

让程序化变得更简单——

隽焱智投 1.0 版 用户指南



**友情提示：**

隽焱智投是与指定的期货公司绑定的，  
如需注册为隽焱智投的用户，请向您开户的期货公司申请。

➤ 一眼看懂隽焱智投 .....	/02
➤ 安装隽焱智投 .....	/06
➤ 注册和登录 .....	/10
➤ 配置 CTP 账户 .....	/14
➤ CTP 账户的登录 .....	/16
➤ 手工下单 .....	/22
➤ 挂单表、持仓表与资金表 .....	/26
➤ 创建自动交易方案 .....	/32
➤ 修改自动交易方案 .....	/46
➤ 客服 .....	/50

® 隽焱智投

版权所有，翻制必究  
网址：www.780008.com

追求程序化的简洁  
让不懂编程的用户也能轻松驾驭程序化交易

## 👉 一眼看懂隽焱智投

隽焱智投追求的是程序化的简洁——在执行过程中摒弃冗余操作，使主线明晰，让不懂编程的用户也能轻松驾驭程序化交易，避免了繁杂操作给非专业人士带来的失误。

下图所示的，是隽焱智投的核心部分，从这里可以看到这款软件是如何工作的。注意图中的红字：

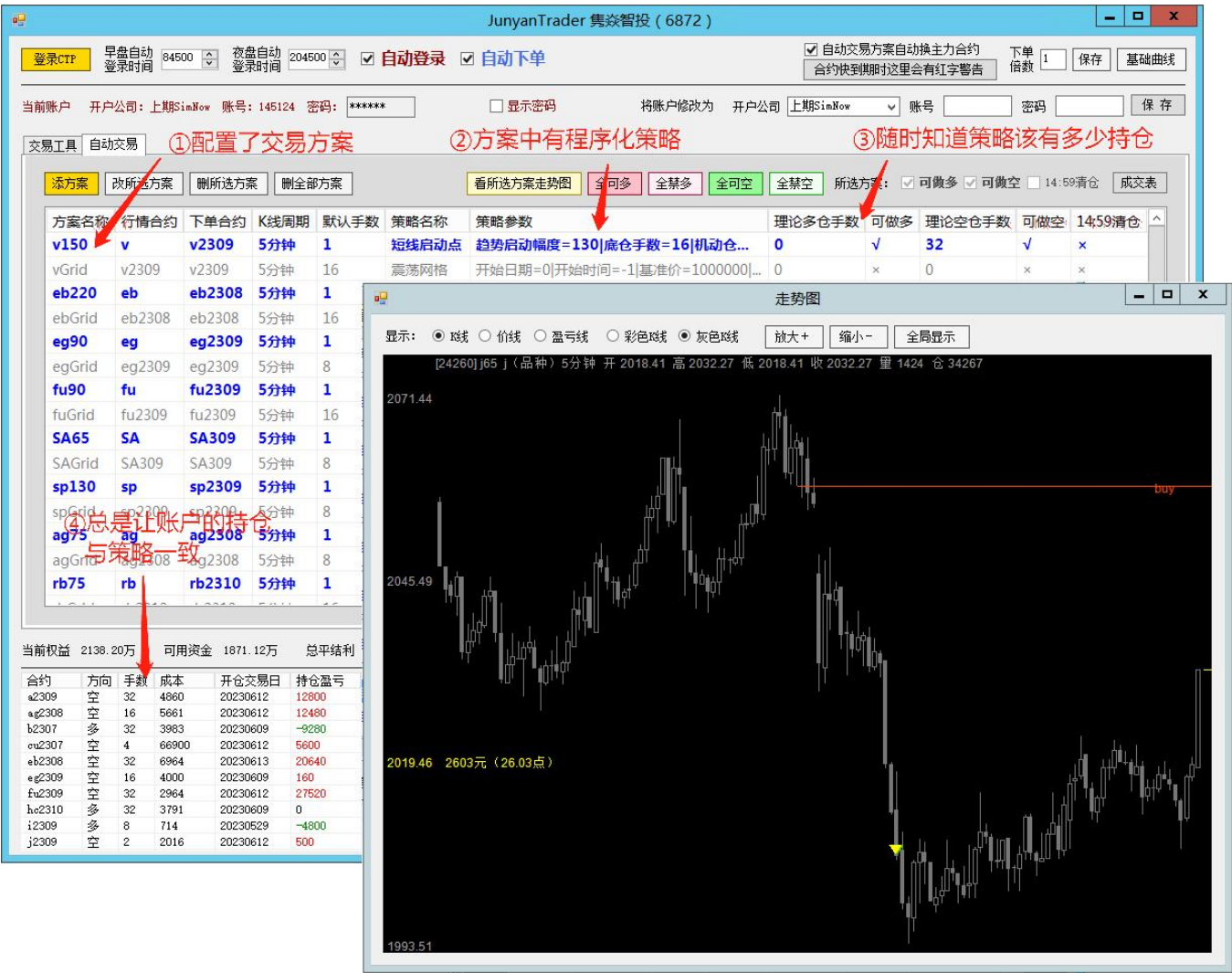


图 1-1 隽焱智投主界面

关键的步骤是——

### ① 配置了交易方案

我们知道，程序化交易是一系列因素的组合——合约、K 线周期、手数、策略等。我们把这种组合叫做“交易方案”，简称“方案”。

比方说，你要对苯乙烯进行程序化交易，它的主力合约目前是 **eb2308**，这个你知道。

你又有有一个不错的策略叫“短线启动点”。

但是，仅有 **eb2308** 这个合约，或者仅仅有策略，还不足以开展程序化交易，你还要告诉软件，策略要加载在什么样的 K 线上（是几分钟 K 线呢，还是小时线呢，还是日线）、默认手数是多少，等等。因此，咱们需要的是各种因素的组合，是一个交易方案，而不仅仅是一个合约或一个策略。

在图 1-1 中，你看到了一个表，这就是配置好的交易方案，每一行是一个交易方案：

方案名称	行情合约	下单合约	K线周期	默认手数	策略名称	策略参数	理论多仓手数	可做多	理论空仓手数	可做空	14:59清仓
v150	v	v2309	5分钟	1	短线启动点	趋势启动幅度=130 底仓手数=16 机动仓...	0	√	32	√	×
vGrid	v2309	v2309	5分钟	16	震荡网格	开始日期=0 开始时间=-1 基准价=1000000 ...	0	×	0	×	×
eb220	eb	eb2308	5分钟	1	短线启动点	趋势启动幅度=220 底仓手数=16 机动仓...	0	√	32	√	×
ebGrid	eb2308	eb2308	5分钟	16	震荡网格	开始日期=0 开始时间=-1 基准价=1000000 ...	0	×	0	×	×
eg90	eg	eg2309	5分钟	1	短线启动点	趋势启动幅度=90 底仓手数=8 机动仓手数...	0	√	16	√	×

图 1-2 交易方案表

② 方案中有程序化策略

方案中最重要的成分就是策略。策略是这样的东西——它有一套规则，规定什么时候应该买、什么时候应该卖、什么时候应该开、什么时候应该平，不需要我们人来判断，这样可以实现全自动交易，保持一致性，在实时行情中，策略随时判断当前 K 线的形态有没有达到下单的条件，达到了就出信号。

策略是有参数的，比如均线策略的参数是均线周期，不同的参数会带来不同的结果。在上图所示的界面上，我们看到，交易方案表中，关于策略的部分，有策略名称、策略参数。

策略通常是依附于 K 线运行的，所以隼焱智投有 K 线图，在 K 线图上标出策略产生的信号。

信号用三角形表示，每当策略产生一个信号，K 线图上就出现一个三角形。

红色的三角形代表买开，绿色的三角形代表卖开，黄色的三角形代表平仓。

有时候，红绿三角形与黄色三角形重叠在一起，这是反手（既平仓又开仓）。

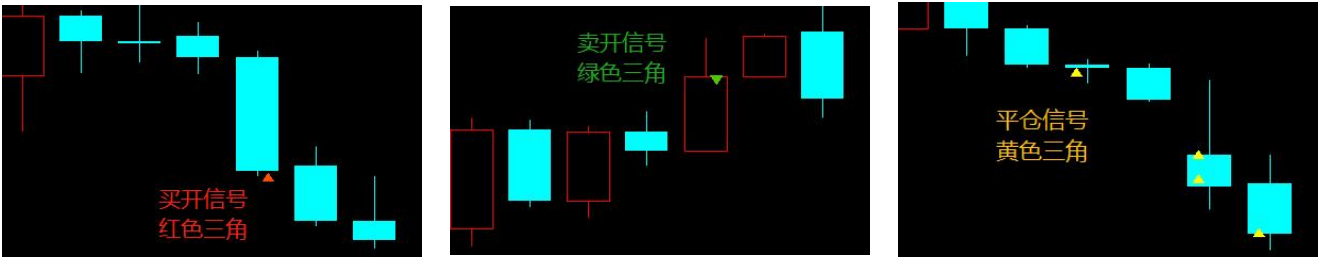


图 1-3 程序化信号

③ 随时知道策略该有多少持仓

策略产生信号，其结果是持仓的变化。

比如，本来没有持仓，策略产生了一个买开信号（红三角），那么持仓就变成了多仓。又比如本来持多，策略产生了一个卖平信号，那么多仓就减少了。

程序首先知道现在应该有多少持仓，这就是交易方案表中的“理论多仓手数”、“理论空仓手数”：

理论多仓手数	可做多	理论空仓手数	可做空
0	√	32	√

图 1-4 理论持仓

#### ④ 总是让账户的持仓与策略一致

然后，程序看账户现在有多少持仓，与理论持仓比较，如果不够，就补齐，也有时候，账户的持仓比理论持仓多，那就减少账户的持仓（平仓就可以达到这个目的）。

总的来说，是让账户的持仓与理论持仓一致。

合约	方向	手数	成本	开仓交易日	持仓盈亏	最新价
a2309	空	32	4860	20230612	12800	4805
ag2308	空	16	5661	20230612	12480	5636
b2307	多	32	3983	20230609	-9280	3997

图 1-5 账户持仓

### ➤ 特殊情况

如果有多个交易方案对同一个合约操作，那么要保持一致的是：

该合约账户持仓的总数 = 该合约理论持仓的总数

特别强调，这里面说的是“总数”。

比如，方案 A 的理论持仓是 2 手多仓、1 手空仓，方案 B 的理论持仓是没有多仓、3 手空仓，它们的合约是相同的。

那么，总的理论持仓是，2 手多仓、4 手空仓。

程序会设法让账户持仓也是这样。

所以，隼焱智投在程序化交易方面的出发点，是与另外一些程序化软件有区别的。通常的软件是每出一个信号，就按照这个信号下一单，隼焱智投则是每出一个信号，要全局性地计算理论持仓、账户持仓，比较这二者，再让账户持仓跟上理论持仓，并且，在没有信号的时候，也要频繁地比较理论持仓与账户持仓，一旦发现差别立刻纠正。这么做的好处是：把程序化交易的失误减少到最低限度。

### ➤ 账户持仓与理论持仓匹配的条件

基本条件：

- 1.交易账户已经成功登录（成功登录的标准，是完成了结算确认、成功查询并校正了现有持仓记录）。
- 2.交易线路通讯正常，交易所的后台服务正常。
- 3.所操作的品种确实是在交易时间，而且有交易权限。

另外，还需要界面上的几个选项被勾上：

- 4.“自动下单”：这是全局选项，它被勾选，程序才会做账户持仓与理论持仓匹配的工作。
- 5.“可做多”：这是针对每个交易方案的，勾选了，这个方案的多仓才会参与匹配，否则，匹配工作会忽略这个方案的多

仓。

6. “可做空”：这是针对每个交易方案的，勾选了，这个方案的空仓才会参与匹配，否则，匹配工作会忽略这个方案的空仓。

7. “14:59 清仓”：这是针对每个交易方案的，勾选了，在 14:59 至收盘的这段时间，该方案的理论持仓不参与匹配。

用通俗的话说，要用隼焱智投跑程序化，你要做的是：

### **1.交易账户要成功登录**

实盘账户在这方面的运行是很稳定的，但模拟账户有时会由于模拟后台的故障而完成不了交易登录，这时，程序会给出警告，要求重新登录。

### **2.使用正常的网络通讯线路**

通常，服务器的网络比台式机的网络稳定，有线网络比无线网络稳定。程序化需要每天 24 小时开机，大多数时候是无人值守的，网络故障必须降低到最低限度，为了您的资金安全，务必使用最稳定的网络，最好是服务器，切勿使用无线通讯。

### **3.全局的“自动下单”要勾上**

勾上这个，程序才会比较账户持仓与理论持仓是否一致，否则，程序是不干涉持仓的（这通常是很危险的，当你需要在适当的时候平掉亏损仓位时，由于你没有勾选“自动下单”，程序没有平掉这个仓位，谁知道它的亏损会扩大到什么程度？）。

### **4.具体对于每一个交易方案，要不要勾“可做多”、“可做空”、“14:59 清仓”，你自己决定**

比方说，你看到现在的大趋势是向上的，你希望自动交易只做多，不执行做空指令，那么，就对相应的交易方案勾上“可做多”，取消“可做空”的勾，那么，程序在比较持仓时，会忽略这个方案的理论持仓中的空仓，这就相当于不执行它的做空指令了。

对于有的方案，你想先观察一下，并不急于下单，那就把“可做多”、“可做空”都取消。

为保障网络的稳定，最好是在服务器上运行

最佳配置是 Windows2012 或 Windows2019 的 64 位的操作系统、2 核 CPU、4G 内存、2M 带宽

## 安装隽焱智投

隽焱智投是 Windows 系统中 64 位的软件，具体地说，它能够运行于以下环境：

- Windows2012 或更高版本的 64 位的服务器
- Windows7 或更高版本的 64 位的台式机

对硬件的要求是：

- 中央处理器 2 核或更多
- 内存 4G 或更多
- 带宽 2M 或更多

### 推荐配置

程序化交易是长时间连续运行的，要保证网络的稳定、电源的稳定，在这方面，服务器比台式机稳定得多，因此，强烈推荐使用服务器运行隽焱智投。

（设想一下，用办公室里的电脑，随时可能断电断网，这样来搞程序化交易，这能让你自己放心吗？）

云服务器的推荐配置：

- 如果不是自己搭建服务器，就租用口碑良好的云服务器
- 2 核 4G，带宽 2M，是硬件基本配置，可以更高，但如果仅仅是为了运行隽焱智投，没有必要太高而增加成本
- 操作系统，最好是 Windows2012 或 Windows2019，都必须是 64 位的版本

在上述系统中，双击隽焱智投的安装文件，可打开隽焱智投安装向导，如下图所示。





图 2-1 开始安装隼焱智投

点击“下一步”，进入如下图所示的界面。



图 2-2 选择安装位置

如果你不想把隼焱智投安装在默认的位置，可以点“浏览”按钮，给它找一个新的位置。

在某些环境中，把隼焱智投安装在 C 盘是不能正常运行的，这是因为这台电脑不允许你修改 C 盘的内容，这时，你可以点“浏览”按钮找别的盘来安装隼焱智投（比如“D:\隼焱智投”）。

如果不是在台式机上，而是在服务器上，你可能只有 C 盘可用，但 Windows2012、Windows2019 的服务器通常可以让你把软件安装在 C 盘上并正常运行。

简单地说，如果你是在服务器上安装，在这一步，你通常什么也不用改，如果是在台式机上安装，最好把安装位置改到非系统盘。

然后点“下一步”。

接下来的事情，按照安装程序的默认设置，接连点“下一步”即可。

值得一提的是，如果你的电脑或服务器安装了 360 安全卫士，它可能会发出如下提示：



图 2-3 360 误报错

这是 360 过于敏感，是误报，所以，勾选“不再提醒”，在下拉菜单中选择“允许程序所有操作”，以便今后不再被它骚扰（升级安装隼焱智投时，不再出现这个警告）。

安装完成之后，在桌面上会出现隼焱智投的图标：



图 2-4 隼焱智投桌面图标

每次打开隼焱智投，就从双击这个图标开始。



以后如果要卸载隼焱智投，就右键单击这个图标，在弹出菜单中选择与卸载有关的菜单，如“强力卸载此软件”（各操作系统的卸载菜单有差别）。

隽焱智投有两套用户名密码——

一套是用来登录软件的，另一套是用来登录期货 CTP 的

## 注册和登录

隽焱智投有两套用户名密码——

一套是用来登录软件的，本文称它为“软件账户”；

另一套是用来登录期货 CTP 的，本文称它为“期货账户”。

这一章讲的是软件账户，而期货账户，要到下一章再讲。

上一章讲过，隽焱智投安装好后，桌面上有一个橘黄色的图标。

双击这个图标，打开如下窗口：



图 3-1 隽焱智投启动窗口

这里要填的用户名、密码，就属于软件账户。

注意：软件账户并不是让你登录到期货交易平台上做交易的，只是让你登录到隽焱智投这个软件中的。

软件账户的注册，是线下人工进行的，所以在这里看不到注册的按钮。

你向有关人员申请开通隽焱智投的使用权，得到了软件账户的用户名、密码，然后，在这里输入它们，如下图所示。



图 3-2 软件登录

为了下一次登录不再输入密码，可勾选“保存密码”。

用户名则始终是自动保存的。

如果用户名、密码都正确，点“登录”按钮后，就能通过隼焱后台的审核，进入主界面，如下图所示。

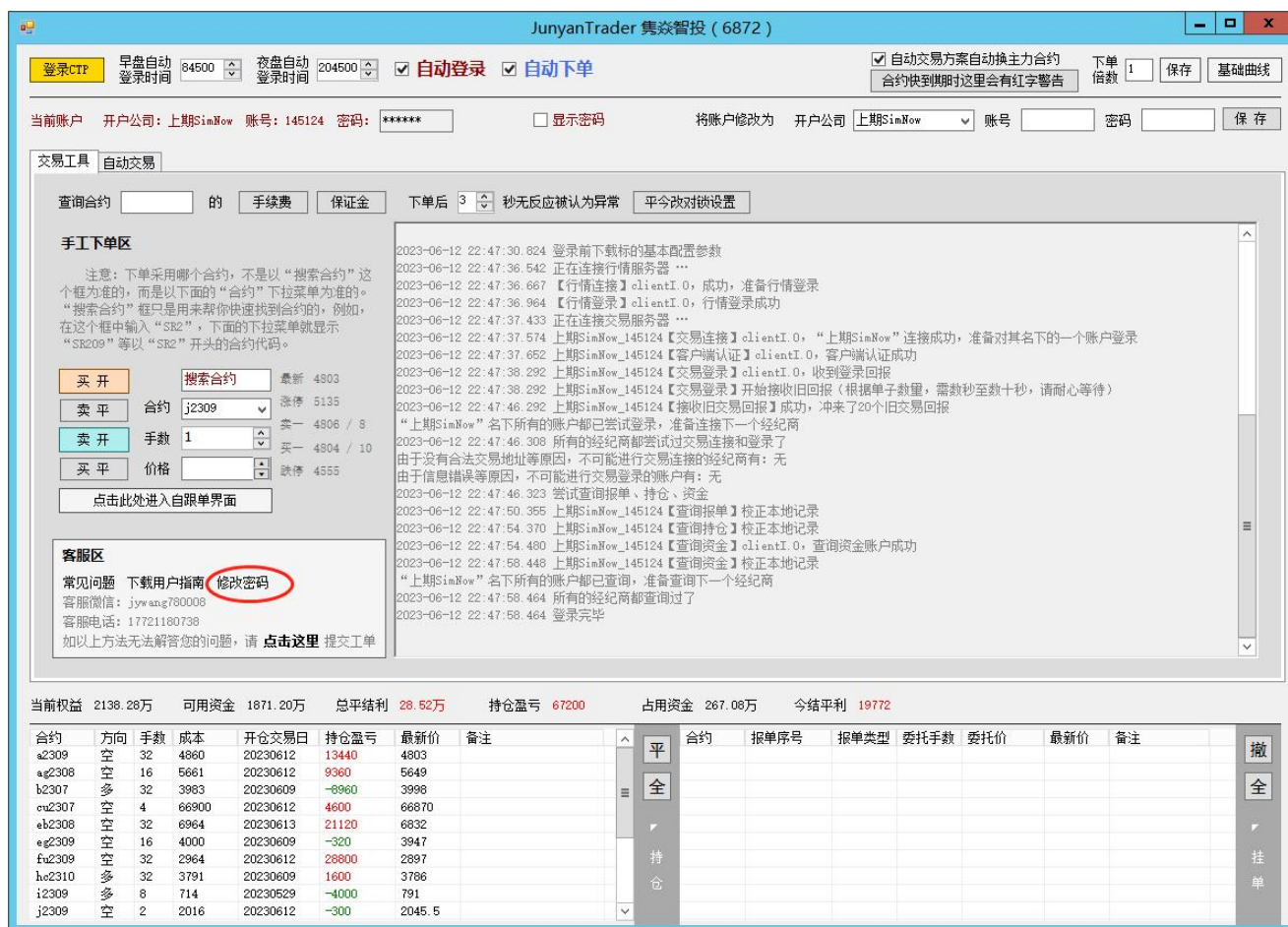


图 3-3 集焱智投主界面

在这里面要做什么，我们都会一五一十地告诉你。现在先说第一件要紧的事——修改密码。

注意上图中画红圈的地方，这就是修改密码的地方。

点击它，打开一个小窗口，就是修改密码的窗口：



图 3-4 修改密码

在这里填入旧密码、新密码，点“确定修改”按钮。

如果集焱后台接受了这个请求，并修改了这个密码，这个修改密码的小窗口就会自动关闭，这说明密码修改成功了。

如果密码修改成功了，又允许保存密码（刚打开软件时的小窗口上的“保存密码”是被勾上的），那么，新的密码会被自

动记录下来，下次打开软件时，它显示的密码会是新密码。

但是，如果修改密码的窗口迟迟不能自动关闭，这说明密码修改没有成功，如果这是由于旧密码输入错误，或新密码尚未输入，或两次输入的新密码不一致，当时就会有提示给你看，如果没有任何提示，这个修改密码的小窗口仍然不关闭，这多半是与隼焱后台的网络通讯中断了。

密码修改成功后，下次登录就得使用新密码了。

要使用隼焱智投做交易，必须在期货公司开立 CTP 账户  
绝大多数期货公司都能开立 CTP 账户

## ➤ 配置 CTP 账户

你通过某期货公司开通隼焱智投的使用权（也就是获得其软件账户）时，应该也在这家期货公司开立期货 CTP 账户。

如果你还没有在这家期货公司开立期货 CTP 账户，请向该公司申请此业务。

然后，还要为使用隼焱智投而进行看穿式认证，这一点，也请咨询该期货公司。

当你完成期货 CTP 账户的开户之后，你会拥有：

- 期货交易用户名
- 期货交易密码

这正是你要填到隼焱智投中的内容，在下图所示的区域填写。



图 4-1 填写 CTP 账户信息的地方

你第一次打开隼焱智投时，这部分是空白的，你需要：

- 1.在“开户公司”下拉菜单中选择给你的上述期货账户开户的公司；
- 2.把期货交易用户名填到这里的“账号”栏中；
- 3.把期货交易密码填到这里的“密码”栏中。

如下图所示。



图 4-2 设置 CTP 账户

核对信息无误后，点“保存”按钮，会有一个对话框跳出来，这是怕你修改账户之前的仓位没有得到妥善处理，如下图所示。





图 4-3 修改账户之前的警告

如果不存在这方面的问题，就点“确定”按钮，然后，期货账户区域左边就有了内容，相关信息就被软件记录下来了，如下图所示。



图 4-4 设置好的账户信息

将来，你要想修改期货账户信息，仍然用上述办法。比如要把密码改为“123456”，就在上图所示的界面的右边的“密码”框中填“123456”，点“保存”按钮，就这么简单。

#### ➤ CTP 账户的自动保存

在隽焱智投中，CTP 账户始终是自动保存的。

就是说，你关闭软件后，再打开，软件会显示你上次设置的 CTP 账户。

这样的话，如果你不修改 CTP 账户，就只需要设置一次。

有人工登录和自动登录两种方式。

程序化交易必须采用自动登录。

## CTP 账户的登录

有两种登录方式——

### • 手工登录

点“登录 CTP”按钮即可。

### • 自动登录

勾选“自动登录”，程序将按照预定的时间，在每个交易日的早盘、夜盘开盘之前自动登录。

如下图所示。

The image shows the CTP login interface. At the top, there is a yellow button labeled '登录CTP'. To its right are two time selection fields: '早盘自动登录时间' (Morning automatic login time) set to 84500 and '夜盘自动登录时间' (Night session automatic login time) set to 204500. Further right are two checked checkboxes: '自动登录' (Automatic login) and '自动下单' (Automatic order). Below these is a horizontal line. Under the line, it says '当前账户' (Current account) followed by '开户公司: 上期SimNow' (Opening company: Shengqi SimNow), '账号: 145124' (Account number: 145124), and '密码: \*\*\*\*\*' (Password: \*\*\*\*\*). To the right of the password field is a checkbox labeled '显示密码' (Show password).

图 5-1 登录 CTP 的界面

按上图所示的数字设置自动登录时间时，每个交易日早晨 8:45:00、晚上 20:45:00 各登录一次，这时候还没有开盘，登录过程不影响交易。

你也可以修改这些时间，比如，如果你把早盘登录时间改为 83000，程序就会在每个交易日早晨 8:30:00 自动登录。但是你要确定，你开户的期货公司在这个时间允许登录。

某用户曾犯这种错误——他把早盘自动登录时间设为 8:30:00，但他开户的期货公司在这个时间还没有打开服务器，登录就不成功，那一天的程序化策略就没有下单，损失很大。

8:45:00 是正常的期货公司肯定会打开服务器的时间，所以默认的早盘自动登录时间是 8:45:00；同理，默认的夜盘自动登录时间是 20:45:00。

在休息日（周末、国家规定的假日），即使到了你设置的自动登录时间，也不会登录。

自动登录是否被勾选、早盘自动登录时间、夜盘自动登录时间，都是被程序自动记忆的，一旦你设置好它们，你关了软件再打开，它们还是你设置的样子。

但是，这种自动记忆也带来了一个问题——勾选自动登录，重启软件，自动登录仍是被勾上的，按理说这时候就要登录了，但你想在登录前修改某些参数（比如策略参数、默认手数），这样就需要一个缓冲时间让你暂时取消“自动登录”的勾。所以，“自动登录”的勾选与登录并不是同时进行的，换句话说，勾选“自动登录”之后，要等一会儿再登录。

这个“一会儿”到底是多久呢？通常是 1 分钟，但也有特殊情况。

比方说，你把早盘自动登录时间、夜盘自动登录时间分别设为 8:45:00、20:45:00，那么——

- 先声明一点：法定假日、周日都不需要自动登录，周六凌晨收盘后也不需要自动登录，下面说的情况都不包括这些时段。

- 再声明一点：在已经登录的情况下，勾选“自动登录”是没有用的，程序不会重复登录，所以，下面说的情况仅适用于尚未登录的时候（下午 15:20:00 自动登出后、再次登录前，凌晨 2:35:00 自动登出后、再次登录前，也处于尚未登录的状态，下面的操作也有效）。

- 早晨，你在 8:45:00 以前勾选“自动登录”，程序会等到 8:45:00 再登录。

- 你在 8:45:00 或这以后勾选“自动登录”，程序通常会等 1 分钟再登录，但如果已逼近收盘（勾选“自动登录”时已到 15:10:00，未到 15:15:00），程序会立即登录。

- 下午或晚上，你在 20:45:00 以前勾选“自动登录”，程序会等到 20:45:00 再登录。

- 你在 20:45:00 或这以后勾选“自动登录”，程序通常会等 1 分钟再登录，但如果已逼近收盘（勾选“自动登录”时已到凌晨 2:25:00，未到 2:30:00），程序会立即登录。

- 任何时候，你点“登录 CTP”按钮，就会立即进入人工登录，中断自动登录流程。

## ➤ 程序化交易自动登录

程序化交易在很多时候是无人值守的，所以，必须勾选“自动登录”。

注意，不是应该，而是必须！

试想，如果未勾选“自动登录”，下午收盘后，晚上再开盘，期货公司服务器都已经把你的账户踢掉了，你不登录，晚上的单子都发不出去，你的损失将是不可控的！

如果你在做程序化交易，为了改某些参数而暂时取消了自动登录，请记住，务必在改完那些参数之后立刻恢复自动登录！

手工登录与自动登录，最终的结果是一样的，就是让你可以对期货合约下单。

不管你是手工点“登录 CTP”按钮，还是让程序自动登录，在开始登录后，在日志区都能看到登录的过程——



来无法下买平单，那么你的单子到了交易所就会被拒）。

上述故障，在实盘中是很罕见的，在 SimNow 模拟中时有出现，一旦出现，隼焱智投会报警：

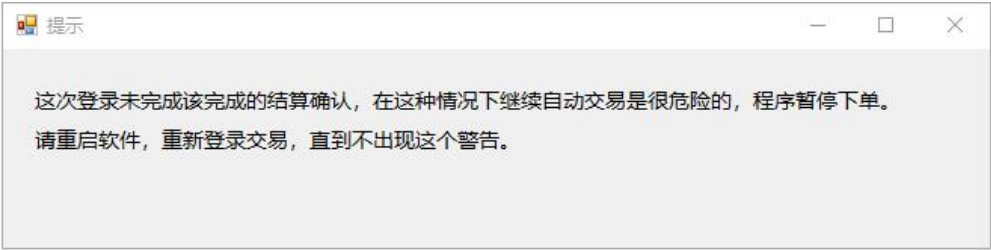


图 5-3 未完成结算确认的警告

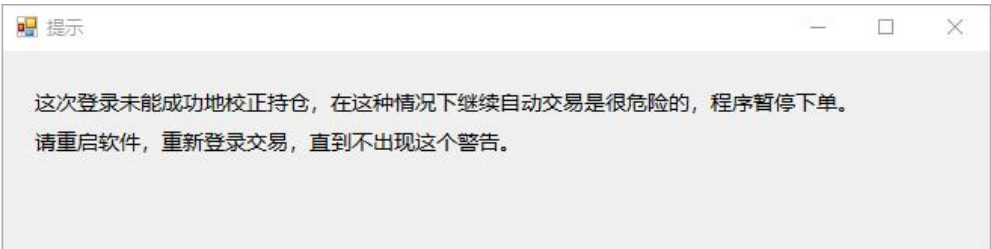


图 5-4 未成功校正持仓的警告

登录中的各种故障，还会出现在日志里，如下图所示。

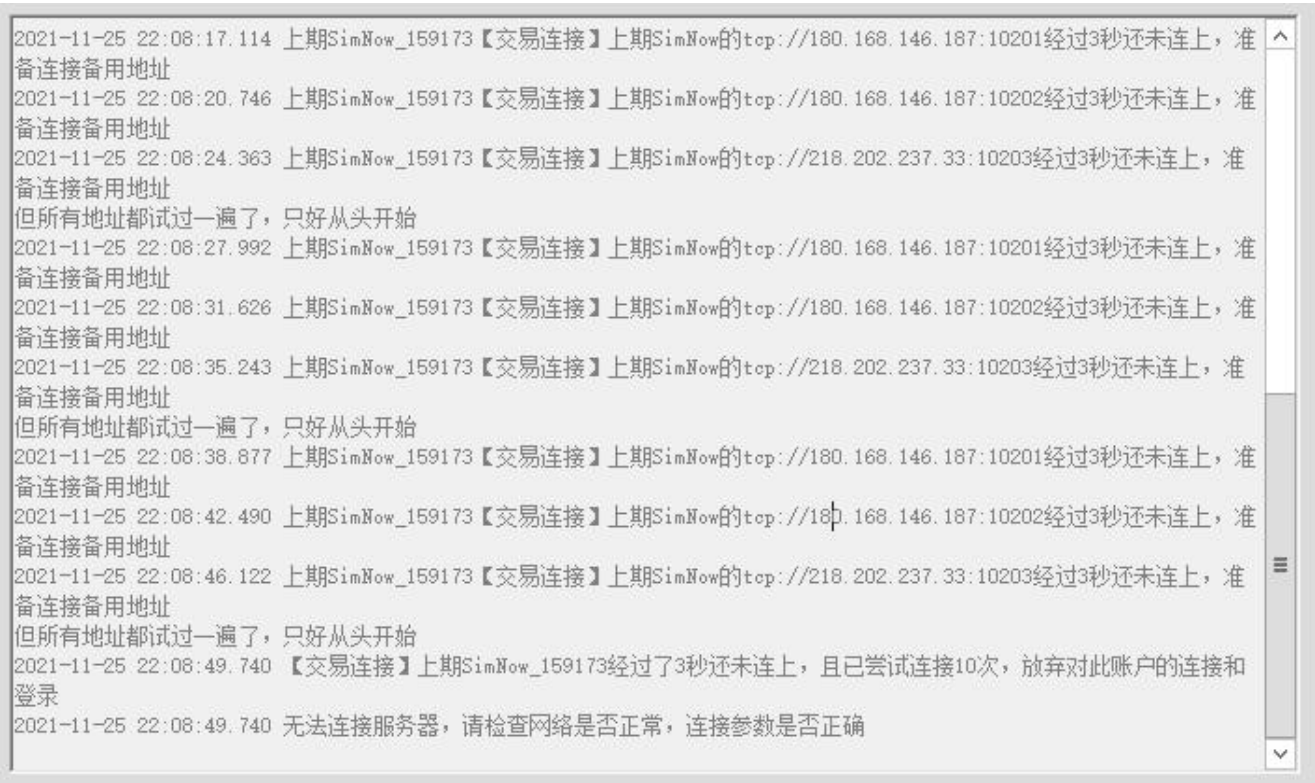


图 5-5 登录故障反映在日志里



另外还有一种故障，虽说不属于登录，也在这里说一下。这也是实盘中很罕见、SimNow 模拟中时有出现的，就是下单之后收不到回报。正常情况下，下单后 50-200 毫秒就能收到交易所的答复，这叫报单回报，即使这个单子是错的（比如没有仓位的时候下了平仓单），也能收到交易所拒绝的消息，绝不应该查无音讯。实盘，交易所和期货公司为我们搭建的通讯线路是稳定的，报单回报来得很快，但 SimNow 模拟的报单回报经常延迟几秒甚至迟迟不来，这样的话，程序不知道报出去的单子挂上没有，无法继续交易。虽然实盘不大可能出现这种错误，但隽焱智投仍然建立了防范机制，在出现这种错误时会有警报：

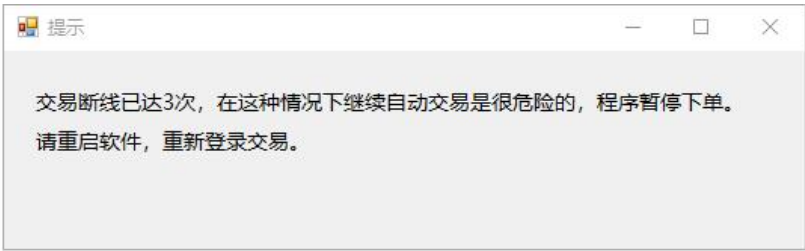


图 5-6 交易断线警告

另外要提醒大家，有一个地方可以提高对这种错误的宽容度：

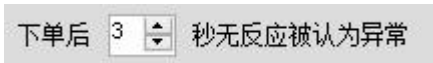


图 5-7 下单回报延迟设置

对于实盘，这里设成 3 秒就行（实盘的报单回报通常在半秒钟以内到来），对于 SimNow 模拟，可以设成 10 秒（这意味着，如果下单以后过了 10 秒钟还没有回报，就认定这是故障）。

➤ 程序化真的可以无人值守吗？

发射卫星够自动化吧？那发射卫星的时候，监控大厅里会没有人吗？

这已经回答了咱们的问题。

无人值守是咱们的美好愿望，这是建立在两个条件之上的——

- 1.程序的逻辑没有问题。
- 2.环境稳定。

隽焱智投的逻辑是没有问题的，如果是在绝对稳定的环境中运行，肯定不会出故障，那就可以无人值守了。

但是很遗憾，我们是在复杂多变的网络环境中运行。

每个合约每秒有 2 个 tick，如果你操作 10 个合约，每秒就有 20 个 tick。这意味着你在进行每秒 20 条消息的网络通讯。

请问，QQ 聊天、微信聊天，在咱们的电脑上能达到这样的频率吗？

所以，咱们在进行的，不仅是网络通讯，而且是复杂的网络通讯。

网络环境是动态的、多变的，稍有不慎就会丢失数据。

感谢咱们的交易所、期货公司，搭建了高难度的通讯线路，这已经很稳定了，在多年的实盘中，几乎没有出现故障。

但是，我们不能苛求这么复杂的环境永远不出一次故障，更不能奢望自己公司的网络或租用的服务器永远不出一次故障。



出一次故障的后果是什么？

假如你有 30 手螺纹钢多仓，该在损失 50 点时平仓，这时的损失是 1.5 万元。但由于故障，未能平仓，晚上你来巡视时，螺纹钢又暴跌 300 点，损失扩大了 9 万元。

如果同时还有十几个品种在跑程序化呢，如果它们正好都是持多的、市场正好遭遇黑天鹅而全线暴跌呢，如果是三板跌停呢？损失不可估量。

回顾一下刚才说过的报错窗口：

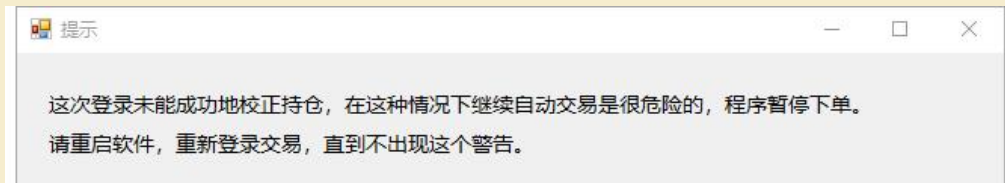


图 5-9 报错窗口

不管是由于交易所的网络故障，还是你公司的网络故障，反正，出现了这么一次故障，你能避免吗？

软件也避免不了它，因为它是外部的原因造成的，超出了软件的控制范围。软件能做的只是报警。

这个时候，如果你在场，看见了这个报警，就能做出处理，简单的如重启软件，复杂的如打电话给期货公司，反正能避免一大笔损失。如果你不在场，损失就不可控了。

好在这些故障万一出现也是出现在登录的时候，就是早晨 8:45、晚上 20:45 这两个时候。

在实盘中，可能一年到头也未必出现一次故障，但要出现，通常就出现在登录的时候。

**所以，程序化的值守，最低的限度是，在每次登录的时候有人看着。如果更有责任心，就在开盘的几分钟里也看一看。**

在有自动交易的情况下，尽量不要手工下单，以免干扰自动交易。

## ➤ 手工下单

隽焱智投的手工交易面板如下图所示。



手工交易界面截图。左侧有四个交易按钮：'买开'（橙色）、'卖平'（灰色）、'卖开'（青色，当前选中）、'买平'（灰色）。中间是输入区域，包含：'搜索合约'文本框（内有'a2201'）、'合约'下拉菜单（显示'a2201'）、'手数'输入框（内有'1'）、'价格'输入框（内有'6308'）。右侧显示行情数据：'最新 6309'、'涨停 6834'、'卖一 6310 / 7'、'买一 6309 / 9'、'跌停 5822'。

图 6-1 手工交易界面

注意：下单采用哪个合约，不是以“搜索合约”这个框为准的，而是以下面那个下拉菜单（“合约”二字右边的下拉菜单）所显示的代码为准的。“搜索合约”框只是用来帮你快速找到合约的，例如，在这个框中输入“SR2”，下面的列表就显示“SR201”、“SR205”等以“SR2”开头的、现在可以交易的合约代码。

在有行情、已经登录行情的时候，在合约列表中选择某个合约，会自动订阅它的行情，进而显示它变化的行情数字。为了帮助您理解这些话，我们来做个试验——

### 一、在“搜索合约”框里输入“z”

软件自动找到以“z”开头的所有合约，并选择其中第一个合约“ZC112”显示在合约列表的顶端，同时，ZC112 的行情数字显示出来（到你做试验的时候，可能不是 ZC112 而是 ZC 的其他合约）。如下图所示。



开始搜索合约截图。左侧交易按钮与图6-1一致。中间输入区域：'搜索合约'文本框（内有'z'）、'合约'下拉菜单（显示'ZC112'）、'手数'输入框（内有'1'）、'价格'输入框（内有'6308'）。右侧行情数据：'最新 1018'、'涨停 1088.2'、'卖一 1017.8 / 2'、'买一 1004 / 1'、'跌停 890.2'。

图 6-2 开始搜索合约

### 二、再输入一个“n”，成为“zn”

选中的合约变成了“zn2112”，旁边的行情数字也变成了 zn2112 的行情数字（你做试验的时候，可能不是 zn2112 而是 zn 的其他合约）。如下图所示。

买开	zn	最新	22935
卖平	合约	zn2112	涨停
卖开	手数	1	卖一
买平	价格	6308	买一
			跌停

图 6-3 搜索到以“zn”开头的合约

当然，你也可以不通过搜索，而直接在合约列表中选择，如下图所示。

zn2112	▼
zn2112	▲
zn2201	
zn2202	
zn2203	
zn2204	
zn2205	
zn2206	
zn2207	
zn2208	
zn2209	
zn2210	
zn2211	
sn2112	
sn2201	
sn2202	
sn2203	
sn2204	
sn2205	
sn2206	
sn2207	
sn2208	
sn2209	
sn2210	
sn2211	
rb2112	
rb2201	
rb2202	
rb2203	
rb2204	
rb2205	

图 6-4 直接在合约列表中选择合约

### 三、还有两个小窍门

点一下行情数字，这个数字就会进入“价格”栏，如下图所示，点了“买一”旁边的数字“22935”之后，“价格”栏的数字也变成了 22935。

买开	zn	最新	22940
卖平	合约	zn2112	涨停
卖开	手数	1	卖一
买平	价格	22935	买一
			跌停

图 6-5 快捷修改价格

另外，“手数”栏的上下箭头、“价格”栏的上下箭头，都可以微调数字。

➤ 检验登录正常的办法

在确定应该有行情的时候（在开盘的日子、开盘的时间），在上述合约列表选择一个活跃合约。

这时，如果一切正常，它的行情数字应该显示在界面上，并且正常变化。

如果不是这样，那就是没有成功登录行情，那就要重启软件，重新登录。

“买开”、“卖平”、“卖开”、“买平”这四个按钮的作用，正是它们字面上表达的，就不多说了。要特别提醒的是：

1. 它们都不会事先询问，会直接下单。
2. 它们都按你选中的合约、你设置的手数和价格下单。

➤ 手工交易与自动交易共存

隽焱智投能够区分当前终端的手工仓位与自动仓位，也就是说，在同一个终端（再次强调，同一个终端），你在手工下单区下的单子，与自动交易区下的单子，不会混淆，它们各做各的，互不干扰。

但如果你用一个终端搞自动交易，用另一个终端下手工单，就会乱。比如，用隽焱智投搞自动交易，用快期或隽焱智投的另一个终端下手工单，结果将是——搞自动交易的那个终端，把外来的单子统统纳入自动化的管理，如果它们不符合自动化的理论持仓，就要平掉多余的仓位、补上缺乏的仓位。

所以，绝对不要在自动化交易终端之外下单，而且，为了避免你自己的迷惑，就连自动化交易终端本身，也最好不要掺杂手工单（一个终端要搞自动化就单纯地搞自动化，要手工就纯手工，这样不容易乱）。

交易中出现错误时，会在日志中显示。比如，资金不足时下单，会得到如下图所示的提示。



图 6-6 交易错误在日志中显示

所以要学会看日志，在遇到异常情况时，先看看日志里有没有解释。

凡是以“CTP:”开头的日志，都是期货公司或交易所发来的消息，其他的则是由本软件生成的。

挂单表、持仓表、资金表，反映的是整个账户的情况，但不一定是单个策略的情况。

## 挂单表、持仓表与资金表

隽焱智投主界面下方，是反映资金、持仓、挂单的地方：

当前权益		1959.06万		可用资金		1950.44万		总平结利		8.75万		持仓盈亏		3090		占用资金		8.62万		今平净利		-2188	
合约	方向	手数	成本	开仓交易日	持仓盈亏	最新价	备注	平 全  持仓	合约	报单序号	报单类型	委托手数	委托价	最新价	备注	撤 全  挂单							
ni2112	多	3	149550	20211123	120	149590			a2201	10017	买开	1	5785	6240	账户开								
01201	空	3	12469	20211123	210	12462																	
rb2201	多	4	4271	20211123	2760	4340																	

图 7-1 反映资金、持仓、挂单的地方

之所以把这三个表放在同一章里讲，是因为它们有一个共同点——它们都反映整个账户的情况，而不是某个策略的情况。

### 举例

现在对某合约下单的交易方案有两个：

方案 A：使用策略 a，应持多仓 3 手；

方案 B：使用策略 b，应持多仓 1 手。

那么，现在持仓表上显示的是多仓 4 手。

你能说这 4 手是 A 的还是 B 的？

都不是。只能说，这 4 手是账户上的。

持仓表显示的是账户的总持仓，应该是各交易方案的持仓的总和。在计算这个“总和”时，要考虑以下因素：

- 有没有勾选“可做多”；
- 有没有勾选“可做空”；
- 有没有勾选“自动下单”

### 举例



全局勾选了“自动下单”时，有如下交易方案：

登录CTP

早盘自动登录时间84500

夜盘自动登录时间204500

☒ 自动登录

☒ 自动下单

当前账户

开户公司：上期SimNow

账号：159173

密码：\*\*\*\*\*

☐ 显示密码

修改为

开户公司：上期SimNow

账号

密码

保存

交易工具

自动交易

添加交易方案

修改所选方案

删除所选方案

查看所选方案走势图

方案“rb震荡”：

☒ 可做多

☐ 可做空

☐ 14:59清仓

成交表

方案名称	行情合约	下单合约	K线周期	默认手数	策略名称	策略参数	理论多仓手数	可做多	理论空仓手数	可做空	14:59清仓
ni	ni	ni2112	1分钟	3	趋势反转	N1=20 N2=30 P1=1 X...	3	√	0	√	×
OI趋势	OI	OI201	1分钟	3	趋势追踪	N1=20 N2=30 M=60 ...	0	√	3	√	×
rb趋势	rb2201	rb2201	15分钟	6	趋势追踪	N1=20 N2=30 M=60 ...	3	√	0	√	×
OI震荡	OI201	OI201	1分钟	1	震荡网格	开始年=2021 开始月=11...	0	√	0	√	×
rb震荡	rb2201	rb2201	5分钟	2	震荡网格	开始年=2021 开始月=11...	0	√	6	×	×

图 7-2 交易方案表

注意：“rb 震荡”这个方案，没有勾选“可做空”。

那么，持仓表应该显示多少持仓？

如果“可做多”、“可做空”都被勾选，持仓表上显示的持仓，应该是各交易方案的理论持仓的总和。

但当某个交易方案没有勾选“可做空”时，该交易方案的理论空仓就不应该进入上述总和。

所以，本例的持仓表应是各交易方案的理论持仓总和扣除方案“rb 震荡”的理论空仓，也就是：

合约	方向	手数	成本	开仓交易日	持仓盈亏	最新价	备注
ni2112	多	3	149550	20211123	2070	150240	
rb2201	多	3	4271	20211123	2040	4339	
OI201	空	3	12436	20211123	-690	12459	

图 7-3 交易方案“rb 震荡”未勾选“可做空”时的账户持仓

如果交易方案“rb 震荡”的“可做空”是被勾上的，另外还有手工下单产生的 1 手空仓，又当如何呢？

持仓表应该变成这样：

合约	方向	手数	成本	开仓交易日	持仓盈亏	最新价	备注
ni2112	多	3	149550	20211123	2130	150260	
rb2201	多	3	4271	20211123	1980	4337	
OI201	空	3	12436	20211123	-360	12448	
rb2201	空	6	4337	20211123	0	4337	
rb2201	空	1	4338	20211123	10	4337	账户开

图 7-4 交易方案“rb 震荡”勾选“可做空”时的账户持仓

手工仓位的备注含有“账户”二字。

如果总的“自动下单”没有被勾上，持仓表就不会有各交易方案的仓位了，只有手工仓位了。

挂单表很少发挥作用，但如果采用手工下单，而且把价格定在一个不会马上成交的位置，你就会看见挂单出现在挂单表里。

下图所示的例子，是对 a2201 采用跌停价 5785 买开，现在的市场价离跌停价还很远，跌停价买开是不可能马上成交的，

于是有了一个挂单出现在表中：

合约	报单序号	报单类型	委托手数	委托价	最新价	备注	
as2201	10017	买开	1	5785	6240	账户开	撤 全

图 7-5 挂单表

- **合约**：就是下单的对象。
- **报单序号**：给每次报单编制的号码，在同一个交易日、同一个账户内不会重复。
- **报单类型**：有“买开”、“卖平”、“卖平今”、“卖开”、“买平”、“买平今”六种。
- **委托手数**：就是挂单挂上去多少手。
- **委托价**：就是挂单的价格。
- **最新价**：挂单的合约的最新价。
- **备注**：挂单的备注，手工单全都带有“账户”二字，程序化的单子则没有这两字。

挂单表旁边有两个按钮，在交易时间点击它们有如下作用：

“**撤**”按钮：选择某个挂单后，点该按钮，可撤该单（在表中双击该单的效果是一样的）。

“**全**”按钮：就是全撤，点击它后，可撤掉所有挂单。

注意：在非交易时间撤单是撤不了的，而且不同品种的交易时间可能是不同的。比如挂单表中有镍的挂单，有螺纹钢的挂单，到了凌晨 1 点，你点“全”按钮，希望撤掉所有挂单，但实际上只能撤掉镍的单子，因为螺纹钢这时候不在交易时间，撤不了单。

### ➤ 自动交易需要挂单表吗？

自动交易用到了挂单表，但是肉眼不易察觉。

自动交易的每个单子首先是挂上的，但一瞬间就成交了，反映在挂单表里，就是在挂单表里闪现了一下，立刻就消失了。

持仓表的形式如下：

合约	方向	手数	成本	开仓交易日	持仓盈亏	最新价	备注	
ni2112	多	3	149550	20211123	3330	150660		平
rb2201	空	4	4337	20211123	120	4334		全
rb2201	空	1	4338	20211123	40	4334	账户开	
OI201	空	1	12473	20211123	-450	12518		
OI201	空	1	12500	20211123	-180	12518		
OI201	空	1	12522	20211123	40	12518		
OI201	多	3	12525	20211123	-210	12518		持 仓

图 7-6 持仓表

- **合约**：就是持有仓位的产品。

• **方向**：“多”或“空”。

• **手数**：持仓的数量。

• **成本**：持仓的平均成本，也就是说，平均是在哪个价位开的仓。

• **开仓交易日**：开仓的交易日（而非普通日期），比如在 2021 年 11 月 19 日（星期五）晚上 22:00 开仓，交易日是 2021 年 11 月 20 日（星期一）。

• **持仓盈亏**：即快期的“持仓盈亏”，简单地说就是昨仓从昨结算价到最新价的盈亏、今仓从成本价到最新价的盈亏，更确切地说，这是把昨仓的昨结算价、今仓的真实成本当成持仓成本来计算的盈亏（也就是说，对于上一个交易日或更早开的仓，把昨结算价当成成本来计算盈亏，对于当前交易日开的仓，就用真实成本计算盈亏）。注意，快期的“浮动盈亏”与此不同，浮动盈亏无论对昨仓还是今仓都取真实成本。

持仓表中的持仓盈亏的算法，与资金表中的持仓盈亏的算法完全相同，所以，持仓表中各合约的持仓盈亏之和，等于当前账户的持仓盈亏。

但持仓表中的成本是真实成本，而非昨结算价，因此，你用这些成本算出来的浮盈，不一定等于表中显示的持仓盈亏，遇到这种情况时不要惊讶。

• **最新价**：当前市场的价格。

• **备注**：持仓的备注，手工仓位全都带有“账户”二字，程序化的仓位则没有这两字。

持仓表旁边有两个按钮，在交易时间点击它们有如下作用：

“平”按钮：选择某个手工持仓后，点该按钮，可平该仓（在表中双击该仓的效果是一样的）。

“全”按钮：就是全平，点击它后，可平掉所有手工持仓。

注意：

程序化的仓位（备注不含“账户”二字的仓位）用上述方式是平不了的。

在非交易时间，连手工仓也平不了，注意，不同品种的交易时间可能是不同的。比如持仓表中有镍的持仓，有螺纹钢的持仓，到了凌晨 1 点，你点“全”按钮，希望平掉所有手工持仓，但实际上只能平掉镍的手工仓，因为螺纹钢这时候不在交易时间，平不了仓。

## ➤ 特别注意

自动交易如果想要人工干预，就取消“可做多”或“可做空”的勾（取消“可做多”的勾相当于平多仓，取消“可做空”的勾相当于平空仓）。

资金表的形式如下：

当前权益	1959.20万	可用资金	1947.61万	总平结利	8.85万	持仓盈亏	3590	占用资金	11.59万	今平净利	-1220
------	----------	------	----------	------	-------	------	------	------	--------	------	-------

图 7-7 资金表

• **当前权益**：相当于快期的“动态权益”，代表着账户现在的真实财力，是把浮动盈亏算在内、按市场的最新价算出来的、账户上真正的钱数（也就是说，假如现在突然平仓，若不考虑平仓的手续费和点差，账户上就会有这么多钱）。

- **可用资金**：相当于快期的“可用资金”，等于当前权益减去挂单、持仓占用的保证金。

- **总平结利**：在快期中找不到相应的条目，是你在当前电脑或服务器上使用隼焱智投以来的平仓净利总额（已经平掉的仓位，从真实成本到平仓价的盈亏）加上结算盈亏总额（尚未平仓的上个交易日或更早的仓位，从真实成本到昨结算价的盈亏）。

- **持仓盈亏**：即快期的“持仓盈亏”，简单地说就是昨仓从昨结算价到最新价的盈亏、今仓从成本价到最新价的盈亏，更确切地说，这是把昨仓的昨结算价、今仓的真实成本当成持仓成本来计算的盈亏（也就是说，对于上一个交易日或更早开的仓，把昨结算价当成成本来计算盈亏，对于当前交易日开的仓，就用真实成本计算盈亏）。注意，快期的“浮动盈亏”与此不同，浮动盈亏无论对昨仓还是今仓都取真实成本。

- **占用资金**：即快期的“占用资金”，挂单、持仓占用的保证金。

- **今平净利**：即快期的“平仓盈亏”减“手续费”，是当前交易日已发生的平仓净利的总额，确切地说，对于当前交易日的每一笔平仓，如果此仓是上一个交易日或更早开的，就把昨结算价当成成本，如果此仓是当前交易日开的，就取真实成本，算出平仓盈亏，再扣掉这笔交易的手续费，得到这笔交易的平仓净利，再把当前交易日的所有交易的平仓净利加起来，得到今平净利。

## ➤ 不同平台的资金算法的差异与共同点

简单地说，在平仓以前，代表中间过程的数据（如浮动盈亏、保证金）可能是有差异的，但平仓后的数据（或者代表“假设平仓后会有多少钱”的总权益）应该是相同的。

中间过程数据的差异，来自对平仓顺序的不同理解。比如，先是手工开了1手螺纹钢多仓，开仓价是3000，然后程序化开了1手螺纹钢多仓，开仓价是3100，然后程序化平1手多仓。软件认为程序化平的是程序化开的仓，就把那个3100的仓位拿来平掉了，剩下的是3000的仓位，于是持仓平均成本变为3000，浮动盈亏、保证金都在这个基础上计算。但是，有些平台会按时间顺序来平仓，先平最早的仓，那就平掉了3000的那个，剩下3100的那个，持仓平均成本是3100，浮动盈亏、保证金都在这个基础上计算。结果就是，不同的平台给出的浮动盈亏、保证金数据不一样。

实际上平仓顺序是人为规定的，不管按什么顺序来平，把仓位平光以后的最终权益都是一样的，即使是在中间环节，平仓盈亏加上浮动盈亏得到的总权益也是一样的。

我国的期货采用结算价制度，把事情搞得更复杂了，比如官方软件“快期”的“持仓盈亏”和“浮动盈亏”经常是不同的，对于昨仓，持仓盈亏是以昨结算价为成本来计算的，而浮动盈亏是按真实成本来计算的。

这种复杂性，在做隔夜交易时表现得尤为突出，即使是在官方软件“快期”上，你也经常会对它报的数字感到迷茫——“这一单不是赚了很多吗，怎么显示的浮盈才这么点？”“这一单不是亏着的吗，怎么一开盘变成赚的了？”类似的疑问经常产生。要知道，你的直觉是按真实成本来估计盈亏的，而快期是按昨结算价来计算持仓盈亏的，有时昨结算价和真实成本差很多，所以官方报的数字跟你感觉不符合。但是请放心，所有仓位都平完后，官方的数字会符合你的感觉，该赚的就是赚，该赔的就是赔。

另外，不同平台之间资金数据的差异，可能仅仅是由于貌似相同的名称之下采用了不同的算法。比如保证金监控中心的“浮动盈亏”与快期的“浮动盈亏”不一样，这是因为前者是用成本价和当日结算价算出来的，后者是用成本价和最新价算出来的。

如果你对于不同平台的资金数据的差异感到迷茫，不必纠结于此，只要它们在平仓以后一致就对了。如果一定要在中间环节关注资金数据，那就找一个你习惯的平台来关注吧，比如某人习惯快期的资金表，又要用别的软件下单，他完全可以在做交易时开着快期看资金变化。

## 附：官方平台对资金和盈亏的算法

### （1）保证金监控中心的算法

当日结存 = 上日结存 + 当日存取合计 + 当日平仓盈亏 - 当日手续费

（上日结存就是上一个交易日的当日结存，而当前交易日的当日结存，也会变成下一个交易日的上日结存）

客户权益 = 当日结存 + 浮动盈亏

（浮动盈亏是根据当前持仓的成本价、相应合约的当日结算价算出来的）

（如果想知道真正的权益，就把各合约结算价与最新价之差对盈亏的影响算出来，加到上面的客户权益上去）

比如，在某日的 17:00，结算单出来了，

当前持仓为镍的 1 手空单，成本价为 117060，当日结算价为 117260，则浮动盈亏为-200，

若上日结存为 20000，当日出金 1000，当日平仓盈亏为 500，当日手续费为 20，

则当日结存 =  $20000 - 1000 + 500 - 20 = 19480$ （“结存”有“平仓净利”的意思）。

客户权益 =  $19480 - 200 = 19280$

到了明天，上日结存会是 19480。

### （2）CTP 的算法（也就是快期的算法）

静态权益 = 上一个交易日结束时保监中心算出的“客户权益”+ 当前交易日存取合计

（上一个交易日结束时保监中心算出的“客户权益”，包含把昨结算价当成最新价来计算的浮动盈亏——上个交易日开的仓，从开仓价到昨结算价，浮盈是多少，这被计入了这个“客户权益”，而从昨结算价到现在的最新价，这部分浮盈，将被计入当前的“持仓盈亏”。

也可以这么理解——CTP 在计算静态权益时，假设我们昨天下午 15 点已经在昨结算价平了仓，这个假设的已平仓的盈亏，被计入了静态权益；然后，假设我们在昨结算价又重新开了仓，这个假设的重新开仓的盈亏，就是当前的持仓盈亏。）

持仓盈亏是根据持仓表中的持仓均价（对昨仓来说，是昨结算价，对今仓来说，是真实成本价）、相应合约的最新价算出来的

浮动盈亏是根据真实成本价和最新价算出来的

当日平仓盈亏是根据平仓价格与持仓均价（对昨仓来说，是昨结算价，对今仓来说，是真实成本价）算出来的

动态权益 = 静态权益 + 当日平仓盈亏 + 持仓盈亏 - 当日手续费

也就是说：

动态权益=

静态权益（假设我昨天下午 15 点已经把所有持仓在当时的结算价平了仓，当时的权益，再加上今天的出入金）+

当日平仓盈亏（假设我在上述平仓之后又重新开了仓，从昨天的结算价到今天的平仓价，平仓盈亏是多少）+

持仓盈亏（假设我在上述平仓之后又重新开了仓，从昨天的结算价到现在的最新价，浮盈是多少）- 当日手续费

（因此，这个动态权益，体现的是按最新价计算的权益，是资金真实状况的体现，它说我有多少钱，我现在实际上就有多少钱，尽管这个钱是变动的）

如果你希望新的方案自动下单，  
不要忘了勾选“可做多”、“可做空”和全局的“自动下单”。

## ➤ 创建自动交易方案

在“自动交易”区，点黄色按钮“添方案”，就可创建自动交易方案，如下图所示。



图 8-1 创建自动交易方案

- 方案名

由你自己取名，但不要采用除“.”、“\_”以外的英文标点符号，不要与已有的方案重名。

- 灰色 K 线



勾选这个后，该方案的 K 线都将显示为灰色。对于想要看清信号、忽略 K 线颜色的用户，这个选项可以采用。

#### • 使用品种行情

勾选这个后，该方案将使用所选合约所属品种的各合约的综合行情来制造 K 线。例如，你选的合约是“ag2308”（这是在下面的“合约”下拉菜单中选的），那么，如果你勾选了“使用品种行情”，程序就将使用品种 ag 的各合约（ag2306、ag2307、ag2308、ag2309、ag2310……）的行情的加权平均值来制造 K 线，如果没有勾选“使用品种行情”，就只用你选择的 ag2308 的行情来制造 K 线，无论是否勾选“使用品种行情”，下单始终是照着你选择的 ag2308 来下的。

注意：是否使用品种行情，取决于你在决定上实盘之前的历史测试中用的是不是品种行情。

#### • 使用主连行情

勾选这个后，该方案将使用所选合约所属品种的主力连续行情来制造 K 线。例如，你勾选“使用主连行情”后，选择合约的下拉菜单中就只有以“888”结尾的合约，这是各品种的主力合约，如果你又从中选择了“ag888”，程序就将使用品种 ag 的主力连续行情来制造 K 线，下单则照着主力合约 ag2308 来下。

注意：是否使用主力连续行情，取决于你在决定上实盘之前的历史测试中用的是不是主力连续行情。

#### • 最新价

在交易时间，若已登录 CTP 行情，每当你改变对合约的选择，这里就显示当前选择的合约的最新价。

#### • 合约

这里的文字框是用来搜索合约的，下拉菜单才是用来选择合约的，最终在下拉菜单中选择的合约，才是交易方案要采用的。如果勾选了“使用主连行情”，这里就只显示以“888”结尾的合约（各品种的主力连续合约）。

否则，如果在主界面上方勾选了“自动交易方案自动换主力合约”，这里就只显示各品种的主力合约，如果没有勾选“自动交易方案自动换主力合约”，这里就显示全部合约。

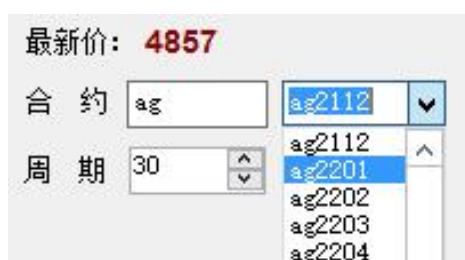


图 8-2 选择合约

有时，在你选好合约之后，点“添加此方案”按钮，会出现如下警告：

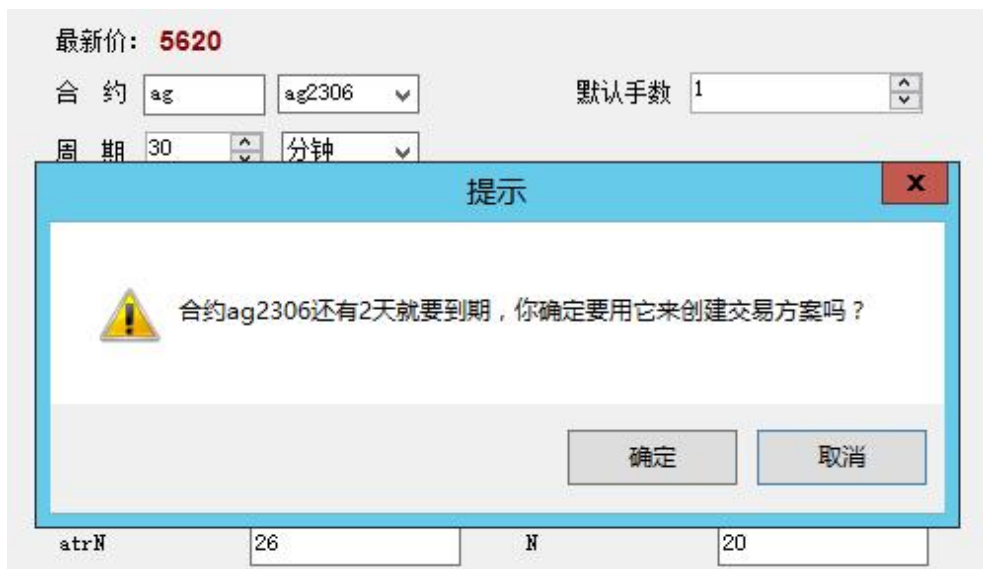


图 8-3 合约快要到期的警告

这时如果点“确定”按钮，就仍会用这个快要到期的合约来创建交易方案（那你就要提防合约到期后交割的严重后果）。大多数人都不愿意承担交割的风险，这时候应该点“取消”按钮，再重新选择合约。

#### • 周期

就是将来承载自动化策略的 K 线的周期，如 5 分钟、15 分钟、1 日。

#### • 默认手数

就是自动化策略的基本手数，通常是每次下单的手数。

但是，某些策略把手数设为参数了（例如“短线启动点”这个策略用参数“底仓手数”、“机动仓手数”来规定下单手数），上面说的手数就不起作用了。

#### • 使用策略

勾选此项时，所建立的交易方案是带有自动化策略的，在适当的时候会自动下单；不勾选此项时，所建立的交易方案只有 K 线而不会自动交易。通常，你来到这里就是为了建立自动交易方案，应该勾选此项。

#### • 策略下拉菜单

这是你从服务器下载的策略的列表，选择一个，当前交易方案就将用它进行自动交易。



图 8-4 选择策略

## • 查询参数意义

每当选择一个策略，在其名称下方会出现其参数列表，当你对这些参数（如“N”、“M”）不熟悉时，可以点击“查询参数意义”按钮，打开如下窗口。

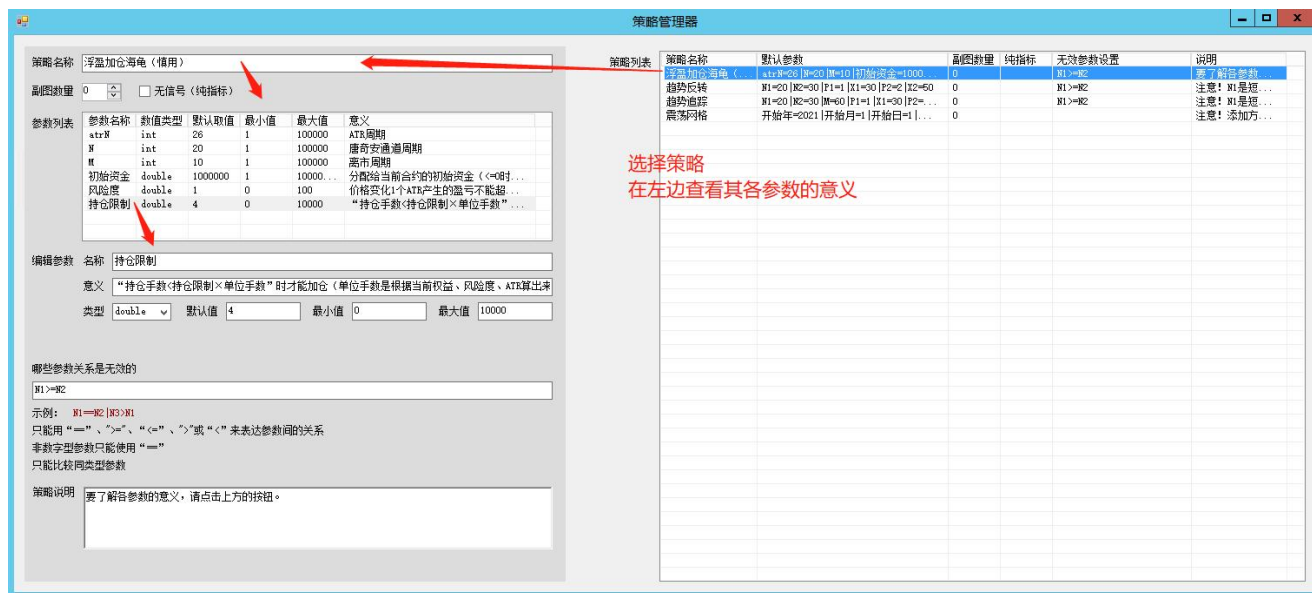


图 8-5 查询参数意义

此窗口右边的表，列出了你所下载的所有策略的概貌，每一行描述一个策略。

在这里选择你想要了解的策略，然后，左边会显示该策略的详细信息，其中的参数列表，列出了该策略的所有参数的详细信息，你可以看到该参数的数值类型、默认值、最小值、最大值、意义等。

## • 设置策略参数

每当你选择一个策略，下方就显示其参数输入框，在这些框里最初出现的是这些参数的默认值，但你可以按自己的意愿修改它们。

另外，让光标悬停在参数框上面，你会看到一个浅黄色的浮动小窗，显示该参数的取值范围。如果你填的数字超出了取值范围，软件会提醒你，不会让你添加这样的方案。



图 8-6 设置策略参数

另外还有一种参数，不需要填数字，只需要打勾。其实这种参数只有两种取值——是、否，打勾表示“是”，如下图所示。

开始年	2021	开始月	11
开始日	25	开始时	23
开始分	13	基准价	4853
步长跳数	10	区间跳数	200
反复做	<input checked="" type="checkbox"/> 打勾表示“是”	网格渐宽	<input type="checkbox"/> 打勾表示“是”

图 8-7 只需要打勾的参数

设置好上述参数后点“添加此方案”按钮，稍等几秒，此方案会出现在主界面的表格中（这几秒是用来补历史 K 线的）。

交易工具		自动交易																							
添方案		改所选方案		删所选方案		删全部方案		看所选方案走势图		全可多		全禁多		全可空		全禁空		所选方案:		<input type="checkbox"/> 可做多 <input type="checkbox"/> 可做空		14:59清仓		成交表	
方案名称		行情合约		下单合约		K线周期		默认手数		策略名称		策略参数		理论多仓手数		可做多		理论空仓手数		可做空		14:59清仓		^	
hcGrid		hc2310		hc2310		5分钟		16		震荡网格		开始日期=20230213 开始时间=-1 基准价=...		0		×		0		×		×			
SF200		SF		SF308		5分钟		1		短线启动点		趋势启动幅度=200 底仓手数=8 机动仓手...		0		√		16		√		×			
SFGrid		SF308		SF308		5分钟		16		震荡网格		开始日期=20220303 开始时间=-1 基准价=...		0		×		0		×		×			
a115		a		a2309		5分钟		1		短线启动点		趋势启动幅度=115 底仓手数=16 机动仓...		0		√		32		√		×			
aGrid		a2309		a2309		5分钟		16		震荡网格		开始日期=0 开始时间=-1 基准价=1000000 ...		0		×		0		×		×			
b70		b		b2307		5分钟		1		短线启动点		趋势启动幅度=70 底仓手数=16 机动仓手...		32		√		0		√		×			
bGrid		b2307		b2307		5分钟		16		震荡网格		开始日期=0 开始时间=-1 基准价=1000000 ...		0		×		0		×		×			
y180		y		y2309		5分钟		1		短线启动点		趋势启动幅度=180 底仓手数=8 机动仓手...		16		√		0		√		×			
yGrid		y2309		y2309		5分钟		8		震荡网格		开始日期=20230309 开始时间=-1 基准价=...		0		×		0		×		×			
i43		i		i2309		5分钟		1		短线启动点		趋势启动幅度=43 底仓手数=4 机动仓手数...		8		√		0		√		×			
iGrid		i2309		i2309		5分钟		4		震荡网格		开始日期=0 开始时间=-1 基准价=1000000 ...		0		×		0		×		×			
j65		j		j2309		5分钟		1		短线启动点		趋势启动幅度=65 底仓手数=1 机动仓手数...		0		√		2		√		×			
cu650		cu		cu2307		5分钟		1		短线启动点		趋势启动幅度=650 底仓手数=2 机动仓手...		0		√		4		√		×			
rb双均线		rb888		rb2310		30分钟		1		双均线追...		N1=20 N2=30 X=50		0		√		1		√		×			
白银海龟		ag		ag2308		30分钟		1		浮盈加仓...		atrN=26 N=20 M=10 初始资金=1000000 ...		47		×		181		×		×			
刚刚添加进来的交易方案																									
“可做多”、“可做空” 尚未被勾选																									

图 8-8 新的交易方案进入表格

注意：刚被添加进来的交易方案，“可做多”、“可做空”是没有被勾选的，这样是不会下单的，如果你希望它自动买开，就勾选“可做多”，希望它自动卖开，就勾选“可做空”。

另外，如果你希望它只做日内，就勾选“14:59 清仓”，这样一来，每个交易日下午 14:59，该方案会清仓（仅仅该方案，不影响别的方案），而到了下一个交易日开盘（晚上 21:00 或早晨 9:00），该方案又根据自动信号补齐仓位。





图 8-9 勾选“可做多”、“可做空”

要看到某方案的 K 线、自动策略信号等，就在表中选择该方案，再点上方的浅黄色按钮“查看所选方案走势图”，如下图所示。



图 8-10 查看走势图

走势图有三种显示模式：

1. **K 线**：显示 K 线（又叫“蜡烛图”），这又有两种模式。

（1）彩色 K 线：阳线是红色的，阴线是青色的。

（2）灰色 K 线：阴阳线都是灰色的。

程序化的线条、标记多起来的时候，用灰色 K 线能看得更清楚，如下图所示。



图 8-11 K 线图

2. **价线**：用白色线条表示收盘价的连线。

也许你更喜欢看到走势的整体，而忽略局部 K 线的细节，那就可以采用价线。



图 8-12 价线图

3. 盈亏线：用黄色曲线显示盈亏的变化。

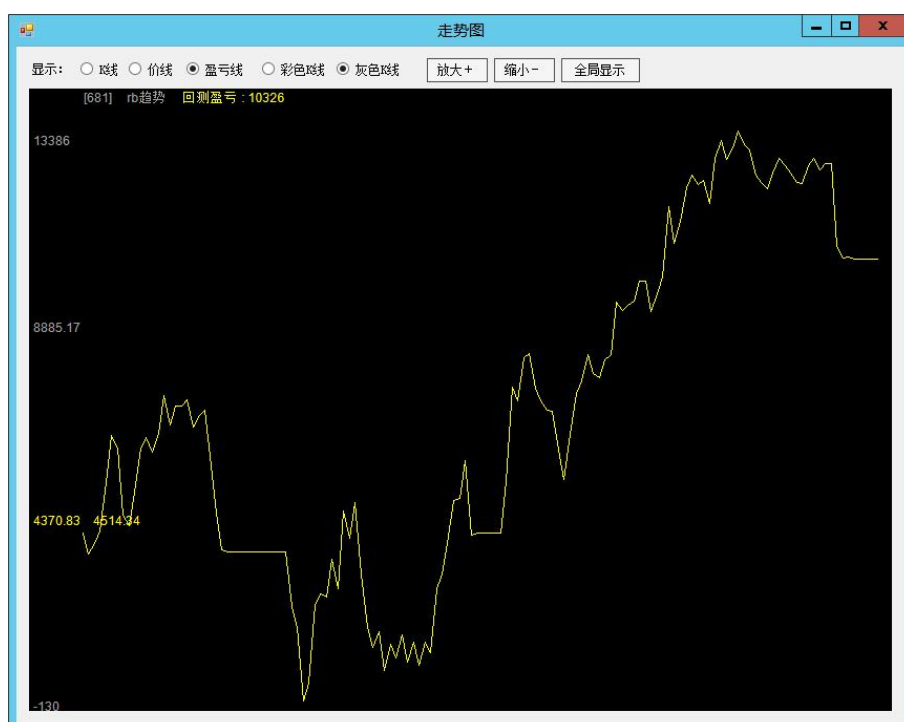


图 8-13 盈亏线图



注意：这里的黄色曲线，仅仅是理论上的盈亏曲线，至于实盘是否能和它一致，取决于实际成交是否总能跟上信号，具体地说：

- (1) 你是否总是勾选了“可做多”、“可做空”；
- (2) 你是否总是勾选了“自动下单”；
- (3) 在应该下单的时候，你是否总是正常登录了 CTP 账户；
- (4) 滑点是否在可控范围内；
- (5) 交易方案、策略的参数是否长期不变（如果中途改变了参数，你曾经的实盘记录就不同于现在的交易方案的理论值）。

实际上，要长期做到以上几点是不容易的，也没有必要。程序化难免有一些人工干预（比如某些阶段只做多、某些阶段只做空、某些阶段暂停、有时候修改参数），没有必要强迫实盘记录始终与理论上的一致。

走势图的放大、缩小，与多数交易软件一样，采用键盘上的向上键、向下键，也可以采用隼焱智投界面上的“放大+”、“缩小-”、“全局显示”按钮。

走势图的平移，采用鼠标左右拖动。

走势图上的参考线，通过单击产生，通过上下滑动鼠标而删除。

单击 K 线图或价线图，会在单击处产生十字虚线，并有一些数据显示，如下图所示。



图 8-14 K 线图的参考线及数据

图中，十字虚线的交叉点就是刚才单击的位置，它附近的数据的意义如下：

(1) “4068×1，一级止盈”、“4108×2，二级止盈”是单击处往左第一根有信号的 K 线上的信号的数据，“4068×1”表示这根 K 线上有个信号的价格是 4068，手数是 1 手，“一级止盈”是这个信号的备注，依此类推。

(2) “20211123 10:30:00”是单击处的 K 线的开始日期、时间。

(3) “4168.8”是单击处的价格。

(4) 走势图上方：

“[618]”是单击处的 K 线的序号；

“rb 趋势”是当前交易方案的名称；

“开 4048 高 4142 低 4048 收 4078 量 266506 仓 1454192”表示单击处的 K 线的开盘价、最高价、最低价、收盘价、成交量、持仓量，“15 分钟”是当前方案的 K 线周期；

“MA[N=20] 3997.5 MA[N=30] 3993.6 MA[N=60] 3935”是当前方案的各指标在单击处 K 线上的数据；

“自动信号持仓：多 3 手”是单击处 K 线的理论持仓手数（如果你想知道一个策略的仓位是怎么变化的，可以在 K 线图上从左到右依次单击各个 K 线，看这个数据）。

在盈亏线上，数据要少得多：

(1) “20211123 10:30:00”是单击处的节点的日期时间。

(2) “10299.5”是单击处的盈亏金额。

(3) 走势图上方：

“[618]”是单击处的节点的序号；

“rb 趋势”是当前交易方案的名称；

“回测盈亏：7296”是单击处的节点的盈亏金额。



图 8-15 盈亏线图的参考线及数据

上下滑动鼠标，可删除此十字虚线。

没有十字虚线时，上述数据是走势图中最右边的 K 线或节点的数据。

走势图左边还有标尺，如下图所示。

K 线图在竖直方向上被划分为 3 份，每份的高度约为 174.3（也就是价格变化 174.3），这就是“10461 元（174.3 点）”的由来，其中的“10461 元”是这么算出来的——当前方案的默认手数  $6 \times$  当前品种的合约乘数  $10 \times 174.3 = 10458$ ，但 174.3 只是一个四舍五入后的数字，程序在算这道题的时候用的并非正好是 174.3，而是小数点后有很多位的数字，计算结果就不是 10458 而是 10461。

盈亏线在竖直方向上被划分为 3 份，每份的高度约为 4514.34（这是金额，单位是“元”），所以在标尺旁边有“4514.34”这个数字。

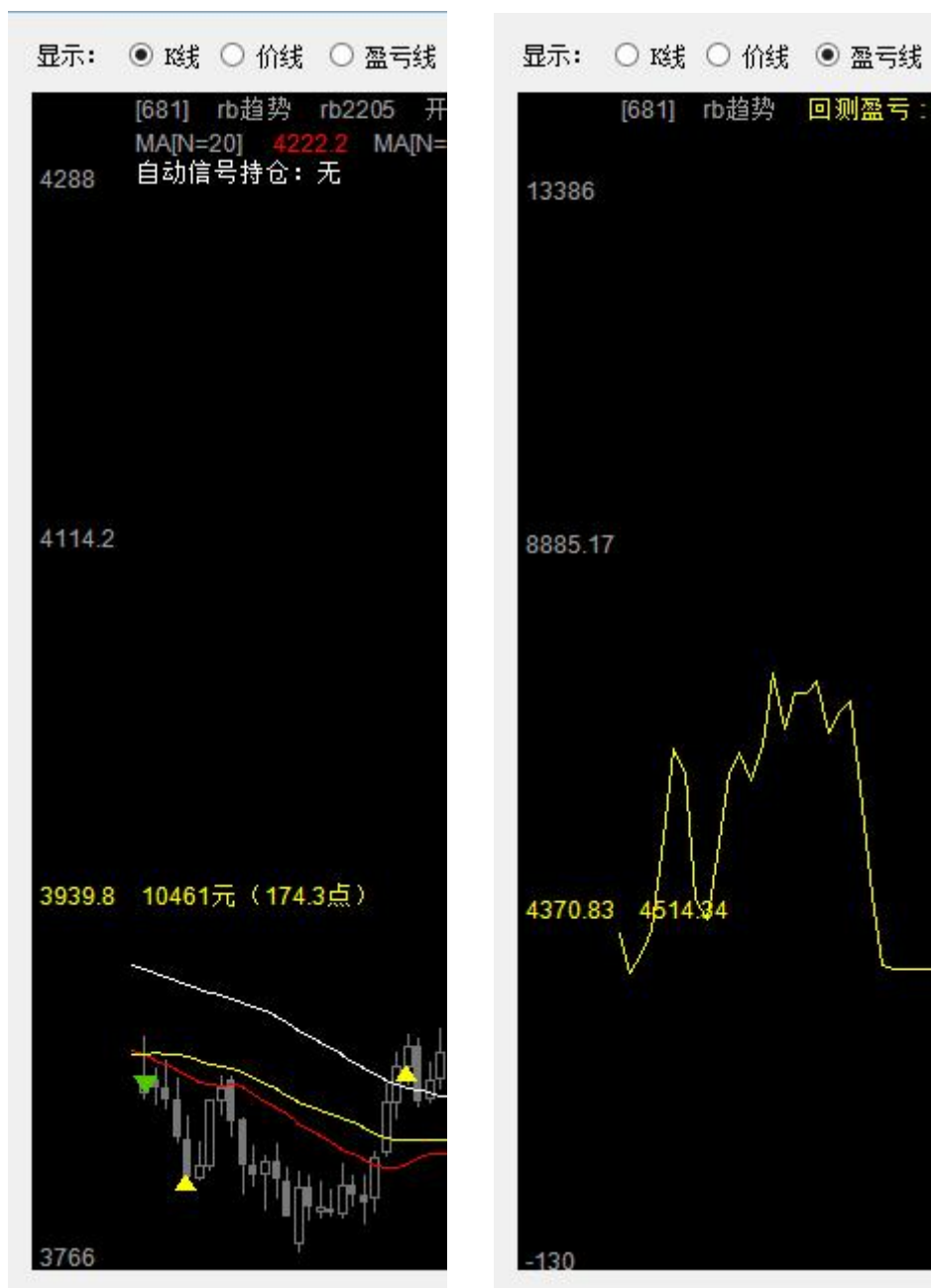


图 8-16 走势图上的标尺

特别重要的是信号。

走势图上的三角形，都是自动化策略产生的信号：

- 红色三角形是买开信号
- 绿色三角形是卖开信号
- 黄色三角形是平仓信号

有时候，红绿三角形与黄色三角形重叠在一起，这是反手信号（既平仓又开仓）。

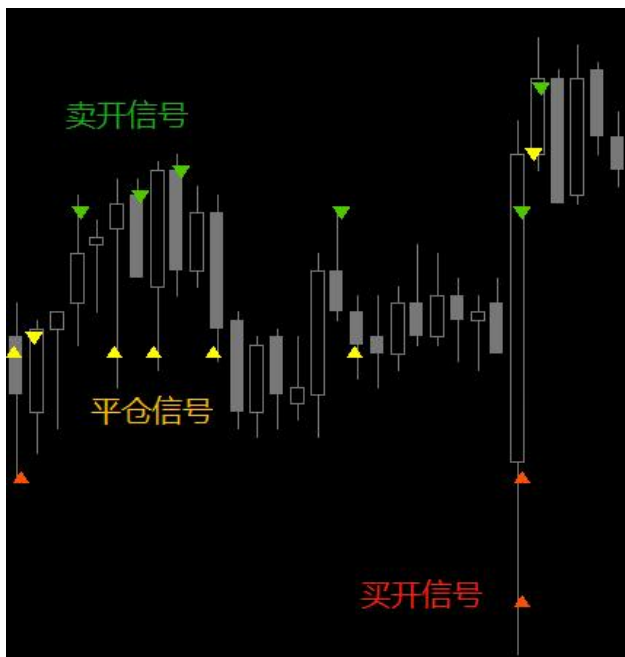


图 8-17 信号

在自动交易区有“成交表”按钮，点击它可以查看成交记录，但请注意，这是整个账户的成交记录，而不是某一个交易方案的成交记录。

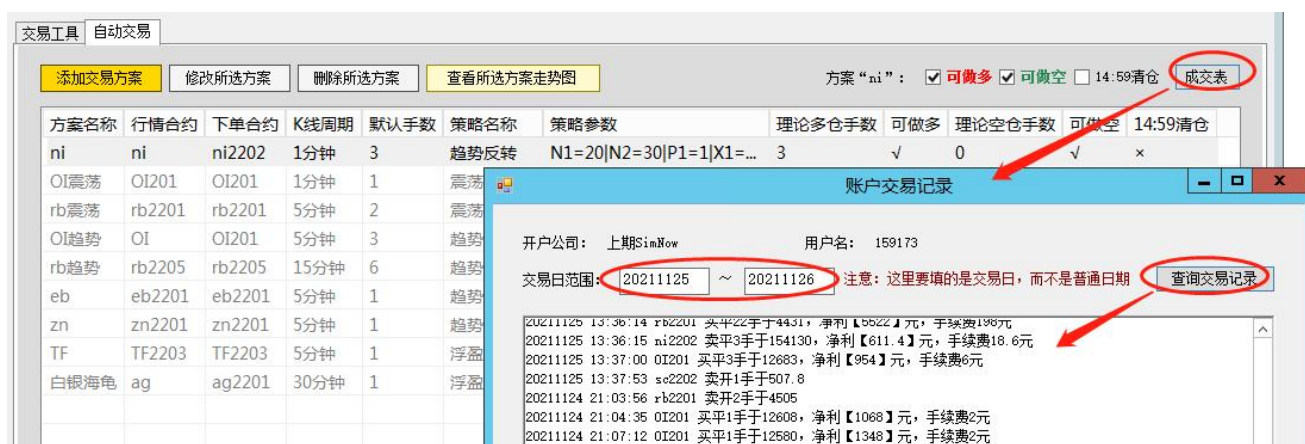


图 8-18 成交表

### ➤ 隽焱智投的成交表为什么不反映个别交易方案的成交记录

这和隽焱智投的下单逻辑有关。

它不是像一般的程序化软件那样见一个信号下一次单，而是从账户整体的视角，让账户的总持仓与程序化理论持仓匹配，这样一来，有时就不能把单子落到某一个交易方案上。

举个例子来说，有两个交易方案都是做 rb2201 的，在某一时刻，一个方案买开 3 手，另一个方案买开 1 手，这几乎是同时发生的，隽焱智投并不是先给一个方案开 3 手、再给另一个方案开 1 手，而是在同一时间开 4 手，它的目的并不是追某一个

方案的信号，而是让账户整体持仓与交易方案持仓总和一致。

那么，这 4 手，你没法说它是方案甲的还是方案乙的，只能说是账户的。

正因为如此，把账户的成交记录与策略的信号拿来对比通常是没有意义的。你难免改变过策略的参数、交易方案的手数，甚至改变过交易方案的合约，也难免有过人工干预，也难免开过手工仓，甚至难免有其他软件在同一期货账户开过仓（它的成交信息来过当前软件，留下了记录），所以，你很难保证账户的成交记录就等于现在看到的（不知是否曾经修改过的）信号的序列。

### ➤ 重要的是——

目前的账户持仓，与目前的理论持仓匹配，就对了。

这种匹配，是建立在下列前提之上的：

1. 全局，勾选了“自动下单”，才能把理论持仓拿来与账户持仓匹配。
2. 对于每个交易方案，勾选了“可做多”，其理论多仓才参与匹配，勾选了“可做空”，其理论空仓才参与匹配。
3. 对于每个交易方案，在 14:59 及以后半小时内，不勾选“14:59 清仓”，其理论持仓才参与匹配。
4. 手工仓位（备注含“账户”二字的仓位）不参与匹配。

改了方案之后，至关重要的是，  
账户持仓可能会马上跟着变化……

## ➤ 修改自动交易方案

在交易方案表中，选择某方案，有两种方法可以修改它：

- 1. 点击“改所选方案”按钮；
- 2. 直接双击该方案在表中的那一行。

上述操作，打开了“修改程序化实时方案”窗口，如下图所示。



图 9-1 修改方案的窗口

这个窗口的结构，与添加方案的窗口完全一样，其中各种参数的意义，在“创建自动交易方案”一章中已经讲过。

现在修改方案，可以修改这个窗口里的任何一项，可以在交易时间修改，可以在登录 CTP 账户之后修改，随时都可以修



改，隽焱智投会实时地改变此方案及相关元素。

修改完毕，点“修改此方案”按钮之后，软件会做这几件事：

1. 如果你修改了方案名称，软件就给方案重命名。
2. 如果你修改了“使用品种行情”、“使用主连行情”、合约代码、K 线周期，软件就更换 K 线序列。
3. 如果你修改了默认手数、策略（更换了策略或修改了参数），软件就重新生成信号序列，并且，至关重要的是一一在交易时间，在你正常登录了期货账户的情况下，在全局勾选了“自动下单”、对当前方案勾选了“可做多”或“可做空”、对当前方案在 14:59 及之后的半小时内未勾选“14:59 清仓”的情况下，**软件会自动调整账户持仓，使之与当前方案的改变相匹配**（例如，改了方案之后，某合约的多仓由 4 手变为 1 手，账户上该合约的多仓就会跟着减 3 手）。

### ➤ 特殊情况——更换合约

程序化经常有这种需要——某合约快要到期了，要换成主力合约。

这件事，在隽焱智投上很简单，就是修改交易方案中的合约。

如果你勾选了“自动交易方案自动换主力合约”，这件事情就不用你操心了。

否则，手工换主力合约的方法是：

1. 在交易方案表中双击该方案，或在选择该方案之后点击“修改所选方案”按钮，打开“修改程序化实时方案”窗口。
2. 选择新的合约，点“修改此方案”按钮。
3. 然后，如果是在交易时间，正常登录了期货账户，勾选了“自动下单”，对于“可做多”、“可做空”、“14:59 清仓”的勾选也没有错，那么，程序立刻就会平掉原来的仓位，给新的合约开仓，如果不满足以上条件，程序就会等满足这些条件时再换仓。

修改方案会引起颜色的变化。

在交易方案表中，每个方案的颜色，都跟当前的状态有关。

总的来说，能够自动开仓时，就是彩色的（仅能做多时是红色的，仅能做空时是绿色的，两个方向都能做时是蓝色的），不能自动开仓时，是灰色的。

具体规则是：

1. 未完成该完成的结算确认，或未成功查询持仓，或交易断线达 3 次，或未勾选“自动下单”时：灰色
2. 结算确认没毛病，成功查询了持仓，交易断线不到 3 次，已勾选“自动下单”时：
  - （1）多空都可做时：蓝色
  - （2）只能做多时：红色
  - （3）只能做空时：绿色
  - （4）多空都不能做时：灰色

如下图所示。

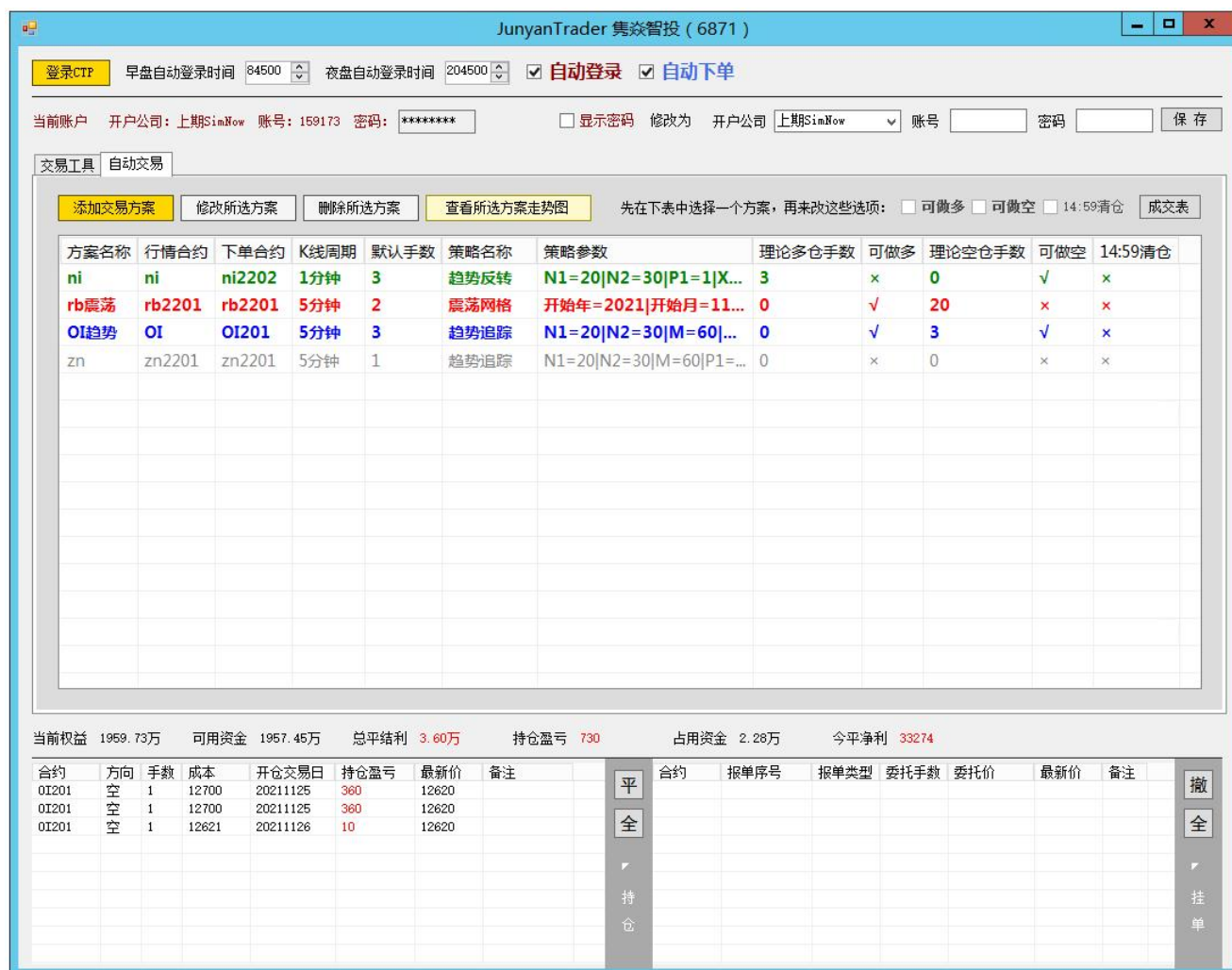


图 9-2 方案的颜色反映不同的状态

还可以删除方案：

1. 在方案表中选择某个方案。
2. 点“删所选方案”按钮。

然后在交易时间，若正常登录了期货账户，勾选了“自动下单”，程序就会自动扣减该方案的仓位，使账户持仓与理论持仓保持一致。

## ➤ 对于人工干预的重要提示

有时候你希望平掉某个程序化仓位（比如提前止盈），你会随手在持仓表中双击。

但在本软件中，这是错误的。

在持仓表中双击，只能平掉手工仓位（备注含“账户”二字的仓位），无法平掉自动仓位。

如果你真的想平掉自动仓位，正确的动作应该是：

1. 在交易方案表中选择这个方案。

2. 如果这是多仓，就取消“可做多”的勾，如果这是空仓，就取消“可做空”的勾。

交易工具 自动交易

平仓正确的方法是取消这里的勾

添加交易方案 修改所选方案 删除所选方案 查看所选方案走势图

方案“rb震荡”：☒ 可做多 ☒ 可做空 14:59平仓 成交表

方案名称	行情合约	下单合约	K线周期	默认手数	策略名称	策略参数	理论多仓手数	可做多	理论空仓手数	可做空	14:59平仓
ni	ni	ni2202	1分钟	3	趋势反转	N1=20 N2=30 P1=1 X1=...	3	✓	0	✓	×
OI震荡	OI201	OI201	1分钟	1	震荡网格	开始年=2021 开始月=11 ...	0	✓	5	✓	×
rb震荡	rb2201	rb2201	5分钟	2	震荡网格	开始年=2021 开始月=11 ...	0	✓	16	✓	×
OI趋势	OI	OI201	5分钟	3	趋势追踪	N1=20 N2=30 M=60 P1=...	0	✓	3	✓	×
rb趋势	rb2205	rb2205	15分钟	6	趋势追踪	N1=20 N2=30 M=60 P1=...	0	✓	0	✓	×
eb	eb2201	eb2201	5分钟	1	趋势反转	N1=20 N2=30 P1=1 X1=...	0	✓	0	✓	×
zn	zn2201	zn2201	5分钟	1	趋势追踪	N1=20 N2=30 M=60 P1=...	0	✓	1	✓	×
TF	TF2203	TF2203	5分钟	1	浮盈加仓...	atrN=26 N=20 M=10 初...	0	✓	0	✓	×
白银海龟	ag	ag2201	30分钟	1	浮盈加仓...	atrN=26 N=20 M=10 初...	0	✓	0	✓	×

当前权益 可用资金 总平结利 持仓盈亏 占用资金 今平净利

合约	方向	手数	成本	开仓交易日	持仓盈亏	最新价	备注	平	全	合约	报单序号	报单类型	委托手数	委托价	最新价	备注	撤	全	挂	单
OI201	空	1	12621	20211125	740	12582		平												
OI201	空	1	12608	20211125	740	12582		全												
OI201	空	1	12700	20211125	740	12582														
OI201	空	1	12700	20211125	740	12582														
rb2201	空	14	4457	20211125	9660	4415														
rb2201	空	2	4505	20211125	1380	4415														
rb2201	空	2	4436	20211125	1380	4415														
rb2201	空	4	4464	20211125	2760	4415														
rb2205	多	3	4245	20211125	-2370	4172														
TF2203	多	10	101.18	20211125	-1500.00	101.165														

在这里平掉程序化的仓位是错误的

图 9-3 程序化平仓的正确方法

除了客服电话等，还可通过提交工单，  
详细报告使用中遇到的问题。

## 客服

在“交易工具”区，有“客服区”，如下图所示。

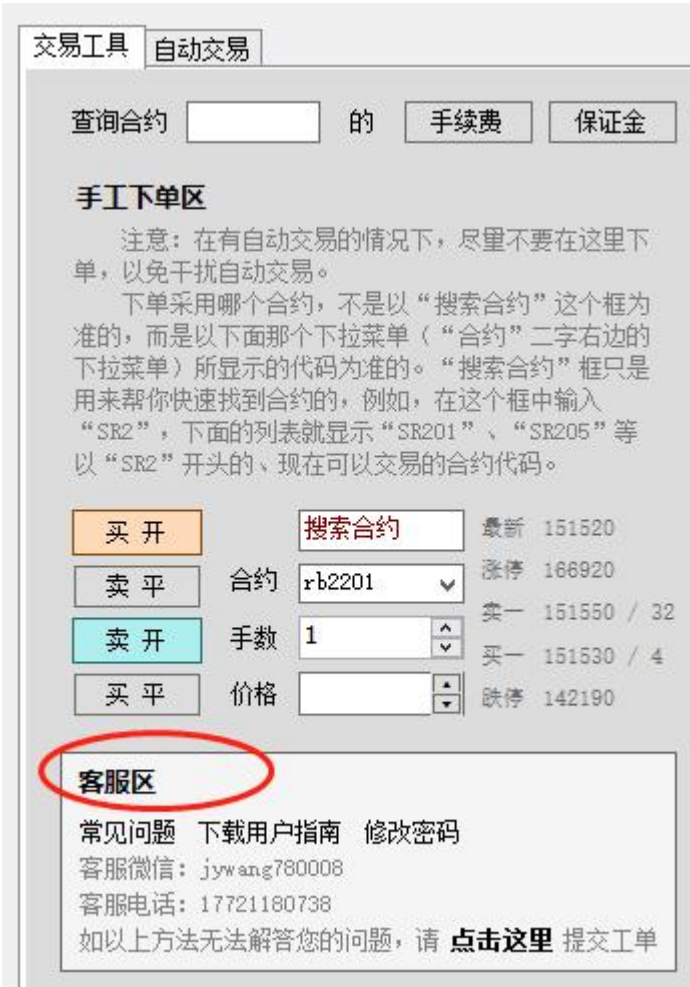


图 10-1 集焱智投的客服区

这里除了客服联系方式外，特别重要的有两点：

### 一、修改密码

这里修改的是软件账户的密码，而不是期货账户的密码（后者要在快期中修改）。

点“修改密码”按钮，打开如下窗口：



图 10-2 修改密码窗口

在此填入旧密码、新密码，点“确定修改”按钮即可。

## 二、提交工单

对于客服电话无法解决的复杂问题，可以用打包的形式，把出问题时的数据传给客服人员。

点“点击这里”按钮，打开“报告软件问题”按钮，如下图所示。

报告软件问题

摘要

某某环节某某操作出现的某某问题

用户名

6871

要填的是软件的用户名，而非期货账户的用户名

联系方式

13888888888

出问题的时间

2021 年 11 月 26 日 9 时 16 分

要填的是出问题的时间，而不一定是此时此刻

出问题的交易方案

白银海龟

如果问题不是针对某个具体的交易方案的，就选择“全局问题”

出问题的自动策略

浮盈加仓海龟（慎用）

如果问题不是针对某个策略的，就选择“全局问题”

问题描述

在怎样操作的情况下，  
软件有怎样的症状……

添加附件

bg01.png|bg02.png|bg03.png

删除附件

C:\softs\TraderJunyan\img\bg03.png

打包

“text”文件夹中将生成一个以“zip”为后缀的文件，请将它发送给客服人员

图 10-3 报告软件问题

把内容都填完之后，点“打包”按钮，就会在软件安装目录下的“text”文件夹中生成一个后缀为“zip”的文件，请联系客服人员递交此文件。