

程序化交易管理 解决方案交流会

上海德索信息技术有限公司

交流内容



01

程序化交易客户
行为筛查

02

程序化交易客户
资料维护

03

Q & A



01. 程序化交易客户行为筛查

“双十”行为筛查

“在1个交易日内出现10次（含）以上1秒钟内10笔（含）以上报撤单”的**单客户**或**实控关系账户组**

程序化交易行为筛查 ×

营业部 数据日期 ~ 单交易日内出现次数>= 1秒内报撤单笔数>=

客户号/实控组号 客户名称/实控组名称

筛查开始日期	筛查截止日期	营业部代码	营业部名称	实控组/客户号	实控组/客户名称	客户类型	客户状态	开户日期	行为命中天数	首次行为出现日期	末次行为出现日期	期间累计出现次数	分交易所单日最高出现次数
2025-04-01	2025-09-22	02	IB券商	02000004939	恒黑银	自然人	有效	2022-09-07	1	2025-04-07	2025-04-07	10	10
2025-04-01	2025-09-22	-	-	pldr0001	批量导入0001				1	2025-04-07	2025-04-07	10	10

共 2 条

10条/页 < 1 > 前往 1 页

“双十”行为筛查

筛查开始日期	筛查截止日期	实控组/客户号	实控组/客户名称	末次行为出现日期	期间累计出现次数	分交易所单日最高出现次数	分交易所1秒最高报撤单频率	分交易所单日最高报撤单笔数	涉及交易所	是否报告	实控组	行为命中详情
2024-12-31	2025-09-25	01010004300	汤上乌	2025-04-07	10	10	17	119	大连商品交易所	是		查看
2024-12-31	2025-09-25	02000004939	桓黑银	2025-04-08	20	10	14	106	大连商品交易所	否		查看
2024-12-31	2025-09-25	pldr0001	批量导入0001	2025-04-07	10	10	17	119	大连商品交易所	是	pldr0001	查看
2024-12-31	2025-09-25	pldr0002	批量导入0002	2025-04-08	20	10	14	106	大连商品交易所	否	pldr0002	查看

- 区分不同交易所统计1秒内报撤单笔数及1个交易日内出现的次数
- 实控组客户以实控组为单位统计，整个实控组在任1个交易所的统计数据满足“双十”标准，即会被筛查出来
- 检查该客户/实控组本次交易的APPID是否已经上报监管（【程序化交易客户信息维护】）
- 行为命中详情展示

是否上报明细（单客户）

已上报

程序化交易行为筛查 x 01010004300程序化交易客户信息维护 x

投资者代码 01010004300 APPID 多个值使用半角逗号,隔开 录入时间区间

Q 查询 重置 查看 导出

营业部名称	投资者代码	投资者名称	投资者类型	投资者状态	休眠状态	开户日期	软件名称	APPID	软件接入系统	终止状态	程序化使用报告日期	程序化
期货北京营业部	01010004300	汤上乌	自然人	有效	休眠	2025-01-02	软件1号	1	CTP,飞马	否	2025-09-01	

未上报

程序化交易行为筛查 x 02000004939上报信息 x

数据日期 2024-12-31 ~ 2025-09-24 单交易日内出现次数>= 10 1秒内报撤单笔数>= 10 客户号 02000004939

客户名称 恒票银

Q 查询 导出 显示列

甄别是否存在未上报的APPID

客户号	客户名称	APPID	是否报告	申请日期
02000004939	恒票银	2	是	-
02000004939	恒票银	3	否	-

- 如当前客户存在APPID未在【程序化交易客户信息维护】中维护，视为未报告

是否上报明细（实控组）

已上报

客户号	客户名称	实控组	实控组名称	APPID	是否报告	申请日期
01040003007	亢新油	pldr0001	批量导入0001	1	是	-

未上报

客户号	客户名称	实控组	实控组名称	APPID	是否报告	申请日期
01160003483	彭郑蒙	pldr0002	批量导入0002	2	是	-
02110002718	曲兴马	pldr0002	批量导入0002	2	否	-

甄别是否存在未上报的APPID或客户

- APPID对应的客户未报告

实控组详情展示

例：当编号pldr0001实控组组内资金账号合计达到“在1个交易日内出现10次（含）以上1秒钟内10笔（含）以上报撤单”的筛查要求，会以一条实控组的记录显示在【程序化交易行为筛查】中，通过【实控组】下钻页，查看全部成员基本资料。

筛查开始日期	筛查截止日期	实控组/客户号	实控组/客户名称	数	分交易所单日最高出现次数	分交易所1秒最高报撤单频率	分交易所单日最高报撤单笔数	涉及交易所	接入申请	实控组	行为命中详情
2024-12-31	2025-09-23	pldr0001	批量导入0001		10	17	119	大连商品交易所		pldr0001	查看

点击查看【实控组详情】



实控组编号	实控组名称	客户资金账号	客户名称	部门代码	部门名称
pldr0001	批量导入0001	01000003433	申屠彦振	01	期货
pldr0001	批量导入0001	01160004001	郗霖专	011605	期货上海分公司上海徐汇区营业部
pldr0001	批量导入0001	888880036	陈志帆的小迷弟	nh00001	
pldr0001	批量导入0001	888880037	徐启林的小迷弟	nh00001	

实控组详情展示

例：通过【行为命中详情】下钻页，查看每1秒内的报撤单笔数

筛查开始日期	筛查截止日期	实控组/客户号	实控组/客户名称	数	分交易所单日最高出现次数	分交易所1秒最高报撤单频率	分交易所单日最高报撤单笔数	涉及交易所	接入申请	实控组	行为命中详情
2024-12-31	2025-09-23	pldr0001	批量导入0001		10	17	119	大连商品交易所		pldr0001	查看

点击查看【行为命中详情】

实控组/客户号	实控组/客户名称	交易所	交易日期	交易时间	1秒内报单笔数	1秒内撤单笔数	1秒内报撤单笔数	报撤单详情
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:00:55	10	0	10	查看
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:00:57	15	0	15	查看
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:07:57	12	0	12	查看
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:08:52				
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:08:57				
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:18:57				
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:28:57				
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:38:57				
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:48:57				
pldr0001	批量导入0001	大连商品交易所	2025-04-07	13:58:57				

共 10 条

程序化交易行为筛查 x | 02000004939筛查情况 x | 02000004939报撤单明细 x

🔍 查询 | 📄 导出 | 🗨 显示列

实控组/客户号	实控组/客户名称	交易日期	交易所	合约号	交易所委托号	报单时间	报单状态	撤单时间	撤销产品标识	APPID	IP	MAC
02000004939	糖黑银	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000540	14:01:57	全部成交					
02000004939												
02000004939												
02000004939												
02000004939	糖黑银	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000545	14:01:57	全部成交					
02000004939	糖黑银	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000546	14:01:57	全部成交					
02000004939	糖黑银	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000554	14:01:57	全部成交					
02000004939	糖黑银	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000556	14:01:57	全部成交					
02000004939	糖黑银	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000557	14:01:57	全部成交					

共 12 条

10条/页 | < 1 2 > 前往 1 页

【报撤单详情】：每1秒内的客户报撤单明细

报撤单明细

展示该客户或实控组内客户在这1秒内的报单明细和撤单明细，
包括交易所、合约号、委托号、报单状态、撤单时间（报单状态为“撤单”时展示）以及交易终端信息（终端产品标识、APPID、IP、MAC）

实控组/客户号	实控组/客户名称	交易日期	交易所	合约号	交易所委托号	报单时间	报单状态	撤单时间	终端产品标识	APPID	IP	MAC
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000540	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000541	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000542	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000543	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000544	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000545	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000546	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000554	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000556	14:01:57	全部成交					
02000004939	恒黑根	2025-04-07	大连商品交易所	m2401	138000557	14:01:57	全部成交					

共 12 条

10条/页 < 1 2 > 前往 1 页



02.程序化交易客户资料维护

信息维护大类

实控关系维护

外接软件APPID维护

程序化交易客户信息维护

*视为已上报

实控关系维护

实控关系账户组



实控关系客户

实控组编号

实控组名称

单一维护

批量导入

实控组内投资者信息

投资者代码/投资者名称

单一维护

批量导入

实控组编号	实控组名称	备注
001	1	11
002	2	2
003	IPBAC	3
004	4	4
p00001	批量导入,0001	
p00002	批量导入,0002	
p00003	批量导入,0003	
p00004	批量导入,0004	
p00005	批量导入,0005	
p00006	批量导入,0006	

实控组编号	实控组名称	投资者代码	投资者名称
001	1	00100003264	开曼群岛
002	2	01330004750	德西人
003	IPBAC	01160003470	阮新智地
004	4	01230004128	蔡生保
p00001	批量导入,0001	01000003433	蔡瑞德
p00001	批量导入,0001	01160004001	郑智宇
p00001	批量导入,0001	0088000636	陈进平的小提琴
p00001	批量导入,0001	0088000637	徐台祥的小提琴

外接软件APPID维护

- ✓ APPID
- ✓ 软件名称
- ✓ 开发商
- ✓ 类型
- ✓ 功能

*** APPID** **不支持修改**

* 软件名称

软件版本及标识

* 开发商名称

开发商联系人

开发商联系电话

软件接入系统 CTP 飞马

软件类型 标准客户端 标准中继 外接客户端 外接中继

接入模式

软件功能 自动开/平仓 止盈/止损功能 批量下单 多账户管理 套利/组合套利
 交易模型编写 一键/快捷下单 日内短线 其他功能, 请描述

其他软件功能

分账户功能

* 程序化交易功能

每秒最高报撤单频率

单日最高报撤单笔数

其他软件接入

备注

页面配置

外接软件APPID维护 > 详情设置

可用公共字段

可用自定义字段

添加自定义字段

文本框 多行文本 单选 多选

下拉框 日期 附件上传

可扩展字段

* APPID

* 软件名称

开发商联系人

开发商联系电话

软件接入系统 CTP 飞马

软件类型 标准客户端 标准中继 外接客户端 外接中继

接入模式

软件功能 自动开/平仓 止盈/止损功能 批量下单 多账户管理
 日内短线 其他功能, 请描述

其他软件功能

分账户功能

*支持根据监控中心系统要求或个性化要求进行调整

程序化交易客户信息维护

在此报表维护信息后，做【程序化交易客户行为筛查】时“接入申请”字段数据展示为“是”

* 投资者代码

投资者类型

程序化交易客户信息维护 x 程序化交易行为筛查 x

营业部 数据日期 2024-12-31 ~ 2025-09-24 单交易日内出现次数 >= 10 1秒内报撤单笔数 >= 10

客户号/实控组号 客户名称/实控组名称

筛查开始日期	筛查截止日期	实控组/客户号	实控组/客户名称	日期	期间累计出现次数	分交易所单日最高出现次数	分交易所1秒最高报撤单频率	分交易所单日最高报撤单笔数	涉及交易所	实控组	是否报告	行为命中详情
2024-12-31	2025-09-24	01010004300	汤上乌	7	10	10	17	119	大连商品交易所		是	查看详情
2024-12-31	2025-09-24	02000004939	恒黑银	7	10	10	14	106	大连商品交易所		否	查看详情
2024-12-31	2025-09-24	pldr0001	批量导入0001	7	10	10	17	119	大连商品交易所	pldr0001		查看详情

软件功能 自动开/平仓,止盈/止损功能

其他软件功能 7

接入模式 直连模式

采购模式 公司自购

交易指令执行方式 手动下单

* 投资者代码 006068697 张怀甫

投资者类型

软件名称 软件1号

采购模式 请选择

交易指令执行方式 请选择

其他交易指令执行方式

程序化交易负责人

程序化交易负责人联系电话

产品管理人

终止状态 请选择