# 华鑫证券有限责任公司

# 剑鱼星整合版使用说明

华鑫证券有限责任公司

(版权所有,翻版必究)

# 修订历史记录

| 版本号 | 日期 | 修改说明 |
|---|---|---|
| 1.0.0 | 2023-03-21 | 创建 |
| 1.0.2 | 2023-09-18 | 添加"组合条件单"及其他功能完善 |
| 1.0.3 | 2023-12-15 | 完善"组合条件单"：支持前/后复权的指标条件，添加换手率、量比、价格反弹和回落条件 |
| 1.1.0 | 2024-04-02 | 新增"定时委托"：预设时间和参数，到达时间后报单 |
| 1.1.3 | 2024-12-25 | 添加沪港通业务的支持<br>添加冰山算法模块 |
| 1.1.4 | 2025-01-06 | 添加网格单模块<br>添加历史查询功能（交割单、资金、流水、持仓、盈亏） |
| 1.1.5 | 2025-06-12 | 添加同客户号的多节点登录<br>添加节点间资金划拨<br>添加要约收购 |
| 1.1.6 | 2025-07-24 | 添加重要公告弹窗<br>完善"闪电下单"：预估金额，按委托金额报单，数量比例 |
| 1.1.7 | 2025-09-24 | 完善"算法交易"：支持快捷创建算法任务<br>添加"条件触发单"：涨停板封单减少条件卖出 |
| 1.1.9 | 2025-10-27 | 网格单/冰山/twap 算法的交易所废单机制完善：<br>添加废单自动停止并弹窗提示 |
| 1.2.0 | 2025-11-12 | 添加"当日撤单记录"查询功能（撤成功/交易所拒绝/预埋） |
| 1.2.2 | 2025-12-29 | 修复港股相关汇总资产的汇率转换计算（市值/总资产）<br>完善港股休市日的昨收盘价和汇率获取，用于市值展示 |
| 1.2.3 | 2026-01-06 | 添加历史查询中指定证券代码的筛选查询<br>修复北交所定价发行模式新股申购的已知问题 |
| 1.2.4 | 2026-01-26 | 适配 IOPV 独立行情 |
| 1.2.5 | 2026-03-12 | 完善"冰山算法"隔日任务进度 |
| 1.2.6 | 2026-04-13 | 信用支持北交所业务<br>定时单添加"执行流速控制"功能 |

© 华鑫证券有限责任公司，2026

| 版本号 | 日期 | 修改说明 |
| --- | --- | --- |
| 1.2.7 | 2026-06-11 | 支持盘后固定价格类型和盘后行情展示 |
| 1.2.8 | 2026-07-08 | 定时单支持盘后类型 |
| 1.2.9 | 2026-07-28 | 添加两融多节点的资金归集转出<br>修复港股通标的名单之外的港股持仓无法卖出<br>完善资金划转功能<br>完善登录进度展示信息 |
| 1.2.10 | 2026-08-12 | 完善登录时查询连接尚未建立导致后续数据更新异常<br>日志输出添加节点号 |
| 1.2.11 | 2026-08-19 | 添加置顶功能：启用后窗口始终最前端显示 |
| 1.2.12 | 2026-09-10 | 完善设备信息获取 |

© 华鑫证券有限责任公司，2026

# 目 录

1 适用场景 ..... 6
2 测试环境账号 ..... 6
3 运行环境 ..... 6
4 功能介绍 ..... 6
4.1 账号登录 ..... 6
4.2 账号管理 ..... 8
4.3 主功能区 ..... 8
4.4 菜单-系统 ..... 9
4.4.1 系统设置 ..... 10
4.4.2 多窗口模式 ..... 14
4.5 菜单-交易 ..... 15
4.5.1 闪电下单 ..... 15
4.5.2 普通下单 ..... 19
4.5.3 算法交易 ..... 25
4.5.3.1 TWAP ..... 25
4.5.3.2 POV ..... 32
4.5.4 冰山交易 ..... 36
4.5.5 网格交易 ..... 40
4.5.6 定时交易 ..... 47
4.5.7 条件触发单 ..... 52
4.5.8 组合条件单 ..... 54
4.6 菜单-综合 ..... 59
4.6.1 资金划转 ..... 60
4.6.2 密码修改 ..... 61
4.6.3 申购赎回 ..... 61
4.7 菜单-查询 ..... 61
4.7.1 信用查询（两融） ..... 62
4.7.1.1 信用资产明细 ..... 62
4.7.1.2 信用负债记录 ..... 62

© 华鑫证券有限责任公司，2026

4.7.1.3 标的证券查询 ..... 63
4.7.2 持仓明细 ..... 63
4.7.3 当日委托 ..... 64
4.7.4 当日成交 ..... 64
4.7.5 当日撤单 ..... 65
4.7.6 历史记录 ..... 65
4.7.7 设置表头栏位 ..... 66
4.8 菜单-帮助 ..... 67
4.8.1 检查更新 ..... 67

# 1 适用场景

剑鱼星整合版交易终端作为一款轻量级、操作简单快捷的交易软件，支持普通和两融业务。主要适用于交易员快速下单、实时行情跟踪和仓位信息查看等场景。为了达到交易快一步的目的，交易终端融合了多种鼠标快捷交易操作，可自定义符合各种用户习惯的快捷操作。同时终端也支持多个交易窗口的分屏显示，拖放位置记忆，可以让交易员方便地对多个标的进行跟踪、快速操作。

# 2 测试环境账号

为配合投资者熟悉我司交易系统，用户可通过登录界面的通讯设置，切换至测试环境。测试环境需要 N 视界账号，请前往 N 视界官网注册获取：

http://n-sight.com.cn/u/w/authLogin/register.html。

# 3 运行环境

本软件为 64 位绿色免安装版本，解压之后即可使用，支持 Win7、Win10、Win11 操作系统。若软件运行后提示缺少 MSVCP140.DLL 等库文件，安装 vcredist_x64.exe 即可解决。

# 4 功能介绍

## 4.1 账号登录

登录窗口如下：

© 华鑫证券有限责任公司，2026



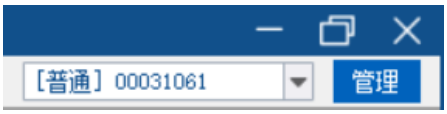

当前版本支持普通账户/信用账户的登录。自动记忆上次登录成功的客户号。




可通过右下角的“通讯设置”打开“网络测速”窗口，切换实盘环境与测试环境。注意每个实盘账号有对应的交易节点号，请在左侧交易节点线路列表中勾选账号所在的节点，否则会提示“找不到用户”。例如 12 号节点，节点名后缀代表可供选择的不同线路（电信、联通、移动）。如果是多节点账号，可勾选多个交易节点，后续该账号将同时登录所有选中的节点。

## 4.2 账号管理

登录成功进入主界面，右上角显示当前登录的账号及其类型（普通/两融），点击“管理”按钮可打开账号管理窗口。





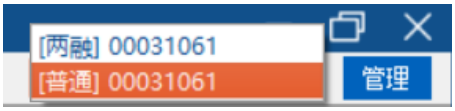


支持最多同时登录 1 个普通账号（多节点）和 1 个两融账号（多节点）。账号管理窗口中显示了普通和两融账号的登录情况。如左图所示，普通账号已登录 12 号和 19 号两个节点，两融为“未登录”状态。

点击已经登录账号的登出按钮，将退出指定节点账号，但要求至少存在一个账号处于登录状态，即如果当前账号是唯一已登录状态则不允许登出。

点击左下方的添加账号，可以额外登录当前账号另外的节点。

点击两融的登录按钮，弹出登录窗口完成账户登录后，会同时显示普通和两融账户、上次登录、前置节点名称等信息。




当存在多个账号皆为已登录状态时，在主界面右上角，可实现快速切换。

## 4.3 主功能区

登录成功后交易终端主界面如图所示。从上往下依次为菜单栏、汇总字段栏、操作区、连接状态栏。

© 华鑫证券有限责任公司，2026









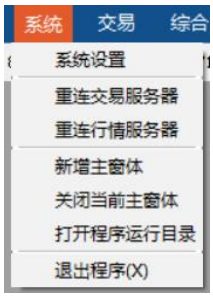
汇总字段栏根据当前主窗体的账号类型（普通/两融），展示不同的字段。




普通账号主窗口汇总栏的”?”按钮，点击后展开计算明细。

剑鱼星终端自动记忆窗口位置布局，每次登录进入主界面后，会自动载入上次打开的子窗口，并显示在之前关闭前的位置。

## 4.4 菜单-系统



### 4.4.1 系统设置

- 主界面设置




报单/撤单弹窗确认：报单/撤单是否需要确认。弹窗确认的配置项适用于闪电下单和普通下单窗口。

提示音设置：可选成交、撤单时是否播放指定的提示音效。

成本计算方式：可设置采用哪种成本金额来计算持仓成本和盈亏。

注：摊薄成本（或持仓成本）指的是中途有盈利卖出，成本价就会摊低，相反如果是亏损卖出，成本价就会提高；而开仓成本（或买入成本）指的是仅考虑买入开仓时候的成本，中途卖出不影响该成本价。

清仓后盈亏率：仅摊薄成本适用，清仓后盈亏率=盈亏/(当日卖出金额-盈亏)

全部撤单范围：定义委托表格全撤按钮的范围。买卖方向仅对普通和两融买卖批量撤单，全部方向包含配股配债、转股回售等等所有方向。

自成交控制：开启后如果发送一笔可能会引起自成交的委托，将被柜台拒绝该笔委托（该功能取决于柜台是否开启支持）

融券头寸类型：适用于闪电下单、算法交易、组合条件单的两融融券卖出方向的默认头寸类型（普通、专项）。仅登录信用后显示，设置确定后立即生效。

默认股东号：全局生效，发送报单时采用股东号，默认为主股东号，用户修改后仅当次登录期间有效，软件重启后恢复为默认采用主股东号。

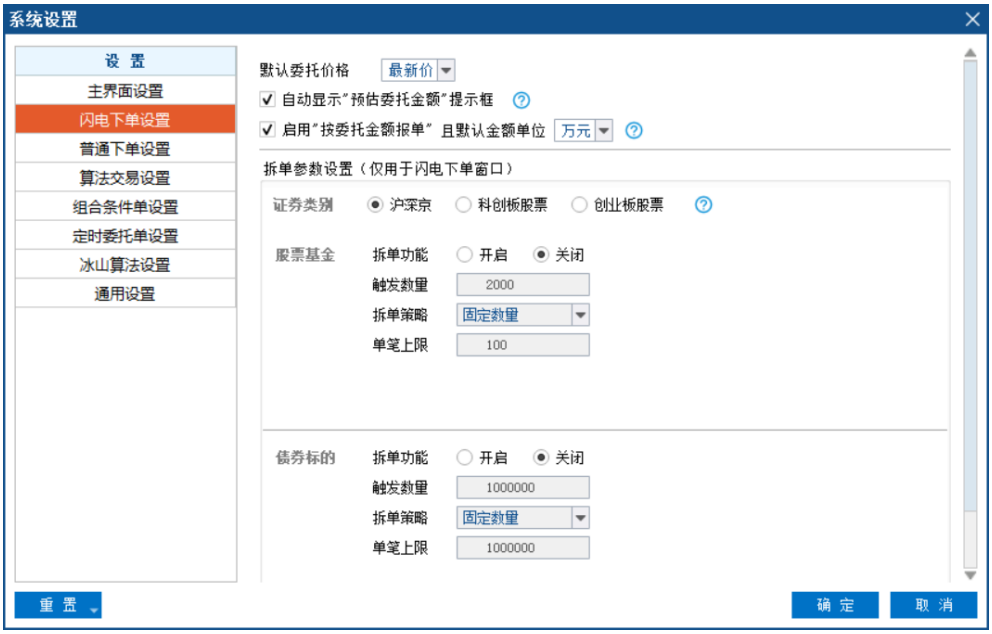
港股通默认通道：选择双通道则输入港股代码后会同时出现沪港通和深港通

候选项，选择单通道则只会出现所选通道候选项。

提示音设置：对于成交/撤单事件设置提示音。

字体大小设置：缩放所有窗口中的展示字体大小。

- 闪电下单设置




此页的所有配置项仅对闪电下单窗口有效。

默认委托价格：切换证券代码后在委托价格输入框的默认填入值。

自动提示"预估委托金额"：委托价格/数量修改后，将实时弹窗提示该笔报单的预估委托金额。

启用"委托金额报单"：闪电下单最下方多显示一行委托金额输入框，用户可直接填入委托金额（单位可选元或者万元），委托数量将自动更新。

拆单参数：当对应证券类别和报单类型的拆单功能开启后，如果输入的委托数量大于等于触发数量自动拆单。

由于不同品种证券的单笔最大数量各有不同，因此可对不同品种证券，分组设置各自的拆单参数。默认参数为拆单功能全部是关闭状态；触发数量科创板股票默认为限价单 10 万股，市价单 5 万股；创业板股票默认为限价单 30 万股，市价单 15 万股；其余类别默认为 100 万（股\张\份）。

数量单位说明：股票为股，债券为张，基金为份。




固定数量模式：每笔委托数量=单笔上限，最后一笔报出剩余量；

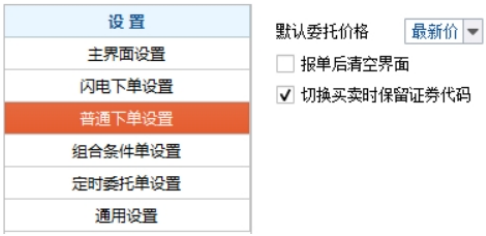
数量递减模式：第一笔委托数量=单笔上限，后续每笔委托数量=上一笔委托数量-递减数量，最后一笔报出剩余量；

区间随机模式：每笔委托数量=单笔上限和单笔下限之间的随机值，最后一笔报出剩余量；

最后一笔报出剩余量解释：根据当前设置的拆单策略和参数计算拆单笔数和每笔数量时，如果某一笔计算完成后，最后剩余的数量小于等于设定的单笔上限，后续一笔直接报出所有剩余量。

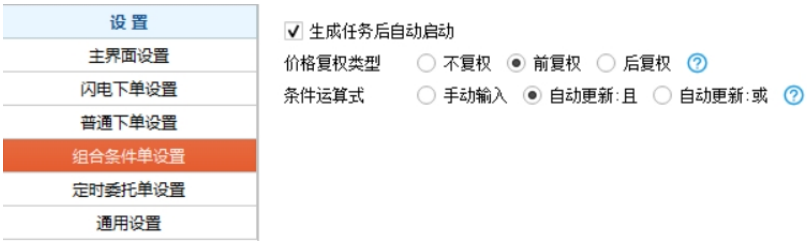
注：如果拆单笔数过多，可能因每秒最大笔数的流控限制导致废单。另外本拆单策略不含撤单补单逻辑。

- 普通下单设置




可配置“普通下单”窗口的默认价格及是否自动清空界面。

- 组合条件单设置

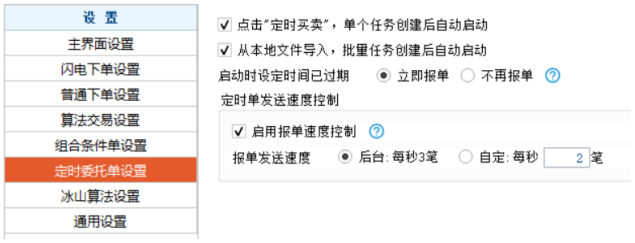



复权类型：仅对 1、5、60 分钟、日线有效。周线和月线固定为不复权，且仅对指标类型的条件有效（MA、MACD、KDJ），不会修改已经存在任务的复权类型。

条件运算时：开启自动更新时，当选中条件表格中的条目新增/修改/删除后，

下方的运算表达式自动用 "且" 或者 ”或” 连接所有选中条件，自动填入表达式。

- 定时委托单设置




任务自动启动：通过定时委托单界面上单个任务的手动创建，或者通过本地文件导入多个任务的批量创建，勾选后任务创建后立即启动。

启动时设定时间过期：任务启动时，如果当前时间已经超过设定时间，可选择启动后立即发出该笔报单，或者禁止报单。

发送速度控制：定时单触发后本程序是否控制报单发送流速。

该功能未启用时，当定时任务触发后立即发送报单，如果速度超过后台最大流控值会导致本地报单失败。该功能启用时，当定时任务触发后由本程序控制发送速度从而避免报单失败，实际报单时间会滞后于触发时间。此外用户也可设置自定义报单速度，要求不大于后台流控值每秒 n 笔（n 后台返回的参数值）。

- 冰山算法设置




任务初始状态：任务创建后启动（如果未到设定自动启动时间则进入初始状态），或创建后进入暂停状态。

判断任务完成：全部成交为任务成交数量等于目标数量后进入已完成状态，剩余零股为剩余数量不足交易规则的最小单笔委托数量时进入已完成状态。

- 通用设置

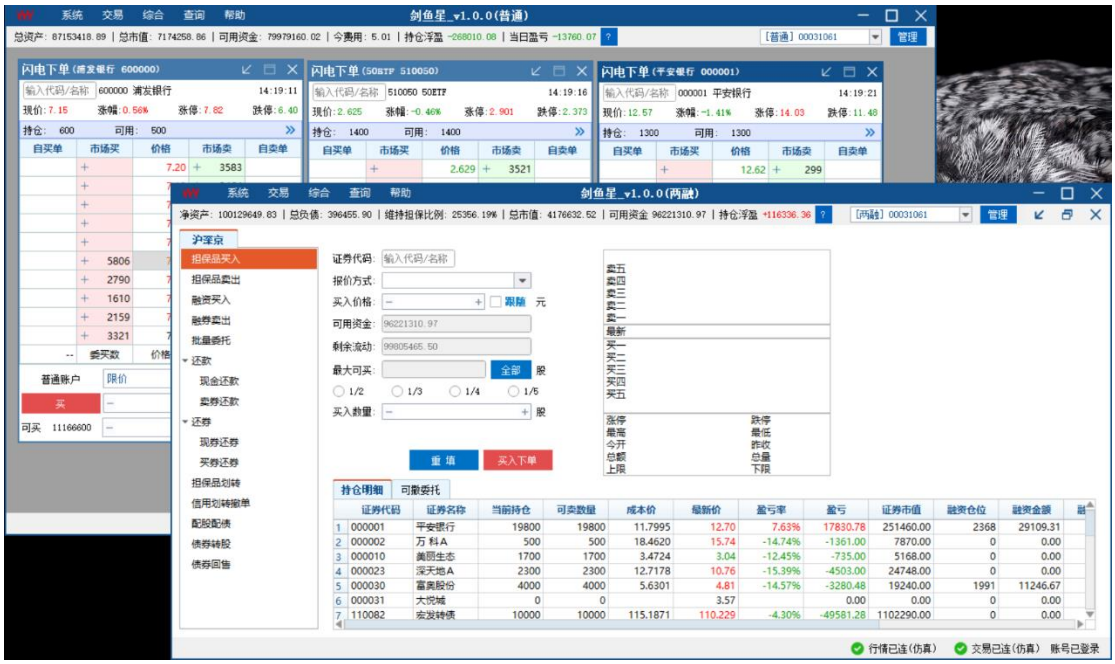
© 华鑫证券有限责任公司，2026



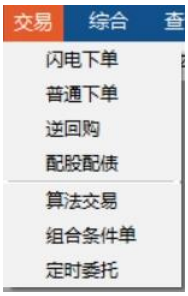

可配置自动锁定时间，是否开启自动检查版本更新。

### 4.4.2 多窗口模式

用户可通过“新增主窗体”，复制多个主窗口，适用于多个显示屏环境。每个主窗口都可在右上角切换到一个已登录状态的现货\两融账号。



# 4.5 菜单-交易




交易菜单包括闪电下单、普通下单、逆回购（仅普通账号）、配股配债、算法交易、组合条件单、定时委托等功能模块。

## 4.5.1 闪电下单

点击交易菜单下的 “闪电下单”可新建股票交易窗口。交易员可根据自己的需求生成多个交易窗口，方便交易。在弹出的交易窗口股票信息框中可直接输入需要操作的股票代码或名称,鼠标单击之后直接清空搜索框中的内容。

每个交易窗口可以在灰底的操作区域自由拖动摆放，并按记忆放置位置，终端再次启动会自动打开上次未关闭的交易窗口，恢复至原先位置。

闪电下单窗口支持股票债券基金的买卖，逆回购（卖出按钮）业务



交易窗口上方显示了该个股的综合信息，中间是盘口行情，用户可以在下方的报单区域进行个股的买卖操作。行情区域的第一列和第五列是用户以该委托价挂单的买卖总可撤数量（仅统计未成交未撤单部分的总数量，沪深 A 的单位为手，深港通为股），第二列和第四列是盘口数量（沪深 A 的单位为手，深港通为股）。可直接点击第二列（红色底）快速买入，第四列（绿色底）快速卖出。

请特别注意：行情盘口数量显示单位统一为手（深港通为股），而下方报单区域的委托数量单位为（股\份\张），而不是手。



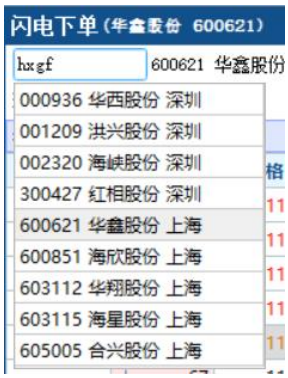

闪电下单右上方，点击 展开扩展区域，点击 收回扩展区域。

扩展区域：展示行情明细以及该证券的持仓字段。

行情明细表格最下的两个字段，买价上限和卖价下限，实时揭示了该证券（仅限股票）的限价类型价格笼子的报价范围。

具体操作方式如下：

- 选择证券



闪电下单左上方的输入框，支持证券代码、中文名、拼音首字母。

- 选择价格类型：包括限价、五档剩余撤销、五档剩余限价、本方最优、对手方最优、立即成交剩余撤销、全额成交或撤销、盘后定价




- 委托价格和数量




报单可以通过单击盘口价格或下方输入框手动修改价格和数量。

- 报单

两种方式：一为买卖按钮；二为行情区域的单击快捷报单；

| 序号 | 操作 | 说明 |
|---|---|---|
| 1 | 手动输入价格、类型进行报单 | 在输入框中填入价格类型、委托价格、委托数量，点击左右两侧的买\卖按钮发送报单。 |
| 2 | 单击行情区域的买卖列快捷报单 | 在行情表格对应列上直接单击报单，价格为该行的行情价格。价格类型和委托数量为下方报单区域内的值。 |

- 撤单

两种方式：一为撤全和撤近按钮；二为行情区域的双击快捷撤单；

另外在“委托明细”窗口中也可通过双击委托记录等方式进行撤单操作。

| 序号 | 操作 | 说明 |
|---|---|---|
| 1 | 撤近、撤全按钮 | 撤近：撤销该证券最新一笔的可撤挂单（所有委托方向）；<br>撤全：撤销该证券所有的可撤挂单（所有委托方向）； |
| 2 | 双击行情区域的自 | “自买单”列，双击撤销买单； |

© 华鑫证券有限责任公司，2026

| | | |
|---|---|---|
| | 买自卖列快捷撤单 | “自卖单”列，双击撤销卖单； |

快捷报单和快捷撤单的具体操作方式：

在行情表格区域的对应列中，可通过鼠标单击快速报单，双击快速撤单。

| 自买单 | 市场买 | 价格 | 市场卖 | 自卖单 |
|---|---|---|---|---|
| | + | 7.23 | + 4543 | 5 |
| | + | 7.22 | + 8890 | |
| | + | 7.21 | + 3571 | |
| | + | 7.20 | + 8005 | |
| | + | 7.19 | + 8692 | |
| | + 1328 | 7.18 | + | |
| | + 2233 | 7.17 | + | |
| 1 | + 2087 | 7.16 | + | |
| 2 | + 2738 | 7.15 | + | |
| | + 3110 | 7.14 | + | |
| 3 | 委买数 | 价格 | 委卖数 | 10 |

快速报买单：第 2 列（红底），鼠标单击，会以该行所在的行情价格作为委托价格，立即发送一笔买单。价格类型和委托数量取决于下方的报单区域。

快速报卖单：第 4 列（绿底），鼠标单击，会以该行所在的行情价格作为委托价格，立即发送一笔卖单。价格类型和委托数量取决于下方的报单区域。

快速撤买单：第 1 列“自买单”显示该证券用户挂出买单的可撤数量，双击可撤销该委托价格的所有买单。最后一行是所有买单的可撤数量的累加总和，双击可撤销该证券的所有买单。

快速撤卖单：第 5 列“自卖单”显示该证券用户挂出卖单的可撤数量，双击可撤销该委托价格的所有卖单。最后一行是所有卖单的可撤数量的累加总和，双击可撤销该证券的所有卖单。

例如当用户通过以下操作后，最后展示结果如图中所示。

以 7.16 元 200 股报买单，且部分成交 100 股，剩余 100 股未成交。

以 7.15 元 200 股报买单，已报状态，没有成交。

以 7.23 元 500 股报卖单，已报状态，没有成交。

以 7.24 元 500 股报卖单，已报状态，没有成交。

报单\撤单时默认会弹出确认框，用户点击确定之后才会发送报单\撤单请求。

© 华鑫证券有限责任公司，2026

是否显示确认弹窗的开关可在设置中修改。




### 4.5.2 普通下单




现货普通下单窗口




两融普通下单窗口

- 买入、卖出

买入(卖出)页面可通过输入代码或点击下方持仓记录的方式选择证券，可在设置窗口中修改默认填入的委托价格。

选择价格类型：包括限价、五档剩余撤销、五档剩余限价、本方最优、对手方最优、立即成交剩余撤销、全额成交或撤销、盘后定价。

勾选“跟随”后委托价格会自动随当前所选择的档位价格变化，也可通过鼠标双击行情价格更改价格跟随的档位。

- 批量买入、批量卖出

用于固定数量模式的拆单，可在“买入(卖出)数量”输入框内输入批量买入(卖出)的总数量，“单笔数量”处填入拆单的单笔委托数量，点击下单即可按固定的单笔数量批量下单，直至完成买入(卖出)总数量。

- 融资买入



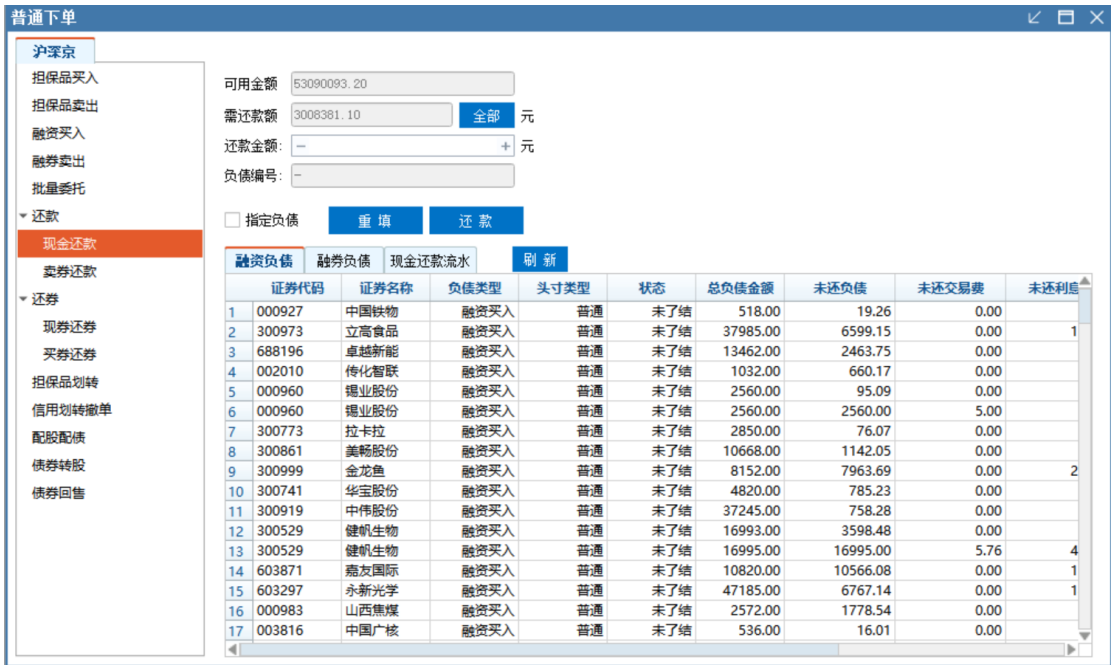

融资买入页面下方显示了“持仓明细”和“融资负债”“可撤委托”三张表格。输入证券代码后，会提示当前的可融资买入数量，用户可根据提示来进行报单。

- 融券卖出




在“融券卖出”页面输入证券代码后，展示所有可融券数量。下方会显示“持仓明细”、“可撤委托”、“融券负债”以及“可融券”四张表，用户可以通过选择不同头寸类型标的（普通、专项）来进行融券卖出操作。

- 还款




现金还款




卖券还款

可以通过现金或卖券的 2 种方式进行融资或融券负债中资金部分（包括融资负债金额、利息、费用等）的偿还。如果勾选“指定负债”，并在下方负债表格中选中需要还款的负债记录，负债编号会根据选择的记录自动填入报单信息中，对应的还款金额也会自动更新。如果不指定负债，则默认归还最早到期负债。归

还负债的优先级为先还利息再还负债。

- 还券




现券还券页面




买券还券页面

可以通过现券或买券两种方式进行融券负债中券数量的偿还。还券必须指定一个融券负债编号，可以通过鼠标单击下方“融券负债”表格中的记录选择。

勾选“一并还款”，同时偿还融券负债中的费用资金。

- 担保品划转




输入证券代码或点击下方持仓记录，选择划转方向（普通->信用或信用->普通）后，自动更新当前标的的“最大可划”数量，输入“划转数量”后点击划转即可完成信用与普通账户之间持仓的划转。同时可在下方的“划转流水”表格中查看当天的所有划转记录。

担保品划转默认显示的是“单笔划转”功能页，点击“批量划转”按钮切换到批量划转页，可勾选和修改持仓表的请求数量进行批量划转。



### 4.5.3 算法交易

支持 TWAP 和 POV 两种算法，建议实盘交易前先在仿真环境测试验证。

点击左上方”<<”图标按钮，可展开”创建即时任务”区域，快捷创建一个算法任务并立即执行。




#### 4.5.3.1 TWAP

时间加权平均价格（TWAP）是国际通行的算法，TWAP 交易时间加权平均价格 Time Weighted Average Price 模型是把一个母单的数量平均地分配到一个交易时段上。该模型将交易时间进行均匀分割，并在每个分割节点上将拆分的订单进行提交。例如，可以将某个交易日的交易时间平均分为 N 段，TWAP 策略会将该交易日需要执行的订单均匀分配在这 N 个时间段上去执行，从而使得交易均价跟踪 TWAP，也是一个计算公式：

$$Twap = \frac{\sum_{i=1}^{n} price_i}{n}$$

TWAP 不考虑交易量的因素。TWAP 的基准是交易时段的平均价格，试图付出

比此时段内平均买卖差价小的代价执行一个大订单。TWAP 模型设计的目的是使交易对市场影响减小的同时提供一个较低的平均成交价格，从而达到减小交易成本的目的。在分时成交量无法准确估计的情况下，该模型可以较好地实现算法交易的基本目的。

- 主功能区




上方区域为策略信息，下方为最新的持仓、委托、成交、其他信息。

算法交易窗口中，同时展示了 TWAP 和 POV 的任务和交易记录，在不同区域内可以通过（全部/TWAP/POV）对算法任务、委托记录、成交记录进行过滤。

可以对选中的股票启动、暂停和停止策略，策略暂停后可修改策略的参数，启动后继续执行未完成的任务量，策略停止则会终止当前策略执行，再次启动则重头开始执行策略。需手动点击“启动”后继续运行。手工暂停或停止操作后，会立即撤销所有未成交挂单。

执行状态会显示本次策略运行状态，分“初始”“执行中”“执行结束”“手动停止”等状态，执行信息则会显示本策略执行起始和结束的时间。完成比例显示当前时间片的完成比例和总任务的完成比例。当前时间片则会显示本策略目前运行的时间片序号。

- 参数设置

点击主界面的“参数设置”，在弹出的“设置策略参数”界面中可新增、删除策略。以及对每条策略的时间片进行增、删、改等操作。设置完成点击“保存”

按钮后策略参数立即生效，重启软件后自动载入上次设置的策略参数。

具体策略参数解释，请查阅后文中的“TWAP 策略文件字段说明”表。




- 添加删除策略

点击上述界面中的“新增策略”按钮，选择证券和方向。现货支持委托方向为买入、卖出；两融支持的委托方向为买入、卖出、融资买入、融券卖出。




选中证券代码，点击“删除策略”，弹出确认删除窗口。




- 添加策略时间片

策略增加后，首先必须进行时间片的添加。左侧列表选中某一个策略后（如没有策略需先新增策略），可以在“设置参数”页面的右上区域进行时间片的添加。时间片参数可对“开始时间”“结束时间”等参数进行设置，输入片内总量、执行模式、每笔数量、报单间隔。“报价优化”可以填正负数值，不带正负号则

以正数处理。输入完成后点击“添加时间片”即可。




注：单个策略具有唯一的委托方向，各时间片的委托方向相同。

- 删除策略时间片

右下时间片表格，选中一条时间片，点击“删除时间片”可以删除该时间片。

- 修改策略时间片

| 序号 | 起始时间 | 结束时间 | 任务比例 | 片内总量 | 执行模式 | 每笔数量 | 报单间隔 | 价格类型 | 报单价格 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 09:30:00 | 10:30:00 | 50.0% | 1000000 | 指定单笔数量 | 1000 | (自动计算) | 买一价 | 无 |
| 2 | 13:00:00 | 14:00:00 | 25.0% | 500000 | 指定单笔和间隔 | 10000 | 60 | 指定限价 | 11.460 |
| 3 | 14:30:00 | 14:55:00 | 25.0% | 500000 | 指定报单间隔 | (自动计算) | 20 | 市价 | 0.000 |
| 合计 | | | 100% | 2000000 | | | | | |

右下时间片表格，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。

- 导入策略

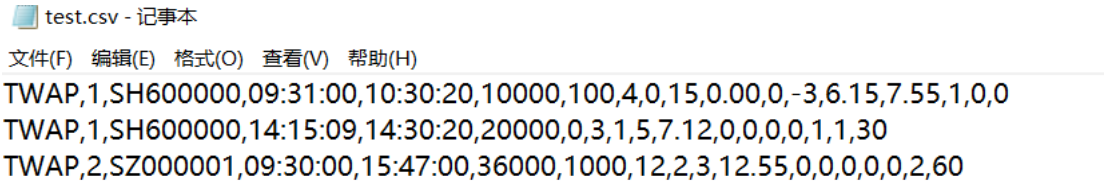
从 csv 格式文本的策略文件导入策略，导入前建议先清空原有策略。文本的第一行默认为标题，不会被识别为策略内容。后续每一行代表着某个策略中的一条时间片对应的参数。详细字段解释请查阅“TWAP 策略文件字段说明”表。

| TWAP 策略文件字段说明 | |
|---|---|
| **字段名** | **说明** |
| 算法类型 | 固定填”TWAP” |
| TWAP 策略号 | 策略唯一的序号（从 1 递增）<br>同一策略号下的时间片，必须是相同的证券和买卖方向 |
| 策略名称 | 市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，深港通 SZH，北京 BJ）<br>例：SH600000，SZ000001，SZH00001（深港通） |
| 开始时间 | 格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示<br>例：09:30:00，（注：该时间为电脑本地时间） |

| | |
|---|---|
| 结束时间 | 格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示<br>例：14:57:00，（注：该时间为电脑本地时间） |
| 片内总量 | 时间片内需完成的目标量，单位：股/份/张 |
| 每笔数量 | 每笔报单的数量，单位：股/份/张<br>仅对执行模式”指定单笔数量”和”指定单笔数量和间隔”有效 |
| 价格类型 | 报单的价格类型：<br>0-最新价, 1-卖一, 2-买一, 3-市价, 4-卖二, 5-买二, 6-卖三, 7-买三, 8-卖四, 9-买四, 10-卖五, 11-买五, 12-指定限价<br>当前版本，3-市价只支持最优五档成交剩余转撤销。 |
| 撤单类型 | 0-自动撤单自动补 1-自动撤单不补单 2-手动撤单 |
| 撤单时间(秒) | 仅针对行情盘口档位的价格类型有效。<br>当撤单类型为 0-自动撤单自动补，或 1-自动撤单不补单时，该字段有效，不允许小于 3 秒。<br>某一笔委托挂单未全部成交，超过设定的撤单时间，且该笔委托价格与从行情计算出的新价格不同时，才会撤销该笔委托。 |
| 报单价格 | 用户自定义的委托价格<br>价格类型为 12-指定限价时，需填入有效价格的值。<br>价格类型为 3-市价时，该委托价格为保护限价。<br>填值大于 0 的有效价格，则以此为保护限价。<br>填 0，则买入时用涨停价，卖出时用跌停价作为保护限价。<br>价格类型为其他时，填 0 即可。<br>例：<br>价格类型限价时，填 113.92<br>价格类型市价时，填 5.49（有效的保护限价）<br>价格类型市价且为买入方向，填 0（涨停价作为保护限价）<br>价格类型市价且为卖出方向，填 0（跌停价作为保护限价） |
| 优化方式 | 仅仅针对行情盘口档位的价格类型有效。<br>最终委托价格 = 基准价经过报价优化调整后的值 |

| | |
|---|---|
| | 优化方式可选择最小变动价格 tick 或百分比<br>Tick 值：最终委托价格 = 基准价 + 报价优化<br>百分比：最终委托价格 = 基准价 * （1 + 优化百分比）<br>0-tick , 1-百分比 |
| 报价优化 | 当优化方式为 0-tick 时：<br>整形数据，可设置正负，表示±N 个最小变动价格<br>例：-2（如果股票，优化值为 -0.02 元，即基准价下调 0.02 元）<br>当优化方式为 1-百分比时：<br>浮点型，可设置正负，表示±N%<br>例：0.5（报价优化为 0.5%，即基准价向上调整 0.5%） |
| 价格下限 | 如果行情最新价小于该值，则不报单<br>0 表示不启用价格下限； |
| 价格上限 | 如果行情最新价大于该值，则不报单<br>0 表示不启用价格上限； |
| 买卖方向 | 0-买入, 1-卖出, i-融资买入, j-融券卖出 |
| 执行模式 | 0-指定单笔数量，1-指定报单间隔，2-指定单笔数量和间隔<br>指定单笔数量时，根据起止时间均分，计算报单间隔<br>指定报单间隔时，根据起止时间均分，计算单笔数量<br>指定单笔数量和间隔：按照设定的单笔数量和间隔执行，直到完成所有任务数量或者达到结束时间为止 |
| 报单间隔(秒) | 每两笔报单之间的间隔<br>仅对执行模式”指定报单间隔”和”指定单笔数量和间隔”有效 |

导入 TWAP 算法任务的 csv 文件说明：



标题行（可填可不填）：算法,策略号,策略名称,开始时间,结束时间,片内总量,每笔数量,价格类型,撤单类型,撤单时间(秒),报单价格,优化方式,报价优化,价格下限,价格上限,买卖方向,执行模式,报单间隔。

后续行为正文，每一行内容对应一个 TWAP 算法任务中的某个时间片任务。

TWAP,1,SH600000,09:31:00,10:30:20,10000,100,4,0,15,0.00,0,-3,6.15,7.55,1,0,0

策略号 1 的第一段时间片：以卖二价卖出 600000 股票，总数量 10000，指定单笔数量 100，自动计算报单间隔，报价优化-0.03 元，起止时间 09:31:00 到 10:30:20，当最新价范围超过[6.15, 7.55]之外就不报单，报单 15s 后未成交且满足撤单条件时自动撤单自动补。

TWAP,1,SH600000,14:15:09,14:30:20,20000,0,3,1,5,7.12,0,0,0,0,1,1,30

策略号 1 的第二段时间片：以市价卖出 600000 股票，总数量 20000，指定报单间隔 30 秒，自动计算单笔数量，保护限价 7.12 元，起止时间 14:15:09 到 14:30:20，报单 5s 未成交且满足撤单条件时撤单不补单。

以上两条记录对应着同一 TWAP 策略(策略号为 1)中的两段时间片参数。

TWAP,2,SZ000001,09:30:00,15:47:00,36000,1000,12,2,3,12.55,0,0,0,0,0,2,60

策略号 2 的时间片：以指定限价买 000001 股票，总数量 36000，指定单笔数量 1000，指定报单间隔 60 秒，起止时间 09:30:00 到 15:47:00，指定委托价格 12.55 元，不自动撤单。

- 导出策略

  点击“导出策略”，可把策略文件保存至其他目录。

- 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。

  启动策略前务必确认各股票的策略参数是否设置正确。

  如果启动失败，在“其他信息”中会显示策略启动失败的原因。

- 一键补单

策略执行结束后，可以通过“一键补单”功能快速自动补单。勾选需要补单的任务，点击“一键补单”，设置价格、委托间隔和每笔报单数量后启动。





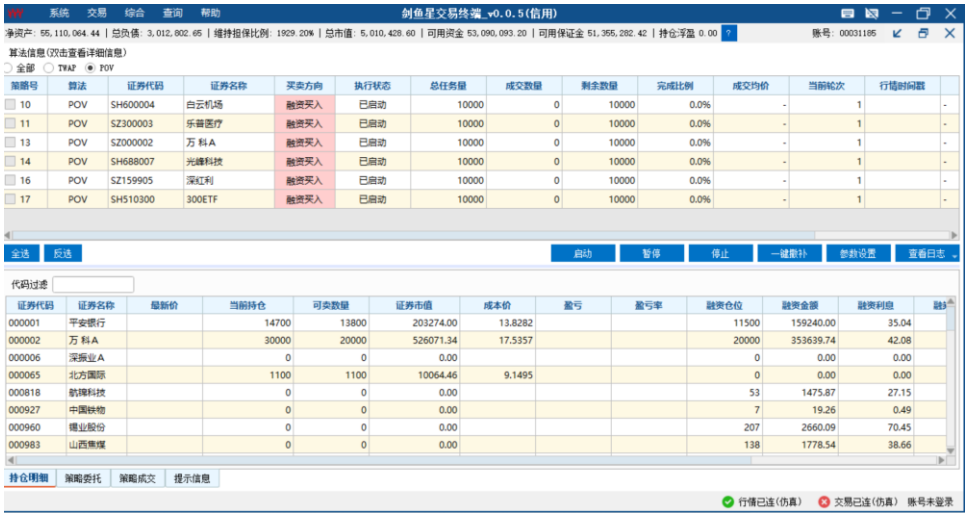


#### 4.5.3.2 POV

POV(Percent of Volume)参与率算法是一种与市场成交量同步的算法，有时它们也被称为目标成交量算法或跟随算法。与 VWAP 算法一样，参与率算法的表现取决于它们所采用的追踪目标成交量的技术，并且重点目标都是为了最小化市场冲击。模型使用实际成交量作为指标，因此在交易时段内总是按照市场成交量的一定比例交易剩余的头寸，该算法为行情触发模式。

- 主功能区

与 TWAP 算法共用一个算法交易管理窗口。上方区域为策略信息，下方为持仓信息、算法委托、成交、其他信息。



- 参数设置

点击主界面的“参数设置”可对 POV 策略参数进行修改。策略任务以及时间片的增删改操作可直接参考上述 TWAP 部分的对应内容。



- 导入策略

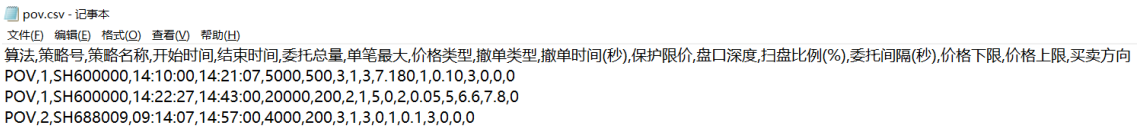
从 csv 格式文本的策略文件导入策略，导入前建议先清空原有策略。文本的第一行默认为标题，不会被识别为策略内容。后续每一行代表着某个策略中的一条时间片对应的参数。详细字段解释请查阅“POV 策略文件字段说明”表。

| POV 策略文件字段说明 | |
|---|---|
| **字段名** | **说明** |
| 算法类型 | 固定填”POV” |
| POV 策略号 | 策略唯一的序号（从 1 递增）<br>同一策略号下的时间片，必须是相同的证券和买卖方向 |
| 策略名称 | 市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，深港通 SZH，北京 BJ）<br>例：SH600000，SZ000001，SZH00001（深港通） |
| 开始时间 | 格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒按两位表示<br>例：09:30:00，（注：该时间为电脑本地时间） |
| 结束时间 | 格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒按两位表示<br>例：14:57:00，（注：该时间为电脑本地时间） |
| 委托总量 | 时间片内需完成的目标量，单位：股/份/张 |
| 单笔最大 | 单笔报单最大数量，单位：股/份/张<br>如果从行情计算的委托数量超过该值，取单笔最大数量。 |
| 价格类型 | 报单的价格类型：<br>0-最新价, 1-卖一, 2-买一, 3-市价, 4-卖二, 5-买二, 6-卖三, 7-买三, 8-卖四, 9-买四, 10-卖五, 11-买五<br>当前版本，3-市价只支持最优五档成交剩余转撤销。 |
| 撤单类型 | 1-自动撤单, 2-手动撤单 |
| 撤单时间（秒） | 仅针对行情盘口档位的价格类型有效。<br>当撤单类型为 1-自动撤单时，该字段有效，不允许小于 3 秒。<br>某一笔委托挂单未全部成交，超过设定的撤单时间，且该笔委托价格与此时从行情计算出的新委托价格不同时，才会撤销该笔委 |

© 华鑫证券有限责任公司，2026

| | |
|---|---|
| | 托。 |
| 保护限价 | 当价格类型为 3-市价时，<br>填值大于 0 的有效价格，则以此为保护限价。<br>填 0，则买入时用涨停价，卖出时用跌停价作为保护限价。<br>价格类型为其他时，填 0 即可。<br>例：<br>价格类型市价时，填 5.49（有效的保护限价）<br>价格类型市价且为买入方向，填 0（涨停价作为保护限价）<br>价格类型市价且为卖出方向，填 0（跌停价作为保护限价） |
| 盘口深度 | 扫描盘口的档位数。<br>1-对手盘一档, 2-对手盘二档, 3-对手盘三档, 4-对手盘四档, 5-对手盘五档；<br>例：3（如买入，基准量=行情盘口卖一量+卖二量+卖三量） |
| 扫盘比例(%) | 执行报单量参照的盘口量的比例。<br>例：1.5（如盘口深度为 3，委托数量=盘口 1~3 档量 * 1.5%） |
| 委托间隔（秒） | 同策略下每次报单的最少间隔时间（不允许小于 3 秒） |
| 价格下限 | 如果行情最新价小于该值，则不报单<br>0 表示不启用价格下限； |
| 价格上限 | 如果行情最新价大于该值，则不报单<br>0 表示不启用价格上限； |
| 买卖方向 | 0-买入, 1-卖出, i-融资买入, j-融券卖出 |

导入 POV 算法任务的 csv 文件说明：




标题行（可填可不填）：算法,策略号,策略名称,开始时间,结束时间,委托总量,单笔最大,价格类型,撤单类型,撤单时间(秒),保护限价,盘口深度,扫盘比例(%),委托间隔(秒),价格下限,价格上限,买卖方向。

后续行为正文，每一行内容对应一个 POV 算法任务中的某个时间片任务。

POV,1,SH600000,14:10:00,14:21:07,5000,500,3,1,3,7.180,1,0.10,3,0,0,0

策略号 1：以市价买入 600000，总数量 5000，单笔最大 500，保护限价 7.18 元，行情盘口中的卖一量*0.1%作为委托数量，最小委托和撤单间隔都为 3 秒，起止时间 14:10:00 到 14:21:07。

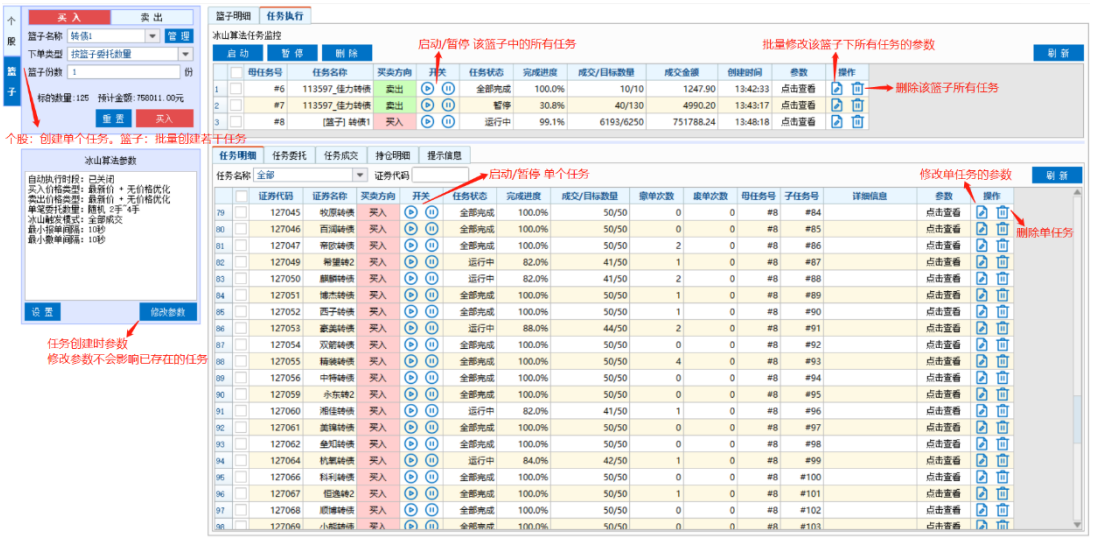
POV,1,SH600000,14:22:27,14:43:00,20000,200,2,1,5,0,2,0.05,5,6.6,7.8,0

策略号 1：以买一价买入 600000，总数量 20000，单笔最大 200，行情盘口中的(卖一量+卖二量)*0.05%作为委托数量，最小委托和撤单间隔都为 5 秒，行情最新价上下限范围为[6.6 元, 7.8 元]，超出范围不报单，时间 14:10:00 到 14:21:07。

以上两条记录对应着同一 POV 策略(策略号为 1)中的两段时间片参数。

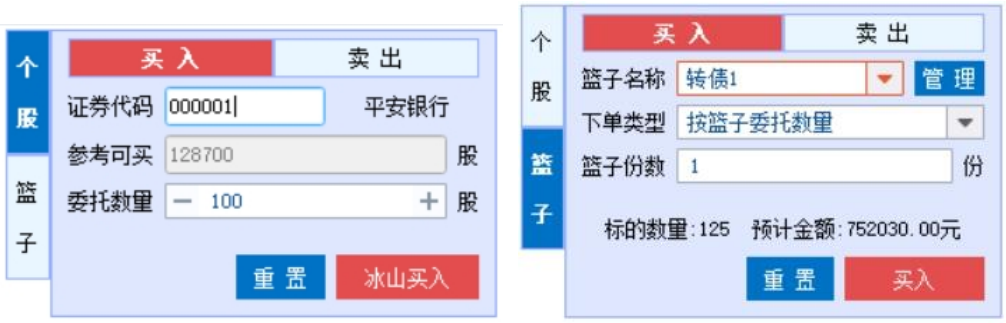
### 4.5.4 冰山交易

冰山交易主要用于将大订单拆分成多笔小订单，减少对市场的冲击，同时利用随机算法降低被探测的概率。执行逻辑为指定个股或篮子、分配总任务量、报单方向、配置算法参数后，自动以指定盘口档位+偏移量计算出委托价格挂单，委托量为单笔最小量和单笔最大量之间的随机值。挂单后按照全成模式或部成模式判断触发条件是否满足则挂出下一笔委托；如果行情更新后，按照新行情计算出的价格已优于上一笔挂单的委托价，则自动撤单并以新的委托价挂单。



- 任务创建区

支持分别以个股和篮子的方式，单个或批量创建冰山算法任务。




如果采用篮子方式批量创建任务，可选的篮子下单分配类型如下：

篮子资金权重：报单区域输入的委托总金额，按照权重分配。

篮子委托金额：每支成份股按设定委托金额算出委托数量*篮子份数。

篮子委托数量：每支成分股按设定委托数量*篮子份数。

篮子数量比例：每支成分股按设定委托数量*数量比例。

单证券委托金额：每支成份股按输入的委托金额算出委托数量。

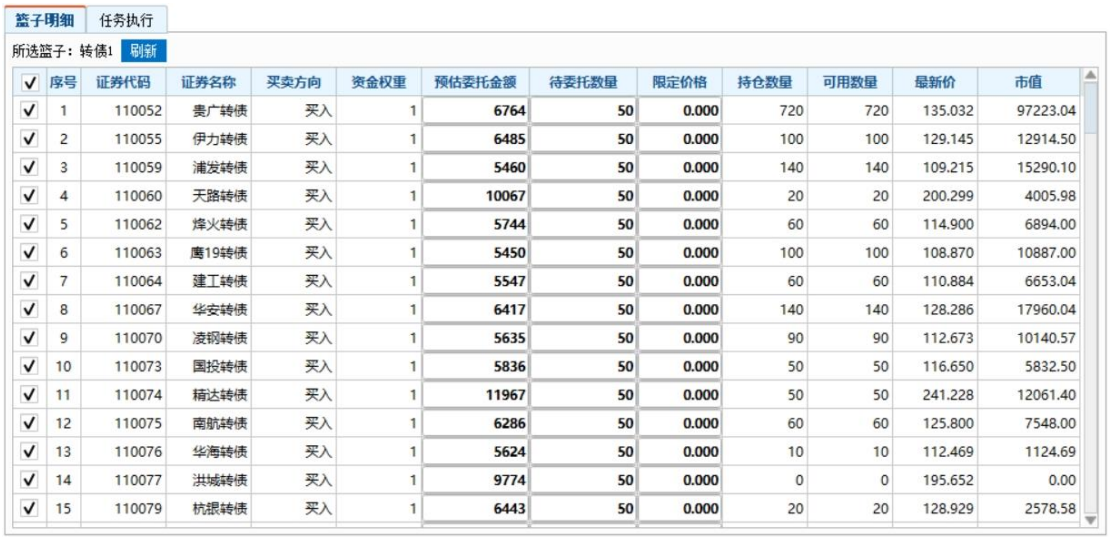
单证券委托数量：每支成份股按输入的委托数量。

持仓比例：每支成分股按当前持仓数量*持仓比例。

可用数量比例：每支成分股按可用持仓数量*持仓比例。

如果采用篮子方式创建任务，右侧篮子明细表格中会显示该篮子中所有成份股的待委托数量，修改了篮子分配方式后表格自动刷新。可以通过第一列勾选/取消勾选，双击修改金额/数量进行调整，最终批量生成冰山任务。

© 华鑫证券有限责任公司，2026


篮子明细 任务执行

所选篮子：转债1 刷新

| | 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 买卖方向 | 资金权重 | 预估委托金额 | 待委托数量 | 限定价格 | 持仓数量 | 可用数量 | 最新价 | 市值 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ✓ | 1 | 110052 | 贵广转债 | 买入 | 1 | 6764 | 50 | 0.000 | 720 | 720 | 135.032 | 97223.04 |
| ✓ | 2 | 110055 | 伊力转债 | 买入 | 1 | 6485 | 50 | 0.000 | 100 | 100 | 129.145 | 12914.50 |
| ✓ | 3 | 110059 | 浦发转债 | 买入 | 1 | 5460 | 50 | 0.000 | 140 | 140 | 109.215 | 15290.10 |
| ✓ | 4 | 110060 | 天路转债 | 买入 | 1 | 10067 | 50 | 0.000 | 20 | 20 | 200.299 | 4005.98 |
| ✓ | 5 | 110062 | 烽火转债 | 买入 | 1 | 5744 | 50 | 0.000 | 60 | 60 | 114.900 | 6894.00 |
| ✓ | 6 | 110063 | 鹰19转债 | 买入 | 1 | 5450 | 50 | 0.000 | 100 | 100 | 108.870 | 10887.00 |
| ✓ | 7 | 110064 | 建工转债 | 买入 | 1 | 5547 | 50 | 0.000 | 60 | 60 | 110.884 | 6653.04 |
| ✓ | 8 | 110067 | 华安转债 | 买入 | 1 | 6417 | 50 | 0.000 | 140 | 140 | 128.286 | 17960.04 |
| ✓ | 9 | 110070 | 凌钢转债 | 买入 | 1 | 5635 | 50 | 0.000 | 90 | 90 | 112.673 | 10140.57 |
| ✓ | 10 | 110073 | 国投转债 | 买入 | 1 | 5836 | 50 | 0.000 | 50 | 50 | 116.650 | 5832.50 |
| ✓ | 11 | 110074 | 精达转债 | 买入 | 1 | 11967 | 50 | 0.000 | 50 | 50 | 241.228 | 12061.40 |
| ✓ | 12 | 110075 | 南航转债 | 买入 | 1 | 6286 | 50 | 0.000 | 60 | 60 | 125.800 | 7548.00 |
| ✓ | 13 | 110076 | 华海转债 | 买入 | 1 | 5624 | 50 | 0.000 | 10 | 10 | 112.469 | 1124.69 |
| ✓ | 14 | 110077 | 洪城转债 | 买入 | 1 | 9774 | 50 | 0.000 | 0 | 0 | 195.652 | 0.00 |
| ✓ | 15 | 110079 | 杭银转债 | 买入 | 1 | 6443 | 50 | 0.000 | 20 | 20 | 128.929 | 2578.58 |

点击篮子名称旁的“设置”按钮进入篮子设置窗口，可在此新增修改删除篮子及成份标的，或从文件导入已编辑好的篮子文件。


篮子设置

篮子列表 导入 导出 所有篮子 当前篮子 当前篮子：lz4 参数 委托金额 0 批量修改

| | 序号 | 篮子名 |
|---|---|---|
| | 1 | lz1 |
| | 2 | lz2 |
| | 3 | lz3 |
| | 4 | lz4 |

| | 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 委托金额 | 资金权重 | 委托数量 | 限定价格 | 操作 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 1 | 600000 | 浦发银行 | 50000 | 2 | 500 | 0 | = ✕ |
| | 2 | 000001 | 平安银行 | 20000 | 1 | 800 | 0 | = ✕ |

新增篮子 删除篮子 添加证券：输入代码/名称 删除证券

从本地文件导入篮子支持两种导入方式：所有篮子和当前篮子。具体导入格式详见上文组合条件单中的篮子导入格式。

- 参数设置区




冰山算法具体参数说明如下：

**执行时间段：**未勾选时为手动模式，需要用户自行控制任务的启动和停止。勾选后为自动模式，到了设定时间后任务将自动切换至运行/暂停状态。

**委托价格+浮动：**发送订单时以指定行情某档位价格为基准，再向上\向下浮动（可选 tick 或%），生成最终的委托价格。

**单笔最小\大数量（手）：**每次发送订单时的委托数量（单位为手）。当两者相等时即为固定委托数量，否则为该范围之内的随机数量。

**冰山报单模式：**全部成交是某笔委托全部成交后发送下一笔；部分成交是上笔委托(如果有)全部成交，且当前一笔委托部分成交数量与委托数量的比率达到参数“单笔部成占比”后，发送下一笔委托。

**单笔部成占比：**配合”部分成交”报单模式使用。

**最小报单间隔：**单任务中两次发送委托之间的最小时间间隔。

**最小撤单间隔：**单任务中委托挂出指定时间后,才会根据实际情况撤单。当根据设置计算出的下单价优于目前委托价格并满足撤单间隔时，才会撤单。

**最大撤单次数：**勾选后，单任务中当撤单次数达到该设置时算法将暂停。如

果不勾选，则撤单次数没有上限控制。

**最大错单次数：**勾选后，单任务中当错单次数达到该设置时算法将暂停。如果不勾选，则错单次数没有上限控制。

- 任务执行区

个股方式创建的任务：一个母任务+一个子任务。

篮子方式创建的任务：一个母任务+若干子任务。

任务执行区上方表格为母任务列表，下方表格为子任务列表。

可通过控制母任务的启动\暂停，批量控制对应子任务的运行\暂停。修改母任务参数，批量覆盖修改对应子任务参数。删除母任务，批量删除对应子任务。

也可对于单个子任务控制开关状态，修改参数以及删除单个子任务。




在任务明细、任务委托、任务成交三个表格中，均可使用母任务号、证券代码对展示内容进行筛选。

### 4.5.5 网格交易

网格是一种交易策略，利用价格的频繁波动获取动态价格区间的收益，抓住每次波峰的卖出机会和波谷的买入机会从而达到减小交易成本的目的。

对于每一个网格交易任务，允许定义初始基准价、上下网格幅度、委托价格

数量类型、基准价变动类型、以及持仓上下限、买卖次数、价格区间等其他限制参数。运行时随着价格的波动，当达到设定的网格幅度后报单，成交后动态生成新基准价格，直到达到停止时间或限制条件为止。

网格交易的核心运行逻辑为：任务启动时初始基准价为行情最新价/自定义价格（遵循参数”初始基准价类型”），并确定观察价为最新价/对手价（遵循参数”观察价类型”）。任务启动后，程序将实时监控观察价。

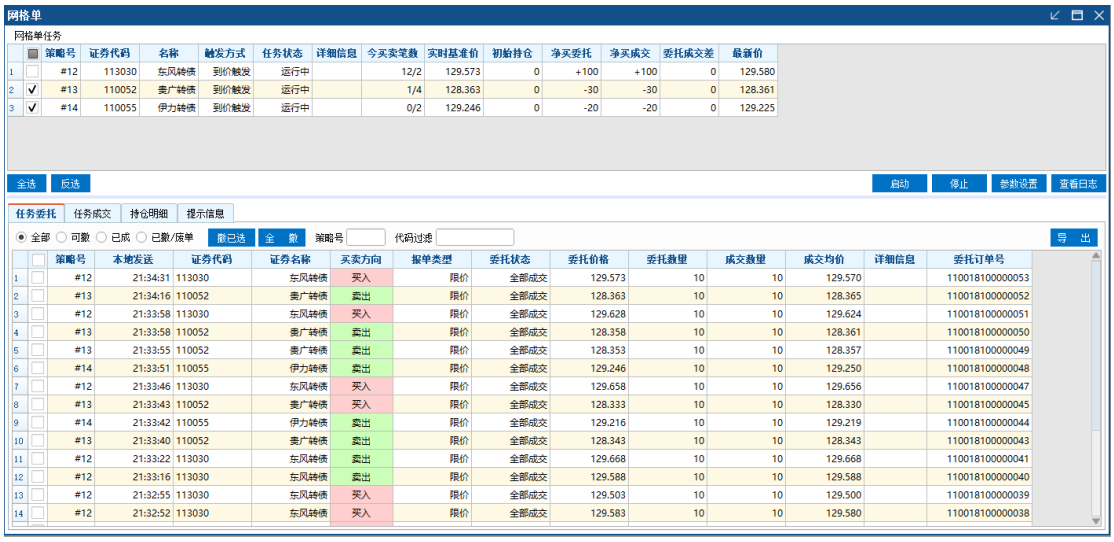
(1)触发卖单：当观察价上涨到大于等于”基准价格+上网格幅度+上网格浮点”，采用”基准价+上网格幅度+上网格浮点-报价优化”作为卖出委托价格发送报单，当该笔卖单成交后，更新基准价=旧基准价+上网格幅度。

(2)触发买单：当观察价下跌到小于等于”基准价格-下网格幅度-下网格浮点”，采用”基准价-下网格幅度-下网格浮点+报价优化”作为买入委托价格发送报单，当该笔买单成交后，更新基准价=旧基准价-下网格幅度。

上述网格幅度、网格浮点计算可设为元\tick\百分比（遵循参数”幅度类型”），报价优化可设为元\tick\百分比（遵循参数”报价优化类型”）。

此外如某时刻跳过 N 个网格，即观察价达到”基准价±N*网格幅度±浮点”，则委托价格为第 N 个网格计算出的价格，委托数量可设为单\多倍网格对应数量（遵循参数”数量类型”），且后续实时基准价更新可设为单\多倍网格对应基准价（遵循参数”基准价更新类型”）。

- 网格交易主界面



上方区域为策略任务，下方为最新的持仓委托成交以及其他信息。

可通过勾选网格单任务，按钮批量启动停止，或者开启参数中的执行时间段后，到时自动启动停止。仅当任务停止时可修改对应参数，启动后继续执行未完成的任务量。当任务被手动或自动停止后，会立即撤销所有未成交的挂单。

执行状态会显示本次策略运行状态、当前实时基准价、最新价、以及今买卖笔数、净委托成交数量等其他统计字段。

- 参数设置

点击主界面的“参数设置”，在弹出的“网格单设置参数”界面中可新增、删除、导入导出策略。以及对每条策略任务的参数设置。点击“保存”按钮后策略参数立即生效，重启软件后自动载入上次设置的策略参数。

具体策略参数解释，请查阅后文中的“网格交易文件字段说明”表。




- 添加删除策略

点击上述界面中的“新增”按钮，输入选择证券。选中高亮某一个任务，点击“删除”，弹出确认删除窗口。点击”清空”，将删除当前所有任务。

© 华鑫证券有限责任公司，2026




- 修改任务参数

策略任务增加后，可对每个网格单任务修改参数。单个策略具有唯一的委托方向。具体策略参数解释，请查阅后文中的“网格交易文件字段说明”表。

- 导入策略

从 csv 格式文本的策略文件导入策略，导入文件会先清空原有任务。csv 文本的第一行可以为标题也可省略。后续每一行代表着某个网格单策略任务参数。

| 网格单任务 csv 文件格式说明 | | |
|---|---|---|
| **字段名** | **示例** | **说明** |
| 算法类型 | GRID_1 | 固定填”GRID_1”（代表网格单以及格式版本号） |
| 策略号 | 1 | 策略唯一序号（需保证唯一不重复且最小为 1 递增） |
| 证券标的 | SH600000 | 市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，北京 BJ）<br>例：SH600000，SZ000001。（暂不支持港股通证券） |
| 开始时间 | 09:30:00 | 格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示<br>例：09:30:00，（注：该时间为电脑本地时间）<br>填写 00:00:00 或留空代表手动控制任务启动停止 |
| 结束时间 | 14:57:00 | 格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示<br>例：14:57:00，（注：该时间为电脑本地时间）<br>填写 00:00:00 或留空代表手动控制任务启动停止 |
| 触发方式 | 0 | 填 0。当前版本只支持”到价触发” |
| 价格类型 | 0 | 0-限价，1-市价。<br>注：其中 1-市价类型代表最优五档成交剩余转撤销 |
| 初 始 基 准 | 0 | 0-行情最新价，1-自定义价格 |

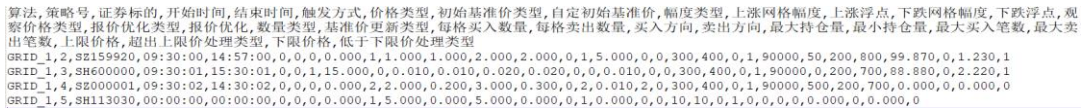
| | | |
|---|---|---|
| 价类型 | | 启动时取行情最新价或自定价作为第一个基准价 |
| 自定初始基准价 | 10.16 | 适用于基准价类型为”自定义价格”时，<br>要求大于 0 的有效价格，否则填 0 或任意值 |
| 幅度类型 | 1 | 计算网格幅度和网格浮点的方式<br>0-价差元，1-价差 tick，2-百分比 |
| 上涨网格幅度 | 3.0 | 配合”幅度类型”计算上涨网格幅度实际价差。<br>上触发价 = 基准价格+上网格幅度+上网格浮点 |
| 上涨网格浮点 | 1.0 | 配合”幅度类型”计算上涨网格幅度实际价差。<br>上触发价 = 基准价格+上网格幅度+上网格浮点 |
| 下跌网格幅度 | 2.0 | 配合”幅度类型”计算下跌网格幅度实际价差。<br>下触发价 = 基准价格-下网格幅度-下网格浮点 |
| 下跌网格浮点 | 1.0 | 配合”幅度类型”计算下跌网格幅度实际价差。<br>下触发价 = 基准价格-下网格幅度-下网格浮点 |
| 观察价格类型 | 0 | 0-对手一档价，1-行情最新价。<br>观察价格用于判断是否达到上\下网格 |
| 报价优化类型 | 1 | 0-价差元，1-价差 tick，2-百分比。<br>仅仅针对限价价格类型有效。<br>最终委托价格 = 计算价经过报价优化调整后的值<br>价差元：最终委托价=委托价±优化值<br>价差 Tick：最终委托价=委托价±优化值*最小变动价格（根据证券类型，可能 0.01 或 0.001）<br>百分比：最终委托价 = 委托价*（1 ± 优化值 / 100） |
| 报价优化 | 5 | 配合”报价优化类型”使用，修正最终委托价格，<br>要求该值大于等于 0（整数或小数），0 为不调整<br>当方向为买入，委托价向上调整<br>当方向为卖出，委托价向下调整 |
| 数量类型 | 0 | 0-单网格数量，1-多网格数量，2-多网格数量拆单<br>配合”买入\卖出网格数量”使用，确定委托数量 |

© 华鑫证券有限责任公司，2026

| | | |
|---|---|---|
| | | 当跳过一个网格触发时，3 种类型完全相同<br>当跳过 N 个网格触发时，参数含义如下<br>0-单网格数量，发一笔委托数量=单网格数量<br>1-多网格数量，发一笔委托数量=单网格数量*N<br>2-多网格数量拆单，发 N 笔委托数量=单网格数量 |
| 基准价更新类型 | 0 | 0-多倍网格价，1-单倍网格价<br>成交后更新基准价的方式<br>当跳过一个网格触发时，2 种类型完全相同<br>当跳过 N 个网格触发时，参数含义如下<br>0-多倍网格价，新基准价=旧基准价± N*单网格幅度<br>1-单倍网格价，新基准价=旧基准价± 单网格幅度 |
| 每格买入数量 | 500 | 一个下跌网格对应的数量<br>要求该值大于 0，且符合交易所规则 |
| 每格卖出数量 | 500 | 一个上涨网格对应的数量<br>要求该值大于 0，且符合交易所规则 |
| 买入方向 | 0 | 0-买入，i-融资买入（仅信用账号） |
| 卖出方向 | 1 | 1-卖出，j-融券卖出（仅信用账号） |
| 最大持仓 | 500000 | 要求该值大于等于 0，填 0 代表无该限制 |
| 最小持仓 | 300000 | 要求该值大于等于 0，填 0 代表无该限制 |
| 最大买入笔数 | 20 | 要求该值大于等于 0，填 0 代表无该限制 |
| 最大卖出笔数 | 30 | 要求该值大于等于 0，填 0 代表无该限制 |
| 区间上限价格 | 13.32 | 要求大于等于 0 的有效价格，填 0 代表无该限制 |
| 超上限价处理类型 | 0 | 0-立即暂停，1-继续运行但不触发卖出委托 |
| 区间下限 | 9.58 | 要求大于等于 0 的有效价格，填 0 代表无该限制 |

© 华鑫证券有限责任公司，2026

| | | |
|---|---|---|
| 价格 | | |
| 超下限价处理类型 | 0 | 0-立即暂停，1-继续运行但不触发买入委托 |




导入网格交易任务文件格式（第一行为标题或省略）：

算法,策略号,证券标的,开始时间,结束时间,触发方式,价格类型,初始基准价类型,自定初始基准价,幅度类型,上涨网格幅度,上涨浮点,下跌网格幅度,下跌浮点,观察价格类型,报价优化类型,报价优化,数量类型,基准价更新类型,每格买入数量,每格卖出数量,买入方向,卖出方向,最大持仓量,最小持仓量,最大买入笔数,最大卖出笔数,上限价格,超出上限价处理类型,下限价格,低于下限价处理类型

GRID_1,2,SZ159920,09:30:00,14:57:00,0,0,0,0.000,1,1.000,1.000,2.000,2.000,0,1,5.000,0,0,300,400,0,1,90000,50,200,800,99.870,0,1.230,1

GRID_1,3,SH600000,09:30:01,14:30:01,0,0,1,15.000,0,0.010,0.010,0.020,0.020,0,0,0.010,0,0,300,400,0,1,90000,0,200,700,88.880,0,2.220,1

GRID_1,4,SZ000001,09:30:02,14:30:02,0,0,0,0.000,2,2.000,0.200,3.000,0.300,0,2,0.010,2,0,300,400,0,1,90000,500,200,700,0.000,0,0.000,0

- 导出文件

点击“导出策略”，可把网格单任务 csv 文件保存至本地目录。

- 启动/停止策略

主界面勾选多个网格交易任务后，点击“启动”\“停止”按钮，批量启动\停止策略任务。启动策略前务必确认各股票的策略参数是否设置正确。

### 4.5.6 定时交易

定时交易为用户提供了预设时间和报单参数设置，从而实现本地时间到达设定时间后自动发送报单的智能交易功能。




- 定时单输入区

输入设定时间和报单参数，创建定时委托的单个任务。

两融支持切换：担保品买/融资买，担保品卖/融券卖。

支持的价格类型如下：最新价、涨停价、跌停价、卖一~卖五价、买一~买五价、价格笼子上下限、市价（最优五档剩余撤单）、自定义限价、盘后（今收盘价）、盘后（自定义价）。

支持的价格优化：Ticks 和百分比浮动调整。

涨跌停限制：支持勾选涨停不卖和跌停不买选项。

当卖出方向且已勾选涨停不卖，定时任务触发时要求行情中的买一价(优先)或最新价(其次)，两者至少一个有效且与涨停价相等，否则该任务立即被拒绝。

当买入方向且已勾选跌停不买，定时任务触发时要求行情中的卖一价(优先)或最新价(其次)，两者至少一个有效且与跌停价相等，否则该任务立即被拒绝。

盘后(今收盘价)，定时任务触发时要求在 15:00 闭市之后，否则今收盘价获取失败导致任务被拒绝。

© 华鑫证券有限责任公司，2026




- 母任务监控区

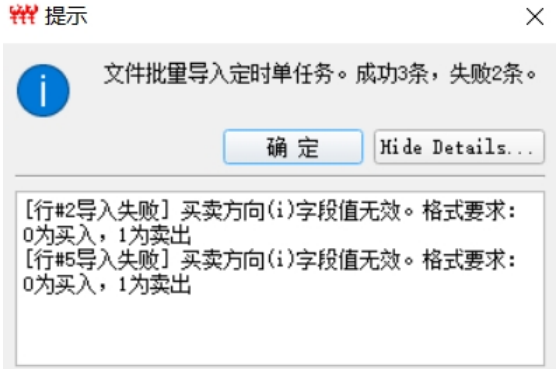



| | | 母任务号 | 母任务名称 | 买卖方向 | 设定时间 | 母任务状态 | 触发状态 | 创建时间 | 操作 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | | #1 | 110044_广电转债 | 买入 | 09:30:00 | 全部触发 | 全部触发(1/1) | 15:24:16 | 删除 |
| 2 | | #2 | 159512_汽车ETF | 买入 | 09:30:00 | 全部触发 | 全部触发(1/1) | 15:24:34 | 删除 |
| 3 | | #3 | 600000_浦发银行 | 买入 | 09:30:00 | 全部触发 | 全部触发(1/1) | 15:24:44 | 删除 |
| 4 | | #4 | 000001_平安银行 | 卖出 | 09:30:00 | 全部触发 | 全部触发(1/1) | 15:24:48 | 删除 |
| 5 | | #5 | 300001_特锐德 | 卖出 | 09:30:00 | 全部触发 | 全部触发(1/1) | 15:24:53 | 删除 |
| 6 | | #6 | 688001_华兴源创 | 卖出 | 09:30:00 | 全部触发 | 全部触发(1/1) | 15:24:59 | 删除 |
| 7 | | #7 | 127043_川恒转债 | 卖出 | 09:30:00 | 全部触发 | 全部触发(1/1) | 15:25:08 | 删除 |

从上述定时单输入区可以手动创建一个仅包含一个子任务的母任务。

另外也支持从 csv 文件中批量导入。点击表格上方的“导入”按钮，选择本地文件，导入成功后将创建一个包含若干子任务的母任务。母任务的名称默认为导入文件名，文件中识别成功的每一行将成为该母任务中的子任务参数。

文件导入过程中，如果存在某些参数行格式有误，将在导入后弹窗提示用户导入失败的数量，并在下方明细信息中展示对应的行数以及格式错误原因。



具体文件内容格式如下（注：第一行为字段解释，可填可不填）：

类型标识,证券标的,买卖方向,设定开始时间,设定结束时间,价格类型,指定价格,报价优化方式,报价优化值,委托数量,涨停不卖,跌停不买

SCHED, SH600000, 0, 09:30:00, 0, 0, 7.02, 0, -1, 200, 1, 1

SCHED, SH600000, 1, 10:00:00, 0, 3, 0, 0, 0, 300, 1, 1

SCHED, SH510050, 0, 15:05:10, 0, 18, 0, 0, 0, 100, 0, 0

SCHED, SZ000001, 0, 13:30:00, 0, 16, 0, 0, 0, 200, 0, 1

SCHED, SZ000001, 1, 13:30:00, 0, 17, 0, 0, -1, 400, 1, 0

SCHED, BJ430047, 0, 14:30:00, 0, 12, 16.33, 0, 0, 300, 1, 1

| 定时单导入文件的格式说明 | |
|---|---|
| **字段名** | **说明** |
| 类型标识 | 固定填写”SCHED” |
| 证券标的 | 市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，北京 BJ）<br>例：SH600000，SZ000001，BJ920001 |
| 买卖方向 | 0-买入, 1-卖出, i-融资买入, j-融券卖出 |
| 设定开始时间 | 格式：hh:mm:ss，即 时:分:秒，时分秒各两位表示<br>例：14:57:00，（注：该时间为电脑本地时间） |
| 设定结束时间 | 保留字段，暂时无用，填写 0。 |
| 价格类型 | 报单的价格类型：<br>0-最新价, 1-卖一, 2-买一, 3-市价(最优五档成交剩余转撤销), 4-卖二, 5-买二, 6-卖三, 7-买三, 8-卖四, 9-买四, 10-卖五, 11-买五, 12-自定义限价, 14-涨停价, 15-跌停价, 16-价格笼子买入上限, 17-价格笼子卖出下限, 18-盘后(今收盘价), 19-盘后(自定义价) |
| 指定价格 | 用户自定义的委托价格<br>价格类型为 12-自定义限价时，需填入自定义委托价格。<br>价格类型为 19-盘后(自定义价)时，需填入自定义委托价格。<br>价格类型为 3-市价时，该委托价格为保护限价。 |

| | |
|---|---|
| | 填值大于 0 的有效价格，则以此为保护限价。<br>填 0，则买入时用涨停价，卖出时用跌停价作为保护限价。<br>价格类型为其他时该字段无用，填 0 即可。<br>例：<br>价格类型限价时，填 113.92<br>价格类型市价时，填 5.49（有效的保护限价）<br>价格类型市价且为买入方向，填 0（涨停价作为保护限价）<br>价格类型市价且为卖出方向，填 0（跌停价作为保护限价） |
| 报价优化方式 | 0-tick , 1-百分比<br>当价格类型为市价/自定义限价/盘后(今收盘价)/盘后(自定义价)，该字段无用，不会优化价格。<br>最终委托价格 = 基准价经过报价优化调整后的值<br>优化方式可选择最小变动价格 tick 或百分比<br>Tick 值：最终委托价格 = 基准价 + 报价优化*最小价格单位<br>百分比：最终委托价格 = 基准价 * （1 + 优化百分比） |
| 报价优化值 | 当优化方式为 0-tick 时：<br>整形数据，可设置正负，表示±N 个最小变动价格<br>例：-2（如果股票，优化值为 -0.02 元，即基准价下调 0.02 元）<br>当优化方式为 1-百分比时：<br>浮点型，可设置正负，表示±N%<br>例：0.5（报价优化为 0.5%，即基准价向上调整 0.5%） |
| 委托数量 | 委托数量。单位：股/份/张 |
| 涨停不卖 | 0-不限制, 1-涨停时不发卖单 |
| 跌停不买 | 0-不限制, 1-跌停时不发买单 |

- 子任务明细表

  监控母任务中所包含所有子任务的详细参数信息及运行状态。

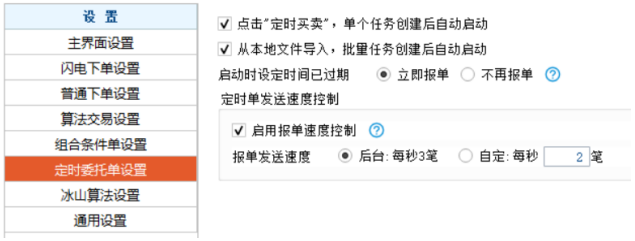



| | 母任务号 | 证券代码 | 证券名称 | 买卖方向 | 设定时间 | 子任务状态 | 触发状态 | 目标数量 | 报单数量 | 成交数量 | 触发时间 | 详细错误信息 | 报单参数 | 操作 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 8 | #2 | 430047 | 诺思兰德 | 买入 | 14:00:00 | 已完成 | 已触发(全成交) | 300 | 300 | 300 | 14:13:51 | | 点击查看 | 修改 |
| 9 | #3 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 09:30:00 | 已触发 | 已触发(失败) | 200 | 0 | 0 | 14:11:02 | 启动时(14:11:02)，设... | 点击查看 | 修改 |
| 10 | #3 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 10:00:00 | 已触发 | 已触发(失败) | 300 | 0 | 0 | 14:11:02 | 启动时(14:11:02)，设... | 点击查看 | 修改 |
| 11 | #3 | 000001 | 平安银行 | 卖出 | 14:30:00 | 运行中 | 未触发 | 200 | 0 | 0 | - | | 点击查看 | 修改 |
| 12 | #3 | 000001 | 平安银行 | 卖出 | 14:30:00 | 运行中 | 未触发 | 400 | 0 | 0 | - | | 点击查看 | 修改 |
| 13 | #3 | 430047 | 诺思兰德 | 卖出 | 14:30:00 | 运行中 | 未触发 | 300 | 0 | 0 | - | | 点击查看 | 修改 |
| 14 | #4 | 600000 | 浦发银行 | 买入 | 14:12:00 | 已完成 | 已触发(全成交) | 100 | 100 | 100 | 14:12:00 | | 点击查看 | 修改 |
| 15 | #5 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 14:15:30 | 已完成 | 已触发(全成交) | 100 | 100 | 100 | 14:15:30 | | 点击查看 | 修改 |
| 16 | #7 | 600000 | 浦发银行 | 买入 | 09:30:00 | 已触发 | 已触发(失败) | 200 | 0 | 0 | 14:17:32 | 启动时(14:17:32)，设... | 点击查看 | 修改 |
| 17 | #7 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 10:00:00 | 已触发 | 已触发(失败) | 300 | 0 | 0 | 14:17:32 | 启动时(14:17:32)，设... | 点击查看 | 修改 |
| 18 | #7 | 000001 | 平安银行 | 买入 | 15:30:00 | 运行中 | 未触发 | 200 | 0 | 0 | - | | 点击查看 | 修改 |
| 19 | #7 | 000001 | 平安银行 | 卖出 | 15:29:00 | 运行中 | 未触发 | 400 | 0 | 0 | - | | 点击查看 | 修改 |
| 20 | #7 | 430047 | 诺思兰德 | 买入 | 14:18:00 | 已完成 | 已触发(全成交) | 300 | 300 | 300 | 14:18:00 | | 点击查看 | 修改 |
| 21 | #8 | 000510 | 新金路 | 卖出 | 14:20:00 | 已触发 | 已触发(废单) | 300 | 0 | 0 | 14:20:00 | 被柜台拒绝 | 点击查看 | 修改 |
| 22 | #9 | 300750 | 宁德时代 | 卖出 | 14:30:00 | 运行中 | 未触发 | 100 | 0 | 0 | - | | 点击查看 | 修改 |

对于尚未成功触发的子任务，用户可以点击表格最右操作列的”修改”按钮，在弹窗中对单个子任务的参数进行修改，确认后新参数立即生效。




- 设置




点击右上角”设置”按钮打开定时单的设置 tab 页面。

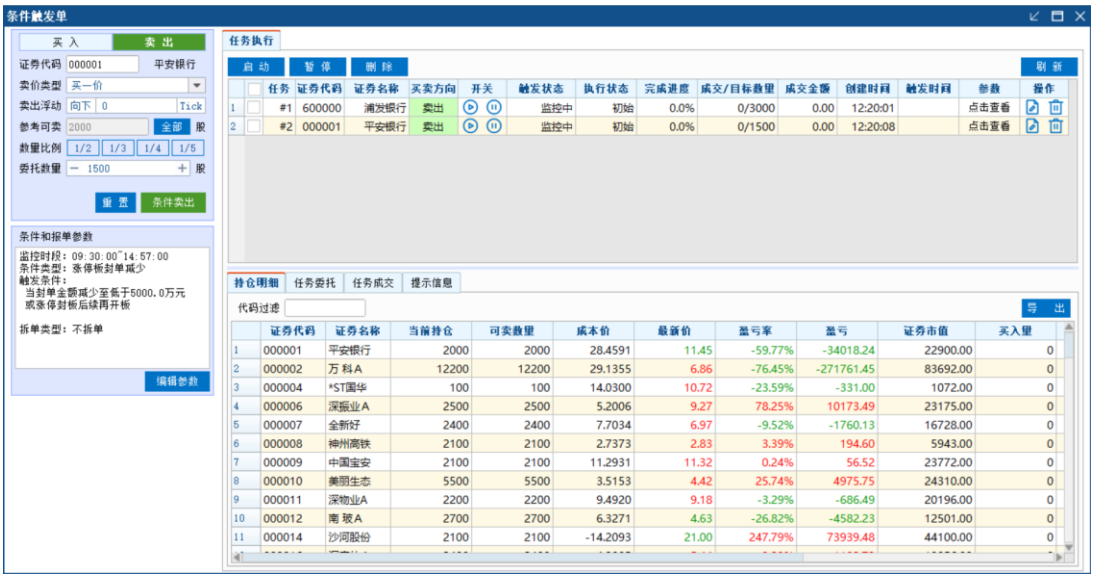
发送速度控制功能：定时单任务触发后本程序是否控制报单发送流速。

该功能未启用时，当定时任务触发后立即发送报单，如果任务较多使得报单速度（每秒 x 笔）超过后台最大流控值，导致本地报单失败。该功能启用时，当定时任务触发后由本程序控制发送速度从而避免报单失败，实际报单时间会滞后于触发时间。此外用户也可设置自定义报单速度，要求不大于后台流控值每秒 n 笔（n 为后台返回的参数值）。

© 华鑫证券有限责任公司，2026

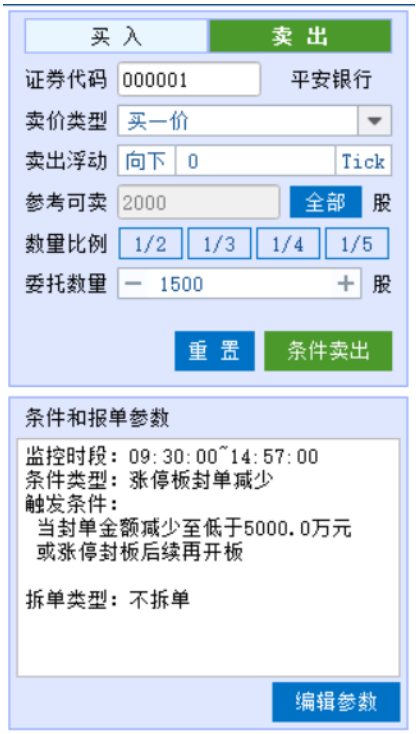
### 4.5.7 条件触发单

条件单为用户提供了自动行情监控和报单的智能交易功能。




- 任务创建区

  修改指定个股，编辑条件参数以及执行参数即可创建条件单任务。



- 参数设置区

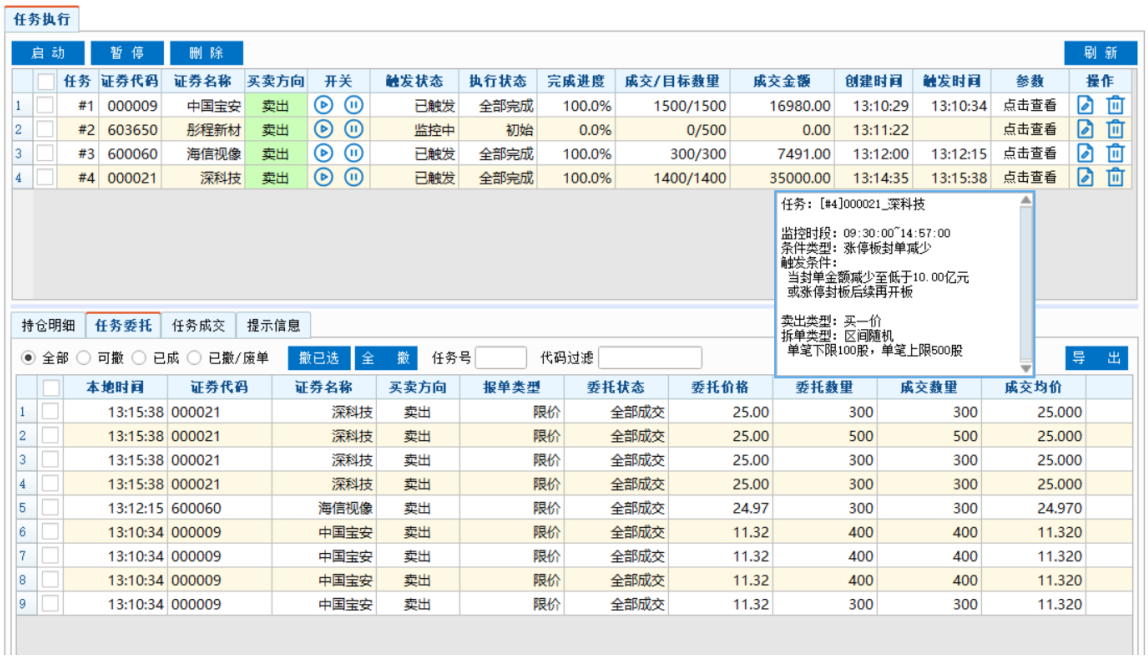
条件类型涨停板封单减少：封单数量或封单金额二选一，在行情监控时段内当该值小于设定参数值，或者开板后触发自动报单。

拆单类型：支持不拆单、最大数量扣减、固定数量、递减数量、区间随机。



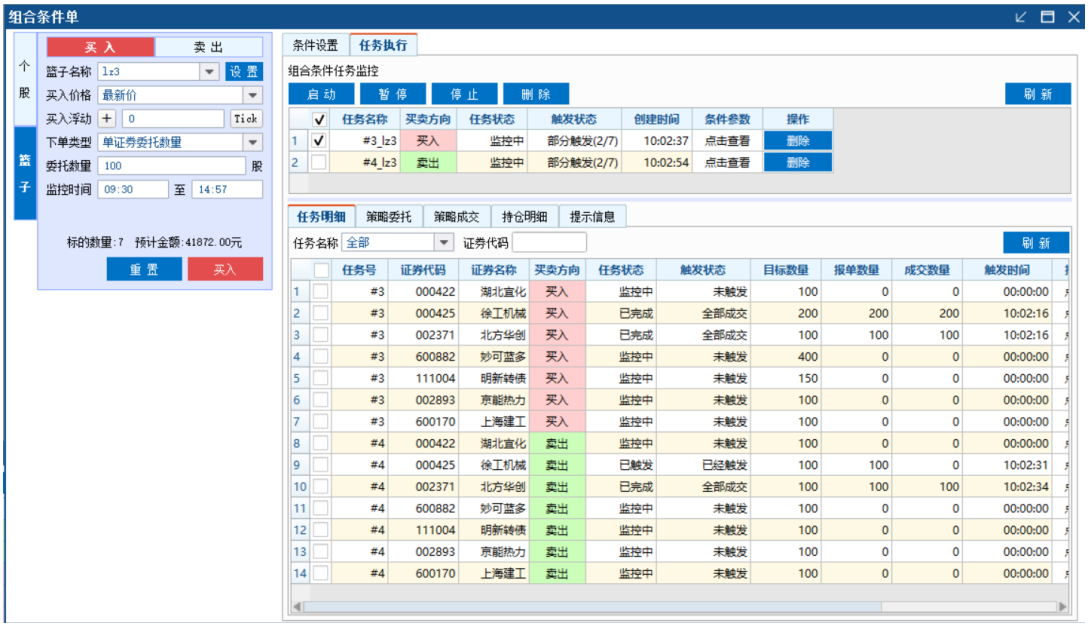

- 任务执行区

监控所有任务的触发和执行状态。上方表格展示的是条件单任务，”点击查看”弹出当前行任务的参数明细。在触发之前可点击最后一列”操作列”中图标按钮，重新修改该任务的触发参数和拆单参数。下方表格展示的是所有属于条件单的委托和成交记录。




### 4.5.8 组合条件单

组合条件单为用户提供了自定义若干条件的组合，从而实现自动行情监控和报单的智能交易功能。




- 报单输入区

支持分别以个股和篮子为单位，创建组合条件单任务。篮子中各成分股的可选分配类型如下：

篮子资金权重：报单区域输入的委托总金额，按照权重分配。

篮子委托金额：每支成份股按设定委托金额算出委托数量*篮子份数。

篮子委托数量：每支成分股按设定委托数量*篮子份数。

篮子数量比例：每支成分股按设定委托数量*数量比例。

单证券委托金额：每支成份股按输入的委托金额算出委托数量。

单证券委托数量：每支成份股按输入的委托数量。

持仓比例：每支成分股按当前持仓数量*持仓比例。

可用数量比例：每支成分股按可用持仓数量*持仓比例。




点击篮子名称旁的“设置”按钮进入篮子设置窗口，可直接从界面新增修改删除篮子及成份标的，或从文件导入已编辑好的篮子文件。




从本地文件导入篮子支持两种导入方式：所有篮子和当前篮子。

方式一（导入所有篮子）：

只操作一次即可导入所有篮子，本地文件中记录所有篮子及成份股信息，具体文件内容格式如下：

（注：第一行为字段解释，必填，解析时会跳过第一行内容）

篮子序号,篮子名称,证券代码,委托金额,委托数量,资金权重,限定价格

1,lz1,SZ300033,100000,3300,1,0

1,lz1,SZ300015,300000,500,1,0

2,lz2,SH512010,400000,14000,4,0

3,lz3,SZ000422,100000,100,1,0

3,lz3,SZ000425,80000,400,2,0

方式二（导入当前篮子的成份股）：

需要先在界面中新增或选中某一个篮子再导入，一次操作更新一个篮子的成分股明细。本地文件中记录某一个篮子的成份股信息，文件格式如下：

（注：第一行为字段解释，必填，解析时会跳过第一行内容）

证券代码,委托金额,委托数量,资金权重,限定价格

SH600000,50000,500,2,0

SZ000001,20000,800,1,0

© 华鑫证券有限责任公司，2026

| 导入篮子文件的格式说明 | |
|---|---|
| **字段名** | **说明** |
| 篮子序号 | （仅导入方式一）篮子唯一的序号（从 1 递增） |
| 篮子名称 | （仅导入方式一）与序号对应的篮子名称<br>同一序号的篮子，必须是相同的篮子名称 |
| 证券代码 | 市场+证券代码（上海 SH，深圳 SZ，北京 BJ）<br>例：SH600000，SZ000001，BJ837663 |
| 委托金额 | 预设委托金额。单位：元 |
| 委托数量 | 预设委托数量。单位：股/份/张 |
| 资金权重 | 预设资金权重。 |
| 限定价格 | 限定价格，可填 0 代表无限制。 |

- 条件设置区

支持以下三种类型的条件。

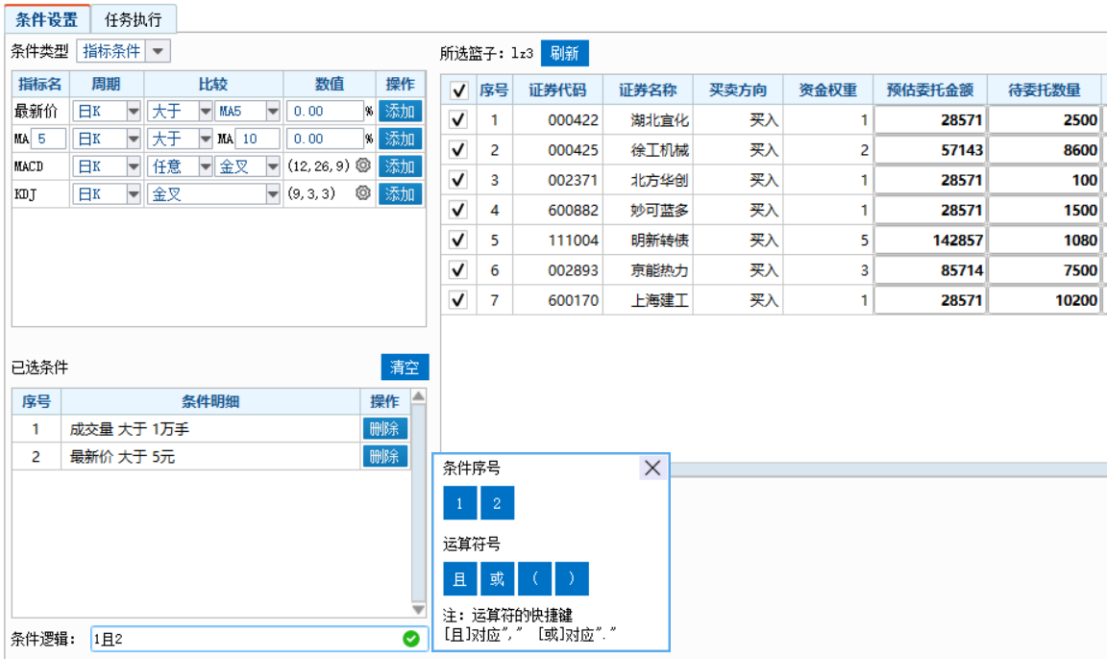
实时条件：包括盘口档位价、最新价均价、涨跌幅、成交量、成交金额、振幅、换手率、量比。

指标条件：包括最新价与 MA、自定义 MA、MACD、KDJ 金叉死叉。支持周期为 1 分钟、5 分钟、60 分钟、日线、周线、月线。支持日线及以下周期的前复权和后复权。支持自定义修改 MACD 和 KDJ 的三个参数。

价格条件：最新价大于、小于、反弹（下破后上穿）、回落（上穿后下破）。

用户可通过下方的条件逻辑表达式，合成自定义的组合条件。表达式中支持“且”,“或”逻辑。且、或两者之间具有相同的优先级。“(”和“)”括号能提升内部表达式的优先级。

© 华鑫证券有限责任公司，2026

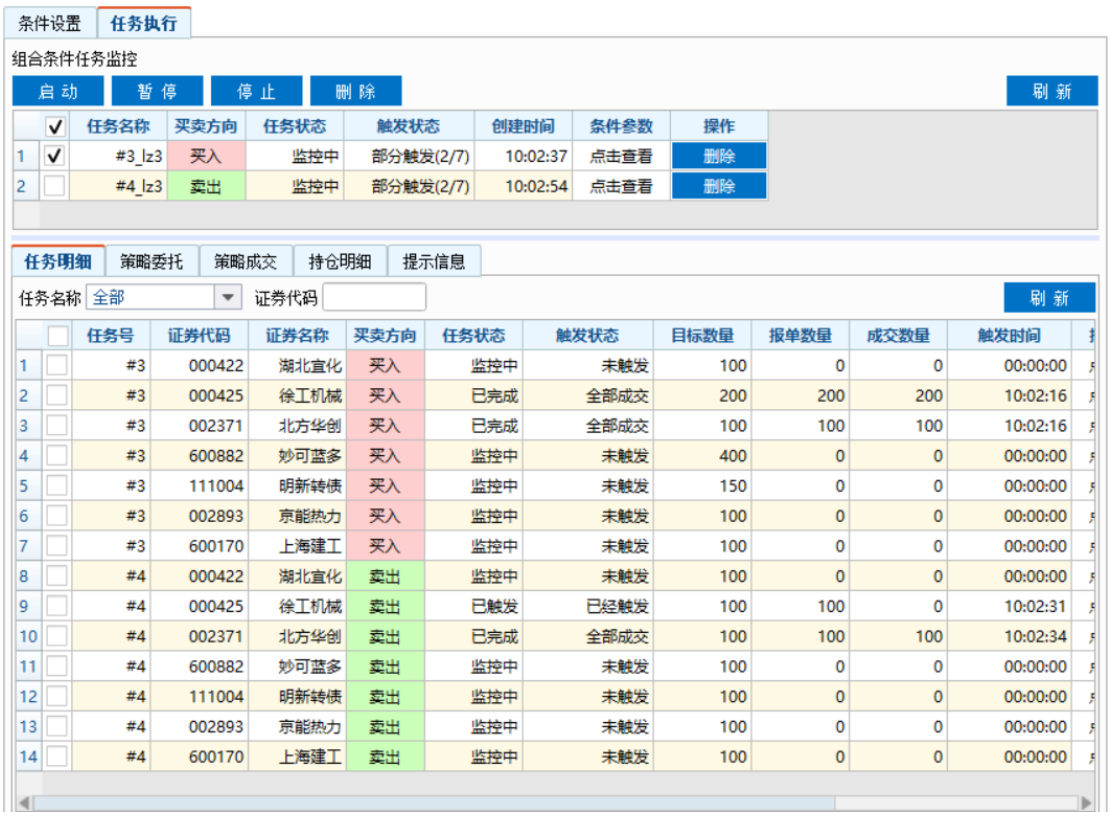






- 任务执行区

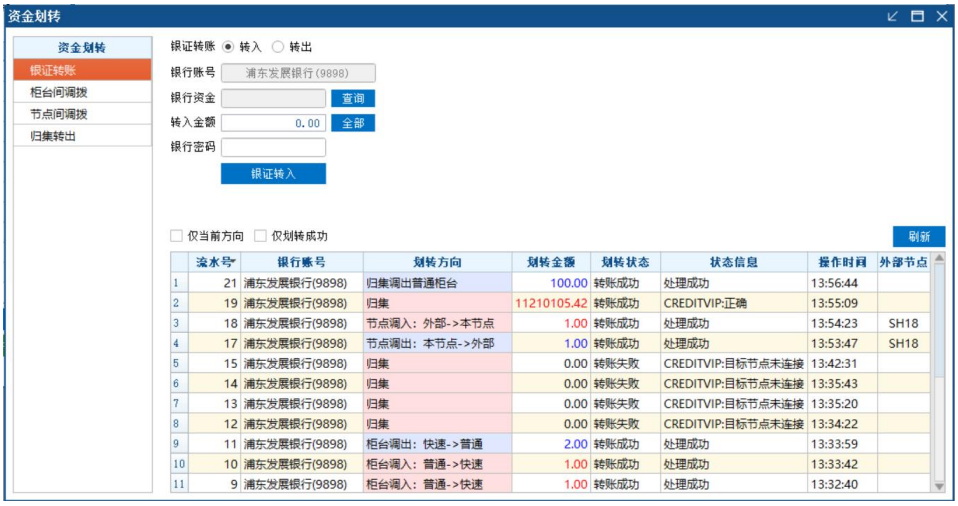
  监控所有任务的执行状态以及触发状态。


条件设置
任务执行
组合条件任务监控
启 动
暂 停
停 止
删 除
刷 新
任务名称 买卖方向 任务状态 触发状态 创建时间 条件参数 操作
1 #3_lz3 买入 监控中 部分触发(2/7) 10:02:37 点击查看 删除
2 #4_lz3 卖出 监控中 部分触发(2/7) 10:02:54 点击查看 删除
任务明细
策略委托
策略成交
持仓明细
提示信息
任务名称 全部
证券代码
刷 新
任务号 证券代码 证券名称 买卖方向 任务状态 触发状态 目标数量 报单数量 成交数量 触发时间
1 #3 000422 湖北宜化 买入 监控中 未触发 100 0 0 00:00:00
2 #3 000425 徐工机械 买入 已完成 全部成交 200 200 200 10:02:16
3 #3 002371 北方华创 买入 已完成 全部成交 100 100 100 10:02:16
4 #3 600882 妙可蓝多 买入 监控中 未触发 400 0 0 00:00:00
5 #3 111004 明新转债 买入 监控中 未触发 150 0 0 00:00:00
6 #3 002893 京能热力 买入 监控中 未触发 100 0 0 00:00:00
7 #3 600170 上海建工 买入 监控中 未触发 100 0 0 00:00:00
8 #4 000422 湖北宜化 卖出 监控中 未触发 100 0 0 00:00:00
9 #4 000425 徐工机械 卖出 已触发 已经触发 100 100 0 10:02:31
10 #4 002371 北方华创 卖出 已完成 全部成交 100 100 100 10:02:34
11 #4 600882 妙可蓝多 卖出 监控中 未触发 100 0 0 00:00:00
12 #4 111004 明新转债 卖出 监控中 未触发 100 0 0 00:00:00
13 #4 002893 京能热力 卖出 监控中 未触发 100 0 0 00:00:00
14 #4 600170 上海建工 卖出 监控中 未触发 100 0 0 00:00:00

## 4.6 菜单-综合


综合
查询
资金转账
密码修改
新股新债
ETF申赎
基金申赎

### 4.6.1 资金划转




| | 流水号 | 银行账号 | 划转方向 | 划转金额 | 划转状态 | 状态信息 | 操作时间 | 外部节点 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 21 | 浦东发展银行(9898) | 归集调出普通柜台 | 100.00 | 转账成功 | 处理成功 | 13:56:44 | |
| 2 | 19 | 浦东发展银行(9898) | 归集 | 11210105.42 | 转账成功 | CREDITVIP:正确 | 13:55:09 | |
| 3 | 18 | 浦东发展银行(9898) | 节点调入：外部->本节点 | 1.00 | 转账成功 | 处理成功 | 13:54:23 | SH18 |
| 4 | 17 | 浦东发展银行(9898) | 节点调出：本节点->外部 | 1.00 | 转账成功 | 处理成功 | 13:53:47 | SH18 |
| 5 | 15 | 浦东发展银行(9898) | 归集 | 0.00 | 转账失败 | CREDITVIP:目标节点未连接 | 13:42:31 | |
| 6 | 14 | 浦东发展银行(9898) | 归集 | 0.00 | 转账失败 | CREDITVIP:目标节点未连接 | 13:35:43 | |
| 7 | 13 | 浦东发展银行(9898) | 归集 | 0.00 | 转账失败 | CREDITVIP:目标节点未连接 | 13:35:20 | |
| 8 | 12 | 浦东发展银行(9898) | 归集 | 0.00 | 转账失败 | CREDITVIP:目标节点未连接 | 13:34:22 | |
| 9 | 11 | 浦东发展银行(9898) | 柜台调出：快速->普通 | 2.00 | 转账成功 | 处理成功 | 13:33:59 | |
| 10 | 10 | 浦东发展银行(9898) | 柜台调入：普通->快速 | 1.00 | 转账成功 | 处理成功 | 13:33:42 | |
| 11 | 9 | 浦东发展银行(9898) | 柜台调入：普通->快速 | 1.00 | 转账成功 | 处理成功 | 13:32:40 | |

在菜单栏综合项中有银证转账，柜台间调拨，节点间调拨，归集转出（仅限两融）。点击任意一项打开资金划转窗口且切换到对应 tab 功能页。

当前版本剑鱼星软件仅支持奇点客户使用，所连后台为奇点快速柜台，奇点支持同一客户号多个节点。此外还存在普通柜台（顶点集中交易柜台），某些场景下资金可能留在普通柜台。

银证转账：奇点和银行之间的资金转账。

柜台间调拨：奇点快速柜台和普通柜台之间的内部资金调拨。

节点间调拨：奇点当前节点和奇点另一节点之间的内部资金调拨。

归集转出（仅限两融）：奇点多节点客户，把资金从所有节点归集到当前节点后再统一转出至银行或调出至普通柜台。

当前版本中归集转出的规则（后续可能调整）：只有一个节点有归集权限，当日只允许归集一次且在 15:30:00 之后，第一次归集后展示的归集资金就是最大可转出金额，归集到当前节点成功后所有资金变为冻结状态，后续无法重复归集但仍可转出已归集资金。

© 华鑫证券有限责任公司，2026

### 4.6.2 密码修改




输入原交易密码和新密码后，点击“确定”即可完成修改。

### 4.6.3 申购赎回




支持新股新债申购、配号中签号查询、ETF 基金申赎、要约收购业务。

## 4.7 菜单-查询



### 4.7.1 信用查询（两融）

信用查询包括信用资产明细、负债记录、标的证券、两融利率费率等子页面。

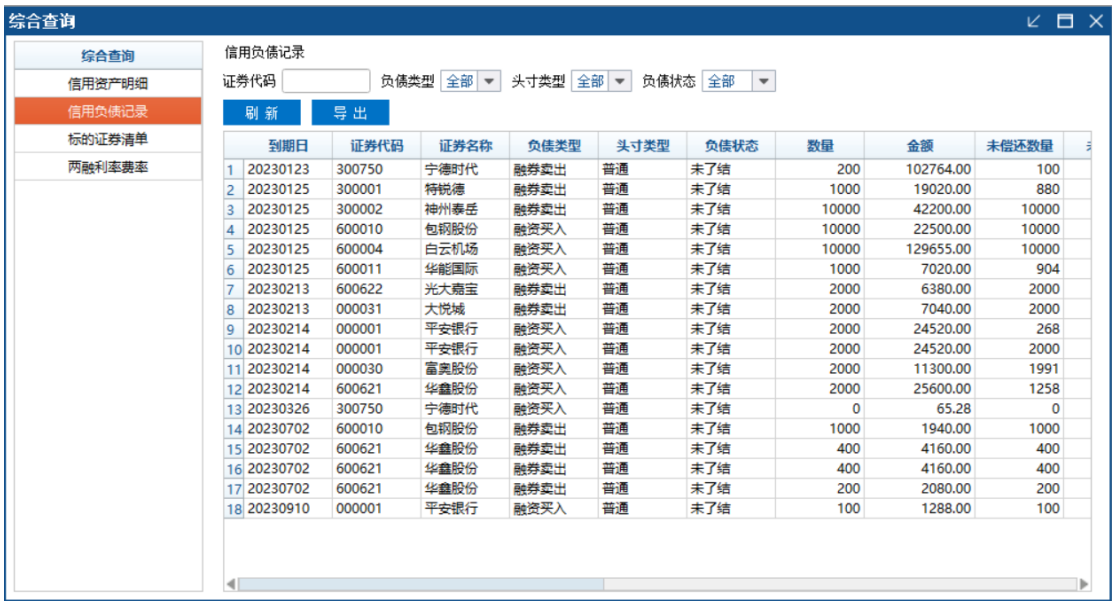
#### 4.7.1.1 信用资产明细




| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 维持担保比例 | 25208.84% | 融资额度上限 | 5000000.00 | 融券额度上限 | 6000000.00 |
| 可用资金 | 96221310.97 | 融资负债 | 215072.90 | 融券卖出金额 | 136079.60 |
| 可用保证金 | 97292105.99 | 融资未成交金额 | 0.00 | 融券金额可用 | 128162.24 |
| 套餐类型 | 标准套餐 | 融资冻结保证金 | 0.00 | 融券负债市值 | 164605.40 |
| 剩余流动性额度 | 99817078.17 | 融资占用保证金 | 189264.15 | 融券未成交负债 | 0.00 |
| 上日结存 | 96221310.97 | 融资利息 | 10527.92 | 融券冻结保证金 | 0.00 |
| 当日入金总额 | 0.00 | 融资盈亏未折算 | 19769.14 | 融券占用保证金 | 98763.24 |
| 当日出金总额 | 0.00 | 融资盈亏折算后 | 11925.78 | 融券费用 | 8622.03 |
| 证券市值 | 4190518.39 | | | 融券盈亏未折算 | -28525.80 |
| 担保品市值 | 3955741.63 | | | 融券盈亏折算后 | -34218.52 |
| 总资产 | 100539991.60 | | | | |
| 总负债 | 398828.25 | | | | |
| 总利息/费用 | 19149.95 | | | | |
| 净资产 | 100141163.36 | | | | |

资产明细页面显示了账户的两融详细信息。

#### 4.7.1.2 信用负债记录




| | 到期日 | 证券代码 | 证券名称 | 负债类型 | 头寸类型 | 负债状态 | 数量 | 金额 | 未偿还数量 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 20230123 | 300750 | 宁德时代 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 200 | 102764.00 | 100 |
| 2 | 20230125 | 300001 | 特锐德 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 1000 | 19020.00 | 880 |
| 3 | 20230125 | 300002 | 神州泰岳 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 10000 | 42200.00 | 10000 |
| 4 | 20230125 | 600010 | 包钢股份 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 10000 | 22500.00 | 10000 |
| 5 | 20230125 | 600004 | 白云机场 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 10000 | 129655.00 | 10000 |
| 6 | 20230125 | 600011 | 华能国际 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 1000 | 7020.00 | 904 |
| 7 | 20230213 | 600622 | 光大嘉宝 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 2000 | 6380.00 | 2000 |
| 8 | 20230213 | 000031 | 大悦城 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 2000 | 7040.00 | 2000 |
| 9 | 20230214 | 000001 | 平安银行 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 2000 | 24520.00 | 268 |
| 10 | 20230214 | 000001 | 平安银行 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 2000 | 24520.00 | 2000 |
| 11 | 20230214 | 000030 | 富奥股份 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 2000 | 11300.00 | 1991 |
| 12 | 20230214 | 600621 | 华鑫股份 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 2000 | 25600.00 | 1258 |
| 13 | 20230326 | 300750 | 宁德时代 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 0 | 65.28 | 0 |
| 14 | 20230702 | 600010 | 包钢股份 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 1000 | 1940.00 | 1000 |
| 15 | 20230702 | 600621 | 华鑫股份 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 400 | 4160.00 | 400 |
| 16 | 20230702 | 600621 | 华鑫股份 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 400 | 4160.00 | 400 |
| 17 | 20230702 | 600621 | 华鑫股份 | 融券卖出 | 普通 | 未了结 | 200 | 2080.00 | 200 |
| 18 | 20230910 | 000001 | 平安银行 | 融资买入 | 普通 | 未了结 | 100 | 1288.00 | 100 |

© 华鑫证券有限责任公司，2026

信用负债页面中显示了账户所有未了结及当日已了结的负债记录，包括了总负债数量金额，剩余未偿还，息费交易费用等信息。

#### 4.7.1.3 标的证券查询




| | 证券代码 | 证券名称 | 交易所 | 担保品 | 融资标的 | 融券标的 | 折算率 | 融资保证金率 | 融券保证金率 | 白名单 | 最大展期数 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000001 | 平安银行 | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.70 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 2 | 000002 | 万 科A | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.68 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 3 | 000004 | ST国华 | 深圳 | 否 | 否 | 否 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 4 | 000005 | ST星源 | 深圳 | 否 | 否 | 否 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 5 | 000006 | 深振业A | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.52 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 6 | 000007 | 全新好 | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.46 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 7 | 000008 | 神州高铁 | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.00 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 8 | 000009 | 中国宝安 | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.63 | 1.00 | 0.70 | 否 | 不支持 |
| 9 | 000010 | 美丽生态 | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.47 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 10 | 000011 | 深物业A | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.57 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 11 | 000012 | 南 玻A | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.59 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 12 | 000014 | 沙河股份 | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.54 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 13 | 000016 | 深康佳A | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.51 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 14 | 000017 | 深中华A | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 15 | 000019 | 深粮控股 | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.57 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 16 | 000020 | 深华发A | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 17 | 000021 | 深科技 | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.65 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 18 | 000023 | 深天地A | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 19 | 000025 | 特 力A | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.54 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 20 | 000026 | 飞亚达 | 深圳 | 是 | 否 | 否 | 0.59 | 0.00 | 0.00 | 否 | 不支持 |
| 21 | 000027 | 深圳能源 | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.63 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |
| 22 | 000028 | 国药一致 | 深圳 | 是 | 是 | 是 | 0.65 | 1.00 | 0.65 | 否 | 不支持 |

标的证券页面中显示了证券属性，是否担保品，是否融资融券标的。

### 4.7.2 持仓明细




| | 合计 | 总资产 | 总市值 | 可用资金 | 港股通市值 | 持仓盈亏 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 合计 | 74285749.98 | 71086086.60 | 3199663.38 | 0.00 | -30137119.00 |

| | 证券代码 | 证券名称 | 当前持仓 | 可卖数量 | 成本价 | 最新价 | 盈亏率 | 盈亏 | 证券市值 | 买入量 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 991 | 870436 | 大地电气 | 1600 | 1600 | 8.0098 | 10.33 | 28.97% | 3712.25 | 16528.00 | |
| 992 | 871245 | 威博液压 | 1600 | 1600 | 12.7694 | 10.19 | -20.20% | -4127.04 | 16304.00 | |
| 993 | 871396 | 常辅股份 | 1600 | 1600 | 7.4542 | 11.59 | 55.48% | 6617.21 | 18544.00 | |
| 994 | 871553 | 凯腾精工 | 1600 | 1600 | 3.7094 | 4.59 | 23.74% | 1409.00 | 7344.00 | |
| 995 | 871642 | 通易航天 | 1600 | 1600 | 6.8094 | 9.67 | 42.01% | 4577.03 | 15472.00 | |
| 996 | 871857 | 泓禧科技 | 1600 | 1600 | 9.0802 | 14.70 | 61.89% | 8991.61 | 23520.00 | |
| 997 | 871970 | 大禹生物 | 3200 | 3200 | 4.2409 | 7.11 | 67.65% | 9181.01 | 22752.00 | |
| 998 | 871981 | 晶赛科技 | 1600 | 1600 | 13.8889 | 13.00 | -6.40% | -1422.18 | 20800.00 | |
| 999 | 873122 | 中纺标 | 1600 | 1600 | 12.9016 | 48.86 | 278.71% | 57533.49 | 78176.00 | |
| 1000 | 873169 | 七丰精工 | 1600 | 1600 | 6.6513 | 6.59 | -0.92% | -98.01 | 10544.00 | |

持仓明细表格上方输入框可以用来过滤证券代码。双击持仓某条记录，可快速打开对应持仓证券的闪电下单窗口。

### 4.7.3 当日委托




| | 委托时间 | 证券代码 | 证券名称 | 方向 | 报单类型 | 委托状态 | 委托价格 | 委托数量 | 成交数量 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 14:05:32 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 限价 | 全部成交 | 7.15 | 200 | 200 |
| 2 | 14:04:50 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 限价 | 全部撤单 | 7.29 | 200 | 0 |
| 3 | 14:03:56 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 限价 | 全部成交 | 7.07 | 200 | 200 |
| 4 | 11:19:33 | 600000 | 浦发银行 | 买入 | 限价 | 全部撤单 | 7.12 | 500 | 0 |
| 5 | 11:19:22 | 600000 | 浦发银行 | 买入 | 限价 | 交易所已接收 | 7.13 | 500 | 0 |
| 6 | 11:18:59 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 限价 | 全部撤单 | 7.21 | 500 | 0 |
| 7 | 11:18:57 | 600000 | 浦发银行 | 买入 | 限价 | 全部撤单 | 7.13 | 500 | 0 |
| 8 | 11:18:50 | 600000 | 浦发银行 | 买入 | 限价 | 全部撤单 | 7.13 | 500 | 0 |
| 9 | 10:34:28 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 限价 | 全部撤单 | 7.30 | 500 | 0 |
| 10 | 10:34:12 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 限价 | 全部撤单 | 7.22 | 500 | 0 |
| 11 | 10:32:21 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 限价 | 全部撤单 | 7.30 | 500 | 0 |

当日委托明细表格上方可过滤证券代码，根据委托状态进行筛选。双击某条记录可撤单。

### 4.7.4 当日成交




| 合计 | 总买入金额(CNY) | 总卖出金额(CNY) | 当日逆回购金额(CNY) |
|---|---|---|---|
| 合计 | 716.00 | 2868.00 | 0.00 |

| | 成交时间 | 证券代码 | 证券名称 | 委托方向 | 成交价格 | 成交数量 | 成交金额 | 成交编号 | 委托编号 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 14:05:32 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 7.17 | 200 | 1434.00 | 13724425 | 110018100025975 |
| 2 | 14:03:56 | 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 7.17 | 200 | 1434.00 | 13629014 | 110018100025931 |
| 3 | 10:45:32 | 600000 | 浦发银行 | 买入 | 7.16 | 100 | 716.00 | 6567094 | 110018100014663 |

| 合计 | 总买入金额(CNY) | 总卖出金额(CNY) | 当日逆回购金额(CNY) |
|---|---|---|---|
| 合计 | 716.00 | 2868.00 | 0.00 |

| 证券代码 | 证券名称 | 委托方向 | 平均成交价格 | 成交数量 | 成交金额 | 客户号 | 股东号 | 交易所 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600000 | 浦发银行 | 买入 | 7.160 | 100 | 716.00 | 00031061 | A00031061 | 上海 |
| 600000 | 浦发银行 | 卖出 | 7.170 | 400 | 2868.00 | 00031061 | A00031061 | 上海 |

当日成交明细表格上方输入框可用来过滤证券代码，可切换显示当日每笔成交详情和当日成交汇总模式。

© 华鑫证券有限责任公司，2026

### 4.7.5 当日撤单


撤单明细

全部 撤成功 被拒绝 代码过滤 点击刷新按钮，获取当日撤单记录 刷 新 栏位设定 导 出

| | 撤单时间 | 证券代码 | 证券名称 | 撤单状态 | 方向 | 报单类型 | 委托价格 | 委托数量 | 委托时间 | 节点 | 其他信息 | 委托编号 | 本地报单号 | 本地撤单号 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 09:25:54 | 510100 | SZ50ETF | 预埋 | 买入 | 限价 | 2.712 | 100 | 09:17:55 | 19 | | 110010190000005 | 0190000005 | 0190000021 |
| 2 | 09:21:52 | 510100 | SZ50ETF | 被拒绝 | 买入 | 限价 | 2.713 | 100 | 09:20:26 | 19 | 11240:该时段不允许删除订单 | 110010190000006 | 0190000006 | 0190000009 |
| 3 | 09:21:42 | 510100 | SZ50ETF | 被拒绝 | 买入 | 限价 | 2.712 | 100 | 09:17:55 | 19 | 11240:该时段不允许删除订单 | 110010190000005 | 0190000005 | 0190000008 |
| 4 | 09:20:31 | 510100 | SZ50ETF | 被拒绝 | 买入 | 限价 | 2.713 | 100 | 09:20:26 | 19 | 11240:该时段不允许删除订单 | 110010190000006 | 0190000006 | 0190000007 |
| 5 | 09:11:14 | 510100 | SZ50ETF | 成功 | 买入 | 限价 | 2.712 | 100 | 09:11:08 | 19 | | 110010190000003 | 0190000003 | 0190000004 |

当日撤单明细表格通过点击”刷新”按钮手动获取数据，撤单记录的状态包括：预埋/提交/成功/交易所拒绝。可按照证券代码和撤单状态进行筛选过滤。

### 4.7.6 历史记录


历史委托

日期 2026/1/5 至 2026/1/14 代码 204001 查 询 导 出 所有数据已加载完毕(共8条)

| | 委托日期 | 委托时间 | 证券代码 | 证券名称 | 买卖类别 | 报单状态 | 报单类型 | 委托价格 | 委托 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 20260114 | 14:38:36 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 全部成交 | 限价 | 1.480 | |
| 2 | 20260113 | 14:58:18 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 全部成交 | 限价 | 1.400 | |
| 3 | 20260112 | 14:53:14 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 全部成交 | 限价 | 1.680 | |
| 4 | 20260109 | 14:50:42 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 全部成交 | 限价 | 1.440 | |
| 5 | 20260108 | 15:10:00 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 全部成交 | 限价 | 1.075 | |
| 6 | 20260106 | 15:02:08 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 全部成交 | 限价 | 1.745 | |
| 7 | 20260105 | 14:54:56 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 全部成交 | 限价 | 1.405 | |
| 8 | 20260105 | 14:51:40 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 全部撤单 | 限价 | 1.435 | |


历史成交

日期 2026/1/5 至 2026/1/14 代码 204001 查 询 导 出 所有数据已加载完毕(共7条)

| | 成交日期 | 成交时间 | 证券代码 | 证券名称 | 买卖类别 | 成交价格 | 成交数量 | 成交编号 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 20260114 | 14:38:45 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 1.480 | 139 | 12008010066 |
| 2 | 20260113 | 14:59:27 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 1.400 | 139 | 12008010076 |
| 3 | 20260112 | 14:53:15 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 1.680 | 139 | 12008010078 |
| 4 | 20260109 | 14:50:42 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 1.440 | 139 | 12008010071 |
| 5 | 20260108 | 15:10:01 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 1.075 | 139 | 12008010089 |
| 6 | 20260106 | 15:02:15 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 1.745 | 139 | 12008010078 |
| 7 | 20260105 | 14:54:56 | 204001 | GC001 | 逆回购 | 1.405 | 159 | 12008010067 |

© 华鑫证券有限责任公司，2026




| | 成交日期 | 成交时间 | 证券代码 | 证券名称 | 买卖类别 | 成交价格 | 成交数量 | 成交金额 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 20260114 | 14:38:45 | 204001 | GC001 | 融券 | 1.480 | 139 | 139000.00 |
| 2 | 20260114 | 00:00:00 | 204001 | GC001 | 融券购回 | 1.400 | 139 | 139005.33 |
| 3 | 20260113 | 14:59:27 | 204001 | GC001 | 融券 | 1.400 | 139 | 139000.00 |
| 4 | 20260113 | 00:00:00 | 204001 | GC001 | 融券购回 | 1.680 | 139 | 139006.40 |
| 5 | 20260112 | 14:53:15 | 204001 | GC001 | 融券 | 1.680 | 139 | 139000.00 |
| 6 | 20260112 | 00:00:00 | 204001 | GC001 | 融券购回 | 1.440 | 139 | 139005.48 |
| 7 | 20260109 | 14:50:42 | 204001 | GC001 | 融券 | 1.440 | 139 | 139000.00 |
| 8 | 20260109 | 00:00:00 | 204001 | GC001 | 融券购回 | 1.075 | 139 | 139012.28 |
| 9 | 20260108 | 15:10:01 | 204001 | GC001 | 融券 | 1.075 | 139 | 139000.00 |
| 10 | 20260107 | 00:00:00 | 204001 | GC001 | 融券购回 | 1.745 | 139 | 139006.65 |
| 11 | 20260106 | 15:02:15 | 204001 | GC001 | 融券 | 1.745 | 139 | 139000.00 |
| 12 | 20260106 | 00:00:00 | 204001 | GC001 | 融券购回 | 1.405 | 159 | 159006.12 |
| 13 | 20260105 | 14:54:56 | 204001 | GC001 | 融券 | 1.405 | 159 | 159000.00 |
| 14 | 20260105 | 00:00:00 | 204001 | GC001 | 融券购回 | 2.080 | 159 | 159009.06 |

可查询指定日期范围之内的历史委托、成交、交割单、资金、流水、持仓、盈亏、负债信息（两融）等记录。

证券代码输入框中可填入具体代码实现单只股票的筛选查询，否则查询所有证券的历史交易记录。

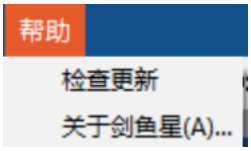
### 4.7.7 设置表头栏位




在持仓和当日委托表格上方点击“栏位设定”按钮，可分别对不同表格设置

自定义表头，可调整表头栏位的显示内容和顺序。

## 4.8 菜单-帮助




### 4.8.1 检查更新




点击菜单中的检查更新按钮可以手动检查是否有新版本。另外每次程序退出后也会自动检查当前版本是否为最新，如有新版本自动弹出该更新工具，用户可在设置中修改自动检查版本功能的开关。