

量化投资利器

Wind量化投资平台

数据就是未来

Data
Future

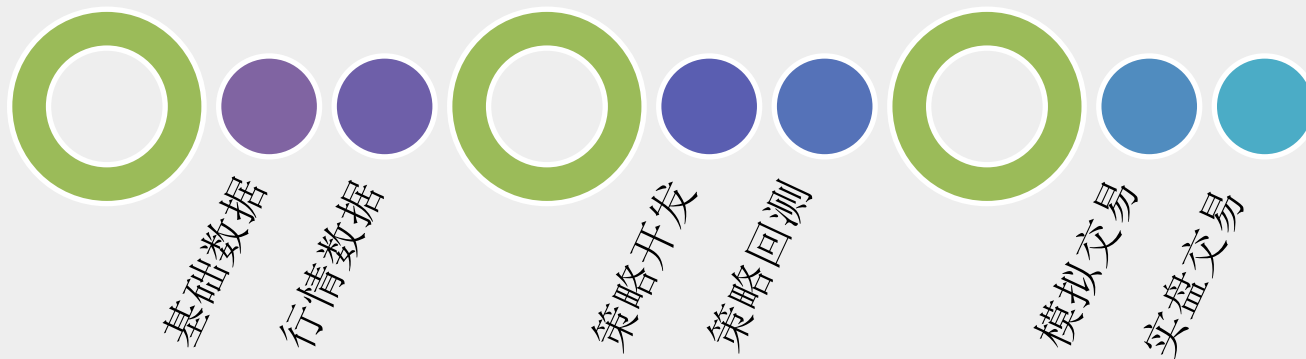
中国金融数据和解决方案的领导者

Leading Provider of Chinese Financial Data & Solutions

数据

策略

交易





目录

CONTENTS

Wind量化平台介绍

Wind量化平台使用案例

使用Wind平台进行量化投资

帮助获取方式

Wind量化投资平台结构





参考数据服务

沪深股票数据库
中国债券数据库
中国泛基金数据库



行情数据服务

实时行情数据
日线行情数据
分钟行情数据
高频数据
Level 2



目录

CONTENTS

量化投资简介

Wind量化平台介绍：如何使用

Wind量化平台使用案例

使用Wind平台进行量化投资

Wind量化平台使用方法

Wind资讯金融终端 2015 - [首页]

文件 股票 债券 商品 外汇 基金 指数 新闻 宏观 资管 量化 帮助

股票 Stock

债券 Bond

商品 Commodity

外汇 FX

基金 Fund

指数 Index

新闻 News

宏观 Macro & Industry

资管 Portfolio

量化

行情资讯

综合屏 板块报价 综合排名 新闻资讯 交易机会

全球市场概览	0	自选股监控	06
沪深股票综合屏	1	股转系统综合屏	NEEQ
香港股票综合屏	2	沪港通监控	SHSC
台湾股票综合屏	3	股指期货综合屏	6
国际股票综合屏	7	Wind灵活屏	WP

多维数据

深度资料	F9	行业中心	WI
数据浏览器	EDE	板块数据浏览器	SEE
财务纵比	FA	板块财务纵比	SFA
行情序列	HPS	板块行情序列	SES
条件选股	EQS		

专题统计

沪深股市 股转系统 区域股权 香港股市 台湾市场

Messenger 3C会议平台 万得市场 债券旗舰店 量化交易平台

群英会 Wind大学 校园招聘 职业导师 幸运交易日

Wind资讯

Wind资讯金融终端 2015 - [量化交易平台]

文件 股票 债券 商品 外汇 基金 指数 新闻 宏观 资管 量化 帮助

Wind QNT 量化交易平台 联系客服

康龙 欢迎您，您可以共享您的资源，发布您的需求了 2015-09-21 周一

开放接口(Open API)

接口介绍 使用手册 案例大全 互动问答 付费包申请

交流社区

iWind群 大奖章网站

Wind资讯开放应用接口

依附于Wind金融终端
在您和Wind数据中心之间搭建一座桥梁

为您提供7*24小时数据服务

Wind量化平台使用方法



有WFT终端即可使用
首次使用需点击量化菜单下修复



！ 需要有安装软件的电脑权限，如果没有，可联系IT协助解决

在excel中使用VBA的Wind量化接口

Microsoft Visual Basic - 篮子下单 (2).xlsb - [模块1 (代码)]

文件(F) 编辑(E) 视图(V) 插入(I) 格式(O) 调试(D) 运行(R) 工具(T) 外接程序(A) 窗口(W) 帮助(H)

工程 - VBAProject

VBAProject (篮子下单 (2).xlsb)

- Sheet1 (篮子)
- Sheet2 (资金)
- Sheet3 (交易)
- ThisWorkbook
- 模块1
- 引用 WindVBA.
- WindExcelFunc
- WindVBA (WindVBA)

IsLogon

```
Option Explicit
Public LogonID As Long
Sub IsConnected()
    If Not vba_IsConnected Then
        Call vba_start
    End If
End Sub
Function IsLogon()
    Dim retcode As Long
    Dim k As Variant, indicis As Variant

    Call IsConnected
    k = vba_tquery("LogonID", "", indicis, retcode)
    If retcode = 0 Then
        LogonID = k(0, 0)
        IsLogon = True
    Else
        IsLogon = False
    End If
End Function

Sub Logon()
    Dim k As Variant
    Dim BrokerID As Variant
    Dim DepartID As Variant
    Dim AccountID As Variant
    Dim Password As Variant
    Dim Market As Variant
    Dim indicis As Variant
```

账号已登出

清除	品种	方向	数量
	600000.SH	Buy	100
	000029.SZ	Buy	100
	000401.SZ	Buy	100
	000537.SZ	Buy	100
	000567.SZ	Buy	100
	000690.SZ	Buy	100
	000798.SZ	Buy	100
	000908.SZ	Buy	100
	000982.SZ	Buy	100
	002324.SZ	Buy	100
	600507.SH	Buy	100
	600588.SH	Buy	100

品种	方向	数量	0	BOP	14
600000.SH	Buy	100	0	BOP	14
000029.SZ	Buy	100	0	ITC	15
000401.SZ	Buy	100	0	B5TL	16
000537.SZ	Buy	100	0	B5TC	17

篮子下单 资金持仓 交易明细

在Matlab软件中使用Wind量化接口

The screenshot displays the MATLAB R2013a environment. The top toolbar includes tabs for HOME, PLOTS, APPS, and SHORTCUTS. A custom toolbar, 'WindMatlab', is overlaid, featuring icons for WSD, WSS, WST, WSI, WSQ, WSET, EDB, WEQS, WPF, TDays, Trade, BKT, Help, and About. The left sidebar shows the 'Current Folder' and 'Command History' panels. The 'Command Window' on the right shows the execution of the 'w=windmatlab' command, which outputs a welcome message and a list of data points.

Command Window Output:

```
Warning: Name is nonexistent or not a directory: C:\Program Files\MATLAB\LOUIE
>> w=windmatlab
Welcome to Wind Quant API!
Copyright(c) 2012-2013 Shanghai Wind Information Co., Ltd. All rights reserved.
In no circumstance shall Wind be responsible for any damages or losses caused by u

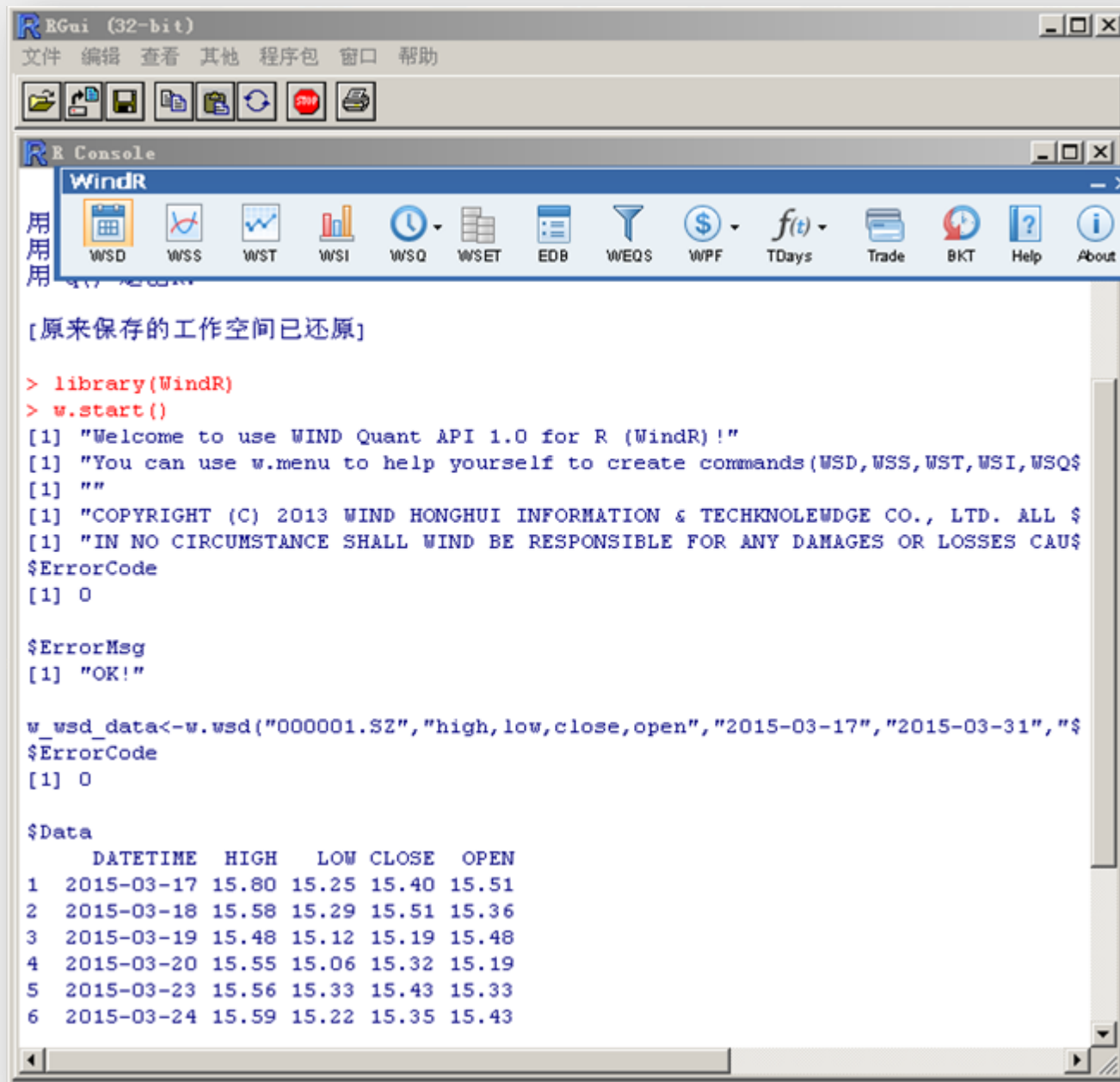
You can use w.menu to toggle the wind toolbar on and off.
Type 'help windmatlab' for more information.
>> w.menu
[w_wsd_data,w_wsd_codes,w_wsd_fields,w_wsd_times,w_wsd_errorid,w_wsd_reqid]=w.wsd('00

w_wsd_data =

    15.3300    15.5600    15.3300    15.4300
    15.4300    15.5900    15.2200    15.3500
    15.2800    15.3200    14.8900    14.9100
    14.8600    15.4200    14.7100    15.1100
    15.1000    15.2900    14.8600    15.0800
    15.2300    15.9400    15.1000    15.6600
    16.0400    16.6000    15.6300    15.7500

fx w_wsd_codes =
```

在R语言中使用Wind量化接口



RGui (32-bit)

文件 编辑 查看 其他 程序包 窗口 帮助

R Console

WindR

WSD WSS WST WSI WSQ WSET EOB WEQS WPF TDays Trade BKT Help About

[原来保存的工作空间已还原]

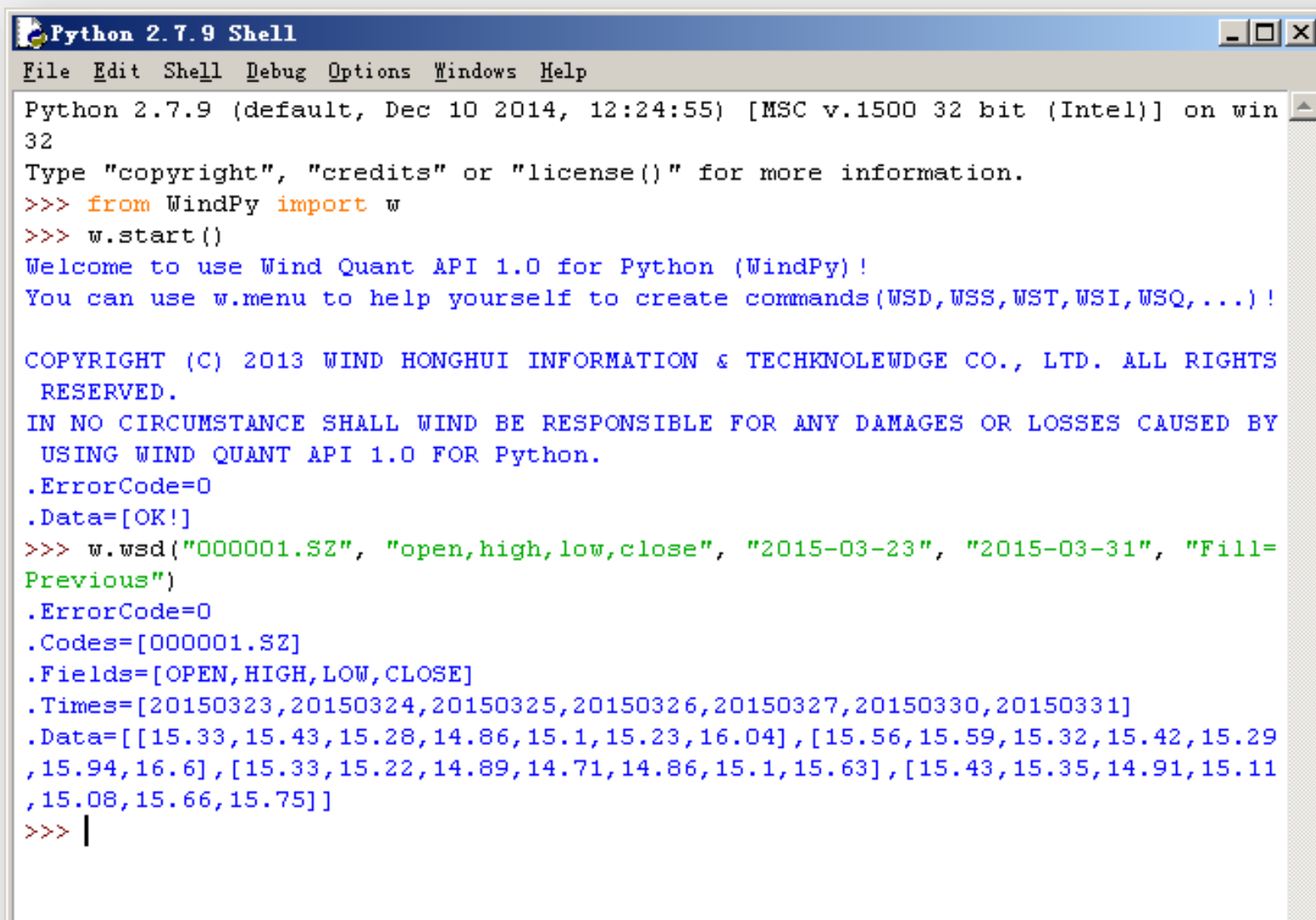
```
> library(WindR)
> w.start()
[1] "Welcome to use WIND Quant API 1.0 for R (WindR)!"
[1] "You can use w.menu to help yourself to create commands(WSD,WSS,WST,WSI,WSQ$
[1] ""
[1] "COPYRIGHT (C) 2013 WIND HONGHUI INFORMATION & TECHKNOLEWDGE CO., LTD. ALL $
[1] "IN NO CIRCUMSTANCE SHALL WIND BE RESPONSIBLE FOR ANY DAMAGES OR LOSSES CAU$
$ErrorCode
[1] 0

$ErrorMsg
[1] "OK!"

w.wsd_data<-w.wsd("000001.SZ", "high,low,close,open", "2015-03-17", "2015-03-31", "$
$ErrorCode
[1] 0

$Data
  DATETIME  HIGH  LOW CLOSE  OPEN
1 2015-03-17 15.80 15.25 15.40 15.51
2 2015-03-18 15.58 15.29 15.51 15.36
3 2015-03-19 15.48 15.12 15.19 15.48
4 2015-03-20 15.55 15.06 15.32 15.19
5 2015-03-23 15.56 15.33 15.43 15.33
6 2015-03-24 15.59 15.22 15.35 15.43
```

在Python中使用Wind量化接口



```
Python 2.7.9 Shell
File Edit Shell Debug Options Windows Help
Python 2.7.9 (default, Dec 10 2014, 12:24:55) [MSC v.1500 32 bit (Intel)] on win
32
Type "copyright", "credits" or "license()" for more information.
>>> from WindPy import w
>>> w.start()
Welcome to use Wind Quant API 1.0 for Python (WindPy)!
You can use w.menu to help yourself to create commands(WSD,WSS,WST,WSI,WSQ,...)!

COPYRIGHT (C) 2013 WIND HONGHUI INFORMATION & TECHKNOLEWDGE CO., LTD. ALL RIGHTS
RESERVED.
IN NO CIRCUMSTANCE SHALL WIND BE RESPONSIBLE FOR ANY DAMAGES OR LOSSES CAUSED BY
USING WIND QUANT API 1.0 FOR Python.
.ErrorCode=0
.Data=[OK!]
>>> w.wsd("000001.SZ", "open,high,low,close", "2015-03-23", "2015-03-31", "Fill=
Previous")
.ErrorCode=0
.Codes=[000001.SZ]
.Fields=[OPEN,HIGH,LOW,CLOSE]
.Times=[20150323,20150324,20150325,20150326,20150327,20150330,20150331]
.Data=[[15.33,15.43,15.28,14.86,15.1,15.23,16.04],[15.56,15.59,15.32,15.42,15.29
,15.94,16.6],[15.33,15.22,14.89,14.71,14.86,15.1,15.63],[15.43,15.35,14.91,15.11
,15.08,15.66,15.75]]
>>> |
```



目录

CONTENTS

量化投资简介

Wind量化平台介绍：特点

Wind量化平台使用案例

使用Wind平台进行量化投资

全市场金融数据



实时/历史行情数据



高频数据
分钟数据
日数据

宏观经济数据



煤炭

上游



基本金属

中游



工业机械

中游

财务数据



财务数据
分析师预测数据
专题统计报表



支持多种语言

支持多种通用语言，灵活性强，门槛低

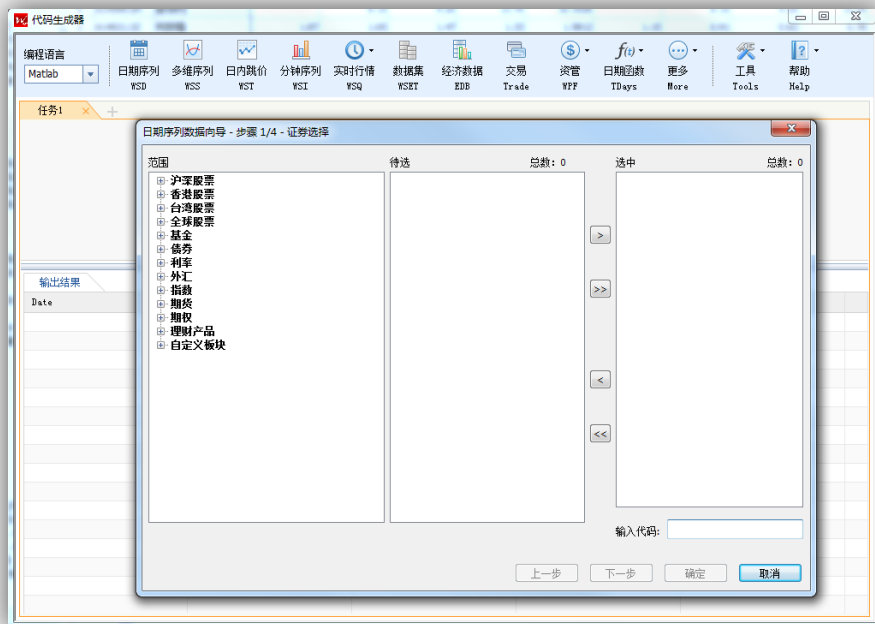
策略开发难易程度

工具	特点
Matlab	矩阵运算，有丰富的计算包，适用于策略研究和回测
R	开源，矩阵运算，有丰富的计算包，适用于策略研究和回测
Python	开源，有丰富的计算包，可对接各种编程语言
VBA	相比Excel，可实现复杂逻辑，无计算包，适合将结果在Excel中展示
C#/C++	适用于底层开发，运行速度快，开发周期长

数据全面

以函数提取指标，无需了解底层数据库表结构，提取方便

`w.wsd("000001.SZ","open,high,low,close,volume","2015-03-15","2015-03-24","PriceAdj=F")`



结果:

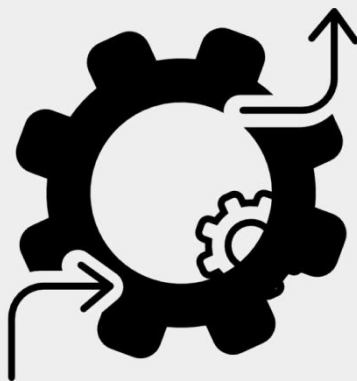
\$Data

	DATETIME	OPEN	HIGH	LOW	CLOSE	VOLUME
1	2015-03-16	15.10	15.50	14.92	15.41	221847246
2	2015-03-17	15.51	15.80	15.25	15.40	195984187
3	2015-03-18	15.36	15.58	15.29	15.51	183100067
4	2015-03-19	15.48	15.48	15.12	15.19	158030028
5	2015-03-20	15.19	15.55	15.06	15.32	197639447
6	2015-03-23	15.33	15.56	15.33	15.43	178205583
7	2015-03-24	15.43	15.59	15.22	15.35	155919347

○ 安全、灵活、多账户交易



策略与平台隔离
策略由用户控制
交易直达柜台

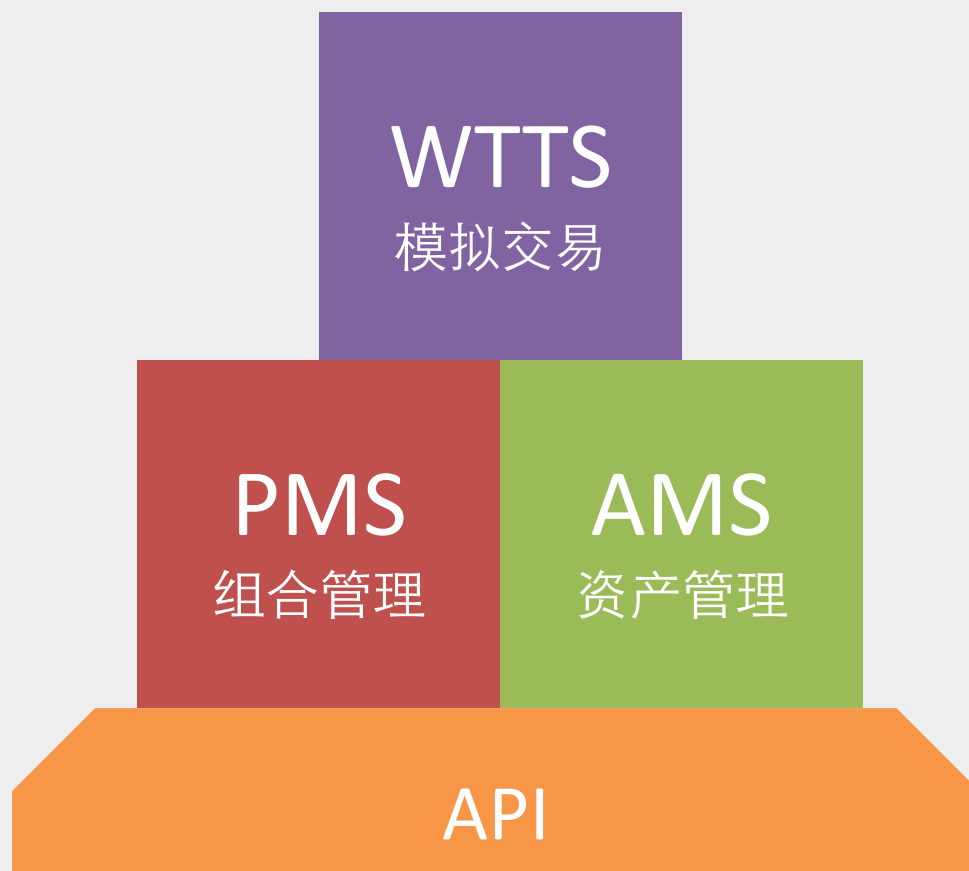


接口方式使用灵活
可独立构建投资系统
可与已有系统集成



支持多账户交易
支持所有CTP柜台

○ 多种辅助工具



○ 使用场景

量化研究

量化交易

行情监控

统计报表

- ✓ 适用于一切对数据有需求，掌握某种工具的用户
- ✓ 可用来进行研究、生成报表、制作模板、策略回测、程序化交易
- ✓ 不仅仅限于量化，是自动化工具，能极大提高工作效率。



目录

CONTENTS

量化投资简介

Wind量化平台介绍

Wind量化平台使用案例

使用Wind平台进行量化投资

案例展示——多因子选股 (VBA)



案例大全->VBA

案例展示——Wind量化接口应用实例

沪港通溢价监控

Wind 資訊

A/H股溢价监控

代码	简称	最新价	涨跌幅	最高价	最低价	开盘价	前收盘价	刷新	停止	代码	简称	最新价
HSAHP.HI	恒生AH股溢价指数	97.52	-0.15%	98.25	96.89	97.70	97.67			HKDCNY.FX	港币兑人民币	0.8040
A股代码	A股简称	最新价	涨跌幅	换手率	市盈率	A/H	H股代码	H股简称	最新价	涨跌幅	换手率	市盈率
000039.SZ	中集集团	12.7	2.75%	0.65%	16.19	1.09	2039.HK	中集集团	14.54	3.12%	0.02%	14.71
000063.SZ	中兴通讯	12.96	2.53%	0.92%	25.10	1.12	0763.HK	中兴通讯	14.4	-0.69%	0.46%	22.12
000157.SZ	中联重科	4.68	3.31%	0.72%	9.90	1.14	1157.HK	中联重科	5.12	0.99%	0.24%	8.58
000338.SZ	潍柴动力	17.68	2.49%	1.32%	9.27	0.82	2338.HK	潍柴动力	26.85	2.68%	0.72%	11.17
000488.SZ	晨鸣纸业	4.32	2.13%	0.57%	11.84	1.53	1812.HK	晨鸣纸业	3.52	2.03%	0.76%	7.65
000513.SZ	丽珠集团	43.89	1.39%	0.28%	26.81	1.21	1513.HK	丽珠医药	45.1	1.81%	0.22%	21.85
000585.SZ	东北电气	2.33	2.19%	0.42%	270.75	3.18	0042.HK	东北电气	0.91	3.41%	0.56%	83.86
000666.SZ	经纬纺机	9.1	8.33%	1.92%	11.00	1.65	0350.HK	经纬纺织机械股份	6.86	0.29%	0.33%	6.52
000756.SZ	新华制药	5.42	2.26%	0.51%	51.57	2.56	0719.HK	山东新华制药股份	2.63	-0.75%	0.50%	20.28
000898.SZ	鞍钢股份	2.93	3.17%	0.42%	41.08	0.79	0347.HK	鞍钢股份	4.59	0.88%	0.56%	51.04
000921.SZ	海信科龙	8.2	1.99%	0.30%	9.00	1.32	0921.HK	海信科龙	7.73	1.98%	0.82%	6.64
002202.SZ	金风科技	8.73	2.11%	0.70%	52.75	1.37	2208.HK	金风科技	7.93	2.32%	0.30%	38.00
002490.SZ	山东墨龙	6.62	3.12%	1.32%	-27.94	3.74	0568.HK	山东墨龙	2.2	2.33%	0.42%	-7.36
002594.SZ	比亚迪	41.83	2.68%	0.96%	217.55	1.33	1211.HK	比亚迪股份	39	5.55%	0.46%	160.86
002672.SZ	东江环保	36.4	1.96%	1.54%	39.44	1.61	0895.HK	东江环保	28.1	0.90%	0.06%	24.14
002703.SZ	浙江世宝	19.02	0.48%	4.52%	107.30	5.97	1057.HK	浙江世宝	3.96	1.54%	1.53%	17.72
600011.SH	华能国际	5.34	1.33%	0.11%	6.44	0.85	0902.HK	华能国际电力股份	7.84	1.95%	0.24%	7.56
600012.SH	皖通高速	4.33	-0.46%	0.22%	8.19	1.24	0995.HK	安徽皖通高速公路	4.35	-0.68%	0.33%	6.59
600016.SH	民生银行	7.74	1.18%	0.43%	5.00	1.26	1988.HK	民生银行	7.66	1.73%	0.43%	3.92
600026.SH	中海发展	4.14	3.76%	0.24%	-8.00	1.25	1138.HK	中海发展股份	4.13	2.48%	1.03%	-6.57
600027.SH	华电国际	3.17	1.93%	0.47%	5.16	0.93	1071.HK	华电国际电力股份	4.26	1.91%	1.03%	6.03
600028.SH	中国石化	5.07	2.22%	0.07%	9.14	0.90	0386.HK	中国石油化工股份	7.02	3.24%	0.38%	10.23
600029.SH	南方航空	2.41	2.12%	0.44%	15.44	1.32	1055.HK	中国南方航空股份	2.27	-0.44%	0.70%	10.89
600030.SH	中信证券	11.98	3.90%	1.73%	23.66	0.92	6030.HK	中信证券	16.2	6.30%	1.20%	25.37
600036.SH	招商银行	10.03	1.21%	0.23%	4.71	0.92	3968.HK	招商银行	13.5	0.90%	0.34%	5.03
600115.SH	东方航空	2.38	2.15%	0.26%	13.10	1.28	0670.HK	中国东方航空股份	2.31	0.43%	0.03%	10.10
600188.SH	兖州煤业	7.22	10.06%	0.64%	33.65	1.48	1171.HK	兖州煤业股份	6.07	5.20%	1.26%	42.16
600196.SH	复星医药	18.97	3.95%	0.76%	20.99	0.89	2196.HK	复星医药	26.5	3.72%	0.50%	23.26
600332.SH	白云山	24.64	1.27%	0.87%	27.80	1.40	0874.HK	白云山	21.9	0.92%	0.50%	19.60
600362.SH	江西铜业	12.89	6.79%	1.76%	15.17	1.30	0358.HK	江西铜业股份	12.38	1.31%	0.81%	11.59
600377.SH	宁沪高速	5.58	1.45%	0.27%	10.37	0.79	0177.HK	江苏宁沪高速公路	8.73	0.11%	0.07%	12.87

案例大全->VBA

数据就是未来 Data is the Future

案例展示——相关性矩阵

<div>Wind 資訊</div> <div>计算相关性</div>		时间设置:					说明:									
		<div><div><div><div><div></div><div>向前推:</div></div><div>8周</div></div><div><div><div><div></div><div>自定义:</div></div><div><div>开始时间</div><div>结束时间</div></div><div>2014020120140321</div></div></div></div></div>					<div>0-0.2</div> <div>0.2-0.4</div> <div>0.4-0.6</div> <div>0.6-0.8</div> <div>0.8-1</div>									
清除数据	导入数据	600055.SH 华润万东	600073.SH 上海梅林	600088.SH 中视传媒	000011.SZ 深物业A	000032.SZ 深桑达A	000055.SZ 方大集团	000100.SZ TCL集团	000430.SZ 张家界	CU1410.SH 沪铜1410	AU1410.SH 沪金1410	AG1412.SH 沪银1412	RB1411.SH 螺纹钢1411	M1412.DCE 豆粕1412		
WR1410.SH	线材1410	-0.1183	0.4095	0.2970	-0.0970	0.2069	-0.7567	0.5636	0.0316	0.9234	-0.5618	0.4603	0.8578	-0.4402		
FU1410.SH	燃油1410	-0.0670	0.3665	0.1522	0.2758	0.0069	-0.6466	0.3962	0.1555	0.5854	-0.5411	0.0349	0.4813	0.1130		
RU1408.SH	橡胶1408	-0.0988	0.7116	0.7382	0.5695	-0.1915	0.0236	-0.0567	0.2593	0.4359	-0.5610	-0.0053	0.5847	-0.4130		
AG1410.SH	沪银1410	0.3061	0.0770	-0.2329	-0.4232	0.6686	-0.2994	0.2167	0.2360	0.2861	0.3607	0.9930	0.3351	0.0078		
000032.SZ	深桑达A	0.3564	0.1138	-0.2498	-0.1875	1.0000	-0.1916	0.1866	0.3775	0.1170	0.4007	0.6802	0.1138	0.2215		
P1411.DCE	棕榈油1411	0.4049	-0.6045	-0.8246	-0.5336	0.4132	0.1107	-0.3544	0.1226	-0.6091	0.8777	0.3592	-0.6138	0.5666		
TF1409.CFE	TF1409	0.0681	-0.5156	-0.5078	-0.4589	-0.2552	-0.1318	0.2819	-0.4159	-0.2001	0.2643	-0.0495	-0.1917	0.0031		
ACET.O	ACETO CORP	0.2960	-0.2648	-0.2586	0.1172	0.0052	0.7642	-0.4885	0.2577	-0.8266	0.5890	-0.2748	-0.8220	0.5834		
ACAS.O	American Cap	-0.2593	-0.1326	-0.0628	-0.4580	0.3143	-0.7094	0.1536	-0.2395	0.5602	-0.2199	0.3884	0.5209	-0.3943		
ABMD.O	ABIOMED INC	0.1141	-0.0127	-0.2575	-0.3309	0.2562	-0.6780	0.1473	0.2403	0.4620	-0.0993	0.4301	0.3672	0.0384		
ACOR.O	ACORDA THERA	0.4032	-0.5391	-0.7676	-0.3814	0.3997	0.3220	-0.1946	0.0758	-0.6729	0.8453	0.1882	-0.7074	0.7210		
ADSK.O	欧特克	0.0579	0.3227	0.1731	-0.3529	0.2923	-0.5631	0.2399	0.1633	0.7547	-0.3093	0.6012	0.7548	-0.5045		
601216.SH	内蒙君正	-0.2966	0.6071	0.7517	0.2098	-0.0988	-0.4974	0.3351	0.1322	0.8966	-0.7862	0.1230	0.8954	-0.7150		
601169.SH	北京银行	0.2183	0.4096	-0.1006	0.2120	0.4687	-0.2484	0.3709	0.1476	0.3463	-0.0920	0.4283	0.3394	0.1572		
601106.SH	中国一重	-0.0726	0.8444	0.7993	0.7158	-0.0324	-0.0179	0.1159	0.4273	0.5418	-0.6649	-0.0758	0.5724	-0.3400		
601099.SH	太平洋	-0.3249	0.0955	0.3833	-0.0825	-0.0122	-0.5867	0.0542	0.0852	0.5676	-0.4561	0.0406	0.4873	-0.5019		
601008.SH	连云港	0.1313	0.8792	0.5371	0.5796	0.2949	-0.1056	0.3893	0.6082	0.6107	-0.4091	0.2880	0.6017	-0.0435		
000011.SZ	深物业A	-0.0422	0.6568	0.5730	1.0000	-0.1875	0.2014	0.0441	0.3269	0.1151	-0.4510	-0.3936	0.1034	0.1276		
000020.SZ	深华发A	0.1402	-0.1727	-0.0917	0.3081	-0.0641	0.8449	-0.3163	0.0373	-0.7889	0.4577	-0.3497	-0.7501	0.4681		
000034.SZ	深信泰丰	0.1784	-0.0963	-0.0694	0.3833	-0.0582	0.8337	-0.3928	0.1081	-0.8025	0.4604	-0.3575	-0.7465	0.5047		
000060.SZ	中金岭南	0.2275	0.4015	0.0133	0.1165	0.4898	-0.4608	0.7232	0.3600	0.5723	-0.1199	0.3691	0.5315	-0.0202		
000006.SH	上证房地产指数	-0.1327	0.8604	0.8126	0.8455	-0.1685	0.0125	0.1512	0.3099	0.4839	-0.7159	-0.2181	0.5136	-0.2727		
000007.SH	上证公用事业指数	-0.0088	0.9026	0.6956	0.5652	0.1558	-0.3197	0.4685	0.4343	0.8063	-0.6804	0.1635	0.8040	-0.3432		
FR001.IR	FR001	-0.4028	0.4407	0.7780	0.5322	-0.6168	0.0981	0.0601	-0.1036	0.3366	-0.7578	-0.6226	0.3550	-0.4929		
IB0001.IB	IB0001	-0.4231	0.3654	0.6995	0.4883	-0.5415	0.1081	0.0617	-0.2203	0.2984	-0.6919	-0.5962	0.3049	-0.4361		
OR001.IB	OR001	-0.3414	0.3726	0.7562	0.4222	-0.5462	0.0552	0.1873	-0.1896	0.3731	-0.7198	-0.5070	0.4197	-0.5507		
600009.SH	上海机场	-0.0920	0.8518	0.7378	0.4711	0.0299	-0.4120	0.3660	0.3348	0.8675	-0.8018	0.0989	0.8568	-0.4942		
600300.SH	维维股份	-0.0973	0.8851	0.8201	0.5692	0.0090	-0.1646	0.2753	0.3491	0.7283	-0.7033	0.0855	0.7897	-0.5135		
000300.SH	沪深300	-0.0512	0.8844	0.7671	0.5173	0.0541	-0.2495	0.3548	0.3471	0.7915	-0.7048	0.1623	0.8302	-0.5172		

案例大全->VBA



案例展示——篮子交易

Wind 专业下单器 (多账号、组合、对冲下单)

导入账号

账号下单次序:

- ☒ 次序不变
- ☐ 依次变化
- ☐ 次序随机
- ☐ 资金优先

#	LogonID	可用资金	资金总量	资金账号	账号类型
1	1	99871581.794	99980141.794	W081263801	SH,SZ
2	2	10000009867.201	10000009867.201	000100000080	SH,SZ
3	3	9999539686.883	9999539686.883	000100000081	SH,SZ
4	4	999788840	999788840	000100000180	CFE,CZC
5	5	999878300	999878300	000100000181	CFE,CZC
6	6	102019857.979	102337292.299	W081263802	CFE,CZC

导入篮子

价格策略:

- ☒ 对手价加减
- ☐ 本方价位
- ☐ 市价
- ☐ 涨/跌停价

1 价位

#	证券代码	证券名称	买卖方向	数量(股/比例)	可交易量
1	600000.SH	浦发银行	buy	100	NA
2	000001.SZ	平安银行	buy	100	NA
3	600177.SH	雅戈尔	sell	100	0
4	IF1409.CFE	IF1409	short	1	NA
5	TF1409.CFE	TF1409	sell	1	0

数量策略:

- ☒ 每账户数量相同
- ☐ 一个品种一个账号
- ☐ 按总资产比例分配
- ☐ 按可用资产比例分配
- ☐ 随机分配: 最小 1 手, 最大 9999999 手
- ☐ 拆单: 最小 1 手, 最大 9999999 手

下单总量:

- ☐ 总金额(按委托比例) 1000000 元
- ☒ 按委托数量倍数* 11
- ☐ 清空篮子内证券的仓位

执行下单

查询下单结果

查询持仓

全部撤单

补单

全部清仓

执行结果:

#	证券代码	证券名称	持仓方向	可交易量	持仓量
1	600859.SH	王府井	buy	6200	6200
2	002399.SZ	海普瑞	buy	5900	5900
3	159901.SZ	深100ETF	buy	2800	2800
4	IF1409.CFE	IF1409	buy	1	1
5	IF1409.CFE	IF1409	short	1	1
6	IO1409-C-2300.CFE	沪深300指数期权1409	buy	1	1
7	IO1409-P-2300.CFE	沪深300指数期权1409	buy	1	1

案例大全->R语言

案例展示——Wind量化接口应用实例

C++股票策略程序例子,能根据给定条件进行股票自动买入卖出

股票策略交易程序

实时行情

资金与持仓

当日委托查询

当日成交查询

股票代码	最高价	最低价	现价	现额	现量	成交额	成交量
600000.SH	9.91	9.77	9.83	59040.00	6000	1308626408.00	133030186
000001.SZ	10.20	10.13	10.16	2915920.00	287000	669474243.00	65934904
000002.SZ	9.71	9.41	9.57	6424408.00	671307	1131702750.00	117857898
002043.SZ	6.26	6.05	6.11	347048.00	56800	71106709.00	11622224
000859.SZ	6.23	6.10	6.12	562428.00	91900	57724535.00	9381802
002102.SZ	11.04	10.56	10.91	2781003.00	254904	111826663.00	10325363
600152.SH	9.49	9.11	9.21	45169.00	4900	137321073.00	14700031
000678.SZ	6.85	6.68	6.79	815479.00	120100	63351065.00	9420648
600633.SH	19.68	19.15	19.20	493592.00	25700	677967433.00	35029692
600666.SH	16.65	16.26	16.30	39117.00	2400	174443725.00	10625798
603000.SH	48.30	46.87	47.05	32935.00	700	450063999.00	9499893
002181.SZ	19.05	18.60	18.80	2028539.00	107901	226088104.00	12013187
000540.SZ	7.97	7.77	7.89	1483162.00	187980	222765347.00	28209769
601888.SH	37.88	36.67	37.07	1500956.00	40500	255682579.00	6875657
600560.SH	14.87	14.37	14.47	17364.00	1200	57876285.00	3948918
000034.SZ	7.06	6.91	6.96	408545.00	58699	38496248.00	5510614
002401.SZ	22.70	21.50	21.98	2791460.00	127000	322343177.00	14733496
000889.SZ	9.12	8.85	8.90	373800.00	42000	80327539.00	8989874
600988.SH	11.34	11.11	11.18	22380.00	2000	84890423.00	7591317
600995.SH	7.60	7.30	7.36	7360.00	1000	60121313.00	8097145

买入条件：单支股票现价高于本日k线最低点5%时买入

卖出条件：单支股票盈利超过3%时全部卖出

策略开始

策略停止

策略执行周期：

60

秒

策略执行状态：停止

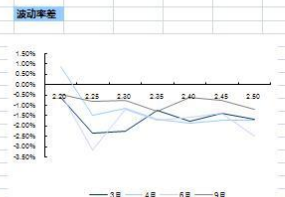
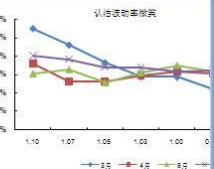
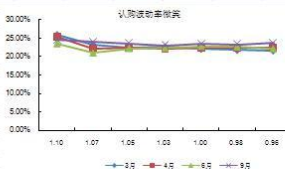
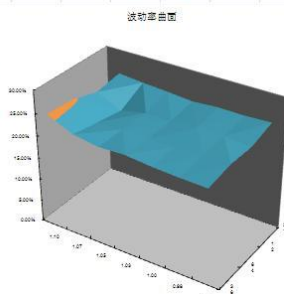
案例展示——波动率曲面、波动率微笑

代码	期权类型	行权价	成交量	成交额	当前价	买一价	卖一价	买一量	卖一量	隐含波动率	Delta	Gamma	Vega	Theta	Rho	买一隐含波动率	卖一隐含波动率	持仓数量
SHIBOR3M 期					0.05076													
SI00000.SR	36 认购	2.2	759	1778307	0.2296	0.2263	0.2281	5	2	0.26	0.765	0.874	0.002	-0.002	0.002	6.2	0.0018	1.10
SI00000.SR	36 认购	2.2	614	70771	0.0127	0.0126	0.0127	10	8	0.26	-0.235	0.874	0.002	-0.001	-0.001	45.0	0.0001	1.10
SI000002.SR	36 认购	2.25	245	464532	0.183	0.183	0.1838	1	10	0.23	0.715	0.965	0.003	-0.002	0.002	9.4	0.0008	1.07
SI000007.SR	36 认购	2.25	581	100363	0.0195	0.0195	0.0197	15	5	0.26	-0.285	0.965	0.003	-0.002	-0.001	35.2	0.0002	1.07
SI000003.SR	36 认购	2.3	270	359887	0.1419	0.1408	0.1413	5	10	0.22	0.662	1.040	0.003	-0.002	0.001	11.3	0.0005	1.05
SI000008.SR	36 认购	2.3	662	171590	0.0291	0.0289	0.029	10	6	0.25	-0.338	1.040	0.003	-0.002	-0.001	28.2	0.0001	1.05
SI000004.SR	36 认购	2.35	436	470863	0.1078	0.1055	0.1082	1	10	0.23	0.607	1.094	0.003	-0.002	0.001	13.9	0.0027	1.03
SI000005.SR	36 认购	2.35	668	257306	0.045	0.0428	0.045	10	5	0.24	-0.394	1.094	0.003	-0.002	-0.001	22.2	0.0002	1.03
SI000005.SR	36 认购	2.4	583	452430	0.0769	0.0744	0.0769	5	6	0.22	0.550	1.126	0.003	-0.002	0.001	17.8	0.0025	1.00
SI000010.SR	36 认购	2.4	512	301091	0.0659	0.0638	0.0659	3	1	0.24	-0.450	1.126	0.003	-0.002	-0.001	17.0	0.0001	1.00
SI000041.SR	36 认购	2.45	435	228610	0.0925	0.0891	0.0922	1	1	0.22	0.494	1.134	0.003	-0.002	-0.001	25.3	0.0012	0.98
SI000042.SR	36 认购	2.45	513	425444	0.0882	0.0877	0.0882	10	5	0.23	-0.506	1.134	0.003	-0.002	-0.001	13.9	0.0005	0.98
SI000049.SR	36 认购	2.5	742	260776	0.0343	0.0345	0.0351	1	1	0.22	0.439	1.121	0.003	-0.002	-0.001	30.7	0.0006	0.96
SI000050.SR	36 认购	2.5	822	932920	0.1203	0.1201	0.1207	20	15	0.23	-0.561	1.121	0.003	-0.002	-0.002	11.3	0.0006	0.96
SI000011.SR	64 认购	2.2	285	637071	0.2476	0.2399	0.2473	1	10	0.25	0.725	0.716	0.003	-0.001	0.003	7.3	0.0074	1.10
SI000016.SR	64 认购	2.2	512	100353	0.0224	0.0224	0.0225	9	10	0.25	-0.275	0.716	0.003	-0.001	-0.001	29.6	0.0001	1.10
SI000012.SR	64 认购	2.25	128	264263	0.1594	0.1597	0.16	2	5	0.22	0.685	0.762	0.004	-0.001	0.002	6.3	0.0003	1.07
SI000017.SR	64 认购	2.25	325	92950	0.0204	0.0213	0.0215	10	5	0.24	-0.315	0.762	0.004	-0.001	-0.002	24.2	0.0002	1.07
SI000015.SR	64 认购	2.3	131	218737	0.1538	0.1507	0.1535	10	10	0.22	0.644	0.800	0.004	-0.001	0.002	9.7	0.0028	1.05
SI000018.SR	64 认购	2.3	446	186035	0.0442	0.0445	0.0449	10	5	0.24	-0.336	0.800	0.004	-0.001	-0.002	19.3	0.0004	1.05
SI000014.SR	64 认购	2.35	80	104340	0.1306	0.1278	0.1306	10	5	0.22	0.602	0.828	0.004	-0.002	0.002	11.4	0.0028	1.03
SI000019.SR	64 认购	2.35	656	389458	0.0632	0.0621	0.0631	10	5	0.24	-0.398	0.828	0.004	-0.001	-0.002	15.5	0.0010	1.03
SI000013.SR	64 认购	2.4	134	140734	0.1055	0.102	0.1055	1	4	0.22	0.589	0.847	0.004	-0.002	0.002	12.2	0.0005	1.00
SI000020.SR	64 认购	2.4	331	273442	0.0859	0.0857	0.0859	2	5	0.24	-0.441	0.847	0.004	-0.001	-0.002	12.4	0.0002	1.00
SI000043.SR	64 认购	2.45	230	184544	0.0787	0.0796	0.0814	5	1	0.22	0.517	0.855	0.004	-0.002	0.002	15.7	0.0018	0.98
SI000044.SR	64 认购	2.45	283	304806	0.1114	0.112	0.1127	10	20	0.24	-0.483	0.855	0.004	-0.001	-0.002	10.4	0.0007	0.98
SI000051.SR	64 认购	2.5	181	110090	0.0599	0.0603	0.0605	10	10	0.23	0.475	0.854	0.004	-0.002	0.002	19.0	0.0002	0.96
SI000052.SR	64 认购	2.5	200	272891	0.1421	0.1422	0.144	1	5	0.24	-0.585	0.854	0.004	-0.001	-0.003	6.9	0.0016	0.96
SI000021.SR	127 认购	2.2	232	750174	0.2778	0.2642	0.2778	15	10	0.24	0.696	0.535	0.005	-0.001	0.008	6.4	0.0135	1.10
SI000026.SR	127 认购	2.2	115	51737	0.0445	0.0442	0.0463	5	1	0.24	-0.304	0.535	0.005	-0.001	-0.003	16.6	0.0021	1.10
SI000022.SR	127 认购	2.25	210	500298	0.2308	0.2283	0.2396	5	10	0.21	0.667	0.556	0.005	-0.001	0.004	7.0	0.0113	1.07
SI000027.SR	127 认购	2.25	104	61126	0.0601	0.058	0.0592	10	1	0.24	-0.334	0.556	0.005	-0.001	-0.003	13.9	0.0012	1.07
SI000023.SR	127 认购	2.3	268	553104	0.2059	0.1578	0.2053	1	13	0.22	0.637	0.574	0.005	-0.001	0.004	7.9	0.0075	1.05
SI000028.SR	127 认购	2.3	89	46466	0.0734	0.0734	0.0754	10	1	0.24	-0.353	0.574	0.005	-0.001	-0.004	11.9	0.0002	1.05
SI000024.SR	127 认购	2.35	195	344099	0.1728	0.1674	0.175	5	10	0.22	0.606	0.588	0.006	-0.001	0.004	8.7	0.0076	1.03
SI000029.SR	127 认购	2.35	56	52105	0.0958	0.0925	0.0946	5	1	0.24	-0.394	0.588	0.006	-0.001	-0.004	10.3	0.0021	1.03
SI000025.SR	127 认购	2.4	98	145668	0.1485	0.1425	0.1485	10	10	0.23	0.576	0.599	0.006	-0.001	0.004	9.8	0.0060	1.00
SI000030.SR	127 认购	2.4	94	108496	0.1206	0.1144	0.119	5	1	0.24	-0.424	0.599	0.006	-0.001	-0.004	6.9	0.0046	1.00
SI000045.SR	127 认购	2.45	83	103296	0.1254	0.1204	0.1254	10	10	0.23	0.546	0.606	0.006	-0.001	0.004	10.9	0.0050	0.98
SI000046.SR	127 认购	2.45	72	101738	0.1441	0.1436	0.1477	1	10	0.24	-0.454	0.606	0.006	-0.001	-0.003	7.6	0.0041	0.98
SI000053.SR	127 认购	2.5	86	89834	0.0995	0.101	0.1058	5	10	0.22	0.517	0.610	0.006	-0.001	0.004	12.3	0.0048	0.96
SI000054.SR	127 认购	2.5	124	210948	0.1758	0.1708	0.1774	1	10	0.25	-0.483	0.610	0.006	-0.001	-0.005	6.8	0.0066	0.96
SI000031.SR	218 认购	2.2	8	26115	0.3266	0.3138	0.3266	3	5	0.23	0.687	0.414	0.007	-0.001	0.007	5.2	0.0068	1.10
SI000036.SR	218 认购	2.2	78	39519	0.0762	0.0779	0.0802	10	5	0.25	-0.313	0.414	0.007	-0.001	-0.006	9.7	0.0003	1.10
SI000032.SR	218 认购	2.25	247	709646	0.2506	0.2308	0.2503	1	5	0.24	0.664	0.426	0.007	-0.001	0.007	5.7	0.0107	1.07
SI000037.SR	218 认购	2.25	98	90612	0.0936	0.0932	0.0964	12	5	0.25	-0.336	0.426	0.007	-0.001	-0.006	8.7	0.0032	1.07
SI000033.SR	218 认购	2.3	120	309145	0.2573	0.2511	0.262	1	5	0.24	0.642	0.437	0.007	-0.001	0.007	6.2	0.0109	1.05
SI000038.SR	218 认购	2.3	185	199117	0.1094	0.1094	0.1119	10	5	0.24	-0.359	0.437	0.007	-0.001	-0.007	7.9	0.0025	1.05
SI000034.SR	218 认购	2.35	263	597957	0.2251	0.2251	0.2257	11	5	0.23	0.619	0.446	0.007	-0.001	0.007	6.0	0.0061	1.05
SI000039.SR	218 认购	2.35	337	440751	0.1501	0.1376	0.1576	1	5	0.24	-0.381	0.446	0.007	-0.001	-0.007	7.0	0.0058	1.05
SI000035.SR	218 认购	2.4	245	490193	0.2016	0.1976	0.2063	1	5	0.23	0.596	0.453	0.007	-0.001	0.006	7.3	0.0087	1.00
SI000040.SR	218 认购	2.4	158	228337	0.1518	0.1458	0.1584	5	1	0.24	-0.404	0.453	0.007	-0.001	-0.006	6.4	0.0081	1.00

认购期权波动率					
行权价	价内率	3月	4月	6月	9月
2.20	1.10	25.85%	25.44%	23.58%	24.50%
2.25	1.07	23.23%	22.12%	21.07%	23.97%
2.30	1.05	22.38%	22.42%	22.30%	23.58%
2.35	1.03	22.62%	22.23%	22.35%	23.07%
2.40	1.00	22.05%	22.27%	22.88%	23.48%
2.45	0.98	21.75%	22.29%	22.71%	23.40%
2.50	0.96	21.60%	22.50%	22.23%	23.68%

		认沽期权波动率				
行权价	价内率	3月	4月	6月	9月	12月
2.20	1.10	26.49%	24.59%	24.03%	25.00%	24.00%
2.25	1.07	25.60%	23.61%	24.25%	24.80%	24.00%
2.30	1.05	24.64%	23.60%	23.54%	24.37%	24.00%
2.35	1.03	23.88%	23.94%	24.08%	24.36%	24.00%
2.40	1.00	23.86%	24.15%	24.48%	24.13%	24.00%
2.45	0.98	23.18%	24.05%	24.13%	24.19%	24.00%
2.50	0.96	23.32%	24.26%	24.74%	24.87%	24.00%

行权价		隐含波动率	
3月	4月	3月	4月
2.20	1.10	-0.64%	0.85%
2.25	1.07	-2.37%	-1.49%
2.30	1.05	-2.26%	-1.18%
2.35	1.03	-1.26%	-1.71%
2.40	1.00	-1.81%	-1.88%
2.45	0.98	-1.43%	-1.76%
2.50	0.96	-1.72%	-1.76%



案例大全->VBA

案例展示——分级基金套利监控

实时数据更新完毕				已启动监控				2015-5-5 16:36:00																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																							
----------	--	--	--	-------	--	--	--	-------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

案例大全->VBA

案例展示——债券监控

实时数据更新完毕				刷新时间 13:10:27							
开始监控		已关闭监控		结束监控		清除数据					
债券代码	债券名称	卖一量	卖一价	买一价	买一量	现价	前价	债项评级	主体评级	剩余期限(年)	推送时间
113008.SH	电气转债	80000	134.79	134.75	2043000	134.75	134.8	AAA	AAA	5.93	131021
113001.SH	中行转债	408000	155.43	155.41	81000	155.41	155.44	AAA	AAA	1.25	131021
110023.SH	民生转债	2000	135.78	135.76	20000	135.77	135.77	AA+	AAA	4.04	131021
113008.SH	电气转债	391000	134.8	134.75	74000	134.8	134.74	AAA	AAA	5.93	131012
110023.SH	民生转债	122000	135.77	135.76	408000	135.77	135.77	AA+	AAA	4.04	131012
113008.SH	电气转债	1000	134.7	134.65	81000	134.74	134.65	AAA	AAA	5.93	131003
113001.SH	中行转债	16000	155.43	155.4	500000	155.44	155.4	AAA	AAA	1.25	131003
110020.SH	南山转债	9000	138.79	138.65	50000	138.8	138.7	AA	AA	3.63	131003
113008.SH	电气转债	81000	134.73	134.65	84000	134.65	134.73	AAA	AAA	5.93	130947
113006.SH	深燃转债	394000	148	147.95	2000	148	147.95	AA+	AA+	4.79	130947
113001.SH	中行转债	442000	155.4	155.38	33000	155.4	155.45	AAA	AAA	1.25	130951
019407.SH	14国债07	505000	100.11	100.1	8335000	100.1	100.1			0.12	130942
113008.SH	电气转债	61000	134.73	134.65	89000	134.73	134.64	AAA	AAA	5.93	130942
113008.SH	电气转债	5000	134.7	134.64	66000	134.64	134.7	AAA	AAA	5.93	130932
113001.SH	中行转债	390000	155.45	155.43	254000	155.45	155.47	AAA	AAA	1.25	130932
110020.SH	南山转债	8000	138.8	138.7	400000	138.7	138.7	AA	AA	3.63	130932
010107.SH	21国债(7)	650000	106.7	106.68	546000	106.7	106.7			6.42	130817
010504.SH	05国债(4)	20000	105.26	105.2	157000	105.2	105.26			10.21	130642
113001.SH	中行转债	27000	155.53	155.51	3000	155.5	155.54	AAA	AAA	1.25	130642
110023.SH	民生转债	326000	135.66	135.65	226000	135.66	135.7	AA+	AAA	4.04	130642
113008.SH	电气转债	9000	134.66	134.65	31000	134.65	134.62	AAA	AAA	5.93	130637

案例大全->VBA



目录

CONTENTS



量化投资简介

Wind量化平台介绍

Wind量化平台使用案例

使用Wind平台进行量化投资

○ 利用Wind平台进行量化投资

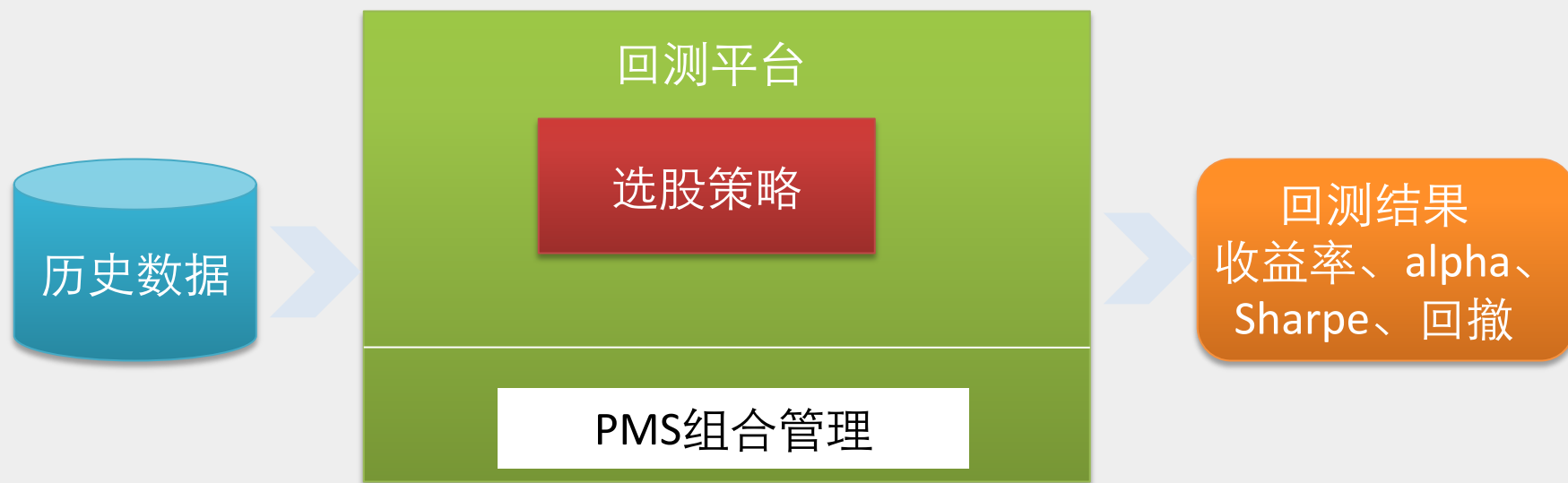
策略思路发现

基于PMS的回测平台构建

基于WTTTS的策略模拟验证

基于交易接口的实盘策略运行

量化投资-回测





量化投资-组合管理PMS

日间策略回测工具PMS





量化投资-组合管理PMS

WindMatlab

WSD

WSS

WST

WSI

WSQ

WSET

EDB

WEQS

\$

f(t)

AMS

PMS

WUPF

Trade

BKT

Help

About

PMS数据提取

选择组合

关注组合

全球投资组合管理演示

短线技术驱动

方正农业精选组合

国信金工-量化模型1号

国债期货套利演示

2014中信证券金股

2014中金公司金股

MUFC

我的组合

港股证券模拟组合

证券模拟组合

趋势突破1211

趋势突破回测

概念套利

我的持仓

回测

test2

test1

test3

test4

rightstragety

选择报表

组合日报算数据

组合日持仓数据

组合区间统计

组合持仓区间统计

设置报表参数

参数名称	中文名称	参数值
startdate	开始日期	20150506
enddate	结束日期	20150606
reportcurrency	报告币种	人民币

显示报表字段

	中文名称	英文名称
<input checked="" type="checkbox"/>	组合名称	Portfolio_Name
<input checked="" type="checkbox"/>	组合ID	Portfolio_ID
<input checked="" type="checkbox"/>	报告货币	Report_Currency
<input checked="" type="checkbox"/>	交易日期	Trade_Date
<input checked="" type="checkbox"/>	总资产	Total_Asset
<input checked="" type="checkbox"/>	持仓市值	Holding_Amount
<input checked="" type="checkbox"/>	现金	Cash

运行设置

☒ 不运行

☐ 直接运行

数据列表

证券代码列表

指标列表

输出变量名

w_wpf_data

w_wpf_codes

w_wpf_fields

时间列表

w_wpf_times

错误ID

w_wpf_errorid

请求ID

w_wpf_reqid

确定

取消

组合上传

组合名称

Wind帐号

调整日期

证券代码

证券数量

成本价格

买卖方向

2015/6/6

Long

增加

☒ 启用键盘精灵

调整日期

证券代码

证券数量

成本价格

买卖方向

运行设置

☒ 不运行

☐ 直接运行

数据列表

证券代码列表

指标列表

输出变量名

w_wupf_data

w_wupf_codes

w_wupf_fields

时间列表

w_wupf_times

错误ID

w_wupf_errorid

请求ID

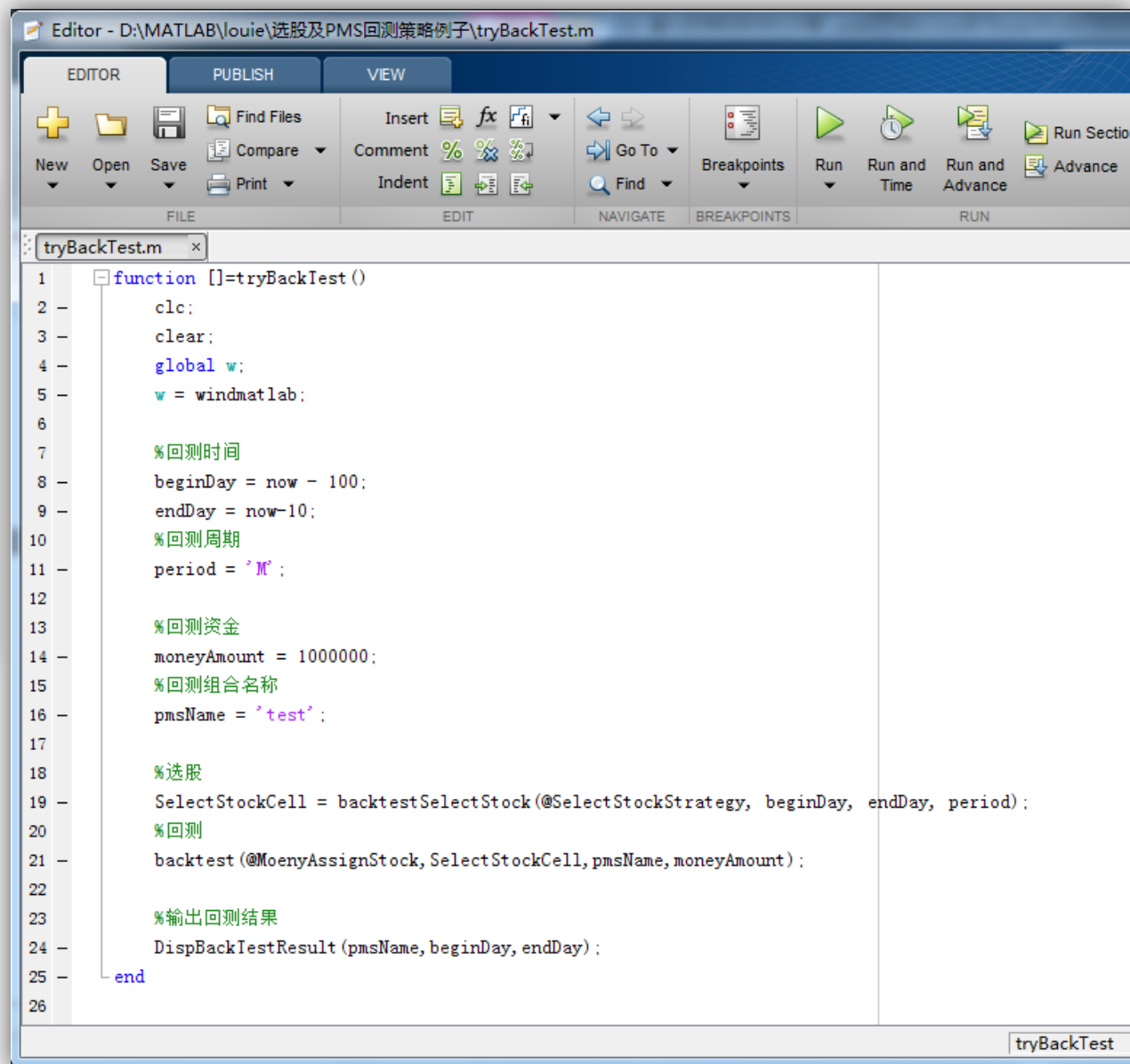
w_wupf_reqid

确定

取消

量化投资-示例代码

- backtest.m
- backtestSelectStock.m
- DispBackTestResult.m
- GetDataByField.m
- MoenyAssignStock.m
- OutputSelectStock.m
- readme.txt
- SelectStockStrategy.m
- tryBackTest.m
- WTTSTest.m



The image shows a MATLAB Editor window with the title bar "Editor - D:\MATLAB\louie\选股及PMS回测策略例子\tryBackTest.m". The window has three tabs: EDITOR, PUBLISH, and VIEW. The EDITOR tab is active, showing a toolbar with icons for New, Open, Save, Find Files, Compare, Print, Insert, Comment, Indent, Go To, Find, Breakpoints, Run, Run and Time, Run and Advance, and Run Section. The main editing area displays the following MATLAB code:

```
1 function []=tryBackTest ()
2     clc;
3     clear;
4     global w;
5     w = windmatlab;
6
7     %回测时间
8     beginDay = now - 100;
9     endDay = now-10;
10    %回测周期
11    period = 'M';
12
13    %回测资金
14    moneyAmount = 1000000;
15    %回测组合名称
16    pmsName = 'test';
17
18    %选股
19    SelectStockCell = backtestSelectStock(@SelectStockStrategy, beginDay, endDay, period);
20    %回测
21    backtest (@MoenyAssignStock, SelectStockCell, pmsName, moneyAmount);
22
23    %输出回测结果
24    DispBackTestResult (pmsName, beginDay, endDay);
25 end
26
```

The status bar at the bottom right of the window shows "tryBackTest".

量化投资-模拟交易

WTTTS 模拟交易 V3.4

W081449701-模拟证券账户 × W081449702-模拟期货账户-期货 × W081449703-模拟衍生品账户-期权 × W081449704-模拟港股账户-港股 ×

资金持仓

当日交易

历史成交

自选股

账户查询

修改密码

组合监控

账户重置

手续费

在线客服

资金持仓

刷新

币种	总资产	资金余额	可用金额	可取金额	证券市值	浮动盈亏
人民币	1,093,758,515.00	859,600,803.00	859,600,803.00	859,600,803.00	234,157,712.00	83,334,448.51

名称	持仓数量	可用数量	成本价	最新价	最新市值	浮动盈亏	盈亏率	占总资产比	占持仓总市值...	股票代码
深信泰丰 000034	7810600	7810600	9.15	20.00↓	156,212,000.00	84,723,921.38	118.51%	14.28%	66.71%	000077741
山西证券 002500	1268900	1268900	11.23	13.08↓	16,597,212.00	2,352,540.60	16.52%	1.52%	7.09%	000077741
雅戈尔 600177	1114400	1114400	12.78	14.42↓	16,069,648.00	1,824,495.68	12.81%	1.47%	6.86%	000077741
中金岭南 000060	1396500	1396500	10.20	11.24↑	15,696,660.00	1,452,499.65	10.20%	1.44%	6.70%	000077741
深圳能源 000027	1442200	1442200	9.87	6.84↓	9,864,648.00	-4,376,644.34	-30.73%	0.90%	4.21%	000077741
新潮中宝 600208	1719700	1719700	5.22	3.71↓	6,380,087.00	-2,598,294.73	-28.94%	0.58%	2.72%	000077741
乐视网 300104	30000	30000	49.41	--	1,764,000.00	281,556.00	18.99%	0.16%	0.75%	000077741
安泰科技 000969	130200	130200	11.39	12.87↓	1,675,674.00	192,253.32	12.96%	0.15%	0.72%	000077741
均胜电子 600699	49600	49600	29.91	32.63↓	1,618,448.00	134,936.80	9.10%	0.15%	0.69%	000077741
宁波华翔 002048	97600	97600	15.19	16.09	1,570,384.00	87,400.80	5.89%	0.14%	0.67%	000077741
飞乐音响 600651	115700	115700	12.82	12.56↓	1,453,192.00	-30,591.08	-2.06%	0.13%	0.62%	000077741
康得新 002450	42000	42000	35.27	32.52↓	1,365,840.00	-115,521.00	-7.80%	0.12%	0.58%	000077741
唐山港 601000	176600	176600	8.40	7.69↓	1,358,054.00	-125,933.46	-8.49%	0.12%	0.58%	000077741
天药股份 600488	228900	228900	6.48	--	1,313,886.00	-169,958.25	-11.45%	0.12%	0.56%	000077741
京能电力 600579	251900	251900	5.89	4.71↓	1,186,449.00	-297,821.37	-20.07%	0.11%	0.51%	000077741
平安银行 000001	3000	3000	10.39	10.51↓	31,530.00	375.00	1.20%	0.00%	0.01%	000077741

买入 F1

卖出 F2

代码

指定价

可买:0

数量

买入

卖五

卖四

卖三

卖二

卖一

买一

买二

买三

买四

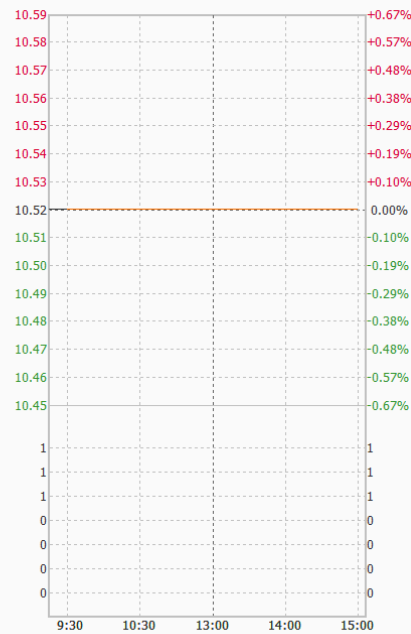
买五

涨停

跌停

分时

分笔



17:34:14

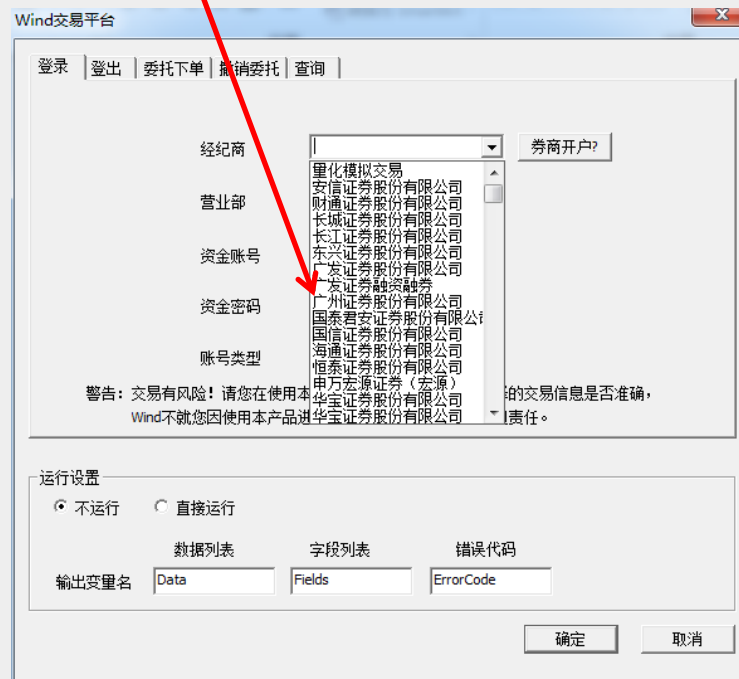
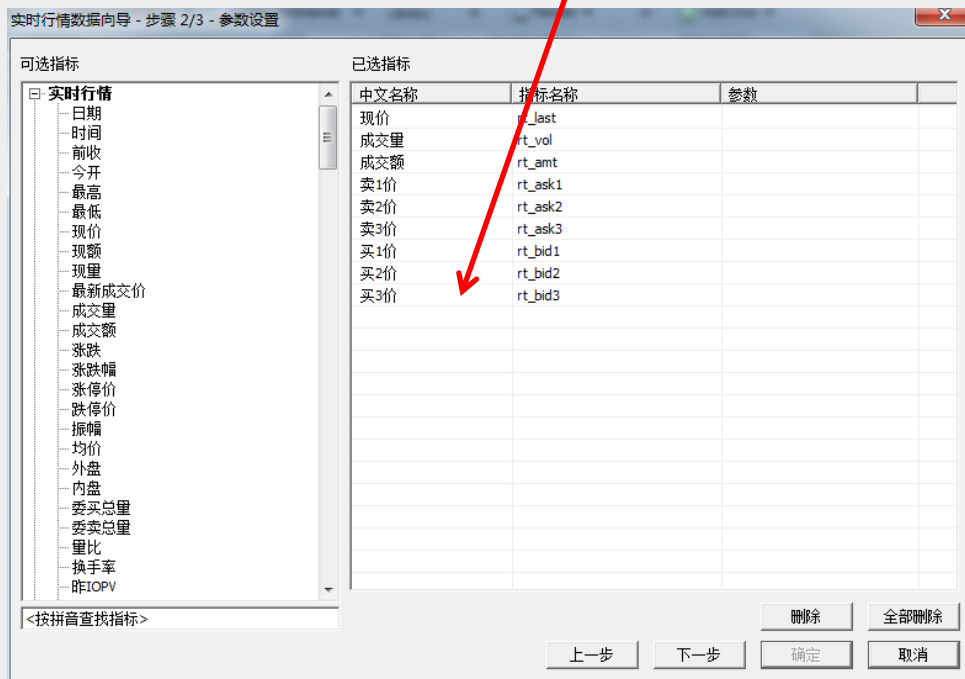
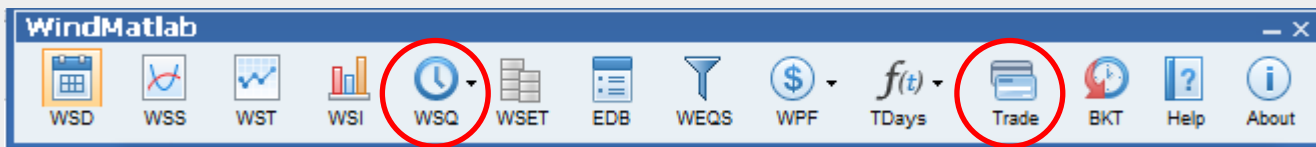
数据就是未来 Data is the Future



量化投资-实盘策略运行



量化投资-实盘策略运行





目录

CONTENTS

量化投资简介

Wind量化平台介绍

Wind量化平台使用案例

使用Wind平台进行量化投资

帮助获取方式

Wind量化接口使用帮助

群英會

推荐 | 固定收益 | 股票 | 商品与基金

让你的群加入群英会，将群名称与群号

MATLAB

65914

基于MATLAB的量化投资讨论群 交流MATLAB技巧，皆大欢喜，以...

959人

已加入

R交流群 (群号->60747)

60747

R是属于GNU系统的一个自由、免费、源代码开放的软件，它是...

937人

已加入

中国量化投资学会群 (群...

61546

以推动量化投资与对冲基金研究在中国的发展为目的，以学术...

1047人

已加入

策略研究

65313

策略分析门槛最低，几乎人人都能做出对市场和风格的判断；...

1418人

已加入

自然语言量化策略-100387

100387

大家一起探索一些自然语言方面测策略，涉及技术 搜索、机

81人

申请加入 >

中国量化交易群 (群号 59...

59289

策略、量化、交易、资管、DataFeed、Matlab、VBA

5181人

已加入

按住shift同时点击登录，触发强制升级流程，升级后修复插件

郑舒尹 [广州证券] 11:40:33

@李少鹏 [广东易赞投资管理有限公司] 我看了下数据，好像是持仓吧

周银燕 [深圳市汇百利财富国际资产] 12:40:44

主推新版项目 募集资金5000万 有资金的朋友可以联系 15014076298 QQ 986522383

李少鹏 [广东易赞投资] 13:41:37

@郑舒尹 [广州证券股份有限公司] 哦哦哦。那就是我记错了。。。

李少鹏 [广东易赞投资] 13:42:27

400委托失败:获取 (xxxx)品种的相关合约信息失败! 商品期货的。这是为什么?

李朝瑞 [西藏德传投资] 13:45:02

怎么得到 wind代码对应的名字?

群公告(群号:59289)

量化投资方方面面

公告:

1) 只想接收量化接口紧急消息的加群 105971

2) 导航界面或者命令生成器可以帮助产生语句; 文档、例子、问题可在大奖章中 www.dajiangzhang.com中找找。

群成员(3276/9655) 仅显示活跃成员

- Wind资讯 [Wind资讯]
- 韩洪卫 [Wind资讯]
- 张金其 [Wind资讯]
- 胡庆鹤 [Wind资讯]
- 张双喜 [北京凯恩德资产]
- 方齐荣 [中信证券]
- 李少鹏 [广东易赞投资]
- 郑舒尹 [广州证券]
- 沈子敬 [Wind资讯]
- 杜昭言 [山西证券]

数据就是未来 Data is the Future

搜索 话题/答案/人



新话题 | 模拟交易

注册

登录



首页

话题

新闻

投资机会

开放接口

应用模板



用户登录

邮箱/手机号

请输入密码

☒ 自动登录

登录

点击注册

忘记密码?



投资机会

行情监控
抓住每一次投资机会



话题讨论

思维碰撞
探讨各种投资话题



开放接口

量化金融
构建个性化投资系统

推荐话题

用 Python 写了个简单的股票量化交易框架 最新

集成了以前写的 [easytrader](http://github.com/shidenggui/easytrader) 和 [easyquotation](https://gith...

- 【通知】个人版API接口已升级
- 使用py2exe打包成exe程序

更多...

模拟交易排行榜



1 白连生

+ 关注

总收益率

33.96%



2 邵滔

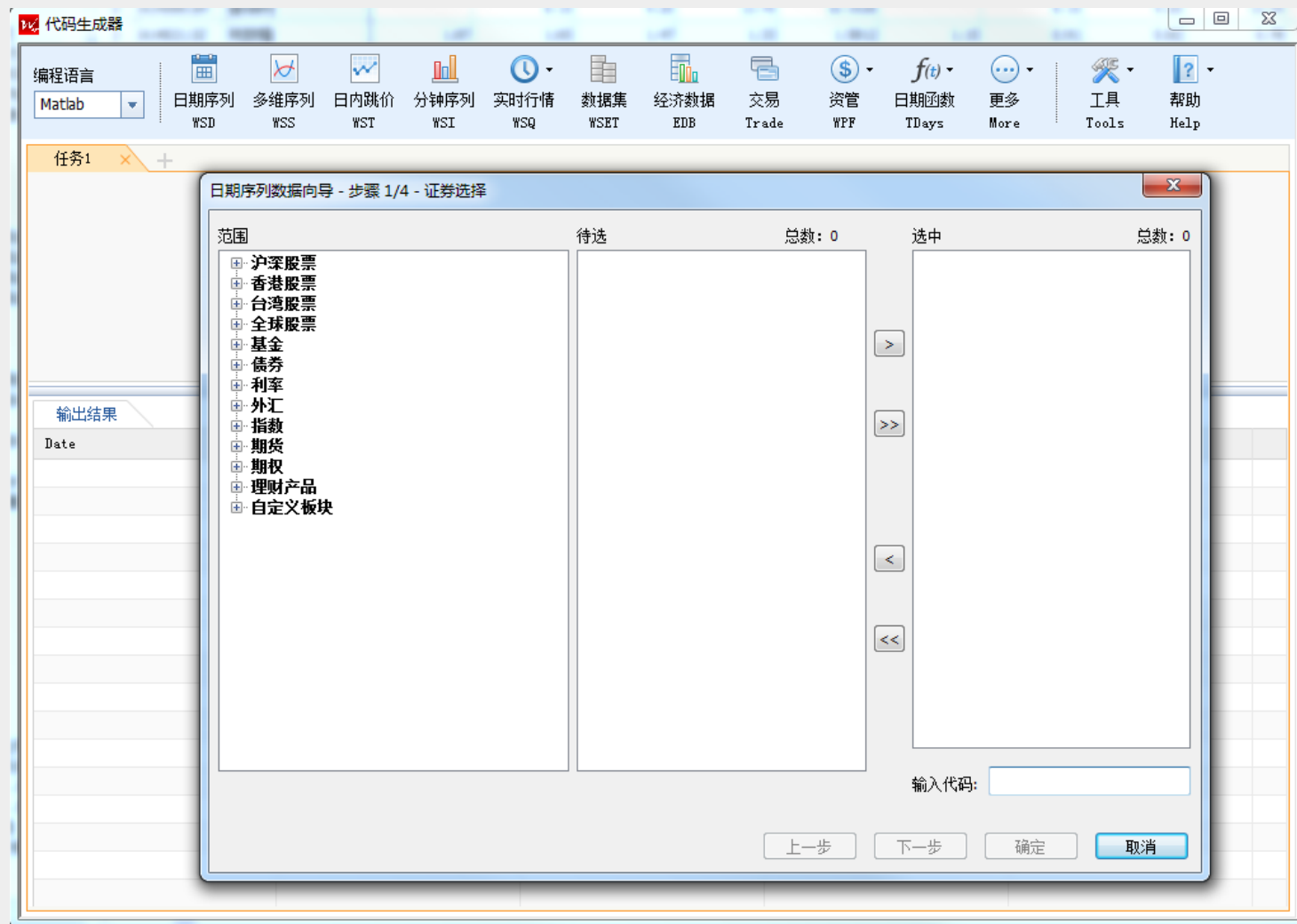
+ 关注

总收益率

13.46%

Wind量化接口-代码生成器

Wind金融终端->量化->开放接口->代码生成器 快捷键 **CG**



Wind量化接口帮助手册



Wind资讯金融终端 2015 - [量化交易平台]

文件 股票 债券 商品 外汇 基金 指数 新闻 宏观 资管 量化 市场 帮助

QNT 量化交易平台 联系客服

欢迎您, 您可以共享您的资源, 发布您的需求了 2016-01-21 周四

开放接口(Open API)					交流社区	
接口介绍	使用手册	案例大全	互动问答	付费包申请	iWind群	大奖章网站

在线手册

- ★ 用前必读 ★
- 接口安装说明
- 开放接口FAQ
- Matlab接口手册
- R语言接口手册
- Python接口手册
- VBA接口手册
- C++接口手册
- C#接口手册
- PMS策略回测
- 数据含义说明
- 错误码列表

离线手册下载

Wind量化平台-介绍	版本1.0 2.56MB	Wind量化平台-个人版安装说明	版本1.0 215.01KB
Wind量化平台-交易专题	版本1.0 474.77KB	Wind量化平台-常...	版本1.0 969.45KB
Wind量化平台-用户手册	版本1.1 831.42KB	Wind量化平台-用...	版本1.0 2.91MB
Wind量化平台-用户手册(R语言)	版本1.0 3.17MB	Wind量化平台-用...	版本1.0 4.95MB
Wind量化平台-用户手册(Python)...	版本1.1 2.89MB	Wind量化平台-用...	版本1.2 1.32MB
Wind量化平台-用户手册(C++)...	版本1.1 2.07MB	Wind量化平台-用...	版本1.0 450.41KB

Wind资讯 金融终端

QNT 量化交易平台

IQNT.0 INTELIQUENT INC

TQNT.0 TRIQUINT SEMICONDUCTOR INC

68946.HK 恒指高盛四七牛T

更多...

130 +0.0036 QNT

Wind量化接口参考应用案例

Wind 资讯金融终端 2015 - [量化交易平台]

文件 股票 债券 商品 外汇 基金 指数 新闻 宏观 资管 量化 帮助

CNS 60 F9 F6 WEI W/P HKS 7 6 NEWS RPP 5 BMCN

Wind QNT 量化交易平台 联系客服

欢迎您, 您可以共享您的资源, 发布您的需求了 2015-09-21 周一

开放接口(Open API)					交流社区	
接口介绍	使用手册	案例大全	互动问答	付费包申请	iWind群	大奖章网站

数据获取 交易案例 综合案例

全部语言

Matlab

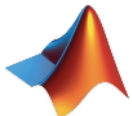
VBA

R语言


Python


C++


C#


**Matlab案例汇总** ★★★★★
简介: Matlab案例汇总, 包括获取数据、交易、综合应用等方面的案例
下载926次 56.57KB 开发语言Matlab
下载


**Matlab选股及PMS回测策...** ★★★★★
简介: 该案例是以HS300为基准做的策略模型, 并使用PMS对策略进行回测。
下载48614次 9.08KB 开发语言Matlab
下载


**Alpha套利股票组合下单...** ★★★★★
简介: 实现功能: 1. 可自动添加股票代码, 记录组合指数 2. 自动画图, 时间频率可自由更改, 但不支持历史
下载253次 4.13MB 开发语言VBA
下载

**wsq订阅数据** ★★★★★
简介: 该案例是基于Python语言使用wsq函数订阅数据, 然后存储到硬盘中。
下载14587次 0.77KB 开发语言Python
下载

**量化选股交易演示VBA模...** ★★★★★
简介: 量化选股交易演示VBA模板, 该模板演示从量化选股到交易的整个流程
下载488次 624.54KB 开发语言VBA
下载

**相关性计算模板** ★★★★★
简介: 该模板可计算各个股票或者期货之间的相关性
下载165次 95.72KB 开发语言VBA
下载

**股指期货与组合动态指...** ★★★★★
简介: 实现功能: 1. 可自动添加股票代码, 记录组合指数 2. 自动画图, 时间频率可自由更改, 但不支持历史
下载199次 498.5KB 开发语言VBA
下载

**分级基金套利监控 (VB...** ★★★★★
简介: 该案例是在Wind量化接口基础之上开发的分级基金套利监控应用, 包括普通分级监控以及上交所分级
下载197次 420.14KB 开发语言VBA
下载



谢谢!