## 算法交易问题汇总

1. 使用算法交易，如何计算节省的交易成本？

答：统计上将，A股买卖价差大概在17个BP左右。使用算法进行交易，与市场均价价差大概是4.22个BP，因此可以节省约12个BP左右的交易成本（17-4.22）。以一年20倍换手率计算，节省的交易成本大概为2.4%，也就意味着收益提高2.4%。

1. 算法交易如何与客户的系统对接？

答：我司已经与恒生系统提供商签订了战略合作协议，对公募、保险等机构类客户（使用恒生O32资管系统），一般采用专线对接的方式，将我司的算法直接接入到O32资管系统中。如果是私募类客户，我司提供的PB、迅投、根网系统都已经嵌入了算法交易服务，客户可直接使用。

1. 已经在PB系统中开户的客户，使用算法交易是否需要单独申请？

答：不需要。

1. 算法交易是否可以用来抢单？

答：算法交易不适合此类操作。

1. 算法交易是否支持商品期货？

答：目前没有支持。

1. 算法交易是否会因为替代人工下单，而遭到客户交易人员的抵触？

答：算法交易是提高交易员工作效率的重要工具，本质上并不是要替换交易员。通过支持【人工干预委托】的方式，算法交易支持交易员充分发挥其个人的主管能动性，不存在互相否定的问题。

1. 算法交易中的Algo风控系统具体包括哪些内容？

答：具体包括：

1）不创日内新高新低

2）不发涨跌停单

3）不在交易所报出巨量单

4）不超过交易所规定的单笔最大值

5）不造成价格异动-最新成交价

6）不造成价格异动-最新区间价

7）撤单率的控制

8）市场占比方面的控制

1. 减持类客户是否适合使用算法交易，应该如何使用？

答：算法交易非常适合减持类客户的使用，能够在不影响市场的同时，达到客户减持的目的。