

附录一:

拆单案例: 下面是真实的 2 个 tick 数据的成交量(手)与价格(元/股)
假设需要成交的总手数为 25000

Q1:[3303, 264, 278, 124, 7502],[14.55, 14.54, 14.53, 14.52, 14.51]

Q2:[198, 2045, 3052, 2276, 281], [14.57, 14.56, 14.55, 14.54, 14.53]

提交结果

Q1:10000

Q2:10000

Q3: 剩余手数

实际撮合逻辑:

Q1 撮合:

$3303 * 100 * 14.55 = 4805865$ (剩余 $10000 - 3303 = 6697$)

$264 * 100 * 14.54 = 383856$ (剩余 $6697 - 264 = 6433$)

$278 * 100 * 14.53 = 403934$ (剩余 $6433 - 278 = 6155$)

$124 * 100 * 14.52 = 180048$ (剩余 $6155 - 124 = 6031$)

$6031 * 100 * 14.51 = 8750981$ ($6031 < 7502$, 全部成交剩余:0)

当期实际成交:10000

总手数成交剩余= $25000 - 10000 = 15000$

Q2 撮合:

$198 * 100 * 14.57 = 288486$ (剩余 $10000 - 198 = 9802$)

$2045 * 100 * 14.56 = 2977520$ (剩余 $9802 - 2045 = 7757$)

$3052 * 100 * 14.55 = 4440660$ (剩余 $7757 - 3052 = 4705$)

$2276 * 100 * 14.54 = 3309304$ (剩余 $4705 - 2276 = 2429$)

$281 * 100 * 14.53 = 408293$ (剩余 $2429 - 281 = 2148$)

当期实际成交: $198 + 2045 + 3052 + 2276 + 281 = 7852$

总手数成交剩余: $15000 - 7852 = 7148$

Q3:剩余手数 7148 手, 按照 Q1 或者 Q2 撮合逻辑成交。

若因后面再无提交,剩余的所有手数用历史的最低价格 14.51 成交

$7148 * 100 * 14.51 = 10371748$

成交后总市值为所有成交的市值和 36320695 元