

同花顺智能交易机构版

功能说明书



创新 · 专业 · 安全

二〇一九年十一月

目 录

一、产品介绍.....	4
1.1产品简介.....	4
1.2产品优势.....	4
二、使用步骤.....	5
2.1账户操作.....	5
2.1.1账户管理.....	5
2.2普通交易.....	8
2.2.1多户交易.....	8
2.2.2单户交易.....	12
2.2.3新股申购.....	13
2.2.4银证转账.....	15
2.3融资融券.....	16
2.3.1交易.....	16
2.3.2查询.....	20
2.4篮子交易.....	21
2.4.1篮子修改.....	21
2.4.2篮子买入/卖出.....	26
2.4.3篮子调仓.....	27
2.4.4篮子批量修改.....	27
2.4.5篮子交易设置.....	28
2.4.6交易策略：TWAP.....	28
2.4.7委托管理.....	29
2.4.8信用账号篮子交易.....	29
2.5算法管理.....	30
2.5.1算法交易.....	30
2.5.2华创算法.....	33
2.5.3绩效分析.....	33
2.5.4执行日志.....	34
2.6策略交易.....	34
2.6.1条件买卖.....	34
2.6.2网格交易.....	36
2.6.3云端预埋.....	37
2.7信息查询.....	39
2.7.1账户数据.....	39
2.7.2净值走势.....	40
2.7.3资产汇总.....	41
2.8风控管理.....	42

2.8.1风控设置	42
2.8.2触警查询	50
2.8条件交易	51
三、附录	52
3.1其他操作	52
3.1.1版本切换	52
3.1.2如何添加模拟资金账号	52
3.1.2快捷键键位设置	52
3.1.4支持券商	53
3.1.5行情联动	54
3.2版本差异	56

一、产品介绍

1.1 产品简介

同花顺智能交易机构版是一款全新的智能交易系统软件，具有智能交易、篮子交易、策略交易、算法交易等多种交易功能，为客户提供快速、高效、智能交易服务的同时帮助客户规避风险保住收益，是投资者最强大的交易助手

1.2 产品优势

- **丰富的交易工具：**支持算法拆单、条件买卖、云端预埋、网格交易、融资融券、批量新股申购等。
- **批量下单：**资金账户实盘交易，可按9个预设方案一键下单，提供锁定价格、数量等个性化功能，满足多种交易场景的需要。
- **完备的风险控制：**多层次风险控制，提供黑白名单、合规控制、持仓控制等多条风控规则用于预防风险。
- **丰富的交易选择：**提供算法交易、华创算法二大算法系统，包含TWAP、VWAP、冰山、AI算法等经典拆单算法和支持条件买卖、云端预埋、网格交易多方式对交易时间、交易算法进行选择。
- **融资融券：**融资融券账户管理+交易。
- **篮子交易：**支持股票、两融多类账号同时交易，支持篮子算法单，一键调仓等功能，满足多样化投资交易场景。
- **信息查询：**专业的数据汇总展示，灵动界面展现。

二、使用步骤

2.1 账户操作

账户功能支持账户管理（新增、删除、登陆、注销、编辑、绑定）、账户查询功能。

账户管理										
账户	实盘账号 模拟账号									
账户组	新增账户 删除所选 登录所选 注销所选 申请模拟账户 导入 导出									
	☒	序号	账户名称	用户名称	资金账户	账户类型	券商名称	登录状态	备注	操作
	☒	01	541333k31	541333k31_模拟炒股	56414639	股票	模拟炒股	已登录	—	编辑 注销 绑定
	☒	02	541333k40	541333k40_模拟炒股	57600133	股票	模拟炒股	未登录	—	编辑 登录 绑定
	☒	03	541333k2*	541333k2*_模拟炒股	56414636	股票	模拟炒股	已登录	—	编辑 注销 绑定
	☒	04	541333k30	541333k30_模拟炒股	56414638	股票	模拟炒股	已登录	—	编辑 注销 绑定
	☒	05	541333k45f	541333k45f_模拟炒股	57600132	股票	模拟炒股	未登录	—	编辑 登录 绑定

2.1.1 账户管理

2.1.1.1 账户添加

账户管理包括实盘、模拟账户的管理

- 添加实盘账号或者模拟账号
- 点击“新增账户”
- 选择账户类型（证券账户、期货账户、融资账户、期权账户）
- 选择对应券商，同花顺智能交易系统覆盖市场上大部分券商交易通道（如操作过程中遇到不支持的券商，请及时联系对应同花顺对应销售反馈）
- 输入资金账号信息、交易密码、通讯密码、动态口令等

菜单路径：【账户管理】-【实盘账户】-【添加账户】

添加模拟账号同上操作

2.1.1.2账户设置

删除账号：删除已经绑定的账号，不再显示相关账号数据

登陆所选：打开系统后，所有账号默认为未登录状态，需要手动选择单账户登陆或者一键登陆

注销所选：讲所有已经登陆的账号下线为未登录状态

申请模拟账号：通过该入口可以申请模拟账号绑定用户使用。参见3.1.2如何添加模拟资金账号

绑定：将该资金账号绑定当前客户端，不允许其余客户端新增显示

模拟账号									
新增账户 删除所选 登录所选 注销所选 申请模拟账户 导入 导出									
☒	序号	账户名称	用户名称	资金账户	账户类型	券商名称	登录状态	备注	操作
☒	01	54133b31	54133b31_模拟炒股	56414639	股票	模拟炒股	已登录	—	编辑 注销 绑定
☒	02	5484a460	5484a460_模拟炒股	57500133	股票	模拟炒股	未登录	—	编辑 登录 绑定
☒	03	54133b2e	54133b2e_模拟炒股	56414636	股票	模拟炒股	已登录	—	编辑 注销 绑定
☒	04	54133b30	54133b30_模拟炒股	56414638	股票	模拟炒股	已登录	—	编辑 注销 绑定
☒	05	5484a45f	5484a45f_模拟炒股	57500132	股票	模拟炒股	未登录	—	编辑 登录 绑定

导出导入功能：将当前账户数据平移到另外的智能交易客户端中。支持保密加锁，保护资金账户不外泄（使用场景：资金账号用户切换客户端使用）

模拟账号									
新增账户 删除所选 登录所选 注销所选 导入 导出									
☒	序号	账户名称	用户名称	资金账户	账户类型	券商名称	登录状态	备注	操作
☒	01	5cb029e9		55545822	股票	模拟炒股	已登录	—	编辑 注销 绑定
☒	02	5cb029e8					已登录	—	编辑 注销 绑定

账户导出

导出密码：

可不输入密码

请输入6-12位密码

确认 取消

2.1.1.3账户组添加

- 点击“新建账户组”，
- 弹出子窗口，选择账户类型，
- 输入账户组名称，
- 点击“确定”。

账户管理

查询

账户管理

账户

账户组

新增账户组

删除账户组

序号	账户组名称	账户类型	已登录/账户总数
01	111	股票	02/02

新增账户组

账户类型:

股票

股票

期货

信用

账户组名称:

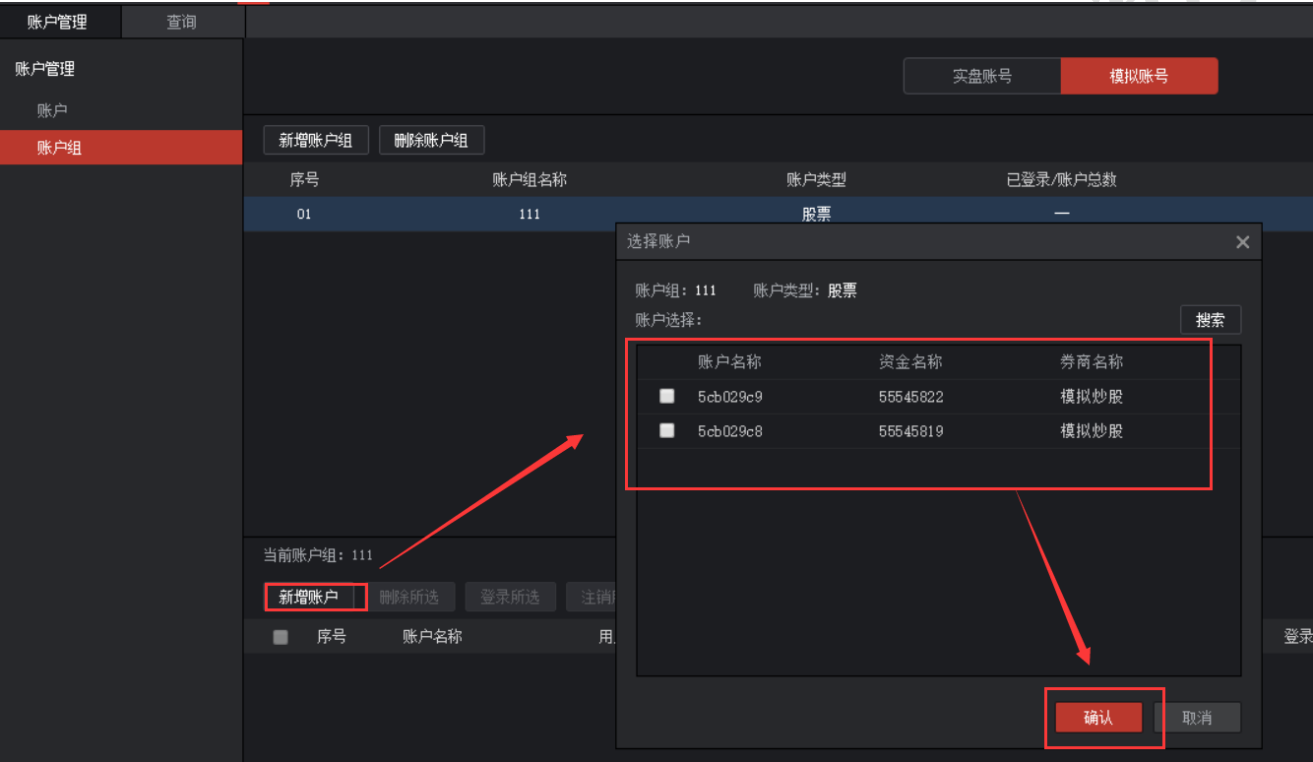
确认

取消

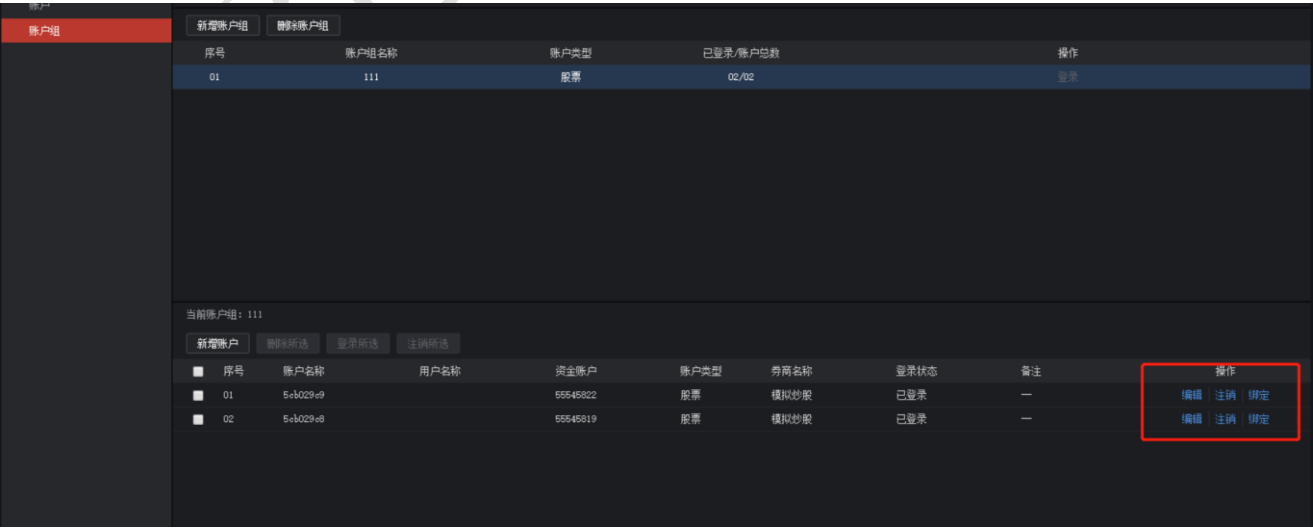
- 删除账户组：选中账户组后点击“删除账户组”，在弹出框中点击“确定”即可删除。



- 账户组内添加子账户：选中某一个账户组，点击“添加账户”，在弹出框中选中预添加的子账户，点击添加，弹出框如下图所示。



- 编辑、注销、绑定功能同2.1.1.2账户设置中字段说明



2.2 普通交易

2.2.1 多户交易

多户交易提供账户管理、账户交易、批量撤单和清仓等多样化交易功能。

2.2.1.1 资金账户

股票账户功能主要是显示账户的资金明细及持仓明细。在资金账户选择中可以下拉来选定全部账户还是单一账户，相应的资金明细及持仓明细会显示指定的账户的信息。（注：资金明细和持仓明细信息无法自动刷新当前数据，因此需要点击“刷新”按键来更新信息，示意图如下）

序号	资金账户	资金余额	可用余额	冻结金额	可取金额	可用资金占比(%)	盈亏	股票市值	总资产	场外资产	站点名称
1	57500133 5484460	9933708.880	9933708.880	0.000	0.000	99.333	373.880	66665.000	10000373.880	0.000	花顺模拟
2	57500132 548445F	9963822.360	886836.940	13384.010	0.000	88.708	-2231.050	1115549.000	9997768.950	0.000	花顺模拟
3	56347937 54044906	10000000.000	10000000.000	0.000	0.000	100.000	0.000	10000000.000	0.000	0.000	花顺模拟
4	56414639 54133331	8013226.080	8013226.080	0.000	0.000	79.537	74869.080	2061643.000	10074869.080	0.000	花顺模拟
5	56414638 54133330	1703186.660	1703186.660	0.000	0.000	16.421	372161.660	8668975.000	10372161.660	0.000	花顺模拟
6	56414636 54133324	470748.590	470748.590	0.000	0.000	4.467	537361.590	10066613.000	10537361.590	0.000	花顺模拟

2.2.1.2 账户买入

多户买入界面中，能实现资金账户同时买入同一个股票。用户可以选择相应策略，控制每个账户分配的委托数量，支持下单委托再拆单的方式用于个性化交易。

序号	资金账户	资金余额	可用余额	冻结金额	可取金额	可用资金占比(%)	盈亏	股票市值	总资产	场外资产	站点名称
1	56414638 54133330	7751095.430	7751095.430	0.000	0.000	76.986	68152.430	2317057.000	10068152.430	0.000	花顺模拟
2	56414636 54133324	2104659.460	2104659.460	0.000	0.000	20.957	42712.060	7938052.600	10042712.060	0.000	花顺模拟

输入证券代码、委托价格、数量，选好委托方案、价格策略等信息后点击“买入”即可。方案选择可以下拉选定买入委托方案，主要包括以下内容：



分配方案说明：分配方案就是用户委托在各个账户之间的分配规则。根据具体情况，设定的

的总委托量不一定能完全分配，可用金额也不一定完全用尽。可以从  框跳转到分配方案说明中。



- **平均分配**：输入的总委托数量将在各个账户之间**平均**分配。
- **等量分配**：各个账户都将**按照输入的委托量**分配。
- **顺序分配**：总委托将按照账户列表的**排列顺序**优先进行分配，若一个账户分配完所有可用资金后委托量仍有剩余，则按照顺序为下一个账户进行分配。
- **总委托按可用比例分配**：当总委托将按照各个资金账户**可用资金**的多少为权重进行分配。可用资金越多的账户，就将分配到越大比例的委托量。
- **总委托按总资产比例分配**：总委托将按照各个资金账户**总资产**的多少为权重进行分配。总资产越多的账户，就将分配到越大比例的委托量。
- **按账户可用比例分配**：买入时，按用户设定的百分比，每个资金账户都将**分配其可用资金的相应百分比**作为委托量。卖出时，按照用户设定的百分比，每个资金账户都将分配其持仓的相应百分比作为委托量。
- **按账户总资产比例分配**：买入时，按用户设定的百分比，每个资金账户都将**分配其总资产的相应百分比**作为委托量。卖出时，按照用户设定的百分比，每个资金账户都将分配其总资产的相应百分比作为委托量。
- **按单股持仓固定比例**：买入时，直到将每个账户的该股持仓市值占**总资产的比例**补充至用户设定的百分比为止，如大于设定比例不买入。卖出时，直到将每个账户的该股持仓市值占总资产的比例清仓至用户设定的百分比位置，如小于设定比例不卖出。
- **按持仓数量固定比例**：买入时，买入每个资金账户中，用户设定的**百分比的持仓数量**。卖出时，卖出每个资金账户中，用户设定的百分比的持仓数量。

2.2.1.3 账户卖出

交易卖出界面能实现资金帐号同时卖出同一个股票。用户可以选择相应策略，控制每个账户分配的委托数量，支持下单委托再拆单的交易方式。账户卖出和账户买入是对应关系，这里的可卖数量是选定的各个账户对于当前选定的证券代码持仓量的总和。（如果显示的可卖数量不正确，可能是因为没有及时更新股票查询，点击分配栏位中的刷新按钮可以重新查询股票持仓、并且更新可卖数量。）

输入证券代码、委托价格、数量，选好委托方案、价格策略等信息后点击“卖出”即可。

1、选择卖出
2、选中资金账号
3、输入卖出参数
4、查看每个账号分配数量
5、点击卖出

序号	资金账户	备注	可买数量	可卖数量	委托数量	分配资金
1	56414638 5d133b30	—	679600	57800	1000	11370.00
2	56414636 5d133b2e	—	184500	83000	1000	11370.00

2.2.1.4 拆单策略

在拆单策略功能中，有价格策略和数量策略两种策略方式。

其中：
价格策略：设置浮动区间X元，即每笔报单价格为基准价格±X元，达成随机价格报单，隐蔽交易目的。
数量策略：数量策略通过固定数量和浮动数量两个方式对大笔数量委托进行拆单。

如在固定数量中设置单笔上限为8000。当委托数量为20000股时候，即会拆成8000、8000、6000股的三笔委托，实现机械式拆单目的。

当设定浮动区间为上限8000股，下限3000股时候，应用该策略买入，即可发现实际委托数量成为随机数量不等的三笔委托。

11.35 8.36万

11.34 2.99万

11.33 6.59万

11.32 10.56万

11.31 19.87万

涨停 12.43 跌停 10.17

分配方案 1-平均分配

拆单策略 量[3000-6000]

2.00万股 金额 22.81万

☐ 下单前不需要确认

重置 买入

卖出 14

成交数量

分配	任务	持仓 F6	成交 F7	委托 F8	刷新 F5	☐ 只显示可撤委托	全量	撤买	撤卖	撤单	代码筛选			
序号	资金账户	备注	证券代码	证券名称	委托价格	委托数量	成交价格	成交数量	操作	委托日期	委托时间	合同编号	订单状态	订单类型
1	56414638 54133330	—	600000	浦发银行	11.370	7100	11.354	7100	买	20190828	10:57:25	1188957194	全部成交	限价
2	56414638 54133330	—	600000	浦发银行	11.370	6600	11.354	6600	买	20190828	10:57:25	1188976216	全部成交	限价
3	56414638 54133330	—	600000	浦发银行	11.370	6300	11.354	6300	买	20190828	10:57:25	1188964581	全部成交	限价

添加自定义拆单策略后，可以再后续交易中直接调用设置的拆单策略进行使用。无需多次填写修改



2.2.1.5 批量撤单

- 撤单：勾选好需要撤单委托，点击“撤单”或者直接双击需要撤单的股票订单，在对话框中选择是，即可对当前子单进行撤单。
- 撤买：点击“撤买”将会撤销所有操作方向为买入的订单。在对话框中选择是，即可对买入子单进行撤单。
- 撤卖：点击“撤卖”将会撤销所有操作方向为卖出的订单。在对话框中选择是，即可对卖出子单进行撤单。
- 全撤：点击“全撤”将会撤销所有订单。在对话框中选择是，即可对所有订单进行撤单。

浦发银行

600000

买入

卖出

最新 11.87 涨幅 0.69%

买一 11.87 8800

买二 11.86 6.01万

买三 11.85 2.92万

买四 11.84 3.09万

买五 11.83 3.20万

涨停 12.97 跌停 10.61

证券代码 600000 浦发银行

委托价格 11.89 限价

可卖数量 200

委托数量 1/2 1/3 1/4 1/5

下单前不需要确认

重置 卖出

分配方案 等量分配

价格策略 固定价格

浮动区间

数量策略 固定数量

单笔上限 1000000

重置

全部账户 全量 反选 刷新

资金账户 站点名称 资金余额 可用余额 冻结金额 可取金额 可用资金占比 盈亏 股

55545822 54102949 沪深股通-两花博模拟抄 9995086.380 9806525.540 16353.230 0.000 96.060 541.770 177

55545819 54102948 沪深股通-两花博模拟抄 9998057.520 9996498.450 0.000 0.000 99.965 47.450 35

分配 任务 持仓 F6 成交 F7 委托 F8 刷新 F5 只显示可撤委托 全选 全量 撤买 撤卖 撤单 代码筛选

序号 资金账户 备注 证券代码 证券名称 委托价格 委托数量 成交价格 成交数量 操作 委托日期 委托时间 合同编号 订单状态 订单类型 股东户

8 55545822 54102949 — 600000 浦发银行 11.620 200 0.000 0 买 20190614 16:35:24 1118112850 未成交 限价 A682096711

9 55545822 54102949 — 600000 浦发银行 11.710 200 0.000 0 买 20190614 16:35:24 1118114544 未成交 限价 A682096711

10 55545822 54102949 — 600000 浦发银行 11.670 200 0.000 0 买 20190614 16:35:24 1118118634 未成交 限价 A682096711

12 55545822 54102949 — 600000 浦发银行 11.690 200 0.000 0 买 20190614 16:35:24 1118122280 未成交 限价 A682096711

15 55545822 54102949 — 600000 浦发银行 11.730 200 0.000 0 买 20190614 16:35:24 1118123071 未成交 限价 A682096711

16 55545822 54102949 — 600000 浦发银行 11.640 200 0.000 0 买 20190614 16:35:24 1118125577 未成交 限价 A682096711

17 55545822 54102949 — 600000 浦发银行 11.600 200 0.000 0 买 20190614 16:35:24 1118164554 未成交 限价 A682096711

2.2.1.6账户清仓

在下拉框选择好需要清仓的资金账户和股东账户，输入清仓价格、价格浮动比例、清仓比例等信息，点击“清仓”即可实现账户的清仓，即将持仓批量卖出。



2.2.2单户交易

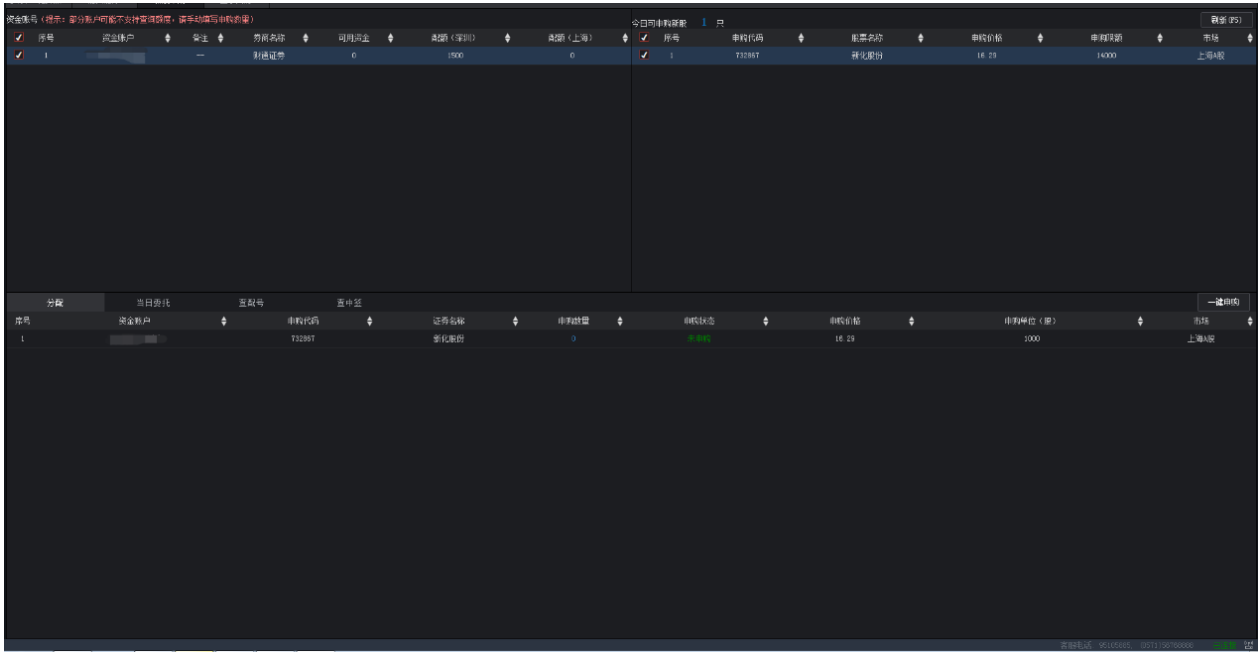
2.2.2.1买入/卖出

单账户交易主要提供股票的交易，以及查看资金信息、持仓信息、成交信息，委托股票下单等，通过单一证券帐号对某一选中股票进行交易。



买入/卖出下单操作：

- 选中系统菜单中的买入/卖出；
- 在证券代码中输入需要操作的股票的代码；
- 手动或者在右侧行情中选择您委托的价格；
- 手动输入委托数量或选择可买/可卖数量所对应的百分比；
- 点击买入/卖出按钮，弹出确认委托单的信息
- 仔细核对委托信息后，点击确认，即可在系统信息提示中看到提示信息，该单已经委托。您也可以进入账户主要信息中的委托子页面查看详细信息。



新股申购操作完成后，点击【查配号】可查询各资金账户分配到的配号序列，支持账户配号查询。操作步骤：

- 1.在资金账户界面中选择需要查询的账户
- 2.将时间周期设置为“近一周”、“近一月”或自定义指定时间，点击“刷新”
- 3.在下方列表中自动显示选定账户对应的新股申购配号信息，内容包括资金账户、成交日期、交易市场、证券代码、证券名称、成交数量、起始配号等。



新股申购中签结果公布后，点击【查中签】可查询指定账户的申购中签结果，支持账户查询。操作步骤：

- 1.在资金账户界面中选择需要查询的账户
- 2.将时间周期设置为“近一周”、“近一月”或自定义指定时间，点击“刷新”。
- 3.在下方列表中自动显示选定账户对应的中签信息，内容包括资金账户、成交日期、交易市场、证券代码、证券名称、成交数量、成交均价等。



2.2.4 银证转账

支持银行->券商、券商->银行双方向转账，右侧框列表选择需要查询的资金账号，设置查询日期，点击“刷新”。即可查询资金账户的转账流水，内容包括资金账号、委托编号、时间、状态、银行代码、银行账号等。

银证转账操作步骤如下：

- 1.选择证券账户
- 2.设置转账方向、转账银行、转账币种。
- 3.手动输入转账金额和银行/资金密码。
- 4.点击“转账”按钮，弹出确认转账的信息。
- 5.仔细核对转账信息后，点击确认，即可在系统信息提示中看到提示信息，转账已经申请。

查询资金账户的银证转账流水具体步骤如下：

- 1.选择需要查询的资金账号
- 2.设置查询日期，点击“刷新”或“账户查询”。即可查询资金账户的转账流水，内容包括流水号、操作、日期、时间、银行名称、发生金额、状态、备注等。

The screenshot shows the '银证转账' (Silver and Securities Transfer) interface. At the top, there are tabs for '多账户交易' (Multi-account Trading), '单账户交易' (Single-account Trading), '新股申购' (New Share Subscription), and '银证转账' (Silver and Securities Transfer). The '银证转账' tab is selected. Below the tabs, there are input fields for '证券账户' (Securities Account) and '券商名称' (Broker Name). The '证券账户' field is set to '56135225 5cecd547' and '券商名称' is '同花顺金融实验室'. To the right of these fields is a '账户查询' (Account Query) button. Below these fields, there are three dropdown menus: '转账方向' (Transfer Direction) set to '银行->证券' (Bank to Securities), '转账银行' (Transfer Bank), and '转账币种' (Transfer Currency) set to '人民币' (RMB). Below these dropdowns are input fields for '银行密码' (Bank Password), '资金密码' (Fund Password), and '转账金额' (Transfer Amount) set to '0'. At the bottom left are buttons for '查询银行资金' (Query Bank Funds) and '转账' (Transfer). On the right side, there is a '查询日期' (Query Date) section with '2019-06-18' and a '刷新(F5)' (Refresh) button. Below this is a table with columns: '序号' (Serial Number), '流水号' (Transaction Number), '操作' (Operation), and '日期' (Date). The table is currently empty.

2.3融资融券

融资融券提供融资融券交易、查询、银证转帐多项操作功能。



2.3.1交易

2.3.1.1信用买入/卖出

信用买入/卖出可实现信用账户同时买入/卖出同一个股票。用户可以选择相应的分配策略，控制每个账户分配的委托数量，也可以控制委托单拆分的方式。



操作步骤如下：

1. 在方案选择下拉选定买入/卖出委托方案
2. 在证券代码输入需要买入/卖出的股票代码，委托价格自动显示该股的最新价，可以自己手工修改价格值，也可以在右边行情报价中单击指定其中的一个价格为委托价格。
3. 在数量选择选定全部或1/2、1/3、1/4、2/3和1/5时，委托金额（委托数量）会按照全部或者全部的比例来定，也可选择自填，自己手工输入需要下单的金额或数量。
4. 若方案选择选定是总额基础上分配的，则“全部”显示可下单总金额；
5. 若方案选择选定是总量基础上分配的，则“全部”显示可下单总量；6.设置完后，

分配数量会显示分配后总的下单量。

- 单笔上限是指下单单笔委托数量上限，默认是1000000股。由于交易所对于股票的申报有单笔数量上限，超过上限的委托无法申报，所以客户端发出的委托单委托数量一定不能超过上限。当分配到的总数量超过这个值，则会自动拆分成每笔不超过单笔上限数量的多笔委托。

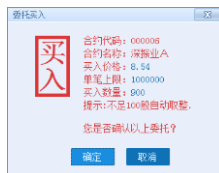


账户信用卖出和账户信用买入是对应关系，可卖数量是各个账户对于当前选定的证券代码持仓量的总和，如果显示的可卖数量不正确，可能是因为没有及时更新股票查询，点击分配栏位中的刷新按钮可以重新查询股票持仓、并且更新可卖数量。下方的分配列表自动显示各个资金账户分配到的委托信息，其中，委托数量栏可以手工修改。如需取消某资金账户的委托下单，可在该资金账户前的方框内撤消勾选。

- 担保品：显示信用账户下所有的股票及其折扣率
- 持仓：显示账户组中选定的信用账户组当日成交信息成交：显示账户组中选定的账户们当日成交信息
- 撤单：显示账户组账户的当天委托信息，其中撤单按钮可以用于简易批量撤单，撤单是撤序号栏那选定的单；全撤撤全部未成交的委托单；撤买是撤全部未成交的买入单；撤卖是撤全部未成交的卖出单
- 委托：显示账户组中选定的账户的当日委托信息，双击未成交的委托单，可以实现撤单功能，具体方式和撤单栏位中的双击同样的效果



在分配列表中查看各账户的申购信息，确认无误后点击上方的【买入】或【卖出】按钮，在弹出的委托申购确认框内核对合约代码、买入/卖出价格、数量等数据后，点击【确定】，即可下单。



2.3.1.2 融资买入/融券卖出

融资买入/融券卖出和信用买入/卖出类似。可买卖数量是各个账户对当前选定的证券代码可买卖数量的总和，具体操作和账户信用买入/卖出类似，不同的是融资买入融券/卖出的证券一定要是融资融券标的的证券，具体请查看信用买入/卖出的操作步骤。

2.3.1.3 现金还款

通过现金还款，可使用自有现金偿还从券商融资的本、息负债。现金还款主可选2种还款方式：1、按负债顺序还款2、按流水编号还款

按金额还款操作步骤：

1. 在操作类型下拉选择“按负债顺序还款”
2. 在方案选择选定还款金额在各个账户之间的分配方案

交易

- 信用买入
- 信用卖出
- 融资买入
- 融券卖出
- 现金还款**
- 卖券还款
- 现券还券
- 买券还券

查询

担保品划转

- 普通—>信用
- 信用—>普通

多账户现金还款

操作类型: 按负债顺序还款 方案选择: 总额顺序分配

可还总额: 0

债总金额: 0 委托金额: 0 元

重置 还款

账户组: 全部账户 全选 全不选

分配 融资负债 刷新(F5) 上移 下移

操作类型: 按负债顺序还款 方案选择: 总额顺序分配

可还总额: 0

债总金额: 0 委托金额: 0 元

总额顺序分配

总额平均分配

总额比例分配

3. 在下方分配列表勾选需要还款的信用账户
4. 勾选后债总金额、利息、可用总额、尚欠总额等数据自动读取，调整委托金额后点击【还款】按钮即可还款。

按笔还款操作步骤：

1. 在操作类型下拉选择“按笔还款”
2. 在下方融资负债列表勾选需要还款的融资负债委托单
3. 勾选后负债金额、利息、可用总额、尚欠总额等数据自动读取，调整委托金额后点击【还款】按钮即可还款。

信用买入

信用卖出

融资买入

融券卖出

现金还款

卖券还款

操作类型：

按流水编号还款

方案选择：

总额顺序分配

可还总额：0

债总金额：0

委托金额：

0

元

重置

还款

2.3.1.4卖券还款

通过卖券还款，可卖出持仓中的证券来偿还券商融资的本、息负债。卖券还款方案选择以及数量分配的操作和账户信用卖出类似，具体请查看信用卖出的操作步骤。

交易

信用买入

信用卖出

融资买入

融券卖出

现金还款

卖券还款

现券还券

买券还券

查询

担保品划转

普通一>信用

信用一>普通

查询划转流水

多账户卖券还款

证券名称：

浦发银行

证券代码：

600000

方案选择：

总额按顺序分配

委托价格：

12.62

债总金额：0

拆单策略：

定量

随机

数量选择：

全部

(0)

1/2

1/3

1/4

2/3

1/5

自填

单笔上限：

1000000

股

委托金额：

200

元

分配数量：0

重置

卖出

浦发银行 600000

卖五 12.62 32200

卖四 12.61 26700

卖三 12.60 6500

卖二 12.59 91643

卖一 12.58 24705

最新 12.57 涨幅 -1.57%

买一 12.57 152700

买二 12.56 343341

买三 12.55 440200

买四 12.54 102300

买五 12.53 118400

涨停 14.05 跌停 11.49

账户组：

全部账户

全选

全不选

分配

融资负债

持仓

成交

委托

刷新(F5)

上移

下移

2.3.1.5现券还券

通过现券还券，可使用信用账户持仓证券以非交易方式来偿还融资负债。
点击“现券还券”，在下方融资负债列表勾选需要还款的委托单，核对可用数量和负债数量后，输入还券数量，点击【确定】按钮即可还款。

交易

信用买入

信用卖出

融资买入

融券卖出

现金还款

卖券还款

现券还券

买券还券

查询

担保品划转

普通一>信用

信用一>普通

查询划转流水

单账户现券还券(按流水编号)

证券名称：

浦发银行

证券代码：

600000

负债数量：0

流水编号：

可用数量：0

还券数量：

0

股

重置

还券

浦发银行 600000

卖五 12.62 32200

卖四 12.61 26700

卖三 12.60 6500

卖二 12.59 91643

卖一 12.58 37305

最新 12.56 涨幅 -1.64%

买一 12.56 245241

买二 12.55 441200

买三 12.54 102300

买四 12.53 118400

买五 12.52 120500

涨停 14.05 跌停 11.49

账户组：

全部账户

分配

融资负债

持仓

刷新(F5)

2.3.1.6买券还券

通过买券还券，可买入与融券卖出相同的股票并自动偿还券商所融出的证券，用来了结融券负债。

买券还券主买入方式和账户信用买入类似，方案选择参照信用买入的使用说明。

交易

信用买入

信用卖出

融资买入

融券卖出

现金还款

卖券还款

现券还券

买券还券

查询

担保品划转

普通—>信用

信用—>普通

多账户买券还券

证券名称: 浦发银行

证券代码: 600000

方案选择: 总额按顺序分配

委托价格: 12.62

负债总量: 0

可用资金: 0

拆单策略: 定单 随机

数量选择: 全部 (0)

单笔上限: 1000000 股

委托金额: 200 元

分配数量: 0

重置

买入

账户组: 全部账户

全选

全不选

浦发银行 600000

卖五 12.61 26700

卖四 12.60 6500

卖三 12.59 88043

卖二 12.58 16405

卖一 12.57 23000

最新 12.57 涨幅 -1.57%

买一 12.56 261741

买二 12.55 448800

买三 12.54 102300

买四 12.53 118400

买五 12.52 120500

涨停 14.05 跌停 11.49

2.3.2查询

撤单：能实现批量订单撤单，撤单的是账户下过的母单单子。

交易

信用买入

信用卖出

融资买入

融券卖出

现金还款

卖券还款

现券还券

买券还券

查询

撤单

查询成交

查询委托

查询资产

资金账户: 18097558 E065.20.51

刷新(F5)

信用总资产: 保证金可用余额: 融资保证金比例:

信用总负债: 可提取担保物金额: 融券保证金比例:

信用净资产: 可提取资金: 融资授信额度:

维持担保比例: 可买担保证券资金: 融券授信额度:

预计维持担保比例: 可还款资金: 已用总信用额度:

预计应追加担保物金额: 证券市值: 可用总信用额度:

序号 信用账户 证券代码 证券名称 股票余额 可用数量 冻结数量 成交均价

撤单/全撤/撤买单/撤卖单：这些按钮时对撤单的操作，撤单时对选定的母单操作的；全撤是对全部委托母单；撤买单是对其中买入操作的母单；撤卖单时对其中卖出操作的母单，也可以双击母单信息中显示委托单来实现撤单。点击按键或者双击委托单行会弹出确认界面，确认为有效。

资金账户: 18097558 E065.20.51

选择市场: 沪深两市

刷新(F5)

撤单(Del)

全撤(Z)

撤买(X)

撤卖(C)

刷新：点击可以刷新智能交易模块中委托的母单信息

查询成交/委托/资产/交割单/融资负债/融券负债：可查询指定日期范围内的历史成交/委托/资产/交割单/融资负债/融券负债详情。选择资金账户，选择市场，设置查询的时间区间，点

击刷新按钮即可查看。

2.4 篮子交易

篮子交易主要实现多标的同时交易，支持股票篮子交易、信用账户篮子交易等多种交易方式，便于用户切换选择。同时提供调仓功能，便于用户对当前仓位直接做换仓处理，简化买卖操作流程，提高投资效率。

点击“篮子交易”，可新建篮子、修改篮子，数据导入导出、调仓等功能。篮子交易中，投资者可以先设置一个投资组合，让程序自动按照投资比例买入或卖出所包含的股票，实现一篮子股票委托的功能。

2.4.1 篮子修改

点击“篮子修改”可新建、导入、导出、编辑和删除篮子。



● 新建篮子

- 1. 点击“管理”后点击“新建”按钮
- 2. 输入“篮子名称”
- 3. 输入选定的个股代码后
- 4. 输入预期设定的“委托金额”“资金权重”“委托数量”
- 5. 点击“确定”



备注：

批量设置：对篮子中存在的个股参数统一应用设定的默认值模板。

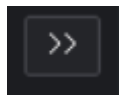
应用场景：将资金平均分配到预期个股，做到控制个股委托金额一致/委托数量一致/分配资金一致等。

委托金额：当将两支个股A、B分别设定委托金额为50000和40000，那么每次买入一份篮子股票即视为买入A股票数量为50000/委托价格，买入B数量为40000/委托价格，如买入X份，则进行相乘。

委托数量：当将两支个股A、B分别设定委托数量设定为1000和500，那么每次买入一份篮子股票即视为买入A股票数量为1000股，买入B数量为500股，如买入X份，则分别是1000X和500X股。

资金权重：当将两支个股A、B分别设定资金权重设定为2和3，当本次操作金额为50000元时候，分配买入个股A资金为20000元，个股B资金为30000元，那么视为买入A股票数量为20000/委托价格，买入B股票数量为30000/委托价格。

买入个股A金额=委托金额/（A权重+B权重+.....+Z权重）*A权重，其他计算同理

- 板块选股添加成分股“在篮子列表中；选择对应板块后，点击 ，将选择后的板块直接生成对应篮子，修改篮子名称后确认即可。

点击“板块选股”，选择概念、行业、地域，双击个股即可完成添加

1. 右下角输入证券代码，资金权重或单笔数量，点击“添加证券”，完成添加
2. 点击“>>”按钮，可一次性添加所有该板块的个股。
3. 右侧可通过“删除证券”按钮，来调整成分股。
4. 点击“<<”按钮，可一次性删除所有成分股。

快速选股

批量导入

板块选股

问财选股

公式选股

概念

新股与次新股

医药电商

车联网

华为概念

透明工厂

二胎概念

腾讯概念

5G

富士康概念

节能环保

军民融合

国产软件

北汽新能源

集成电路概念

金改

知识产权保护

一带一路

青蒿素

摘帽

蓝宝石

石墨烯

健康中国

二维码识别

002933 新兴装备

002935 天奥电子

002936 郑州银行

002937 兴瑞科技

002938 鹏鼎控股

002939 长城证券

002940 昂利康

002941 新疆交建

002942 新农股份

002943 宇晶股份

002945 华林证券

002946 新乳业

002947 恒铭达

002948 青岛银行

002949 华阳国际

002950 奥美医疗

002951 金时科技

002952 亚世光电

002953 日丰股份

待选项：总数【145】

证券代码：000001 平安银行

添加证券 删除证券 上移 下移

☐	序号	证券代码	证券名称	委托金额	资金权重	委托数量	限定价格
☐	136	002946	新乳业	100000	4	500	0
☐	137	002945	华林证券	100000	4	500	0
☐	138	002943	宇晶股份	100000	4	500	0
☐	139	002942	新农股份	100000	4	500	0
☐	140	002941	新疆交建	100000	4	500	0
☐	141	002940	昂利康	100000	4	500	0
☐	142	002939	长城证券	100000	4	500	0
☐	143	002938	鹏鼎控股	100000	4	500	0
☐	144	002937	兴瑞科技	100000	4	500	0
☐	145	002936	郑州银行	100000	4	500	0
☐	146	002935	天奥电子	100000	4	500	0
☐	147	002933	新兴装备	100000	4	500	0

成份预览：总数【147】

默认值

委托金额：100000 资金权重：4 委托数量：500 批量设置

篮子名称：测试篮子 * 取消 确认

- 问财选股添加成份股：在篮子列表中选中篮子，点击 **问财选股**，在弹出窗口中输入问句，勾选问财选出的股票，点击“加入篮子”，即可添加股票到篮子，如下图所示；
 - 点击“问财选股”，输入选股条件，点击“问一下财”，待选项出现选股结果，双击个股，即可完成添加。
 - 右下角输入证券代码，资金权重或单笔数量，点击“添加证券”，完成添加
 - 点击“>>”按钮，可一次性添加所有该板块的个股。
 - 右侧可通过“删除证券”按钮，来调整成份股。
 - 点击“<<”按钮，可一次性删除所有成份股。

1、点击问财选股

2、输入选股条件-问一下财

3、点击 >>

4、点击确认

序号	证券代码	证券名称	委托金额	资金权重	委托数量	限定价格
169	002507	涪陵榨菜	100000	4	500	0
170	002497	雅化集团	100000	4	500	0
171	002470	金正大	100000	4	500	0
172	002458	益生股份	100000	4	500	0
173	002416	爱施德	100000	4	500	0
174	002310	东方园林	100000	4	500	0
175	002271	东方雨虹	100000	4	500	0
176	002249	华东数控	100000	4	500	0
177	002169	智光电气	100000	4	500	0
178	002157	正邦科技	100000	4	500	0
179	000615	京汉股份	100000	4	500	0
180	000595	宝塔实业	100000	4	500	0

成份预览：总数【180】

默认值
委托金额：100000 资金权重：4 委托数量：500 批量设置

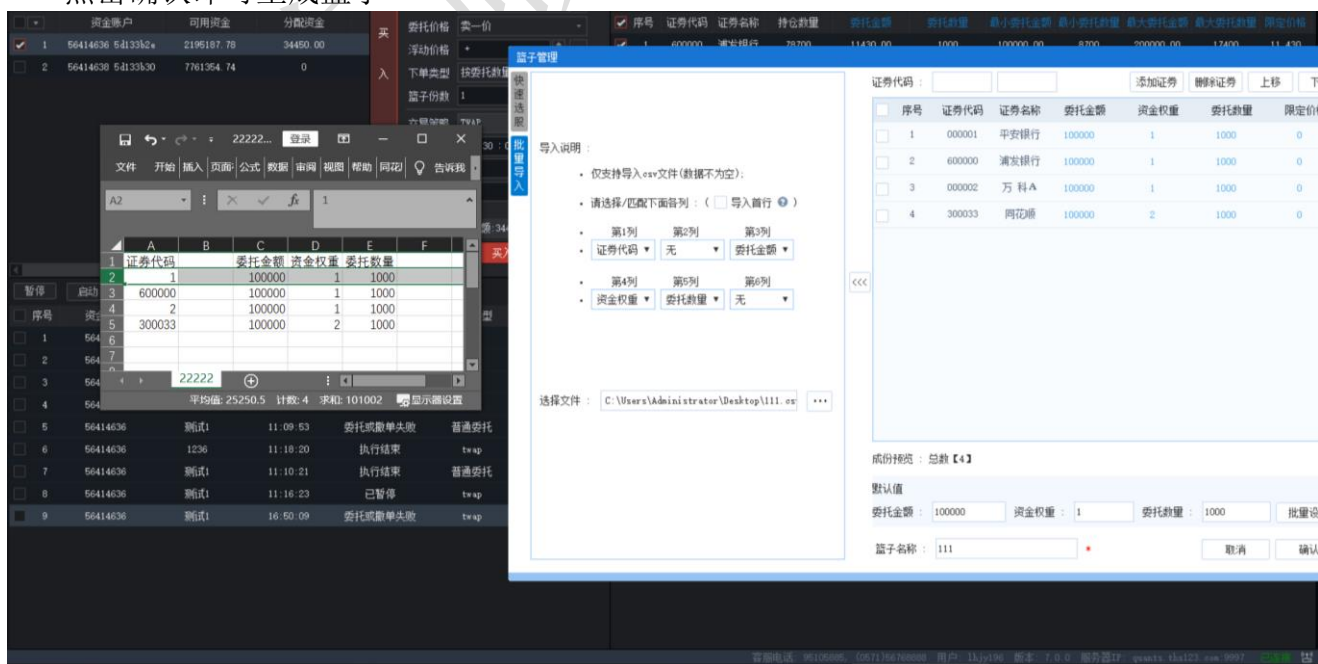
篮子名称：测试篮子 * 取消 确认

- 公式选股添加成份股：在篮子列表中选中篮子，点击 **公式选股**，在弹出窗口中输入公式，勾选问财选出的股票，点击加入篮子，即可添加股票到篮子，如下图所示；
 - 点击“公式选股”，输入选股条件公式，选择选股周期，支持1m、5m、15m、30m、60m、日、周、月、年线点击“公式选股”，待选项出现选股结果，双击个股，即可完成添加。
 - 右下角输入证券代码，资金权重或单笔数量，点击“添加证券”，完成添加
 - 点击“>>”按钮，可一次性添加所有该板块的个股。
 - 右侧可通过“删除证券”按钮，来调整成份股。
 - 点击“<<”按钮，可一次性删除所有成份股。



- 导入成份股：在篮子列表中选中篮子，点击“批量导入”，在弹出窗口中选中导入内容格式，并选中导入 csv 格式文件，导入文件后勾选股票，点击加入篮子，即可添加股票到篮子，如下图所示；

1. 点击导入篮子
 2. 输入篮子名称
 3. 选中导入csv格式文件，一次性导入文件内的成份股
 4. 右侧可通过“删除证券”按钮，来调整成份股。
- 点击确认即可生成篮子



- 导出成份股：在篮子列表中选中篮子，点击“导出”，将篮子导出到本地路径中。



2.4.2 篮子买入/卖出

- 篮子买入/卖出的操作步骤如下：
 1. 在资金账户栏勾选相应的资金账户
 2. 在点击篮子名称按钮选择篮子
 3. 设置委托价格为买卖五档价格或最新价、涨停价、跌停价
 4. 设置浮动价格为按价格，输入浮动数值
 5. 若选择的篮子的分配方式为资金权重，则输入总委托金额；若选择的篮子的分配方式为单笔数量，则输入委托份数，若为委托金额，则输入委托份数
 6. 点击买入/卖出即可实现篮子买入/卖出下单。



备注：
账号分配：支持多种选择模式，灵活对买卖资金账号做控制



2.4.3 篮子调仓

调仓：将当前持仓调整至目标仓位，按照目标篮子中股票数量进行调整，遵循多卖少买的原则，提供双边同时买卖的篮子交易，便于用户操作使用。

示例：

委托数量=持仓数量-目标仓位

当出现可用金额不足以买入股票的时候，系统将先卖出股票，获得可用资金后买入股票。



2.4.4 篮子批量修改

在该功能中，可以通过对选中的篮子，进行批量修改其委托数量、委托数量比例、委托金额、持仓比例的修改。买入的篮子即为修改后篮子。

应用场景：期望在保持当前持仓个股比例情况下，进行按当前持仓比例调整。如每个个股增加80%的委托数量，或者增加50%个股市值，既可以应用批量修改的方式实现。

操作步骤：

- 1、选择篮子
- 2、选择修改方式“委托数量”“委托金额”“委托数量比例”“持仓比例”，输入相应的比例数值、数量、金额等，点击批量修改
- 3、篮子批量修改完成
- 4、点击买入

示例：

篮子修改前参数：



将该篮子委托金额批量修改为20000元后点击“批量修改”

序号	证券代码	证券名称	持仓数量	委托金额	委托数量	限定价格	最低佣金	最新价	涨跌幅
1	600000	浦发银行	0	19050.00	1500	0.000	4.76	12.700	-1.55
2	000001	平安银行	0	18348.00	1100	0.000	4.59	16.680	-1.19
3	000002	万科A	0	18774.00	700	0.000	4.69	26.820	-0.56

2.4.5 篮子交易设置

买入限定价格：买入委托价格大于设定限定价，则不再报单，如设定为空或者为0，则没有限制

卖出限定价格：卖出委托价格小于设定限定价，则不再报单，如设定为空或者为0，则没有限制

佣金费率：通过调整资金账户佣金费率，直观展示佣金费用。

最小单笔金额：在使用TWAP的算法时候，当委托总价超过最小单笔金额，调用算法拆单，算法拆单中子单委托不小于单笔最小金额。

最大单笔金额：TWAP拆单后子单委托最大金额不超过设定最大单笔金额

切换买卖方向同步篮子数据：如不勾选，无法保存修改后的篮子，需要重新修改

可用不足时按照最大数量交易：如不勾选，则交易按照输入数量交易，不再校验持仓和可用金额

创建算法单后立即启动：如不勾选，创建算法单后，需要手动选中母单，点击启动运行

序号	证券代码	证券名称	持仓数量	委托金额	委托数量	限定价格	最低佣金	最新价	涨跌幅
1	600000	浦发银行	0	19050.00	1500	0.000	4.76	12.700	-1.55
2	000001	平安银行	0	18348.00	1100	0.000	4.59	16.680	-1.19
3	000002	万科A	0	18774.00	700	0.000	4.69	26.820	-0.56

重置：将修改后的新篮子重置回选中的篮子。

过滤涨停：将篮子中涨停股票剔除。

过滤跌停：将篮子中跌停股票剔除。

2.4.6 交易策略：TWAP

同花顺智能交易系统在篮子交易中提供TWAP算法交易，辅助大单拆分，更好的隐藏交易目的，避免大单对市场的冲击，减少不可控风险。

TWAP算法中减少参数配置，通过程序自主学习市场订单，做到自动调整参数寻求市场最优解。

下单间隔：每笔个股子单委托间隔

撤单时间：每笔委托再规定时间内未成交则撤销。

交易策略: TWAP

起止时间: 09:30:00 - 15:00:00

下单间隔: 60 秒

撤单时间: 30 秒

合计金额: 0.00 元

买入

TWAP交易将交易时间进行均匀分割,并在每个分割节点上将均匀拆分的订单进行提交。TWAP策略设计的目的是在使交易对市场影响最小化的同时提供一个较低的平均成交价格,从而达到减小交易成本的目的。

2.4.7 委托管理

在篮子交易界面下方,左侧为母单委托管理界面,右侧为子单委托明细界面。点击左侧母单条目查看其子单成交的明细状况。可以在上方暂停、启动、撤单、刷新中做到对母单执行任务暂停、启动、撤销任务和刷新进度的功能。

母单撤单步骤:

- 1、在左下方选择对应母单, 点击方框, 勾选母单
- 2、点击撤单, 即可完成

子单撤销步骤:

- 1、在左下方选择对应母单
- 2、在母单中找到对应的子单, 点击上方撤销, 即可完成对应子单个股委托撤销。

智能交易·机构版

客户管理 普通交易 融资融券 篮子交易 算法管理 策略交易 信息查阅 风险控制

篮子名称: 测试1

委托价格: 卖一价

浮动价格: +0.02

下单类型: 按委托金额

篮子份数: 1

交易策略: TWAP

起止时间: 09:30:00 - 15:00:00

下单间隔: 60 秒

撤单时间: 30 秒

合计金额: 297738.00 元

买入

暂停 启动 撤单 刷新

序号	资金账户	篮子名称	委托时间	母单状态	交易类型	成交进度
1	56414636	测试1	11:09:53	委托或撤单失败	普通委托	0/36700
2	56414636	测试1	11:10:21	委托中	普通委托	18000/36700
3	56414636	测试1	11:13:27	委托中	twap	0/36700

持仓比例: * 批量修改

当前分配篮子: 测试1

已勾选/总数: 3/3

合计: 297738.00 元

序号	证券代码	证券名称	持仓数量	委托金额	委托数量	最小委托金额	最小委托数量	最大委托金额	最大委托数量	限定价格
1	600000	浦发银行	78700	99180.00	8700	100000.00	8700	200000.00	17500	11.400
2	600004	白云机场	20000	98766.00	5400	100000.00	5400	200000.00	10900	18.290
3	600006	东风汽车	29500	99792.00	21600	100000.00	21600	200000.00	43200	4.620

暂停 启动 撤单 刷新

序号	资金账户	证券代码	证券名称	委托日期	委托时间	操作	委托数量	委托价格	成交数量	成交价格	合同编号	订单状态	委托	
1	5413332	56414636	600000	浦发银行	20190822	11:10:21	买	8700	11.400	8700	11.399	1183011882	全部成交	是
2	5413332	56414636	600006	东风汽车	20190822	11:10:21	买	21600	4.620	9300	4.620	1182996102	部分成交	是
3	5413332	56414636	600004	白云机场	20190822	11:10:21	买	5400	18.290	0	0.000	1182997003	未成交	是

2.4.8 信用账号篮子交易

信用账号篮子交易, 在左上角选择信用账号, 其余操作参见上方2.4篮子交易操作流程



2.5 算法管理

2.5.1 算法交易

2.5.1.1 TWAP

TWAP (Time Weighted Average Price)，时间加权平均价格算法。TWAP将交易时间进行均匀分割，并在每个分割节点上将均匀拆分的订单进行提交。TWAP策略设计的目的是在使交易对市场影响最小化的同时提供一个较低的平均成交价格，从而达到减小交易成本的目的。通过指定开始时间、结束时间、买入数量、下单间隔时间或每次下单的数量，来计算每个时间间隔的下单量。

买入/卖出下单操作的主要步骤如下：

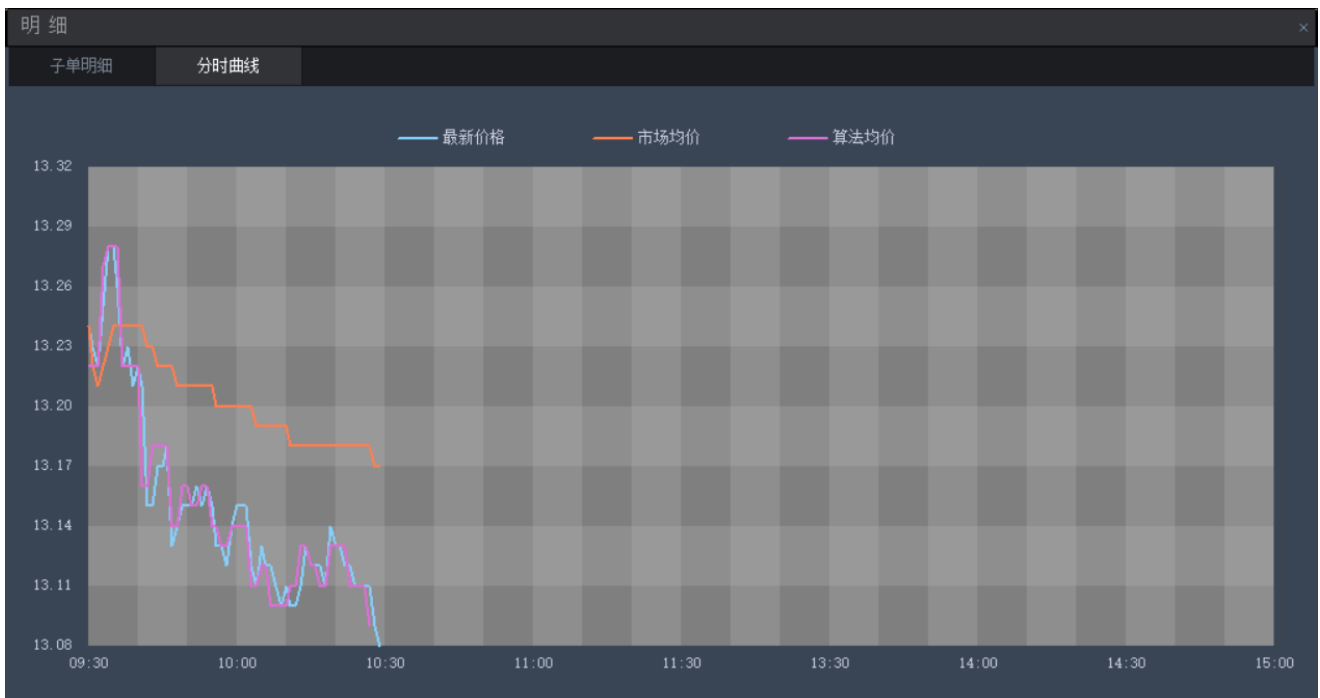
1. 选中资金账户
2. 在买卖方向下拉框选择买入/卖出，并在数量窗口选择需要买入/卖出的股票数量
3. 输入股票代码
4. 输入委托数量
5. 设置下单开始时间和结束时间
6. 选择委托价格
7. 设置下单间隔，单位为秒，时间可以任意输入
8. 点击“创建”，弹出委托买卖提示信息，核实无误后，点击“确认”启动交易
9. 可以在任务栏查看委托进度，成交进度，在母单明细-子单明细界面查看成交情况



提供约束时间

2.5.2 VWAP

VWAP (Volume Weighted Average Price)，成交量加权平均价格算法，它是一段时间内



2.5.3 冰山算法

冰山指令是限价指令的扩展，下单时需要投资者设定委托价格、委托总量和可见委托量(暴露量)，其中可见委托量必须小于委托总量。在指令下达后，系统会按设定的委托价格发出一个限价指令，委托量等于暴露量；待该笔限价委托成交，系统便会以同样的价格再发出一笔同等数量的限价委托，等待成交；依次类推，直至交易结束。

该算法的核心是，通过把一个很大的单子拆分成几个小的单子。每次只提交一个小单，等该小单全部成交后，再提交下一个小单，直到整个大单成交完成为止。

买入/卖出下单操作的主要步骤如下：

1. 选中资金账户
2. 选择买入/卖出
3. 输入股票代码
4. 输入委托数量
5. 设置下单开始时间和结束时间
6. 选择委托价格
7. 设置价格浮动，买入时默认为买入价格*0.1%。卖出时默认为卖出价格*0.1%。取整到0.01元，变动单位0.01元，如果浮动为“0”，则以最新价格下达限价委托
8. 设置每单占比，即设定冰山算法的每笔子单暴露量占总委托量的比例
9. 选择到达结束时间后是否允许继续下单，即当时间到达结束时间，并且委托数量没有全部完成时，选择是否继续委托
10. 选择未成交是否允许撤单，如果允许撤单则对已经委托的子单在选定的时间内未成交（自定义输入时间）进行撤单

算法交易

冰山

开始时间

09 : 30 : 00

证券代码

600000

浦发银行

结束时间

15 : 00 : 00

委托价格

卖一价

每单占比

5.0

%

浮动价格

+

元

撤单时间

0

秒

浮动范围

±

元

可买数量

644100

股

委托数量

20000

股

限定价格

☒创建算法单后立即启动

策略说明

重置

创建

1. 点击“创建”，弹出委托买卖提示信息，核实无误后，点击“确认”启动交易

2. 可以在任务栏查看委托进度、成交进度，在任务-明细-子单监控查看成交情况

算法管理

浦发银行

600000

算法交易

冰山

开始时间

09 : 30 : 00

结束时间

15 : 00 : 00

委托价格

卖一价

每单占比

5.0

%

浮动价格

+

元

撤单时间

0

秒

浮动范围

±

元

可买数量

647000

股

委托数量

20000

股

限定价格

☒创建算法单后立即启动

策略说明

重置

创建

资金账户

资金余额

可用余额

冻结金额

可取金额

用资金占比(%)

盈亏

股票市

56414639 54133b31

8553707.32

8553707.32

0.00

0.00

84.7

97230.32

1543521

56414636 54133b2e

486419.60

486419.60

0.00

0.00

4.5

783557.60

1029713

56414638 54133b30

1682466.42

1682466.42

0.00

0.00

15.8

672720.42

8990254

任务

持仓 F6

成交 F7

委托 F8

刷新 F5

全选

暂停

启动

停止

删除

序号

资金账户

备注

证券代码

证券名称

算法类型

操作

算法数量

委托数量

委托进度(%)

成交数量

成交进度(%)

成交均价

任务状态

错误信息

1

56414639 54133b31

—

600000

浦发银行

iceberg

买入

20000

19000

95.0

18000

90.0

13.197

执行中

明细

2

明细

刷新

全选

撤单

×

明细

3

子单明细

分时曲线

明细

序号

资金账户

证券代码

证券名称

委托日期

委托时间

操作

委托数量

委托价格

成交数量

成交价格

合同编号

订单状态

1

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:37

买入

1000

13.170

0

0.000

1237811903

未成交

2

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:34

买入

1000

13.170

1000

13.170

1237810602

全部成交

3

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:31

买入

1000

13.170

1000

13.170

1237811962

全部成交

4

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:28

买入

1000

13.180

1000

13.170

1237816044

全部成交

5

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:25

买入

1000

13.180

1000

13.180

1237814151

全部成交

6

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:22

买入

1000

13.180

1000

13.170

1237828504

全部成交

7

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:19

买入

1000

13.190

1000

13.180

1237816233

全部成交

8

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:16

买入

1000

13.200

1000

13.190

1237817492

全部成交

9

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:13

买入

1000

13.210

1000

13.200

1237819528

全部成交

10

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:10

买入

1000

13.210

1000

13.200

1237814991

全部成交

11

56414639 54133b31

600000

浦发银行

20191018

09:41:07

买入

1000

13.210

1000

13.200

1237822518

全部成交

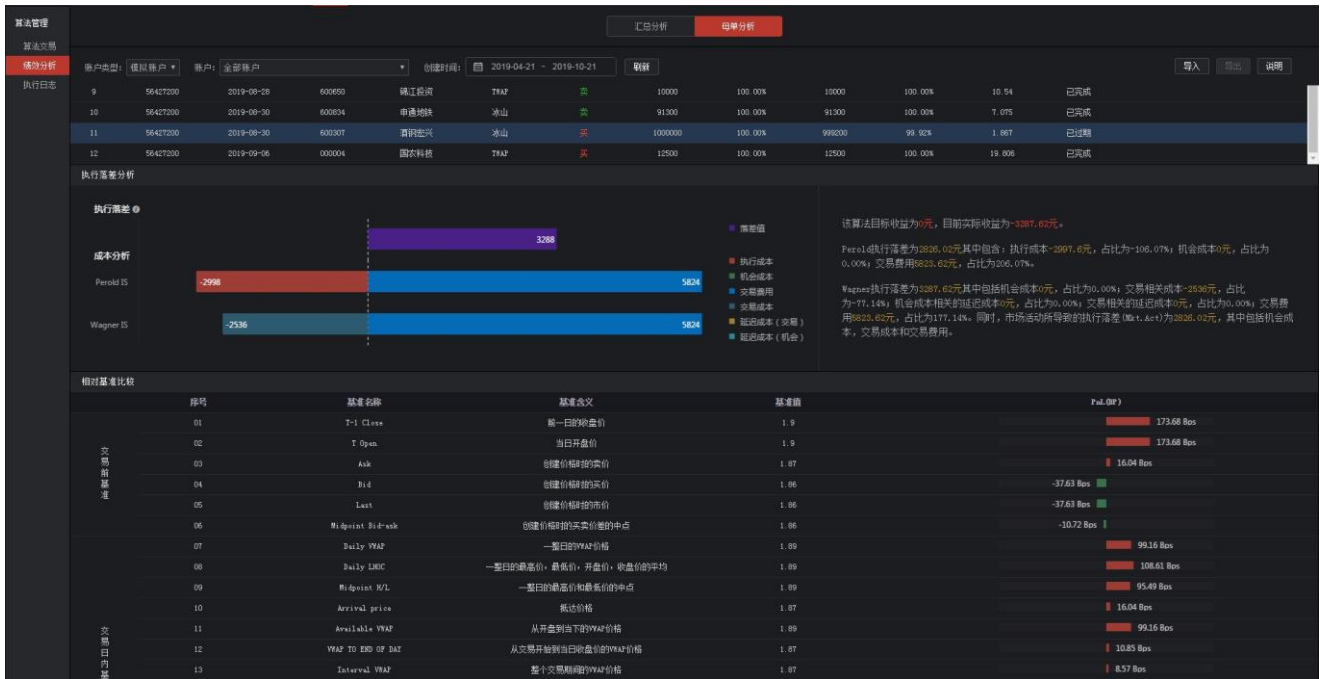
2. 5. 2华创算法

华创算法中提供TWAP、VWAP、VWAPPLUS、STRICTTWAP、POV算法，针对不同的交易场景提供算法支持服务。当前仅在环境为正式三的时候提供华创算法服务，用户在使用华创算法前，需要确认本系统所启动的服务器是否为正式三。

2. 5. 3绩效分析

绩效分析主要由两个页面组成，分别为汇总分析和母单分析两个维度；两个页面展示的内容都是由时间控件来决定。

绩效分析说明参见绩效分析页面中说明部分,主要对历史某段时间内算法单参数分析展示，通过该说明中的操作文档辅助用户了解绩效分析主要功能。



2.5.4 执行日志

执行日志主要对算法母单中下单-撤单-补单流程做数据展示，可以查看历史某周期内算法母单的每一笔子单运行状态。在该界面下对某一子单时间，委托回报时间做详尽的展示。

将每个子单下发过程中，涉及到的撤销、再下单合并成一条记录，清晰的展示其委托延迟、回报结果、错误参数等数据。

序号	资金账户	证券代码	证券名称	创建时间	算法类型	操作	委托数量	委托数量 (0)	成交数量	成交数量 (0)	平均价格	任务状态
1	54062895	600030	中信证券	2019-10-18	HC-TWAP	买	5000	96.00%	4800	96.00%	22.150	已过期
2	54062895	002236	大华股份	2019-10-11	HC-VWAPLITE	买	100000	100.00%	100000	100.00%	15.853	已完成
3	54062895	002236	大华股份	2019-10-11	HC-TWAP	买	100000	100.00%	100000	100.00%	15.854	已完成
4	56427200	000006	深赛格A	2019-09-27	HC-STICKTWAP	卖	385200	17.94%	69100	17.94%	5.112	已暂停
5	56427200	000002	万科A	2019-09-27	HC-TWAP	买	60000	11.50%	6900	11.50%	26.151	已过期
6	56427200	000004	国农科技	2019-09-06	twap	买	12500	100.00%	12500	100.00%	19.806	已完成
7	56427200	600307	泰阳在兴	2019-08-30	iceberg	买	1000000	100.00%	998200	99.82%	1.867	已过期

母单ID: 11571377226189

只显示摘要信息

Q 请输入委托编号

序号	委托编号	委托代码	委托动作	委托时间	委托数量	委托价格	回报时间	成交数量	成交价格	撤单数量	状态	错误信息
01-1	1238328303	600030	买入	13:40:29.1669	1000	22.200	13:40:29.1669	--	--	--	已申报	--
01-2	1238328303	600030	撤单	13:42:06.2538	--	--	13:42:06.2538	--	--	1000	已撤单	--
02-1	1238361532	600030	买入	13:42:06.2663	800	22.230	13:42:12.2695	800	22.230	--	全部成交	--
03-1	1238363079	600030	买入	13:44:26.4039	800	22.200	13:44:31.4002	800	22.200	--	全部成交	--
04-1	1238418461	600030	买入	13:57:13.1704	800	22.150	13:57:13.1704	--	--	--	已申报	--
04-2	1238418461	600030	撤单	13:58:03.2205	--	--	13:58:04.2211	--	--	800	已撤单	--
05-1	1238394453	600030	买入	13:58:04.2212	800	22.210	13:58:08.2254	800	22.200	--	全部成交	--
06-1	1238404216	600030	买入	14:09:54.9315	800	22.100	14:10:52.9895	800	22.100	--	全部成交	--
07-1	1238474131	600030	买入	14:22:40.6973	800	22.070	14:24:05.7824	800	22.070	--	全部成交	--
08-1	1238523615	600030	买入	14:35:10.4578	800	22.100	14:36:06.5032	800	22.100	--	全部成交	--

2.6 策略交易

2.6.1 条件买卖

条件买卖可以定价买入或者卖出某只股票，可以对个股设置止损止盈。在参数设置模块设置好交易参数，启动策略，可以跟踪对应的股票价格，使股票按照设定的价格买入和卖出。

设置交易参数的主要步骤如下：

1. 选中资金账户（备注：请先在同花顺智能交易客户端登录股票资金账户，这样系统可以自

动获取资金账户信息)

2. 选择买卖方向，买入或者卖出
 3. 输入股票代码
 4. 设置委托价格：为保证成交一般需要设置价格浮动
 5. 数量选择：设置委托数量，同时设置单笔委托上限
 6. 买入条件：勾选对应的买入条件，并设置对应的定价参数
 7. 卖出条件：勾选对应的卖出条件，并设置对应的止损参数
 8. 点击重置按钮，可以重置交易参数，点击确定按钮则执行买入或者卖出计划
- 交易监控主要操作步骤如下：

交易监控主要操作步骤如下：

1. 点击“交易监控”，进入交易监控界面
2. 选择对应母单，点击“暂停”，可以暂停对应母单；选择已暂停的母单，点击“运行”，可以再次启动运行该笔母单
3. 在对应母单停止状态下，点击“修改”，可以修改母单委托信息，监控信息修改界面如下：

资金账户: 55545822 5cb029c9 模拟炒股-同花顺模拟

买卖方向: ☒ 买入 ☐ 卖出

证券名称: 浦发银行 证券代码: 600000

可用资金: 9829811.83 可买(股): 833700

委托价格: 卖一价 浮动价格: 0 分

数量选择: ☐ 全部 (833700)

☐ 1/2 ☐ 1/3 ☐ 1/4 ☐ 1/5

☐ 2/3 ☐ 3/4 ☐ 3/5 ☒ 自填 委托数量: 20000 股

买入条件:

☒ a. 下破买入: 最新价下破至 11.79 元执行

☐ b. 上穿买入: 最新价上穿至 元执行

☐ c. 反弹买入: 最新价下破至 元之后, 此价格反弹

按价位 元执行

策略说明 重置 运行

1. 选择对应母单，点击“删除”，可以删除对应母单，未成交的母单将被取消，已经成

就的子单将不做处理，已委托将会被撤单。

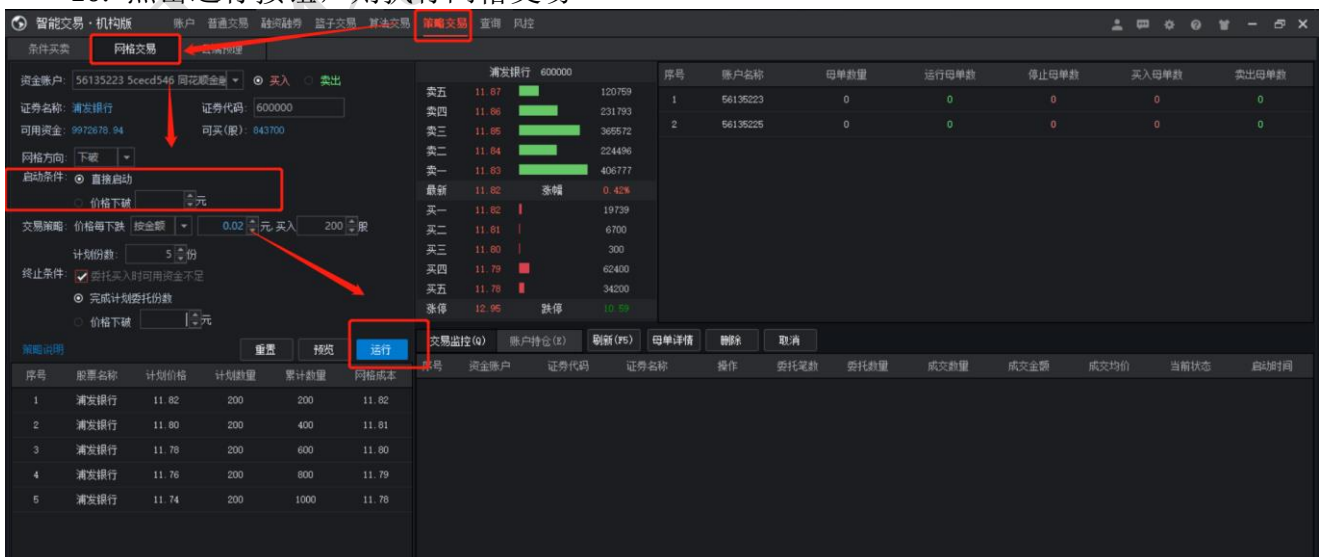
2. 选择对应母单，点击“停止”，则会停止该笔母单；选择已停止的母单，点击“运行”，则会再次重启该笔母单
3. 点击刷新，则刷新母单最新委托进度
4. 点击“账户持仓”则可以查看对应账户下持仓情况

2.6.2 网格交易

网格交易策略适用于大笔买入或卖出某只股票。在参数设置模块设置好交易参数，启动策略，策略可以在买入时候将大单拆分成若干份，生成几档不同的委托价位，达到委托价位时候委托买入对应份额。

设置交易参数的主要步骤如下：

1. 选中资金账户（备注：请先在同花顺量化客户端登录股票资金账户，这样系统可以自动获取资金账户信息）
2. 选择买卖方向，买入或者卖出
3. 输入股票代码
4. 设置启动条件：选择直接启动或者买入价格下破设置价位；卖出价格上穿设置价位
5. 设置交易策略：当方向为买入时，选择价格每下跌固定价格买入一份固定数量的股票，或者价格每下跌一定百分比时候买入一份固定数量的股票；当方向为卖出时，选择价格每上涨固定价格卖出一份固定数量的股票，或者价格每上涨一定百分比时候卖出一份固定数量的股票。同时设置触发时的委托价格。
6. 设置买卖计划份数：输入计划份数数值，勾选“启动时买入”/“卖出第一份”。在买入时候，如果选择直接启动并且勾选了启动时买入第一份，则在启动的时候买入第一份；同理，在卖出时候，如果选择直接启动并且勾选了启动时卖出第一份，则在启动的时候卖出第一份。
7. 设置终止条件：默认勾选“委托买入时可用资金不足”/“委托卖出时可用股票不足”，意味着委托买入时可用资金不足或委托卖出时可用股票不足，则自动停止网格交易。当勾选“完成计划委托份数”时，在完成交易策略设置的计划份数后，网格交易自动停止。若不勾选“完成计划委托份数”，则在买入时候，设置价格下破价位或在卖出时候，设置价格上穿价位，达到该价位时，网格交易自动停止；
8. 点击重置按钮，可以重置交易参数
9. 点击预览按钮，可以预览设置的交易计划
10. 点击运行按钮，则执行网格交易



交易监控主要操作步骤如下：

交易监控(Q)	账户持仓(E)	刷新(F5)	母单详情	删除	取消						
序号	资金账户	证券代码	证券名称	操作	委托笔数	委托数量	成交数量	成交金额	成交均价	当前状态	启动时间
1	55545819	600000	浦发银行	买入	1	200	0	0.00	0.00	委托中	20190614 16:29:50

1. 点击“交易监控”，进入交易监控界面
2. 在对应母单停止状态下，点击“母单管理”，可以管理母单管理信息，母单管理界面如下：

母单详情

证券名称: 浦发银行

操作: 网格买入

网格方向: 向下

启动条件: 直接启动.

交易策略: 价格每下跌0.02元, 买入200股, 计划5份

终止条件: 买入时可用资金不足: 完成计划份数: 当前状态: 委托中

网格明细:

序号	股票名称	计划价格	计划数量	累计数量	网格成本	委托数量	成交数量	成交价格	订单状态	合同编号
1	浦发银行	11.79	200	200	11.79	200	0	0	未成交	1118162104
2	浦发银行	11.77	200	400	11.78				未委托	
3	浦发银行	11.75	200	600	11.77				未委托	
4	浦发银行	11.73	200	800	11.76				未委托	
5	浦发银行	11.71	200	1000	11.75				未委托	

确定

1. 选择对应母单，点击“删除”，可以删除对应母单，未成交的母单将会被取消，已经成就的子单将不做处理，已委托将会被撤单。
2. 选择对应母单，点击“停止”，则会停止该笔母单。
3. 选择已停止的母单，点击“运行”，则会再次重启该笔母单。
4. 点击刷新，则刷新母单最新委托进度。
5. 点击“子单监控”，则可以查看最新子单委托进度。
6. 点击“账户持仓”，则可以查看对应账户下持仓情况。

2.6.3 云端预埋

云端预埋策略可通过预先设定相对应的买卖信号，让计算机自动根据信号交易，节省看盘时间，提高投资效率。

设置交易参数的主要步骤如下：

1. 选中资金账户（备注:请先在同花顺量化客户端登录股票资金账户，这样系统可以自动获取资金账户信息）
2. 选择买卖方向，买入或者卖出

3. 输入股票代码
4. 选择分配方案: 可选择等量分配、等差递增分配或者等差递减分配, 具体详细分配方案, 请点击“方案详情”进行预览
5. 设置价格区间
6. 设置委托时间, 委托时间要大于当前启动时间
7. 设置分档数量, 即预埋分笔下单次数
8. 设置首档数量, 即预埋第一笔下单的数量
9. 设置公差数量, 即当分配方案为等差递增或者等差递减分配时候, 每一档分配数量的等差
10. 点击“重置”按钮, 可以重置交易参数, 点击“计算序列”按钮, 可以预览设置的预埋交易计划, 预览预埋交易计划如下图所示:
11. 点击“确定预埋”, 则可以执行预埋交易计划

策略说明				重置	预览	运行
序号	资金账户	股票名称	方向	数量	价格	
1	55545822	浦发银行	买入	200	11.8	
2	55545822	浦发银行	买入	200	11.78	
3	55545822	浦发银行	买入	200	11.76	
4	55545822	浦发银行	买入	200	11.73	
5	55545822	浦发银行	买入	200	11.71	
6	55545822	浦发银行	买入	200	11.69	
7	55545822	浦发银行	买入	200	11.67	
8	55545822	浦发银行	买入	200	11.64	
9	55545822	浦发银行	买入	200	11.62	
10	55545822	浦发银行	买入	200	11.6	

智能交易 · 机构版

账户 普通交易 融资融券 篮子交易 算法交易 **策略交易** 查询 风控

条件买卖 网络交易 **云端预埋**

资金账户: 56135223 5cecd546 同花顺金 买入 卖出

证券名称: 建投能源 证券代码: 000600

可用资金: 9972678.94 可买(股): 1508700

分配方案: 等量分配 方案详情

价格区间: 6.7 下至 6.6 元

委托时间: 2019/06/18 9:30:00

首档数量: 20000 股

分档数量: 20 份

预计金额: 2660000元

策略说明 重置 预览 运行

序号	资金账户	股票名称	方向	数量	价格
1	56135223	建投能源	买入	20000	6.7
2	56135223	建投能源	买入	20000	6.69
3	56135223	建投能源	买入	20000	6.69
4	56135223	建投能源	买入	20000	6.68
5	56135223	建投能源	买入	20000	6.68
6	56135223	建投能源	买入	20000	6.67
7	56135223	建投能源	买入	20000	6.67

建投能源 000600

卖五 6.66 213

卖四 6.65 171

卖三 6.64 200

卖二 6.63 123

卖一 6.62 610

最新 6.61 涨幅 -1.4

买一 6.61 860

买二 6.60 244

买三 6.59 20

买四 6.58 970

买五 6.57 570

涨停 7.38 跌停 6.4

预埋单(Q) 账户持仓(E) 刷新

序号 资金账户

交易监控主要操作步骤如下：

预埋母单(Q)	账户持仓(E)	刷新(F5)	母单管理	删除							
序号	资金账户	证券代码	证券名称	操作	埋单笔数	委托数量	成交数量	成交金额	成交均价	当前状态	预埋时间
1	55545822	600000	浦发银行	买入	10	2000	0	0	0	已预埋	20190614 09:30:00

1. 点击“预埋母单”，进入预埋母单界面
2. 点击“母单管理”，可以管理母单管理信息，母单管理界面如下

母单管理

证券名称: 浦发银行

操作: 买入

序号: 1

分配方案: 平均分配

启动时间: 2019/06/14 9:30:00

价格区间: 11.8元 下至 11.6元

分档数量: 10

首档数量: 200

累计数量: 2000

当前状态: 已预埋

预埋明细:

添加

删除

修改

序号	股票名称	预埋价格	预埋数量	加权均价	委托数量	成交数量	成交价格	订单状态	合同编号
1	浦发银行	11.80	200	11.8	200	0	0	委托中	1118122828
2	浦发银行	11.78	200	11.79	200	0	0	委托中	1118120436
3	浦发银行	11.76	200	11.78	200	0	0	委托中	1118122438
4	浦发银行	11.73	200	11.77	200	0	0	委托中	1118123071
5	浦发银行	11.71	200	11.76	200	0	0	委托中	1118114544
6	浦发银行	11.69	200	11.75	200	0	0	委托中	1118122280
7	浦发银行	11.67	200	11.73	200	0	0	委托中	1118118634
8	浦发银行	11.64	200	11.72	200	0	0	委托中	1118126577

确定

取消

1. 选择对应母单，点击“删除”，可以删除对应母单，未成交的母单将被取消，已经成交的子单将不做处理，已委托将会被撤单。
2. 点击“刷新”，则刷新母单最新委托进度。
3. 点击“账户持仓”，则可以查看对应账户下持仓情况。

2.7 信息查询

2.7.1 账户数据

账户管理页面添加账户后，查询页面可查询账户的资金股票、股票余额、成交记录、委托记录、资金明细、对账单、配号等情况。

账户数据		净值走势		资产汇总																													
资金股票		资金账户		全部账户		选择市场		沪深两市		刷新 (F5)		常用操作																					
		序号		资金账户		备注		总资产		可用资金		可用资金占比		盈亏		冻结资金		股票市值															
股票余额		1		57500133 5824460		—		10000778.65		9995378.65		99.95%		778.65		0.00		15400.00															
成交记录		2		57500132 582446f		—		10000293.55		9995033.55		99.95%		293.55		0.00		5260.00															
委托记录		3		56414636 5413332*		—		10801343.00		486419.60		4.50%		801343.00		0.00		10314923.40															
资金明细		4		56414638 54133330		—		10730533.42		1682466.42		15.68%		730533.42		0.00		9048067.00															
对账单		5		56414639 54133331		—		10104379.50		8553707.32		8245791.50		81.61%		104379.50		1859588.00															
配号																																	
				汇总				51637328.12		30703005.54		30395089.72		1637328.12				21242238.4															
账户持仓列表																																	
代码筛选: 重置																																	
		序号		资金账户		备注		证券代码		证券名称		股票余额		可用数量		冻结数量		成交均价		市价		盈亏		盈亏比(%)		市值		交易市场		股东账户		实际数量	
		1		57500133 5824460		—		000001		平安银行		600		600		0		16.092		16.900		485.10		5.02		10140.00		深圳A股		00106327207		600	
		2		57500133 5824460		—		600000		浦发银行		400		400		0		12.416		13.150		293.55		5.91		5260.00		上海A股		A684047541		400	
		3		57500132 582446f		—		600000		浦发银行		400		400		0		12.416		13.150		293.55		5.91		5260.00		上海A股		A684047540		400	
		4		56414636 5413332*		—		000001		平安银行		105900		105900		0		14.002		16.900		306910.04		20.70		1789710.00		深圳A股		00107243773		105900	
		5		56414636 5413332*		—		000002		万科A		32400		32400		0		28.991		27.570		-46025.19		-4.90		893268.00		深圳A股		00107243773		32400	
		6		56414636 5413332*		—		000007		全新好		10000		10000		0		6.612		9.420		28076.18		42.46		94200.00		深圳A股		00107243773		10000	
		7		56414636 5413332*		—		002373		千方科技		300		300		0		17.641		18.380		221.80		4.19		5514.00		深圳A股		00107243773		300	
		8		56414636 5413332*		—		002932		明德生物		200		200		0		41.212		39.970		-248.47		-3.01		7994.00		深圳A股		00107243773		200	
				汇总								3004340		2981040		23300										1637328.12				21242238.4			
操作信息																																	
<09:42:14 [E0002] [账户: 56414636, 查配号失败, 错误信息: 系统暂时不提供[查询配号(T-C)]功能的服务, 敬请谅解!]																																	
<09:42:14 [E0002] [账户: 56414636, 查配号失败, 错误信息: 系统暂时不提供[查询配号(T-C)]功能的服务, 敬请谅解!]																																	

常用操作中能对方所有账户持仓做汇总，支持数据文件格式导出和文本数据复制。

账户数据	净值走势	资产汇总								
资金股票	资金股票	全部账户	选择市场	沪深两市	刷新 (F5)	常用操作				
股票余额	序号	资金账户	备注	总资产	可用资金	可用资金	可用资金占比	盈亏	冻结资金	股票市值
成交记录	1	57500133 5824460	—	10000778.65	9995378.65	9995378.65	99.95%	778.65	0.00	15400.00
委托记录	2	57500132 582445f	—	10000293.55	9995033.55	9995033.55	99.95%	293.55	0.00	5260.00
资金明细	3	56414636 5413332*	—	10801343.00	486419.60	486419.60	4.50%	801343.00	0.00	10314923.40
对账单	4	56414638 54133330	—	10730533.42	1682466.42	1682466.42	15.68%	730533.42	0.00	9048067.00
配号	5	56414639 54133331	—	10104379.50	8553707.32	8245791.50	81.61%	104379.50	0.00	1859588.00
汇总				51637328.12	30703005.54	30395089.72		1637328.12		21242238.4
账户持仓列表										
代码筛选: 重置										
	证券代码	证券名称	股票余额	可用数量	冻结数量	成交均价	盈亏	市值		
	000001	平安银行	360400	360400	0	15.005	700205.7	6090760		
	000002	万科A	51300	51300	0	27.579	-29370.08	1414341		
	000004	国农科技	1500	1500	0	18.979	-223.54	28245		
	000007	全新好	10000	10000	0	6.612	28076.18	94200		
	000011	深物业A	700	700	0	9.966	-95.11	6895		
	000565	渝三峡A	1400	1400	0	5.245	244.8	7588		
	002143	印纪视	2000000	2000000	0	0.540	19670	1100000		
	002373	千方科技	41700	41700	0	17.596	34523.26	766446		
汇总				3004340	2981040	23300		1637328.12		21242238.4

- 资金股票：查询账户中股票、资金等数据
- 股票余额：查询某资金账号中股票明细等数据
- 成交记录：对历史某段时间内（含当日）资金账号每笔子单成交明细查询展示
- 委托记录：对历史某段时间内（含当日）资金账号每笔委托记录查询展示
- 资金明细：查询资金账号当前资金数据
- 对账单：对历史某段时间内（含当日）资金账号对账单查询展示
- 配号：对历史某段时间内（含当日）新股配号对账单查询展示

2.7.2净值走势

在净值走势界面中，可以对资金账户历史时段内收益走势曲线、相关回测参数更加直观的展示出来。

- 1、在资金账户中选择需要查看的资金账户
- 2、选中需要展示的历史时间段
- 3、选择比较基准，选择上证50、中证500、以及沪深300等

4、点击查询展示收益曲线和相关参数



2.7.3资产汇总

对系统中资金账号的资产汇总情况做展示, 可对某一特殊资金账号做展示导出。

操作步骤:

1. 选择资金账号
2. 选择查询日期
3. 点击查询
4. 对选中的账户、时间确认后导出

资产汇总表	56414639	57500133	56414636	56414638	57500132
125017	56414636	56414636	56414638	56414638	57500132
科目代码	57500132	57500132	57500132	57500132	57500132
1101	1101	1101	1101	1101	1101
1101.01	1101.01	1101.01	1101.01	1101.01	1101.01
1101.01.600000.SH	1101.01.600000.SH	1101.01.600000.SH	1101.01.600000.SH	1101.01.600000.SH	1101.01.600000.SH
1101.01.600004.SH	1101.01.600004.SH	1101.01.600004.SH	1101.01.600004.SH	1101.01.600004.SH	1101.01.600004.SH
1101.01.600006.SH	1101.01.600006.SH	1101.01.600006.SH	1101.01.600006.SH	1101.01.600006.SH	1101.01.600006.SH
1101.01.600009.SH	1101.01.600009.SH	1101.01.600009.SH	1101.01.600009.SH	1101.01.600009.SH	1101.01.600009.SH
1101.01.600928.SH	1101.01.600928.SH	1101.01.600928.SH	1101.01.600928.SH	1101.01.600928.SH	1101.01.600928.SH
1101.01.600989.SH	1101.01.600989.SH	1101.01.600989.SH	1101.01.600989.SH	1101.01.600989.SH	1101.01.600989.SH
1101.01.601068.SH	1101.01.601068.SH	1101.01.601068.SH	1101.01.601068.SH	1101.01.601068.SH	1101.01.601068.SH
1101.01.601162.SH	1101.01.601162.SH	1101.01.601162.SH	1101.01.601162.SH	1101.01.601162.SH	1101.01.601162.SH
1101.01.601298.SH	1101.01.601298.SH	1101.01.601298.SH	1101.01.601298.SH	1101.01.601298.SH	1101.01.601298.SH
1101.01.601319.SH	1101.01.601319.SH	1101.01.601319.SH	1101.01.601319.SH	1101.01.601319.SH	1101.01.601319.SH
1101.01.601577.SH	1101.01.601577.SH	1101.01.601577.SH	1101.01.601577.SH	1101.01.601577.SH	1101.01.601577.SH
1101.01.601598.SH	1101.01.601598.SH	1101.01.601598.SH	1101.01.601598.SH	1101.01.601598.SH	1101.01.601598.SH

科目代码	科目名称	币种	汇率	持仓数量	成本价	持仓成本	成本占比	行情价格	市值	市值占比	盈亏	盈亏占比	停牌信息
56414639	57500133,56414638,56414636,57500132资产汇总表2019-10-18												
1101	股票	CNY	1	0		37402706	29.92%		41996973	33.60%	4594270	12.28%	
1101.01	沪A股票	CNY	1	0		12583267	10.07%		14529234	11.62%	1945974	15.46%	
1101.01.6	浦发银行	CNY	1	464300	11.41	5296800	4.24%	13.17	6082330	4.87%	785537.3	14.83%	正常交易
1101.01.6	白云机场	CNY	1	152600	15.56	2374580	1.90%	22.44	3410957	2.73%	1036377	43.64%	正常交易
1101.01.6	东风汽车	CNY	1	256200	4.35	1113445	0.89%	4.81	1209264	0.97%	95818.8	8.61%	正常交易
1101.01.6	上海机场	CNY	1	40000	80.09	3203540	2.56%	80.43	3220800	2.58%	17260	0.54%	正常交易
1101.01.6	西安银行	CNY	1	400	8.11	3242.2	0.00%	7.51	2996	0.00%	-246.2	-7.59%	正常交易
1101.01.6	宝丰能源	CNY	1	400	11.33	4530.6	0.00%	9.92	3976	0.00%	-554.6	-12.24%	正常交易
1101.01.6	中铝国际	CNY	1	400	6.47	2588.2	0.00%	5.77	2304	0.00%	-284.2	-10.98%	正常交易
1101.01.6	天风证券	CNY	1	400	10.36	4144.8	0.00%	8.05	3172	0.00%	-972.8	-23.47%	正常交易
1101.01.6	青岛港	CNY	1	400	7.42	2967.8	0.00%	7.52	3000	0.00%	32.2	1.08%	正常交易
1101.01.6	中国人保	CNY	1	400	9.25	3698.2	0.00%	9.04	3588	0.00%	-110.2	-2.98%	正常交易
1101.01.6	长沙银行	CNY	1	400	9.22	3686.2	0.00%	9.01	3604	0.00%	-82.2	-2.23%	正常交易
1101.01.6	中国外运	CNY	1	400	4.36	1743.8	0.00%	4.35	1728	0.00%	-15.8	-0.91%	正常交易
1101.01.6	长城军工	CNY	1	400	15.45	6178.6	0.00%	13.21	5284	0.00%	-894.6	-14.48%	正常交易
1101.01.6	明阳智能	CNY	1	400	11.05	4418.6	0.00%	12.01	4820	0.00%	401.4	9.08%	正常交易
1101.01.6	紫金银行	CNY	1	400	7.36	2944	0.00%	6.93	2736	0.00%	-208	-7.07%	正常交易
1101.01.6	福莱特	CNY	1	400	10.12	4048.4	0.00%	9.65	3796	0.00%	-252.4	-6.23%	正常交易
1101.01.6	长飞光纤	CNY	1	400	38.11	15243	0.01%	33.06	13360	0.01%	-1883	-12.35%	正常交易
1101.01.6	招商南油	CNY	1	400	3.14	1256.8	0.00%	2.99	1196	0.00%	-60.8	-4.84%	正常交易
1101.01.6	芯能科技	CNY	1	400	11.15	4459	0.00%	7.29	2928	0.00%	-1531	-34.34%	正常交易
1101.01.6	华培动力	CNY	1	400	19.2	7679	0.01%	23.21	9320	0.01%	1641	21.37%	正常交易
1101.01.6	上机数控	CNY	1	560	29.01	16244.76	0.01%	27.72	15528.8	0.01%	-715.96	-4.41%	正常交易
1101.01.6	海客冷链	CNY	1	400	29.27	11709.6	0.01%	36.05	14492	0.01%	2782.4	23.76%	正常交易
1101.01.6	汇得科技	CNY	1	400	27.34	10935.2	0.01%	27.63	11068	0.01%	132.8	1.21%	正常交易
1101.01.6	元利科技	CNY	1	400	67.19	26877.6	0.02%	52.34	20988	0.02%	-5889.6	-21.91%	正常交易
1101.01.6	中贝通信	CNY	1	400	28.24	11295.4	0.01%	25.94	10440	0.01%	-855.4	-7.57%	正常交易

2.8 风控管理

2.8.1 风控设置

风控再全局层面、账户层两个层面进行控制。

全局：当前系统中使用的每一个资金账号都受到全局层下设置的风控规则限制。

账户：针对某个特定的资金账号进行风险控制，其余账号不受影响。

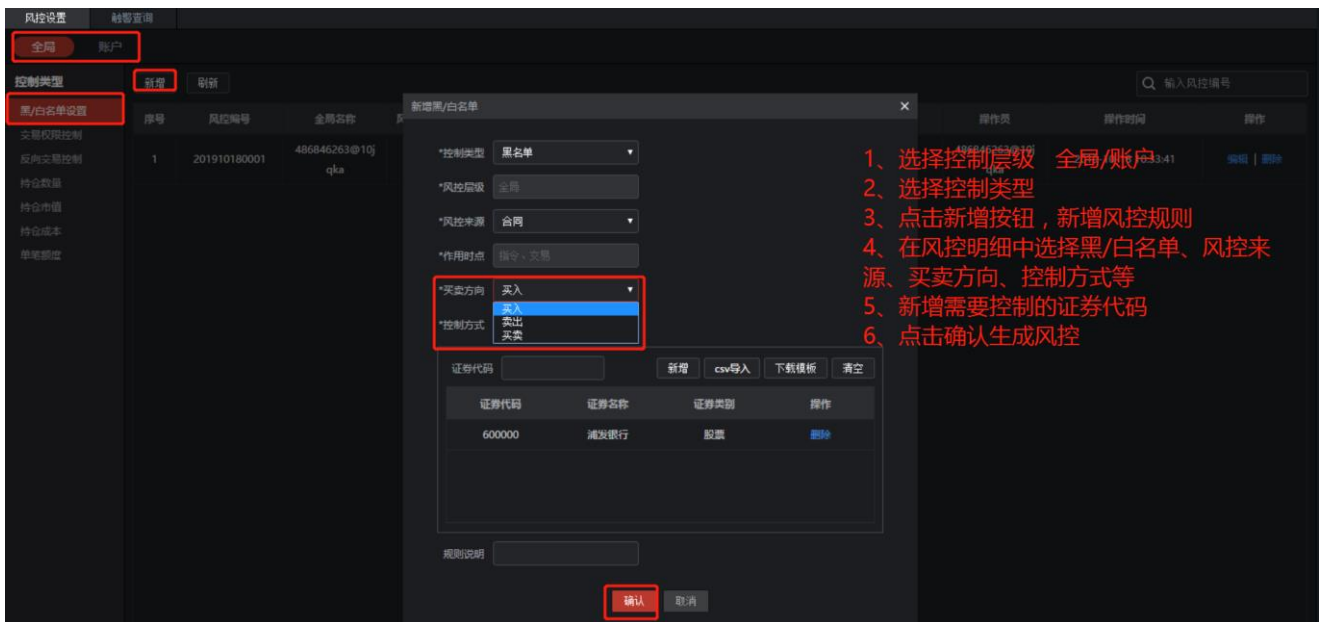


2.8.1.1 黑/白名单设置

黑名单风控：禁止买入/卖黑名单内的股票。

白名单风控：只允许买/卖白名单内的股票。

1. 选择控制层级，决定风控生效是针对全局还是针对特定的资金账号
2. 选择风控类型“黑名单”
3. 在黑/白名单中新增风控规则
4. 新增风控规则中输入相关参数如来源、方向、控制方式等
5. 新增需要控制的证券代码，可以手动输入，也可以通过CSV文件导入
6. 点击确认生成风控

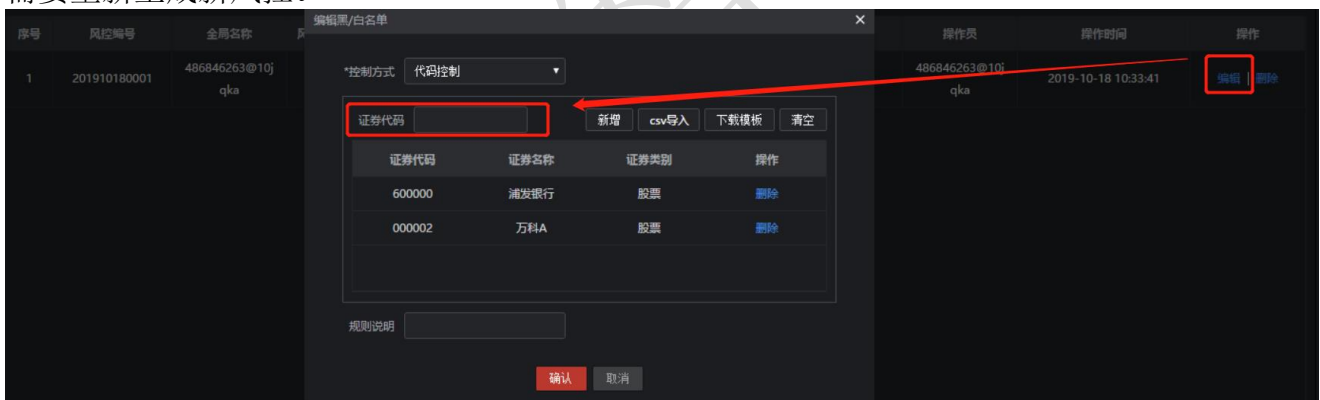


完成黑/白名单风控设置后，右侧页面查看风控信息，包括风控编号、来源、类型、买卖方向、控制方式、控制的证券代码、以及操作时间等数据对

控制类型	新增	刷新	输入风控编号
黑/白名单设置			
交易权限控制			
持仓数量			
持仓市值			
持仓成本			
单笔额度			

序号	风控编号	全局名称	风控来源	控制类型	买卖方向	控制方式	资产类别	资产子类	证券代码	操作员	操作时间	操作
1	201910180001	486846263@10j qka	合同	黑名单	买入	代码控制	--	--	600000	486846263@10j qka	2019-10-18 10:33:41	编辑 删除

编辑：点击“编辑”，可修改黑名单里的股票列表及规则说明，如果你需要修改风控层级，需要重新生成新风控。



删除：点击操作下面的删除按钮，将该条风控删除。删除后不可恢复。

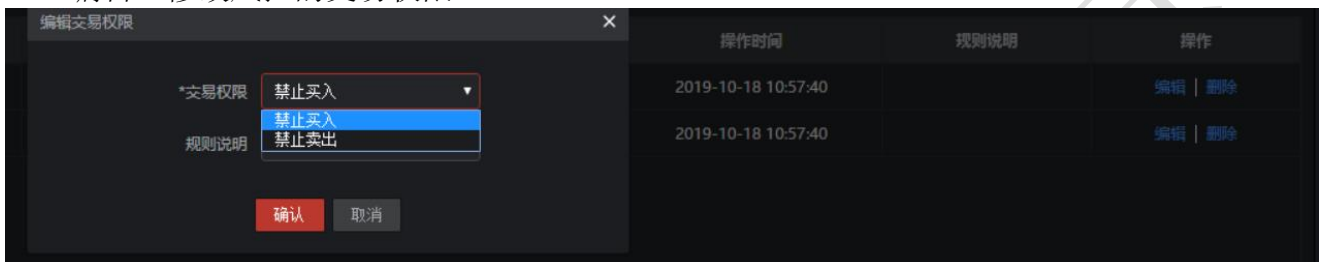


2.8.1.2交易权限控制

交易权限限制：在全局中该风控主要控制所有资金账号买入、卖出权限
账户层控制，主要控制单个资金账号买卖权限



编辑：修改风控的交易权限



删除：点击操作下面的删除按钮，将该条风控删除。删除后不可恢复。



2.8.1.3 反向交易控制

反向风控中禁止双向有效委托，防止对敲、自成交等现象发生

对敲风控：风控对象下账户间未成交部分不允许出现买价大于等于卖价。

自成交：单账户下未成交部分不允许买价大于等于卖价



完成反向限制风控设置后，右侧页面查看风控信息，包括风控来源、风控类型、控制类型、控制规则、修改时间等信息。

2.8.1.4 持仓数量设置

持仓数量限制：该条风控监控持仓中个股持仓数量是否达到设定数量/比例，当达到阈值后给予预警、禁止交易等触警措施。

1. 点击导航栏上方“风控”，进入风控设置页面
2. 选择风控类型：“持仓数量”
3. 在新增风控中选择风控来源、控制方式等参数
4. 输入需要控制的代码、或者导入股票模板
5. 选择计算方式：数值/比例
 - 1) **数值**：监控持仓股票数量是否达到一定限制

2) **比例**：控制规则按照持仓数量/总股本数量或者流通股本数量，限制个股仓位比例

*计算方式

比例

*作用时点

指令、交易

*控制规则

持仓数量

/

请设置控制规则

流通股本数量

总股本数量

*统计方式

单券

6. 选择统计方式，如单券/汇总（在某些风控中需要对所有持仓总和进行计算统计）

7. 选择控制阈值，提供多层预警提示和触警措施

1) **比较符号**：大于和大于等于时仅控制买入，小于和小于等于时仅控制卖出

2) **触警措施**：

警告：当达到阈值后提示警告信息，不限制交易。

禁止交易：当达到阈值后提示风控信息，限制其交易行为

新增

注：目前只支持使用相同的比较符设置阈值

序号	比较符	阈值(股)	触警措施	操作
1	大于	大于和大于等于时仅控制买入 小于和小于等于时仅控制卖出		删除
2	大于	0	警告 警告 禁止交易	删除

全局

账户

控制类型

新增

刷新

黑名单设置

交易权限控制

反向交易控制

持仓数量

持仓市值

持仓成本

单笔额度

序号

风控编号

1

201910180011

规则说明

*风控类别

持仓数量

*风控来源

合同

Sd8da45f-模拟炒股

*控制方式

代码控制

*计算方式

数值

*作用时点

指令、交易

*控制规则

持仓数量

*统计方式

单券

证券代码

0001

新增

000001 平安银行 股

模板

清空

000002 万科A 股票

证券代码

000004 国农科技 股

证券类别

股票

操作

600000 世纪星源 股

股票

删除

600000 深振业A 股

股票

删除

000001 平安银行 股票

删除

新增

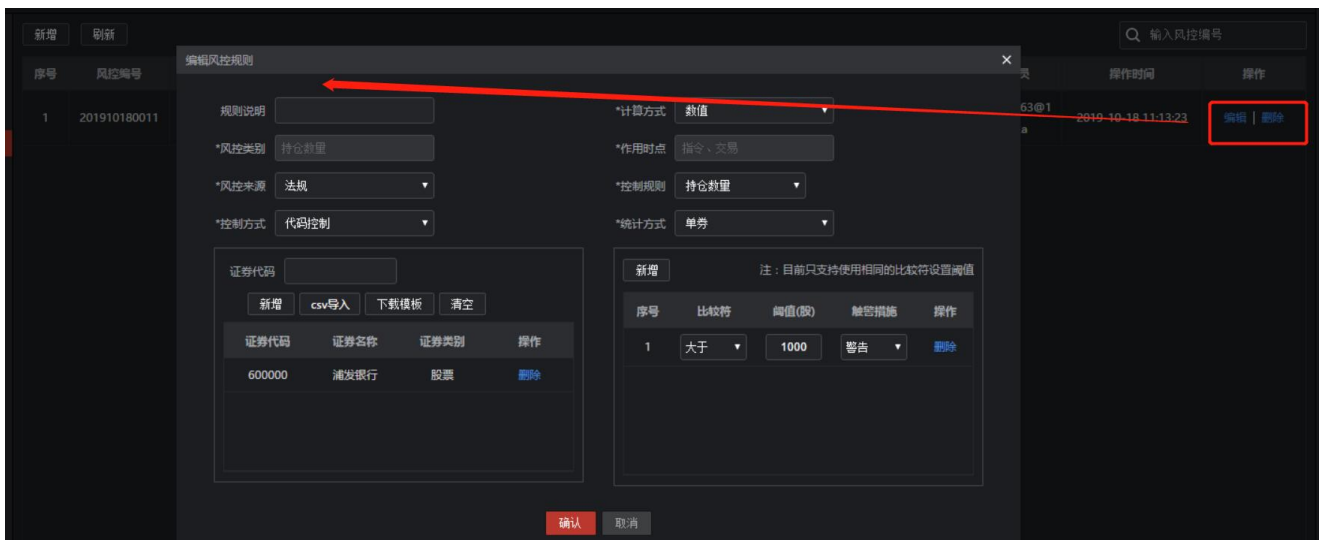
注：目前只支持使用相同的比较符设置阈值

序号	比较符	阈值(股)	触警措施	操作
1	大于	500	警告	删除
2	大于	1000	禁止交易	删除

确认

取消

编辑：点击编辑按钮，可实现对风控的编辑设置。



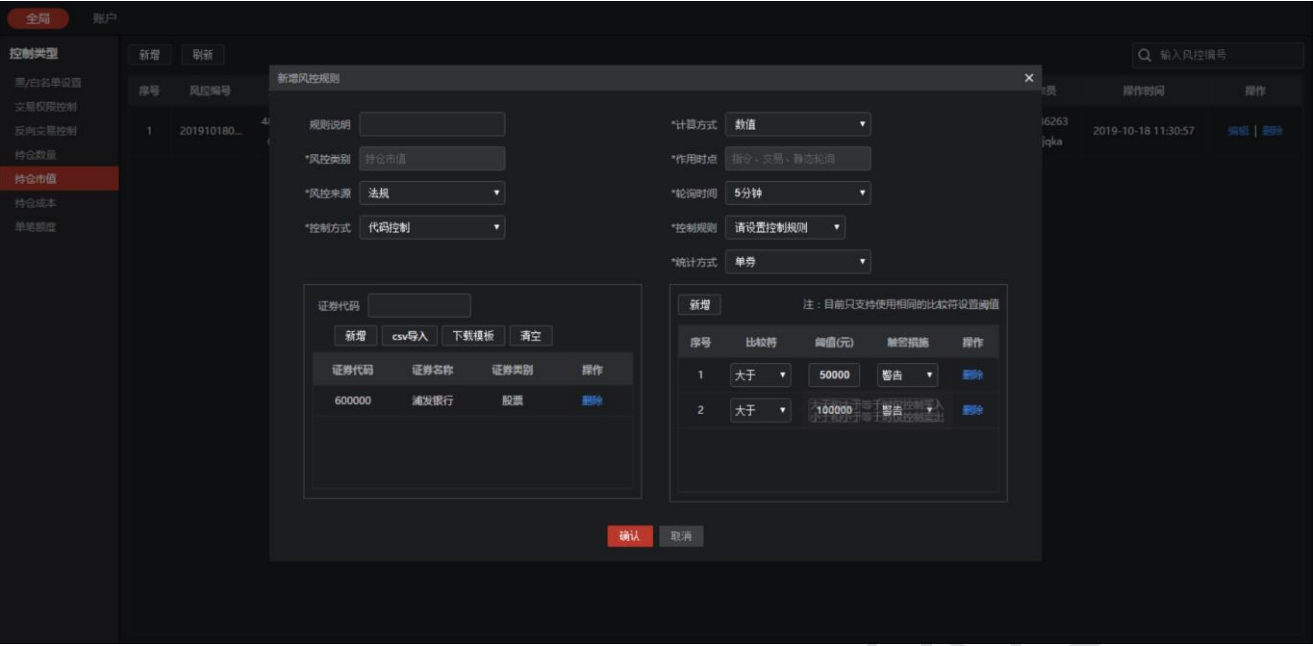
删除：点击操作下面的删除按钮，将该条风控删除。删除后不可恢复。



2.8.1.5 持仓市值设置

持仓市值设置：通过对资金账号的持仓市值做计算，当达到阈值后给予预警、禁止交易等触警措施。

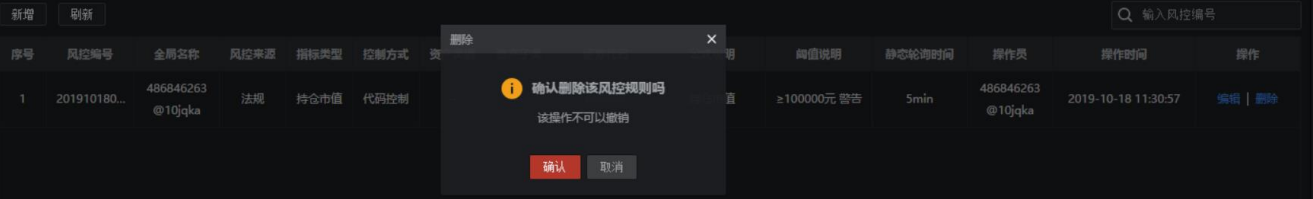
1. 点击导航栏上方“风控”，进入风控设置页面
2. 选择风控类型：“持仓市值”
3. 在新增风控中选择风控来源、控制方式等参数
4. 输入需要控制的代码、或者导入股票模板
5. 选择计算方式：数值（监控股票市值）
6. 选择轮询时间：达到轮询时间后对持仓市值做风控校验，如每5分钟检查一次持仓市值是否达到阈值
7. 选择统计方式，如单券/汇总
 - 单券：**监控每个资金账号下个股持仓市值是否达到阈值
 - 汇总：**监控所有资金账户下该个股持仓市值是否达到阈值
8. 选择控制阈值，提供多层预警提示和触警措施
 - a) **比较符号：**大于和大于等于时仅控制买入，小于和小于等于时仅控制卖出
 - b) **触警措施：**
 - 警告：**当达到阈值后提示警告信息，不限制交易。
 - 禁止交易：**当达到阈值后提示风控信息，限制其交易行为



编辑： 点击编辑按钮，可实现对风控的编辑设置。



删除： 点击操作下面的删除按钮，将该条风控删除。删除后不可恢复。



2.8.1.6持仓成本设置

持仓成本：对股票持仓成本做控制，限制个股持仓成本。

具体操作步骤：

- 1. 点击导航栏上方“风控”，进入风控设置页面
- 2. 选择风控类型：“持仓成本”
- 3. 在新增风控中选择风控来源、控制方式等参数
- 4. 输入需要控制的代码、或者导入股票模板
- 5. 选择计算方式：数值（监控持仓成本）
- 6. 选择轮询时间：达到轮询时间后对持仓市值做风控校验，如每5分钟检查一次持仓成本是否达到阈值
- 7. 选择统计方式，如单券/汇总

单券：监控每个资金账号下个股持仓成本是否达到阈值

汇总：监控所有资金账户下该个股持仓成本总和是否达到阈值

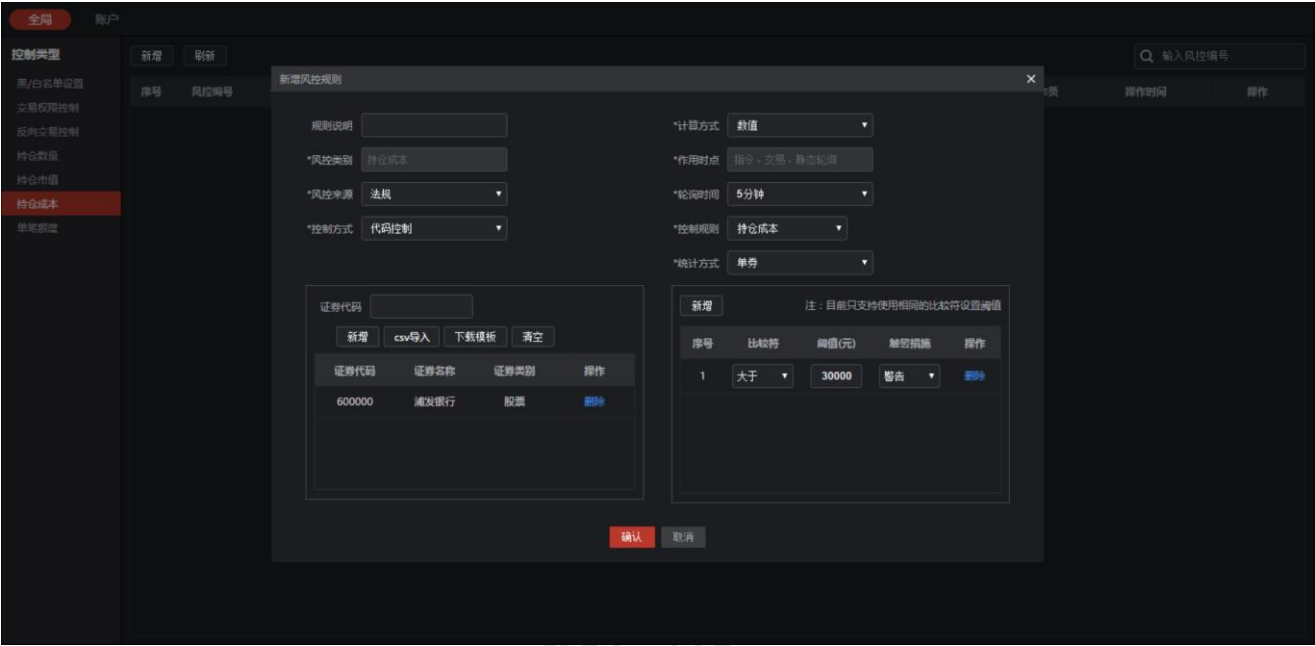
8. 选择控制阈值，提供多层预警提示和触警措施

a) **比较符号：**大于和大于等于时仅控制买入，小于和小于等于时仅控制卖出

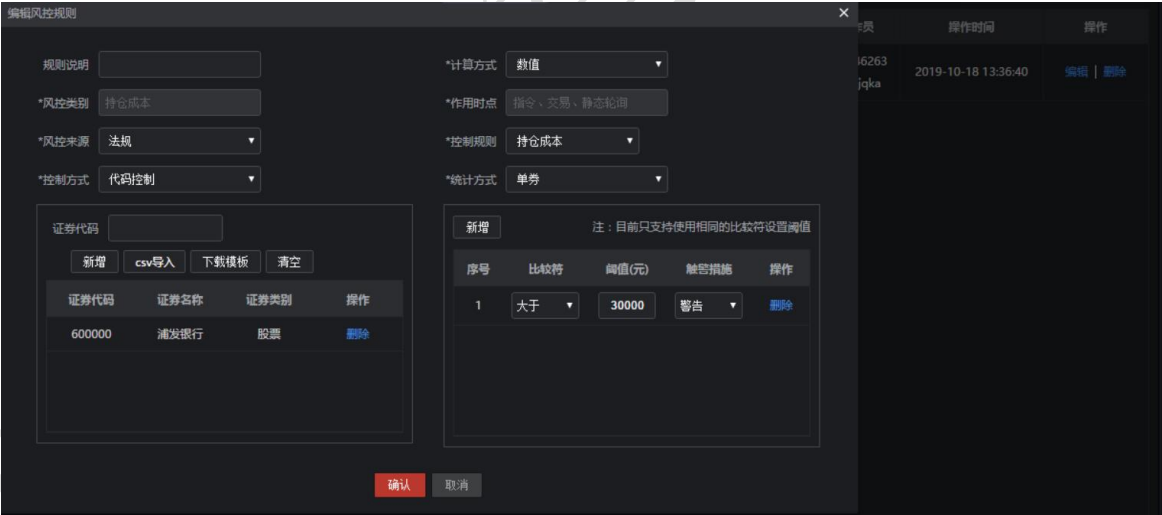
b) **触警措施：**

警告：当达到阈值后提示警告信息，不限制交易。

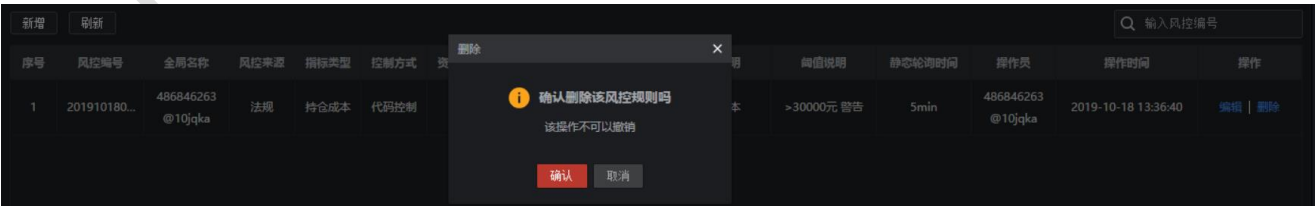
禁止交易：当达到阈值后提示风控信息，限制其交易行为



编辑：点击编辑按钮，可实现对风控的编辑设置。



删除：点击操作下面的删除按钮，将该条风控删除。删除后不可恢复。



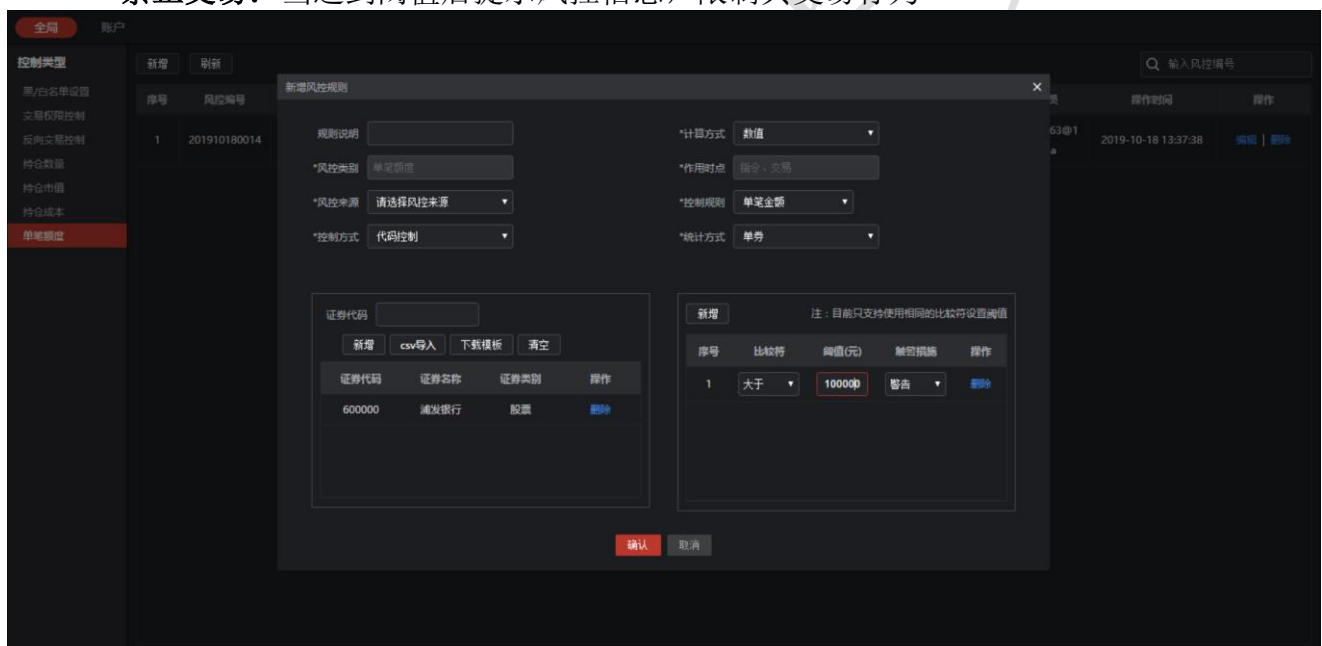
2.8.1.7 单笔额度设置

多日持仓限制风控：对股票标的多日仓位调整限制。具体操作步骤：

1. 点击导航栏上方“风控”，进入风控设置页面
2. 选择风控类型：“持仓成本”
3. 在新增风控中选择风控来源、控制方式等参数
4. 输入需要控制的代码、或者导入股票模板
5. 选择计算方式：数值（监控持仓成本）
6. 选择轮询时间：达到轮询时间后对持仓市值做风控校验，如每5分钟检查一次持仓成本是否达到阈值
7. 选择统计方式，如单券/汇总
 - a) **单券**：监控每个资金账号下个股持仓成本是否达到阈值
 - b) **汇总**：监控所有资金账户下该个股持仓成本总和是否达到阈值
8. 选择控制阈值，提供多层预警提示和触警措施
 - a) **比较符号**：大于和大于等于时仅控制买入，小于和小于等于时仅控制卖出
 - b) **触警措施**：

警告：当达到阈值后提示警告信息，不限制交易。

禁止交易：当达到阈值后提示风控信息，限制其交易行为



编辑：点击编辑按钮，可实现对风控的编辑设置。

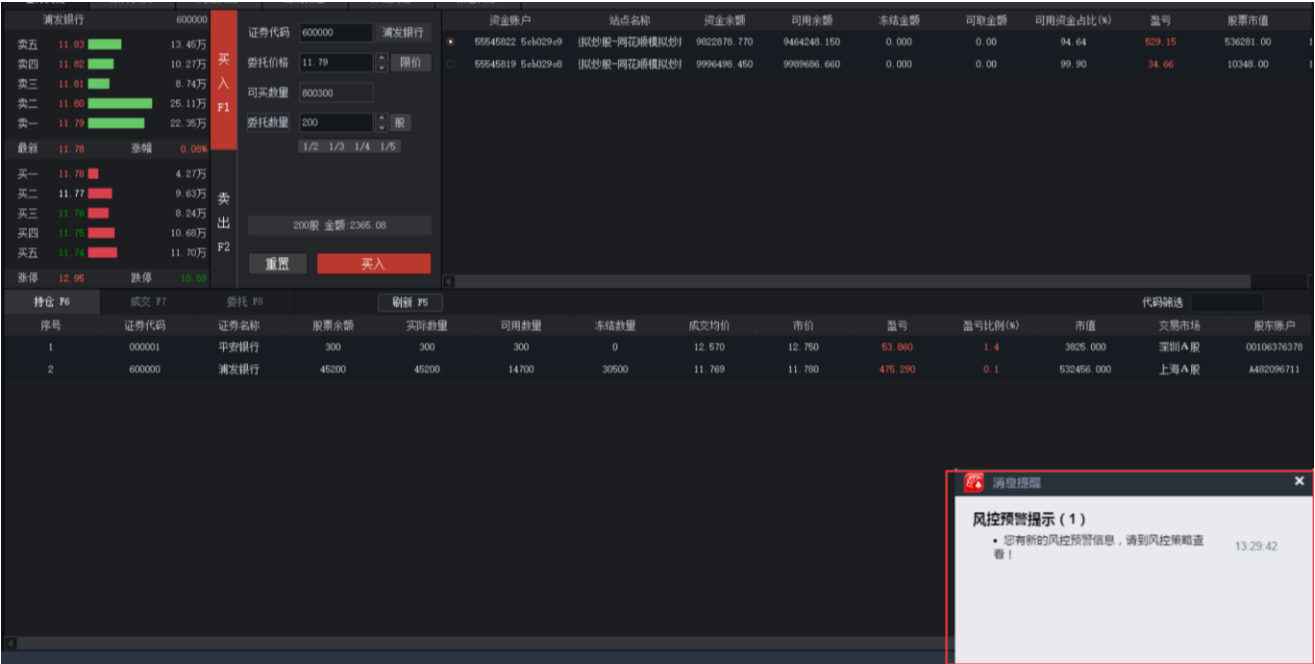


删除：点击操作下面的删除按钮，将该条风控删除。删除后不可恢复。

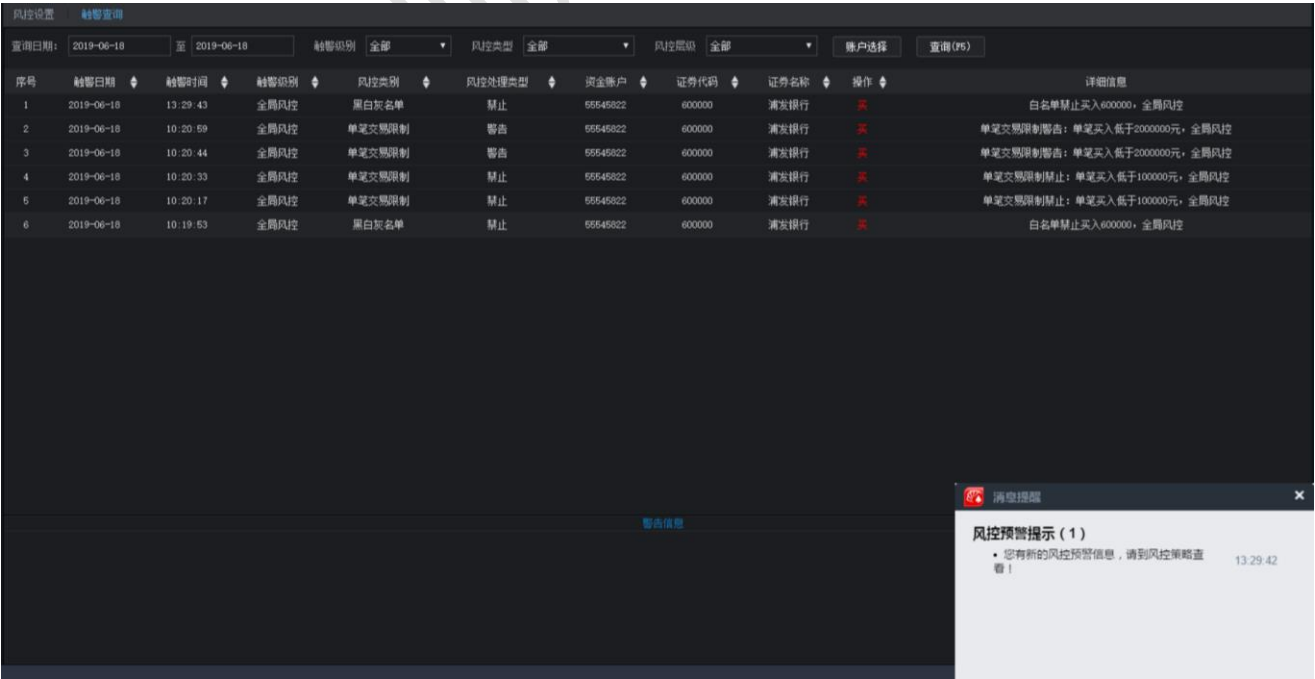


2.8.2触警查询

生成风控后，如果风控处于运行状态，账户交易触发风控条件，则会出现提示。



风控功能页面的二级导航栏，点击“触警查询”，进入风控触警页面，点击“账户选择”确定账户，默认为全部账户，并查询详细信息，筛选条件包括：查询日期、触警级别、风控类型、风控层级等信息。



2.8条件交易

条件交易主要提供买卖条件单、集合竞价条件单等功能，主要操作步骤如下：

- 1、选择资金账号，支持股票、信用资金账号使用
- 2、选择对应代码，输入买卖数量、价格、策略等
策略中支持调用TWAP、冰山等策略
- 3、添加买卖条件，提供策略交易中条件交易的判断参数
- 4、执行订单

备注：条件交易中支持信用账户、普通账户调用使用。
在买卖条件中，参照2.6.1条件买卖功能说明。



查看订单：对创建的条件订单查看是否触发，支持查看母单明细等数据。



集合竞价条件单：针对该代码集合竞价时候提供触发条件设定。
当监控集合竞价过程中成交价上涨至设定值，分批买入固定数量/百分比/元的股票



三、附录

3.1其他操作

3.1.1版本切换

1.识别客户端版本：成功登陆客户端后，如果右上角显示“智能交易·机构版”、“智能交易蜂鸟版”或“智能交易·个人版”，你需要切换客户端版本。



2.切换客户端版本：点击右上角“”-“客户端版本切换”，选择相应版本，点击“确定”，并重新登录，即可登录至对应客户端。



3.1.2如何添加模拟资金账号

打开账户管理-账户-模拟账户-申请模拟账户，如下所示，点击添加账户，登陆同花顺用户ID后即可生成相应的资金账号，可申请资金量为500w，1000w。将申请后的模拟资金账号按照账号添加流程即可。



3.1.2快捷键键位设置

提供快捷键键位设置，支持用户手动设定快捷键，提高交易效率，保留原有的交易习惯。

操作步骤:

- 1、点击设置按钮，进入快捷交易设置界面
- 2、在快捷交易设置中针对想要设置的操作功能设定快捷键
- 3、支持恢复默认、保存新键位设置等功能。



3.1.4 支持券商

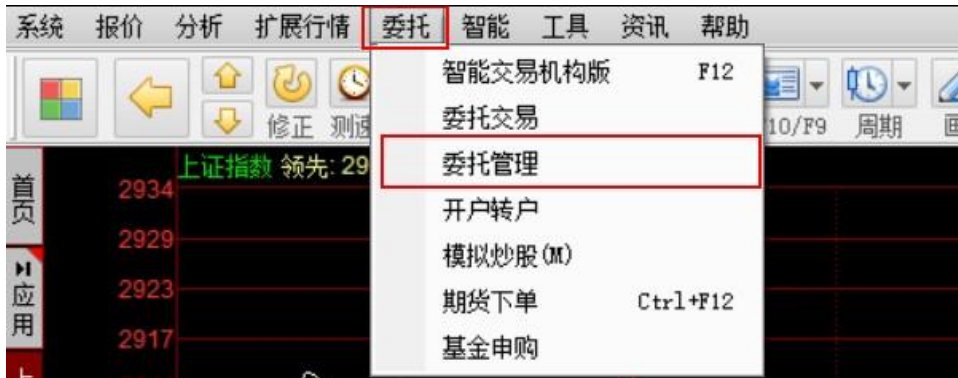
在实盘账号中新增账户，在选择证券公司中搜索查看是否支持相关券商。



3.1.5 行情联动

同花顺智能交易系统能够和同花顺统一版、远航版形成联动。实现行情和交易一体化展示，以下为操作说明。

1、登陆同花顺行情端.统一版/远航版，**打开委托管理**



2、在委托管理界面中，打开智能交易XX版（备注：智能交易系统须关闭，通过该种方式打开才能实现行情与交易联动）



3、打开、登陆智能交易后，在行情端双击个股盘口信息

1、双击盘口信息，跳转闪电下单界面
2、可以在闪电下单界面中进行交易
3、支持多户交易中提供的相关功能

闪电下单 ■ 置于顶层

全部账户 刷新 上移 下移

资金账户	可买(股)	分配(股)
1 7500133 5d8da4e	425300	0
2 3347937 5d0ae9c	448800	0
3 3414639 5d133b3	446300	0
4 3414636 5d133b2	342200	0

账户数量: 4 可用资金: 37,027,472.12
总委托量: 0 可用比例: 92.02%

证券代码: 601066 中信建投

委托价格: 22.20 无锁

可买数量: 1662600

委托数量: 无锁

全仓 1/2 1/3 1/4 1/5

分配方案: 1-顺序分配

拆单策略: 不拆单

☐ 下单前不需要确认

重置 买入

中信建投 601066

委比 +52.00% 715

委比	委价	委量
5	22.26	129
4	22.25	107
3	22.24	57
2	22.23	32
1	22.22	5
1	22.21	105
2	22.19	125
3	22.18	237
4	22.17	364
5	22.16	214

最新 22.21 开盘 22.22
涨跌 -0.04 最高 22.39
涨幅 -0.18% 最低 22.10
振幅 1.30% 量比 0.67
总手 61066 换手 0.71%
金额 1.36亿 换手(实) 0.71%
市盈(静) 55.01 市盈(动) 33.34
总市值 1698亿 流通值 192.0亿
涨停 24.48 跌停 20.03
外盘 26739 内盘 34327

短线精灵
10:48:27 钧达股份 大笔买入 1057手
10:48:33 钧达股份 大笔卖出 741手
10:48:42 钧达股份 大笔买入 634手
10:48 22.20 106 2
10:48 22.20 2 1

资金分析

主力流入(万元) 2260.1
主力流出(万元) 2955.3
主力净流出(万元): 695.2

流入(万元) 流出(万元)

特大单 623
大单 1637
中单 5718
小单 5581

净特大单 -699
净大单 -635
净中单 -133
净小单

时间 总排名
今日 第2693名
2日 第3151名
3日 第2787名
5日 第3073名

业绩预测

年份	预测收益
2019	0.57
2020	0.68
2021	0.78

4、撤单、查询

闪电下单 ■ 置于顶层

全部账户 刷新 上移 下移

资金账户	可买(股)	分配(股)
1 7500133 5d8da4e	425300	0
2 3347937 5d0ae9c	448800	0
3 3414639 5d133b3	446300	0
4 3414636 5d133b2	342200	0

账户数量: 4 可用资金: 37,027,472.12
总委托量: 0 可用比例: 92.02%

证券代码: 601066 中信建投

委托价格: 22.20 无锁

可买数量: 1662600

委托数量: 无锁

全仓 1/2 1/3 1/4 1/5

分配方案: 1-顺序分配

拆单策略: 不拆单

☐ 下单前不需要确认

重置 买入

中信建投 601066

委比 +52.00% 715

委比	委价	委量
5	22.26	129
4	22.25	107
3	22.24	57
2	22.23	32
1	22.22	5
1	22.21	105
2	22.19	125
3	22.18	237
4	22.17	364
5	22.16	214

最新 22.21 开盘 22.22
涨跌 -0.04 最高 22.39
涨幅 -0.18% 最低 22.10
振幅 1.30% 量比 0.67
总手 61066 换手 0.71%
金额 1.36亿 换手(实) 0.71%
市盈(静) 55.01 市盈(动) 33.34
总市值 1698亿 流通值 192.0亿
涨停 24.48 跌停 20.03
外盘 26739 内盘 34327

短线精灵
10:48:27 钧达股份 大笔买入 1057手
10:48:33 钧达股份 大笔卖出 741手
10:48:42 钧达股份 大笔买入 634手
10:48 22.20 106 2
10:48 22.20 2 1

资金分析

主力流入(万元) 2260.1
主力流出(万元) 2955.3
主力净流出(万元): 695.2

流入(万元) 流出(万元)

特大单 623
大单 1637
中单 5718
小单 5581

净特大单 -699
净大单 -635
净中单 -133
净小单

时间 总排名
今日 第2693名
2日 第3151名
3日 第2787名
5日 第3073名

业绩预测

年份	预测收益
2019	0.57
2020	0.68
2021	0.78

09:41 [研报] 投行维持强势，自营与经纪助
的密码 08:24 [公告] 中信建投2019年10月份财务数
药品大“砍... 07:29 [公告] 中信建投H股公告
在此类龙头 11-13 [研报] 2019年三季度点评：投行优势

您是否确认撤销这(0)笔委托

确定 取消

备注:

- 1) 可以实现行情端个股自动填充到闪电下单界面中
- 2) 支持买卖价格锁定、买卖数量锁定等其他交易功能
- 5、其余交易操作参照2.2.1普通交易-多户交易

3.2 版本差异

同花顺智能交易系统推出个人版、机构版和蜂鸟版三个版本，以下为三个版本包含的功能示例。

		个人版	机构版	蜂鸟版
功能	账户交易	√	√	√
	篮子交易	√	√	√
	策略交易-条件买卖	√	√	√
	策略交易-网络交易		√	√
	策略交易-云端预埋		√	√
	账户融资融券		√	√
	算法管理-算法交易		√	√
	算法管理-华创算法		√	√
	算法管理-智能算法		√	√
	风控		√	√
	量化交易			√
	策略定制增值服务			√
	条件交易		√	√
支持业务	沪深 A 股	√	√	√
	新股申购	√	√	√
	场内基金债券	√	√	√
	国债逆回购	√	√	√
	可转债	√	√	√
	融资融券		√	√