上海龙软信息技术有限公司

RAGONSOFT

龙软程序化交易平台

DTS

Dragonsoft Trading System

DTS
Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

上海龙软信息技术有限公司——简介

DTS
Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

- 九六年与日本Bradea公司合作，进入日本证券交易软件开发领域。公司于2003年在上海以软件外包形式正式成立。至今有十三年的证券软件服务经验。国外客户：德意志银行日本、惠瑞银行、冈山证券、Cosmo证券、MorgonStanley日本、瑞穗银行、UBS日本、HSBC。。。
- 年均营业额6000万。
- 整体通过了CMMI3认证。

龙软信息产业园

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

投资者的需求

1、我有自己的投资思想！甚至每天在变！

2、我的投资思想要软件化！

3、我的投资思想要高效的执行！

4、我的投资过程会用到各种各样的数据！

5、我要简单的投资多品种、多市场！

Point

产品化投资通道，能获利吗？

DTS Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

经纪商的需求

1、独立的投资团队有自己的投资思想！

2、我的投资思想要软件化！

3、我的投资思想要高效的执行！

4、我的投资过程会用到各种各样的数据！

5、经纪业务的服务要有创新、个性化！

产品化投资通道，能获利吗？

DTS
Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软的产品

DTS
Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

国内客户名单

券商、期货商

湘财祈年期货 XIANGCAI QINIAN FUTURES

东海证券 DONGHAI SECURITIES

东海期货 DONGHAI FUTURES CO.,LTD

KIIIK 中国金融投资

東航期货 KIIIK CES FUTURES

广发证券 GF SECURITIES

TEBON 德邦证券

长江证券 CHANGJIANG SECURITIES

山西证券

- 投资机构

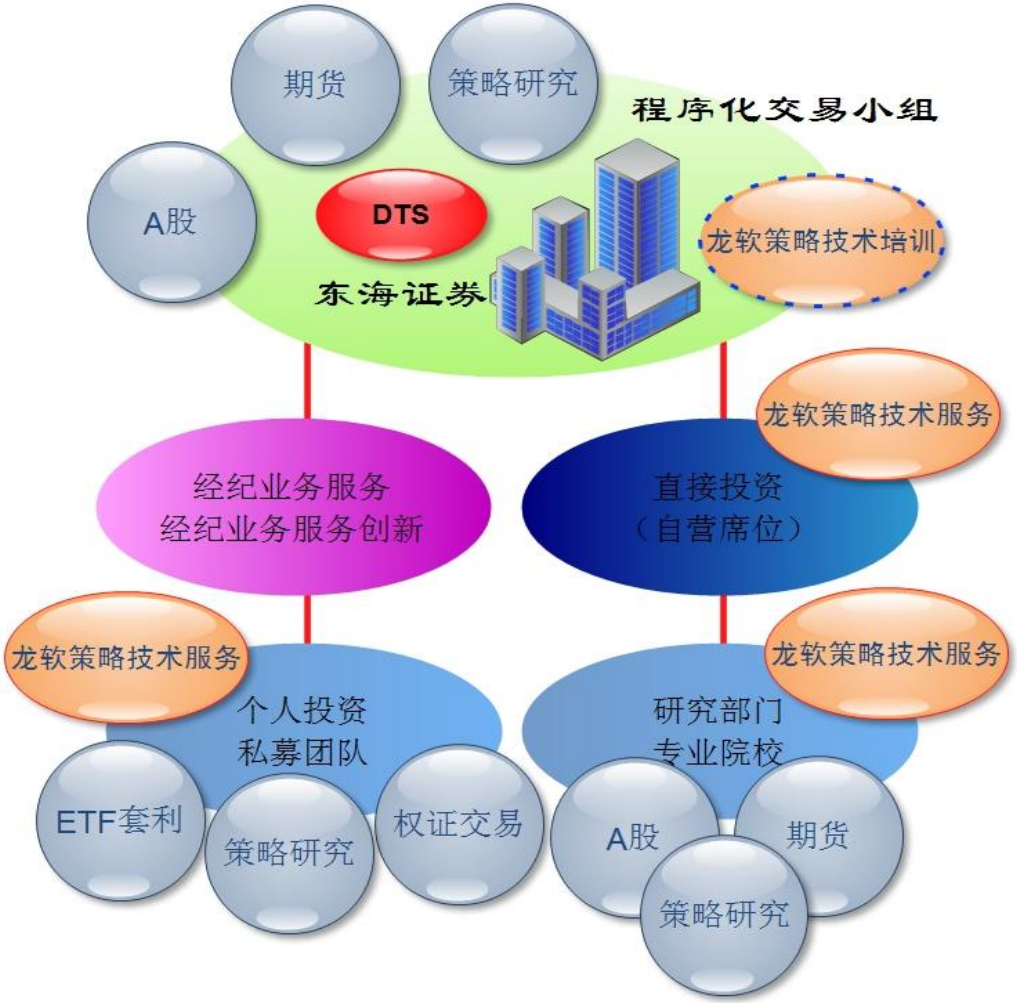
浦合缘投资、颐合财经、富晶资管、宝赛贸易

DTS Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软产品：DTS交易平台

国内实际应用案例



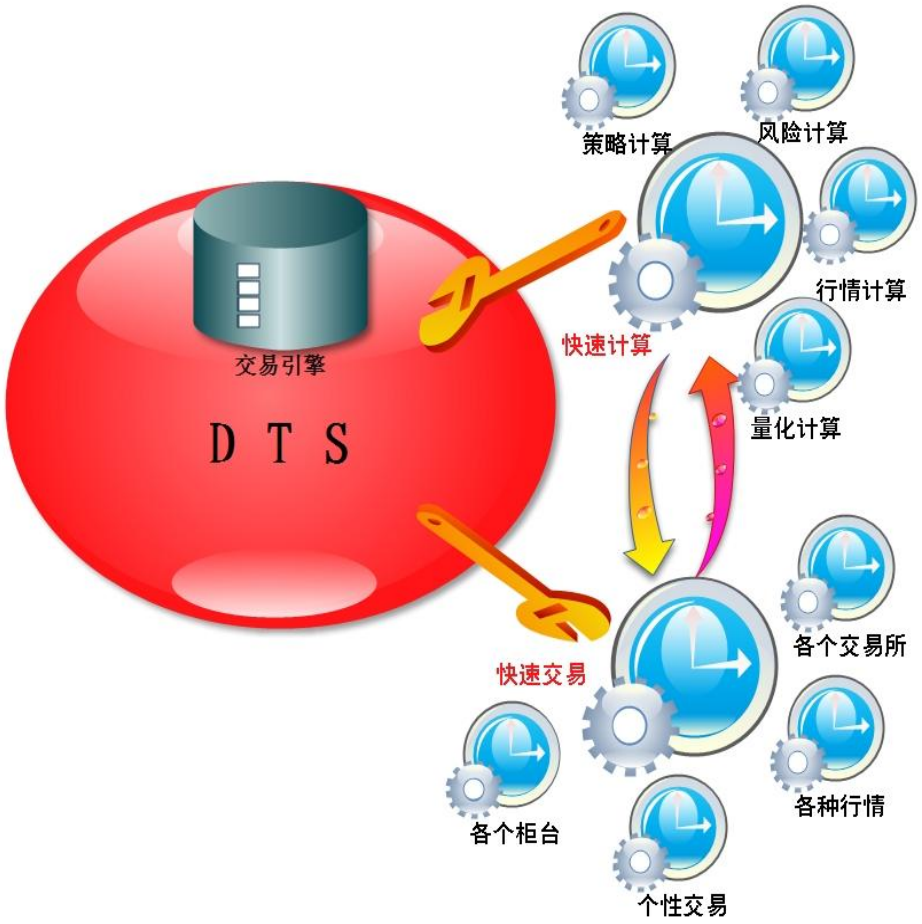
© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软产品——DTS交易平台

DTS
Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软产品：DTS交易平台



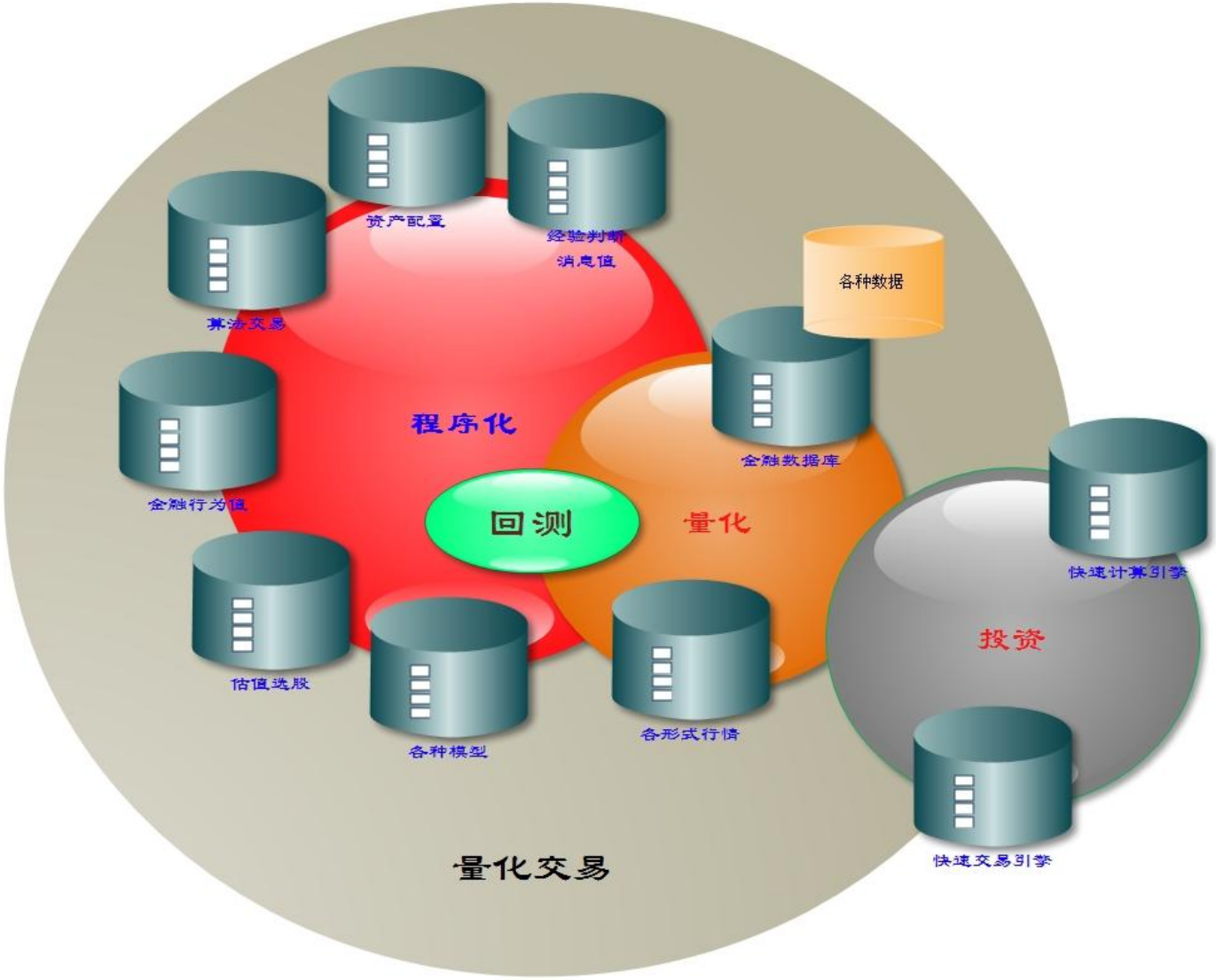
- 快速计算能力
- 快速交易能力

——DTS核心

DTS
Dragonsoft Trading System

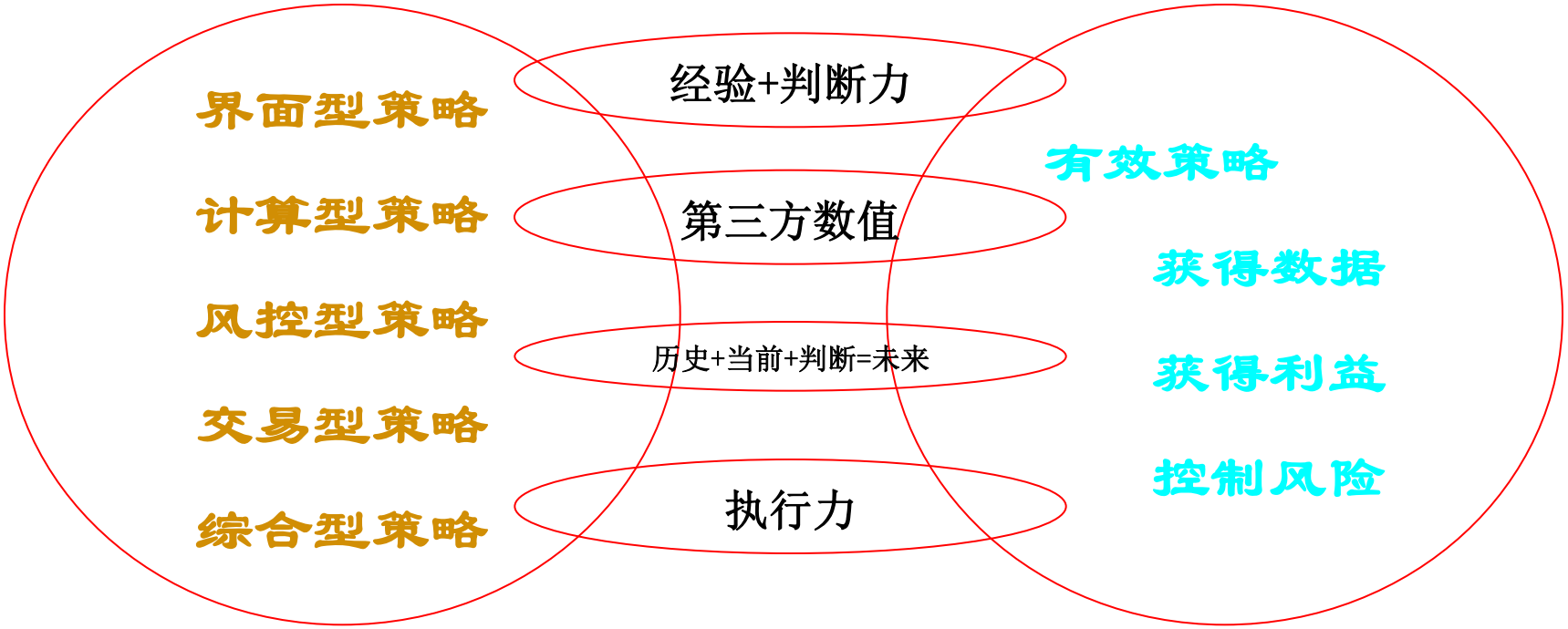
© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

程序化交易在量化投资中的角色



DTS
Dragonsoft Trading System
© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

有效策略是怎么炼成的

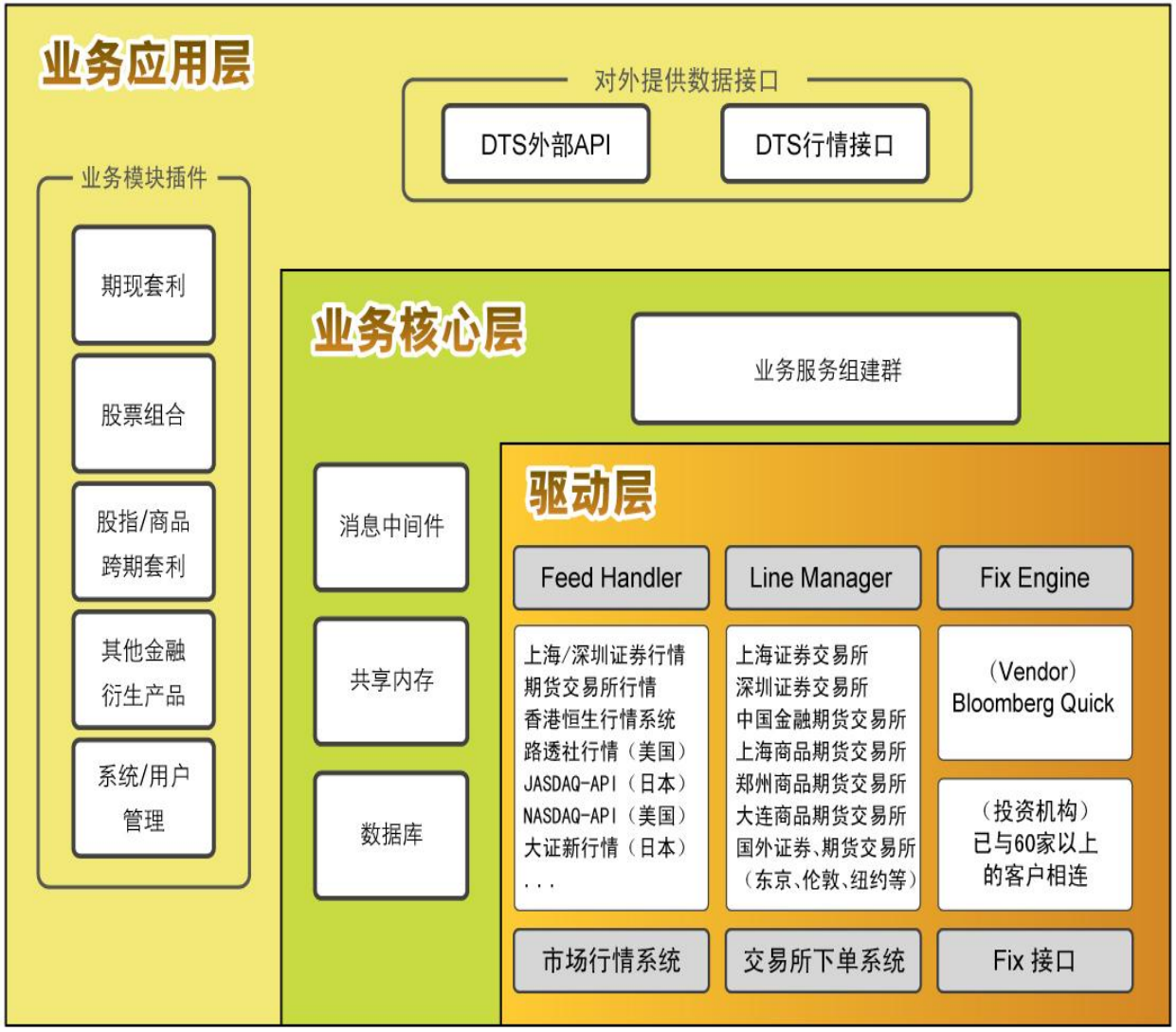


产生以下IT需求：

策略编写语言的开放、简易；可利用多种数据形式；执行力强

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

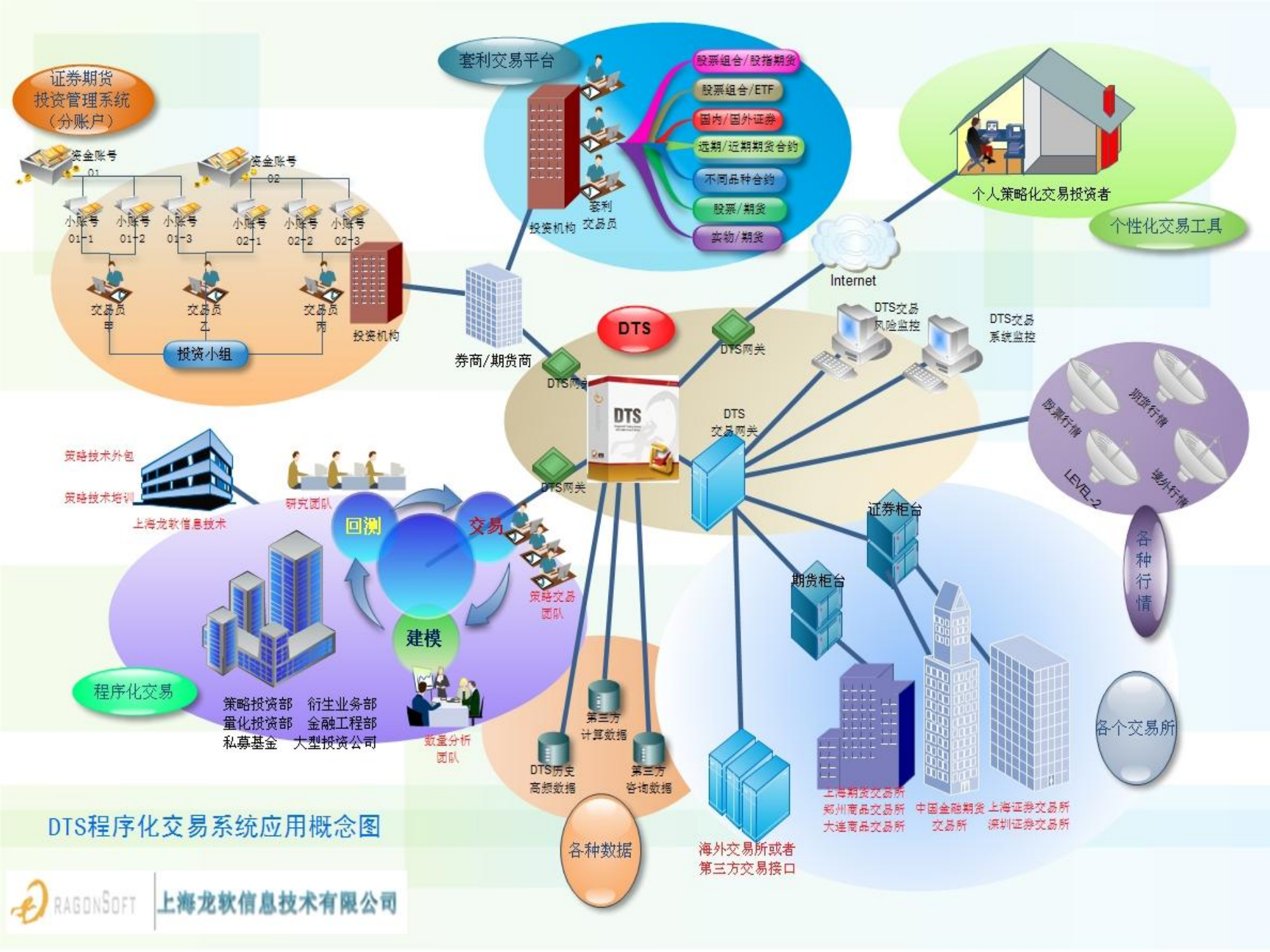
龙软产品：DTS交易平台



- 业务应用层——业务模块插件，对外数据接口
- 交易操作系统核心层——业务服务组件和数据驱动组件
- 外部接口驱动——Line Manager，Feed Handler，FIX接口

DTS
Dragonsoft Trading System

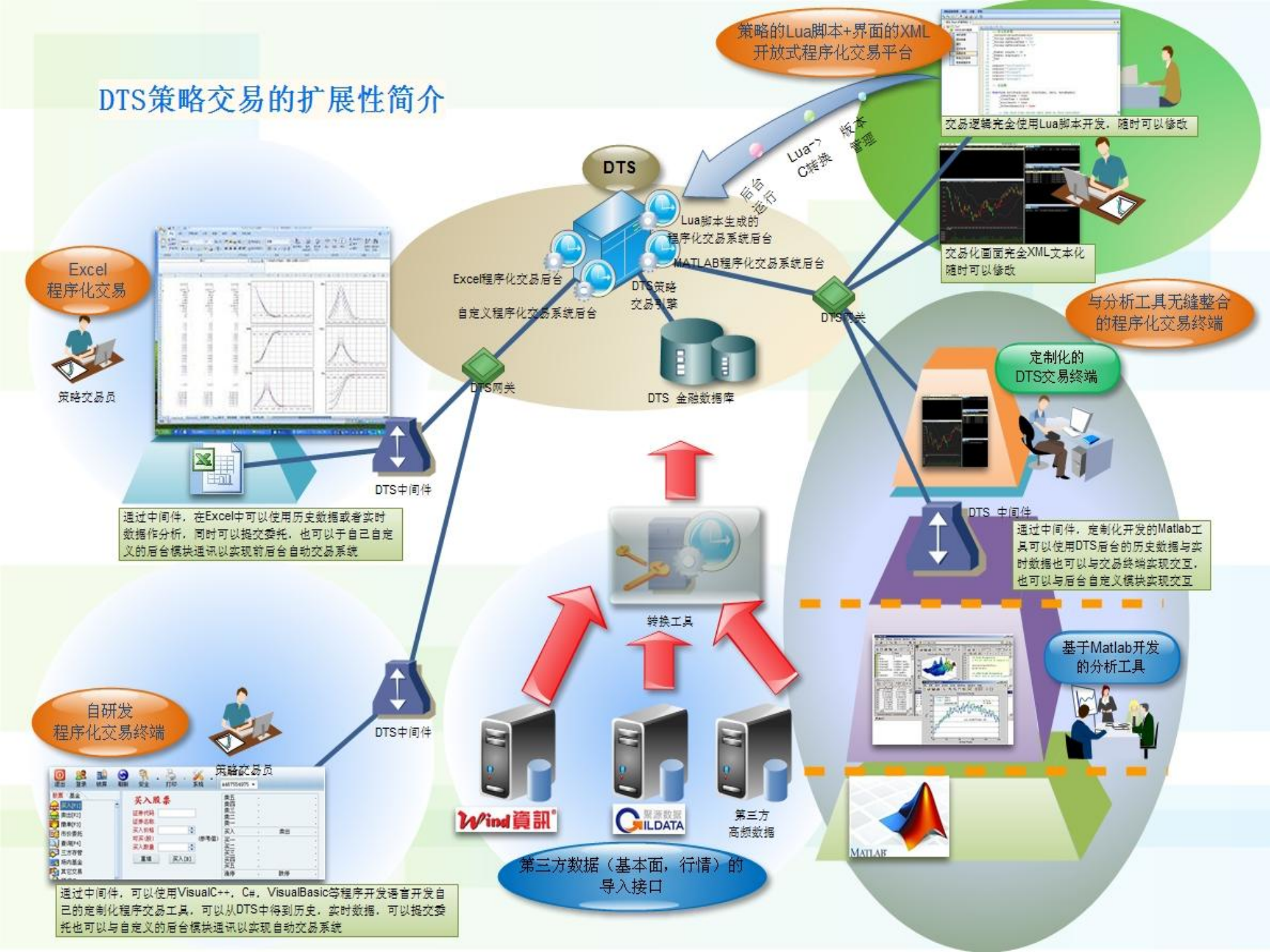
© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved



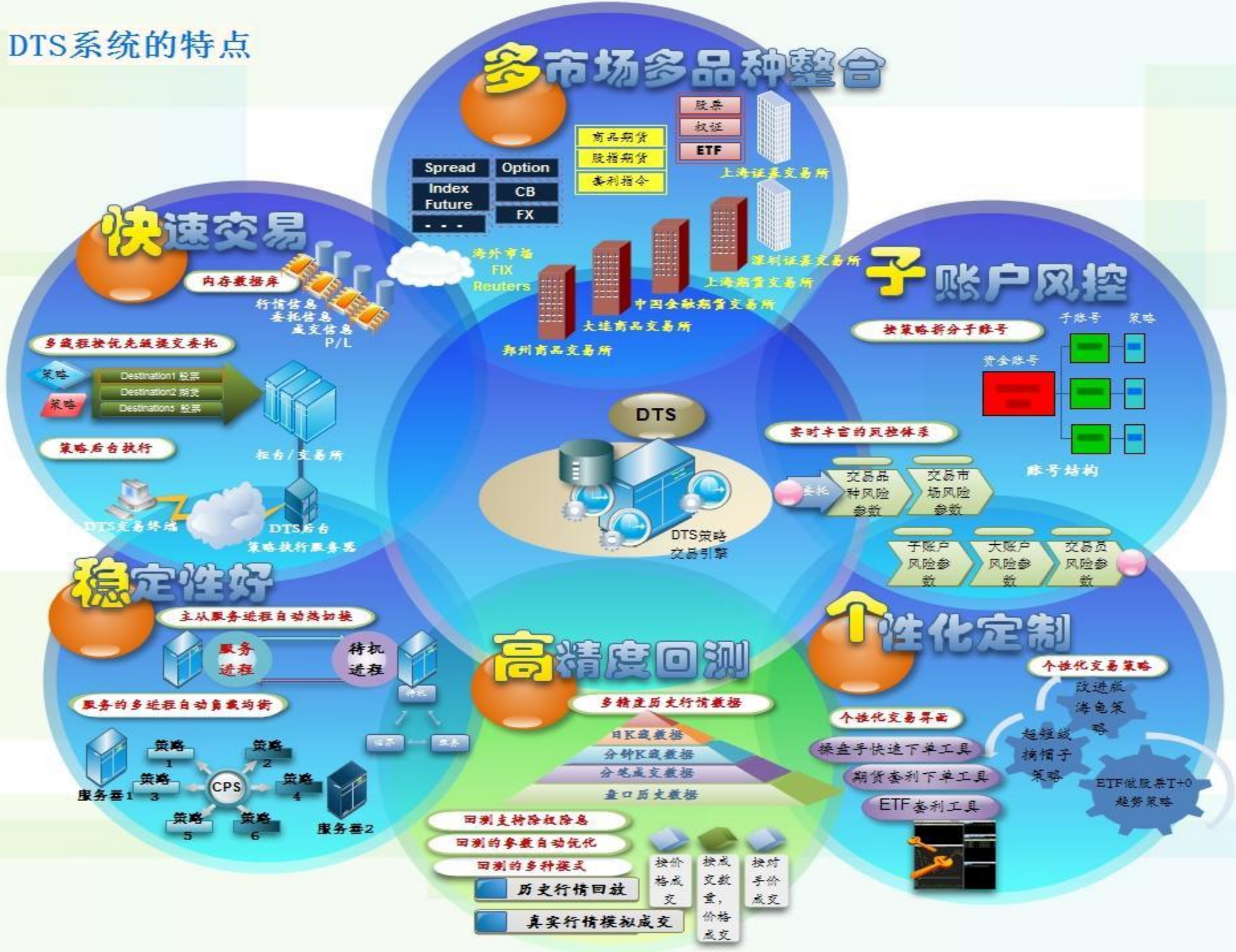
DTS程序化交易系统应用概念图

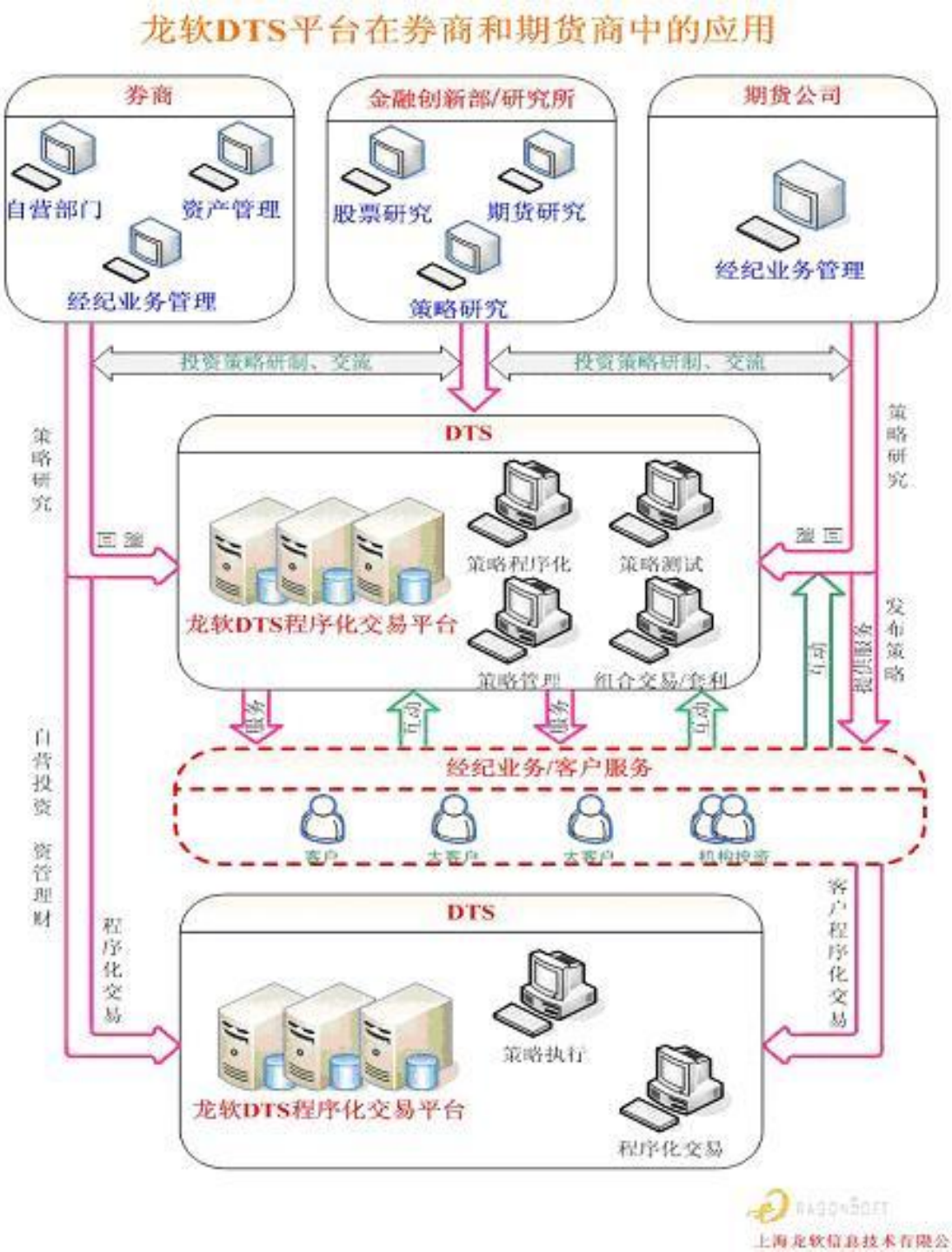
RAGONSOFT 上海龙软信息技术有限公司

DTS策略交易的扩展性简介



DTS系统的特点


多市场多品种整合
股票
权证
ETF
上海证券交易所
商品期货
股指期货
套利指令
Spread
Option
Index Future
CB
FX
- - -
海外市场
FIX
Reuters
深圳证券交易所
上海期货交易所
中国金融期货交易所
大连商品交易所
郑州商品交易所
快速交易
内存数据库
行情信息
委托信息
成交信息
P/L
多线程按优先级提交委托
策略
策略
Destination1 股票
Destination2 期货
Destination3 股票
策略后台执行
柜台/交易所
DTS交易终端
DTS后台
策略执行服务器
DTS
DTS策略
交易引擎
子账户风控
按策略拆分子账号
子账号
策略
资金账号
账号结构
实时丰富的风控体系
委托
交易品种风险参数
交易市场风险参数
子账户风险参数
大账户风险参数
交易员风险参数
稳定性好
主从服务进程自动热切换
服务进程
待机进程
服务的多进程自动负载均衡
服务器1
策略1
策略2
策略3
策略4
策略5
策略6
CPS
服务器2
高精度回测
多精度历史行情数据
日K线数据
分钟K线数据
分笔成交数据
盘口历史数据
回测支持除权除息
回测的参数自动优化
回测的多种模式
历史行情回放
真实行情模拟成交
按价格成交
按成交数量，价格成交
按对手价成交
个性化定制
个性化交易策略
改进版海龟策略
超短线倒帽子策略
ETF做股票T+0超势策略
个性化交易界面
操盘手快速下单工具
期货套利下单工具
ETF套利工具



龙软产品：DTS交易平台

投资业务或经纪业务中的应用

- 研究部门价值转换
- 投资部门交易经验和智慧的价值体现
- 经纪业务服务创新

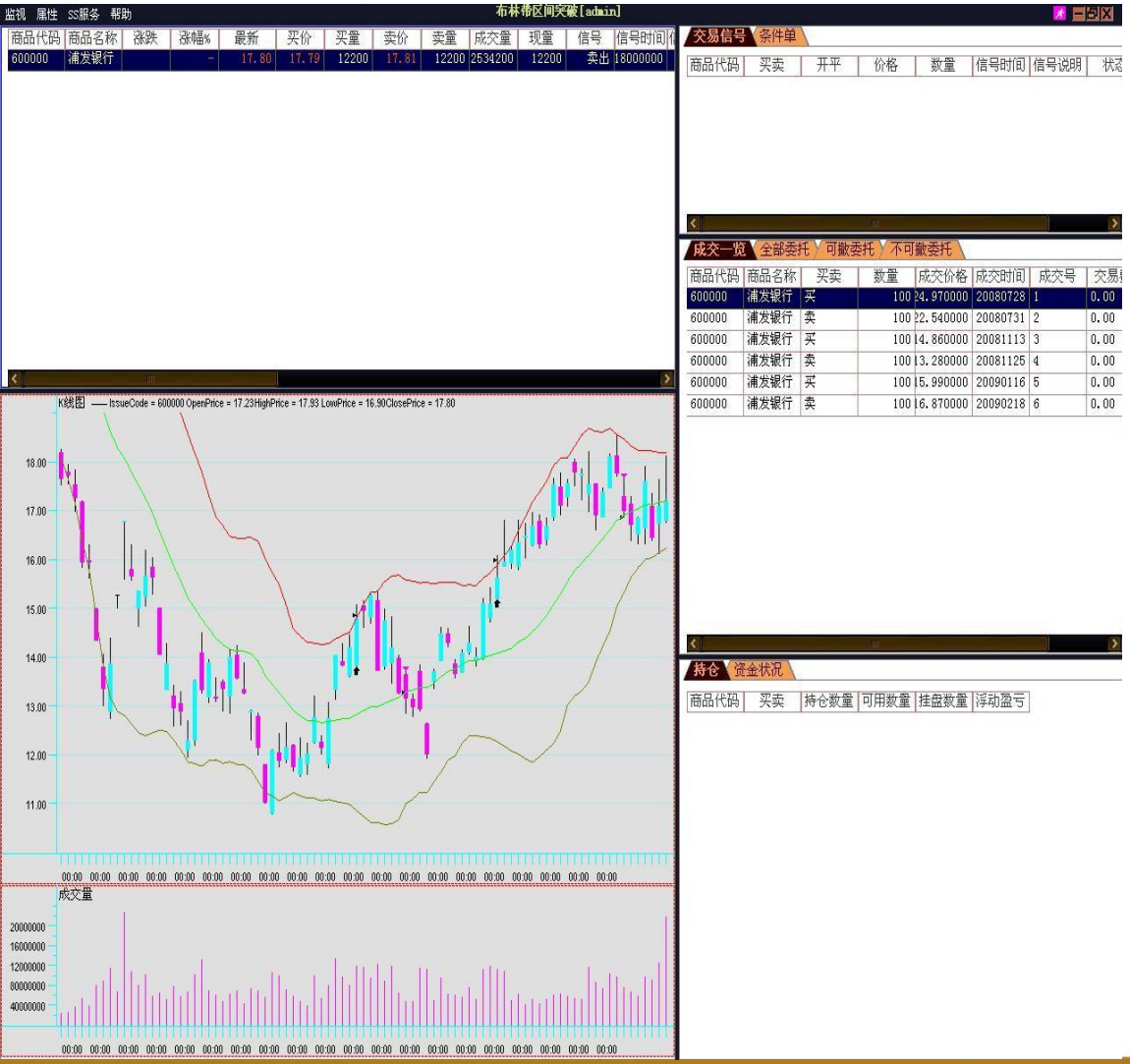
DTS
Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软产品：DTS交易平台

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软产品：DTS交易平台



股票/期货程序化交易平台

- 支持常规交易
- 支持金融期货、备兑权证等等其他衍生品交易
- 支持香港及海外市场
- 支持上交所新一代数据接口
- 全消息机制
- 内存数据管理：区域设计、动态分配
- 交易线程动态管理

（参考：界面—布林带区间震荡交易）

DTS Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软产品：DTS交易平台

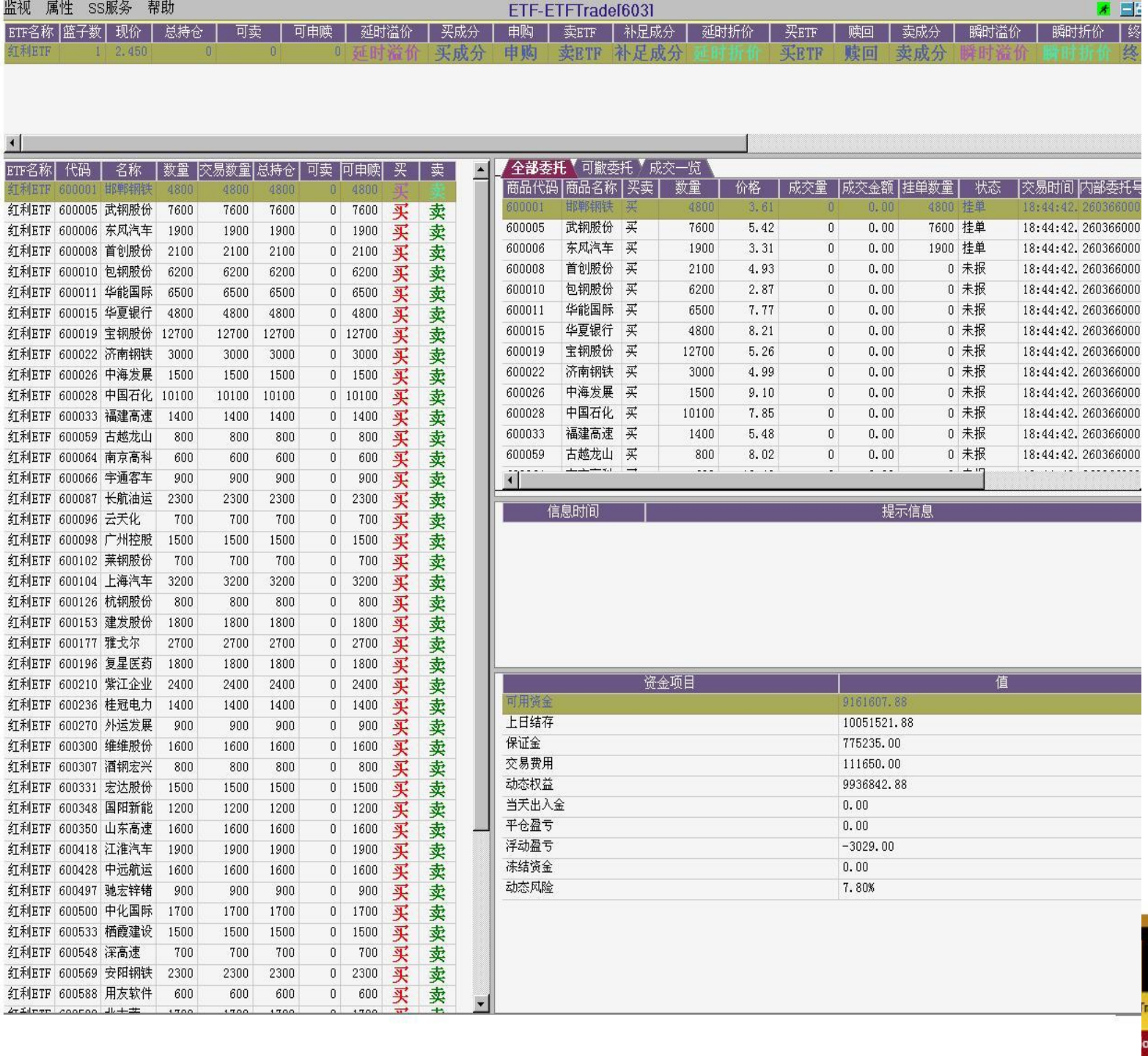
快速交易系统中的应用

- 界面由LUA脚本语言实现，可针对每个客户提供定制服务
- 开发行情接口，实现交易系统的嵌套
- 左上角显示自选行情，双击持仓卖出、，双击最新价买入
- 右下角可显示策略交易服务，双击启动策略
- 右中可显示各项查询功能
- 右上角可显示各项成交回报
- 本界面数据都由后台实时推送更新

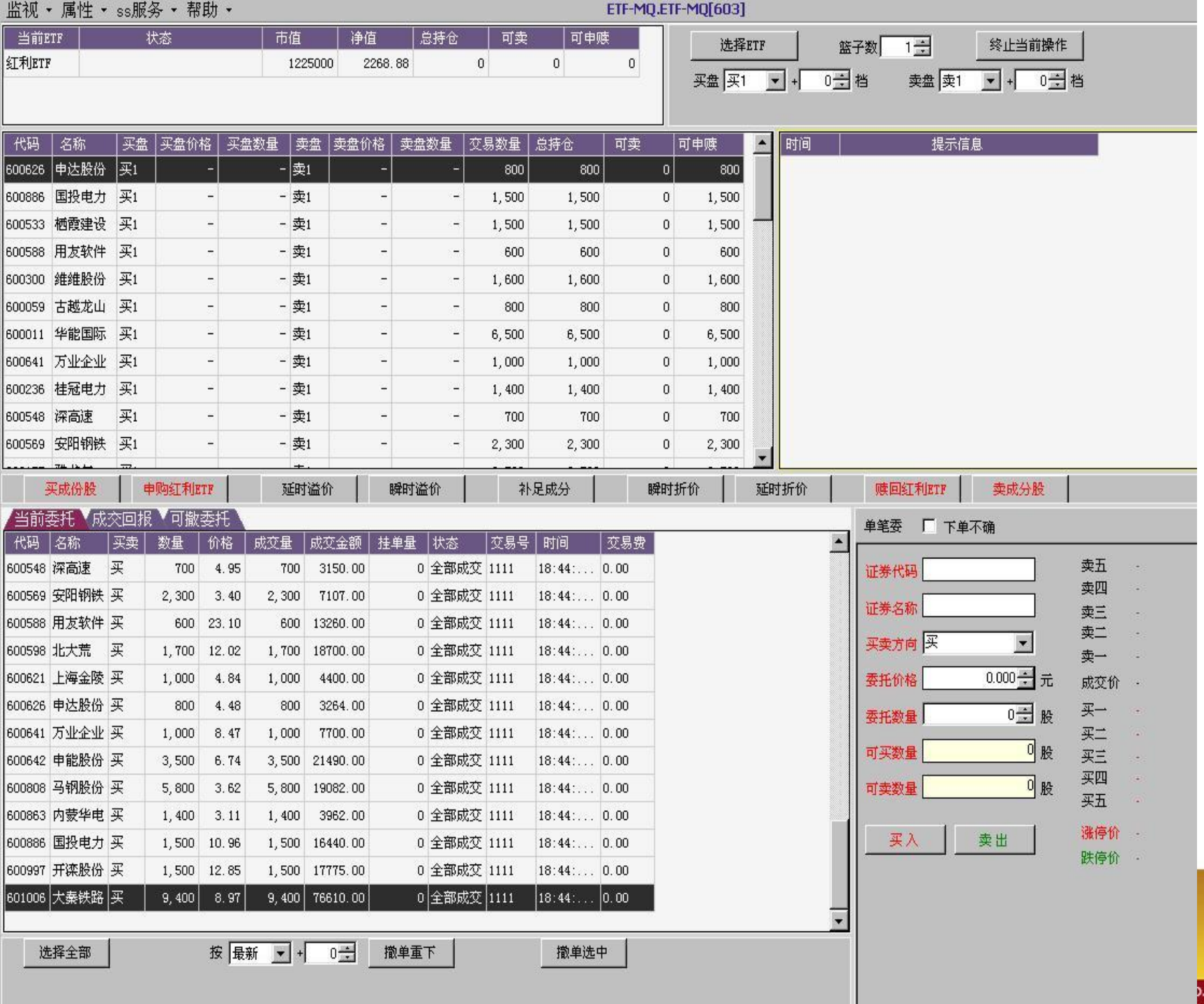
（参考：客户界面—商品套利界面）

DTS Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved



参考：客户界面之ETF套利界面



参考：客户界面之ETF套利界面

. All rights reserved

系统 ▾ 属性 ▾ 功能 ▾ 帮助 ▾

inner.股指期货交易测试用[沈兆源]

开仓 | 持仓管理 | 委托 | 成交

收益率计算设置

买

卖

510180	test1	IF1003	IF1004	IF1006	ETF
0.709 0.007 1.00%	3293.871 26.316 0.81%	3286.4 7.2 0.22%	3420.2 5.2 0.15%	3667.6 7.2 0.20%	3293.871 26.316 0.81%
卖1 0.708 385000	对应张数 1.0张	03/19 剩1/1	04/16 剩21/29	06/18 剩66/92	对应张数 1.0张
买1 0.707 83300	停牌0,0.0% 涨停0,0.0% 跌停0,0.0%				停牌0,0.0% 涨停0,0.0% 跌停0,0.0%
IF1003	test1-IF1003				ETF-IF1003
3286.4 7.2 0.22%	-8164 -0.66% -238.82%				-8164 -0.66% -238.82%
03/19 剩1/1	1230564 -7.47 0				1230564 -7.47 0
卖1 3286.4 32	交易设置 2				交易设置 1
买1 3285.6 3	手动开仓 条件开仓价差				手动开仓 条件开仓价差
安全域 3.82%					
IF1004	test1-IF1004	IF1003-IF1004			ETF-IF1004
3420.2 5.2 0.15%	31856 2.24% 38.38%	34104 5.16% 1857.35%			31856 2.24% 38.38%
04/16 剩21/29	1422874 126.33 0	661019 133.80 0			1422874 126.33 0
卖1 3420.2 20	交易设置 1	交易设置 1			交易设置 1
买1 3419.8 1	手动开仓 条件开仓价差	手动开仓 条件开仓价差			手动开仓 条件开仓价差
安全域 18.64%					
IF1006	test1-IF1006	IF1003-IF1006	IF1004-IF1006		ETF-IF1006
3667.6 7.2 0.20%	105853 6.33% 34.52%	108101 11.87% 4273.47%	67541 6.62% 113.49%		105853 6.33% 34.52%
06/18 剩66/92	1672508 373.73 0	910653 381.20 0	1020221 247.40 1		1672508 373.73 0
卖1 3669.2 27	交易设置 1	交易设置 2	交易设置 3		交易设置 2
买1 3667.6 4	手动开仓 条件开仓价差	手动开仓 条件开仓价差	手动开仓 条件开仓价差		手动开仓 条件开仓价差
安全域 35.16%					
IF1009	test1-IF1009	IF1003-IF1009	IF1004-IF1009	IF1006-IF1009	ETF-IF1009
3743.6 3.2 0.09%	128585 6.69% 18.39%	130833 11.29% 4063.34%	90573 7.14% 122.38%	15830 1.14% 6.23%	128585 6.69% 18.39%
09/17 剩131/183	1920998 449.73 0	1159143 457.20 0	1268711 323.40 0	1386916 76.00 1	1920998 449.73 0
卖1 3743.6 82	交易设置 1	交易设置 4	交易设置 5	交易设置 6	交易设置 3
买1 3743.4 23	手动开仓 条件开仓价差	手动开仓 条件开仓价差	手动开仓 条件开仓价差	手动开仓 条件开仓价差	手动开仓 条件开仓价差
安全域 52.55%					

时间	提示信息
15:00:49	在<B31003162139230011M>中下单: IssueCode:600000,Quantity:100,Price:21.81
15:00:51	持仓表手动刷新，下一次自动刷新时间1000秒后
15:01:51	在<01100315155136000 4M>中下单: IssueCode:IF1003,Quantity:1,Price:0
15:04:21	持仓表手动刷新，下一次自动刷新时间1000秒后

系统 ▾ 属性 ▾ 功能 ▾ 帮助 ▾

inner.股指期货交易测试用[沈兆源]

开仓 持仓管理 委托 成交

平 仓 | 平 多 | 平 空 | 单笔委托 | 买入现货组合 | 平选中 | 平仓交易设置 | 持仓刷新设置 | 刷新持仓

类型	组合数	持仓规模	组合敞口	现货敞口	组合平仓敞口	单位组合平仓敞口	组合编号	开仓基价差	当前基价差	基价差变化	基价差当日变化	交易员	条件平仓设置	最近交割日	占用资金	占用资金比例
Total	104	220	53897588.99	2151951.79	754264.00	6492.33								20100319	181462788.80	100.00%
SP-IFL0	21	51	1383115.10	1257235.70	431008.00	8406.25								20100319	59401420.10	32.73%
SP-IFL0	0001	8	267397.60	267397.60	107752.00	13028.32	A0100315133254000 2M	135.00	-7.47	-142.47	-19.12	047	No	20100319	9485070.00	5.23%
SP-IFL0	0002	8	267397.60	267397.60	107752.00	13028.32	A0100315135909001 9M	135.00	-7.47	-142.47	-19.12	047	No	20100319	9484472.00	5.23%
SP-IFL0	0003	8	264992.60	264992.60	107752.00	13032.15	A0100316124428000 3M	135.00	-7.47	-142.47	-19.12	047	No	20100319	9488224.00	5.23%
SP-IFL0	0004	8	308223.60	308223.60	107752.00	12963.56	A0100317142453000 2M	135.00	-7.47	-142.47	-19.12	047	No	20100319	9727742.00	5.36%
SP-IFL0	0005	1	6993.30	-6993.30	0.00	0.00	A0100318190713000 2M	11.64	-7.47	-19.12	-19.12	047	No	20100319	1174918.00	0.65%
SP-IFL0	0006	1	6993.30	-6993.30	0.00	0.00	A0100318194658001 0M	11.64	-7.47	-19.12	-19.12	047	No	20100319	1174918.00	0.65%
SP-IFL0	0007	1	6993.30	-6993.30	0.00	0.00	A0100318195627000 2M	11.64	-7.47	-19.12	-19.12	047	No	20100319	1174918.00	0.65%
SP-IFL0	0008	1	6993.30	-6993.30	0.00	0.00	A0100318201315000 2M	11.64	-7.47	-19.12	-19.12	047	No	20100319	1174918.00	0.65%
SP-IFL0	0009	1	6993.30	-6993.30	0.00	0.00	A0100318210039000 2M	11.64	-7.47	-19.12	-19.12	047	No	20100319	1174918.00	0.65%
SP-IFL0	0010	1	6993.30	-6993.30	0.00	0.00	A0100318210122000 3M	11.64	-7.47	-19.12	-19.12	047	No	20100319	1174918.00	0.65%
SP-IFL0	0011	1	6993.30	-6993.30	0.00	0.00	A0100319112327000 2M	17.86	-7.47	-25.33	-19.12	047	No	20100319	1167488.00	0.64%

组合编码	证券/合约代码	多空	持仓量	可用数量	成本	BASubID
A1100318190904000 4M	IF1004	空	1	1	3415.0	1A11003181...
A1100318190904000 4M	000001	多	14200	14200	23.05	3A11003181...
A1100318190904000 4M	600000	多	30000	30000	21.70	3A11003181...

时间	提示信息
15:00:49	在<B3100316213923001 1M>中下单: IssueCode:600000,Quantity:100,Price:21.81
15:00:51	持仓表手动刷新，下一次自动刷新时间1000秒后
15:01:51	在<0110031515513600 04M>中下单: IssueCode:IF1003,Quantity:1,Price:0
15:04:21	持仓表手动刷新，下一次自动刷新时间1000秒后

监视 ▾ 属性 ▾ ss服务 ▾ 功能 ▾ 帮助 ▾

股指主策略.股指期货套利标准版

期现套利 | 跨期套利 | 自定义合约

组合代码	第一腿	第二腿	买入预估	卖出预估	指数点位	期货价格
ETFOnly-IFL0	ETFOnly	IFL0	2834.1	2832.7	2818.16	2836.2
ETFOnly-IFL1	ETFOnly	IFL1	2834.1	2832.7	2818.16	2870.0
ETFOnly-IFL2	ETFOnly	IFL2	2834.1	2832.7	2818.16	2900.2
ETFOnly-IFL3	ETFOnly	IFL3	2834.1	2832.7	2818.16	2940.0
hh-IFL0	hh	IFL0	2854.6	2851.2	2818.16	2836.2
hh-IFL1	hh	IFL1	2854.6	2851.2	2818.16	2870.0
hh-IFL2	hh	IFL2	2854.6	2851.2	2818.16	2900.2

下单 | 图形区 | 下单方案 | 参数设置

组合代码 选择下单方案

总单位

持仓情况

第一腿 第二腿

可开单位 可开单位

可平单位 可平单位

期现套利

下单设置

下单顺序 第一腿优先 组合买卖 买

开平 开

委托设置

第一腿 价格类型 涨停 0 Tic

第二腿 价格类型 涨停 0 Tic

行情

第一腿 第二腿

成本价估算 点 成本价估算

行情点数 点 行情点数

触发条件

手动 自动

第一腿 成交比例 >= %

第二腿 成交比例 >= %

启动套利任务

未完成条件单 | 全部条件单

任务号	组合代码	类型	状态	Totol	Remai

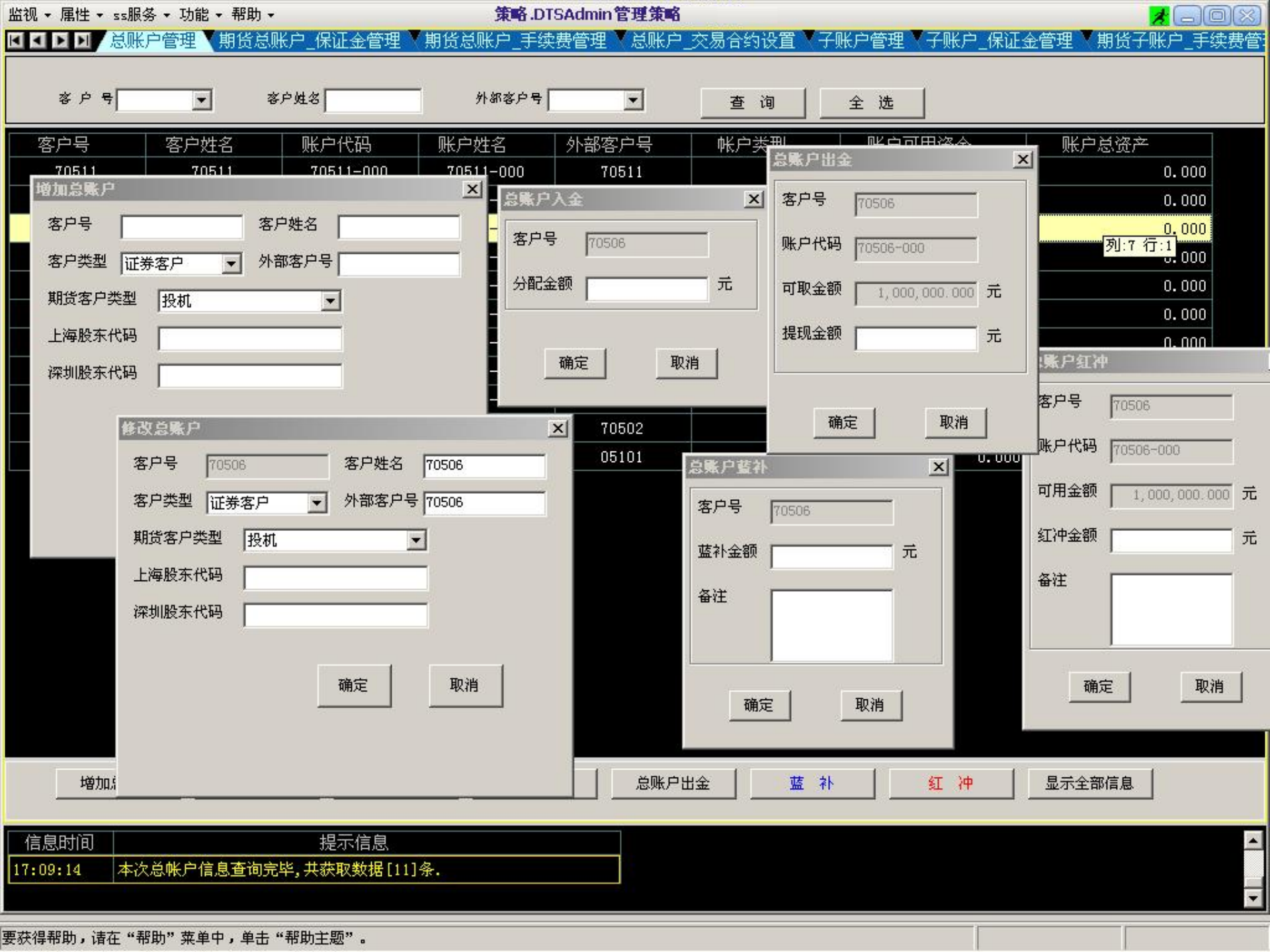
成交一览 | 全部委托 | 可撤委托 | 现货未成交明细 | 现

标的代	买卖	开平	成交数量	成交价格	成交比例	成交额
IF1005	卖	开仓	1	2803	100.00	84.09
IF1005	卖	开仓	2	2832.2	200.00	169.93
IF1005	卖	开仓	1	2832.2	100.00	84.97
IF1006	买	开仓	1	2847	100.00	85.41
IF1006	买	开仓	2	2870	200.00	172.20
IF1006	卖	开仓	1	2869.4	100.00	86.08
IF1009	买	开仓	1	2904	100.00	87.12
IF1009	买	开仓	1	2905	100.00	87.15
IF1009	卖	开仓	2	2880.6	200.00	172.84
IF1009	卖	开仓	2	2886.2	200.00	173.17

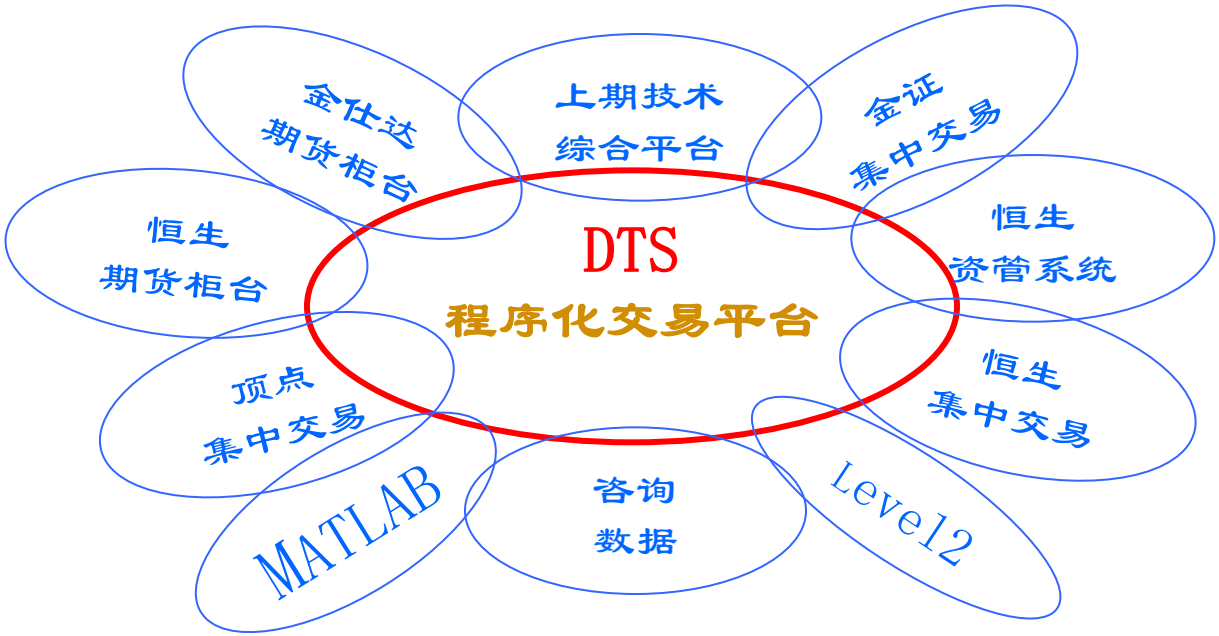
策略持仓 | 品种持仓 | 现货持仓明细 | 资金状况 | 提示信息

组合代码	标的名称	多空	上日持仓	今日持仓
ETFOnly-IF1005	ETFOnly	多	0	
ETFOnly-IF1005	IF1005	空	4	
ETFOnly-IF1005				
hh-IF1005	hh	多	2	
hh-IF1005	IF1005	空	1	
hh-IF1005				
Test04-IF1009	IF1009	空	0	
Test04-IF1009	Test04	多	0	
Test04-IF1009				

开始 « 16:38


监视 属性 ss服务 功能 帮助
策略.DTSAdmin管理策略
总账户管理 期货总账户_保证金管理 期货总账户_手续费管理 总账户_交易合约设置 子账户管理 子账户_保证金管理 期货子账户_手续费管
客 户 号
客户姓名
外部客户号
查 询
全 选
客户号 客户姓名 账户代码 账户姓名 外部客户号 帐户类型 账户总资产
70511 70511 70511-000 70511-000 70511 0.000
0.000
0.000
0.000
0.000
0.000
70502
05101
增加总账户
客户号
客户姓名
客户类型 证券客户
外部客户号
期货客户类型 投机
上海股东代码
深圳股东代码
总账户入金
客户号 70506
分配金额
元
确定
取消
总账户出金
客户号 70506
账户代码 70506-000
可取金额 1,000,000.000 元
提现金额
元
确定
取消
修改总账户
客户号 70506
客户姓名 70506
客户类型 证券客户
外部客户号 70506
期货客户类型 投机
上海股东代码
深圳股东代码
确定
取消
总账户蓝补
客户号 70506
蓝补金额
元
备注
确定
取消
账户红冲
客户号 70506
账户代码 70506-000
可用金额 1,000,000.000 元
红冲金额
元
备注
确定
取消
列:7 行:1
总账户出金
蓝 补
红 冲
显示全部信息
信息时间 提示信息
17:09:14 本次总帐户信息查询完毕,共获取数据[11]条.
要获得帮助，请在“帮助”菜单中，单击“帮助主题”。

DTS程序化交易平台已经连接过



© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术介绍

DTS
Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术

- 共享内存数据库(shmDB)技术
  - 利用系统内存，提供高速，大容量的数据存储空间和方便的数据管理功能。由于没有任何磁盘读写操作，访问速度可以提升到极限，一个操作所需时间不到1微秒。我们设计了函数调用形式的数据访问，既免去了SQL解析优化的开销，又可以象访问普通的关系型数据库一样，进行查找、更新和删除
  - 多年不断的优化，形成数据的动态管理和区域管理
  - 由数据进内存带来的灾难恢复问题，则由专门的交易保存服务进程在独立的机器上完成，保障了灾难后的恢复

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术

分布式计算技术

- 业务层的每个服务，都可以在不同的机器上启动多个实例。通过通信中间件，这些实例可以分工合作，提高数据吞吐量和响应速度，也可以完全进行相同的计算，互为备份。
- 我们的分布式计算环境把消息中间件的广播组播功能，和相对廉价的Linux服务器集群结合起来，具有以下3个特色。
- 系统中即使有进程因为软件，硬件故障不能访问，备份的副进程也会及时发现，实时切换，不间断地提供服务。备份进程的数量可以任意设定，使服务停止的可能性接近于零。
- 通过负载均衡，可以简单地通过增加机器，增加线路的方法，成倍地提高整个系统的处理能力。
- 不必采购高昂设备，用较廉价的Linux服务器集群（Outlimit机制+并行机制）提供媲美小型机、大型机的性能和备份机制。

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术

- 负载均衡技术
  - 智能地判断线路的繁忙程度，选择最优线路把订单发出，减少延迟时间。
  - 智能管理下单线程，根据需要划分优先等级（999级）
  - 持仓管理、订单管理、自动交易、盯市这些服务的计算量很大，每一个价格的更新都有可能触发成百上千个计算，通过负载均衡技术，我们能把这些计算量分配到合适的机器上，充分利用计算资源，提高系统响应速度。

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术

- 高可用性HA技术

  - 互为备份的服务进程可以自动探知系统中本服务的运行状况，如果发现主进程状态不正常，备份的副进程能够无间隔地接替主进程提供服务，使交易不因系统故障而停止。

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术

- **DATAPOOL技术**

  - 用于多数据源的行情发布的DATAPOOL技术
  - 行情信息变动快，数据量大，龙软独创的DATAPOOL技术可以从多个数据源接收不同速率行情和咨询数据，并实时地在系统内发布。使用行情信息的服务可以从共享内存数据库中取得完整的行情信息，也可以在某个字段发生变动时收到更新，由于只发布有更新的字段，对于网络资源的占用率被大大地降低了

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术

- 多市场消息转换技术
  - 市场扩充非常方便的市场消息转换技术
  - 对于行情，订单，各种交易所回报信息，系统中定义了一套通用的传输协议-UMF(Unified Message Format)，覆盖了国际上流行的信息格式，通过制作消息格式转换模块，可以方便地适应任何市场。

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术

- 易用性、有效性

  - 快速、强大、精炼的LUA脚本语言（著名案例：暴雪公司+魔兽世界），使更多有初级计算机能力的投资者方便学习、使用。而Lua与C/C++函数互相调用、替代xml、小巧、可简单的数学运算等等 能力，使Lua成为最优秀的嵌入式脚本语言
  - 可充分利用各种数据（分笔成交、各种K线、咨询数据、Matlab、SAS或自行研发的第三方数据等），让“交易策略”更加贴近实际，反映历史

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS的核心技术

- 总结

DTS交易引擎是程序化交易中的核心

- 前后台数据分离 ——目的：计算快！交易快！
- 分布计算、DATAPOOL、内存数据库、UMF让交易速度不断创新 ——目的：计算快！交易快！
- OUTLIMIT、负载均衡 ——目的：计算快！交易快！
- LUA脚本 ——目的：编写快！执行快！
- 多数据接入、多数据回测、多速率行情应用、多市场

——目的：高开放性、高应用性！

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

附录：策略举例-双均线

策略启动图形

DTS Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

附录：策略举例-双均线交易逻辑编辑


```
        if indi.ShortMA[evalIndex - 2] <= indi.LongMA[evalIndex - 2] and indi.ShortMA[evalIndex-
1] > indi.LongMA[evalIndex-1] and
                  _SubmitOrderFlag
        then--短周期均线上穿长周期均线
                  if GetShortQty(issueCode) > 0 then
                          ExitShort(issueCode, "", "Ask", "tic", 0, qty, "买平", "1")
                 end
                  if GetLongQty(issueCode) == 0 then
                           EnterLong(issueCode, "", "Ask", "tic", 0, qty, "买开")
                  end
                  return
        end
        if indi.ShortMA[evalIndex - 2] >= indi.LongMA[evalIndex - 2] and indi.ShortMA[evalIndex-
1] < indi.LongMA[evalIndex-1] and
                  _SubmitOrderFlag
        then--短周期均线下穿长周期均线

                  if GetLongQty(issueCode) > 0 then
                           ExitLong(issueCode, "", "Bid", "tic", 0, qty, "卖平", "1")
                  end
                  if GetShortQty(issueCode) == 0 then
                           EnterShort(issueCode, "", "Bid", "tic", 0, qty, "卖开")
                  end
                  return
        end
```


© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

RAGONSOFT 上海龙软信息技术有限公司

回测报告

策略回测

可据TBT、各种K线进行回测

策略性能报告

性能汇总：所有交易

净利润	699,613.20	总手续费	29,686.80
总利润	1,854,863.20	总损失	-1,155,250.00
总交易次数	259	盈利次数比例	21.62%
盈利次数	56	总损失次数	203
最大盈利	145,821.60	最大损失	-217,817.60
平均盈利	33,122.56	平均损失	-5,690.89
平均盈利/平均损失	5.82	平均净利润	2,701.21
最大连续盈利次数	1	最大连续损失次数	11
盈利因子（总盈利/总损失）	1.61	最大合约持仓数	52
需要资金	543,340.00	资金回报率（净利润/原始	699.61%
最大回撤	217,817.60	原始资金	100,000.00

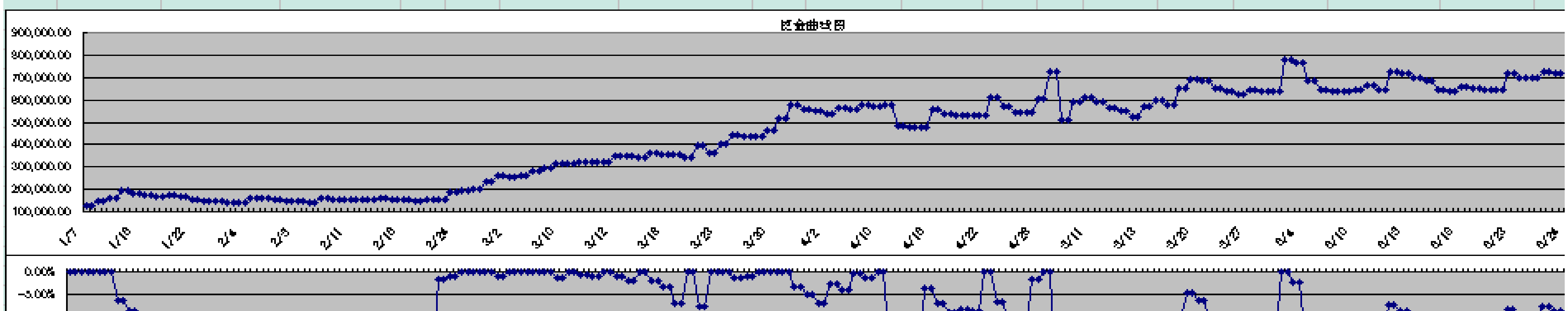
功能按键:

- 更新统计
- 清除数据
- 重新计算
- 恢复参数

源数据文件名及存放路径

C:\Program Files\DTS(DH)\report\exec.P2010021211272

标出盈利	20000
标出亏损	20000



DTS
Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

常规组合交易速度 实盘测试

时间：2009年9月
券商：东海证券
柜台：顶点
中间件：顶点一台中间件
席位：自营席位
流数：一个流数
品种：红利50
计算策略：无
DTS：单线程连接中间件

策略开始买成分(49个委托)	09:55:11.514		
策略买成分最后一个委托发出	09:55:13.071		
开始第一次委托查询	09:55:12.569		
第一个查询结果回来	09:55:12.619		
最后一个成交回报回来	09:55:14.892	49个委托成交耗时	00:00:03.378
策略发出申购委托	09:55:14.928		
拿到申购委托号	09:55:15.209		
查申购委托	09:55:16.246		
查申购成交	09:55:17.276		
申购成交回报回来	09:55:17.302	申购耗时	00:00:02.374
策略开始买成分(49个委托)	13:29:25.818		
策略买成分最后一个委托发出	13:29:27.389		
开始第一次委托查询	13:29:26.925		
第一个查询结果回来	13:29:26.941		
最后一个成交回报回来	13:29:29.200	49个委托成交耗时	00:00:03.382
策略发出申购委托	13:33:02.133		
拿到申购委托号	13:33:02.186		
查申购委托	13:33:03.233		
查申购成交	13:33:05.253		
申购成交回报回来	13:33:05.283	申购耗时	00:00:03.150

DTS Dragonsoft Trading System

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

上海龙软信息技术有限公司

时间：2009年11月
券商：东海证券
柜台：顶点
中间件：顶点三台中间件
席位：VIP大客户席位
流数：两个流数
品种：红利50
计算策略：无
DTS：三线程连接中间件

常规组合交易速度 实盘测试

东海证券 DONGHAI SECURITIES

程序化交易腊梅傲雪交易策略正式启用

2009-12-01 16:29 东海证券

在公司领导的大力支持下，经过程序化交易工作小组和相关业务部门的共同努力，程序化交易DTS客户端（生产环境）已于11月30日向客户正式开放。目前，程序化交易生产环境提供的交易策略主要有“腊梅傲雪交易策略”、“日出东海交易策略”和“龟兔赛跑交易策略”等。

腊梅傲雪交易策略是ETF手工瞬时套利和延时套利交易策略，是当前大客户做日内交易的主流方式。随着央企ETF、治理ETF和深成ETF近期的发行和上市，ETF板块从5只将逐步扩容到8只，ETF逐步成为热门的交易板块之一。

为验证腊梅傲雪交易策略的速度和稳定性，11月30日上海一大客户首次试用腊梅傲雪交易策略，分别进行了延时溢价套利和折价套利操作，受大盘上涨的影响，该客户试用当天取得了不错的收益。经过试用，腊梅傲雪交易策略延时套利的时间为5.8秒，其中买卖股票的时间为2.2秒，申购赎回的时间为3.6秒，大大领先于业内10多秒的延时套利时间，为客户开展ETF套利奠定了良好的基础。

在现有的腊梅傲雪交易策略的基础上，程序化交易工作小组拟从以下三个方面进一步提高速度、改进性能：

1、在交易中对接LEVEL2行情；

2、研发全自动的ETF延时套利技术；

3、研发成交回报主动推送技术。

预计这三项改进将在2-3个月内完成，届时我公司ETF套利交易工具将更加先进和快捷。

友情提示：如无法打开上文中附件，请访问Adobe官方网站下载PDF阅读器

关闭窗口

免责声明：东海龙网所有信息均不构成直接投资建议，仅供参考，本公司不承担任何投资行为产生的相应后果。

市场有风险，投资需谨慎；注意防范非法证券活动。

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

国外同类产品或企业

tradestation

MT4

Amibroker

GSTrUE

Etrade.com

Jtrade

富士通

GL

SunGard

高盛技术团队

国内同类产品

交易开拓者

文华财经

投资赢家

大智慧

算法交易

ETF套利

股指期货套利

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

龙软DTS程序化交易平台　　目前缺点

1、对国内来讲，“落地”时间还不够长，经验还不够丰富

2、完整业务管理中，国内外没有实现“清算流程”

3、虽然核心系统中带有“柜台系统”，但国内股票业务还未直连过交易所

4、理论上外汇投资业务也能实现，但是还未能实际应用

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved

您擅长：投资

+

我擅长：投资软件技术

=

各展所长，共同提高

© Dragonsoft information technology Co ., LtD. All rights reserved