

# 结算程序使用说明文档（V2.3.0）

为自动计算每日盈亏和持仓，编写该结算程序。本文档用于指导使用者正确使用该结算程序。

## 1 结算程序包含的内容

本结算程序包含的内容如下：

Main.bat

setting.ini

委托信息 2018052101.xls

A 股行情 20180522.xls

委托信息 2018052101\_pieces.xlsx

委托信息 2018052101\_legacy.xlsx

委托信息 2018052101\_trader.xlsx

委托信息 2018052101\_system.xlsx

conf

|----- HeadConvert.xls

|----- names\_to\_account.xlsx

doc

|----- 结算 V2.3.0 使用说明.pdf

src

|----- main.py

log

|----- calculator\_20180522.log

|----- 2018-05-21\_trader\_detail.xlsx

|----- 2018-05-21\_system\_detail.xlsx

|----- 2018-05-21\_tax\_detail.xls

- 1 黄底色的文件是结算程序的组成部分；
- 2 蓝底色《委托信息 2018052101.xls》是结算程序输入文件，从 PB 导出；
- 3 蓝底色《A 股行情 20180522.xls》是结算程序行情来源，提供收盘价；
- 4 绿底色的四个 xls 文件是结算程序的输出文件；
- 5 灰底色的文件是程序的日志文件，用于辅助诊断问题。

## 2 结算程序输入文件说明

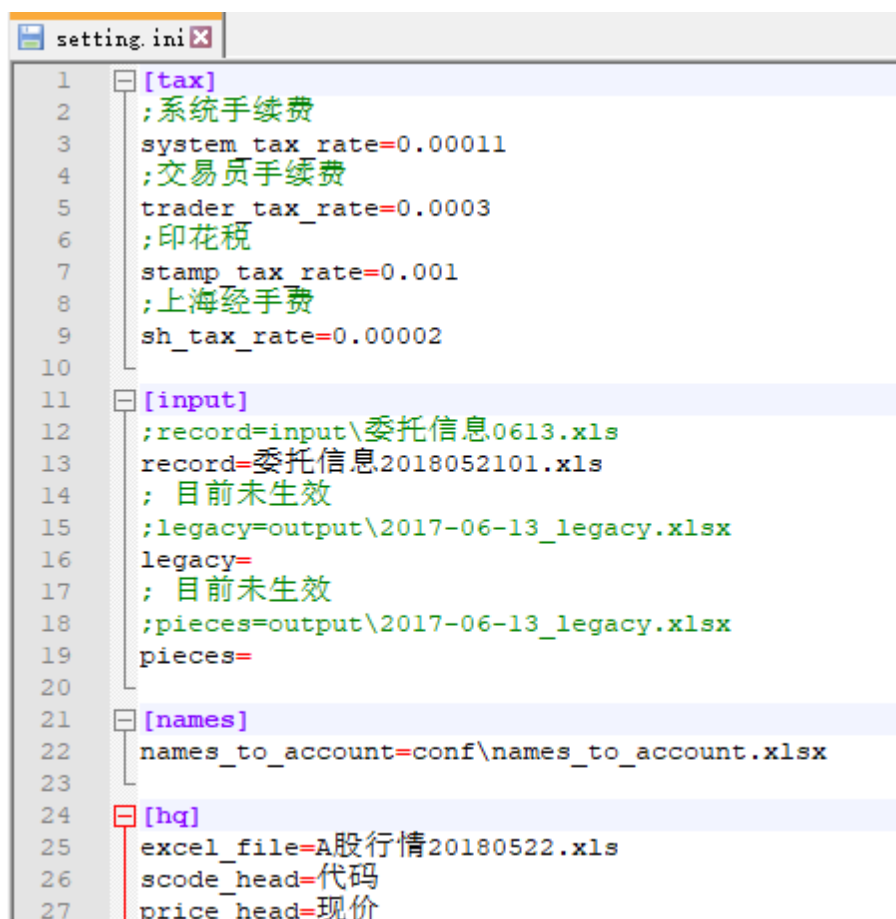
本结算程序设计用于可以接收各类形式的输入文件，基本要求是 Excel 格式的文件，同时需包含以下信息：日期、时间、交易员编号、证券代码、价格、交易数量、操作方向。目前，结算程序的输入文件是 PB 导出的 Excel 文件，该文件已包含以上信息（参看《委托信息 2018052101.xls》文件）。

输入的行情文件请参看示例文件，为交易软件当天收盘后导出的实时行情文件，要求文件中有全市场的股票以及其最新价，用来获取成交价。在配置文件 setting.ini 中 [hq] 部分配置，详细配置请参考示例配置文件。

## 3 结算程序配置文件说明

结算程序配置文件主要有三个：settings.ini, HeadConvert.xls, names\_to\_account.xlsx

1. names\_to\_account.xlsx 是交易员编号与姓名的对应关系。包括两列：Account 和 Names。
2. HeadConvert.xls 配置的是输入文件的转换方法，以及多仓空仓的字段。需要包含 date, time, scode, tcode, vol, price, posit, long, short 的定义，详细的配置方法请参看示例文件。
3. settings.ini 内配置结算程序的手续费、输入文件、隔夜仓开关和行情文件。



```
1 [tax]
2 ;系统手续费
3 system tax rate=0.00011
4 ;交易员手续费
5 trader tax_rate=0.0003
6 ;印花税
7 stamp tax rate=0.001
8 ;上海经手费
9 sh_tax_rate=0.00002
10
11 [input]
12 ;record=input\委托信息0613.xls
13 record=委托信息2018052101.xls
14 ; 目前未生效
15 ;legacy=output\2017-06-13_legacy.xlsx
16 legacy=
17 ; 目前未生效
18 ;pieces=output\2017-06-13_legacy.xlsx
19 pieces=
20
21 [names]
22 names_to_account=conf\names_to_account.xlsx
23
24 [hq]
25 excel_file=A股行情20180522.xls
26 scode_head=代码
27 price head=现价
```

图 1 setting.ini 示例内容

## 4 结算程序输出文件说明

结算程序输出文件包括有四个主要输出 Excel 文件，它们的文件名格式为：

|输入文件名|-|类别|.xlsx

和程序中间计算过程详细文件（detail 文件），中间计算过程详细文件用于定位问题。其余四个文件为所要求的输出文件。

表格 1 输出文件说明

输出文件	类别	输出文件字段
详细文件	detail	
隔夜仓	legacy	日期，交易员编号，交易员姓名，股票代码，股票名称，结算价，数量，多空
零头股	pieces	日期，交易员编号，交易员姓名，股票代码，股票名称，结算价，数量，多空
系统收益	system	日期，盈亏
交易员收益	trader	日期，交易员编号，交易员姓名，盈亏

## 5 结算程序运行方法

首先，修改 settings.ini 内的输入文件和隔夜仓文件，如果有需要，视情况修改其他配置项和其他配置文件。完成程序的配置后，双击 Main.bat 文件，会弹出一个程序运行框体。该步骤的运行时间取决于视输入文件的大小。

程序成功运行完成后，最后一行是“程序执行完成，请按回车结束”，告知使用者程序已经运行结束，请使用者及时核对程序的输出。

如果程序的输出不符合预期，或者程序没有生成使用者期待的输出文件。请使用者及时保存 log/calculator\_{date}.log 文件（其中{date}表示当天的日期）、输入文件和配置文件，以便于定位问题。

```
C:\WINDOWS\system32\cmd.exe

e:\XiRun\capital-calculator>pushd E:\XiRun\capital-calculator\

e:\XiRun\capital-calculator>python src\main.py setting.ini
2018-05-22 22:18:47,801 [INFO] 结算程序[2.3.0]开始执行。
2018-05-22 22:18:47,804 [WARNING] 隔夜仓文件[]没有找到!
2018-05-22 22:18:47,804 [WARNING] 零头股文件[]没有找到!
WARNING *** OLE2 inconsistency: SSCS size is 0 but SSAT size is non-zero
2018-05-22 22:18:47,954 [WARNING] 编号为[400007]交易员的成交记录被忽视!
2018-05-22 22:18:47,970 [INFO] 开始计算手续费和印花税。
2018-05-22 22:18:48,099 [INFO] 输出详细的手续费记录到[log/2018-05-21_tax_detail.xls]文件。
2018-05-22 22:18:48,248 [INFO] 计算手续费和印花税结束。
2018-05-22 22:18:48,249 [INFO] 从行情文件[A股行情20180522.xls]中获取收盘价。
2018-05-22 22:18:48,251 [INFO] [001/022] 股票代码:[600048] 收盘价:[13.2]
2018-05-22 22:18:48,265 [INFO] [002/022] 股票代码:[600176] 收盘价:[13.16]
2018-05-22 22:18:48,266 [INFO] [003/022] 股票代码:[600297] 收盘价:[7.44]
2018-05-22 22:18:48,267 [INFO] [004/022] 股票代码:[600338] 收盘价:[28.65]
2018-05-22 22:18:48,268 [INFO] [005/022] 股票代码:[600487] 收盘价:[36.35]
2018-05-22 22:18:48,270 [INFO] [006/022] 股票代码:[600585] 收盘价:[35.51]
2018-05-22 22:18:48,270 [INFO] [007/022] 股票代码:[600660] 收盘价:[25.65]
2018-05-22 22:18:48,272 [INFO] [008/022] 股票代码:[600741] 收盘价:[25.2]
2018-05-22 22:18:48,273 [INFO] [009/022] 股票代码:[600887] 收盘价:[27.28]
2018-05-22 22:18:48,275 [INFO] [010/022] 股票代码:[601155] 收盘价:[30.46]
2018-05-22 22:18:48,276 [INFO] [011/022] 股票代码:[601601] 收盘价:[34.38]
2018-05-22 22:18:48,277 [INFO] [012/022] 股票代码:[601688] 收盘价:[17.94]
2018-05-22 22:18:48,277 [INFO] [013/022] 股票代码:[601699] 收盘价:[10.71]
2018-05-22 22:18:48,284 [INFO] [014/022] 股票代码:[000050] 收盘价:[17.29]
2018-05-22 22:18:48,289 [INFO] [015/022] 股票代码:[000830] 收盘价:[21.49]
2018-05-22 22:18:48,289 [INFO] [016/022] 股票代码:[000858] 收盘价:[77.65]
2018-05-22 22:18:48,291 [INFO] [017/022] 股票代码:[002285] 收盘价:[8.3]
2018-05-22 22:18:48,294 [INFO] [018/022] 股票代码:[002304] 收盘价:[129.32]
2018-05-22 22:18:48,296 [INFO] [019/022] 股票代码:[002343] 收盘价:[33.26]
2018-05-22 22:18:48,298 [INFO] [020/022] 股票代码:[002456] 收盘价:[19.63]
2018-05-22 22:18:48,298 [INFO] [021/022] 股票代码:[002508] 收盘价:[36.23]
2018-05-22 22:18:48,308 [INFO] [022/022] 股票代码:[300433] 收盘价:[22.85]
2018-05-22 22:18:48,312 [INFO] 所有股票收盘价获取结束。
2018-05-22 22:18:48,316 [INFO] 开始计算系统收入。
2018-05-22 22:18:48,509 [INFO] 输出系统详细记录到[log/2018-05-21_system_detail.xlsx]文件。
2018-05-22 22:18:48,684 [INFO] 计算系统收入结束。
2018-05-22 22:18:48,685 [INFO] 开始计算交易员收入。
2018-05-22 22:18:48,969 [INFO] 输出交易员详细记录到[log/2018-05-21_trader_detail.xlsx]文件。
2018-05-22 22:18:49,170 [INFO] 开始计算交易员收入。
2018-05-22 22:18:49,312 [INFO] 成功输出系统盈亏到[委托信息2018052101_system.xlsx]文件。
2018-05-22 22:18:49,474 [INFO] 成功输出交易员盈亏到[委托信息2018052101_trader.xlsx]文件。
2018-05-22 22:18:49,705 [INFO] 成功输出隔夜仓到[委托信息2018052101_legacy.xlsx]文件。
2018-05-22 22:18:49,856 [INFO] 成功输出零头股到[委托信息2018052101_pieces.xlsx]文件。
程序执行完成,请按回车结束。■
```

图 2 程序运行窗体

(完)