

量化资产管理平台系统

【客户端】

V1.0.0 使用说明书



CONTENTS

目录

一、 引言	4
1. 系统介绍	4
2. 资管系统介绍	6
2.1. 优势	6
2.2. 说明	7
二、 安装与部署	7
1. 客户端安装	8
三、 客户端登录与交易	9

1. 登录	9
2. 交易	10
3. 历史查询	11
4. 合约信息	12
5. 保证金监控中心查询	14
6. 修改密码	15
7. 行情显示	16
8. 程序化交易	18
9. 自动重连	21
10. 风控预警	21
11. 风控参数	22
12. 行情K线	22
13. 自由布局	23
14. 条件单预埋单	23
15. 热重载	23
16. 工作区多图表交易	24
17. 一键启停	24
18. AI 形态匹配	25
19. 足迹图	25
20. 订单流	25
21. 双动量工具	25
22. 邮件预警	25

23. 企业微信监控	25
24. 蒙特卡洛量化实验区	26
25. 全自动换月与强弱切换	26
26. 更多功能扩展中	28

一、引言

专门面向期货 FOF/MOM 基金/量化交易团队/交易员培训与孵化团队/机构团队或个人多策略/多账户混合交易而打造的以账户管理为核心，兼具风险管理，多账户独立结算，账户信息实时监控，是一个综合性的集主观交易，程序化交易分仓独立结算，独立分析的综合管理平台，支持不同期货公司 CTP 柜台，兼具内外盘市场，包括数字货币，内外盘期货，股票市场等。

1. 优势

1. 系统集成管理的方式能更方便管理多个交易员和多个市场的经纪商，实时查看交易员动态及各个经纪商包括内外盘的主账户和子账户的实时情况。

2. 传统方式需要保证每个账户有充足资金交易，但是实际整体资金使用率可能只有 50-80%，使用资管系统后，同样资金可以根据使用率适当放大，分配给更多的交易员。

3. 多个交易员或策略分开独立运行，但是收益拟合到一个总账户，交易曲线在总账户上可以更加平滑，各策略和交易员独立结算，方便进行归因分析，事后的策略回溯。

4. 提前给各个子账户按照各自风险偏好的不同设置开仓、强平规则，黑白名单交易合约，是否日内清仓等等风控规则，避免”死扛” ”贪婪”等人性弱点导致的不按约定开平仓。降低交易思路的人为干扰因素。

2. 说明

团队长期致力于量化交易系统，投研平台终端开发，自研 Global-Trader 全球量化交易-投研一体化终端的框架和前端建设，专注于私募/资产管理团队策略运维与运营自动化 IT 建设，打造更高效的策略投研与交易团队管理，交易实践一体化的平台整合方案。同时长期致力于自上而下的 CTA 投资组合的研究与实战，是一家兼具量化系统开发与量化资产管理的双赛道驱动的金融科技公司，秉承长期主义，欢迎交流。

二、安装与部署

1. 客户端安装

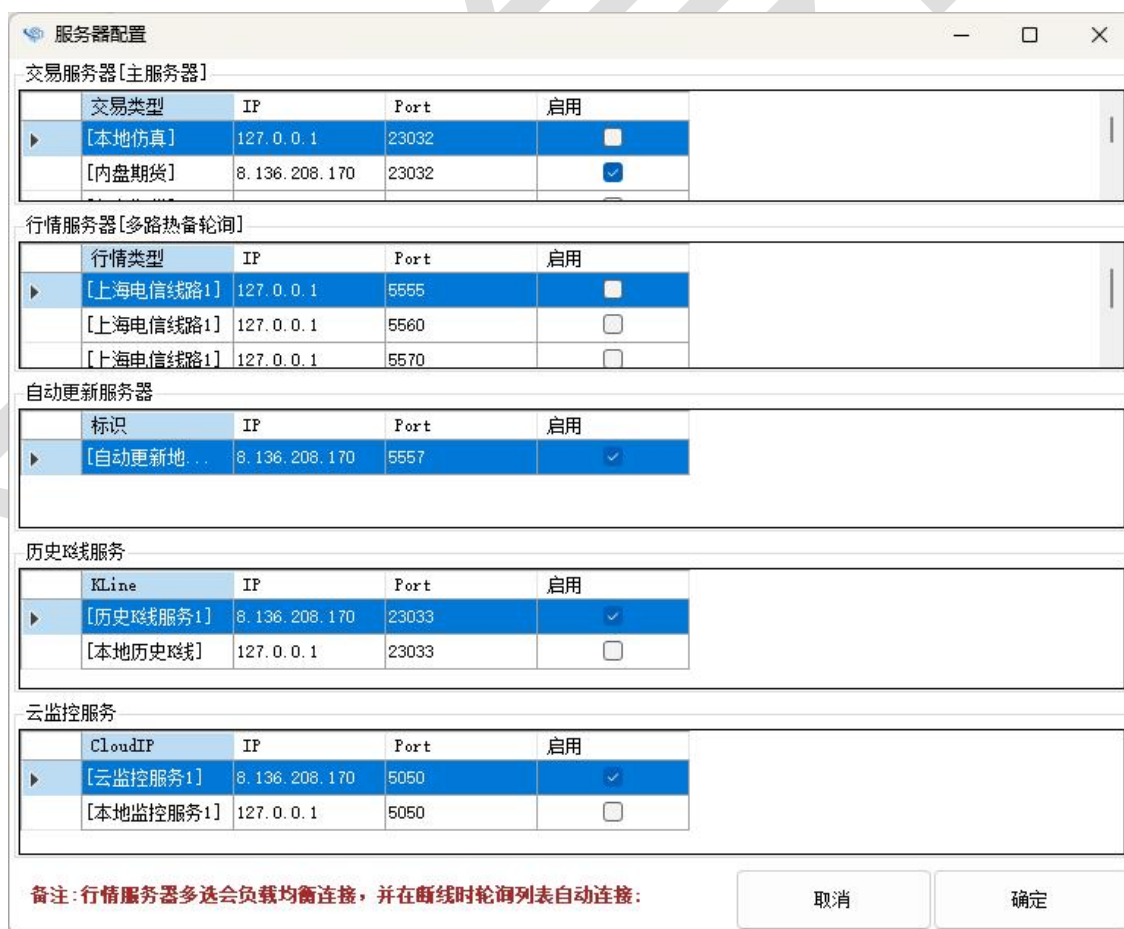
1.1 接收安装包接收

官网[www.code2trade.cn]下载安装包；

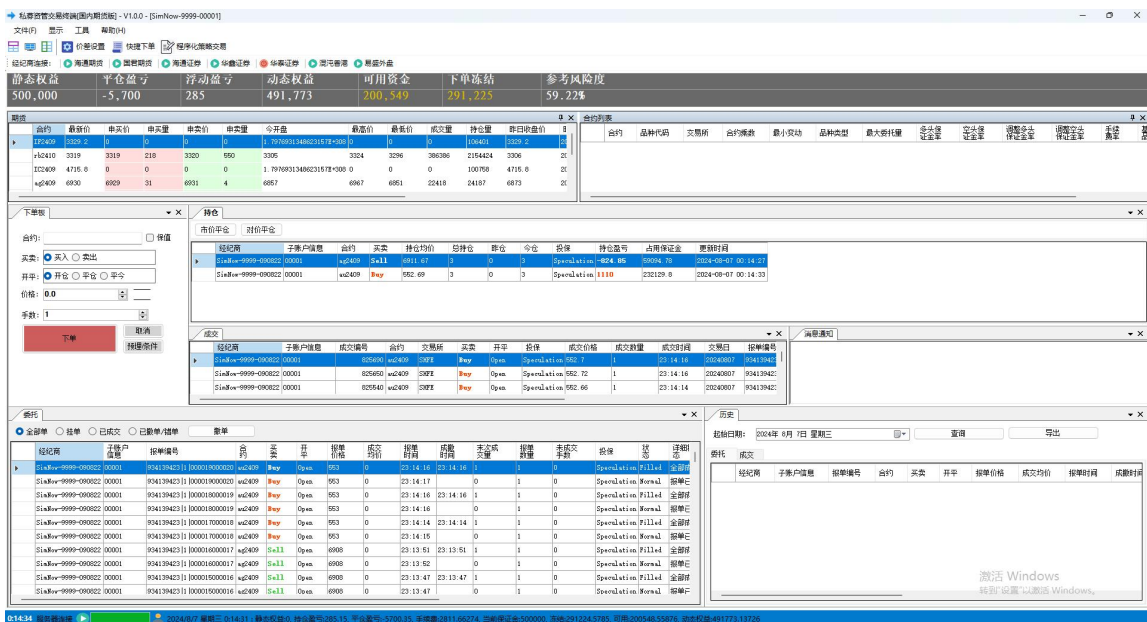
1.2 安装

安装之前，或需将 360 等杀毒软件先关闭。杀毒软件会拦截本软件不能正常安装。

1.3 客户端登录

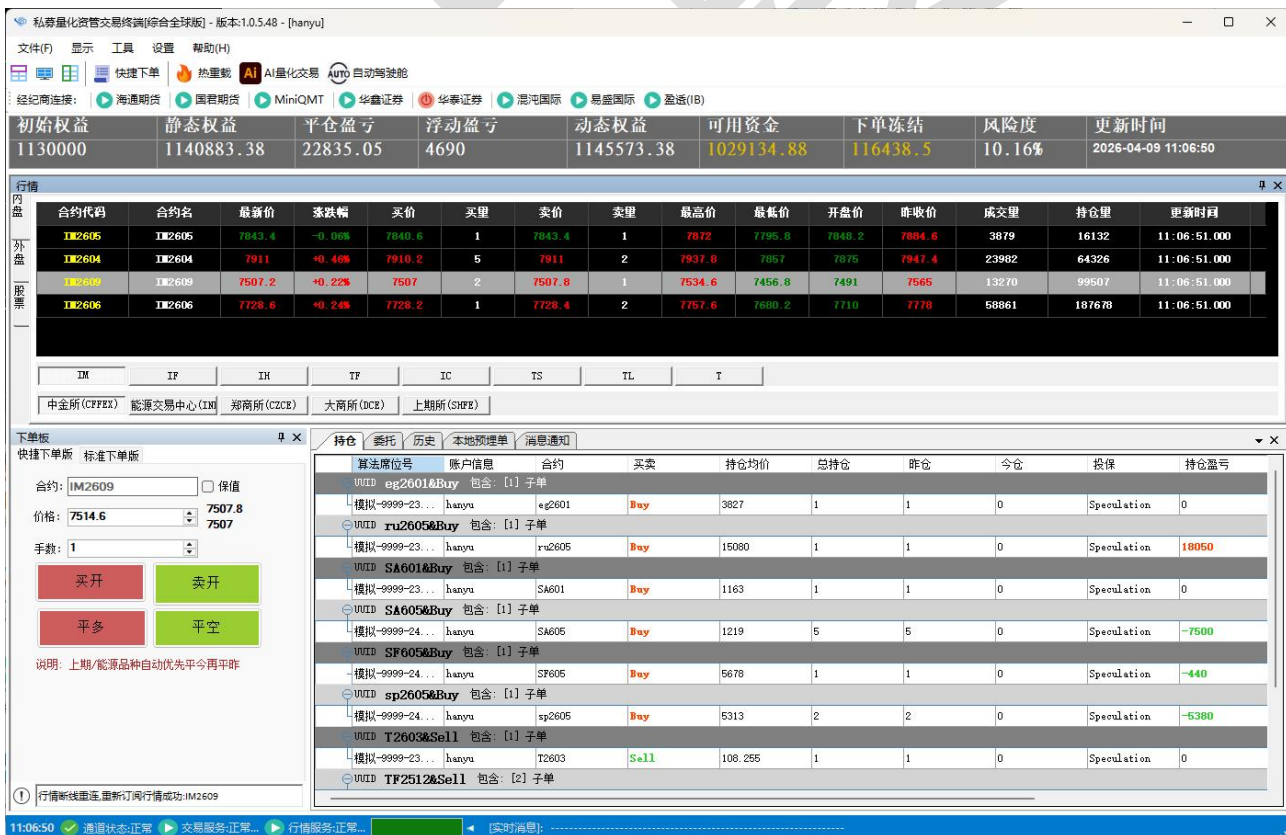


根据技术支持人员给到的站点, 主账户, 子账户和密码等信息, 完成子账户的登录。



匹配交易员熟悉的博易，快期等软件交易界面。交易界面可自由组合，根据交易员操作习惯定制化，符合使用者的习惯。

1.4 交易





包括下单在内的所有子功能模块全部在主界面->显示下拉菜单中调取

1.4 历史查询

经纪商	子账户信息	成交编号	合约	交易所	买卖	开平	投保	成交价格	成交数量	成交时间	交易日	报单编号	交易所编号	平仓盈亏	手续费
SinNov-9999-090822	00001	2125390	rb2410	SHFE	Buy	Open	Speculation	3347	1	11:06:12	20240806	-1834278305 1 000001000002	320578	0	26.776
SinNov-9999-090822	00001	2126820	ag2409	SHFE	Buy	Open	Speculation	6995	1	11:06:30	20240806	-1834278305 1 000002000003	320803	0	31.4775
SinNov-9999-090822	00001	2126950	ag2409	SHFE	Buy	Open	Speculation	6995	1	11:06:32	20240806	-1834278305 1 000003000004	320808	0	31.4775
SinNov-9999-090822	00001	2133630	i2409	DCE	Buy	Open	Speculation	789	1	11:07:40	20240806	-1834278305 1 000004000005	321923	0	63.12
SinNov-9999-090822	00001	2138961	i2409	DCE	Sell	Close	Speculation	787.5	1	11:08:46	20240806	-1834278305 1 000005000006	322800	-150	63
SinNov-9999-090822	00001	2311790	IF2409	CFFEX	Buy	Open	Speculation	3318.4	1	13:09:05	20240806	-1437536877 1 000005000006	347469	0	183.17568000000003
SinNov-9999-090822	00001	2354580	rb2410	SHFE	Buy	Open	Speculation	3318	1	13:31:09	20240806	-1437536877 1 000031000032	368077	0	26.544000000000004
SinNov-9999-090822	00001	2359650	i2409	DCE	Buy	Open	Speculation	784.5	1	13:31:51	20240806	-1437536877 1 000032000033	368873	0	62.760000000000005

根据日期，获取到该交易员的历史委托和成交记录，并可以导出为文件保存在本地。

1.5 合约信息

合约	品种代码	交易所	合约乘数	最小变动	品种类型	最大持仓量	多头保证金率	空头保证金率	调整多头保证金率	调整空头保证金率	手续费率	基础商品代码	更新时间
si2501	si	SHFE	5	5	Futures	1000	0.1	0.1	0.1	0.1		si	2024-08-06 22:48:04
sc2509	sc	INE	1000	0.1	Futures	500	0.17	0.17	0.17	0.17		sc	2024-08-06 22:48:04
si2412	si	SHFE	5	5	Futures	1000	0.1	0.1	0.1	0.1		si	2024-08-06 22:48:04
ag2501	ag	SHFE	15	1	Futures	500	0.19	0.19	0.19	0.19		ag	2024-08-06 22:48:04
v2412	v	DCE	5	1	Futures	1000	0.18	0.18	0.18	0.18		v	2024-08-06 22:48:04
v2411	v	DCE	5	1	Futures	1000	0.18	0.18	0.18	0.18		v	2024-08-06 22:48:04
v2410	v	DCE	5	1	Futures	1000	0.18	0.18	0.18	0.18		v	2024-08-06 22:48:04
rr2504	rr	DCE	10	1	Futures	1000	0.12	0.12	0.12	0.12		rr	2024-08-06 22:48:04
sc2703	sc	INE	1000	0.1	Futures	500	0.17	0.17	0.17	0.17		sc	2024-08-06 22:48:04
lc2506	lc	INE	10	1	Futures	500	0.17	0.17	0.17	0.17		lc	2024-08-06 22:48:04
lc2411	lc	INE	10	1	Futures	500	0.17	0.17	0.17	0.17		lc	2024-08-06 22:48:04
bb2409	bb	DCE	500	0.05	Futures	1000	0.45	0.45	0.45	0.45		bb	2024-08-06 22:48:04
lc2412	lc	SHFE	1	50	Futures	1000	0.09	0.09	0.09	0.09		lc	2024-08-06 22:48:04
TS2412	TS	CFEX	20000	0.002	Futures	50	0.01	0.01	0.01	0.01		TS	2024-08-06 22:48:04
fu2501	fu	SHFE	10	1	Futures	500	0.17	0.17	0.17	0.17		fu	2024-08-06 22:48:04
lc2409	lc	SHFE	1	50	Futures	1000	0.09	0.09	0.09	0.09		lc	2024-08-06 22:48:04
sn2408	sn	SHFE	1	10	Futures	500	0.2	0.2	0.2	0.2		sn	2024-08-06 22:48:04

合约信息列表提供给交易员查看目前可交易的所有合约的基础信息

1.6 保证金监控中心查询

The screenshot displays a trading software interface with a central login window for the 'Futures Statements Query Service System'. The window title is '保证金监控中心业务系统' and features the CFMCC logo and the text '中国期货市场监控中心' and 'China Futures Market Monitoring'. The login form includes fields for '用户名' (Username), '密码' (Password), and '验证码' (Verification Code). A '资金安全特别提示' (Special提示 on fund safety) is displayed below the login fields, stating that the system is provided by the China Securities Regulatory Commission to ensure fund safety and market service, and that users should verify their account information and report any discrepancies. The background shows a trading platform with various data tables and charts.

保证金监控中心结算单查询
- □ ×

结算单 绩效报告

日期:

结算日期

 交易日2026/4/8 0:00:00

客户信息

账户名称 hanyu	账户ID hanyu
---------------	---------------

资金状况

上日结存 1140883.38	客户权益 1147983.38
当日存取合计 0.00	质押金 0.00
平仓盈亏 22835.05	保证金占用 116438.5
当日手续费 11951.67	可用资金 1031544.88
当日结存 1147983.38	风险度 0.1014%
浮动盈亏 7100	追加保证金 0.00

出入金明细

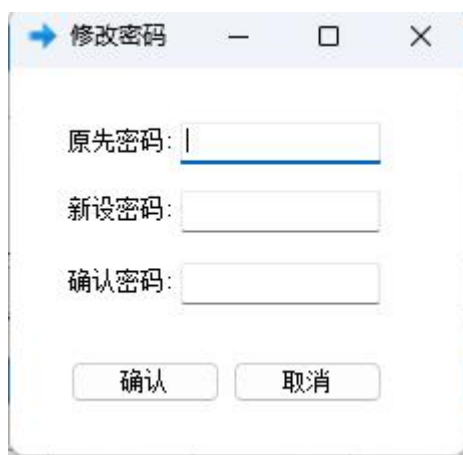
发生日期	入金	出金	方式	摘要
2025-09-11 10:21:12	1000000	0.00	银行转账	入金
2025-09-03 18:25:15	10000	0.00	银行转账	入金
2025-08-07 17:03:30	10000	0.00	银行转账	入金
2025-08-07 16:50:50	10000	0.00	银行转账	入金
合计	1030000	0		

成交汇总



保证金监控中心可以查看主账户的交割单以和本地历史委托成交记录比对，确保笔笔对应到市场真实的订单

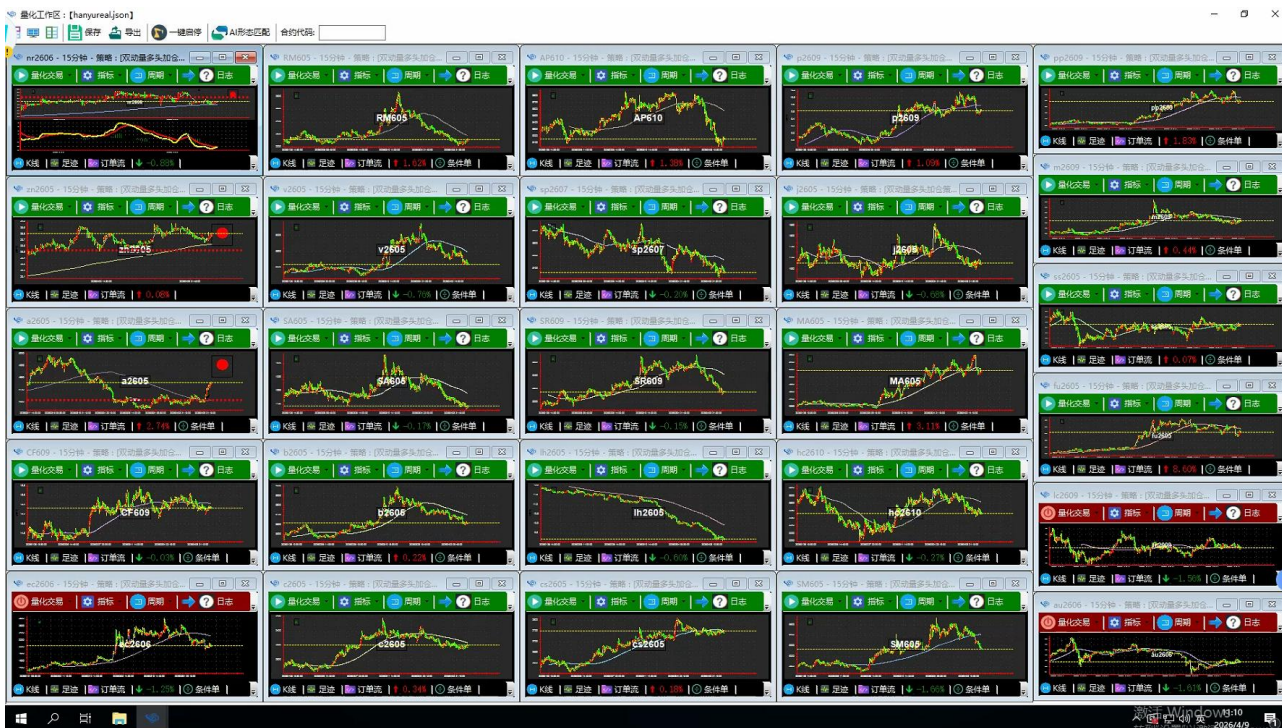
1.7 修改密码



可以在登录后完成子账户密码的修改，盘中修改即时生效，确保子账户交易安全。

1.8 行情显示





1.9 程序化交易

私享量化资管交易终端(综合全球版) - 版本:1.0.5.48 - [hanyu]

文件(F) 显示 工具 设置 帮助(H)

快捷下单 热盘 交易 **Ai AI量化交易** 自动策略

经纪商连接: 海通期货 国君期货 M... MMT 华泰证券 华泰证券 混沌国际 易盛国际 盈透(B)

初始权益	静态权益	持仓盈亏	浮动盈亏	动态权益	可用资金	下单冻结	风险度	更新时间
1130000	1140883.38	22835.05	4600	1145483.38	1029044.88	116438.5	10.17%	2026-04-09 11:32:44

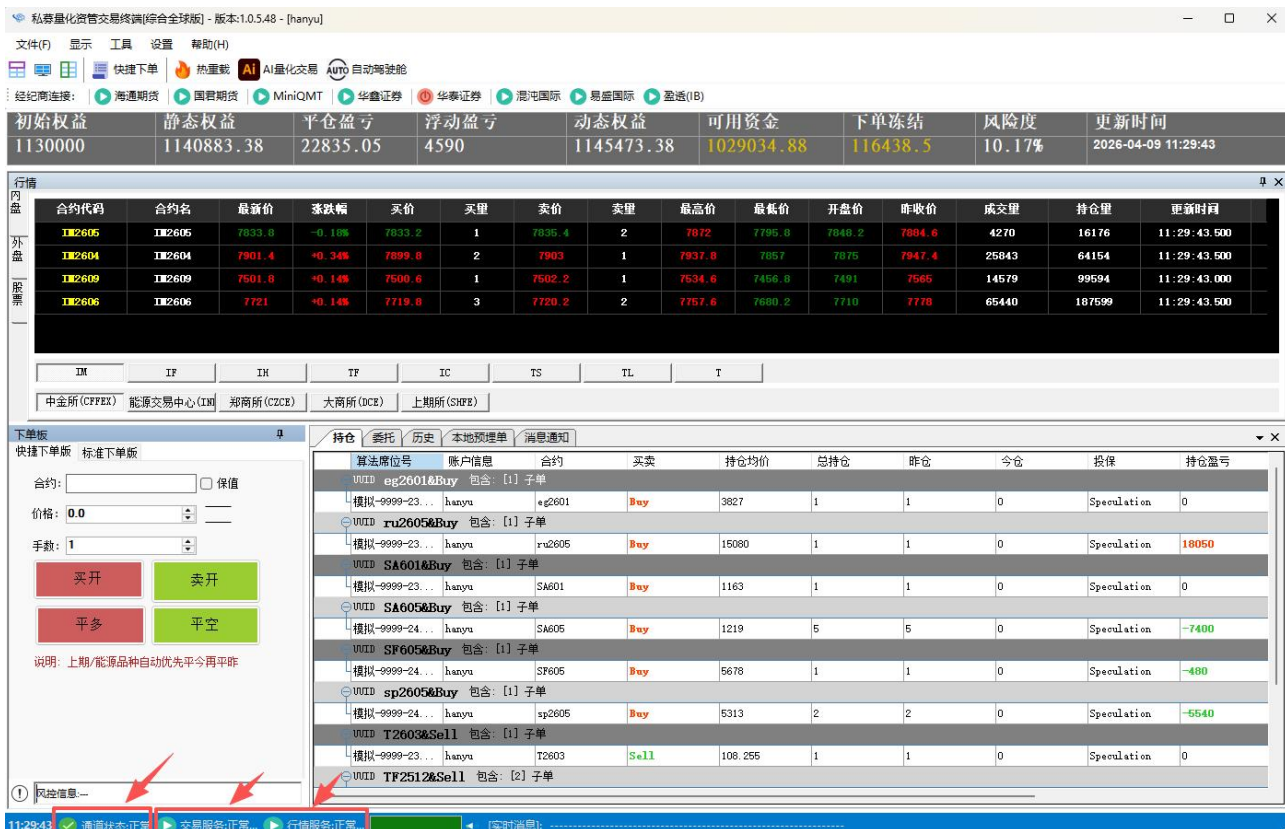
合约代码	合约名	最新价	涨跌幅	买价	买量	卖价	卖量	最高价	最低价	开盘价	昨收价	成交量	持仓量	更新时间
IR2605	IR2605	7833.2	-0.19%	7831.6	1	7834	1	7972	7795.8	7848.2	7804.6	4271	16177	11:29:55.500
IR2604	IR2604	7903	+0.36%	7900.2	1	7903	1	7937.8	7857	7875	7947.4	25858	64152	11:30:00.000
IR2609	IR2609	7501.8	+0.14%	7500.4	1	7502	1	7534.6	7458.8	7491	7565	14621	99602	11:30:00.000
IR2606	IR2606	7719	+0.12%	7718.8	1	7719	1	7757.6	7680.2	7710	7770	65516	187585	11:30:00.000

行情 内盘 外盘 股票

中金所(CFFEX) 能源交易中心(INE) 郑商所(CZCE) 大商所(DCE) 上期所(SHFE)

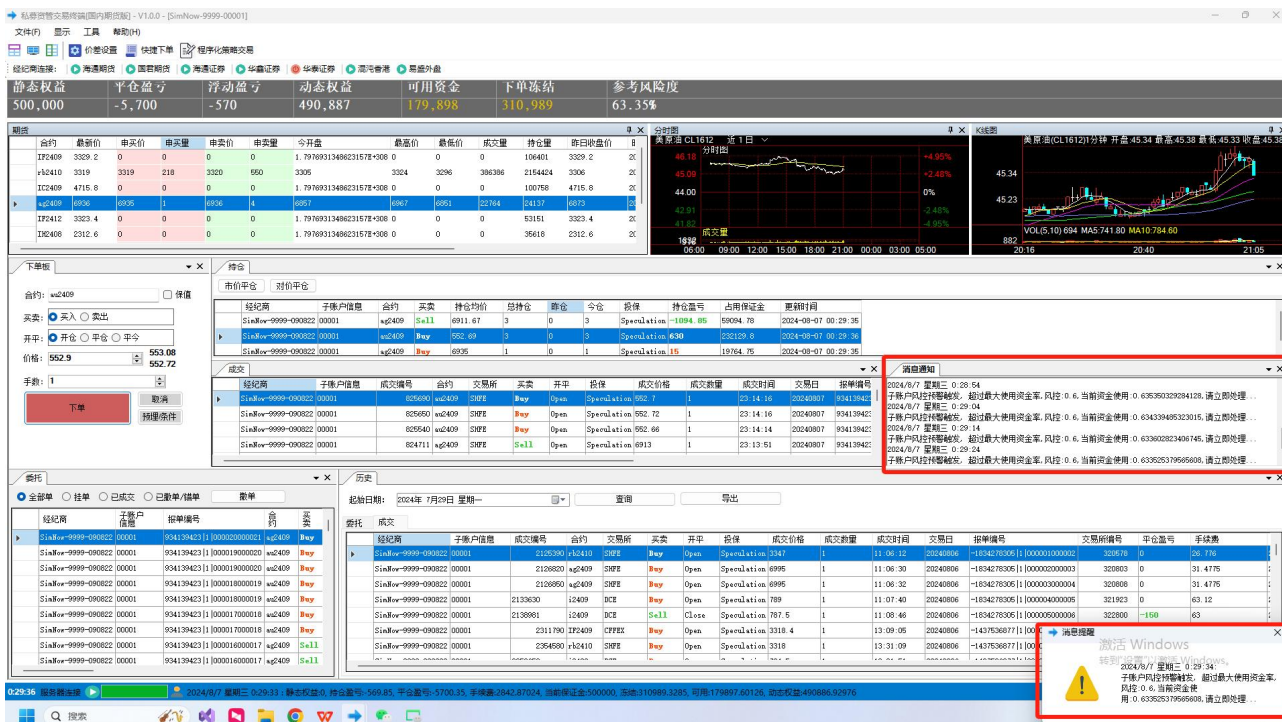
客户端全面开放客户侧的 API 接口，接口采用标准的 CTP 接口模式，方便量化团队/机构/个人对接 TB、mt4、文华等量化软件的信号到子账户，或自己有能力开发属于自己的程序化交易系统依托于子账户进行程序化交易。对接简洁高效。

1.10 自动重连



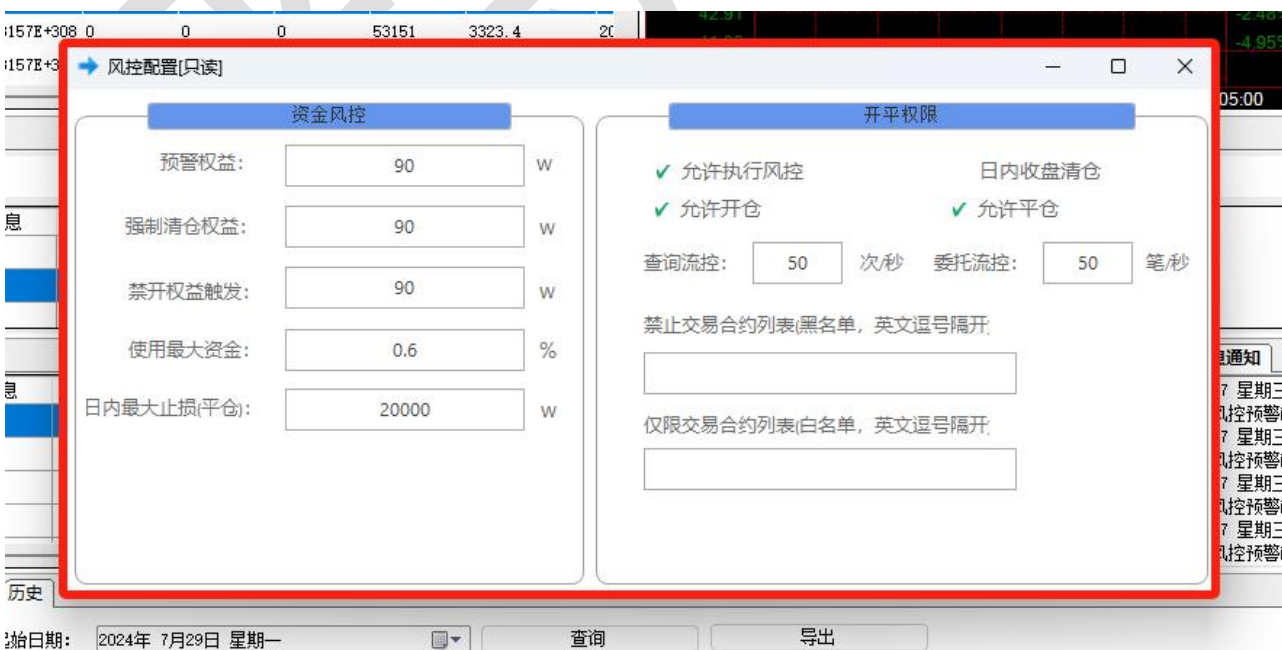
服务端或客户端异常断线，或服务端退出，都会触发客户端的自动重连机制，自动重连将会每隔 10 秒重连一次，直到连上服务端子账户系统为止，无需人工退出或重启。

1.11 风控预警



达到了服务端资管系统设置的风控参数配置之后，客户端会进行警示，告知交易员当前已经处于风控阶段，注意仓位风险，可以配置右下角弹窗和声音同步提醒。

1.11 风控参数



服务端为该子账户配置的风控参数会在登录后下发给子账户,以便于子账户交易员可以观测到该账户的风控范围。

1.12 行情 K 线



1.13 自由布局

账户概况

初始权益	静态权益	平仓盈亏	浮动盈亏	动态权益	可用资金	下单冻结	风险度	更新时间
1130000	1140883.38	22835.05	4600	1145483.38	1029044.88	116438.5	10.17%	2026-04-09 11:35:49

委托列表

算法席位号	客户信息	报单编号	合约	买卖	开平	报单价
模拟-9999-23...	hanyu	-158316927 3...	eb2606	Buy	Open	10003
模拟-9999-23...	hanyu	-158316927 3...	eb2606	Buy	Open	10003
模拟-9999-23...	hanyu	-158316927 3...	eb2606	Buy	Open	10003
模拟-9999-24...	hanyu	-1447537891 ...	pp2605	Sell	Close	8880

行情内盘

合约	最新价	涨跌幅	前收	持仓	涨跌
eb2610	9222	+1.60%	9217	1	9229
eb2608	9565	+3.34%	9563	2	9572
eb2607	9790	+4.71%	9788	1	9791
eb2606	9993	+4.50%	9991	20	10000
eb2604	10012	0.00%	9930	50	0

下单板

合约: eb2604 保值:

价格: 10012.0 0 9930

手数: 1

买开 卖开

平多 平空

说明: 上期/能源品种自动优先今再平昨

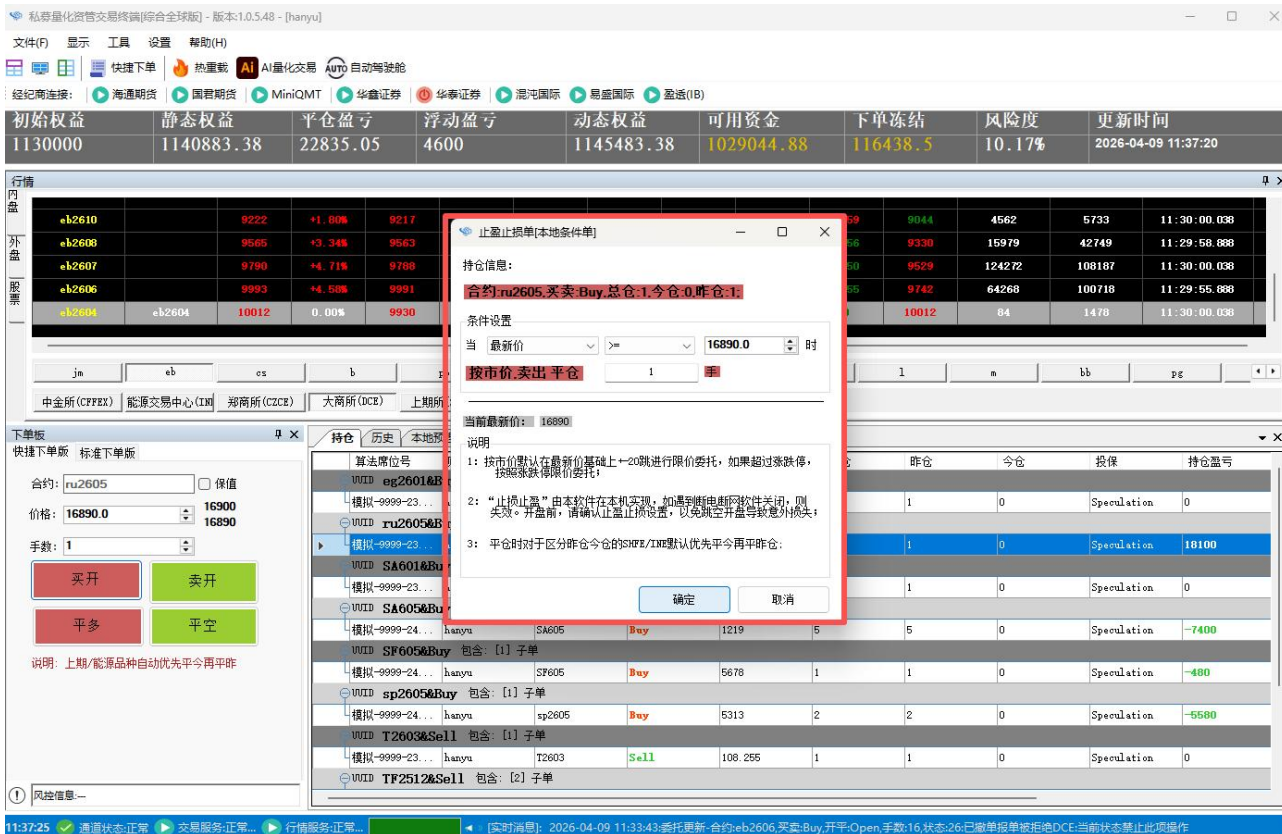
持仓列表

算法席位号	客户信息	合约	买卖	持仓均价
UID eg2601&Buy	包含: [1] 子单			
模拟-9999-23...	hanyu	eg2601	Buy	3827
UID ru2605&Buy	包含: [1] 子单			
模拟-9999-23...	hanyu	ru2605	Buy	15080
UID SA601&Buy	包含: [1] 子单			
模拟-9999-23...	hanyu	SA601	Buy	1163
UID SA605&Buy	包含: [1] 子单			
模拟-9999-24...	hanyu	SA605	Buy	1219
UID SF605&Buy	包含: [1] 子单			
模拟-9999-24...	hanyu	SF605	Buy	5678
UID sp2605&Buy	包含: [1] 子单			
模拟-9999-24...	hanyu	sp2605	Buy	5313
UID T2603&Sell	包含: [1] 子单			
模拟-9999-23...	hanyu	T2603	Sell	108.255
UID TF2512&Sell	包含: [2] 子单			

灵活的布局模式使得交易员可根据日常交易习惯灵活拖拽组合,每个窗口皆可多开和组合,并且可保存布局,完全灵活的配置布局方案最大化交易员使用交易客户端进行交易的效率,提高交易便利性。

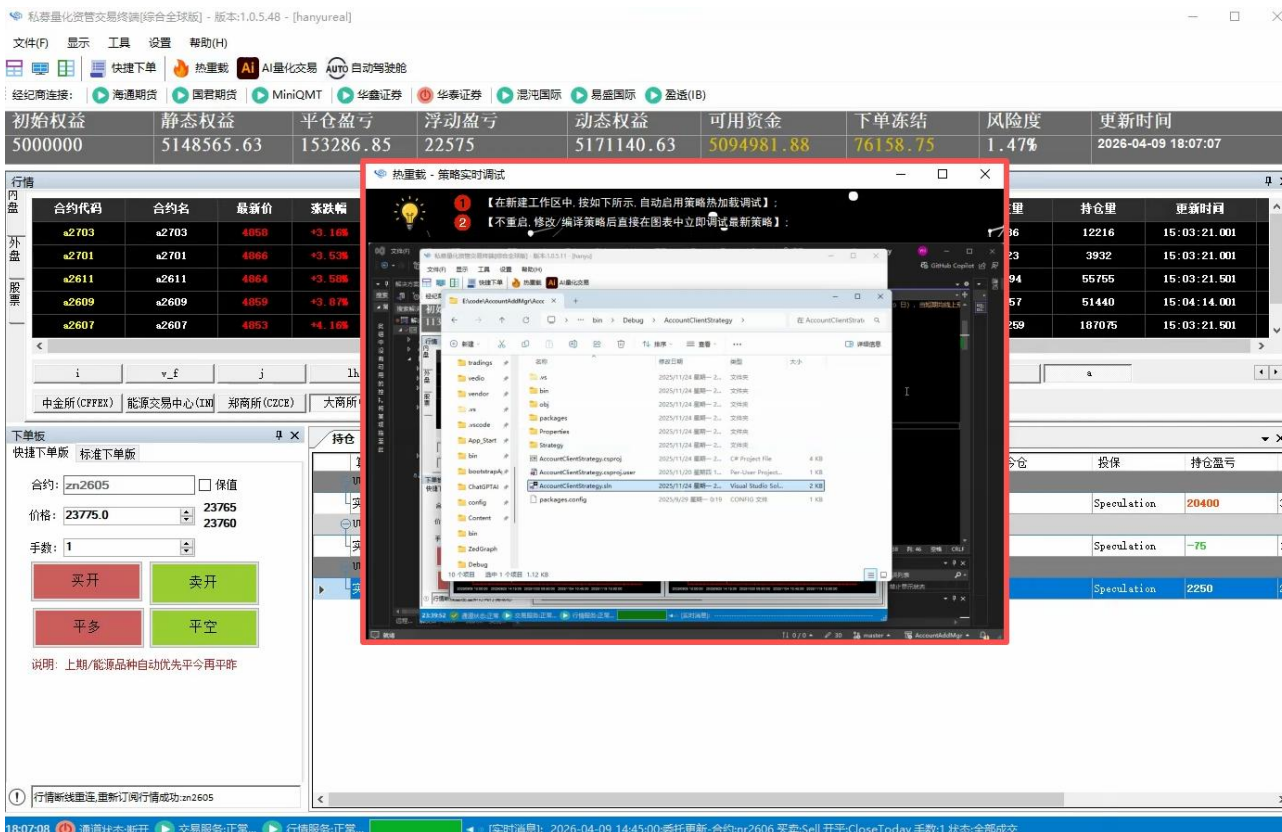
1.14 条件单预埋单





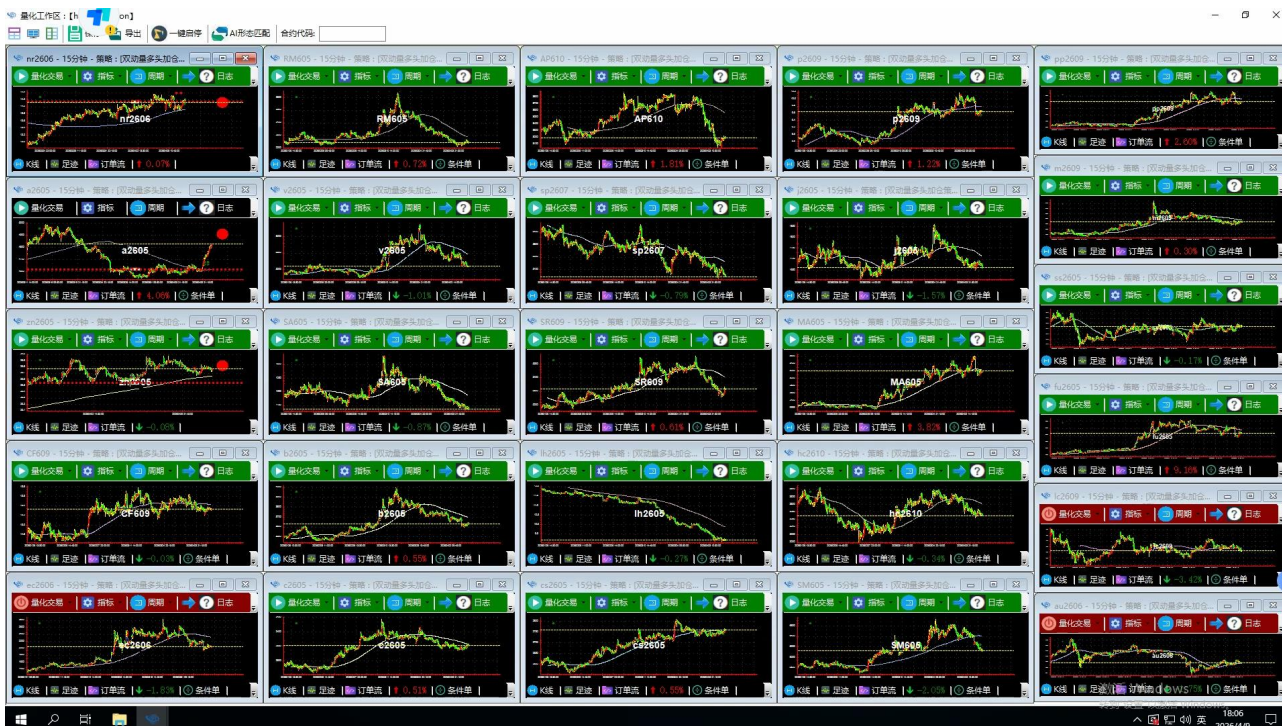
本地预埋单和条件单可供交易员操盘手进行交易的实时机会的追踪,以达到条件触发追单,平仓或止盈止损的目的,半自动化的预埋与条件单可以使得交易员无人值守捕捉市场机会。

1.15 热重载



热重载调试技术：代码改完立刻生效，不用重启程序、不丢失当前状态，秒级看到修改结果，用于策略观测，策略投研实时调试非常高效。

1.16 工作区多图表交易



允许交易员以区分工作区的方式同时进行多周期、多策略、多图表的量化自动化实时交易；

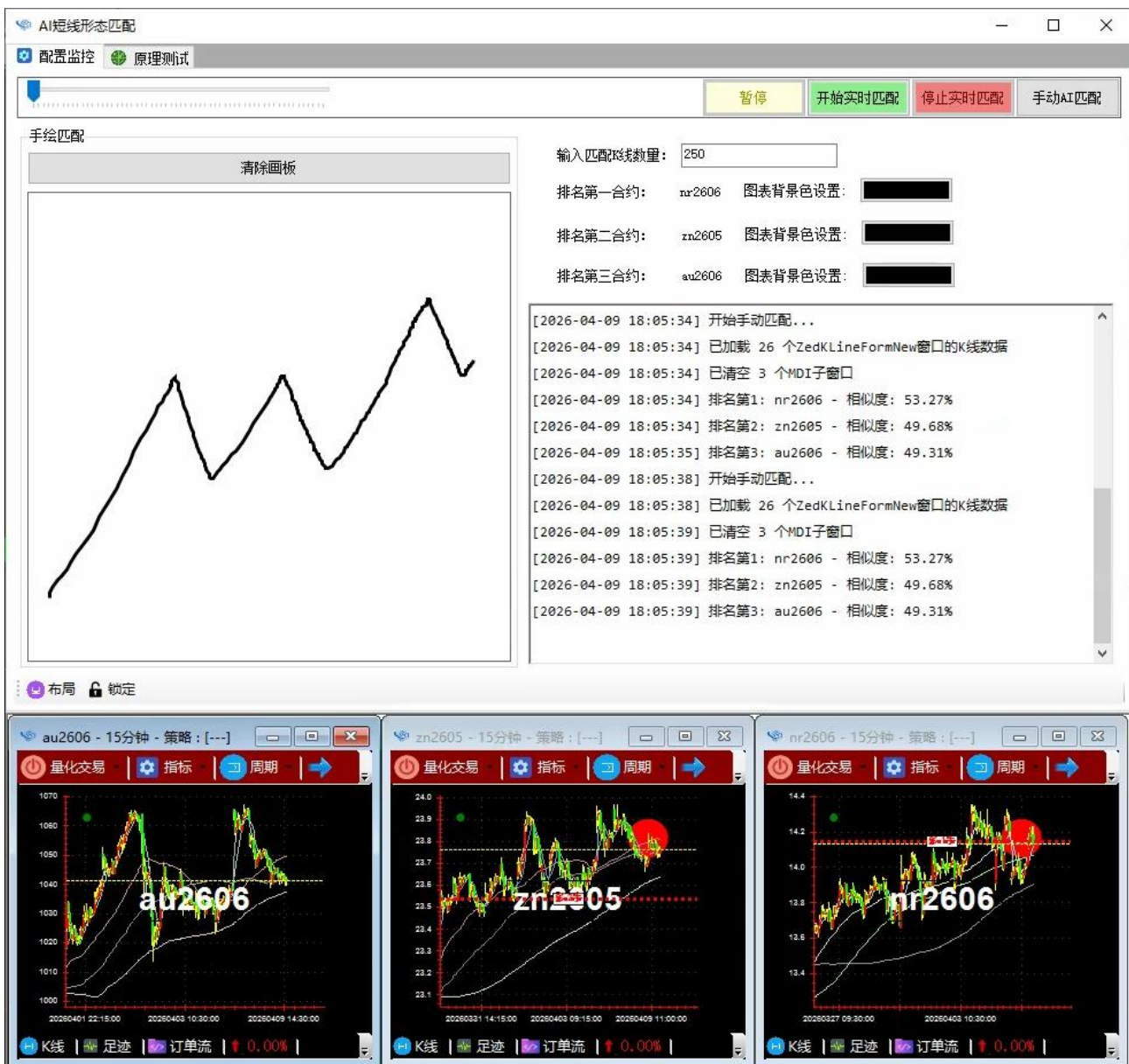
1.17 一键启停

The image shows a control panel for starting and stopping trading strategies. At the top, there are buttons for '一键启动' (One-click Start) and '一键停止' (One-click Stop). Below these is a table listing various trading strategies with their current status and parameters.

选择	合约	周期	策略名称	策略状态	异常预警	策略参数	配置策略	初始持仓	账户持仓	浮动盈亏	条件单数	配置持仓	配置策略数	日志	备注	H	L
<input type="checkbox"/>	au2606	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	CF609	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	1c2009	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	fu2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	sz2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	h2609	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	nr2606	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	多 2手	多 2手	8141.42, 50	-75.00	0	配置持仓	配置策略数	日志		
<input type="checkbox"/>	pp2609	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	SM605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	zn2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	多 2手 @23540	多 2手	2250.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	hc2610	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	MA605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	j2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	p2609	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	ec2606	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	cs2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	lh2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	SR609	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	sp2607	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	AP610	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	c2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	a2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	多 10手 @4622	多 10手	64609.00	20400.00	0	配置持仓	配置策略数	日志		
<input type="checkbox"/>	b2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	SA605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	v2605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			
<input type="checkbox"/>	RM605	15	双动量多头加仓策略	●	●	止损: 5, 止盈: 5, 加仓: 2, 平仓: 2	配置策略	无持仓	无持仓	0.00	0	配置持仓	配置策略数	日志			

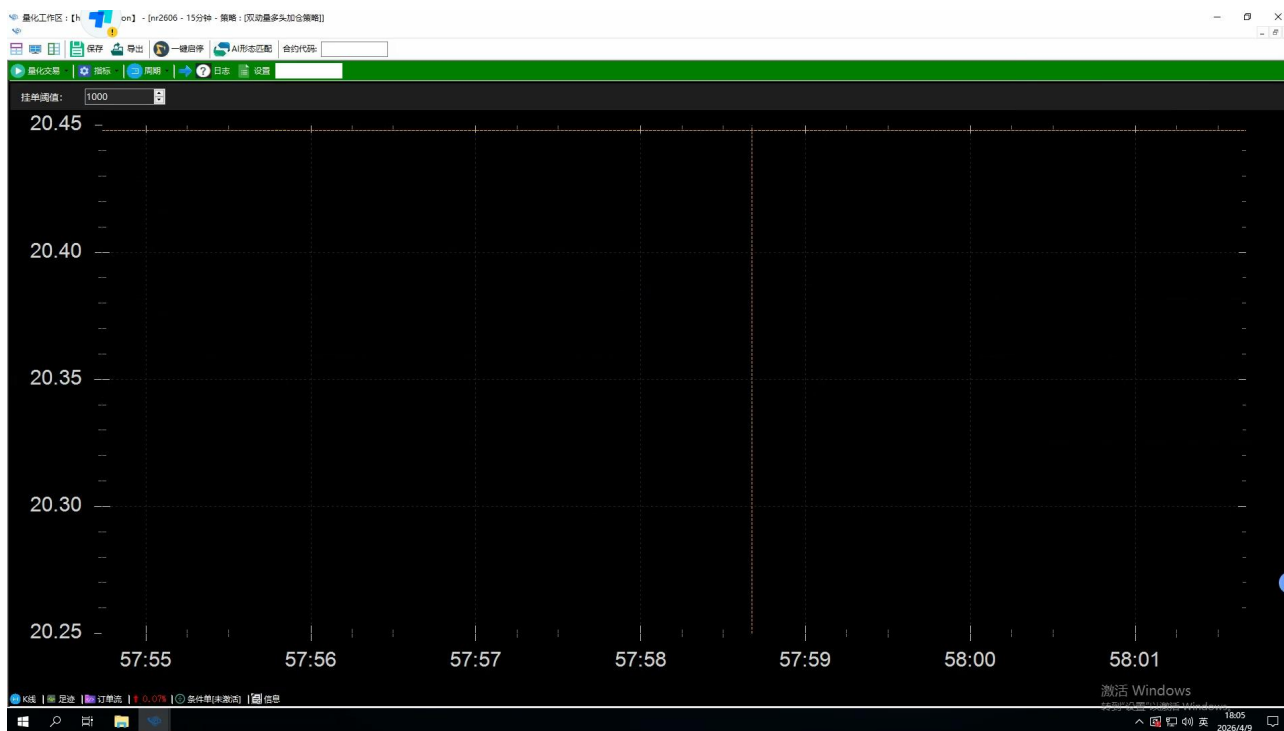
允许交易员在进行投资组合多策略、多周期、多图表交易的时候，可以进行一键式的管理，比如一键开启策略，一键停止所有的策略，对所有的策略进行一键式的配置参数等等

1.18 AI 形态匹配



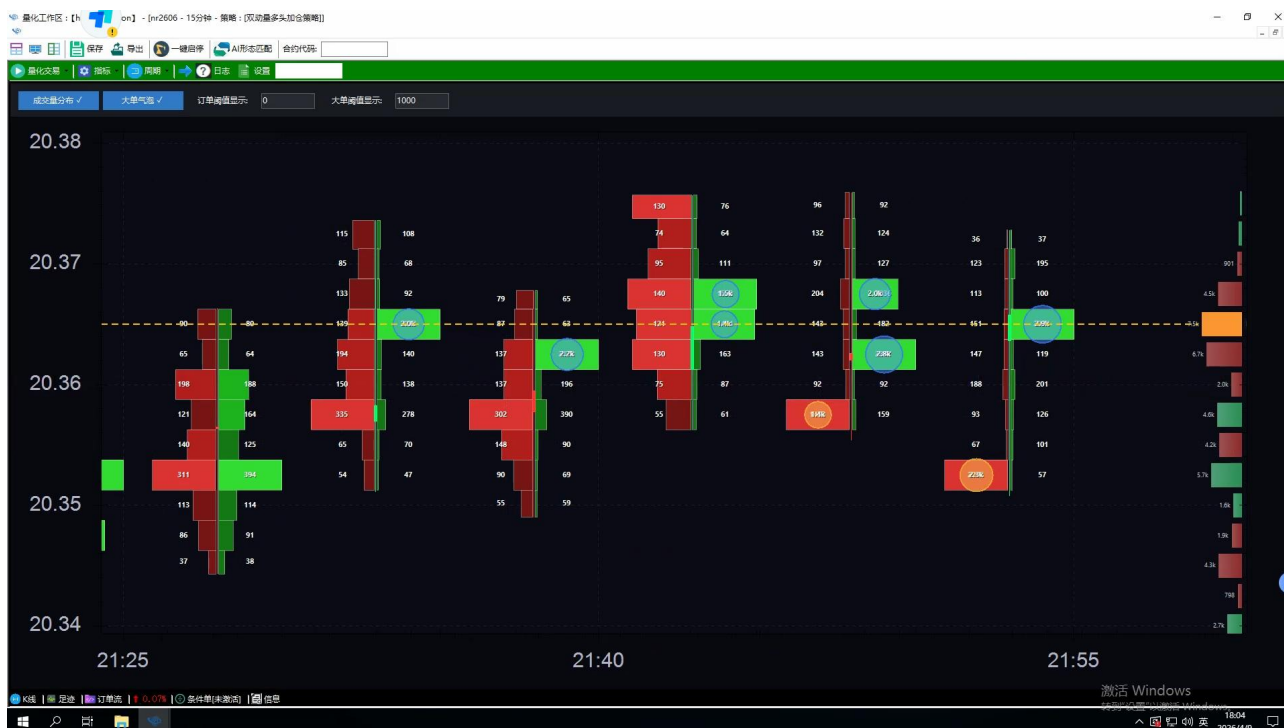
该功能可以让短线交易员和波段交易员交易员进行形态匹配的策略，形态匹配的策略可以基于我们画出来的曲线的形式走势，或者说以某一幅图为主要走势进行全量的走势的匹配。能够在众多的图表当中，快速的检索出我们所需要交易的高胜率形态的走势图表，进行快速的程序化交易

1.19 足迹图



足迹图 = 穿透 K 线、看清每个价位真实成交的“资金显微镜”，是 CTA / 订单流交易的核心微观工具。

1.20 订单流



订单流工具 = 交易所逐笔成交 + 盘口挂单变动，用来看清谁在主动买、谁在主动卖、资金在哪发力。

1.21 双动量工具

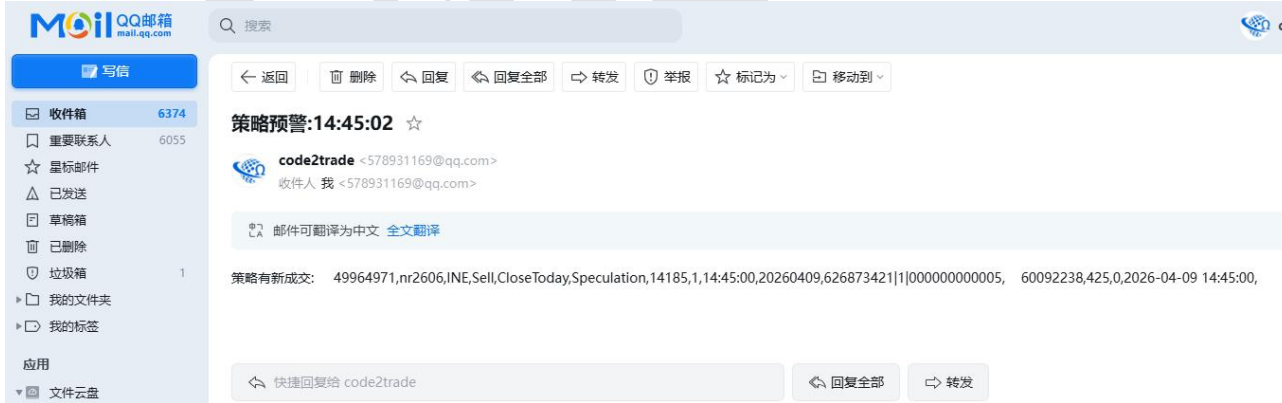
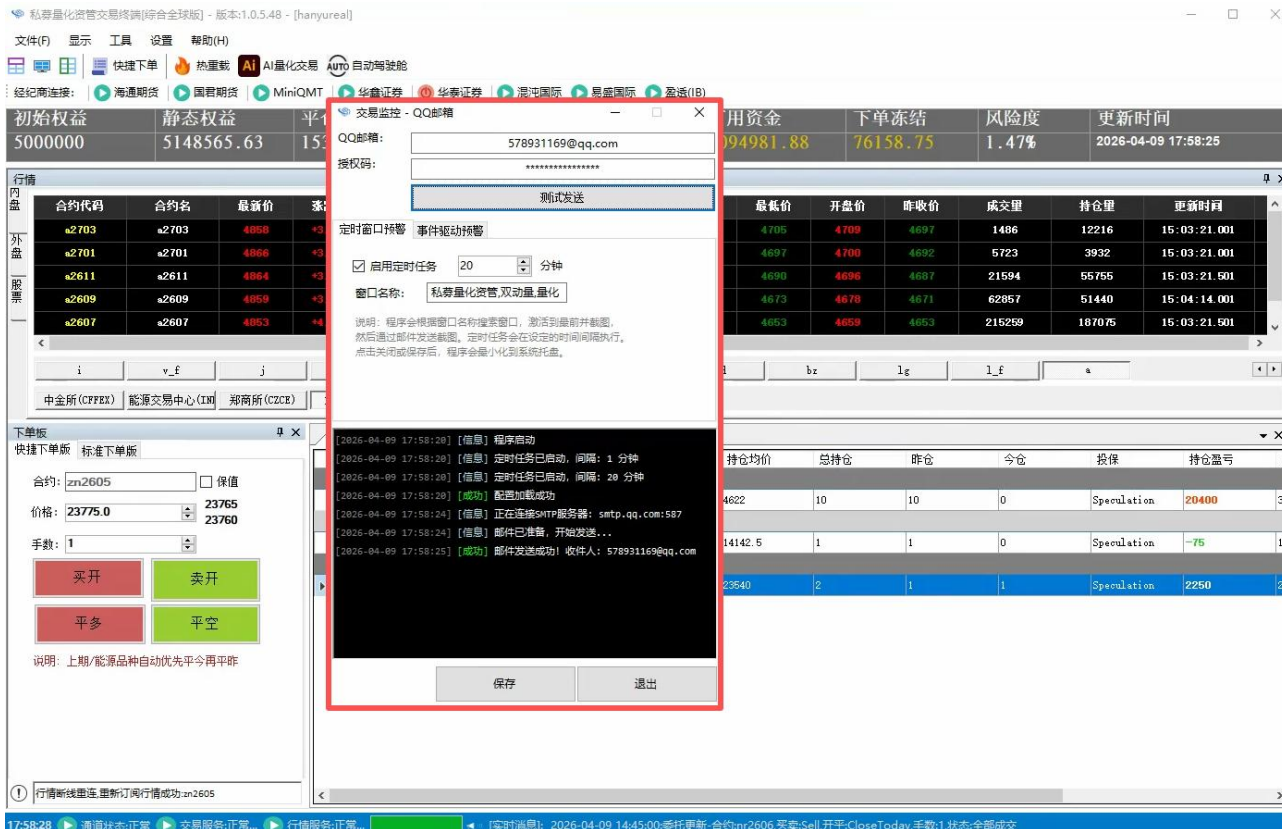


双动量工具的功能就在于把全市场进行一个板块化的区分,看到在每一个板块里面的不同品种之间的强弱关系。对做截面策略的交易员而言,可以很快的发现每个板块里面最强势的品种和最弱势的品种,进行强弱对冲的交易,或者进行动量的交易。



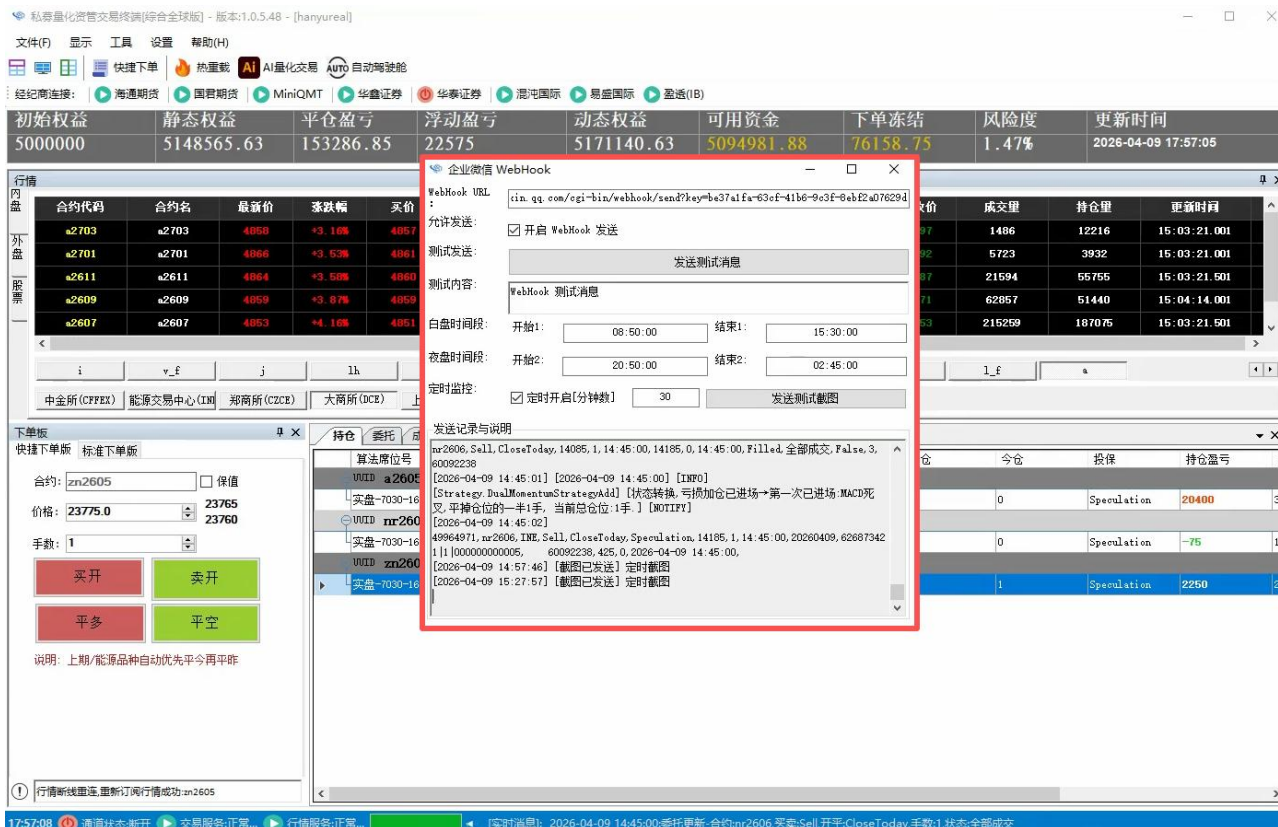
双动量的热图功能在于我们可以快速的发现哪个板块是属于强势板块,哪个板块是属于中等和弱勢的板块,就像热图透视一样,能够快速的便于我们去发现强弱势的板块。

1.22 邮件预警



7×24 小时策略预警信号的预警,量化交易终端的多品种的投资组合交易的终端的状态,通道,行情,交易的实时连接状态等等,都可以实时的发送到邮件以及企业微信当中。

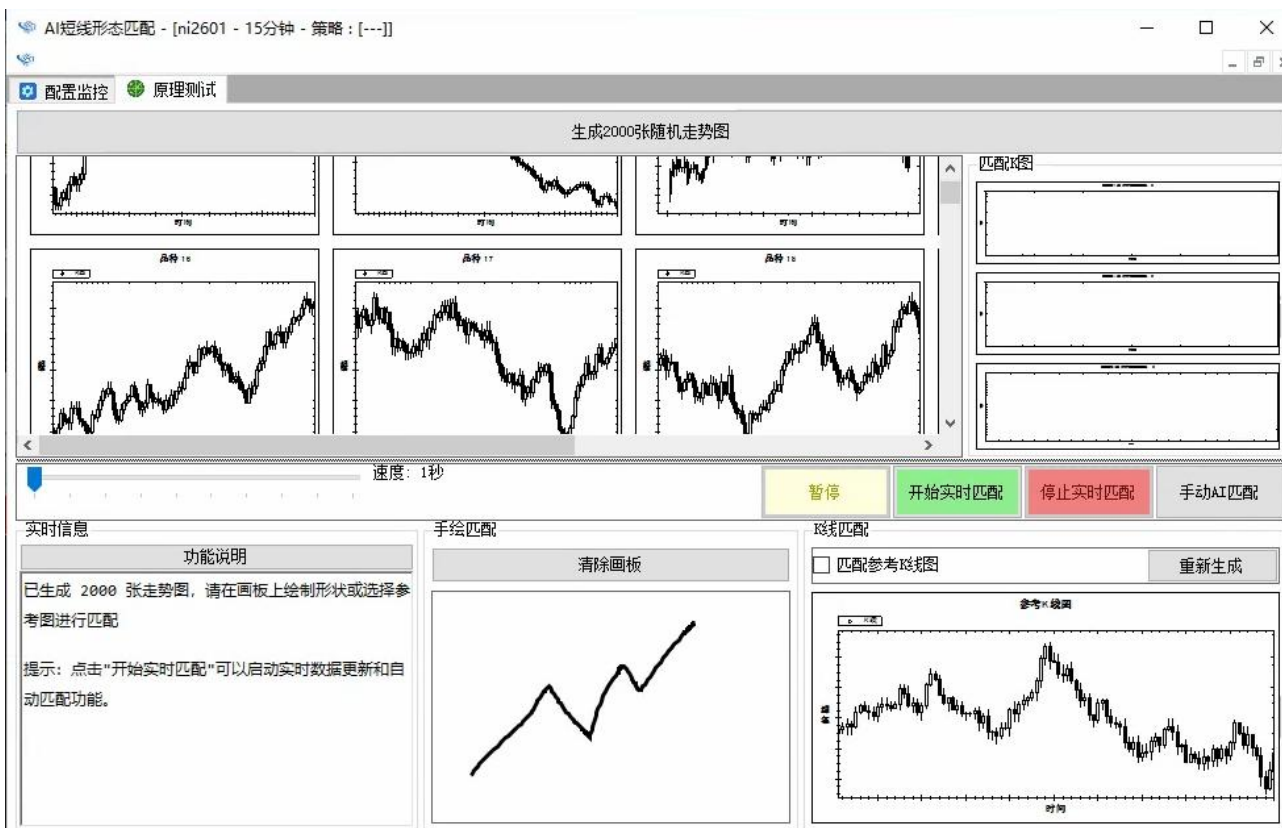
1.23 企业微信实时推送监控





7×24 小时策略预警信号的预警,量化交易终端的多品种的投资组合交易的终端的状态,通道,行情,交易的实时连接状态等等,都可以实时的发送到邮件以及企业微信当中。

1.24 蒙特卡洛投研区



蒙特卡罗功能可以使用海量随机模拟，帮你看清策略“最坏会怎样、稳不稳定”，是量化CTA风控与可信度的核心工具。

1.25 全自动幻月&强弱切换



主力和强弱预警功能，横幅闪烁会提醒主力合约换月；同时也可以进行自动驾驶模式，监控主力切换和强弱切换之后，进行自动化流水线的切换；

