

智能輔助下單工具使用說明書  
( 智能蛛網 )

## 使用風險須知

本軟體提供之資訊內容僅供參考，對於資料內容錯誤、更新延誤或傳輸中斷，本公司不負任何法律責任；投資人對任何參考資料仍需自行判斷，一切交易所生之風險或損失均與本軟體無關，特此聲明。未經凱基期貨顧問事業部授權同意，不得將凱基期貨顧問事業部所提供之文件內容轉載於任何形式媒體。

凡購買凱基顧問產品之客戶，已完成簽訂期貨顧問委任契約，並已了解及清楚交易可能發生之風險：

1. 使用智能輔助下單工具者，須先了解交易軟體與相關設定及限制，避免因操作不當而造成交易損失。
2. 智能輔助下單工具不保證獲利，運用於期貨與選擇權交易執行時具有風險，投資人務必審慎評估後再行運作。
3. 智能輔助下單工具的擬真績效係為回溯之績效，過去績效並不保證未來之績效，還請投資人審慎了解策略內容後執行交易。
4. 在使用智能輔助下單工具時，仍可能面臨主機異常、網路斷線、斷電或網路堵塞等不確定因素，這些情況可能導致委託無法及時傳送或接收。此外，市場經濟數據發布時，行情可能會出現劇烈波動或交易所熔斷等情況，這些都可能影響執行價格，進而導致滑價風險，請投資人自行評估。
5. 智能輔助下單工具串接凱基期貨 API ( Application Programming Interface ) 服務之程式。雖經連線測試後，使用人可使用 API 功能透過凱基期貨 ( 以下簡稱本公司 ) 電子交易平台而進行交易，但本公司就使用人所使用之程式無確保與本公司電子交易平台相容之義務，凡屬程式端所產生之交易限制、障礙或其他電腦程式交易錯誤，致衍生任何問題或造成錯帳，均由使用人自行承擔。
6. 使用人除應妥善保管使用個人帳號、授權密碼、自訂密碼及電子憑證外，不得擅自授與他人或資訊廠商全權委託期貨交易；凡經驗證屬使用人之帳號、密碼及憑證所為之委託指示，均應由使用人負全部之法律責任，與本公司無涉。
7. API 係屬程式交易亦為電子式交易之一種，買進賣出訊號雖經程式計算提出，但最終買賣之決策與執行應由使用人審慎評估後自行為之。
8. 使用人瞭解藉由電子交易方式取得各類期貨交易資料包含行情變動、即時資訊或其他資訊，本公司之此項資訊提供不代表勸誘使用人進行期貨交易，且本公司對於所提供之資訊雖得自於一般認為可資信賴之來源，但本公司與相關資訊服務業無擔保該資訊之正確性或完整性之義務，使用人應就相關資訊自行獨立判斷。如因不可抗力或因本公司及第三人資

訊服務業者難以合理控制之其他原因，所致資訊錯誤、延遲或遺漏，而直接或間接產生之任何損失或損害，本公司或第三人資訊服務業者皆無需負責。

9. 如遇交易極為活絡及不可抗力情形 ( 包括但不限於斷線、斷電、網路壅塞、系統壅塞等狀況 )，使用人的委託及成交回報資訊可能有延遲或停止之情形，故使用人應隨時注意委託單之執行狀況，如發現異常，應即向所屬營業員反應。
10. 使用人應在穩定、快速的連線環境使用 API 程式下單功能，不宜使用無線網路、4G、3G 或 3.5G 網卡。如因連線品質不穩或同時開啟太多報價軟體，導致凱基電子平台商品行情報價延遲與真實報價產生落差，則會造成無法正確警示與下單狀況發生。
11. 使用人應遵守本公司所訂定使用 API 功能及下單所應遵循之交易約定，如暫停下單機制等。
12. 本公司得因風險管理或其他考量，逕行限制或取消 API 介面連結，不需先行告知。
13. 使用人使用 API 功能及下單除應遵循與本公司所訂之相關約定外，並不得為任何不法之使用。

## 壹、簡要操作程序

一、申請並設置凱基期貨 API：線上簽署使用同意書或洽營業員。

二、登入：輸入登入凱基交易的帳號密碼，電腦中須登錄凱基的交易憑證。

1. 手動輸入帳號密碼。
2. 存帳密：將帳號密碼儲存在「我的文件/kgiMulti/idpw.txt」。
3. 若存在「我的文件/kgiMulti/idpw.txt」，啟動程式時將自動讀取並登入。
4. 成功登入後會回傳交易帳號，並以交易帳號驗證是否有使用權限。

三、選擇商品：

1. 成功登入後在「策略」與「報價」會自動載入當月指數期貨商品，包含大台、小台與微台。
2. 選擇「股期類別」→「股期商品」，自動加入報價。
3. 按下「新策略」會新增到「策略」，其中預設的參數僅為程式設計需要數字，並非可行參數，請自行重新設定。

四、設定策略：

1. 按下「策略」裡商品列的「修改」，彈出參數設定視窗，參數的定義與用法在視窗右側一一說明。列出如下：
  - i. **啟動策略**：勾取後，在主畫面的**開始運作**有勾選的狀態下，會開始本策略的運作。
  - ii. **移除策略**：勾取後按下 **OK** 回主表單時會取消本策略的所有委託單，並從策略表中移除策略。
  - iii. **最小價差**：要求每次交易間隔的最小價差。程式會以**參考價×(1+最小價差)**計算賣價，以**參考價÷(1+最小價差)**計算買價。同時請注意價格是換算成微台口數當量，賣價隨微台賣價浮動，買價隨微台買價浮動。
  - iv. **參考價**：自行設定或上一次成交的價格（微台口數當量）。
  - v. **set↑**：將**參考價**設置為**現價**。
  - vi. **現價**：即時個股期貨價格換算成即時微台價格的口數當量。
  - vii. **操作價格區間**：**現價**在**上限**與**下限**之間才可運行，若超出會把庫存全部平倉，並將 **active** 設為不啟動，想繼續操作必須回來調整**操作價格區間**。
  - viii. **庫存現值**：目前的**庫存×價格×轉換比率**，若超出**上限**或**下限**不會再下增加庫存的委託單，並分比依照**上下風控動作**的設定進行風控。
  - ix. **暫停**：保留目前倉位，但**參考價**會停住，繼續往上（下）不會再下賣（買）單，反向的平倉單會繼續下並等待價格往回走。
  - x. **跟隨**：保留目前倉位，但**參考價**會改成**現價**，大於**庫存上限**（多倉太大）時若**現價<參考價**，或，小於**庫存下限**（空倉太大）時且**現價>參考價**會繼續調整

參考價為現價，以加快平倉的速度。

- xi. **平倉**：將目前的倉位平掉，參考價也改成現價，接著重新開始。一樣在操作價格區間內運作。
- xii. **單筆量**：每一筆委託的量。
- xiii. **下單數**：買方與賣方的分別委託單數。請注意下單也是需要保證金。
- xiv. **最小間隔**：下出的第一筆委託單會是按照**最小價差**算出的買賣價，其後依五檔報價的委託量多寡，間隔需大於**最小間隔**下出其後的委託，而且隨時依市場報價進行調整。

2. 「存策略」：把策略表中的所有策略參數儲存在「我的文件/kgiMulti/strategy.json」。

3. 「讀策略」：把「我的文件/kgiMulti/strategy.json」中的策略讀進到策略表中。

NOTE：在結算日會提醒即將到期，結算日後不會讀進策略表，請重新設定。

#### 五、選擇下單伺服器：

- 1. **凱基**：實際下單到凱基交易伺服器，點選後會讀取庫存與權益數，之後每分鐘再讀取一次。
- 2. **虛擬**：模擬交易，虛擬交易伺服器內建在程式中。當即時報價大於委託賣價或小於委託買價時傳回成交訊息。

#### 六、開始運作：

- 1. 勾取後會對策略表中有勾選「啟動」的商品，向凱基報價伺服器呼叫檢查是否為「盤中」，是的話即開始策略下單，否則會等到開盤時間才進行運作。
- 2. 若在勾取「開始運作」的狀態下設定策略為「啟動」，立刻進行前項操作。

七、自動繼續操作：執行批次檔「凱基排程每日八點重啟」會在 Windows 工作排程器加入排程，重啟時會詢問是否保留其它執行個體（不建議保留），10 秒未回應或按 No 會自動關閉其它執行個體，接著 20 秒後重讀策略並勾起開始運作，達到連續不間斷執行的功能。

PS 自動繼續操作可能因電腦當機或 Windows 更新而中斷，建議每日關機並在 BIOS 中設定電腦開機時間，最好在 7:30 以前開機等候工作排程器啟動程式。

## 貳、使用者操作介面

The screenshot displays a user interface with several sections. On the left, there are input fields for '帳號' (Account), '密碼' (Password), '期貨帳號' (Futures Account) with a dropdown menu showing 'F00' and '455', and '權益總值' (Total Equity) with a value of '57'. There are buttons for '登出' (Logout), '存帳密' (Save Password), and '開始運作' (Start Operation). In the center, there are buttons for '清訊息' (Clear Messages) and '下單' (Place Order), with radio buttons for '凱基' (Citic) and '虛擬' (Virtual). On the right, there are dropdown menus for '股期類別' (Stock/Futures Category) and '股期商品' (Stock/Futures Product), and buttons for '存策略' (Save Strategy), '全刪單' (Delete All Orders), '讀策略' (Load Strategy), '清刪單' (Clear Deleted Orders), '新報價' (New Quotes), and '新策略' (New Strategy). There is also a checkbox for '清晨收盤自動關閉' (Auto-close at Morning Close).

- 登出 / 登入：手動登入或登出凱基伺服器。
  - 存帳密：儲存帳號密碼到「文件\kgiMulti\idpw.txt」，程式啟動時若有這個檔案會自動讀取並登入。
  - 清訊息：把訊息區儲存到「文件\kgiMulti\Msg」並清空。
  - 手動單介面：在下單伺服器選凱基時活化，顯示簡易的下單介面，可用來測試下單與回報功能是否正常。
  - 清晨收盤自動關閉：清晨五點會自動關閉程式。
  - 全刪單：刪除所有在回報表中的委託單。請注意在開始運作狀態下，程式會自動再下出啟動策略的委託單。
  - 清刪單：把已刪除的委託單從回報表中移除。
  - 策略表「檢視」：顯示與策略相關的有效委託單。左側為買單，右側為賣單。
    1. Price: 委託單價格。
    2. OrderId: 券商單號。
    3. 總序：估計在委託匣中所有價格的總排序。
    4. 本序：估計在委託匣中同價格的排序。
- PS: 順序是從五檔報價回推估計，下單時排在末端，若同價格的委託數量減少，依照機率推估往前移動順序，所以不是準確值，只是估計。
- 回報表「刪單」：點下後立刻送出刪單訊號到交易所，Note: 不會有確認訊息。
  - 報價表「移除」：將商品從報價表中移除，也不再收到商品報價。Note: 沒有新報價就不會檢查策略，所以請先移除策略再來移除報價。
  - 報價表「五檔」：買賣五檔報價。若中間有委託量為 0 的報價會自動補上，並且強迫至少顯示五檔，衍生一檔的報價會加到同價格的五檔報價。另外，若持續顯示五檔報價表，被擠到五檔之外的價格還會留存，但委託量為空值。

## 參、資料表欄位解釋

### 一、策略表

委託	設定	啟動	商品名	參考價	價差比	各單距	單筆量	下單數	全部庫存	庫存值	庫存值上限	上限後動作	庫存值下限	下限後動作	現價	換算指數	區間上限
		<input type="checkbox"/>	TXFH5	0	100.00%	100	1	1	0	0	2147483647	暫停	-2147483648	暫停	23222	20.000861...	792281625
		<input type="checkbox"/>	MXFH5	0	100.00%	100	1	1	0	0	2147483647	暫停	-2147483648	暫停	23222	5.0002153...	792281625
		<input type="checkbox"/>	TMFH5	0	100.00%	100	1	1	1	232210	2147483647	暫停	-2147483648	暫停	23221	1	792281625
檢視	修改	<input type="checkbox"/>	DHFF5	1.41701...	0.70%	0	1	2	0	0	1500000	跟隨	-1500000	跟隨	180	1.5503208...	792281625
檢視	修改	<input type="checkbox"/>	QFFH5	0.49398...	100.00%	100	1	1	0	0	2147483647	暫停	-2147483648	暫停	1130	0.4866284...	792281625
檢視	修改	<input type="checkbox"/>	DXFL5	1.02828...	2.00%	0	1	2	0	0	1300000	跟隨	-1300000	跟隨	120	1.0335472...	1.5
檢視	修改	<input type="checkbox"/>	DXFH5	0.99646...	100.00%	100	1	1	0	0	2147483647	暫停	-2147483648	暫停	120	1.0335472...	792281625
檢視	修改	<input checked="" type="checkbox"/>	DHFL5	1.53813...	1.50%	0	1	2	-1	-360000	1300000	跟隨	-1300000	跟隨	180	1.5503208...	2.25

1. 委託：按下「檢視」顯示目前與策略相關之委託
2. 設定：按下「修改」彈出修改設定之介面
3. 啟動：勾取時，若勾取主介面“開始運作”並且在盤中，策略為啟動狀態。
4. 商品名：
5. 參考價：當前計算之基準價格，以微台當量顯示
6. 價差比：從參考價往上賣出與往下買進要求之價差比例
7. 各單距：多委託單時，各委託之間的排序間隔
8. 單筆量：每一筆委託的數量
9. 下單數：買賣方各自舖單的數量
10. 全部庫存：當前庫存數量，多倉為正，空倉為負
11. 庫存值：庫存數量乘以價格
12. 庫存值上限：限制庫存值的最高數字，超出後依(13)風控
13. 上限後動作：見設定說明
14. 庫存值下限：限制庫存值的最低數字，超出後依(15)風控
15. 下限後動作：見設定說明
16. 現價：商品目前價格 ( 實價 )
17. 換算指數：商品價格換算成微台當量
18. 區間上限：換算指數價格的區間上限，超出則平倉並停止策略

19. 區間下限：換算指數價格的區間下限，超出則平倉並停止策略
20. 漲停價：當日之漲停價
21. 跌停價：當日之跌停價
22. 轉換比率：期貨商品轉換台幣的比率
23. 結算日：期貨商品之結算日

## 二、 回報表

刪除	回報	報價															
刪	券單號	委託書號	商品名	委託價	買 / 賣	委託量	市 / 限	成交均價	成交量	狀態	附註	委託時間	異動時間	WEBID	clientId		
<input type="checkbox"/>	16812882	caaOH	DHFL5	181.50	sell	1	限價	0	0	live		10:44:22	10:44:22	150	0056_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812879	caaOD	DHFL5	182.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:44:01	10:44:22	150	0055_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812859	caaNI	DHFL5	175.00	buy	1	限價	0	0	live		10:33:01	10:33:01	150	0054_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812838	caaLH	DHFL5	181.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:25:17	10:44:01	150	0053_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812837	caaLG	DHFL5	182.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:24:45	10:25:17	150	0052_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812831	caaLx	DHFL5	181.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:23:15	10:24:45	150	0051_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812825	caaLq	DHFL5	182.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:22:44	10:23:15	150	0050_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812817	caaLe	DHFL5	176.00	buy	1	限價	0	0	cancel...		10:21:01	10:33:01	150	0049_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812762	caaKQ	DHFL5	181.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:17:32	10:22:44	150	0048_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812758	caaKM	DHFL5	182.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:17:19	10:17:32	150	0047_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812748	caaKJ	DHFL5	181.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:17:00	10:17:19	150	0046_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812745	caaKI	DHFL5	182.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:16:53	10:17:00	150	0045_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812741	caaKG	DHFL5	181.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:16:52	10:16:53	150	0044_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812733	caaKA	DHFL5	182.50	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:16:48	10:16:52	150	0043_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812566	caaIO	DHFL5	182.00	sell	1	限價	0	0	live		10:05:44	10:05:44	150	0042_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812557	caaIK	DHFL5	181.00	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:05:00	10:05:44	150	0041_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812553	caaIJ	DHFL5	182.00	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:04:36	10:05:00	150	0040_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812533	caaly	DHFL5	181.00	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:02:47	10:04:36	150	0039_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812521	caalo	DHFL5	182.00	sell	1	限價	0	0	cancel...		10:01:14	10:02:47	150	0038_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812452	caaHM	DHFL5	181.00	sell	1	限價	0	0	cancel...		09:55:27	10:01:14	150	0037_DH...		
<input type="checkbox"/>	16812430	caaHN	DHFL5	182.00	sell	1	限價	0	0	cancel...		09:55:20	09:55:27	150	0036_DH...		

1. 刪單：點核取方塊立即刪單（不提示）
2. 券商單號：券商標示的委託單號
3. 委託書號：交易所的委託書號
4. 商品名：
5. 委託價：
6. 買 / 賣：
7. 委託量：
8. 市 / 限：
9. 成交均價：
10. 成交量：
11. 狀態：新增 new, 有效 live, 部份成交 partially\_fillid, 完全成交 filled, 刪單中 canceling, 已刪單 canceled, 失敗 failed
12. 附註：失敗時券商回傳原因
13. 委託時間
14. 異動時間
15. WEBID
16. ClientID：由本程式下出的定單都有 ClientID

### 三、報價表

移	商品名	市場別	結算日	現價	開盤價	最高價	最低價	買價	買量	賣價	賣量	漲停價	跌停價	單量	轉換比率	時間	五檔
<input checked="" type="checkbox"/>	TXFH5	fut	20250820	23219	23108	23264	23032	23219	1	23220	4	25679	21011	1	200	10:55:30	查看
<input type="checkbox"/>	MXFH5	fut	20250820	23219	23114	23265	23032	23218	10	23220	10	25679	21011	1	50	10:55:30	查看
<input type="checkbox"/>	TMFH5	fut	20250820	23218	23120	23263	23030	23217	4	23218	3	25679	21011	1	10	10:55:30	查看
<input type="checkbox"/>	DHFFH5	fut	20250820	180	179.5	180.5	178	180	63	180.5	117	199.5	163.5	10	2000	10:55:05	查看
<input type="checkbox"/>	QFFH5	fut	20250820	1130	1125	1130	1125	1125	618	1130	150	1255	1035	10	100	10:54:50	查看
<input type="checkbox"/>	DXFL5	fut	20251217	120	120	120	120	119.5	2	120.5	2	136.5	112.5	1	2000	10:32:11	查看
<input type="checkbox"/>	DXFH5	fut	20250820	120	122	122.5	119.5	120	62	120.5	54	136	112	1	2000	10:52:15	查看
<input type="checkbox"/>	DHFL5	fut	20251217	180	179	180.5	178.5	180	63	180.5	12	200	164	2	2000	10:38:17	查看

1. 移除：點下後移除報價
2. 商品名
3. 市場別：目前都是期貨市場 fut
4. 結算日
5. 現價
6. 開盤價
7. 最高價
8. 最低價
9. 買價
10. 買量
11. 賣價
12. 賣量
13. 漲停價
14. 跌停價
15. 單量
16. 轉換比率：報價轉換台幣之比率
17. 時間：最近成交時間
18. 五檔：按下「查看」顯示五檔報價