

网格交易增强版使用说明

(2017 年 03 月 07 日)

公司名称		文档编号	
文档名称	网格交易增强版 APP 使用说明	文档版本	1.0
起 草		起草日期	20170307
审 批		审批日期	

目录

第一章 应用介绍.....	3
第二章 使用说明.....	4
1. 依赖说明.....	4
2. 操作建议.....	4
3. 功能介绍.....	4
(1) 参数设置说明.....	4
(2) 主界面.....	6
(3) 操作说明.....	6
(4) 订单列表.....	7
(5) 配置文件保存与恢复.....	7
(6) 操作日志.....	7
(7) 交易记录.....	7
(8) 撤单和撤补.....	7

第一章 应用介绍

网格交易增强版 App 是基于国信证券股份有限公司推出的 TradeStation 量化交易平台的一款应用。该应用是基于短线交易中需求开发，适用于震荡行情。其基本的委托单逻辑为，预先设置一个价格（图 1.1 中价格 A）作为基准价，设置一定的幅度（图 1.1 中 B）为步长，设置一个较小的数值作为买入溢价以确保订单能快速成交。当价格向上突破（基准价+步长）时，则以（当前最新价-溢价）的价格执行卖出一定数量标的证券的操作，并上调基准价为（原基准价+步长）。相反，当价格向下突破（基准价-步长）时，则以（当前最新价+溢价）的价格执行买入一定数量标的证券的操作，并上调基准价为（原基准价-步长）。如图 1^①所示，蓝色实线为价格走势，蓝色点为卖出点，红色点为买入点。

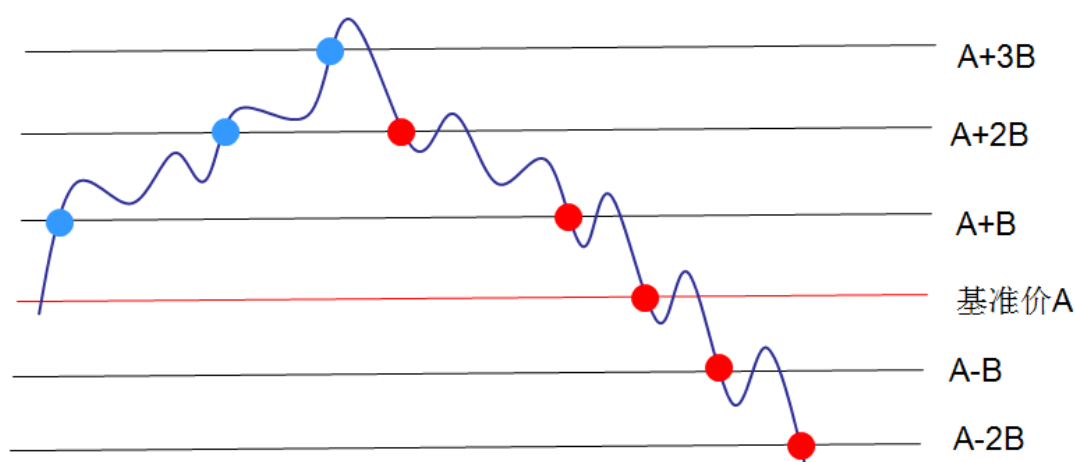


图 1.1 网格交易逻辑图

基于此交易想法，设计并实现此基于国信证券 TradeStation 应用。本应用能获得最新的市场价格，时时判断是否触及网格交易的逻辑发单条件，并及时发出委托，并获得成交回报，并能够在委托还未完全成交的状态下实现撤单和补单操作。

第二章 使用说明

1. 依赖说明

由于本应用是基于[国信证券 TradeStation](#)开发的，因此要使用该程序，必须安装国信证券 TradeStation。国信证券 TradeStation 会根据实际需求及时发出更新，因此建议在使用时下载更新到[最新版本](#)的 TradeStation。

2. 操作建议

- 1) 非官方的 windows 系统可能会因为组件缺失等导致 TradeStation 运行异常，建议使用完整版本的 Windows 系统。
- 2) 本应用是作为案例编写，不能用于实盘交易，若有需要可根据此案例自行开发并进行严格的测试。

3. 功能介绍

(1) 参数设置说明

账户：资金账号。资金账号必须为国信证券 TradeStation 绑定的账号，否则会导致发单失败等。支持普通账户，信用账户和期货账户。若账户为信用账户，则有融资买/卖券还 ☐ 融资买/卖券还 和担保品买卖 ☒ 担保品买卖 两种选择，用户可以从二者中勾选一项。若账户为期货账户，则有多 ☐ 多 和空 ☒ 空 两种选择，选择“多”则配对指令为开多仓(买入信号)和平多仓(卖出信号)。选择“空”则为开空仓(卖出信号)和平空仓(买入信号)。

代码：需要进行交易的股票代码。股票代码必须为附带“SH”或“SZ”的全称，不区分大小写，但建议为大写。输入代码后会显示股票全称。

基准价：不得为负数，最初基准价，首次输入代码时初始基准价默认为最新价值，可以据此修改。

步长：不得为负数。当勾选“百分比”复选框时，步长为当前基准价的百分

数；若不勾选“百分比”复选框，步长则为固定值。

溢价：必须为整数或 0。当为 0 时，以最新价发单。当为整数时则代表发单时的最小变动单位的溢出数。如溢价设置为 2 的 IF1712.ZJ 开多仓时价格为(买一价+ 2 × 0.2)，同理溢价设置为 5 的 RB1706.SQ 开空仓的价格为(卖一价- 5 × 1)。此外，基金的最小变动单位一般为 0.001，股票的为 0.01。各品种的最小变动单位请参考 TS 手动下单栏输入代码后的限价增量变动查询。

常见品种的最小价格变动单位（截至 2017 年 3 月 8 日）：

沪深股票（0.01）

场内基金（0.001）

股指期货（0.02）

沪铜 Cu（1）

沪金 Au（0.01）

沪银 Ag（1）

沪银 Ag（1）

豆一 A（1）

螺纹钢 Rb（1）

铁矿石 I（0.5）

最新的报价最小变动单位以交易所公告的合约规定为准。

单笔数量：不得为负数，每次交易的股数。

持仓下限：不得为负数，允许持仓的最小数量。以股票为例，若一次卖出会导致持仓低于此下限，则该次卖出不会被执行。其他品种同理。

持仓上限：必须大于持仓下限。允许持仓的最大数量，以股票为例，若一次买入会导致持仓高于此上限，则该次买入不会被执行。其他品种同理。

(2) 主界面

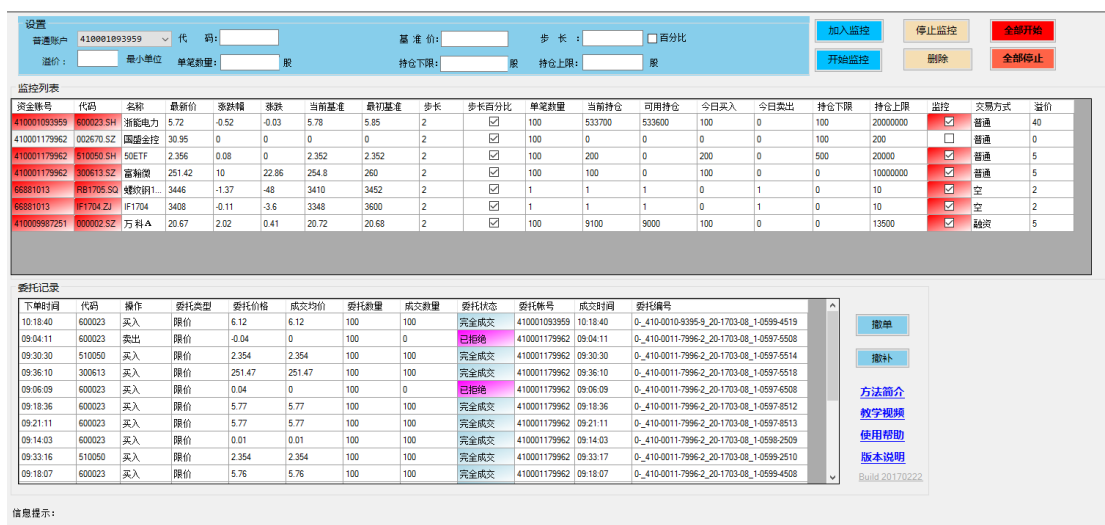


图 2.1 网络交易-主界面

(3) 操作说明

依次输入各参数，然后点击**加入监控**按钮，则该代码被加入到监控列表。重复以上操作可在监控列表中加入多只证券。点击某一代码所在行，再点击**删除**按钮，可以从监控列表中删除该行。

选中监控列表中的行，该行的参数会出现在设置栏中，可以直接进行参数修改然后点击**加入监控**。

在监控列表中点击需要开始监控的证券，点击**开始监控**按钮，则可以开始监控。开始监控后资金账号、代码和监控栏会变为红色。点击某一代码所在行，再

点击**停止监控**按钮，则该代码的监控被停止。**全部开始**

全部停止按钮用于将监控列表中的所有代码全部开始监控和全部停止监控。

监控列表															
资金账号	代码	名称	最新价	涨跌幅	涨跌	当前基准	最初基准	步长	步长百分比	单笔数量	当前持仓	可用持仓	今日买入	今日卖出	持仓上限
410038212453	600519.SH	贵州茅台	367.20	2.30	8.24	367.20	367.20	2	<input checked="" type="checkbox"/>	100	0	0	0	0	10000
410038212453	600518.SH	康美药业	17.43	-0.23	-0.04	17.43	17.43	2	<input checked="" type="checkbox"/>	100	0	0	0	0	10000
410038212453	000001.SZ	平安银行	9.45	0.00	0.00	9.45	9.45	2	<input checked="" type="checkbox"/>	100	0	0	0	0	10000
410038212453	000002.SZ	万科A	20.26	0.20	0.04	20.26	20.26	2	<input checked="" type="checkbox"/>	100	0	0	0	0	10000

图 2.2 网络交易-监控列表

当处于开市期间，价格会自动获取行情并实时更新，当满足条件时会发单。订单发出后，出现在图 2.3 中的下方表格中。

特别说明：当最新价与基准价出现断崖式差距时，不再按照逐 Tick 渐进逼近的方式连续发送委托，而是直接将基准价调整为最近的基准价且仅发送一笔委托。如基准价为 6.0，最新价为 6.9，步长为 0.2 的情况下，当收到下一个 Tick 时发出一笔卖出委托（单笔数量），并直接调整基准价位 7.0（最邻近的基准价）。

（4）订单列表

下单时间	代码	操作	委托类型	委托价格	成交均价	委托数量	成交数量	委托状态	委托帐号	成交时间	委托编号
13:51:53	601989	买入	限价	7.49	7.49	17000	17000	完全成交	410001179962	13:51:53	0_410-0011-7996-2_20-1703-07_1-0597-1580
13:51:53	601989	融资买入	限价	7.49	7.49	100	100	完全成交	410009987251	13:51:53	155_410-0099-8725-1_20-1703-07_1-0596-26

图 2.3 网格交易-委托单列表

（5）配置文件保存与恢复

因为最新价、基准价等信息要保存，并有可能在重新打开应用后启用。因此，在本版本中，系统自动将参数设置记录在 Mywork 文件夹下，用户无需重复设置。文件名为%TS-Install-Dir%\Mywork\GridPlus_Config20170222.csv，可以查看或直接手动修改（建议在 APP 中修改，不建议直接修改配置文件）。如"E:\Program Files\TradeStation 9.5\MyWork\ GridPlus_Config20170307.csv"

（6）操作日志

为了便于分析操作和查阅记录，默认记录订单发送操作和订单状态变更等写入日志。该日志路径为：TradeStation 安装目录\MyWork\GridPlus_LogFiles_xxxxxxx.txt，如："E:\Program Files\TradeStation 9.5\MyWork\GridPlus_LogFiles_20170307.txt"。

（7）交易记录

交易记录保存在安装目录下的 Mywork 文件夹中。文件名为 GridPlus_Order+ 文件保存日期+.csv，如 "E:\Program Files\TradeStation 9.5\MyWork\ GridPlus_Order20170307.csv"

（8）撤单和撤补

选中未全部成交的订单，点击**撤单**按钮，则会发出撤单操作，如图 2.4 所示。

委托记录										
下单时间	代码	操作	委托类型	委托价格	成交均价	委托数量	成交数量	委托状态	委托帐号	委托编号
13:51:53	601989	买入	限价	7.49	7.49	17000	17000	完全成交	410001179962	0_410-0011-7996-2_20-1703-07_1-0597-1580
13:51:53	601989	融资买入	限价	7.49	7.49	100	100	完全成交	410009987251	155_410-0099-8725-1_20-1703-07_1-0596-26

[方法简介](#)
[教学视频](#)
[使用帮助](#)
[版本说明](#)
Build 20170222

图 2.4 网格交易-撤单与补单

如果有未全部成交的订单，点击撤补按钮，则会发出撤单并在撤单成功后自动以**最新价**补发剩余数量（如果是股票会四舍五入取整百数量，期货则为未成交数量）的委托单，如图 2.4 所示。

免责声明

本 APP 仅供学习使用，对于因系统异常或代码失误导致的投资损失由使用者自行承担。