

# **迅投 QMT 日内回转策略 使用手册**

北京睿智融科控股股份有限公司

二〇二〇年三月



## 文档信息

客户名称	北京睿智融科控股股份有限公司
标题	迅投 QMT 日内回转策略使用手册
类别	使用手册
摘要	日内回转策略使用手册
当前版本	V4.0
日期	2020.03.20
作者	北京睿智融科控股股份有限公司

# 目 录

1. 使用申请流程 .....	1
2. 使用教程 .....	1
2.1. 创建前准备 .....	1
3. 策略交易 .....	2
3.1. 新建策略交易 .....	2
3.2. 启动策略 .....	3
3.3. 策略监控 .....	3
3.3.1. 策略总控 .....	3
3.3.2. 图形化交易监控 .....	3
4. 常见问题 .....	5
4.1. 券商反馈没有 c++ 策略白名单设置项 .....	5
4.2. 在模型交易界面没有对应的日内回转策略 .....	5
4.3. 提示“启动策略失败，增强交易同时运行文件数量已达上限！” .....	5
4.4. 客户端提示“函数交易无下单权限” .....	6
4.5. 策略启动时间 .....	6
4.6. 客户端白名单传输的时间限制 .....	6
4.7. 信用账号交易模式 .....	6
4.8. 客户根据自己的风控水平，设置策略止损位 .....	7
4.9. 达到配平时间，仓位没有复原 .....	7
4.10. 当天未配平股票怎么处理 .....	8

---

4.10.1. 收益计算方式 .....	8
4.10.2. 跨日累加配平 .....	9
4.11. 交易成本过高 .....	9
4.12. 很早启动了客户端，但是每天 8:50 客户端就重启，导致策略关闭 .....	10
4.13. 阿里云服务器安全规则设置 .....	10
4.14. 出现收盘之后还在继续下单的问题 .....	11
4.14.1. 阿里云的机器 .....	11
4.14.2. 非阿里云机器 .....	12

# 1. 使用申请流程

联系您的客户经理，申请**迅投 QMT** 使用权限

获取日内回转策略文件 (\*.dll 和 \*.ini)

向券商提供\*.dll 对应 **MD5 值**和**名称**，申请 **C++策略**和**函数交易下单**使用权限

## 2. 使用教程

### 2.1. 创建前准备

将\*.dll 文件放入 QMT 客户端安装目录【customerDLL】文件夹中；

本地磁盘 (D:) > qmt测试1022 > customerDLL >			
名称	修改日期	类型	大小
XtTradeFramework	2019/10/23 9:06	文件夹	
XtTradeFramework.dll	2019/8/21 17:28	应用程序扩展	1,983 KB

将\*.ini 文件放入 QMT 客户端安装目录【config】文件夹中；


本地磁盘 (C:) > qmt > config >			
名称	修改日期	类型	大小
managerInfoConfig.lua	2019/10/30 9:01	LUA 文件	1 KB
indexUserConfig.xml	2019/10/29 18:36	XML 文档	52 KB
xtframeworkservice.ini	2019/10/21 17:47	配置设置	1 KB
calcConfigEnv.lua	2019/9/7 10:13	LUA 文件	10 KB
clientEnv.lua	2019/9/7 10:13	LUA 文件	2 KB

向迅投提供以下信息，用于接收增强交易行情授权

序号	提供信息	备注
1	迅投 QMT 登陆 <b>用户名</b>	
2	需要使用日内回转策略的 <b>资金账号</b>	需注明账号类型（普通/信用）

## 3. 策略交易

### 3.1. 新建策略交易

登陆 QMT，点击进入【模型交易】界面，点击左侧策略图标 ，在弹出对话框中对相关信息进行完善后，点击<确定>，即可**新建策略交易**。

策略类型

XtTradeFramework

资金账号

8000000999

主图代码

000300 沪深300

运行周期

分笔线

☐ 终端启动后自动运行
 ☐ 交易日切换后停止策略运行

☐ 限制日内最大净买入 0 元
 ☐ 禁止使用白名单

策略股票清单

账号持仓

白名单

全选

反选

	股票代码	股票名称	持仓量	可用量	策略可用量
	600012	皖通高速	400	400	400
	600020	中原高速	1300	1300	1300
3	600026	中远海能	100	100	100
4	600039	四川路桥	200	200	200
5	600054	黄山旅游	300	300	300
6	600055	万东医疗	300	300	300
7	600056	中国医药	100	100	100
8	600057	厦门象屿	1300	1300	1300
9	600059	古越龙山	500	500	500
10	600062	华润双鹤	200	200	200

☐ 启用策略亏损停止
 ☐ 启用策略自动配平

确定


取消



<b>策略类型：</b> 选择对应*.dll 名称	<b>资金账号：</b> 选择需进行交易的资金账号
<b>主图代码：</b> 使用默认代码“000300”即可	<b>运行周期：</b> 分笔线
<b>终端启动后自动运行：</b> 是否自动使用上一次配置自动启动策略	
<b>交易日切换后停止策略运行：</b> 终端不关闭情况下，策略跨日是否停止	
<b>限制日内最大净买入：</b> 限制当日最大净买入金额	
<b>策略股票清单（账号持仓/白名单）：</b> 导入需要使用日内回转策略的股票清单	

**启用策略亏损停止：**启动后输入最大亏损金额，达到阈值系统会自动停止策略

**启用策略自动配平：**启动后输入配平时间点，达到阈值后系统自动停止策略，进行轧差配平

## 3.2. 启动策略

在新建策略交易对应【操作】栏  将策略状态切换为“运行中” ，策略即启动成功。

	策略名称	主图标的	策略周期	资金账号	操作	运行模式	设置	策略状态	亏损停止	自动配平	开始时间	结束时间
1	XtTradeFramework	沪深300(000300)	分笔线	8000000129				运行中 		14:45:00	12:07:01	

## 3.3. 策略监控

### 3.3.1. 策略总控

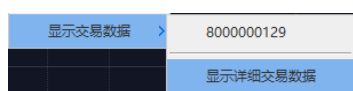
客户可在策略启动之后，在下方的【策略统计】窗口对运行中的策略进行状态监控

持仓		委托	成交	策略信号		策略日志		策略统计											
<input checked="" type="radio"/> 当日数据		<input type="radio"/> 历史数据																	
	资金账号	账号名称	账号类型	经纪公司	策略名称	运行状态	运行中任务	运行中委托	总买量	总卖量	净买量	总买额	总卖额	净买额	手续费	盈亏	配平	操作	
1			期货				0	0	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00		
2			股票				1	9	228700	344348	-115648	2053219.00	2901783.90	-848564.90	4388.28	2747.85	2399128.79	配平	
3			期货		ITTradeFramework		0	0	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00		
4			股票		ITTradeFramework	运行中	1	6	151300	279764	-127464	1470834.00	2308251.46	-837417.46	3437.76	2847.90	1213403.83	配平	

### 3.3.2. 图形化交易监控

当日策略运行进程，客户可以通过图形化的展示更为直观的进行策略监控。

客户在主图上鼠标右键选择 【显示交易数据 -> 显示详细交易数据】

 即可显示相应设置框。根据勾选不同的选项，在主图上为客户展示相应的数据。

交易详情 [分时]

导入委托

导入成交

资金账号

☒ 8000000129
 

CS

交易数据

☐ 委托
 ☒ 成交
 ☐ 任务

☐ 买卖额
☐ 净买额
☒ 盈亏
☒ 配平

☐ 全部查看
☒ 按策略查看

交易策略

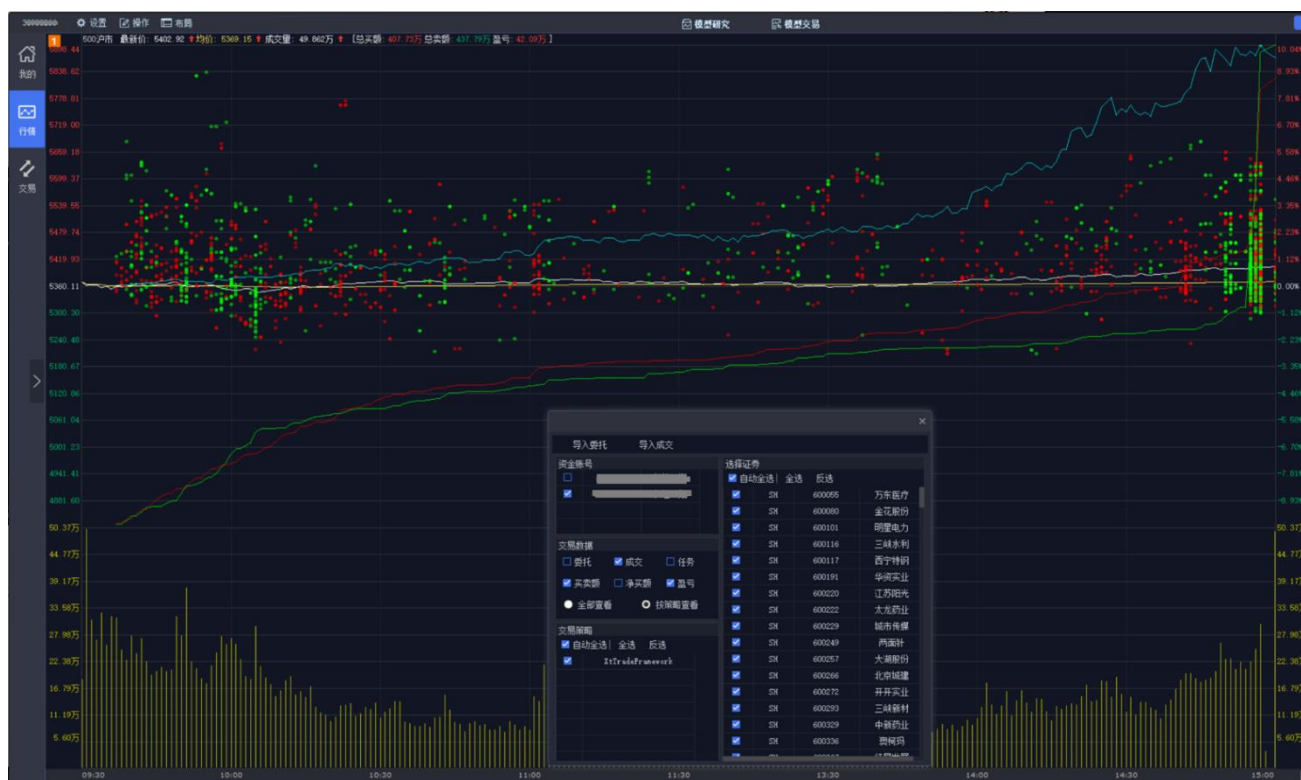
☐ 自动全选
☒ 全选
☐ 反选

☒ XTradeFramework

选择证券

☒ 自动全选
☒ 全选
☐ 反选

<input checked="" type="checkbox"/>	SH	600207	安彩高科
<input checked="" type="checkbox"/>	SH	600812	华北制药
<input checked="" type="checkbox"/>	SH	603013	亚普股份
<input checked="" type="checkbox"/>	SH	603693	江苏新能
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	300510	金冠股份
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000498	山东路桥
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000923	河北宣工
<input checked="" type="checkbox"/>	SH	600055	万东医疗
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000925	众合科技
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	300628	亿联网络
<input checked="" type="checkbox"/>	SH	600702	舍得酒业
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000901	航天科技
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	002258	利尔化学
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	002396	星网锐捷
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	002557	洽洽食品
<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	002769	普路通



除了针对策略进行进程监控以外，客户还可运用 QMT 多屏、多窗口的组合对于当日交易个股进行更为清晰的跟踪。





## 4. 常见问题

### 4.1. 券商反馈没有 c++ 策略白名单设置项

需券商与迅投运维人员联系，获取【C++策略】授权；

### 4.2. 在模型交易界面没有对应的日内回转策略

排查是否已经向券商申请该 DLL 的 C++ 策略权限；

确保券商授权 DLL 名称和 MD5 值和本地文件一致；

对应 DLL 文件和 ini 文件是否已经放置于客户端对应目录中；

### 4.3. 提示“启动策略失败，增强交易同时运行文件数量已达上限！”

现有【C++策略】授权数量达到上限，需券商与迅投运维人员联系，调整【C++策略】授权数量；

## 4.4. 客户端提示 “函数交易无下单权限”

保证登陆用户已在管理端开通 **“允许使用函数交易下单”**【**用户管理—>选择对应用户 设置—>功能权限—> “允许使用函数交易下单”**】。开通之后，需重启客户端。

## 4.5. 策略启动时间

系统接受客户在交易日 15:00 以前任意时间启动策略。

为保护客户利益，保证算法正常运行，建议在**资金账号能正常登陆之后，每日 8:00~9:25**启动策略。

## 4.6. 客户端白名单传输的时间限制

客户端只接收交易日当天进行白名单上传。请参照以下时间段进行白名单上传：

序号	时间段	系统操作
1	8:00~9:25	允许客户在此时间段内多次更新本地白名单，系统将以最后一次上传白名单为依据，进行增强行情订阅
2	9:25 以后	允许客户在此时间段启动策略，系统将以第一次启动时上传的白名单为依据，进行增强行情订阅

## 4.7. 信用账号交易模式

现阶段，智能日内回转策略对于信用账号，只做担保品交易，即普通买入、普通卖出。后续有新的变化将做补充说明。

**如果对于现有融资买入的底仓进行回转交易，是否能通过普通卖出进行交易，需要询问券商 IT 人员。**

## 4.8. 客户根据自己的风控水平，设置策略止损位

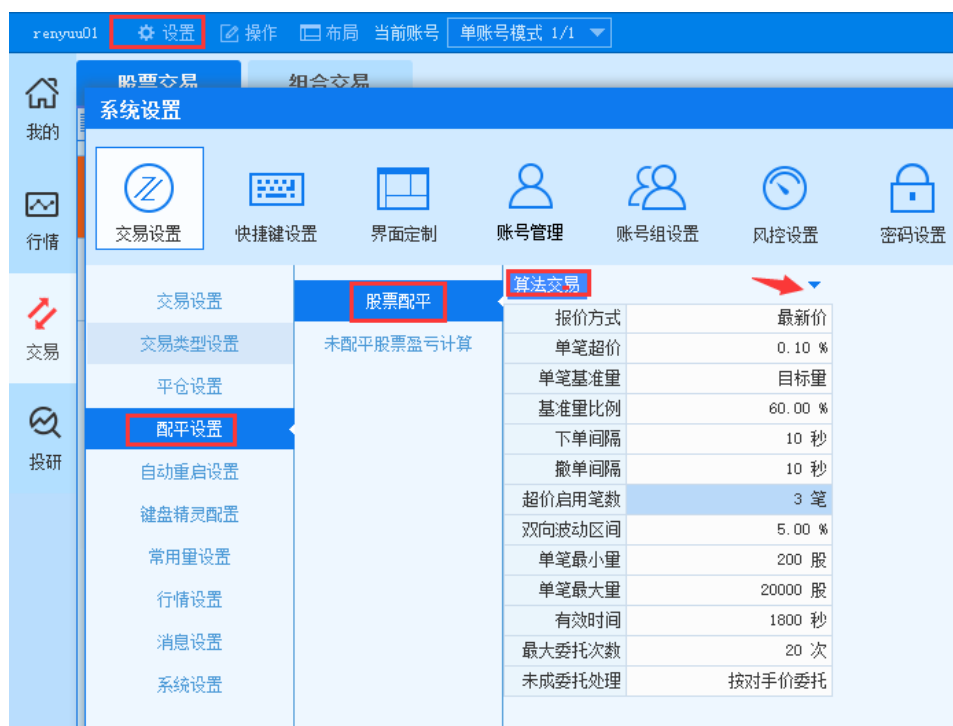
为保护客户利益，满足不同类型客户对于风控止损的不同需要，客户可在新建策略交易的同时，设置“策略亏损停止”线 ☒ 启用策略亏损停止 策略亏损限额  。

## 4.9. 达到配平时间，仓位没有复原

系统会实时计算账号或策略当日成交情况，扎差买卖未平股票。

点击【策略监控】中对应策略操作栏中“配平”，即可立刻停止策略交易并进行配平买卖下单。

**配平交易对应下单方式**，可以在【设置】-【交易设置】-【配平设置】中进行预设。



**为保证仓位有效复原，请务必选择【算法交易】进行配平下单！**

配平交易执行情况，会在<股票交易>--<任务列表>界面进行。

股票交易										期货交易										融资融券										组合交易										股票期权										沪港通										深港通										ETF申赎																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																
[ALT+F1] 下单面板										持仓[F6]										成交[F7]										委托[F8]										任务列表[F4]																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																														
买入	普通交易		算法交易		平安银行		13.414		000001		-0.34		-2.47%		全部任务		全部撤销		全部暂停		全部继续		请输入代码		Q																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																												</	

## 4.10. 当天未配平股票怎么处理

### 4.10.1. 收益计算方式

未配平零股直接按照当日收盘价进行策略收益结算；

因涨跌停造成的无法交易的股票，将根据客户在【配平设置】-【未配平股票盈亏计算】中设置的方式进行策略收益结算；

系统设置

交易设置

快捷键设置

界面定制

账号管理

账号组设置

风控设置

密码设置

交易设置

交易类型设置

平仓设置

配平设置

自动重启设置

键盘精灵配置

常用量设置

行情设置

消息设置

历史波动率设置

系统设置

股票配平

期货配平

融资融券配平

股票期权配平

沪港通配平

深港通配平

未配平股票盈亏计算

涨跌停股票加权系数

0.00 % [0-100]

涨跌停ST股票加权系数

0.00 % [0-100]

## 4.10.2. 跨日累加配平

收盘后存在未配平股票时，勾选【自动添加到历史配平】或手动点击【添加到历史配平】，系统会将未配平股票放入历史配平数据中，进行累加计算。客户可配置自动配平或手动择时配平。

持仓	委托	成交	策略信号	策略日志	策略统计		
<input checked="" type="radio"/> 当日数据 <input type="radio"/> 历史数据 <input type="radio"/> 历史配平		<input type="button" value="添加到历史配平"/>		<input checked="" type="checkbox"/> 自动添加到历史配平		15:30	配平设置
资金账号	账号名称	账号类型	经纪公司	策略名称	运行状态	运行中任务	
1	8000000888	peng	股票	睿智融科喜牛柜台		0	
2	8000000888	peng	股票	睿智融科喜牛柜台	XtTradeFramework	0	
3	8000000999	xiaopeng	股票	睿智融科喜牛柜台		0	
4	8000000999	xiaopeng	股票	睿智融科喜牛柜台	XtTradeFramework	运行中	

持仓	委托	成交	策略信号	策略日志	策略统计				
<input type="radio"/> 当日数据		<input type="radio"/> 历史数据		<input checked="" type="radio"/> 历史配平		<input type="button" value="删除所有数据"/>		<input type="button" value="删除已配平数据"/>	
	资金账号	账号名称	账号类型	经纪公司	策略名称	配平	自动配平时间	操作	
1	8000000999	xiaopeng	股票	睿智融科喜牛柜台	XtTradeFramework	55327.00	09:30	<input type="button" value="配平"/>	

策略配平 [8000000999] [XtTradeFramework]							
全选 反选							
	选择	市场	证券代码	证券名称	配平操作	配平量	操作
1	<input checked="" type="checkbox"/>	SH	601717	郑煤机	买入	100	<input type="button" value="删除"/>
2	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000006	深振业A	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
3	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000009	中国宝安	卖出	200	<input type="button" value="删除"/>
4	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000012	南玻A	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
5	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000066	中国长城	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
6	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000537	广宇发展	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
7	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000541	佛山照明	卖出	200	<input type="button" value="删除"/>
8	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000559	万向钱潮	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
9	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000581	威孚高科	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
10	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000600	建投能源	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
11	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000623	吉林敖东	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
12	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000686	东北证券	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>
13	<input checked="" type="checkbox"/>	SZ	000690	宝新能源	卖出	100	<input type="button" value="删除"/>

配平参数设置

☒ 自动配平

09:30

全部撤销

下单

取消

## 4.11. 交易成本过高

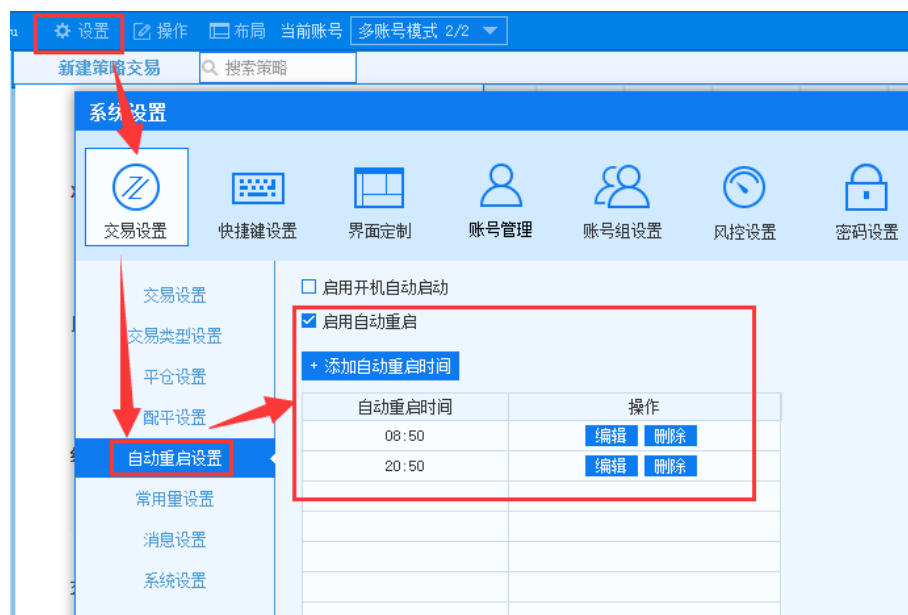
因为是日内回转交易，且分单比较细，为避免交易佣金影响收益，请客户务必确认取消每笔5元的最小佣金限制。

## 4.12. 很早启动了客户端，但是每天 8:50 客户端就重启，导致策略关闭

客户端默认会有一个自动重启，若不希望系统自动重启或自定义重启时间，请前往【设置】

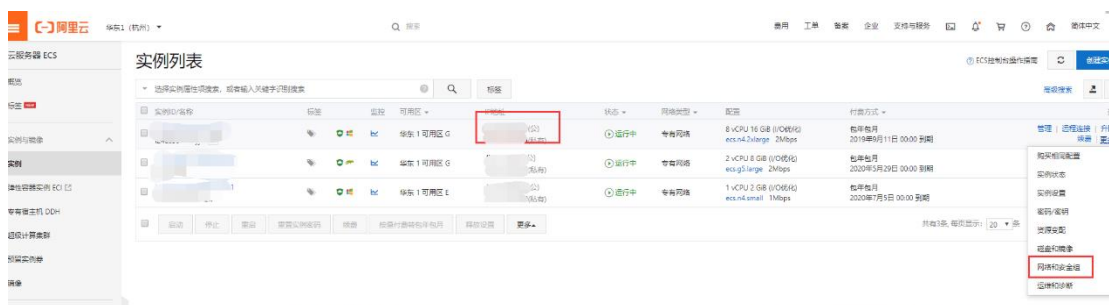
- 【交易设置】- 【自动重启设置】进行设置：

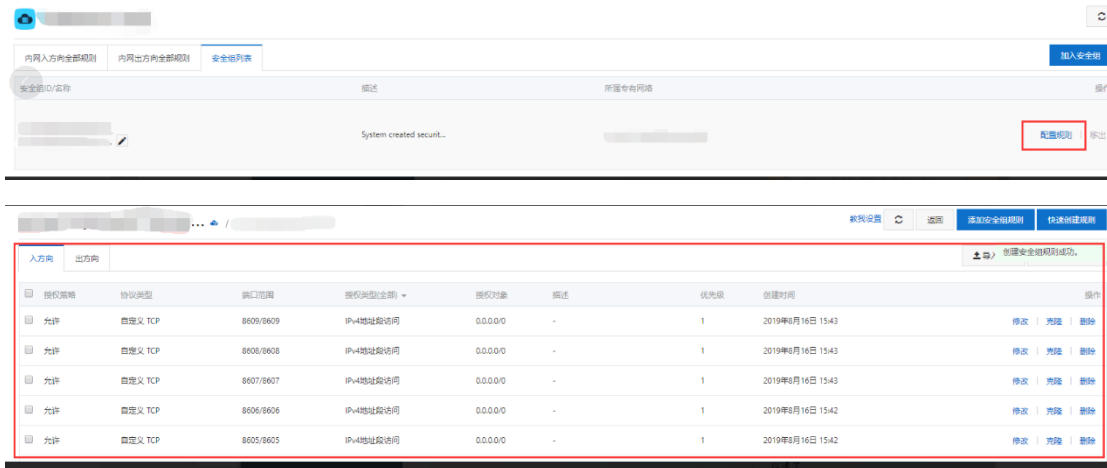
同时，为了避免电脑操作系统由于长时间不操作，导致电脑断网，影响策略交易，请务必取消掉电脑的超时休眠功能。



## 4.13. 阿里云服务器安全规则设置

选择进入阿里云管理后台，选择【实例列表】，选择运行 QMT 客户端的服务器，选择【网络和安全组】如下图，创建下图安全规则：





## 4.14. 出现收盘之后还在继续下单的问题

比较大的可能是机器性能问题，导致严重的执行滞后。

### 4.14.1. 阿里云的机器

观察是否是 Antimalware Service Executable 占用过多的 CPU 资源。如果是，需要注意关掉系统的以下服务：

- (1) win 键+R 键打开运行对话框，输入 gpedit.msc 打开本地组策略编辑器（组策略）；
- (2) 依次打开计算机配置-管理模板-Windows 组件-Windows Defender；
- (3) 如果要关闭 Windows defender，则将“关闭 Windows Defender”项设置为“已启用”即可。
- (4) 如果要保留 Windows defender，只解决 CPU 占用和内存占用高的问题，则继续下列步骤；
- (5) 打开“实时保护”，将里面的“不论何时启动实时保护，都会启动进程扫描”这一配置项设置为“已禁用”（此步骤最关键）；
- (6) 打开“扫描”，将其中最高 CPU 占用设置为 5（含义是不得超过 5%的 CPU）





#### 4.14.2. 非阿里云机器

以 WIN10 为例，需要执行以下部署

- (1) win 键+R 键打开运行对话框，输入 gpedit.msc 打开本地组策略编辑器（组策略）；
- (2) 依次打开计算机配置-管理模板-Windows 组件-Windows Defender；
- (3) 如果要关闭 Windows defender，则将“关闭 Windows Defender”项设置为“已启用”

即可。

(4) 如果要保留 Windows defender，只解决 CPU 占用和内存占用高的问题，则继续下列步骤；

(5) 打开“实时保护”，将里面的“不论何时启动实时保护，都会启动进程扫描”这一配置项设置为“已禁用”（此步骤最关键）；