

结算程序使用说明文档

为了计算每日的交易盈亏，特编写该结算程序，自动化盈亏和仓单的计算。
本文档用于指导使用者正确使用该结算程序。本文档对应的结算程序 V1.0.0 。

1 结算程序包含的内容

本结算程序包含的内容如下：

```
main.py
settings.ini
结算主程序.bat
委托信息 0602.xls
委托信息 0602-detail.xls
委托信息 0602-legacy.xls
委托信息 0602-pieces.xls
委托信息 0602-system.xls
委托信息 0602-trader.xls
conf
|----- HeadConvert.xls
|----- names_to_account.xlsx
log
|----- last.log
结算程序使用说明文档
```

其中黄底色的文件是结算程序的组成部分，红底色的《委托信息 0602.xls》是结算程序的输入文件，该文件从 PB 程序界面导出得到。绿底色的五个 xls 文件是结算程序的输出文件。红底色和绿底色的文件是示例文件。log/last.log 是程序的日志文件，用于帮助诊断问题。

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 0602.xls》文件）。

3 结算程序配置文件说明

本结算程序的配置文件主要有三个：settings.ini、HeadConvert.xls 和 names_to_account.xlsx。

1. names_to_account.xlsx 配置的是交易员编号与交易员名称的对应关系。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 内配置了结算程序的手续费、输入文件和隔夜仓开关。

```
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  [excel]
9  ;输入文件，不允许在其他路径内
10 input=委托信息0602.xls
11 ;加载隔夜仓的开关，1 为加载隔夜仓，2 为不加载隔夜仓
12 enable_legacy=1
13 ;隔夜仓文件，格式同本结算程序输出的隔夜仓文件
14 init_legacy=20170501-0524-excel-legacy.xls
15 ;自动加载隔夜仓的开关，1 为自动加载，2 为不自动加载
16 ;当输入文件包含不止一天的交易记录时，计算次日的交易记录时，
17 ;自动加载前一日计算得到的隔夜仓
18 auto_load_legacy=1
19
```

图 1 settings.ini 示例内容

4 结算程序输出文件说明

结算的程序包括有五个 Excel 文件，它们的文件名格式为：

|输入文件名|-|类别|.xls

其中，详细收益是产生的中间文件，有助于定位问题。其余四个文件为所要求的输出文件。

表 1 输出文件说明

输出文件说明	类别	输出文件字段
详细收益	detail	date, price, scode, sname, stamp_tax, system_profit
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“结算主程序.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。

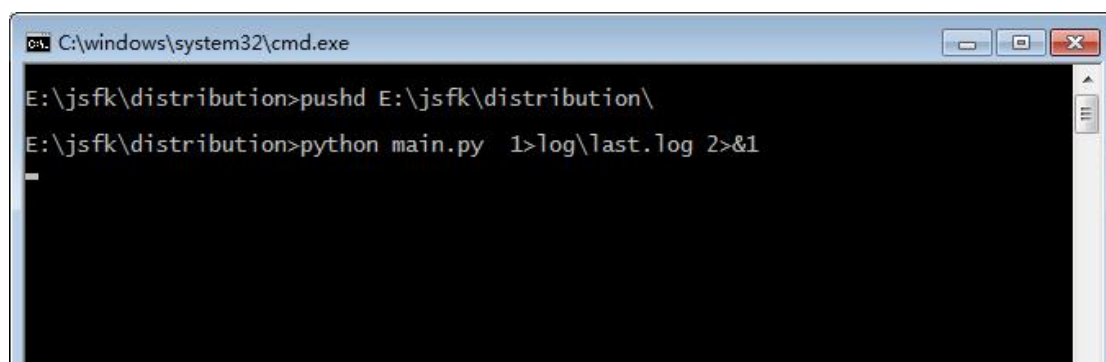


图 2 程序运行框体

程序运行完成后，会弹出一个对话框，提醒使用者程序已经运行结束，请使用者及时核对程序的输出。

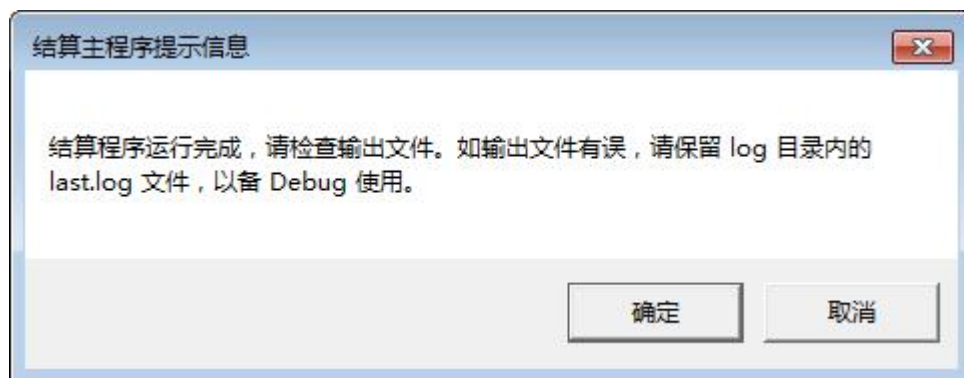


图 3 程序运行完提示对话框

如程序的输出有问题，请及时保存 `log/last.log` 文件、输入文件和配置文件，以便于定位问题。