

金阳光QMT 特色功能介绍

文档版本V202504

发布日期 20250403

修改记录

版本号	修改日期	修改人	修改说明
V202404	20240419	陈健鹏、 陈洁	<ol style="list-style-type: none">1.修订ETF申赎和套利2.组合交易增加交易类型沪、深港通3.两融交易新增担保品划转补充交易界面和操作4.新增配股配债补充交易界面和操作5.新增批量埋单功能，以DBF文件形式进行下单和委托回报，补充交易界面和操作6.新增银证转账功能，银行转证券/证券转银行/数据查询，补充界面和操作7.新增资金划拨，支持资金划拨功能，补充界面和操作8.修订账号准备
V202405	20240523	陈健鹏	<ol style="list-style-type: none">1. 增加期货公司2. 针对上海level2行情进行更新
V202504	202504	关文雅	<ol style="list-style-type: none">1.更新绑定资金账号时相关配置信息

目录

一、 账号准备	1
1.1 绑定集中交易柜台资金账号	1
1.2 绑定顶点极速柜台资金账号	3
1.3 绑定信用账号	4
1.4 绑定期货账号	7
1.5 绑定期权账号	7
1.6 资金账号查看	8
二、 高速 Level-2 行情	9
2.1 买卖盘口	10
2.2 深交所千档行情	13
2.3 逐笔成交	14
2.4 分时成交	15
2.5 行情图	17
2.6 全息行情	21
2.7 委托队列	22
2.8 深交所逐笔委托	22
2.9 资讯、财务诊断	23
2.10 行情基本信息	24
2.11 分价表	24
2.12 走势图和相关行情	25
2.13 龙虎看盘	26
三、 自定义布局和多屏扩展	27
四、 多组行情和交易联动	30
五、 星空图	39
六、 交易点在行情图上标识	46
七、 一键打新、 一键调仓、 一键撤单	47
7.1 一键打新	47
7.2 一键调仓	49
7.3 一键撤单	49
八、 条件单（预埋单、触价单）	50
九、 算法交易	53
9.1 多种交易模式	53
9.2 算法交易	54

9.3 随机量交易	57
十、组合交易	59
10.1 篮子管理	59
10.2 篮子交易	61
10.3 一键调仓	62
10.4 期现套利	63
10.5 交易类型	64
①买入	64
②卖出	65
③一键买卖	65
⑤期货交易	66
⑥一键期货	67
⑦港股通	67
十一、策略回测	69
11.1 创建策略	69
11.2 策略回测	75
11.3 策略运行	80
11.4 操作记录	83
十二、策略交易	85
十三、网格交易策略	88
13.1 网格交易特色	88
13.2 操作流	90
13.3 参数说明	93
13.4 应用举例	95
十四、两融交易	103
14.1 担保品买卖	103
14.2 融资融券	106
14.3 担保品划转	112
十五、资金划拨	113
十六、期货交易和期现套利	115
16.1 普通交易	115
16.2 期货展期	117
16.3 期货套利	118
16.4 期现套利	121

十七、自定义风控设置	121
17.1 账号风控	121
17.1.1 黑白名单	122
17.1.2 交易量价限制	123
17.1.3 交易所合规	125
17.1.4 资产组合风控	126
17.2 风控密码管理	127
十八、配股配债	128
18.1 配股交易	128
18.2 配债交易	129
十九、批量埋单	130
二十、银证转账	132
20.1 银行转证券	132
20.2 证券转银行	133
20.3 数据查询	133

一、 账号准备

请用户根据业务开通情况，绑定相应账号。

如需开展沪港通、深港通交易，可选择对应账号类型进行账号绑定，并在经纪公司一栏选择“光大证券沪港通”或者“光大证券深港通” 登录操作即可。

1.1 绑定集中交易柜台资金账号

金阳光 QMT 客户端支持对接集中交易柜台， 只需将 QMT 绑定集中交易柜台资金帐号

即可。

如下图所示，添加路径为【设置】->【账号管理】->【添加】。

其中【账号类型】选“股票账号”；

【交易平台】选“光大证券SPX实盘”；

【经纪公司】选“集中交易001”

【资金账号】输入集中交易柜台的资金账号；

【密码】是集中交易柜台资金账号的密码，输入两遍；

点击【登录校验】看到“登陆成功”；

点击【确认】查看登录状态。



图1 集中交易柜台账号添加

若还绑定了除集中交易柜台账号之外的其他股票账号，请在交易股票之前，勾选需要下

单的账号。

1.2 绑定顶点极速柜台资金账号

金阳光QMT客户端支持对接顶点HTS极速柜台，只需将QMT绑定顶点HTS极速柜台资金帐号即可。

如下图所示，添加路径为【设置】->【账号管理】->【添加】。

【账号类型】选“股票账号”；

【交易平台】选“光大证券HTS股票实盘”；

【经纪公司】选“顶点HTS股票”；

【资金账号】输入对应的资金账号；

【密码】是对应账号的密码，输入两遍；

点击【登录校验】看到“登陆成功”；

点击【确认】查看登录状态。



图2 极速柜台账号添加

1.3 绑定信用账号

金阳光 QMT 已经支持对接两融交易，只需要将 QMT 绑定两融资金帐号即可。

如下图所示，【设置】->【账号管理】->【添加】。

【账号类型】选“信用账号”；

【交易平台】选“光大证券SPX实盘”

【经纪公司】选“光大证券信用”；

【资金账号】输入融资融券的资金账号；

【密码】是融资融券账号的密码，输入两遍；

点击【登录校验】看到“登陆成功”；

点击【确认】，查看登录状态

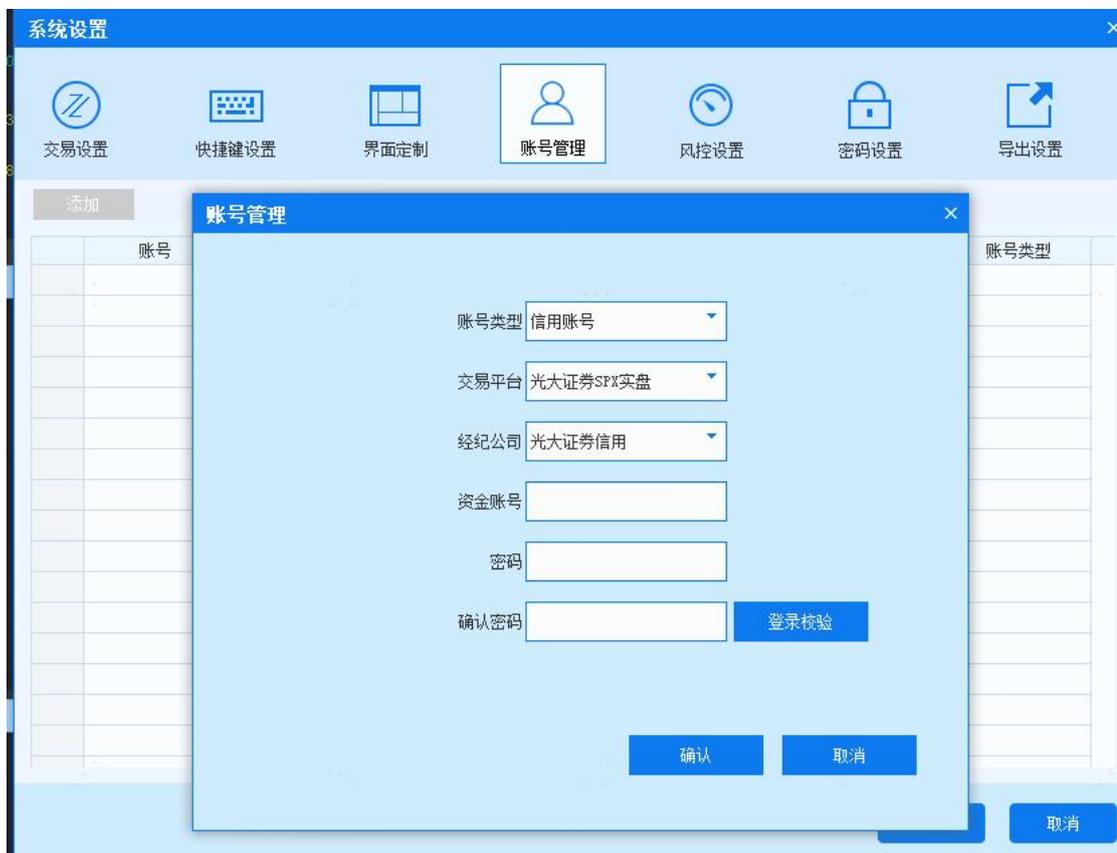


图3 两融资金帐号添加



图4 两融下单面板-使用两融合资金帐号下单绑定成功后，就可以到融资融券页面去进行信用交易。

金阳光QMT客户端支持对接两融交易，只需要将QMT 绑定顶点HTS极速柜台两融帐号即可。

如下图所示，添加路径为【设置】->【账号管理】->【添加】。

【账号类型】选“信用账号”；

【交易平台】选“光大证券HTS两融实盘”

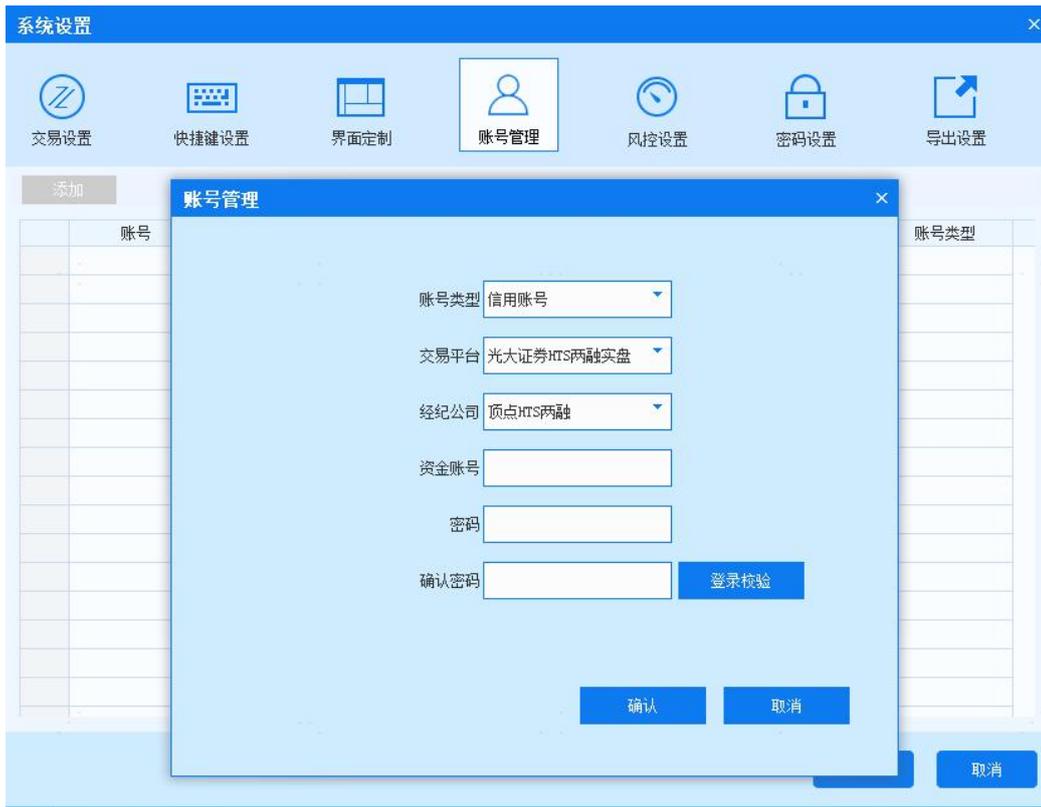
【经纪公司】选“顶点HTS两融”；

【资金账号】输入对应的资金账号；

【密码】是对应账号的密码，输入两遍；

点击【登录校验】看到“登陆成功”；

点击【确认】查看登录状态。



1.4 绑定期货账号

金阳光QMT客户端支持对接期货交易，只需要将QMT 绑定期货帐号即可。

如下图所示，添加路径为【设置】->【账号管理】->【添加】。

【账号类型】选“期货账号”；

【经纪公司】可选“华西期货、东兴期货、长江期货、国投安信期货、光大期货、广发期货、建信期货”；

【资金账号】输入对应的资金账号；

【密码】是对应账号的密码，输入两遍；

点击【登录校验】看到“登陆成功”；

点击【确认】查看登录状态。



1.5 绑定期权账号

金阳光 QMT 客户端支持对接股票期权交易，只需要将 QMT 绑定股票期权帐号即可。如下图所示，添加路径为【设置】->【账号管理】->【添加】。

- 【账号类型】选“股票期权账号”；
- 【经纪公司】选“光大个股期权实盘”；
- 【资金账号】输入对应的资金账号；
- 【密码】是对应账号的密码，输入两遍；
- 点击【登录校验】看到“登陆成功”；
- 点击【确认】查看登录状态。

1.6 资金账号查看

通过依次点击【设置】->【账号管理】，如下图所示，可以查看已绑定的资金账号和状态信息。

序号	账号	账号名称	登录状态	总资产	可用资金	操作	账号类型
1	06002535	刘浩	登录成功	12955525.60	11582031.66	删除	期货账号
2	40612236	name40612236	登录成功	1169521937.76	177556551.46	删除	股票账号
3	65602304	no.name	登录成功	0.00	0.00	删除	信用账号
4	65602283	no.name	登录成功	100046671.73	99903617.37	删除	信用账号

图5 股票账号

序号	账号	账号名称	登录状态	总资产	可用资金	操作	账号类型
1	00002563	刘浩	登录成功	12335525.86	11582031.66	删除	期货账号
2	40612236	name40612236	登录成功	1169521937.76	177556551.46	删除	股票账号
3	65602304	no.name	登录成功	0.00	0.00	删除	信用账号
4	65602283	no.name	登录成功	100046671.73	99903617.37	删除	信用账号
5	40610645	name40610645	登录成功	1104664549067.46	1104267521112.04	删除	股票账号

二、高速 Level-2 行情

金阳光 QMT 提供沪深交易所的 Level-2 行情（以下简称 L2 行情），包括十档快照、逐笔成交、深圳千档行情、深圳逐笔委托等深度行情信息。服务端利用交易所信息公司云平台进行行情发布。

两市 L2 行情整体展示效果如下图：



图7 QMT 行情界面

8 个区域依次为：

- 1、行情图区，默认为分时图，还可以切换为分笔数据、K 线图等。
- 2、买卖总量。
- 3、L2 行情的委托队列区。还可以切换为资讯、财务诊断以及 L2 特有的逐笔委托。
- 4、基本信息区。
- 5、L2 行情的逐笔成交区。
- 6、深圳特有的千档行情区。
- 7、买卖盘口区。L1 时只有 5 档，L2 时有 10 档和 15 档。
- 8、分时成交区。还可以切换分价成交、走势图、相关证券和龙虎榜。

2.1 买卖盘口

L2 601788 光大证券			
卖⑩	11.75	809	
卖⑨	11.74	2947	
卖⑧	11.73	846	
卖⑦	11.72	437	
卖⑥	11.71	542	
卖⑤	11.70	2089	
卖④	11.69	667	
卖③	11.68	401	
卖②	11.67	358	
卖①	11.66	59	+2
最新	11.66	现手	7
买①	11.65	66	+5
买②	11.64	418	
买③	11.63	535	
买④	11.62	633	
买⑤	11.61	802	
买⑥	11.60	1502	
买⑦	11.59	1054	
买⑧	11.58	473	
买⑨	11.57	200	
买⑩	11.56	179	

L1 601788 光大证券			
卖⑤	11.70	2089	
卖④	11.69	667	
卖③	11.68	400	
卖②	11.67	358	
卖①	11.66	147	
最新	11.65	现手	65
买①	11.65	138	+35
买②	11.64	387	
买③	11.63	535	
买④	11.62	633	
买⑤	11.61	802	

图8 QMT 上海 L2/L1 买卖盘口
 盘口信息界面的左上角有【L1/L2】，
 L1 显示上下五档数据，L2 显示上下 10 档数据。



图9 QMT 深圳 15 档盘口

对于深圳市场，另有千档行情和优化十档行情展示，通过 L1/L2 按钮旁边的蓝色【15/千/10】按钮进行切换。千档行情基于逐笔委托撮合，更新速度优于普通十档。

千档盘口				L2 千	000100	TCL 集团	
二④	4.34	58	4222	卖⑩	4.18	22067	
二③	4.33	77	4834	卖⑨	4.17	8706	
二②	4.32	65	4147	卖⑧	4.16	19063	
二①	4.31	32	1252	卖⑦	4.15	54150	
二〇	4.30	316	19139	卖⑥	4.14	23408	
十⑨	4.29	124	10541	卖⑤	4.13	29950	
十⑧	4.28	188	13150	卖④	4.12	77492	
十⑦	4.27	42	1545	卖③	4.11	63139	+1
十⑥	4.26	104	12650	卖②	4.10	82942	-10
十⑤	4.25	228	11981	卖①	4.09	25801	-109
十④	4.24	74	2381	最新	4.09	现手	119
十③	4.23	102	3792	买①	4.08	69576	-10
十②	4.22	120	8770	买②	4.07	45112	
十①	4.21	89	4023	买③	4.06	31038	
卖⑩	4.20	618	28215	买④	4.05	32081	
卖⑨	4.19	282	20021	买⑤	4.04	27721	
卖⑧	4.18	495	22689	买⑥	4.03	26376	
卖⑦	4.17	172	8769	买⑦	4.02	36350	
卖⑥	4.16	406	19080	买⑧	4.01	17243	
卖⑤	4.15	1158	54358	买⑨	4.00	25930	
卖④	4.14	376	26120	买⑩	3.99	6783	

图10 QMT 深圳千档行情与 10 档行情

点击蓝色按键，当变成【千】时，买卖盘口变成 10 档快照，而在快照的左边另开辟了一个千档盘口窗口，如上图所示。再次点击该按钮，千档窗口将自动隐藏。

2.2 深交所千档行情

千档盘口			
二④	4.35	128	20815
二③	4.34	58	4321
二②	4.33	76	4833
二①	4.32	84	4146
二〇	4.31	31	1251
十⑨	4.30	316	19163
十⑧	4.29	123	10540
十⑦	4.28	187	13149
十⑥	4.27	42	1644
十⑤	4.26	103	12649
十④	4.25	227	11980
十③	4.24	73	2380
十②	4.23	100	3691
十①	4.22	118	8702
卖⑩	4.21	89	4047
卖⑨	4.20	618	27244
卖⑧	4.19	284	20377
卖⑦	4.18	495	22990 +30
卖⑥	4.17	175	10170
卖⑤	4.16	413	18180
卖④	4.15	1172	54283 +20
卖③	4.14	395	30965 +100
卖②	4.13	423	26974 +20
卖①	4.12	968	41902 +11
最新	4.12	现手	1
买①	4.11	99	32944 -3
买②	4.10	221	46013 -20
买③	4.09	85	57261
买④	4.08	323	29415 -15
买⑤	4.07	259	19753
买⑥	4.06	248	25224
买⑦	4.05	400	31005
买⑧	4.04	295	26433
买⑨	4.03	450	24987 -100
买⑩	4.02	212	36082
十①	4.01	253	15951
十②	4.00	516	25387
十③	3.99	107	6495
十④	3.98	167	11732
十⑤	3.97	44	3039
十⑥	3.96	85	4443
十⑦	3.95	76	3510
十⑧	3.94	21	1305
十⑨	3.93	24	2056
二〇	3.92	28	1533
二①	3.91	24	615
二②	3.90	74	2071
二③	3.89	17	1101

图11 QMT 深圳千档行情

千档行情是深交所特有的行情，一般情况下速度优于L2 十档行情。

千档行情理论上买卖档位无限制，但由于受界面高度的限制，只显示卖 1~卖24 和买 1~23，共 47 档盘口。

2.3 逐笔成交

时间	价格	数量	方向	其他
13:36:14	11.64	6	买	6
5	11.64	9	买	9
6	11.64	1	买	1
7	11.64	1	买	49
8	11.64	2	买	2
9	11.64	24	买	28
13:36:20	11.65↑	1	买	1
13:36:27	11.65	1	买	49
13:36:43	11.64↓	1	买	1
13:36:44	11.65↑	1	买	49
13:36:47	11.64↓	3	买	28
2	11.64	2	买	2
3	11.64	5	买	5
4	11.64	3	买	42
5	11.64	1	买	1
6	11.64	28	买	30
13:36:51	11.64	2	买	2

图12 QMT 逐笔成交

逐笔成交根据交易所数据进行毫秒级的刷新，界面如上图。刷新频率取决于股票的成交活跃度。如下图所示，从左到右依次是：

第一列成交序号：黄字所示，为同一秒内的成交的笔数。下图展示的是 13:36:47 秒到48 秒之间一共有 6 笔成交。

13:36:47
2
3
4
5
6

图13 逐笔成交时间

第二列为成交价格：下图所示红色表示高于昨收价，绿色表示低于昨收价。白色表示持平。红色向上箭头↑表示此笔的成交价格大于前一笔的成交价格；绿色向下箭头↓表示此笔

的成交价格小于前一笔的成交价格。

11.65↑
11.65
11.64↓

图14 逐笔成交价格

第三列成交手数：红色的成交量代表该笔成交是主动性买入，绿色的成交量代表该笔成交是主动性卖出。

第四列和第五列为一秒之内的总手数：如下图所示分为卖单和买单，分别用绿色和红色数字表示。底色为蓝色的一方是主动成交方，数字前面的箭头表示该委托单在这笔之前已有

成交，数字后面的箭头表示还未完全成交，之后还有成交。



图15 一秒之内的总手数

逐笔成交买卖单折叠：收起/显示买卖单。点击逐笔成交右上角的横杠按钮，可以切换收起买卖单或者显示买卖单，见下图。



图16 收起/显示买卖单

2.4 分时成交

分时成交：如下图所示，为传统 L1 行情展示，每 3 秒刷新一次，显示 3 秒内累计的成交量和最后一笔的成交价格，分时成交可能是一笔或多笔成交的集合。红色表示高于昨收价，绿色表示低于昨收价，白色表示持平。红色向上箭头↑表示此笔的成交价格大于前一笔的成交价格；绿色向下箭头↓表示此笔的成交价格小于前一笔的成交价格。底色为蓝色的一条表示最新的数据。

例如，下图最后一笔数据的含义是：在 3 秒内，共成交 3 手，最后一笔的成交价格是 11.69 元。



The image shows a screenshot of a financial data interface. It displays a list of minute transactions with columns for time, price, and volume. The price column uses green text for downward movements and red text for upward movements, accompanied by small arrows. A blue bar highlights the last row of data. At the bottom, there are navigation tabs: '分笔' (Minute Transactions), '分价' (Price), '走势' (Trend), '相关' (Related), and '龙虎' (Dragon and Tiger).

Time	Price	Volume
13:53:02	11.69	3
:08	11.69	8
:11	11.68↓	87
:14	11.70↑	8
:20	11.68↓	17
:26	11.69↑	26
:40	11.69	1
:43	11.68↓	1
:46	11.69↑	3

图17 QMT 分时成交

2.5 行情图



图18 QMT 分时图

行情图区域默认显示的是分时图和买卖总量柱状图。用键盘敲击数字，能切换到相应的K线图或者分笔数据图。点击右下角的【全息】按钮，会弹出全息行情界面。



图19 QMT 按键对应的图形



图20 1分钟K线图



图21 分笔成交图

2.6 全息行情



图22 QMT 深圳全息行情

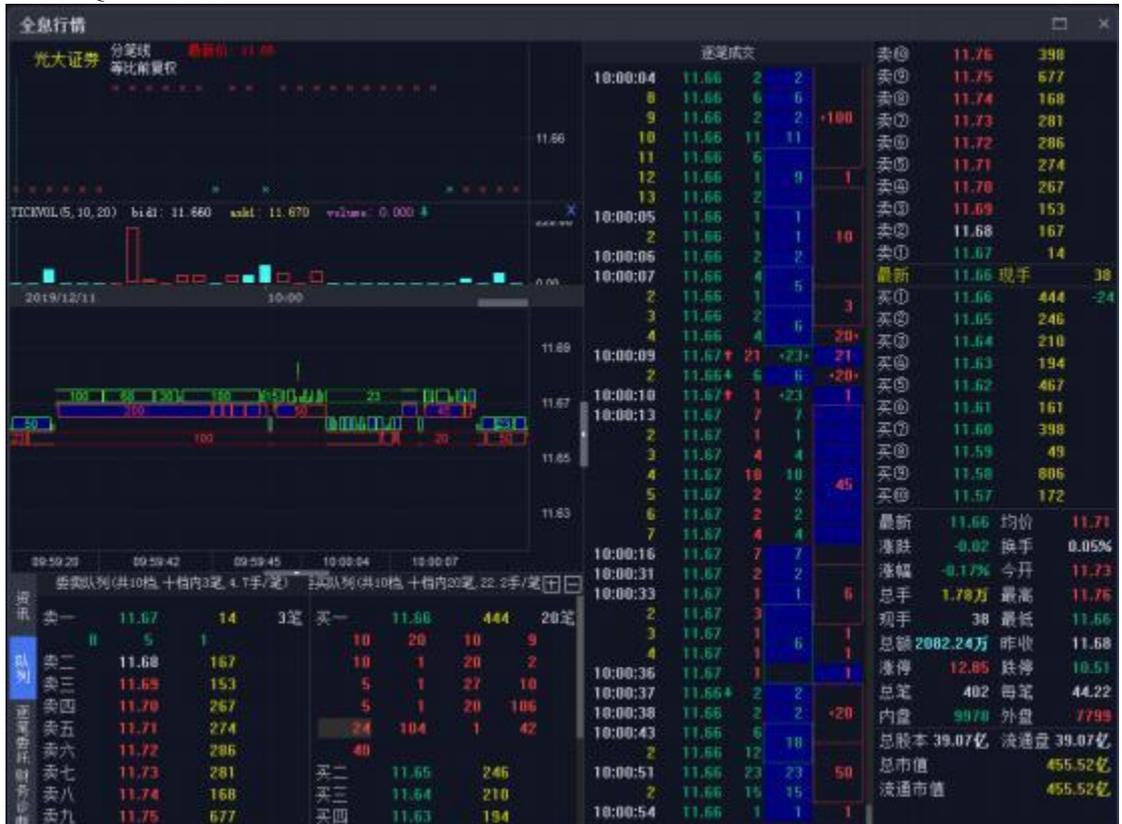


图23 QMT 上海全息行情

全息高速盘口：由分笔线图、逐笔交易图、委买委卖队列、逐笔成交、千档盘口（深圳 专有）、买卖 10 档盘口、行情基本信息等 7 个子窗口组成，可以完整揭示交易所交易主机的交易撮合过程，提供最全面的行情信息，最快速的行情刷新速度，以及最透明的行情细节

揭示。上两图分别展示了深圳和上海的全息行情。

2.7 委托队列

委卖队列 (共10档, 十档内42笔, 14.8手/笔)				委买队列 (共10档, 十档内36笔, 23.2手/笔)					
卖一	11.69	178	19笔	9.4手/笔	买一	11.68	21	4笔	5.2手/笔
卖二	11.70	442			买二	11.67	367		
卖三	11.71	295			买三	11.66	448		
卖四	11.72	247			买四	11.65	298		
卖五	11.73	515			买五	11.64	104		
卖六	11.74	516			买六	11.63	226		
卖七	11.75	464			买七	11.62	467		
卖八	11.76	478			买八	11.61	160		
卖九	11.77	518			买九	11.60	496		
卖十	11.78	794			买十	11.59	45		

图24 QMT 委托队列

委托队列是 L2 行情买盘和卖盘的实时分笔委托明细，是申买量一（即最佳买入价）上前 50 笔分 s 笔委托和申卖量一（即最佳卖出价）上前 50 笔分笔委托。委托队列可以查看买卖委托单明细，观察单笔委托单大小。第一时间洞察最新的委托，以及哪些委托已被撮合成交。

2.8 深交所逐笔委托

时间	方向	价格	手数	金额	撤单
10:18:53	B	3.98	10	3980.00元	2 S 4.00 10 4000.00元
7	B	4.00	3	1200.00元	3 B 3.99 81 3.23万
8	S	3.99	60	2.39万	4 S 4.00 1 400.00元
9	B	3.99	9	3591.00元	5 B 3.99 4 1596.00元
10:18:54	B	3.98	20	7960.00元	6 S 4.00 20 8000.00元
2	S	4.00	25	1.00万	7 S 3.99 5 1995.00元
3	B	3.99	58	2.30万	8 S 4.00 56 2.24万
4	B	3.99	18	3990.00元	9 S 4.04 20 8080.00元
5	S	4.20	11	4620.00元	10 B 3.99 127 5.07万
6	S	4.03	35	3500.00元	11 B 3.99 5 1995.00元
7	S	4.00	15	6000.00元	12 B 3.99 9 3591.00元
8	B	4.01	8	3208.00元	10:18:56 S 4.00 4 1600.00元
9	S	4.03	283	8.18万	2 S 3.99 28 1.12万
10:18:55	B	3.98	30	1.17万	3 B 3.99 20 7980.00元

图25 QMT 深圳逐笔委托

深圳逐笔委托是 Level-2 行情中完整的逐笔成交明细列表，列举出每一笔挂单的时间、买卖方向、报价、手数、金额和撤单情况，以及当日截止当前挂单和撤单的总笔数。

2.9 资讯、财务诊断



图26 QMT 资讯和财务诊断

2.10 行情基本信息

最新	11.72	均价	11.67
涨跌	0.02	换手	0.20%
涨幅	0.17%	今开	11.71
总手	8.00万	最高	11.74
现手	1	最低	11.60
总额	9334.74万	昨收	11.70
涨停	12.87	跌停	10.53
总笔	2391	每笔	33.46
内盘	35357	外盘	44639
总卖	31896	均价	12.07
总买	14754	均价	11.48
总股本	39.07亿	流通盘	39.07亿
总市值			457.87亿
流通市值			457.87亿

图27 QMT 行情基本信息

2.11 分价表

11.74	719	0.90%
11.73	3466	4.32%
11.72	3667	4.62%
11.71	3649	4.55%
11.70	4107	5.12%
11.69	7634	9.51%
11.68	7310	9.11%
11.67	9491	11.88%
11.66	13359	16.65%
11.65	12209	15.28%
11.64	5539	6.90%
11.63	3728	4.65%
11.62	3193	3.98%
11.61	1964	2.45%
11.60	4	0.00%

分笔 分价 走势 相关 龙虎

图28 QMT 分价表

分价表展示的是在各成交价格上分别成交的总手数、各价位成交的笔数、平均每笔手数、以及各价位上的成交量占总成交量的比例。

红柱代表外盘，也称主动性买盘，即股票在卖出价成交，成交价为申卖价，说明买盘比较积极。绿柱代表内盘，也称主动性卖盘，即股票在买入价成交，成交价为申买价，说明抛盘比较踊跃。

分价表的作用有：

- (1) 判断该股今日交易者持仓成本。
- (2) 判断阻力与支撑的位置。
- (3) 判断该价位成交平均每笔手数大小来分析买卖能量。
- (4) 比较自己的交易成本与市场交易成本的差距。

2.12 走势图和相关行情

走势图即分时图；相关行情就是与当前界面展示股票相关板块的其它证券行情。



图29 QMT 走势图与相关行情

2.13 龙虎看盘



图30 龙虎看盘

龙虎看盘（逐笔分析）是 L2 行情中根据主动性买入和卖出的成交量进行统计，根据盘中红色区域与绿色区域的比例用户可以直观的了解主动性买入与主动性卖出的比例。

下表仅供参考：

数据	含义
特大买入单 > 特大卖出单	主力增仓
大买入单 > 大卖出单	
特大买入单+大买入单 > 特大卖出单+大卖出单	
小买单 < 小卖单	主力减仓
特大买入单 < 特大卖出单	
大买入单 < 大卖出单	
特大买入单+大买入单 < 特大卖出单+大卖出单	
小买单 > 小卖单	

需注意的是，此数据是对历史数据的统计，不代表未来趋势。

三、自定义布局和多屏扩展

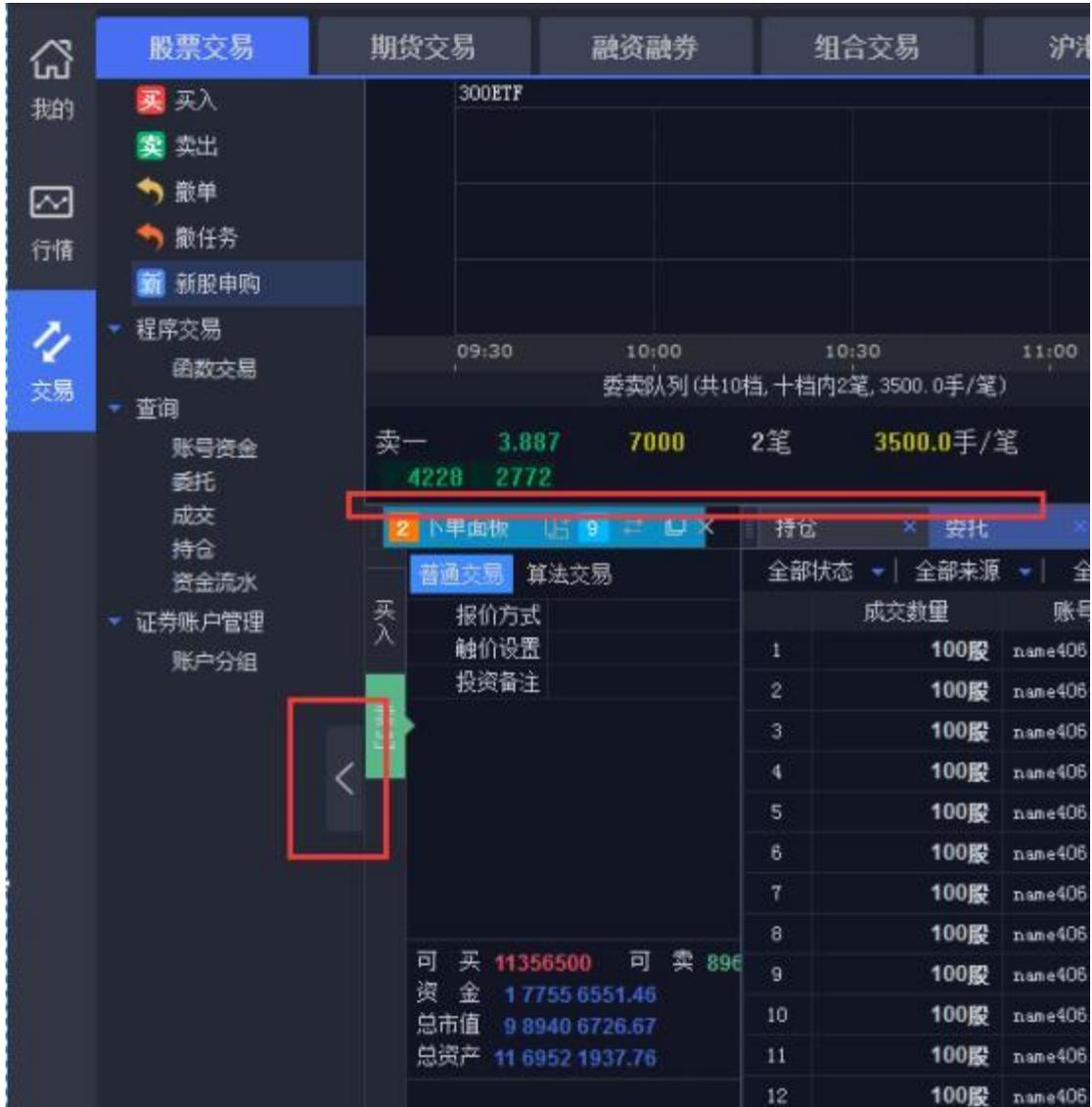


图31 可以展开、缩进、调整的子界面

QMT 页面上几乎每一个子界面都可以通过拖拽调整位置，也可以在“展开/缩进”之间切换，还能弹出成为独立界面，并自由拖拽。以下图行情页面为例：



图32 弹出页面

点击行情页面右上角的“弹出页面”按钮，可以将行情页面从主界面中独立出来，并支持自由拖拽，还可以拖拽到不同屏幕中展示。



图33 同屏展示多个证券的行情

经过反复的“复制页面”、“弹出页面”和拖拽，可以实现同屏展示多个证券的行情。上图就利用两个屏幕同时展示 7 支不同股票的行情。



图34 嵌入主界面

也可以通过点击按钮，将弹出的页面嵌回主界面。

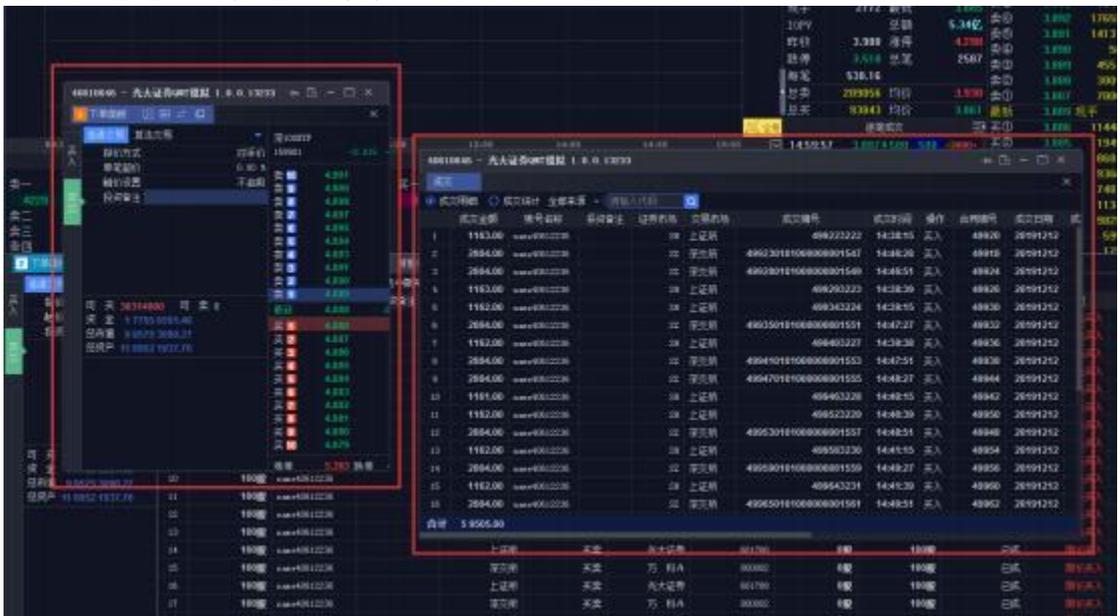


图35 弹出下单面板和成交信息

除了行情页面之外，下单面板、成交信息等子界面都可以独立出主界面展示。

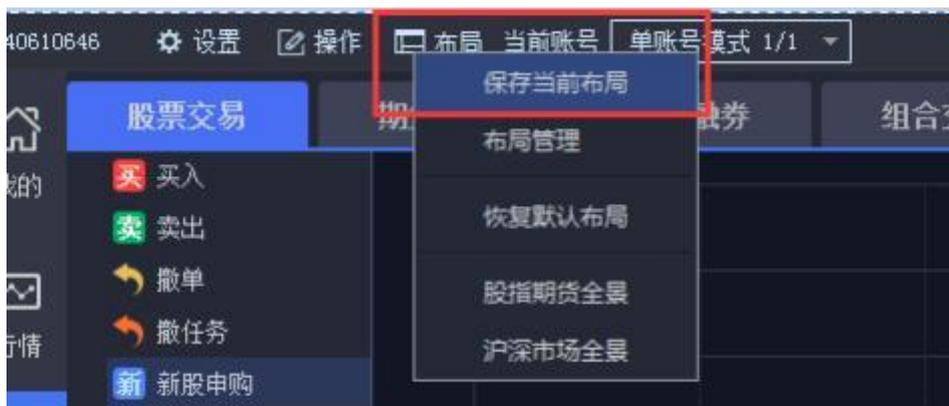


图36 保存布局

对调整后的布局进行保存，再次登录 QMT 时界面会自动调整为已保存的布局。

四、多组行情和交易联动

交易界面由上半部分的行情模块和下半部分的交易模块组成。无论是行情模块还是交易模块，都可以复制，最多 9 份。





图37 复制下单面板

步骤 1: 复制交易页面。如上图所示, 在下单面板, 点击右上角的“复制页面”按钮, 复制出 2 号交易页面。此页面选中的股票与 1 号页面相同, 并且二者之间是相互独立、互不干扰。



图38 复制行情页面



图39 2个行情页面+2个下单面板

步骤 2：复制行情页面。此时界面上有 2 个行情页面+2 个交易页面。为了整齐，可以把 1 区行情关联 1 号下单面板，2 区行情关联 2 号下单面板。交叉关联也是允许的。

11.61 均价	601788	11.61 均价
-0.06 换手 0.21%	卖⑩ 11.71 3	关联 1
-0.51% 今开 11.69	卖⑨ 11.70 7	关联 2
8.03万 最高 11.74	卖⑧ 11.69 5	关联 3
4 最低 11.60	卖⑦ 11.68 4	关联 4
3356.84万 昨收 11.67	卖⑥ 11.67 6	关联 5
12.84 跌停 10.50	卖⑤ 11.66 3	关联 6
2745 每笔 29.24	卖④ 11.65 338	关联 7
0 外盘 0	卖③ 11.64 147	关联 8
27051 均价 12.08	卖② 11.63 397	关联 9
7588 均价 11.45	卖① 11.62 17	
39.07亿 流通盘 39.07亿	最新 11.61 现手 4	
	买① 11.61 174 -3	
	买② 11.60 627	
	买③ 11.59 641	
	买④ 11.58 614	
	买⑤ 11.57 180	
	买⑥ 11.56 409	
	买⑦ 11.55 1162	
	买⑧ 11.54 78	

1 1.63 均价	601788 光大证券
-0.04 换手 0.21%	卖⑩ 11.72 631
-0.34% 今开 11.69	卖⑨ 11.71 308
8.06万 最高 11.74	卖⑧ 11.70 710
20 最低 11.60	卖⑦ 11.69 526
3393.18万 昨收 11.67	卖⑥ 11.68 494
12.84 跌停 10.50	卖⑤ 11.67 666
2750 每笔 29.30	卖④ 11.66 365
0 外盘 0	卖③ 11.65 338
27006 均价 12.08	卖② 11.64 147
7383 均价 11.44	卖① 11.63 369 -12
39.07亿 流通盘 39.07亿	最新 11.63 现手 20
	买① 11.61 5 +4
	买② 11.60 561
	买③ 11.59 641
	买④ 11.58 614
	买⑤ 11.57 180
	买⑥ 11.56 409
	买⑦ 11.55 1162
	买⑧ 11.54 78

图40 将行情页面之一关联 1 号位

步骤 3：将 1 区的行情关联 1 号位。点击行情右上角的关联按钮，选中橙色的“关联 1”。这个行情页面的左上角便多了一个橙色的“1”。



图41 将下面面板之一关联 1 号位

步骤 4：将 1 号下单面板也关联 1 号位。点击 1 号下单面板右上角的关联按钮，选中橙色的“关联 1”。此时，原本 1 号下单面板的 Tab 背景由深蓝色变成了橙色，并且 1 区行情

页面和 1 号下单面板就都关联了 1 号位，二者实现联动。



图42 行情页面与下单面板联动

原本行情页面和下单面板展示的都是“601788 光大证券”。现在若在行情页面输入“510050”，则 1 号下单面板的证券也切换到了“510050”。



图43 下单面板与行情页面联动示例 1 - 510050

对应的，若在 1 号下单面板输入“159901”，则行情页面的证券也切换到了 159901。

The image displays a trading software interface for stock 601788. It is divided into several sections:

- Main Market Data Table:**

11.62	均价	0.21%	卖⑩	11.70	7
-0.05	换手	11.69	卖⑨	11.69	2
-0.43%	今开	11.74	卖⑧	11.68	4
8.28万	最高	11.59	卖⑦	11.67	6
3	最低	11.67	卖⑥	11.66	3
1654.82万	昨收	10.50	卖⑤	11.65	3
12.84	跌停	29.70	卖④	11.64	145
2789	每笔	12.08	卖③	11.63	384
0	外盘	11.44	卖②	11.62	180
27124	均价	最新	卖①	11.61	4
7232	均价	11.62	最新	11.62	现手 3
39.07亿	流通盘	39.07亿	买①	11.60	200
		453.96亿	买②	11.59	961 +3
		453.96亿	买③	11.58	629
			买④	11.57	180
			买⑤	11.56	419 +10
			买⑥	11.55	1032
			买⑦	11.54	78
			买⑧	11.53	209
- 逐笔成交 (Order Execution) Table:**

11.60	17	228	17
11.60	127		127
11.61↑	4		4
11.62↑	3		3
- Second Market Data Table (光大证券):**

11.61	均价	0.21%	卖⑩	11.70	710
-0.06	换手	11.69	卖⑨	11.69	260
-0.51%	今开	11.74	卖⑧	11.68	494
8.30万	最高	11.59	卖⑦	11.67	666
4	最低	11.67	卖⑥	11.66	376
1676.76万	昨收	10.50	卖⑤	11.65	338
12.84	跌停	29.70	卖④	11.64	145
2795	每笔	12.06	卖③	11.63	384
0	外盘	11.44	卖②	11.62	183
27997	均价	最新	卖①	11.61	874 -4
7280	均价	11.61	最新	11.61	现手 4
39.07亿	流通盘	39.07亿	买①	11.60	237 +41
		453.57亿	买②	11.59	1012
		453.57亿	买③	11.58	629
			买④	11.57	180
			买⑤	11.56	419
			买⑥	11.55	1002
			买⑦	11.54	78
			买⑧	11.53	209
- 下单面板 (Order Entry Panel):**
 - Buttons: 普通交易, 算法交易
 - Fields: 买入, 卖出, 报价方式, 单笔超价, 触价设置, 投资备注
 - 关联 (Link) menu with 9 options (1-9).

图44 下单面板与行情页面联动示例2-159901

此外，下单面板可以被关联到尚未使用的任一位置。比如，2 也可以关联到 9 号位，同时 2 区的行情也关联到 9 号位，这样二者也可以实现关联。



图45 页面关联

五、 星空图



图46 QMT 星空图

星空图通过显示板块内股票的涨幅和涨速，帮助客户快速定位异动股票，并通过行情交易关联快速下达委托指令，抢占交易先机。



图47 QMT 星空图

主界面，【操作】->【星空图】，进入星空图界面。



图48 星空图各区域

星空图是独立弹出的界面，总共分为 4 个区域，如上图：

- 1 号区：指数、板块列表。
- 2 号区：1 区选中板块的证券列表。
- 3 号区：2 区或者 4 区里选中股票的行情图
- 4 号区：2 区选中板块的星空图。

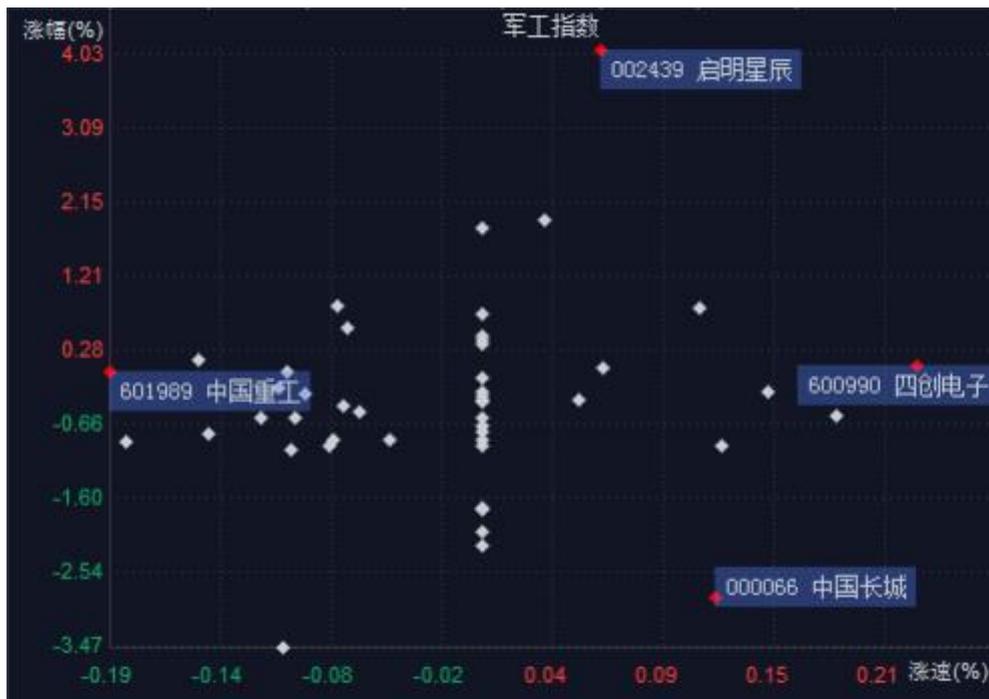


图49 QMT 星空图

星空图中每一个点表示当前板块下的每一支证券。星空图纵轴坐标表示涨幅百分比，横轴坐标表示涨速百分比。也就意味着：

- 1、越靠近上方的点，说明该证券的涨幅越大。如上图的 002439 启明星辰。
- 2、越靠近下方的点，说明该证券的跌幅越大。如上图的 000066 中国长城。
- 3、越靠近左边的点，说明该证券的跌速越快。如上图的 601989 中国重工。
- 4、越靠近右边的点，说明该证券的涨速越快。如上图的 600990 四创电子。

通常情况下，一个板块内大多数的证券涨跌速度和涨跌幅度都在 0%附近，因此星空图上大都数点位都在大多数点都集中于纵向与横向的两个狭窄的带上。而那些涨速、跌速、涨幅、跌幅突出的个股在星空上明显偏离集中区域，追涨杀跌的用户能快速找出它们。



图50 星空图的设置

在星空的区域点击右键，进入设置界面，对星空图的显示进行配置。

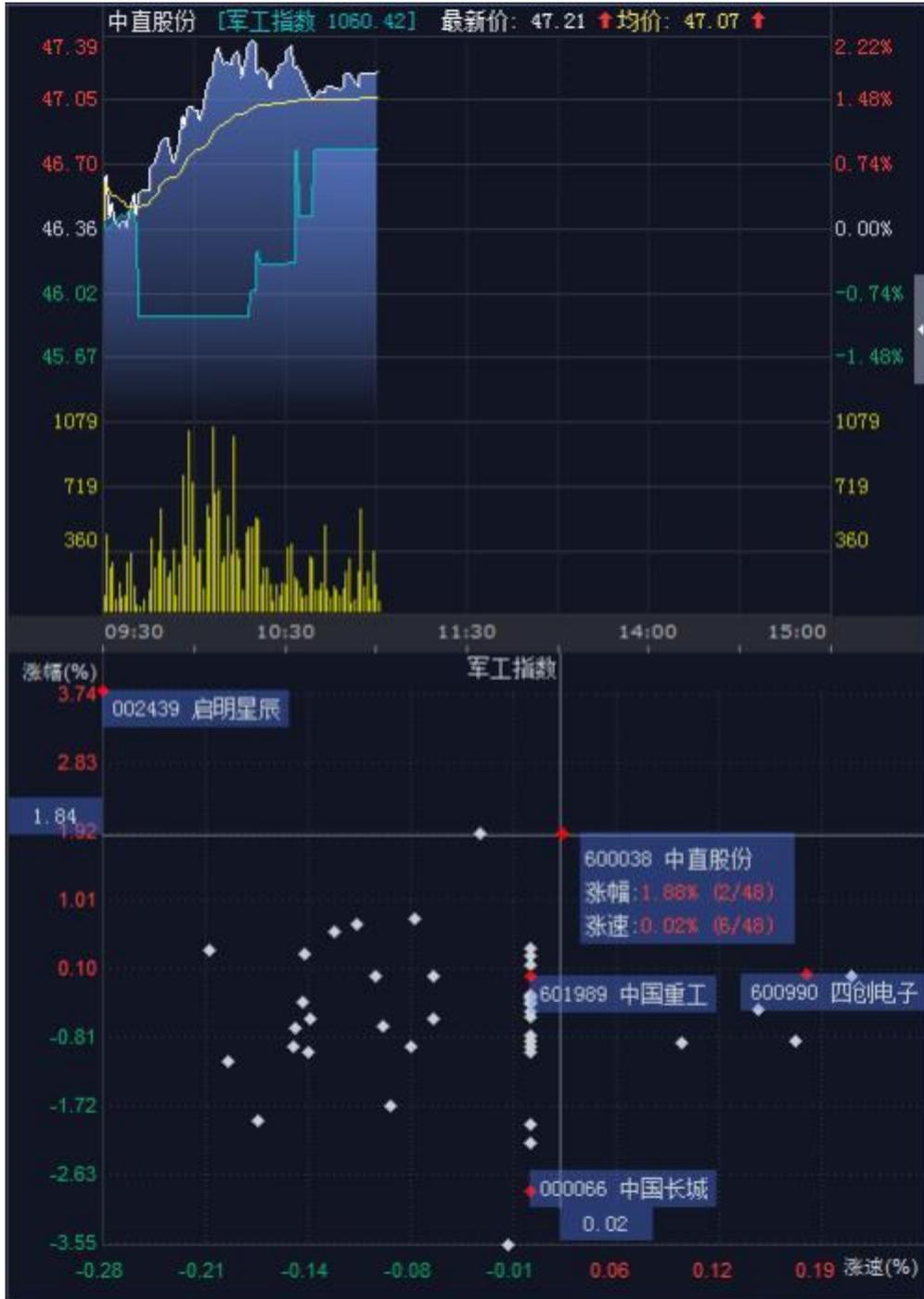


图51 星空图的联动

点击图中的点，星空图会将用户关心的这支券颜色变红，并且在右侧显示出这个点代表的证券代码、证券名称、实时涨/跌幅和涨/跌速。同时，星空图上方的行情图也切换到选中的券。



图52 走势图叠加指标

除了缺省显示的分时图，还可以通过右键自行添加指标。

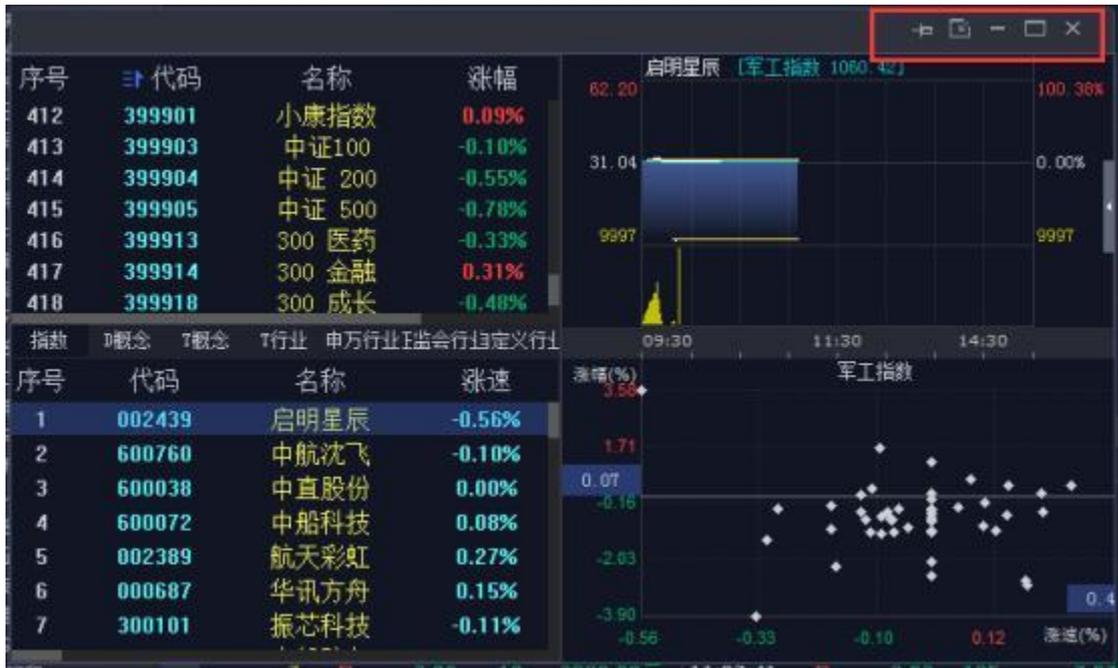


图53 星空图功能按钮

星空图右上角的功能键，从左到右依次是：固定在界面最上方、嵌入到主界面、最小化、最大化、关闭。

下面举个完整的运用星空图的例子。比如，关注的是军工板块，在屏幕左上方区域选中“军工指数”，则左下方区域展示出组成军工指数的各成分股、即军工板块的证券列表。右下方的星空图展示了该板块成分股的涨幅和涨速情况。点击左下方的证券或者星空图上的点，可以在右上方看到该证券的行情图及其它指标。



图54 军工板块星空图

六、交易点在行情图上标识

当行情图显示的是分时图时，鼠标移动到分时图区域 -> 【邮件】 -> 【显示交易数据】 -> 选中需要标识交易点的账号，行情图就能标识出该账号在当日买卖这支证券时间点、价位和方向（红色 B 表示买入，绿色的 S 表示卖出）。

如下图，该账号在 13:16 买入“601788 光大证券”个股，另外还在买入的某个篮子中包含有光大证券的成分股。因此当行情图切换到光大证券的分时图时，在图中 13:16 的位置标识有 2 个红 B。



图55 交易点在行情图上标识

七、一键打新、一键调仓、一键撤单

7.1 一键打新



图56 新股申购

【交易】->【股票交易】->【新股申购】，显示新股申购 Tab 页。



图57 新股查询

在新股查询中查询可申购的新股以及发行数量、单位申购量、最大申购量等信息。



图58 单独申购
点击每一支新股，可以依次申购。

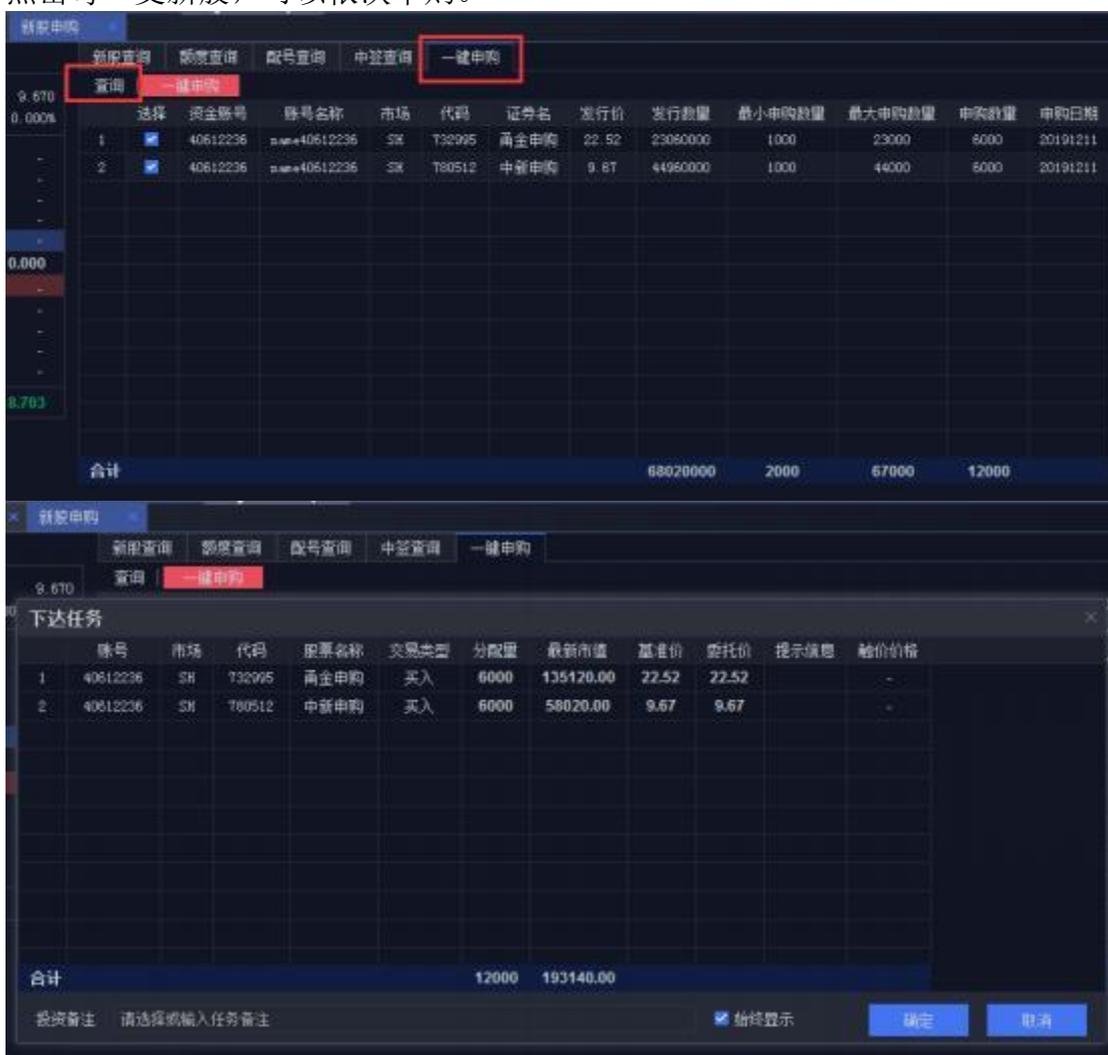


图59 一键申购
亦或一键申购。在一键申购页，【查询】-> 勾选需要申购的新股->【一键申购】，确认无误后点击【确定】，完成一键打新。

7.2 一键调仓

详见 10.3 小节【一键调仓】的内容。

7.3 一键撤单

QMT 的个股交易、组合交易都是以任务的形式存在。在生成委托的同时也生成了任务。一个任务代表一次个股的委托或者一次组合委托。用户可以对单个任务进行撤销、暂停/继续，也可以一键撤销、暂停/继续所有的任务。



图60 一键撤单

八、条件单（预埋单、触价单）

条件单，又称预埋单、触价单。QMT 里条件单的路径是：下单面板 -> 【买入/卖出】-> 【普通交易/算法交易】-> 【触价设置】。



触价设置的默认状态是“不启用”。点击触价设置，勾选之后可启用触价单。判断规则是“ \geq ”或者“ \leq ”最新价，阈值可自行填写。

如下图所示触价单设置的规则是：当最新价大于或等于 11.72 元时，按照 11.73 元的委托价委托 500 股的“601788 光大证券”个股。点击【买入】后，生成一个交易方向是买入的触价单任务。



图62 一个触价单的例子
在弹出的确认框点击【确认】后，触价单的任务生成。

序号	账号	市场	代码	股票名称	交易类型	分配量	最新市值	基金价	委托价	提示消息	触价价格
1	40612236	SH	601788	光大证券	买入	500	5855.00	11.75	11.75		11.720

图63 触价单确认框

在任务列表中可以看到刚刚生成的触价单任务。以及每个触价单当前的状态。每条触价单都是一次性的，一旦价格满足条件，任务就结束。在委托触发之前，也可以选择【撤销】或者【暂停】某一个任务或者一键全撤销、全暂停。

操作	撤单次数	状态
暂停	0	11.7300全部委托!
暂停	0	[40612236] [SH601788] 最新价11.7000未触及11.7100, 暂缓报单!
暂停	0	[40612236] [SH601788] 最新价11.7000未触及11.7200, 暂缓报单!

图64 任务列表里的触价单

九、算法交易

金阳光QMT 客户端内置的算法交易，包括自动化拆单、随机量拆单、股票触价单、期货止损止盈单等，满足客户降低交易成本、隐藏交易意图和条件触发下单等需求。

支持算法交易的业务包括：股票、期货、融资融券、沪港通、深港通、ETF 申赎等。

9.1 多种交易模式

在下单面板中点击向下的【】图标，会弹出几种支持的交易选项，包含：普通交易、算法交易、随机量交易。



图65 切换下单模式

勾选对应的交易选项后，下单面板上就会将对应的交易选项罗列出来。支持各种下单方式。



图66 三种下单模式：普通交易、算法交易、随机量交易

9.2 算法交易

点击【算法交易】，左侧栏中显示算法交易支持的参数设置，如：报价方式、单笔超价、单笔基准量、基准量比例、下单间隔、撤单间隔、超价启用笔数、双向波动敬意、单笔最小量、单笔最大量、有效时间、最大委托次数、未成委托处理、触价设置、投资备注。



图67 算法交易-下单面板

点击【】图标，会弹出算法交易使用提示窗口。请仔细阅读相关提示，在提示末尾处，勾选【我已阅读】并点击【接受】按钮。阅读并接受“算法交易使用提示”之后，下单面

板中的提示图标将变成【】样式。



图68 算法交易-提示说明

用户可以根据需求，参照使用提示的内容，设置下单参数，并执行下单操作。

下单后，系统会生成一个任务。任务会判断当前行情是否满足下单条件，如不满足条件 则不会生成委托；待满足条件时，会依照预先设置的算法生成一笔或多笔委托，报送给交易所。

示例：当前 601788（光大证券）的股价为 12.04 元。若预设一个下单算法，如下图所示，下图当股价小于或等于 12.01 元时，开始下买单，每次买 300 股，分 10 次购买，且每两次委托的间隔为 10 秒。



图69 算法交易-参数示例

下单后，可以看到下图的任务列表中，新增了一个任务，但是委托列表中并没有生成委托。



图70 算法交易-任务列表

当价格跌到预设的价格时（12.01 元），可以看到委托列表中即刻生成了一笔价格 12.01 元、数量为 300 股的委托。当股价上升后，不会再生成新的委托。随着股价的起伏，最终一

共生成的 10 笔委托，每两笔委托的时间间隔都大于 10 秒。

成交数量	账号名称	投资备注	委托类别	证券名称	证券代码	委托剩余量	委托量	委托状态	买卖标记	委托时间
1	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	14:02:49
2	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	14:01:48
3	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	14:00:48
4	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	13:59:48
5	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	13:58:48
6	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	13:57:49
7	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	13:56:48
8	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	13:55:49
9	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	13:54:48
10	300股	nan+40612236	买卖	光大证券	601788	0股	300股	已成	限价买入	13:53:48

图71 算法交易-委托列表

9.3 随机量交易

随机量交易主要用于大单的买入和卖出，即将一个大单分拆成若干个数量随机的小单，也可以分多次执行。这能非常好地隐藏客户的交易目的。

随机量交易支持的参数有：报价方式、下单间隔、双向波动区间、有效时间、最大委托次数、单笔量区间、投资备注。点击下单面板上方的【】【】图标，查看使用提示。



图72 随机量交易-使用说明

示例：客户需要购买 30 万股 601788（光大证券）。为了隐藏购买意图、降低对价格的冲击，客户可以使用随机量交易。设置总量为 30 万股票，每 10 秒购买一次，每次购买的数量为 1000-5000 股不等，最多购买 120 次，有效时间为 1200 秒。客户下单后，会首先生成一个总量为 30 万股的买单任务。然后每隔 10 秒，系统会生成一笔数量在 1000-5000 之间的买单。

序号	委托数量	委托价格	委托时间	委托状态	成交数量	成交价格	成交时间
1	4800股	12.00	14:41:09	已成交	4800股	12.00	14:41:09
2	1800股	12.00	14:41:09	已成交	1800股	12.00	14:41:09
3	1500股	12.00	14:41:09	已成交	1500股	12.00	14:41:09
4	4800股	12.00	14:41:09	已成交	4800股	12.00	14:41:09
5	4800股	12.00	14:41:09	已成交	4800股	12.00	14:41:09
6	4300股	12.00	14:41:09	已成交	4300股	12.00	14:41:09
7	2700股	12.00	14:41:09	已成交	2700股	12.00	14:41:09
8	3000股	12.00	14:41:09	已成交	3000股	12.00	14:41:09
9	4800股	12.00	14:41:09	已成交	4800股	12.00	14:41:09
10	3700股	12.00	14:41:09	已成交	3700股	12.00	14:41:09
11	2800股	12.00	14:41:09	已成交	2800股	12.00	14:41:09
12	3800股	12.00	14:41:09	已成交	3800股	12.00	14:41:09
13	4200股	12.00	14:41:09	已成交	4200股	12.00	14:41:09
14	3100股	12.00	14:41:09	已成交	3100股	12.00	14:41:09
15	4300股	12.00	14:41:09	已成交	4300股	12.00	14:41:09
16	1800股	12.00	14:41:09	已成交	1800股	12.00	14:41:09
17	1700股	12.00	14:41:09	已成交	1700股	12.00	14:41:09
18	4900股	12.00	14:41:09	已成交	4900股	12.00	14:41:09
19	3800股	12.00	14:41:09	已成交	3800股	12.00	14:41:09
20	2900股	12.00	14:41:09	已成交	2900股	12.00	14:41:09
21	2800股	12.00	14:41:09	已成交	2800股	12.00	14:41:09

图73 随机量交易-委托列表

15 分钟以后，总共有 90 笔委托被申报，总量 30 万股的下单任务完成

任务	账号	代码	名称	交易参数	交易类型	金额	进度	委托详情	开始时间	结束时间
任务407	40612236	601788	光大证券	随机量	买入	361.33万	300000 / 300000	已报90 收到90	14:41:44	14:56:36
任务406	40612236	601788	光大证券	算法	买入	3.60万	3000 / 3000	已报10 收到10	14:33:39	14:35:10
任务405	40612236	601788	光大证券	算法	买入	3.60万	3000 / 3000	已报10 收到10	14:29:33	14:32:35
任务404	40612236	601788	光大证券	算法	买入	3.60万	3000 / 3000	已报10 收到10	13:53:50	14:02:56
任务403	40612236	000822	中装建设	普通	卖出	911.00	100 / 100	已报1 收到1	11:27:11	11:27:12
任务402	40612236	300731	科创板算	普通	买入	1.90万	700 / 700	已报1 收到1	11:25:09	11:25:10

图74 随机量交易-任务列表

十、组合交易

组合交易是指同时完成一个股票或期货组合的交易，具有自动套利、对冲的功能，通过预设条件自动判断，并执行套利、对冲。

QMT 的组合交易支持篮子管理、篮子交易、一键调仓、期现套利等功能。

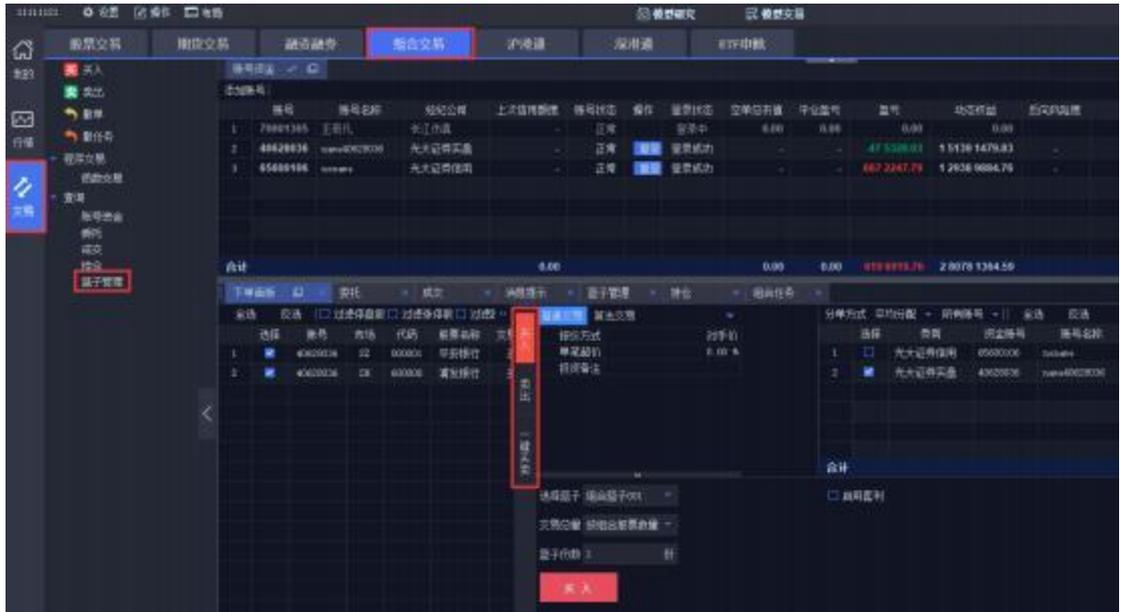


图75 组合交易界面

10.1 篮子管理

篮子管理界面分为左右两部分。界面左边显示篮子分类，包括股票篮子和期货篮子。可分别新增、导入、删除多个同类型篮子。右半界面显示某一篮子内期货或股票的具体信息，包括合约代码、名称、数量、相对权重、绝对权重、涨跌停价。同时可以导入、导出、删除。



图76 篮子管理界面

合法的篮子导入格式为金阳光 QMT 默认格式。在 excel 表格中新建篮子时，要事先将每种格式下的条目填充完整，并保存为.csv 格式。



图77 篮子管理-导入篮子-帮助

10.2 篮子交易



图78 篮子交易-下单面板

下单面板可以对一篮子股票债券进行买入、卖出或一键买卖的操作。【交易参数】有普通交易、算法交易两种，能对多个股票债券合约进行交易。【报价方式】有最新价、对手价等多种方式。在【选择篮子】后，下单面板的左边列表会展示出该篮子所包含的证券代码，以及每支代码的交易类型和分配量。

【交易总量】有按组合股票数量、按组合股票权重、按账户可用、按总资产比例。

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

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

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

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

10.3 一键调仓



图79 组合交易-一键调仓

【一键买卖】功能包括买入和卖出两个过程。如无持仓，则卖出指令不发出，但买入指令照常发出。此外，QMT 还支持一键调仓功能。点击【调仓】按后会弹出调仓界面。左边展示当前持仓，右边展示目标持仓。配置好目标持仓的相关参数后，点击【确定】。



图80 一键调仓-篮子选择

此时，【选择篮子】中将变成调仓组合，并在下单面板中展示调仓组合的明细。用户可以再次针对这些委托组合进行微调。比如：取消勾选某一支代码，或者勾选【过滤涨停股】等操作。最后点击【下单】完成调仓。



图81 一键调仓-委托单确认

10.4 期现套利

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

①手动套利是在组合交易时买入或卖出股票篮子的同时手动开空或者开多一种期货合约，实现期现套利。

②按合约价值套利是自动套利，指按照篮子中买入的现货价格和期货合约价格自动计算出需要开空的期货手数进行期现套利下单。同时，可以设定套利比例，套利比例是指买入的现货和卖出的期货之间的比例（套利比例设定为20%时是指买入100元现货的时候需要卖出20元期货）。

③按固定金额套利是自动套利，指按照用户设定的固定金额，现货交易每达到一次这个金额就自动开空一手期货的期现交易方法。比如说用户设定1000元的固定金额套利，当用户购买股票的价格为2万元是，就会开空 $20000/1000=20$ 手的期货。

④按固定手数套利是自动套利，指用户设定套利的固定手数后，在买入现货的同时，

自动卖出设定的手数的期货。（当现货部分成交时，会根据成交的比例来开空同样比例的期货）。



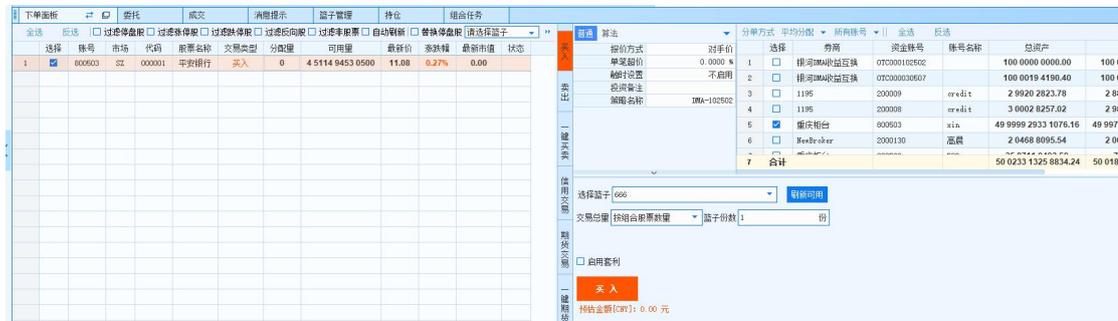
图82 组合交易-期现套利开关

10.5 交易类型

① 买入

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

在下单面板中还添加了全选、反选按钮，快速选择全部标的或者部分标的。



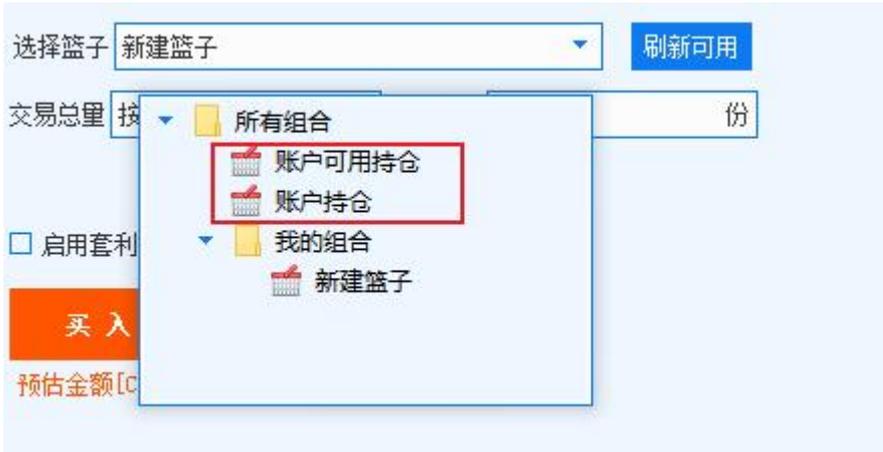
按组合股票数量：篮子中每支股票的分配量=一份篮子中每支股票的分配量*篮子份数。

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

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

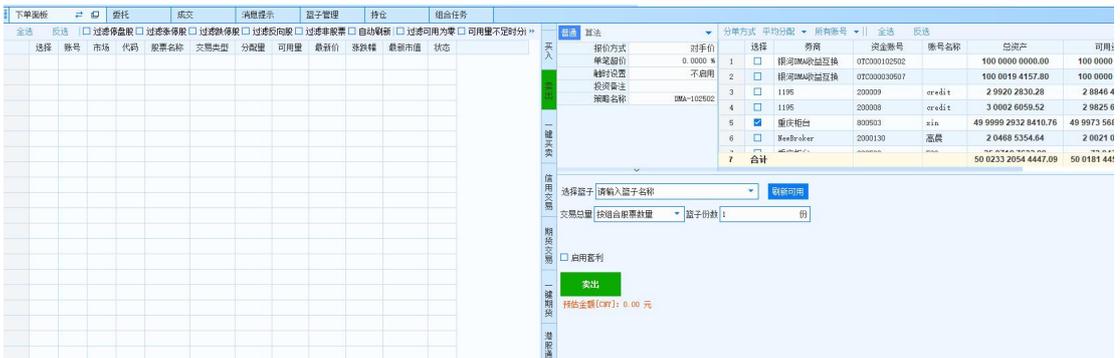
按总资产比例:自定义输入比例，系统就会根据篮子管理中每只合约权重分配,分配量=总资产*比例*(某只股票相对权重/相对权重合计)/最新价。

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



② 卖出

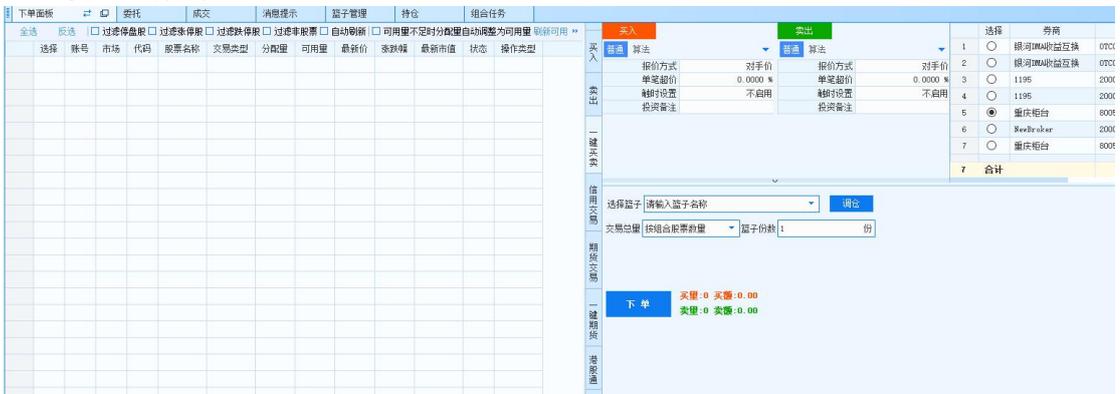
卖出交易界面功能和买入交易类似，可以多个账号对多个股票债券合约进行卖出。



卖出界面

③ 一键买卖

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



一键买卖界面

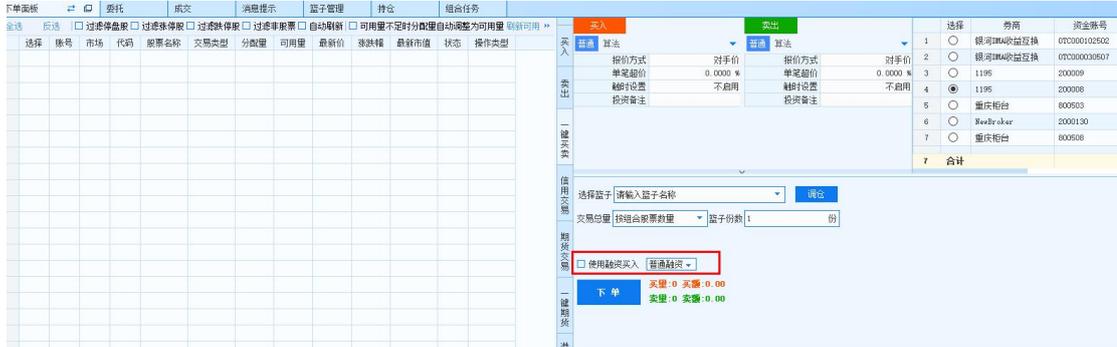
交易类型：可以通过在交易类型字段下选择买入或卖出，便捷决定买卖方向。

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

账号选择：一键买卖只能选择一个账号。

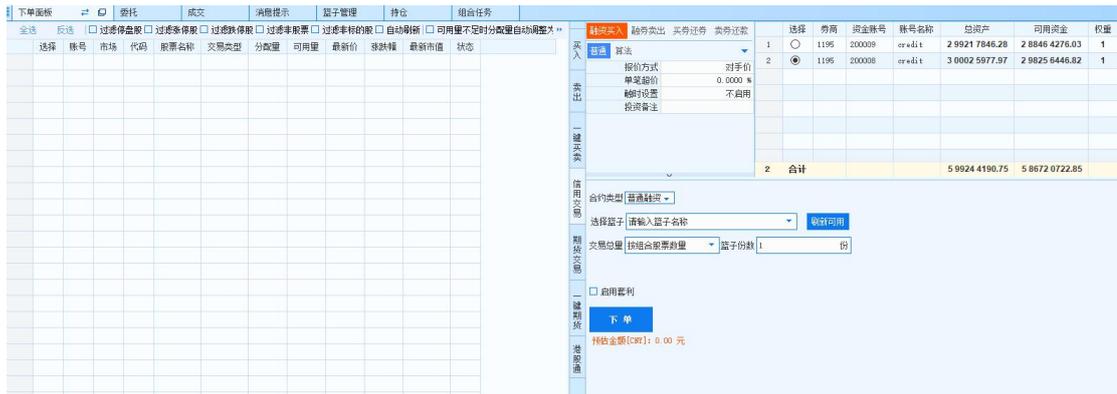
一键买卖包括买入和卖出两个过程，如无持仓卖出指令不发出，但买入指令照常发出。因为一键买卖涉及卖出过程，所以经常配合调仓功能使用。

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



④信用交易

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



信用交易

⑤期货交易

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

在期货交易下单面板选择“篮子管理”-“期货篮子”中创建的篮子；

选择交易总量并设置参数；

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

选择交易算法并设置交易参数；

选择交易账号，点击下单按钮。



期货交易

⑥ 一键期货

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

下单板设置中有投机、套利、套保三种套利模式供选择。



套利模式选择

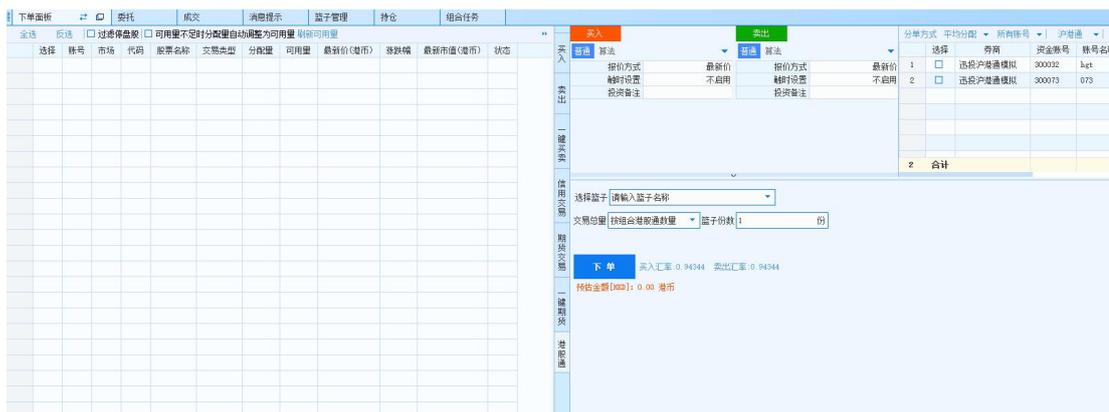
下单面板中单击“交易类型”就可切换买卖方向，系统会根据账号持仓来显示可平或可开的数量。



切换买卖方向

⑦ 港股通

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



港股通界面

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



交易总量分配方式

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

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

十一、策略回测

金阳光 QMT 支持 VBA 和 Python 开发策略模型，并且提供了丰富详尽的历史数据，供用户进行策略回测。用户也可以一键操作将策略用于实盘交易。

金阳光 QMT 内部预设了示例策略模板，供用户参考。如果客户有需要，光大证券也提供策略编写的支持。

11.1 创建策略

在主页界面或者模型研究界面，用户可创建自己的策略模型，策略模型的创建方法有两种：

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

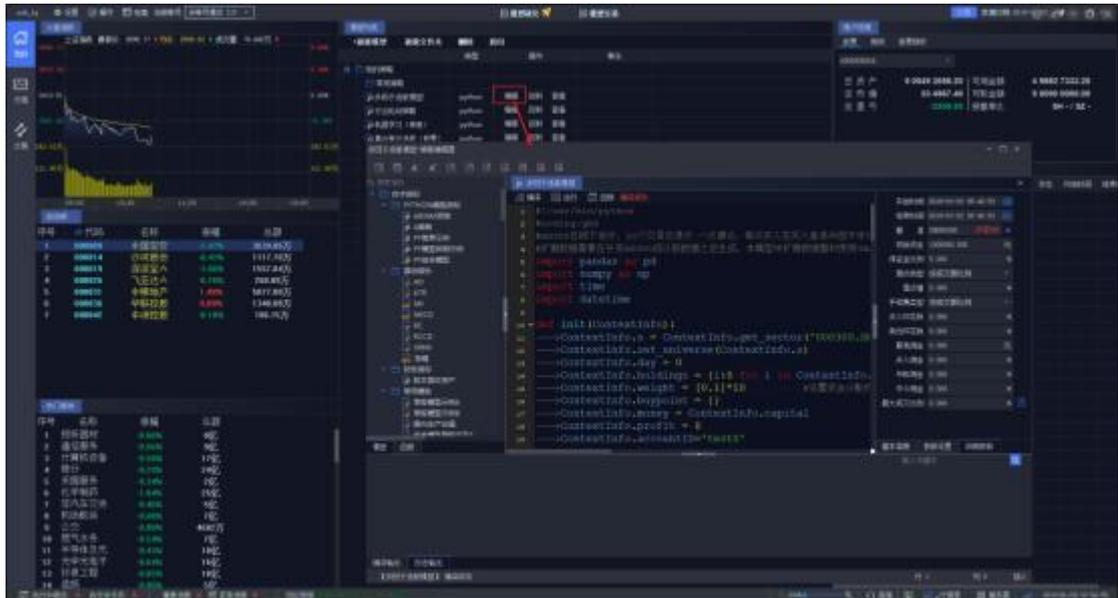


图83 我的主页—编辑模型

方法二，点击【新建模型】按钮，并选择模型语言类型，在弹出的模型编辑器中从头开始实现一个用户自己的量化模型。

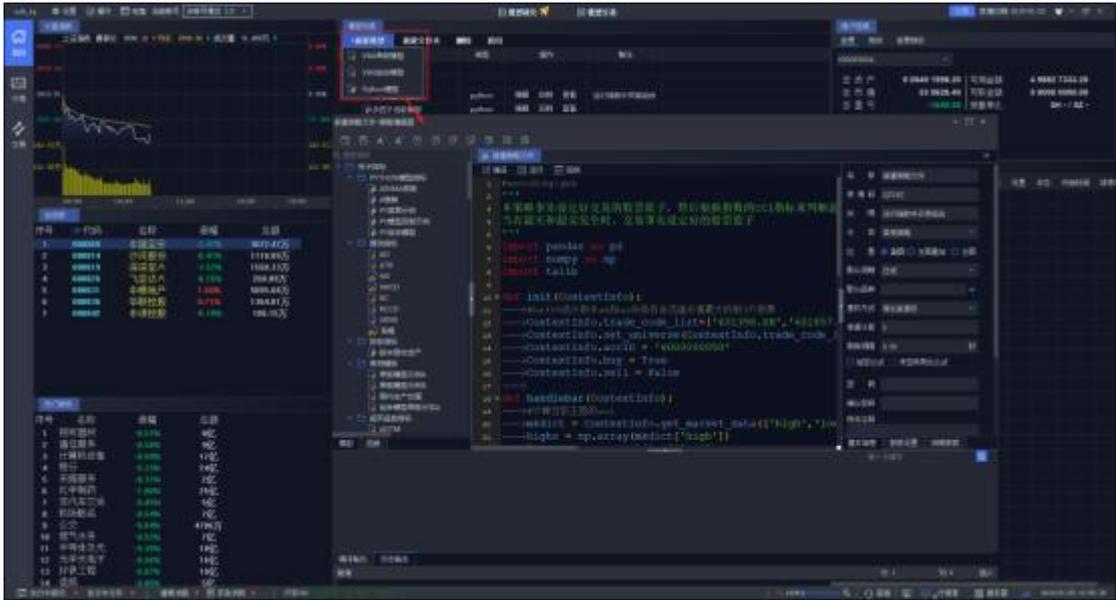


图84 我的主页—新建模型

新建模型时有三个选项，分别为：

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

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

Python 模型：适合开发各种单股、组合策略。

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

创建模型时，会弹出模型编辑器窗口，此编辑器是专门为模型开发者设计的、集成了模型列表、函数列表、函数帮助、模型基本信息、参数设置、回测参数等多个部分，拥有代码高亮、自动补全等特色功能的便捷编辑、开发环境。详细的模型编辑教程见《VBA 模型编辑教程》、《Python API 说明》等文档。

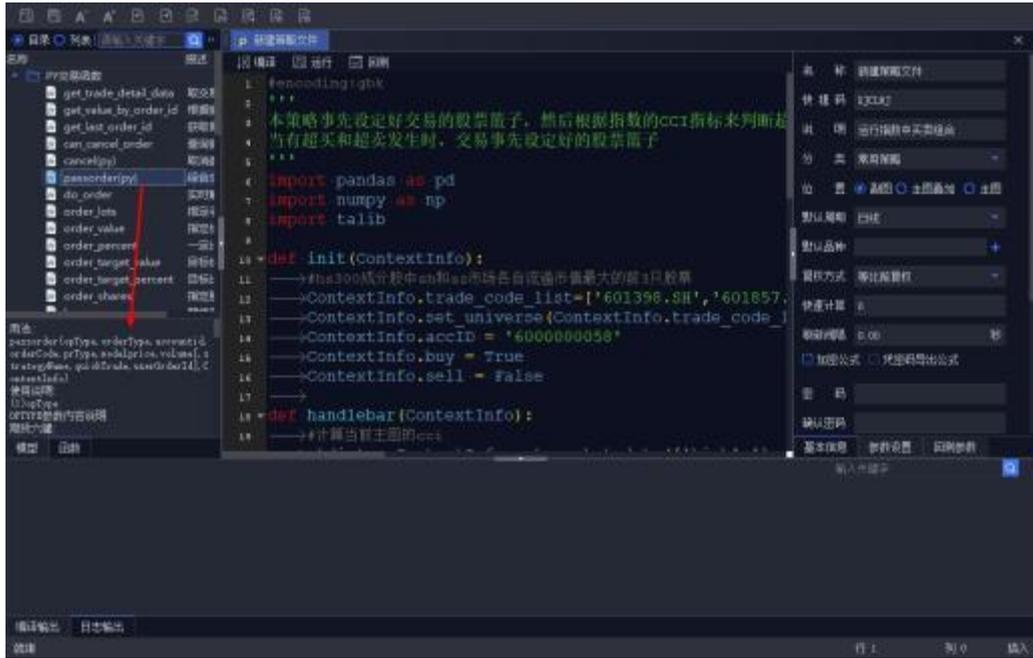


图85 模型编辑器—函数帮助

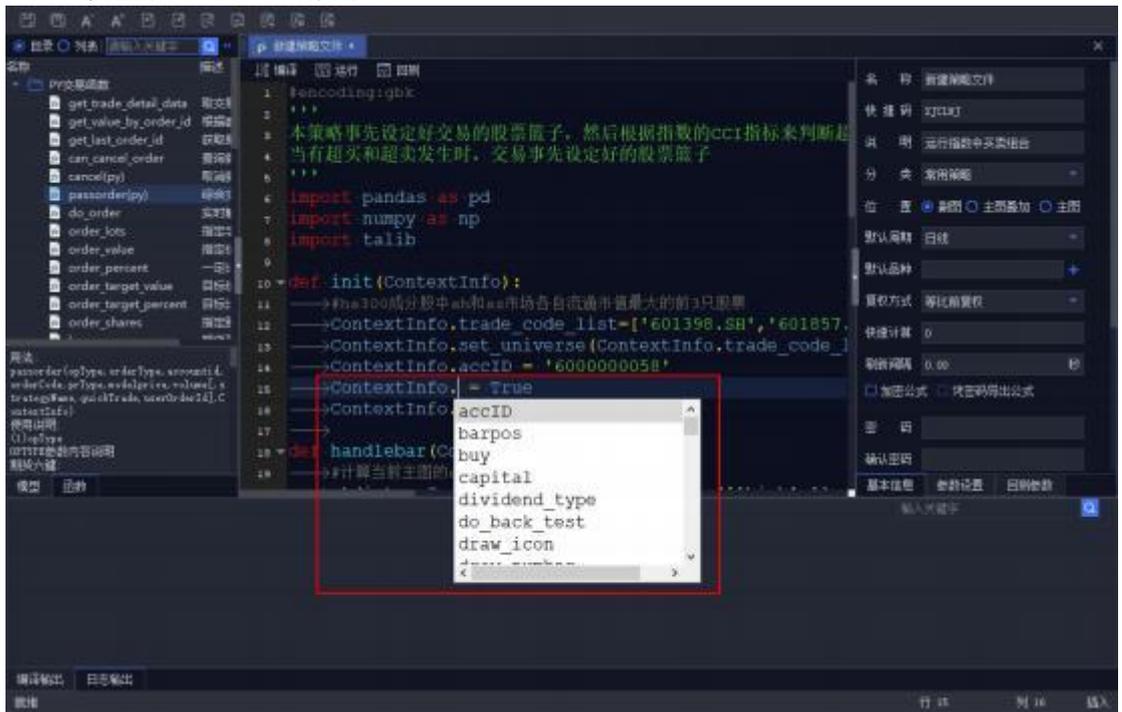


图86 模型编辑器—代码补全

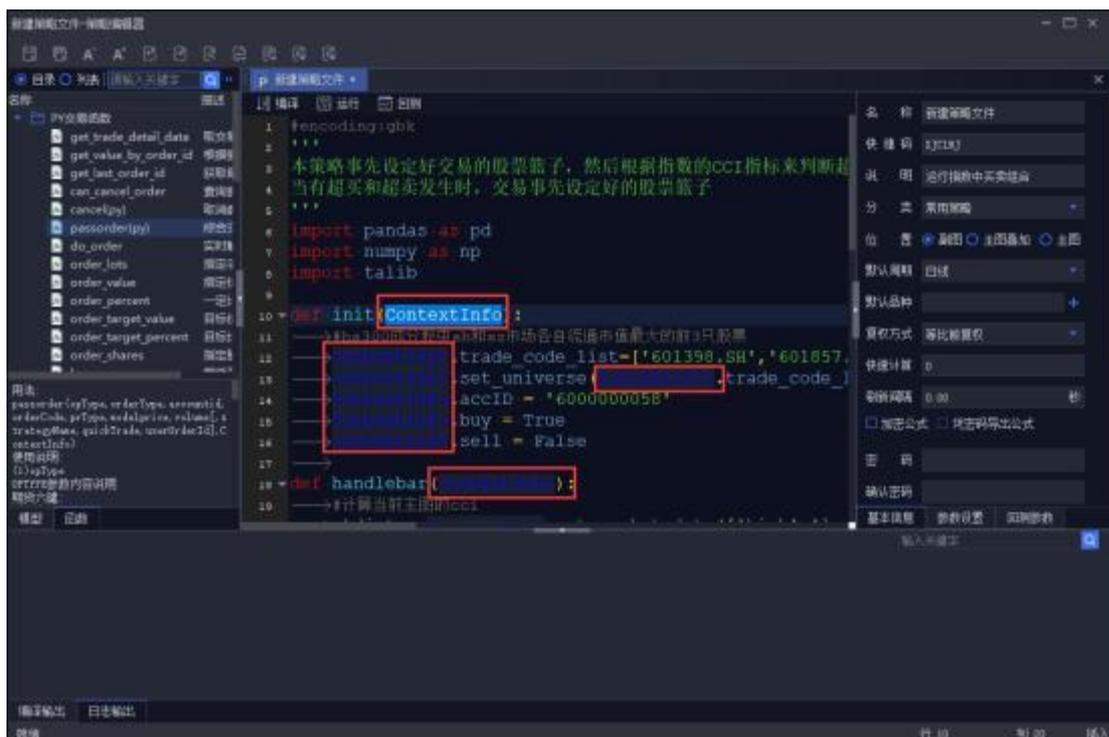


图87 模型编辑器—选中相同代码高亮

在模型创建完成之后，需对模型的基本信息和回测参数进行设置，基本信息包括：

名称：填写模型名称；

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

说明：简单的说明模型功能；

分类：保存当前模型到某个分类下面；

位置：模型回测或运行时的位置，有副图、主图叠加、主图三种显示位置；

默认周期：点击模型回测或运行时的默认主图周期，可手动切换；

默认品种：点击模型回测或运行时的默认主图品种，可手动切换；

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

快速计算：限制计算范围，默认为 0 时模型运行时会从模型设置的默认品种（主图）的

第一根 k 线开始计算，设置为 n 则从当前 k 线再往前 n 个 k 线开始计算；

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

加密公式：加密后的公式只有输入密码才可以查看源代码；

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

用法注释：简短的说明模型使用的一些注意事项。

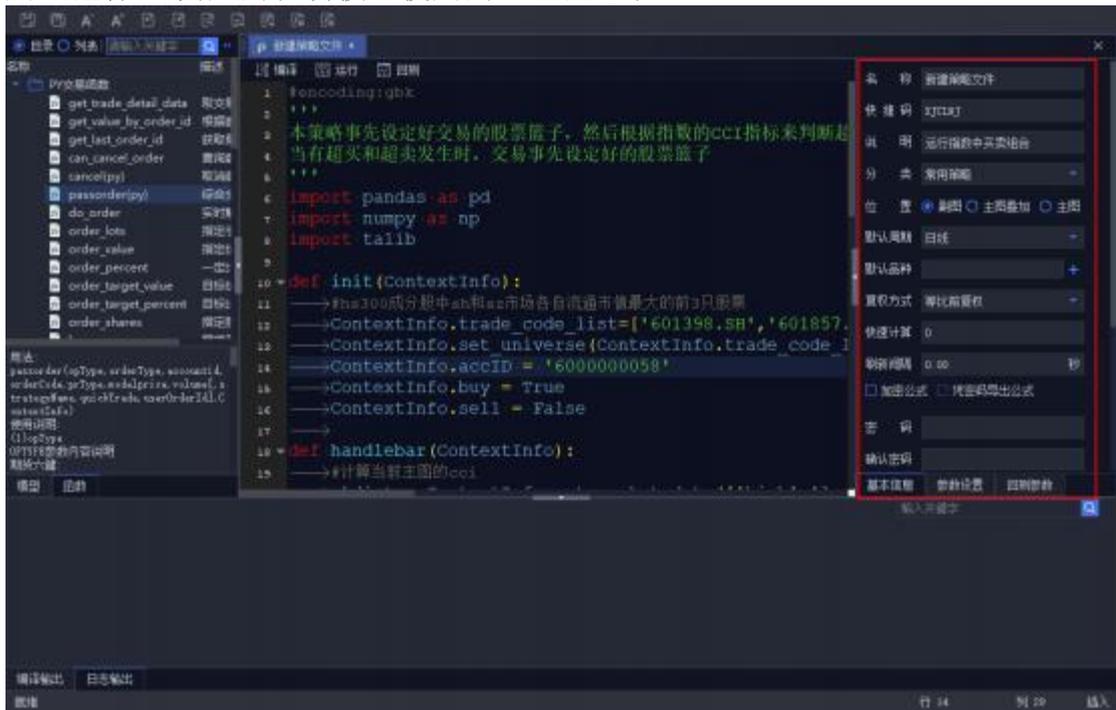


图88 模型编辑器—基本信息设置

参数设置中参数名为变量名，模型中可以调用。最新值为变量默认值，运行/回测模式使用。最小/最大/步长项，为遍历参数。初始项可不填。最小/最大都是包含在遍历区间内的，如图 27 所示，a，b 两变量，5- 15，步长为 1，会遍历 11 * 11 种组合

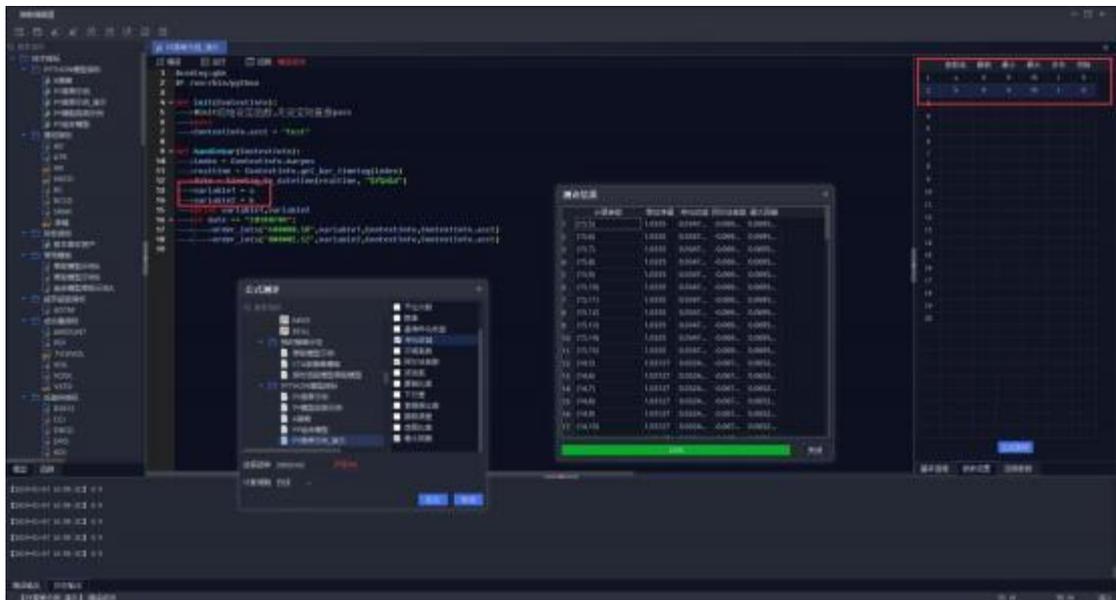


图89 模型编辑器—参数设置

点击公式测评，可选择回测模式支持的指标，如单位净值，最大回撤等，作为评价标准。

点击优化，评测结果弹窗显示不同参数变量组合下的回测结果。可点击所需指标进行排序。测评完成后，用户可根据测评结果，选取最优的值赋给对应的参数。模型的基本信息和回测参数设置完毕后，点击编译，可以查看模型编译情况，如果编译失败，请检查模型代码是否有误，并进行修正后再次编译，如果编译成功，则终端会自动保存模型的相关代码及设置到本地。

回测参数包括：开始时间、结束时间：设置模型回测时间区间；

基准：设置模型收益的参考基准；

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

保证金比例：设置期货的保证金比例；

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

手续费类型：支持按成交额比例或者固定值计算手续费，代码里通过 `set_commission` 函

数来设定，具体用法详见《PythonAPI_使用说明》；

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

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

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

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

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

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

最大成交比例：控制回测中最大成交量不超过同周期（行情周期）成交量*最大成交比例，例如运行周期为 1 分钟线，最大成交量比例设置为 10%，则回测时，最大成交量比例不超过 1 分钟成交量*最大成交比例 10%；以上回测参数的设置，在回测参数界面设置后，代码里无需再赋值。相反地，如果代码里面设置了，那么以代码里设置的值为准。

总结：代码里的设置优先级高于回测参数界面设置。

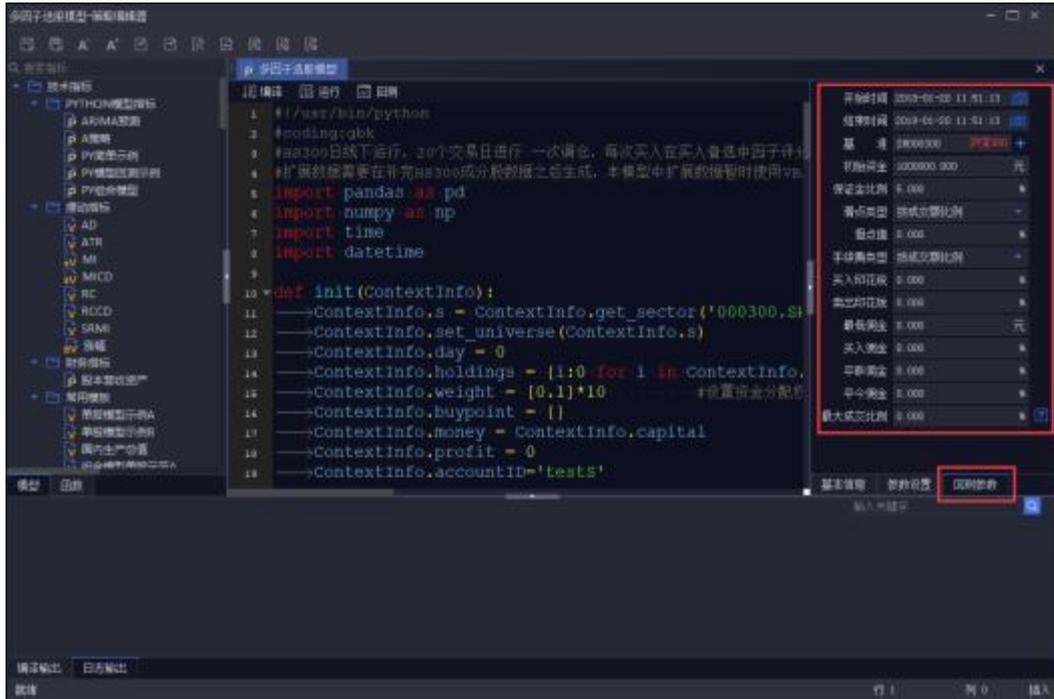


图90 模型编辑器—回测参数设置

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

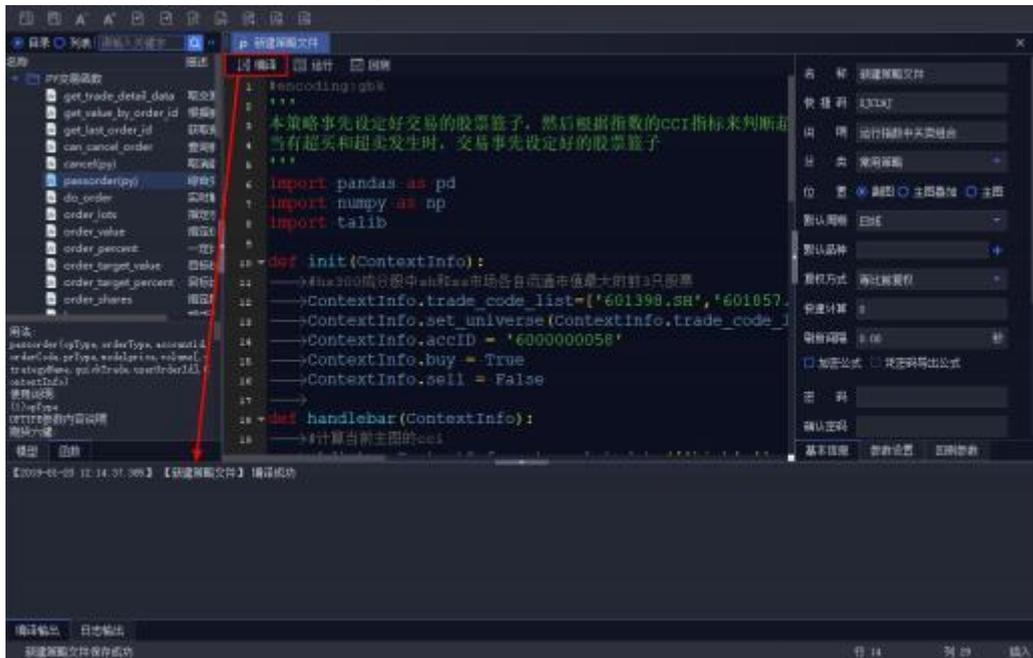


图91 模型编辑器—模型编译

11.2 策略回测

在回测之前，可手动在设置-数据管理中补充数据，以方便回测运行。

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



图92 模型编辑器—模型回测

如回测所需时间较长，不想再继续进行下去，可直接点击【策略停止】按钮，停止回测。按钮下方显示回测进度条，进度条上方数字表示当前回测已运行的时长，进度条内数字表示当前已计算的 K 线数量。



图93 模型编辑器—进度查看

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



图94 回测结果分析—回测结果随十字光标移动动态展示

如需根据模型生成的买入、卖出列表进行手工交易，则可直接点击【买入】或【卖出】按钮，系统会弹出下单界面由用户进行确认后，进行普通交易下单或算法交易下单。交易方式可点击卖出按钮右侧的普通交易进行切换设置。



图95 回测结果卖出

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



图96 转到实盘交易

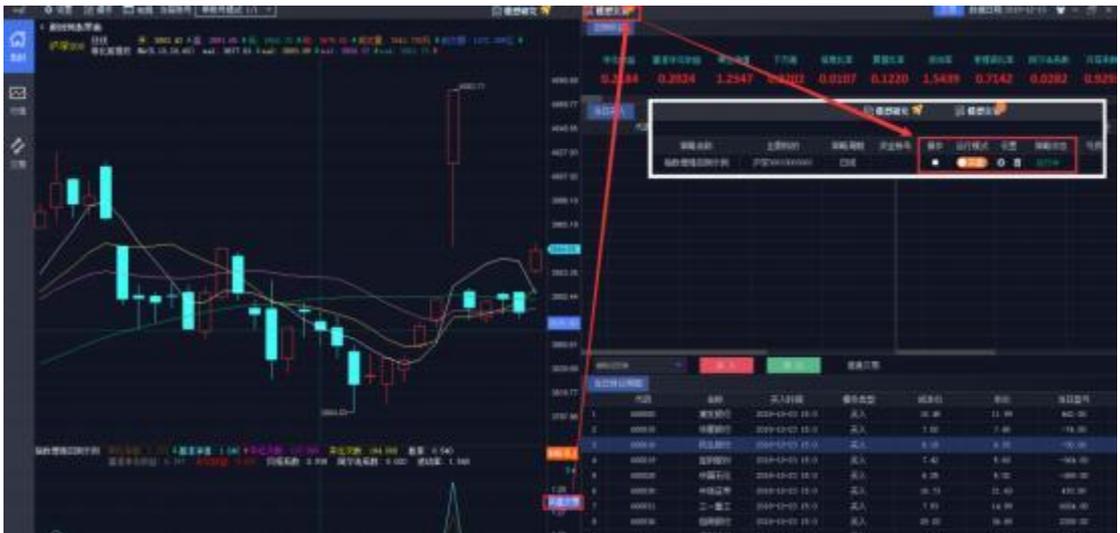


图97 转到实盘交易

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



图98 回测结果分析—附图指标输出

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

持仓明细：可查看光标所在当天的持仓明细，鼠标右键可以复制和导出数据。

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

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

操作明细：可查看模型回测的历史每一笔交易的明细。

日志输出：可用于调试输出模型回测和运行情况。



图99 回测结果分析—绩效分析、当日买入、当日卖出、持仓分析

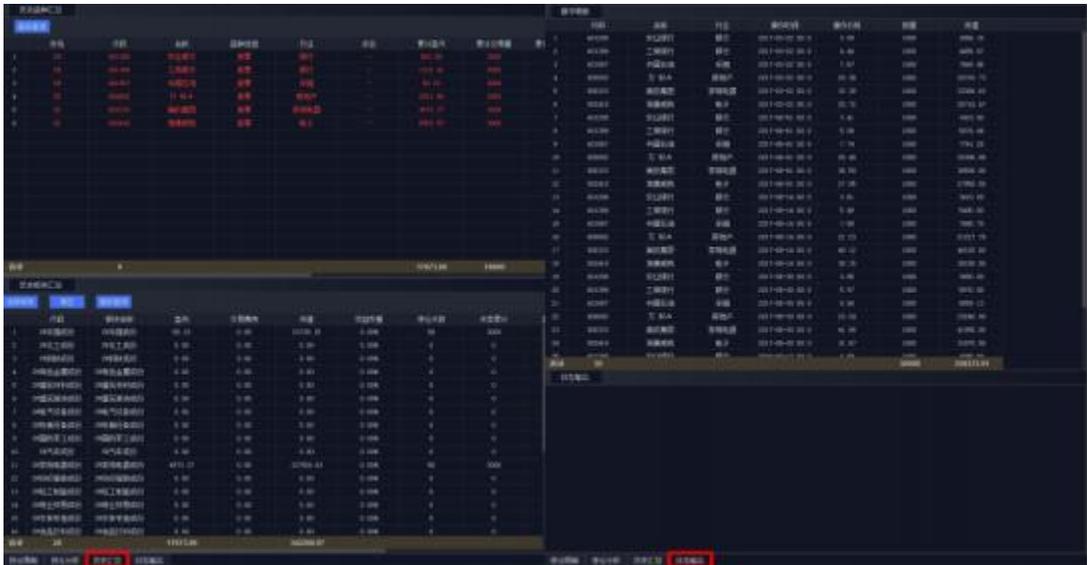


图100 回测结果分析—历史板块汇总、操作明细、日志输出

11.3 策略运行

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

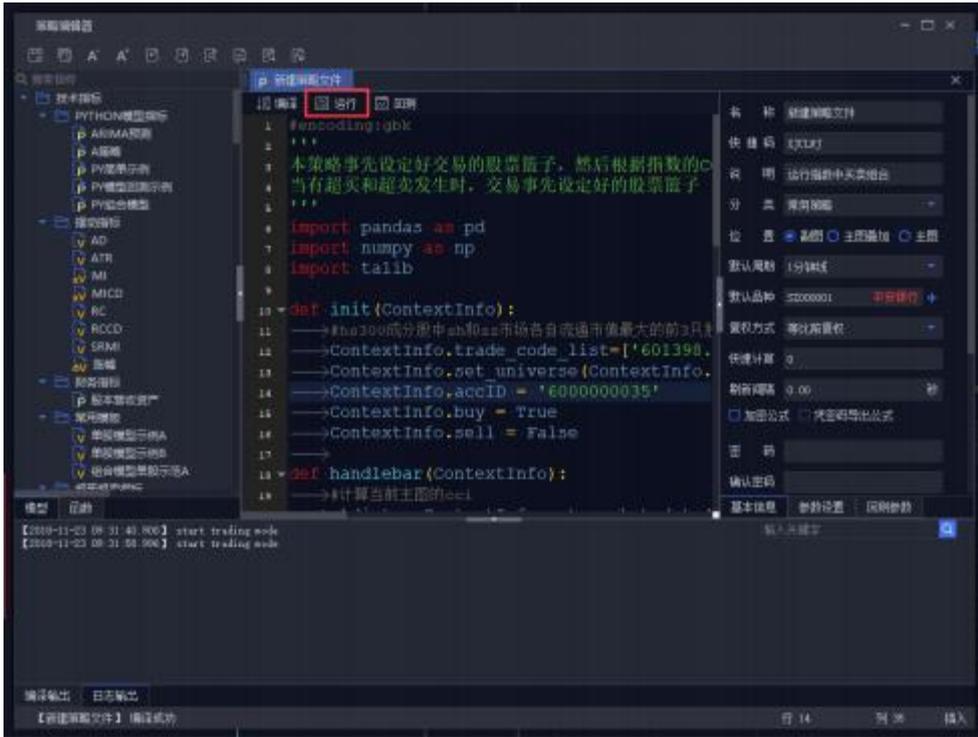


图101 策略运行

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

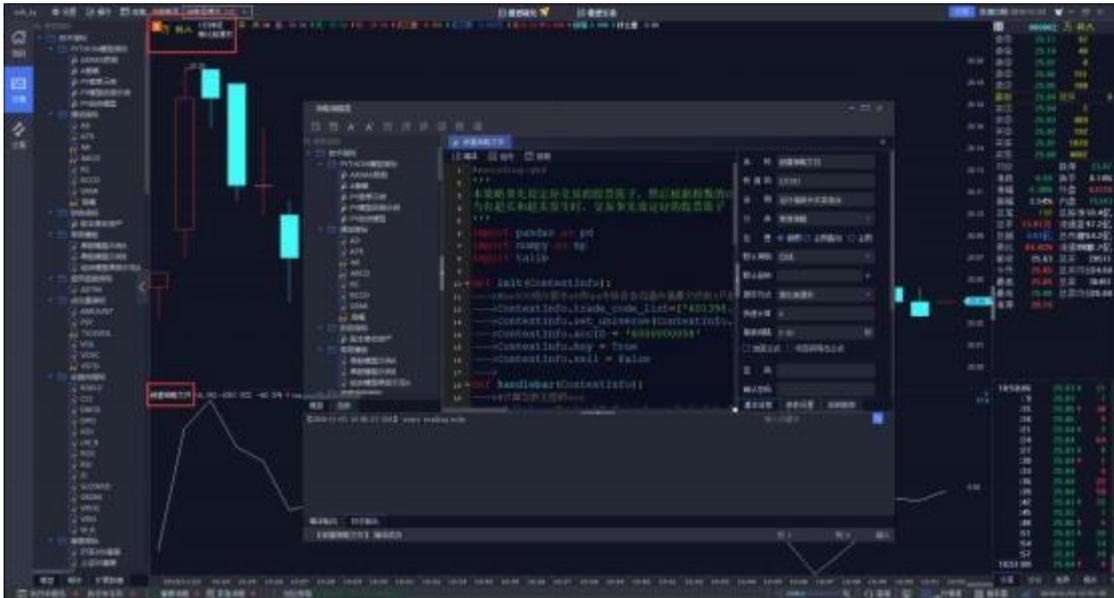


图102 策略运行状态之一

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



图103 策略运行状态之二

当选择的运行位置为副图时，**位置** 副图 主图叠加 主图 如想关闭策略，将主图下方策略运行的附图关闭即可。

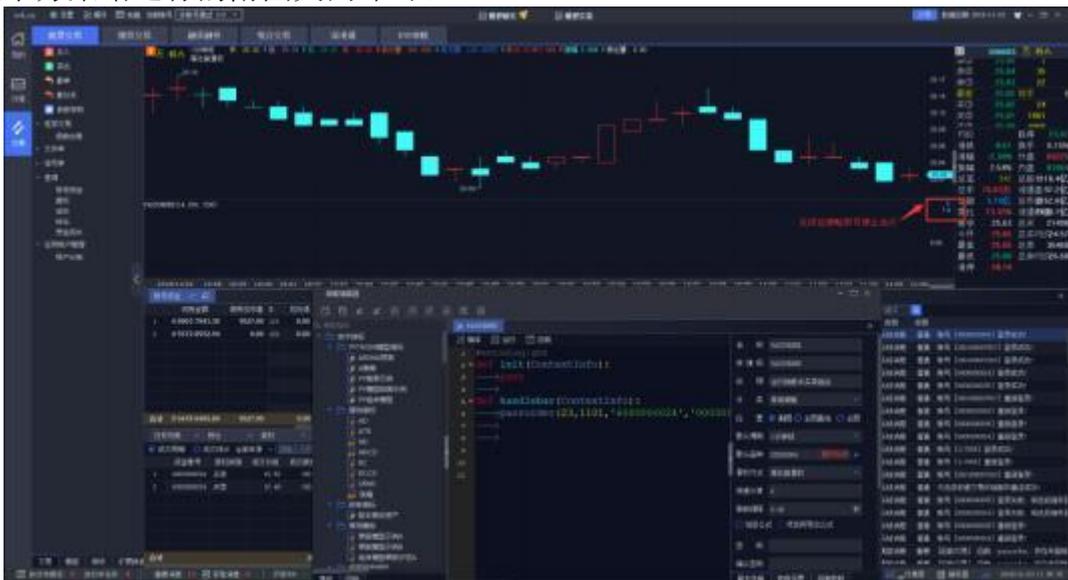


图104 关闭运行中的策略之一

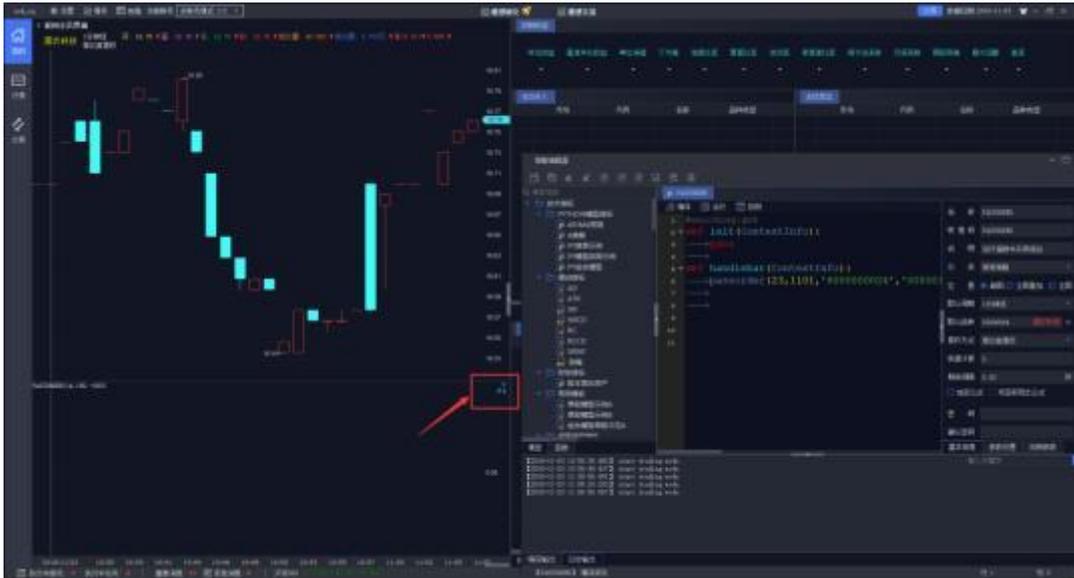


图105 关闭运行中的策略之二

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

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

11.4 操作记录

在模型列表点击查看，可查看该策略的历史运行和回测记录。

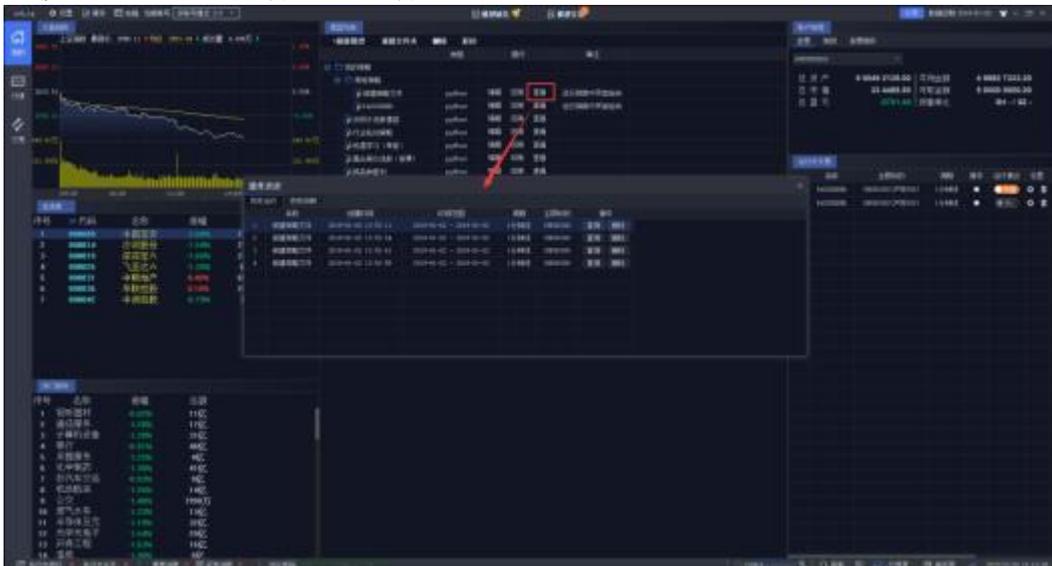


图106 操作记录-查看操作记录

点击某条记录后的查询按钮，可查看当时运行或回测时使用的策略代码。

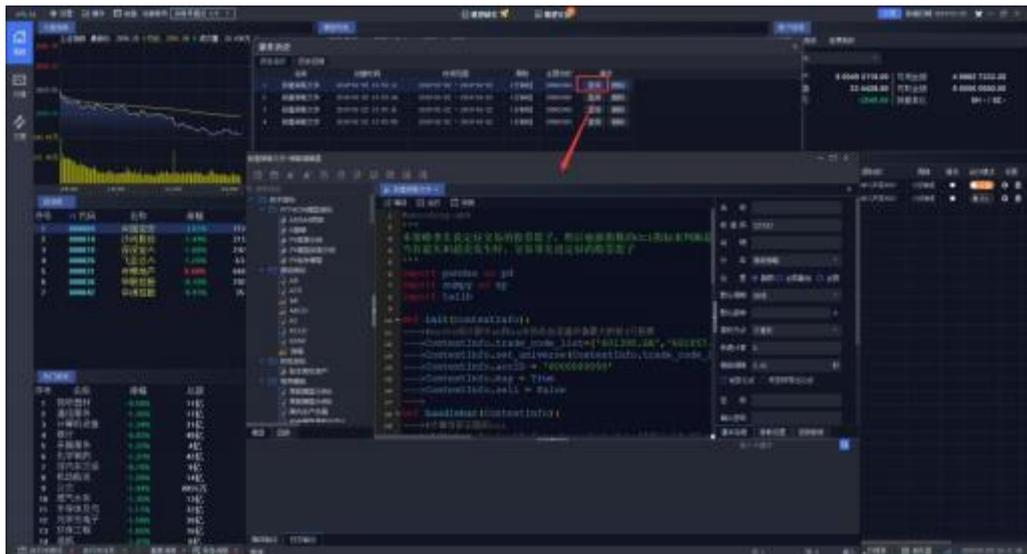


图107 操作记录-查看策略代码
点击某条记录后的删除按钮，可在表中删除该条记录。

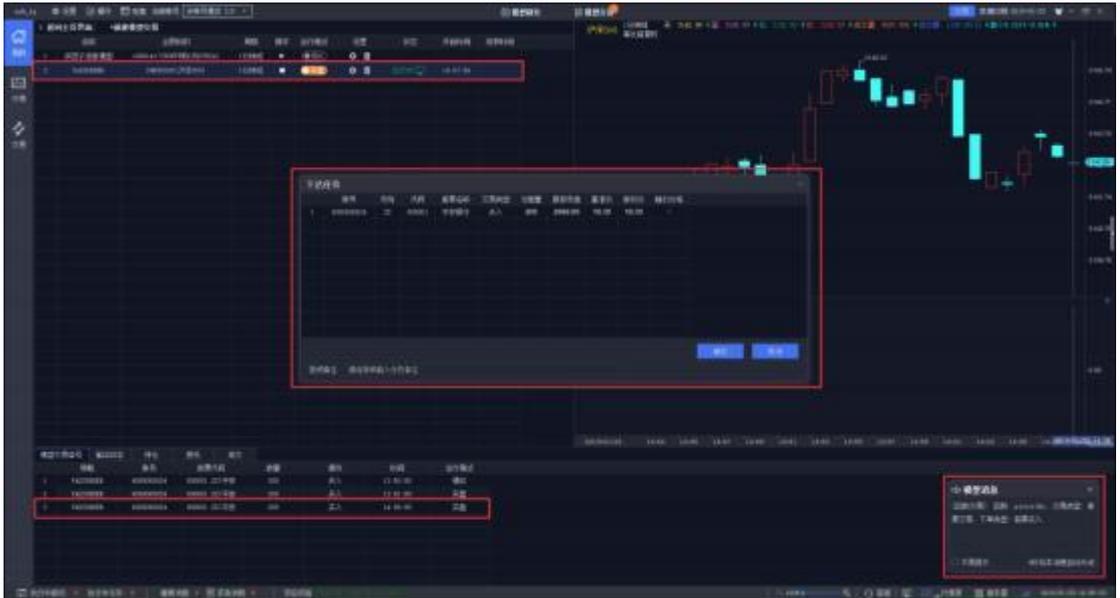


图111 实盘交易-下单信号

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



图112 输入投资备注



图113 任务中显示投资备注

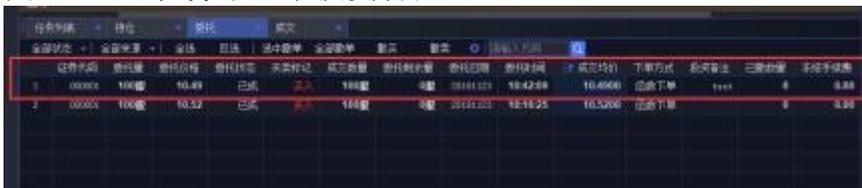
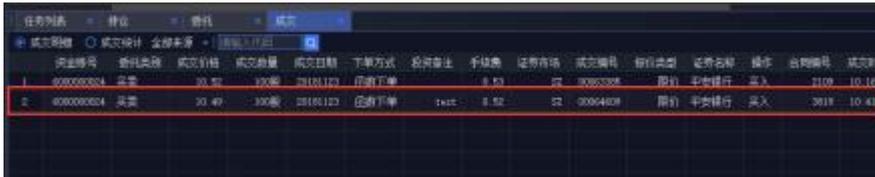


图114 委托中显示投资备注



成交编号	委托类型	成交价格	成交数量	成交日期	下单方式	投资备注	手续费	证券市场	成交编号	标的类型	证券名称	操作	仓位编号	成交日期
0000000001	买卖	30.92	100股	20181123	市价下单		0.03	深	0000000001	限价	平安银行	买入	1100	10.16
0000000002	买卖	30.49	100股	20181123	市价下单		0.03	深	0000000002	限价	平安银行	买入	3018	10.41

图115 成交中显示投资备注

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



图116 模型交易—状态显示

十三、网格交易策略

13.1 网格交易特色

13.1.1 网格交易简介

QMT 网格策略，是一种利用‘交易档位’模式对标的进行机械式买入卖出操作的量化策略，是一个适用于震荡行情的经典策略。

我们假定一个价值中值 X ，如图所示，以 X 为基准，以变动价格 Y 作为图中网格的间距，并当价格上涨/下跌至 Y_1, Y_2, Y_3 时进行反复的分档的买入和卖出操作，当发生成交时反向按照网格收益 Z 进行下单，即可在持续波动的行情中实现买卖分别成交一次便能获取一次收益 Z 的效果。

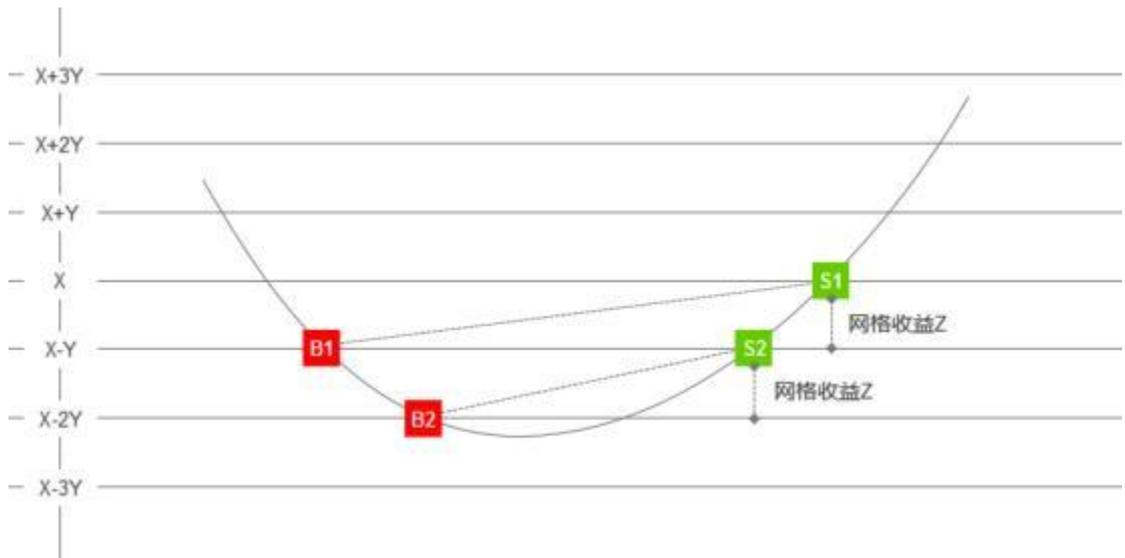


图117 网格交易-买卖网格图示

13.1.2 适用场景

(1) 重仓套牢/长期持有客户

使用日内网格交易，重仓套牢用户可以在等待股价回升的过程中，主动获取部分波动收益，降低持仓成本，加快解套周期，长期持有客户，可以利用手中的持仓，增加收益，使持仓利用更有效率。

(2) 偏好 T+0 交易客户

在不承担底仓风险的情况下（如通过借券、融券等方式建立底仓），或交易 T+0 品种，可以获得日内交易收益。

(3) 特定产品

阿尔法收益型产品，不仅可以利用阿尔法底仓所建立的股票市值头寸，参与新股线下配售，而且还可以在已有股票池基础上，实现日内网格交易，捕捉股票日内已有的波动，增厚产品收益

13.1.3 注意事项

网格策略适在某只股票在某个价格区间来回震荡时，表现优异，尤其在 K 线呈 W 型时能获取最佳收益，但策略在 K 线呈单边时，表现不佳，因此我们需要注意以下几点：

①使用网格交易时，需要股票价格区间反复震荡，因此应当注意选择投资标的，避开可能出现单边情况的标的，以免造成损失。

②使用网格交易时，要注意参数的设置是否能够有效地覆盖手续费，避免反复成交后，出现收益金额反而不足支付手续费的情况。

③使用网格交易时，要注意底仓成本与闲置资金的配比，推荐底仓成本与闲置资金配比大概在 3: 1 左右，避免出现频繁触发买入，金额不足，导致网格交易效率降低的情况。

13.2 操作流

13.2.1 打开策略模块

在系统主界面上方点击【模型交易】按钮，将界面切换至 QMT 策略功能界面。点击左方的【网格策略】图标。

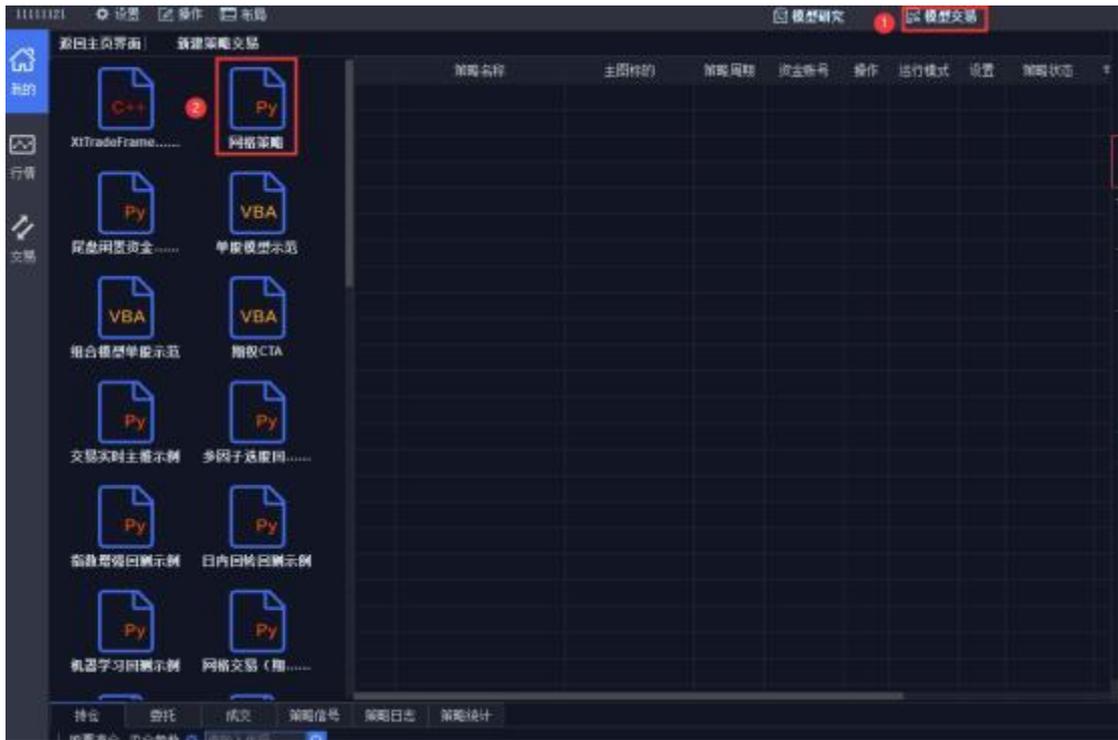


图118 网络交易-主页

13.2.2 配置网络策略

在弹出【编辑策略交易】设置框中设置网络参数，参数说明请参照 13.3 小节。



图119 网格策略-参数设置

13.2.3 运行网格策略

点击策略列表中对对应策略的【操作】列中的“”按钮，运行策略。点击“”按钮，终止策略运行。终止后的策略，可以对进行参数修改和策略的删除操作。

注意：终止策略只是终止策略运行，不能撤销执行中的委托。

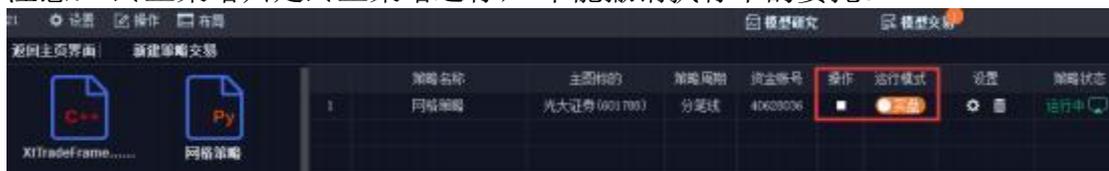


图120 网格策略-运行控制界面

13.3 参数说明

13.3.1 主要参数

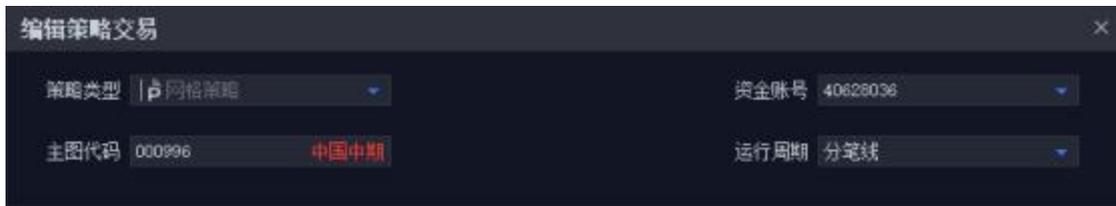


图121 网格策略-参数设置界面

资金账号：选定交易资金账号（只支持股票）

主图代码：选择交易标的证券代码

运行周期：选择分笔线

13.3.2 基础参数

基础		买入		卖出	
基准价差	0.12 元	基准价格	13.16	基准价格	13.34
结束前仓位复原	是	委买最低价	12.01 元	委卖最高价	14.67 元
仓位复原报价方式	最新价	单笔大小	1200 股	单笔大小	1200 股
网格间距	0.06 元	单向笔数	2 笔	单向笔数	2 笔
仓位复原时间	14:50:00	-	-	-	-
最大买卖笔数偏差	3 笔	-	-	-	-

图122 网格策略-基础参数

基准价差：买入成交一笔后，系统依据买入成交的价格上浮一个“基准价差”单位，做为反向卖出的委托价格；同样的，卖出成交一笔后，系统会依据卖出成交的价格下调一个“基准价差”做为反向买入的委托价格。

仓位复原时间：当“结束前仓位复原”选择“是”时，支持自定义设置仓位复原时间。

仓位复原报价方式：支持自定义恢复初始仓位时的报价方式，注意：仓位复原操作仅是于复原时间系统依照选用的报价方式下达进行补仓的委托，并不能保证一定成交。建议选择对手价，恢复初始仓位的委托更容易成交。

网格间距：初始下达委托及发生成交，系统补全买入/卖出委托队列时使用的价格间距
结束前仓位复原：设置是否在收盘前进行恢复初始仓位，仓位复原的基准是当前交易日的初始持仓数量。

最大买卖笔数偏差：对卖出成交笔数与买入成交笔数的数量进行判断，若卖出成交笔数减买入成交笔数大于最大买卖笔数偏差，则把执行中的卖出委托全部撤单；同样的，若买入成交笔数减卖出成交笔数大于最大买卖笔数偏差，则把执行中的买入委托全部撤单。之后，除了“结束前恢复仓位”情况的撤单和委托，其他报撤单操作不再执行。

13.3.3 买入参数

基础		买入		卖出	
基准差价	0.12 元	基准价格	13.16	基准价格	13.34
结束前仓位复原	是	委买最低价	12.01 元	委卖最高价	14.67 元
仓位复原报价方式	最新价	单笔大小	1200 股	单笔大小	1200 股
网格间距	0.06 元	单向笔数	2 笔	单向笔数	2 笔
仓位复原时间	14:50:00	-	-	-	-
最大买卖笔数偏差	3 笔	-	-	-	-

图123 网格策略-买入参数

基准价格：执行买入委托的初始基准价格，也就是初始委买队列的最高价格

委买最低价：限定委托买入最低的价格

单笔大小：委买队列的单笔委托股数

单向笔数：委买队列的委托笔数，即买入方向的网格数量，系统按照此参数值下达对应数量的买入委托，当出现买入成交时，为保证委托笔数不变，会以此参数值及网格间距为依据，补全对应价格的买入委托

13.3.4 卖出参数

基础		买入		卖出	
基准差价	0.12 元	基准价格	13.16	基准价格	13.34
结束前仓位复原	是	委买最低价	12.01 元	委卖最高价	14.67 元
仓位复原报价方式	最新价	单笔大小	1200 股	单笔大小	1200 股
网格间距	0.06 元	单向笔数	2 笔	单向笔数	2 笔
仓位复原时间	14:50:00	-	-	-	-
最大买卖笔数偏差	3 笔	-	-	-	-

图124 网格策略-卖出参数

基准价格：执行卖出委托的初始基准价格，也就是初始委卖队列的最低价格

委卖最高价：委托卖出最高的价格

单笔大小：委卖队列的单笔委托股数

单向笔数：委卖队列的委托笔数，即卖出方向的网格数量，系统按照此参数数值下达对应数量的卖出委托，当出现卖出成交时，为保证委托笔数不变，会以此参数值及网格间距为依据，补全对应价格的卖出委托

启动策略前需交易者参照实际行情及套利需求填入以上参数，系统可自动根据上述参数生成委托队列，随后进行一系列报撤单操作，具体过程及注意事项见应用举例。

13.4 应用举例

13.4.1 初始下单

设定初始网格参数并运行策略开始下单，如下例：
此次网格交易案例的交易标的为 000996 中国中期。

【基础参数】

基准价差设置为 0.12 元；
结束前恢复初始仓位，仓位恢复报价方式为对手价；
价格复原时间为 14: 50: 00；
网格间距设置为 0.06 元；
最大买卖笔数偏差为 3 笔；

【买入参数】

买入基准价为 13.16 元；
最低委买价格为 12.1 元(此次取了当天跌停价)；
单笔数量为 1200 股；
单向笔数为 2 笔；

【卖出参数】

卖出基准价格设置为 13.34 元；
委卖最高价为 14.67 元(此次取了当天涨停价)；
单笔大小为 1200 股；
单向笔数为 2 笔。



图125 网格策略-参数设置

策略运行时，系统自动下入 2 笔卖出委托单和 2 笔买入委托单，如下：

表 1 初始卖出委托

单向笔数 (2 笔)	委托卖出	定价公式
1	13.40	卖出基准价+网格间距 (13.34+0.06)
2	13.34	卖出基准价 (13.34)

表 2 初始买入委托

单向笔数 (2 笔)	委托买入	定价公式
1	13.16	买入基准价 (13.16)
2	13.10	买入基准价- 网格间距 (13.16-0.06)

13.4.2 成交时价格突破处理

委托成交的默认定义：委托的委托状态变为“已成”时，判断这一笔委托成交，不包含“部分成交”的委托状态。

当有一笔买入委托成交时，完成以下三个操作：

(1) 下一笔买入委托，价格为当前买入委托的最低价减去网格间距，股数为买入的单向笔数；

(2) 下一笔卖出委托，价格为此次买入成交价加上基准价差，股数为买入的单向笔数；

(3) 撤单，对卖出委托队列的最高价的委托撤单。

同理，当有一笔卖出委托成交时，完成以下三个操作：

(1) 下一笔卖出委托，价格为当前卖出委托的最高价加上网格间距，股数为卖出的单向笔数；

(2) 下一笔买入委托，价格为此次卖出成交价减去基准价差，股数为卖出的单向笔数；

(3) 撤单，对买入委托队列的最低价的委托撤单。

案例：下午 13:00 开始交易至 15:00 收盘，共成交 5 笔（买入 1 笔，卖出 4 笔），成交情况如图 10，委托列表如图 11。

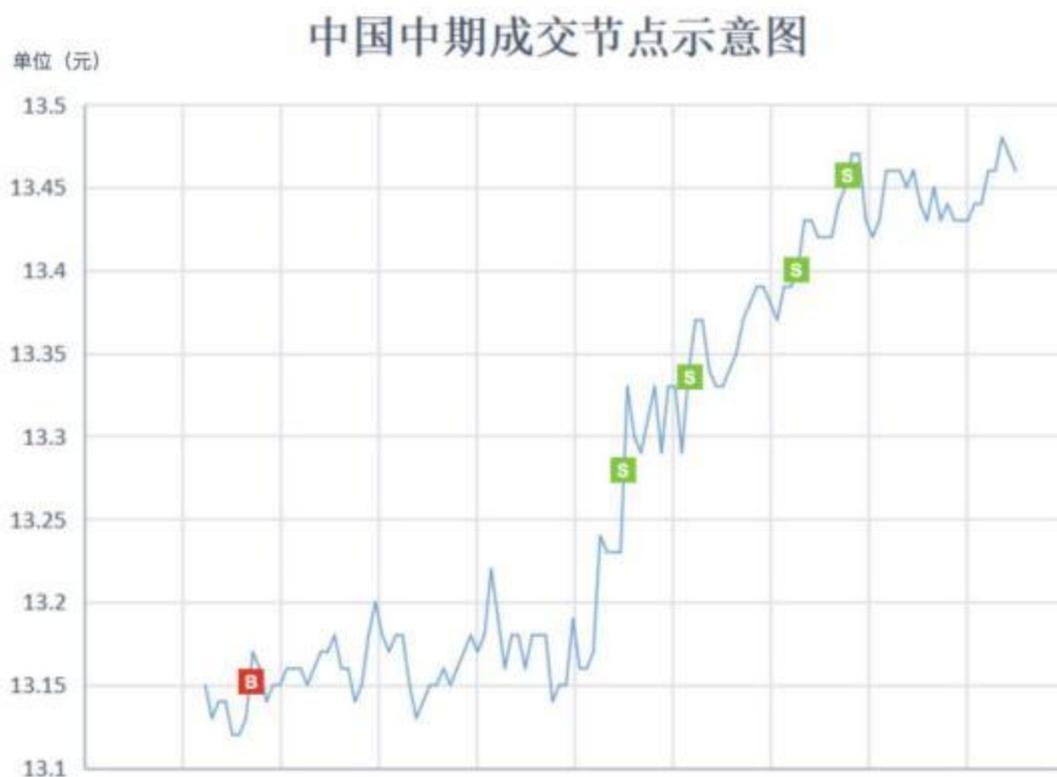


图126 网格策略-买卖节点

委托时间	证券代码	证券名称	买卖标记	委托量	委托价格	合同编号	成交数量	委托状态	委托剩余量
14:50:59	000996	中国中期	限价买入	3600股	13.44	704949	3600股	已成	0股
14:32:47	000996	中国中期	限价买入	1200股	13.34	704941	0股	已撤	1200股
14:32:47	000996	中国中期	限价卖出	1200股	13.58	704940	0股	已撤	1200股
14:25:32	000996	中国中期	限价卖出	1200股	13.52	704930	0股	已撤	1200股
14:25:32	000996	中国中期	限价买入	1200股	13.28	704929	0股	已撤	1200股
14:04:08	000996	中国中期	限价卖出	1200股	13.46	702497	1200股	已成	0股
14:04:08	000996	中国中期	限价买入	1200股	13.22	702496	0股	已撤	1200股
14:00:11	000996	中国中期	限价卖出	1200股	13.40	702494	1200股	已成	0股
14:00:11	000996	中国中期	限价买入	1200股	13.16	702493	0股	已撤	1200股
13:34:02	000996	中国中期	限价买入	1200股	13.04	702486	0股	已撤	1200股
13:34:02	000996	中国中期	限价卖出	1200股	13.28	702487	1200股	已成	0股
13:33:56	000996	中国中期	限价买入	1200股	13.40	702482	0股	已撤	1200股
13:33:56	000996	中国中期	限价买入	1200股	13.16	702481	1200股	已成	0股
13:33:56	000996	中国中期	限价卖出	1200股	13.34	702480	1200股	已成	0股
13:33:56	000996	中国中期	限价买入	1200股	13.10	702479	0股	已撤	1200股
合计				20400			20400		10800

图127 网格策略-委托列表

按照行情走势，第一次成交为买入成交，此时，买入委托的成交价格为13.16元。按照网格交易的参数的三个操作：

- (1) 按照买入委托队列的最低价（13.10元）减去网格间距（0.06元），下买入委托（13.04元）；
- (2) 按照买入成交价格（13.16元）加上基准价差（0.12元），反向下卖出委托（13.28元）；
- (3) 撤掉最高价（13.40元）的卖出委托。

此时委托列表更新为：

表3 第一次成交之后执行中的卖出委托列表

单向笔数（2笔）	委托卖出	定价公式
1	13.34	原卖出委托（13.34）
2	13.28	买入成交价+基准价差（13.16+0.12）

表4 第一次成交之后执行中的买入委托列表

单向笔数（2笔）	委托买入	定价公式
1	13.10	原买入委托（13.10）
2	13.04	最低买入价-网格间距（13.10-0.06）

按照行情走势，第二次成交为委托卖出成交，此时，卖出委托的成交价格为13.28元。

按照网格交易的参数的三个操作：

(1) 按照卖出委托队列的最高价 (13.34 元) 加上网格间距 (0.06 元), 下卖出委托 (13.40元);

(2) 按照卖出成交价格 (13.28 元) 减去基准价差 (0.12 元), 反向下买入委托 (13.16元);

(3) 撤掉最低价 (13.04 元) 的买入委托。

此时委托列表更新为:

表 5 第二次成交之后执行中的卖出委托列表

单向笔数 (2 笔)	委托卖出	定价公式
1	13.40	最高卖出价+网格间距 (13.34+0.06)
2	13.34	原卖出委托 (13.34)

表 6 第二次成交之后执行中的买入委托列表

单向笔数 (2 笔)	委托买入	定价公式
1	13.16	卖出成交价-基准价差 (13.28-0.12)
2	13.10	原买入委托 (13.10)

第三次成交为卖出成交, 此时, 卖出委托的成交价格为 13.34 元。按照网格交易的参数的三个操作:

(1) 按照卖出委托队列的最高价 (13.40 元) 加上网格间距 (0.06 元), 下卖出委托 (13.46元);

(2) 按照卖出成交价格 (13.34 元) 减去基准价差 (0.12 元), 反向下买入委托 (13.22元);

(3) 撤掉最低价 (13.10 元) 的买入委托。

此时委托列表更新为:

表 7 第三次成交之后执行中的卖出委托列表

单向笔数 (2 笔)	委托卖出	定价公式
1	13.46	最高卖出价+网格间距 (13.40+0.06)
2	13.40	原卖出委托 (13.40)

表 8 第三次成交之后执行中的买入委托列表

单向笔数 (2 笔)	委托买入	定价公式
1	13.22	卖出成交价-基准价差 (13.34-0.12)
2	13.16	原买入委托 (13.16)

第四次成交为卖出成交, 此时, 卖出委托的成交价格为 13.40 元。按照网格交易的参数的三个操作:

(1) 按照卖出委托队列的最高价 (13.46 元) 加上网格间距 (0.06 元), 下卖出委托 (13.52元);

(2) 按照卖出成交价格 (13.40 元) 减去基准价差 (0.12 元), 反向下买入委托 (13.28元);

(3) 撤掉最低价 (13.16 元) 的买入委托。

表 9 第四次成交之后执行中的卖出委托列表

单向笔数 (2 笔)	委托卖出	定价公式
1	13.52	最高卖出价+网格间距 (13.46+0.06)
2	13.46	原卖出委托 (13.46)

表 10 第四次成交之后执行中的买入委托列表

单向笔数 (2 笔)	委托买入	定价公式
1	13.28	卖出成交价-基准价差 (13.40-0.12)
2	13.22	原买入委托 (13.22)

第五次成交为卖出成交，此时，卖出委托的成交价格为 13.46 元。按照网格交易的参数的三个操作：

(1) 按照卖出委托队列的最高价 (13.52 元) 加上网格间距 (0.06 元)，下卖出委托 (13.58 元)；

(2) 按照卖出成交价格 (13.46 元) 减去基准价差 (0.12 元)，反向下买入委托 (13.34 元)；

(3) 撤掉最低价 (13.22 元) 的买入委托。

表 11 第五次成交之后执行中的卖出委托列表

单向笔数 (2 笔)	委托卖出	定价公式
1	13.58	最高卖出价+网格间距 (13.52+0.06)
2	13.52	原卖出委托 (13.52)

表 12 第五次成交之后执行中的买入委托列表

单向笔数 (2 笔)	委托买入	定价公式
1	13.34	卖出成交价-基准价差 (13.46-0.12)
2	13.28	原买入委托 (13.28)

最终，盘中时间到达设定的恢复仓位时间 (14: 50: 00)，网格策略触发恢复底仓操作，此时撤掉所有未成交委托，并对比初始持仓 (即开盘前持仓数量)，以“仓位复原报价方式” (此次设置为对手价)，下数量为 3600 股 (当日卖出数量 4800-当日买入数量 1200) 的买入委托，此时委托列表更新为：

表 13 执行恢复持仓操作后的委托

委托买入	定价公式
13.44	对手价 (13.44) 买入 3600 股

13.4.3 特殊情况处理

1、对于可用资金不足，持仓可用数量不足的处理：

(1) 可用资金不足：即可用资金小于委买最高价乘以委买数量时，撤销除买入委托价格最高的其他委托，以确保如果下一次“买入成交”时对新增买入委托。此次操作之后，买入委托队列只有一笔。

(2) 持仓可用数量不足：即证券持仓可用量小于网格卖出挂单数量，撤销除卖出委托价格最低的其他委托，以确保如果下一次“卖出成交”时对新增卖出委托。此次操作之后，卖出委托队列只有一笔。

2、暴跌或暴涨跳空处理： (委买或委卖在两个分笔之间的时间内全部成交)，除了“结束前恢复仓位”的委托，其他报撤单操作不再执行；

判断是否触发跳空的定义：

对于买入方向，前一分笔时间点的买入委托笔数大于 1（排除因“可用资金不足”造成的买入委托只有一笔的情况），当前分笔最新价小于前一分笔时间点的买入委托的最低价，

判断即为暴跌跳空；

对于卖出方向，前一分笔时间点的卖出委托笔数大于 1（排除因“持仓数量不足”造成的买入委托只有一笔的情况），当前分笔最新价大于前一分笔时间点的卖出委托的最高价，判断即为暴涨跳空。

13.4.4 收盘前恢复持仓处理

当到达参数所设时间时，执行以下两个操作：

（1）撤回所有交易标的委托，等待主图三个分笔主推之后（防止撤单过程中继续有成交，导致当日持仓变化数量计算错误）。

（2）计算当日持仓数量的变化量。如果当日持仓数量的减少，以“仓位复原报价方式”的报价方式、“当日持仓数量的变化量”的股数发起买入委托；如果当日持仓数量的增加，以“仓位复原报价方式”的报价方式、“当日持仓数量的变化量”的股数发起卖出委托；后续不再进行买卖撤单等操作，等待成交恢复今天开盘前的持仓数量。

十四、两融交易

金阳光 QMT 客户端支持对接两融交易，用户需将 QMT 绑定两融资金账号。绑定方法详情请见 1.3 绑定信用账号。

14.1 担保品买卖



图128 担保品买入普通交易



图129 担保品买入算法交易



图130 担保品卖出普通交易



图131 担保品卖出算法交易
担保品买入和卖出包括普通交易和算法交易。设置方法详见股票交易。

14.2 融资融券

The screenshot shows a trading interface for margin trading (融资融券). The main menu includes '易', '融资融券', '组合交易', '沪港通', and '深港通'. The '融资融券' section is active, with sub-tabs for '融资买入' (Margin Buy), '融券卖出' (Margin Sell), '买券还券', '卖券还款', '直接还券', and '直接还款'. The '融资买入' sub-tab is selected, with further options for '普通交易' (Ordinary Trade) and '算法交易' (Algorithmic Trade). The '普通交易' sub-tab is active, showing '报价方式' (Quote Method) and '指定价' (Designated Price). The '投资备注' (Investment Remarks) field is empty.

The main trading area displays the following information:

- 证券名称: 光大证券 (Guangda Securities)
- 当前价格: 12.70+
- 涨跌幅: +0.14 +1.11%
- 股票代码: 601788

交易方向	价格	数量	交易方向	价格	数量
卖 1	12.71	95	买 1	12.70	64
卖 2	12.72	1402	买 2	12.69	11
卖 3	12.73	1094	买 3	12.67	183
卖 4	12.74	529	买 4	12.66	78
卖 5	12.75	2317	买 5	12.65	478
卖 6	12.76	303	买 6	12.64	116
卖 7	12.77	94	买 7	12.63	219
卖 8	12.78	593	买 8	12.62	76
卖 9	12.79	296	买 9	12.61	238
卖 10	12.80	2637	买 10	12.60	721

Additional information shown:

- 涨停: 13.82 跌停: 11.30
- 委托价: 12.71
- 总量: 100 股
- 买入按钮

图132 融资买入普通交易



图133 融资买入算法交易



图134 融券卖出普通交易

易		融资融券	组合交易	沪港通	深港通				
下单面板									
		融资买入	融券卖出	买券还券	卖券还款	直接还券	直接还款		
担保品买入	普通交易	算法交易	!	光大证券		12.71+			
	报价方式		指定价	601788		+0.15 +1.19%			
担保品卖出	单笔基准量		目标量	卖 1	12.71	105	买 1	12.70	1160
	基准量比例		10.00 %	卖 2	12.72	1384	买 2	12.69	10
	下单间隔		60.00 秒	卖 3	12.73	1041	买 3	12.68	104
	数单间隔		60.00 秒	卖 4	12.74	624	买 4	12.67	177
	双向波动区间		5.00 %	卖 5	12.75	2426	买 5	12.66	143
	单笔最小量		100 股	卖 6	12.76	303	买 6	12.65	488
	单笔最大量		10000 股	卖 7	12.77	94	买 7	12.64	116
	有效时间		1800 秒	卖 8	12.78	588	买 8	12.63	219
	最大委托次数		20 次	卖 9	12.79	276	买 9	12.62	76
	未成委托处理		不处理	卖 10	12.80	2637	买 10	12.61	338
投资备注				涨停		13.82	跌停	11.30	
				卖出					

图135 融券卖出算法交易



图136 买券还券普通交易



图137 买券还券算法交易

易		融资融券	组合交易	沪港通	深港通			
下单面板								
担保品买入	融资买入	融券卖出	买券还券	卖券还款	直接还券 直接还款			
	资金账号	65602304	光大证券	12.68+				
	负债金额	0.00 元	601788	+0.12 +0.96%				
担保品卖出	可卖持仓数量	0 股						
	普通交易 算法交易							
融资融券	报价方式	指定价	卖 1	12.69	458	买 1	12.68	149
	投资备注		卖 2	12.70	481	买 2	12.67	96
			卖 3	12.71	430	买 3	12.66	163
			卖 4	12.72	957	买 4	12.65	487
			卖 5	12.73	1252	买 5	12.64	116
			卖 6	12.74	709	买 6	12.63	219
			卖 7	12.75	2524	买 7	12.62	137
			卖 8	12.76	313	买 8	12.61	388
			卖 9	12.77	94	买 9	12.60	854
			卖 10	12.78	588	买 10	12.59	120
			涨停	13.82	跌停	11.30		
委托价		12.68						
总里		100						
				还款				

图138 卖券还款普通交易

易		融资融券	组合交易	沪港通	深港通			
下单面板								
担保品买入	融资买入	融券卖出	买券还券	卖券还款	直接还券 直接还款			
	资金账号	65602304	光大证券	12.69+				
	负债金额	0.00 元	601788	+0.13 +1.04%				
担保品卖出	可卖持仓数量	0 股						
	普通交易 算法交易							
融资融券	报价方式	指定价	卖 1	12.69	65	买 1	12.67	213
	单笔基准量	目标量	卖 2	12.70	238	买 2	12.66	163
	基准量比例	10.00 %	卖 3	12.71	561	买 3	12.65	92
	下单间隔	60.00 秒	卖 4	12.72	957	买 4	12.64	116
	撤单间隔	60.00 秒	卖 5	12.73	1252	买 5	12.63	232
	双向波动区间	5.00 %	卖 6	12.74	719	买 6	12.62	137
	单笔最小量	100 股	卖 7	12.75	2534	买 7	12.61	388
	单笔最大量	10000 股	卖 8	12.76	313	买 8	12.60	864
	有效时间	1800 秒	卖 9	12.77	94	买 9	12.59	70
	最大委托次数	20 次	卖 10	12.78	640	买 10	12.58	419
未成委托处理	不处理			涨停	13.82	跌停	11.30	
投资备注								
				还款				

图139 卖券还款算法交易

易		融资融券	组合交易	沪港通	深港通																																																																																
下单面板																																																																																					
	融资买入	融券卖出	买券还券	卖券还款	直接还券																																																																																
担保品买入	资金账号	65602304		光大证券	12.69+																																																																																
	未还合约数量	0 股		601788	+0.13 +1.04%																																																																																
	当日可还款数量	0 股																																																																																			
	可用持仓数量	0 股																																																																																			
担保品卖出	总量 0		- + 股																																																																																		
	还券																																																																																				
融资融券	<table border="1"> <thead> <tr> <th>卖</th> <th>1</th> <th>12.70</th> <th>72</th> <th>买</th> <th>1</th> <th>12.69</th> <th>11</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>卖</td> <td>2</td> <td>12.71</td> <td>568</td> <td>买</td> <td>2</td> <td>12.68</td> <td>135</td> </tr> <tr> <td>卖</td> <td>3</td> <td>12.72</td> <td>1032</td> <td>买</td> <td>3</td> <td>12.67</td> <td>189</td> </tr> <tr> <td>卖</td> <td>4</td> <td>12.73</td> <td>1261</td> <td>买</td> <td>4</td> <td>12.66</td> <td>163</td> </tr> <tr> <td>卖</td> <td>5</td> <td>12.74</td> <td>719</td> <td>买</td> <td>5</td> <td>12.65</td> <td>133</td> </tr> <tr> <td>卖</td> <td>6</td> <td>12.75</td> <td>2533</td> <td>买</td> <td>6</td> <td>12.64</td> <td>116</td> </tr> <tr> <td>卖</td> <td>7</td> <td>12.76</td> <td>313</td> <td>买</td> <td>7</td> <td>12.63</td> <td>232</td> </tr> <tr> <td>卖</td> <td>8</td> <td>12.77</td> <td>94</td> <td>买</td> <td>8</td> <td>12.62</td> <td>137</td> </tr> <tr> <td>卖</td> <td>9</td> <td>12.78</td> <td>640</td> <td>买</td> <td>9</td> <td>12.61</td> <td>388</td> </tr> <tr> <td>卖</td> <td>10</td> <td>12.79</td> <td>328</td> <td>买</td> <td>10</td> <td>12.60</td> <td>864</td> </tr> </tbody> </table>					卖	1	12.70	72	买	1	12.69	11	卖	2	12.71	568	买	2	12.68	135	卖	3	12.72	1032	买	3	12.67	189	卖	4	12.73	1261	买	4	12.66	163	卖	5	12.74	719	买	5	12.65	133	卖	6	12.75	2533	买	6	12.64	116	卖	7	12.76	313	买	7	12.63	232	卖	8	12.77	94	买	8	12.62	137	卖	9	12.78	640	买	9	12.61	388	卖	10	12.79	328	买	10	12.60	864
卖	1	12.70	72	买	1	12.69	11																																																																														
卖	2	12.71	568	买	2	12.68	135																																																																														
卖	3	12.72	1032	买	3	12.67	189																																																																														
卖	4	12.73	1261	买	4	12.66	163																																																																														
卖	5	12.74	719	买	5	12.65	133																																																																														
卖	6	12.75	2533	买	6	12.64	116																																																																														
卖	7	12.76	313	买	7	12.63	232																																																																														
卖	8	12.77	94	买	8	12.62	137																																																																														
卖	9	12.78	640	买	9	12.61	388																																																																														
卖	10	12.79	328	买	10	12.60	864																																																																														
	张停		13.82 跌停	11.30																																																																																	

图140 直接还券

易		融资融券	组合交易	沪港通	深港通
下单面板					
	融资买入	融券卖出	买券还券	卖券还款	直接还券
担保品买入	资金账号	65602304			
	负债金额	0.00 元			
	可还款资金	0.00 元			
担保品卖出	金额 0.00		- + 元		
	还款				
融资融券					

图141 直接还款

融资融券交易包括 6 种类型：融资买入、卖券还款，融券卖出、买券还券，直接还券、直接还款。前面 4 种有普通交易和算法交易。设置的详情同股票交易。

14.3 担保品划转

担保券划转界面的界面主要用于将普通账号与信用账号的股票仓位进行划转操作。担保品划入是将普通账户中的股票划转到信用账户中，普通账户持仓减少，信用账户持仓增加。

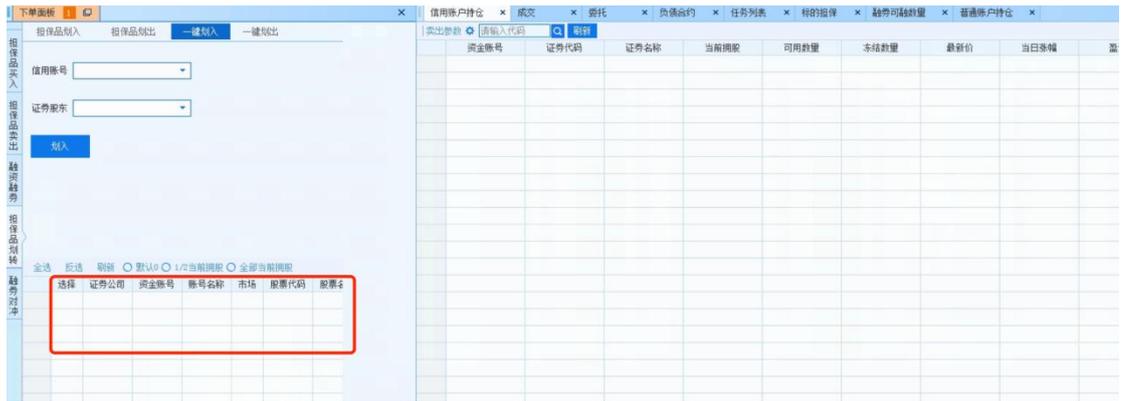


点击担保品划入时，系统自动展示普通账户持仓。担保品划出是将信用账户中的股票划转到普通账户中，普通账户持仓增加，信用账户持仓减少。

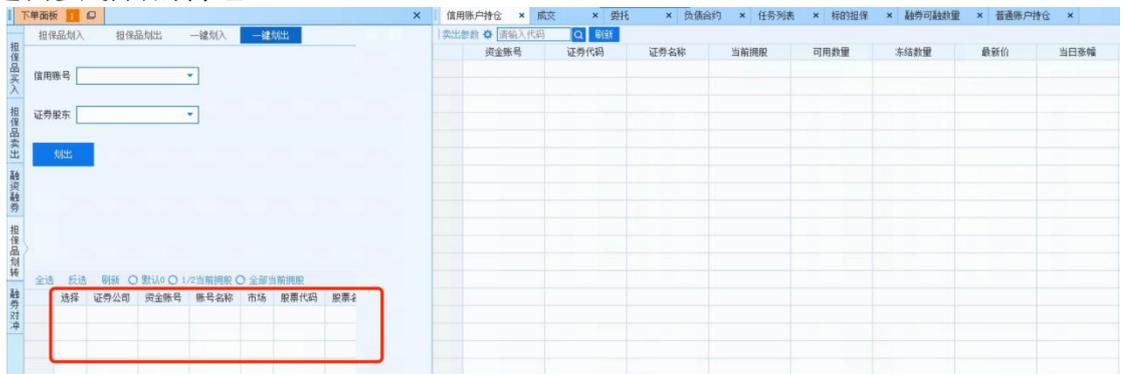


点击担保品划出时，系统自动展示信用持仓。

- ① 一键划入是将普通账户中的股票批量划转到信用账户中，普通账户持仓减少，信用账户持仓增加。一键划入时，选择账号信息后，可在账号下方的表中勾选需要划转的持仓。



- ② 一键划出是将信用账户中的股票批量划转到普通账户中，普通账户持仓增加，信用账户持仓减少。一键划出时，选择账号信息后，可在账号下方的表中勾选需要划转的持仓。



十五、资金划拨

QMT支持资金划拨功能。用户可点击功能栏中的“资金划拨”或操作-查看中“资金划拨”功能，进行极速交易客户资金划拨操作。可以选择划拨方向和资金账号，币种类别默认人民币。点击查询按钮可以查询可转金额。

极速交易客户资金划拨

划拨方向: 极速柜台划到普通柜台

资金账号: 普通柜台划到极速柜台
极速柜台划到普通柜台

币种类别: 人民币

划拨金额: 0.0 元

可转金额: 10 0000 0000.000 查询

确定 取消

选择好划拨方向、资金账号和划拨金额后，点击确认按钮，出现提示弹出，点击确认即可。

十六、期货交易和期现套利

QMT 期货交易、期现套利

金阳光 QMT 支持期货交易，并根据用户的需求对接不同的期货公司。用户可以在金阳光 QMT 客户端进行条件单、算法交易、策略交易、期现套利，并指定一些列套利参数，如套利比例、套利合约、套利时机等。

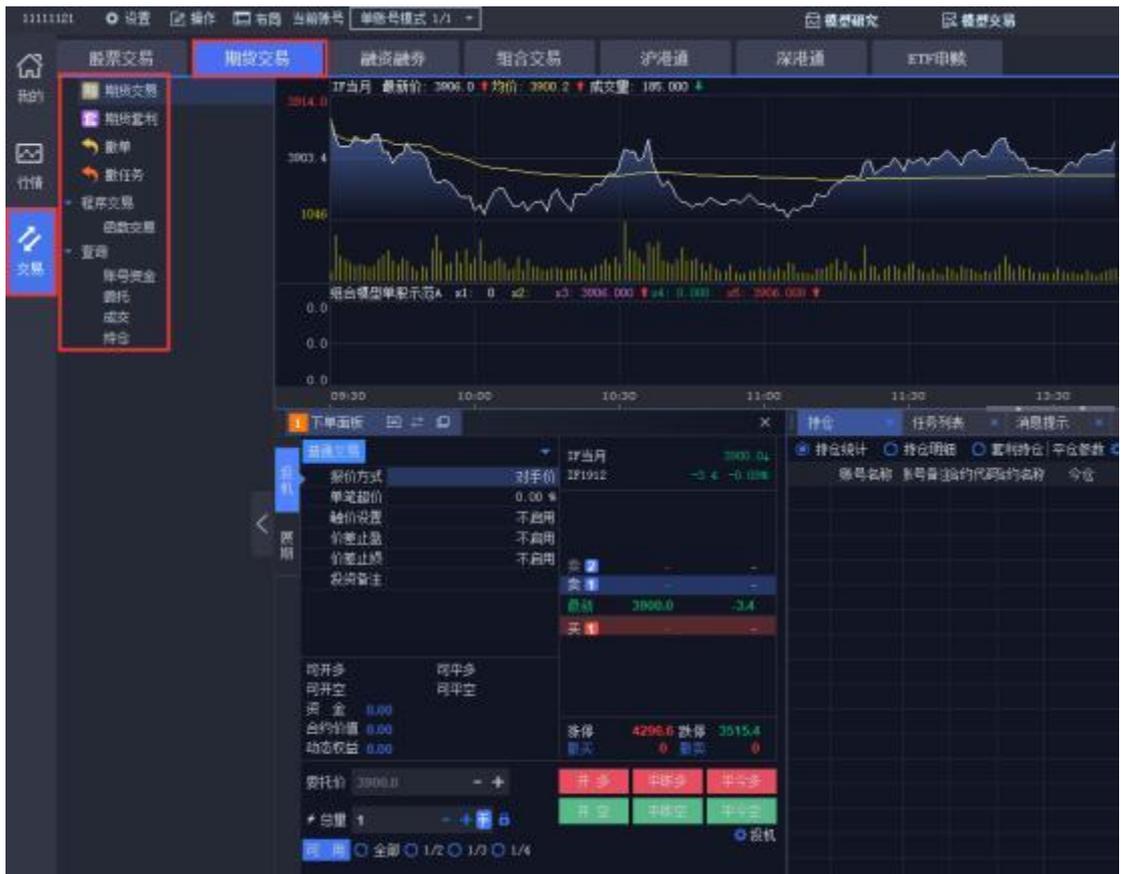


图167 期货交易主页

16.1 普通交易

普通交易支持投机、套利、套保的三种套利模式。下单面板有两种风格：默认风格和传统风格。通过下单面板的按钮可以随时更换这两个界面。



图168 期货交易-默认风格

默认风格下单面板可以随意切换六键、四键、两键，可以使用普通交易和算法交易。右侧展示账号关联的产品，可用资金、总资产、可开多、可开空、可平仓等一些数量，快速了解账号相关信息以便交易。



图169 期货交易-下单面板设置

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



图170 期货交易-传统风格

16.2 期货展期

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



图171 期货展期

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

16.3 期货套利

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

图174 期货套利-状态

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

⑤ 统计：

主要用于统计当前这笔单子合约 1、合约 2 的成交情况

⑥ 条件不符则放弃优先合约执行中的套利：

勾选“条件不符则放弃优先合约执行中的套利”：优先合约在执行过程中，若由于行情的变动，之前设置的规则不满足，任务就会被撤销。在期货套利的状态中会显示成交了多少、失败了多少。

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

⑦ 交易数限制：

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

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

⑧ 操作功能键

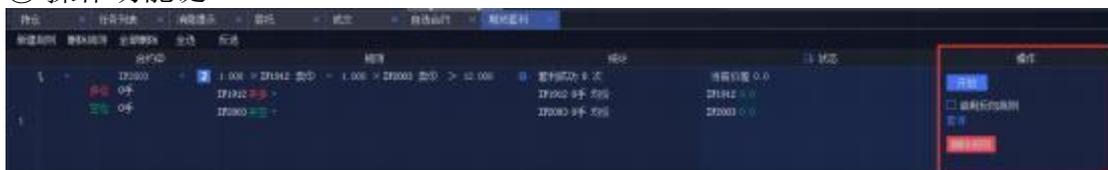


图175 期货逃离操作

开始、暂停与停止：点击【开始】后会出现暂停和停止功能键。启用反向

规则：类似于止盈止损功能，开多对应平多，开空对应平空；

新建规则、删除规则：删除规则必需先选中规则再删除；

自选合约：自选合约中选择套利合约，双击合约就会出现在期货套利规则列表中。



图176 期货套利-自选合约

16.4 期现套利

见组合交易章节的 10.4 小节

十七、自定义风控设置

QMT 风控设置

金阳光 QMT 客户端支持用户自定义风控规则，并采用多层次并行的处理方式对不同规则的风控检查，提高风控效率，降低风控延迟，对任何一条不符合规则会立即返回，确保安全至上。

点击主界面左上角的【设置】，在弹出框中可以看到风控设置的设置界面。

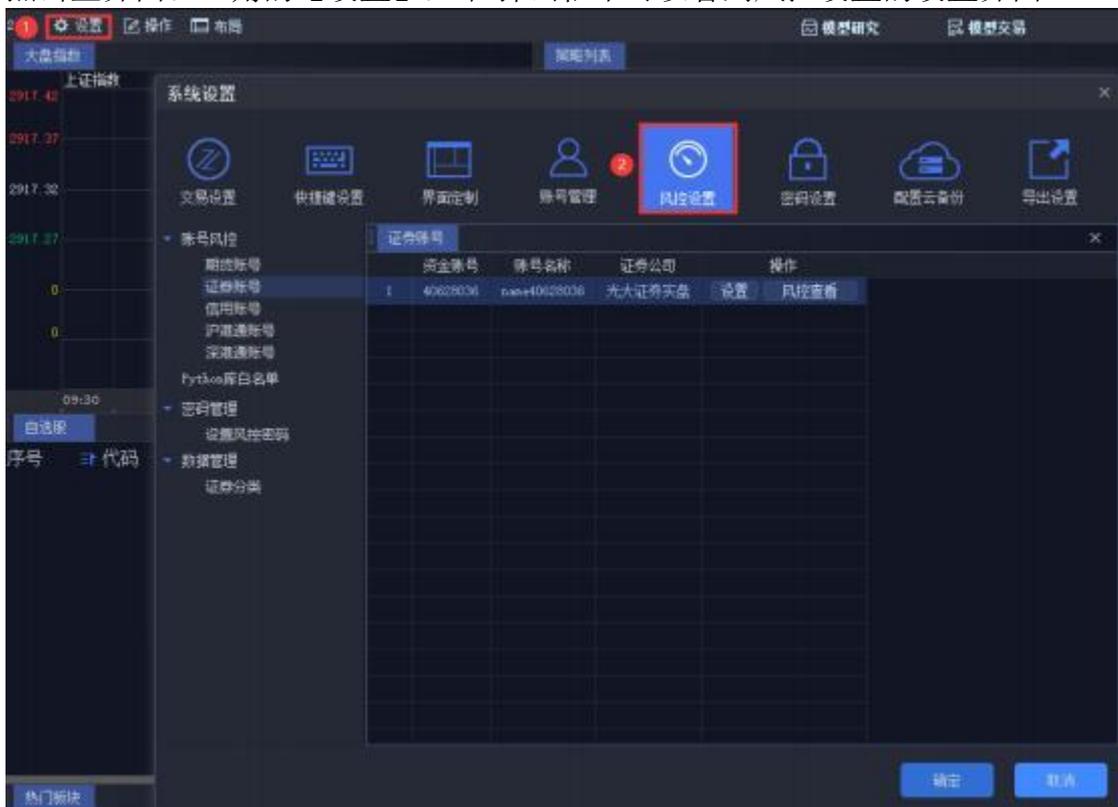


图177 风控设置-设置界面

17.1 账号风控

账号列表中展示所有已被添加的账号，在操作列中点击【设置】按钮进行账号风控设置。或者点击【风控查看】查看已配置的风控。



图178 风控设置-帐号风控

帐号风控设置包括黑白名单、交易限制、资产组合风控、个股限制、上交所合规、深交所合规。



图179 风控设置-帐号风控-设置

17.1.1 黑白名单

下单前，用户可以增减证券和期货交易设置帐号黑白名单，这属于事前风控。黑名单中的代码或分类被禁止交易，白名单中的代码或分类允许参与交易。如果没有设置黑白名单，则默认所有都为白名单；如果黑、白名单均已设置，且黑、白名单之间不存在交集，则除了白名单外的都属于黑名单；如果黑、白名单都设置，且黑、白名单存在交集，则白名单为白名单除了黑、白名单交集的部分，其它为黑名单；如果只设置黑名单，不设置白名单，则属于黑名单模式，即黑名单以内的禁止交易；如果只设置白名单，不设置黑名单，则属于白名单模式，即白名单以内的允许交易。同一代码、分类不能既存在于黑名单又存在于白名单。当勾选不限制卖出/平仓，黑名单中的股票代码可以卖出，黑名单中的期货合约可以平仓。

例如，设置 600815 为黑名单，601788 为白名单。



图180 风控设置-黑白名单

17.1.2 交易量价限制

交易量价限制可以对证券、期货添加不同分类的代码，分别设置不同的交易价格限制。

下单会根据限制规则提示，被风控驳回。

交易量价设置包括生效时间、生效日期和生效条件。交易量价限制有对市价、涨停价、跌停价、与当前价偏离超过设置百分比、与昨日收盘价偏离超过设置百分比、单笔最大委托量、单笔最大金额的限制。

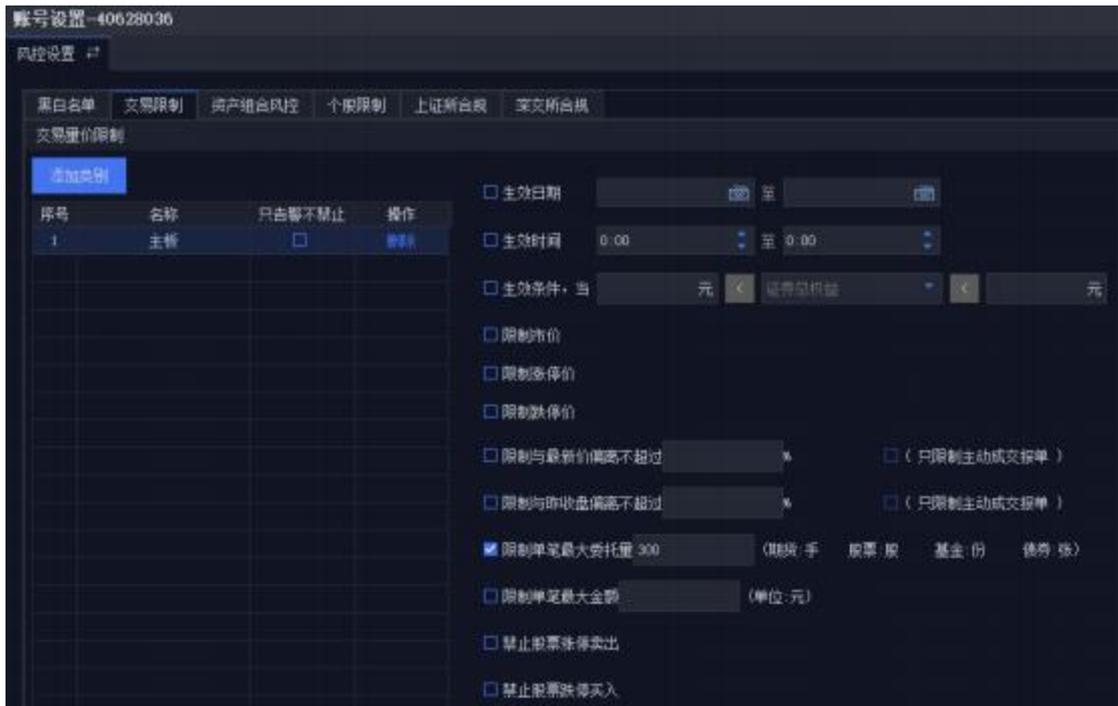


图181 风控设置-交易限制

例如：若限制单笔最大委托量是300，则每笔下单委托超过 300 股时会被风控驳回。

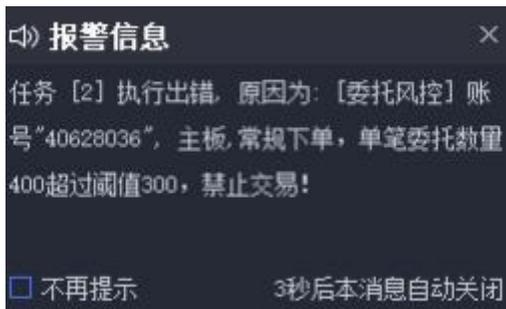


图182 风控报警-禁止交易

若勾选了【只警告不禁止】时，再次对其下单，仅会出现告警，但不禁止。告警信息和下单结果如下两图所示。

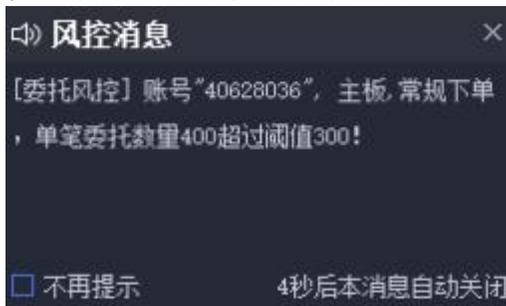


图183 风控消息提示

持仓	成交	任务列表	消息提示	新股申购	委托			
全部任务 全部撤销 全部暂停 全部继续 请输入代码								
任务	账号	代码	名称	交易参数	交易类型	金额	进度	委托详情
任务3	40628036	601788	光大证券	普通	买入	4672.00	400 / 400	已报! 收到!

图184 风警告警-任务下单成功

17.1.3 交易所合规

交易所合规分为上证所合规和深交所合规，用于控制单个资金账号的交易风险。其中证券帐号、信用帐号、股票期权帐号交易合规包含频率合规、数量合规、比例合规、金额合规。期货帐号交易合规包含频率合规和数量合规。沪港通账号和深港通账号交易合规包含频率合规。

序号	名称	交易所	最大报单参数	操作
1	频率合规	1	200笔/30000笔秒	删除 编辑
2	数量合规			
3	比例合规			
4	金额合规			

图185 风控设置-交易所合规

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



图186 风控设置-驳回 or 排队

17.1.4 资产组合风控

资产组合风控，即对投资者的一组或多组资产进行风险控制，通过设置各项风控条款去限制交易操作，减少或避免风险事件发生的各种可能性，减少风险事件发生时造成的损失。设置资产组合风控时需要选择资产组合规则，设置生效日期、时间、条件，添加资产指标，对设置指标进行分档限制。此外，用户可以自定义添加资产组合风控规则，目前分类为法规、合同、操作；或自定义生效日期、时间、条件，只有在设置的生效日期、时间、条件范围内，设置的资产组合风控才会被检查。



图187 组合资产指标

组合资产指标的设置支持添加多个。选择分母后可设置资产占比，在占比范围内的下单是被允许的，不在占比范围内的则视为违反设置的资产组合风控法规。设置轮询将会轮询

检查该资产组和风控，若有违规将会产生报警消息。



图188 组合风控触发提示

17.2 风控密码管理

对于已设置密码的用户，提供密码修改的功能；对于未设置密码的用户，提供密码设置功能。用户完成密码设置后，进入【风控设置】需输入正确密码才可进行风控设置。



图189 风控密码设置

十八、配股配债

本系统支持配股配债交易。

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

18.1 配股交易

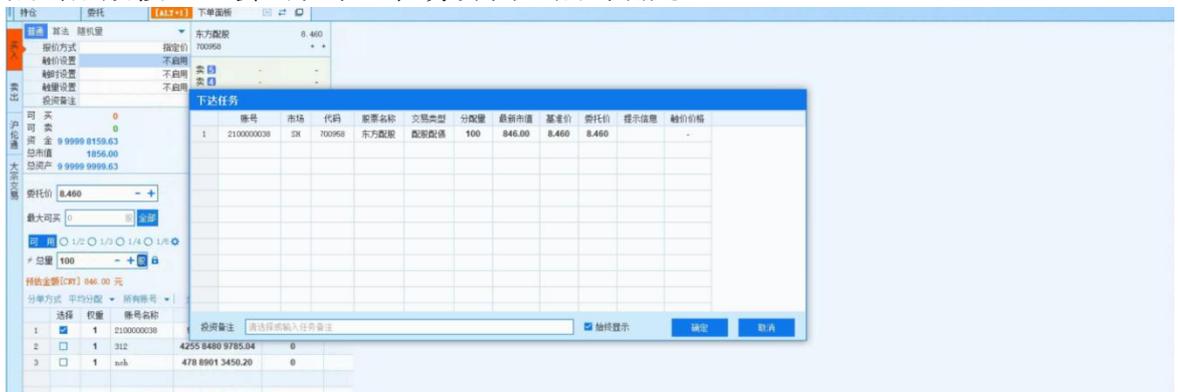
股票配股一般会发出公告在交易所网站，其中内容会有正股的代码和名称，同时会有配股截止日期、配股价格、配股比例、配股期限。同时会给出相应股票的配股代码。

本系统账号持仓中会有一条配股代码的持仓。

配股持仓中的可用数量就是这个账号可以配股的额度。这条持仓不算入总市值。此时的总资产和可用资金还是产生这条配股持仓之前的，没有发生变化。当在下单面板中填入相应的配股代码后，下单面板会出现配股按钮。



点击配股按钮，会出现下达任务界面，点击确定。



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

持仓	委托	下单面板																	
选择	资金账号	委托时间	证券代码	证券名称	委托类型	委托量	委托数量	委托状态	委托均价	成交价格	申报编号	申报备注	冻结金额	冻结手续费	申报原因	订单编号	股东号	客户端委托编号	委托编号
1	2100000038	15:16:25	700958	东方证券	配股	100股	0股	100股	已成交	8.460	8.4600	1000000102	0.00	0.00		940572674	2100000038		0
2	2100000038	14:12:27	600958	东方证券	首次公开发行网下配售申购	200股	0股	200股	已成交	9.2000	9.2000	1000000102	0.00	0.00		940572673	2100000038		0

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

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

如果交易所反馈配股失败，可用资金会恢复到配股之前，冻结资金恢复，且相应配股持仓也会消失。持正股数不变。

18.2 配债交易

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

十九、批量埋单

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

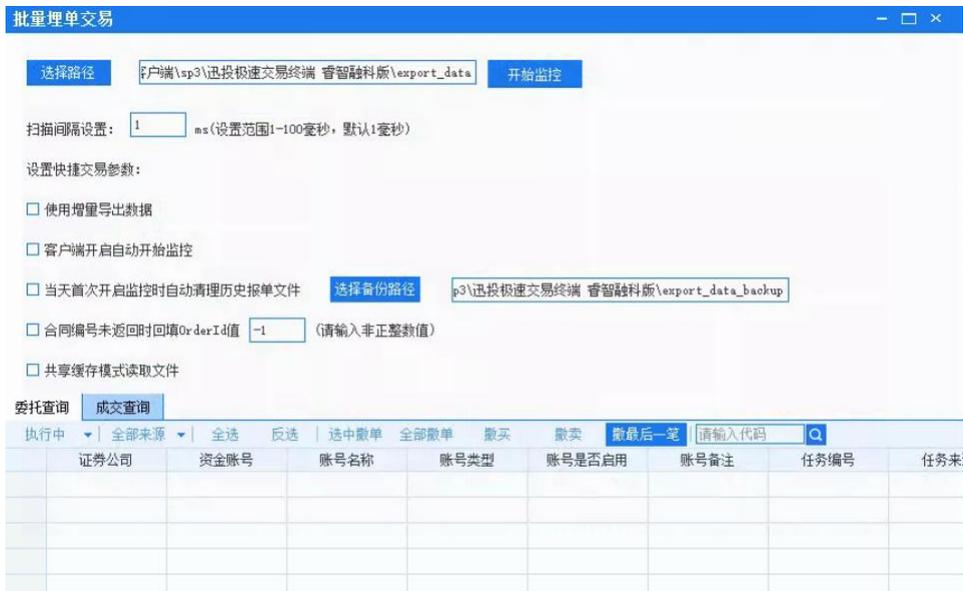
文件交互流程如下：

- ①外部系统在交易端监控路径文件中写入委托参数；
- ②终端实时扫描监控目录，读取委托参数自动进行委托下单；
- ③通过主推的方式将委托、成交回报等订单执行情况更新到共享文件中；
- ④外部系统实时读取共享文件，根据委托、成交回报进行后续委托、撤单任务的下发。

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



功能入口



功能界面

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

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

客户端开启自动开始监控：支持选择是否在客户端开始后自动开启埋单监控。

设置完成后点击开始监控，批量埋单即开始运行。

名称	修改日期	类型	大小
XT_CCTJ_Stock_20200907.dbf	2020/9/7 14:36	DBF Viewer 200...	9 KB
XT_CJCX_Stock_20200907.dbf	2020/9/7 14:16	DBF Viewer 200...	6 KB
XT_DBF_ORDER.dbf	2020/9/7 14:16	DBF Viewer 200...	1 KB
XT_DBF_ORDER_result.dbf	2020/9/7 14:16	DBF Viewer 200...	1 KB
XT_RWCX_Stock_20200907.dbf	2020/9/7 14:16	DBF Viewer 200...	4 KB
XT_WTCX_Stock_20200907.dbf	2020/9/7 14:16	DBF Viewer 200...	7 KB
XT_ZJCX_Stock_20200907.dbf	2020/9/7 14:36	DBF Viewer 200...	3 KB

路径设置

XXX.dbf: 委托、撤单文件，支持同时监控多个dbf文件。

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

XT_ZJCX_业务类型_#YYYYMMDD#.DBF: 记录资金查询信息。

XT_CCMX_业务类型_#YYYYMMDD#.dbf: 记录持仓明细信息。

XT_CCTJ_业务类型_#YYYYMMDD#.dbf: 记录持仓统计信息。

XT_CJCX_业务类型_#YYYYMMDD#.dbf: 记录成交查询信息。

XT_WTCX_业务类型_#YYYYMMDD#.dbf: 记录委托查询信息。

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

HGT（6）SGT

扫单间隔：可调整扫单间隔，设置范围为1-100毫秒。

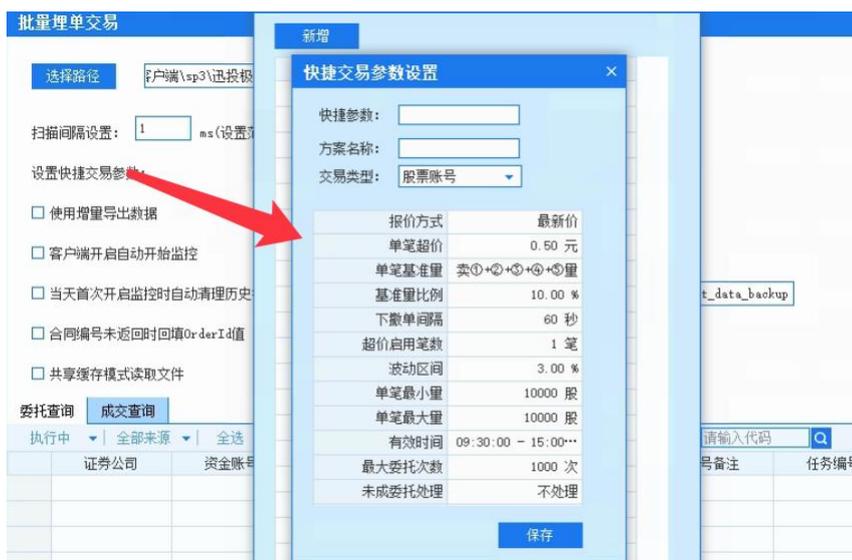
当天首次开启监控时自动清理历史报单文件：每天第一次开启监控时，会清空历史报单文件。并且历史报单文件会备份到设置的路径里。如勾选了自动清理历史报单文件功能，备份路径地址不可修改。

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

共享缓存模式读取文件：可支持是否选择共享缓存模式读取文件。

使用增量导出数据：勾选后使用增量导出数据。

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



参数设置

ab_order_type	ab_price_type	ab_order_price	ab_stock_code	ab_value	ab_account_id	ab_account_type	ab_broker_type	ab_module_name	ab_note	ab_order_id	ab_message
23	A1	10	600000	1000	4000000030	49	2	策略A	投资备注1	126	已报

下单

消息提示：消息面板会有相应的消息提示，记录‘批量埋单’交易详情。

时间	账号	类别	级别	消息	操作
11 17:59:00	-	系统消息	普通	[批量埋单] 文件监控停止!	
12 17:59:00	-	系统消息	重要	策略10000: 停止运行!	
13 17:59:59	6000000338	交易消息	重要	账号 [6000000338] 下单, 操作: 买入, 市场: SZ, 代码: 000001, 报价方式: 指定价, 基准价: 12.88, 交易总量: 200, 融价设置: 不启用	
14 17:59:59	-	交易消息	重要	[新任务] 来自用户: yk_投资者, 交易类型: 股票, 止损类型: 非止损, 子任务个数: 1	
15 17:59:59	6000000338	交易消息	重要	账号 [6000000338] 下单, 操作: 买入, 市场: SZ, 代码: 000001, 报价方式: 指定价, 基准价: 12.88, 交易总量: 200, 融价设置: 不启用	
16 17:59:59	-	交易消息	重要	[新任务] 来自用户: yk_投资者, 交易类型: 股票, 止损类型: 非止损, 子任务个数: 1	
17 17:59:56	-	系统消息	重要	[批量埋单] 通道号: 10000, 通道类型: 股票交易, 下单类型: 股票买入, 策略类型:	
18 17:59:56	-	系统消息	重要	[批量埋单] 通道号: 10000, 通道类型: 股票交易, 下单类型: 股票买入, 策略类型:	
19 17:59:56	-	系统消息	普通	[批量埋单] 读入2条任务, 请及时处理!	
20 17:59:56	-	系统消息	普通	[批量埋单] 文件监控开始!	

消息提示

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

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

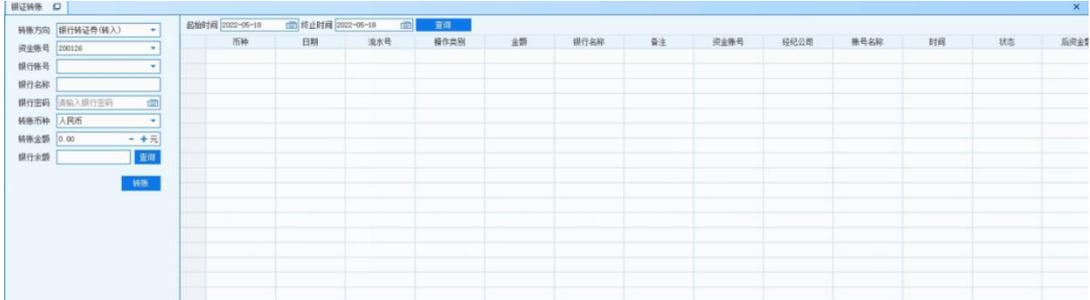
二十、银证转账

20.1 银行转证券

【操作步骤】

- 1.选择转账方向为“银行转证券”；
- 2.选择要转出资金的“银行账号”；

- 3.输入银行密码;
- 4.选择要转入资金的“资金账号”;
- 5.选择币种,默认“人民币”;
- 6.设置转账金额;
- 7.点击【转账】按钮。



20.2 证券转银行

【操作步骤】

- 1.选择转账方向为“证券转银行”;
- 2.选择要转入资金的“银行账号”;
- 3.选择要转出资金的“资金账号”;
- 4.输入资金密码;
- 5.选择币种,默认“人民币”;
- 6.设置转账金额;
- 7.点击查询可取资金,可以查看当前最大可取资金的额度;
- 8.点击【转账】按钮。



20.3 数据查询

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

