融航信息
ROHONINFO

大资管时代优质的信息技术提供商

THE SUPERIOR INFORMATION TECHNOLOGY PROVIDER IN ASSET MANAGEMENT

随心易 PC 客户端说明书

V.3.113.0.0

上海融航信息技术股份有限公司

公司地址:上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦7楼D座

网址:http://www.rohon.net/

客服热线:400-083-4361

随心易线上服务QQ群:618741262

联系邮箱:terminalteam@rohon.net

上海融航信息技术股份有限公司版权所有

目录

1、文档说明.....7
2、产品功能.....7
3、登录/退出.....8
3.1功能点简介.....8
3.2入口路径.....8
3.3使用说明.....8
3.3.1登录.....8
3.3.2指令权限.....11
4、云端.....20
4.1功能点简介.....20
4.2入口路径.....20
4.3使用说明.....20
4.3.1随心云服务.....20
4.3.2上传日志.....25
5、K线.....25
5.1功能点简介.....25
5.2入口路径.....26
5.3使用说明.....27
6、系统.....43
6.1功能点简介.....43
6.2入口路径.....43
6.3使用说明.....43
6.3.1查询历史结算单.....43
6.3.2查询资金.....44
6.3.3重查合约.....45
6.3.4退出.....45
7、报表.....45
7.1功能点简介.....45
7.2入口路径.....45
7.3使用说明.....46
8、套利.....46
8.1功能点简介.....46
8.2入口路径.....46
8.3使用说明.....47
9、配置.....47
9.1功能点简介.....47
9.2入口路径.....48

9.3使用说明 48
9.3.1选项 48
9.3.2界面锁定 67
9.3.3合约快捷键 67
9.3.4界面风格及配置项切换 68
9.3.5分组设置 70
9.3.6资金使用比例设置 73
10、帮助 74
10.1功能点简介 74
10.2入口路径 74
10.3使用说明 74
11、账户管理面板 76
11.1功能点简介 76
11.2入口路径 76
11.3使用说明 78
11.3.1“有效”勾选 78
11.3.2“选择”勾选 79
11.3.3添加账户 79
11.3.4同步账户持仓 81
11.3.5分组设置 86
12、行情面板 86
12.1功能点简介 86
12.2入口路径 87
12.3使用说明 87
12.3.1普通行情 87
12.3.2套利行情 89
12.3.3篮子行情 90
12.3.4期权行情 92
13、策略面板 93
13.1.1网格策略 93
14、下单板 94
14.1功能点简介 94
14.2入口路径 94
14.3使用说明 95
14.3.1【标准】下单板 95
14.3.1.1标准下单板支持设置拆单算法 96
14.3.1.2标准下单板支持TWAP智能算法 97
14.3.2【两键】下单板 102

14.3.3【三键】下单板 103
14.3.4【六键】下单板 103
14.3.5【预埋单】下单板 105
14.3.6【条件单】下单板 107
14.3.7【自设套利】下单板（HOT） 110
14.3.8【标准套利】下单板（HOT） 111
14.3.9【篮子下单】下单板 114
14.3.10【闪电点价】下单板（HOT） 117
14.3.11【组合报单】下单板 131
15、信息类面板 131
15.1功能点简介 131
15.2入口路径 134
15.3使用说明 134
15.3.1信息类面板-【所有委托】 134
15.3.2信息类面板-【成交记录】 136
15.3.3信息类面板-【持仓信息】 138
15.3.4信息类面板-【未成交记录】 144
15.3.5信息类面板-【自设套利】（HOT） 145
15.3.6信息类面板-【预埋单】 149
15.3.7信息类面板-【止盈止损】 155
15.3.8信息类面板-【平仓信息】 156
15.3.9信息类面板-【条件单】 157
15.3.10信息类面板-【盈亏分析】 160
15.3.11信息类面板-【 Delta】 161
15.3.12信息类面板-【篮子下单信息】 162
15.3.13信息类面板-【网格下单信息】 162
15.3.14信息类面板-【算法列表】 163
16、状态栏 170
16.1功能点简介 170
16.2入口路径 170
16.3使用说明 170
17、【自设套利】策略下单整体流程 170
17.1功能点简介 170
17.2入口路径 170
17.3使用说明 171
17.3.1自设套利添加策略 171
17.3.2自设套利复制策略 186
17.3.3自设套利修改策略 188

17.3.4套利行情面板 189
17.3.5【自设套利】下单板 189
17.3.6【自设套利】信息面板 193
17.3.7 套利报单实例（HOT） 196
17.3.8 移仓换月使用方法（HOT） 206
18、【篮子下单】策略下单整体流程 207
18.1功能点简介 207
18.2入口路径 208
18.3使用说明 208
18.3.1篮子下单添加策略 208
18.3.2篮子下单复制策略 211
18.3.3篮子下单修改策略 211
18.3.4【篮子下单】下单板 212
18.3.5【篮子下单信息】 213
19、【网格策略】策略下单整体流程（HOT） 214
19.1功能点简介 214
19.2入口路径 216
19.3使用说明 217
19.3.1添加策略 218
19.3.2修改策略 225
19.3.3删除策略 226
19.3.4什么是网格策略 227
19.3.5网格策略报单实例（普通合约、标准套利合约）： 227
19.3.6网格策略报单实例（自设套利策略）： 231
19.3.7网格策略异常状态： 232
20、【智能算法】算法下单整体流程 234
20.1功能点简介 234
20.2入口路径 235
20.3使用说明 237
20.3.1智能算法-冰山指令 237
20.3.2智能算法-TWAP(限价) 239
20.3.4智能算法-VWAP 247
20.3.5 算法列表 249
21、梯度扫盘指令 250
21.1功能点简介 250
21.2入口路径 251
21.3使用说明 253
21.3.1参数含义&设置范围 253

21.3.2举例 255
21.3.3注意事项 260
22、附录 260
23、备注 261
23.1指定资金账户 261
23.1.1功能点简介 262
23.1.2入口路径 262
23.1.3使用说明 262
24、修订记录 266

客户端部署配置

操作系统：仅支持 windows 系统，win7 及以上版本。

内存：4G 以上。

硬盘：500G 以上 。

CPU 4 核以上。

1、文档说明

本文档作为随心易PC客户端的产品说明书，以图文结合的方式描述了PC客户端的核心功能点，旨在帮助投资者更好的使用随心易PC客户端。

（HOT）标识：热门功能推荐。

2、产品功能

主要包含了 PC 客户端核心功能点和新增、更新的功能点，正文部分将详细展开描述。

。

页面大致可分为：软件标题栏，页面快捷键，系统菜单栏，行情组切换（初始默认、+），信息展示区，操作区，状态栏。

3、登录/退出

3.1功能点简介

1、“登录”是用户进入和使用随心易 PC 客户端的途径。“退出”是用户关闭和退出随心易 PC 客户端的途径。

2、支持拥有“期货交易”权限的人员使用人员账户登录随心易进行期货交易，对其关联的操作账户直接下达期货委托。

3、支持拥有指令权限的账户登录随心易，下达交易指令。根据登录账户权限的不同显示对应功能面板。

3.2入口路径

登录：对于使用随心易 PC 客户端的用户，双击桌面上的“随心易”图标，输入账户、密码，可直接打开本软件的登录界面。

3.3使用说明

3.3.1登录

单账户登录：选择经纪公司，输入账号、密码，并阅读勾选免责声明及隐私条款后，才能进行单交易账户登录。

点击修改密码可修改密码。点击通信设置，可以配置行情服务器、交易服务器。

多账户登录：通过官网注册的账号进行登录。如果没有我们平台的账号，可以通过登录界面下方，点击“快速注册”，在我们官网对账号进行注册；注册完毕后，在信息栏输入账号、密码，点击登录即可。点击通信设置，可以配置行情服务器、交易服务器。

授权模式登录：此外，随心易支持授权模式登录，即在无互联网连接的情况下通过授权模式进行验证登录。点击通信设置，可以配置行情服务器、交易服务器。

登录界面显示版本号，并且**支持 IPv6 网络。**

账号到期提醒： 临近账号到期的 30 天，软件标题栏会出现具体到期日的提醒。

若账号到期，会提示与服务商联系。点击“确定”可以跳转至融航官网。

联系我们/反馈： 可以通过扫码或群号加入随心易线上 QQ 群，邮件。以便联系到我们，进行答疑。

如何导出日志、查问题：可以点击对应文件夹跳转到目录，拷贝并压缩相关日志、dump 文件发送给我们。

3.3.2指令权限

账户在管理后台配置不同权限。不同权限的账户登录后显示对应页面：

指令下达：只能下达指令。

指令审批： 只能审批指令。

指令执行： 只能执行指令。

期货交易： 进行自主交易。

注意事项：

01. 一个登录账户可以同时拥有多个权限。

02. 指令下达和指令交易权限不能同时拥有。

03. 若不设置指令配置，默认无指令权限，即登录普通单账户交易端。

04. 指令权限只支持单账户登录，不支持多账户登录。

05. 指令端口设置一次后，退出软件或重启之后依然保留设置的指令端口数据。

功能简介：

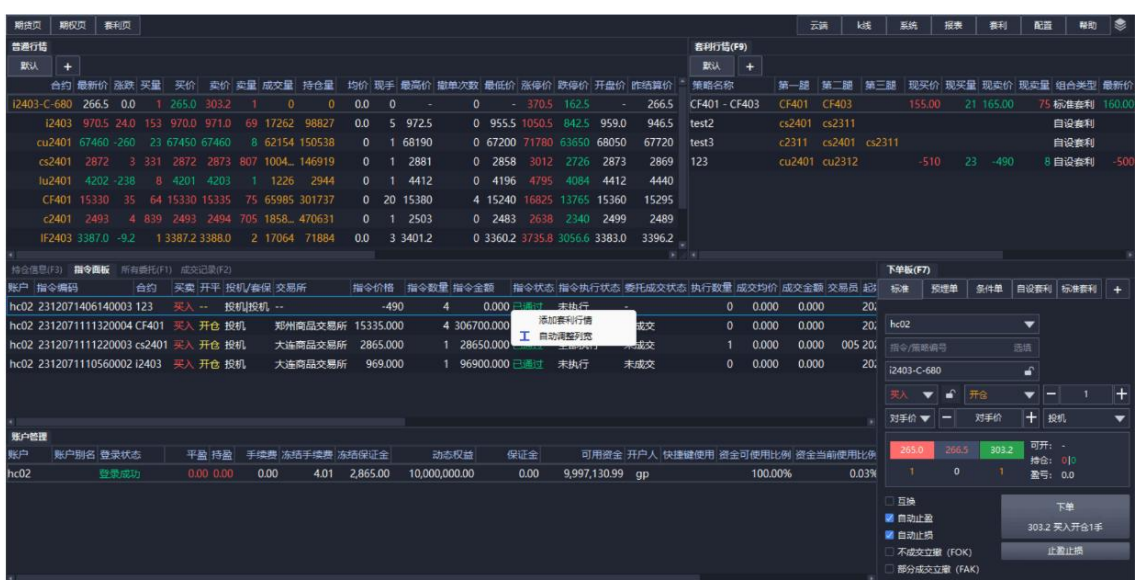
01.随心易-指令下达选择人员时展示交易员人员姓名，指令信息面板展示交易员姓名、投资经理账户/姓名。

02.当同一笔指令执行时分成了多笔委托，支持快捷撤销指令执行后的多笔未成交委托或快捷撤销指令任务。

指令执行人员登录随心易，在指令信息面板选择指令后，右击“撤销任务”，可对该条指令撤销任务。

03、交易员在指令信息面板上双击该条自设套利指令，该条指令填入下单板的同时，

指令中所带的自设套利策略行情也添加至自设套利行情面板。

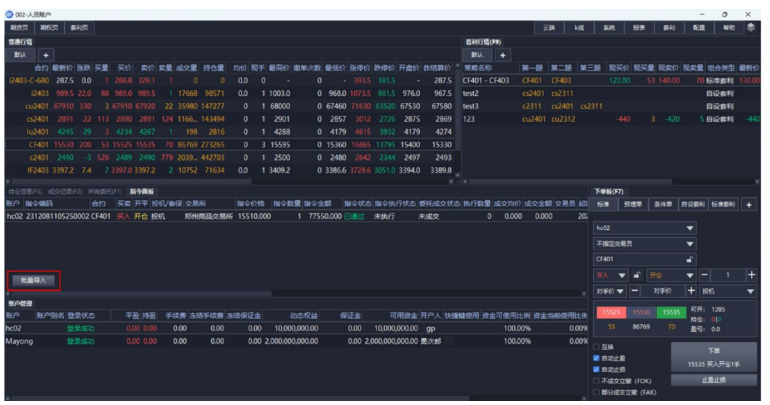


04、指令下达人员登录随心易终端后，在标准、两键、三键、六键、自设套利下单板支持指令开始日期和结束日期的选择。

（1）非指令下达人员登录，自设套利下单板默认显示当日有效日期。

（2）非指令下达人员登录后，在自设套利面板上选择的有效日期需在指令下达人员设置的时间范围内。

05、指令信息面板支持批量导入。



06、指令端支持以价格类型发出指令：

（1）指令下达端下单板的价格类型支持选择“不限价”。

指令下达-下单板

（2）价格类型支持“不限价”的下单板：指令下达端：标准、两键、三键、六键。

07、支持使用TWAP执行指令：

(1)指令执行人员接收到普通指令需求时，双击该指令，该指令对应的指令参数自动填写在标准下单板中。并支持选择使用 TWAP 算法执行该指令。

点击“TWAP”，显示TWAP设置弹窗：

(2)下单成功后，提示“下单成功，详细信息展示在：算法列表”。

08、指令审批支持批量处理：指令审批列表支持多选，批量通过、批量拒绝；

09、单合约指令、标准套利指令支持以条件单、预埋单、止盈止损单执行：指令执行人员接收到单合约指令、标准套利指令时，支持使用普通下单板、条件单、预埋单、止盈止损单的方式执行单合约指令、标准套利指令；且指令执行人员支持调整下单参数。

3.3.3通讯设置

不论单账户、多账户，在登录界面右下角都有“通信设置”按钮。点击可以对行情服务器、交易服务器进行编辑。

3.3.3.1行情服务器：

可以添加 、删除行情服务器组， 服务器组选项对应已有服务器组的切换。

左下角的添加、删除、修改按钮是针对行情服务器组内具体行情地址的操作。

目前支持的**行情地址类型**有： CTP、融航、个股期权、外盘。

“连接”按钮可以在正式登录前，对列表选中的行情地址检验状态。

3.3.3.2交易服务器：

点击上方交易服务器按钮，可以添加、删除交易服务器组，服务器组选项对应已有服务器组的切换。

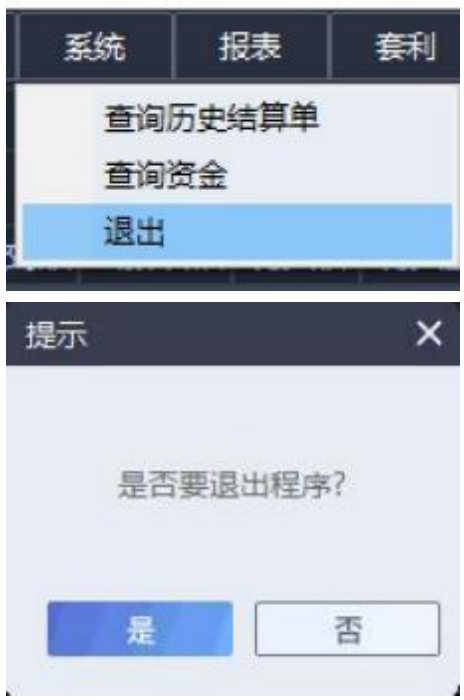
目前交易服务器组的柜台类型支持：融航、CTP、个股期权、融航外盘、SP外盘、飞创、金仕达。

左下角的添加、删除、修改按钮是针对交易服务器组内具体交易地址的操作。

(其中，**飞创柜台**添加交易地址会区分交易端口、查询端口。)

“连接”按钮可以在正式登录前，对列表选中的交易地址检验状态。

3.3.4退出



当用户想要退出登录时，可直接点击右上角的关闭按钮（也可选择系统-退出）都会出现提示弹窗，点击“是”，系统自动保存，退出系统。

4、云端

4.1功能点简介

1、创建随心云账号体系，让使用随心易的用户可将个性化设置，如：自选、交易账户及分组信息等数据云端保存，实现异机漫游。避免数据丢失，方便与其他设备共享。

2、上传日志功能（无需登录随心云），便于上传日志、问题反馈。

4.2入口路径

点击软件右上角菜单栏-云端。

4.3使用说明

4.3.1随心云服务

4.3.1.1随心云-登录

1、点击“随心云服务（未登录）”，弹出随心云服务登录弹窗。

2、输入随心云账号、密码登录。

3、随心易多账户的外部账号、交易账户都不能直接登录随心云，需要新注册。随心云的登录与外部账号、交易账户都不是绑定关系。

4.3.1.2随心云-注册

1、若未注册，可以点击注册。

2、点击注册，弹出【注册随心云账号】，需要手机号进行注册、验证码（再次发送需 30s 等待）。密码为 6-16 个数字、字母的组合。

4.3.1.3随心云-密码找回

若忘记密码，可以点击忘记密码，在【找回随心云账号/密码】进行重置。

4.3.1.4上传个性化数据到云端

1、登录成功，随心云出现：【上传个性化数据到云端】、【同步个性化数据到本地】按钮。

2、点击【上传个性化数据到云端】：

可以勾选：自选、账户及分组信息（随心易单账户登录，无账户及分组信息）。

自选（仅普通行情）的自选分组与自选合约。

3、对于“账户及分组信息上传”时，可以选择设置安全密钥（非必须），若设置安全密钥，同步时需要填入密钥。

4、若已有相关的云端数据，会提示是否进行信息覆盖。

5、点击“上传到云端”，进行判断提示，上传成功或有失败项会提示结果。

4.3.1.5同步个性化数据到本地

1、点击【同步个性化数据到本地】：

弹出弹窗，可以选择导入云端电脑数据。

导入电脑端数据到本地：

2、同步到本地时，若设置过密钥需要输入才能导入成功。

3、导入可能会覆盖当前本地信息，需要确认是否继续。

4、点击“导入到本地”，进行判断提示，导入成功或有失败项会提示结果。

5、点击设置按钮，可以修改当前账户密码或退出登录。

4.3.2上传日志

点击“云端-上传日志”，可以将问题、日志（支持指定日期或近 3 天、近 7 天）直接上传，更方便问题反馈。

5、K 线

5.1功能点简介

1、K 线模式可以从行情面板展示 K 线图，包括合约的分时图。

2、K 线模式支持画线下单功能：K 线面板支持以画线的方式设置价格条件单。支持最新价/买一价/卖一价，碰触/越过画线时触发画线下单；如果价格跳空直接穿越画线也可触发。

3、K 线模式时间显示：各类时间 K 线图，遇到日期跨度，下方横坐标显示对应的时间规则：年份、月份或日期。

4、多周期同列功能：K 线模式下，支持同时显示同一合约不同时期的 6 个

K 线图。默认 1 分、3 分、5 分、15 分、30 分、60 分钟 K，并支持切换周期。

5、多股同列功能：K 线模式下，支持同时显示不同合约的 6 个 K 线图，并支持滚动鼠标滚轮切换合约、双击指定合约，打开该合约 K 线图。

5.2入口路径

点击菜单栏-K 线勾选【使用 K 线模式】， 在行情面板双击或者右键可以打开 K 线图 。行情右键也可以打开多股同列。

5.3使用说明

1.画线：可以在 K 线中打开画线，或者右键点画线，弹出【画图】弹窗。画图弹窗内的功能可以画在 K 线内。

2.分时图：在 K 线左上角可以选择分时图，以及详细的时间。

3.指标线：可以在左下侧点击进行切换，红色的为当前指标线。目前支持：VOL，ATR，BIAS，DMI，MACD，RSI，WR，KDJ 指标。

4.关闭 K 线图：点击【返回】按钮，或者右键关闭 K 线就可以回到行情面板。

5.画线下单：

5.1K 线面板显示

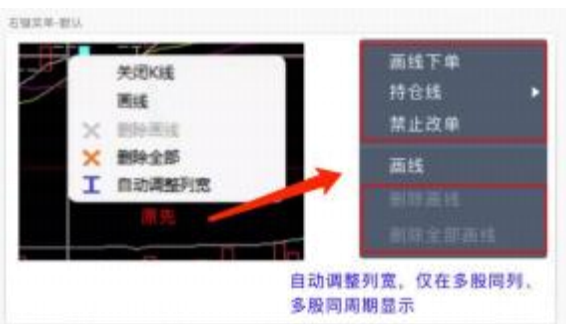
1 多账户 K 线面板增加“账户显示”选项，单账户 K 线不进行显示。

2 多账户未登录时默认为空，登录后默认显示登录成功第一个账户。

3 账户有设置别名先显示别名，在“账户显示”处切换账户，K 线画线信息与账户联动切换。

④ 画线下单的账户若与 K 线“账户显示”不同，画线后不会显示在 K 线上。

5.2K 线右键菜单



1、功能打开方式：K 线图-鼠标右击。

1 “画线下单”，点击弹出画线下单功能弹窗。

2 “持仓线”，点击展开为持仓均价、开仓均价、不显示；默认勾选持仓均价。

3 选择“持仓均价”，对应的盈亏计算显示为“持仓盈亏”；选择“开仓均价”，对应的盈亏计算显示为“逐笔盈亏”。

4 **“禁止改单”功能；勾选后，将无法在 K 线上进行拖拽形成条件单、止盈止损单**；与条件单、止盈止损信息面板的“禁止改单”无功能关联。

⑤ 点击“删除全部”仅删除全部画线。不会删除条件单、挂单、止盈止损单、持仓线。

3、没有画线，右键“删除画线”、“删除全部画线”、为禁用状态。

4、条件单会在 K 线面板上进行展示，并支持拖拽修改、删除。

5、在 K 线面板画线下条件单后，点击右键，出现“修改条件单”、“删除条件单”。

6、**在【条件单】信息面板-右键点击“删除所有”，K 线图上的条件单同步删除 。**

7、在【条件单】信息面板，点击停止，则对应条件单不展示在 K 线；点击激活，再进行展示。K 线右键无停止、激活功能。

5.3 画线下单弹窗

5.3.1 参数设置

1、点击“画线下单”弹出：“画线下单”弹窗。

2、【画线下单】-默认如下图所示：

只有一个画线下单弹窗。

1、在画线下单面板中，选择具体参数。

2、服务器条件单开关、开平、手数、展开的参数进行记录，重启仍生效。若有效期到了，切换默认当日。

服务器条件单开关，默认关闭；开启后后续的画线下单变更为服务器条件单。

若选中“分组”，则按照分组进行提示下单。

1 开平：默认开仓。点击下拉展开：“开仓”、“平今”、“平仓”。

当选择“平今”，交易所不支持平今指令时，报单合约不区分平今/平昨，将平今属性转为平仓并直接报单，不作提示。

2 手数：默认 1。点击加减按钮加减 1 整数，最小为 1。

3 画线条件单若可能立刻触发，弹出提示：“当前行情已满足条件，是否继续执行条件单？点击“是”按钮将立即触发条件单”。

选择“是”继续报单-画线成功。选择“否”或 X，关闭弹窗不进行任何操作-取消画线。

4 点击“买入”，鼠标变为画笔样式，界面上显示黄色线。单击左键后，画红色线；线最左侧显示-红框配白色文字“买开/买平 N 手 XXXX.X”。N 为条件单委托数量，XXXX.X 为条件单触发价格。小数位数同合约精度。

5 点击“卖出”，鼠标变为画笔样式，界面上显示黄色线。单击左键后，画绿色线；线最左侧显示-绿框配白色文字“卖开/卖平 N 手 XXXX.X”。N 为条件单委托数量，XXXX.X 为条件单触发价格。小数位数同合约精度。

6 画线条件单、止盈止损单，同当前 K 线账户选择一致。

7 点击橡皮擦删除按钮，鼠标变为橡皮擦样式。可以对条件单、止盈止损进行擦除并撤单。

画线下单的橡皮擦不可对画线进行擦除，同理画线的橡皮擦不能擦除条件单、止盈止损单。

8 点击蓝色“**更多↓**”展开更多设置。

01、触发价：可选最新价、买一价、卖一价。默认选择最新价。

02、委托价：可选最新价、对手价、触发价、市价、自定义。默认选择最新价。

03、选择自定义后，超价变为自定义价格输入框。

价格默认填入最新价，点击全选价格可以输入改价。

04、有效日期：默认当日，下拉可选当日、本周、本月、自定义。

05、“拖拽持仓使用服务器止盈止损单”，默认不勾选，**为本地止盈止损单。**

若勾选，拖拽持仓线，生成服务器止盈止损单。

06、“画线止盈止损手数默认全部持仓数量”，默认不勾选。

即拖拽持仓生成止盈止损会出弹窗进行数量选择。默认止损、止盈是按当前K线账户持仓数量填入。

1）下止盈止损单，当前账户只有投机持仓时，需要设置投机止盈手数或设置投机止损手数：

2）下止盈止损单，当前账户只有套保持仓时，需要设置套保止盈手数或设置套保止损手数：

3）下止盈止损单，当前账户同时具有投机持仓、套保持仓时，需要设置投机止盈手数和套保止盈手数，或需要设置投机止损手数和套保止损手数：

☞ 若设置超出持仓数量，不进行拦截提示，同止盈止损逻辑一致。可以设置多条止盈止损单。

☞ 勾选“画线止盈止损手数默认全部持仓数量”等同于勾选“以后默

认全部持仓，无需弹窗”，勾选需联动。

- 勾选后无需每次弹窗提示，默认按持仓最大数量设置止盈止损。
- 若无持仓默认手数为 1。点击加减按钮加减 1 整数，最小为 1。
- 若之前选中“以后默认全部持仓，无需弹窗”，那么下次下单不会显示弹窗，并且重启客户端后也不会显示弹窗。若之前未选中该选项，则下次下单会弹出此弹窗并且重启客户端后也会弹出此弹窗。

5.3.2K 线-线段信息样式展示

1、条件单：

1）显示条件：条件单下单后，K 线面板上显示该条件单线。该条件单触发或删除后不显示。

2）样式描述：界面具体显示为实线，买开/平为红色实线、卖开/平为绿色实线。信息展示在左侧。最右侧进行数值显示。

2、持仓线：

1）显示条件：下单形成持仓后，K 线面板上显示该持仓线。

2）样式描述：白色紧密的虚线，展示方向、数量。空单为绿色，多单为红色。白字展示盈或亏，亏损前面有负号，小数位数同合约精度。

3、挂单线：

1）显示条件：下单后未成交即形成挂单后，K 线面板上显示该挂单线。该挂单撤除或成交后不显示。

2）样式描述：白色的实线，不区分买卖方向。信息展示在左侧。最右侧也进行数值显示，小数位数同合约精度。

4、止盈止损线：

1）显示条件：K 线面板上，持仓线向上拖拽形成止损线，持仓线向下拖拽形成止盈线。该止盈止损单触发或删除后不显示。

2）样式描述：白色长短的虚线，不展示方向。信息展示在左侧。最右侧也进行数值显示，小数位数同合约精度。

5、画线下单时，鼠标变为画笔样式，可以在分时图、K 线图、多股同类、多周期同列进行画线下单。

6、鼠标点到线时，画线下单鼠标样式同画线，右键可以进行相关操作。

7、拖拽持仓进行止盈止损时，鼠标样式与画线相同。

8、若因显示不完整或调整 K 线时间导致目前 K 线外有条件单，在最上方或下方进行提示“界外有条件单”。

01、非画线下单产生的条件单，也会显示在 K 线上；

02、界外：超出当前 K 线面板的时间周期内的最高价和最低价；

03、当界外有条件单线、止盈止损线，会在 K 线面板右上角显示字段“界

外有条件单”； 当界外有持仓线、挂单线，不做提示。

5.3.3 持仓止盈止损 K 线显示

1、直接拖动持仓线， 即设置为止盈止损； 自动判断止盈、止损方向。

多仓持仓线：拖动多仓持仓线， 向上拖动为止盈， 向下拖动为止损；

空仓持仓线：拖动空仓持仓线， 向下拖动为止盈， 向上拖动为止损；

默认止盈止损设置条件：“最新价”大于等于或小于等于 xxx 元时， 以对价进行平仓。XXX 为具体拖动的价格，拖动时未停下， 价格会在右侧进行展示。

拖拽持仓线形成止盈止损单时， 出现设置手数的弹窗，联动同画线下单配置属性。

持仓线处右键

2、在持仓线右键-止盈止损，跳转到止盈止损单设置。填充当前账户、合约。

3、在持仓面板里面设置止盈止损，通过该方式设置的止盈止损同样展示在 k 线图中。

在损盈单处右键

4、在止盈止损线右键，**修改止盈止损线单、删除止盈止损单。**

若此时为 K 线-禁止改单状态，则修改止盈止损单为禁用样式。

01、在 K 线止盈止损的线上右键-修改止盈止损，修改后止盈止损线对应调整到相应的价格。**止损价格：触发价。**

02、浮动止盈止损的画线会因为行情变动而变动。

5.3.4K 线功能特别说明

K 线-画线下单，

1、【附加条件】中，若选择时间条件单，K 线只支持显示【大于等于】和【小于等于】；

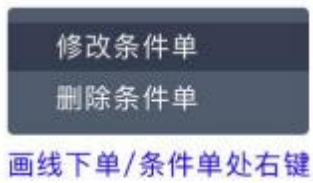
2、【附加条件】中，若选择价格条件单的最新价/买一价/卖一价，在 K 线上不显示该附加条件；

3、价格条件单中，K 线不支持显示【向上突破】、【向下突破】、【大于】、【小于】。

5.4 修改画线参数

1、鼠标放到条件单线上，变为手样式可以进行拖拽。

2、通过【条件单】信息面板，未触发时进行改单。



3、支持右键-修改条件单。

设置触发价/手数后，点击选择“确定”保存当前设置，选择“否”或 X，关闭弹窗不进行任何操作。

5.5 删除画线下单

1、通过“画线下单”弹窗的橡皮擦，点击“橡皮擦”后，光标变为橡皮样式，点击对应的条件单线后，即可进行删除。

2、在对应条件单右键-删除条件单进行删除。

3、若在【条件单】信息面板进行删除，对应 K 线显示也会消失。

4、若【条件单】信息板，右键停止了，则也不进行 K 线条件单展示。

5、K 线图中，点击某一画线，将其拖到 K 线图区域外可以删除该画线。

5.6K 线联动显示

1、普通行情保留联动；弹出不联动。切换下单板合约、会联动显示 K 线显示。

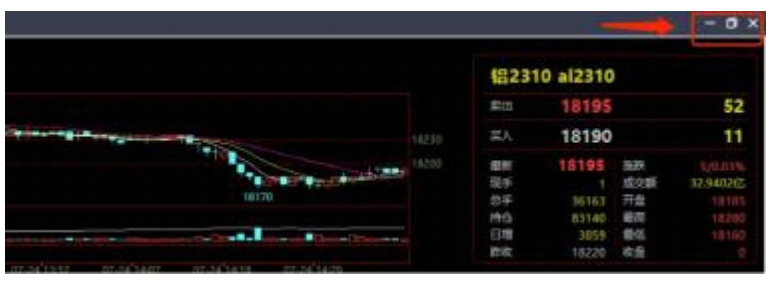
【持仓面板与盘口信息联动】

当盘口信息被点开后，用户在点击“持仓信息”中的合约，盘口信息同时进行切换。

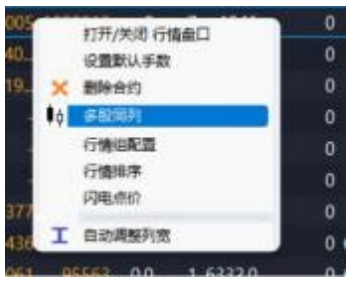
5.7K 线窗口弹出功能

1、当在右上角菜单栏-K 线勾选使用 K 线模式后，行情右键，此时右键增加：K 线下方，“弹出 K 线”；多股同列下方：“弹出多股同列”、“多周期同列”、“弹出多周期同列”功能，点击对应弹出选项，弹出时对应 K 线面板。

2、弹出时 K 线此期不增加联动显示。下单板、持仓信息面板、盘口面板。



3、弹出式 K 线窗口，没有“返回”按钮。且右上角需要有悬浮控件、关闭按钮、最大化按钮、向下还原按钮。



4、未勾选 K 线菜单-使用 K 线功能，行情面板右键，去掉多股同列功能。

6.K 线时间显示

各类时间 K 线图，遇到日期跨度，下方横坐标显示时间规则如下：

6.1、1 分、3 分、5 分、15 分和 30 分 K 线图：显示月份、日期和时间；

6.2、60 分 K 线图：显示月份、日期；

6.3、日、周 K 线图：显示月份和日期，不显示时间；

6.4、月 K 线图：显示年份、月份；

如遇到跨年：

6.5、 日、周 K 线图：遇到跨年显示具体年份、月份和日期；

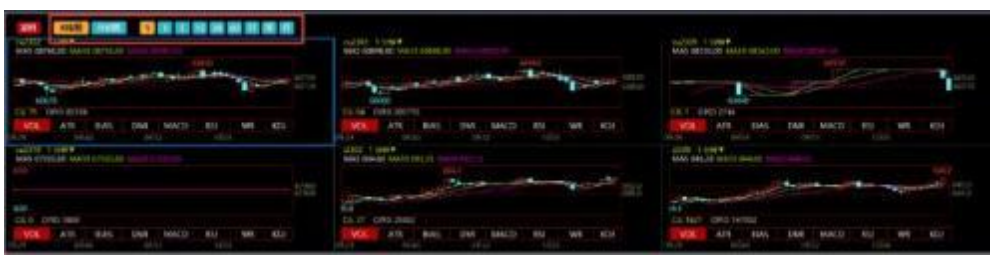
7.多周期同列

7.1 在普通行情面板右键，“多股同列”下方，增加“多周期同列”、“弹出多周期同列”功能。

7.2 点击多周期同列，展示同合约不同时期的 6 个 K 线图。默认 1 分、3 分、5 分、15 分、30 分、60 分钟 K，支持切换周期。

7.3 重启界面恢复为默认值周期值。默认 1 分、3 分、5 分、15 分、30 分、60 分钟 K。

7.4 双击支持切换 K 线面板、返回 6 图模式；增加周、月切换。



7.5、选中具体 K 线图，点击上面一排也可以切换对应 K 线图。

7.6、多周期同列支持 K 线功能。

8.多股同列功能

8.1 开启 K 线模式，右键多股同列下方增加“弹出多股同列”，即弹出对应的多股同列弹窗。

时间切换，增加周、月切换。

6、系统

6.1功能点简介

系统菜单包括：添加账户，查询历史结算单，查询资金，重查合约，退出。

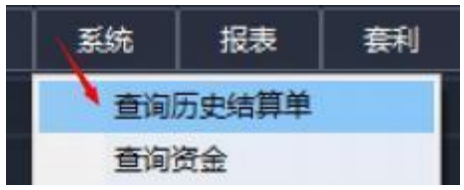
添加账户除此入口外，账户管理面板右键也可以进行更多操作。

6.2入口路径

点击【系统】按钮，出现选项。

6.3使用说明

6.3.1查询历史结算单



点击-系统-查询历史结算单， 出现查询历史结算单弹窗。可以选择查询的账号和日期，点击筛选， 出现结算单信息。点击“保存至文件”可以保存到电脑。

6.3.2查询资金

点击-系统-查询资金， 出现查询资金弹窗。可以选择账户进行查询。

6.3.3重查合约

点击-系统-重查合约，重启客户端后生效。

支持随时重新启动合约查询。

6.3.4退出

点击系统-退出， 选择是可以退出系统。

7、报表

7.1功能点简介

报表菜单内包含交易及账户报告。

7.2入口路径

点击-报表-交易及账户报告，弹出交易及账户报告弹窗。

7.3使用说明

选择账号，时间段，点击生成报告，左侧会出现项目名称和结果，右侧绘制客户权益走势图。

8、套利

8.1功能点简介

在套利页中，可以点击套利，添加 2～3 腿合约的套利策略，进行套利下单，这里的套利对应的是**自设套利。**

8.2入口路径

在配置-选项-显示配置-选择显示面板中，勾选【套利行情】、【自设套利】。

点击套利-添加策略， 出现套利【添加策略】弹窗。（本文 17.3.1 有第二种方式打开添加策略弹窗。）

8.3使用说明

1.添加的策略为自设套利策略。添加策略弹窗的具体内容可详见本文 17.3.1。

2.填好信息点击确定，添加的策略会显示在 12.3.2【套利行情】面板中。策略下单可参见 14.3.7【自设套利】下单板， 或本文 17【自设套利】策略下单整体流程。

9、配置

9.1功能点简介

配置菜单内容包括：选项，界面锁定，合约快捷键；界面风格及配置项切换（保存界面风格及配置、切换界面风格及配置、恢复默认界面风格及配置）；分组设置， 资金使用比例设置。

9.2入口路径

点击菜单栏-配置， 出现配置菜单。

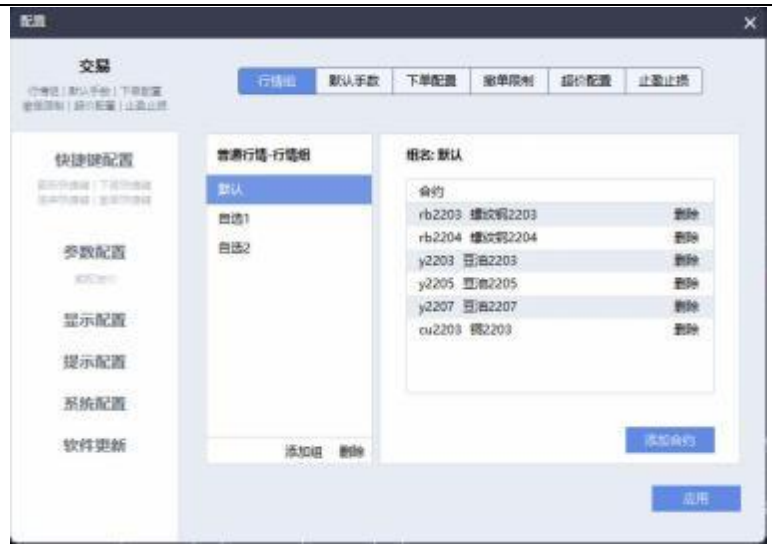
9.3使用说明

9.3.1选项

9.3.1.1交易

点击配置-选项， 出现配置弹窗。包括【交易】，【快捷键配置】，【参数配置： 】，【显示配置】，【提示配置】，【系统配置】，【软件更新】。

1.【交易】包括：行情组 | 默认手数 | 下单配置 | 撤单限制 | 超价配置 | 止盈止损。



01.**行情组**的添加，页面切换会显示在对应的行情【普通行情】或【套利行情】Tab 键下方。配置项的行情组仅管理【普通行情】行情组。

02.**默认手数**： 选择品种/合约， 点击添加，双击默认手数列输入具体手数。默认手数是可以对品种或行情右键-设置默认手数， 对具体合约进行默认手数设置， 进行双击行情或快捷键配置填单对应数量。

03.下单配置：

1) “拆分委托上限 ” 是全局的配置，是一个拆单功能。更多大单拆单可以了解单合约/标准套利： 追单设置： 对止盈止损 、条件单的追单勾选生效， 是限价 GFD 当日有效的委托方式进行追单。以当时的价格，加上设置的追单超价 tick，按照设置的频次进行追单， 追不成最后一次挂单保留。

2) 此设置与自设套利、篮子下单的追单次数不同（篮子是对价 FAK 追单 2 次，自设套利是根据对应的价格类型 、追单次数进行追单） 。

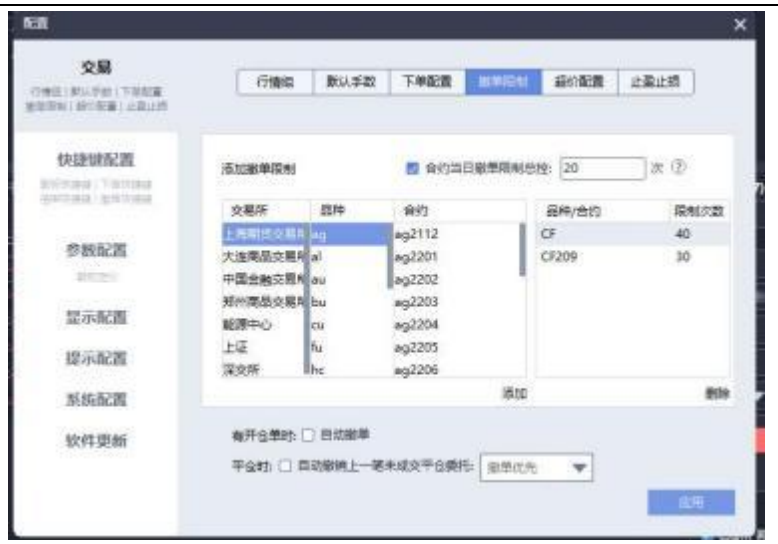
3) 自设套利触发原则：01、均分；02、按时间优先；

- 均分：当同一自设套利策略存在两笔及以上委托时，按照市场量平均分配套利单；
- 按时间优先：当同一自设套利策略存在两笔及以上委托时，按照时间优先的原则分配套利单。

04.撤单限制：计算的为当日挂单模式的撤单次数，不计算 FAK、FOK 撤单数量。

可勾选对所有合约当日撤单限制总控 。若有套保额度， 可调整上限。

提示可以隐藏或调出， 在提示配置-撤单是提示确认。



达到次数，提示达到撤单次数。

提示设置合约>品种>合约当日撤单限制总控。

套利 GFD 撤单不进行每次的提示，达到撤单次数上限的自定义套利设置：立即停止相关套利合约报单、追单（未完成挂单不撤单），最终未成交的挂单计入单腿统计，支持手动平达到上限的合约仓位。

选择具体交易所-品种-合约，点击添加，双击限制次数可以手动输入具体限制次数。

☞ 触发止盈止损的时候（不包含网格策略的止损线），平掉该合约的持仓，是否撤单取决于设置项：撤单优先还是平仓优先。若未勾选则：不进行撤单。

☞ 手动全平的时候，平掉该账户的所有持仓，是否撤单取决于设置项：撤单优先还是平仓优先。若未勾选则：不进行撤单。

有开仓单时，自动撤单：在对某一合约进行开仓申报时，需要先撤销上一笔未成交的此合约的开仓委托报单，然后再报最新一笔的开仓委托。

平仓时，自动撤销上一笔未成交平仓委托：

当累计发出的平仓委托量大于等于持仓量时，系统自动撤掉所有平仓委托报单，再上报最新一笔的平仓委托。（注意都是针对同一账户的同一合约）

若勾选，仓位不够时，做平仓操作就会按照这个设置去撤销上一笔同品种、同方向的平仓未成交单。顺序选择：

撤单优先：先撤销上一笔未成交的平仓委托报单，然后再报最新一笔的平仓委托。

平仓优先：平仓未成交时，继续对同一合约同一方向挂平仓单，平仓到持仓可平量不足时，再全部撤销同合约同方向的未成交平仓委托，重新按最后一次平仓委托挂单。

05.超价配置：超价配置的基准价可以选择对手价、最新价、排队价。选择好品种，点击添加，可以进行买超价、卖超价的设置。

06.止盈止损：点击添加，可以输入具体的产品、多空、止损、止盈、突破价、回撤 n 个 tick 止损（>0 起效）；开仓成交后，止盈方式：挂止盈单/挂止损单（支持普通合约和标准套利合约）；默认触发价；执行价格；超价 tick；追单类型；强撤类型的选择。

止盈方式 2 种类型区别：

01.“挂止盈单”成交后达到止盈参数设置才会挂止盈单。

02.“挂平仓单”成交后立刻按照止盈参数报出一笔平仓单进行止盈。

止盈止损“默认触发价”是指达到参数点是按哪个价格类型行情判断的，执行类型是指报出止盈或止损单的价格类型。

强撤类型，是指触发止盈或者止损，强撤掉平仓或者反向的挂单，也可以设置为都不勾选。

配置项针对品种的止盈止损设置好后，需要在下单板勾选对应的“自动止盈”或“自动止损”进行下单。

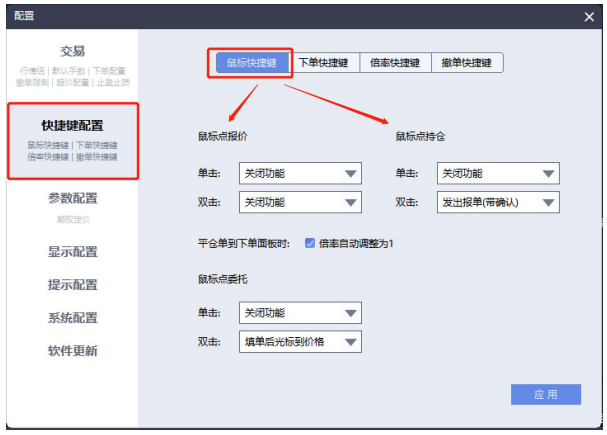
若触发止盈止损，触发的那一笔在【所有委托】“报单来源”会有标识：止损单、止盈单。

此配置对应的是自动止盈止损，与 14.3.1 和 15.3.3 标准下单板或持仓信息点开的针对已有持仓的止盈止损设置不同，不冲突，谁先到达就触发。

这里的止盈止损可以对合约品种进行预设，设置回撤 tick，建仓后会监测行情，浮动止盈止损。

9.3.1.2快捷键配置

1.【快捷键配置】包括：鼠标快捷键｜下单快捷键｜倍率快捷键｜撤单快捷键。



2.鼠标快捷键：包括鼠标点报价、鼠标点持仓、鼠标点委托的设置。配置后可以通过【持仓信息】进行单击/双击对操作对下单板进行填单，【持仓信息-组合持仓】支持自设套利填单。此类型快捷配置不支持【篮子下单】下单板填单。

01.鼠标点报价

单击时，若配置发出报单（不带确认）、发出报单（带确认）：有持仓先平仓，无持仓开仓。

双击时，若配置发出报单（不带确认）、发出报单（带确认）：不论有无持仓，都是开仓。

02.鼠标点持仓

单击/双击时，若配置发出报单（不带确认）、发出报单（带确认）：自动平该条持仓明细全部持仓量。

03.鼠标点委托：

1) 支持设置单击、双击后，委托信息是否与下单板的账号、合约信息联动显示。

2) 下单板交易手数信息不联动。与默认手数一致。

3) 此功能适用的下单板：标准、两键、三键、六键、 预埋单和条件单下单板。

4) 若设置了“鼠标点报价”、“鼠标点持仓”和“鼠标点委托“，单击/双击相应信息面板后，光标会自动跳转到此时随心易显示下单板相应的位置。

- 例如，若此时客户端界面显示标准下单板，当设置“鼠标点委托”双击“填单后光标到买卖”，那么在委托面板双击后，光标自动显示在标准下单板买卖的位置。
- 若此时客户端界面显示条件单下单板，当设置“鼠标点委托”双击“填单后光标到价格”，那么在委托面板双击后，光标自动显示在条件单下单板触发价的位置。

5) 以下3个下单板，因配置项与下单板功能无法一一对应，因此配置后，填单生效，光标定位不生效：

- 三键下单板-填单后光标到开平、买卖、下单按钮。
- 六键下单板-填单后光标到开平、买卖、下单按钮。

➢ 两键下单板-填单后光标到买卖、下单按钮。

6）点击持仓信息面板，下单板手数填写全部持仓手数；点击委托和行情面板，下单板手数填写品种默认手数；

7）设置“填单后光标到价格”后，鼠标在条件单信息面板点击委托合约时，会将信息

面板的“委托价”填到条件单下单板的触发价。

下单快捷键的【分笔】为快捷键拆单功能，如需更多类型，推荐使用 20【算法列表】的冰山指令、TWAP、VWAP。

【添加下单快捷键】中，配置平仓动作时，选择框下拉菜单名称显示：平多仓、平空仓、平双边持仓。

02.下单快捷键包含如上图所示内容。

03.倍率快捷键：可以添加倍率快捷键，数量乘数，在快捷键、数量乘数列表内双击可以修改内容。

04.撤单快捷键：选定撤单操作，点击添加，在具体点撤单操作内，双击快捷键列可以输入具体的快捷键。

9.3.1.3参数配置

3.【参数配置】包括： 期权定价， 如上图所示。

9.3.1.4显示配置

4.【显示配置】中的“选择显示面板”常用于调出界面。

显示配置内点击具体面板名称，可以勾选面板列表内具体文字展示内容。

9.3.1.5提示配置

5.【提示配置】包括：确认提示配置和提示音配置，部分提示音配置支持具体语音提示。

9.3.1.6系统配置

6.【系统配置】包括上图展示内容。

7.其中，在【列表字体大小】输入框，可以自定义输入字号，字号的范围为10-72px。

8.【软件更新】可以选择自动更新的属性。

9.3.2界面锁定

点击界面锁定，将无法移动框架，再次点击，对号消失可移动。

锁定界面配置风格保证用户在正常交易的过程中，界面显示不受影响。

9.3.3合约快捷键

点击合约快捷键，出现合约快捷键弹窗。点击增加，出现输入框，填入合约名（普通合约、标准套利合约），和对应快捷键（仅支持大写字母），配置交易合约的快捷键。下单板合约快捷填充支持标准、两键、三键、六键下单板。

9.3.4界面风格及配置项切换

“界面风格切换”功能让用户可以自定义界面框架结构和部分配置项（配置项：交易-下单配置，快捷键配置），并可进行切换和恢复默认风格及配置。

点击配置出现：保存界面风格及配置、切换界面风格及配置、恢复默认界面风格及配置选项。

1.【保存界面风格及配置】

自定义名称：默认空白。默认选中保存当前界面框架和保存配置项：交易-下单配置，快捷键配置。复选框至少需要勾选一项。对应的是配置-选项【交易-下单配置】和【快捷键配置-鼠标快捷键】中的内容。

2.【切换界面风格及配置】

默认【切换界面风格及配置】中，名称第一行为：默认界面风格及配置，此选项不可删除。表格第二行后对应【保存界面风格及配置】中的自定义名称。选中界面名称， 点击应用， 切换至已保存的界面风格及配置。

在系统菜单栏的最右侧有【切换界面风格及配置】选项的快捷入口，已保存的界面风格及配置可以在 按钮的菜单中找到。

3.【恢复默认界面风格及配置】

界面框架可以拖拽，想要恢复可以点击-配置【恢复默认界面及风格配置】，弹出提示：【确定恢复默认界面风格及配置？】点击确定，加载随心易初始默认的界面框架，以及默认的配置项-交易-下单配置、快捷键配置（包含鼠标快捷键、下单快捷键 、倍率快捷键、撤单快捷键） 内容。

9.3.5**分组设置**

1.点击-配置-分组设置（或账户面板右键分组设置）出现【分组设置】弹窗。可以设置当前分组，组名，所有账户。

2.支持对分组进行基准账户或者倍率模式的选择，此选择为全局设置，即切换会对所有分组生效。

3.设置下单比例

（1）“基准账户”模式：

*基准账户下单数量：参照账户下单数量=下单数量(份数)，

非参照账户下单数量=(非参照账户下单比例/参照账户下单比例)×下单数量(份数)。

点击添加组，选中组可修改分组名称，在【组名】列表双击可以改变参照账户。

切换会有二次确认提示。参照账户为橘色，有参照账户的分组可进行批量下单。

在下单比例列双击可以修改下单比例，支持小数比例的设置。

如上图所示在双击账户 A2 为基准账户后，设置 A1 下单比例为 1，设置账户 A2 下单比例为 3，账户 A3 下单比例为 6，那么此时下单比例为 1:3:6。

即当账户 A1 下单 2 手时、账户 A2 下单 6 手，账户 A3 下单 12 手。如果账户 A2 下单 1 手，此时系统计算 A1 应下单手数为 1/3 手，由于不足一手（向下取整），故不会对账户 A1 进行报单，A3 下单 1/3*6=2 手。下单比例支持小数比例设置，报单手数换算后还是以整数报单。

(2) “倍率”模式:

*倍率下单数量=对应账户倍率×下单数量(份数)

在倍率列双击可以修改账户倍率。

如上图所示在设 A1 倍率为 1，A2 倍率为 2，A3 倍率为 3 时，对组名 1 进行下单 10 数量，则 A1 下单 10 手，A2 下单 20 手，A3 下单 30 手。

倍率也可以设置小数，精确到整数位后 2 位数，具体下单时向下取整。

例如设置 A1 倍率 0.25， A2 倍率 1.00，A3 倍率 1.50，这时去进行分组下单 2 数量。此时系统计算 A1 应下单手数为 1/2 手，由于不足一手（向下取整），故不会对账户 A1 进行报单；A2 下单 1*2=2 手；A3 下单 1.5*2=3 手。

9.3.6**资金使用比例设置**

点击-配置-资金使用比例设置， 出现【资金使用比例设置】， 可设置：总资金可用于开仓比例。

10、帮助

10.1功能点简介

用于查询软件版本号，说明书信息，联系我们/反馈，免责声明及隐私条款，服务器单授权文档。

10.2入口路径

点击软件右上角的“帮助”菜单。

10.3使用说明

1.点击帮助-关于，可查看：软件的名称，版本，联系方式。

2.点击帮助-说明书，跳转浏览器查看对应版本的随心易 PDF 格式说明书。

3.点击帮助-视频教程，默认浏览器跳转到哔哩哔哩网站：随心易_Official 的主页，可以查看录制的视频教程、往期直播交流录屏。

https://space.bilibili.com/2131286907?spm_id_from=333.337.0.0

4.点击帮助-联系我们/反馈：

联系我们/反馈： 可以通过扫码或群号加入随心易线上 QQ 群， 邮件。 以便联系到我们， 进行答疑。

如何导出日志、查问题：可以点击对应文件夹跳转到目录，拷贝并压缩相关日志、dump 文件发送给我们。

5.点击帮助-免责声明及隐私条款， 登录软件后， 也可随时查看随心易软件的免责声明及隐私条款内容。

6.点击帮助-服务器单授权文档，登录软件后，也可随时查看服务器单授权文档内容，了解随心易服务器单运行机制。

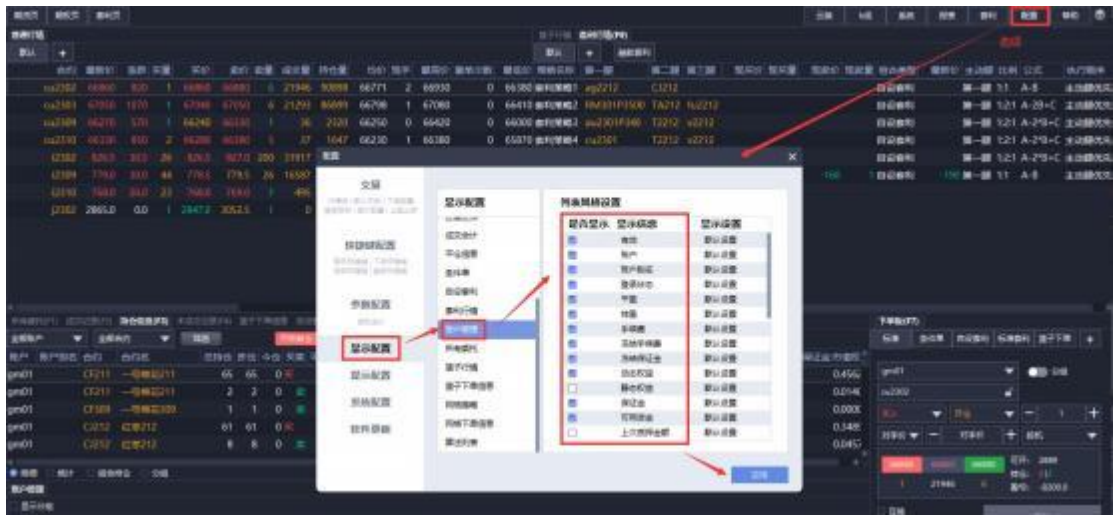
11、账户管理面板

11.1功能点简介

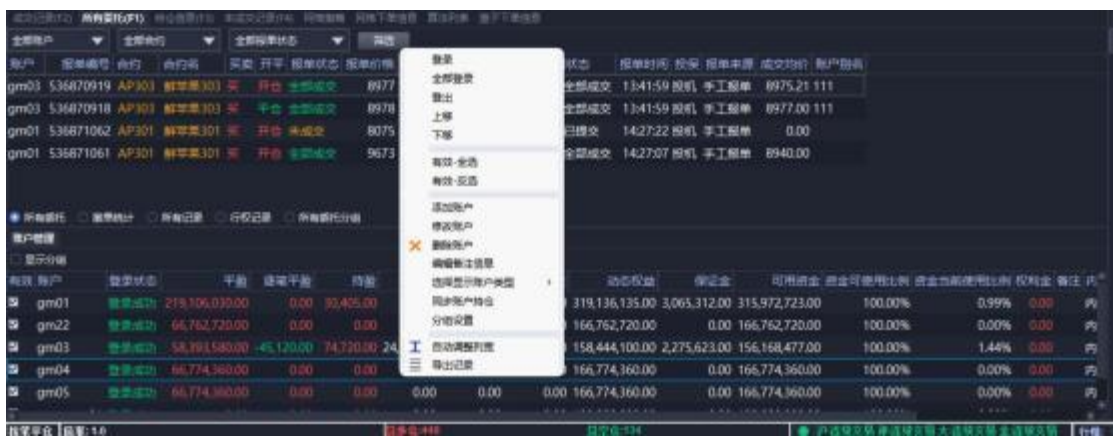
【账户管理】面板包括：登录、全部登录、登出、上移、下移；有效-全选、有效-反选；添加账户、修改账户、删除账户、编辑备注信息，选择显示账户类型（多选/单选）、同步账户持仓、分组设置；自动调整列宽、导出记录。

11.2入口路径

1.账户管理面板默认在界面左下方。想要调出（或关闭）可以在右上角系统菜单栏中点击-配置-显示配置-选择显示面板中-勾选账户管理， 点击应用。



2.具体账户管理面板信息可以在【配置-选项-配置弹窗-显示配置-账户管理】中选择是否显示。

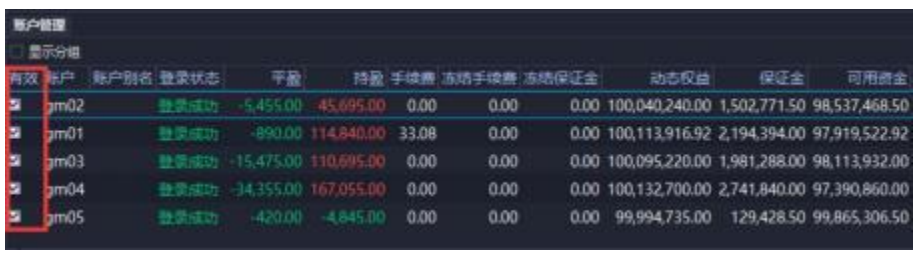


3.在账户面板选中具体行，右键可以调出 11.1 中的功能选项。

11.3使用说明

接下来将对【有效】，【添加账户】，【同步账户持仓】，【分组设置】进行详细说明。

11.3.1 “有效”勾选



1.可以随意取消勾选“有效”选项。登录且勾选有效的账户才能进行报单。

2.取消勾选的账户：

01.不为分组中的参照账户时：按照分组进行下单、改单、分组统计（包括分组、所有委托分组、成交合计分组）时，只对此分组内登录且勾选有效的账户进行操作、记录。

下单时，同未登录一样，未勾选的账户不能进行报单。

账户较多时，右键通过“有效-全选”，“有效-反选”功能更便捷的操作。

02.若取消勾选的账户是此分组中的参照账户：

下单时提示：“请登录且勾选有效的参照账户”。

点击确定或 X 按钮，不进行任何操作。

改单、分组统计（包括分组、所有委托分组、成交合计分组）时，只对此分组内登录且勾选有效的账户进行操作、记录。

11.3.2“选择”勾选

1.与右键“选择显示账户类型”的单选、多选联动。

2.默认不选为都显示。

3.勾选的账户，对全局所有信息类面板进行勾选的账户筛选显示。未勾选的账户，报单不受影响。

11.3.3添加账户

1.在【账户】面板右击， 点击“添加账户” 出现【添加账户】弹窗。

【内盘/外盘】按钮： 用户资料默认选中“内盘” 。

外盘” 显示：当添加的经纪公司中，存在有效添加的外盘经纪公司时，才显示“外盘” 切换按钮。

根据选择的内外盘， 切换【经纪公司】下拉控件展示的名称。

经济公司、账户、密码为必填项， 可以选填账户别名。

2.【经纪公司】控件：

选择【内盘-经纪公司】时， 根据登录界面-【通信配置】配置的交易服务器

柜台类型，经纪公司列表页头相应展示内盘柜台类型：“融航”、“CTP”、“个股期权”、“飞创”、“金仕达”。

默认选中“融航”。选中“融航”时，右侧展示【添加客户编码】按钮，点击出现“添加客户编码”弹窗。

选择【外盘-经纪公司】时，根据配置的交易服务器柜台类型，经纪公司列表页头相应展示外盘柜台类型：“融航外盘”、“SP”，展开时默认选中“融航外盘”。

【账户和密码】：输入相应的账户名称和密码。

11.3.4同步账户持仓

“同步账户持仓”功能让用户可针对 1 个或多个基准账户进行 1 个或多个账户按比例同步持仓的操作，同步账户的具体持仓=基准账户所有持仓合约手数*倍率。对基准账户（若为多个即多个基准账户持仓相加）设定的倍率（0.00≤倍率≤1000.00），对应被同步账户进行开仓（或平仓）操作，达到与基准账户设

置的倍率。

e.g. 基准账户持有合约 a、合约 b、合约 c 分别 1、2、3 手，倍率为 2，则同步账户的持仓将为合约 a、合约 b、合约 c 分别 2、4、6 手。

账户面板右击点击“同步账户持仓”， 出现同步账户持仓弹窗。

初始界面不展示字段。登录成功后，基准账户默认为账户列表排序中第一个账户名称。

选择基准账户，输入倍率，选择价格类型，输入超价 tick（此项非必填），左下角会刷新“总持仓”和“持仓市值”。

【价格类型】：当展示对手价时，以 FAK（部分成交立撤）报单；当展示市价时，超价 tick 禁用；当一个或多个合约无法使用市价下单时，将以涨跌停价报单。

【同步账户】点击“添加”展示【添加同步账户】弹窗，进行同步账户的选择操作（除已选基准账户）。

【同步】：单击“同步”按钮将对同步账户列表选中项进行进行同步操作。

如图中*倍率 这个位置的数值，进行统一的同步。

【按最后倍率同步】：单击“按最后倍率同步”按钮将对同步账户列表选中项进行数据验证后进行同步操作，如图中“最后同步倍率”列 ，对应一个或多个账户，最后同步倍率可以为不同数值。若一个或多个同步账户最后同步倍率无数据时，将出现提示确认弹窗。

联动记忆：若*基准账户的账户曾同步过（曾经同步/按最后倍率同步过），再次选中同步过的其中一个基准账户，在此界面的*同步账户中自动展示并勾选中最后一次匹配的同步账户。

e.g. 当基准账户 2、同步账户 3；基准账户 1，2、同步账户 4，5；当基准账户再次选中 2 时，同步账户自动勾选 4，5。

【同步确认】弹窗：如无特殊情况，点击“同步”或“按最后倍率同步”按钮，将展示【同步确认】弹窗，点击“确定”则进行同步操作。

11.3.5分组设置

同 9.3.5 分组设置，详见前文。

12、行情面板

12.1功能点简介

行情面板包括：普通行情、套利行情、篮子行情和期权行情面板。

12.2入口路径

行情面板默认在界面的最上方，可以通过系统菜单栏中【配置-显示配置-选择显示面板】勾选调出。

12.3使用说明

12.3.1普通行情

1.用户在普通行情可以直接查看行情盘口信息，双击空白处可添加合约（合约名称按交易所不同区分大小写），右键可以设置默认手数，删除合约，K 线，多股同列，行情组配置，行情排序，闪电点价等操作。拖拽整行可调整顺序。

2.可以通过右键-行情组配置（或菜单栏的配置-行情组）添加/删除行情组和合约。也可以选中具体合约按键盘上的“Delete”键删除合约。

3.可以通过鼠标拖拽合约排序。

4.可以通过 9.3.5 分组设置实现单、多账户批量同步下单。

5.行情组会展示在【普通行情】下方。

6.【闪电点价】详情可见本文 14.3.10【闪电点价】下单板中的普通合约【闪电点价】和标准套利合约【闪电点击】。

12.3.2**套利行情**

1.【套利行情】面板显示套利类策略信息，包括自设套利和标准套利。

2.可以通过鼠标拖拽合约排序。

3.标准套利行情的添加可以从套利行情面板-右键-【标准套利合约配置】，勾选合约进行添加。

4. 自设套利策略行情添加可以从套利行情面板-右键-添加策略里进行 2～3 腿策略的添加。（或从右上菜单栏【套利】-【添加策略】中进行添加，同 8.3。

自设套利下单详情可参见 15.3.5 信息类面板-【自设套利】。）

4. 自设套利的修改策略在行情面板-右键-修改策略，标准套利策略不能修改。

12.3.3篮子行情

1.篮子行情包括篮子下单策略的显示。

2.在篮子行情-右键可以添加策略、复制策略、修改策略、删除策略； 自动调整列宽的功能。

3.信息类面板-【篮子下单信息】可参见 15.3.12，【篮子下单】下单板可参见 14.3.9。更详细的篮子下单整体流程可参考本文-18【篮子下单】策略下单整体流程。

12.3.4**期权行情**

1.T 型报价： 期权合约由于有认沽认购两种形式， 因此， 交易方向由期货的开、平双向，变成了四个方向。随心易的期权交易界面提供 T 型报价，可直接抓取合约，并配合特有的下单板和组合报单板两种不同风格的下单模式，让投资者在不需要改变期货交易操作习惯的前提下， 更便捷的交易期权。

2.选择标的后，可以进行勾选，并在 14.3.11【组合报单】面板中进行操作。

3.选择完具体的标的合约，若没有价格展示，右键可以进行期权“询价”功能。

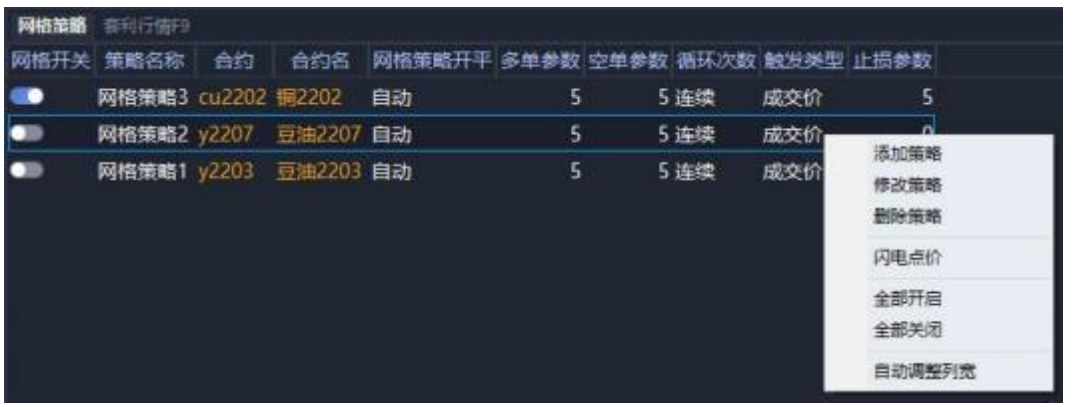
多账户时，询价账户默认为“登录且有效”的第一个账户（期权询价是指在当市场没有出现报价、只有单边报价或者双边报价价差太大的情形，投资者可向做市商询价）。

注意：询价计算交易所申报费品种信息量，请合理进行询价次数。

4.右键-显示/隐藏 列表字段，可以进行勾选调整字段展示内容（看涨、看跌字段显示一致）。

13、策略面板

13.1.1网格策略



1.此面板为【网格策略】主模板的设置的入口：添加、修改、删除都在这个界面进行设置（已设置并报单的网格策略信息展示在 15.3.13【网格下单信息】面板）。

2.右键功能包括：添加策略、修改策略、删除策略；自动调整列宽。

3.网格策略的设置与之前的报单无关联，修改、删除不影响已报的单子，仅对修改后下一次的报单产生影响。

4.开启中的网格策略，默认只能从【闪电点价】报单进行触发网格，添加策略时，可以设置本地条件单、本地预埋单进行网格触发。

5.更详细的网格策略讲解，可以详见本文 19【网格策略】策略下单整体流程。

14、下单板

14.1功能点简介

随心易共有 11 款针对期货期权的下单板，包括：标准下单板、两键下单板、三键下单板、六键下单板、预埋单下单板、条件单下单板、自设套利下单板、标准套利下单板、篮子下单、闪电点价、组合报单。

14.2入口路径

下单板基本可以在操作区找到，点击“+”进行切换。

键盘 Tab 键可以对下单板的部分下拉项快捷展开切换，切换选中到下单按钮+Enter 可以进行发出报单操作。

【闪电点价】下单板在普通行情面板右键找到，详情可见本文 14.3.10。

【组合报单】下单板在【配置-选项-显示配置-勾选：组合报单】后可以展现。也可以点击界面左上角快捷按钮“期权页”展现。详情可见本文 14.3.11。

14.3使用说明

14.3.1【标准】下单板

标准下单板有上图功能。

14.3.1.1标准下单板支持设置拆单算法

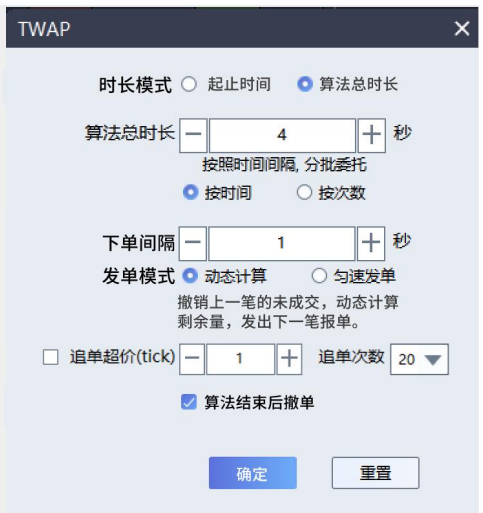
01、指令执行账号登录随心易，支持使用拆单算法。即每一笔委托按照拆单设置自动拆分多笔，输入指定的拆单数量后，按每笔指定数量拆单。

02、若下单板信息无误，则出现下单确认弹窗：

14.3.1.2标准下单板支持TWAP智能算法

1.TWAP 支持与标准下单板叠加使用。在标准下单板设置价格等参数，在 TWAP 中设置算法信息后，在标准下单板点击“下单”按钮下单。

点击“TWAP”后，显示TWAP设置弹窗：



2.下单成功后，提示“下单成功，详细信息展示在：算法列表”。

14.3.1.1止盈止损

止盈止损有 2 种方式进行设置，对品种进行设置可以在配置项，参考本文【9.3.1.1 交易-止盈止损】内容，配置项的设置好后，需要结合下单板（目前支持：标准、两键、三键、六键）勾选“自动止盈”或“自动止损”进行下单。

第二种方式是可以对已有的持仓进行止盈止损，下文将会详细介绍，这 2 种设置不冲突，谁先到达就先触发。

在标准下单板点击【止盈止损】： 同 15.3.3 信息类面板-【持仓信息】中右键【设置止盈止损】。

填入账户/分组，合约，选择平仓类型（设置止盈止损的对应仓位），填入手数，触发价格（行情突破价格后），执行价，有效日期，就可以设置好止盈止损单。

此面板的止盈止损设置与【配置-选项-交易-止盈止损】中的配置不冲突，若都设置，谁先到达触发谁。

如上图，对 cu2109 合约**平多仓**进行止盈止损设置，基准价为最新价，设为 69310。勾选并输入自定义止损设置：最新价小于等于↘69280 平仓，平仓时以最新价超 0tick 价位委托。

勾选并输入自定义止盈设置：最新价大于等于↗69420 平仓，平仓时，以最新价超 0 价位委托。

有效日期：当日。

因为 cu 的一个 tick 是 10（最小变动价位 10 元/吨），所以按钮“-”、“+”都为 1 个 tick=10 价位的变化。

浮动止损：如上图，对 cu2112 合约**平空仓 1 手**进行止盈止损设置，基准价为最新价 69440。

勾选并输入自定义止损设置：最新价大于等于↗69460 平仓，平仓时以最新价超 0tick 价位委托。

勾选： 当最新价向下跌破 69420 回撤 1 个 tick 止盈。

不勾选止盈设置。

有效日期： 当日。

此时若价格下跌为 69410， 突破了 69420 价格，仍然在下跌， 此时浮动止盈开启， 当价格下跌到 69390 时， 开始上涨， 此时启动浮动止盈回撤 1 个 tick 平空仓， 即 69400 平空仓 1 手。

若是勾选按分组，这里手数同下单板的分组设置类似，是对组内每一个账户

进行这个数量的止盈止损，不是总数量均分。若设置的数量超出其中部分账户的持仓，会对这部分账户的此合约最大仓位持仓平仓，不影响设置，也不会导致持仓少的账户一笔都平不掉。

对已有持仓的止盈止损设置，未触发时会显示在 15.3.7【止盈止损】信息展示类面板-所有里， 已触发在“显示已触发”分类。

同时【所有委托】内也会有报单来源标识。

直连柜台账户初次开启服务器单时（例如这里的，服务器止盈止损），需要先对登录的对应账户进行授权，授权会有弹窗展示随心易相关的《服务器单使用同意书》， 授权后才可报服务器单。

14.3.2【两键】下单板

两键下单板有上图功能。

14.3.3【三键】下单板

三键下单板有上图功能。

14.3.4【六键】下单板

六键下单板有上图功能。

14.3.4.1ETF 期权合约-市价

在【标准、两键、三键、六键】下单板输入 ETF 期权合约，选择"市价"

指令：

01.按对应合约的最优模式进行报单：

深圳 ETF 期权合约，“市价”最优模式为 FOK 模式。FOK 优于 GFD 模式。

上海 ETF 期权合约，“市价”最优模式为 FAK 模式。FAK 优于 FOK，FOK 优于 GFD 模式。

02、选择“市价”时，支持选择是否勾选FOK、FAK。当只选择市价，即市价GFD模式。FOK、FAK不支持同时勾选。若所选合约不支持FOK、FAK，在下单时提示“XX合约不支持FAK/FOK委托方式，是否继续报单？”选择“是”继续报单，选择“否”不做任何操作。

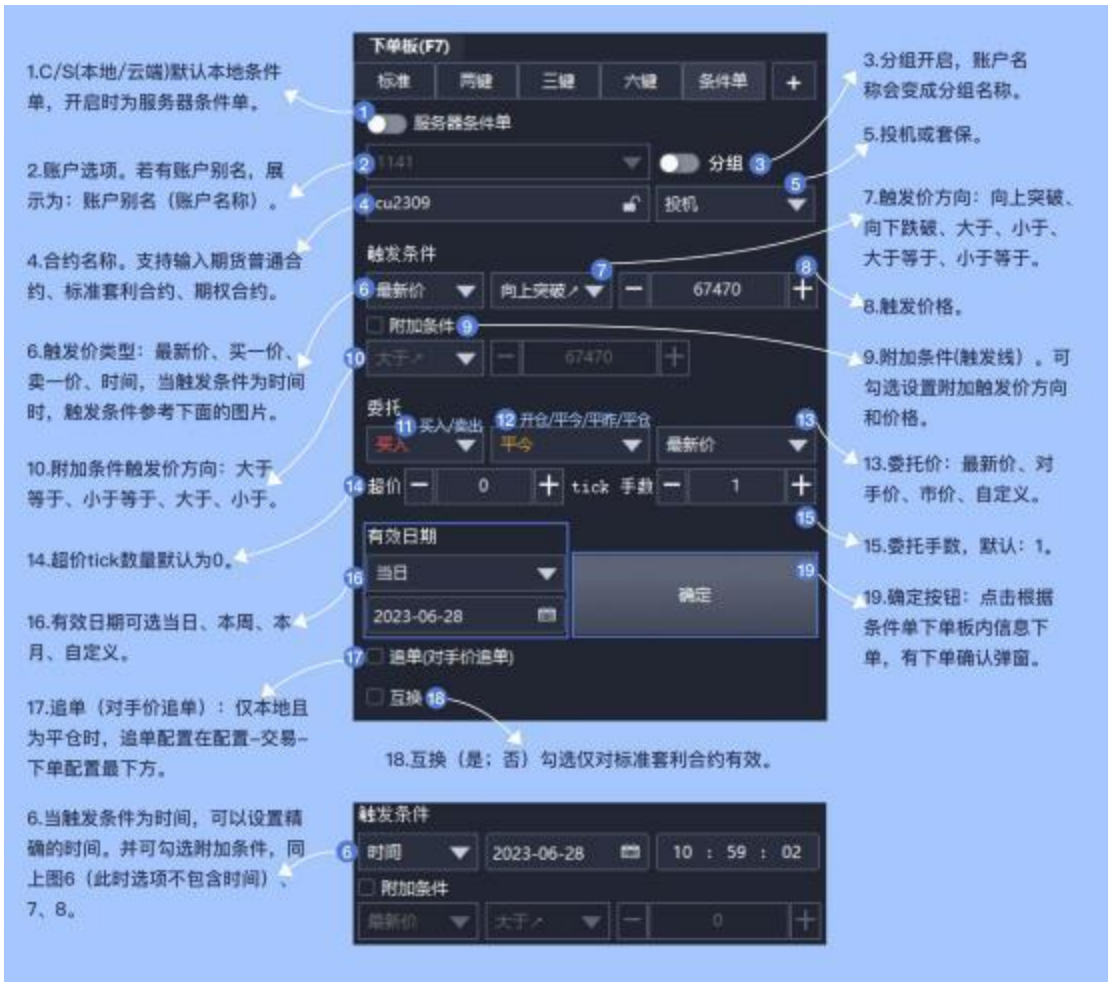
2.在【标准、两键、三键、六键】下单板输入 ETF 期权合约，选择限价指令，即“指定价”、“对手价”、“排队价”、“最新价”、“超价”、“涨停价”、“跌停价”时，只有 GFD 模式。

14.3.5【预埋单】下单板

预埋单下单板有上图功能。

直连柜台账户服务器单初次开启时（例如这里服务器预埋单），需要先对登录的对应账户进行授权，授权会有弹窗展示随心易相关的《服务器单使用同意书》，授权后才可报服务器单。

14.3.6【条件单】下单板



条件单下单板有上图功能。

直连柜台账户服务器单初次开启时（例如这里服务器条件单），需要先对登录的对应账户进行授权，授权会有弹窗展示随心易相关的《服务器单使用同意书》， 授权后才可报服务器单。

若希望下次登录随心易客户端时，记录上次设置的有效日期数据。那么日期选择“自定义”选项，同时选择很久之后的日期，该设置将被保存。

14.3.6.1 支持价格区间条件单， 防止条件单策略偏离预期价格范围

1、在【条件单下单板】中，价格条件单（最新价、买一价、卖一价）和时间条件单均显示【附加条件】单选字段，勾选【附加条件】后，设置新的触发条件。

2、当选择价格条件单，第一个价格条件选择框 的下拉菜单显示【向上突破】、【向下跌破】、【大于】、【小于】、【大于等于】和【小于等于】；第二个价格条件选择框 的下拉菜单显示【大于】、【小于】、【大于等于】和【小于等于】。

3、01.当 2 个价格触发条件设置有误，在下单板点击【确定】之后，显示弹窗，弹窗字段为：触发条件的两个价格条件必须形成一个价格范围。

02.当 2 个价格触发条件设置与最新行情价格相同，在下单板点击【确定】之后，显示弹窗，弹窗字段为：当前行情已满足条件，是否继续执行条件单？点击“是”按钮将立即触发条件单。

点击【否】或【✖】， 取消下单；点击【是】， 显示【下单确认】弹窗。弹窗内容为：弹窗内容为：合约、交易账户、触发类型、委托价格、有效日期、买卖、开平、数量和投保，并显示相关详情信息。点击【确定】， 下单成功。点击【取消】或【✖】， 取消下单。

03.当 2 个价格触发条件设置正确（不同于最新行情价格且在合理触发条件区间内），在下单板点击【确定】之后，显示【下单确认】弹窗，弹窗内容为：合约、交易账户、

触发类型、委托价格、有效日期、买卖、开平、数量和投保，并显示相关详情信息。点击【确定】， 下单成功。点击【取消】或【✖】， 取消下单。

4、下单板【附加条件】设置后，在【条件单】信息面板右键选择【条件单改单】， 显示的【条件单改单】弹窗显示下单板中设置的价格区间信息。在【条件单改单】弹窗，只能调整触发条件的两种价格，价格类型和条件无法修改。点击【确定】， 保存改单信息。点击【取消】或【✖】， 仍为下单板条件单设置的触发条件。

14.3.7【自设套利】下单板 (HOT)

1、自设套利下单板有上图功能。

2、支持服务器自设套利通过指令下单。

14.3.8【标准套利】下单板（HOT）

标准套利下单板有上图功能。

14.3.8.1标准套利： 互换功能

对标准套利进行快速的一开一平报单。

以下单板开平设置为第一腿开平， 第二腿开平相反。

14.3.8.2标准套利： 锁仓功能（HOT）

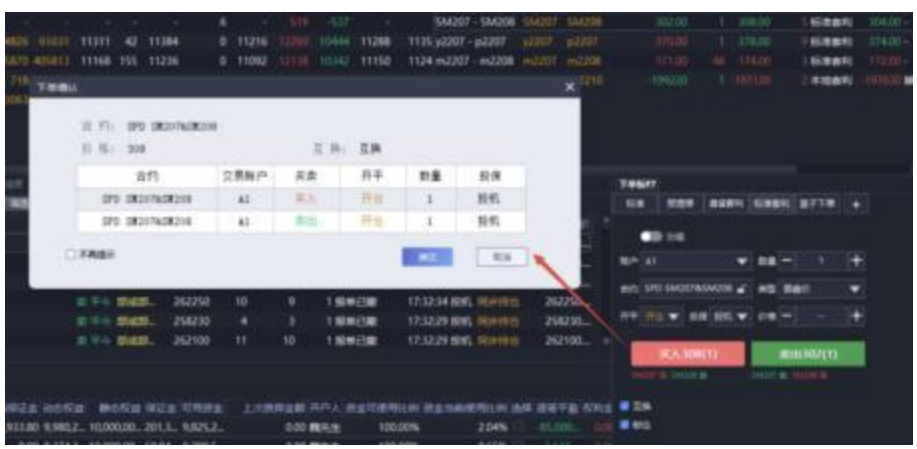
手工交易员想要做同时两个方向的标准套利，满足交易所持仓返还业务（具体套利品种、返还细节， 因变动较多，请以最新的交易所规则为准）。手工报单容易有时间差，而计算机进行的标准套利锁仓功能，可以达到同时发出，时间差小到忽略不记。

1、下单时会对标准套利合约进行买、卖不同方向的 2 笔报单（价格、开平、数量、投保相同），锁仓套利对的成交会尽可能规避滑点。

2、标准套利合约是大商所、郑商所提供：标准的套利指令。

3、成交均价若与套利委托的价格（跟盘价、指定价）不同，也是往标准套利有利的价格成交，不会往标准套利的不利方向成交。

14.3.8.3标准套利：互换+锁仓功能



可以支持标准套利互换+锁仓功能进行报单，即标准套利每腿开平不同（以下单板设置的开平为标准套利合约第一腿开平，第二腿相反），报出对应的买卖标准套利单。

互换功能涉及到有平仓腿，需要注意持仓状态。

以上的功能支持所有交易所的标准套利合约（包括：大商所、郑商所的所有标准套利指令）。

14.3.9【篮子下单】下单板

【篮子下单】下单板有上图功能。

若篮子策略是期货合约+ETF 期权合约，对应的篮子下单板就会变成上图样式，对应的期货合约就会报到期货账户，ETF 期权合约报到 ETF 账户。期货和 ETF 期权合约的篮子策略暂不支持分组报单模式。

“总份数”与“单一份数”的区别：

总份数为此次下单总共的数量。

例如：当**总份数为：2**，触发条件为：最新价值，大于等于，价值方案：价

值递增，最低价值： 10.00，最高价值： 100.00，价值步长 10.00 时，点击买入，从起始价值 10.00 开始买，若买不到就按照价值递增 10.00 下单，在不超过最高价值 100.00， 只要下单份额总共为 2 份， 就算完成下单。

单一份数： 若价值方案为“价值递增/价值递减/偏离值递增/偏离值递减”，则根据“价值步长/偏离值步长”进行每一步长的份数下单。

例如： 当**单一份数为： 2**，触发条件为： 最新价值， 大于等于， 价值方案： 价值递增， 最低价值： 10.00， 最高价值： 100.00， 价值步长 10.00 时， 点击买入， 即每个价值步长下单 2 份，从起始价值 10.00 到最高价值 100.00，总共 10 个步长，总共买 20 份。

选择策略填好信息后，下单板点击【买入】/ 【卖出】， 根据策略弹出【下单确认】提示。

14.3.10【闪电点价】下单板 (HOT)

14.3.10.1普通合约【闪电点价】

对于普通合约，在【普通行情】面板选中右键-闪电点价。

1.普通合约【闪电点价】下单板可以实现单/多账户报单模式。

2.普通合约【闪电点价】支持：挂单后拖拽改价。

3.普通合约【闪电点价】支持：挂单后双击撤单。

4.普通合约【闪电点价】支持： 五档行情显示（根据具体行情源）。

5.支持自定义点价栏位：开启后可以自定义设置间隔更多的 tick 值，设置可直接影响界面， 减少翻滚点价栏位。关闭即恢复默认 1tick。

6.普通合约【闪电点价】支持： 多个闪电点价下单板同时在线。

7.普通合约【闪电点价】下单板有上图功能。支持鼠标滑滚翻滚价格行情。

8.支持网格策略功能。详见本文 19【网格策略】策略下单整体流程。

9.支持智能算法：冰山指令、TWAP、VWAP。详见本文 20【智能算法】算法下单整体流程。

10.支持梯度扫盘指令：详情可参考本文 21-梯度扫盘指令。

14.3.10.2标准套利合约【闪电点价】

对于标准套利合约【闪电点价】， 入口可以是普通行情面板，选中右键-闪电点价；

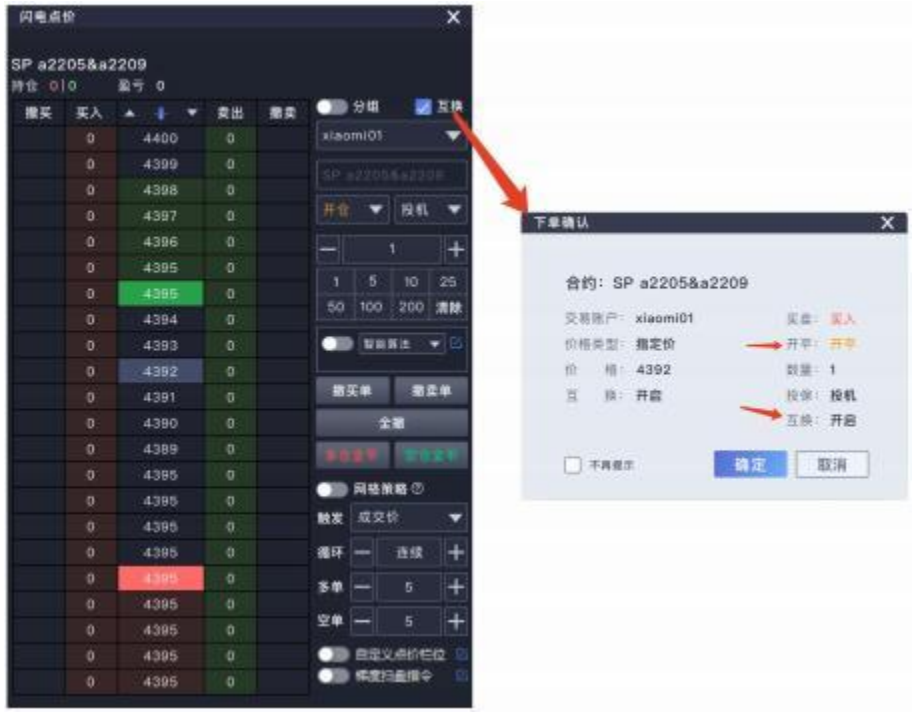
也可以在套利行情中选中标准套利合约， 右键-闪电点价。

1.标准套利合约【闪电点价】可以实现单/多账户报单模式。

2.标准套利合约【闪电点价】支持：挂单后拖拽改价。

3.标准套利合约【闪电点价】支持：挂单后双击撤单。

4.支持自定义点价栏位：开启后可以自定义设置间隔更多的 tick 值，设置可直接影响界面， 减少翻滚点价栏位。关闭即恢复默认 1tick。



5.支持标准套利互换单。

即： 第一腿合约与下单板设置的开平属性相同， 第二腿为相反属性。

6.标准套利合约【闪电点价】支持： 多个闪电点价下单板同时在线。

7.标准套利合约【闪电点价】下单板有上图功能。8.支持鼠标滑滚翻滚价格行情。

8.支持网格策略功能。详见本文 19【网格策略】策略下单整体流程。

9.支持智能算法：冰山指令、TWAP。详见本文 20【智能算法】算法下单整体流程。

10.支持梯度扫盘指令：详情可参考本文 21-梯度扫盘指令。

14.3.10.3自设套利策略【闪电点价】

对于自设套利策略【闪电点价】， 入口是在【套利行情】面板，选中自设套利策略右键-闪电点价。

1. 自设套利策略【闪电点价】可以实现单/多账户报单模式。

2. 自设套利策略【闪电点价】支持：挂单后拖拽改价（注：这里的改价、撤单，统计的都是此账户套利策略：未成交的份数）。

3. 自设套利策略【闪电点价】支持：挂单后双击撤单。

4.支持开平- 自定义、合约信息展示

01、默认按照策略设置的每腿开平执行。

02、合约信息展开可以显示对应每腿合约信息，可以更改投保、开平（开平为自定义时）属性。便于在闪电点价下单板做移仓换月功能。

5.支持自定义价差栏位：开启后可以自定义设置套利策略点价面板间隔价差值，直接影响点价界面，减少翻滚点价栏位。关闭即恢复正常价差。

6. 自设套利策略【闪电点价】支持：多个闪电点价下单板同时在线。

7. 自设套利策略【闪电点价】下单板有上图功能。支持鼠标滑滚翻滚价格行情。

8. 自设套利的网格策略详见本文 19【网格策略】策略下单整体流程。

9.支持梯度扫盘指令， 详见本文 21【扫盘指令】。

14.3.11【组合报单】下单板

1.在 12.3.4【期权行情】中的信息会联动显示在【组合报单】下单板中，在【组合报单】中可以进行一键下单、选中下单的快捷操作。也可以做重置、选中删除、加入标的、添加合约、买卖反向等操作。

2.【组合报单】支持改单，单击具体行的行权价、合约类别、买卖、开平、价格类别、数量进行改单。

3. 点击添加合约，可以自定义添加期货类合约形成组合报单。

15、信息类面板

15.1功能点简介

1、随心易的信息类面板，主要包括：所有委托，成交记录，持仓信息，未成交记录， 自设套利，预埋单，平仓信息，止盈止损，条件单，篮子下单信息， 网格

下单信息，盈亏分析，Delta，算法列表。

2.在具有合约筛选功能的信息面板，输入一个合约后，系统会从所选账户中持有的合约中进行筛选，在选中的信息面板中显示与输入合约匹配的合约。例如：“持仓信息”面板、“所有委托”面板、“成交记录”面板、“未成交记录”面板、“预埋单”面板、“条件单”和“自设套利”信息面板等。

3、在“所有委托”“未成交记录”“成交记录”“持仓信息”信息面板的筛选按钮前显示“输入关键字查询”输入框。支持模糊搜索、智能匹配。

03、信息类面板筛选功能：支持多选筛选，点击左侧复选框勾选多选，点击筛选进行展示。**若习惯为单选，点击右侧文字可快速单选切换。**

04、若筛选后右键“导出记录”，导出的表格为筛选后信息（所见即所得）。

15.2入口路径

配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-选择显示面板-窗口热键配置-是否显示。

15.3使用说明

信息类面板目前总共有 14 个面板，包括：【所有委托】面板，【成交记录】面板，【持仓信息】面板，【未成交记录】面板，【自设套利】面板，【预埋单】面板，【止盈止损】面板，【平仓信息】面板，【条件单】面板，【盈亏分析】面板，【 Delta】面板，【篮子下单信息】面板，【网格下单信息】面板，【算法列表】面板。

15.3.1信息类面板-【所有委托】

1.在每一次交易后都会产生相应的委托项并记录在所有委托窗口中。所有委托窗口会显示每笔委托的当前状态，给用户一个直观的显示。用户也可以在表头根据账户或合约输入框进行**筛选**相关**账户/合约/报单状态**的委托信息。

2.【所有委托】面板内单选“所有委托”和“所有记录”页面内，右键可以快捷撤单。左下角单选项可以切换到撤单统计栏，显示出当前每个合约品种的撤单次数统计。同时，可以查看所有记录，行权记录。

3.【所有委托】中不仅有所有委托界面。还可以在左下角切换为撤单统计、所有记录、行权记录、和所有委托分组界面。其中，所有委托、所有记录、所有委托分组中包含对全部账户、全部合约、和全部报单状态的筛选功能。

4.右键包括：撤去选中报单、撤去全部报单、自定义排序、自动调整列宽、导出记录。

自定义排序：是指不仅可以对单一表头进行升序或降序的排序，可以选择最多 3 个表头进行排序。例如：主排序列优先，若主排序一致的情况下，按次级排序列进行排序，若主排序、次排序内容一致，则按照三级排序列进行排序，重启软件后恢复默认排序。

5.所有委托的最大记录可以在配置-选项-【配置】弹窗-系统配置中找到。

6.具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-所有委托，勾选【是否显示】对应的显示信息。

7.【所有委托】报单来源显示“累仓策略”标识。

8.【所有委托】-所有委托、所有记录页面：增加委托金额、成交金额字段。默认不展示，可配置调出。

8.1 委托金额：报单价格 X 委托量 X 合约乘数。

8.2 成交金额：成交价格/成交均价 X 成交量 X 合约乘数。

9.在人员账户登录时，所有委托面板显示“报单人员账户”“报单人员姓名”字段。

15.3.2**信息类面板-【成交记录】**

1.报单成交之后会在成交记录栏显示相应的成交记录。

2.具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-成交记录，勾选【是否显示】对应的显示信息。

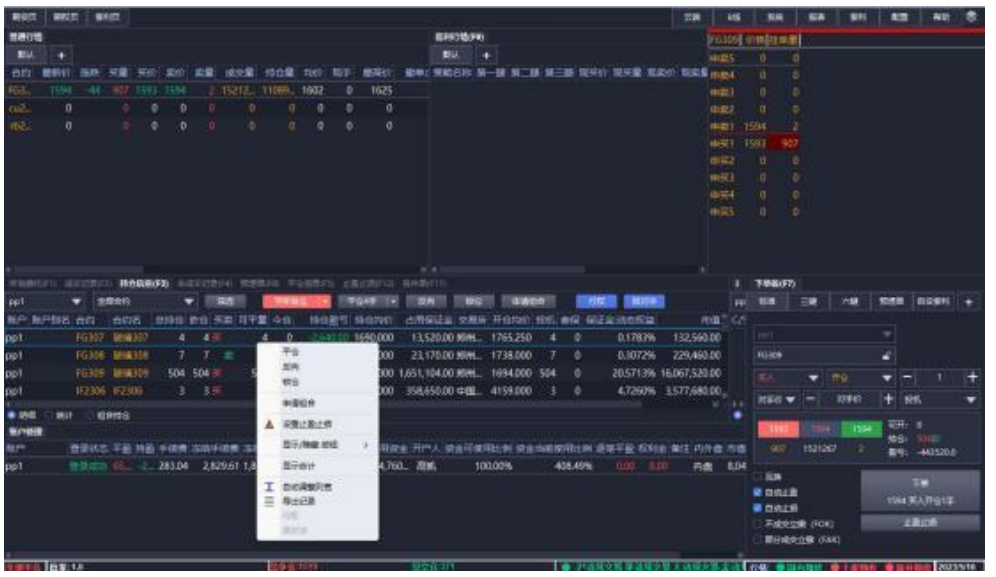
3.成交记录面板左下角具体分为：成交明细、成交合计、显示所有记录、成交合计分组，目前成交明细、显示所有记录页面有对全部账户、全部合约的筛选功能，成交合计分组内有对全部组、全部合约的筛选功能。

4.成交记录右键包括：自定义排序、自动调整列宽、导出记录。

5.成交记录面板-成交明细页面： 增加成交金额字段。默认不展示。

6.在人员账户登录时，成交记录面板显示“报单人员账户” “报单人员姓名”字段。

15.3.3信息类面板-【持仓信息】



1.下单成交后会产生对应的持仓，显示在持仓信息窗口里用于查询和平仓等操作。右键菜单栏：平仓、锁仓、反向； 申请组合；设置止盈止损；显示/隐藏 按钮；显示合计（可勾选，最下方会进行相关数据合计）； 自动调整列宽、导出记录、行权、 自对冲的快捷操作。

2.可以通过对账户、合约筛选（支持多选筛选），进行批量的平所有仓、平筛选比例仓（支持输入自定义比例）、平比例仓、反向、锁仓、申请组合、行权（针对期权合约）的操作。

3.持仓盈亏（实时刷新）是每条持仓盈利情况。

4.持仓面板中针对到交割期限的持仓信息，将以红色背景标注以示提醒。

5.持仓信息面板左下角分为明细、统计、组合持仓（设置【配置项-快捷键配置-鼠标快捷键功能-鼠标点持仓】功能后，可以点击进行填单）、分组的具体页面，明细中可以进行全部账户、全部合约的筛选功能，分组中可以进行全部组、全部合约的筛选功能。

6.具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-持仓信息，勾选【是否显示】对应的显示信息。

7. **申请组合**：支持大商所、广期所商品期货、期权的盘中申请组合，以及ETF 期权合约的持仓进行盘中申请组合、申请拆分，以达到优惠保证金。默认为手动模式。也支持开启自动模式。

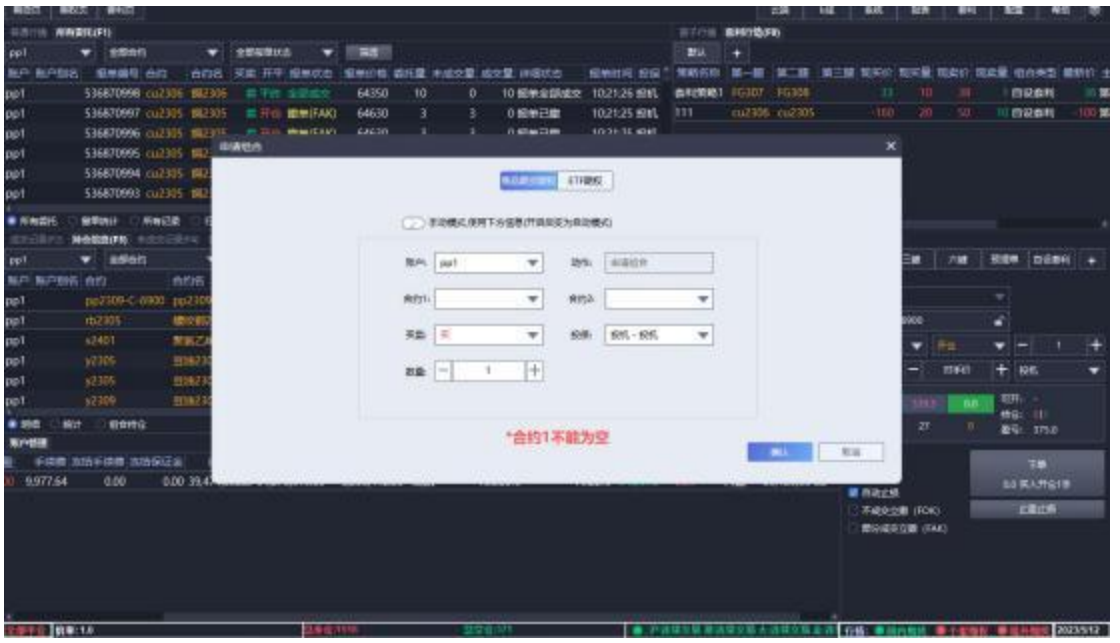
具体盘中组合优惠详见大商所交易所规则-组合保证金业务。

客户在盘中有两种方式享受组合保证金优惠：

一是可以通过套利订单实时享受组合保证金优惠。套利合约需属于优惠组合才可以直接享受保证金优惠；若套利合约不属于优惠组合，则按各单腿计算其保证金，其成交形成的持仓记为各单腿持仓。

二是可以按照交易所规定的组合策略发送组合申请，将单腿持仓进行组合，实时享受保证金优惠。

1、在【持仓信息】面板右击，显示弹窗中选择【申请组合】，选中后弹出【申请组合】弹窗。默认显示“商品期货期权”Tab，可以切换 Tab 键到“ETF 期权”。



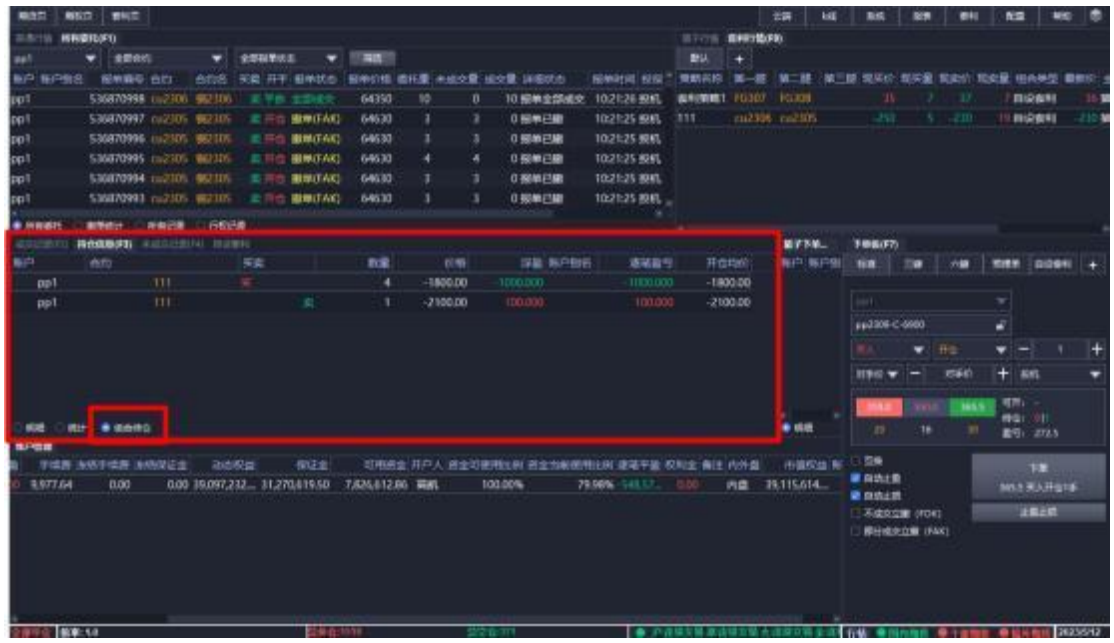
商品期货期权：

01.默认手动模式，根据自己的需求填入页面信息后，点击【确认】， 发出组合申请 。点击【取消】或“X”按钮，关闭【申请组合】弹窗。

02.若填写信息有误或服务器等原因不支持组合申请，弹窗中会显示红字提示无法组合的原因。

03.开启自动模式后，无需输入/选择信息，点击【确认】后，当持仓变化时会自动组合。

04.点击【确认】， 申请组合成功后的持仓在【持仓信息】面板底部的【组合持仓】中展示。



ETF 期权：

可以满足上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所相关股票期权组合策略业务。

【申请组合】弹窗切换 Tab 到“ETF 期权”， 通过选择单选项，可以切换“申请组合”、“申请拆分”弹窗内容。

账户	组合策略类型	合约名	合约	持仓数量	可用	节约保证金（每组）
1358（账户...	认购牛市价差（CNSJC）	50ETF购9月3400&50ETF购9月3500	SH 10003205 & SH 1003206	2/2	2	14128.80
1358（账户...	认沽熊市价差（PXSJC）	50ETF购9月3200&50ETF购9月3500	SH 10003305 & SH 1003206	2/2	2	14128.80
1358（账户...	认沽牛市价差（PNSJC）	50ETF购9月3200&50ETF购9月3100	SH 10003305 & SH 1003241	2/2	2	12043.20
1358（账户...	认购熊市价差（CXSJC）	50ETF购8月3300&50ETF购8月3400	SH 10003463 & SH 1003464	2/2	2	10208.40
1358（账户...	跨式空头（KS）	50ETF购8月3300&50ETF购8月3600	SH 10003463 & SH 1003466	2/2	2	6637.20
1358（账户...	宽跨式空头（KKS）	50ETF购8月3500&50ETF购8月3600	SH 10003465 & SH 1003466	2/2	2	6637.20
1358（账户...	认购牛市价差（CNSJC）	50ETF购7月3300&50ETF购7月3600	SH 10003463 & SH 1003466	2/2	2	6637.20
1358（账户...	认购牛市价差（CNSJC）	50ETF购7月3500&50ETF购7月3600	SH 10003465 & SH 1003466	2/2	2	6637.20

*双击可快捷组合（按可用数量）

✇ ETF 期权-申请组合：

有可组合的持仓会显示在此弹窗列表，按“节约保证金（每组）”从大到小排序。

01.可以通过“账户”、“组合策略类型”、“合约名/合约”的关键词，筛选可组合合约的信息。

02.双击可以快捷组合（此时按可用数量，可以直接组合，组合成功的可以在申请拆分页面看到，也可以再申请拆分）。

03.选中列表中有数据的行，点击“申请组合”按钮，弹出“组合数量（账户：具体账户名称）”弹窗。在此弹窗可以进行选中合约，组合数量的选择。

04.选择好组合数量点击“确定”，没有错误提示会弹出最终的“组合确认”弹窗。点击“确定”，进行组合操作。点击“取消”或 X，不进行任何操作。

ETF 期权-申请拆分：

有可拆分的持仓会显示在此弹窗列表，按“拆仓后加收保证金”从大到小排序。

01.可以通过“账户”、“组合策略类型”、“合约名/合约”的关键词，筛选可拆分合约的信息。

02.双击可以快捷拆分（此时按可拆数量，可以直接拆分，拆分成功的可以在申请组合页面看到，也可以再申请组合）。

03.此弹窗表格的“占用保证金”、“拆仓后加收保证金”，均按照可拆数量进行计算。

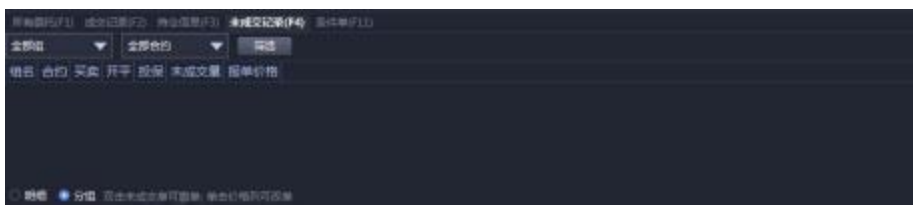
04.选中列表中有数据的行，点击“申请拆分”按钮，弹出“拆分数量（账户：具体账户名称）”弹窗。在此弹窗可以进行选中合约，拆分数量的选择。

05.选择好拆分数量点击“确定”，没有错误提示会弹出最终的“组合确认”弹窗。点击“确定”，进行组合操作。点击“取消”或 X，不进行任何操作。

15.3.4信息类面板-【未成交记录】

1.未成交记录面板显示账户所有的挂单信息，可以对不同分组和单个账户进行挂单的筛选和查询。此外可进行快捷撤单和改单操作， 例如； 双击信息撤单；单击价格列可改单，右键二级菜单中包含撤去选中报单、撤去全部报单；预埋撤单（选中）、预埋撤单（所有）；选中到预埋单、全部到预埋单、导出为预埋单表格； 按对手价改单； 禁止改单； 自动调整列宽、导出记录功能。

2.“预埋撤单（选中）、预埋撤单（所有）”，仅当日有效。操作类型为“撤单”，普通的预埋单操作类型为“报单”，仅预埋撤单有具体未成交报单的“报单编号”。



3.未成交记录-明细包含对全部账户和全部合约的筛选，未成交记录-分组中包含对全部组和全部合约的筛选。

4.具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-未成交记录，勾选【是否显示】对应的显示信息。

5.在人员账户登录时，未成交记录面板显示“报单人员账户” “报单人员姓名”字段。

15.3.5信息类面板-【自设套利】 (HOT)

1.在【自设套利】下单板、【自设套利-闪电点价】下单板下单后，“自设套利”面板会显示套利信息。

2.明细、分组都可以对套利进行账户、合约、委托状态的筛选。

3.右键可以进行撤单（选中）、撤单（所有）、展开明细；补齐单腿（选中）、清除单腿（选中）；单腿背景色设置；修改报单数量模式；自定义排序、自动调整列宽、导出记录的快捷操作。

01.补齐单腿（选中）是在自设套利已**终止此套利策略**且有单腿的情况下，忽视滑点以当前的对手价超 1tick 进行补齐；

02.清除单腿（选中）是在自设套利已**终止此套利策略**且有单腿的情况下，对已完成的但未配成对的单进行：忽视滑点以当前的对手价超 1tick 进行平仓。

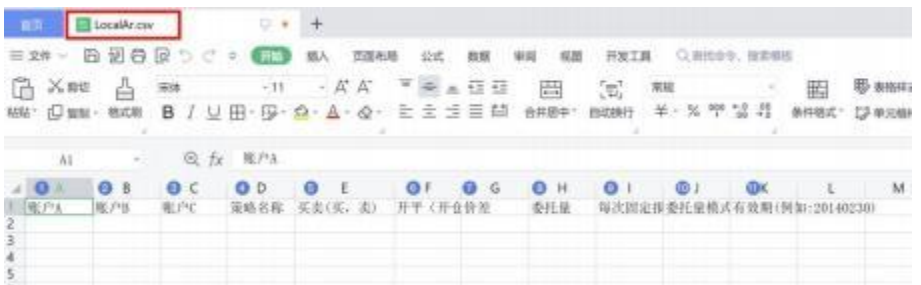
03.单腿背景色设置：可以右键进行颜色设置：默认为跟随系统走，可以根据个人喜好选择：海蓝、酱紫、鲜红中的一种颜色，确定后实时生效。

恢复默认即变回系统默认对应颜色。

4.支持改单，委托状态已排队状态，单击委托价格具体行，可以修改委托价格。

5. 自设套利面板分明细、分组两种类型，每种类型都有全部、未完成、已完

成的面板分类。



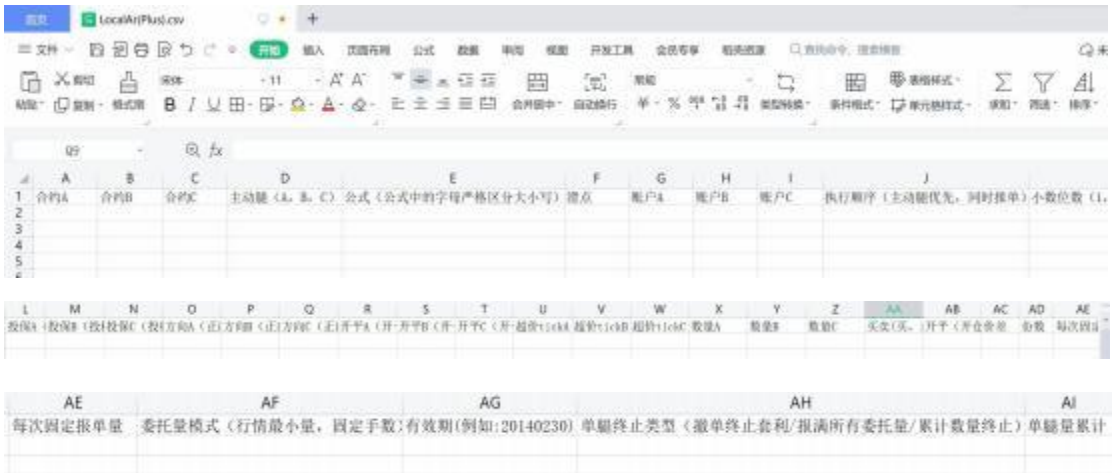
6.【批量导入】：

（1） **LocalAr.csv**：在套利行情添加好自设套利策略后，去安装包找到 LocalAr 命名的 csv 文件，填写好对应的表格内容。列表内文字对应自设套利下单板的内容如上图。

填写好对应的 LocalAr 自设套利**批量导入** csv 文档内容，保存后关闭表格。

批量导入有问题会提示，可以选择继续报正确单，并生成同名称的 csv 文件副本到指定文件夹。

在【自设套利】信息面板内点击**批量导入**，就可以进行一键批量下单。



(2) LocalAr(Plus).csv：这个表格可以直接添加套利策略的属性、下单属性，导入时直接进行套利下单。此表格生成的策略不会生成到【套利行情】中，直接报单到【自设套利】面板，后台记录策略。表格中没有填写的属性，按照版本当前默认值处理。此表格不支持自定义模式套利生成、导入。

需要填写的信息为套利生成策略、以及下单板的属性。填写好对应的 LocalArPlus.csv 文档内容，保存后关闭表格。

在【自设套利】面板点击“批量导入”按钮，打开刚刚填写保存好的 LocalAr（Plus），如有问题会进行错误提示，可以选择继续报正确单，并生成同名称的

csv 文件副本到指定文件夹。成功的导入会直接进行套利报单，可以在自设套利信息面板查看。但是并不会生成策略到【套利行情】面板，是一个快捷下单操作。

7.【自设套利】面板，具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置- 自设套利，勾选【是否显示】对应的显示信息。

8.在人员账户登录时，自设套利面板显示“报单人员账户” “报单人员姓名”字段。

15.3.6**信息类面板-【预埋单】**

1.在【预埋单】下单板中下单或批量导入的信息会展示此面板。

2.在【未成交记录】面板进行“预埋撤单功能（选中）/（所有）、选中/全部到预埋单”，也会展示在【预埋单】面板。左下角单选项可以选择所有或分组查看。

3.可在开盘前通过本地或服务器预埋**报单**，当开盘时对有效预埋单自动发出。或在盘中预埋多笔报单，等待合适的时机触发。

4.可查看服务器/本地预埋单、勾选是否生效、选择是否开盘发送，也可以全选发送、删除，批量发送、删除和对手价发送，批量导入的功能。

ParkOrders.csv
账户
合约
数量

下单板(F7)
标准
三键
六键
预埋单
自设套利
(本地)重新进入连续交易时
服务器预埋单
分组
FG309
买入
开仓
投机
数量
1
指定价
0.00
可开: 0
持仓: 0|0
盈亏: 0.0
互换
不成交立撤（FOK）
部分成交立撤（FAK）
确定

[只读]ParkOrdersGroup.csv
分组
合约
数量

5.【批量导入】：在安装包内找到 ParkOrders 或分组对应 ParkOrdersGroup 命名的 csv 文件，填写好对应的表格内容。列表内文字对应预埋单下单板的内容如上图。

填写好表格内容，保存后关闭表格。

在预埋单信息面板内点击**批量导入**，就可以进行一键批量下单。有问题会提示，可以选择继续报正确单，并生成同名称的 csv 文件副本到指定文件夹。

6.支持改单，单击价格、数量具体行，可以进行改单。

7.【是否显示】对应的显示信息。具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-预埋单，勾选

8.预埋单支持以涨跌停价格类型进行报出：下单板中，下单条件支持选择【指定价】、【涨停价】或【跌停价】。若选择【涨停价】或【跌停价】，当预埋单触发时将会以触发时的涨/跌停价进行报单。设定的信息在【预埋单】信息面板的【价格】列显示。

01.在【下单板】面板，选择-预埋单，委托价可选择【指定价】、【涨停价】或【跌停价】。

02.选中【涨停价】或【跌停价】进行下单，点击【确定】按钮之后显示【下单确认】弹窗。

03.弹窗中【价格类型】和【价格】显示所选的【指定价】、【涨停价】或【跌停价】。点击【确定】应用当前设置。

04.【预埋单】信息面板，可以看到【价格】显示所选的【指定价】、【涨停价】或【跌停价】。默认按下单最新时间降序排序。

05.【预埋单】面板右击，可以选择【自动调整列宽】，优化列表数据显示。

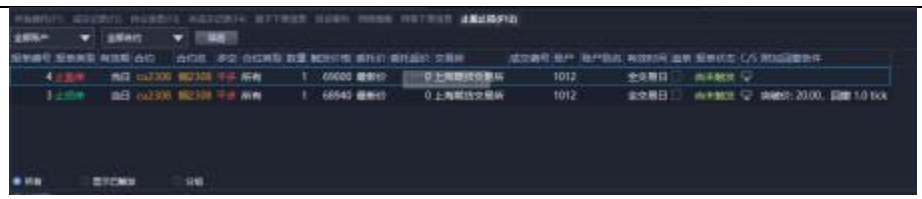
06.预埋单面板中【价格】目录下的数据可以选择修改。例如：点击【涨停价】，显示选择菜单。

07.未触发的预埋单，下次启动时将继续生效。

9. 在人员账户登录时，预埋单面板显示“报单人员账户”“报单人员姓名”字段。

10. 在未成交记录面板右键选择“预埋撤单”时，连续交易、集合竞价时的预埋单都会触发撤单。触发信息显示在预埋单信息面板。

15.3.7信息类面板-【止盈止损】



1.由标准下单板或普通持仓信息面板右键中设置的止盈止损单，信息会显示在此面板。

2.支持改单，在尚未触发状态， 可以单击具体行的数量、触发价格、委托价进行改单。

3.右键可以进行删除、删除所有、禁止改单、激活、停止、全部激活、全部停止等功能。

4.具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-止盈止损，勾选【是否显示】对应的显示信息。

5.在人员账户登录时，止盈止损面板显示“报单人员账户” “报单人员姓名”字段。

15.3.8信息类面板-【平仓信息】

序号	合约	合约名	买卖	数量	平仓价	开仓价	平仓总盈亏	平仓日期	账户	账户别名	逐笔平盈
0	cu2212	cu2212	卖	1	66050.00	66060.00	-50.00	20221212	mncs05		-50.00
1	FG301	玻璃1月	买	1	1457.00	1439.00	-580.00	20221212	mncs05		-360.00
2	cu2212	cu2212	卖	1	66140.00	66160.00	-100.00	20221212	mncs05		-100.00
3	cu2212	cu2212	卖	1	66120.00	66160.00	-200.00	20221212	mncs05		-200.00
4	cu2301	cu2301	买	1	66000.00	64560.00	4,000.00	20221212	mncs05		-7200.00
5	cu2212	cu2212	卖	1	66120.00	66150.00	-150.00	20221212	mncs05		-150.00
6	cu2212	cu2212	买	1	66150.00	65300.00	4,000.00	20221212	mncs05		-4250.00

1.向交易所服务器进行平仓会记录在平仓信息面板内，方便了解账户的单笔盈亏。点击查询按钮进行更新。

2.右键可进行导出记录、 自动调整列宽的操作。

3.具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-平仓信息，勾选【是否显示】对应的显示信息。

15.3.9信息类面板-【条件单】

1.通过 13.3.6【条件单】下单板下单和条件单批量导入的信息会展示在此面板。

2.支持改单，在尚未触发时，可以单击具体行的数量、触发条件、委托价进行修改。

3.右键可进行删除一系列操作、禁止改单、激活、停止等功能。

4.左下角有所有、显示已触发、显示未触发、所有分组的分类。

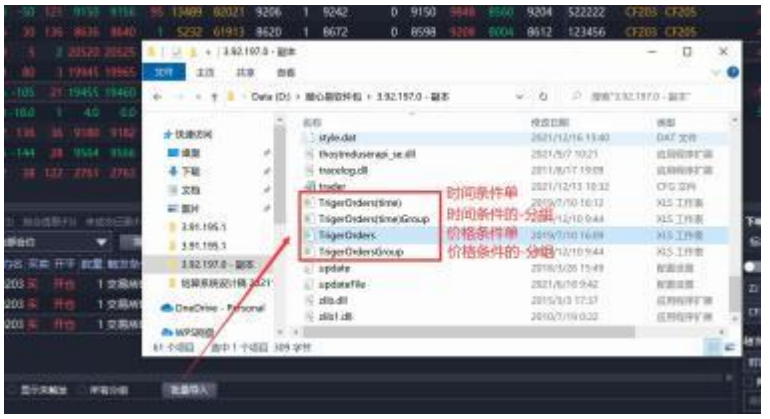
TrigerOrder.csv 对应价格条件单。

TrigerOrderGroup.csv 对应分组价格条件单。

TrigerOrder(time).csv 对应时间条件单。

TrigerOrderGroup(time).csv 对应分组时间条件单。

5.【批量导入】：在安装包内找到 TrigerOrders 命名的 csv 文件，填写好对应的表格内容。列表内文字对应预埋单下单板的内容如上图。



填写好表格内容，保存后关闭表格。

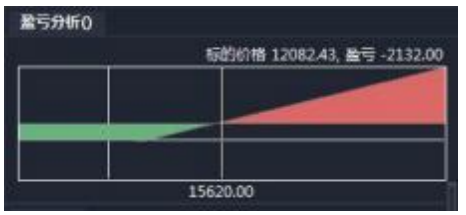
在条件单信息面板内点击批量导入，就可以进行一键批量下单。有问题会提示，可以选择继续报正确单，并生成同名称的 csv 文件副本到指定文件夹。

6.具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-条件单，勾选【是否显示】对应的显示信息。

7.在人员账户登录时，条件单面板显示“报单人员账户”“报单人员姓名”字段。

8.条件单面板-【所有】-客户端重启时展示全部的已触发、未触发条件单。

15.3.10信息类面板-【盈亏分析】



根据期权行情，【盈亏分析】会用红绿颜色显示标的价格和盈亏，通过鼠标光标移动查看。

15.3.11信息类面板-【 Delta】

Delta()

期货价格	Delta	Gamma	Theta	Vega
16245	-0.01	0.00001	-0.84	71.51
15932	-0.01	0.00002	-0.83	76.20
15620	-0.01	0.00002	-0.81	81.82
15308	2.56	0.00026	-56.82	2317.91

【Delta】面板主要包含期货价格、Delta、Gamma、Theta、Vega 参数。

右键可以自动调整列宽，导出记录。

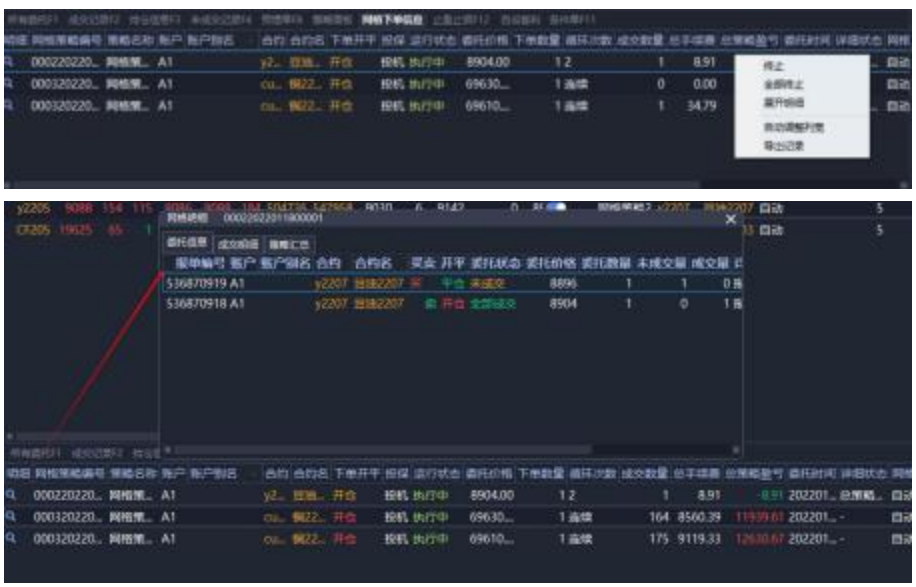
15.3.12信息类面板-【篮子下单信息】

1.【篮子下单】下单板 14.3.9 下单后的记录会显示在此面板中，可以查看全部、未完成、已完成三种分类。

2.右键可以进行撤单（选中）、撤单（全部）、清空、展开明细、修改报单数量模式；自动调整列宽、导出记录的快捷操作。

3.具体的显示信息可以在配置-选项-【配置】弹窗-显示配置-篮子下单信息，勾选【是否显示】对应的显示信息。

15.3.13信息类面板-【网格下单信息】



1.此面板为网格策略的具体报单信息，具体的明细可以点击放大镜或右键-

展开明细，进行进一步的弹窗查看。

2.右键功能包括：终止、全部终止；展开明细；自动调整列宽、导出记录。

3.此界面的信息与【网格策略】面板的设置无关联，仅为已报单的网格策略参数以及运行情况。

4.更详细的网格策略讲解，可以详见本文 19【网格策略】策略下单整体流程。

15.3.14信息类面板-【算法列表】

1、功能介绍：

01.在【闪电点价】开启智能算法，成功下单后会展示在此面板。累仓策略下单后也会展示在该面板。

02.右键功能包括：添加累仓策略、暂停、继续、终止；全部暂停、全部继续、全部终止；自动调整列宽、导出记录。

03.更详细的算法下单，可以参考本文 20【智能算法】算法下单整体流程。

04.累仓策略初始默认展示在累仓策略-全部算法tab，若选择具体标签页，重启恢复选中全部算法。

05.支持未成交改单：在【未成交面板】，手动改单（支持改价格，此面板改数量会终止策略-撤单），成交后策略可以继续执行。

2、入口路径：配置-选项-显示配置-选择显示面板-算法列表；

3、使用说明：

01、运行状态：根据合约状态显示【执行中】、【已完成】、【已终止】三种

02、算法类型：显示当前【累仓策略】。

03、算法编号：策略执行的 13 位编号样式。

04、账户：显示用户账户名称。

05、账户别名：有别名展示别名，无别名为空。

06、合约：显示合约代码。

07、合约名：中文或套利展示。

08、买卖：显示具体优先、反向方向。例如：买卖、卖买，需要给具体颜色。

09、开平：显示**“开:开”**、**“平:平”**；若是上期、能源合约，存在**“平今:平今”**显示。

10、投保：显示“投机:投机”、“套保:套保”。

11、委托价格：显示第一笔委托的具体价格。

12、总委托数量：显示总委托数量=单边总委托数量*2。

当在【算法列表】选中【累仓策略】tab，对应的页面显示内容如上图，增加：

13、买成交量：买方向策略的累计成交量。

14、卖成交量：卖方向策略的累计成交量。

15、触发类型：显示用户自主选择的【对手价】或【排队价】。

16、总触发数量：显示策略累计的总触发数量。

17、单腿量：单边的数量。有单边数量，有背景颜色，且支持右键进行对价超1tick 补齐。

18、执行进度：举例“50/100”，左侧为总成交量 50，右侧为总委托量 100。

19、总手续费：累计总成交的总手续费。

20、总盈亏：同网格策略明细-总策略盈亏。

21、多仓浮盈：多仓方向的浮动盈亏累计。

22、空仓浮盈：空仓方向的浮动盈亏累计。

23、累计价差：（卖方向的成交均价-买方向的成交均价）*min 累仓策略（买方向持仓，卖方向持仓）。正即为赚钱，负为亏钱。

24、算法参数：显示具体设置信息。例如：“1000;100;开仓-开仓;买入;投机-投机;对手价；超价 0tick；收盘前 5 分钟终止：开启。”

在【算法列表】-【累仓策略】tab，点击右键调出弹窗，显示信息如上图所示。

1、**终止/全部终止**：下单默认开启，若手动原因终止，未成交单撤单。若因网络、收盘等异常情况导致的终止，无法撤单。

2、对价超 1tick 补齐：当出现非优先合约未配对时，过程中就可以进行补

齐操作。会先撤单，再以最新的对价超 1tick 进行补齐。若补齐成功，按照设置的参数-对手价/排队价，进行新一轮反向报单。

补齐仅对反向被动腿生效，对优先方向不生效-优先方向可通过未成交-改单价格调整。

2、**单边背景色设置**：当出现单边合约时，底色变深红：类似于套利时的单腿样式。但是分别记录的，与套利不是一个设置，重启也生效。

15.3.14.1累仓策略

1、功能介绍：累仓策略：一买一卖为一次循环，持续进行循环直到完成设定手数；无需设定循环次数，以单边总手数/单次手数，自动计算出具体次数。

2、入口路径：

01、配置-选项-显示配置-选择显示面板-算法列表；

02、算法列表面板，点击右键调出弹窗，选择【添加累仓策略】。

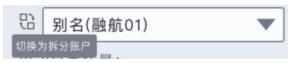
点击后显示累仓策略弹窗。

3、使用说明：

点击【添加累仓策略】， 调出【累仓策略】弹窗。

1、账户/分组：用户可自主选择执行累仓策略的【账户】/ 【分组】（当多账户登录时，显示“账户”与“分组”，当单账户登录时，仅显示“账户”）

2、多账户模式下支持将买和卖交易的资金拆分流向到两个账户里。

01、在账户选择框前点击切换拆分账户图标，鼠标悬浮显示字段“切换为拆分账户” 

；

02、切换为拆分账户之后，界面显示“多”和“空”字段，可以选择对应的账户。鼠标悬浮图标，显示字段“切换为同账户”。点击图标可以返回同账户模式；

2、合约： 自主输入【合约】名称；

3、单边总委托量：用户可配置累仓策略的单边委托量，即多仓/空仓单边的委托总量。例如：需要针对 cu2305 多仓建仓 100 手、空仓建仓 100 手，则填入单边委托总量 100.

4、单次委托量：策略自动执行的每次单边开仓/平仓委托的手数。

5、策略开平：支持配置策略双边的开平方向：开仓-开仓、平仓-平仓。

6、优先方向：策略执行的优先买卖方向，即策略开始执行时的第一笔委托的买卖方向。支持选择买、卖、同时报单。

01、买：支持在执行过程中设置优先方向为买。

02、卖：支持在执行过程中设置优先方向为卖

03、同时报单：支持在执行过程中行情震荡时自动切换优先委托方向，即支持设置优先方向为同时报单。

7、投保：支持选择：投机-投机、套保-套保。

8、优先价格类型：策略执行时优先执行的方向（买、买）的委托价格类型。

9、超价：支持设置执行非优先方向的委托时，按照优先腿的成交价，超价 n 个 tick 执行非优先方向的委托。超价支持设置负数、0和正数。

10、累仓策略支持时间设置追单：

优先方向选择买卖或同时，都支持当一次追单后未成交，选择是否设置时间再追单一次。

11、自动追单功能：

当优先委托方向成交后，如果非优先方向的报单未成交，系统将在行情偏离设定的tick数后，按照对手价超价设置的tick数立即自动进行一次追单。如果追单

还未成交则挂单，支持手工处理。可在未成交记录面板中修改报单价格。

12、累仓策略设置完毕后，点击下单，出现下单确认弹窗：

13、下单成功后可在算法列表查看策略详细信息。

举例：合约：cu2305；单边总手数 1000 手（实际总数量为 2000 手），每次委托数 100 手，价格类型：对手价，策略开平：开仓-开仓；优先方向：买入，投保：投机-投机；优先价格类型：对手价；超价：1tick，勾选-收盘前 5 分钟终止策略（撤单），支持手动补齐

开始：以卖一价委托买开 100 手 cu2305；100 手全部成交后，立刻以**成交价超 1tick** 委托卖开 100 手，全部成交后-以最新的对价报出买开 100 手，进行下一次循环。

循环 10 次，直到完成全部的总手数。

累仓策略-异常状态：

1、策略终止：

因收盘等异常情况导致终止不撤单；

手动未成交-改价格、右键补齐，撤单重新挂单。

手动撤单单笔-停止整个策略。

2、【未成交记录】改数量-终止整个策略并撤单。

断线重连后，不会导致策略终止；重连后可以继续准确执行策略剩余量。

16、状态栏

16.1功能点简介

在底部简洁的信息提示。

16.2入口路径

登入随心易界面下方，可以右键进行显示的选择。

16.3使用说明

状态栏主要显示：“平仓方式”、“默认手数”、“当前倍率”、“总多仓，总空仓”、“交易所状态”、“行情服务器状态”、“交易日”。圆点红色表示网络断线，绿色原点表示已连接。

17、【自设套利】策略下单整体流程

17.1功能点简介

套利行情面板支持多种下单模式，这里主要讲述 4 种执行顺序的【自设套利】策略下单整套流程。

期货合约之间的价差为套利投资者提供了机会，通过对价差趋势的分析，进行套利单以达到获利、规避风险、投资、判断价格走势等目的。

17.2入口路径

点击套利页-在配置中点击“选项”调出配置弹窗，选择【显示配置】-【选

择显示面板】-勾选【自设套利】和【套利行情】， 点击应用。

17.3使用说明

17.3.1自设套利添加策略

在套利行情右键【添加策略】出现【添加策略】弹窗，进行套利策略配置。添加/复制/修改套利策略时，会根据**执行顺序**对套利策略模型进行切换：

17.3.1.1执行顺序：主动腿优先 (HOT)

17.3.1.2执行顺序： 同时报单 (HOT)

1 【策略名称】： 输入名称（若不输入点击确定会自动生成“套利策略”名称）、公式（默认 A-B，可修改）、合约和滑点，就可以添加 2～3 腿策略。

2 【公式】： 默认 A-B，可以自定义公式，支持+-*/四则运算且运算符号不能少。公式字母严格区分大小写。公式会涉及各腿行情（对手价）如何计算价差触发，以及主动腿成交后，被动腿的计算。

3 【小数位数】： 默认 2，可以选 1-8 位。公式使用除法“/”时，对套利行情、报价显示对应位数。

4 【追单次数】：默认 2，下拉可选 1-20

对被动腿的对手价 FAK（或 ETF 期权-对价 FOK）追单次数生效，根据设置的 1-20 次。被动腿在滑点范围内按照次数报单；若被动腿**行情超出滑点且未成交**，即视为单腿，单腿对套利策略的执行根据“单腿”对应的选项。

主动腿无触发次数限制：若勾选滑点，超出滑点，会暂停报单，滑点回落，等待触发。可能触发再一轮主动腿对价 FAK（或 ETF 期权对价 FOK）。

请根据合约品种申报费，自行选择可接受的追单次数。

注意：“同时委托”每腿可能在滑点范围内触发多次，追单次数按照设定的追单次数生效。

5 【合约】：合约支持输入普通期货合约、期权合约（支持 ETF 期权合约）。

6 【投保】：投机（默认），下拉可选套保。**下单时，以套利下单板的投保为准，**点击套利行情-具体添加的套利策略，预填的投保会填充到套利下单板。

7 【方向】：默认为正向，下拉可选反向。正反与公式中的符号无关，只与合约买卖方向有关。正向就是与买卖方向相同，反向就是与买卖方向相反（即：买入时，正向就是买，反向就是卖；卖出时，正向就是卖，反向就是买）。【自设套利】下单板买入、卖出按钮下方会有具体合约方向提示。

8 【开平】：开仓（默认）、平仓、自动。自动为有仓平仓，无仓开仓。上期所、能源所平仓顺序可以再选。**下单时以套利下单板的开平为准，**点击套利行情，预填的套利策略开平会填充到自设套利下单板，报单的开平以下单板为准。

⑨ 【委托方式】：非自定义模式委托方式不展示。普通期货合约、商品期权合约为对手价 FAK 模式；ETF 期权为对价 FOK 模式。

10 【价格类型】：非自定义模式，仅支持**对手价**。

11 【超价 tick】：该策略**开始**报单时对应腿增加的 tick 值，每次追单时仍计算在内。

12 【数量】：指每份策略中各腿的报单数量，以选定的【执行顺序】确定报单合约的顺序。（例如主动腿优先，主动腿为腿 A，腿 A 数量 10，腿 B 数量

1，表示该策略每报单 10 手腿 A，再报单 1 手腿 B。）在自设套利下单板内的【份数】会和【添加/修改策略】弹窗里的数量进行乘法。

13 【滑点】：在自设套利报单时，**两、三腿价差可容忍的价差滑点值**。这个滑点就**是实际的价格差（不是 tick 值）**。建议滑点值是输入合约中，最小的合约 tick 值的三倍，可以根据自身情况输入能够接受的价差。

例如：（tick 为合约最小变动价位）铜合约 1tick=10，可以接受 5tick，那么滑点可以设置为 50。注意：滑点是每个批次对 2～3 腿的总控，并不是每个腿都给 50。实际报单是在滑点范围内，按照合约 tick 整数倍进行报单。

滑点：默认勾选，勾选后滑点为必填项：主动腿优先报单严控滑点，主动腿超出滑点暂不触发，等待滑点回落再触发。被动腿因超价、追单超价超出滑点（非行情，行情超出滑点终止追单）会拉回，在滑点范围内报单。

主动腿设置的追单次数内未追上，价差达到且在滑点范围内，主动腿会再次触发追单次数。

01、“主动腿优先”执行顺序（非自定义模式）：达到价差，主动腿发出报单，对滑点实时监控。主动腿+超价+滑点值/腿数（均分后报单价格是以滑点范围内的合约 tick 整数倍报单）达到价差条件，在滑点范围内（加超价）进行主动腿报单，被动腿是根据主动腿成交价、公式、剩余滑点值来计算，打满剩余滑点值报单，被动腿的报单严控在滑点范围内。被动腿不成交，以相同价格进行对价 FAK 追单。

02、“同时报单”执行顺序时（非自定义模式）：实时对滑点与行情进行监控，滑点范围内达到价差，判断可以同时发出相同数量报单，每腿+滑点/腿数+超价 tick。滑点范围内，各腿均会进行对价 FAK（或 ETF 期权对价 FOK）追单 2 次（根据设置的追单次数）：买方向按照对价+滑点/腿数+超价，卖方向按照对价-滑点/腿数-超价（实际报单价格是取合约 tick 整数倍报单）。追单为撤单

再以原报单价格进行报单。追单次数内，若超出滑点，则终止对应批次的报单，形成单腿，根据单腿配置执行剩余套利整体策略报单。

注意：设置同时报单时，首次配置超价 tick 若已经超出滑点范围，继续报单。

FAK/FOK 撤单不算入交易所异常报单次数，也不计入随心易配置项的撤单限制次数。交易所收取申报费的合约，FAK/FOK 指令也计算入信息量统计。

14 **【单腿】**：主动腿已成交，被动腿（或同时报单的任一腿）追单次数完成，仍未成功，即单腿。

“撤单终止套利”：出现单腿立即停止此套利策略所有委托。

“报满所有委托量”：出现单腿也继续委托直至做满此套利设置的总委托量。

“累计数量终止”：达到设置的单腿数量后停止套利委托。

举例：

策略报出 20 份套利，第 2 份就出现了单腿，剩下的 18 份是继续报出还是终止，或者是达到设定的单腿量终止。

1、如果选“撤单终止”，就是出现单腿就终止。第 2 份时单腿了，剩下 18 份不报出。

2、如果选“报满所有委托量”，就是不管单腿数量，剩下的继续报出。即第 2 份单腿，剩下 18 份继续报，报满 20 份。

3、如果选“累计数量终止”，设置单腿数量为 6，就是累记此策略达到设置的单腿数量 6 后，终止策略剩下份数的报单。

在自设套利信息面板右键，终止策略后，可以根据行情及时进行一键补齐、一键清除操作（将忽视滑点，按照最新的对手价 FAK 超 1tick 报单，不成交可以多次操作补齐或清除）。

如果追单过程中未超出滑点，被动腿（或同时报单的任一腿）完成 2 次追单（根据设置的 1-20 次）对价 FAK（或 ETF 期权对价 FOK）追单，还未成交，即单腿，根据单腿的选择，达到条件终止套利策略。

单腿时【自设套利】对应的策略会出现单腿背景提示，可以根据实际价格考虑是否右键进行“补齐单腿（选中）”或“清除单腿（选中）”操作，即忽视滑点，以当合约最新的对手价超 1tick 进行补齐或清除。

15 【现买(卖)量系数】：默认 1，可输入 0.00～1.00 范围的值，若输入为 0.00，**则现买(卖)量行情默认为 1**。根据这里的系数，对【套利行情】面板中现买量、现卖量乘以此系数显示。

例如：如果系数为 0.50，实际的套利现买量为 30，现卖量为 20，则乘以系数 0.50，在【套利行情】面板显示现买量为 15，现卖量为 10。

如果系数为特殊值 0，实际的套利现买量为 30，现卖量为 20，在【套利行情】面板显示现买量为 1，现卖量为 1。

16 上期所、能源所平仓顺序：先平昨，再平今（默认），下拉可选：先平今，再平昨。

17 【价格满足立即触发】：未勾选时，触发与价格、数量有关；若勾选，触发只与价格有关。合约填写的数量对现买量和现卖量的计算没有影响。策略的现买量、现卖量均与行情保持一致。

18　套利行情相关名词解释：

现买价：第一腿买价 - 第二腿卖价，即第一腿买价与第二腿卖价的价格差。

现卖价：第一腿卖价-第二腿买价，即第一腿卖价与第二腿买价的价格差。

17.3.1.3执行顺序：主动腿优先自定义

17.3.1.4执行顺序： 同时报单自定义

1 【策略名称】： 输入名称（若不输入点击确定会自动生成“套利策略”名称）、公式（默认 A-B，可修改）、合约和滑点，就可以添加 2～3 腿策略。

2 【公式】： 默认 A-B，支持+-*/四则运算且运算符号不能少。公式字母严格区分大小写。公式会涉及各腿行情如何计算价差触发。

3 【小数位数】： 默认 2，可以选 1-8 位。公式使用除法“/”时，对套利行情、报价显示对应位数。

4 【追单次数】： 默认 2，下拉可选 1-20 次。

主动腿自定义：

对被动腿追单次数生效，在滑点范围内报单；若被动腿行情超出滑点，即视为单腿，单腿对套利策略的执行根据“单腿”对应的选项。

主动腿触发次数无限制：若勾选滑点，超出滑点，会暂停报单，滑点回落，等待触发。

同时委托自定义：

达到行情（若有滑点，判断各腿行情在滑点范围内，达到价差进行发单，发单时+超价 tick 进行报单），每腿触发次数不限，但是追单次数按照“追单次数”1-20 次，具体的次数选择进行追单。

请注意：主动腿排队价 GFD 可能会造成较多的频繁报撤次数，满足行情往不利方向跳动+价差往有利条件走，撤单立即追单（最新的排队价+超价），不限制次数直到成交。

可以在【配置项-交易-撤单限制】对合约、品种、或当日总控进行设置，详见本文 9.3.1.1。

5 【合约】：合约可以是同品种，也可以跨品种。合约目前支持输入普通期货合约、期权合约（支持 ETF 期权合约）。

6 【投保】：可下拉选投机（默认）或套保。**下单时以套利下单板的投保为准，**点击套利行情，对应策略内预填的投保会对应填充到套利下单板。

7 【方向】：默认为正向，下拉可选反向。正反与公式中的符号无关，只与合约买卖方向有关。正向就是与买卖方向相同，反向就是与买卖方向相反（即：买入时，正向就是买，反向就是卖；卖出时，正向就是卖，反向就是买）。【自设套利】下单板按钮下方会有具体合约方向提示。

8 【开平】：开仓（默认）、平仓、自动。自动为有仓平仓，无仓开仓。上期所、能源所平仓顺序可以再选。下单时以套利下单板的开平为准，点击套利行情，对应策略内预填的开平会对应填充到套利下单板。

9 【价格类型】：对手价（默认）、排队价。

对手价：买用卖价报单，卖用买价报单。

排队价：买用买价报单，卖用卖价报单。

10 【委托方式】：可以选择 FAK（默认）、FOK、GFD。

⑪ ·FAK 委托方式：部分成、部分撤。报单手数部分成交，未成交部分立即撤单，FAK 撤单不计入交易所异常撤单次数统计，上交所、深交所不支持 FAK 指令：即 ETF 期权不支持 FAK 委托方式。

·FOK 委托方式：是指立即全部成交否则自动撤销。FOK 撤单不计入交易所异常撤单次数统计，郑商所不支持 FOK 指令。

·GFD 委托方式：当日有效报单，频繁报撤会记录交易所异常。

12 【超价 tick】：该策略开始报单时的对应腿增加的 tick 值，每次追单时仍计算在内。

13 【数量】：指主动腿和被动腿每份的各腿报单数量，以选定的【执行顺序】确定报单合约的顺序。（例如主动腿优先，主动腿为腿 A，腿 A 数量 10，腿 B 数量 1，表示该策略每报单 10 手腿 A，再报单 1 手腿 B。）在自设套利下单板内的【份数】会和【添加/修改策略】弹窗里的数量进行乘法。

14 【滑点】：默认勾选，勾选后滑点为必填项；在自设套利报单时，两、三腿价差可容忍的价差滑点值。滑点就是实际的价格差（不是 tick 值）。建议滑点值是输入合约中最小变动价位的三倍，可以根据自身情况输入能够接受的价差。

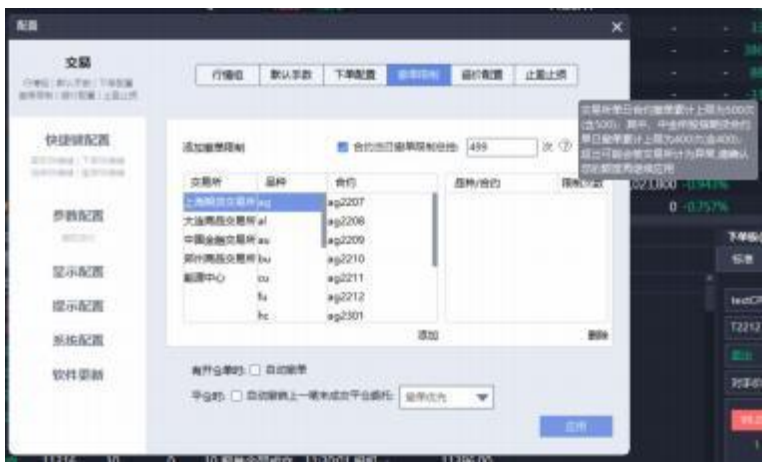
自定义模式可以不勾选滑点，每腿均不判断滑点值，报单根据超价、追单逻辑走：主动腿+超价，被动腿+超价+追单超价。

***勾选滑点，报单逻辑：**

·主动腿优先自定义：报单严控滑点，主动腿超出滑点暂不触发，等待滑点回

落再触发。被动腿因超价、追单超价超出滑点会拉回（非行情超出滑点，行情超出不论追单次数是否用完，都会终止被动腿追单），在滑点范围内报单。

01、主动腿：排队价/对手价+GFD 报单，**委托不叠加滑点值，**达到价差条件开始报单，若设置超价 tick，首次报单会加上超价 tick。主动腿撤单次数不限制：**满足行情往不利方向跳动+价差往有利条件走**，撤单立即追单（最新的排队价/对手价+超价）。不限制次数直到成交，不满足则一直挂单。



可以根据自身套保额度，在配置项-交易-撤单限制配置合约当日撤单限制总控（默认关闭）、或对品种/合约设定更高优先级的撤单次数提醒，优先级：合约>品种>总控。

主动腿成交后，被动腿不会直接加满剩余滑点值，会在滑点范围内，加超价、追单超价 tick 进行追单；若加超价、追单超价 tick 超出滑点，按剩余滑点值报单。追单次数按照具体选择。

02、主动腿：对手价/排队价+FAK/FOK 报单，**首次委托不需要叠加滑点值**，达到价差即报单，若设置超价 tick，首次报单会加上超价 tick。若不成交，根据委托方式撤单（FAK 部分成交部分撤单、FOK 全成否则全撤），以最新的对手价/排队价+超价进行报单。

注意：FAK/FOK 撤单不算入交易所异常报单次数，也不计入随心易配置项的撤单限制次数。交易所收取申报费的合约，FAK/FOK 指令也计算入信息量统计。

03、被动腿：排队价/对手价+GFD 报单，主动腿成交后，被动腿不会直接加满剩余滑点值。滑点范围内，行情往不利方向走 1tick，撤单，以最新的排队价/对手价+超价、追单超价进行追单。

被动腿行情超出滑点值，不论追单次数有没有用完，终止不追单。

被动腿行情未超出滑点，因超价、追单超价超出滑点，追单时会拉回，以剩余最大滑点值进行追单，严控滑点。

被动腿追单次数可以选择 1-20 次，默认 2 次。委托方式 GFD 的撤单会记录到随心易的撤单限制。

04、被动腿：对手价/排队价+FAK/FOK 报单，主动腿成交后，不会直接加满剩余滑点值，在滑点范围内，根据设置的超价、追单超价 tick 追单。因超价、追单超价超出滑点，拉回按照剩余滑点值报单。被动腿行情超出滑点，不论追单次数是否用完，都终止追单。

·同时报单自定义：监控套利滑点与行情，符合价差各腿+超价 tick 进行报单。

（注意：设置同时报单时，首次配置超价 tick 若已经超出滑点范围，继续报单。）

***不勾选滑点，对应的同时报单自定义报单逻辑：**

01、排队价/对手价+GFD 报单，达到价差即报单，若设置超价 tick，首次报单会加上超价 tick。若行情往不利方向跳动 1tick，撤单以最新的排队价/对手价+超价、追单超价按照追单次数进行追单。

02、对手价/排队价+FAK/FOK 报单，达到价差即报单，若设置超价 tick，首次报单会加上超价 tick。若不成交，根据委托方式撤单（FAK 部分成交部分撤单、FOK 全成否则全撤）。因 FAK/FOK 撤单不算入交易所异常报单次数，也不计入随心易配置项的撤单限制次数，满足价差再次报单，不判断滑点。

***勾选滑点，对应的同时报单自定义报单逻辑：**

01、排队价/对手价+GFD 报单，**达到价差报单，**若设置超价 tick，首次报

单会加上超价 tick。若行情往不利方向跳动 1tick，撤**单以最新的**排队价/对手价**+超价、追单超价按照追单次数进行追单。**

若任意腿行情超出滑点，不论追单次数是否用完，对应腿终止追单。

若行情未超出滑点，因超价、追单超价超出滑点，追单时会拉回滑点（按照剩余最大滑点值）进行追单。

02、对手价/排队价+FAK/FOK 报单，达到价差即报单，若设置超价 tick，首次报单会加上超价 tick。若不成交，根据委托方式撤单（FAK 部分成交部分撤单、FOK 全成否则全撤）。

若任意腿**行情超出滑点**，不论追单次数是否用完，对应腿终止追单。

若行情未超出滑点，因超价、追单超价超出滑点，追单时会拉回滑点（按照剩余最大滑点值）进行追单。

（注意：设置同时报单时，首次配置超价 tick 若已经超出滑点范围，继续报单。）

15 **【单腿】：主动腿已成交，被动腿追单次数完成，仍未成功，即单腿。**（默认）撤单终止套利，即出现单腿就立即停止此套利策略所有委托。

“报满所有委托量”：出现单腿也继续委托直至做满此套利设置的总委托量。

“累计数量终止”：达到设置的单腿数量后停止套利委托。

被动腿追单过程中完成追单次数，还未成交，即单腿，根据单腿的选择，达到条件终止套利策略。

单腿时【自设套利】对应的策略会出现单腿背景提示，可以根据实际价格考虑是否右键进行“补齐单腿（选中）”或“清除单腿（选中）”操作，即忽视滑点以当前的对手价超 1tick 进行补齐或清除。

16 【现买(卖)量系数】：默认 1，可输入 0.00～1.00 范围的值，若输入为

0.00，则现买(卖)量行情默认为 1。根据这里的系数，对【套利行情】面板中现买量、现卖量乘以此系数显示。

例如：如果系数为 0.50，实际的套利现买量为 30，现卖量为 20，则乘以系数 0.50，在【套利行情】面板显示现买量为 15，现卖量为 10。

如果系数为特殊值 0，实际的套利现买量为 30，现卖量为 20，在【套利行情】面板显示现买量为 1，现卖量为 1。

17 **【上期所、能源所平仓顺序】：先平昨，再平今（默认），下拉可选：先平今，再平昨。**

18 【追单超价 tick】：默认 2tick。即被动腿追单时，每次叠加追单滑点值。若有设置滑点，滑点控制优先。

19 【被动腿伺机追单：GFD 价格偏离(tick)】：

·不勾选，仅设置追单超价 tick，被动腿 GFD 为立即追单，即行情往不利方向跳 1tick，就撤单立即以最新单委托类型+超价、追单超价，进行追单。

·勾选被动腿伺机追单+追单超价 tick，**且被动腿为排队价+GFD 时生效**，参数需≥1(tick)。

即：对手盘往不利方向偏离设定 tick 值，立即撤单，根据最新的委托类型+超价、追单超价，未成即撤反复超价挂单。被动腿 GFD 挂单满足触发后，实时监控报单行情，若对手盘行情往不利方向偏离达到设定的偏离值，被动腿开始积极主动的追单。

·此功能与被动腿：FAK/FOK 追单失败最后一笔变为 GFD 挂单功能无关。

若勾选且被动腿委托方式为 GFD，对手盘朝不利方向偏移 n 个 tick（n 为价格偏移设定值），立即撤单，改以立即追单（**根据最新的价格+超价挂单**，未成

即撤反复超价挂单，直到成交为止）。**需要结合是否勾选滑点，有滑点在滑点范围内进行报单。**

20 【被动腿： FAK/FOK 追单失败最后一笔变为 GFD 挂单】：

若被动腿为 FAK/FOK，追单次数内，前面的被动腿追单次数一直未成，最后一笔变为 GFD 挂单（假设设置的是 20 次，前 19 次都失败了，那么最后 1 次变为 GFD 挂单；如果设置追单次数为 1，被动腿报单失败，第一笔追单就是 GFD 挂单了）。

·挂单成交再报单： 因被动腿 FAK/FOK 追单失败变成的这一笔 GFD 挂单，等它成交再继续下一批次的主动腿触发。

·挂单同时继续报单： 因被动腿 FAK/FOK 追单失败变成的这一笔 GFD 挂单，挂出去后可以继续执行接下来批次的主动腿、被动腿单。

21 【价格满足立即触发】：未勾选时，触发与价格、数量有关；若勾选，触发只与价格有关。合约填写的数量对现买量和现卖量的计算没有影响。策略的现买量、现卖量均与行情保持一致。

17.3.2自设套利复制策略

在套利行情面板可以对已有的自设套利策略进行右键，复制策略，弹出复制策略弹窗，选项内容都和选中的策略内容一致，需要自行更改策略名称。

17.3.3自设套利修改策略

1.在套利行情中选择具体的自设套利策略， 右键-修改策略， 出现修改策略弹窗。

2.策略名称 、合约、策略未填写合约项不可修改。

3.公式、执行顺序、小数位数、**已填写合约**的：投保、方向、开平、超价 tick、数量，滑点、单腿、现买(卖)量系数、上期所，能源所平仓顺序、追单超价 TICK（勾选和数值）；以及自定义模式的：被动腿伺机追单：GFD 价格偏离(tick)、被动腿：FAK/FOK 追单失败最后一笔变为 GFD 挂单-可更改。

17.3.4套利行情面板

填写好的策略会显示在套利行情面板中，同 12.3.2，自设套利的策略添加后会展示在套利行情面板中。右键可以进行：标准套利合约配置、显示/关闭合约行情；闪电点价；添加策略、复制策略、修改策略、删除策略；自动调整列宽的功能。

支持鼠标拖拽调整排序。

17.3.5【自设套利】下单板

1.下单板处加号【+】勾选自设套利。

2.同 14.3.7，点击套利行情中具体的策略，自设套利下单板内会显示对应策略，可以进行策略下单。选中【套利行情】中的具体策略，右键-修改策略可以进行策略的修改。

选择策略填好信息后， 点击买入、卖出可以下单。

支持服务器自设套利，配置好对应的环境信息并且授权后，开启服务器自设套利开关，下单对应的自设套利单会保存到云端交易（服务器单标识为云端 icon；本地为电脑 icon）。

详情可参考【帮助-服务器单授权】了解服务器单运行机制。

右键【自设套利】下单板可以支持设置：每腿同账户（默认勾选）、每腿同开平、每腿同投保（默认勾选）。若要每腿属性不同，需要取消对应属性的勾选。

添加/复制/修改套利策略的内容为预设， 点击套利行情会联动填充下单板，每腿属性不同，需要确保下单板对应的属性不相同-需要右键取消勾选。

套利每腿最终的报单属性，以【自设套利】下单板的属性（账户、开平、投保）为准。

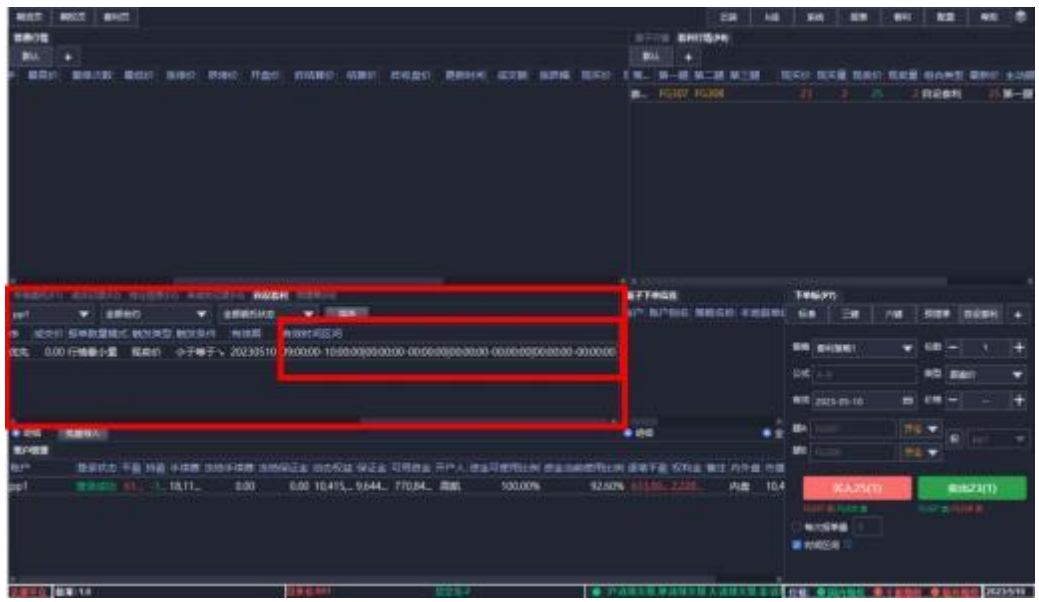
3.**套利下单加上时间条件：** 下单板中， 自设套利可以设置时间区间下单，设定的有效时间区间在自设套利面板中显示。

01.在【下单板】面板，选择- 自设套利，下方会显示【时间区间】。

02.点击编辑图标，显示时间区间设置弹窗，可以对自设套利的“开始时间”和“结束时间”进行设置。点击“开始使用”保存相关时间区间设置信息。

03.【下单板】不勾选-不生效， 多选框勾选生效

。



04.【时间区间】设置完成后， 时间区间信息会显示在【自设套利】面板。默认按照下单时间排序。

05.【自设套利】面板右击，可以选择【自动调整列宽】， 优化列表数据显示。

06.退出软件， 下次登录时保留上次设置自动套利时间区间数据。

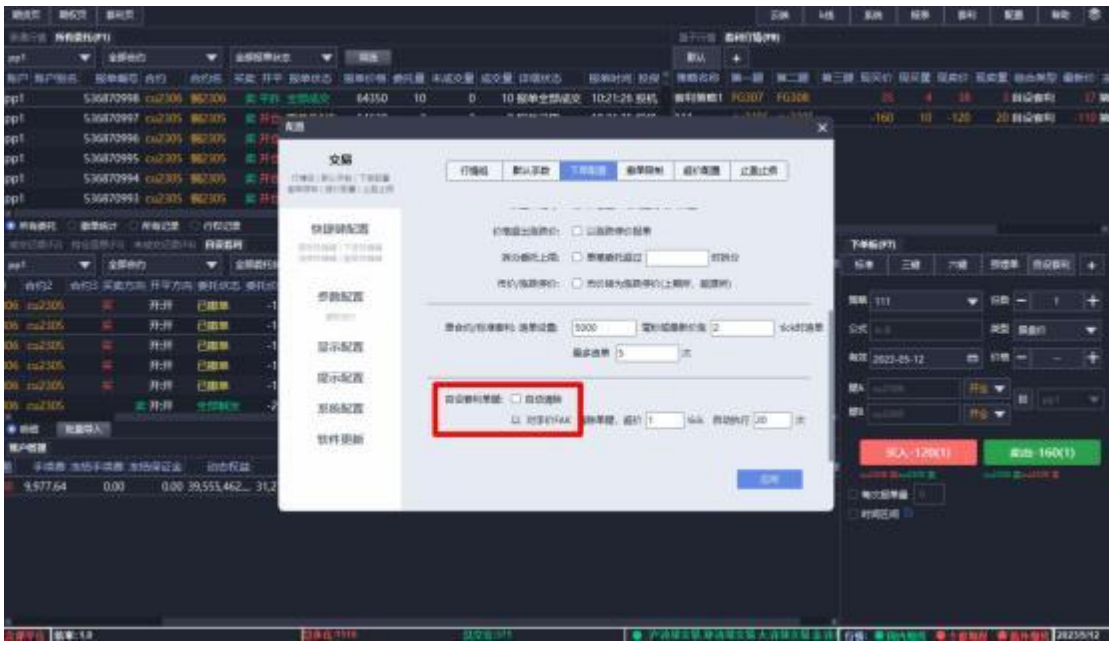
17.3.6【自设套利】信息面板

下单后的策略信息会展示在【自设套利】信息类面板， 同前文 15.3.5。

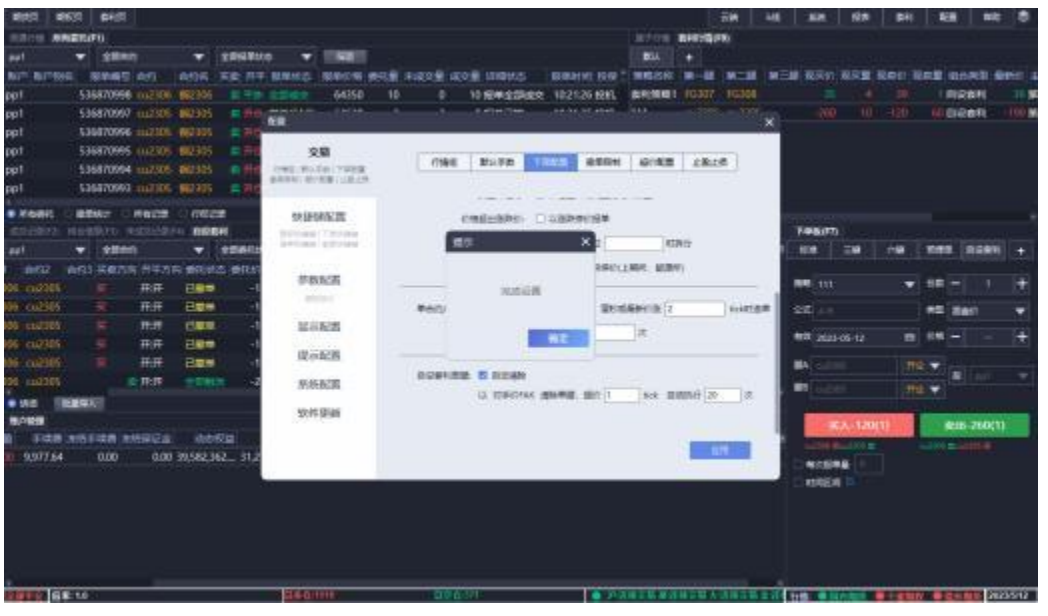
1、套利自动清除单腿： 自设套利报单在右键手动清除单腿的基础上，新增系统自动清除单腿功能。

01.在随心易客户端点击右上角【配置】， 显示下拉菜单。

02.点击【选项】， 显示【配置】弹窗。选择【交易】-【下单配置】， 在下方可以看到【自设套利单腿： 自动清除】。

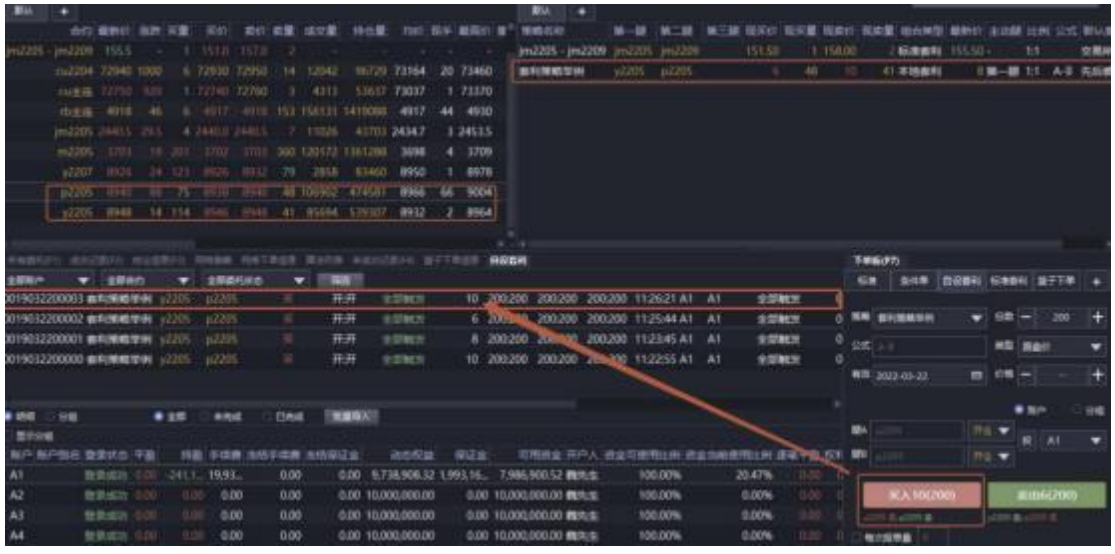


03.默认不勾选【自动清除】， 勾选后点击【应用】， 显示【提示】弹窗，完成设置，点击【确定】。



04.在【自设套利】面板，可以看到符合条件的套利会自动清除单腿。

17.3.7 套利报单实例 (HOT)



为了您更好的理解，我们为您举一些实例：

17.3.7.1 执行顺序：主动腿优先举例

目前我们需要对 y2305 和 p2305 采用**主动腿优先**的执行顺序，设定 y2305 为主动腿且委托超价点位（超价 tick）为 1，滑点值为 6 ，单腿设置为：撤单终

止套利。

如下图：

① 由于报单是采用**买方向**（即第一腿 y2305 买开， 第二腿 p2305 卖开）进行报单，故当价差小于等于 10 后，报单触发，并开始实时对滑点进行监控。

2 优先对 y2305 采用对手价 8948 超滑点值/2 再超 1 个 tick 进行报单，即 8948+(6/2+1*2）=8953，因为是买方向按照 tick 数值 2 向下取整为 8952（若合约为卖方向就是参照 tick 值向上取整，低买高卖）。假定当前市场现买量、现卖量不足 200 手，仅 95 手，则会优先触发报单第一腿 95 手。

3 待 y2305 报单成交后，这 95 手的实际成交价为 8948，此时会对第二腿 p2305 合约进行报单 95 手，采用主动腿成交价 8948 的基础上，加上第一腿

y2305 成交剩余的滑点值，因第一腿 y2305 成交价为 8948，即实际未使用滑点，此时第二腿 p2305 卖方向会减满剩余滑点值 6，通过第一腿成交价，公式价差、滑点值，计算出第二腿报单价，即 8948-10-6=8932 价格发出委托 95 手。最终第二腿 p2305 这 95 手的实际成交价为 8938，此时成交价差是 10。

④ 因未做满 200 份，当前市场又有现买量、现卖量 55，则继续对第一腿 y2305 进行以当前对手价 8948 超滑点值/2 再超 1 个 tick 报单 55 手，即 8948+(6/2+1*2) =8953，买方向按照 tick 数值 2 向下取整为 8952 的价格进行委托（若合约为卖方向就是参照 tick 值向上取整，低买高卖），此时第一腿 y2205 有 45 手以 8948 成交，10 手未成交。

⑤ 符合价差触发对第二腿 p2305 报出 45 手，因主动腿成交价为 8948 未占用滑点值，故第二腿报单价为 8938-10-6=8932 报出 45 手，这 45 手第二腿 p2305 的实际成交价为 8940，此时价差为 8。

6 对第一腿的 y2305 未成的 10 手（未超出滑点）未成交进行 FAK（部分成交立撤）追单 2 次。这里第一腿 y2305 买方向的 FAK 的 2 次追单按照：对价+滑点/2+超价。这 10 手 FAK 追单成功，即 y2305 以 8950 价格成交，实际成交占用了 2 个滑点值。则第二腿 p2305 卖方向会根据与第一腿的价差，和剩余滑点值：4，以 8950-10-4=8936 进行同样数量的 10 手报单。

7 若第二腿 p2305 的 10 手报单，未完全成交且未超出滑点，则发起 FAK（部分成交立撤）追单 2 次。这里第二腿 p2305 卖方向的 FAK 的 2 次追单：滑点范围内，第一腿成交价-价差-第一腿剩余的滑点值，仍是 8936 进行追单。

8 被动腿在报单、追单过程中或追单完毕后行情超出了滑点，则会终止对应批次被动腿报单、追单。

9 此时第二腿 p2305 的 10 手追单成功，以 8938 卖出。第一腿合约 y2305 的 10 手与第二腿合约 p2305 的 10 手成交价差为 8950-8938=12。

10 继续等待行情、触发条件进行 50 份套利报单。

⑪ 若最终一切顺利，未超出滑点做满 200 份套利（腿 1 合约 y2305 买开成交 200 手，腿 2 合约 p2305 卖开成交 200 手），则此自设套利策略委托状态显示为全部触发。

12 如果报单和追单中未超出滑点，被动腿完成 2 次 FAK 追单，还未成交，即单腿：撤单终止套利，表示该套利失去机会，该策略整体停止。此时【自设套利】对应的策略会出现单腿红色背景提示，可以根据实际价格考虑是否右键进行“补齐单腿（选中）”或“清除单腿（选中）”操作。

17.3.7.2 执行顺序： 同时报单举例

目前我们需要对 y2305 和 p2305 采用**同时报单的执行顺序**，设定 y2305 为主动腿且委托超价点位（超价 tick）为 1，滑点值为 6 ，单腿设置为：撤单终止套利。

如下图：

1 由于报单是采用**买方向**（即合约 y2305 正向-买开，合约 p2305 反向-卖开）进行报单，故当价差小于等于 10 后，报单触发，并开始实时对滑点进行监控。

② 假定当前市场现买量、现卖量不足 200 手，仅 80 手。执行顺序采用“**同时报单**”，两腿 y2305 和 p2305 合约的触发后是同时委托各 80 手。

3 合约 y2305 为对手价+超滑点值/2 进行委托的，即 y2305 是 8948+6/2=8951，买方向按照 tick 数值 2 向下取整，即以 8950 进行委托 80 手。

4 卖方向合约 p2305 是按照对手价-滑点值/2，即 8938-6/2=8935，根据卖方向 tick 值 2 向上取整为 8936，委托 80 手。

5 报单触发后，会开始实时对滑点进行监控。同时两腿均会进行 FAK 追单 2 次的判断：买方向按照 y2305 对价+滑点/2，卖方向按照 p2305 对价-滑点/2，如在报单、追单过程中或追单完毕后，报单超出了滑点，则会暂停报单。

⑥ 合约 y2305 的 80 手实际以 8948 成交 80 手，合约 p2305 实际以 8942 成交 80 手，这 80 手 y2305 和 p2305 的成交价差为 6。

⑦ 再根据行情买量、卖量、每腿合约对手价价差进行触发，进行第二笔同

样数量的同时报单。

⑧ 若最终一切顺利，做满 200 份套利（腿 1 合约 y2305 买开 200 手，腿 2 合约 p2305 卖开 200 手），则此自设套利策略委托状态显示为全部触发。

⑨ 如果报单和追单过程中未超出滑点，各腿分别完成 2 次 FAK 追单，若还未成交，即对应批次单腿：撤单终止套利，表示该套利失去机会，该套利策略整体停止。此时【自设套利】对应的策略会出现单腿红色背景提示，可以根据实际价格考虑是否右键进行“补齐单腿（选中）”或“清除单腿（选中）”操作。

17.3.7.3 执行顺序： 主动腿自定义举例

目前我们需要对 y2305 和 p2305 采用**主动腿优先自定义**的执行顺序，设定 y2305 为主动腿，滑点值为 6 ，单腿设置为：撤单终止套利，追单超价 tick2，主动腿为 GFD 模式、被动腿为 FAK 且勾选被动腿 FAK 追单失败最后一笔变为 GFD 挂单（挂单成交再报单）。追单次数 20 次（可自定义）。

如下图：

买入价差为-316 的此套利策略 50 份。

① 由于报单是采用买方向（即合约 y2305 正向-买开，合约 p2305 反向-卖开）进行报单，故当价差小于等于-316 时，报单触发，并开始实时对滑点进行监控。

② 达到价差-316 开始触发报单，对 y2305 采用 11430 报排队价 GFD 挂单 2 手成交，当前市场现买量、现卖量不足 50 手，仅 2 手，则会优先触发报单第一腿 2 手。

③ 待 y2305 报单 2 手成交后，这 2 手的实际成交价为 11430，此时会对第二腿 p2305 合约进行报单 2 手，采用当前 p2305 的对手价 11748 发出 FAK 报单，因第一腿 y2305 成交价为 11430，即实际未使用滑点，故 FAK 报撤会在 6 个滑点内，进行追单超价 2tick 的报撤。因最终第二腿 p2305 卖方向

2 手报单，最终的成交价为 11748，未占用滑点值。

④ 因未做满 50 份，当前市场又有现买量、现卖量 3 份，则继续对第一腿 y2305 进行以当前排队价 GFD 挂单报单 3 手 11430，实际成交也为 11430 未占用滑点值。

⑤ 符合价差触发对第二腿 p2305 报出 3 手，此时 p2305 的对手价为 11748，委，即 11748 报出 3 手，这 3 手第二腿 p2305 的实际成交价为 11430，未占用滑点值。

⑥ 行情有报单量 5 份，并且达到符合套利策略价差，继续第一腿的报单 y2305 报出主动腿 11428 的 5 手。因此时主动腿 GFD 满足行情往不利方向跳动+价差往有利条件走，撤单立即追单（最新的排队价+超价）。以 11434 追单 5 手，最终这 5 手成交在 11432。

⑦ 主动腿成交，报出第二腿 p2305 的 3 手 11750，未完全成交且未超出滑点，则发起 FAK（部分成交立撤）追单 20 次。因此批次的主动腿成交为 5 手，故有行情量时，会再发出 2 手 11750 的对价被动腿 p2305，最终这 2 手是在 11750 成交。

⑧ 主动腿行情触发量，发出 14430 的 4 手委托，并以 14430 成交。被动腿拆分成了 11750 的 2 手，并在 11750 成交。因主动腿为 4 手，会在行情条件达到，继续发出被动腿 2 手。

⑨ 因为勾选了滑点，主动腿如果在报单、追单过程中或追单完毕后报单超出了滑点，则会暂停报单。主动腿待滑点回落，会继续报单。
因为勾选了滑点，被动腿会严控滑点，行情在滑点范围内，会判断是在追单超价内是否超出滑点，超出会拉回滑点范围内报单。

⑩ 如果报单和追单中未超出滑点，主动腿的批次成交了，被动腿勾选了“被动腿：FAK/FOK 追单失败最后一笔变为 GFD 挂单，且选择的是挂单成交再

报单”，则完成 19 次 FAK 追单，若还未成交，此批次被动腿第 20 次追单变为 GFD 挂单，等待此挂单成交，且满足价差、滑点，继续报下个批次主动腿。

⑪ 若此挂单直至当日收盘都未成交，被交易所撤单，则套利未完成，套利委托状态为已撤单。

⑩ 因为显示为全部触发，即最终一切顺利，未超出滑点且做满 50 份套利（腿 1 合约 y2305 买开成交 50 手，腿 2 合约 p2305 卖开成交 50 手）。

因自定义模式的选择功能、组合方式较多，无法全部举例，请结合自身业务、具体合约申报费或频繁报撤考虑，在充分了解具体功能的情况下（可以模拟盘先试用），进行自定义策略的添加。

17.3.7.4 执行顺序：同时报单自定义举例

目前我们需要对 cu2311 和 cu2310 采用**同时报单自定义**的执行顺序，设定滑点值为 30，每腿为排队价 GFD 委托方式，单腿设置为：撤单终止套利，追单超价 tick 为 2。

如下图：

① 报单采用买方向（即合约 cu2311 正向-买开，合约 cu2310 反向-卖开）进行报单，故当价差小于等于-100 后，报单触发，并开始实时对滑点进行监控。

② 当前市场现买量、现卖量不足 50 手，仅 2 手。执行顺序采用“同时报单自定义”，两腿 cu2310 和 cu2311 合约的触发后是同时委托各 2 手。

腿	报单编号	账户	合约	买卖	开平	委托状态	委托价格	委托数量	未成交...
1	5368713...	pp1	cu2311	买	开仓	全部成交	61300	3	0
2	5368713...	pp1	cu2310	卖	开仓	全部成交	61460	2	0
2	5368713...	pp1	cu2310	卖	开仓	撤单	61490	2	2
1	5368713...	pp1	cu2311	买	开仓	全部成交	61300	2	0
1	5368713...	pp1	cu2311	买	开仓	全部成交	61320	1	0
2	5368713...	pp1	cu2310	卖	开仓	全部成交	61450	1	0
1	5368713...	pp1	cu2311	买	开仓	撤单	61300	1	1
2	5368713...	pp1	cu2310	卖	开仓	全部成交	61450	2	0
2	5368713...	pp1	cu2310	卖	开仓	撤单	61480	2	2
1	5368713...	pp1	cu2311	买	开仓	全部成交	61350	2	0

③ 合约 cu2310、cu2311 为排队价进行委托 2 手。第一笔的 cu2211 买开委托价格为 61350，成交了 。同时报单的 cu2310 卖开委托价为 61480，因行情往不利方向跳动 1tick，撤单立即改以最新的排队价+追单超价进行追单，即 61450 进行卖开 2 手。

④ 价差达到，此时行情也仅有 1 份，报出买开方向合约 cu2311，价格为 61300。同时报出 cu2310 卖开仓 1 手，价格为 61450。卖开 1 手 cu2310，以 61450 成

交，买开仓因行情往不利方向跳动 1tick，撤单立即追单（最新的排队价+追单超价），即 61320 进行买开 1 手，买开成交。

⑤ 因未做满 50 份，价差达到，根据行情现有量报单 2 份。如在报单、追单过程中或追单完毕后，报单超出了滑点，则会暂停报单。此时报出合约 cu2311 的 61300 买开 2 手，合约 cu2310 的 61490 卖开 2 手。

⑥ 因未做满 50 份，价差达到，根据行情现有量报单 2 份。cu2311 的 2 手买开 61300 报单，同时cu2310 发出 2 手卖开 61490 报单；cu2311 买开 2 手 61300 成交，卖开 2 手 61490 未成交，撤单立即追单（最新的排队价+追单超价），cu2310 追单报出 61460 卖开 2 手，成交。

⑦ 根据行情买量、卖量、每腿合约价差进行触发，进行下一批次同样数量的同时报单.....

⑧ 最终一切顺利，做满 50 份套利（腿 1 合约cu2311 买开成交 50 手，腿 2 合约 cu2310 卖开成交 50 手），则此自设套利策略委托状态显示为全部触发。

⑨ 如果报单和追单过程中未超出滑点，且两腿分别完成 2 次排队价追单，若还未成交，即单腿：撤单终止套利，表示该套利失去机会，该套利策略整体停止。此时【自设套利】对应的策略会出现单腿红色背景提示，可以根据实际价格考虑是否右键进行“补齐单腿（选中）”或“清除单腿（选中）”操作。

因自定义模式的选择功能、组合方式较多，无法全部举例，请结合自身业务、具体合约申报费或频繁报撤考虑，在充分了解具体功能的情况下（可以模拟盘先试用），进行自定义策略的添加。

17.3.8 移仓换月使用方法 (HOT)

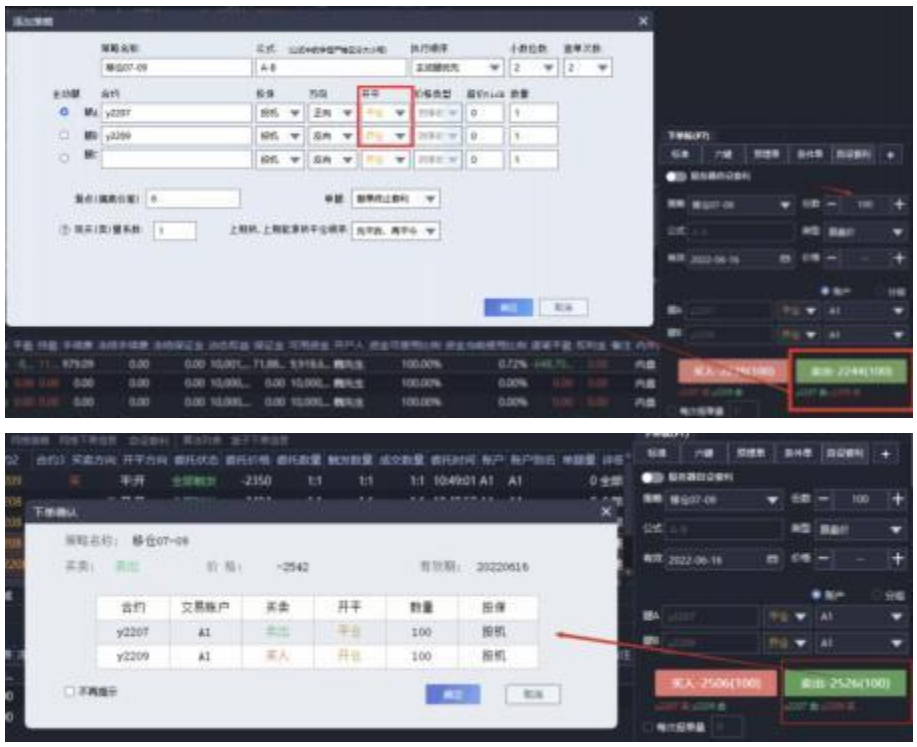
通过设置套利进行快捷的【移仓换月】功能：如果持有大量单合约临近交割月，想要快速切换为其他月份的合约，可以通过设置自设套利进行主动腿优先执

行顺序达到移仓换月。

设置需要交割的合约和要切换的新合约为套利的两腿：

01.临近交割合约： 开平设置为**平仓，** 下单时买卖方向与原先持仓相反（临近交割持仓为多仓就需要卖平； 临近交割持仓为空仓就需要买平）。

02.需要切换的合约： 开平设置为**开仓。**



例如： 现有持仓 100 手 y2207 多仓（临近交割月）， 想要替换成 y2209 多仓。此时可以设置自设套利 y2207 合约卖平仓， y2209 买开， 对应份数为 100（下单腿 A 数量*份数=1*100 即 100 手卖平 y2207；下单腿 B 数量量*份数=1*100 即 100 手买开 y2209）。

18、【篮子下单】策略下单整体流程

18.1功能点简介

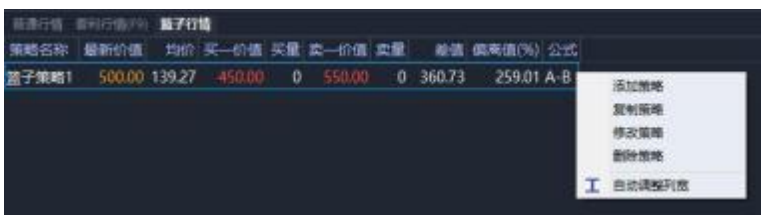
篮子下单支持多种下单模式，这里主要讲述【篮子下单】策略下单整套流程。

18.2入口路径

点击套利页-在配置中点击“选项”调出配置弹窗，选择【显示配置】-【选择显示面板】-勾选【篮子下单信息】和【篮子行情】， 点击应用。

18.3使用说明

18.3.1篮子下单添加策略



在篮子行情右键，二级菜单中选择【添加策略】出现【添加策略】弹窗，进行篮子策略配置。

输入策略名称，公式，选择偏离值、小数位数，输入步长，合约，选择每笔的方向（与公式中符号无关），输入超价 tick，数量，选择上期所，能源所平仓顺序，追单超价 TICK，输入买(卖)量系数，就可以添加策略，策略信息将显示在篮子行情中。

1.策略名称： 可填写也可自动生成。

2.公式： 必填项， 公式中的字母严格区分大小写， 对应合约腿的具体字母。

3.偏离值：默认为(最新价值-均价)/均价，还可选(买一价值-均价)/均价，(卖一价值-均价)/均价。

4.小数位数可选 1-2 位。

5.步长：默认 1，可以控制价值加减。

6.合约可以是同品种，也可以跨品种。合约输入从腿 A 开始，连续向下填，至少填入两腿。合约目前支持输入普通合约、期权合约、支持 ETF 期权合约。

7.委托方式：普通合约、期权合约为对手价 FAK 委托方式；ETF 期权为限价 FOK 委托方式。

8.方向：默认为正向，下拉可选反向。正反与公式中的符号无关，只与合约买卖方向有关。正向就是与买卖方向相同，反向就是与买卖方向相反（即：买入时，正向就是买，反向就是卖；卖出时，正向就是卖，反向就是买）。

9.超价 tick：默认为 0。

10.数量：默认为 1。

11.上期所、能源所平仓顺序：只针对合约中的上期所、能源所合约，默认为先平昨，再平今，可下拉选择为先平今，再平昨。

12.追单超价 TICK：默认勾选，数值为 2。

13.买(卖)量系数：默认为 1，可输入 0.00～1.00 的数值。根据这里的系数，对【篮子行情】面板中的买量、卖量，乘以此系数显示。若系数为 0，则买量、卖量显示为 1。若系数设置为 0.01～1.00，则以盘口行情买量、卖量乘以设置的系数。若系数设置为 0，则第一腿买量、第二腿卖量行情显示为 1。

例如：如果设置系数为 0.50，实际的篮子买量为 30，卖量为 20，则乘以系数 0.50，在【篮子行情】显示买量为 15，卖量为 10。

18.3.2篮子下单复制策略

在篮子行情面板可以对已有策略进行右键，复制策略，弹出复制策略弹窗，选项内容都和选中的策略内容一致，需要自行更改策略名称。

18.3.3篮子下单修改策略

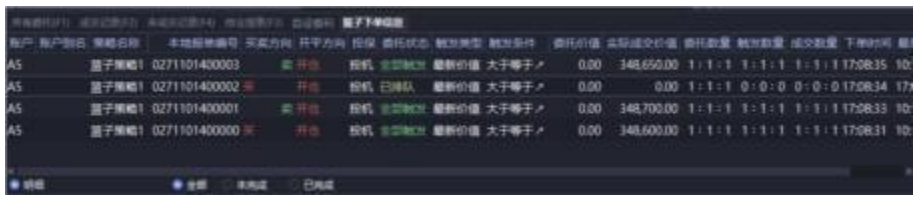
在篮子行情中，选中已有的策略右键>>修改策略，出现修改策略弹窗。公式、偏离值、小数位数，步长，已填写合约的“方向、超价 tick、数量”，上期所、能源所平仓顺序，追单超价 TICK，买(卖)量系数可以进行修改。策略名称、合约和未填写的合约方向、超价 tick、数量不可修改。

18.3.4【篮子下单】下单板

同 14.3.9，选择篮子行情中添加的策略，可以进行下单。

选择策略填好信息后，下单板点击【买入】/【卖出】，根据策略弹出【下单确认】提示。

18.3.5【篮子下单信息】



下单后的策略信息会展示在 15.3.12 信息类面板-【篮子下单信息】中。

右键可以进行撤单（选中）、撤单（全部）、清空、展开明细、修改报单数量模式；自动调整列宽、导出记录的快捷操作。

19、【网格策略】策略下单整体流程 (HOT)

19.1功能点简介

对于许多进行日内波段交易的用户，常会感到波段交易机会很难把握，且盯盘耗费精力，交易速度跟不上。为此可以设定网格策略，结合自身对市场震荡行情的预判，设定策略参数，实现高抛低吸自动执行-网格策略下单，无需时刻人工盯盘，节省交易时间，轻松完成多笔波段交易。

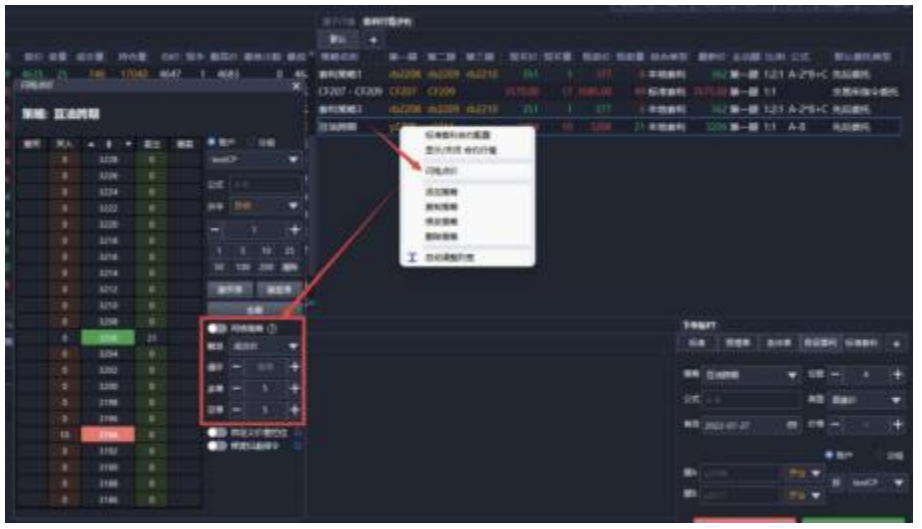
新增【网格下单信息】面板，将网格策略的设置与具体的下单进行区分，严格把控网格触发单，不会因外部报单造成误触发。增加智能止损设置，对网格触发的单进行智能平仓，而不是合约的全部仓位。

通过设置止损线，防范价格大幅上涨、下跌造成敞口损失的风险。并通过勾

选“智能平仓”选项，由客户自主选择触发止损仅终止并撤单，还是终止撤单并对网格触发的单子进行智能平仓。

通过设置最大下单手数，在开启网格下单时给出友好提示。增加“收盘前 5 分钟终止网格撤单平仓”勾选项，便捷客户对日内盘网格进行智能平仓。

1.网格策略设置方式：调出【网格策略】、【网格下单信息】面板，添加策略进行配置，开启网格策略后，通过【闪电点价】对此账户合约进行下单，可生成网格策略单，进入循环，循环结束，【网格下单信息】中已触发的网格策略单自动关闭。

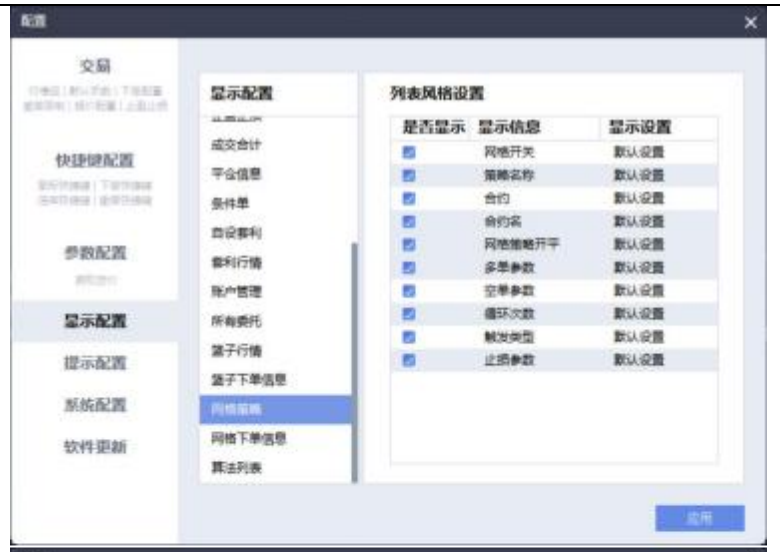


2. 自设套利策略网格策略设置方式：打开对应自设套利策略-闪电点价面板，输入参数，开启网格策略，自动生成对应的自设套利网格策略。

19.2入口路径

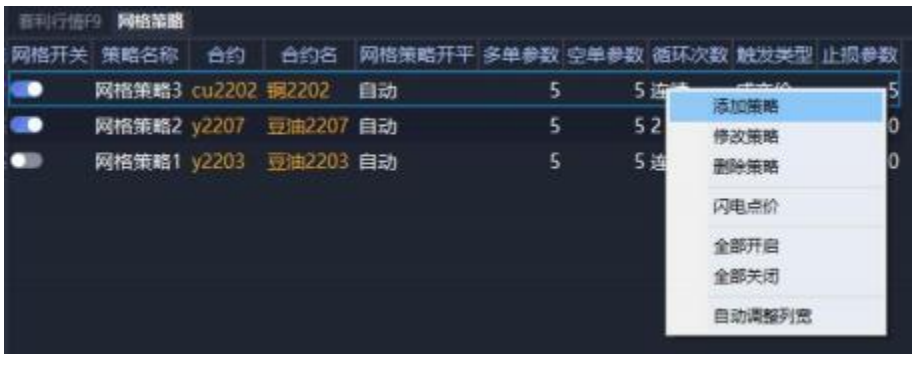
1.在配置-选项-【配置】弹窗：显示配置-选择显示面板-勾选中【网格策略】、【网格下单信息】面板，点击应用。

2.打开【闪电点价】下单板，默认勾选展示【网格策略】面板。



3.在【配置-显示配置-网格策略/网格下单信息】中：可以对面板具体的显示信息进行设置。

19.3使用说明



1.在【网格策略】面板右键，出现：添加策略、修改策略、删除策略；全部

开启、全部关闭； 自动调整列宽。

2. 自设套利网格的添加、修改，仅在对应自设套利策略的闪电点价面板进行设置（开启闪电点价的网格策略生成，修改参数需要先关闭闪电点价中的开关）。

3.已设置的网格策略， 可以在此面板通过开关按钮，进行开启、关闭操作。

注意：此面板的开启、关闭并不会影响已报出的网格策略单，参数是一个预设值， 仅对之后的网格策略报单产生影响。

4.增加内部保护机制：若网格策略执行中（包括自设套利网格），此批次网格连续亏损 2 个循环， 则此批次的网格终止并撤单。详细状态提示“**连续 2 个循环亏损，终止撤单**”。注意，此网格策略单的保护机制，计算不是真实的持仓盈亏，而是网格策略单买、卖的盈亏，不计算手续费，故一般情况不会触发，只有异常亏钱时进行保护终止。

19.3.1添加策略

19.3.1.1期货合约、期权合约 、标准套利合约添加网格策略（方式 1）

在【网格策略】面板右键点击-添加策略， 出现“添加策略”弹窗。

填充内容如上图所示。更多细节点：

1.策略名称不可重复； 为空可以自动生成策略名称。

一个合约只能开启**一个**网格策略模板，可以修改参数进行多笔网格策略报单，已报单参数可以与当前主策略不一致，报单详细信息将会显示在【网格策略下单信息】中。标准套利合约和普通合约的会判断重复。

2.期货、套利和期权合约支持模糊搜索，智能匹配。

3. 网格策略开平：为网格策略触发执行逻辑。网格策略开平为网格开平触发逻辑： 自动为有仓平仓，无仓开仓，收到成交回报，根据多空参数反向挂单；开仓为双向开仓； 平仓为双向平仓。

4.触发类型：成交价和委托价。会涉及网格触发时的价格，在此基础上进行网格策略参数的设置， 以及止损线的绘制。

5.循环次数：默认为连续。可输入正整数。“一买一卖”或“一卖一买”为一次循环，连续循环的上限为 999 次。

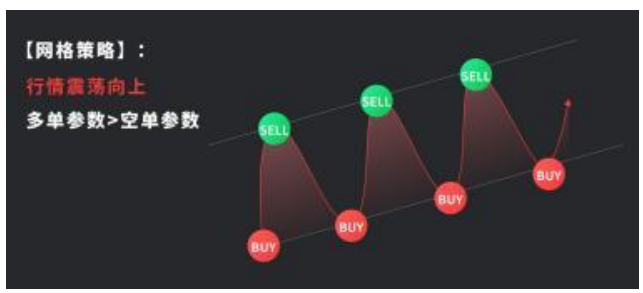
例如：

☞ 循环设置为 3 次（开平为自动），此时去下单买入开仓 1 手成交，触发网格策略，那么这三次循环就是“买开 1 手，卖平 1 手；买开 1 手，卖平 1 手；买开 1 手，卖平 1 手”，3 次循环结束，此批次网格策略报单执行完终止。

☞ 循环设置为 3 次（开平为开仓），此时去下单买入开仓 1 手成交，触发网格策略，那么这三次循环就是“买开 1 手，卖开 1 手；买开 1 手，卖开 1 手；买开 1 手，卖开 1 手”，3 次循环结束，此批次网格策略报单执行完终止。

☞ 循环设置为 3 次（开平为平仓），在持仓充足的情况下，去下单买入平仓 1 手成交，触发网格策略，那么这三次循环就是“买平 1 手，卖平 1 手；买平 1 手，卖平 1 手；买平 1 手，卖平 1 手”，3 次循环结束，此批次网格策略报单执行完终止。

6.多单参数、空单参数（tick）：可根据行情进行预判，填入适用的参数。



多单>空单，适用于震荡向上的行情。

多单=空单，适用于区间震荡的行情。

多单<空单，适用于震荡向下的行情。

止损参数：止损参数≠0 时开启止损线，止损线=最后一笔委托成交均价±止损参数*tick（tick 为最小变动价位），一旦触发止损线，终止此批次的网格报单，对网格生成的仓位：

01.网格策略开平是自动（一开一平或一平一开），平掉网格生成的仓位（单边的）；

02.如果网格策略开平是开仓（双向开仓），就是平掉未对锁的仓位，已对锁的仓位不会平仓；

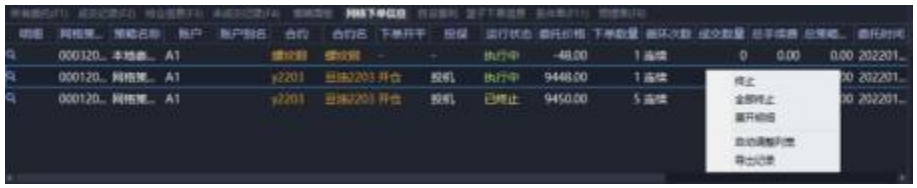
03.对于网格策略开平为平仓（双向平仓），没有网格生成的仓位，仅撤单(不会进行反向开仓)

7.最大下单手数：设置最大下单手数后，在下单实际数量超出时，出弹窗提示。可以选择“继续网格”：继续下超出原先设置的网格单。也可以选择“报普通单”：即此【闪电下单】仅报单笔普通单，不生成网格单。或者“取消”关闭此次下单。

8.添加成功的策略会以开启的状态转到【网格策略】面板。此面板的网格策略模板修改、删除，不会影响到已报出的网格策略单，仅对下一次的报单参数生效。

9.关闭软件、登出账户、断线重连，不会导致【网格策略】面板中的策略模

板关闭。会导致【网格下单信息】中的网格单终止，未成交单因异常导致不撤单。



10.在闪电点价面板对开启的网格策略进行下单，生成的网格策略报单会展示在【网格下单信息】面板。

11.关闭软件、登出账户、断线重连，会导致【网格下单信息】中的网格报单终止，不撤单。

19.3.1.2期货合约、期权合约、标准套利合约添加网格策略（方式 2）

1.点击普通合约、标准套利合约-闪电点价，右下角有网格策略模块。

2.未设置此合约/自设套利的网格策略时，打开闪电点价，网格策略开关默认不开启。开启时不能在此面板修改参数。

3. 由闪电点价面板开启网格策略，首次生成普通合约/标准套利合约/商品期权/ETF 期权到【网格策略】面板，“网格策略开平”为自动。可以从【网格策略】面板，右键-修改策略，对“网格策略开平”修改。

4.若合约已添加网格策略，打开此合约的【闪电点价】面板，网格策略模块

联动显示开关、参数，“网格策略开平”以合约【网格策略】面板内网格策略模型的设置为准。

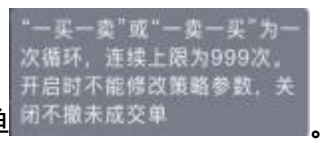
5.【闪电点价】内网格策略开关：关闭时，参数为可修改样式。开启时闪电点价面板内不可以修改网格策略的参数。

6.参数设置：

触发：默认成交价。下拉展开为：成交价、委托价。

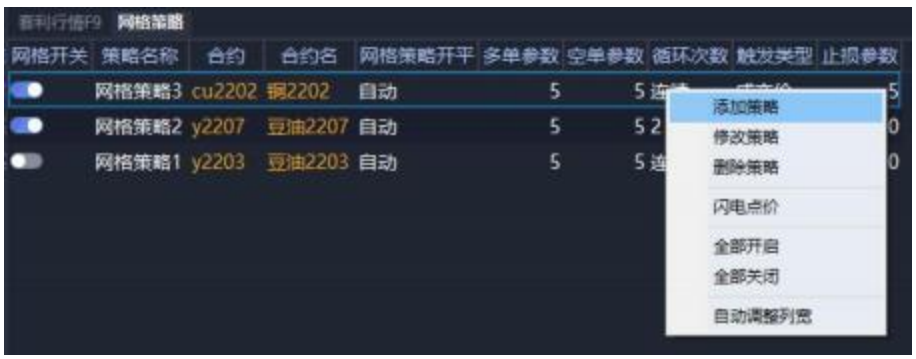
循环：默认连续，连续=999 次。点击+、-变化为 1，范围为 1-999。

多单：默认为 5。点击+、-变化为 1，正整数。

空单：默认为 5。点击+、-变化为 1，正整数。悬浮到回，提示：“一买一卖”或“一卖一买”为一次循环，连续上限 999 次。开启时不能修改策略参数，关闭不撤未成交单 

。

注意：这里的关闭不撤单是指的【网格策略】模板关闭不会导致撤单，但是【网格下单信息】中具体的网格单如果终止了，会撤单。



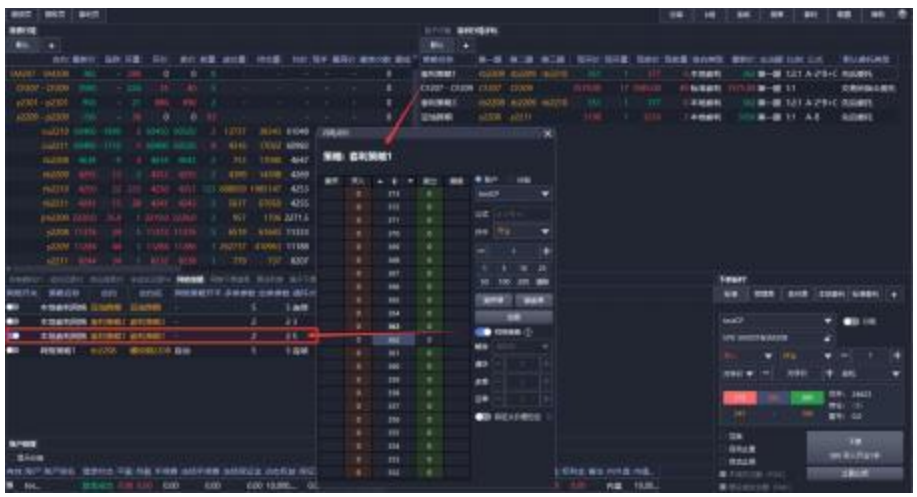
7.开启网格策略，自动将此账户合约信息的网格生成主策略，以开启状态，添加到【网格策略】面板。

若此合约通过闪电点价面板生成的网格主策略，“网格策略开平”视为自动。

具体参数可以在【网格策略】面板内，右键进行参数修改。

闪电点价面板内网格策略开关同【网格策略】面板内的开关、参数联动。

19.3.1.3自设套利策略添加网格策略



在套利行情中选择对应的自设套利策略， 右键-闪电点价功能， 设置对应参数后，开启网格策略，在【网格策略】面板生成对应此账户的自设套利策略网格。【网格策略】面板中的开关联动相同自设套利【闪电点价】 中网格策略的开关。

1. 自设套利添加网格策略的方式仅可从自设套利【闪电点价】面板进入。

2.首次开启自设套利网格策略开关， 自动在【网格策略】面板生成对应的网格策略模板。

3. 由闪电点价面板首次生成的网格主策略，暂无自设套利**“网格策略开平”**设置，在【网格策略】面板以“-”显示。

4. 自设套利网格下单，生成的网格套利开平= 自设套利闪电点价面板下单实际的开平 。因【自设套利-闪电点价】下单板仅支持每腿同账户、同开平，**所以自设套利的网格单仅支持每腿同账户、同开平。**

5. 自设套利网格暂不支持：“止损参数；最大下单手数；触发止损，立即平仓；收盘前 5 分钟终止网格撤单平仓功能”功能。

自设套利网格策略参数：

01、循环次数：默认为连续（即 999 次）， 可输入 1-999。

02、开启中的网格策略参数不能修改参数，关闭时可以修改。此开关与【网格策略】面板中的策略模板开关联动，不影响到已报单的网格策略单（即【网格下单信息】中的网格单不受影响）。

03、循环过程中，若最终有一部分自设套利网格没成交，状态变为已终止，则此批次的自设套利的网格未成交挂单撤单。

19.3.2修改策略

19.3.2.1期货合约、期权合约 、标准套利合约

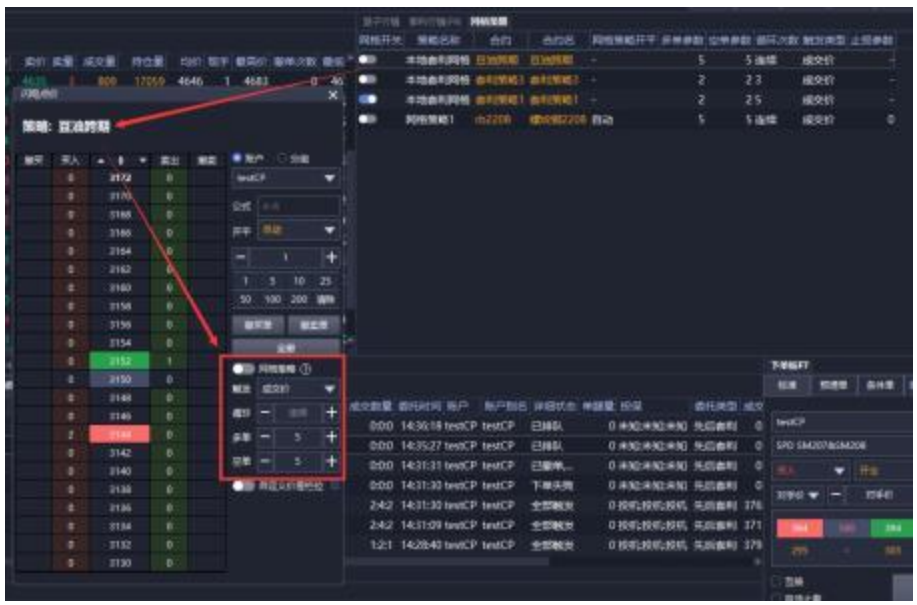
1.在【网格策略】面板选中右键“修改策略”，弹出“修改策略”弹窗。

2.修改策略中：“策略名称”、“合约”不可进行修改。

3.修改后的策略，不影响已报单的网格策略（即【网格下单信息】中的网格

策略单），仅对下一次此合约的报单产生影响。

19.3.2.2自设套利修改网格策略



点开对应的自设套利闪电点价，将网格策略开关关闭（或关闭对应的套利网格开关，再打开闪电点价），进行自设套利网格参数修改，修改后的参数仅对下一次的报单生效，对已报单的套利不产生影响。

19.3.3删除策略

【网格策略】面板，选中对应的网格策略右键“删除策略”，删除策略模板会进行提示。

19.3.4**什么是网格策略**

在期货中，高抛低吸自动执行，收到成交回报立马反向买入/卖出。与止盈止损不同的是，一旦收到成交回报，就会立刻反向下单。（此时开平为自动）

若开平为开仓，进行双向开仓（买开、卖开）。若开平为平仓，进行双向平仓（买平、卖平）。

19.3.5**网格策略报单实例（普通合约、标准套利合约）：**

举一个开平为自动，初始为买开的例子：

设置参数如图，设置网格策略 1 开启后，买开 2 手 cu2201，以 69650 买开成功（cu 最小变动价位为 10 元/吨）。

在 69650 价格买开成交的同时，立即以+3*tick 即 69680 挂 2 手卖平；

在 69680 价格卖平成交的同时，立即以-2*tick 即 69660 挂 2 手买开；

在 69660 价格买开成交的同时，立即以+3*tick 即 69690 挂 2 手卖平；

在 69690 价格卖平成交的同时，立即以-2*tick 即 69670 挂 2 手买开；

在 69670 价格买开成交的同时，立即以+3*tick 即 69700 挂 2 手卖平；

在 69700 价格卖平成交的同时，立即以-2*tick 即 69680 挂 2 手买开；

在 69680 价格买开成交的同时，立即以+3*tick 即 69710 挂 2 手卖平；

在 69710 价格卖平成交的同时，立即以-2*tick 即 69690 挂 2 手买开；

……

按照以上规律连续循环（循环上限为 999 次，循环结束此批次的网格策略终止）。

有买开持仓时，止损线=最后一笔委托成交均价-6*tick；一旦行情触发止损线，网格策略关闭；同时，此批次网格策略单终止，未成交单撤单。

举一个开平为开仓，初始为买开的例子：

设置参数如图，设置网格策略 2 开启后，买入开仓 1 手 cu2201，以 69650 买开成功（cu 最小变动价位为 10 元/吨）。

在 69650 价格买开成交的同时，立刻以+5*tick 即 69700 挂 1 手卖开；

在 69660 价格卖开成交的同时，立刻以-5*tick 即 69650 挂 1 手买开；

在 69650 价格买开成交的同时，立刻以+5*tick 即 69700 挂 1 手卖开；

在 69660 价格卖开成交的同时，立刻以-5*tick 即 69650 挂 1 手买开；

在 69650 价格买开成交的同时，立刻以+5*tick 即 69700 挂 1 手卖开；

在 69660 价格卖开成交时，3 次循环结束，此批次的网格策略终止。

此时持有 3 手卖开仓、3 手买开仓。

有持仓时：持仓空头止损线=最后一笔委托成交均价+10*tick；

持仓多头止损线=最后一笔委托成交均价-10*tick。

在此网格执行过程中，因开启止损线且勾选了“触发止损，立即平仓”，因此一旦行情触发止损线，终止此批次的网格策略，撤销未成交单，并平此网格触发的未对锁的仓位（例：若卖开 3 手，买开 2 手时触发止损，仅平卖开 1 手）。

举一个开平为平仓，初始为卖平的例子。

设置参数如图，设置网格策略 3 开启后，买开 3 手，卖开 3 手，持仓均价：买开 69620，卖开 69670。

卖出平仓 1 手 cu2201，以 69650 卖平成功（cu 最小变动价位为 10 元/吨）。

在 69650 价格卖平成交的同时，立即以-4*tick 的价格即 69610 挂 1 手买平；

在 69610 价格买平成交的同时，立即以+2*tick 的价格即 69630 挂 1 手卖平；

在 69630 价格卖平成交的同时，立即以-4*tick 的价格即 69590 挂 1 手买平；

在 69590 价格买平成交的同时，立即以+2*tick 的价格即 69610 挂 1 手卖平；

在 69610 价格卖平成交的同时，立即以-4*tick 的价格即 69570 挂 1 手买平；

有持仓时： 持仓空头止损线=最后一笔委托成交均价+10*tick；

持仓多头止损线=最后一笔委托成交均价-10*tick。

在 69570 价格买平成交时， 3 次循环结束， 此批次的网格策略终止。

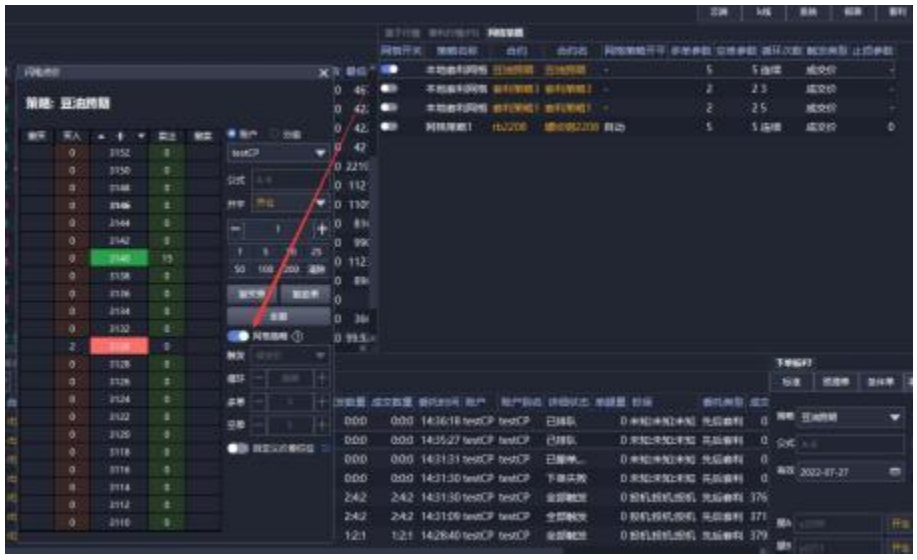
开启中一旦行情触发止损线，关闭网格策略；同时，未成交单撤单，因本身为平仓方向，仅撤单。

19.3.6**网格策略报单实例（自设套利策略）：**

1.设置“套利策略 1 如”图，对“套利策略 1”设置网格策略， 网格参数 5（即多单参数=空单参数=5*tick），循环 3 次。

2.勾选网格策略，并对“套利策略 1”下 1 手买入开仓。

3.此时生成套利策略 1 的“自设套利网格”。是对此套利单整体进行网格“买开、卖开”；“买开、卖开”；“买开、卖开”3 次循环。



4.具体的进行可以在【网格下单信息】面板找到对应进程。并且点击放大镜或右键展开明细。若想要看到套利的每腿信息，可以在【自设套利】找到对应的套利单子，右键-展开明细查看。

5.循环过程中，若有一部分自设套利网格没成交，最终自设套利网格变为已终止状态，未成交的自设套利网格挂单撤单。

19.3.7**网格策略异常状态：**

1.网格策略使用过程中，根据当日断线重连或重启过程中最后一次报单是否发生成交，判断该网格策略继续执行还是终止。

01、若当日断线重连或重启客户端时，最后一次报单有委托成交，则该网格策略终止；

02、若当日断线重连或重启客户端时，最后一次报单没有委托成交，则该网格策

略继续执行。执行直到设定的循环次数全部完成。

03、举例：

（1）对ru2401合约设置网格策略。以成交价触发，循环10次，多单参数为2，空单参数为1。现在ru2401买一价是13415，以13420的指定价买入开仓。若此时ru2401合约以13420的价格在买方向成交一笔，则买方向成交一笔后，立即以成交价13420+空单参数1=13421的卖一价发起第二次委托。此时循环次数还剩9次未循环。那么：

① 若ru2401合约的第一次循环的卖平仓成交了1笔，成交后立即发出第二次循环的买开仓委托。第二次循环的买开仓未成交，则此时网格断线重连/重启，该网格继续执行。执行直到设定的循环次数全部完成。

② 若ru2401合约的第一次循环的卖平仓成交了1笔，成交后还未来及发起第二次循环的买开仓委托。则此时网格断线重连/重启，该网格策略终止。

③ 若ru2401合约的第一次循环的卖平仓未成交，则此时网格断线重连/重启，网格策略继续执行。执行直到设定的循环次数全部完成。

（2）对ru2401设置网格策略。以成交价触发，循环1次，多单参数为2，空单参

数为1。现在ru2401买一价是13415，以13420的指定价买入开仓。若网格策略循环1次后，买开仓和卖平仓的委托都成交，则如果此时网格断线/重启后，该网格策略的状态是已完成。

2.若断线重连 、账户登出 、关闭软件导致的网格策略终止，【网格下单信息】中的策略详细状态会显示对应信息， 并且不撤单 。若这批未撤单的单子成交了，对应的网格展开明细中， 委托信息会显示未知， 成交明细 、策略汇总不会显示。

20 、【智能算法】算法下单整体流程

20.1功能点简介

【智能算法】目前支持多种算法模式，包括：冰山指令、TWAP、VWAP。算法交易能够帮助用户解决大量委托单拆单， 防止冲击成本。

冰山指令：将大单委托按指定单笔数量范围内随机进行拆单，隐匿交易踪迹，只露冰山一角。

TWAP（限价）：在指定时间、限价范围内，把大单委托自动拆分为多笔（限价）分散成交。

TWAP：在现有 TWAP 功能基础上增加“委托价格”的设置。选择委托价格、设置相关参数，闪电点价面板选择委托价下单时，下单的价格类型不是选择的委托价，而是在 TWAP 选择的委托价格类型。

VWAP：根据市场成交量，把大单委托自动拆分为多笔（对手价）分散成交。

20.2入口路径

点击配置-“选项”调出配置弹窗，选择【显示配置】-【选择显示面板】-勾选相关面板【普通行情】、【下单板】、【算法列表】， 点击应用。

在行情面板找到具体合约，右键-【闪电点价】， 可以看到智能算法模块，算法支持普通合约、标准套利合约。暂不支持智能算法与网格策略同时开启。

1.在【闪电点价-普通合约/标准套利合约】算法模块，切换点击算法下拉项：冰山指令、TWAP、VWAP，弹出对应算法弹窗。或点击编辑按钮，弹出对应算法弹窗。

2.算法开关：按钮的开关与已下单的算法委托无关。

3.初始开关按钮为关闭状态，显示“智能算法”字段。此时无黄色数值提示。**未选择具体算法（文字为智能算法时），此时点击编辑按钮不生效，不出具体弹窗。**

4.下拉切换点击**具体算法**、或在**已有具体算法**时点击编辑按钮（不论智能算法开关状态），弹出对应的算法设置弹窗。

5.初始状态（智能算法）点击“开启”按钮，默认开启第一个算法“冰山指令”初始数据为 1;1，若设置过冰山指令，则显示对应记录数据。

6.下拉可切换智能算法

按钮处于**关闭状态时**：

可以进行下拉切换的操作，选择具体下拉项，弹出对应弹窗。

关闭软件再打开，算法模块显示“智能算法”，切换对应的算法类型后，显示最新记录的算法参数。

7.算法参数缩写：

1 已成功设置的算法参数，不论算法开关，会保留当前算法最新的参数缩（黄色），展示在算法下拉选项的下方。

② **不论算法开关状态**，鼠标移动到有黄色缩写部分，悬浮展对应的算法提示信息。

20.3使用说明

20.3.1智能算法-冰山指令

1.参数必须为正整数，且单笔上限（数量）不能小于单笔下限（数量）。

2.下单时的委托总量必须大于等于单笔上限。

3.下单确认中有“算法： 冰山指令”提示。

4.成功报单的信息会展示在【算法列表】面板中。

5.冰山指令计算逻辑：在下单板设置好委托价格、委托数量，使用冰山指令算法下单时，则每笔以单笔上限与单笔下限之间任一随机数量进行报单，上一笔成交后进行下一笔报单，最后一笔报单数量小于单笔下限时仍然执行。

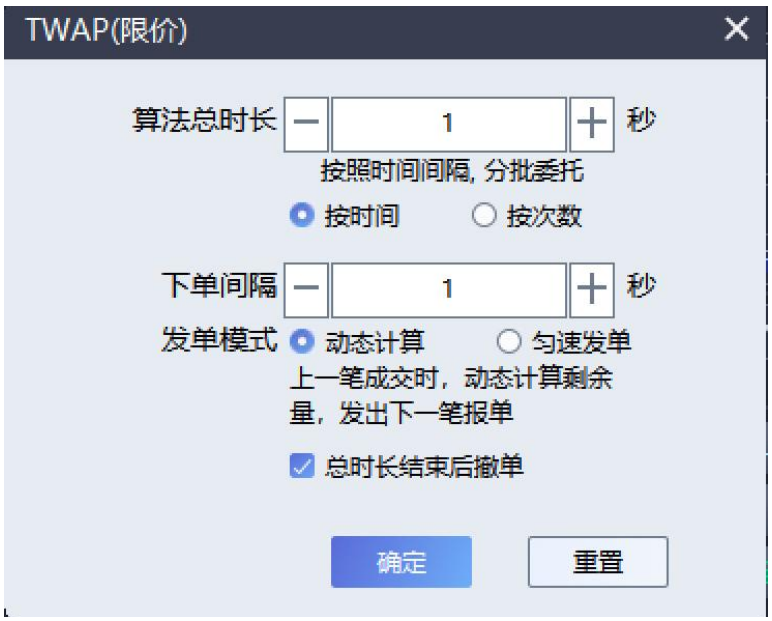
例如：设置单笔上限 50，单笔下限 10，总委托数量 100。

下单后第一笔以 10～50（包含 10、50）之间的随机数量进行报单，待第一笔成交后，再以 10～50（包含 10、50）之间的随机数量进行第二笔报单.....最后一笔报单可以是 10 以下报单，达成总委托数量 100，则此冰山指令全部报出，待最后一笔成交后，冰山指令运行状态变为已完成。

单笔上限可以等于单笔下限，设置单笔上限 10，单笔下限 10，总委托数量 100。

按照每次数量 10 进行报单。第一笔以数量 10 报出，成交后再报出第二笔数量 10，第二笔成交后报出第三笔数量 10...第 10 笔数量 10 报完，达成总委托数量 100，则此冰山指令全部报出，待第十笔数量 10 成交后，冰山指令运行状态变为已完成。

20.3.2**智能算法-TWAP(限价)**



1.算法总时长、下单间隔/委托次数为必填项，且需要为正整数。

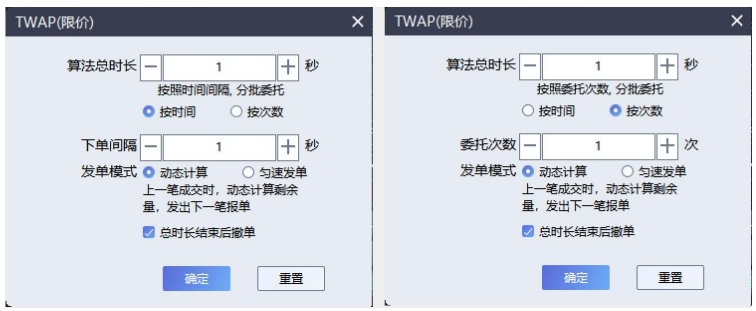
2.算法总时长需大于等于下单间隔，算法总时长需大于等于委托次数。

3.下单确认中有“算法： TWAP”提示。

4.成功报单的信息会展示在【算法列表】面板中。

5. 目前有动态计算、匀速发单 2 种模式，详见下文 2 种模式举例。

20.3.2.1TWAP(限价)-动态计算



TWAP(限价）-动态计算逻辑：

选择按时间或者按次数，进行时间的拆单。第一笔会在委托后先报出，成交后根据时间委托出下一笔，若价格不满足，则等待行情满足后再报出第二笔。设定的算法总时长，未做满总委托，根据是否勾选复选框：总时长结束后撤单，进行撤单。

详见举例：

按时间：

算法总时长 200s，下单间隔 2s，勾选“总时长结束后撤单”。下单板总委托量 600。

200s 算法总时长内，若价格一直满足，则每隔 2s（下单间隔），委托 6 手（根据时间和委托总量计算单笔委托量：600 除以 200/2，等于 6），第一笔在算法单成立时报出，上一笔成交后，方进行下一笔委托，若价格不满足，则等待行情满足时，自动委托，200s 后仍未做满总委托量 600，则立即撤单且不再执

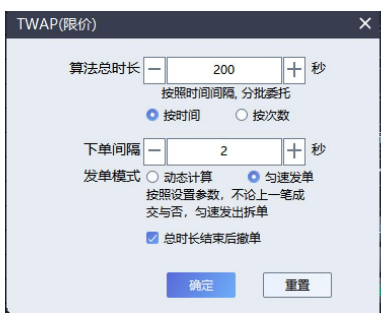
行（不勾选总时长结束后撤单，若有未成交单不撤单。异常情况不撤单）。

按次数：

算法总时长 200s，委托次数 100 次，勾选“总时长结束后撤单”。下单板总委托量 600。

200s 算法总时长内，若价格一直满足，则每隔 2s**（总时长/委托次数）**，委托 6 手（**委托总量/委托次数）**，第一笔在算法单成立时报出，**上一笔成交后，方进行下一笔委托**，若价格不满足，则等待行情满足时，自动委托，200s 后仍未做满总委托量 600，则立即撤单且不再执行（不勾选**总时长结束后撤单**，若有未成交单不撤单。异常情况不撤单）。

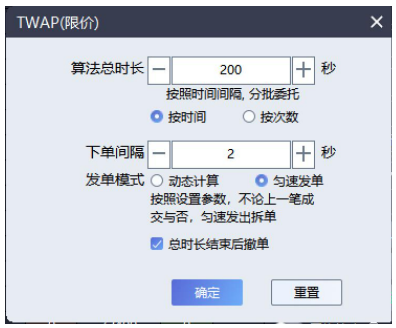
20.3.2.2TWAP(限价)-匀速发单



TWAP(限价)-匀速发单逻辑：

选择按时间或者按次数，进行时间的拆单。第一笔会在委托后立即报出，成交后根据时间委托出下一笔，不论是否成交(未成交有挂单），达到下一次时间，

报出第二笔。设定的算法总时长，未做满总委托，根据是否勾选复选框：总时长结束后撤单，进行撤单。



按时间：

算法总时长 200s，下单间隔 2s，勾选“总时长结束后撤单”。下单板总委托量 600。

200s 算法总时长内，则每隔 2s（下单间隔），委托 6 手。第一笔在算法单成立时报出，2s 后继续委托下一笔 6 手...200s 总共委托 100 次，每次 6 手，报满 600 委托量。200s 总时长结束，立即撤单且不再执行（不勾选总时长结束后撤单，若有未成交单不撤单。异常情况不撤单）。

按次数：

算法总时长 200s，委托次数 100 次，勾选“总时长结束后撤单”。下单板总委托量 600。

200s 算法总时长内，若价格一直满足，则每隔 2s**（总时长/委托次数）**，委托 6 手（**委托总量/委托次数）**，第一笔在点价报单时算法开始立即报出，

2s 后报出第二笔...200s 总共委托 100 次，每次 6 手，报满 600 委托量。200s 总时长结束，立即撤单且不再执行（不勾选**总时长结束后撤单**，若有未成交单不撤单。异常情况不撤单）。

20.3.3智能算法-TWAP

1. 委托价格支持设置最新价、对手价、市价、排队价四种。默认显示对手价。
2. 当委托价格选择“市价”，即选择市价 FAK。
3. 下单详情信息显示在“算法列表”面板。

20.3.3.1TWAP-起止时间

“TWAP”在现有支持设置“算法总时长”的基础上，增加设置“起止时间”。

在“时长模式”中选择“算法总时长”或“起止时间”。选择后显示相应功能。

“TWAP”默认选中“起止时间”。

1. “TWAP”设置“起止时间”，即选择合约下单后，TWAP会在设定的起始时间开始运行。而“算法总时长”是选择合约下单后即时生效的。

2. “起止时间”为当日有效。即起止时间需要设置小时、分钟、秒，日期默认指当前交易日。

3.TWAP算法在终止时间后，会自动终止该策略。

20.3.3.2TWAP-动态计算、匀速发单的计算逻辑

1.动态计算的逻辑为：在算法运行过程中，最后一次委托量报出剩余总委托量。每次委托量的计算逻辑为：(总委托量 - 已成交量)/(总委托次数-已委托次数)，每次数值向上取整。

例如：按时间，起止时间为 09：00：00 至 09：10：00，委托价格为最新价，总委托量为 523 手，发单模式 60 秒，匀速发单。那么一共委托 10 次，10 次的委托量分别是：53、53、53、52、52、52、52、52、52、52。

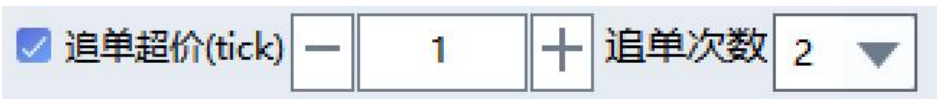
2.匀速发单的逻辑为：第一笔成交后根据时间委托出下一笔，不论是否成交(未成交有挂单），达到下一次时间，报出第二笔。每次委托量的计算逻辑为：

(总委托量 - 已委托量)/(总委托次数-已委托次数)，每次数值向上取整。

例如：若委托价格设置最新价，起止时间为09：00：00至09：25：00。总委托量7手。按次数，委托次数：5次。发单模式：匀速发单。那么：5次的委托量分别是：2，2，1，1，1 。

20.3.3.3TWAP-支持设置追单超价

1.每次不成交的委托单，根据上一笔报单价 + n 个 Tick 的形式，触发追单，可设定追单次数。追单超价为 FAK 模式。若设定的最后一次追单未成交，则最后一笔追单委托挂单，为 GFD 模式。



2.追单超价（tick）支持设置0和正数；追单次数支持设置1-20次。

3.市价不支持设置追单超价。市价最后一笔不成交的委托单在追单时不会转GFD模式。

20.3.3.4 支持 TWAP 执行指令

指令执行人员接收到普通指令需求时，双击该指令，该指令对应的指令参数自动填写在标准下单板中。并支持选择使用TWAP算法执行该指令。（详见3.3.2-07）

20.3.4智能算法-VWAP

1.设置参数，正整数。

2.VWAP 算法不支持市价委托，下单时需检查价格类型。

3.委托总量必须大于等于 VWAP 单笔委托数量：以对手价、单笔数量的设置。

4.因 VWAP 算法扣除自身成交量较准确，故开启过个同合约的 VWAP 时计算会有影响，有友好提示。

5.下单确认中有“算法：VWAP”提示。

6.在 VWAP 算法下单时，满足市场成交量才开始报第一笔单。若算法最后剩余的报单数量小于设置的单笔数量，报出剩余报单数量，以满足总委托量为主。

7.VWAP 算法计算逻辑：

例如：假设总委托量为 600，市场成交量每增加 200 数量，以对手价、单笔数量 20 进行委托，追单超价 1tick，追单次数 20。

从总委托下单开始累计市场成交量-这里指的是行情中“成交量”字段（每次扣除自身 VWAP 算法成交量），每增加 200（市场成交量），则以对手价委托 20 手（单笔数量），对手价不成交，则每次根据最新的对手价+1 个 Tick（追单超价）的形式，触发追单，最多追单 20 次（看具体选择次数，追单次数用完撤单，走 FAK 模式），直至委托满 600 总委托数量。

扣除自身行情举例：

① 市场行情从 VWAP 设置开始行情量为 2000，增长到 2500，此时（2500-2000）/200 取整*20，报 40 数量。

② 市场行情量变为 2700，此时第一批 VWAP 报单 40 都成交。第二次报（2700-2000-40）/200 取整*20-40，报 20 数量。

③ 市场行情量变为 2940，此时第二批报单 20 也都成交。第三次报（2940-2000-40-20）/200 取整*20-40-20，报 20 数量。

...

直至委托满 600 总量。

8.若 VWAP 算法遇到市场成交量激增的情况：若市场成交量激增 n 倍，则

直接按 n 倍直接报出以对手价、单笔数量的委托。后续市场成交量放缓，再正常进行 VWAP 分批报单。

20.3.5 算法列表

1.算法下单成功会出提示并将下单算法展示到【算法列表】。

2.运行规则：

若算法至收盘仍未完成，终止不撤单。有效期-当日有效，算法列表第二个交易日清空。

异常情况：登出账户、关闭软件、收盘、资金不足、断线重连等都会导致此算法终止，不撤单。

① 账户登出，详细状态：“异常-账户登出导致终止，不撤单”。

② 关闭软件，详细状态：“异常-软件关闭，不撤单”。

3.冰山指令、TWAP、VWAP、累仓策略算法，若因【未成交记录】面板改单导致撤单，继续执行算法策略。

4.【算法列表】中冰山指令支持改单。

a.改价时对输入价格进行判定：若价格高于涨停价、价格低于跌停价，则弹出系统提示弹窗；若价格输入正确，则弹出改单确认弹窗。

b.改价成功后，若该冰山指令算法单有未成交单，则该笔未成交单撤单，并以新的委托价进行报单，报单数量为单笔上限与单笔下限区间的随机数值。

c.改价成功后，若该冰山指令算法单无未成交单，则该笔算法单以新的委托价继续执行。

d.冰山指令算法生成的未成交单，在未成交记录页修改该笔未成交单的报单价格时，对输入价格进行判定，若价格无误则弹出改单确认弹窗，点击【确定】， 价格修改成功，该笔报单转为普通单。

① 暂停/全部暂停：对选中/全部“执行中”的算法委托暂停执行（TWAP 暂停算法总时长的计时，暂停发出报单委托，未成交单不撤单；冰山指令、VWAP 暂停发出报单委托，未成交单不撤单）。运行状态变为“暂停”。

② 继续/全部继续：对选中/全部“暂停”状态的算法委托恢复执行。运行状态变为“执行中”。

③ 终止/全部终止：对选中/全部执行中或“暂停”状态的算法变为“已终止”，未完成的报单取消报单，不能再次开启。（手动终止，未成交单撤单、断线重连、关闭软件、账户登出、收盘仍未完成等导致的终止，未成交单不撤单。未发出的报单数量，不再发出）因未做满委托数量，运行状态变为“已终止”。

5.【算法列表】中，累仓策略-算法列表面板未成交单支持改单，详见 15.3.14。

21、梯度扫盘指令

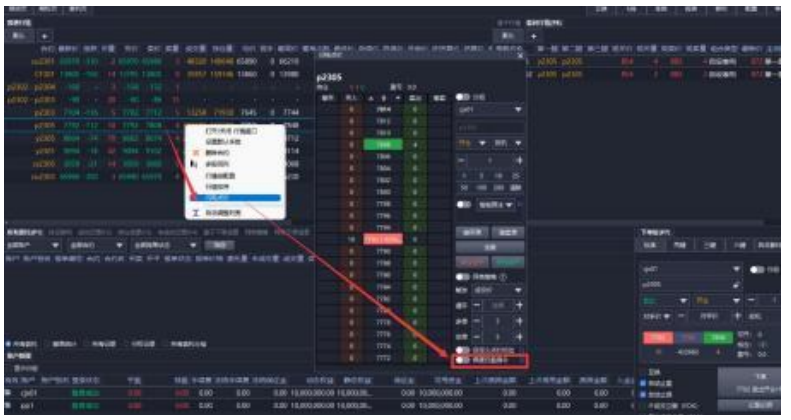
21.1功能点简介

梯度扫盘指令支持自定义价格间隔、委托量，进行扫盘式批量报单。在期货、证券市场会贴切的形容为“金字塔”或“倒金字塔”委托，满足行情下跌时一直建仓，上涨反向卖出。

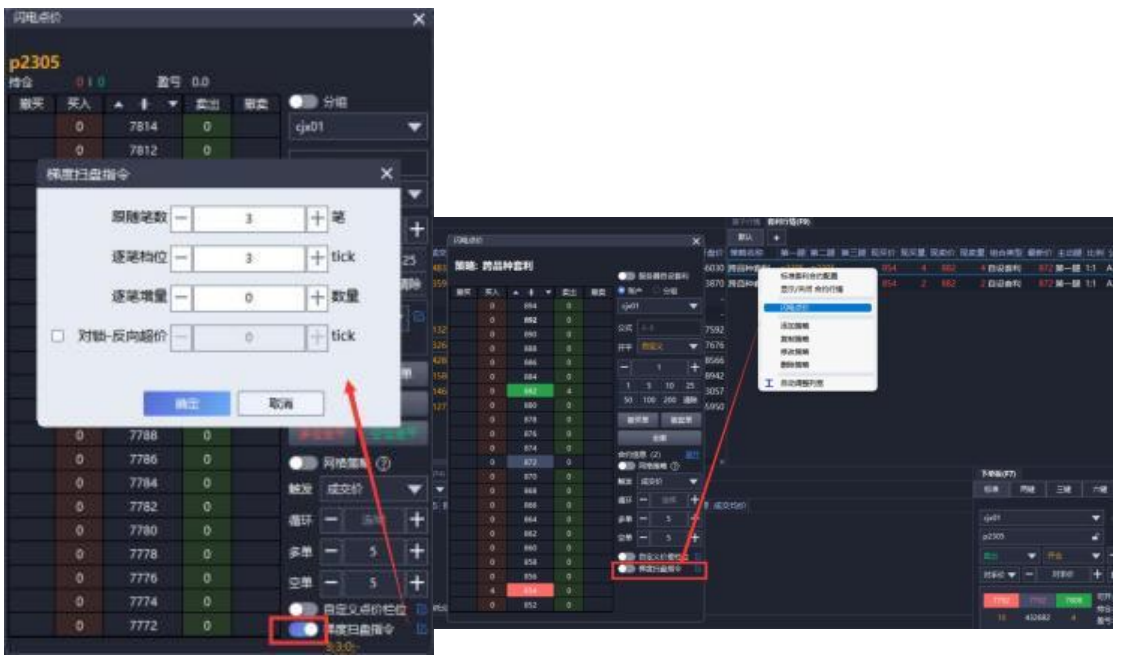
随心易的扫盘不仅满足普通期货、期权合约、标准套利、套利的扫盘价格梯度扫盘，也可以支持做市商业务，同时发出同合约不同买卖方向的报单，设置另

一个方向间隔的 tick 值。

21.2入口路径

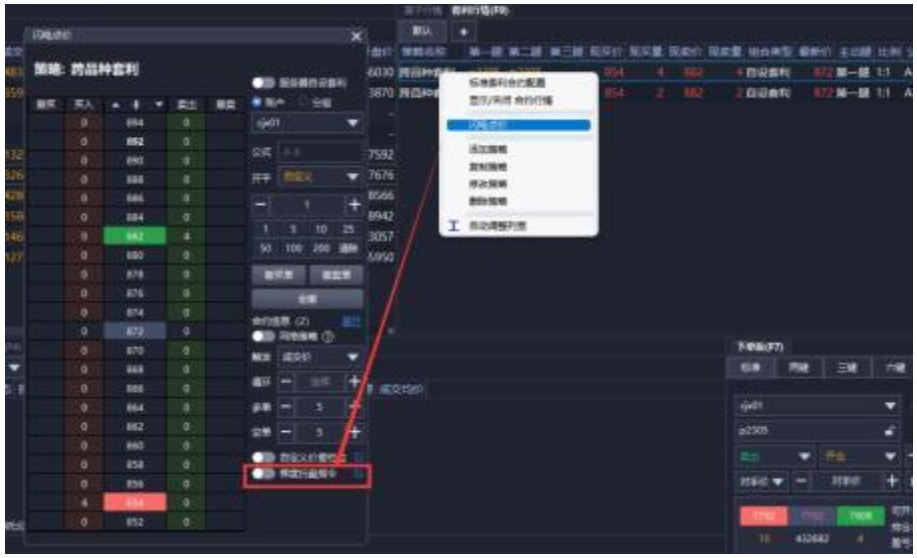


普通期货、期权合约：普通行情-右键【闪电点价】， 在点价下单板最下方-开启梯度扫盘指令， 点击右侧的编辑按钮即可编辑参数。



标准套利/套利策略：套利行情-右键【闪电点价】， 在点价下单板最下方-开启梯度扫盘指令， 点击右侧的编辑按钮即可编辑参数。

普通期货、期权合约：普通行情-右键【闪电点价】， 在点价下单板最下方-开启梯度扫盘指令，点击右侧的编辑按钮即可编辑参数。



标准套利/套利策略：套利行情-右键【闪电点价】， 在点价下单板最下方-开启梯度扫盘指令，点击右侧的编辑按钮即可编辑参数。

设置后会根据点价进行梯度扫盘指令。支持叠加智能算法、网格策略。

21.3使用说明

点击按钮开关，开启生成默认参数，开启时点击 编辑按钮，弹出“梯度扫盘指令”弹窗。

21.3.1参数含义&设置范围

1、**跟随笔数：**每笔委托之后跟随多少笔委托。范围：0-99999 的整数。

当跟随笔数设置为 0，逐笔档位、逐笔增量为禁用模式。

2、逐笔档位：每笔委托价格相差多少 tick，买入委托越买越低，卖出委托越卖越高。范围：0-99 的整数。

（注意：自定义点价栏位和梯度扫盘指令可以同时开启，下单时以实际的 tick 值进行下单、展示。若调整自定义点价栏位，闪电点价的挂单显示可能有折叠）

3、逐笔增量：下一笔委托数量增加多少手。范围：0-99999 的整数。

4、对锁-反向超价 tick：默认不勾选（且 D 默认值为 0），禁用样式；勾选后，范围：0-99999 的整数。

01、勾选数值为 0，即做与点价-同价位买卖相反的对锁单（第一笔）。

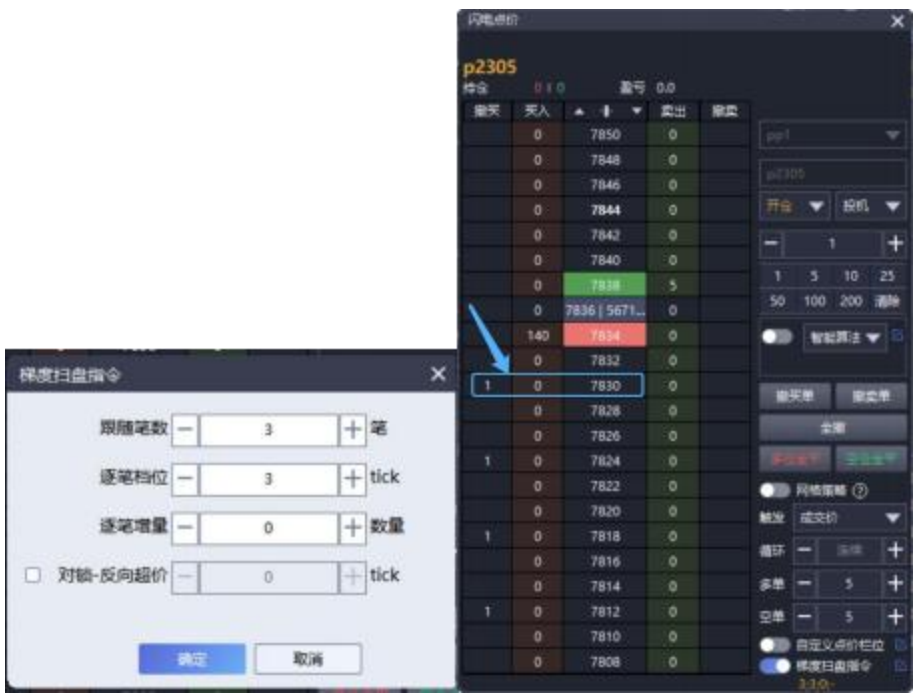
02、数值大于 0，点买单（第一笔）价位**增加**对应的 tick 数值计算第一笔卖出；点卖单（第一笔）价位**减少**对应 tick 数值计算第一笔买入。

第一笔买、卖价位确定后，根据跟随笔数、逐笔档位（买入委托越买越低，卖出委托越卖越高），逐笔增量，计算出其他报单。

5、点击确定，会进行参数判断提示。成功设置后，会记录参数并以黄字、鼠标悬浮参数，展示到点价界面。

按钮初始状态-默认关闭，关闭【闪电点价】再次打开，梯度扫盘指令按钮关闭。开启后会记录最后一笔成功设置的参数（不区分合约品种/标套/套利策略）。

21.3.2**举例**



1、设置：跟随笔数、逐笔档位、逐笔增量。

如上图设置举例：

点价-**买入**合约 p2305（棕榈油，1tick=2）价格为 7830，1 手；

跟随笔数 3、逐笔档位 3，逐笔增量 0。

买入价格向下每 3tick 买入 1 手，总共跟随 3 笔。因未勾选对锁-反向超价，故仅有买方向报单。

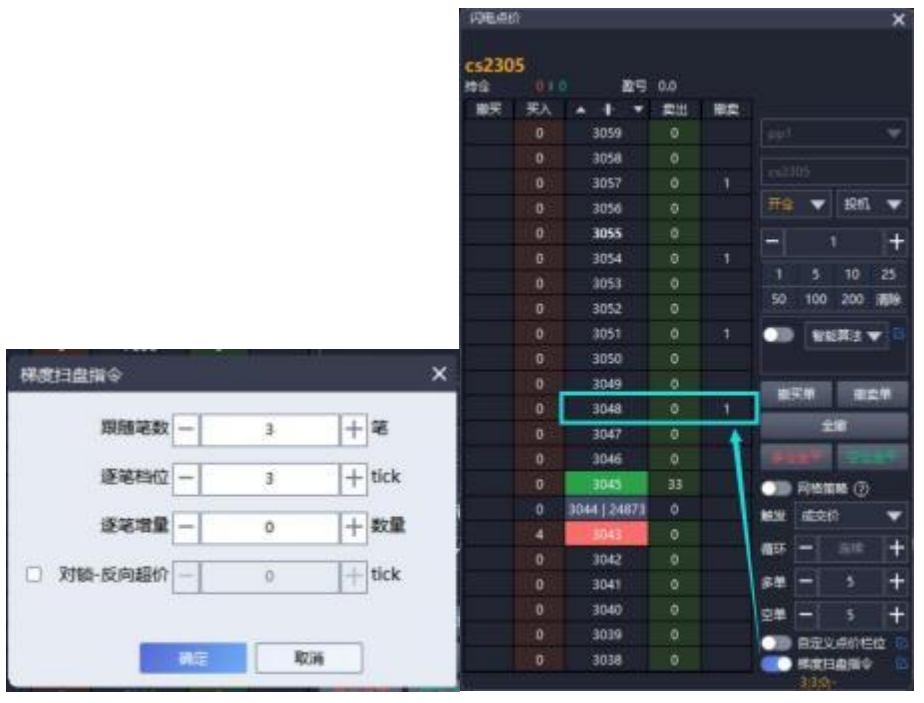
买入方向：

通过点价报单 7830 价格 1 手；

跟随第一笔：7830-3tick=7824 价格（逐笔档位 3tick，买越买越低）1 手（逐笔增量 0）；

跟随第二笔：7824-3tick=7818 价格（逐笔档位 3tick，买越买越低），1 手（逐笔增量 0）；

跟随第三笔：7818-3tick=7812 价格（逐笔档位 3tick，买越买越低），1 手（逐笔增量 0）。



2、设置：跟随笔数、逐笔档位、逐笔增量。

如上图设置举例：

点价-**卖出**合约 cs2305（玉米淀粉，1tick=1）价格为 3048，1 手；

跟随笔数 3、逐笔档位 3，逐笔增量 0。

卖出价格向上每 3tick 买入 1 手，总共跟随 3 笔。因未勾选对锁-反向超价，故仅有卖方向报单。

卖出方向：

通过点价报单 3048 价格 1 手；

跟随第一笔：3048+3tick=3051 价格（逐笔档位 3tick，卖越卖越高）1 手（逐笔增量 0）；

跟随第二笔：3051+3tick=3054 价格（逐笔档位 3tick，卖越卖越高），1 手（逐笔增量 0）；

跟随第三笔：3054+3tick=3057 价格（逐笔档位 3tick，卖越卖越高），1 手（逐笔增量 0）。

3、设置：跟随笔数、逐笔档位、逐笔增量、对锁-反向超价。

如上图设置举例：

点价：买入 eg2301（乙二醇，1tick=1）价格为 4389，3 手；

跟随笔数 4、逐笔档位 2、逐笔增量 2、对锁-反向超价 2。

买入方向，价格向下每 2tick 增加买入 2 手，总共跟随 4 笔；卖出对锁点价那笔增加 2tick，对应的卖出方向也跟随 4 笔。

买入方向：

通过点价报单 4389 价格 3 手；

跟随第一笔：4389-2tick=4387 价格（逐笔档位 2tick，买越买越低），3+2=5 手（逐笔增量 2）；

跟随第二笔：4387-2tick=4385 价格（逐笔档位 2tick，买越买越低），5+2=7 手（逐笔增量 2）；

跟随第三笔：4385-2tick=4383 价格（逐笔档位 2tick，买越买越低），7+2=9 手（逐笔增量 2）；

跟随第四笔：4383-2tick=4381 价格（逐笔档位 2，买越买越低），9+2=11 手（逐笔增量 2）。

卖出方向：

因为设置的“买入对锁-反向超价 2tick”，即-卖出方向首次报单为 4389+2tick=4391 价格 3 手；

跟随第一笔：4391+2tick=4393 价格（逐笔档位 2，卖越卖越高），3+2=5 手（逐笔增量 2）；

跟随第二笔：4393+2tick=4395 价格（逐笔档位 2，卖越卖越高），5+2=7 手（逐笔增量 2）；

跟随第三笔：4395+2tick=4397 价格（逐笔档位 2，卖越卖越高），7+2=9

手（逐笔增量 2）；

跟随第四笔：4397+2tick=4399 价格（逐笔档位 2，卖越卖越高），9+2=11 手逐笔增量 2）。

4、设置：跟随笔数、对锁反向超价。

如上图设置举例：

点价-**卖出**合约（cu2303， 1tick=10）价格为 66550， 1 手；

跟随笔数 0 笔、对锁-反向超价 0tick。

点击报单对同价位进行买、卖方向的报单。

买入方向：

通过点价买入报单 66650 价格 1 手；

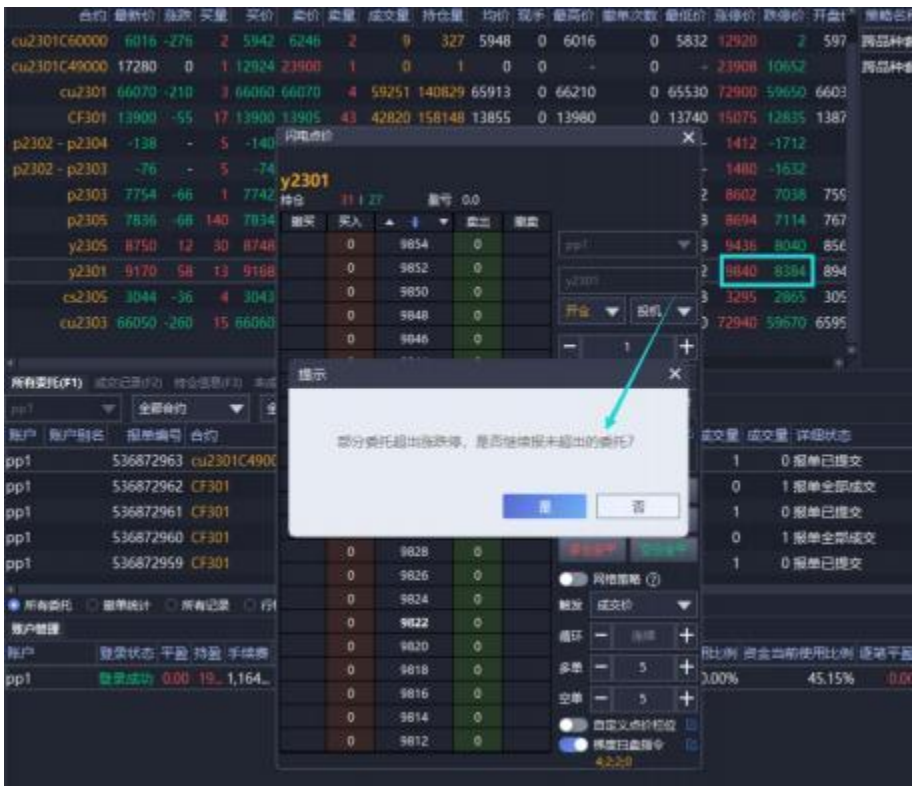
卖出方向：

对锁-反向 0tick： 同价位卖出报单 66650 价格 1 手。

此参数设置请注意规避自成交风险。

21.3.3注意事项

1、若超出涨跌停会进行提示。



2、可以选择仅对未超出涨跌停进行报单。

3、若部分超出涨跌停，对未超出部分报单**且勾选了“对锁-反向超价 tick”，仅报未超出部分的买卖成对的数量。**

22、附录

系统快捷键一览

所有委托 （F1）

成交记录 （F2）

持仓信息 （F3）

未成交记录 （F4）

平仓信息 （F5）

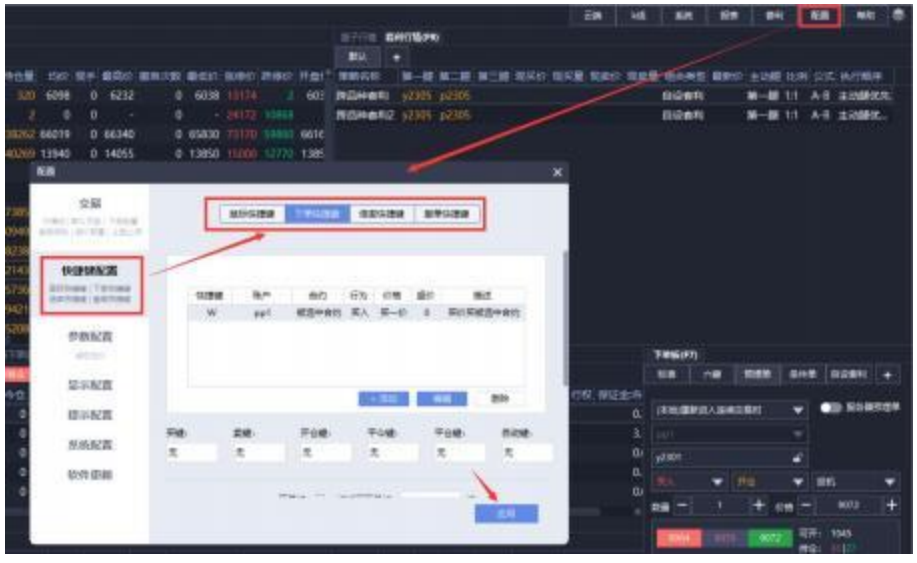
下单面板 （F7）

预埋单 （F8）

套利行情 （F9）

条件单 （F11）

止盈止损 （F12）



更多快捷键配置可参考配置-选项-配置弹窗-快捷键配置内的具体项。

23、备注

备注内容为隐藏功能，如需开启，可以联系融航信息运维协助开启使用。

23.1指定资金账户

23.1.1功能点简介

可以为当前操作账户，指定具体的资金账户进行下单。不再是由服务器分配资金账户下单。

23.1.2入口路径

在【账户管理】面板，右键-指定资金账户设置。

23.1.3使用说明

23.1.3.1指定资金账户弹窗

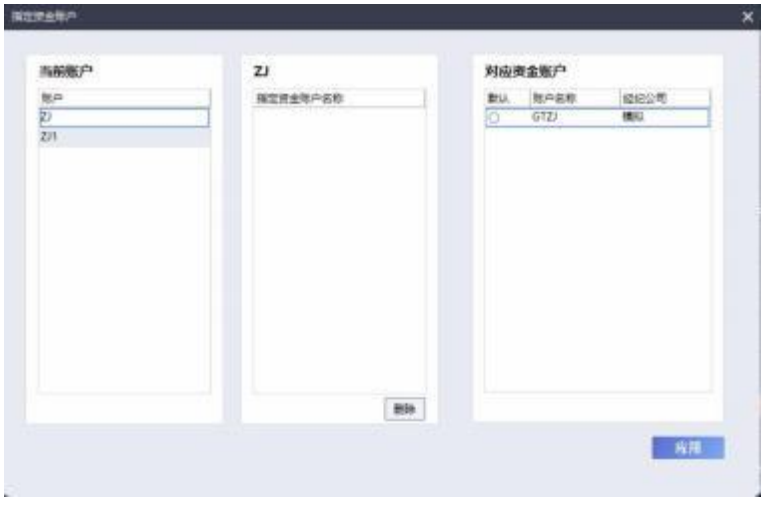
弹出【指定资金账户】弹窗。

1.只能进行一对一勾选：选择一个当前账户，例如 ZJ，中间指定资金账户

名称的标题就会对应变为 ZJ。右侧为具体对应的资金账户（目前仅支持单选）。

2.点击“应用”生效。点击 X 关闭，不进行任何操作。

23.1.3.2未指定资金账户弹窗

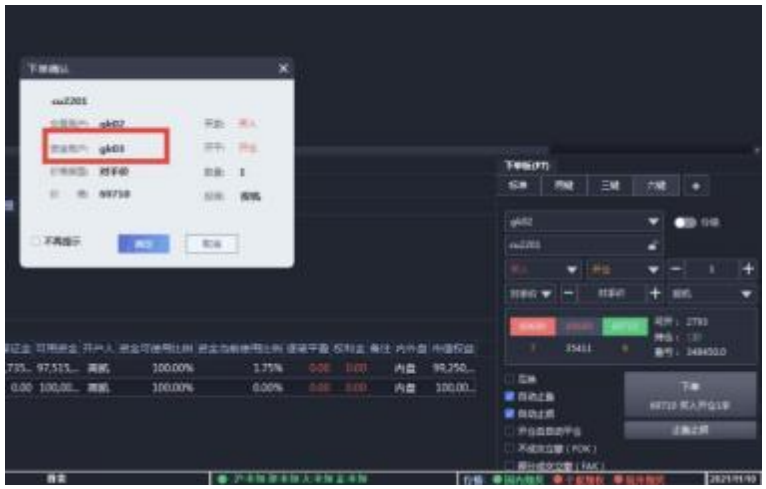


初始、未进行指定资金账户、**重启随心易客户端**，此处为空白，即由服务器分配资金账户下单。

注：为防止设置资金账户后，重启客户端忘记对应关系，所以每次重启客户端会直接清除绑定关系。

23.1.3.3下单支持

1.设置指定资金账户后： 随心易服务器预埋单及所有的**本地下单（下单板下单、闪电点价、套利下单、篮子下单）**都可以使用对应的资金账户中的资金。



2.在【标准、两键、三键、六键】下单板进行下单，确认弹窗会具体显示对应的资金账户。

3.支持：服务器条件单、服务器预埋单、服务器止盈止损。例如：

01、当用户设置了指定的资金账户后，在使用预埋单下单板进行“服务器预埋单”下单时，系统会自动匹配指定的资金账户。

02、服务器预埋单下单确认弹窗显示“资金账户”字段，预埋单信息面板显示资金账户字段。

24、修订记录

序号	版本号	修订日期	修订描述
1	V3.85.170.0	2021/05/17	建立初稿。
2	V3.86.173.0	2021/06/22	1.【本地套利】面板增加三腿套利的支持，增加套利报单实例。 2.分组设置中下单比例支持小数比例设置。 3.条件单、预埋单、止盈止损单支持分组展示和改单。 4.预埋单面板支持改单。 5.支持账户别名展示。 6.【所有委托】面板添加报单状态的筛选。 7.更新“同步账户持仓”按钮说明。 8.【组合行情】名称优化为【套利行情】。 9.配置-分组设置、资金使用比例设置对应弹窗标题一致。
3	V3.87.175.0	2021/07/12	1.所有委托新增“所有委托分组”。 2.所有委托、未成交记录、成交记录、持仓信息-分组面板/成交合计分组面板，增加筛选功能。

			3.【同步账户持仓】支持基准账户多选。 4.【篮子行情】面板右键增加“复制策略”功能，添加策略面板内增加步长设置。 5.套利类现卖量、现卖量数量除以 2，套利报单实例更新。 6.信息面板类-本地套利、条件单、预埋单批量导入使用描述。
4	V3.88.181.0	2021/08/10	1.【组合报单】新增【添加合约】按钮，支持自定义期货合约形成组合报单。 2.【组合报单】新增行情的“最新价、买量、卖量、买价、卖价”的显示。 3.篮子下单板优化：新增份数、价值方案的选择，支持梯度下单功能。
5	V3.89.183.0	2021/09/14	1.登录界面更新，支持 IPv6 网络。 2.【配置】项优化：界面风格及配置切换增加界面快捷入口；组设置-基准账户变更操作二次确认。 3.【套利行情】增加复制策略；【本地套利】添加/复制/修改策略中，新增“现买(卖)量系数”。 4.【持仓信息】优化：支持大商所组合申请。

			5.【篮子下单】优化：【篮子下单】价值显示-千分位；【篮子下单信息】右键增加“展开明细”；【篮子行情】添加/复制/修改策略中，新增“上期所、能源所平仓优先级选择”，“买(卖)量系数”。
6	V3.90.187.0	2021/10/18	1.新增账号到期提醒功能。 2.【篮子下单】下单板开仓/平仓优化。
7	V3.91.0.0	2021/11/23	1.新增【网格策略】功能。 2.本地套利支持【闪电点价】功能。 3.【持仓信息】优化：支持 ETF 期权申请组合、申请拆分。 4.【账户管理】优化：增加“有效”勾选状态描述。 5.新增备注：指定资金账户功能。
8	V3.92.197.0	2021/12/21	1.配置项新增、优化。 2.网格策略新增套利支持。 3.本地套利、篮子下单新增、优化。 4.条件单、预埋单：批量导入支持分组。 5.持仓信息优化。 6.备注：指定资金账户优化。 7.新增：帮助-说明书。
9	V3.93.202.0	2022/01/21	1.网格策略整体逻辑更新。

			2.配置项-系统配置，增加外观颜色选择。 3.账户管理面板：增加“选择”功能讲解。 4.本地套利增加正向、反向讲解。 5.本地套利、篮子下单中现买(卖)量系数增加讲解。
10	V3.94.206.0	2022/02/24	1.行情组优化。 2.【未成交记录】优化：新增预埋撤单，选中到预埋单功能。 3.下单板（标准、两键、三键、六键）新增价格类型：涨停价、跌停价。 4.登录、帮助新增“联系我们/反馈”。 5.网格策略优化：超出最大下单手数提示、批量导入提示。 6.批量导入样式整体优化。 7.套利优化：现买（卖）量系数默认为 1。下单确认优化。
11	V3.95.209.0	2022/3/28	1.新增算法列表，支持冰山指令、TWAP、VWAP 算法单。 2.【闪电点价】面板增加算法入口。 3.【条件单】批量导入优化，下单板优化。

			4.【持仓信息】优化。 5.K 线优化，增加周、月，K 线底部时间显示。 6.【套利行情】支持鼠标拖拽排序，套利报单实例逻辑更新。
12	V3.96.215.0	2022/4/22	1. 分组设置优化-新增“倍率”模式。 2. 下单板优化-标准套利锁仓功能。 3. 【账户管理】优化-新增“有效”全选、反选。 4. 配置项优化-鼠标点持仓配置支持【预埋单、条件单】下单板填单。
13	V3.97.217.1	2022/6/13	1. 支持对接飞创柜台。 2. 闪电点价新增-自定义栏位。 3. 本地套利-批量导入表格新增：**LocalAr(Plus)。** 4. 本地套利优化-增加单腿配置。
14	V3.98.224.0	2022/8/17	1.支持对接金仕达柜台。 2.新增云端菜单：随心云、上传日志功能。 3.配置项优化：增加撤单总限制、快捷键优化。 4.本地套利优化：新增 2 种自定义模式、下单板增加套保选择、本地套利面板增加

			筛选功能。 5.闪电点价-标准套利优化：支持互换。 6.期权询价。
15	V 3.99.225.0	2022/9/9	1.免责声明及隐私条款。 2.支持直连柜台服务器单使用，相关授权提示。
16	V3.101.238.0	2022/12/14	1.支持服务器自设套利。 2.闪电点价新增功能：扫盘指令、套利开平自定义。 3.预埋单、条件单支持期权合约。 4.TWAP 算法优化：增加匀速发单模式。
17	V3.102.243.0	2023/1/17	1. 自设套利界面更新、逻辑优化。
18	V3.103.248.0	2023/2/16	1. 信息类面板-多选筛选功能。 2. 止盈止损优化：附加回撤条件显示。 3. 持仓信息：筛选比例平仓；明细-显示合计功能。 4. 合约添加优化。 5. 期权 T 型报价优化。
19	V.3.104.256.1	2023/3/30	1.【算法列表】新增【累仓策略】

20	V.3.105.258.2	2023/5/12	1.支持套利下单加上时间条件; 2.支持预埋单支持以涨跌停价格类型进行报出; 3.支持套利自动清除单腿; 4.支持大商所期权盘中申请组合;
21	V.3.106.0.0	2023/7/18	1、配置项【添加下单快捷键】文字描述优化; 2、支持价格区间条件单，防止条件单策略偏离预期价格范围; 3、【系统配置】中，【列表字体大小】支持自定义输入;
22	V.3.107.264.0	2023/9/26	1、【登录/退出】优化并增加指令权限; 2、【K 线】新增画线下单、多周期同列、多股同列等功能， 优化时间显示。 3、【所有委托】、【成交记录】增加委托金额、成交金额等。
23	V.3.108.267.0	2023/11/23	1、【自设套利】策略新增有利、不利、区间; 2、【配置】自设套利触发原则新增按时间优先; 3、【累仓策略】新增互换、切换账户、同时报单、自动追单功能，超价逻辑优化; 4、指令下单支持服务器自设套利；展示交

			易员人员姓名；指令信息面板增加交易员姓名展示、投资经理账户/姓名展示； 5、【系统】新增重查合约； 6、条件单面板展示全部的已触发、未触发条件单； 7、委托及成交面板显示对应操作的人员；
24	V.3.109.0.0	2024/1/3	1、支持服务器预埋单指定资金帐户； 2、点击委托信息后，下单板信息联动显示 3、合约筛选优化； 4、支持市价FOK、市价FAK下单。
25	V.3.110.0.0	2024/1/19	1、随心易下单板平仓逻辑优化； 2、“所有委托”、“未成交记录”、“成交记录”和“持仓信息”面板增加关键字筛选功能； 3、当同一笔指令执行时分成了多笔委托，支持快捷撤销指令执行后的多笔未成交单； 4、套利指令执行操作自动添加对应策略行情； 5、网格策略当日断线或重启后状态优化； 6、预埋单集合竞价时撤单逻辑优化； 7、自设套利添加策略的行情，现买量与现卖量的计算逻辑调整； 8、标准下单板支持设置拆单算法。

26	V.3.113.0.0	2024/4/2	1、支持随心易指令自定义周期； 2、支持随心易批量导入指令； 3、网格策略面板添加策略支持搜索期权合约； 4、闪电点价中，TWAP 支持选择委托价格； 5、TWAP 支持设置起止时间； 6、TWAP-动态计算、匀速发单的计算逻辑； 7、标准下单板支持设置 TWAP 智能算法； 8、指令端支持以价格类型发出指令； 9、支持使用 TWAP 执行指令； 10、指令审批支持批量处理； 11、单合约指令、标准套利指令支持以条件单、预埋单、止盈止损单执行；

此文档含有具体的技术和业务相关的专有信息，文中涉及的所有资料必须严格保密。除因需要而得到授权的客户和本公司有关人员外，不得向他人泄露。