

程序化交易软件信息说明（v1）

用途：交易者向期货公司 / 交易所填报《程序化交易软件信息》时可直接引用的技术事实材料。

主体提示：报备主体是**软件使用者本人**（交易者）。本文只陈述我方软件的真实技术事实，不代使用者作任何申报承诺，也不代替使用者判断其是否需要报备。

对应版本：GlassBasisTrader **1.91.0**（内部 v101 打包，含 v104c 全部合规改造）。**生成日期：**2026-10-17。**提供方：**玻璃观察网（glass.sh.cn）。

一、速填表（可直接抄入报备表）

报备项	填写内容
软件名称	GlassBasisTrader（玻璃期现套期保值程序化交易系统）
软件版本号	1.91.0（软件内「版本检查」与自更新接口均显示此号）
开发 / 提供主体	玻璃观察网（glass.sh.cn）
软件类型	单机桌面客户端（Python + PyWebView + WebView2）， 非 云端托管、 非 代客理财
运行位置	使用者本人电脑；策略计算与委托决策均在本机完成
交易通道	使用者自行在软件内填入其 开户期货公司 的 CTP 交易前置（含 BrokerID / 账号 / 密码 / 认证码）
行情来源（模拟）	第三方公开渠道（东方财富 / 新浪财经），本机直连，仅用于模拟盘演示
行情来源（实盘）	使用者自行连接的期货公司 CTP 通道； 本软件不采集、不转发、不存储任何期货行情数据
现货数据来源	玻璃观察网自有采集：沙河出厂（金宏阳）、湖北出厂（明弘），有偿提供
策略与参数来源	全部由使用者本人填写 ；本软件 不预置默认值、不提供推荐值、不提供策略模型
报单触发方式	事件驱动：基差首次穿越使用者设定的档位阈值时，按使用者设定的阶梯自动报单
人工确认开关	支持「触发时人工确认」；关闭时自动报单
单轮建仓最大委托笔数	4 笔（阶梯 4 档各一次，每档只报一次、不重复刷单）
单笔委托最大重报次数	2 次（未全成时按使用者设定的超价跳数追价，间隔 2 秒）
总持仓硬阈	6 手（config.py max_totalLots）；另有「现货库容 × 盘面比重 ÷ 20 吨/手」换算的盘面上限
是否存在周期性高频报撤单	不存在 。无任何按固定周期（每秒 / 每毫秒）连续报单或撤单的逻辑
告知义务	首次使用须签署《用户使用协议》 v1.4 ；界面常驻风险提示条
免责边界	不含投资建议、不预测价格、不推荐品种与买卖时机、不含代客理财，不构成投资顾问关系

二、逐项说明

1. 软件名称与版本

- 产品名：GlassBasisTrader（中文：玻璃期现套期保值程序化交易系统）
- 版本号：**1.91.0**。软件内「版本检查」会向 glass.sh.cn 查询最新 / 最低版本号；该接口只返回版本号与文件名，不上传任何交易信息。

2. 开发 / 提供主体

玻璃观察网（站点域名 glass.sh.cn）。软件为免费提供，收费部分仅为现货数据服务费 / 会员服务，与交易通道无关。

3. 软件类型与运行环境

- 形态：单机桌面客户端。Python 主进程 + 内嵌 WebView2 渲染界面。
- 策略计算、参数保存、报单决策**全部在使用者本机完成**；我方服务器不参与任何委托生成。
- 我方向使用者提供的线上服务仅三类：账号登录 / 会员权益校验、现货数据、版本与公告下发。**均不含期货行情、不含委托指令**。

4. 行情数据来源（关键项）

场景	来源	说明
----	----	----

模拟盘	东方财富公开接口（1 秒轮询）+ 新浪财经（30 秒兜底）	由使用者本机直接请求，不经过我方服务器
实盘	使用者开户期货公司的 CTP 行情前置	由使用者自行连接 ；本软件仅将其用于本机策略计算

- **本软件不提供行情数据服务、不转发行情、不存储行情。**
- 我方云端 /trade 站点的对外接口已核查：/trade/api/state、/trade/api/intraday、/trade/api/backtest_trades 等对外一律 **403**（实测）；线上展示页 (/trade-demo/) 已改为**日频口径**（现货价 - 昨结算价），并移除盘中分时与盘口，页面常驻声明「本页行情为日频口径，非实时行情」。
- 交易前置为**单账户个位数连接**性质，技术上也不具备向第三方转发行情的条件。

5. 现货数据来源

- 沙河出厂价（金宏阳）、湖北出厂价（明弘），由玻璃观察网自有采集并维护，属有偿服务。
- 现货为**日频数据**（一天一价）。软件内所有“基差”在展示口径上均为**现货价 - 昨结算价**，避免用秒级期货价减日频现货价制造伪精度。

6. 报单方式与触发条件

1. 使用者在软件内完成「期现配置」（现货基准、区域升贴水、空单阈值、阶梯比例、库存与资金）。
2. 使用者手动点击「启动监控」后，程序在交易时段内按下述规则自动报单：计算实时基差 = 现货价 - 该档合约最新价；基差**首次**穿越使用者设定的某档阈值时，按该档累计仓位比例报出一次开仓委托；同一档位**只报一次**，不重复刷单；下档须基差进一步深化才会触发。
3. 若使用者勾选「触发时人工确认」，则每次触发均先弹窗，需人工点击才发单。
4. 平仓同理为事件驱动（止损 / 移动止损 / 到期 / 使用者手动）。

该设计使报单频率**由基差实现值的穿越次数决定**，而非由时间周期决定；正常交易时段内不会出现连续刷单。

7. 策略与参数（关键项）

- **本软件不预置任何阈值默认值、不提供推荐值、不提供策略模型。**
- 空单阈值（主力 / 次主力 / 远月三档）在出厂状态下为空（Null）。使用者未填写前，该档**一律不开仓**（程序对该档写入一个永远触发不到的阈值作为兜底），且界面会强制要求先完成配置。
- 软件内虽提供“按公式参考值填充”按钮（公式： $-(\text{距交割月数} \times \text{使用者填写的仓储成本} + 50)$ ），但**必须由使用者两次点击确认**才会填入，填入后仍属使用者自选参数；软件不会自动写入或自动生效。
- 阈值、阶梯比例、资金使用率、保证金比例、止损幅度、现货库存与库容**全部为使用者输入项**。
- 软件不含任何价格预测、不含品种或时机推荐、不含收益承诺。
- 市场结构判定（牛市 / 熊市 / 不明确）仅由 1/5/9 主力系列合约结算价的先后关系机械判定，属客观计算，不构成投资建议。

8. 最大申报速率与持仓上限

指标	值	依据
单轮建仓最大委托笔数	4	阶梯 4 档，每档首次穿越各报一次 (strategy.py::ladder_open, scale_stage 防重复)
单笔委托最多重报	2	未全成时按超价追价，等待 2 秒 / 次 (config.py wait_secs=2.0、chase_retry=2)
单轮建仓理论最大报单笔数	12	$4 \times (1 + 2)$ ，且全部集中在基差穿越时刻展开
持仓硬闸	6 手	config.py::max_total_lots，超出直接拒绝报单
盘面上限	库容换算	现货库容 $\times$ 盘面比重 $\div 20$ 吨/手，由使用者在期现配置中填写
周期性报撤单	无	代码中不存在按时间周期连续报单 / 撤单的循环
做市 / 双边持续报价	无	不支持

说明：上表为**代码层面的理论上限**。实际申报速率取决于基差穿越次数，正常时段远低于 1 笔/秒。若报备表要求填写实测“最高申报速率”，建议由使用者在自己账户上实测后填写。

9. 账号与凭据保管

- 交易通道的 BrokerID / 账号 / 密码 / 验证码由使用者填入，**加密后仅存于本机**（Windows DPAPI CryptProtectData，绑定当前 Windows 用户），不上传我方服务器。

- 我方服务器不持有任何使用者的交易账号或交易密码。
- 使用者在软件内使用的 glass.sh.cn 账号仅用于登录与会员权益校验。

10. 告知义务与协议

- 首次使用强制弹出并签署《用户使用协议》v1.4，协议签署留痕（时间 / 版本 / 机器码 / 账号）落盘本机。
- 协议 v1.4 已明示：参数由使用者自行设定、软件不提供默认值 / 推荐值 / 策略模型、软件不提供期货行情数据服务。
- 界面常驻风险提示条，明确「本软件不提供行情通道」与「参数由您自行判断填写」。协议版本变更后强制重新确认。

11. 免责边界

本软件为**工具类软件**：不含投资建议、不预测价格、不推荐具体品种或买卖时机、不含策略模型、不含代客理财，与使用者之间不构成投资顾问关系。交易决策及其后果由使用者自行承担。

12. 明确不做的事（对照核查结论）

事项	状态	依据
转发 / 转售期货行情	不做	云端不存行情；对外行情类接口 403；APP 本机直连公开源或用户自连 CTP
代客理财 / 代客下单	不做	委托必须由使用者本机发起、由使用者自己的账号报出
为使用者预置阈值或推荐参数	不做（v104c 起）	出厂阈值全空；缺值不再自动补公式值；未填写则该档禁止开仓
策略信号 / 荐股式提示	不做（v104c 起）	界面原「信号:」已改为「运行状态:」；协议删除「策略信号参考」
云端托管交易账号	不做	交易凭据本机 DPAPI 加密，不上云
高频 / 做市 / 刷单	不做	无周期性报撤单逻辑，有持仓硬闸

三、事实核查索引（自查用，报备时不必提交）

结论	核查方式
APP 不向服务器取期货行情	data_source.py 全文检索 trade/api → 0 命中
CTP 只交易、不订阅行情	broker_ctp.py 检索 MdApi / SubscribeMarketData / CreateFtdcMdApi → 0 命中
云端不持有交易凭据	云端 cloud_server.py 检索 td_fronts / broker_id / auth_code → 0 命中
上报内容不含凭据与行情	usage.py 上报 payload 仅 machine / version / summary（事件计数）
出厂无预置阈值	server.py 检索 -110.0 / -170.0 / -230.0 → 0 命中
缺值不自动补公式值	server.py::_hedge_load 已移除自动补值循环
未填写则禁止开仓	server.py::_hedge_apply 对该档写入 -1.0e9；_hedge_setup_state 强制先配置
对外行情接口已关闭	curl -I https://www.glass.sh.cn/trade/api/state → 403
展示页为日频口径	GET /trade-demo/api/state → quote_freq=daily

四、待确认项（对外报备前须由我方 / 使用者确认）

- 软件名称口径不统一【已解决 2026-10-16】**：APP 与展示版已统一为「玻璃期现**套期保值**程序化交易系统」，随 1.91.0 出包生效。
- 实测最高申报速率**：第 8 节为代码理论上限，若报备表要求实测值，需由使用者实盘实测后填写。
- 是否启用「触发时人工确认」**：若使用者选择开启，则本软件不构成"自动报单"，报备口径会不同，须由使用者自行判断。
- 存量使用者已保存的阈值**：老版本曾把公式值静默写入使用者配置文件（如 -95/-155/-215）。新版不再写入，但**不会主动改写使用者已保存的值**。若使用者希望彻底回到"未填写"状态，需手动清空该档阈值。