

华鑫证券有限责任公司 剑鱼星软件使用说明

华鑫证券有限责任公司
(版权所有,翻版必究)

修订历史记录

版本号	日期	修订者	修订	修改说明
1.0.0	2023-03-21	定制终端组	新增	创建
1.0.2	2023-09-18	定制终端组	更新	添加"组合条件单"及其他功能完善
1.0.3	2023-12-15	定制终端组	更新	完善"组合条件单": 支持前/后复权的指标条件, 添加换手率、量比、价格反弹和回落条件
1.1.0	2024-04-02	定制终端组	更新	新增"定时委托": 预设时间和参数, 到达时间后报单
1.1.3	2024-12-25	定制终端组	更新	添加沪港通业务的支持 添加冰山算法模块
1.1.4	2025-01-06	定制终端组	更新	添加网格单模块 添加历史查询功能(交割单、资金、流水、持仓、盈亏)
1.1.5	2025-06-12	定制终端组	更新	添加同客户号的多节点登录 添加节点间资金划拨 添加要约收购
1.1.6	2025-07-24	定制终端组	更新	添加重要公告弹窗 完善"闪电下单": 预估金额, 按委托金额报单, 数量比例
1.1.7	2025-09-24	定制终端组	更新	完善"算法交易": 支持快捷创建算法任务 添加"条件触发单": 涨停板封单减少条件卖出

目 录

1 适用场景	5
2 测试环境账号	5
3 运行环境	5
4 功能介绍	5
4.1 账号登录	5
4.2 账号管理	6
4.3 主功能区	7
4.4 菜单-系统	8
4.4.1 系统设置	8
4.4.2 多窗口模式	12
4.5 菜单-交易	13
4.5.1 闪电下单	13
4.5.2 普通下单	18
4.5.3 算法交易	23
4.5.3.1 TWAP	24
4.5.3.2 POV	31
4.5.4 冰山算法	35
4.5.5 网格交易	39
4.5.6 定时委托	46
4.5.7 条件触发单	50
4.5.8 组合条件单	53
4.6 菜单-综合	57
4.6.1 资金转账	58
4.6.2 密码修改	58
4.6.3 申购赎回	59
4.7 菜单-查询	59
4.7.1 信用查询（两融）	59
4.7.1.1 信用资产明细	60
4.7.1.2 信用负债记录	60

4.7.1.3 标的证券查询..... 61

4.7.2 持仓明细..... 61

4.7.3 当日委托..... 62

4.7.4 当日成交..... 62

4.7.5 历史记录..... 63

4.7.6 设置表头栏位..... 63

4.8 菜单-帮助..... 64

4.8.1 检查更新..... 64

1 适用场景

剑鱼星交易终端作为一款轻量级、操作简单快捷的交易软件，支持普通和两融业务。主要适用于交易员快速下单、实时行情跟踪和仓位信息查看等场景。为了达到交易快一步的目的，交易终端融合了多种鼠标快捷交易操作，可自定义符合各种用户习惯的快捷操作。同时终端也支持多个交易窗口的分屏显示，拖放位置记忆，可以让交易员方便地对多个标的进行跟踪、快速操作。

2 测试环境账号

为配合投资者熟悉我司交易系统，用户可通过登录界面的通讯设置，切换至测试环境。测试环境需要 N 视界账号，请前往 N 视界官网注册获取：

<http://n-sight.com.cn/u/w/authLogin/register.html>。

3 运行环境

本软件为 64 位绿色免安装版本，解压之后即可使用，支持 Win7、Win10、Win11 操作系统。若软件运行后提示缺少 MSVCP140.DLL 等库文件，安装 vc_redist_x64.exe 即可解决。

4 功能介绍

4.1 账号登录

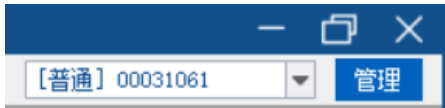
登录窗口如下：



当前版本支持普通账户/信用账户的登录。自动记忆上次登录成功的客户号。可通过右下角的“通讯设置”，弹出“网络测速”窗口，切换实盘环境与测试环境。注意每个实盘账号有对应的交易节点号，请在交易主站地址的列表，双击对应行选中该节点号，否则会提示“找不到用户”。例如宛平 12#-电信 1，代表 12 号节点，节点名后缀代表可供选择的线路（电信、联通、移动）。

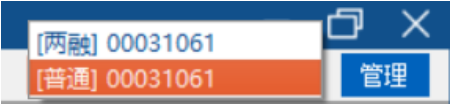
4.2 账号管理

登录成功进入主界面，右上角显示当前登录的账号及其类型（普通/两融），点击“管理”按钮可打开账号管理窗口。





支持最多同时登录 1 个普通账号和 1 个两融账号。账号管理窗口中显示了普通和两融账号的登录情况。如左图所示，普通账号已登录并显示其账号，两融为“未登录”状态，点击两融的登录按钮，弹出登录窗口完成账户登录后，在右图中同时显示普通和两融账户、上次登录、前置节点名称等信息。



当两个账号皆为已登录状态时，在主界面右上角，可实现快速切换。

4.3 主功能区

登录成功后交易终端主界面如图所示。从上往下依次为菜单栏、汇总字段栏、操作区、连接状态栏。



总资产: 95981583.52		总市值: 95963659.41		可用资金: 17924.10		今费用: 0.00		持仓浮盈: -4305032.17		当日盈亏: 371780.45		?	[普通] 00031061	管理
净资产: 100140857.34		总负债: 396579.65		维持担保比例: 25351.13%		总市值: 4187963.78		可用资金: 96221310.97		持仓浮盈: +127548.42			[两融] 00031061	管理

汇总字段栏根据当前主窗体的账号类型（普通/两融），展示不同的字段。

剑鱼星_v1.0.0(普通)	
15.70	?
总资产 = 总市值 + 可用资金 + 逆回购 + 冻结资金 + 冻结手续费	
总市值: 95889294.67	可用资金: 17924.11
今逆回购: 0.00	未到期逆回购: 0.00
冻结资金: 0.00	冻结手续费: 0.00
当日盈亏 = 实时总资产 - 上日资金结存 - 上日持仓市值 - 未到期逆回购 + 当日出金 - 当日入金	
其中:	
实时总资产 = 95907218.77	
上日资金结存 = 17924.11	
上日持仓市值 = 95591878.96	
未到期逆回购 = 0.00	
当日出金 = 0.00	
当日入金 = 0.00	

普通账号主窗口汇总栏的“?”按钮，点击后展开计算明细。

剑鱼星终端自动记忆窗口位置布局，每次登录进入主界面后，会自动载入上次打开的子窗口，并显示在之前关闭前的位置。

4.4 菜单-系统

系统	交易	综合
系统设置		
重连交易服务器		
重连行情服务器		
新增主窗体		
关闭当前主窗体		
打开程序运行目录		
退出程序(X)		

4.4.1 系统设置

- 主界面设置



报单/撤单弹窗确认：报单/撤单是否需要确认。弹窗确认的配置项适用于闪电下单和普通下单窗口。

提示音设置：可选成交、撤单时是否播放指定的提示音效。

成本计算方式：可设置采用哪种成本金额来计算持仓成本和盈亏。

注：摊薄成本（或持仓成本）指的是中途有盈利卖出，成本价就会摊低，相反如果是亏损卖出，成本价就会提高；而开仓成本（或买入成本）指的是仅考虑买入开仓时候的成本，中途卖出不影响该成本价。

清仓后盈亏率：仅摊薄成本适用，清仓后盈亏率=盈亏/(当日卖出金额-盈亏)

全部撤单范围：定义委托表格全撤按钮的范围。买卖方向仅对普通和两融买卖批量撤单，全部方向包含配股配债、转股回售等等所有方向。

自成交控制：开启后如果发送一笔可能会引起自成交的委托，将被柜台拒绝该笔委托（该功能取决于柜台是否开启支持）

融券头寸类型：适用于闪电下单、算法交易、组合条件单的两融融券卖出方向的默认头寸类型（普通、专项）。仅登录信用后显示，设置确定后立即生效。

默认股东号：全局生效，发送报单时采用股东号，默认为主股东号，用户修改后仅当次登录期间有效，软件重启后恢复为默认采用主股东号。

提示音设置：对于成交/撤单事件设置提示音。

● 闪电下单设置



此页的所有配置项仅对闪电下单窗口有效。

默认委托价格：切换证券代码后在委托价格输入框的默认填入值。

拆单参数：当对应证券类别和报单类型的拆单功能开启后，如果输入的委托数量大于等于触发数量自动拆单。

由于不同品种证券的单笔最大数量各有不同，因此可对不同品种证券，分组设置各自的拆单参数。默认参数为拆单功能全部是关闭状态；触发数量科创板股票默认为限价单 10 万股，市价单 5 万股；创业板股票默认为限价单 30 万股，市价单 15 万股；其余类别默认为 100 万（股\张\份）。

数量单位说明：股票为股，债券为张，基金为份。



固定数量模式：每笔委托数量=单笔上限，最后一笔报出剩余量；

数量递减模式：第一笔委托数量=单笔上限，后续每笔委托数量=上一笔委托数量-递减数量，最后一笔报出剩余量；

区间随机模式：每笔委托数量=单笔上限和单笔下限之间的随机值，最后一笔报出剩余量；

最后一笔报出剩余量解释：根据当前设置的拆单策略和参数计算拆单笔数和

每笔数量时，如果某一笔计算完成后，最后剩余的数量小于等于设定的单笔上限，后续一笔直接报出所有剩余量。

注：如果拆单笔数过多，可能因每秒最大笔数的流控限制导致废单。另外本拆单策略不含撤单补单逻辑。

● 普通下单设置

设置
主界面设置
闪电下单设置
普通下单设置
组合条件单设置
定时委托单设置
通用设置

默认委托价格 最新价
☐ 报单后清空界面
☒ 切换买卖时保留证券代码

可配置“普通下单”窗口的默认价格及是否自动清空界面。

● 组合条件单设置

设置
主界面设置
闪电下单设置
普通下单设置
组合条件单设置
定时委托单设置
通用设置

☒ 生成任务后自动启动
 价格复权类型 ☐ 不复权 ☒ 前复权 ☐ 后复权 ?
 条件运算式 ☐ 手动输入 ☒ 自动更新: 且 ☐ 自动更新: 或 ?

复权类型：仅对 1、5、60 分钟、日线有效。周线和月线固定为不复权，且仅对指标类型的条件有效（MA、MACD、KDJ），不会修改已经存在任务的复权类型。

条件运算时：开启自动更新时，当选中条件表格中的条目新增/修改/删除后，下方的运算表达式自动用“且”或者“或”连接所有选中条件，自动填入表达式。

● 定时委托单设置

设置
主界面设置
闪电下单设置
普通下单设置
组合条件单设置
定时委托单设置
通用设置

☒ 点击“定时买卖”，单个任务创建后自动启动
☒ 从本地文件导入，批量任务创建后自动启动
 启动时设定时间已过期 ☐ 立即报单 ☒ 不再报单 ?

任务自动启动：通过定时委托单界面上单个任务的手动创建，或者通过本地文件导入多个任务的批量创建，勾选后任务创建后立即启动。

启动时设定时间过期：任务启动时，如果当前时间已经超过设定时间，可选择启动后立即发出该笔报单，或者禁止报单。

● 冰山算法设置

设置	
主界面设置	
闪电下单设置	
普通下单设置	
组合条件单设置	
定时委托单设置	
冰山算法设置	

任务初始状态 ☒ 立即启动 ☐ 暂停状态

判断任务完成 ☒ 全部成交 ☐ 剩余零股 ?

任务初始状态：任务创建后启动（如果未到设定自动启动时间则进入初始状态），或创建后进入暂停状态。

判断任务完成：全部成交为任务成交数量等于目标数量后进入已完成状态，剩余零股为剩余数量不足交易规则的最小单笔委托数量时进入已完成状态。

● 通用设置

设置	
主界面设置	
闪电下单设置	
普通下单设置	
组合条件单设置	
通用设置	

自动锁屏间隔时间 不锁屏

☐ 详细日志模式

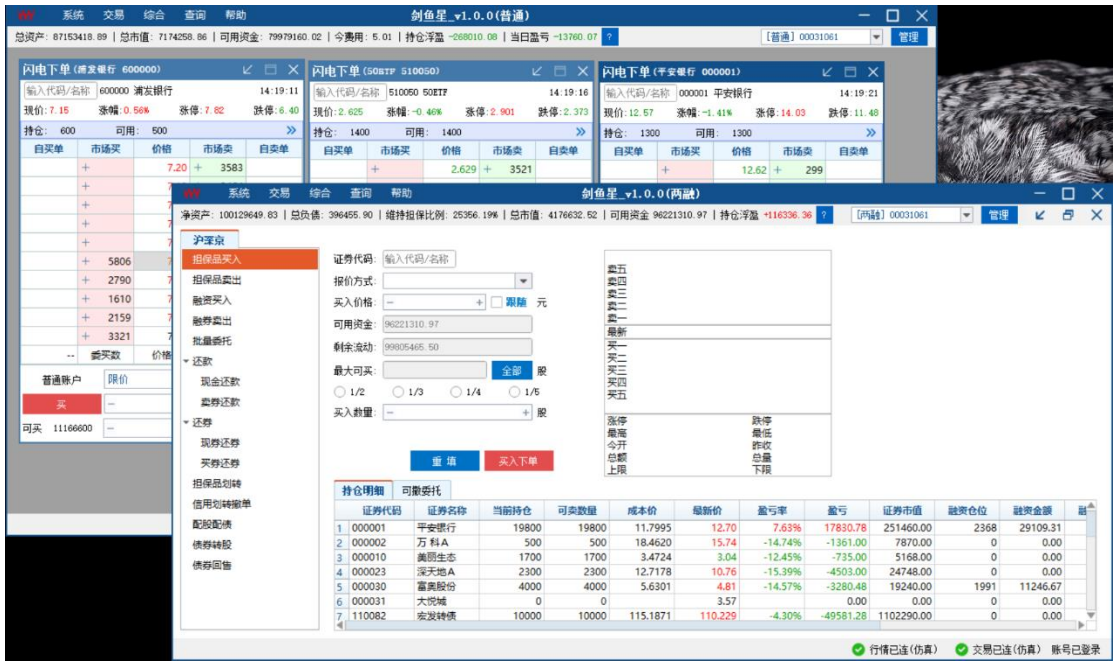
☒ 自动检查版本更新

☐ 监控版(禁用交易权限)

可配置自动锁定时间，是否开启自动检查版本更新。

4.4.2 多窗口模式

用户可通过“新增主窗体”，复制多个主窗口，适用于多个显示屏环境。每个主窗口都可在右上角切换到一个已登录状态的现货\两融账号。



4.5 菜单-交易



交易菜单包括闪电下单、普通下单、逆回购（仅普通账号）、配股配债、算法交易、组合条件单、定时委托等功能模块。

4.5.1 闪电下单

点击交易菜单下的“闪电下单”可新建股票交易窗口。交易员可根据自己的需求生成多个交易窗口，方便交易。在弹出的交易窗口股票信息框中可直接输入需要操作的股票代码或名称，鼠标单击之后直接清空搜索框中的内容。

每个交易窗口可以在灰底的操作区域自由拖动摆放，并按记忆放置位置，终端再次启动会自动打开上次未关闭的交易窗口，恢复至原先位置。

闪电下单窗口支持股票债券基金的买卖，逆回购（卖出按钮）业务

闪电下单 (浦发银行 600000)

输入代码/名称 600000 浦发银行 10:04:11
现价: 7.19 涨幅: 0.84% 涨停: 7.84 跌停: 6.42
持仓: 83400 可用: 82900

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单
	+	7.23 +	4282	5
	+	7.22 +	4909	
	+	7.21 +	3269	
	+	7.20 +	6252	
	+	7.19 +	5312	
	+	1198 7.18 +		
	+	1004 7.17 +		
1	+	1633 7.16 +		
	+	2519 7.15 +		
	+	2190 7.14 +		
1	委买数	价格	委卖数	5

普通账户 限价 撤全 撤近
买 7.23 + 卖
可买 2300 500 + 股 82900 可卖

闪电下单 (浦发银行 600000)

输入代码/名称 600000 浦发银行 10:04:50
现价: 7.19 涨幅: 0.84% 涨停: 7.84 跌停: 6.42
持仓: 50800 可用: 50800

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单
	+	7.23 +	4287	
	+	7.22 +	4909	
	+	7.21 +	3280	
	+	7.20 +	6508	
	+	7.19 +	5422	
	+	1551 7.18 +		
	+	1004 7.17 +		
	+	1633 7.16 +		
	+	2621 7.15 +		
	+	2190 7.14 +		
--	委买数	价格	委卖数	--

担保品 限价 撤全 撤近
担保品买 7.19 + 担保品卖
可买 13378200 100 + 股 50800 可卖

交易窗口上方显示了该个股的综合信息，中间是盘口行情，用户可以在下方的报单区域进行个股的买卖操作。行情区域的第一列和第五列是用户以该委托价挂单的买卖总可撤数量（仅统计未成交未撤单部分的总数量，沪深 A 的单位为手，深港通为股），第二列和第四列是盘口数量（沪深 A 的单位为手，深港通为股）。可直接点击第二列（红色底）快速买入，第四列（绿色底）快速卖出。

请特别注意：行情盘口数量显示单位统一为手（深港通为股），而下方报单区域的委托数量单位为（股\份\张），而不是手。

闪电下单 (半导体 512480)

输入代码/名称 512480 半导体 连续交易 11:27:01
现价: 0.936 涨幅: 0.00% 涨停: 1.030 跌停: 0.842
持仓: 40000 可用: 40000

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单	行情明细	持仓统计
	+	0.940 +	52961		状态	连续交易
	+	0.939 +	15210		昨收	0.936
	+	0.938 +	24956		最高	0.942
	+	0.937 +	33238		最低	0.928
	+	0.936 +	67544		总手	799.6万
	+	43789 0.935 +			金额	7.5亿
	+	67017 0.934 +			实时净值	0.9362
	+	36884 0.933 +			买价上限	-
	+	38847 0.932 +			卖价下限	-
	+	34886 0.931 +				
--	委买数	价格	委卖数	--		

普通账户 限价 撤全 撤近
买 0.935 + 卖
可买 37700 100 + 份 40000 可卖

闪电下单 (半导体 512480)

输入代码/名称 512480 半导体 连续交易 11:28:13
现价: 0.936 涨幅: 0.00% 涨停: 1.030 跌停: 0.842
持仓: 40000 可用: 40000

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单	行情明细	持仓统计
	+	0.940 +	54499		持仓	40000
	+	0.939 +	15090		可用	40000
	+	0.938 +	29791		市值	37400.00
	+	0.937 +	28584		盈亏	2200.00
	+	0.936 +	71885		盈亏率	6.25%
	+	45615 0.935 +			今天金额	0.00
	+	65223 0.934 +			今天均价	0.000
	+	43683 0.933 +			今天卖量	0
	+	42396 0.932 +			今天金额	0.00
	+	34590 0.931 +			今天均价	0.000
--	委买数	价格	委卖数	--		

普通账户 限价 撤全 撤近
买 0.935 + 卖
可买 37700 100 + 份 40000 可卖

闪电下单右上方，点击展开扩展区域，点击收回扩展区域。

扩展区域：展示行情明细以及该证券的持仓字段。

行情明细表格最下的两个字段，买价上限和卖价下限，实时揭示了该证券（仅限股票）的限价类型价格笼子的报价范围。

具体操作方式如下：

● 选择证券



闪电下单左上方的输入框，支持证券代码、中文名、拼音首字母。

● 选择价格类型



● 委托价格和数量



报单可以通过单击盘口价格或下方输入框手动修改价格和数量。

● 报单

两种方式：一为买卖按钮；二为行情区域的单击快捷报单；

序号	操作	说明
1	手动输入价格、类型	在输入框中填入价格类型、委托价格、委托数量，点击左右

	进行报单	两侧的买\卖按钮发送报单。
2	单击行情区域的买 卖列快捷报单	在行情表格对应列上直接单击报单，价格为该行的行情价格。 价格类型和委托数量为下方报单区域内的值。

● 撤单

两种方式：一为撤全和撤近按钮；二为行情区域的双击快捷撤单；

另外在“委托明细”窗口中也可通过双击委托记录等方式进行撤单操作。

序号	操作	说明
1	撤近、撤全按钮	撤近：撤销该证券最新一笔的可撤挂单（所有委托方向）； 撤全：撤销该证券所有的可撤挂单（所有委托方向）；
2	双击行情区域的自 买自卖列快捷撤单	“自买单”列，双击撤销买单； “自卖单”列，双击撤销卖单；

快捷报单和快捷撤单的具体操作方式：

在行情表格区域的对应列中，可通过鼠标单击快速报单，双击快速撤单。

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单
	+	7.23	+	4543
	+	7.22	+	8890
	+	7.21	+	3571
	+	7.20	+	8005
	+	7.19	+	8692
	+	1328	7.18	+
	+	2233	7.17	+
1	+	2087	7.16	+
2	+	2738	7.15	+
	+	3110	7.14	+
3	委买数	价格	委卖数	10

快速报买单：第 2 列（红底），鼠标单击，会以该行所在的行情价格作为委托价格，立即发送一笔买单。价格类型和委托数量取决于下方的报单区域。

快速报卖单：第 4 列（绿底），鼠标单击，会以该行所在的行情价格作为委托价格，立即发送一笔卖单。价格类型和委托数量取决于下方的报单区域。

快速撤买单：第 1 列“自买单”显示该证券用户挂出买单的可撤数量，双击可撤销该委托价格的所有买单。最后一行是所有买单的可撤数量的累加总和，双击可撤销该证券的所有买单。

快速撤卖单：第 5 列“自卖单”显示该证券用户挂出卖单的可撤数量，双击可撤销该委托价格的所有卖单。最后一行是所有卖单的可撤数量的累加总和，双击可撤销该证券的所有卖单。

例如当用户通过以下操作后，最后展示结果如图中所示。

以 7.16 元 200 股报买单，且部分成交 100 股，剩余 100 股未成交。

以 7.15 元 200 股报买单，已报状态，没有成交。

以 7.23 元 500 股报卖单，已报状态，没有成交。

以 7.24 元 500 股报卖单，已报状态，没有成交。

报单\撤单时默认会弹出确认框，用户点击确定之后才会发送报单\撤单请求。是否显示确认弹窗的开关可在设置中修改。



4.5.2 普通下单

沪深京

深港通

买入

卖出

批量委托

逆回购

配股配债

债券转股

债券回售

证券代码: 000001 平安银行

报价方式: 限价

买入价格: 12.75 跟随 元

可用资金: 13632.86

最大可买: 1000 全部 股

☐ 1/2

☐ 1/3

☐ 1/4

☐ 1/5

买入数量: 股

重 填 买入下单

深000001 平安银行 11:29:40

卖五	12.79	425
卖四	12.78	649
卖三	12.77	494
卖二	12.76	126
卖一	12.75	728
最新	12.75	+0.05 +0.39%
买一	12.74	260
买二	12.73	4106
买三	12.72	6594
买四	12.71	6039
买五	12.70	10974
涨停	13.97	10%
跌停	11.43	
最高	12.88	最低 12.71
今开	12.75	昨收 12.70
总额	2.6亿	总量 2049.8万
上限	13.01	下限

持仓明细 可撤委托

	证券代码	证券名称	当前持仓	可卖数量	成本价	最新价	盈亏率	盈亏
1	000001	平安银行	9800	9800	11.9052	12.75	7.10%	8275
2	000002	万科A	17900	17900	16.0078	15.86	-0.92%	-264
3	000006	深振业A	2300	2300	5.0915	5.34	4.88%	57
4	000007	全新好	2200	2200	7.9522	7.80	-1.91%	-33
5	000008	神州高铁	2200	2200	2.6568	2.44	-8.16%	-47
6	000009	中国宝安	2300	2300	12.3383	11.78	-4.52%	-128
7	000010	美丽生态	2300	2300	3.5895	2.95	-17.82%	-147
8	000011	深物业A	2300	2300	10.3531	10.87	4.99%	118
9	000012	南玻A	2300	2300	7.2560	6.68	-7.94%	-132
10	000014	沙河股份	2300	2300	-11.8755	9.73	181.93%	4969
11	000016	深康佳A	2300	2300	5.1978	4.70	-9.58%	-114

现货普通下单窗口

沪深京

担保品买入

担保品卖出

融资买入

融券卖出

批量委托

还款

现金还款

卖券还款

还券

现券还券

买券还券

担保品划转

信用划转撤单

配股配债

债券转股

债券回售

证券代码: 000001 平安银行

报价方式: 限价

买入价格: 12.75 跟随 元

可用资金: 96221310.97

剩余流动: 99817773.78

最大可买: 1000000 全部 股

☐ 1/2

☐ 1/3

☐ 1/4

☐ 1/5

买入数量: 股

重 填 买入下单

深000001 平安银行 11:29:40

卖五	12.79	425
卖四	12.78	649
卖三	12.77	494
卖二	12.76	126
卖一	12.75	728
最新	12.75	+0.05 +0.39%
买一	12.74	260
买二	12.73	4106
买三	12.72	6594
买四	12.71	6039
买五	12.70	10974
涨停	13.97	10%
跌停	11.43	
最高	12.88	最低 12.71
今开	12.75	昨收 12.70
总额	2.6亿	总量 2049.8万
上限	13.01	下限

持仓明细 可撤委托

	证券代码	证券名称	当前持仓	可卖数量	成本价	最新价	盈亏率	盈亏
1	000001	平安银行	19800	19800	11.7995	12.75	8.06%	18
2	000002	万科A	500	500	18.4620	15.86	-14.09%	-1
3	000010	美丽生态	1700	1700	3.4724	2.95	-15.04%	-4
4	000023	深天地A	2300	2300	12.7178	10.71	-15.79%	-4
5	000030	富奥股份	4000	4000	5.6301	4.83	-14.21%	-3
6	000031	大悦城	0	0		3.58		
7	110082	宏发转债	10000	10000	115.1871	110.800	-3.81%	-43
8	128108	蓝帆转债	9946	9946	101.2325	101.496	0.26%	2
9	159915	创业板	1000	1000	2.3490	2.267	-3.49%	
10	159919	300ETF	1000	1000	3.7990	4.059	6.84%	
11	150020	恒生ETF	26300	26300	1.0746	1.008	-7.18%	

两融普通下单窗口

● 买入、卖出

买入(卖出)页面可通过输入代码或点击下方持仓记录的方式选择证券，可在设置窗口中修改默认填入的委托价格。

勾选“跟随”后委托价格会自动随当前所选择的档位价格变化，也可通过鼠

标双击行情价格更改价格跟随的档位。

● 批量买入、批量卖出

用于固定数量模式的拆单，可在“买入(卖出)数量”输入框内输入批量买入(卖出)的总数量，“单笔数量”处填入拆单的单笔委托数量，点击下单即可按固定的单笔数量批量下单，直至完成买入(卖出)总数量。

● 融资买入

普通下单

沪深京

担保品买入

担保品卖出

融资买入

融券卖出

批量委托

还款

现金还款

卖券还款

还券

现券还券

买券还券

担保品划转

信用划转撤单

配股配债

债券转股

债券回售

证券代码: 000001 平安银行

报价方式: 限价

买入价格: - 13.67 + 跟随 元

可用资金: 53090093.20

最大可融: 584800 全部 股

☐ 1/2 ☐ 1/3 ☐ 1/4 ☐ 1/5

买入数量: - + 股

重填 融资买入

深000001 平安银行 14:34:25

卖五	13.71	829
卖四	13.70	1868
卖三	13.69	1073
卖二	13.68	1418
卖一	13.67	1135 +977
最新	13.66	-0.30 -2.15%
买一	13.66	998 -1
买二	13.65	8515
买三	13.64	10937
买四	13.63	14451
买五	13.62	14319
涨停	15.36	10%
跌停	12.56	
最高	13.96	最低 13.62
今开	13.95	昨收 13.96
总额	3.1亿	总量 2278.9万

持仓明细 可撤委托 融资负债

	证券代码	证券名称	最新价	当前持仓	可卖数量	证券市值	成本价	盈亏	盈亏率	
1	000001	平安银行	13.66	14700	14700	200802.00	13.8282	-2472.00	-1.22%	
2	000002	万科A	17.30	30000	30000	519000.00	17.5357	-7071.34	-1.34%	
3	000006	深振业A	5.60	0	0	0.00		0.00		
4	000065	北方国际	10.01	1100	1100	11011.00	9.1495	946.54	9.40%	
5	000818	航瑞科技	33.47	0	0	0.00		0.00		
6	000927	中国铁物	2.95	0	0	0.00		0.00		
7	000960	锡业股份	14.90	0	0	0.00		0.00		
8	000983	山西焦煤	11.38	0	0	0.00		0.00		
9	001979	招商蛇口	14.59	0	0	0.00		0.00		
10	002008	大族激光	30.38	0	0	0.00		0.00		
11	002010	传化智联	5.99	0	0	0.00		0.00		
12	002025	航天中星	61.63	0	0	0.00		0.00		

融资买入页面下方显示了“持仓明细”和“融资负债”“可撤委托”三张表格。输入证券代码后，会提示当前的可融资买入数量，用户可根据提示来进行报单。

● 融券卖出

沪深京

担保品买入

担保品卖出

融资买入

融券卖出

批量委托

还款

现金还款

融券还款

还券

现券还券

买券还券

担保品划转

信用划转撤单

配股配债

债券转股

债券回售

证券代码: 000001 平安银行

报价方式: 限价

卖出价格: - 13.66 + 跟 元

头寸类型: 普通 专项

最大可融: 585500 全部 股

1/2 1/3 1/4 1/5

卖出数量: - + 股

重填 融券卖出

深000001 平安银行 14:34:43

卖五	13.71	849	+20
卖四	13.70	1868	
卖三	13.69	1073	
卖二	13.68	1477	
卖一	13.67	1722	+22
最新	13.66	-0.30	-2.15%
买一	13.66	574	-240
买二	13.65	7958	
买三	13.64	11245	
买四	13.63	14431	-10
买五	13.62	14304	
涨停	15.36	10%	跌停 12.56
最高	13.96		最低 13.62
今开	13.95		昨收 13.96
总额	3.1亿		总量 2279.0万

持仓明细 可撤委托 融券负债 公司可融券 刷新

	证券代码	证券名称	头寸类型	可融数量	到期日
1	000001	平安银行	普通	999806901	20991231
2	000002	万科A	普通	999913700	20991231
3	000006	深振业A	普通	999994600	20991231
4	000008	神州高铁	普通	999997800	20991231
5	000009	中国宝安	普通	999996800	20991231
6	000012	南玻A	普通	999999900	20991231
7	000016	深康佳A	普通	999981500	20991231
8	000021	深科技	普通	1000000000	20991231
9	000025	特力A	普通	1000000000	20991231
10	000027	深圳能源	普通	1000000000	20991231
11	000028	国药一致	普通	1000000000	20991231
12	000029	深深房A	普通	1000000000	20991231

在“融券卖出”页面输入证券代码后，展示所有可融券数量。下方会显示“持仓明细”、“可撤委托”、“融券负债”以及“可融券”四张表，用户可以通过选择不同头寸类型标的（普通、专项）来进行融券卖出操作。

● 还款

沪深京

担保品买入

担保品卖出

融资买入

融券卖出

批量委托

还款

现金还款

融券还款

还券

现券还券

买券还券

担保品划转

信用划转撤单

配股配债

债券转股

债券回售

可用金额: 53090093.20

需还款额: 3008381.10 全部 元

还款金额: - + 元

负债编号: -

☐ 指定负债 重填 还款

融资负债 融券负债 现金还款流水 刷新

	证券代码	证券名称	负债类型	头寸类型	状态	总负债金额	未还负债	未还交易费	未还利息
1	000927	中国铁物	融资买入	普通	未了结	518.00	19.26	0.00	
2	300973	立高食品	融资买入	普通	未了结	37985.00	6599.15	0.00	1
3	688196	卓越新能	融资买入	普通	未了结	13462.00	2463.75	0.00	
4	002010	传化智联	融资买入	普通	未了结	1032.00	660.17	0.00	
5	000960	锡业股份	融资买入	普通	未了结	2560.00	95.09	0.00	
6	000960	锡业股份	融资买入	普通	未了结	2560.00	2560.00	5.00	
7	300773	拉卡拉	融资买入	普通	未了结	2850.00	76.07	0.00	
8	300861	美畅股份	融资买入	普通	未了结	10668.00	1142.05	0.00	
9	300999	金龙鱼	融资买入	普通	未了结	8152.00	7963.69	0.00	2
10	300741	华宝股份	融资买入	普通	未了结	4820.00	785.23	0.00	
11	300919	中伟股份	融资买入	普通	未了结	37245.00	758.28	0.00	
12	300529	健帆生物	融资买入	普通	未了结	16993.00	3598.48	0.00	
13	300529	健帆生物	融资买入	普通	未了结	16995.00	16995.00	5.76	4
14	603871	嘉友国际	融资买入	普通	未了结	10820.00	10566.08	0.00	1
15	603297	永新光学	融资买入	普通	未了结	47185.00	6767.14	0.00	1
16	000983	山西焦煤	融资买入	普通	未了结	2572.00	1778.54	0.00	
17	003816	中国广核	融资买入	普通	未了结	536.00	16.01	0.00	

现金还款

普通下单

沪深京

担保品买入

担保品卖出

融资买入

融券卖出

批量委托

还款

现金还款

卖券还款

还券

现券还券

买券还券

担保品划转

信用划转撤单

配股配债

债券转股

债券回售

证券代码: 输入代码/名称

报价方式: 元

卖出价格: 跟随

最大可卖: 全部 股

卖出数量: 股

负债编号:

☐ 指定负债

重填

卖券还款

卖五

卖四

卖三

卖二

卖一

最新

买一

买二

买三

买四

买五

涨停

跌停

最高

最低

今开

昨收

总额

总量

持仓明细

可撤委托

融资负债

融券负债

刷新

	证券代码	证券名称	负债类型	头寸类型	状态	总负债金额	未还负债	未还交易费	未还利息
1	000927	中国铁物	融资买入	普通	未了结	518.00	19.26	0.00	
2	300973	立高食品	融资买入	普通	未了结	37985.00	6599.15	0.00	1
3	688196	卓越新能	融资买入	普通	未了结	13462.00	2463.75	0.00	
4	002010	传化智联	融资买入	普通	未了结	1032.00	660.17	0.00	
5	000960	锡业股份	融资买入	普通	未了结	2560.00	95.09	0.00	
6	000960	锡业股份	融资买入	普通	未了结	2560.00	2560.00	5.00	
7	300773	拉卡拉	融资买入	普通	未了结	2850.00	76.07	0.00	
8	300861	美畅股份	融资买入	普通	未了结	10668.00	1142.05	0.00	
9	300999	金龙鱼	融资买入	普通	未了结	8152.00	7963.69	0.00	2
10	300741	华宝股份	融资买入	普通	未了结	4820.00	785.23	0.00	
11	300919	中伟股份	融资买入	普通	未了结	37245.00	758.28	0.00	
12	200520	建明生物	融资买入	普通	未了结	16002.00	3508.48	0.00	

卖券还款

可以通过现金或卖券的 2 种方式进行融资或融券负债中资金部分（包括融资负债金额、利息、费用等）的偿还。如果勾选“指定负债”，并在下方负债表格中选中需要还款的负债记录，负债编号会根据选择的记录自动填入报单信息中，对应的还款金额也会自动更新。如果不指定负债，则默认归还最早到期负债。归还负债的优先级为先还利息再还负债。

● 还券



现券还券页面



买券还券页面

可以通过现券或买券两种方式进行融券负债中券数量的偿还。还券必须指定一个融券负债编号，可以通过鼠标单击下方“融券负债”表格中的记录选择。

勾选“一并还款”，同时偿还融券负债中的费用资金。

● 担保品划转



输入证券代码或点击下方持仓记录，选择划转方向（普通->信用或信用->普通）后，自动更新当前标的的“最大可划”数量，输入“划转数量”后点击划转即可完成信用与普通账户之间持仓的划转。同时可在下方的“划转流水”表格中查看当天的所有划转记录。

担保品划转默认显示的是“单笔划转”功能页，点击“批量划转”按钮切换到批量划转页，可勾选和修改持仓表的请求数量进行批量划转。



4.5.3 算法交易

支持 TWAP 和 POV 两种算法，建议实盘交易前先在仿真环境测试验证。

点击左上方“<<”图标按钮，可展开“创建即时任务”区域，快捷创建一个算法任务并立即执行。



4.5.3.1 TWAP

时间加权平均价格（TWAP）是国际通行的算法，TWAP 交易时间加权平均价格 Time Weighted Average Price 模型是把一个母单的数量平均地分配到一个交易时段上。该模型将交易时间进行均匀分割，并在每个分割节点上将拆分的订单进行提交。例如，可以将某个交易日的交易时间平均分为 N 段，TWAP 策略会将该交易日需要执行的订单均匀分配在这 N 个时间段上去执行，从而使得交易均价跟踪 TWAP，也是一个计算公式：

$$Twap = \frac{\sum_{i=1}^n price_i}{n}$$

TWAP 不考虑交易量的因素。TWAP 的基准是交易时段的平均价格，试图付出比此时段内平均买卖差价小的代价执行一个大订单。TWAP 模型设计的目的是使交易对市场影响减小的同时提供一个较低的平均成交价格，从而达到减小交易成本的目的。在分时成交量无法准确估计的情况下，该模型可以较好地实现算法交

易的基本目的。

● 主功能区



上方区域为策略信息，下方为最新的持仓、委托、成交、其他信息。

算法交易窗口中，同时展示了 TWAP 和 POV 的任务和交易记录，在不同区域内可以通过（全部/TWAP/POV）对算法任务、委托记录、成交记录进行过滤。

可以对选中的股票启动、暂停和停止策略，策略暂停后可修改策略的参数，启动后继续执行未完成的任务量，策略停止则会终止当前策略执行，再次启动则重头开始执行策略。需手动点击“启动”后继续运行。手工暂停或停止操作后，会立即撤销所有未成交挂单。

执行状态会显示本次策略运行状态，分“初始”“执行中”“执行结束”“手动停止”等状态，执行信息则会显示本策略执行起始和结束的时间。完成比例显示当前时间片的完成比例和总任务的完成比例。当前时间片则会显示本策略目前运行的时间片序号。

● 参数设置

点击主界面的“参数设置”，在弹出的“设置策略参数”界面中可新增、删除策略。以及对每条策略的时间片进行增、删、改等操作。设置完成点击“保存”按钮后策略参数立即生效，重启软件后自动载入上次设置的策略参数。

具体策略参数解释，请查阅后文中的“TWAP 策略文件字段说明”表。



● 添加删除策略

点击上述界面中的“新增策略”按钮，选择证券和方向。现货支持委托方向为买入、卖出；两融支持的委托方向为买入、卖出、融资买入、融券卖出。



选中证券代码，点击“删除策略”，弹出确认删除窗口。



● 添加策略时间片

策略增加后，首先必须进行时间片的添加。左侧列表选中某一个策略后（如没有策略需先新增策略），可以在“设置参数”页面的右上区域进行时间片的添加。时间片参数可对“开始时间”“结束时间”等参数进行设置，输入片内总量、执行模式、每笔数量、报单间隔。“报价优化”可以填正负数值，不带正负号则以正数处理。输入完成后点击“添加时间片”即可。

当前任务 TWAP#3_SZ000001_平安银行_卖出

开始时间 结束时间 片内总量

执行模式 单笔数量 报单间隔

价格类型 报单价格 报价浮动

撤单类型 撤单时间

价格下限 ☒ 开启 价格上限 ☒ 开启

注：单个策略具有唯一的委托方向，各时间片的委托方向相同。

● 删除策略时间片

右下时间片表格，选中一条时间片，点击“删除时间片”可以删除该时间片。

● 修改策略时间片

序号	起始时间	结束时间	任务比例	片内总量	执行模式	每笔数量	报单间隔	价格类型	报单价格
1	09:30:00	10:30:00	50.0%	1000000	指定单笔数量	1000	(自动计算)	买一价	无
2	13:00:00	14:00:00	25.0%	500000	指定单笔和间隔	10000	60	指定限价	11.460
3	14:30:00	14:55:00	25.0%	500000	指定报单间隔	(自动计算)	<input type="text" value="20"/>	市价	0.000
合计			100%	2000000					

右下时间片表格，在需要设置的参数值显示格上双击，即可填入需要设置的参数，填完后需按回车键确认。

● 导入策略


从 csv 格式文本的策略文件导入策略，导入前建议先清空原有策略。文本的第一行默认为标题，不会被识别为策略内容。后续每一行代表着某个策略中的一条时间片对应的参数。详细字段解释请查阅“TWAP 策略文件字段说明”表。

TWAP 策略文件字段说明	
字段名	说明
算法类型	固定填“TWAP”
TWAP 策略号	策略唯一的序号（从 1 递增） 同一策略号下的时间片，必须是相同的证券和买卖方向
策略名称	市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，深港通 SZH，北京 BJ） 例：SH600000，SZ000001，SZH00001（深港通）
开始时间	格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示 例：09:30:00，（注：该时间为电脑本地时间）
结束时间	格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示

	例：14:57:00，（注：该时间为电脑本地时间）
片内总量	时间片内需完成的目标量，单位：股/份/张
每笔数量	每笔报单的数量，单位：股/份/张 仅对执行模式“指定单笔数量”和“指定单笔数量和间隔”有效
价格类型	报单的价格类型： 0-最新价, 1-卖一, 2-买一, 3-市价, 4-卖二, 5-买二, 6-卖三, 7-买三, 8-卖四, 9-买四, 10-卖五, 11-买五, 12-指定限价 当前版本，3-市价只支持最优五档成交剩余转撤销。
撤单类型	0-自动撤单自动补 1-自动撤单不补单 2-手动撤单
撤单时间(秒)	仅针对行情盘口档位的价格类型有效。 当撤单类型为 0-自动撤单自动补，或 1-自动撤单不补单时，该字段有效，不允许小于 3 秒。 某一笔委托挂单未全部成交，超过设定的撤单时间，且该笔委托价格与从行情计算出的新价格不同时，才会撤销该笔委托。
报单价格	用户自定义的委托价格 价格类型为 12-指定限价时，需填入有效价格的值。 价格类型为 3-市价时，该委托价格为保护限价。 填值大于 0 的有效价格，则以此为保护限价。 填 0，则买入时用涨停价，卖出时用跌停价作为保护限价。 价格类型为其他时，填 0 即可。 例： 价格类型限价时，填 113.92 价格类型市价时，填 5.49（有效的保护限价） 价格类型市价且为买入方向，填 0（涨停价作为保护限价） 价格类型市价且为卖出方向，填 0（跌停价作为保护限价）
优化方式	仅仅针对行情盘口档位的价格类型有效。 最终委托价格 = 基准价经过报价优化调整后的值 优化方式可选择最小变动价格 tick 或百分比

	<p>Tick 值：最终委托价格 = 基准价 + 报价优化</p> <p>百分比：最终委托价格 = 基准价 * (1 + 优化百分比)</p> <p>0-tick, 1-百分比</p>
报价优化	<p>当优化方式为 0-tick 时：</p> <p>整形数据，可设置正负，表示±N 个最小变动价格</p> <p>例：-2（如果股票，优化值为 -0.02 元，即基准价下调 0.02 元）</p> <p>当优化方式为 1-百分比时：</p> <p>浮点型，可设置正负，表示±N%</p> <p>例：0.5（报价优化为 0.5%，即基准价向上调整 0.5%）</p>
价格下限	<p>如果行情最新价小于该值，则不报单</p> <p>0 表示不启用价格下限；</p>
价格上限	<p>如果行情最新价大于该值，则不报单</p> <p>0 表示不启用价格上限；</p>
买卖方向	0-买入, 1-卖出, i-融资买入, j-融券卖出
执行模式	<p>0-指定单笔数量，1-指定报单间隔，2-指定单笔数量和间隔</p> <p>指定单笔数量时，根据起止时间均分，计算报单间隔</p> <p>指定报单间隔时，根据起止时间均分，计算单笔数量</p> <p>指定单笔数量和间隔：按照设定的单笔数量和间隔执行，直到完成所有任务数量或者达到结束时间为止</p>
报单间隔(秒)	<p>每两笔报单之间的间隔</p> <p>仅对执行模式“指定报单间隔”和“指定单笔数量和间隔”有效</p>

导入 TWAP 算法任务的 csv 文件说明：

 test.csv - 记事本

文件(F) 编辑(E) 格式(O) 查看(V) 帮助(H)

```

TWAP,1,SH600000,09:31:00,10:30:20,10000,100,4,0,15,0.00,0,-3,6.15,7.55,1,0,0
TWAP,1,SH600000,14:15:09,14:30:20,20000,0,3,1,5,7.12,0,0,0,1,1,30
TWAP,2,SZ000001,09:30:00,15:47:00,36000,1000,12,2,3,12.55,0,0,0,0,2,60

```

标题行（可填可不填）：算法,策略号,策略名称,开始时间,结束时间,片内总量,

每笔数量,价格类型,撤单类型,撤单时间(秒),报单价格,优化方式,报价优化,价格下限,价格上限,买卖方向,执行模式,报单间隔。

后续行为正文，每一行内容对应一个 TWAP 算法任务中的某个时间片任务。

TWAP,1,SH600000,09:31:00,10:30:20,10000,100,4,0,15,0.00,0,-3,6.15,7.55,1,0,0

策略号 1 的第一段时间片：以卖二价卖出 600000 股票，总数量 10000，指定单笔数量 100，自动计算报单间隔，报价优化-0.03 元，起止时间 09:31:00 到 10:30:20，当最新价范围超过[6.15, 7.55]之外就不报单，报单 15s 后未成交且满足撤单条件时自动撤单自动补。

TWAP,1,SH600000,14:15:09,14:30:20,20000,0,3,1,5,7.12,0,0,0,0,1,1,30

策略号 1 的第二段时间片：以市价卖出 600000 股票，总数量 20000，指定报单间隔 30 秒，自动计算单笔数量，保护限价 7.12 元，起止时间 14:15:09 到 14:30:20，报单 5s 未成交且满足撤单条件时撤单不补单。

以上两条记录对应着同一 TWAP 策略(策略号为 1)中的两段时间片参数。

TWAP,2,SZ000001,09:30:00,15:47:00,36000,1000,12,2,3,12.55,0,0,0,0,0,2,60

策略号 2 的时间片：以指定限价买 000001 股票，总数量 36000，指定单笔数量 1000，指定报单间隔 60 秒，起止时间 09:30:00 到 15:47:00，指定委托价格 12.55 元，不自动撤单。

- 导出策略

点击“导出策略”，可把策略文件保存至其他目录。

- 启动/停止策略

主界面选中股票后，点击“启动策略”（“停止策略”），相应选中的证券代码会自动开始（停止）按设置策略进行交易。

启动策略前务必确认各股票的策略参数是否设置正确。

如果启动失败，在“其他信息”中会显示策略启动失败的原因。

- 一键补单

策略执行结束后，可以通过“一键补单”功能快速自动补单。勾选需要补单

的任务，点击“一键补单”，设置价格、委托间隔和每笔报单数量后启动。



4.5.3.2 POV

POV(Percent of Volume)参与率算法是一种与市场成交量同步的算法，有时它们也被称为目标成交量算法或跟随算法。与 VWAP 算法一样，参与率算法的表现取决于它们所采用的追踪目标成交量的技术，并且重点目标都是为了最小化市场冲击。模型使用实际成交量作为指标，因此在交易时段内总是按照市场成交量的一定比例交易剩余的头寸，该算法为行情触发模式。

- 主功能区

与 TWAP 算法共用一个算法交易管理窗口。上方区域为策略信息，下方为持仓信息、算法委托、成交、其他信息。

系统 交易 综合 查询 帮助 创星交易终端_v0.0.5 (信用)											
净资产: 55,110,064.44 总负债: 3,012,802.65 维持担保比例: 1929.20% 总市值: 5,910,428.60 可用资金: 53,090,093.20 可用保证金: 51,355,282.42 持仓浮盈: 0.00											
基本信息 (点击查看详细行情)											
全部 TWAP POV											
策略号	算法	证券代码	证券名称	买卖方向	执行状态	总任务量	成交数量	剩余数量	完成比例	成交均价	当前轮次
10	POV	SH600004	白云机场	融资买入	已启动	10000	0	10000	0.0%	-	1
11	POV	SZ300003	乐普医疗	融资买入	已启动	10000	0	10000	0.0%	-	1
13	POV	SZ000002	万科A	融资买入	已启动	10000	0	10000	0.0%	-	1
14	POV	SH688007	光峰科技	融资买入	已启动	10000	0	10000	0.0%	-	1
16	POV	SZ159905	深红利	融资买入	已启动	10000	0	10000	0.0%	-	1
17	POV	SH510300	300ETF	融资买入	已启动	10000	0	10000	0.0%	-	1
持仓											
启动 暂停 停止 一键撤单 参数设置 查看日志											
代码过滤											
证券代码	证券名称	最新价	当前持仓	可卖数量	证券市值	成本价	盈亏	盈亏率	融资仓位	融资金额	融资利息
000001	平安银行		14700	13800	203274.00	13.8282			11500	159240.00	35.04
000002	万科A		30000	20000	526071.34	17.5357			20000	353639.74	42.08
000006	深振业A		0	0	0.00				0	0.00	0.00
000065	北方国际		1100	1100	10064.46	9.1495			0	0.00	0.00
000818	麒麟科技		0	0	0.00				53	1475.87	27.15
000927	中国铁物		0	0	0.00				7	19.26	0.49
000960	糖业股份		0	0	0.00				207	2660.09	70.45
000983	山西焦煤		0	0	0.00				138	1778.54	38.66
持仓明细 策略委托 策略成交 提示信息											
行情已读 (仿真) 交易已读 (仿真) 账号未登录											

● 参数设置

点击主界面的“参数设置”可对 POV 策略参数进行修改。策略任务以及时间片的增删改操作可直接参考上述 TWAP 部分的对应内容。

策略参数设置

策略类型 ☐ TWAP ☒ POV

策略	方向	证券名称
1	买入	SH600004 白云机场
2	买入	SZ000002 万科A
3	买入	SZ300008 前海防务
4	买入	SH688005 容百科技
5	买入	SZ128026 众兴转债
6	买入	SH110045 海澜转债
7	买入	BJ430090 同辉信息
8	买入	SZ159915 创业板
9	买入	SH510330 华夏300

请选择策略
开始时间 结束时间
总委托量 单笔最大
价格类型 最新价
盘口深度
委托间隔(秒) 自动撤单(秒) ☒ 开启
价格下限 ☐ 开启 价格上限 ☐ 开启

添加时间片 删除时间片

序号	起始时间	结束时间	任务比例	片内总量	单笔最大	价格类型
----	------	------	------	------	------	------

添加策略
 华兴源创

确定 取消

新增策略 删除策略 清空策略 导入 导出 保存 关闭

当前策略 POV#2_SH688009_中国通号_买入

开始时间 结束时间
总委托量 单笔最大
价格类型 最新价
盘口深度
委托间隔(秒) 自动撤单(秒) ☒ 开启
价格下限 ☐ 开启 价格上限 ☐ 开启

添加时间片 删除时间片


● 导入策略

从 csv 格式文本的策略文件导入策略，导入前建议先清空原有策略。文本的第一行默认为标题，不会被识别为策略内容。后续每一行代表着某个策略中的一条时间片对应的参数。详细字段解释请查阅“POV 策略文件字段说明”表。

POV 策略文件字段说明	
字段名	说明
算法类型	固定填“POV”
POV 策略号	策略唯一的序号（从 1 递增） 同一策略号下的时间片，必须是相同的证券和买卖方向
策略名称	市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，深港通 SZH，北京 BJ） 例：SH600000，SZ000001，SZH00001（深港通）
开始时间	格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒按两位表示 例：09:30:00，（注：该时间为电脑本地时间）
结束时间	格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒按两位表示 例：14:57:00，（注：该时间为电脑本地时间）
委托总量	时间片内需完成的目标量，单位：股/份/张
单笔最大	单笔报单最大数量，单位：股/份/张 如果从行情计算的委托数量超过该值，取单笔最大数量。
价格类型	报单的价格类型： 0-最新价, 1-卖一, 2-买一, 3-市价, 4-卖二, 5-买二, 6-卖三, 7-买三, 8-卖四, 9-买四, 10-卖五, 11-买五 当前版本，3-市价只支持最优五档成交剩余转撤销。
撤单类型	1-自动撤单, 2-手动撤单
撤单时间(秒)	仅针对行情盘口档位的价格类型有效。 当撤单类型为 1-自动撤单时，该字段有效，不允许小于 3 秒。 某一笔委托挂单未全部成交，超过设定的撤单时间，且该笔委托价格与此时从行情计算出的新委托价格不同时，才会撤销该笔委

	托。
保护限价	<p>当价格类型为 3-市价时，</p> <p>填值大于 0 的有效价格，则以此为保护限价。</p> <p>填 0，则买入时用涨停价，卖出时用跌停价作为保护限价。</p> <p>价格类型为其他时，填 0 即可。</p> <p>例：</p> <p>价格类型市价时，填 5.49（有效的保护限价）</p> <p>价格类型市价且为买入方向，填 0（涨停价作为保护限价）</p> <p>价格类型市价且为卖出方向，填 0（跌停价作为保护限价）</p>
盘口深度	<p>扫描盘口的档位数。</p> <p>1-对手盘一档, 2-对手盘二档, 3-对手盘三档, 4-对手盘四档, 5-对手盘五档；</p> <p>例：3（如买入，基准量=行情盘口卖一量+卖二量+卖三量）</p>
扫盘比例(%)	<p>执行报单量参照的盘口量的比例。</p> <p>例：1.5（如盘口深度为 3，委托数量=盘口 1~3 档量 * 1.5%）</p>
委托间隔(秒)	同策略下每次报单的最少间隔时间（不允许小于 3 秒）
价格下限	<p>如果行情最新价小于该值，则不报单</p> <p>0 表示不启用价格下限；</p>
价格上限	<p>如果行情最新价大于该值，则不报单</p> <p>0 表示不启用价格上限；</p>
买卖方向	0-买入, 1-卖出, i-融资买入, j-融券卖出

导入 POV 算法任务的 csv 文件说明：

 pov.csv - 记事本
 文件(F) 编辑(E) 格式(O) 查看(V) 帮助(H)
 算法,策略号,策略名称,开始时间,结束时间,委托总量,单笔最大,价格类型,撤单类型,撤单时间(秒),保护限价,盘口深度,扫盘比例(%),委托间隔(秒),价格下限,价格上限,买卖方向
 POV,1,SH600000,14:10:00,14:21:07,5000,500,3,1,3,7.180,1,0.10,3,0,0,0
 POV,1,SH600000,14:22:27,14:43:00,20000,200,2,1,5,0,2,0.05,5,6.6,7.8,0
 POV,2,SH688009,09:14:07,14:57:00,4000,200,3,1,3,0,1,0.1,3,0,0,0

标题行（可填可不填）：算法,策略号,策略名称,开始时间,结束时间,委托总量,单笔最大,价格类型,撤单类型,撤单时间(秒),保护限价,盘口深度,扫盘比例(%),委托间隔(秒),价格下限,价格上限,买卖方向。

后续行为正文，每一行内容对应一个 POV 算法任务中的某个时间片任务。

POV,1,SH600000,14:10:00,14:21:07,5000,500,3,1,3,7.180,1,0.10,3,0,0,0

策略号 1：以市价买入 600000，总数量 5000，单笔最大 500，保护限价 7.18 元，行情盘口中的卖一量*0.1%作为委托数量，最小委托和撤单间隔都为 3 秒，起止时间 14:10:00 到 14:21:07。

POV,1,SH600000,14:22:27,14:43:00,20000,200,2,1,5,0,2,0.05,5,6.6,7.8,0

策略号 1：以买一价买入 600000，总数量 20000，单笔最大 200，行情盘口中的(卖一量+卖二量)*0.05%作为委托数量，最小委托和撤单间隔都为 5 秒，行情最新价上下限范围为[6.6 元, 7.8 元]，超出范围不报单，时间 14:10:00 到 14:21:07。

以上两条记录对应着同一 POV 策略(策略号为 1)中的两段时间片参数。

4.5.4 冰山算法

冰山算法主要用于将大订单拆分成多笔小订单，减少对市场的冲击，同时利用随机算法降低被探测的概率。执行逻辑为指定个股或篮子、分配总任务量、报单方向、配置算法参数后，自动以指定盘口档位+偏移量计算出委托价格挂单，委托量为单笔最小量和单笔最大量之间的随机值。挂单后按照全成模式或部成模式判断触发条件是否满足则挂出下一笔委托；如果行情更新后，按照新行情计算出的价格已优于上一笔挂单的委托价，则自动撤单并以新的委托价挂单。



● 任务创建区

支持分别以个股和篮子方式，单个或批量创建冰山算法任务。

如果采用篮子方式批量创建任务，可选的篮子下单分配类型如下：

篮子资金权重：报单区域输入的委托总金额，按照权重分配。

篮子委托金额：每支成份股按设定委托金额算出委托数量*篮子份数。

篮子委托数量：每支成份股按设定委托数量*篮子份数。

篮子数量比例：每支成份股按设定委托数量*数量比例。

单证券委托金额：每支成份股按输入的委托金额算出委托数量。

单证券委托数量：每支成份股按输入的委托数量。

持仓比例：每支成份股按当前持仓数量*持仓比例。

可用数量比例：每支成份股按可用持仓数量*持仓比例。

如果采用篮子方式创建任务，右侧篮子明细表格中会显示该篮子中所有成份股的待委托数量，修改了篮子分配方式后表格自动刷新。可以通过第一列勾选/取消勾选，双击修改金额/数量进行调整，最终批量生成冰山任务。

篮子明细		任务执行										
所选篮子：转债1 刷新												
<input checked="" type="checkbox"/>	序号	证券代码	证券名称	买卖方向	资金权重	预估委托金额	待委托数量	限定价格	持仓数量	可用数量	最新价	市值
<input checked="" type="checkbox"/>	1	110052	贵广转债	买入	1	6764	50	0.000	720	720	135.032	97223.04
<input checked="" type="checkbox"/>	2	110055	伊力转债	买入	1	6485	50	0.000	100	100	129.145	12914.50
<input checked="" type="checkbox"/>	3	110059	浦发转债	买入	1	5460	50	0.000	140	140	109.215	15290.10
<input checked="" type="checkbox"/>	4	110060	天路转债	买入	1	10067	50	0.000	20	20	200.299	4005.98
<input checked="" type="checkbox"/>	5	110062	烽火转债	买入	1	5744	50	0.000	60	60	114.900	6894.00
<input checked="" type="checkbox"/>	6	110063	鹰19转债	买入	1	5450	50	0.000	100	100	108.870	10887.00
<input checked="" type="checkbox"/>	7	110064	建工转债	买入	1	5547	50	0.000	60	60	110.884	6653.04
<input checked="" type="checkbox"/>	8	110067	华安转债	买入	1	6417	50	0.000	140	140	128.286	17960.04
<input checked="" type="checkbox"/>	9	110070	凌钢转债	买入	1	5635	50	0.000	90	90	112.673	10140.57
<input checked="" type="checkbox"/>	10	110073	国投转债	买入	1	5836	50	0.000	50	50	116.650	5832.50
<input checked="" type="checkbox"/>	11	110074	精达转债	买入	1	11967	50	0.000	50	50	241.228	12061.40
<input checked="" type="checkbox"/>	12	110075	南航转债	买入	1	6286	50	0.000	60	60	125.800	7548.00
<input checked="" type="checkbox"/>	13	110076	华海转债	买入	1	5624	50	0.000	10	10	112.469	1124.69
<input checked="" type="checkbox"/>	14	110077	洪城转债	买入	1	9774	50	0.000	0	0	195.652	0.00
<input checked="" type="checkbox"/>	15	110079	杭银转债	买入	1	6443	50	0.000	20	20	128.929	2578.58

点击篮子名称旁的“设置”按钮进入篮子设置窗口，可在此新增修改删除篮子及成份标的，或从文件导入已编辑好的篮子文件。

篮子设置

篮子列表

导入 导出 当前篮子: lz4

参数 委托金额 0 批量修改

☐

序号

篮子名称

所有篮子

当前篮子

☐

1

lz1

=

×

☐

2

lz2

=

×

☐

3

lz3

=

×

☒

4

lz4

=

×

新增篮子

删除篮子

添加证券: 输入代码/名称

删除证券

☐

序号

证券代码

证券名称

委托金额

资金权重

委托数量

限定价格

操作

☐

1

600000

浦发银行

50000

2

500

0

=

×

☐

2

000001

平安银行

20000

1

800

0

=

×

从本地文件导入篮子支持两种导入方式：所有篮子和当前篮子。具体导入格式详见上文组合条件单中的[篮子导入格式](#)。

● 参数设置区

冰山参数设置

冰山参数设置 通用

执行时间段

☒ 定时启动停止 开始时间 结束时间

报单参数

买入委托价格 价格浮动

卖出委托价格 价格浮动

单笔最小数量 手 单笔最大数量 手

冰山报单模式 ☐ 全部成交 ☒ 部分成交 单笔部成占比 %

最小报单间隔 报单发送至少 秒后, 允许发送下一笔(满足报单条件时)

最小撤单间隔 报单发送至少 秒后, 允许对其撤单(满足撤单条件时)

运行限制参数

☒ 最大撤单次数 撤单次数不超过 次, 否则暂停任务

☒ 最大错单次数 错单次数不超过 次, 否则暂停任务

冰山算法具体参数说明如下：

执行时间段：未勾选时为手动模式，需要用户自行控制任务的启动和停止。勾选后为自动模式，到了设定时间后任务将自动切换至运行/暂停状态。

委托价格+浮动：发送订单时以指定行情某档位价格为基准，再向上\向下浮动（可选 tick 或 %），生成最终的委托价格。

单笔最小\大数量（手）：每次发送订单时的委托数量（单位为手）。当两者相等时即为固定委托数量，否则为该范围内的随机数量。

冰山报单模式：全部成交是某笔委托全部成交后发送下一笔；部分成交是上笔委托(如果有)全部成交，且当前一笔委托部分成交数量与委托数量的比率达到参数“单笔部成占比”后，发送下一笔委托。

单笔部成占比：配合“部分成交”报单模式使用。

最小报单间隔：单任务中两次发送委托之间的最小时间间隔。

最小撤单间隔：单任务中委托挂出指定时间后,才会根据实际情况撤单。当根据设置计算出的下单价优于目前委托价格并满足撤单间隔时，才会撤单。

最大撤单次数：勾选后，单任务中当撤单次数达到该设置时算法将暂停。如

果不勾选，则撤单次数没有上限控制。

最大错单次数：勾选后，单任务中当错单次数达到该设置时算法将暂停。如果不勾选，则错单次数没有上限控制。

● 任务执行区

个股方式创建的任务：一个母任务+一个子任务。

篮子方式创建的任务：一个母任务+若干子任务。

任务执行区上方表格为母任务列表，下方表格为子任务列表。

可通过控制母任务的启动\暂停，批量控制对应子任务的运行\暂停。修改母任务参数，批量覆盖修改对应子任务参数。删除母任务，批量删除对应子任务。

也可对于单个子任务控制开关状态，修改参数以及删除单个子任务。

篮子明细											
冰山算法任务监控											
启动/暂停 该篮子中的所有任务											
批量修改该篮子下所有任务的参数											
删除该篮子所有任务											
母任务号	任务名称	买卖方向	开关	任务状态	完成进度	成交/目标数量	成交金额	创建时间	参数	操作	
#6	113597_佳力转债	卖出		全部完成	100.0%	10/10	1247.90	13:42:33	点击查看		
#7	113597_佳力转债	卖出		暂停	30.8%	40/130	4990.20	13:43:17	点击查看		
#8	[篮子] 转债1	买入		运行中	99.1%	6193/6250	751788.24	13:48:18	点击查看		

子任务											
任务明细											
启动/暂停 单个任务											
修改单任务的参数											
删除单任务											
任务名称	全部	证券代码	任务状态	完成进度	成交/目标数量	撤单次数	废单次数	母任务号	子任务号	详细信息	参数
127045	牧原转债	买入		全部完成	100.0%	50/50	0	#8	#84	点击查看	
127046	百润转债	买入		全部完成	100.0%	50/50	0	#8	#85	点击查看	
127047	帝欧转债	买入		全部完成	100.0%	50/50	2	#8	#86	点击查看	
127049	希盟转债2	买入		运行中	82.0%	41/50	1	#8	#87	点击查看	
127050	麒麟转债	买入		运行中	82.0%	41/50	2	#8	#88	点击查看	
127051	博杰转债	买入		全部完成	100.0%	50/50	1	#8	#89	点击查看	
127052	西子转债	买入		全部完成	100.0%	50/50	1	#8	#90	点击查看	
127053	蒙奥转债	买入		运行中	88.0%	44/50	2	#8	#91	点击查看	
127054	双箭转债	买入		全部完成	100.0%	50/50	0	#8	#92	点击查看	
127055	精锻转债	买入		全部完成	100.0%	50/50	4	#8	#93	点击查看	
127056	中特转债	买入		全部完成	100.0%	50/50	0	#8	#94	点击查看	
127059	永东转债2	买入		全部完成	100.0%	50/50	0	#8	#95	点击查看	
127060	湘佳转债	买入		运行中	82.0%	41/50	1	#8	#96	点击查看	

在任务明细、任务委托、任务成交三个表格中，均可使用母任务号、证券代码对展示内容进行筛选。

4.5.5 网格交易

网格是一种交易策略，利用价格的频繁波动获取动态价格区间的收益，抓住每次波峰的卖出机会和波谷的买入机会从而达到减小交易成本的目的。

对于每一个网格交易任务，允许定义初始基准价、上下网格幅度、委托价格

数量类型、基准价变动类型、以及持仓上下限、买卖次数、价格区间等其他限制参数。运行时随着价格的波动，当达到设定的网格幅度后报单，成交后动态生成新基准价格，直到达到停止时间或限制条件为止。

网格交易的核心运行逻辑为：任务启动时初始基准价为行情最新价/自定义价格（遵循参数“初始基准价类型”），并确定观察价为最新价/对手价（遵循参数“观察价类型”）。任务启动后，程序将实时监控观察价。

(1)触发卖单：当观察价上涨到大于等于“基准价格+上网格幅度+上网格浮点”，采用“基准价+上网格幅度+上网格浮点-报价优化”作为卖出委托价格发送报单，当该笔卖单成交后，更新基准价=旧基准价+上网格幅度。

(2)触发买单：当观察价下跌到小于等于“基准价格-下网格幅度-下网格浮点”，采用“基准价-下网格幅度-下网格浮点+报价优化”作为买入委托价格发送报单，当该笔买单成交后，更新基准价=旧基准价-下网格幅度。

上述网格幅度、网格浮点计算可设为元\tick\百分比（遵循参数“幅度类型”），报价优化可设为元\tick\百分比（遵循参数“报价优化类型”）。

此外如某时刻跳过 N 个网格，即观察价达到“基准价 \pm N*网格幅度 \pm 浮点”，则委托价格为第 N 个网格计算出的价格，委托数量可设为单\多倍网格对应数量（遵循参数“数量类型”），且后续实时基准价更新可设为单\多倍网格对应基准价（遵循参数“基准价更新类型”）。

● 网络交易主界面

网络单												
网络单任务												
	策略号	证券代码	名称	触发方式	任务状态	详细信息	今天买卖数	实时基准价	初始持仓	净买委托	净买成交	委托成交差
1	#12	113030	东风转债	到价触发	运行中		12/2	129.573	0	+100	+100	0
2	#13	110052	奥广转债	到价触发	运行中		1/4	128.363	0	-30	-30	0
3	#14	110055	伊力转债	到价触发	运行中		0/2	129.246	0	-20	-20	0
<div>全部 应用</div> <div>启动 停止 参数设置 查看日志</div>												
任务委托 任务成交 持仓明细 提示信息												
<div> <input checked="" type="radio"/>全部 <input type="radio"/>可撤 <input type="radio"/>已成 <input type="radio"/>已撤/废单 <input type="radio"/>前已选 <input type="radio"/>全部 <input type="radio"/>策略号 <input type="text"/> 代码过滤 <input type="button" value="导出"/> </div>												
	策略号	本地发送	证券代码	证券名称	买卖方向	报单类型	委托状态	委托价格	委托数量	成交数量	成交均价	详细信息
1	#12	21:34:31	113030	东风转债	买入	限价	全部成交	129.573	10	10	129.570	1100181000000053
2	#13	21:34:16	110052	奥广转债	卖出	限价	全部成交	128.363	10	10	128.365	1100181000000052
3	#12	21:33:58	113030	东风转债	买入	限价	全部成交	129.628	10	10	129.624	1100181000000051
4	#13	21:33:58	110052	奥广转债	卖出	限价	全部成交	128.358	10	10	128.361	1100181000000050
5	#13	21:33:55	110052	奥广转债	卖出	限价	全部成交	128.353	10	10	128.357	1100181000000049
6	#14	21:33:51	110055	伊力转债	卖出	限价	全部成交	129.246	10	10	129.250	1100181000000048
7	#12	21:33:46	113030	东风转债	买入	限价	全部成交	129.658	10	10	129.656	1100181000000047
8	#13	21:33:43	110052	奥广转债	卖出	限价	全部成交	128.333	10	10	128.330	1100181000000046
9	#14	21:33:42	110055	伊力转债	卖出	限价	全部成交	129.216	10	10	129.219	1100181000000045
10	#13	21:33:40	110052	奥广转债	卖出	限价	全部成交	128.343	10	10	128.343	1100181000000044
11	#12	21:33:22	113030	东风转债	买入	限价	全部成交	129.668	10	10	129.668	1100181000000041
12	#12	21:33:16	113030	东风转债	买入	限价	全部成交	129.588	10	10	129.588	1100181000000040
13	#12	21:32:55	113030	东风转债	买入	限价	全部成交	129.503	10	10	129.500	1100181000000039
14	#12	21:32:52	113030	东风转债	买入	限价	全部成交	129.583	10	10	129.580	1100181000000038

上方区域为策略任务，下方为最新的持仓委托成交以及其他信息。

可通过勾选网格单任务，按钮批量启动停止，或者开启参数中的执行时间段后，到时自动启动停止。仅当任务停止时可修改对应参数，启动后继续执行未完成的任务量。当任务被手动或自动停止后，会立即撤销所有未成交的挂单。

执行状态会显示本次策略运行状态、当前实时基准价、最新价、以及今买卖笔数、净委托成交数量等其他统计字段。

● 参数设置

点击主界面的“参数设置”，在弹出的“网格单设置参数”界面中可新增、删除、导入导出策略。以及对每条策略任务的参数设置。点击“保存”按钮后策略参数立即生效，重启软件后自动载入上次设置的策略参数。

具体策略参数解释，请查阅后文中的“网格交易文件字段说明”表。

● 添加删除策略

点击上述界面中的“新增”按钮，输入选择证券。选中高亮某一个任务，点击“删除”，弹出确认删除窗口。点击“清空”，将删除当前所有任务。

● 修改任务参数

策略任务增加后，可对每个网格单任务修改参数。单个策略具有唯一的委托方向。具体策略参数解释，请查阅后文中的“网格交易文件字段说明”表。

● 导入策略

从 csv 格式文本的策略文件导入策略，导入文件会先清空原有任务。csv 文本的第一行可以为标题也可省略。后续每一行代表着某个网格单策略任务参数。

网格单任务 csv 文件格式说明		
字段名	示例	说明
算法类型	GRID_1	固定填“GRID_1”（代表网格单以及格式版本号）
策略号	1	策略唯一序号（需保证唯一不重复且最小为 1 递增）
证券标的	SH600000	市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，北京 BJ） 例：SH600000，SZ000001。（暂不支持港股通证券）
开始时间	09:30:00	格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示 例：09:30:00，（注：该时间为电脑本地时间） 填写 00:00:00 或留空代表手动控制任务启动停止
结束时间	14:57:00	格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示 例：14:57:00，（注：该时间为电脑本地时间） 填写 00:00:00 或留空代表手动控制任务启动停止
触发方式	0	填 0。当前版本只支持“到价触发”
价格类型	0	0-限价，1-市价。 注：其中 1-市价类型代表最优五档成交剩余转撤销
初始基准	0	0-行情最新价，1-自定义价格

价类型		启动时取行情最新价或自定价作为第一个基准价
自定初始基准价	10.16	适用于基准价类型为“自定义价格”时，要求大于 0 的有效价格，否则填 0 或任意值
幅度类型	1	计算网格幅度和网格浮点的方式 0-价差元，1-价差 tick，2-百分比
上涨网格幅度	3.0	配合“幅度类型”计算上涨网格幅度实际价差。 上触发价 = 基准价格+上网格幅度+上网格浮点
上涨网格浮点	1.0	配合“幅度类型”计算上涨网格幅度实际价差。 上触发价 = 基准价格+上网格幅度+上网格浮点
下跌网格幅度	2.0	配合“幅度类型”计算下跌网格幅度实际价差。 下触发价 = 基准价格-下网格幅度-下网格浮点
下跌网格浮点	1.0	配合“幅度类型”计算下跌网格幅度实际价差。 下触发价 = 基准价格-下网格幅度-下网格浮点
观察价格类型	0	0-对手一档价，1-行情最新价。 观察价格用于判断是否达到上\下网格
报价优化类型	1	0-价差元，1-价差 tick，2-百分比。 仅仅针对限价价格类型有效。 最终委托价格 = 计算价经过报价优化调整后的值 价差元：最终委托价=委托价±优化值 价差 Tick：最终委托价=委托价±优化值*最小变动价格 （根据证券类型，可能 0.01 或 0.001） 百分比：最终委托价 = 委托价*（1± 优化值 / 100）
报价优化	5	配合“报价优化类型”使用，修正最终委托价格，要求该值大于等于 0（整数或小数），0 为不调整 当方向为买入，委托价向上调整 当方向为卖出，委托价向下调整
数量类型	0	0-单网格数量，1-多网格数量，2-多网格数量拆单 配合“买入\卖出网格数量”使用，确定委托数量

		<p>当跳过一个网格触发时，3 种类型完全相同</p> <p>当跳过 N 个网格触发时，参数含义如下</p> <p>0-单网格数量，发一笔委托数量=单网格数量</p> <p>1-多网格数量，发一笔委托数量=单网格数量*N</p> <p>2-多网格数量拆单，发 N 笔委托数量=单网格数量</p>
基准价更新类型	0	<p>0-多倍网格价，1-单倍网格价</p> <p>成交后更新基准价的方式</p> <p>当跳过一个网格触发时，2 种类型完全相同</p> <p>当跳过 N 个网格触发时，参数含义如下</p> <p>0-多倍网格价，新基准价=旧基准价± N*单网格幅度</p> <p>1-单倍网格价，新基准价=旧基准价± 单网格幅度</p>
每格买入数量	500	<p>一个下跌网格对应的数量</p> <p>要求该值大于 0，且符合交易所规则</p>
每格卖出数量	500	<p>一个上涨网格对应的数量</p> <p>要求该值大于 0，且符合交易所规则</p>
买入方向	0	0-买入，i-融资买入（仅信用账号）
卖出方向	1	1-卖出，j-融券卖出（仅信用账号）
最大持仓	500000	要求该值大于等于 0，填 0 代表无该限制
最小持仓	300000	要求该值大于等于 0，填 0 代表无该限制
最大买入笔数	20	要求该值大于等于 0，填 0 代表无该限制
最大卖出笔数	30	要求该值大于等于 0，填 0 代表无该限制
区间上限价格	13.32	要求大于等于 0 的有效价格，填 0 代表无该限制
超上限价处理类型	0	0-立即暂停，1-继续运行但不触发卖出委托
区间下限	9.58	要求大于等于 0 的有效价格，填 0 代表无该限制

价格		
超 下 限 价	0	0-立即暂停，1-继续运行但不触发买入委托
处理类型		

算法,策略号,证券标的,开始时间,结束时间,触发方式,价格类型,初始基准价类型,自定初始基准价,幅度类型,上涨网格幅度,上涨浮点,下跌网格幅度,下跌浮点,观察价格类型,报价优化类型,报价优化,数量类型,基准价更新类型,每格买入数量,每格卖出数量,买入方向,卖出方向,最大持仓量,最小持仓量,最大买入笔数,最大卖出笔数,上限价格,超出上限价处理类型,下限价格,低于下限价处理类型
GRID_1,2,SZ159920,09:30:00,14:57:00,0,0,0,0.000,1,1.000,1.000,2.000,2.000,0,1,5.000,0,0,300,400,0,1,90000,50,200,800,99.870,0,1.230,1
GRID_1,3,SH600000,09:30:01,15:30:01,0,0,1,15.000,0,0.010,0.010,0.020,0.020,0,0,0.010,0,0,300,400,0,1,90000,0,200,700,88.880,0,2.220,1
GRID_1,4,SZ000001,09:30:02,14:30:02,0,0,0,0.000,2,2.000,0.200,3.000,0.300,0,2,0.010,2,0,300,400,0,1,90000,500,200,700,0.000,0,0.000,0
GRID_1,5,SH113030,00:00:00,00:00:00,0,0,0,0.000,1,5.000,0.000,5.000,0.000,0,1,0.000,0,0,10,10,0,1,0,0,0,0,0.000,0,0.000,0

导入网格交易任务文件格式（第一行为标题或省略）：

算法,策略号,证券标的,开始时间,结束时间,触发方式,价格类型,初始基准价类型,自定初始基准价,幅度类型,上涨网格幅度,上涨浮点,下跌网格幅度,下跌浮点,观察价格类型,报价优化类型,报价优化,数量类型,基准价更新类型,每格买入数量,每格卖出数量,买入方向,卖出方向,最大持仓量,最小持仓量,最大买入笔数,最大卖出笔数,上限价格,超出上限价处理类型,下限价格,低于下限价处理类型

GRID_1,2,SZ159920,09:30:00,14:57:00,0,0,0,0.000,1,1.000,1.000,2.000,2.000,0,1,5.000,0,0,300,400,0,1,90000,50,200,800,99.870,0,1.230,1

GRID_1,3,SH600000,09:30:01,14:30:01,0,0,1,15.000,0,0.010,0.010,0.020,0.020,0,0,0.010,0,0,300,400,0,1,90000,0,200,700,88.880,0,2.220,1

GRID_1,4,SZ000001,09:30:02,14:30:02,0,0,0,0.000,2,2.000,0.200,3.000,0.300,0,2,0.010,2,0,300,400,0,1,90000,500,200,700,0.000,0,0.000,0

● 导出文件

点击“导出策略”，可把网格单任务 csv 文件保存至本地目录。

● 启动/停止策略

主界面勾选多个网格交易任务后，点击“启动”\“停止”按钮，批量启动\停止策略任务。启动策略前务必确认各股票的策略参数是否设置正确。

4.5.6 定时委托

定时委托为用户提供了预设时间和报单参数设置，从而实现本地时间到达设定时间后自动发送报单的智能交易功能。



● 定时单输入区

输入设定时间和报单参数，创建定时委托的单个任务。

两融支持切换：担保品买/融资买，担保品卖/融券卖。

支持的价格类型如下：最新价、涨停价、跌停价、卖一~卖五价、买一~买五价、价格笼子上下限、市价（最优五档剩余撤单）、指定限价。

支持的价格优化：Ticks 和百分比浮动调整。

涨跌停限制：支持勾选涨停不卖和跌停不买选项。

买入

卖出

证券代码600000浦发银行

买价类型卖一价

买入浮动向上0.10%

参考可买443000股

委托数量-500+股

设定时间13:30:00

涨跌停板☒ 涨停不卖☒ 跌停不买

重置

定时买入

买入

卖出

证券代码000001平安银行

方向类型融券卖出

卖价类型买一价

卖出浮动向下5Tick

参考可卖962800股

委托数量-300+股

设定时间10:30:00

涨跌停板☐ 涨停不卖☐ 跌停不买

重置

定时卖出

● 母任务监控区

启动暂停删除导入				设置刷新					
<input type="checkbox"/>	母任务号	母任务名称	买卖方向	设定时间	母任务状态	触发状态	创建时间	操作	
1	<input type="checkbox"/>	#1	110044_广电转债	买入	09:30:00	全部触发	全部触发(1/1)	15:24:16	删除
2	<input type="checkbox"/>	#2	159512_汽车ETF	买入	09:30:00	全部触发	全部触发(1/1)	15:24:34	删除
3	<input type="checkbox"/>	#3	600000_浦发银行	买入	09:30:00	全部触发	全部触发(1/1)	15:24:44	删除
4	<input type="checkbox"/>	#4	000001_平安银行	卖出	09:30:00	全部触发	全部触发(1/1)	15:24:48	删除
5	<input type="checkbox"/>	#5	300001_特锐德	卖出	09:30:00	全部触发	全部触发(1/1)	15:24:53	删除
6	<input type="checkbox"/>	#6	688001_华兴源创	卖出	09:30:00	全部触发	全部触发(1/1)	15:24:59	删除
7	<input type="checkbox"/>	#7	127043_川恒转债	卖出	09:30:00	全部触发	全部触发(1/1)	15:25:08	删除

从上述定时单输入区可以手动创建一个仅包含一个子任务的母任务。

另外也支持从 csv 文件中批量导入。点击表格上方的“导入”按钮，选择本地文件，导入成功后将创建一个包含若干子任务的母任务。母任务的名称默认为导入文件名，文件中识别成功的每一行将成为该母任务中的子任务参数。

文件导入过程中，如果存在某些参数行格式有误，将在导入后弹窗提示用户导入失败的数量，并在下方明细信息中展示对应的行数以及格式错误原因。

提示

文件批量导入定时单任务。成功3条，失败2条。

确定Hide Details...

[行#2导入失败] 买卖方向(i)字段值无效。格式要求：0为买入，1为卖出

[行#5导入失败] 买卖方向(i)字段值无效。格式要求：0为买入，1为卖出

具体文件内容格式如下（注：第一行为字段解释，可填可不填）：

类型标识,证券标的,买卖方向,设定开始时间,设定结束时间,价格类型,指定价格,报价优化方式,报价优化值,委托数量,涨停不卖,跌停不买

SCHED, SH600000, 0, 09:30:00, , 0, 7.02, 0, -1, 200, 1, 1

SCHED, SH600000, 1, 10:00:00, , 3, 0, 0, 0, 300, 1, 1

SCHED, SZ000001, 0, 13:30:00, , 16, 0, 0, 0, 200, 1, 1

SCHED, SZ000001, 1, 13:30:00, , 17, 0, 0, -1, 400, 1, 1

SCHED, BJ430047, 0, 14:30:00, , 12, 16.33, 0, 0, 300, 1, 1

定时单导入文件的格式说明	
字段名	说明
类型标识	固定填写“SCHED”
证券标的	市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，北京 BJ） 例：SH600000，SZ000001，BJ837663
买卖方向	0-买入, 1-卖出, i-融资买入, j-融券卖出
设定开始时间	格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示 例：14:57:00，（注：该时间为电脑本地时间）
设定结束时间	保留字段，暂时无用，填写 0。
价格类型	报单的价格类型： 0-最新价, 1-卖一, 2-买一, 3-市价(最优五档成交剩余转撤销), 4-卖二, 5-买二, 6-卖三, 7-买三, 8-卖四, 9-买四, 10-卖五, 11-买五, 12-指定限价, 14-涨停价, 15-跌停价, 16-价格笼子买入上限, 17-价格笼子卖出下限
指定价格	用户自定义的委托价格 价格类型为 12-指定限价时，需填入指定的委托价格。 价格类型为 3-市价时，该委托价格为保护限价。 填值大于 0 的有效价格，则以此为保护限价。 填 0，则买入时用涨停价，卖出时用跌停价作为保护限价。 价格类型为其他时该字段无用，填 0 即可。

	<p>例：</p> <p>价格类型限价时，填 113.92</p> <p>价格类型市价时，填 5.49（有效的保护限价）</p> <p>价格类型市价且为买入方向，填 0（涨停价作为保护限价）</p> <p>价格类型市价且为卖出方向，填 0（跌停价作为保护限价）</p>
报价优化方式	<p>0-tick, 1-百分比</p> <p>当价格类型为市价或指定限价，该字段无用，不会优化价格。</p> <p>最终委托价格 = 基准价经过报价优化调整后的值</p> <p>优化方式可选择最小变动价格 tick 或百分比</p> <p>Tick 值：最终委托价格 = 基准价 + 报价优化*最小价格单位</p> <p>百分比：最终委托价格 = 基准价 * (1 + 优化百分比)</p>
报价优化值	<p>当优化方式为 0-tick 时：</p> <p>整形数据，可设置正负，表示±N 个最小变动价格</p> <p>例：-2（如果股票，优化值为 -0.02 元，即基准价下调 0.02 元）</p> <p>当优化方式为 1-百分比时：</p> <p>浮点型，可设置正负，表示±N%</p> <p>例：0.5（报价优化为 0.5%，即基准价向上调整 0.5%）</p>
委托数量	委托数量。单位：股/份/张
涨停不卖	0-不限制, 1-涨停时不发卖单
跌停不买	0-不限制, 1-跌停时不发买单

● 子任务明细表

监控母任务中所包含所有子任务的详细参数信息及运行状态。

子任务明细													提示信息
任务名称													刷新
任务名称													
母任务号	证券代码	证券名称	买卖方向	设定时间	子任务状态	触发状态	目标数量	报单数量	成交数量	触发时间	详细错误信息	报单参数	操作
8	#2	430047 诺思兰德	买入	14:00:00	已完成	已触发(全成交)	300	300	300	14:13:51		点击查看	修改
9	#3	600000 浦发银行	卖出	09:30:00	已触发	已触发(失败)	200	0	0	14:11:02	启动时(14:11:02), 设...	点击查看	修改
10	#3	600000 浦发银行	卖出	10:00:00	已触发	已触发(失败)	300	0	0	14:11:02	启动时(14:11:02), 设...	点击查看	修改
11	#3	000001 平安银行	卖出	14:30:00	运行中	未触发	200	0	0	-		点击查看	修改
12	#3	000001 平安银行	卖出	14:30:00	运行中	未触发	400	0	0	-		点击查看	修改
13	#3	430047 诺思兰德	卖出	14:30:00	运行中	未触发	300	0	0	-		点击查看	修改
14	#4	600000 浦发银行	买入	14:12:00	已完成	已触发(全成交)	100	100	100	14:12:00		点击查看	修改
15	#5	600000 浦发银行	卖出	14:15:30	已完成	已触发(全成交)	100	100	100	14:15:30		点击查看	修改
16	#7	600000 浦发银行	买入	09:30:00	已触发	已触发(失败)	200	0	0	14:17:32	启动时(14:17:32), 设...	点击查看	修改
17	#7	600000 浦发银行	卖出	10:00:00	已触发	已触发(失败)	300	0	0	14:17:32	启动时(14:17:32), 设...	点击查看	修改
18	#7	000001 平安银行	买入	15:30:00	运行中	未触发	200	0	0	-		点击查看	修改
19	#7	000001 平安银行	卖出	15:29:00	运行中	未触发	400	0	0	-		点击查看	修改
20	#7	430047 诺思兰德	买入	14:18:00	已完成	已触发(失败)	300	300	300	14:18:00		点击查看	修改
21	#8	000510 新金路	卖出	14:20:00	已触发	已触发(席单)	300	0	0	14:20:00	被柜台拒绝	点击查看	修改
22	#9	300750 宁德时代	卖出	14:30:00	运行中	未触发	100	0	0	-		点击查看	修改

对于尚未成功触发的子任务，用户可以点击表格最右操作列的“修改”按钮，在弹窗中对单个子任务的参数进行修改，确认后新参数立即生效。

子任务修改参数

证券代码

000001 平安银行 买入

方向类型

融资买入

买价类型

买一价

买入浮动

向上 0.10 %

委托数量

- 200 + 股

设定时间

10:30:00

涨跌停板

☐ 涨停不卖 ☐ 跌停不买

恢复

确认

取消

4.5.7 条件触发单

条件单为用户提供了自动行情监控和报单的智能交易功能。

条件触发单												
任务执行												
启动	暂停	删除										
任务	证券代码	证券名称	买卖方向	开关	触发状态	执行状态	完成进度	成交/目标数量	成交金额	创建时间	触发时间	操作
1	#1	600000 浦发银行	卖出	<input checked="" type="radio"/>	监控中	初始	0.0%	0/3000	0.00	12:20:01		点击查看
2	#2	000001 平安银行	卖出	<input checked="" type="radio"/>	监控中	初始	0.0%	0/1500	0.00	12:20:08		点击查看
持仓明细												
代码过滤												
证券代码	证券名称	当前持仓	可卖数量	成本价	最新价	盈亏率	盈亏	证券市值	买入量			
1	000001 平安银行	2000	2000	28.4591	11.45	-59.77%	-34018.24	22900.00	0			
2	000002 万科A	12200	12200	29.1355	6.86	-76.45%	-271761.45	83692.00	0			
3	000004 *ST国华	100	100	14.0300	10.72	-23.59%	-331.00	1072.00	0			
4	000006 深振业A	2500	2500	5.2006	9.27	78.25%	10173.49	23175.00	0			
5	000007 全新好	2400	2400	7.7034	6.97	-9.52%	-1760.13	16728.00	0			
6	000008 神州高铁	2100	2100	2.7373	2.83	3.39%	194.60	5943.00	0			
7	000009 中国宝安	2100	2100	11.2931	11.32	0.24%	56.52	23772.00	0			
8	000010 美丽生态	5500	5500	3.5153	4.42	25.74%	4975.75	24310.00	0			
9	000011 深物业A	2200	2200	9.4920	9.18	-3.29%	-686.49	20196.00	0			
10	000012 南玻A	2700	2700	6.3271	4.63	-26.82%	-4582.23	12501.00	0			
11	000014 沙河股份	2100	2100	-14.2093	21.00	247.79%	73939.48	44100.00	0			

- 任务创建区

修改指定个股，编辑条件参数以及执行参数即可创建条件单任务。

买入 卖出

证券代码 000001 平安银行

卖价类型 买一价

卖出浮动 向下 0 Tick

参考可卖 2000 全部 股

数量比例 1/2 1/3 1/4 1/5

委托数量 - 1500 + 股

重置 条件卖出

条件和报单参数

监控时段: 09:30:00~14:57:00

条件类型: 涨停板封单减少

触发条件:
当封单金额减少至低于5000.0万元
或涨停封板后续再开板

拆单类型: 不拆单

编辑参数

- 参数设置区

条件类型涨停板封单减少：封单数量或封单金额二选一，在行情监控时段内当该值小于设定参数值，或者开板后触发自动报单。

拆单类型：支持不拆单、最大数量扣减、固定数量、递减数量、区间随机。

条件参数设置

参数设置（通用）

条件参数

触发条件类型

涨停板封单减少

☒ 指定监控时段

开始时间

09:30:00

+

结束时间

14:57:00

+

当

封单数量

▼

低于

200000

+

手

后触发

☒ 涨停开板

封涨停后开板也触发本条件

报单参数

任务拆单类型

区间随机

▼

拆分为区间内随机数量：单笔下限

100

+

~ 单笔上限

300

+

保存模板

确定

放弃

● 任务执行区

监控所有任务的触发和执行状态。上方表格展示的是条件单任务，“点击查看”弹出当前行任务的参数明细。在触发之前可点击最后一列“操作列”中图标按钮，重新修改该任务的触发参数和拆单参数。下方表格展示的是所有属于条件单的委托和成交记录。

任务执行

启动

暂停

删除

刷新

	任务	证券代码	证券名称	买卖方向	开关	触发状态	执行状态	完成进度	成交/目标数量	成交金额	创建时间	触发时间	参数	操作	
1	<input type="checkbox"/>	#1	000009	中国宝安	卖出		已触发	全部完成	100.0%	1500/1500	16980.00	13:10:29	13:10:34	点击查看	
2	<input type="checkbox"/>	#2	603650	彤程新材	卖出		监控中	初始	0.0%	0/500	0.00	13:11:22		点击查看	
3	<input type="checkbox"/>	#3	600060	海信视像	卖出		已触发	全部完成	100.0%	300/300	7491.00	13:12:00	13:12:15	点击查看	
4	<input type="checkbox"/>	#4	000021	深科技	卖出		已触发	全部完成	100.0%	1400/1400	35000.00	13:14:35	13:15:38	点击查看	

持仓明细

任务委托

任务成交

提示信息

☒ 全部

☐ 可撤

☐ 已成

☐ 已撤/废单

撤已选

全

撤

任务号

代码过滤

导出

	本地时间	证券代码	证券名称	买卖方向	报单类型	委托状态	委托价格	委托数量	成交数量	成交均价	
1	<input type="checkbox"/>	13:15:38	000021	深科技	卖出	限价	全部成交	25.00	300	300	25.000
2	<input type="checkbox"/>	13:15:38	000021	深科技	卖出	限价	全部成交	25.00	500	500	25.000
3	<input type="checkbox"/>	13:15:38	000021	深科技	卖出	限价	全部成交	25.00	300	300	25.000
4	<input type="checkbox"/>	13:15:38	000021	深科技	卖出	限价	全部成交	25.00	300	300	25.000
5	<input type="checkbox"/>	13:12:15	600060	海信视像	卖出	限价	全部成交	24.97	300	300	24.970
6	<input type="checkbox"/>	13:10:34	000009	中国宝安	卖出	限价	全部成交	11.32	400	400	11.320
7	<input type="checkbox"/>	13:10:34	000009	中国宝安	卖出	限价	全部成交	11.32	400	400	11.320
8	<input type="checkbox"/>	13:10:34	000009	中国宝安	卖出	限价	全部成交	11.32	400	400	11.320
9	<input type="checkbox"/>	13:10:34	000009	中国宝安	卖出	限价	全部成交	11.32	300	300	11.320

任务：[#4]000021_深科技

监控时段：09:30:00~14:57:00

条件类型：涨停板封单减少

触发条件：
当封单金额减少至低于10.00亿元
或涨停封板后连续开板

卖出类型：买一价

拆单类型：区间随机

单笔下限100股，单笔上限500股

4.5.8 组合条件单

组合条件单为用户提供了自定义若干条件的组合，从而实现自动行情监控和报单的智能交易功能。



● 报单输入区

支持分别以个股和篮子为单位，创建组合条件单任务。篮子中各成分股的可选分配类型如下：

篮子资金权重：报单区域输入的委托总金额，按照权重分配。

篮子委托金额：每支成份股按设定委托金额算出委托数量*篮子份数。

篮子委托数量：每支成份股按设定委托数量*篮子份数。

篮子数量比例：每支成份股按设定委托数量*数量比例。

单证券委托金额：每支成份股按输入的委托金额算出委托数量。

单证券委托数量：每支成份股按输入的委托数量。

持仓比例：每支成份股按当前持仓数量*持仓比例。

可用数量比例：每支成份股按可用持仓数量*持仓比例。

个股

买入 卖出

证券代码 000001 平安银行

买入价格 卖一价

买入浮动 + 0 Tick

参考可买 37600 股

委托数量 - 100 + 股

监控时间 09:30 至 14:57

重置 买入

篮子

买入 卖出

篮子名称 lz3 设置

买入价格 最新价

买入浮动 + 0 Tick

下单类型 按篮子资金权重

委托金额 10000 元

监控时间 09:30 至 14:57

标的数量:7 预计金额:9997.00元

重置 买入

点击篮子名称旁的“设置”按钮进入篮子设置窗口，可直接从界面新增修改删除篮子及成份标的，或从文件导入已编辑好的篮子文件。

篮子设置

篮子列表 导入 导出 当前篮子: lz4 参数 委托金额 - 0 + 批量修改

序号	篮子名	所有篮子	当前篮子
1	lz1		
2	lz2	=	×
3	lz3	=	×
4	lz4	=	×

新增篮子 删除篮子

序号	证券代码	证券名称	委托金额	资金权重	委托数量	限定价格	操作
1	600000	浦发银行	50000	2	500	0	= ×
2	000001	平安银行	20000	1	800	0	= ×

添加证券: 输入代码/名称 删除证券

从本地文件导入篮子支持两种导入方式：所有篮子和当前篮子。

方式一（导入所有篮子）：

只操作一次即可导入所有篮子，本地文件中记录所有篮子及成份股信息，具体文件内容格式如下：

（注：第一行为字段解释，必填，解析时会跳过第一行内容）

篮子序号,篮子名称,证券代码,委托金额,委托数量,资金权重,限定价格

1,lz1,SZ300033,100000,3300,1,0

1,lz1,SZ300015,300000,500,1,0

2,lz2,SH512010,400000,14000,4,0

3,lz3,SZ000422,100000,100,1,0

3,lz3,SZ000425,80000,400,2,0

方式二（导入当前篮子的成份股）：

需要先在界面中新增或选中某一个篮子再导入，一次操作更新一个篮子的成分股明细。本地文件中记录某一个篮子的成份股信息，文件格式如下：

（注：第一行为字段解释，必填，解析时会跳过第一行内容）

证券代码,委托金额,委托数量,资金权重,限定价格

SH600000,50000,500,2,0

SZ000001,20000,800,1,0

导入篮子文件的格式说明	
字段名	说明
篮子序号	（仅导入方式一）篮子唯一的序号（从 1 递增）
篮子名称	（仅导入方式一）与序号对应的篮子名称 同一序号的篮子，必须是相同的篮子名称
证券代码	市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，北京 BJ） 例：SH600000，SZ000001，BJ837663
委托金额	预设委托金额。单位：元
委托数量	预设委托数量。单位：股/份/张
资金权重	预设资金权重。
限定价格	限定价格，可填 0 代表无限制。

● 条件设置区

支持以下三种类型的条件。

实时条件：包括盘口档位价、最新价均价、涨跌幅、成交量、成交金额、振幅、换手率、量比。

指标条件：包括最新价与 MA、自定义 MA、MACD、KDJ 金叉死叉。支持周

期为 1 分钟、5 分钟、60 分钟、日线、周线、月线。支持日线及以下周期的前复权和后复权。支持自定义修改 MACD 和 KDJ 的三个参数。

价格条件：最新价大于、小于、反弹（下破后上穿）、回落（上穿后下破）。

用户可通过下方的条件逻辑表达式，合成自定义的组合条件。表达式中支持“且”，“或”逻辑。且、或两者之间具有相同的优先级。“(”和“)”括号能提升内部表达式的优先级。

条件设置任务执行

条件类型 指标条件

指标名	周期	比较	数值	操作	
最新价	日K	大于	MA5	0.00%	添加
MA 5	日K	大于	MA 10	0.00%	添加
MACD	日K	任意	金叉	(12, 26, 9)	添加
KDJ	日K	金叉		(9, 3, 3)	添加

所选篮子: 1x3 刷新

✓	序号	证券代码	证券名称	买卖方向	资金权重	预估委托金额	待委托数量
✓	1	000422	湖北宣化	买入	1	28571	2500
✓	2	000425	徐工机械	买入	2	57143	8600
✓	3	002371	北方华创	买入	1	28571	100
✓	4	600882	妙可蓝多	买入	1	28571	1500
✓	5	111004	明新转债	买入	5	142857	1080
✓	6	002893	京能热力	买入	3	85714	7500
✓	7	600170	上海建工	买入	1	28571	10200

已选条件 清空

序号	条件明细	操作
1	成交量 大于 1万手	删除
2	最新价 大于 5元	删除

条件逻辑: 1且2

条件序号 1 2

运算符 且 或 ()

注: 运算符的快捷键 [且]对应“,” [或]对应“.”

条件类型 实时条件

指标名	周期	比较	数值	操作
最新价	即时	大于	5.000元	添加
最新价	即时	大于均价	0.00%	添加
涨跌幅	即时	大于	1.00%	添加
成交量	即时	大于	1.00万手	添加
成交金额	即时	大于	0.00亿元	添加
换手率	即时	大于	2.00%	添加
振幅	即时	大于	0.00%	添加

条件类型 指标条件

指标名	周期	比较	数值	操作	
最新价	日K	大于	MA5	0.00%	添加
MA 5	日K	大于	MA 10	0.00%	添加
MACD	日K	任意	金叉	(12, 26, 9)	添加
KDJ	日K	金叉		(9, 3, 3)	添加

- 任务执行区
监控所有任务的执行状态以及触发状态。

条件设置

任务执行

组合条件任务监控

启动

暂停

停止

删除

刷新

	✓	任务名称	买卖方向	任务状态	触发状态	创建时间	条件参数	操作
1	✓	#3_lz3	买入	监控中	部分触发(2/7)	10:02:37	点击查看	删除
2		#4_lz3	卖出	监控中	部分触发(2/7)	10:02:54	点击查看	删除

任务明细

策略委托

策略成交

持仓明细

提示信息

任务名称 全部 证券代码 刷新

		任务号	证券代码	证券名称	买卖方向	任务状态	触发状态	目标数量	报单数量	成交数量	触发时间
1		#3	000422	湖北宣化	买入	监控中	未触发	100	0	0	00:00:00
2		#3	000425	徐工机械	买入	已完成	全部成交	200	200	200	10:02:16
3		#3	002371	北方华创	买入	已完成	全部成交	100	100	100	10:02:16
4		#3	600882	妙可蓝多	买入	监控中	未触发	400	0	0	00:00:00
5		#3	111004	明新转债	买入	监控中	未触发	150	0	0	00:00:00
6		#3	002893	京能热力	买入	监控中	未触发	100	0	0	00:00:00
7		#3	600170	上海建工	买入	监控中	未触发	100	0	0	00:00:00
8		#4	000422	湖北宣化	卖出	监控中	未触发	100	0	0	00:00:00
9		#4	000425	徐工机械	卖出	已触发	已经触发	100	100	0	10:02:31
10		#4	002371	北方华创	卖出	已完成	全部成交	100	100	100	10:02:34
11		#4	600882	妙可蓝多	卖出	监控中	未触发	100	0	0	00:00:00
12		#4	111004	明新转债	卖出	监控中	未触发	100	0	0	00:00:00
13		#4	002893	京能热力	卖出	监控中	未触发	100	0	0	00:00:00
14		#4	600170	上海建工	卖出	监控中	未触发	100	0	0	00:00:00

4.6 菜单-综合

综合	查询	帮助
资金转账		
密码修改		
新股新债		
ETF申赎		
基金申赎		

4.6.1 资金转账

资金划转

资金币种人民币

银行账号中国建设银行 *1185

奇点可取53090093.20

银行余额-

转账方向银证转入 银行->快速柜台

转入金额

资金密码

银行密码

刷新

转账

查询普通柜台错误代码: 4592 , 错误信息: CREDITVIP: 找不到组件运行信息

转账流水号	签约银行账号	转移方向	出入金额	转移状态	状态信息	操作时间
-------	--------	------	------	------	------	------

转账方向

资金密码

银证转入 银行->快速柜台

银证转出 快速柜台->银行

资金调入 普通柜台->快速柜台

资金调出 快速柜台->普通柜台

点击菜单栏综合->资金转账可进入“资金转账”窗口，支持银证转账，以及普通柜台和快速交易柜台之间的资金调拨。

4.6.2 密码修改

密码修改

原交易密码: 请输入原密码...

新交易密码: 请输入新密码...

新密码确认: 再次输入新密码...

重填

确定

输入原交易密码和新密码后，点击“确定”即可完成修改。

4.6.3 申购赎回

申购赎回

新股申购

新债申购

增发申购

北交所申购

配号查询

中签号查询

ETF申购

ETF赎回

基金申购

基金赎回

申购代码: 787531

新股名称: 日联申购

可用资金: 35344.81 元

申购价格: 152.380 元

可申购数: 1000 股

申购数量: - 1000 股

全部

重填

新股申购

新股信息

刷新

一键申购

申购代码	申购名称	发行方式	发行价格	申购单位	申购下限
1 787531	日联申购	市值配售方式	152.38	500	500

可申购额度

沪市主板

1000

沪市科创板

1000

深市

0

支持新股新债申购、配号中签号查询、ETF 基金的申赎业务。

4.7 菜单-查询

查询

帮助

3

综合查询

持仓明细

当日委托

当日成交

历史记录

4.7.1 信用查询（两融）

信用查询包括信用资产明细、负债记录、标的证券、两融利率费率等子页面。

4.7.1.1 信用资产明细

综合查询

信用资产明细

信用负债记录

标的证券清单

两融利率费率

信用资产明细

刷新

导出

维持担保比例	25208.84%	融资融券上限	5000000.00	融券额度上限	6000000.00
可用资金	96221310.97	融资负债	215072.90	融券卖出金额	136079.60
可用保证金	97292105.99	融资未成交金额	0.00	融券金额可用	128162.24
套餐类型	标准套餐	融资冻结保证金	0.00	融券负债市值	164605.40
剩余流动性额度	99817078.17	融资占用保证金	189264.15	融券未成交负债	0.00
上日结存	96221310.97	融资利息	10527.92	融券冻结保证金	0.00
当日入金总额	0.00	融资盈亏未折算	19769.14	融券占用保证金	98763.24
当日出金总额	0.00	融资盈亏折算后	11925.78	融券费用	8622.03
证券市值	4190518.39			融券盈亏未折算	-28525.80
担保品市值	3955741.63			融券盈亏折算后	-34218.52
总资产	100539991.60				
总负债	398828.25				
总利息/费用	19149.95				
净资产	100141163.36				

资产明细页面显示了账户的两融详细信息。

4.7.1.2 信用负债记录

综合查询

信用负债记录

信用资产明细

信用负债记录

标的证券清单

两融利率费率

信用负债记录

证券代码

负债类型

全部

头寸类型

全部

负债状态

全部

刷新

导出

	到期日	证券代码	证券名称	负债类型	头寸类型	负债状态	数量	金额	未偿还数量
1	20230123	300750	宁德时代	融券卖出	普通	未了结	200	102764.00	100
2	20230125	300001	特锐德	融券卖出	普通	未了结	1000	19020.00	880
3	20230125	300002	神州泰岳	融券卖出	普通	未了结	10000	42200.00	10000
4	20230125	600010	包钢股份	融资买入	普通	未了结	10000	22500.00	10000
5	20230125	600004	白云机场	融资买入	普通	未了结	10000	129655.00	10000
6	20230125	600011	华能国际	融资买入	普通	未了结	1000	7020.00	904
7	20230213	600622	光大嘉宝	融券卖出	普通	未了结	2000	6380.00	2000
8	20230213	000031	大悦城	融券卖出	普通	未了结	2000	7040.00	2000
9	20230214	000001	平安银行	融资买入	普通	未了结	2000	24520.00	268
10	20230214	000001	平安银行	融资买入	普通	未了结	2000	24520.00	2000
11	20230214	000030	富奥股份	融资买入	普通	未了结	2000	11300.00	1991
12	20230214	600621	华鑫股份	融资买入	普通	未了结	2000	25600.00	1258
13	20230326	300750	宁德时代	融资买入	普通	未了结	0	65.28	0
14	20230702	600010	包钢股份	融券卖出	普通	未了结	1000	1940.00	1000
15	20230702	600621	华鑫股份	融券卖出	普通	未了结	400	4160.00	400
16	20230702	600621	华鑫股份	融券卖出	普通	未了结	400	4160.00	400
17	20230702	600621	华鑫股份	融券卖出	普通	未了结	200	2080.00	200
18	20230910	000001	平安银行	融资买入	普通	未了结	100	1288.00	100

信用负债页面中显示了账户所有未了结及当日已了结的负债记录，包括了总负债数量金额，剩余未偿还，息费交易费用等信息。

4.7.1.3 标的证券查询

综合查询

信用资产明细

信用负债记录

标的证券清单

两融利率费率

标的证券清单

证券代码

标的类型全部

刷新

导出

	证券代码	证券名称	交易所	担保品	融资标的	融券标的	折算率	融资保证金率	融券保证金率	白名单	最大展期数
1	000001	平安银行	深圳	是	是	是	0.70	1.00	0.65	否	不支持
2	000002	万科A	深圳	是	是	是	0.68	1.00	0.65	否	不支持
3	000004	ST国华	深圳	否	否	否	0.00	0.00	0.00	否	不支持
4	000005	ST星源	深圳	否	否	否	0.00	0.00	0.00	否	不支持
5	000006	深振业A	深圳	是	是	是	0.52	1.00	0.65	否	不支持
6	000007	全新好	深圳	是	否	否	0.46	0.00	0.00	否	不支持
7	000008	神州高铁	深圳	是	是	是	0.00	1.00	0.65	否	不支持
8	000009	中国宝安	深圳	是	是	是	0.63	1.00	0.70	否	不支持
9	000010	美丽生态	深圳	是	否	否	0.47	0.00	0.00	否	不支持
10	000011	深物业A	深圳	是	否	否	0.57	0.00	0.00	否	不支持
11	000012	南玻A	深圳	是	是	是	0.59	1.00	0.65	否	不支持
12	000014	沙河股份	深圳	是	否	否	0.54	0.00	0.00	否	不支持
13	000016	深康佳A	深圳	是	是	是	0.51	1.00	0.65	否	不支持
14	000017	深中华A	深圳	是	否	否	0.00	0.00	0.00	否	不支持
15	000019	深粮控股	深圳	是	否	否	0.57	0.00	0.00	否	不支持
16	000020	深华发A	深圳	是	否	否	0.00	0.00	0.00	否	不支持
17	000021	深科技	深圳	是	是	是	0.65	1.00	0.65	否	不支持
18	000023	深天地A	深圳	是	否	否	0.00	0.00	0.00	否	不支持
19	000025	特力A	深圳	是	是	是	0.54	1.00	0.65	否	不支持
20	000026	飞亚达	深圳	是	否	否	0.59	0.00	0.00	否	不支持
21	000027	深圳能源	深圳	是	是	是	0.63	1.00	0.65	否	不支持
22	000028	国药一致	深圳	是	是	是	0.65	1.00	0.65	否	不支持

标的证券页面中显示了证券属性，是否担保品，是否融资融券标的。

4.7.2 持仓明细

持仓明细

代码过滤

栏位设定

导出

	合计	总资产	总市值	可用资金	港股通市值	持仓盈亏
1	合计	74285749.98	71086086.60	3199663.38	0.00	-30137119.00

	证券代码	证券名称	当前持仓	可卖数量	成本价	最新价	盈亏率	盈亏	证券市值	买入量
991	870436	大地电气	1600	1600	8.0098	10.33	28.97%	3712.25	16528.00	
992	871245	威博液压	1600	1600	12.7694	10.19	-20.20%	-4127.04	16304.00	
993	871396	常辅股份	1600	1600	7.4542	11.59	55.48%	6617.21	18544.00	
994	871553	凯腾精工	1600	1600	3.7094	4.59	23.74%	1409.00	7344.00	
995	871642	通易航天	1600	1600	6.8094	9.67	42.01%	4577.03	15472.00	
996	871857	泓禧科技	1600	1600	9.0802	14.70	61.89%	8991.61	23520.00	
997	871970	大禹生物	3200	3200	4.2409	7.11	67.65%	9181.01	22752.00	
998	871981	鼎泰科技	1600	1600	13.8889	13.00	-6.40%	-1422.18	20800.00	
999	873122	中纺标	1600	1600	12.9016	48.86	278.71%	57533.49	78176.00	
1000	873169	七丰精工	1600	1600	6.6513	6.59	-0.92%	-98.01	10544.00	

持仓明细表格上方输入框可以用来过滤证券代码。双击持仓某条记录，可快速打开对应持仓证券的闪电下单窗口。

4.7.3 当日委托

委托明细

全部

可撤

已成

已撤/废单

全

撤

代码过滤

栏位设定

导出

	委托时间	证券代码	证券名称	方向	报单类型	委托状态	委托价格	委托数量	成交数量
1	14:05:32	600000	浦发银行	卖出	限价	全部成交	7.15	200	200
2	14:04:50	600000	浦发银行	卖出	限价	全部撤单	7.29	200	0
3	14:03:56	600000	浦发银行	卖出	限价	全部成交	7.07	200	200
4	11:19:33	600000	浦发银行	买入	限价	全部撤单	7.12	500	0
5	11:19:22	600000	浦发银行	买入	限价	交易所已接收	7.13	500	0
6	11:18:59	600000	浦发银行	卖出	限价	全部撤单	7.21	500	0
7	11:18:57	600000	浦发银行	买入	限价	全部撤单	7.13	500	0
8	11:18:50	600000	浦发银行	买入	限价	全部撤单	7.13	500	0
9	10:34:28	600000	浦发银行	卖出	限价	全部撤单	7.30	500	0
10	10:34:12	600000	浦发银行	卖出	限价	全部撤单	7.22	500	0
11	10:32:21	600000	浦发银行	卖出	限价	全部撤单	7.30	500	0

全 数

代码过滤

栏位设定

导 出

当日委托明细表格上方可过滤证券代码，根据委托状态进行筛选。双击某条记录可撤单。

4.7.4 当日成交

成交明细									
<div><div><div><div></div></div><div>成交汇总模式</div></div><div>代码过滤</div><div></div><div>导 出</div></div>									
合计	总买入金额(CNY)		总卖出金额(CNY)		当日逆回购金额(CNY)				
合计	716.00		2868.00		0.00				
成交时间	证券代码	证券名称	委托方向	成交价格	成交数量	成交金额	成交编号	委托编号	
1	14:05:32	600000	浦发银行	卖出	7.17	200	1434.00	13724425	110018100025975
2	14:03:56	600000	浦发银行	卖出	7.17	200	1434.00	13629014	110018100025931
3	10:45:32	600000	浦发银行	买入	7.16	100	716.00	6567094	110018100014663

成交明细									
<div><div><div><div></div></div><div>成交汇总模式</div></div><div>代码过滤</div><div></div><div>导 出</div></div>									
合计	总买入金额(CNY)		总卖出金额(CNY)		当日逆回购金额(CNY)				
合计	716.00		2868.00		0.00				
证券代码	证券名称	委托方向	平均成交价格	成交数量	成交金额	客户号	股东号	交易所	
600000	浦发银行	买入	7.160	100	716.00	00031061	A00031061	上海	
600000	浦发银行	卖出	7.170	400	2868.00	00031061	A00031061	上海	

当日成交明细表格上方输入框可用来过滤证券代码，可切换显示当日每笔成交详情和当日成交汇总模式。

4.7.5 历史记录

历史委托

日期2022/3/12至2023/3/21顺序新纪录在上查询导出下滑滚动条以显示更多记录(已加载100条)全部加载

	委托日期	委托时间	证券代码	证券名称	买卖类别	报单状态	报单类型	委托价格	委托数量	成交数量
17	20221230	14:36:26	204001	GC001	逆回购	全部撤单	限价	3.705	1	0
18	20221230	14:35:44	204001	GC001	逆回购	全部撤单	限价	3.800	1	0
19	20221230	14:32:38	204001	GC001	逆回购	全部撤单	限价	3.820	1	0
20	20221230	14:32:24	204001	GC001	逆回购	全部撤单	限价	3.820	1	0
21	20221230	14:32:17	204001	GC001	逆回购	全部撤单	限价	3.820	1	0
22	20221230	14:32:09	204001	GC001	逆回购	全部撤单	限价	3.820	1	0
23	20221230	14:31:59	204001	GC001	逆回购	全部撤单	限价	3.805	1	0

历史成交

日期2021/3/12至2023/3/21顺序新纪录在上查询导出下滑滚动条以显示更多记录(已加载200条)全部加载

	成交日期	成交时间	证券代码	证券名称	买卖类别	成交价格	成交数量	成交编号	客户号
98	20220127	14:50:55	204001	GC001	逆回购	2.635	100	1200801003006278	39800009
99	20220126	15:07:24	204001	GC001	逆回购	2.860	100	1200801003251017	39800009
100	20220117	14:58:43	131811	R-002	逆回购	1.910	20	0201000007359536	39800009
101	20220117	14:58:32	131810	R-001	逆回购	2.081	10	0201000007343094	39800009
102	20220117	15:14:07	204002	GC002	逆回购	2.255	100	1200801003284507	39800009
103	20220113	15:21:08	131811	R-002	逆回购	2.340	200	0201000009471737	39800009
104	20220113	15:20:58	131810	R-001	逆回购	2.460	100	0201000009465732	39800009

可查询指定日期范围之内的历史委托、成交、交割单、资金、流水、持仓、盈亏、负债信息（两融）等记录。

4.7.6 设置表头栏位

表格栏位设定

可选栏位

1 今买入量
2 今卖出量
3 今买入金额
4 今卖出金额
5 昨收盘价
6 登录账号
7 客户号
8 股东号
9 交易所
10 股份昨余
11 冻结数量
12 仓位占比
13 持仓成本金额

→
←
↑
↓

已显示栏位

1 证券代码
2 证券名称
3 最新价
4 当前持仓
5 可卖数量
6 证券市值
7 成本价
8 盈亏
9 盈亏率
10 融资仓位
11 融资金额
12 融资利息
13 融券仓位

预设值 确定 取消

在持仓和当日委托表格上方点击“栏位设定”按钮，可分别对不同表格设置

© 华鑫证券有限责任公司，2025

第 63 页 共 64 页

自定义表头，可调整表头栏位的显示内容和顺序。

4.8 菜单-帮助



4.8.1 检查更新



点击菜单中的检查更新按钮可以手动检查是否有新版本。另外每次程序退出后也会自动检查当前版本是否为最新，如有新版本自动弹出该更新工具，用户可在设置中修改自动检查版本功能的开关。