

结算说明

目录

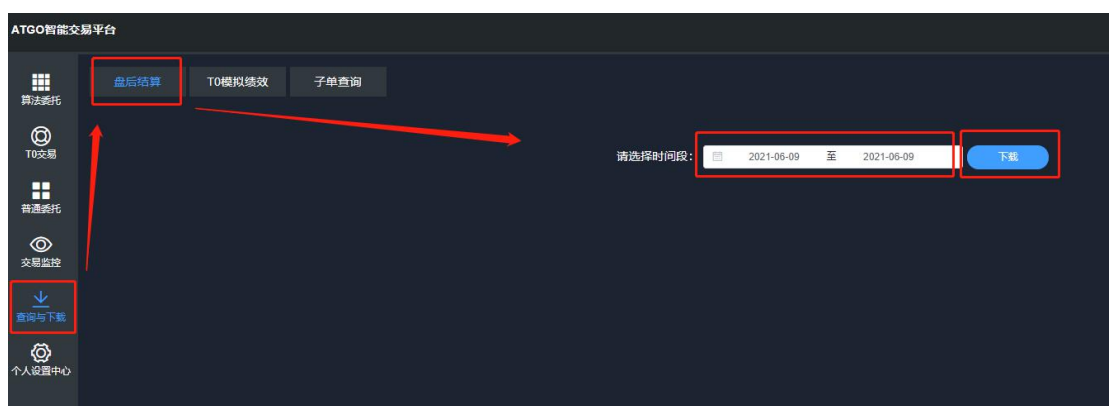
1 相关介绍.....	1
2 结算下载位置及表格附件.....	1
3 表格释义.....	1
3.1 ALGOACTUAL.CSV.....	1
3.2 ALGONOMINAL.CSV.....	2
3.3 ALGOSUMMARY.CSV.....	5
3.4 T0OVERNIGHT.CSV.....	6
3.5 T0SUMMARY.CSV.....	6

1 相关介绍

结算是指在卡方 ATGO 系统交易的子单明细、母单汇总、和账户汇总的信息。注意：区别于券商系统的清算对账工作，此记录只计算在卡方系统的交易明细及绩效情况。

下载结算时间：当天的结算在 4 点下载；以前的结算记录在收盘后可以下载

2 结算下载位置及表格附件



名称	压缩前	压缩后	类型	修改日期
.. (上级目录)			文件夹	
algoActual.csv	34.3 MB	5.6 MB	Microsoft Excel ...	2021-06-10 18:17
algoNominal.csv	8.5 MB	1.7 MB	Microsoft Excel ...	2021-06-10 18:17
algoSummary.csv	14.2 KB	5.7 KB	Microsoft Excel ...	2021-06-10 18:17
algoSummaryBasketId.csv	38.3 KB	14.1 KB	Microsoft Excel ...	2021-06-10 18:17
algoSummaryBuyAndSell.csv	6.6 KB	2.7 KB	Microsoft Excel ...	2021-06-10 18:17
algoSummaryFutureTotal.csv	1 KB	1 KB	Microsoft Excel ...	2021-06-10 18:17
t0Overnight.csv	1 KB	1 KB	Microsoft Excel ...	2021-06-10 18:17
t0Summary.csv	1 KB	1 KB	Microsoft Excel ...	2021-06-10 18:17

3 表格释义

这里重点讲解基本的表格释义和 T0 表格释义

3.1 algoActual.csv

代表各账户当日所有的子单委托成交记录

Date	ClientName	Side	Symbol	QuoteID	OrderID	TransactTime	OrderQty	OrdType	Price	AvgPx	CumQty	LeavesQty	OrdStatus	Fee	FilledValue	OtherFee	AlgoNote
2021/6/9		1B	600000 SH	0	2080073332000000	1869	91532630	100	Limit	9.29	0	0	0	Canceled	0	0	1
2021/6/9		1B	600000 SH	0	2080073332000001	5000000	91532656	100	Limit	9.29	0	0	0	Canceled	0	0	1
2021/6/9		1B	600000 SH	0	2080073332000002	-1	91532688	100	Limit	9.29	0	0	0	Rejected	0	0	1
2021/6/9		1B	600000 SH	0	2080073332000003	0.90 1.386	91532721	100	Limit	9.29	0	0	0	Canceled	0	0	1
2021/6/9		1B	600000 SH	0	2080073332000004	0.1038 1.1104	91532735	100	Limit	9.29	0	0	0	Canceled	0	0	1
2021/6/9		1B	600000 SH	0	2080073332000005	C.831 1.7	91532753	100	Limit	9.29	0	0	0	Canceled	0	0	1
2021/6/9		1S	300324 SZ	2080073383 50507975342000001170	1703 2.683	93000620	100	Limit	3.6	0	0	0	0	Canceled	0	0	1
2021/6/9		1S	300324 SZ	2080073384 50507975342000001180	1703 2.688	93000621	100	Limit	3.6	0	0	0	0	Canceled	0	0	1
2021/6/9		1S	300324 SZ	2080073385 5050797534200000119	312646434	93000621	100	Limit	3.6	3.6	100	0	Filed	0	360	0.391932	1
2021/6/9		1S	300324 SZ	2080073410 5050797534200000120	34200017	93000621	100	Limit	3.6	0	0	0	0	Canceled	0	0	1
2021/6/9		1S	300324 SZ	2080073412 5050797534200000121	2661	93000621	100	Limit	3.6	0	0	0	0	Canceled	0	0	1

Date: 交易日期

ClientName: 账户别名

Side: 买卖方向—B 为买, S 为卖, CB 为买券还券, SS 为融券卖出

Symbol: 股票代码

QuoteID: 该子单对应的母单编号

ClOrdID: 子单编号

OrderID: 该子单真实的柜台编号

TransactTime: 交易时间

OrderQty: 委托数量

OrdType: 委托类型, 统一为限价

Price: 报单价格

AvgPx: 成交均价, 该均价为委托总子单的情况, 我们页面上不展示逐笔成交明细

CumQty: 成交数量

LeavesQty: 仍可撮合量

OrdStatus: 子单状态, 常见 Canceled、Filled、Rejected

Fee: 佣金费用

FilledValue: 完成量, $CumQty * AvgPx$

OtherFee: 其他费用

AlgoNote: 该笔子单所属是算法子单还是 T0 子单, 算法单 1, T0 单子

2

BasketID: 委托单的参数, 不设置 basketid 则为空

3.2 algoNominal.csv

代表各账户当日委托所有母单的成交情况

Date	ClientName	Side	Symbol	OrdType	TaskQty	ClOrdID	StartTime	EndTime	CancelFlag	OrderCount	CancelledCount	FilledQty	AvgPx	Status	TWAP	VWAP	BasketID	Fee	OtherFee	CumVoiPercentage(%)	Pri
2021/6/9	1.S	110055	SH	TWAP.Plus	1150	20800733404000000	93000000	93500000	2	15	2	1150	189.6904	0	189.6577	190.2478	3983093022	0	-2.18144	2.2965	null
2021/6/9	1.S	110066	SH	TWAP.Plus	250	20800733404000001	93000000	93500000	2	13	3	250	165.827	0	165.9358	165.916	3983093022	0	-0.41457	2.3351	null
2021/6/9	1.S	110074	SH	TWAP.Plus	270	20800733404000002	93000000	93500000	2	12	3	270	149.2633	0	150.61	150.9906	3983093022	0	-0.40307	3.7469	null
2021/6/9	1.S	113012	SH	TWAP.Plus	40	20800733404000003	93000000	93500000	2	5	2	40	119.605	0	120.3115	120.1734	3983093022	0	-0.04784	0.9588	null
2021/6/9	1.S	113047	SH	TWAP.Plus	30	20800733404000004	93000000	93500000	2	1	0	30	149	0	149.4387	149.3866	3983093022	0	-0.0447	4.0708	null
2021/6/9	1.S	113502	SH	TWAP.Plus	190	20800733404000005	93000000	93500000	2	16	6	190	119.2742	0	119.3597	119.6634	3983093022	0	-0.22662	1.2394	null
2021/6/9	1.S	113526	SH	TWAP.Plus	80	20800733404000006	93000000	93500000	2	4	0	80	303.9538	0	303.3265	304.5986	3983093022	0	-0.24316	0.4558	null
2021/6/9	1.S	113527	SH	TWAP.Plus	360	20800733404000007	93000000	93500000	2	19	1	360	212.7342	0	212.4667	212.4841	3983093022	0	-0.76584	1.8735	null
2021/6/9	1.S	113534	SH	TWAP.Plus	1120	20800733404000008	93000000	93500000	2	24	0	1120	125.9883	0	127.0065	126.9972	3983093022	0	-1.41107	8.7598	null
2021/6/9	1.S	113537	SH	TWAP.Plus	820	20800733404000009	93000000	93500000	2	27	2	820	172.2912	0	172.4211	172.4345	3983093022	0	-1.41279	6.2098	null
2021/6/9	1.S	113543	SH	TWAP.Plus	20	20800733404000010	93000000	93500000	2	1	0	20	221	0	221.7611	222.2082	3983093022	0	-0.0442	0.5348	null

Date: 交易日期

ClientName: 账户别名

Side: 买卖方向—B 为买, S 为卖, CB 为买券还券, SS 为融券卖出, SB 为融资买入, CB 为买券还券, 0 为 T0

Symbol: 股票代码

OrdType: 算法类型

TaskQty: 委托数量

ClOrdID: 母单编号, 和子单唯一对应的关系

StartTime: 委托交易开始时间

EndTime: 委托交易结束时间

CancelFlag: 母单状态,

0: 已报

1: 部成

2: 已成

4: 已撤

6: 待撤

8: 拒绝

10: 未报

-1: 无效

OrderCount: 该母单的子单委托数量

CancelledCount: 该母单的子单撤单数量

FilledQty: 成交数量

AvgPx: 成交均价, 该均价为子单成交均价的加权平均

Status: 母单最后半小时里股票的状态, 若在母单生效时间的最后半小时出现涨停/跌停, 则记为 1/-1, 若最后半小时一直涨停/跌停, 则记为 10/-10, 停牌记为 3

TWAP: 市场上同一时间段内的 TWAP

VWAP: 市场上同一时间段内的 VWAP

一、基准 VWAP & TWAP 计算方式

1、使用数据：交易所发布的 level 1 快照数据

2、VWAP、TWAP 计算公式：

$$\text{指定时间段的 VWAP} = \frac{\text{指定时间段的成交金额}}{\text{指定时间段的成交股数}}$$

status：在该时刻涨停则记为 1，跌停记为-1，停牌记为 3，正常记为 0

虚拟成交量、虚拟成交金额：若本次 tick 的 status!=0，则本次 tick 到上次 tick 之间虚拟成交量记为 0，若本次 tick 的 status==0，则本次 tick 与上次 tick 之间虚拟成交量记为两次 tick 之间的时间差（以秒为单位），且成交价记为本次 tick 的(bestAsk+bestBid)/2

$$\text{指定时间段的 TWAP} = \frac{\text{指定时间段的虚拟成交金额}}{\text{指定时间段的虚拟成交量}}$$

虚拟成交额=(ask1+bid1)/2 * 虚拟成交量

Time	Ask1	Bid1	(Ask1+Bid1)/2
9:30:00	10.1	9.9	10
9:30:03	10.0	9.9	9.95
9:30:06	10.1	10.0	10.05
9:30:09	10.2	10.1	10.15

假设每个 tick 的虚拟成交量为 3 的话：

$$\text{twap} = (10*0+9.95*3+10.05*3+10.15*3) / (0+3+3+3) = 10.05$$

注意：

- 1.交易活跃是按照 3 秒来计算的；
- 2.交易不活跃，有可能是 6 秒或者 9 秒；

另外，母单指定的交易时间在 3 秒的 tick 以内，比如：指定的时间接近第 3 秒，就以接近的第一个 tick 来计算

BasketID：委托单的参数，不设置 basketid 则为空

Fee：该母单的佣金总和

OtherFee：该母单的其他费用总和

CumVolPercentage(%)：母单量和该时间段内市场量的占比

Pnl：只在 T0 交易时候生效，代表该母单不计算费用下的盈利金额

CumQtyBuy：T0 交易买入方向已成数量

CumQtySell: T0 交易卖出方向已成数量

AvgPxBuy: T0 交易买入已成的均价

AvgPxSell: T0 交易卖出已成的均价

EodPrice: T0 交易委托母单的当天收盘价

3.3 algoSummary.csv

代表按账户和买卖方向分别汇总的交易数据和绩效

Date	ClientName	Side	TaskAmt	FilledAmt	PnL2TWAP(BPS)	PnL2VWAP(BPS)	PnL2Benchmark(BPS)	PnL2TWAP(YUAN)	PnL2VWAP(YUAN)	PnL2Benchmark(YUAN)	Fee	OtherFee
2021/6/9		1B	2.25E+07	2.24E+07	3.412720447	4.599989529	3.412720447	7636.06764	10292.61672	7636.06764	0	-1984.689555
2021/6/9		1S	2.20E+07	2.20E+07	1.72223582	-3.66491638	1.72223582	3780.338723	-8044.557631	3780.338723	0	-23897.15794
2021/6/9		1B	4551960.68	4549952.68	7.134630525	8.41470158	7.134630525	3243.369275	3825.28352	3243.369275	0	-403.226125
2021/6/9		1S	4431000.35	4431000.35	-0.053849367	-5.007266754	-0.053849367	-23.86065651	-2218.720074	-23.86065651	0	-4824.030352
2021/6/9		1B	3931595.51	3929062.81	7.474690121	8.428109148	7.474690121	2936.852697	3311.457021	2936.852697	0	-348.508025
2021/6/9		1S	4195831.368	4195831.368	1.629161609	2.099852871	1.629161609	683.5687382	881.0628544	683.5687382	0	-4568.000873

Date: 日期

ClientName: 账户别名

Side: 买卖方向—B 为买, S 为卖, CB 为买券还券, SS 为融券卖出, SB 为融资买入, CB 为买券还券

TaskAmt: 计划成交金额, 为 $\Sigma (\text{AvgPx} * \text{TaskQty})$, 注意: 如没有 AvgPx, 则使用 Twap 价格

FilledAmt: 实际成交金额, 为 $\Sigma (\text{AvgPx} * \text{FilledQty})$

PnL2TWAP(BPS): 根据 TWAP 计算的收益, 单位 BPS

$\text{PnL2TWAP(BPS)} = \text{PnL2TWAP(YUAN)} * 10000 / \text{filledAmt}$

PnL2VWAP(BPS): 根据 VWAP 计算的收益, 单位 BPS, 计算方式同上

PnL2Benchmark(BPS): 根据合同基准计算的收益, 单位 BPS, 该字段表示为上传的算法单类型的对比收益

PnL2TWAP(YUAN): 根据 TWAP 计算的收益, 单位元

$\text{PnL2TWAP(YUAN)} =$

$\Sigma (\text{买: } (\text{twap} - \text{avgPx}) * \text{filledQty}, \text{卖: } (\text{avgPx} - \text{twap}) * \text{filledQty})$

PnL2VWAP(YUAN): 根据 VWAP 计算的收益, 单位元, 计算方式同上

PnL2Benchmark(YUAN): 根据合同基准计算的收益, 单位元, 该字段表示为上传的算法单类型的对比收益

Fee: 该账户总的佣金费用总和

OtherFee: 该账户总的其他费用总和

注：如果需要计算账户的双边汇总，需要用完成量加权平均来计算

3.4 t0Overnight.csv

代表 T0 隔夜仓表

Date	ClientName	Symbol	EodQty	EodPrice	EodValue	

Date: 日期

ClientName: 账户名

Symbol: 证券代码

EodQty: 未平仓股数（区分正负号）

EodPrice: 当天收盘价

EodValue: 未平仓收盘市值（区分正负号）

注：+ 当日多买，隔夜需卖出 / - 当日多卖，隔夜需买入

3.5 t0Summary.csv

代表按账户和买卖方向汇总的交易数据

Date	ClientName	TaskAmt	FilledAmt	CancelRate	PnlToday	PnlClearYesterday	PnlAggregate
2021/6/9	1	4253111	91062	0.2	224.384	0	224.384
2021/6/9	1	1299904	15856	0.333333	70.42685	0	70.42685

Date: 日期

ClientName: 账户别名

TaskAmt: 计划成交金额，计算公式：OrderQty*TodayPx

FilledAmt: 实际成交金额，计算公式：FilledQty* TodayPx

TotalFilledAmt: T0 交易买卖双边实际成交金额汇总

CancelRate: 撤单率

PnlToday: 当日收益,计算公式：pnl+fee+otherfee

PnlClearYesterday: 隔夜仓收益盈亏

*注：前一日未平仓股数按照当天收盘价做一次虚拟结算，隔夜再以开盘价做平仓操

作，取两次结算的差值作为隔夜仓收益盈亏

PnlAggregate: 当日最终收益，计算公式： $\text{PnlToday} + \text{PnlClearYesterday}$