

# 初次对接 XTP

## XTP 程序化交易流程:

下载 sdk 包在测试环境调通程序——XTP 开户——托管服务器——部署实盘环境——开通所需权限——上传程序——接入实盘前置地址交易。

### 一、XTP 接入方式

- 合规上要求策略产生的交易指令在内网生成，外网是不能通过 API 向内网发交易指令的，客户需要通过服务器把量化程序托管在机房内交易；
- 程序化接入可以下载 XTP SDK 包，里面有详尽的对接说明文档和 demo，手工交易可以下载极速通、SmartX 客户端；
- 以下带\*的接入方式，需要发起增值服务申请流程后部署使用，其中 SmartX-Kungfu 可以申请计算单元无需托管服务器，其他接入方式需托管服务器用于部署策略。
- XTP SDK/客户端下载链接：<https://xtp.zts.com.cn/service/download>
- XTP 支持业务列表：<https://xtp.zts.com.cn/doc/api/business>

支持的接入方式	可满足客户的需求
Monitor*	是大多数客户选择的程序化交易接入方式，上线时间快（1 周左右）。Monitor 是您的程序对接我们的 api（XTP.API SDK），用于订阅行情、下单、撤单、成交回报推送、查询等；我们另外给您预留了一个 Monitor 客户端的通道（XTP.Monitor.SDK），辅助您对托管服务器进行配置文件上传、盘中策略程序启停以及日志监控等操作。
SmartX-Kungfu*	SmartX-Kungfu 集成并优化开源的低延迟量化策略平台 Kungfu，通过 SmartX 客户端可以实时上传策略、配置和启停策略，实时收策略的委托、成交数据，分析策略级别的持仓，查看实时的策略执行日志。Kungfu 策略平台基于事件机制，支持 Python 3 及 linux C++ 形式的策略编写，同时集成常用第三方库 rqdatac、tushare 等，支持带纳秒级时间戳的交易数据实时存储和盘后分析。支持普通股票交易、融资融券交易、期货交易等。

<b>功夫、VNPY*</b>	第三方策略平台，主要面向技术能力稍薄弱，没有能力开发自己的量化交易程序的客户。
<b>定制化*</b>	一般是面向有特殊定制的交易需求的客户，客户有自己成套的服务端和客户端的系统架构，且风控和盯盘机制很繁琐复杂。系统架构应为 B/S 架构或 C/S 架构中的一种，S 端对接我们的 API。但由于流程上线时间较长（3 个月左右），一般不推荐。
<b>SmartX、极速通</b>	是标准客户端，用于手工交易和查看程序下单的记录，SmartX 智能交易终端是中泰证券自主研发，客户端支持 Windows、MacOS 系统，支持普通交易、算法交易、CSV 下单、篮子交易、套利交易、极简交易、行情、资讯、研报、等功能。
<b>XTP.迅投 PB</b>	迅投 PB 是机构产品客户使用较多的接入方式，作为 PB 系统可以提供覆盖业务面较广的支持，除了日常的现货交易、期现套利等功能，还包含有机构常用到的估值和清算功能，产品风控、交易 workflow、多产品多交易员管理。交易终端具有开放式的量化策略接口、智能算法交易、便捷篮子股票交易、批量下单等高度自定义交易界面和完整数据导入导出功能。
<b>XTP.迅投 QMT</b>	迅投 QMT 极速策略交易系统是一款专门为证券、期货公司等专业金融机构的私募基金管理人、VIP 客户、个人高净值客户等活跃交易用户量身定制的，集行情显示、投资研究、策略编写、组合下单自动交易、极速交易、智能算法交易、合规风险管理于一体的专业策略交易平台。

## 二、测试

### 1、普通账户申请

官网申请：<https://xtp.zts.com.cn/register>，可参考以下常见文档的测试指引：

<https://xtp.zts.com.cn/doc/api/common>

- 测试环境相关技术问题，可加入中泰 XTP 官方技术支持 QQ 群 [188500929](#) 咨询。
- 仿真交易地址：122.112.139.0:6102
- 仿真行情地址：119.3.103.38:6002
- XTP SDK/客户端下载：<https://xtp.zts.com.cn/service/download>
- 在线文档：<https://xtp.zts.com.cn/doc/api/xtpDoc>

极速交易客户端 (SmartX)：选择测试环境

登录

---

登录

## 2、两融、期权、monitor 客户端账号申请

- 请联系分支机构走 XTP 工单流程申请测试账号。

## 3、测试环境维护时间

- 9:00 和 00:00 各一次，维护时长半小时，其他时间都可测。

## 4、测试环境注意事项

- 测试账户默认有底仓，每天都会重置，会清除昨日操作，如需保留持仓或修改可用资金请登录 XTP 官网 <https://xtp.zts.com.cn/> 个人中心设置；

XTP 首页 产品中心 文档中心 X-Club 关于我们

证券账户: A722360148 当前组合模式: confirm 登录

证券账户: 0128995298 当前组合模式: reportOne

**保留资金和持仓**

是否保留资金和持仓: 否

注: 测试账户默认有仓位 是 如需保留仓位请于当日23点前提交申请, 次日生效。(信用账户无法保留仓位) 否

提交

**资金蓝补** 资金可隐藏空位

调整可用资金为目标金额(元): 0

1) 可用资金最大金额为10亿, 如需调整请于当日23点前提交申请, 次日生效。(信用账户不支持资金蓝补)  
2) 如未申请保留资金和持仓, 每日重置后, 测试账号可用资金默认为10亿。

提交

- 仿真行情提供逐笔委托和逐笔成交行情，需使用 TCP 连接，仿真行情数据是基于线上的行情数据，然后定时取过来再显示出来，所以不可能达到线上的标准；
- 行情频繁断线：测试环境仅支持连通性测试，建议仅订阅几只股票做连通性测试。并尽快处理行情数据，否则可能会因为接收缓存满而被断线；
- 模拟撮合目前默认采用轮询模式进行撮合，上交所模拟撮合会每秒去轮循一次，然后轮流按照不成交、部分成交、全部成交、拒单等方式给用户的订单进行模拟撮合，确保用户下单时，所有可能的报单情况都能给到用户。如果想要设置不同的撮合方式，请至 XTP 官网 (xtp.zts.com.cn) 的个人中心中设置默认撮合方式，次日生效。

(个人中心->账号设置->撮合模式配置)

个人中心

账号设置

测试帐号

撮合模式配置 →

我的消息

撮合模式设置

市场：上海

证券账户：

A305998269

当前撮合模式：

all matched ▼

市场：深圳

证券账户：

0054465627

当前撮合模式：

report ▼

确认修改

❖ 设置模式包括上交所和深交所，其中上交所对应关系如下：

设置模式	撮合模式
altmate match	轮询（未成、部成、全成、拒单轮流来）
all matched	全部成交
match half	部分成交
not match	全部订单都是未成交
match error	全部拒单

深交所对应关系如下：

设置模式	撮合模式
auto	轮询（未成、部成、全成、拒单轮流来）
fail	全部拒单
pending	全部订单都是未成交
report	全部成交
part	部分成交
cancel	撤单

### 三、托管服务器

#### 1、寄送服务器、提交申请流程

- 托管服务器请联系营业部走申请流程，根据交易偏好选择机房寄送服务器，目前有上海华京路机房、上海金桥路机房、深圳机房。托管涉及到费用，请咨询营业部和机构销售部；
- 托管服务器及相关配件要求请参考常见文档：  
<https://xtp.zts.com.cn/doc/api/common> 《服务器及相关配件要求》。

#### 2、访问托管机方式

- 远程连接托管服务器的方式是 VPN+堡垒机，或者拉专线；一个 VPN 只能同时有一个连接，如需要多人管理服务器请申请多个 VPN；
- 待服务器上架和 XTP 开户后，会以邮件的形式发送以下信息给客户：服务器 IP、VPN 和堡垒机账号密码、交易/行情前置地址、授权 key 等，请参照使用手册连接服务器。

- 运维人员会按上架单的系统版本重装系统，登录服务器后即可根据需要安装软件、配置环境等。可以在内网查找需要的源，内源地址：

<http://mirrors.xtp.com/mirrors/#>，如因为权限问题无法安装请联系我方 XTP 运营人员。

### 3、服务器可开通的权限

#### 1) L2 行情

- UDP 推送，提供行情快照、买一卖一委托队列、逐笔、订单簿（10ms/张）；
- 服务器上架后默认可以连接 L1 行情，L2 行情交易所是要收取一定费用，若需要请向分支机构申请；同一个管理人申请一次即可；
- L2 行情不能转发出机房，只能在托管机能读取。



XTP行情接入前文  
档(2021-10-28).docx

#### 2) 鲁证期货 CTP 行情

- XTP 本身不接期货，但可以给客户的托管服务器开通通道连鲁证 CTP，鲁证 CTP 行情是从宁桥路机房转发，走内部专线；
- 如果是从其他期货公司获取行情，只能走互联网线路，需提供互联网 IP 地址和端口，再联系分支机构走互联网访问权限申请流程开通权限。

#### 3) 互联网访问权限

- 托管机默认只连接交易网，无法访问公网，需要访问特定的外网可以开通互联网访问权限；
- 互联网访问权限可以开通由内到外的 tcp 协议通道，需要提供特定互联网 IP 和端口给分支机构申请；

- 优先保证交易我们盘中网访问有限速，每个 IP 限制在 2M 带宽，200Kb/s 的速度，如果您对速度和数据量的要求较高请开通专线。

#### 4) [sftp 下载权限和 XMS 平台](#)

- 开通 sftp 权限可下载托管机上指定目录的文件，需要提供一个三级目录给分支机构申请；
- XMS 是我们目前在试运行阶段的客户自助平台，可以支持文件上传和下载，还能支持 api 调用；开通 XMS，请提供以下信息给运营：手机号、邮箱、服务器 IP、深圳 VPN 账号。
- 具体内容请参考指引：详见 <https://xtp.zts.com.cn/doc/api/common> 《文件的上传和下载》。

### 四、实盘环境交易

- 请按邮件发送的前置地址连接 XTP 行情和交易服务，资金账号的密码为客户在营业部设置的交易密码。账户转入 XTP 后无法再在金证柜台的客户端交易（融易汇、齐富通等）。XTP 支持业务详见链接：<https://xtp.zts.com.cn/doc/api/business>；
- XTP 资金转入需要在金证柜台银证转账后，再从 XTP 划转，为避免透支，盘中预扣手续费比实际清算的佣金高，详见指引 <https://xtp.zts.com.cn/doc/api/common> 《XTP 资金划转与总资产查询》。

#### [一账户两中心](#)

- 对交易速度有极致要求的客户，可以在上海深圳机房分别托管服务器，开通一账户两中心，解决跨地 40ms 的链路延迟；
- 需要提供两地资金分配比例给分支机构走 XTP 柜台业务办理申请流程，开通后，上海服务器只能交易上海市场，深圳服务器只能交易深圳市场；

- 账户为上海节点，开通双中心前要变更节点到南方，若账号有深圳持仓，需要盘中操作转托管（联系分支机构走 XTP 柜台业务办理申请流程）；
- 详细内容请参考指引：<https://xtp.zts.com.cn/doc/api/common> 《一账户两中心》。

## 五、业务/技术支持

- 测试环境相关技术问题，可加入中泰 XTP 官方技术支持 QQ 群 [188500929](#) 咨询；
- 初次对接、XTP 开户、权限开通请联系中泰证券分支机构和 PB 业务服务中心人员；

中泰证券营业网点：<https://www.zts.com.cn/branches/branches.html>

PB 服务支持微信：



- 托管服务器、服务器调试、软件安装、实盘交易、行情问题请通过分支机构联系 XTP 运营人员，我们会为您建立微信群提供技术支持。