

---

# 国金 QMT 极速策略交易 系统普通算法交易 使用手册

国金证券股份有限公司

二〇二〇年一月

## 算法交易

**1、触价设置：**启用触价后，标的最新价达到触价设置价格时，算法任务开始执行。未达到触价设置价格时，任务维持等待状态。这是整个算法交易任务是否启动的第一个判断条件。

**2、下单间隔：**算法交易任务开始执行后，会按照下单间隔设置，定时报送委托。

**3、报价方式：**统称“基准价”

卖⑤价-卖①价，买①价-买⑤价：盘口对应的买卖委托价格；

涨跌停价：买入的时候用涨停价，卖出的时候用跌停价；

最新价：盘口最新的委托价格；

挂单价：买入的时候就是买①价，卖出的时候就是卖①价；

对手价：买入的时候就是卖①价，卖出的时候就是买①价；

昨收价：昨日的收盘价；

指定价：在基准价的位置手动填写委托价格；

**4、波动区间：**限制股票基准价的波动范围，当基准价超过波动区间下限（波动区间上限），以波动区间下限（波动区间上限）为基准价报送委托。

波动区间支持单向、双向两种模式，

单向即买入时仅限制上限，卖出时仅限制下限。

双向即买入、卖出均限制上下限。

**5、单笔超价：**单笔超价是以基准价为基础，对委托价格做调整。支持“元”、“%”两种模式。

正值加速成交，注重成交速度：买入时委托价格=基准价\*（1+x%），卖出时

委托价格=基准价\* (1-x%)

负值优化成交，注重节约成本：买入时委托价格=基准价\* (1-%)，卖出时委托价格=基准价\* (1+x%)

**6、超价启用笔数：**从第 N 笔开始，委托价格根据单笔超价调整。

**7、单笔基准量：**单笔委托数量以此为基准。

卖①+②...量，买①+②...量：对手盘口的委托量；

目标量：下单的交易总量；

目标剩余量：目标量-已报委托量=目标剩余量；

持仓数量：卖出时可将现有的持仓量作为单笔基准量；

**8、基准量比例：**基准量比例×单笔基准量=单笔委托数量。单笔委托数量小于单笔最小量，按单笔最小量报单；单笔委托数量大于单笔最大量，按单笔最大量报单。

**9、单笔最小量、单笔最大量：**组成单笔委托量范围，单笔委托数量必须在单笔范围内。低于单笔最小量，按单笔最小量委托。高于单笔最大量，按单笔最大量委托。当算法任务未报委托量小于单笔最小量，会按未报委托量报单。

**10、撤单间隔：**按撤单间隔，每隔 XX 秒，根据当前行情判断，撤单重报是否更有利于成交（买入报单后，价格上涨，原买入价格无法成交，需要以更高的价格重新报单才能成交。或卖出报单后，价格下跌，原卖出价格无法成交需要以更低的价格重新报单才能成交），当有利于成交时才会执行撤单，否则继续挂单。

**11、未成委托处理：**撤单的部分属于未成委托，如果未成委托选择不处理，撤回的部分按照下单参数继续委托报单；如果选择了未成委托的处理方式，撤回的部分按照未成委托处理所选的方式委托下单。

**12、有效时间：**按照算法任务的开始时间计算，超出有效时间，算法任务终止同时向柜台发起撤销委托。

**13、最大委托次数：**即算法任务最大可委托的次数，含未成委托再次报单。当委托次数达到最大委托次数后再次到达下单时点，算法任务终止同时向柜台发起撤销委托。

**14、投资备注：**用于填写该笔算法交易任务备注信息。

国金证券股份有限公司