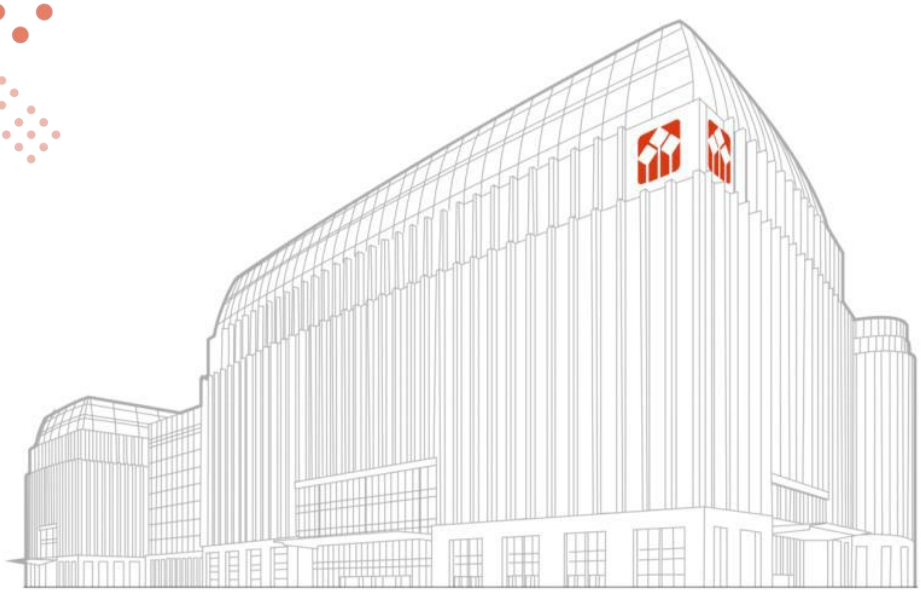
华泰期货MATIC交易终端

用户使用手册



版本号：MATIC_2.1.8

2025年09月24日

目录

1. 下载 1
2. 注册登录 2
2.1. 注册 2
2.2. 登录 2
2.3. 忘记密码 3
2.4. 自动升级 4
2.5. 系统弹窗 5
3. 首页 6
4. 量化 6
4.1. 量化权限申请 6
4.2. 首页 9
4.2.1. 操作说明 9
4.3. 编写策略 10
4.3.1. 功能概述 10
4.3.2. 操作说明 15
4.4. 数据平台 21
4.4.1. 功能概述 21
4.4.2. 操作说明 21
4.5. 因子研究 26
4.5.1. 功能概述 26
4.5.2. 操作说明 26
4.6. 我的策略 45
4.6.1. 功能概述 45
4.6.2. 操作说明 45
4.7. 策略社区 49
4.7.1. 策略检索、排序、筛选 50
4.7.2. 策略卡片 52
4.7.3. 策略分享 53
4.8. 量化学院 54
4.8.1. 课程总览 54
4.8.2. 课程详情 55
4.9. 知识库 56
4.9.1. 文件检索 56
4.9.2. 文档创建 57
4.9.3. 文档热度 58
4.10. 用户中心 59
4.10.1. 功能概述 59
4.10.2. 操作说明 59
5. 行情 60
5.1. 首页 60
5.2. 国内期货 61
5.2.1. 切换期货板块 62

5.2.2. 配置合约报价列表 62
5.2.3. 展示分时/K 线走势 63
5.3. 合约详情 64
5.3.1. 切换分类标签 64
5.3.2. 展示分时/K 线走势 65
5.3.3. 画线 66
5.3.4. 工具 67
5.3.5. 查看关联品种 68
5.3.6. 查看合约信息 68
5.3.7. 查看买卖档口 68
5.3.8. 查看盘口指标 69
5.3.9. 查看分笔成交 69
5.4. 自定义界面 70
5.4.1. 新建自定义界面 70
5.4.2. 修改自定义界面 72
5.4.3. 删除自定义界面 73
5.5. 键盘精灵 74
6. 交易 75
6.1. 基础交易 75
6.1.1. 普通交易 75
6.1.2. 增强交易 79
6.1.3. 期权交易 82
6.1.4. 期货交易 88
6.1.5. 期货期权交易 92
6.2. 特色交易 95
6.2.1. 组合交易 95
6.2.2. 对冲助手 106
6.3. 算法交易 108
6.3.1. HT-TWAP 109
6.3.2. HT-VWAP 115
6.3.3. HT-套利 121
6.3.4. HT-移仓/普通移仓 127
6.3.5. HT-移仓/套利移仓 133
6.3.6. 异常情况处理 139
6.4. 套利交易 139
6.4.1. 套利雷达 139
6.4.2. 多品种套利 141
6.5. 指令流程 153
6.5.1. 指令说明 153
6.5.2. 指令下达 153
6.5.3. 指令审批 155
6.5.4. 指令分发 155
6.5.5. 指令执行 155
6.5.6. 指令撤销 156

6.6. 运营管理 156
6.6.1. 消息中心 156
6.7. 收藏 156
7. 特色服务 157
7.1. 算法交易 157
7.2. 多品种套利 158
7.3. 量化投研平台 159
7.4. 低延时实验室 161
8. 开户 162
9. 系统 162
9.1. 资金账户 162
9.1.1. 账户管理 162
9.2. 关于 164
9.2.1. 关于我们 164
9.2.2. 注销账号 164
10. 组件列表 165
11. 用户数据上传下载 165
12. 设置 165
12.1. 交易设置 165
12.1.1. 全局交易设置 165
12.1.2. 基础交易设置 166
12.1.3. 指令交易设置 167
12.1.4. 期货交易设置 167
12.1.5. 价格笼子设置 167
12.1.6. 交易费率设置 168
12.1.7. 期权交易设置 168
12.1.8. 期货期权交易设置 169
12.1.9. 组合交易设置 170
12.2. 账号设置 170
12.2.1. 账号简称设置 170
12.2.2. 账号优先级设置 171
12.3. 密码设置 171
12.4. 客户端设置 172
12.4.1. 通用设置 172
12.4.2. 修改密码 172
12.4.3. 监控剪贴板 173
12.4.4. 系统公告 173
13. 下载中心 174

1.下载

在浏览器中打开：

https://www.htfc.com/main/wsyyt/rjxz/matic/index.shtml?id=12892

点击软件下载，下载完成后，双击应用程序根据页面提示进行协议阅读、安装位置选择等相关操作，进行系统安装。

安装完成后，桌面出现系统应用图标，双击打开后可进行系统登录等下一步操作。

2.注册登录

2.1.注册

注册界面主要用于为普通投资者注册 MATIC 账号。具体操作步骤如下：

（1）打开 MATIC 客户端，进入登录界面；

（2）点击左下角“注册账号”，弹出注册界面（如下）；

（3）输入手机号获取并填写验证码，设置密码，勾选同意隐私政策和用户协议，点击注册，即可注册 MATIC 账户；

（4）注册完成后的，点击去登录，即可回到登录界面。

2.2.登录

登录界面主要用于为已有 MATIC 账号的投资者输入用户名、密码登录使用系统。具体

操作步骤如下：

（1）在登录界面输入用户名和密码；

（2）勾选同意隐私政策和用户协议；

（3）点击“登录”按钮，通过密码校验即可登录进入系统。

2.3.忘记密码

忘记密码界面主要用于为已注册过 MATIC 账号但忘记该账号密码的普通投资者重置密码。具体操作步骤如下：

（1）点击 MATIC 客户端登录界面右下角“忘记密码”；

（2）弹出忘记密码界面（如下），输入手机号获取并填写验证码，重置密码（不能和原密码相同），勾选同意隐私政策和用户协议，点击确定，即可修改密码；

（3）修改密码完成后的，点击去登录，即可回到登录界面。

2.4.自动升级

用户在登录通过身份验证后，如果有新版本需要更新，系统将启动自动升级，请您关注网络情况及升级状态，耐心等待。

2.5.系统弹窗

系统会不定期进行版本升级，升级版本登录后可能会出现系统弹窗，用户按照界面提示进行操作即可。

示例：开户弹窗（根据需求，不定期设置开户弹窗），用户可根据界面提示操作。

示例：公告弹窗（系统版本升级会有系统公告弹窗），用户可根据界面提示操作。

3.首页

首页展示 7*24 快讯资讯信息，信息实时更新，支持按照品种和特色栏目进行分类筛选。

4.量化

HT_Quant 量化投资模块为平台用户提供人工智能量化投资助手，平台可实现数据资源探索、因子构建及生成、策略编写、策略回测、策略模拟、实盘交易（后续版本迭代）的量化投资全流程。同时，平台内置了 Quant Agent，Quant Chat 等丰富的智能工具，辅助客户进行数据探索、因子生成、策略创建等过程，大幅提升工作效率。

4.1.量化权限申请

用户登录 Matic 后：

- ✓ 若登录时已经有量化功能权限，点击顶部量化页签则可直接进入量化模块进行使用。
- ✓ 若登录时还没有量化功能权限，点击顶部量化页签则进入量化功能权限申请页，如下：

您可以选择手机扫描二维码，加入 Matic 服务群和华泰期货量化服务群；

单击底部“申请试用”或“立即开户”：

若您已 Matic 绑定期货资金账号，则进入量化权限功能申请：

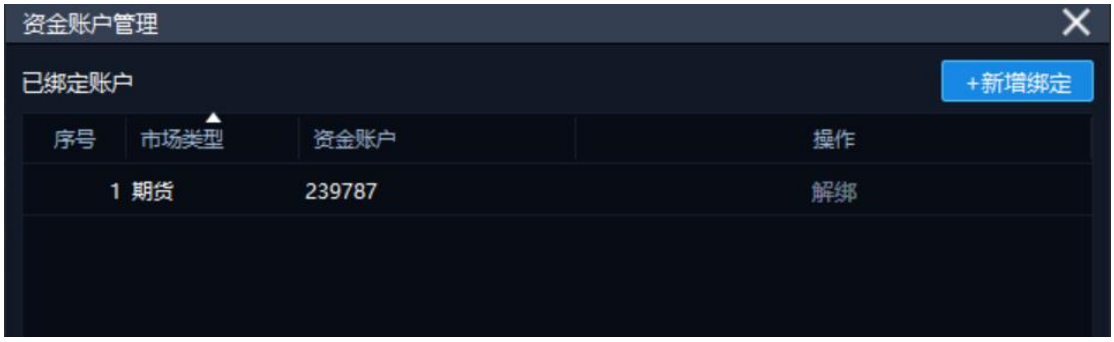
按照界面提示填写业务经理、量化经验和您还想对我们说的内容，单击“提交”则可进行量化权限功能申请，申请提交后，审核可能需要 1~3 个工作日，我们会尽快为您处理，请耐心等待。审核结果会通过系统的消息中心发送审核结果通知，请及时关注。

若您未在 Matic 绑定期货资金账号，则会展示如下界面：

您可以根据界面提示进行：

1) 手机扫描二维码，进入华泰期货在线开户平台；

2) 若您已开户，但未在 Matic 绑定期货资金账号，则可以单击“我已开户，绑定资金账号”进入资金账户管理界面，单击右上角新增绑定，进行资金账户绑定：



3) 您也可以选择“跳过此步骤”，直接进入量化试用申请界面。

4.2.首页

4.2.1.操作说明

Matic 系统用户点击顶部导航栏【量化】则会进入到量化系统首页：

1. 用户登录至首页则可见平台名称和平台的主体标语；
2. 用户点击【编写策略】则默认进入 AIStudio 开发环境；
3. 可见平台各核心模块入口：

1）编写策略：用户点击【编写策略】则进入到 AIStudio 开发环境，用户可在开发环境中进行数据查询、因子研究、策略研究等；

2）数据平台：用户点击【数据平台】则进入到数据模块，该模块用户可按照表名或者字段查找平台有权限的基础数据，并查看相关数据的解释说明和读取代码等；

3）因子研究：用户点击【因子研究】则进入到因子研究模块，该模块用户可对自己的因子进行持续跟踪并可以进行团队协作和平台共享等；

4）我的策略：用户点击【我的策略】则进入到我的策略模块，该模块提供用户查看自己提交的策略持续跟踪，可见策略相关状态和绩效表现；

5）策略社区：用户点击【策略社区】则进入到策略社区模块，该模块提供平台维护的以及用户分享的策略，用户可以在该模块内进行策略查看。

6）量化学院：用户点击【量化学院】则进入到量化学院模块，该模块聚焦量化策略分享、量化平台操作、量化交易与金融基础知识的学习中心，致力于为用户打造从入门到精通的一站式学习平台，通过系统化的知识传递与实操指导，逐步提升金融认知与量化应用能力。

7）知识库：提供丰富的文档资源，涵盖量化交易基础知识、经典策略编写教程、数据指标说明及常见问题解答等，方便用户随时查阅与学习。用户可通过关键词搜索或分类筛选

快速定位所需资料，提升学习效率与实操能力。同时，知识库还为用户提供文档管理工具，进行文档的新建、编写、保存、发布。

4.3.编写策略

4.3.1.功能概述

Aistudio 综述

AIstudio 是平台核心集成功能，是策略、因子和代码加工的生产基地：

1. 用户可在 AIStudio 进行相关数据的读取，加工和存储等处理操作；
2. 用户可在 AIStudio 进行因子的创建、编辑、分析和保存等相关操作；
3. 用户可在 AIStudio 进行策略的回测、绩效查看和提交模拟等相关操作；
4. 用户可在 AIStudio 进行任务的创建、提交和管理等相关操作；

我们在首页点击【编写策略】或者点击【立即体验】则可以进入到我们的 AIStudio 开发环境：

1. 我们的 AIStudio 开发环境被切分为了 5 个大的区域，我们可以对照下图的数字标记查看；

1）【1】表示 AIStudio 的主菜单功能区域，每个图标都代表一个功能主键；

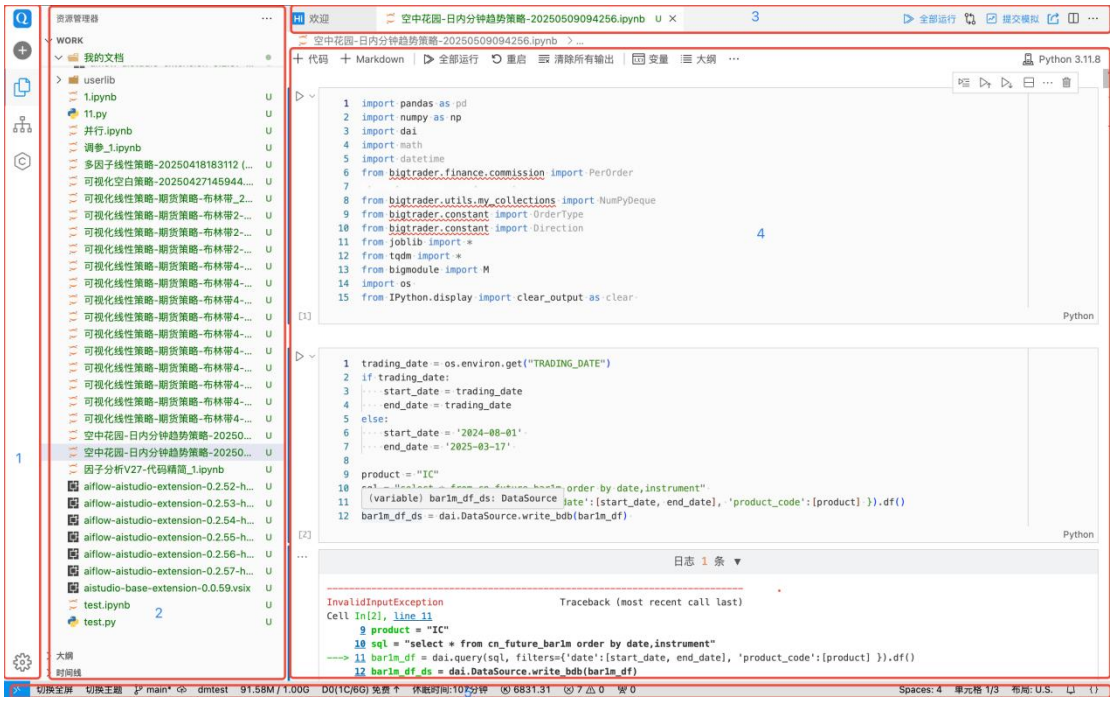
2）【2】表示 AIStudio 的副菜单功能区域或者对应主菜单的明细功能分类；

3）【3】表示 AIStudio 的具体某个功能触发打开的工作区间名称；

4）【4】表示 AIStudio 的具体某个功能触发打开的工作区间，您可以在该区域进行代码

的编写、测试、调整以及相关结果查看；

5）【5】表示 AIStudio 的基础信息及预警区域，展示对应的用户名称、资源规格、主题等；



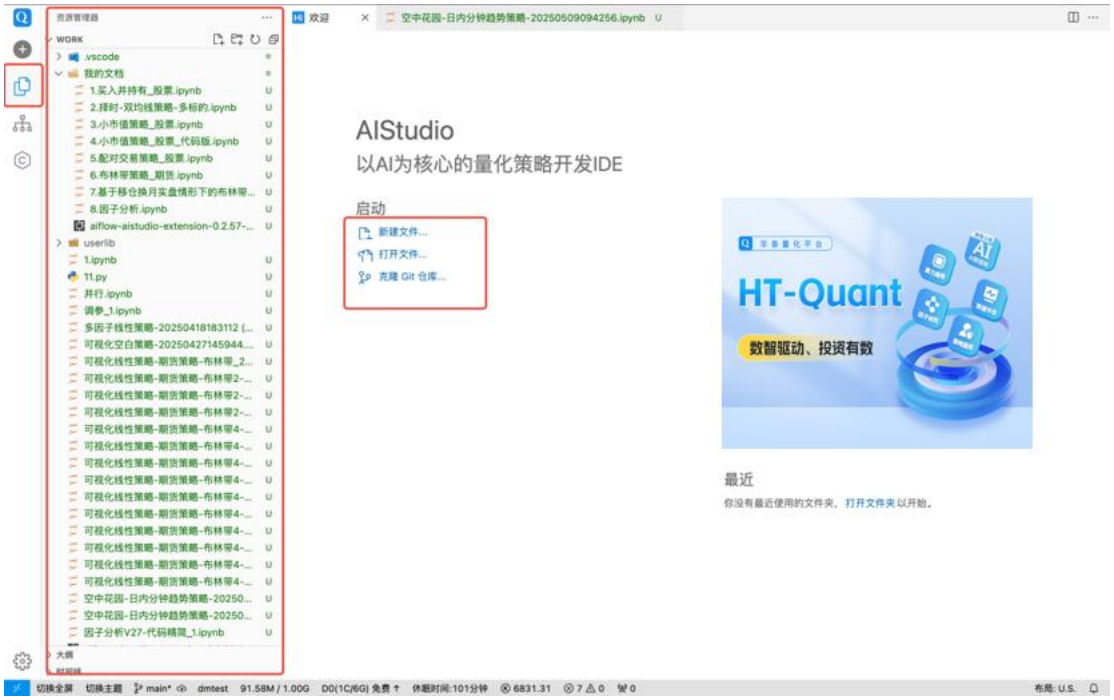
2. 文件管理

文件管理主要是我们可以通过在 AIStudio 进行相关文件的创建、保存、删除、查看等相关功能，我们点击【 】则进入到文件管理模块，会自动展开资源管理副菜单。

1）在资源管理器模块，我们可进行文件的相关管理，如：

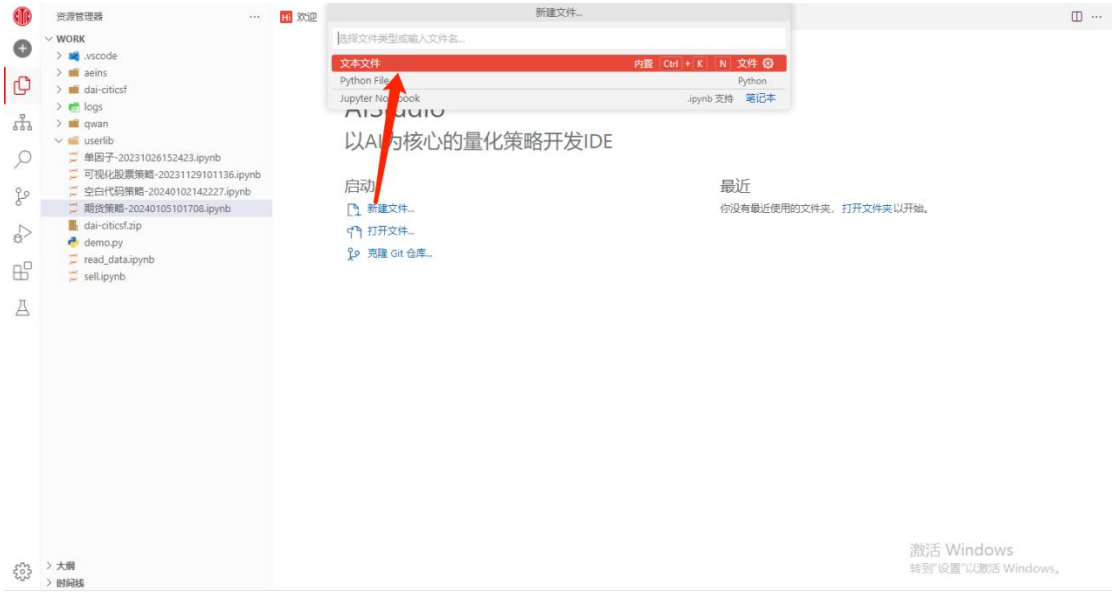
- 新建文件、新建文件夹、刷新资源管理器、折叠文件夹等操作

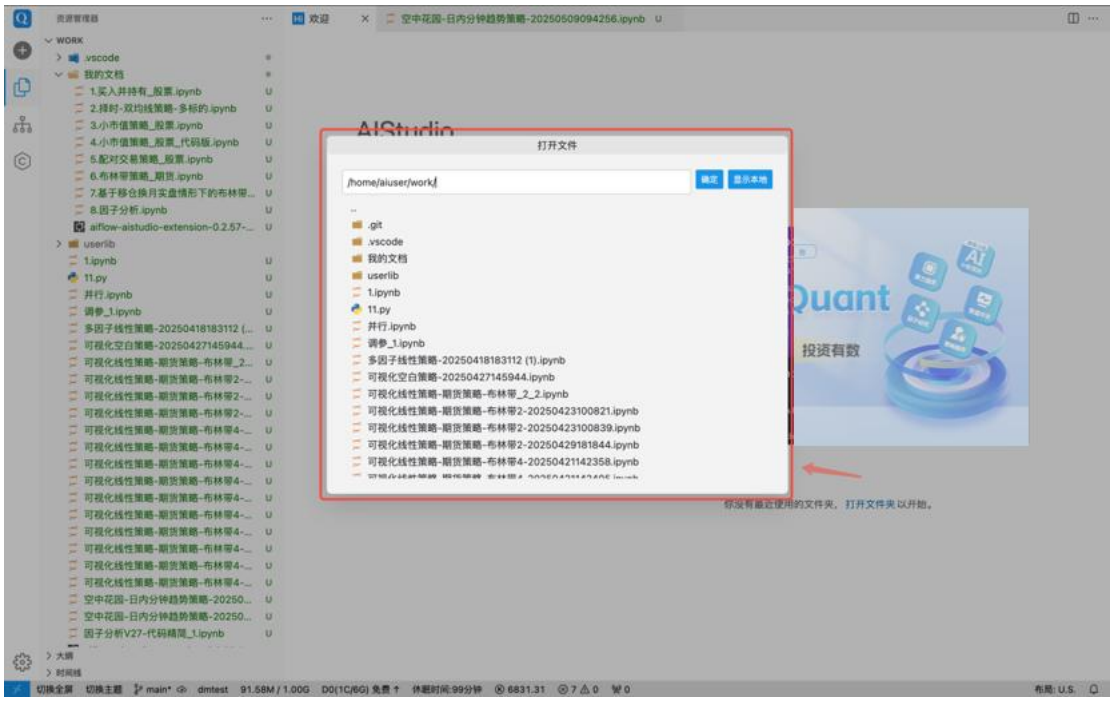
- 针对文件夹可以进行新建、复制、删除、终端打开等操作；
- 针对具体文件可以进行新建、复制、删除、终端打开等操作；



2）在我们的引导就页面用户可以快捷启动功能，如：

- 新建文件
- 打开文件
- 克隆 git 仓库：将远程仓库克隆到本地文件夹





3. 策略创建

策略创建主要是我们可以通过在 AIStudio 进行相关策略代码的编写、调试、绩效查看和提交模拟等相关功能，详情请查看策略创建专题。

4. 因子创建

因子创建主要是我们可以通过在 AIStudio 进行相关因子代码的编写、调试、绩效分析和代码提交等相关功能，详情请查看因子创建专题。

5. 任务管理

任务管理主要是我们可以通过在 AIStudio 进行相关任务的提交、任务状态、日志的查看等相关功能，详情请查看任务管理专题。

4.3.2.操作说明

4.3.2.1.数据读取

- **DAI 简介**

Dai 是 PaSS 平台读取数据的入口。Dai 返回的数据统一是 pd.DataFrame 格式。如果获取的数据为空，可能返回 None 值。

- **数据读取**

代码示例

```
import dai
df = dai.query("SELECT date, open/close, volume FROM cn_stock_bar1d WHERE date
BETWEEN '2020-01-01' AND '2021-01-01' ").df()
df
```

1. dai.query 是 DAI 读取平台数据的接口，可以对平台所有数据做读取和计算

2. SELECT date, open, close, volume FROM cn_stock_bar1d WHERE date BETWEEN '2023-01-01' AND '2023-05-01' AND instrument = '000001.SZ' 是 SQL 数据访问语言，SQL 是使用简单也是使用最广泛的数据操作语言，DAI 会解析 SQL 并调用 C++执行引擎，充分利用现代 CPU/GPU 特性实现高性能计算

(1) SELECT 读取/选择数据

(2) date, open/close, volume 需要的数据列

① date 日期，

② open/close 表示计算开盘价除以收盘价，通过表达式和 SQL 算子可以实现对数据的衍生计算，支持使用 python 函数自定义算子

③ volume 交易量

(3) FROM 用于指定应从哪个表格或者多个表读取数据

(4) cn_stock_bar1d 是 后复权日行情数据 表名

(5) WHERE date BETWEEN '2023-01-01' AND '2023-05-01' AND instrument =

'000001.SZ' 按条件过滤数据，WHERE 之后是条件

① date BETWEEN '2023-01-01' AND '2023-05-01' 日期在 2023-01-01 和 2023-05-01 间

② AND 并且

③ instrument = '000001.SZ' 股票代码为 000001.SZ

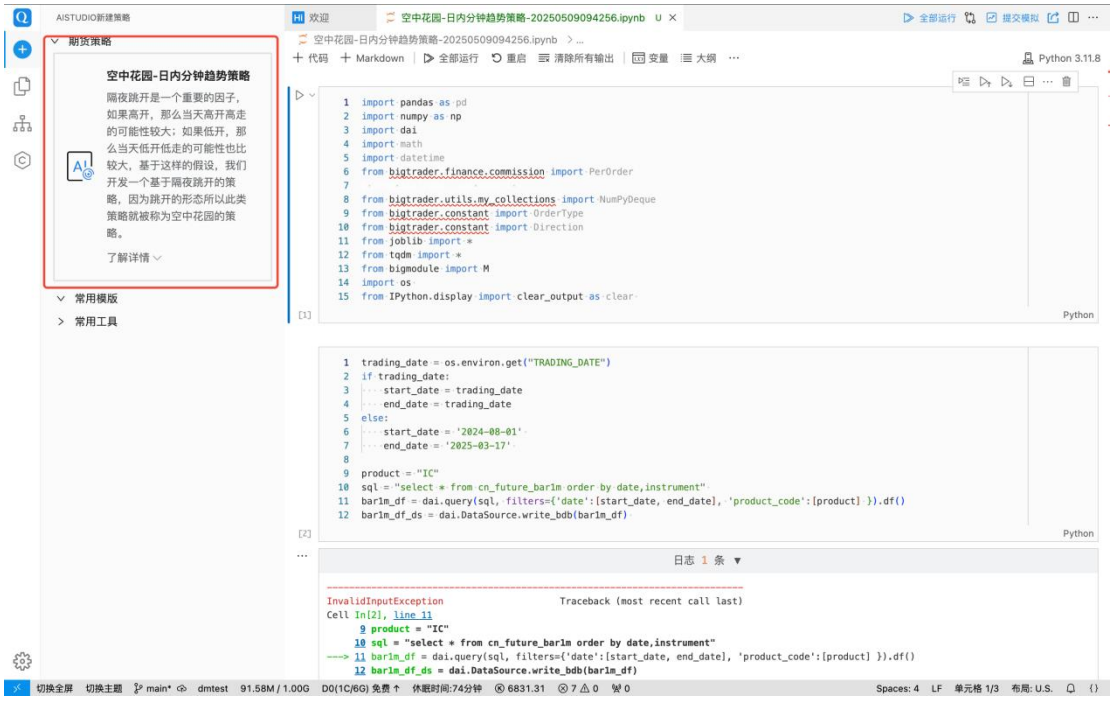
④ .SZ 是深交所的股票代码后缀，.SH 为上交所，平台所有数据定义保持一致

(6) .df() 将返回数据转为 pandas DataFrame

4.3.2.2. 策略创建

我们通过【编写策略】进入到 AIStudio 开发环境。

1. 用户点击【 】则展开业务研究选择的菜单；
2. 在业务选择菜单我们可以选择股票策略、期货策略或者是因子进行研究；

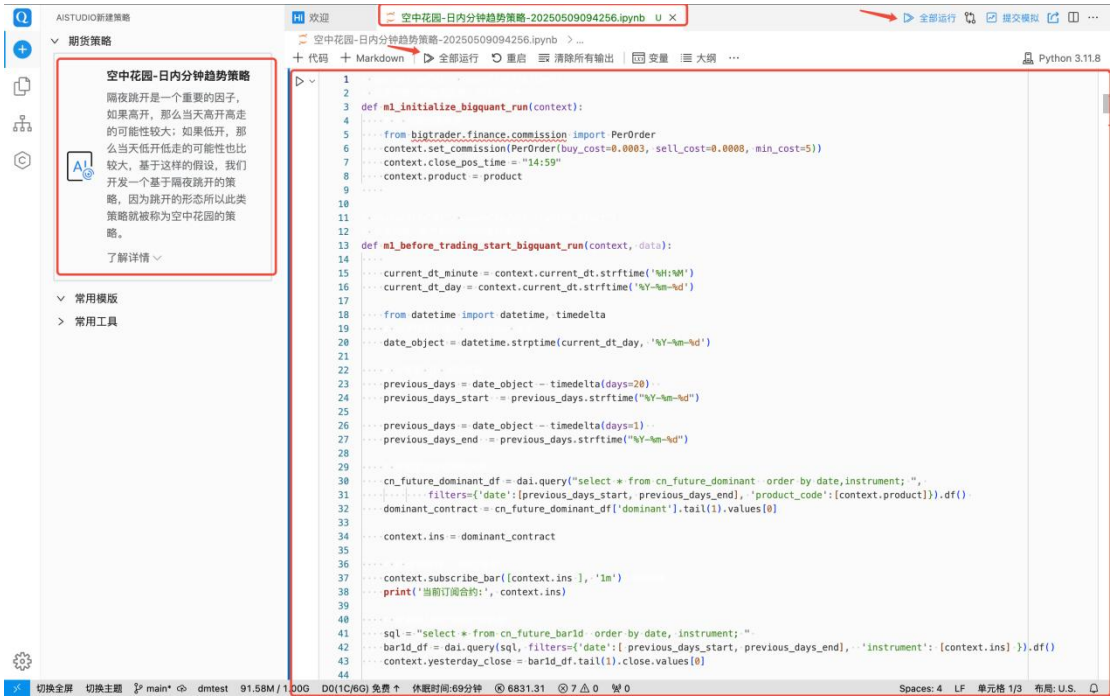


- **期货策略**

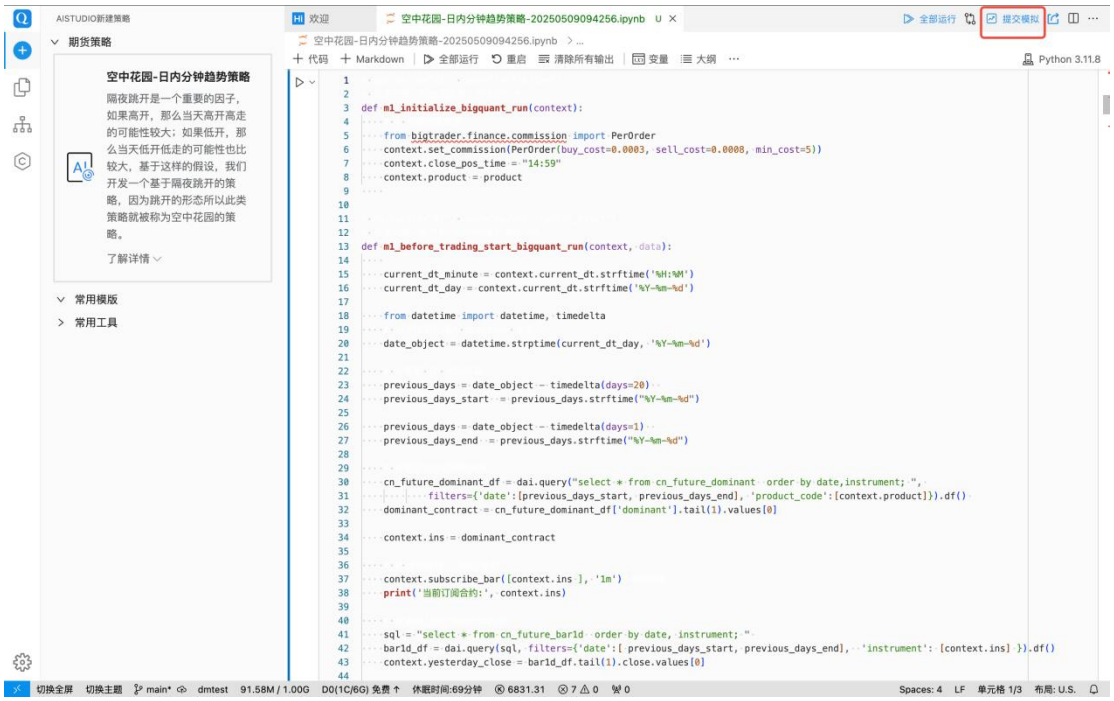
1. 用户点击【 】则展开业务研究选择的菜单；
2. 用户点击【期货策略】则会显示股票策略下具体的创建方式；
3. 用户可选择期货策略，用户点击则显示策略创建弹窗；
4. 策略创建弹窗：系统会自动创建一个工作空间名称，用户可以自己修改，修改完成后按 enter 键则成功创建对应因子的工作空间；

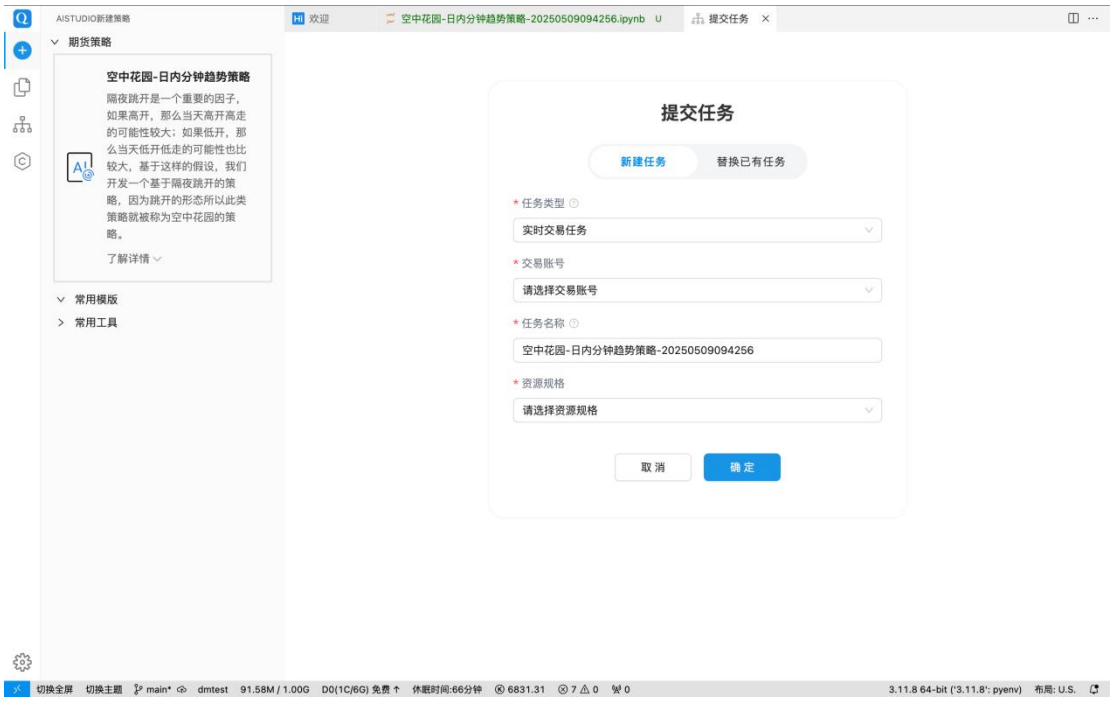
- **期货策略**

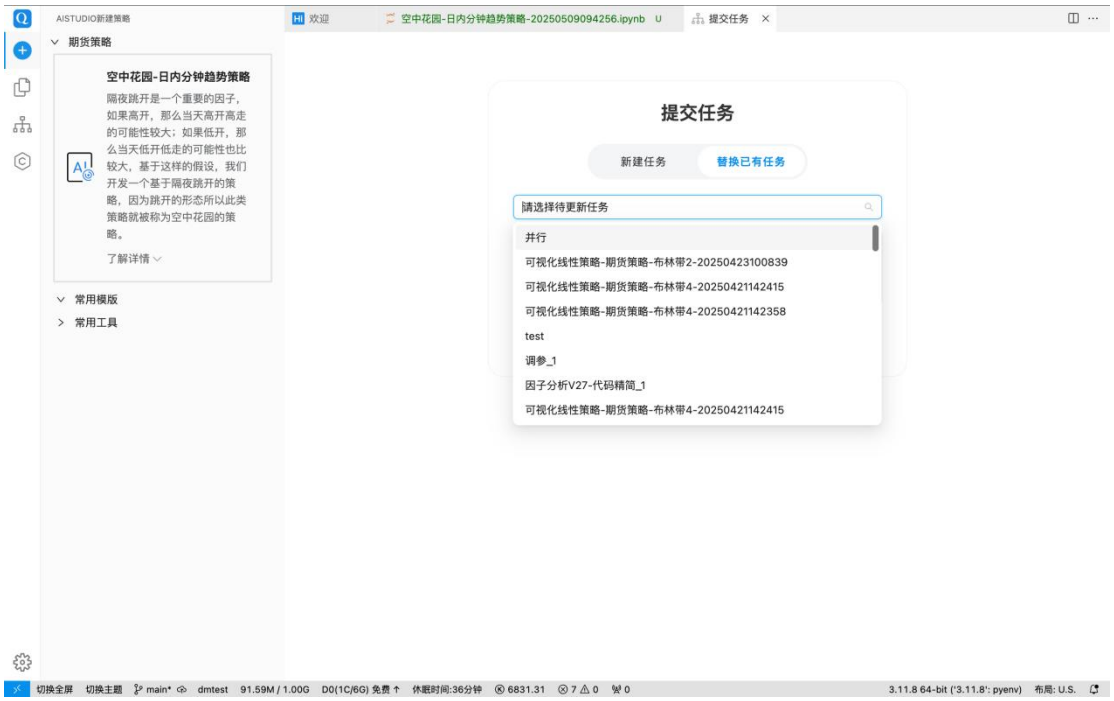
1. 期货策略是我们内置的简单期货模板策略，用户可直接使用内置模版进行策略回测；
2. 策略执行完毕，则会展示对应的回测绩效；



3. 用户可点击【 】可进行策略提交，我们填写相关任务参数：
   (1) 需要选择任务操作：新建策略还是替换已有任务；
   (2) 新建策略
      ① 选择任务类型
      ② 若选择实时交易任务，需要选择交易账号（非实时交易任务不用选择）
      ③ 选择资源规格
      ④ 高级设置，仅非实时交易任务和立即运行一次的任务可以使用用高级设置
         1) 输入标签：会自动带出系统默认标签，用户可使用自己创建的标签
         2) 输出标签：用户自己输入的标签，可以作为其他任务引用的输入标签
      ⑤ 点击【确定】则确认进行任务提交，点击【取消】则不进行任务提交；
   (3) 替换已有任务
      ① 选择需要替换的目标任务
      ② 点击【确定】则确认进行任务替换，点击【取消】则不进行任务替换；


AISTUDIO新建策略
期货策略
空中花园-日内分钟趋势策略
隔夜跳开是一个重要的因子，如果高开，那么当天高开高走的可能性较大；如果低开，那么当天低开低走的可能性也比较大，基于这样的假设，我们开发一个基于隔夜跳开的策略，因为跳开的形态所以此类策略就被称为空中花园的策略。
了解详情
常用模版
常用工具
欢迎
空中花园-日内分钟趋势策略-20250509094256.ipynb
全部运行
提交模拟
代码
Markdown
全部运行
重启
清除所有输出
变量
大纲
Python 3.11.8
def m1_initialize_bigquant_run(context):
from bigtrader.finance.commission import PerOrder
context.set_commission(PerOrder(buy_cost=0.0003, sell_cost=0.0008, min_cost=5))
context.close_pos_time = "14:59"
context.product = product
def m1_before_trading_start_bigquant_run(context, data):
current_dt_minute = context.current_dt.strftime('%H:%M')
current_dt_day = context.current_dt.strftime('%Y-%m-%d')
from datetime import datetime, timedelta
date_object = datetime.strptime(current_dt_day, '%Y-%m-%d')
previous_days = date_object - timedelta(days=20)
previous_days_start = previous_days.strftime("%Y-%m-%d")
previous_days = date_object - timedelta(days=1)
previous_days_end = previous_days.strftime("%Y-%m-%d")
cn_future_dominant_df = dai.query("select * from cn_future_dominant order by date,instrument; ",
filters={'date':[previous_days_start, previous_days_end], 'product_code':[context.product]}).df()
dominant_contract = cn_future_dominant_df['dominant'].tail(1).values[0]
context.ins = dominant_contract
context.subscribe_bar([context.ins], '1m')
print('当前订阅合约:', context.ins)
sql = "select * from cn_future_bar1d order by date, instrument; "
bar1d_df = dai.query(sql, filters={'date':[previous_days_start, previous_days_end], 'instrument': [context.ins] }).df()
context.yesterday_close = bar1d_df.tail(1).close.values[0]
切换全屏
切换主题
main*
dmtest
91.58M / 1.00G
D0(1C/6G) 免费
休眠时间:69分钟
6831.31
Spaces: 4
LF
单元格 1/3
布局: U.S.


AISTUDIO新建策略
期货策略
空中花园-日内分钟趋势策略
隔夜跳开是一个重要的因子，如果高开，那么当天高开高走的可能性较大；如果低开，那么当天低开低走的可能性也比较大，基于这样的假设，我们开发一个基于隔夜跳开的策略，因为跳开的形态所以此类策略就被称为空中花园的策略。
了解详情
常用模版
常用工具
欢迎
空中花园-日内分钟趋势策略-20250509094256.ipynb
提交任务
提交任务
新建任务
替换已有任务
* 任务类型
实时交易任务
* 交易账号
请选择交易账号
* 任务名称
空中花园-日内分钟趋势策略-20250509094256
* 资源规格
请选择资源规格
取 消
确 定
切换全屏
切换主题
main*
dmtest
91.58M / 1.00G
D0(1C/6G) 免费
休眠时间:66分钟
6831.31
3.11.8 64-bit ('3.11.8': pyenv)
布局: U.S.



- **常用模板**

用户可点击【常用模板】查看平台内置的期货模板策略。

4.3.2.3. 任务管理

任务管理主要是用户进行日频交易任务、实时交易任务、因子任务、定时任务或者一次性任务的管理页面。

1. 用户编写相关代码后，点击点击【 】可进行策略提交任务，则打开任务提交页面：

1）用户选择任务类型：数据任务、因子任务、日频交易任务、实时交易任务、定时任务、立即运行一次

2）数据任务：用户需要输入对应的任务名称，选择可使用的资源规格；高级设置用户可设置任务输出的标签，以及任务依赖的标签，任务依赖的默认标签请用户勿删除；

3）因子任务：用户需要输入对应的任务名称，选择可使用的资源规格；高级设置用户可设置任务输出的标签，以及任务依赖的标签，任务依赖的默认标签请用户勿删除；

4）日频交易任务：用户需要输入对应的任务名称，选择可使用的资源规格；高级设置用户可设置任务输出的标签，以及任务依赖的标签，任务依赖的默认标签请用户勿删除；

5）实时交易任务：用户需要输入对应的任务名称，选择可使用的资源规格，设置对应

交易账户；

6）定时任务：用户需要输入对应的任务名称，触发时间，选择可使用的资源规格；；

7）立即运行一次：用户需要输入对应的任务名称，选择可使用的资源规格；

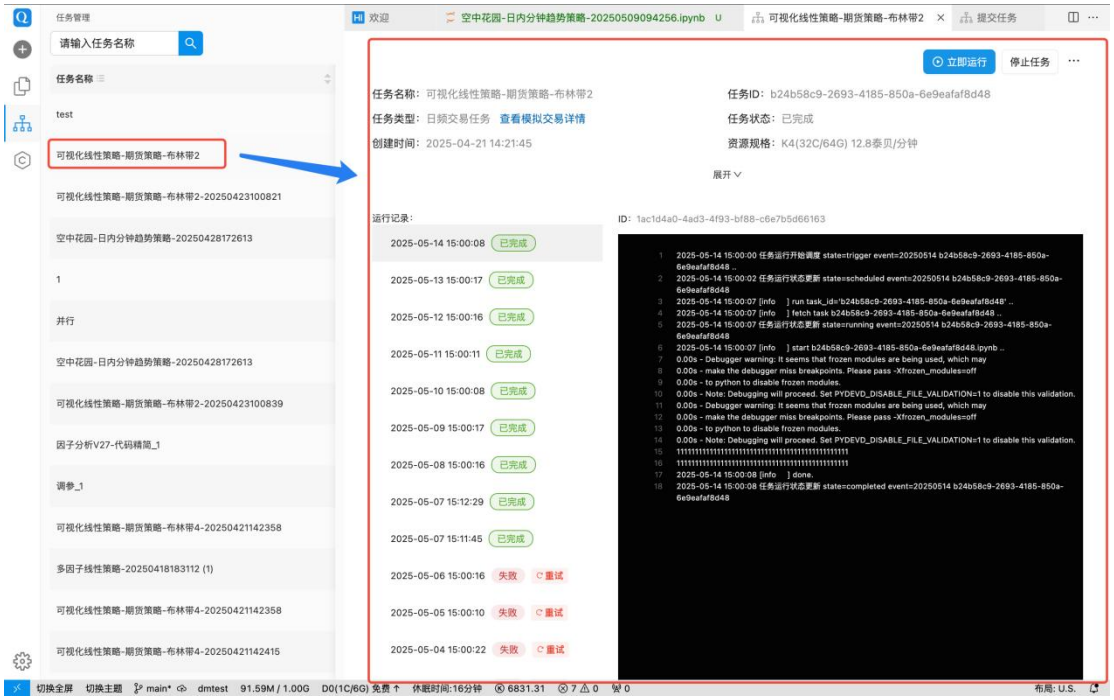
任务设置完成后，用户点击【确定】则确认进行任务提交，点击【取消】则不进行任务提交，提交完成后的任务统一在任务管理界面查看；

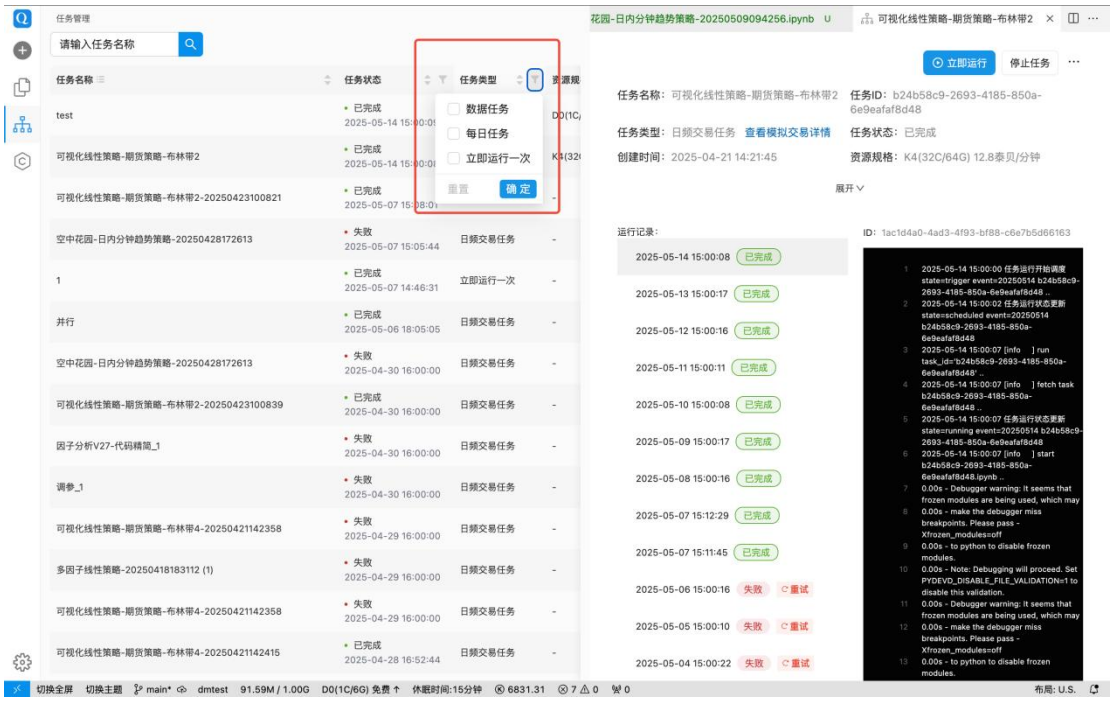
任务管理

用户在 AIStuio 主菜单点击【 】则进入到任务管理页面；

1. 在任务管理区域我们可以看到具体的任务名称、任务类型、任务状态；
2. 我们点击【 】可对任务名称、任务类型、任务状态进行排序；
3. 我们点击【 】可对任务类型、任务状态进行筛选；
4. 我们点击具体的任务名称则可以查看任务每次记录的运行详情：

任务名称、任务 ID、任务类型、任务状态、创建时间、资源规格以及每次的任务运行记录和任务的详细日志；





4.4.数据平台

4.4.1.功能概述

数据平台是数据字典查询页面；针对平台用户来说：

A. 数据平台是用户的目标数据搜索的统一平台；

B. 数据平台是用户的目标数据字段查询的统一平台；

C. 数据平台是用户的目标数据代码调用方法查询的统一平台；

4.4.2.操作说明

4.4.2.1.数据看板

用户进入数据平台，则可见有相关权限的数据字典信息：

1. 用户通过点击导航菜单【数据平台】模块则会进入到数据平台业务模块；

2. 用户默认进入到数据平台整体页面展示界面，该界面展示该用户所有有权限看到的数据字典信息；

3. 用户可以输入对应的数据表或字段的关键字信息在该平台查询相关数据，查询结果

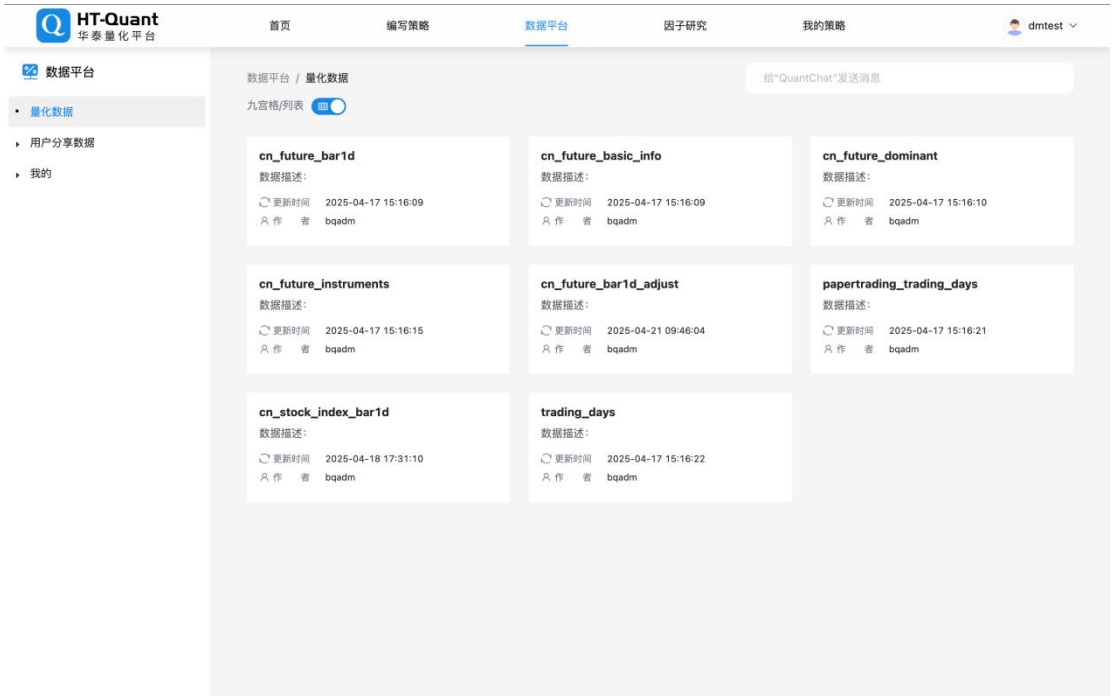
会全部以卡片的形式呈现在右侧的表卡片中（注：搜索匹配的字段目前也只会展示数据表的卡片信息，若需要看详细的字段信息，需要点进卡片里面）；

4. 目前的数据平台的菜单权限及其展示的内容统一由管理员配置：

1）用户点击左侧的菜单，菜单会自动展开或收起，同时右侧会展示对应的数据字典卡片；

2）鼠标移入对应的数据字典卡片，卡片会呈现蓝色选中状态；

3）用户点击数据字典卡片则会进入该卡片的数据字典详情页面；



5. 数据字典详情：用户可以点击[XXX 数据字典卡片]则进入到数据字典详情：

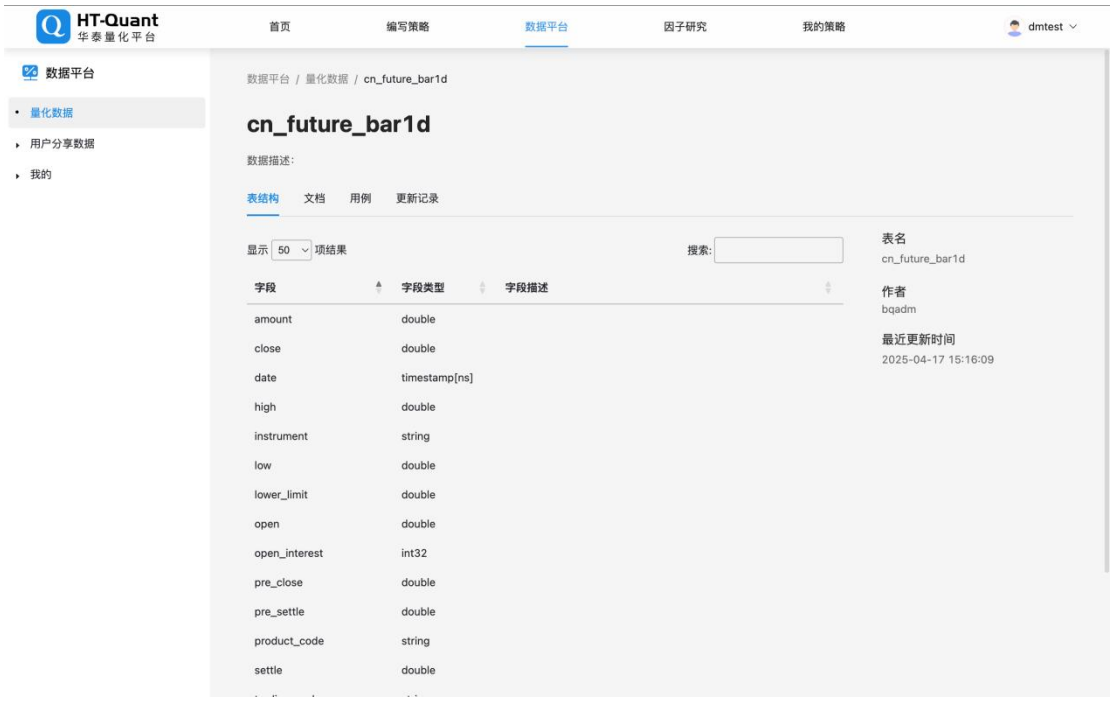
1）数据字典详情页面表头会展示对应的表名，表中文名，创建日期，更新频率和表描述等相关信息；

2）数据字典详情页面会展示对应表的表结构、数据文档和使用用例三大模块的内容；用户点击对应的 tab 则显示对应的内容

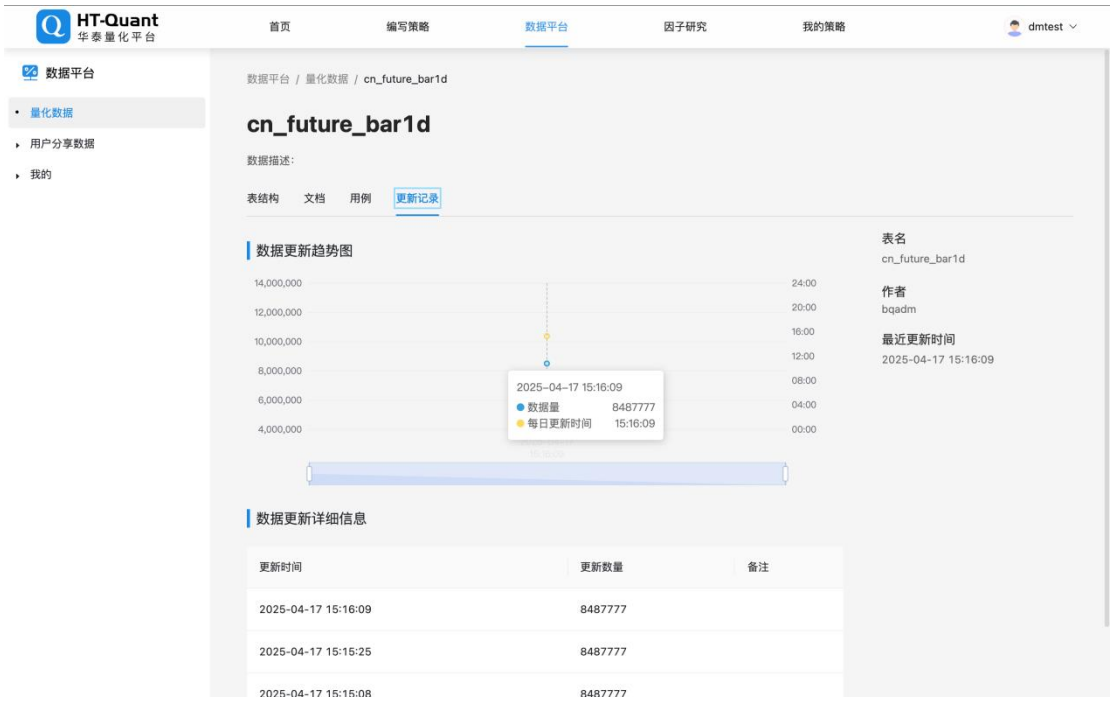
3）表结构：展示表对应的字段、字段类型、字段描述；

4）数据文档：管理员编写的相关表的具体说明信息；（该内容由数据生产者配置）

5）使用用例：管理员编写的相关表的具体使用用例信息；（该内容由数据生产者配置）

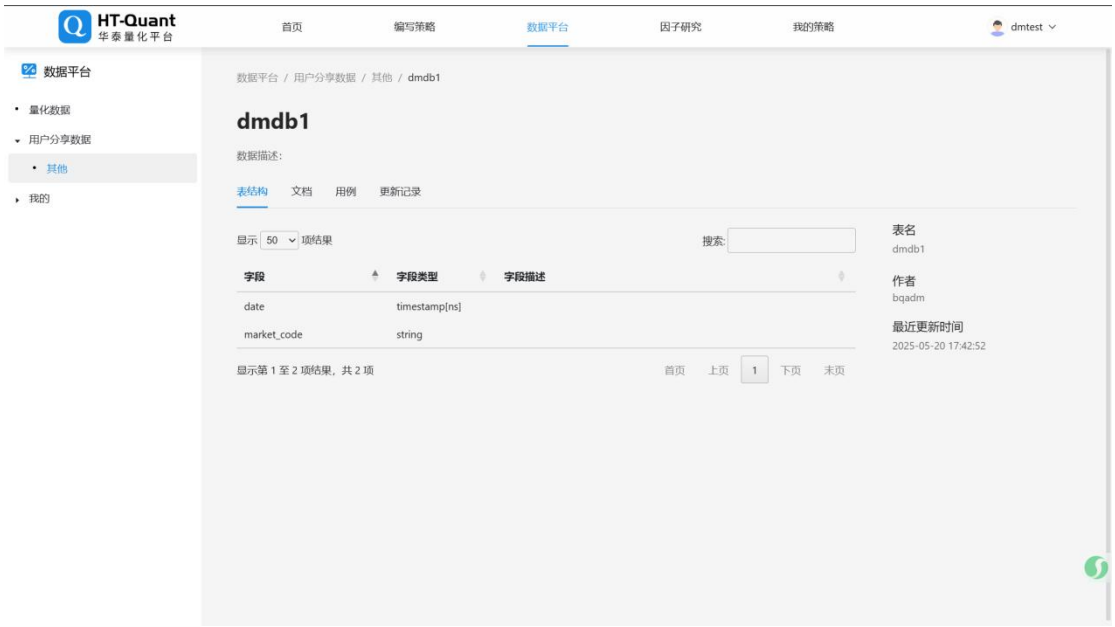

HT-Quant
华泰量化平台
首页
编写策略
数据平台
因子研究
我的策略
dmtest
数据平台
量化数据
用户分享数据
我的
数据平台 / 量化数据 / cn_future_bar1d
cn_future_bar1d
数据描述:
表结构
文档
用例
更新记录
显示 50 项结果
搜索:
字段
字段类型
字段描述
amount double
close double
date timestamp[ns]
high double
instrument string
low double
lower_limit double
open double
open_interest int32
pre_close double
pre_settle double
product_code string
settle double
表名
cn_future_bar1d
作者
bqadm
最近更新时间
2025-04-17 15:16:09

HT-Quant
华泰量化平台
首页
编写策略
数据平台
因子研究
我的策略
dmtest
数据平台
量化数据
用户分享数据
我的
数据平台 / 量化数据 / cn_future_bar1d
cn_future_bar1d
数据描述:
表结构
文档
用例
更新记录
表名
cn_future_bar1d
作者
bqadm
最近更新时间
2025-04-17 15:16:09



4.4.2.2.用户分享数据

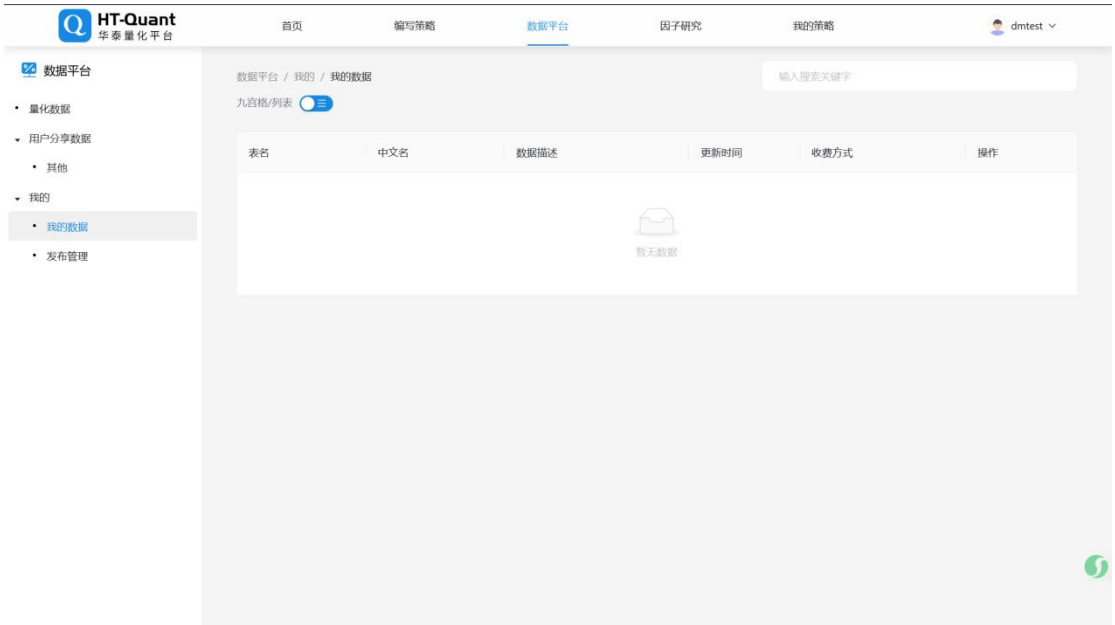
用户分享数据：展示用户在平台上分享的数据信息。



4.4.2.3. 我的

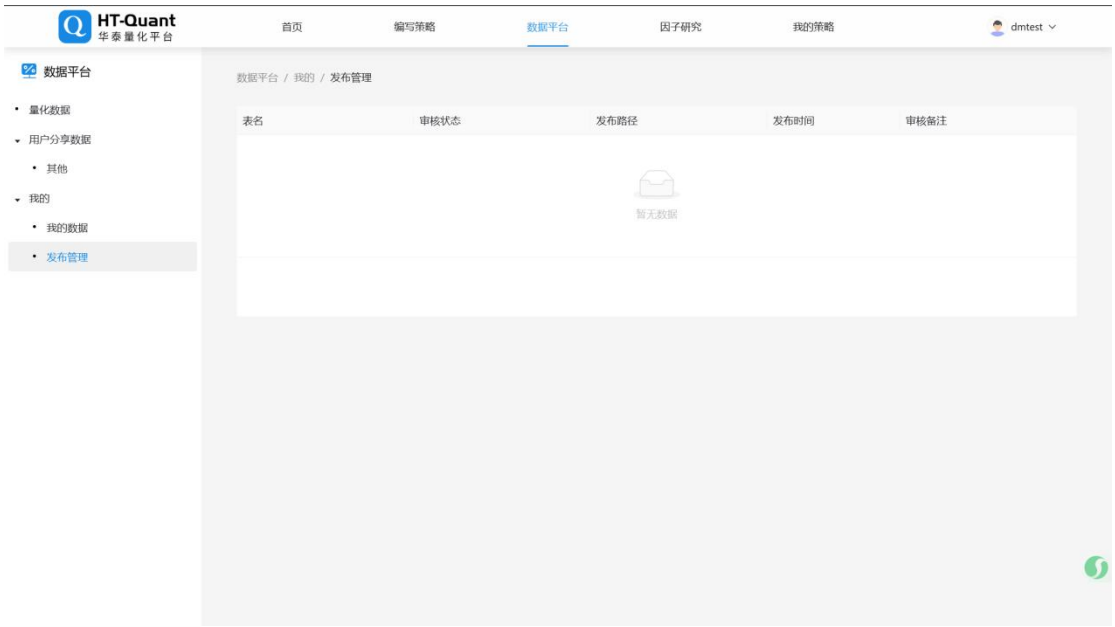
- **我的数据**

展示我拥有权限的数据及购买的数据信息。



- **发布管理**

用户将自己的数据发布到平台上，当数据是发布到非用户分享数据列表时，需经平台管理员审核。在发布管理模块可查看数据发布的审核状态、发布路径、发布时间等。



4.5.因子研究

4.5.1.功能概述

因子研究模块的主要功能主要是以下几点：

1. 方便用户对自己的因子进行持续观察；
2. 方便用户将自己的因子进行团队分享；
3. 方便用户加入他人团队享受其他用户分享的因子；
4. 方便用户对关注的因子进行分组收藏；
5. 方便用户对公共因子表现进行筛选，观察公共因子的表现；

4.5.2.操作说明

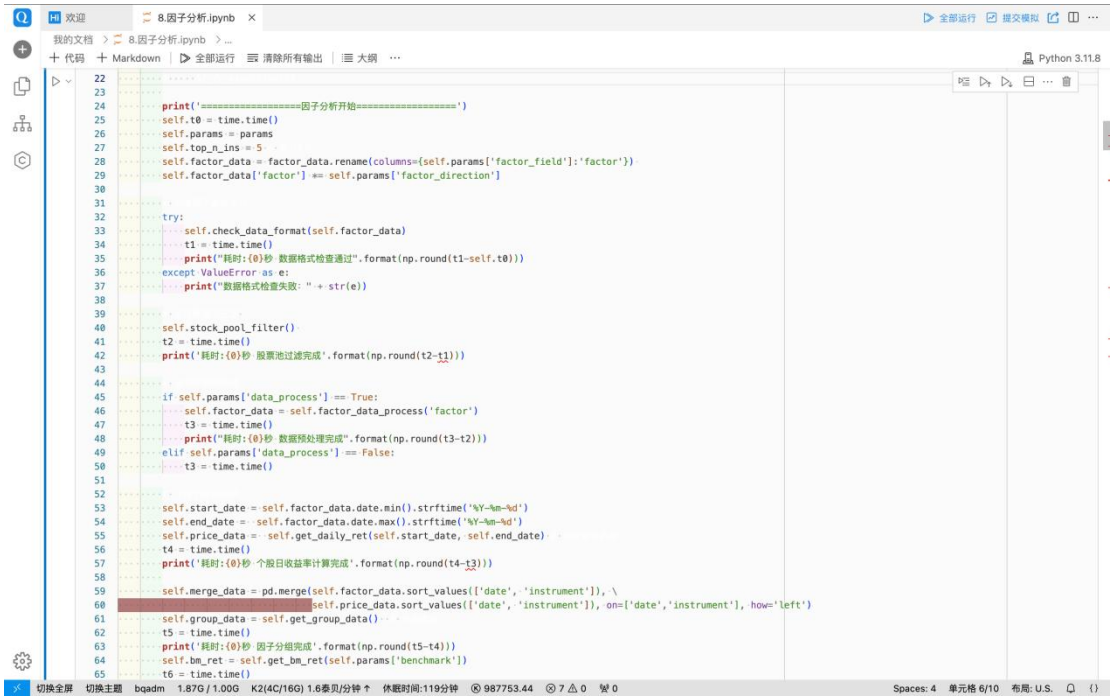
4.5.2.1.因子创建

用户想要进行因子创建则必须先登录系统，登录成功，则通过以下步骤则可以进行因子创建：

1. 首先在投研平台首页点击【编写策略】，则会新开窗口进入 AIstudio 开发环境；
2. 用户在开发环境点击[⊕]，然后选择因子研究菜单点击[因子]，然后系统会显示对应的系统预创建的因子名称(用户可手动编辑，只可输入英文或数字)，我们敲击回车键（Enter）

表示确认创建或者退出（Esc）表示取消创建；

3. 创建成功后，在代码编辑区域会出现系统默认的因子编辑模板，用户可根据自己的需求去改编自己的逻辑代码；



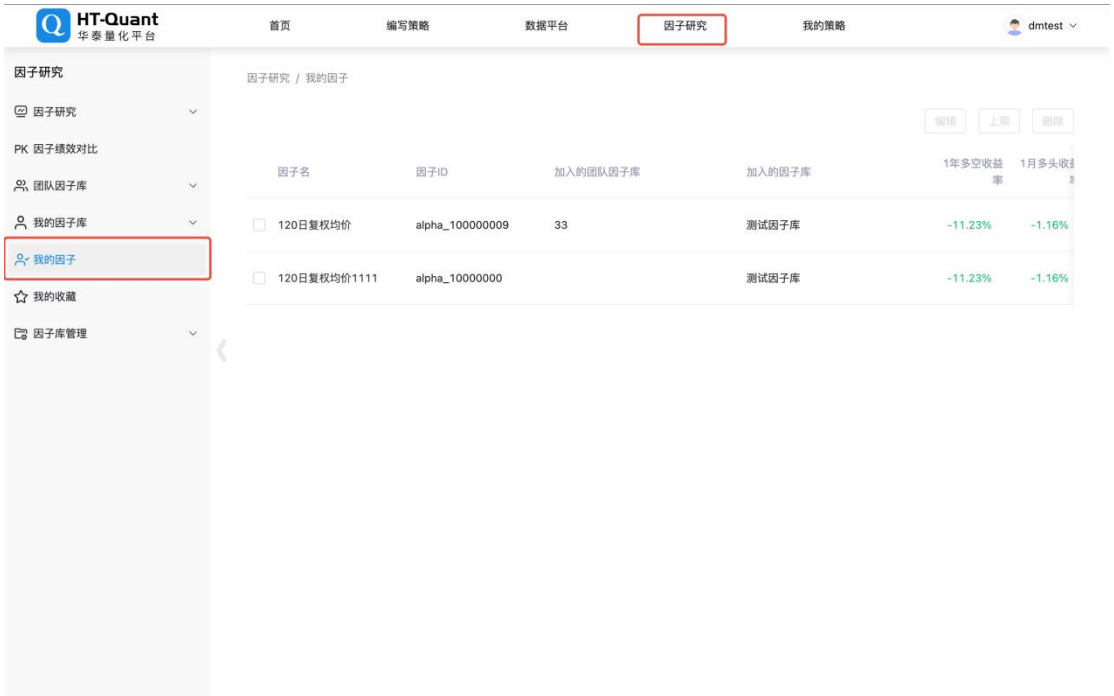
4.5.2.2. 我的因子

用户在 aistudio 编辑好相应的因子逻辑代码后，通过因子提交接口，可将对应的因子数据提交到【因子研究】-【我的因子】模块：

1. 用户通过点击导航菜单【因子研究】模块则会进入到因子研究模块；【因子研究】主要业务内容包括：因子看板、公共因子库（系统审批通过发布的因子库）、团队因子库、我的因子库、我的因子、我的收藏：

2. 用户通过点击导航菜单【因子研究】-[我的因子]则进入我的因子业务内容展示模块；

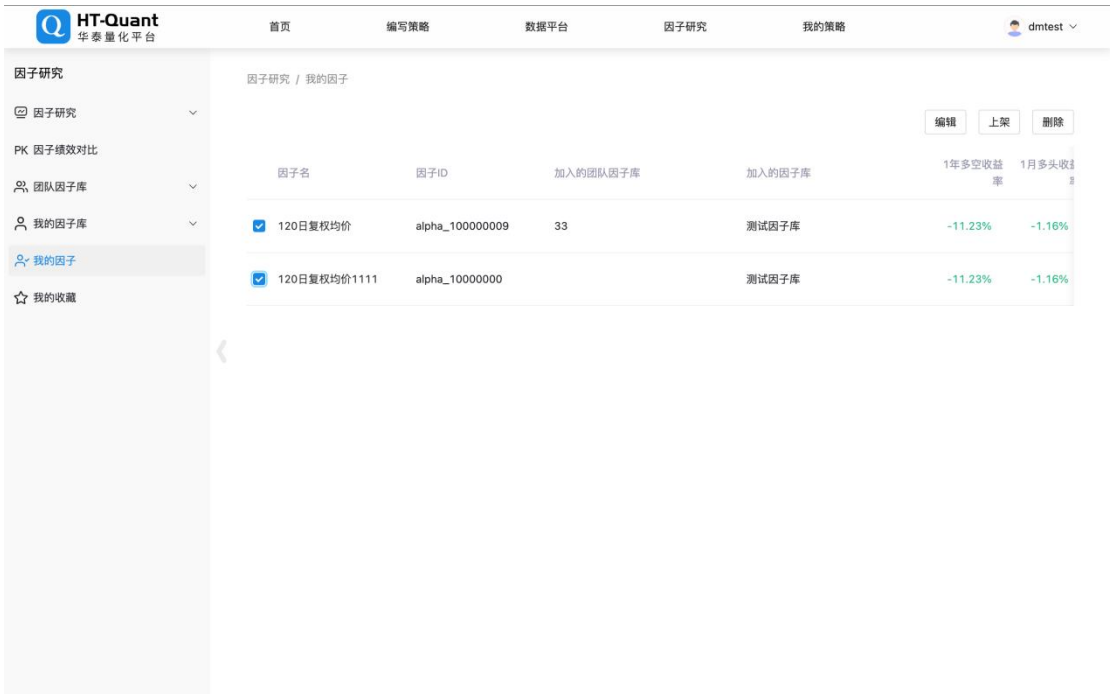
3. 用户所有通过因子提交接口进行保存过的因子都会出现在该业务模块；

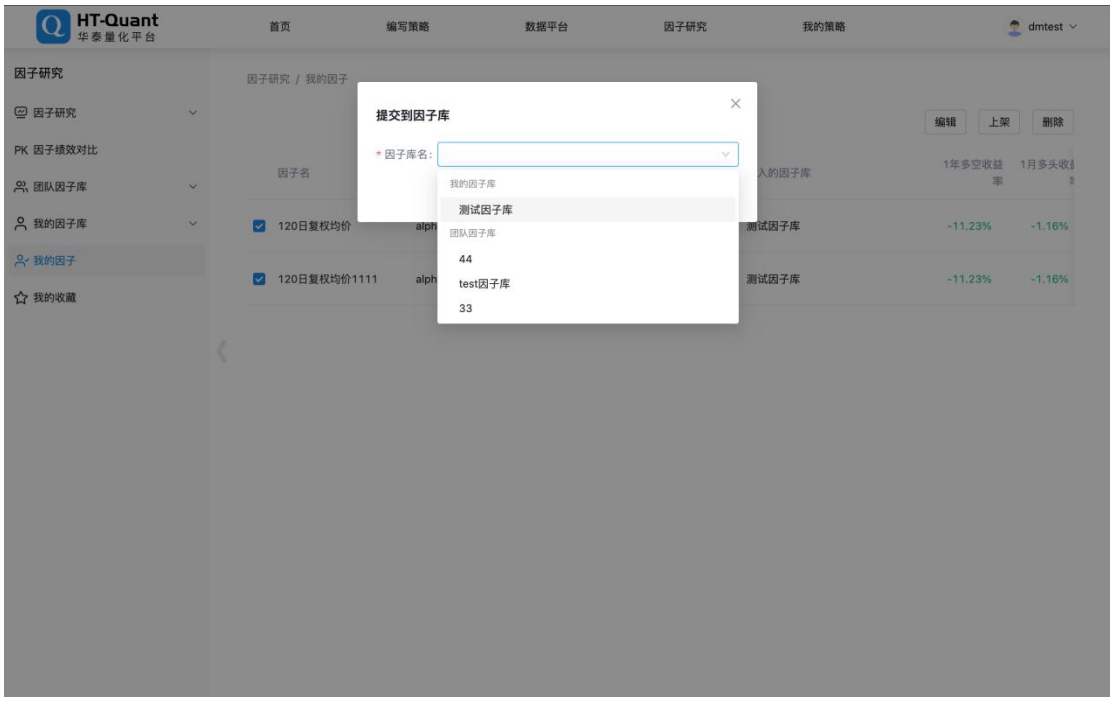


4. 用户可选择相关因子，然后将对应的因子提交至目标因子库：

1）用户勾选☑对应的目标因子，点击[提交因子库]，则会显示因子库弹窗；

2）用户在因子库弹窗选择目标因子库，点击[取消]则关闭弹窗，不将选怎的因子加入对应的因子库；点击[确认]则关闭弹窗，并且将选怎的因子加入对应的因子库；

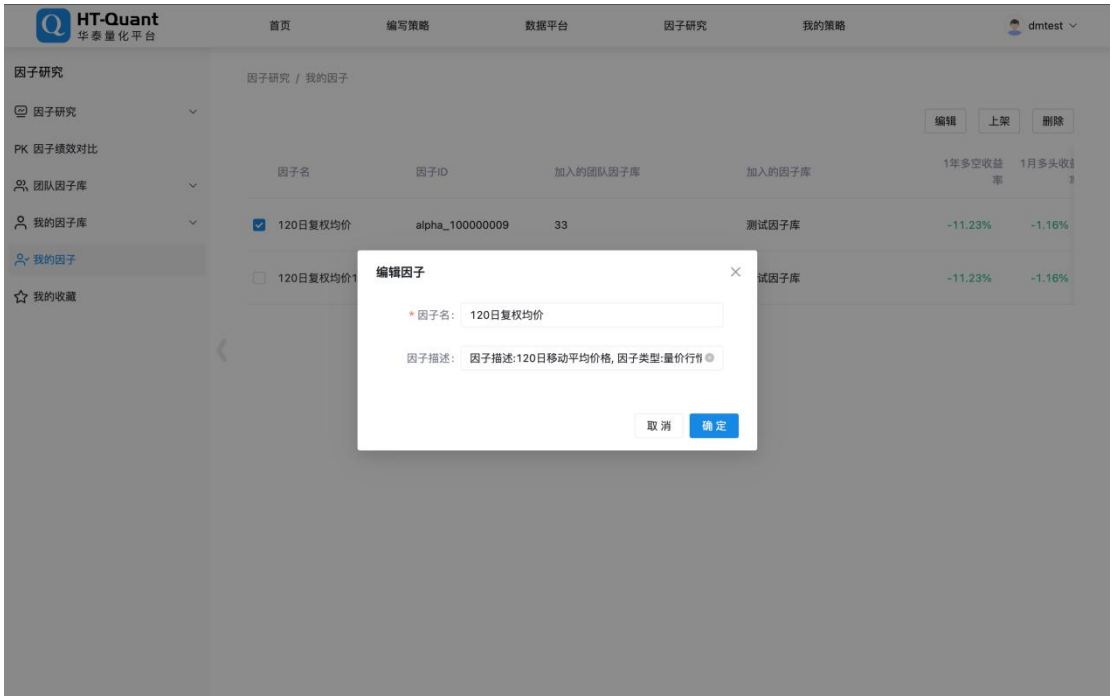


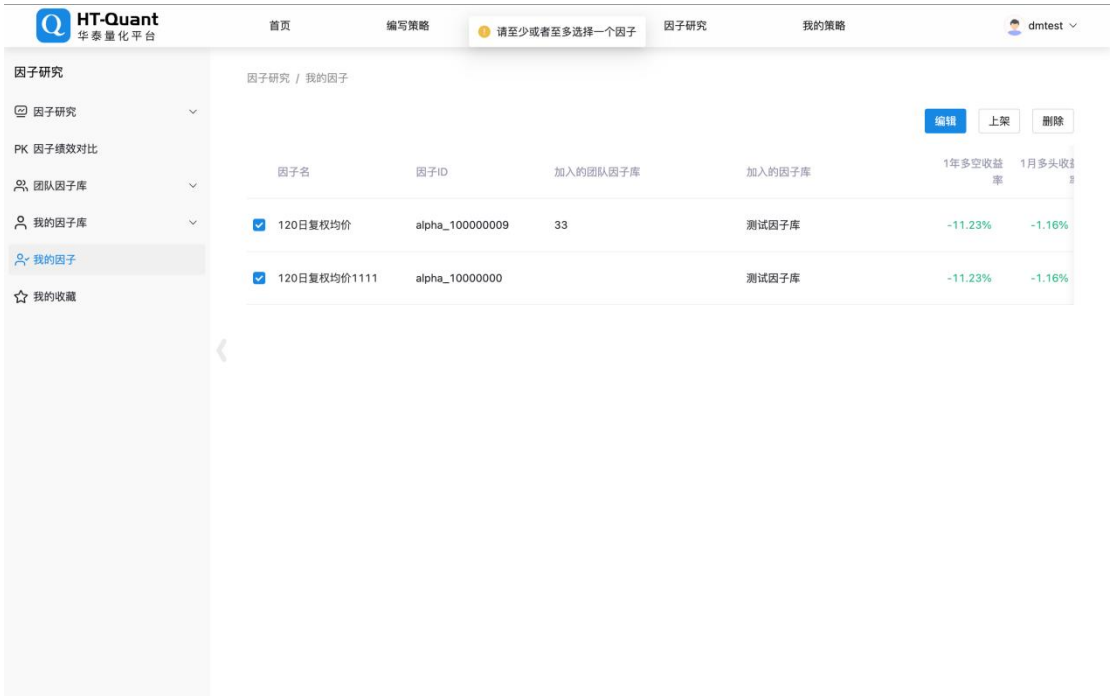


5. 编辑：用户可选择对应的因子进行编辑操作：

1）用户选择目标因子（只可选择单个因子进行编辑操作）；

2）选择好目标因子后，点击[编辑]则显示编辑因子弹窗；用户可修改因子名和因子描述；点击[取消]则关闭弹窗，不保存因子更改数据；点击[确认]则关闭弹窗，并且保存因子更改后的数据；

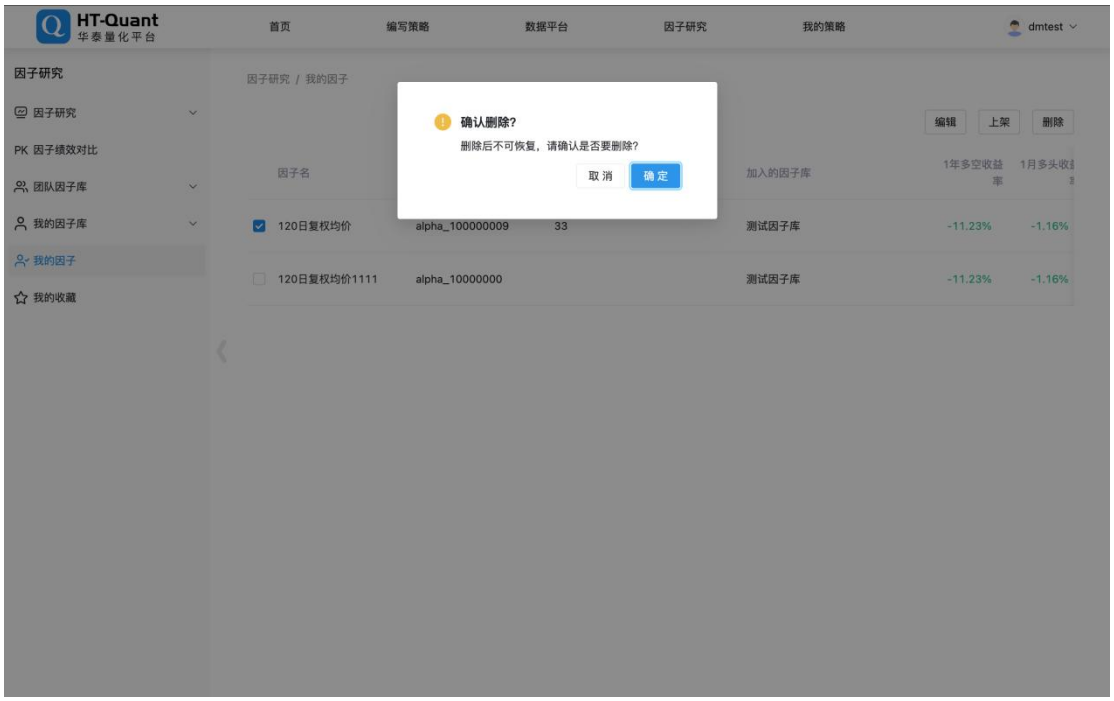




6. 删除：用户可选择对应的因子进行删除操作：

1）用户选择目标因子（可选择多个因子）；

2）选择好目标因子后，点击[删除]则显示因子删除弹窗；点击[取消]则关闭弹窗，不删除该因子数据；点击[确认]则关闭弹窗，并且删除该因子数据；

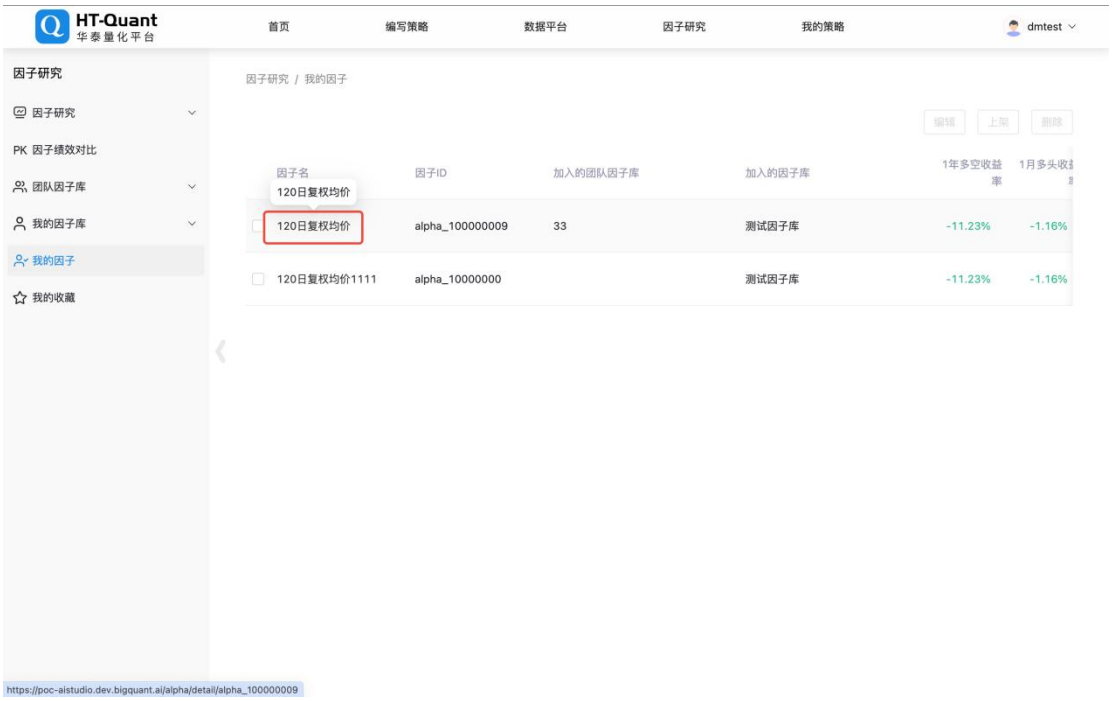


7. 因子详情：用户点击对应因子的因子名称则可进入该因子的详情信息：

1）用户点击对应因子的[因子名称]则进入因子详情页面；

2）用户在因子详情页面可进行因子标签编写，用户点击[+]，则激活标签输入框，用户可在标签输入框中，输入对应的因子标签，输入完成后点击回车则完成标签设置，注：标签为全局变量，标签不支持编辑，但是标签可删除后重新设置；

3）因子详情：因子详情的内容来源于因子分析接口的内容，用户可自定义因子分析里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；



4.5.2.3. 我的因子库

用户通过点击导航菜单【因子研究】模块则会进入到因子研究模块；

1. 用户通过点击导航菜单【因子研究】-[我的因子库]则进入我的因子库业务内容展示模块；

2. 用户创建的所有因子库都会展现在该业务模块；

3. 用户可通过点击[新建因子库]创建对应的因子库数据：

1）用户可通过点击[新建因子库]，则显示新建因子库弹窗；

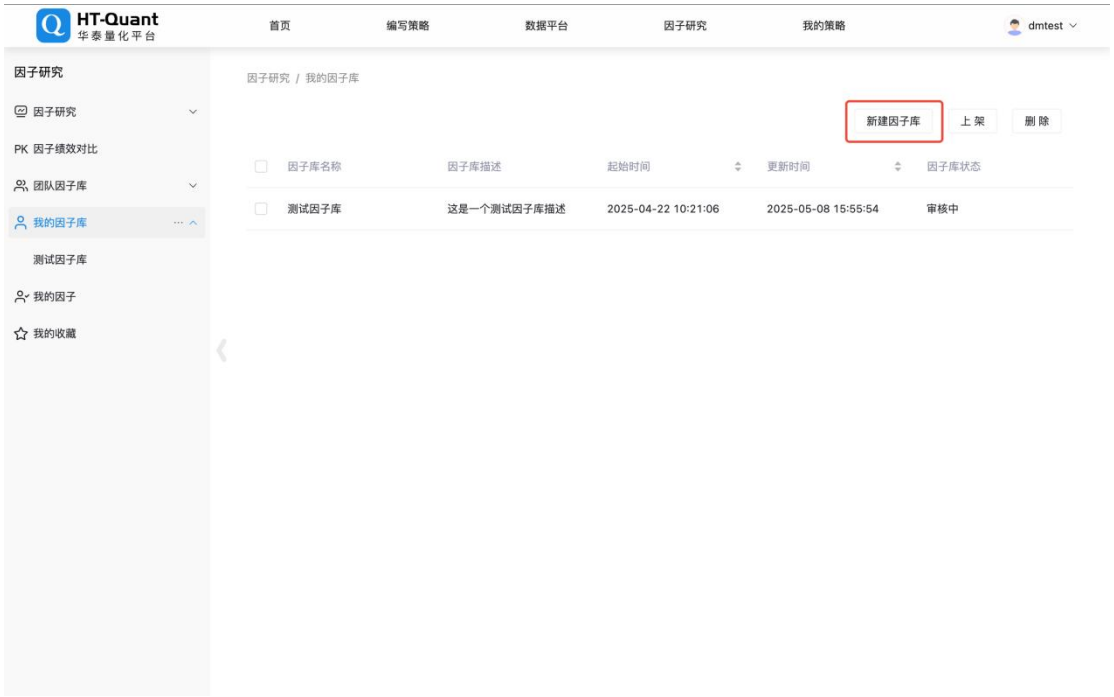
2）因子库名称：用户输入因子库名称；

3）因子库描述：用户输入对应的因子库描述；

4）取消：用户点击，则不创建该因子库，关闭弹窗；

5）确认：用户点击，则创建该因子库，并且关闭弹窗；

6）新建的因子库会自动成为我的因子库的二级菜单；



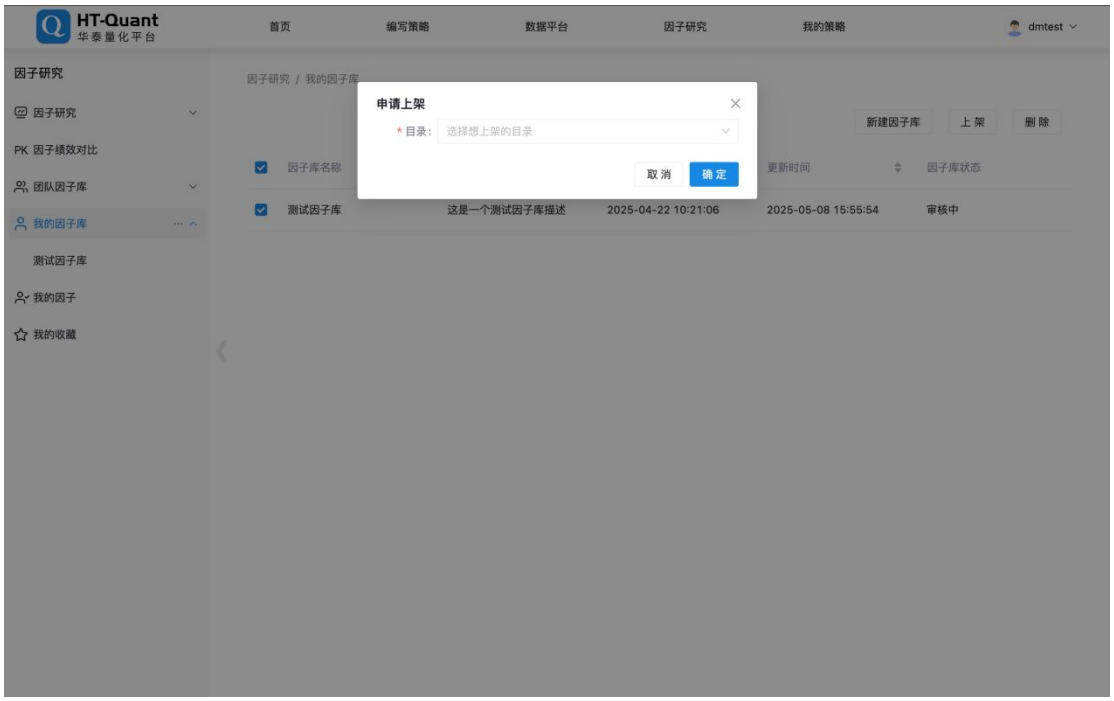
4. 用户可通过选择对应的因子库，然后点击[上架]，可将对应的因子库及其数据发布至公共平台：

1）用户选择目标因子库；

2）用户点击[上架]，输入对应的上架目录；目录指的是想要将因子上架至哪个菜单目录下，管理会进行统一目录管理，这里只是用户的预输入项，具体上架至哪个目录由管理审批时统一确定；

3）取消：用户点击，则不将该因子库提交上架审批，关闭弹窗；

4）确认：用户点击，则将该因子库提交上架审批，并且关闭弹窗；



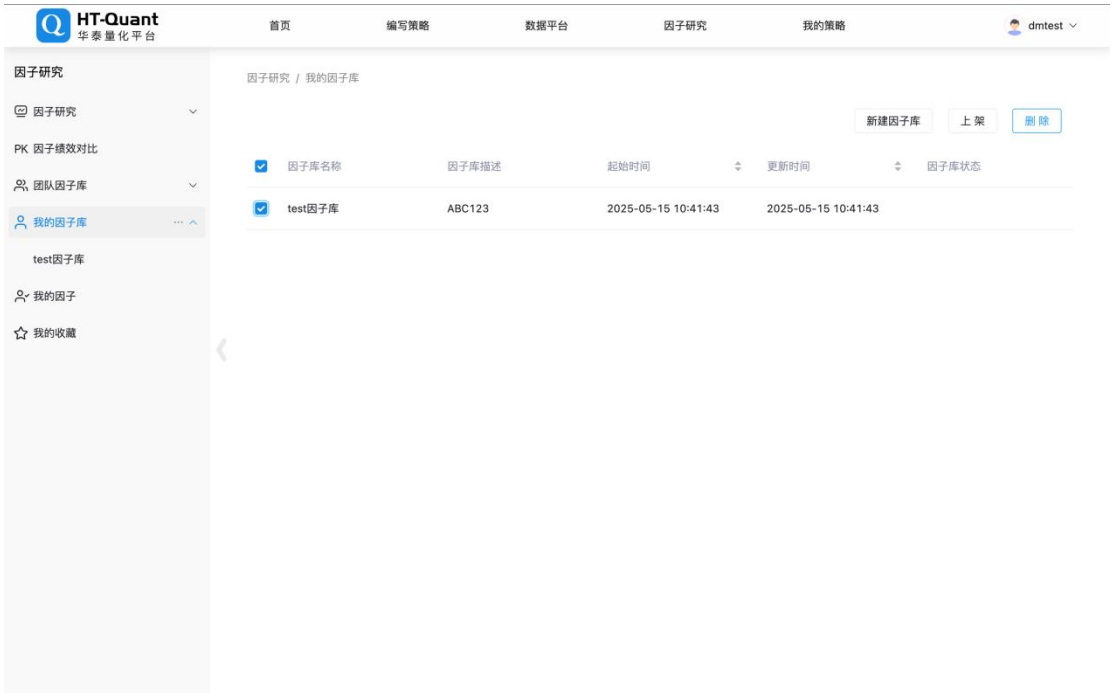
5. 用户可通过选择对应的因子库，然后点击[删除]，可将对应的因子库及其数据删除：

1）用户选择目标因子库；

2）用户点击[删除]，弹窗显示删除提示：是否删除选择的因子库；

3）取消：用户点击，则不删除选择的因子库，关闭弹窗；

4）确认：用户点击，则删除选择的因子库，并且关闭弹窗；



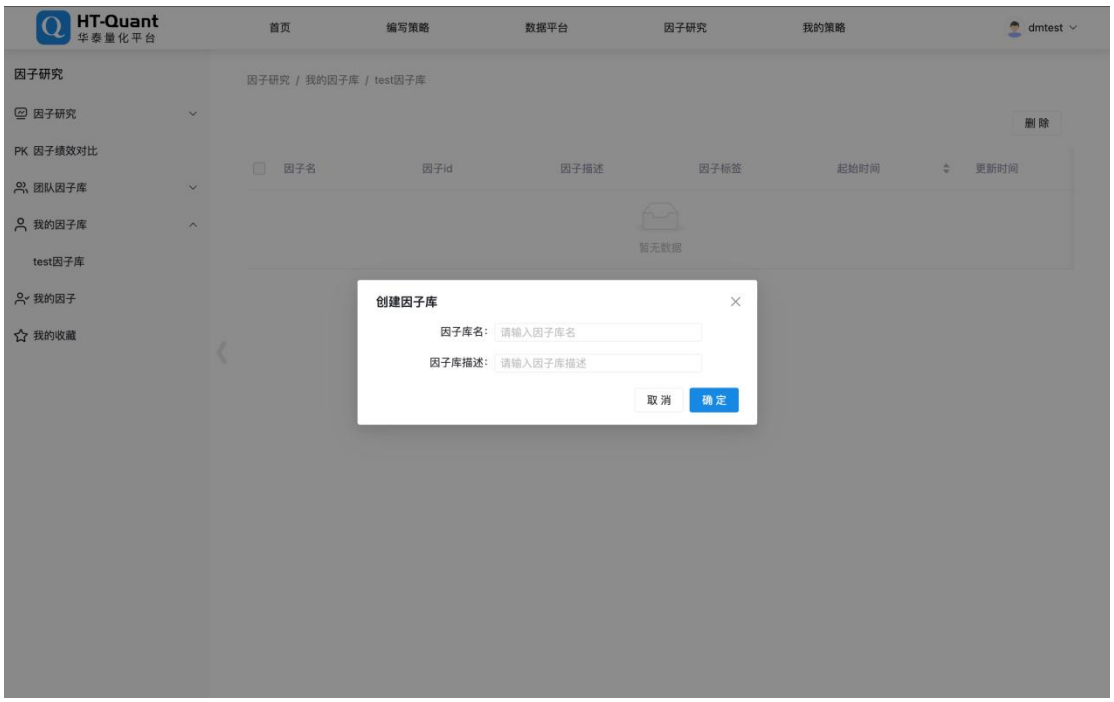
6. 用户可通过点击左侧因子库菜单或因子库名称，可进行相关操作：

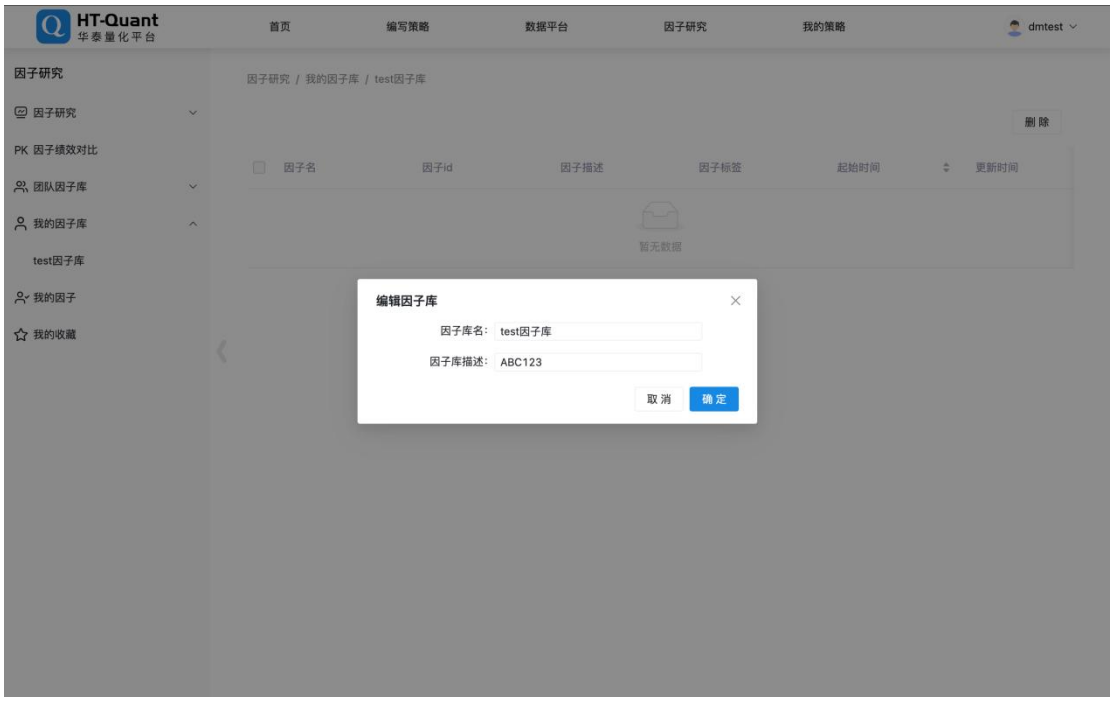
1）用户点击目标因子库名称或点击左侧具体的因子库菜单则进入到具体的因子库；

2）用户点击[...]操作，则显示操作按钮：[编辑因子库] [删除因子库]；

3）用户点击[编辑因子库]则弹窗显示因子库编辑窗口，用户可编辑因子库名称和因子库描述，编辑完成后用户点击[取消]则不保存编辑内容，关闭弹窗；用户点击[确认]则保存编辑内容并关闭弹窗；

4）用户点击[删除]，弹窗显示删除提示：是否删除选择的因子库；用户点击[取消]，则不删除选择的因子库，关闭弹窗；用户点击[确认]，则删除选择的因子库，并且关闭弹窗；





7. 用户进入到具体的因子库，可进行相关操作：

1）用户点击目标因子库名称或点击左侧具体的因子库菜单则进入到具体的因子库；

2）用户点击[删除]，弹窗显示删除提示：是否删除选择的因子；用户点击[取消]，则不删除选择的因子，关闭弹窗；用户点击[确认]，则删除选择的因子，并且关闭弹窗；

8. 用户点击具体的因子名称或者是因子 ID 则可进入到因子详情页面：

1）用户点击对应因子的[因子名称]或[因子 ID]超链接则进入因子详情页面；

2）用户在因子详情页面可进行因子标签编写，用户点击[+]，则激活标签输入框，用户可在标签输入框中，输入对应的因子标签，输入完成后点击回车则完成标签设置，注：标签为全局变量，标签不支持编辑，但是标签可删除后重新设置；

3）因子详情：因子详情的内容来源于因子分析接口的内容，用户可自定义因子分析里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；

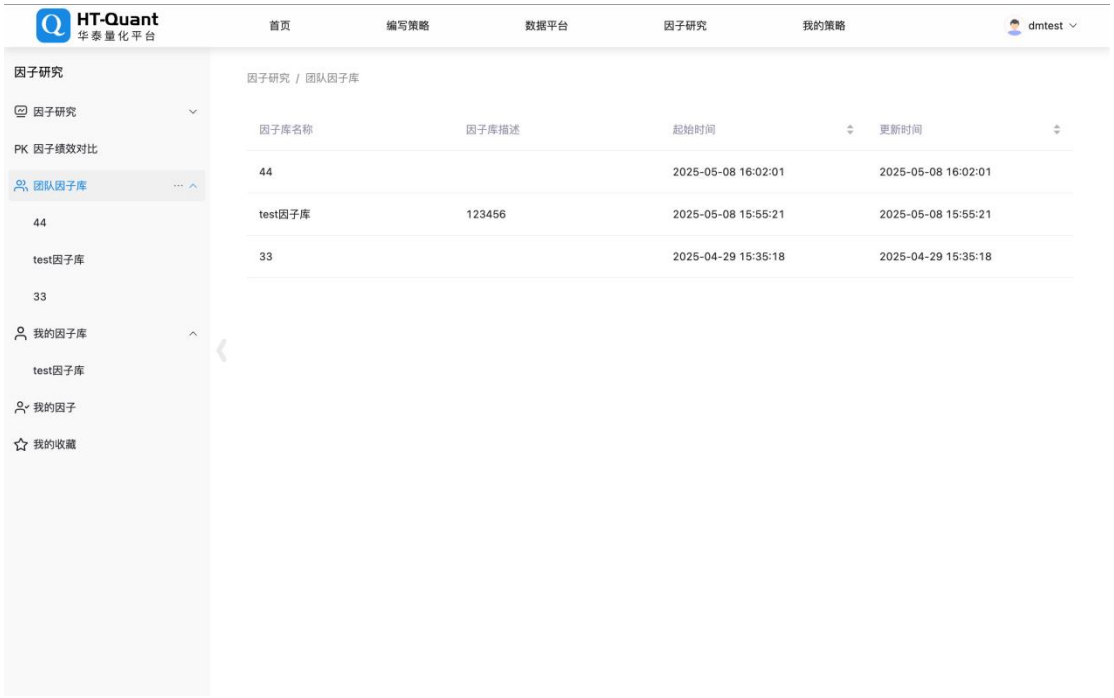
4.5.2.4. 团队因子库

用户通过点击导航菜单【因子研究】模块则会进入到因子研究模块；

1. 用户通过点击导航菜单【因子研究】-[团队因子库]则进入团队因子库业务内容展示模块；

2. 其他用户分享给该用户的所有因子库都会展现在该业务模块；

3. 团队因子库，用户不可自己创建，他人创建好的因子库给该用户分配好权限，则对应的因子库自动可见并出现在团队因子库的二级菜单下；



4. 用户进入到具体的因子库，可进行相关操作：

1）用户点击目标因子库名称或点击左侧具体的因子库菜单则进入到具体的因子库；

2）搜索：系统支持搜索因子名称、描述、作者和标签；

3）高级筛选搜索：

a. 选择筛选项

b. 筛选方式

c. 具体数值：用户填写

5. 用户点击具体的因子名称则可进入到因子详情页面：

1）用户点击对应因子的[因子名称]则进入因子详情页面；

2）因子详情：因子详情的内容来源于因子分析接口的内容，用户可自定义因子分析里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；

4.5.2.5. 因子研究

用户在【我的因子库】模块，用户通过因子库的[上架]操作和管理员的[审核]操作，可将对应的因子因子库上架到【因子研究】模块：

1. 用户通过点击导航菜单【因子研究模块则会进入到该业务模块；；
2. 所有审核通过的因子库中包含的因子都会出现在该业务模块；
3. 用户可通过对列表因子进行搜索：

   1）普通搜索：可通过因子名称、因子标签等对因子列表进行搜索；

   2）高级筛选搜索：

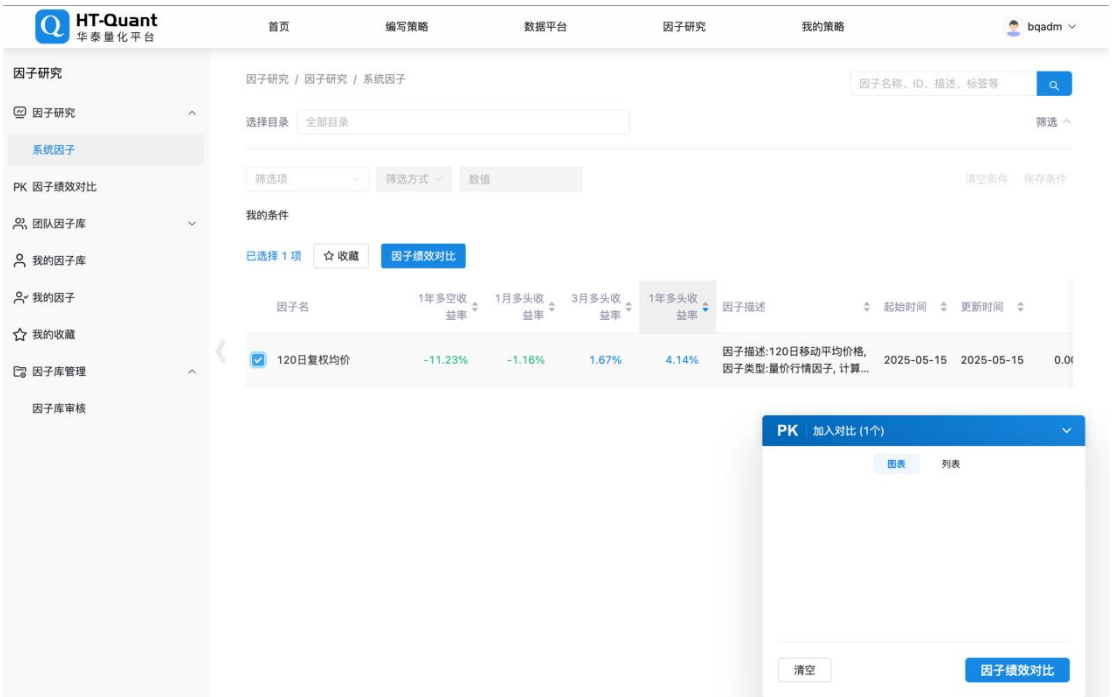
      a. 选择搜索目录

      b. 选择筛选项

      c. 筛选方式

      d. 具体数值：用户填写

4. 收藏：用户点击，则显示收藏夹选择弹窗，用户可选择具体的收藏夹，选择好收藏夹后；用户点击[取消]，则不加入收藏夹，关闭弹窗；用户点击[确认]，则加入收藏夹，并且关闭弹窗；

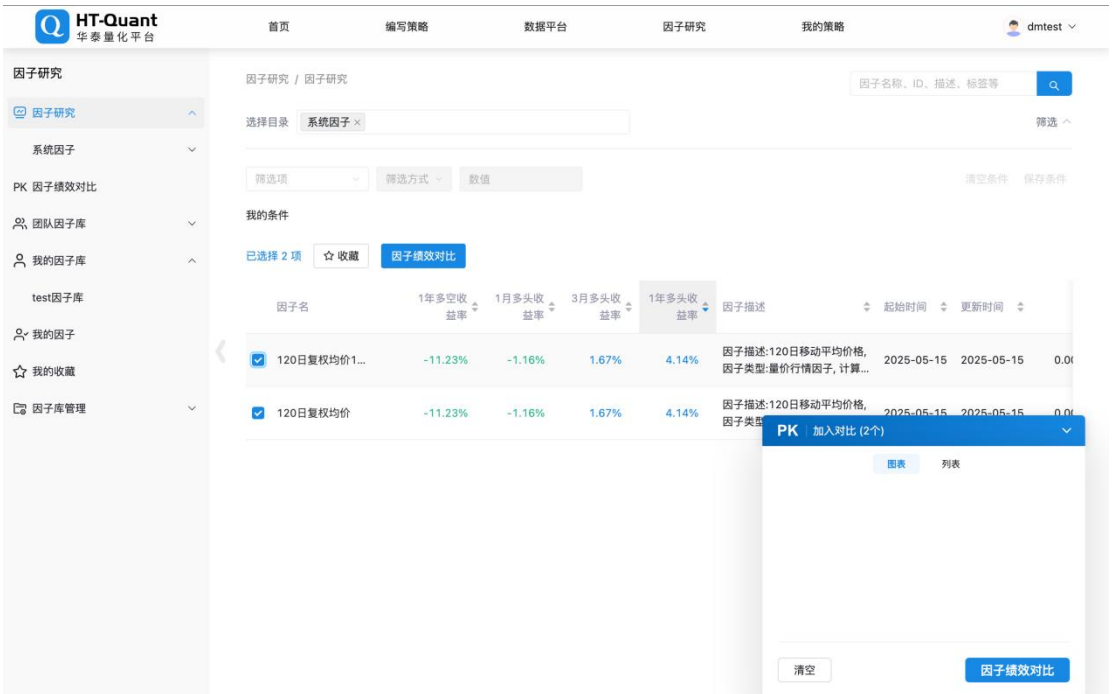


5. 因子绩效对比：用户可选则多个因子进行因子对比

1）用户勾选多个因子；

2）用户勾选多个因子会在 PK 面板出现对应趋势图的走势；

3）点击 PK 面板的[因子绩效对比]则会跳转进入到因子绩效对比模块；

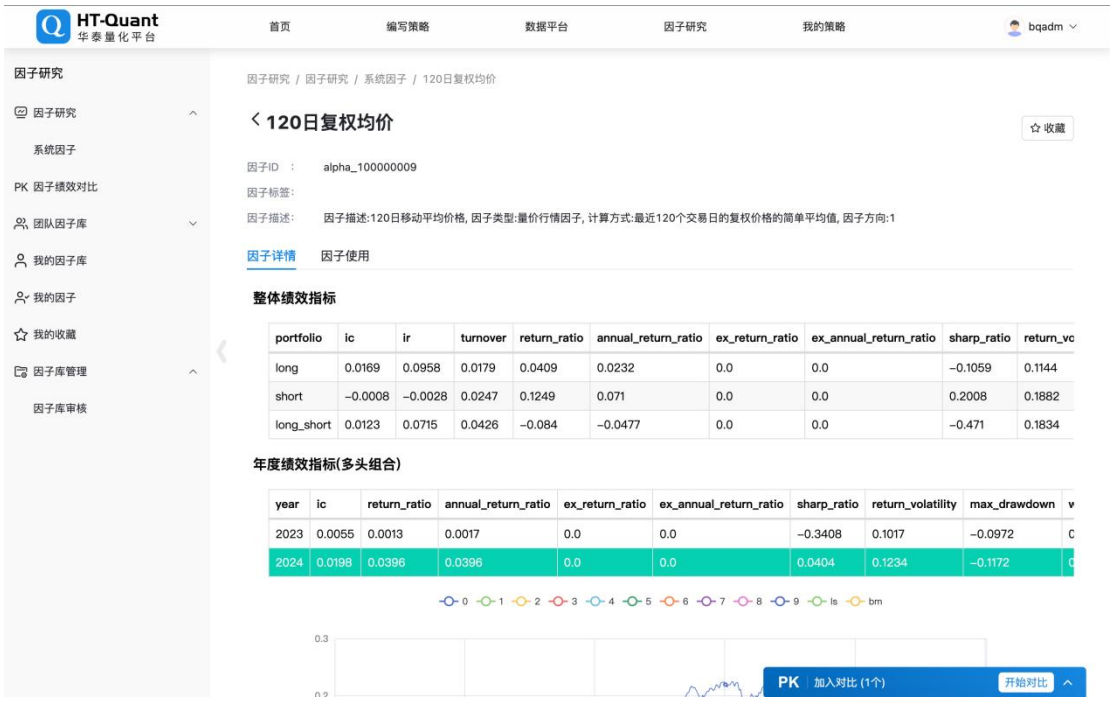


6. 因子详情：用户点击对应因子的因子名称或因子 ID 超链接则可进入该因子的详情信息：

1）用户点击对应因子的[因子名称]或[因子 ID]超链接则进入因子详情页面；

2）用户在因子详情页面可看见因子标签，这里的因子标签是因子创建者同步的标签，不可编辑；

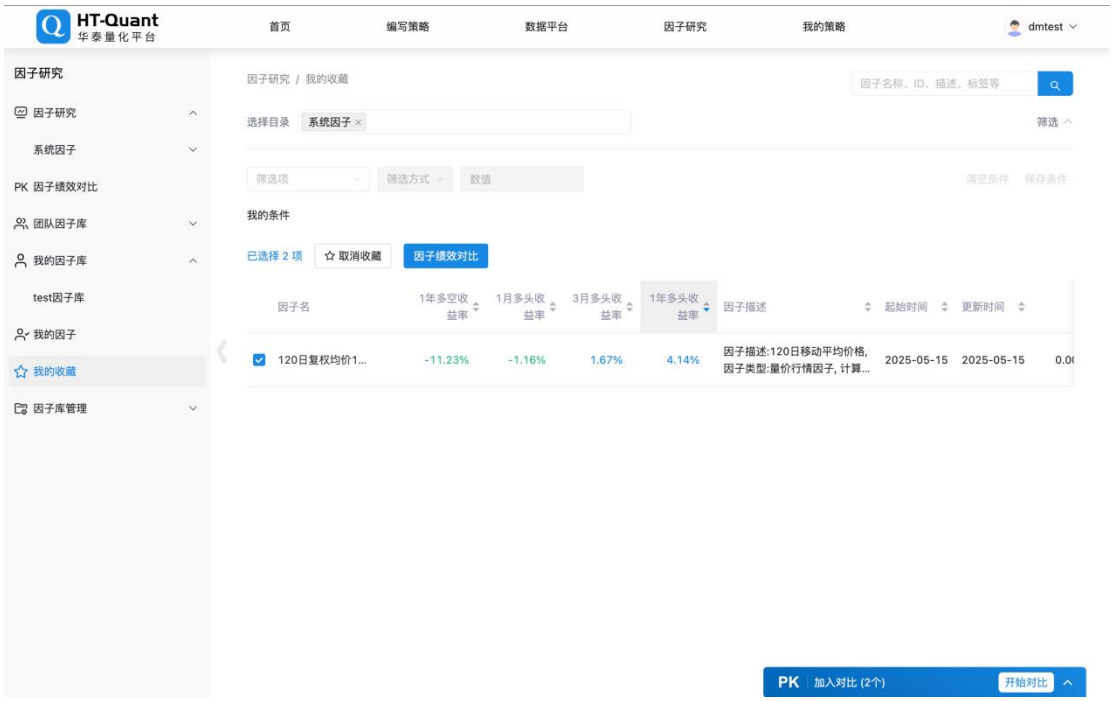
3）因子详情：因子详情的内容来源于因子分析接口的内容，用户可自定义因子分析里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；



4.5.2.6. 我的收藏

用户在【因子研究】模块进行收藏操作收藏的因子，则会进入到【我的收藏模块】：

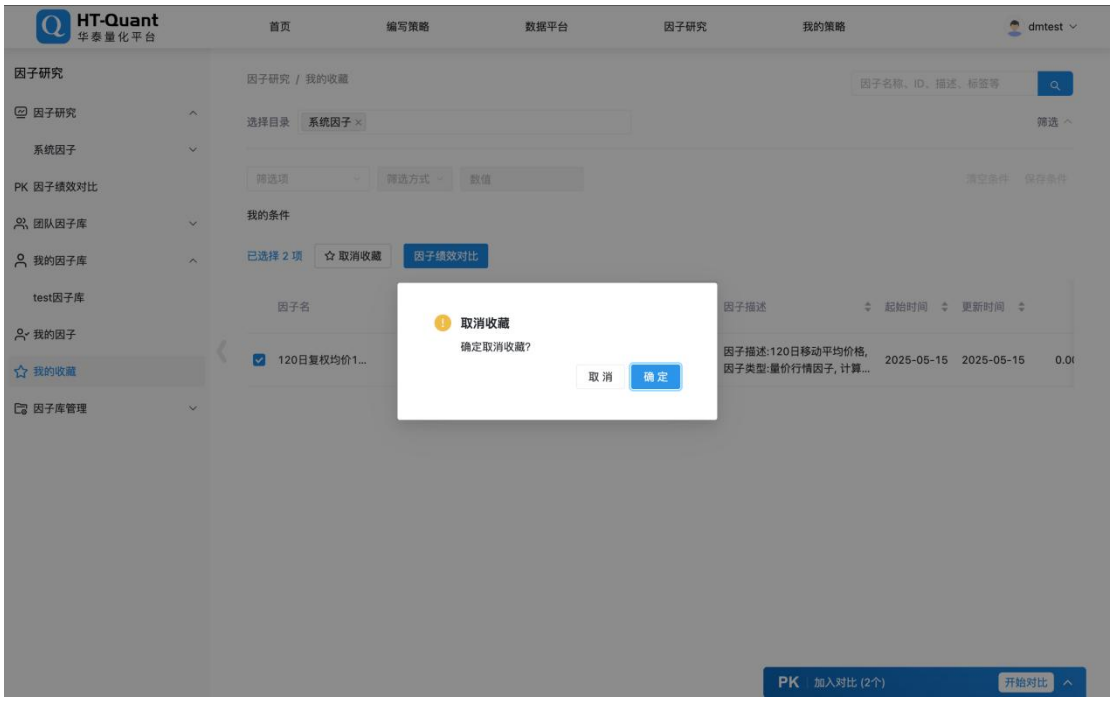
1. 用户通过点击导航菜单【因子研究】-【我的收藏】模块则会进入到该业务模块；
2. 用户收藏的因子都会出现在该业务模块；



3. 取消收藏：

1）用户选择目标因子，点击[取消收藏]，则显示取消收藏夹确认弹窗；

2）用户点击[取消]，则不取消收藏夹，关闭弹窗；用户点击[确认]，则取消收藏该因子关闭弹窗；

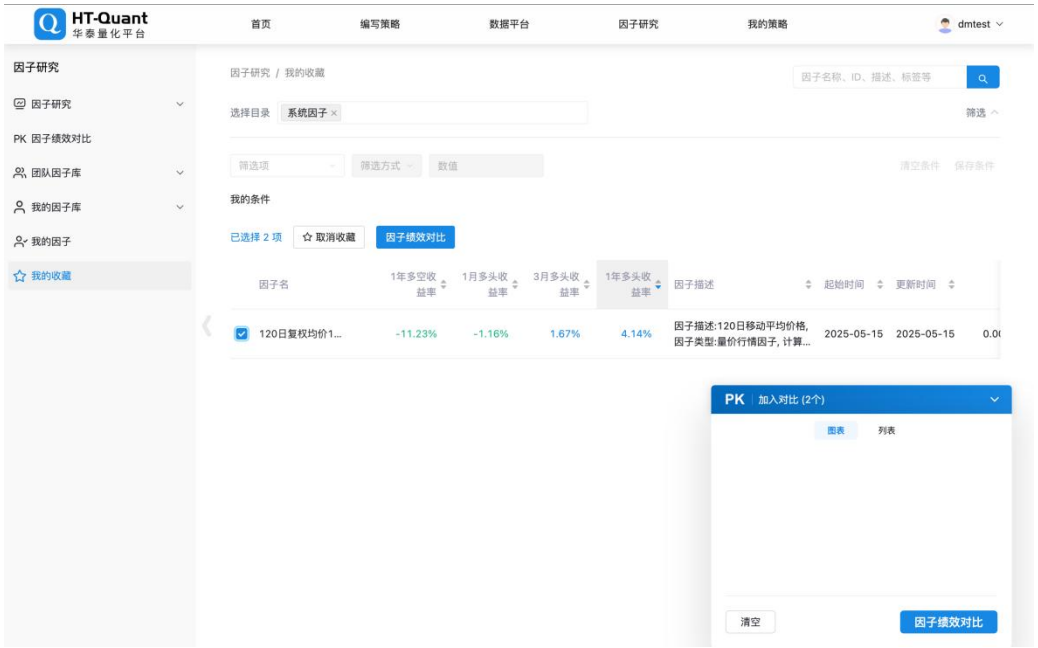


4. 因子绩效对比：用户可选则多个因子进行因子对比

1）用户勾选多个因子；

2）用户勾选多个因子会在 PK 面板出现对应趋势图的走势；

3）点击 PK 面板的[因子绩效对比]则会跳转进入到因子绩效对比模块；



5. 因子详情：用户点击对应因子的因子名称则可进入该因子的详情信息：

1）用户点击对应因子的[因子名称]则进入因子详情页面；

2）用户在因子详情页面可看见因子标签；

3）因子详情：因子详情的内容来源于因子分析接口的内容，用户可自定义因子分析里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；

4.6.我的策略

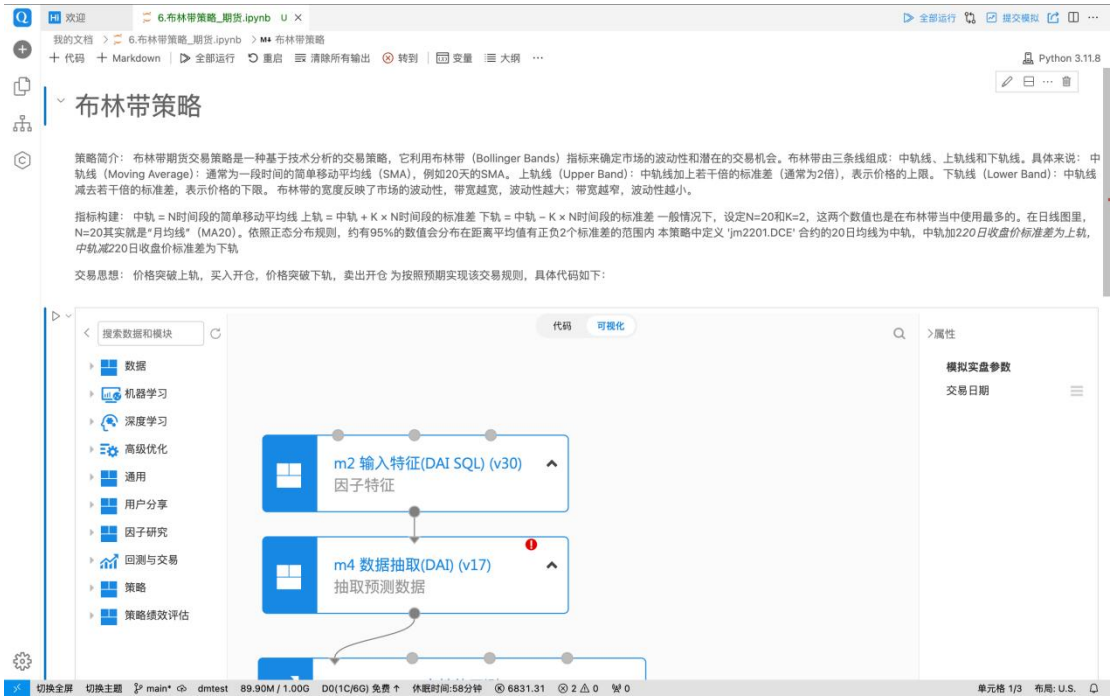
4.6.1.功能概述

我的策略是用户对自己的相关策略进行持续绩效跟踪和监控调整的模块。

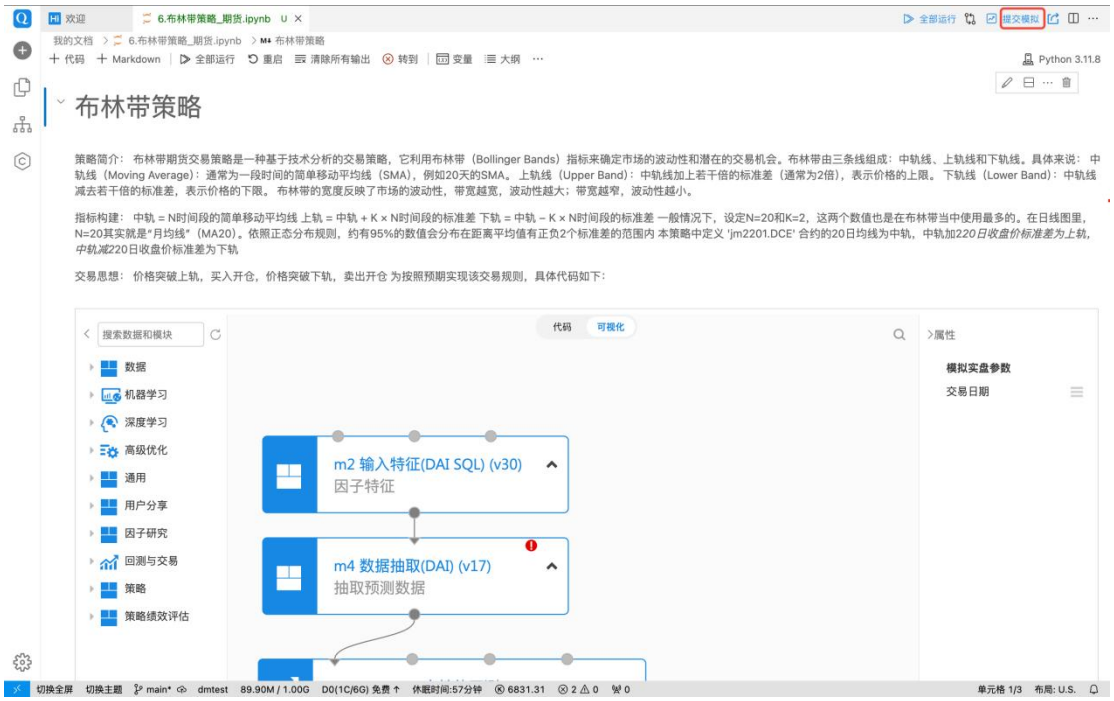
4.6.2.操作说明

4.6.2.1.提交交易任务

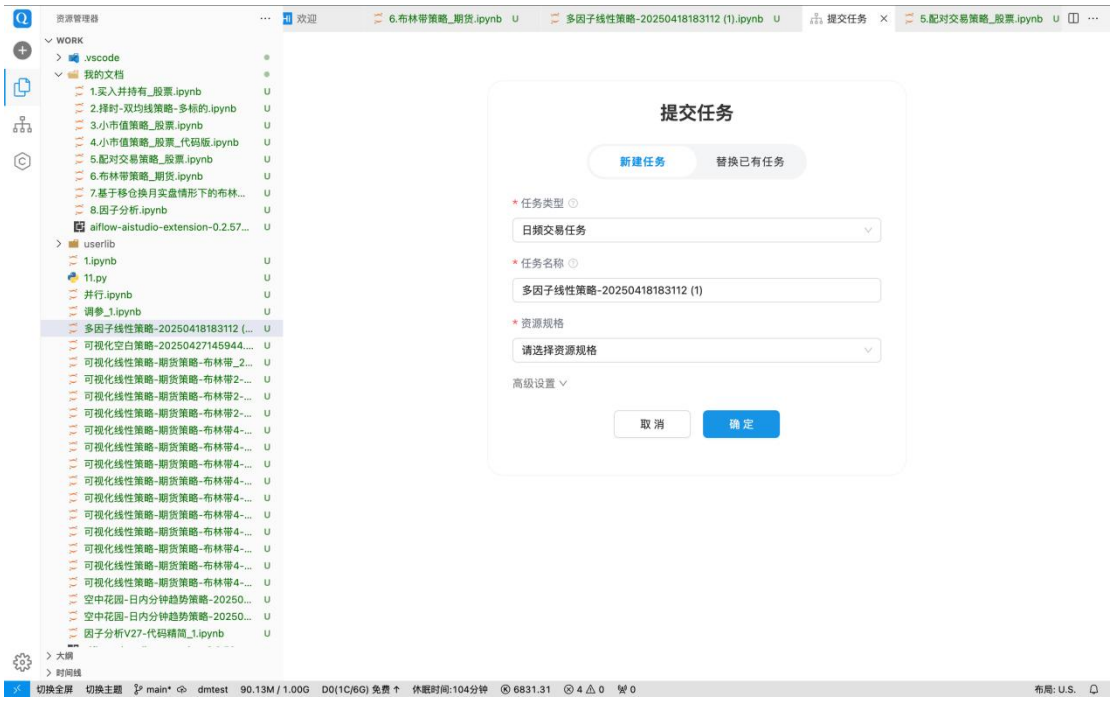
进入开发空间，新建一个策略文件



点击右上角提交任务



任务类型选择



4.6.2.2. 我的策略

用户点击导航【我的策略】则会默认进入我的策略页面，我的策略页面提供以下操作：

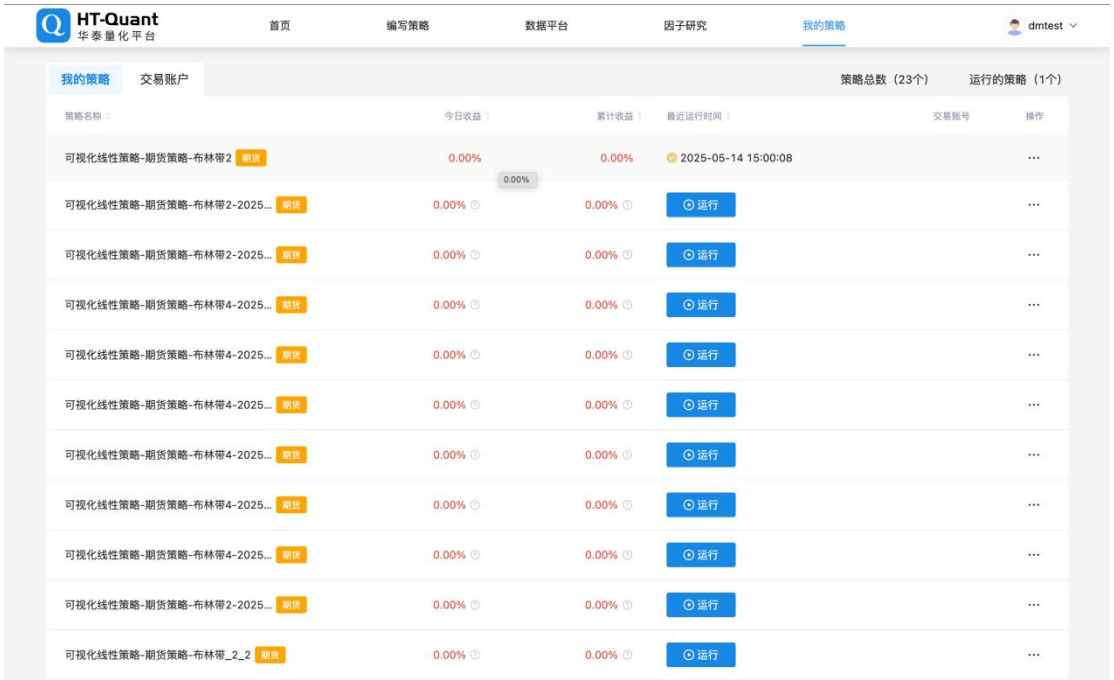
1. 查看策略的基本收益信息
2. 可针对策略任务进行操作

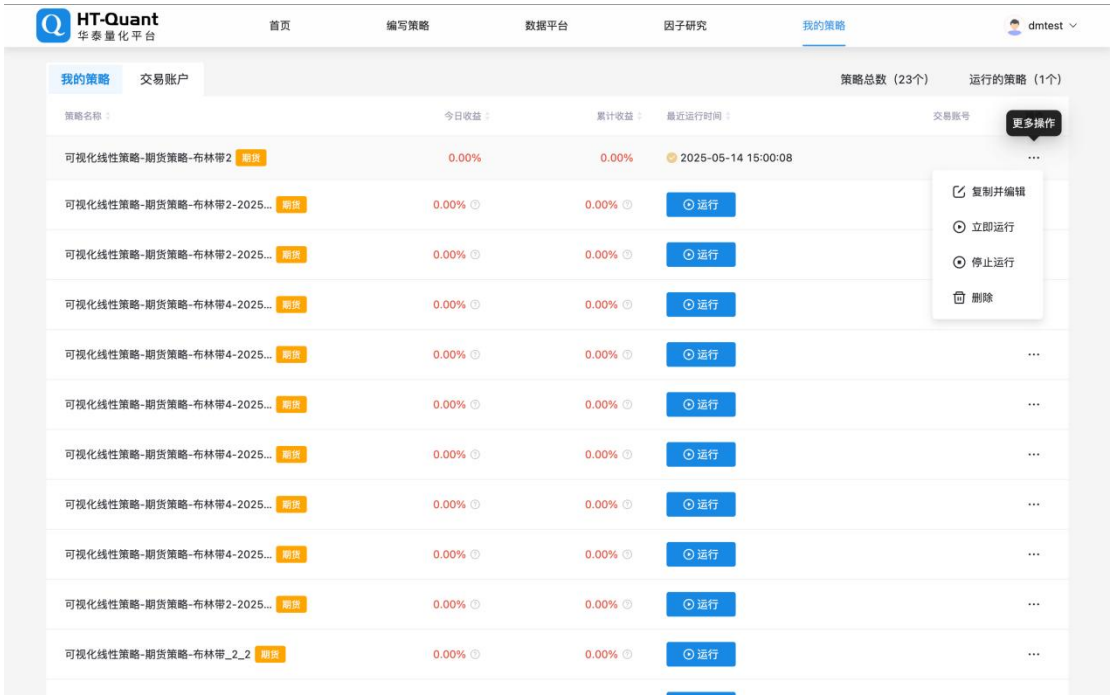
(1) 复制并编辑：点击则会在 AIstudio 一键复制策略，用户可以启动工作空间前往 AIstudio 进行策略编辑。

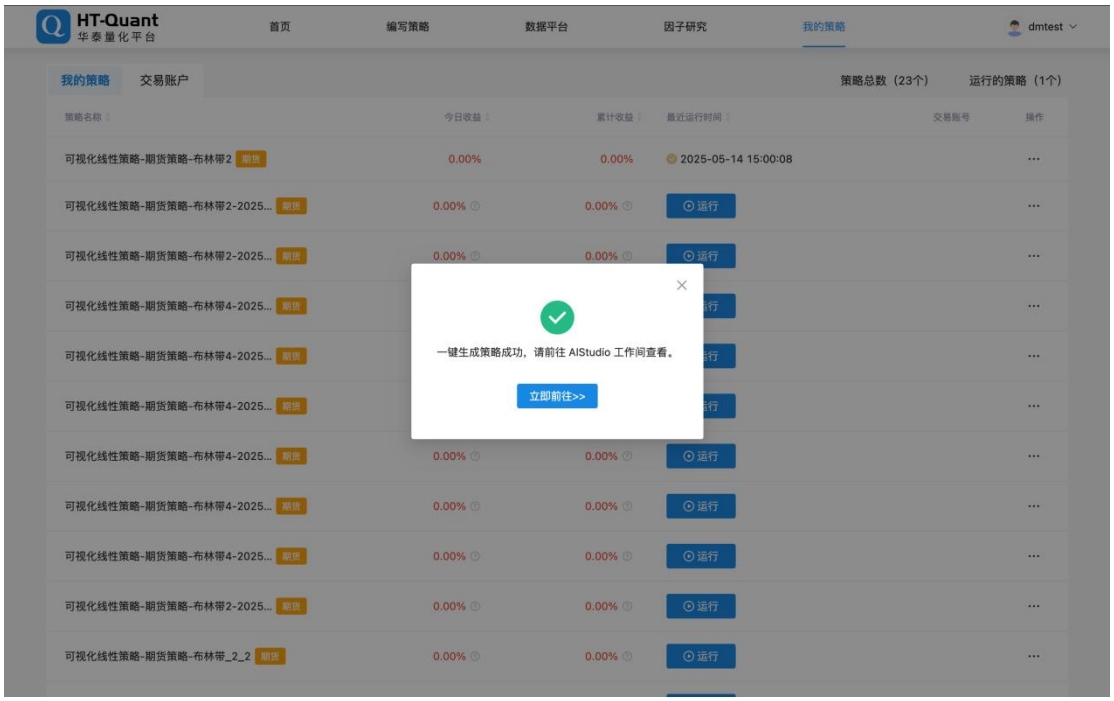
(2) 立即运行：即启动策略任务立即运行一次

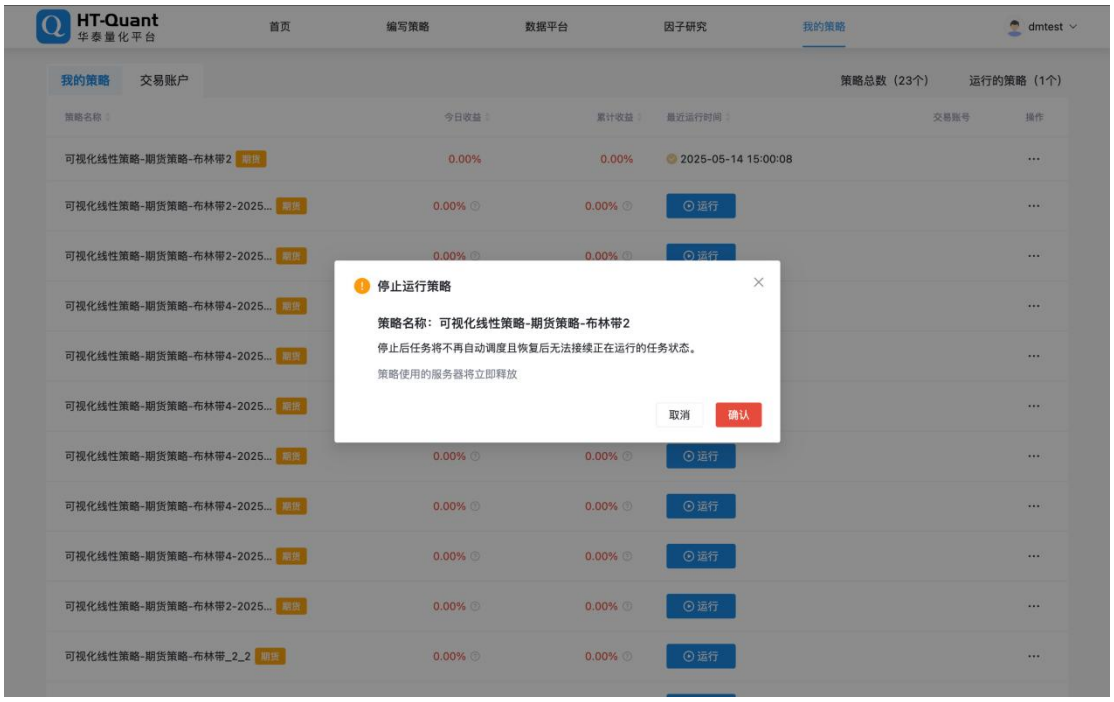
(3) 停止运行：即停止任务调度，任务将不再进行自动调度

(4) 删除：删除任务会进行二次确认，删除后任务不可恢复









3. 策略详情

用户点击策略名称，即可进入策略详情：

1. 日频交易任务

(1) 查看计划交易

(2) 查看策略收益走势

(3) 查看持仓详情

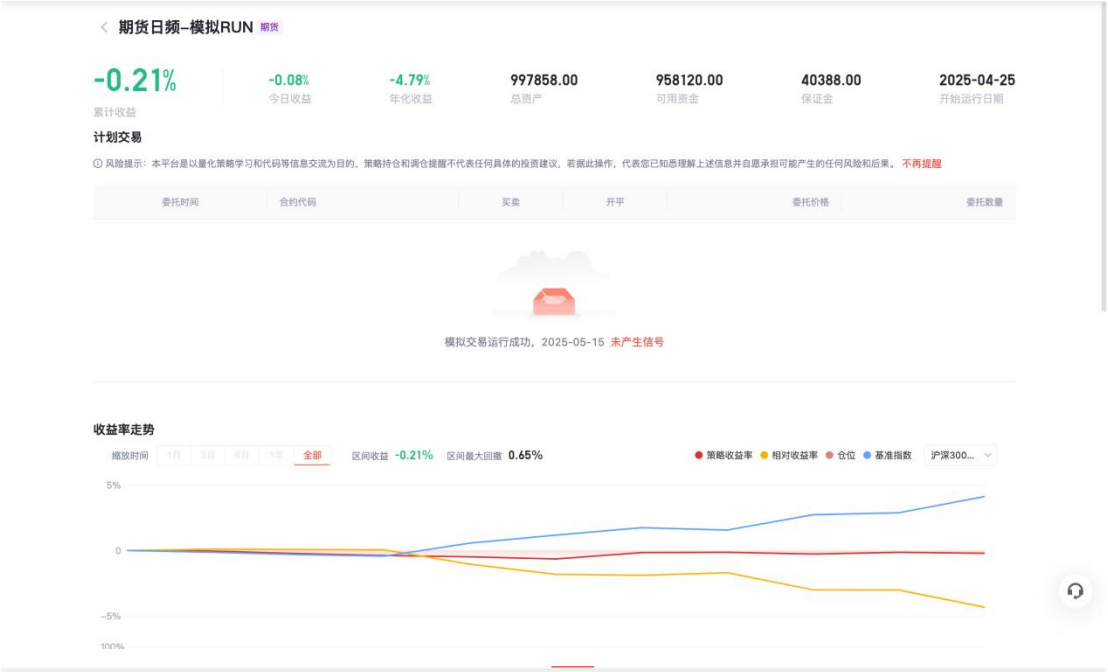
(4) 查看交易详情

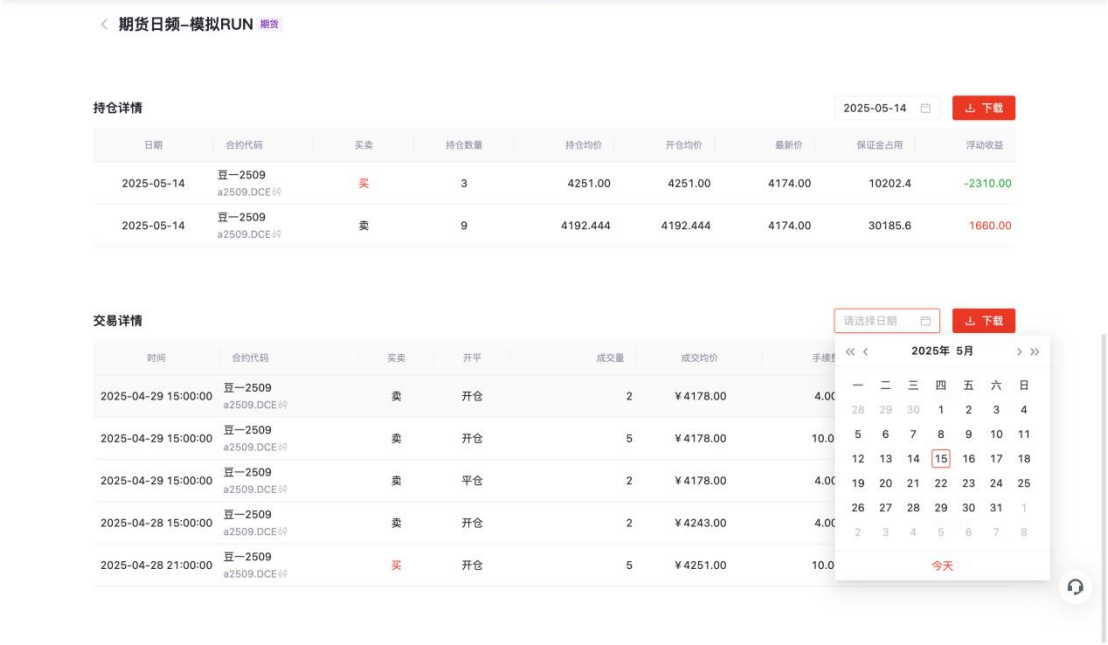
2. 实时交易任务

(1) 查看策略委托

(2) 查看策略成交

(3) 查看策略日志





4.7.策略社区

策略社区提供平台维护的以及用户分享的策略，用户可以在该模块内进行策略的查看和针对策略通过评论进行沟通交流。

4.7.1.策略检索、排序、筛选

- ✓ 支持针对策略名称进行模糊匹配搜索；
- ✓ 支持针对特定指标进行排序：系统默认为综合排序，其他排序指标包括累计收益、近一年收益、近 6 月收益、近 3 月收益、近 1 月收益、近 1 周收益、近 10 日收益
- ✓ 筛选：点击右侧的筛选开启按钮，则会展示条件筛选区域

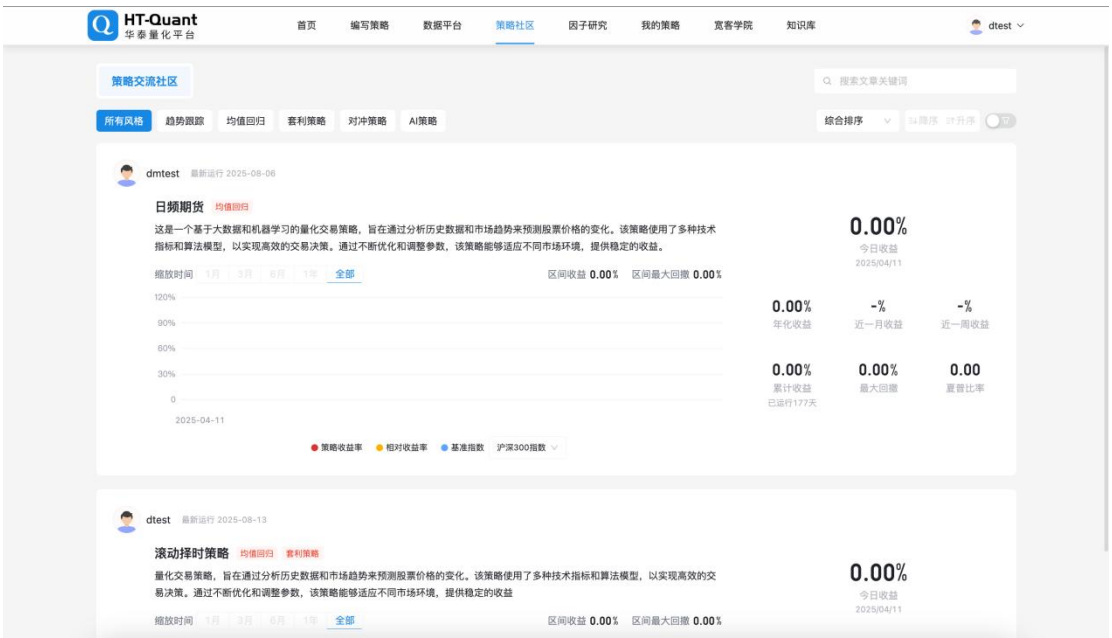
(1) 用户可选择特定指标选择或者自己设置对应的指标阈值，指标包括：2.累计收益、近一年收益、近 6 月收益、近 3 月收益、近 1 月收益、近 1 周收益、今日收益、年化收益、最大回撤、夏普比率、交易胜率和开始运行时间。具体每个指标的可选范围见页面展示。

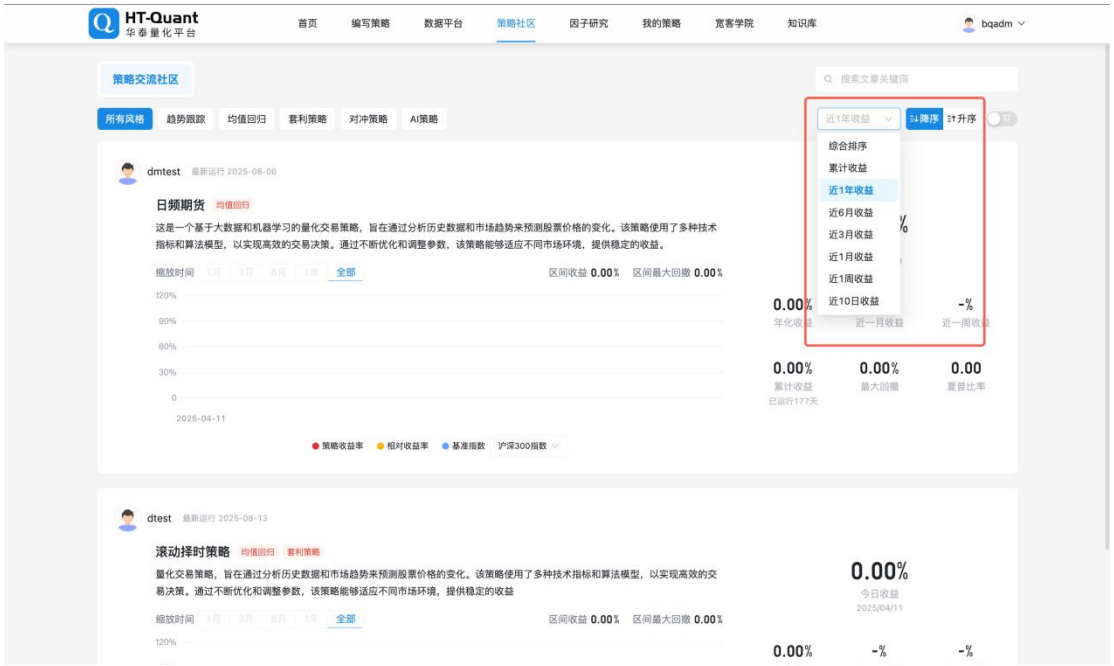
(2) 指标相关阈值设置完成后，可以点击[保存条件]，点击保存条件则会弹窗显示命名弹窗，用户需要输入条件名称进行条件保存。

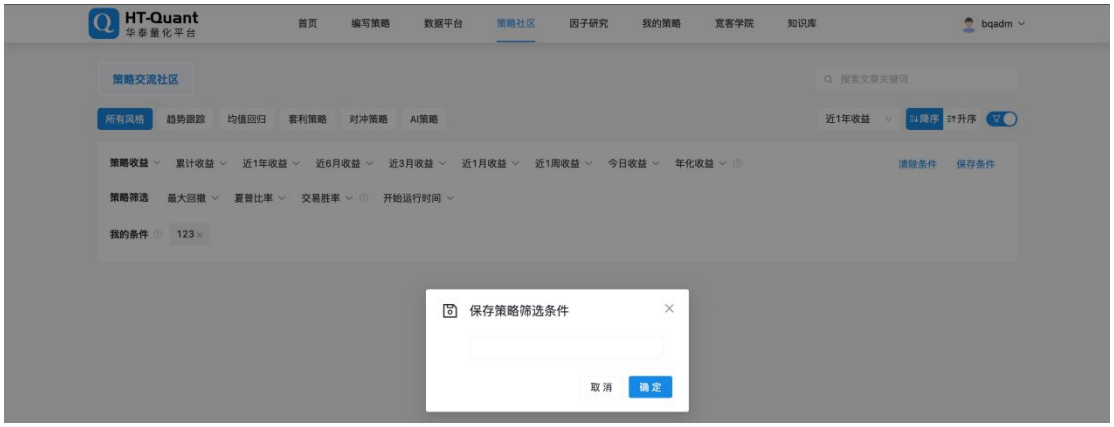
(3) 条件保存完成后，则会出现在我的条件中，用户可点击[X]进行删除。

注意：这里保存的条件是存在浏览器本地的，若切换浏览器或者清楚浏览器缓存后则无法看见保存的相关条件信息。

(4) 保存好的条件，用户可直接点击条件选中后则能够进行快捷搜索。




HT-Quant
华泰量化平台
首页
编写策略
数据平台
策略社区
因子研究
我的策略
宽客学院
知识库
bqadm
策略交流社区
搜索文章关键词
所有风格
趋势跟踪
均值回归
套利策略
对冲策略
AI策略
近1年收益
降序
升序
综合排序
累计收益
近1年收益
近6月收益
近3月收益
近1月收益
近1周收益
近10日收益
dmtest
日频期货
均值回归
这是一个基于大数据和机器学习的量化交易策略，旨在通过分析历史数据和市场趋势来预测股票价格的变化。该策略使用了多种技术指标和算法模型，以实现高效的交易决策。通过不断优化和调整参数，该策略能够适应不同市场环境，提供稳定的收益。
缩放时间
全部
区间收益 0.00%
区间最大回撤 0.00%
0.00%
年化收益
近一月收益
近一周收益
累计收益
最大回撤
夏普比率
策略收益率
相对收益率
基准指数
沪深300指数
dtest
滚动择时策略
套利策略
0.00%
今日收益
2025/04/11


HT-Quant
华泰量化平台
策略交流社区
所有风格
趋势跟踪
均值回归
套利策略
对冲策略
AI策略
策略收益
累计收益
近1年收益
近6月收益
近3月收益
近1月收益
近1周收益
今日收益
年化收益
清除条件
保存条件
策略筛选
最大回撤
夏普比率
交易胜率
开始运行时间
我的条件
123
保存策略筛选条件
取 消
确 定

HT-Quant
华泰量化平台
策略交流社区
所有风格
趋势跟踪
均值回归
套利策略
对冲策略
AI策略
近1年收益
降序
升序
策略收益
累计收益
近1年收益
近6月收益
近3月收益
近1月收益
近1周收益
今日收益
年化收益
清除条件
保存条件
策略筛选
最大回撤
夏普比率
交易胜率
开始运行时间
我的条件
dmtest
日频期货
均值回归
这是一个基于大数据和机器学习的量化交易策略，旨在通过分析历史数据和市场趋势来预测股票价格的变化。该策略使用了多种技术指标和算法模型，以实现高效的交易决策。通过不断优化和调整参数，该策略能够适应不同市场环境，提供稳定的收益。
缩放时间
全部
区间收益 0.00%
区间最大回撤 0.00%
0.00%
今日收益
2025/04/11
0.00%
年化收益
-%
近一月收益
-%
近一周收益
累计收益
最大回撤
夏普比率
策略收益率
相对收益率
基准指数
沪深300指数

4.7.2.策略卡片

- ✓ 策略的卡片信息包括策略的名称（分享时的命名）、描述、策略的区间收益、策略的今日收益、年化收益、近一月收益、近一周收益、累计收益、最大回撤、夏普比率。
- ✓ 点击策略名称或者点击卡片空白部分则会进入到策略详情。
- ✓ 策略卡片详情信息：

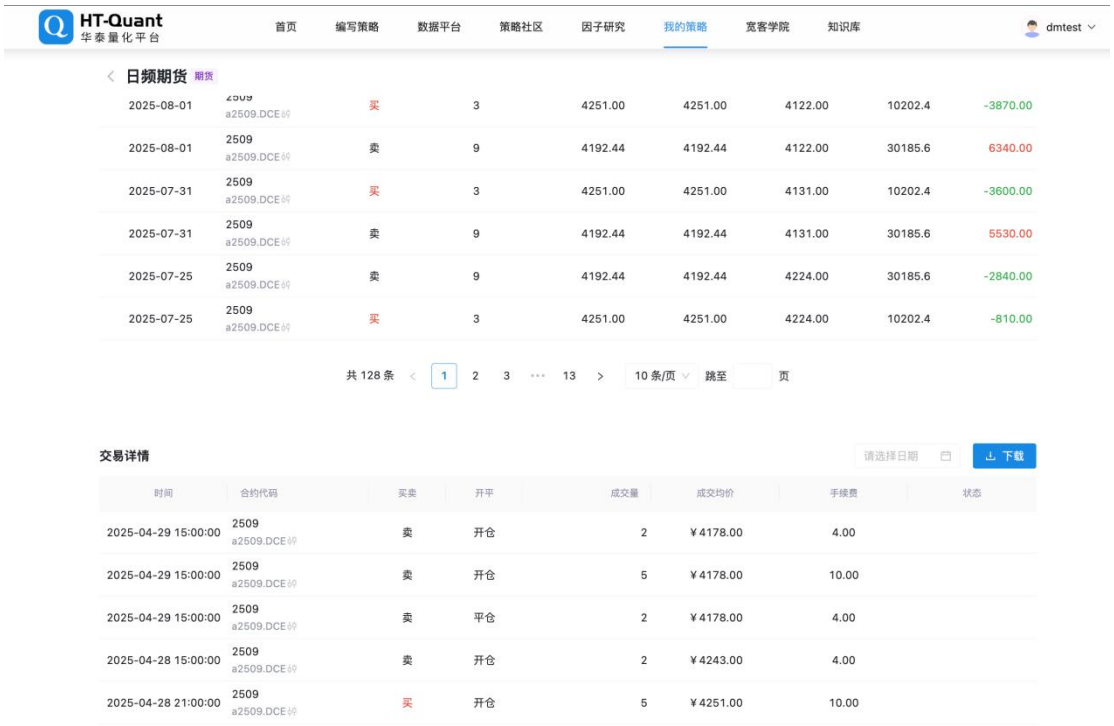
  (1) 策略基本信息，包含策略名称、今日收益、累计收益、年化收益、策略作者、最新运行时间、策略简述；

  (2) 概要：即策略区间内的收益走势，展示策略收益、基准收益和相对收益的走势图。点击基准指数可选择切换基准展示在不同走势下的趋势图

  (3) 持仓详情：展示对应的交易日期、合约代码、买卖、持仓数量、持仓均价、开仓均价、最新价、保证金占用、浮动收益

  (4) 交易详情：时间、合约代码、买卖、开平、成交量、成交均价、手续费、状态。

  (5) 评论：评论仅评论人和策略发布人可见相关信息。



4.7.3.策略分享

用户可以在【我的策略】模块选择目标想要分享的策略：

- ✓ 选择策略：在策略列表选择想要分享的策略，点击操作列的[...]
- ✓ 在对应的下拉菜单中点击[分享到社区]

  注意：1）仅标识为期货日频的策略可分享至策略社区，其他类型的策略无法看见[分享到社区]功能键；2）仅白名单用户才可使用分享到策略社区的功能。

- ✓ 点击分享到社区后，会显示对应的分享弹窗：

  (1) 标题：即该策略在策略社区展示的名称

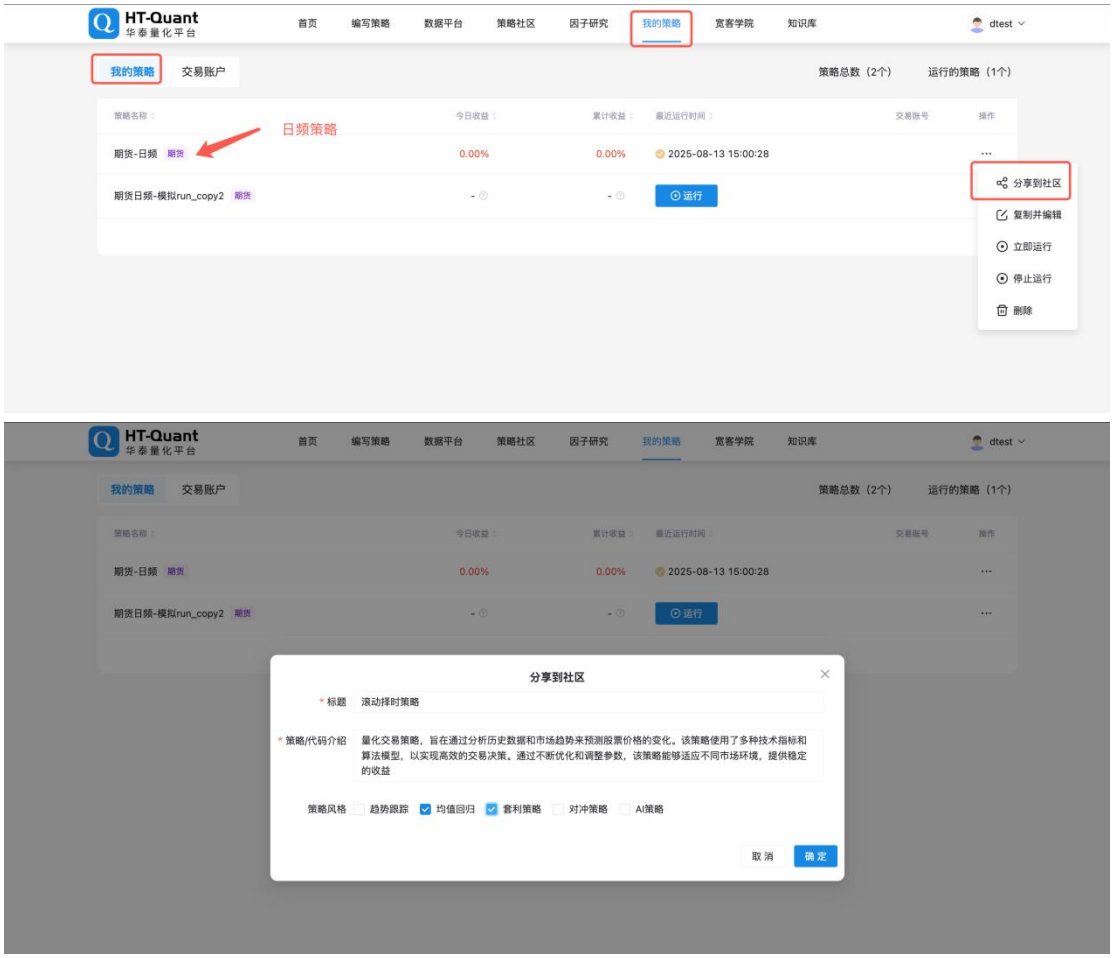
  (2) 策略/代码介绍：用户可根据策略内容填写，一般是针对该策略的思想和代码逻辑，有字数不少于 50 字的限制；

  (3) 策略风格：系统预设的风格标签，用户可多选，在社区可用来分类或者搜索时使用；

  (4) 取消：取消则关闭弹窗并不触发分享操作；

  (5) 确定：确定则触发分享操作并关闭弹窗。

- ✓ 策略分享成功后，我们会默认进入到策略详情页面，确认策略分享的信息是否无误。



4.8.量化学院

量化学院是聚焦量化策略分享、量化平台操作、量化交易与金融基础知识的学习中心，致力于为用户打造从入门到精通的一站式学习平台，通过系统化的知识传递与实操指导，逐步提升金融认知与量化应用能力。

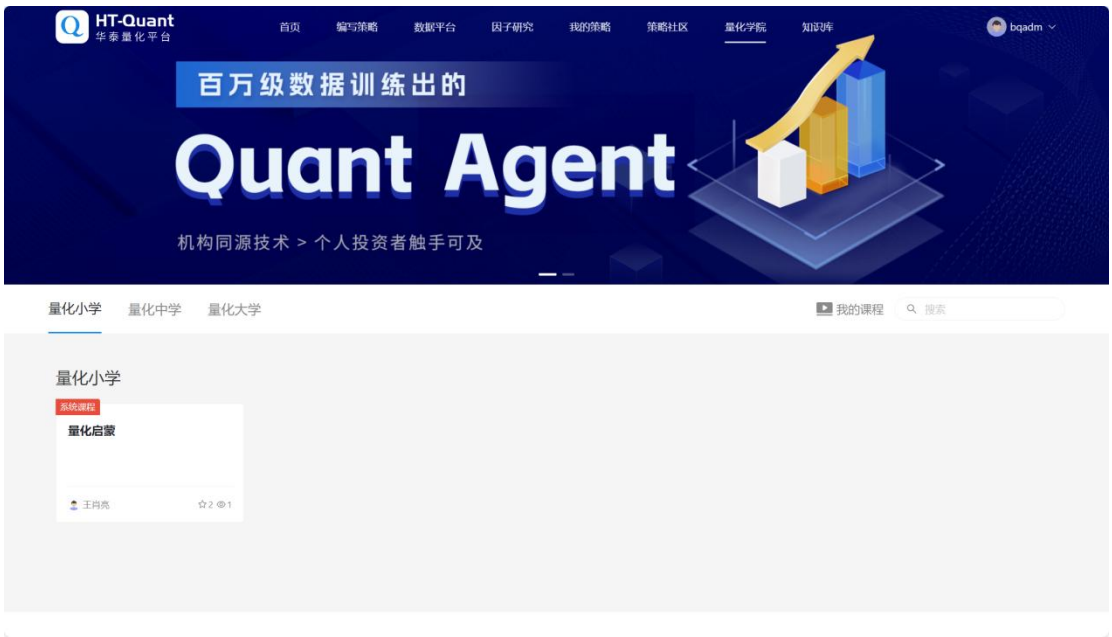
4.8.1.课程总览

模块核心内容涵盖三大内容，课程内容持续迭代：

- **基础理论课程**：系统梳理量化交易原理、金融市场基础知识、数据分析方法等核心内容，帮助用户构建扎实的理论框架，无论零基础入门还是专业知识补强，都能找到适配的学习资源；
- **平台操作指南**：通过直观的操作视频，详解平台功能的使用逻辑与实操技巧，包括策略编写、数据调取、回测分析等关键环节，助力用户快速上手，提升平台使用效率；
- **动态学习资源**：后续将持续更新直播回放、专题讲座等内容，涵盖市场热点解读、进阶策略分享、行业专家交流等，让用户及时获取前沿知识与实战经验，保持学习的时效性与互动性。

用户打开量化学院页签进入该模块如下（后续逐步丰富）：

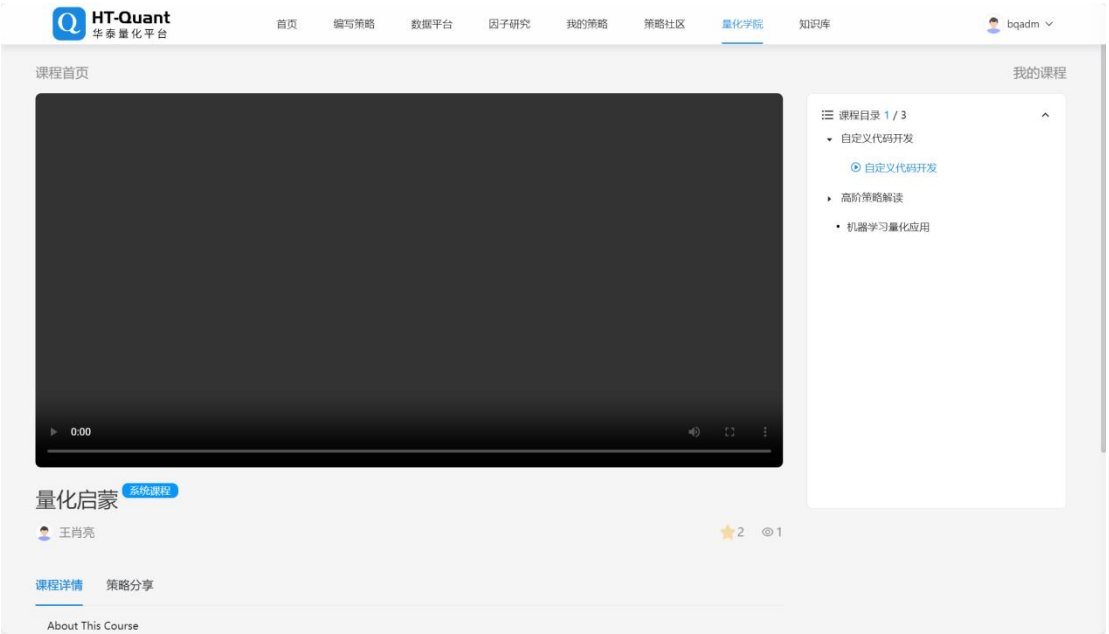
可点击相应页签查看课程分类和课程内容，选择感兴趣的课程进行学习。



4.8.2.课程详情

点击课程进入课程详情页

- 点击播放按钮可进行课程播放；
- 可根据需要选择播放/暂停、播放速度选择、全屏显示、画中画等；
- 右侧展示课程目录，单击相应课程可进行播放课程的切换；
- 底部显示课程基础信息：课程类型、授课老师、进行课程收藏、展示浏览记录；
- 课程详情为课程内容介绍；
- 课程中如果有分享的策略，会在策略分享模块展示。



4.9.知识库

知识库模块提供丰富的文档资源，涵盖量化交易基础知识、经典策略编写教程、数据指标说明及常见问题解答等，方便用户随时查阅与学习。用户可通过关键词搜索或分类筛选快速定位所需资料，提升学习效率与实操能力。同时，知识库还为用户提供文档管理工具，进行文档的新建、编写、保存、发布。

4.9.1.文件检索

- ✓ 用户可针对知识库所有的信息进行搜索，用户可输入关键词进行匹配
- ✓ 用户可搜索到用户有权搜索到的内容；
- ✓ 用户可通过点击搜索匹配的内容进入到该文档详情；

4.9.2.文档创建

✓ 用户点击[新建文档]则进入进入新建文档页面

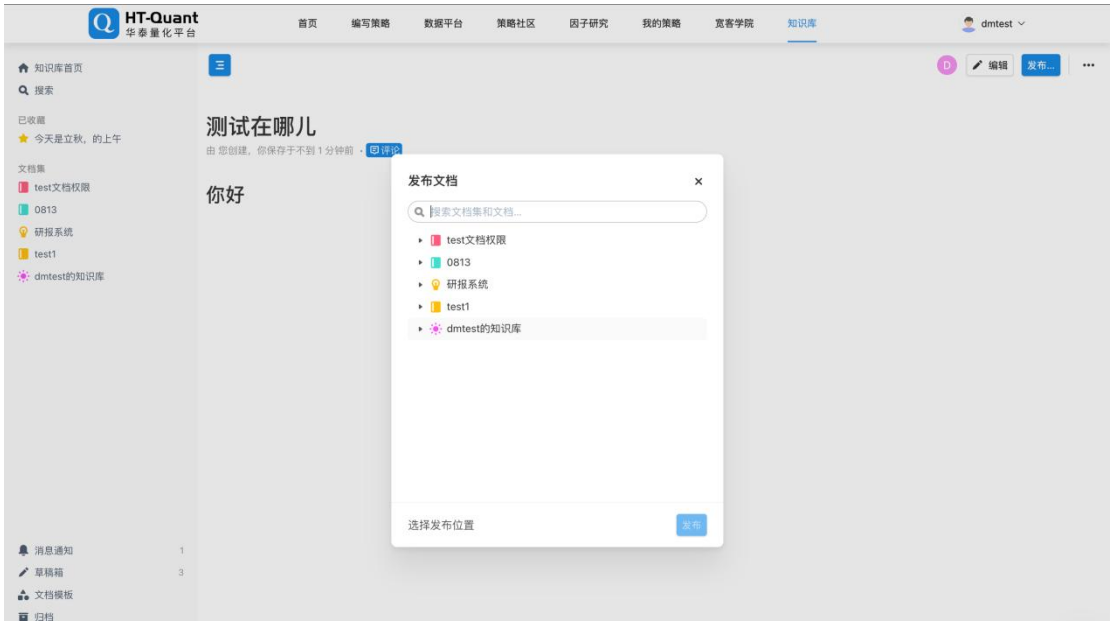
✓ 创建文档输入支持相关格式调整：包括标题、任务列表、图片、PDF、MP4、链接的嵌入。

✓ 用户内容编辑完成，可以选择存为草稿或者选择发布，存为草稿文件便会保存至草稿箱。

✓ 发布：

(1) 若是在具体文档集上创建的文档点击发布会直接发布至该文档集；

(2) 若是直接点击全局通用的[新建文档]需要指定文档发布的文档集（用户只能选择自己有权编辑的文档集）

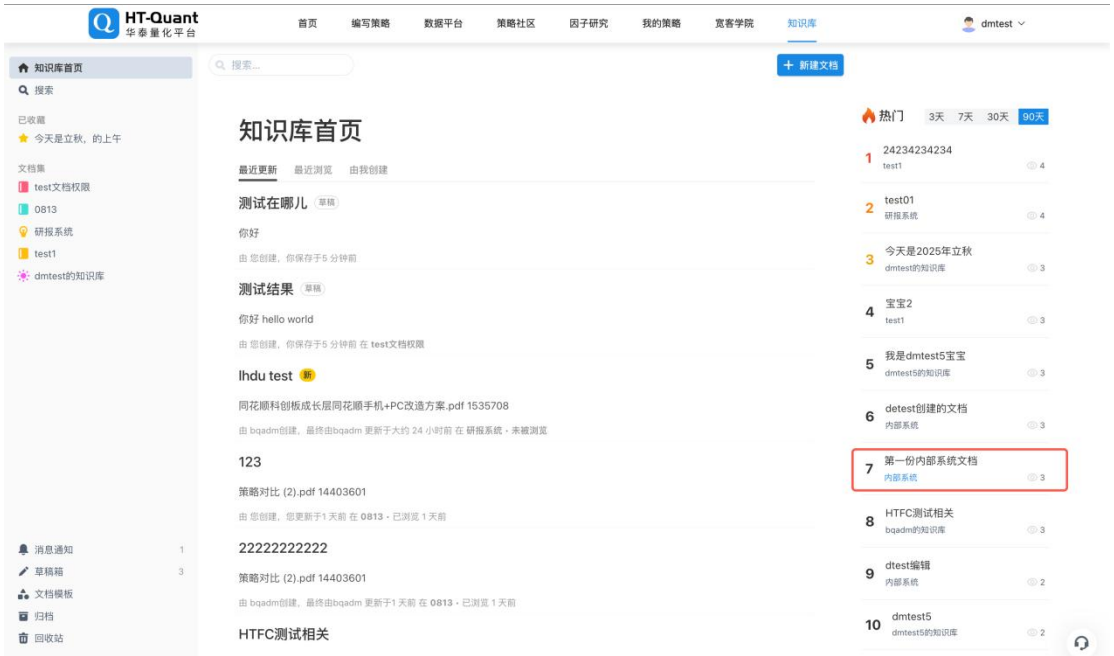


4.9.3.文档热度

右侧热门的排行根据文档的阅读量展示。

用户单击相应文档，若用户有该文档的相应权限，则可以直接根据权限查看或编辑；

用户可见自己没有权限的文档，会展示在排行榜中，但是用户点击无法查看详情。会显示找不到主页。



4.10.用户中心

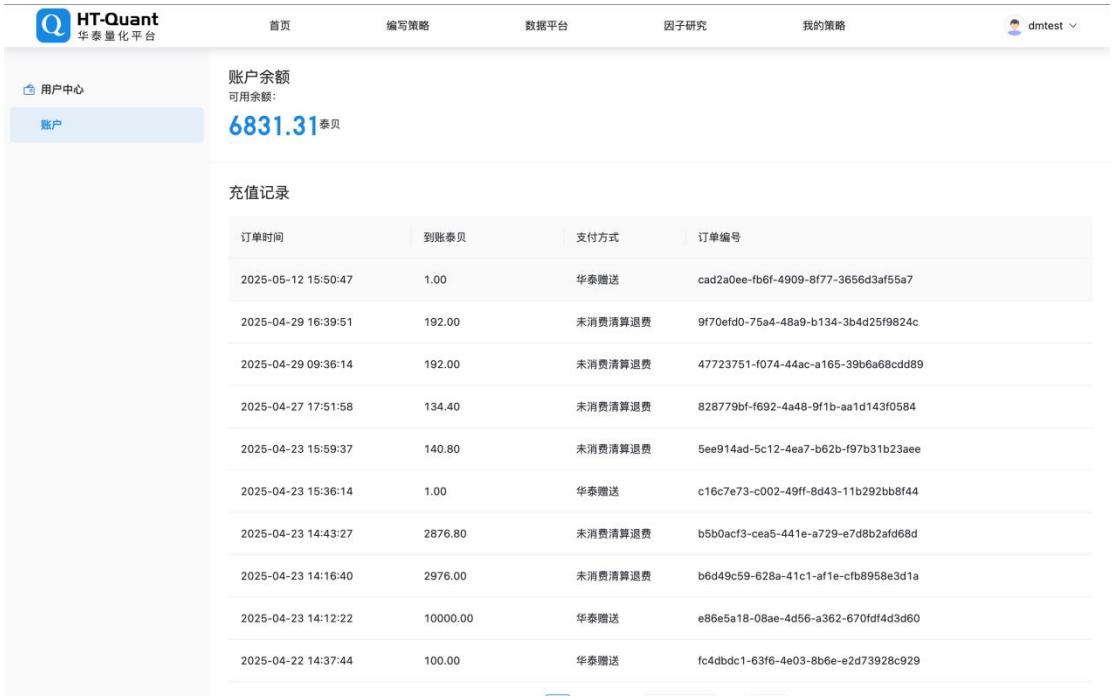
4.10.1.功能概述

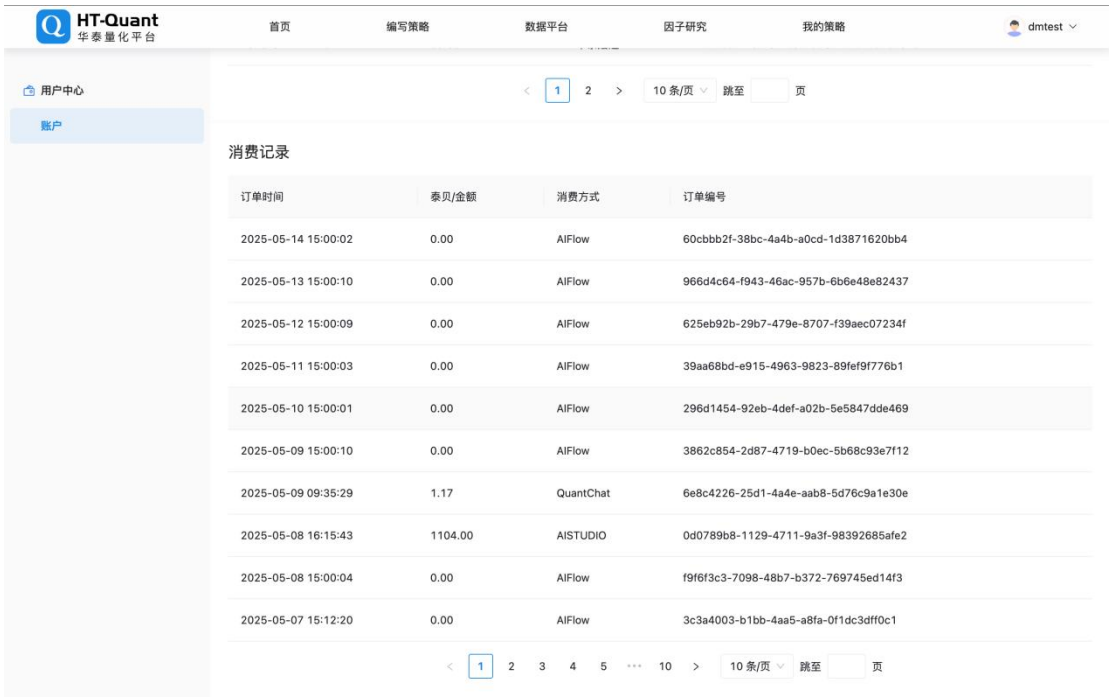
用户中心是平台提供给用户自己的相关基础信息查看页面。

4.10.2.操作说明

用户可点击自己的用户名则进入到该业务模块：

1. 用户在菜单栏右侧点击用户名称，则显示用户账户信息；
2. 【账户】展示用户的账户余额；
3. 充值记录：展示用户的账户充值信息；
4. 消费记录：展示用户的账户消费信息；



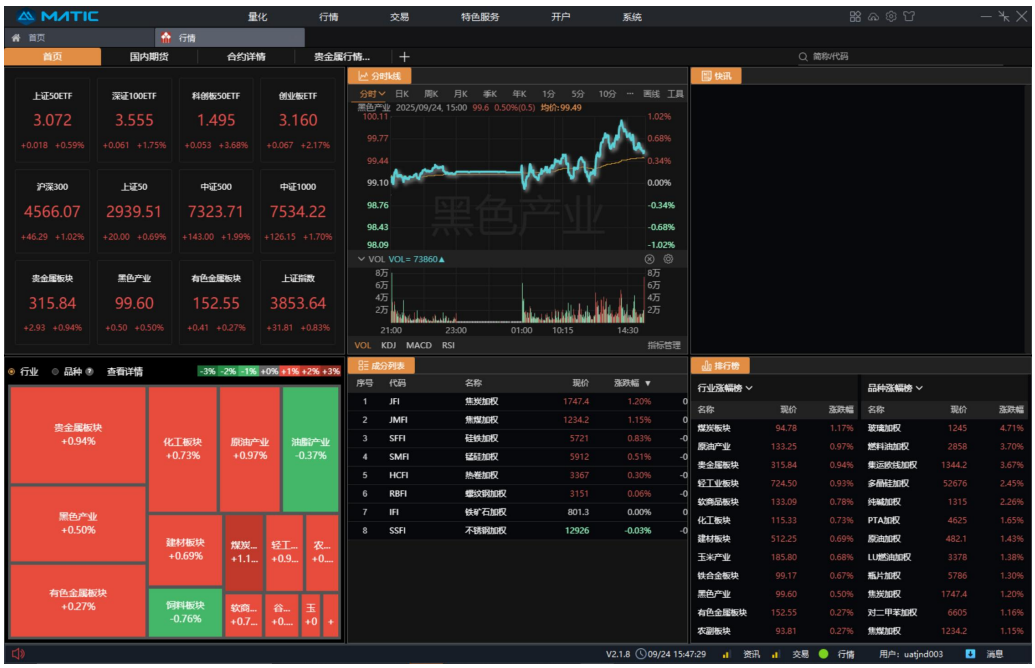


5.行情

用户登录 Matic，点击顶部“行情”页签，进入行情页面，页面展示行情首页、国内期货、合约详情及自定义界面。

5.1.首页

用户单击顶部“行情”，即可进入行情界面，默认展示行情首页。



首页包括六大板块：

1) 左上：自定义看板，目前看板暂不支持自定义，为选取后固定展示：上证 50ETF、深证 100ETF、科创板 50ETF、创业板 ETF、沪深 300、上证 50、中证 500、中证 1000、贵金属、黑色金属、有色金属、上证指数 12 个 ETF 及指数品种，后续将支持用户自定义。

2) 中上：分时 K 线组件，展示合约包含副图指标在内各周期的分时/K 线走势，默认展示贵金属板块走势数据，单击左侧自定义组件合约，分时组件可相应切换。

3) 右上：快讯组件，支持展示期货相关快讯信息。

4) 左下：热力图组件，支持展示期货行业以及品种分类下的热力分布。

5) 中下：成分列表组件，展示相应合约的现价、涨跌幅等指标，具体见界面展示。

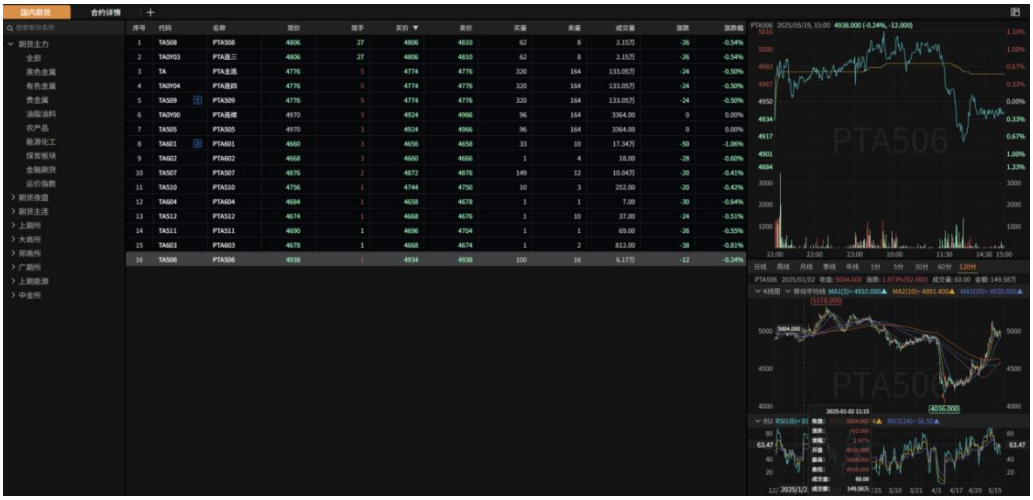
6) 右下：右下区域放置两个排行榜组件，左侧组件默认展示行业涨幅榜，右侧组件默认展示品种涨幅榜。

- 首页各板块联动关系：
  - 自定义看板组件-- (合约 code) --> 分时 K 线组件
  - 热力图组件 -- (板块 ID) --> 分时 K 线组件
  - 热力图组件 -- (板块 ID) --> 成分列表组件
  - 期货排行榜组件 -- (板块 ID) --> 分时 K 线组件
  - 期货排行榜组件 -- (板块 ID) --> 成分列表组件
  - 成分列表组件 -- (合约 code 或板块 ID) --> 分时 K 线组件

5.2.国内期货

用户可切换查看不同期货板块的行情报价，包括期货主力、期货夜盘、期货主连、上期所、大商所、郑商所、广期所、上期能源、中金所板块。

1）菜单栏选中【国内期货】的时候，切换至该页面；



5.2.1.切换期货板块

点击某一个板块树节点（期货主力、期货夜盘、期货主连、上期所、大商所、郑商所、广期所、上期能源、中金所），可展开板块子节点，点击切换不同板块，搜索框支持根据板块名称进行搜索。

5.2.2. 配置合约报价列表

1）点击左侧板块树节点切换不同的板块成分，展示对应成分的合约报价列表。

2）报价列表中点击鼠标右键，选择【列表字段配置】，跳出成分列表字段配置弹窗，从左侧可选指标选择字段到右侧已选指标列表中，已选指标支持冻结、排序、删除功能，点击【恢复默认】恢复成默认字段配置，点击【确认】按钮完成字段配置。

3）点击表头字段名称，支持列表按对应字段升序、降序排列。

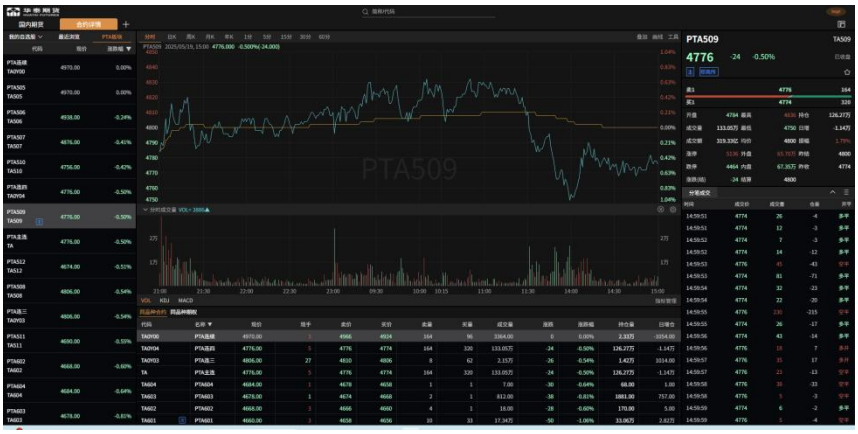
5.2.3.展示分时/K 线走势

点击合约报价列表切换合约，展示对应合约的分时/K 线走势，支持切换不同周期，分时包含 1 日、2 日、3 日、4 日、5 日、6 日、7 日、8 日、9 日、10 日，K 线包含日/周/月/季/年/1 分/5 分/30 分/60 分/120 分。

5.3.合约详情

用户可以在合约详情页面获取合约最新行情、买卖盘、分笔明细等信息。

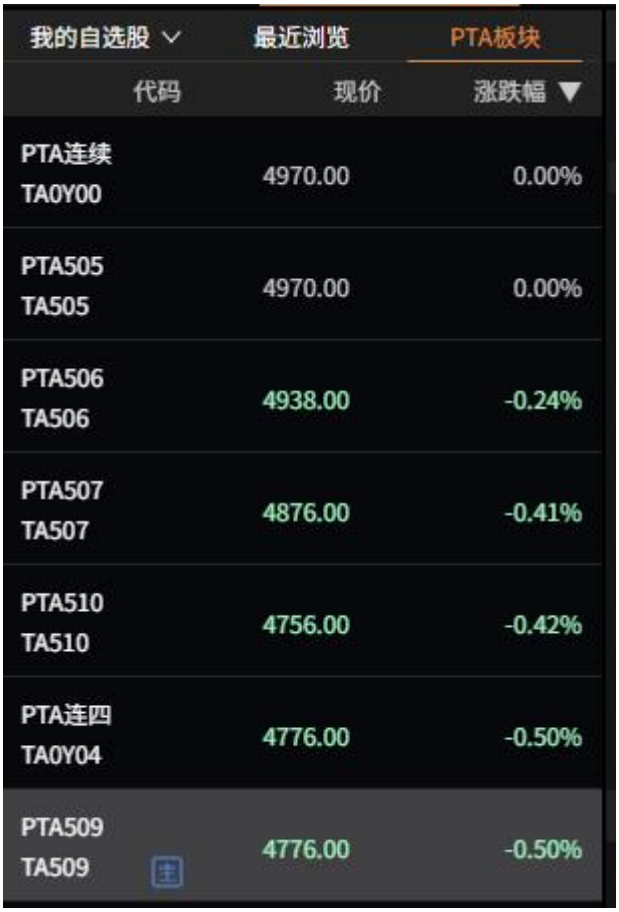
1） 双击任一条合约数据，进入合约详情页面。



5.3.1. 切换分类标签

1） 分类标签切换：进入合约详情页面后，左侧为简约报价列表，支持我的自选股、最近浏览、上一级分类标签切换。

2） 简约报价列表展示：仅展示基础的代码、现价、涨跌幅，点击表头字段名称，支持列表按对应字段升序、降序排列。



5.3.2. 展示分时/K 线走势

1）分时走势：进入合约详情后，点击【分时】，展示合约当日分时走势，点击【分时】右侧的下拉箭头，支持选择多日分时。

2）K 线走势：进入合约详情后，点击【日 K】，展示合约当日 K 线走势，点击【日 K】右侧 K 线周期按钮，支持选择多周期 K 线。

3）走势图右上角操作按钮，支持对走势图进行放大、缩小、刷新数据、修改参数。

4）副图指标：点击【指标管理】，跳出指标管理弹窗，从左侧可选指标选择指标到右侧已选指标中，已选指标支持置顶、排序、删除功能，点击【恢复默认】恢复成默认副图指标组合，点击【确认】按钮完成副图指标配置。

5）副图指标参数设置：点击 x 号删除走势图中的对应副图指标，点击设置按钮，支持设置副图指标参数。

5.3.3. 画线

用户可使用合约详情页面画线工具，添加直线、黄金分割、通道线等，自定义修改画线样式。

1) 打开画线工具：点击分时/K 线图，右上角【画线】，即可打开画线工具，进行画线、隐藏、删除等操作，比如选中直线-线段，即可在走势图中进行以下操作：

① 画线：共两个锚点，第一次点击确定第一个锚点，第二次点击确定第二个锚点后，即可画出两锚点之间的线段；

② 调整：点击选中线段锚点后拖动，可调整线段锚点位置，以调整线段倾斜度及长度；

③ 移动：点击选中线段线条后拖动，可调整线段位置。

5.3.4. 工具

用户可使用合约详情页面工具，设置主图类型以及修改走势图样式。

1）打开工具：点击分时/K 线图，右上角【工具】，即可打开工具，进行主图类型设置、走势图样式修改等操作。

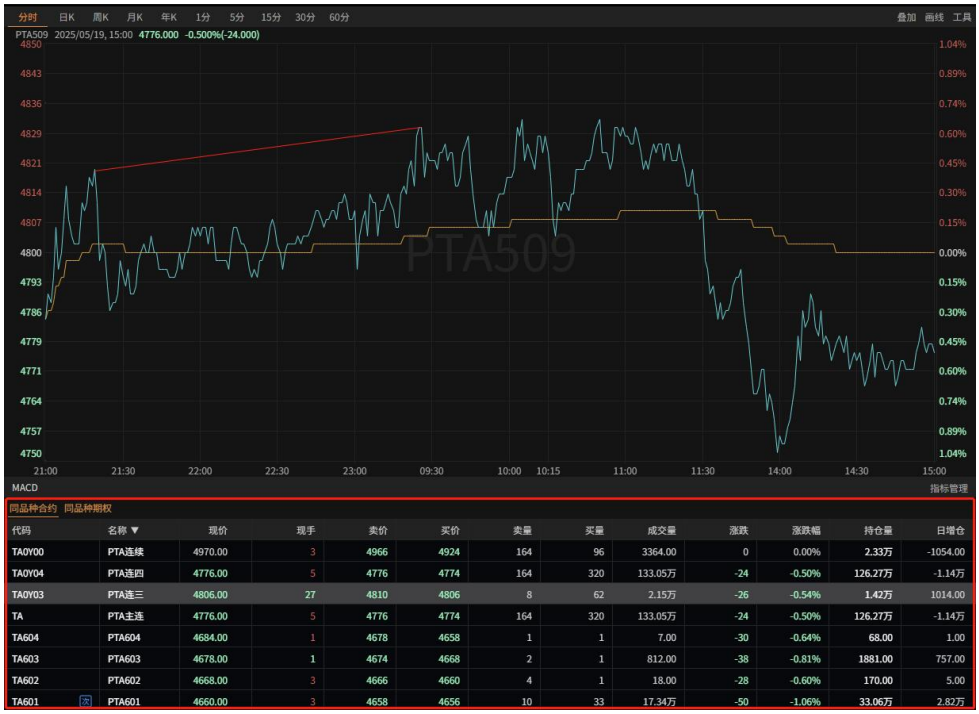
（1）查看区间统计数据：点击【工具】后再点击【区间统计】，即可在合约信息面板内查看区间统计的数据结果，字段包括：起止日期、区间涨跌幅、起始价、终止价、最高价、最低价、均价、振幅、成交量、成交额、涨跌值、区间周期数以及涨跌平统计。

（2） 调整时间区间：时间区间的左右边界有移动端点，点击并拖动移动端点可调整区间统计的时间范围。

5.3.5. 查看关联品种

进入合约详情页面，在分时 K 线图下方即可查看合约关联品种数据，支持切换同品种合约以及同品种期权，关联品种数据以报价列表形式展示，支持字段配置功能。

【注】中金所期权标的为沪深指数，因此中金所期货无同品种期权。



5.3.6. 查看合约信息

进入合约详情页面，在页面右侧区域即可查看合约信息，支持展示合约信息以及点击【+】按钮将合约加入默认的“我的自选股”分组。

5.3.7. 查看买卖档口

进入合约详情页面，在页面右侧区域即可查看合约买卖一档行情数据。

5.3.8. 查看盘口指标

进入合约详情页面，在页面右侧区域即可查看盘口指标数据。

【注】盘后更新当日结算价数据。

开盘	4784	最高	4836	持仓	126.27万
成交量	133.05万	最低	4750	日增	-1.14万
成交额	319.33亿	均价	4800	振幅	1.79%
涨停	5136	外盘	65.70万	昨结	4800
跌停	4464	内盘	67.35万	昨收	4774
涨跌(结)	-24	结算	4800		

5.3.9. 查看分笔成交

进入合约详情页面，在页面右侧区域即可查看分笔成交数据。

1） 点击分笔成交组件标签栏下拉按钮，弹出设置栏，支持按代码、名称、简拼搜索合约代码。

2） 点击分笔成交组件标签栏操作按钮，弹出操作选项，支持删除分笔成交组件、跳转分笔成交详情页面并查看分笔成交的时间、成交价、成交量、仓差、开平性质。

分笔成交

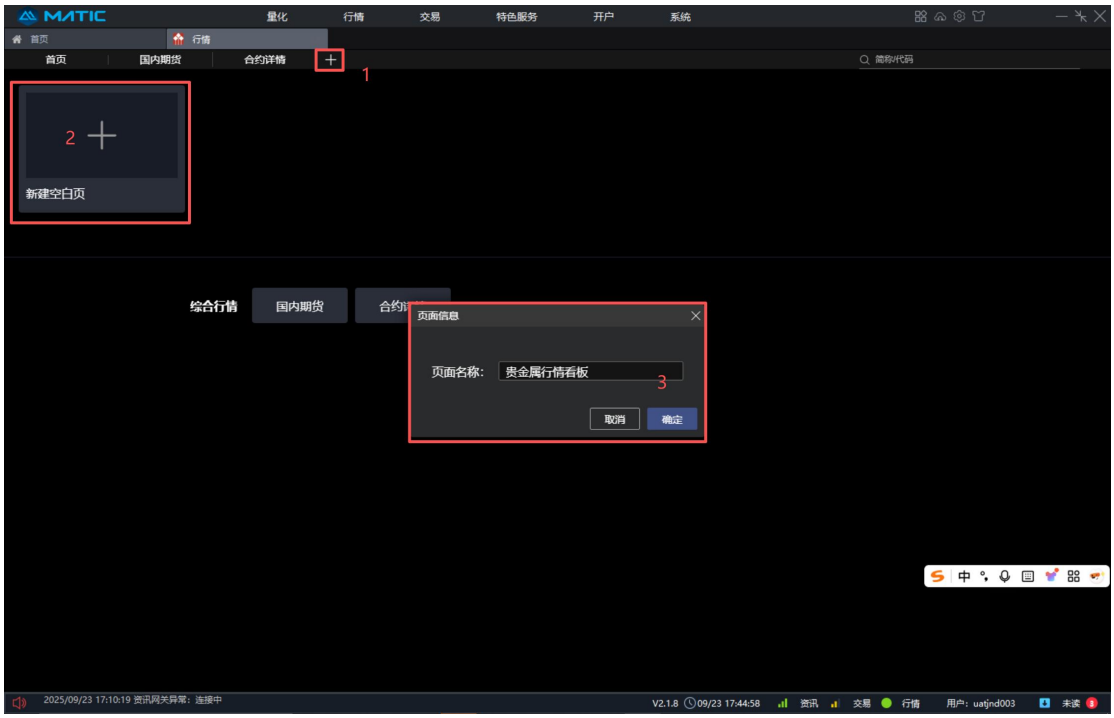
时间	成交价	成交量	仓差	开平
14:59:44	4183	1	-1	双平
14:59:45	4183	1	1	双开
14:59:46	4183	1	-1	双平
14:59:47	4183	1	-1	双平
14:59:47	4183	1	-1	双平
14:59:48	4183	4	-3	空平
14:59:49	4183	3	-3	双平
14:59:49	4183	13	-11	空平
14:59:50	4183	4	-3	空平
14:59:51	4183	1	-1	双平
14:59:51	4183	3	-1	空平
14:59:52	4183	24	-18	空平
14:59:54	4183	1	-18	空平
14:59:55	4182	11	-2	多平
14:59:55	4183	53	6	多开
14:59:57	4184	2	1	多开
14:59:58	4182	2	-1	多平
15:04:02	4182	11	-11	双平

5.4.自定义界面

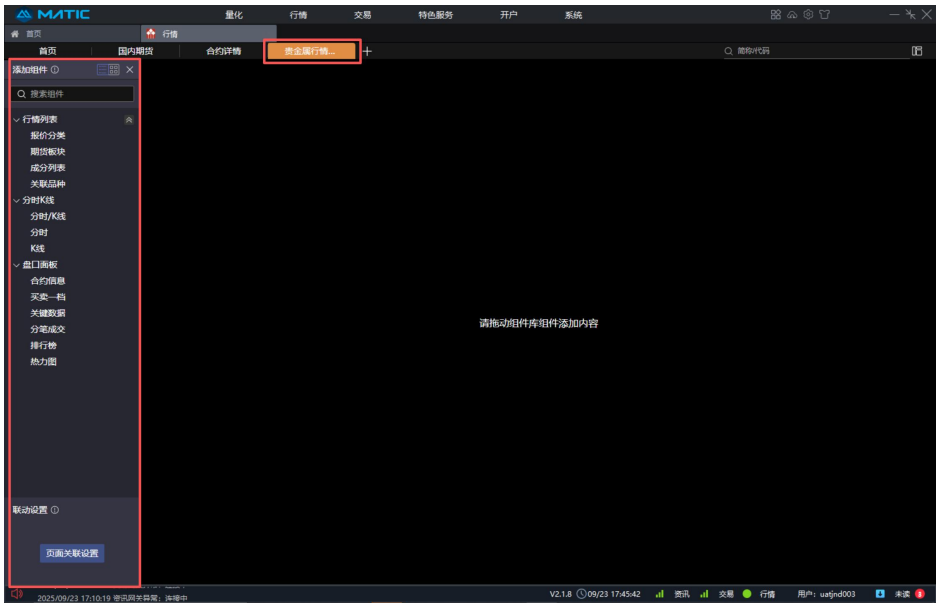
5.4.1.新建自定义界面

- **组件设置**

用户可在行情页面内单击顶部“+”来添加自定义界面，单击新建空白页弹出页面信息，可对页面名称进行自定义，这里以贵金属行情看板为例



单击确定后，生成贵金属行情看板页面：



在页面内可从左侧添加组件并进行联动设置，单击添加组件右上方按钮 ，可对组件展

示形式进行设置，以列表的形式或者以图表的形式展示组件：

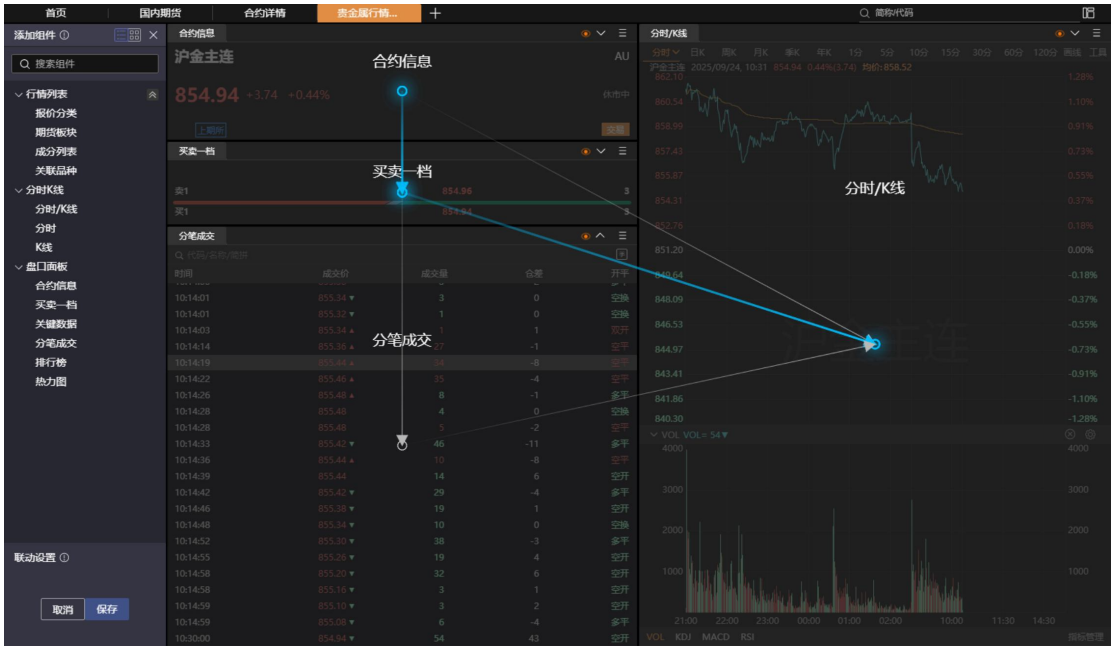
拖动组件库内组件至右侧界面，可进行界面内容设计，这里以沪金主连的合约信息、买卖一档、成分列表，以及分时 K 线为例，展示如下图：

- 单击按钮，可折叠或展示搜索框，在搜索框内可设置组件的合约。
- 单击组件右上角，可删除相应组件；
- 鼠标放在组件边界，拖动，可进行组件大小设置；

- **联动设置**

单击界面左下方页面联动设置，可进行界面联动设置：

在界面上的各个组件之间，通过鼠标拖拽的方式，根据需求进行联动设置，如下图所示：如无法拖拽，则说明组件之间不支持设置联动关系



组件设置完毕后，单击左下角“取消”、“保存”按钮，对设置的联动关系进行取消或保存。

- 单击右上角组件库，可设置影藏或显示组件库。
- 自定义界面设置完毕后，下次打开客户端，则自动加载自定义界面。

5.4.2.修改自定义界面

- 重命名、标签设置、标签页复制

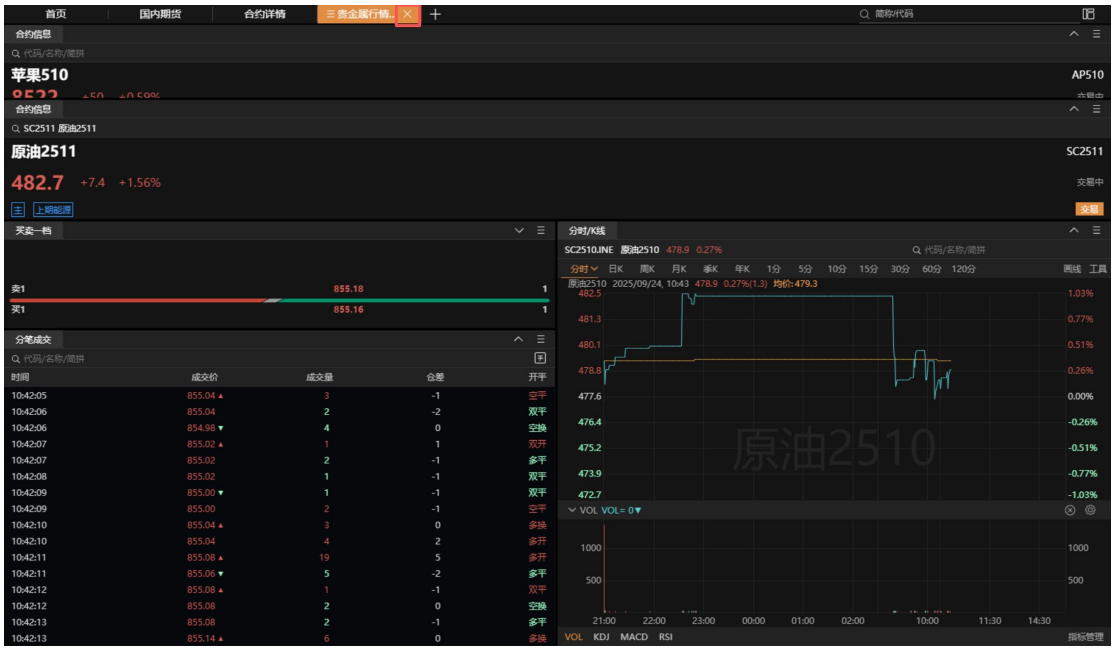
  单击顶部页签左侧 ，可对界面进行修改：重命名、隐藏/显示标签、复制标签页。

- 单击右上角组件库，显示组件库后，可对界面的组件及页面关联进行设置，或重新设计自定义界面。

5.4.3.删除自定义界面

顶部页签右侧，单击

，可关闭该页签



单击“ ”打开自定义界面，单击“ ”可编辑自定义界面名称：

单击“ ”可删除自定义界面：

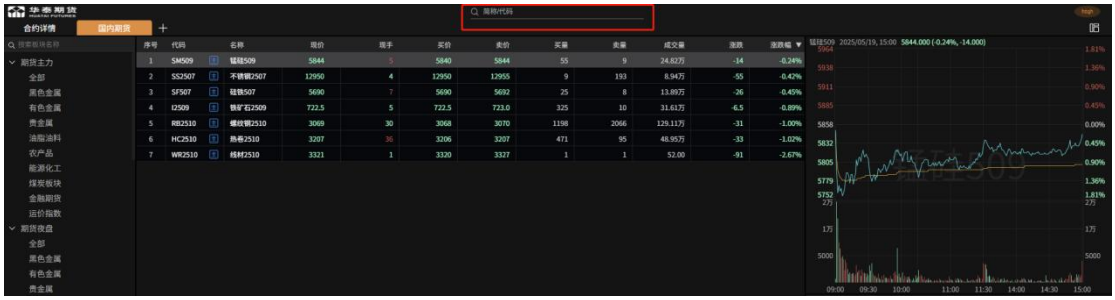
删除确认：

5.5.键盘精灵

用户可使用键盘精灵搜索合约代码、名称并跳转至对应合约。

1）搜索股票：进入【国内期货】或【合约详情】页面，上方搜索框中输入代码或名称，可查看相关合约。

2）跳转详情：在相关合约列表中，双击合约即可跳转至对应合约详情页面。



6.交易

交易模块包含基础交易、特色交易、套利交易、指令流程和运营管理五个模块。其中基础交易模块包括普通交易、增强交易、期权交易、期货交易和期货期权交易模块，展示相应的行情信息、账户资产列表、持仓列表、委托列表和成交列表等信息。

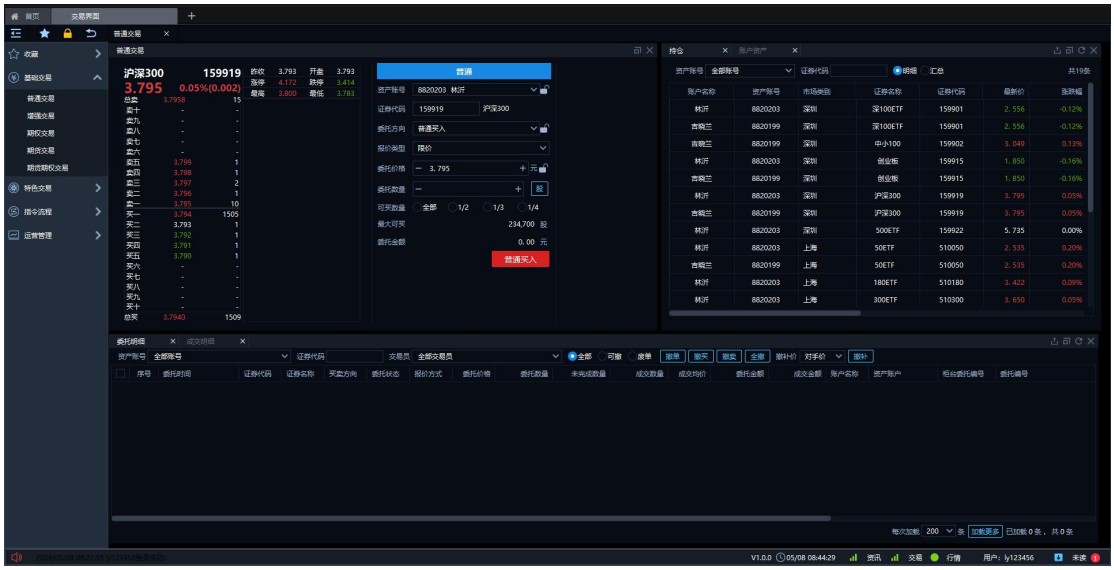
6.1.基础交易

6.1.1.普通交易

普通交易模块提供 ETF 基础交易功能，支持上交所、深交所上市的 9 只 ETF 标的的交易，具体包括：

交易所	标的名称	标的证券代码
上交所	华夏上证 50ETF	510050　50ETF
	华泰柏瑞沪深 300ETF	510300　300ETF
	南方中证 500ETF	510500　500ETF
	华夏上证科创板 50ETF	588000　科创 50
	易方达上证科创板 50ETF	588080　科创板 50
深交所	易方达深证 100ETF	159901　深 100ETF
	易方达创业板 ETF	159915　创业板
	嘉实沪深 300ETF	159919　沪深 300
	嘉实中证 500ETF	159922　500ETF

该模块包含：普通交易下单组件、持仓列表、账户资产列表、委托明细列表和成交明细列表。不同组件支持拖动、放大、缩小和伸缩，可自由布置组件布局。



6.1.1.1. 普通交易下单

普通交易下单组件，支持 Level 2 行情，包括十档盘口、标的静态信息、当前标的成交队列。

下单面板各字段说明如下表：

字段名	字段说明
资金账号	只支持选择当前用户已授权且密码检验通过的普通资金账号
证券代码	支持上交所、深交所 ETF 基金代码 ，支持模糊匹配输入内容。输入代码后，展示对应的基金名称
委托方向	支持买入、卖出
报价类型	下拉选择框，包括：限价，最新价，买一价，卖一价，五档即成剩撤，五档即成剩转限价，本方最优，对手方最优，涨停价，跌停价，市价单，卖五/卖四/卖三/卖二，买二/买三/买四/买五 其中最新价、买卖五档盘口档位价、涨跌停价委托时，支持设置浮动比例，浮动单位为标的最小变动价差
委托价格	仅在限价单情况下有效
委托数量/委托金额	默认展示的是按委托数量下单，基金的单位统一是“股”， 可点击“股/张”切换成“元”，同时变更为按委托金额下单
可买/可卖数量比例	委托数量的快捷键
最大可买/可卖	系统预估的当前最大的可买或可卖数量
交易金额	当前委托的涉及金额

填写完下单面板各项信息后，点击“普通买入/卖出”按钮，按照填写的方向、委托价格和委托数量/金额下单委托。

锁定：通过单击资产账号、委托方向、委托价格右侧的锁定符“ ”可对相应委托要素

进行锁定。被锁定的要素不允许修改，若要修改需要再次点击锁定符进行解锁。

拆单逻辑：如果委托数量超过标的的单笔委托上限，系统会自动按照单位最大委托数量进行拆单。

行情：输入证券代码时系统会根据当前输入的内容自动匹配符合条件的标的证券并显示在下拉列表中，下拉列表支持上下方向键快速选择并支持回车键确认，确定标的证券后系统会自动刷新委托面板左侧的行情信息。

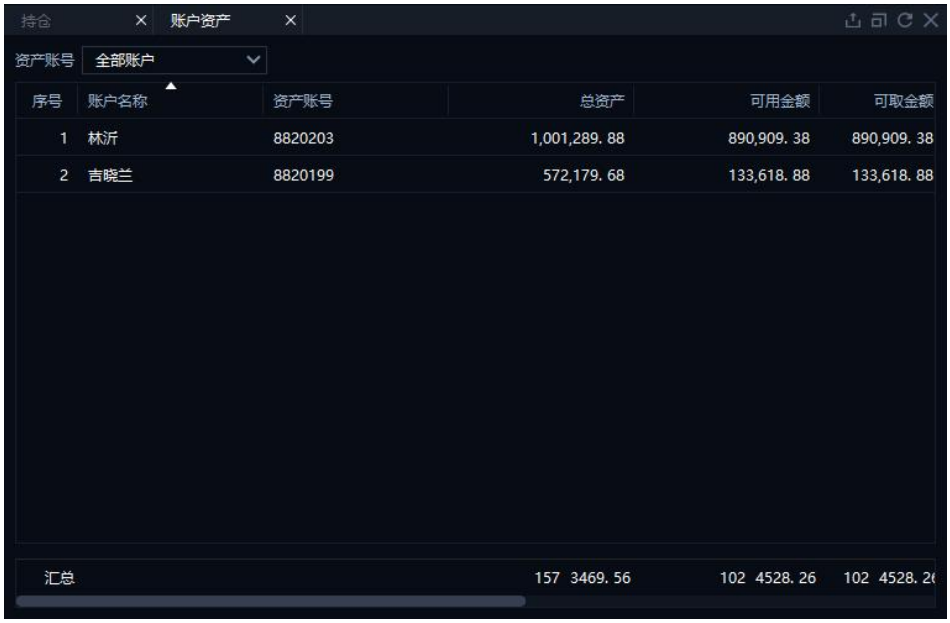
6.1.1.2.持仓

持仓列表展示交易下单面板中选择的普通账户的持仓数据，支持按证券代码筛选及导出持仓数据。默认展示持仓明细，可切换展示持仓汇总。

账户名称	资产账号	市场类别	证券名称	证券代码	最新价	涨跌幅
林沂	8820203	深圳	深100ETF	159901	2.556	-0.12%
吉晓兰	8820199	深圳	深100ETF	159901	2.556	-0.12%
吉晓兰	8820199	深圳	中小100	159902	3.049	0.13%
林沂	8820203	深圳	创业板	159915	1.850	-0.16%
吉晓兰	8820199	深圳	创业板	159915	1.850	-0.16%
林沂	8820203	深圳	沪深300	159919	3.795	0.05%
吉晓兰	8820199	深圳	沪深300	159919	3.795	0.05%
林沂	8820203	深圳	500ETF	159922	5.735	0.00%
林沂	8820203	上海	50ETF	510050	2.535	0.20%
吉晓兰	8820199	上海	50ETF	510050	2.535	0.20%
林沂	8820203	上海	180ETF	510180	3.422	0.09%
林沂	8820203	上海	300ETF	510300	3.650	0.05%

6.1.1.3.账户资产

账户资产列表展示交易下单面板中选择的普通账户的资产，支持导出资产明细。



6.1.1.4.委托明细

支持查询当前用户关联的所有普通账户的委托明细，支持按证券代码、交易员、委托状态（全部、可撤、废单）筛选订单，支持对委托订单进行干预，废单原因可查看委托明细中的“备注”字段。

委托订单干预方式说明如下：

干预方式	操作说明
撤单	必须勾选委托订单后才能进行此操作，对勾选的可撤订单进行撤单
撤买	对符合筛选条件（资产账号、证券代码和交易员）的全部买方向的可撤订单进行撤单（与订单勾选情况无关）
撤卖	对符合筛选条件（资产账号、证券代码和交易员）的全部卖方向的可撤订单进行撤单（与订单勾选情况无关）
全撤	对符合筛选条件（资产账号、证券代码和交易员）全部可撤订单进行撤单（与订单勾选情况无关）
撤补	必须勾选委托订单后才能进行此操作，对勾选的可撤订单部分（已报、部成），则先撤单成功后，再按照撤补价补单；对勾选的非可撤订单部分（已撤、部撤、废单），则直接按照订单的未完成数量及撤补价进行补单

撤补价	对手价：默认值，指的是对手方一档 挂单价：指的是本方一档 最新价：行情中的最新成交价 买/卖一价到买/卖五价：行情中的买/卖 5 档盘口价 自动盘口：根据委托数量、买卖方向以及 5 档行情买卖盘的价格和数量，自动计算出的委托价格，使得按当前盘口情况可以完全成交。如果当前 5 档的盘口总量小于委托数量时则取第 5 档价格。

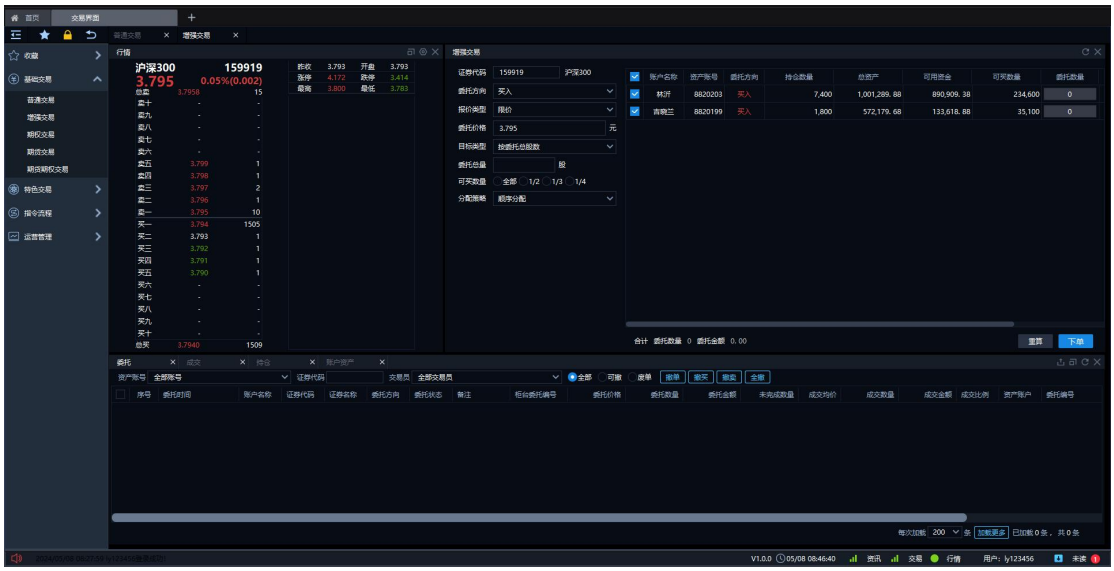
双击委托列表中可撤的订单，二次确认后可撤销双击的订单。

6.1.1.5. 成交明细

支持查询当前用户关联的所有普通账户的成交明细，支持对成交数据按资产账号、证券代码、交易员等条件进行过滤。

6.1.2.增强交易

增强交易模块支持的交易品种与普通交易一致，即上交所、深交所上市的 9 只 ETF 标的。该模块包含：行情面板、增强交易下单组件、委托列表、成交列表、持仓列表和账户资产列表。不同组件支持拖动、放大缩小和伸缩，可自由布置组件布局。



6.1.2.1. 行情组件

支持 Level 2 行情，包括十档盘口、标的静态行情信息（包括昨收价、开盘价、涨跌停

价、最高价、最低价）。

6.1.2.2.增强交易面板

下单面板各字段说明如下：

字段名	字段说明
证券代码	支持上交所、深交所 ETF 基金代码 ，支持模糊匹配输入内容。输入代码后，展示对应的基金名称
委托方向	支持买入、卖出
报价类型	下拉选择框，包括：限价，最新价，买一价，卖一价，全额成交或撤，即成剩撤，五档即成剩撤，本方最优，对手方最优，涨停价，跌停价，卖五/卖四/卖三/卖二，买二/买三/买四/买五 其中最新价、买卖五档盘口档位价、涨跌停价委托时，支持设置浮动比例，浮动单位为标的最小变动价差
委托价格	仅在限价单情况下有效
目标类型	按委托总股数、按委托总金额、按总资产比例、按可用资金比例

委托总量	目标类型为按委托总股数、按委托总金额时展示此字段 按委托总股数时单位为“股” 按委托总金额时单位为“元”
可买数量（比例）	目标类型为按委托总股数、按委托总金额时展示此字段 单选项，无默认值，分为：全部、1/2、1/3、1/4
分配策略	目标类型为按委托总股数、按委托总金额时展示此字段，枚举值如下： **顺序分配**，即账户列表勾选多个账户时，委托总量按顺序先分配给第一个账户，超出的部分再分给后面的账户；否则全部分给单个账户，超出可买/卖部分去掉 **可用金额比例分配**，即按照勾选的账户各自可用金额的比例分配委托数量 **总资产比例分配**，即按照勾选的账户各自总资产比例分配委托数量 **自定义比例分配**，即按用户自己设置的比例分配，单个账户时默认100%
目标比例	当目标类型为按总资产比例、按可用资金比例时展示该字段无默认值，快捷比例设置选项：全部（100%）、1/2、1/3、1/4

交易账户列表

（1）展示当前用户勾选的全部普通账户，展示字段包括：账户名称、资产账号、委托方向、持仓数量、总资产、可用资金、可买数量、占比/目标比例、委托数量、委托金额、备注。

（2）勾选账户的复选框时，按照下单面板填写的下单信息自动填充勾选的各账户的委托比例（占比/目标比例）、委托数量。

（3）占比/目标比例、委托数量这两个字段支持用户手动修改。

操作按钮

重算，点击按钮，按照下单面板设置的信息重算账户列表中勾选账户的各字段值。

下单，点击按钮，按照下单面板设置的委托方向、委托价格，以及账户列表中勾选账户的委托数量下单。

6.1.2.3.委托列表

除不支持撤补外，同普通交易的 4.1.1.4 委托明细。

6.1.2.4.成交列表

交互同普通交易的 4.1.1.5 成交明细。

6.1.2.5.持仓列表

持仓列表展示当前用户关联的全部普通账户的持仓数据，交互同普通交易的 4.1.1.2 持仓账户资产。

6.1.2.6.账户资产

账户资产列表展示当前用户关联的全部普通账户的资产，支持导出资产明细。

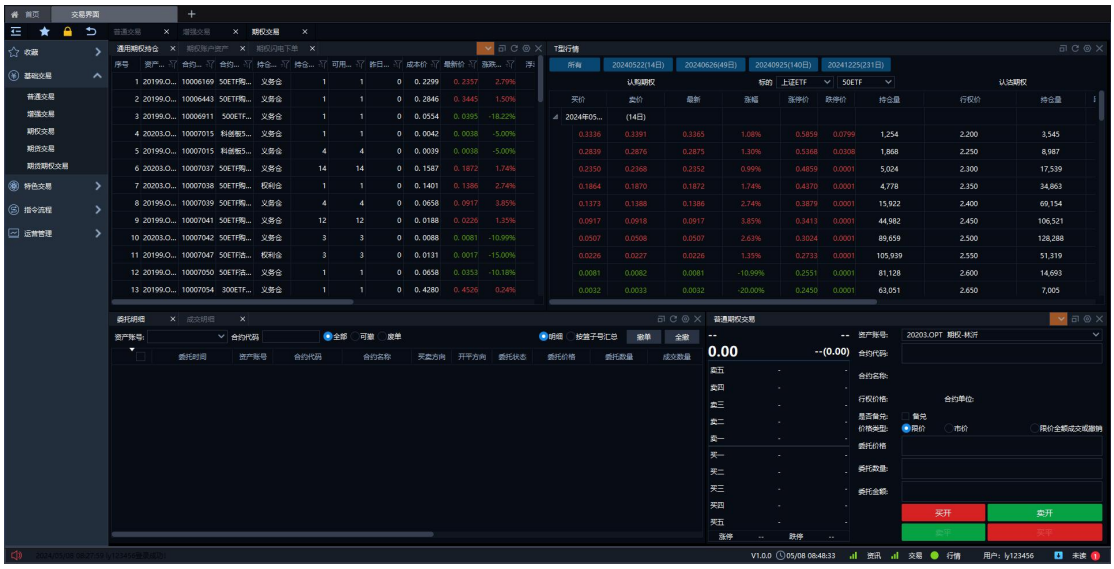
6.1.3.期权交易

期权交易提供 ETF 期权基础交易功能，支持上交所、深交所上市的 9 只 ETF 标的的期权交易，具体包含：

交易所	标的类型	标的证券代码
上交所	华夏上证 50ETF 期权	510050.SH　50ETF
	华泰柏瑞沪深 300ETF 期权	510300.SH　300ETF
	南方中证 500ETF 期权	510500.SH　500ETF
	华夏上证科创板 50ETF 期权	588000.SH　科创 50
	易方达上证科创板 50ETF 期权	588080.SH　科创板 50
深交所	易方达深证 100ETF 期权	159901.SZ　深 100ETF
	易方达创业板 ETF 期权	159915.SZ　创业板
	嘉实沪深 300ETF 期权	159919.SZ　沪深 300

	嘉实中证 500ETF 期权	159922.SZ　500ETF

该模块包含：通用期权持仓、期权账户资产、闪电下单，T 型行情，委托明细，成交明细，交易面板等功能模块，界面如下：



6.1.3.1.通用期权持仓

持仓列表展示当前资产账号当日的持仓记录，展示用户持仓类型，浮动盈亏，时间价值和涨跌幅等，支持按不同字段排序、筛选持仓列表，支持拖动列表字段调整字段排序，支持导出表格、设置列表字段的展示和隐藏。

表格列显隐设置弹窗，勾选的的字段展示，未勾选的字段隐藏。

6.1.3.2.期权账户资产

展示当前用户关联的全部期权账户的资产信息，包括期初金额、当前金额、可用金额、占用保证金、可用保证金等信息。

6.1.3.3.闪电下单

闪电下单面板，支持用户快速设置下单信息实现快速下单。

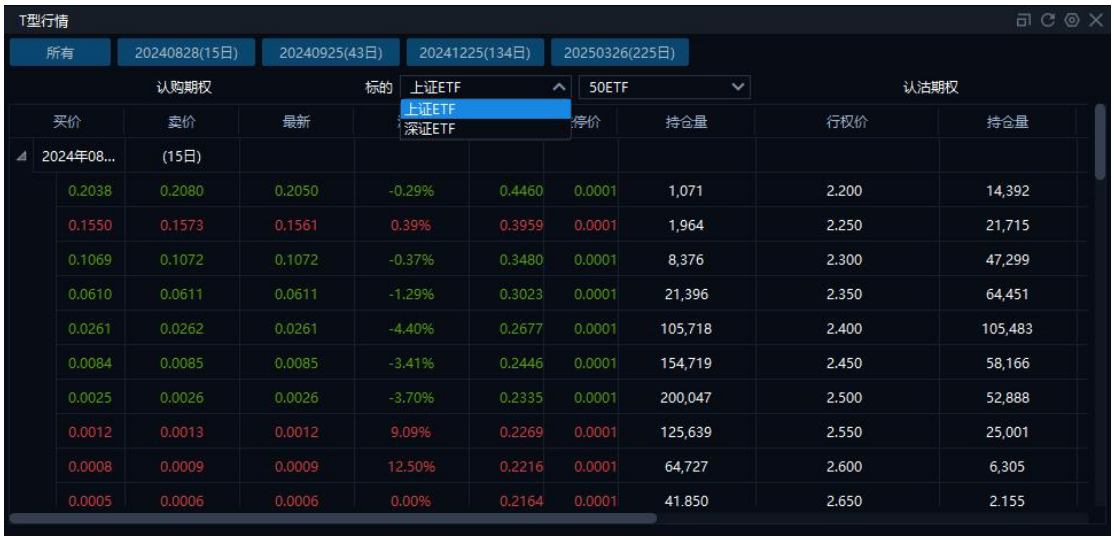
闪电下单面板个字段说明如下；

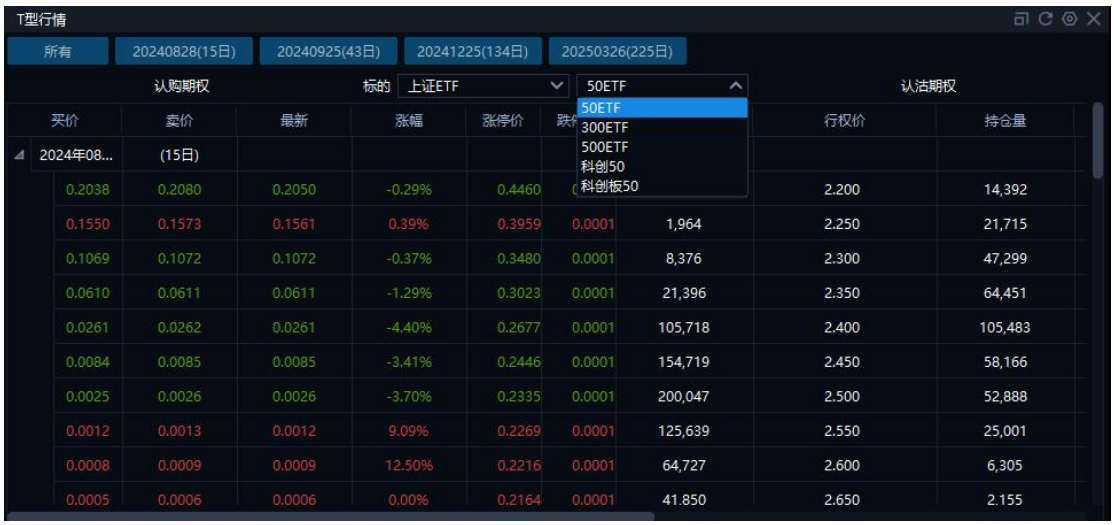
字段名称	说明	备注
资产账号	下拉单选框，展示当前用户绑定的全部资产号，点击选中自动填充	
期权名称	输入合约代码自动展示对应的期权名称	
合约代码	支持手动输入合约代码，输入框支持联想 双击 T 型行情中的标的时，可自动给填充对应的合约代码	
现价	当前合约的最新价	
多仓/空仓/净持仓	当前资产账号持有当前合约的持仓情况	
净仓	勾选该选项，当前资产账号持有当前标的，下单方向和持仓方向相反时，则执行先平后开的下单逻辑	若当前资产账号有未成交委托，则不执行先平后开逻辑，只

	例：当前持有当前合约权利仓 100 张，闪电下单卖出 150 张，则分两笔下单平仓权利仓 100 张合约，开仓义务仓 50 张合约	有一笔开仓委托
买/卖挂单	当前资产账号对当前合约的挂单情况	
行情价格展示	单选项，分为盘口价格（默认选项）、详细价格	
行情盘口	选择盘口价格时，展示买卖五档盘口价格及对应的挂单数 选择详细价格时，按最小单位价格变动展示标的价格及对应挂单数	
市买/市卖	点击“市买”按涨停价委托限价单买入标的 点击“市卖”按跌停价委托限价单卖出标的	
买/卖	点击按钮，按委托价格输入框输入的价格买入/卖出标的	
委托价格	数字输入框，选中标的后默认填充为最新价 支持手动修改	
委托数量	默认为 0，点击常用数量（+1/+5/+10/+20）则自动添加对应的委托数量	

6.1.3.4. T 型行情

T 型行情支持沪深市场切换及合约标的切换，便于查看不同期权品种的行情。





6.1.3.5.委托明细&成交明细

1、委托明细。

（1）委托明细列表当前交易面板选中资产账号当日的委托记录，支持资产账号、合约代码和委托状态（全部/可撤/废单）筛选委托列表。

（2）支持点击委托列栏上的快捷按钮，进行撤单、全撤操作。

撤单 & 全撤：对未成交或部分成交的委托，进行“撤单”或者“全撤”操作。

（3）展示方式，默认展示明细，勾选“按篮子号汇总”则切换为按篮子号汇总展示委托明细

2、成交明细。

成交明细列表分别展示当前交易面板选中资产账号当日的成交记录。

6.1.3.6.普通期权交易下单面板

交易面板分为行情盘口和委托下单两部分，行情盘口部分展示买卖五档实时行情的盘口信息，如图所示：

委托下单的操作流程包括以下步骤：

1. 选择资产账号，通过点击下拉框选择当前用户关联的期货资产账号。当切换资产账号时，资金列表、委托明细、成交明细、持仓明细等信息都将同步切换为当前选中的资产账号的数据信息。

2.输入交易要素，包括合约代码、委托数量和委托价格三大要素。

（1）合约代码支持手工输入或双击行情（包括左侧行情盘口、T 型行情）获取。

（2）委托价格支持限价和市价。

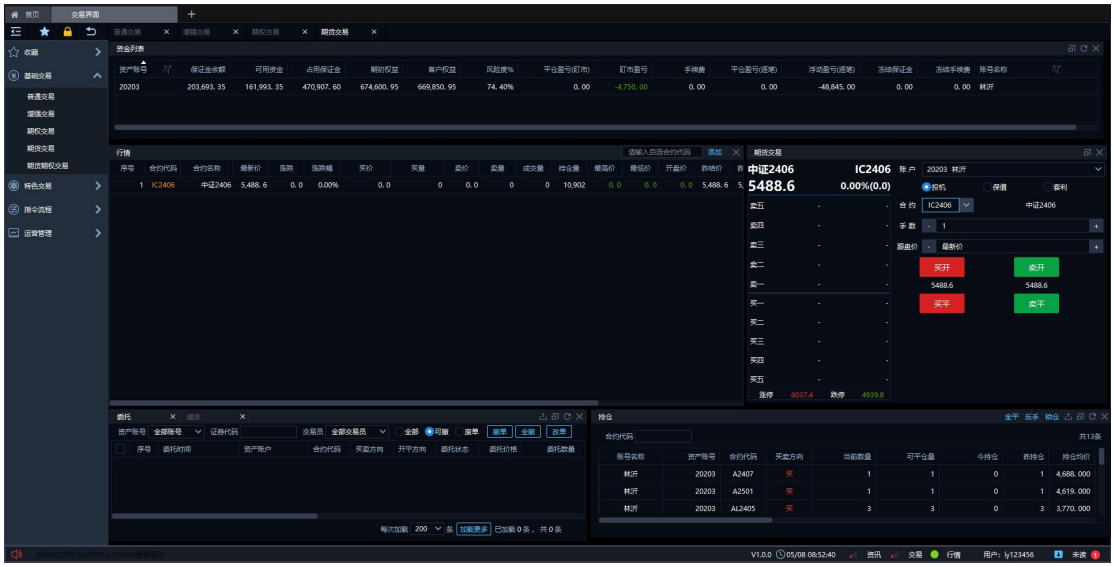
限价是指用户输入的固定价格。

市价是指用户按市价指令下单，支持即时成交剩余转限价，即时成交剩余撤销，剩余转限价等。

3.下单，支持买开、卖开、买平、卖平 4 种交易方向下单。

6.1.4.期货交易

期货交易提供期货基础交易功能，支持中金所、大商所、郑商所、上能源、上期所、广期所等六大交易所的所有期货品种的交易。该模块包含：资金列表、自选行情列表、交易面板、委托明细、成交明细、持仓明细等六大功能模块，界面如下：



6.1.4.1.资金列表

展示当前下单面板中选中的期货账户的资金信息。

6.1.4.2.自选行情列表

自选合约实时行情，可以通过在行情列表的右上角搜索框输入合约代码添加自选合约，搜索框支持模糊匹配。

支持鼠标右击已添加的自选合约进行上移、下移、置顶、置底、删除等排序操作（如下图所示）。

6.1.4.3.交易面板

交易面板分为行情盘口和委托下单两部分。行情盘口部分展示买卖五档实时行情的盘口信息，如图所示：

委托下单的操作流程包括以下步骤：

1.选择资产账号，通过点击下拉框选择当前用户关联的期货资产账号。当切换资产账号时，资金列表、委托明细、成交明细、持仓明细等信息都将同步切换为当前选中的资产账号的数据信息。

2.输入交易要素，包括合约代码、委托数量和委托价格三大要素。

（1）合约代码支持手工输入或点击行情获取（包括点击五档行情价格或点击自选行情列表）。

（2）委托价格支持指定价和跟盘价，指定价是指用户输入的固定价格，跟盘价是指跟随盘面行情实时变动的价格，最终取值以下单确认时刻的盘面价为准。

跟盘价取值说明：

跟盘价	买单	卖单	备注
对手价	卖一价	买一价	
最新价	最新价	最新价	
挂单价	买一价	卖一价	
涨跌停价	涨停价	跌停价	
市价	市价	市价	上期所品种不支持市价

3.点击下单按钮下单，支持买开、卖开、买平、卖平 4 种交易方向下单。

备注：标的选择上期所品种时，支持优先平今仓，如下图所示：

6.1.4.4.委托明细&成交明细

委托明细列表和成交列表分别展示交易面板当前选中资产账号当日的委托记录和成交记录。

1、委托明细

支持按资产账号、证券代码、交易员和委托状态（全部、可撤、废单）筛选委托记录。

右键点击列表中可撤的委托记录或点击列表右上方委托列栏上的快捷按钮，进行撤单、全撤以及改单操作：

1）撤单&全撤：对未成交或部分成交的委托，进行“撤单”或者“全撤”操作。

2）改单：基于先撤后下的原则，改单时先将委托中未成交部分撤单，若撤单不成功，则提 示改单失败，原委托继续生效，若撤单成功，按修改后的委托价格下达新委托。

2、**成交明细**

支持按资产账号、证券代码和交易员筛选成交记录。

6.1.4.5.持仓列表

持仓列表展示交易面板当前选中资产账号当日的持仓记录。支持右击持仓记录或点击持仓栏上的快捷 按钮，进行反手、锁仓以及全平操作：

1）全平：所有可平持仓一次全部平仓。

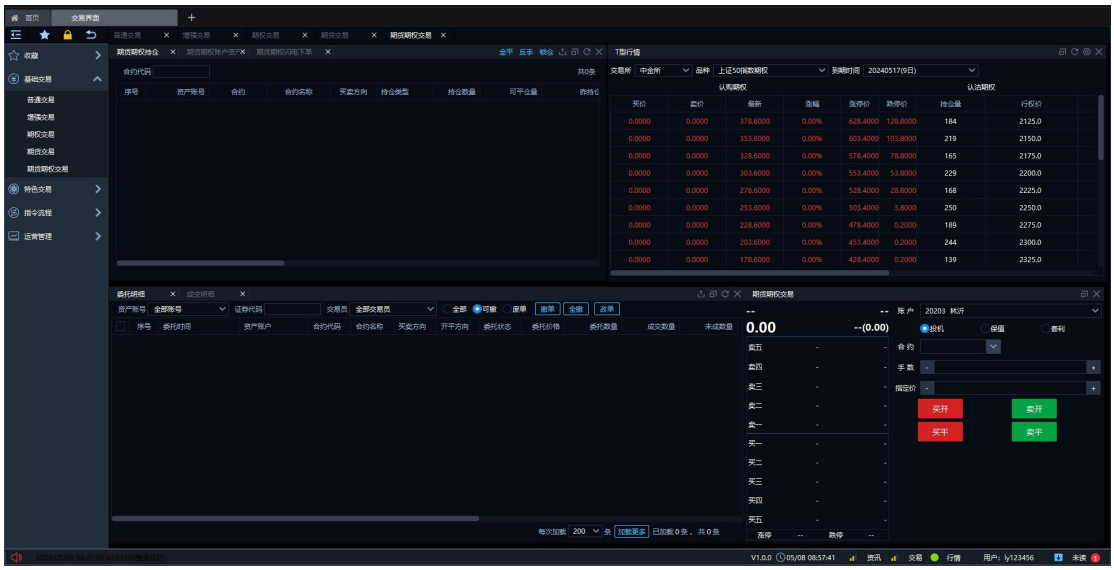
备注：因为上期所品种不支持市价指令，所以此处上期所品种的委托价格选择“市价”时，实际上是用限价指令以涨停价下单。

2）反手：已有的持仓平仓并反向开仓。持仓列表中选中一条持仓，点击“反手”按钮， 即发出两条委托：第一条是平持仓，第二条是同一标的反方向相同数量开仓。二次确认弹窗中确认后下单，如下图所示（反手 AP404 的两手多仓）。

3）锁仓：对已有的持仓反向开仓，即开仓相同数量，方向相反的相同合约。

6.1.5.期货期权交易

期货期权交易提供期货期权基础交易功能，支持中金所、大商所、郑商所、上能源、上期所、广期所等六大交易所的所有期货期权品种的交易。该模块包含：期货期权持仓列表、期货期权账户资产、期货期权闪电下单、期货期权 T 型行情、委托明细、成交明细和交易面板，如下图所示：



6.1.5.1.期货期权持仓

展示交易面板当前选中资金账户的持仓情况，包括持仓类型、盯市盈亏、占用保证金、

浮动盈亏和持仓市值等信息，支持按合约代码筛选持仓记录，支持持仓数据导出。

支持对持仓进行“全平”“反手”“锁仓”操作，交互逻辑同 4.1.4.5 期货持仓列表中的相同操作。

6.1.5.2. 期货期权账户资产

展示交易面板当前选中资金账户的资产明细，包括保证金余额、可用保证金、占用保证金、客户权益、风险度、盯市盈亏、浮动盈亏等信息，支持设置字段显隐。

6.1.5.3. 期货期权闪电下单

期货期权闪电下单面板，支持用户快速设置下单信息实现快速下单，同 4.1.3.3 闪电下单。

6.1.5.4. 期货期权 T 型行情

支持切换查看不同交易所、不同品种不同到期时间的合约的行情。

6.1.5.5. 委托明细&成交明细

委托明细列表和成交列表分别展示交易面板当前选中资产账号当日的委托记录和成交记录。

1、委托明细

同 4.1.4.4 委托明细&成交明细。

2、成交明细

同 4.1.4.4 委托明细&成交明细。

6.1.5.6.交易面板

交易面板分为行情盘口和委托下单两部分。行情盘口部分展示买卖五档实时行情的盘口信息，如图所示。

同 4.1.4.3 交易面板。

6.2.特色交易

6.2.1.组合交易

组合交易支持一篮子标的批量下单的功能，通过预先维护组合模版或使用文件导入的方式，实现手工和算法两大类交易模式的批量委托。

功能内部嵌入了多种组合场景，包括持仓组合。持仓组合是系统自动获取账号持仓标的，实现批量减仓。

支持品种和交易方向如下：

资产账号	市场	品种	交易方向
普通证券账号	上海、深圳	ETF 基金	买入
			卖出

点击主菜单【特色交易】→【组合交易】，进入组合交易界面，界面包含组合管理、成分股管理、下单面板、组合订单监控、委托、成交、持仓等功能。界面如下图所示：

6.2.1.1.组合管理

在组合交易界面的最左侧是组合列表，支持用户在组合列表中进行手工创建组合、文件导入组合和组合日常管理等操作。组合列表中的组合有效期为导入或创建后一个月，过期系统自动删除。

1、手工创建组合

点击【手工创建】按钮，在【新建组合】弹窗中完成组合模板维护。

（1）手工逐个添加证券代码、委托数量或相对权重等信息完成组合创建，操作如下图所示：

（2）快速对当前用户关联的单个资金账号下的持仓进行批量减仓，操作如图所示：

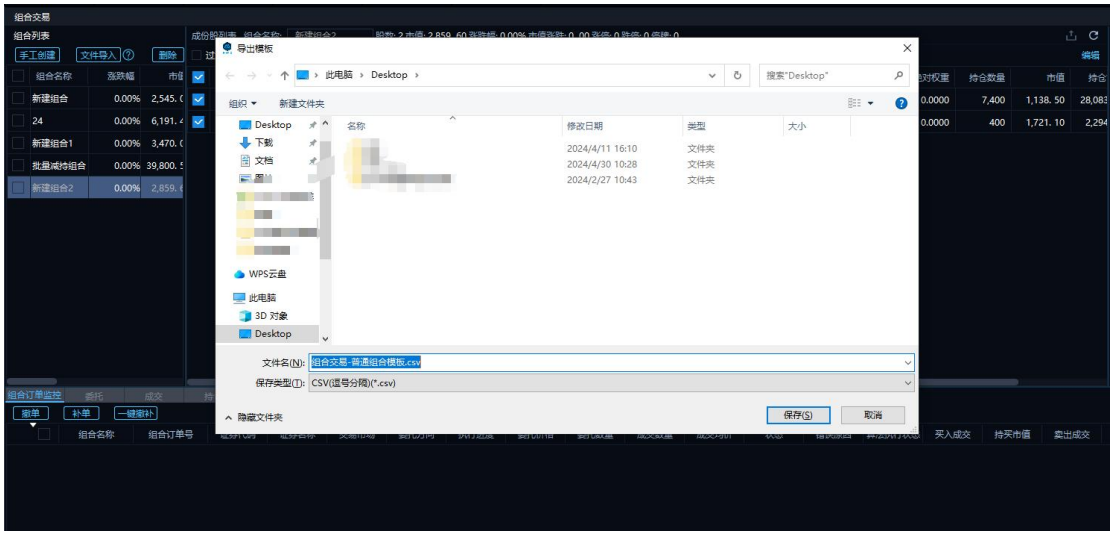
2、文件导入组合

支持通过手工导入组合和自动导入组合两种方式完成组合文件导入。

（1）手工导入组合

组合管理支持手工导入组合文件，点击【文件导入】按钮即可导入组合。导入组合支持 CSV、 EXCEL 两种格式，组合模板可点击“文件导入”按钮旁的“？”按钮，自行下载组合模板。

操作如图所示：

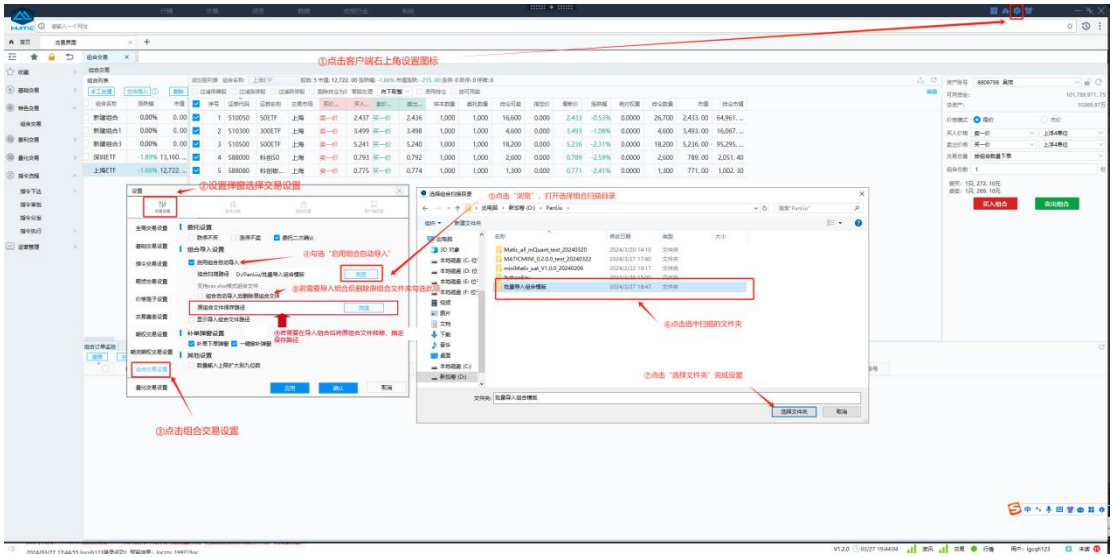


（2）自动导入组合

在指定组合扫描路径后，系统会自动导入组合文件，自动导入规则：

（1）每隔 1 秒扫描一次 文件夹，捡测到新的组合文件名会自动导入；

（2）导入成功后的组合，支持自动删除或移至 备份文件夹两种处理方式。操作如图所示：



3、组合日常管理

在组合列表中选择选中某个组合后右击，可对该组合进行复制、删除、置顶、置底、上移、 下移等操作。操作如图所示：

双击组合名称单元格，可对组合名称进行重命名操作。

6.2.1.2.成分股管理

在成分股列表查询成分股信息，并对成分股进行管理操作。

1.成分股快捷操作功能

在组合列表选中某个组合后，在成分股列表中展示该组合中所有成分股的信息，包括代码、 市场、委托数量、最新价、涨跌幅等信息。支持快速对停牌股、涨停股、跌停股的做过滤处 理，以及完成零股处理、使用持仓和按可用卖等快捷操作。操作如图所示：

2.成分股编辑

点击【编辑】按钮，实现新增成分股、删除成分股、及修改委托方向、样本数量、 指定价和相对权重等字段。修改后点击【保存】按钮，完成成分股信息的调整。

6.2.1.3.组合下单

在组合交易界面的最右侧是下单面板，下单面板包含资产账号、价格模式、下单模式、下单 按钮等要素。在组合列表选中要下单的组合后，操作如图所示：

点击“买入组合”/“卖出组合”后弹出二次确认弹窗，点击“确定”完成下单。

1.价格模式

（1）限价模式

限价模式下，需选择买入价格和卖出价格的价格类型及超价设置，下单时组合中委托方向为 买入的成分股按买入价格报单，组合中委托方向为卖出的成分股按卖出价格报单。操作如图 所示：

买入价格和卖出价格选项说明：

价格选项	取值说明	浮动说明
指定价	成分券列表中"指定价"，即用户自定义价格	允许上下浮动，有涨跌停价的标的浮动上下限为涨跌停价，超过上/下限的分别按涨/跌停价报单； 无涨跌停限制的不设限，按用户设置的值下单
自动盘口	是指根据当前的委托数量、买卖方向以及 5 档行情买卖盘的价格和数量，自动计算出的委托价格，使得按当前盘口情况可以完全成交。如果当前 5 档的盘口总量小于委托数量时，则取第 5 档价格	允许上下浮动，有涨跌停 价的标的浮动上下限为涨 跌停价，超过上/下限的分别按涨/跌停价报单； 无涨跌停限制的不设限，按用 户设置的值下单
最新价	行情中的最新价，取不到最新价，按“今收盘价—开盘价—昨收价”顺序取值	允许上下浮动，有涨跌停价的标的浮动上下限为涨跌停价，超过上/下限的分别按涨/跌停价报单； 无涨跌停限制的不设限，按用户设置的值下单
对手价	买方向取卖一价、卖方向取买一价，取不到对手价，按“最新价—今收盘价—开盘价—昨收价”顺序取值	允许上下浮动，有涨跌停 价的标的浮动上下限为涨 跌停价，超过上/下限的分别按涨/跌停价报单；无涨跌停限制

		的不设限，按用户设置的值下单
涨停价	行情中的涨停价，取不到涨停价的按“卖五价—卖四价—卖三价—卖二价—卖一价—最新价—今收盘价—开盘价—昨收价”顺序取值	仅允许向下浮动，浮动下 限为跌停价，低于下限的 按跌停价报单；无涨跌停 限制的不设限，按用户设 置的值下单
卖/买*价 (*可以是 五到一)	行情中的买/卖*价，取不到买/卖*价的按 “买/卖*价……（逐级递减）—买/卖一价 —最新价—今收盘价—开盘价—昨收价” 顺序取值	允许上下浮动，有涨跌停 价的标的浮动上下限为涨 跌停价，超过上/下限的分 别按涨/跌停价报单；无涨 跌停限制的不设限，按用 户设置的值下单
跌停价	行情中的跌停价，取不到跌停价的按“买五价—买四价—买三价—买二价—买一价—最新价—今收盘价—开盘价—昨收价”顺序取值	仅允许向上浮动，浮动上 限为涨停价，高于上限的 按涨停价报单；无涨跌停 限制的不设限，按用户设 置的值下单

（2）市价模式

市价模式下，需分别选择上海和深圳两个市场的市价类型，下单时组合中所属市场为上海的 成分股按上海市价类型报单，所属市场为深圳的成分股按深圳市价报单。操作如图所示：

2.下单模式

下单模式有“按组合数量下单”、“按总金额及权重下单”、“按账户可用资金比例下单”。

（1）按组合数量下单

下单时如果交易总量选择“按组合数量下单”，交易总量下方的“组合份数”必填，以组合为单位，成分股委托数量系统会自动计算，计算公式=样本数量*组合份数。操作如图所示：

（2）按总金额及权重下单

下单时如果交易总量选择“按总金额及权重下单”，交易总量下方的“委托金额”以及组合中成分股的“相对权重”必填，成分股委托数量系统会自动计算，买入委托数量计算公式= 总金额*绝对权重/买入价格，卖出委托数量计算公式=总金额*绝对权重/卖出价格。

（3）账户可用资金比例下单

下单时如果交易总量选择“按账户可用资金比例下单”，交易总量下方的“所占比例”以及组合中成分股的“相对权重”为必填，成分股委托数量系统会自动计算，

买入计算公式=账户可用资金*可用资金比例*绝对权重/买入价格，

卖出计算公式=账户可用资金*可用资金比 例*绝对权重/卖出价格。

3.下单按钮

下单按钮会根据成分股是否指定委托方向以及资产账号类型做区分。

（1）一键下单

当成分股已指定委托方向，则下单按钮显示【一键下单】。

（2）【买入组合】和【卖出组合】

当成分股未指定委托方向且资产账号为普通 A 股账号，则下单按钮显示【买入组合】和【卖 出组合】。

4.订单数据监控

（1）组合订单监控

组合下单后，支持用户在组合订单监控中查看全部订单的委托及成交进度，对未完成的组合 做撤单、补单和一键撤补的操作

撤单：组合下单后，可对未成交的订单做撤单操作。对于组合算法单，撤单后原算法实例停止。

补单：组合撤单后，可对撤单和废单部分的订单做补单操作。补单时可调整报价方式及价格类型、 委托方向和零股处理的参数选项。对于组合算法单，补单后会创建新的算法实例。

一键撤补：组合下单后，可对未完成的组合做“先撤后补”的一键撤补操作。一键撤补时可调整报价方 式及价格类型、委托方向和零股处理的参数选项。

（2）委托明细

展示当日所有组合的委托明细，可通过账号、组合订单号、代码等条件筛选委托订单，也可 通过可撤、废单、全部等委托状态筛选委托订单。支持选择单笔或多笔订单进行撤单。

（3）成交明细

展示当日所有组合的成交明细，可通过账号、组合订单号、代码等条件筛选成交订单，并提供按代码汇总和明细两种方式查看成交订单，默认展示明细数据。

（4）持仓明细

展示当前用户全部账号下的持仓数据，可通过按账号、代码等条件筛选持仓，并提供汇总和明细两种方式查看持仓数据，默认展示明细数据。

6.2.2.对冲助手

6.2.2.1.功能介绍

对冲助手模块提供上证 50（000016）、沪深 300（000300）、中证 500（000905）和中证 1000（000852）四只指数及相应的期货合约的对冲组合的实时行情信息、分时行情信息以及基差信息，以为客户进行期现对冲提供支持工具。

用户登录 Matic 系统，单击一级菜单“交易”、左侧菜单栏单击“特色交易”、选择“对冲助手”可进入对冲助手模块。界面示意图如下：

界面上从上至下，从左至右分别展示上证 50（000016）、沪深 300（000300）、中证 500（000905）和中证 1000（000852）四只指数及其期货合约的对冲组合的实时行情信息、分时行情信息以及基差信息。

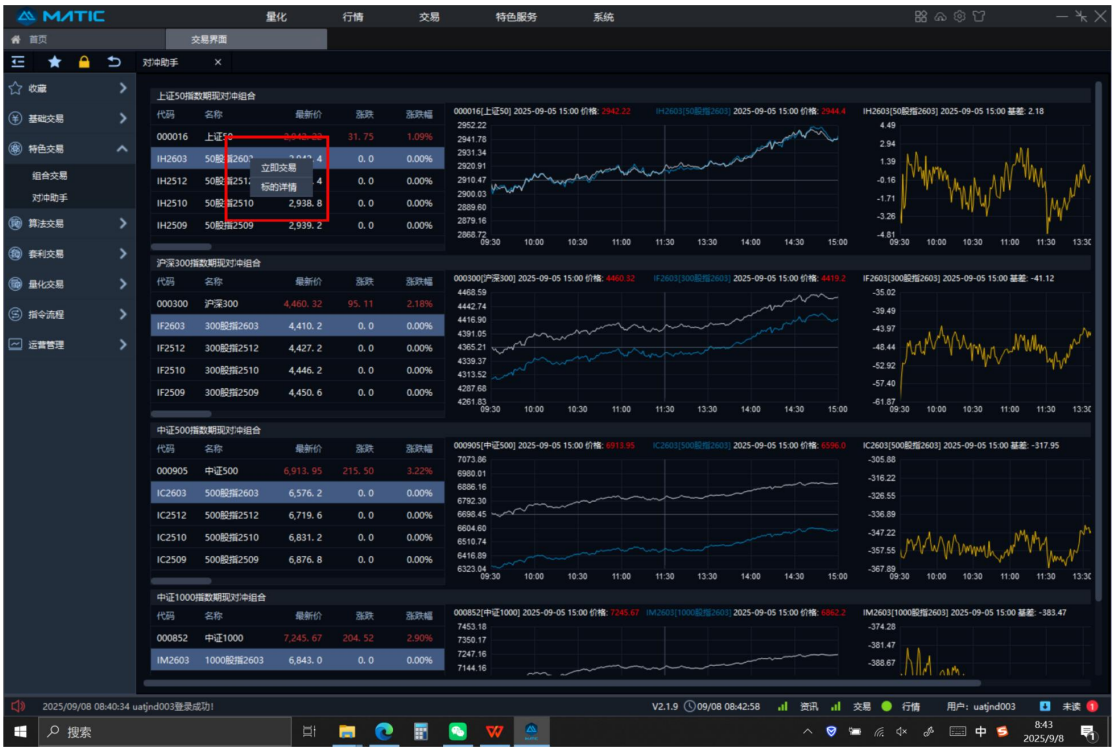
6.2.2.2.系统交互

左侧期现组合列表中单击期货合约列表，右侧相应切换选中合约的分时行情和基差信息。

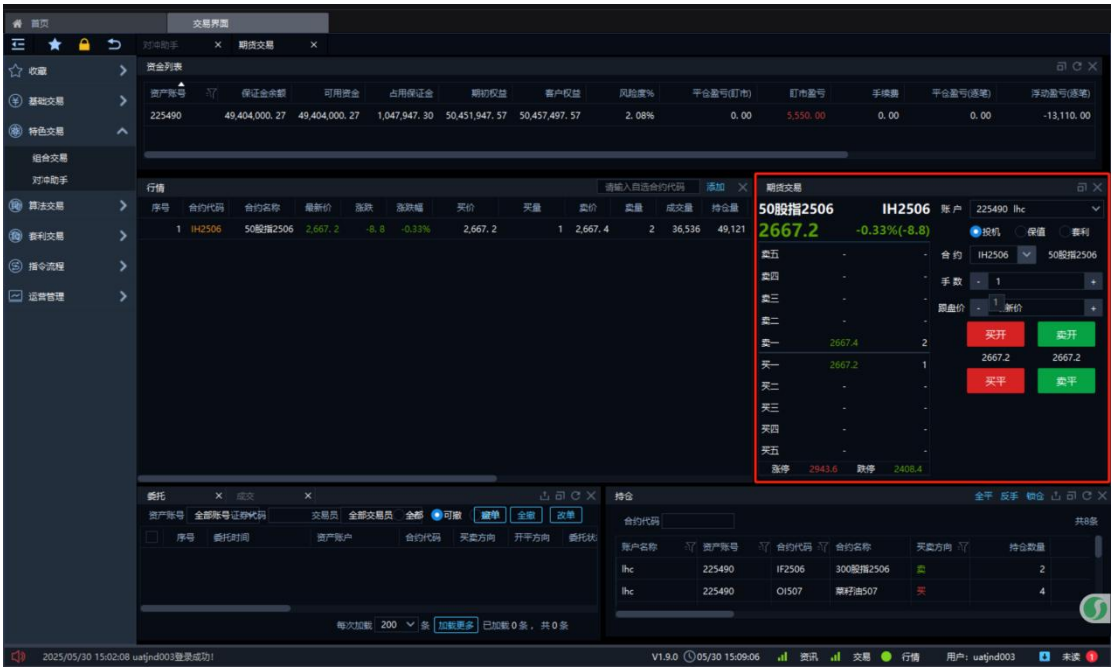
左侧期现组合列表中双击期货合约列表，在新开窗口打开相应合约的标的详情页，展示

标的合约详细的行情信息，该操作同鼠标右键选择标的详情页信息。

左侧期现组合列表中选中期货合约后，右键可单击选择“立即交易”和“标的详情”。



立即交易：选中相应期货合约，点击立即交易，即打开期货交易界面，且行情列表和下单面板带入该期货合约信息。示例界面：



标的详情：选中相应期货合约，点击标的详情/或双击期货合约列表，新打开页面展示选中合约的标的详情页

示例界面：

6.3.算法交易

算法交易是国内外非常普遍的一种智能化交易，用户将交易目标输入算法模型后，算法模型可根据参数与限制条件，结合复杂的数学建模、统计分析和市场数据，捕捉市场交易机会，将大额订单拆为若干小单，降低冲击成本，隐藏交易意图，提高交易效率。

MATIC 系统通过引入市场认可的优秀算法，结合自身数据分析能力、专业模型能力和交易规划能力，为投资者提供更丰富的选择和更灵活的算法服务，帮助投资者更高效地跟踪市场变化，合理执行交易，降低交易成本，管理交易风险。

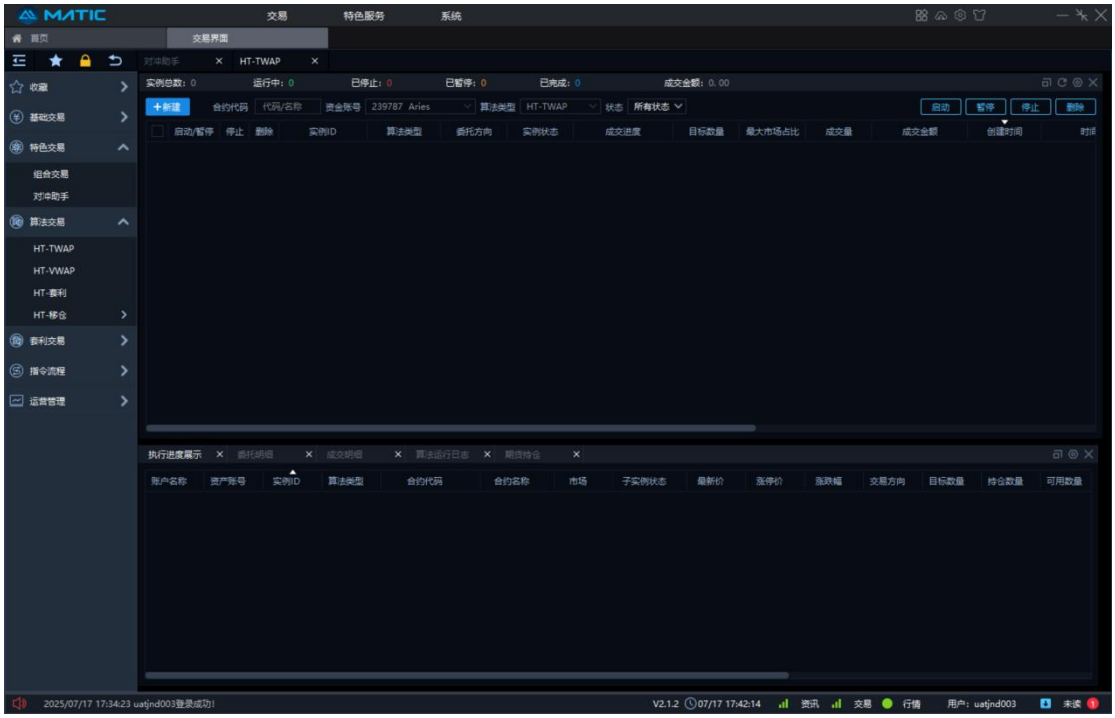
MATIC 算法交易功能默认不对客户开放，客户需申请开通后才可使用该功能。本期引入的算法策略包含 HT-TWAP、HT-VWAP、HT-套利、HT-移仓，支持国内六大交易所（中金所、大商所、郑商所、上期所、上能源、广期所）的所有期货品种。

MATIC 系统算法管理界面包含实例列表、执行进度展示、委托明细、成交明细、算法运行日志以及期货持仓六大组件，各组件支持复制、关闭、撤销关闭、拖动等操作。

功能分类	主功能	子功能	主要功能点
管理类	实例管理	实例列表	创建/修改/复制/启动/暂停/停止/删除算法实例，展示实例执行情况和执行状态。
交易类	实例监控	执行进度展示	展示选中实例的执行进度。
		委托明细	展示选中实例执行的委托明细数据。

		成交明细	展示选中实例执行的成交明细数据
		算法运行日志	展示选中实例运行的日志记录。
		期货持仓	展示期货资金账户的持仓明细数据。

全局界面如下：



6.3.1.HT-TWAP

HT-TWAP 是指在指定的时间间隔内，按照时间平均下单的算法，旨在对市场影响最小化的同时按照平均价格进行交易。适用于希望成交均价接近该时间段内的市场均价（按时间加权），想用 VWAP 执行，但近期市场波动较大或成交量分布无特定规律的标的。

6.3.1.1.实例列表

6.3.1.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。

算法创建参数说明如下：

（1）实例参数模板

选择框，默认未使用算法模板，下拉展示已保存的算法模板，右侧“+”按钮可将当前设置的算法参数，保存为参数模板；右侧“-”按钮可删除选择框中选择的实例参数模板。

（2）账户名称

选择框，必填项，展示所绑定的期货资金账号。右侧锁定/解锁切换按钮，默认解锁状态，点击则锁定选择当前资产账号。

（3）算法类型

选择框，默认值 HT-TWAP。

（4）合约代码

输入框+选择框，必填项，输入过程中支持模糊匹配。点击下拉按钮，展示账户名称下所支持的所有市场合约。选择合约时，需注意关注该合约是否交易活跃的合约，交易不活跃合约可能影响算法执行。

（5）市场

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

（6）委托数量

输入框，必填项，只允许输入正整数，数值输入上限为 10 位数，超出则无法输入，合约代码选择后，输入框右侧显示对应的数量单位（随着合约代码切换自动变化），委托数量不能小于该合约单笔(合约限价有最小下单数量)最小下单数量。

注意：当交易方向-开平方向为平时，需注意委托数量设置尽量不要大于可平仓量，否

则可能影响策略执行。

（7）限价

输入框，必填项，无默认值，整数位限填 15 位，小数位根据价格精度来限制位数，超过则无法输入。注意：限价填写数值不能超出该合约的涨跌幅范围，否则创建后无法运行且日志报错。限价设置时，需考虑当前市场行情数据，否则买价过低或卖价过高可能会影响算法执行。

（8）交易方向

选择框，必填项，不支持手工输入，支持买开、买平、卖开、卖平四种选择，默认买开。

（9）平今/昨

选择框，必填项，不支持手工输入，支持平今和平昨两种选择，默认平今；在市场是上期所和上期能源，开平仓选择平仓时，展示该字段，否则不展示。

（10）算法开始时间

输入框，必填项，默认展示当前系统时间，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）。

右侧选择框即算法执行时间，相关关系为：算法开始时间+算法执行时间+非交易时间（如含）=算法过期时间，过滤掉非交易时间，鼠标悬停该区域，提示“仅剔除日盘非交易时间”，默认空白，下拉可以选择“空白、15 分、20 分、30 分、40 分、45 分、60 分、120 分、180 分、240 分”。

注意：算法开始时间不能早于当前系统时间 10 分钟，算法开始时间不能早于开盘时间，算法开始时间不能晚于收盘时间。

（11）算法过期时间

输入框，必填项，默认展示当前交易日日期的 15:00:00，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）；当算法开始时间右侧选择框有选择值时，根据选择值重新生成并更新算法过期时间。

注意：算法过期时间不能早于当前系统时间，算法过期时间不能早于算法开始时间。算法开始/过期时间设置上不支持跨日，仅支持设置一个交易日内从夜盘开始-日盘休市的时间段的策略，具体的开/收盘时间以所选择品种合约在交易所的开收盘时间为准。

（12）风格参数

指算法实例执行过程中允许与目标偏离度的差异程度，保守风格对执行目标的偏离容忍度更高。选择框，必填项，支持保守、正常和激进三种选择，默认正常。

（13）最大市场占比

输入框，选填项，默认 30（单位%），有效范围 0-100，限 2 位小数。不填写、填写 0 或填写 100 表示不控制。

（14）最小委托金额

输入框，选填项，默认 0，只能输入正数和小数点，整数位限 15 位，小数位限 2 位，超过则无法输入。不填写或填写 0 表示不控制。

注意：如果最小委托金额大于实例剩余委托数量*委托价格*合约乘数，则按照实例剩余委托数量下单。

（15）相对限价

选择框，选填项，支持对方盘口/己方盘口/昨收价/最新价/到达价/市场 VWAP 均价/不控制选项，默认值不控制。

（16）单位

选择框，选填项，支持价格最小变动单位/基点(万分之一)/金额选择。默认价格最小变动单位。（如果相对限价选择了价格类型，则必填，选择不控制，则无法填写）

（17）变化量

输入框，选填项，默认 0，可以是正数/零/负数。（如果相对限价选择了价格类型，则必填，选择不控制，则无法填写）

相对限价、单位、变化量关系如下：

（1）单位为价格最小变动单位

·对于买单:相对限价=基准价+单位*变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-单位*变化量

（2）单位为基点

·对于买单:相对限价=基准价*（1+变化量*万分之一）

·对于卖单:相对限价=基准价*（1-变化量*万分之一）

（3）单位为金额

·对于买单:相对限价=基准价+变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-变化量

（4）单位为百分比

·对于买单:相对限价=基准价*（1+变化量%）*100%

·对于卖单:相对限价=基准价*（1-变化量%）*100%

实际拆单时，委托价格须同时满足限价和相对限价参数。

（18）涨跌停委托

选择框，必填项，默认涨跌停不委托，其他选项包括：涨停不买跌停不卖、跌停不买涨停不卖、涨跌停挂剩余量、涨跌停委托。

（19）投保标记

选择框，选填项，展示默认值投机。

（20）备注

可手动输入，如无输入，输出默认备注：合约代码+交易所简称　合约名称　委托+数值　限价+数值。

（21）创建后关闭

默认勾选，勾选表示算法创建成功后关闭该页面，不勾选则表示算法创建成功过不关闭该页面。

参数设置完成后，点击确定，即确定创建并启动算法；点击取消，即取消本次算法创建，页面关闭。

6.3.1.1.2.算法改单

在算法实例列表中，右击“运行中”状态的算法实例，可以进行改单，除算法类型、合约标的及买卖方向外，其他参数均可修改，注意：修改后的委托量要大于已委托未成量+成交的数量，否则改单失败。

6.3.1.1.3.算法复制

在算法实例列表中，右击任意一条算法实例可以进行算法复制（以操作复制前的算法参数值为复制值），可对全参数进行修改。

6.3.1.1.4. 启动/暂停/停止/删除

在算法实例列表中，可对单条选中的算法实例进行启动/暂停/停止/删除操作。点击右上角启动、暂停、停止、删除按钮，可对选中的算法实例进行批量操作。

各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

删除：针对处于终态，例如“已完成”、“已停止”和“异常”状态的算法可以操作。

6.3.1.2. 执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。

6.3.1.3. 委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

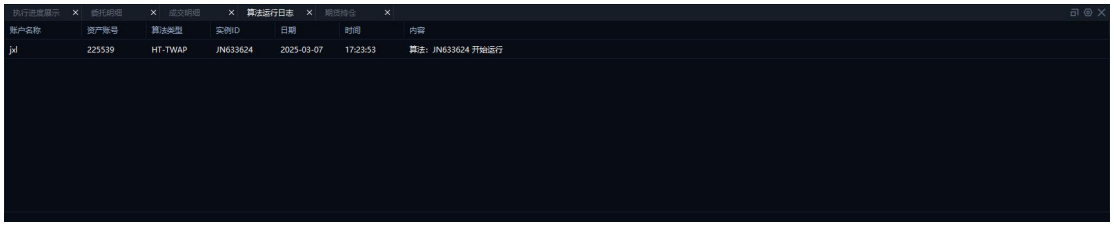
全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

6.3.1.4.成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

6.3.1.5.算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。



6.3.1.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。

6.3.2.HT-VWAP

HT-VWAP 是指在指定的时间间隔内，结合历史交易量分布及当天实时交易量情况进行下单的算法，旨在以一个尽可能接近市场按成交量加权的均价进行交易，尽量降低对市场的冲击。适用于希望成交均价接近该时间段内的市场均价（按成交量加权），交易比较频繁、流动性好，并且成交量分布比较规律的标的（大概率和历史成交量分布吻合度高）。

6.3.2.1.实例列表

6.3.2.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。

算法创建参数说明如下：

（1）实例参数模板

选择框，默认未使用算法模板，下拉展示已保存的算法模板，右侧“+”按钮可将当前设置的算法参数，保存为参数模板；右侧“-”按钮可删除选择框中选择的实例参数模板。

（2）账户名称

选择框，必填项，展示所绑定的期货资金账号。右侧锁定/解锁切换按钮，默认解锁状态，点击则锁定选择当前资产账号。

（3）算法类型

选择框，默认值 HT-VWAP。

（4）合约代码

输入框+选择框，必填项，输入过程中支持模糊匹配。点击下拉按钮，展示账户名称下所支持的所有市场合约。选择合约时，需注意关注该合约是否交易活跃的合约，交易不活跃合约可能影响算法执行。

（5）市场

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

（6）委托数量

输入框，必填项，只允许输入正整数，数值输入上限为 10 位数，超出则无法输入，合约代码选择后，输入框右侧显示对应的数量单位（随着合约代码切换自动变化），委托数量不能小于该合约单笔(合约限价有最小下单数量)最小下单数量。

注意：当交易方向-开平方向为平时，需注意委托数量设置尽量不要大于可平仓量，否则可能影响策略执行。

（7）限价

输入框，必填项，无默认值，整数位限填 15 位，小数位根据价格精度来限制位数，超过则无法输入。注意：限价填写数值不能超出该合约的涨跌幅范围，否则创建后无法运行且日志报错。限价设置时，需考虑当前市场行情数据，否则买价过低或卖价过高可能会影响算法执行。

（8）交易方向

选择框，必填项，不支持手工输入，支持买开、买平、卖开、卖平四种选择，默认买开。

（9）平今/昨

选择框，必填项，不支持手工输入，支持平今和平昨两种选择，默认平今；在市场是上期所和上期能源，开平仓选择平仓时，展示该字段，否则不展示。

（10）算法开始时间

输入框，必填项，默认展示当前系统时间，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）。

右侧选择框即算法执行时间，相关关系为：算法开始时间+算法执行时间+非交易时间（如含）=算法过期时间，过滤掉非交易时间，鼠标悬停该区域，提示“仅剔除日盘非交易时间”，默认空白，下拉可以选择“空白、15 分、20 分、30 分、40 分、45 分、60 分、120 分、180 分、240 分”。

注意：算法开始时间不能早于当前系统时间 10 分钟，算法开始时间不能早于开盘时间，算法开始时间不能晚于收盘时间。

（11）算法过期时间

输入框，必填项，默认展示当前交易日日期的 15:00:00，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）；当算法开始时间右侧选择框有选择值时，根据选择值重新生成并更新算法过期时间。

注意：算法过期时间不能早于当前系统时间，算法过期时间不能早于算法开始时间。算法开始/过期时间设置上不支持跨日，仅支持设置一个交易日内从夜盘开始-日盘休市的时间段的策略，具体的开/收盘时间以所选择品种合约在交易所的开收盘时间为准。

（12）风格参数

指算法实例执行过程中允许与目标偏离度的差异程度，保守风格对执行目标的偏离容忍

度更高。选择框，必填项，支持保守、正常和激进三种选择，默认正常。

（13）最大市场占比

输入框，选填项，默认 30（单位%），有效范围 0-100，限 2 位小数。不填写、填写 0 或填写 100 表示不控制。

（14）最小委托金额

输入框，选填项，默认 0，只能输入正数和小数点，整数位限 15 位，小数位限 2 位，超过则无法输入。不填写或填写 0 表示不控制。

注意：如果最小委托金额大于实例剩余委托数量*委托价格*合约乘数，则按照实例剩余委托数量下单。

（15）相对限价

选择框，选填项，支持对方盘口/己方盘口/昨收价/最新价/到达价/市场 VWAP 均价/不控制选项，默认值不控制。

（16）单位

选择框，选填项，支持价格最小变动单位/基点(万分之一)/金额选择。默认价格最小变动单位。（如果相对限价选择了价格类型，则必填，选择不控制，则无法填写）

（17）变化量

输入框，选填项，默认 0，可以是正数/零/负数。（如果相对限价选择了价格类型，则必填，选择不控制，则无法填写）

相对限价、单位、变化量关系如下：

（1）单位为价格最小变动单位

·对于买单:相对限价=基准价+单位*变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-单位*变化量

（2）单位为基点

·对于买单:相对限价=基准价*（1+变化量*万分之一）

·对于卖单:相对限价=基准价*（1-变化量*万分之一）

（3）单位为金额

·对于买单:相对限价=基准价+变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-变化量

（4）单位为百分比

·对于买单:相对限价=基准价*（1+变化量%）*100%

·对于卖单:相对限价=基准价*（1-变化量%）*100%

实际拆单时，委托价格须同时满足限价和相对限价参数。

（18）涨跌停委托

选择框，必填项，默认涨跌停不委托，其他选项包括：涨停不买跌停不卖、跌停不买涨停不卖、涨跌停挂剩余量、涨跌停委托。

（19）投保标记

选择框，选填项，展示默认值投机。

（20）备注

可手动输入，如无输入，输出默认备注：合约代码+交易所简称　合约名称　委托+数值　限价+数值。

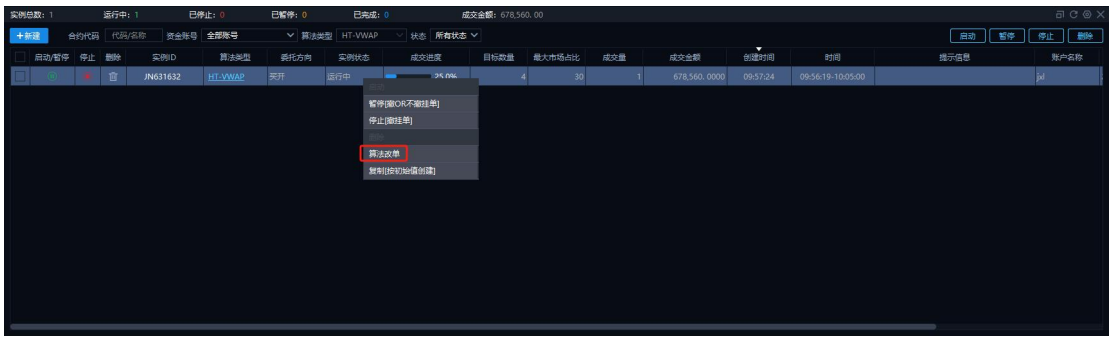
（21）创建后关闭

默认勾选，勾选表示算法创建成功后关闭该页面，不勾选则表示算法创建成功过不关闭该页面。

参数设置完成后，点击确定，即确定创建并启动算法；点击取消，即取消本次算法创建，页面关闭。

6.3.2.1.2.算法改单

在算法实例列表中，右击“运行中”状态的算法实例，可以进行改单，除算法类型、合约标的及买卖方向外，其他参数均可修改，注意：修改后的委托量要大于已委托未成量+成交的数量，否则改单失败。



6.3.2.1.3.算法复制

在算法实例列表中，右击任意一条算法实例可以进行算法复制（以操作复制前的算法参数值为复制值），可对全参数进行修改。

6.3.2.1.4. 启动/暂停/停止/删除

在算法实例列表中，可对单条选中的算法实例进行启动/暂停/停止/删除操作。点击右上角启动、暂停、停止、删除按钮，可对选中的算法实例进行批量操作。

各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

删除：针对处于终态，例如“已完成”、“已停止”和“异常”状态的算法可以操作。

6.3.2.2. 执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。

6.3.2.3. 委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

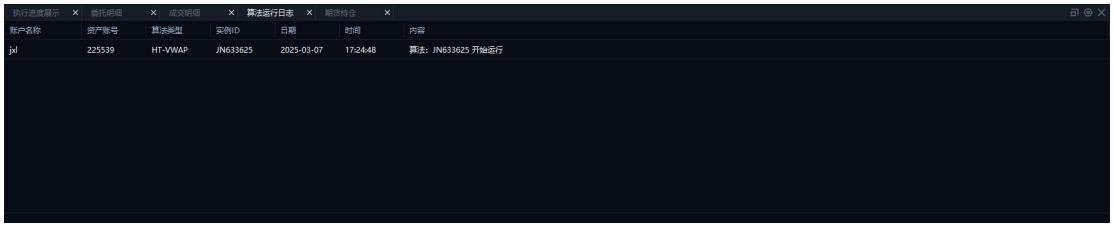
全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

6.3.2.4.成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

6.3.2.5.算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。



6.3.2.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。

6.3.3.HT-套利

HT-套利是机会型交易策略，策略自动监控交易机会，仅在有交易机会的时候触发交易。本策略适用于期货的跨期套利和自动展期，其原理是利用价差变化，在期货市场上进行交易方向相反的交易，以期在价差发生有利变化而获利，根据设置的阈值等条件信息进行利差判断，当套利价差大于阈值时，认为有套利机会进行交易。

6.3.3.1.实例列表

6.3.3.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。

算法创建策略相关参数说明如下：

（1）实例参数模板

选择框，默认未使用算法模板，下拉展示已保存的算法模板，右侧“+”按钮可将当前设置的算法参数，保存为参数模板；右侧“-”按钮可删除选择框中选择的实例参数模板。

（2）账户名称

选择框，必填项，展示所绑定的期货资金账号。右侧锁定/解锁切换按钮，默认解锁状态，点击则锁定选择当前资产账号。

（3）算法类型

选择框，默认值 HT-套利。

（4）算法开始时间

输入框，必填项，默认展示当前系统时间，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）。

右侧选择框即算法执行时间，相关关系为：算法开始时间+算法执行时间+非交易时间（如含）=算法过期时间，过滤掉非交易时间，鼠标悬停该区域，提示“仅剔除日盘非交易时间”，默认空白，下拉可以选择“空白、15 分、20 分、30 分、40 分、45 分、60 分、120 分、180 分、240 分”。

注意：算法开始时间不能早于当前系统时间 10 分钟，算法开始时间不能早于开盘时间，算法开始时间不能晚于收盘时间。

（5）算法过期时间

输入框，必填项，默认展示当前交易日日期的 15:00:00，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）；当算法开始时间右侧选择框有选择值时，根据选择值重新生成并更新算法过期时间。

注意：算法过期时间不能早于当前系统时间，算法过期时间不能早于算法开始时间。算法开始/过期时间设置上不支持跨日，仅支持设置一个交易日内从夜盘开始-日盘休市的时间段的策略，具体的开/收盘时间以所选择品种合约在交易所的开收盘时间为准。

（6）风格参数

指算法实例执行过程中允许与目标偏离度的差异程度，保守风格对执行目标的偏离容忍度更高。选择框，必填项，支持保守、正常和激进三种选择，默认正常。

（7）机会阈值

触发算法实例拆单的价差值，具体触发条件为卖出期货价格-买入期货价格>机会阈值（即出现套利机会）。输入框，必填项，默认值 0。

（8）单次最大手数

算法实例拆单过程中，单次允许拆单的最大手数值。输入框，必填项。

（9）套利间隔

出现套利机会时，触发算法实例拆单的最小时间间隔。输入框，必填项。

（10）机会稳定时间

触发算法实例拆单的价差值稳定时间，即卖出期货价格-买入期货价格>机会阈值的时间区间超过设定的时间值时，才触发算法拆单。输入框，必填项。

（11）交易方式

算法实例拆单时，买单和卖单优先拆单的选项。选择框，必填项，支持买优先、卖优先两种选择，默认卖优先。

（12）智能模式

动态调整算法实例的价差阈值来进行期货套利的选项。选择框，必填项，支持是、否两种选择，默认否。

（13）备注

可手动输入，如无输入，输出默认备注：合约代码+交易所简称　合约名称　委托+数值　限价+数值。

算法创建标的相关参数说明如下：

（1）合约代码

输入框+选择框，必填项，输入过程中支持模糊匹配。点击下拉按钮，展示账户名称下所支持的所有市场合约。选择合约时，需注意关注该合约是否交易活跃的合约，交易不活跃合约可能影响算法执行。

（2）合约名称

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的合约名称。

（3）市场

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

（4）可平仓量

填写框，必填项，不支持手工输入，**合约代码**选择后，自动带入对应的可平仓量。

（5）委托数量

输入框，必填项，只允许输入正整数，数值输入上限为 10 位数，超出则无法输入，合约代码选择后，输入框右侧显示对应的数量单位（随着合约代码切换自动变化），委托数量不能小于该合约单笔(合约限价有最小下单数量)最小下单数量。

注意：两个合约的委托数量必须相同，当交易方向-开平方向为平时，需注意委托数量设置尽量不要大于可平仓量，否则可能影响策略执行。

（6）交易方向

选择框，必填项，不支持手工输入，支持买开、买平、卖开、卖平四种选择，默认买开。

（7）平今/昨

选择框，必填项，不支持手工输入，支持平今和平昨两种选择，默认平今；仅在市场是上期所和上期能源，开平仓选择平仓时，支持设置。

（8）限价

输入框，必填项，无默认值，整数位限填 15 位，小数位根据价格精度来限制位数，超过则无法输入。注意：限价填写数值不能超出该合约的涨跌幅范围，否则创建后无法运行且日志报错。限价设置时，需考虑当前市场行情数据，否则买价过低或卖价过高可能会影响算法执行。

（9）投保标记

选择框，选填项，展示默认值投机。

（10）创建后关闭

默认勾选，勾选表示算法创建成功后关闭该页面，不勾选则表示算法创建成功过不关闭

该页面。

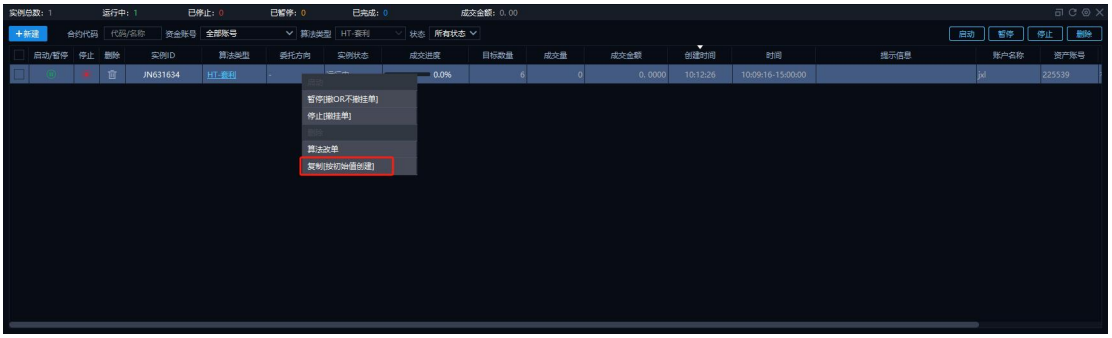
参数设置完成后，点击确定，即确定创建并启动算法；点击取消，即取消本次算法创建，页面关闭。

6.3.3.1.2.算法改单

在算法实例列表中，右击“运行中”状态的算法实例，可以进行改单，仅支持修改算法开始时间、算法过期时间、限价和机会阈值。

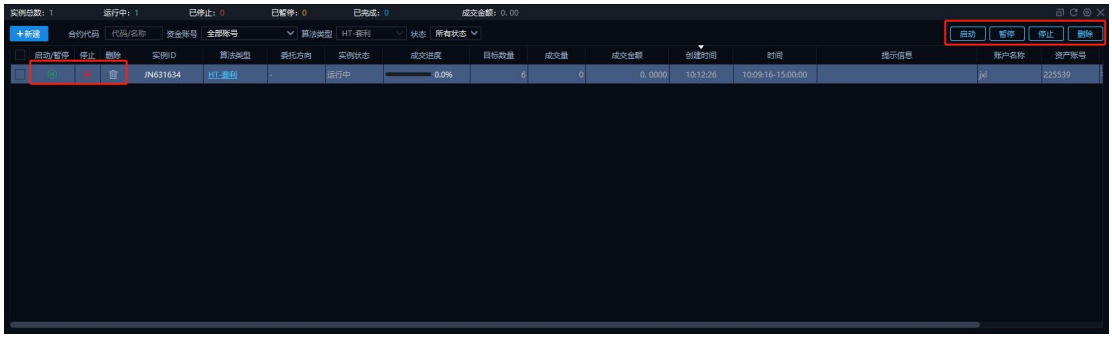
6.3.3.1.3.算法复制

在算法实例列表中，右击任意一条算法实例可以进行算法复制（以操作复制前的算法参数值为复制值），可对全参数进行修改。



6.3.3.1.4.启动/暂停/停止/删除

在算法实例列表中，可对单条选中的算法实例进行启动/暂停/停止/删除操作。点击右上角启动、暂停、停止、删除按钮，可对选中的算法实例进行批量操作。



各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

删除：针对处于终态，例如“已完成”、“已停止”和“异常”状态的算法可以操作。

6.3.3.2. 执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。

6.3.3.3. 委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

6.3.3.4. 成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

6.3.3.5. 算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。

6.3.3.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。

6.3.4.HT-移仓/普通移仓

HT-普通移仓以快速成交为目的，近、远月合约通过 TWAP、VWAP 快速拆单成交，过程中实时监控并控制敞口，避免出现持仓风险，适用于移仓后期或者移仓窗口紧张时，希望快速完成移仓目标，主要满足产业客户在移仓的过程中，快速进行仓位调整的需求。

6.3.4.1.实例列表

6.3.4.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。

算法创建策略相关参数说明如下：

（1）实例参数模板

选择框，默认未使用算法模板，下拉展示已保存的算法模板，右侧“+”按钮可将当前设置的算法参数，保存为参数模板；右侧“-”按钮可删除选择框中选择的实例参数模板。

（2）账户名称

选择框，必填项，展示所绑定的期货资金账号。右侧锁定/解锁切换按钮，默认解锁状态，点击则锁定选择当前资产账号。

（3）算法类型

选择框，默认值 HT-普通移仓。

（4）算法开始时间

输入框，必填项，默认展示当前系统时间，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）。

右侧选择框即算法执行时间，相关关系为：算法开始时间+算法执行时间+非交易时间（如含）=算法过期时间，过滤掉非交易时间，鼠标悬停该区域，提示“仅剔除日盘非交易时间”，默认空白，下拉可以选择“空白、15 分、20 分、30 分、40 分、45 分、60 分、120 分、180 分、240 分”。

注意：算法开始时间不能早于当前系统时间 10 分钟，算法开始时间不能早于开盘时间，算法开始时间不能晚于收盘时间。

（5）算法过期时间

输入框，必填项，默认展示当前交易日日期的 15:00:00，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）；当算法开始时间右侧选择框有选择值时，根据选择值重新生成并更新算法过期时间。

注意：算法过期时间不能早于当前系统时间，算法过期时间不能早于算法开始时间。算法开始/过期时间设置上不支持跨日，仅支持设置一个交易日内从夜盘开始-日盘休市的时间段的策略，具体的开/收盘时间以所选择品种合约在交易所的开收盘时间为准。

（6）风格参数

指算法实例执行过程中允许与目标偏离度的差异程度，保守风格对执行目标的偏离容忍度更高。选择框，必填项，支持保守、正常和激进三种选择，默认正常。

（7）最大市场占比

输入框，选填项，默认 30（单位%），有效范围 0-100，限 2 位小数。不填写、填写 0 或填写 100 表示不控制。

（8）最小委托金额

输入框，选填项，默认 0，只能输入正数和小数点，整数位限 15 位，小数位限 2 位，超过则无法输入。不填写或填写 0 表示不控制。

注意：如果最小委托金额大于实例剩余委托数量*委托价格*合约乘数，则按照实例剩余

委托数量下单。

（9）相对限价

选择框，选填项，支持对方盘口/己方盘口/昨收价/最新价/到达价/市场 VWAP 均价/不控制选项，默认值不控制。

（10）单位

选择框，选填项，支持价格最小变动单位/基点(万分之一)/金额选择。默认价格最小变动单位。（如果相对限价选择了价格类型，则必填，选择不控制，则无法填写）

（11）变化量

输入框，选填项，默认 0，可以是正数/零/负数。（如果相对限价选择了价格类型，则必填，选择不控制，则无法填写）

相对限价、单位、变化量关系如下：

（1）单位为价格最小变动单位

·对于买单:相对限价=基准价+单位*变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-单位*变化量

（2）单位为基点

·对于买单:相对限价=基准价*（1+变化量*万分之一）

·对于卖单:相对限价=基准价*（1-变化量*万分之一）

（3）单位为金额

·对于买单:相对限价=基准价+变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-变化量

（4）单位为百分比

·对于买单:相对限价=基准价*（1+变化量%）*100%

·对于卖单:相对限价=基准价*（1-变化量%）*100%

实际拆单时，委托价格须同时满足限价和相对限价参数。

（12）涨跌停委托

选择框，必填项，默认涨跌停不委托，其他选项包括：涨停不买跌停不卖、跌停不买涨停不卖、涨跌停挂剩余量、涨跌停委托。

（13）敞口模式

买单和卖单执行进度差值的计算方式。选择框，必填项，支持不控制、数量模式（手）、金额模式（元）、比例模式（%）四种选择，默认不控制。

（14）敞口

算法实例中买单和卖单执行进度差值超过该值时，优先方停止拆单，驱动落后方追赶进度。敞口模式选择不控制时，敞口参数无法输入；敞口模式选择其余三项时，必填项，设置具体敞口参数，通过敞口参数控制买卖进度差。

（15）交易方式

算法实例拆单时，买单和卖单优先拆单的选项。选择框，必填项，支持买优先、卖优先、买卖同时三种选择，默认卖优先。

（16）执行策略

算法实例执行过程中，实例标的所使用的拆单策略。选择框，必填项，支持 HT-TWAP 和 HT-VWAP 选项，默认 HT-TWAP。

（17）备注

可手动输入，如无输入，输出默认备注：合约代码+交易所简称　合约名称　委托+数值　限价+数值。

算法创建标的相关参数说明如下：

（1）合约代码

输入框+选择框，必填项，输入过程中支持模糊匹配。点击下拉按钮，展示账户名称下所支持的所有市场合约。选择合约时，需注意关注该合约是否交易活跃的合约，交易不活跃合约可能影响算法执行。

（2）合约名称

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的合约名称。

（3）市场

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

（4）可平仓量

填写框，必填项，不支持手工输入，**合约代码**选择后，自动带入对应的可平仓量。

（5）委托数量

输入框，必填项，只允许输入正整数，数值输入上限为 10 位数，超出则无法输入，合约代码选择后，输入框右侧显示对应的数量单位（随着合约代码切换自动变化），委托数量不能小于该合约单笔(合约限价有最小下单数量)最小下单数量。

（6）交易方向

选择框，必填项，不支持手工输入，支持买开、买平、卖开、卖平四种选择，默认买开。

（7）平今/昨

选择框，必填项，不支持手工输入，支持平今和平昨两种选择，默认平今；仅在市场是上期所和上期能源，开平仓选择平仓时，支持设置。

（8）限价

输入框，必填项，无默认值，整数位限填 15 位，小数位根据价格精度来限制位数，超过则无法输入。注意：限价填写数值不能超出该合约的涨跌幅范围，否则创建后无法运行且日志报错。限价设置时，需考虑当前市场行情数据，否则买价过低或卖价过高可能会影响算法执行。

（9）投保标记

选择框，选填项，展示默认值投机。

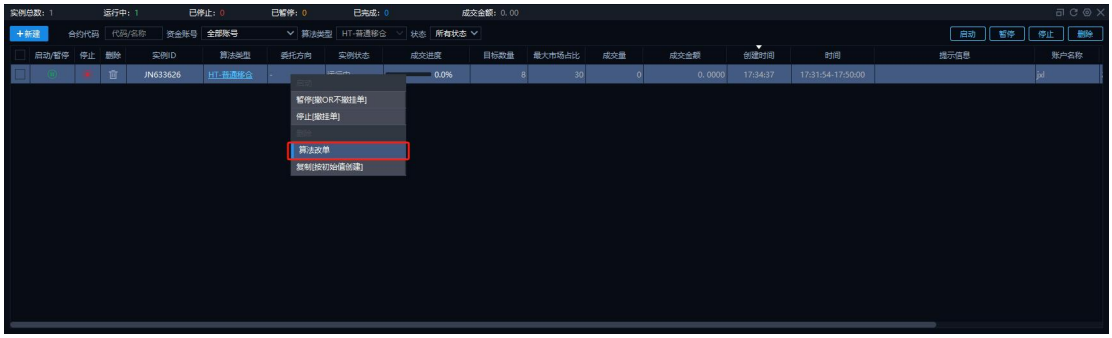
（10）创建后关闭

默认勾选，勾选表示算法创建成功后关闭该页面，不勾选则表示算法创建成功过不关闭该页面。

参数设置完成后，点击确定，即确定创建并启动算法；点击取消，即取消本次算法创建，页面关闭。

6.3.4.1.2.算法改单

在算法实例列表中，右击“运行中”状态的算法实例，可以进行改单，允许对以下**策略参数**进行修改：包括委托数量(修改后的委托量要校验大于已委托未成量+成交的数量）、限价、算法开始时间、算法过期时间、风格参数、最大市场占比、最小委托金额、相对限价、单位、变化量、涨跌停委托、敞口模式、敞口、交易方式、执行策略。



6.3.4.1.3.算法复制

在算法实例列表中，右击任意一条算法实例可以进行算法复制（以操作复制前的算法参数值为复制值），可对全参数进行修改。

6.3.4.1.4.启动/暂停/停止/删除

在算法实例列表中，可对单条选中的算法实例进行启动/暂停/停止/删除操作。点击右上角启动、暂停、停止、删除按钮，可对选中的算法实例进行批量操作。

各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

删除：针对处于终态，例如“已完成”、“已停止”和“异常”状态的算法可以操作。

6.3.4.2.执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。

6.3.4.3.委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

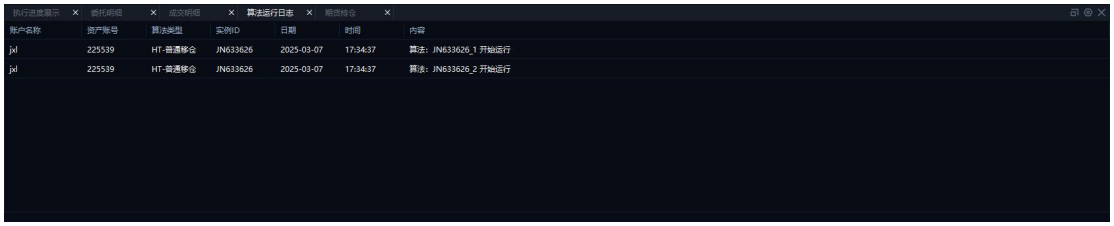
全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

6.3.4.4.成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

6.3.4.5.算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。



6.3.4.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。

6.3.5.HT-移仓/套利移仓

HT-套利移仓是通过自动监控机会阈值，出现套利机会时通过平近月，开远月的方式，获取价差利润的同时实现移仓目标，适用于移仓初期，时间相对充裕，兼顾移仓目标和价差收益，主要满足产业客户在移仓的过程中，希望通过价差监控增厚收益的场景。

6.3.5.1.实例列表

6.3.5.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。

算法创建策略相关参数说明如下：

（1）实例参数模板

选择框，默认未使用算法模板，下拉展示已保存的算法模板，右侧“+”按钮可将当前设置的算法参数，保存为参数模板；右侧“-”按钮可删除选择框中选择的实例参数模板。

（2）账户名称

选择框，必填项，展示所绑定的期货资金账号。右侧锁定/解锁切换按钮，默认解锁状态，点击则锁定选择当前资产账号。

（3）算法类型

选择框，默认值 HT-套利移仓。

（4）算法开始时间

输入框，必填项，默认展示当前系统时间，支持手工修改，点击上（+）/下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）。

右侧选择框即算法执行时间，相关关系为：算法开始时间+算法执行时间+非交易时间（如含）=算法过期时间，过滤掉非交易时间，鼠标悬停该区域，提示“仅剔除日盘非交易时间”，默认空白，下拉可以选择“空白、15 分、20 分、30 分、40 分、45 分、60 分、120 分、180 分、240 分”。

注意：算法开始时间不能早于当前系统时间 10 分钟，算法开始时间不能早于开盘时间，算法开始时间不能晚于收盘时间。

（5）算法过期时间

输入框，必填项，默认展示当前交易日日期的 15:00:00，支持手工修改，点击上（+）/

下（-）箭头或滚动鼠标滚动轮，增加/减少光标定位区域的数值（按 1 个单位增减）；当算法开始时间右侧选择框有选择值时，根据选择值重新生成并更新算法过期时间。

注意：算法过期时间不能早于当前系统时间，算法过期时间不能早于算法开始时间。算法开始/过期时间设置上不支持跨日，仅支持设置一个交易日内从夜盘开始-日盘休市的时间段的策略，具体的开/收盘时间以所选择品种合约在交易所的开收盘时间为准。

（6）风格参数

指算法实例执行过程中允许与目标偏离度的差异程度，保守风格对执行目标的偏离容忍度更高。选择框，必填项，支持保守、正常和激进三种选择，默认正常。

（7）机会阈值

触发算法实例拆单的价差值，具体触发条件为卖出期货价格-买入期货价格>机会阈值（即出现套利机会）。输入框，必填项，默认值 0。

（8）单次最大手数

算法实例拆单过程中，单次允许拆单的最大手数值。输入框，必填项。

（9）套利间隔

出现套利机会时，触发算法实例拆单的最小时间间隔。输入框，必填项。

（10）机会稳定时间

触发算法实例拆单的价差值稳定时间，即卖出期货价格-买入期货价格>机会阈值的时间区间超过设定的时间值时，才触发算法拆单。输入框，必填项。

（11）交易方式

算法实例拆单时，买单和卖单优先拆单的选项。选择框，必填项，支持买优先、卖优先两种选择，默认卖优先。

（12）智能模式

动态调整算法实例的价差阈值来进行期货套利的选项。选择框，必填项，支持是、否两种选择，默认否。

（13）备注

可手动输入，如无输入，输出默认备注：合约代码+交易所简称　合约名称　委托+数值　限价+数值。

算法创建标的相关参数说明如下：

（1）合约代码

输入框+选择框，必填项，输入过程中支持模糊匹配。点击下拉按钮，展示账户名称下

所支持的所有市场合约。选择合约时，需注意关注该合约是否交易活跃的合约，交易不活跃合约可能影响算法执行。

（2）合约名称

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的合约名称。

（3）市场

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

（4）可平仓量

填写框，必填项，不支持手工输入，**合约代码**选择后，自动带入对应的可平仓量。

（5）委托数量

输入框，必填项，只允许输入正整数，数值输入上限为 10 位数，超出则无法输入，合约代码选择后，输入框右侧显示对应的数量单位（随着合约代码切换自动变化），委托数量不能小于该合约单笔(合约限价有最小下单数量)最小下单数量。

注意：两个合约的委托数量必须相同，当交易方向-开平方向为平时，需注意委托数量设置尽量不要大于可平仓量，否则可能影响策略执行。

（6）交易方向

选择框，必填项，不支持手工输入，支持买开、买平、卖开、卖平四种选择，默认买开。

（7）平今/昨

选择框，必填项，不支持手工输入，支持平今和平昨两种选择，默认平今；仅在市场是上期所和上期能源，开平仓选择平仓时，支持设置。

（8）限价

输入框，必填项，无默认值，整数位限填 15 位，小数位根据价格精度来限制位数，超过则无法输入。注意：限价填写数值不能超出该合约的涨跌幅范围，否则创建后无法运行且日志报错。限价设置时，需考虑当前市场行情数据，否则买价过低或卖价过高可能会影响算法执行。

（9）投保标记

选择框，选填项，展示默认值投机。

（10）创建后关闭

默认勾选，勾选表示算法创建成功后关闭该页面，不勾选则表示算法创建成功过不关闭该页面。

参数设置完成后，点击确定，即确定创建并启动算法；点击取消，即取消本次算法创建，

页面关闭。

6.3.5.1.2.算法改单

在算法实例列表中，右击“运行中”状态的算法实例，可以进行改单，仅支持修改算法开始时间、算法过期时间、限价和机会阈值。

6.3.5.1.3.算法复制

在算法实例列表中，右击任意一条算法实例可以进行算法复制（以操作复制前的算法参数值为复制值），可对全参数进行修改。

6.3.5.1.4.启动/暂停/停止/删除

在算法实例列表中，可对单条选中的算法实例进行启动/暂停/停止/删除操作。点击右上角启动、暂停、停止、删除按钮，可对选中的算法实例进行批量操作。

各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

删除：针对处于终态，例如“已完成”、“已停止”和“异常”状态的算法可以操作。

6.3.5.2. 执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。

6.3.5.3. 委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

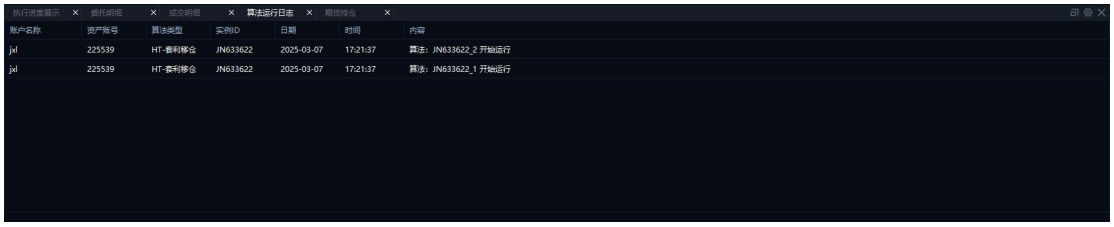
全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

6.3.5.4. 成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

6.3.5.5. 算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。



6.3.5.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。

6.3.6.异常情况处理

（1）行情推送中断处理

超过行情正常推送的时间间隔现象，视为行情中断。例如：期货行情正常推送的时间间隔为 500 毫秒，当合约的行情在 500 毫秒内未接收到新行情的推送，即认为出现行情中断现象。此时，算法状态不变，但是会停止发单，在算法运行日志和备注中揭示“***合约行情中断”的信息，等行情恢复时算法继续发单。

（2）实例委托失败处理

算法拆单出现委托失败（原因可能是系统故障或者柜台资金/持仓不足，超过涨跌停价等）时视为算法实例出错，算法实例暂停，同时在实例日志和备注中揭示委托失败原因的信息。如出现以上情况，建议客户操作停止该算法。

（3）交易服务异常处理

出现交易服务链接中断、算法引擎服务异常等系统故障时，算法实例暂停，同时在实例日志和备注中揭示系统故障的信息。如出现以上情况，建议客户操作停止该算法。

6.4.套利交易

6.4.1.套利雷达

套利雷达是对常见期货套利合约组合进行价差监控的智能工具，具体包括套利雷达监控界面和套利组合构建界面。

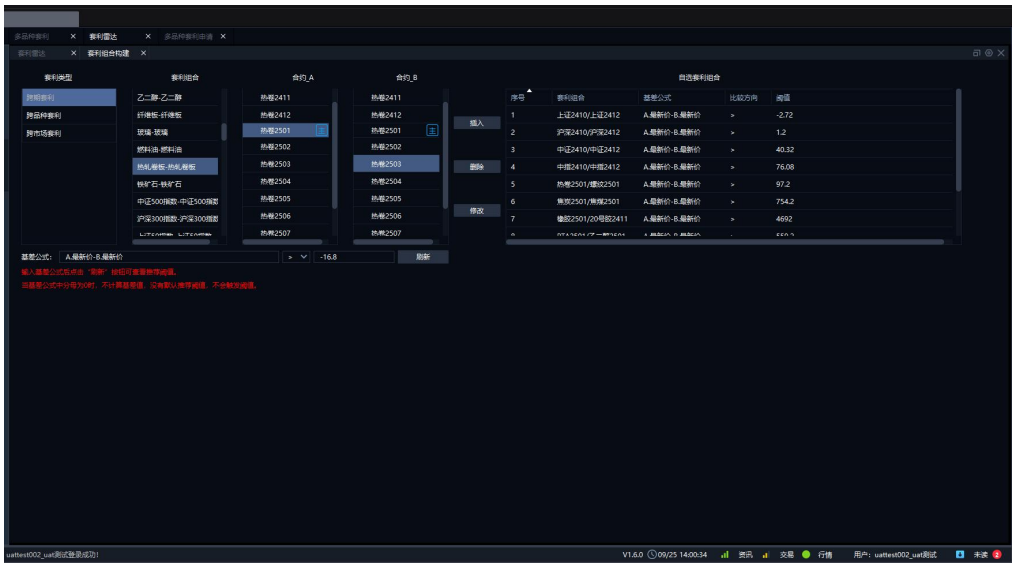
套利雷达功能支持包含中金所、大商所、郑商所、上能源、上期所、广期所等六大交易所在内的所有期货品种任意组合，支持的套利类型包括：

类型	说明	举例
跨期套利	相同合约不同月份	例：银 2407-银 2409
跨品种套利	互补性强的品种之间套利	例：玉米 2407-玉米淀粉 2407
跨市场套利	不同交易市场之间的套利	例：豆油 2409-菜籽油 2409

6.4.1.1.套利组合构建

自选套利组合中会展示系统默认推荐的套利组合，支持构建新的套利组合，删除、修改已插入的套利组合。

套利组合构建：首先选择套利类型后，套利组合会出现当前推荐的组合类型，选定套利组合后，合约 A 和合约 B 分别展示选中标的组合对应月份的合约列表（已标记主力合约），选择具体标的后，下方展示所推荐的基差公式，例如：A.最新价-B.最新价，阈值数值默认为计算值*(1±20%)，可自定义数值。设置完阈值后点击插入，即可添加进自选套利组合中，组合选中后支持删除组合和修改阈值。



基差公式：支持小数和整数，委托价支持买一价，卖一价，最新价，买方盘口均价（盘口深度 N 档加权平均价），卖方盘口均价（盘口深度 N 档加权平均价）及特定符号（加，减，乘，除，括号和实行点号），输入方式为“标的序号.价格类型”，例如：A.最新价-B.最新价*1.5/2。

方向：方向为选择框，提供“＞，≥，＝，＜，≤” 5 个选项。

阈值：整数位需小于等于 11 位，小数位需小于等于 4 位。

基差公式下方提示：

输入基差公式后点击“刷新”按钮可查看推荐阈值。

当基差公式中分母为 0 时，不计算基差值，没有默认推荐阈值，不会触发阈值。

插入：点击可将设置好的组合添加至自选套利组合列表。

删除：选中一条自选套利组合后，点击“删除”可删除监控中合约组合。

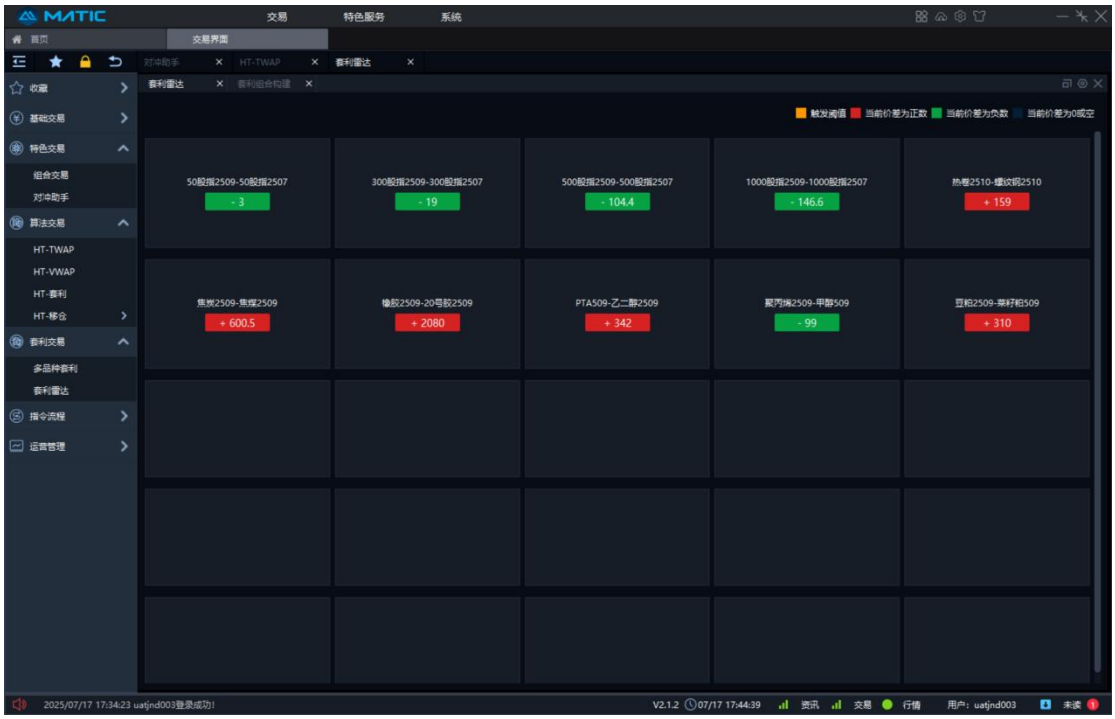
修改：选中一条自选套利组合后，可重新编辑基差公式，方向和阈值（请注意仅支持修改基差公式），然后点击“修改”生效。

6.4.1.2.套利雷达

套利雷达界面展示套利组合构建页面设置好的合约组合基差监控，5*5 展示组合合约名称和价差（系统默认推荐当前市场热点套利组合）。

若价差为正，价差背景为红色，价差为负，价差背景为绿色，价差为 0 或空，价差背景为灰色（右上角提供了图示说明）。

若价差处于设置的阈值范围，监控中的合约组合橘色闪烁提醒。



6.4.2.多品种套利

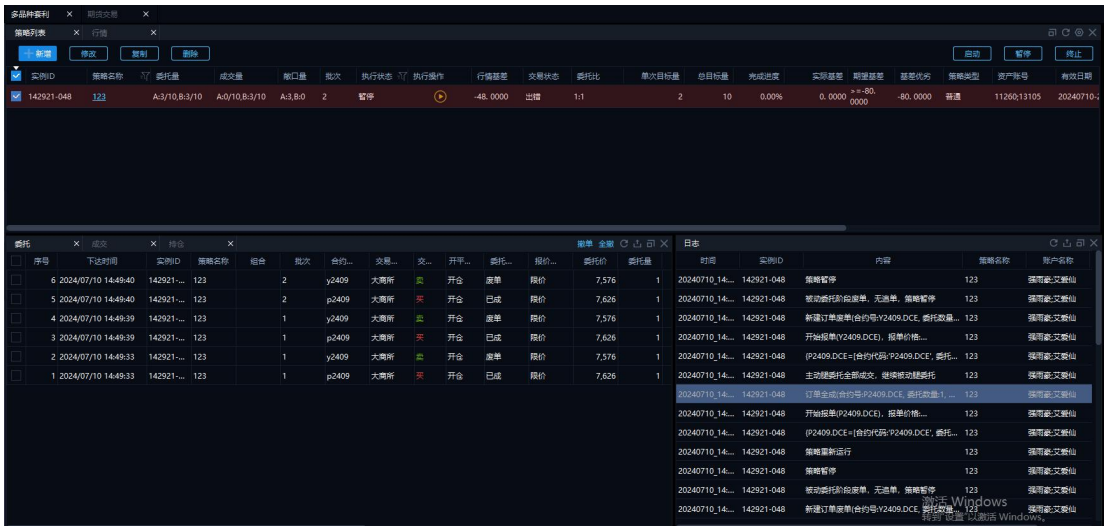
多品种套利功能模块为投资者提供跨期、跨品种、跨市场套利的解决方案，该模块通过对套利机会和套利逻辑的全自动监控和执行,有效解决人工盯盘“范围小、效率低”的痛点，助力投资者扩大盯盘范围并提升套利效率。多品种套利功能默认不对客户开发，客户需申请开通后才可使用该功能。

多品种套利功能模块支持的交易所、品种以及交易方向如下：

资产账号	交易所	品种	交易方向
证券现货账号	上交所/深交所	ETF	买入、卖出
证券期权账号	上交所/深交所	ETF 期权	买开、卖开

			买平、卖平
期货账号	中金所/上期所/上能源/大商所/郑商所/广期所	股指期货、国债期货、商品期货	买开、卖开 买平、卖平 买平(优先平今) 卖平(优先平今) 买平(优先平昨) 卖平(优先平昨)

该模块包含策略列表、行情、委托、成交、持仓以及执行日志六大组件，各组件可复制、关闭、撤销关闭、拖动等操作。全局界面如下：



6.4.2.1.策略列表

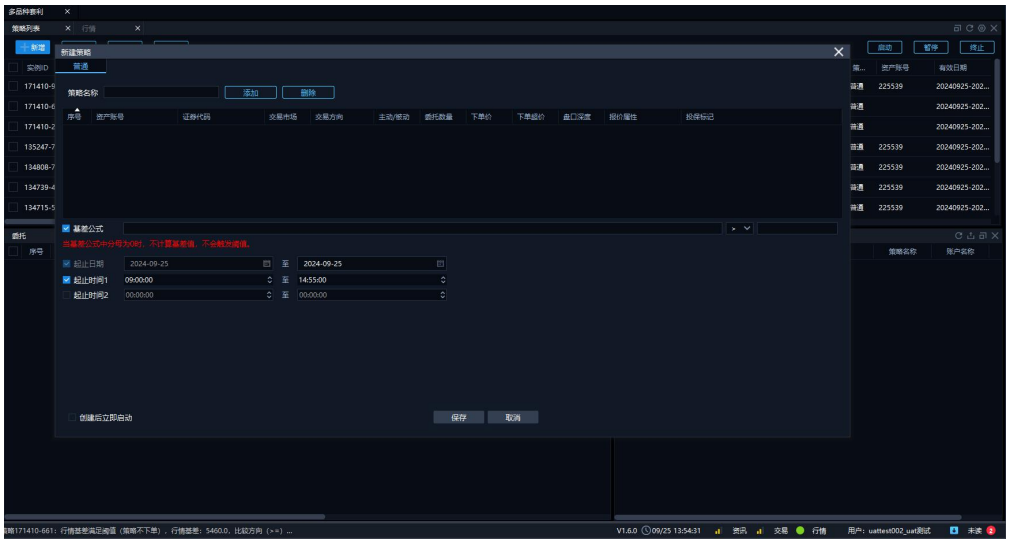
策略列表展示用户当日创建以及跨日还未清除的策略信息，包括策略的实例 ID、策略名称、委托量、成交量、敞口量、执行状态、执行操作、行情基差等信息。

点击策略名称可以选中该条策略，点击执行操作列的图标可对策略进行操作。对执行状态为未执行、暂停、正在执行的策略，双击期望基差，可对基差阀值进行修改。

点击策略列表上的快捷按钮，可进行新增、修改、复制、删除以及启动、暂停、终止策略的操作，选中策略点击鼠标右键，可以对策略进行修改、复制、删除、加入行情列表等操作。

6.4.2.1.1.新增策略

在策略列表上方点击“新增”按钮，弹出新建策略页面，可在此页面进行参数设置。



新建策略参数：

（1）策略名称

输入框，必填项，支持输入字母、数字、文字和特殊符号，最长 45 个字符。

（2）添加、删除

添加腿，删除腿，目前支持添加两条腿。

（3）序号

添加腿时自动带出，默认从 A 开始。

（4）资产账号

展示绑定的证券现货账号、证券期权账号、期货账号。

（5）证券代码

输入数字或字母，可以模糊匹配合约代码首位或者合约名称首位。

（6）交易市场

选中合约后自动带出，不可修改。

（7）交易方向

根据不同市场的合约，可以选择不同的交易方向。

证券现货账号

添加
删除
证券代码
交易市场
交易方向
主动/被动
委托数量
159901 深100ETF
深圳
买入
卖出

证券期权账号

添加
删除
证券代码
交易市场
交易方向
主动/被动
委托数量
10006730 50ETF购9月...
上海
买开
卖开
买平
卖平

期货账号

添加
删除
证券代码
交易市场
交易方向
主动/被动
委托数量
A2409 豆一2409
大商所
买开
卖开
买平
卖平

（8）主动/被动

在策略创建，添加标的时，提供“主动”和“被动”两个选项，这个参数影响的是策略执行时不同标的的下单顺序，当满足策略执行的触发条件时，设为主动的标的(称为“主动腿”会率先下单，设为“被动”的标的（称为“被动腿”〉需等主动腿全部成交后再下单。

注意：目前一个策略组合下，主动腿标的只允许设置 1 个，一般情况下，会把流动性较差的标的设为主动腿，流动性较好的标的设为被动腿。若标的之间的流动性相差不大，都可以瞬时成交，可以把全部标的都设为被动腿，此时满足策略触发条件后，所有标的将同时下单。

（9）委托数量

非负整数，当资产账号为证券现货账号时，委托数量必须为 100 的整数。

（10）下单价

下拉框选项，可选择对手价、最新价、挂单价、盘口价、涨停价、跌停价。

在策略创建，添加标的时，在“下单价”这一列可输入标的的下单价格，当满足策略执行的触发条件时，每个标的都会按满足触发条件的这一时刻的“下单价和下单超价”行情进行委

托报单。

下单价的行情取值与标的交易方向的关系见下表：

下单价选项	买方向标的	卖方向标的
对手价	卖一价	买一价
最新价	最新价	最新价
挂单价	买一价	卖一价
盘口价	对手盘 N 档加权平均价，N 取盘口深度	

（11）下单超价

输入框，必填项，支持输入整数，单位为 tick(标的最小变动价格)，正数代表价格往有利成交方向进行报单,负数代表价格往不利成交方向进行报单,默认为 0。交易方向为买时，委托价格=下单价+下单超价，交易方向为卖时，委托价格=下单价-下单超价。

例:以正数为例

多头：下单价：对手价，下单超价：1tick，实际下单价格：对手价+1tick

空头：下单价：对手价，下单超价：1tick，实际下单价格：对手价-1tick

（12）盘口深度

下单价选择对手价、最新价、挂单价、涨停价、跌停价时，盘口深度默认为一档，不可编辑，下单价选择盘口价时，盘口深度可选择一档、二档、三档、四档、五档、六档、七档、八档、九档、十档、自动。

（13）报价属性

只有资产账号为期货账号时报价属性才可选择，资产账号为证券现货账号、证券期权账号时，报价属性默认为空，不可编辑。

期货各个交易所的报价属性见下表：

交易所	报价属性
中金所	GFD 当日有效
	FAK 任意成交剩余撤销
	FOK 全部成交或撤销
上期所	GFD 当日有效
	FAK 任意成交剩余撤销
	FOK 全部成交或撤销
上能源	GFD 当日有效
	FAK 任意成交剩余撤销
	FOK 全部成交或撤销
大商所	GFD 当日有效
	FAK 任意成交剩余撤销
	FOK 全部成交或撤销

郑商所	GFD 当日有效
	FAK 任意成交剩余撤销
广期所	GFD 当日有效

（14）投保标记

只有资产账号为期货账号时投保标记才可选择，资产账号为证券现货账号、证券期权账号时，投保标记默认为空，不可编辑。目前投保标记只支持选择投机。

（15）基差公式

输入框，支持数字（小数和整数)、标的序号、买一价、卖一价、最新价、盘口均价（盘口深度 N 档之内的加权平均价〉以及特定符号（加、减、乘、除、括号和实心点号)，输入方式为“标的序号.价格”(价格系统自动提供，类似!Lsal 的方式)，例如:0.8*B.最新价-A.最新价/5.7*100。基差方向可以选择>、>=、<、<=、=，阀值可以输入负数、0，正数。

基差公式中，阈值设置整数位需小于等于 11 位，小数位需小于等于 4 位。

基差公式下方提示：当基差公式中分母为 0 时，不计算基差值，不会触发阈值。

（16）起止日期和起止时间

起始日期默认为新建策略的当天，不可修改，终止日期可以选择当天及以后的日期。起止时间可以设置两个时间段，勾选后才会生效，默认勾选第一个起止时间。

（17）创建后立即启动

该参数默认不勾选，勾选后保存，策略会立即启动，监控有效时间和基差。

6.4.2.1.2.修改策略

勾选策略后点击修改按钮或者选中策略-点击鼠标右键-修改，可对执行状态为未执行、暂停的策略进行修改，执行状态为正在执行、执行结束的策略不可修改。执行状态为未执行的策略可以修改除起始日期外的所有参数，执行状态为暂停的策略，只能修改策略名称、基差阀值、终止日期、创建后立即启动。

6.4.2.1.3. 复制策略

勾选策略后点击复制按钮或者选中策略-点击鼠标右键-复制，可以快速复制策略，复制的策略除起始日期外的所有参数都可以修改。

6.4.2.1.4. 删除策略

勾选策略后点击删除按钮或者选中策略-点击鼠标右键-删除，可对执行状态为未执行、暂停、执行结束的策略进行删除，执行状态为正在执行的策略不可删除。

6.4.2.1.5.启动策略

勾选策略后点击启动按钮或者点击执行操作列的未执行、暂停图标，可对执行状态为未执行、暂停的策略进行启动，执行状态为正在执行、执行结束的策略不可启动。

6.4.2.1.6.暂停策略

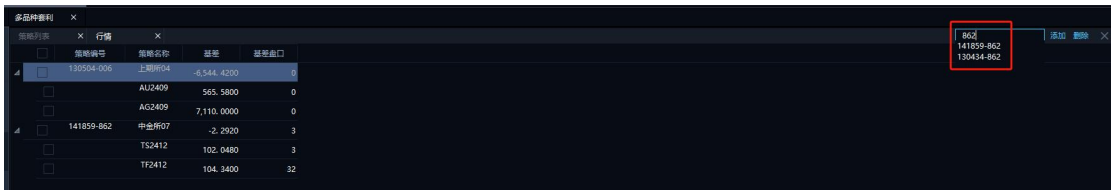
勾选策略后点击暂停按钮或者点击执行操作列的正在执行图标，可对执行状态为正在执行的策略进行暂停，执行状态为未执行、暂停、执行结束的策略不可暂停。

6.4.2.1.7.终止策略

勾选策略后点击终止按钮，可对执行状态为正在执行、暂停的策略进行终止，执行状态为未执行、执行结束的策略不可终止。

6.4.2.2. 行情

以“树状”形式展示自选策略的基差、基差盘口以及该策略下每个标的的行情明细。在行情列表的右上角输入策略编码（即实例 ID）添加策略行情,也可通过右击策略列表中的策略，点击“加入行情列表”选项后添加至策略行情。



6.4.2.3. 委托

展示已触发基差条件并且已下单的委托订单，只展示选中策略的委托订单。勾选委托状态为已报、部成的委托订单，点击撤单按钮，可对委托订单进行撤单操作，点击全撤按钮，可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

6.4.2.4.成交

展示已成交的订单，只展示选中策略的成交订单。

6.4.2.5.持仓

展示登录账号绑定的所有资产账号的持仓数据，包括证券现货账号、证券期权账号、期货账号的所有持仓。选中一条持仓数据，点击手工平仓按钮，弹出手工平仓页面，可进行平仓操作，只有平仓价格、平仓数量可修改，其它字段不可修改。点击手工补单按钮，弹出手工补单页面，可进行下单，所有字段都可修改，下单后的委托订单和持仓订单需要到其它交易模块才可以查看（证券现货账号的补单，需要到 ETF 交易模块如普通交易的委托明细、成交明细查看；证券期权账号的补单，需要到期权交易的委托明细、成交明细查看；期货账号的补单，需要到期货交易的委托明细、成交明细查看）。

6.4.2.6. 日志

与策略列表联动，展示套利策略的运行日志,按时间的倒序记录策略运行的详细情况，主要包括策略执行的行情信息、策略运行的交易信息等，只展示选中策略的日志信息。

日志

时间	实例ID	内容	策略名称	账户名
20240814_13:49:04	134853-519	策略终止运行	上期所05	jxl
20240814_13:49:04	134853-519	完成所有批次的执行，共1批	上期所05	jxl
20240814_13:49:04	134853-519	被动腿本次委托全部成交，继续下一批次的...	上期所05	jxl
20240814_13:49:04	134853-519	订单全成(合约号:AG2409.SHF, 委托数量:1, ...	上期所05	jxl
20240814_13:49:04	134853-519	订单全成(合约号:AU2409.SHF, 委托数量:1, ...	上期所05	jxl
20240814_13:49:04	134853-519	开始报单(AG2409.SHF)，报单价格:...	上期所05	jxl
20240814_13:49:04	134853-519	开始报单(AU2409.SHF)，报单价格:...	上期所05	jxl
20240814_13:48:53	134853-519	进入有效时间，监听基差	上期所05	jxl
20240814_13:48:53	134853-519	策略开始运行	上期所05	jxl

6.5.指令流程

6.5.1.指令说明

6.5.1.1.指令流程

指令流程是用来实现多岗位流程化指令交易的功能模块，通过指令流程可以实现指令下达、指令审批、指令分发、执行交易的功能。可以根据具体需要，选择以下几种流程:

两节点:指令下达-指令执行（or 指令复核）

三节点:指令下达-指令分发-指令执行（or 指令复核）

三节点:指令下达-指令审批-指令执行（or 指令复核）

四节点:指令下达-指令审批-指令分发-指令执行（or 指令复核）

6.5.1.2.指令模式

1. 主动模式

指令交易员执行指令时，可对待执行指令的价格、数量、下单类型进行编辑后执行。

2. 复核模式

指令复核员复核指令时，不可对待复核指令的证券代码、指令方向、指令价格、指令数量进行编辑，仅可点击指令通过或指令拒绝。

6.5.1.3.指令类型和交易品种

指令类型	市场	品种	交易类型
个股指令	上海、深圳	ETF 基金	买入、卖出

6.5.2.指令下达

6.5.2.1.个股指令下达

6.5.2.1.1.参数释义

参数	说明
证券代码	必填，支持模糊匹配
指令方向	必填，枚举值：买入、卖出
报价类型	必选 限价：指令模式为普通交易复核和主动管理时，可选限价 不限价：指令模式为主动管理时，可选不限价 市价：本方最优、对手方最优、即成剩撤、全额成交或撤、五档即成剩撤。指令模式为普通交易复核时，可选市价类型

指令价格	必填
目标类型	必选 1）当指令方向为买入时，选项包括： 按委托总股数 按委托总金额 按总资产占比 按可用资金比例 2）当指令方向为卖出时，选项包括： 按委托总股数 按可卖数量比例
指令数量	必填 1）当目标类型为按委托总股数时，指令数量单位为股； 2）当目标类型为按委托总金额时，指令数量单位为元。
目标比例	必填。 当目标类型为按总资产占比、按可用资金比例、按可卖数量比例时，该字段必填。
分配策略	必选。目标类型选择按委托总股数、按委托总金额时，可选择该字段： 顺序分配：各资金账号的指令数量=min(可买 or 可卖数量，指令数量) 按可用金额比例分配：各资金账号的指令数量=min(可买 or 可卖数量，指令数量*可用金额占比) 总资产比例分配：各资金账号的指令数量=min(可买 or 可卖数量，指令数量*总资产占比) 自定义比例分配：各资金账号的指令数量=min(可买 or 可卖数量，指令数量*自定义比例)
分配给	默认不指定，即下一节点所有用户均可处理该指令； 如选择下一指令节点指定用户，则仅指定用户可处理该指令。
指令模式	主动模式时：默认展示主动管理，不可选择； 复核模式时：可选择普通交易复核
到期日期	主动模式时：默认展示当日，可选择未来 3 个月时间，即跨日指令 复核模式时：展示当日，不可编辑，不支持跨日
指令备注	选填

6.5.2.1.2.操作说明

（1）入口：【指令流程】->【指令下达】->【个股下达】；

（2）选择资金账号；

（3）编辑指令要素，要素说明见《4.3.2.1.1 参数释义》；

（4）点击指令下达按钮；

（5）弹框点击确认即完成指令下达。

6.5.3.指令审批

（1）入口：【指令流程】->【指令审批】；

（2）选择需要审批的指令，可多选；

（3）点击指令审批通过或者指令拒绝按钮；

（4）如点击指令审批通过，选择下一节点人员；

（5）点击确认，即可完成指令审批。

6.5.4.指令分发

（1）入口：【指令流程】->【指令分发】；

（2）选择需要分发的指令，可多选；

（3）点击指令分发或者指令拒绝按钮；

（4）如点击指令分发，选择下一节点人员；

（5）点击确认，即可完成指令分发。

6.5.5.指令执行

6.5.5.1.主动执行

个股指令主动执行操作步骤如下：

（1）入口：【指令流程】->【指令执行】->【主动执行】；

（2）双击待执行的指令；

（3）在执行面板编辑委托价格、委托数量。

6.5.5.2.复核执行

个股指令复核执行操作步骤如 下：

（1）入口：【指令流程】->【指令执行】->【复核执行】；

（2）双击待执行的指令；

（3）执行面板的指令要素进行核对，不可编辑；

（4）如指令下达时设置算法，可点击查看算法参数按钮进行算法参数校验；

（5）点击通过后弹框继续点击下单。

6.5.6.指令撤销

指令下达员可对自己下达的指令进行撤销。

（1）入口：【指令流程】->【指令下达】->各指令下达菜单入口；

（2）点击指令管理组件；

（3）勾选需要撤销的指令，可多选；

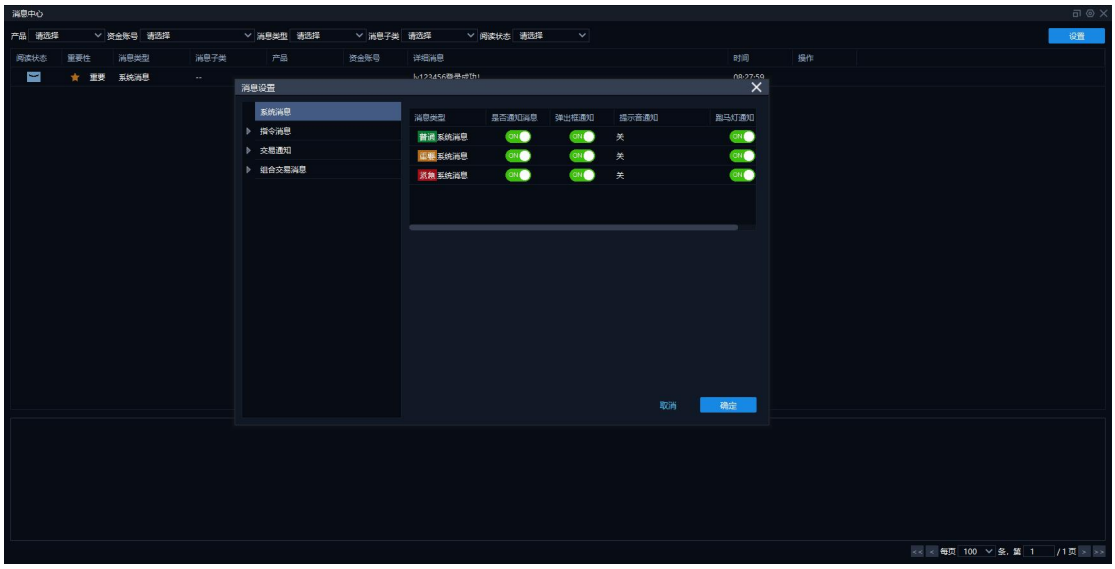
（4）点击撤销按钮；

（5）弹框点击确认，即可展示撤销结果。

6.6.运营管理

6.6.1.消息中心

展示当前用户关联的全部资金账号接收到的消息通知，支持用户按产品、资金账号、消息类型、消息子类和阅读状态筛选列表消息。支持设置系统消息、指令消息、交易通知和组合交易通知的不同通知方式的开关，如下图所示：



6.7.收藏

支持用户收藏二级菜单页面，实现快速访问。

7.特色服务

7.1.算法交易

算法交易界面展示算法交易相关产品介绍和申请使用按钮。

点击特色服务-算法交易，可进入算法交易介绍界面，主要介绍算法交易及其优势等内容，页面底部显示相关联系方式（微信号、QQ 号、邮箱）、申请使用流程及申请使用按钮。如图：

页面底部可申请试用，点进申请流程下“申请试用”或底部申请试用按钮，弹框提示“确定申请开通算法交易功能？”。具体流程如下：

7.2.多品种套利

多品种套利界面展示多品种套利交易相关产品介绍和申请使用按钮。

点击特色服务-多品种套利，可进入多品种套利介绍界面，主要介绍套利的本质、常见难点、多品种套利解决方案及优势等内容，页面底部显示相关联系方式（微信号、QQ 号、邮箱）、申请使用流程及申请使用按钮。如图：

页面底部可申请试用，点进申请流程下“申请试用”或底部申请试用按钮，弹框提示“申请成功，请耐心等待”。具体流程如下：

7.3.量化投研平台

量化投研平台功能界面展示相关产品介绍和申请使用按钮。

点击 MATIC 客户端上方特色服务-量化投研平台菜单可进入量化投研平台介绍界面，页面底部显示相关联系方式（微信号、QQ 号、邮箱）、申请使用流程，及申请使用按钮。如图：

页面底部可申请使用，点进申请流程下“申请使用”进入申请页，依照规范填写申请表，提交成功后有提示语提示“耐心等待”。每位客户最多填写 10 次，如超过次数弹框提示申请次数超过限制，具体流程如下：

同时，页面底部有“申请使用”按钮，点击按钮同样弹出以上申请表。

7.4.低延时实验室

低延时实验室功能界面展示相关产品介绍、线路图及合作生态。

点击 MATIC 客户端上方特色服务-低延时实验室菜单可进入低延时实验室介绍界面，页面底部显示相关联系方式（微信号、QQ 号、邮箱）。如图：

8.开户

点击顶部一级菜单“开户”，可进入开户页面，您可通过手机扫描二维码进入华泰期货互联网开户平台，在页面内按照提示填写相关信息进行线上开户。

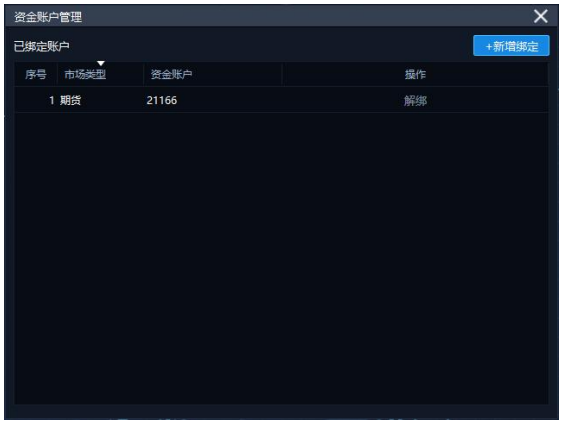
如您已完成开户，但未在 Maitc 绑定期货资金账号，则可通过单击“已完成开户，绑定账号”前往账户管理界面进行资金账号绑定。

9.系统

9.1.资金账户

9.1.1.账户管理

点击“系统-资金账户-账户管理”，打开“资金账户管理”页面，页面内容如下：



点击新增绑定，选择市场类型（单选），填写资金账户和密码，点击绑定按钮，通过匹配性校验后，即绑定成功，否则绑定不成功。绑定成功后，在已绑定账户列表新增一条资金账号信息。

注意：新增绑定可操作时间为每天 8：40-16：30 和 20：40-次日 2：00，请在此时间段内操作。新增绑定后，重新登录客户端正式生效。同一市场类型仅支持绑定一个资金账户。

对于已绑定账户，点击列表操作栏中解绑按钮，弹出确认解绑的弹框提示，点击确认可操作解绑资金账户，注意：解绑可操作时间为每天 15：30-20：00，请在此时间段内操作。解绑后，重新登录客户端正式生效。

9.2.关于

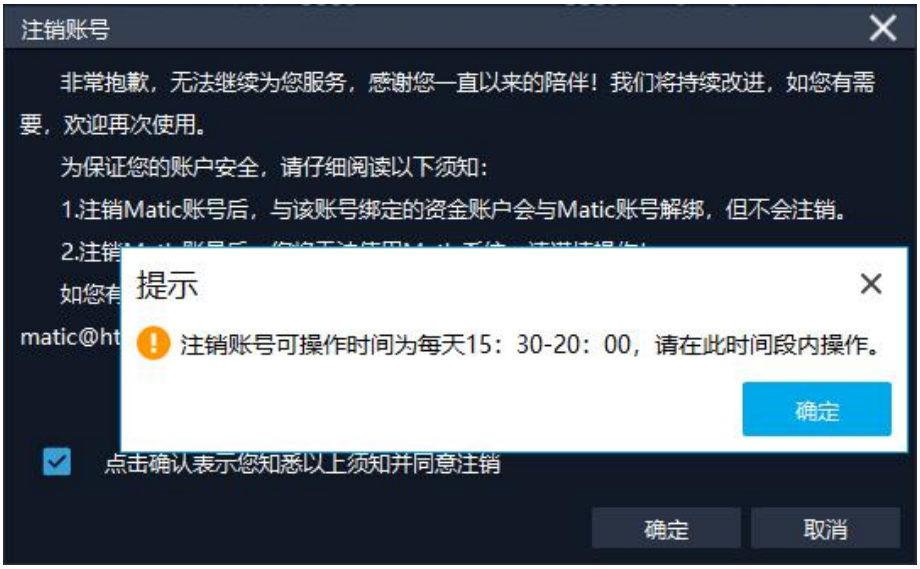
9.2.1.关于我们

关于我们页面，展示终端开发方的公司网站、服务邮箱，服务热线等信息，同时展示本软件开发过程中使用的库以及第三方软件协议。

9.2.2.注销账号

注销账号功能仅针对个人客户开放。点击注销账号，打开注销账号页面，勾选确认同意注销，即可注销当前登录所使用的 Maitc 账号。

注意：注销账号可操作时间为每天 15：30-20：00，请在此时间段内操作。注销账号后，该账号不可用，系统将退回到客户端登录页。



10.组件列表

展示本系统可供使用所有组件，包含常用组件、交易组件、其他组件，期权交易等类别，每个组件类别下有多种组件可供选择。支持按组件名称搜索功能。

组件类别	组件明细
常用组件	普通交易下单（含资产和持仓）、期货下单、期货委托明细、期货行情、消息中心、账户资产，通用委托成交表格组件、通用持仓。
交易组件	多账户交易
其他组件	指令委托列表，通用行情组件
期权交易	T 型行情，期权交易、期货期权交易、期货期权委托明细、期货期权行情、期货期权闪电下单

11.用户数据上传下载

用户数据上传下载配置，包含上传用户设置、上传自定义布局、下载用户设置，下载自定义布局等功能模块。

12.设置

系统设置包含交易设置、账号设置、密码设置，客户端设置四大模块，每个模块下又包含对应的子模块，具体见下表。

设置大模块	设置子模块
交易设置	全局交易设置、基础交易设置、指令交易设置、期货交易设置、价格笼子设置、交易费率设置、期权交易设置、期货期权交易设置、组合交易设置
账号设置	账号简称设置、账号优先级设置，股东账号设置
密码设置	交易密码校验
客户端设置	通用设置、修改密码、监控剪贴板、系统公告，关于

12.1.交易设置

12.1.1.全局交易设置

分为全局交易设置和价格浮动设置（仅支持普通交易和组合交易）。

12.1.2.基础交易设置

分为常用数量和金额、可买/可卖数量比例显隐设置（仅支持普通交易）、单笔委托数量上限（仅支持普通交易）、限价买卖价格初始设置（仅适配普通交易）、行情联动设置（仅适配普通交易）。

12.1.3.指令交易设置

包括指令执行设置、单笔委托数量上线（暂时仅适配个股指令）。

12.1.4.期货交易设置

设置不同交易操作的默认价格类型、默认数量以及是否进行二次确认。

12.1.5.价格笼子设置

包括价格笼子应用设置和价格笼子参数设置，见下图：

当前设置发生变化且未保存，切换模块时弹出保存设置二次确认弹窗。

12.1.6.交易费率设置

包括交易费率启用开关、上交所交易费率、深交所交易费率、费率说明。

12.1.7.期权交易设置

包括下单习惯、拆单设置、默认价格价格类型三部分，支持用户设置三键/四键下单，

设置期权下单单笔委托的拆单规则，选择默认价格类型。

12.1.8.期货期权交易设置

包括闪电下单拆单设置、期货期权交易下单操作设置。

12.1.9.组合交易设置

包括组合委托、组合导入设置、补单弹窗设置、其他设置。

12.2.账号设置

账号设置包含账号简称设置、账号优先级设置，股东账号设置。

12.2.1.账号简称设置

双击目标账号的账号简称单元格，即可编辑账号简称。

12.2.2.账号优先级设置

点击目标账号上下拖动可调整目标账号优先级顺序。

12.3.密码设置

密码设置包含交易密码校验。支持资金账户的密码校验。

注意：密码校验成功后，需重新登录客户端才可进行交易。

12.4.客户端设置

客户端设置包含通用设置、修改密码、监控剪贴板、系统公告，关于等模块。

12.4.1.通用设置

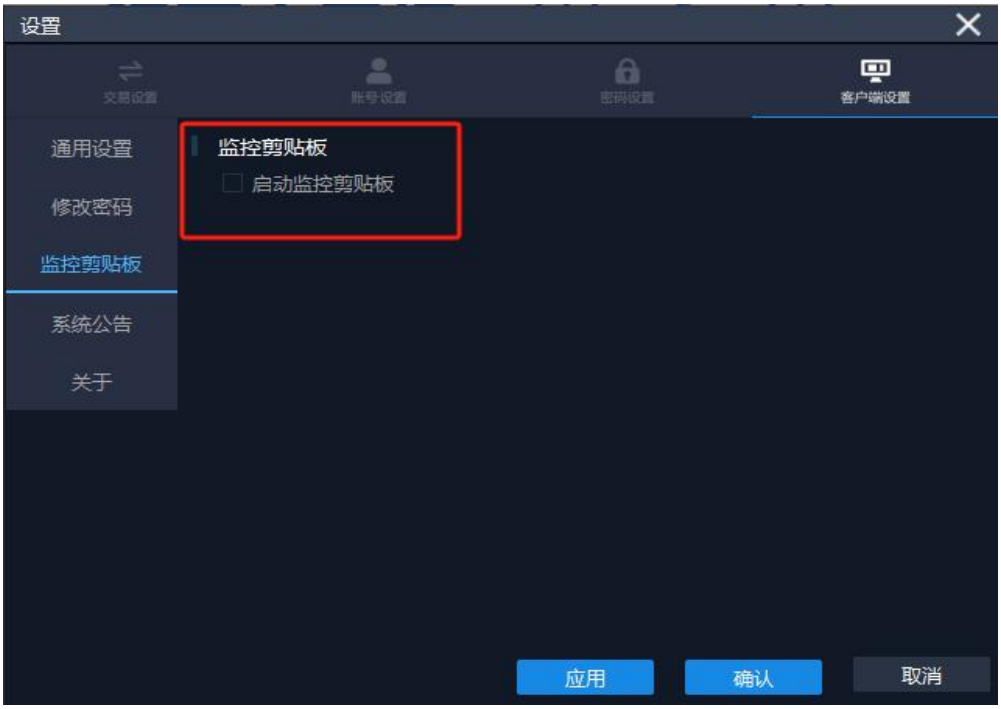
包括客户端字体缩放、客户端锁定、预留信息设置三部分设置。

12.4.2.修改密码

通过验证原密码的方式修改当前用户登录密码。

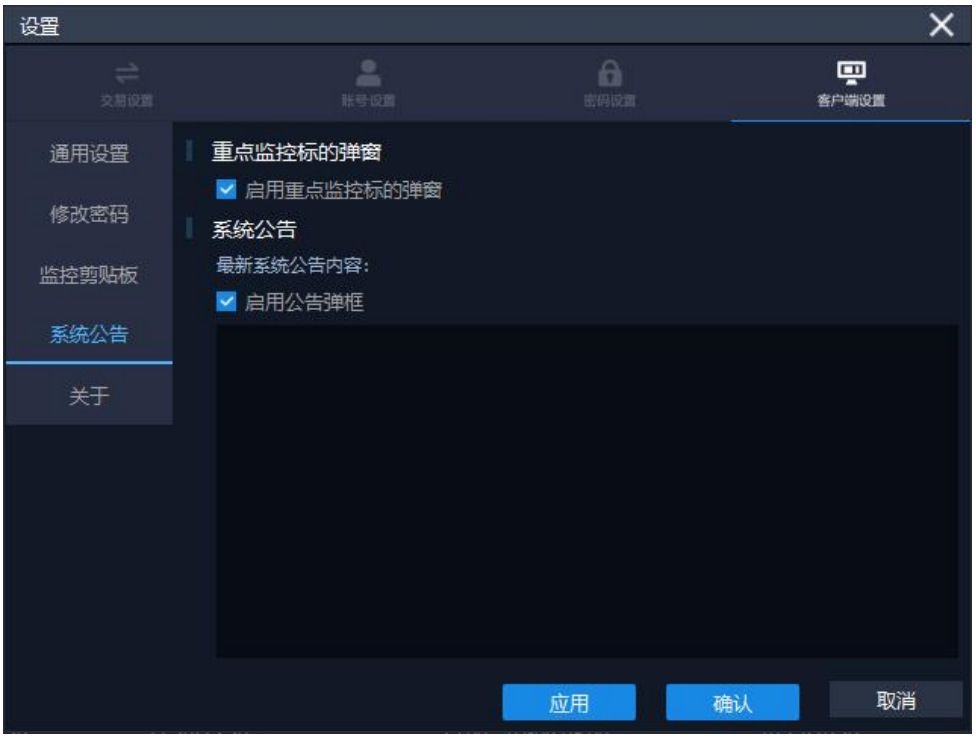
12.4.3.监控剪贴板

剪贴板监控开关，默认不开启。



12.4.4.系统公告

包含重点监控标的弹窗、系统公告两部分。



13.下载中心

展示当日下载文件列表，支持按文件类型和状态进行筛选。