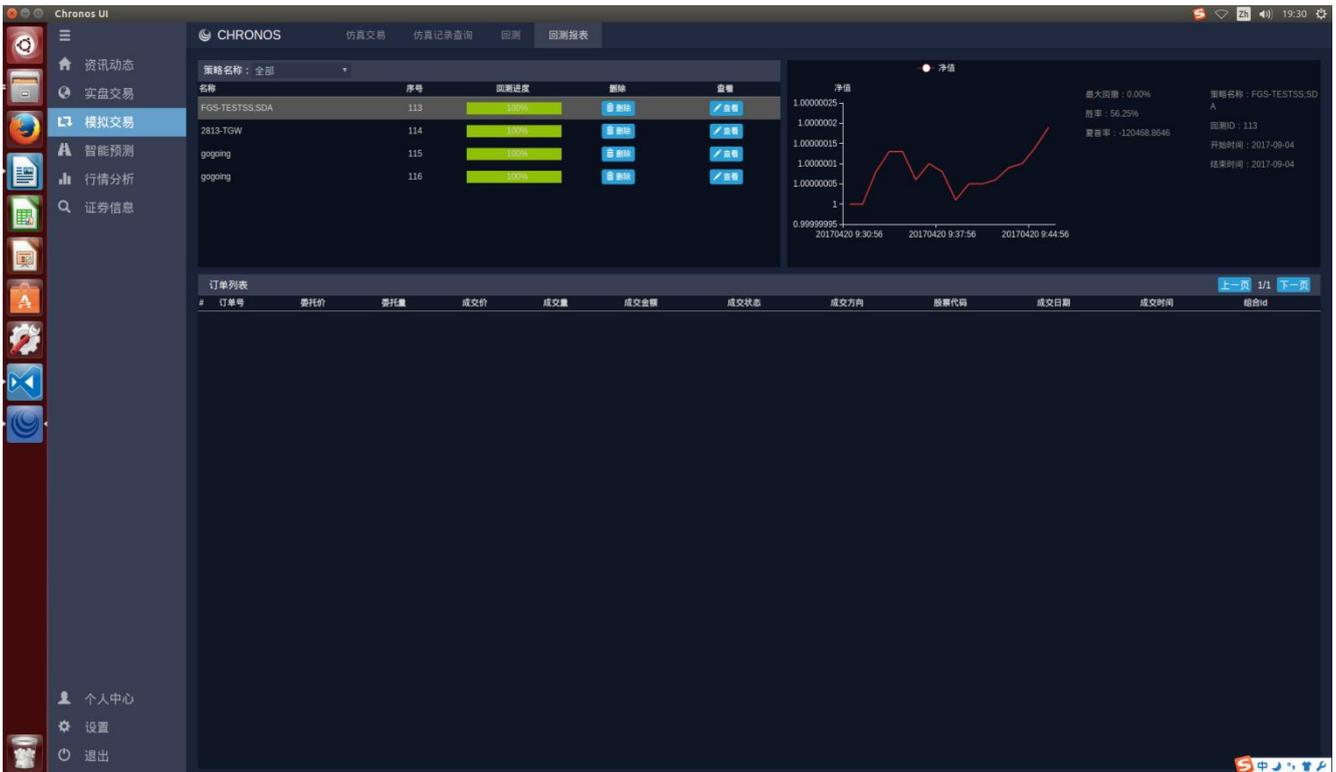
3.4 回测

回测策略/回测策略交易界面说明见仿真交易。

3.5 回测报表

3.5.1 概览

模拟交易>>回测报表



3.5.2 功能介绍

本模块功能是查询展示回测策略下的订单列表和净值图表。页面由策略列表（左上角）、净值曲线图（右上角）、订单列表（下半部分）三部分组成。页面初始化后会展示策略列表并显示每个策略的回测进度，初始时默认选中第一个策略并查询该策略的订单列表和净值，通过切换策略查看各个策略的订单和净值详情。

名称	序号	回测进度	删除	查看
FGS-TESTSS.SDA	113	100%	删除	查看
2813-TGW	114	100%	删除	查看
gogoing	115	100%	删除	查看
gogoing	116	100%	删除	查看
test-26	119	100%	删除	查看

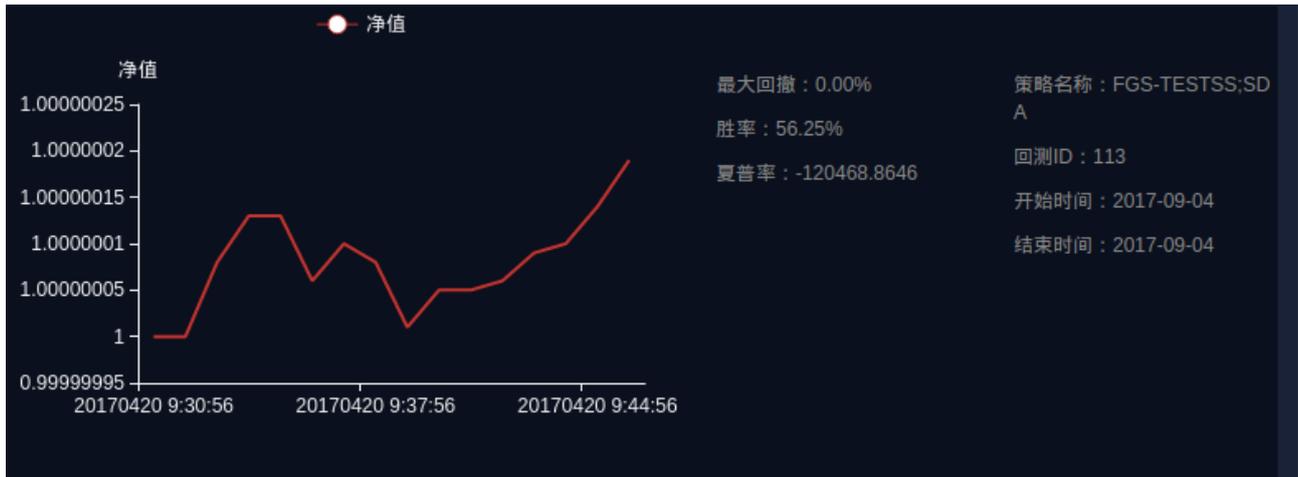
(1) 策略名称是指回测策略名称。同一策略名称下可有多个回测，每个回测的序号唯一。回测进度从 0%至 100%，进度条中绿色部分所占比例即为进度百分比。界面初始化是默认选择第一个回测，选择状态为灰色。

(2) 过滤出同一名称的回测。通过标题右侧下拉列表选择策略名称来过滤出同名回测，下拉列表默认选择全部，展示所有回测。

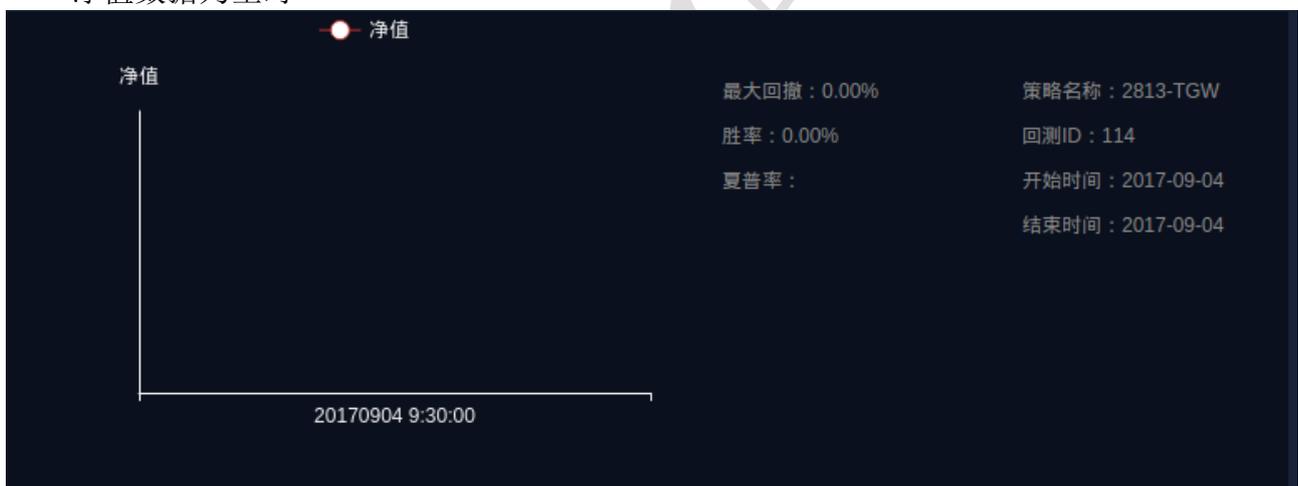
(3) 切换回测。可通过单击每个策略列最右侧的查看按钮或双击策略列来切换回测。切换后会有选中状态，同时净值图和订单表格数据会切换到对应的策略。

(4) 删除策略。通过单击策略列的删除按钮删除相应策略，删除后该策略列会从界面消失。

(5) 净值图部分由折线图和文字信息组成。净值图纵轴为净值，横轴为时间，时间点频率由后台数据点决定，若无数据则净值图只有坐标轴。文字信息分别为最大回撤、胜率、夏普率。



净值数据为空时



订单表功能可分页，与仿真查询部分订单表一致。

3.5.3 其他说明

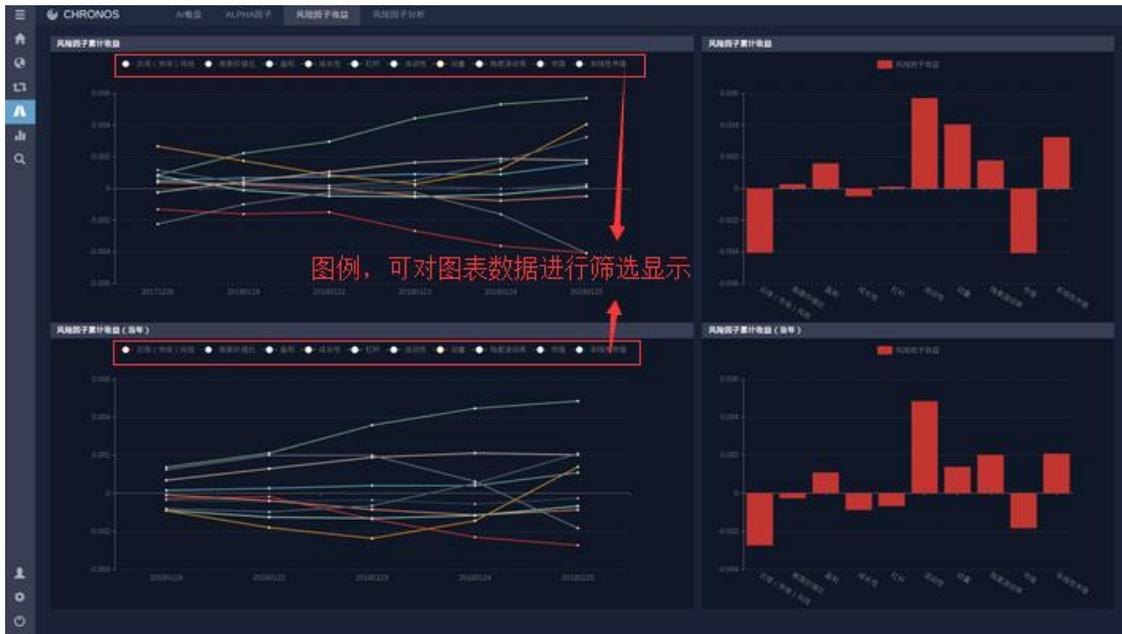
回测列表由本地保存，删除也是删除本地部分。

4. 智能预测

4.1. 风险因子收益

展示风险因子收益情况，分为风险因子累计收益（折线图、柱状图）、风险因子当年的累计收益（折线图、柱状图）四个图。

折线图支持鼠标滚轮放大缩小和鼠标左键按住进行左右拖动。



4.2. 风险因子分析

对风险因子的数据分析，分为风险因子暴露（折线图、柱状图）、风险因子收益归因（折线图、柱状图）四个图。

折线图支持鼠标滚轮放大缩小和鼠标左键按住进行左右拖动。

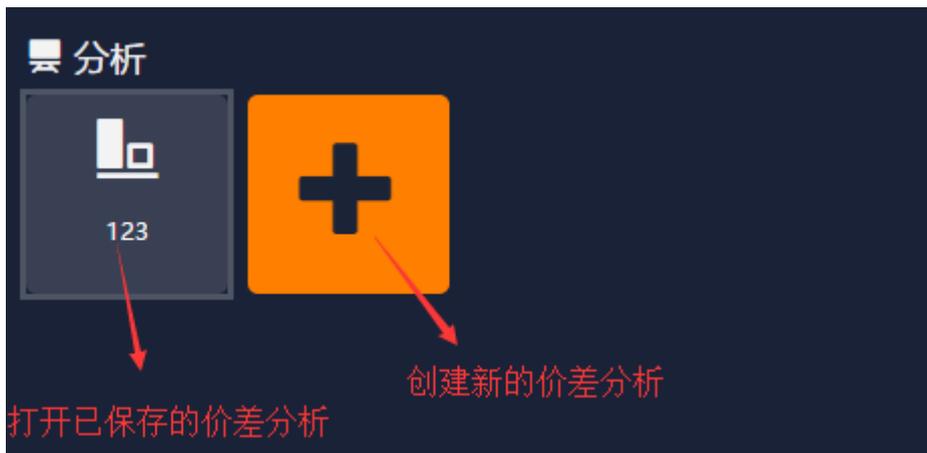


5. 行情分析

5.1. 价差分析

SpreadViewer 软件主要为进行价差分析的专业交易研究员和高级交易员提供的一种辅助分析工具，软件通过连接历史行情和实时行情显示两腿的价差曲线，寻找有效的投资时机。

点击鼠标右键出现菜单，可点击删除将此实例删除。



价差分析界面：



价差分析主要通过设置目标代码，进行分析，并对两个目标的参数进行设置，以便让

图形显示出合理的曲线对比。可将设置保存并创建一个实例，方便下次打开使用。

时间轴区间可选（10 分钟（秒线），1 小时（秒线），1 天（10 秒线）），交易时间过滤可选（两个目标代码的交易时间取交集或者并集），参数设置栏可选择隐藏或显示。

点击计算按钮后开始计算，请求获取实时行情，并在第一次成功获取到两条腿的实时行情后去请求历史行情。历史行情与实时行情之间无缝对接，显示完整的曲线。

图表分上下两个图，上图显示两个计算公式的计算结果曲线，下图显示两个目标代码的最新价曲线。图表支持鼠标滚轮放大缩小，鼠标点击拖动。

界面左下方按钮点击显示或隐藏日志面板，界面右下方显示行情连接状态。

日志面板：



当前时间	Ukey1行情时间	Ukey2行情时间	其他信息
2018/05/08 09:38:55			历史行情获取成功
2018/05/08 09:38:54	2018/05/08 09:38:54	2018/05/08 09:38:54	
2018/05/08 09:38:51			Ukey2行情获取成功，等待Ukey1行情...
2018/05/08 13:55:06			正在请求行情...

日志表格分 4 列，分别为当前时间，ukey1 行情时间，ukey2 行情时间，其他信息。

Ukey1 行情时间表示当前时间点 ukey1 获取到的最新一条行情的时间，如果与当前时间不相同（标红显示），就表示图表中对应此时间点的行情并不是准确的行情，而是自动补齐的行情（根据上一个点进行补齐）。Ukey2 行情时间同理。

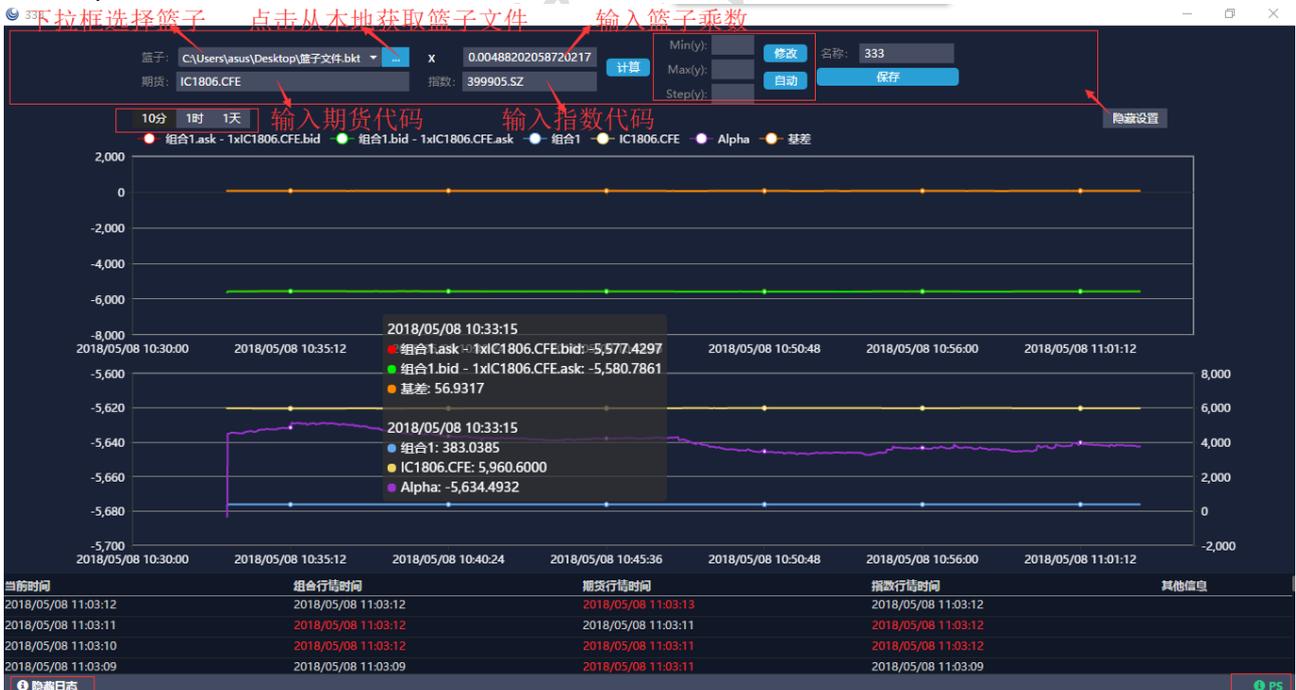
其他信息包括行情连接状态、请求行情状态等。

5.2. Alpha&基差

点击鼠标右键出现菜单，可点击删除将此实例删除。



Alpha&基差界面:



篮子或篮子文件选取后会根据篮子内容，对篮子乘数、期货、指数进行初始化，也可手动更改。可将设置保存并创建一个实例，方便下次打开使用。

其余功能内容与价差分析类似。

5.3. 集中行情



集中行情界面：

证券代码输入框，输入万得代码或拼音首字母会进行智能识别，在下拉框中鼠标点击或者键盘回车选择

当前行情的时间

证券代码	时间戳	挂买量	价格	挂卖量
000001.SZ	2018/05/08 11:17:51		11.1500	730456
			11.1400	246200
			11.1300	319600
			11.1200	508100
			11.1100	513700
			11.1000	1641420
			11.0900	1012400
			11.0800	438375
			11.0700	333100
			11.0600	31837
		417600	11.0500	
		203800	11.0400	
		53400	11.0300	

证券代码	时间戳	挂买量	价格	挂卖量
000002.SZ	2018/05/08 11:17:51		28.4400	11500
			28.4300	15700
			28.4200	12600
			28.4100	8700
			28.4000	213500
			28.3900	64100
			28.3800	97500
			28.3700	24500
			28.3600	20448
			28.3500	51000
		35700	28.3400	
		17072	28.3300	
		15566	28.3200	

证券代码	时间戳	挂买量	价格	挂卖量
000004.SZ	2018/05/08 11:17:42		21.4500	4600
			21.4400	1300
			21.4000	800
			21.3900	200
			21.3800	1100
			21.3600	1300
			21.3300	800
			21.3200	1600
			21.3100	600
			21.3000	5800
		500	21.2800	
		700	21.2600	
		2600	21.2500	

证券代码	时间戳	挂买量	价格	挂卖量
000005.SZ	2018/05/08 11:17:48		3.8100	8700
			3.8000	200400
			3.7900	114200
			3.7800	357124
			3.7700	196900
			3.7600	90000
			3.7500	210200
			3.7400	175800
			3.7300	130200
			3.7200	17658
		69000	3.7100	
		299400	3.7000	
		157500	3.6900	

6. 篮子管理

6.1. 篮子管理

篮子管理界面：包括我创建的篮子和我关注的篮子



(1) 我创建的篮子支持编辑、共享、删除操作功能



(2) 导入&导出：支持导入/导出带参数的 bkt 文件和不带参数的 CSV 文件两种的篮子文件格式

(3) CSV 文件格式如下：A-标的代码；B-标的数量/比例（数量可为负，表示卖出）；C-初始价格，非必填，不填时导入篮子时默认展示昨收价

	A	B	C	D
1	000001.SZ	-100		
2	000002.SZ	200		
3	000004.SZ	300		
4				
5				

- (4) bkt 文件格式如下：AmountType=0 表示数量篮子，1 表示权重篮子；BasketValue 为篮子总金额；BasketMultiplier 为篮子乘数。Components 下输入标的的代码和标的的数量/比例

```

qixiantaoli.bkt
[Parameters]
AmountType=0
BasketValue=1183755
BasketMultiplier=200.3209

[Components]
000012.SZ,1600
000028.SZ,200
000039.SZ,1600
000089.SZ,1600
[End]

```

- (5) SH: 上海证券交易所、SZ: 深圳证券交易所、CFE: 中国金融期货交易所、SHF: 上海商品期货交易所、CZC: 郑州商品期货交易所、DCE: 大连商品交易所
- (6) 版本: 首次建篮子时默认为空，新建后变为 1，后续根据更新的次数叠加。可选择查看历史某个版本的篮子，并可修改生成最新版本篮子
- (7) 更新时间: 记录当前版本更新的具体时间
- (8) 指数篮子: 支持搜索指数和 ETF 代码，一键生成篮子
- (9) 添加单只证券时，默认展示在第一条，【数量/比例】默认 0、【初始价格】默认昨收价
- (10) 删除: 需勾选标的后该按钮才变亮
- (11) 篮子总金额、篮子乘数: 默认为空。如导入的篮子文件带有该参数则自动填充，可修改
- (12) 输入篮子总金额可将比例换算成数量，换算公式: 单只证券数量=篮子总金额*比例/初始价格，需取整



- (13) 当我关注的篮子有更新时，会出现红点，点击后红点消失
- (14) 具体某个篮子有更新时，篮子图标右上角出现红点，点击【查看】后红点消失
- (15) 可搜索篮子名称搜索社区内其他用户共享的篮子
- (16) 可复制关注的篮子至【我创建的篮子】模块



7. 报表管理

报表管理支持实盘和模拟盘【产品】、【策略】、【绩效】和【AI T+0 收益】统计相关数据的查询和导出功能



The screenshot shows the 'Report Management' section of the CHRONOSPACE system. The interface includes a sidebar with navigation options like '资讯动态', '实盘交易', '模拟交易', '智能预测', '行情分析', '篮子管理', '报表管理', and '证券信息'. The main area displays a table with columns for various financial metrics. The data shown is for a single entry labeled '1 ceshi001 (210001)'.

# 名称	当日盈亏	浮动盈亏	最新净值	可用资金	敞口比例	风险度	交易冻结资金	融资负债	融券负债	可用融资余额	平仓盈亏	持仓盈亏	盯市平仓盈亏	盯市持仓盈亏
1 ceshi001 (210001)	-211,259,569.67	-211,259,569.67	1.003	99,999,998,756.00	0.00	0.000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	-211,259,569.6700	0.0000	0.0000

红塔证券

8. 证券信息

8.1. 证券信息

8.1.1. 概览

默认显示的是上证指数（000001.SH）

若为期货或是期权，显示 6 个部分，分别是公司信息、K 线图、市场信息、关键指标、合约简介、标准合约；否则只显示公司信息、K 线图、市场信息、关键指标 4 个部分



8.1.2. 公司信息

公司信息	
公司名称	沪深300期货1712合约
英文名	CFFEX-IF1712
上市日期	2017,04,24
聚源证券代码	2008508
wind证券代码	IF1712.CFE
中文拼写	IF1712
板块	--
品种状态	普通
大类型	期货
小类型	股指期货
交易时间	[0930,1130],[1300,1500]
结算和交易货币	人民币
ukey码	3801258
交易所标识	IF1712
市场	中国金融期货交易所
退市时间	2017,12,15

8.1.3. K线图

K线图显示日线、周线、月线、季线和年线。可按需求选择相应的时间线来进行查看。



注：持鼠标滚轮放大缩小和鼠标左键按住进行左右拖动。



8.1.4. 市场信息

展示上一个交易日的涨跌停价格、昨收价、做结算值和昨持仓等数据。

市场信息	
交易日	2017,12,18
上个交易日	2017,12,15
涨停价格	4387.78
跌停价格	3590
昨收盘	3987.6
昨结算	3988.89
昨持仓	0
上次交易总量	5898

8.1.5. 关键指标

对总股本、流通股本、最小单笔成交量、资金到账日期延时等指标的展示。

关键指标	
总股本	0
流通股本	0
关联编码	0
行权价	0
最小单笔成交量	1
最大单笔成交量	999999999
每手股数	0
资金用于交易时间	0
证券用于交易时间	0
资金到账日期延时	0
证券到账日期延时	0

8.1.6. 合约简介

对合约内容的介绍，包括合约标的、合约乘数、合约价格、交易时间等。

合约简介	
合约标的	沪深300指数
合约乘数	每点300元
合约价值	沪深300指数点×300元
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2点
合约月份	当月、下月及随后两个季月
交易时间	上午9:15-11:30,下午13:00-15:15
最后交易日交易时间	上午9:15-11:30,下午13:00-15:00
价格限制	上一个交易日结算价的正负10%
合约交易保证金	合约价值的8%
交割方式	现金交割
最后交易日	合约到期月份的第三个周五，遇法定节假日顺延
最后结算日	同最后交易日
手续费	30元/手(含风险准备金)
交易代码	IF
上市交易所	中国金融期货交易所

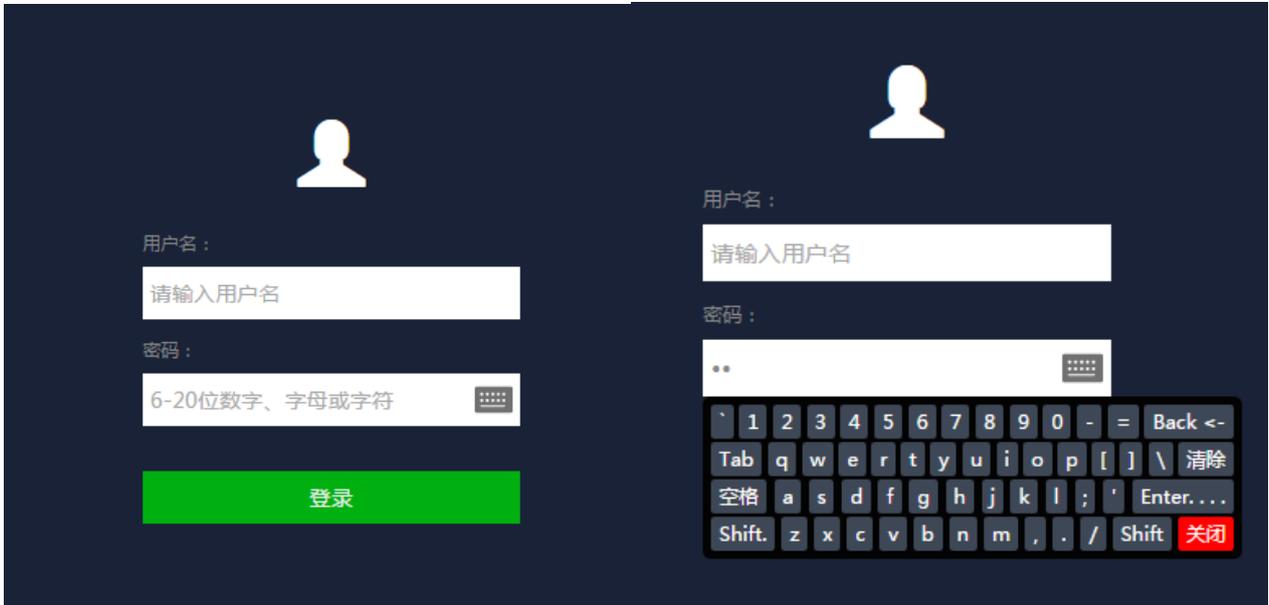
8.1.7. 标准合约

对标准合约相关指标的详细介绍。

标准合约			
合约编码	24	市场编码	IF
标的中文名称	沪深300期货	标的英文名称	IF
报价单位	指数点	最小变动价位	0.2指数点
每日价格最大波动限制	上一个交易日结算价的±10%	合约交割月份	1,2,3,4,5,6,7,8,9,10,11,12(当月,下...
交易时间	上午9:30-11:30,下午13:00-15:00	最后交易日	合约到期月份的第三个周五,遇法定...
交割日期	合约到期月份的第三个周五,遇法定...	交割品级	
交割地点		最低交易保证金	最低交易保证金:合约价值的15%
交易手续费	30元/手(含风险准备金)	交割方式	现金交割
上市日期	2010,04,16	下市日期	未退市
交易货币	人民币		

9. 个人中心

(1) 首次打开软件时，即进入到个人中心模块，输入正确的用户名和密码点击登陆进入软件首页。其中密码部分为防止键盘监听，可用软件自带的软件盘进行输入，如下图：



(2) 登陆成功后，再进入个人中心模块时，显示三个按钮：锁定用户 XXX，切换用户，修改密码。



(3) 点击锁定用户 XXX 可进入软件锁屏页（该功能用于防止用户离开后其他人的恶意操作）。进入锁屏页面后需要输入登录密码点击解锁按钮后才能重新解锁；或者点击切换用户按钮回到登录界面；或者点击退出按钮弹出对话框选择最小化或退出软件。



- (4) 点击切换用户后回到登录界面。
- (5) 点击修改密码进入修改密码界面。



输入正确的原密码和新密码后点击确认完成密码修改；或点击取消返回个人中心。

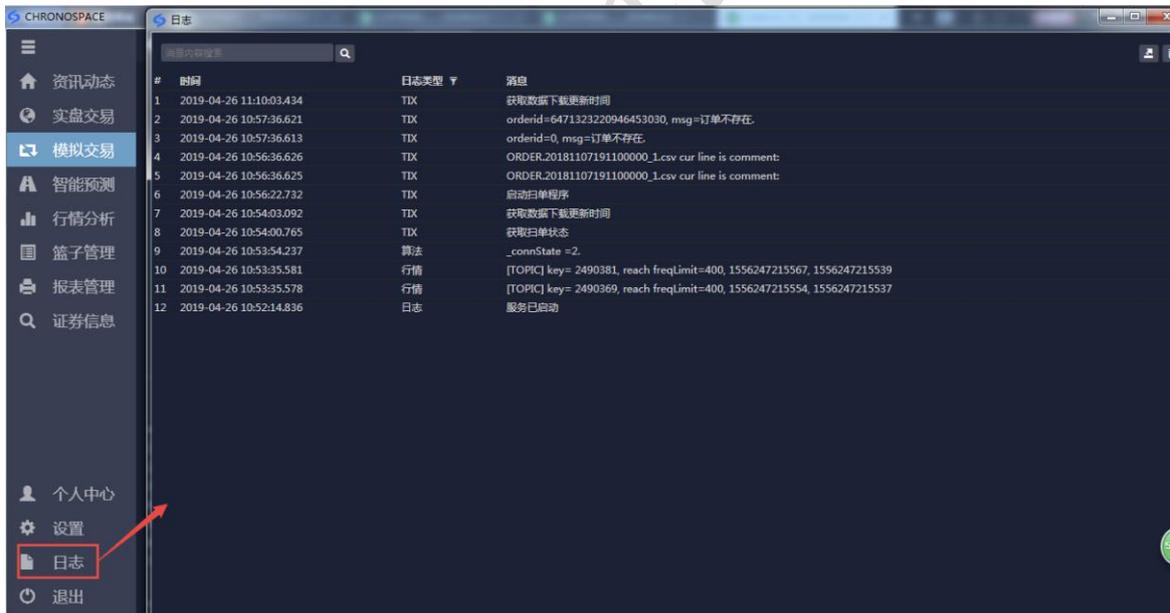
10. 设置

设置模块可用来配置软件所需要的交易服务器和行情服务器的地址。同时可查看软件相关信息。



注意：系统在生产环境或是测试环境之间的切换，就是通过在该设置下来更改服务器地址以及行情地址。

11. 日志

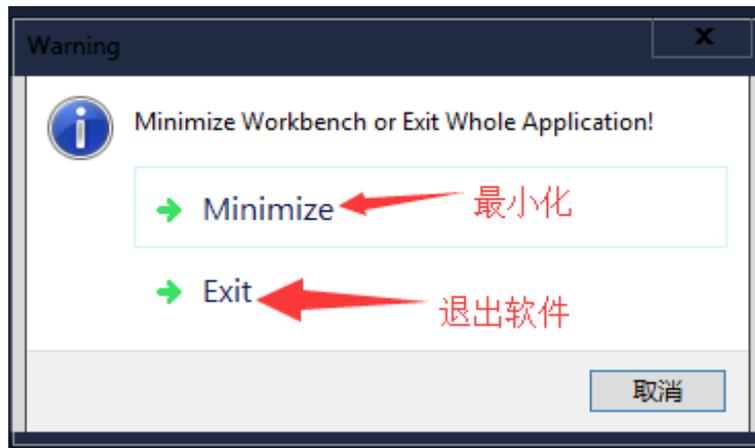


- (1) 界面展示当天日志，从启用客户端到当天 24:00:00 000，默认按时间倒序排列，支持排序
- (2) 日志类型：TIX、算法、升级、系统、行情
- (3) 仅展示警告以上级别的日志，包含：警告、危险、致命
- (4) 支持一键清屏日志和导出日志操作

12. 退出



退出按钮点击后弹出对话框，可以选择软件最小化或者退出软件。如下图：



红塔