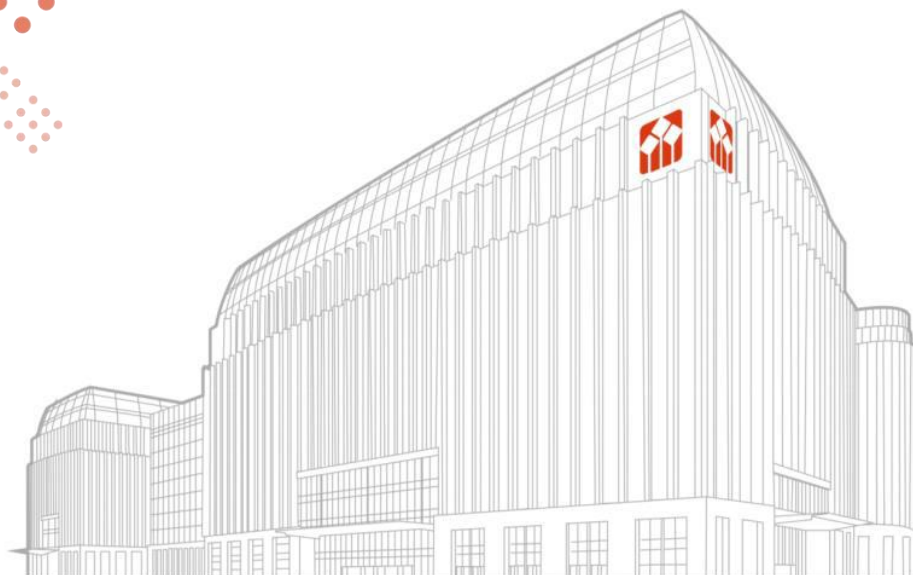
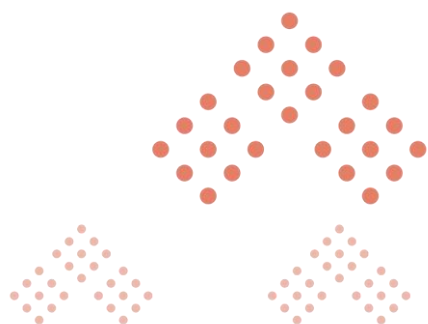




# 华泰期货MATIC交易终端 用户使用手册



版本号：MATIC\_2.2.7

2026年05月08日

## 目录

1. 下载 .....	1
2. 注册登录 .....	2
2.1. 注册 .....	2
2.2. 登录 .....	2
2.2.1. 登录参数 .....	2
2.2.2. 通信设置 .....	3
2.3. 忘记密码 .....	5
2.4. 自动升级 .....	5
2.5. 系统弹窗 .....	6
3. 首页 .....	8
4. 行情 .....	9
4.1. 首页 .....	9
4.1.1. 行情看板 .....	10
4.1.2. 热力图 .....	10
4.1.3. 排行榜 .....	11
4.1.4. 成分列表 .....	11
4.1.5. 分时/K 线 .....	12
4.1.6. 快讯 .....	12
4.2. 国内期货 .....	13
4.2.1. 切换期货板块 .....	13
4.2.2. 配置合约报价列表 .....	14
4.2.3. 展示分时/K 线走势 .....	15
4.2.4. 成分列表交易跳转 .....	15
4.3. 合约详情 .....	16
4.3.1. 切换分类标签 .....	16
4.3.2. 展示分时/K 线走势 .....	17
4.3.3. 画线 .....	18
4.3.4. 工具 .....	18
4.3.5. 指标管理 .....	19
4.3.6. 查看关联品种 .....	20
4.3.7. 查看成分列表 .....	20
4.3.8. 查看合约信息 .....	21
4.3.9. 查看买卖档口 .....	21
4.3.10. 查看盘口指标 .....	21
4.3.11. 查看分笔成交 .....	22
4.4. 自选页面 .....	22
4.4.1. 快捷配置自选板块及合约 .....	23
4.4.2. 查看自选合约行情 .....	24
4.4.3. 板块管理 .....	24
4.4.4. 展示分时/K 线走势 .....	26
4.5. 期权页面 .....	26
4.5.1. 切换期权交易所 .....	27

4.5.2. 查看期权标的行情 .....	27
4.5.3. 查看期权合约列表 .....	28
4.5.4. 展示分时/K 线走势 .....	29
4.6. 自定义界面 .....	30
4.6.1. 新建自定义界面 .....	30
4.6.2. 修改自定义界面 .....	32
4.6.3. 删除自定义界面 .....	32
4.7. 键盘精灵 .....	34
5. 量化 .....	34
5.1. 量化权限申请 .....	34
5.2. 首页 .....	36
5.2.1. 操作说明 .....	36
5.3. 编写策略 .....	37
5.3.1. 功能概述 .....	37
5.3.2. 操作说明 .....	42
5.4. 数据平台 .....	48
5.4.1. 功能概述 .....	48
5.4.2. 操作说明 .....	48
5.5. 因子研究 .....	54
5.5.1. 功能概述 .....	54
5.5.2. 操作说明 .....	55
5.6. 我的策略 .....	70
5.6.1. 功能概述 .....	70
5.6.2. 操作说明 .....	70
5.7. 策略交易 .....	74
5.7.1. 实时策略模拟交易 .....	74
5.8. 策略社区 .....	90
5.8.1. 策略检索、排序、筛选 .....	91
5.8.2. 策略卡片 .....	92
5.8.3. 策略分享 .....	93
5.9. 量化学院 .....	94
5.9.1. 课程总览 .....	95
5.9.2. 课程详情 .....	95
5.10. 知识库 .....	96
5.10.1. 文件检索 .....	96
5.10.2. 文档创建 .....	96
5.10.3. 文档热度 .....	97
5.11. 用户中心 .....	98
5.11.1. 功能概述 .....	98
5.11.2. 操作说明 .....	98
6. 交易 .....	99
6.1. 基础交易 .....	99
6.1.1. 普通交易 .....	99
6.1.2. 期权交易 .....	103

6.1.3. 期货交易 .....	108
6.1.4. 期货期权交易 .....	112
6.2. 特色交易 .....	116
6.2.1. 对冲助手 .....	116
6.3. 算法交易 .....	118
6.3.1. HT-TWAP .....	119
6.3.2. HT-VWAP .....	124
6.3.3. HT-套利 .....	130
6.3.4. HT-移仓/普通移仓 .....	136
6.3.5. HT-移仓/套利移仓 .....	142
6.3.6. 异常情况处理 .....	147
6.4. 套利交易 .....	147
6.4.1. 套利雷达 .....	147
6.5. 运营管理 .....	149
6.5.1. 消息中心 .....	149
6.6. 收藏 .....	149
7. 开户 .....	149
8. 交易魔方 .....	150
8.1. Colo 开盘抢单 .....	150
8.1.1. 功能介绍 .....	150
8.1.2. 预埋下单 .....	151
8.1.3. 普通下单 .....	154
8.1.4. 下单辅助 .....	157
9. 用户服务 .....	158
9.1. 热门活动 .....	159
9.2. 特色服务 .....	159
9.2.1. 量化投研 .....	159
9.2.2. Colo 条件单 .....	162
9.3. 用户反馈 .....	165
10. 系统 .....	166
10.1. 资金账户 .....	166
10.1.1. 账户管理 .....	166
10.2. 关于 .....	167
10.2.1. 关于我们 .....	167
10.2.2. 注销账号 .....	167
11. 组件列表 .....	168
12. 用户数据上传下载 .....	168
13. 设置 .....	168
13.1. 交易设置 .....	169
13.1.1. 全局交易设置 .....	169
13.1.2. 基础交易设置 .....	169
13.1.3. 指令交易设置 .....	169
13.1.4. 期货交易设置 .....	170
13.1.5. 价格笼子设置 .....	170

13.1.6. 交易费率设置 .....	171
13.1.7. 期权交易设置 .....	171
13.1.8. 期货期权交易设置 .....	172
13.1.9. 组合交易设置 .....	172
13.2. 账号设置 .....	173
13.2.1. 账号简称设置 .....	173
13.2.2. 账号优先级设置 .....	173
13.3. 密码设置 .....	173
13.4. 客户端设置 .....	174
13.4.1. 通用设置 .....	174
13.4.2. 修改密码 .....	174
13.4.3. 监控剪贴板 .....	175
13.4.4. 系统公告 .....	175
14. 下载中心 .....	176

# 1. 下载

在浏览器中打开：

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



手机软件	期货交易	股票期权	仿真测试	程序化交易软件	其他软件
软件名称	软件介绍			下载地址	操作手册
 华泰期货MATIC交易终端 (全类型) 更新时间: 2025-07-24 17:00:00	适用客户类型: 我司交易客户   软件类型: 行情交易软件   适用品种: 期货/期货期权/ETF期权/现货ETF基金 华泰期货MATIC系统是华泰证券集团技术底座研发的全自研系统, 具备自主、兼容、可扩展特性, 致力于通过科技驱动交易领域的变革, 打造平台化、生态化、智能化的交易服务平台, 为客户提供闪电下单、增强交易、组合交易、跨市场对冲、跨市场套利、套利雷达、多品种套利、算法交易、对冲助手和行情等一系列交易解决方案。 大小: 314M   版本号: 2.1.2   语言: 中文 软件登录方式: 账号+密码 MD5校验码: 3299f3f4bf8f7429b345533db4c9ba2f			 <a href="#">软件下载</a>	<a href="#">点击查看</a>

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

名称	修改日期	类型	大小
Matic	2025/8/4 9:43	文件夹	
Matic 2.1.0 Setup.exe	2025/8/4 9:29	应用程序	285,13
Matic 2.1.2 Setup.exe	2025/8/4 9:31	应用程序	274,61
<input checked="" type="checkbox"/> Matic 2.1.3 Setup.exe	2025/8/5 11:23	应用程序	274,41

安装完成后，桌面出现系统应用图标，双击打开后可进行系统登录等下一步操作。



## 2.注册登录

### 2.1.注册

注册界面主要用于为普通投资者注册 MATIC 账号。具体操作步骤如下：

- (1) 打开 MATIC 客户端，进入登录界面；
- (2) 点击左下角“注册账号”，弹出注册界面（如下）；
- (3) 输入手机号获取并填写验证码，设置密码，勾选同意隐私政策和用户协议，点击注册，即可注册 MATIC 账户；
- (4) 注册完成后的，点击去登录，即可回到登录界面。



### 2.2.登录

#### 2.2.1.登录参数

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

- (1) 在登录界面输入用户名和密码；
- (2) 勾选同意隐私政策和用户协议；
- (3) 点击“登录”按钮，通过密码校验即可登录进入系统。



### 2.2.2.通信设置

单击登录界面左上角 网络信号，进入通信设置界面，如下：

界面上展示当前系统各站点的地址及链接状态信息、MAC 及虚拟机检测、及终端信息。

**复制信息至剪贴板：** 点击后可将界面上的通信信息复制到剪贴板。

**刷新：** 单击后可刷新当前通信设置信息：网关的通联情况、MAC 及虚拟机检测、终端信息重获取。

**测速：** 单击后对当前列表中的通信速度进行测速，并返回本次测速的速度至表格中。

**自动优选：** 与测速一起并影响站点连接及配置文件默认配置，用户可以勾选或者不勾选，默认勾选：

- 勾选时，测速后则自动连接至速度较快的站点；
- 未勾选时，仍保留登录时的默认站点连接，测速后更新站点速度，用户可自主决定是否切换连接。

**连接：** 显示当前站点的链接状态，连接按钮亮起且可点击 **连接**，表示可选择连接当前站点；连接按钮置灰且不可点击 **连接**，表示当前站点已连接或者不可用。

**首选站点：** 取配置文件的配置，目前默认的首选站点为“电信”。



登录页网络状态展示，如下图，新增行情站点后，以各自的首选站点为准：

- 交易和资讯的站点、行情站点，两者有一个不通，则展示不通；
- 交易和资讯的站点、行情站点，两者信号强度以较慢的为准展示。



网络状态含义及影响，如下：

	未连接	一格 红色 网络状态差	两格 黄色 网络状态一般	三格 绿色 网络状态良好
影响模块	×	>200ms	80ms<延时<=200ms	<=80ms
行情	登录失败	行情数据更新严重滞后，无法实时反映市场变化，影响交易决策的及时性	行情更新有轻微延迟，对普通趋势交易的影响较小，但对短线、波段交易的精准入场 / 出场判断有一定干扰	行情数据实时更新，完全满足日内交易、套利交易对市场波动的即时监控需求
交易	登录失败	交易指令发送、委托确认存在明显延迟，可能导致订单错失最佳成交时机，甚至引发交易滑点（成交价格与预期偏离）	普通订单交易可正常执行，但对“市价单快速成交”“止损止盈即时触发”等场景有轻微影响；高频交易、闪电下单类业务的效率会降低	交易指令“秒级响应、即时成交”，市价单、限价单均可高效执行，止损止盈等条件单能精准触发，保障交易体验和资金效率
量化	登录失败	量化策略执行严重滞后，套利、高频交易等对实时性要求高的策略会完全失效，策略逻辑与市场实际走势脱节	中低频量化策略可基本执行，但高频套利、tick 级策略的收益空间会被压缩，策略的时效性和准确性打折扣	高频交易、tick 级套利、多品种对冲等对实时性要求极高的量化策略可稳定运行，策略逻辑能精准贴合市场变化，实现预期收益

请您结合实际业务需求，结合网络状态，综合判断影响及进行相关操作。

## 2.3.忘记密码

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

- (1) 点击 MATIC 客户端登录界面右下角“忘记密码”；
- (2) 弹出忘记密码界面（如下），输入手机号获取并填写验证码，重置密码（不能和原密码相同），勾选同意隐私政策和用户协议，点击确定，即可修改密码；
- (3) 修改密码完成后的，点击去登录，即可回到登录界面。



## 2.4.自动升级

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



## 2.5.系统弹窗

系统会不定期进行版本升级，升级版本登录后可能会出现系统弹窗，以下弹窗在特定条件下才会弹出，弹出后按照界面提示进行操作即可。

### ● 开户弹窗

示例：开户弹窗（根据需求，不定期设置开户弹窗），用户可根据界面提示操作。



### ● 升级公告弹窗

示例：公告弹窗（系统版本升级会有系统公告弹窗），用户可根据界面提示操作。



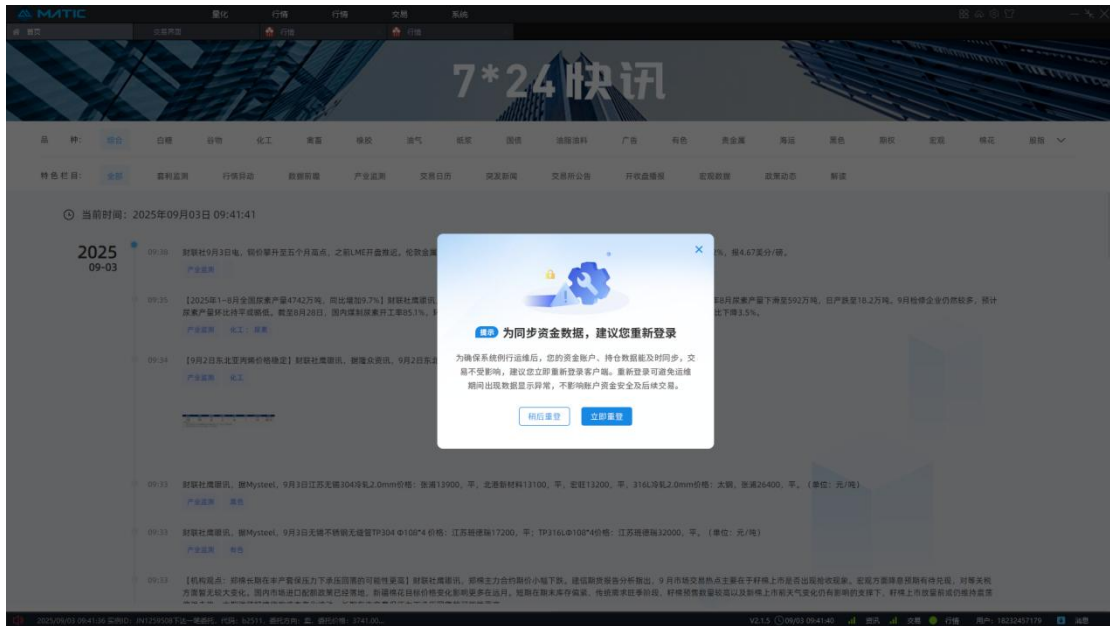
● 资金账户登录失败弹窗

如下，请按弹窗内提示进行操作：



● 系统运维重新登录弹窗

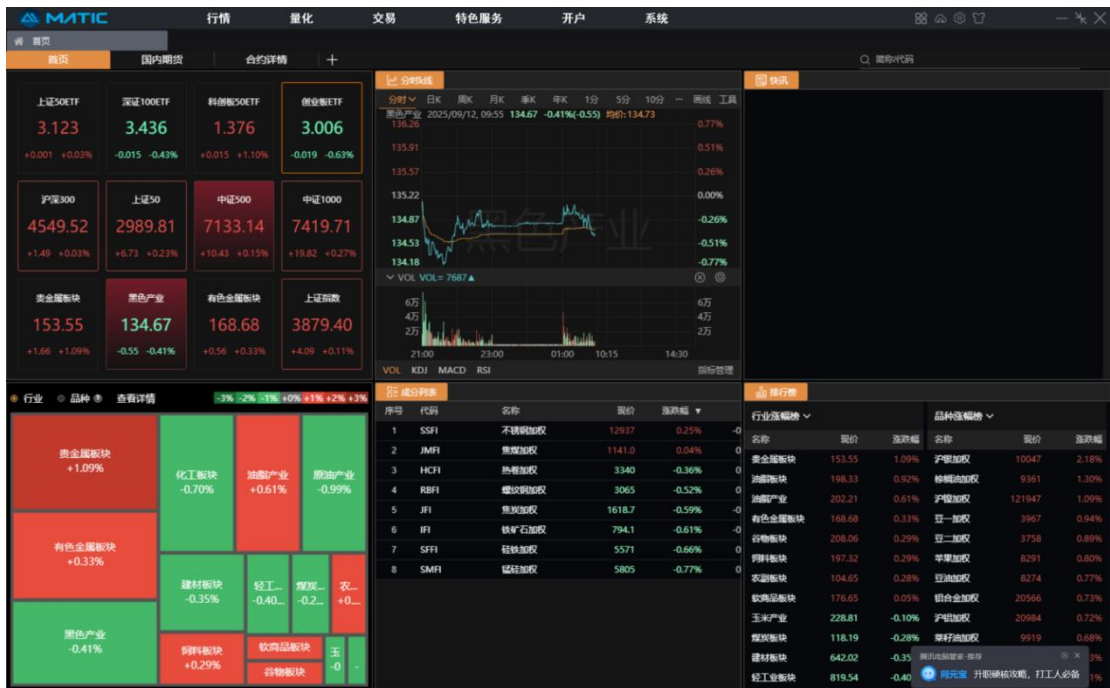
如下，请按弹窗内提示进行操作：



### 3. 首页

用户登录 Matic 加载首页，首页展示内容取决于用户的行情权限：

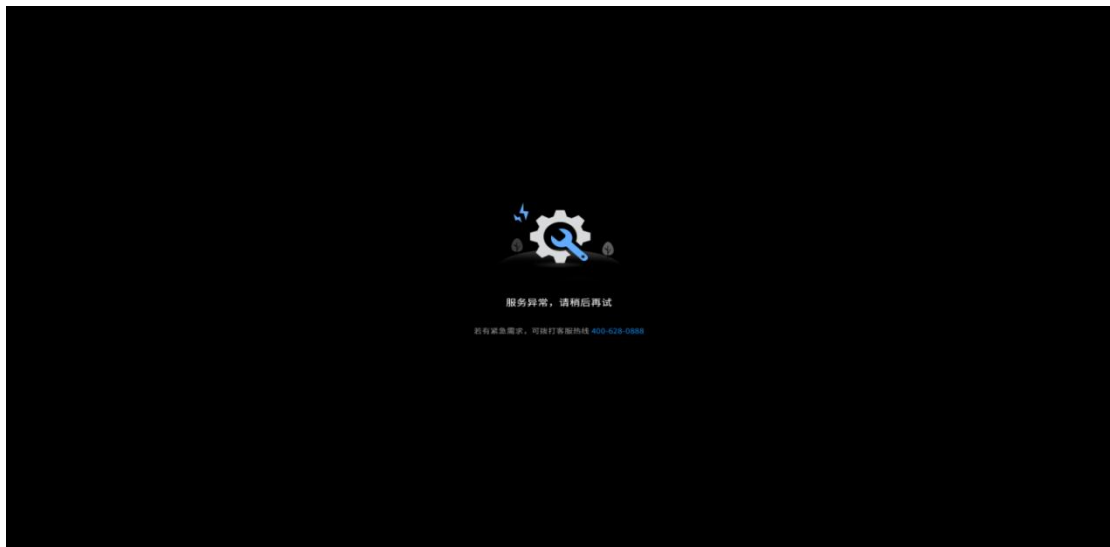
- 用户登录时已具备行情权限，展示如下实时行情首页，包括预设的左上为关键指数行情、中上为相应的分时 K 线行情，右上为期货快讯，左下为行业及品种热力图（单击查看详情可跳转热力图详情页），中下为左上选定的指数行情的成分列表，右下为排行榜信息：



- 用户登录时已无行情权限，展示如下界面 7\*24 快讯资讯首页，信息实时更新，支持按照品种和特色栏目进行分类筛选：



页面加载过程中可能面临服务器断开、资源加载失败、网络波动等风险，客户端弹出如下异常界面：



服务异常，请稍后再试，若有紧急需求，可拨打客服热线：400-628-0888。

## 4.行情

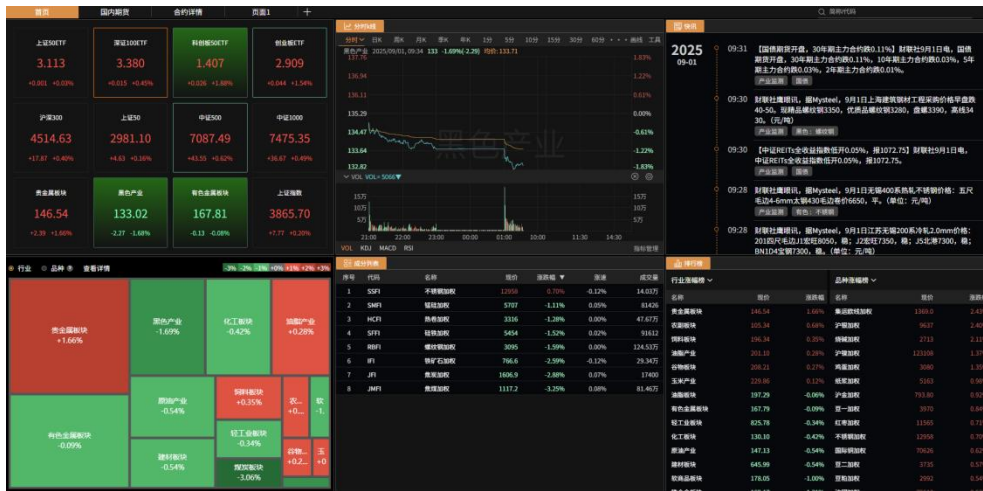
用户登录 Matic，点击顶部“行情”页签，进入行情页面，页面展示行情首页、国内期货、合约详情及自定义界面。

### 4.1.首页

用户单击顶部“行情”，即可进入行情界面，默认展示行情首页。

根据不同分区展示市场的行情概况，包括重要 ETF、指数、合约行情，期货行业和品种的热力图分布和成分合约涨跌情况，期货市场快讯等。

1) 菜单栏选中【首页】的时候，切换至该页面；



### 4.1.1.行情看板

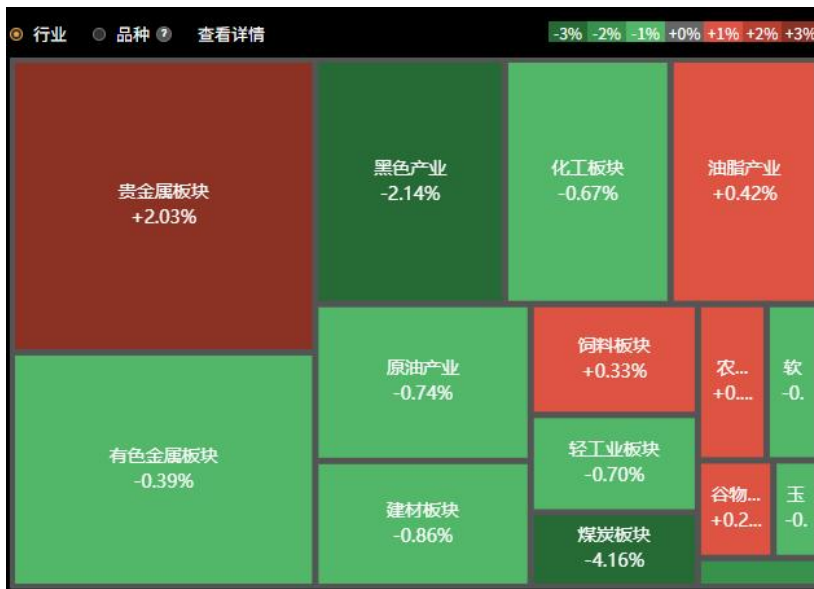
行情看板放置了重要 ETF、市场指数、期货板块的现价、涨跌、涨跌幅，行情卡片根据对应代码的涨跌方向变动闪烁红绿背景色。



### 4.1.2.热力图

用户可切换不同标签查看期货行业或者品种分类的热力图分布，热力图中的矩形面积大小与对应的沉淀资金成正比

- 1) 鼠标移至对应矩形上方，出现板块详情弹窗，展示对应板块的沉淀资金与涨跌幅。
- 2) 单击矩形板块，可在热力图右侧查看对应板块的分时 K 线走势以及成分列表。
- 3) 双击矩形板块，跳转对应板块的合约详情页面。
- 4) 点击【查看详情】按钮，跳转热力图分布详情页面。



### 4.1.3. 排行榜

支持点击切换涨幅榜或者跌幅榜，查看行业和品种分类下的板块和指数涨跌情况，双击板块或指数，跳转对应的合约详情页面。

行业涨幅榜			品种涨幅榜		
名称	现价	涨跌幅	名称	现价	涨跌幅
贵金属板块	148.32	2.89%	沪银加权	9774	3.86%
油脂产业	201.39	0.42%	集运欧线加权	1364.5	2.10%
饲料板块	196.36	0.36%	沪金加权	801.78	1.93%
谷物板块	208.28	0.30%	沪镍加权	123454	1.66%
玉米产业	229.67	0.04%	烧碱加权	2698	1.54%
油脂板块	197.41	0.00%	油菜籽加权	5042	1.22%
农副板块	104.36	-0.26%	国际铜加权	70838	0.92%
有色金属板块	167.40	-0.32%	豆一加权	3972	0.89%
化工板块	129.71	-0.72%	沪铜加权	79823	0.79%
原油产业	146.85	-0.73%	不锈钢加权	12969	0.78%
轻工业板块	821.76	-0.83%	菜籽粕加权	2492	0.65%
软商品板块	178.09	-0.97%	纸浆加权	5138	0.49%
建材板块	643.08	-0.99%	豆二加权	3731	0.46%

### 4.1.4. 成分列表

支持点击热力图以及排行榜中行业或者品种分类对应的成分合约，查看对应合约行情。

- 1) 列表中点击鼠标右键，选择【列表字段配置】，跳出成分列表字段配置弹窗，从左侧可选指标选择字段到右侧已选指标列表中，已选指标支持冻结、排序、删除功能，点击【恢复默认】恢复成默认字段配置，点击【确认】按钮完成字段配置。
- 2) 列表中点击鼠标右键，选择【添加自选】，支持将合约添加至自选板块。
- 3) 点击表头字段名称，支持列表按对应字段升序、降序排列。
- 4) 双击合约行，跳转对应的合约详情页面。

序号	代码	名称	现价	涨跌幅 ▼	增速	成交量
1	A2511	豆-2511	3964	0.79%	-0.08%	77392
2	A2509	豆-2509	4099	0.74%	0.00%	20
3	A2601	豆-2601	3963	0.69%	-0.08%	24279
4	A2603	豆-2603	3965	0.66%	-0.03%	4892
5	A2605	豆-2605	4010	0.65%	0.00%	1041
6	A2607	豆-2607	4013	0.53%	-0.05%	1746

### 4.1.5.分时/K 线

支持点击热力图、排行榜中行业或者品种分类对应的成分合约、以及成分列表组件中的合约，查看对应板块、指数或合约的分时/K 线走势。

1) 切换不同周期，分时包含 1 日、2 日、3 日、4 日、5 日、6 日、7 日、8 日、9 日、10 日，K 线包含日/周/月/季/年/1 分/5 分/30 分/60 分/120 分。

2) 走势图操作设置参见合约详情 2.3.3 画线、2.3.4 工具、2.3.5 指标管理章节。



### 4.1.6.快讯

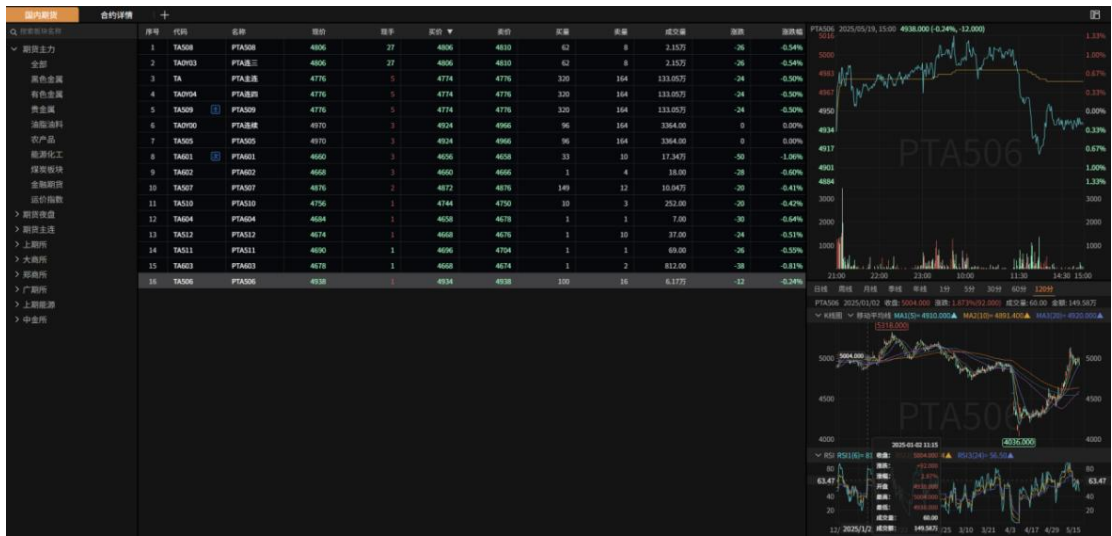
支持按时间轴滚动查看期货市场快讯。



## 4.2.国内期货

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

1) 菜单栏选中【国内期货】的时候，切换至该页面：

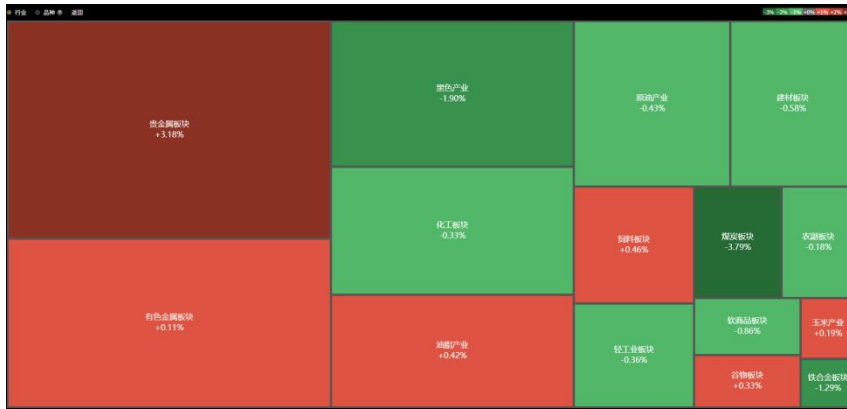


### 4.2.1.切换期货板块

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



点击热力图节点，跳转热力图详情页面



### 4.2.2.配置合约报价列表

点击左侧板块树节点切换不同的板块成分，展示对应成分的合约报价列表。

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

2) 报价列表中点击鼠标右键，选择【添加自选】，支持将合约添加至自选板块。

3) 报价列表中点击鼠标右键，选择【立即交易】，支持跳转至交易页面进行交易操作。

4) 点击表头字段名称，支持列表按对应字段升序、降序排列。

5) 双击合约行，跳转对应的合约详情页面。

序号	代码	名称	现价	现手	买价	卖价	买量	卖量	成交量	涨跌	涨跌幅
1	TA	PTA主连	4776	5	4774	4776	320	164	133.05万	-24	-0.50%
2	TA0Y00	PTA连续	4970	3	4924	4966	96	164	3364.00	0	0.00%
3	TA0Y03	PTA连三	4806	27	4806	4810	62	8	2.15万	-26	-0.54%
4	TA0Y04	PTA连四	4776	5	4774	4776	320	164	133.05万	-24	-0.50%
5	TA505	PTA505	4970	3	4924	4966	96	164	3364.00	0	0.00%
6	TA506	PTA506	4938	1	4934	4938	100	16	6.17万	-12	-0.24%
7	TA507	PTA507	4876	2	4872	4876	140	12	10.04万	-20	-0.41%
8	TA508	PTA508	4806	27	4806	4810	62	8	2.15万	-26	-0.54%
9	TA509	PTA509	4776	5	4774	4776	320	164	133.05万	-24	-0.50%
10	TA510	PTA510	4756	1	4756	4756	100	16	6.17万	-20	-0.42%
11	TA511	PTA511	4690	1	4690	4690	100	16	6.17万	-26	-0.55%
12	TA512	PTA512	4674	1	4674	4674	100	16	6.17万	-24	-0.51%
13	TA601	PTA601	4660	3	4660	4660	100	16	6.17万	-50	-1.06%
14	TA602	PTA602	4668	3	4668	4668	100	16	6.17万	-28	-0.60%
15	TA603	PTA603	4678	1	4678	4678	100	16	6.17万	-38	-0.81%
16	TA604	PTA604	4684	1	4684	4684	100	16	6.17万	-30	-0.64%

**成分列表字段配置**

可选指标:  序号  代码  名称  现价  涨跌幅  涨跌  现手  买价  卖价  买量

已选指标: 序号 代码 名称 现价 主次 现手 买价 卖价 买量 卖量

冻结列数: 3

### 4.2.3.展示分时/K 线走势



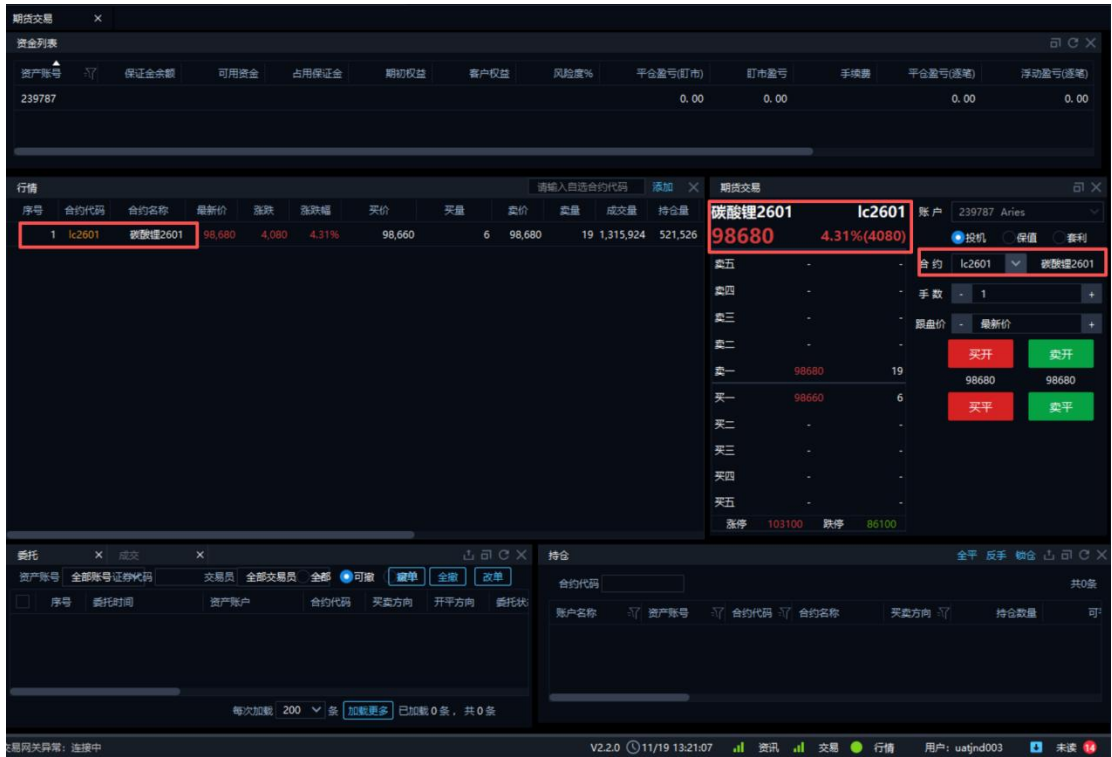
点击合约报价列表切换合约，展示对应合约的分时/K 线走势，支持切换不同周期，分时包含 1 日、2 日、3 日、4 日、5 日、6 日、7 日、8 日、9 日、10 日，K 线包含日/周/月/季/年/1 分/5 分/10 分/15 分/30 分/60 分/120 分，双击合约走势图，跳转对应的合约详情页面。

### 4.2.4.成分列表交易跳转

成分列表界面，选中合约后，右键选择“立即交易”，即可跳转交易界面，如下图所示，以碳酸锂 2601 为例：

国内期货	合约名称	名称	现价	涨跌幅	买手	成交量
1	LC2601	新嘉坡2601	82.92	4.31%	28	131.59万
2	SI2601	工业硅2601	16.25	2.01%	13	24.18万
3	P2601	棕榈油2601	7.66	1.66%	7	70.86万
4	AG2602	沪银2602	12014	1.06%	5	113.90万
5	I2601	铁矿石2601	793.5	1.02%	2	16.47万
6	PS2601	多晶硅2601	52905	0.99%	2	16.92万
7	PX601	对二甲苯601	6856	0.94%	1	25.06万
8	EB2512	苯乙烯2512	6518	0.88%	7	20.92万
9	C601	红米601	9360	0.81%	11	86648
10	Y2601	豆油2601	8368	0.75%	11	31.13万
11	SN2512	沪镍2512	291950	0.70%	6	76128
12	SC2601	原油2601	485.2	0.63%	18	10.14万
13	ALU2512	沪金2512	932.30	0.58%	1	20.81万
14	NR2601	20号胶2601	12435	0.53%	2	47268
15	RU2601	橡胶2601	15400	0.52%	1	16.44万
16	TA601	PTA601	4708	0.51%	3	69.05万
17	WR2601	线材2601	3312	0.45%	1	29
18	PG2512	液化气2512	4400	0.43%	1	61959
19	IH2512	50股指期货2512	3007.4	0.43%	2	23450
20	CY601	棉花601	19780	0.43%	1	12687
21	BR2601	BR橡胶2601	10585	0.38%	2	85082
22	CF601	棉花601	13465	0.37%	2	16.43万
23	ZN2512	沪锌2512	22410	0.27%	2	78965
24	BU2601	沥青2601	3057	0.26%	4	13.87万
25	HC2601	热卷2601	3291	0.24%	10	18.49万
26	CU2512	沪铜2512	86080	0.17%	11	57713
27	IF2512	300股指期货2512	4550.0	0.15%	4	48323
28	NI2512	沪镍2512	115450	0.12%	1	70721
29	RR2601	粳米2601	3588	0.11%	3	801
30	RB2601	螺纹钢2601	3088	0.10%	10	51.96万

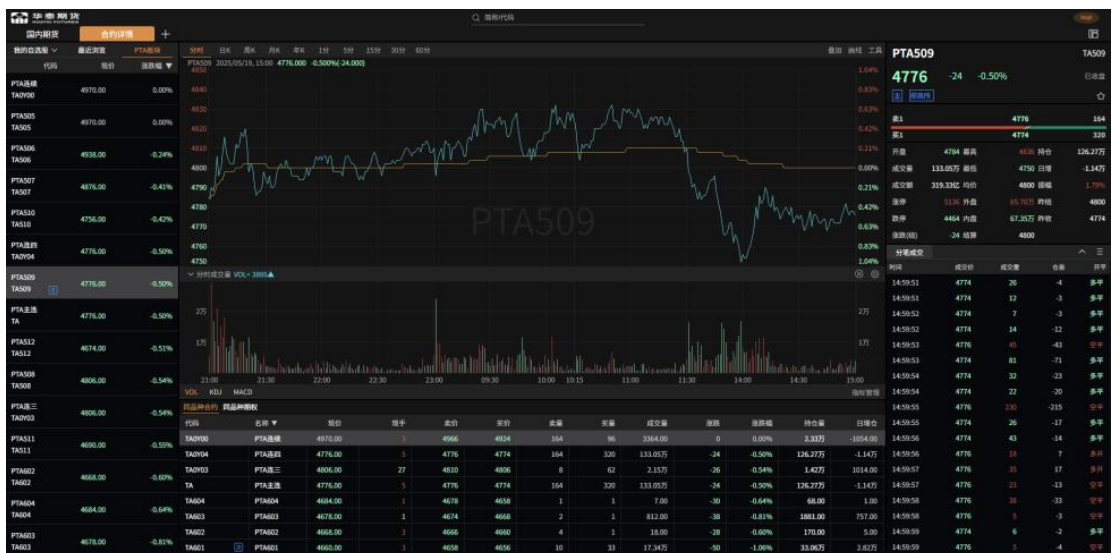
交易界面会自动带入所选合约信息、行情信息等，用户可根据需求进行交易下单，如下图所示，以碳酸锂 2601 为例：



### 4.3. 合约详情

用户可以在合约详情页面获取合约最新行情、买卖盘、分笔明细等信息。

- 1) 双击任一条合约数据，进入合约详情页面。



#### 4.3.1. 切换分类标签

- 1) 分类标签切换：进入合约详情页面后，左侧为简约报价列表，支持我的自选、最近浏览、上一级分类标签切换。
- 2) 简约报价列表展示：仅展示基础的代码、现价、涨跌幅，点击表头字段名称，支持

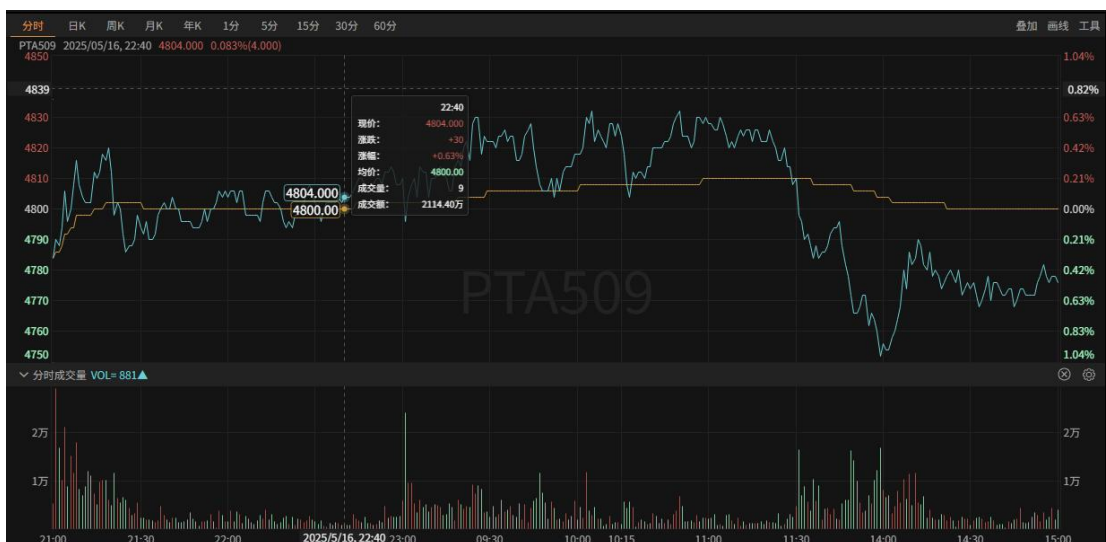
列表按对应字段升序、降序排列。

- 3) 简约报价列表中点击鼠标右键，选择【添加自选】，支持将合约添加至自选板块。
- 4) 简约报价列表中我的自选、最近浏览列表点击鼠标右键，选择【删除】或【清空】，支持删除或清空对应列表的合约。

名称/代码	现价	涨跌幅
二年债26... TS2606	102.496	-0.03%
有色金属... 808001	176.35	-0.31%
铝合金26... AD2604	22640	-0.33%
聚丙烯26... PP2604	9638	7.02%
聚丙烯连四 PP0Y04	9290	8.20%

### 4.3.2.展示分时/K 线走势

- 1) 分时走势：进入合约详情后，点击【分时】，展示合约当日分时走势，点击【分时】右侧的下拉箭头，支持选择多日分时。
- 2) K 线走势：进入合约详情后，点击【日 K】，展示合约当日 K 线走势，点击【日 K】右侧 K 线周期按钮，支持选择多周期 K 线。
- 3) 走势图右上角操作按钮，支持对走势图进行放大、缩小、刷新数据、修改参数。
- 4) 副图指标：点击【指标管理】，跳出指标管理弹窗，从左侧可选指标选择指标到右侧已选指标中，已选指标支持置顶、排序、删除功能，点击【恢复默认】恢复成默认副图指标组合，点击【确认】按钮完成副图指标配置。
- 5) 副图指标参数设置：点击 x 号删除走势图中的对应副图指标，点击设置按钮，支持设置副图指标参数。





### 4.3.3.画线

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

- 1) 打开画线工具：点击分时/K线图，右上角【画线】，即可打开画线工具，进行画线、隐藏、删除等操作，比如选中直线-线段，即可在走势图中进行以下操作：
  - ① 画线：共两个锚点，第一次点击确定第一个锚点，第二次点击确定第二个锚点后，即可画出两锚点之间的线段；
  - ② 调整：点击选中线段锚点后拖动，可调整线段锚点位置，以调整线段倾斜度及长度；
  - ③ 移动：点击选中线段线条后拖动，可调整线段位置。



### 4.3.4.工具

用户可使用合约详情页面工具，设置主图类型以及修改走势图样式。

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

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

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



### 4.3.5.指标管理

用户可使用合约详情页面指标管理，设置分时或者 K 线的主图以及副图指标。

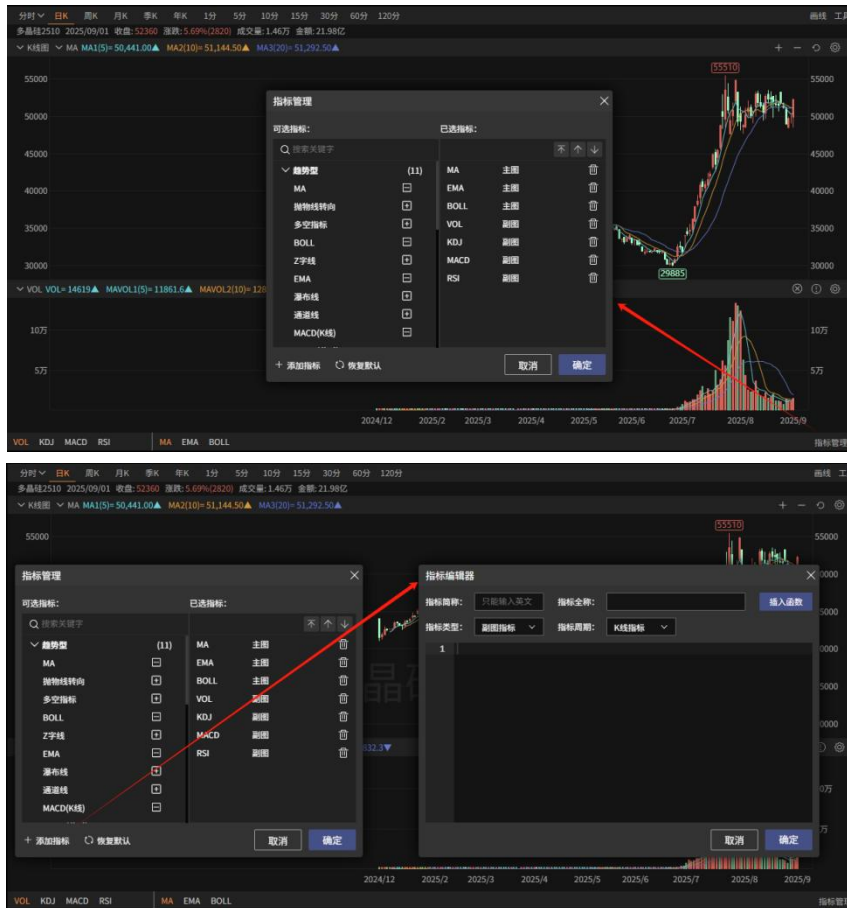
打开指标管理：点击分时/K 线图，右下角【指标管理】，即可打开指标管理弹窗，进行指标设置。

- 1) 选择展示指标：在指标管理弹窗左侧可选指标列表，点击对应指标后的“+”或“-”按钮，即可设置对应指标是否展示。

注：指标区分分时与 K 线，不支持对应走势时不展示“+”或“-”按钮

- 2) 添加自定义指标：点击指标管理弹窗左下角【添加指标】按钮，即可打开指标编辑器弹窗，支持设置自定义指标，可点击【插入函数】，按参考格式添加对应指标。

- 3) 恢复默认：一键恢复指标默认设置。

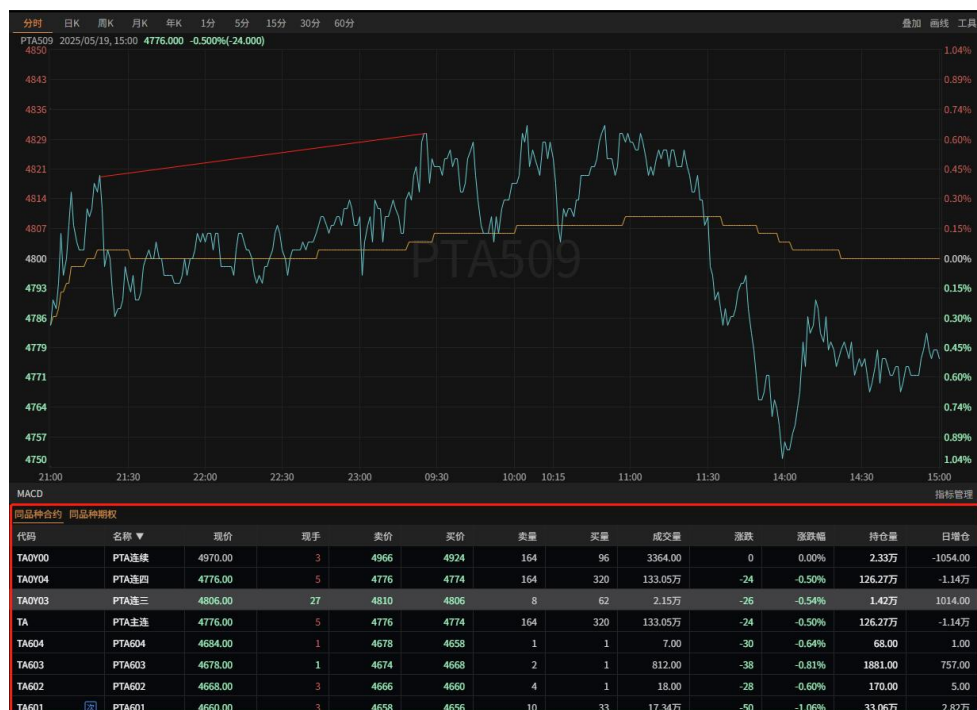


【注】上图弹窗布局为手动调整，非默认布局，此处仅供示意。

### 4.3.6.查看关联品种

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

【注】中金所期权标的为沪深指数，因此中金所期货无同品种期权。



### 4.3.7.查看成分列表

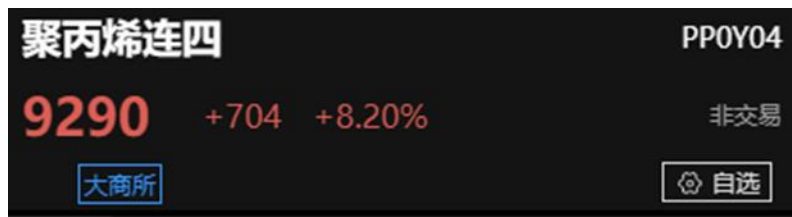
进入合约详情页面，在分时 K 线图下方即可查看板块及指数品种的成分列表，支持字

段配置以及添加自选功能。

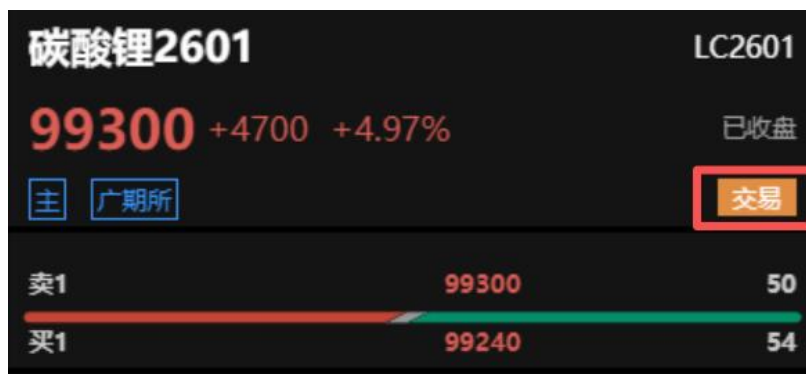
【注】仅期货板块以及指数品种展示成分列表，与合约的关联品种列表展示在相同位置。

### 4.3.8.查看合约信息

进入合约详情页面，在页面右侧区域即可查看合约信息，支持展示合约信息以及点击【自选】按钮将合约加入自选分组。



点击合约信息中“交易”按钮，即可跳转交易界面，如下图所示，以碳酸锂 2601 为例：



交易界面会自动带入所选合约信息、行情信息等，用户可根据需求进行交易下单，如下图所示，以碳酸锂 2601 为例：



### 4.3.9.查看买卖档口

进入合约详情页面，在页面右侧区域即可查看合约买卖一档行情数据。



### 4.3.10.查看盘口指标

进入合约详情页面，在页面右侧区域即可查看盘口指标数据。

【注】盘后更新当日结算价数据。

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

### 4.3.11.查看分笔成交

进入合约详情页面，在页面右侧区域即可查看分笔成交数据。

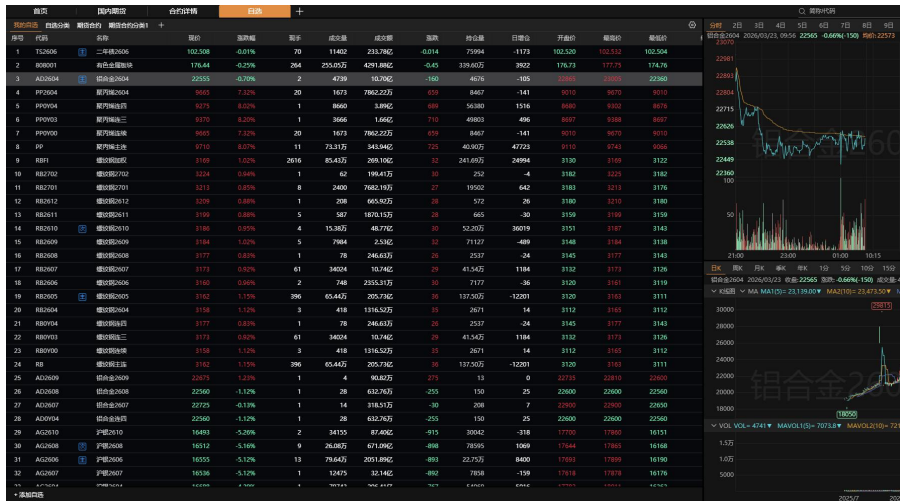
- 1) 点击分笔成交组件标签栏下拉按钮，弹出设置栏，支持按代码、名称、简拼搜索合约代码。
- 2) 点击分笔成交组件标签栏操作按钮，弹出操作选项，支持删除分笔成交组件、跳转分笔成交详情页面并查看分笔成交的时间、成交价、成交量、仓差、开平性质。

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

### 4.4.自选页面

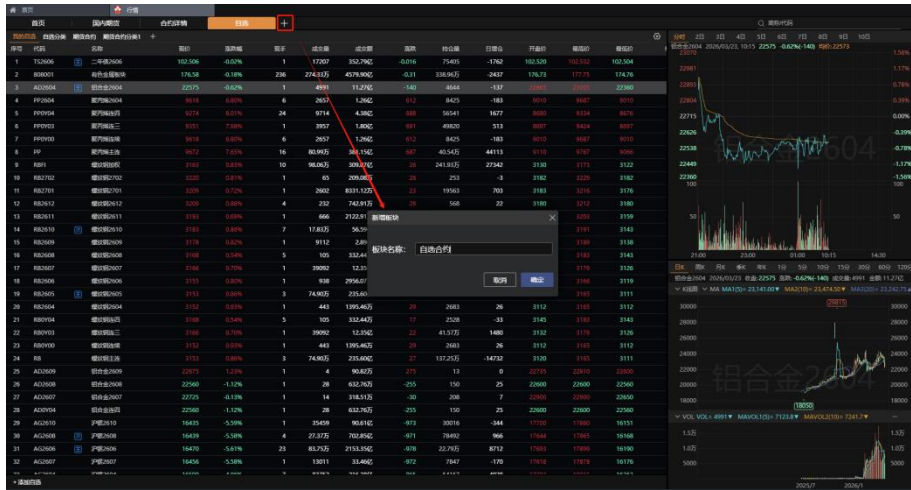
用户可以在自选页面配置自选板块以及查看对应自选合约行情及走势。

菜单栏选中【自选】的时候，切换至该页面。

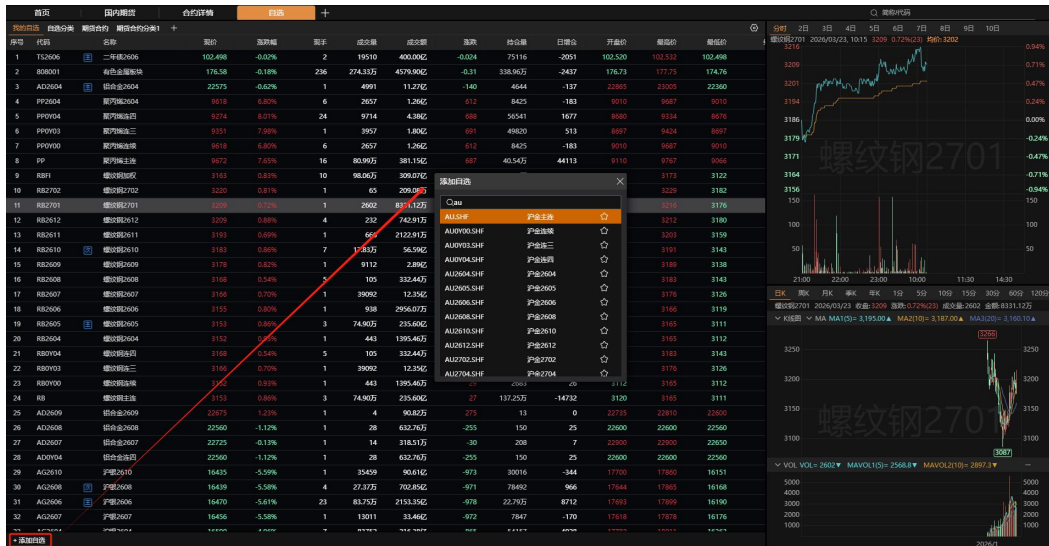


### 4.4.1.快捷配置自选板块及合约

- 1) 默认自选板块为“我的自选”。
- 2) 点击板块标签后的【+】按钮，弹出新增板块弹窗，输入板块名称，点击确定后即可快捷新增板块。

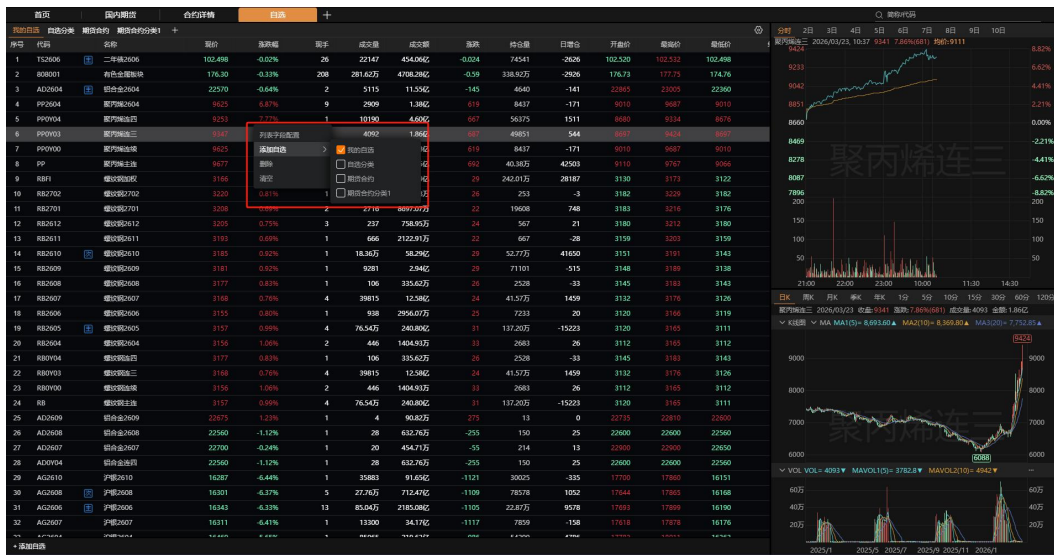


- 3) 点击自选列表最下方的【+添加自选】按钮，弹出添加自选弹窗，可通过搜索代码对自选板块添加合约。



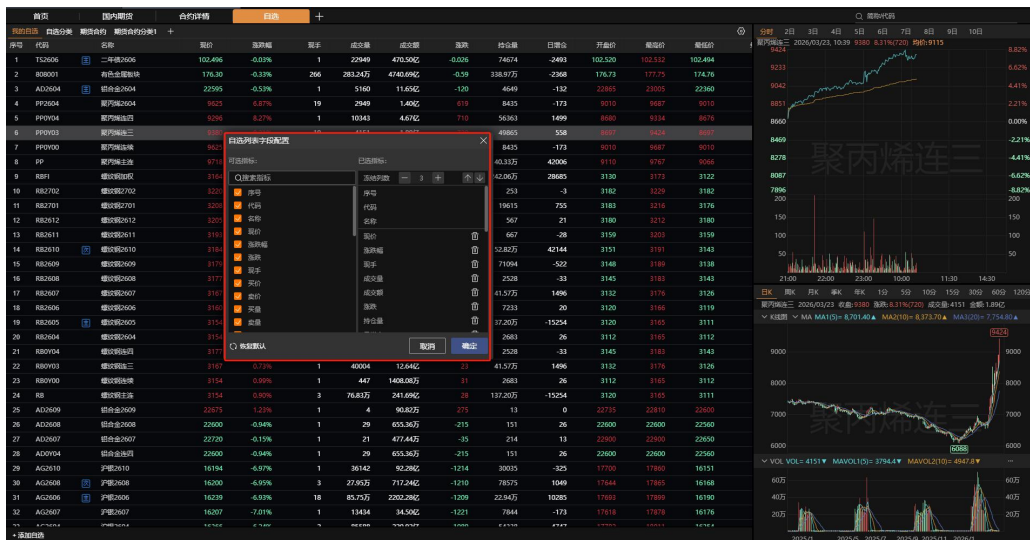
- 4) 右键自选列表，支持列表字段配置、添加自选、删除、清空合约操作，合约所属自选板

块的勾选框为勾选状态。列表字段配置参见 2.4.2-查看自选合约行情章节。



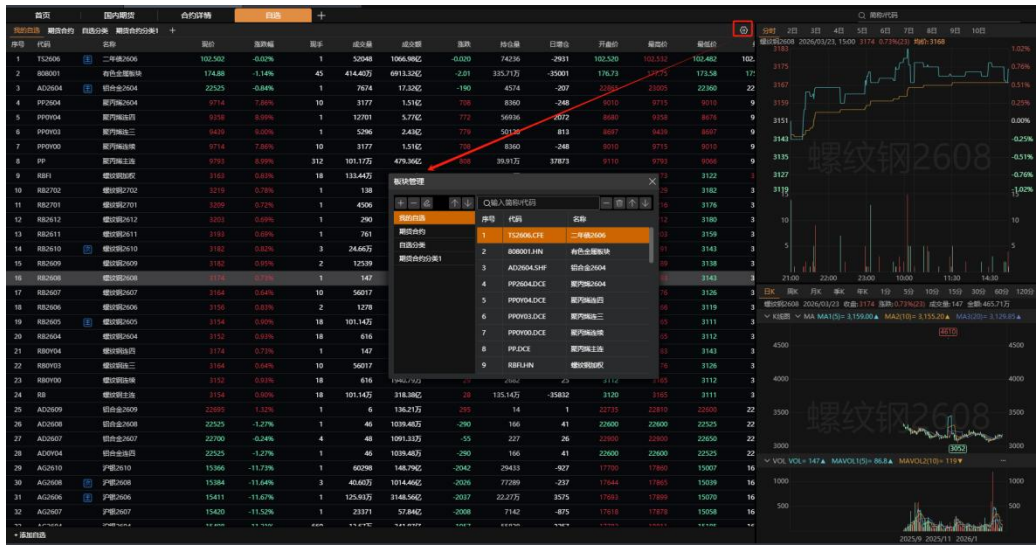
### 4.4.2.查看自选合约行情

- 1) 点击自选板块标签，展示对应自选板块下合约的行情报价列表。
- 2) 列表中右键选择【列表字段配置】，跳出自选列表字段配置弹窗，从左侧可选指标选择字段到右侧已选指标列表中，已选指标支持冻结、排序、删除功能，点击【恢复默认】恢复成默认字段配置，点击【确认】按钮完成字段配置。
- 3) 点击表头字段名称，支持列表按对应字段升序、降序排列。
- 4) 双击合约行，跳转对应的合约详情页面。



### 4.4.3.板块管理

点击自选板块标签行最右侧的【设置】按钮，弹出板块管理弹窗，支持进行板块管理。



1) 左侧列表为自选板块列表，列表左上方为新增、删除、修改板块按钮，支持新增、删除、重命名选中板块。列表右上方为排序按钮，支持移动对应自选板块的标签位置。



2) 右侧列表为自选合约列表，选中左侧板块，右侧展示对应的合约列表。



(1) 搜索框支持输入简称/代码，点击列表右侧的【+】按钮支持快捷添加合约至对应自选板块。

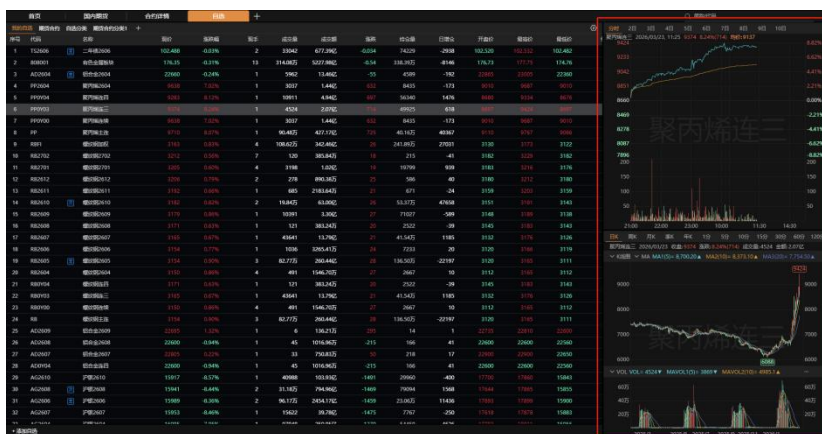


(2)列表右上方为删除、清空、上移、下移按钮，支持删除、清空对应自选合约列表的合约，以及移动合约位置。



#### 4.4.4.展示分时/K 线走势

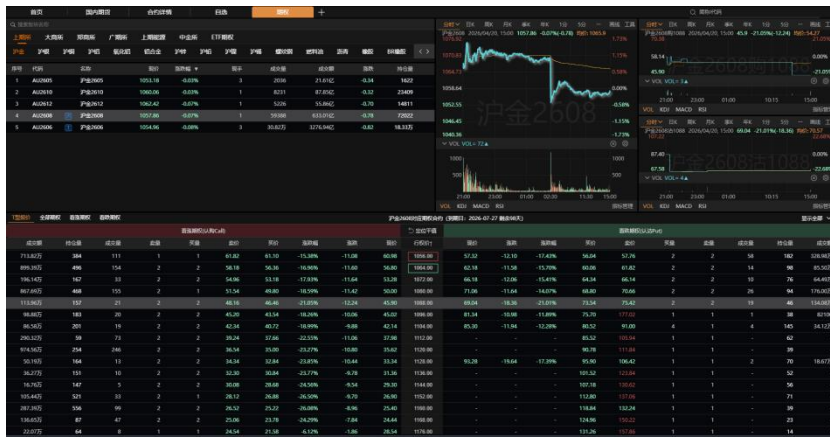
点击自选合约报价列表切换合约，展示对应合约的分时/K 线走势，支持切换不同周期，分时包含 1 日、2 日、3 日、4 日、5 日、6 日、7 日、8 日、9 日、10 日，K 线包含日/周/月/季/年/1 分/5 分/10 分/15 分/30 分/60 分/120 分，双击合约走势图，跳转对应的合约详情页面。



#### 4.5.期权页面

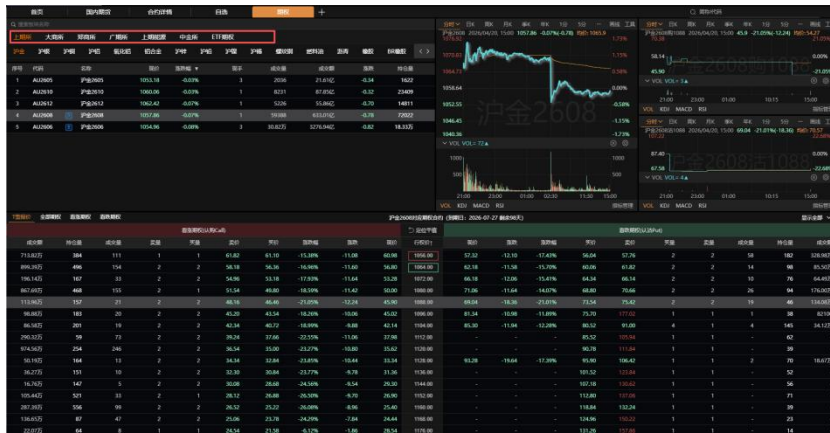
用户可在期权页面查看期权标的行情、期权合约报价及分时 K 线走势等信息，支持切换不同交易所的期权合约进行查看。

菜单栏选中【期权】的时候，切换至该页面。



### 4.5.1. 切换期权交易所

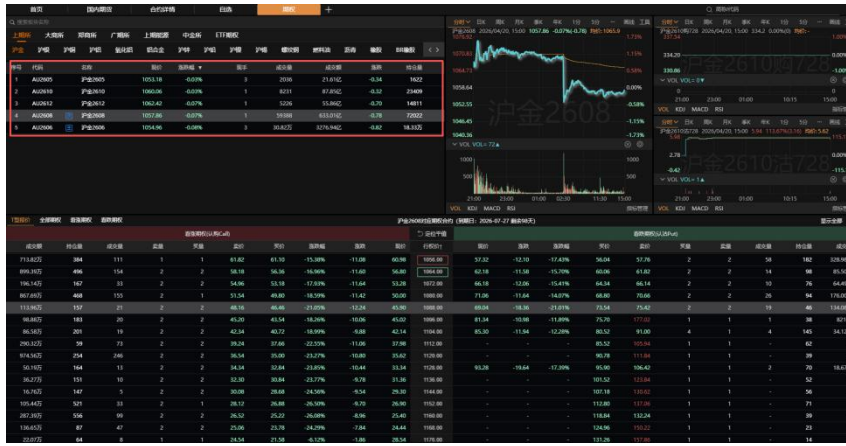
点击菜单组件中的交易所标签，可切换查看不同交易所的期权合约，包括上期所、大商所、郑商所、广期所、上期能源、中金所的商品和金融期权以及沪深交易所的 ETF 期权。



### 4.5.2. 查看期权标的行情

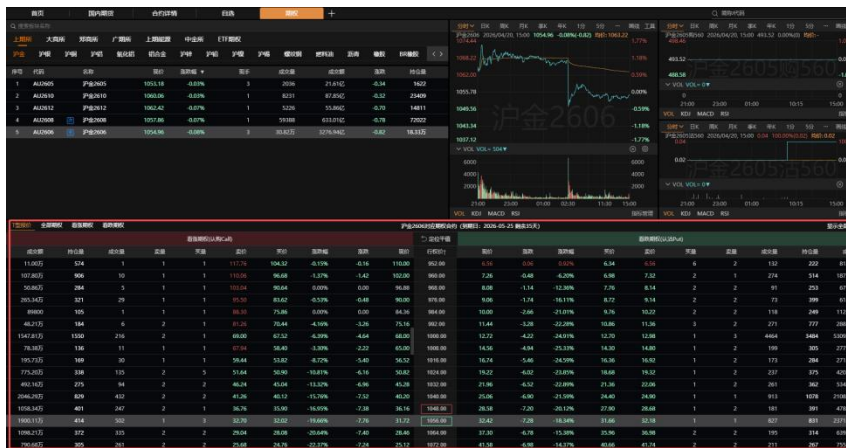
支持点击交易所期权品种，查看对应标的合约行情。

- 1) 列表中点击鼠标右键，选择【列表字段配置】，跳出列表字段配置弹窗，从左侧可选指标选择字段到右侧已选指标列表中，已选指标支持冻结、排序、删除功能，点击【恢复默认】恢复成默认字段配置，点击【确认】按钮完成字段配置。
- 2) 列表中点击鼠标右键，选择【添加自选】，支持将合约添加至自选板块。
- 3) 列表中点击鼠标右键，选择【立即交易】，支持跳转至交易页面进行交易操作。
- 4) 点击表头字段名称，支持列表按对应字段升序、降序排列。
- 5) 双击合约行，跳转对应的合约详情页面。



### 4.5.3.查看期权合约列表

期权列表组件展示对应标的的期权合约行情数据，支持多种视图切换。



1) 列表标签切换:

T 型报价: 展示期权 T 型报价视图

(1) 左侧展示看涨期权列表, 右侧展示看跌期权列表, 中间列默认按行权价降序排列

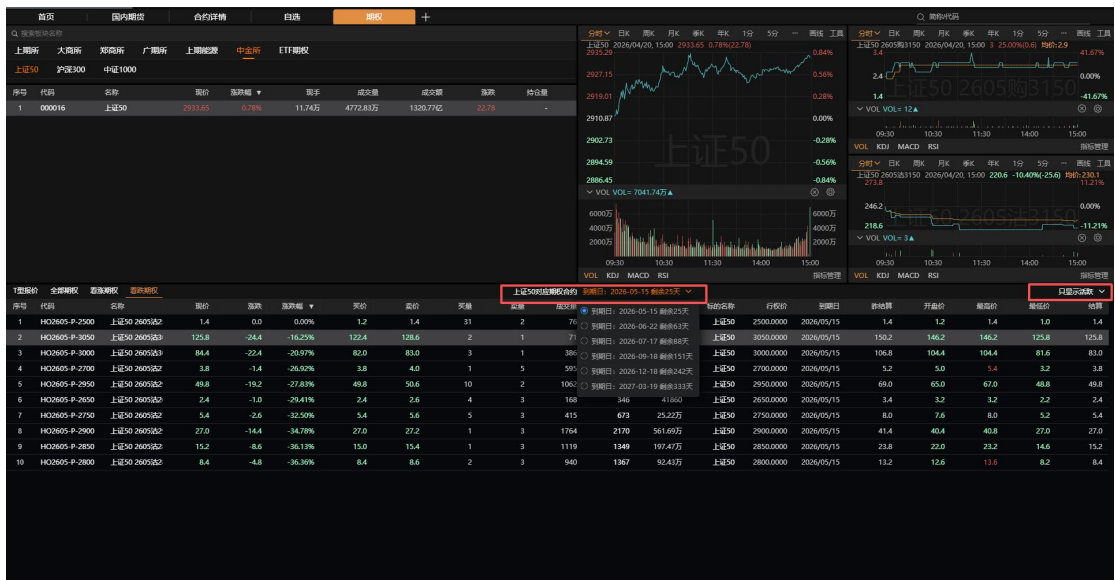
(2) 使用红绿边框标注平值期权的上下档位

全部期权: 展示标的对应的所有期权合约

看涨期权: 仅展示看涨期权合约

看跌期权: 仅展示看跌期权合约

所有列表均支持按五档和活跃筛选期权合约, 中金所期权和 ETF 期权的同一标的区分不同的到期日, 使用下拉列表支持选择不同的到期日。

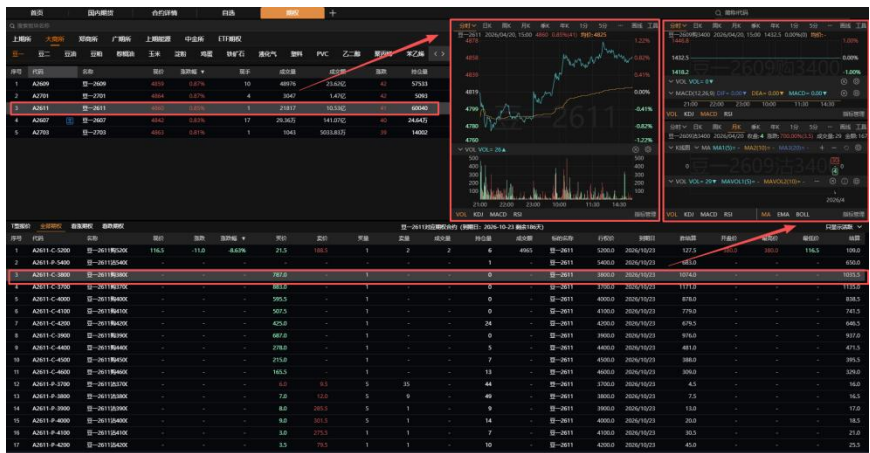


- 2) 列表（不含 T 型报价）中点击鼠标右键，选择【列表字段配置】，跳出列表字段配置弹窗，从左侧可选指标选择字段到右侧已选指标列表中，已选指标支持冻结、排序、删除功能，点击【恢复默认】恢复成默认字段配置，点击【确认】按钮完成字段配置。
- 3) 列表中点击鼠标右键，选择【添加自选】，支持将合约添加至自选板块。
- 4) 列表中点击鼠标右键，选择【立即交易】，支持跳转至交易页面进行交易操作。
- 5) 点击表头字段名称，支持列表按对应字段升序、降序排列。
- 6) 双击合约行，跳转对应的合约详情页面。

#### 4.5.4.展示分时/K 线走势

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

单击期权列表，右侧上部分时 K 线组件展示同一行权价下的看涨期权走势，下部分时 K 线组件展示同一行权价下的看跌期权走势。

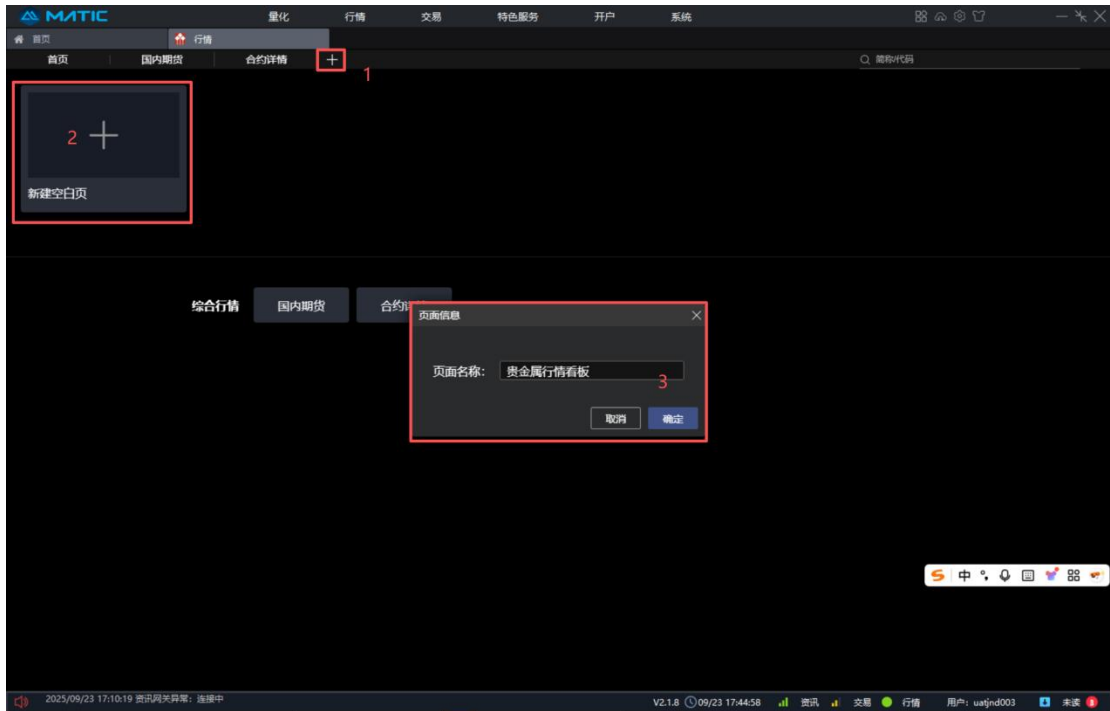


## 4.6.自定义界面

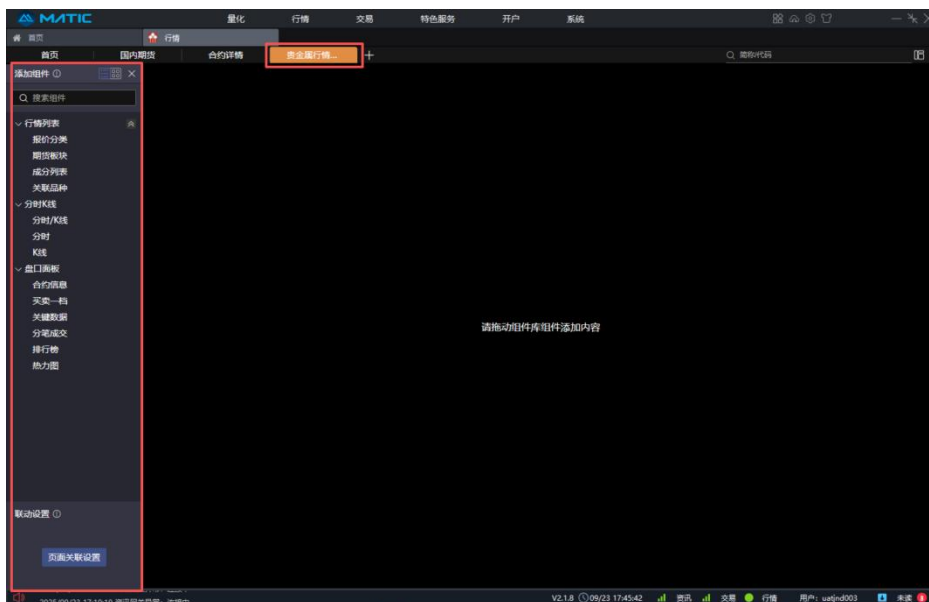
### 4.6.1.新建自定义界面


- 组件设置

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



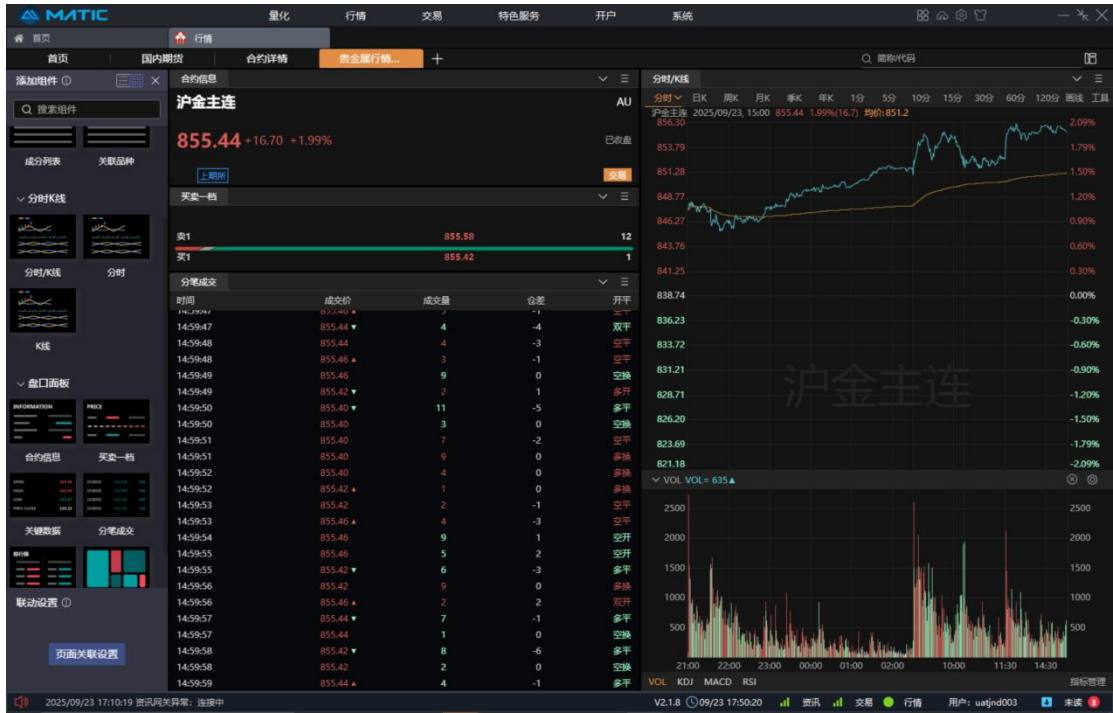
单击确定后，生成贵金属行情看板页面：





在页面内可从左侧添加组件并进行联动设置，单击添加组件右上方按钮，可对组件展示形式进行设置，以列表的形式或者以图表的形式展示组件：



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



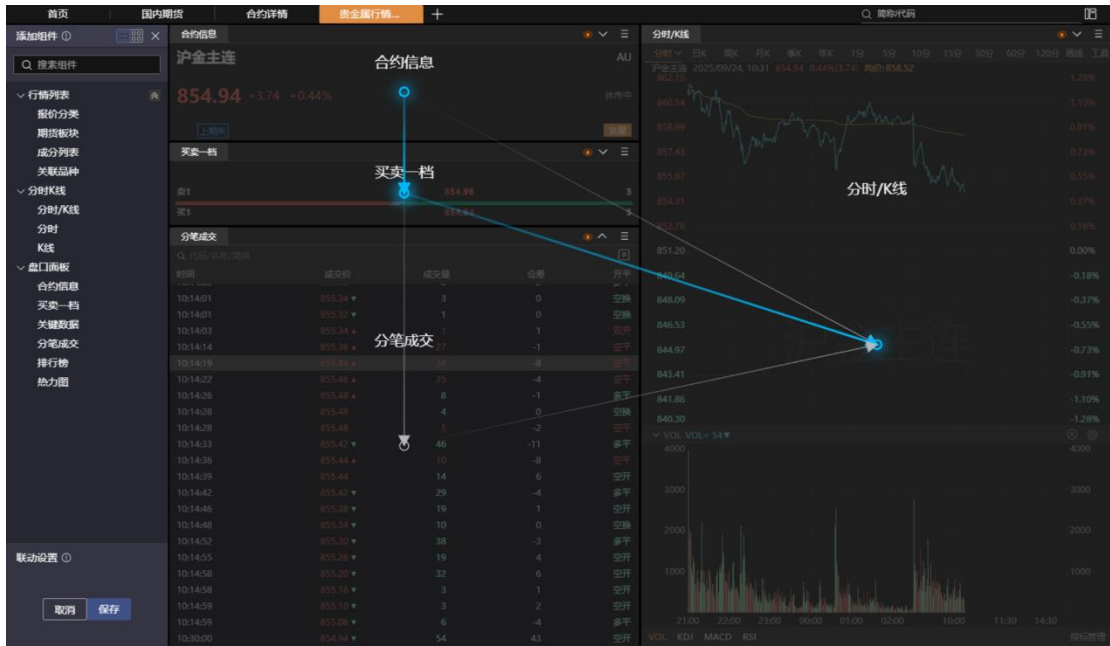
- 单击  按钮，可折叠或展示搜索框，在搜索框内可设置组件的合约。
- 单击组件右上角 ，可删除相应组件；
- 鼠标放在组件边界，拖动，可进行组件大小设置；

### ● 联动设置


单击界面左下方页面联动设置，可进行界面联动设置：



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





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

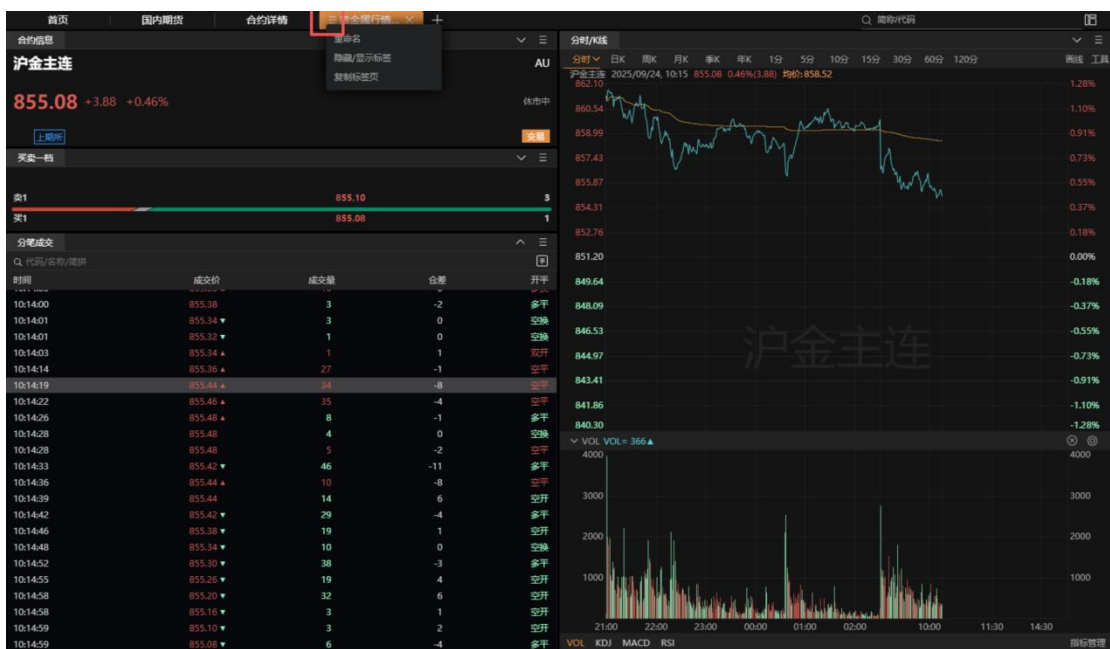
- 单击右上角  组件库，可设置隐藏或显示组件库。
- 自定义界面设置完毕后，下次打开客户端，则自动加载自定义界面。

#### 4.6.2.修改自定义界面

- 重命名、标签设置、标签页复制

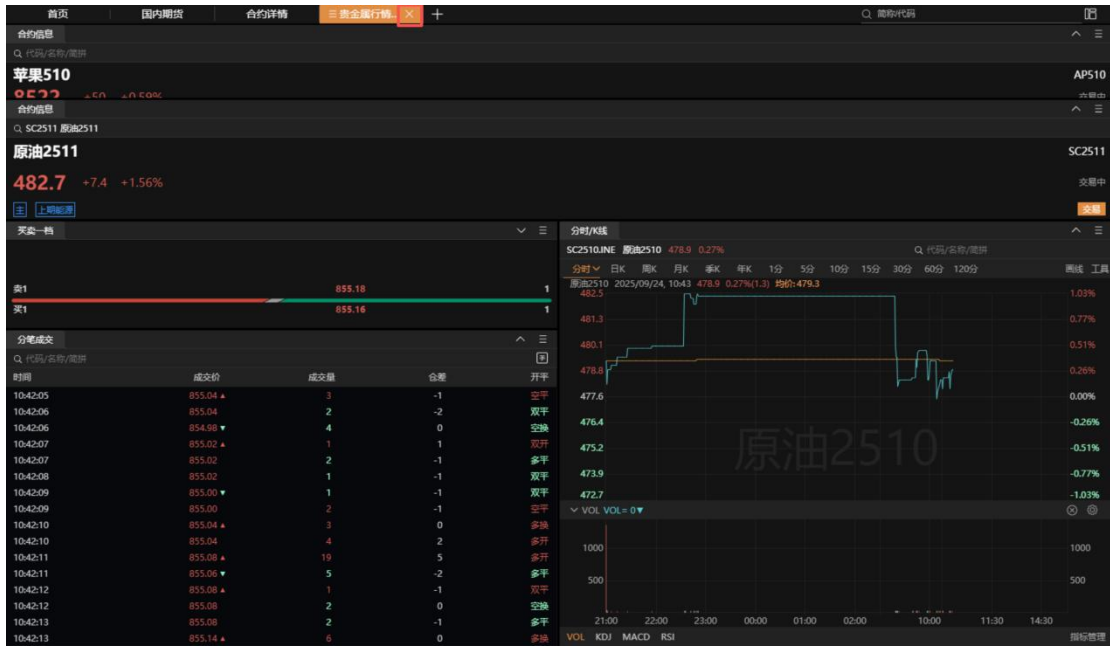
单击顶部页签左侧 ，可对界面进行修改：重命名、隐藏/显示标签、复制标签页。

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



#### 4.6.3.删除自定义界面

顶部页签右侧，单击 ，可关闭该页签



单击“+”打开自定义界面，单击“”可编辑自定义界面名称：



单击“X”可删除自定义界面：



删除确认：



## 4.7. 键盘精灵

用户可使用键盘精灵搜索合约代码、名称并跳转至对应合约。

- 1) 搜索股票：进入【国内期货】或【合约详情】页面，上方搜索框中输入代码或名称，可查看相关合约。
- 2) 跳转详情：在相关合约列表中，双击合约即可跳转至对应合约详情页面。



## 5. 量化

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

### 5.1. 量化权限申请

用户登录 Matic 后：

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



您可以选择手机扫描二维码，加入 Matic 服务群和华泰期货量化服务群；

单击底部“申请试用”或“立即开户”；

若您已 Matic 绑定期货资金账号，则进入量化权限功能申请：



按照界面提示填写业务经理、量化经验和您还想对我们说的内容，单击“提交”则可进行

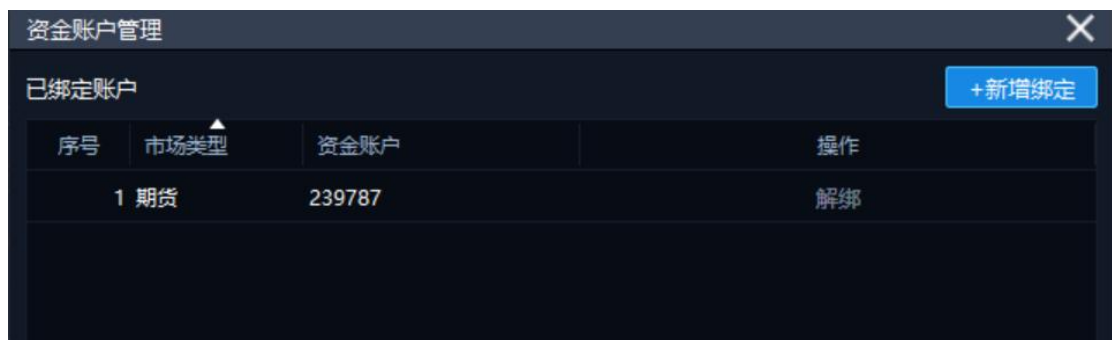
量化权限功能申请，申请提交后，审核可能需要 1~3 个工作日，我们会尽快为您处理，请耐心等待。审核结果会通过系统的消息中心发送审核结果通知，请及时关注。

若您未在 Matic 绑定期货资金账号，则会展示如下界面：



您可以根据界面提示进行：

- 1) 手机扫描二维码，进入华泰期货在线开户平台；
- 2) 若您已开户，但未在 Matic 绑定期货资金账号，则可以单击“我已开户，绑定资金账号”进入资金账户管理界面，单击右上角新增绑定，进行资金账户绑定：



- 3) 您也可以选择“跳过此步骤”，直接进入量化试用申请界面。

## 5.2. 首页

### 5.2.1. 操作说明

Matic 系统用户点击顶部导航栏【量化】则会进入到量化系统首页：

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

进行数据查询、因子研究、策略研究等；

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

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

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

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

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

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



## 5.3.编写策略

### 5.3.1.功能概述

#### Aistudio 综述

Aistudio 是平台核心集成功能，是策略、因子和代码加工的生产基地：

1. 用户可在 Aistudio 进行相关数据的读取，加工和存储等处理操作；

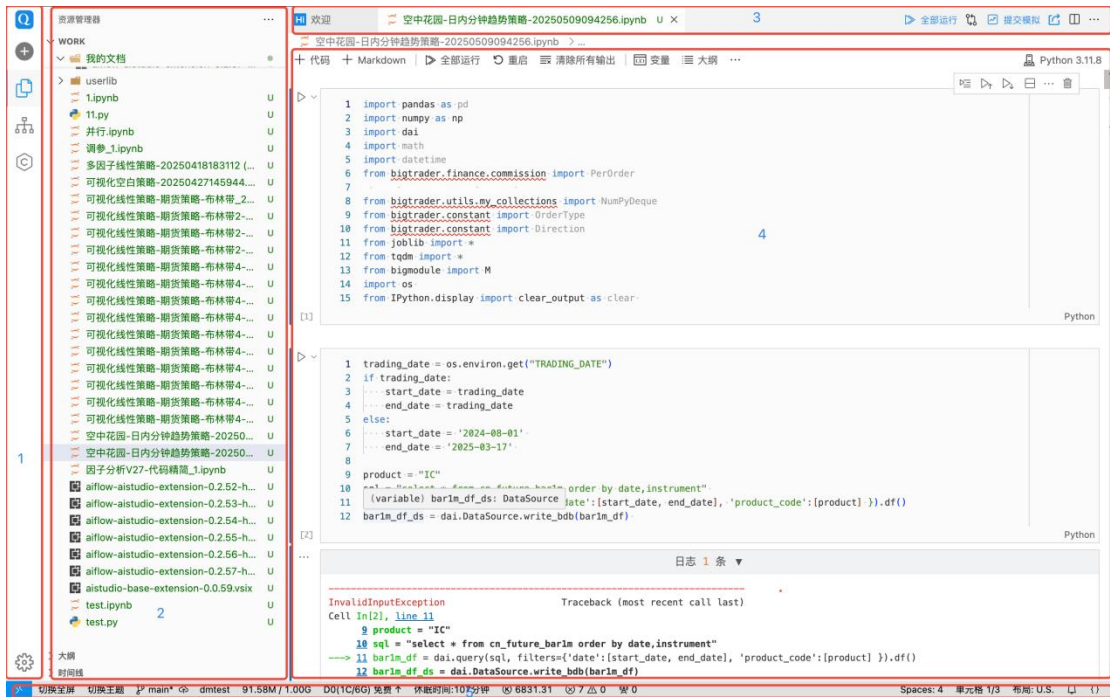
2. 用户可在 AIStudio 进行因子的创建、编辑、分析和保存等相关操作；
3. 用户可在 AIStudio 进行策略的回测、绩效查看和提交模拟等相关操作；
4. 用户可在 AIStudio 进行任务的创建、提交和管理等相关操作；

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


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

- 1) 【1】表示 AIStudio 的主菜单功能区域，每个图标都代表一个功能主键；
- 2) 【2】表示 AIStudio 的副菜单功能区域或者对应主菜单的明细功能分类；
- 3) 【3】表示 AIStudio 的具体某个功能触发打开的工作区间名称；
- 4) 【4】表示 AIStudio 的具体某个功能触发打开的工作区间，您可以在该区域进行代码的编写、测试、调整以及相关结果查看；
- 5) 【5】表示 AIStudio 的基础信息及预警区域，展示对应的用户名称、资源规格、主题等；





## 2. 文件管理

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

1) 在资源管理器模块，我们可进行文件的相关管理，如：

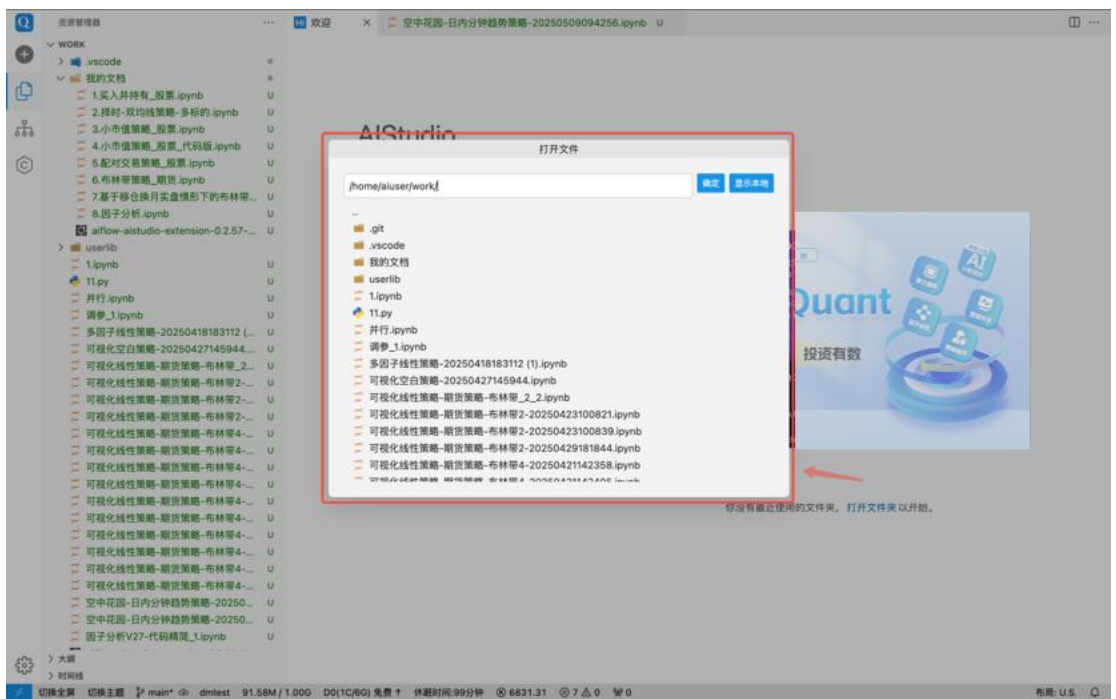
- 新建文件、新建文件夹、刷新资源管理器、折叠文件夹等操作
- 针对文件夹可以进行新建、复制、删除、终端打开等操作；
- 针对具体文件可以进行新建、复制、删除、终端打开等操作；





2) 在我们的引导就页面用户可以快捷启动功能，如：

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



### 3. 策略创建

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

#### 4. 因子创建

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

#### 5. 任务管理

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

### 5.3.2.操作说明

#### 5.3.2.1.数据读取

- **DAI 简介**

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

- **数据读取**

##### 代码示例

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

1. `dai.query` 是 DAI 读取平台数据的接口，可以对平台所有数据做读取和计算
2. `SELECT date, open, close, volume FROM cn_stock_bar1d WHERE date BETWEEN '2023-01-01' AND '2023-05-01' AND instrument = '000001.SZ'` 是 SQL 数据访问语言，SQL 是使用简单也是使用最广泛的数据操作语言，DAI 会解析 SQL 并调用 C++ 执行引擎，充分利用现代 CPU/GPU 特性实现高性能计算

- (1) `SELECT` 读取/选择数据

- (2) `date, open/close, volume` 需要的数据列

- ① `date` 日期，

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

- ③ `volume` 交易量

- (3) `FROM` 用于指定应从哪个表格或者多个表读取数据

- (4) `cn_stock_bar1d` 是 后复权日行情数据 表名


(5) WHERE date BETWEEN '2023-01-01' AND '2023-05-01' AND instrument = '000001.SZ' 按条件过滤数据，WHERE 之后是条件

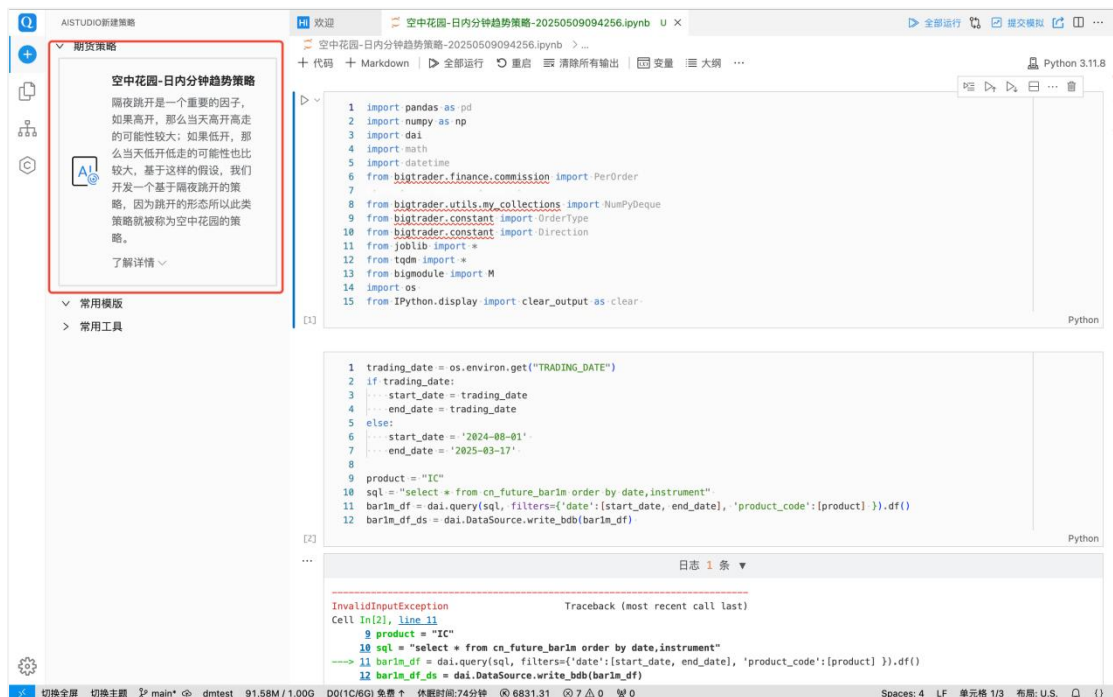
- ① date BETWEEN '2023-01-01' AND '2023-05-01' 日期在 2023-01-01 和 2023-05-01 间
- ② AND 并且
- ③ instrument = '000001.SZ' 股票代码为 000001.SZ
- ④ .SZ 是深交所的股票代码后缀，.SH 为上交所，平台所有数据定义保持一致

(6) .df() 将返回数据转为 pandas DataFrame


### 5.3.2.2.策略创建

我们通过【编写策略】进入到 AISTudio 开发环境。

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

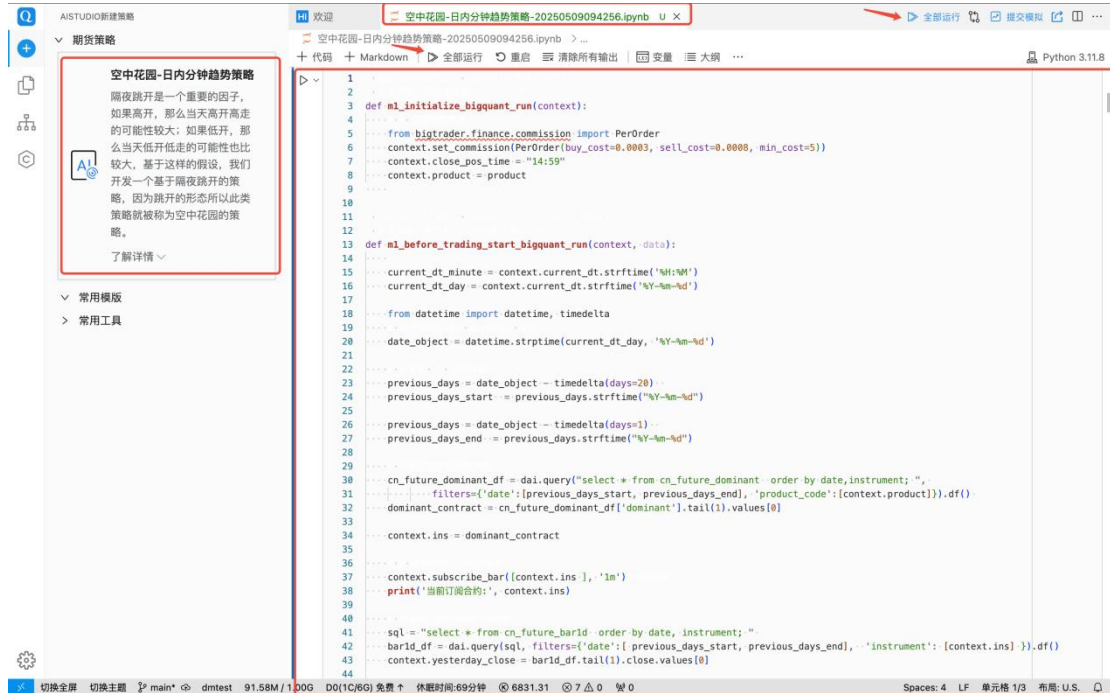



#### ● 期货策略

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

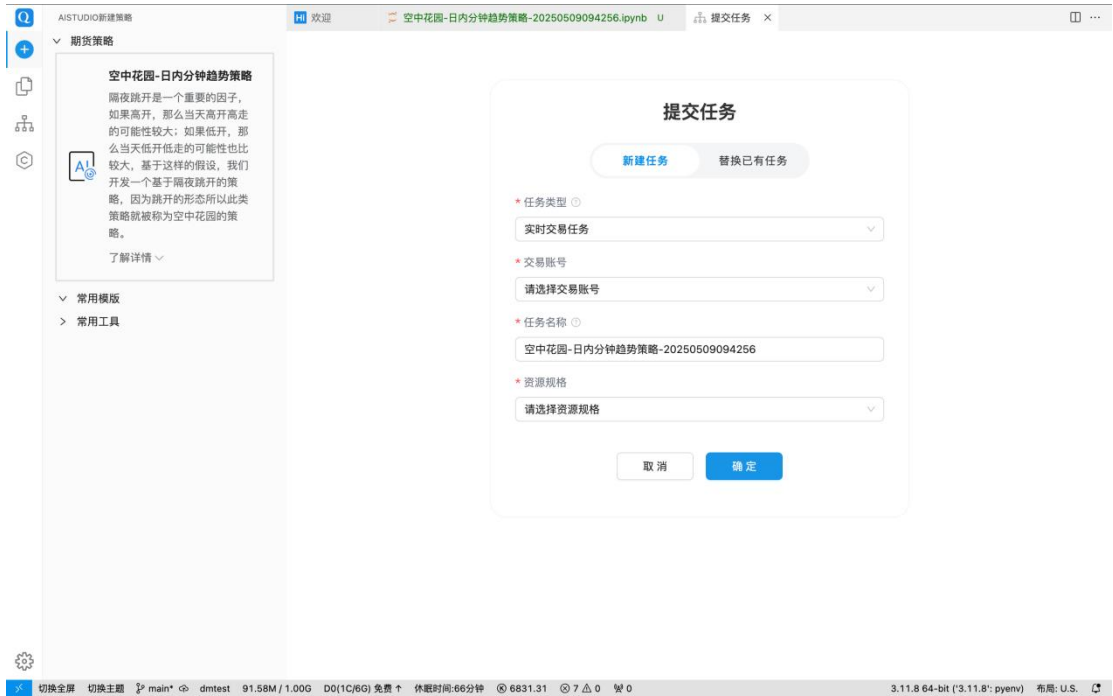
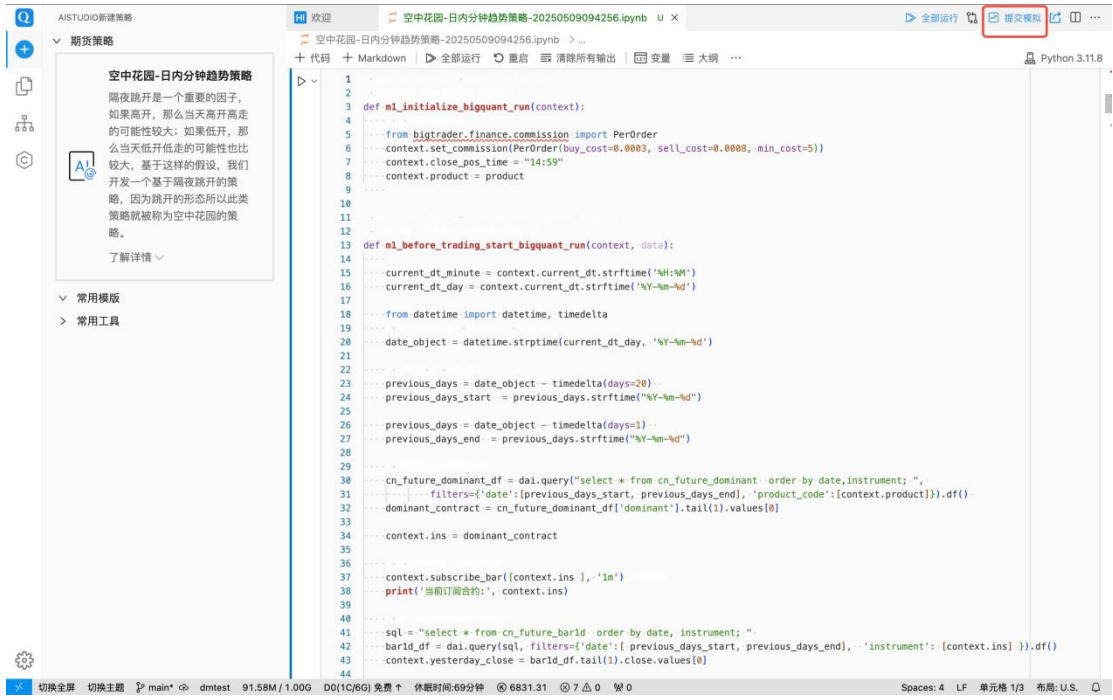
#### ● 期货策略

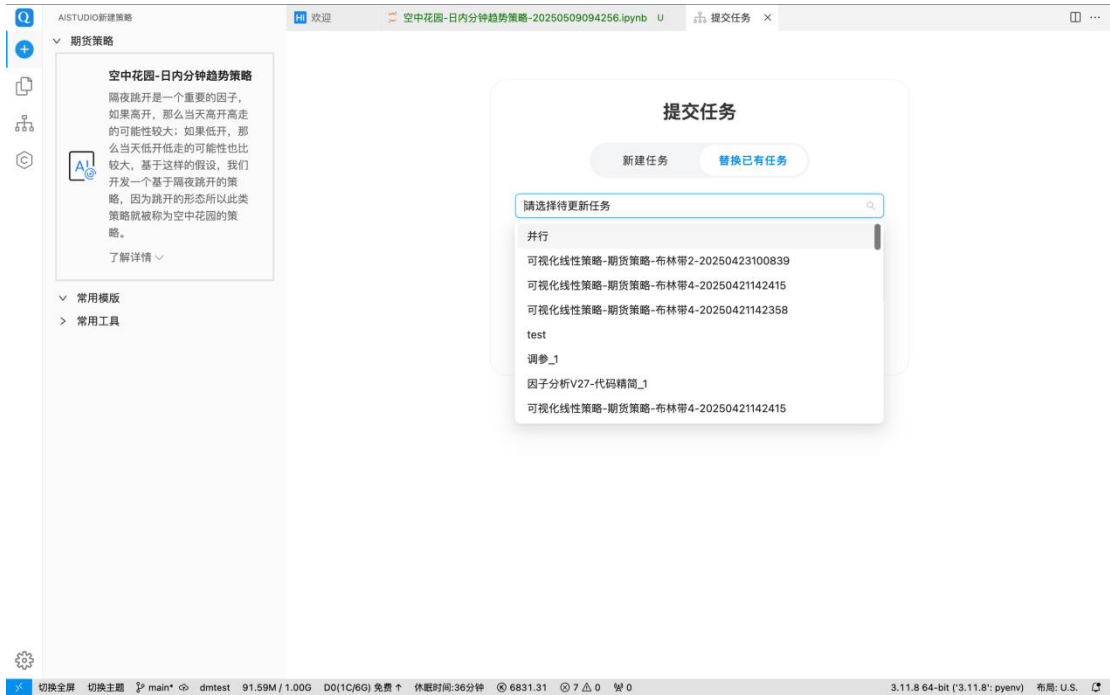
1. 期货策略是我们内置的简单期货模板策略，用户可直接使用内置模版进行策略回测；
2. 策略执行完毕，则会展示对应的回测绩效；



3. 用户可点击【】可进行策略提交，我们填写相关任务参数：

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






● 常用模板

用户可点击【常用模板】查看平台内置的期货模板策略。

5.3.2.3.任务管理

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

1. 用户编写相关代码后，点击【】可进行策略提交任务，则打开任务提交页面：

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

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

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

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

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

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



7) 立即运行一次：用户需要输入对应的任务名称，选择可使用的资源规格；

任务设置完成后，用户点击【确定】则确认进行任务提交，点击【取消】则不进行任务

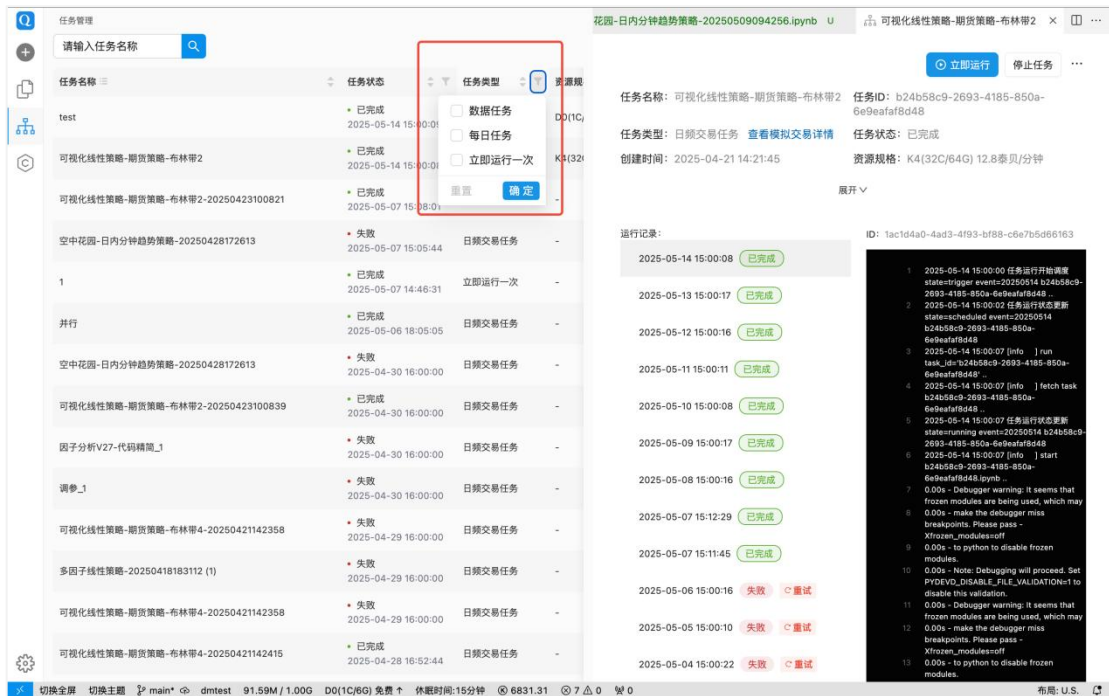
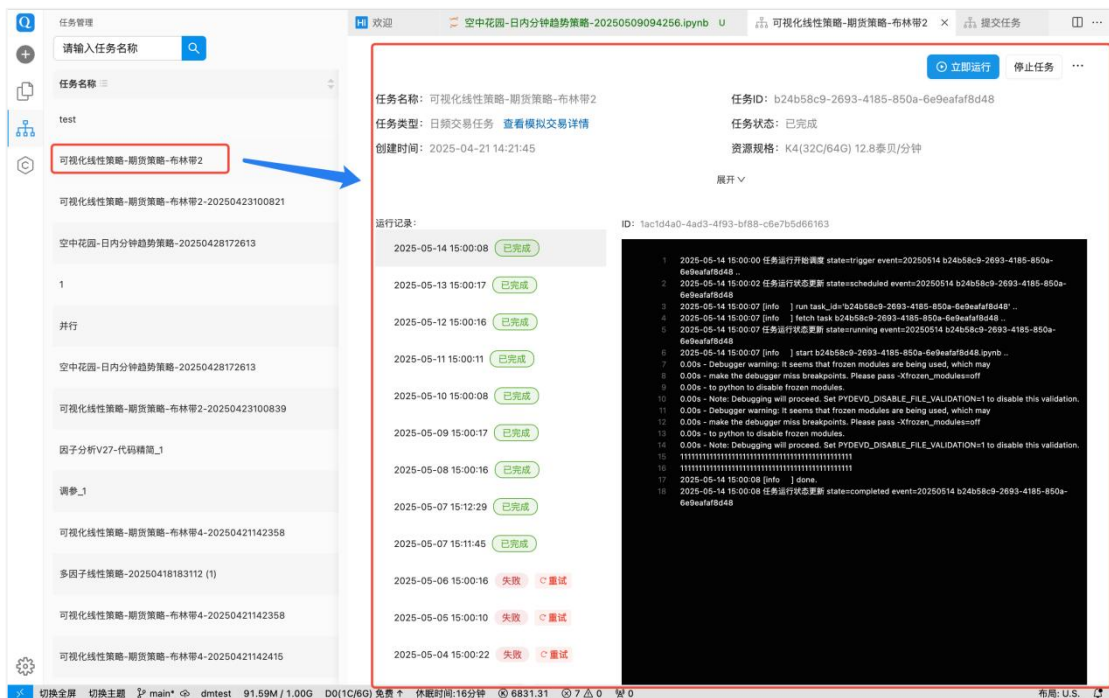
提交，提交完成后的任务统一在任务管理界面查看：

### 任务管理

用户在 AIStudio 主菜单点击【】则进入到任务管理页面；

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

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



## 5.4.数据平台

### 5.4.1.功能概述

数据平台是数据字典查询页面；针对平台用户来说：

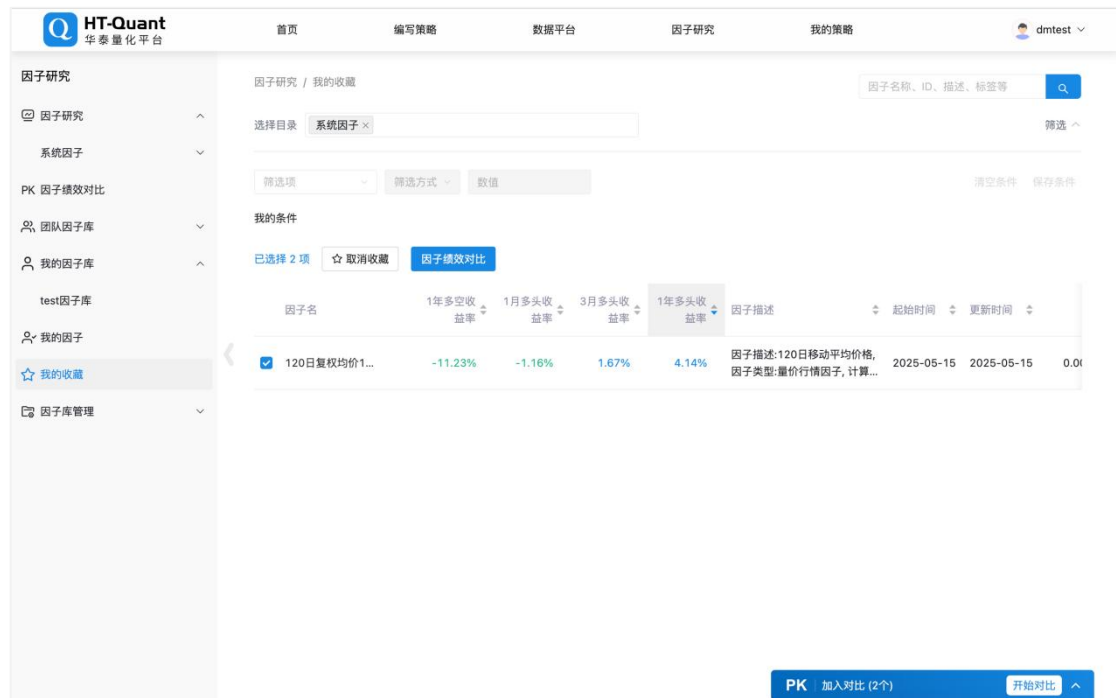
- A. 数据平台是用户的目标数据搜索的统一平台；
- B. 数据平台是用户的目标数据字段查询的统一平台；
- C. 数据平台是用户的目标数据代码调用方法查询的统一平台；

### 5.4.2.操作说明

#### 5.4.2.1.我的收藏

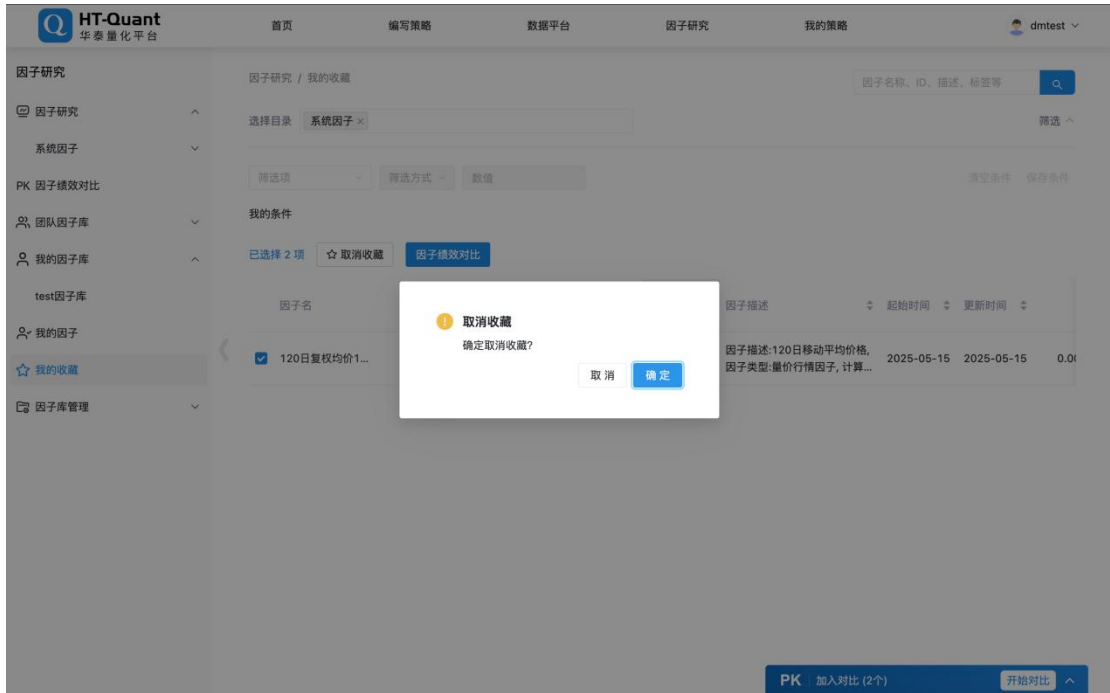
用户在【因子研究】模块进行收藏操作收藏的因子，则会进入到【我的收藏模块】：

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



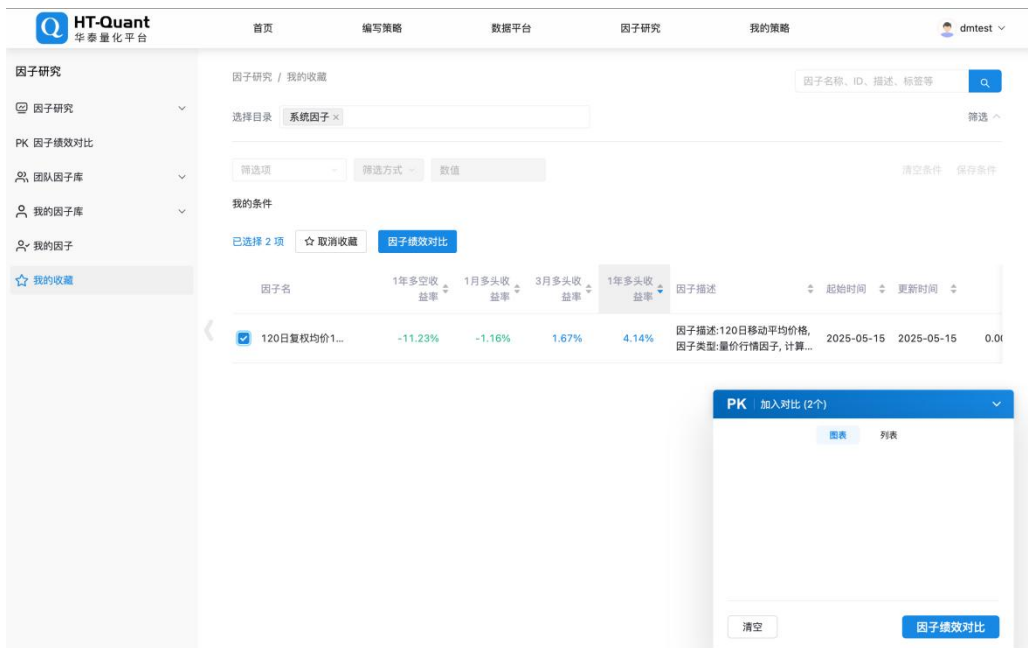
3. 取消收藏：

- 1) 用户选择目标因子，点击[取消收藏]，则显示取消收藏夹确认弹窗；
- 2) 用户点击[取消]，则不取消收藏夹，关闭弹窗；用户点击[确认]，则取消收藏该因子关闭弹窗；



4. 因子绩效对比：用户可选则多个因子进行因子对比

- 1) 用户勾选多个因子；
- 2) 用户勾选多个因子会在 PK 面板出现对应趋势图的走势；
- 3) 点击 PK 面板的[因子绩效对比]则会跳转进入到因子绩效对比模块；



5. 因子详情：用户点击对应因子的因子名称则可进入该因子的详情信息：

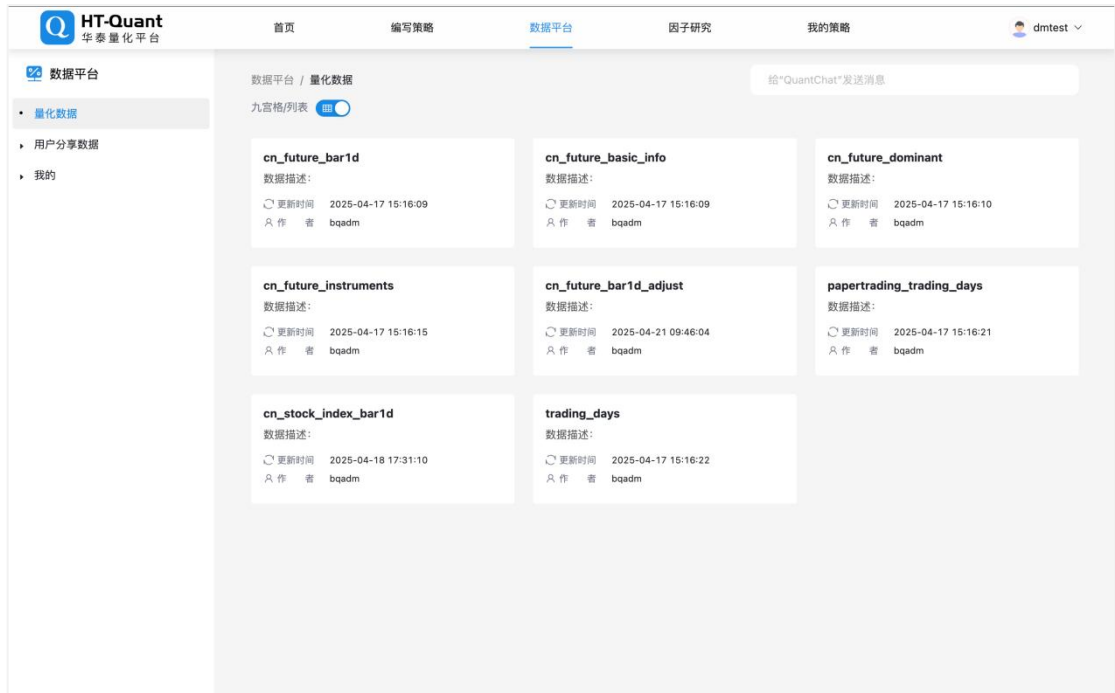
- 1) 用户点击对应因子的[因子名称]则进入因子详情页面；
- 2) 用户在因子详情页面可看见因子标签；
- 3) 因子详情：因子详情的内容来源于因子分析接口的内容，用户可自定义因子分析里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；



### 5.4.2.2.数据看板

用户进入数据平台，则可见有相关权限的数据字典信息：

1. 用户通过点击导航菜单【数据平台】模块则会进入到数据平台业务模块；
2. 用户默认进入到数据平台整体页面展示界面，该界面展示该用户所有有权限看到的数据字典信息；
3. 用户可以输入对应的数据表或字段的关键字信息在该平台查询相关数据，查询结果会全部以卡片的形式呈现在右侧的表卡片中（注：搜索匹配的字段目前也只会展示数据表的卡片信息，若需要看详细的字段信息，需要点进卡片里面）；
4. 目前的数据平台的菜单权限及其展示的内容统一由管理员配置：
  - 1) 用户点击左侧的菜单，菜单会自动展开或收起，同时右侧会展示对应的数据字典卡片；
  - 2) 鼠标移入对应的数据字典卡片，卡片会呈现蓝色选中状态；
  - 3) 用户点击数据字典卡片则会进入该卡片的数据字典详情页面；



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

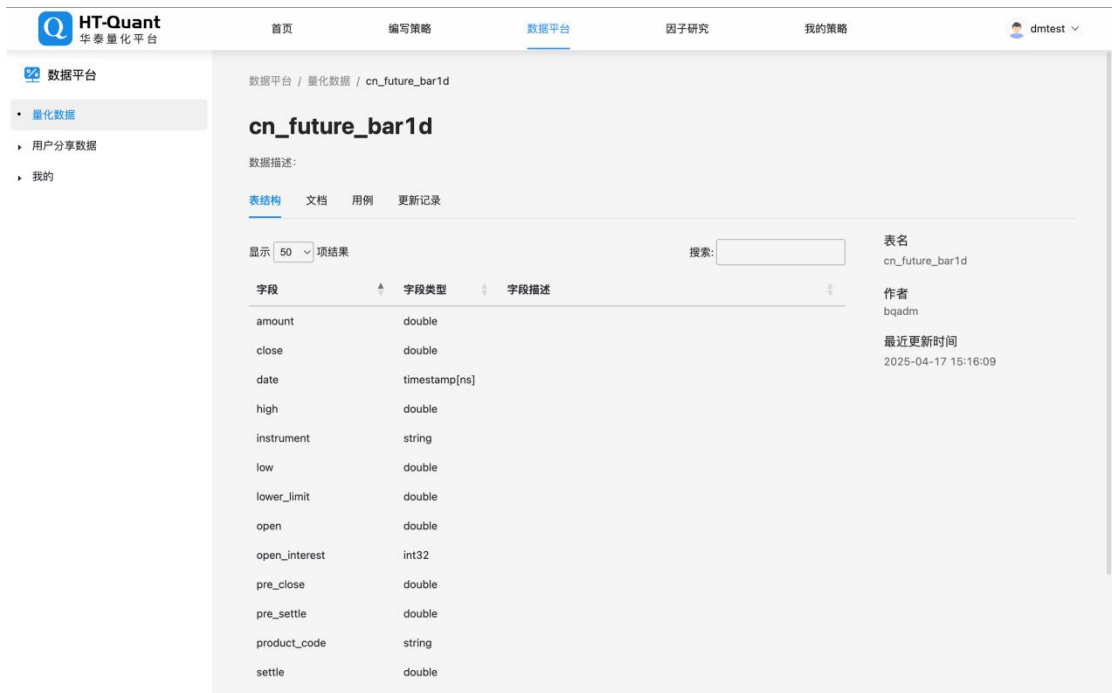
1) 数据字典详情页面表头会展示对应的表名，表中文名，创建日期，更新频率和表描述等相关信息；

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

3) 表结构：展示表对应的字段、字段类型、字段描述；

4) 数据文档：管理员编写的相关表的具体说明信息；（该内容由数据生产者配置）

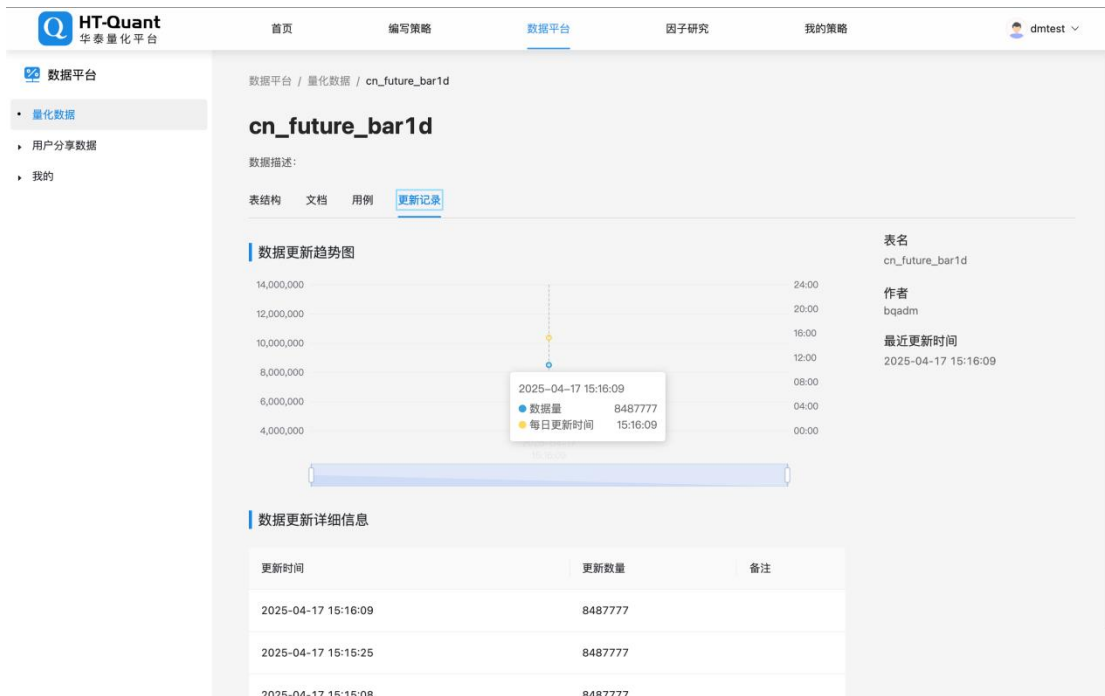
5) 使用用例：管理员编写的相关表的具体使用用例信息；（该内容由数据生产者配置）



The screenshot shows the HT-Quant Data Platform interface. The top navigation bar includes '首页', '编写策略', '数据平台', '因子研究', and '我的策略'. The user 'dmtest' is logged in. The left sidebar shows '数据平台' with sub-items '量化数据', '用户分享数据', and '我的'. The main content area displays the table 'cn\_future\_bar1d' with a breadcrumb '数据平台 / 量化数据 / cn\_future\_bar1d'. Below the table name is a '数据描述:' section with tabs for '表结构', '文档' (selected), '用例', and '更新记录'. On the right, a metadata table is shown:

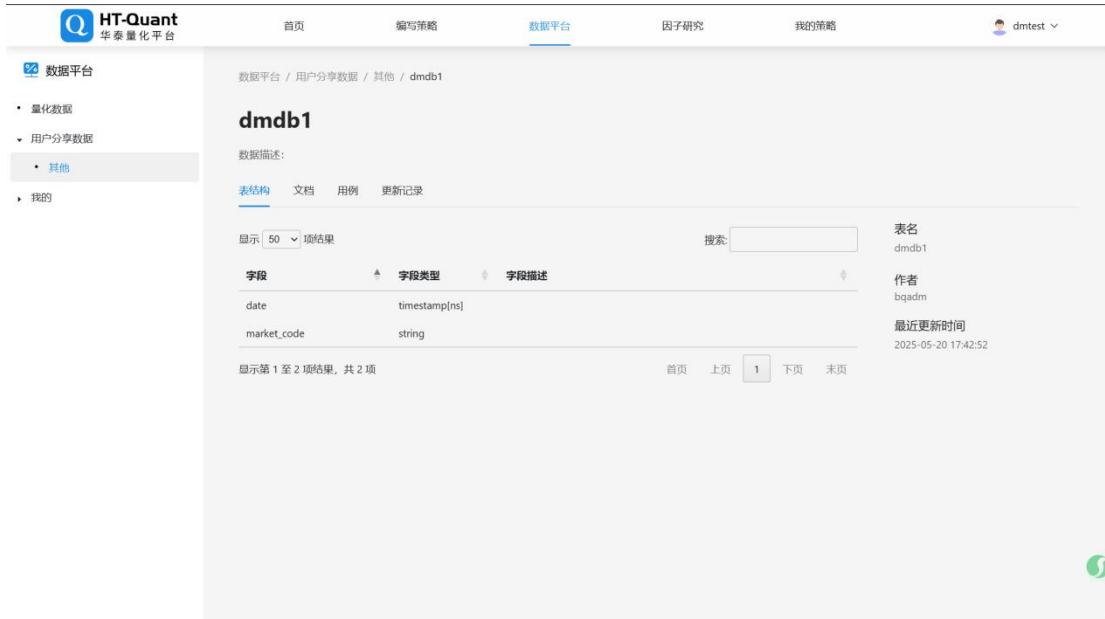
表名	cn_future_bar1d
作者	bqadm
最近更新时间	2025-04-17 15:16:09

This screenshot is identical to the one above, showing the same HT-Quant Data Platform interface. The only difference is that the '用例' (Use Case) tab is now selected in the '数据描述:' section, and the '文档' tab is no longer highlighted.



### 5.4.2.3.用户分享数据

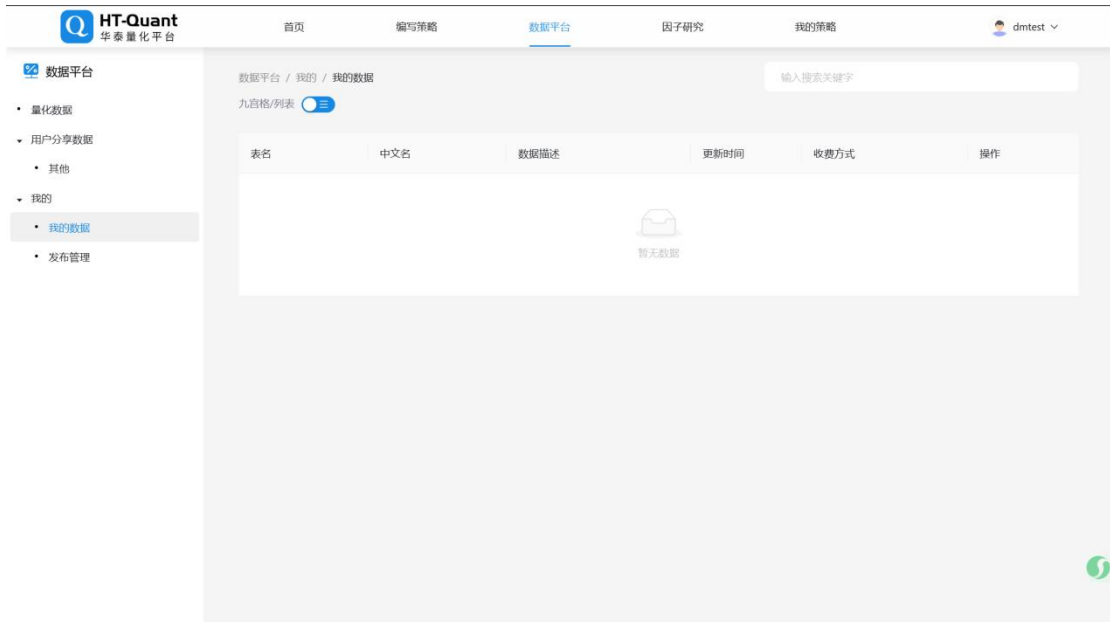
用户分享数据：展示用户在平台上分享的数据信息。



### 5.4.2.4.我的

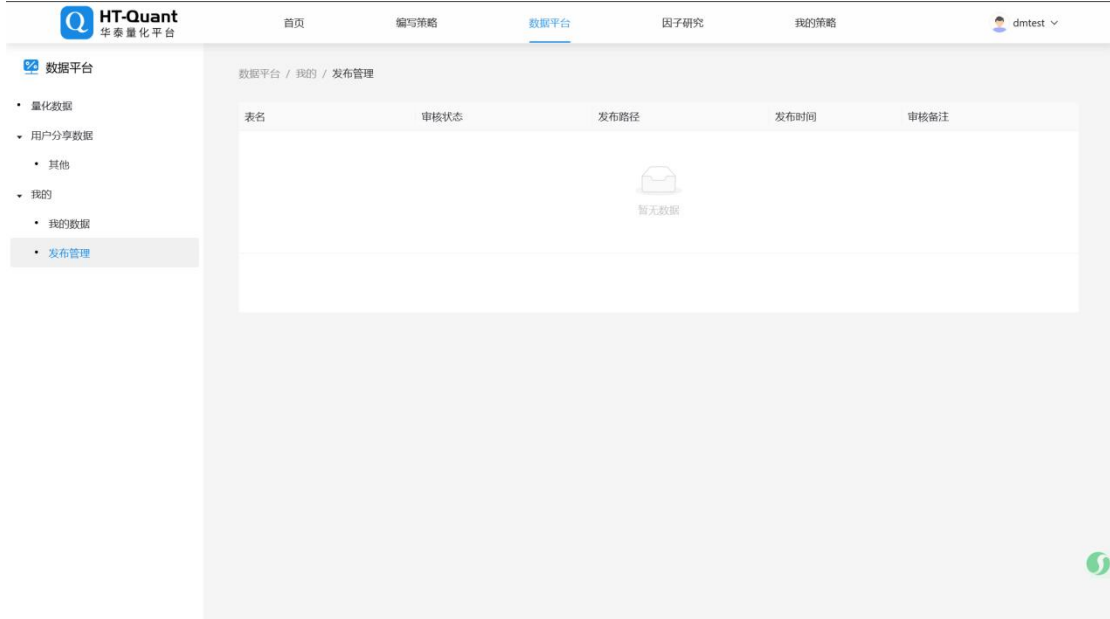
- 我的数据

展示我拥有权限的数据及购买的数据信息。



● **发布管理**

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



**5.5.因子研究**

**5.5.1.功能概述**

因子研究模块的主要功能主要是以下几点：

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

## 5.5.2.操作说明

### 5.5.2.1.因子创建

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

1. 首先在投研平台首页点击【编写策略】，则会新开窗口进入 AIstudio 开发环境；
2. 用户在开发环境点击[+]，然后选择因子研究菜单点击[因子]，然后系统会显示对应的系统预创建的因子名称(用户可手动编辑，只可输入英文或数字)，我们敲击回车键(Enter)表示确认创建或者退出 (Esc) 表示取消创建；
3. 创建成功后，在代码编辑区域会出现系统默认的因子编辑模板，用户可根据自己的需求去改编自己的逻辑代码；

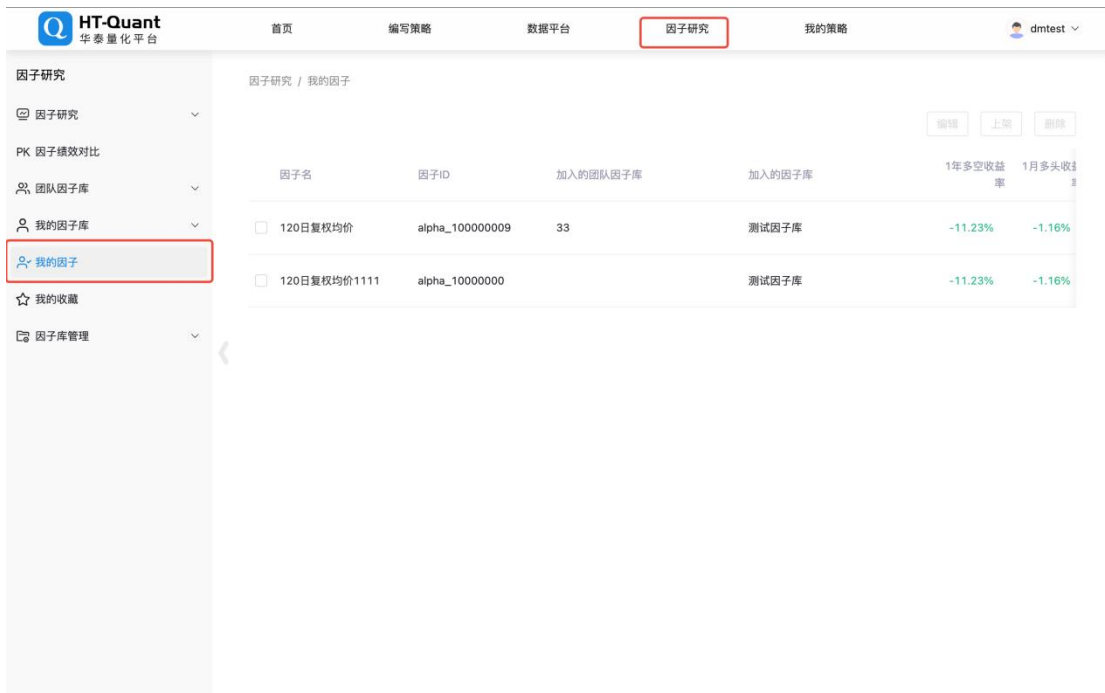
```

22 .....
23 .....
24 .....print('=====因子分析开始=====')
25 .....self.t0 = time.time()
26 .....self.params = params
27 .....self.top_n_ins = 5
28 .....self.factor_data = factor_data.rename(columns={self.params['factor_field']: 'factor'})
29 .....self.factor_data['factor'] += self.params['factor_direction']
30 .....
31 .....
32 .....try:
33 .....    self.check_data_format(self.factor_data)
34 .....    t1 = time.time()
35 .....    print('耗时: {}秒 数据格式检查通过'.format(np.round(t1-self.t0)))
36 .....except ValueError as e:
37 .....    print("数据格式检查失败: " + str(e))
38 .....
39 .....
40 .....self.stock_pool_filter()
41 .....t2 = time.time()
42 .....print('耗时: {}秒 股票池过滤完成'.format(np.round(t2-t1)))
43 .....
44 .....
45 .....if self.params['data_process'] == True:
46 .....    self.factor_data = self.factor_data_process('factor')
47 .....    t3 = time.time()
48 .....    print('耗时: {}秒 数据预处理完成'.format(np.round(t3-t2)))
49 .....elif self.params['data_process'] == False:
50 .....    t3 = time.time()
51 .....
52 .....
53 .....self.start_date = self.factor_data.date.min().strftime('%Y-%m-%d')
54 .....self.end_date = self.factor_data.date.max().strftime('%Y-%m-%d')
55 .....self.price_data = self.get_daily_ret(self.start_date, self.end_date)
56 .....t4 = time.time()
57 .....print('耗时: {}秒 个股日收益率计算完成'.format(np.round(t4-t3)))
58 .....
59 .....self.merge_data = pd.merge(self.factor_data.sort_values(['date', 'instrument']), \
60 .....                             self.price_data.sort_values(['date', 'instrument']), on=['date', 'instrument'], how='left')
61 .....self.group_data = self.get_group_data()
62 .....t5 = time.time()
63 .....print('耗时: {}秒 因子分组完成'.format(np.round(t5-t4)))
64 .....self.bm_ret = self.get_bm_ret(self.params['benchmark'])
65 .....t6 = time.time()
    
```

### 5.5.2.2.我的因子

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

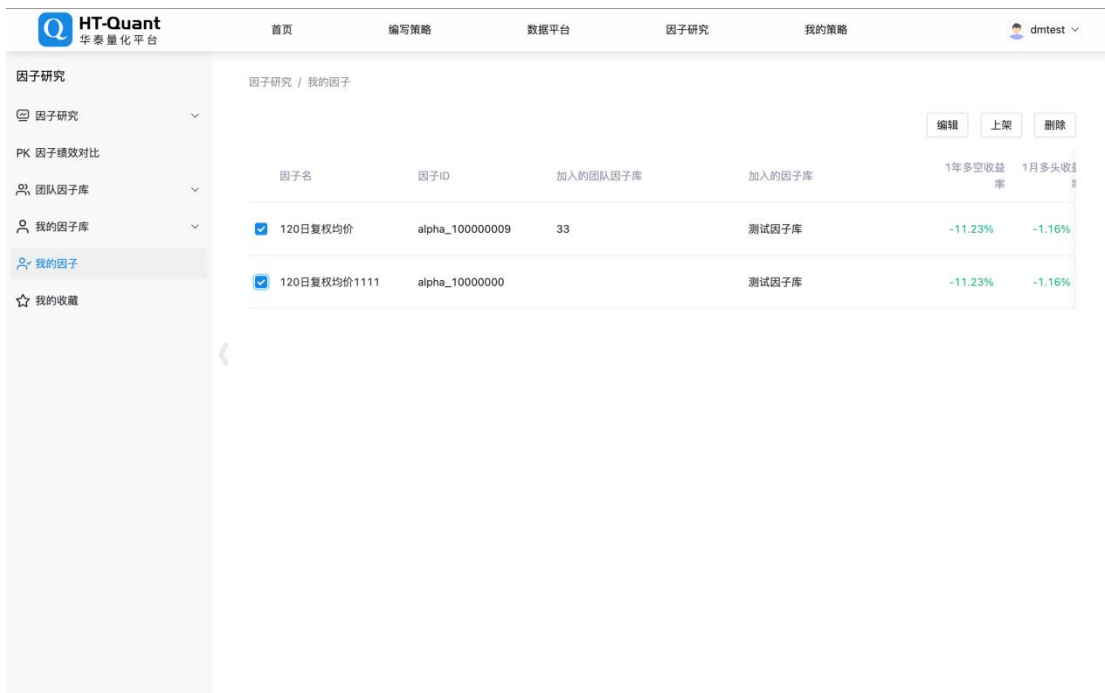
1. 用户通过点击导航菜单【因子研究】模块则会进入到因子研究模块；【因子研究】主要业务内容包括：因子看板、公共因子库（系统审批通过发布的因子库）、团队因子库、我的因子库、我的因子、我的收藏；
2. 用户通过点击导航菜单【因子研究】-[我的因子]则进入我的因子业务内容展示模块；
3. 用户所有通过因子提交接口进行保存过的因子都会出现在该业务模块；

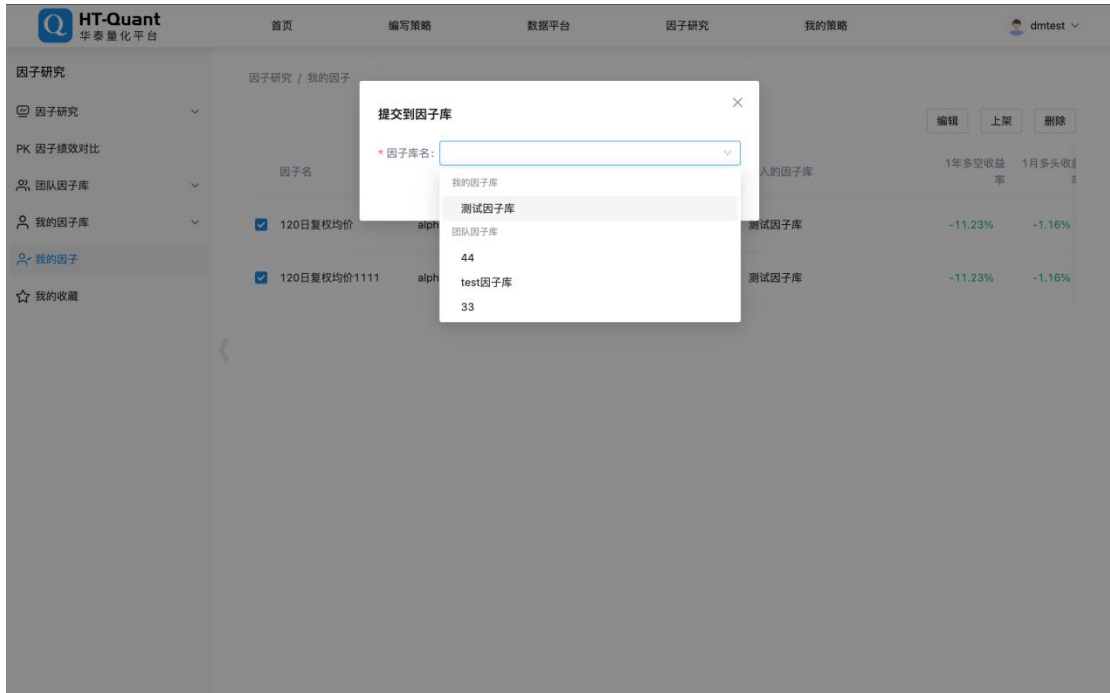


4. 用户可选择相关因子，然后将对应的因子提交至目标因子库：

1) 用户勾选对应的目标因子，点击[提交因子库]，则会显示因子库弹窗；

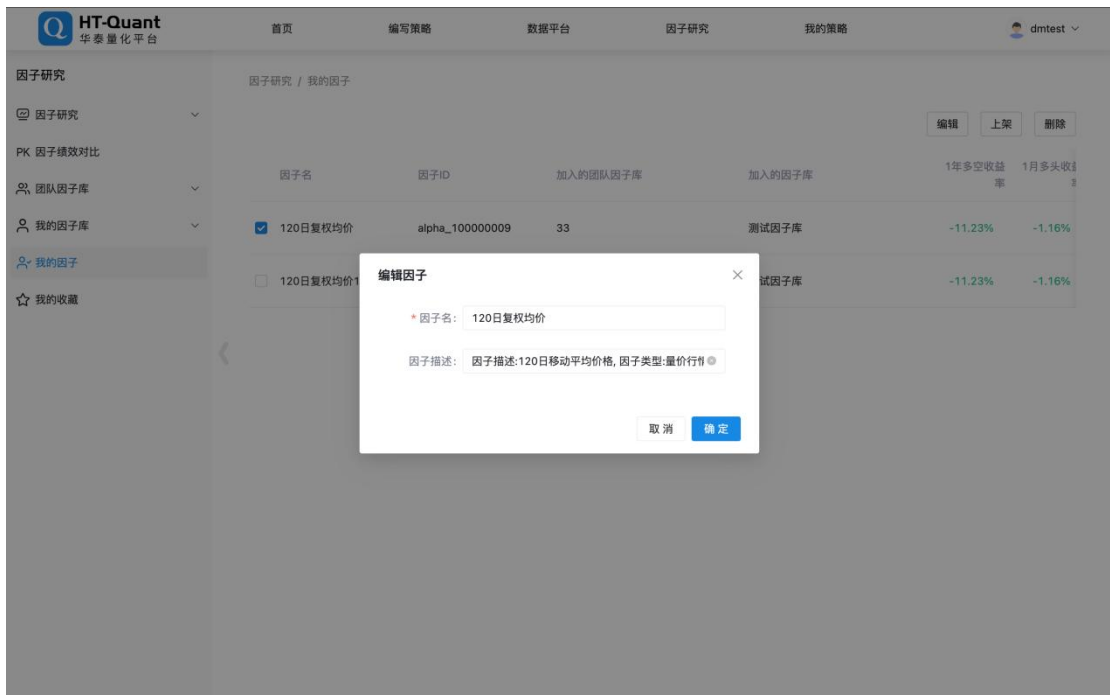
2) 用户在因子库弹窗选择目标因子库，点击[取消]则关闭弹窗，不将选怎的因子加入对应的因子库；点击[确认]则关闭弹窗，并且将选怎的因子加入对应的因子库；

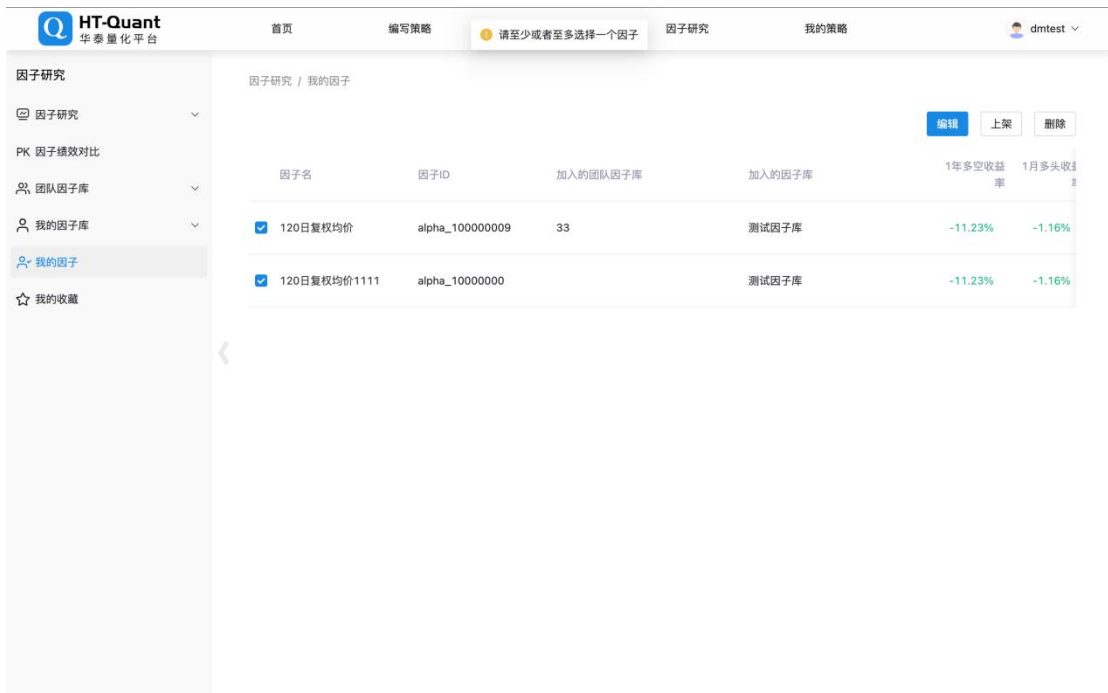




5. 编辑：用户可选择对应的因子进行编辑操作：

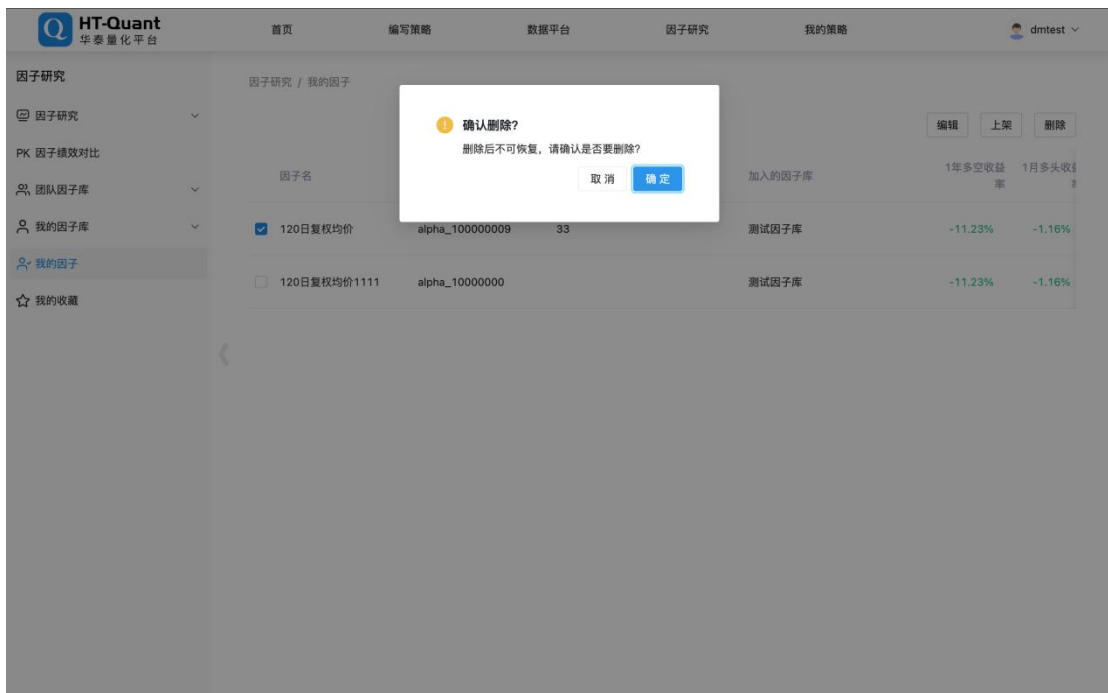
- 1) 用户选择目标因子（只可选择单个因子进行编辑操作）；
- 2) 选择好目标因子后，点击[编辑]则显示编辑因子弹窗；用户可修改因子名和因子描述；点击[取消]则关闭弹窗，不保存因子更改数据；点击[确定]则关闭弹窗，并且保存因子更改后的数据；






6. 删除：用户可选择对应的因子进行删除操作：

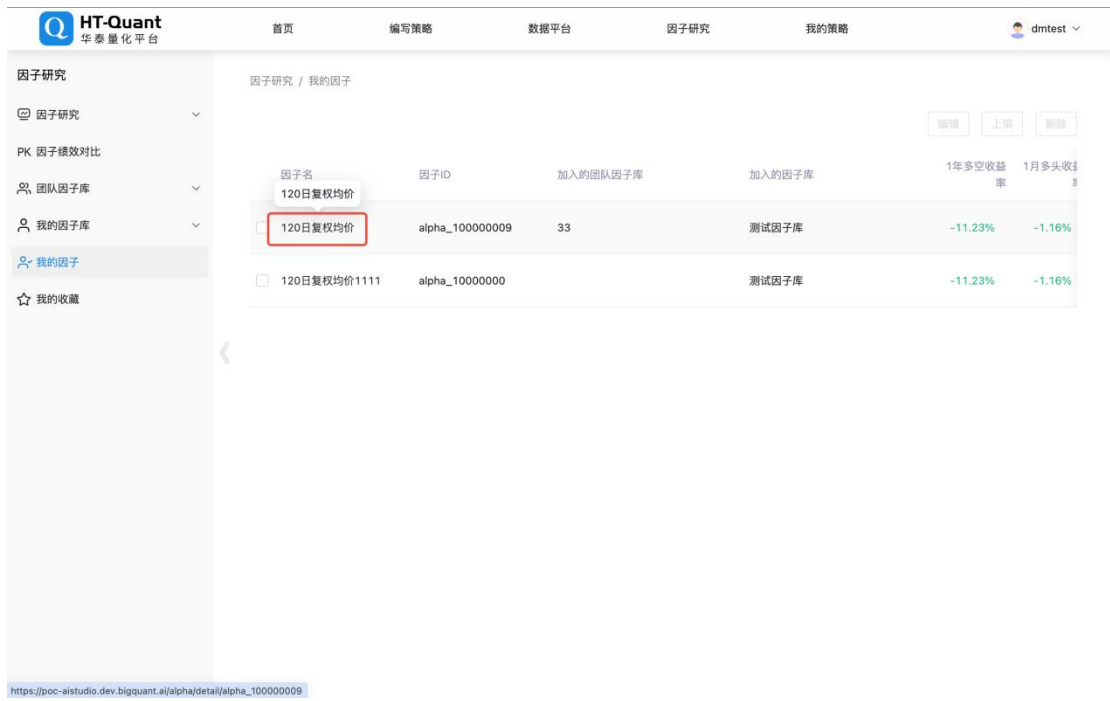
- 1) 用户选择目标因子（可选择多个因子）；
- 2) 选择好目标因子后，点击[删除]则显示因子删除弹窗；点击[取消]则关闭弹窗，不删除该因子数据；点击[确认]则关闭弹窗，并且删除该因子数据；



7. 因子详情：用户点击对应因子的因子名称则可进入该因子的详情信息：

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

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





### 5.5.2.3.我的因子库

用户通过点击导航菜单【因子研究】模块则会进入到因子研究模块；

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

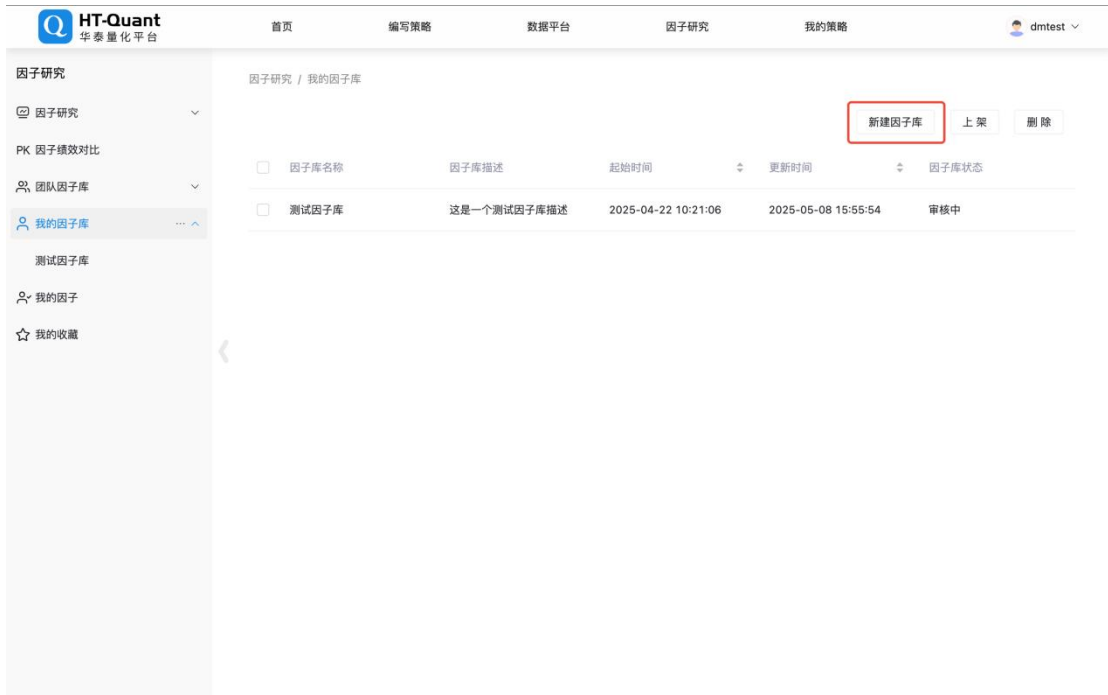
2. 用户创建的所有因子库都会展现在该业务模块；



3. 用户可通过点击[新建因子库]创建对应的因子库数据：

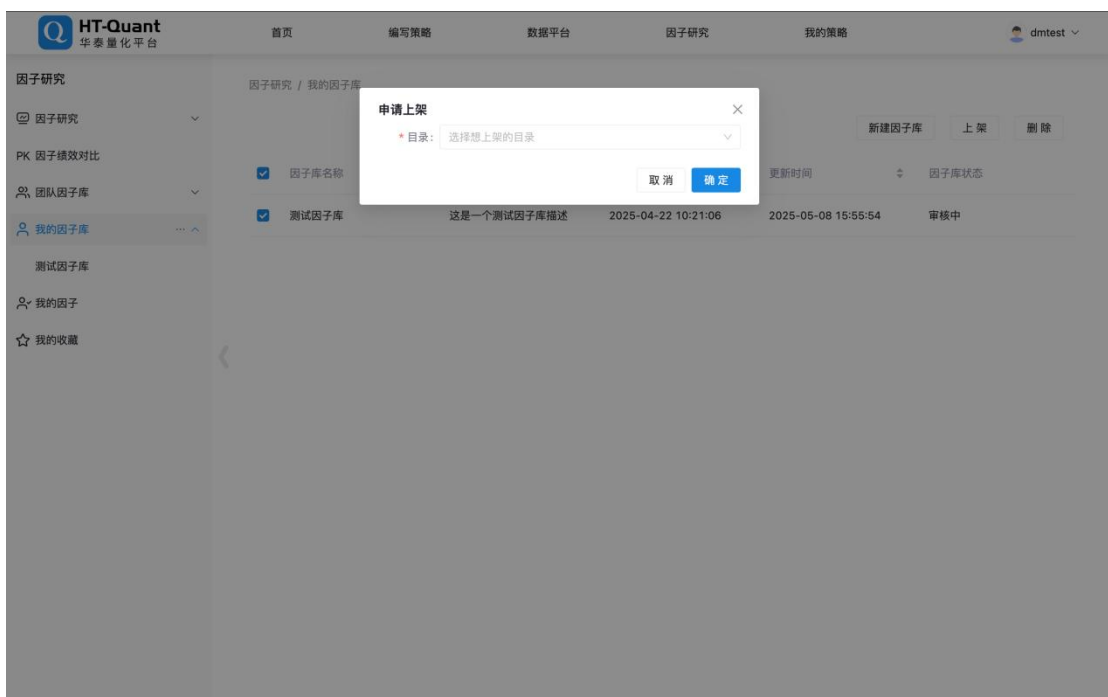
- 1) 用户可通过点击[新建因子库]，则显示新建因子库弹窗；
- 2) 因子库名称：用户输入因子库名称；
- 3) 因子库描述：用户输入对应的因子库描述；
- 4) 取消：用户点击，则不创建该因子库，关闭弹窗；

- 5) 确认：用户点击，则创建该因子库，并且关闭弹窗；
- 6) 新建的因子库会自动成为我的因子库的二级菜单；



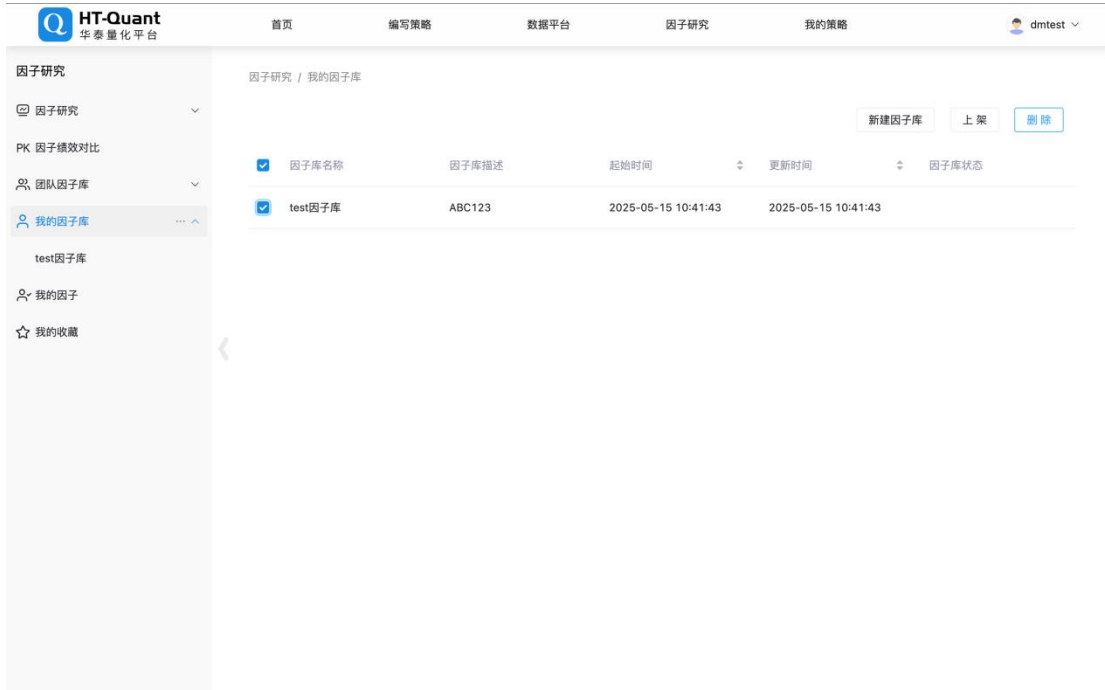
4. 用户可通过选择对应的因子库，然后点击[上架]，可将对应的因子库及其数据发布至公共平台：

- 1) 用户选择目标因子库；
- 2) 用户点击[上架]，输入对应的上架目录；目录指的是想要将因子上架至哪个菜单目录下，管理会进行统一目录管理，这里只是用户的预输入项，具体上架至哪个目录由管理审批时统一确定；
- 3) 取消：用户点击，则不将该因子库提交上架审批，关闭弹窗；
- 4) 确认：用户点击，则将该因子库提交上架审批，并且关闭弹窗；



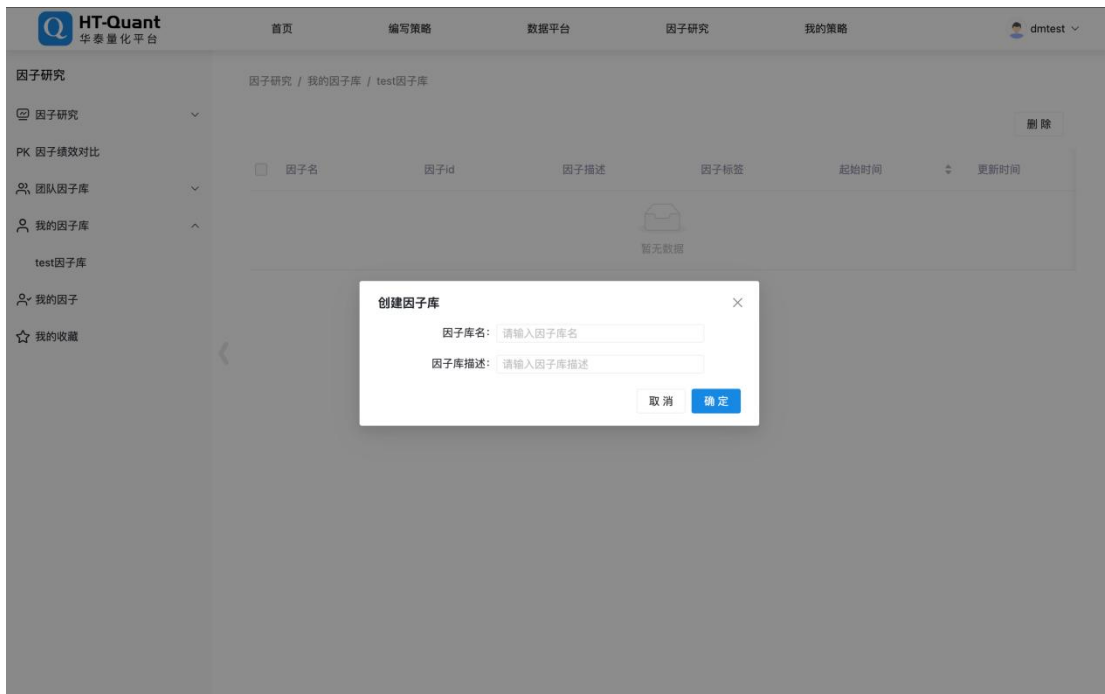
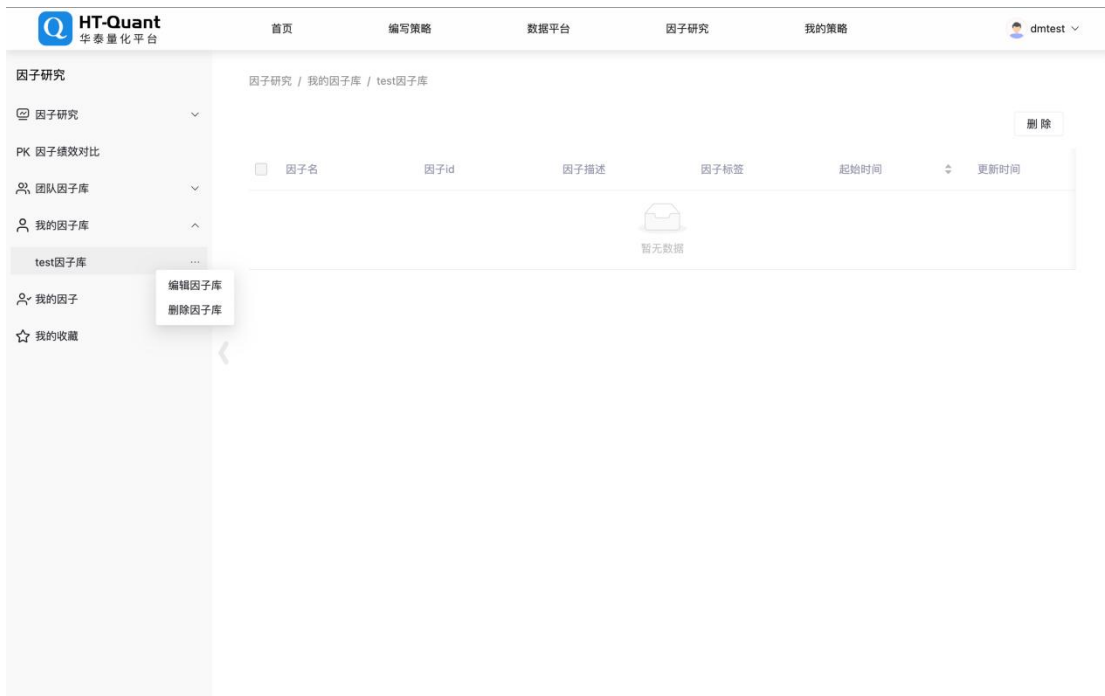
5. 用户可通过选择对应的因子库，然后点击[删除]，可将对应的因子库及其数据删除：

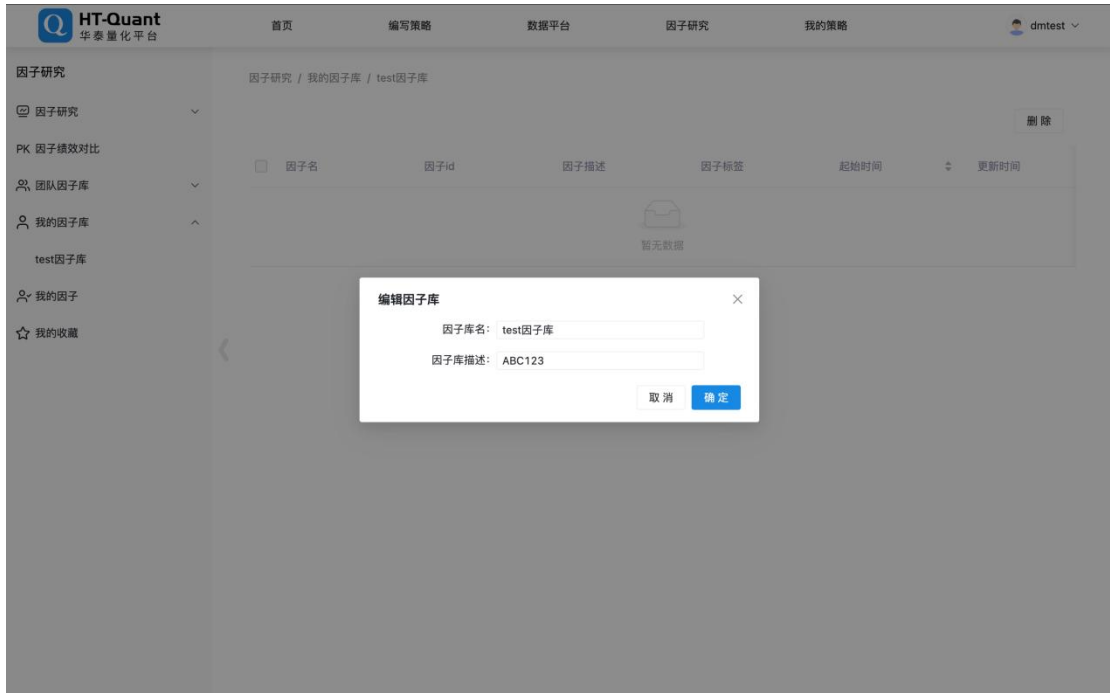
- 1) 用户选择目标因子库；
- 2) 用户点击[删除]，弹窗显示删除提示：是否删除选择的因子库；
- 3) 取消：用户点击，则不删除选择的因子库，关闭弹窗；
- 4) 确认：用户点击，则删除选择的因子库，并且关闭弹窗；



6. 用户可通过点击左侧因子库菜单或因子库名称，可进行相关操作：

- 1) 用户点击目标因子库名称或点击左侧具体的因子库菜单则进入到具体的因子库；
- 2) 用户点击[...]操作，则显示操作按钮：[编辑因子库] [删除因子库]；
- 3) 用户点击[编辑因子库]则弹窗显示因子库编辑窗口，用户可编辑因子库名称和因子库描述，编辑完成后用户点击[取消]则不保存编辑内容，关闭弹窗；用户点击[确认]则保存编辑内容并关闭弹窗；
- 4) 用户点击[删除]，弹窗显示删除提示：是否删除选择的因子库；用户点击[取消]，则不删除选择的因子库，关闭弹窗；用户点击[确认]，则删除选择的因子库，并且关闭弹窗；





7. 用户进入到具体的因子库，可进行相关操作：

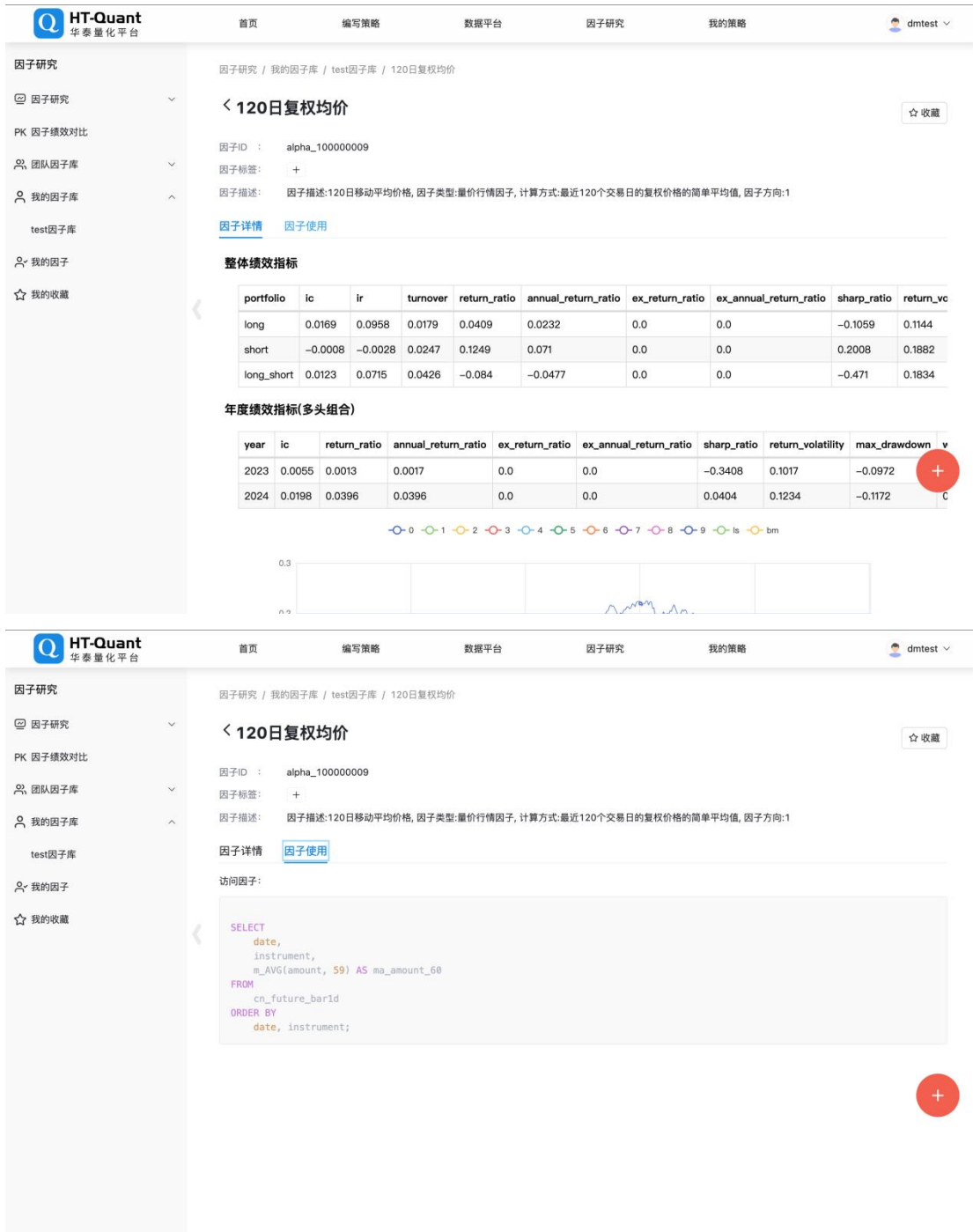
- 1) 用户点击目标因子库名称或点击左侧具体的因子库菜单则进入到具体的因子库；
- 2) 用户点击[删除]，弹窗显示删除提示：是否删除选择的因子；用户点击[取消]，则不删除选择的因子，关闭弹窗；用户点击[确认]，则删除选择的因子，并且关闭弹窗；



8. 用户点击具体的因子名称或者是因子 ID 则可进入到因子详情页面：

- 1) 用户点击对应因子的[因子名称]或[因子 ID]超链接则进入因子详情页面；
- 2) 用户在因子详情页面可进行因子标签编写，用户点击[+], 则激活标签输入框，用户可在标签输入框中，输入对应的因子标签，输入完成后点击回车则完成标签设置，注：标签为全局变量，标签不支持编辑，但是标签可删除后重新设置；
- 3) 因子详情：因子详情内容来源于因子分析接口的内容，用户可自定义因子分析

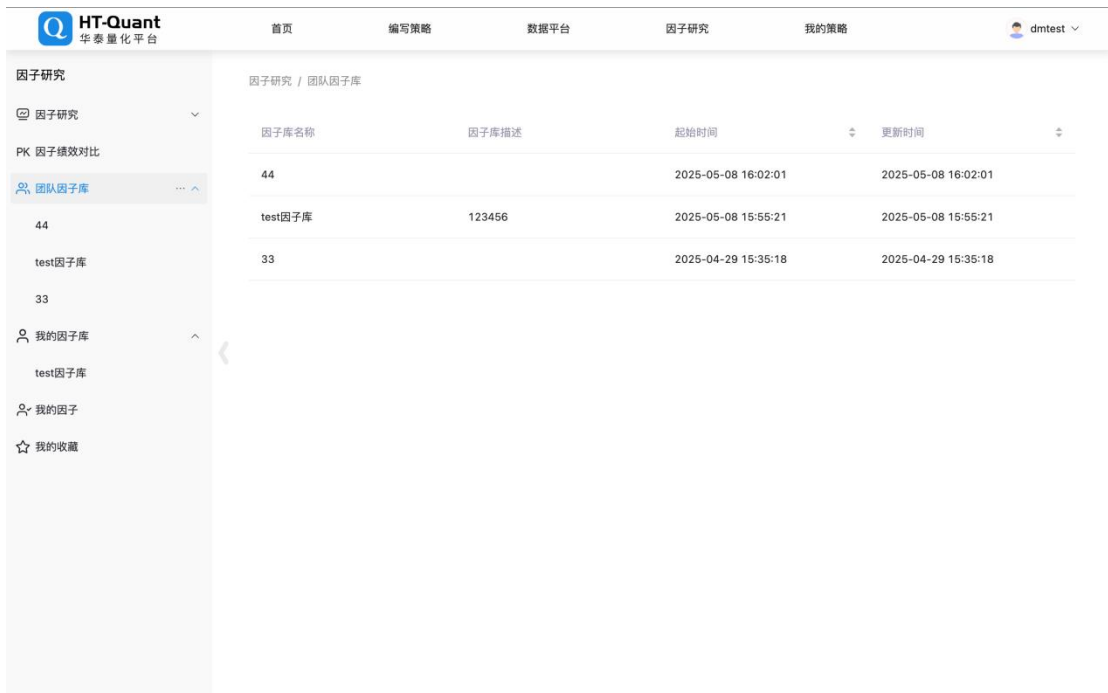
里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；



### 5.5.2.4.团队因子库

用户通过点击导航菜单【因子研究】模块则会进入到因子研究模块；

1. 用户通过点击导航菜单【因子研究】-[团队因子库]则进入团队因子库业务内容展示模块；
2. 其他用户分享给该用户的所有因子库都会展现在该业务模块；
3. 团队因子库，用户不可自己创建，他人创建好的因子库给该用户分配好权限，则对应的因子库自动可见并出现在团队因子库的二级菜单下；



4. 用户进入到具体的因子库，可进行相关操作：

- 1) 用户点击目标因子库名称或点击左侧具体的因子库菜单则进入到具体的因子库；
- 2) 搜索：系统支持搜索因子名称、描述、作者和标签；
- 3) 高级筛选搜索：
  - a. 选择筛选项
  - b. 筛选方式
  - c. 具体数值：用户填写



5. 用户点击具体的因子名称则可进入到因子详情页面：

- 1) 用户点击对应因子的[因子名称]则进入因子详情页面；
- 2) 因子详情：因子详情内容来源于因子分析接口内容，用户可自定义因子分析

里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；



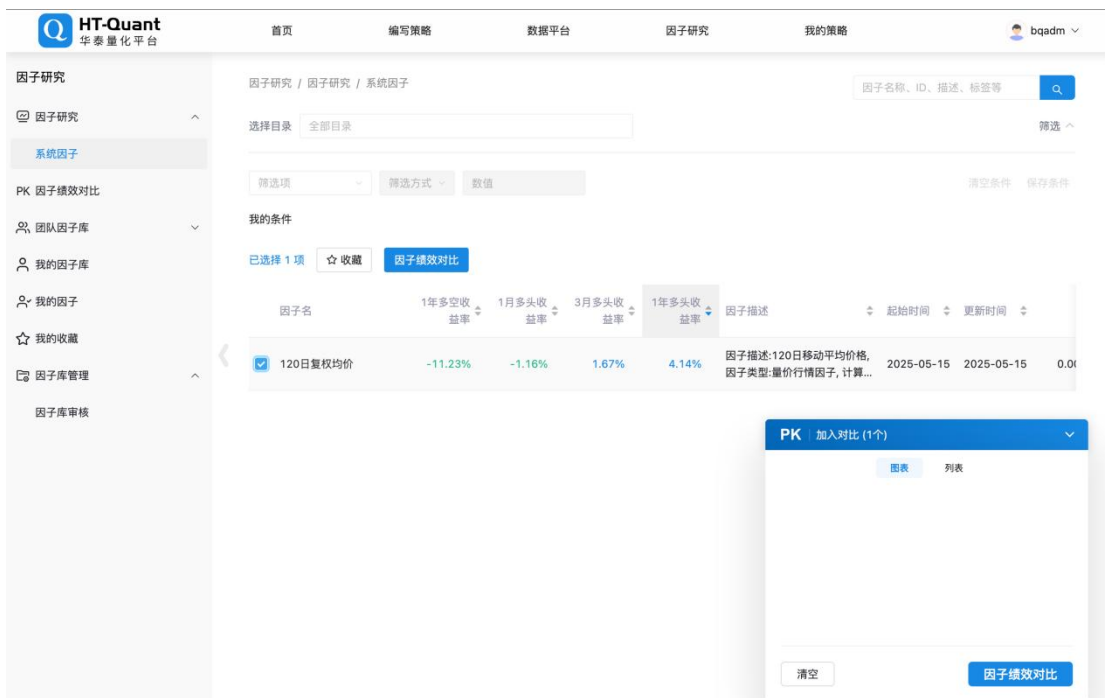
### 5.5.2.5.因子研究

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

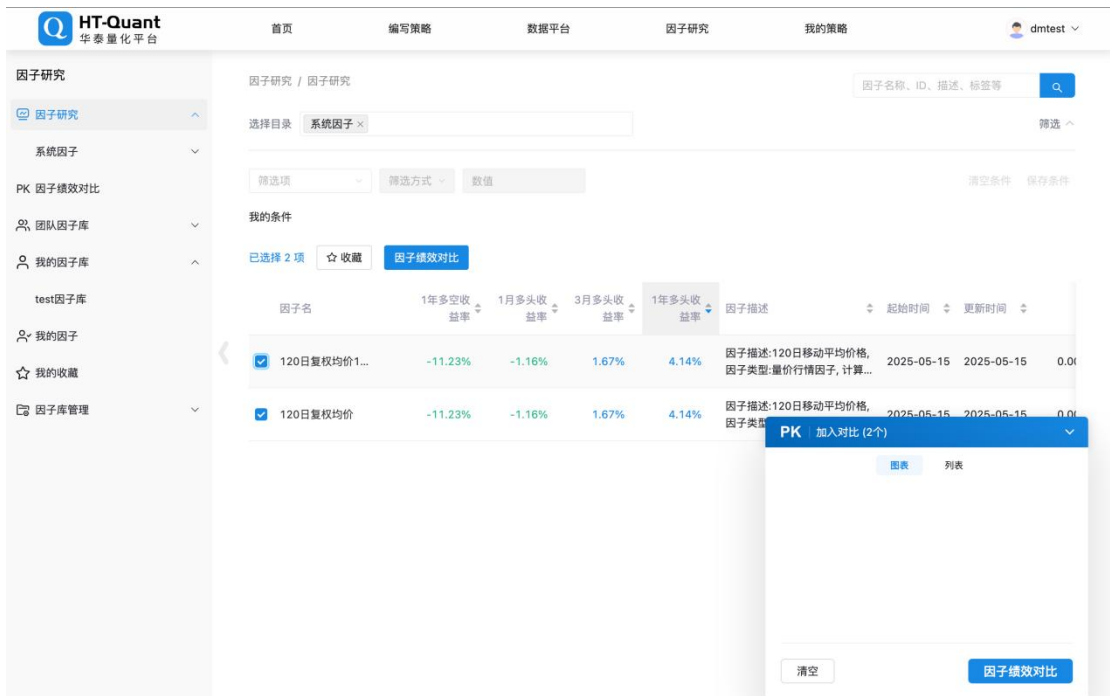
1. 用户通过点击导航菜单【因子研究模块则会进入到该业务模块；
2. 所有审核通过的因子库中包含的因子都会出现在该业务模块；
3. 用户可通过对列表因子进行搜索：
  - 1) 普通搜索：可通过因子名称、因子标签等对因子列表进行搜索；
  - 2) 高级筛选搜索：
    - a. 选择搜索目录
    - b. 选择筛选项
    - c. 筛选方式
    - d. 具体数值：用户填写



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

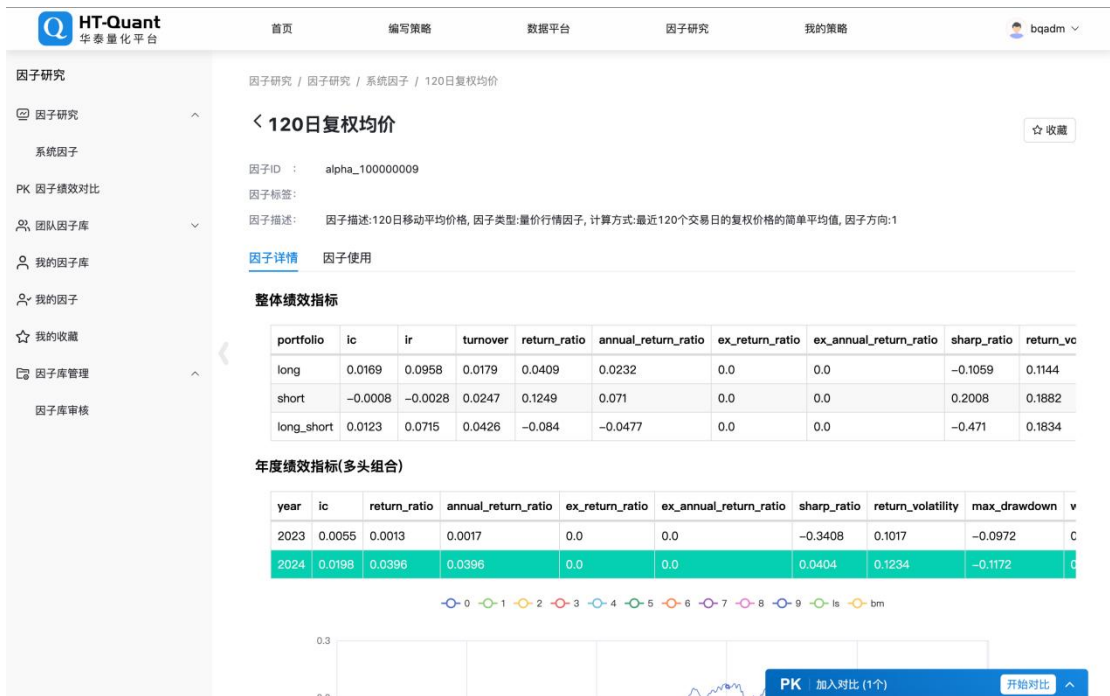


5. 因子绩效对比：用户可选则多个因子进行因子对比
- 1) 用户勾选多个因子；
  - 2) 用户勾选多个因子会在 PK 面板出现对应趋势图的走势；
  - 3) 点击 PK 面板的[因子绩效对比]则会跳转进入到因子绩效对比模块；



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

- 1) 用户点击对应因子的[因子名称]或[因子 ID]超链接则进入因子详情页面；
- 2) 用户在因子详情页面可看见因子标签，这里的因子标签是因子创建者同步的标签，不可编辑；
- 3) 因子详情：因子详情的内容来源于因子分析接口的内容，用户可自定义因子分析里面的全部内容，因此，因子详情的详细信息跟用户自定义的因子分析的内容相关联，并非所有因子的因子详情的都完全一样；



## 5.6.我的策略

### 5.6.1.功能概述

我的策略是用户对自己的相关策略进行持续绩效跟踪和监控调整的模块。

### 5.6.2.操作说明

#### 5.6.2.1.提交交易任务

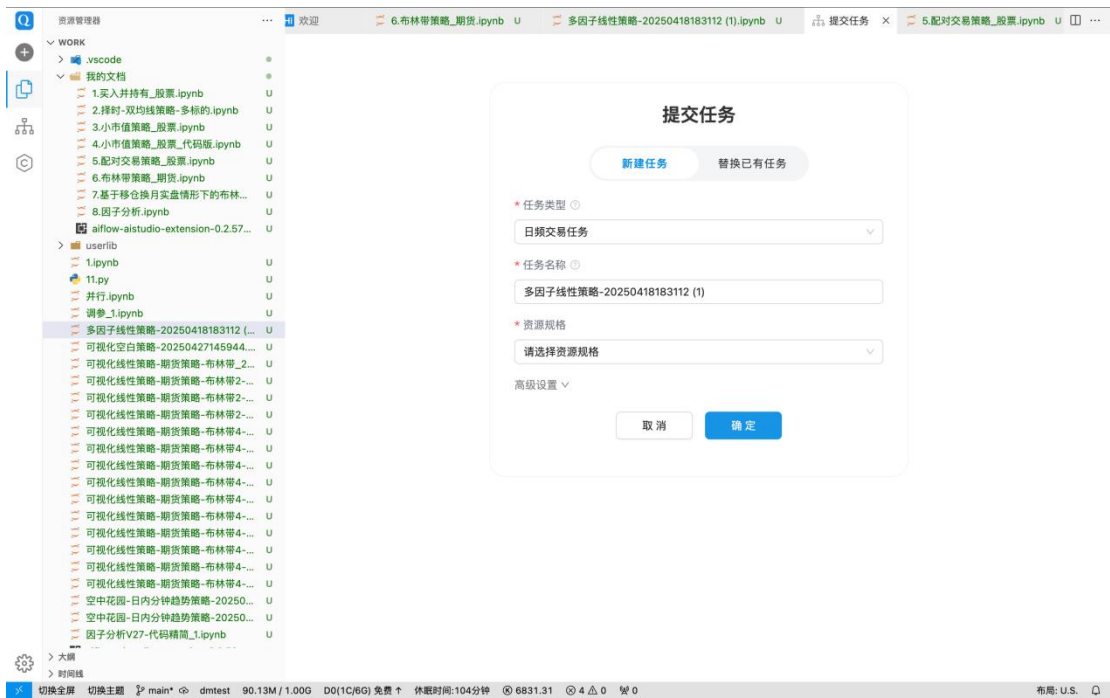
进入开发空间，新建一个策略文件



点击右上角提交任务



任务类型选择

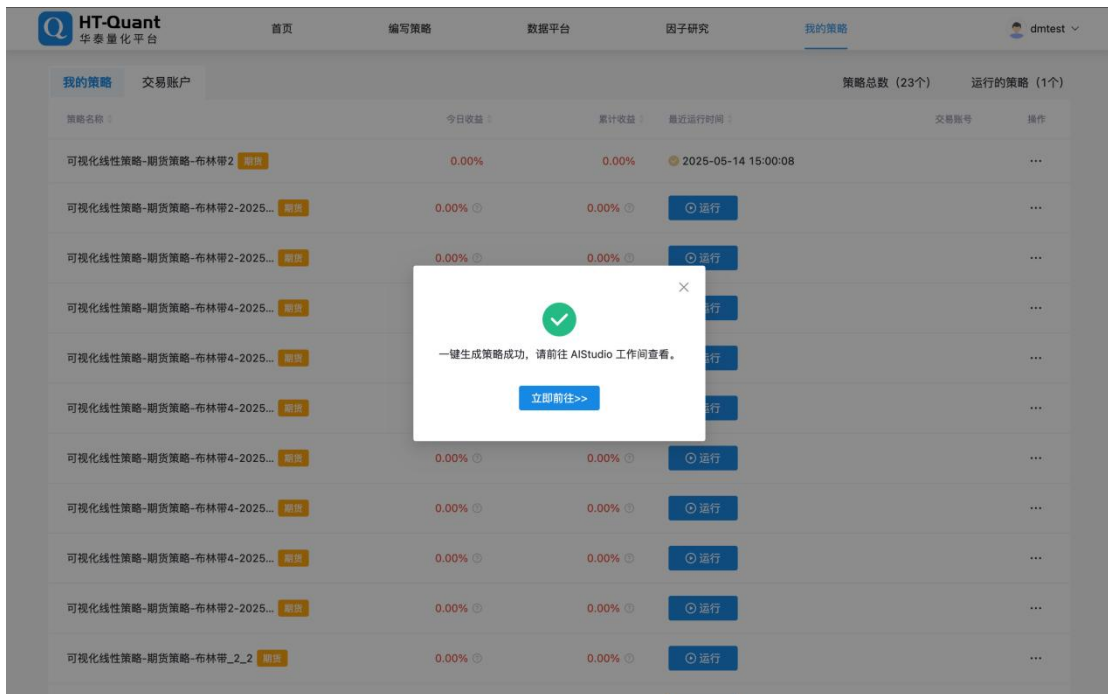
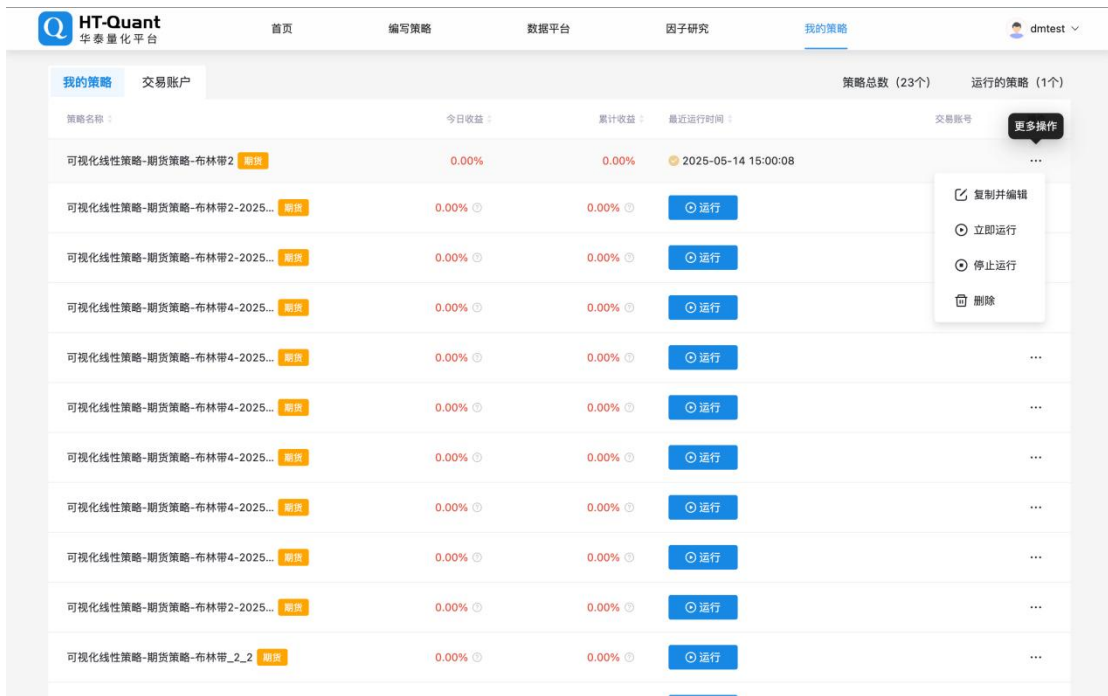


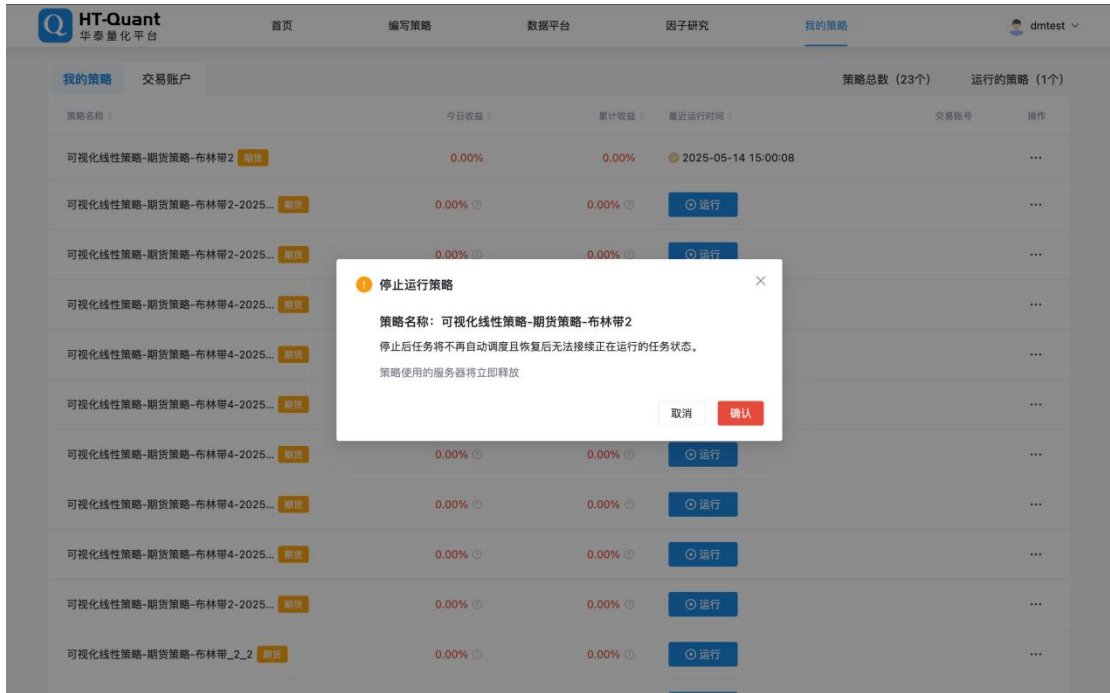
### 5.6.2.2.我的策略

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

1. 查看策略的基本收益信息
2. 可针对策略任务进行操作
  - (1) 复制并编辑：点击则会在 AIstudio 一键复制策略，用户可以启动工作空间前往 AIstudio 进行策略编辑。
  - (2) 立即运行：即启动策略任务立即运行一次
  - (3) 停止运行：即停止任务调度，任务将不再进行自动调度
  - (4) 删除：删除任务会进行二次确认，删除后任务不可恢复

策略名称	今日收益	累计收益	最近运行时间	交易账号	操作
可视化线性策略-期货策略-布林带2	0.00%	0.00%	2025-05-14 15:00:08		...
可视化线性策略-期货策略-布林带2-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带2-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带4-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带2-2025...	0.00%	0.00%			运行
可视化线性策略-期货策略-布林带2_2	0.00%	0.00%			运行





### 3. 策略详情

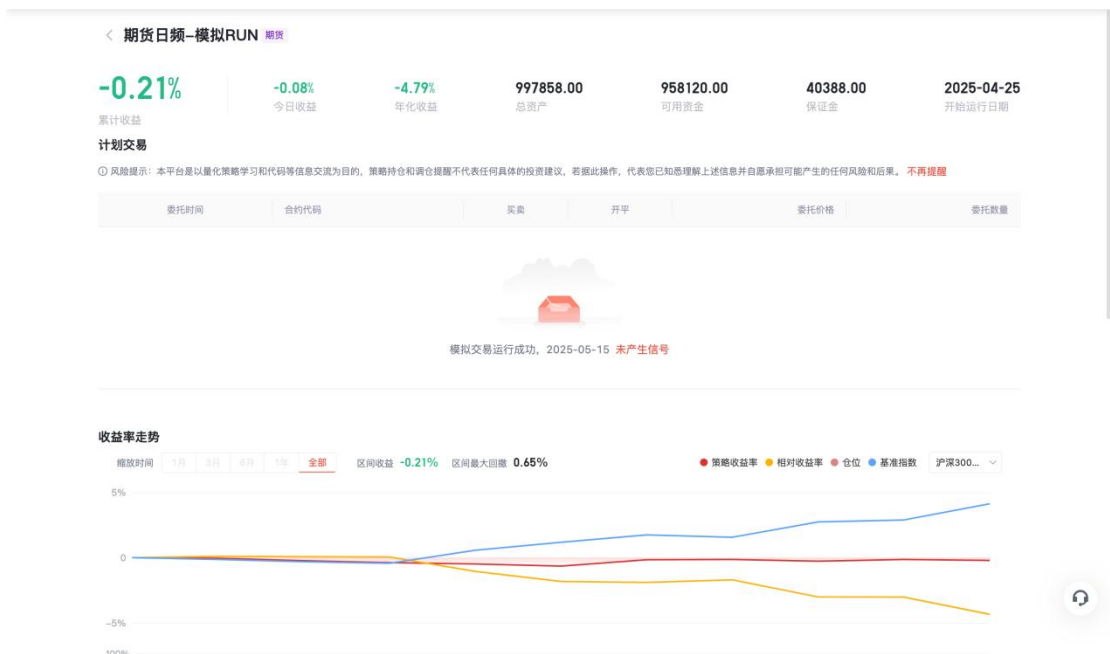
用户点击策略名称，即可进入策略详情：

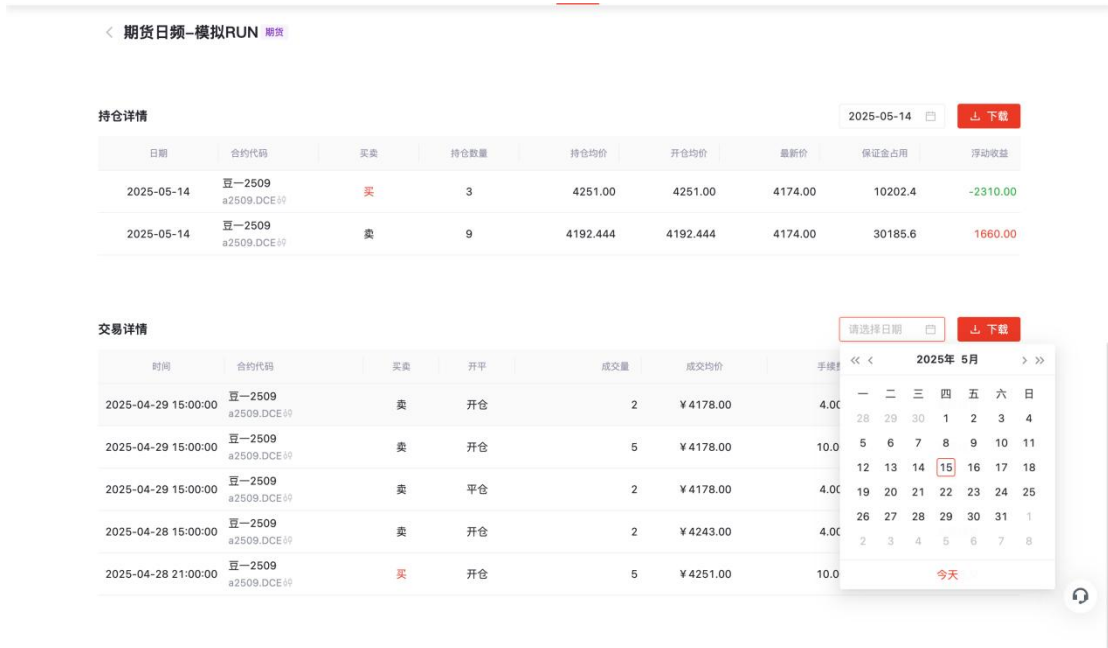
#### 1. 日频交易任务

- (1) 查看计划交易
- (2) 查看策略收益走势
- (3) 查看持仓详情
- (4) 查看交易详情

#### 2. 实时交易任务

- (1) 查看策略委托
- (2) 查看策略成交
- (3) 查看策略日志





## 5.7.策略交易

### 5.7.1.实时策略模拟交易

整体流程包括：绑定账户、编写策略、提交策略、策略运行四个阶段。

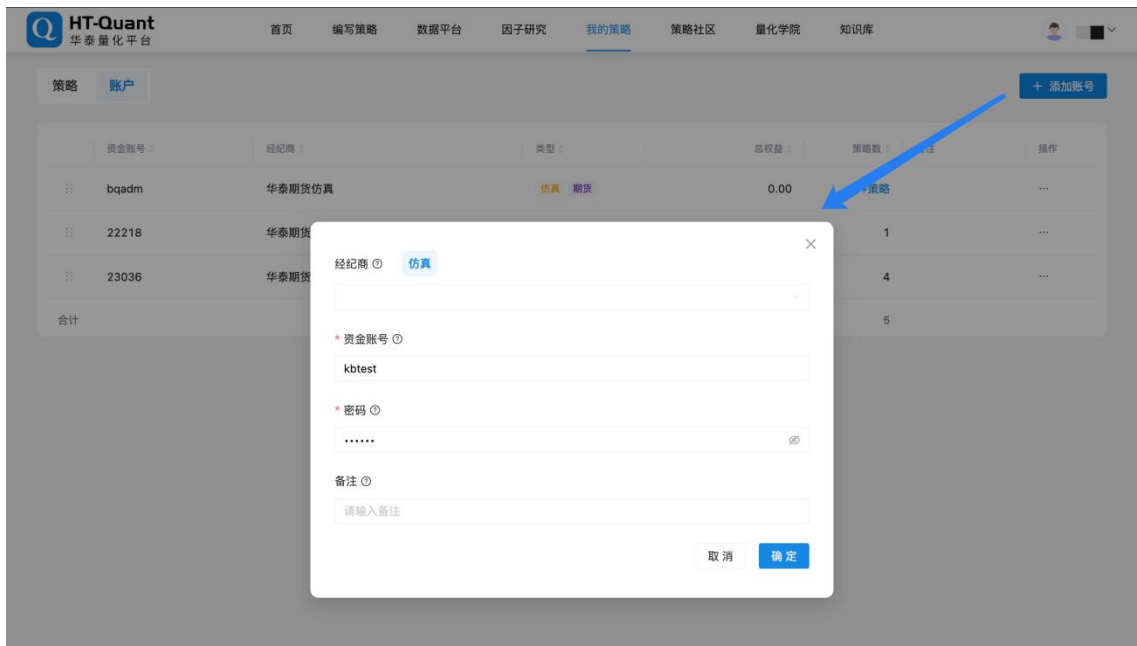
#### 5.7.1.1.绑定账户

用户点击【我的策略】-【账户】则进入到账户模块：

1. 通过点击「添加账号」来实现仿真账户绑定，点击后会出现账号绑定弹窗：
  - (1) 经纪商：用户可选择需要绑定的经纪商柜台（当前我们只对接 SimNow，因此只有 SimNow 的经纪商）
  - (2) 资金账号：即对应经纪商的资金账号
  - (3) 密码：即对应资金账号的密码；可通过点击可见图标来查看输入的密码是否正确
  - (4) 备注：用户自己输入的备注信息

注：

1. 输入资金账号和密码时请务必保证其正确性，平台只做加密存储，不做对应正确性校验；
2. 仅会在运行策略连接柜台时，柜台会抛出对应的连接错误信息；
3. 同一个用户在同一个经纪商下只允许存在一个资金账号；
4. 由于浏览器的不同，资金账号和密码可能会被浏览器自动填充（这是浏览器附加功能），平台本身未做任何账号密码自动填充功能



### 5.7.1.1.1.账户绑定后

用户模拟资金账户绑定后，平台将自动去连接柜台：

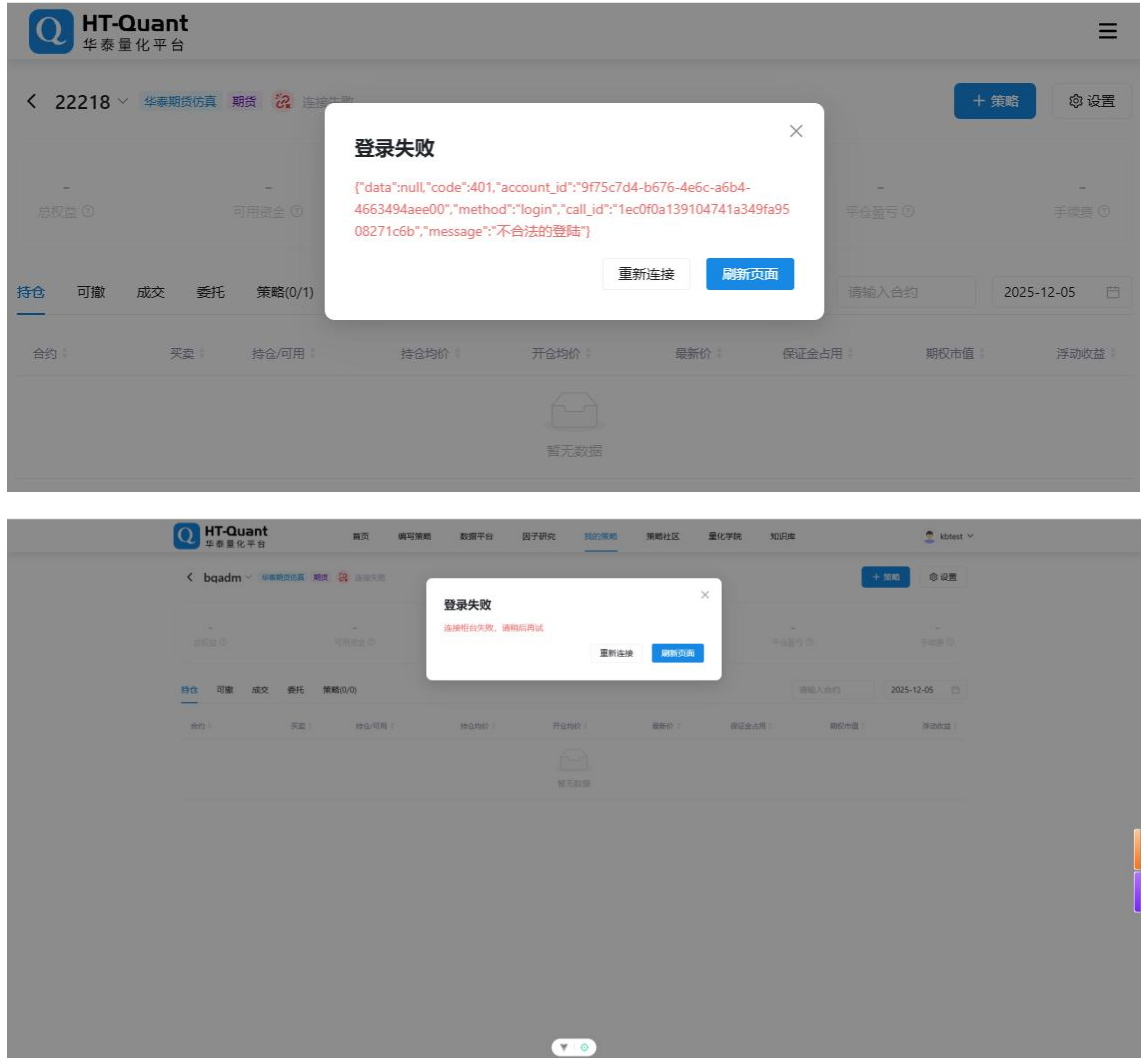
1. 若当前时段为柜台开放时间，柜台能够连接，则可以登录柜台
  - (1) 柜台登录成功，则我们可以获取柜台返回所有的数据；此时账户状态显示正常，数据会自动刷新；



- (2) 柜台登录失败，则我们会弹窗显示对应的柜台返回的报错信息；此时账户状态显示连接失败；用户需要根据柜台返回的具体信息进行相关操作：

- ① 连接柜台失败：此种情况一般需要多重试几次
- ② 不合法的登录：此种情况一般是用户的账号或密码错误

③ 其他



2. 若当前时段为柜台关闭时间，柜台无法连接，则无法登录柜台，也无法校验用户的资金账号和密码是否正确，只能下一交易时间连接时校验其正确性；此时账户状态显示离线

**5.7.1.1.2.修改账户**

平台仅允许用户修改账户密码，可通过点击【修改密码】进行对应账户的密码的修改。

密码：允许用户输入对应资金账户的新密码。

注：这里的密码我们仍然不做正确性校验，但是修改密码后会去重新连接柜台。

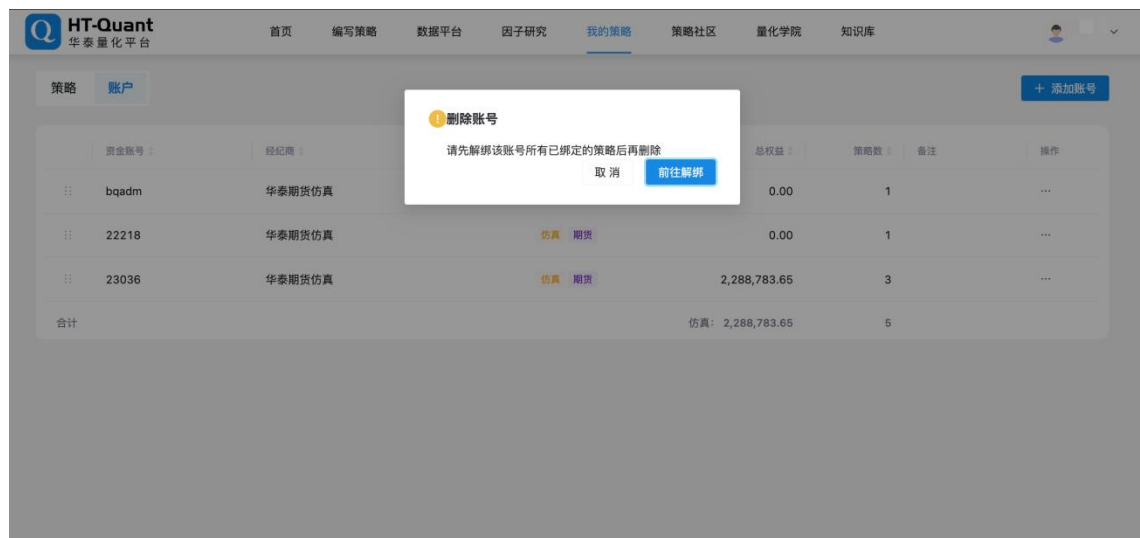


### 5.7.1.1.3.删除账户

用户可点击列表操作栏中的【...】-【删除账户】进行账户删除：

1. 删除时会先对应的资金账户是否存在绑定的策略：

- (1) 存在，则不允许删除，用户根据提示点击【前往解绑】则进入到【账户详情】-【策略】模块，用户可在该模块解绑所有策略。



2. 不存在，则需要根据提示输入正确的随机码来确认删除。用户输入随机码，点击确认删除账户则会进行账户删除。



#### 5.7.1.1.4. 账户添加策略

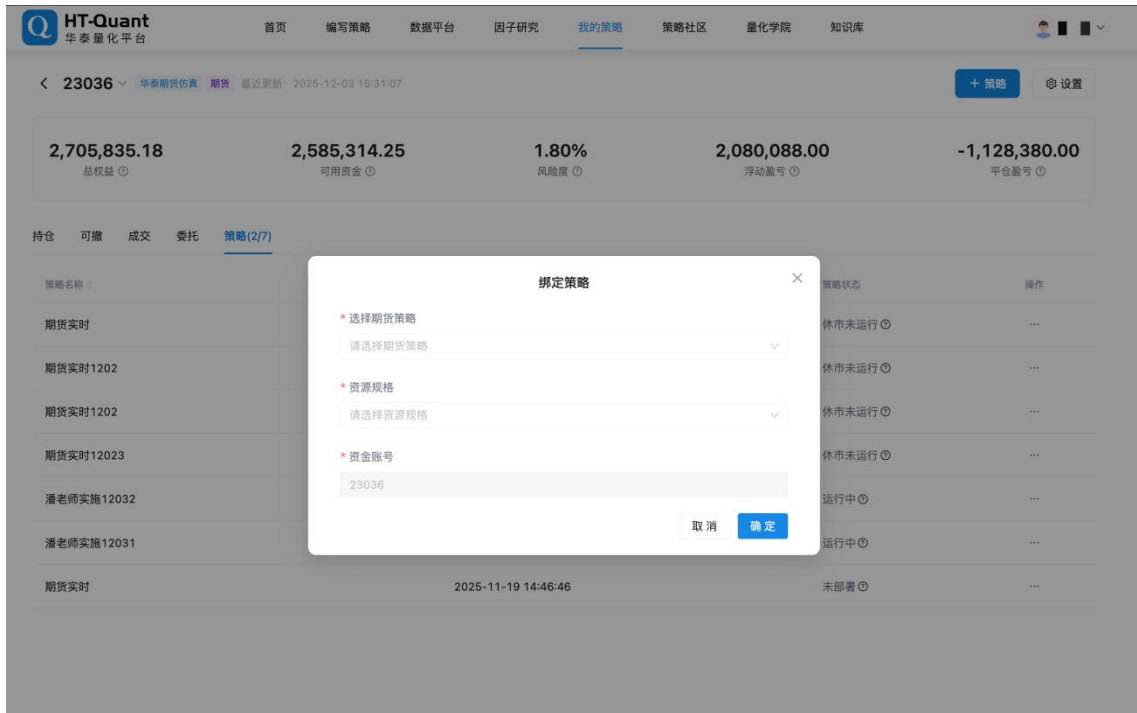
用户可通过点击策略列表【+策略】或者策略详情中的【+策略】按钮进行策略绑定，其中策略列表的【+策略】按钮只会在未绑定策略时显示，绑定策略后显示的是策略数量。

1. 选择策略：下拉选择，只可选择策略状态为未部署且交易账号为空的策略。
2. 资源规格：选择目标资源规格
3. 资金账号：默认带出操作的资金账号

用户绑定完成点击确定则成功绑定策略。

注：账户绑定成功后会默认立即触发策略运行。





### 5.7.1.1.5.账户详情

账户的详情信息目前我们是通过直联柜台进行的数据获取，因此我们获取的账户详情数据不止跟策略相关，还跟账户的其他操作相关，比如手动下单等。

- **盘中数据**

盘中可直连柜台，我们会直接从柜台获取到对应的数据进行前端展示：

1. 盘中采用长链接的方式进行数据互通（虽然是长链接，但是默认查询时间仍然是 10S 查询一次）
2. 盘中的数据包括：
  - (1) 账户数据：总权益、可用资金、风险度、浮动盈亏、平仓盈亏数据均取自柜台
  - (2) 持仓：合约、买卖、持仓/可用、持仓均价、开仓均价、最新价、保证金占用、期权市值、浮动收益
  - (3) 可撤：委托时间、合约、买卖、开平、委托数量、委托价格、成交数量、委托状态、报单编号
  - (4) 成交：成交时间、合约、买卖、开平、成交价格、成交数量、平仓盈亏、成交编号、报单编号
  - (5) 委托：委托时间、合约、买卖、开平、委托数量、委托价格、成交数量、委托状态、报单编号
3. 更新时间：指盘中实时查询时间，盘中时间会实时变化
4. 盘中的数据我们不进行任何加工处理

HT-Quant 华泰量化平台

策略 23036 华泰期货仿真 期货 最近更新: 2025-12-03 15:31:07

2,705,835.18 总权益 2,585,314.25 可用资金 1.80% 风险度 2,080,088.00 浮动盈亏 -1,128,380.00 平仓盈亏

持仓 可撤 成交 委托 策略(2/9) 请输入合约 2025-12-03

合约	买卖	持仓/可用	持仓均价	开仓均价	最新价	保证金占用	期权市值	浮动收益
AP601 AP601.CZC	买	1/1	9,508.000	9,000.000	9,467.000	19,016.00	0	4,670.00
AP512 AP512.CZC	买	1/1	9,889.000	8,269.000	9,889.000	29,667.00	0	16,200.00

HT-Quant 华泰量化平台

策略 23036 华泰期货仿真 期货 最近更新: 2025-12-03 15:31:07

2,705,835.18 总权益 2,585,314.25 可用资金 1.80% 风险度 2,080,088.00 浮动盈亏 -1,128,380.00 平仓盈亏

持仓 可撤 成交 委托 策略(2/9) 请输入合约

委托时间	合约	买卖	开平	委托数量	委托价格	成交数量	委托状态	报单编号	信号来源
2025-12-03 14:59:40	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	未成交	39179	
2025-12-03 14:59:40	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	未成交	39178	
2025-12-03 14:59:40	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	未成交	39176	
2025-12-03 14:59:40	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	未成交	39174	
2025-12-03 14:59:40	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	未成交	39177	
2025-12-03 14:59:40	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	未成交	39175	

HT-Quant 华泰量化平台

策略 23036 华泰期货仿真 期货 最近更新: 2025-12-03 15:31:07

2,705,835.18 总权益 2,585,314.25 可用资金 1.80% 风险度 2,080,088.00 浮动盈亏 -1,128,380.00 平仓盈亏

持仓 可撤 成交 委托 策略(2/9) 请输入合约 2025-12-03

成交时间	合约	买卖	开平	成交价格	成交数量	平仓盈亏	成交编号	报单编号	信号来源
2025-12-03 14:59:34	rb2601 rb2601.SHF	卖	平仓	1,686.000	6	0.00	14917	39150	
2025-12-03 14:59:31	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1,686.000	1	--	14901	39118	
2025-12-03 14:59:31	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1,686.000	1	--	14908	39124	
2025-12-03 14:59:31	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1,686.000	1	--	14903	39120	
2025-12-03 14:59:31	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1,686.000	1	--	14907	39123	
2025-12-03 14:59:31	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1,686.000	1	--	14902	39119	
2025-12-03 14:59:31	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1,686.000	1	--	14906	39122	

HT-Quant 华泰量化平台											
23036 华泰期货仿真 期货 最近更新: 2025-12-03 15:31:07											
2,705,835.18		2,585,314.25		1.80%		2,080,088.00		-1,128,380.00			
总权益		可用资金		风险度		浮动盈亏		平仓盈亏			
持仓	可撤	成交	委托	策略(2/9)							请输入合约
委托时间	合约	买卖	开平	委托数量	委托价格	成交数量	委托状态	报单编号	信号来源		
2025-12-03 15:00:53	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	报单已提交				
2025-12-03 15:00:53	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	报单已提交				
2025-12-03 15:00:53	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	报单已提交				
2025-12-03 15:00:53	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	报单已提交				
2025-12-03 15:00:53	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	报单已提交				
2025-12-03 15:00:53	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	报单已提交				
2025-12-03 14:59:40	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	未成交	39179			
2025-12-03 14:59:40	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1	1,939.000	0	未成交	39178			

● 盘后数据

盘后的相关数据跟盘中的数据一致，只是盘后数据是我们通过 CTP 的接口在盘中将当天的数据进行入库，在柜台关闭后，我们会直接去查询数据库的数据。

1. 盘后的数据包括：

- (1) 账户数据：总权益、可用资金、风险度、浮动盈亏、平仓盈亏数据均取自柜台
- (2) 持仓：合约、买卖、持仓/可用、持仓均价、开仓均价、最新价、保证金占用、期权市值、浮动收益
- (3) 可撤：委托时间、合约、买卖、开平、委托数量、委托价格、成交数量、委托状态、报单编号
- (4) 成交：成交时间、合约、买卖、开平、成交价格、成交数量、平仓盈亏、成交编号、报单编号
- (5) 委托：委托时间、合约、买卖、开平、委托数量、委托价格、成交数量、委托状态、报单编号

2. 更新时间：此时的更新时间显示为查询数据库数据的时间（一般不会变化）。

● 特殊说明

1. 由于现在实现账户数据的方式为直连 CTP 查询，因此我们没办法区分委托信号的来源，即我们不知道委托信号是来源于具体哪个策略还是用户手动下单

2. 由于我们直接取柜台数据，因此数据准确性问题只要核对与柜台数据一致，那数据便是正确的，我们不承担数据计算错误的问题

● 策略

账户详情看到的策略是已经绑定该账户的策略：

1. 策略总数：该账户绑定的所有实时策略数量
2. 运行中的策略数量：该账户的绑定的策略并且处于运行中状态的策略
3. 策略状态同策略详情-状态，针对策略我们可进行相关操作
  - ① 立即运行：即触发策略立即运行
  - ② 取消部署：即停止策略运行，停止后任务将不再自动调度且恢复后无法接续正在运行的任务状态。并且策略使用的服务器将立即释放
  - ③ 解绑策略：解绑后，策略将停止运行并释放关联的服务器和交易账号。恢复策略运行需要重新绑定账号。
4. 是否存在策略不会影响账户详情信息的展示：因为现在账户详情的数据都是通过直接连接 CTP 柜台获取。

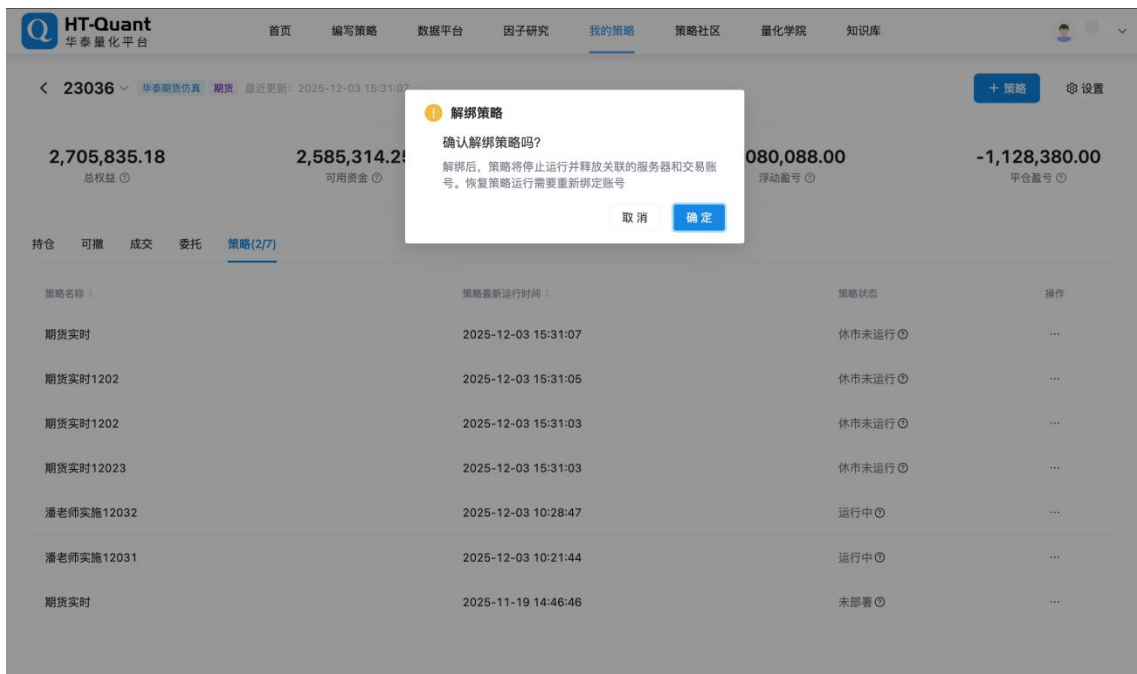
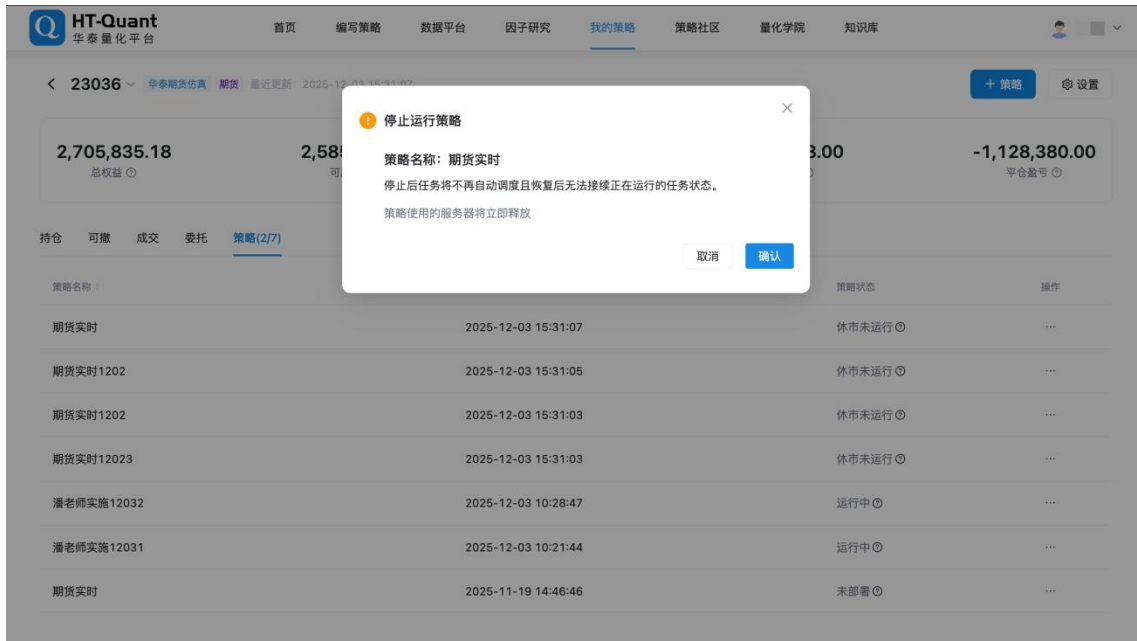
The screenshot displays the HT-Quant trading platform interface. At the top, there is a navigation bar with the HT-Quant logo and menu items: 首页, 编写策略, 数据平台, 因子研究, 我的策略 (highlighted), 策略社区, 量化学院, 知识库. Below the navigation bar, the account ID '23036' is shown along with '华泰期货仿真 期货' and '最近更新: 2025-12-03 15:31:07'. A '+ 策略' button and a '设置' icon are also visible.

The main content area shows account statistics:

- 总权益: 2,705,835.18
- 可用资金: 2,585,314.25
- 风险度: 1.80%
- 浮动盈亏: 2,080,088.00
- 平仓盈亏: -1,128,380.00

Below the statistics, there are tabs for '持仓', '可撤', '成交', '委托', and '策略(2/8)'. The '策略(2/8)' tab is active, displaying a table of strategies:

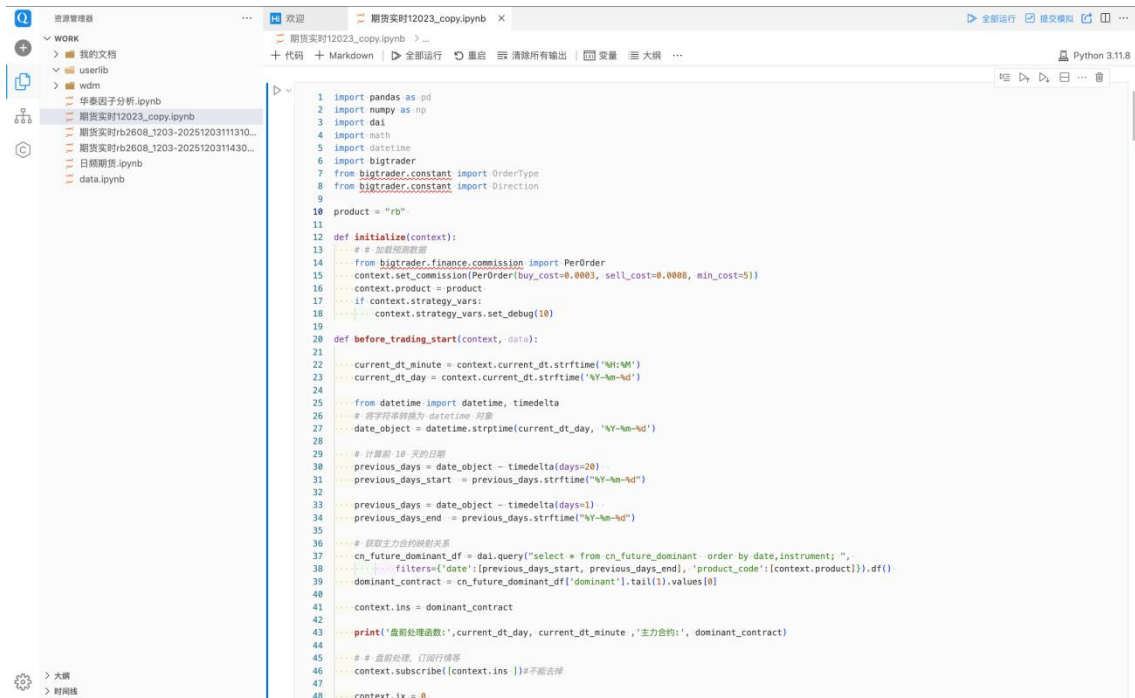
策略名称	策略最新运行时间	策略状态	操作
期货实时	2025-12-03 15:31:07	休市未运行	...
期货实时	2025-12-03 15:31:07	休市未运行	...
期货实时1202	2025-12-03 15:31:05	休市未运行	...
期货实时1202	2025-12-03 15:31:03	休市未运行	...
期货实时12023	2025-12-03 15:31:03	休市未运行	...
潘老师实施12032	2025-12-03 10:28:47	运行中	...
潘老师实施12031	2025-12-03 10:21:44	运行中	...
期货实时	2025-11-19 14:46:46	未部署	...



### 5.7.1.2.编写策略

用户编写实时策略的具体代码需通过点击【编写策略】进入到 AStudio 开发环境。

注：当前实时策略只支持 tick 级别，不支持分钟策略。



### 5.7.1.3.提交策略

用户在 AIstudio 编译完成对应的策略代码逻辑后，则可提交策略进行策略运行。

1. 用户在 AIstudio 环境编译完成对应的策略（务必保证**实时策略为 tick 策略，当前不支持分钟策略**）
2. 用户点击右上角的【提交模拟】则会显示策略提交的弹窗：
  - (1) 任务类型：实时策略务必选择——实时交易任务
  - (2) 交易账号：选择对应的交易账号
    - ① 交易账号会跟不同的经纪商柜台连接绑在一起，我们默认会去使用对应资金账号登录对应柜台的连接
    - ② 若需要获取更多的资金账号，点击【获取更多资金账号】进入到账户页面进行绑定
  - (3) 任务名称：默认是文件名称，用户可修改
  - (4) 资源规格：用户主动选择
  - (5) 用户点击确定后会立即提交策略运行

### 提交任务

新建任务
替换已有任务

\* 任务类型 ⓘ

实时交易任务
▼

\* 交易账号

请选择交易账号
▼

\* 任务名称 ⓘ

期货实时12023\_copy

\* 资源规格

请选择资源规格
▼

取消
确定

**\* 交易账号**

请选择交易账号
▼

华泰期货仿真\_23036

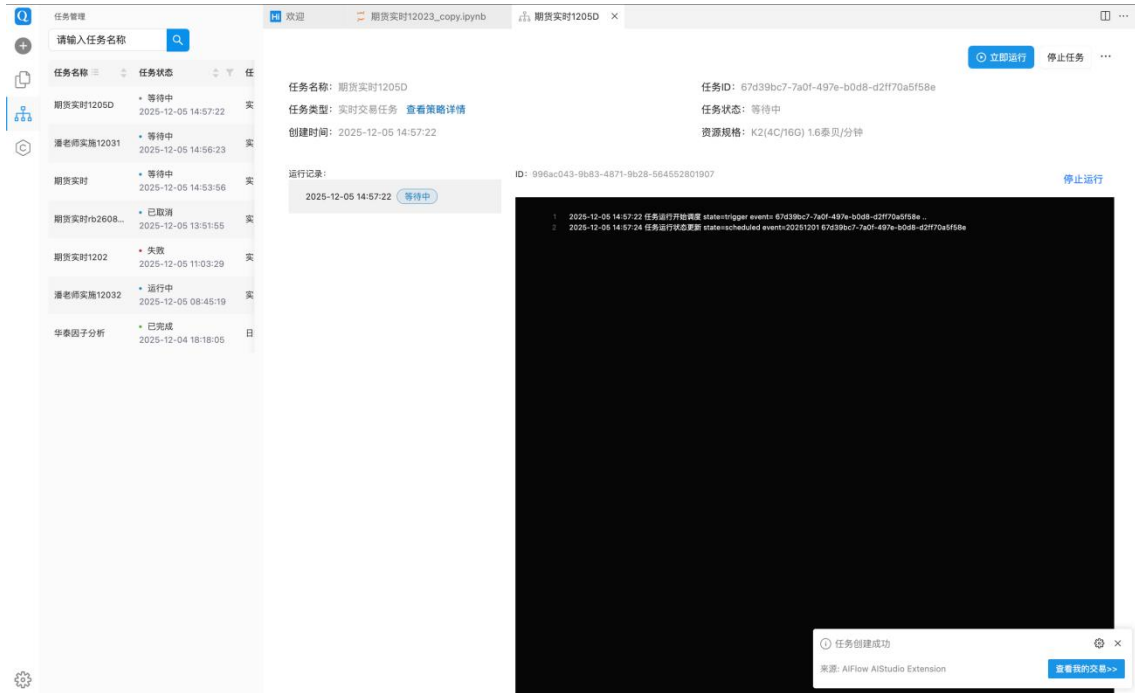
华泰期货仿真\_22218

获取更多资金账号 >

#### 5.7.1.4.策略运行

策略任务提交后，会立即跳转至任务详情页面：

1. 用户成功提交的实时策略会立即调度进行策略运行：
2. 策略会立即在对应仿真柜台进行登录，登录失败策略日志会返回失败信息，策略运行最终会失败；登录成功则连接柜台获取对应信息。
3. 登录成功，则会依次去获取对应资金账号的相关信息：
  - (1) 获取账户资金信息
  - (2) 获取账户委托信息
  - (3) 获取账户成交信息
  - (4) 获取账户持仓信息
  - (5) 获取柜台的实时行情
4. 在成功状态下，策略会根据上述信息以及策略逻辑在对应盘中一直调度；即策略任务会一直运行直到用户手动干预策略或者闭市后自动退出。
5. 用户可通过点击【查看策略详情】进入到策略详情页面。



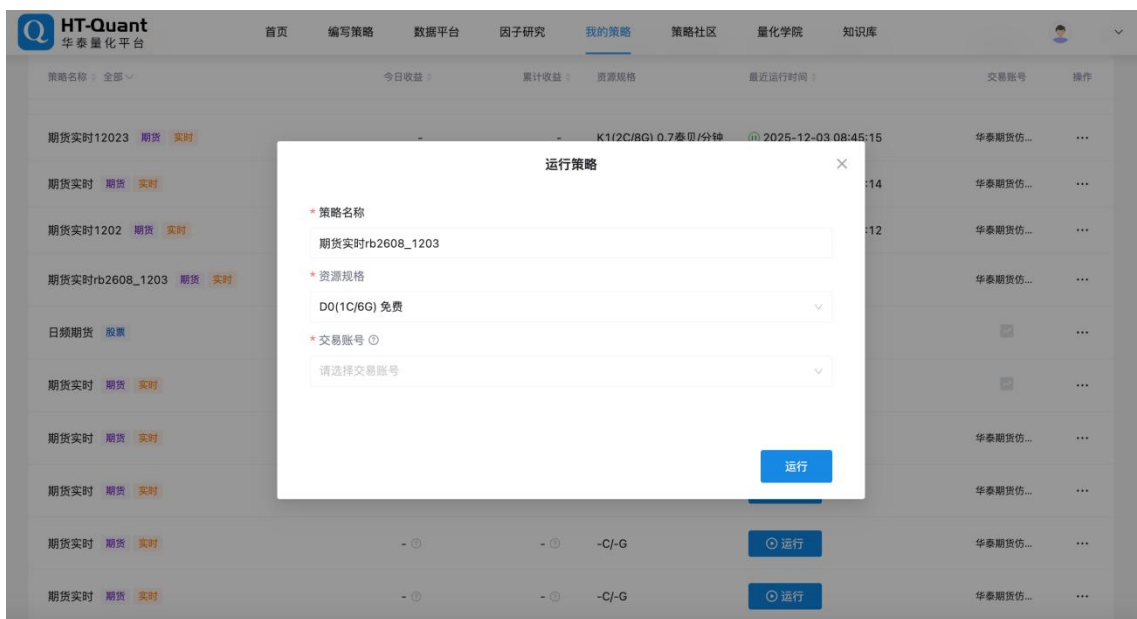
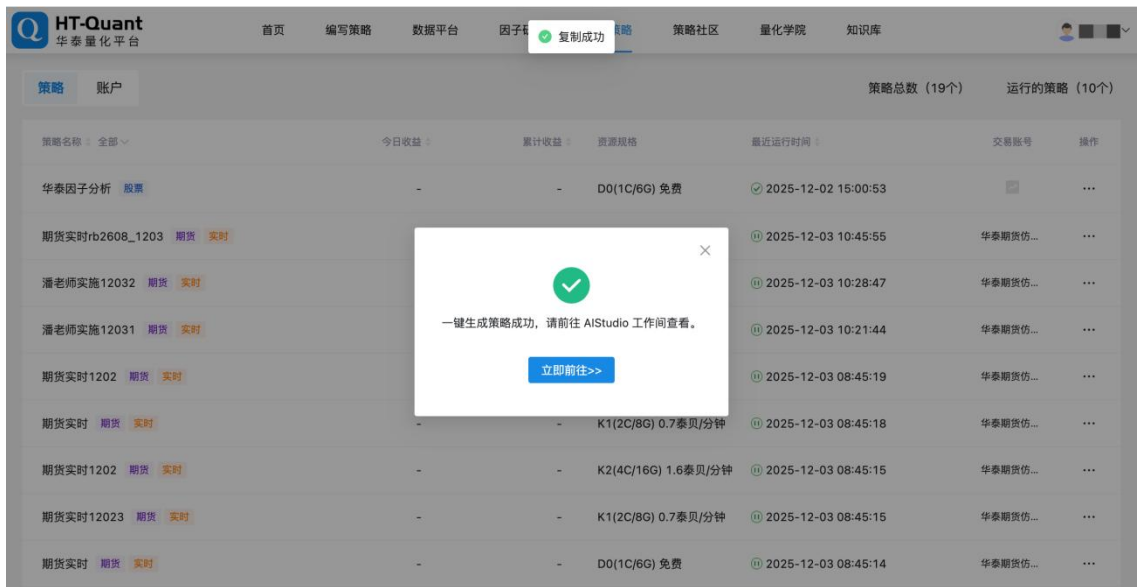
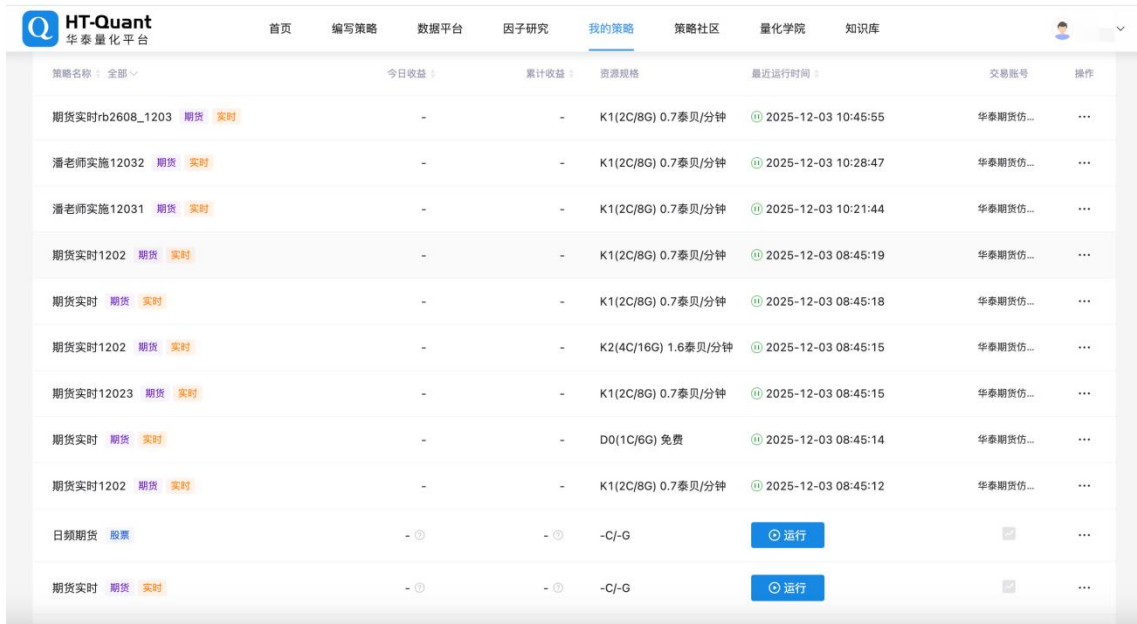
### 5.7.1.4.1.我的策略

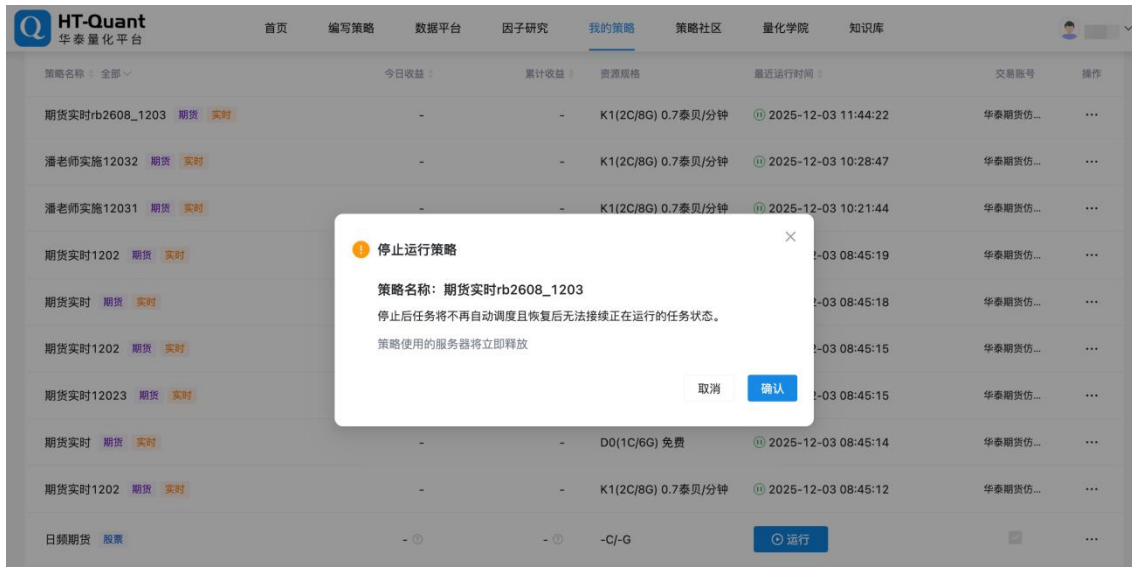
策略提交后，可以在【我的策略】-【策略】模块看到我们提交的实时策略。

#### ● 策略列表

1. 策略名称
2. 标签：实时策略区别于普通策略，有‘实时’标签，标明策略时效性（注：只有提交为实时交易任务的才会有实时标签）
3. 今日收益：该字段只针对日频策略有效，实时策略未计算策略收益
4. 累积收益：该字段只针对日频策略有效，实时策略未计算策略收益
5. 资源规格：该策略使用的资源规格
6. 最近运行时间：策略的最新的运行时间
7. 交易账号：策略绑定的交易账号，点击可进入到账户详情
8. 操作：
  - (1) 复制并编辑：能够自动复制代码并在 AIstudio 打开对应代码文件，用户快捷进行代码修改
  - (2) 立即运行：指处于未部署状态的策略的再次运行，立即运行需要用户再次选择对应的资源规格和交易账号
  - (3) 停止运行：停止运行是指立即停止策略本次运行并且策略后续都不再进行调度，若用户想要再次运行策略需要点击「立即运行」进行激活

(4) 删除：删除会同时删除策略的模拟交易任务，并且删除后没办法恢复





### 5.7.1.4.2.策略详情

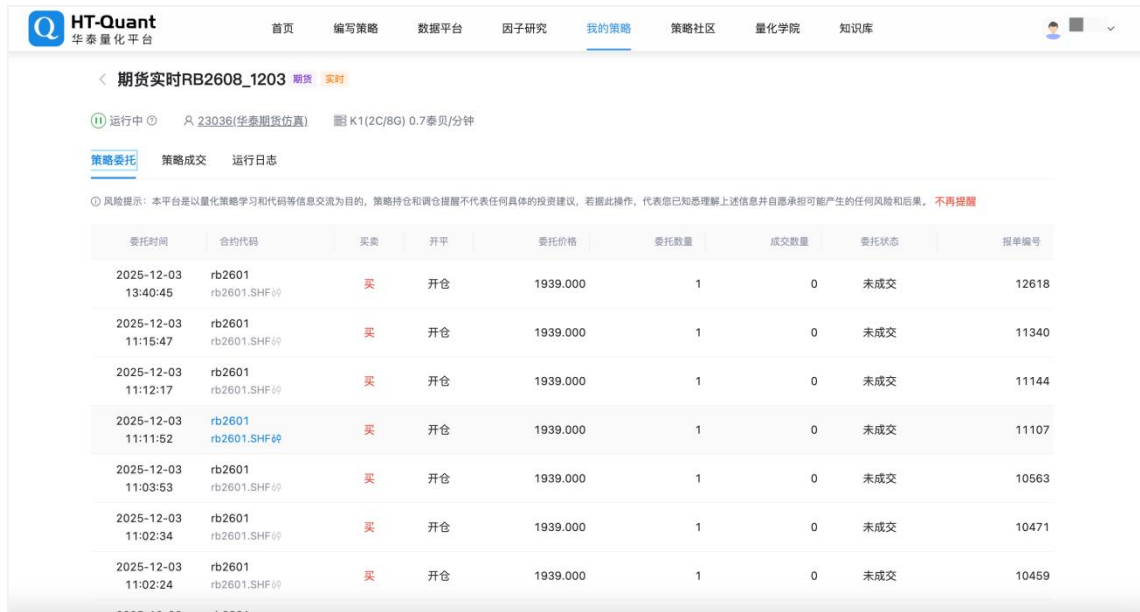
- 详情

用户点击策略列表的策略名称即可进入到该策略的详情页面，策略详情展示：

1. 策略名称和策略标签
2. 策略的运行状态
3. 策略连接的经纪商柜台和资金账号
4. 策略使用的服务器资源大小和费用
5. 策略委托
  - (1) 委托时间
  - (2) 合约代码
  - (3) 买卖
  - (4) 开平
  - (5) 委托价格
  - (6) 委托数量
  - (7) 成交数量
  - (8) 委托状态
  - (9) 报单编号
6. 策略成交
  - (1) 成交时间
  - (2) 合约代码
  - (3) 买卖
  - (4) 开平
  - (5) 成交数量
  - (6) 成交价格
  - (7) 成交编号
  - (8) 报单编号
  - (9) 平仓盈亏（逐笔）
7. 运行日志
  - (1) 默认显示实时日志
  - (2) 可下拉选择历史日志进行查看

注：

1. 策略委托、成交和实时日志信息都是直接从柜台取的数据，我们未做任何加工或处理
2. 策略的运行状态显示详见策略状态描述



HT-Quant 华泰量化平台

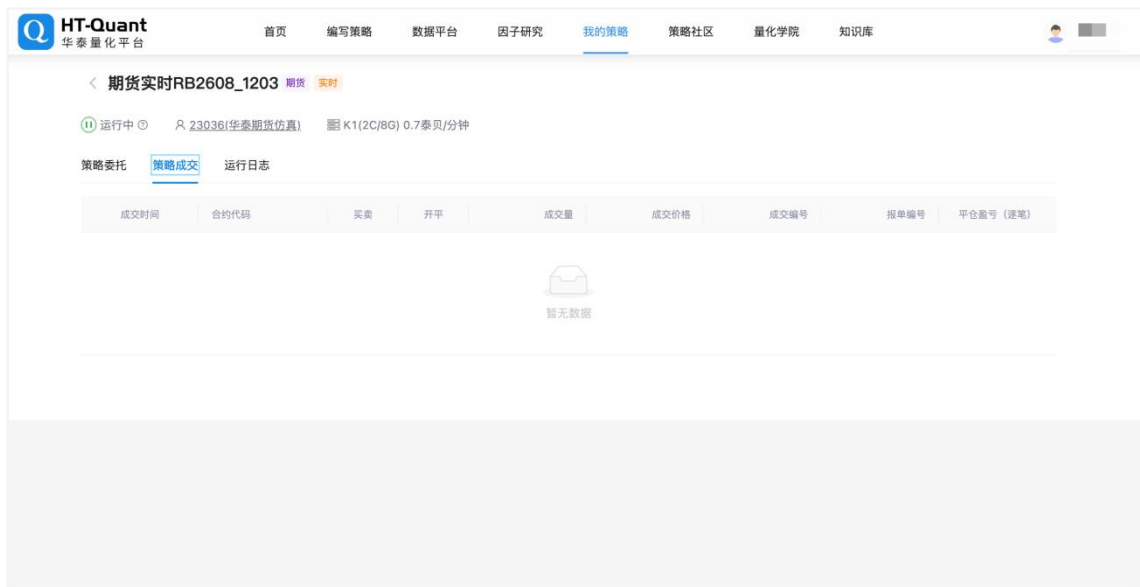
期货实时RB2608\_1203 期货 实时

运行中 23036(华泰期货仿真) K1(2C/8G) 0.7泰贝/分钟

策略委托 策略成交 运行日志

风险提示：本平台是以量化策略学习和代码等信息交流为目的，策略持仓和持仓提醒不代表任何具体的投资建议，若据此操作，代表您已知悉理解上述信息并自愿承担可能产生的任何风险和后果。不再提醒

委托时间	合约代码	买卖	开平	委托价格	委托数量	成交数量	委托状态	报单编号
2025-12-03 13:40:45	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1939.000	1	0	未成交	12618
2025-12-03 11:15:47	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1939.000	1	0	未成交	11340
2025-12-03 11:12:17	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1939.000	1	0	未成交	11144
2025-12-03 11:11:52	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1939.000	1	0	未成交	11107
2025-12-03 11:03:53	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1939.000	1	0	未成交	10563
2025-12-03 11:02:34	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1939.000	1	0	未成交	10471
2025-12-03 11:02:24	rb2601 rb2601.SHF	买	开仓	1939.000	1	0	未成交	10459



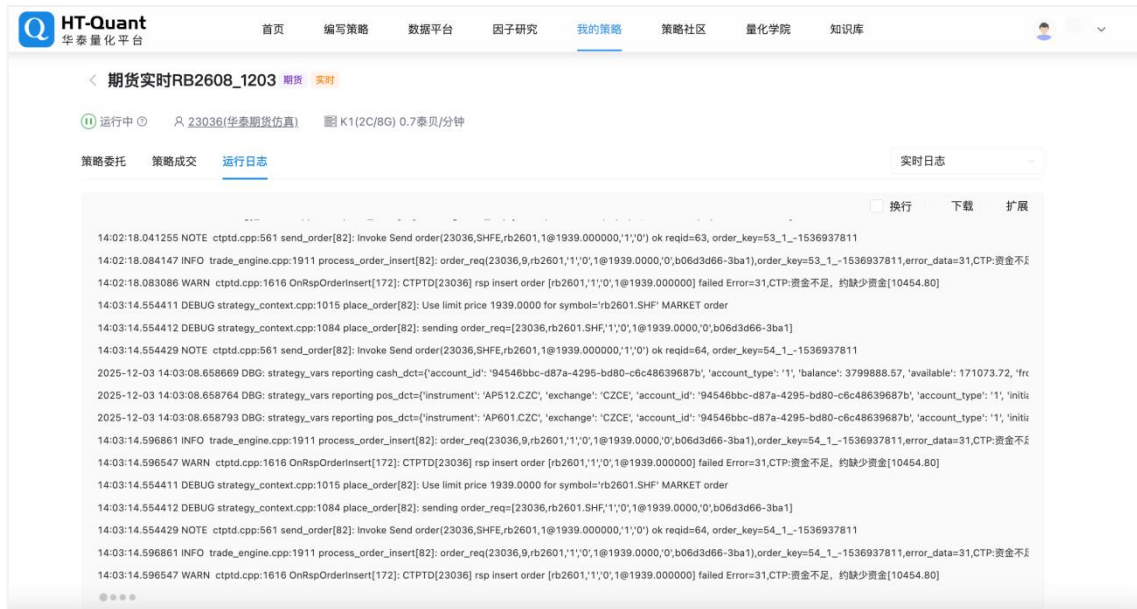
HT-Quant 华泰量化平台

期货实时RB2608\_1203 期货 实时

运行中 23036(华泰期货仿真) K1(2C/8G) 0.7泰贝/分钟

策略委托 策略成交 运行日志

成交时间	合约代码	买卖	开平	成交量	成交价格	成交编号	报单编号	平仓盈亏 (逐笔)
暂无数据								



● 状态

策略状态的显示依赖于任务的状态，前端页面为能够让用户更好地理解策略运行状态，单独地对任务状态做了加工显示策略的状态。

任务状态	策略状态	策略状态说明	备注
已停止	未部署	指策略未绑定服务器的状态，需绑定服务器才能执行手动或自动调度。	此状态下策略不会自动执行调度
调度中，等待中，运行中	运行中	策略自动或手动调度运行并且运行正常的状态（实时策略自动调度运行时间为：股票一般为 9:10-15:30；期货一般为日盘 8.45-15:30，夜盘：20:45-次日凌晨 3:00）	
失败	失败	策略自动或手动调度运行但是运行失败的状态	
-	盘中未调度	盘中策略应该正常调度但是后台并未成功调度运行的状态（实时策略自动调度运行时间为：股票一般为 9:10-15:30；期货一般为日盘 8.45-15:30，夜盘：20:45-次日凌晨 3:00）	此时，策略还是上次任务运行的状态，本次应该触发运行的任务未触发
已完成	休市未运行	策略运行成功后自动正常退出运行的状态（实时策略自动调度运行时间为：股票一般为 9:10-15:30；期货一般为日盘 8.45-15:30，夜盘：20:45-次日凌晨 3:00）	此时本次盘中调度已完成

注：如果是完全自动调度操作整体的状态应该是一致的，但是如果用户手动去干预，可能会到有策略启动的原因，导致状态异常。

## 5.8.策略社区

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

### 5.8.1.策略检索、排序、筛选

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

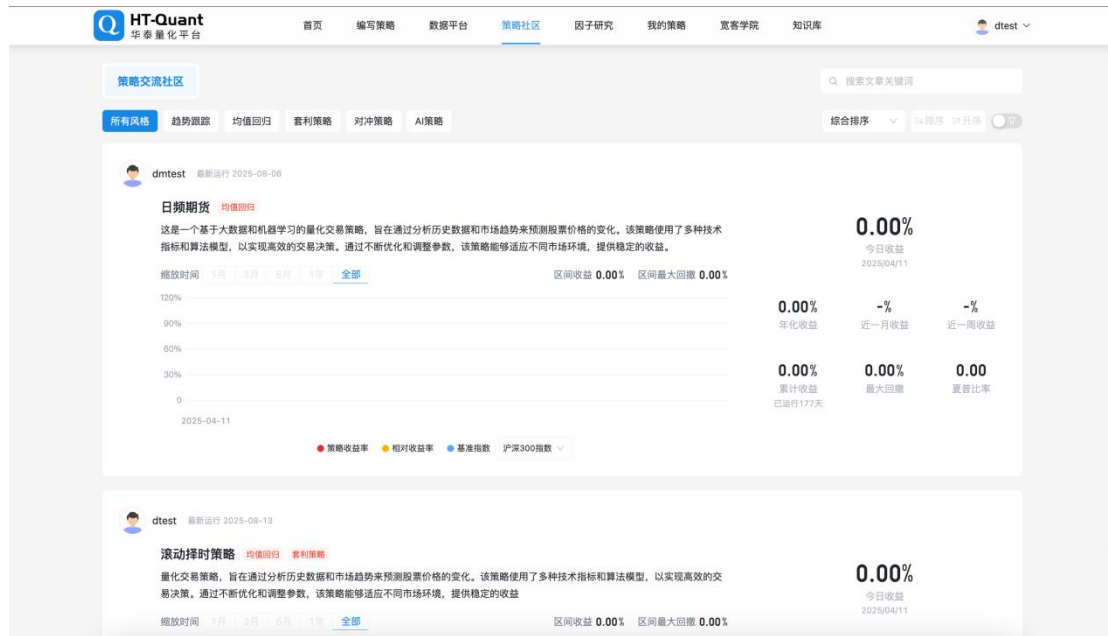
(1) 用户可选择特定指标选择或者自己设置对应的指标阈值，指标包括：2.累计收益、近一年收益、近 6 月收益、近 3 月收益、近 1 月收益、近 1 周收益、今日收益、年化收益、最大回撤、夏普比率、交易胜率和开始运行时间。具体每个指标的可选范围见页面展示。

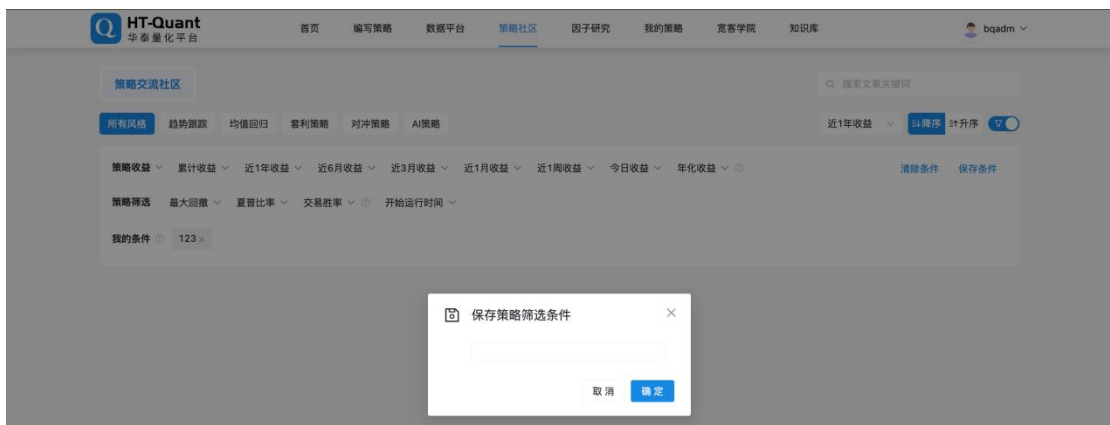
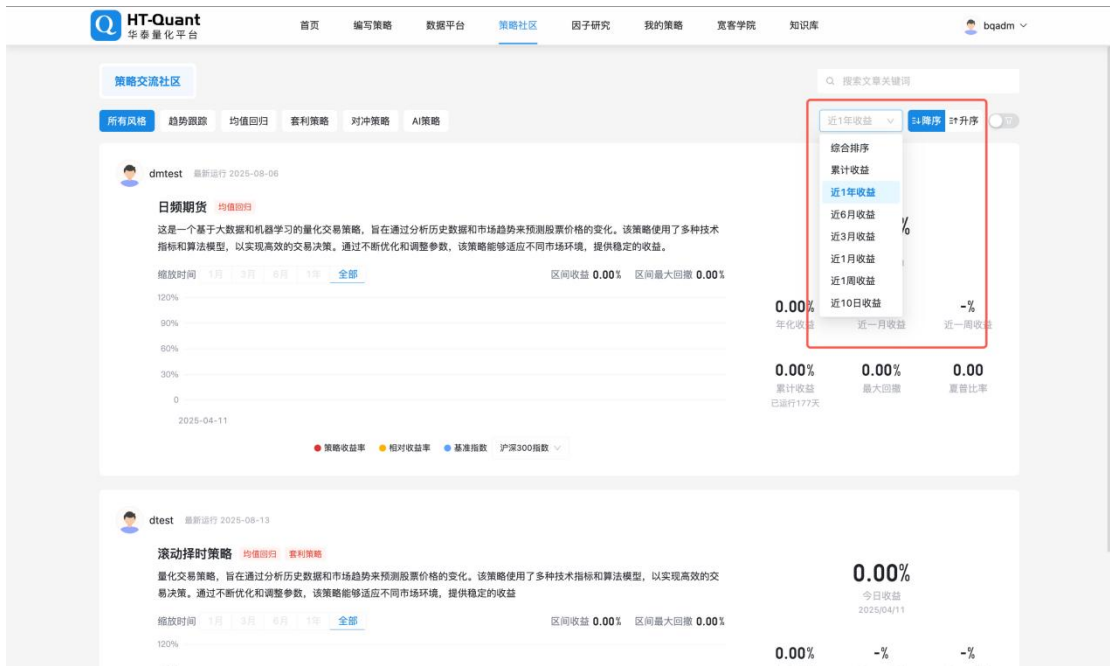
(2) 指标相关阈值设置完成后，可以点击[保存条件]，点击保存条件则会弹窗显示命名弹窗，用户需要输入条件名称进行条件保存。

(3) 条件保存完成后，则会出现在我的条件中，用户可点击[X]进行删除。

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

(4) 保存好的条件，用户可直接点击条件选中后则能够进行快捷搜索。





### 5.8.2.策略卡片

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

✓ 策略卡片详情信息：

- (1) 策略基本信息，包含策略名称、今日收益、累计收益、年化收益、策略作者、最新运行时间、策略简述；
- (2) 概要：即策略区间内的收益走势，展示策略收益、基准收益和相对收益的走势图。点击基准指数可选择切换基准展示在不同走势下的趋势图
- (3) 持仓详情：展示对应的交易日期、合约代码、买卖、持仓数量、持仓均价、开仓均价、最新价、保证金占用、浮动收益
- (4) 交易详情：时间、合约代码、买卖、开平、成交量、成交均价、手续费、状态。
- (5) 评论：评论仅评论人和策略发布人可见相关信息。

The screenshot displays the '日频期货' (Daily Frequency Futures) strategy card. At the top, it shows key metrics: 今日收益 0% (Today's Return), 年化收益 0% (Annualized Return), and 累计收益 0% (Cumulative Return). The strategy author is 'dmtest' and it was last run on 2025-08-06 17:42:26. A brief description follows, explaining it's a data-driven and machine learning-based strategy.

The '概要' (Summary) section features a line chart comparing the strategy's performance (策略收益率) against a benchmark (基准指数) and relative performance (相对收益率) over time. The chart shows a flat line at 0% for all three metrics.

The '持仓详情' (Position Details) table lists the current position:

日期	合约代码	买卖	持仓数量	持仓均价	开仓均价	最新价	保证金占用	浮动收益
2025-05-07	2509 a2509.DCE 昨	买	3	4251.00	4251.00	4246.00	10202.4	-150.00

The bottom section shows a list of historical transactions with columns for date, contract code, trade type, open/close, volume, average price, commission, and status. The table is paginated, showing 128 total records.

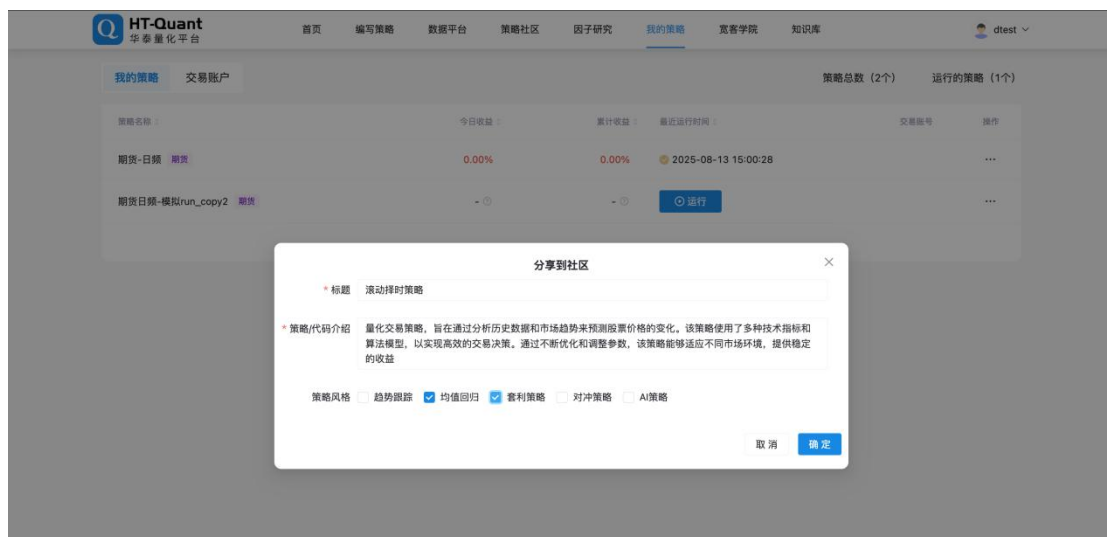
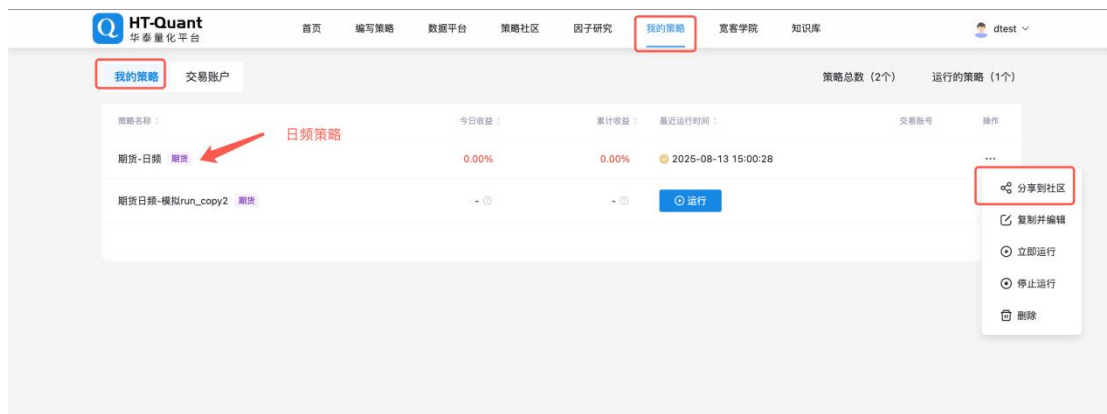
### 5.8.3.策略分享

用户可以在【我的策略】模块选择目标想要分享的策略：

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

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

- ✓ 点击分享到社区后，会显示对应的分享弹窗：
  - (1) 标题：即该策略在策略社区展示的名称
  - (2) 策略/代码介绍：用户可根据策略内容填写，一般是针对该策略的思想和代码逻辑，有字数不少于 50 字的限制；
  - (3) 策略风格：系统预设的风格标签，用户可多选，在社区可用来分类或者搜索时使用；
  - (4) 取消：取消则关闭弹窗并不触发分享操作；
  - (5) 确定：确定则触发分享操作并关闭弹窗。
- ✓ 策略分享成功后，我们会默认进入到策略详情页面，确认策略分享的信息是否无误。



## 5.9.量化学院

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

### 5.9.1.课程总览

模块核心内容涵盖三大内容，课程内容持续迭代：

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

用户打开量化学院页签进入该模块如下（后续逐步丰富）：

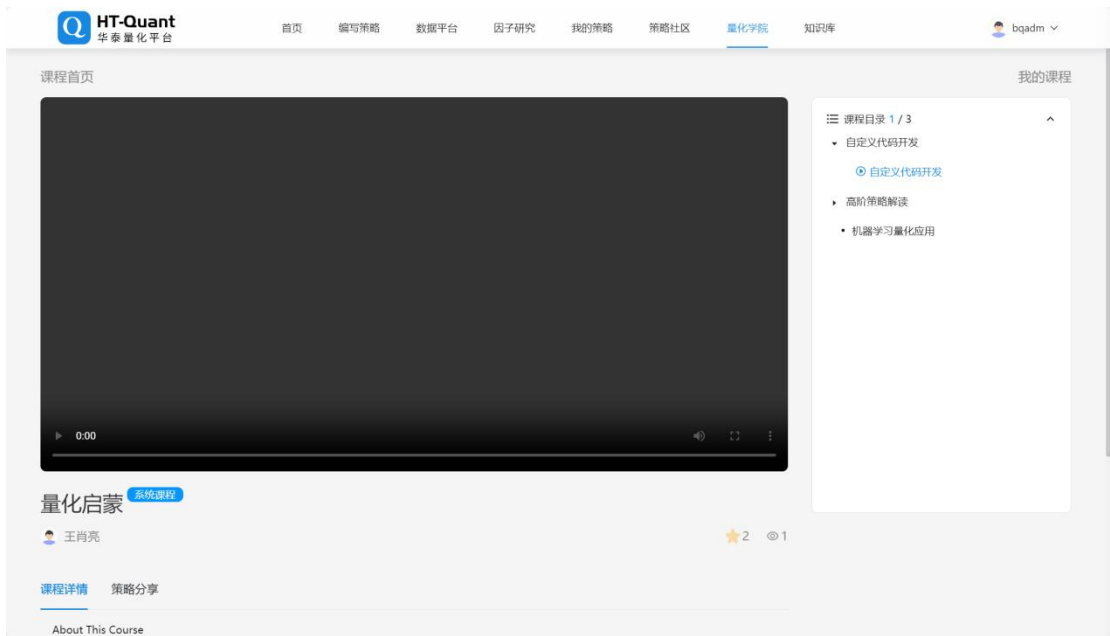
可点击相应页签查看课程分类和课程内容，选择感兴趣的课程进行学习。



### 5.9.2.课程详情

点击课程进入课程详情页

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



## 5.10.知识库

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

### 5.10.1.文件检索

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



### 5.10.2.文档创建

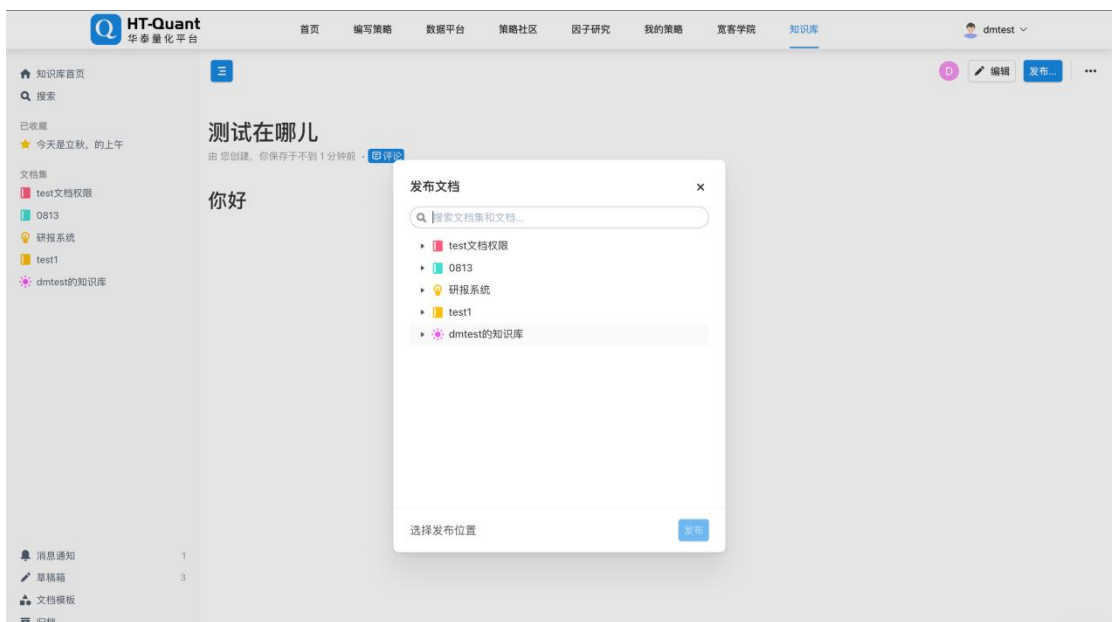
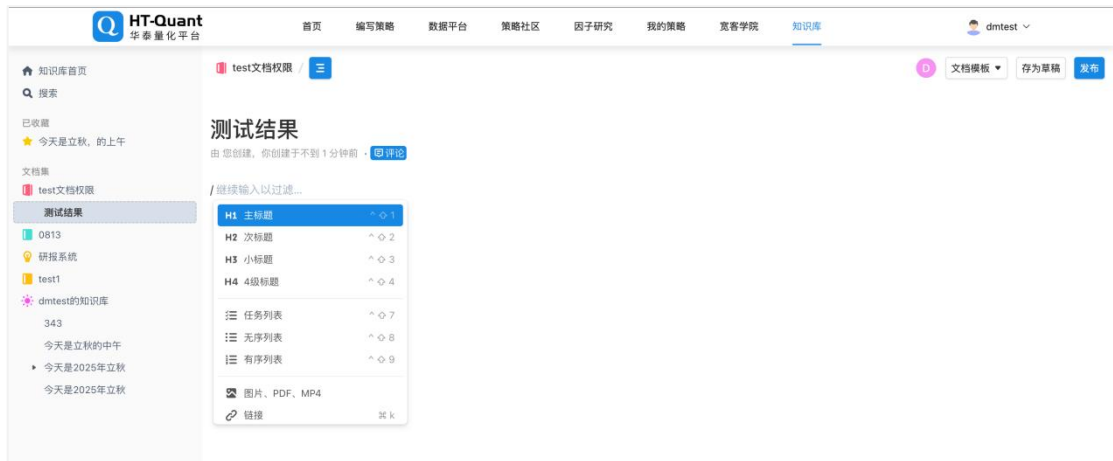
- ✓ 用户点击[新建文档]则进入进入新建文档页面
- ✓ 创建文档输入支持相关格式调整：包括标题、任务列表、图片、PDF、MP4、链接的嵌入。

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

✓ 发布：

(1) 若是在具体文档集上创建的文档点击发布会直接发布至该文档集；

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

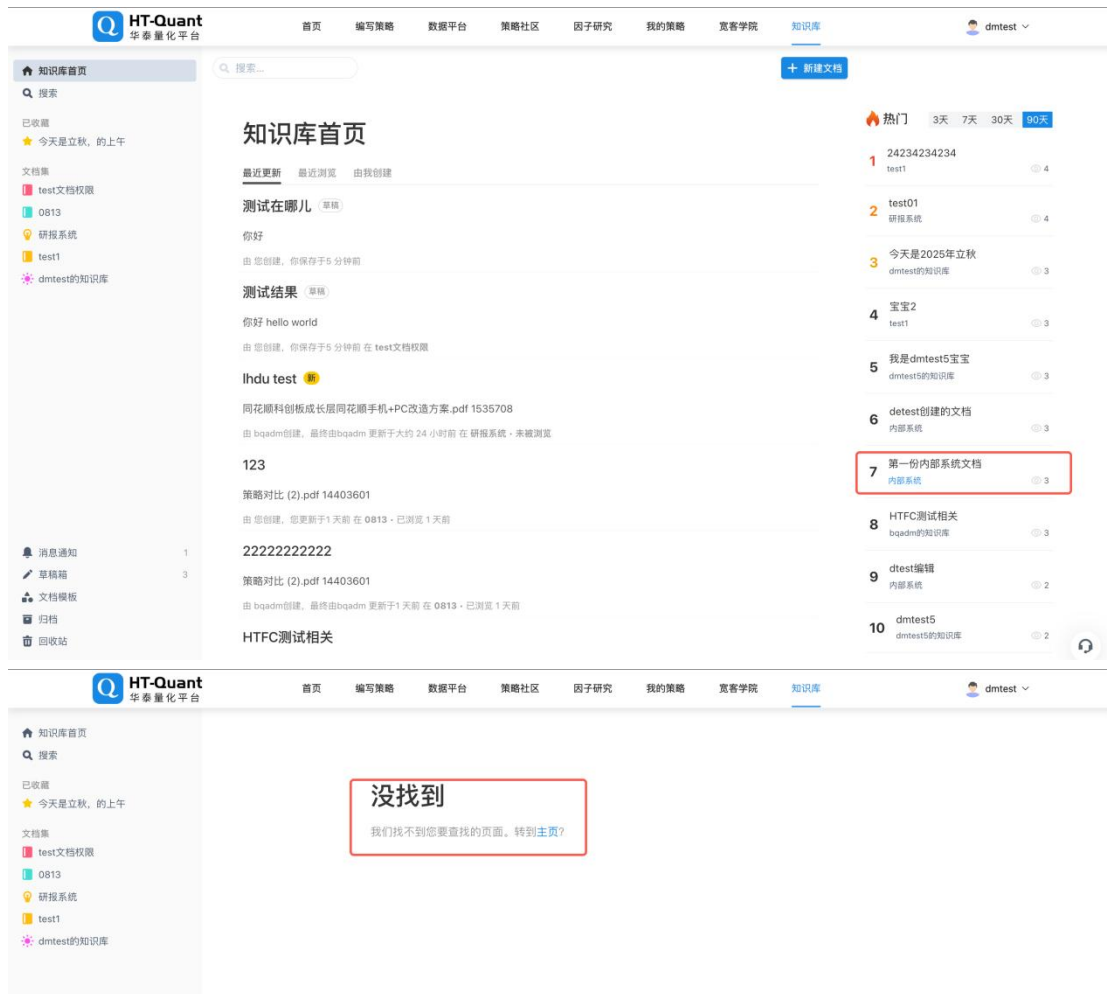


### 5.10.3.文档热度

右侧热门的排行根据文档的阅读量展示。

用户单击相应文档，若用户有该文档的相应权限，则可以直接根据权限查看或编辑；

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



## 5.11.用户中心

### 5.11.1.功能概述

用户中心是平台提供给用户自己的相关基础信息查看页面。

### 5.11.2.操作说明

用户可点击自己的用户名则进入到该业务模块：

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

HT-Quant 华泰量化平台																																															
首页	编写策略	数据平台	因子研究																																												
			我的策略																																												
<p>账户余额</p> <p>可用余额: <b>6831.31</b> 泰贝</p>																																															
<p>充值记录</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>订单时间</th> <th>到账泰贝</th> <th>支付方式</th> <th>订单编号</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2025-05-12 15:50:47</td> <td>1.00</td> <td>华泰赠送</td> <td>cad2a0ee-fb6f-4909-8f77-3656d3af55a7</td> </tr> <tr> <td>2025-04-29 16:39:51</td> <td>192.00</td> <td>未消费清算退费</td> <td>9f70efd0-75a4-48a9-b134-3b4d25f9824c</td> </tr> <tr> <td>2025-04-29 09:36:14</td> <td>192.00</td> <td>未消费清算退费</td> <td>47723751-f074-44ac-a165-39b6a68cdd89</td> </tr> <tr> <td>2025-04-27 17:51:58</td> <td>134.40</td> <td>未消费清算退费</td> <td>828779bf-f692-4a48-9f1b-aa1d143f0584</td> </tr> <tr> <td>2025-04-23 15:59:37</td> <td>140.80</td> <td>未消费清算退费</td> <td>5ee914ad-5c12-4ea7-b62b-f97b31b23aee</td> </tr> <tr> <td>2025-04-23 15:36:14</td> <td>1.00</td> <td>华泰赠送</td> <td>c16c7e73-c002-49ff-8d43-11b292bb8f44</td> </tr> <tr> <td>2025-04-23 14:43:27</td> <td>2876.80</td> <td>未消费清算退费</td> <td>b5b0acf3-cea5-441e-a729-e7d8b2af68d</td> </tr> <tr> <td>2025-04-23 14:16:40</td> <td>2976.00</td> <td>未消费清算退费</td> <td>b6d49c59-628a-41c1-af1e-cfb8958e3d1a</td> </tr> <tr> <td>2025-04-23 14:12:22</td> <td>10000.00</td> <td>华泰赠送</td> <td>e86e5a18-08ae-4d56-a362-670fdf4d3d60</td> </tr> <tr> <td>2025-04-22 14:37:44</td> <td>100.00</td> <td>华泰赠送</td> <td>fc4dbdc1-63f6-4e03-8b6e-e2d73928c929</td> </tr> </tbody> </table>				订单时间	到账泰贝	支付方式	订单编号	2025-05-12 15:50:47	1.00	华泰赠送	cad2a0ee-fb6f-4909-8f77-3656d3af55a7	2025-04-29 16:39:51	192.00	未消费清算退费	9f70efd0-75a4-48a9-b134-3b4d25f9824c	2025-04-29 09:36:14	192.00	未消费清算退费	47723751-f074-44ac-a165-39b6a68cdd89	2025-04-27 17:51:58	134.40	未消费清算退费	828779bf-f692-4a48-9f1b-aa1d143f0584	2025-04-23 15:59:37	140.80	未消费清算退费	5ee914ad-5c12-4ea7-b62b-f97b31b23aee	2025-04-23 15:36:14	1.00	华泰赠送	c16c7e73-c002-49ff-8d43-11b292bb8f44	2025-04-23 14:43:27	2876.80	未消费清算退费	b5b0acf3-cea5-441e-a729-e7d8b2af68d	2025-04-23 14:16:40	2976.00	未消费清算退费	b6d49c59-628a-41c1-af1e-cfb8958e3d1a	2025-04-23 14:12:22	10000.00	华泰赠送	e86e5a18-08ae-4d56-a362-670fdf4d3d60	2025-04-22 14:37:44	100.00	华泰赠送	fc4dbdc1-63f6-4e03-8b6e-e2d73928c929
订单时间	到账泰贝	支付方式	订单编号																																												
2025-05-12 15:50:47	1.00	华泰赠送	cad2a0ee-fb6f-4909-8f77-3656d3af55a7																																												
2025-04-29 16:39:51	192.00	未消费清算退费	9f70efd0-75a4-48a9-b134-3b4d25f9824c																																												
2025-04-29 09:36:14	192.00	未消费清算退费	47723751-f074-44ac-a165-39b6a68cdd89																																												
2025-04-27 17:51:58	134.40	未消费清算退费	828779bf-f692-4a48-9f1b-aa1d143f0584																																												
2025-04-23 15:59:37	140.80	未消费清算退费	5ee914ad-5c12-4ea7-b62b-f97b31b23aee																																												
2025-04-23 15:36:14	1.00	华泰赠送	c16c7e73-c002-49ff-8d43-11b292bb8f44																																												
2025-04-23 14:43:27	2876.80	未消费清算退费	b5b0acf3-cea5-441e-a729-e7d8b2af68d																																												
2025-04-23 14:16:40	2976.00	未消费清算退费	b6d49c59-628a-41c1-af1e-cfb8958e3d1a																																												
2025-04-23 14:12:22	10000.00	华泰赠送	e86e5a18-08ae-4d56-a362-670fdf4d3d60																																												
2025-04-22 14:37:44	100.00	华泰赠送	fc4dbdc1-63f6-4e03-8b6e-e2d73928c929																																												

HT-Quant 华泰量化平台																																															
首页	编写策略	数据平台	因子研究																																												
			我的策略																																												
<p>消费记录</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>订单时间</th> <th>泰贝/金额</th> <th>消费方式</th> <th>订单编号</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2025-05-14 15:00:02</td> <td>0.00</td> <td>AIFlow</td> <td>60cbb2f-38bc-4a4b-a0cd-1d3871620bb4</td> </tr> <tr> <td>2025-05-13 15:00:10</td> <td>0.00</td> <td>AIFlow</td> <td>966d4c64-f943-46ac-957b-6b6e48e82437</td> </tr> <tr> <td>2025-05-12 15:00:09</td> <td>0.00</td> <td>AIFlow</td> <td>625eb92b-29b7-479e-8707-f39aec07234f</td> </tr> <tr> <td>2025-05-11 15:00:03</td> <td>0.00</td> <td>AIFlow</td> <td>39aa68bd-e915-4963-9823-89fef9f776b1</td> </tr> <tr> <td>2025-05-10 15:00:01</td> <td>0.00</td> <td>AIFlow</td> <td>296d1454-92eb-4def-a02b-5e5847dde469</td> </tr> <tr> <td>2025-05-09 15:00:10</td> <td>0.00</td> <td>AIFlow</td> <td>3862c854-2d87-4719-b0ec-5b68c93e7f12</td> </tr> <tr> <td>2025-05-09 09:35:29</td> <td>1.17</td> <td>QuantChat</td> <td>6e8c4226-25d1-4a4e-aab8-5d76c9a1e30e</td> </tr> <tr> <td>2025-05-08 16:15:43</td> <td>1104.00</td> <td>AISTUDIO</td> <td>0d0789b8-1129-4711-9a3f-98392685afe2</td> </tr> <tr> <td>2025-05-08 15:00:04</td> <td>0.00</td> <td>AIFlow</td> <td>f9f6f3c3-7098-48b7-b372-769745ed14f3</td> </tr> <tr> <td>2025-05-07 15:12:20</td> <td>0.00</td> <td>AIFlow</td> <td>3c3a4003-b1bb-4aa5-a8fa-0f1dc3dff0c1</td> </tr> </tbody> </table>				订单时间	泰贝/金额	消费方式	订单编号	2025-05-14 15:00:02	0.00	AIFlow	60cbb2f-38bc-4a4b-a0cd-1d3871620bb4	2025-05-13 15:00:10	0.00	AIFlow	966d4c64-f943-46ac-957b-6b6e48e82437	2025-05-12 15:00:09	0.00	AIFlow	625eb92b-29b7-479e-8707-f39aec07234f	2025-05-11 15:00:03	0.00	AIFlow	39aa68bd-e915-4963-9823-89fef9f776b1	2025-05-10 15:00:01	0.00	AIFlow	296d1454-92eb-4def-a02b-5e5847dde469	2025-05-09 15:00:10	0.00	AIFlow	3862c854-2d87-4719-b0ec-5b68c93e7f12	2025-05-09 09:35:29	1.17	QuantChat	6e8c4226-25d1-4a4e-aab8-5d76c9a1e30e	2025-05-08 16:15:43	1104.00	AISTUDIO	0d0789b8-1129-4711-9a3f-98392685afe2	2025-05-08 15:00:04	0.00	AIFlow	f9f6f3c3-7098-48b7-b372-769745ed14f3	2025-05-07 15:12:20	0.00	AIFlow	3c3a4003-b1bb-4aa5-a8fa-0f1dc3dff0c1
订单时间	泰贝/金额	消费方式	订单编号																																												
2025-05-14 15:00:02	0.00	AIFlow	60cbb2f-38bc-4a4b-a0cd-1d3871620bb4																																												
2025-05-13 15:00:10	0.00	AIFlow	966d4c64-f943-46ac-957b-6b6e48e82437																																												
2025-05-12 15:00:09	0.00	AIFlow	625eb92b-29b7-479e-8707-f39aec07234f																																												
2025-05-11 15:00:03	0.00	AIFlow	39aa68bd-e915-4963-9823-89fef9f776b1																																												
2025-05-10 15:00:01	0.00	AIFlow	296d1454-92eb-4def-a02b-5e5847dde469																																												
2025-05-09 15:00:10	0.00	AIFlow	3862c854-2d87-4719-b0ec-5b68c93e7f12																																												
2025-05-09 09:35:29	1.17	QuantChat	6e8c4226-25d1-4a4e-aab8-5d76c9a1e30e																																												
2025-05-08 16:15:43	1104.00	AISTUDIO	0d0789b8-1129-4711-9a3f-98392685afe2																																												
2025-05-08 15:00:04	0.00	AIFlow	f9f6f3c3-7098-48b7-b372-769745ed14f3																																												
2025-05-07 15:12:20	0.00	AIFlow	3c3a4003-b1bb-4aa5-a8fa-0f1dc3dff0c1																																												

## 6.交易

交易模块包含基础交易、特色交易、套利交易和运营管理四个模块。其中基础交易模块包括普通交易、期权交易、期货交易和期货期权交易模块，展示相应的行情信息、账户资产列表、持仓列表、委托列表和成交列表等信息。

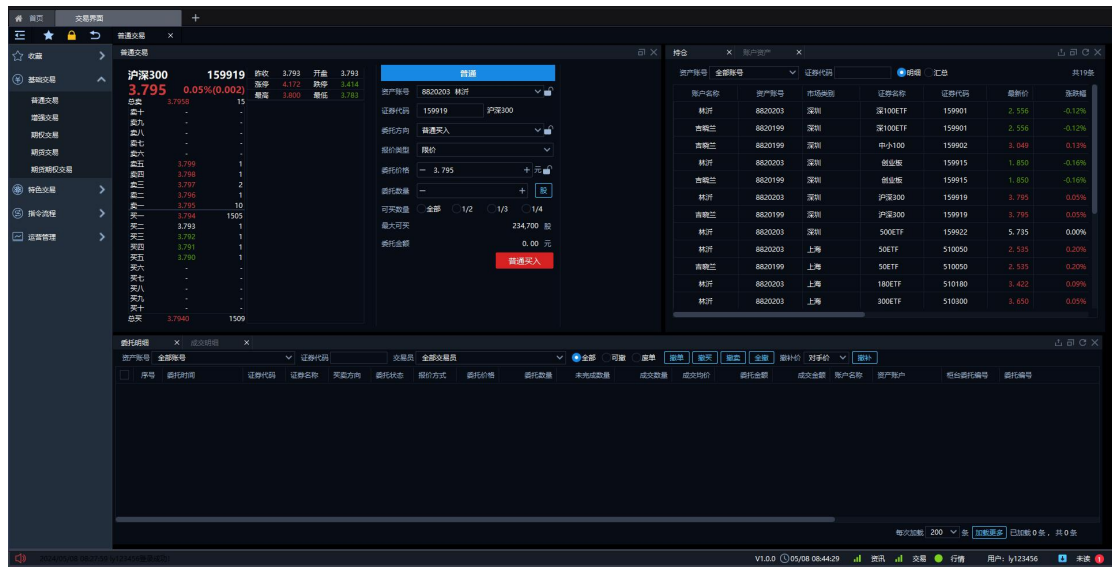
### 6.1.基础交易

#### 6.1.1.普通交易

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

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

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



### 6.1.1.1.普通交易下单


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



下单面板各字段说明如下表：

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

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

锁定：通过单击资产账号、委托方向、委托价格右侧的锁定符“”可对相应委托要素进行锁定。被锁定的要素不允许修改，若要修改需要再次点击锁定符进行解锁。

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

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

### 6.1.1.2.持仓

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

资产账号	全部账号	证券代码	明细	汇总	共19条	
账户名称	资产账号	市场类别	证券名称	证券代码	最新价	涨跌幅
林沂	8820203	深圳	深100ETF	159901	2.556	-0.12%
吉晓兰	8820199	深圳	深100ETF	159901	2.556	-0.12%
吉晓兰	8820199	深圳	中小100	159902	3.049	0.13%
林沂	8820203	深圳	创业板	159915	1.850	-0.16%
吉晓兰	8820199	深圳	创业板	159915	1.850	-0.16%
林沂	8820203	深圳	沪深300	159919	3.795	0.05%
吉晓兰	8820199	深圳	沪深300	159919	3.795	0.05%
林沂	8820203	深圳	500ETF	159922	5.735	0.00%
林沂	8820203	上海	50ETF	510050	2.535	0.20%
吉晓兰	8820199	上海	50ETF	510050	2.535	0.20%
林沂	8820203	上海	180ETF	510180	3.422	0.09%
林沂	8820203	上海	300ETF	510300	3.650	0.05%

### 6.1.1.3. 账户资产

账户资产列表展示交易下单面板中选择的普通账户的资产，支持导出资产明细。

序号	账户名称	资产账号	总资产	可用金额	可取金额
1	林沂	8820203	1,001,289.88	890,909.38	890,909.38
2	吉晓兰	8820199	572,179.68	133,618.88	133,618.88
汇总			157 3469.56	102 4528.26	102 4528.26

### 6.1.1.4. 委托明细

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

序号	委托时间	证券代码	证券名称	买卖方向	委托状态	报价方式	委托价格	委托数量	未完成数量	成交数量	成交价格	委托金额	成交金额	客户名称	资产账号	柜台委托编号	委托编号
<p>每次加载 200 条 加载更多 已加载 0 条, 共 0 条</p>																	

委托订单干预方式说明如下：

干预方式	操作说明
撤单	必须勾选委托订单后才能进行此操作,对勾选的可撤订单进行撤单
撤买	对符合筛选条件(资产账号、证券代码和交易员)的全部买方向的可撤订单进行撤单(与订单勾选情况无关)
撤卖	对符合筛选条件(资产账号、证券代码和交易员)的全部卖方向的可撤订单进行撤单(与订单勾选情况无关)
全撤	对符合筛选条件(资产账号、证券代码和交易员)全部可撤订单进行撤单(与订单勾选情况无关)
撤补	必须勾选委托订单后才能进行此操作,对勾选的可撤订单部分(已报、部成),则先撤单成功后,再按照撤补价补单;对勾选的非可撤订单部分(已撤、部撤、废单),则直接按照订单的未完成数量及撤补价进行补单
撤补价	对手价:默认值,指的是对手方一档 挂单价:指的是本方一档 最新价:行情中的最新成交价 买/卖一价到买/卖五价:行情中的买/卖 5 档盘口价 自动盘口:根据委托数量、买卖方向以及 5 档行情买卖盘的价格和数量,自动计算出的委托价格,使得按当前盘口情况可以完全成交。如果当前 5 档的盘口总量小于委托数量时则取第 5 档价格。

双击委托列表中可撤的订单,二次确认后可撤销双击的订单。

### 6.1.1.5.成交明细

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



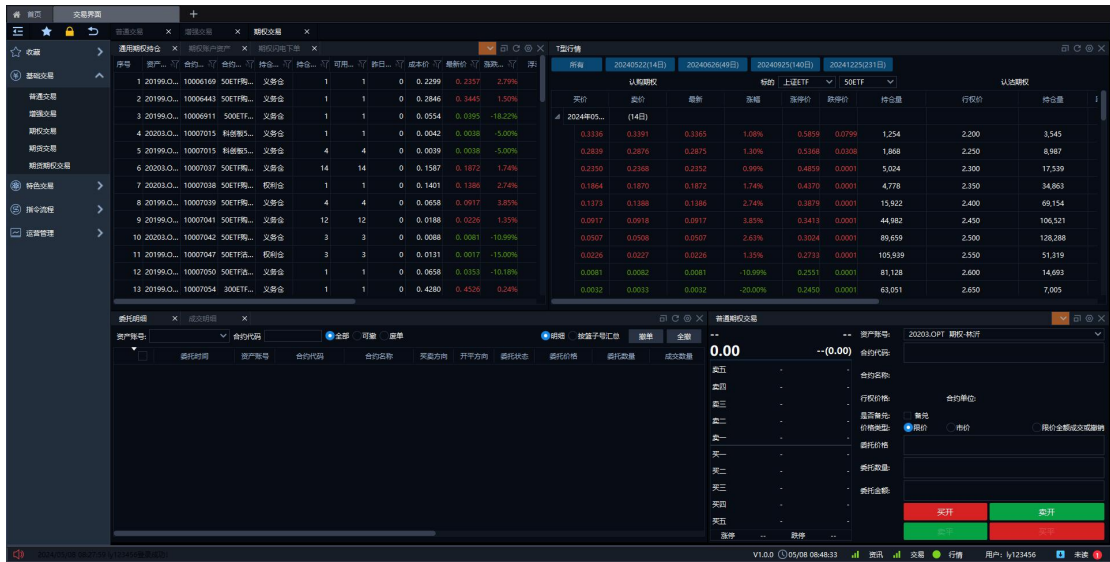
### 6.1.2.期权交易

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

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

	嘉实沪深 300ETF 期权	159919.SZ 沪深 300
	嘉实中证 500ETF 期权	159922.SZ 500ETF

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



### 6.1.2.1.通用期权持仓

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

表格列显隐设置弹窗，勾选的的字段展示，未勾选的字段隐藏。



### 6.1.2.2.期权账户资产

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

资产账号	账号名称	期初金额	当前金额	可用金额
20203	期权-林沂	1,035,249.88	1,035,249.88	1,035,249.88
20199	期权-吉晓兰	1,779,069.48	1,779,069.48	1,779,069.48

### 6.1.2.3.闪电下单

闪电下单面板，支持用户快速设置下单信息实现快速下单。

资产账号: 20203.OPT 期权-林沂  
 期权名称: 50ETF购6月2214A 合约代码: 10006167  
 现价: 0.3286 多仓: 0 空仓: 0 净持仓: 0  净仓  
 买挂单: 0 卖挂单: 0  盘口价格  详细价格

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单
		0.3347	10	
		0.3337	1	
		0.3330	1	
	1	0.3270		
	10	0.3255		
	1	0.3225		

市买 买 - 0.3286 + 卖 市卖  
 量 - 0 + +1 +5 +10 +20

闪电下单面板个字段说明如下：

字段名称	说明	备注
资产账号	下拉单选框，展示当前用户绑定的全部资产号，点击选中自动填充	
期权名称	输入合约代码自动展示对应的期权名称	
合约代码	支持手动输入合约代码，输入框支持联想双击 T 型行情中的标的时，可自动给填充对应的合约代码	
现价	当前合约的最新价	
多仓/空仓/净持仓	当前资产账号持有当前合约的持仓情况	
净仓	勾选该选项，当前资产账号持有当前标的，下	若当前资产账号有

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

### 6.1.2.4.T 型行情

T 型行情支持沪深市场切换及合约标的的切换，便于查看不同期权品种的行市。

T型行情									
所有 20240828(15日) 20240925(43日) 20241225(134日) 20250326(225日)									
认购期权			标的		上证ETF		认沽期权		
买价	卖价	最新	涨幅	涨停价	跌停价	持仓量	行权价	持仓量	
0.2038	0.2080	0.2050	-0.29%	0.4460	0.0001	1,071	2.200	14,392	
0.1550	0.1573	0.1561	0.39%	0.3959	0.0001	1,964	2.250	21,715	
0.1069	0.1072	0.1072	-0.37%	0.3480	0.0001	8,376	2.300	47,299	
0.0610	0.0611	0.0611	-1.29%	0.3023	0.0001	21,396	2.350	64,451	
0.0261	0.0262	0.0261	-4.40%	0.2677	0.0001	105,718	2.400	105,483	
0.0084	0.0085	0.0085	-3.41%	0.2446	0.0001	154,719	2.450	58,166	
0.0025	0.0026	0.0026	-3.70%	0.2335	0.0001	200,047	2.500	52,888	
0.0012	0.0013	0.0012	9.09%	0.2269	0.0001	125,639	2.550	25,001	
0.0008	0.0009	0.0009	12.50%	0.2216	0.0001	64,727	2.600	6,305	
0.0005	0.0006	0.0006	0.00%	0.2164	0.0001	41,850	2.650	2,155	

T型行情									
所有 20240828(15日) 20240925(43日) 20241225(134日) 20250326(225日)									
认购期权			标的		上证ETF		认沽期权		
买价	卖价	最新	涨幅	涨停价	跌停价	持仓量	行权价	持仓量	
0.2038	0.2080	0.2050	-0.29%	0.4460	0.0001	1,964	2.200	14,392	
0.1550	0.1573	0.1561	0.39%	0.3959	0.0001	8,376	2.250	21,715	
0.1069	0.1072	0.1072	-0.37%	0.3480	0.0001	21,396	2.300	47,299	
0.0610	0.0611	0.0611	-1.29%	0.3023	0.0001	105,718	2.350	64,451	
0.0261	0.0262	0.0261	-4.40%	0.2677	0.0001	154,719	2.400	105,483	
0.0084	0.0085	0.0085	-3.41%	0.2446	0.0001	200,047	2.450	58,166	
0.0025	0.0026	0.0026	-3.70%	0.2335	0.0001	125,639	2.500	52,888	
0.0012	0.0013	0.0012	9.09%	0.2269	0.0001	64,727	2.550	25,001	
0.0008	0.0009	0.0009	12.50%	0.2216	0.0001	41,850	2.600	6,305	
0.0005	0.0006	0.0006	0.00%	0.2164	0.0001		2.650	2,155	

### 6.1.2.5.委托明细&成交明细

#### 1、委托明细。



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

(2) 支持点击委托列栏上的快捷按钮，进行撤单、全撤操作。

撤单 & 全撤：对未成交或部分成交的委托，进行“撤单”或者“全撤”操作。

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

#### 2、成交明细。

成交明细列表分别展示当前交易面板选中资产账号当日的成交记录。



### 6.1.2.6.普通期权交易下单面板

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



委托下单的操作流程包括以下步骤：

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

2. 输入交易要素，包括合约代码、委托数量和委托价格三大要素。

- (1) 合约代码支持手工输入或双击行情（包括左侧行情盘口、T 型行情）获取。
- (2) 委托价格支持限价和市价。

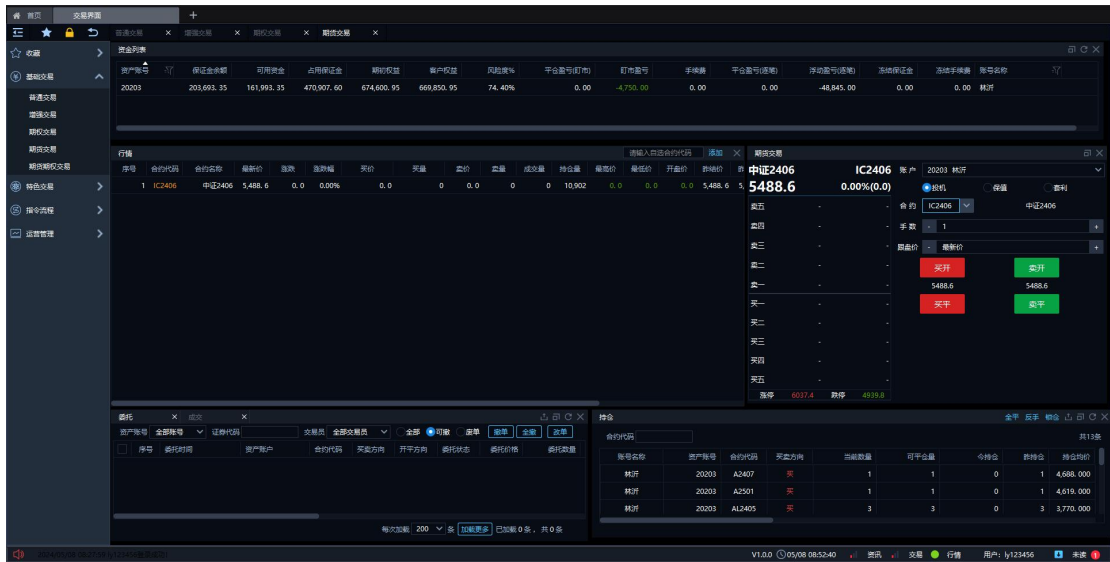
限价是指用户输入的固定价格。

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

3. 下单，支持买开、卖开、买平、卖平 4 种交易方向下单。

### 6.1.3. 期货交易

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



### 6.1.3.1.资金列表

展示当前下单面板中选中的期货账户的资金信息。



### 6.1.3.2.自选行情列表

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

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

行情															AO2406		添加
序号	合约代码	合约名称	最新价	涨跌	涨跌幅	买价	买量	卖价	卖量	成交量	持仓量	最高价	最低价	开盘价	昨结价	昨	
1	IC2412	中证2412	5,414.2	0.0	0.00%	0.0	0	0.0	0	0	909	0.0	0.0	0.0	5,414.2	5	
2	A2501	豆一2501	4,619	0	0.00%	0	0	0	0	0	1,281	0	0	0	4,619		
3	AG2406	沪银2406	1,382	78	5.98%	1,382	28	0	0	385	4,320	1,382	1,245	1,350	1,304		
4	A2409	豆一2409	4,949	279	5.97%	4,391	161	4,949	72	11	2,602	4,949	4,390	4,390	4,670		
5	AO2406	氧化铝2406	4,188	380	9.98%	3,787	1	0	0	14	431	4,188	3,787	3,787	3,808		

### 6.1.3.3.交易面板

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



委托下单的操作流程包括以下步骤：

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

2.输入交易要素，包括合约代码、委托数量和委托价格三大要素。

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

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

跟盘价取值说明：

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

3.点击下单按钮下单，支持买开、卖开、买平、卖平 4 种交易方向下单。

备注：标的选择上期所品种时，支持优先平今仓，如下图所示：



#### 6.1.3.4.委托明细&成交明细

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

##### 1、委托明细



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

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

1) 撤单&全撤：对未成交或部分成交的委托，进行“撤单”或者“全撤”操作。

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

##### 2、成交明细

支持按资产账号、证券代码和交易员筛选成交记录。



### 6.1.3.5.持仓列表

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



1) 全平：所有可平持仓一次全部平仓。

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

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

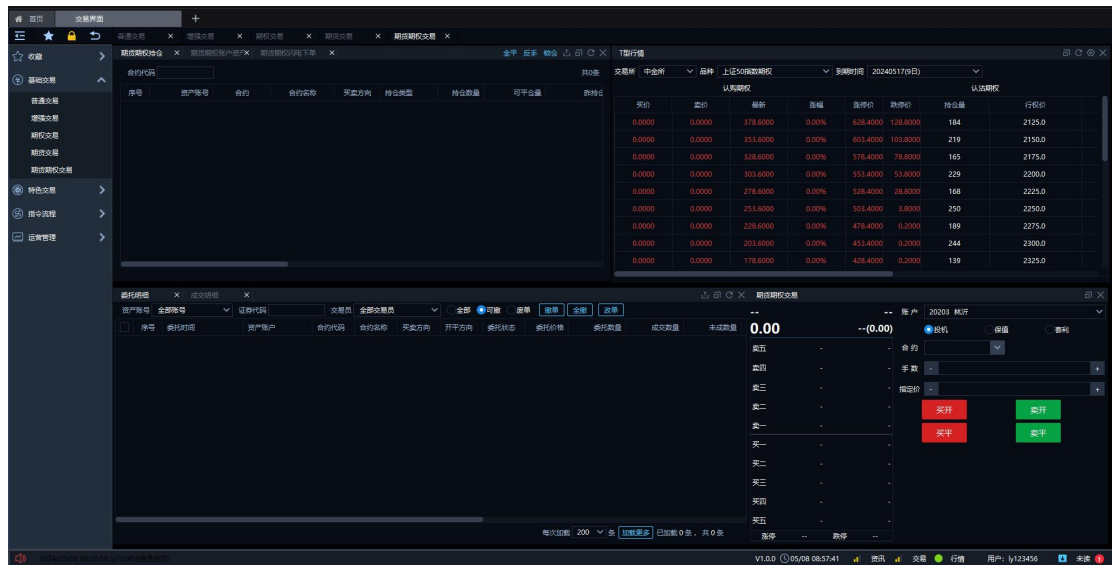


3) 锁仓：对已有的持仓反向开仓，即开仓相同数量，方向相反的不同合约。

### 6.1.4.期货期权交易

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

面板，如下图所示：



#### 6.1.4.1.期货期权持仓

展示交易面板当前选中资金账户的持仓情况，包括持仓类型、盯市盈亏、占用保证金、浮动盈亏和持仓市值等信息，支持按合约代码筛选持仓记录，支持持仓数据导出。



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

#### 6.1.4.2.期货期权账户资产

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

资产账号	保证金余额	可用资金	占用保证金	期初权益	客户权益	风险度%	盯市盈亏
20203	203,693.35	161,883.04	470,907.60	674,600.95	669,850.95	74.40%	-4,750.00

### 6.1.4.3.期货期权闪电下单

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

资产账号: 20203 林沂  
 期权名称: 合约代码:   
 现价: 多仓:  空仓:  净持仓:  净仓  
 买挂单: 卖挂单:  盘口价格  详细价格

自买单 市场买 价格 市场卖 自卖单

市买 买 - + 卖 市卖

量 - 0 + +1 +5 +10 +20

### 6.1.4.4.期货期权 T 型行情

支持切换查看不同交易所、不同品种不同到期时间的合约的行情。

交易所	品种	最新	涨幅	涨停价	跌停价	持仓量	行权价
中金所	认购期权	378.6000	0.00%	628.4000	128.8000	184	2125.0
上期所	认沽期权	353.6000	0.00%	603.4000	103.8000	219	2150.0
郑商所		328.6000	0.00%	578.4000	78.8000	165	2175.0
大商所		303.6000	0.00%	553.4000	53.8000	229	2200.0
能源中心		278.6000	0.00%	528.4000	28.8000	168	2225.0
广期所		253.6000	0.00%	503.4000	3.8000	250	2250.0
		228.6000	0.00%	478.4000	0.2000	189	2275.0
		203.6000	0.00%	453.4000	0.2000	244	2300.0
		178.6000	0.00%	428.4000	0.2000	139	2325.0

### 6.1.4.5.委托明细&成交明细

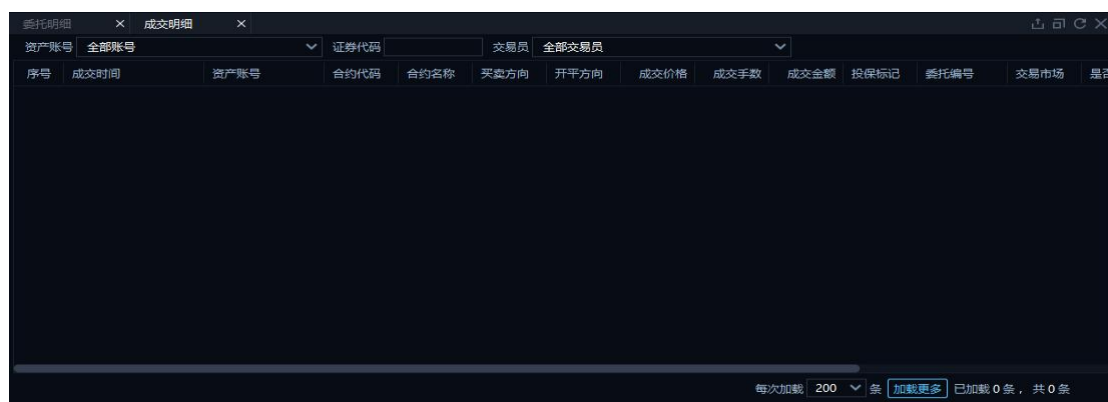
委托明细列表和成交列表分别展示交易面板当前选中资产账号当日的委托记录和成交记录。

#### 1、委托明细



同 4.1.4.4 委托明细&成交明细。

#### 2、成交明细



同 4.1.4.4 委托明细&成交明细。

### 6.1.4.6.交易面板

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



同 4.1.4.3 交易面板。

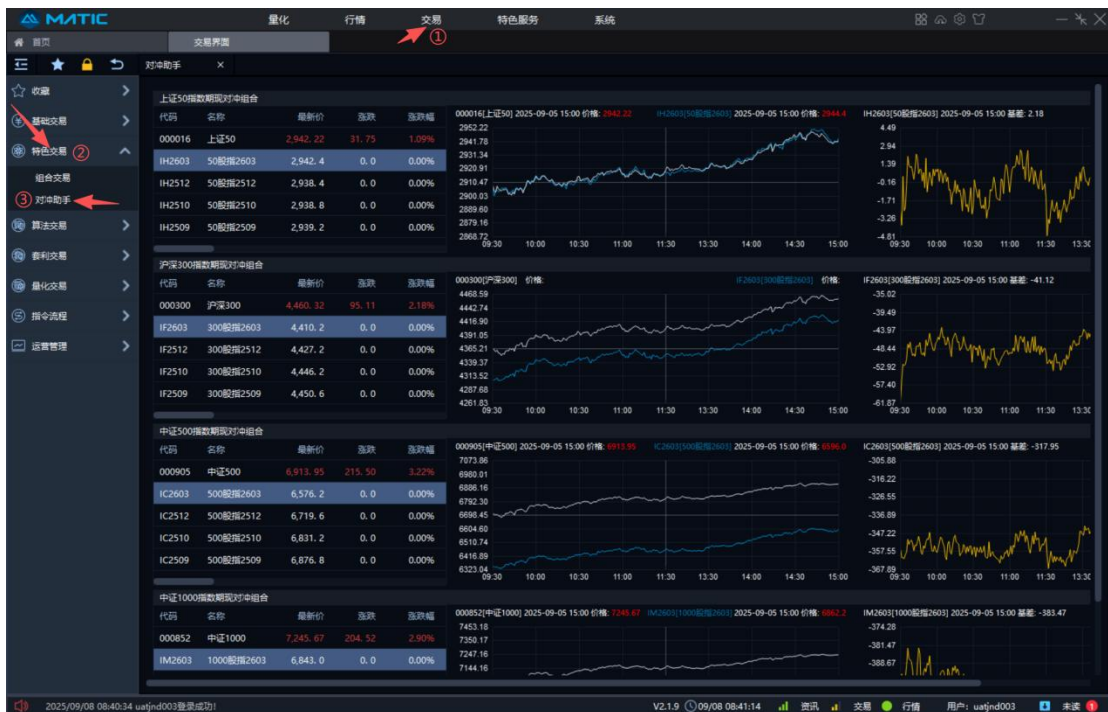
## 6.2.特色交易

### 6.2.1.对冲助手

#### 6.2.1.1.功能介绍

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

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



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

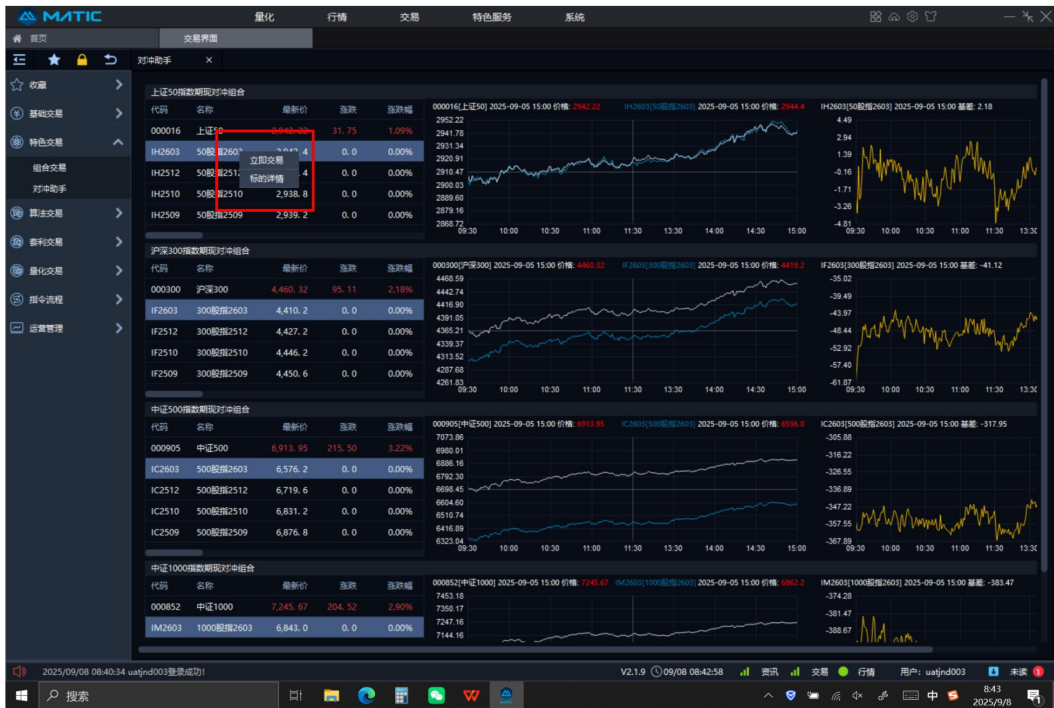
时行情信息以及基差信息。

### 6.2.1.2.系统交互

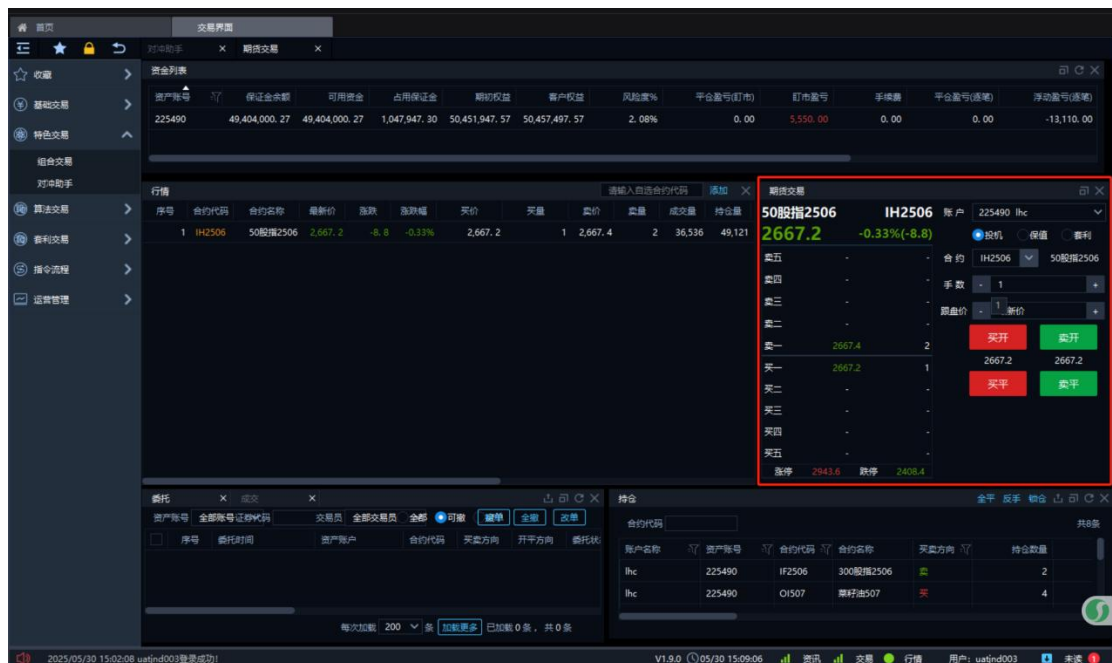
左侧期现组合列表中单击期货合约列表,右侧相应切换选中合约的分时行情和基差信息。

左侧期现组合列表中双击期货合约列表,在新窗口打开相应合约的标的详情页,展示标的合约详细的行情信息,该操作同鼠标右键选择标的详情页信息。

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



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



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

示例界面：



### 6.3. 算法交易

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

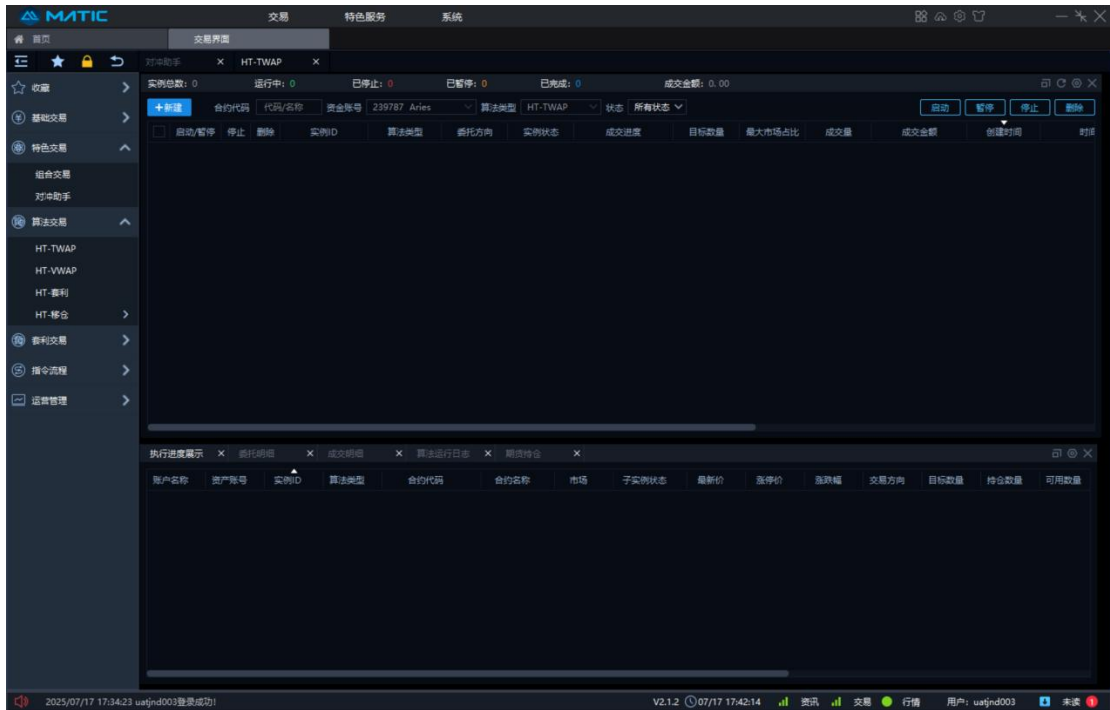
MATIC 系统通过引入市场认可的优秀算法，结合自身数据分析能力、专业模型能力和交易规划能力，为投资者提供更丰富的选择和更灵活的算法服务，帮助投资者更高效地跟踪市场变化，合理执行交易，降低交易成本，管理交易风险。

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

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

功能分类	主功能	子功能	主要功能点
管理类	实例管理	实例列表	创建/修改/复制/启动/暂停/停止/删除算法实例，展示实例执行情况和执行状态。
交易类	实例监控	执行进度展示	展示选中实例的执行进度。
		委托明细	展示选中实例执行的委托明细数据。
		成交明细	展示选中实例执行的成交明细数据
		算法运行日志	展示选中实例运行的日志记录。
		期货持仓	展示期货资金账户的持仓明细数据。

全局界面如下：



### 6.3.1.HT-TWAP

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

#### 6.3.1.1.实例列表

##### 6.3.1.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。



算法创建参数说明如下：

#### (1) 实例参数模板

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

## (2) 账户名称

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

## (3) 算法类型

选择框，默认值 HT-TWAP。

## (4) 合约代码

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

## (5) 市场

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

## (6) 委托数量

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

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

## (7) 限价

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

## (8) 交易方向

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

## (9) 平今/昨

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

## (10) 算法开始时间

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

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

180 分、240 分”。

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

#### (11) 算法过期时间

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

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

#### (12) 风格参数

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

#### (13) 最大市场占比

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

#### (14) 最小委托金额

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

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

#### (15) 相对限价

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

#### (16) 单位

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

#### (17) 变化量

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

相对限价、单位、变化量关系如下：

(1) 单位为价格最小变动单位

·对于买单:相对限价=基准价+单位\*变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-单位\*变化量

(2) 单位为基点

·对于买单:相对限价=基准价\*(1+变化量\*万分之一)

·对于卖单:相对限价=基准价\*(1-变化量\*万分之一)

(3) 单位为金额

·对于买单:相对限价=基准价+变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-变化量

(4) 单位为百分比

·对于买单:相对限价=基准价\*(1+变化量%)\*100%

·对于卖单:相对限价=基准价\*(1-变化量%)\*100%

实际拆单时, 委托价格须同时满足限价和相对限价参数。

#### (18) 涨跌停委托

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

#### (19) 投保标记

选择框, 选填项, 展示默认值投机。

#### (20) 备注

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

#### (21) 创建后关闭

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

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

### 6.3.1.1.2.算法改单

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



### 6.3.1.1.3.算法复制

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



### 6.3.1.1.4.启动/暂停/停止/删除

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



各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

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

### 6.3.1.2.执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。



### 6.3.1.3.委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。



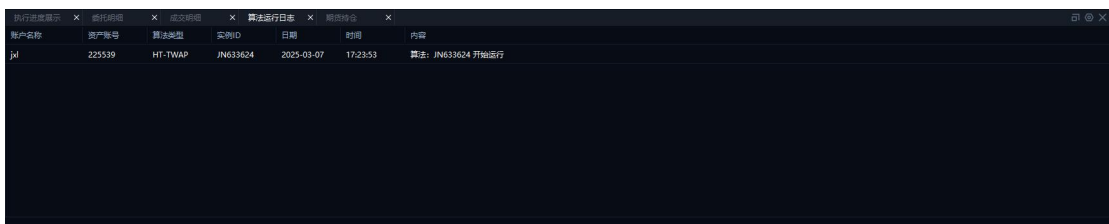
### 6.3.1.4.成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。



### 6.3.1.5.算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。



### 6.3.1.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。



## 6.3.2.HT-VWAP

HT-VWAP 是指在指定的时间间隔内，结合历史交易量分布及当天实时交易量情况进行下单的算法，旨在以一个尽可能接近市场按成交量加权的均价进行交易，尽量降低对市场的

冲击。适用于希望成交均价接近该时间段内的市场均价（按成交量加权），交易比较频繁、流动性好，并且成交量分布比较规律的标的（大概率和历史成交量分布吻合度高）。

### 6.3.2.1.实例列表

#### 6.3.2.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。



算法创建参数说明如下：

##### (1) 实例参数模板

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

##### (2) 账户名称

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

##### (3) 算法类型

选择框，默认值 HT-VWAP。

##### (4) 合约代码

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

##### (5) 市场

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

##### (6) 委托数量

输入框，必填项，只允许输入正整数，数值输入上限为 10 位数，超出则无法输入，合

约代码选择后，输入框右侧显示对应的数量单位（随着合约代码切换自动变化），委托数量不能小于该合约单笔(合约限价有最小下单数量)最小下单数量。

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

#### **(7) 限价**

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

#### **(8) 交易方向**

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

#### **(9) 平今/昨**

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

#### **(10) 算法开始时间**

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

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

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

#### **(11) 算法过期时间**

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

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

#### **(12) 风格参数**

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

### (13) 最大市场占比

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

### (14) 最小委托金额

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

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

### (15) 相对限价

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

### (16) 单位

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

### (17) 变化量

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

相对限价、单位、变化量关系如下：

#### (1) 单位为价格最小变动单位

·对于买单:相对限价=基准价+单位\*变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-单位\*变化量

#### (2) 单位为基点

·对于买单:相对限价=基准价\*（1+变化量\*万分之一）

·对于卖单:相对限价=基准价\*（1-变化量\*万分之一）

#### (3) 单位为金额

·对于买单:相对限价=基准价+变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-变化量

#### (4) 单位为百分比

·对于买单:相对限价=基准价\*（1+变化量%）\*100%

·对于卖单:相对限价=基准价\*（1-变化量%）\*100%

实际拆单时，委托价格须同时满足限价和相对限价参数。

### (18) 涨跌停委托

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

停不卖、涨跌停挂剩余量、涨跌停委托。

### (19) 投保标记

选择框，选填项，展示默认值投机。

### (20) 备注

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

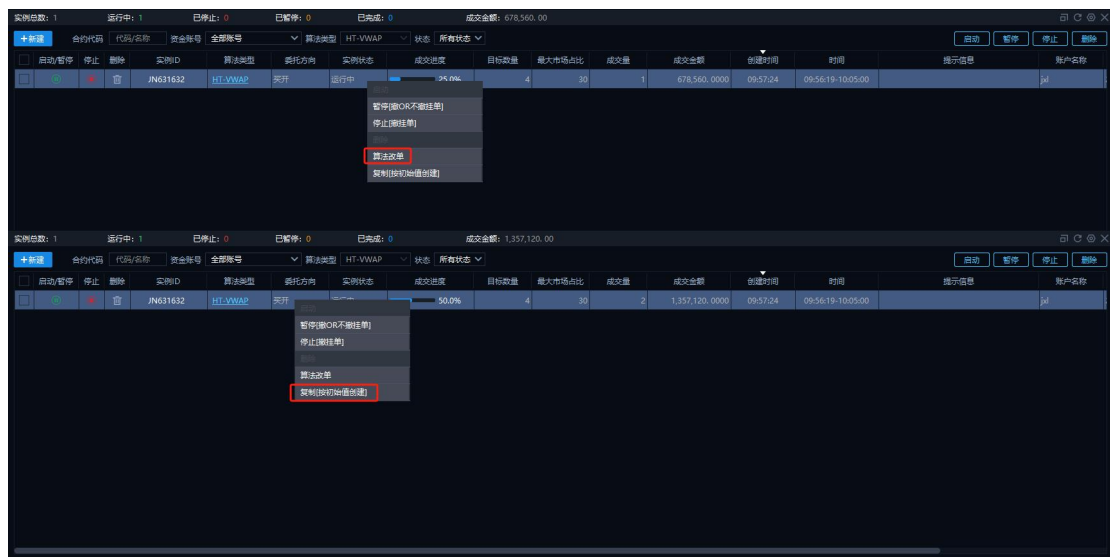
### (21) 创建后关闭

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

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

## 6.3.2.1.2.算法改单

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



## 6.3.2.1.3.算法复制

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

## 6.3.2.1.4.启动/暂停/停止/删除

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



各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

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

### 6.3.2.2. 执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。



### 6.3.2.3. 委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。



### 6.3.2.4. 成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

序号	成交时间	合约代码	合约名称	交易市场	买卖方向	开平方向	报单标记	成交价格	成交数量	成交金额	客户名称	资产账户	成交编号	柜台委托编号	委托编号	实例ID	实例备注	备注
10	2024/12/23 14:59:30	IF2501	300股指期货	中金所	买	开仓	投机	3,937.6...	1	1,181,280.0...	林沂	20203	173557	2458762	101-202412...	JN599852	IF2501...	G-VV
9	2024/12/23 14:56:22	IF2501	300股指期货	中金所	买	开仓	投机	3,936.4...	1	1,180,920.0...	林沂	20203	170463	2438134	101-202412...	JN599852	IF2501...	G-VV
8	2024/12/23 14:54:31	IF2501	300股指期货	中金所	买	开仓	投机	3,935.2...	1	1,180,560.0...	林沂	20203	168883	2416525	101-202412...	JN599852	IF2501...	G-VV
7	2024/12/23 14:53:19	IF2501	300股指期货	中金所	买	开仓	投机	3,934.6...	1	1,180,380.0...	林沂	20203	167886	2404056	101-202412...	JN599852	IF2501...	G-VV
6	2024/12/23 14:50:49	IF2501	300股指期货	中金所	买	开仓	投机	3,936.4...	1	1,180,920.0...	林沂	20203	165998	2378808	101-202412...	JN599852	IF2501...	G-VV
5	2024/12/23 14:48:49	IF2501	300股指期货	中金所	买	开仓	投机	3,939.8...	1	1,181,940.0...	林沂	20203	164473	2357665	101-202412...	JN599852	IF2501...	G-VV
4	2024/12/23 14:47:39	IF2501	300股指期货	中金所	买	开仓	投机	3,940.0...	1	1,182,000.0...	林沂	20203	163779	2346132	101-202412...	JN599852	IF2501...	G-VV

### 6.3.2.5.算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。

账户名称	资产编号	算法类型	实例ID	日期	时间	内容
jhl	225539	HT-VWAP	JN633625	2025-03-07	17:24:48	算法: JN633625 开始运行

### 6.3.2.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。

账户名称	资产编号	合约代码	买卖方向	持仓数量	可平数量	令持仓	持仓	持仓均价	最新价	盯市盈亏	平仓盈亏-盯市	占用保证金	手续费	报单标记	交易
林沂	20203	AP501	苹果501	1	1	0	1	7,460.000	6,870	-5,900.00	0.00	14,920.00	0.00	投机	持仓
ly123456	225511	AP503	苹果503	2	2	0	2	2,357.000	7,076	-5,620.00	0.00	22,071.00	0.00	投机	持仓
林沂	20203	FG501	玻璃501	17	17	0	17	1,240.000	1,238	-1,360.00	0.00	96,968.00	0.00	投机	持仓
ly123456	225511	FG501	玻璃501	3	3	0	3	1,240.000	1,236	-240.00	0.00	12,648.00	0.00	投机	持仓
林沂	20203	IC2412	中证500指数24...	10	10	0	10	5,909.000	...	...	0.00	1,772,700.00	0.00	投机	持仓
林沂	20203	IC2412	中证500指数24...	88	88	0	88	5,909.000	...	...	0.00	15,999,760.00	0.00	投机	持仓
林沂	20203	IF2501	500股指期货2501	90	90	3	87	5,868.867	5,803.0	-1,756,600.00	0.00	15,676,840.00	241.67	投机	持仓

## 6.3.3.HT-套利

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

### 6.3.3.1.实例列表

#### 6.3.3.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。



算法创建策略相关参数说明如下：

### (1) 实例参数模板

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

### (2) 账户名称

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

### (3) 算法类型

选择框，默认值 HT-套利。

### (4) 算法开始时间

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

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

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

### (5) 算法过期时间

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

注意：算法过期时间不能早于当前系统时间，算法过期时间不能早于算法开始时间。算法开始/过期时间设置上不支持跨日，仅支持设置一个交易日内从夜盘开始-日盘休市的时间

段的策略，具体的开/收盘时间以所选择品种合约在交易所的开收盘时间为准。

#### (6) 风格参数

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

#### (7) 机会阈值

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

#### (8) 单次最大手数

算法实例拆单过程中，单次允许拆单的最大手数值。输入框，必填项。

#### (9) 套利间隔

出现套利机会时，触发算法实例拆单的最小时间间隔。输入框，必填项。

#### (10) 机会稳定时间

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

#### (11) 交易方式

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

#### (12) 智能模式

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

#### (13) 备注

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

**算法创建标的相关参数说明如下：**

#### (1) 合约代码

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

#### (2) 合约名称

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的合约名称。

#### (3) 市场

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

#### (4) 可平仓量

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

#### (5) 委托数量

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

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

#### (6) 交易方向

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

#### (7) 平今/昨

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

#### (8) 限价

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

#### (9) 投保标记

选择框，选填项，展示默认值投机。

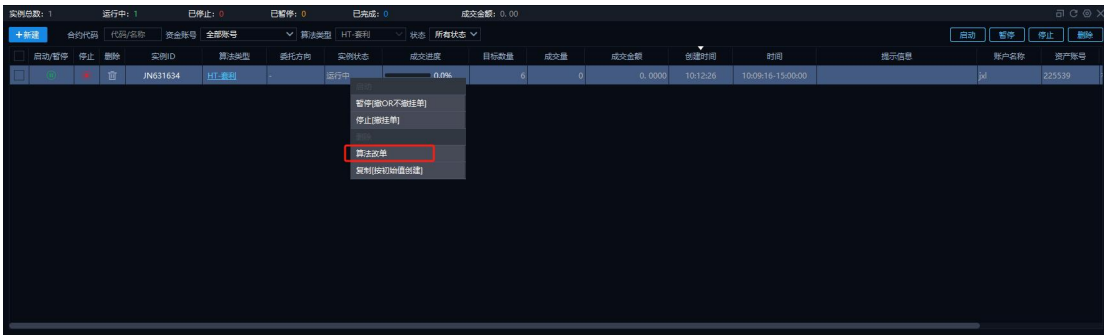
#### (10) 创建后关闭

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

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

### 6.3.3.1.2.算法改单

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



### 6.3.3.1.3.算法复制

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



### 6.3.3.1.4.启动/暂停/停止/删除

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



各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

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

### 6.3.3.2.执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。

账户名称	资产账号	实例ID	算法类型	合约代码	合约名称	市场	子实例状态	最新价	涨停价	涨跌幅	交易方向	目标数量	持仓数量	可用数量	委托比率	委托总量	成交比率	成交总量
jl	225539	JN631634_1	HT-套利	au2504	沪金2504	上期所	运行中	677.70	747.38	-0.26%	卖开	3	5	5	0.0%	0	0.0%	0
jl	225539	JN631634_2	HT-套利	au2505	沪金2505	上期所	运行中	679.00	748.02	-0.15%	买开	3	0	0	0.0%	0	0.0%	0

### 6.3.3.3.委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

序号	委托时间	账户名称	实例ID	合约代码	合约名称	交易市场	交易方向	开平方向	报单标志	价格类型	委托状态	委托价格	委托数量	委托金额	
11	2024/12/23 14:58:12	林开	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,937.6000	1	1,181,280.0000
10	2024/12/23 14:56:22	林开	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,936.6000	1	1,180,980.0000
9	2024/12/23 14:54:31	林开	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,935.4000	1	1,180,620.0000
8	2024/12/23 14:54:18	林开	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,934.6000	1	1,180,380.0000
7	2024/12/23 14:52:37	林开	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,933.8000	1	1,180,140.0000
6	2024/12/23 14:50:49	林开	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,936.8000	1	1,181,040.0000
5	2024/12/23 14:48:49	林开	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,940.0000	1	1,182,000.0000

### 6.3.3.4.成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

序号	成交时间	合约代码	合约名称	交易市场	交易方向	开平方向	报单标志	成交价格	成交数量	成交金额	账户名称	资产账号	实例ID	实例备注	算法
10	2024/12/23 14:59:30	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,937.6...	1	1,181,280.0...	林开	20203	JN599852	IF2501...	G-VV
9	2024/12/23 14:56:22	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,936.4...	1	1,180,920.0...	林开	20203	JN599852	IF2501...	G-VV
8	2024/12/23 14:54:31	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,935.2...	1	1,180,560.0...	林开	20203	JN599852	IF2501...	G-VV
7	2024/12/23 14:53:19	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,934.6...	1	1,180,380.0...	林开	20203	JN599852	IF2501...	G-VV
6	2024/12/23 14:50:49	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,936.4...	1	1,180,920.0...	林开	20203	JN599852	IF2501...	G-VV
5	2024/12/23 14:48:49	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,939.8...	1	1,181,940.0...	林开	20203	JN599852	IF2501...	G-VV
4	2024/12/23 14:47:39	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,940.0...	1	1,182,000.0...	林开	20203	JN599852	IF2501...	G-VV

### 6.3.3.5.算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。

账户名称	资产账号	算法类型	实例ID	日期	时间	内容
jl	225539	HT-套利	JN631634	2025-03-07	10:18:36	[JN631634_2]改单成功
jl	225539	HT-套利	JN631634	2025-03-07	10:18:36	[JN631634_1]改单成功
jl	225539	HT-套利	JN631634	2025-03-07	10:17:52	[JN631634_2]改单成功
jl	225539	HT-套利	JN631634	2025-03-07	10:17:52	[JN631634_1]改单成功
jl	225539	HT-套利	JN631634	2025-03-07	10:12:26	算法: JN631634_2 开始运行
jl	225539	HT-套利	JN631634	2025-03-07	10:12:26	算法: JN631634_1 开始运行

### 6.3.3.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。

资产名称	资产账号	合约代码	合约名称	买卖方向	持仓数量	可平仓量	今持仓	昨持仓	持仓均价	最新价	订单盈亏	平仓盈亏	占用保证金	手续费	质押标记	交易
林开	20203	AP901	苹果901	买	1	1	0	1	7,460.000	6,870	-590.00	0.00	14,920.00	0.00	投机	持仓
ly123456	225511	AP903	苹果903	买	2	2	0	2	7,357.000	7,076	-560.00	0.00	22,071.00	0.00	投机	持仓
林开	20203	FG501	玻璃501	买	17	17	0	17	1,240.000	1,236	-1,950.00	0.00	96,956.00	0.00	投机	持仓
ly123456	225511	FG501	玻璃501	买	3	3	0	3	1,240.000	1,236	-240.00	0.00	12,648.00	0.00	投机	持仓
林开	20203	IC2412	中证500指数24...	买	10	10	0	10	5,909.000	--	--	0.00	1,772,700.00	0.00	投机	持仓
林开	20203	IC2412	中证500指数24...	买	88	88	0	88	5,909.000	--	--	0.00	15,599,760.00	0.00	投机	持仓
林开	20203	IC2501	中证500指数2501	买	00	00	3	87	5,888.867	5,891.0	-1,725,600.00	0.00	14,626,640.00	0.00	投机	持仓

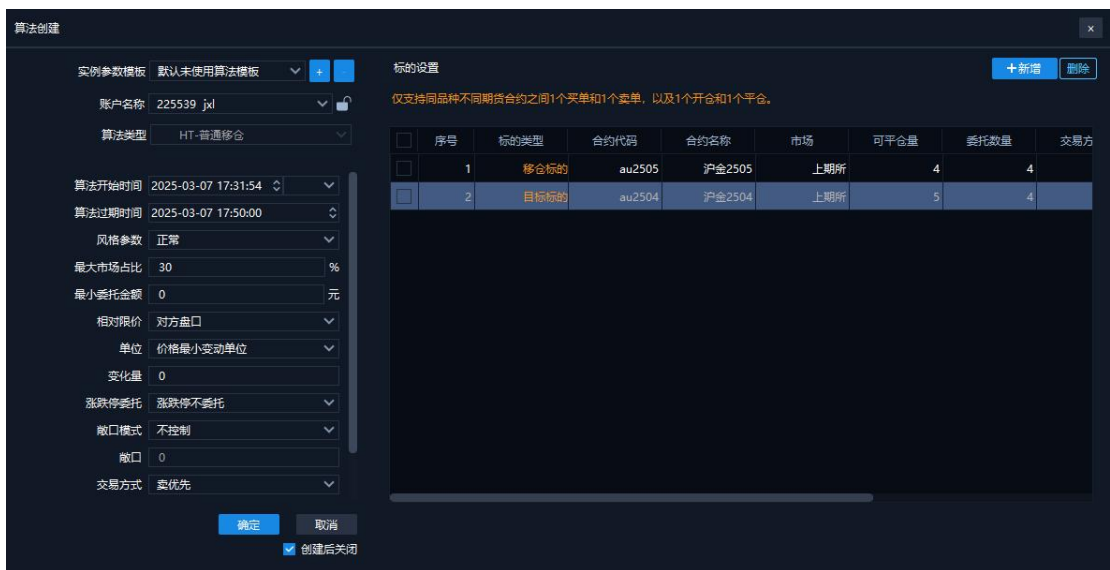
### 6.3.4.HT-移仓/普通移仓

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

#### 6.3.4.1.实例列表

##### 6.3.4.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。



算法创建策略相关参数说明如下：

#### (1) 实例参数模板

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

#### (2) 账户名称

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

#### (3) 算法类型

选择框，默认值 HT-普通移仓。

#### (4) 算法开始时间

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

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

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

#### **(5) 算法过期时间**

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

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

#### **(6) 风格参数**

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

#### **(7) 最大市场占比**

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

#### **(8) 最小委托金额**

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

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

#### **(9) 相对限价**

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

#### **(10) 单位**

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

#### **(11) 变化量**

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

相对限价、单位、变化量关系如下：

(1) 单位为价格最小变动单位

·对于买单:相对限价=基准价+单位\*变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-单位\*变化量

(2) 单位为基点

·对于买单:相对限价=基准价\*(1+变化量\*万分之一)

·对于卖单:相对限价=基准价\*(1-变化量\*万分之一)

(3) 单位为金额

·对于买单:相对限价=基准价+变化量

·对于卖单:相对限价=基准价-变化量

(4) 单位为百分比

·对于买单:相对限价=基准价\*(1+变化量%)\*100%

·对于卖单:相对限价=基准价\*(1-变化量%)\*100%

实际拆单时，委托价格须同时满足限价和相对限价参数。

#### (12) 涨跌停委托

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

#### (13) 敞口模式

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

#### (14) 敞口

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

#### (15) 交易方式

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

#### (16) 执行策略

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

#### (17) 备注

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

**算法创建标的相关参数说明如下：**

**(1) 合约代码**

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

**(2) 合约名称**

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的合约名称。

**(3) 市场**

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

**(4) 可平仓量**

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

**(5) 委托数量**

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

**(6) 交易方向**

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

**(7) 平今/昨**

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

**(8) 限价**

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

**(9) 投保标记**

选择框，选填项，展示默认值投机。

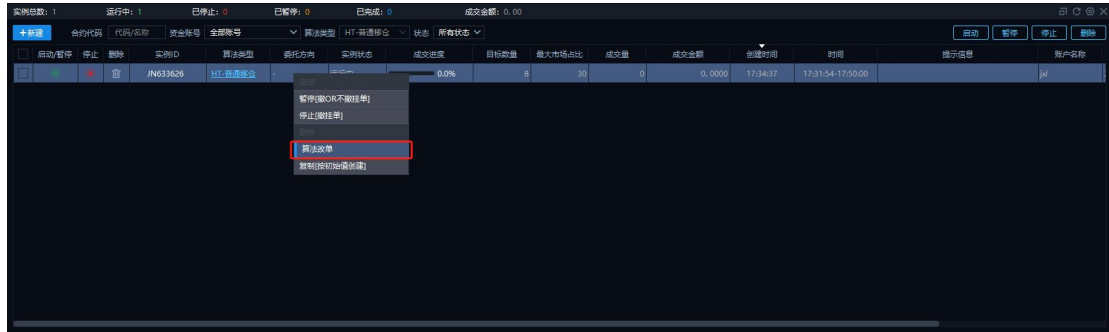
**(10) 创建后关闭**

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

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

### 6.3.4.1.2.算法改单

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



### 6.3.4.1.3.算法复制

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



### 6.3.4.1.4.启动/暂停/停止/删除

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



各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

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

### 6.3.4.2.执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。

账户名称	资产账号	实例ID	合约类型	合约代码	合约名称	市场	子实例状态	最新价	涨停价	跌停价	交易方向	目标数量	持仓数量	可用数量	委托进度	委托总量	成交进度	成交总量
jl	225539	JN633626_1	HT-普通移仓	au2505	沪金2505	上期所	运行中	680.26	748.00	0.04%	买开	4	4	4	0.0%	0	0.0%	
jl	225539	JN633626_2	HT-普通移仓	au2504	沪金2504	上期所	运行中	679.48	747.38	0.01%	买开	4	5	5	0.0%	0	0.0%	

### 6.3.4.3.委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

序号	委托时间	客户名称	客户代码	实例ID	合约代码	合约名称	交易市场	买卖方向	开平方向	报单标志	价格类型	委托状态	委托价格	委托数量	委托金额
11	2024/12/23 14:58:12	林沂	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,937.6000	1	1,181,280.0000
10	2024/12/23 14:56:22	林沂	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,936.6000	1	1,180,980.0000
9	2024/12/23 14:54:31	林沂	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,935.4000	1	1,180,620.0000
8	2024/12/23 14:53:18	林沂	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,934.6000	1	1,180,380.0000
7	2024/12/23 14:52:37	林沂	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,933.8000	1	1,180,140.0000
6	2024/12/23 14:50:49	林沂	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,936.8000	1	1,181,040.0000
5	2024/12/23 14:48:49	林沂	20203	JN599852	IF2501	300股指期货2501	中金所	买	开仓	报单	限价	已报	3,940.0000	1	1,182,000.0000

### 6.3.4.4.成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

序号	成交时间	合约代码	合约名称	交易市场	买卖方向	开平方向	报单标志	成交价格	成交数量	成交金额	客户名称	资产账号	成交编号	柜台委托编号	委托编号	实例ID	实例备注
10	2024/12/23 14:59:30	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,937.6...	1	1,181,280.0...	林沂	20203	173557	2458762	101-202412...	JN599852	IF2501...
9	2024/12/23 14:56:22	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,936.4...	1	1,180,920.0...	林沂	20203	170463	2438134	101-202412...	JN599852	IF2501...
8	2024/12/23 14:54:31	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,935.2...	1	1,180,560.0...	林沂	20203	168883	2416525	101-202412...	JN599852	IF2501...
7	2024/12/23 14:53:19	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,934.6...	1	1,180,380.0...	林沂	20203	167886	2404056	101-202412...	JN599852	IF2501...
6	2024/12/23 14:50:49	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,936.4...	1	1,180,920.0...	林沂	20203	165998	2378808	101-202412...	JN599852	IF2501...
5	2024/12/23 14:48:49	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,939.8...	1	1,181,940.0...	林沂	20203	164473	2357665	101-202412...	JN599852	IF2501...
4	2024/12/23 14:47:39	IF2501	300股指期货...	中金所	买	开仓	报单	3,940.0...	1	1,182,000.0...	林沂	20203	163779	2346132	101-202412...	JN599852	IF2501...

### 6.3.4.5.算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。

账户名称	资产账号	算法类型	实例ID	日期	时间	市场
jl	225539	HT-普通移仓	JN633626	2025-03-07	17:34:37	算法: JN633626_1 开始运行
jl	225539	HT-普通移仓	JN633626	2025-03-07	17:34:37	算法: JN633626_2 开始运行

### 6.3.4.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。

资产名称	资产编号	合约代码	合约名称	买卖方向	持仓数量	可平仓位	今持仓	昨持仓	持仓均价	最新价	订单盈亏	平仓盈亏	持仓盈亏	手续费	质押记录	交易
林开	20203	AP901	苹果501	买	1	1	0	1	7,460.000	6,870	-5,900.00	0.00	14,920.00	0.00	投机	持仓
ly123456	225511	AP903	苹果503	买	2	2	0	2	7,357.000	7,076	-5,620.00	0.00	22,071.00	0.00	投机	持仓
林开	20203	FG501	玻璃501	买	17	17	0	17	1,240.000	1,235	-1,950.00	0.00	96,956.00	0.00	投机	持仓
ly123456	225511	FG501	玻璃501	买	3	3	0	3	1,240.000	1,235	-240.00	0.00	12,648.00	0.00	投机	持仓
林开	20203	IC2412	中证500指数24...	买	10	10	0	10	5,909.000	--	--	0.00	1,772,700.00	0.00	投机	持仓
林开	20203	IC2412	中证500指数24...	买	88	88	0	88	5,909.000	--	--	0.00	15,599,760.00	0.00	投机	持仓
林开	20203	IC2412	中证500指数24...	买	88	88	0	88	5,909.000	--	--	0.00	15,599,760.00	0.00	投机	持仓

### 6.3.5.HT-移仓/套利移仓

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

#### 6.3.5.1.实例列表

##### 6.3.5.1.1.算法创建

在实例列表上方点击“新建”按钮，弹出算法创建页面，可在此页面进行参数设置。



算法创建策略相关参数说明如下：

#### (1) 实例参数模板

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

#### (2) 账户名称

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

#### (3) 算法类型

选择框，默认值 HT-套利移仓。

#### (4) 算法开始时间

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

右侧选择框即算法执行时间，相关关系为：算法开始时间+算法执行时间+非交易时间

(如含)=算法过期时间, 过滤掉非交易时间, 鼠标悬停该区域, 提示“仅剔除日盘非交易时间”, 默认空白, 下拉可以选择“空白、15分、20分、30分、40分、45分、60分、120分、180分、240分”。

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

#### (5) 算法过期时间

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

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

#### (6) 风格参数

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

#### (7) 机会阈值

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

#### (8) 单次最大手数

算法实例拆单过程中, 单次允许拆单的最大手数值。输入框, 必填项。

#### (9) 套利间隔

出现套利机会时, 触发算法实例拆单的最小时间间隔。输入框, 必填项。

#### (10) 机会稳定时间

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

#### (11) 交易方式

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

#### (12) 智能模式

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

#### (13) 备注

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

值 限价+数值。

**算法创建标的相关参数说明如下：**

**(1) 合约代码**

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

**(2) 合约名称**

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的合约名称。

**(3) 市场**

填写框，必填项，不支持手工输入，合约代码选择后，自动带入对应的市场名称。

**(4) 可平仓量**

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

**(5) 委托数量**

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

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

**(6) 交易方向**

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

**(7) 平今/昨**

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

**(8) 限价**

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

**(9) 投保标记**

选择框，选填项，展示默认值投机。

**(10) 创建后关闭**

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

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

### 6.3.5.1.2.算法改单

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



### 6.3.5.1.3.算法复制

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



### 6.3.5.1.4.启动/暂停/停止/删除

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



各操作类型与对应的执行状态关系如下：

启动：针对“已暂停”状态的算法可以操作。

暂停：针对“运行中”状态的算法可以操作。

停止：针对“未启动”、“运行中”和“已暂停”状态的算法可以操作。

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

### 6.3.5.2.执行进度展示

展示所选中实例对应的合约标的执行进度。

### 6.3.5.3.委托明细

展示所选中实例运行过程中已下单的委托订单，支持撤单、撤买、撤卖和全撤操作。

撤单：勾选委托状态为已报、部成的委托订单，可对委托订单进行撤单操作；

撤买：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托买单进行撤单操作；

撤卖：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托卖单进行撤单操作；

全撤：点击可对所有委托状态为已报、部成的委托订单进行撤单操作。

### 6.3.5.4.成交明细

展示实例列表中所选中实例的成交订单。

### 6.3.5.5.算法运行日志

展示所选中实例运行的日志记录。

### 6.3.5.6.期货持仓

展示所绑定的期货资金账户的持仓数据。



### 6.3.6.异常情况处理

#### (1) 行情推送中断处理

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

#### (2) 实例委托失败处理

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

#### (3) 交易服务异常处理

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

## 6.4.套利交易

### 6.4.1.套利雷达

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

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

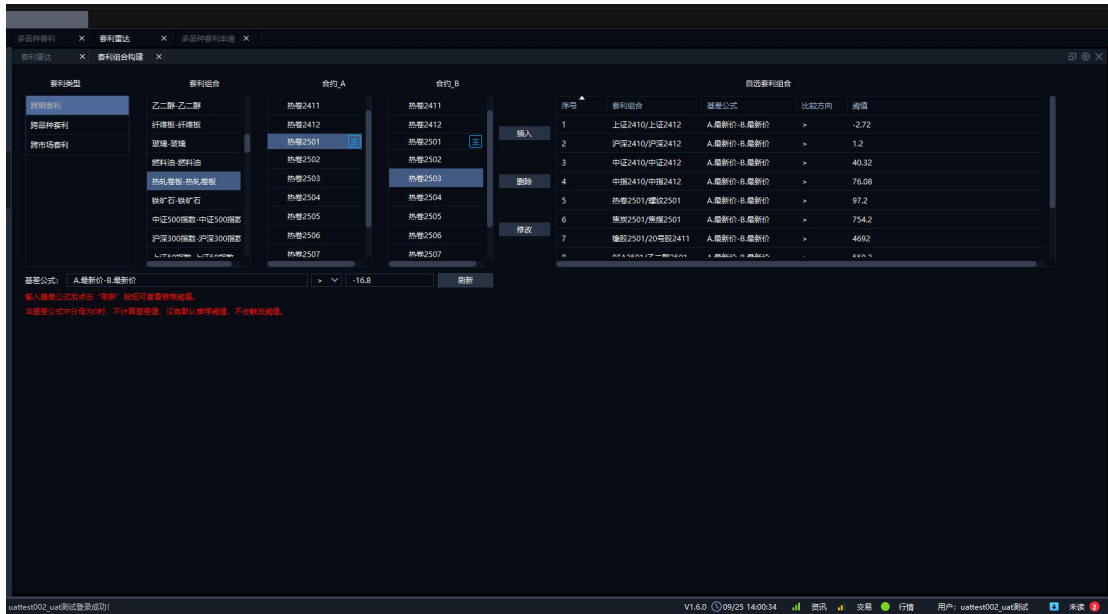
类型	说明	举例
跨期套利	相同品种不同月份	例：银 2407-银 2409
跨品种套利	互补性强的品种之间套利	例：玉米 2407-玉米淀粉 2407
跨市场套利	不同交易市场之间的套利	例：豆油 2409-菜籽油 2409

#### 6.4.1.1.套利组合构建

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

**套利组合构建：**首先选择套利类型后，套利组合会出现当前推荐的组合类型，选定套利

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



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

**方向：**方向为选择框，提供“>，≥，=，<，≤”5 个选项。

**阈值：**整数位需小于等于 11 位，小数位需小于等于 4 位。

基差公式下方提示：

输入基差公式后点击“刷新”按钮可查看推荐阈值。

当基差公式中分母为 0 时，不计算基差值，没有默认推荐阈值，不会触发阈值。

**插入：**点击可将设置好的组合添加至自选套利组合列表。

**删除：**选中一条自选套利组合后，点击“删除”可删除监控中合约组合。

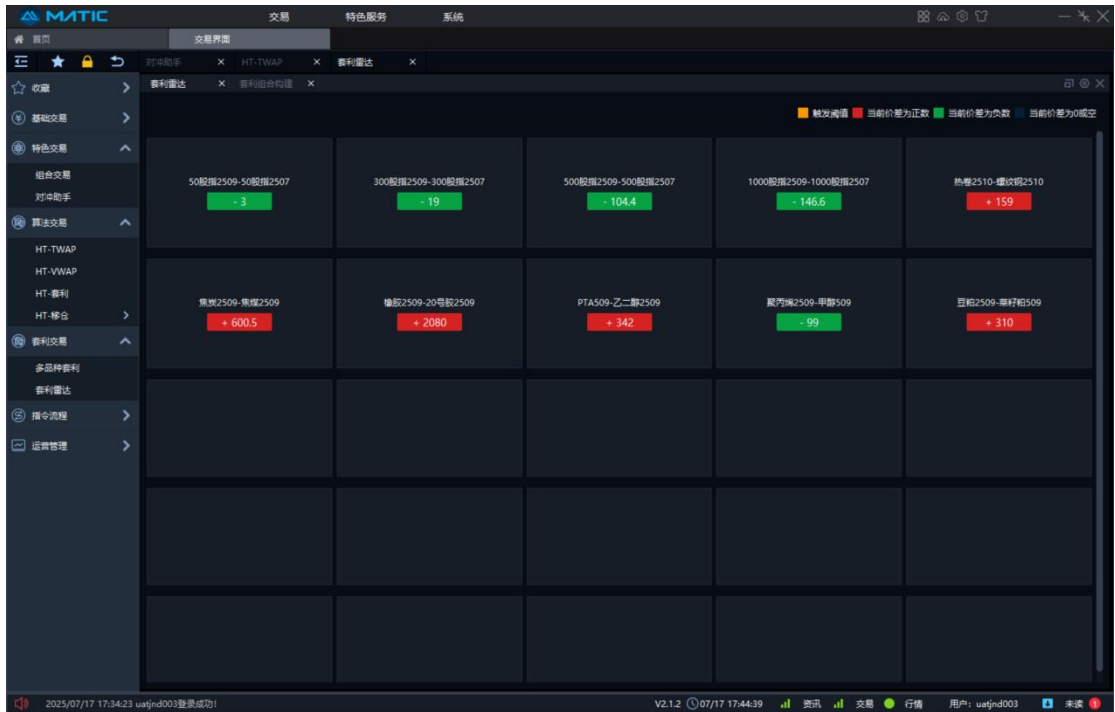
**修改：**选中一条自选套利组合后，可重新编辑基差公式，方向和阈值（请注意仅支持修改基差公式），然后点击“修改”生效。

### 6.4.1.2.套利雷达

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

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

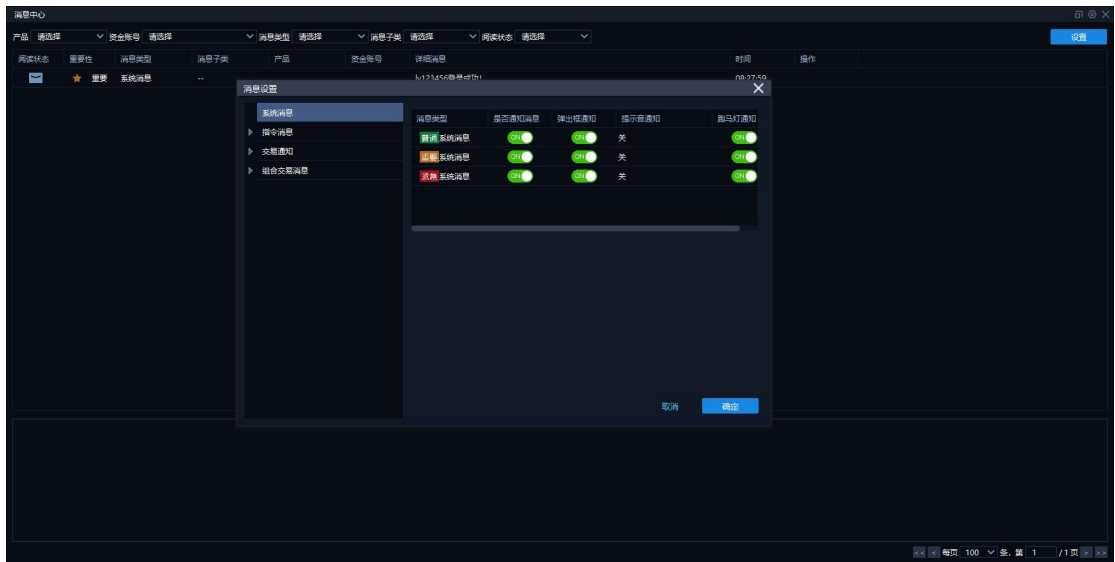
若价差触发了设置的阈值，监控中的合约组合橘色闪烁提醒。



## 6.5.运营管理

### 6.5.1.消息中心

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



## 6.6.收藏

支持用户收藏二级菜单页面，实现快速访问。

## 7.开户

点击顶部一级菜单“开户”，可进入开户页面，您可通过手机扫描二维码进入华泰期货互

联网开户平台，在页面内按照提示填写相关信息进行线上开户。

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



## 8.交易魔方

交易魔方模块是 Matic 研发团队打造的核心模块，模块的设计充分体现了 Matic 期货终端“以客户为中心”的设计理念，通过金融科技赋能，旨在为期货交易者提供高度可定制化的交易工作空间与场景化、一站式的交易解决方案，将分散的交易功能、行情数据与分析工具整合为统一、直观的操作界面，为期货交易者打造一个高效、灵活、智能的交易平台，助力客户更好地捕捉市场机会，实现交易目标。

交易魔方模块需要申请并审核通过后才可使用。您可以在【用户服务-特色服务】中，根据自身需求选择相应的场景化解决方案进行申请，审核通过后即可使用相应的交易魔方下的场景化服务内容。

### 8.1.Colo 开盘抢单

#### 8.1.1.功能介绍

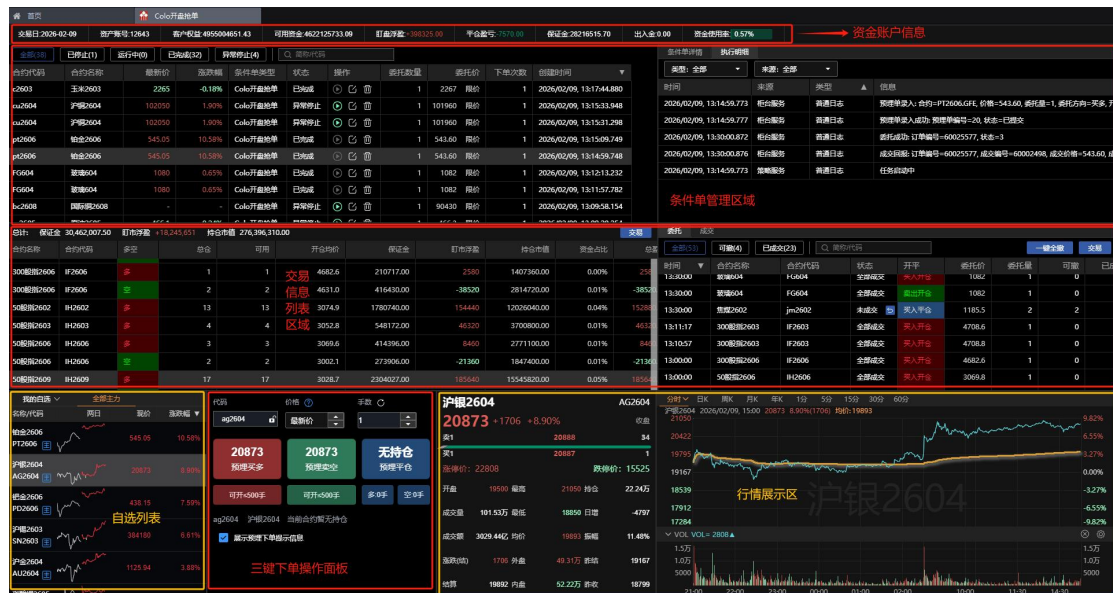
##### 8.1.1.1.核心功能

- **预埋下单：**支持 Colo 开盘抢单（预埋单）启停、修改、删除，实时监控触发状态，适配开盘前预埋抢单场景。
- **普通下单：**支持期货合约实时买入、卖出（开仓、平仓）操作，实时反馈委托及成交状态，适配盘中正常交易场景。
- **下单辅助：**展示合约实时行情、盘口信息，分时/K 线走势，辅助您精准配置下单参数

- **交易监控：**同步展示用户的持仓、委托、成交明细，支持撤单、一键全撤，方便用户实时掌控交易状态。

### 8.1.1.2.页面布局

- **资金账户信息：**展示用户当前的资金账户编码、客户权益、可用资金、盯市浮盈等核心资金信息，方便您随时核对资金情况。
- **条件单管理区域：**条件单列表区+详情/执行明细区，展示所有条件单（预埋单）的状态，点击条件单可查看详情及操作记录。
- **交易信息列表区域：**展示当前资金账户的持仓、委托、成交明细。
- **操作区：**包含三键下单操作面板，可切换普通下单、预埋下单模式，配置交易参数（合约、价格、手数等）并完成下单。
- **行情展示区：**同步展示持仓或者自选列表选中合约的盘口、分时/K 线走势。



## 8.1.2.预埋下单

### 8.1.2.1.适用场景

非交易时段，用户提前预埋委托单，待进入下个连续交易阶段时，系统自动提交委托、抢占交易先机的场景（交易日收盘后不可预埋）。

### 8.1.2.2.下单流程

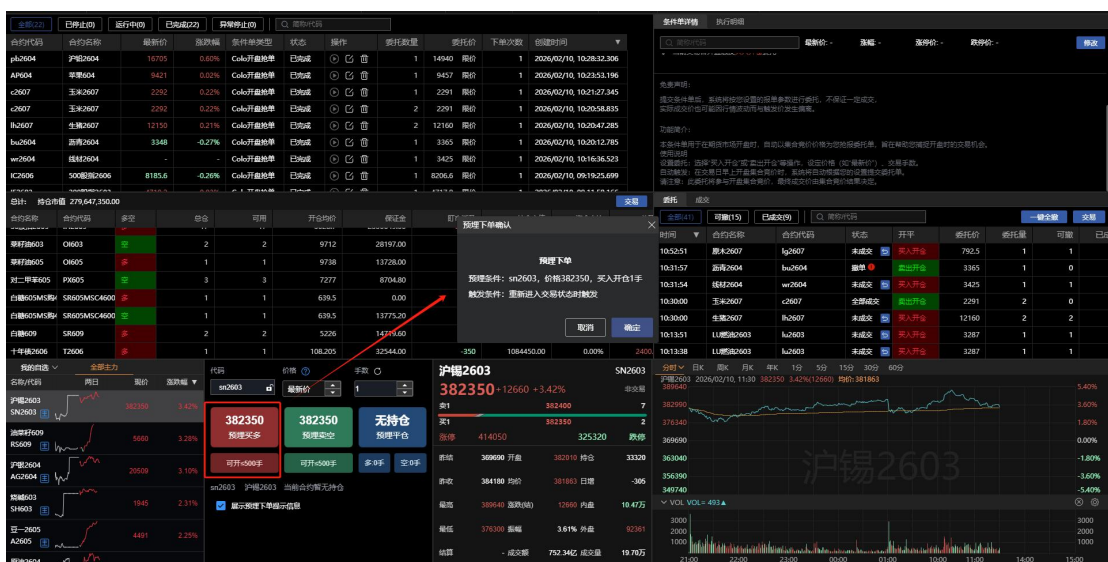
- 1) 进入 Colo 开盘抢单页面后，确认中间操作区为【预埋下单】面板（非交易时段会自动切换为预埋下单）。
- 2) **选择目标合约：**操作与普通下单一致，搜索或点击选中目标合约。
- 3) **配置核心参数：**选择交易方向（预埋买多/预埋卖空/预埋平仓）、设置委托价格、委托手数。

- 4) **提交预埋单**: 核对参数无误后, 点击对应预埋下单按钮, 弹出确认弹窗, 核对后点击【确定】, 完成提交。
- 5) **查看与管理**: 提交后, 条件单列表会新增一条状态为“运行中”的预埋单; 可在列表中对其中进行启停、修改、删除操作 (运行中不可修改/删除, 需先停止)。
- 6) **触发与查看**: 进入下一个连续交易阶段时, 系统自动触发预埋单并提交委托; 可在【委托列表】【成交列表】查看结果, 或在条件单【执行明细】中查看触发记录。

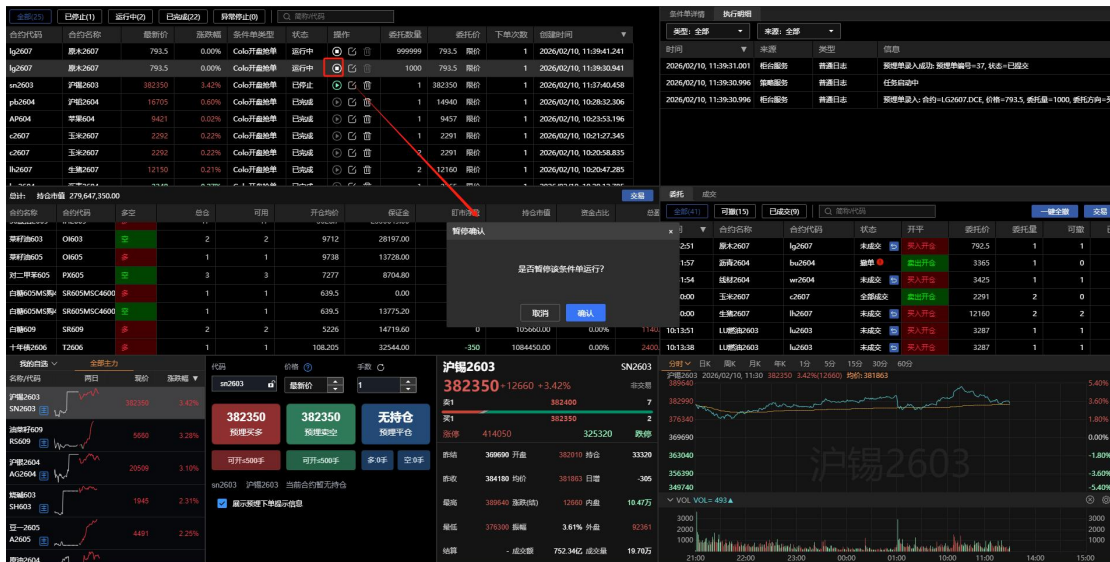
● 预埋下单面板



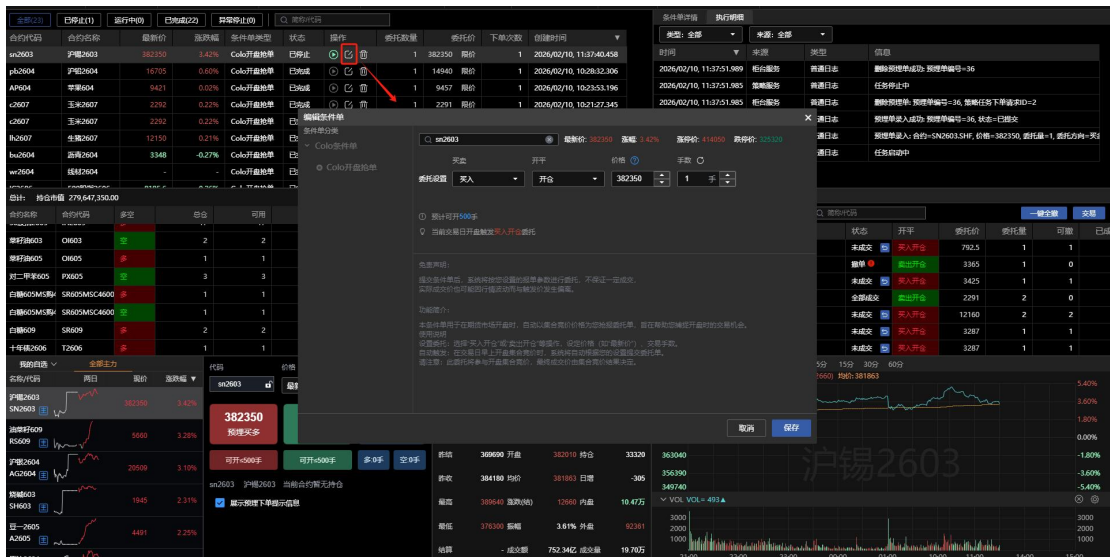
● 预埋下单确认弹窗



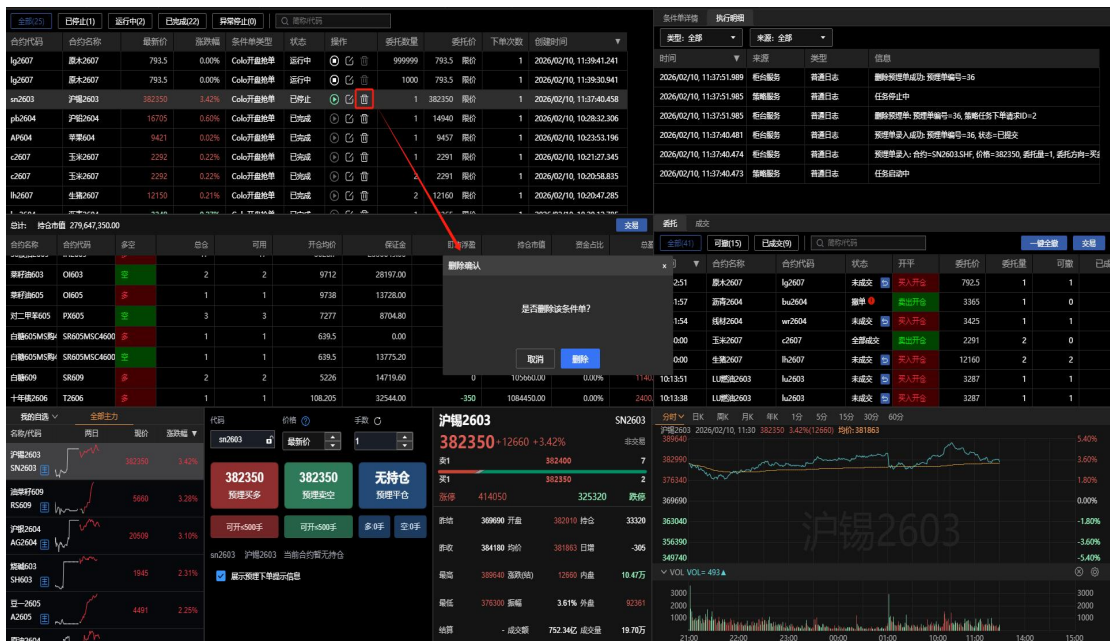
● 条件单暂停



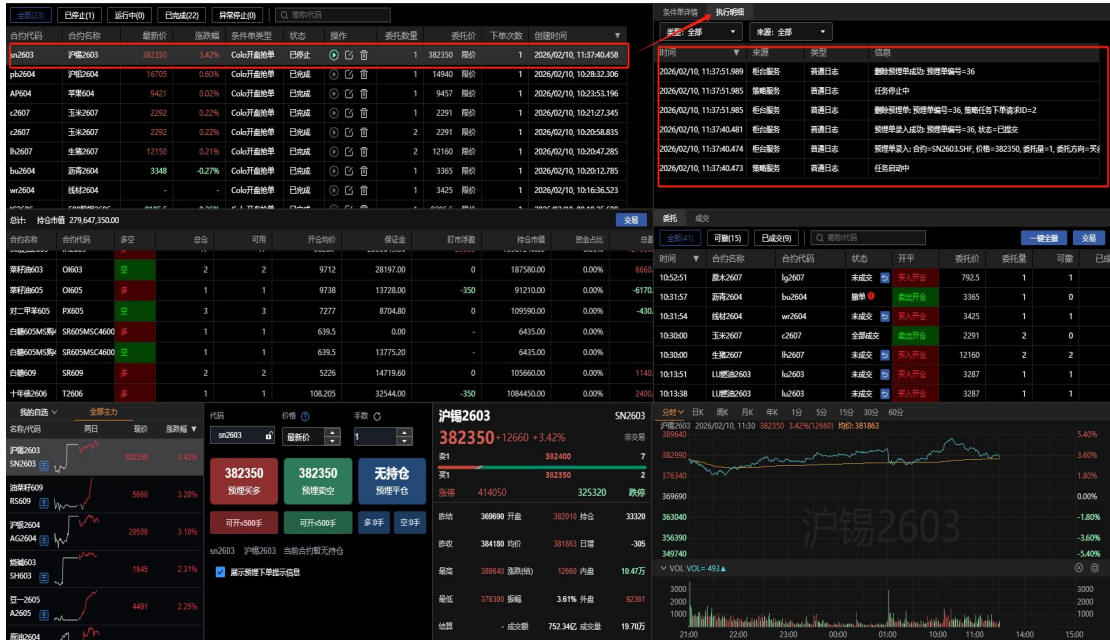
● 条件单编辑



● 条件单删除

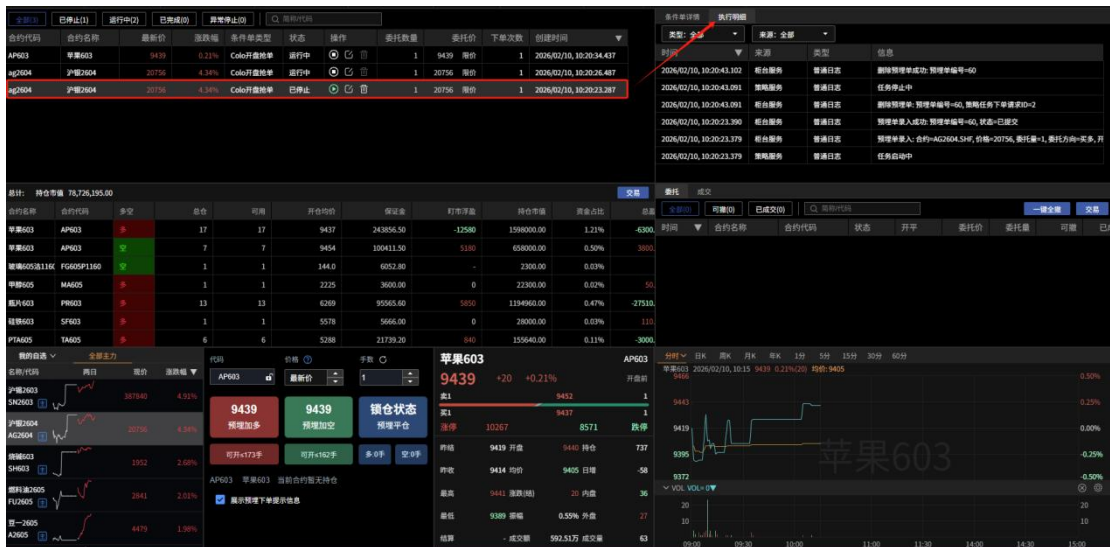


● 查看执行明细



### 8.1.2.3.预埋撤单

- 在左侧【条件单列表】找到未触发的预埋单，若为“运行中”先点击【停止】，停止后完成撤销预埋，具体撤单情况可查看执行明细。



### 8.1.3.普通下单

#### 8.1.3.1.适用场景

盘中连续交易时段，用户需要实时提交委托、快速成交的场景（下单后直接报送交易所，不经过预埋等待）。

#### 8.1.3.2.下单流程

- 1) 进入 Colo 开盘抢单页面后，确认中间操作区为【普通下单】面板（非交易时段会自动切换为预埋下单，无法普通下单）。
- 2) 选择目标合约：通过操作区搜索框搜索合约，或从自选列表、持仓列表点击选中合约。
- 3) 配置核心参数：选择交易方向（买多/卖空/平仓）、设置委托价格、委托手数。

- 4) **提交委托**: 核对参数无误后, 点击对应交易方向的下单按钮, 弹出确认弹窗, 再次核对后点击【确定】, 完成委托提交。
- 5) **查看结果**: 在右侧【委托列表】查看委托状态 (未成交/已成交); 未成交可执行撤单, 成交后会同步显示在【成交列表】。

● 选择目标合约

总计: 持仓市值 279,844,800.00

合约名称	合约代码	多空	总仓	可用	开仓均价	保证金	盯市浮盈	持仓市值	资金占比	总基
玻璃604	FG604	多	2	2	1074	9871.60	0	43160.00	0.00%	200
玻璃604	FG604	空	1	1	1082	4935.80	0	21580.00	0.00%	60
玻璃605	FG605	空	2	2	1068	9871.60	0	43040.00	0.00%	-320
500股指2603	IC2603	多	4	4	8285.2	996264.00	-25440	6616640.00	0.02%	-11480
500股指2606	IC2606	多	1	1	8213.0	246198.00	-5560	1635720.00	0.00%	-6880
500股指2606	IC2606	空	3	3	8155.5	739266.00	21160	4907160.00	0.01%	-13880
300股指2603	IF2603	多	6	6	4690.4	1273806.00	7200	8499240.00	0.03%	56460

我的自选 全部主力

名称/代码	两日	现价	涨跌幅
沪银2604	AG2604	20557	3.34%
沪镍2603	SN2603	381950	3.32%
烧碱603	SH603	1951	2.63%
燃料油2605	FU2605	2837	1.87%
原油2604	SC2604	474.5	1.82%

代码: FG604 价格: 最新价 手数: 1

1078 加多 1078 加空 锁仓状态 平仓

可开≤1000手 可开≤1000手 多:2手 空:1手

FG604 玻璃604 2手多仓 1手空仓

展示普通下单提示信息

**玻璃604** FG604  
1078 +5 +0.47% 连续交易

卖1 1080 228  
买1 1078 201

涨停 1170 跌停 976

昨结 1073 开盘 1088 持仓 24231  
昨收 1080 均价 1085 日增 -3224

最高 1092 涨跌(结) 5 内盘 21203  
最低 1071 振幅 1.96% 外盘 3831

结算 - 成交额 5.43亿 成交量 25034

总计: 持仓市值 279,805,915.00

合约名称	合约代码	多空	总仓	可用	开仓均价	保证金	盯市浮盈	持仓市值	资金占比	总基
玻璃604	FG604	多	2	2	1074	9871.60	0	43160.00	0.00%	200
玻璃604	FG604	空	1	1	1082	4935.80	0	21580.00	0.00%	60
玻璃605	FG605	空	2	2	1068	9871.60	0	43040.00	0.00%	-320
500股指2603	IC2603	多	4	4	8285.2	996264.00	-34400	6607200.00	0.02%	-20920
500股指2606	IC2606	多	1	1	8213.0	246198.00	-7760	1633720.00	0.00%	-8880
500股指2606	IC2606	空	3	3	8155.5	739266.00	27760	4901160.00	0.01%	-7880
300股指2603	IF2603	多	6	6	4690.4	1273806.00	-360	8491320.00	0.03%	48540

我的自选 全部主力

名称/代码	两日	现价	涨跌幅
沪银2604	AG2604	20564	3.38%
沪镍2603	SN2603	381890	3.30%
烧碱603	SH603	1950	2.58%
原油2604	SC2604	474.7	1.87%
燃料油2605	FU2605	2837	1.87%

代码: ag2604 价格: 最新价 手数: 1

20560 买多 20560 卖空 无持仓 平仓

可开≤500手 可开≤500手 多:0手 空:0手

ag2604 沪银2604 当前合约暂无持仓

展示普通下单提示信息

**沪银2604** AG2604  
20560 +668 +3.36% 连续交易

卖1 20567 4  
买1 20559 2

涨停 23870 跌停 15913

昨结 19892 开盘 20500 持仓 21.09万  
昨收 20873 均价 20586 日增 -11472

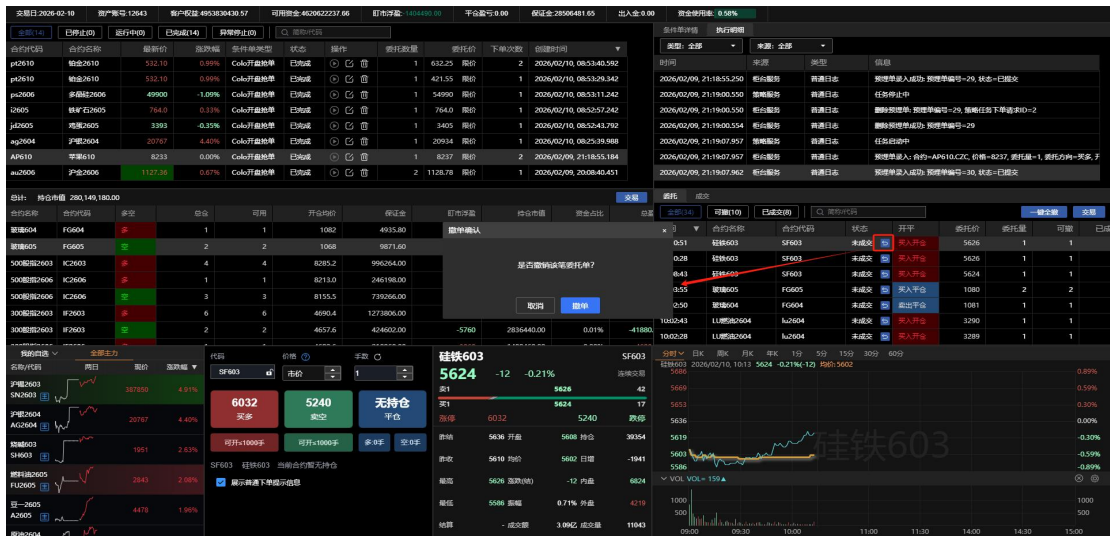
最高 20963 涨跌(结) 688 内盘 23.30万  
最低 20103 振幅 4.32% 外盘 21.51万

结算 - 成交额 1382.10亿 成交量 44.80万

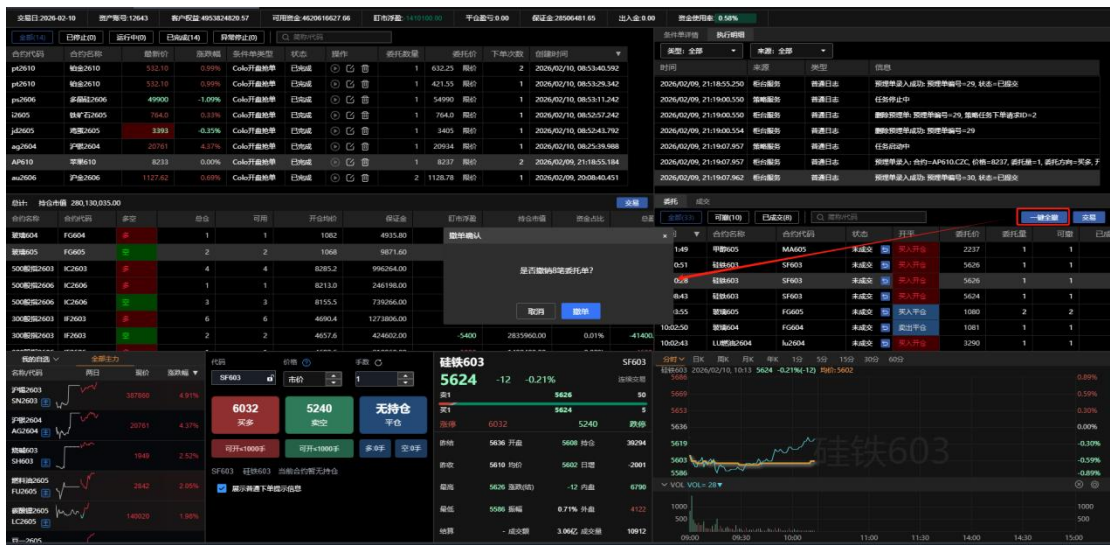
● 配置核心参数



成撤单。



- 一键全撤：在【委托列表】顶部点击【一键全撤】，确认后可撤销所有未成交委托。



### 8.1.4. 下单辅助

**行情参考：**选中任意自选或持仓列表中的合约，行情区会同步显示该合约盘口、分时/K线走势，辅助您判断下单价格。

**自选添加：**持仓列表中右键点击目标合约，选择【添加自选】分组，可将合约添加到页面左下角自选列表，方便后续快速选择。

- 行情展示区



● 自选合约添加

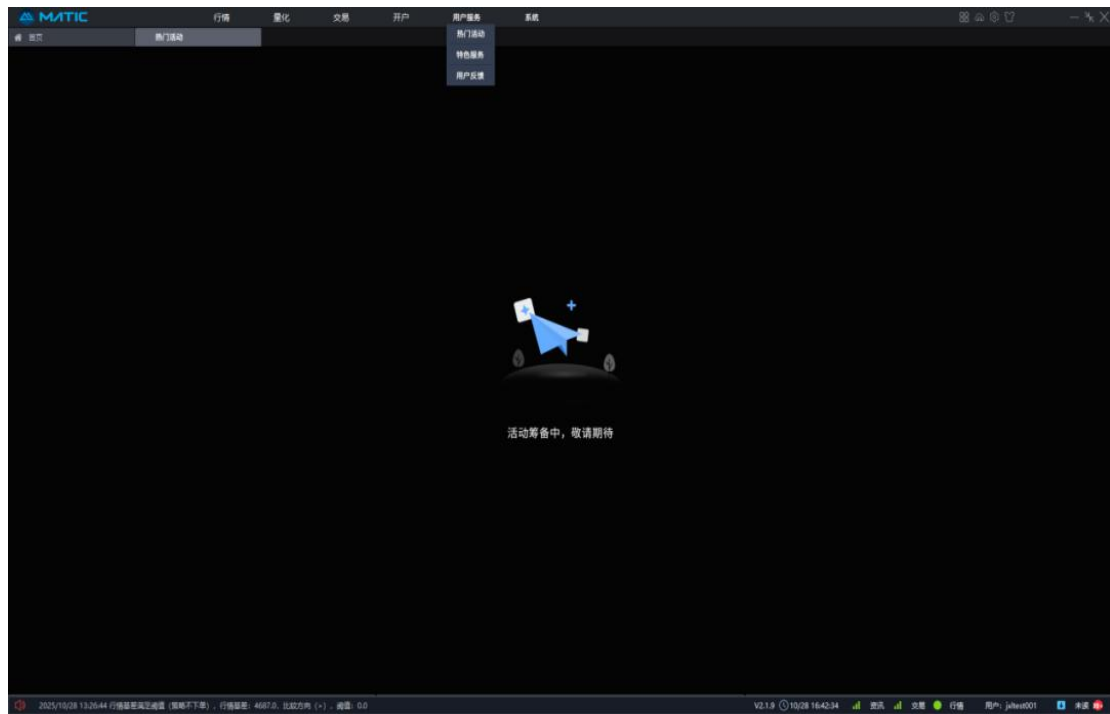
总计: 保证金 30,462,007.50 盯市盈 +18,245,651 持仓市值 276,396,310.00											交易
合约名称	合约代码	多空	总仓	可用	开仓均价	保证金	盯市盈	持仓市值	资金占比	总盈	
300股指期货	IF2606	多	1	1	4682.6	210717.00	2580	1407360.00	0.00%	2580	
300股指期货	IF2606	空	?	?	4631.0	416430.00	-38520	2814720.00	0.01%	-38520	
50股指期货	IH2602	多			3074.9	1780740.00	154440	12026040.00	0.04%	152880	
50股指期货	IH2603	多	4		3052.8	548172.00	46320	3700800.00	0.01%	46320	
50股指期货	IH2606	多	3		3069.6	414396.00	8460	2771100.00	0.01%	8460	
50股指期货	IH2606	空	2	2	3002.1	273906.00	-21360	1847400.00	0.01%	-21360	
50股指期货	IH2609	多	17	17	3028.7	2304027.00	185640	15545820.00	0.05%	185640	

## 9. 用户服务

为给用户提供更好的运营服务，Matic 设计了“用户服务”模块，模块内含三个二级菜单，分别提供：

- **热门活动：**以合规为前提，集中承载 Matic 营销活动及宣传内容，如量化大赛，提供大赛介绍、活动日历、报名入口、进度展示、大赛成果公示等。
- **特色服务：**覆盖“服务认知-申请办理-使用保障-续期转化”全链路，满足用户的差异化增值服务需求。根据业务开展及运营需求提供增值服务（如 Level2 行情、量化权限、算法交易、Colo 条件单等）的介绍及申请入口，申请进度展示、增值服务使用介绍、到期续费等。
- **用户反馈：**构建“主动服务+被动响应”体系，快速解决用户操作问题，收集需求用于产品迭代，提升用户信任度。

## 9.1.热门活动



## 9.2.特色服务

### 9.2.1.量化投研

用户可以在【**用户服务-特色服务-量化投研**】申请页面了解华泰期货 Matic 量化平台的定位、核心功能、目标用户及服务、试用申请流程，并可以单击底部“试用申请”按钮进行试用申请。



若您已通过量化申请，请勿重复提交（系统会提示，请勿重复提交）。

若您已在 Matic 绑定期货资金账号，则进入量化权限功能申请：



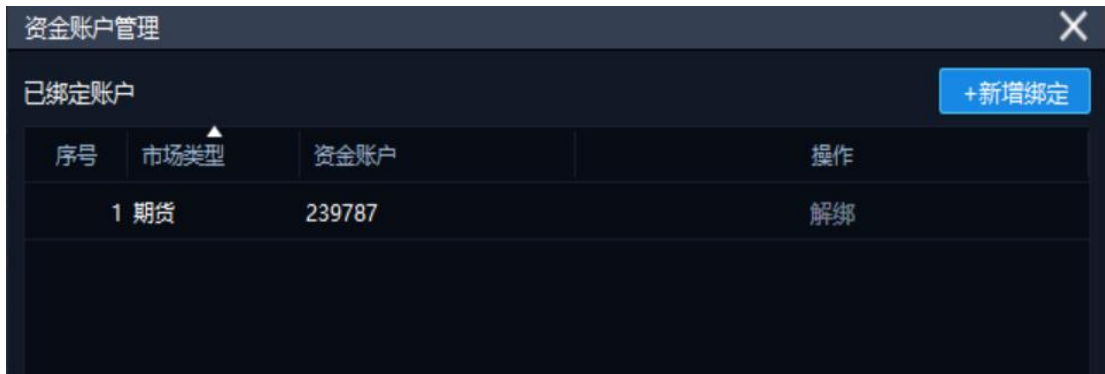
按照界面提示填写业务经理、量化经验和您还想对我们说的内容，单击“提交”则可进行量化权限功能申请，申请提交后，审核可能需要 1~3 个工作日，我们会尽快为您处理，请耐心等待。审核结果会通过系统的消息中心发送审核结果通知，请及时关注。

若您未在 Matic 绑定期货资金账号，则会展示如下界面：



您可以根据界面提示进行：

- 1) 手机扫描二维码，进入华泰期货在线开户平台；
- 2) 若您已开户，但未在 Matic 绑定期货资金账号，则可以单击“我已开户，绑定资金账号”进入资金账户管理界面，单击右上角新增绑定，进行资金账户绑定：



3) 您也可以选择“跳过此步骤”，直接进入量化试用申请界面。

### 9.2.2.Colo 条件单

Colo 条件单是基于 Colo 低时延交易能力打造的条件单类型。在行情异动捕捉、多品种联动交易、组合策略执行等需高效执行的场景中，通过物理链路优化实现交易指令的高效传输与稳定触发，有效解决网络延迟带来的执行偏差问题，帮助交易者在速度决胜的市场中建立先发优势。

用户可以在【[用户服务-特色服务-Colo 条件单](#)】申请页面上了解华泰期货 Colo 条件单的定位、核心功能、目标用户及进行试用申请，您可以单击底部“[试用申请](#)”按钮进行申请。

# Colo条件单

低时延链路赋能，交易执行快人一步

[我的申请](#)

Colo条件单是基于 Colo 低时延交易能力打造的条件单类型。在行情异动捕捉、多品种联动交易、组合策略执行等需高效执行的场景中，通过物理链路优化实现交易指令的高效传输与稳定触发，有效解决网络延迟带来的执行偏差问题，帮助交易者在速度决胜的市场上建立先发优势。

## Colo开盘抢单

MARKET ORDER

### 适用场景

- 开盘前锁价预埋**  
基于开盘前预设价格或突发事件应对需求，依托低时延通道在开盘瞬间精准成交，锁定目标成本
- 竞价衔接布局**  
在集合竞价结束、连续竞价开始的瞬间，基于最新开盘价及盘口变化，依托低时延通道抢占更优成交位置

### 核心价值

- 01 「高效执行」**  
在开盘阶段提升订单执行效率，抢占更优成交位置
- 02 「通道稳定」**  
在巨量订单并发的高压时段，保持交易通道稳定畅通
- 03 「盯盘无忧」**  
预埋单指令在云端待命，确保在开盘瞬间自动触发，无需人工盯盘

### 申请试用流程

- 填写申请表**  
按照页面提示进行试用申请
- 席位切换**  
您需线下联系客服经理进行交易席位切换
- 申请审核**  
我们将依据规则进行审核，请您耐心等待
- 等待反馈**  
审核完成后，将通过系统消息等告知您审核结果
- 重启使用**  
审核通过后，需重启客户端以查看相关功能

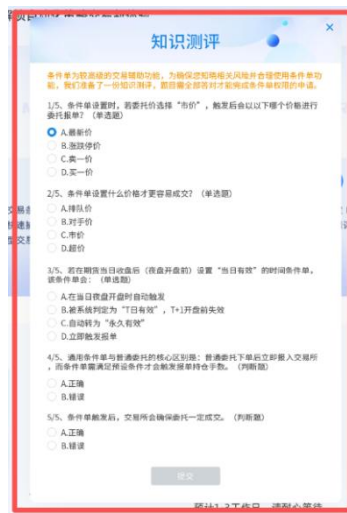
[申请试用](#)

免责声明：华泰期货量化交易平台目前为公测阶段，功能及数据仅供参考，平台产出不构成投资建议，用户自行承担投资风险，提交申请不代表告知并同意以上全部条款。

- 若您已在 Matic 绑定期货资金账号，则进入 Colo 条件单权限功能申请页面：

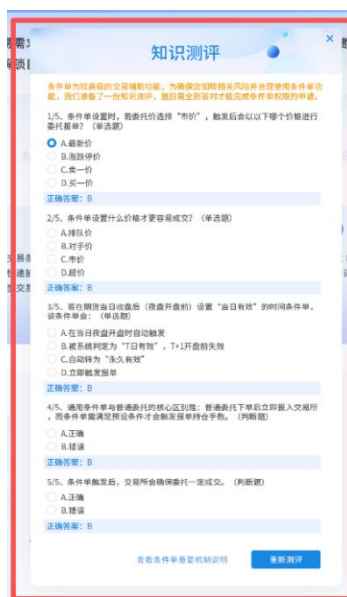


按照界面提示填写业务经理、选择您想要开通的 Colo 条件单类型、填写您还希望增加哪些场景下的条件单服务、勾选条件单协议等内容，单击“下一步”进行知识测评：



知识测评内容与您的申请记录相关，您看根据界面展示的知识测评题目进行作答，需全部作答正确才可点击提交。

提交后，若知识测评未全部通过，您可选择查看相关文档，并进行重新测试：



测评全部通过时，您可查看您的历史申请记录及申请情况，如下：



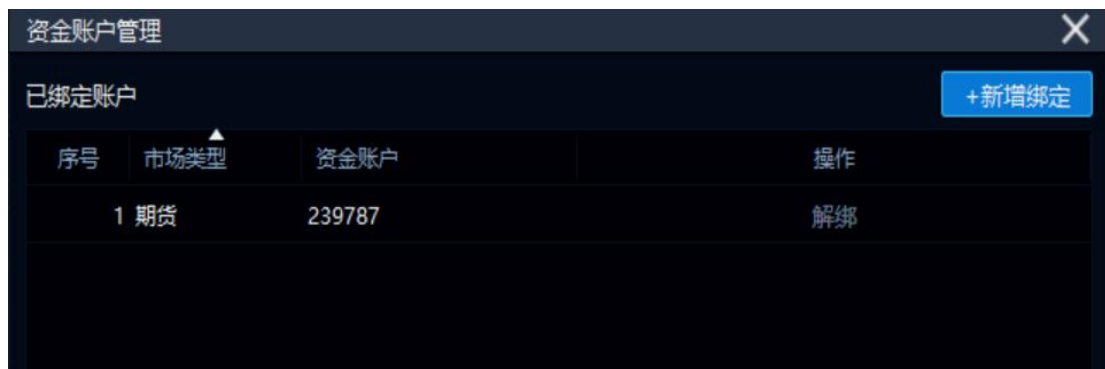
您也可以通过点击页面顶部“我的申请”按钮，进入并查看申请及审核状态。

- 若您未在 Matic 绑定期货资金账号，点击试用申请则会展示如下弹窗：



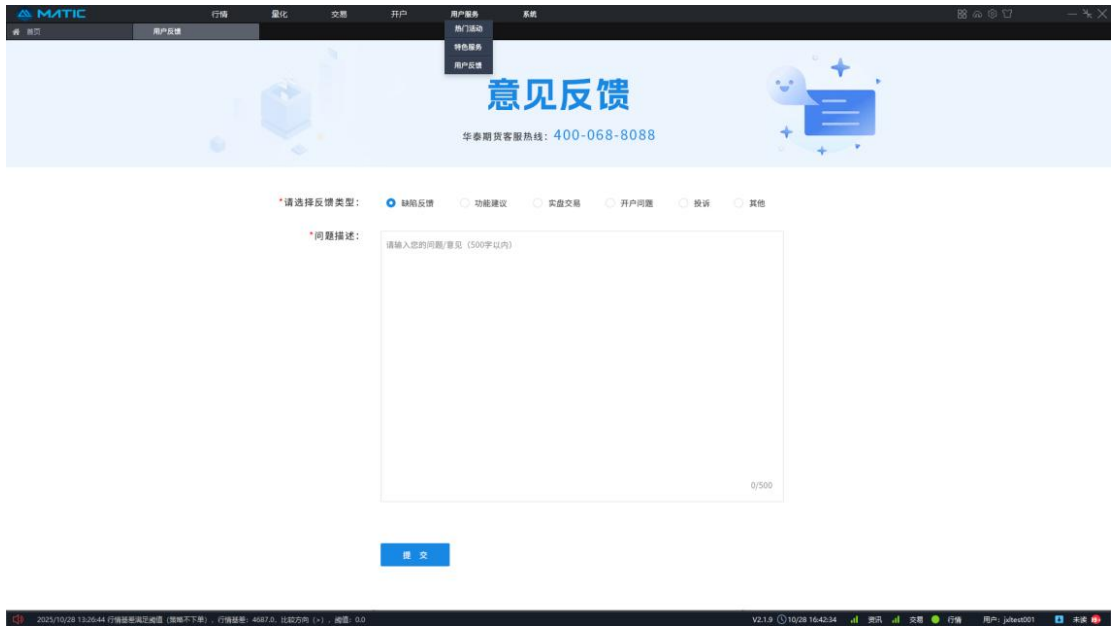
您可以根据界面提示进行：

- 1) 手机扫描二维码，进入华泰期货在线开户平台；
- 2) 若您已开户，但未在 Matic 绑定期货资金账号，则可以单击“我已开户，绑定资金账号”进入资金账户管理界面，单击右上角新增绑定，进行资金账户绑定：



### 9.3.用户反馈

如下，您通过单击“用户反馈”进入该界面：



在界面中您需要结合实际情况选择反馈类型、及进行问题描述，点击提交后，我们会收到您的反馈，并尽快与您取得联系。

## 10.系统

### 10.1.资金账户

#### 10.1.1.账户管理

点击“系统-资金账户-账户管理”，打开“资金账户管理”页面，页面内容如下：



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

注意：新增绑定可操作时间为交易日 8: 40-16: 30（节假日前一交易日会提前至 16:00）和 20: 40-次日 2: 00。请在此时间段内操作。新增绑定后，重新登录客户端正式生效。同一市场类型仅支持绑定一个资金账户。



对于已绑定账户，点击列表操作栏中解绑按钮，弹出确认解绑的弹框提示，点击确认可操作解绑资金账户。

## 10.2.关于

### 10.2.1.关于我们

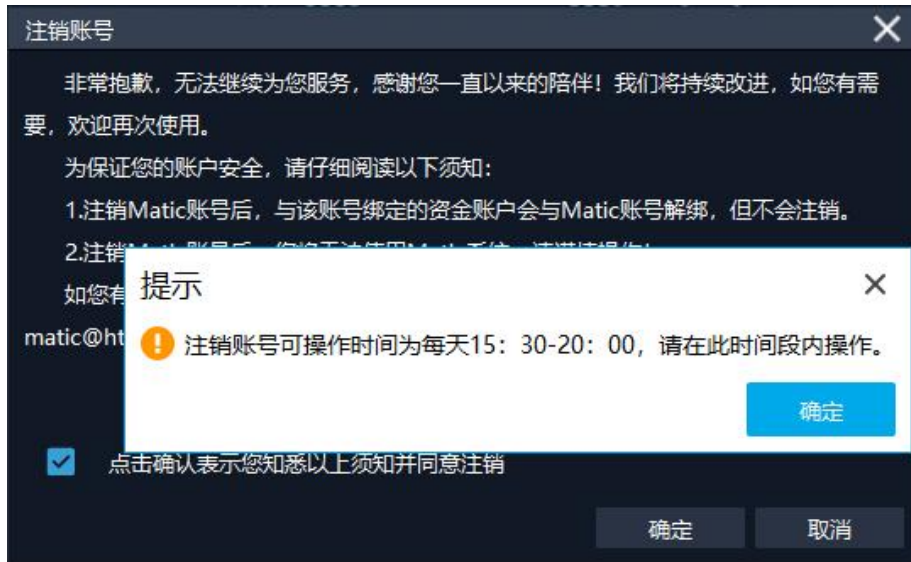
关于我们页面，展示终端开发方的公司网站、服务邮箱，服务热线等信息，同时展示本软件开发过程中使用的库以及第三方软件协议。



### 10.2.2.注销账号

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

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



## 11. 组件列表

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

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

## 12. 用户数据上传下载

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

## 13. 设置

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

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

## 13.1.交易设置

### 13.1.1.全局交易设置

分为全局交易设置和价格浮动设置（仅支持普通交易和组合交易）。



### 13.1.2.基础交易设置

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



### 13.1.3.指令交易设置

包括指令执行设置、单笔委托数量上线（暂时仅适配个股指令）。



### 13.1.4.期货交易设置

设置不同交易操作的默认价格类型、默认数量以及是否进行二次确认。



### 13.1.5.价格笼子设置

包括价格笼子应用设置和价格笼子参数设置，见下图：



当前设置发生变化且未保存，切换模块时弹出保存设置二次确认弹窗。

### 13.1.6.交易费率设置

包括交易费率启用开关、上交所交易费率、深交所交易费率、费率说明。



### 13.1.7.期权交易设置

包括下单习惯、拆单设置、默认价格价格类型三部分，支持用户设置三键/四键下单，设置期权下单单笔委托的拆单规则，选择默认价格类型。



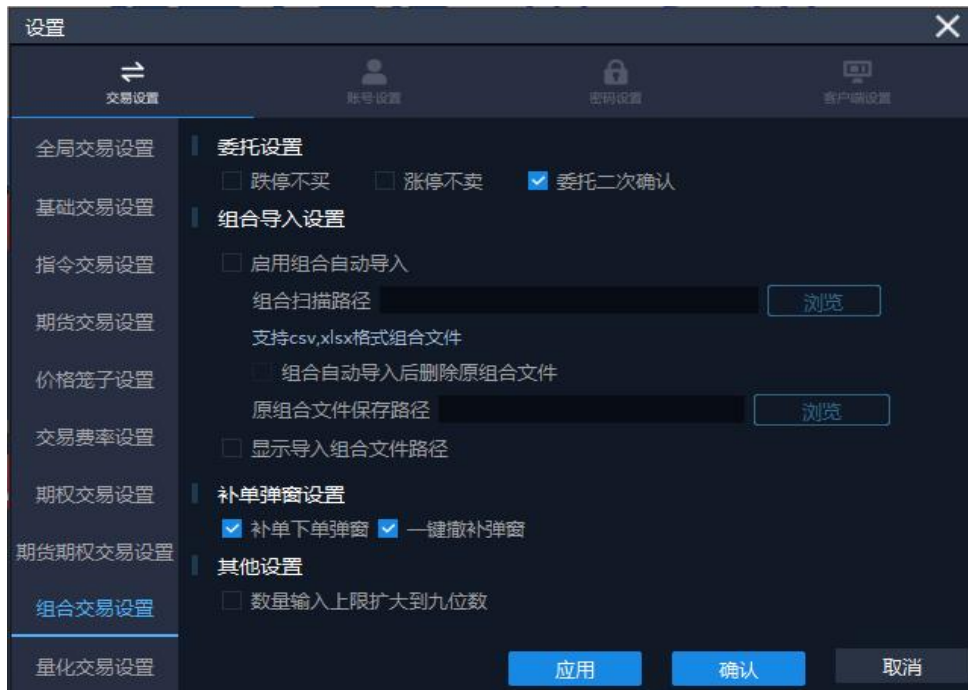
### 13.1.8.期货期权交易设置

包括闪电下单拆单设置、期货期权交易下单操作设置。



### 13.1.9.组合交易设置

包括组合委托、组合导入设置、补单弹窗设置、其他设置。



## 13.2.账号设置

账号设置包含账号简称设置、账号优先级设置，股东账号设置。

### 13.2.1.账号简称设置

双击目标账号的账号简称单元格，即可编辑账号简称。



### 13.2.2.账号优先级设置

点击目标账号上下拖动可调整目标账号优先级顺序。

## 13.3.密码设置

密码设置包含交易密码校验。支持资金账户的密码校验。

注意：密码校验成功后，需重新登录客户端才可进行交易。



### 13.4.客户端设置

客户端设置包含通用设置、修改密码、监控剪贴板、系统公告，关于等模块。

#### 13.4.1.通用设置

包括客户端字体缩放、客户端锁定、预留信息设置三部分设置。



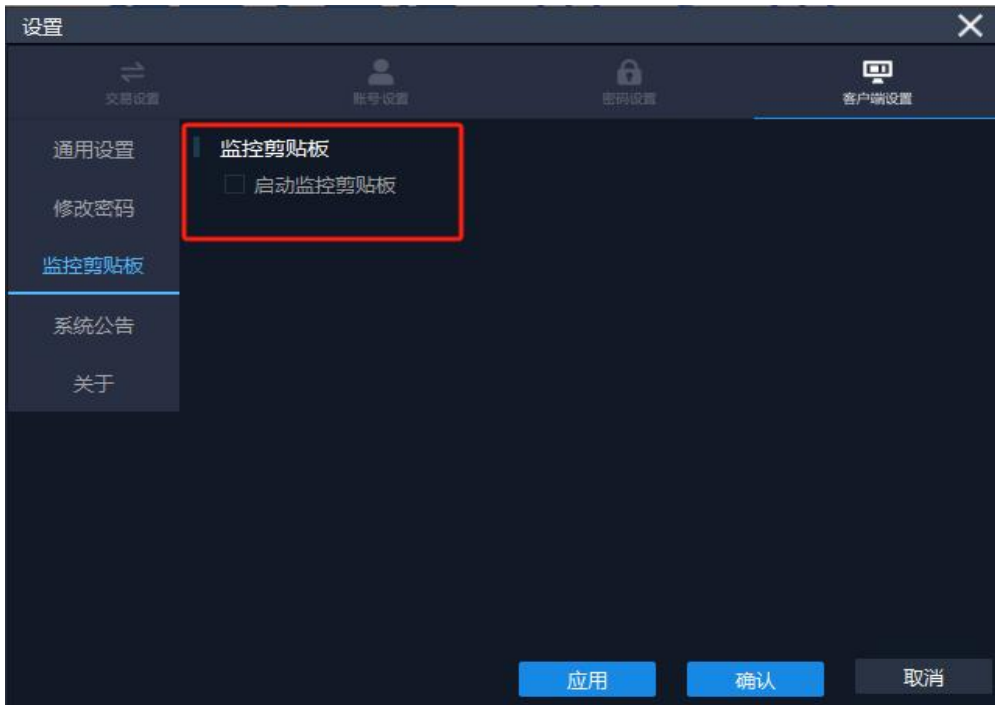
#### 13.4.2.修改密码

通过验证原密码的方式修改当前用户登录密码。



### 13.4.3. 监控剪贴板

剪贴板监控开关，默认不开启。



### 13.4.4. 系统公告

包含重点监控标的弹窗、系统公告两部分。



## 14. 下载中心

展示当日下载文件列表，支持按文件类型和状态进行筛选。

