迅投 QMT 极速策略交易
系统说明文档

北京睿智融科控股股份有限公司

二〇二三年

目录

1. 概述 1
2. 交易终端运行环境 1
2.1. 系统配置 1
2.2. 网路配置 2
2.3. 行情源选择 2
2.4. 登录界面 3
3. 功能模块总述 6
3.1. 我的板块 9
3.1.1. 主页界面 9
3.1.2. 模型研究 10
3.1.3. 模型交易 28
3.2. 行情模块 33
3.2.1. 管理面板 35
3.2.2. 行情报价界面 49
3.2.3. 个股分析界面 63
3.2.4. 个股分时界面 76
3.2.5. Level2 行情界面 85
3.2.6. 行情模块快捷键汇总 94
3.3. 交易模块 95
3.3.1. 账号管理 96

3.3.2. 交易服务 97
3.4. 极简模式 247
3.4.1. 股票交易 248
3.4.2. 信用交易 249
3.4.3. 港股通 250
3.4.4. 策略交易 251
3.4.5. 其他 ..... **错误！未定义书签。**
3.5. 投资研究 282
3.6. 其他设置 284
3.6.1. 顶部工具栏 284
3.6.2. 底部状态栏 285
3.6.3. 设置 294
3.6.4. 操作 377
3.6.5. 布局 396
3.6.6. 当前账号 398
3.6.7. 用户协议 398
3.6.8. 交易 399
3.6.9. 帮助 399
3.6.10. 回转交易 399
3.6.11. 换肤 400
4. 附录 402

1. 概述

迅投QMT极速策略交易系统是一款专门针对券商、期货公司、信托等机构的高净值客户开发设计的集行情显示，投资研究，产品交易于一身，并自备完整风控系统的综合性平台。其自带的行情显示系统可以灵活显示沪深两市所有类型股票、债券和国内五大期货交易所所有合约的实时行情；自带投研量化平台可以灵活实现CTA，无风险套利等多种量化策略，并能够对策略进行回测检验和自动化交易；支持股票交易、期货交易、融资融券交易、组合交易等多种交易类型，可以实现对冲下单，组合下单，以及高度灵活的算法交易，并支持对多个资金账号进行批量化的管理；多层次并行风控的处理方式，可以对单一帐号、多个帐号分别同时进行不同规则的风控检查，大幅降低交易延迟、提高风控执行效率。同时，迅投QMT极速策略交易系统还支持完整数据导入导出等诸多功能。

2. 交易终端运行环境

2.1. 系统配置

操作系统	Windows® 10 64-bit
处理器	Intel® Core™ i7-7770或更高配置
显卡	Intel® HD Graphics 4400
内存	8 GB RAM
储存	SSD 200G可用空间
网络	10M及以上

分辨率	1920×1080

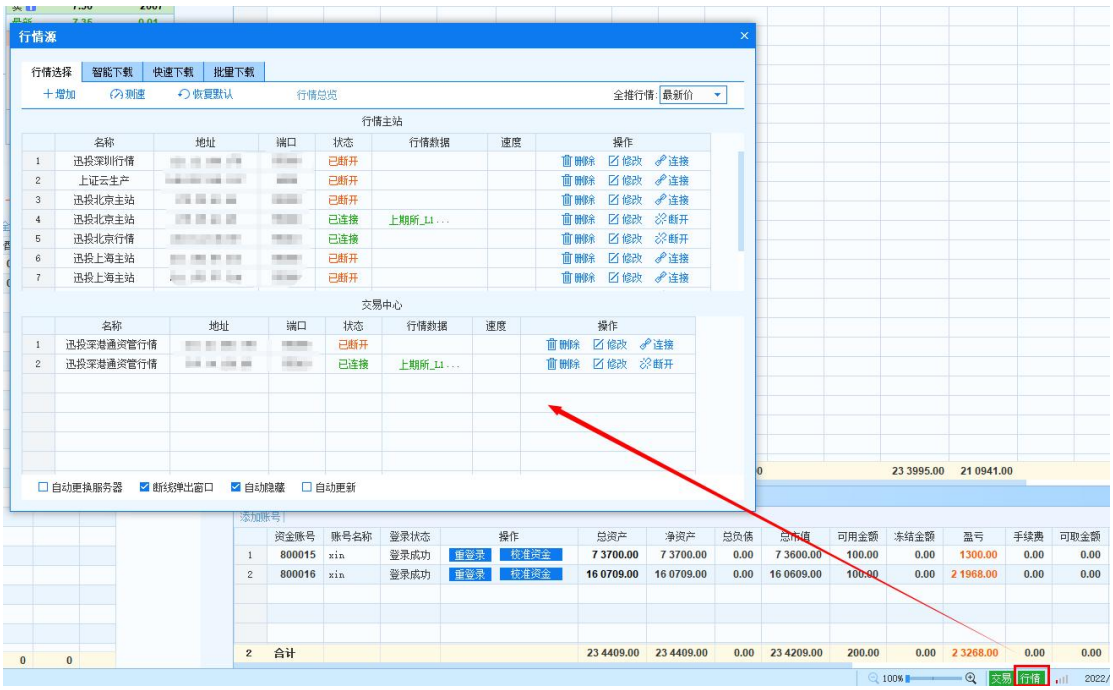
推荐配置

2.2. 网路配置

服务器建议网络使用百兆及以上网络接入，客户端网络建议 10 兆以上网络接入。

2.3. 行情源选择

用户可在行情源选择中添加所需使用的行情源。



通信设置行情选择界面

行情选择：行情选择中包括行情主站和交易中心。行情主站指行情界面的行情来源，交易中心指交易界面盘口的行情来源。

行情选择支持自动更新、自动更换服务器、断线弹出窗口、自动隐藏四种。

自动更新：自动更新行情地址。

自动更换服务器：某一行情源断开后，不会重新连接，会寻找下一个可用行情源。

断线弹出窗口：某一行情源断开后，自动弹出行情源设置窗口。

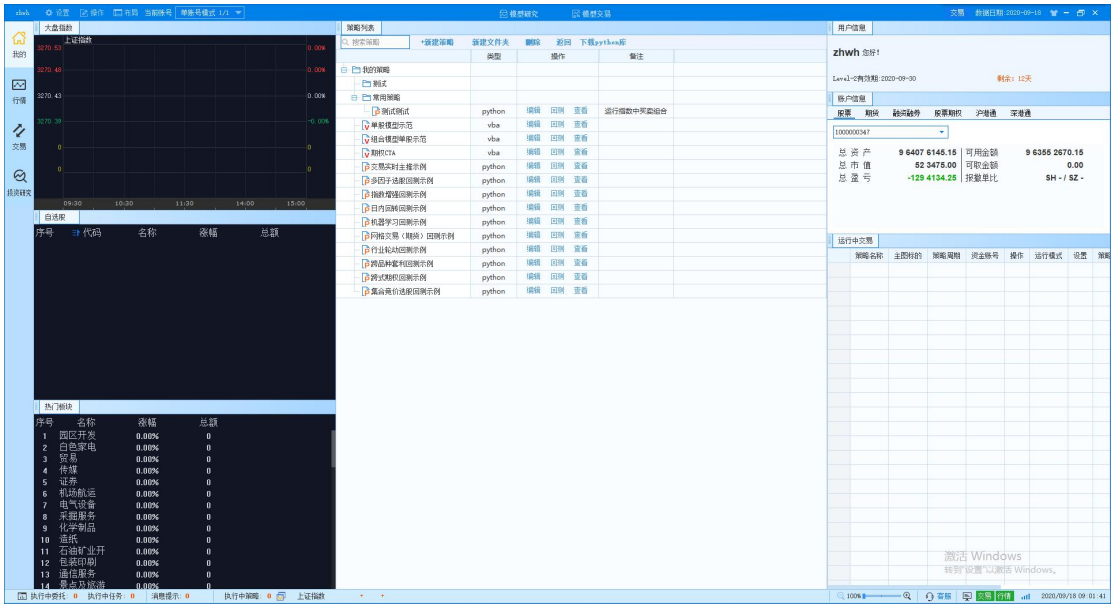
自动隐藏：“断线弹出窗口”开启后生效，断线并重连成功后，行情源设置窗口自动隐藏。

2.4. 登录界面

登录界面

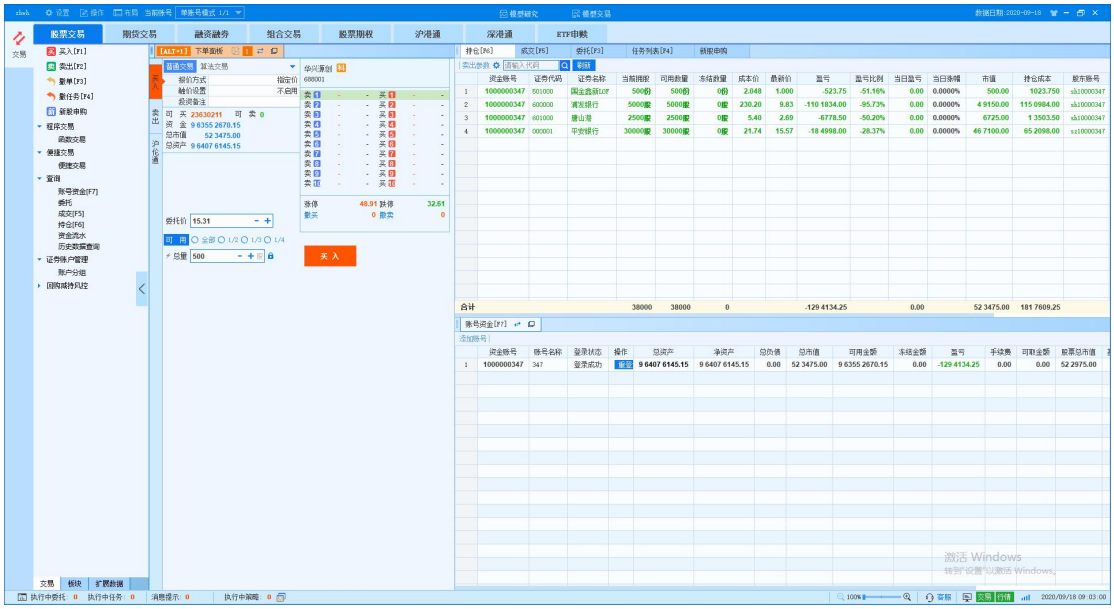
输入正确的用户名密码及验证码后可正常登录（资金账号登录模式下直接输入资金账号及对应的交易密码，需要该资金账号已添加至管理端账号白名单），若出现输入错误或网络问题导致无法正常登录会出现相应的提示，可在通信设置中进行修改，或联系对应的人员帮助解决。

“行情+交易”：登录进入系统后，可同时查看行情信息并进行交易。



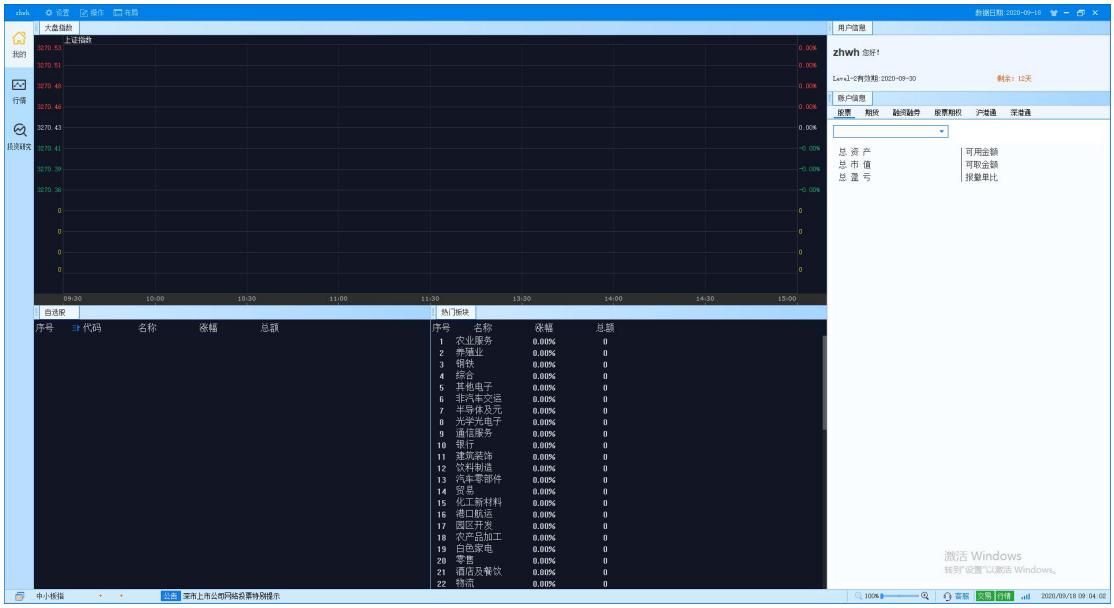
行情+交易

“独立交易”：登录进入系统后，可进行交易。



独立交易

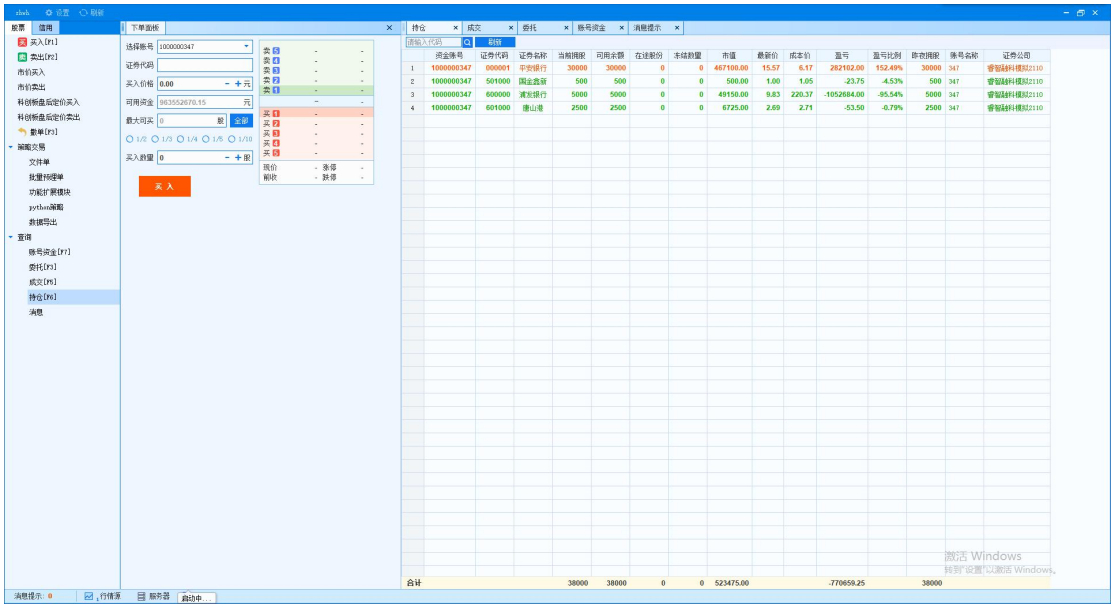
“独立行情”：登录进入系统后，仅可查看行情。



独立行情

“记住密码”功能可以使用户操作起来更加方便、快捷（资金账号登录无此项功能）。

“极简模式”：登录进入系统后，进入极简模式（详见3.4.极简模式）。



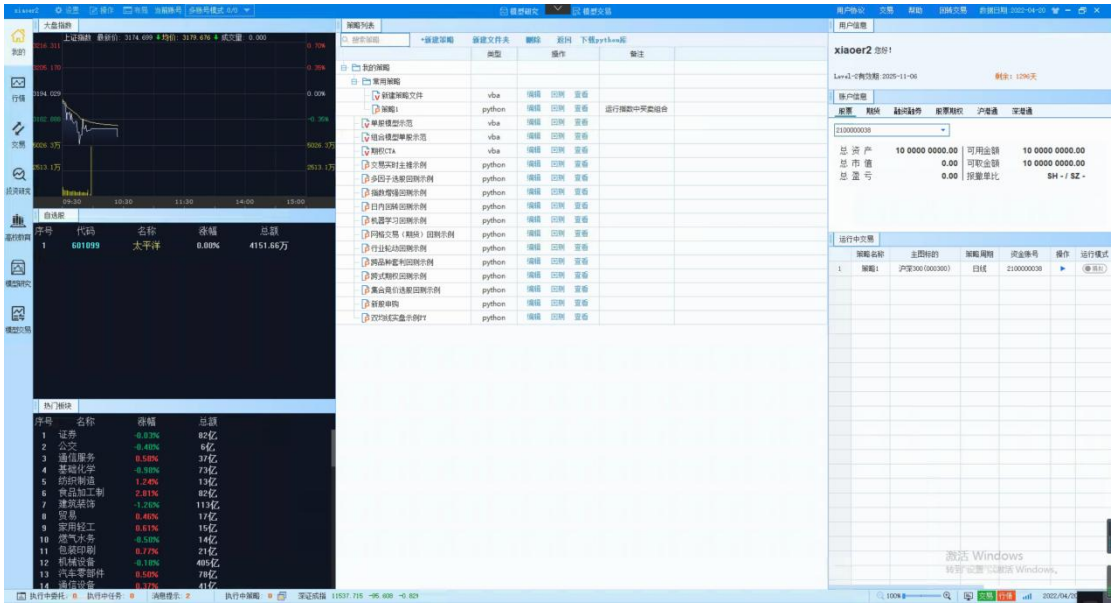
极简模式

“意见反馈”窗口可随时提出意见反馈，相应客服人员会在第一时间进行处理。

“系统信息”窗口可以查看系统信息，可以复制和导出系统信息的内容。

3. 功能模块总述

迅投 QMT 极速策略交易系统涵盖三大功能板块：我的板块，行情板块和交易板块。



我的板块

我的板块主页界面： 主要包括大盘指数、自选股、热门板块、策略列表、快速交易、用户信息、账户信息和运行中交易 8 个模块。

模型研究：主要提供技术指标和自定义策略模型指标的研究、编辑和回测。

模型交易：添加的模型策略，可选择模拟盘或实盘运行。模型运行过程中，会有相应的模型交易信号，输出日志，持仓，委托和成交产生。

行情板块

模型：模型中指标包括搜索框、技术指标、组合模型、我的策略和系统策略，指标建模支持 VBA 和 Python 两种语言。

技术指标包括：PYTHON 模型指标、摆动指标、财务指标、常用模板、超买超卖指标、成交量指标、反趋向指标、基差指标、量价指标、能量指标、强弱指标、趋向指标、压力支撑指标、特色指标、因子函数、择时策略示范等；

组合模型包括：模板（系统预置的多个组合模型的示例）；

我的策略包括：常用策略以及系统预置的回测示例（如：交易实时主推示例、机器学习回测示例、指数增强回测示例等）；

系统策略包括：网格策略、尾盘闲置资金自动逆回购、期权网络、期货网格。

板块：板块用于行情报价,包括我的、沪深板块，沪市板块，深市板块，京市板块、期货板块，期权板块，指数板块，自定义指数板块，持仓板块，全球市场、扩展数据、WIND 数据库、过期合约。

扩展数据：包括搜索框、扩展数据、多因子库、宏观经济指标、外部数据。

交易板块

交易类型菜单栏：分为股票交易、期货交易、融资融券、组合交易、深港通、沪港通和 ETF 申赎等，可以方便、快捷切换到各种模块进行交易。

快捷工具栏：该区域展示各种快捷按钮，有操作和设置按钮，操作中包含数据管理、布局、查看（根据当前界面的交易类型，显示不同的选项）、复制、置顶、锁定布局、锁定终端、画图工具、星空图、龙虎榜等，设置中可进行系统各项设置。

交易功能导航栏:在交易界面快捷导航到各个所需要的界面，鼠标左键单击即跳转，根据交易类型不同，交易功能导航栏的功能也不同。包括买入、卖出、撤销任务、撤单；程序交易中的函数交易、便捷交易；查询资金账号、当日委托、当日成交、当日持仓、资金流水和历史数据查询；以及账号分组，银证转账和划拨功能等。

交易面板：交易面板包括下单面板，任务列表。

查询面板：查询面板包括资金账号，当日委托，当日成交，当日持仓，资金流水。

其他面板：包括自选股，股票列表，消息提示，行情图形。

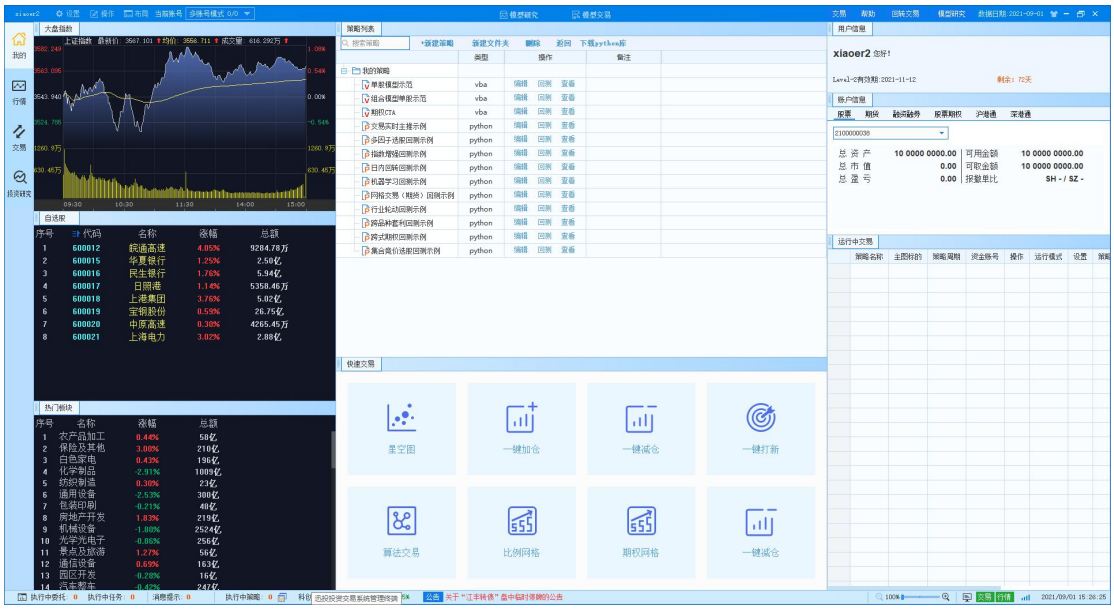
状态栏：该栏包括执行中委托，执行中任务，消息提示，执行中策略，上证指数（深证成指，创业板指，沪深300，科创50等主要指数轮动），极简交易，交易所公告，字体扩大，客服，便捷交易、批量埋单、CSV预埋，账号登录状态，行情源，网络延时等功能的快捷键。

3.1. 我的板块

我的面板作为一个集合视图，主要为用户提供便捷的模型研究、模型交易入口，同时，也能让用户更方便的查看大盘指数、自选股和账号等多种信息。

3.1.1. 主页界面

主页界面为用户展示大盘指数、自选股、热门板块、策略列表、快速交易、账户信息以及运行中的模型交易等信息。



主页界面

大盘指数：展示大盘指数的价格走势，便于用户了解整个股票市场的行情。

自选股：展示用户自己的自选股。双击可切换到行情板块个股分时图。

策略列表：列举用户自定义的模型策略指标，可编辑，回测和查看历史操作。

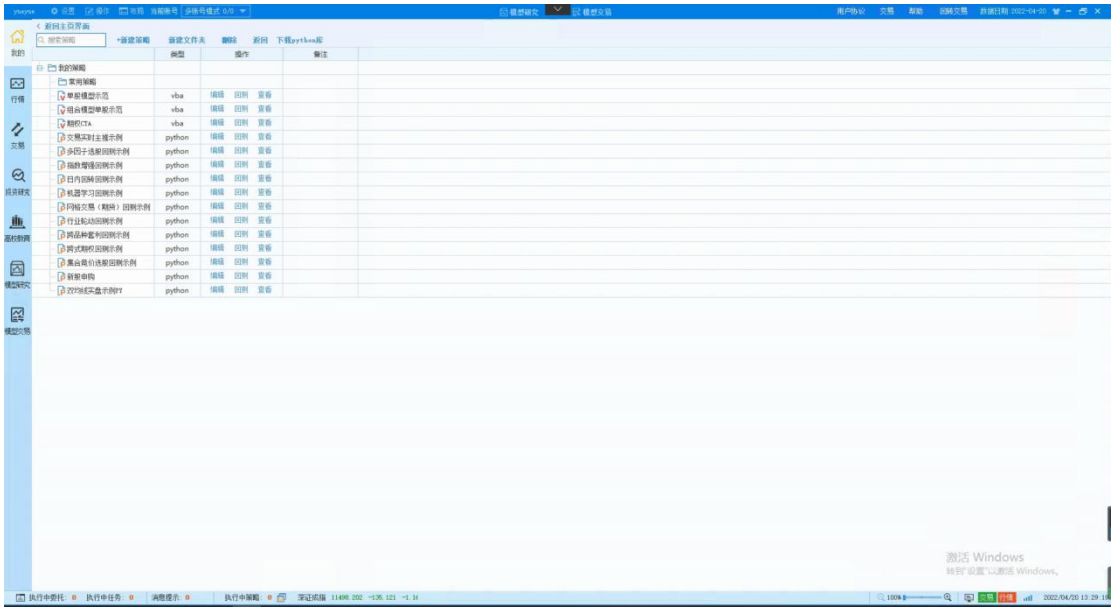
快速交易：点击图标后可快速跳转到对应功能，快速交易面板中的功能项和顺序可在管理端进行设置。

用户信息：展示用户名及该用户的 level2 权益。

账户信息：展示用户的账户信息，包括资产、市值、盈亏等，多账号情况下可在下拉菜单中选择不同的资金账号进行展示。

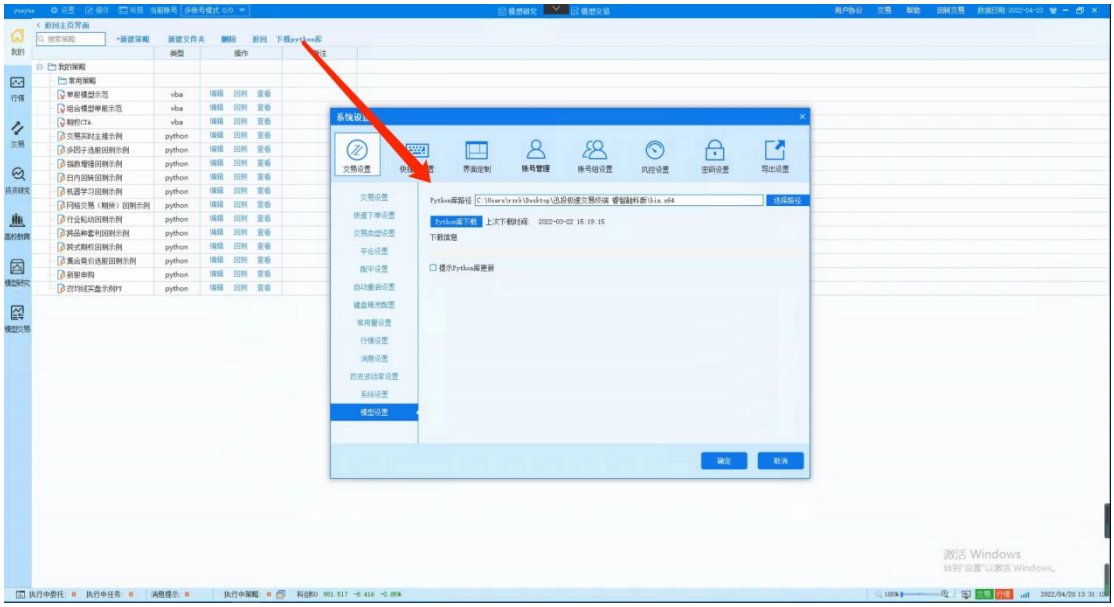
运行中交易：列举用户添加的模型交易以及相应的运行模式和状态。

3.1.2. 模型研究



上图——模型研究页面

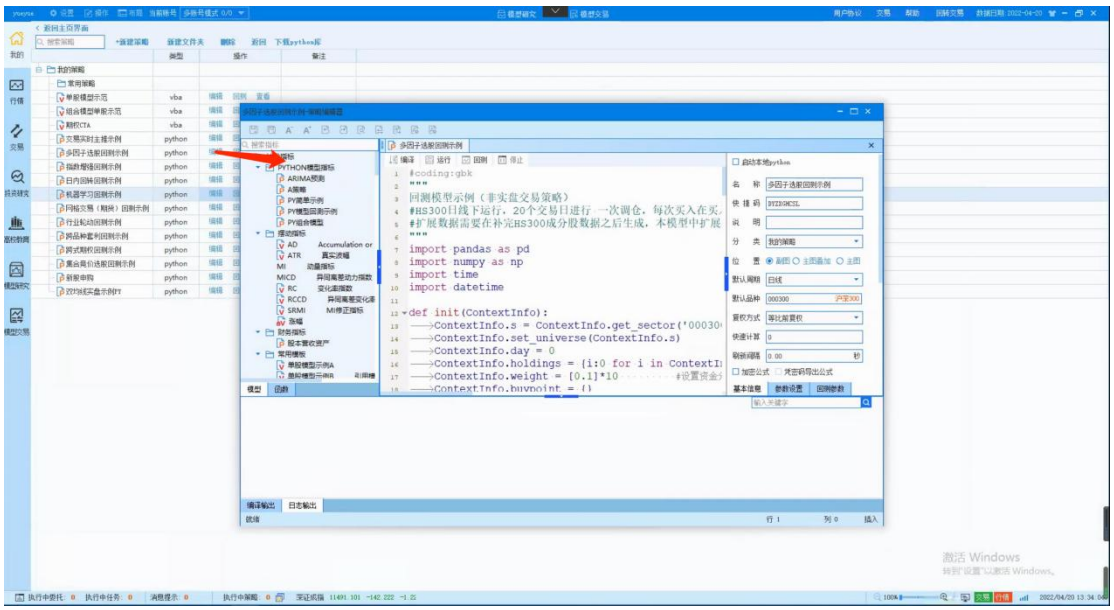
用户在使用模型功能前，需先下载模型运行所需的 python 库。点击下载 python 库后，弹出模型设置界面，可选择 python 库的路径，并展示相关的下载信息。在此页面中再次点击“python 库下载”即可。



3.1.2.1. 创建模型

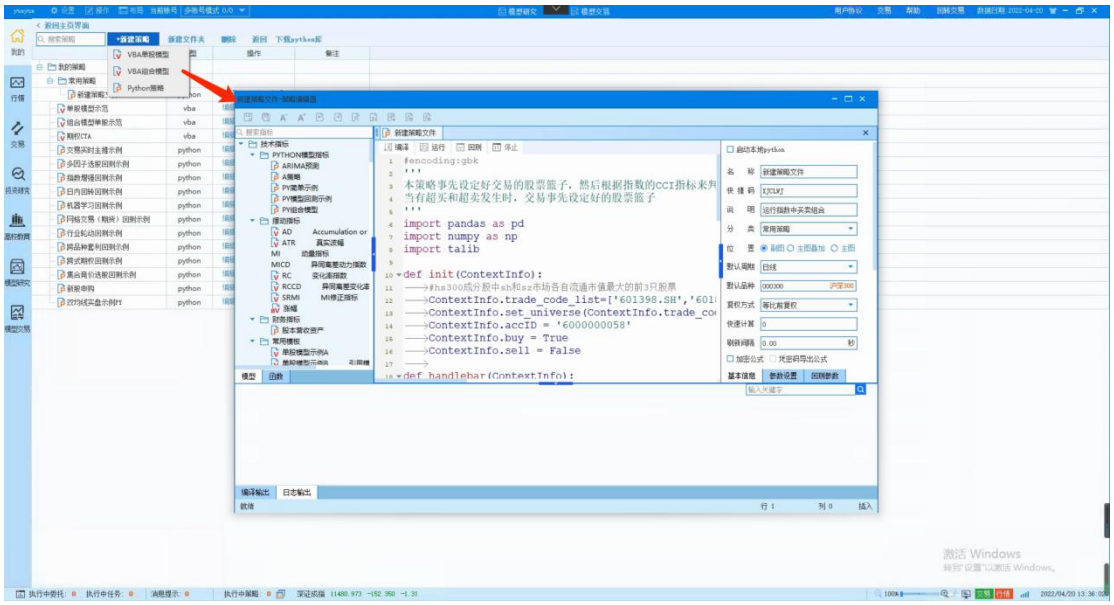
在「主页界面」或者「模型研究」界面，用户可创建自己的模型，模型创建方法有两种：

方法一，使用系统预置的各种示例模型，点击后方“编辑”按钮，并在弹出的「模型编辑器」中以此示例模型代码为基础进行编写。



我的主页—编辑模型

方法二，点击“新建模型”按钮并选择模型语言类型，在弹出「模型编辑器」中从头开始实现一个用户自己的量化模型。



我的主页—新建模型

在新建模型时有三个选项，分别为：

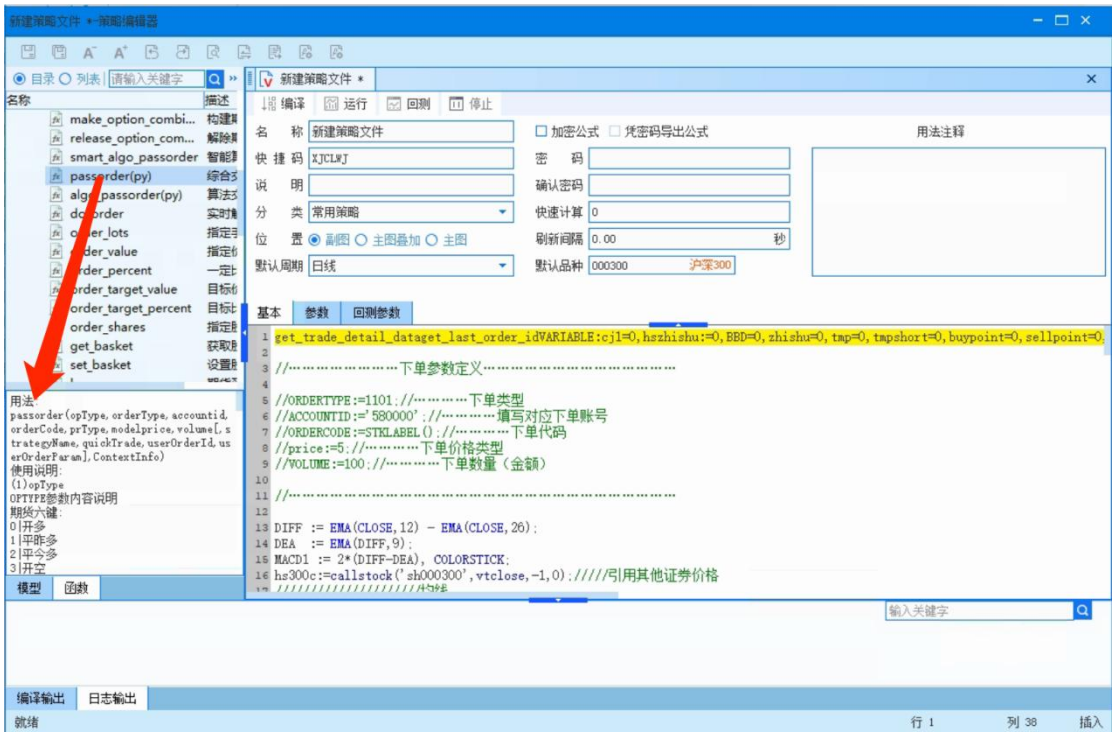
VBA 单股模型：适用于单个标的的择时和买卖信号的触发、以及各种技术指标的开发。

VBA 组合模型：分为母模型和子模型两部分，其中子模型与单股模型使用同一编辑窗口，主要负责向母模型传递买卖信号和各种择时参数。母模型主要承担股票篮子管理与综合收益计算等功能。

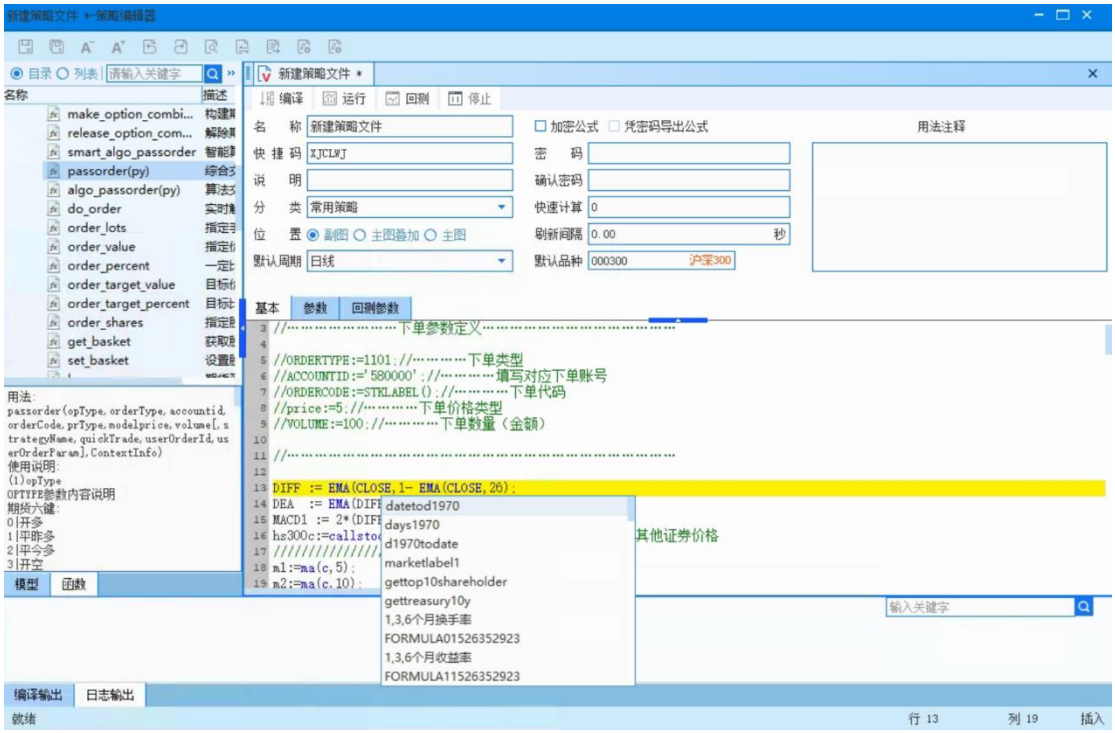
Python 模型：适合开发各种单股、组合策略。

本系统支持 VBA 和 Python 两种语言进行模型开发，VBA 模型框架兼容市面上常用交易终端的指标语言，内部封装了大量功能强大、简洁易用的函数，供用户快速开发使用，而且通过迅投独家模型解析转换和多线程加速技术，运行和回测效率远超同类平台。Python 模型框架则更为灵活，在授权允许的情况下，支持导入各种第三方包，且兼容主流社区型量化平台的回测框架，用户可无缝切换至迅投 QMT 系统。

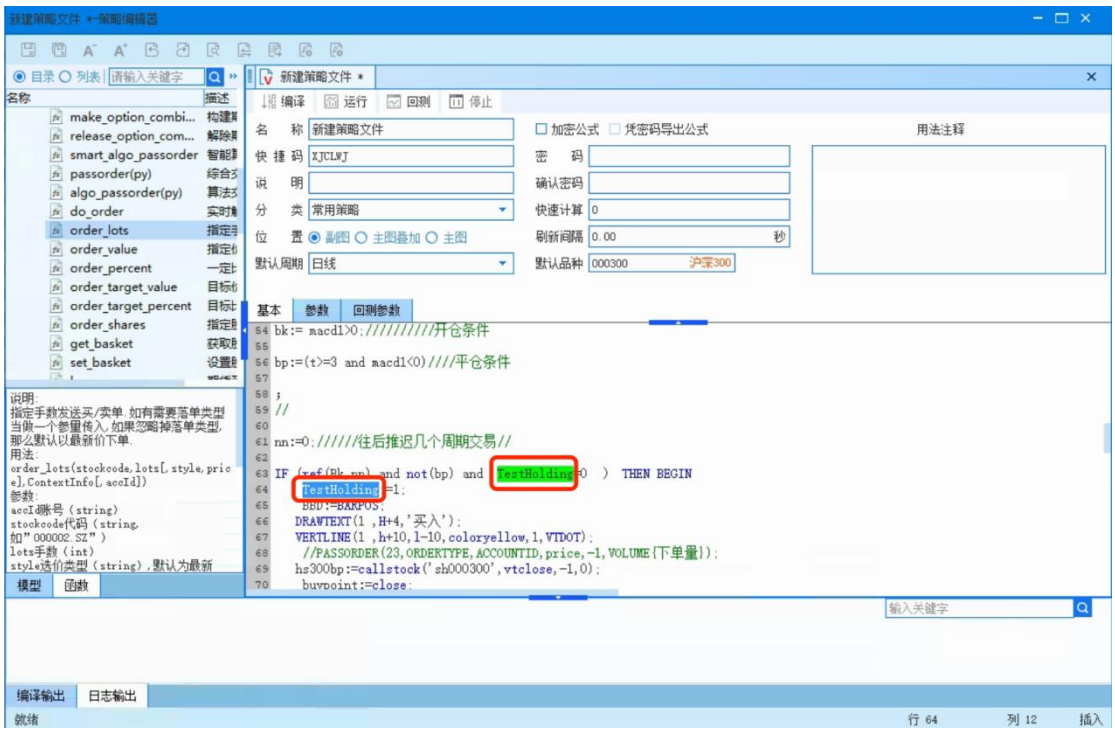
创建模型时，会弹出「模型编辑器」窗口，「模型编辑器」是迅投专门为模型开发者设计的、集成了模型列表、函数列表、函数帮助、模型基本信息、参数设置、回测参数等多个部分，拥有代码高亮、自动补全等特色功能的便捷的模型编辑、开发环境。详细的模型编辑教程见知识库或帮助手册。



模型编辑器—函数帮助



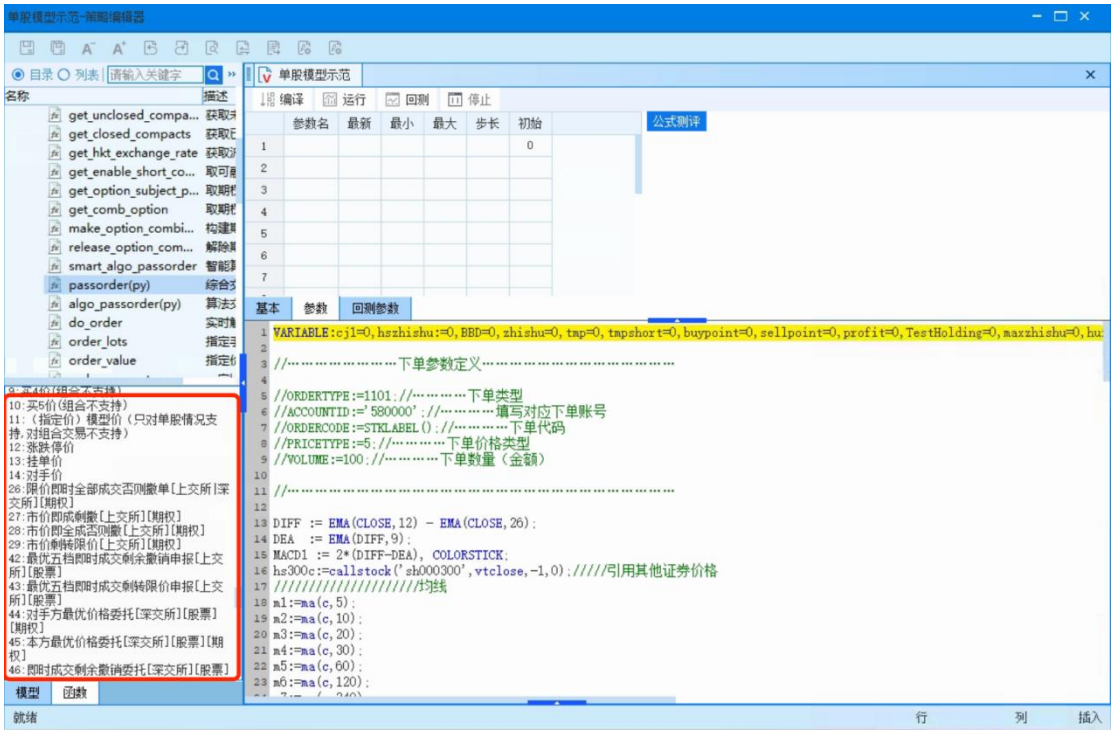
模型编辑器—代码补全



模型编辑器—选中相同代码高亮

目前我们的策略模型编写中支持交易所市价报价方式，针对不同的交易类型

以及交易所规则，支持各类报价方式：



各类交易所市价报价方式

在创建完模型之后，应对模型的基本信息和回测参数进行设置，**基本信息包括：**

启用本地 python：勾选后此项后，在模型编辑器中点击运行，或在策略交易中运行该策略，默认使用用户本地的 python 环境运行。

名称：填写模型名称；

快捷码：默认根据模型名称自动生成拼音首字母拼写，如需自定义可以手动进行更改，用于键盘精灵快速引用模型；

说明：简单的说明模型功能；

分类：保存当前模型到某个分类下面；

位置：模型回测或运行时的位置，有副图、主图叠加、主图三种显示位置；

默认周期：点击模型回测或运行时的默认主图周期，可手动切换；

默认品种：点击模型回测或运行时的默认主图品种，可手动切换；

复权方式：提供不复权、前复权、后复权、等比前复权、等比后复权 5 种复权方式；

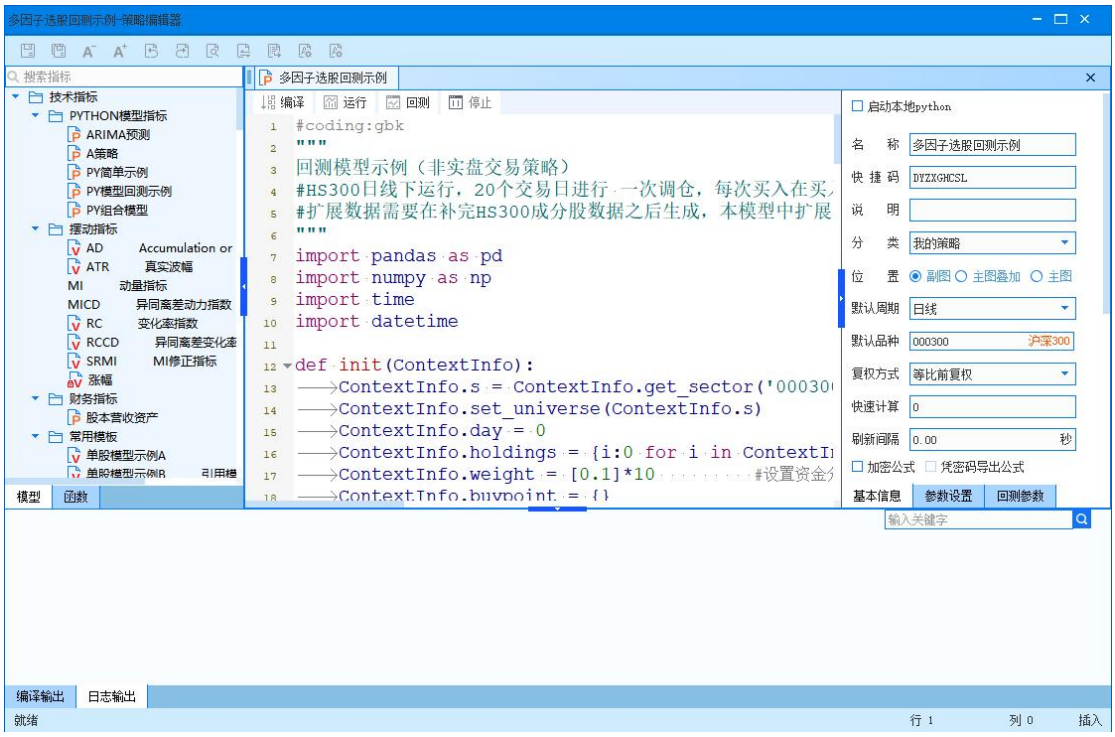
快速计算：限制计算范围，默认为 0 时模型运行时会从模型设置的默认品种（主图）的第一根 k 线开始计算，设置为 n 则从当前 k 线再往前 n 个 k 线开始计算；

刷新间隔：用来设置策略运行的时间间隔。设置了刷新间隔，即每隔一段时间策略按照当前行情运行一次；

加密公式：加密后的公式只有输入密码才可以查看源代码；

凭密码导出公式：此项只有在开启“加密公式”后才能生效，生效后只能使用密码导出到本地。

用法注释：简短的说明模型使用的一些注意项。

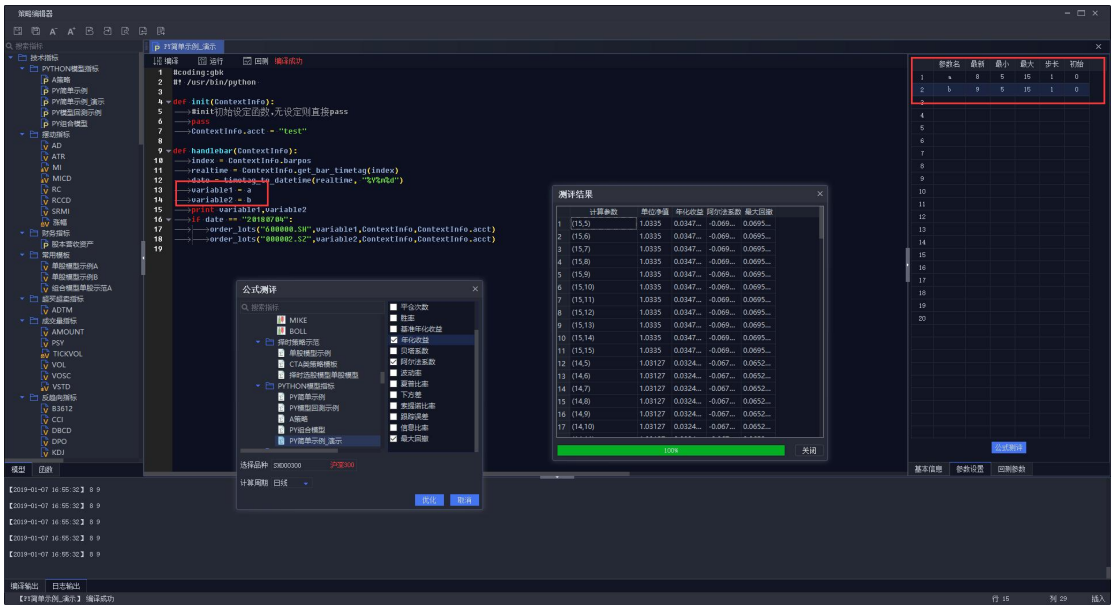


模型编辑器—基本信息设置

参数设置中参数名为变量名，模型中可以调用。最新值为变量默认值，运行

/回测模式使用。

最小/最大/步长项，为遍历参数。初始项可不填。最小/最大都是包含在遍历区间内的，如图所示，a，b 两变量，5-15，步长为 1，会遍历 11 * 11 种组合。



模型编辑器—参数设置

点击公式测评，可选择回测模式支持的指标，如单位净值，最大回撤等，作为评价标准。点击优化，评测结果弹窗显示不同参数变量组合下的回测结果。可点击所需指标进行排序。

测评完成后，用户可根据测评结果，选取最优的值赋给对应的参数。

模型的基本信息和回测参数设置完毕后，点击编译，可以查看模型编译情况，如果编译失败，请检查模型代码是否有误，并进行修正后再次编译，如果编译成功，则终端会自动保存模型的相关代码及设置到本地。

回测参数包括：开始时间、结束时间：设置模型回测时间区间；

基准：设置模型收益的参考基准；

初始资金：设置模型回测的初始资金，回测时系统使用一个虚拟账号进行交易操作，在此处为该虚拟账号设置资金量。代码中可使用 ContextInfo.capital

进行设置；

保证金比例：设置期货的保证金比例；

滑点：设置回测撮合时的滑点，模拟真实交易的冲击成本,在代码里通过使用 ContextInfo.set_slippage 函数来设定；

手续费类型：支持按成交额比例或者固定值计算手续费,代码里通过 set_commission 函数来设定；

买入印花税：设置买入印花税比例，代码里同样通过 set_commission 函数来设定；

卖出印花税：设置卖出印花税比例，代码里同样通过 set_commission 函数来设定；

最低佣金：设置单笔交易的最低佣金数额，代码里同样通过 set_commission 函数来设定；

买入佣金：设置买入标的时的佣金比例，代码里同样通过 set_commission 函数来设定；

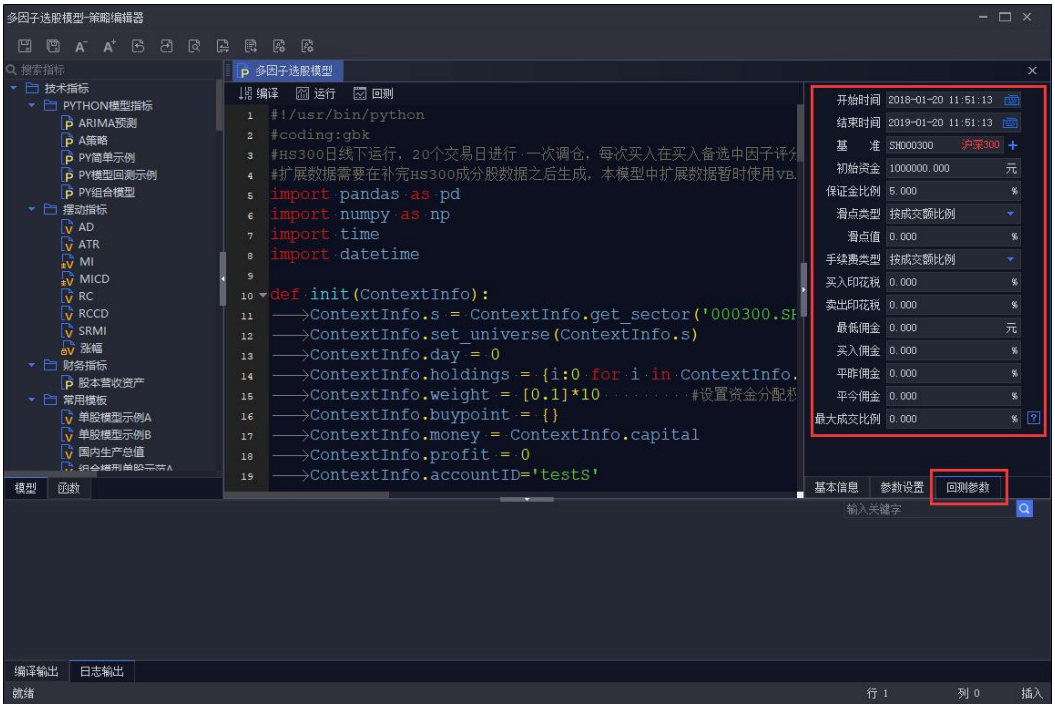
平昨佣金：设置股票、期货平昨佣金比例，代码里同样通过 set_commission 函数来设定；

平今佣金：设置期货平今佣金比例，代码里同样通过 set_commission 函数来设定；

最大成交比例：控制回测中最大成交量不超过同周期（行情周期）成交量*最大成交比例，例如运行周期为 1 分钟线，最大成交量比例设置为 10%，则回测时，最大成交量比例不超过 1 分钟成交量*最大成交比例 10%，最大成交比例设置为 0，则不限制成交比例；

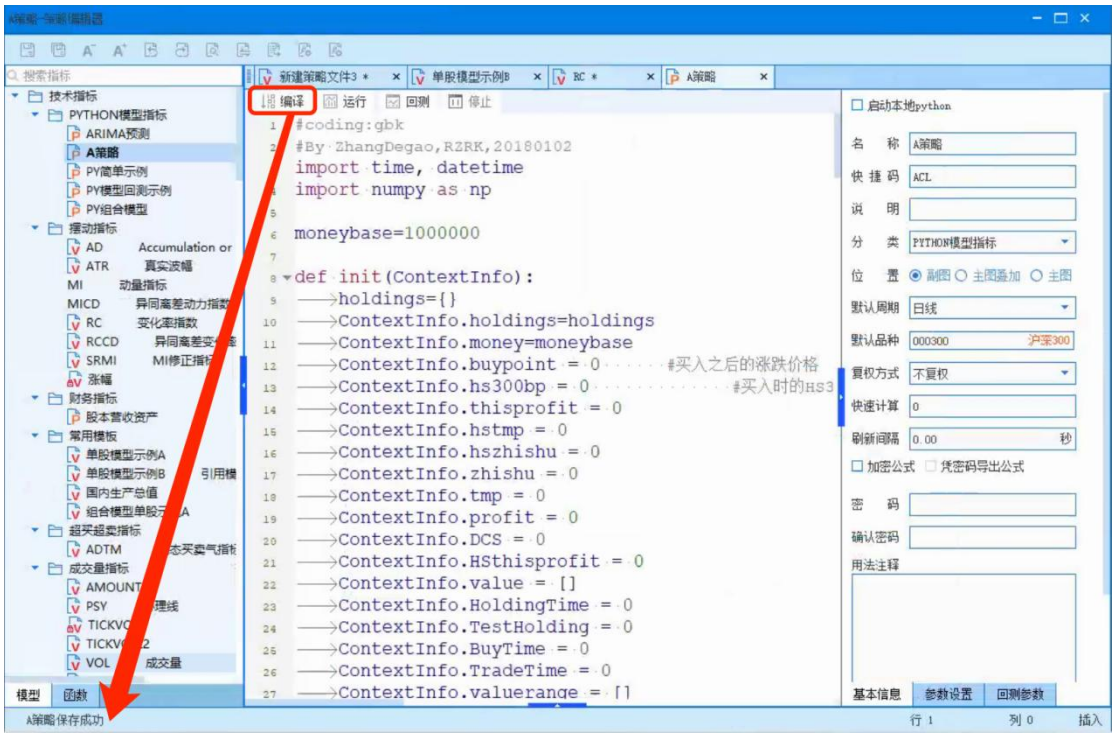
以上回测参数的设置，在回测参数界面设置后，代码里无需再赋值。相反地，如果代码里面设置了，那么以代码里设置的值为准。

总结：代码里的设置优先级高于回测参数界面设置。



模型编辑器—回测参数设置

模型的基本信息和回测参数设置完毕后，点击编译，可以查看模型编译情况，如果编译失败，请检查模型代码是否有误，并进行修正后再次编译，如果编译成功，则系统会自动保存模型的相关代码及设置到本地。



模型编辑器—模型编译

3.1.2.2. 策略回测

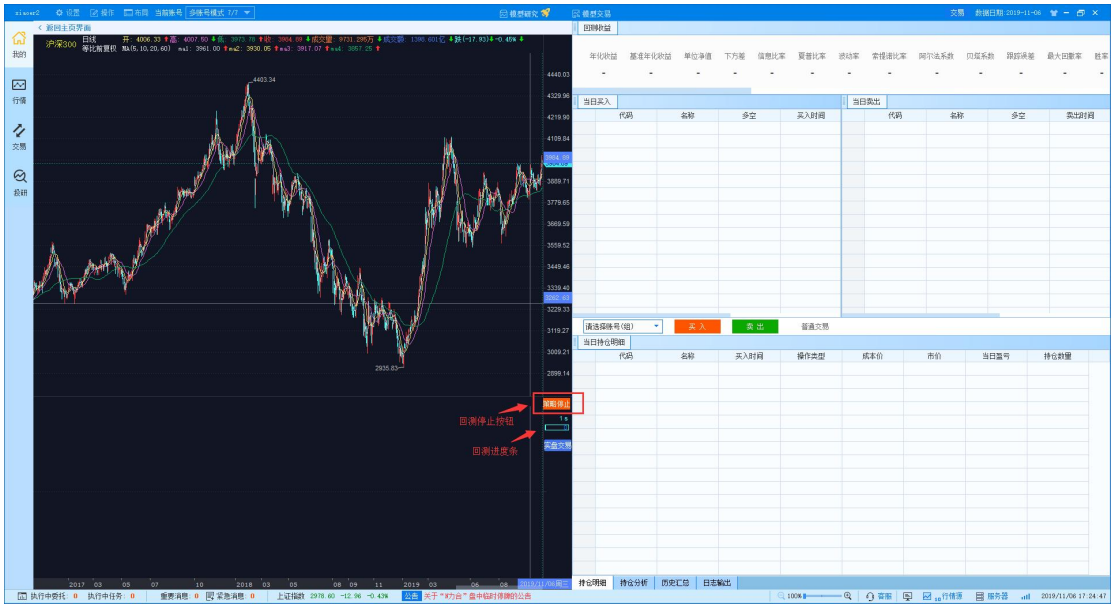
在回测之前，可手动在操作-数据管理中补充数据，以方便回测运行。也可直接回测，系统会自动补全相应品种指定运行周期的所有历史数据。

对某一策略编译成功后，点击回测，可以通过日志输出查看模型回测情况，主界面会跳转到模型设置的默认标的和默认周期界面，并输出模型绩效分析结果。

模型编辑器—模型回测

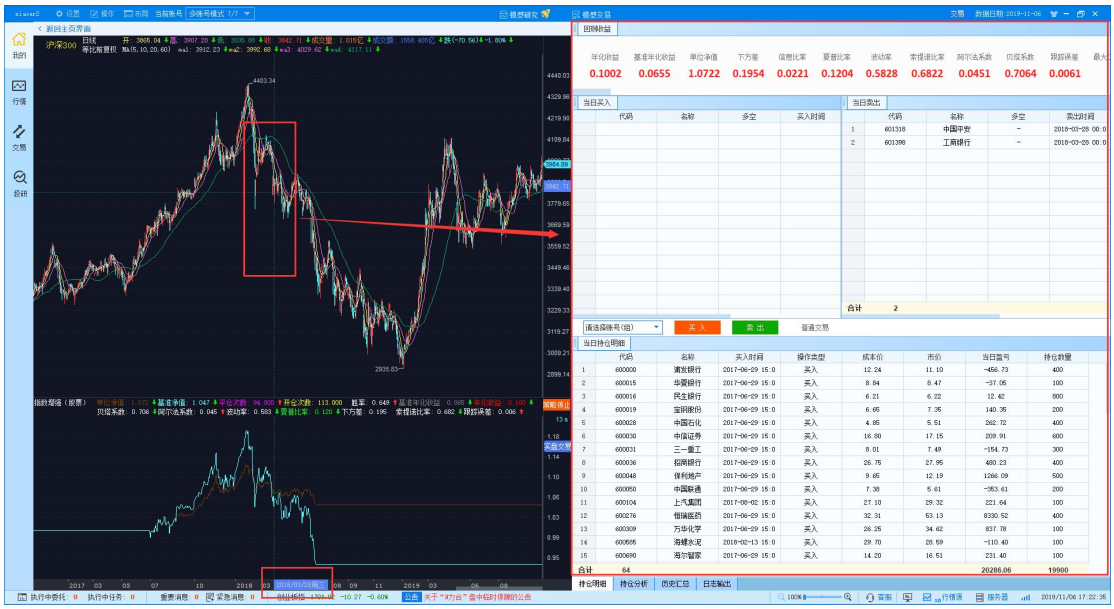
如回测所需时间较长，不想再继续进行下去，可直接点击“策略停止”按钮，停止回测。

按钮下方显示回测进度条，进度条上方数字表示当前回测已运行的时长，进度条内数字表示当前已计算的K线数量。



模型编辑器—进度查看

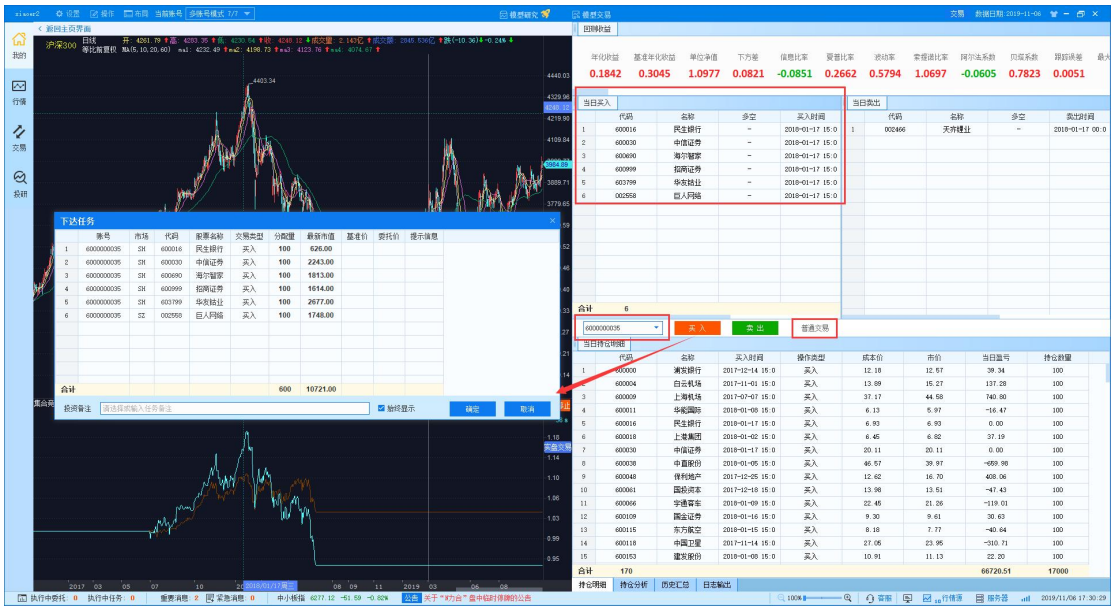
随着光标在K线主图上的移动，右边回测结果展示窗口会动态显示截止光标所在当日的绩效分析结果（包括年化收益，基准年化收益，单位净值，下方差，信息比率，夏普比率，波动率，索提诺比率，阿尔法系数，贝塔系数，跟踪误差，最大回撤，胜率等）、买卖操作和持仓分析等。



回测结果分析—回测结果随十字光标移动动态展示

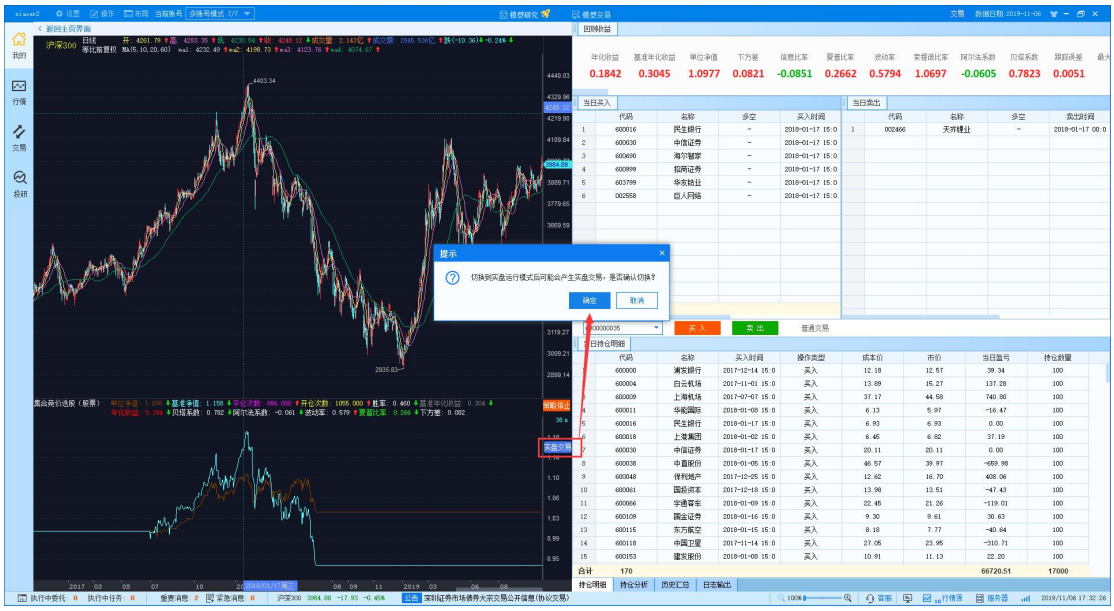
如需根据模型生成的买入、卖出列表进行手工交易，则可直接点击“买入”

或“卖出”按钮，系统会弹出下单界面由用户进行确认后进行普通交易下单或算法交易下单。交易方式可点击卖出按钮右侧的普通交易进行切换设置。

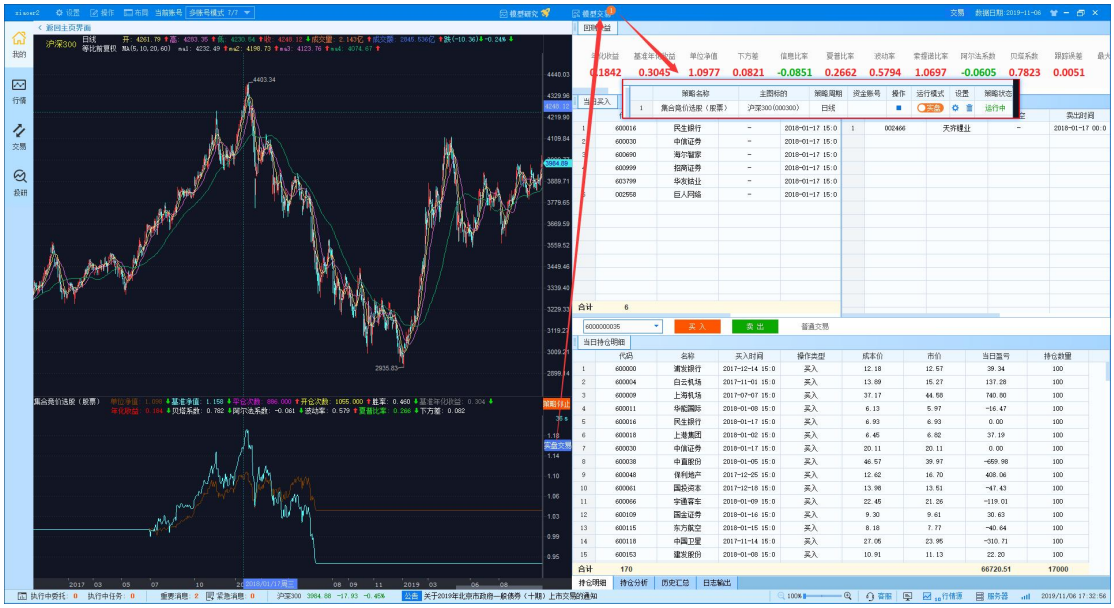


回测结果买入

同时，也可以直接在回测界面将该策略添加到实盘交易，转到实盘交易后策略默认为运行状态。



转到实盘交易



转到实盘交易

副图回测指标：提供图形化的展示，除去绩效分析的相关指标外，用户可以通过编辑模型代码自定义输出一些特色指标，鼠标右键可以选择复制模型运行结果（每一天的数据）保存到个人文档中。

回测结果分析—附图指标输出

另外，回测结果还提供了持仓分析、历史板块汇总、操作明细、日志输出等信息，方便用户进行深入分析。

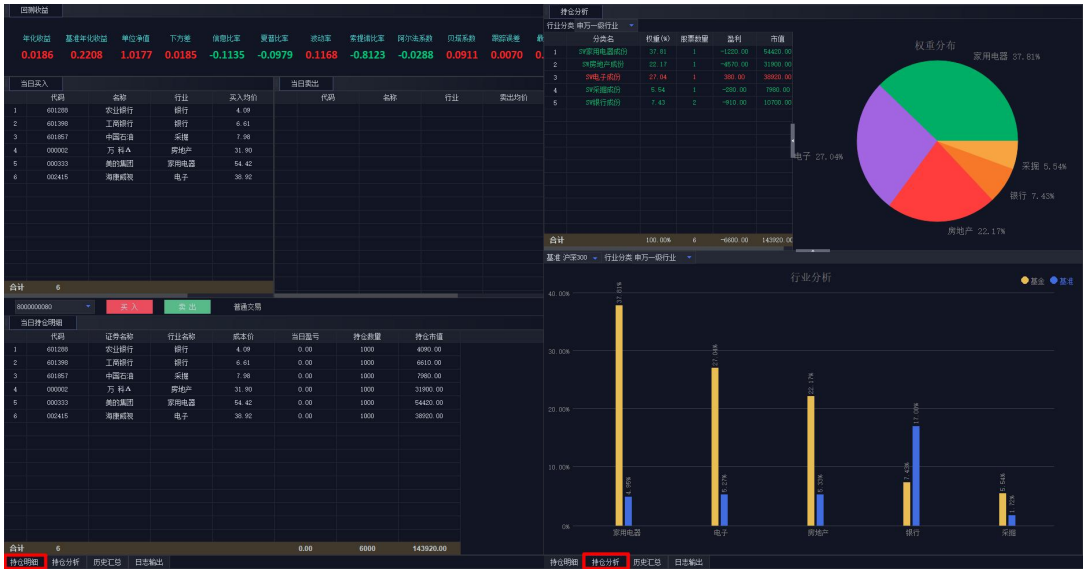
持仓明细：可查看光标所在当天的持仓明细，鼠标右键可以复制和导出数据。

持仓分析：可查看光标所在当天持仓的行业分布，展示在相关行业的市值情况、盈利情况、权重以及股票数量情况，鼠标右键可以复制和导出数据；可切换对比基准，和模型持仓进行对比。

历史汇总：可查看模型自回测日期以来到光标所在日期该模型交易标的的汇总信息，包括累计盈亏、累计交易量、累计交易额、持仓天数等；点击选择板块，可以自定义添加指定板块，并对持仓在该板块的收益情况进行分析；汇总数据均可以进行排序，鼠标右键可以复制和导出数据。

操作明细：可查看模型回测的历史每一笔交易的明细。

日志输出：可用于调试输出模型回测和运行情况。



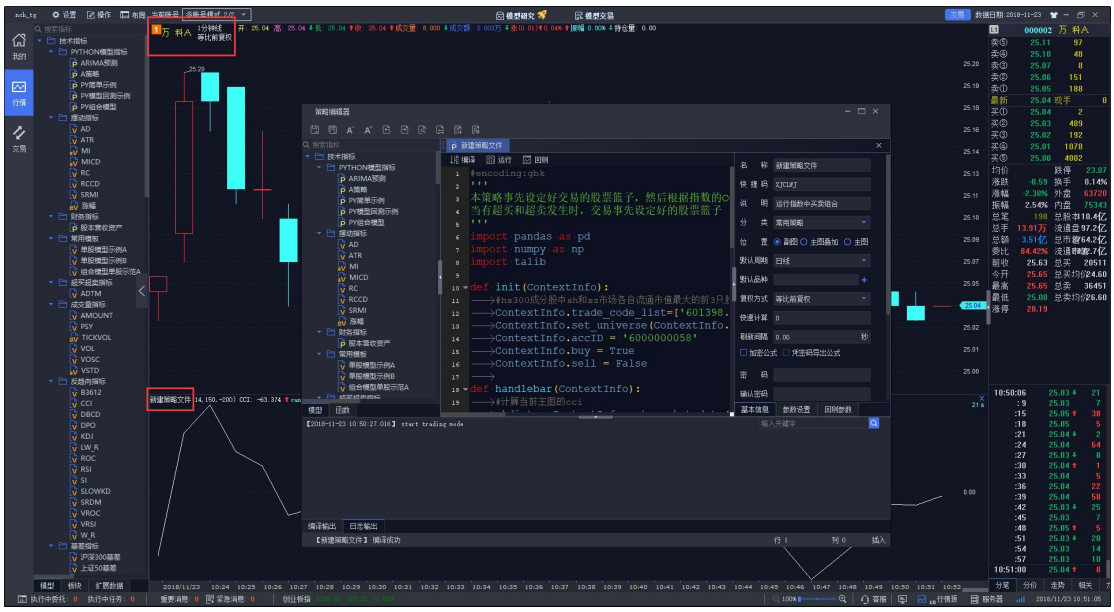
回测结果分析—绩效分析、当日买入、当日卖出、持仓分析

回测结果分析—历史板块汇总、操作明细、日志输出

3.1.2.3. 策略运行

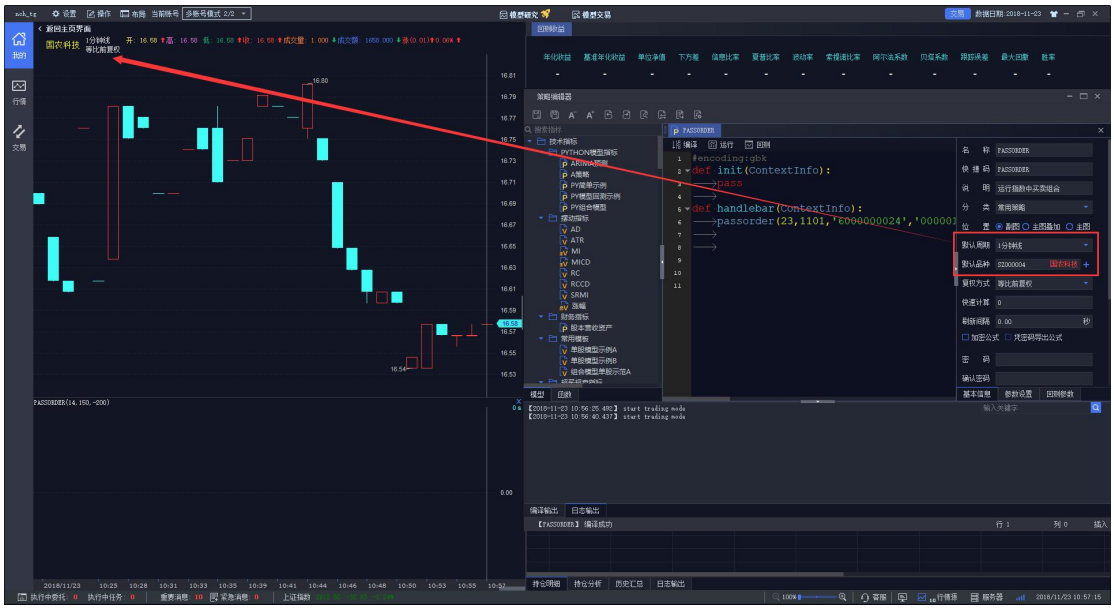
对某一策略编译成功后，点击运行，该策略即进入模拟运行的状态，模拟运行状态不进行任何实盘交易操作。

如当前系统所处界面中有行情主图，点击运行之前，需在行情中手动设置好K线品种和周期，点击运行后，策略即可在当前主图下运行，如下图所示。



策略运行状态之一

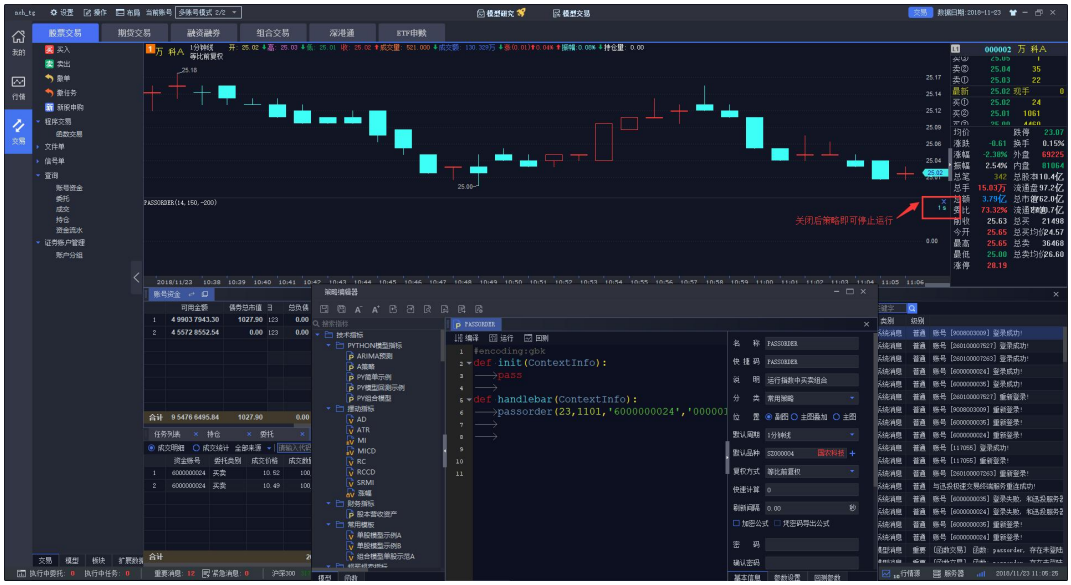
如系统当前界面处于“我的”界面或“模型研究”和“模型交易”等非行情界面，点击运行时，会基于策略编辑器-基本信息中所设置的默认周期和默认品种运行。



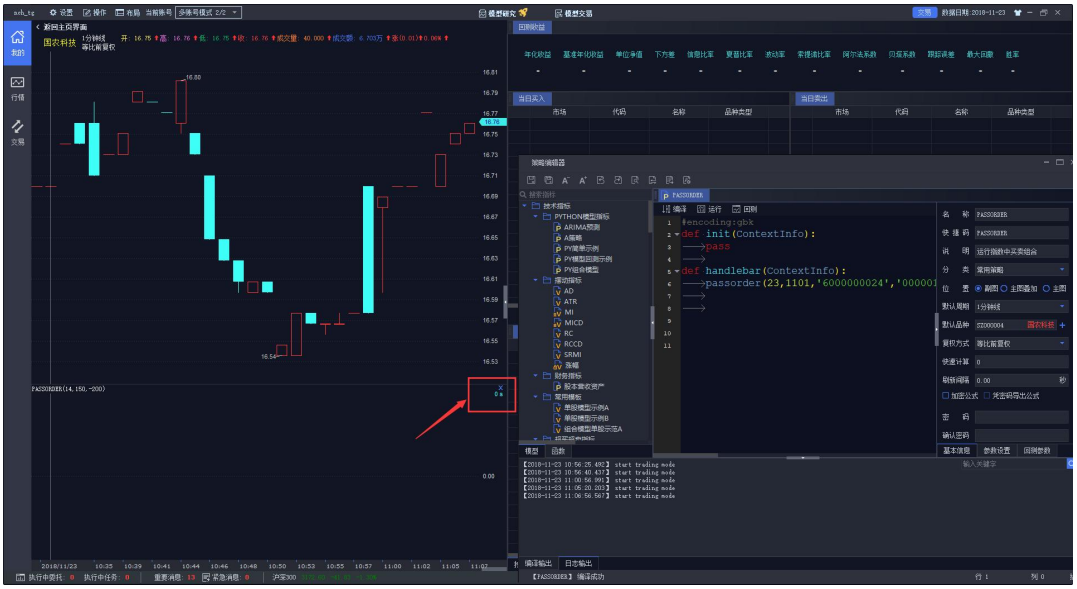
策略运行状态之二

当选择的运行位置为副图时，

如想关闭策略，将主图下方策略运行的附图关闭即可。



关闭运行中的策略之一



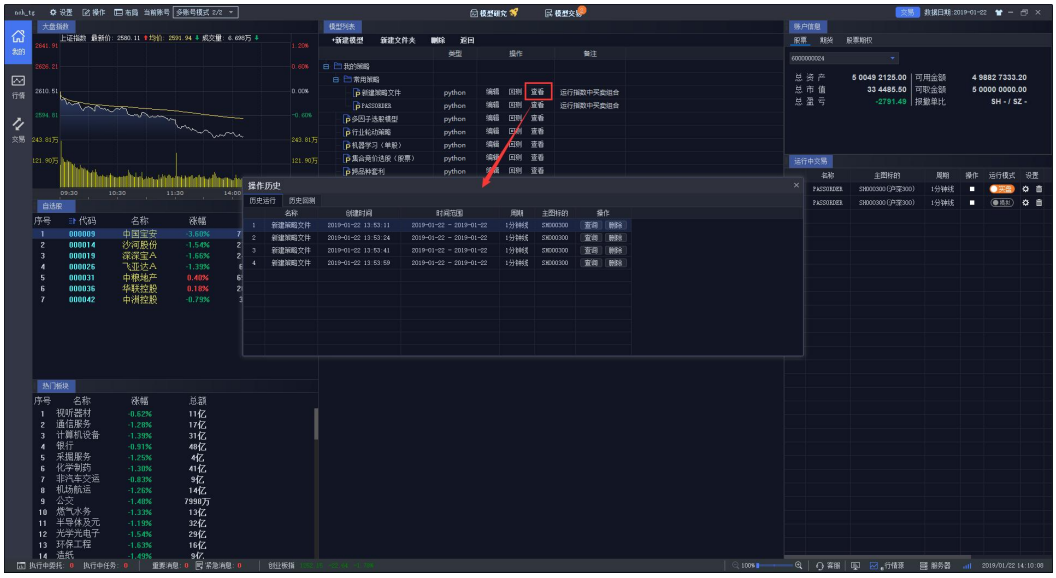
关闭运行中的策略之二

当选择的运行位置为主图叠加时，如想关闭策略，在主图上右键单击取消叠加指标即可。

当选择的运行位置为主图时，键盘精灵输入 kLINE 即可替换当前主图上的运行结果为 K 线图。

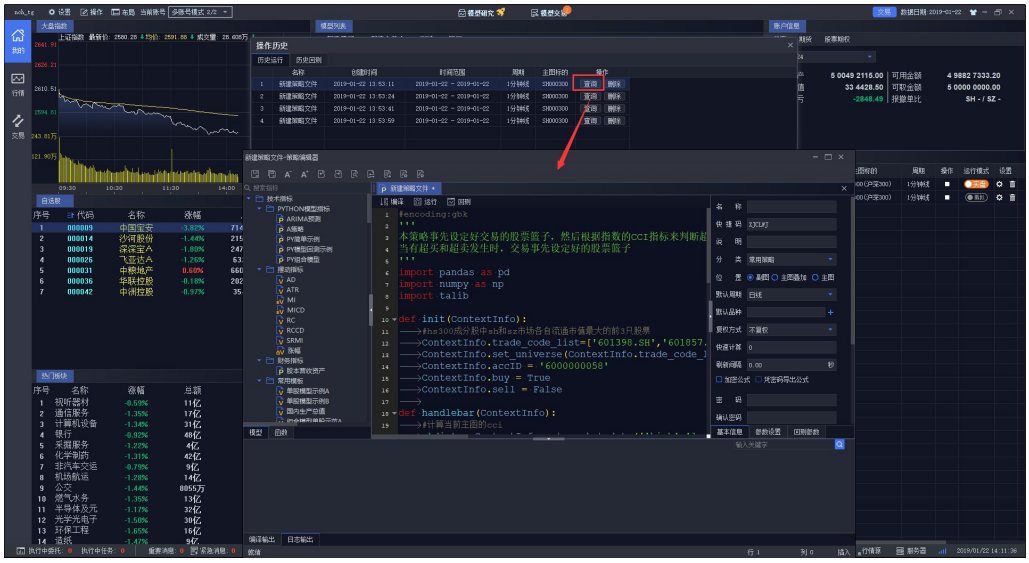
3.1.2.4. 操作记录

在模型列表点击查看，可查看该策略的历史运行和回测记录。



操作记录-查看操作记录

点击某条记录后的查询按钮，可查看当时运行或回测时使用的策略代码。



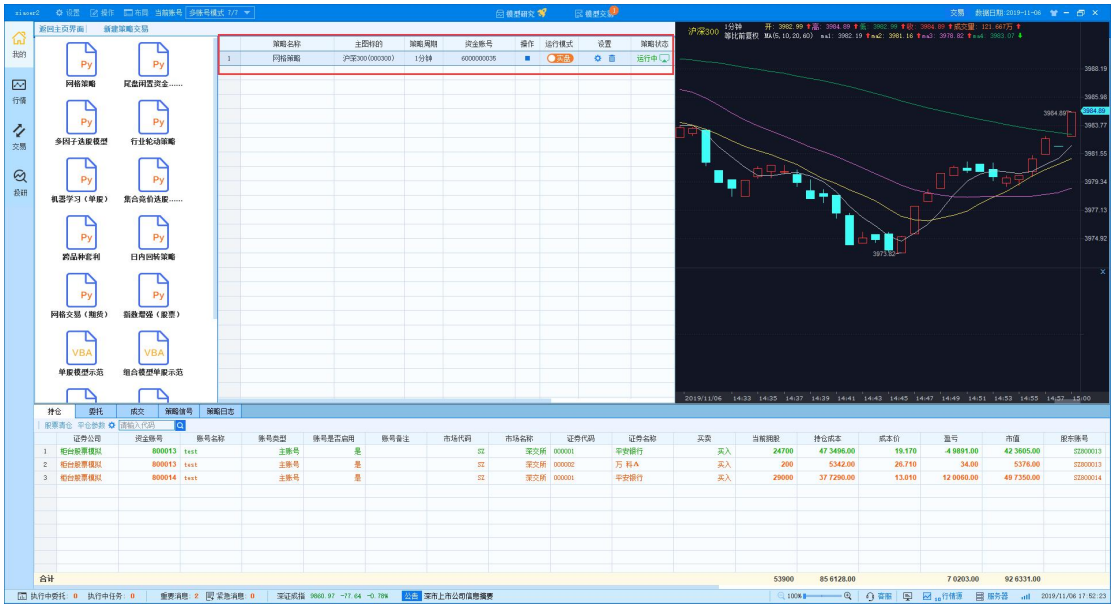
操作记录-查看策略代码

点击某条记录后的删除按钮，可在表中删除该条记录。

3.1.3.模型交易

点击客户端顶部“模型交易”按钮，进入「模型交易」界面，可以看到已添加的模型的运行情况。

在模型交易中，可运行增强策略，python 策略和 vba 策略。

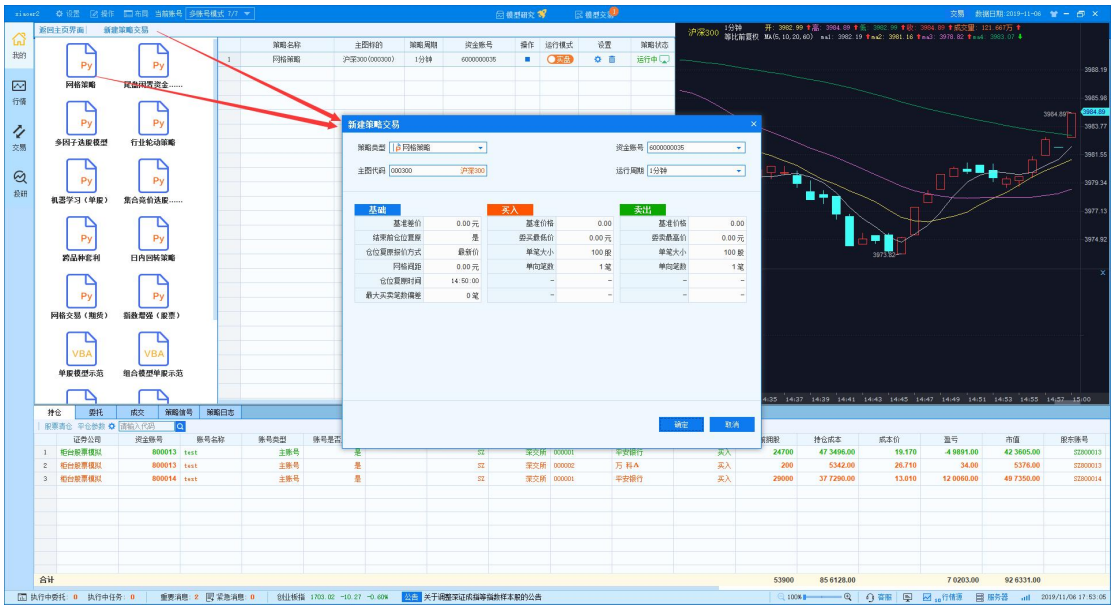


模型交易—模型交易列表

创建模型交易的方法有两种：

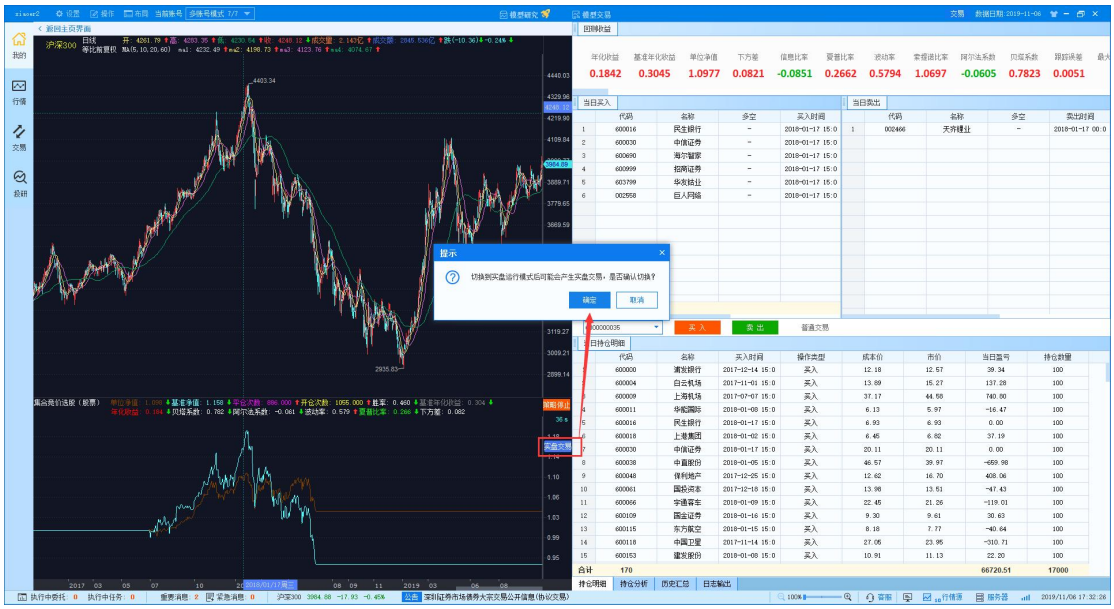
方法一：在模型交易界面，点击新建模拟交易，选择相应模型、运行标的及运行周期，此方法创建的模型交易默认状态为“停止”状态，运行模式为“模拟”。

此时新建策略交易，会要求填写资金账号。若策略中交易函数已设置了资金账号参数，则以策略中设置的为准；如策略中交易函数未设置资金账号参数，则以新建模型交易界面为准。



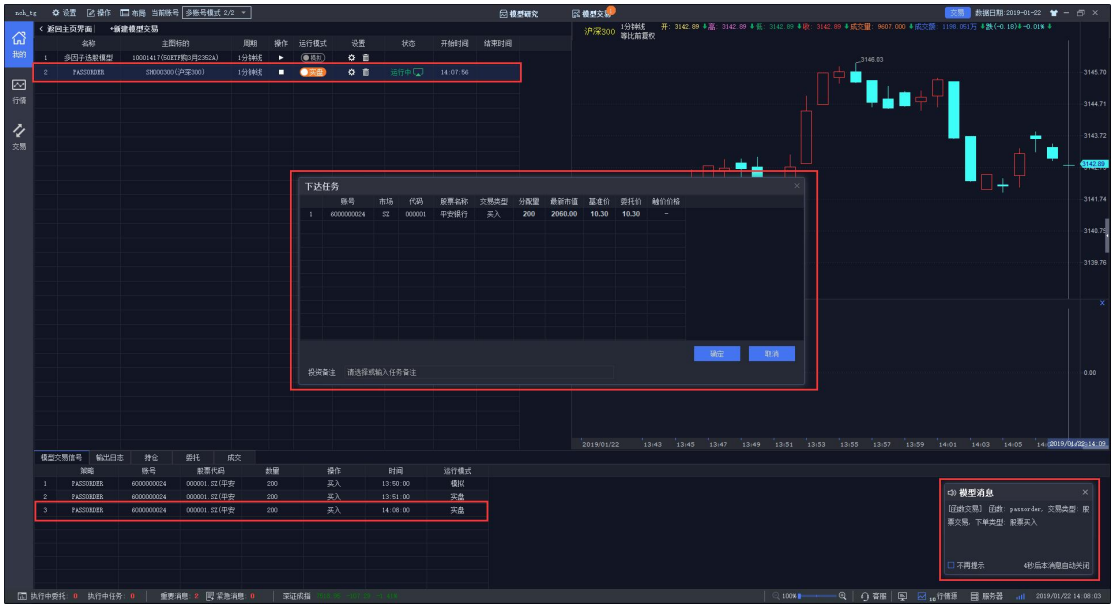
模型交易—新建模型交易

方法二：在回测分析界面副图右上角点击实盘交易按钮，该模型会直接添加至模型交易界面，此方法创建的模型交易默认状态为“运行中”，运行模式为“实盘”。



模型交易—添加回测模型到实盘交易

点击“运行模式栏”的“实盘”或“模拟”可以直接切换运行模式，“实盘”和“模拟”模式一样都会在模型交易信号显示区显示交易信号，区别仅仅在于“实盘”模式还会向柜台发送实盘交易信号，而“模拟”模式不会。



实盘交易-下单信号

在下达任务对话框中还可输入投资备注，用于区分函数交易所产生的不同任务。随后可在任务列表、委托和成交中查看投资备注。

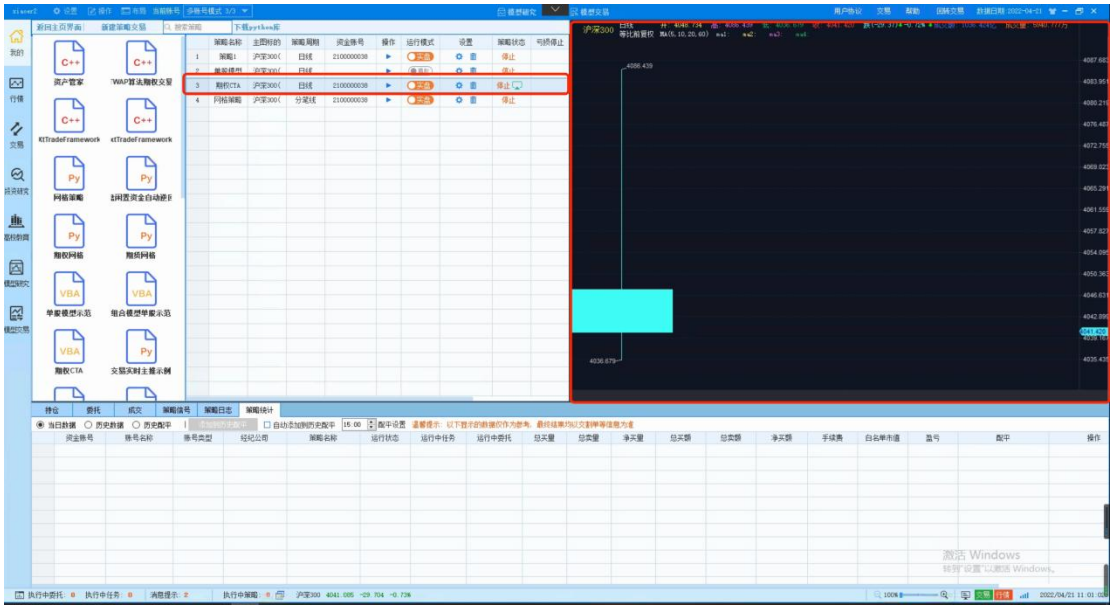
输入投资备注

任务中显示投资备注

委托中显示投资备注

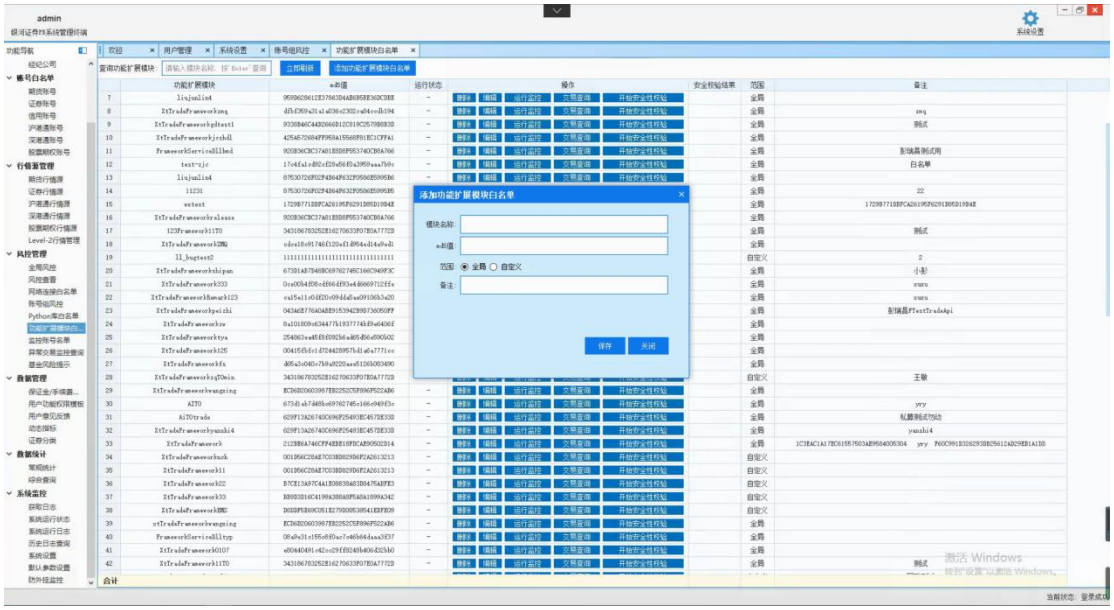
成交中显示投资备注

如需图形化地观察某个模型交易的信号输出情况，可双击运行中的策略，右侧行情页面会跳转到相应运行标的，副图会显示模型的具体运行情况；左下方的按钮可以查看模型的策略信号、策略日志、策略统计、持仓、委托、成交。



模型交易—状态显示

功能扩展模块策略的运行，需要客户将自己的模块文件放到 QMT 客户端 customDll 文件夹下，同时需要在管理端【风控管理】增强交易白名单中添加该模块。添加白名单时需要输入 md5 值实现模块运行时对文件的校验。



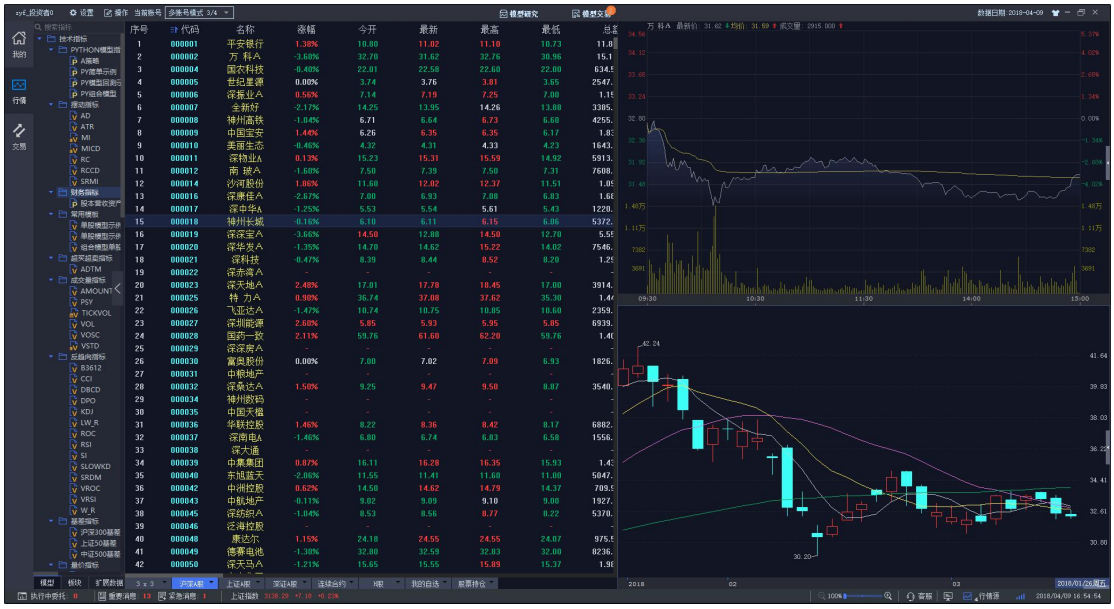
管理端-添加功能扩展模块白名单

添加到白名单的功能扩展模块，才能出现在 QMT 交易端模型交易中。此时若客户已经放置模块文件到 QMT 客户端 customDll 目录下，启动 QMT 客户端后，便可以开始运行增加的模块。

3.2. 行情模块

行情模块包括管理面板，行情报价界面，个股分析界面，个股分时界面。所有界面支持复制界面的特色功能。将鼠标移动到界面的顶端，便可出现 4 个蓝色小标志，从左往右，功能依次选择关联分组、弹出页面、复制页面和关闭窗口。

复制多个行情界面



不同界面无关联，可选择不同状态

行情模块中的所有界面支持键盘精灵。当焦点在行情界面时，键盘精灵支持输入数字和拼音。

键盘精灵

3.2.1. 管理面板

管理面板中包括模型、板块和扩展数据三部分。模型用于个股分析界面和个股分时界面；板块用于行情报价界面，鼠标左键单击板块选项可实现在行情报价界面中切换板块；扩展数据用于添加或导入扩展数据。

3.2.1.1. 板块

板块用于行情报价界面,包括搜索框、我的、沪深板块、沪市板块、深市板块、京市板块、期货板块、期权板块、指数板块、自定义指数版块、持仓板块、全球市场、扩展数据、WIND 数据库、过期合约。

搜索框：快速搜索所需要的板块。

我的：我的自选

沪深板块：沪深 A 股、沪深 B 股、沪深指数、沪深基金、沪深 ETF、沪深债券、沪深 CRD、沪深转债、沪深回购、沪深 REITS、沪深风险警示、沪深退市整理。

沪市板块：上证A股、上证B股、沪市指数、沪市基金、沪市ETF、沪市债券、上证CRD、科创板、上证GDR、上证转债、上证回购、上证REITS、沪市风险警示、沪市退市整理。

深市板块：深证A股、深证B股、深市指数、深市基金、深市ETF、深证主板、创业板、深市债券、深市转债、深市回购、深圳REITS、深市风险警示、深市退市整理。

京市版块：京市A股。

期货板块：连续合约、中金所、上期所、大商所、郑商所、能源中心、套利合约、夜市。

期权板块：上证期权、深证期权、T型报价版。

指数板块：D概念、T概念、T行业、指数成分股板块、申万一级行业板块、申万一级行业板块（港股）、申万二级行业板块、申万三级级行业板块、证监会行业板块、证监会二级行业板块、星空图指数。

自定义指数版块：自定义指数、自定义指数成分。

持仓板块：股票持仓、期货持仓、融资融券持仓、股票期权持仓、沪港通持仓、深港通持仓。

全球市场：沪港通、深港通、香港联交所股票、香港联交所指数。

扩展数据：外部数据

过期合约：过期沪深板块、过期沪市板块、过期深市板块、过期期货板块、过期期权板块。

WIND数据库：

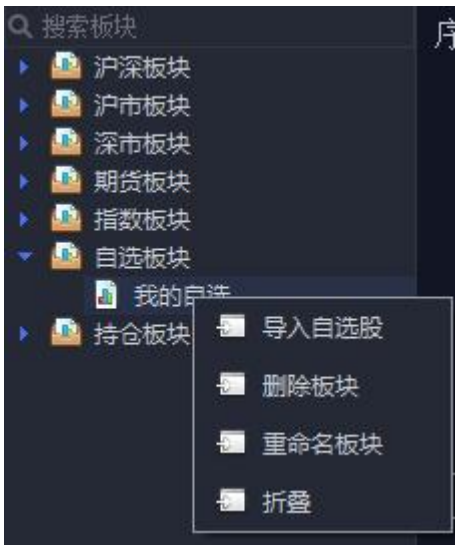
一级板块右键菜单

如图，选中一级板块后右键，出现导入板块文件选项。可导入板块文件。支持如下几种格式，推荐使用第一种格式。

板块导入

自选板块右键菜单

如图，选中自选板块中的一级板块后右键，出现导入板块文件，新建分类，导出板块文件，新建板块等。



自选板块二级板块右键菜单

如图，选中自选板块中的二级板块后右键，出现导入自选股，删除板块，重命名板块等选项。

3.2.1.2. 模型

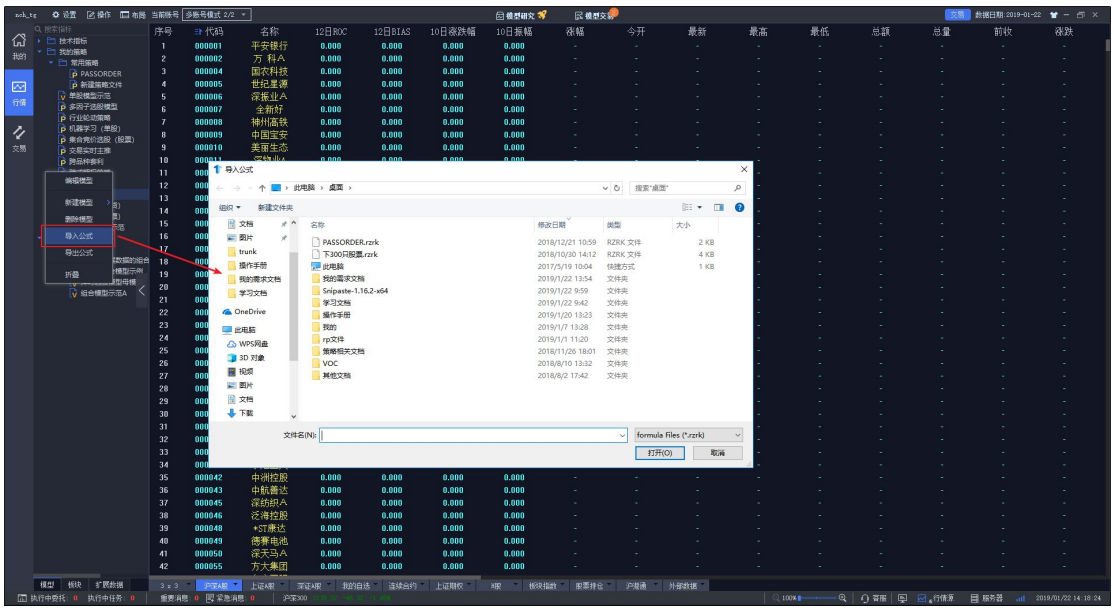
模型包括指标搜索框、技术指标、组合模型、我的策略和系统策略，支持VBA和Python两种语言。

默认技术指标包括：能量指标、摆动指标、成交量指标、趋向指标、量价指标、基差指标、强弱指标、反趋向指标、超买超卖指标、压力支撑指标、择时策略示范、PYTHON模型指标、常用模板、财务指标、因子函数、特色指标等。因子函数包括：成长因子、估值因子、价量因子、价值因子、债务因子、BARRA因子、特色指标（技术分析、Level2专用）。

组合模型包括：多因子组合模型、不使用扩展数据的组合模型、择时选股模型母模型、组合模型示范A。

我的策略包括系统内置策略模板，如单股模型示范、多因子选股模型、行业轮动策略、机器学习等。同时用户也可右键选择“导入公式”，导入本地策略，系统默认策略格式为*.rzrk。

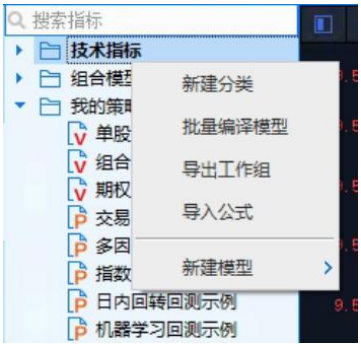
系统策略包括网格策略、尾盘闲置资金自动逆回购、期权网格、期货网格、增强网格策略V2。。



模型-导入公式

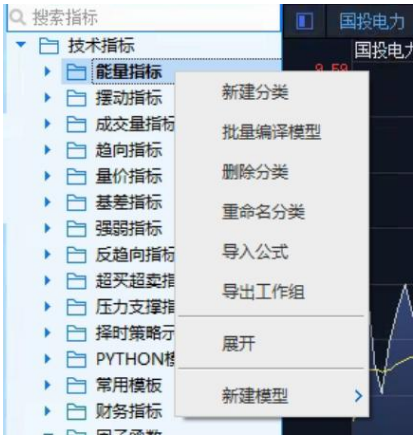
模型面板配合个股分析界面和分时界面使用，鼠标左键双击指标或策略选项可实现在分析界面或分时界面切换主图指标、增加附图指标或模拟运行相应策略。

指标搜索框：输入指标名称即可快速搜索所需要的指标。



一级指标右键菜单

选择一级指标后，右键出现新建分类，批量编译模型，导出工作组，导入公式，新建模型的选择菜单。



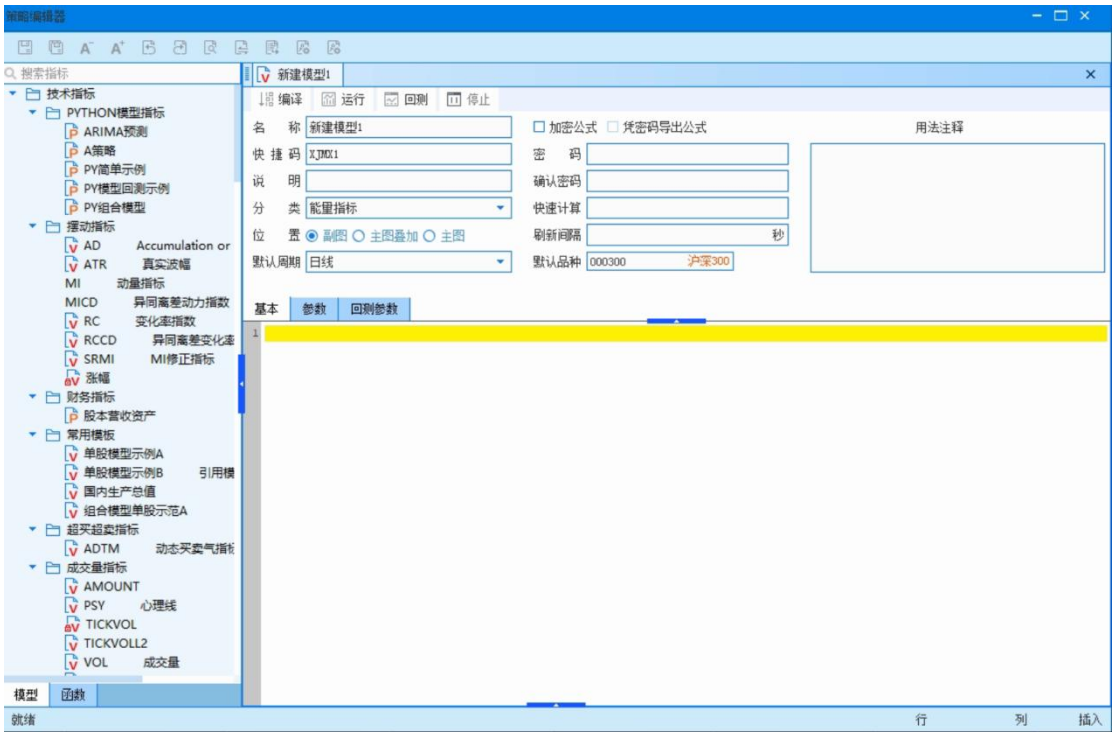
二级指标右键菜单

选择二级指标后，右键出现新建分类，批量编译模型，删除分类，重命名分类，导入公式，导出工作组，新建模型的选择菜单。

三级指标右键菜单

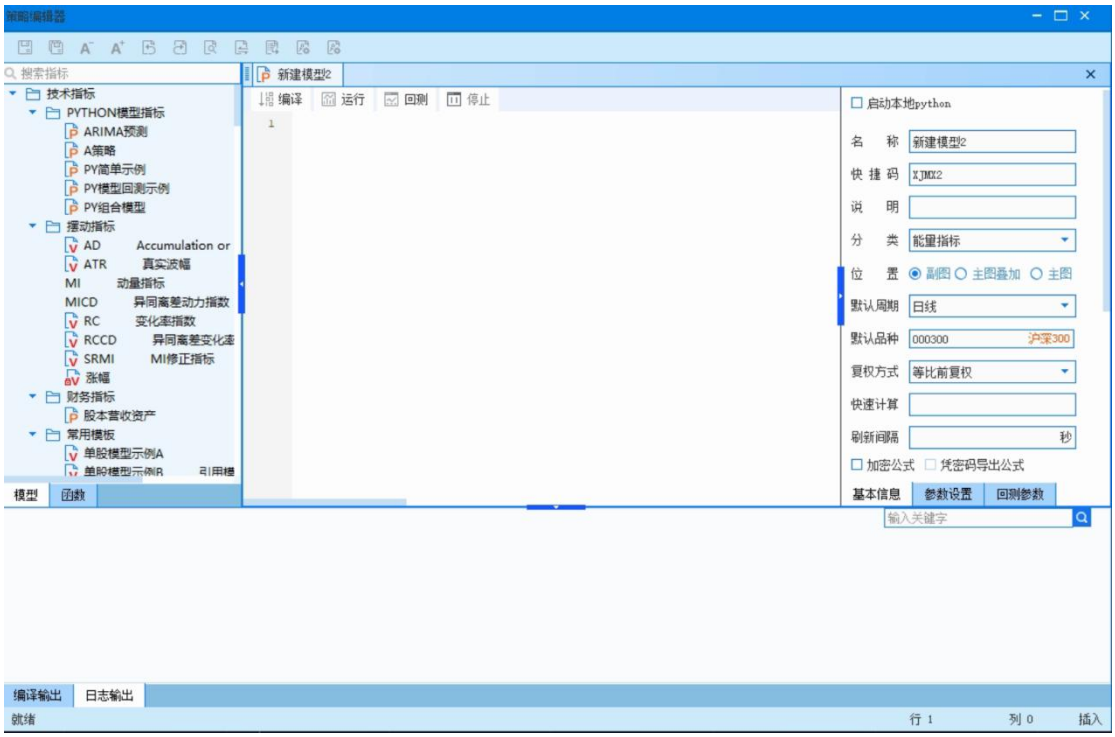
选择三级指标后，右键出现编辑模型，编译模型，新建模型，删除模型，导入公式，导出公式的选择菜单。

新建及编辑模型：VBA 模型



迅投 VBA 模型编辑器

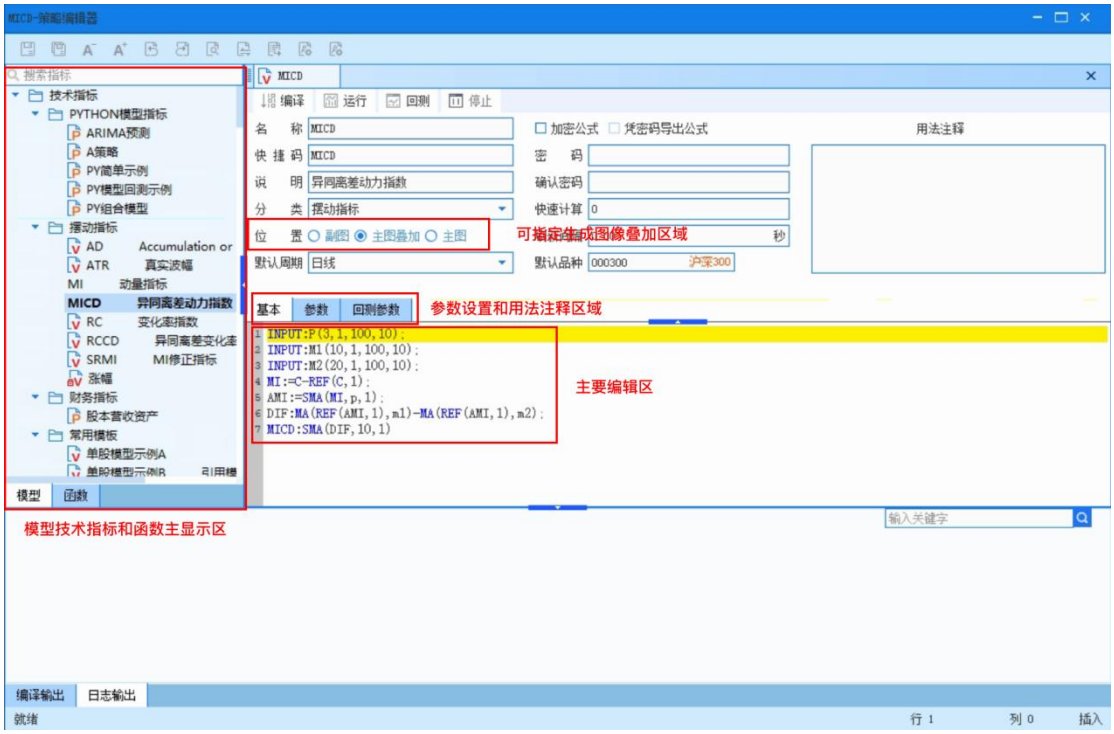
Python 模型



迅投 Python 模型编辑器

新建模型可新建用户自己的技术指标。用户只需要通过描述一个数据是如何计算的，公式系统就能将所有数据计算出来，并以曲线的形式显示出来。

模型系统以时间序列为基础，其计算对象是一组沿时间递增的数据序列，每一个时间周期包含一组数据，公式系统能对其中的任何数据进行操作。



VBA 模型编辑功能区介绍

通过该界面用户可以了解该系统的公式设定的内容和相关规则：

①每一个指标公式必须有一个名称，这个名称由中文、字母和数字组成，公式名称在同类公式中必须是唯一的；公式描述是一段文字，用来简单描述该公式的含义，在公式列表时显示这段文字，这段文字不宜过长；同时该界面也定义了该指标显示的位置，是在主图上与 K 线叠加还是显示在副图上，一般来讲，只有少数几个主图指标会设定为主图叠加，例如 MA 均线、BOLL 线等。

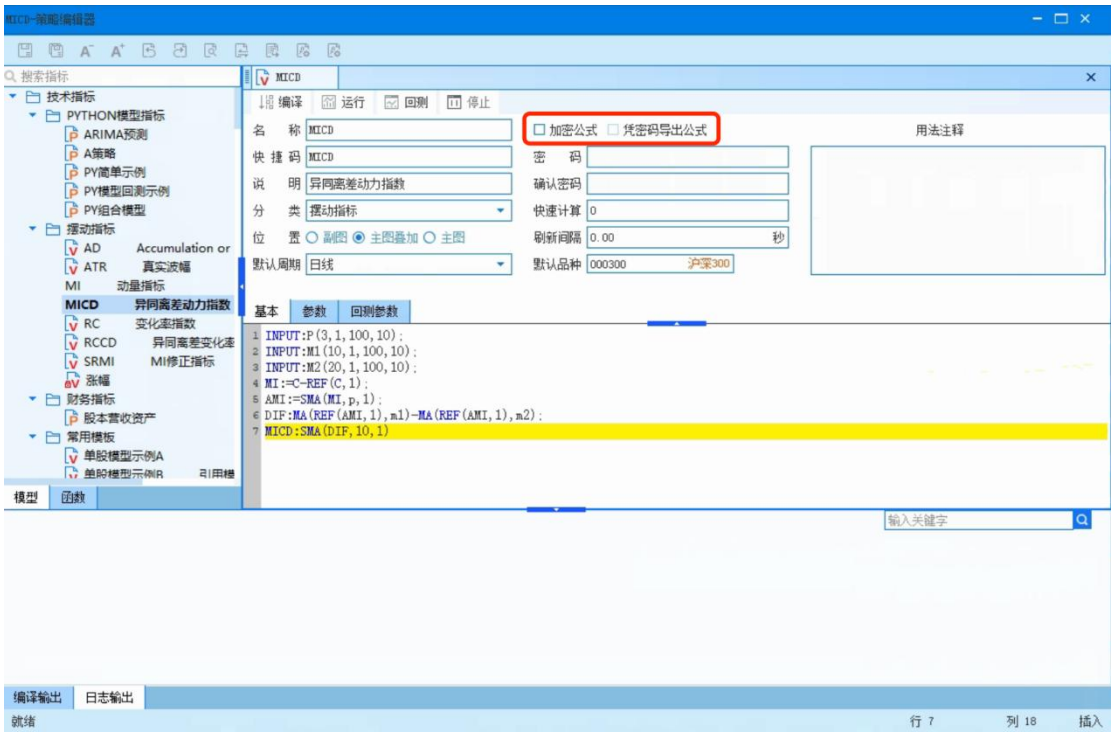
②参数：计算参数用来替代公式中所需要的常数，在使用时可以方便地调节参数，不必修改公式就可以对计算方法进行调节。参数包括参数名、最小值、最大值、缺省值、步长五个部分，参数名称用于标识参数，计算公式时采用缺省值计算，而最小值和最大值是参数的调整范围。

③其他：包括加密、快速计算、刷新间隔等内容。模型终端支持公式加密功能和凭密码导出公式功能，如果用户不想让别人看到您的公式内容，可以通过此功能对公式进行加密。

④用法注释：模型注释是一段文字，相对于模型描述而言它可以很长，主要

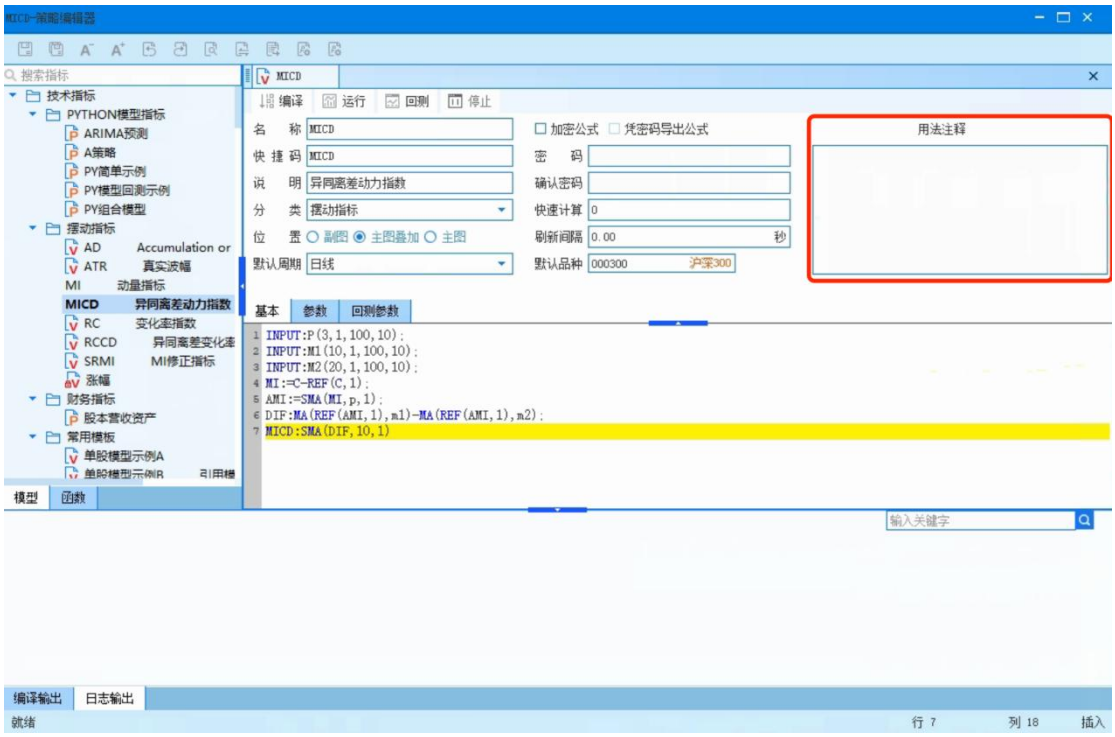
用来描述一个公式如何使用、注意事项、计算方法等等。

3.2.1.2.1. 加密及注释



指标公式加密

加密:用户所编制的公式可以只是密码进行加密。当在个股分析界面和分时界面调用相关公式时，会提示用户输入密码。



用法注释

注释：迅投系统自带的指标都带有相应的用法注释。若是用户自定义的指标，用户可自己添加用法注释。

3.2.1.2.2. 修改指标参数

可在个股分析界面和分时界面通过右键菜单选择“编辑指标”，在“参数”中进行修改。

编辑指标

同时，也可以直接在指标界面右键选择”修改指标参数”来修改。如图所示：

修改指标参数

3.2.1.3. 扩展数据

3.2.1.3.1. 扩展数据

扩展数据用于添加、批量添加、刷新、编辑、显示、重命名、导入、导出、删除扩展数据，导入财务数据等。

扩展数据

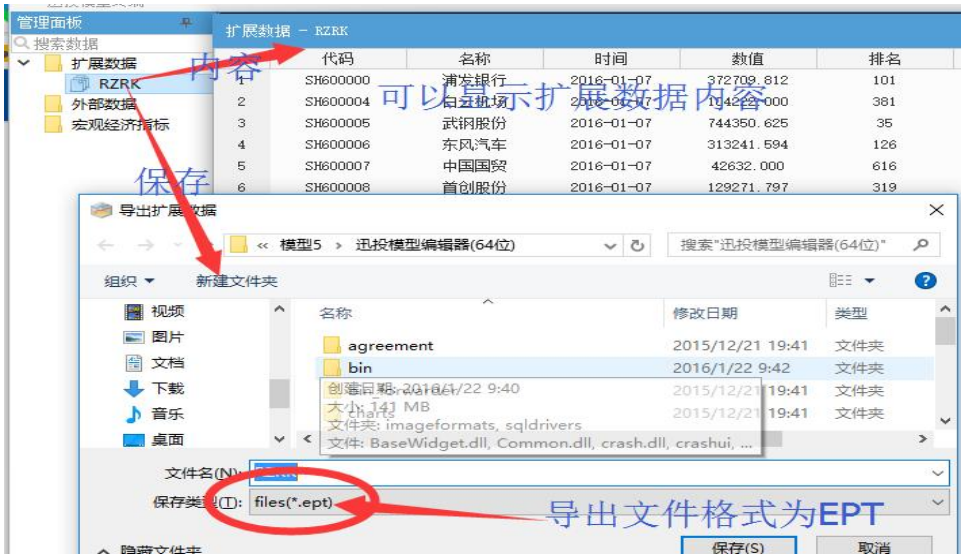
当我们需要用公式对一些个股进行打分排序时，特别复杂的公式的计算值可以转化到扩展库保存起来，盘中若需要用到这种公式的计算值，直接去扩展数据库中取就行了，不用临时计算，这样就节约了每次运行时间。

在选择扩展数据中，您可以选择不同的计算周期，指标类型，时间区间，复权类型。此外，您也可以选择是否每天收盘更新和对于无效时序的处理方式。当您设置完成扩展数据之后，就可以在模型编辑器中使用扩展数据库了，引用方法为：

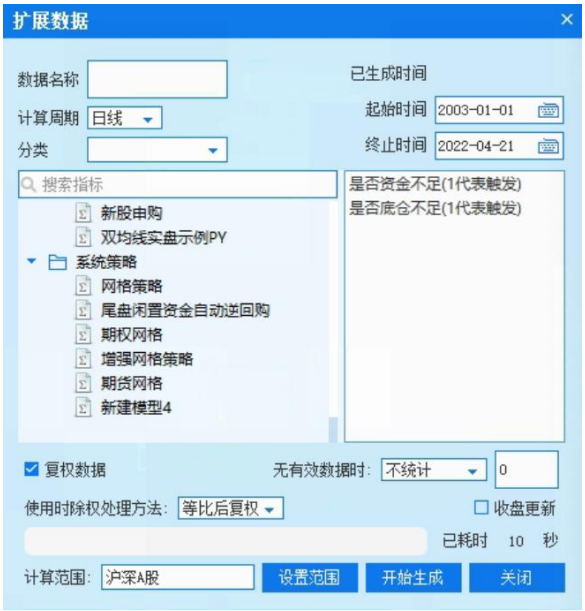
EXTDATA（‘NAME’,STOCK,TIME）;

其中，NAME 为扩展数据名称，STOCK 表示品种，TIME 表示相对当前周期的偏移值，0 表示当前周期。

您可以将生成的扩展数据进行显示，或者再次编辑。此外，也可将扩展数据以 EPT 文件格式导出，或者将之前生成的扩展数据导入到模型终端以供使用。使用方式如下图。

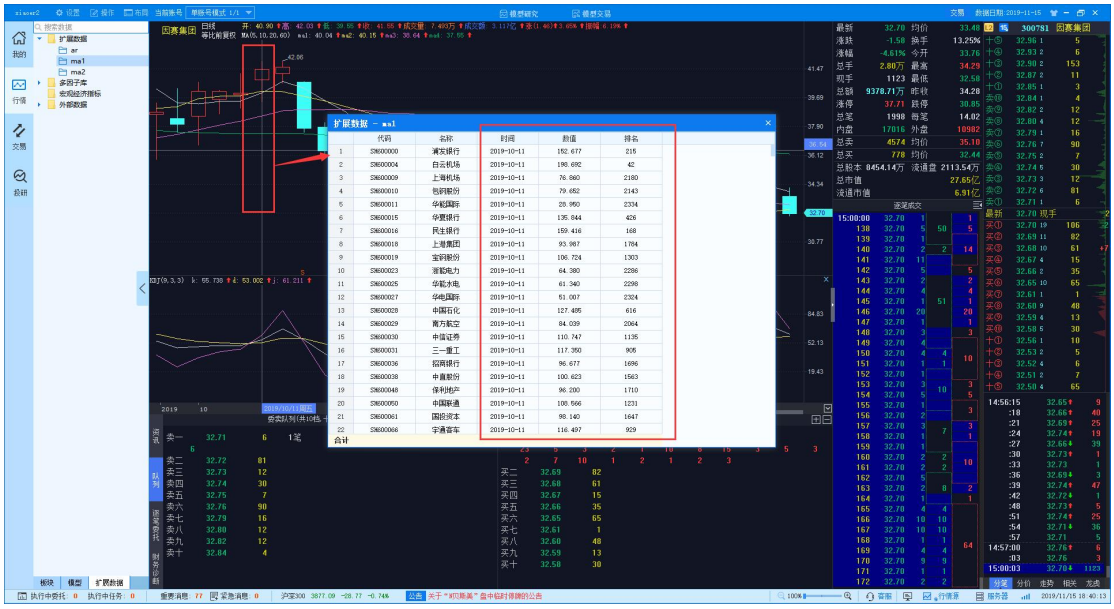


扩展数据操作



添加扩展数据

如果需要查看已生成的扩展数据，需前往对应周期的 K 线界面，并通过移动十字线的位置，来查看不同周期扩展数据的数值。



显示扩展数据

3.2.2. 行情报价界面

行情报价界面功能区域划分

行情报价面板包括左侧的管理面板，行情报价主界面，和下方的行情分类标签栏。

使用 Esc 退出键从其他界面返回行情报价界面。

3.2.2.1. 管理界面

板块用于行情报价界面,包括沪深板块，沪市板块，深市板块，京市板块，期货板块，期权板块，指数板块，自选板块，自定义指数，持仓板块，WIND 数据库，过期合约，全球市场和扩展数据。

在板块上右键可从本地导入板块文件，支持如下几种格式，推荐使用第一种格式。

板块导入

3.2.2.2. 行情分类标签栏

行情分类标签栏中每一栏的字段右侧设置倒三角下拉键，点击可选择相应版块内的显示内容。默认显示上次选择的内容。

多股展示方式

第一栏为多股同列栏。点击可选择以“2*2”“3*3”“4*4”“4*2”这四种方式同时显示多股。

多股同列 2*2

多股同列 3*3

多股同列 4*4

多股同列 4*2

按键“F5”可切换为 k 线同列。

多股同列状态下 F5 切换

我的自选：

我的自选面板

用户可看到自选股信息，您也可以看到自己设定的板块股以及自定义板块的行情信息；用户可在行情报价界面右键将关心的股票添加到“我的自选股”。

3.2.2.3. 报价主界面

3.2.2.3.1. 显示字段

报价主界面上方显示个股参数字段。参数包括：序号，代码，名称，涨幅，今开，最新，最高，最低，总额，总量，昨收，涨跌，持仓，委买价，委买量，委卖价，委卖量，买二价，买三价，买四价，买五价，买二量，买三量，买四量，买五量，卖二价，卖三价，卖四价，卖五价，卖二量，卖三量，卖四量，卖五量，权重，总市值，流通市值和换手率等。

显示字段支持自定义，通过右键-定制列功能实现。

3.2.2.3.2. 排序功能

点击任意显示字段，都可根据相应参数排序。可按升序或降序排列。

按涨幅降序排列

3.2.2.3.3. 布局调整

按住鼠标左键任意拖动字段名称可调整字段位置，界面下方和右方都有滚动

条。

3.2.2.3.4. 多选功能

按住 Ctrl 键可多选多只股票。鼠标右键可选择加入自选板块。

按住 Shift 键单击第一只和最后一只证券合约，可选择之间的全部证券。鼠标右键可选择加入自选板块。

序号	代码	名称	最新	涨幅	涨跌	总额	委买价	委卖价	换手率	总市值	流通市值	昨收	今开	最高	最低
1	300181	佐力药业	8.29	-6.01%	-0.53	1.52亿	8.29	8.30	3.53%	50.45亿	42.11亿	8.82	8.84	8.91	8.26
2	300799	左江科技	41.69	-4.69%	-2.05	3881.76万	41.69	41.70	2.79%	42.57亿	13.60亿	43.74	43.74	43.81	41.51
3	003030	祖名股份	23.07	-2.66%	-0.63	2022.77万	23.07	23.08	1.72%	28.79亿	11.61亿	23.70	23.50	23.85	22.98
4	603602	纵横通信	11.34	-7.05%	-0.86	7830.01万	11.34	11.35	3.29%	23.12亿	23.12亿	12.20	12.20	12.22	11.29
5	688070	纵横股份	23.18	1.09%	0.25	530.52万	23.18	23.19	0.61%	20.30亿	8.64亿	22.93	22.93	23.89	22.52
6	002431	棕榈股份	2.96	-4.82%	-0.15	1.02亿	2.95	2.96	2.32%	44.01亿	43.17亿	3.11	3.09	3.10	2.93
7	600770	综艺股份	6.97	-6.19%	-0.46	1.82亿	6.97	6.99	1.95%	90.61亿	90.61亿	7.43	7.34	7.43	6.96
8	001696	宗申动力	5.90	-2.96%	-0.18	3426.63万	5.89	5.90	0.65%	67.56亿	51.87亿	6.08	6.15	6.15	5.89
9	002118	紫鑫药业	2.87	-5.28%	-0.16	1.09亿	2.86	2.87	2.93%	36.76亿	36.76亿	3.03	3.00	3.02	2.86
10	300280	紫天科技	24.58	-4.80%	-1.24	4667.64万	24.58	24.61	1.16%	39.84亿	39.44亿	25.82	25.63	25.93	24.50
11	688086	紫晶存储	10.62	-3.54%	-0.39	3160.31万	10.62	10.63	2.21%	20.22亿	14.09亿	11.01	11.01	11.13	10.43
12	601860	紫金银行	3.00	-1.64%	-0.05	1.05亿	3.00	3.01	1.00%	109.83亿	104.25亿	3.05	3.05	3.06	2.99
13	601899	紫金矿业	11.01	-3.76%	-0.43	21.06亿	11.00	11.01	0.92%	2898.86亿	2256.46亿	11.44	11.36	11.48	10.91
14	600210	紫江企业	4.99	-5.49%	-0.29	1.69亿	4.98	4.99	2.20%	75.69亿	75.69亿	5.28	5.26	5.28	4.94
15	002049	紫光国微	168.00	-3.40%	-6.05	11.58亿	167.98	168.00	1.12%	1019.52亿	1019.52亿	174.05	174.17	175.90	167.09
16	000938	紫光股份	16.80	-3.45%	-0.60	2.79亿	16.80	16.81	0.57%	480.49亿	480.49亿	17.40	17.16	17.43	16.56
17	688196	卓越新能	55.93	-3.93%	-2.29	4660.54万	55.93	55.95	2.71%	67.12亿	16.78亿	58.22	58.99	59.00	55.31
18	002369	卓翼科技	4.19	-4.12%	-0.18	5449.04万	4.18	4.19	2.22%	24.17亿	24.13亿	4.37	4.42	4.43	4.14
19	688258	卓易信息	27.00	-1.50%	-0.41	887.91万	26.99	27.00	0.74%	23.48亿	11.73亿	27.41	27.50	28.23	26.96
20	300782	卓胜微	196.00	-2.92%	-5.90	6.55亿	196.16	196.00	1.63%	653.84亿	394.74亿	201.90	200.99	204.79	195.00
21	688121	卓然股份	20.17	-4.99%	-1.06	1796.01万	20.13	20.17	2.01%	40.80亿	8.75亿	21.23	21.29	21.29	20.00
22	600545	卓郎智能	2.92	-6.11%	-0.19	7519.18万	2.92	2.93	1.33%	55.35亿	55.35亿	3.11	3.03	3.10	2.90
23	688701	卓锐股份	11.52	-4.00%	-0.48	436.78万	11.52	11.61	1.31%	15.47亿	3.29亿	12.00	11.92	11.98	11.50
24	002207	准油股份	7.40	-6.92%	-0.55	2.32亿	7.40	7.41	11.71%	19.39亿	19.25亿	7.95	7.78	7.98	7.34
25	002910	庄园牧场	12.58	-5.27%	-0.70	1.32亿	12.58	12.59	6.00%	29.23亿	21.52亿	13.28	13.12	13.32	12.52
26	300564	筑博设计	20.67	-4.31%	-0.93	2622.44万	20.67	20.68	3.70%	21.28亿	6.98亿	21.60	21.66	21.73	20.58
27	600961	株冶集团	10.09	0.00%	0.00	-	-	-	0.00%	53.22亿	53.22亿	10.09	-	-	-
28	002461	珠江啤酒	7.74	-3.01%	-0.24	7597.69万	7.74	7.75	0.44%	171.31亿	171.31亿	7.98	7.93	7.99	7.73
29	600684	珠江股份	3.77	-5.04%	-0.20	1.20亿	3.77	3.78	3.65%	32.18亿	32.18亿	3.97	3.95	3.98	3.78
30	002678	珠江钢琴	5.70	-2.23%	-0.13	1093.23万	5.70	5.71	0.14%	77.42亿	77.38亿	5.83	5.83	5.87	5.70
31	000659	珠海中富	3.34	-4.30%	-0.15	4893.05万	3.34	3.36	1.12%	42.94亿	42.94亿	3.49	3.45	3.50	3.33
32	688772	珠海冠宇	23.03	-6.38%	-1.57	1.04亿	23.03	23.04	4.03%	258.36亿	25.10亿	24.60	24.54	24.75	22.73
33	000507	珠海港	5.69	-4.05%	-0.24	7362.20万	5.69	5.70	1.53%	52.33亿	47.26亿	5.93	5.89	5.93	5.67
34	300232	洲明科技	6.07	-4.26%	-0.27	5815.73万	6.08	6.07	1.08%	66.41亿	53.01亿	6.34	6.32	6.36	6.06
35	600759	洲际油气	2.63	-4.01%	-0.11	1.21亿	2.62	2.63	2.01%	59.53亿	59.39亿	2.74	2.74	2.76	2.61
36	002867	周大生	12.91	-2.57%	-0.34	8860.67万	12.91	12.92	0.57%	141.50亿	139.20亿	13.25	13.25	13.35	12.85
37	000950	重药控股	5.01	-3.47%	-0.18	1.27亿	5.01	5.02	1.45%	87.34亿	86.58亿	5.19	5.19	5.19	5.00
38	601963	重庆银行	8.36	-2.34%	-0.20	1.57亿	8.36	8.37	2.69%	290.47亿	57.80亿	8.56	8.53	8.56	8.35
39	601158	重庆水务	5.64	-2.59%	-0.15	5691.71万	5.63	5.64	0.21%	270.72亿	270.72亿	5.79	5.77	5.79	5.61
40	600917	重庆燃气	7.14	-4.03%	-0.30	2697.90万	7.13	7.14	0.24%	112.19亿	111.10亿	7.44	7.44	7.44	7.11
41	600132	重庆啤酒	123.57	-1.43%	-1.79	4.65亿	123.54	123.57	0.77%	598.04亿	598.04亿	125.36	124.40	126.53	121.00
42	600106	重庆路桥	3.91	-4.07%	-0.20	1.16亿	3.90	3.91	2.19%	51.96亿	51.96亿	4.11	4.06	4.14	3.89

多选功能

3.2.2.3.5. 设置指标颜色

点击自定义指标列按钮 ，即可对该指标值的颜色进行设置。

指标处默认填充该栏指标值名称。点击 可新增或删减某条指标值颜色设置。

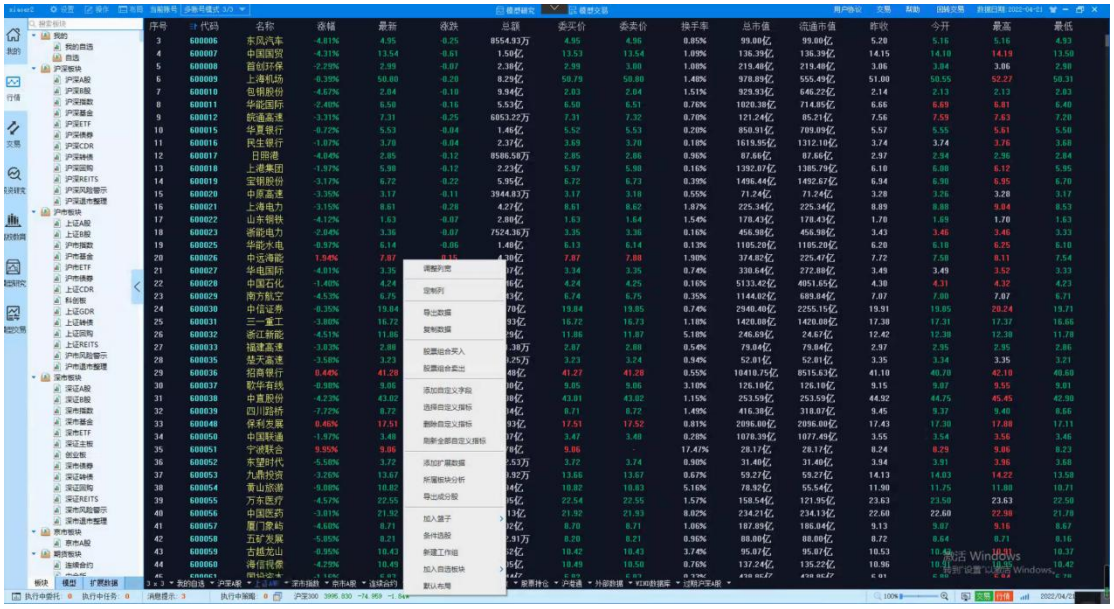
添加指标值颜色

示例：

指标颜色显示

3.2.2.3.6. 右键菜单

报价界面右键菜单如图所示。



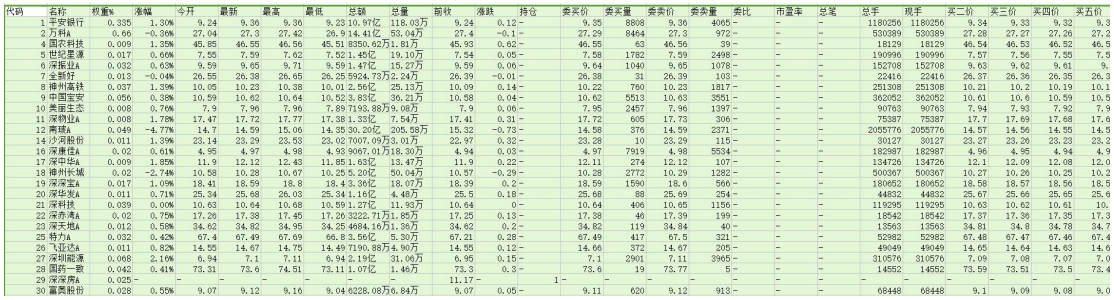
行情报价界面右键菜单

调整列宽：可一键将列宽改正为默认格式。

定制列：选择定制列来勾选您所需要关注的数据。

定制列选择

导出数据：导出所显示界面的全部数据，导出数据支持 txt，csv 和 excel 两种格式。

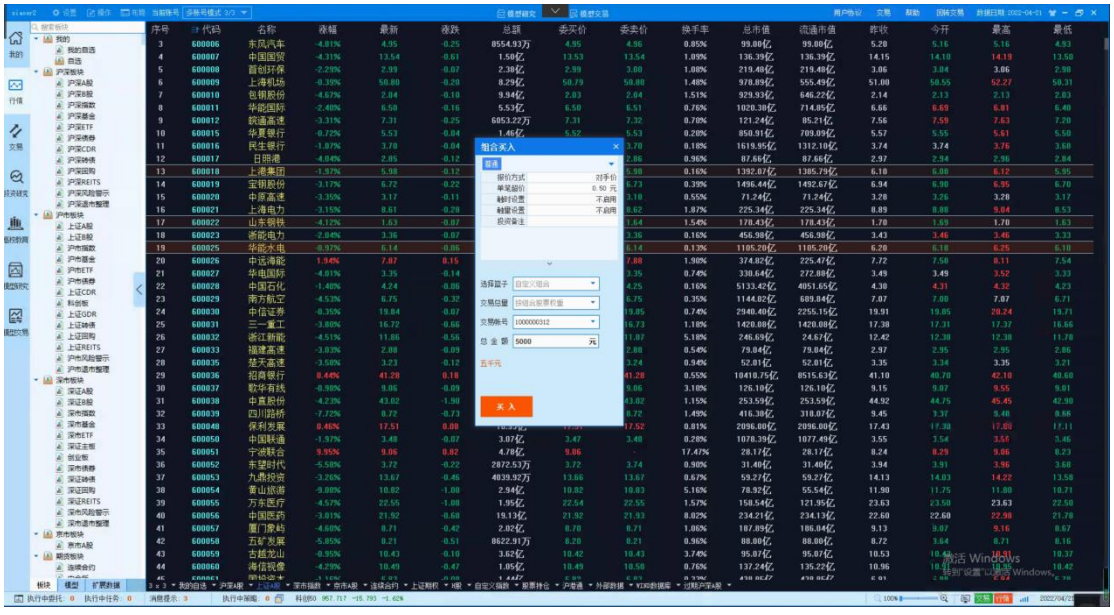


代码	名称	权重%	涨幅	今开	最新	最高	最低	总额	总量	前收	涨跌	持仓	委买价	委买量	委卖价	委卖量	委比	市盈率	总笔	总手	现手	买二价	买三价	买四价	买五价
1	平安银行	0.335	1.30%	9.24	9.36	9.36	9.23	10.97亿	118.03万	9.24	0.12	-	9.35	8808	9.36	4065	-	-	-	1180256	1180256	9.34	9.33	9.32	9.3
2	万科A	0.66	-0.36%	27.04	27.3	27.42	26.9	14.41亿	53.04万	27.4	-0.1	-	27.29	8464	27.3	972	-	-	-	530389	530389	27.28	27.27	27.26	27.2
4	国农科技	0.009	1.35%	45.85	46.55	46.56	45.51	8350.62万	1.81万	45.93	0.62	-	46.55	63	46.56	39	-	-	-	18129	18129	46.54	46.53	46.52	46.5
5	世纪星源	0.017	0.66%	7.55	7.59	7.62	7.52	1.45亿	19.10万	7.54	0.05	-	7.58	1782	7.59	2498	-	-	-	190996	190996	7.57	7.56	7.55	7.5
6	深振业A	0.032	0.63%	9.59	9.65	9.71	9.59	1.47亿	15.27万	9.59	0.06	-	9.64	1040	9.65	1078	-	-	-	152708	152708	9.63	9.62	9.61	9.
7	全新好	0.013	-0.04%	26.55	26.38	26.65	26.25	5924.73万	2.24万	26.39	-0.01	-	26.38	31	26.39	103	-	-	-	22416	22416	26.37	26.36	26.35	26.3
8	神州高铁	0.037	1.39%	10.05	10.23	10.38	10.01	2.56亿	25.13万	10.09	0.14	-	10.22	760	10.23	1817	-	-	-	251308	251308	10.21	10.2	10.19	10.1
9	中国宝安	0.056	0.38%	10.59	10.62	10.64	10.52	3.83亿	36.21万	10.58	0.04	-	10.62	5513	10.63	3551	-	-	-	362052	362052	10.61	10.6	10.59	10.5
10	美丽生态	0.008	0.76%	7.9	7.96	7.96	7.89	7193.88万	9.08万	7.9	0.06	-	7.95	2457	7.96	1397	-	-	-	90763	90763	7.94	7.93	7.92	7.9
11	深物业A	0.008	1.78%	17.47	17.72	17.77	17.38	1.33亿	7.54万	17.41	0.31	-	17.72	605	17.73	306	-	-	-	75387	75387	17.7	17.69	17.68	17.6
12	南玻A	0.049	-4.77%	14.7	14.59	15.06	14.35	30.20亿	205.58万	15.32	-0.73	-	14.58	376	14.59	2371	-	-	-	2055776	2055776	14.57	14.56	14.55	14.5
13	沙河股份	0.011	1.39%	23.14	23.29	23.53	23.02	7007.09万	3.01万	22.97	0.32	-	23.28	10	23.29	115	-	-	-	30127	30127	23.27	23.26	23.23	23.2
15	深康佳A	0.02	0.61%	4.95	4.97	4.98	4.93	9067.01万	18.30万	4.94	0.03	-	4.97	7919	4.98	5534	-	-	-	182987	182987	4.96	4.95	4.94	4.9
17	深中华A	0.009	1.85%	11.9	12.12	12.43	11.85	1.63亿	13.47万	11.9	0.22	-	12.11	274	12.12	107	-	-	-	134726	134726	12.1	12.09	12.08	12.0
18	神州长城	0.02	-2.74%	10.58	10.28	10.67	10.25	5.20亿	50.04万	10.57	-0.29	-	10.28	2772	10.29	1282	-	-	-	500367	500367	10.27	10.26	10.25	10.2
19	深深宝A	0.017	1.09%	18.41	18.59	18.8	18.4	3.36亿	18.07万	18.39	0.2	-	18.59	1590	18.6	566	-	-	-	180652	180652	18.58	18.57	18.56	18.5
20	深华发A	0.011	0.71%	25.34	25.68	26.03	25.34	1.16亿	4.48万	25.5	0.18	-	25.68	88	25.69	254	-	-	-	44832	44832	25.67	25.66	25.65	25.6
21	深科技	0.039	0.00%	10.63	10.64	10.68	10.59	1.27亿	11.93万	10.64	0	-	10.64	406	10.65	1156	-	-	-	119295	119295	10.63	10.62	10.61	10.
22	深赤湾A	0.02	0.75%	17.26	17.38	17.45	17.26	3222.71万	1.85万	17.25	0.13	-	17.38	46	17.39	199	-	-	-	18542	18542	17.37	17.36	17.35	17.3
23	深天地A	0.012	0.58%	34.62	34.82	34.95	34.25	4684.16万	1.38万	34.62	0.2	-	34.82	119	34.84	40	-	-	-	13563	13563	34.81	34.8	34.78	34.7
25	特力A	0.032	0.42%	67.4	67.49	67.69	66.8	3.56亿	5.30万	67.21	0.28	-	67.49	417	67.5	321	-	-	-	52982	52982	67.48	67.47	67.46	67.4
26	飞亚达A	0.011	0.82%	14.55	14.67	14.75	14.49	7190.88万	4.90万	14.55	0.12	-	14.66	372	14.67	205	-	-	-	49049	49049	14.65	14.64	14.63	14.6
27	深圳能源	0.068	2.16%	6.94	7.1	7.11	6.94	2.19亿	31.06万	6.95	0.15	-	7.1	2901	7.11	3965	-	-	-	310576	310576	7.09	7.08	7.07	7.0
28	国药一致	0.042	0.41%	73.31	73.6	74.51	73.11	1.07亿	1.46万	73.3	0.3	-	73.6	19	73.77	5	-	-	-	14552	14552	73.59	73.51	73.5	73.4
29	深深房A	0.025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
30	富奥股份	0.028	0.55%	9.07	9.12	9.16	9.04	6228.08万	6.84万	9.07	0.05	-	9.11	620	9.12	913	-	-	-	68448	68448	9.1	9.09	9.08	9.0

excel 文件导出界面

复制数据：复制所显示界面的全部数据（即只复制了一屏的数据，并非全部的数据）。

股票组合买入：当前界面选中股票后，右键选择股票组合买入，用户选择资金账号并填入投资金额后点击下单，即可为所选中的股票平均分配金额并买入。

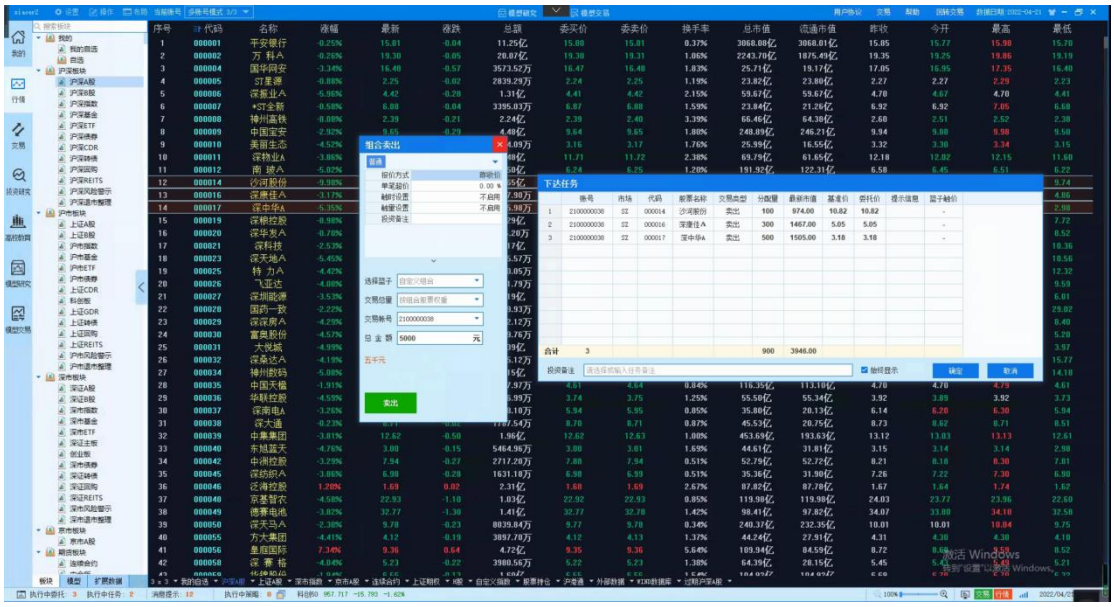


股票组合买入

组合买入金额分配

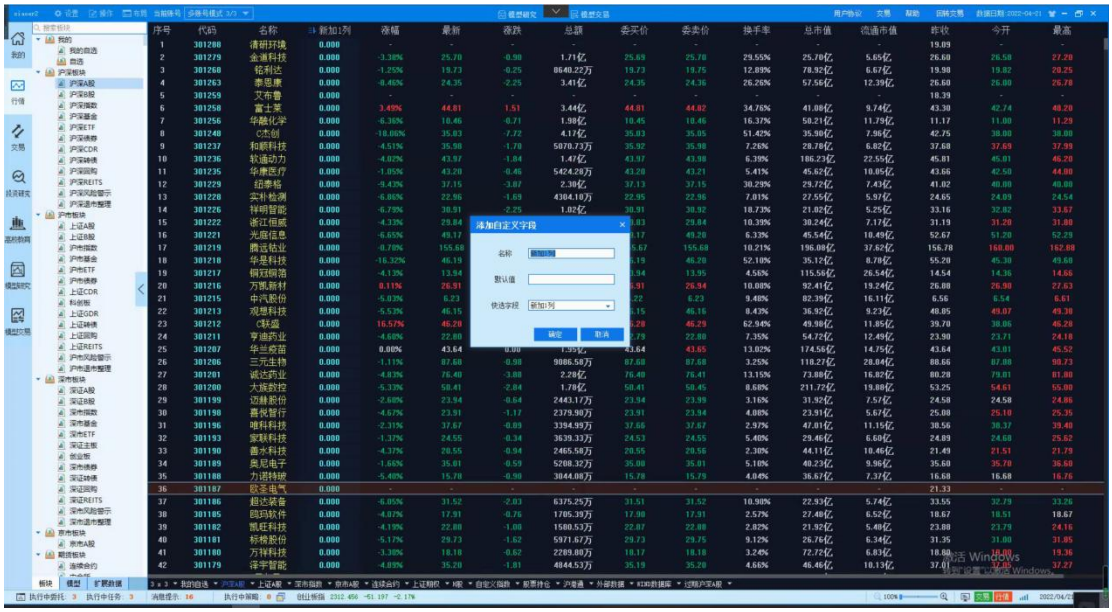
股票组合卖出：当前界面选中股票后，右键选择股票组合卖出，用户选择资金账号并填入投资金额后点击下单，即可为所选中的股票平均分配金额并卖出。

如果当前用户不拥有选中的某只股票的持仓，则不对选中的该只股票进行卖出操作；如果当前用户的持仓可用量不足分配的资金，则卖出全部持仓可用量，剩余的所分配资金部分不予处理。



股票组合卖出

添加自定义字段：可将自定义字段添加到报价界面中。



添加自定义字段

选择自定义指标：可将指标数据以字段形式添加到报价界面中。

选择自定义指标

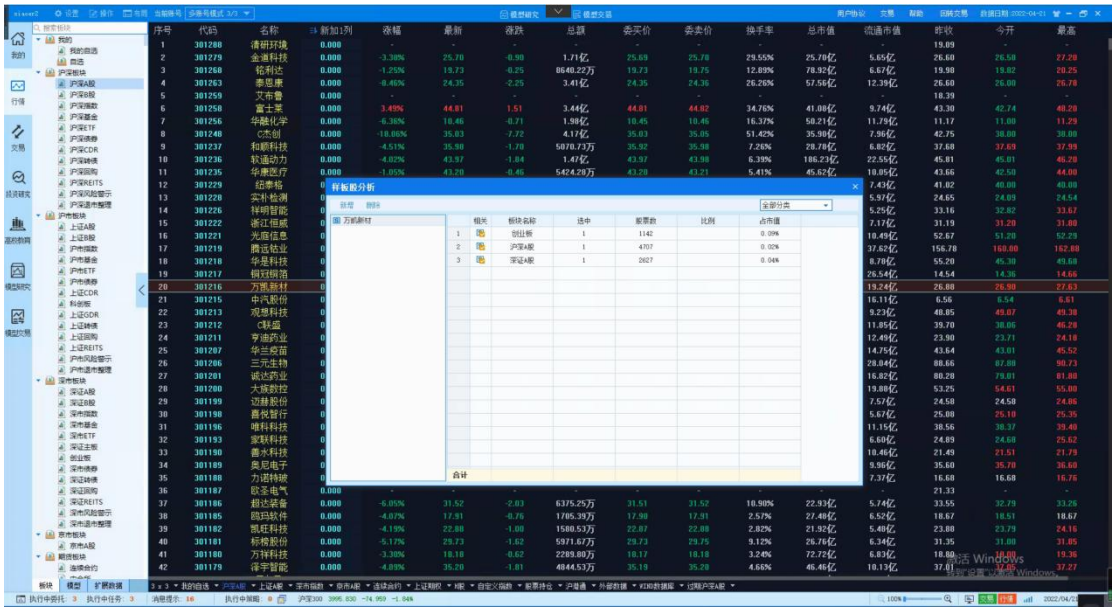
删除自定义指标：可将指标数据从面板中删除。

删除全部自定义指标：可将全部指标数据从面板中删除。

添加扩展数据：选择数据类型添加。

所属板块分析：勾选出所选证券存在的所有板块。支持新增多个证券，切换

对比。



样板股分析界面

导出成分股：可将本板块的全部成分股导出。（只导出成分股代码，要导出全部数据如今开，今收，最高，最低等全部数据请使用导出数据功能。）

加入自选板块：将选中的股票加入我的自选板块。

加入篮子：将选中的股票创建成一个新的篮子，创建完成后可在组合交易-篮子管理中查看。

条件选股：根据指标的条件可筛选符合条件的代码。

条件选股界面

新建工作组：即复制页面的功能。

默认布局：点击恢复默认布局，报价主界面即恢复到以下状态。

恢复默认布局

3.2.3. 个股分析界面

个股分析界面功能区域划分

个股分析界面包括管理面板，K 线图界面，附图指标界面，行情界面和个股信息界面。

3.2.3.1. 管理面板

指标管理面板配合个股分析界面使用。管理指标同 3.2.1.2 所述。

双击这些指标,K 线图中指标会相应变化或 K 线图下方区域会添加副图指标。

副图指标

3.2.3.2. K线图界面

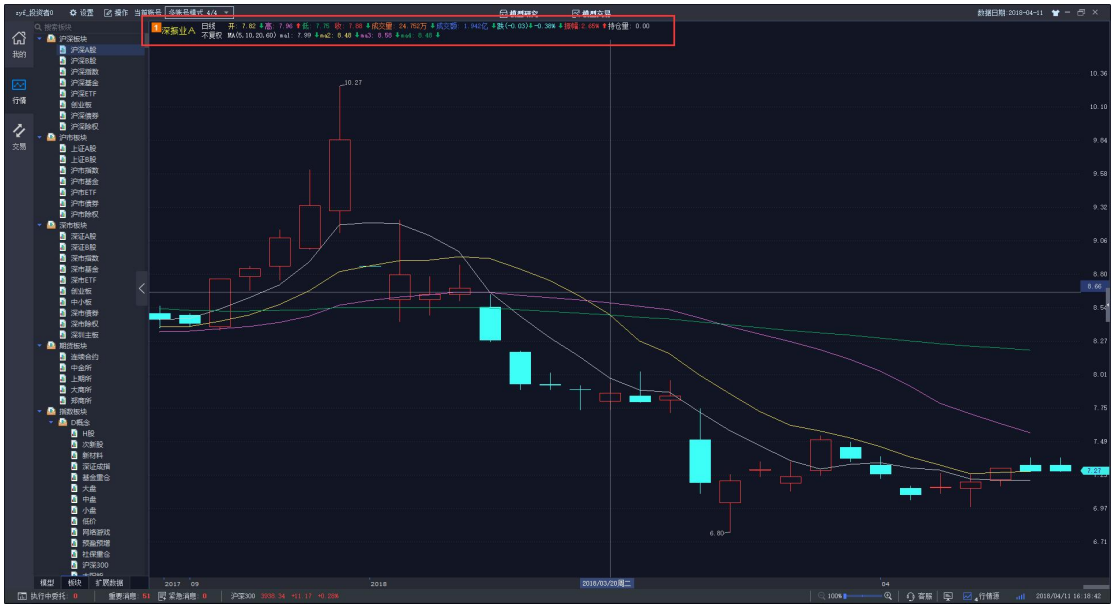
K线图界面会显示该品种的开盘价，最高价，最低价，收盘价，成交量，成交额，涨幅以及振幅等数据。K线默认叠加ma指标，可手动选择其他指标。同时在K线图界中双击相应日期历史k线，右侧行情及个股信息界面变动为相应日期数据。

界面切换：使用回车键和F5键都可实现个股分析界面和个股分时界面的切换。

十字光标：双击鼠标左键可在界面上出现十字光标，横向移动可选择要做分析的时间点，纵向移动可看到某一天的K线价格。

历史行情及个股信息：

鼠标在十字光标状态时，移动鼠标，相应的历史行情数据和ma指标值会在界面组上方跟随变动。

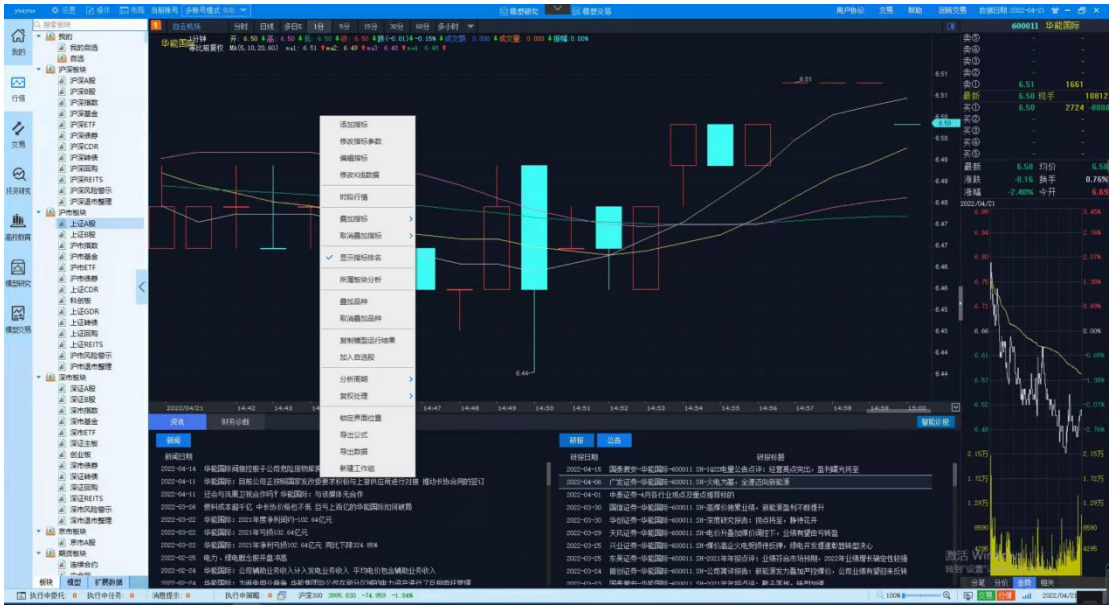


随十字光标变动数据

双击任意一根K线，最右侧的行情及个股信息界面会显示相应日期的历史行情和个股信息。

双击k线变动

右键菜单：

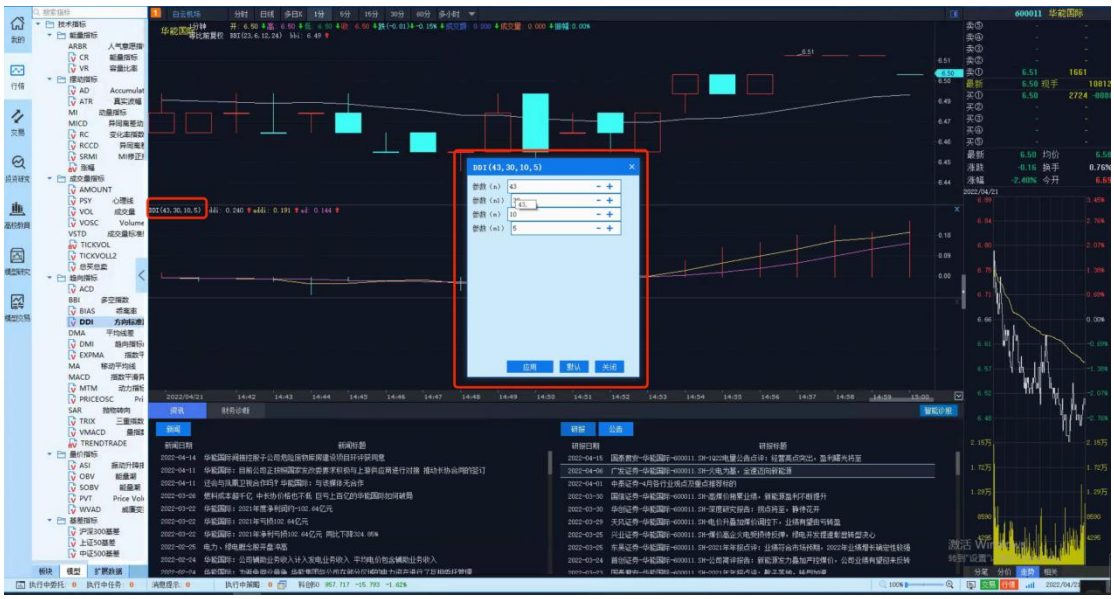


右键菜单

①添加指标：点击添加指标，会出现新的一栏附图指标。如下图显示 3 种指标。

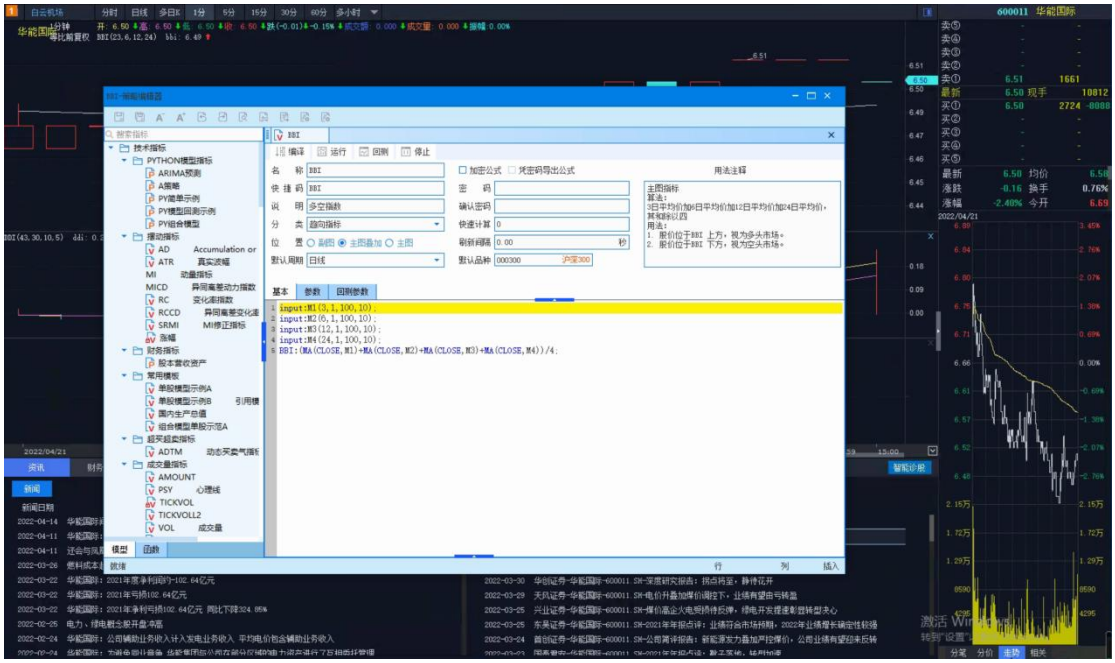
添加指标

②修改指标参数：修改所选指标的参数值。



修改参数

③编辑指标：出现迅投模型编辑器。可自定义编制指标。



编辑指标

④时段行情：输入起始日期和终止日期，选择所需观察时间段的 K 线图。勾选时段统计，会出现所选时段的价格及成交量的统计数据。

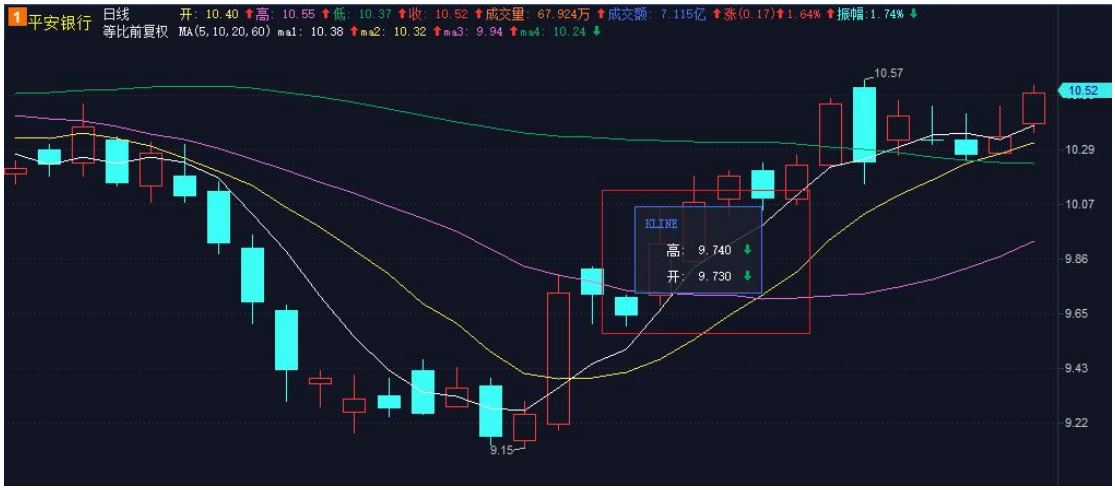
行情时段选择

时段统计

⑤叠加指标：点击叠加指标，出现主图指标选择，勾选后在主图坐标中叠加指标（或直接在指标管理面板中双击带有主图标志的指标），取消勾选后即取消叠加指标。

⑥取消叠加指标：显示现主图叠加的指标，取消勾选后即可取消叠加某一指标。

⑦显示指标排名：主图叠加指标并勾选显示指标排名后，鼠标悬停在 K 线上即可查看某根 K 线上的高开低收情况。

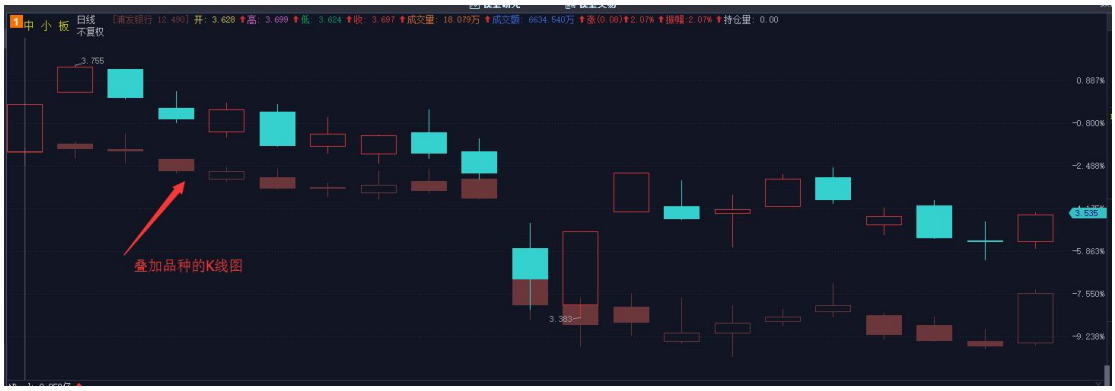


显示指标排名

⑧所属板块分析：可查看当前股票所属板块，同时还可新增其他股票，查看不同股之间的板块重合情况。

所属板块分析

⑨叠加品种：选择叠加品种后，会在左上角当前品种的后面出现叠加品种的种类。并出现选择的叠加品种的 k 线图，不止可叠加一个品种，可叠加多个品种。在未取消叠加品种的状态下，切换不用的股票（当前品种），叠加品种都不变。



叠加品种 k 线

⑩取消叠加品种：点取消叠加品种，所有叠加的品种都会取消。

⑪复制模型运行结果：选择复制运行结果之后，粘贴至记事本。

新建文本文档 - 记事本

文件(F) 编辑(E) 格式(O) 查看(V) 帮助(H)

```
时间,开,高,低,收,成交量,成交额,涨跌,涨跌百分比,振幅,持仓量
1992/03/30,10.0000,11.9500,10.0000,11.0000,4615.0000,5144986.0000,1.0000,0.1000,0.1773,0.0000
1992/03/31,11.1500,11.1500,10.3000,11.0000,6405.0000,6974020.0000,0.0000,0.0000,0.0773,0.0000
1992/04/01,11.0000,11.5000,10.6000,11.4000,4740.0000,5216986.0000,0.4000,0.0364,0.0818,0.0000
1992/04/02,11.2500,11.7000,11.0000,11.5500,5140.0000,5845979.0000,0.1500,0.0132,0.0614,0.0000
1992/04/03,11.5000,11.7000,11.2000,11.5000,4890.0000,5592008.0000,-0.0500,-0.0043,0.0433,0.0000
1992/04/06,11.5000,11.5500,11.2000,11.5000,4055.0000,4604006.0000,0.0000,0.0000,0.0304,0.0000
1992/04/07,11.3500,11.5000,11.2000,11.5000,4515.0000,5162992.0000,0.0000,0.0000,0.0261,0.0000
1992/04/08,11.5000,12.6000,11.5000,12.3500,4305.0000,5143011.0000,0.8500,0.0739,0.0957,0.0000
1992/04/09,12.5000,13.6000,12.5000,13.3000,4275.0000,5604012.0000,0.9500,0.0769,0.0891,0.0000
1992/04/10,13.4500,14.2000,13.3000,13.7500,4880.0000,6716002.0000,0.4500,0.0338,0.0677,0.0000
1992/04/13,13.9000,16.4000,13.8000,16.0000,4750.0000,7111985.0000,2.2500,0.1636,0.1891,0.0000
1992/04/14,16.0000,17.5000,16.0000,17.4500,5745.0000,9789997.0000,1.4500,0.0906,0.0938,0.0000
1992/04/15,17.5000,18.0000,15.6000,15.9500,6005.0000,10510971.0000,-1.5000,-0.0860,0.1375,0.0000
1992/04/16,15.7000,17.0000,15.3000,16.4000,6020.0000,9775998.0000,0.4500,0.0282,0.1066,0.0000
```

复制模型运行结果

⑫加入自选股：加入自选股，可添加至我的自选板块。

加入自选股

⑬分析周期：选择 k 线分析周期。

k 线分析周期

⑭复权处理：复权处理可选择不复权，前复权，后复权，等比前复权，等比后复权。

复权处理

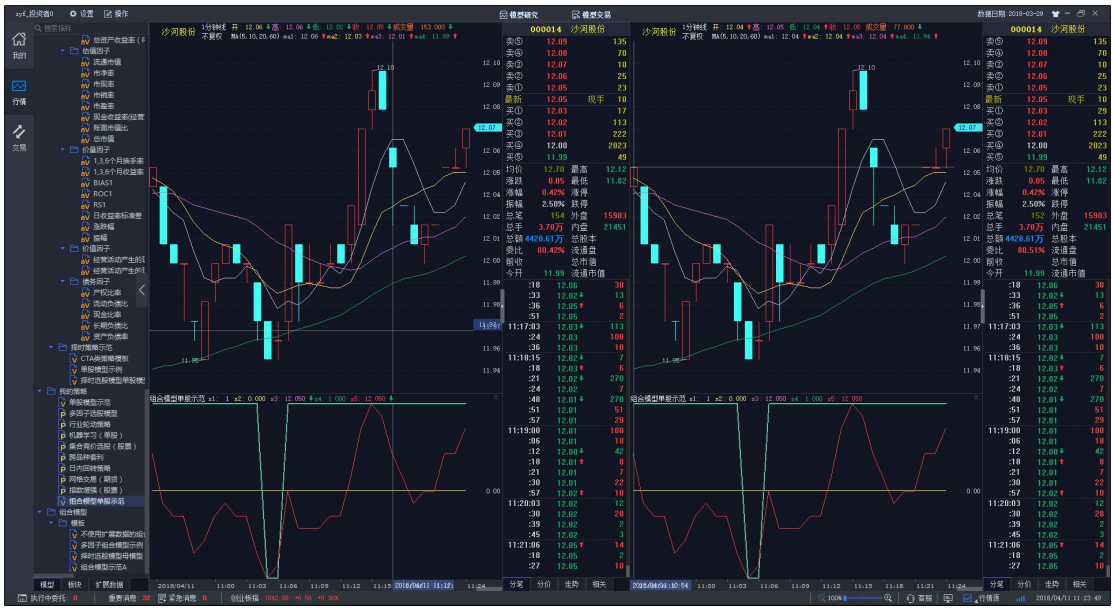
⑮锁定界面位置：选择锁定界面位置后，每次点击十字光标时十字光标会固定在所选位置 k 线的收盘价处。

锁定界面位置

⑯导出公式：点击导出公式，可将主图或副图叠加的指标或模型导出到本地。

⑰导出数据：点击导出数据，可将主图或副图叠加的指标或模型计算生成的数据以.csv 的格式导出到本地。

⑱新建工作组：选择新建工作组后，会复制一个当前相同的个股分析面板，复制内容包括主图和附图指标。



新建工作组

⑲ **修改 K 线数据：**修改指定 K 线的内容。

修改 K 线数据

3.2.3.3. 行情及个股信息界面

通过点击这个图中箭头所指的灰色标志可隐藏或打开盘口及个股信息界面。

行情及个股信息界面

①五档行情：

五档盘口

②个股信息：用户可以选择观察分笔、分价与分时走势。

个股信息

③分笔：提供分时成交明细表。在此可看到实时报价。

分笔界面

④分价： 提供每个成交金额及该金额对应的成交数量，可结合筹码指标一起使用。

分价界面

⑤走势 ：显示所在周期的分时走势图。

走势界面

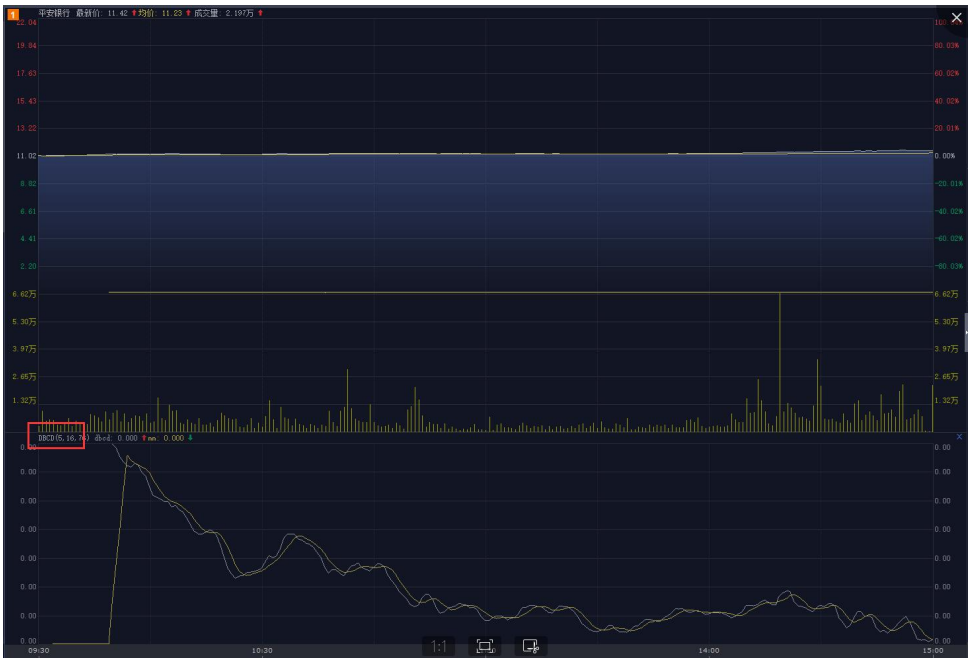
3.2.4. 个股分时界面

分时图与K线图可以通过”enter”键或“F5”键来回切换。

个股分析界面功能区域划分

3.2.4.1. 管理界面

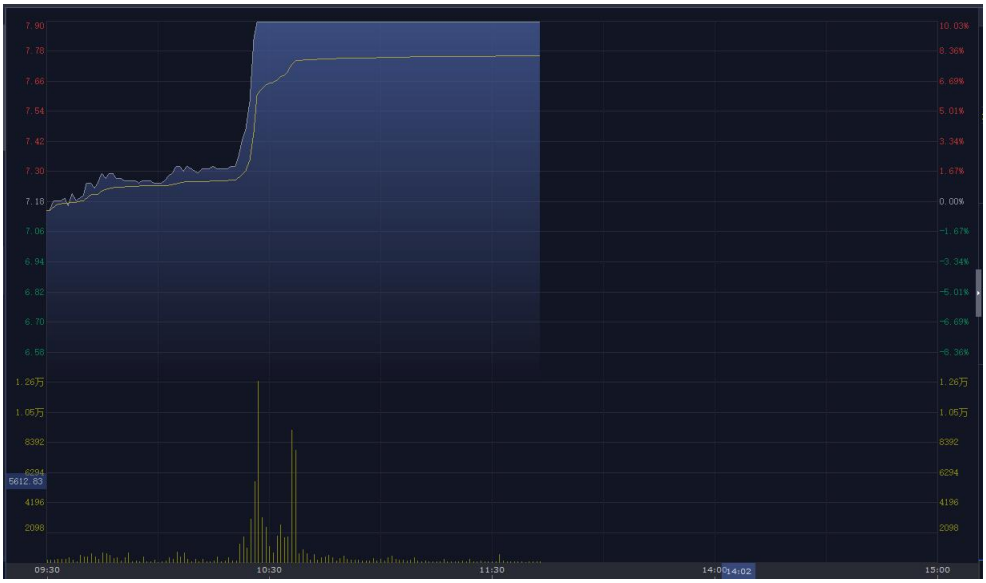
管理模型面板用于分时主界面的指标和模型的选择和叠加。管理指标同3.1.1.2所述。双击这些指标，分时图中指标会相应变化或分时图下方区域会添加附图指标。



附图指标

3.2.4.2. 分时主界面

分时图默认显示分时价格线、分时均价线和成交量。和个股分析界面一样，可自行选择主图坐标和附图坐标。



分时主界面

右键菜单：

右键菜单

①添加指标：点击添加指标，会出现新的一栏附图指标。

②叠加指标：点击叠加指标，出现主图指标选择，选择后在主图坐标中叠加指标（或直接在指标管理面板中双击带有主图标志的指标。）

③所属板块分析：勾选出所选证券存在的所有板块。支持新增多个证券，切

换对比。

④取消叠加指标：会相应出现已添加的主图指标，需要勾选即取消叠加指标。

⑤叠加品种：选择品种后，会出现相应品种的分时分时价格线。选择叠加品后会在左上角当前品种的后面出现叠加品种的种类。不止可叠加一个品种，可叠加多个品种。在未取消叠加品种的状态下，切换不用的股票（当前品种），叠加品种都不变。

叠加品种

⑥取消叠加品种：点击取消叠加品种，会将所有叠加品种取消。

⑦修改指标参数：修改所选指标的优化步长。

⑧编辑指标：系统指标不能编辑。非系统指标可以编辑。出现迅投模型编辑器。可自定义编制指标。

⑨显示成交量：不勾选显示成交量，仅显示分时价格线和分时均价线。勾选显示成交量。

不显示成交量

显示成交量

⑩显示渐变色：勾选则为渐变，分时图可渐变显示。

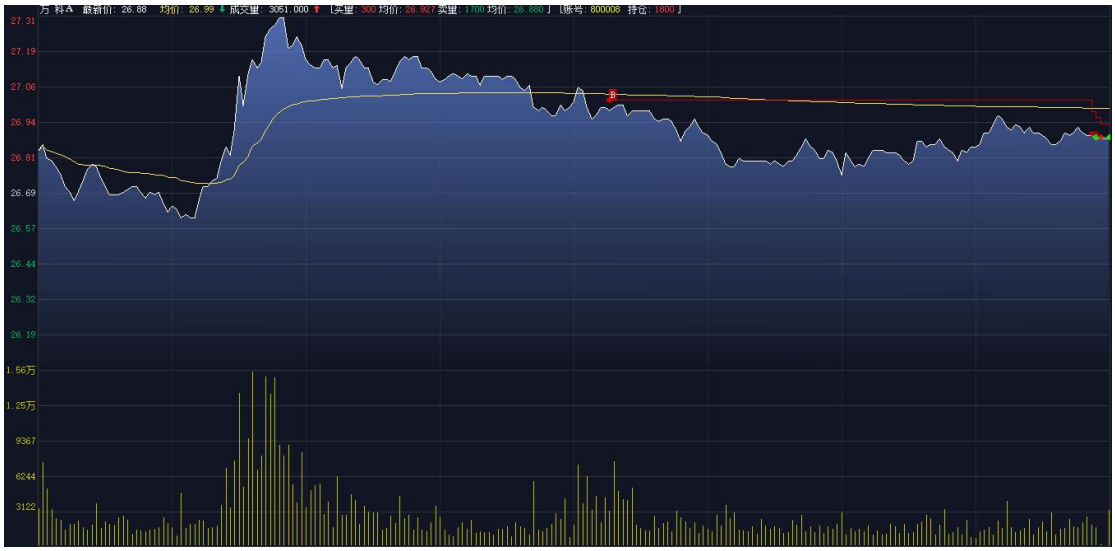
⑪加入自选股：加入自选股，可添加至我的自选板块。

⑫导出公式：系统指标不能导出，非系统指标可以导出。

⑬新建工作组：选择新建工作组后，会复制一个与当前相同的个股分时面板，

复制内容包括主图和附图指标。

⑭显示交易数据：勾选相关账号可显示交当日成交情况，如下图所示。



显示交易数据

3.2.4.3. 行情及个股信息界面

通过点击这个图中箭头所指的灰色标志可隐藏或打开盘口及个股信息界面。

行情及个股信息界面

①五档盘口：

五档盘口

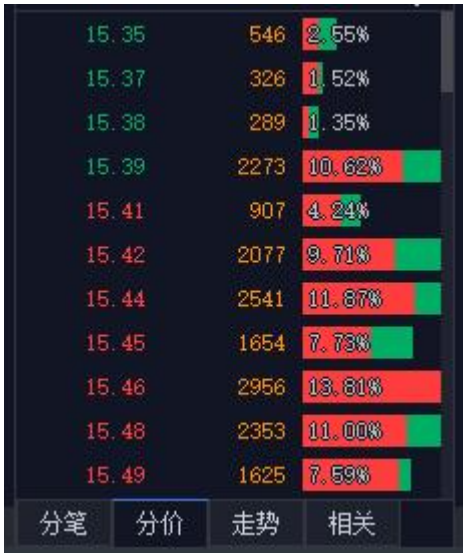
②个股信息：用户可以选择观察分笔、分价与分时走势。

个股信息

③分笔：提供分时成交明细表。在此可看到实时报价。

分笔界面

④分价： 提供每个成交金额及该金额对应的成交数量，可结合筹码指标一起使用。



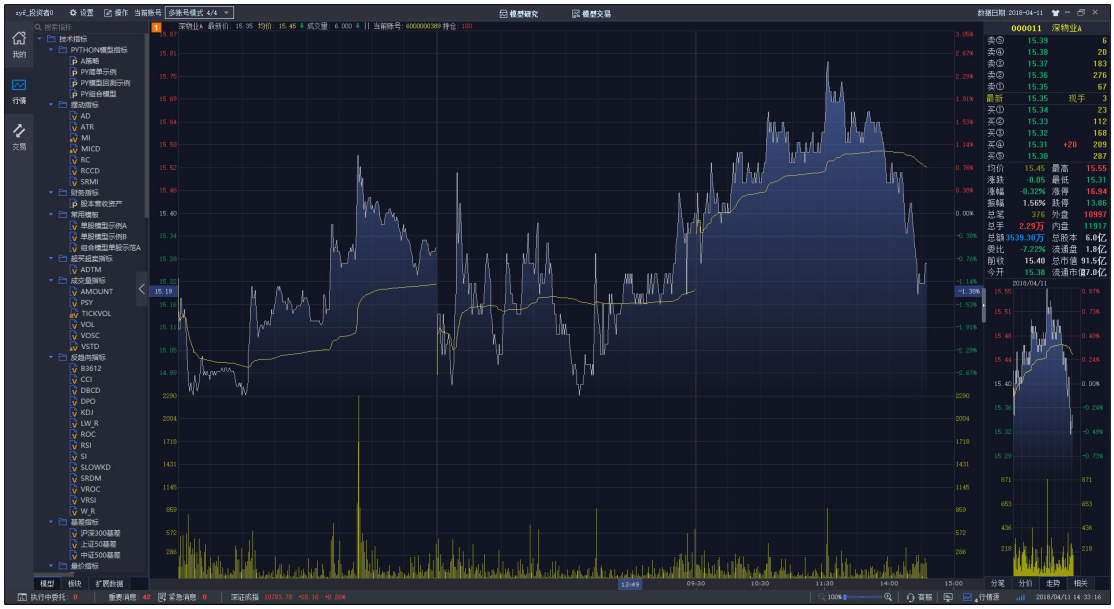
分价界面

⑤走势 ：显示所在周期的分时走势图。

走势界面

3.2.4.4. 多日历史分时图

在分时图界面里面每按“↓”一次，即可多显示历史交易日的分时图。



显示多日分时图

3.2.5. Level2 行情界面

3.2.5.1. Level2 行情入口

对于有 level2 使用权限的用户，在登录后即可查看 level2 行情。

Level1 主界面

Level2 主界面

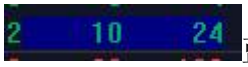
Level2 行情界面的主要组成部分为：主图、今日参数、委托队列、逐笔委托、逐笔成交、千档盘口、十档盘口、分笔数据和全息看盘等。

3.2.5.2. 买卖队列

委卖队列和委买队列是指实时的分笔委托明细。其中，买卖一档分别展示了申买量和申买量前 50 笔的分笔委托数据。

买卖队列

使用右上角的按钮可以变换买卖队列的多种展现形式，包括五档、十档以及其他各种队列模式。

队列中，  蓝色底色代表新增委托单， 灰色底色代表撤单， 白色字体代表已成交委托单， 蓝底灰字代表部成委托单， 浅绿色底色代表挂卖单在 1000-5000 手之内， 深绿色底色代表挂卖单大于 5000 手， 浅紫色底色代表挂买单在 1000-5000 手之内， 深紫色底色代表挂卖买单大于 5000 手。

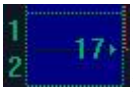
3.2.5.3. 逐笔成交

逐笔成交真实的展示了每笔成交价和成交量的明细数据。

逐笔成交

同时，分笔和逐笔数据实现联动，点击某条分笔数据，相应的逐笔成交部分高亮。

逐笔和分笔联动

队列中， 蓝色底色表示主动成交， 数字前面的箭头表示该委托单在这笔之前已有成交，  数字后面的箭头表示还未完全成交，之后还有成交。

鼠标悬停弹出每笔详情，其中表头右侧编号代表当天成交的第几笔数据，如下图所示：

逐笔成交详情

默认展开买卖列，点击 图标收起买卖列，如下图所示：

买卖队列收展

3.2.5.4. 逐笔委托

逐笔委托真实的展示了沪深市场的每一笔挂单和撤单，及其成交情况的明细数据。点击逐笔委托可追踪该委托，展示该笔委托对应的成交、撤单明细。

3.2.5.5. 千档盘口

在深市股票个股界面，十档盘口默认显示为千档的前十五档（盘口当前状态为15），单击15可展开完整千档行情和十档盘口（盘口当前状态为千），再次单击千可将完整千档关闭，仅显示十档盘口。

千档盘口显示全部价位的买卖盘价格、委托量、委托单数，点击可查看委托队列详情。

千档盘口中显示当前千档资金分布状态的缩略图（即展示整个千档的资金分布状态，并非与左侧各档位一一对应）。

千档盘口

鼠标置于千档上下滑动可查看更多数据，滑动后点击如下图所示按钮即可将千档居中展示。

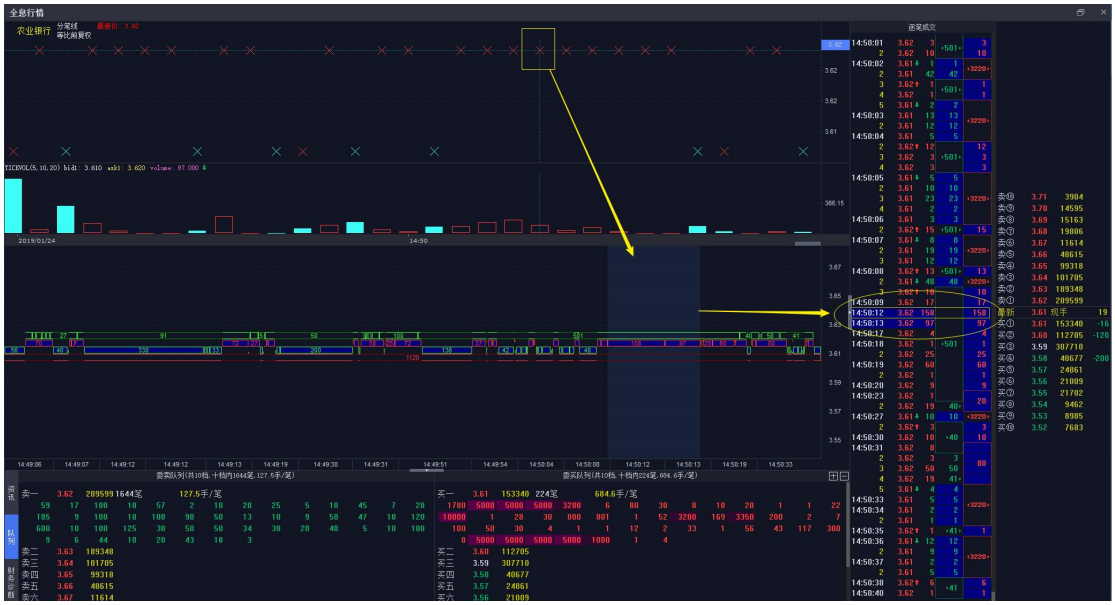
居中按钮

3.2.5.6. 全息看盘

点击全息按钮或在主界面使用空格键进入全息看盘界面。

全息界面由分笔图、成交量图、全息图、买卖队列、逐笔成交、千档盘口和十档盘口组成。分笔线、逐笔线和逐笔成交实时联动，展现交易撮合过程，为快速全方位的股票深度分析提供了解决方案。

全息界面可使用 pageup 和 pagedown 切换股票。



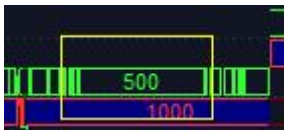
分笔、全息和逐笔联动

使用上下方向键实现图形的放缩，可查看全天的数据。

全部数据展示

全息图根据成交量决定显示的宽度，显示为上下两个矩形，分别表示买卖双方的委托单大小。

如果相邻成交来自于同一个委托单，则会将图形合并成一个矩形，展示效果如下：



相邻委托单

如果某笔委托单被其他委托中断，形成不连续成交，则其矩形图形中间用浅色线连接，如下图：

不连续成交

同一个委托单跨价位成交，用浅色斜线连接，如下图：

跨价位成交

对于主动成交的委托单，对其图形内部进行高亮处理，如下图：

主动成交

矩形右侧显示黄色三角，代表该委托单为市价单等特殊委托单；矩形右侧显示橙色三角，代表该委托单是委托价格优于成交价格的委托单。

在全息图形上放置鼠标后显示逐笔成交相关信息，其中表头右侧编号代表当天成交的第几笔数据。

成交详情

3.2.5.7. 其他特色功能

资讯页面可查看相关股票的最新动态，快速了解相关资讯。

相关资讯

3.2.6. 行情模块快捷键汇总

F3 上证指数分时图
F4 深圳成指分时图
F5 分时图、K线图切换
F6 沪深A股行情列表界面
F8 切换K线分析周期

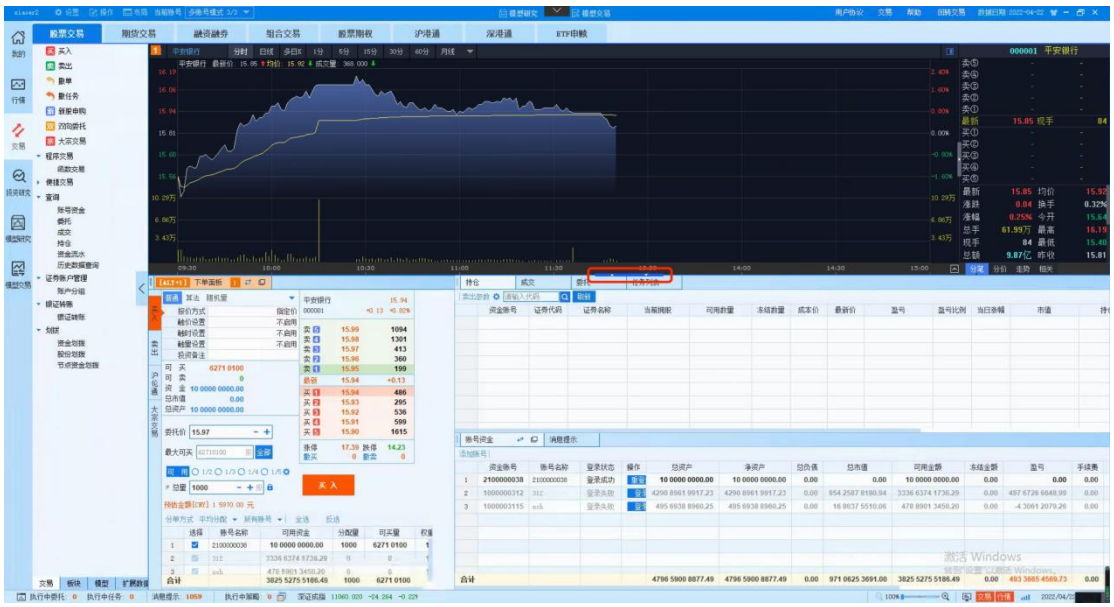
Ctrl+O 弹出指标叠加对话框
Ctrl+Z 添加自选股
Ctrl+M 多股同列
Ctrl+X 多周期同列（在K线界面下使用）
Ctrl+R 系统切换至光标所指日期（在K线界面下使用）
Ctrl+V 不复权/前复权切换
Ctrl+B 不复权/后复权切换
SHIFT +Q 弹出变量查看器（模型条件下）
SHIFT +L 锁定界面位置
SHIFT +W 弹出/关闭管理面板
HOME 光标移至最左
END 光标移至最右
Insert 添加自选股

下列快捷键是由键盘精灵输入
60 全部A股张幅
61 沪A张幅排名
62 沪B张幅排名
63 深A张幅排名
64 深B张幅排名
65 沪债张幅排名
66 深债张幅排名
67 深沪A张幅排名
68 深沪B张幅排名
69 中小企业张幅排名

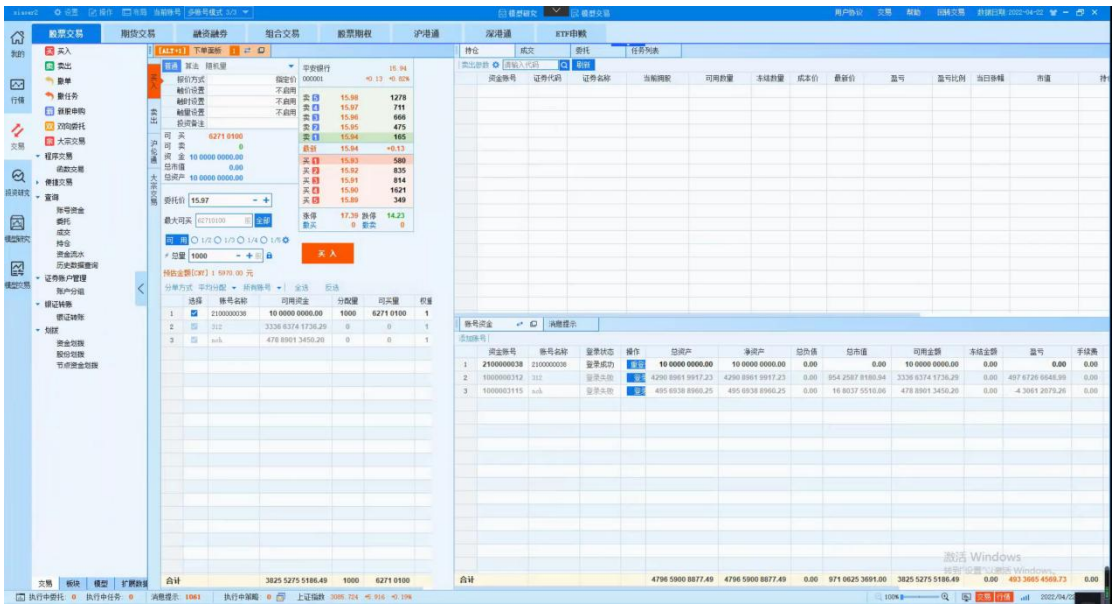
快捷键汇总

3.3. 交易模块

交易模块中同样可见行情面板，易于投资者观察行情进行交易。行情模块和交易模块通过按键实现行情模块或交易模块的收起和展开。



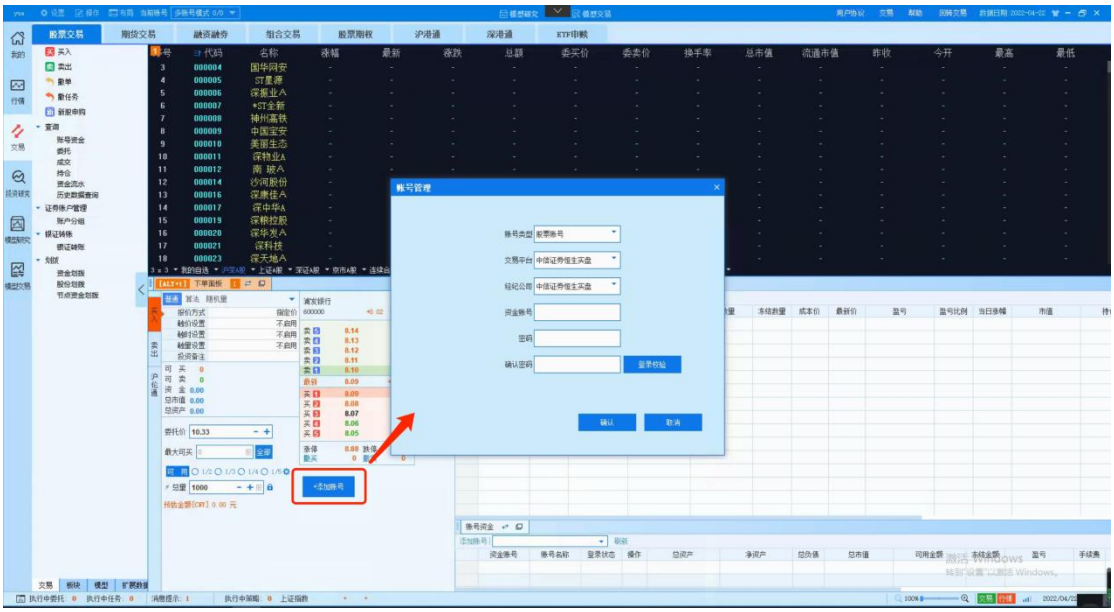
收起展开按钮



交易模块展开界面及收起键

3.3.1. 账号管理

首次使用交易模块，未在系统中添加过账号时，可以点击下单面板中添加账号按钮，添加账号。



如需继续添加多账号时，可点击账号资金面板中的添加账号功能继续添加资金账号。

还可以通过系统设置中账号管理功能添加资金账号。

添加账号界面

在账号管理中，可添加和删除账号，可查看账号名称、账号登录状态、总资产、可用资金、账号类型，可对登录失败的账号进行重登录。

添加账号：选择账号类型，交易平台，经纪公司,资金账号和密码后可添加账号，需注意的是，如果系统开启了账号白名单，则所添加账号必须已经在迅投QMT极速策略交易系统管理终端白名单中才能添加成功，否则需先在管理端将此账号添加在白名单中。

登录校验是校验账号密码，校验成功后点击确定账号即添加成功。

添加成功的账号可以删除、手续费设置和改密码操作。

3.3.2. 交易服务

迅投极速策略交易系统下单界面支持如下特色功能：

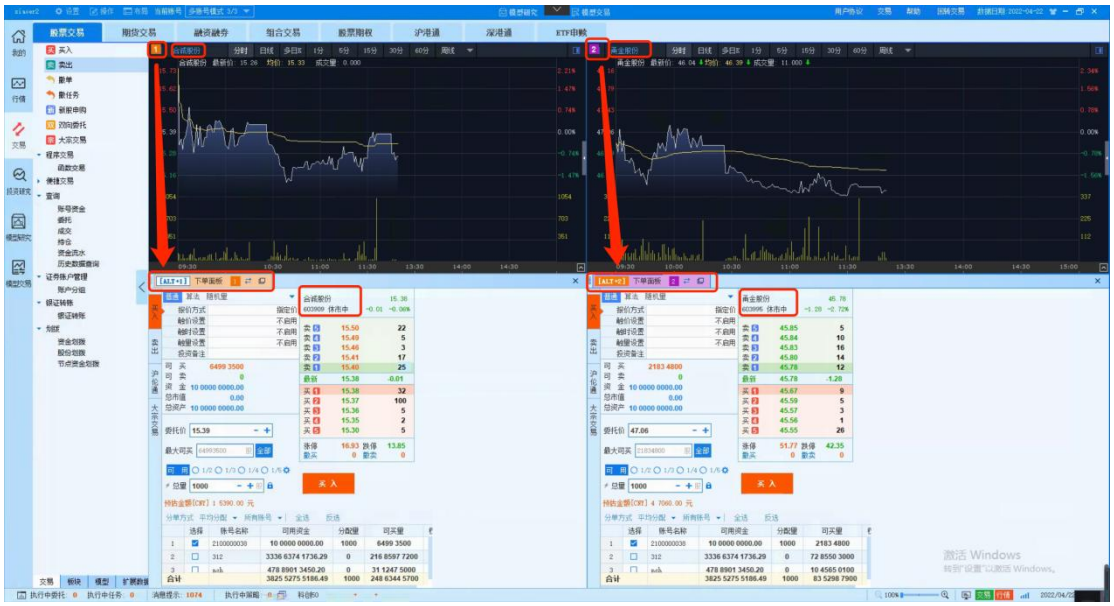
①复制下单面板：

面板复制可以让用户按照自己的需要将软件的下单面板复制出多个界面窗口，让用户可以在同一个版面上查看到更多的信息及进行更多的操作。

用户可使用ALT+数字键的方式，根据下单面板的数字标识，在不同的下单面板中进行切换（需在系统设置-快捷键设置中开启本功能）。

复制下单面板

②分组联动下单



行情与下单面板分组联动下单

分组联动下单功能需要配合复制面板功能使用。行情界面和下单面板都有选择分组的图标，点击图标，从 1 到 9 的关联中选择分组。不同分组下单面板可关联不同的行情界面，在不同行情界面双击某证券时，实现在下单面板中联动出现相关信息，即实现联动快速下单。

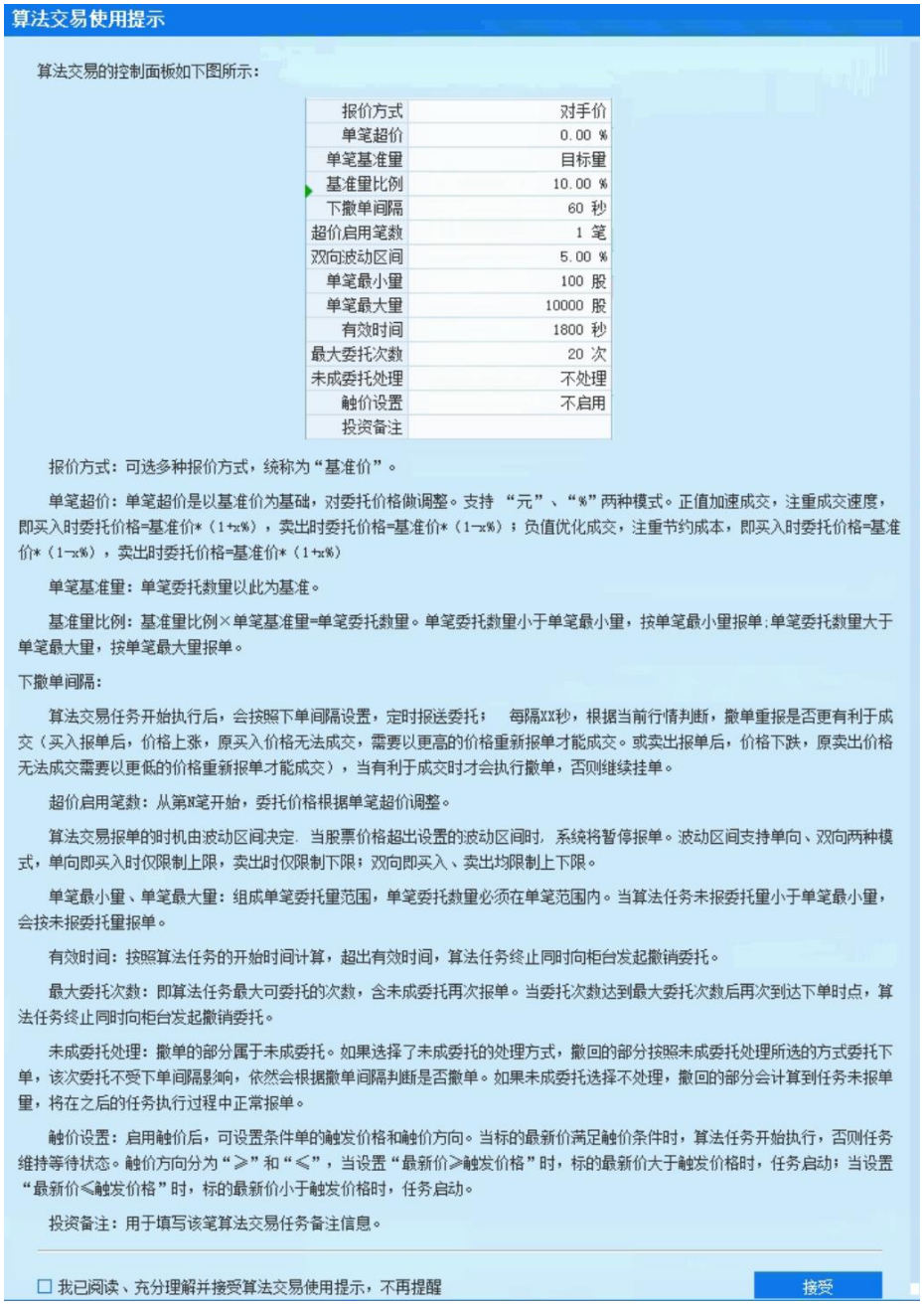
例如：在关联分组 1 的行情界面双击任意证券，关联分组为 1 的下单面板中，相应自动填充此证券的信息。

下单面板选择分组图标位置

行情界面选择分组图标位置

③算法交易

迅投 QMT 算法交易通过大单拆分方式减少对市场的冲击，并且根据行情波动及时调整报价已保证快速成交。详情见图。



算法交易使用提示

算法交易的控制面板如下图所示：

报价方式	对手价
单笔超价	0.00 %
单笔基准量	目标量
基准量比例	10.00 %
下撤单间隔	60 秒
超价启用笔数	1 笔
双向波动区间	5.00 %
单笔最小量	100 股
单笔最大量	10000 股
有效时间	1800 秒
最大委托次数	20 次
未成委托处理	不处理
触价设置	不启用
投资备注	

报价方式：可选多种报价方式，统称为“基准价”。

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，即买入时委托价格=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，即买入时委托价格=基准价*（1-x%），卖出时委托价格=基准价*（1+x%）

单笔基准量：单笔委托数量以此为基准。

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。

下撤单间隔：

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； 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。

超价启用笔数：从第x笔开始，委托价格根据单笔超价调整。

算法交易报单的时机由波动区间决定. 当股票价格超出设置的波动区间时, 系统将暂停报单。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。

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。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。

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。

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。

未成委托处理：撤单的部分属于未成委托。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，该次委托不受下单间隔影响，依然会根据撤单间隔判断是否撤单。如果未成委托选择不处理，撤回的部分会计算到任务未报单量，将在之后的任务执行过程中正常报单。

触价设置：启用触价后，可设置条件单的触发价格和触价方向。当标的最新价满足触价条件时，算法任务开始执行，否则任务维持等待状态。触价方向分为“≥”和“≤”，当设置“最新价≥触发价格”时，标的最新价大于触发价格时，任务启动；当设置“最新价≤触发价格”时，标的最新价小于触发价格时，任务启动。

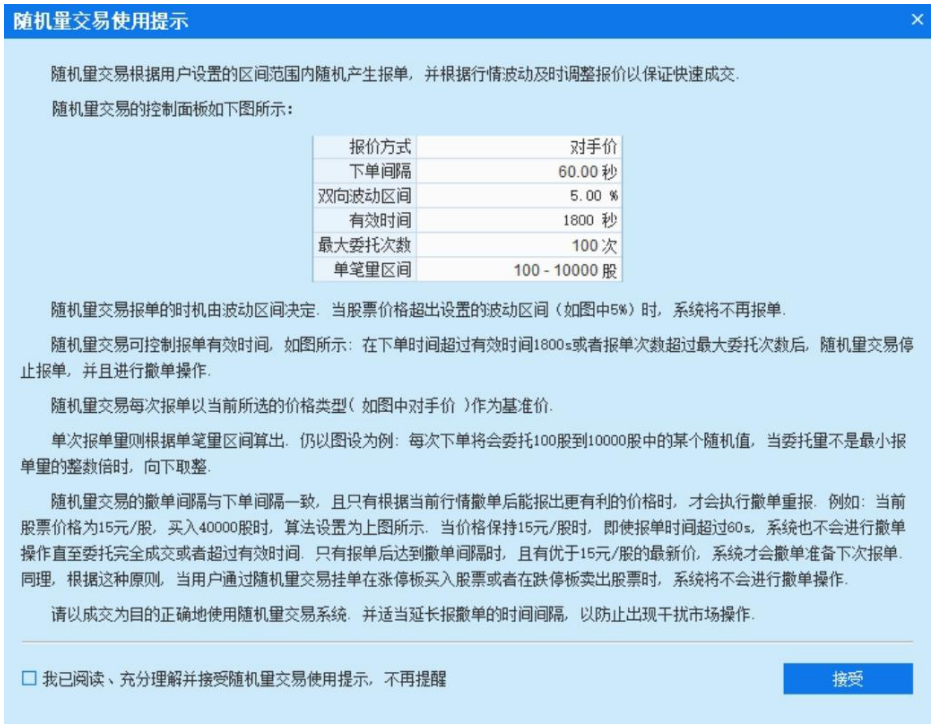
投资备注：用于填写该笔算法交易任务备注信息。

☐ 我已阅读、充分理解并接受算法交易使用提示，不再提醒　　接受

算法交易

④随机量交易

迅投 QMT 随机量交易是根据用户设置的区间范围内随机产生报单，并根据行情波动及时调整报价以保证快速成交。详情见图。



随机量交易

⑤多账户分单

迅投 QMT 支持多账号快捷选择，选中的账号才会显示在资金面板处。

多账号

当用户管理多账户时，支持对多账号和账号组内以“平均分配”“交易权重”“可用比例”三种方式进行分单。

分单方式

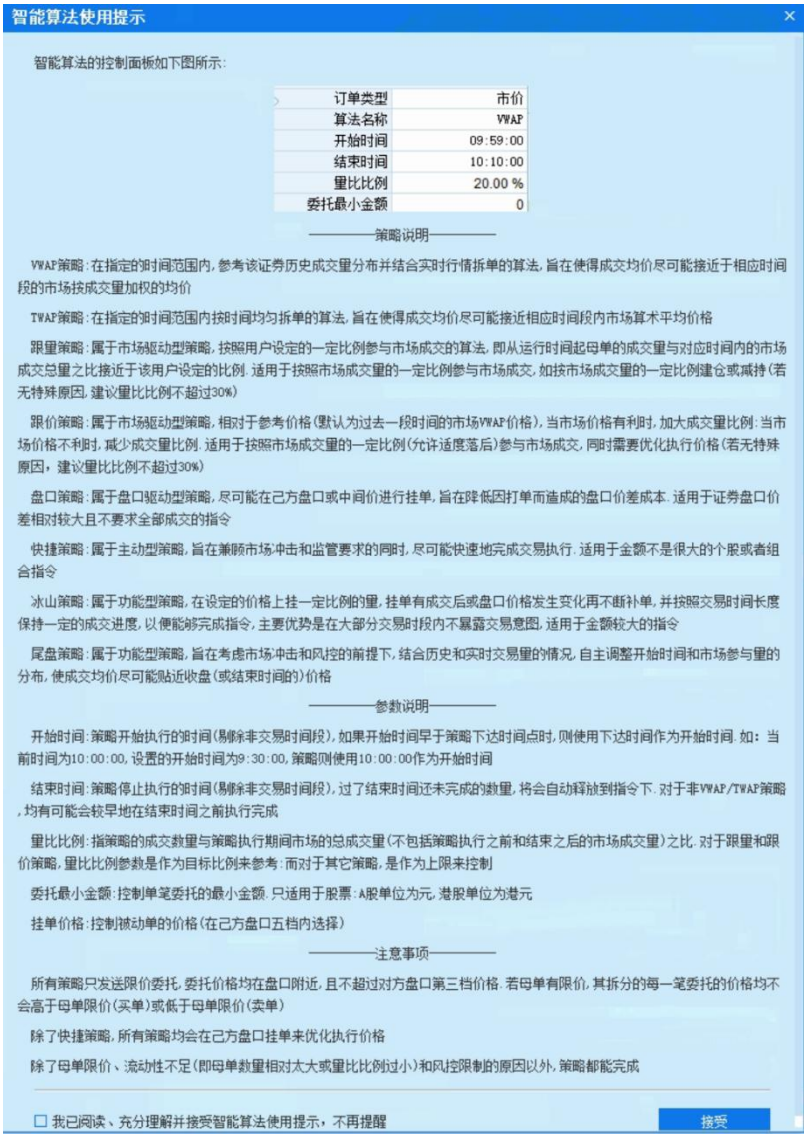
平均分配：多账户平均分配。例如：下单 300 股，选中三个账户按平均分配，则为每个账户下单 100 股。

交易权重：多账户之间按设置的权重分配。例如：下单 300 股股票，选中 2 个账号按照交易权重分配，A 账号权重设为 2，B 账号权重设为 1，则 A 账户下单 200 股，B 账号下单 100 股。

可用比例：多账户之间按可用资金比例下单。例如：下单 1000 股股票，选中三个账号。A 账号可用资金 30 万，B 账户可用资金 60 万，C 账户可用资金 10 万，则按照 3：6：1 的比例下单，A 账户下单 300 股股票，B 账户下单 600 股股票，C 账户下单 100 股股票。

⑥智能算法交易

迅投 QMT 智能算法交易是根据用户设置的对应智能算法策略进行下单，包括但不限于 TWAP、VWAP、跟量、冰山等（具体算法说明请参考《智能算法交易介绍及使用手册》）。用户使用时可参考智能算法使用提示进行操作，详情见图。



智能算法

3.3.2.1. 股票交易

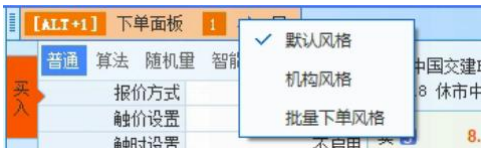
股票交易是指股票投资者之间按照市场价格对已发行上市的股票进行的买卖。目前系统支持普通买卖、科创板、逆回购、新股申购和 CDR 存托凭证等交易操作.

3.3.2.1.1. 下单面板

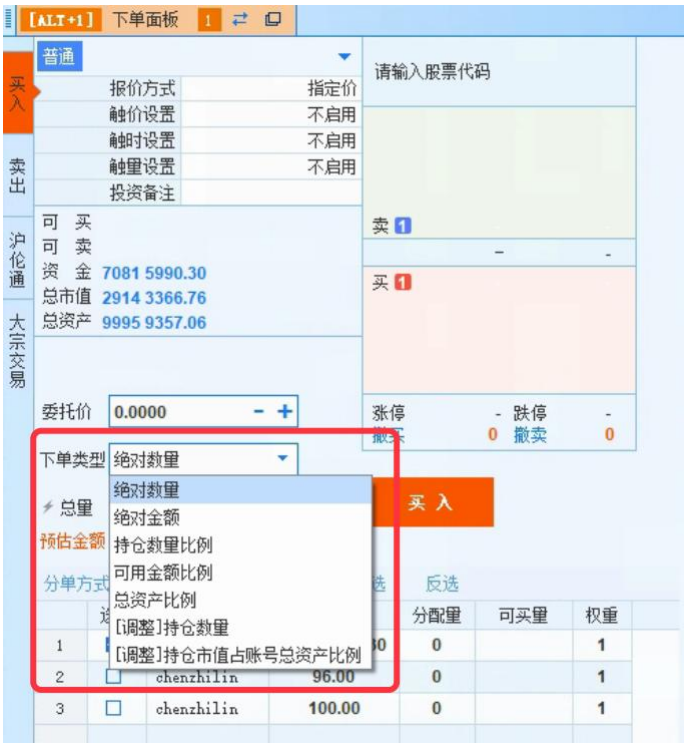
下单面板

盘口清晰显示该合约的行情变动情况。股票交易和期货交易下单面板可选择不同盘口风格，切换为机构风格时，可选择下单类型。

以股票交易为例：



盘口风格切换



机构风格时选择下单类型

使用机构风格时：

下单类型选用**绝对数量**，是指按照股票总量下单；

下单类型选用**绝对金额**时，根据输入金额总量和委托价计算买入数量，当计算出来的数量存在零股时，向下取整；

下单类型选用**持仓数量比例**时，根据当前账号下该合约的持仓和买入比例计算下单数量；

下单类型选用**可用金额比例**时，根据当前账号的可用金额和买入比例计算下单数量，当计算出来的数量存在零股时，向下取整；

下单类型选用**总资产比例**时，根据当前账号的总资产和买入比例计算下单数量，当计算出来的数量存在零股时，向下取整；

下单类型选用**[调整]持仓数量**时，按照输入的数量调整当前持仓的数量；

下单类型选用**[调整]持仓市值占账号净资产比例**时，按照账号净资产和输入的比例计算目标持仓市值，当计算出来的数量存在零股时，向下取整。

五档盘口清晰显示该合约的行情变动情况。

可使用快捷键下单，快捷键可查看系统设置-快捷键设置中进行设置。

下单时，有多个资金账号时，可选用不同的分单方式，包括平均分配、交易权重和可用比例。

平均分配：多账户平均分配。例如：下单 300 股，选中三个账户按平均分配，则为每个账户下单 100 股。

交易权重：多账户之间按设置的权重分配。例如：下单 300 股股票，选中 2 个账号按照交易权重分配，A 账号权重设为 2，B 账号权重设为 1，则 A 账户下单 200 股，B 账号下单 100 股。

可用比例：多账户之间按可用资金比例下单。例如：下单 1000 股股票，选中三个账号。A 账号可用资金 30 万，B 账户可用资金 60 万，C 账户可用资金 10 万，则按照 3：6：1 的比例下单，A 账户下单 300 股股票，B 账户下单 600 股股票，C 账户下单 100 股股票。

当系统支持 Level2 行情数据时下单面板支持切换五档或十档盘口展示模式。

3.3.2.1.2. 买入

买入界面

买入是对股票、债券、基金、存托凭证 CDR 等证券进行普通股票交易的买入操作，增加账号持仓量，减少可用资金。其中债券的最小交易单位为 10 的整数倍，采用 T+0 交易制度（当日买入，当日可卖出），股票的最小交易单位为 100 的整数倍，采用 T+1 交易制度，T 日买入，增加在途股份，T+1 日由在途转为可用，可以卖出。

3.3.2.1.3. 卖出

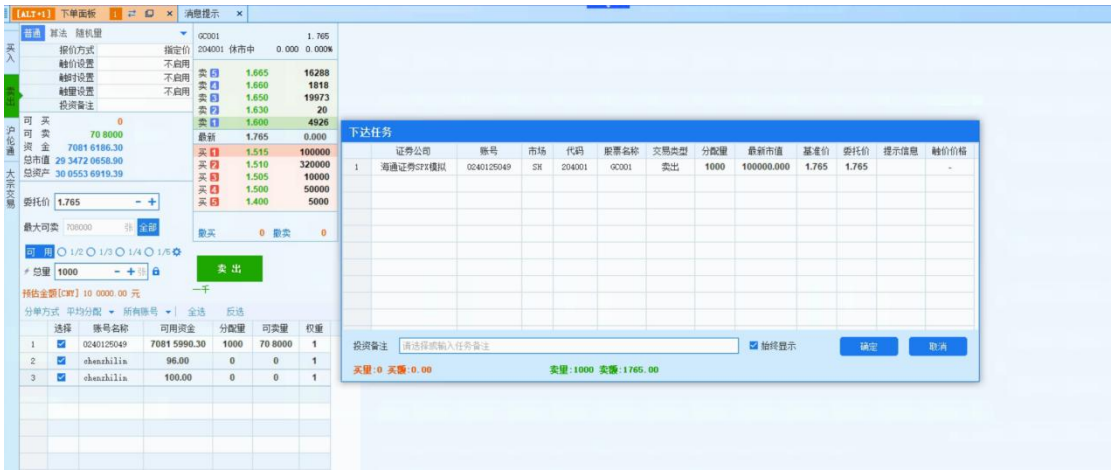
卖出是对股票、债券、基金、存托凭证 CDR 等证券进行普通股票交易的卖出操作，减少账号持仓量，增加可用资金。

卖出界面

3.3.2.1.4. 逆回购

逆回购是指资金融入方将符合要求的债券申报质押，以相应折算率计算出的质押券价值为融资额度进行质押融资，交易双方约定在回购期满后返还资金同时解除债券质押的交易中的融出资金方。

逆回购交易通过“卖出”操作获取仓位，逆回购到期后，仓位自动清除，资金自动增加至可用资金中，次日可取。



逆回购操作界面

3.3.2.1.5. 可转债

可转换债券是可转换公司债券的简称，又简称可转债，是一种可以在特定时间、按特定条件转换为对应公司普通股票的特殊企业债券。可转换债券兼具债权和期权的特征。公司发行的含有转换特征的债券，在招募说明中发行人承诺根据转换价格在一定时间内可将债券转换为公司普通股，转换特征为公司所发行债券的一项义务。可转换债券的优点为具备普通股所不具备的固定收益和一般债券不具备的升值潜力。

对可转债在“买入面板”做买入、转股操作。

买入及转股操作

在“卖出面板”做卖出、回售操作。

卖出及回售操作

除股票买入/卖出界面外，融资融券-担保品买卖界面也支持可转债的买卖、

转股及回售交易，后续不再赘述。

3.3.2.1.5.1. 转股

当在下单面板中填入相应的转股代码后，单次转股申报时委托量不能超过可转债可用量，但同一交易日内可多次申报转股，在收市后合并计算转股数量。

可转债持有人申请转股的可转债数额大于实际拥有的可转债数额的，按其实际拥有的数额进行转股，申请剩余部分予以取消。

当转股操作执行后就会产生一条对应的转股委托，没有成交。转股申报当日可以撤单。

由于可转债买卖申报优于转股申报，当转股产生已报委托后，不会冻结持仓和可用资金。转股成功后的当天晚上 9 点以后或第二天早上，可转债相应的持仓消失，出现可转债的正股，相应正股持仓的可用持仓会增加转股成功的股数，并且股票第二天(T+1 日)就可卖出。转股不会影响资金变化。

若转股失败，可转债持仓不变，持正股数不变。

3.3.2.1.5.2. 回售

当在下单面板中卖出界面填入相应的回售代码后，回售申报时委托量不可超过可转债可用量。

当回售操作执行后，会产生一条对应的回售委托，没有成交。回售申报当日可以撤单，但申报一经确认，不得撤销。

可转债的买卖申报优于回售申报，当回售操作执行成功后，当日收市前可卖

出。收市清算后可转债可用量减少，可用资金不变。回售申报期限一过，回售资金到账期，可用资金相应变化。

若回售失败，可转债持仓可用不变。

3.3.2.1.5.3. 交易方式

转股和回售仅支持普通交易，当选择其他交易方式时，会出现弹框提示，如下图所示：

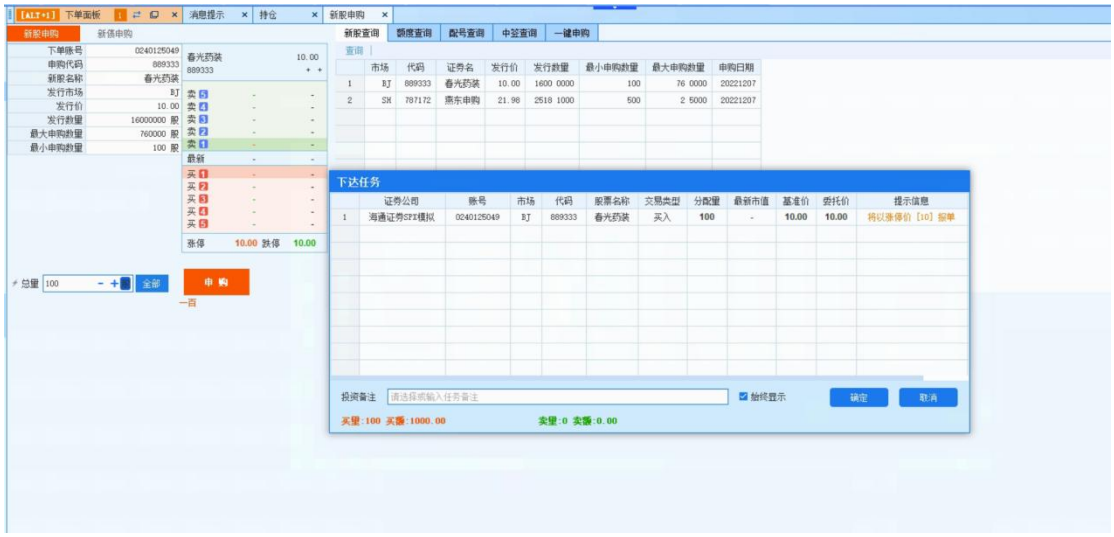
3.3.2.1.6. 新股申购和新债申购

系统支持新股申购和新债申购，用户根据交易所要求申购新股和债券。新股申购和新债申购的流程基本相同，以下以新股申购为例进行介绍。

新股申购和新债申购

新股申购：系统支持新股申购，用户根据交易所要求申购新股。

投资者参与网上公开发行股票的申购，只能使用一个证券账户。以同一证券账户多次参与同一只新股申购的，以第一笔申购为有效申购，其余申购均为无效申购。一经申报，不得撤单。



新股申购界面

查询当日新发行股票：

	市场	代码	证券名	发行价	发行数量	最小申购数量	最大申购数量	申购日期
1	BJ	889333	春光药装	10.00	1600 0000	100	76 0000	20221207
2	SH	787172	燕东申购	21.98	2518 1000	500	2 5000	20221207
2	合计				41181000	600	785000	

新股查询界面

查询资金账号可申购额度。

额度查询界面

交易所以实际到位资金作为有效申购进行配号。配号公布后可在“配号查询”中查询。申购配号根据实际有效申购进行，每一有效申购单位配一个号，对所有有效申购单位按时间顺序连续配号。

配号查询界面

如果申购成功，可在“中签查询”中查询申购成功的股票信息。中签后，由柜台在缴款日自动扣款，请注意预留可用资金。

中签查询界面

一键申购新股：

一键申购界面

3.3.2.1.7. 沪伦通

沪伦通业务是指上海证券交易所与伦敦证券交易所互联互通机制，符合条件的两地上市公司，依照对方市场的法律法规，发行存托凭证（DR）并在对方市场上市交易。存托凭证(DR)是指由存托人签发，以境外证券为基础在中国境内发行、代表境外基础证券权益的可转让凭证。

投资者使用A股证券账户参与沪伦通存托凭证(CDR)的认购与交易。沪伦通存托凭证业务上参照A股，资金均以人民币计价、交易日历按照A股安排、证券及资金账户均与投资者参与A股交易的做法一致。

迅投QMT极速策略交易系统沪伦通交易模块，实现了沪伦通行情显示、委托查询、成交查询、持仓查询、单笔委托、撤单等功能。

沪伦通交易面板

3.3.2.1.8. 大宗交易

大宗交易是指达到规定的最低限额的证券单笔买卖申报，买卖双方经过协议达成一致并经过交易所确定成交的证券交易。

在股票交易模块，增加大宗交易面板，支持意向申报，成交申报，定价申报，盘后固定价申报。

需要在管理端系统设置和用户账号设置中开启允许使用大宗交易的权限，用户才可以在交易端看到此功能。

3.3.2.1.8.1. 意向申报

大宗交易客户意向报价发布，必须填写证券代码、买卖方向，联系方式、联系人，意向申报中是否明确交易价格和交易数量，由申报方决定。意向申报应当真实有效。申报方价格不明确的，视为至少愿以规定的最低价格买入或最高价格

卖出；数量不明确的，视为至少愿以最低限额成交。意向申报指令可以撤销。意向申报要冻结资金/证券。

1、输入代码；自动查询代码相关行情；

2、选资金账号；

3、填写相关信息；

4、点击买入/卖出弹出确认面板；

5.核对相关信息无误后，点击确定生成指令发布意向。否则点击取消返回修改。

3.3.2.1.8.2. 成交申报

买卖双方达成协议后，提出成交申报，申报的交易价格和数量必须一致。必须填写证券代码、买卖方向，数量，价格。选填约定号、对手席位。

价格：

有价格涨跌幅限制证券的协议大宗交易的成交价格，在该证券当日涨跌幅限制价格范围内确定。

无价格涨跌幅限制证券的协议大宗交易的成交价格，在前收盘价的上下30%之间确定。

1、输入股票代码；自动查询代码相关行情；

2、选择资金账号

3、深圳大宗交易有两种下单方式

（1）**点击成交**（即与定价申报报对手交易），选择行情信息，自动填充相关信息。无需勾选配对成交

（2）**配对成交**，买卖双方线下协商后互报对手，手动输入买卖标的、方向、数量、对手席位，约定号相关信息自行报单。

进行深交所配对成交时需要勾选配对成交

4、上交所只有配对模式所以盘口输入上交所代码时无需显示配对成交勾选框

5、点击买入/卖出弹出确认面板。

6、核对信息填写无误，点击确定发布成交申报指令。否则点击取消返回修改。

3.3.2.1.8.3. 深交所定价申报

深交所定价申报指令必须填写包括证券代码、买卖方向、价格、数量，联系方式、联系人。市场所有参与者可以提交成交申报，按指定的价格与定价申报全部或部分成交，深交所按时间优先顺序进行成交确认，会按指定的价格与定价申

报全部或部分成交。定价申报的未成交部分可撤销，定价申报每笔成交的数量或交易金额，需要满足协议大宗交易最低额的要求。定价申报约定号由交易所自动生成，通过行情查看。

步骤与意向申报相同不再赘述

3.3.2.1.8.4. 盘后定价申报

盘后定价大宗交易的申报指令必须填写证券代码、买卖方向、数量、价格类型等内容。

盘后定价大宗交易的价格类型包括：

（一）证券当日收盘价（上交所和深交所）；

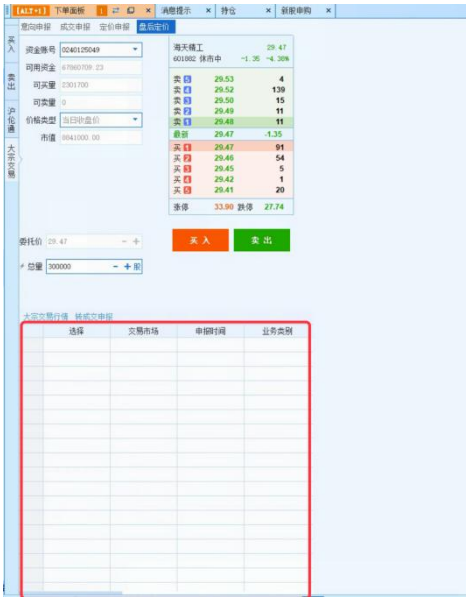
（二）证券当日成交量加权平均价格（仅深交所）。

盘口输入上交所代码时价格类型只能选择当日收盘价

输入证券代码，选择交易账号，选择价格类型。系统自动获取价格，计算市值。点击买入/卖出弹出确认面板。核对信息填写无误，点击确定发布盘后定价申报指令。否则点击取消返回修改。

3.3.2.1.8.5. 大宗交易行情

输入代码后自动查询代码相关行情。

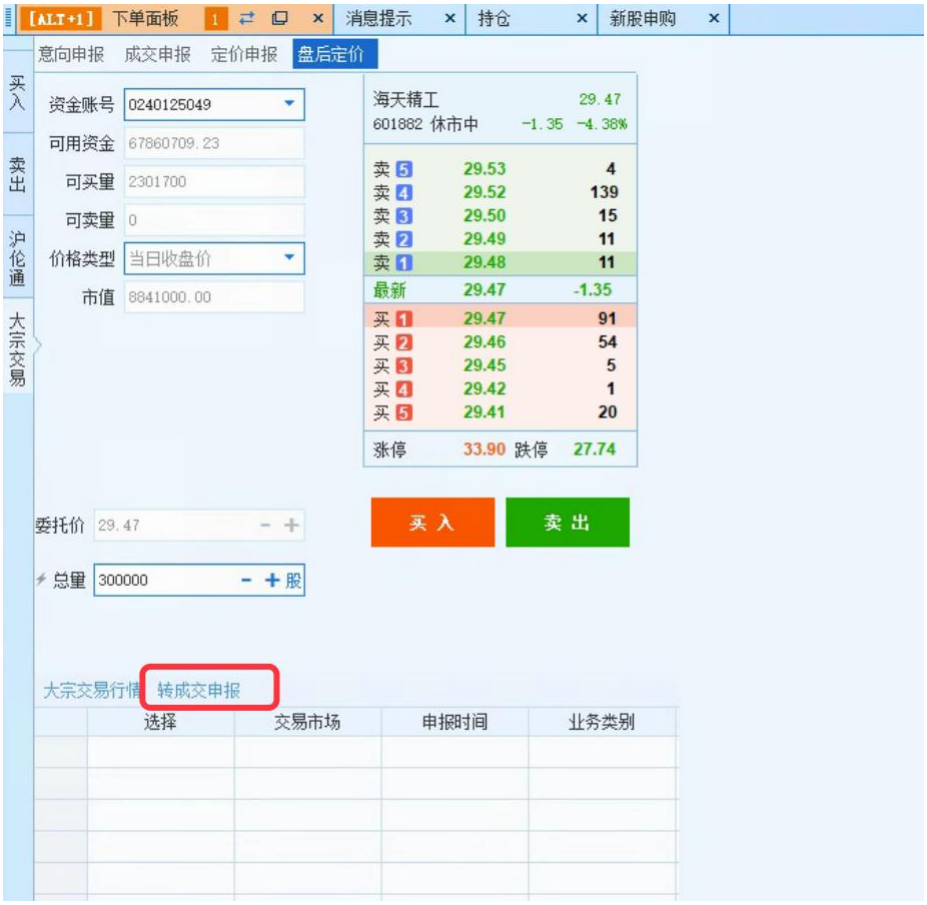


3.3.2.1.8.6. 转成交申报

为了方便用户进行成交申报，在行情面板添加【转成交申报】功能。

（1）选择他人发布的申报信息；自动填充相应数量及价格。

（2）点击转成交申报按钮，在任意面板跳转到成交申报面板；自动将相关信息填充至成交申报面板。且买入/卖出按钮，根据报价方向自动变灰不可用，若用户修改了约定号或对方席位，则买入/卖出按钮，恢复颜色变为可用。



3.3.2.1.9. 科创板

本系统支持科创板限价申报，市价申报，盘后定价申报多种报价方式。并支持科创板新股申购，科创板融资融券交易等科创板业务。

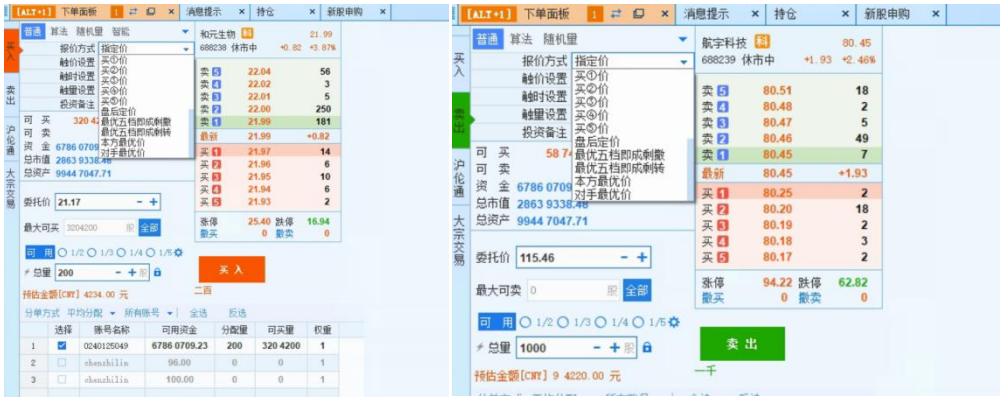
3.3.2.1.9.1. 科创板限价申报

在股票交易-下单面板中输入科创板股票代码，选择指定价、对手价、挂单价、买卖 1-5 档，填写总量，即可限价申报科创板股票。

下达任务时 QMT 会对科创板价格笼子限制做出对应提示。

3.3.2.1.9.2. 市价申报

本系统支持科创板股票本方最优价、对手方最优价、最优五档即时成交剩余撤销申报、最优五档即时成交剩余转限价申报 4 种市价报单方式。



在股票交易-下单面板中输入科创板股票代码，选择上述市价报价方式并填写保护限价参数，此时委托价显示“市价”，填写总量，点击买入/卖出下单。

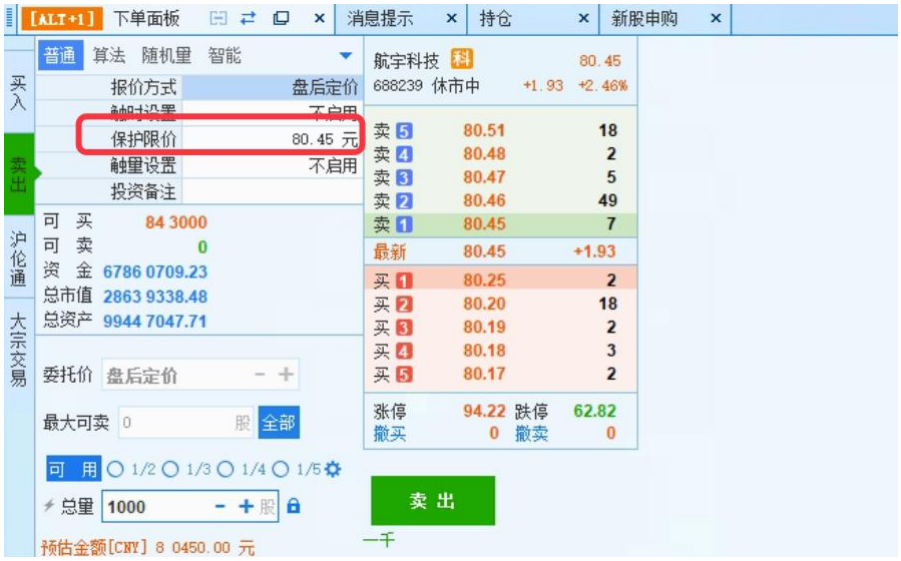
3.3.2.1.9.3. 盘后定价申报

科创板股票支持盘后固定价格申报。

每个交易日的 9:30 至 11:30、13:30 至 15:30 均可进行盘后固定价格交易申报。

盘口输入科创板股票代码，报价方式“盘后定价”类型。

盘后申报时保护限价默认为收盘价，不可更改。



盘中申报时需要输入限价，“限价”参数可手动输入价格，所起作用如下：

针对买入方向，若收盘价高于买入申报指令的限价，则该笔买入申报无效；

针对卖出方向，若收盘价低于卖出申报指令的限价，则该笔卖出申报无效。

3.3.2.1.10. 创业板

本系统支持创业板盘后固定价格交易。

每个交易日的 9:30 至 11:30、13:00 至 15:00 均可进行盘后固定价格交易申报。连续竞价时间段（未产生收盘价之前），报价方式选择“盘后定价”。“限价”参数可手动输入价格，所起作用如下：

针对买入方向，若收盘价高于买入申报指令的限价，则该笔买入申报无效；

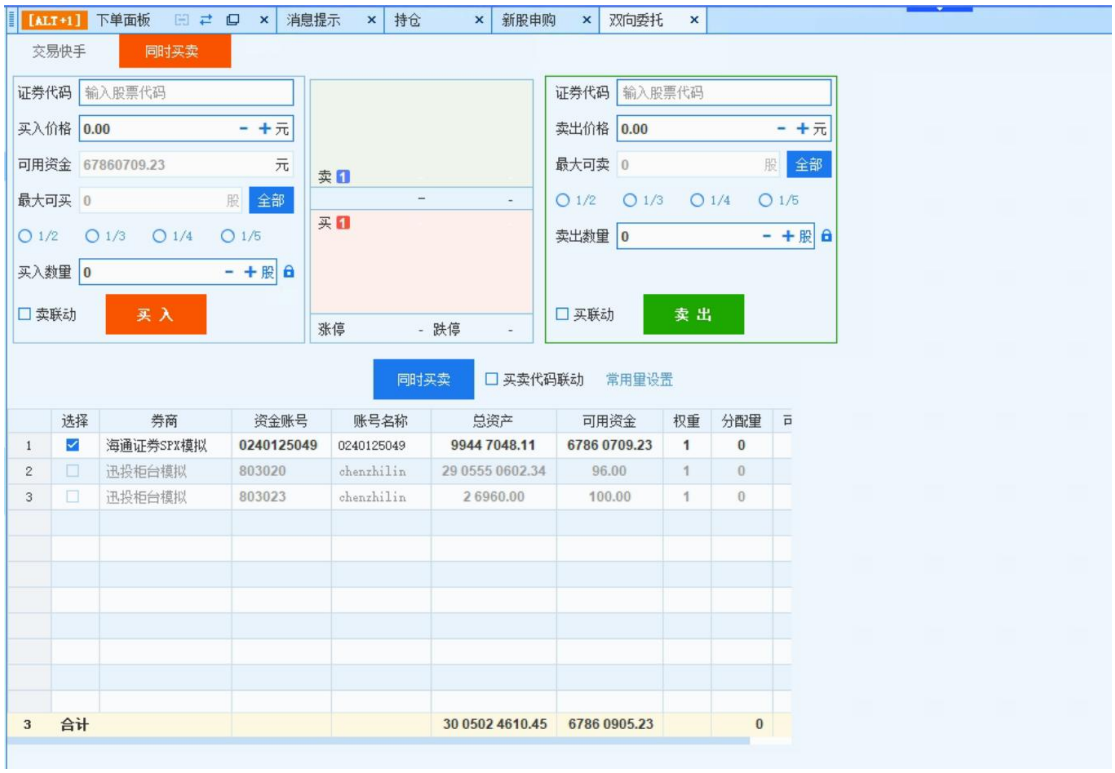
针对卖出方向，若收盘价低于卖出申报指令的限价，则该笔卖出申报无效。

点击买入按钮，下达任务，交易类型显示为“盘后定价买入”，委托价显示“盘后定价”，核对信息填写无误，点击确定发布盘后定价申报任务。

每个交易日的 15:05 到 15:30 为盘后固定价格交易时间。在此交易时段，盘口选择创业板代码时，交易状态显示为“盘后定价中”，限价置灰定位收盘价格，委托价位盘后定价。

3.3.2.1.11. 双向委托

股票交易中支持双向委托。点击左侧导航栏双向委托功能入口，打开如下界面。



3.3.2.1.11.1. 买联动/卖联动

如果勾选了卖联动，则买入面板中委托成交后，自动将成交数量填入卖出面板的委托数量框中。

如果勾选了买联动，则卖出面板中委托成交后，自动将成交数量填入买入面板的委托数量框中。

3.3.2.1.11.2. 买卖代码联动

如果勾选了买卖代码联动后，当焦点在买入面板时，输入买入代码后，卖出面板自动填写对应码对应的卖出信息；当焦点在卖出面板时，输入卖出代码后，买入面板自动填写对应码对应的买入信息。

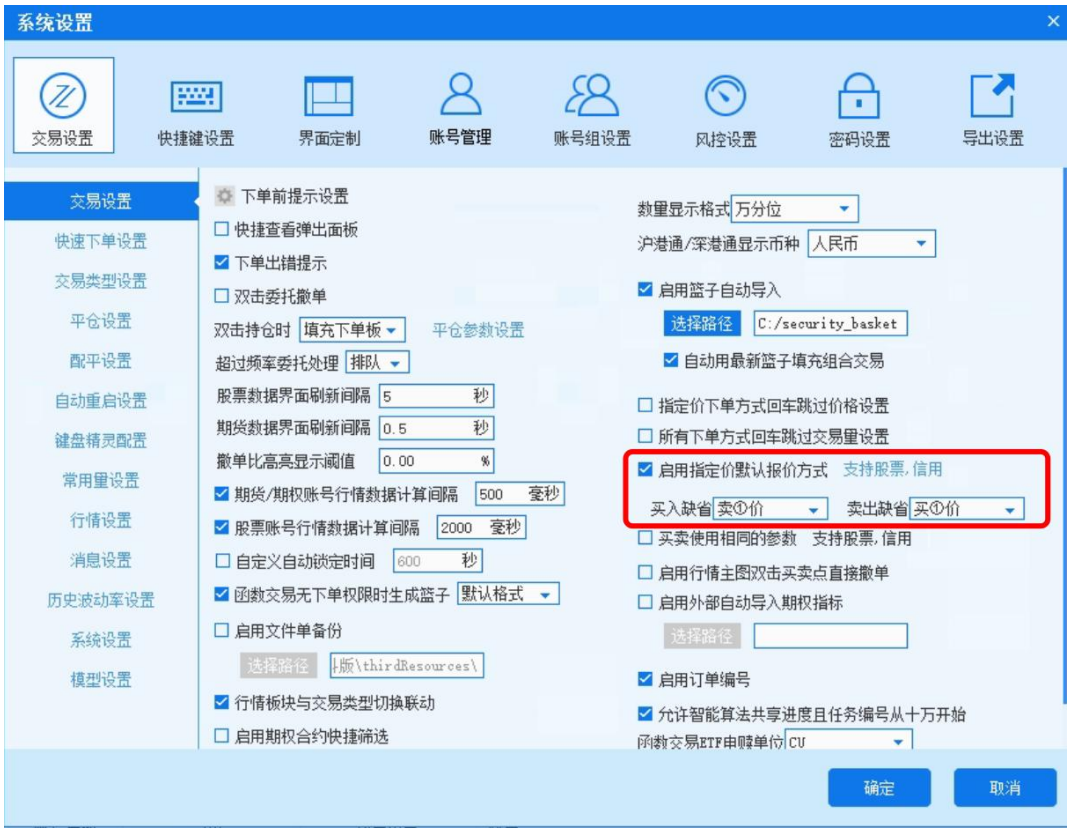
3.3.2.1.11.3. 量/价设置

买入价格和卖出价格分别默认填充卖一价和买一价，默认填充价格可在快捷键中进行自定义。

同时，点击常用量设置，可直接打开设置面板。可以代码为维度，分别设置买入和卖出的默认量和价。

如果快捷键中设置的价格，与常用量价设置中某一代码的价格设置有冲突，则对该代码进行买卖时，按照常用量价中该代码的设置填充。即快捷键中设置的价格针对全局生效，常用量价中的价格针对特定代码生效。

还可在系统设置中设置指定价的默认填充价格。



3.3.2.1.11.4. 光标切换

输入框之间使用上下键切换，或使用回车键顺序切换，直至下单。顺序为代码-价格-数量-买入/卖出按钮。

光标在委托价格时默认选中小数点后全部位数。

根据买入成交情况，定位光标所在位置：

买入全部成交，则光标在卖出界面委托价格栏。

买入部分成交，则不管是否有撤单动作，光标都在卖出界面委托价格栏。

3.3.2.1.11.5. 交易快手

可进行实现双向委托快速交易，买联动/卖联动、买卖代码联动和常用设置功能和同时买卖功能一致，快手交易可以勾选卖出数量默认填充最大可卖的功能。

3.3.2.1.12. 配股配债

本系统支持配股配债交易。

除股票买入/卖出界面外，融资融券-担保品买卖界面也支持配股配债交易，后续不再赘述。

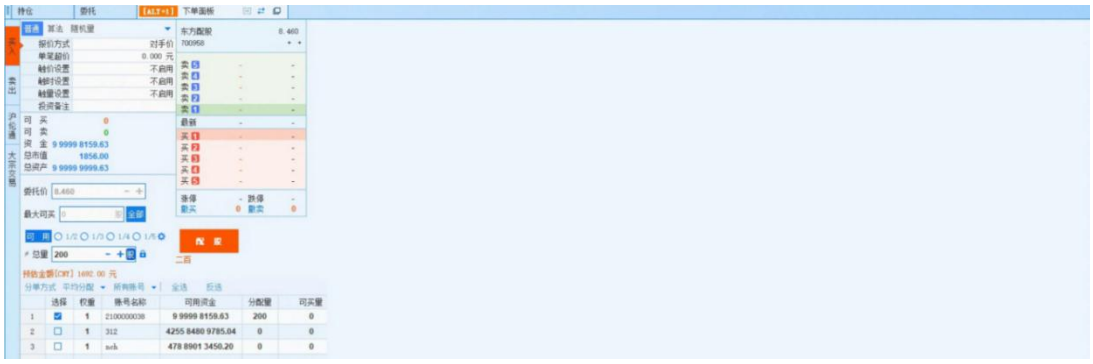
3.3.2.1.12.1. 配股交易

股票配股一般会发出公告在交易所网站，其中内容会有正股的代码和名称，同时会有配股截止日期、配股价格、配股比例、配股期限。同时会给出相应股票的配股代码。

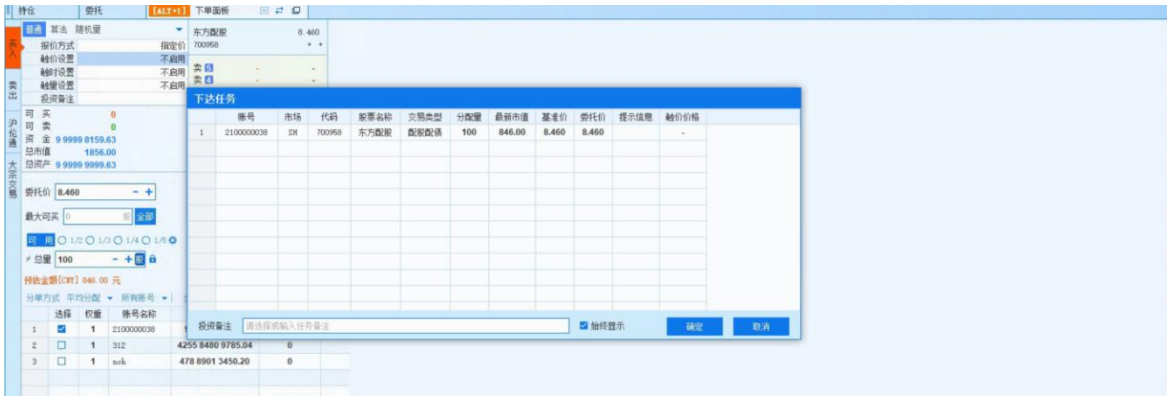
本系统账号持仓中会有一条配股代码的持仓。

配股持仓中的可用数量就是这个账号可以配股的额度。这条持仓不算入总市值。此时的总资产和可用资金还是产生这条配股持仓之前的，没有发生变化。

当在下单面板中填入相应的配股代码后，下单面板会出现配股按钮。



点击配股按钮，会出现下达任务界面，点击确定。



当配股操作执行后就会产生一条对应的配股委托。委托量和委托价格分别是配股操作的配股数量和配股价格，如下图所示：

配股产生已报委托后，本系统会出现冻结资金，冻结金额是配股数量*配股价格，可用资金会减少，减少部分就是冻结金额，持仓中这条配股持仓的可用数量会减少，冻结数量增加，持仓可用减少部分就是配股数量。配股操作不会对股票总市值产生影响，会减少总资产对应数量的冻结资金。

配股成功后，可用资金会减少，冻结资金清零。相应正股持仓的可用持仓会增加配股成功的股数，配股代码相应的持仓会消失。

如果交易所反馈配股失败，可用资金会恢复到配股之前，冻结资金恢复，且

相应配股持仓也会消失。持正股数不变。

3.3.2.1.12.2. 配债交易

同配股功能类似，在下单面板中填入相应的代码后，下单面板会出现配债按钮。在委托中可以查看配债的委托情况。配债成功后可在持仓中进行查看。

3.3.2.2. 期货交易

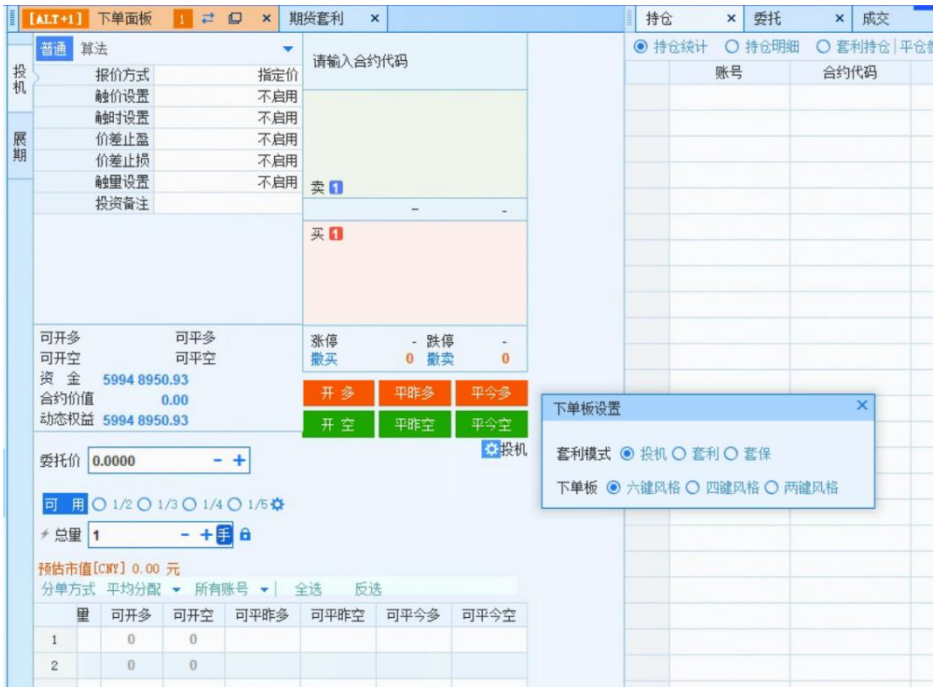
期货交易，是期货合约买卖交换的活动或行为。本系统支持普通期货交易、期货展期和期货套利交易方式。支持上期所（含原油期货）、中金所、郑商所、大商所、广期所所有期货品种交易。

3.3.2.2.1. 普通交易

普通交易支持投机、套利、套保的三种套利模式。下单面板有两种方式，分别为：迅投风格和传统风格。通过下单面板的按钮可以随时更换两个界面。

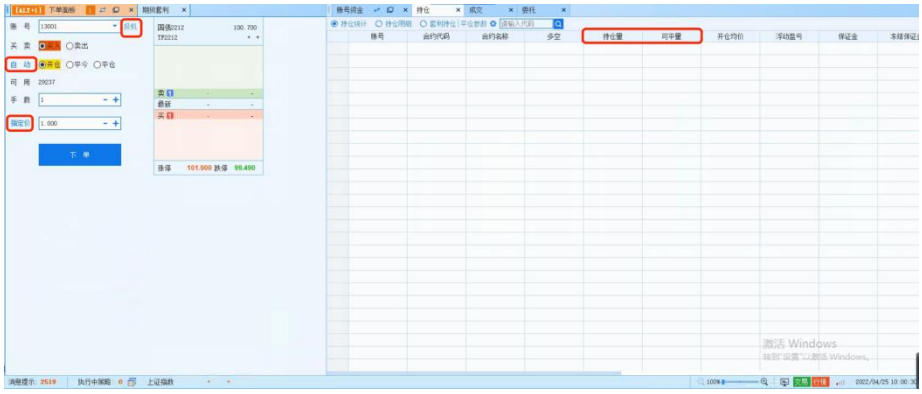
两种下单面板风格

迅投风格下单面板可以随意切换六键、四键、两键，可以使用普通交易和算法交易。关联多个账号可以根据分单方式确定每个账号的下单数量，展示账号关联的产品，可用资金、可开多、可开空、可平仓等，快速了解账号相关信息，方便交易。



下单面板各个功能键展开

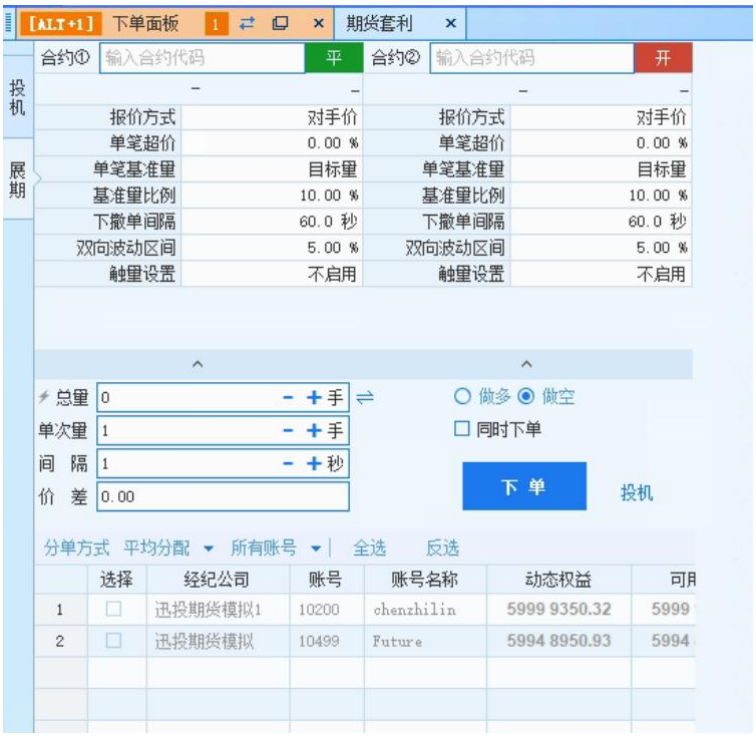
传统风格下单面板有“开平”和“自动”、“跟盘价”和“指定价”按钮。其中通过点击投机可以切换不同的套利模式。“开平”相当于默认风格的四键，“自动”相当于默认风格的两键。“跟盘价”显示的是盘口的最新价，通过“+”、“-”按钮可以增加或者减少最小单位的价格，跟盘价会自动变成指定价。当持仓中有某一合约，点击合约下单面板会自动显示数量和可平仓的方向。



传统风格下单面板

3.3.2.2.2. 期货展期

国内商品期货不可以无限期持仓，每个合约都有一个期限，如果是自然人持仓到交割月前必须平仓，否则交易所会强平。展期可以将快到期限的近期合约仓位通过做多、做空的方式转换成远期合约，设置相应的下单参数、总量、单次量、间隔、价差等，就可以实现长时间推迟平仓。



期货展期界面

总量可以选择一定的手数（输入小于或等于持仓量），或者点击⇌切换总量为即将到期合约的持仓量（需注意的是进行展期交易时必须有该合约的持仓），单次量为一次平多（空）的数量，间隔为每次平多（空）的时间间隔，设置完后就会自动平仓，价差为两展期合约的价差，设置后下单，当价差达到设置的值时，触发报单。可以针对两个合约选择“做多”或“做空”。可以选择套保、套利、投机三种类型。

3.3.2.2.3. 期货套利

迅投 QMT 极速策略交易系统中的期货套利面板，仅为用户提供自定义规则的平台，用户可根据自己的交易要求，新建规则，从实现更换合约、跨期套利、跨市套利、跨品种套利等多种功能。

期货套利界面

具体规则要求如下：

①账号选择：在账号 1 和账号 2 处选择账户，账户选择无限制，可选相同账号也可选不同账号。

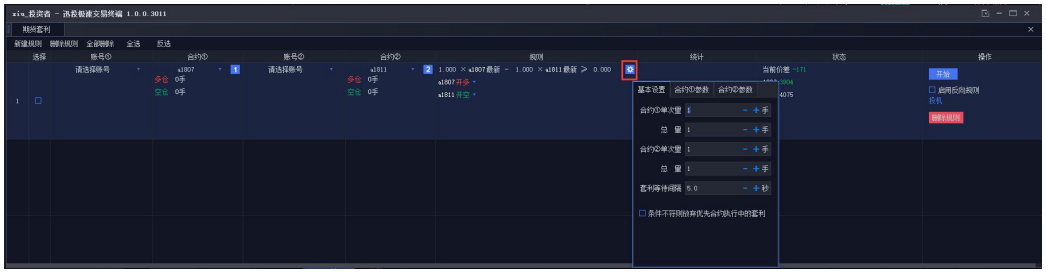
②合约选择：

合约中灰色背景色为 1 的表示优先合约，先产生优先合约的任务，当其成交后，才会产生灰色背景色显示为 2 的合约的任务；选择合约的下面显示的“多仓、空仓”是该账号当前该合约的多仓、空仓的持仓手数。

③规则设置：

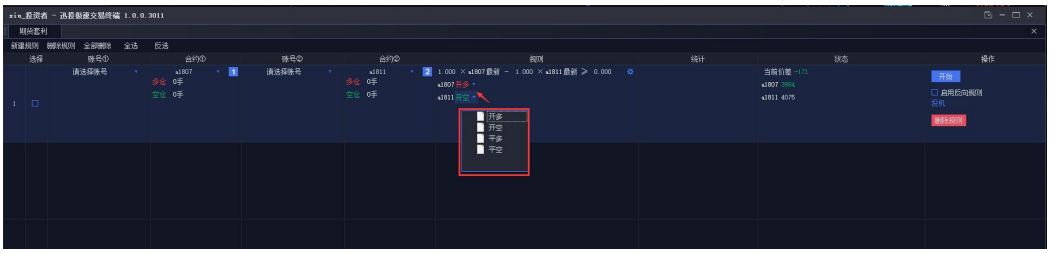
价差规则设置

价差规则设置中的倍数，价位（卖一价，最新价，买一价），价差方向（＜＞≤≥，无）都由用户自定义设置，设计出用户所需要的价差规则。当合约 1-合约 2 的差满足设置的价差规则，该项规则通过产生任务，否则就不产生任务；



选择合约委托量位置

选择合约 1 和 2 的下单参数



选择两个合约的开平方向

设置好价差规则后，可以设置合约 1、合约 2 的报价方式、合约 1 合约 2 的下单量及下单参数、开平及多空方向，基本设置中的单次量相当于目标量，总量是该合约的交易总量，合约参数中的单笔最大量是每次委托的最大委托量。

④状态显示

合约状态栏

显示合约 1、合约 2 在规则中设置的报价方式对应的价格，以及当前的价差，任务状态。

⑤统计：主要用于统计当前这笔单子合约 1、合约 2 的成交情况

⑥条件不符则放弃优先合约执行中的套利：勾选“条件不符则放弃优先合约执行中的套利”：优先合约在执行过程中，由于行情变动不满足之前设置的规则的话，就会撤销任务，在期货套利的状态中会显示成交了多少，失败了多少；

不勾选“条件不符则放弃优先合约执行中的套利” 优先合约在执行过程中，由于行情变动不满足之前设置的规则的话，会继续执行，只有优先合约执行完了，才会执行另外一个合约，与某合约单次量的手数没有关系，单次量只是一种报单方式。

⑦交易数限制：

如果合约 1 为优先合约，单次量为 a，交易后剩余量为 a1，合约 2 的单次量为 b，交易后剩余量为 b1，那么合约最后一笔的执行量为：如果 a＞a1，合约 1 执行 a1 手；如果 b＜b1，那么合约 2 执行 b 手，合约 2 剩余的 b1-b 手合约不会被执行。

例如：如果合约 1 为优先合约，单次量为 10，交易后剩余量为 5，合约 2 的单次量为 20，交易后剩余量为 30，那么合约最后一笔的执行量为：合约 1 为 5 手，合约 2 为 20 手，合约 2 剩余的 10 手不会被执行。

⑧操作功能键

套利过程

开始、暂停与停止：点击开始后会出现暂停和停止功能键，点击暂停按钮，暂停按钮会变成继续按钮的功能。

启用反向规则：类似于止盈止损功能，开多对应平多，开空对应平空；

新建规则、删除规则：删除规则必需先选中规则再删除；

自选合约：自选合约中选择套利合约，双击合约就会出现在期货套利列表中。

自选合约选择套利合约

3.3.2.3. 融资融券

融资融券交易，是指投资者向具有融资融券业务资格的证券公司提供担保物，借入资金或借入证券的行为。

本系统支持提供担保品买入、担保品卖出、融资买入，融券卖出，买券还券、卖券还款、直接还券，直接还款、融券息费，担保品划转等业务。

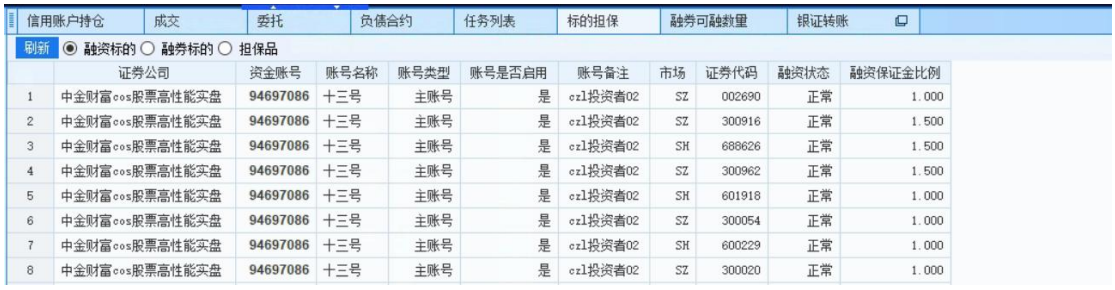
3.3.2.3.1. 担保品交易

买入、卖出界面主要用于信用账号操作担保券的买卖，同交易所的普通证券的买卖操作基本类似，只不过此处只能买卖担保券范围内的证券，而且占用的是信用账号上的可用资金。

担保品买入

担保品卖出

标的担保界面显示融券标的、融资标的、担保品。



	证券公司	资金账号	账号名称	账号类型	账号是否启用	账号备注	市场	证券代码	融资状态	融资保证金比例
1	中金财富cos股票高性能实盘	94697086	十三号	主账号	是	czl投资者02	SZ	002690	正常	1.000
2	中金财富cos股票高性能实盘	94697086	十三号	主账号	是	czl投资者02	SZ	300916	正常	1.500
3	中金财富cos股票高性能实盘	94697086	十三号	主账号	是	czl投资者02	SH	688626	正常	1.500
4	中金财富cos股票高性能实盘	94697086	十三号	主账号	是	czl投资者02	SZ	300962	正常	1.500
5	中金财富cos股票高性能实盘	94697086	十三号	主账号	是	czl投资者02	SH	601918	正常	1.000
6	中金财富cos股票高性能实盘	94697086	十三号	主账号	是	czl投资者02	SZ	300054	正常	1.000
7	中金财富cos股票高性能实盘	94697086	十三号	主账号	是	czl投资者02	SH	600229	正常	1.000
8	中金财富cos股票高性能实盘	94697086	十三号	主账号	是	czl投资者02	SZ	300020	正常	1.000

标的担保

担保券买入时，信用账号持仓增加，担保券卖出时，信用账号持仓减少。

3.3.2.3.2. 融资融券

融资融券包括融资买入，融券卖出，买券还券、卖券还款、直接还券，直接还款、融券息费的交易方式，融资流程主要包括融资买入，卖券还款，直接还款，融券流程主要包括融券卖出，买券还券，直接还券。

① **融资买入**是指投资者向证券公司交纳一定的保证金，融入一定数量的资金买入股票的交易行为。融资买入后，信用账号负债增加，证券持仓增加。

融资买入

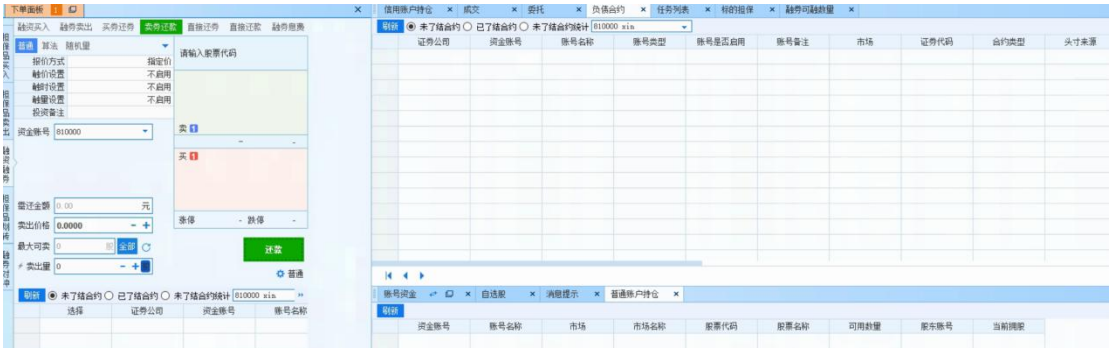
② **融券卖出**是指，投资者向证券公司交纳一定的保证金，融入一定数量的股票进行卖出的交易行为。融券卖出后，信用账号负债增加，资金增加。

融券卖出

③**买券还券**偿还融入证券，投资者通过其信用资金账号买入证券，结算时买入的证券直接划转至券商的融券信用账号。买券还券后，信用账号负债减少，信用账户持仓不变。

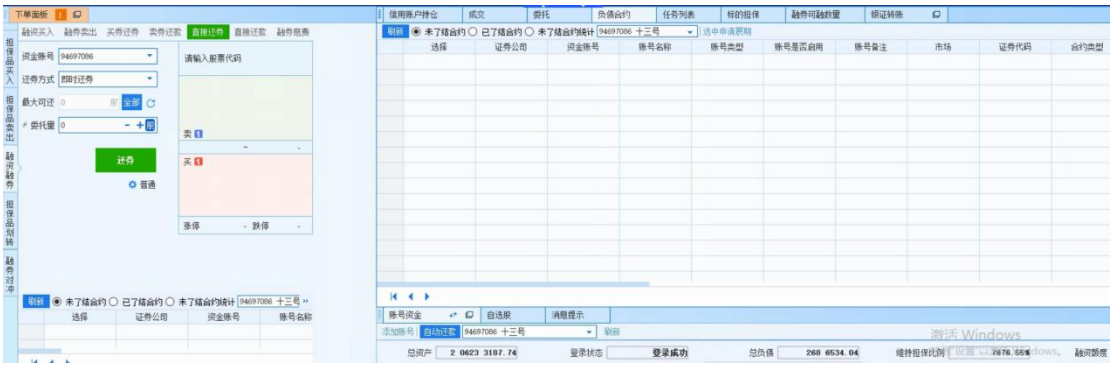
买券还券

④**卖券还款**是指，投资者通过其信用资金账号进行证券卖出，结算时该资金直接划转至证券公司融资专用信用账号的一种还款方式。卖券还款后，信用账号负债减少，证券持仓减少。



卖券还款

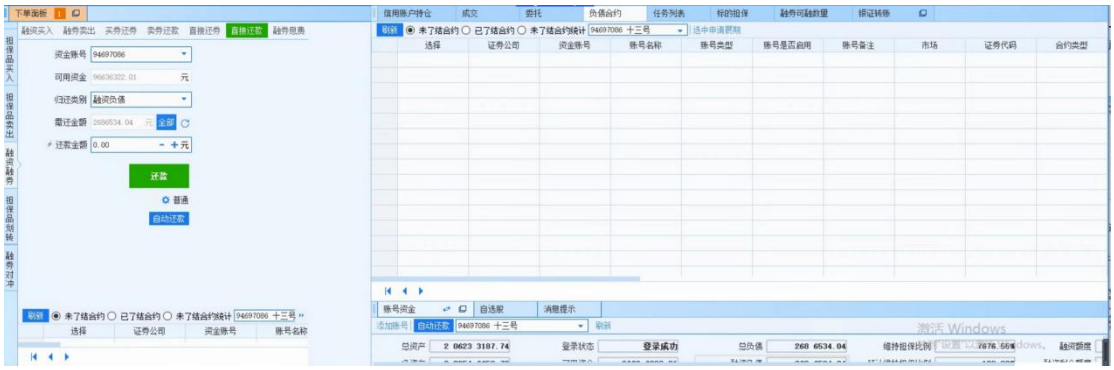
⑤**直接还券**使用的是信用账户中的券，这个券可以是从普通账户转入的担保品，也可以是用信用账户买入的证券。直接还券后，信用账户负债减少。



直接还券

⑥**直接还款**是指，投资者在信用资金账户内存入资金的方式偿还融资债务。

直接还款后，信用账户负债减少。



直接还款

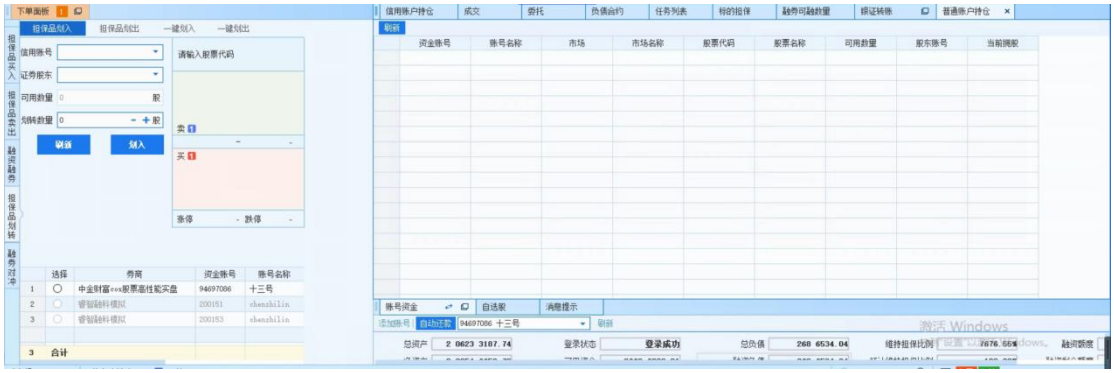
⑦**融券息费**是指，投资者通过信用资金账户的资金偿还融券负债的利息和费用，融券息费后，信用账户负债减少。

融券息费

3.3.2.3.3. 担保品划转

担保券划转界面的界面主要用于将普通账号与信用账号的股票仓位进行划转操作。

① **担保品划入**是将普通账户中的股票划转到信用账户中，普通账户持仓减少，信用账户持仓增加。

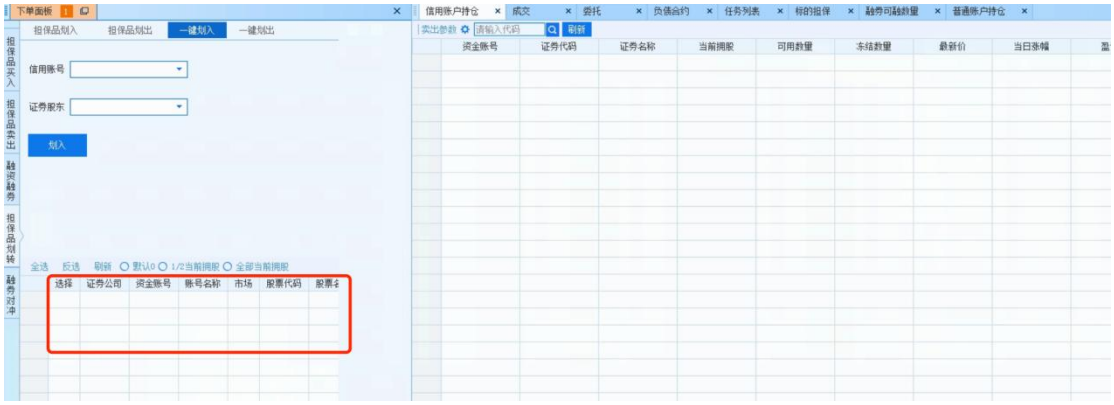


点击担保品划入时，系统自动展示普通账户持仓。

② **担保品划出**是将信用账户中的股票划转到普通账户中，普通账户持仓增加，信用账户持仓减少。

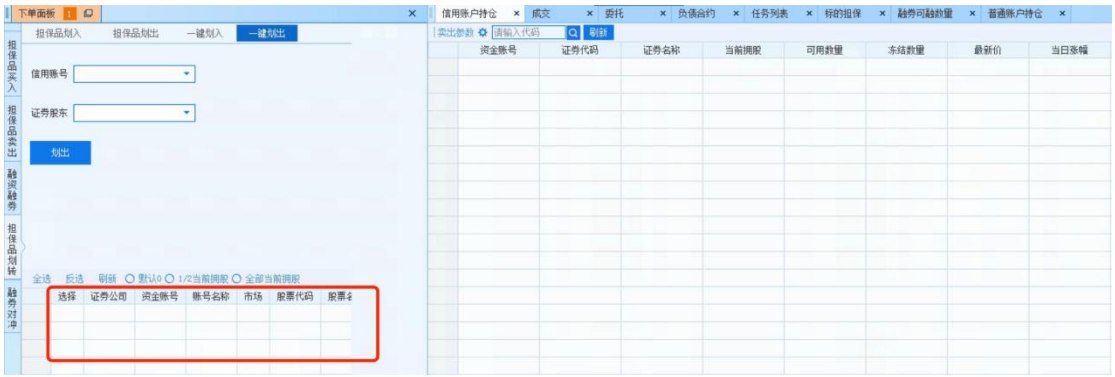
点击担保品划出时，系统自动展示信用持仓。

③ **一键划入**是将普通账户中的股票批量划转到信用账户中，普通账户持仓减少，信用账户持仓增加。一键划入时，选择账号信息后，可在账号下方的表中勾选需要划转的持仓。



④ **一键划出**是将信用账户中的股票批量划转到普通账户中，普通账户持仓增加，

信用账户持仓减少。一键划出时，选择账号信息后，可在账号下方的表中勾选需要划转的持仓。



3.3.2.3.4. 两融查询模式

支持两融查询模式。

查询模式开启后，下单盘口增加最大可下单量查询 ，在盘口输入代码之后查询最大可下单量：

显示综合信息查询面板：

负债明细分页查询：

3.3.2.3.5. 双向委托

两融支持双向委托功能。

使用管理端“允许使用双向委托交易”功能权限进行控制。

委托类型可选：融资买入-融券卖出，融资买入-卖券还款，买券还券-融券卖出，担保品买入-担保品卖出，融资买入-担保品卖出。

下单面板输入框光标切换，输入框之间使用上下键切换，或使用回车键顺序切换，直至下单。顺序为代码-价格-数量-买入/卖出按钮。

3.3.2.3.5.1. 买卖代码联动

买卖代码联动，首次安装，是默认勾选状态；如果不是第一次安装打开系统，记录上次关闭时的状态。

如果勾选了买卖代码联动后，当焦点在买入面板时，输入买入代码后，卖出面板自动填写对应的代码；当焦点在卖出面板时，输入卖出代码后，买入面板自动填写对应的代码。

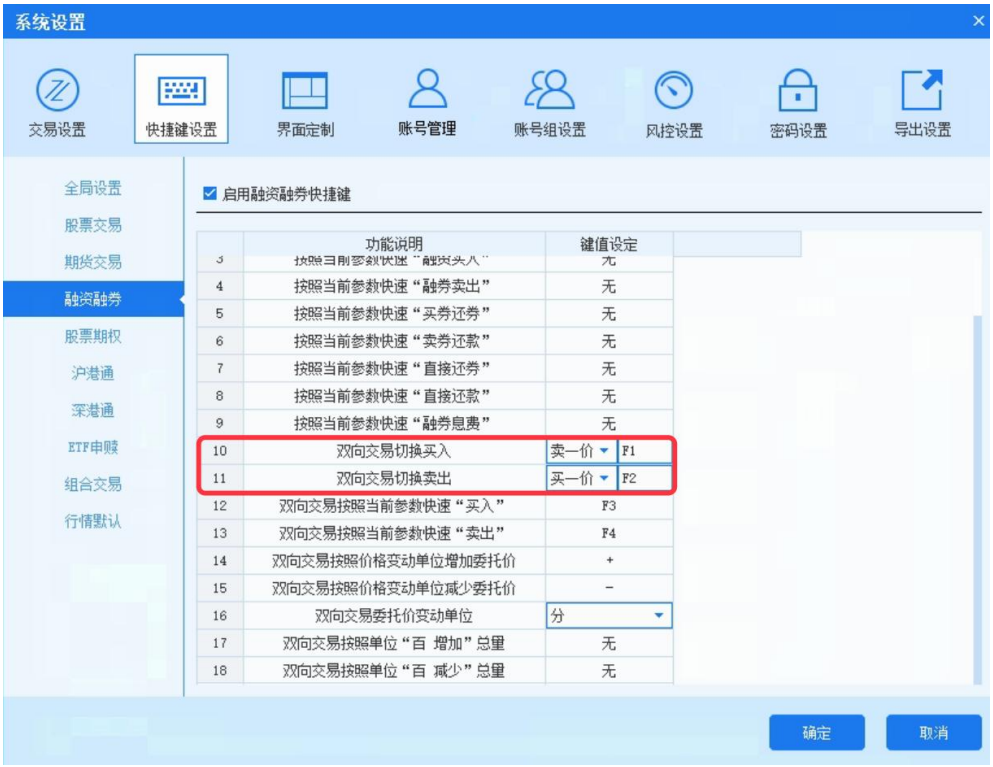
3.3.2.3.5.2. 卖联动/买联动

如果勾选了卖联动，则买入面板中委托成交后，自动将成交数量填入卖出面板的委托数量框中。

如果勾选了买联动，则卖出面板中委托成交后，自动将成交数量填入买入面板的委托数量框中。

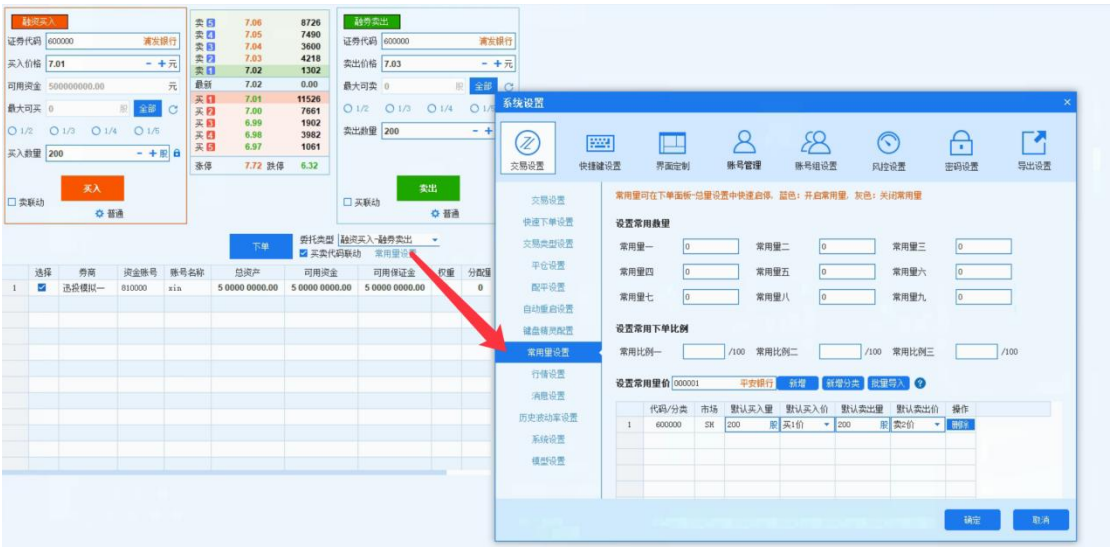
3.3.2.3.5.3. 常用量设置

买入价格和卖出价格分别默认填充卖一价和买一价，默认填充价格可在快捷键中进行自定义。

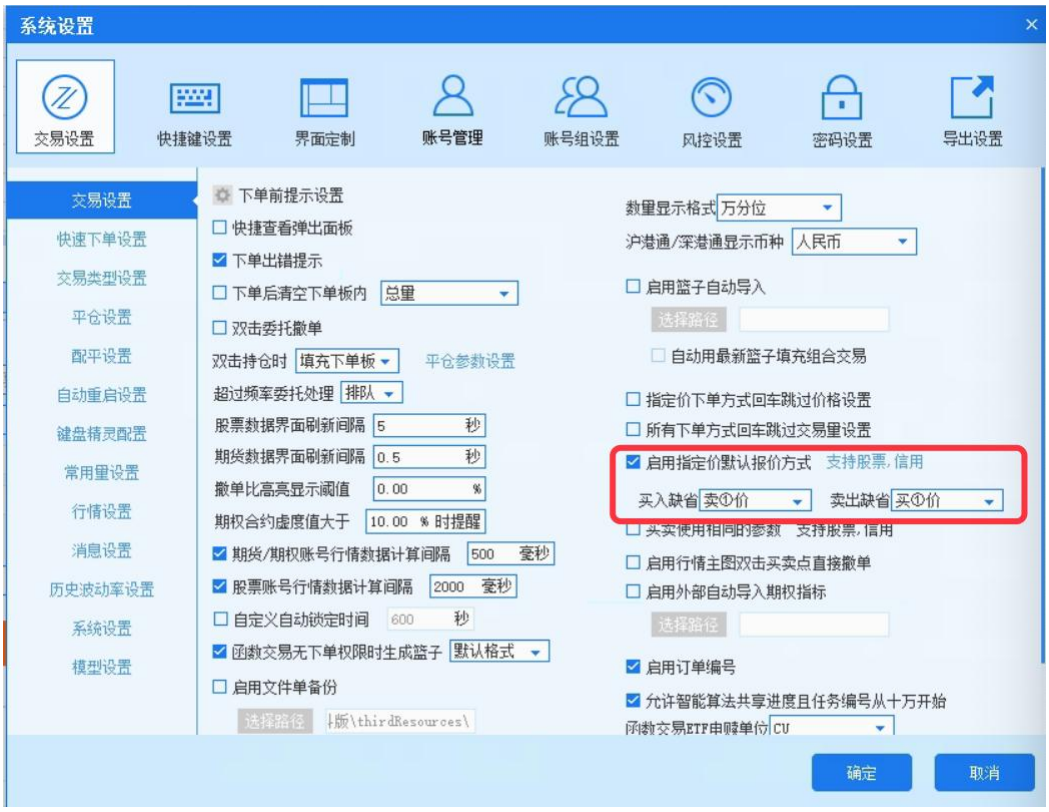


同时，点击常用量设置，可直接打开设置面板。可以代码为维度，分别设置买入和卖出的默认量和价。下单面板输入设置的代码后，价格和数量按照设定的值显示。

如果快捷键中设置的价格，与常用量价设置中某一代码的价格设置有冲突，则对该代码进行买卖时，按照常用量价中该代码的设置填充。即快捷键中设置的价格针对全局生效，常用量价中的价格针对特定代码生效。



还可在系统设置中设置指定价的默认填充价格，优先级比快捷键和常用量设置低。



3.3.2.3.5.4. 自定义快捷键

在系统设置-快捷键设置-融资融券中，启用融资融券快捷键功能，可对双向委托功能自定义设置快捷键，可设置快捷键包括：双向交易切换买入、双向交易切换卖出、双向交易按照当前参数快速“买入”、双向交易按照当前参数快速“卖出”、双向交易按照价格变动单位增加委托价、双向交易按照价格变动单位减少委托价、双向交易委托价变动单位、双向交易按照单位“百 增加”总量、双向交易按照单位“百 减少”总量。

双向交易切换买入：可同时设定委托价格类型和快捷键，证券代码为空时焦点在证券代码，证券代码不为空时焦点在买入价格。

双向交易切换卖出：可同时设定委托价格类型和快捷键，证券代码为空时焦

点在证券代码，证券代码不为空时焦点在卖出价格。

双向交易按照当前参数快速“买入”：点击快捷键后可以按照当前设置的参数进行下单操作。

双向交易按照当前参数快速“卖出”：点击快捷键后可以按照当前设置的参数进行下单操作。

双向交易按照价格变动单位增加委托价：点击快捷键后按照变动单位增加委托价。

双向交易按照价格变动单位减少委托价：点击快捷键后按照变动单位减少委托价。

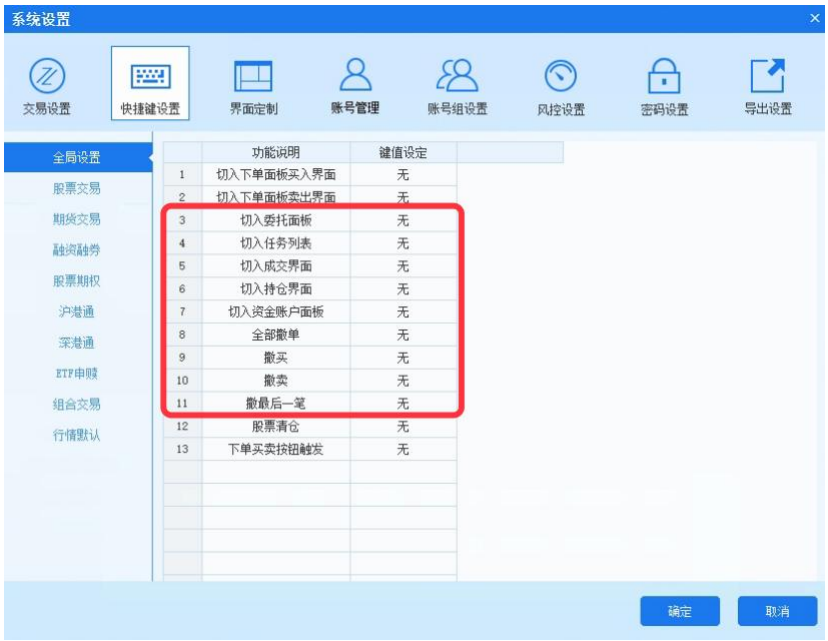
双向交易委托价变动单位：设置委托价变动单位。

双向交易按照单位“百 增加”总量：点击快捷键后增加总量，每次增加 100。

双向交易按照单位“百 减少”总量：点击快捷键后减少总量，每次减少 100。

10	双向交易切换买入	卖一价	F1
11	双向交易切换卖出	买一价	F2
12	双向交易按照当前参数快速“买入”	F3	
13	双向交易按照当前参数快速“卖出”	F4	
14	双向交易按照价格变动单位增加委托价	+	
15	双向交易按照价格变动单位减少委托价	-	
16	双向交易委托价变动单位	分	
17	双向交易按照单位“百 增加”总量	无	
18	双向交易按照单位“百 减少”总量	无	

可在全局设置中，对切入委托面板、切入任务列表、切入成交界面、切入持仓界面、切入资金账户面板、全部撤单、撤买、撤卖、撤最后一笔等操作进行自定义设置。



3.3.2.4. 组合交易

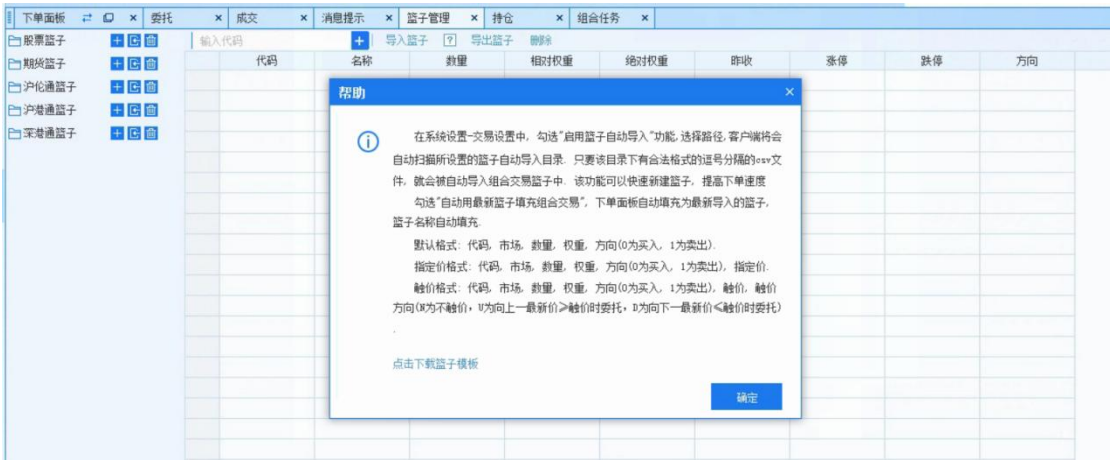
组合交易，也叫篮子交易，是指同时完成一个股票或期货组合的交易，而不是对组合中的股票或期货单独进行交易，还具有自动套利、对冲的功能，通过预设条件，自动判断并执行套利、对冲。

3.3.2.4.1. 篮子管理

篮子管理界面分为左右两部分。左半部分显示篮子分类：股票篮子、期货篮子、沪伦通篮子、沪港通篮子、深港通篮子。它们下面分别可新增、导入、删除多个同类型篮子。界面右半部分显示某一篮子内期货或股票的的具体信息，包括代码、名称、数量、相对权重、绝对权重、昨收、涨停、跌停、方向。同时可以导入、导出、删除。

篮子管理界面

合法的篮子导入格式有为迅投默认格式。在 excel 表格中新建篮子时，要将每种格式下的条目填充完整，并保存为.csv 格式。



合法导入格式

若导入的篮子与已存在的篮子重名，将会提示：

篮子重名提示

导出篮子时需要选择导出的格式，导出到电脑中即可随时查看篮子里的合约内容。

迅投默认格式的篮子

删除整个篮子可以在篮子管理界面左侧点击“x”或删除按钮。

删除篮子按钮

删除篮子中的某条合约可以选中合约，点击如图中的“删除”按钮。

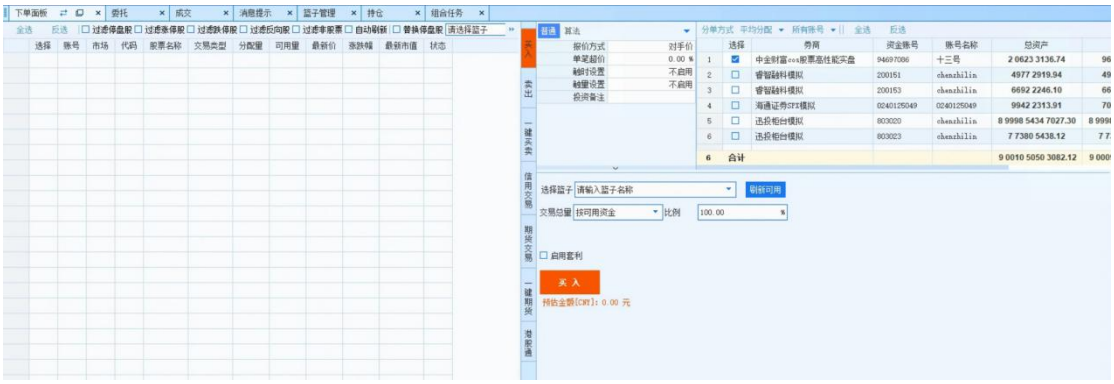
删除合约

3.3.2.4.2. 交易类型

①买入

买入交易面板可以对股票债券进行买入下单，交易参数有普通交易、算法交易、智能算法三种，可以用多个账号对多个股票债券合约进行买入，买入交易方式有“按组合股票数量”、“按组合股票权重”、“按账户可用”、“按总资产比例”。

在下单面板中还添加了全选、反选按钮，快速选择全部标的或者部分标的。



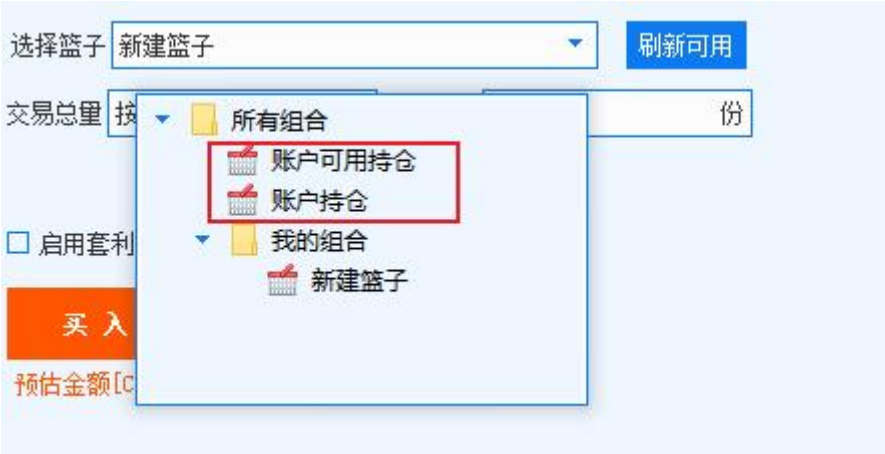
按组合股票数量：篮子中每支股票的分配量=一份篮子中每支股票的分配量*篮子份数。

按组合股票权重：自定义输入金额，系统就会根据篮子管理中每只合约权重分配，分配量=总金额*（某支股票相对权重/相对权重合计）/最新价。

按账户可用：自定义输入比例，系统就会根据篮子管理中每只合约权重分配，分配量=可用资金*比例*（某只股票相对权重/相对权重合计）/最新价。

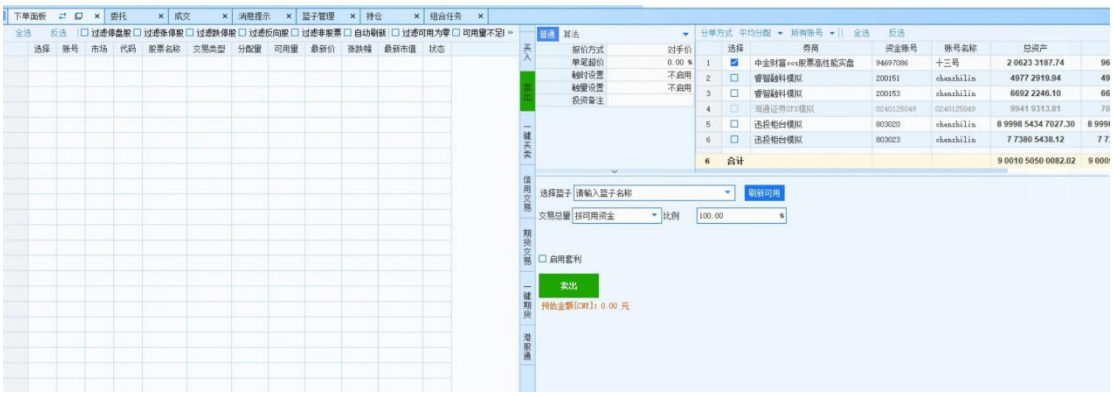
按总资产比例：自定义输入比例，系统就会根据篮子管理中每只合约权重分配，分配量=总资产*比例*(某只股票相对权重/相对权重合计)/最新价。

系统默认支持账户可用持仓篮子和账户持仓篮子。选择账户可用持仓时，会将所选账户的可用持仓显示在左侧下单板内，下单量为持仓可用数量；选择账户持仓时，会将所选账户的持仓显示在左侧下单板内，下单量为持仓量。



②卖出

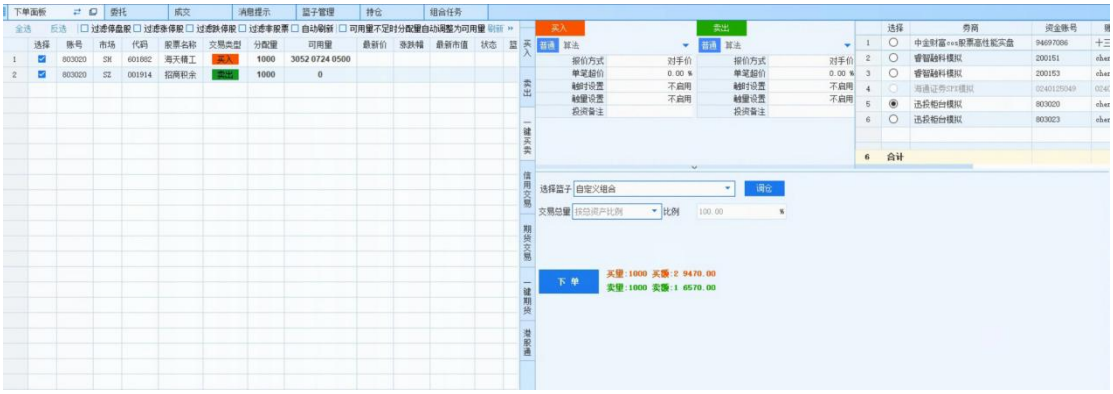
卖出交易界面功能和买入交易类似，可以多个账号对多个股票债券合约进行卖出。



卖出界面

③一键买卖

一键买卖是指进行组合交易时针对单个的证券账号对篮子中的股票同时进行买入和卖出的交易。



一键买卖界面

交易类型：可以通过在交易类型字段下选择买入或卖出，便捷决定买卖方向。

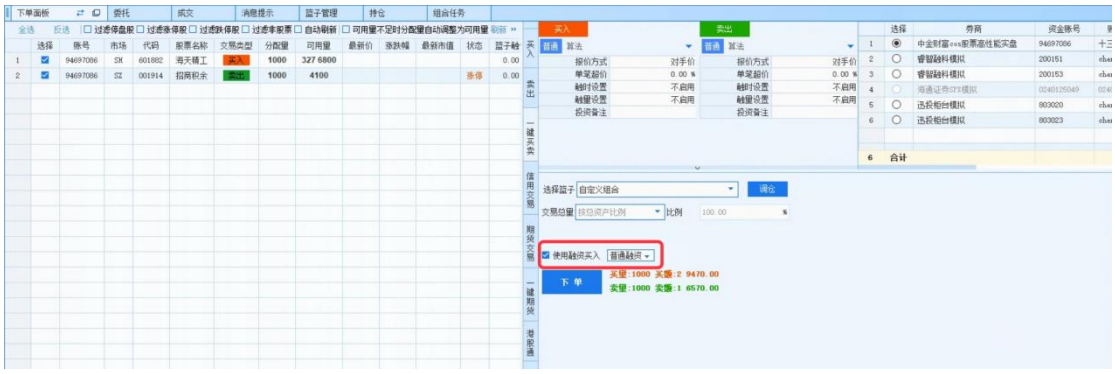
组合交易设置：一键买卖需在组合交易设置中分别设置买入证券和卖出证券的下单参数。

账号选择：一键买卖只能选择一个账号。

一键买卖包括买入和卖出两个过程，如无持仓卖出指令不发出，但买入指令

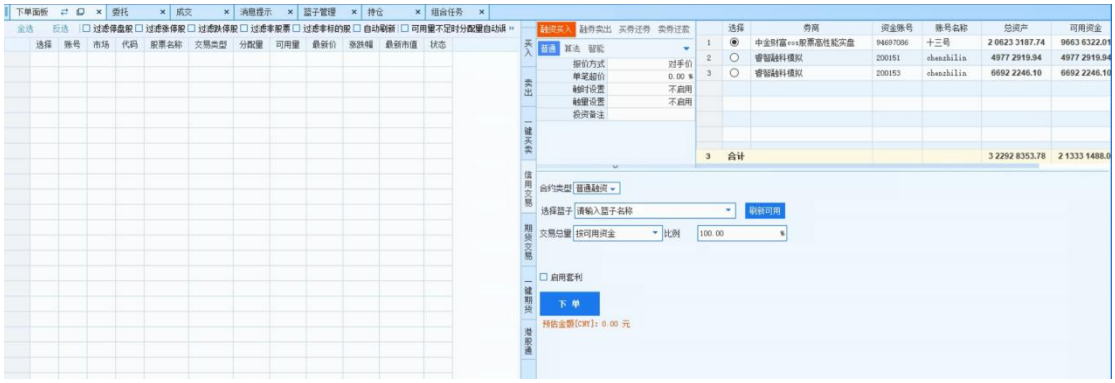
照常发出。因为一键买卖涉及卖出过程，所以经常配合调仓功能使用。

如选择信用账号，会出现使用融资买入的选项，不勾选默认担保品买卖，若勾选，买入部分按照融资买入。



④信用交易

信用交易界面可以进行融券买入、融券卖出、还券和还款等操作，报价方式为普通交易、算法交易和智能算法。需选择篮子和交易总量分配方式，并可启动套利。



信用交易

⑤期货交易

期货交易面板可以对期货篮子进行买入下单，并可以在组合交易设置中选择开仓和平仓；交易方式有“按组合股票数量”和“按组合股票权重”。

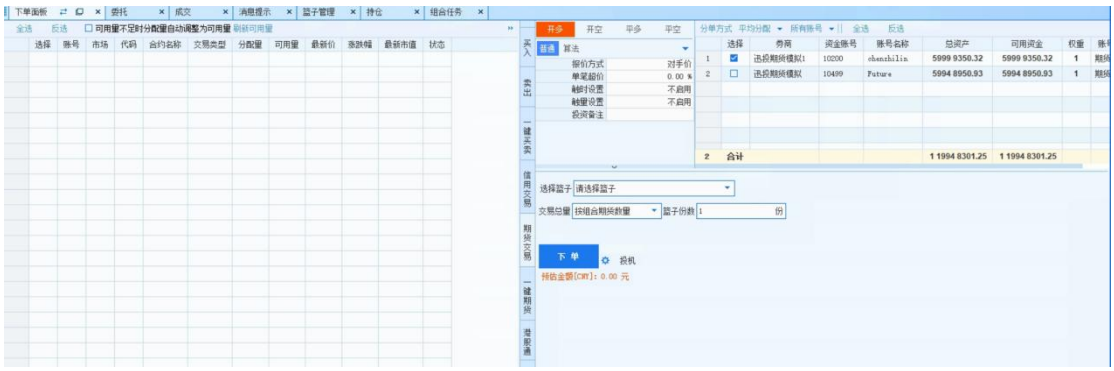
在期货交易下单面板选择“篮子管理”-“期货篮子”中创建的篮子；

选择交易总量并设置参数；

选择组合交易设置中的“开多”、“开空”、“平多”或“平空”，此时篮子中的期货代码交易类型调整为当前所选的类型；

选择交易算法并设置交易参数；

选择交易账号，点击下单按钮。



期货交易

⑥一键期货

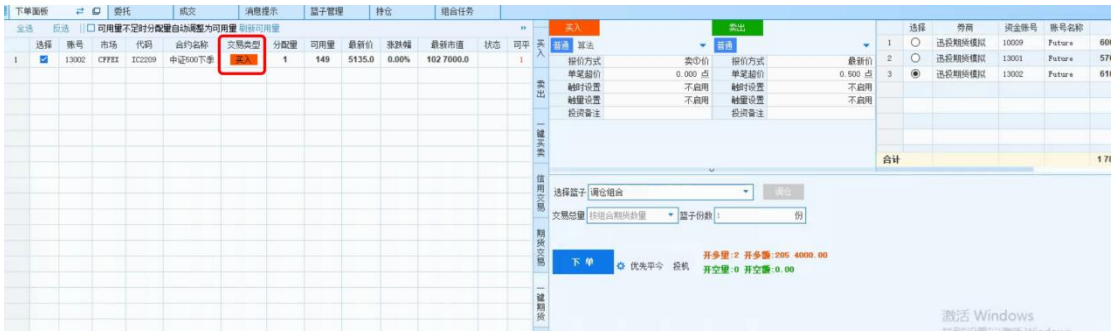
一键期货是指进行组合交易时针对单个的期货账号对篮子中的期货同时进行买入和卖出的交易。

下单板设置中有投机、套利、套保三种套利模式供选择。

套利模式选择

下单面板中单击“交易类型”就可切换买卖方向，系统会根据账号持仓来显

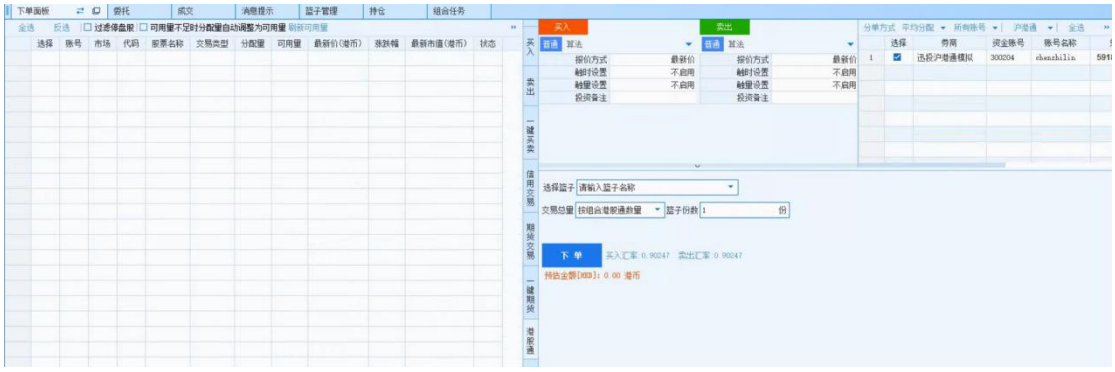
示可平或可开的数量。



切换买卖方向

⑦港股通

在组合交易-港股通界面中，可实现对港股的组合买入、卖出交易。交易参数可设置为普通交易和算法交易等。



港股通界面

选择在交易端篮子管理中创建或导入的沪港通或深港通篮子，买入交易方式有“按组合港股通数量”和“按组合港股通权重”两种。

交易总量分配方式

按组合港股通数量：篮子中每支港股的分配量=一份篮子中每支港股的分配量*篮子份数

按组合港股通权重：自定义输入金额，系统就会根据篮子管理中每只合约权重分配，分配量=总金额*（某支港股的相对权重/相对权重合计）/最新价。

⑧调仓

调仓是指大盘在调整时，将自己手中所持有的股票进行仓位调整和股票品种的及时更换，将手中股票的现有持仓调整到目标持仓中的股票。

调仓界面

以股票交易调仓为例：

在“一键买卖”中点击调仓按钮，打开调仓面板，如下图所示。

调仓面板左侧列出所有账号，点击其中一个账号，在当前持仓位置显示该账号下的所有持仓；在目标持仓位置，选择已创建的目标篮子，选择后将

在下方显示篮子中的股票代码信息，设置完交易总量后，点击确定，即可保存调仓设置，同时下单面板中显示调仓的股票代码并自动计算其交易类型。

下单面板 | 当日委托 | 当日成交 | 消息提示 | 篮子管理 | 当日持仓 | 组合任务

☐ 过滤停盘股 ☐ 过滤涨停股 ☐ 过滤跌停股

	选择	账号	市场	代码	股票名称	交易类型	分配量	可用量	最新价	涨跌幅
1	☑	6000000500	SH	010609	06国债(9)	买入	100	4997100	100.00	0.00%
2	☑	6000000500	SH	010616	06国债(6)	买入	100	4533750	110.22	0.00%
3	☑	6000000500	SZ	101007	国债1007	买入	100	4968280	100.58	0.00%
4	☑	6000000500	SZ	000001	平安银行	卖出	900	900	9.47	-0.32%
5	☑	6000000500	SZ	000008	神州高铁	卖出	100	100	9.60	-0.41%
6	☑	6000000500	SZ	000009	中国宝安	卖出	100	100	11.93	8.36%
7	☑	6000000500	SZ	000010	美丽生态	卖出	100	100	7.70	-0.77%

备注：

1. 调仓中只有按股票数量和按股票权重两种方式可选。

2. 调仓设置保存后，调仓按钮置灰。选择篮子处显示“调仓组合”，交易总量默认为调仓面板中目标篮子选择的交易总量，如下图所示。

选择篮子 调仓组合 调仓

交易总量 按组合股票数量 篮子份数 1 份

3. 设置交易算法并设置交易参数；

4. 选择交易账号，点击“下单”，即可将当前持仓中的股票卖出，买入目标持仓的股票。

⑨下单面板

全选：点击，面板中所有的标的均选中；

反选：点击，面板中未选中的标的均选中；

过滤停盘股：勾选过滤停盘股，取消勾选下单面板中显示停盘的股票；

过滤涨停股：勾选过滤涨停股，取消勾选下单面板中显示涨停的股票；

过滤跌停股：勾选过滤涨停股，取消勾选下单面板中显示跌停的股票；

过滤反向股：勾选过滤反向股，取消勾选下单面板中存在反向的股票；

过滤非股票：勾选过滤非股票，取消勾选下单面板中股票之外的证券；

替换停盘股：若所选篮子中的股票存在停盘股，在交易时可以用其他篮子中的股票替换停盘股，停盘股会被新篮子中的股票按比例替代；

下单面板

3.3.2.4.3. 期现套利

期现套利是指某种期货合约，当期货市场与现货市场在价格上出现差距，从而利用两个市场的价格差距，低买高卖而获利。股票现货市场和股指期货市场紧密相连，实际行情中，期货指数价格常受多种因素影响而偏离其合理的理论价格，与现货指数之间的价格差距往往出现过大或过小的情况，一旦这种偏离出现，就会带来在期货市场和现货市场之间套利的机会，我们把这种跨越期市和现市同时进行交易的操作称之为期现套利，也叫指数套利。

操作介绍

（1）设置参数

点击⚙，可用进行下单类型的选择，包括投机、套利、套保，还可以进行套利算法交易的设置，其设置方式与盘口的算法交易相同。

（2）套利账号选择

点击套利账号 请选择账号，可选择将要进行套利的期货账号。4.套利合约选择 。点击套利合约 输入合约代码，可选择将要进行套利的期货合约。

（3）套利方式设置

点击 套利方式 按固定手数套利 选择设置套利方式，设置套利方式相关的参数和套利算法。套利方式包括手动套利和自动套利，自动套利包括按合约价值套利、按固定金额套利和按固定手数套利。自动套利能够实时监测证券和期货两个市场的数据，通过预设条件，自动判断并执行套利、对冲。

①**按合约价值套利**是自动套利，指按照篮子中买入的现货价格和期货合约价格自动计算出需要开空的期货手数进行期现套利下单。同时，可以设定套利比例，套利比例是指买入的现货和卖出的期货之间的比例（套利比例设定为20%时是指

买入 100 元现货的时候需要卖出 20 元期货）。

②按固定金额套利是自动套利，指按照用户设定的固定金额，现货交易每达到一次这个金额就自动开空一手期货的期现交易方法。比如说用户设定 1000 元的固定金额套利，当用户购买股票的价格为 2 万元时，就会开空 20000/1000=20 手的期货。

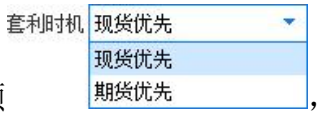
③按固定手数套利是自动套利，指用户设定套利的固定手数后，在买入现货的同时，自动卖出设定的手数的期货。（当现货部分成交时，会根据成交的比例来开空同样比例的期货）。

（4）套利比例设置

点击套利比例输入框

输入套利比例，套利比例用于计算单次套利期货手数，可输入 1-200 的整数。具体计算公式详见帮助。

（5）套利时机选择

点击套利时机，显示现货优先和期货优先两个选项 

，可通过点击进行套利时机的选择。套利时机用于控制对冲期货的时机。

①现货优先：现货优先成交到套利时期再去对冲期货，对冲期间现货不暂停交易，继续成交到下一次套利时机时再次对冲期货，以此类推直至交易结束；

②期货优先：首次期货与现货同时报单，保证先对冲一次期货，待现货成交到套利时机再去对冲一次期货，以此类推直至交易结束。

备注：

（1）无论是期货优先还是现货优先，现货报单不受期货成交限制。

（2）优先比例设置 ：点击

进行优先比例的设置。优先比例用于计算单次套利期货的手数，可输入 1-100 的整数。

（3）对上述参数设置好后，点击下单即可下达期现套利指令。其中手动

套利需手动到期货交易类型中进下单，自动套利自动进行期货的报单。

（4）点击查看期现套利的功能说明及参数设置提示。

3.3.2.5. 股票期权

期权是交易双方关于未来买卖权利达成的合约，就股票期权来说，期权的买方（权利方）通过向卖方（义务方）支付一定的费用（权利金），获得一种权利，即有权在约定的时间以约定的价格向期权卖方买入或卖出约定数量的特定股票或ETF。当然，买方（权利方）也可以选择放弃行使权利。如果买方决定行使权利，卖方就有义务配合。

本系统支持期权业务相关买卖、行权、锁定、策略四类交易方式，报价方式上支持交易所各类限价及市价报价方式，根据合约类型不同分为认沽和认购：认购是看涨的合约，认沽是看跌的合约。另外还可设置股票期权账号的风控，既响应了证监会有关股票期权风险控制制度，还可分散、降低股票期权投资的风险。

3.3.2.5.1. 买卖

买卖面板中有买入开仓、卖出平仓、卖出开仓、卖出平仓、备兑卖出开仓、备兑买入平仓操作。买入开仓和卖出平仓、卖出开仓和买入平仓都是一对操作。

①买入开仓是买入认购期权或认沽期权，如投资者已作为权利方持有仓位时，则买入成交后，增加权利方持有仓位。

买入开仓

②卖出平仓是卖出认购期权或认沽期权，投资者作为权利方持有权利仓时才可卖出平仓，且卖出合约数量不得超过持有的仓位。

卖出平仓

③卖出开仓是投资者卖出认购期权或认沽期权，如投资者已作为义务方持有仓位时，则卖出成交后，增加义务方持有仓位。

卖出开仓

④买入平仓是投资者作为义务方持有仓位（不含备兑开仓持仓），买入期权，减少持有义务仓位。

买入平仓

⑤备兑卖出开仓是投资者在拥有标的证券（含当日买入）的基础上，卖出相

应的认购期权（百分之百现券担保，不需现金保证金）。目前根据交易所的规定，上交所需要手动进行标的证券的锁定及解锁，深交所支持自动锁定及解锁。

备兑卖出开仓

⑥**备兑买入平仓**是买回期权，并解除备兑保证证券的冻结。

备兑买入平仓

⑦**买卖持仓变化**如下图所示：

未成交时：

	买入开仓	卖出平仓	卖出开仓	买入平仓	卖出开仓备兑	买入平仓备兑
资金	冻结资金和手续费	-	冻结保证金和手续费	冻结资金和手续费	-	冻结资金和手续费
持仓	-	冻结持仓	-	冻结持仓	-	冻结持仓

成交后：

	买入开仓	卖出平仓	卖出开仓	买入平仓	卖出开仓	买入平仓

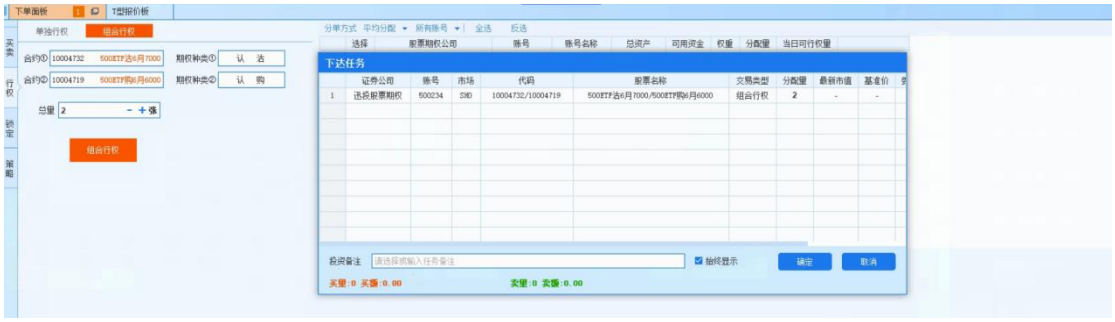
					备兑	备兑
资金	可用减少	可用资金增加	保证金增加	可用增加和保证金减少	可用增加	可用减少
持仓	增加权利持仓	权利持仓减少	增加义务持仓	减少义务持仓	增加备兑持仓	减少备兑持仓

3.3.2.5.2. 行权

针对期权义务方到期行权。有认沽行权和认购行权两种操作，此次交易所推出了组合行权操作，支持一组期权的同时行权。

单独行权

符合交易所规定的一组期权可以在到期日进行组合行权申报，合约 1 为持仓中符合行权条件的期权，合约 2 根据交易所组合行权规则自动筛选出与之匹配的期权合约。



组合行权

买方可以认购行权：准备现金，买入股票。认沽行权：准备股票，收入现金。

卖方可以认购空头被行权：准备股票，收入现金。认沽空头被行权：准备现金，买入股票。

3.3.2.5.3. 锁定

在交易时段，投资者可以将持有的证券（含当日买入，仅限标的证券）作为备兑开仓的保证金。可以在备兑持仓中查看标的证券的相关信息。

①锁定：对投资者现券账户的标的证券未锁定量进行锁定，变成锁定量的操作。

锁定

②解锁：对投资者现券账户的标的证券进行相应解锁操作。

解锁

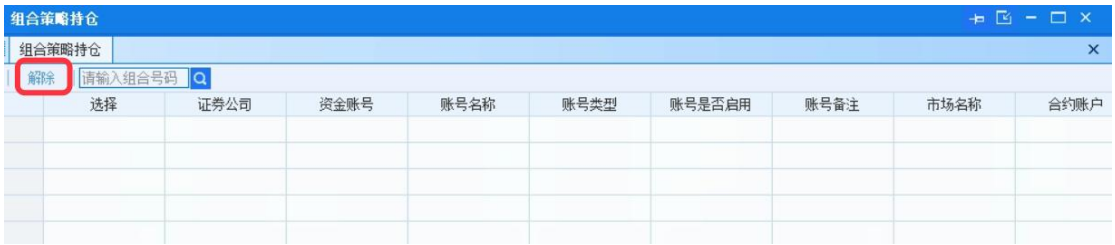
3.3.2.5.4. 期权组合策略

期权组合策略为交易所推出的新功能，支持投资者将持仓中的期权按照一定的原则进行配对构建组合以及进行组合的解除，期权组合策略能够有效节约资金，提到资金利用率水平，方便持仓管理的目的，目前支持交易所推出的各类期

权组合策略的构建。

策略构建

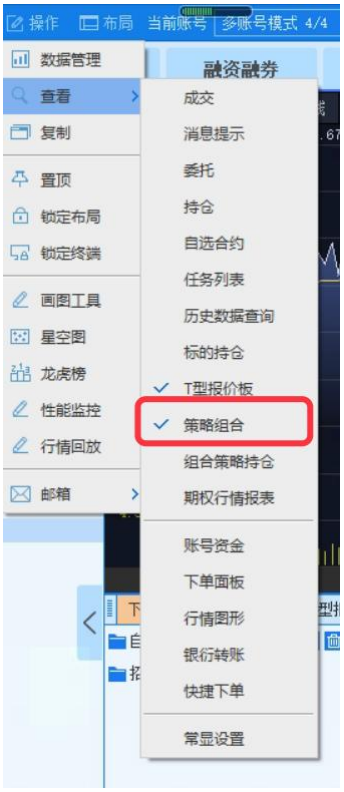
对于构建好的期权组合策略，在组合策略持仓面板中可以看到策略的具体合约构成，并且能够进行对应策略的解除操作：



策略持仓及解除面板

3.3.2.5.5. 策略组合

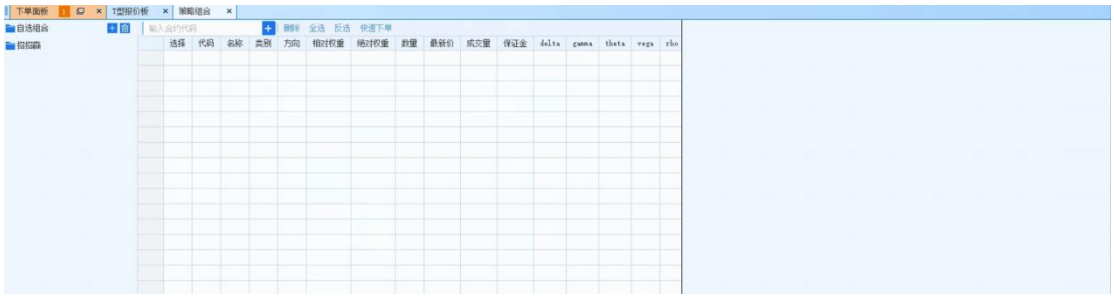
通过操作-查看-策略组合路径可打开股票期权策略组合功能和招招赢功能。



查看中可调出策略组合

【自选组合】

策略组合面板左侧为自选组合名称，中部为选择的合约组合信息，并且可设置方向、权重、数量等相关参数。右侧为期权损益图。



策略组合

点击左侧自选组合后加号，新建自选组合的子菜单。如下图所示。双击子菜单名称可进行重命名。中间下拉列表可添加选择的标的期权合约。

自选策略

勾选合约，右侧出现对应的期权损益图。勾选单支合约为单支合约损益图，勾选多支合约为多支合约叠加损益图。

损益图

双击中部字段相对权重、数量，可修改字段数值。点击方向中买入/卖出按钮可进行互相切换。

【招招赢】

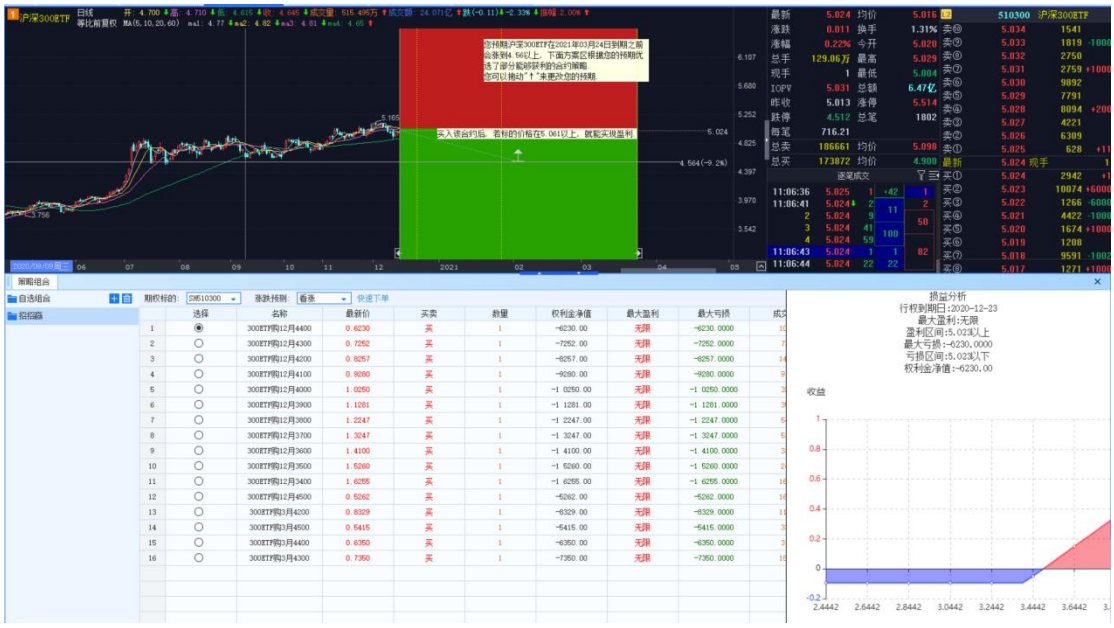
在组合策略中支持“招招赢”功能，功能界面如下所示：主要分为行情区域、方案及下单区域、损益分析区域三大块。

行情区域中可以拖拉添加未来预测区域，以及标的预测点位；

方案及下单区域可以匹配筛选出符合预测要求的股票期权；

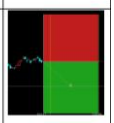
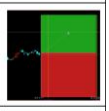
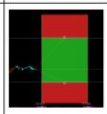
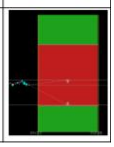
损益分析区域展示各个方案下的到期日、最大盈利、盈利区间、最大亏损、亏损区间、权利金净值及收益图展示；

整体效果如下所示：



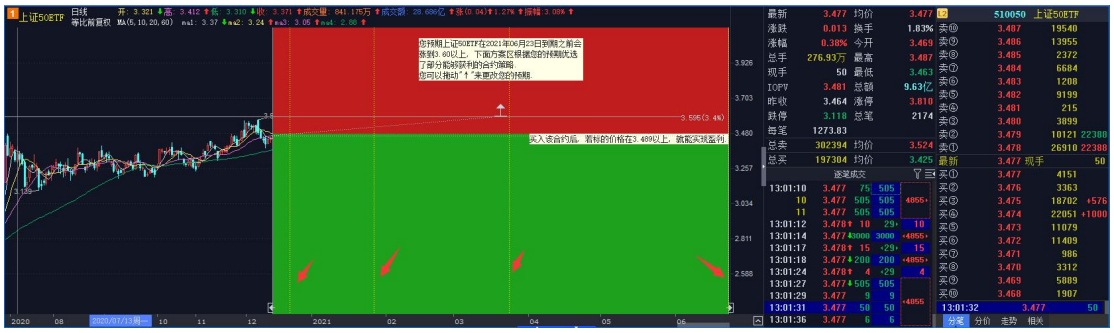
选择期权标的，涨跌预测方向后，行情展示区域显示对应期权标的实时日 K 图，期权标的可供选择的有：SH510050、SH510300、SH510500、SZ159915、SZ159919、SZ159922，选好之后行情里可以定位相关期权标的的日 k 线行情。涨跌预测方向有：看涨、看跌、突破、盘整。

红绿区间规律如下，红绿分界线为下文将提到的盈亏平衡线：

涨跌预测：	红绿区间	示例
看涨	上红下绿	
看跌	上绿下红	
突破	上、下红，中间绿	
盘整	上、下绿，中间红	

k 线图中拖动范围及参数：

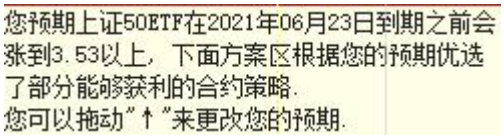
横向区间范围：日 k 线图中，横向可以拖动范围为当前交易日到该标的下所有挂牌期权的最大到期日，在此区间范围可以拖动，对应标的期权的未来每个交易日均用黄虚竖线标出



纵向区间范围：日 k 线图中，箭头符号纵向可以拖动范围为：选中的该标的下所有看涨、看跌期权中最高、最低行权价

k 线图中的文字描述以及筛选出来的合约原则：需要根据选择的预测方向展开描述，不同预测方向，文字内容不同，各种情况规律如下：

看涨：如下图所示，箭头处方向向上“↑”，箭头处文字为



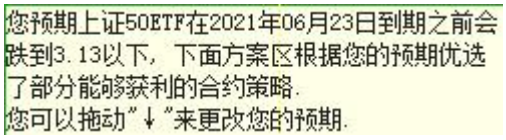
其中“2021 年 6 月 23 日”为所选区间内最远到期日，“3.53”为箭头处对应的标的物价格，即投资者未来预测价格。用一条横实线标出。

筛选出来的合约为标的物行权价在 3.53 以下的认购期权，买卖方向为买入方。

点击筛选出来的合约，根据当前最新价格，算出盈亏平衡点，例如选定合约为 50ETF 购 12 月 3400，最新价为 0.0889，行权价格为 3.4，则盈亏平衡点为：3.4+0.0889=3.4889，提示“买入该合约后，若标的价格在 3.4889 以上，就实现盈利”

3.53 处的横实线我们可以称之为预期点位线，3.489 处的横线我们可以称之为盈亏平衡线，用以分割红、绿区间。

看跌：如下图所示，箭头处方向向下“ ”，箭头处文字为



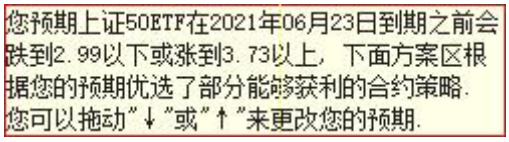
其中“2021 年 6 月 23 日”为所选区间内最远到期日，“3.13”为箭头处对应的标的物价格，即投资者未来预测价格，用一条横实线标出。

筛选出来的合约为到期日内标的物行权价在 3.13 以上的认沽期权，买卖方向为买入方。

点击筛选出来的合约，根据当前最新价格，算出盈亏平衡点，例如选定合约为 50ETF 沽 12 月 4000，最新价为 0.5120，行权价格为 4.000，则盈亏平衡点为：4.000-0.5120=3.488，提示“买入该合约后，若标的价格在 3.488 以下，就实现盈利”

3.13 处的横实线我们可以称之为预期点位线，3.488 处的横线我们可以称之为盈亏平衡线，用以分割红、绿区间。

突破：如下图所示，上方的箭头方向向上“↥”，下方的箭头方向向下“↧”，上方箭头处文字为：

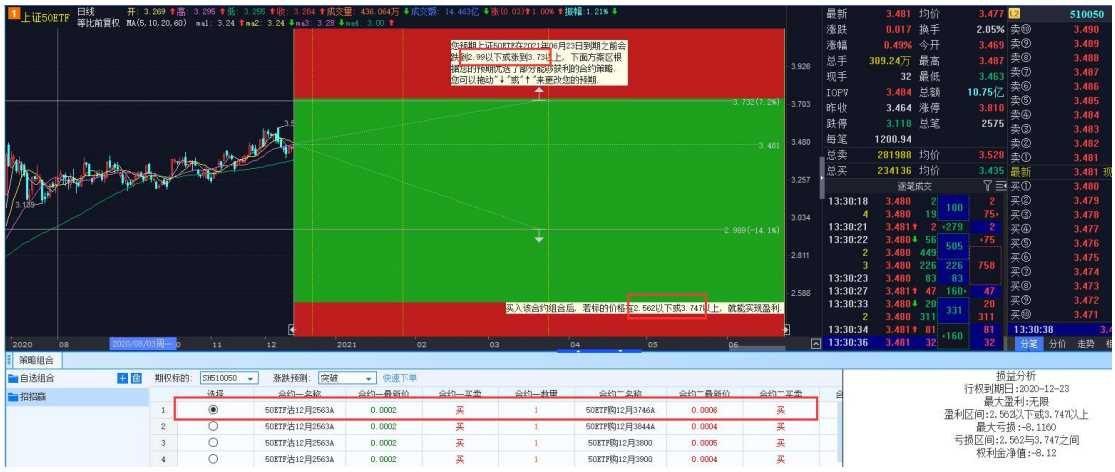


其中“2021 年 6 月 23 日”为所选区间内最远到期日，“2.99、3.73”为箭头处对应的标的物价格。分别用两条横实线标出。

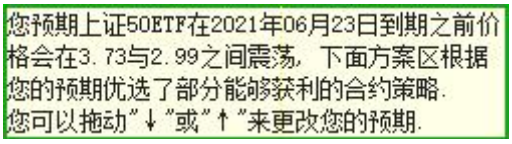
筛选出来的合约为到期日内标的物行权价在 3.73 及以上的认购期权、2.99 及以下的认沽期权的一一组合，买卖方向为均为买入方。

点击筛选出来的合约，根据当前最新价格，算出盈亏平衡点，例如选定合约为 50ETF 沽 12 月 2563A，最新价为 0.0002，行权价 2.563、50ETF 购 12 月 3746 A，最新价为 0.0006，行权价格为 3.746，则盈亏平衡点分别为：2.563-0.0002-0.0006=2.5622，3.746+0.0006+0.0002=3.7468，提示“买入该组合后，若标的价格在 2.562 以下或 3.747 以上，就实现盈利”

2.99、3.73 处的横线我们可以称之为预期点位线，2.562、3.747 处的横线我们可以称之为盈亏平衡线，用以分割红、绿区间。



盘整：如下图所示，上方的箭头方向向下“↓”，下方的箭头方向向上“↑”，上方箭头处文字为：

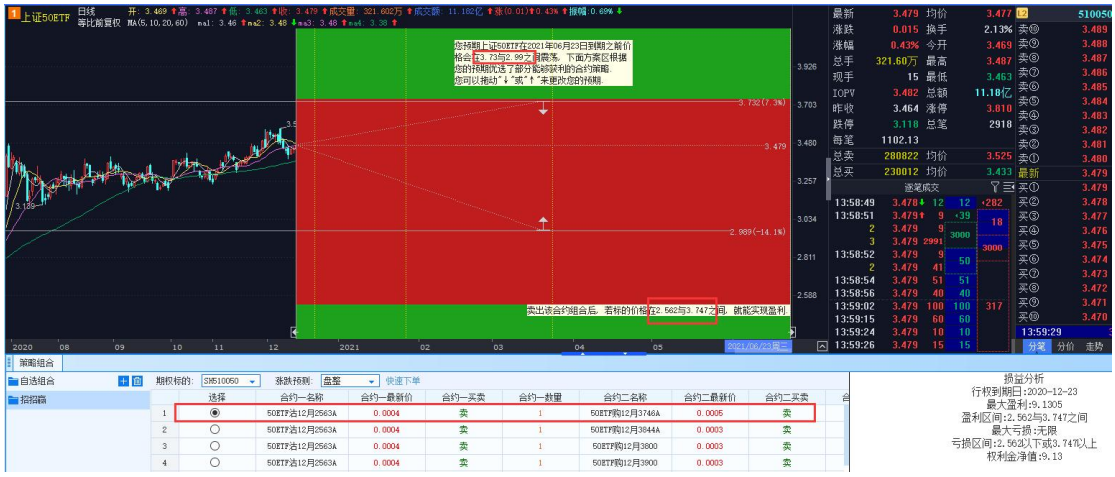


其中“2021 年 6 月 23 日”为所选区间内最远到期日，“3.73、2.99”为箭头处对应的标的物价格。分别用两条横实线标出。

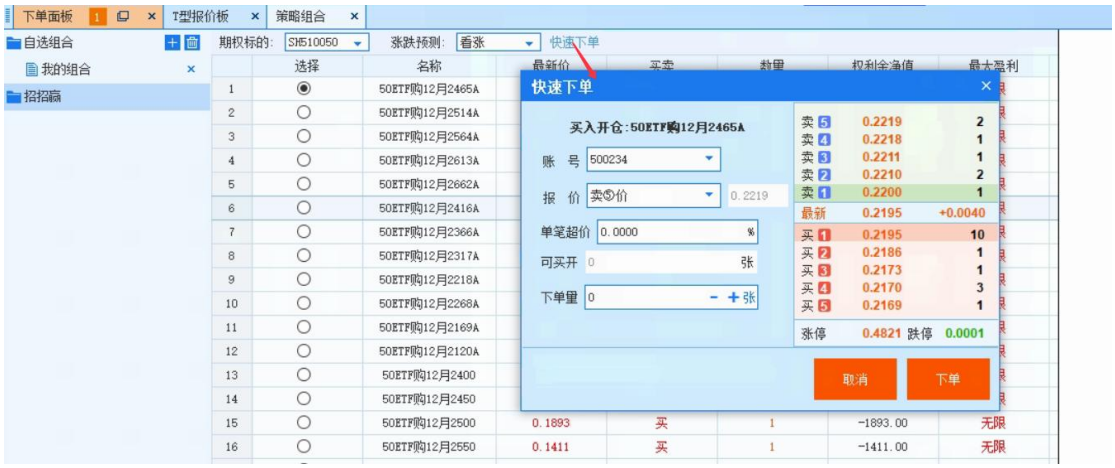
筛选出来的合约为到期日内标的物行权价在 2.99 及以下的认沽期权、3.73 及以上的认购期权的一一组合，买卖方向为均为卖出方。

点击筛选出来的合约，根据当前最新价格，算出盈亏平衡点，例如选定合约为 50ETF 沽 12 月 2563A，最新价为 0.0004，行权价 2.563、50ETF 购 12 月 3746 A，最新价为 0.0005，行权价格为 3.746，则盈亏平衡点分别为：2.563-0.0004 -0.0005=2.5621，3.746+0.0005+0.0004=3.7469，提示“卖出该组合后，若标的价格在 2.562 与 3.747 之间，就实现盈利”

2.99、3.73 处的横线我们可以称之为预期点位线，2.562、3.747 处的横线我们可以称之为盈亏平衡线，用以分割红、绿区间。



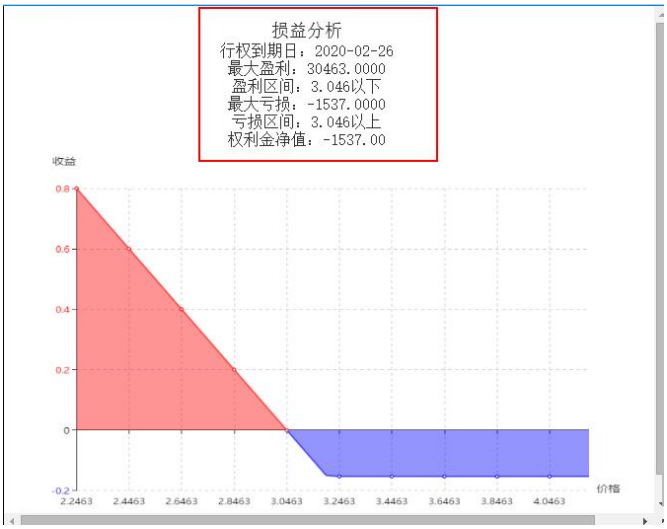
选定期权标的，涨跌预测方向，预测未来标的价格，筛选出符合标准的期权合约，如下所示：看跌、看涨时候，选择都是单个期权；盘整、突破时候，选择的是两个期权的组合。



合约中相关的字段及解释备注如下：

字段名	备注	涉及计算公式
名称	期权合约中文名	无
最新价	对应期权最新价	无
买卖	筛选出来期权的买卖方向	无
数量	下单买卖的期权数量	无
权利金净值	方案中包含期权的权利金净值	合约权利金收入之和-合约权利金支出之和
最大盈利	图上直观展示为 1 单位红柱长度	红柱长度*合约单位
最大亏损	图上直观展示为 1 单位绿柱长度	绿柱长度*合约单位

盈亏分析区域：



相关的字段及解释备注如下：

字样名	备注	位置
行权到期日	选中期权的到期日	参考 T 型面板中期权到期日
最大盈利	该方案下最大盈利金额	取方案区域内的最大盈利字

		段
盈利区间	该方案下盈利的价格区间	参考盈亏平衡线的数值
最大亏损	该方案下最大亏损金额	取方案区域内的最大亏损字段
亏损区间	该方案下亏损的价格区间	参考盈亏平衡线的数值
权利金净值	该方案下净权利金收入水平	取方案区域内的权利金净值字段

3.3.2.5.6. T 型报价板

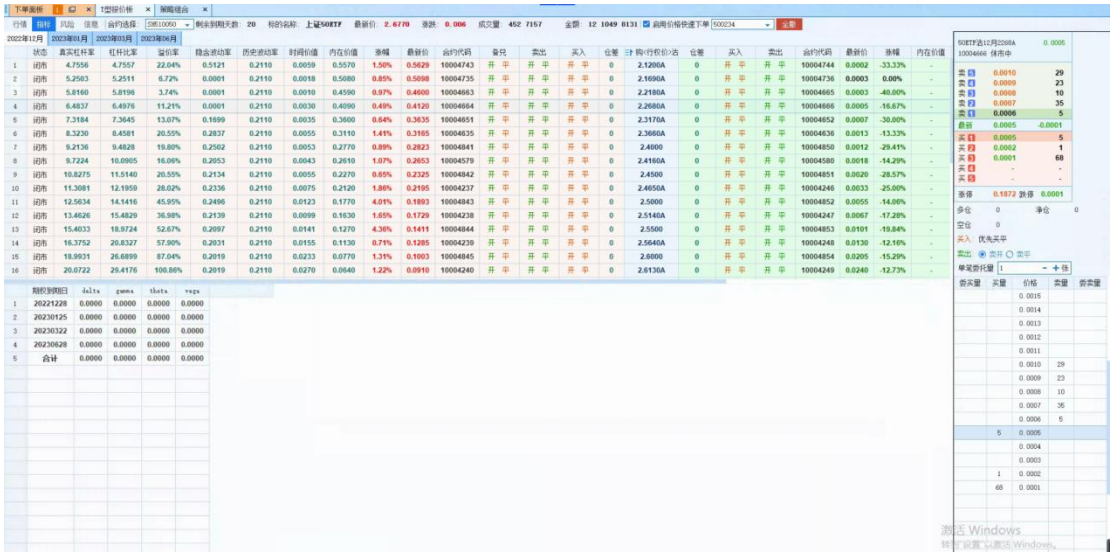
本系统股票期权支持 T 型报价板下单和查看功能，总共包含行情、指标、风险、信息四大板块。以各个期权合约的行权价为中心，左侧为认购合约，右侧为认沽合约。

①行情板块提供展示期权合约的市场行情信息，包括状态、期权理论价值、隐含波动率、持仓量（市场持仓量）、总量（市场成交量）、买价（买一价）、卖价（卖一价）、涨幅、涨跌、最新价和仓差信息（需选择账号）。可进行备兑，买入和卖出操作。

T 型板-行情

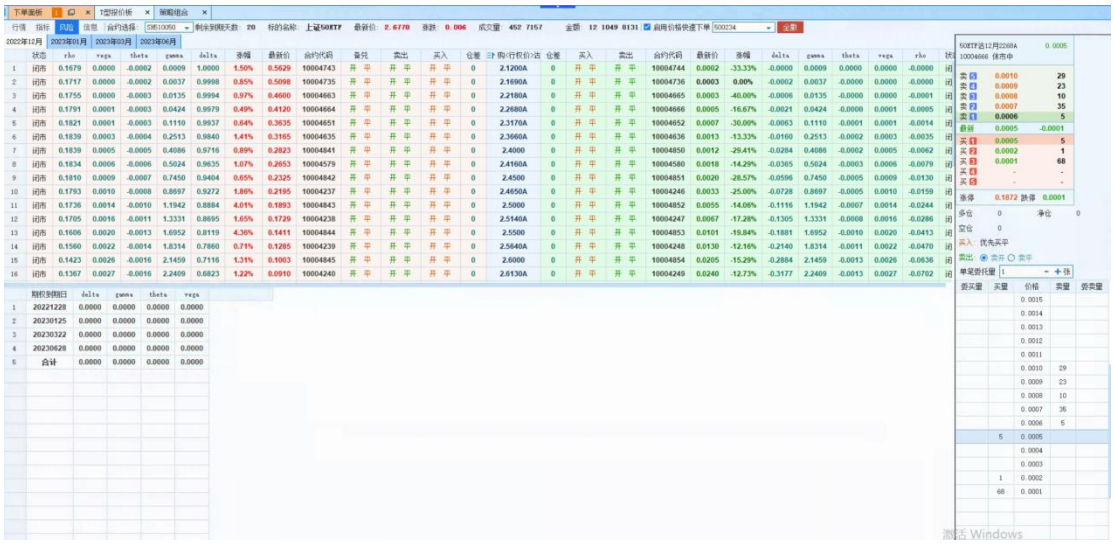
②指标板块提供展示期权合约的真实杠杆率、杠杆比率、溢价率、隐含波动率、历史波动率、时间价值、内在价值、最新价和仓差信息。可进行备兑，买入

和卖出操作。



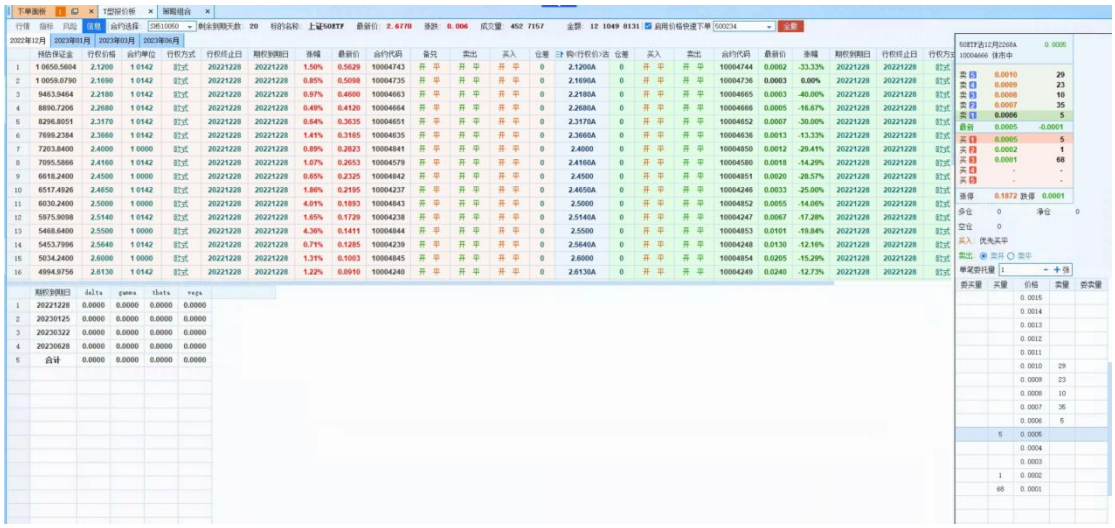
T 型板-指标

③风险板块提供展示期权合约的希腊值（包括外部导入的希腊值、买隐波、卖隐波数据）、最新价、仓差信息。可进行备兑，买入和卖出操作。



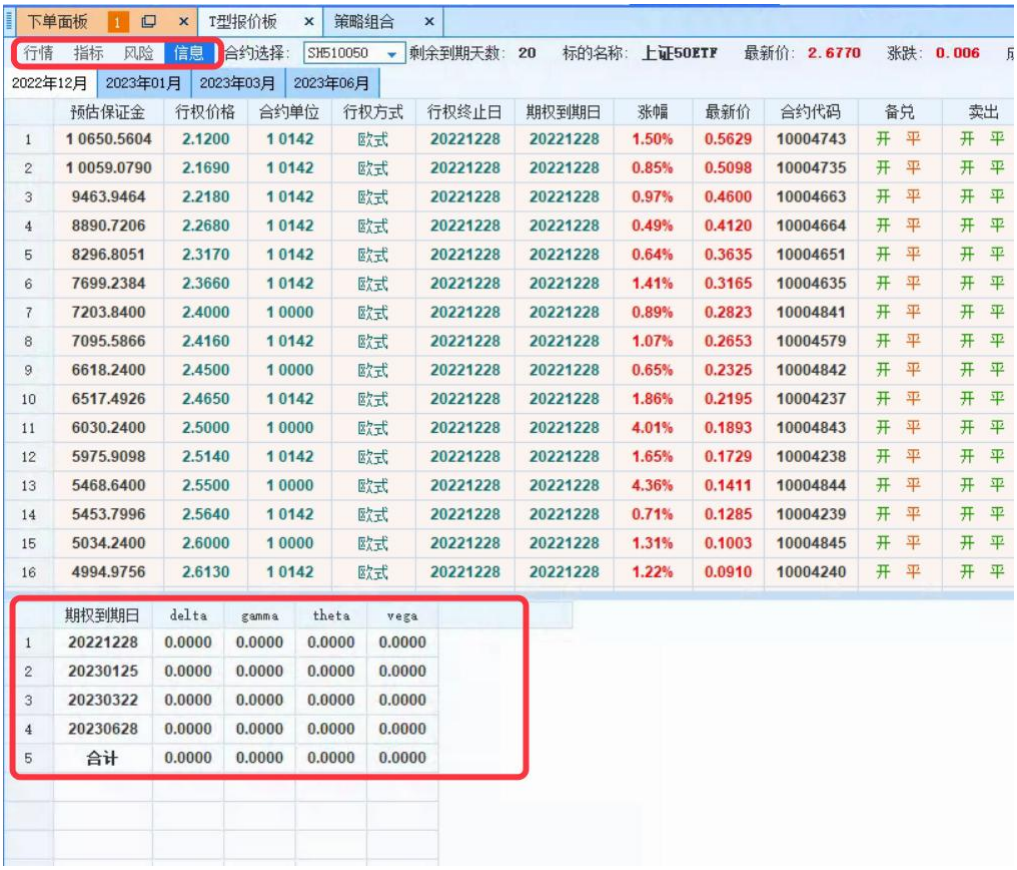
T 型板-风险

④信息板块提供展示期权合约的行权价格、合约单位、行权方式、行权终止日、最新价与仓差的信息。可进行备兑，买入和卖出操作。



T 型板-信息

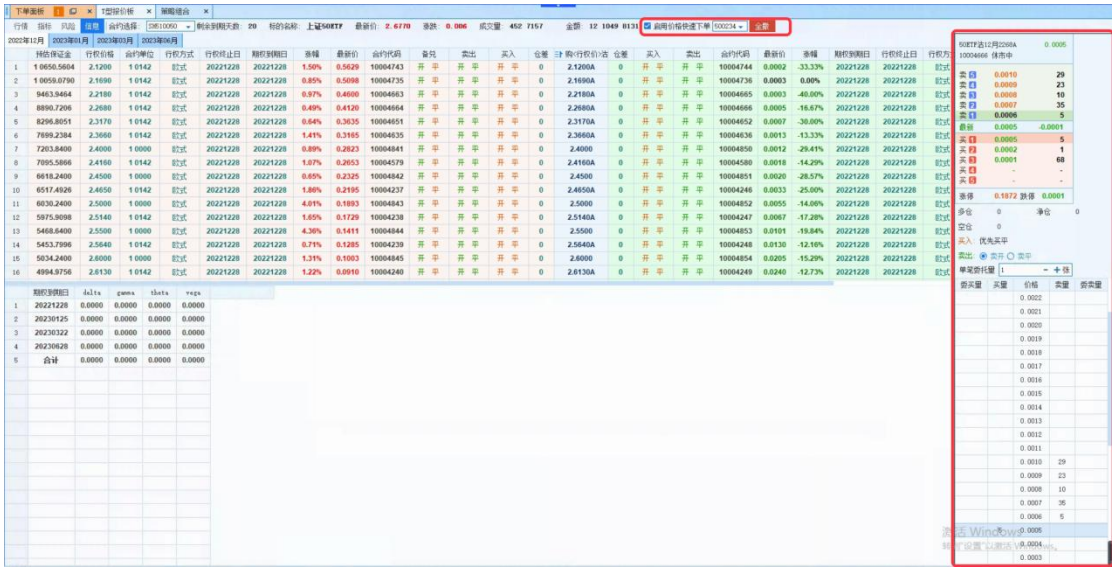
⑤T 型板各个板块的底部支持查看各个月份的希腊值汇总信息。



T 型板-希腊值汇总

3.3.2.5.7. 价格快速下单

本系统股票期权 T 型板增加价格快速下单功能，增加勾选“启用价格快速下单”，勾选之后，T 型板右侧出现价格快速下单版，取消勾选则价格下单板隐藏。T 型板的行情、指标、风险和信息四大板块共用快速下单板，相互切换时不影响快速下单板的使用。



价格快速下单板

启用价格快速下单功能，需要选择账号。价格快速下单板包含五档行情内容、信息展示（多仓=权利仓、空仓=义务仓、净仓=多仓-空仓）、操作选择、以及价格下单区。

①当在 T 型板中选中某合约（以 T 型板执行价格为中心，左边为认购合约，右边为认沽合约），价格快速下单板中将展示该合约的实时五档行情价格、涨跌停价和挂单量，以及该合约在该账号下的多仓、空仓和净仓信息。盘口支持手动输入期权合约。

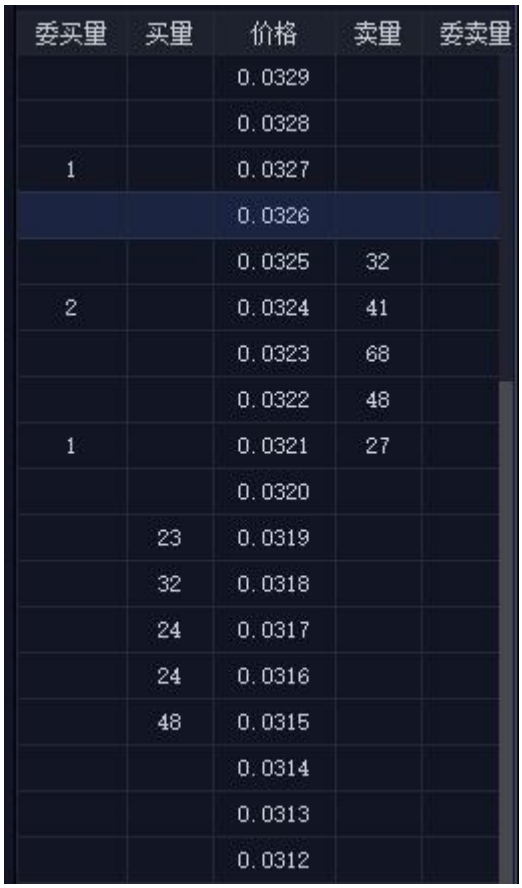
行情与持仓

②操作选择区可用于选择卖出下单操作，卖出分为卖开和卖平，买入默认优先买平操作，即不区分买开和买平，委托下单买入时，若合约有义务仓，优先平掉义务仓再根据委托量是否富余进行买开。可单笔委托量，即下单一笔的委托量，单位为张。

操作选择区

③下单区的价格也是根据选中的合约相应价格所得，若选中合约有最新价，则取最新价为基准向上和向下加减 20 个 tick；若合约无最新价，则取买一价和卖一价的均值做为基准，向上和向下加减 20 个 tick。每个价格左侧第一列为委买量，第二列为买量，点击相应价格行左侧即委买量和买量位置，左击是为买入下单，右击是为买入撤单；点击相应价格行右侧即委卖量和卖量位置，左击是为卖出下单，右击是为卖出撤单。在委买量和委卖量位置会显示出该价格下的累计未成委托量，右击撤单时则撤销该价格下全部未成委托。在买量和卖量位置会展

示五档行情价格的实时挂单量。



委买量	买量	价格	卖量	委卖量
		0.0329		
		0.0328		
1		0.0327		
		0.0326		
		0.0325	32	
2		0.0324	41	
		0.0323	68	
		0.0322	48	
1		0.0321	27	
		0.0320		
	23	0.0319		
	32	0.0318		
	24	0.0317		
	24	0.0316		
	48	0.0315		
		0.0314		
		0.0313		
		0.0312		

价格下单区

3.3.2.6. 沪港通/深港通

深港通和沪港通采用“双通道”独立运行机制，深港通下的港股通和沪港通下的港股通证券账户内股票不能交叉卖出，但沪深港股通账户卖出港股的资金可以交叉使用。内地投资者参与港股通股票交易时，仅能使用两种订单类型：在竞价时段应当采用“竞价限价盘”委托；在持续交易时段应当采用“增强限价盘”委托。投资者参与港股通交易委托申报需输入证券代码、买卖价格、买卖数量等参数。投资者申报的价格遵循香港当地的报价规则，在港股市场，开市报价规则与持续交易时段报价规则不同，但投资者在这两个时段输入的买卖盘价格，均不

可大于上日收盘价或按盘价九倍或以上及少于九分之一或以下，每个买卖盘不得超过 3000 手股份。

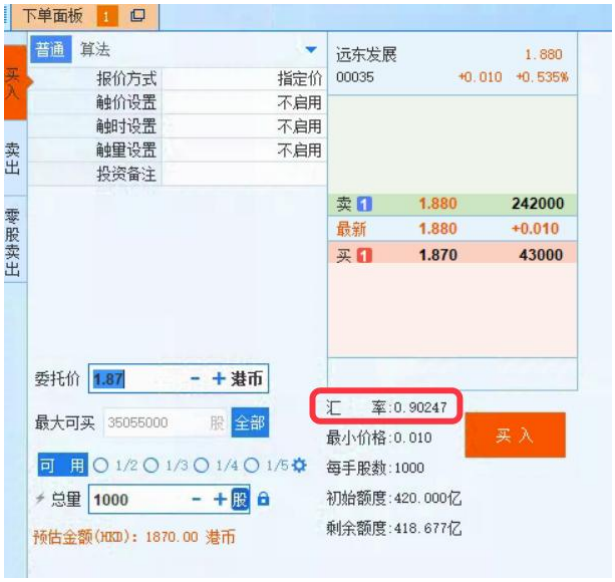
交易系统根据沪港通/深港通交易有买入、卖出、零股卖出的交易操作，如下图所示：

沪港通/深港通交易系统

3.3.2.6.1. 操作介绍

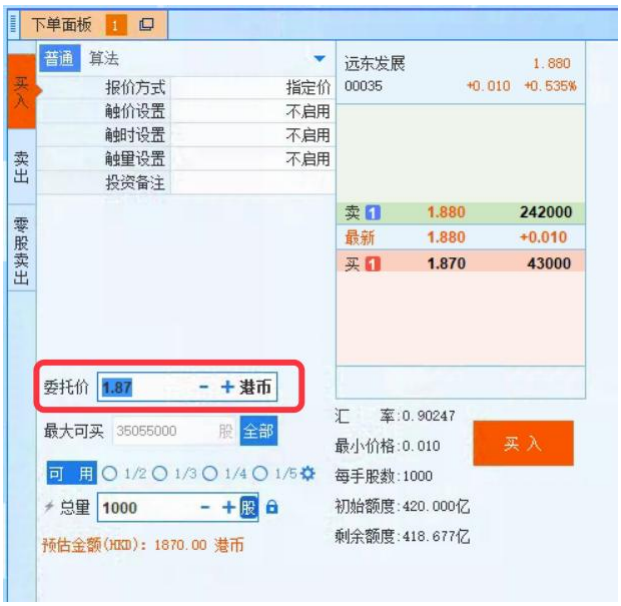
①港股通交易，以港币报价成交，以人民币清算并交收。在交易结算过程中，需要涉及到港币与人民币的换汇处理。在“买入/卖出/零股卖出”下单面板中显

示相应汇率，买入时，显示卖出汇率换算；卖出时，显示买入汇率换算：



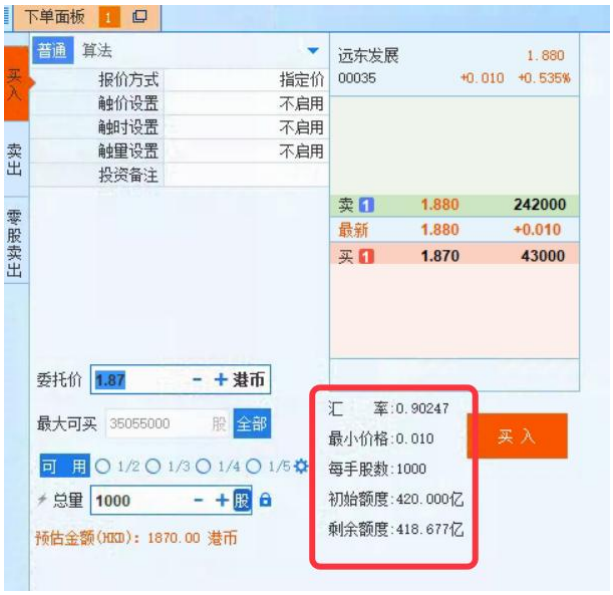
下单面板-汇率

②港股通交易，以港币报价成交，在“买入/卖出/零股卖出”下单面板中显示委托价时以港币为单位。



下单面板-委托价

③在“买入/卖出/零股卖出”下单面板盘口下方展示盘口所选代码对应的“最小价格”、“每手股数”、“初始额度”、“剩余额度”、“汇率”。



下单面板-数值

最小价格：深市 A 股是 0.01 元人民币；而港股不同价格的股票，最小报价单位不同，股价越高，最小报价单位越大。

每手股数：下单时需要输入每手股数数值或其整数倍。

初始额度与剩余额度：深港通设置了每日额度的限制，深港通每日额度限制为深股通 130 亿元人民币，港股通 105 亿元人民币。深港通下的港股通和沪港通下的港股通每日额度由深沪证券交易所分别控制，即均为 105 亿元人民币。

3.3.2.6.2. 买入和卖出

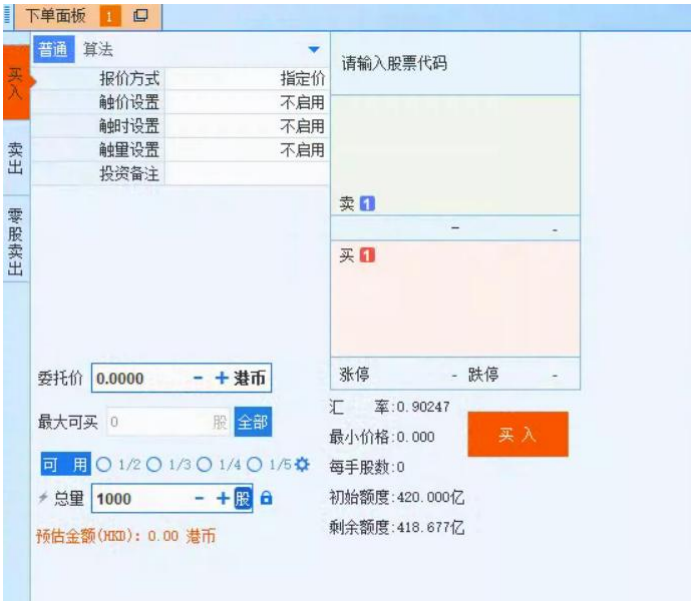
深市 A 股竞价交易买卖股票应为 100 股或其整数倍；港股交易每“手”股数没有统一规定，港股的上市公司可以自行设立不同数量的每手股票交易单位，可以是 100、200、1000 或 5000 等。买卖时下单量不得小于最小交易单位，委托价格必须为最小价格的整数倍。

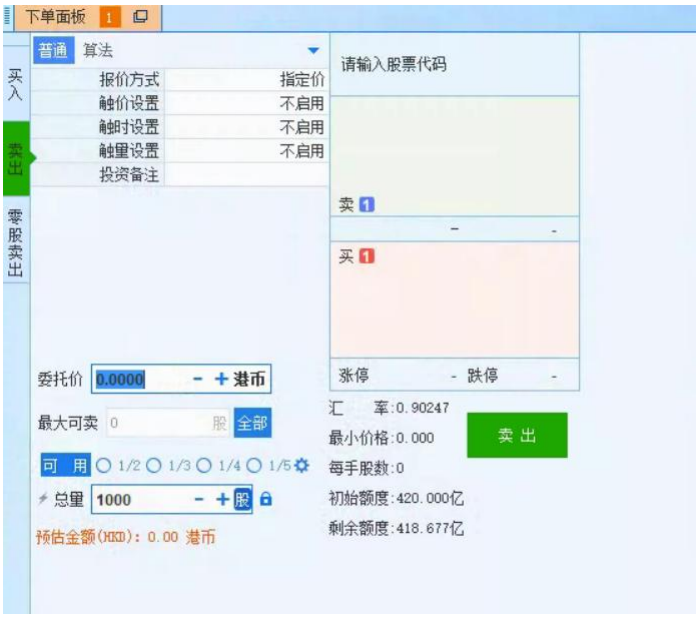
操作介绍：

①在买入/卖出下单面板盘口输入沪港通/深港通代码；

②选择交易方式，如选择普通交易，需设置相应的报价方式和触价设置；

③输入港币为单位的委托价，输入下单总量，点击下单按钮。





买入和卖出

3.3.2.6.3. 零股卖出

零股交易即指不到一个成交单位的股票交易。港交所的交易系统为零股买卖设有专门的系统，参与沪港通业务的内地投资者只能卖出零股，不能买入，为了满足沪港通合约的零股买卖操作，增加零股买卖操作面板。所谓零股是指不到一

个成交单位的股票。在内地市场，一手默认为 100 股（如 1 股、10 股），不满 100 股的股票需要通过零股卖出进行交易。在卖出股票时，可以用零股进行委托。

操作介绍：

①在零股卖出下单面板盘口输入沪港通/深港通代码（存在持仓）；

②选择交易方式，如选择普通交易，需设置相应的报价方式和触价设置；

③输入港币为单位的委托价，输入下单总量，点击下单按钮。

零股卖出

3.3.2.7. ETF 申赎

本系统 ETF 申赎模块支持成份股买入、成份股卖出、申购、赎回、基金买入、基金卖出、一键套利。

3.3.2.7.1. 成分股买入/卖出

申购需要一定数量的成份股，所谓的成份股就是多只股票，每个基金都有自己对应的成份股代码及分配量，可在交易所官网查看。

成份股买入

成份股买入/卖出类似于大篮子下单，以成份股买入操作为例：

点击 ETF 申赎-成份股买入，在 ETF 代码处点击 输入申赎代码 输入要进行交易的 ETF 代码，下单面板显示对应的成份股（交易所公布 ETF 申购赎回清单中，1 份“一级市场基金代码”=1 篮子“成份股信息”），且成份股代码和分配量与交易所公布该 ETF 代码成份股代码和分配量一致；

下单总量 1 CU 在 输入下单总量和交易参数，选择下单账号后点击买入按钮，可以对该 ETF 代码对应的成份股进行买入下单；

下单后委托、成交、持仓中增加相应的成份股信息（点击当日委托、当日成交和当日持仓查看）。

“成分股卖出”操作同成分股买入。

备注

下单总量单位 1CU 为 1 创设，即 ETF 申赎清单中给出的最小申赎单位，例如 510010 最小申赎单位为 1000000 份，即 1 创设为 1000000 份。

3.3.2.7.2. 基金买入/卖出

基金买入卖出和普通股票买入卖出操作类似，以基金买入为例：

输入基金代码，下单面板显示相应的基金信息；在交易设置中设置下单参数，选择非指定价报价方式时，委托价自动填充； 选择指定价报价方式时，

需手动输入委托价，且可以通过 － ＋调整价格，增减最小单位为 0.001 元；在下单总量处 下单总量 1 CU － ＋ 输入下单总量，选择下单账号，点击买入即可进行买入下单。

基金买入

基金买入后，当日持仓中增加该基金持仓，持仓量增加，增加量为下单总量；点击当日委托、当日成交和当日持仓查看其交易数据。

“基金卖出”操作同基金买入。

下单总量最小单位为 1CU/份，CU 和份可以通过点击相互切换。1CU 即 1 创设单位，即 ETF 申赎清单中给出的最小申赎单位，例如 510010 最小申赎单位为 1000000 份，即 1 创设为 1000000 份。选中某只基金代码后，下单总量右侧会联动显示出该只基金代码的最小申赎单位。

3.3.2.7.3. 申购/赎回

申购是用成份股换 ETF 基金的持仓。每个 ETF 的代码都有固定的一篮子股票，在客户端下单面板输入 ETF 的代码，就会在左侧面板出现对应的一篮子成份股的代码。

申购

其中可用量是持仓中成份股的可用于申购的数量，同申赎可用量。

赎回是用 ETF 基金换成份股持仓，在客户端下单面板输入 ETF 的代码，会在左侧面板出现对应的一篮子成份股的代码。其中可用量是持仓中成份股的可用于赎回的数量，同申赎可用量。

赎回

3.3.2.7.4. 一键套利

一键套利界面同样包含交易设置区、账号选择区和下单操作区。

一键套利

交易设置区供用户选择不同交易的交易参数，此处列举了两种交易分别是成份股卖出、基金买入，其他没有参数设置。下单时可以选择普通交易或者算法交易下单。

交易设置区

账号选择区供用户选择资金账号，呈现经纪公司、资金账号、账号名称、权重和总资产、可用资金等内容。账号均为单选，只允许选择一个账号。

账号选择区

下单操作区供用户选择具体的套利方式、下单的 ETF 代码和基金代码，可设置基金价格和下单总量。输入 ETF 代码或者基金代码时，会联动显示对应的基金代码或 ETF 代码；基金价格处显示报价方式的价格，报价方式为指定价时，基金价格可输入，为其他报价方式时基金价格置灰不可输入。下单总量单位为 CU（创设），例如，官网公布的 510021 的最小申赎清单为 100000 份，即为 1 创设。

下单时可选择是否勾选优先使用库存、现金替代，参数设置处可设置报价方式为自动盘口时的盘口比例。参数设置右侧问号标志可点击，点击弹出一键套利功能使用说明。

下单操作区

成份股买入/卖出支持的报价方式有：买 1 价、卖 1-卖 5、最新价、市价、挂单价、对手价、自动盘口报价方式。

基金买入/卖出支持的报价方式有：卖1-卖5、买1-买5、最新价、市价 、挂单价、对手价，支持指定价的取价方式。

自动盘口报价方式选择：如果选择了买、卖自动盘口，则系统会根据交易份额中需要的委托数量来自动选择每只证券委托时使用的盘口。选择的依据是：买入时依次从低到高取相应盘口数量再考虑用户设置的盘口比例后的累积达到委托数量时，则对该盘口价格进行委托。如：使用买自动盘时，先找卖一盘（利于成交方向）的盘口数量*盘口一比例是否小于委托数量。如果不小于，则使用卖一盘的价格进行委托，如果小于则取卖一盘数量*盘口一比例加卖二盘数量*盘口二比例与委托数量比较，不小于则取卖二盘，小于再取卖三盘，依此类推，直至找到卖五盘为止。卖出时同理，依次从高到低取相应盘口数量再考虑用户设置的盘口比例后的累积达到委托数量时，对该盘口价格进行委托。如：使用卖自动盘时，先找买一盘（利于成交方向）的盘口数量*盘口一比例是否小于委托数量。依次类推买二盘、买三盘直至买五盘。 举例如下：SH600016卖出2100股，

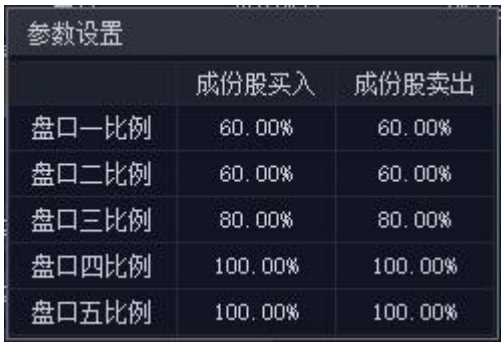
	选择	账号	市场	代码	股票名称	交易类型	分配量	最新价	涨跌幅	最新市值	状态	ETF申赎可用量	单位申赎可用量	替代标志	溢价比率	替代金额	自动盘口
1	☑	260100007504	SH	600016	民生银行	卖出	2100	5.99	-0.17%	12579.00		20900	2100	允许	0.10	0.00	5.99
2	☑	260100007504	SH	600019	宝钢股份	卖出	1600	7.57	1.75%	12112.00		124400	1600	允许	0.10	0.00	7.55
3	☑	260100007504	SH	600028	中国石化	卖出	2200	6.67	-0.45%	14674.00		13150	2200	允许	0.10	0.00	6.66
4	☑	260100007504	SH	600030	中信证券	卖出	800	15.93	0.44%	12744.00		21850	800	允许	0.10	0.00	15.90
5	☑	260100007504	SH	600036	招商银行	卖出	500	28.15	2.36%	14075.00		9550	500	允许	0.10	0.00	28.10

自动盘口

盘口数量如下：

盘口挂单量

盘口比例如下：（盘口比例设置见下单操作区参数设置）



参数设置

	成份股买入	成份股卖出
盘口一比例	60.00%	60.00%
盘口二比例	60.00%	60.00%
盘口三比例	80.00%	80.00%
盘口四比例	100.00%	100.00%
盘口五比例	100.00%	100.00%

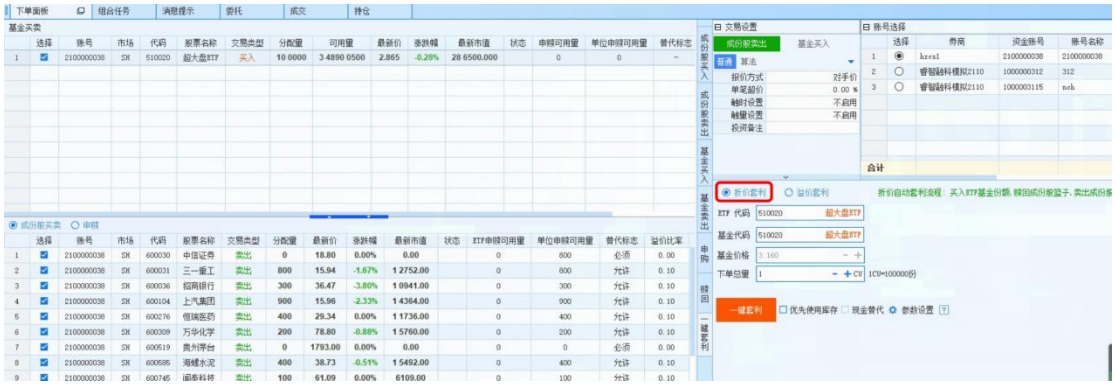
盘口比例

买1盘口数量*60%=711*0.6=426.6<1000<买1盘口数量*60%+买2盘口数量*60%=711*0.6+5270*0.6=3588.6，所以自动盘口报价方式取买2价。买2价为5.99。

折价套利

折价套利是当基金价格低于基金份额参考净值，投资者先以较低的价格买入 ETF 基金，用 ETF 基金赎回成份股篮子，再以较高的价格卖出成份股篮子，赚得差价的套利。所以一键套利中的折价套利流程，将会包含三个交易过程，先后分别是基金买入、ETF 赎回、成份股卖出。体现在系统中，即一个折价套利过程将会先后产生 3 个任务，分别执行。

折价套利下单



折价套利

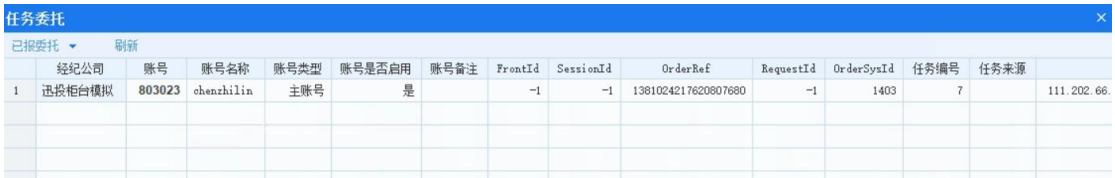
下单后产生套利任务：

折价套利任务

委托反馈将根据任务的先后顺序分别返回：

折价套利委托反馈

已报委托将根据任务报出的顺序分别产生。



折价套利已报委托

组合任务中将先后分别产生三个任务，每次完成一个任务，下一个任务才会开始。如图：

套利进度

套利任务

每次完成一个任务，持仓、委托、成交会相应产生变化。在一次完整地不用库存的折价套利完成后，套利前后的持仓应该是无变化的。

溢价套利

溢价套利是当基金价格高于基金份额参考净值时，投资者先以较低的价格买入成份股篮子，用篮子申购 ETF 基金，再以较高的价格卖出 ETF 基金，赚得差价的套利。所以一键套利中的溢价套利流程，将会包含三个交易过程，先后分别是成份股买入、ETF 申购、基金卖出。体现在系统中，即一个溢价套利过程将会先后产生 3 个任务，分别执行。

溢价套利下单

溢价套利

下单后产生套利任务：

溢价套利任务

委托反馈将根据任务的先后顺序分别返回：

任务委托

委托反馈 | 全部 | 全选 反选 | 选中撤单 全部撤单 | 刷新

	选择	委托时间	代码	名称	买卖标记	委托量	成交数量	委托剩余量	委托状态	委托价格	成交均价	合同编号	废单原因	证券市场	多空	报单状态	账号
1	□	18:18:27	601166	兴业银行	限价买入	1000股	0股	1000股	已报	19.62	0.0000	1000000014		SH	-	-	主
2		18:12:44	603259	药明康德	限价买入	100股	100股	0股	已成	94.40	94.4000	1000000019		SH	-	-	主
3		18:12:44	601888	中国中免	限价买入	100股	100股	0股	已成	163.69	163.6900	1000000018		SH	-	-	主
4		18:12:44	601668	中国建筑	限价买入	3600股	3600股	0股	已成	5.92	5.9200	1000000017		SH	-	-	主
5		18:12:44	601398	工商银行	限价买入	3700股	3700股	0股	已成	4.76	4.7600	1000000016		SH	-	-	主
6		18:12:44	601318	中国平安	限价买入	400股	400股	0股	已成	44.36	44.3600	1000000015		SH	-	-	主
7	□	18:12:44	601066	中信建投	限价买入	600股	300股	300股	部成	21.34	21.3400	1000000013		SH	-	-	主
8		18:12:44	601012	隆基股份	限价买入	200股	200股	0股	已成	67.03	67.0300	1000000012		SH	-	-	主
9		18:12:44	600905	三峡能源	限价买入	2600股	2600股	0股	已成	5.69	5.6900	1000000011		SH	-	-	主
10		18:12:44	600887	伊利股份	限价买入	400股	400股	0股	已成	37.85	37.8500	1000000010		SH	-	-	主
11		18:12:44	600809	山西汾酒	限价买入	100股	100股	0股	已成	253.66	253.6600	1000000009		SH	-	-	主
12		18:12:44	600745	闻泰科技	限价买入	100股	100股	0股	已成	61.09	61.0900	1000000008		SH	-	-	主
13		18:12:44	600585	海螺水泥	限价买入	400股	400股	0股	已成	38.73	38.7300	1000000007		SH	-	-	主
14		18:12:44	600309	万华化学	限价买入	200股	200股	0股	已成	78.81	78.8100	1000000006		SH	-	-	主
15		18:12:44	600276	恒瑞医药	限价买入	400股	400股	0股	已成	29.34	29.3400	1000000005		SH	-	-	主
16		18:12:44	600104	上汽集团	限价买入	900股	900股	0股	已成	15.97	15.9700	1000000004		SH	-	-	主
17		18:12:44	600036	招商银行	限价买入	300股	300股	0股	已成	36.47	36.4700	1000000003		SH	-	-	主
18		18:12:44	600031	三一重工	限价买入	800股	800股	0股	已成	15.95	15.9500	1000000002		SH	-	-	主
合计						15900	14600	1300									

溢价套利委托反馈

已报委托将根据任务报出的顺序分别产生。

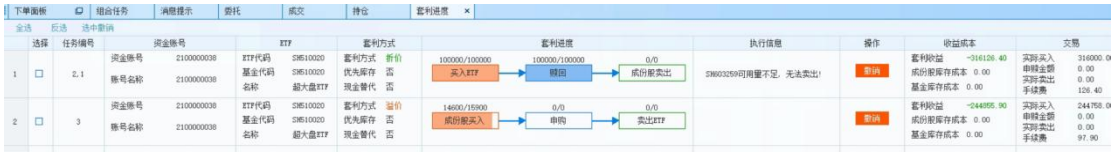
任务委托

已报委托 | 刷新

	经纪公司	账号	账号名称	账号类型	账号是否启用	账号备注	FrontId	SessionId	OrderRef	RequestId	OrderSysId	任务编号	任务来源	
1	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452610	-1	1000000002	3		111.202.66
2	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452611	-1	1000000003	3		111.202.66
3	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452612	-1	1000000004	3		111.202.66
4	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452613	-1	1000000005	3		111.202.66
5	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452614	-1	1000000006	3		111.202.66
6	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452615	-1	1000000007	3		111.202.66
7	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452616	-1	1000000008	3		111.202.66
8	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452617	-1	1000000009	3		111.202.66
9	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452618	-1	1000000010	3		111.202.66
10	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452619	-1	1000000011	3		111.202.66
11	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452620	-1	1000000012	3		111.202.66
12	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452621	-1	1000000013	3		111.202.66
13	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452622	-1	1000000014	3		111.202.66
14	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452623	-1	1000000015	3		111.202.66
15	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452624	-1	1000000016	3		111.202.66
16	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452625	-1	1000000017	3		111.202.66
17	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452626	-1	1000000018	3		111.202.66
18	hres1	2100000038	2100000038	主账号	是		-1	-1	1381024217440452627	-1	1000000019	3		111.202.66
合计														

溢价套利已报委托

组合任务中将先后分别产生三个任务，每次完成一个任务，下一个任务才会开始。如图：



套利进度面板

每次完成一个任务，持仓、委托、成交会相应产生变化。在一次完整地不使用库存的溢价套利完成后，套利前后的持仓应该是无变化的。

优先使用库存

一键套利支持使用当前持仓中的库存，委托时只需委托（目标量-库存量），进而做到减少交易成本，加速成交进程，有效减少套利时间。优先使用库存界面勾选如图：

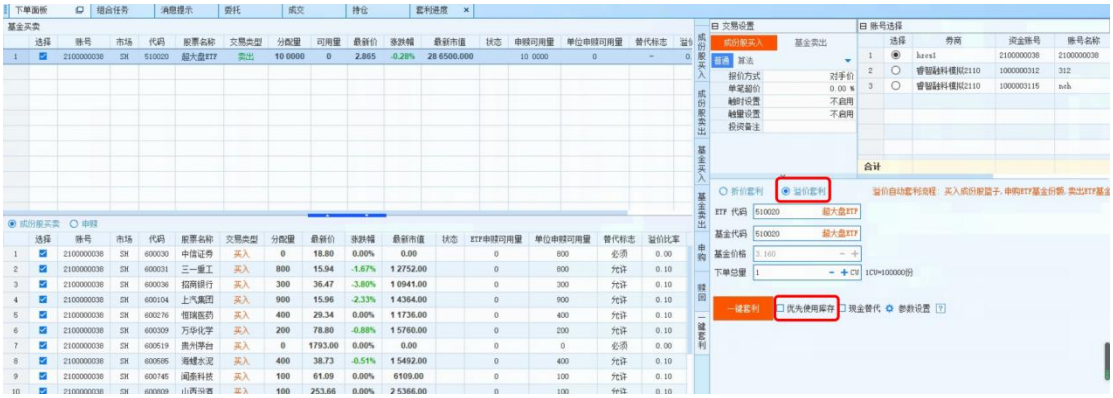
优先使用库存

优先使用库存，优先，即勾选之后，若持仓中有可用来套利的库存，则优先使用，委托量为（目标量-库存量），若持仓中没有可用的库存，则进行全部目标量委托。

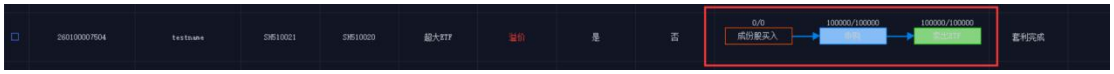
溢价套利流程，包含成份股买入、ETF 申购、基金卖出三个任务。所以，若勾选优先使用库存，则会先检查基金持仓的可用量，基金持仓可用若足够，则直接按目标量卖出，基金持仓可用若不够，则检查申购的可用是否足够。申购可用是否足够检查的是成份股的 ETF 申赎可用量，若足够则直接按目标量进行申购委托，若不够则按（目标量-库存量）进行成份股买入委托。折价套利同理，依次检查成份股持仓可用量、基金持仓的 ETF 申赎可用量，进行委托。

套利任务开始后，勾选了优先使用库存，则在成交的过程中，持仓会被实时检查。例如溢价套利，在成份股买入进行中时，若检查到持仓中申赎可用量足够，则会开始报出申购的任务和委托，同时会撤掉成份股买入的任务。折价套利买入基金时同理。

例：510021 溢价套利，优先使用库存，基金持仓可用不足，申购可用足够，直接从申购开始进行委托。



溢价套利



使用库存

使用库存任务

现金替代

ETF 申购过程中需要考虑现金替代这一环节，考虑现金替代后，一键套利支持除去库存和现金替代部分后进行委托，故在溢价套利成份股买入时能够尽快报出除去库存和现金替代部分后的委托量。因而在选择溢价套利方式后，可勾选是否考虑现金替代，若勾选现金替代，成份股买入时可以实现比只勾选优先库存更快更早的开始进行申购，进而加速套利进度。

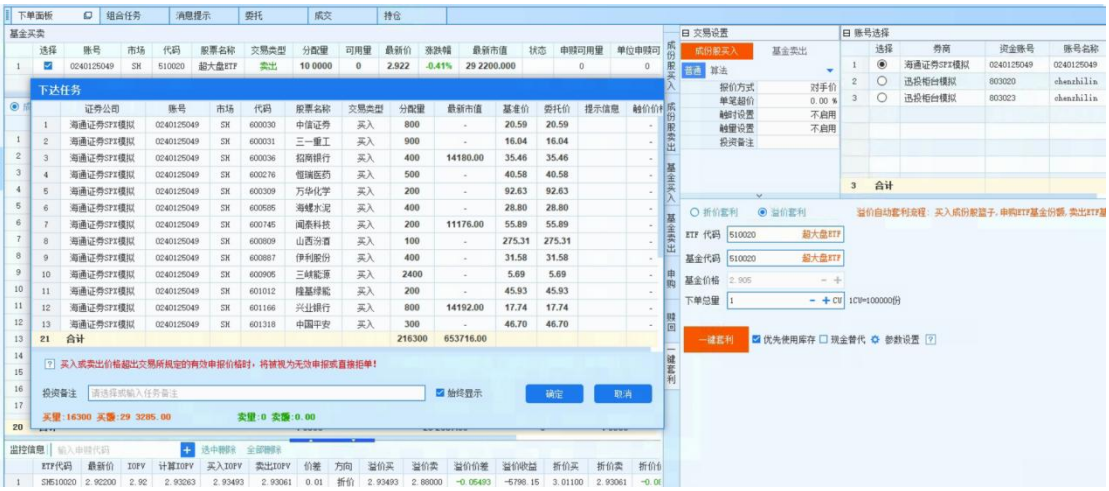
现金替代只会在申购中发生，所以折价套利是不会用到现金替代的。故当选择折价套利时，现金替代勾选项为置灰不可勾选状态，如图：

现金替代

溢价套利勾选现金替代后，优先使用库存也会同步勾选上并且置灰不让更改。考虑使用现金替代，需要在实时检查持仓的基础上实时计算当前现金替代比例，若在成份股买入任务进行过程中，当前现金替代比例达到小于或等于最小申赎清单上的现金替代比例，则系统会立刻开始进行申购，同时会撤掉成份股买入未完成的任务，从而减少成份股买入时间，加快套利进度。溢价套利勾选现金替代，如图所示

默认使用库存

例：510011 溢价套利，成份股有部分持仓，当勾选优先使用库存但不勾选现金替代时，下单弹框，会委托买入（目标量-库存量）数目的成份股：



溢价套利

此时取消下单，同时勾选现金替代，下单弹框，会直接委托申购。这是因为系统经过计算，把需要委托买入的部分成份股用现金替代了，所以直接进行了申购：

使用现金替代

因此，系统有效利用现金替代减少了套利时间，加速了了套利进程，有助于用户抓住短暂的套利时机，实现收益。

若启用了优先使用库存或现金替代两功能，套利可能在第一步买入成份股时由于实时检查持仓，当检查出申购的持仓足够便立刻进行申购，而第一步成份股买入的过程可能并未进行完。此时，系统会发出撤销请求，撤销第一步的任务。

套利进度

用于展示 ETF 一键套利的流程进度，如图：

套利进度面板

呈现每次套利的进度流程到哪一步。包含选择、任务编号、资金账号、ETF（ETF 代码、基金代码、名称）、套利方式、套利进度、执行信息和操作，以及收益成本和交易。套利方式展示溢价还是折价套利方式，是否优先库存和现金替代，套利进度展示每次套利目前进入到了哪一步，，执行信息显示一些持仓状态信息。操作可以选择撤销，申购和赎回中不可撤销指令。一但撤销（在自动套利面板撤销或者任务面板中撤销），即撤销本次套利，套利过程终止。

相关计算：实际买入（溢价）=成份股买入成交金额，实际买入（折价）=ETF 买入成交金额，实际卖出（溢价）=ETF 卖出成交金额，实际卖出（折价）=成份股卖出成交金额。套利收益=实际卖出-实际买入。此处交易过程中大致计算实际买入和实际卖出的套利收益，不计算现金替代造成的替代金额以及成份股买卖的佣金、印花税、过户费及申购赎回费用的交易费用。

由于 ETF 套利能产生多条任务，所以套利进度面板统计套利进度信息时根据任务执行进度来跟踪套利进度。因而只有产生任务的用户客户端才能在“套利进度”面板上展示相关套利进度。

3.3.2.8. 固收业务

固收业务模块支持质押式协议回购、现券买卖和上海/深圳债券交易。

3.3.2.8.1. 质押式协议回购

固收业务模块支持质押式协议回购。

债券质押式协议回购交易（以下简称“协议回购”）是指回购双方自主谈判和协商议定，资金融入方(以下简称“正回购方”)在将债券进行质押登记并向资金融出方(以下简称“逆回购方”)融入资金的同时，双方约定在未来某一日期由正回购方向逆回购方返还本金，并按约定回购利率支付资金利息，同时解除债券质押登记的交易。

上交所、深交所业务描述：

意向申报-只有上海可以做正回购逆回购，深圳不支持；

成交申报-上海深圳只能由正回购方发起；

到期续做-上海深圳只能由正回购方发起；

提前购回-上海正逆回购双方都可以发起，深圳只能由正回购方发起；

质押券变更-只有上海可以做且只能做正回购，深圳不支持；

解除质押-上海正逆回购双方都可以发起，深圳只能由正回购方发起。

3.3.2.8.1.1. 意向申报

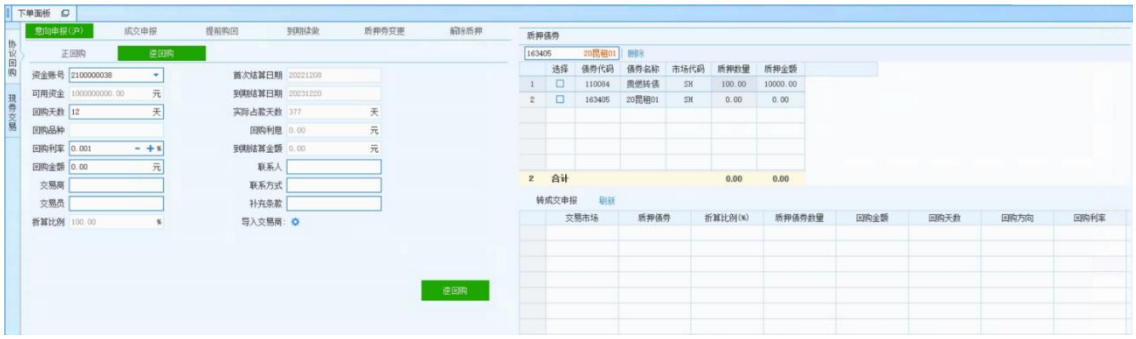
意向申报：是指投资者为寻找交易对手方发送的，表明协议回购意向的报价。

正回购： 在进行正回购时，要选择质押债券，填写好交易要素后，点击正回购按钮进行申报。

下单后，委托已报，不会生成成交，转成交申报列表多一条正回购方向的行情数据，账号资金持仓不变。

逆回购：当要进行逆回购的时候，选择质押债券逆回购，输入代码进行选择想要的债券，填写好交易要素后，点击逆回购按钮进行申报。

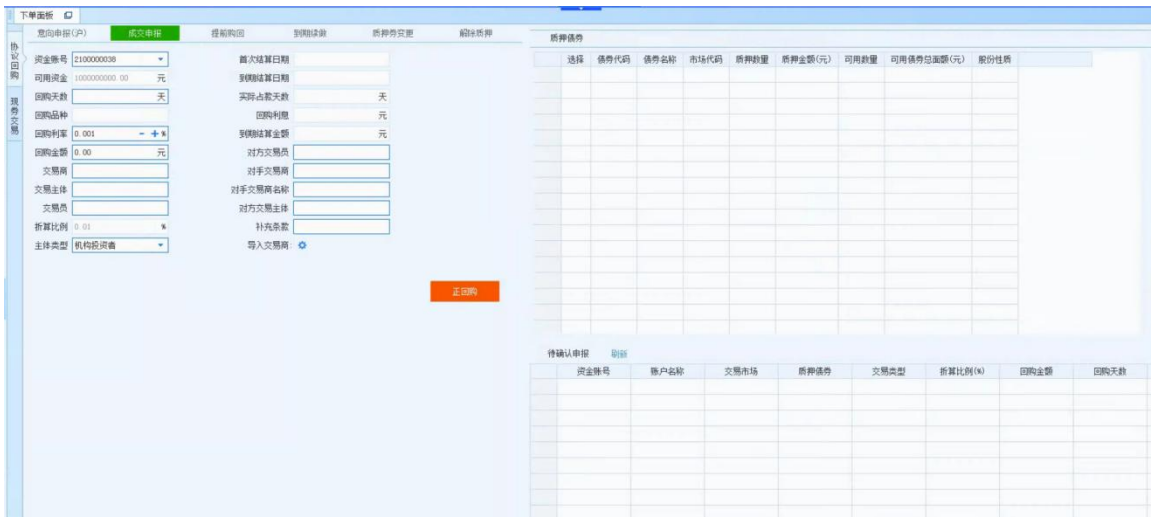
下单后，委托已报，不会生成成交，转成交申报列表多一条逆回购方向的行情数据，账号资金持仓不变。



转成交面板：显示的是所有意向申报的行情，可以在此看到市场上所有的意向申报的信息，可以根据自己需要进行联系对手方进行商谈。

3.3.2.8.1.2. 成交申报

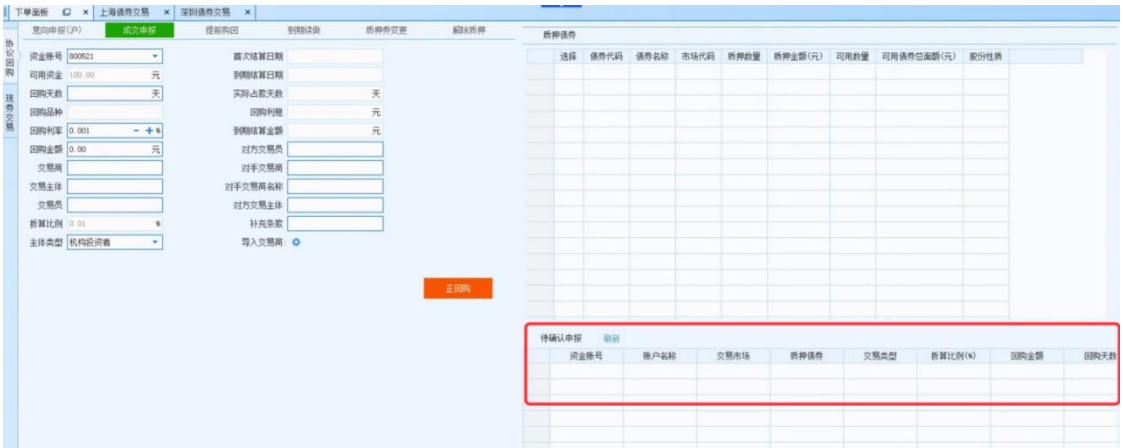
目前都是交易双方进行私下协议，确定好所有交易要素，在交易系统进行成交申报。



（1）正回购

在选择要质押的债券后，在下单面板上填入回购天数等交易要素后进行正回购操作。

下单后，委托已报，不会生成成交，当日持仓面板可用数量减少，冻结数量增加，账号资金不变。

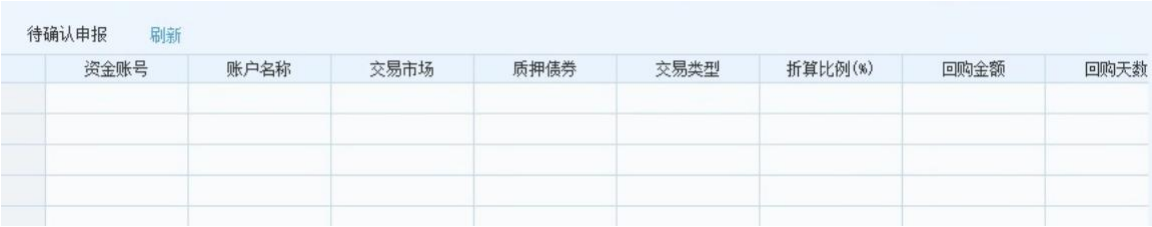


待确认申报面板是由对手方发起本方来确认的委托，只有对手方发起的会显示在待确认里面，本方发起的显示在对手方那里，由于交易员和对手方交易员不是一个人，故查不到记录。

若逆回购方确认，成交申报委托由已报变为已确认，资金、持仓不变。

若逆回购方拒绝，成交申报委托由已报变为废单，废单原因对手方拒绝，当日持仓面板可用数量增加，冻结数量减少，账号资金不变。

（2）逆回购



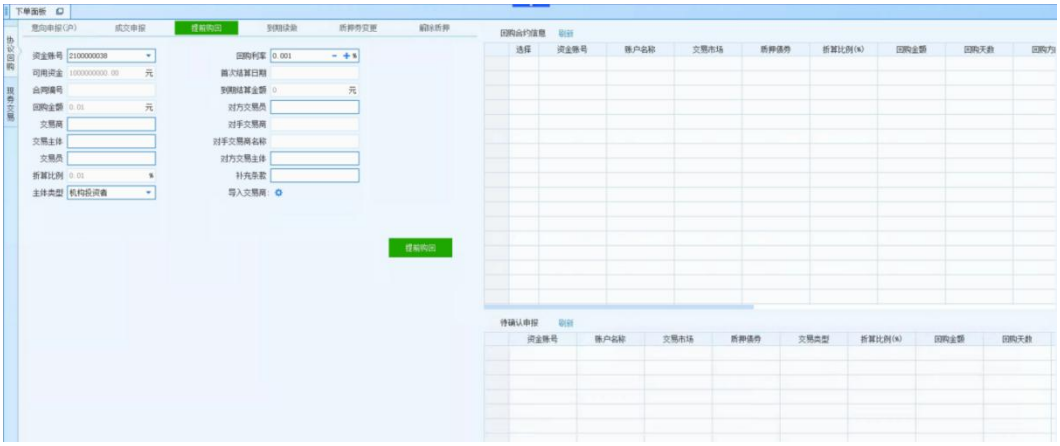
逆回购方可以在待确认申报面板，查看发给本方的委托信息，可在操作栏中确认或拒绝。

若确认，成交申报委托已确认，账号资金面板可用金额减少，冻结金额增加，当日持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

若拒绝，成交申报拒绝后委托已成，账号资金、持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

3.3.2.8.1.3. 提前购回

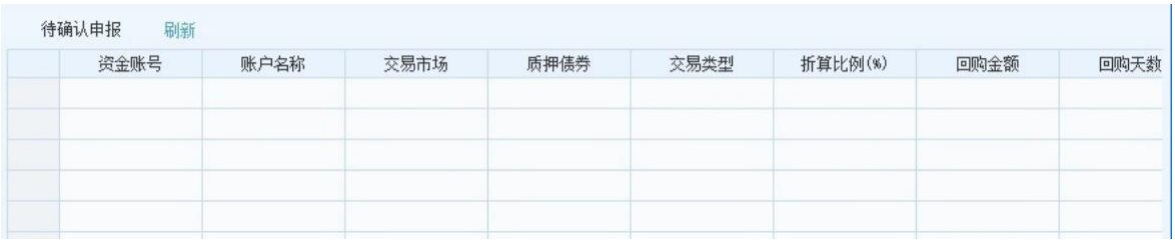
协议回购未到期之前可以进行提前购回申报。



（1）正回购

正回购方：

下单后，会在待确认面板中行成一条数据。提前购回正回购委托已报，账号资金面板可用金额减少，冻结金额增加，当日持仓不变。



若逆回购方确认，委托由已报变为已确认，当日持仓面板可用数量增加，冻结数量减少，账号资金不变，回购合约该条行情的合约状态由初始合同变为已了结合同。

若逆回购方拒绝，委托由已报变为废单，账号资金面板可用金额增加，冻结

金额减少，当日持仓不变。

逆回购方：

逆回购方在待确认申报面板中查看正回购方发给本方的提前购回信息。可在操作栏进行确认或拒绝。

如果点击确认按钮，协议回购提前终止申报委托已确认，账号资金持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

如果点击拒绝按钮，拒绝后委托已成，账号资金、持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

（2）逆回购

逆回购方：

下单后，会在待确认申报面板行程一条数据，提前购回逆回购委托已报，不会生成成交，账号资金持仓不变。

待确认申报　刷新

资金账号	账户名称	交易市场	质押债券	交易类型	折算比例(%)	回购金额	回购天数

若正回购方确认，委托由已报变为已确认，资金、持仓不变，回购合约该条行情的合约状态由初始合同变为已了结合同。

若正回购方拒绝，委托由已报变为废单，废单原因为对手方拒绝，账号资金、持仓不变。

正回购方：

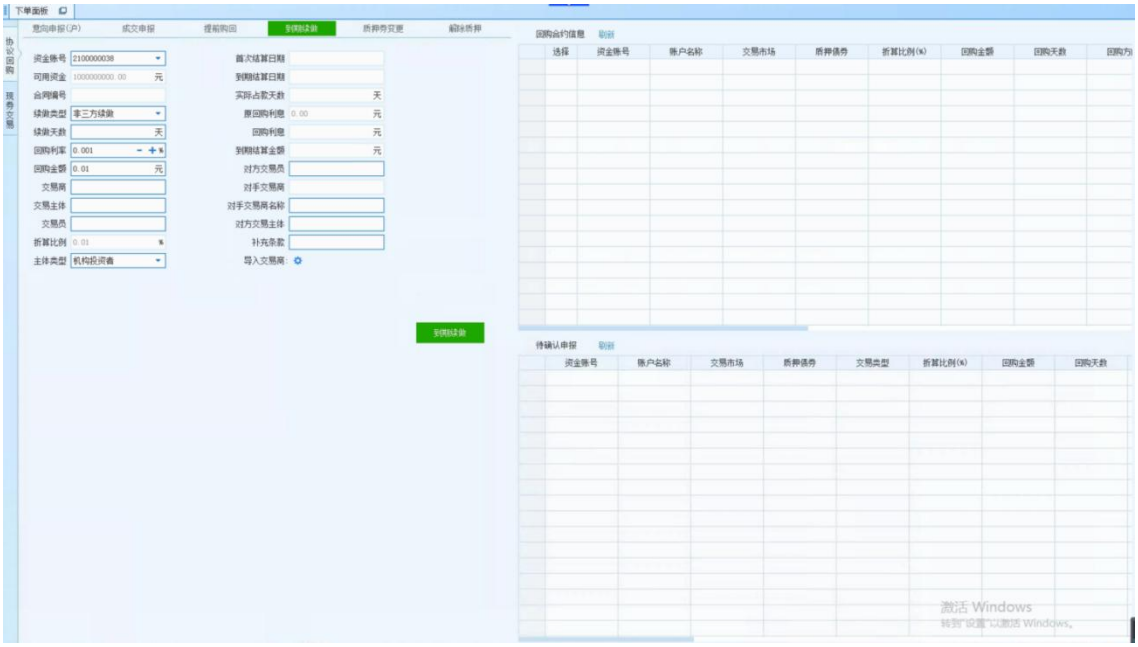
正回购方可在待确认申报面板查看逆回购方发给本方提前购回的申请信息，可在操作栏确认或拒绝。

如果点击确认按钮，委托由已报变为已确认，账号资金面板可用金额减少，冻结金额增加，当日持仓可用数量增加，冻结数量减少，待确认申报中该条行情消失。

如果点击拒绝按钮，拒绝后委托已成，账号资金、持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

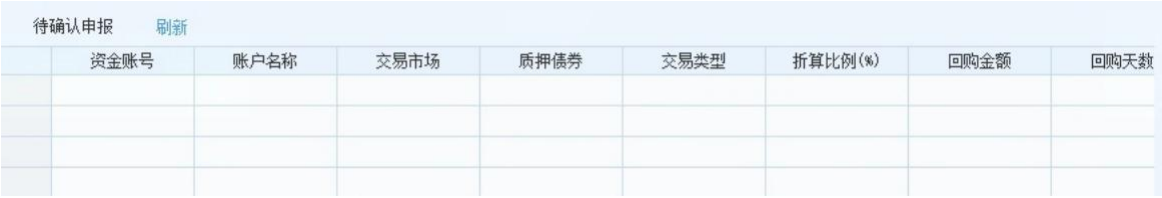
3.3.2.8.1.4. 到期续做

到期续做申报是指正回购方确认履行到期购回义务，同时使用到期购回的全部质押券进行一笔新的协议回购，并与到期续做的逆回购方约定在到期购回的质押券解除质押登记后用于新的协议回购。到期续做的逆回购方可以为到期回购的逆回购方，也可以为其他第三方。



正回购方：

下单后，到期续做委托已报，不会生成成交，账号资金面板可用金额减少，冻结金额增加，当日持仓不变。



待确认申报是由对手方发起本方来确认的委托，只有对手方发起的会显示在

待确认里面，本方发起的显示在对手方那里。

若逆回购方确认，委托由已报变为已确认，回购合约该条行情的合约状态由初始合同变为已了结合同，资金、持仓不变。

若逆回购方拒绝，到期续做申报委托由已报变为废单，废单原因对手方拒绝，账号资金面板可用金额增加，冻结金额减少，当日持仓不变。

逆回购方：

逆回购方可在待确认申报面板中，查看发给本方确认的申报信息，可在操作栏中点击确认或拒绝。

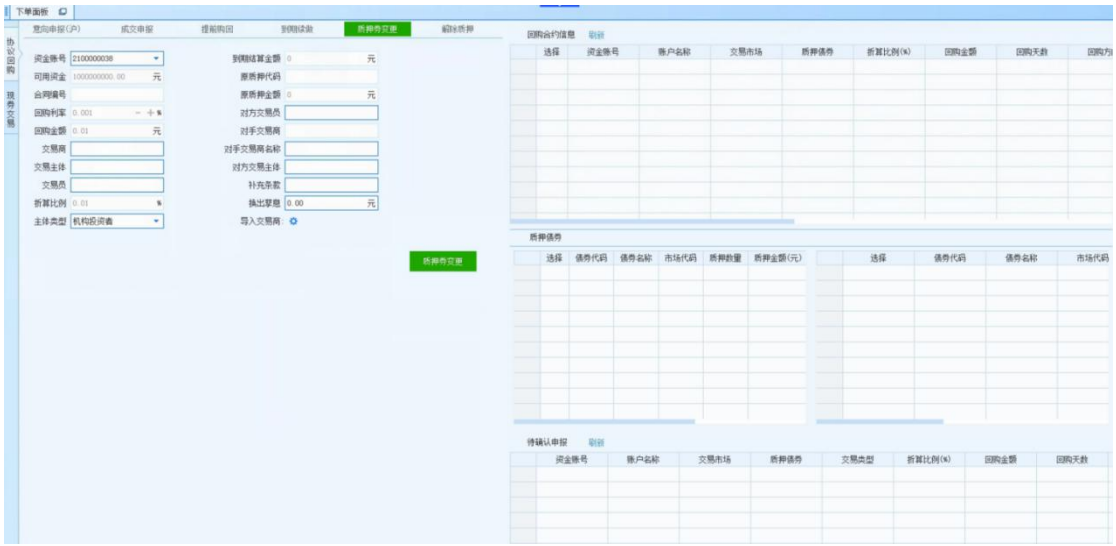
待确认申报确认，到期续做委托已确认，账号资金持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

待确认申报拒绝，拒绝后委托已成，账号资金、持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

3.3.2.8.1.5. 质押券变更

协议回购确认成交后，在协议回购存续期间（不含首次结算日和到期结算日），经双方协商一致，可以对质押券进行变更。

质押券变更申报由正回购方发起，经逆回购方进行确认申报后，由交易系统予以确认。



正回购方：

下单后，委托已报，不会生成成交，当日持仓面板质押债券的可用数量减少，冻结数量增加，账号资金不变。

待确认申报　刷新

资金账号	账户名称	交易市场	质押债券	交易类型	折算比例(%)	回购金额	回购天数

待确认申报是由对手方发起本方来确认的委托，只有对手方发起的会显示在待确认里面，本方发起的显示在对手方那里。

若逆回购方确认，质押券变更委托由已报变为已确认，资金、持仓不变。

若逆回购方拒绝，换券申报委托由已报变为废单，废单原因对手方拒绝，当日持仓面板可用数量增加，冻结数量减少，账号资金不变。

逆回购方：

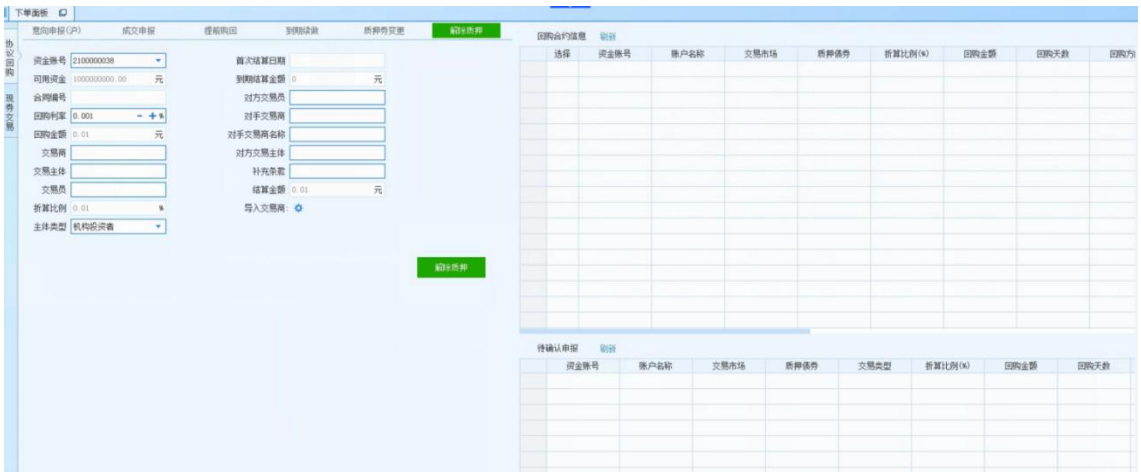
逆回购方可在待确认申报面板查看发给本方确认的申报信息，可在操作栏中进行确认或拒绝。

待确认申报确认，换券申报委托已确认，账号资金持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

待确认申报拒绝，质押券换券申报拒绝后委托已成，账号资金、持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

3.3.2.8.1.6.　解除变更

协议回购达成后，如果协议回购存续期间有违约情况，需要解除质押，可以在此界面解除质押关系。



（1）正回购

正回购方：

下单后，解除质押委托已报，不会生成成交，账号资金面板可用金额减少，冻结金额增加，当日持仓不变。

若逆回购方确认，解除质押委托由已报变为已确认，当日持仓面板可用数量增加，冻结数量减少，账号资金不变，回购合约该条行情的合约状态由初始合同变为已了结合同。

若逆回购方拒绝，委托由已报变为废单，账号资金面板可用金额增加，冻结金额减少，当日持仓不变。

逆回购方：

在待确认申报面板，可对发给本方确认的申报信息，在操作栏进行确认或拒绝。

待确认申报确认，解除质押委托已确认，账号资金持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

待确认申报拒绝，解除质押申报拒绝后委托已成，账号资金、持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

（2）逆回购

逆回购方：

下单后，解除质押申报逆回购委托已报，不会生成成交，资金持仓不变。

若正回购方确认，解除质押委托由已报变为已确认，账号资金持仓不变，回购合约信息面板该条行情的合约状态由初始合同变为已了结合同。

若正回购方拒绝，委托由已报变为废单，废单原因为对手方拒绝，账号资金、持仓不变。

正回购方：

在待确认申报面板，可对放给本方确认的申报信息，在操作栏进行确认或拒绝。

待确认申报确认，解除质押委托由已报变为已确认，账号资金面板可用金额减少，冻结金额增加，当日持仓可用数量增加，冻结数量不变，待确认申报中该条行情消失。

待确认申报拒绝，拒绝后委托已成，账号资金、持仓不变，待确认申报中该条行情消失。

3.3.2.8.2. 现券交易

现券买卖交易功能支持对国债、公司债、企业债等债券进行协议交易。

系统目前仅支持对于上交所债券的现券买卖功能。由投资者自行商议好买卖数量和价格后，在系统中录入对手方交易员信息和约定号数据，进行约定买入和卖出。

3.3.2.8.3. 上海/深圳四种债券交易方式

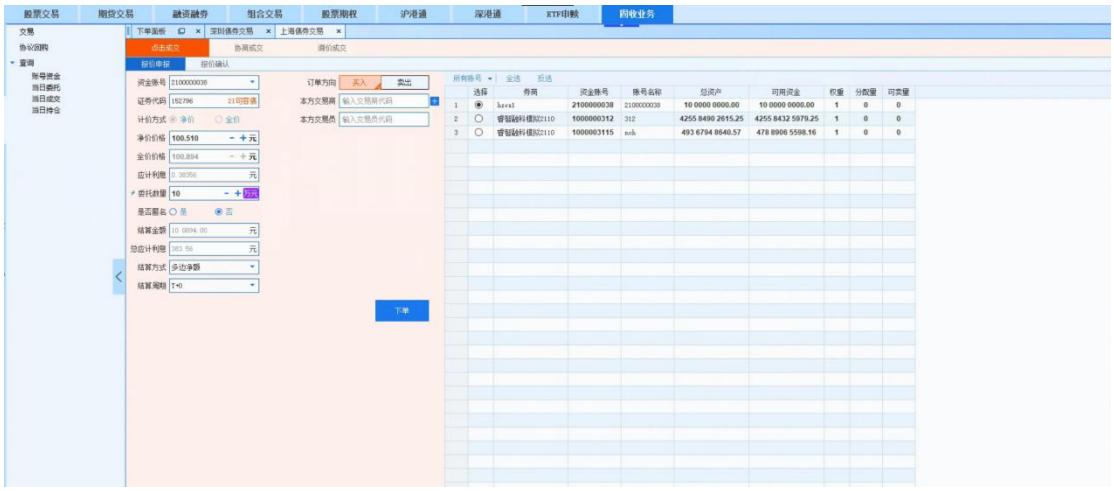
固收业务模块支持上海/深圳债券交易，包括点击成交、协商成交、询价成交和竞买成交每种交易方式。

3.3.2.8.3.1. 点击成交

点击成交是指报价方发出报价，相关报价经其他债券交易者点击后由交易系统确认成交，或者依据交易所规则及相关规定通过交易系统自动匹配成交的交易方式。点击成交对应境外的做市交易、银行间债券市场点击成交和上交所现有的报价交易方式。

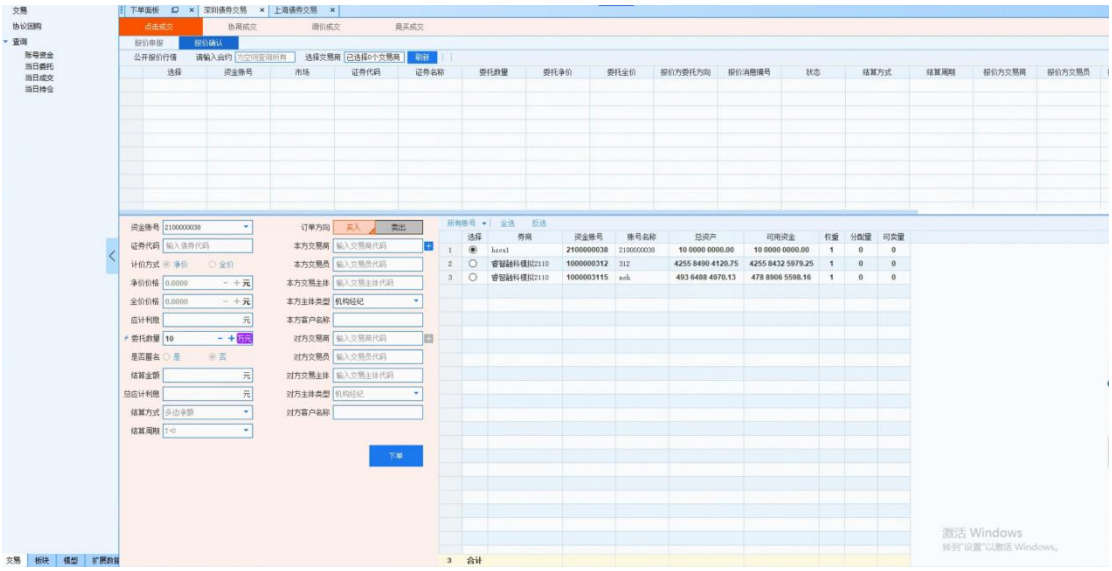
（1）报价申报

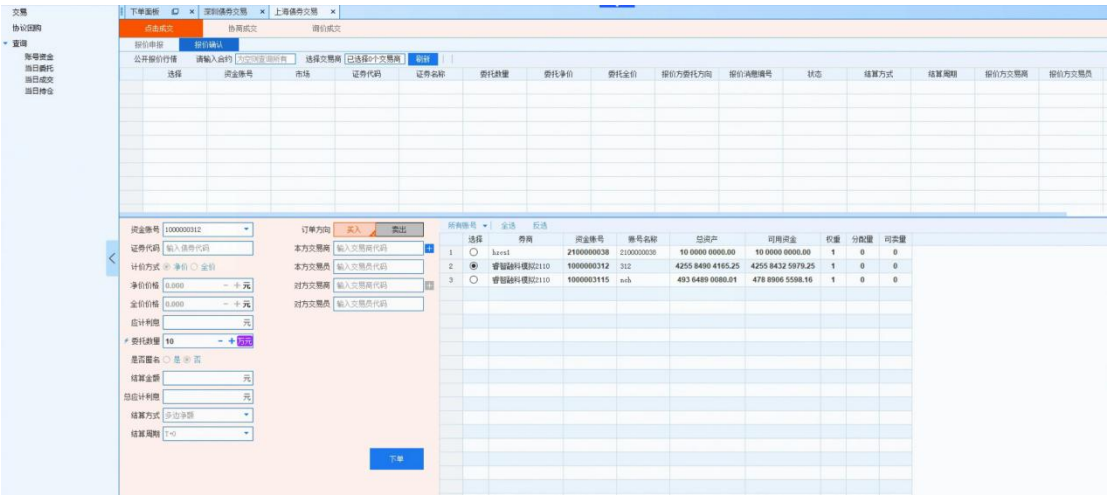
点击成交分为报价申报和报价确认两个面板。报价申报为报价方向全市场或指定参与投资者发起报价，报价确认为接收方看到市场申报后进行点击成交申报或拒绝申报。



（2）报价确认

报价确认，为接收方对报价进行点击成交或拒绝。公开报价行情面板支持查询全市场的所有确定报价申报（支持选择合约和交易商查询）。公开报价行情选定其中一支报价，下方下单面板填充相关信息。交易方向为本方的委托方向，即与报价行情中报价方委托方向相反，例报价行情中委托方向为卖出，本方委托方向即为买入。





（3）公开报价行情

公开报价行情为发起方发起的报价申报行情，能看到全市场的确定报价申报行情。报价消息编号为公开报价行情唯一编号。

上海公开报价行情：

深圳公开报价行情：

3.3.2.8.3.2. 协商成交

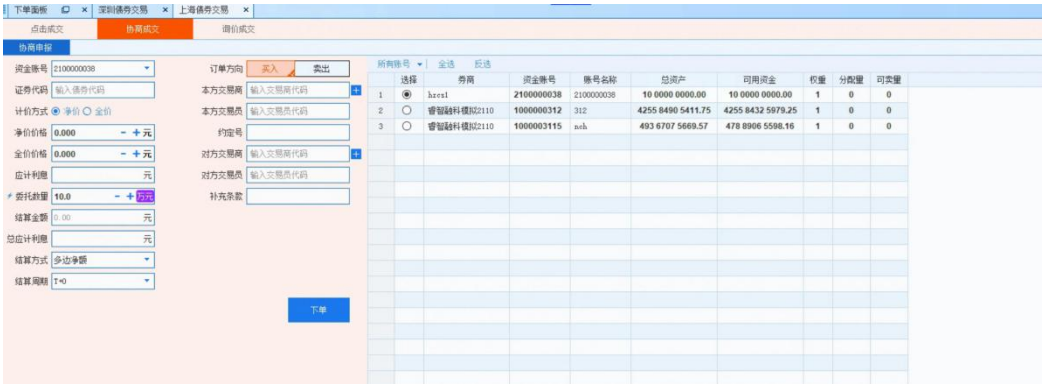
协商成交是指债券交易者之间通过协商等方式达成债券交易意向，并向交易系统申报，经交易系统确认成交的交易方式。协商成交对应境内外询价交易中的自行达成或通过居间服务机构达成交易和上交所现有的指定对手方交易。

（1）协商申报

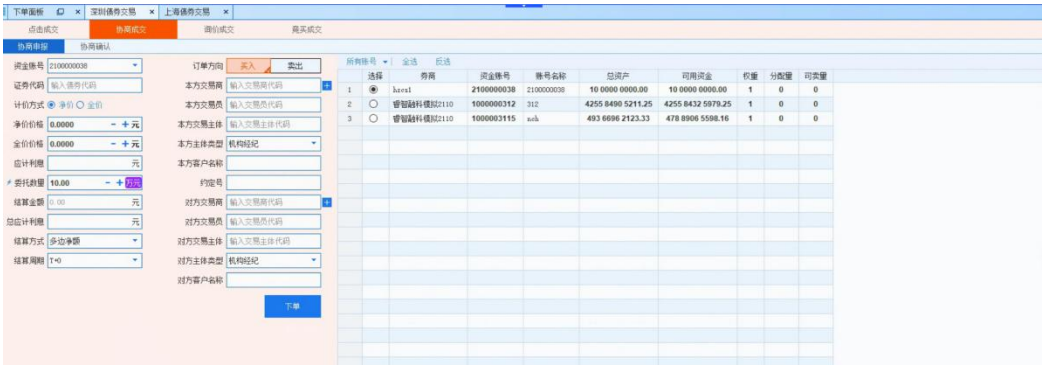
上海：双方均需发起申报，交易所确认成交；

深圳：报价方发起申报，发给确认方，确认方确认或拒绝成交。

上海债券在协商申报中交易，无协商确认。



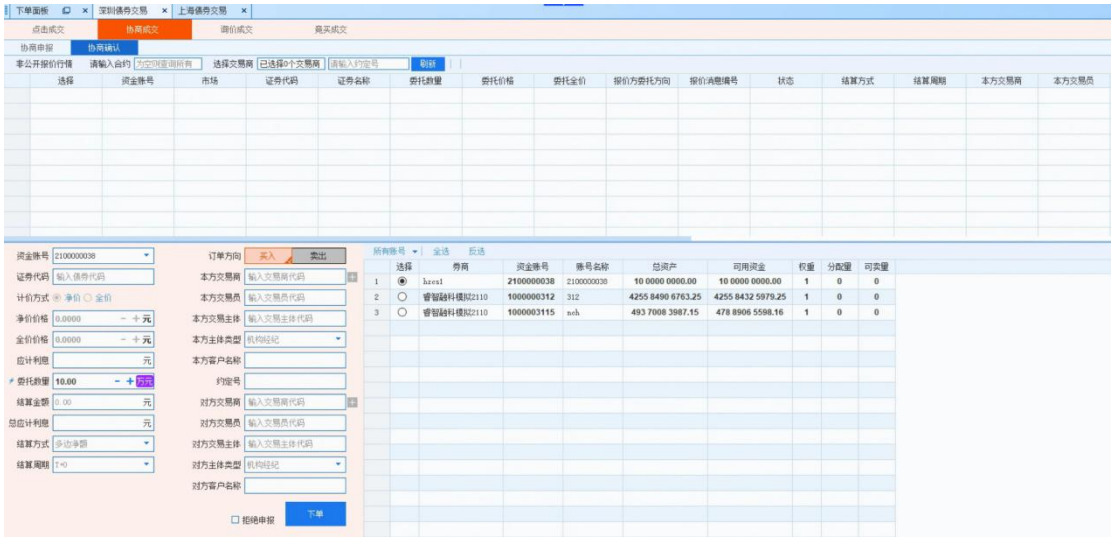
深圳协商成交分为协商申报和协商确认两个面板。



（2）协商确认

协商确认用于深圳市场接收方收到发起方的申报后进行确认。非公开报价行情支持查询发起方发给确认方的所有申报。选中一只报价后，下方下单面板填充相关信息。交易方向为本方的委托方向，即与报价行情中报价方委托方向相反。

勾选“拒绝申报”点击下单，则为申报拒绝，不勾选下单则为申报确认。默认不勾选。



（3）非公开报价行情

非公开报价行情面板仅支持查询深圳市场非公开报价行情。报价消息编号为非公开报价行情唯一编号。

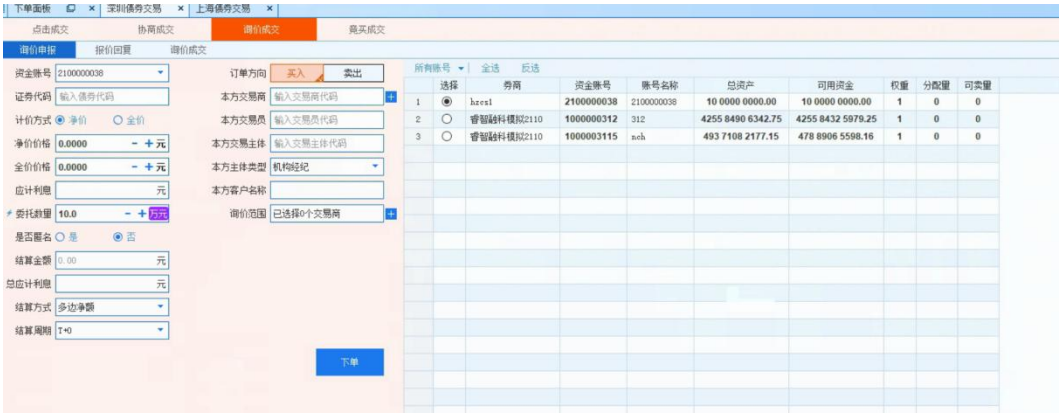
3.3.2.8.3.3. 询价成交

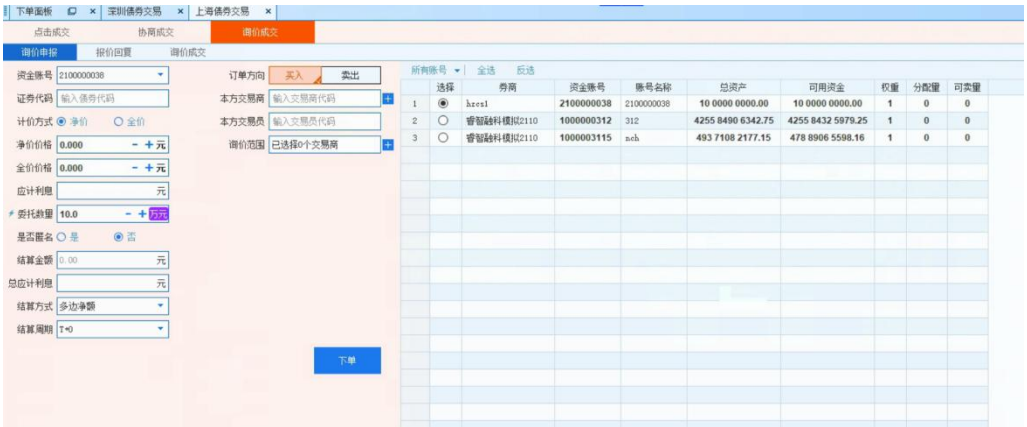
询价成交是指询价方向做市商或者其他债券交易参与人发送询价请求，并选择一个或者多个询价回复确认成交的交易方式。询价成交对应境外、银行间债券市场和上交所现有的询价交易方式。

询价成交分为询价申报、报价回复和询价成交三个面板。

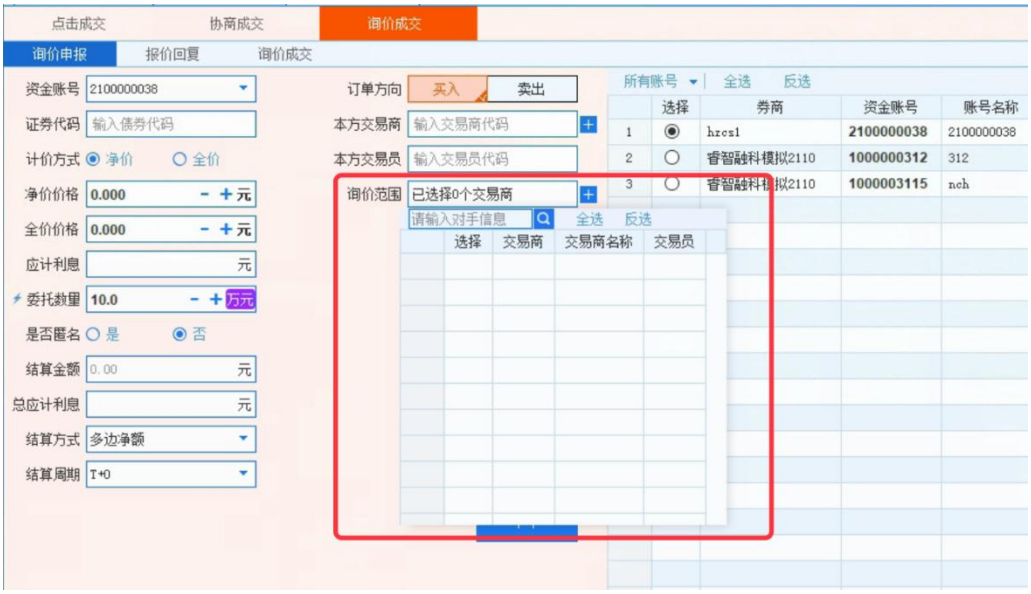
（1）询价申报

询价申报，即询价方发起询价请求，可以指定多个对手方发送询价请求。

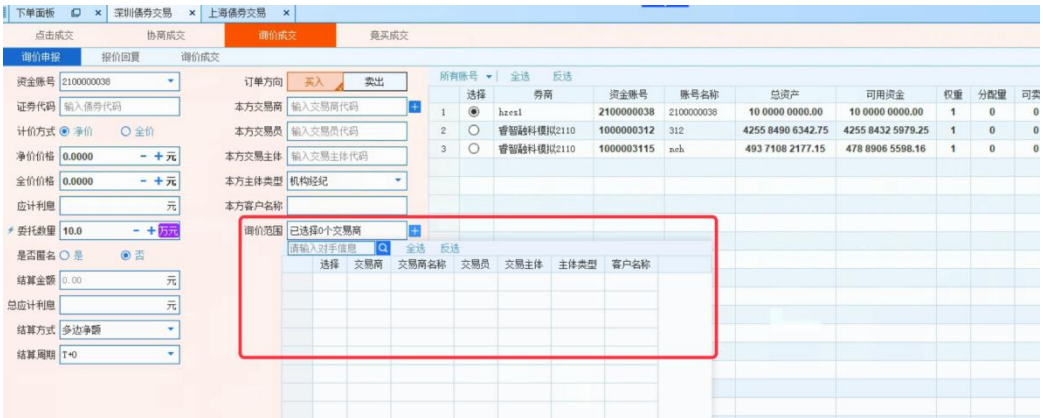




上海市场：

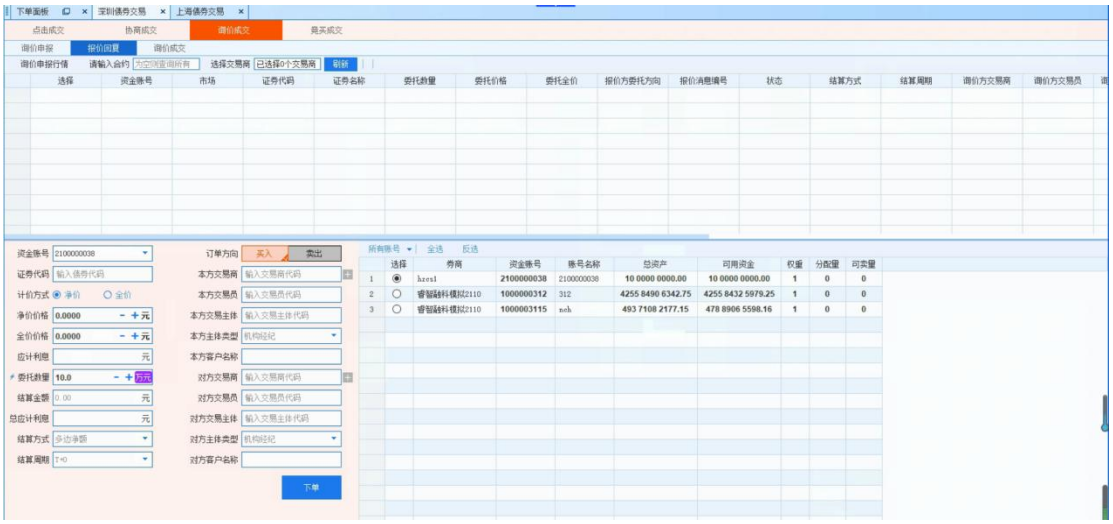


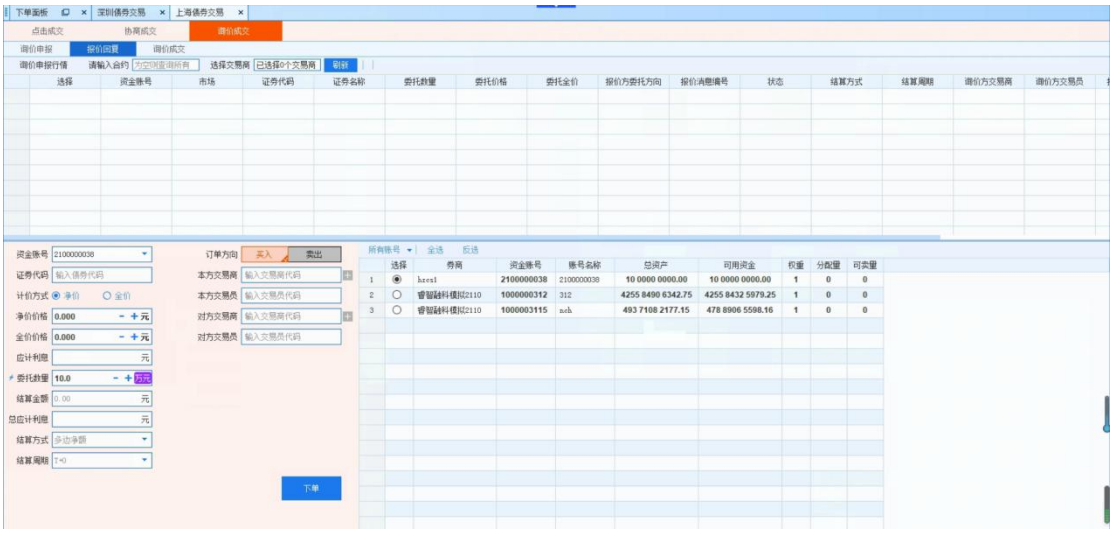
深圳市场：



（2）报价回复

报价回复，即报价方接收到询价请求后进行报价回复。





支持查看本方收到的询价方发来的申报。选定其中一支申报请求，下方下单面板填充相关信息。委托方向与请求行情中相反。

（3）询价申报行情

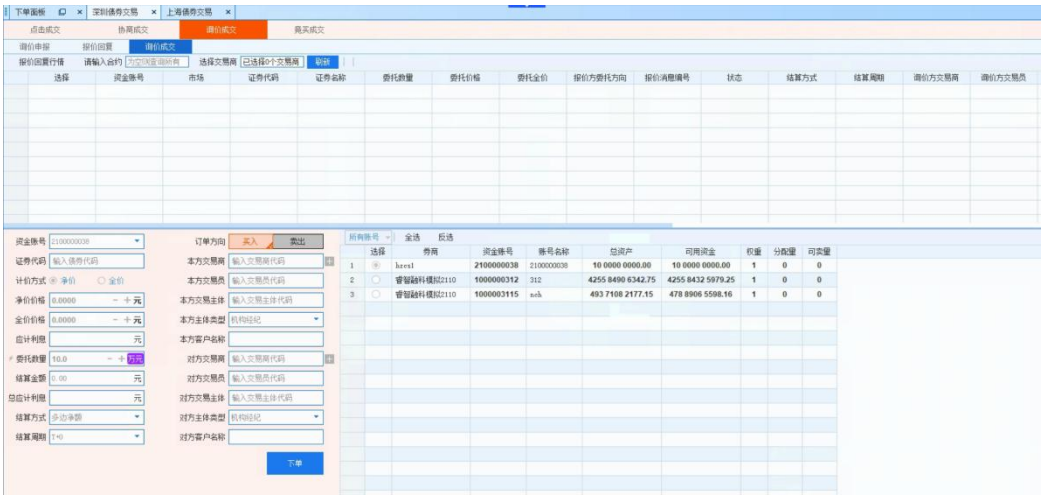
询价申报行情，即询价方发给报价方的询价请求，为非公开行情，本方只能看到由本方接收的询价请求信息。

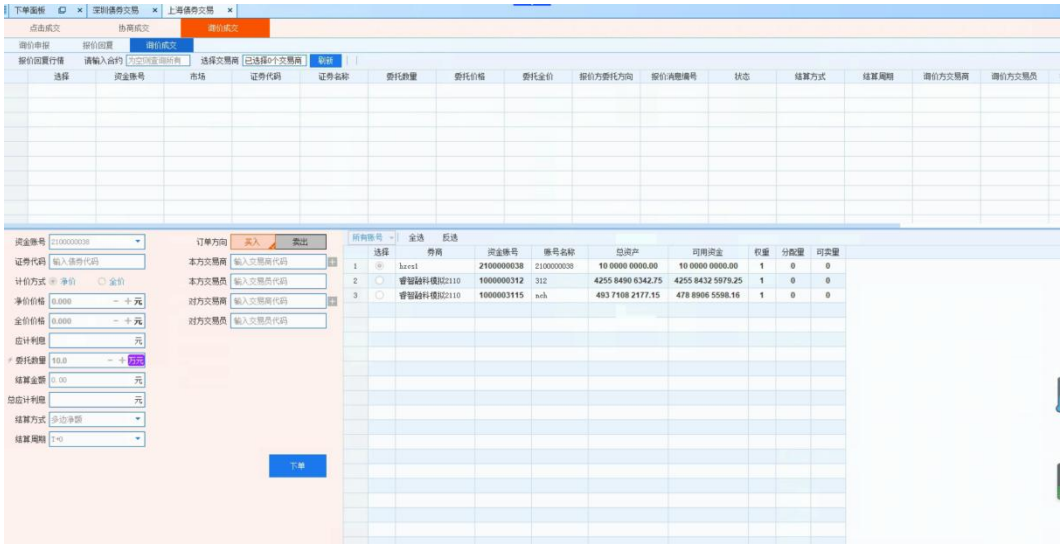
深圳市场：

上海市场：

（4）询价成交

询价成交，即询价方接收到报价方的回复后，对报价方的回复进行确认成交或拒绝成交。





报价回复行情中选定其中一支回复详情，下方下单面板填充相关信息。委托方向与报价回复行情中相反。

（5）报价回复行情

报价回复行情，即报价方回复后发给询价方的回复详情。只有询价方能看到报价方回复的报价回复行情。

上海市场：

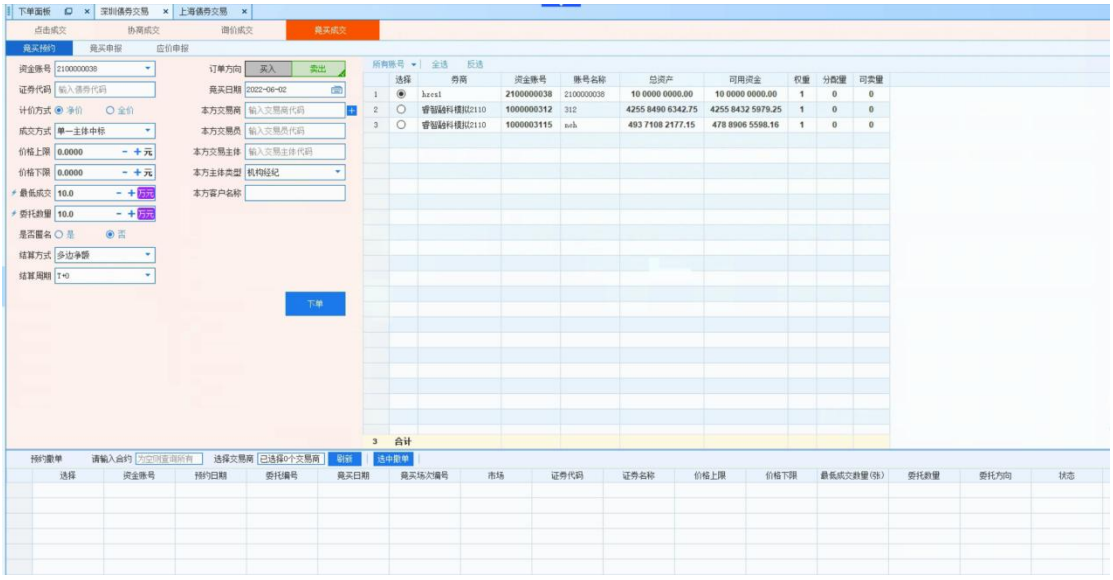
深圳市场：

3.3.2.8.3.4. 竞买成交

竞买成交包含竞买预约、竞买申报、应价申报三个面板。

（1）竞买预约

竞买预约由竞买方发起预约申报，支持当日预约撤单和隔日撤单。

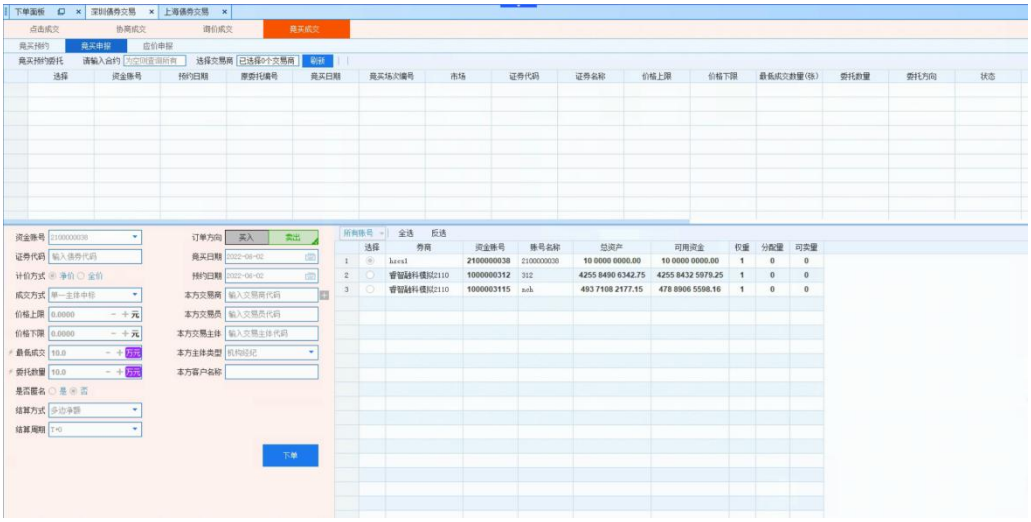


（2）预约撤单

竞买预约支持在竞买日之前进行撤单，含当日撤单和隔日撤单。预约撤单面板支持查询当前在途预约委托信息，包含当日预约委托信息和历史预约委托信息。允许选中未撤的预约委托进行撤销。

（3）竞买申报

竞买申报时，需选择一条在途的竞买预约委托，进行申报。竞买申报下单面板要素与竞买预约要素相同，选择一条预约信息后，下方下单面板要素不可修改。交易方向固定为卖出不可更改。

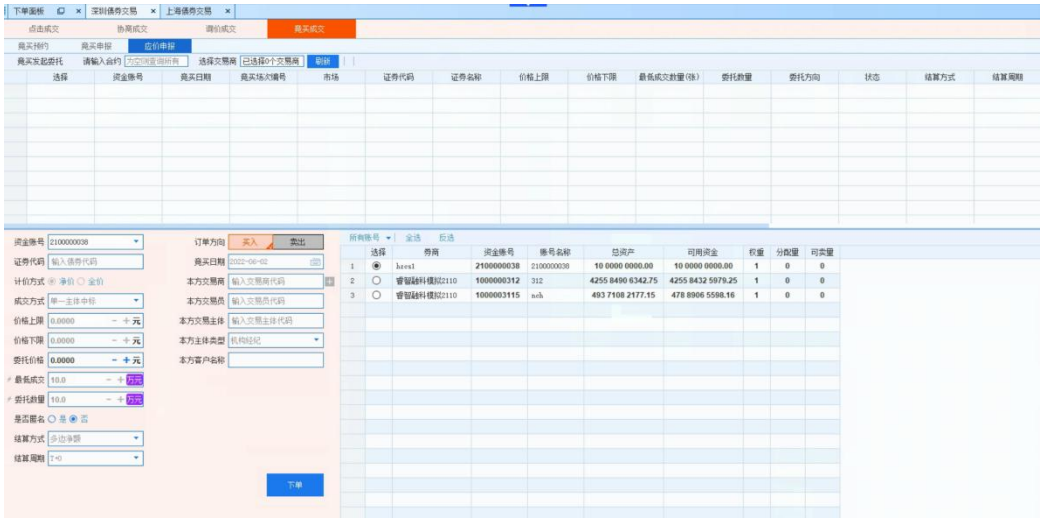


（4）竞买预约行情

竞买预约委托支持查询已经发起的在途预约委托信息。支持查询所有本方发起的竞买预约委托。

（5）应价申报

应价方选择一条竞买申报进行应价，支持输入委托价格，委托价格不可超过价格上下限。委托数量默认竞买申报全额。支持选择是否匿名。交易方向固定为买入不可更改。



（6）竞买发起委托

支持查询竞买方发起的委托。

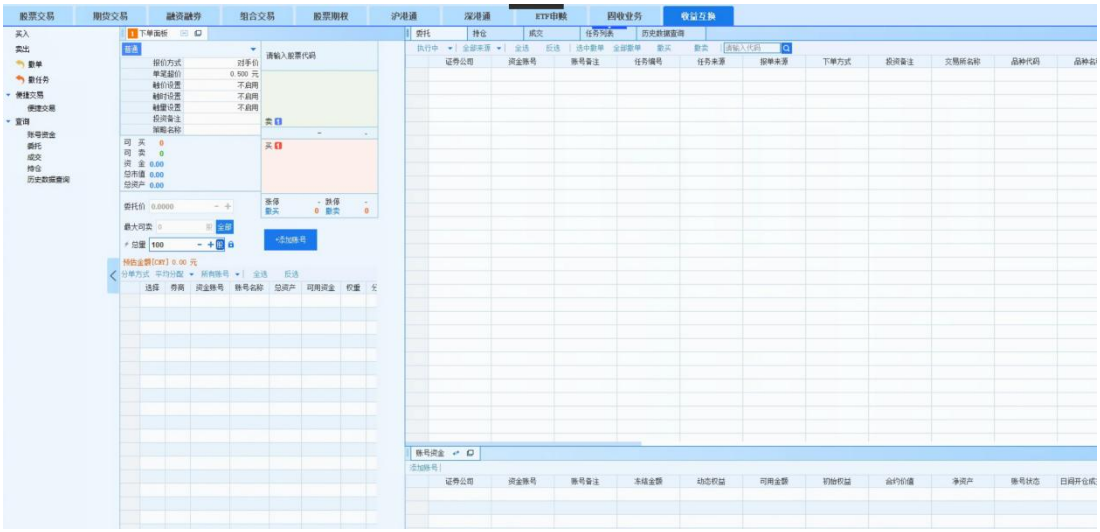
3.3.2.9. 收益互换

本系统支持收益互换业务模块，收益互换业务模块支持股票以及股指期货业务品种下单。

目前支持的业务包括股票、债券、基金和股指期货。支持股票、债券和基金的买入、卖出，支持股指期货买入开仓、卖出开仓和优先平仓设置。

支持限价报单。

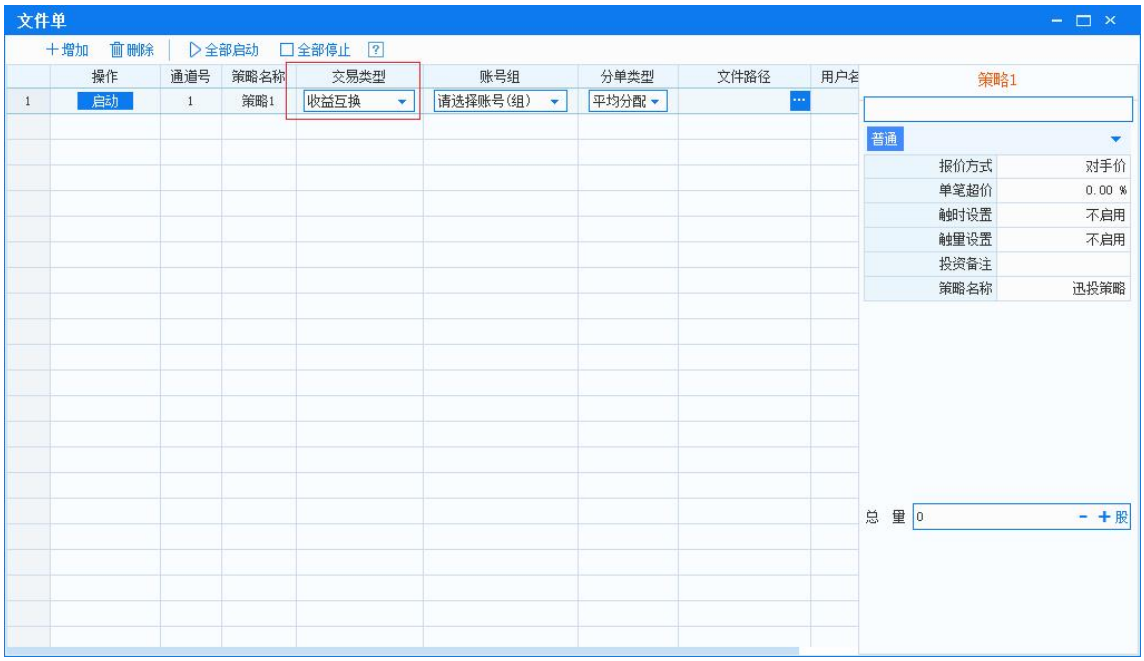
支持查看委托、成交、持仓和资金数据。



支持便捷交易（文件单）下单。文件单下单时，交易类型选择收益互换，下单文件中的下单参数与股票、期货一致。

中间文件格式：下单类型，通道号[，模型价，代码，下单量，股东号]

文件单下单时，需要设置策略名称。有两种设置途径，一是在文件单设置界面的右侧参数设置面板中，在下拉框内选择策略名称，策略名称根据柜台设置显示。二是在文件中使用股东号这个字段，填充策略 ID。



支持批量埋单。设置好监控路径，点击开始监控后，监控路径下产生如下文件夹。

名称	修改日期	类型	大小
XT_CCTJ_IncomeSwap_20220919.dbf	2022/9/19 17:43	Database File	18 KB
XT_CJCX_IncomeSwap_20220919.dbf	2022/9/19 17:43	Database File	177 KB
XT_CLMC_IncomeSwap_20220919.dbf	2022/9/19 17:43	Database File	2 KB
XT_DBF_ORDER.dbf	2022/9/19 17:43	Database File	1 KB
XT_DBF_ORDER_result.dbf	2022/9/19 17:43	Database File	1 KB
XT_WTCX_IncomeSwap_20220919.dbf	2022/9/19 17:43	Database File	302 KB
XT_ZJCX_IncomeSwap_20220919.dbf	2022/9/19 17:43	Database File	2 KB

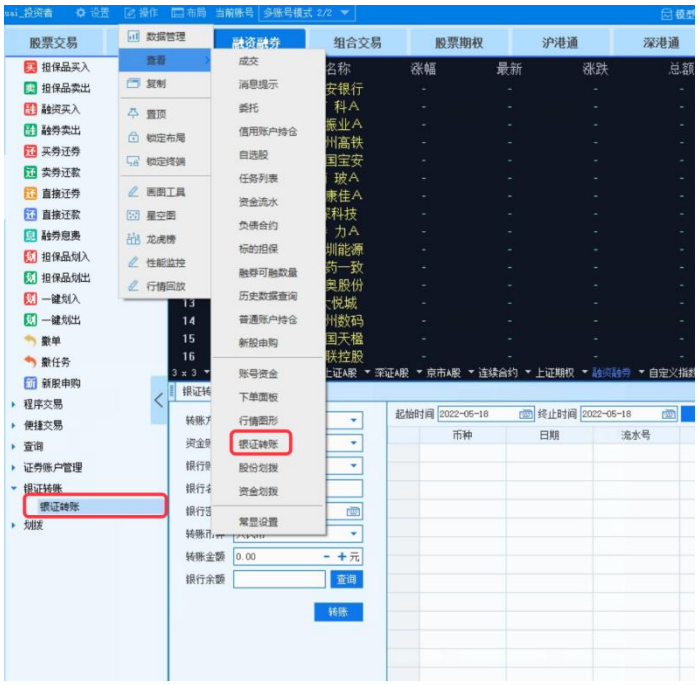
其中 CLMC 文件用来查看账号对应的策略名称和策略 ID。

AccountId	StategyId	StategyNam	账号key	数据key
thinktrader_test	2022081200001	thinktrader-strategy	8____80002____802000____49____thinktrader_test____	2022081200001
thinktrader_test	2022090200001	迅投策略	8____80002____802000____49____thinktrader_test____	2022090200001

使用批量埋单下单时，act_type 参数为必填字段，该字段填充上述文件中的 StategyId 字段；brokertype 字段值为 8，即收益互换账号；其他参数与股票或期货下单参数相同。

3.3.2.10. 银证转账

在导航栏“银证转账”功能入口和工具栏“查看”点击“银证转账”弹出“银证转账”功能界面。



3.3.2.10.1. 银行转证券

【操作步骤】

1. 选择转账方向为“银行转证券”；

2. 选择要转出资金的“银行账号”；

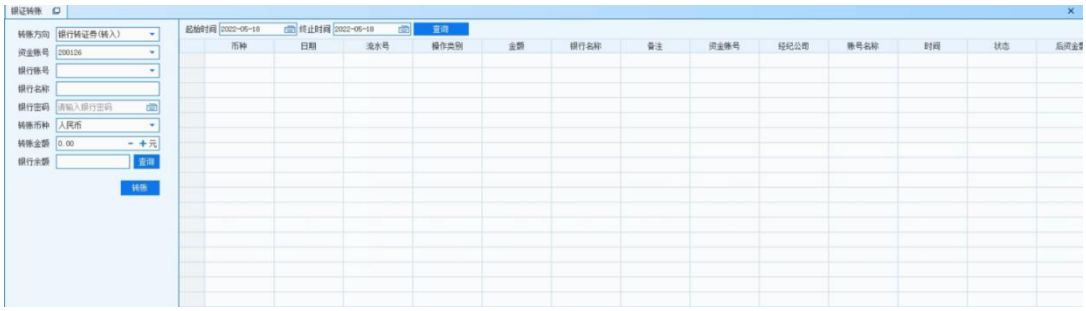
3. 输入银行密码；

4. 选择要转入资金的“资金账号”；

5. 选择币种，默认“人民币”；

6. 设置转账金额；

7. 点击【转账】按钮。



3.3.2.10.2. 证券转银行

【操作步骤】

1. 选择转账方向为“证券转银行”；

2. 选择要转入资金的“银行账号”；

3. 选择要转出资金的“资金账号”；

4. 输入资金密码；

5. 选择币种，默认“人民币”；

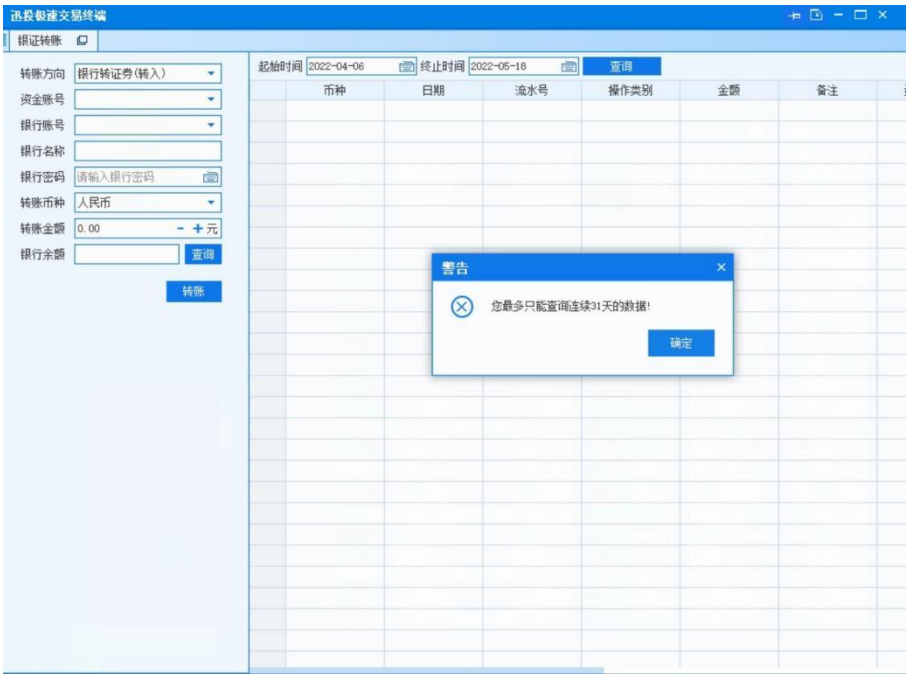
6. 设置转账金额；

7. 点击查询可取资金，可以查看当前最大可取资金的额度；

8. 点击【转账】按钮。

3.3.2.10.3. 数据查询

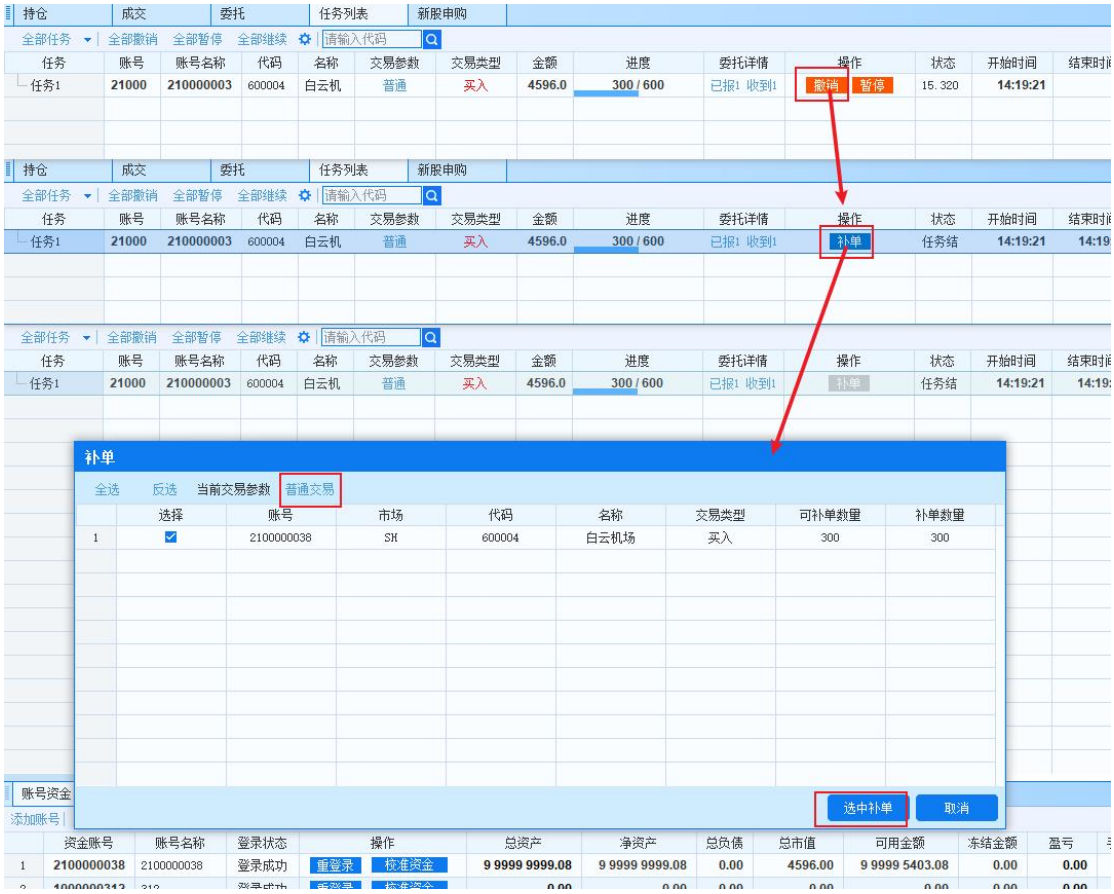
可以根据起始时间和终止时间来筛选某时间段内的转账情况，最多只能查询连续 31 天的数据。如图：

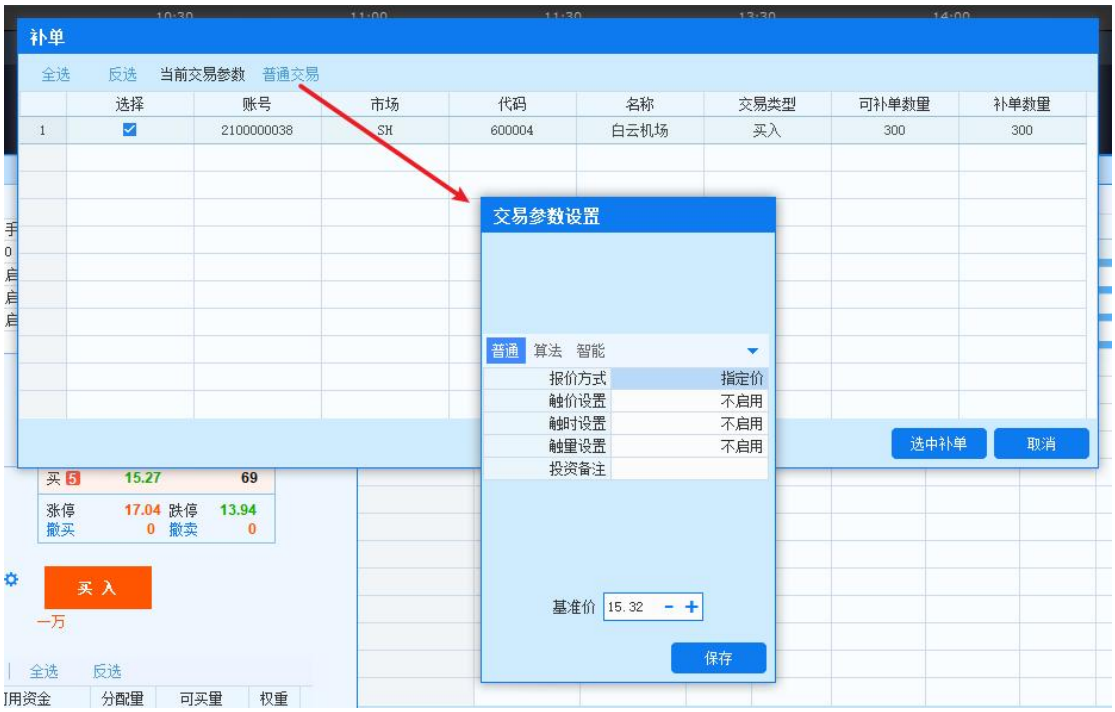


3.3.2.11. 补单

补单即委托状态为“未成交”或“部成”的任务撤单后，未完成量能够再次下单的功能。在任务撤销之后，可以修改交易参数重新下单。股票、两融和组合交易支持补单操作。

当任务状态为未成交或部分成交的时候，任务操作列显示撤销按钮，点击撤销按钮，待委托状态为“已撤”后，操作栏显示“补单”按钮。





点击补单，弹出补单弹框，如下图所示。设置新的委托价和下单量后， 点击“买入/卖出”，弹出下达任务面板，点击确定后，将以修改后的价格及未成交的数量下达一个新任务。

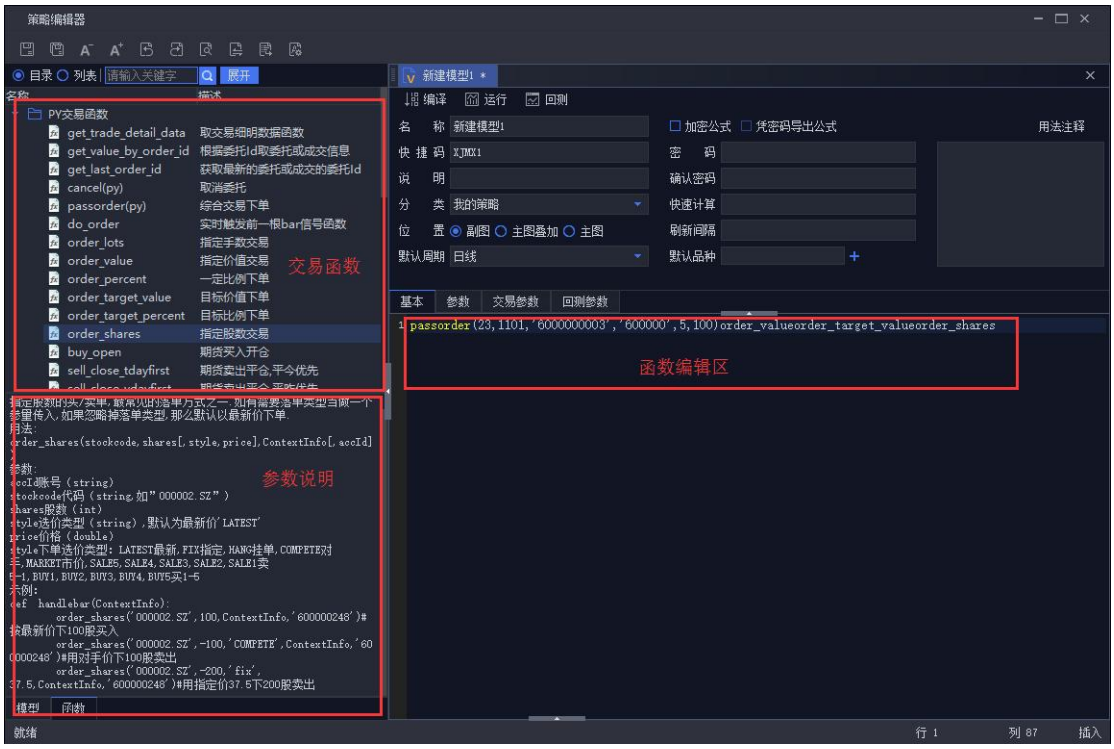
备注

账号为自动填充（不可修改），下单量默认显示为未成交的数量（可在补单面板-补单数量一栏修改）。

在原任务数量没有被补完前，可多次补单，直至原任务完全成交。

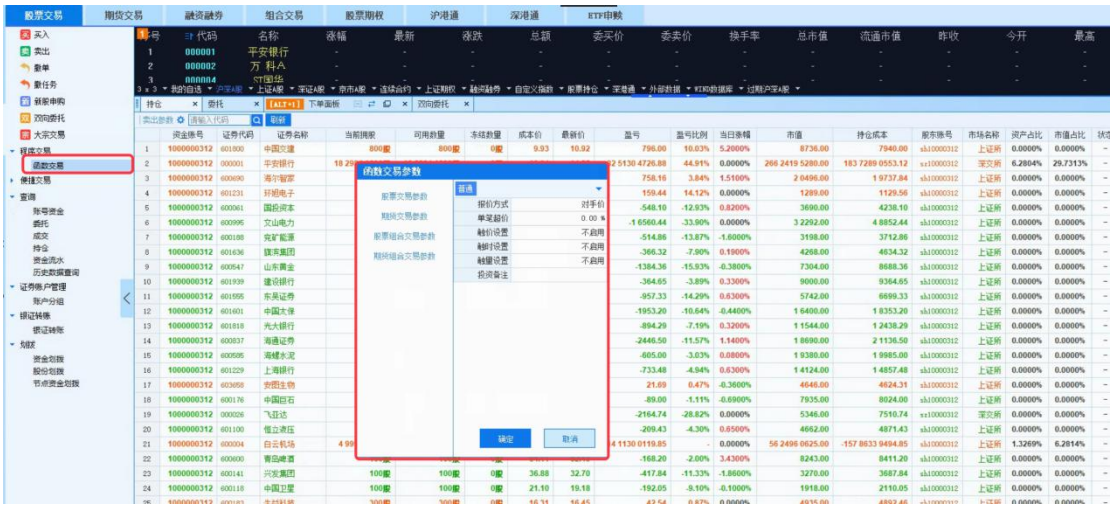
3.3.2.12. 函数交易

本系统支持多种函数交易下单，支持设置函数交易参数。



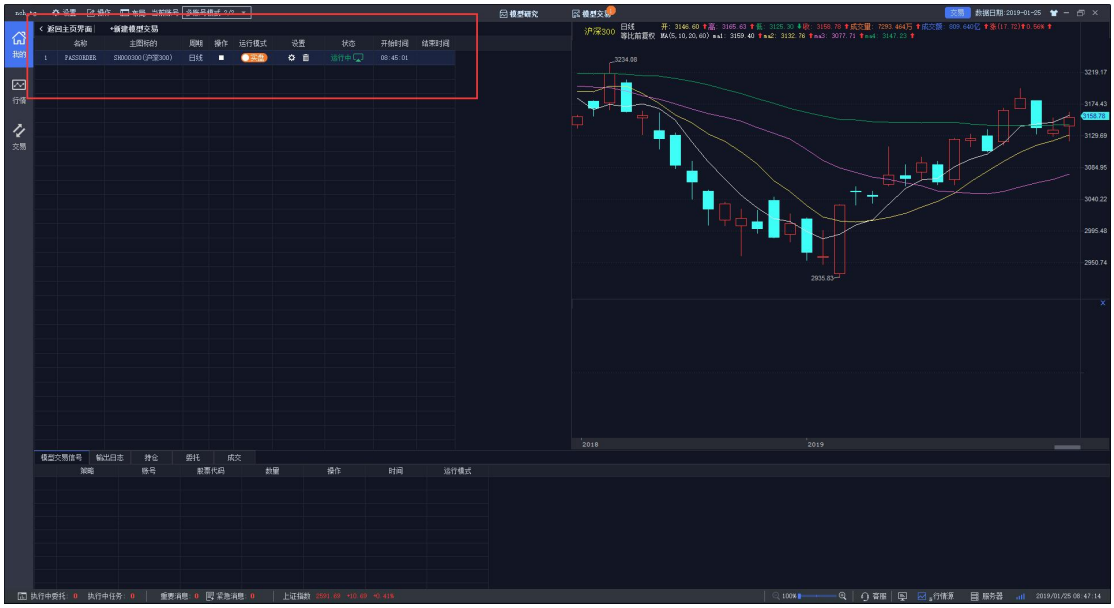
迅投交易函数

函数编辑时，若 passorder 函数的 prType 参数为-1，则按照参数设置中的价格参数下单。



设置函数交易参数

例：passorder 综合交易下单函数。编辑好函数及参数后，编译保存，在模型交易中新建一条，点击启动并切换到实盘运行模式后，即可等待触发下单。

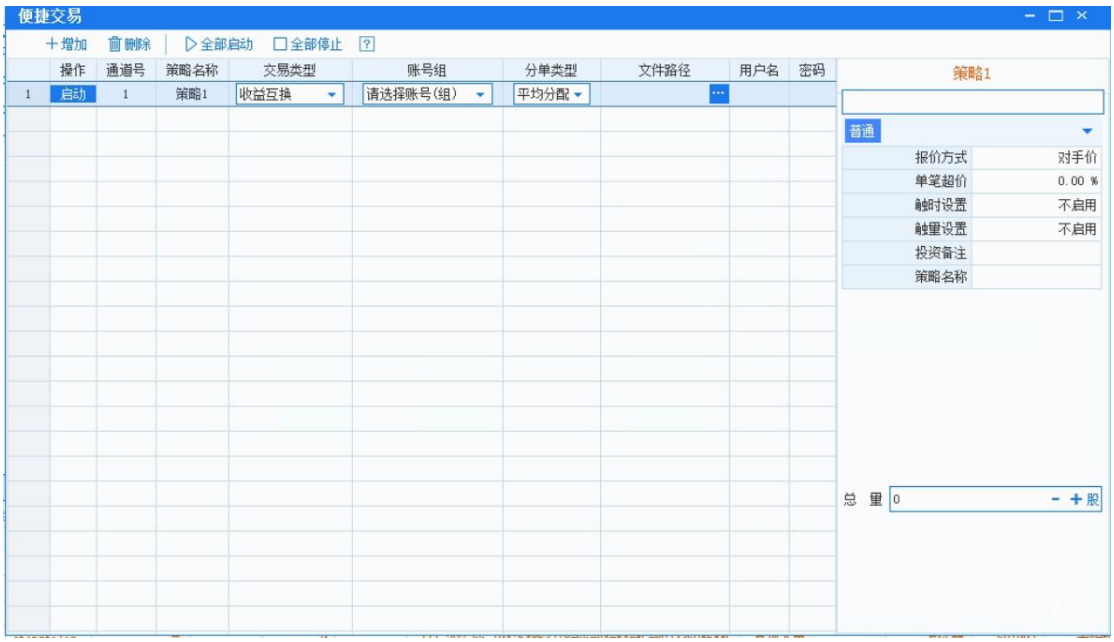


passorder 综合交易下单函数

3.3.2.13. 便捷交易

便捷交易是 QMT 极速策略交易系统端对外提供的下单服务功能。

当 QMT 极速策略交易系统端启动下单服务时，需要导入一个协议文件（.txt 格式），外部程序和下单服务通过该协议文件进行通讯。



便捷交易界面

在启动便捷交易文件单之前先在文件路径中选中创建的中间文件：

文件单创建：

格式：记事本格式（.txt）；

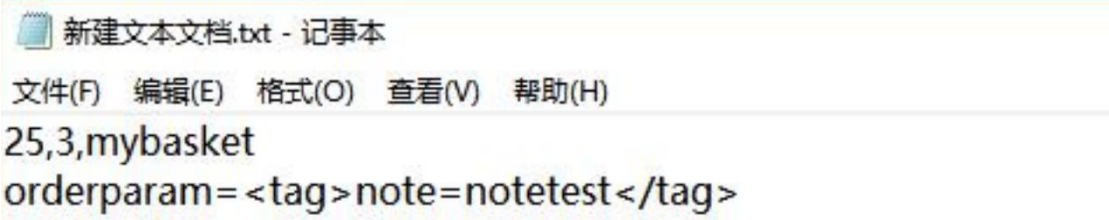
内容：下单类型，通道号，报价方式，下单代码，下单总量；

注意：中间文件的内容之间用英文半角“,”隔开；

中间文件导入后启动便捷交易策略，文件路径下的中间文件被删除，并弹出下达任务面板产生任务。如果需要取消以上下达任务面板的二次确认操作，可在系统设置-下单前提 示设置中取消勾选“便捷交易下单”选项。

便捷交易下单

在便捷交易中支持投资备注，投资备注书写格式如图所示：



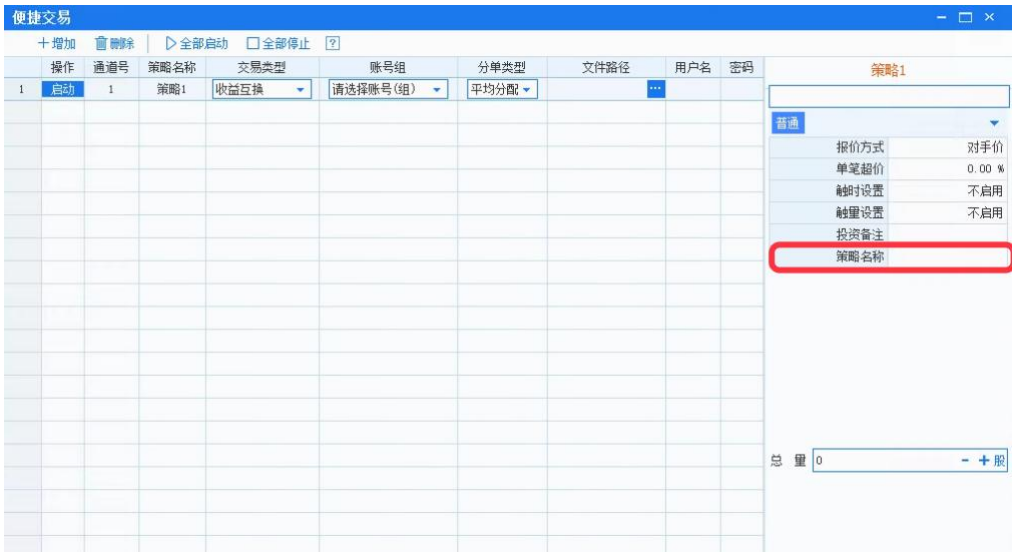
投资备注格式

启动策略后，便捷交易中的投资备注会在下单弹框中显示，如图所示：

投资备注显示

投资备注会显示在任务列表、委托、成交面板中。

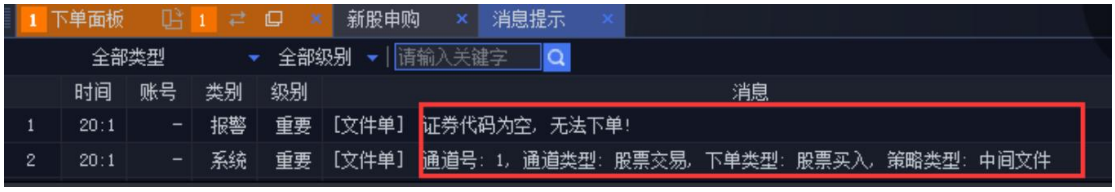
针对文件单面板中的策略，点击投资备注输入框可以输入相应策略的投资备注信息，如下图在文件单面板设置投注备注。



备注：对于文件单指令使用备注的顺序：若文件单中间文件中有备注时，使

用中间文件中的备注；当中间文件中没有备注时，若文件单面板中有备注，则使用文件单面板中设置的备注；当中间文件和文件单面板中都没有备注时，则备注为空。

当便捷交易策略选择的中间文件中有交易代码时，面板右侧股票代码为非必填项。当便捷交易策略选择的中间文件中没有交易代码时，面板右侧股票代码为必填项，否则，启动便捷交易策略报错。



报错消息

3.3.2.14. 批量埋单

批量埋单功能，支持以 DBF 文件形式将委托、撤单指令传至本系统，在本系统内部经过完整的事前、事中、事后风控后本系统将委托报送至柜台。柜台返回的委托、成交数据迅投系统实时以 DBF 文件形式返回，满足用户交易策略执行、风险控制管理等需求。

文件交互流程如下：

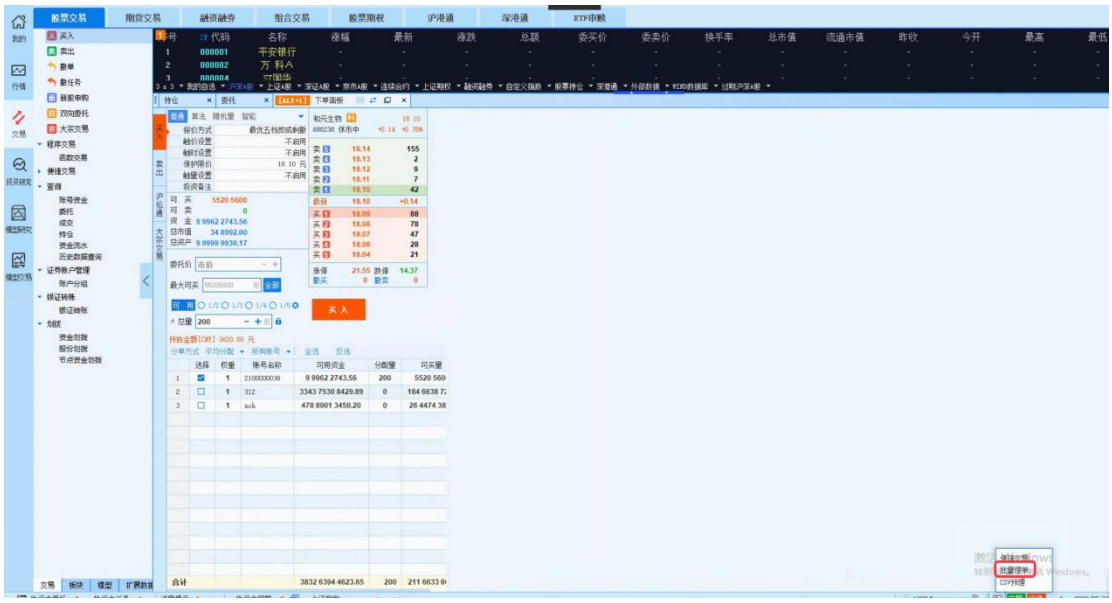
①外部系统在交易端监控路径文件中写入委托参数；

②终端实时扫描监控目录，读取委托参数自动进行委托下单；

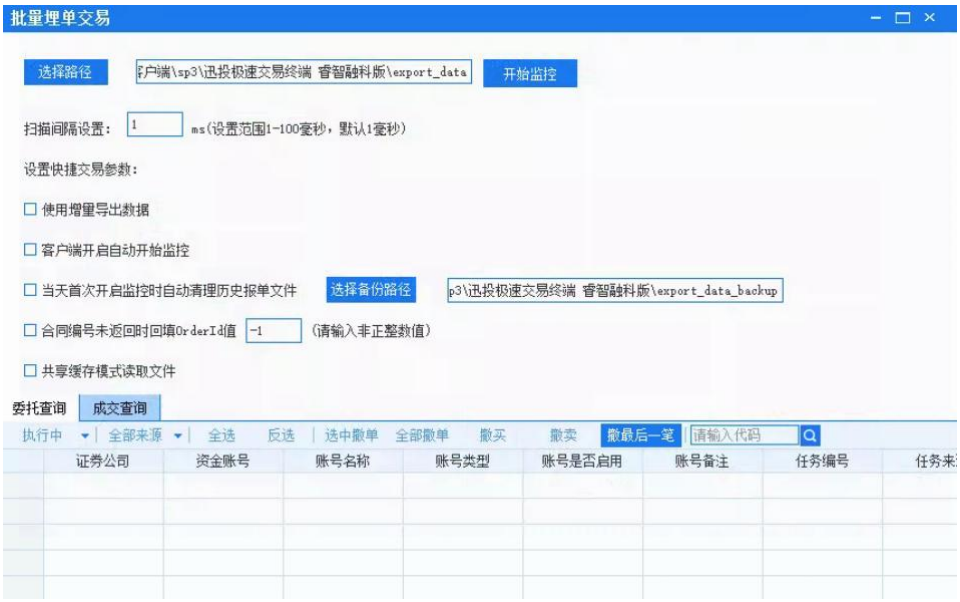
③通过主推的方式将委托、成交回报等订单执行情况更新到共享文件中；

④外部系统实时读取共享文件，根据委托、成交回报进行后续委托、撤单任务的下发。

批量埋单交易功能当前支持股票买卖、交易所债券买卖、债券逆回购、交易所基金买卖、港股通买卖、新股申购、新债申购、融资融券、股票期权、期货交易业务。



功能入口



功能界面

设置路径：选择文件共享路径，系统监控该文件夹下除导出文件外的所有dbf类型文件，符合委托、撤单格式即可成功读入委托；委托、成交回报会同步导出至该路径下。

若文件夹下无可读取dbf文件，系统将自动生成XT_DBF_ORDER.dbf文件。

客户端开启自动开始监控：支持选择是否在客户端开始后自动开启埋单监控。

设置完成后点击开始监控，批量埋单即开始运行。

路径设置

XXX.dbf：委托、撤单文件，支持同时监控多个dbf文件。

XXX_result.dbf：XXX.dbf的反馈文件，对XXX.dbf中委托、撤单数据**按行**进行反馈,以行号对应。如上图XT_DBF_ORDER_result.dbf为XT_DBF_ORDER.dbf的对应反馈文件，**若需更换委托文件，请将对应result文件一并删除**。

XT_ZJCX_业务类型_#YYYYMMDD#.DBF：记录资金查询信息。

XT_CCMX_业务类型_#YYYYMMDD#.dbf：记录持仓明细信息。

XT_CCTJ_业务类型_#YYYYMMDD#.dbf：记录持仓统计信息。

XT_CJCX_业务类型_#YYYYMMDD#.dbf：记录成交查询信息。

XT_WTCX_业务类型_#YYYYMMDD#.dbf：记录委托查询信息。

业务类型：（1）Stock（2）StockOption（3）Credit（4）Future（5）HGT（6）SGT

扫单间隔：可调整扫单间隔，设置范围为1-100毫秒。

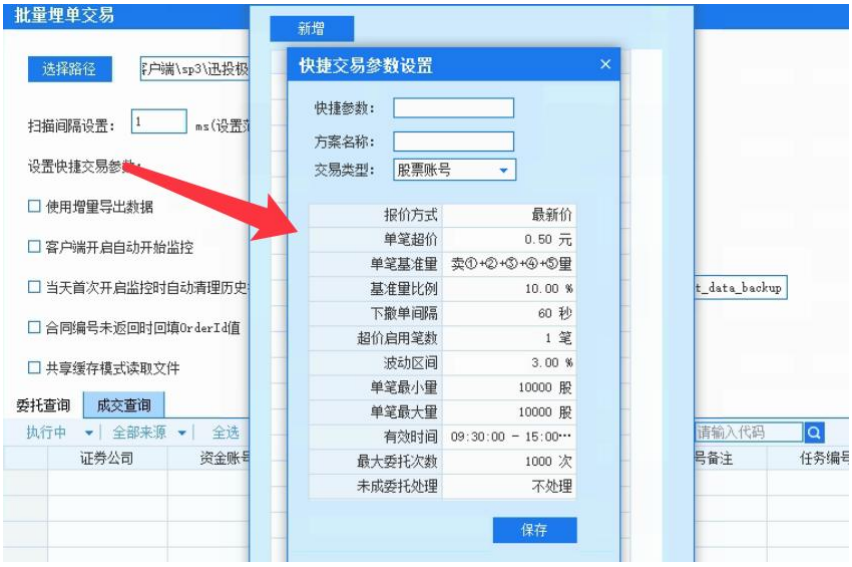
当天首次开启监控时自动清理历史报单文件：每天第一次开启监控时，会清空历史报单文件。并且历史报单文件会备份到设置的路径里。如勾选了自动清理历史报单文件功能，备份路径地址不可修改。

合同编号未返回时回填 OrderId 值：需输入非正整数值。合同编号未返回时，下单反馈文件合同编号列显示填入的值。

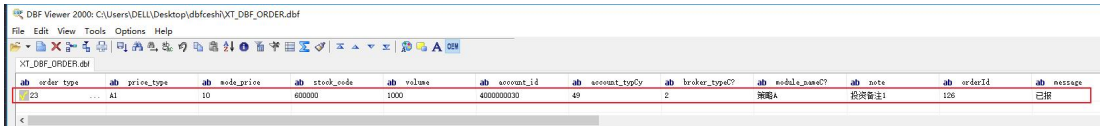
共享缓存模式读取文件：可支持是否选择共享缓存模式读取文件。

使用增量导出数据：勾选后使用增量导出数据。

设置快捷交易参数：支持在交易端设置参数方案，于委托文件 price_type 中输入快捷算法参数调用对应参数方案下单。



参数设置



下单

消息提示：消息面板会有相应的消息提示，记录‘批量埋单’交易详情。

消息提示

在系统设置中，可调整需要导出的内容。点击系统左上角的‘设置’按钮，切换到【导出设置】页面，选择业务模块，在‘持仓导出’‘委托导出’‘成交导出’界面可调整导出列，**目前默认所有字段全部导出**。

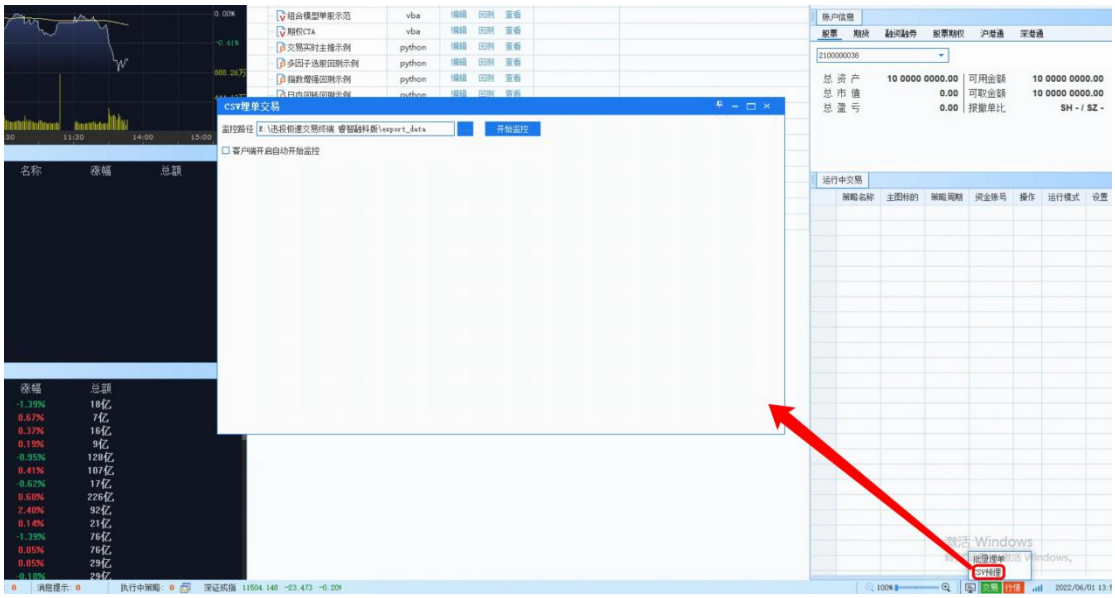
注意事项：单个 DBF 报单文件写入条数不能超过 6W，超过需要用多个文件来支持。

3.3.2.15. CSV 预埋

使用 CSV 预埋单功能，需在管理端全局层及用户层开启批量埋单交易或便捷交易任一功能权限。

设置路径：选择文件共享路径，系统监控该文件夹下除导出文件外的所有 TXT 格式文件，符合委托、撤单格式即可成功读入委托；委托、成交回报会同步导出至该路径下。

客户端开启自动开始监控：支持选择是否在客户端开始后自动开启埋单监控。



设置完成后点击开始监控，预埋单即开始运行。开始监控后，监控路径下针对系统内所有账号自动生成以下文件。

名称	修改日期	类型	大小
signal_backup	2021/3/15 14:45	文件夹	
asset.2100000038_2.20210315.csv	2021/3/15 14:47	XLS 工作表	1 KB
cancel_error.2100000038_2.20210315...	2021/3/15 14:45	XLS 工作表	0 KB
deal.2100000038_2.20210315.csv	2021/3/15 14:45	XLS 工作表	0 KB
order.2100000038_2.20210315.csv	2021/3/15 14:45	XLS 工作表	0 KB
order_error.2100000038_2.20210315....	2021/3/15 14:45	XLS 工作表	0 KB
position.2100000038_2.20210315.csv	2021/3/15 14:45	XLS 工作表	1 KB

文件类型包括：

signal.资金账号_账号类型.下单文件序号.txt：报单/撤单文件

（报/撤单文件支持两种格式，其一为不带日期的格式，即 signal.资金账号_账号类型.下单文件序号.txt；其二为带日期的格式，即 signal.资金账号_账号类型.下单文件序号.YYYYMMDD.txt。使用带日期的格式时，日期为当天的文件才会被执行，否则不执行，不带日期的文件则无此限制。下单序号支持自定义，不可重复，建议使用数字。）

signal.资金账号_账号类型.下单文件序号(年月日_时分_秒).txt：报单/撤单文件备份

order.账号_账号类型.日期.csv：记录委托信息

order_error.账号_账号类型.日期.csv：记录报单失败信息

cancel_error.账号_账号类型.日期.csv：记录撤单失败信息

deal.账号_账号类型.日期.csv：记录成交信息、

position.账号_账号类型.日期.csv：记录持仓信息

asset.账号_账号类型.日期.csv：记录资金账号信息

signal_backup 文件夹：报单文件备份整理，以日期为文件夹

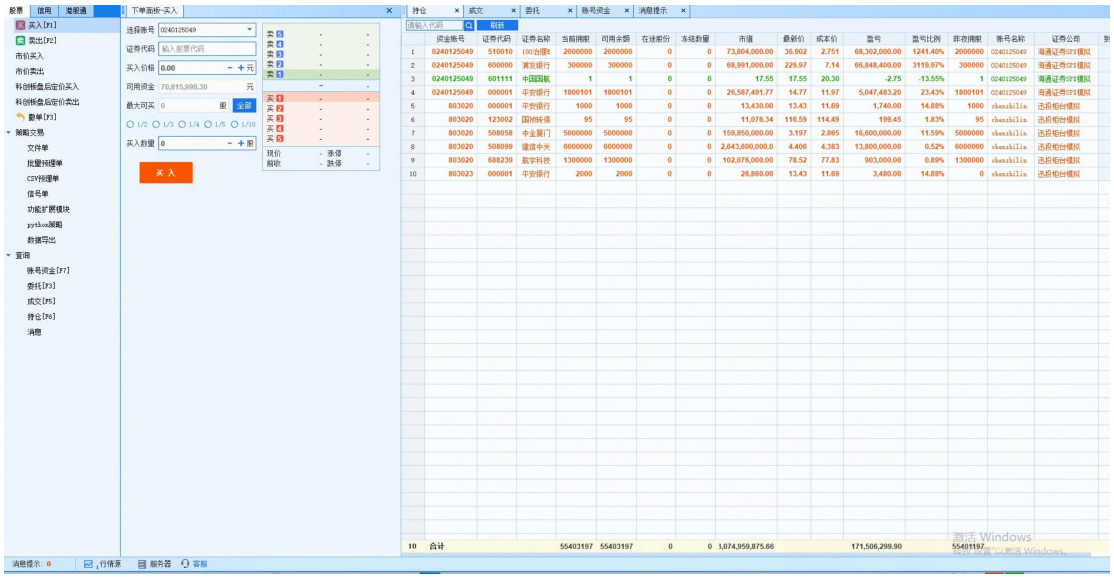
其中，账号类型：2-股票　3-信用　7-沪港通　11-深港通

3.4.极简模式

极简模式是 QMT 极速交易系统的精简版，具有高稳定运行、高频率访问、高性能响应、低延迟报单等特点，同时支持 DBF、TXT、CSV 格式文件交互，支持 Python 和 C++策略。

极简模式支持股票交易、信用交易和港股通交易。

交易业务模块面板分布如下所示。



3.4.1. 股票交易

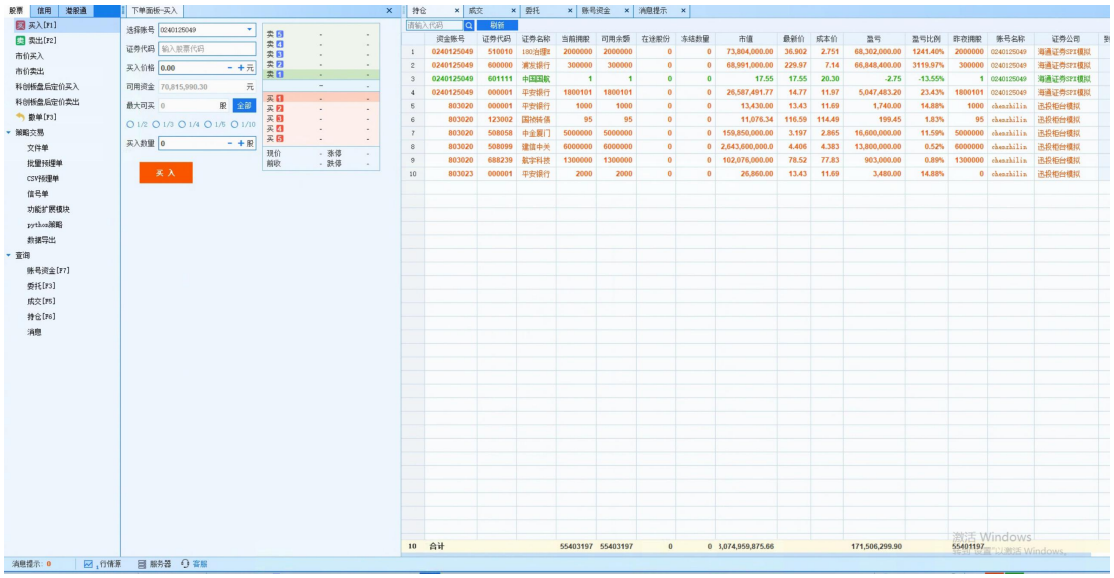
股票交易支持买入、卖出、市价买入、市价卖出、科创板盘后定价买入、科创板盘口定价卖出、撤单、策略交易（包括文件单、批量预埋单、CSV 预埋单、功能扩展模块、python 策略和数据导出，后文有详细介绍）、查询功能（包括账号资金、委托、成交、持仓和消息查询）。

点击功能导航栏对应选项（买入、卖出、市价买入、市价卖出、科创板盘后定价买入、科创板盘口定价卖出），下单板进行相应的跳转。

点击功能导航栏中的撤单，右侧跳转到委托面板，可在委托面板中进行撤单操作。

点击功能导航栏对应选项（账号资金、委托、成交、持仓、消息），右侧显示对应的数据查询面板。

股票交易支持的品种有沪深 A 股，科创板，创业板，债券和基金的普通买卖。



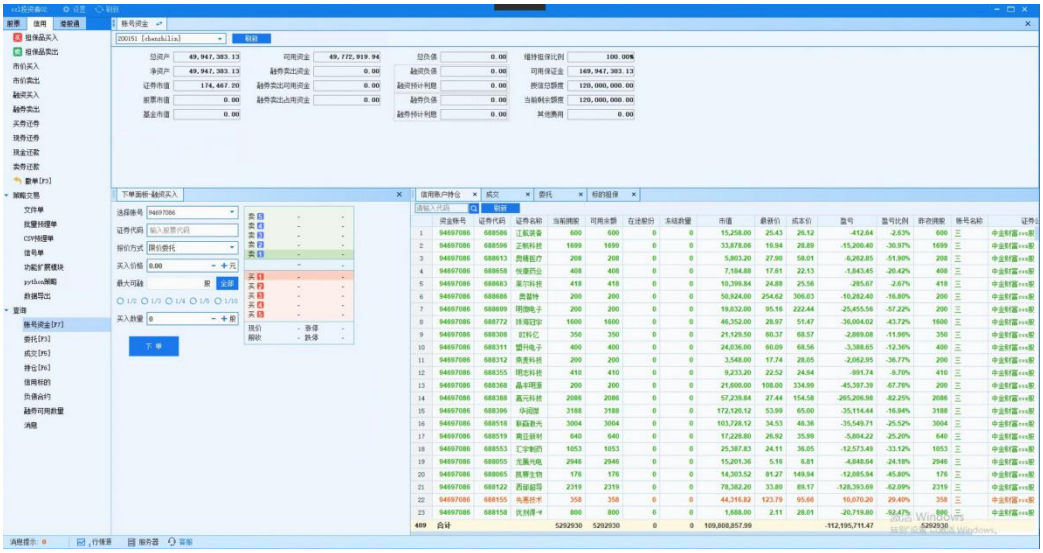
3.4.2. 信用交易

信用交易支持担保品买入、担保品卖出、市价买入、市价卖出、融资买入、融券卖出、买券还券、现券还券、现金还款、卖券还款、撤单、策略交易（包括文件单、批量预埋单、CSV 预埋单、功能扩展模块、Python 策略、数据导出，后文有详细介绍）、查询功能（账号资金、委托、成交、持仓、信用标的、负债合约、融券可融数量和消息查询）。

点击功能导航栏对应选项（担保品买入、担保品卖出、市价买入、市价卖出、融资买入、融券卖出、买券还券、现券还券、现金还款、卖券还款），下单板进行相应的跳转。

点击功能导航栏中的撤单，右侧跳转到委托面板，可在委托面板中进行撤单操作。

点击功能导航栏对应选项（账号资金、委托、成交、持仓、信用标的、负债合约、融券可融数量、消息），右侧显示对应的数据查询面板。



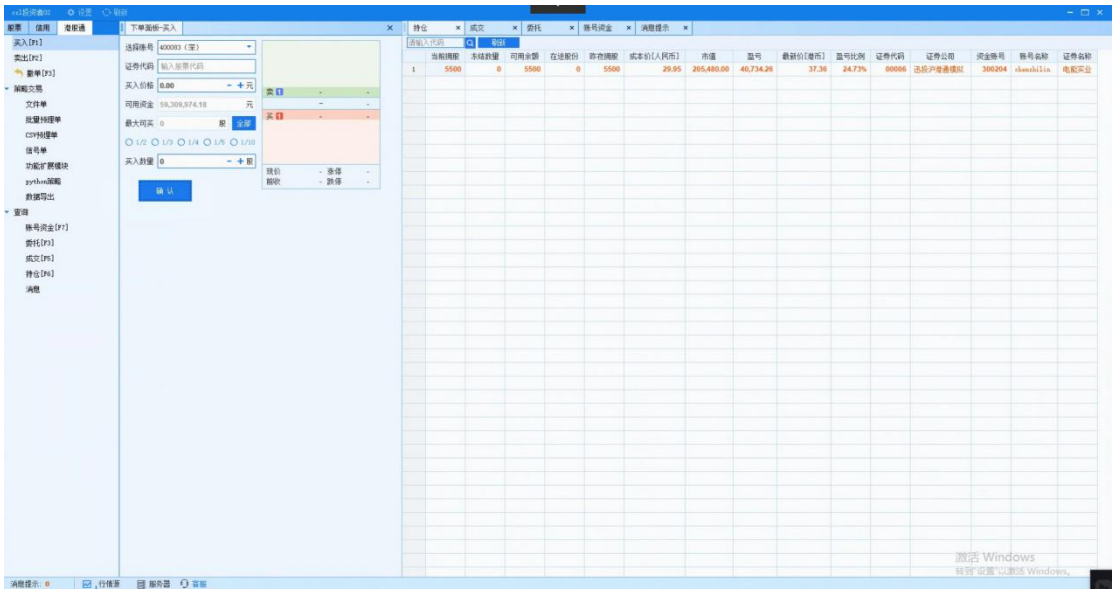
3.4.3. 港股通

港股通支持买入、卖出、撤单、策略交易（包括文件单、批量预埋单、CSV预埋单、功能扩展模块、Python策略和数据导出，后文有详细介绍）、查询功能（账号资金、委托、成交、持仓、和消息查询）。

点击功能导航栏对应选项（买入、卖出），下单板进行相应的跳转。

点击功能导航栏中的撤单，右侧跳转到委托面板，可在委托面板中进行撤单操作。

点击功能导航栏对应选项（账号资金、委托、成交、持仓、消息），右侧显示对应的数据查询面板。



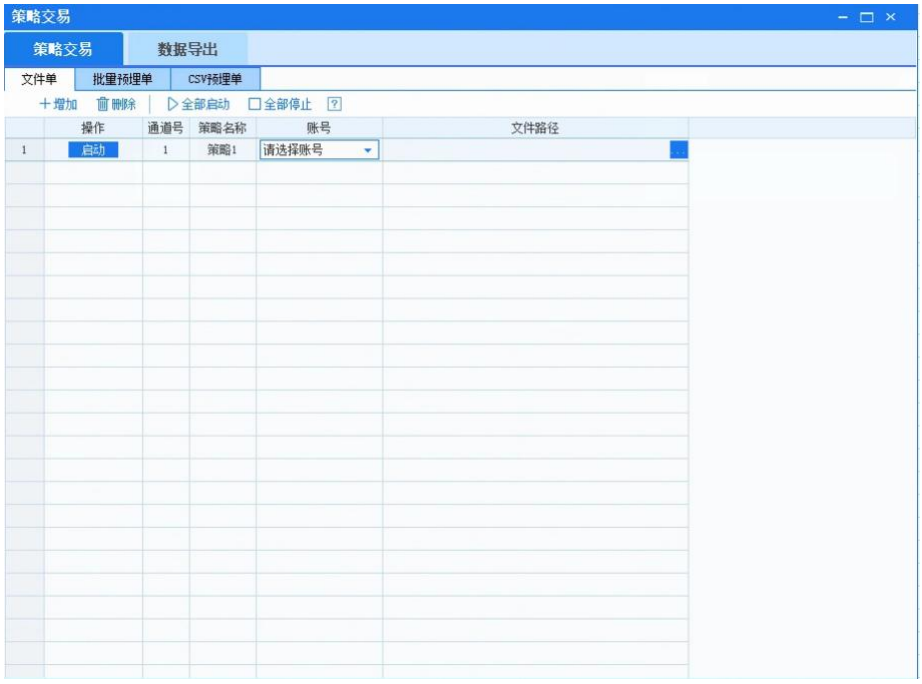
3.4.4. 策略交易

3.4.4.1. 便捷交易

便捷交易是通过下单协议发送下单指令。

在交易终端启动便捷交易下单服务前，需要设置交易类型、账号组、分单类型和文件路径等信息时，启动后，需要导入一个协议文件（.txt/.csv 格式），即中间文件。外部程序和下单服务通过该协议文件进行通讯。

扫单时，系统每隔 1 毫秒就自动扫描文件路径下是否有这个文件，若有就读取里面的内容，然后删除该源文件。采用便捷交易方式进行下单时，持仓、资金变化，成交、委托等回报信息通过数据导出界面的设置进行导出更新。



文件单设置界面如上图所示。可以增加、删除、全部启动和全部停止文件单，点击?可以查看文件单交易使用提示。

以记事本格式（.txt）为例，协议文件大致如下所示，下单协议中的参数依次为：下单类型，通道号，交易市场，交易代码，交易数量，报价类型，交易价格、投资备注（选填）。

交易参数详细说明：

【下单类型】：

23（股票买入，两融担保品买入）；

24（股票卖出，两融担保品卖出）；

27（融资买入）；

28（融券卖出）；

29（买券还券）；

30（现券还券）；

31（卖券还款）；

32（现金还款）。

【通道号】：通道号可在界面中查看，其中 0 属于万能通道号。

【交易市场】：填写 SH 或 SZ

【交易代码】：即股票代码，如 600000

【交易数量】：股票交易量的默认单位为：股；（债券最小单位：10；一般股票代码最小单位：100；回购类最小单位：1000；）

【报价类型】：

5-最新价

11-指定价

42-最优五档即成剩撤(SH)

43-最优五档即成剩转(SH)

44-对手最优价(SZ)

45-本方最优价(SZ)

46-即时成交剩余撤销委托(SZ)

47-最优五档即时成交剩余撤销委托(SZ)

48-全额成交或撤(SZ)

【交易价格】：填写交易的指定价格

撤单协议中的参数依次为：cancel_order 市场代码 合同编号

如需同时撤多个时，直接在尾部添加即可：cancel_order 市场代码 合同编号 市场代码 合同编号...

用户可添加的文件单数量可在券商管理端-用户管理-设置-文件单中进行调整。

3.4.4.2. 批量预埋单

批量预埋单功能支持外部系统和交易终端之间通过共享文件的方式实现数据实时交互。

文件交互流程如下：

①外部系统在交易端监控路径文件中写入委托参数；

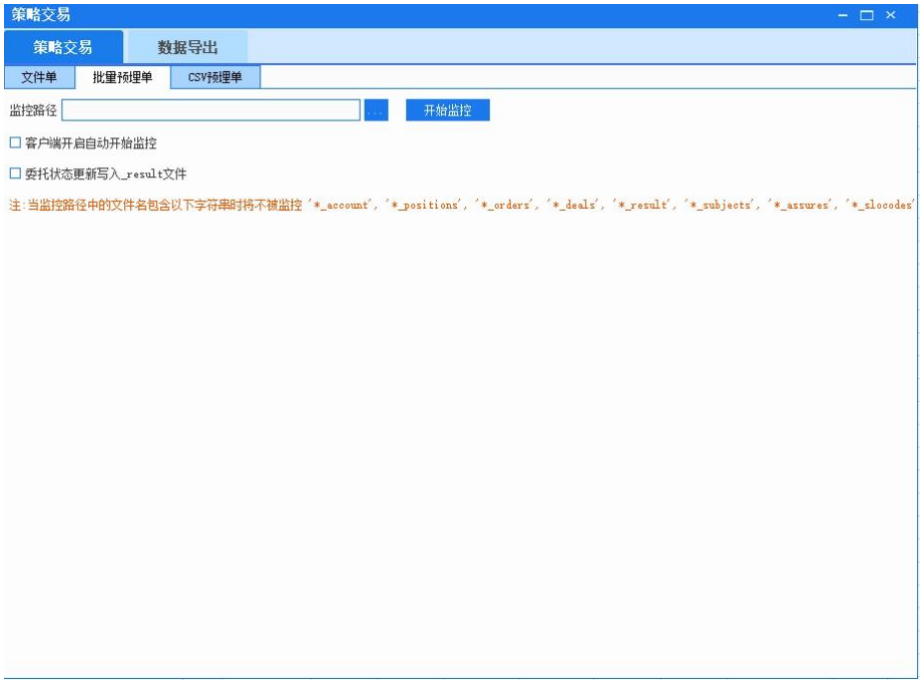
②终端实时扫描监控目录，读取委托参数自动进行委托下单；

③通过主推的方式将委托、成交回报等订单执行情况更新到共享文件中；

④外部系统实时读取共享文件，根据委托、成交回报进行后续委托、撤单任务的下发。

启动监控前，需设置共享文件路径，路径精确到需监控的 dbf 文件所在的文件夹即可。

持仓、资金变化，成交、委托等回报信息通过数据导出界面的设置进行导出更新。数据导出功能在 2.4.6 章节中进行详细介绍。



客户端开启自动开始监控：支持选择是否在客户端开始后自动开启埋单监控。

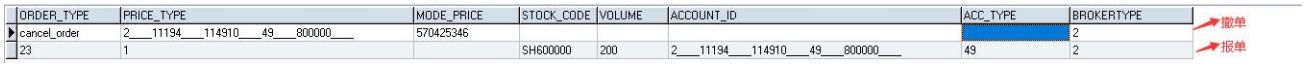
委托状态更新写入 result 文件：如果不勾选，反馈文件就不更新数据，如果勾选，委托状态变了就会更新到反馈文件里面去。

系统开启交易监控后会检索设置路径下的文件，下单文件的文件名不做限制（与导出文件不同名即可）。

开始报单后，系统将自动生成报单反馈文件，可在文件中查看报单状态等信息。

用户可通过策略交易中的数据导出功能，设置导出文件。

下单文件中的交易参数有格式和顺序要求，需要按顺序依次填入字段。



委托字段说明：

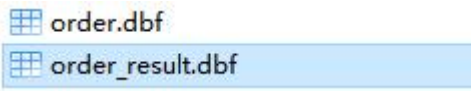
序号	字段名	类型	说明	必填	备注
1	order_type	String	下单类型	Y	23-股票买入 24-股票卖出 27-融资买入 28-融券卖出 29-买券还券 30-直接还券 31-卖券还款

					32-直接还款
2	price_type	String	委托价格类型	Y	1-最新价 3-指定价 6-盘后定价 M1-最优五档即成剩撤(SH) M2-最优五档即成剩转(SH) M3-即时成交剩余撤销委托(SZ) M4-全额成交或撤(SZ) M5-本方最优价(SZ) M6-对手最优价(SZ) M7-最优五档即时成交剩余撤销委托(SZ)
3	mode_price	String	委托价格	N	该字段仅 price_type 为 3-指定价、6-科创盘后定价时生效
4	stock_code	String	证券代码	Y	支持格式为市场代码+证券代码，如 SH600000
5	volume	String	委托数量	Y	——
6	account_id	String	下单资金账号	Y	支持入参账号 key
7	acc_type	String	账号类别	N	49-资金账号
8	brokertype	String	账号类型	N	2-股票账号 3-信用账号 不填时进行模糊匹配
9	strategy	String	策略备注	N	通过策略下单的，可在此列自定义策略备注
10	note	String	投资备注	N	成交、委托查询该字段原样返回

撤单字段说明：

序号	字段名	类型	说明	必填	备注
1	不指定	String	下单类型	Y	撤单填 cancel_order（使用 orderId 撤单）或 cancel（使用合同编号撤单）
2	不指定	String	资金账号	Y	支持入参账号 key
3	不指定	String	委托合同编号	Y	对应委托查询中合同编号（ordersysid）或 orderid
4	不指定	String	市场	Y	SH 或 SZ，使用合同编号（ordersysid）撤单时填写，否则不填写
5-7	不指定	string	空	N	无需填写
8	brokertype	String	账号类型	Y	2-股票账号 3-信用账号

下单后，扫单路径中会生成如下两个文件，可在对应的文件中查看下单详情和结果反馈。



委托反馈文件*_result.dbf 文件中字段如下所示：

序号	字段名	类型	说明	备注
1	ORDERID	String	委托合同编号	多个 orderid 用@分隔
2	MESSAGE	String	委托/撤单状态信息	
3	STATUS	String	委托/撤单状态	1-结束 0-执行中 -1-失败
4	STRATEGY	String	策略备注	该字段返回下单文件中填入的策略备注
5	NOTE	String	投资备注	该字段返回下单文件中填入的投资备注
6	MARKET	String	市场	SH 或 SZ
7	ORDERSYSID	String	合同编号	对应委托查询中的合同编号

采用批量埋单方式进行下单时，持仓、资金变化，成交、委托等回报信息也可通过数据导出界面的设置进行导出更新。数据导出功能在 2.4.6 章节中进行详细介绍。

3.4.4.3. CSV 预埋单

CSV 预埋单功能支持外部系统和交易终端之间通过共享文件的方式实现数据实时交互。

文件交互流程如下：

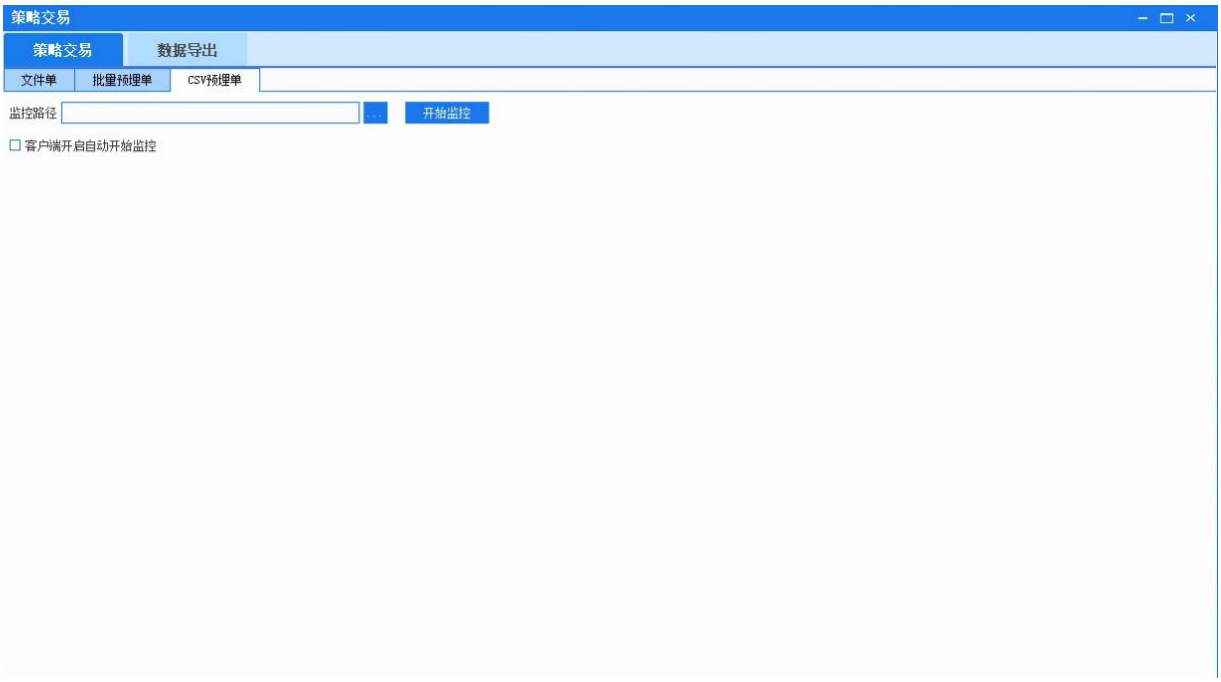
①外部系统在交易端监控路径文件中写入委托参数；

②终端实时扫描监控目录，读取报单参数自动进行委托下单；

③通过主推的方式将委托、成交回报等订单执行情况更新到相应文件中；

④外部系统实时读取文件，根据委托、成交回报进行后续委托、撤单任务的下发。

持仓、资金变化，成交、委托等回报信息通过数据导出界面的设置进行导出更新。数据导出功能在 2.4.6 章节中进行详细介绍。



设置路径：选择文件共享路径，系统监控该文件夹下除导出文件外的所有TXT格式文件，符合委托、撤单格式即可成功读入委托；委托、成交回报会同步导出至该路径下。

客户端开启自动开始监控：支持选择是否在客户端开始后自动开启埋单监控。

设置完成后点击开始监控，预埋单即开始运行。

下单文件中的交易参数有格式和顺序要求，需要按顺序依次填入字段。

委托字段说明：

文件名	signal.资金账号_账号类型.下单文件序号.txt				
序号	字段名	类型	说明	必填	备注
1	不指定	String	投资备注	Y	可自定义投资备注
2	不指定	String	报单类型	Y	23-证券买入/担保品买入 24-证券卖出/担保品卖出 27-融资买入 28-融资卖出 29-买券还券 30-直接还券 31-卖券还款 32-直接还款

					cancel_sys-使用合同编号撤单 cancel_id-使用订单编号撤单
3	不指定	String	报价方式	Y	1-最新价 2-指定价 6-科创盘后定价 M1-最优五档即成剩撤(SH) M2-最优五档即成剩转(SH) M3-即时成交剩余撤销委托(SZ) M4-全额成交或撤(SZ) M5-本方最优价(SZ) M6-对手最优价(SZ) M7-最优五档即时成交剩余撤销委托(SZ)
4	不指定	String	报单价格	Y	
5	不指定	String	证券代码	Y	支持格式为“市场代码+证券代码”，如SH600000
6	不指定	String	下单总量	Y	
7	不指定	String	策略名称	Y	

撤单字段说明：

文件名	signal.资金账号_账号类型.下单文件序号.txt				
序号：	字段名	类型	说明	必填	备注
1	不指定	String	报单类型	Y	cancel_sys 或 cancel_id
2	不指定	String	撤单编号	Y	当使用 cancel_sys 进行撤单时，此处填写合同编号； 当使用 cancel_id 进行撤单时，此处填写订单编号；
3	不指定	String	市场	Y	SZ-深交所 SH-上证所 SGT-深港通 HGT-沪港通

下单文件序号为自定义，建议使用数字。
账号类型：2-股票　3-信用　7-沪港通 11-深港通

3.4.4.4. 功能扩展模块

功能扩展模块即使用 c++语言编写的策略文件进行策略交易。功能扩展模块和 python 策略使用共同的程序界面，界面主要分为以下四个分区。其中，策略设置面板默认显示智能日内回转策略设置面板。

用户通过【策略管理面板】，单击不同的策略，来切换【策略设置面板】中的策略，根据策略的不同，设置项也不尽相同。以下示例图片中为智能日内回转策略的设置面板。用户在选择账号并设置完毕后，可点击确定对策略设置进行保存。保存后，【策略运行状态管理面板】中会新增一条策略数据，用户可在此启停策略，了解策略运行状态。

针对功能扩展模块策略，同一个资金账号，针对同一个策略，只可创建一条。

针对 python 策略，同一个资金账号，针对同一个策略，可创建多条，并可同时处于运行中状态。

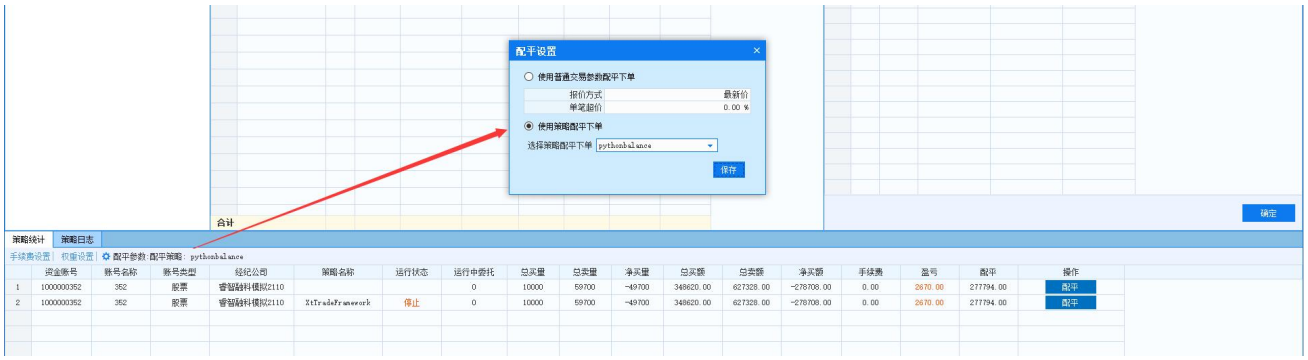
策略在运行过程中，不可修改策略设置，需停止后再进行修改。

【策略统计】中统计功能扩展模块策略运行产生的交易数据。在策略未产生交易的情况下，一个资金账号对应有一条数据，该条数据显示当天所有途径报单的交易数据。策略启动并产生交易后，对应的资金账号会增加一条策略名称为当前运行中策略的数据，在该条数据上，可查看该策略当日产生的交易数据，并进行手工配平操作。

点击配平，显示策略配平界面，可选择配平所有待配平的股票。配平时，系统会撤销运行中委托并重新报单。

如当前系统中有运行中委托，配平界面中会显示“全部撤销”按钮，可点击撤销所有运行中委托。

【策略统计】中可设置策略配平参数，参数对配平下单生效。



【策略统计】中还可设置手续费和涨跌停股票盈亏计算权重。

3.4.4.5. Python 策略

Python 策略即使用 python 语言编写的策略文件进行策略交易。python 策略和功能扩展模块使用共同的程序界面。

策略管理面板中，可新建策略交易（python），编辑策略，删除策略或打开本地策略文件夹。

用户通过【策略管理面板】，单击不同的策略，来切换【策略设置面板】中的策略。用户在选择账号并保存后，【策略运行状态管理面板】中会新增一条策略数据，用户可在此启停策略，了解策略运行状态。

针对 python 策略，同一个资金账号，针对同一个策略，可创建多条，并可同时处于运行中状态。

策略在运行过程中，不可修改策略设置，需停止后再进行修改。

3.4.4.6. 数据导出

使用数据导出功能，可定时导出系统中的资产、持仓、委托和成交等数据。导出数据字段说明详见 3.1.数据导出字段说明。

用户可在数据导出界面设置保存路径，以及针对哪些数据进行导出。导出数据的格式可设置为 DBF/TXT/CSV。委托和成交数据更新为增量更新，其中 TXT/CSV 增量更新为在文件末尾插入新的数据，DBF 增量更新为针对某条数据进行状态更新。默认导出间隔 1ms。

200222618_account.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	1 KB
200222618_deals.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	1 KB
200222618_orders.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	1 KB
200222618_positions.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	3 KB
8008802545_account.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	1 KB
8008802545_assures.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	1 KB
8008802545_compacts.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	1 KB
8008802545_deals.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	1 KB
8008802545_orders.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	2 KB
8008802545_positions.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	2 KB
8008802545_slocodes.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	1 KB
8008802545_subjects.dbf	2020/9/8 10:25	Database File	322 KB

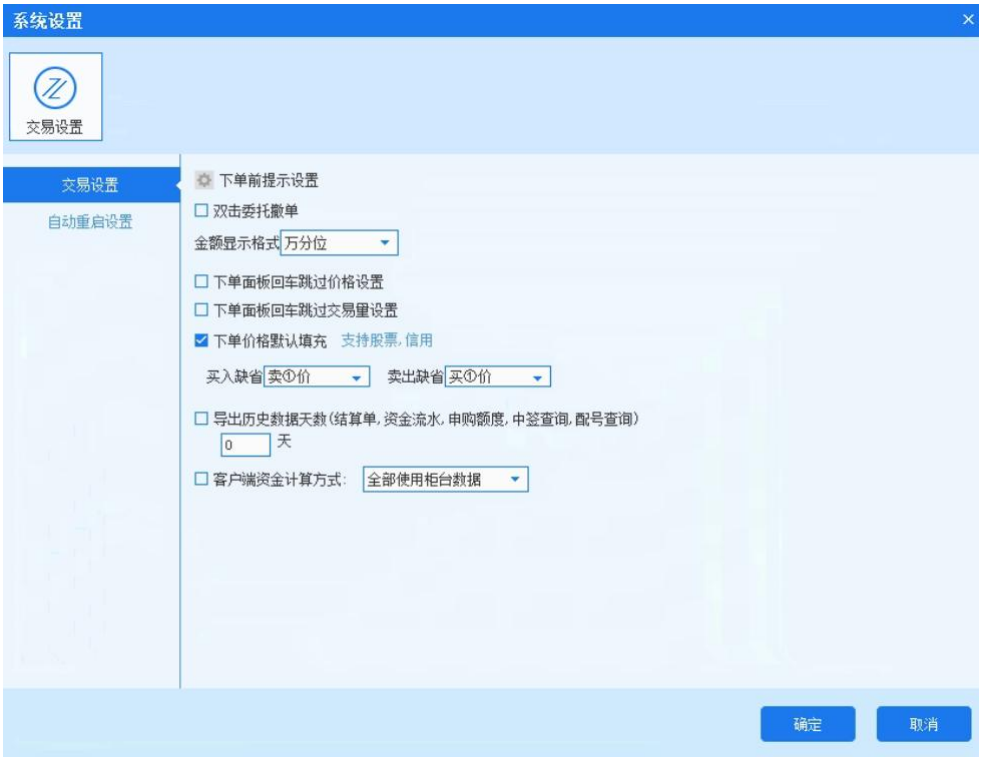
文件命名规则：

数据类型	命名规则
持仓	资金账号_positions.*
委托	资金账号_orders.*
成交	资金账号_deal.*
资金	资金账号_account.*
两融担保品	资金账号_assures.*
两融负债合约	资金账号_compacts.*
融券可融数量	资金账号_slocodes.*
融资融券标的	资金账号_subjects.*
配号信息	*_IPOLuckyInfo.*
结算单	*_stkDelivery.*
资金流水	*_stkFundFlow.*
新股额度	*_subscribInfo.*
中签信息	*_subscribNumber.*
汇率	*_exchangeRate.*

3.4.5. 其他设置

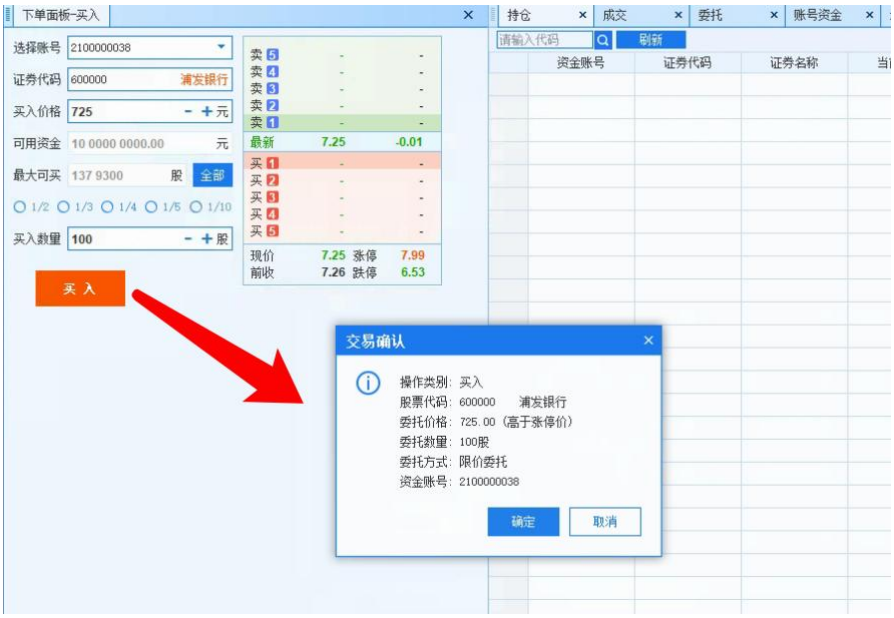
3.4.5.1. 系统设置

点击设置，打开系统设置面板。交易设置包括如下设置项。



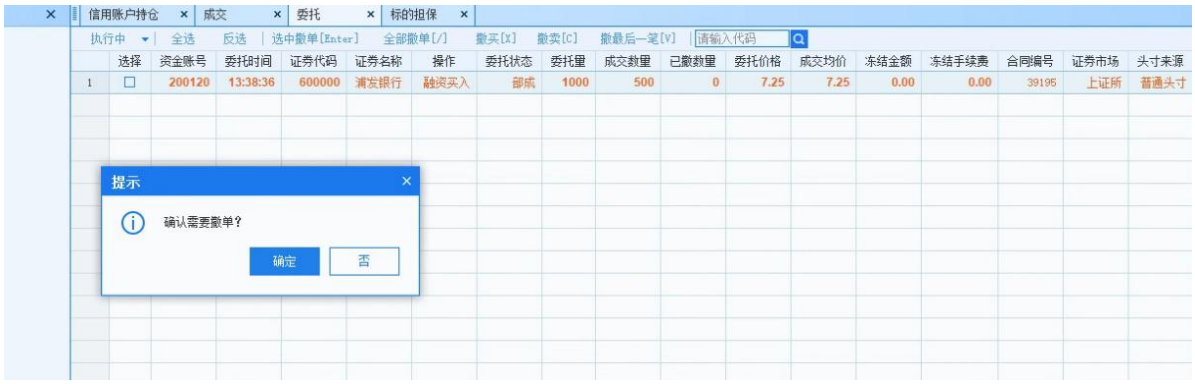
（1）下单前提示设置

支持取消常规下单和市价/涨跌停价下单前提示框，当勾选设置项后，进行下单操作时，系统会弹出二次确认框，确认后可下单，如未勾选则不需二次确认。



（2）双击委托撤单

勾选双击委托撤单后，双击委托面板未成委托，可进行撤单。



（3）金额显示格式

设置系统中金额等数字的显示格式，如当前设置为千分位格式时，系统显示格式如下。

（4）下单面板回车跳过价格设置

勾选此设置项后，下单面板选择代码后回车，会跳过价格设置栏。

（5）下单面板回车跳过交易量设置

勾选此设置项后，下单面板选择代码后回车，会跳过交易量设置栏。

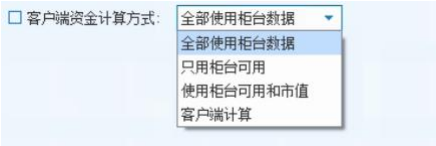
（6）下单价格默认填充

可设置买入缺省值和卖出缺省值，如设置缺省值均为第 5 档价格，下单板价格处将默认填充第五档价格。

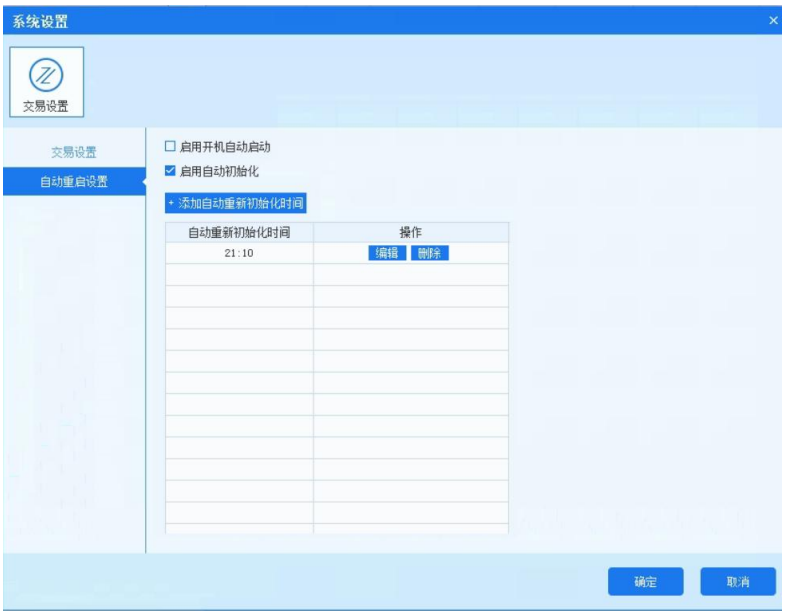
（7）导出历史数据天数

目前支持结算单、资金流水、申购额度、中签查询、配号查询按设置天数导出历史数据。

（8）客户端账号资金计算方式，可以选择计算方式，如下图所示。

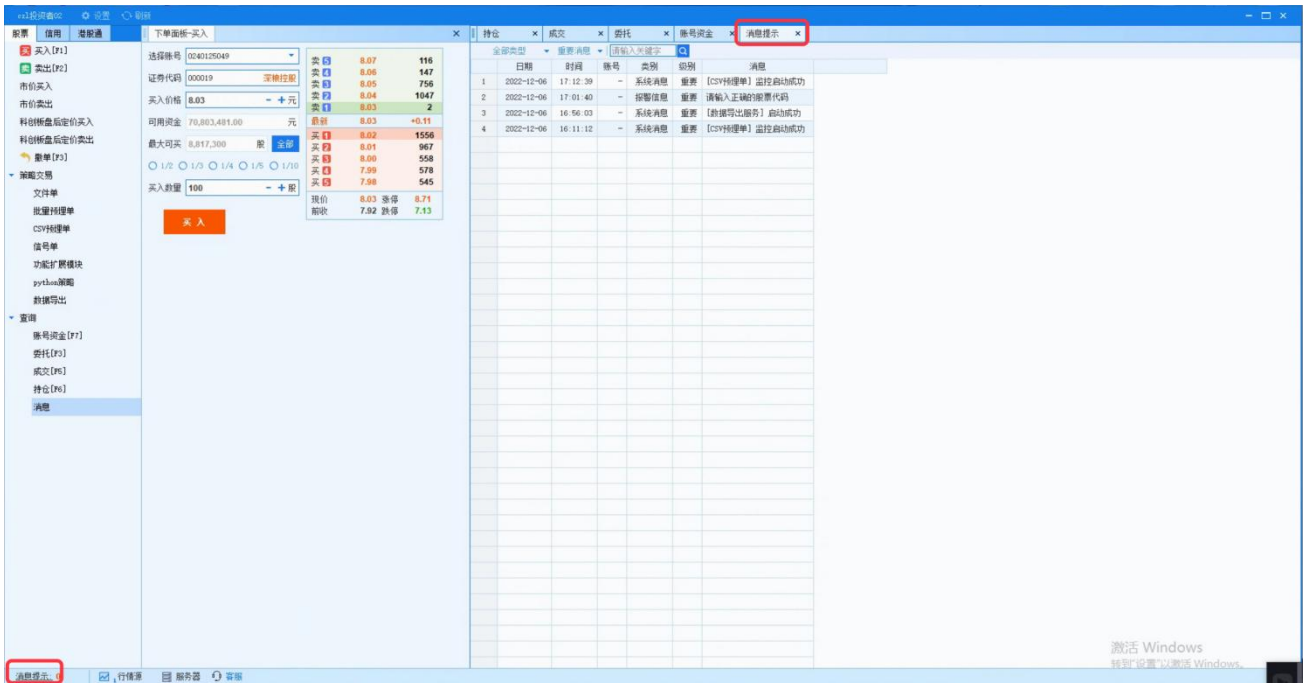


点击自动化重启设置，可以勾选启用开机自动启动和自动初始化设置，如下图所示。



3.4.5.2. 消息提示

点击消息提示，跳转到消息提示面板。



3.4.5.3. 行情源

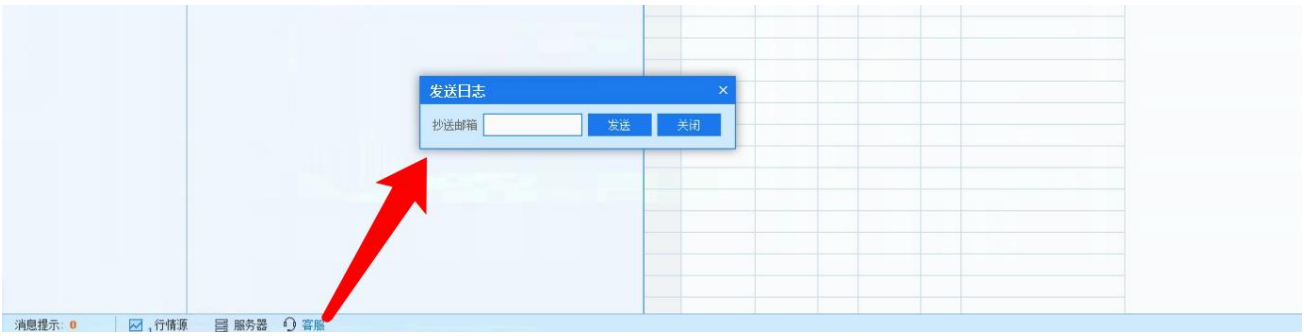
点击状态栏中的行情源，可打开行情源设置面板。用户可增加、删除和修改当前系统中的行情源地址，切换连接的行情源。同时可设置全推行情权限为最新价、一档行情或五档行情。

3.4.5.4. 服务器

点击服务器，可查看当前连接的交易服务器地址。

3.4.5.5. 客服

点击客服，可发送日志到输入的邮箱地址。



3.4.6. 附录

3.4.6.1. 数据导出字段说明

文件名	*_account.*			
功能	资金查询			
说明	支持查询账号资金数据 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	备注
1	账号	String	账号	
2	总资产	String	总资产	
3	可用资金	String	可用资金	
4	总市值	String	总市值	
5	股票市值	String	股票市值	
6	基金市值	String	基金市值	
7	盈亏	String	盈亏	

8	交易日	String	交易日	
9	登录状态	String	登录状态	尚未登录 准备登录 登录中 登录成功 登录失败 初始化中 休市中
10	可取资金	String	可取资金	
11	总负债	String	总负债	信用账号字段
12	可用保证金	String	可用保证金	信用账号字段
13	维持担保比	String	维持担保比	信用账号字段
14	净资产	String	净资产	信用账号字段
15	融资负债	String	融资负债	信用账号字段
16	融资本金	String	融资本金	信用账号字段
17	融资息费	String	融资息费	信用账号字段
18	融券负债	String	融券负债	信用账号字段
19	融券市值	String	融券市值	信用账号字段
20	融券息费	String	融券息费	信用账号字段
21	其它费用	String	其它费用	信用账号字段
22	融资授信额	String	融资授信额	信用账号字段
23	融资可用额	String	融资可用额	信用账号字段
24	融资冻结额	String	融资冻结额	信用账号字段
25	融券授信额	String	融券授信额	信用账号字段
26	融券可用额	String	融券可用额	信用账号字段
27	融券冻结额	String	融券冻结额	信用账号字段
28	融券卖出额	String	融券卖出额	信用账号字段
29	已用融卖额	String	已用融卖额	信用账号字段
30	剩余融卖额	String	剩余融卖额	信用账号字段

文件名	*_deals.*			
功能	成交查询			
说明	支持查询成交数据 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	
1	账号	String	账号	
2	市场	String	市场	SH-上证所 SZ-深交所

3	证券代码	String	证券代码	
4	操作	String	操作	买入 卖出
5	成交价格	String	成交价格	
6	成交数量	String	成交数量	
7	成交金额	String	成交金额	
8	手续费	String	手续费	
9	成交日期	String	成交日期	
10	成交时间	String	成交时间	
11	委托编号	String	委托编号	
12	成交编号	String	成交编号	
13	订单编号	String	订单编号	
14	策略名称	String	策略名称	
15	备注	String	备注	
16	委托类型	String	委托类型	48-买卖 49-查询 50-撤单 52-确认 54-融资委托 55-融券委托 56-信用平仓 57-信用普通委托

文件名	*_orders.*			
功能	委托查询			
说明	支持查询委托数据 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	
1	账号	String	账号	
2	市场	String	市场	SH-上证所 SZ-深交所
3	证券代码	String	证券代码	
4	操作	String	操作	买入 卖出
5	报价类型	String	报价类型	限价 市价 最优价
6	委托价格	String	委托价格	

7	委托数量	String	委托数量	
8	委托日期	String	委托日期	
9	委托时间	String	委托时间	
10	委托编号	String	委托编号	
11	委托状态	String	委托状态	未报 待报 已报 已报待撤 部成待撤 部撤 已撤 部成 已成 废单
12	成交数量	String	成交数量	
13	成交均价	String	成交均价	
14	成交金额	String	成交金额	
15	撤单数量	String	撤单数量	
16	订单编号	String	订单编号	
17	策略名称	String	策略名称	
18	备注	String	备注	
19	废单原因	String	废单原因	
20	委托类型	String	委托类型	48-买卖 49-查询 50-撤单 52-确认 54-融资委托 55-融券委托 56-信用平仓 57-信用普通委托

文件名	*_positions.*			
功能	持仓查询			
说明	支持查询持仓数据 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	
1	账号	String	账号	
2	市场	String	市场	SH-上证所 SZ-深交所

3	证券代码	String	证券代码	
4	当前拥股	String	当前拥股	
5	可用数量	String	可用数量	
6	在途数量	String	在途数量	
7	冻结数量	String	冻结数量	
8	昨夜拥股	String	昨夜拥股	
9	成本价	String	成本价	
10	市值	String	市值	
11	盈亏	String	盈亏	

文件名	*_assures.*			
功能	两融担保品查询			
说明	支持查询两融担保品数据 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	
1	账号	String	账号	
2	市场	String	市场	SH-上证所 SZ-深交所
3	证券代码	String	证券代码	
4	是否可担保	String	是否可担保	担保品 非担保品
5	担保折算比	String	担保折算比	

文件名	*_compacts.*			
功能	负债合约查询			
说明	支持查询两融负债合约数据 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	
1	账号	String	账号	
2	市场	String	市场	SH-上证所 SZ-深交所
3	证券代码	String	证券代码	
4	合约类型	String	合约类型	融资 融券 不限制

5	合约编号	String	合约编号	
6	头寸来源	String	头寸来源	普通头寸 专项头寸 不限制
7	开仓日期	String	开仓日期	
8	到期日	String	到期日	
9	合约数量	String	合约数量	
10	未还数量	String	未还数量	
11	合约金额	String	合约金额	
12	未还金额	String	未还金额	
13	合约息费	String	合约息费	
14	未还息费	String	未还息费	
15	已还金额	String	已还金额	
16	已还息费	String	已还息费	

文件名	*_slocodes.*			
功能	融券可融数量查询			
说明	支持查询融券可融数量 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	
1	账号	String	账号	
2	市场	String	市场	SH-上证所 SZ-深交所
3	证券代码	String	证券代码	
4	头寸性质	String	头寸性质	普通 专项
5	融券可融量	String	融券可融量	

文件名	*_subjects.*			
功能	融资融券标的查询			
说明	支持查询融资融券标的 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	备注
1	账号	String	账号	
2	市场	String	市场	SH-上证所

				SZ-深交所
3	证券代码	String	证券代码	
4	融资状态	String	融资状态	正常 暂停 作废
5	融资保证比	String	融资保证比	
6	融券状态	String	融券状态	正常 暂停 作废
7	融券保证比	String	融券保证比	

文件名	*_IPOLuckyInfo.*			
功能	配号信息查询			
说明	支持查询新股配号信息 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	备注
1	成功	Bool	是否成功	
2	返回信息	String	错误信息	
3	交易市场类别	String	交易市场类别	
4	股东代码	String	股东代码	
5	股票代码	String	股票代码	
6	中签数量	Double	中签数量	
7	中签价格	Double	中签价格	
8	中签金额	Double	中签金额	
9	放弃数量	Double	放弃数量	
10	中签编号	String	中签编号	
11	股票名称	String	股票名称	
12	中签日期	Int	中签日期	
13	申购日期	String	申购日期	
14	资金账号	String	账号信息	

文件名	*_stkDelivery.*
功能	结算单查询
说明	支持查询结算单信息 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符
编码	GBK
出参：	

序号	字段名	类型	说明	备注
1	成功	Bool	是否成功	
2	错误	String	错误信息	
3	日期	Int	日期	
4	成交时间	Int	时间	
5	市场类型	String	市场类型	
6	市场	String	市场	
7	股票账号	String	股票账号	
8	证券代码	String	证券代码	
9	证券名称	String	证券名称	
10	买卖	String	买卖	
11	操作	String	操作	
12	成交数量	Double	成交数量	
13	成交价格	Double	成交价格	
14	成交金额	Double	成交金额	
15	资金余额	Double	资金余额	
16	股份余额	Double	股份余额	
17	成交序号	String	成交序号	
18	手续费	Double	手续费	
19	印花税	Double	印花税	
20	其他杂费	Double	其他杂费	
21	委托号	String	委托号	
22	资金账号		账号信息	
23	业务类型	Int	业务类型	
24	业务名称	String	业务名称	
25	记录序列号	String	记录序列号	

文件名	*_stkFundFlow.*			
功能	资金流水查询			
说明	支持查询资金流水 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	备注
1	成功	Bool	是否成功	
2	返回信息	String	错误信息	
3	账号信息	String	账号信息	
4	发生日期	Int	发生日期	
5	发生时间	Int	发生时间	
6	流水序号	String	流水序号	

7	业务类型	String	业务类型	
8	业务名称	String	业务名称	
9	发生数量	Double	发生数量	
10	剩余数量	Double	剩余数量	
11	币种	String	币种	
12	交易市场类别	String	交易市场类别	
13	资金账号	String	资金账号	
14	证券代码	String	证券代码	
15	定位串	String	定位串	
16	证券名称	String	证券名称	
17	成交价格	Double	成交价格	
18	成交金额	Double	成交金额	
19	手续费	Double	手续费	
20	印花税	Double	印花税	
21	过户费	Double	过户费	
22	其他费用	Double	其他费用	
23	发生数量/金额	Double	发生数量/金额	
24	剩余数量/金额	Double	剩余数量/金额	
25	委托价格	Double	委托价格	
26	委托数量	Double	委托数量	
27	股东账号	String	股东账号	
28	成交序列号	String	成交序列号	
29	委托号	String	委托号	
30	买卖方向	String	买卖方向	

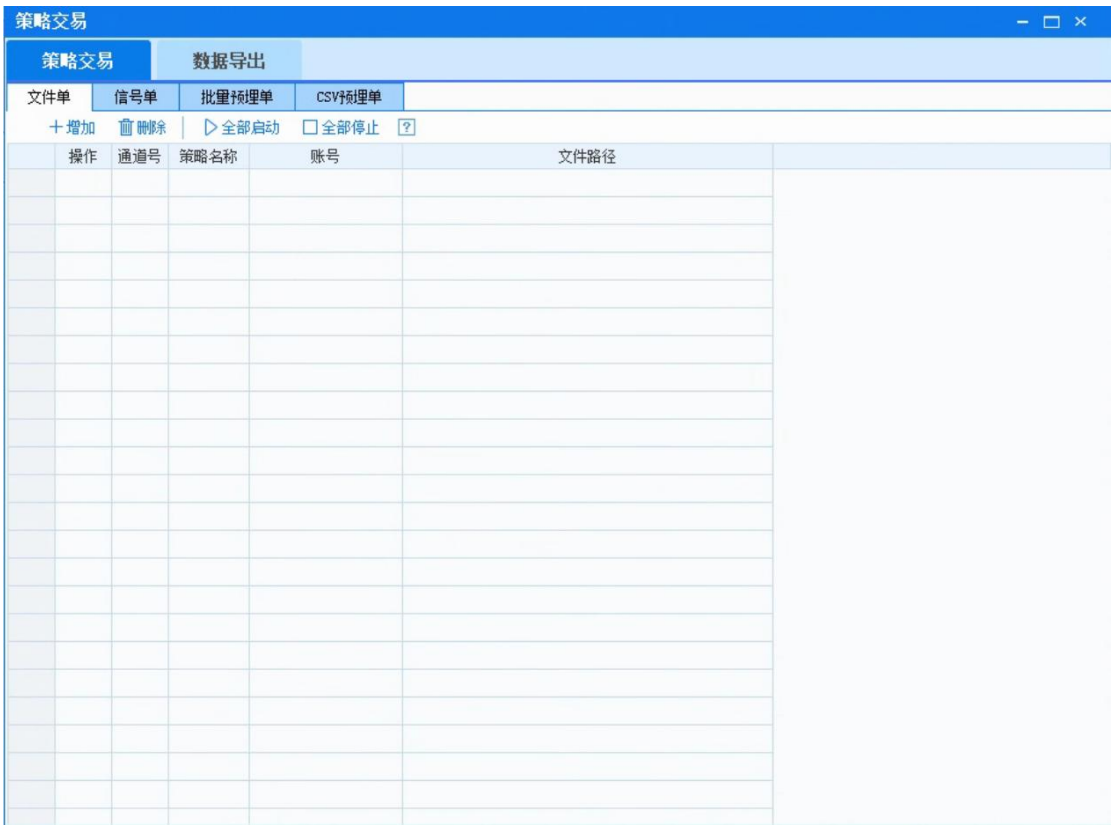
文件名	*_subscribInfo.*			
功能	新股额度查询			
说明	支持查询新股额度 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	备注
1	资金账号	String	账号信息	
2	证券市场	Int	证券市场	
3	证券代码	String	证券代码	
4	可申购额度	Int	可申购额度	
5	科创板可申	Int	科创板可申购额	

	购额度		度	

文件名	*_subscribNumber.*			
功能	中签信息查询			
说明	支持查询中签信息 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	备注
1	成功	Bool	是否成功	
2	返回信息	String	错误信息	
3	资金账号	String	账号信息	
4	市场	String	市场	
5	交易市场类别	String	交易市场类别	
6	股票代码	String	股票代码	
7	股票名称	String	股票名称	
8	起始配号	String	起始配号	
9	配号数量	Double	配号数量	
10	股东账号	String	股东账号	
11	配号日期	String	配号日期	
12	申购日期	String	申购日期	

文件名	*_exchangeRate.*			
功能	汇率查询			
说明	支持查询汇率信息 *由于 dbf 格式限制，表头仅显示前十个字符			
编码	GBK			
出参：				
序号	字段名	类型	说明	备注
1	市场	string	市场	
2	币种	String	币种	
3	买参汇率	String	买参汇率	
4	日买浮动比	String	日买浮动比	
5	夜买浮动比	String	夜买浮动比	
6	卖参汇率	String	卖参汇率	
7	日卖浮动比	String	日卖浮动比	
8	夜卖浮动比	String	夜卖浮动比	
9	中间汇率	Double	中间汇率	

10	日期	String	日期	
11	买结汇率	String	买结汇率	
12	卖结汇率	String	卖结汇率	



便捷交易设置界面如上图所示。可以增加、删除、全部启动和全部停止便捷交易，点击?可以查看便捷交易交易使用提示。

以记事本格式（.txt）为例，协议文件大致如下所示，下单协议中的参数依次为：下单类型，通道号，交易市场，交易代码，交易数量，报价类型，交易价格、投资备注（选填）。

交易参数详细说明：

【下单类型】：

23（股票买入，两融担保品买入）；

24（股票卖出，两融担保品卖出）；

27（融资买入）；

28（融券卖出）；

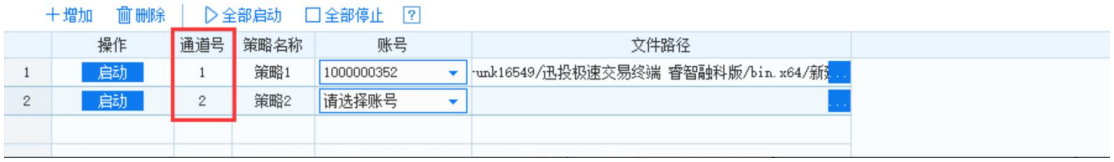
29（买券还券）；

30（现券还券）；

31（卖券还款）；

32（现金还款）。

【通道号】：通道号可在界面中查看，其中 0 属于万能通道号。



【交易市场】：填写 SH 或 SZ

【交易代码】：即股票代码，如 600000

【交易数量】：股票交易量的默认单位为：股；（债券最小单位：10；一般股票代码最小单位：100；回购类最小单位：1000；）

【报价类型】：

5-最新价

11-指定价

42-最优五档即成剩撤(SH)

43-最优五档即成剩转(SH)

44-对手最优价(SZ)

45-本方最优价(SZ)

46-即时成交剩余撤销委托(SZ)

47-最优五档即时成交剩余撤销委托(SZ)

48-全额成交或撤(SZ)

【交易价格】：填写交易的指定价格

撤单协议中的参数依次为：cancel_order 市场代码 合同编号

如需同时撤多个时，直接在尾部添加即可：cancel_order 市场代码 合同编号 市场代码 合同编号...

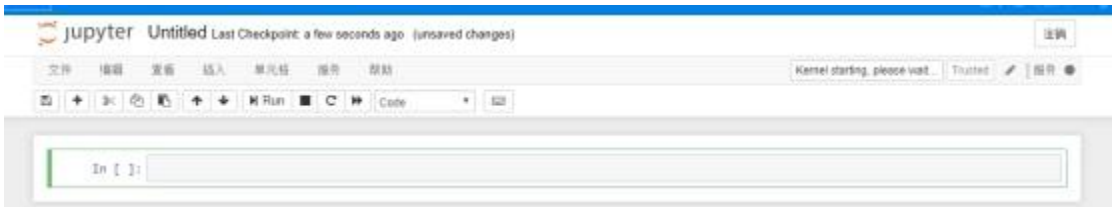
用户可添加的便捷交易数量可在券商管理端-用户管理-设置-便捷交易中进行调整。

3.5. 投资研究

为方便用户进行投资研究，优化模型，支持 Jupyter Notebook，使用方法与 jupyter 一致。

可新建 notebook，文本文件和文件夹等。

可在 notebook 中进行编写和运行等操作，功能与 jupyter notebook 一致。



Jupyter notebook 中可使用 QMT 中提供的 API 接口，具体接口如下所示：

'write_file',

'read_file',

'get_last_volume',

'get_sector',

'get_industry',

'get_stock_list_in_sector',

'get_weight_in_index',

'get_contract_multiplier',

'get_risk_free_rate',

'get_financial_data',

'get_market_data',

'get_divid_factors',

'get_main_contract',

'timetag_to_date_time',

'get_trading_dates'

如下可查看 API 具体使用方法。获取行情数据之前需先通过数据管理功能补充相应数据。

3.6. 其他设置

3.6.1. 顶部工具栏

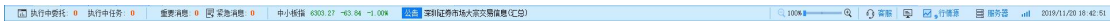
顶部左上角用户名可点击，点击可查看迅投 QMT 交易终端版本及系统信息。

终端版本

用户名右侧为工具栏，工具栏包含设置、操作、布局、当前账号（可选择），右上角有用户协议、交易、帮助、回转交易和换肤功能，并显示当前数据日期，中间模型研究、模型交易。

顶部工具栏

3.6.2. 底部状态栏



状态栏

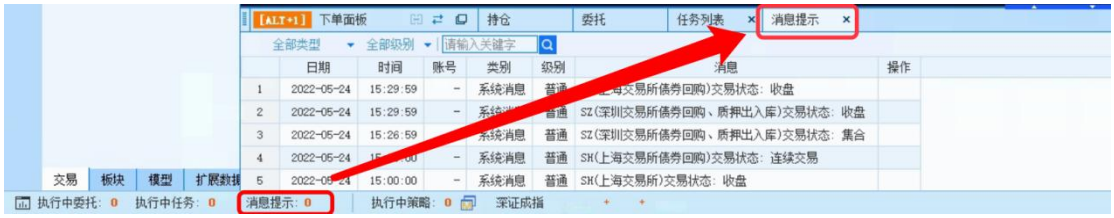
①执行中委托：点击执行中委托，主界面跳转到委托面板-执行中界面。

执行中委托

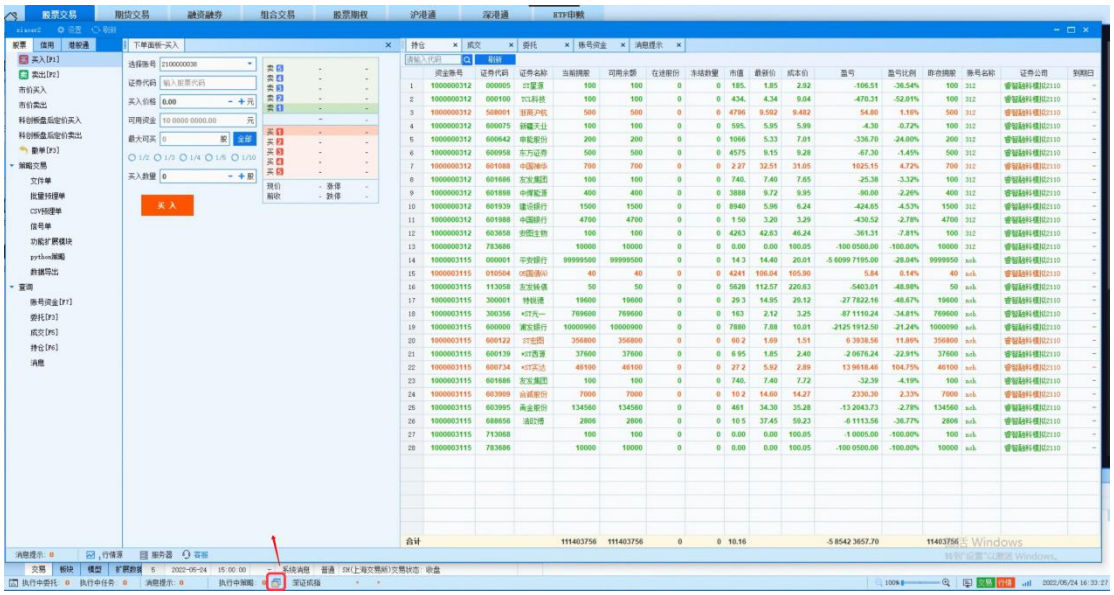
②执行中任务：点击执行中任务，主界面跳转到任务列表-执行中界面。

执行中任务

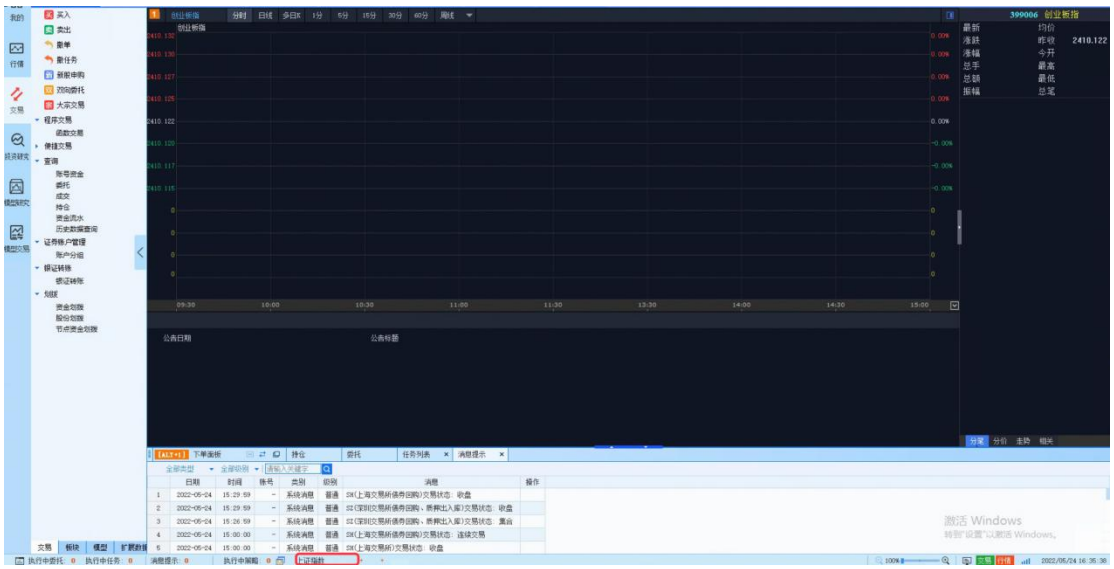
③消息提示：点击消息提示，主界面跳转到消息提示界面。



④极简模式：点击极简模式图标，打开极简模式界面。

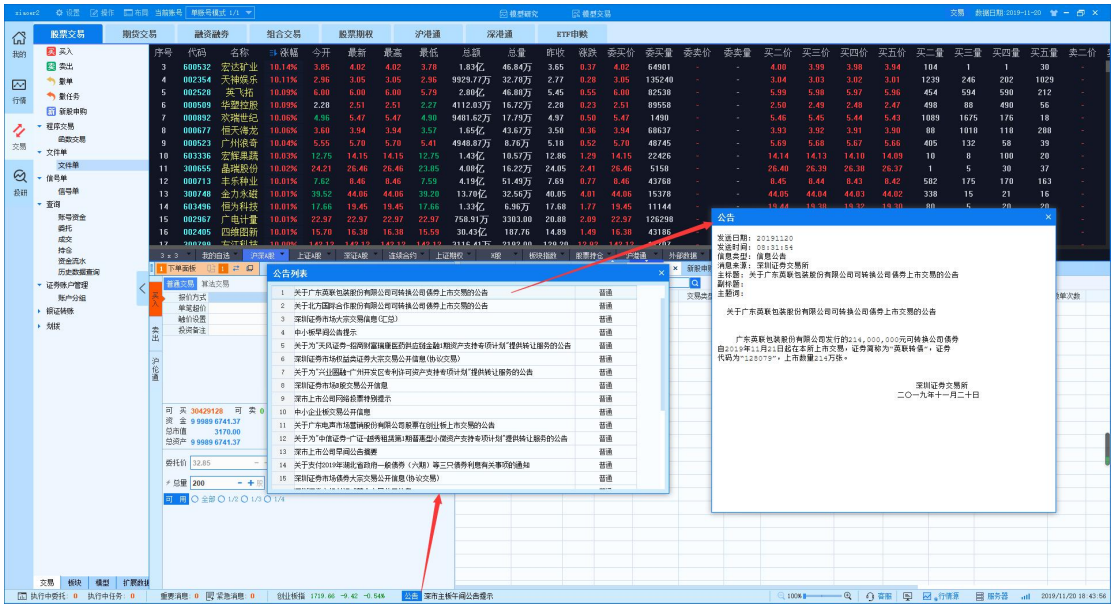


⑤指数信息：状态栏滚动显示上证指数，沪深，创业板指数，和沪深 300 指数。双击可在行情界面中显示相应指数的分时图。



双击指数到分时图

⑥交易所公告：点击可查看交易所的重要公告。

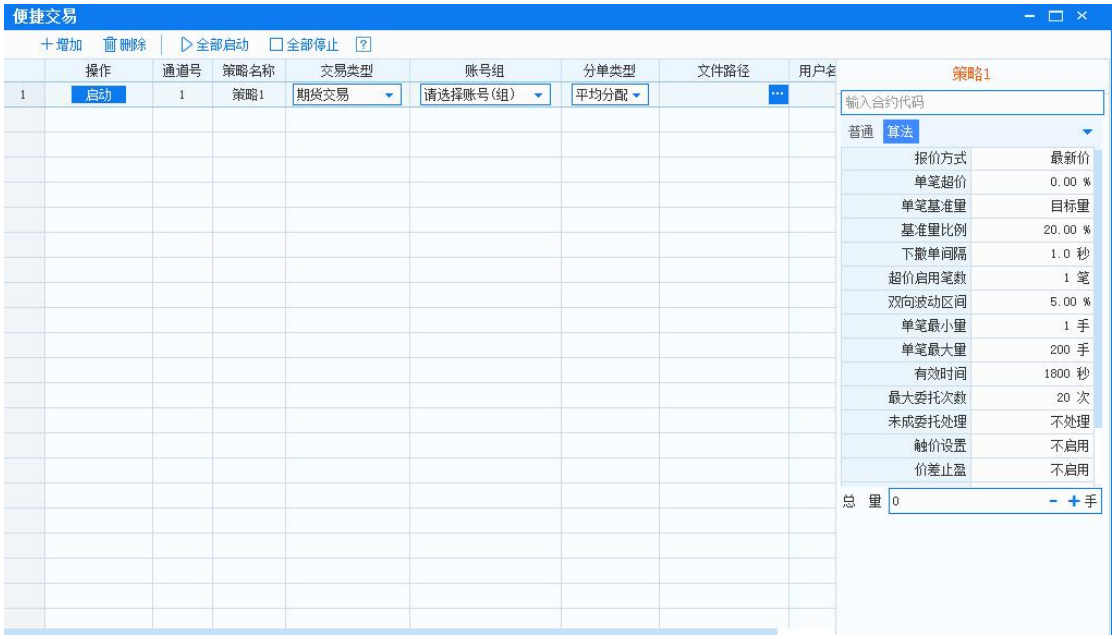


交易所公告

⑦字体扩大功能：支持扩大整个软件的字体大小。

⑧CSV 预埋，便捷交易和批量埋单：CSV 预埋，便捷交易和批量埋单入口。

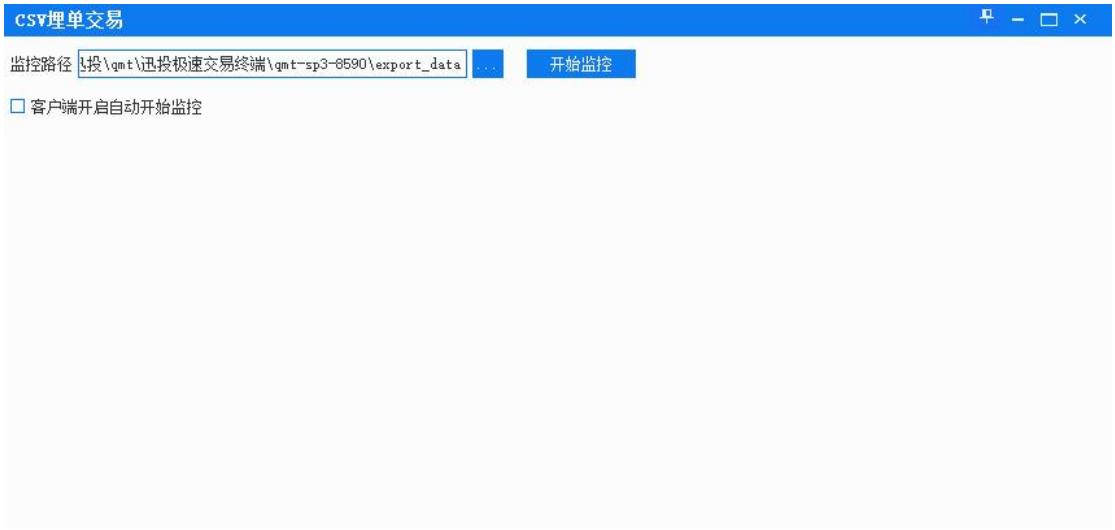
便捷交易、批量埋单和 CSV 预埋入口


便捷交易
增加
删除
全部启动
全部停止
操作
通道号
策略名称
交易类型
账号组
分单类型
文件路径
用户名
1
启动
1
策略1
期货交易
请选择账号(组)
平均分配
策略1
输入合约代码
普通
算法
报价方式
最新价
单笔超价
0.00 %
单笔基准量
目标量
基准量比例
20.00 %
下撤单间隔
1.0 秒
超价启用笔数
1 笔
双向波动区间
5.00 %
单笔最小量
1 手
单笔最大量
200 手
有效时间
1800 秒
最大委托次数
20 次
未成委托处理
不处理
触价设置
不启用
价差止盈
不启用
总 量
0
手

便捷交易

批量埋单交易
选择路径
\qmt\迅投极速交易终端\qmt-sp3-8590\export_data
开始监控
扫描间隔设置：
1
ms(设置范围1-100毫秒，默认1毫秒)
设置快捷交易参数：
使用增量导出数据
客户端开启自动开始监控
当天首次开启监控时自动清理历史报单文件
选择备份路径
\迅投极速交易终端\qmt-sp3-8590\export_data_backup
合同编号未返回时回填OrderId值
-1
(请输入非正整数值)
共享缓存模式读取文件
委托查询
成交查询
执行中
全部来源
全选
反选
选中撤单
全部撤单
撤买
撤卖
撤最后一笔
请输入代码
证券公司
资金账号
账号名称
账号类型
账号是否启用
账号备注
任务编号
任务来

批量埋单



CSV 预埋

⑨交易：查看当前系统中登录账号的连接状态，当有任一账号登录不成功时，显示为红色。

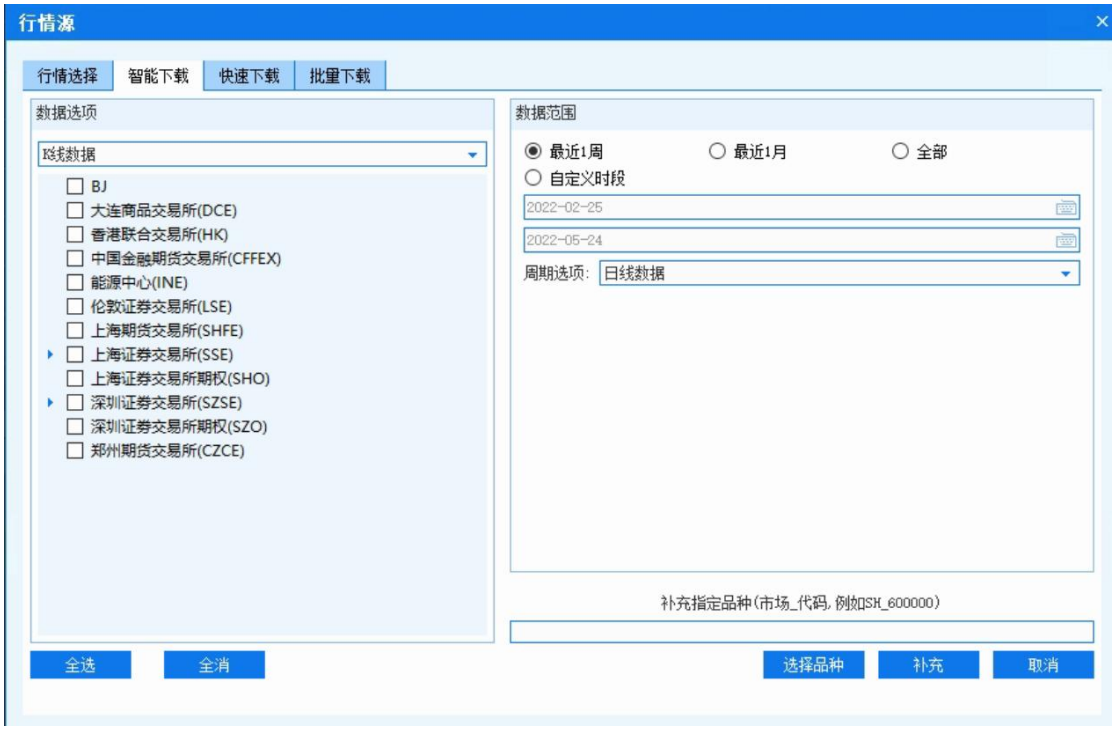
⑩行情源：登录到软件之后，点击行情源，可在此进行行情源的编辑与选择。当行情主站或交易中心中所有链接均未成功时，此处行情显示为红色状态。

登录后行情选择界面

行情总览中可查看当前所连接的各部分的行情地址。

行情总览

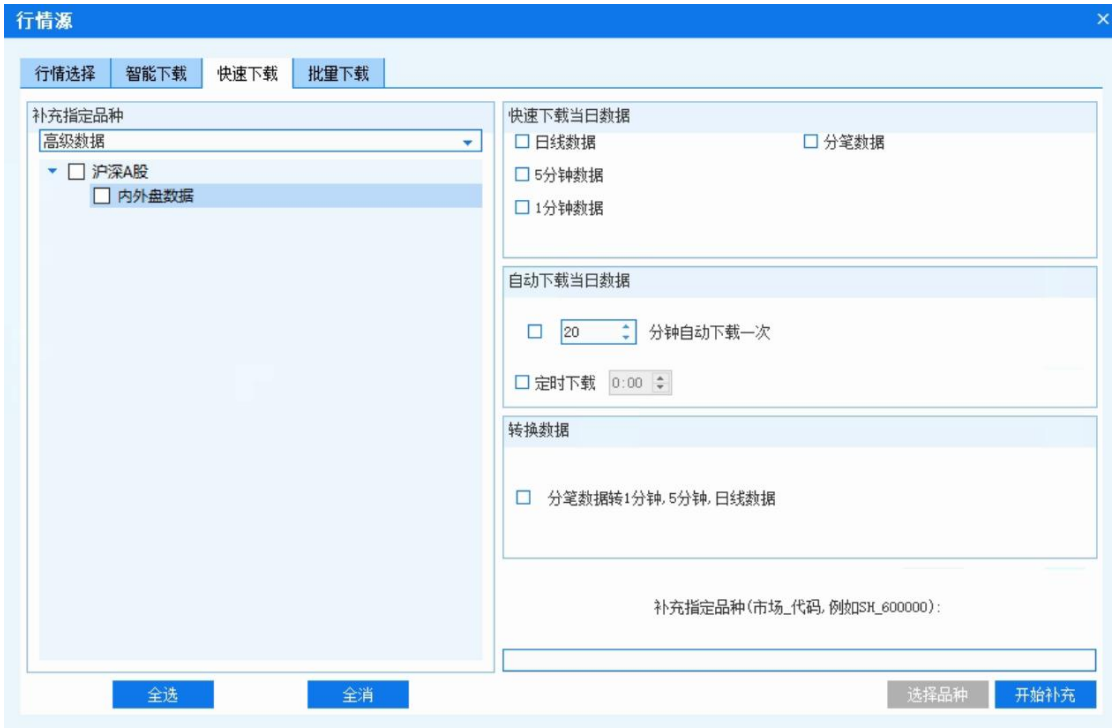
在智能下载界面下载、更新不同种类和范围的历史数据。



登录后智能下载界面

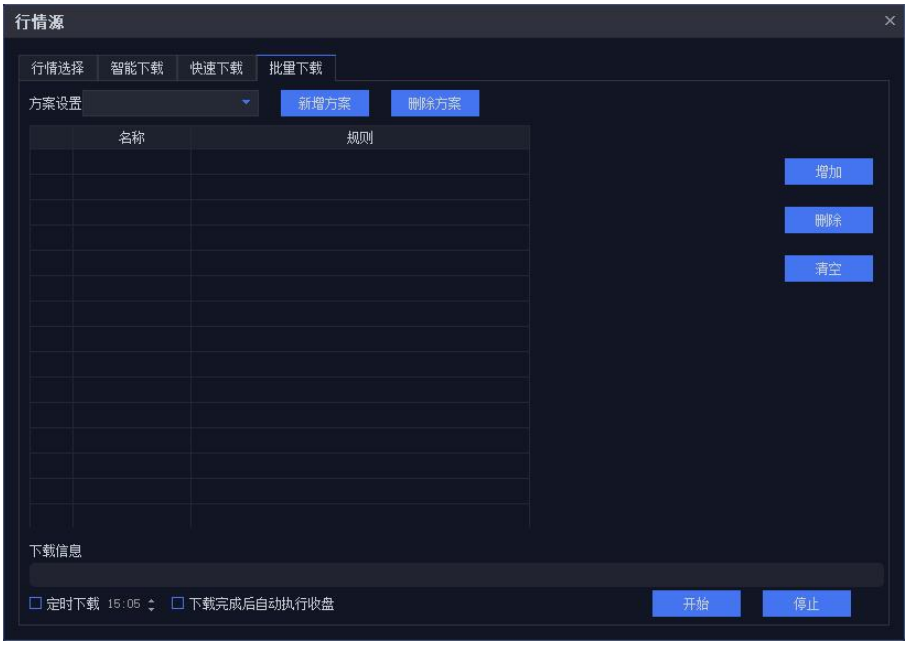
在快速下载标签页内快速下载当日数据，并设置自动下载等选项。

当勾选了迅投高级数据时，默认下载沪深 A 股内外盘日线数据，左侧勾选任何品种均不生效。当迅投高级数据与其他当日数据类型同时勾选时，其他数据类型也默认下载沪深 A 股的内外盘数据。例如：勾选迅投高级数据+5 分钟数据，则下载沪深 A 股日线内外盘数据+沪深 A 股 5 分钟线内外盘数据。



登录后快速下载界面

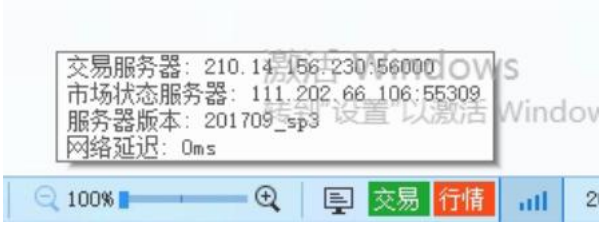
批量下载功能可以在选择指定品种，数据范围和想要下载的数据类型选项后开始下载所选范围内包含的所有数据。



登录后批量下载界面

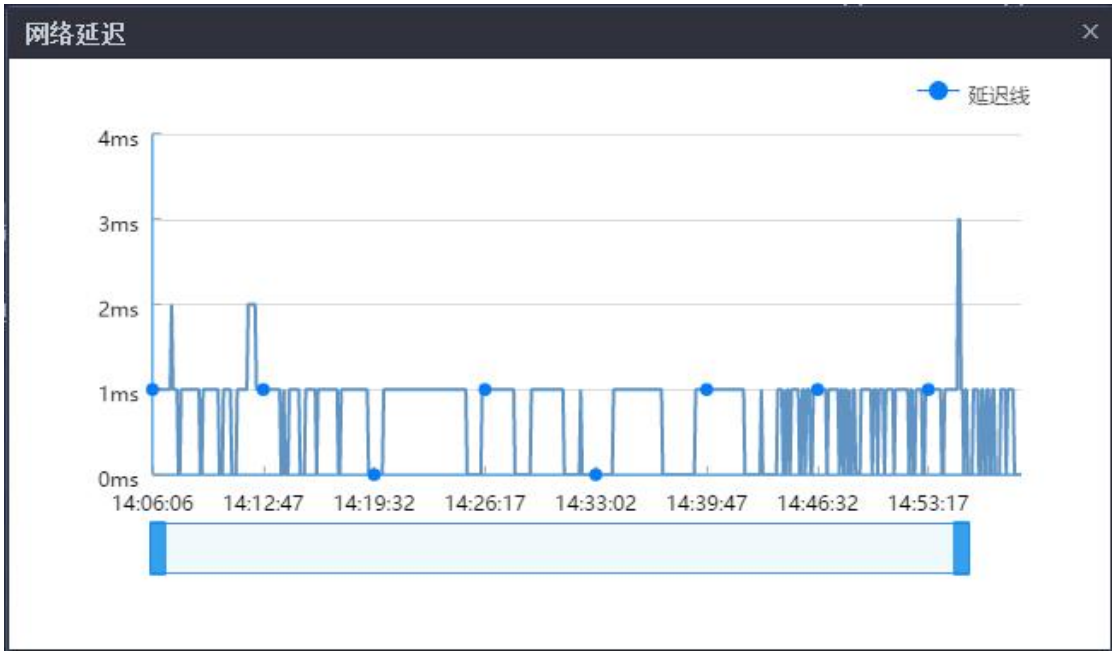
⑪服务器和网络延时：

鼠标悬浮时显示交易服务器和端口及市场状态服务器、端口、服务器版本和网络延迟情况。



查看服务器连接地址端口

鼠标点击时显示网络延迟情况。

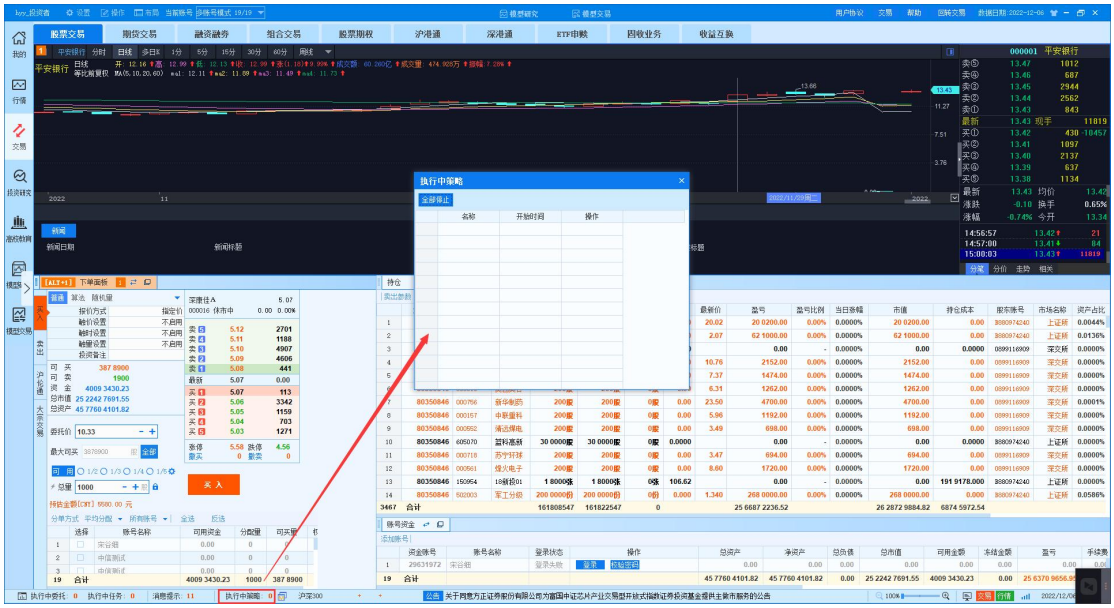


网络延迟

⑫使用网络标准时间：右下角选择时间可选择使用网络标准时间或者本地时间。

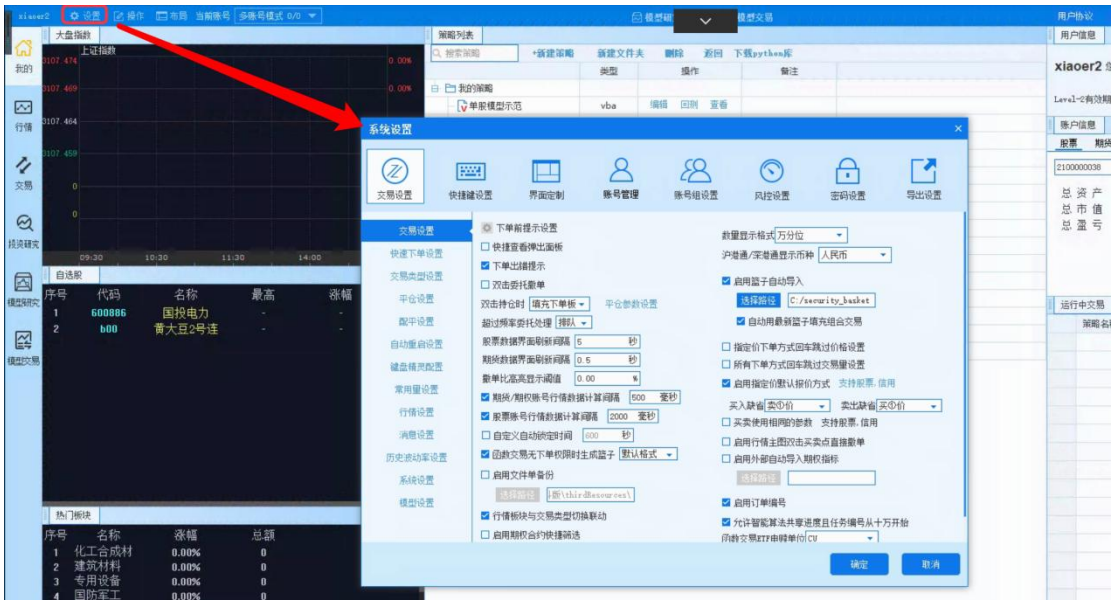
网络标准时间

⑬执行中策略：左下角点击执行中策略，打开执行中策略界面。



3.6.3. 设置

提供交易设置、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、导出设置等。



设置界面

3.6.3.1. 交易设置

交易设置分为以下几部分。

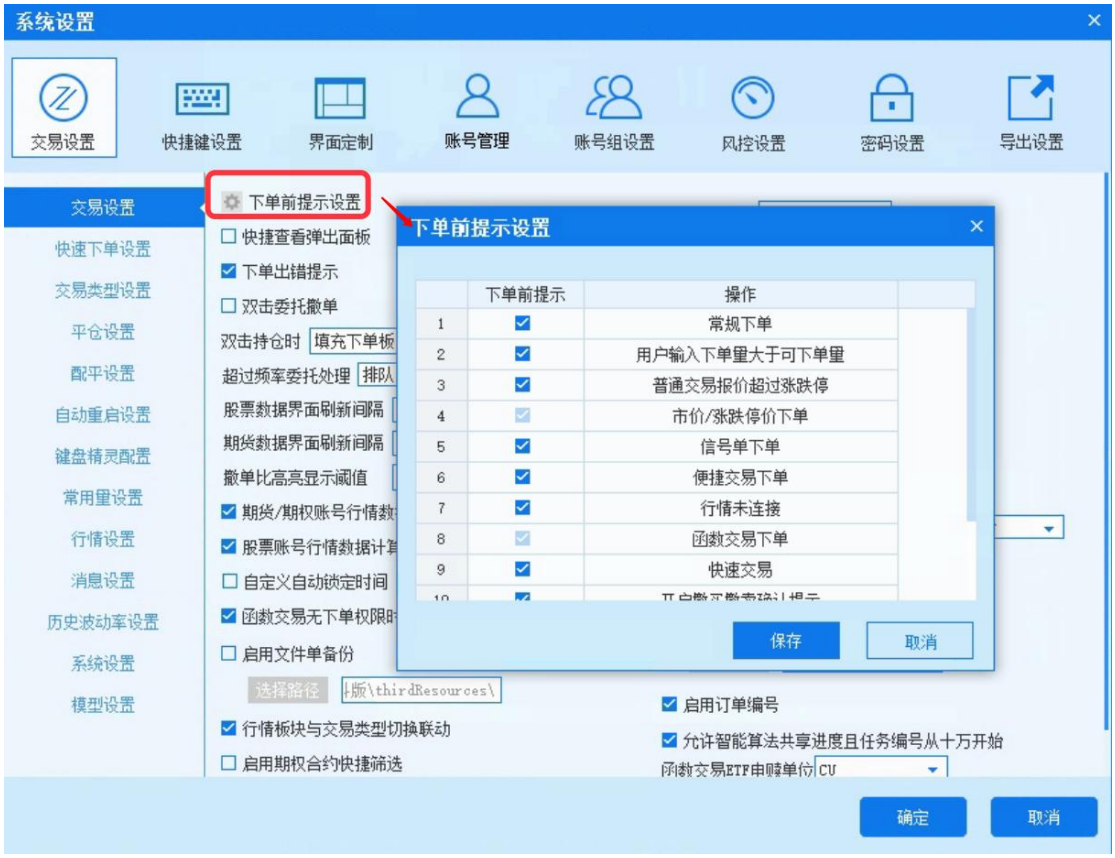
交易设置界面

3.6.3.1.1. 交易设置

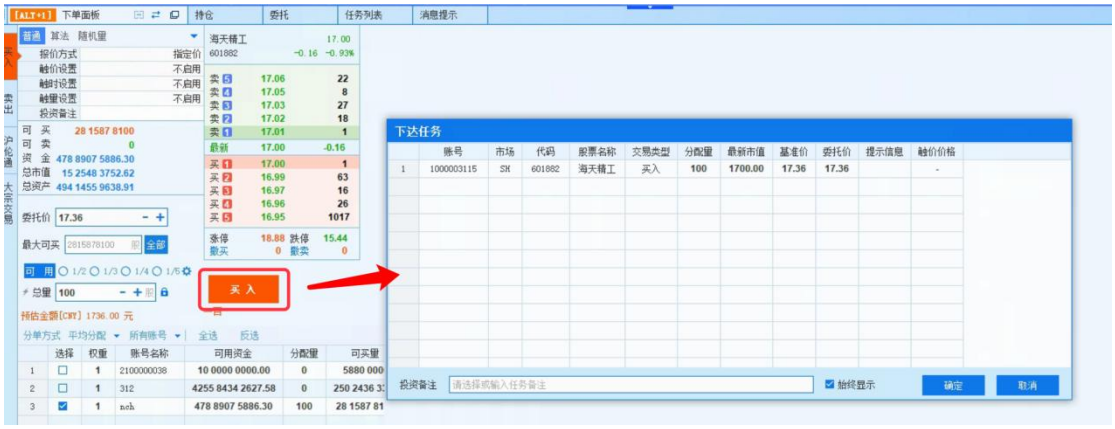
（1）下单前提示

点击

，可选择出现下单提示的情况，下单时会有下达指令的弹框提示。



下单前提示设置选择



下达任务提示

下达任务提示

（2）快捷查看弹出面板

勾选

后，点击执行中委托、执行中任务、重要消息和紧急消息后，可直接弹出相应面板。未勾选该选项时，点击各项后，直接在界面上跳转。

面板弹出

（3）下单出错提示

勾选

，则当下单量不符合规定、在交易时间外进行交易、未选择或登录资金账号、可用资金不足等情况出现时，在客户端右下角会出现报警

信息提示。

报警信息

（4）双击委托撤单

勾选后，双击执行中委托可直接撤单。

（5）双击持仓时填充下单板/直接平仓

设置在当日持仓中双击持仓时直接平仓，或仅填充到下单板。

（6）超过频率委托处理

点击超过频率委托处理下拉框

，显示

，若选择驳回，则超过报单频率的委托进行驳回处理；若选择排队，则超过报单频率的委托进行排队处理。

（7）股票/期货数据界面刷新间隔

设置股票/期货数据界面刷新间隔，交易界面-持仓面板中的股票或期货数据会按照设置每隔一段时间刷新一次。

（8）撤单比高亮显示阈值

设置好阈值，当资金账号面板的报撤单比显示的值大于或等于设置的阈值时会显示红色。当撤单比显示的值小于设置的阈值时，字体显示黑色（适用于股票交易、融资融券、组合交易中的证券交易）。

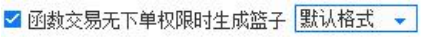
（9）股票/期权账号/期货账号行情数据计算间隔

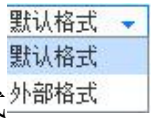
勾选后，柜台会在设置的间隔时间反馈一次数据。

（10）自定义自动锁定时间

自定义锁定时间是为了防止信息泄露。勾选并设置时间，无操作一定时间后客户端自动锁定。

（11）函数交易无下单权限时生成篮子

当勾选 

权限，使用函数交易下单，管理端未开启函数交易下单权限时，所下的单会自动生成篮子保存在本地。可选择保存模式 

。

（12）启用文件单备份

勾选后，便捷交易执行过的文件将备份到指定路径下。

（13）行情板块与交易类型切换联动

勾选后，在交易面板切换交易类型时，上方行情展示部分会根据当前所在交易类型，切换到对应的行情板块。

（14）启用期权合约快捷筛选

勾选后，可以使用期权合约快捷键功能

（15）金额显示格式

金额显示有三种格式，普通、千分位、万分位。各个面板中的金额或者数量会根据不同的格式显示。

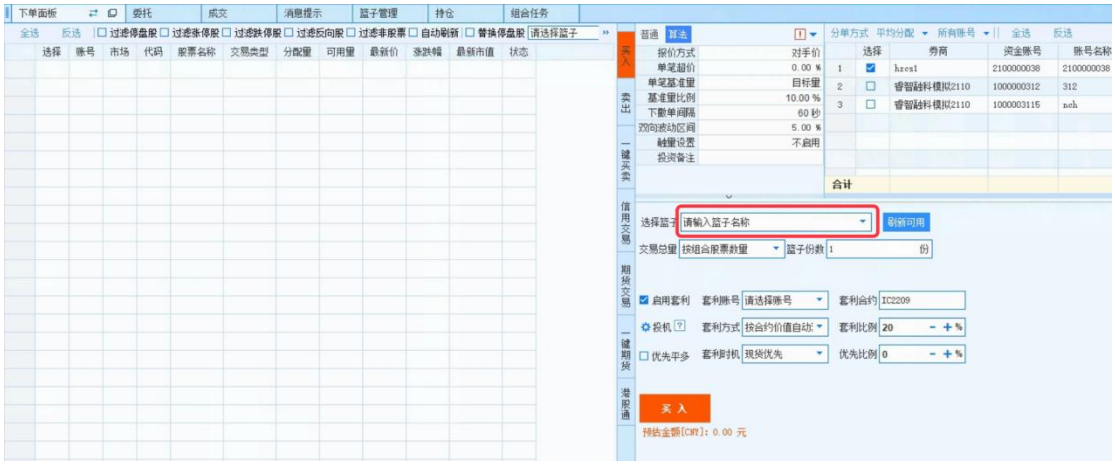
（16）沪港通/深港通显示币种

沪港通/深港通交易可选择货币种类：人民币和港币。

（17）启用篮子自动导入

勾选篮子自动导入并选择路径后，组合交易中的篮子管理内自动导入一栏会将文件夹里的篮子自动导入（股票和期货篮子都支持，仅支持 CSV 文件）。当勾选自动用最新篮子填充组合交易，下单面板中选择篮子选项会自动填入最新的篮子。

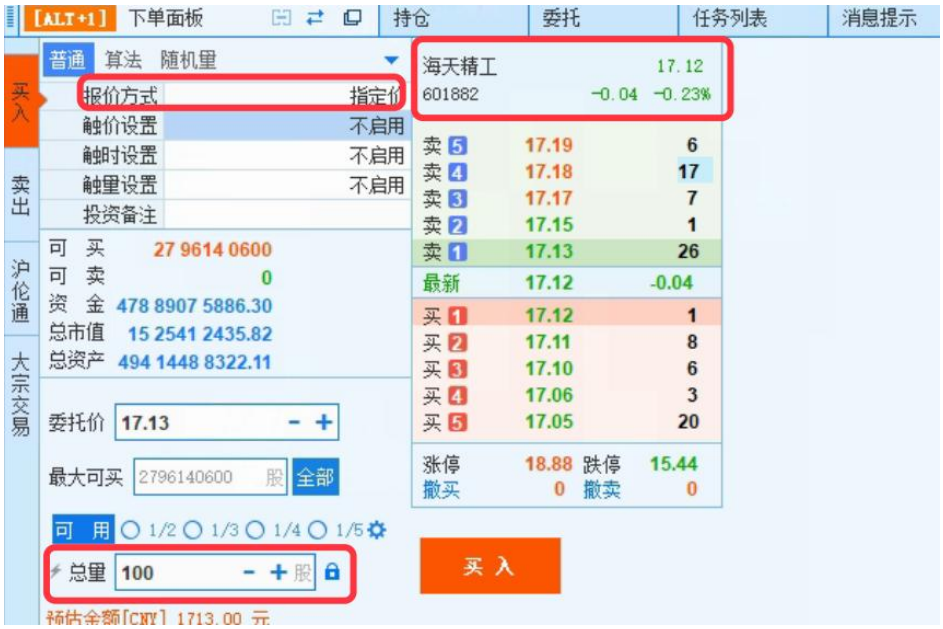
目前自动导入的频率为 1 秒。



启动篮子自动导入

（18）指定价下单方式回车跳过价格设置

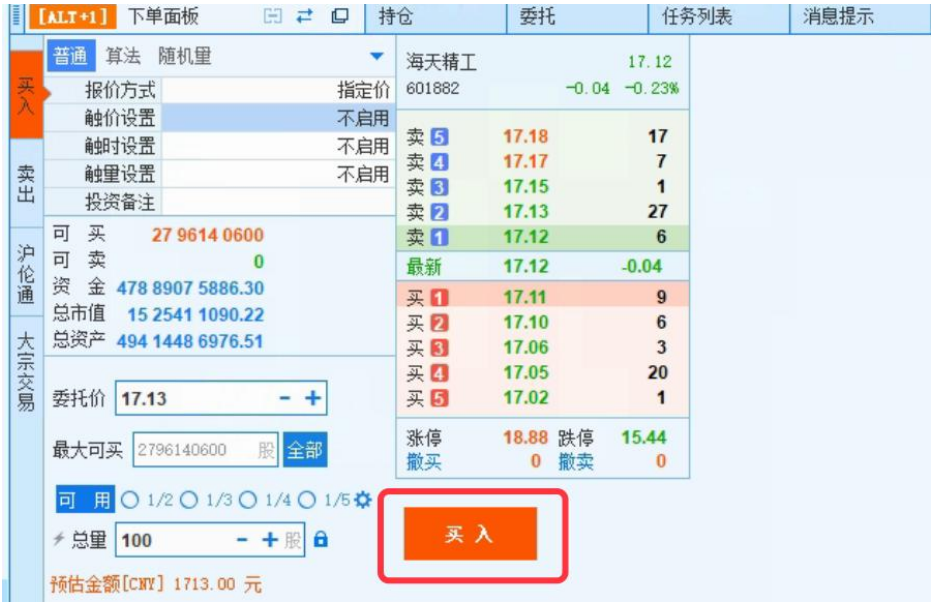
勾选 ☑ 指定价下单方式回车跳过价格设置，报价方式为“指定价”，输入合约代码回车焦点跳到总量；未勾选时，输入合约代码回车焦点跳到委托价。其他报价方式勾不勾选回车后焦点都会跳到总量。



指定价下单方式回车跳过价格设置

（19）所有价格下单方式回车跳过交易量设置

勾选 ☑ 所有下单方式回车跳过交易量设置，报价方式为“指定价”时输入合约后回车后焦点跳到委托价，再回车焦点跳到“买入”按钮上；除“指定价”报单方式，输入合约后，回车焦点跳到“买入”按钮。



所有价格下单方式回车跳过交易量设置

（20）启用指定价默认报价方式

勾选指定价默认报价方式，在指定价下切换股票代码，指定价会按照交易设置中的默认买入缺省和卖出缺省显示。若不勾选指定价默认报价方式，委托价显示上一次的价格。该功能适用于股票和信用。

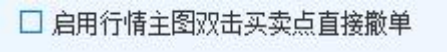
（21）买卖使用相同的参数

不勾选

，在进行买-卖时，修改任意一个报价方式，另一个报价方式不会随之改变。勾选

，修改任意一个报价方式，另一个报价方式会变为与之相同。

（22）启用行情主图双击买卖点直接撤单

勾选 

后，当在分时图显示交易详情时，双击B/S买卖点可直接撤单，不再需要二次确认。

（23）启用外部自动导入期权指标

勾选启用外部自动导入期权指标，选择路径后可把需要导入的期权指标数据文件放到相应路径下，系统会每隔一段时间扫描路径下文件并导入展示在期权T型板中，详情见3.3.2.5.8.外部导入希腊值。

启用外部自动导入期权指标

（24）启用订单编号

勾选后启用订单编号功能。订单编号是迅投 QMT 系统为提升系统的交易速度推出的一项重大功能改进。使用订单编号功能可以显著地降低系统的穿透时延。

订单编号的工作原理如下：

客户端向 QMT 的服务发起委托时，QMT 的服务立即生成一个唯一的订单编号，并推送给客户端。服务端随后继续向柜台发起报单操作。客户端接收到订单编号主推后，会生成一条合同编号为空的委托，量化系统可以用这条委托来确认单子已经报送成功，并且可以用订单编号来发起撤单操作。后续有委托和成交更新时，对应的委托和成交都会带上正确的订单编号，确保 QMT 客户端和外围程序都能正确匹配订单信息。在实现的过程中，我们已经充分考虑了各种时序问题，确保订单编号在不同的时序下都能按照上述说明正确工作。

只有服务器和客户端均支持订单编号功能时，用户才能正常使用订单编号功能。当服务已经升级，但继续使用老版本客户端时，客户端不会受到订单编号功能的影响。

股票交易，融资融券，组合交易和 ETF 申赎的委托面板和成交面板中新增订单编号字段。

用户在使用便捷交易、批量埋单、策略交易时，可使用订单编号撤单。

（25）允许智能算法共享进度且任务编号从十万开始

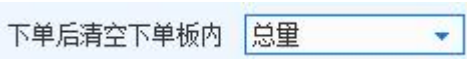
勾选后，同一用户在不同机器使用智能算法下单时，其智能算法任务可在多终端共享，共享到其他终端时，任务编号由十万开始累加。

（26）允许 load_stk_list 函数重命名文件

勾选

，允许使用 load_stk_list 函数重命名文件

（27）下单后清空下单板内

点击下单后清空下单板内下拉框 

，显示

，若勾选后选择总量，下单后自动清空下单面板内的总量。

（28）港股通持仓显示使用汇率

港股通持仓可选择使用汇率：中间汇率、买入参考汇率和卖出参考汇率。

（29）期权合约虚度值阈值

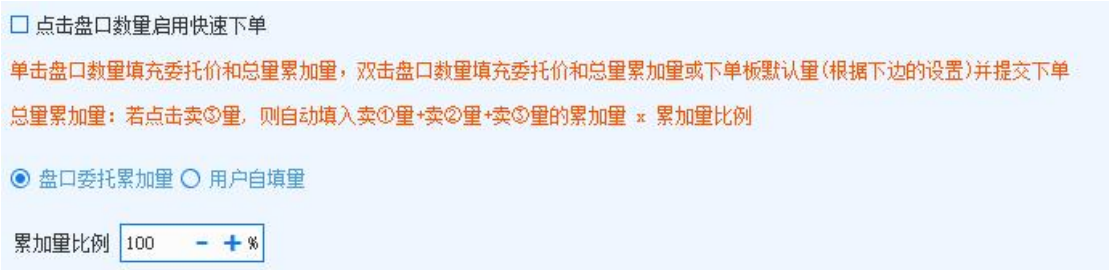
设置期权合约虚度值阈值

后，小于设置虚度值不提醒，大于虚度值会提醒大于设定值，是否继续下单。

期权合约虚度值阈值默认大于 10%提醒，不能设置大于 100%的值，可以设置负值。

3.6.3.1.2. 快速下单设置

如图，支持点击盘口数量快速下单功能。



3.6.3.1.3. 交易类型设置

可以设置各个交易类型在交易类型菜单栏中是否显示。设置后需要重新启动客户端才能生效。

交易类型设置

3.6.3.1.4. 平仓设置

可以设置各种交易类型的平仓参数。勾选双击持仓平仓时，平仓的参数按照平仓设置的参数进行。

平仓设置

3.6.3.1.5. 配平设置

可以设置使用增强交易智能回转策略时的配平参数。

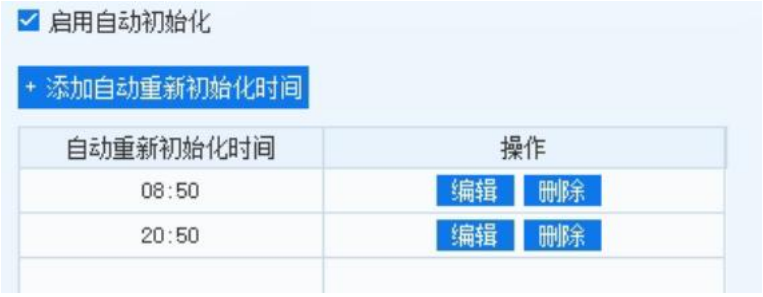
配平设置

3.6.3.1.6. 自动重启设置

①启用开机自动启动：当电脑开机时，客户端会自动启动，输入用户名密码即可登录。

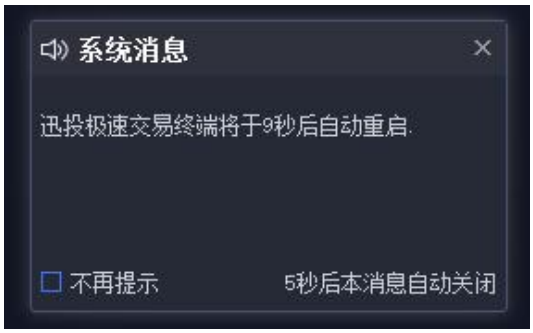
启用开机自动重启

②启用自动重启：自动重启功能则是用户可设定不同的时间重启客户端。勾选“启用自动重启”后，才可添加、编辑和删除设定的时间。勾选后确定，设置的重启时间生效，到了设定的时间客户端会自动重启。若未勾选“启用自动重启”，设定的重启时间则会失效，客户端不会自动重启。



自动重启设置界面

启用自动重启后，客户端会在该时间自动关闭和重启。系统关闭的前 10 秒，消息提示和页面右下角会弹出关于重启客户端的提示。



自动重启消息提示

3.6.3.1.7. 键盘精灵配置

键盘精灵可监控键盘操作。当焦点在行情界面时，键盘精灵支持输入数字和拼音快捷搜索代码。可自定义为不同的分类设置选择是否启用键盘精灵。不启用时，键盘精灵无法查询到该分类下的代码。

键盘精灵配置

键盘精灵

3.6.3.1.8. 常用量设置

3.6.3.1.8.1. 常用量设置

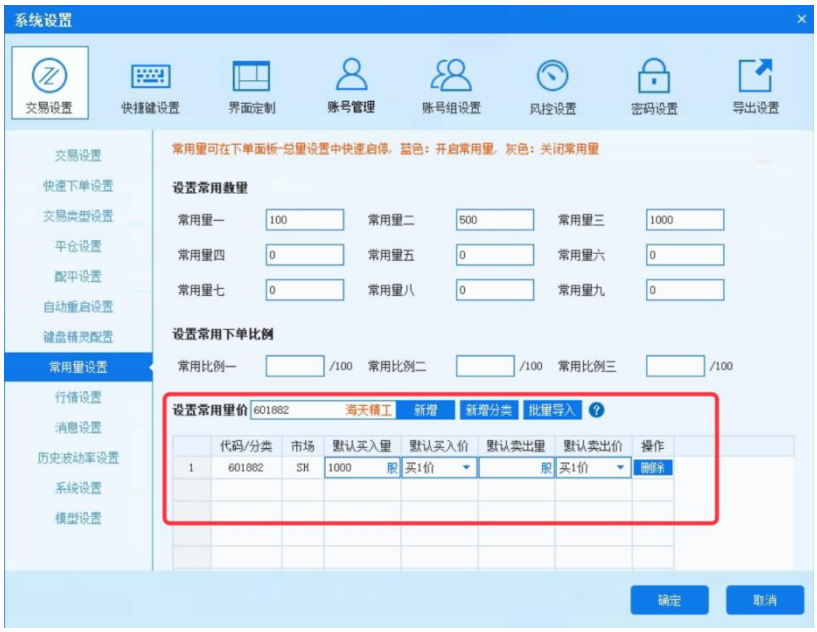
可为输入下单总量提供快捷选择。在常用量一～常用量九中输入具体的数值，点击确定保存设置。

常用量设置

②点击【下单面板】“总量”前的变为状态，表示开启常用量设置。点击总量输入框，显示设置的所有常用量，点击其中的某个常用量可以自动将该常用量输入到总量输入框中。

使用常用量

3.6.3.1.8.2. 设置常用量价

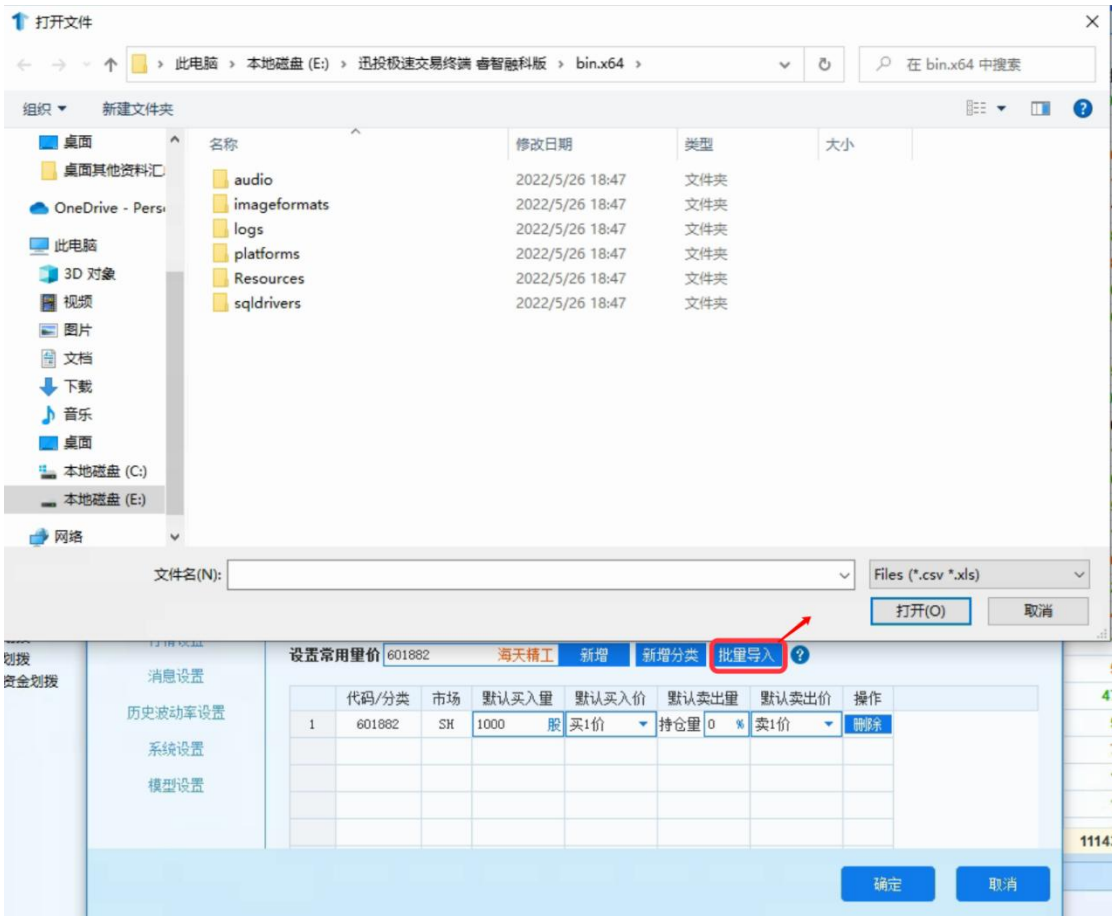


常用量设置中，新增“设置常用量价”，支持针对代码设置默认量价，此处维护常用量价并开启常用量设置（点击【下单面板】“总量”前的变为状态）时，输入代码即自动填充量价：

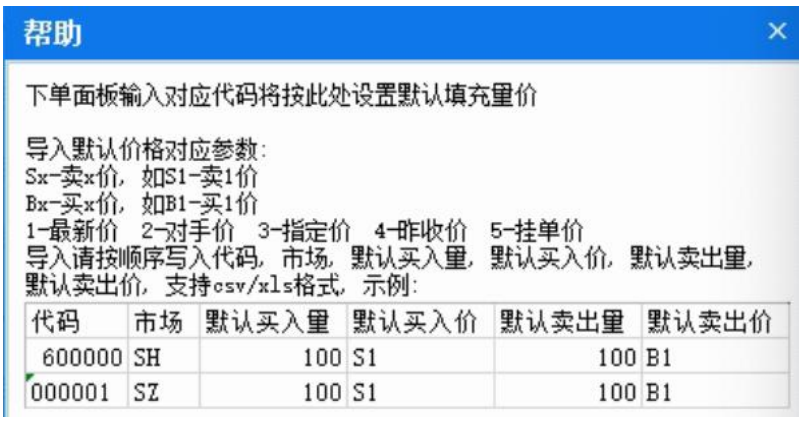
输入代码点击新增即可往下新增一条数据，量可点击输入、价可点击选择，操作中可删除。

量支持两种设置方式：1.固定数量；2.持仓量的百分比。输入框中点击单位切换。

点击批量导入可批量导入常用量价：



导入规则：



帮助

下单面板输入对应代码将按此处设置默认填充量价

导入默认价格对应参数:
Sx-卖x价，如S1-卖1价
Bx-买x价，如B1-买1价
1-最新价 2-对手价 3-指定价 4-昨收价 5-挂单价
导入请按顺序写入代码，市场，默认买入量，默认买入价，默认卖出量，默认卖出价，支持csv/xls格式，示例:

代码	市场	默认买入量	默认买入价	默认卖出量	默认卖出价
600000	SH	100	S1	100	B1
000001	SZ	100	S1	100	B1

常用量价支持针对分类设置默认量价，分类默认量价优先级低于单票默认量价。

*备注：总量输入框前有⚡符号的，才支持常用量功能。

3.6.3.1.9. 行情设置

在行情设置中对各分析周期的参数进行设置后，在行情界面中右键单击鼠标选择多日线、多小时线和多分钟线等 K 线种类时，其周期与所设置的参数相匹配。

行情设置

未勾选 ☐ 分笔图查看本地所有分笔数据 时，只能显现当天的分笔数据，即使补充完成历史分笔数据也不能查看。

分笔图只查看当日数据

勾选此功能后，可以查看所有的保存在本地的历史分笔数据。

分笔图查看本地所有分笔数据

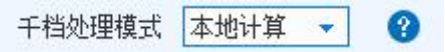
未勾选 ☐ 更换周期时固定副图指标 时，更换周期时副图指标不固定，会被取消。勾选后，更换周期时副图指标固定不取消。

副图指标

未勾选 ☐ 切换股票代码时固定副图指标 时，切换股票代码时副图指标不固定，会被取消。勾选后，切换股票代码副图指标固定不取消。

勾选 ☑ 监视剪贴板(证券智能输入) 启用监视剪贴板后，当系统监视到剪贴板中有股票代码或股票名称后，会自动弹出“智能输入”框。

智能输入提示框

千档处理模式 

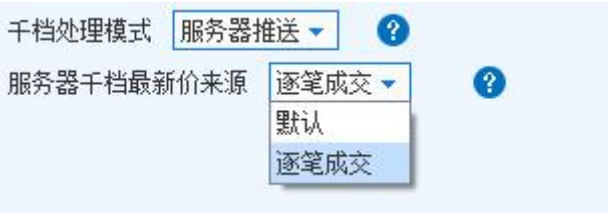
有两种模式

服务器推送和本地计算。千档处理模式选择本地计算，沪市 L2 极速十档和千档模式不再显示，只能看普通十档。本地计算模式只支持深圳市场。

服务器千档最新价来源

。千档处理模式选择本地计算，服务器千档最新价来源置灰不生效。千档处理模式选择服务器推送，服务器千档最新价来源可以点开下拉框选择，选择默认，千档最新价正常显示，选择逐笔成交，最新价来源方式与逐笔成交一致。

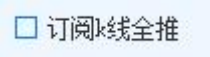
千档处理模式-本地计算



千档处理模式-服务器推送

勾选全推行情数据存盘

后，全推行情数据会保存到本地quoter文件夹下，不勾选全推行情数据存盘，全推行情数据不会保存到本地。

勾选订阅k线全推 

后，K线按全推方式订阅，不勾选订阅k线全推，K线按单股订阅模式订阅。

3.6.3.1.10. 消息设置

在消息设置中，可以对系统消息、交易消息、行情消息、风控消息、报警消息、成交消息、模型消息、站内消息、身份证过期提醒、用户到期提醒、转账消息、适当性校验消息、预埋单执行日志进行面板显示、声音提示、弹框提示和停留时间的设置。

消息设置

3.6.3.1.11. 历史波动率设置

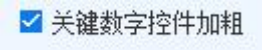
对期权合约的历史波动率设置。

历史波动率设置

勾选“是否使用自定义”，即可对历史波动率进行手动编辑，自定义历史波动率数值，则 T 型板中希腊值计算时取自定义的历史波动率进行计算；取消勾选“是否使用自定义”，则 T 型板中希腊值计算时取行情获取的历史波动率数值进行计算。T 型板中历史波动率不跟随是否自定义变化，取自行情数据。

3.6.3.1.12. 系统设置

系统设置

勾选 

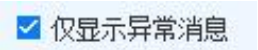
，可将系统中部分交易面板中的数字字段加粗。

勾选

，管理终端进行了预留信息设置，登录交易终端时将提示管理终端设置的预留消息。

勾选

，客户端右下角出现上次登录信息提示；未勾选重新登录客户端不会显示。

勾选 

，勾选客户端仅显示异常信息；不勾选则显示【消息设置】里面设置的信息。

3.6.3.1.13. 模型设置

模型设置

客户端对 Python 库的下载以及路径的选择的设置。在使用 python 模型功能时，需首先下载 python 库。当后续 python 库有更新时，会在用户在登录时提示。

3.6.3.2. 快捷键设置

对不同交易类型自定义设置快捷键，设置后，需要勾选启用快捷键，才会启用。

快捷键设置

当勾选

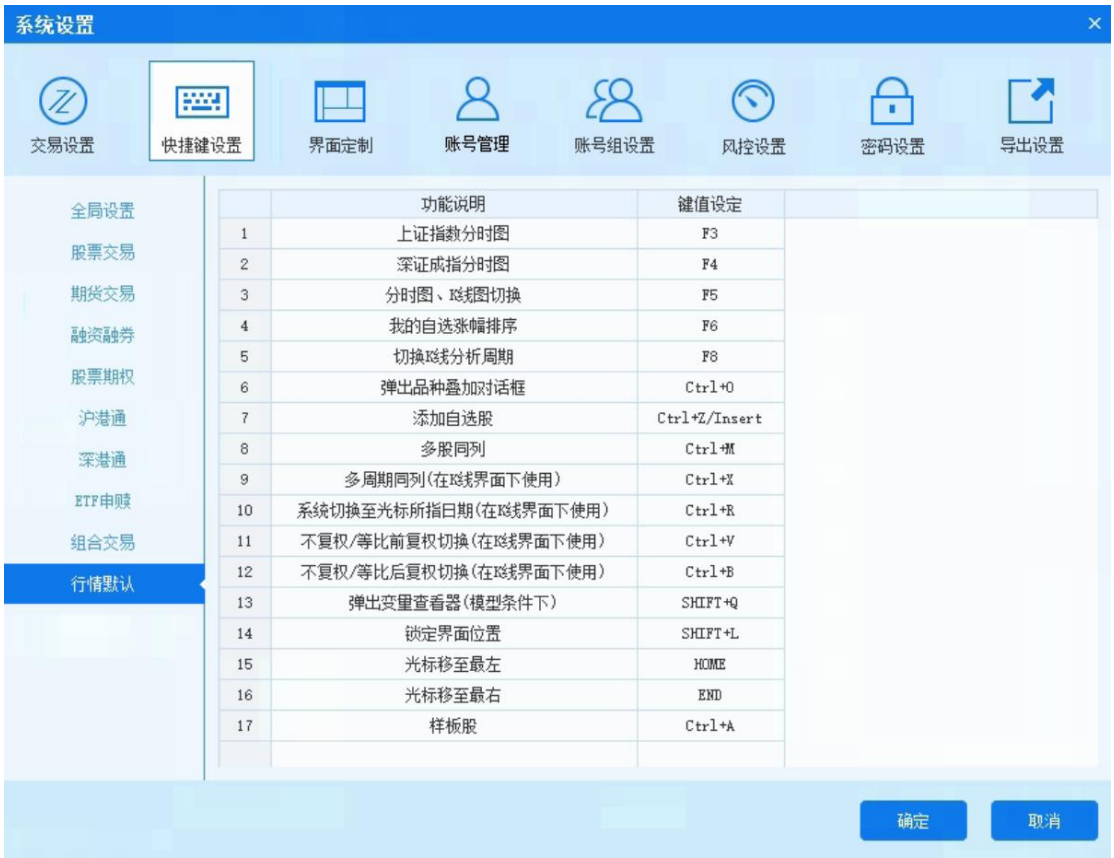
，可对多个下单面板进行快捷键（Alt+数字）定位。

多下单面板

此时焦点在面板 1 上，使用快捷键 Alt+2，焦点转到面板 2。

Alt+数字切换下单面板

行情的快捷键是默认的，无法对其修改。

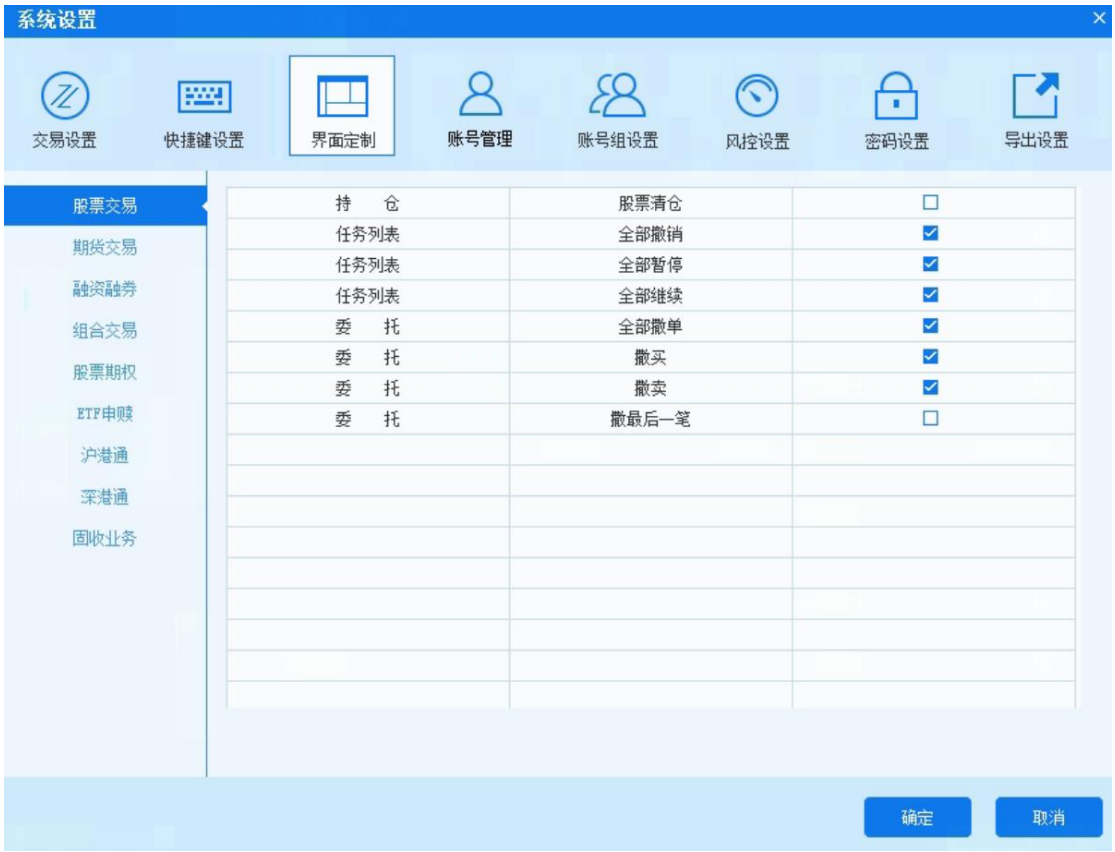


	功能说明	键值设定
1	上证指数分时图	F3
2	深证成指分时图	F4
3	分时图、K线图切换	F5
4	我的自选涨幅排序	F6
5	切换K线分析周期	F8
6	弹出品种叠加对话框	Ctrl+O
7	添加自选股	Ctrl+Z/Insert
8	多股同列	Ctrl+M
9	多周期同列(在K线界面下使用)	Ctrl+X
10	系统切换至光标所指日期(在K线界面下使用)	Ctrl+R
11	不复权/等比前复权切换(在K线界面下使用)	Ctrl+V
12	不复权/等比后复权切换(在K线界面下使用)	Ctrl+B
13	弹出变量查看器(模型条件下)	SHIFT+Q
14	锁定界面位置	SHIFT+L
15	光标移至最左	HOME
16	光标移至最右	END
17	样板股	Ctrl+A

行情快捷键

3.6.3.3. 界面定制

自定义选择不同交易类型不同交易界面是否显示该功能界面功能名称。



界面定制

例如，股票交易中，未勾选和勾选持仓中的股票清仓功能显示结果如下图：

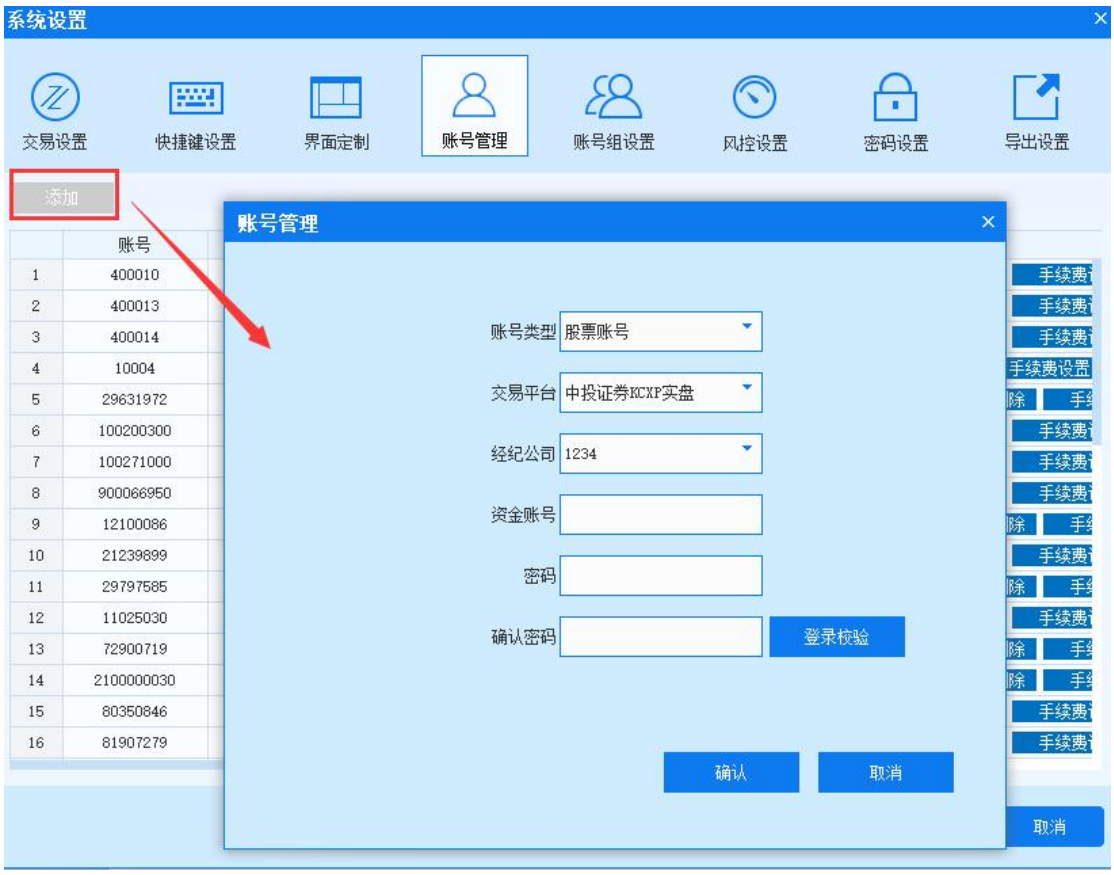
无勾选股票清仓功能键

勾选股票清仓

3.6.3.4. 账号管理

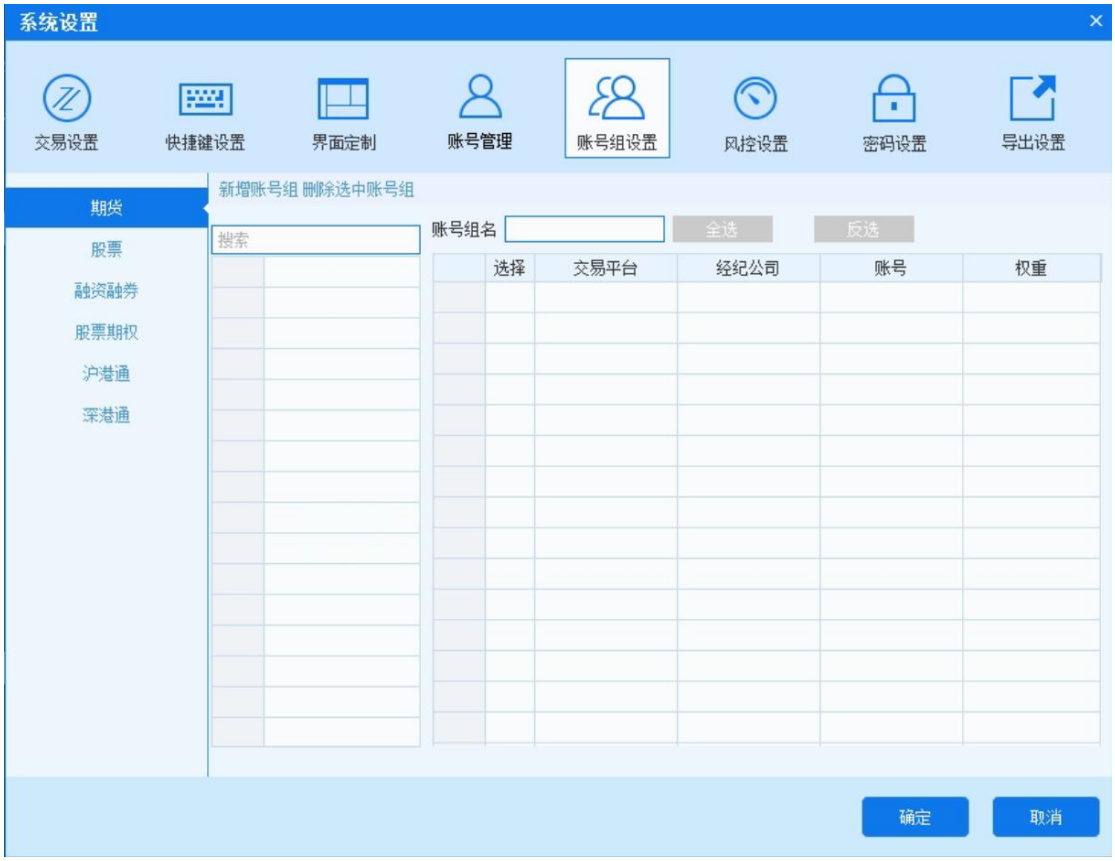
显示当前用户已添加的所有账号，可以对账号进行启用（停用）、删除、手续费设置、修改交易密码、修改资金密码操作。

可以进行账号添加操作。输入账号类型、交易平台、经纪公司、资金账号、密码、确认密码后，点击登陆校验，校验成功后点击确认，账号添加成功。



3.6.3.5. 账号组设置

方便用户进行多个账号委托，提供证券、期货、融资融券、股票期权、沪港通、深港通账号分组、组内账号的默认交易权重等设置，通过选择账号，快速建立相应的账号组，配合多种分单策略，实现多个账号的批量交易。



账号组设置

添加完成的账号组在分单方式的账号选择中作为选项出现，可选择相应账号组分单。

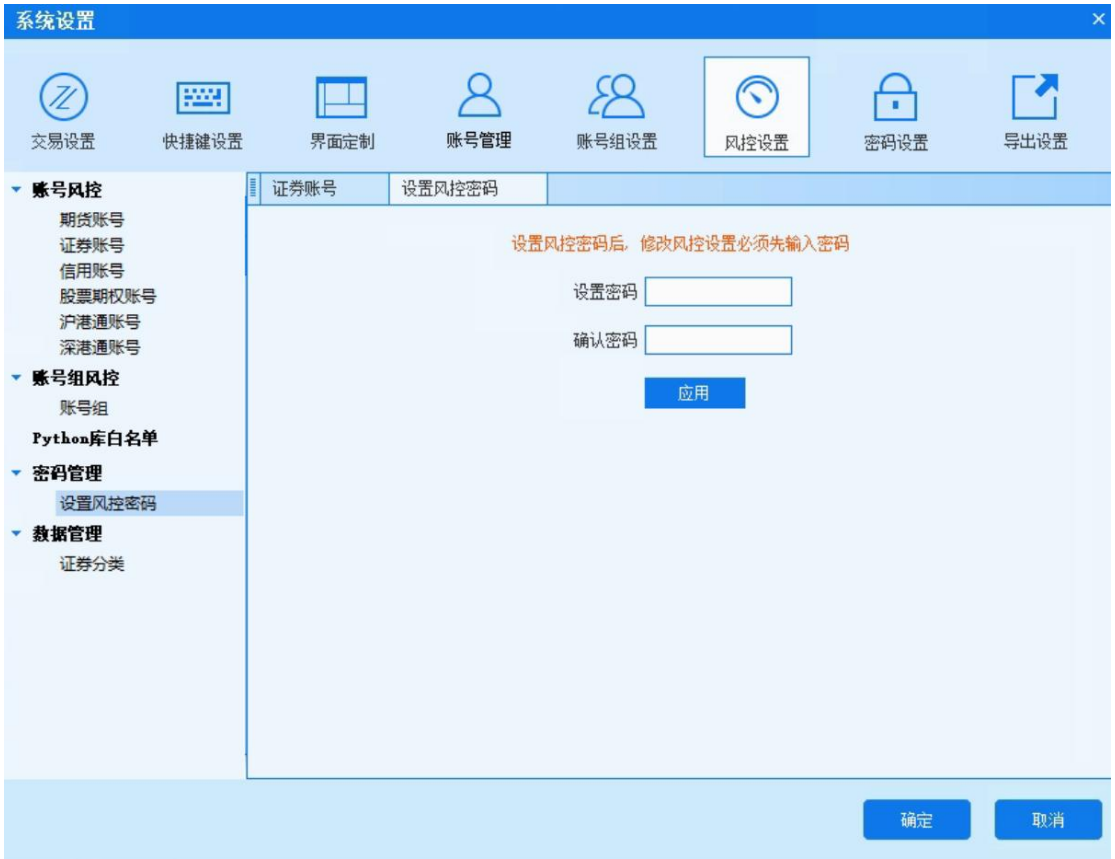
下单面板选择账号组

3.6.3.6. 风控设置

风控是迅投 QMT 极速策略交易系统中一个相当重要的部分，采用了多层次并行风控的处理方式，可以对单一帐号、多个帐号分别同时进行不同规则的风控检查，大幅降低交易延迟、提高风控执行效率。风控逻辑严格准确，若任何一条不符合，立即返回相应的结果，确保资产管理业务安全至上。

风控主要分为事前、事中、事后三种类型。事前风控包含了交易合规检查、仓位检查、交易限制检查、资产占比检查、到期合约提醒等；事中风控包含实时计算无延迟、盘中异常交易监控；事后风控包含交易数据自动同步、预警提示、全部交易数据留痕。其主要作用就是实时监控委托以及整个系统当前的状况是否违反了在风控系统中设置的规则，并根据风控设置进行相应的处理。

风控在功能上主要分为风控设置和风控查询两部分，风控设置完成后，通过上传云配置将风控设置信息传送到云端，用户可通过下载配置查询风控信息。如果设置风控密码后，修改风控设置必须先输入密码。

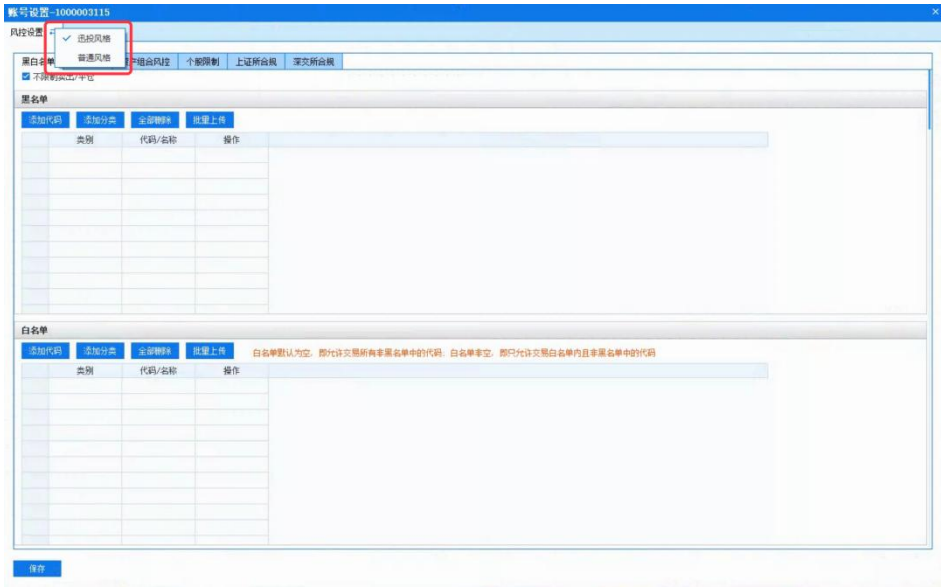


风控设置

风控设置中可设置账号风控、账号组风控、Pyhotn 库白名单、设置风控密码、查看证券分类，在管理端可以设置全局风控。

风控设置

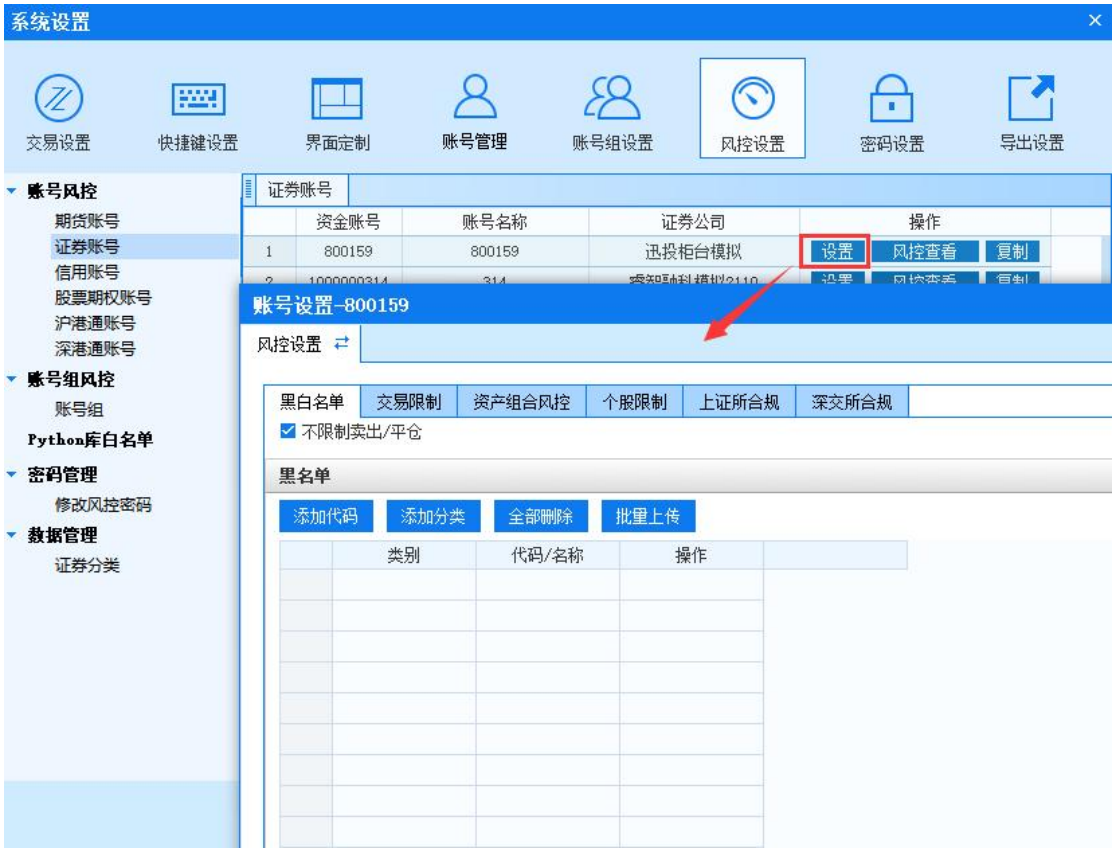
交易端账号风控和账号组风控可选择两种风格进行设置，普通风格和迅投风格。普通风格提供直观的风控设置方式，迅投风格提供丰富多样的风控设置方式。



风控两种显示风格设置

3.6.3.6.1. 账号风控

账号列表中展示所有已被添加的账号，在操作列中点击设置按钮进行账号风控设置。账号风控设置分为黑白名单、交易限制、资产组合风控、个股限制和交易所合规。



账号风控

（1）黑白名单

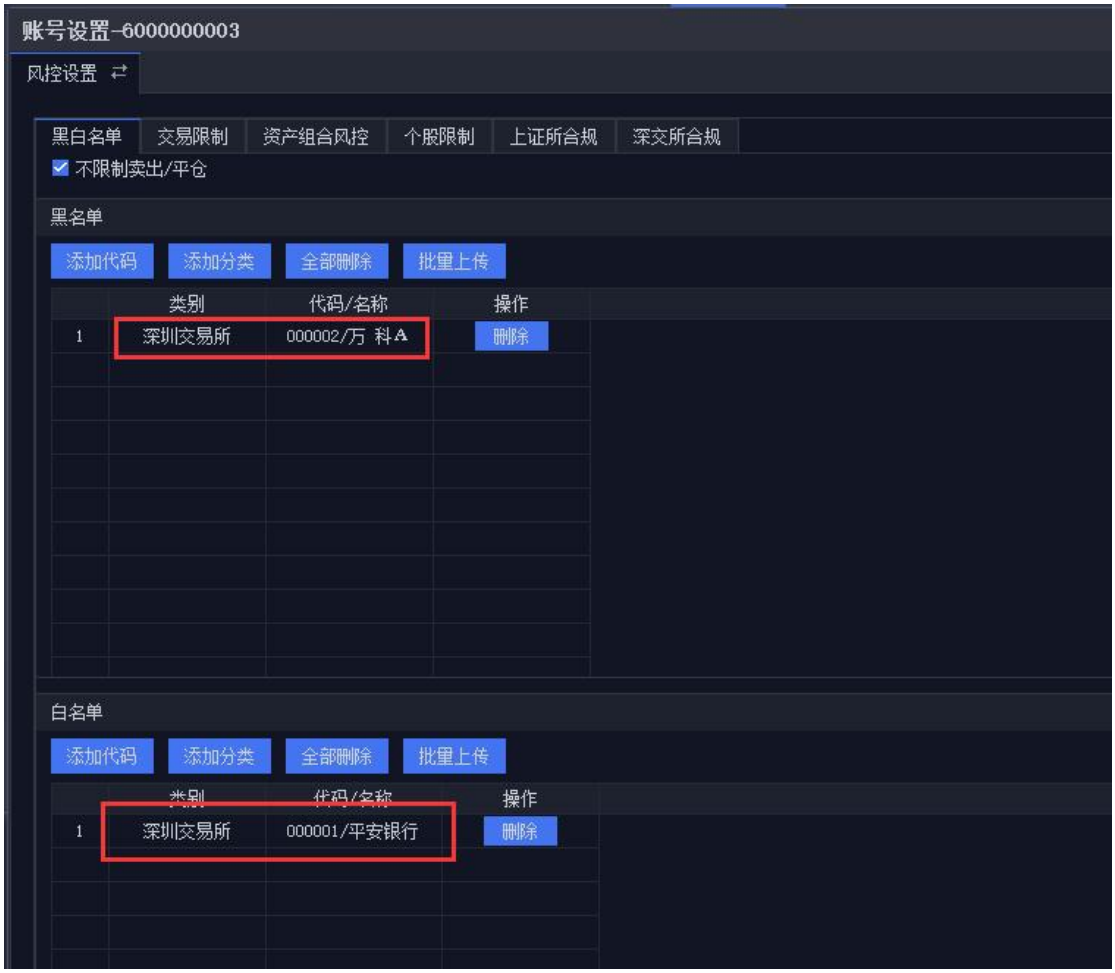
账号黑白名单可以在下单前对证券和期货交易进行设置，属于事前风控。“黑名单”中的代码或分类被禁止交易，“白名单”中的代码或分类允许参与交易。

如果没有设置黑白名单，默认所有证券都为白名单。

如果黑、白名单都设置，且黑、白名单之间不存在交集，那么除了白名单外都属于黑名单；如果黑、白名单都设置，且黑、白名单存在交集，白名单为白名单除了黑、白名单交集的部分，其它为黑名单。只设置黑名单，不设置白名单，属于黑名单模式--黑名单以内的禁止交易。只设置白名单，不设置黑名单，属于白名单模式--白名单以内的允许交易。

同一代码、分类不能既存在于黑名单又存在于白名单。当勾选不限制卖出/平仓，黑名单中的股票代码可以卖出，黑名单中的期货合约可以平仓。黑白名单的普通风格和迅投风格样式一致。

例如，设置 000002 万科 A 为黑名单，000001 平安银行为白名单。



证券账号黑白名单

风控触发

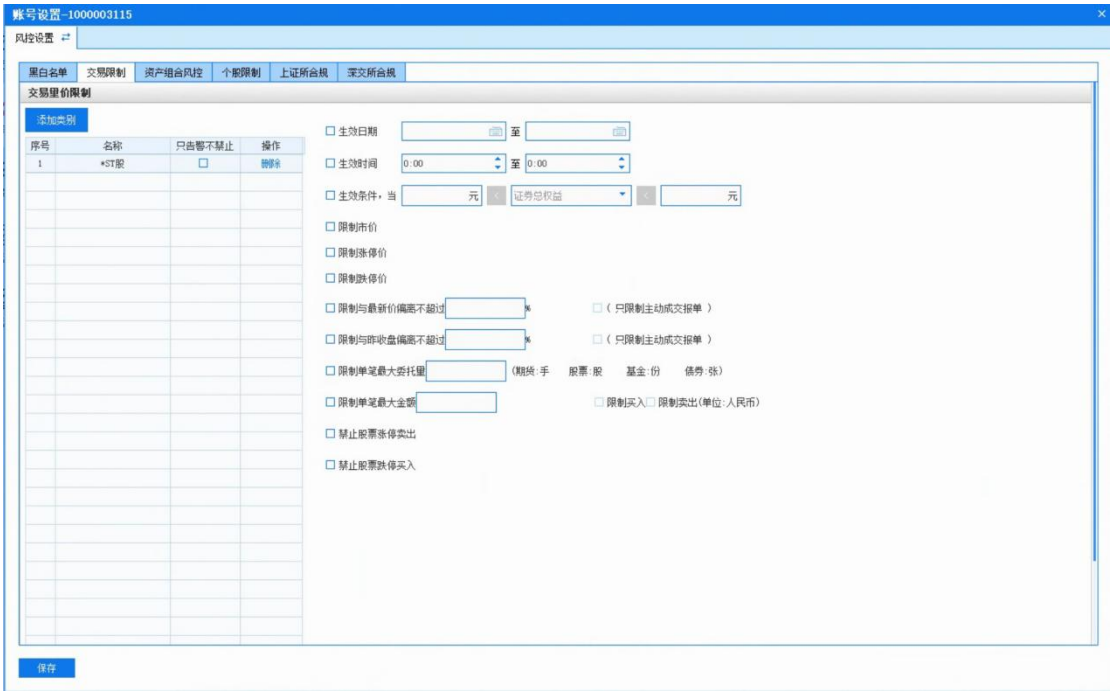
（2）交易限制

QMT 系统提供对证券、期货、信用、深港通和沪港通交易的交易量价限制，对股票期权提供交易量价限制和交易价格限制。交易量价限制可以对证券、期货等添加不同分类的代码，设置交易量价限制后超过限制下单会被风控驳回。

交易量价可以设置生效时间、生效日期和生效条件。交易量价限制包含对市价、涨停价、跌停价、与最新价偏离超过设置百分比、与昨日收盘价偏离超过设置百分比、单笔最大委托量、单笔最大金额的限制，禁止股票涨停卖出，禁止股

票跌停买入。

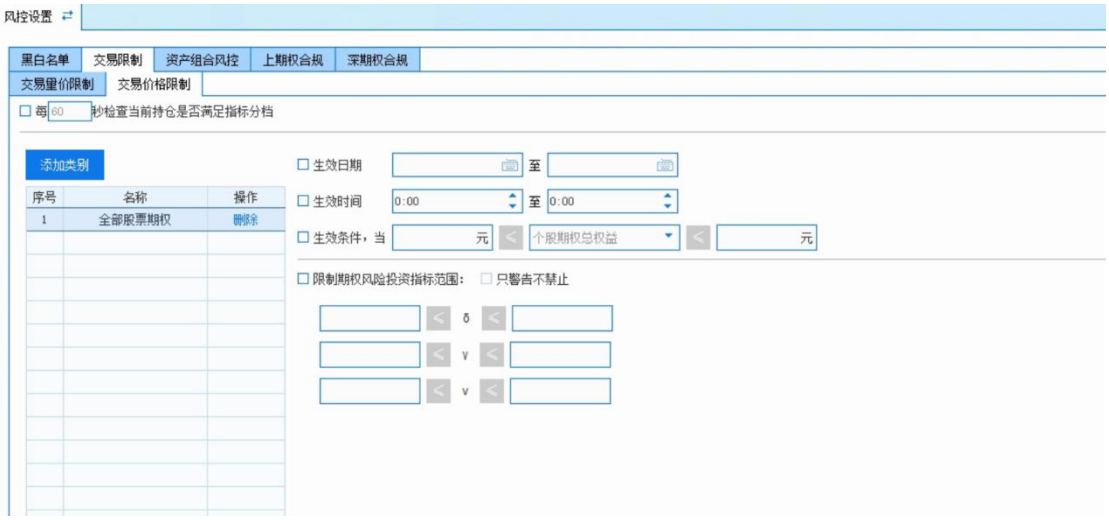
例如：设置单笔最大金额是 200，则每笔下单金额超过 200 会被风控驳回。



交易量价限制

风控触发

股票期权的交易价格限制是针对期权的希腊值指标 δ、γ、ν 的限制，超过限制下单会被风控驳回。黑白名单的普通风格和迅投风格样式基本一致。

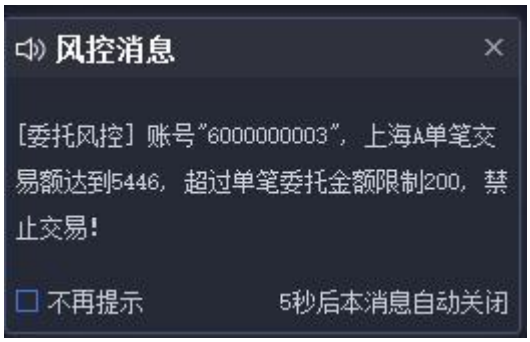


股票期权交易价格限制

风控触发

当勾选

时，再次对其下单，仅会出现告警，但不禁止。告警信息如图。

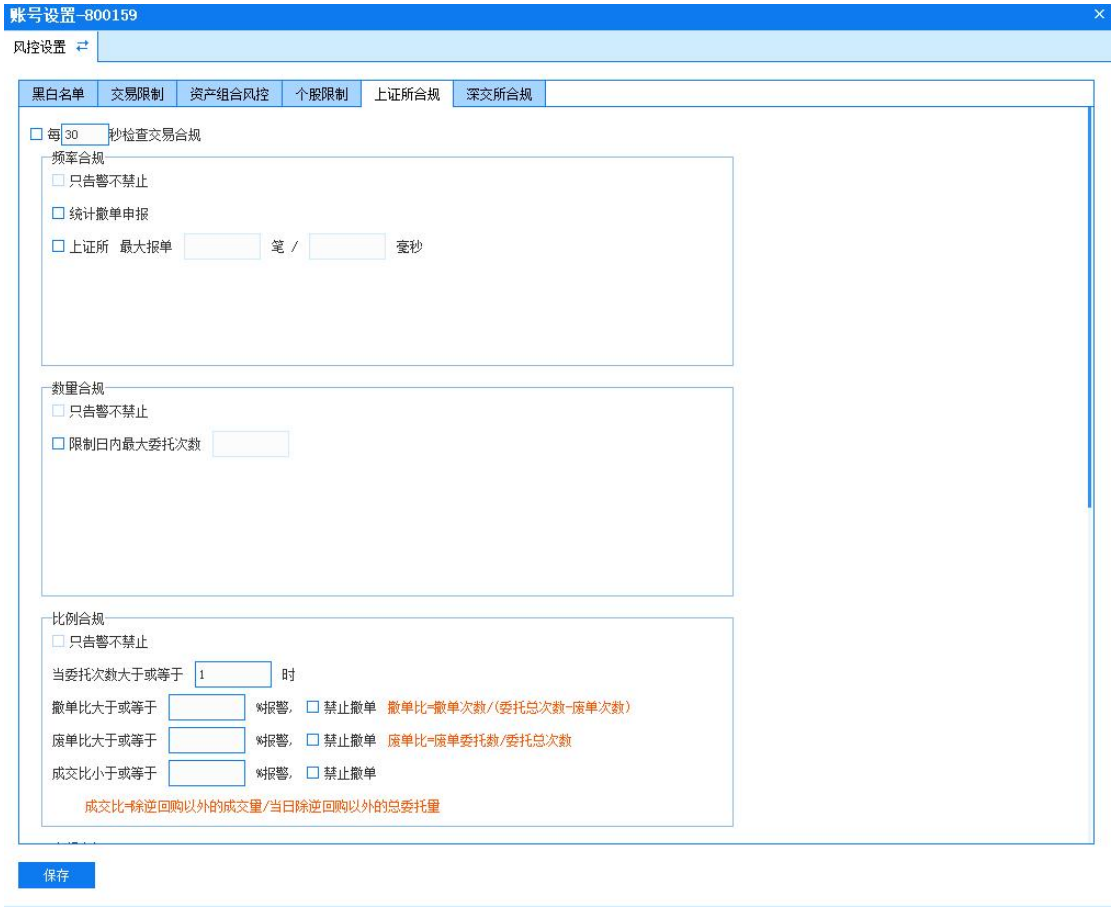


告警提示

（3）交易合规

设置账号的交易合规是为了控制单个资金账号的交易风险。其中证券帐号包含频率合规、数量合规、比例合规、增强频率合规，信用账号交易合规包含频率合规、数量合规、比例合规、金额合规，股票期权包含频率合规、数量合规、比

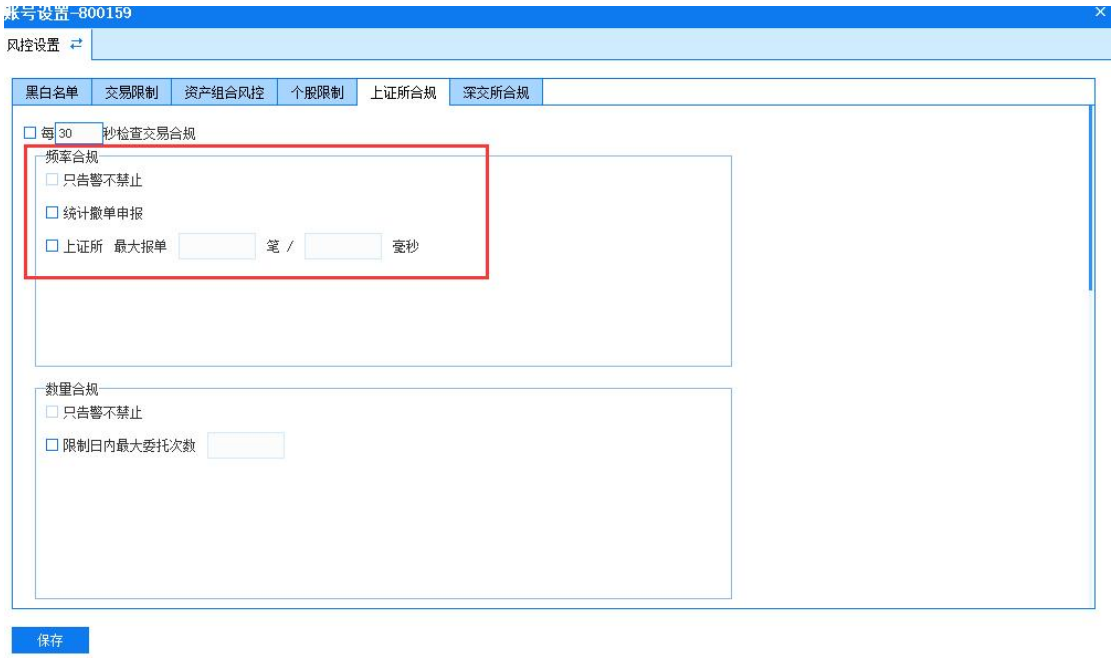
例合规、增强频率合规和行为合规。期货账号交易合规包含频率合规和数量合规。沪港通账号和深港通账号交易合规包含频率合规。



交易合规

①频率合规

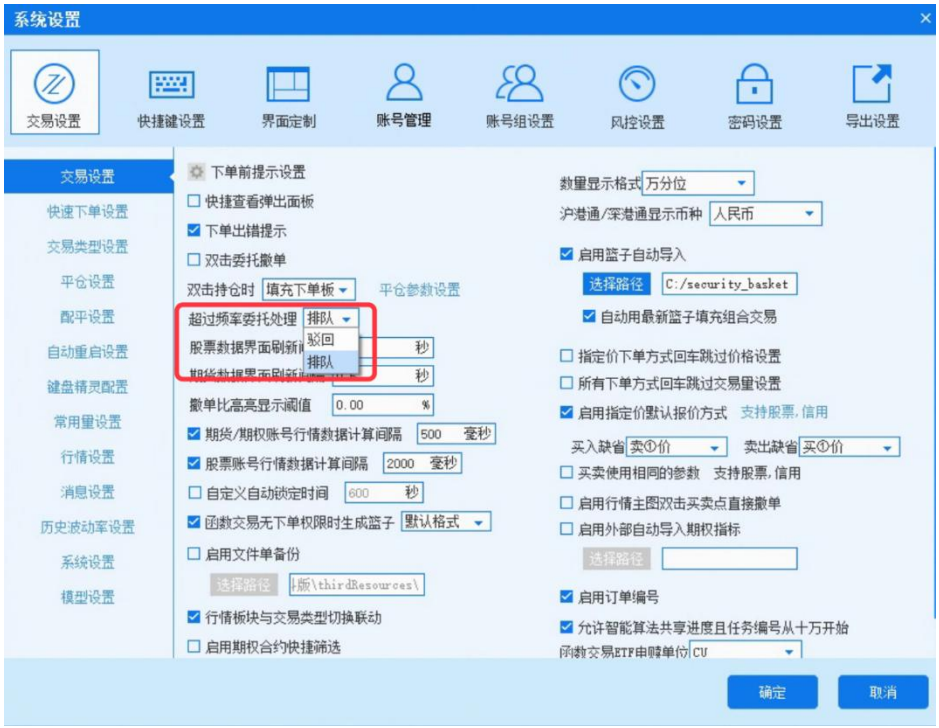
对上交所和深交所的报单频率限制。



交易合规-频率合规

风控触发

客户端系统设置交易设置中可以选择超过频率委托处理方式，设置为“排队”，当报单频率超过了设置的频率合规时会延迟报单，待时间过后再排队进行报单；设置为“驳回”，当报单频率超过了设置的频率合规时指令会被驳回。



超出频率委托设置

②数量合规

限制当日的最大委托次数，证券限制的是该帐号当日的所有委托，期货可以分别限制不同品种的委托次数、撤单次数、持仓量，支持投机、套利、套保。

例如限制委托次数：

交易合规-数量合规

风控触发

③比例合规

比例合规是针对当日撤单、委托、成交的限制，具体分为撤单比、废单比、成交比限制。下单后达到限制的指令会被风控驳回。若设置轮询时间，每次轮询时若检查到到撤单比、废单比、成交比达到所设置的比例，将会报风控轮询消息，当前执行中的任务会暂停。

例如限制成交比：

交易合规-比例合规

风控触发

④金额合规

金额合规是针对当日净买入金额的限制，如果当日净买入金额超过了设置，下单会产生风控报警，禁止开仓，未超过时可正常下单。

公式：当日净买入金额=当日成交中买入金额+冻结金额（不包括逆回购）-当日成交中卖出金额（卖出部分如果是部分成交的话，未成交部分不用计算）。

交易合规-金额合规

风控触发

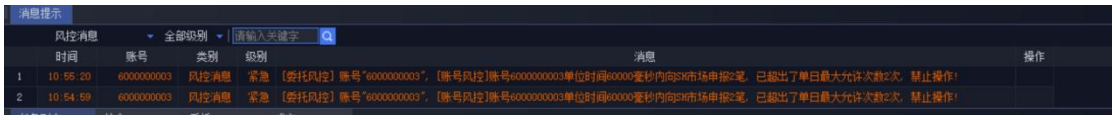
⑤增强频率合规

交易合规中的“增强频率合规”，用以对特定频率申报行为或申报并撤销行为的日内出现次数进行控制。

股票交易可分别针对上证所和深交所证券设置增强频率合规，股票期权可针对上期权设置增强频率合规。

比如设置日内最大出现 2 次每 30000 毫秒申报 2 笔的交易频率限制。

增强频率合规



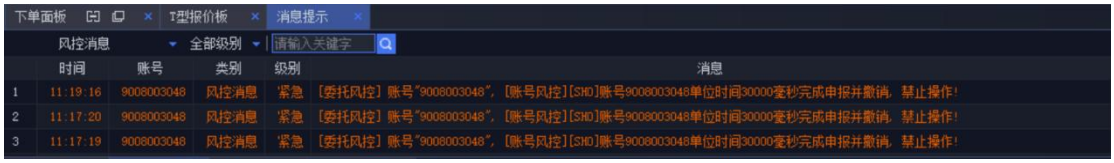
风控触发

⑥行为合规

股票期权交易合规中的“行为合规”，用以对特定行为进行控制。当资金账号的委托数量达到设定的数量后，出现特定的行为即可对其进行警告或禁止。

例如日内申报在 2 笔以上，且存在 30 秒内完成申报并撤销申报的行为等。

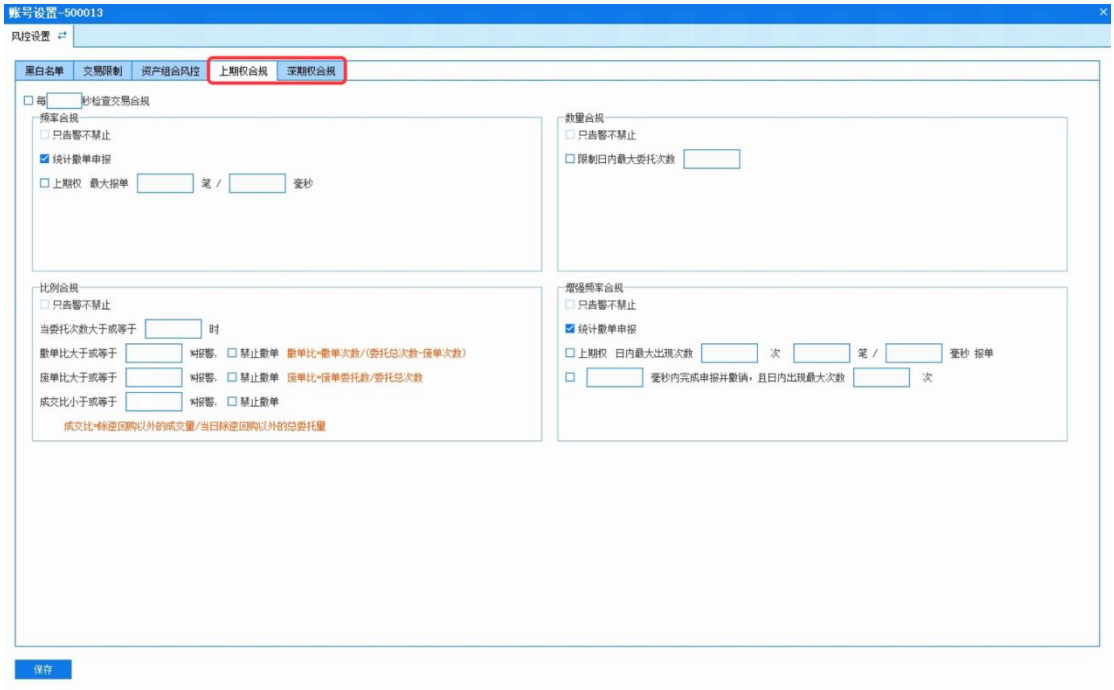
行为合规



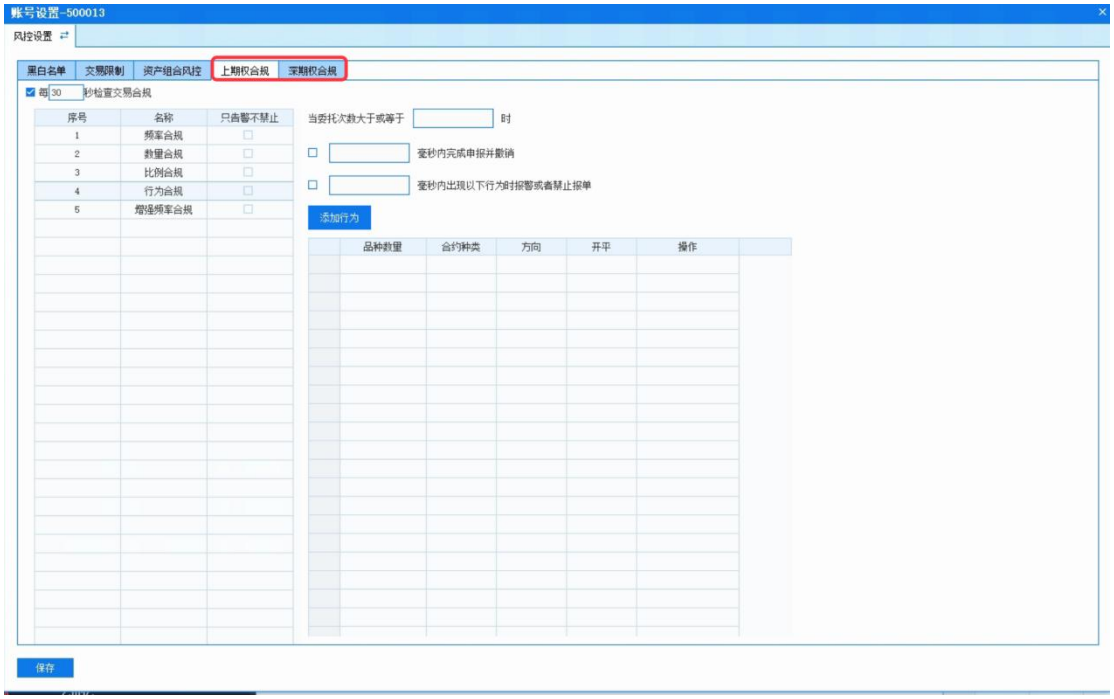
风控触发

⑦普通风格&迅投风格

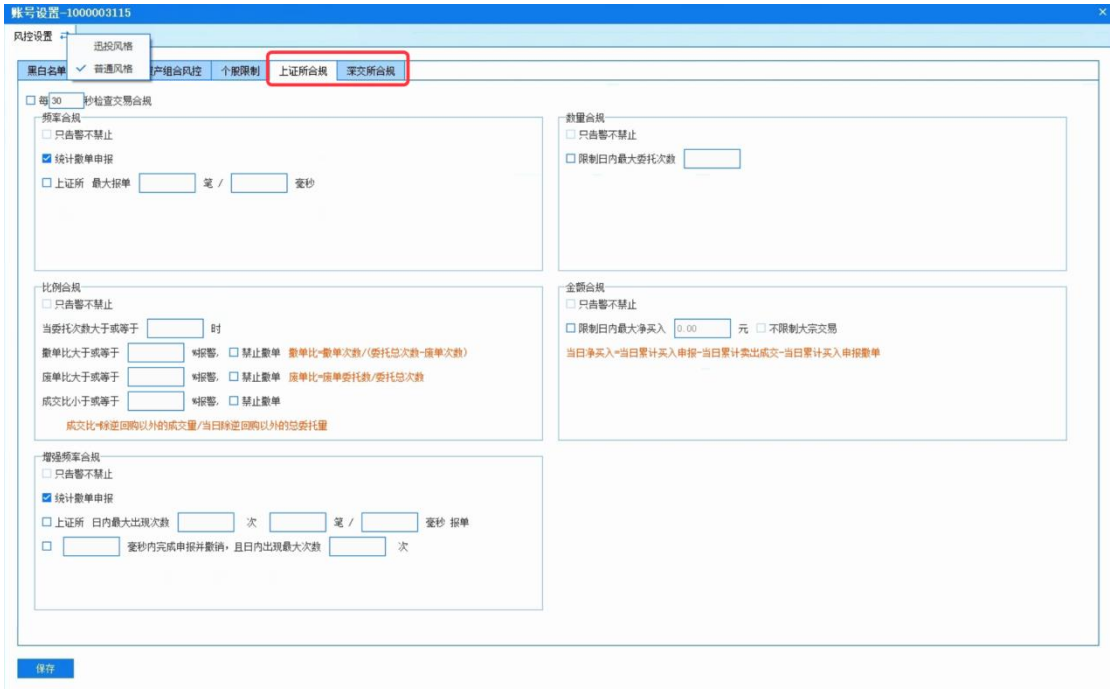
如下图所示。



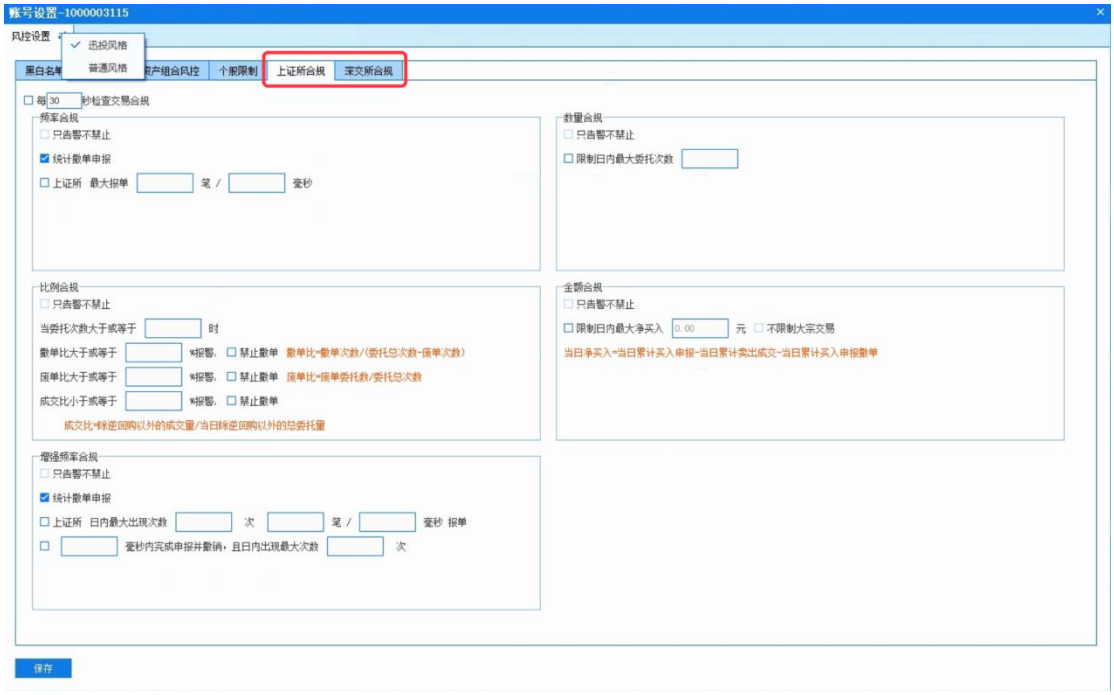
期权交易合规（普通风格）



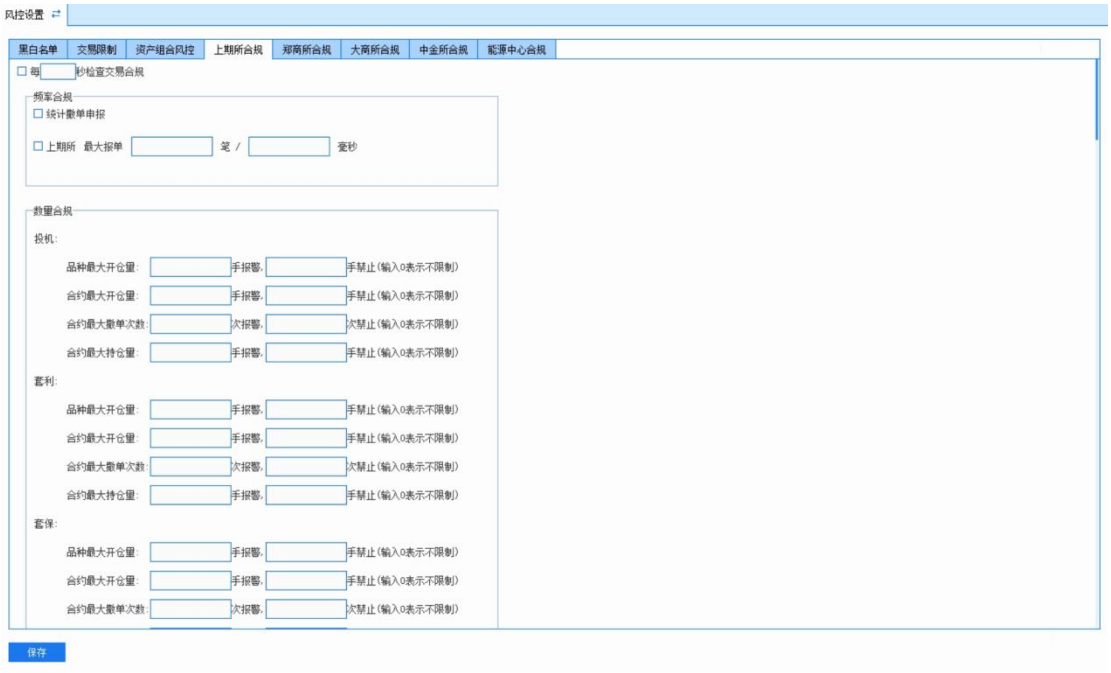
期权交易合规（迅投风格）



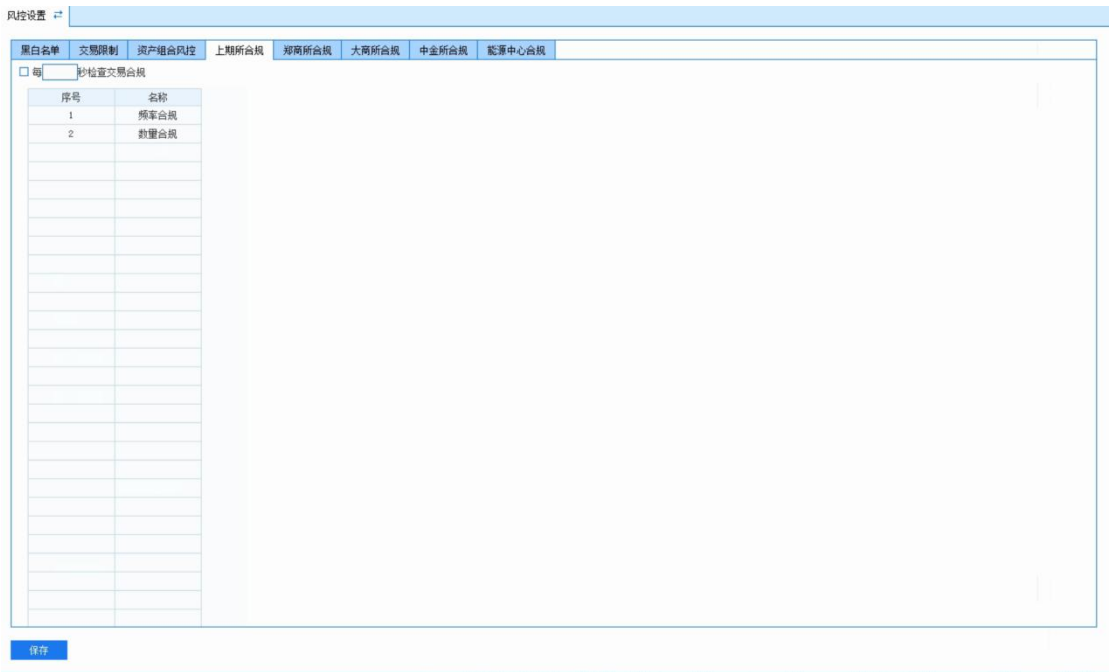
证券交易合规（普通风格）



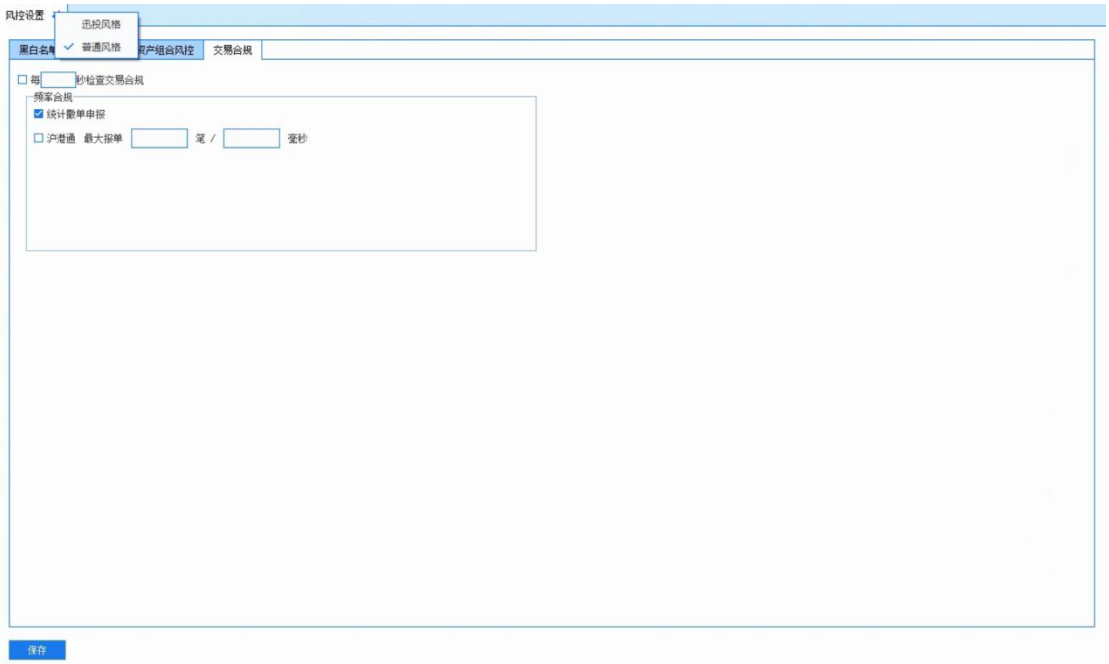
证券交易合规（迅投风格）



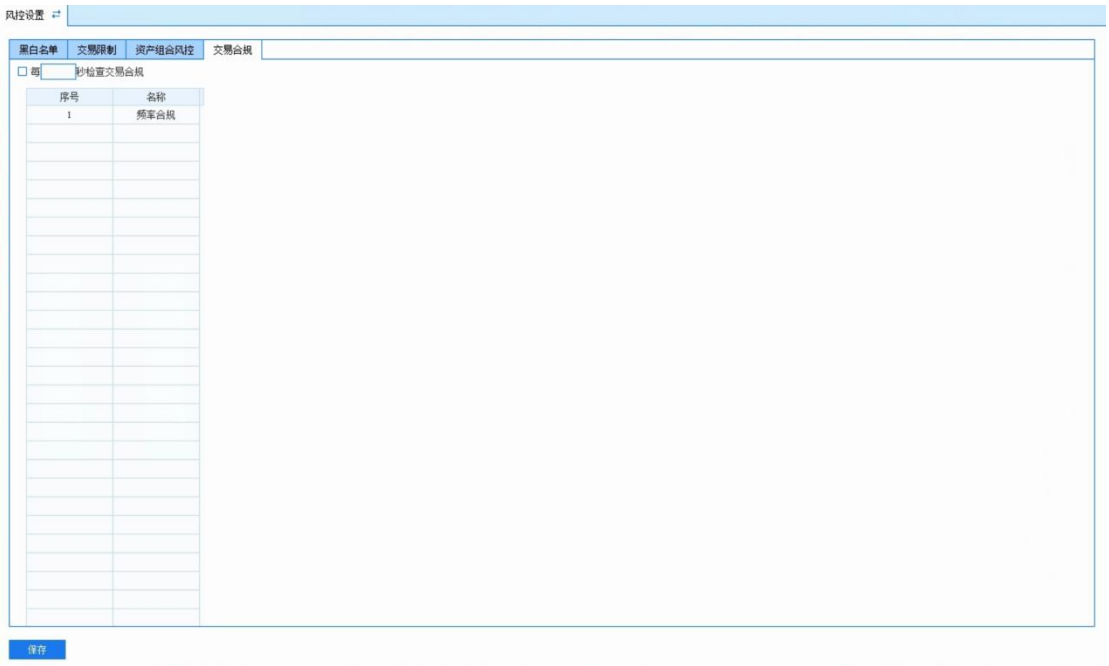
期货交易合规（普通风格）



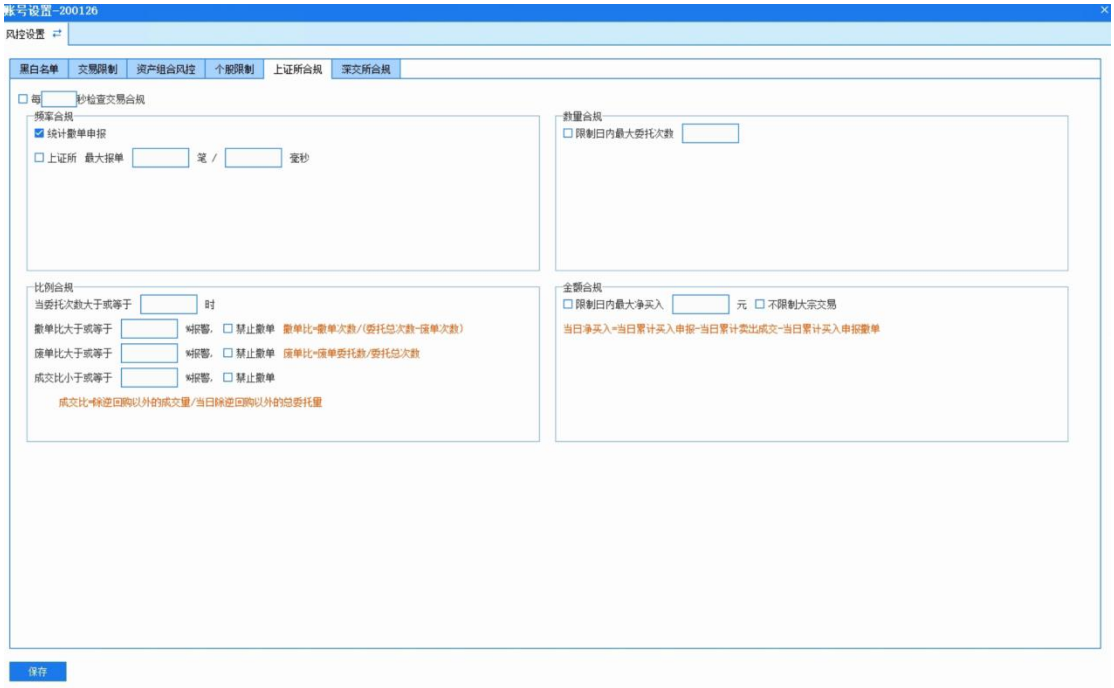
期货交易合规（迅投风格）



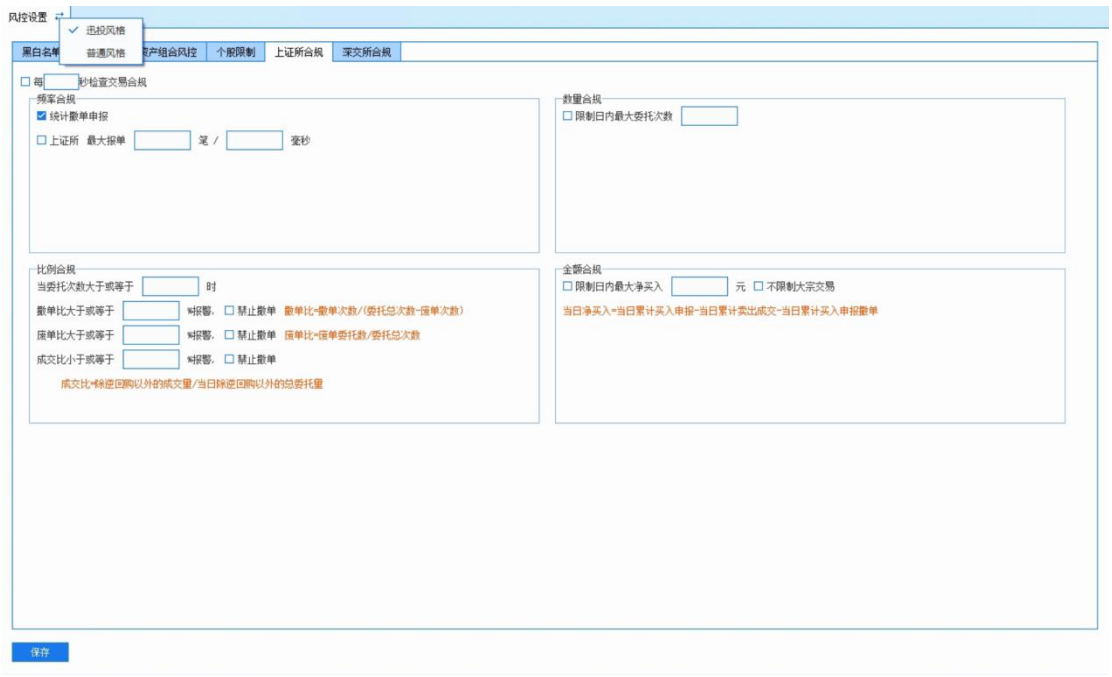
沪港通交易合规（普通风格）



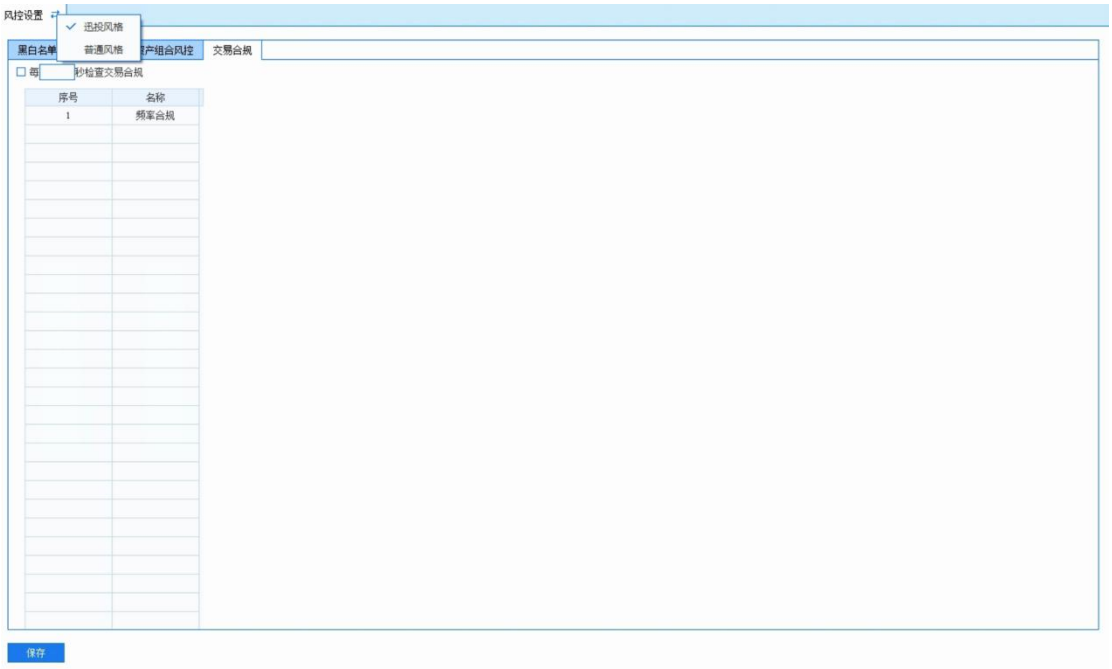
沪港通交易合规（迅投风格）



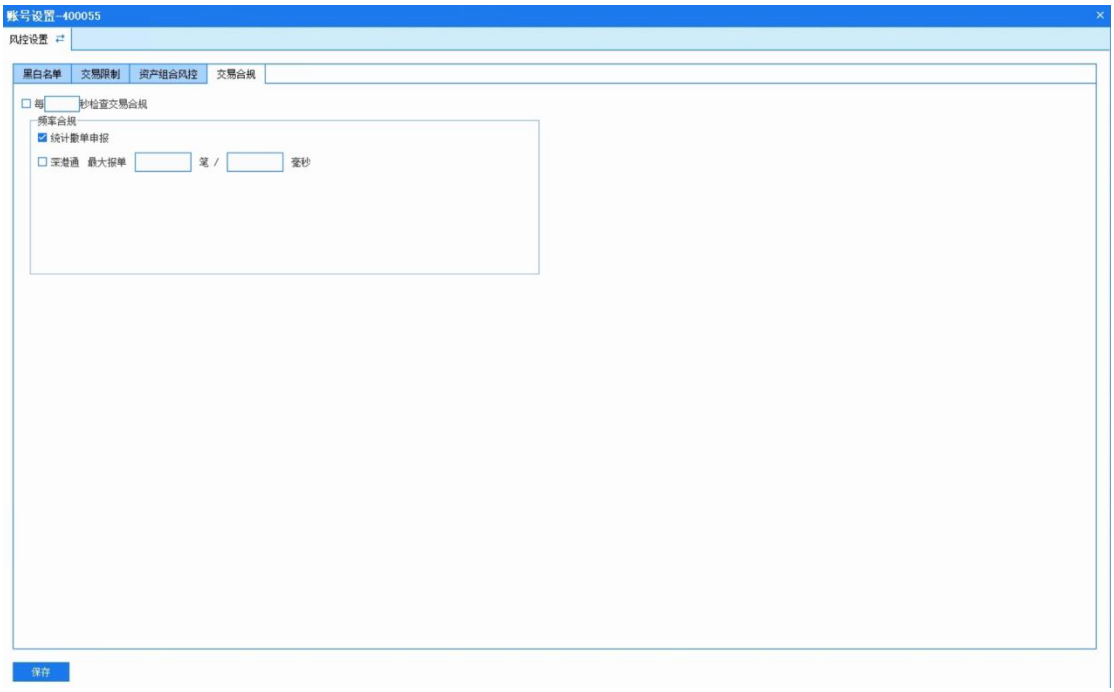
信用账号交易合规（普通风格）



信用账号交易合规（迅投风格）



深港通交易合规（迅投风格）

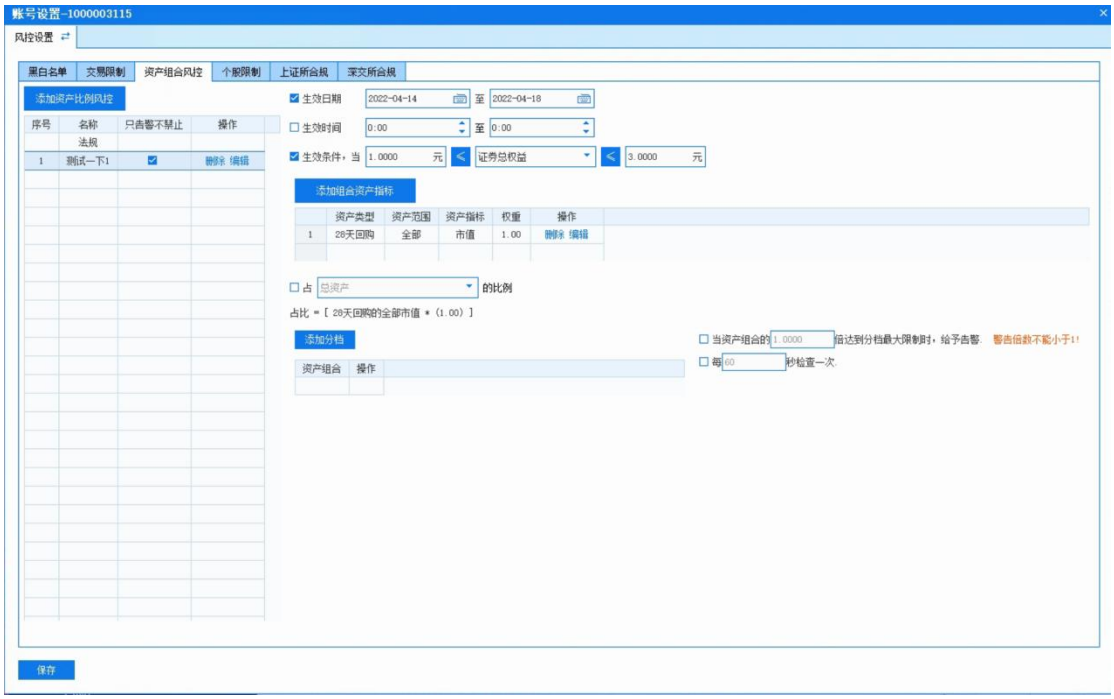


深港通交易合规（普通风格）

（4）资产组合风控

资产组合风控即对投资者的一组或多组资产进行风险控制，通过设置各项风控条款去限制交易操作，减少或避免风险事件发生的各种可能性，减少风险事件发生时造成的损失。

设置时需要选择资产组合规则，设置生效日期、时间、条件，添加资产指标，对设置指标进行分档限制。

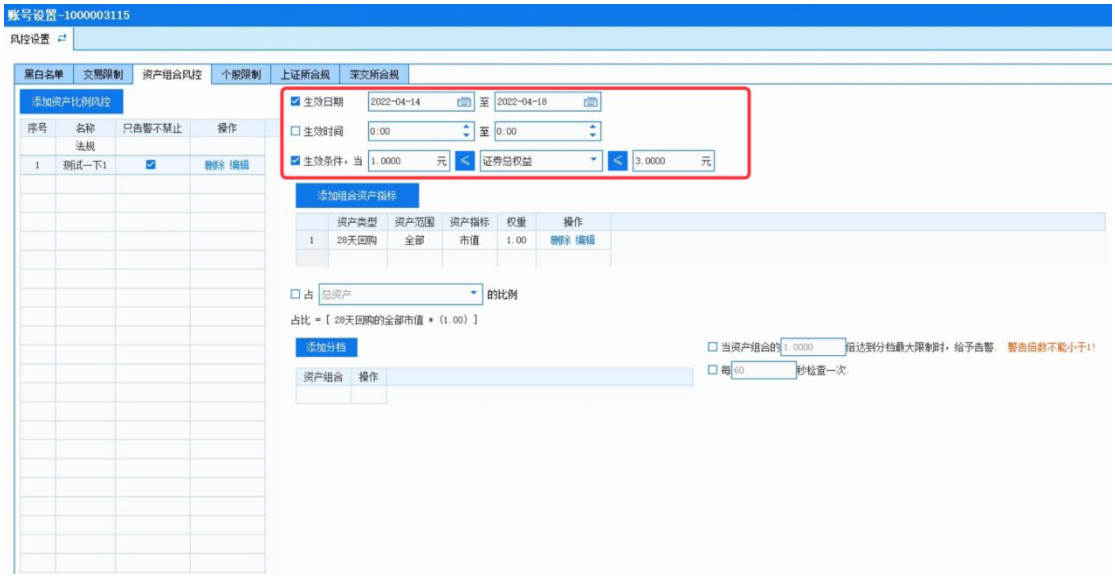


资产组合风控

资产组合风控可以自定义添加资产组合风控规则，目前分类为法规、合同、操作，如下图：

添加资产组合风控

可自定义生效日期、时间、条件，只有在设置的生效日期、时间、条件范围内，设置的资产组合风控才会被检查。如下图：



生效条件

资产类型是系统证券分类中的全部分类，如下图：

资产类别

资产范围证券类包含了全部和单只，期货类包含全部、单只（具体的一个合约）、单品种（cu、y、if、cf 等合约品种），如下图：

资产范围

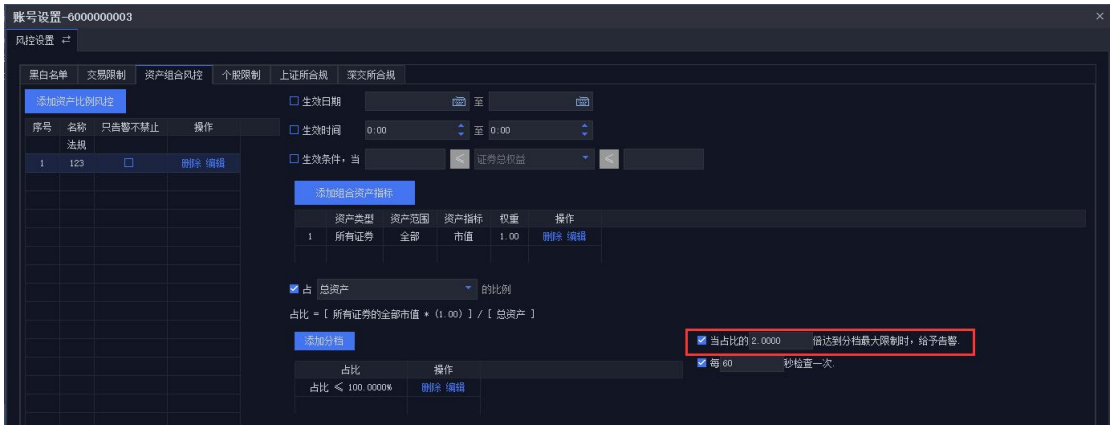
组合资产指标支持添加多个。选择分母后可设置占比，在占比范围内是被允许的，不在占比范围内则视为违反设置的资产组合风控法规。设置轮询将会轮询检查该资产组和风控，若有违规则产生报警消息。

下单时检查到不满足设置的资产组合风控比例范围，则会提示禁止开仓，被风控驳回。例：设置所有证券的全部市值*权重/总资产占比小于 0，若实际占比大于 0 则触发风控。

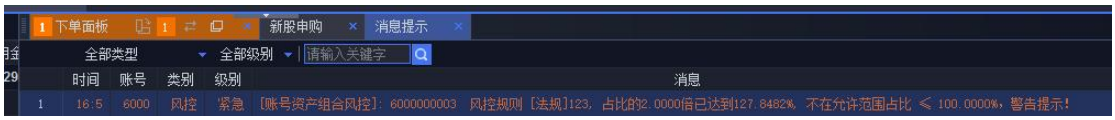
占比设置

风控触发

当前产品比例在设置的占比范围内，所设置的倍数超过最大占比限制，客户端将会有告警提示。如下设置为两倍：

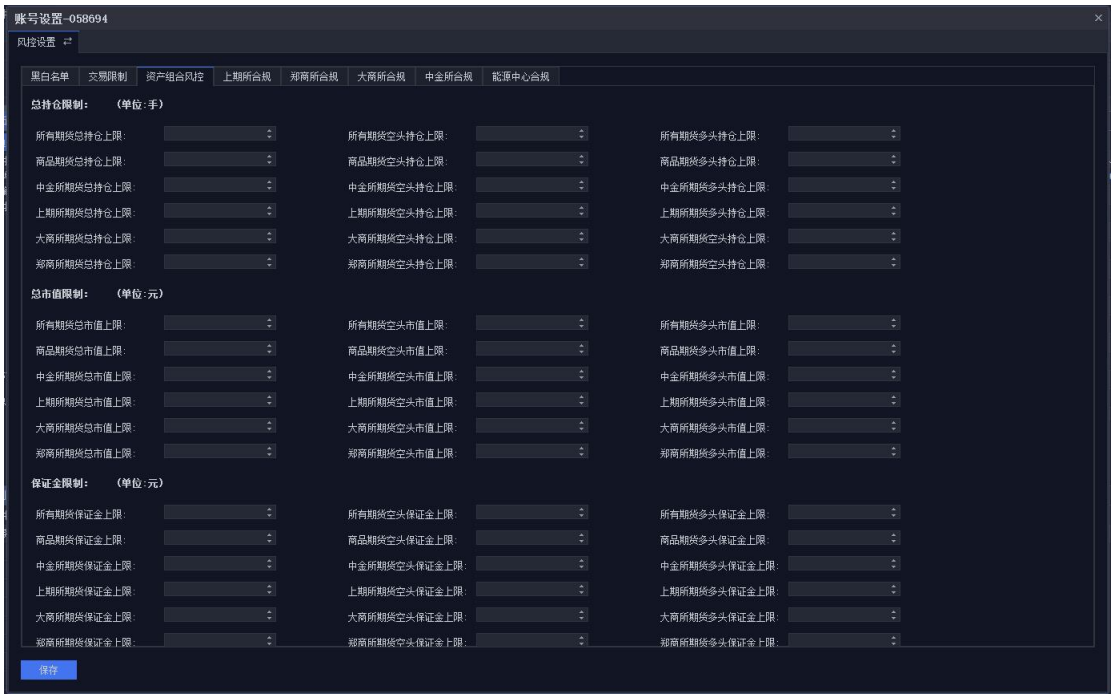


倍数设置



风控触发

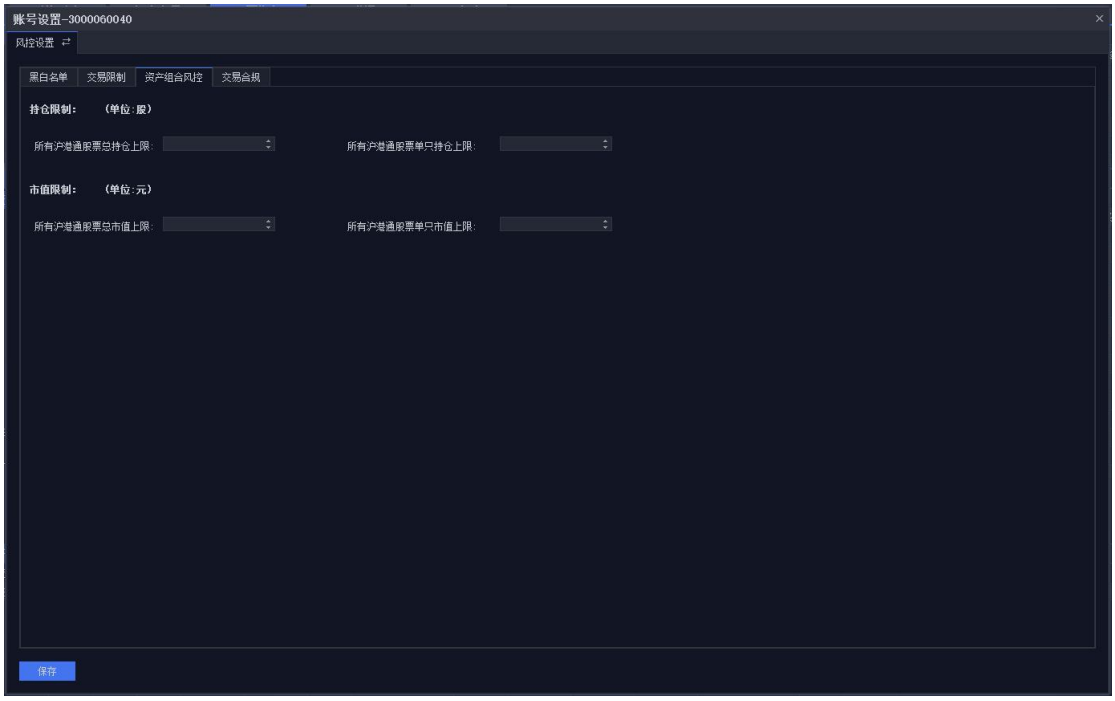
以上所述为账号资产组合风控的迅投风格样式，资产组合的普通风格为比较直观的直接输入的形式。账号的资产组合风控基本分为持仓限制和资产限制。资产主要罗列市值、期货的保证金、期权的权利金、期权的希腊值等项。



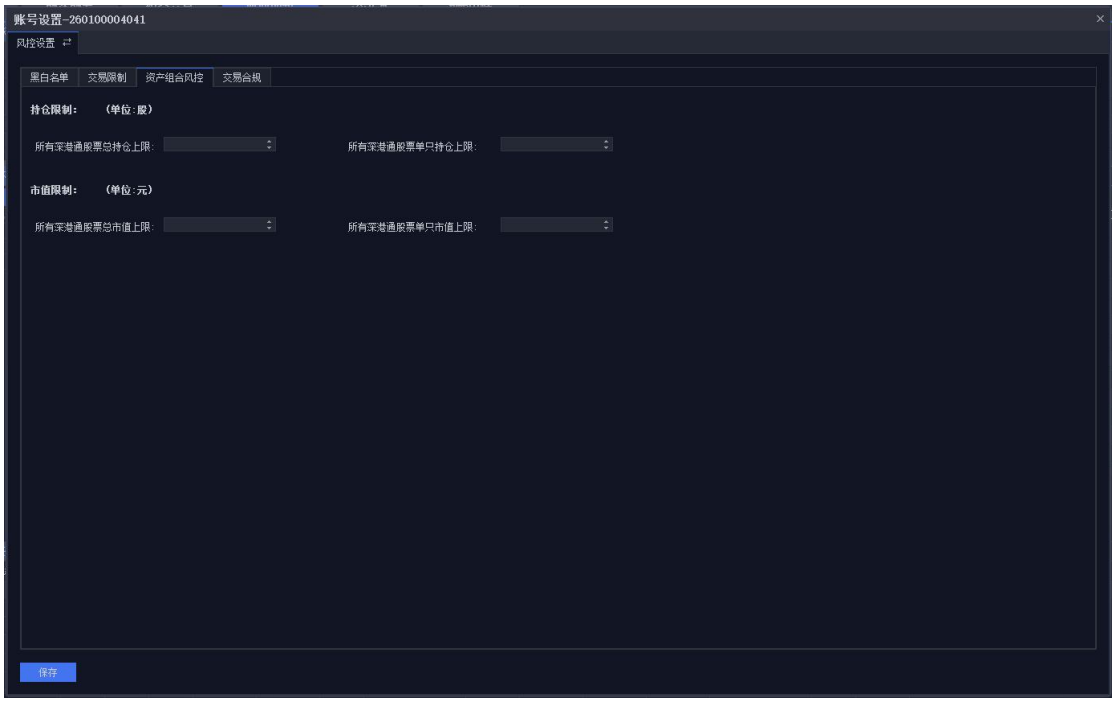
期货资产组合风控（普通风格）

证券、信用资产组合风控（普通风格）

股票期权资产组合风控（普通风格）



沪港通资产组合风控（普通风格）



深港通资产组合风控（普通风格）

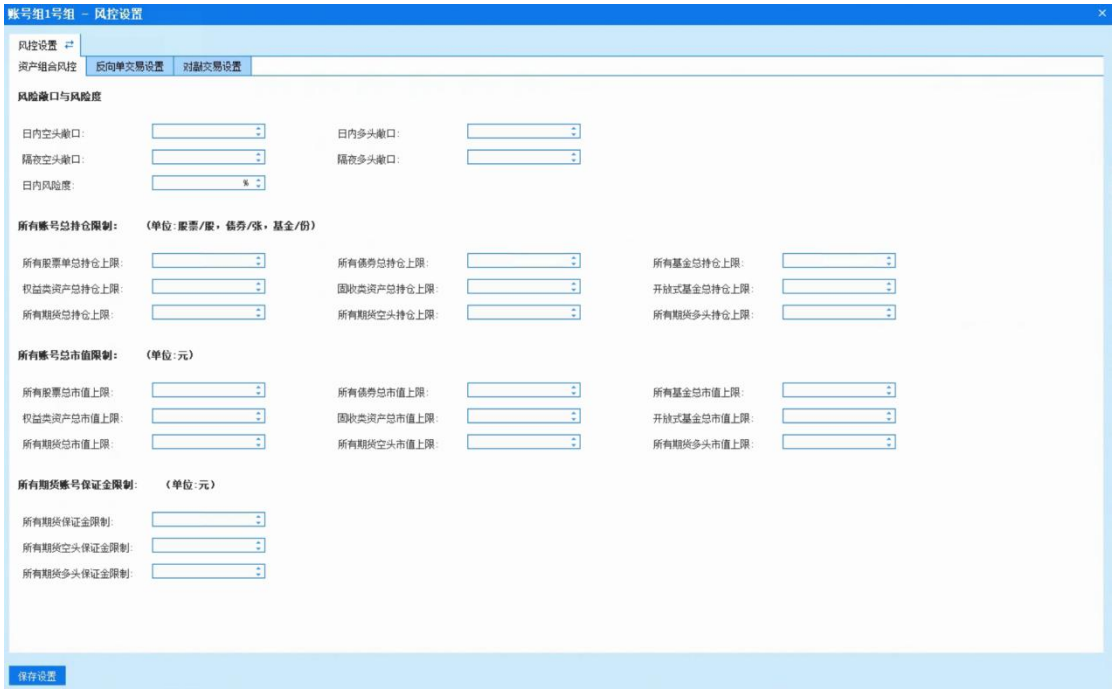
3.6.3.6.2. 账号组风控

进行添加账号组的操作后，账号组展示在账号组列表中，点击风控设置按钮进行风控设置，设置后的账号组可以进行编辑操作和删除。

账号组风控包括资产组合风控、反向单交易设置、对敲交易设置。账号组风控也提供两种风格展示。

（1）资产组合风控

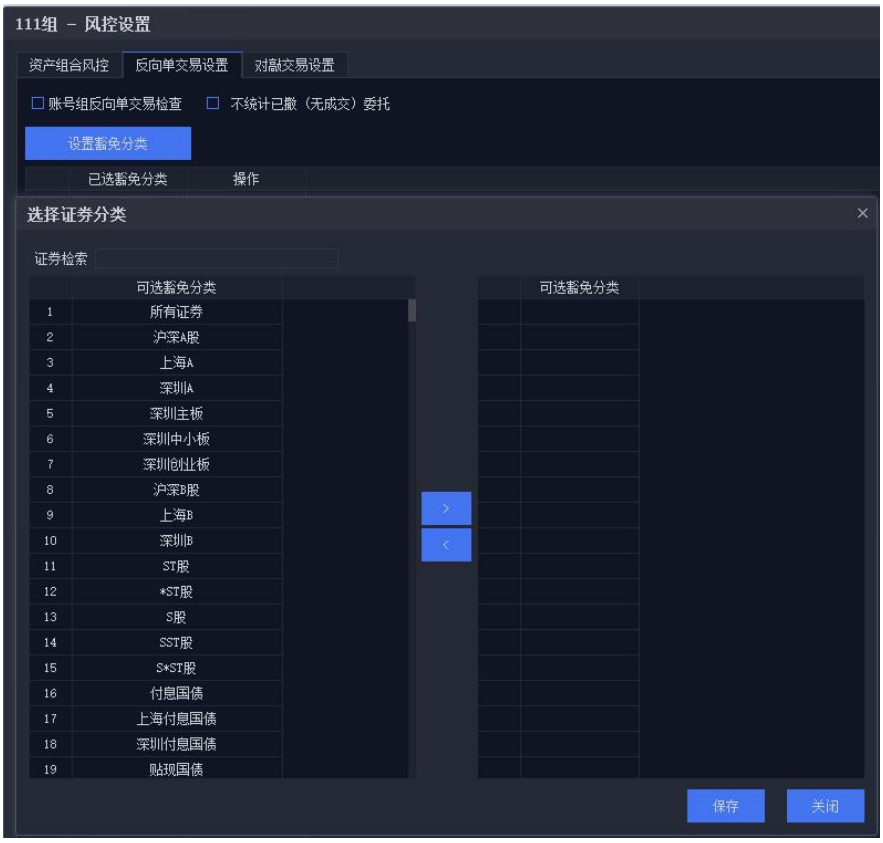
账号组迅投风格参考账号资产组合风控，不再赘述。账号组普通风格主要提供风险敞口、总持仓、总市值和期货保证金的限制。



账号组资产组合风控

（2）反向单交易设置

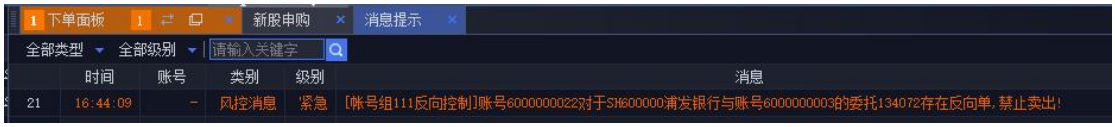
当日委托中存在某只股票或期货的买入（或卖出）委托，再次对该股票或期货进行卖出（或买入）的反向操作时就会形成反向单。反向单是当天的反向操作，之前形成的持仓不算在内。反向单交易设置的普通风格和迅投风格样式一致。



账号组风控-反向单交易设置

设置账号组反向单交易检查后，对于账号组内账号买入（或卖出）某股票代码委托报单后，组内有账号卖出（或买入）该代码时将形成反向单交易，会被禁止，以此限制组内账号之间的反向单交易。

设置账号组禁止反向单交易

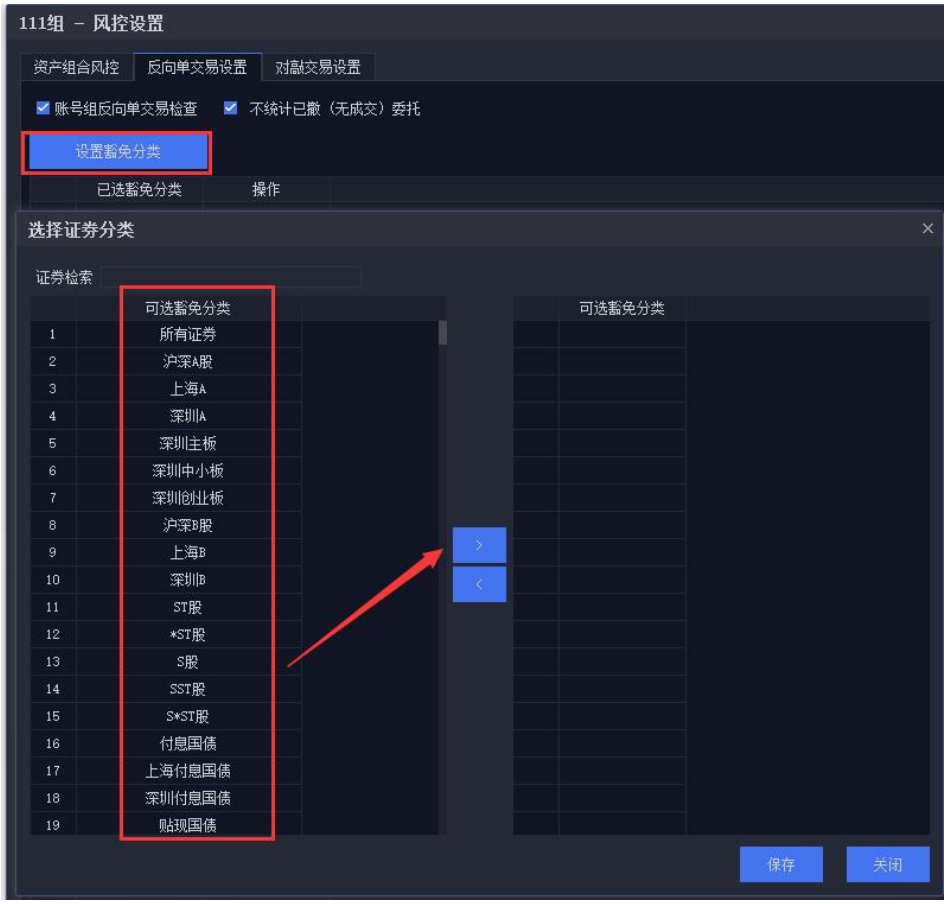


风控触发

勾选“不统计已撤（无成交）委托”后，直接跳过已撤的委托不进行反向单检查，只检查已撤（有成交）、已报的委托。

置不统计已撤（无成交）委托

账号组中添加豁免分类后，对该分类中的代码进行下单时，不进行反向单检查，豁免分类可免去反向单交易检查。



账户组风控-豁免分类

（3）对敲单交易设置

对敲是指对同一只股票代码或期货合约下单时，如果买入为执行中的委托，当卖出价格低于买入时的价格触发对敲单；如果卖出为执行中的委托，当买入价格高于卖出时的价格触发对敲单。对敲单交易设置的普通风格和迅投风格样式一致。

设置账号组禁止对敲交易后，对于账号组内的账号进行对敲检查，触发对敲单将禁止交易。对于豁免的分类，系统将不进行对敲检查。

账号组风控-对敲交易设置

风控触发

注：只有执行中的委托进行高买低卖或低卖高买时才算是对敲单，对于已经成交的任务，不做为对敲单处理。

3.6.3.6.3. 全局风控

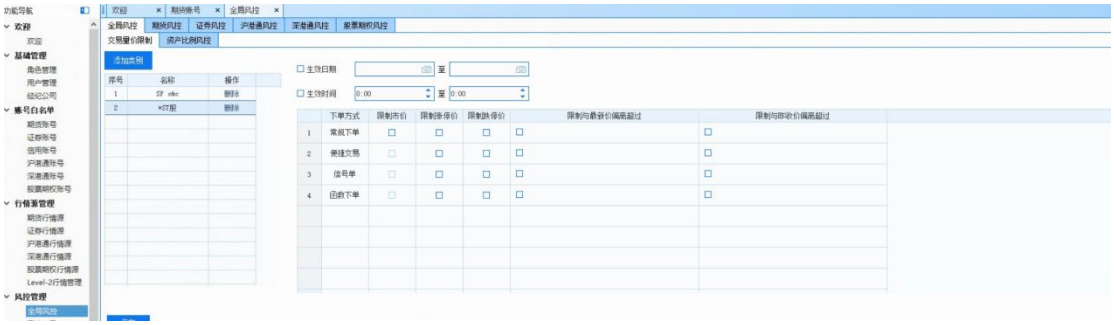
为了控制所有资金账号的交易风险，管理端可以对全局进行全局交易量价限制和全局资产比例风控设置。

（1）全局风控-交易量价限制

交易量价限制可以添加不同分类的代码，分别设置不同的交易量价限制后下单会提示被风控驳回。

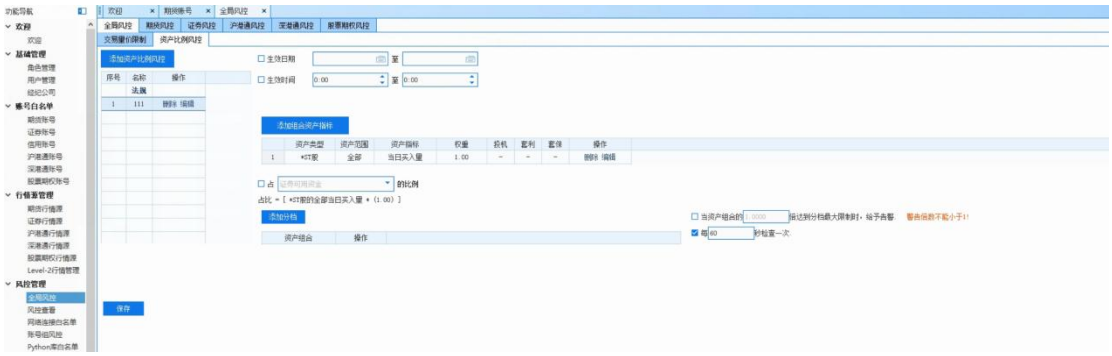
交易量价可以设置生效时间、生效日期。交易量价限制包含限制市价、涨停

价、跌停价，与最新价偏离超过设置百分比、与昨日收盘价偏离超过设置百分比。



全局交易量价限制

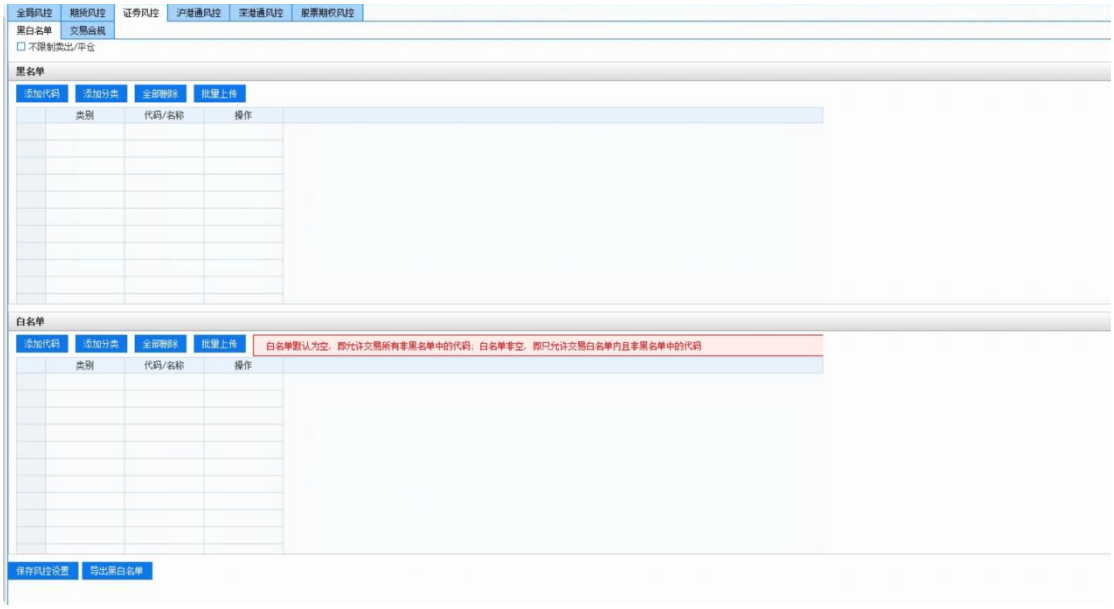
（2）全局风控-资产比例风控



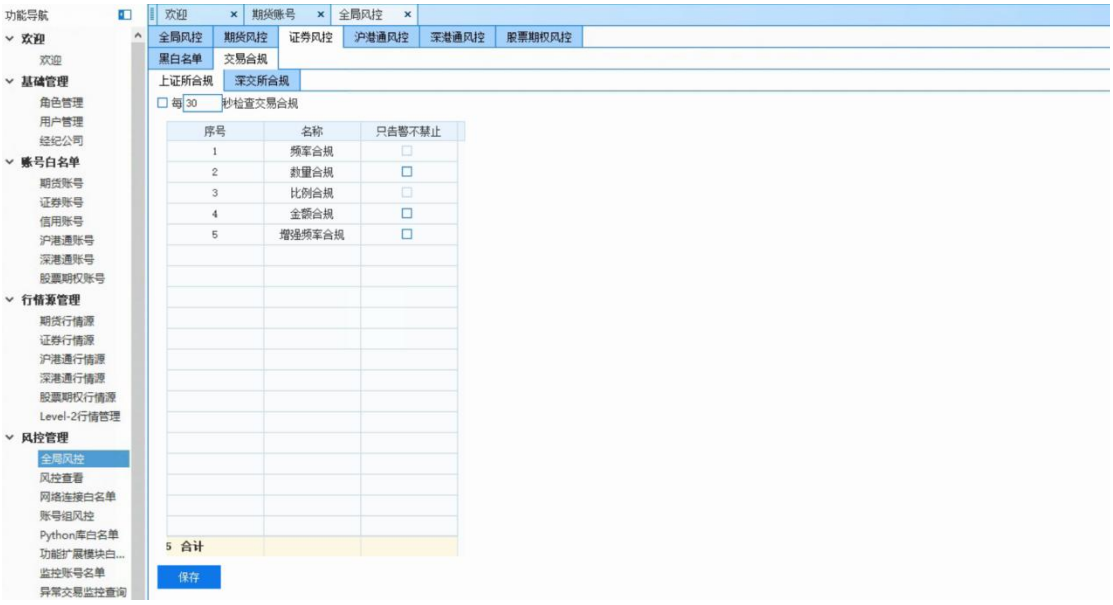
全局资产比例风控

（2）全局风控-证券风控

证券风控，包括黑白名单和交易合规设置。



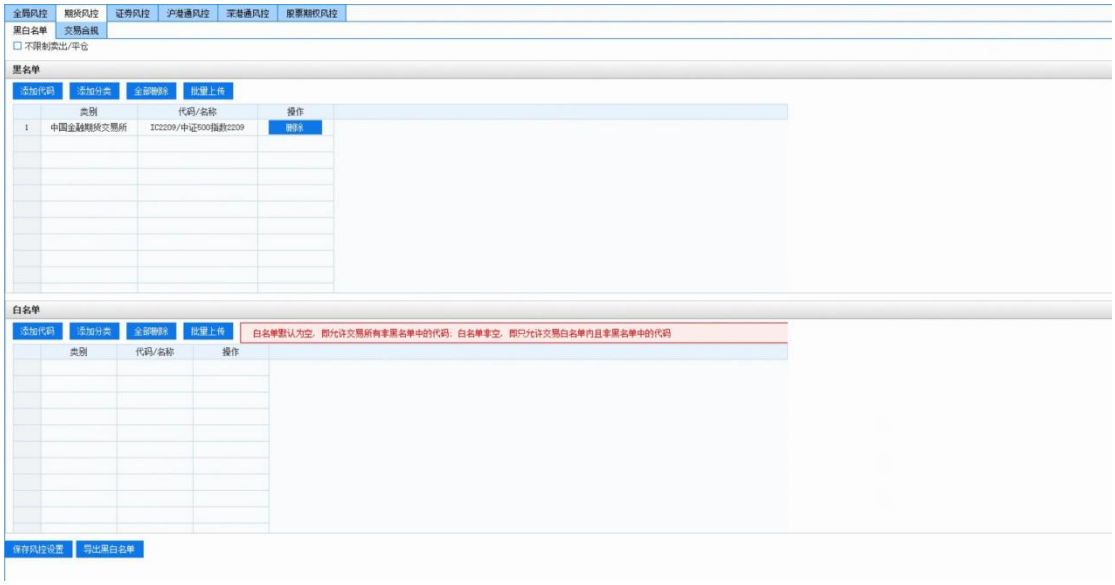
证券黑白名单



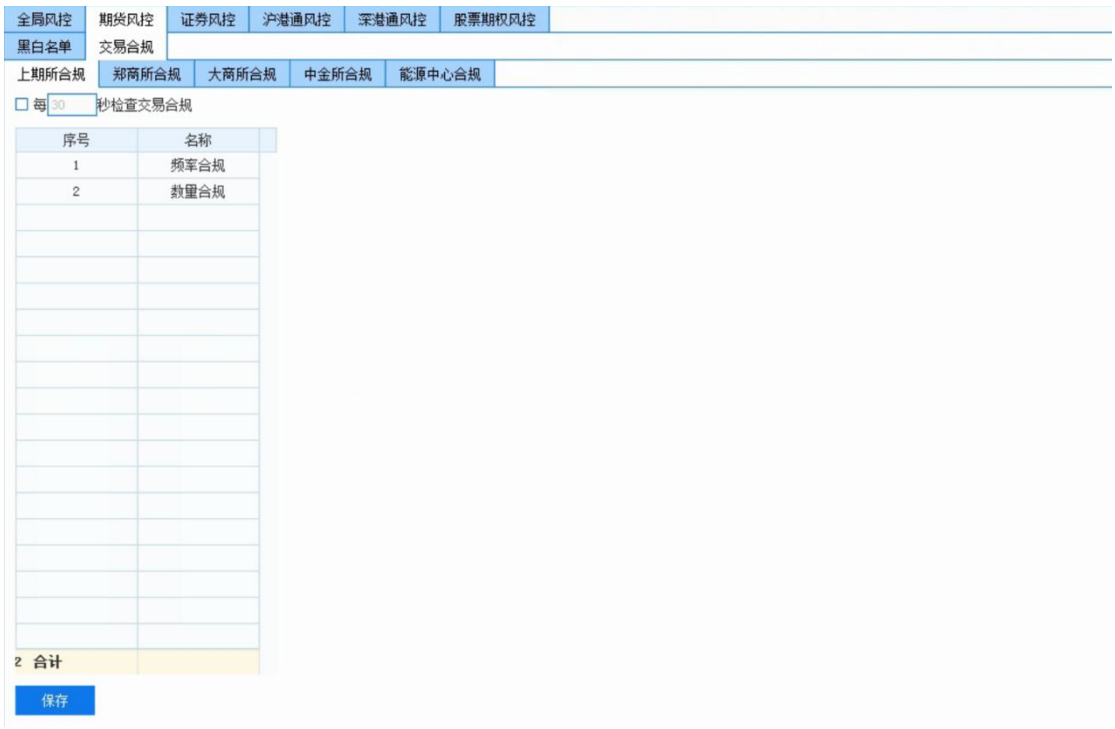
证券交易合规

（3）全局风控-期货风控

期货风控包含黑白名单和交易合规两种。



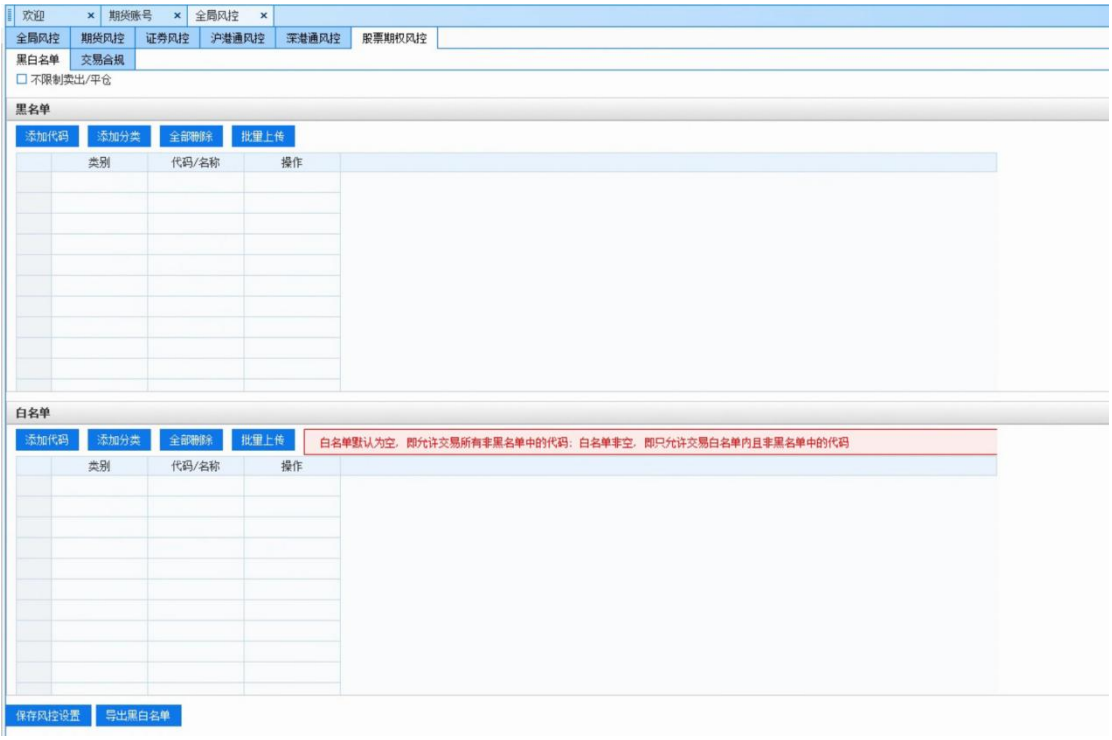
期货风控-黑白名单



期货风控-交易合规

（4）全局风控-股票期权风控

股票期权风控包括黑白名单和交易合规两种

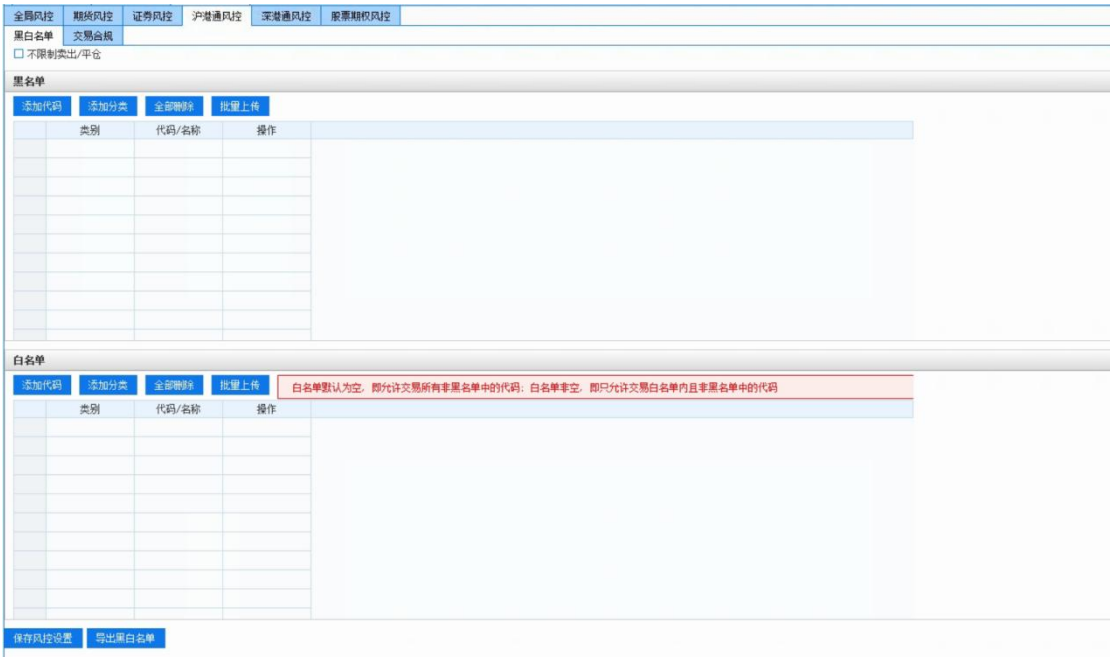


股票期权黑白名单

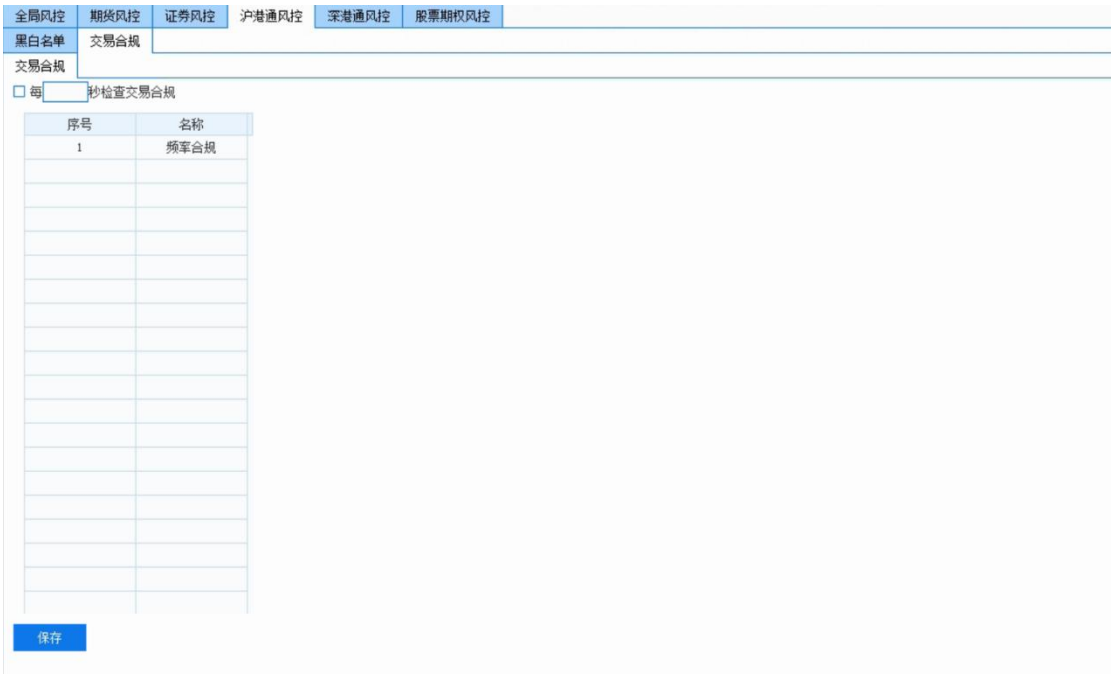
股票期权交易合规

（5）全局风控-沪港通/深港通风控

沪港通/深港通风控包含黑白名单和交易合规两种。



沪港通/深港通黑白名单



沪港通/深港通交易合规

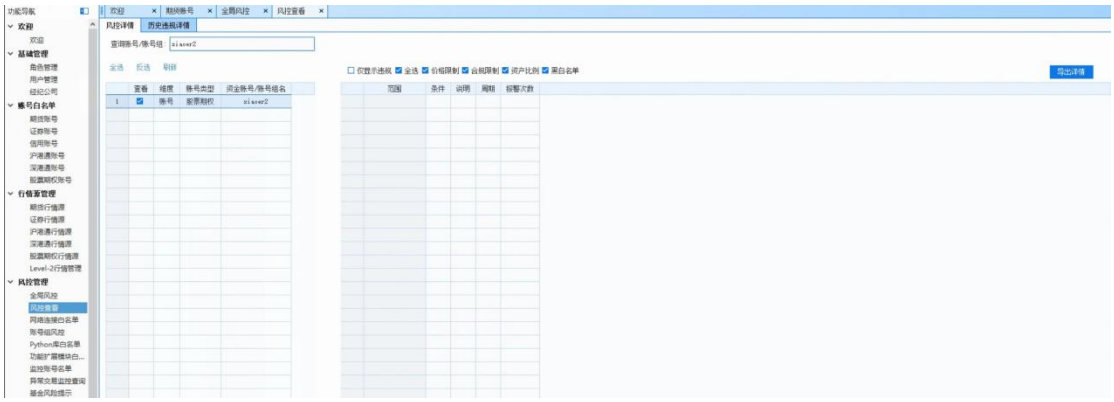
*注意：设置了全局风控后，账号风控设置的数值与全局风控相比将在更严格的范围内设置。比如：设置全局风控中的金额合规，限制日内最大净买入 500 000 元。则在交易端账号管理的风控设置中，设置的金额合规，限制日内最大净买入最大值为 500000 元。

3.6.3.6.4. 风控查看

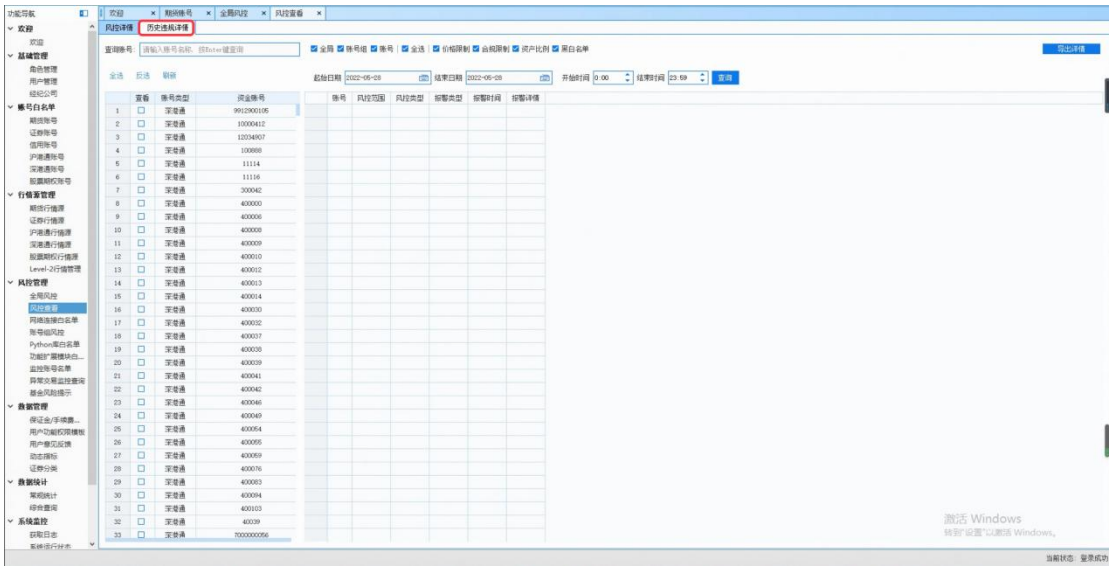
迅投 QMT 极速策略交易系统管理端除了提供全局风控的设置，还提供全局和交易端风控设置的内容查看。

（1）管理端风控查看包含当前风控详情和历史违规风控详情。

当前风控详情可选择全局，具体的一个或多个账号组及账号，查看所选维度的当前风控内容。支持查看价格限制（交易量价限制、交易价格限制）、合规限制（交易合规）、资产比例（资产组合风控）、黑白名单。勾选 ☑ 仅显示违规 仅展示当前违规风控。 导出详情 支持导出当前查询出的风控详情。

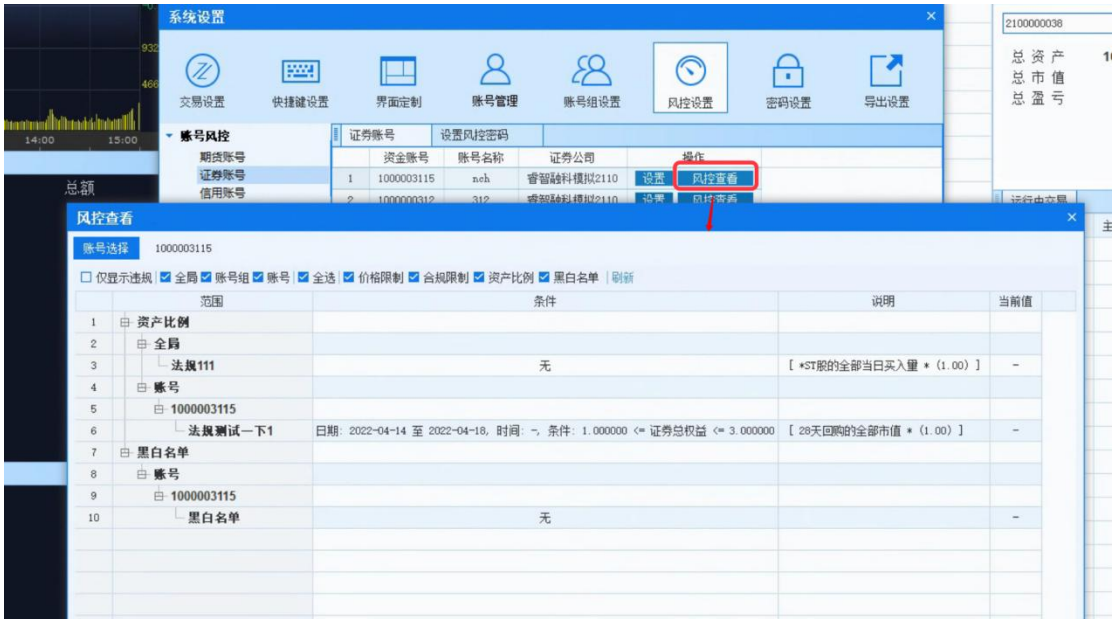


历史违规详情支持查看所选账号在一段时间内的历史违规风控，可选择查看违反的全局、账号和账号组的价格限制（交易量价限制、交易价格限制）、合规限制（交易合规）、资产比例（资产组合风控）和黑白名单风控。 导出详情 支持导出当查询出的历史违规详情。



（2）交易端风控查看，支持查看当前设置的风控内容。账号和账号组列表中，点击风控查看按钮，进入风控查看界面。可选择账号查看全局、账号和账号组设置的价格限制（交易量价限制、交易价格限制）、合规限制（交易合规）、资产比例（资产组合风控）和黑白名单风控。勾选

仅展示当前违规风控。

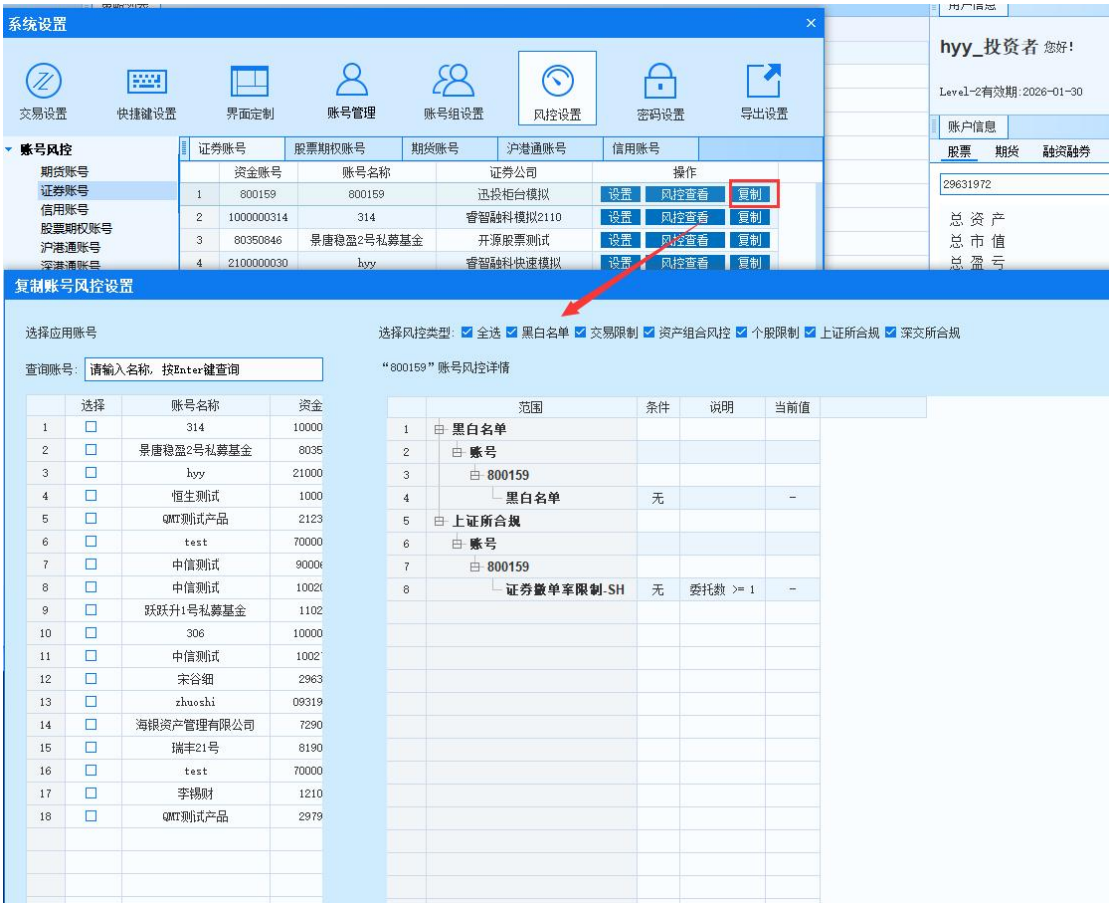


3.6.3.6.5. 风控复制

操作列显示复制按钮，选择账号进行复制操作后，与被复制账号的风控显示

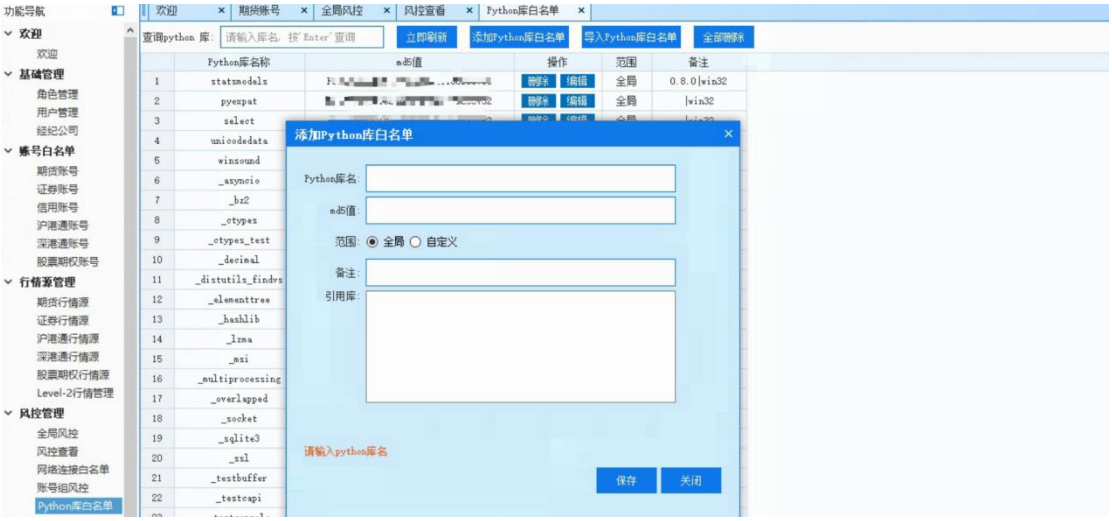
一致。

复制账号风控设置界面显示账号、账号风控详情和查询账号功能，右侧风控详情显示为选中账号的风控。



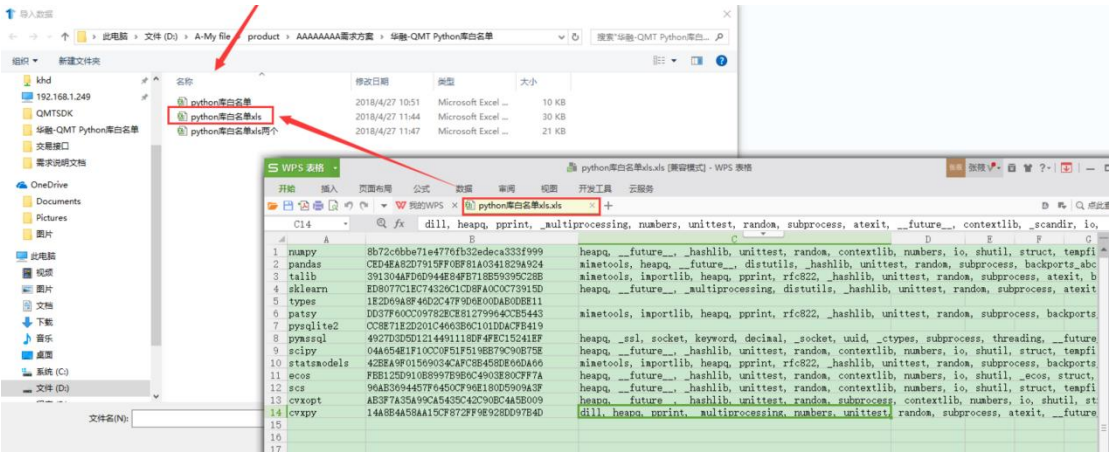
3.6.3.6.6. Python 库白名单

迅投 QMT 极速策略交易系统支持 Python 模型编写，因而对模型编辑的 Python 库也设有一定限制，QMT 管理端【风控管理】Python 库白名单中可增加允许模型使用的 Python 库，添加上在 Python 模型中允许调用，未添加则不允许。添加时需要输入 md5 值及其第一层引用的库，用于模型调用该库时的校验。



管理端-添加 Python 库白名单

Python 自带的库非常多，添加白名单时支持导入多个 Python 库白名单，导入的文件限制为.xls 和.xlsx 表格文件。表格文件内需要提供 Python 库名、Python 库文件 md5 值以及该 Python 库第一层引用库。

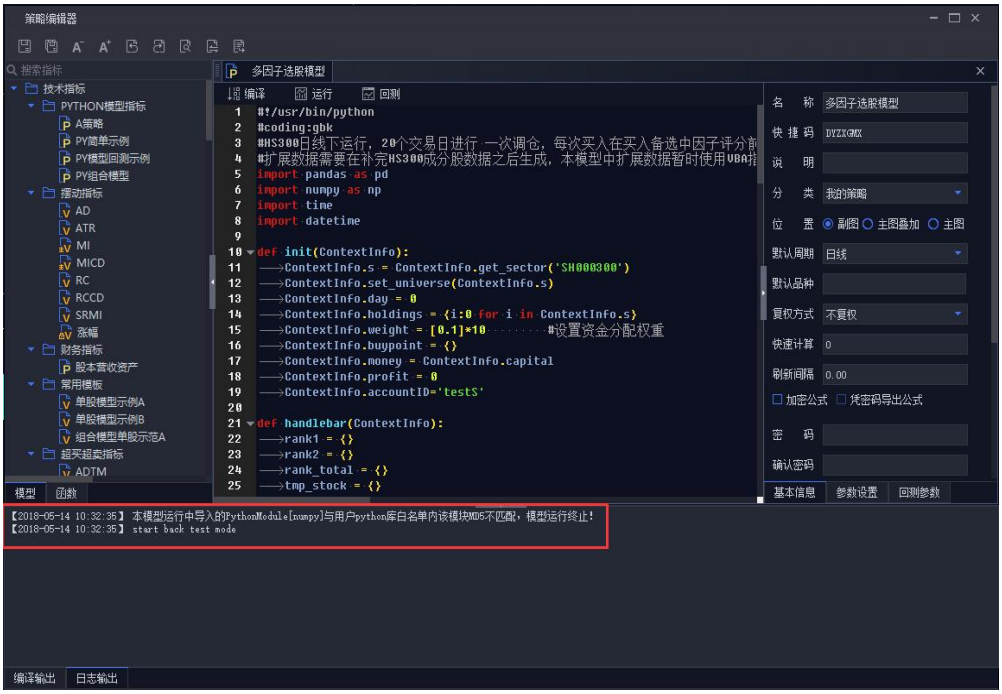


Python 库白名单表格

交易端同步展示管理端添加的白名单，但无法添加、导入、编辑和删除。

交易端-Python 库白名单

加在白名单内的 Python 库允许模型调用，若交易端模型调用了未添加白名单的 Python 库，则有报错；若管理端输入 md5 值错误，则在模型运行时有报错，如下：



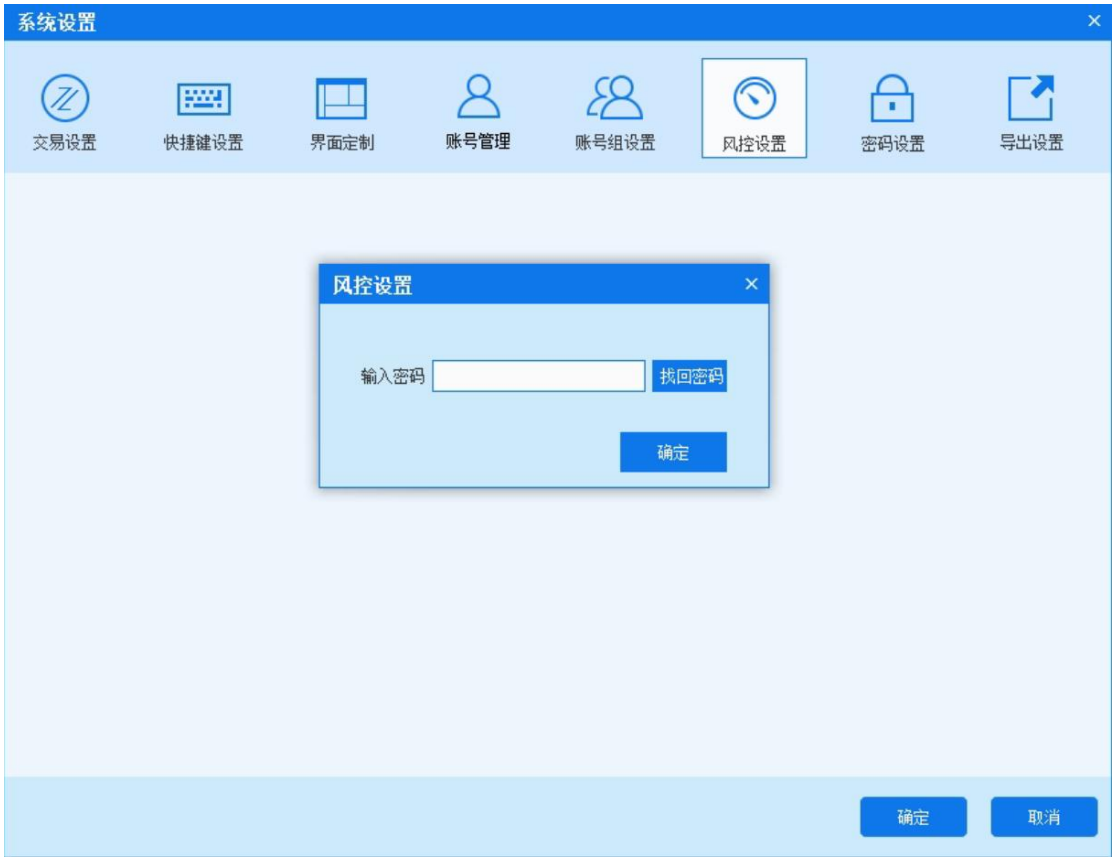
模型调用未添加白名单的 Python 库

3.6.3.6.7. 风控密码管理

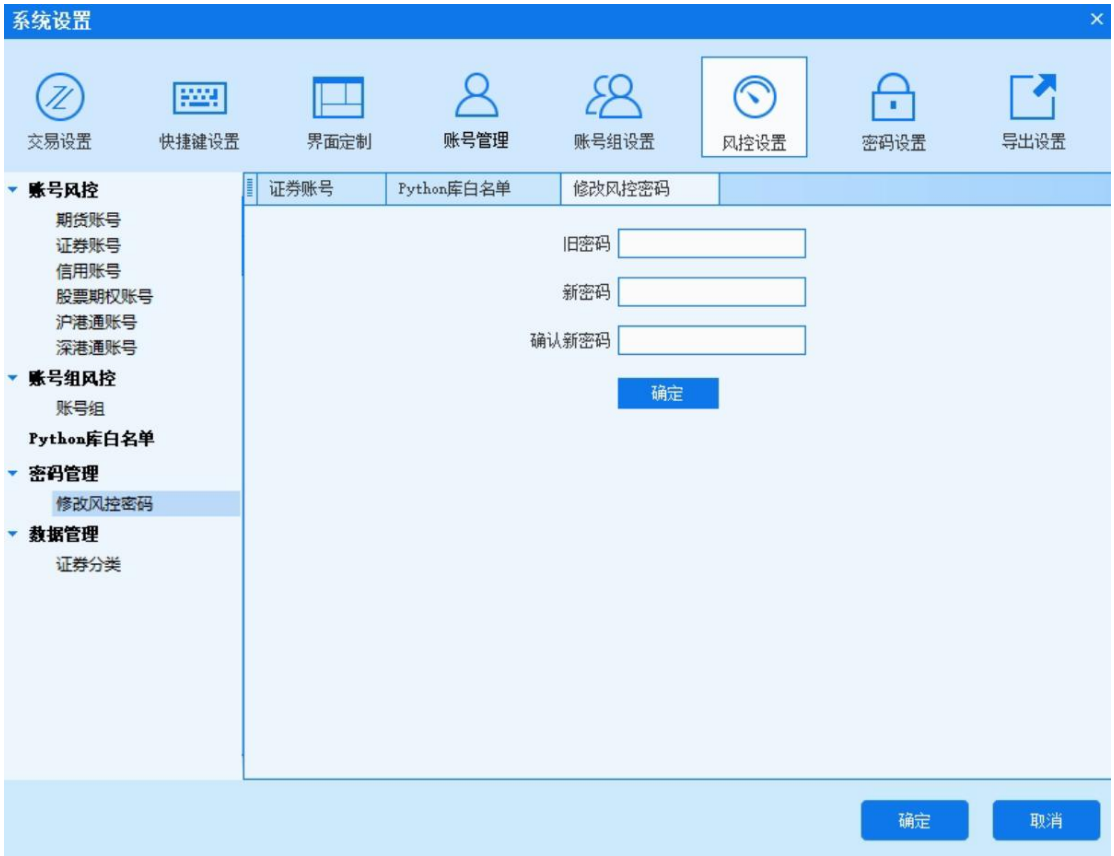
对于用户自己设置的风控，系统提供风控密码管理帮助用户管理自己的风控，防范风控被任意篡改。对于已设置风控密码的用户，支持风控密码修改；对于未设置密码的用户，提供密码设置功能。

未设置风控密码

用户完成密码设置后，进入风控设置需输入正确密码才可进行风控设置。



已设置风控密码-输入密码



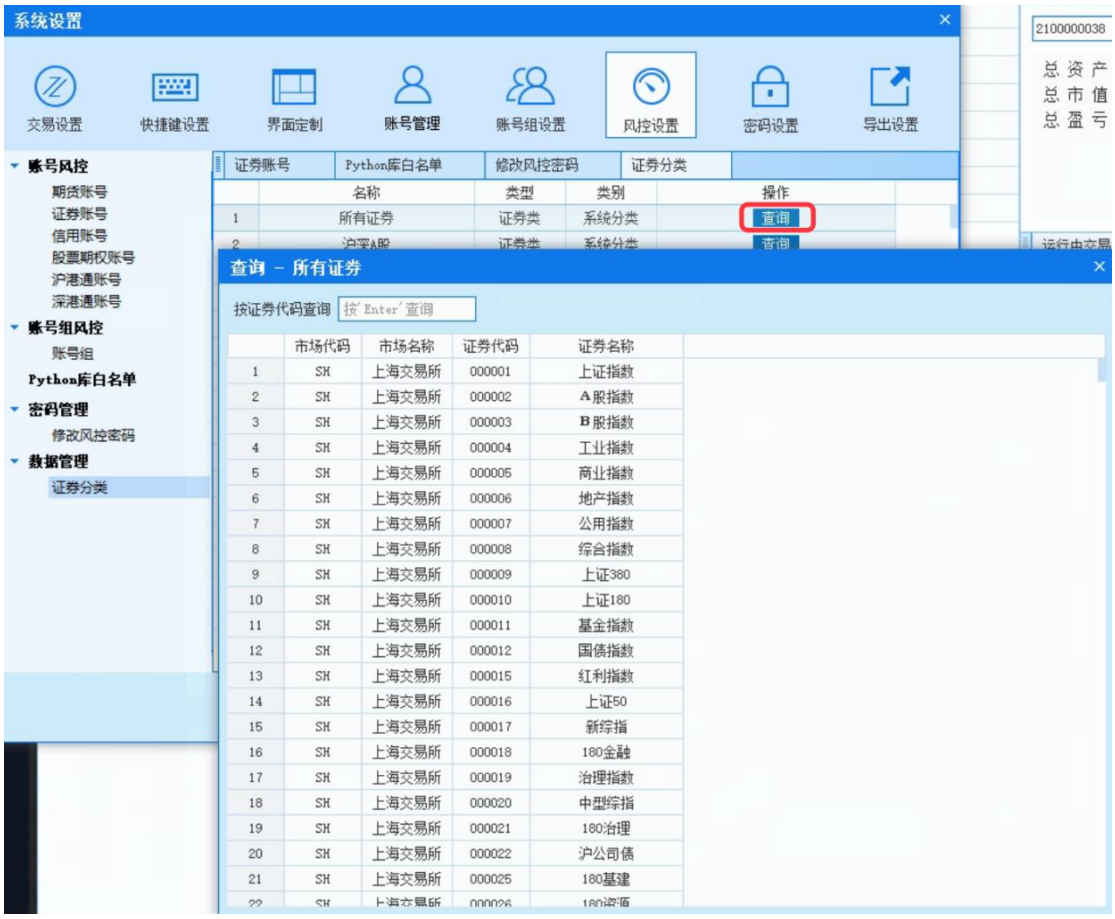
已设置风控密码-修改密码

同时，在管理端，也可以对风控密码进行修改。

管理端支持修改风控密码

3.6.3.6.8. 证券分类

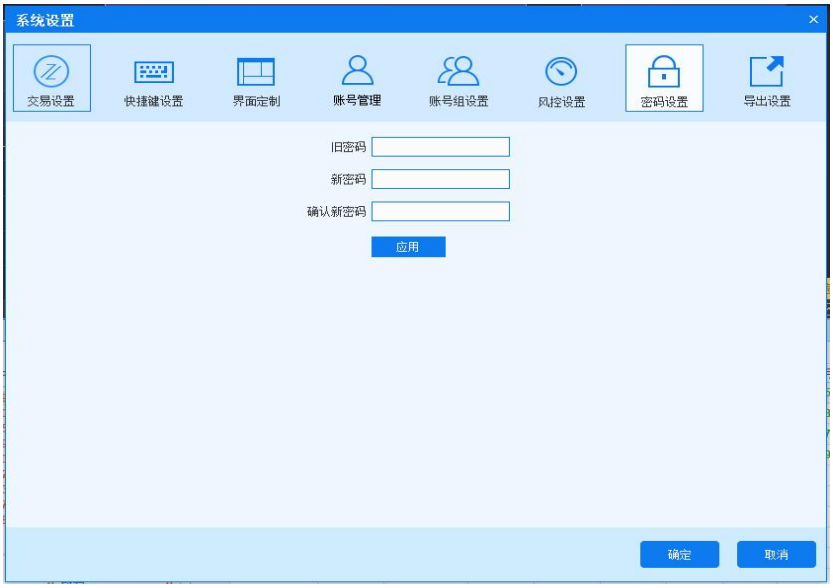
用于用户查询证券分类具体证券代码。



证券分类

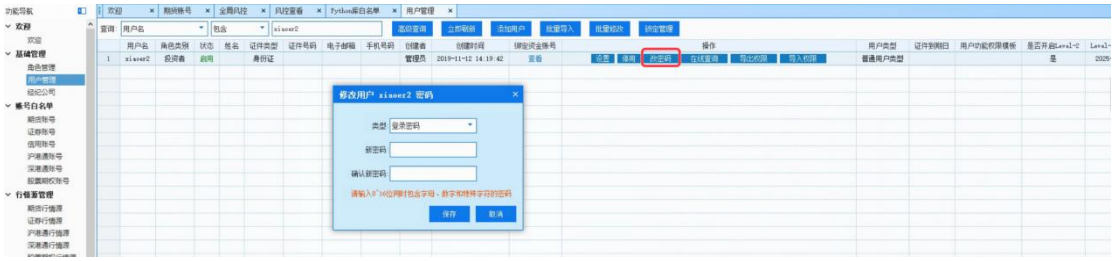
3.6.3.7. 密码设置

可以修改用户的登录密码。



密码设置

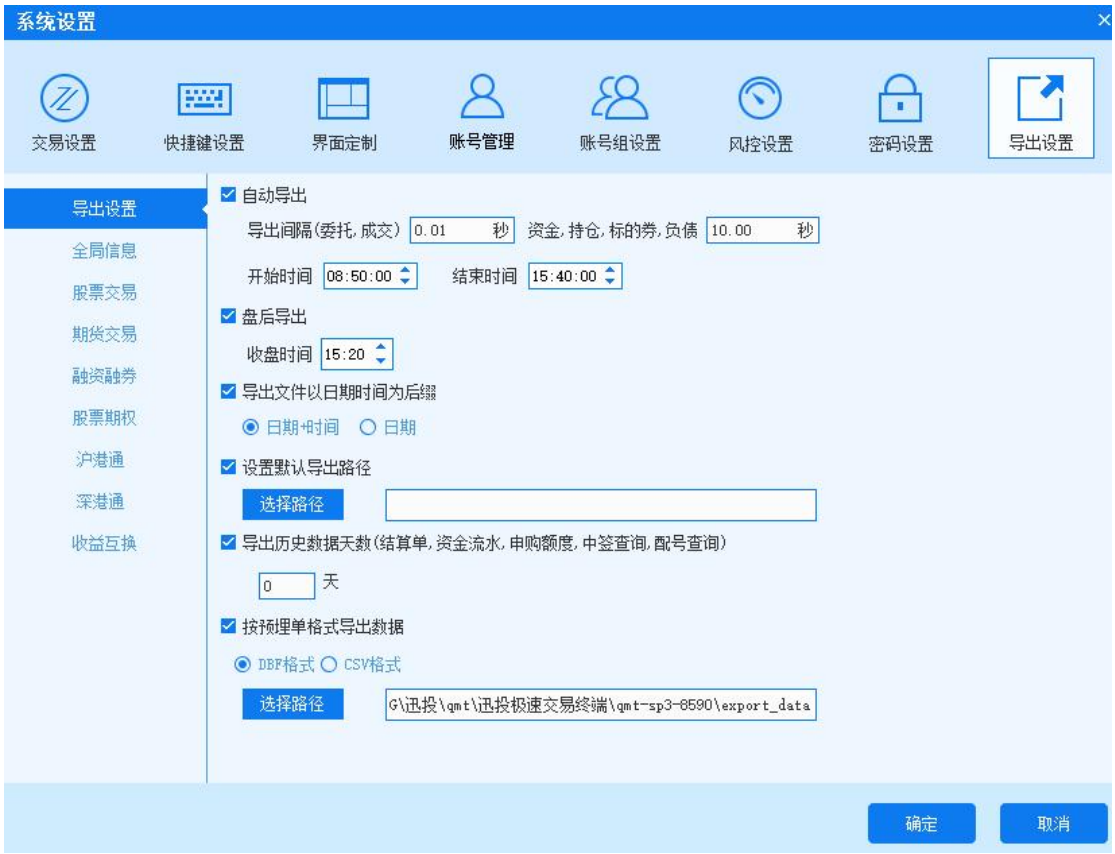
在管理端，也可以对用户密码进行修改设置。



管理端支持修改用户密码

3.6.3.8. 导出设置

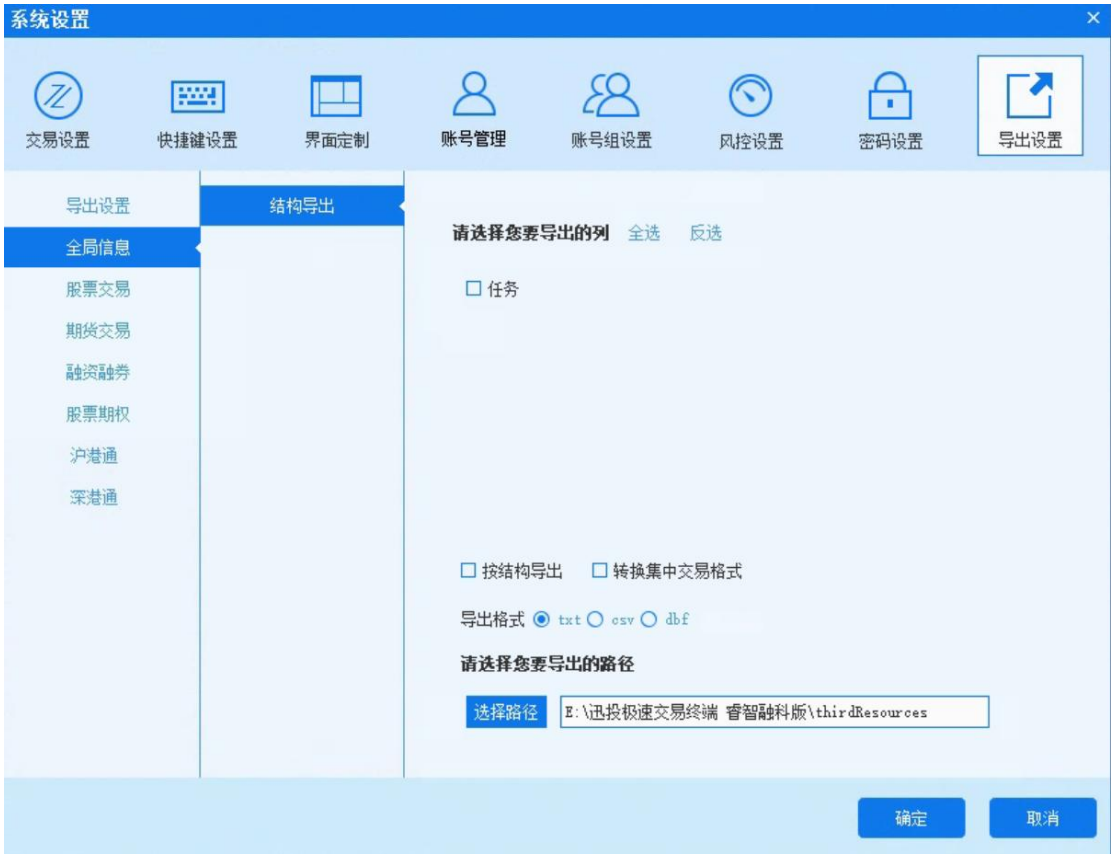
（1）导出设置可选择自动导出或盘后导出，自动导出可设置导出间隔，支持为委托、成交和资金、持仓、标的券、负债等数据设置不同的导出间隔，最短为0.01秒，盘后导出可设置导出开始的时间，两种设置可同时勾选，导出时可自动以导出日期+时间作为后缀。



导出设置

（2）支持全局信息导出、股票交易、期货交易、融资融券、股票期权、沪港通、深港通的账号、持仓、委托、成交数据导出。导出方式分为：普通导出和增量导出。

全局信息可以按结构导出，可以选择导出的列（目前有任务列），同时支持勾选**按结构导出**和**转换集中交易格式**导出。



全局信息导出数据选择

进行**按结构导出**操作后，可在设置好的路径下，看到导出的全局信息。

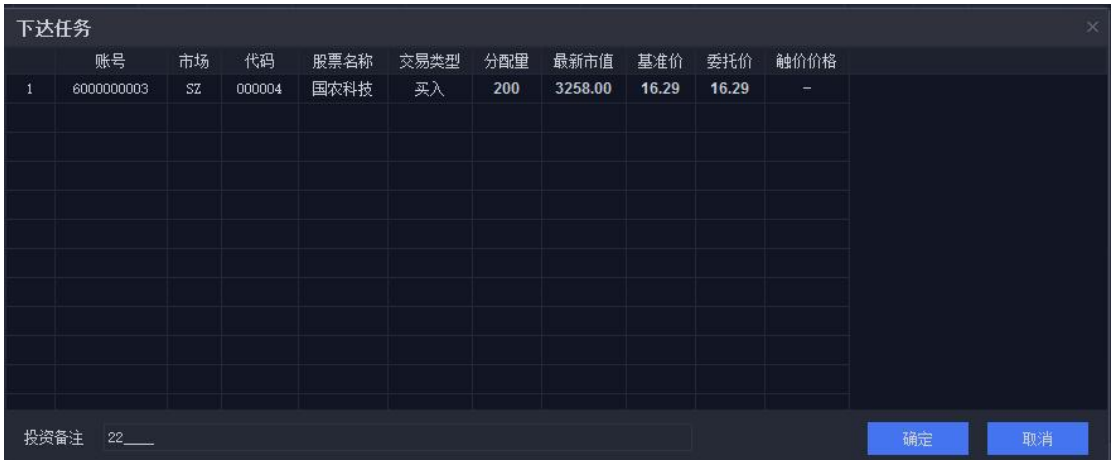
按结构导出任务

转换集中交易格式导出，是集中交易系统结合 QMT 极速策略交易系统下单的定制导出方式。集中交易系统，是迅投为私募管理人统一管理所有券商 PB 产品提供完整解决方案的一套综合系统。集中交易可通过便捷交易、篮子导入、API、CTP 直连等多种方式，对多个券商 PB 进行流程化、自动化的统一下单。

①通过集中交易系统，把便捷交易下到指定路径，QMT 系统通过读取便捷交易，下达任务。

集中交易下单面板

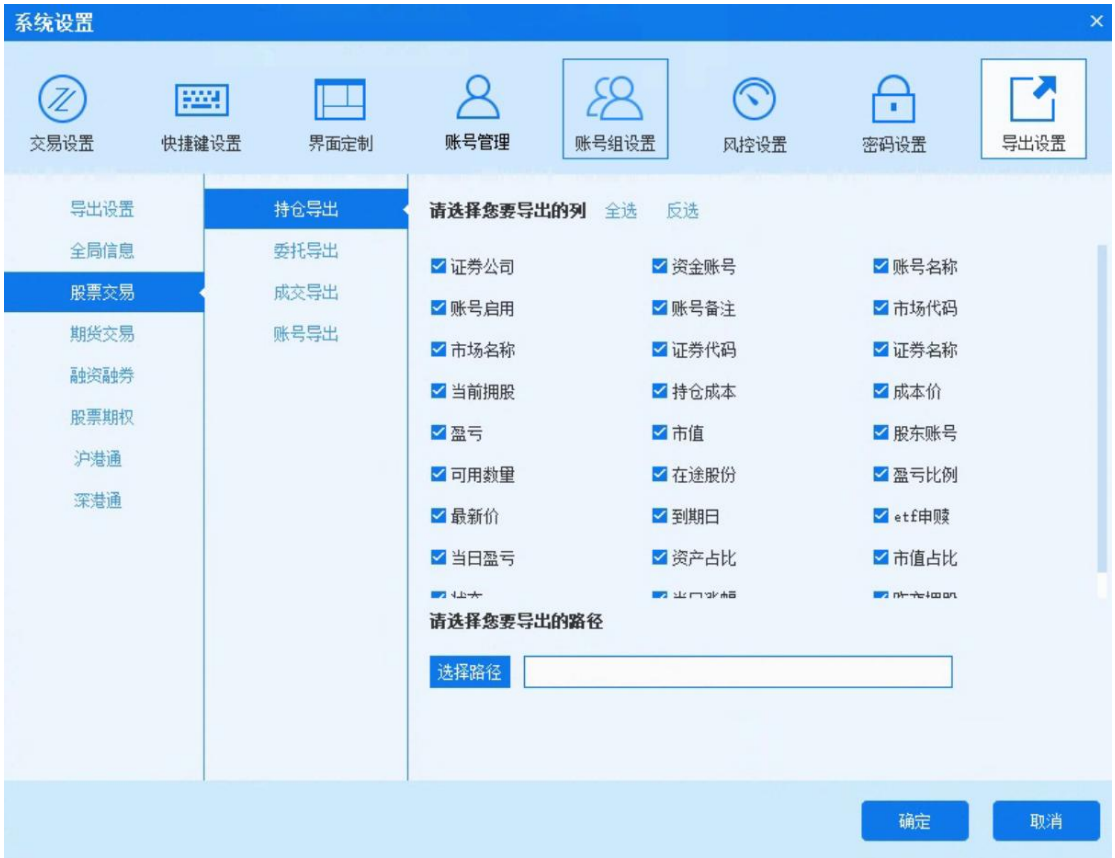
②QMT 读取便捷交易，会弹出下单任务界面。



QMT 下达任务面板

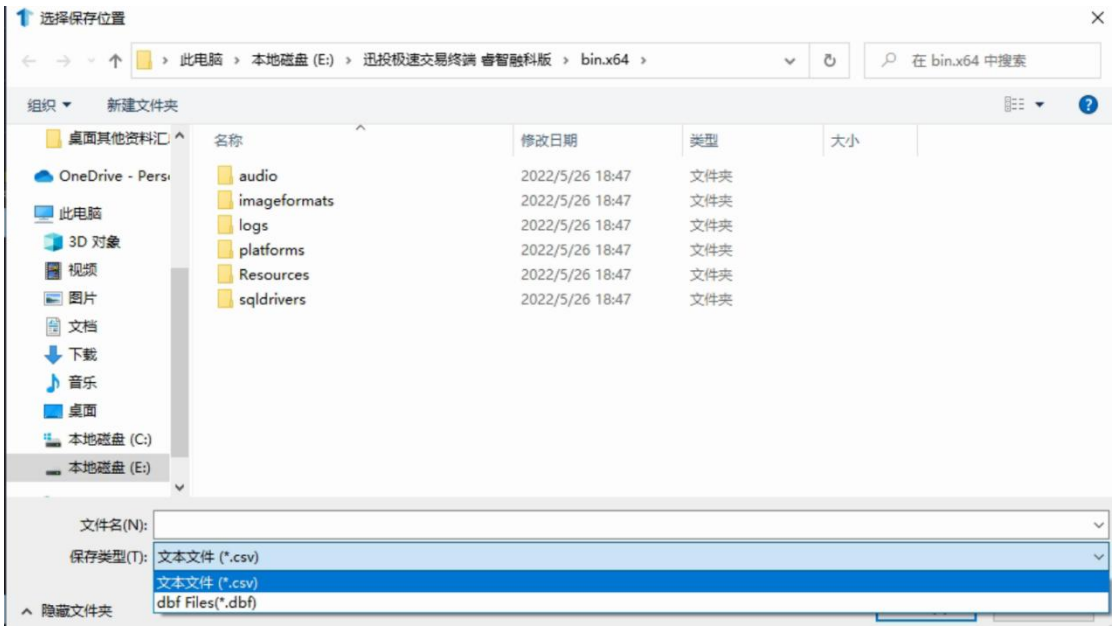
③导出时需勾选转换集中交易格式，按结构导出到指定的默认文件夹，待文件被集中交易系统读取，得到信息反馈。以集中交易格式按结构导出全局信息后，会生成名为 commanddetail 的 txt 文件，而只按结构导出全局信息时，生成的是名为 TaskDetail 的 txt 文件。

（3）导出还可针对单独的交易类型，股票、期货、两融交易、股票期权的持仓、委托、成交和资金账号数据导出。



股票交易导出数据选择

对于不同的交易类型导出文件的格式可分为.csv 格式和.dbf 格式（增量导出）两种。



导出格式

3.6.4. 操作

3.6.4.1. 数据管理

数据管理包括导入数据，清理数据，补充数据，导出数据和收盘清理。

①导入数据：支持将符合格式的文件导入到迅投QMT极速策略交易系统交易终端中。各数据作用域可选择所导入文件的字段和相应的字段顺序。

导入数据

②清理数据：在“清理数据”中可以清除掉混乱和错误的数据。而在“数据删除”中则可以将不需要的数据删掉以释放磁盘空间。用户可根据需要先选择市场，然后选择数据整理的范围，K线种类和需要删除的内容。

清理数据

③补充数据：提供多种范围数据和多种数据类型以供下载。时间周期涵盖：最近一星期，最近一个月，全部，自定义时段；数据类型包含 K 线数据，分笔成交数据，财务数据，除权数据，板块成分股，行业成分股，高级数据，过期合约列表，龙虎榜数据，历史主力合约，ETF 申赎清单，过期合约 K 线，港股资金流向数据，全部板块。如果用户只需要日线数据并且网速不快也不想占用太多时间，建议只下载周期选项里的“日线”部分就可以，一般分钟线较大。

补充数据

④导出数据：用户可将已经存在的数据（补充数据下载的和自动缓存的）导出到指定目录下，支持选择数据类型，选择市场品种，自定义时段，选择复权方式等。用户只需选择导出文件所在的目录，在导出时系统会自动寻找目前软件装载的目录，推荐使用这个目录。

导出数据

④收盘清盘：用户可对于收盘清盘的操作，用户可选择补充指定品种，选择需要保存的数据。

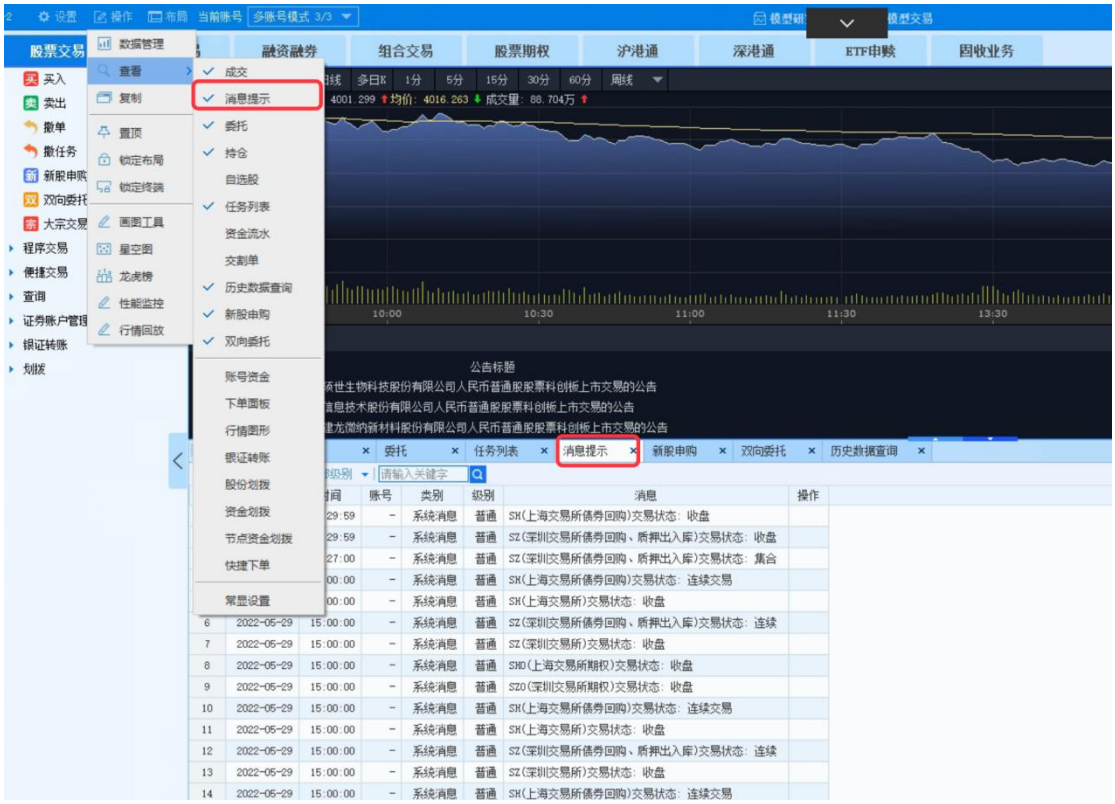
收盘清盘

3.6.4.2. 查看

查询当前交易界面的所有子面板调用信息，子面板若呈选中状态，则表明该子面板窗口已在界面显示。可以一次选中并打开多个子面板。

查看面板显示

选中子面板时，子面板会呈现在窗口中显示。举例：查看消息提示显示。



查看消息提示面板

有一些窗口是不会经常被用到，在需要的时候，可以进行查看，但失去焦点，窗口就会消失。而有些窗口需要一直被显示，这里新增了常显窗口设置。可以选择经常被用到的窗口始终被显示在界面，失去焦点，不会消失。

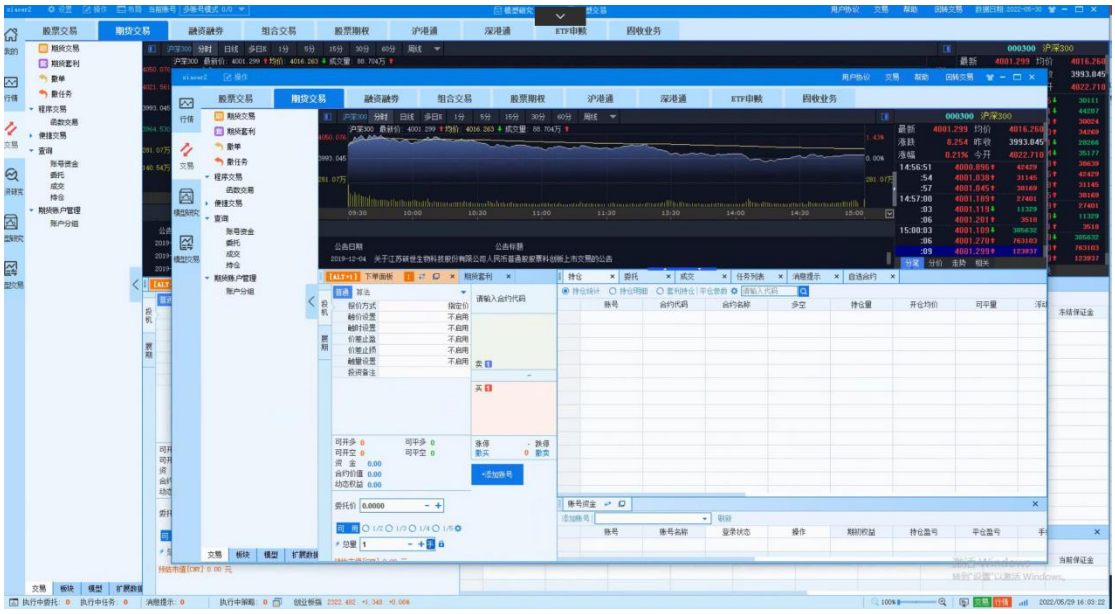
常显窗口设置

QMT 极速策略交易终端的账号资金、下单面板、任务列表、持仓、委托和成交面板在默认布局中固定显示，不会随着焦点改变消失。

固定显示

3.6.4.3. 复制

单击一次“复制面板”即可实现快速复制一个新的整体界面，为用户多账号下单、多屏幕显示提供便利。



复制界面

3.6.4.4. 置顶

设置当前交易终端用户界面为电脑桌面最顶端。单击 ″界面置顶″按钮实现置顶，同时按钮会变成取消置顶，当单击″取消置顶″，则解除界面置顶。

界面置顶

3.6.4.5. 锁定布局

锁定当前交易主界面布局，锁定后用户无法查看面板、任意拖拽子板块窗口、改变窗口大小等操作。单击"布局锁定"按钮，实现锁定功能同时按钮变成解锁布局，再次单击"解锁布局"，则解除布局锁定操作。当布局为锁定状态时，鼠标拖拽改变窗口大小，会弹出解锁布局的提示框，确定即可解锁当前布局。

改变布局提示

3.6.4.6. 锁定终端

防止其他人用自己的计算机进行下单操作或查询一些数据，造成不必要的损失，客户端上锁定终端可以对当前交易端进行锁定，只有再次输入用户名密码后才可以登录到客户端主界面。

锁定终端

3.6.4.7. 画图工具

点击画图工具，可打开画线工具对话框，使用压/撑线、趋势线、矩形和文本工具辅助分析大盘及个股走势。

画图工具

3.6.4.8. 星空图

在星空图二维坐标中，个股的位置反映了其涨幅、涨速等指标在所属板块中的相对情况。星空图中的星星数量取决于该板块内个股的数量。

如图所示，可在界面的左上角选择不同板块，并在界面右下角的星空图中进行展示，同时可在界面的左下角选择该板块内各个股，并在界面的右上角展示该股的分时图和K线图。

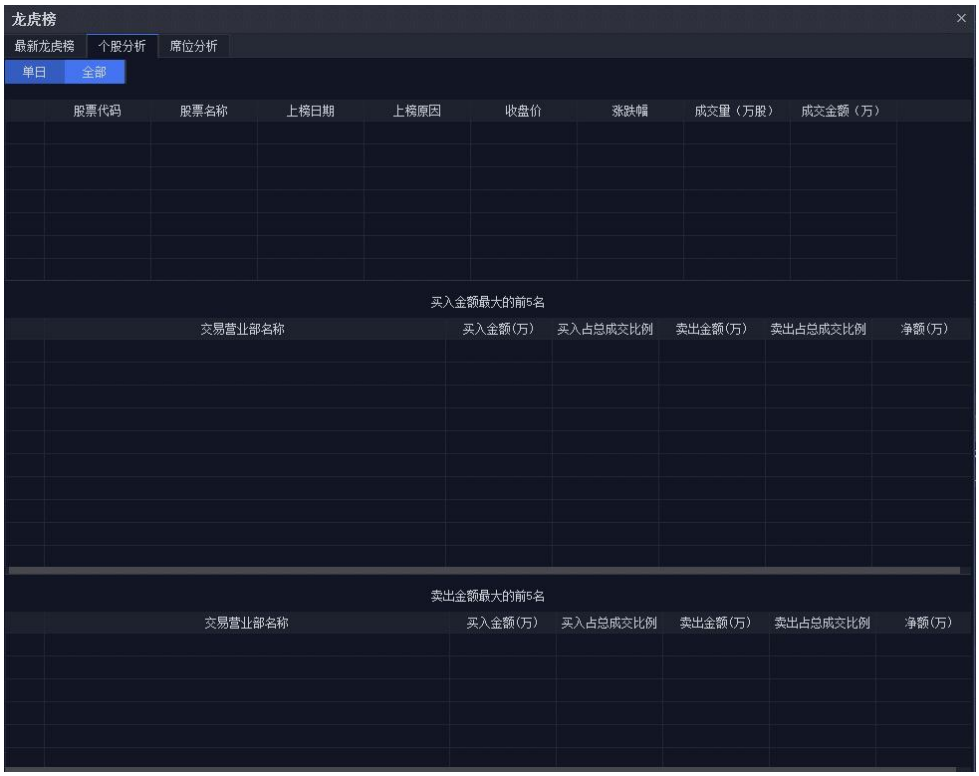
星空图

3.6.4.9. 龙虎榜

龙虎榜从时间跨度划分。分别可以看到不同时间段的最新龙虎榜。龙虎榜显示的主要数据有：代码、名称、详细、上榜日、收盘价、涨跌幅及上榜原因。

龙虎榜

个股分析中存在个股的数据显示和买入（卖出）金额最大前 5 名的交易营业部信息。



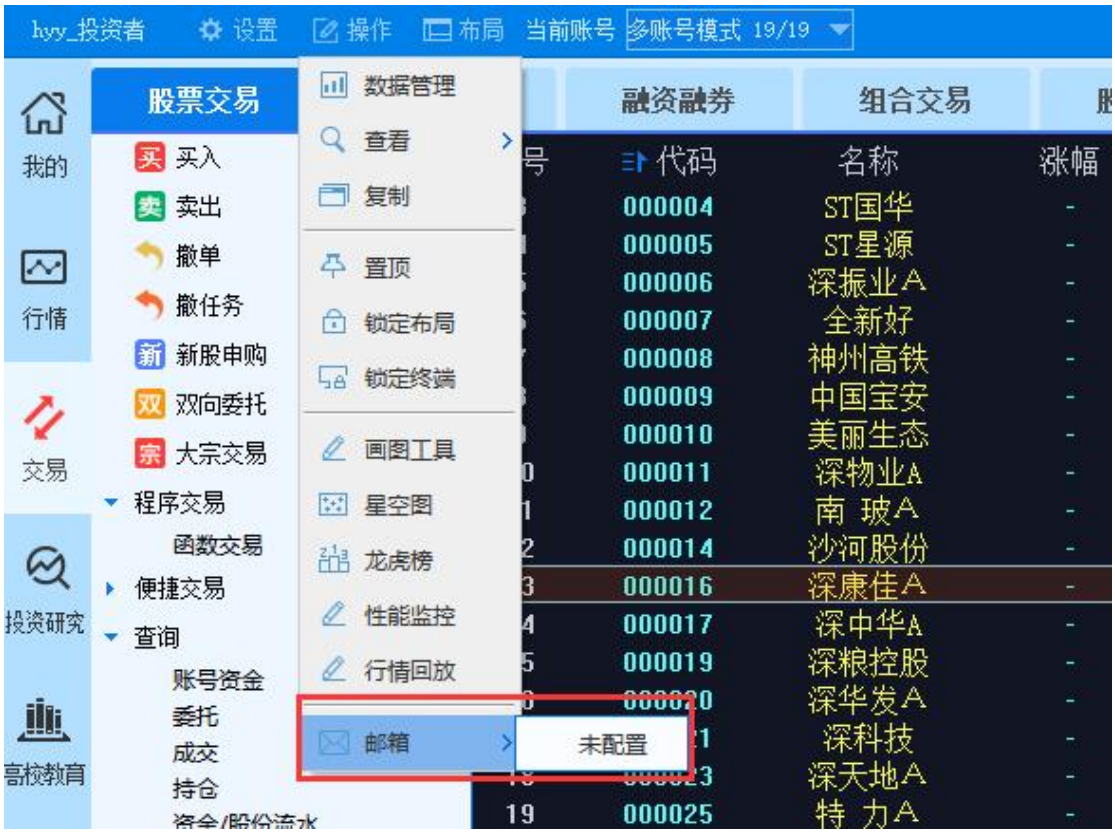
个股分析

席位分析根据时间跨度，对上榜证券进行分析。

席位分析

3.6.4.10. 邮箱

管理端-系统设置-地址配置管理中，填写“接收通知邮箱地址链接”后，交易端导航栏-操作-邮箱选项，可跳转至相应的邮箱链接。


hyy_投资者
设置
操作
布局
当前账号
多账号模式 19/19
我的
行情
交易
投资研究
高校教育
股票交易
买入
卖出
撤单
撤任务
新股申购
双向委托
大宗交易
程序交易
函数交易
便捷交易
查询
账号资金
委托
成交
持仓
数据管理
查看
复制
置顶
锁定布局
锁定终端
画图工具
星空图
龙虎榜
性能监控
行情回放
邮箱
未配置
融资融券
组合交易
代码
名称
涨幅
000004 ST国华
000005 ST星源
000006 深振业A
000007 全新好
000008 神州高铁
000009 中国宝安
000010 美丽生态
000011 深物业A
000012 南 玻A
000014 沙河股份
000016 深康佳A
000017 深中华A
000019 深粮控股
000025 特 力A

邮箱-未配置

邮箱-已配置

3.6.4.11. 性能监控

性能监控包括行情监控、对象数量监控和内存管理器。

行情监控：包括行情源、全推属性、是否需要全推、是否开启全推，查看各行情源链接从全推订阅的代码个数、单只订阅代码个数。

对象数量监控：可以查看对象名称、创建数量和存活数量，可以进行刷新和清理内存操作。

内存管理器：可以查看内存管理器名称、大小，查看详细、删除和刷新操作。

性能监控

行情监控 | 对象数量监控 | 内存管理器

刷新

	行情源	全推属性	是否需要全推	是否开启全推	从全推订阅的代码个数	单支订阅的代码个数
1	proxy股票	强制全推:1, 智能全推:0, 最大订阅数:12000	否	是	0	0
2	proxy期货	强制全推:0, 智能全推:0, 最大订阅数:100000	否	否	0	0
3	股票	强制全推:1, 智能全推:0, 最大订阅数:12000	否	是	0	0
4	期货	强制全推:1, 智能全推:0, 最大订阅数:12000	否	是	0	0
5	proxy股票期权	强制全推:0, 智能全推:0, 最大订阅数:100000	否	否	0	0
6	股票期权	强制全推:1, 智能全推:0, 最大订阅数:12000	否	是	0	0
7	proxy深港通	强制全推:0, 智能全推:0, 最大订阅数:100000	否	否	0	0
8	深港通	强制全推:1, 智能全推:0, 最大订阅数:12000	否	是	0	0
9	proxy沪港通	强制全推:0, 智能全推:0, 最大订阅数:100000	否	否	0	0
10	沪港通	强制全推:1, 智能全推:0, 最大订阅数:12000	否	是	0	0
10	合计					

性能监控-行情监控

性能监控

行情监控 | 对象数量监控 | 内存管理器

刷新 清理内存

	对象名称	创建数量	存活数量
1	AccountDetail	0	0
2	AccountStaticsData	0	0
3	BankAmountDetail	0	0
4	BankDetail	0	0
5	BankTransferReq	0	0
6	CAccountAlgoRange	0	0
7	CAccountCalcInfo	0	0
8	CAccountComplianceForMarket	0	0
9	CAccountDetail	0	0
10	CAccountDetailV2	0	0
11	CAccountDynamicIndex	0	0
12	CAccountFreqCompliance	0	0
13	CAccountFreqPreTimeLimit	0	0
967	合计	0	0

性能监控-对象数量监控

性能监控

行情监控 | 对象数量监控 | 内存管理器

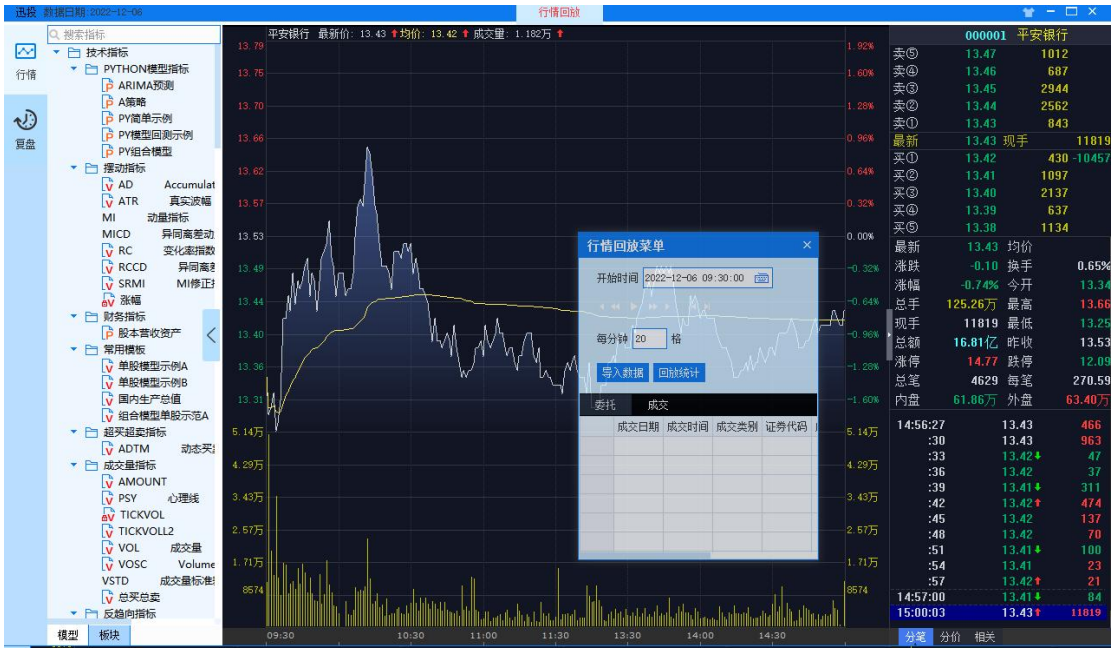
刷新

	名称	大小	操作
1	数据缓存	4	详细 删除

性能监控-内存管理器

3.6.4.12. 行情回放

行情回放，能实现单票L1级别的行情回放，支持分时图和多周期回放，同时提供L1级别的盘口联动，使回放更接近当日实时行情，同时能够实现多票联动回放，最多支持16股联动。

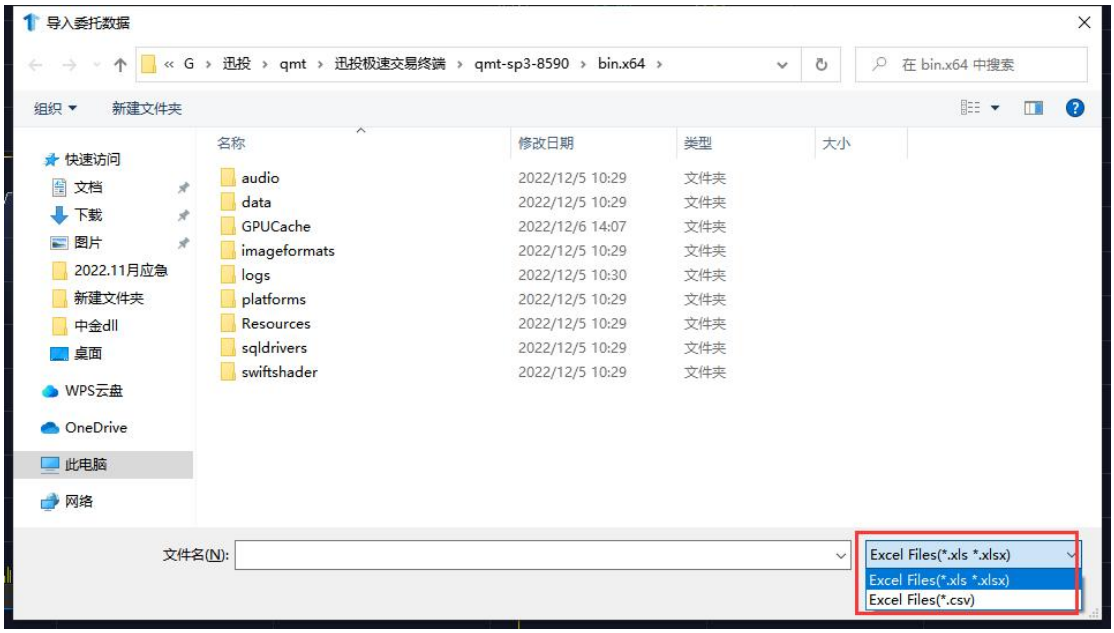


行情回放

行情回放菜单包括日期、时间、播放速率、导入数据、回放统计、委托、成交，系统默认从选定日期开始播放至最新收盘，支持手动模式播放。

行情回放菜单

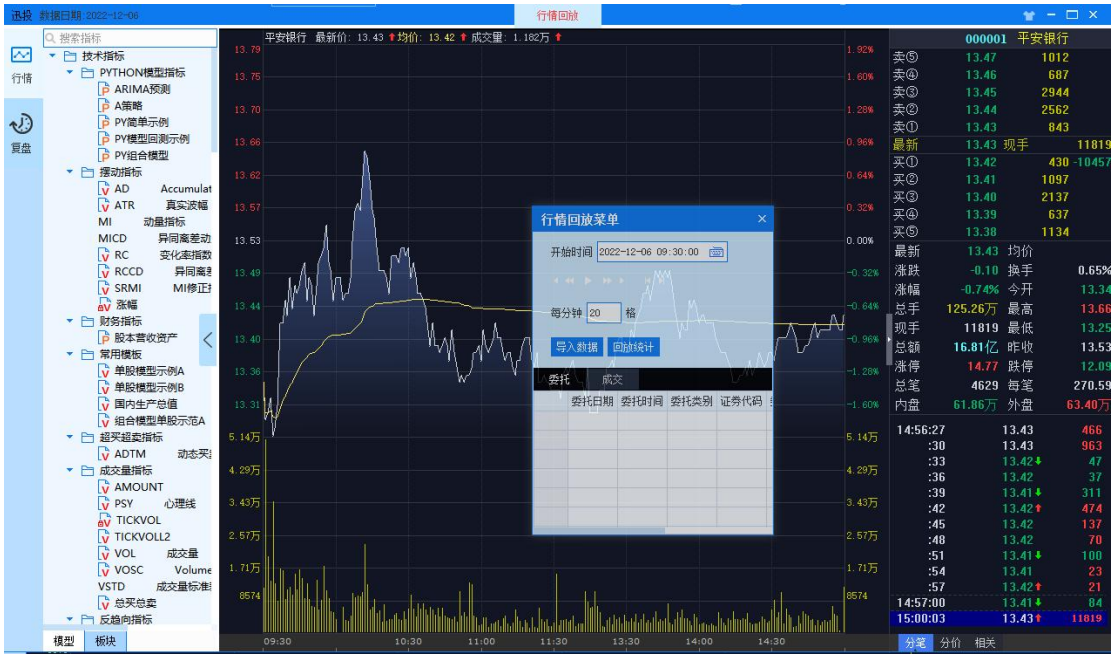
导入数据文件格式，xls、xlsx、csv。



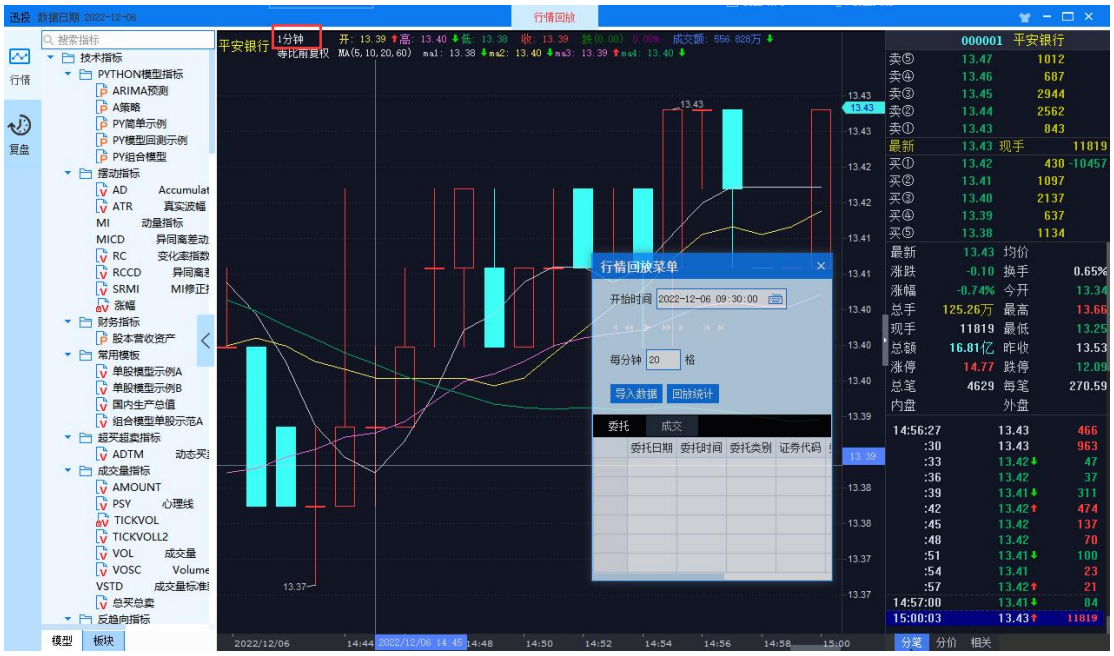
回放统计：实时显示回放时的对应市场成交情况：

平安银行 时段统计
时段统计
追踪统计
起始时间: 09:30
终止时间: 09:30
实时
共 1 个周期
起始价:13.34
最高价:13.34
最低价:13.34
最终价:13.34
总手:13.34
涨跌幅:11570
均价:0.00
振幅:0.00%
换手率:
金额:
大盘涨跌幅:
龙虎看盘（逐笔）
逐笔成交成交里统计
主动买入
共0单 0.0手/单
特大 0 0.0%
大单 0 0.0%
中单 0 0.0%
小单 0 0.0%
主动卖出
共0单 0.0手/单
特大 0 0.0%
大单 0 0.0%
中单 0 0.0%
小单 0 0.0%

回放统计

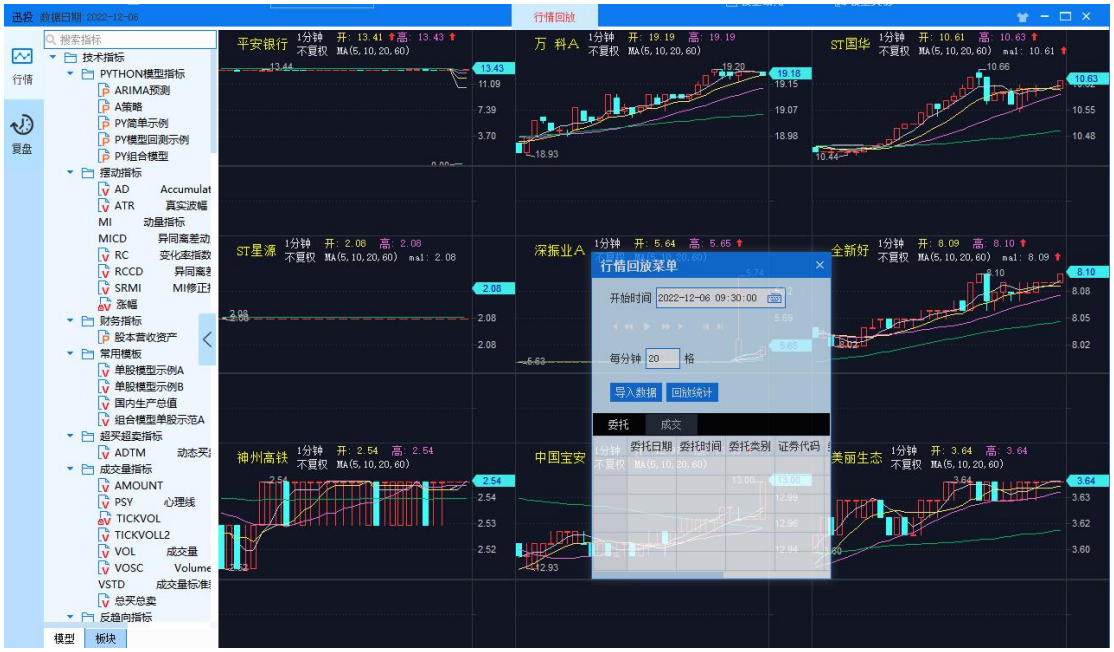

行情回放
行情
复盘
技术指标
PYTHON模型指标
ARIMA预测
A策略
PY简单示例
PY模型回测示例
PY组合模型
摆动指标
AD Accumulat
ATR 真实波幅
MI 动量指标
MICD 异同离差动
RC 变化率指数
RCCD 异同离
SRMI MI修正
涨幅
财务指标
股本营收资产
常用模板
单股模型示例A
单股模型示例B
国内生产总值
组合模型单股示范A
超买超卖指标
ADTM 动态买
成交量指标
AMOUNT
PSY 心理线
TICKVOL
TICKVOLL2
VOL 成交量
VOSC Volume
VSTD 成交量标准
总买总卖
反趋向指标
模型
板块
平安银行 最新价: 13.43 均价: 13.42 成交量: 1.182万
行情回放菜单
开始时间 2022-12-06 09:30:00
每分钟 20 格
导入数据
回放统计
委托
成交
委托日期
委托时间
委托类别
证券代码
000001 平安银行
卖⑤ 13.47 1012
卖④ 13.46 687
卖③ 13.45 2944
卖② 13.44 2562
卖① 13.43 843
最新 13.43 现手 11819
买① 13.42 430 -10457
买② 13.41 1097
买③ 13.40 2137
买④ 13.39 637
买⑤ 13.38 1134
最新 13.43 均价
涨跌 -0.10 换手 0.65%
涨幅 -0.74% 今开 13.34
总手 125.26万 最高 13.66
现手 11819 最低 13.25
总额 16.81亿 昨收 13.53
涨停 14.77 跌停 12.09
总笔 4629 每笔 270.59
内盘 61.86万 外盘 63.40万
14:56:27 13.43 466
:30 13.43 963
:33 13.42 47
:36 13.42 37
:39 13.41 311
:42 13.42 474
:45 13.42 137
:48 13.42 70
:51 13.41 100
:54 13.41 23
:57 13.42 21
14:57:00 13.41 84
15:00:03 13.43 11819
分笔
分价
相关

分时行情回放



1 分钟行情回放

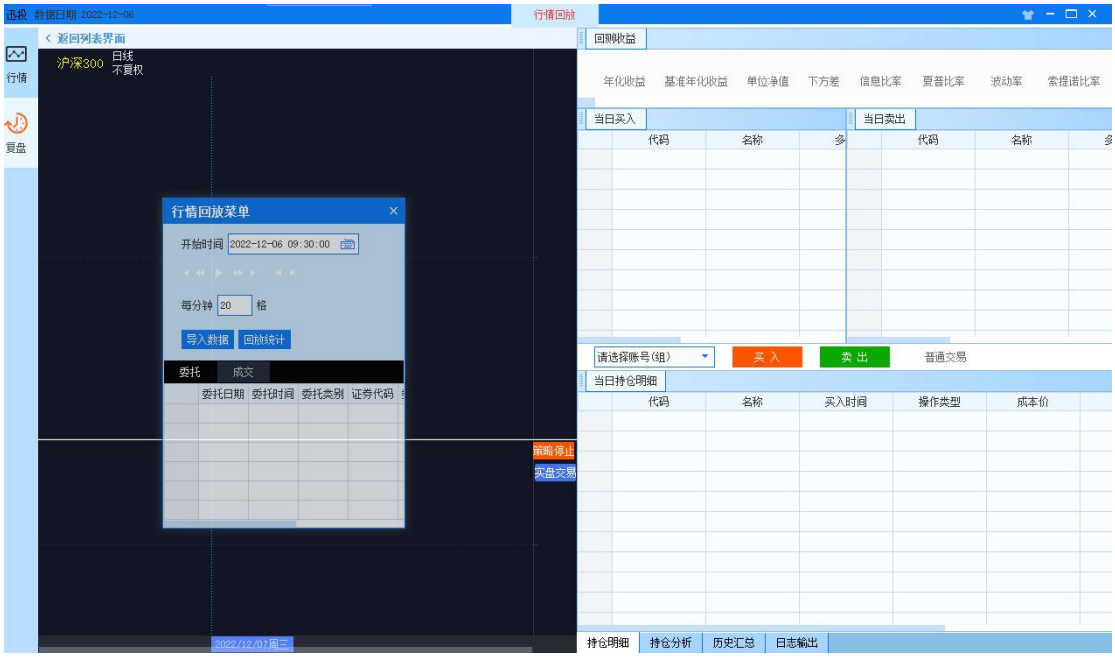
多票联动目前支持同周期同时间段的多票回放，支持 2、4、6、9、16 票联放。



多票联动行情回放

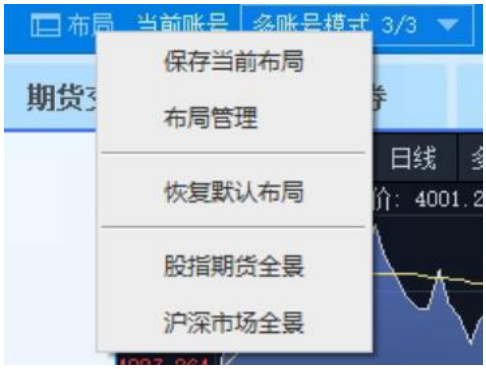
复盘

点击复盘进入策略回测界面：



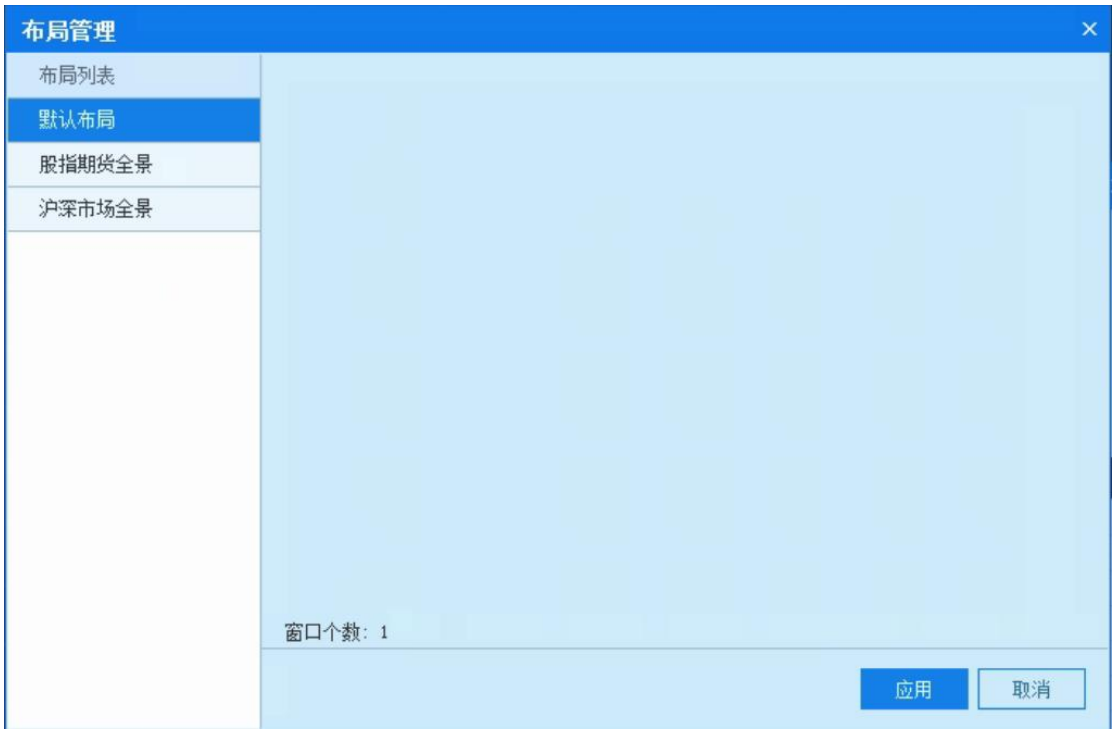
3.6.5. 布局

可以保存自定义布局设计，应用自定义或者系统默认的布局，方便调用。



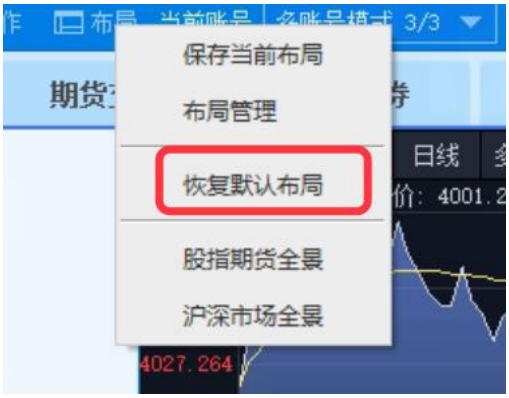
保存当前布局

点击保存当前布局即可保存用户自定义的布局。保存过的布局会相应的在布局管理中保存显示，点击应用即可使用。



布局管理

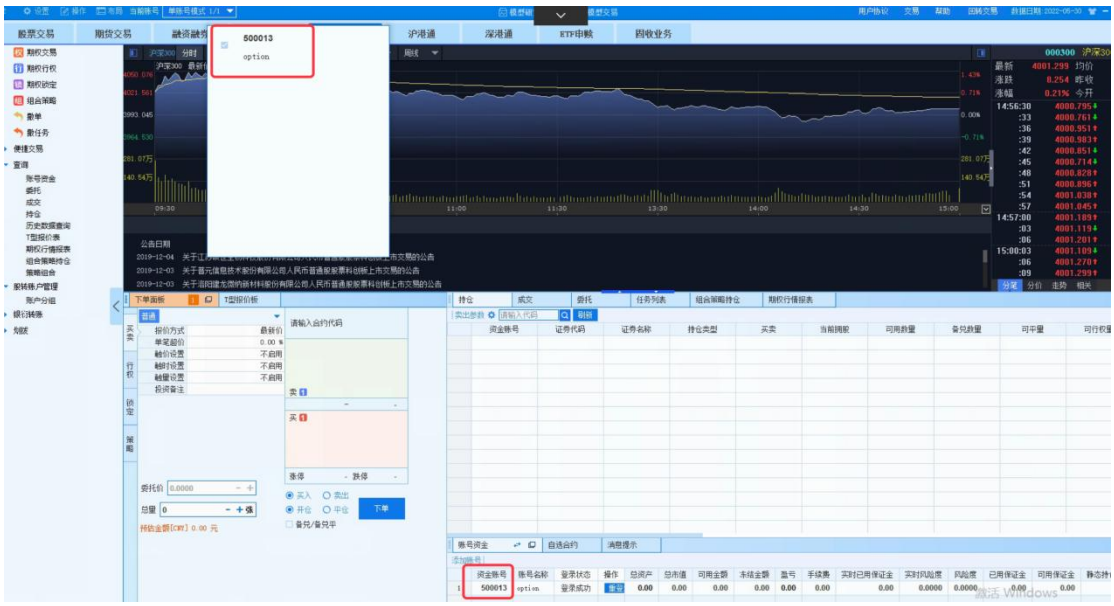
点击恢复默认布局，布局会恢复默认布局。



恢复默认布局

3.6.6. 当前账号

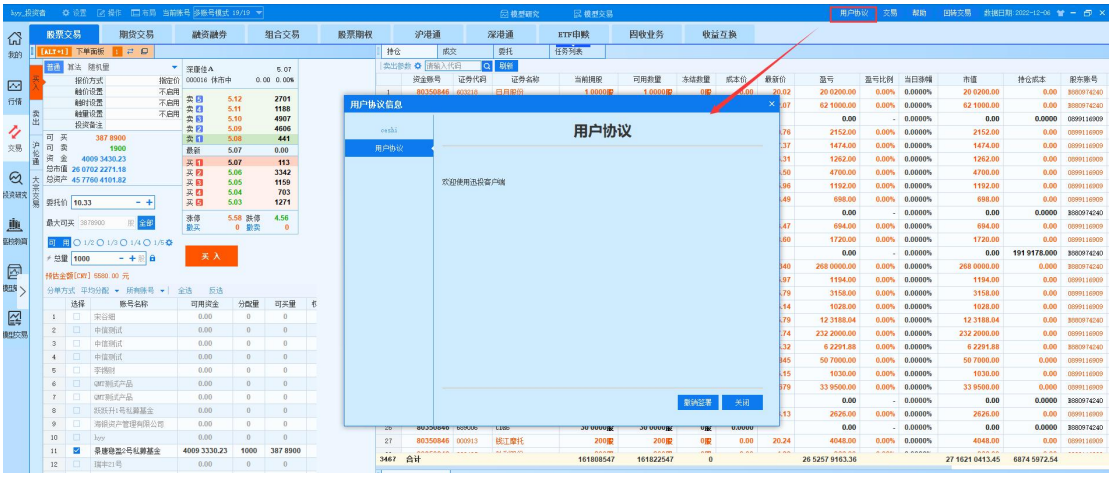
当前账号的下拉框中，可根据用户的当前需求，选择在交易界面显示全部或部分账号，方便交易操作。



当前账号设置

3.6.7. 用户协议

点击界面右上角用户协议按钮，显示用户协议信息。



用户协议

3.6.8. 交易

点击界面右上角交易按钮，打开交易界面。

3.6.9. 帮助

点击界面右上角帮助按钮，可以打开功能帮助手册、python 开发手册和 VBA 开发手册。

帮助

3.6.10. 回转交易

管理端用户功能权限开启股票日内回转权限后，QMT 用户登录交易端，工具栏右上角显示“回转交易”。首次点击“回转交易”时，系统首先进行回转交易端及管理端的下载，下载并解压完成后，弹出回转交易端登录界面，回转交易端界面右下角点击管理终端，即可打开回转管理端登录界面。

回转交易端供回转交易员登录并进行交易，回转交易员由回转单元管理员（即拥有股票日内回转权限的 QMT 用户）在回转单元管理终端创建。

回转单元管理终端供回转单元管理员（即拥有股票日内回转权限的 QMT 用户）登录，进行回转单元的创建和管理。登录回转单元管理终端的用户名和密码同 QMT 用户名和密码。

首次使用回转交易功能时，需确保自己已经拥有股票日内回转交易的权限，同时需在 QMT 交易端添加资金账号，以供回转交易使用。

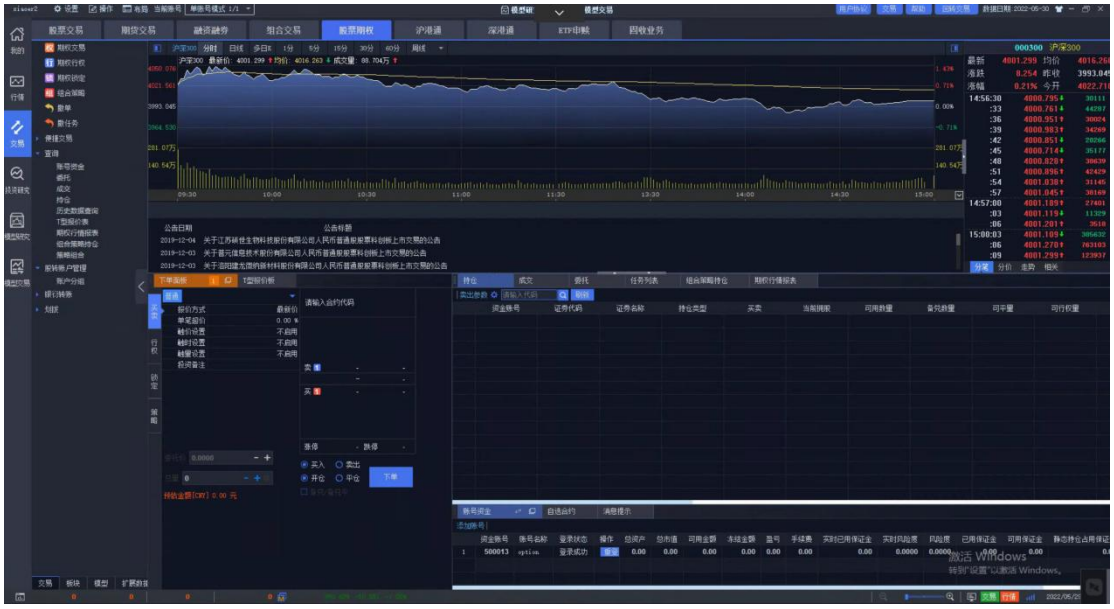
3.6.11. 换肤

点击界面右上角换肤按钮，可按照个人喜好更换系统界面颜色。有三种 UI 可选择，灰蓝色、海蓝色和灰黑色。

系统换肤

灰蓝色皮肤

海蓝色皮肤



灰黑色皮肤

4. 附录

名词解释

迅投 QMT 极速策略交易系统基本模块

- 管理终端：迅投 QMT 极速策略交易系统的组成部分之一，主要功能包括权限配置等方面的用户管理、以及账号管理、行情源管理、全局风控管理、数据支持管理等。
- 交易终端：迅投 QMT 极速策略交易系统的组成部分之一，主要用于客户方对于股票期货、融资融券、股票期权、组合交易、深沪港通等方面的交易操作，也兼有账号账户组的添加及风控设置。
- 用户：迅投 QMT 极速策略交易系统中特指具有角色类型属性的具体用户，角色类型有高级管理员，投资者，运维者和投资者等。
- 经纪公司：迅投中是指证券期货等方面的经纪商，证券经纪商是指以接受客户委托，代客户买卖证券并以此收取佣金的中间人。期货经纪商是指依法设立的以自己的名义代理客户进行期货交易并收取一定手续费的中介组织。

- 行情源：交易变化及流通情况，添加后，盘口会显示接收到的行情。
- 风控：通过对相关数据的限制和实时监控，消灭或减少风险事件发生的各种可能性,或者减少风险事件发生时造成的损失，来实现风险控制。

证券

- 委托：在证券交易市场，投资者买卖证券是不能直接进入交易所办理的，而必须通过证券交易所的会员来进行，换而言之，投资者需要通过经纪商的代理才能在证券交易所买卖证券。在这种情况下，投资者向经纪商下达买进或卖出证券的指令，称为“委托”。
- 报盘：证券经纪商接到投资者的委托指令后，首先要对投资者身份的真实性和合法性进行审查。审查合格后，经纪商要将投资者委托指令的内容传送到证券交易所进行撮合。这一过程称为“委托的执行”，也成为“申报”或“报盘”。
- 资金账户：资金账户即证券交易结算资金账户，是指投资者用于证券交易资金清算的专用账户。资金账户主要分为现金账户和保证金账户两种。
- 可用资金：可用资金是投资者存放在账户内可用于提取现金和开新仓的资金部分，是可以买卖股票，基金，债券，国债回购等的资金。
- 总资产：总资产是指某一经济实体拥有或控制的、能够带来经济利益的全部资产。迅投中总资产=可用资金+市值+冻结金额。
- 市值：市值是指一家上市公司的发行股份按市场价格计算出来的股票总价值，其计算方法为每股股票的市场价格乘以发行总股数。整个股市上所有上市公司的市值总和，即为股票总市值。
- 当前拥股：当前拥股是买入已成交后持有的股数。股份余额显示的是你买入一个交易日后持有的股数。在途股份是你当日买入的股数。当前拥股=可用+在途。
- 保证金：在证券市场融资购买证券时，投资者所需缴纳的自备款。

- 手续费：证券交易手续费是指投资者在委托买卖证券时应支付的各种税收和费用的总和。通常包括印花税、佣金、过户费、其他费用等几个方面的内容。
- 交易日：证券、期货、物资等交易的日期。如中国股市的股票的交易日为除节假日外的周一至周五。（AM：30-11：30 ，PM13：00-15：00）
- 涨停价：涨停价是以早一天的收盘价来算的，即前一天的收盘价加 10%。但是是股票交易以分为最小单位，所以因为四舍五入的存在，只要是收盘价出现分位数，第二天的涨停和跌停价都不会是刚好 10%。
- 逆回购：是金融出资方将资金融给资金融入方，收取有价证券作为抵押，并在未来收回本息，并解除有价证券抵押的交易行为。
- 新股申购：是为获取股票一级市场、二级市场间风险极低的差价收益，不参与二级市场炒作，不仅本金非常安全，收益也相对稳定，是稳健投资者理想投资选择。
- 一级市场：也称为发行市场（Issuance Market），它是指公司直接或通过中介机构向投资者出售新发行的股票的市场。所谓新发行的股票包括初次发行和再发行的股票，前者是公司第一次向投资者出售的原始股，后者是在原始股的基础上增加新的份额。
- 二级市场：也称股票交易市场，是投资者之间买卖已发行股票的场所。这一市场为股票创造流动性，即能够迅速脱手换取现值。我们通常接触到的股票交易，一般指二级市场。
- 单笔超价：在基准价的基础上设定每笔下单的超价，在下单时系统自动向利于成交方向加/减单笔超价。

期货

- 期货交易：是期货合约买卖交换的活动或行为。
- 期货合约：是由期货交易所统一制定的、在将来某一特定时间和地点交割一定数量标的物的标准化合约。这个标的物，又叫基础资产，是期货合约所对

应的现货，可以是某种商品，如铜或原油，也可以是某个金融工具，如外汇、债券，还可以是某个金融指标，如三个月同业拆借利率或股票指数。

- 持仓：在期货交易中，无论是买还是卖，凡是新建头寸都叫开仓。交易者建仓之后手中就持有头寸，这就叫持仓。
- 持仓盈亏：与平仓盈亏相对。亦称账面盈亏或浮动盈亏。交易者在交易闭市时所持有合约按当日结算价计算的持仓值与原持仓值的价差。
- 持仓盯市盈亏（有昨仓）=（持仓价-开仓价）*合约乘数*手数；
- 持仓浮动盈亏=（最近价-持仓价）*合约乘数*手数。
- 平仓盈亏：平仓是指期货交易者买入或者卖出与其所持期货合约的品种、数量及交割月份相同但交易方向相反的期货合约，了结期货交易的行为，简单的说就是“原先买入就卖出，原先是卖出的就买入”。与持仓盈亏相对。期货交易者在实际平仓时所发生的损益。若客户当日没有进行平仓交易，平仓盈亏为0。
- 平仓盯市盈亏（有昨仓）=（平仓价 - 持仓价）*合约乘数*手数；
- 平仓浮动盈亏=（平仓价 - 最新价）*合约乘数*手数。
- 静态权益：静态权益是指最近一次结算时的权益。
- 静态权益=前一交易日结算后的期末结存。
- 动态权益：根据盘面即时价格计算出来的权益，在交易时间里，动态权益是随着价格的波动而不断变化的。
- 动态权益=静态权益+持仓盈亏+平仓盈亏-手续费（除去质押等情况下）。
- 期现套利：期现套利是指某种期货合约，当期货市场与现货市场在价格上出现差距，从而利用两个市场的价格差距，低买高卖而获利。理论上，期货价格是商品未来的价格，现货价格是商品目前的价格，按照经济学上的同一价格理论，两者间的差距，即“基差”（基差=现货价格－期货价格）应该等于该商品的持有成本。一旦基差与持有成本偏离较大，就出现了期现套利的

机会。

- 套期保值：是指企业为规避外汇风险、利率风险、商品价格风险、股票价格风险、信用风险等，指定一项或一项以上套期工具，使套期工具的公允价值或现金流量变动，预期抵消被套期项目全部或部分公允价值或现金流量变动风险的一种交易活动。

融资融券

- 担保品买入：客户通过普通交易买来股票，就是担保品买入。担保品买入不产生负债和利息。资金和持仓的变化类似普通股票交易。
- 担保品卖出：客户通过普通交易卖出股票，就是担保品卖出。担保品卖出不产生负债和利息。资金和持仓的变化类似普通股票交易。
- 融资买入：融资买入是对股票进行买卖操作的一种方法，用很直白的话讲：就是用借钱的办法买入股票。融资买入会产生负债合约。融资买入是借钱买入股票，所以账户里面的可用资金是不发生变化的。因此也不会有冻结资金出现。当融资买入未成交之前会在当日委托里面查询到。当融资买入成交之后，相应的成交数据也会在当日成交中查询到；当有成交之后会有相应的持仓产生。例如：当你看好某只股票想大举介入而手中钱又不多时就可以向券商借钱买股票，当股票上涨到目标价后，你可以卖出股票清偿借款，从而放大你的收益。
- 直接还款：直接还款是指，投资者在信用资金账户内存入资金，通过融资融券交易系统中“直接还款”指令偿还融资债务，结算时该资金直接划转至证券公司融资专用资金账户的一种还款方式。
- 卖券还款：卖券还款是指，投资者通过其信用证券账户选择“卖券还款”的交易指令进行证券卖出，结算时该资金直接划转至证券公司融资专用资金账户的一种还款方式。
- 融券卖出：融券卖出是指证券公司出借证券供投资者卖出的经营活动。融券为你做空赚钱创造了条件，当你看跌某股时，你可以向券商借入该股，然后

将其卖掉，等其下跌后你再买入该股票还给券商，从中获取差额。在做融券卖出这个操作之前，我们需要注意的是你所做的这只股票是否担保品，是否可以进行融券卖出。如果可以当做完融券卖出之后，融券卖出之后并没有成交之前，可用资金和持仓不发生变化。融券卖出产生成交之后，迅投系统可用资金会增加，但是没有持仓产生，相应的会生成一条融券卖出的负债合约。

- 直接还券：直接还券就是客户用信用账号的持仓数量，去还融券的负债。
- 买券还券：买券还券就是客户通过通知买券还券的交易指令去归还融券的负债。

Level-2 行情

- 概述 Level-2 行情为沪深两所推出的增值行情， Level-2 行情具有以下特点：

1. 更丰富的信息：更多的盘口订单数据、逐笔成交数据、逐笔委托数据、 成交与订单关联数据及增值数据，揭示交易细节，全方位反映市场状态；

2. 更丰富的盘口信息：提供买卖方 10 个价位的价格、股数和委托笔数信息，同时提供第一档位的前 50 笔订单的委托量，揭示买卖双方行为细节；

3. 更好的低延时技术：采用国际一流的 FAST 协议，毫秒级时延的技术系 统让数据更迅速直达用户；

4. 更高的服务质量保障：提供重发机制，确保数据可靠、准确，不丢失任 何一笔数据

- 十档盘口

基于 lv1 五档盘口已有结构基础上，扩充为买卖十档，档位更丰富，数据更细节。

- 逐笔委托

逐笔委托真实的展示了每笔委托价和委托量的明细数据。

- 逐笔成交

逐笔成交真实的展示了每笔成交价和成交量的明细数据。

- 委托队列

委卖队列和委买队列是指实时的分笔委托明细。其中，买卖一档分别展示了申买量和申买量前 50 笔的分笔委托数据。

- 千档盘口

千档盘口显示全部价位的买卖盘价格、委托量、委托单数的完整盘口的统称。