

GOLD_MORGAN

QUANT V3.0.0

量化交易平台用户操作手册

中文完整版 - 含全部界面截图

软件	Gold_Morgan Quant V3.0.0
版本	2026-09
时间基准	纽约时间 (NY/ET)
文档类型	用户操作手册

本手册用于说明软件界面与操作流程，不构成投资建议。使用真实账户前，建议先在 IBKR Paper Account 中熟悉下单、撤单、止损、策略和自动交易流程。

目录

1. TWS 连接与启动
2. 主交易界面
3. MARKET BOARD 行情看板
4. SCAN SETTINGS 扫描设置
5. GLOBAL SETTINGS 全局设置
6. LICENSE 授权管理
7. FOLLOW SETTINGS / PUSHER 跟单通讯
8. FOLLOW ACCESS / BINDING 跟单绑定
9. TELEGRAM 通知与消息管理
10. AUTO TRADE WATCH 与 Strategy 1
11. Strategy 2 板块广度策略
12. PRO TRADE 专业交易面板

快速使用原则

- 先登录并连接 TWS，再启动/连接 Quant。
- 任何下单前先确认 Symbol、账户、数量、时段和订单类型。
- 遇到 BLOCKED / DATA BLOCK / UNKNOWN / INVALID 时先查原因，不要连续重复点击。
- 自动策略建议先 WATCH，再 Paper 测试，最后才开启 AUTO。
- 订单与仓位最终以 IBKR Broker 实际状态为准。

1. TWS 连接与启动

启动 Gold_Morgan Quant 后，先完成 Interactive Brokers TWS API 连接。

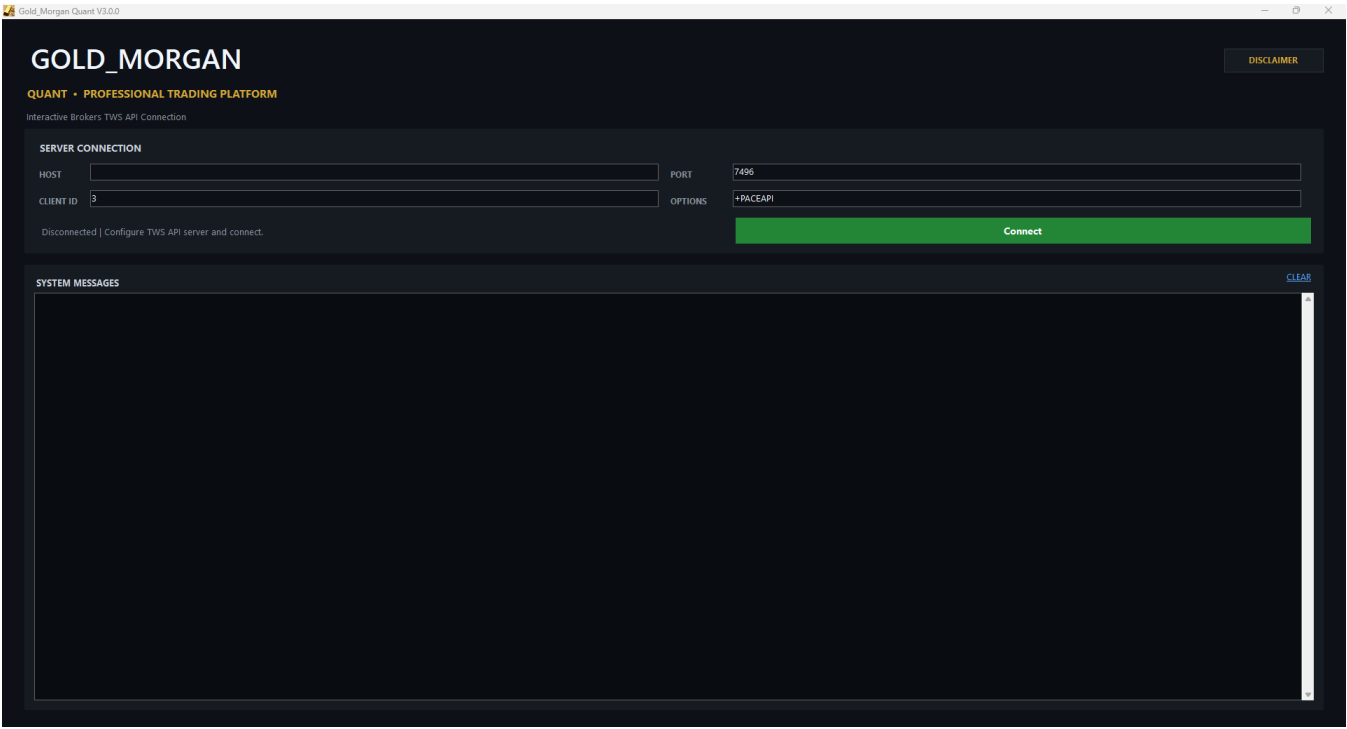


图 1 - SERVER CONNECTION 启动连接界面

推荐启动顺序 先启动并登录 IBKR TWS -> 确认 TWS API 已开启 -> 启动 Quant -> 检查 HOST/PORT -> 点击 Connect。

界面 / 参数	说明
HOST	TWS 与 Quant 在同一台电脑时建议填写 127.0.0.1（或 localhost）。
PORT	必须与 TWS API Socket Port 一致。常见默认值：Live 7496，Paper 7497；如 TWS 已修改，以实际设置为准。
CLIENT ID	用于区分不同 API 客户端。普通用户可保持默认值；多程序同时连接时避免重复。
OPTIONS	通常保持系统默认，例如 +PACEAPI。
Connect	建立 Quant 与 TWS 的 API 连接。
SYSTEM MESSAGES	查看连接、API、错误和系统运行信息。技术支持时建议截图此区域。
CLEAR	仅清空屏幕日志显示，不会删除账户、订单或交易数据。
DISCLAIMER	查看风险提示和免责声明。

1. 确认 TWS 已登录。
2. 确认 Enable ActiveX and Socket Clients / Socket Port 等 API 设置已正确开启。
3. 点击 Connect 后确认界面不再显示 Disconnected。
4. 若失败，优先检查 TWS 状态、HOST、PORT、防火墙和 API 权限。

2. 主交易界面

主界面由顶部状态栏、左侧股票列表、中间 K 线、右侧交易面板以及底部 Positions / Orders 组成。

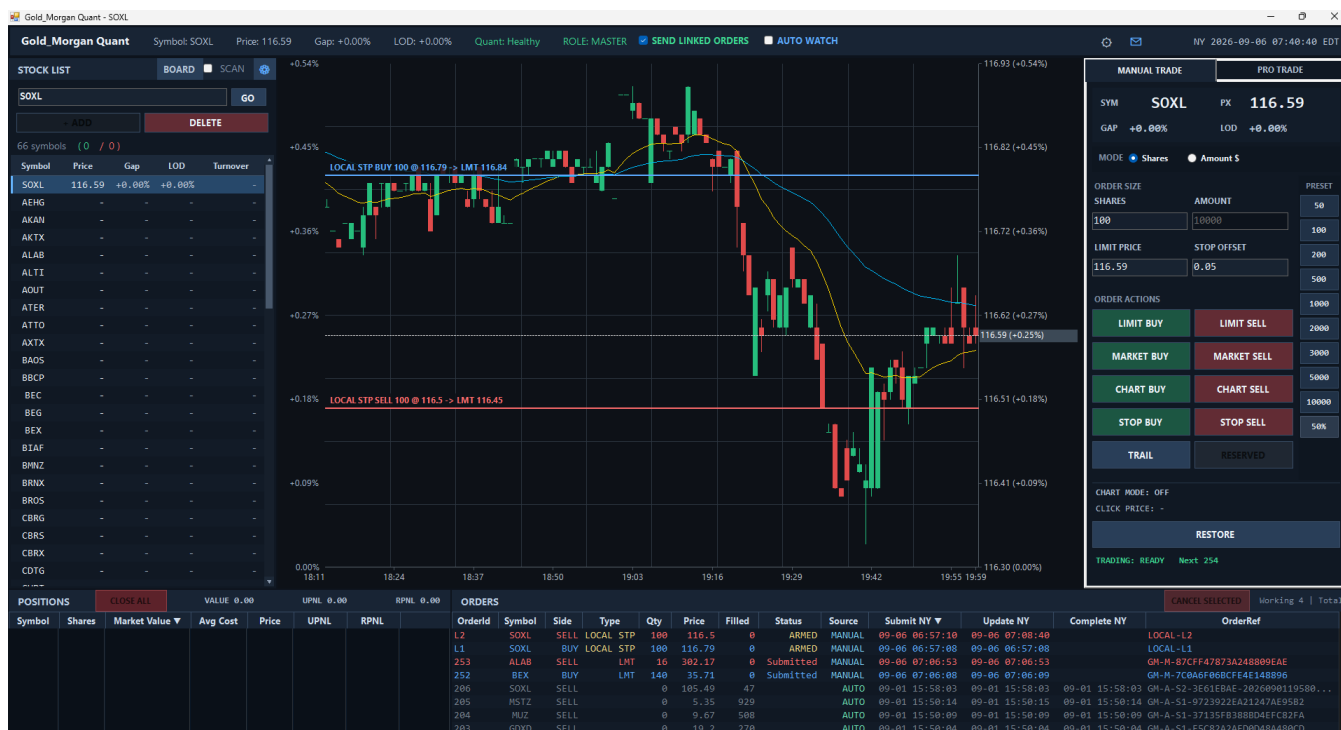


图 2 - Gold_Morgan Quant 主交易界面

界面 / 参数

说明

顶部状态栏

显示 Symbol、Price、Gap、LOD、Quant Health、ROLE、SEND LINKED ORDERS、AUTO WATCH 和纽约时间。

STOCK LIST

点击股票切换；输入代码后 GO 快速定位；+ADD / DELETE 管理列表。

BOARD / SCAN

BOARD 打开行情看板；SCAN 控制自动扫描。

中央 K 线

显示 1m K 线、EMA20/EMA60、当前价格与订单/Stop 价格线。

MANUAL TRADE

Shares / Amount 模式；Limit、Market、Chart、Stop 等手动交易。

PRESET

50、100、200、500、1000、2000、3000、5000、10000、50% 等快捷数量。

POSITIONS

查看 Symbol、Shares、Market Value、Avg Cost、Price、UPNL、RPNL。

ORDERS

查看 OrderId、Symbol、Side、Type、Qty、Price、Filled、Status、Source、时间及 OrderRef。

CLOSE ALL

全部平仓，高风险操作，执行前确认账户与仓位。

CANCEL SELECTED

撤销选中的 Working Order，并检查 Status 确认 Broker 已接受撤单。

状态识别 TRADING: READY 表示交易模块准备完成。若出现 BLOCKED、Disconnected、UNKNOWN 等状态，先处理原因再下单。

Source 可帮助识别订单来源，例如 MANUAL（手动）和 AUTO（自动策略）。UPNL 为未实现盈亏，RPNL 为已实现盈亏。

3. MARKET BOARD 行情看板

用于盘中快速观察强势股、从低点反弹、创新高/低、Scanner 新票、成交和持仓。

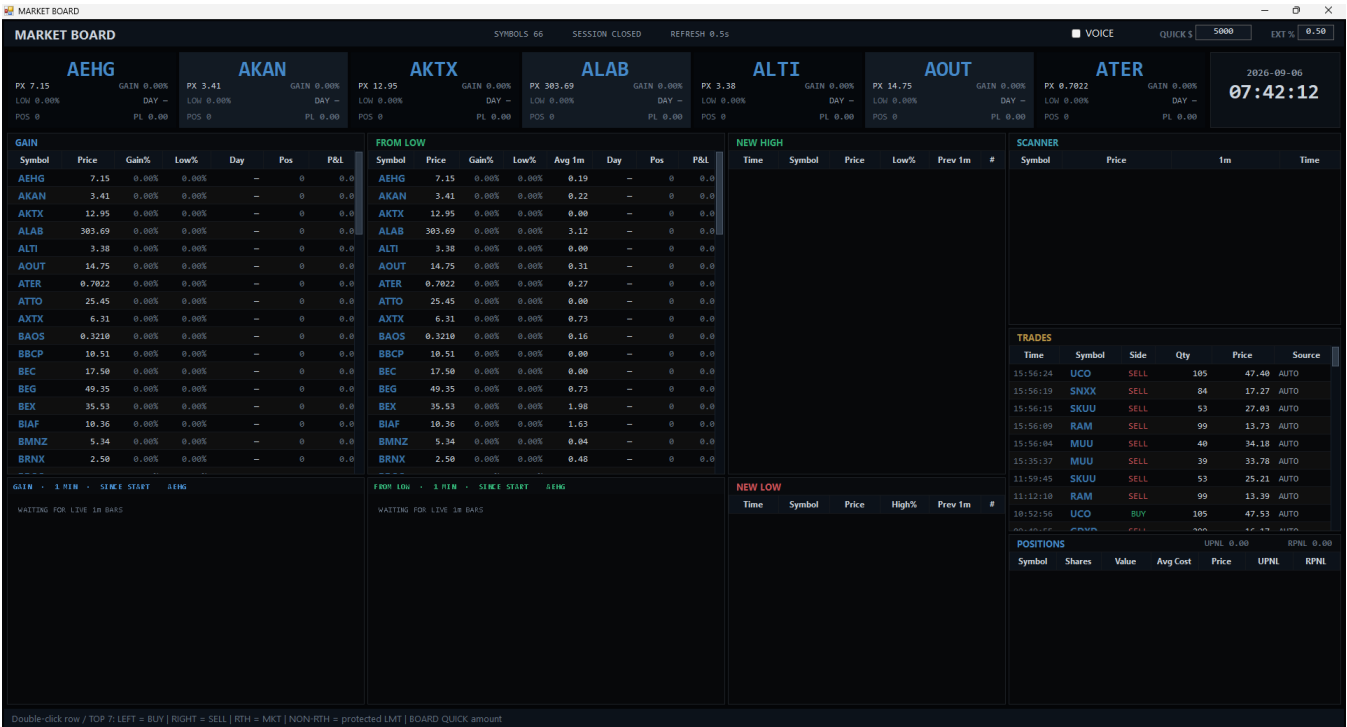


图 3 - MARKET BOARD 行情看板

界面 / 参数

说明

TOP 7

顶部重点股票卡片，显示 PX、GAIN、LOW、DAY、POS、PL。左键双击可 BUY，右键双击可 SELL。

QUICK \$

设置 Board 快速交易的资金金额。

VOICE

勾选开启语音提醒，取消勾选关闭。

GAIN

按进入本次 Quant Runtime 后的整体涨幅观察强势股。

FROM LOW

观察股票从 Runtime Low 反弹的幅度，并结合 Avg 1m 活跃度。

GAIN / FROM LOW - 1 MIN

实时 1 分钟强弱变化；等待有效 1m 数据时会显示 WAITING FOR LIVE 1m BARS。

NEW HIGH / NEW LOW

记录 Runtime 内创新高/创新低的时间、价格、前 1m 成交额及次数。

SCANNER

显示新扫描进入 Quant 的股票。

TRADES

显示最近成交的 Time、Symbol、Side、Qty、Price、Source。

POSITIONS

查看当前 Board 相关持仓与 UPNL/RPNL。

数据口径 Gain、Low、High 等 Runtime 指标从股票进入本次 Quant Runtime 后开始计算，不追溯启动前的全天历史。

RTH 正常交易时段可使用 MKT；Non-RTH 盘前/盘后使用受保护的 LMT 逻辑，以降低低流动性时的价格风险。

4. SCAN SETTINGS 扫描设置

设置盘前、盘中和盘后的自动扫描条件。

SCAN SETTINGS

Common

Minimum Price: 0.10 Maximum Price: 500.00 Scan Interval (sec): 60

Pre-Market

Results: 20 Min Gain %: 10.00 Min USD Volume: 200,000

Regular Hours

Results: 20 Min Gain %: 10.00 Min USD Volume: 500,000

USD Volume / Min: 30,000

After Hours

Results: 10 Min Gain %: 10.00 Min USD Volume: 300,000

Restore Defaults Cancel Save

图 4 - SCAN SETTINGS

界面 / 参数	说明
Minimum / Maximum Price	允许扫描的最低/最高股价范围。
Scan Interval (sec)	自动扫描间隔，示例 60 表示每 60 秒执行一次。
Pre-Market Results	盘前每轮最多返回的股票数量。
Pre-Market Min Gain %	盘前最低涨幅门槛。
Pre-Market Min USD Volume	盘前最低美元成交额。
Regular Hours Results	盘中每轮最多返回的股票数量。
Regular Hours Min Gain %	盘中最低涨幅门槛。

界面 / 参数	说明
Regular Hours Min USD Volume	盘中最低美元成交额。
USD Volume / Min	盘中最低每分钟美元成交额，用于过滤当前不活跃的股票。
After Hours	盘后 Results、Min Gain %、Min USD Volume 条件。
Restore Defaults	恢复系统默认扫描参数。
Save / Cancel	保存并应用 / 放弃未保存修改。

建议 第一次使用先保留默认参数。结果太多时提高 Min Gain % 或成交额门槛；结果太少时再适当降低。

5. GLOBAL SETTINGS 全局设置

集中管理 License、Linked Account、Telegram、Auto Trade 和语言。

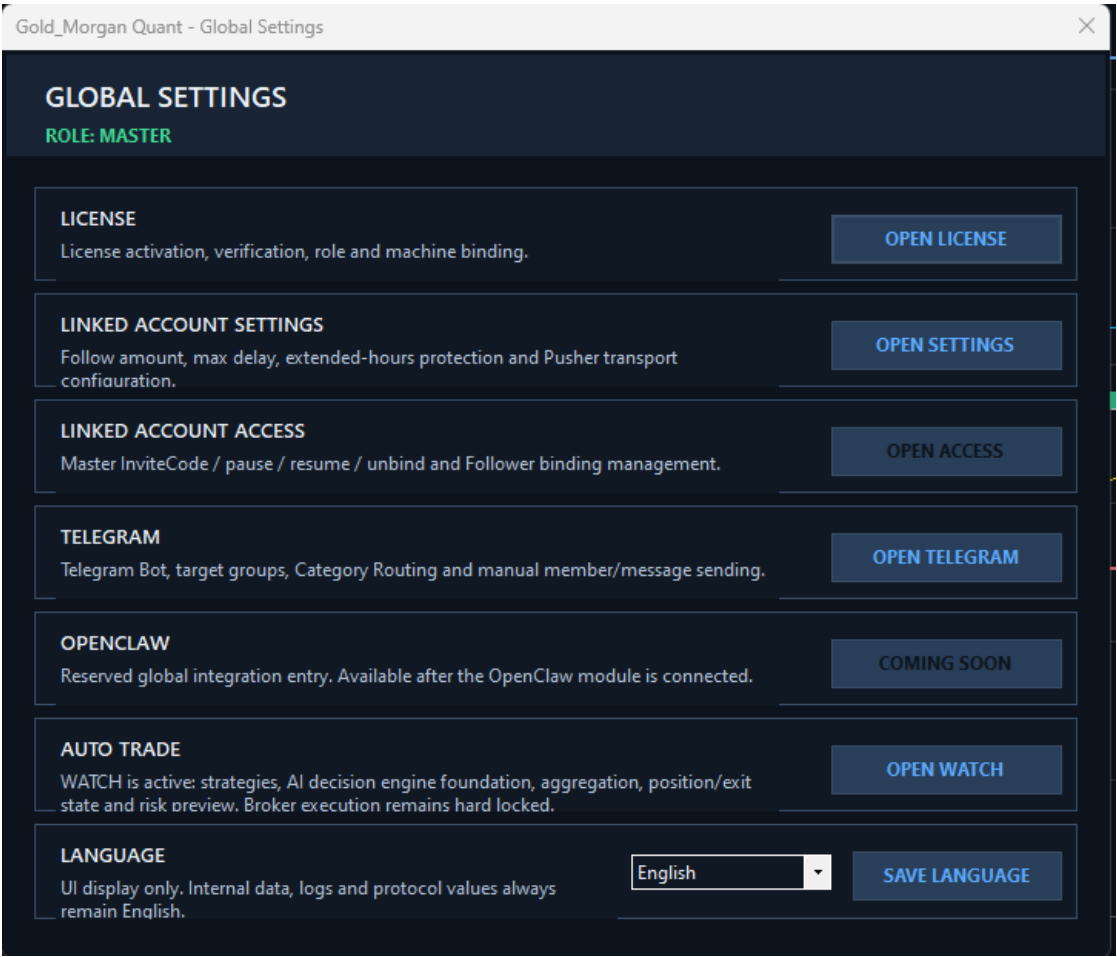


图 5 - GLOBAL SETTINGS

界面 / 参数	说明
ROLE	显示当前 License 角色，例如 MASTER / PRIMARY、LINKED 或独立角色。
LICENSE - OPEN LICENSE	激活、验证、查看角色和设备绑定。
LINKED ACCOUNT SETTINGS	配置 Follow/Pusher 通讯参数。
LINKED ACCOUNT ACCESS	管理 Invite Code、绑定、解绑等 Follow Access。
TELEGRAM	配置 Bot、群组、Routing、Workbench 和 Health。
OPENCLAW	当前版本入口按界面状态为准；未开放时显示 COMING SOON。
AUTO TRADE - OPEN WATCH	进入自动策略监控。
LANGUAGE	切换 UI 显示语言，内部数据、日志和协议值保持英文。

如果某个功能按钮不可用，先检查当前 License 是否包含相应 Entitlement / 权限。

6. LICENSE 授权管理

查看正式授权、试用状态、角色、设备绑定和离线宽限。

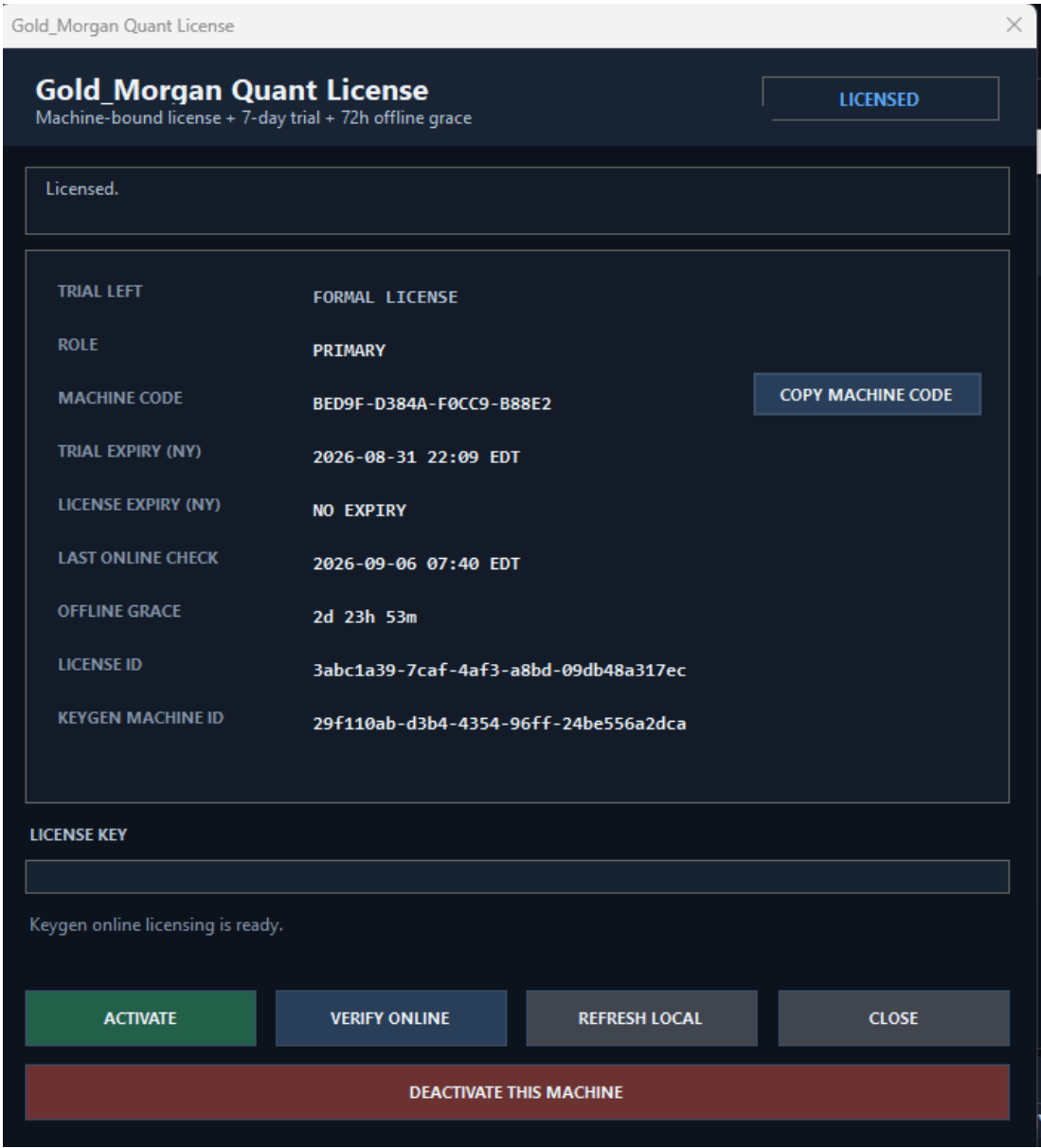


图 6 - Gold_Morgan Quant License

界面 / 参数	说明
LICENSED	当前设备已经成功授权。
TRIAL LEFT / FORMAL LICENSE	显示剩余试用或正式 License 状态。
ROLE	当前授权角色，例如 PRIMARY。
MACHINE CODE	本机设备识别码，可通过 COPY MACHINE CODE 提供给技术支持。

界面 / 参数	说明
TRIAL EXPIRY	试用到期时间。正式 License 用户主要看正式授权状态。
LICENSE EXPIRY	正式 License 到期信息；NO EXPIRY 表示没有固定日期。
LAST ONLINE CHECK	最近一次成功在线验证的纽约时间。
OFFLINE GRACE	网络暂时不可用时剩余可离线使用时间，界面说明为 72h 机制。
LICENSE ID / KEYGEN MACHINE ID	授权系统内部 ID，普通用户无需修改。
LICENSE KEY + ACTIVATE	首次激活时粘贴 License Key 后点击 ACTIVATE。
VERIFY ONLINE	立即在线验证并刷新授权状态。
REFRESH LOCAL	重新读取本地授权状态。
DEACTIVATE THIS MACHINE	解除当前电脑绑定。正常使用不要随意点击。

授权异常处理 确认联网 -> VERIFY ONLINE -> REFRESH LOCAL -> 检查是否恢复 LICENSED。仍失败时提供 Machine Code 和错误截图。

7. FOLLOW SETTINGS / PUSHER 跟单通讯设置

用于 Primary 与 Linked Account 之间的 Follow/Pusher 实时通讯。

Gold_Morgan Quant - Follow Settings

×

FOLLOW SETTINGS / PUSHER

LICENSE ROLE PRIMARY

PRIMARY: SEND LINKED ORDERS is controlled from the main header. Configure PRIMARY identity/network settings here.

PRIMARY SETTINGS

SEND LINKED ORDERS is controlled from the main Quant header next to ROLE.

PRIMARY ID (LICENSE)

GM-M-25D2660367EFEF43

PRIMARY Identity is derived from the current Gold_Morgan PRIMARY LICENSE and cannot be edited. Followers bind through FOLLOW ACCESS + one-time InviteCode.

PUSHER NETWORK - PUBLIC CHANNEL TEST TRANSPORT

APP ID (PRIMARY)

APP KEY

CLUSTER

1896794

93b987f7671054b9ba44

us3

APP SECRET (PRIMARY ONLY)

.....

PUBLIC CHANNEL

EVENT

gold-morgan-quant-follow

gm-follow

AUTO CONNECT: Pusher connects when Quant starts. Saving Follow/Pusher settings automatically reconnects once with the new configuration.

SEND TEST

No auth server is configured, so the current transport supports public channels only. TEST messages never execute Broker orders. App Secret is never required on LINKED.

NETWORK: CONNECTED

TX 0

RX 0

TEST 0

BIND 0

TRADE 0

REJECT 0

TEST - -

BIND - -

TRADE - -

REJECT - -

Encrypted Follow/Pusher configuration loaded.

CLOSE

SAVE

图 7 - FOLLOW SETTINGS / PUSHER

界面 / 参数	说明
LICENSE ROLE	显示当前角色，例如 PRIMARY。
PRIMARY ID (LICENSE)	由当前 Primary License 派生的身份，不可手动编辑。

界面 / 参数	说明
---------	----

SEND LINKED ORDERS	由主界面顶部开关控制，不在本窗口开启。
APP ID / APP KEY / CLUSTER	Pusher 应用连接参数。
APP SECRET	Primary 端敏感参数，不要公开或发送给无关人员。
PUBLIC CHANNEL / EVENT	Follow 消息使用的 Channel / Event。普通用户按配置保持一致。
AUTO CONNECT	Quant 启动后自动连接；保存新配置后按新参数重新连接。
SEND TEST	发送通讯测试；测试不会执行 Broker 订单。
NETWORK: CONNECTED	表示 Pusher 当前连接正常。
TX / RX / TEST / BIND / TRADE / REJECT	用于观察消息和排错统计。
SAVE / CLOSE	保存配置 / 关闭窗口。

安全 APP SECRET 等敏感配置不要出现在公开截图、会员群或公开视频中。

8. FOLLOW ACCESS / BINDING 跟单账户绑定

Linked Account 使用 Invite Code 与一个 Primary Account 建立有效绑定。

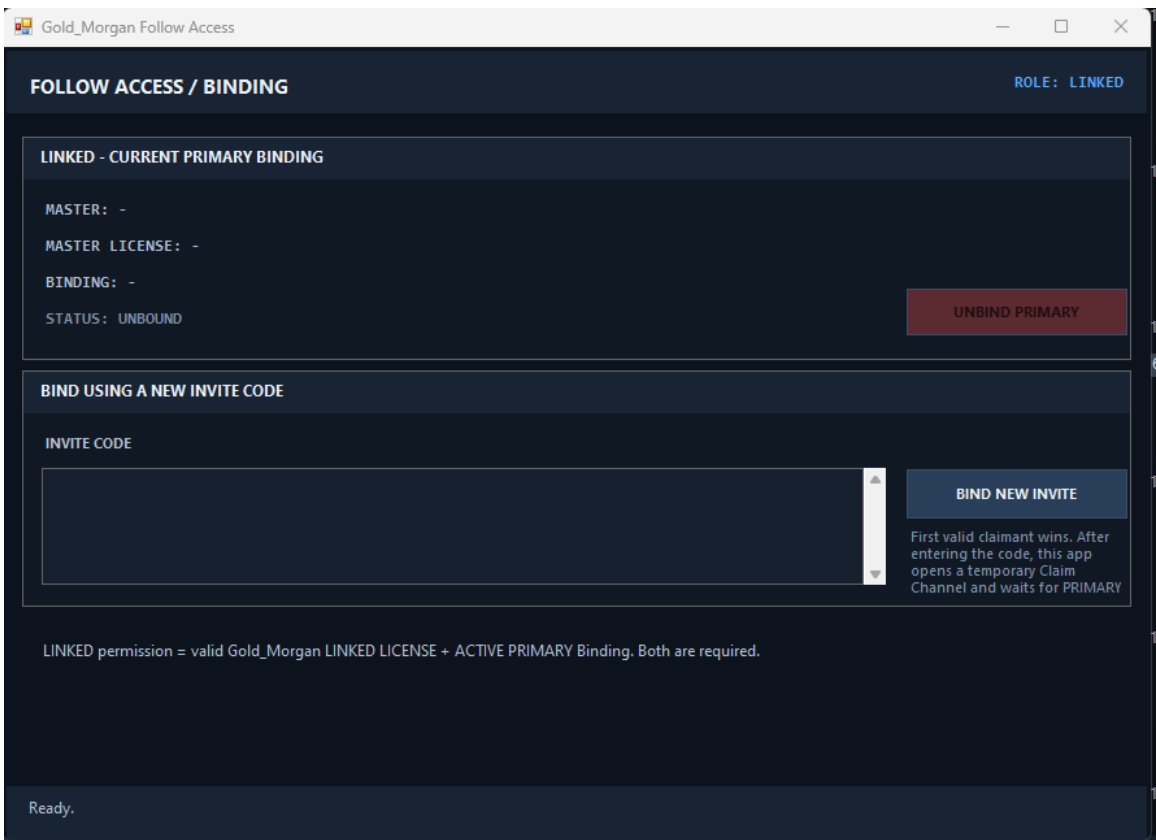


图 8 - FOLLOW ACCESS / BINDING

界面 / 参数	说明
ROLE: LINKED	表示当前账户使用 Linked 角色。
MASTER / MASTER LICENSE / BINDING	显示当前 Primary/Master 的绑定信息。
STATUS: UNBOUND	尚未绑定任何 Primary，不能正式执行 Linked 跟单。
INVITE CODE	粘贴 Primary 提供的一次性/临时邀请码。
BIND NEW INVITE	提交邀请码并进入 Claim/绑定流程。
First valid claimant wins	同一邀请码由第一个成功 Claim 的有效 Linked 用户获得。
UNBIND PRIMARY	解除当前 Linked 与 Primary 的绑定。重新绑定需要新的有效 Invite Code。

Linked 生效条件 有效 Gold_Morgan LINKED License + ACTIVE PRIMARY Binding，两者缺一不可。

5. 向 Primary 获取新的 Invite Code。
6. 打开 FOLLOW ACCESS，将邀请码粘贴到 INVITE CODE。
7. 点击 BIND NEW INVITE，并保持 Quant 和网络在线。
8. 绑定完成后确认 STATUS 不再是 UNBOUND，并核对 Primary 信息。

9. TELEGRAM 通知与消息管理

配置 Telegram Bot、群组、消息路由、手动消息和健康诊断。

Gold_Morgan Quant - Telegram Settings

TELEGRAM NOTIFICATIONS

Bot + Groups + Routing + Sender + Workbench + Health. MEMBER groups stay simplified; ADMIN groups keep full diagnostics.

☒ **ENABLE TELEGRAM**

BOT TOKEN

STATUS

ED

TEST BOT

MANAGE GROUPS

MESSAGE ROUTING

MESSAGE WORKBENCH

HEALTH / DIAG

GROUPS 3 | M 3 | A 0 | ON 3

ROUTES ENABLED: 9 / 12

HEALTH: HEALTHY | Q 0/500 | HW 1 | Sent 1 | Fail 0 | 429 0 | Retry 0 | Drop 0
Telegram Sender is healthy.

SAVE

CLOSE

图 9A - TELEGRAM NOTIFICATIONS 主设置

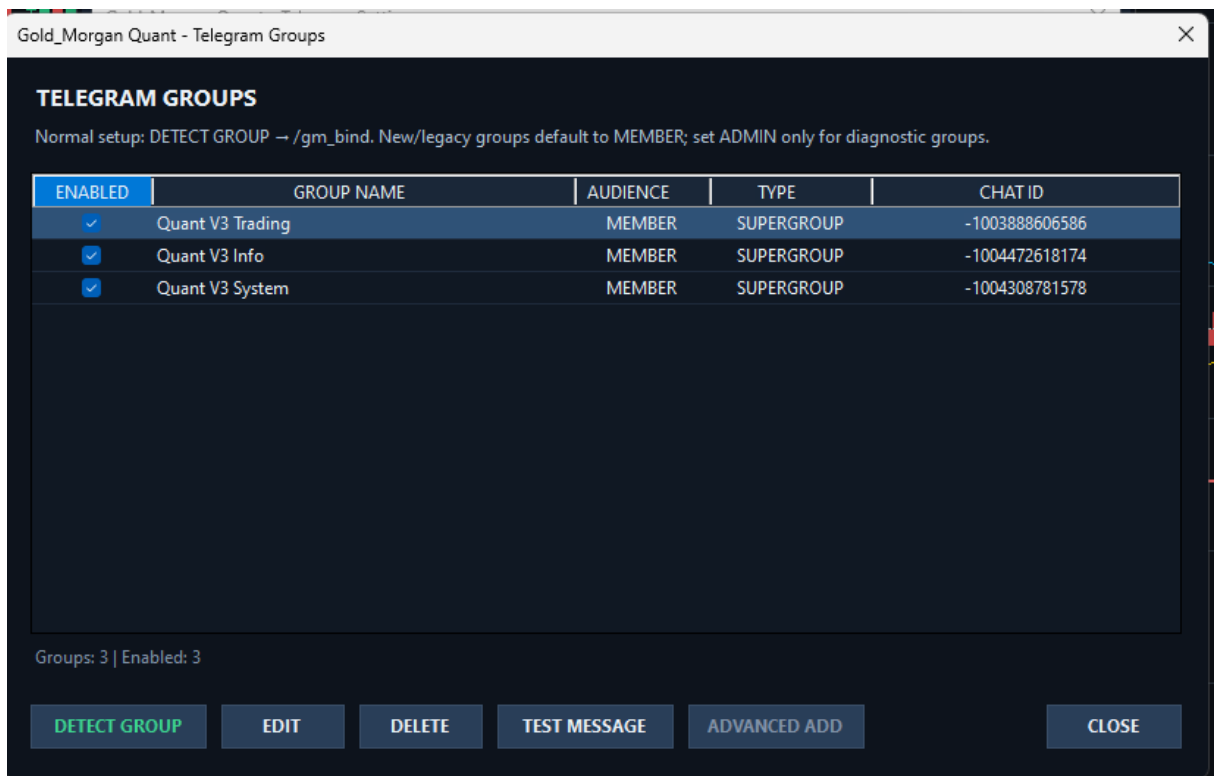


图 9B - TELEGRAM GROUPS 群组管理

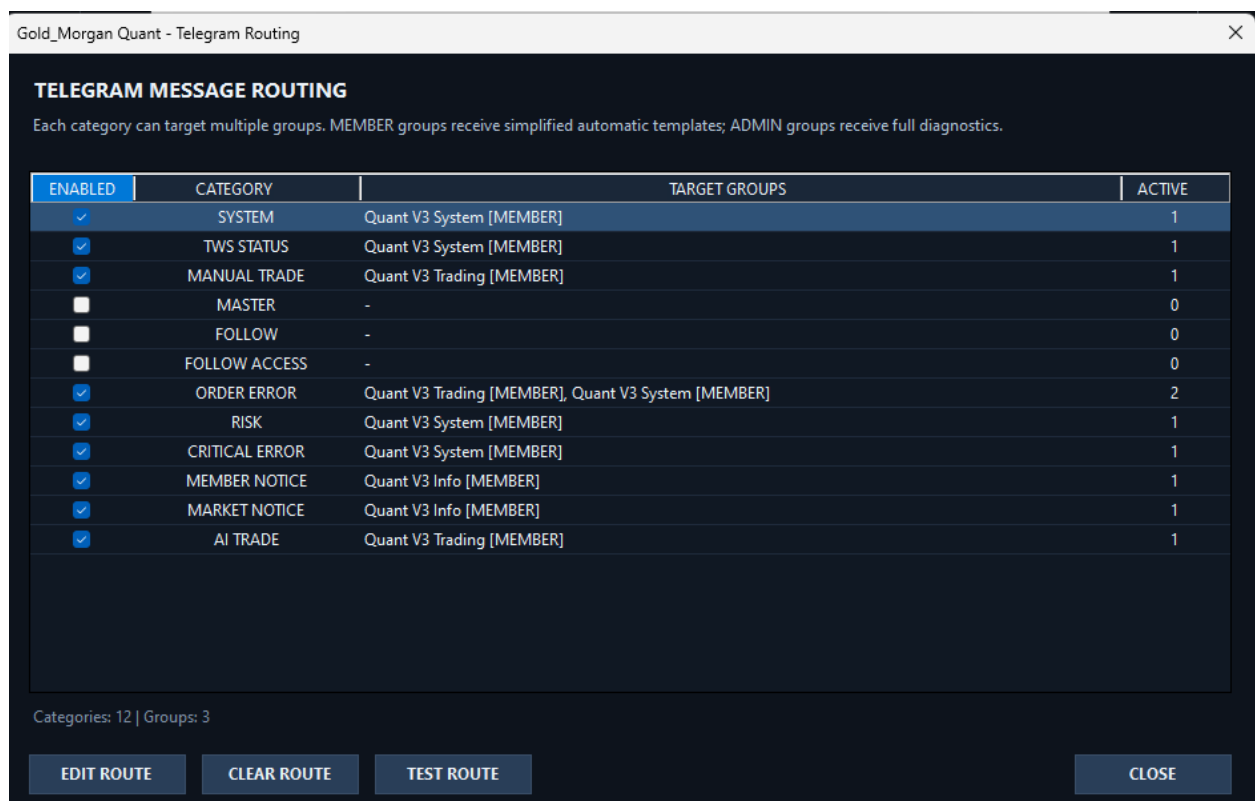


图 9C - TELEGRAM MESSAGE ROUTING 消息路由

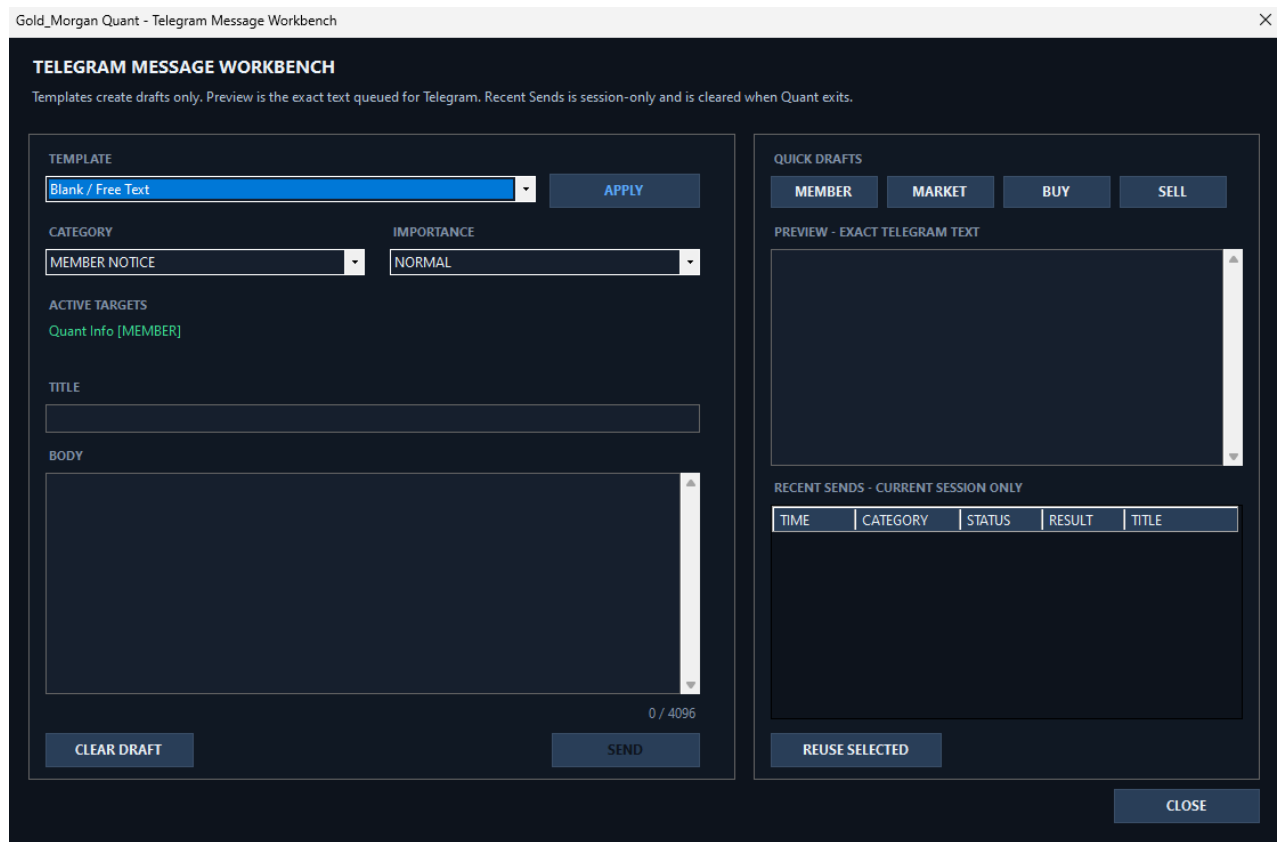


图 9D - TELEGRAM MESSAGE WORKBENCH 手动消息中心

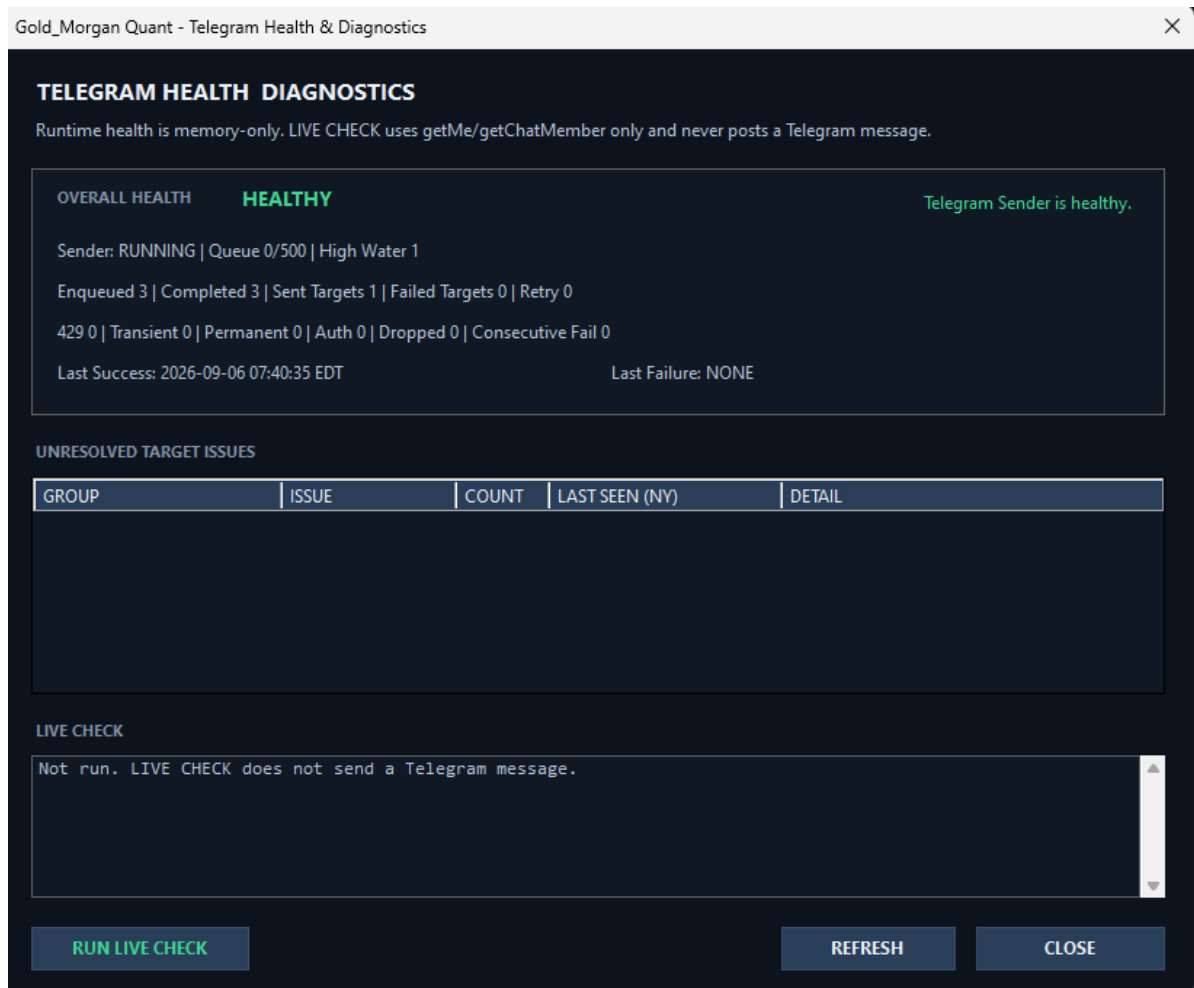


图 9E - TELEGRAM HEALTH DIAGNOSTICS 健康检查

界面 / 参数	说明
ENABLE TELEGRAM	开启/暂停 Telegram Sender，修改后 SAVE。
BOT TOKEN	Telegram Bot Token，等同于 Bot 密钥，不要公开。
TEST BOT	检查 Bot 是否可以正常连接 Telegram。
MANAGE GROUPS	管理可发送的群组 and Chat ID。
DETECT GROUP	推荐绑定方法：将 Bot 加入群 -> 群内发送 /gm_bind -> Quant 点击 DETECT GROUP。
TEST MESSAGE	向选中群发送测试消息。
AUDIENCE	MEMBER 面向会员，ADMIN 可用于完整诊断信息。
MESSAGE ROUTING	决定不同 Category 发到哪些目标群。
EDIT ROUTE / CLEAR ROUTE / TEST ROUTE	编辑、清除和测试当前分类路由。
MESSAGE WORKBENCH	手工编辑和发送 Member/Market/Buy/Sell 等消息。
PREVIEW	显示将进入 Telegram 队列的最终文本。
RECENT SENDS	只记录当前 Quant Session，关闭 Quant 后清空。
HEALTH / DIAG	检查 Sender、Queue、Failed、Retry、Target Issues。
RUN LIVE CHECK	调用在线检查，不会向 Telegram 发送消息。

推荐群组结构 Quant V3 Trading（交易）、Quant V3 Info（会员/市场信息）、Quant V3 System（系统/TWS/风险）。

健康标准 看到 HEALTHY，且 Failed=0、没有 unresolved target issues，通常表示 Telegram 通讯正常。

10. AUTO TRADE WATCH 与 Strategy 1

使用 Watch 观察策略信号和风险；Strategy Settings 用于配置 S1 入场、执行、止损止盈和时间参数。

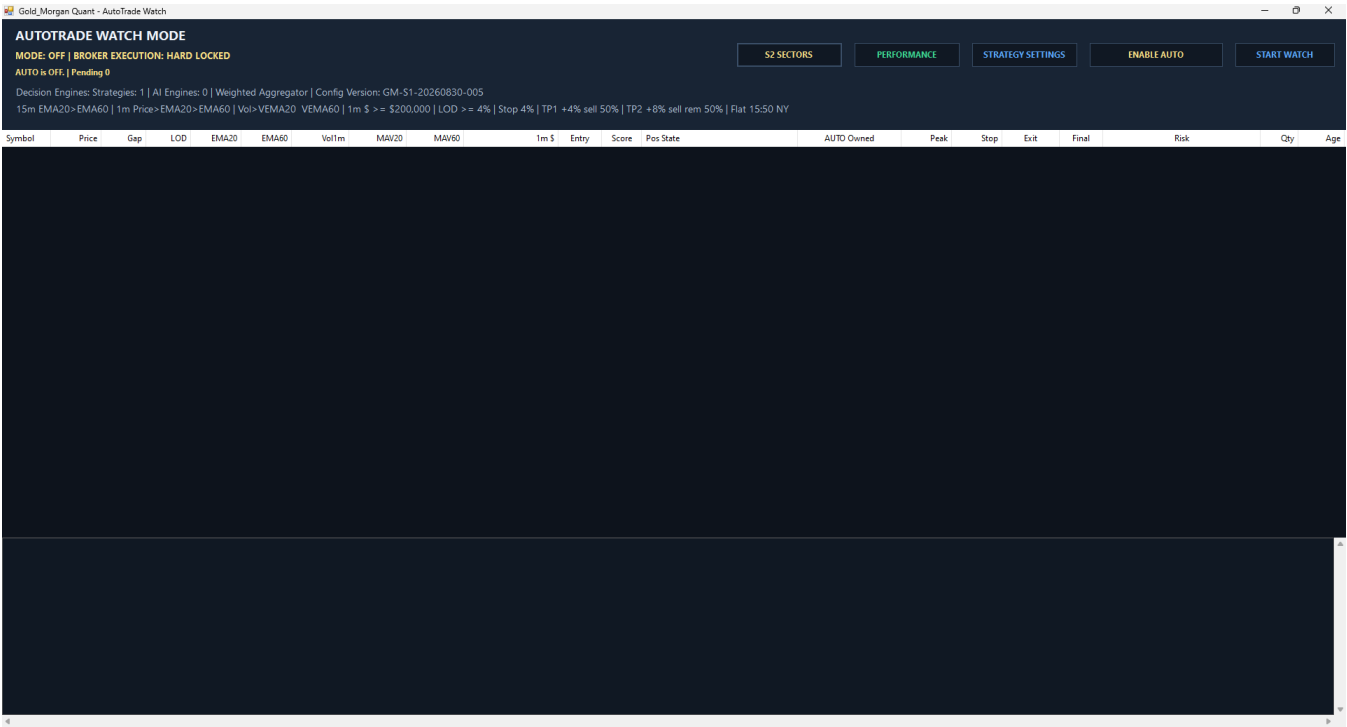


图 10A - AUTOTRADE WATCH MODE

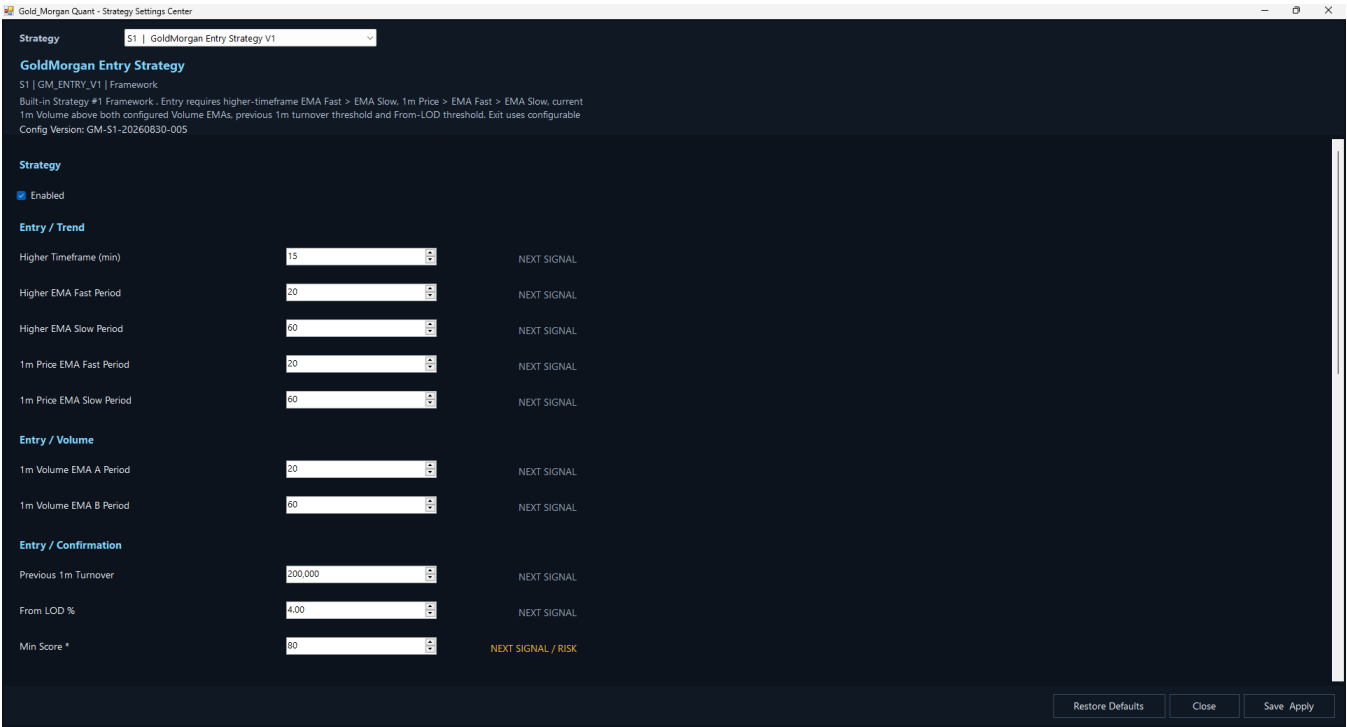


图 10B - S1 Entry / Trend / Volume / Confirmation

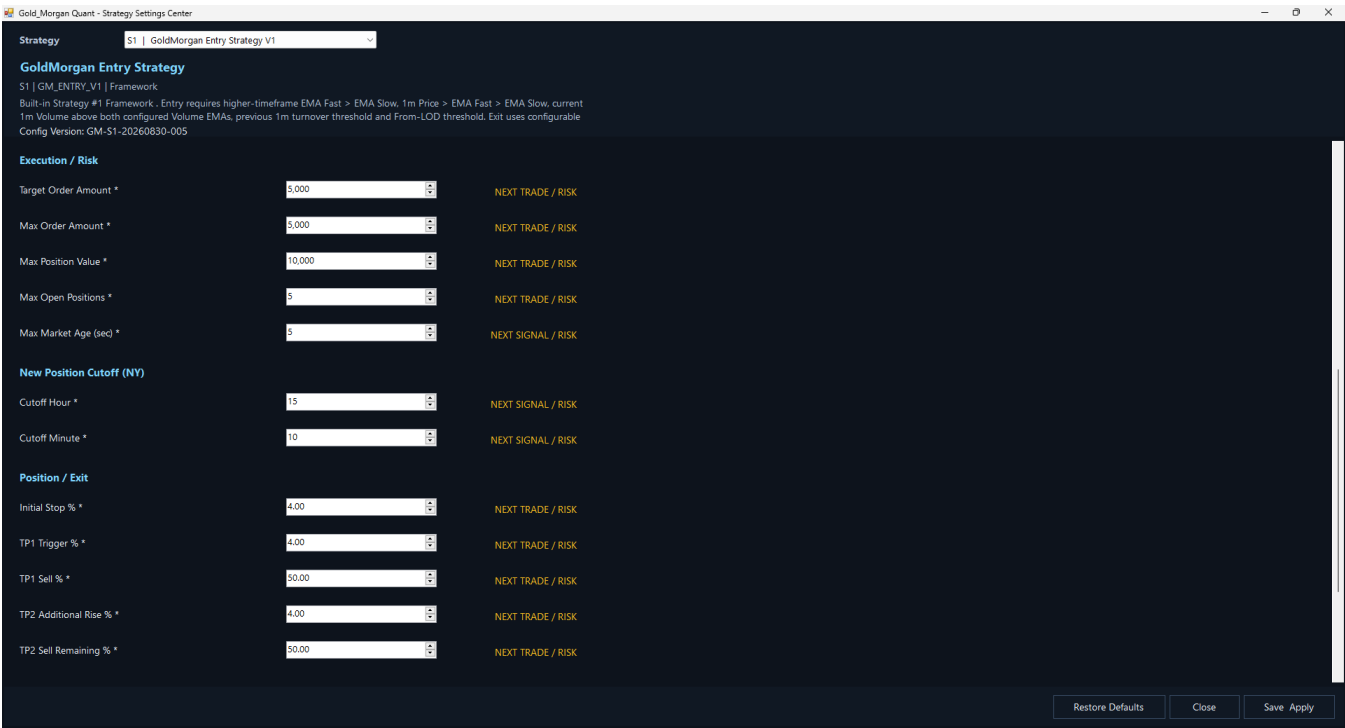


图 10C - S1 Execution / Risk 与 Position / Exit

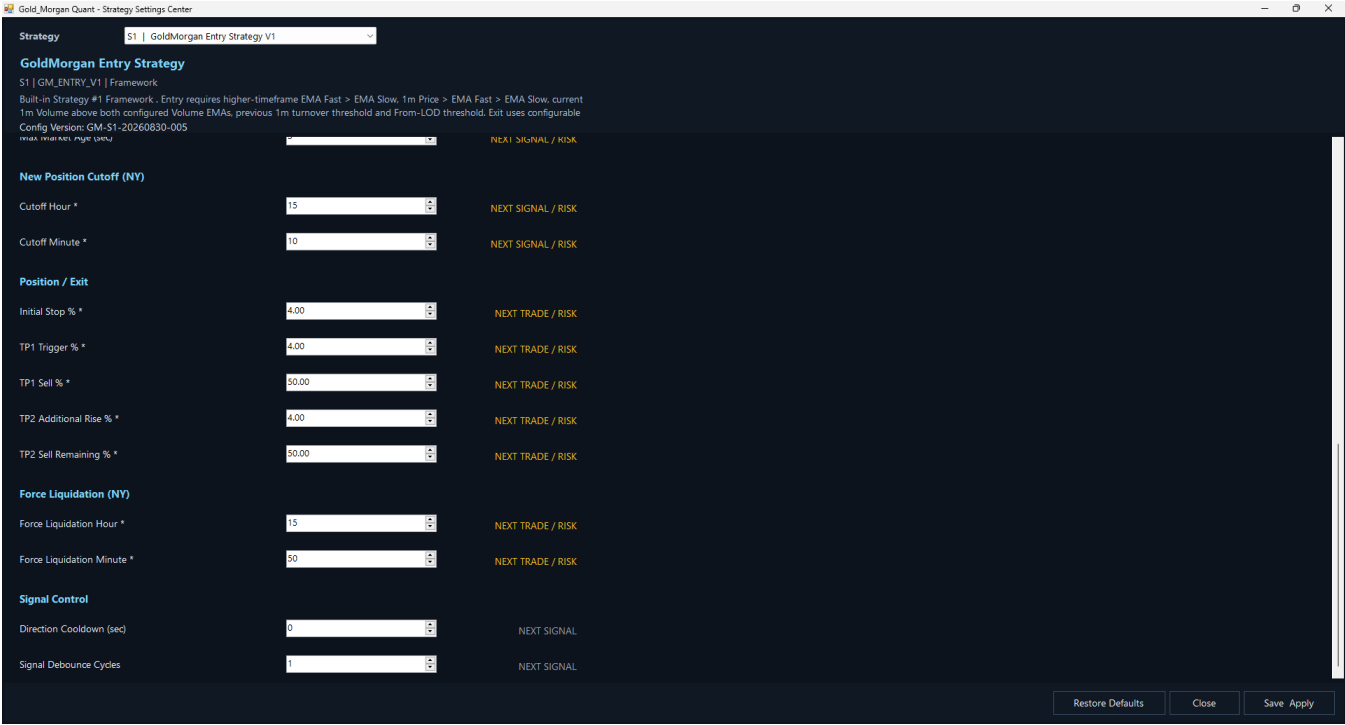


图 10D - S1 Position / Exit、Force Liquidation、Signal Control

界面 / 参数	说明
MODE / AUTO	OFF 表示 Auto 未开启；BROKER EXECUTION: HARD LOCKED 表示 Broker 自动执行被锁定。
START WATCH	开启信号、Score、风险和仓位状态监控；Watch 不等于自动下单。
ENABLE AUTO	允许自动策略执行。开启前确认 TWS、行情、金额、风险和账户状态。

STRATEGY SETTINGS

打开策略参数中心。

Higher Timeframe / EMA

示例 15m EMA20 / EMA60，用作更高周期趋势过滤。

1m Price EMA Fast/Slow

示例 EMA20 / EMA60，用作 1 分钟趋势结构。

1m Volume EMA A/B

用于当前 1m Volume 活跃度判断。

Previous 1m Turnover

上一分钟最低美元成交额门槛。

From LOD %

从日内低点上涨的最低幅度门槛。

Min Score

策略允许继续入场判断的最低综合评分。

Target / Max Order Amount

目标单笔金额 / 单笔最大金额。

Max Position Value / Max Open Positions

单股最大策略仓位 / 最大同时持仓数量。

Max Market Age

允许使用的市场数据最大年龄。

New Position Cutoff

纽约时间截止后不再开新仓。

Initial Stop / TP1 / TP2

初始止损和分阶段止盈参数。

Force Liquidation

纽约时间收盘前强制退出时间。

Direction Cooldown / Debounce

控制短时间重复方向信号和连续确认周期。

Save Apply / Restore Defaults

保存并应用 / 恢复默认。

当前示例逻辑 15m 趋势偏强 + 1m Price>EMA20>EMA60 + Volume 条件 + Prev 1m Turnover>=200,000 + From LOD>=4% + Score>=80，才进入后续 Entry/Risk 判断。

风险示例 截图示例：Target \$5,000；Max Position \$10,000；Initial Stop 4%；TP1 +4% 卖 50%；TP2 再上涨 4% 后按设置处理剩余仓位。参数可修改，实际行为以当前保存配置为准。

11. Strategy 2 板块广度策略

Strategy 2 通过一篮子成分股的同步强弱判断方向。当前预设实例为 Semiconductor / SOXX Top 15。

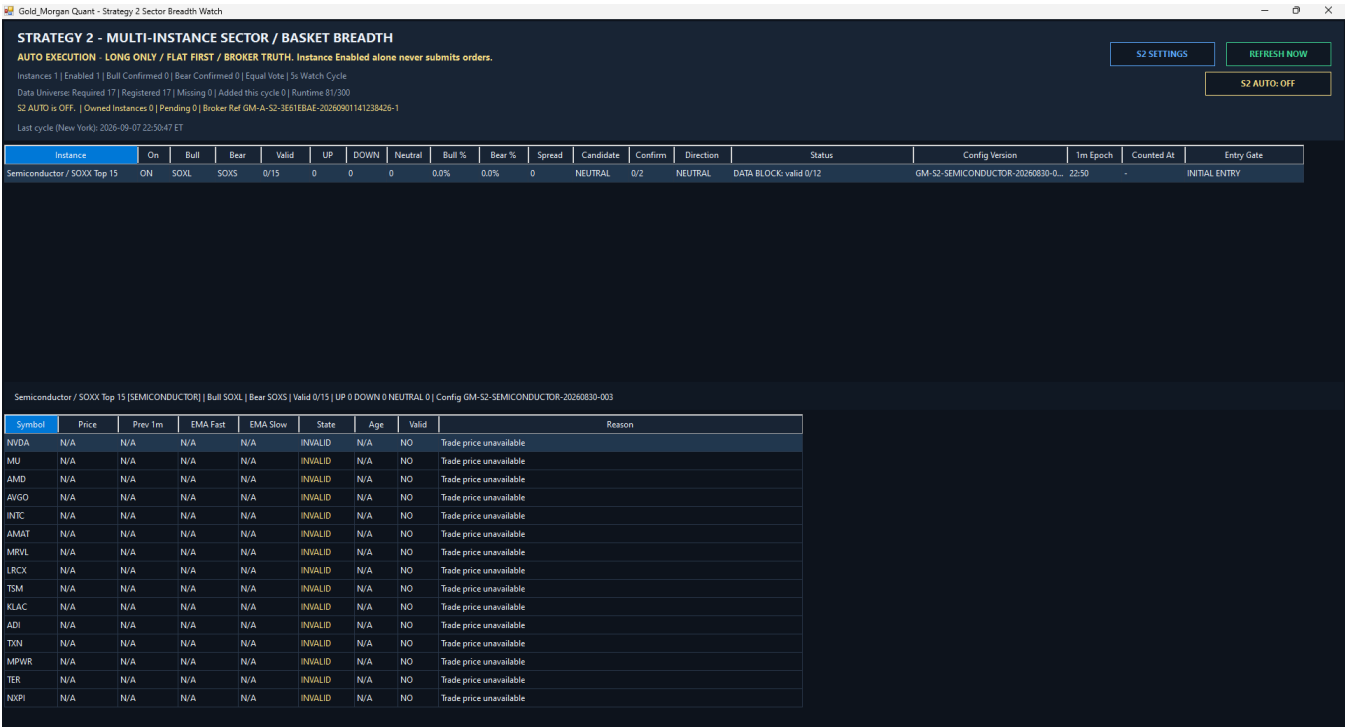


图 11A - Strategy 2 Sector / Basket Breadth Watch

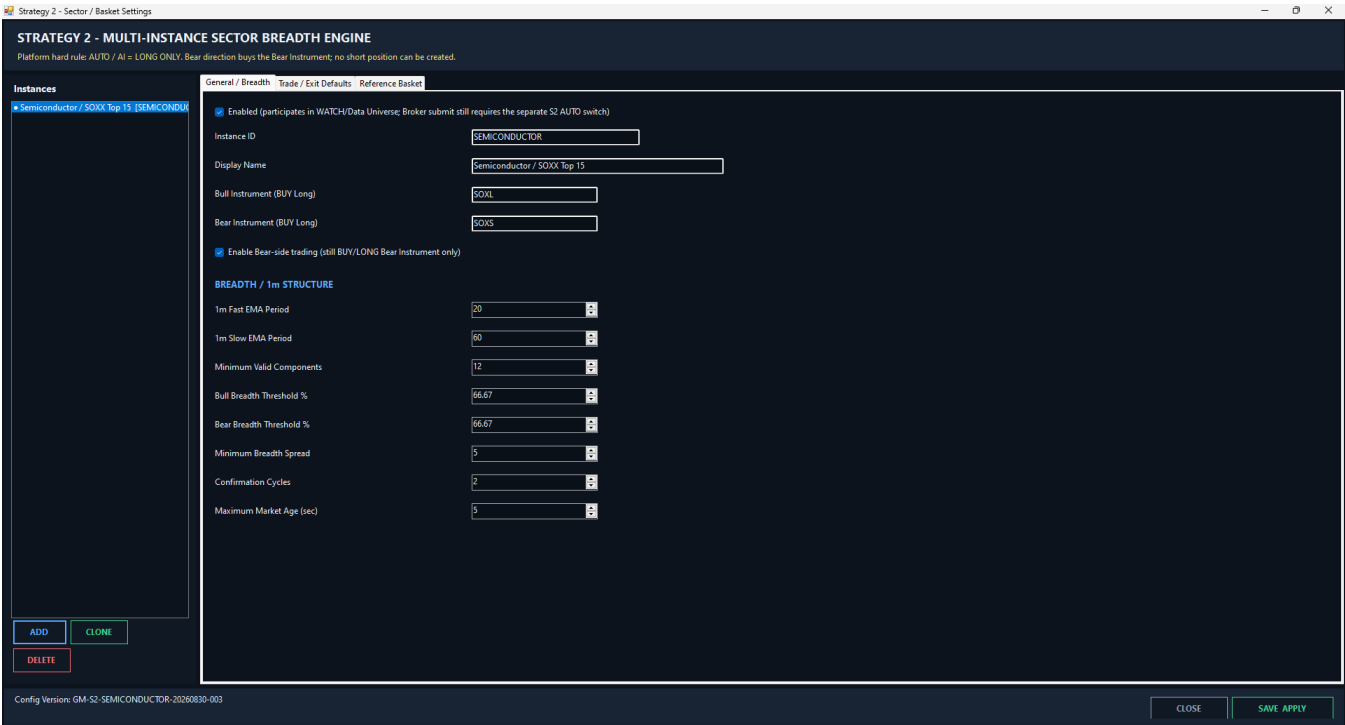


图 11B - S2 General / Breadth

Strategy 2 - Sector / Basket Settings

STRATEGY 2 - MULTI-INSTANCE SECTOR BREADTH ENGINE

Platform hard rule: AUTO / AI = LONG ONLY. Bear direction buys the Bear Instrument; no short position can be created.

Instances

- Semiconductor / SOXX Top 15 [SEMICONDUR]

ADD CLONE DELETE

General / Breadth Trade / Exit Defaults Reference Basket

POSITION SIZING / EXECUTION RISK

Target Order Notional 5,000.00

Maximum Order Notional 5,000.00

Maximum Instance Position Notional 10,000.00

EXIT DEFAULTS - LONG POSITION ONLY

Initial Stop Loss % 4.00

TP1 Trigger % 4.00

TP1 Sell % of Original 50.00

TP2 Additional Rise % 4.00

TP2 Sell % of Remaining 50.00

Hold Breadth Exit Threshold % 50.00

Exit Confirmation Cycles 2

☒ Opposite confirmed Breadth signal = full exit before any reverse-side entry

NEW YORK TIME

Entry Start Hour 9

Entry Start Minute 35

Entry Cutoff Hour 15

Entry Cutoff Minute 55

Force Liquidation Hour 15

Force Liquidation Minute 58

Config Version: GM-S2-SEMICONDUR-20260830-003

CLOSE SAVE APPLY

图 11C - S2 Trade / Exit Defaults

Strategy 2 - Sector / Basket Settings

STRATEGY 2 - MULTI-INSTANCE SECTOR BREADTH ENGINE

Platform hard rule: AUTO / AI = LONG ONLY. Bear direction buys the Bear Instrument; no short position can be created.

Instances

- Semiconductor / SOXX Top 15 [SEMICONDUR]

ADD CLONE DELETE

General / Breadth Trade / Exit Defaults Reference Basket

One symbol per line (comma / semicolon also accepted). Reference components use equal vote.

NVDA MU AMD AVGO INTC AMAT MRVL LRCX TSM KLAC ADI TXN MPWR TER NDXI

Basket Note / Source

SOXX Top-15 template. Review/update the basket before production use because ETF holdings change over time.

Breadth mode: Equal Vote (1 valid symbol = 1 vote). Weighted mode is not enabled.

Config Version: GM-S2-SEMICONDUR-20260830-003

CLOSE SAVE APPLY

图 11D - S2 Reference Basket

核心原则 LONG ONLY + FLAT FIRST + BROKER TRUTH。Bull 方向 BUY SOXL；Bear 方向 BUY SOXS；不建立 Short 仓位。

界面 / 参数

说明

Enabled

实例参与 WATCH/Data Universe；仅 Enabled 不会提交 Broker 订单。

界面 / 参数	说明
S2 AUTO	单独的自动执行开关。S2 AUTO: OFF 时只监控不自动下单。
Bull / Bear Instrument	当前预设 SOXL / SOXS; Bear 方向仍是 BUY/LONG SOXS。
Valid	当前拥有有效数据的成分股数量, 例如 12/15。
UP / DOWN / Neutral	成分股当前强、弱、中性票数。
Bull % / Bear %	有效成分股中多头/空头 Breadth 百分比。
Candidate / Confirm / Direction	候选方向、确认进度和最终确认方向。
Status	显示 DATA BLOCK、数据原因或策略状态。
1m EMA20 / EMA60	单股趋势结构; Price>EMA20>EMA60 计为强, 反向结构计为弱。
Minimum Valid Components	示例 12, 低于此数量会阻止 Breadth 判断。
Bull / Bear Threshold	示例 66.67%, 约要求 2/3 的有效成分股同步。
Minimum Breadth Spread	避免 Bull/Bear 票数太接近时形成信号。
Confirmation Cycles	示例 2, 方向需连续确认两个周期。
Maximum Market Age	市场数据最大可接受年龄, 过期数据变为 Invalid。
Reference Basket	当前 SOXX Top 15: NVDA、MU、AMD、AVGO、INTC、AMAT、MRVL、LRCX、TSM、KLAC、ADI、TXN、MPWR、TER、NXPI。
Equal Vote	每个有效成分股 1 票, 不按市值权重加权。
Target / Max Order Notional	示例目标/最大单笔 \$5,000。
Maximum Instance Position Notional	示例实例最大 \$10,000。
Initial Stop / TP1 / TP2	示例 Stop 4%; TP1 +4% 卖原始仓位 50%; TP2 再上涨 4% 后卖剩余仓位的设定比例。
Hold Breadth Exit Threshold	Breadth 下降到退出阈值时触发板块退出判断。
Opposite confirmed signal	相反方向确认时先完整退出旧方向, 确认 FLAT 后才允许反向新入场。
Entry Start / Cutoff / Force Liquidation	截图示例为 09:35、15:55、15:58 NY。

市场关闭时 若 SESSION CLOSED 或实时行情未准备, 成分股可能显示 N/A / INVALID / Trade price unavailable,

系统应 DATA BLOCK，不产生有效自动交易信号。

Basket 维护 ETF 成分股会变化。长期正式使用前应定期核对 SOXX Top Holdings，并通过 Reference Basket 更新后 SAVE APPLY。

12. PRO TRADE 交易面板

为熟悉日内交易的用户提供 Bid/Ask、Market、Reprice、快速加减仓、Stop、Bracket/OCO 和快捷键。

图 12A - PRO TRADE 主面板

图 12B - PRO TRADE / MORE

界面 / 参数	说明
LAST / BID / ASK / SPR / AGE	实时成交、盘口、点差和数据年龄。行情为 - 或过旧时不要使用依赖盘口的快捷交易。
QTY	设置下单股数；100、200、500、1K 等快捷数量，... 打开更多。

界面 / 参数	说明
BUY ASK / SELL BID	更主动地向对手价成交。
BUY MKT / SELL MKT	市价交易；成交快但存在滑点。
POSITION / FLAT	显示当前股票仓位；FLAT 表示无仓位。
ADD 50% / REDUCE 50%	按当前仓位比例快速加仓/减仓。
FLATTEN	将当前 Symbol 仓位快速归零。执行前确认 Symbol。
REPRICE	TO BID、-0.01、+0.01、TO ASK 快速改单；MORE 中有 +/-0.02。
STOP / SET STOP	设置并提交当前仓位的保护 Stop。
TO BE	将 Stop 调整到 Break Even 附近。
CANCEL SYMBOL	撤销当前 Symbol 的活动订单。
BUY BID / SELL ASK	被动挂在 Bid/Ask 侧等待成交。
TP %	Bracket/OCO 的止盈百分比参数。
BUY + STOP / SELL + STOP	入场并配套 Stop 保护。
BUY BRACKET / SELL BRACKET	Entry + Take Profit + Stop 的 Bracket/OCO 结构。
POSITION DETAIL	25%/50%/75%/100% 比例管理，以及 ADD/REDUCE 快捷操作。
CANCEL BUY / CANCEL SELL	分别撤销当前 Symbol 的 Buy 或 Sell 活动订单。

时段保护 界面显示 ORDERS BLOCKED 时不要重复点击。RTH 与 Non-RTH 的订单类型/保护逻辑不同，盘前盘后通常使用受保护的 Limit 逻辑。

快捷键以界面底部当前显示为准，例如 Alt+B/S Entry、Ctrl+B/S RTH MKT / Non-RTH LMT、Alt+F Flatten、Alt+C Cancel、Alt+P Stop、Alt+G/J Bracket、Ctrl+Up/Down Reprice。

新用户建议 先在 Paper Account 熟悉 BUY/SELL、撤单、Stop、Bracket、Reprice 和 Flatten，再用于真实账户。

故障排查快速清单

- TWS 是否已登录且 API 已连接？
- Quant 顶部是否显示 Healthy / Trading Ready？
- 当前 Symbol、账户、订单数量和交易时段是否正确？
- 行情是否实时且 AGE 未过期？
- License/Entitlement 是否允许当前模块？
- 订单被 Blocked 时，Status/Reason/System Messages 写了什么？
- 自动策略是否仅在 Watch，还是已真正开启对应 AUTO 开关？
- Positions / Orders 是否与 IBKR Broker 实际状态一致？
- 需要技术支持时，提供完整窗口截图和 System Messages / Status / Reason。

文档结束。软件功能和界面可能随 *Gold_Morgan Quant* 后续版本升级而变化，操作时以当前程序实际显示为准。