

# 华鑫证券

## 如意星 V40 终端使用说明

文档版本	修订摘要	日期	变更人
1.1	V1.0(20180328)	3/28/2018	信息技术部
1.2	V1.0(20180329)	3/30/2018	信息技术部
1.3	V3.0(20180410)	4/10/2018	信息技术部
1.5	V3.0(20180412)	4/12/2018	信息技术部
1.5.1	V3.0(20180419)	4/20/2018	信息技术部
1.5.2	V3.0(20180627)增加限速和硬盘序列号	6/27/2018	信息技术部
1.6	V3.3 整合股票和信用，并优化版本	7/22/2020	信息技术部
1.7	V4.0 升级最新版 API，支持北交所业务	11/25/2021	信息技术部
1.8	V4.0 支持策略号	1/14/2022	信息技术部

## 1 适用场景

网格交易法参考渔翁捕鱼的传统智慧，在证券市场布下天罗地网，捕捉证券市场的每一个获利机会，实现超额回报。用网格交易法入市后可以不必理会上市公司的基本面和技术分析，只要价格触及网格，就自动买入或卖出一定数量的股票。

传统上散户投资者主要采用的是追涨杀跌的方法，网格交易法正好与此相反，而是抄底摸顶。这种方法尤其适合于震荡行情中的短线交易。

网格交易法是一种全新的交易策略，可以与趋势交易法补充应用。比如：主要的头寸用于趋势交易，部分的头寸进行短线的网格交易，这样就在不增加风险的情况下，增强收益机会。

如意星结合华鑫证券的特色为有需求的投资者定制了一套网格交易策略终端。给这种网格策略定义为：谷峰网格。

**谷峰网格：**可以让用户定义初始基准价格，随着价格的变动，产生新的基准价格，帮助用户抓住每次波峰的卖出机会和波谷的买入机会。

**注意点：**遇到股票出现分红派息时需要手工关注或纠正基准价格。

## 2 运行环境

本软件为绿色免安装版本，解压之后即可使用，支持 Win7 和 Win10 操作系统，目前只发布 32 位版本，投资者如果需要 64 位版本，可以单独与我司联系。

本软件主要有一个配置文件：config.ini，存放通讯参数、缺省客户号、投资者交易习惯等参数信息。通讯参数的配置见如下：

[COMM]

;TD 配置交易服务器地址和端口；MD 配置行情服务器地址和端口

;请向我公司对口人员索要下列参数

TD=tcp://XXX.XXX.XXX.XXX:XXXX

MD=tcp://XXX.XXX.XXX.XXX:XXXX

## 3 功能介绍

本软件通过程序自动下单，自动捕捉股票每天的波动，利用频繁的波动获取小额收益，从而达到降低持仓成本的目的。

### 3.1 登录

运行执行程序 hxGT3.3.exe 会出现如下登录窗口，如果进行股票交易请选择“0-普通交易”，如果进行两融交易请选择“1-信用交易”。

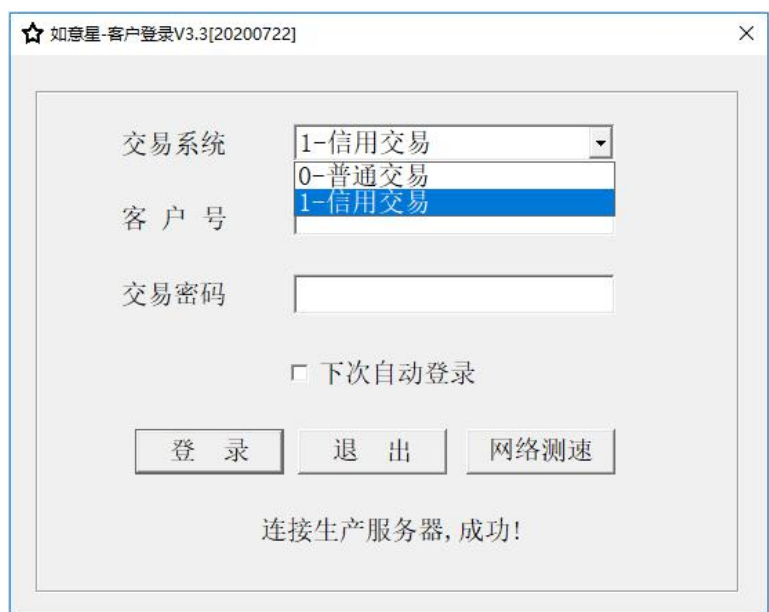


图 1 登录界面

如果如上图显示“连接服务器，成功！”，则说明交易和行情参数均配置正确，和后台通讯正常，反之，会有其中一项或两项连接不正常。

成功登陆的客户号，会自动记录客户号到配置文件中，下次可以不用再输入。如有错误信息，会在类似上述界面中显示。

如果在“下次自动登陆”前打勾，则成功登陆之后，下次无须再输入密码。如果还想要输入密码登陆，则删除“客户号.dat”文件。

如果需要登陆不同的奇点系统，请选择“网络测速”按钮，会进入下列界面，请根据需要选择实盘账号或 N 视界仿真账号。我司实盘账号长度为 12 位，N 视界仿真账号长度为 8 位。

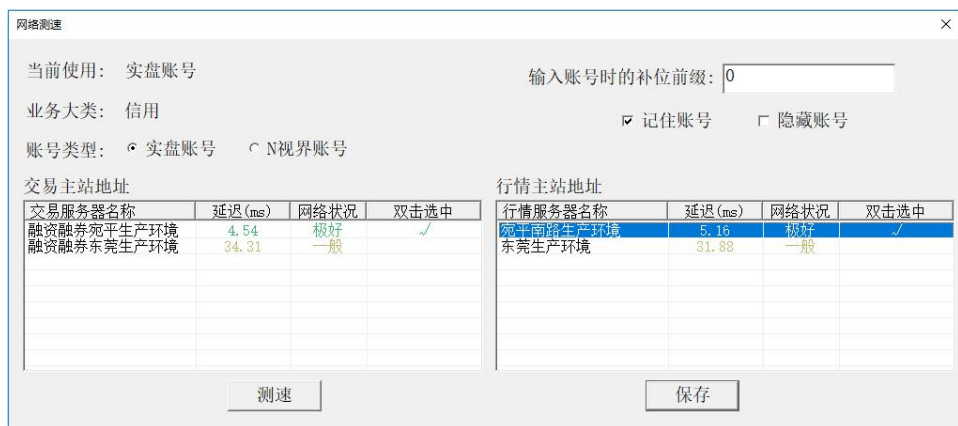


图 2 登录界面

## 3.2 主功能区

登录成功后交易终端主界面显示如下：



图 3 交易终端主界面

主窗口中上方区域为策略信息，中部区域为资金信息和通讯信息，下方为最新的股份、委托、成交、其他信息。

根据参数配置可以在策略信息的右上角显示当前启动策略的股票实时价格。可以通过双击策略信息窗口中的证券代码行，查看该证券对应的详细运行信息。

可以对选中的股票启动和停止策略，每只证券代码有且最多只能有一套独立的策略参数，策略启动之后，股票策略之间的运行互不影响。

在资金信息的上方显示当前账户的总资产情况，点击“刷新资金股份”按钮可以刷新股份、资金资金信息及总资产信息。

策略信息中：

委买差=累计委托买入数量-累计委托卖出数量

成买差=累计委托买入数量-累计委托卖出数量

差额=委买差 - 成买差

如果在“根据行情刷新市值”前打勾，则会根据行情计算市值和盈亏，如果股票个数多建议不要打勾，会影响性能。

### 3.3 查看参数

在主界面上选中需要查看的股票，点击“查看参数”即会弹出所选股票的策略参数窗口。按 Esc 键可以快速关闭。

以下情形可使用“查看参数”功能：

1. 在“启动策略”后可使用“查看参数”查看股票当前启动的策略参数细节；
2. 在“设置参数”完成后可使用“查看参数”功能检查确认策略参数是否设置正确。



图 4 查看参数

### 3.4 设置参数

点击主界面的“设置参数”可对股票的策略参数进行修改。需在弹出的“设置策略参数”界面左边选中需要设置的股票，就可以在右边详细参数界面进行修改策略。在需要设置的参数值显示格上**双击**，即可填入需要设置的参数，填完后需按回车键确认。设置后策略参数立即生效。

不能修改正在运行的策略参数，如需修改，则需要停止策略后才能设置策略参数。

如果修改过策略参数，则主界面中的交易天数、累计买卖次数等统计信息会重新统计。参数设置的结果会保存在 cl.dat 文件中，如删除 cl.dat 文件后则需要重新设置参数。

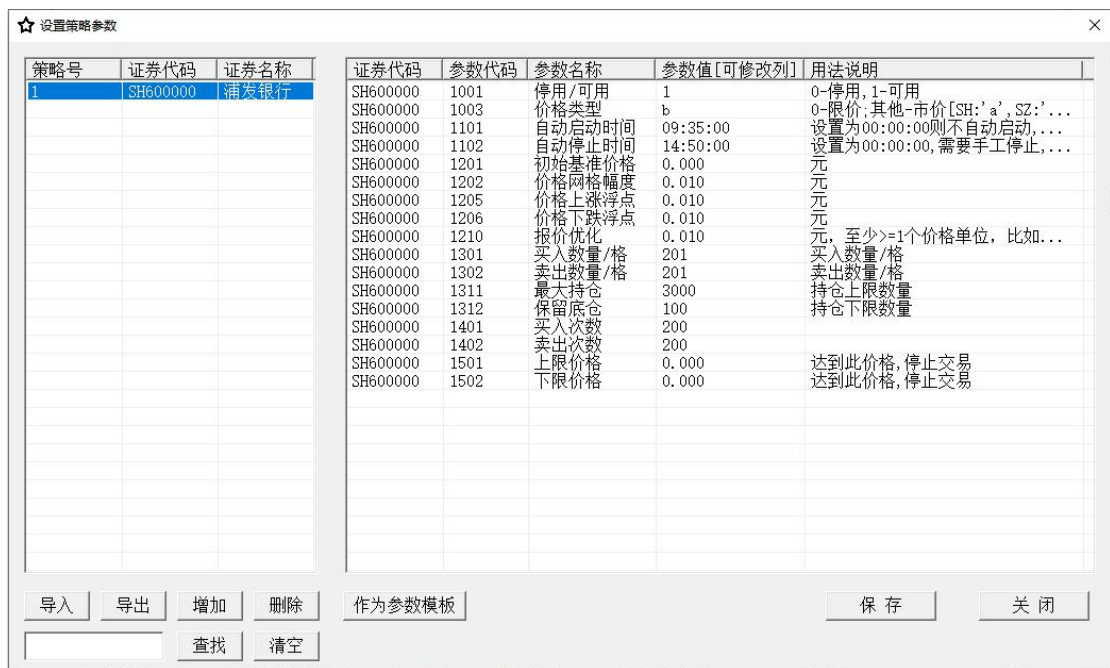


图 5 设置策略参数界面

选择某个证券代码，点击“作为参数模板”，则新增策略时，使用该证券的参数作为模

板。

选择上述界面中的“增加”，会出现如下界面，可以为某个股票定义一种策略。

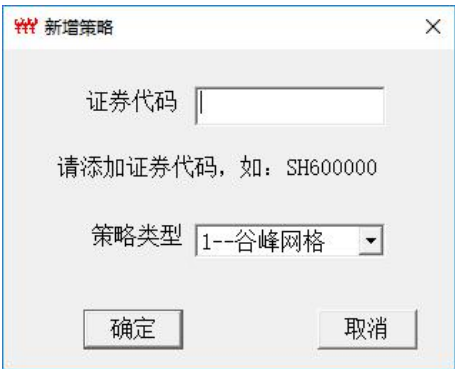


图 6 新增策略界面

- 谷峰网格策略参数说明如下：

表 1 谷峰网格参数说明

参数代码	参数名称	参数说明	例子	用法说明
1001	停用/可用	是否启用策略	0	0 停用；1 启用。如果设置为 0，则无法在策略窗口中见到，也就无法启动。即使自动启动时间设置了一个具体的时间，也不会自动启动。
1002	策略类型	此参数不可修改	1	1 为谷峰网格；
1003	价格类型	支持限价和部分市价	0	下委托时使用限价还是市价。 0 限价 a 上海-五档即成剩撤 A 深圳-五档即成剩撤 b 北京-五档即成剩撤
1101	自动启动时间	09:45:00	00:00:00	按设置的时间自动启动策略，如设置为 00:00:00 则不自动启动，需要手工启动
1102	自动停止时间	14:55:00	00:00:00	按设置的时间自动停止策略，设置为 00:00:00，需要手工停止，如果未手工停止，则在 15:10:00 程序自动停止。
1201	基准价格	策略执行的基准价格	10.00	策略启动时的第一次基准价格。后续策略运行时，会以成功买入价或卖出价网格幅度价格作为下一次的基准价格。
1202	网格幅度		0.50	第一次触发卖出后，连续上涨过程中每上涨 0.50 元触发卖出一笔。 第一次触发买入后，连续下跌过程中每下跌 0.50 元触发买入一笔。

				在 config.ini 中 djms=0，则此处为具体的价格，djms=1，则此处的值为百分比。
1205	上涨浮点	向上触发浮点数	0.2	与网格幅度参数配合使用。当最新价格上涨到大于或等于“基准价格+网格幅度+向上触发浮点数”时，用“基准价格+网格幅度+向上触发浮点数-报价优化”作为卖出委托价格。如果卖出不成交，不需要撤单。
1206	下跌浮点	向下触发浮点数	0.2	与网格幅度参数配合使用。当最新价格下跌到小于或等于“基准价格-网格幅度-向下触发浮点数”时，用“基准价格-网格幅度-向下触发浮点数+报价优化”作为买入委托价格。如果买入不成交，不需要撤单。
1210	报价优化	为提高执行效果的报价优化	0.03	如上所述。卖出触发时以触发价减 0.03 作为委托价；买入触发时以触发价加 0.03 做委托报价。
1301	买入数量	单次买入数量	1000	100 倍数
1302	卖出数量	单次卖出数量	1000	100 倍数
1311	最大持仓	持仓上线数量	3000000	参数值需要设置为 100 的倍数。当持仓余额大于或等于此参数时，会停止触发买入，但会继续触发卖出。
1312	保留底仓	持仓下限数量	50000	参数值需要设置为 100 的倍数。当持仓余额小于或等于此参数时，会停止触发卖出，但会继续触发买入。
1401	买入次数	买入次数	100	每个交易日内累计买入次数达到此参数时，停止当日策略交易。
1402	卖出次数	卖出次数	100	每个交易日内累计卖出次数达到此参数时，停止当日的策略交易。
1501	上限价格	策略运行上限区间价格	15.10	当最新价大于此参数值后，策略空转，且不停止。过一段时间，如果最新价又回到此参数值以下继续执行策略。
1502	下限价格	策略运行下限区间价格	9.60	当最新价小于下限价之后，策略空转，且不停止。过一段时间，如果最新价又回到此参数



				值以上继续执行策略。
--	--	--	--	------------

设置的参数可进行导入或导出，导入、导出对应的是 CVS 格式的文件，格式如下。

表 2 CVS 格式

证券代码	参数代码	参数值
SH600000	1001	1
SH600000	1002	1 谷峰网格
SH600000	1101	00:00:00
...	...	...

正在运行的策略不能导入参数，成功导入后会覆盖之前的参数。建议采用导出备份策略信息。

#### 注意点：

- 1、针对“基准价格”的跳空处理方式，在 config.ini 中有一个参数 TradeMode 进行定义。  
;0--只在触发价附近的网格处下 1 笔委托  
;1--按照网格幅度产生多笔不同阶梯的网格幅度价格的委托  
;2--按照网格幅度产生多笔相同阶梯的网格幅度价格的委托  
TradeMode=0
- 2、遇到股票出现分红派息时需要手工关注或调整基准价格。
- 3、如果有一笔买入或卖出没有成交，不会再触发下一笔，即必须要等到这一笔成交。
- 4、如果使用信用账号登陆，触发的委托单中的买卖类别：买入是融资买入，卖出是普通卖出。

### 3.5 启动/停止策略

主界面选中股票后，点击“启动策略”（“停止策略”），相应选中的证券代码会自动开始（停止）按设置策略进行交易。

启动策略前务必通过“查看参数”确认各股票的策略参数是否设置正确。

在“其他信息”中会显示策略启动失败的原因。

### 3.6 查看日志

策略运行的情况写入文本类型的日志文件中，每天保存一个策略运行的日志文件（在可执行程序相同目录下）。在下列截图中“执行信息”显示最后一笔策略运行信息，比如：“14:50:43,SH510050[谷峰网格]启动”等。“20180102,09:43:30,2.878,1000,1,0,买入 510050[基准价 2.882,触发价 2.877,委托价 2.878,下次基准价 2.879]委托成功”表示受到 2018 年 1 月 2 日 09 点 43 分 30 秒的行情价 2.877 的触发，发生一笔委托：委托价为 2.878 元，买入 1000 份，当批第 1 次数卖出。

### 3.7 锁定窗口

网格交易终端支持锁定窗口功能。点击“锁定窗口”，出现如下界面。锁定之后程



序保持运行状态，只显示如下界面。客户号不可输入，只需要输入登录密码进行解锁返回主界面。



图 7 客户端锁定

### 3.8 刷新资金股份

点击“刷新资金股份”，可刷新主界面的资金、股份信息框内的显示数据。

### 3.9 手工补单

如果行情出现异常情况导致策略未能够保持仓位的平衡，可以利用此功能手工买卖股票，达到仓位的平衡。手工补单请使用买入或卖出按钮，进入对应的买卖功能。

### 3.10 资金划转

每交易日早晨，鑫奇点会从集中交易系统中同步可用资金，如果投资者在日内还需要入金，可以在此功能中把资金从集中交易系统划入到鑫奇点交易系统。

“资金划转”功能是在鑫奇点与集中交易柜台之间的资金划转，以满足日内有资金调拨的场景。选择“资金划转”按钮之后出现如下对话框，按 **Esc** 键可以快速关闭。

图 8 资金划转

## 4 配置文件说明

在程序运行目录中有一个 config.ini 文件，用文本编辑器打开之后，会看到如下配置信息，每一项配置的说明参见如下。

[COMM]

;注册码: 保存按照网卡号码计算的注册码;

;请向我公司对口人员索要注册码

Key=575786952

;交易、行情服务器地址和端口，请向我公司对口人员索要相关参数

TD=tcp://XXX.XXX.XXX.XXX:XXXX

MD=tcp://XXX.XXX.XXX.XXX:XXXX

;记录日志的配置项，0 不记录，1 记录日志。

RLog = 0

;在主界面中显示策略运行股票的行情，0 不显示，1 显示。

SHOWHQ=1

[TRADE]

;缺省客户

defaultkhh=330100000005

;客户号自动补位

khhzdbw=1

;客户号补位前缀

khhbwqz=3301

;客户号长度

khhlen=12

;TradeMode 跳空处理方式

;0--只在触发价附近的网格处下 1 笔委托

;1--按照网格幅度产生多笔不同阶梯的网格幅度价格的委托

;2--按照网格幅度产生多笔相同阶梯的网格幅度价格的委托

TradeMode=0

;遇到股票出现分红派息时需要手工调整基准价格。

;融资买开关，0-使用可用资金买入，1-融资买入

BuyFMode=0

;单笔最大数量，如果设置超过 100 万，则最多为 100 万。

MaxSL=1000000

;网格幅度定价模式 0-值 1-百分比 默认为 0

djms=0