

# EMC 智能交易终端量化功能使用指引

## 目录

EMC 智能交易终端量化功能使用指引 .....	1
终端简介 .....	1
EMC 仿真功能 .....	2
获取 EMC 终端 .....	2
测试账号申请 .....	2
测试账号信息获取 .....	2
仿真启动 .....	3
推荐配置 .....	4
安装 SDK（什么是策略 SDK？） .....	4
策略仿真 .....	5
更多帮助 .....	7
实盘申请 .....	7

# 终端简介

**EMC 智能交易终端**（以下简称“终端”）是一款服务于高净值客户和机构投资者的专业 投资软件。终端为用户提供普通交易、信用交易、扫单交易、量化投研/回测/实盘等各种交易工具，满足用户的各种交易需求和交易场景，帮助用户提高交易效率。

**EMC 量化功能模块**，集成了策略开发到实盘的模块化功能，打通研究、仿真和绩效链路、兼容多种编程语言，易于使用、性能可靠，能够帮助量化投资者提高策略开发效率、减少 IT 投入。对于入门级的量化爱好者，本终端是一个兼容开放的学习、实践平台；对于专业的量化投资机构和个人，本终端是一款高效的投研、投资工具，主要功能包括：

- 策略开发·实时行情、历史数据、多语言策略 SDK+完备的策略编写架构
- 策略优化·回测研究、仿真模拟、绩效分析的无缝衔接
- 策略实盘·股票的多实盘通道，多维度风控
- 定制化提供高性能服务模块

**EMC 智能交易终端**只有一个版本，但用户可以选择登录仿真或登录实盘。量化根据实际应用场景分为 **EMC 量化扫单**、**EMC 量化托管 SDK** 两个不同实盘功能，分别用在不同的场景和环境中。**EMC 量化扫单功能**（实盘）可以在用户本地使用，**EMC 量化 SDK 功能**（实盘）只能在托管环境下使用。同时提供 **EMC 量化仿真**用于测试：

**功能：**EMC 仿真

**描述：**可以本地使用的量化仿真功能。登陆时选择仿真登录。

**特点：**主要提供给客户研究量化策略和技术，提供了回测和交易仿真功能

**功能：**EMC 量化扫单

**描述：**可以本地实盘使用的量化扫单功能。登陆时选择实盘登录。

**特点：**需要实盘扫单账户登录，只支持文件单和界面手工交易功能

**功能：**EMC 量化托管 SDK

**描述：**需要在托管机器上使用的量化托管 SDK 功能。登陆时选择实盘登录。

**特点：**需要实盘托管账户登录，托管终端运行在内部网络环境不能访问外部网络，仅能通过 VPN 和堡垒机连接到托管机启动运行终端和交易策略。

## EMC 仿真功能

### 获取 EMC 终端

下载地址：<https://swdlcdn.eastmoney.com/emctradeotp/installer/EMCTrade.exe>

### 测试账号申请

测试账号申请：[终端测试申请-东方财富证券机构交易平台（18.cn）](#)

### 测试账号信息获取

提交后，会在手机短信和邮箱收取到测试账号、密码、ip 端口等信息；

在官网申请记录也会同步显示相关信息。

然后点击查看详情。保存普通资金账号和密码，用于 EMC 登录。

The screenshot displays the 'EMC 智能交易终端' (EMC Intelligent Trading Terminal) application record on the Eastmoney Securities Institutional Trading Platform. The page header includes the company name '东方财富证券' (Eastmoney Securities) and navigation links. The main content area shows a table with application details.

服务名称	申请日期	截止有效期	登录账号	初始密码	操作
EMC智能交易终端	2021-11-17	2022-11-17	[Redacted]	[Redacted]	<a href="#">查看详情</a>

Below the table, there is a section for '测试账号申请' (Test Account Application) with a message: '您已完成所有申请，暂无可申请内容' (You have completed all applications, no more content to apply for).

The footer contains copyright information: '东方财富证券股份有限公司版权所有 [渝CP备12000041号-9] 沪公网安备 31010402009608号 Copyright © 2000-2022 www.18.cn Inc. 本站点已开启IPv6访问' and a '网络信息安全监测' (Network and Information Security Monitoring) logo.

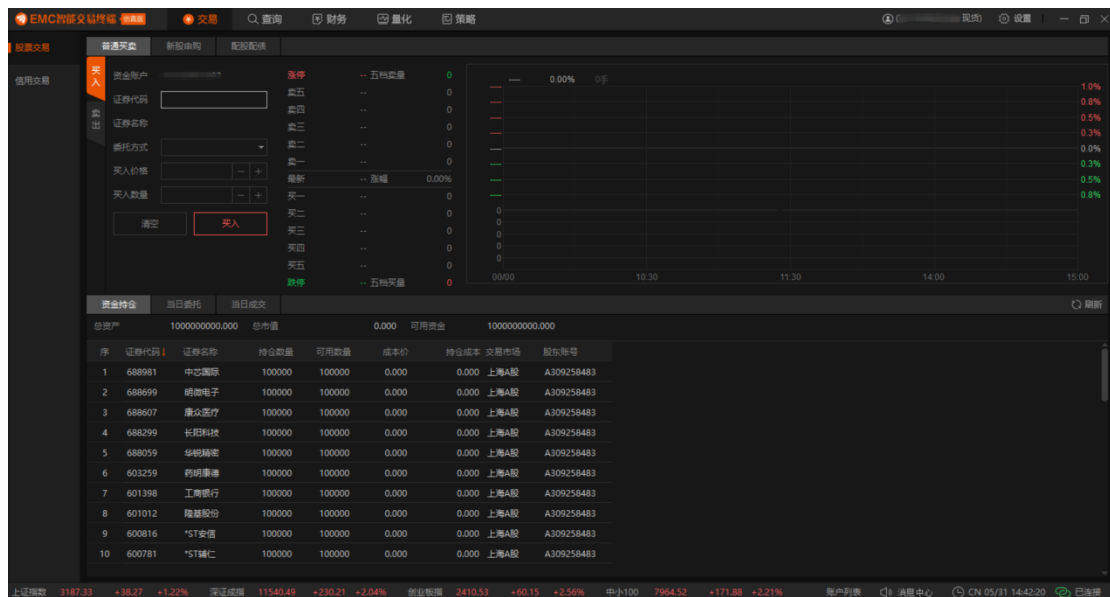

详情
✕

服务名称	EMC智能交易终端
申请日期	2021-11-17
截止有效期	2022-11-17
登录账号	*****
登录密码	*****
普通资金账号	5000000000000000
普通资金密码	*****
信用资金账号	5000000000000000
信用资金密码	*****

手机端用手机浏览器登录、申请步骤类似。

## 仿真启动

启动后量化终端如下：（点击“量化”进入量化模块）



## 推荐配置

本终端运行于本地 Windows 环境，为了保证运行可靠性，推介至少使用以下配置

	最低配置	推荐配置
操作系统	Windows® 7 / Windows® 8 / Windows® 10 64位系统 (或最新版本的 Service Pack)	Windows® 7 / Windows® 8 / Windows® 10 64位系统(最新版本的Service Pack)
处理器	Intel® Core™ i3或是 AMD Phenom™ X3 8650	Intel® Core™ i5或 AMD Phenom™ II X3 处理器及以上
显卡	无特殊需求	无特殊需求
内存	4 GB RAM	6 GB RAM
储存空间	30 GB 硬件空间	
网络	宽带网络	
媒体	无特殊需求	
分辨率	最低 1366 x 768	

## 安装 SDK（什么是策略 SDK？）

策略 SDK 可以比作是策略的承载容器，策略 SDK 以插件形式提供。面向策略时，以标准接口方式供策略直接调用，保证策略简单和稳定，而在 SDK 内部处理许多繁琐的逻辑，包括处理数据、切换运行模式、连接终端等

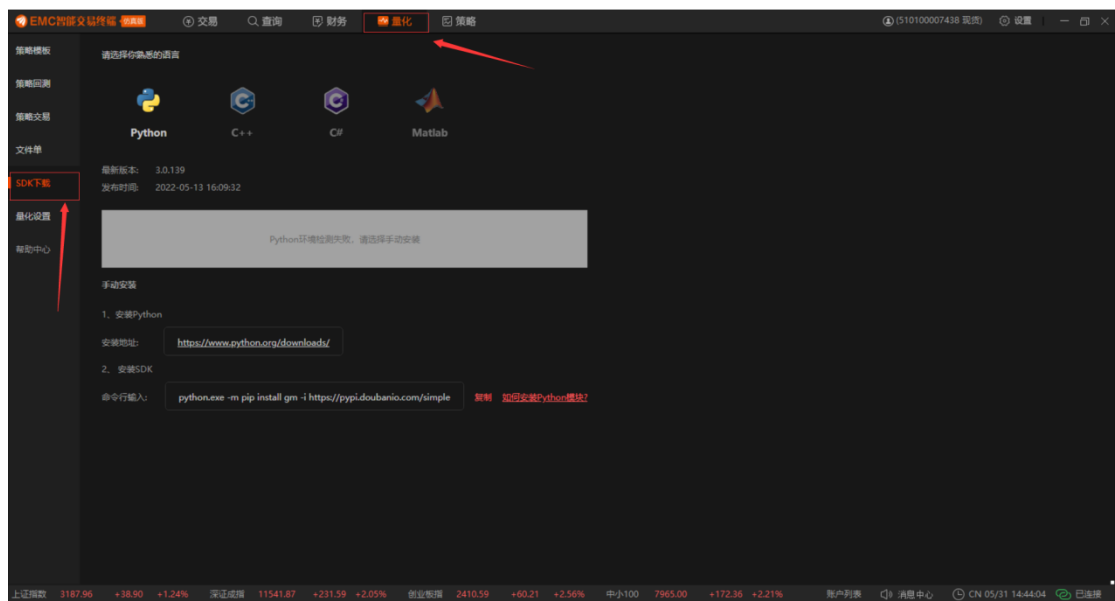
SDK 的使用完美支持外部调用，比如 PythonSDK 通过 pycharm 编辑器进行调用

进入终端后，点击量化模块中“SDK 下载”。

在选择策略编辑语言界面上选择自己熟悉的语言，进行相应 SDK 的安装：。

**注意：**在安装 SDK 之前，请确认已经安装有相应的编程语言环境，其中 Python 语言的 SDK 可自动安装（Python2.7 或者 Python3.6 及以上 Python3.8 及以下，不支持 Python3.10）的环境，下载地址 [www.python.org](http://www.python.org)

此外还可检测是否 SDK 有可更新版本，界面同时提供手动安装指引



关于更新详细的 SDK 安装请参见 Q 群文档《东财量化终端 Python 量化环境搭建.docx》

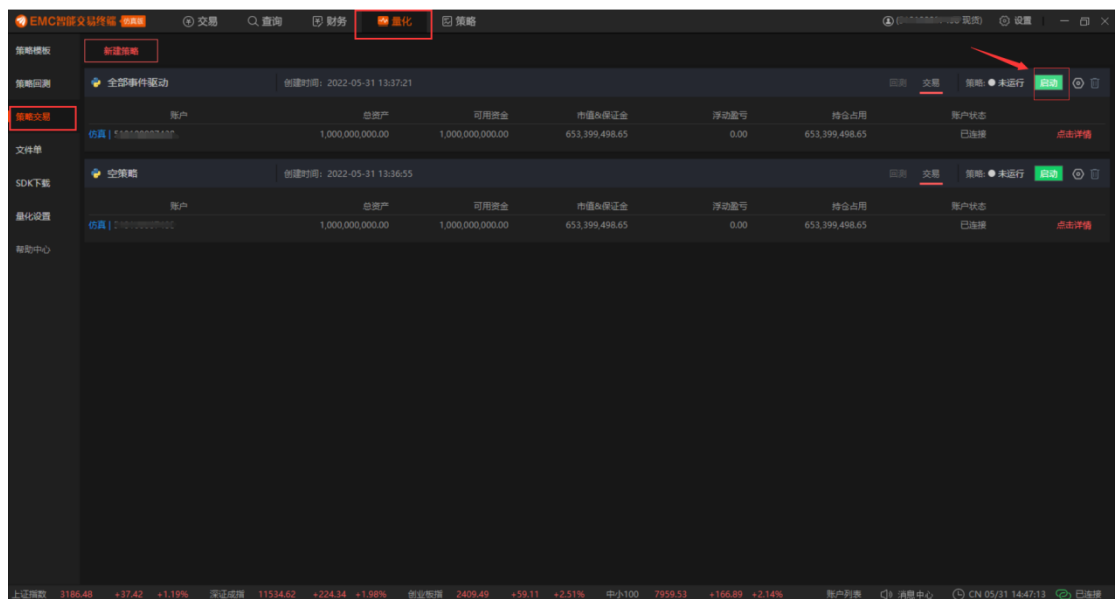
## 策略仿真

点击策略仿真状态，策略会接入仿真柜台，仿真柜台由交易清算系统和实时撮合系统组成，非常接近真实市场环境，能够更准确的检验策略有效性

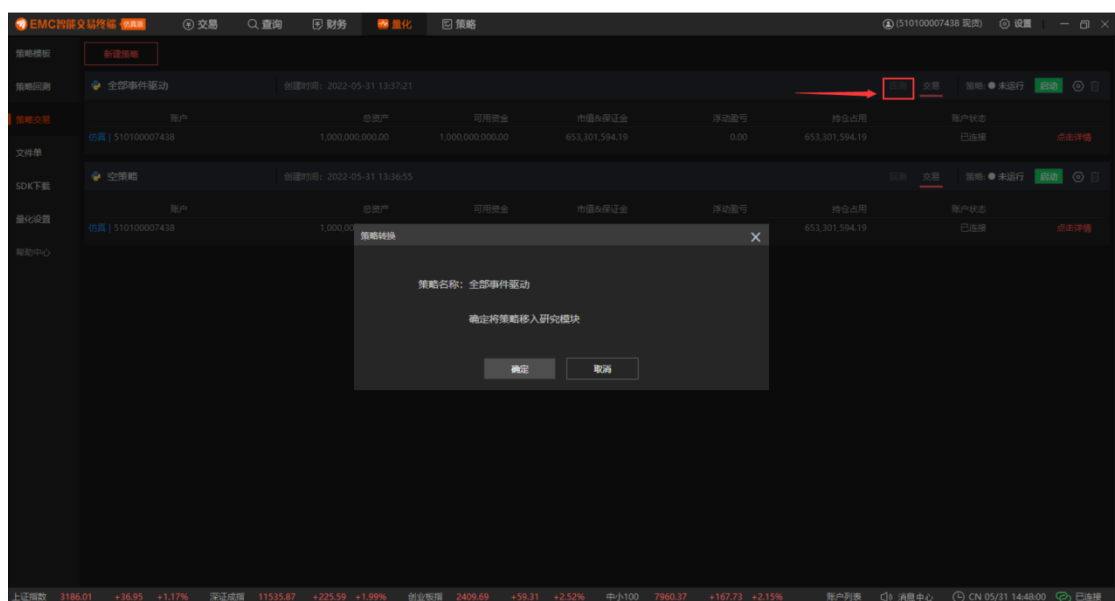
每个账号最多可使用 **10** 个仿真策略

## 策略仿真交易

在策略列表或者策略监控页点击“运行”按钮，开始运行策略代码：



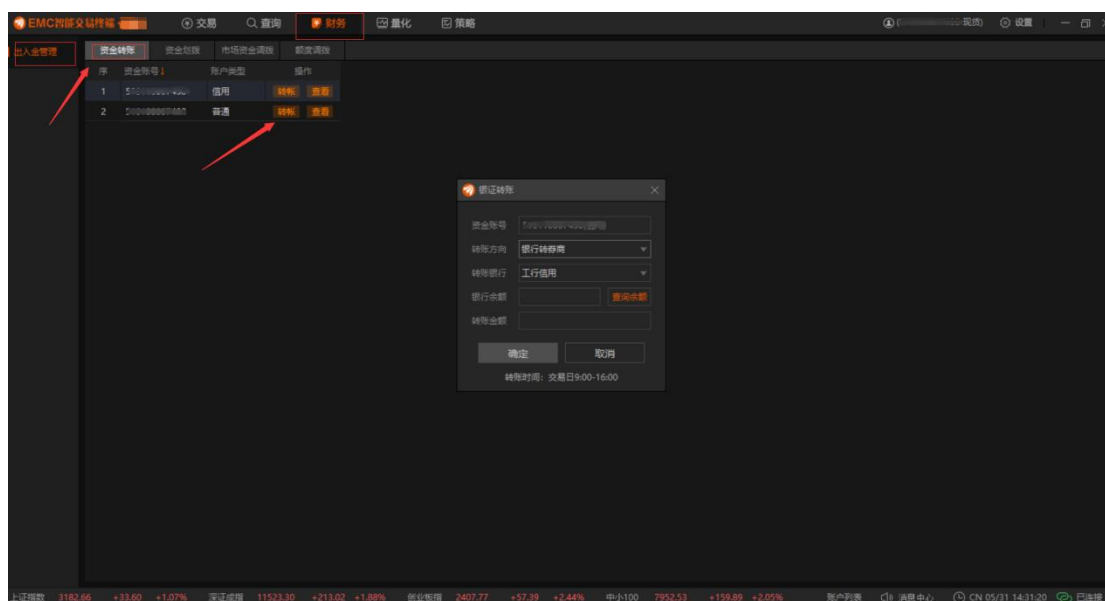
点击“回测”状态按钮之后再次进入策略编辑页面进行修改更新。



## 设置出入金

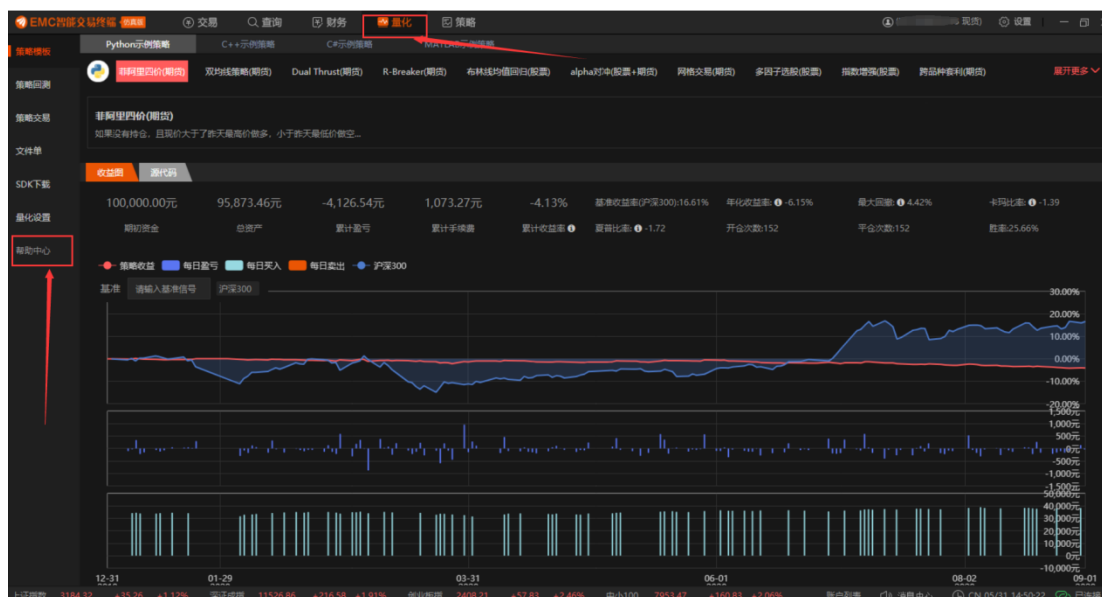
在 EMC 上客户可以通过财务模块的出入金管理中“资金转账”功能进行银证转账，实现仿真出入金管理：





## 更多帮助

需要更多的相关文档和 API 参考请点击“帮助中心”，选择需要参考的内容。



帮助中心地址: <https://emquant.18.cn/help/?doc=guide>

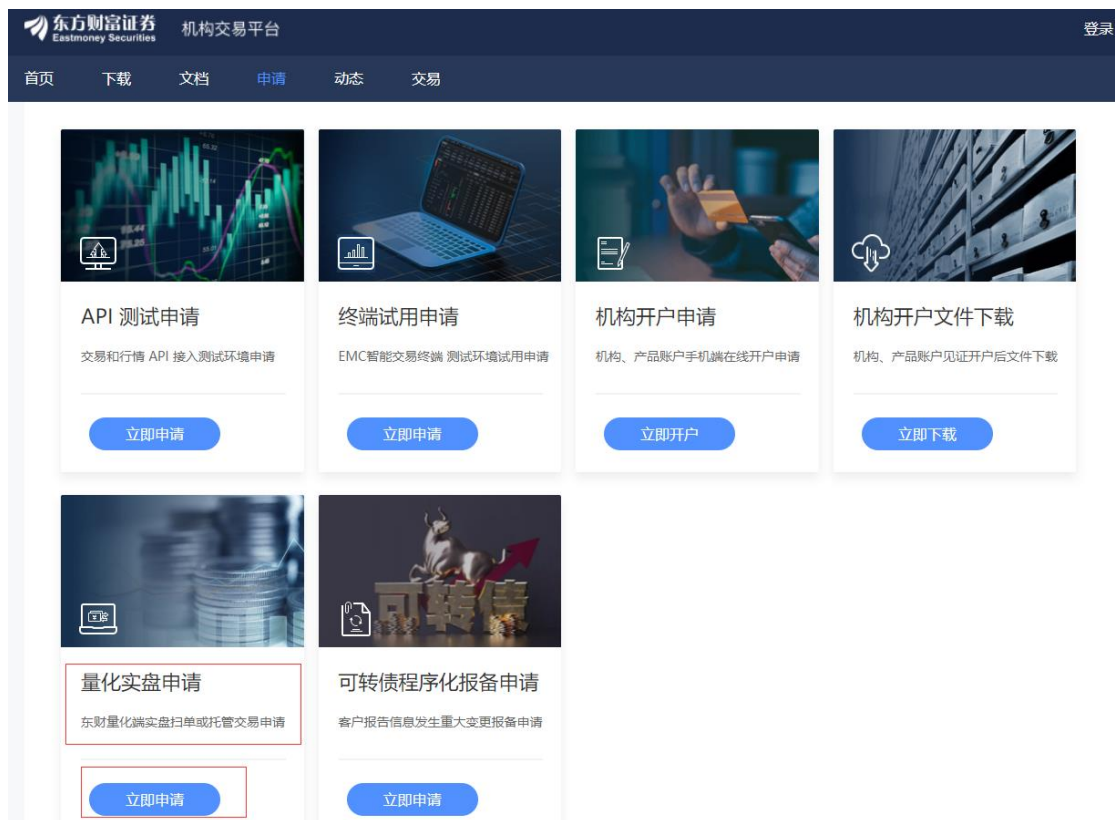
## 实盘申请

通过策略仿真已经熟悉量东财量化业相关技术, 要开通实盘请按照如下流程来办理开通

实盘业务：

1、在 <https://emt.18.cn/> 申请，选择量化实盘申请，请据实填写实盘申请

信息。同时需要沟通东财量化业务人员办理量化实盘开通流程（东财量化 QQ 群联系东方财富证券技术支持，其他通过相关业务渠道联系量化业务人员）。



2、等待客服回访核验密码确认身份，确认东财量化业务相关注意事项以及开通资质。

3、回访通过后内部走开通实盘开通流程配置预计需 3 个工作日办理好。

开通量化实盘确认事项：资金账号、姓名、手机号、开扫单还是托管

注：普通账户不能做融资融券交易，要开通融资融券量化需要用融资融券资金账号来开通量化，同时融券业务需要咨询相关业务人员单独获取权限。

4、收到东财量化业务人员通知的账户、初始密码和下载实盘终端链接，下载、安装、登录实盘终端，开始实盘量化交易。

办理要求：

- 1、当日无交易、T-3 至今无打新、交易日 12 点前办理，T+1 日开通；交易日 12 点后办理，T+2 日开通
- 2、无在途交易，如有需等待交易完成后再办理
- 3、当日不要做夜市委托

注意事项:

- 1、办理实盘开通业务期间不要有任何交易、该期间操作的证券可能会在开通实盘后无法正常进行后续操作
- 2、办理成功后暂时无法在交易终端和手机 APP 上交易，可以查看资金资产(都被冻结)和昨日以前的历史交易