

更新记录:

版本	时间	作者	记录
	2014-2-2	张斌	创建文档
V1.08	2014-4-24	张斌	补充功能： 1、添加自动行权； 2、更新部分截图； 3、删除“套利交易”；
	2016-02-20	黄红兰	补充功能： 1、更新“竖式下单界面”的深交所价格类型； 2、删除“一键下单”； 3、更新止损止盈； 4、添加“多账号下单”、“行情下单”、“持仓列表”、“其他功能”； 5、更新截图
	2016-12-19	黄红兰	补充功能： 1、添加构建组合策略； 2、添加高级下单； 3、修改止盈单、止损单、保本单、预埋条件单； 4、更新截图

目录

第 1 节	交易功能.....	5
1.1	竖式下单.....	5
1.1.1	竖式下单界面	5
1.1.2	竖式下单流程	6
1.1.3	选择交易合约	7
1.1.4	委托价格输入	8
1.1.5	委托数量输入	9
1.1.6	自动开平规则	10
1.2	横式下单.....	10
1.2.1	横式下单界面	10
1.2.2	横式下单流程	11
1.2.3	价格类型.....	11
1.2.4	追价	12
1.3	期权行权.....	12
1.3.1	期权行权界面	12
1.3.2	期权行权流程	12
1.3.3	行权价值.....	13
1.4	锁定解锁.....	13
1.4.1	锁定解锁界面	13
1.4.2	锁定解锁流程	13
1.5	快速下单.....	15
1.5.1	快速下单说明	15
1.5.2	快速下单流程	15
1.6	快捷下单.....	16
1.6.1	双击平仓.....	16
1.6.2	百分比平仓	16
1.6.3	反手	17

1.6.4	风控单	17
1.6.5	右键平仓	17
1.7	止损止盈单	18
1.7.1	止损单	18
1.7.2	止盈单	20
1.7.3	保本单	22
1.8	预埋单/条件单	23
1.8.1	预埋单	24
1.8.2	条件单	25
1.9	撤单	26
1.10	追单	27
1.11	改单	27
1.12	多账号下单	28
1.12.1	多账号登陆	28
1.12.2	多账号下单	30
1.13	行情下单	31
1.13.1	闪电下单	31
1.13.2	盘口下单	32
第 2 节	持仓列表	34
2.1	持仓合约	34
2.1.1	持仓	34
2.1.2	散单	34
2.1.3	希腊值	35
2.2	自选合约	35
2.3	套利策略	36
2.3.1	设置套利组合	36
2.3.2	套利策略下单	37
2.3.3	套利策略监控	37
2.4	备兑股份	38
第 3 节	其他功能	39

3.1	账户查询.....	39
3.2	综合查询.....	39
3.3	银行转账.....	40
3.4	结算单查询.....	41
3.5	修改密码.....	41
3.6	列表联动行情.....	41
第 4 节	参数设置.....	43
4.1	下单设置.....	43
4.1.1	下单参数.....	43
4.1.2	自选合约.....	43
4.1.3	默认数量.....	44
4.1.4	开平设置.....	44
4.1.5	下单选项.....	44
4.1.6	普通下单.....	45
4.2	风险管理.....	47

第1节 交易功能

1.1 竖式下单

1.1.1 竖式下单界面

竖式下单窗口：

下单面板：

界面说明：

图标	功能说明
	：合约代码跟随行情图发生变化；：代码不随行情图发生变化
	：价格跟随当前盘口对价动态变化；：价格不跟随盘口价格
	清空下单面板中的内容
备兑	勾选之后按备兑开仓或备兑平仓

价格类型说明:

交易所	类型	说明
上交所	限价 GFD	按限定的价格或低于限定的价格申报买入期权合约，按限定的价格或高于限定的价格申报卖出期权合约。普通限价申报当日有效，未成交部分可以撤销。
	市价 IOC 剩余即撤	按市场可执行的最优价格买卖期权合约，未成交部分自动撤销。
	市价 剩余转限价 GFD	按市场可执行的最优价格买卖期权合约，未成交部分按本方申报最新成交价格转为普通限价申报；如该申报无成交的，按本方最优报价转为限价申报；如无本方申报的，该申报撤销。
	限价 FOK 全成或撤	按限定的价格或者优于限定的价格买卖期权合约，所申报的数量如不能立即全部成交则自动全部撤销。
	市价 FOK 全成或撤	按市场可执行的最优价格买卖期权合约，所申报的数量如不能立即全部成交则自动全部撤销。
深交所	限价 GFD	按限定的价格或低于限定的价格申报买入期权合约，按限定的价格或高于限定的价格申报卖出期权合约。
	限价 FOK 全成或撤	以限定的价格为成交价，如与申报进入交易主机时集中申报簿中对手方所有申报队列依次成交能够使其完全成交的，则依次成交，否则申报全部自动撤销。
	对方最优价格	以申报进入交易主机时集中申报簿中对手方队列的最优价格为其申报价格。
	本方最优价格	以申报进入交易主机时集中申报簿中本方队列的最优价格为其申报价格。
	即时成交 剩余即撤	以对手方价格为成交价，与申报进入交易主机时集中申报簿中对手方所有申报队列依次成交，未成交部分自动撤销。
	五档即成 剩余即撤	以对手方价格为成交价，与申报进入交易主机时集中申报簿中对手方最优五个价位的申报队列依次成交，未成交部分自动撤销。
	全额成交 或撤销	以对手方价格为成交价，如与申报进入交易主机时集中申报簿中对手方所有申报队列依次成交能够使其完全成交的，则依次成交，否则申报全部自动撤销。

1.1.2 竖式下单流程

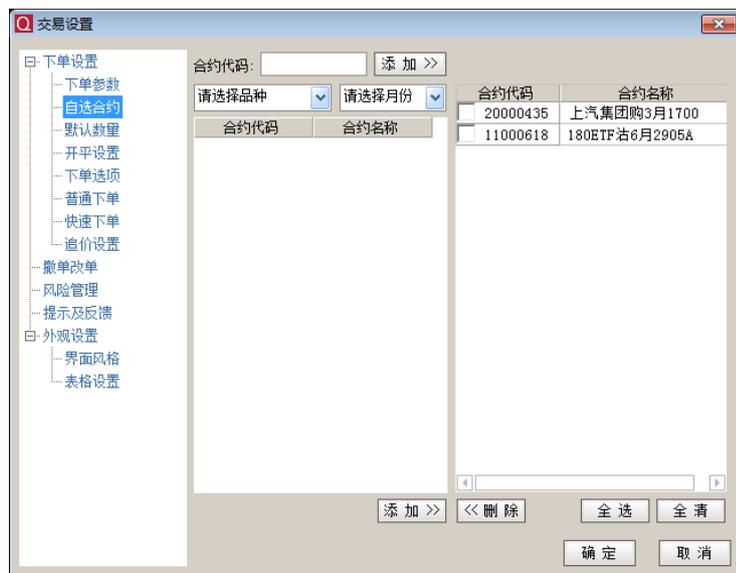
竖式下单的步骤分为如下几步：

- 1、选择交易合约；
- 2、选择买卖方向；
- 3、选择开平方向；
- 4、选择价格类型，若是限价单需要输入价格；
- 5、输入委托数量；
- 6、点击“下单”按钮发送交易委托；
- 7、若是备兑开平仓，需要选中“备兑”复选框。

1.1.3 选择交易合约

交易合约的输入有以下几种方式：

- 1、将锁定图标切换到可锁定状态 ，在代码框中手动输入合约；
- 2、将锁定图标切换到可打开状态 ，在分类报价列表及 T 型报价列表中选中一个合约，或者打开期权合约的 K 线分析图或分时分析图，系统自动将行情中显示的合约代码填到交易代码框中；
- 3、在【交易设置】 - 【下单设置】 - 【自选合约】下设置自选合约。将锁定图标切换到可锁定状态 ，单击【自选合约】标签下的合约代码，可将合约代码快速输入到代码框中。

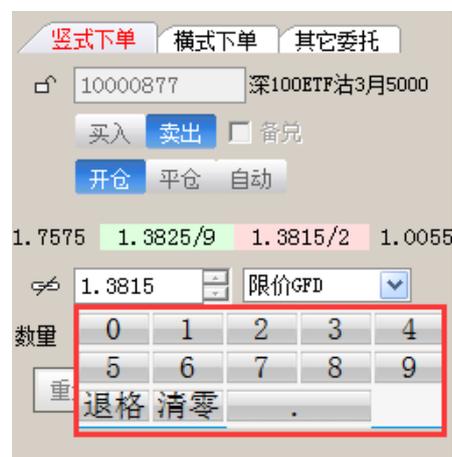
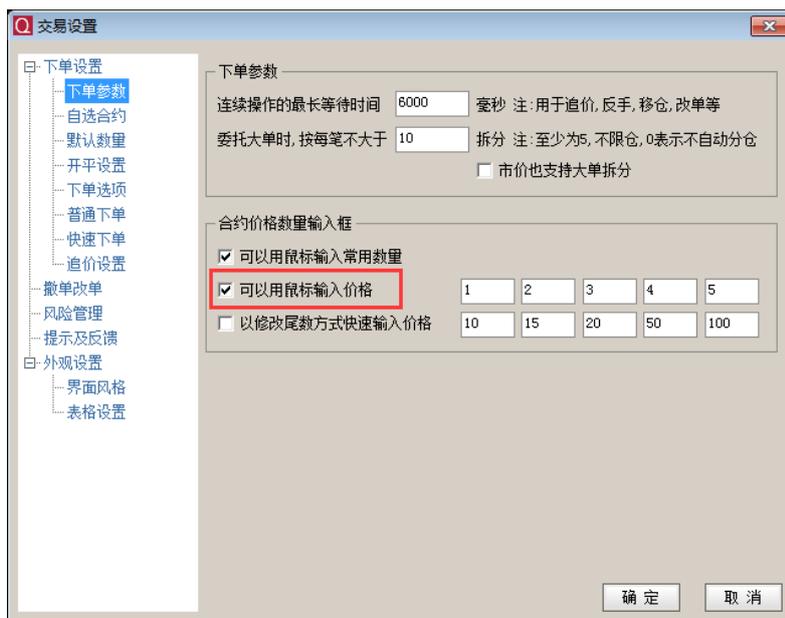




1.1.4 委托价格输入

委托价格的输入有以下几种方式：

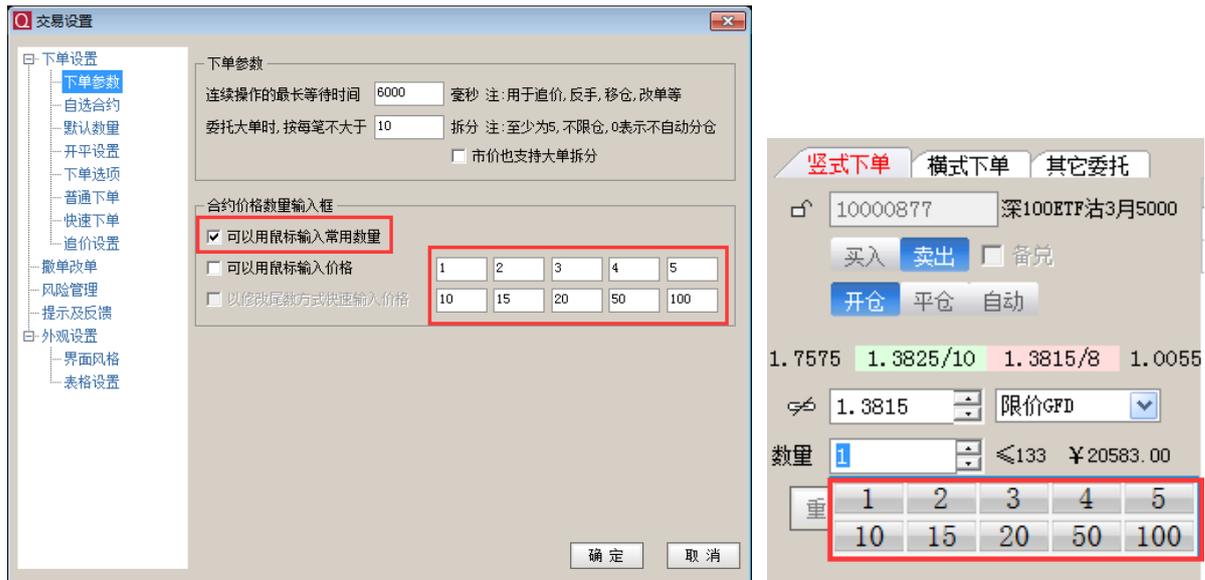
- 1、使用键盘输入价格；
- 2、单击价格条输入价格；
- 3、将联动图标设为联动状态 ，动态获取盘口对价（适用“限价”价格类型）；
- 4、“市价”价格类型，无需输入具体价格，自动以最优价发送委托；
- 5、在【交易设置】-【下单设置】-【下单参数】中选中“可以用鼠标输入价格”复选框。单击价格框，弹出软键盘，使用鼠标输入价格。选中“可以用鼠标输入价格”后，可进一步选中“以修改尾数方式快速输入价格”，单击价格框，则以修改尾数方式进行修改。



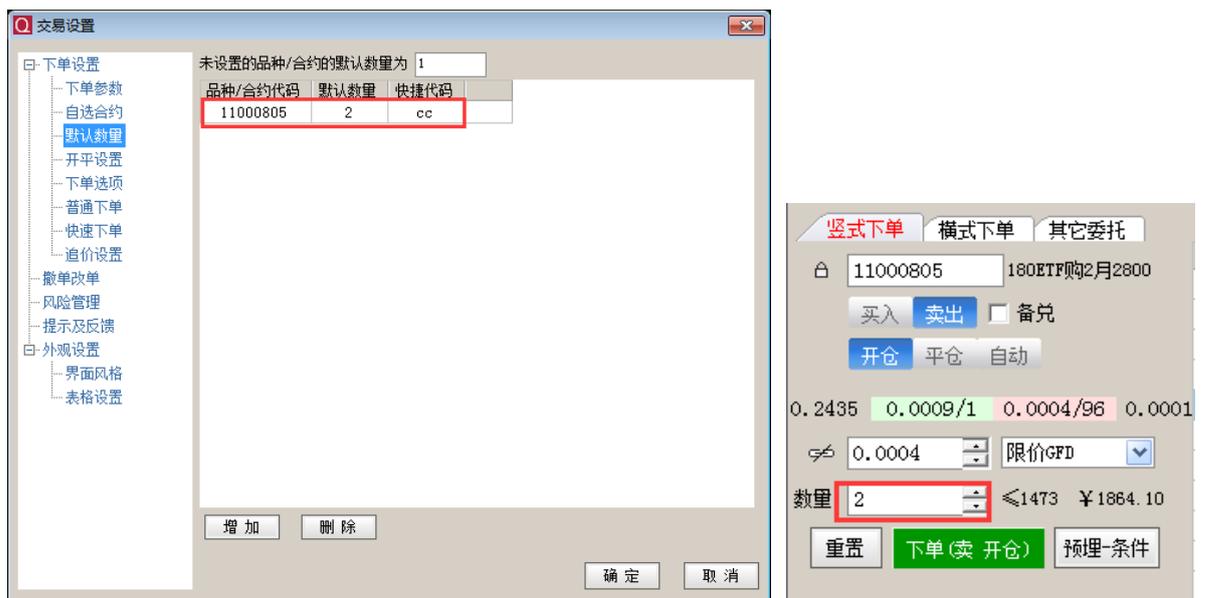
1.1.5 委托数量输入

委托数量的输入有以下几种方式：

- 1、使用键盘输入数量；
- 2、点击数量框后面的最大可交易数量，输入全部数量；
- 3、在【交易设置】-【下单设置】-【下单参数】中选中“可以用鼠标输入常用数量”复选框。单击数量框，弹出软键盘，使用鼠标选取委托数量。



- 4、在【交易设置】-【下单设置】-【默认数量】中修改“默认数量”，设置默认下单数量。



1.1.6 自动开平规则

- 1、开平原则，若当前合约无持仓则开仓，有持仓且买卖方向相同则加仓，有持仓且买卖方向相反则平仓；
- 2、开平设置，在【交易设置】-【下单设置】-【开平设置】中，选择一种开平规则：
 - a) 按可平量全平。
 - b) 按输入数量平仓，如果持仓量不足，只平持仓量。
 - c) 按输入数量平仓，如果持仓量不足，按差量反向开仓。
 同时，可选择是否在下单前先撤销同方向挂单。



1.2 横式下单

1.2.1 横式下单界面

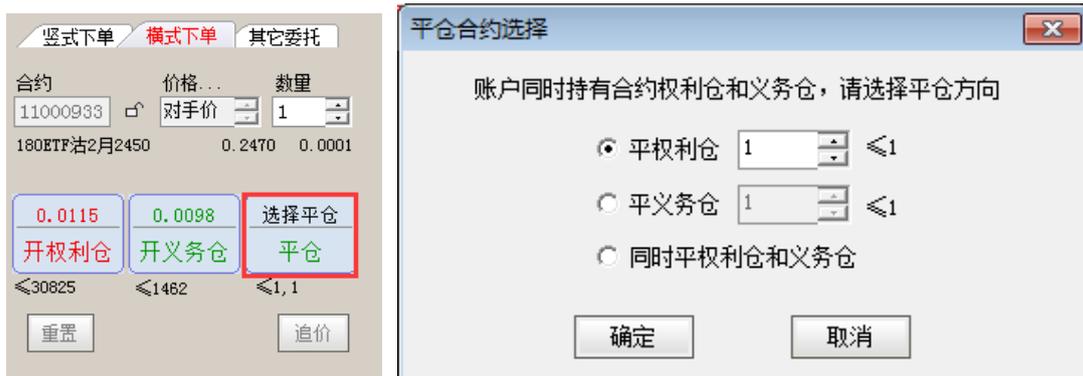
横式下单面板：



1.2.2 横式下单流程

横式下单的步骤分为如下几步：

- 1、选择交易合约；
- 2、选择价格类型，或单击价格类型框后输入价格；
- 3、输入委托数量；
- 4、点击“开权利仓”、“开义务仓”、“平仓”按钮，发送交易委托。
- 5、若同时持有权利仓和义务仓，平仓时需选择平仓合约。



在以上步骤中，交易合约的选择方式和下单数量的输入方式与横式下单相同。

1.2.3 价格类型

横式下单模式下，可以选择下单的价格类型，其含义分别为：

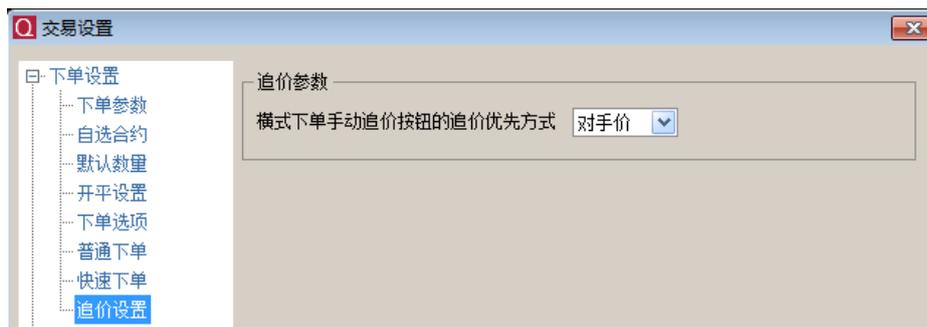
功能	说明
对手价	买入操作，取当前卖价，卖出操作，取当前买价
排队价	买入操作，取当前买价，卖出操作，取当前卖价
最新价	取最近一笔成交的成交价
超价	在对手价基础上偏移 N 个最小变动价位，N 可在【普通下单】中进行设置
涨跌停价	买入操作，取涨停板价格，卖出操作，取跌停板价格



1.2.4 追价

可以对当前合约的所有未成交单进行追价操作，追价价格可以在【追价设置】中进行设置。

- 1、追价时，系统自动先撤未成交单再追价；
- 2、追价的价位使用【交易设置】-【下单设置】-【追价设置】进行设置；
- 3、每点击一次追价按钮，执行一次追价操作；
- 4、买和卖两个方向都有未成交委托的情况下，对两个方向同时执行追价操作。



1.3 期权行权

1.3.1 期权行权界面

点击下单界面的【其他委托】-【期权行权】，进入期权行权面板：



1.3.2 期权行权流程

期权行权流程：

- 1、单击持仓列表选中行权合约，或者手动输入合约代码。
- 2、输入行权数量。

3、点击“行权”按钮执行行权。

1.3.3 行权价值

行权价值，是指立即行权所获得的收益。

认购期权行权价值= $\max(\text{标的价格}-\text{行权价格}, 0) \times \text{合约单位} \times \text{可用数量}$

认沽期权行权价值= $\max(\text{行权价格}-\text{标的价格}, 0) \times \text{合约单位} \times \text{可用数量}$

1.4 锁定解锁

1.4.1 锁定解锁界面

点击下单界面的【其他委托】-【锁定解锁】，进入锁定解锁面板：



1.4.2 锁定解锁流程

备兑开仓前需要首先锁定相应数量的标的证券。锁定/解锁操作流程：

- 1、单击备兑持仓股份代码，或输入标的证券代码；
- 2、选择锁定解锁方向；
- 3、输入委托数量；
- 4、点击下单按钮。

1.5 构建组合策略

1.5.1 构建组合策略界面

点击下单界面的【其他委托】-【构建组合策略】，进入构建组合策略面板：

合约代码	自选合约	组合持仓	套利策略	备兑股份	可平	买入成本价	最新价	买入成本	浮动盈亏	当日委托	当日成交	可撤委托	预埋条件单	止盈止损	风控单	状态	位置	说明	序号	
11001139		180ETF购12月2550	权利	1	1	0.6345	0.4950	6344.60	-1394.											
11001140		180ETF购12月2600	权利	1	1	0.4045	0.2773	4045.00	-1272.											
11001142		180ETF购12月2700	权利	1	0	0.4038	0.3120	4038.50	-918.											
11001143		180ETF购12月2750	权利	8	5	0.2820	0.2919	22562.67	789.											
11001144		180ETF购12月2800	权利	2	2	0.1713	0.0781	3426.00	-1864.											
11001145		180ETF购12月2850	权利	1	1	0.2015	0.1338	2015.00	-677.											
11001145		180ETF购12月2850	义务	1	0	-0.2289	0.1338	-2289.00	951.											
11001146		180ETF购12月2900	权利	4	2	0.1704	0.0611	6816.03	-4372.											
11001146		180ETF购12月2900	义务	1	0	-0.1025	0.0611	-1025.20	414.											
11001147		180ETF购12月2950	义务	5	4	-0.0021	0.0526	-105.00	-2525.											
11001149		180ETF沽12月2600	权利	1	1	0.0029	0.0367	29.00	338.											
11001150		180ETF沽12月2650	权利	3	3	0.0101	0.0126	304.25	73.											

1.5.2 构建组合下单流程

构建组合下单操作流程：

- 1、选择组合类型；
- 2、选择可构建组合合约；
- 3、点击“构建”发送委托。

1.5.3 解除组合下单流程

解除组合操作流程：

- 1、在“组合持仓”界面选择持仓组合；
- 2、单击“组合持仓界面”右下角的“解除”，弹出“解除策略”界面；
- 3、在“解除策略”界面设置解除数量；
- 4、单击“解除策略”界面的“解除”，发送委托。

持仓合约	自选合约	组合持仓	套利策略	备兑股份	解除策略
代码	策略名称	持仓	可用	组合盈亏	解除数量
2016112800000015	认购牛市价差策略	1	1	1038.00	
2016112900000033	认购牛市价差策略	1	1	3146.00	
2016113000000022	认购牛市价差策略	1	1	2336.20	
2016113000000023	认购熊市价差策略	1	1	-3786.00	
2016113000000031	认购熊市价差策略	1	1	-2997.71	
2016113000000061	认沽牛市价差策略	1	1	1206.49	
2016113000000065	认购熊市价差策略	1	1	-1866.45	
2016113000000099	认购熊市价差策略	2	2	606.00	
2016120100000001	认购熊市价差策略	1	1	-1078.17	
2016120100000011	认购牛市价差策略	1	1	1970.79	0.00
2016120100000012	认购牛市价差策略	1	1	-114.72	0.00
2016120100000023	认购牛市价差策略	1	1	-114.72	0.00
2016120500000002	认购牛市价差策略	1	1	3483.00	0.00
2016120600000026	认购牛市价差策略	1	1	-495.45	0.00

解除策略

解除策略名称: 认购熊市价差策略 (2016113000000065)

解除数量: ≤ 1

1.6 快速下单

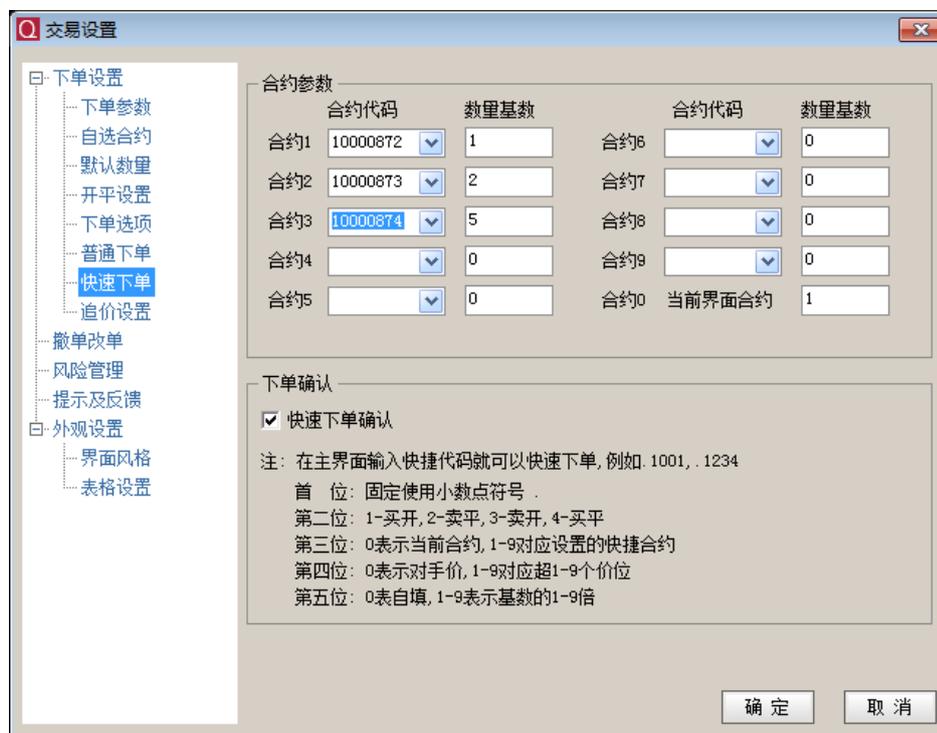
1.6.1 快速下单说明

快速下单，指在主界面输入 5 位字符对期权合约进行下单的方式。数字位数与值的含义如下表：

	第一位	第二位	第三位	第四位	第五位
含义	固定符号	买卖开平方向	指定合约	委托价格	委托数量
值	固定使用 小数点符 号	1- 买开 2- 卖平 3- 卖开 4- 买平	0- 当前合约 1-9 参数中设置 的合约	0- 对价 1-9 对价基础上 超价位数	0-自填数量 1-9 基数的倍数

1.6.2 快速下单流程

- 1、在【交易设置】—【下单设置】—【快速下单】中设置快速下单参数。
- 2、按设定的快捷键进行下单操作。



例，按上面的截图中的设置，在行情界面，输入.1302（意思为买入开仓 10000874 委托价格是对手价，委托数量是基数的 2 倍即 10 手）



1.7 快捷下单

1.7.1 双击平仓

双击“持仓合约”列表中的合约，系统自动填写该合约的代码、名称、买卖方向、开平仓方向，可平数量以及平仓价格（依设置而定），点击“下单”按钮就可发送平仓委托。



1.7.2 百分比平仓

单击选中“持仓合约”列表中的合约，点击“持仓合约”窗口下的“平仓%”按钮，可以实现部分持仓的快速平仓及反手操作。



1.7.3 反手

单击选中“持仓合约”列表中的合约，点击“持仓合约”窗口下的“反手”按钮，可以实现反手操作。

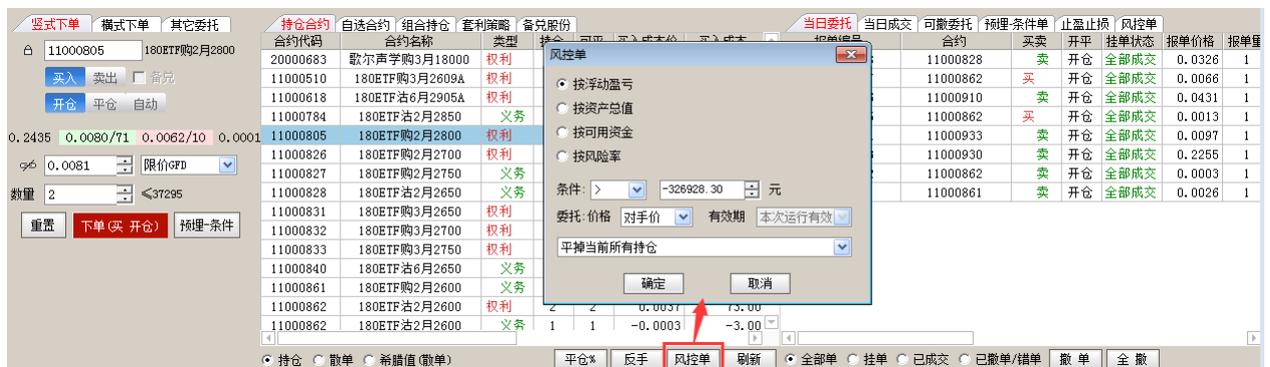
反手分三步执行：①撤销该合约未成交委托单；②以对价平仓；③以对价开仓。



1.7.4 风控单

点击“持仓合约”窗口下的“风控单”按钮，可设置账户风控条件单。

风控单可按浮动盈亏、按资产总值、按可用资金、按风险率进行设置。



1.7.5 右键平仓



右键“持仓合约”列表，可以选择对价平仓、反手、设置止损单、设置止盈单、设置保本单、定时平仓、超价平仓、指定价平仓、挂平仓单、移仓、账户平仓及其他一些操作。

功能	说明
对价平仓	多头持仓，取买一价平仓，空头持仓，取卖一价平仓
反手	分三步执行：①撤销该合约未成交委托单②以对价平仓③以对价开仓
设置止损单	设置止损单和跟盘止损单
设置止盈单	设置止盈单
设置保本单	设置保本单
定时平仓	按设定的平仓时间、价格、数量，定时发送平仓委托
超价平仓	按设定的偏移价位发送平仓委托
指定价平仓	指定价格平仓
挂平仓单	多头持仓：在均价的基础上上浮 N 个价位平仓 空头持仓：在均价的基础上下浮 N 个价位平仓
移仓	对于指定的持仓合约，先平仓同时同方向同数量开仓指定合约
账户平仓	清空当前账户的所有持仓

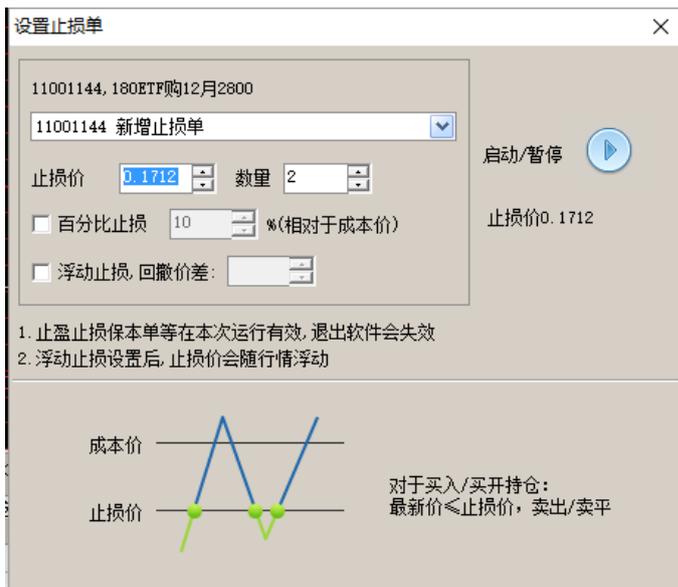
1.8 止损止盈单

右键“持仓合约”列表，可对所选合约设置止损单、止盈单、保本单。

1.8.1 止损单

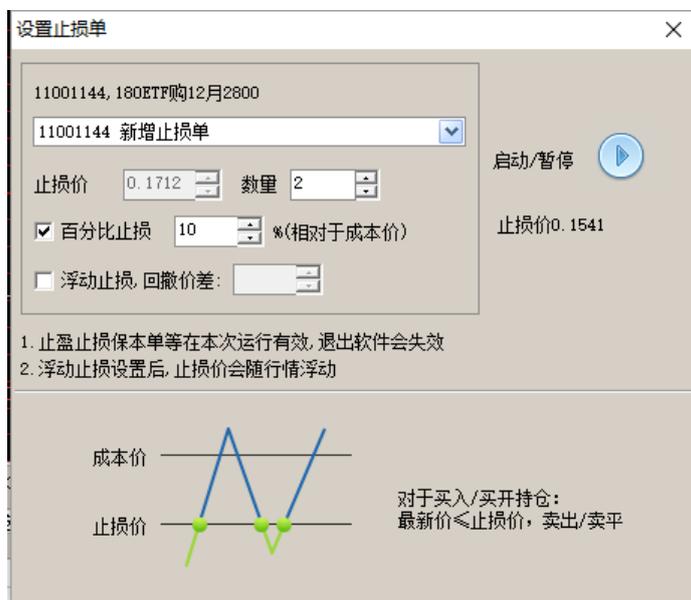
止损单有三种类型：指定价止损、百分比止损、跟盘浮动止损。

- 1、指定价止损，即合约现价触及设定好的止损价时以对价止损掉部分或全部持仓。
 - a) 右键单击持仓合约列表选择“设置止损单”。
 - b) 设置止损价位和数量。若为多头持仓，止损价位应设为<买入成本价；若为空头持仓，止损价位应设为>卖出成本价，否则提示“参数设置已无意义”。
 - c) 点击“运行”按钮。



2、 百分比止损，即按相对于成本价的一定百分比进行止损。若为多头持仓，则止损价为成本价*（1-百分比%）。若为空头持仓，则止损价为成本价*（1+百分比%）。

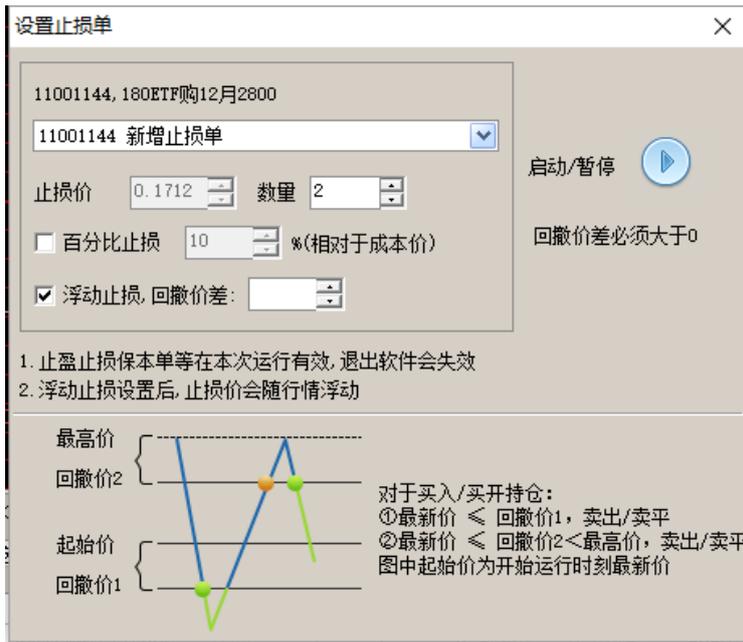
- a) 右键单击持仓合约列表选择“设置止损单”。
- b) 设置止损数量。
- c) 选中“百分比止损”复选框，并设置百分比。
- d) 点击“运行”按钮。



3、 跟盘浮动止损，即以开启止损时的盈亏为标准，当最大盈亏回撤 N 个价位后以对价进行止损的方式。例如，在 2.000 点做多某合约，设置价格回撤 10 个最小变动价位（1.990 点）止损，当价格涨到 2.010 的时候，止损价位会自动调整为 2.000。

- a) 右键单击持仓合约列表选择“设置止损单”。
- b) 设置止损数量。
- c) 选中“跟盘浮动”复选框，设置价格回撤为几个最小变动价位。

d) 点击“运行”按钮。



1.8.2 止盈单

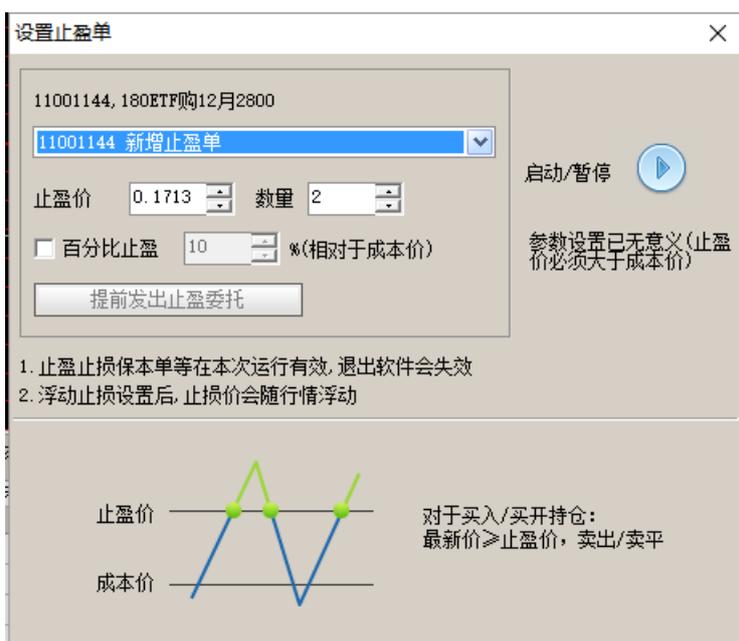
止盈单有三种方式：指定价止盈、百分比止盈、提前发出止盈委托。

1、指定价止盈，即合约现价触及设定好的止盈价时以对价止盈掉部分或全部持仓。

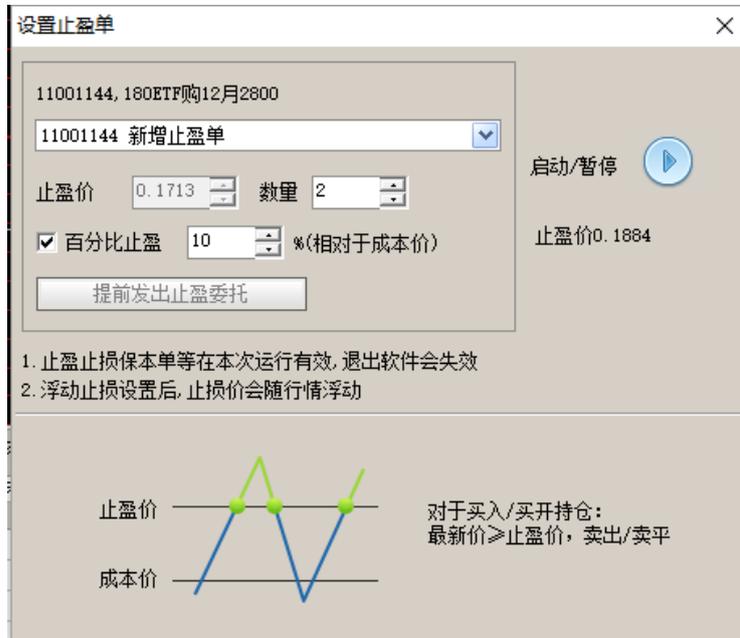
a) 右键单击持仓合约列表选择“设置止盈单”。

b) 设置止盈价位和数量。若为多头持仓，止盈价位应设为>买入成本价；若为空头持仓，止盈价位应设为<卖出成本价，否则提示“参数设置已无意义”。

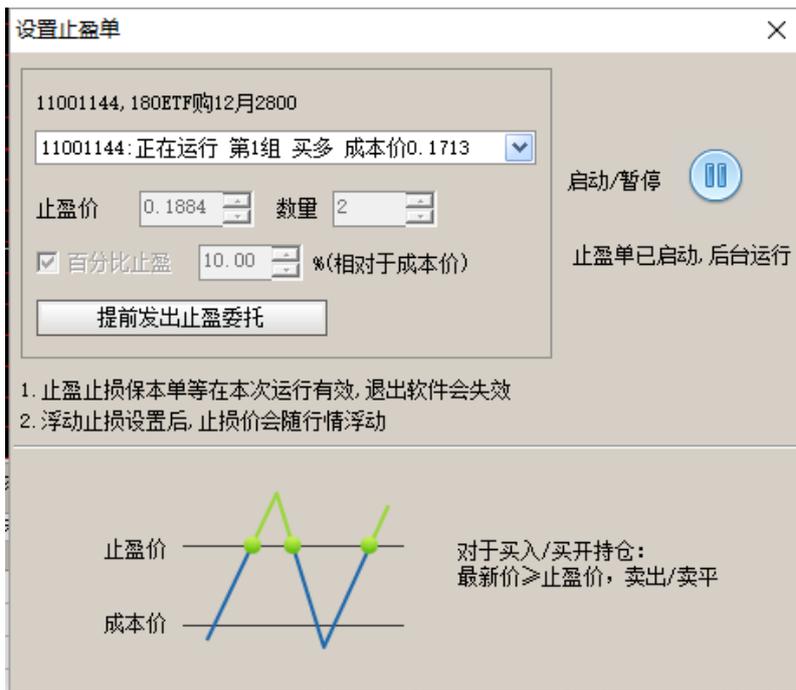
c) 点击“运行”按钮。



- 2、百分比止盈，即按相对于成本价的一定百分比进行止盈。若为多头持仓，则止盈价为成本价*（1+百分比%）。若为空头持仓，则止盈价为成本价*（1-百分比%）。
 - a) 右键单击持仓合约列表选择“设置止盈单”。
 - b) 选择“百分比止盈”复选框，并设置百分比。
 - c) 点击“运行”按钮。



- 3、提前发出止盈委托，适用于处于暂停或运行状态下的止盈单，即立即触发该止盈单并发出止盈平仓委托。
 - a) 右键单击持仓合约列表选择“设置止盈单”。
 - b) 在“设置止盈单”的下拉列表中选择相应的已有止盈单。
 - c) 点击“提前发送止盈委托”按钮。

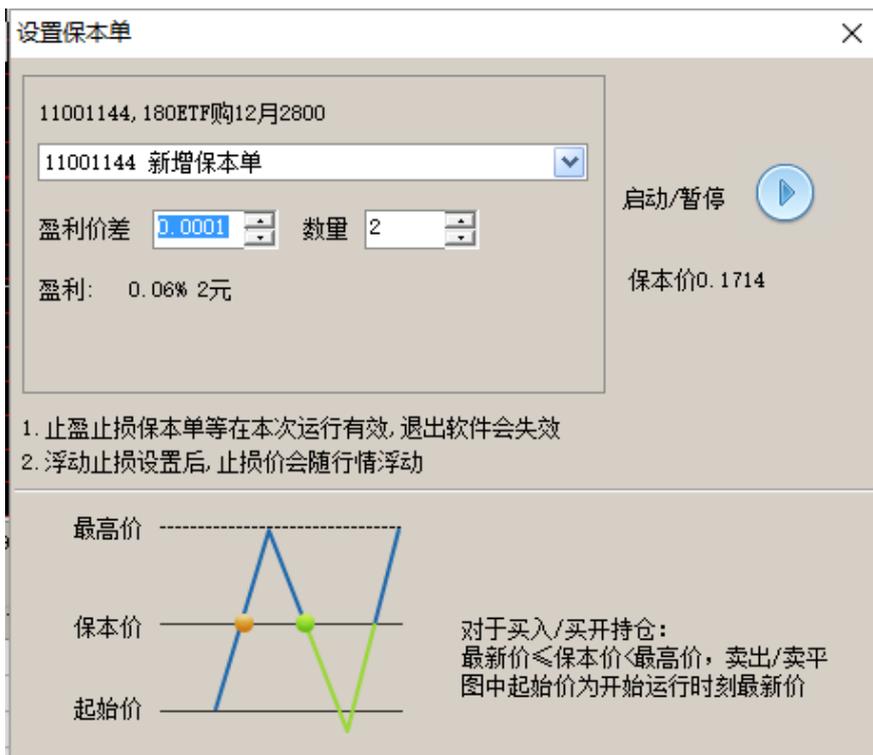


1.8.3 保本单

保本单，即在开仓均价基础上设置盈利价差作为保本价，当价格触及保本价时触发止损的一种盈利状态下的止损方式。

操作方法：

- 1、 右键单击持仓合约列表，选择“设置保本单”。
- 2、 设置盈利价差和满足条件时需要平仓的数量。
- 3、 点击“运行”按钮，启动保本单，启动后的保本单会添加到“止盈止损”列表中。



持仓	盈利状态	保本价	生效	触发
权利仓	盈利(最新价>成本价)	(成本价, 最新价)	即时生效	最新价<=保本价
	盈利(最新价>成本价)	[最新价, +∞]	最新价>保本价	最新价<=保本价
	亏损(最新价<成本价)	(成本价, +∞]	最新价>保本价	最新价<=保本价
	平本(最新价=成本价)	(成本价, +∞]	最新价>保本价	最新价<=保本价
义务仓	盈利(最新价<成本价)	(最新价, 成本价)	即时生效	最新价>=保本价
	盈利(最新价<成本价)	[0, 最新价]	最新价<保本价	最新价>=保本价
	亏损(最新价>成本价)	[0, 成本价)	最新价<保本价	最新价>=保本价
	平本(最新价=成本价)	[0, 成本价)	最新价<保本价	最新价>=保本价

1.9 高级下单

操作方法:

- 1、在“竖式下单”面板下填入交易代码、买卖方向、开平方向、价格；（高级下单只可下“买入开仓”、“买入平仓”、“卖出开仓”、“卖出平仓”四种委托，且委托价格只对限价类型有效）
- 2、单击“高级”按钮，在高级选项面板设置单笔委托量、格线个数、格线价差；
- 3、点击“下单”发送委托。



高级下单，买入方向，则以基准价向下按价差下 N 个买单；卖出方向，则以基准价向上按价差下 N 个卖单。

例：截图中下单将产生 3 笔委托，分别为：

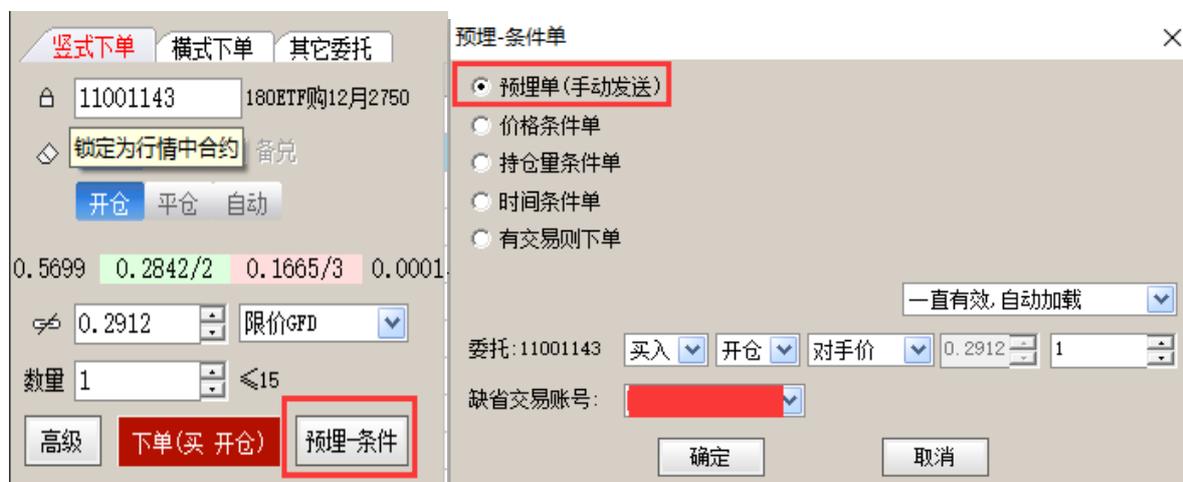
- 1、以 0.2912 的价格委托 2 张买入开仓；
- 2、以 $0.2912 - 0.0001 = 0.2911$ 的价格委托 2 张买入开仓；
- 3、以 $0.2912 - 0.0001 * 2 = 0.2910$ 的价格委托 2 张买入开仓。

1.10 预埋单/条件单

1.10.1 预埋单

操作方法：

- 1、在“竖式下单”面板下填入交易代码、买卖方向、开平方向、价格和数量。
- 2、单击“预埋-条件”按钮，选择“预埋单（手动发送）”。



- 3、设置有效期间，预埋单有一直有效，自动加载和本次运行有效两种方式：

- a) 一直有效，自动加载，表示预埋单在软件重启之后仍然有效。
 - b) 本次运行有效，表示预埋单只在软件本次开启期间是有效的，再次登录软件时条件单失效。
- 4、使用默认的下单参数，或重新调整下单参数。
 - 5、选择交易账号。
 - 6、点击“确定”按钮，设置好的下单会添加到“预埋-条件单”列表下。
 - 7、勾选一个或多个预埋单，点击发送按钮。

当日委托		当日成交		可撤委托		预埋-条件单		止盈止损		风控单	
类型	状态	触发条件	合约	类型	开平	报单价格	报单量	投保	交易所	预埋时间	
<input type="checkbox"/>	手动单	未发送	手动	11000827	买	开仓	对手价	1	投机	上交所	16:13:28

全部
 预埋
 条件
 已发送

1.10.2 条件单

操作方法：

- 1、在“竖式下单”面板下填入交易代码、买卖方向、开平方向、价格和数量。
- 2、单击“预埋-条件”按钮，选择一种条件单触发方式。

竖式下单 横式下单 其它委托

△ 11001143 180ETF购12月2750

◇ 锁定为行情中合约 备注

开仓 平仓 自动

0.5699 0.2842/2 0.1665/3 0.0001

0.2912 限价GFD

数量 1 ≤15

高级 下单(买 开仓) 预埋-条件

预埋-条件单

预埋单(手动发送)

价格条件单

持仓量条件单

时间条件单

有交易则下单

一直有效,自动加载

委托: 11001143 买入 开仓 对手价 0.2912 1

缺省交易账号: [redacted]

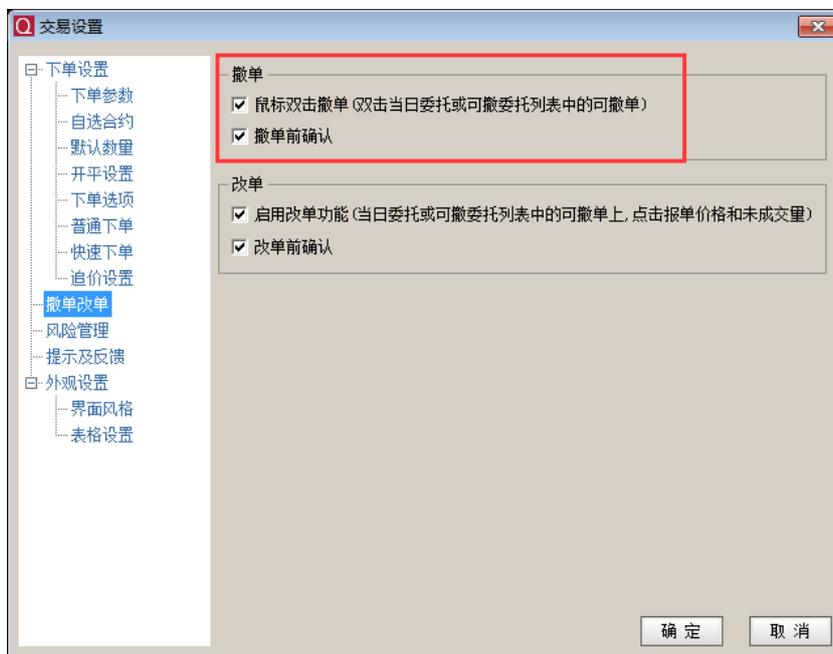
确定 取消

- 3、设置触发条件。
- 4、使用默认的下单参数，或重新调整下单参数。
- 5、选择交易账号。
- 6、点击“确定”按钮，设置好的下单会添加到“预埋-条件单”列表下。
- 7、当行情触发设定条件时，系统自动以所设参数发送委托。

1.11 撤单

撤单的方式有 3 种：

- 1、双击撤单。在【交易设置】窗口修改【撤单改单】，勾选“鼠标双击撤单”。设置完成后，在委托列表中双击未成交挂单即可实现撤单。



- 2、右键撤单。右键单击委托列表，选择撤单或全撤选项。
- 3、按钮撤单。单击委托列表下方的撤单或全撤按钮完成撤单操作。

报单编号	合约	买卖	开平	挂单状态	报单价格	报单量	未成交	成交量	持仓量
#Error-00000001	11000826	卖	平仓	错误	0.2355	2	2	0	180ET
1311000007	11000862	买	开仓	撤单	0.0066	1	0	1	180ET
1311000008	11000828	卖	开仓	全撤	0.00326	1	0	1	180ET
1311000005	11000862	买	开仓	输出	0.0013	1	0	1	180ET
1311000006	11000910	卖	开仓	全部成交	0.00431	1	0	1	180ET
1311000004	11000933	卖	开仓	全部成交	0.00097	1	0	1	180ET
1311000003	11000930	卖	开仓	全部成交	0.2255	1	0	1	180ET
1311000002	11000862	卖	开仓	全部成交	0.0003	1	0	1	180ET
1311000001	11000861	卖	开仓	全部成交	0.0026	1	0	1	180ET

全部单
 挂单
 已成交
 已撤单/错单

1.12 追单

追单，即撤销旧委托的同时将未成交委托按对价、超价重新发出委托。

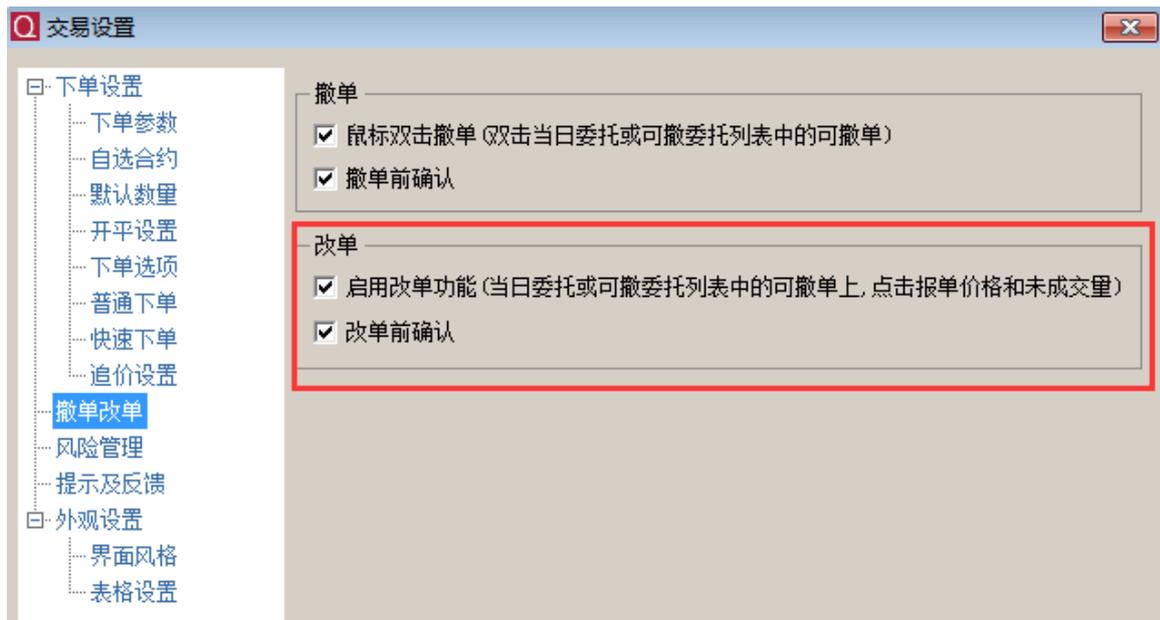
报单编号	合约	买卖	开平	报单量	未成交量	报单价格	报单时间
0010000009	11000782	买	开仓	1	1	0.0001	10:13:49
0010000005	11000	撤单	追对价	1	1	0.0028	10:00:09
		全撤	追超价				
		输出					

1.13 改单

改单，即修改未成交委托的报单价格或数量，撤销旧委托的同时按新价格或数量重新发出委托。

操作方法：

- 1、在【期权交易设置】窗口中修改【撤单设置】，勾选“启用改单功能”选项。



2、在委托列表中，单击报单价格或未成交数量，修改报单参数即可。

当日委托 当日成交 可撤委托 预埋条件单 止盈止损 风控单									
报单编号	合约	买卖	开平	报单量	未成交量	报单价格	报单时间		
0010000009	11000782	买	开仓	1	1	0.0001	10:13:49		
0010000005	11000782	买	开仓	1	1	0.0028	10:00:09		

撤单 全撤

1.14 多账号下单

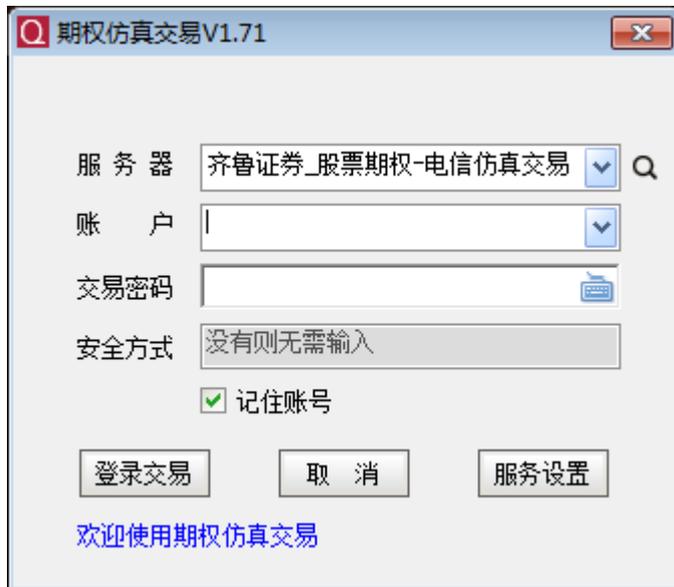
1.14.1 多账号登陆

1、登录账号：

- 1) 点击客户端右上角的【交易】按钮。



2) 输入资金账户和交易密码。



2、添加其它账号：点击交易界面左上角的图标，点击“添加其它账号”。



3、批量登录账号：

1) 点击交易界面左上角的图标，点击“批量登录账号”。



2) 在多账号批量登录窗口选择营业部、服务器填入账号点击添加，将账号添加进列表中。



3) 在列表中输入密码，若密码一致，也可以在“输入统一密码”框中输入统一密码，点击登录按钮。

1.14.2 多账号下单

1、选择账号组：在账号列表中选择“期货多账号组”，切换到多账号交易界面。



2、选择账号：在“账号汇总”标签中选择下单账号。

账号	预设数量	倍数	平仓盈亏	浮动盈亏	资产总值	动态权益	保证金	
<input checked="" type="checkbox"/> ██████████	1	1.0	0.00	-446785.58	3284835.15		77781.00	30
<input checked="" type="checkbox"/> ██████████	2	1.0	0.00	-100388.62	1109432.97		24252.95	10

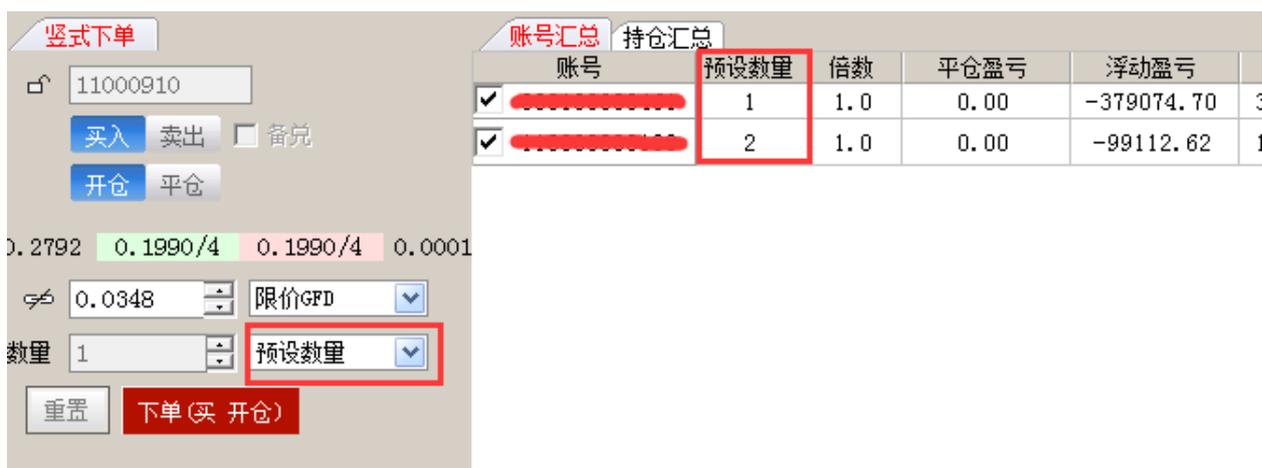
3、输入委托参数：在下单面板中，输入交易合约、交易方式、买卖方向、开平方向、委托价格、委托数量，点击下单按钮，发送委托。

4、委托数量输入：

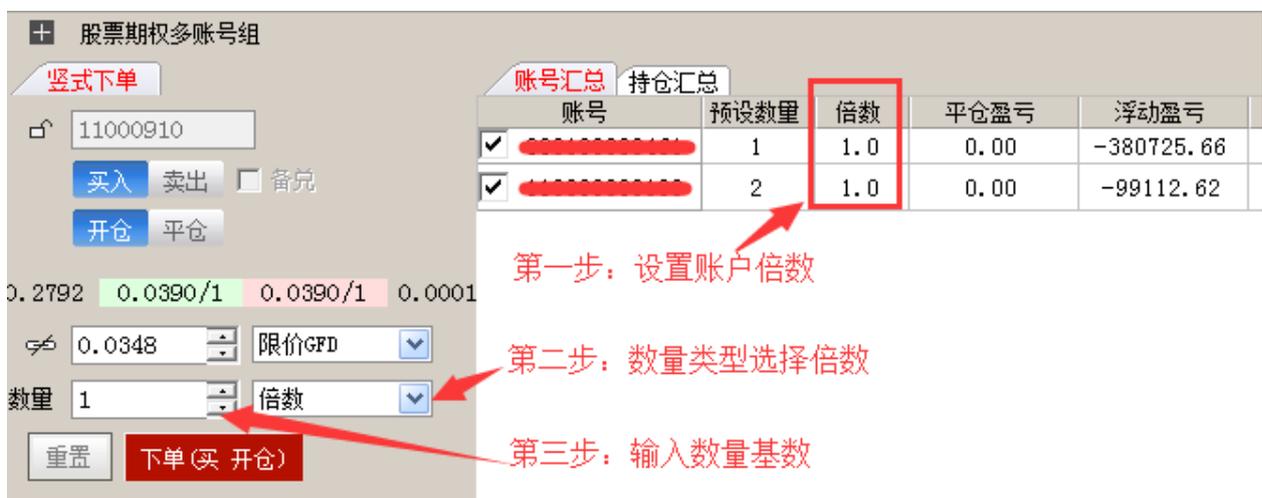
1) 固定数量：每个账号按输入的委托数量下单。



2) 预设数量：首先在“账号汇总”中设置“预设数量”。下单时系统按预设数量下单。



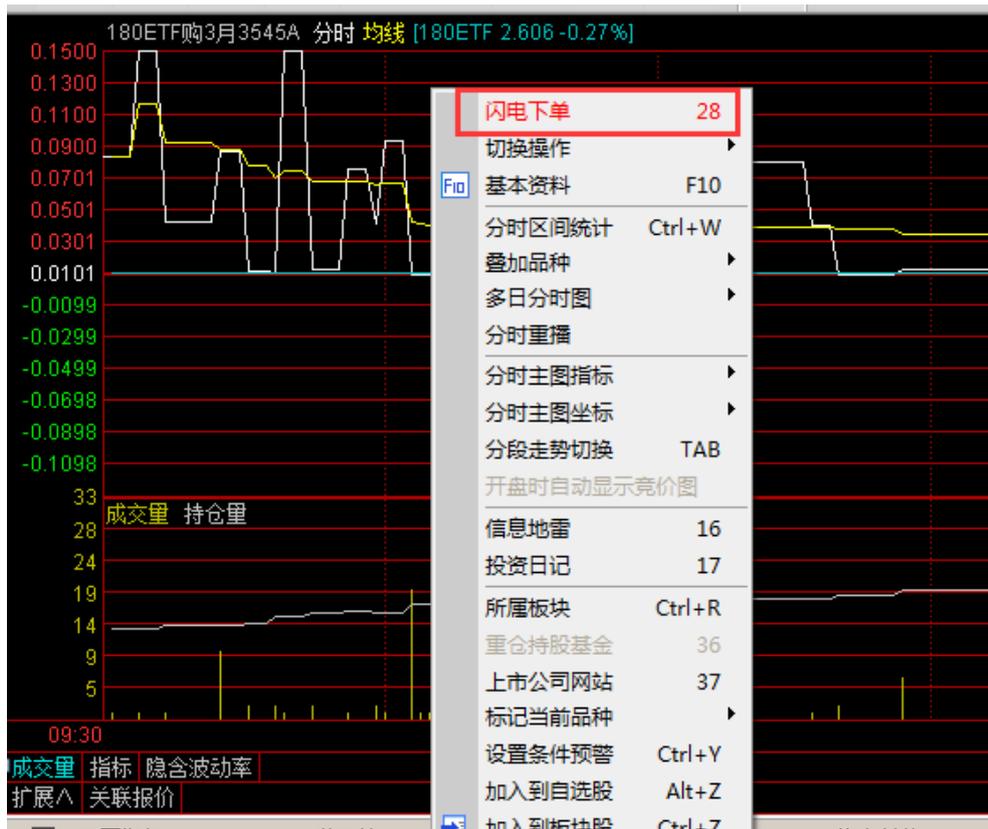
3) 倍数：首先在“账号汇总”中设置“倍数”。下单时，输入一个数量基数，实际下单数量是：数量基数*倍数。



1.15 行情下单

1.15.1 闪电下单

1、在行情中，右键快捷菜单中选择“闪电下单”或输入键盘精灵 28



2、在闪电下单窗口中选择买卖方向、开平方向、委托价格、委托数量后，点击“下单”发送委托

The screenshot shows the '闪电下单' (Lightning Order) window for '11000420 180ETF购3月3545A'. The window contains the following elements:

- Buttons: 买入 (Buy), 卖出 (Sell), 开仓 (Open Position), 平仓 (Close Position)
- Price field: 价格 0.1000
- Quantity field: 数量 1
- Checkboxes: 备用 (Backup)
- Limit: ≤1027
- Button: 下单(买 开仓) (Place Order)

1.15.2 盘口下单

1、在期权合约行情图中点击盘口下单图标，或者按快捷键“Insert”打开盘口下单界面。



- 2、选择开平方向、价格类型、委托数量、是否备兑。
- 3、点击买入/卖出/超一买/超二买/超一卖/超二卖，提交委托。



第2节 持仓列表

2.1 持仓合约

2.1.1 持仓

显示账户全部持仓合约信息。

持仓合约	自选合约	组合持仓	套利策略	备兑股份					
合约代码	合约名称	类型	持仓	可平	买入成本价	最新价	买入成本	浮动盈亏	
11001139	180ETF购12月2550	权利	1	1	0.6345	0.4950	6344.60	-1394.	
11001140	180ETF购12月2600	权利	1	1	0.4045	0.2773	4045.00	-1272.	
11001142	180ETF购12月2700	权利	1	0	0.4038	0.3120	4038.50	-918.	
11001143	180ETF购12月2750	权利	8	5	0.2820	0.2919	22562.67	789.	
11001144	180ETF购12月2800	权利	2	2	0.1713	0.0781	3426.00	-1864.	
11001145	180ETF购12月2850	权利	1	1	0.2015	0.1338	2015.00	-677.	
11001145	180ETF购12月2850	义务	1	0	-0.2289	0.1338	-2289.00	951.	
11001146	180ETF购12月2900	权利	4	2	0.1704	0.0611	6816.03	-4372.	
11001146	180ETF购12月2900	义务	1	0	-0.1025	0.0611	-1025.20	414.	
11001147	180ETF购12月2950	义务	5	4	-0.0021	0.0526	-105.00	-2525.	
11001149	180ETF沽12月2600	权利	1	1	0.0029	0.0367	29.00	338.	
11001150	180ETF沽12月2650	权利	3	3	0.0101	0.0126	304.25	73.	

持仓
 散单
 希腊值(散单)

2.1.2 散单

显示账户除去组合持仓之外的持仓合约信息。

持仓合约	自选合约	组合持仓	套利策略	备兑股份					
合约代码	合约名称	类型	持仓	可平	买入成本价	最新价	买入成本	浮动盈亏	
11001139	180ETF购12月2550	权利	1	1	0.6345	0.4950	6344.60	-1394.	
11001140	180ETF购12月2600	权利	1	1	0.4045	0.2773	4045.00	-1272.	
11001142	180ETF购12月2700	权利	1	0	0.4038	0.3120	4038.50	-918.	
11001143	180ETF购12月2750	权利	8	5	0.2820	0.2919	22562.67	789.	
11001144	180ETF购12月2800	权利	2	2	0.1713	0.0781	3426.00	-1864.	
11001145	180ETF购12月2850	权利	1	1	0.2015	0.1338	2015.00	-677.	
11001145	180ETF购12月2850	义务	1	0	-0.2289	0.1338	-2289.00	951.	
11001146	180ETF购12月2900	权利	4	2	0.1704	0.0611	6816.03	-4372.	
11001146	180ETF购12月2900	义务	1	0	-0.1025	0.0611	-1025.20	414.	
11001147	180ETF购12月2950	义务	5	4	-0.0021	0.0526	-105.00	-2525.	
11001149	180ETF沽12月2600	权利	1	1	0.0029	0.0367	29.00	338.	
11001150	180ETF沽12月2650	权利	3	3	0.0101	0.0126	304.25	73.	

持仓
 散单
 希腊值(散单)

2.1.3 希腊值

统计标的证券相同的持仓合约的组合希腊值。

持仓合约	自选合约	组合持仓	套利策略	备兑股份					
分类	合约	类型	数量	合约单位	Delta	Gamma	Vega	Rho	
所有	90000537	权利	1	10000	-5136.0	9508.0	11503.0	-11731.0	
159915	90000527	备兑	4	10000	-23172.0	-37304.0	-45128.0	-44312.0	
159901	90000302	权利	2	10000	-19998.0	0.0	0.0	-2462.0	
510300	90000189	备兑	1	10000	-8193.0	-48582.0	-825.0	-411.0	
510180	90000059	备兑	1	10000	-6719.0	-12315.0	-7294.0	-6410.0	
	90000054	权利	1	10000	-9992.0	267.0	17.0	-1175.0	
	90000050	权利	2	10000	-3782.0	56572.0	3564.0	-416.0	
	90000044	权利	1	10000	139.0	3708.0	234.0	15.0	
	90000040	权利	5	10000	48750.0	30505.0	1920.0	5060.0	
	90000037	义务	2	10000	-20000.0	-0.0	-0.0	-1916.0	
	11001655	义务	1	10000	-1250.0	-19324.0	-1966.0	-378.0	
	11001654	权利	2	10000	8110.0	72780.0	7406.0	2436.0	

持仓
 散单
 希腊值(散单)

2.2 自选合约

操作流程:

- 1) 打开【交易设置】-【自选合约】;
- 2) 将常用合约添加到自选合约列表中, 并点击【确定】按钮保存;
- 3) 在【自选合约】列表中点击合约, 系统自动关联到该合约行情;

持仓合约	自选合约	组合持仓	套利策略	备兑股份				
合约代码	合约名称	合约单位	交割月份	行权价格	结算方式	单位保证金	到期日	
11001143	180ETF购12月2750	10000	12月	2.7500	欧式	9267.60	2016-12	
11001145	180ETF购12月2850	10000	12月	2.8500	欧式	5567.60	2016-12	
11001146	180ETF购12月2900	10000	12月	2.9000	欧式	5347.60	2016-12	

2.3 组合持仓

显示账户全部组合持仓信息。

持仓合约 代码	自选合约 策略名称	组合持仓	套利策略	备兑股份	组合盈亏	组合保证金	合约代码(1)	合约名称(1)
2016112800000015	认购牛市价差策略	1	1		1038.00	0.00	11001181	180ETF购12月2450
2016112900000033	认购牛市价差策略	1	1		3146.00	0.00	11001143	180ETF购12月2750
2016113000000022	认购牛市价差策略	1	1		2336.20	0.00	11001143	180ETF购12月2750
2016113000000023	认购熊市价差策略	1	1		-3786.00	0.00	11001331	180ETF购12月3200
2016113000000031	认购熊市价差策略	1	1		-2997.71	0.00	11001331	180ETF购12月3200
2016113000000061	认沽牛市价差策略	1	1		1206.49	0.00	11001182	180ETF沽12月2450
2016113000000065	认购熊市价差策略	1	1		-1866.45	0.00	11001279	180ETF购12月3100
2016113000000099	认购熊市价差策略	2	2		606.00	0.00	11001654	180ETF购1月3000
2016120100000001	认购熊市价差策略	1	1		-1078.17	0.00	11001279	180ETF购12月3100
2016120100000011	认购牛市价差策略	1	1		1970.79	0.00	11001142	180ETF购12月2700
2016120100000012	认购牛市价差策略	1	1		-114.72	0.00	11001146	180ETF购12月2900
2016120100000023	认购牛市价差策略	1	1		-114.72	0.00	11001146	180ETF购12月2900
2016120500000002	认购牛市价差策略	1	1		3483.00	0.00	11001143	180ETF购12月2750
2016120600000026	认购牛市价差策略	1	1		-495.45	0.00	11001279	180ETF购12月3100

2.4 套利策略

2.4.1 设置套利组合

操作流程：

- 1) 点击【设置套利组合】，打开组合设置窗口；
- 2) 选择策略类型；
- 3) 选择每腿合约及交易方向；
- 4) 根据合约设置，自动生成套利公式，其中“+”为买，“-”为卖；

套利组合设置

两腿
 三腿
 四腿

合约1: 中国平安 中国平安购12月3687B 基数 1 方向 买
 合约2: 中国平安 中国平安沽12月3687B 基数 1 方向 卖
 合约3: 上汽集团 基数 1 方向 买
 合约4: 上汽集团 基数 1 方向 买

备注: 无

套利公式: 10000218*1+10000223*1

确定

5) 点击【确定】，添加到【套利策略组合】列表中

套利组		备注
10000218*1+10000223*1		无

套利策略持仓 套利策略组合 设置套利组合

2.4.2 套利策略下单

操作流程：

- 1) 在【套利策略组合】列表中双击套利公式；
- 2) 在下单面板中输入该组策略的交易数量及价格类型；
- 3) 点击【开仓】或【平仓】；

套利组		备注
10000218*1+10000223*1		无

套利策略持仓 套利策略组合

2.4.3 套利策略监控

策略成交后，显示到【套利策略持仓】列表中，可以查看该策略的组合持仓数量及组合盈亏。

第3节 其他功能

3.1 账户查询

交易面板上方，可查询账户资金实时行情，也可点击标签查看资金详情。



3.2 综合查询

点击交易面板右上方的“查”，进入综合查询面板。



综合查询，包含委托查询、成交查询、自动行权、当日行权指派、历史行权指派、信息推送、资金资产对账单、资金流水对账单、合约对账单等。



3.3 银行转账

1、选择【银行转账】

可用资金 1041871.73 风险率 2.07%

查 **银** 设置 锁屏 窗口 退出

报单编号	合约	买卖	开平	挂单状态	报单价格	报单量	未成交	成交量	持仓
0010000009	11000782	买	开仓	未成交	0.0001	1	1	0	180ET
0010000008	11000781	买	开仓	全部成交	0.0197	1	0	1	180ET
0010000007	11000909	买	开仓	全部成交	0.1212	1	0	1	180ET
0010000006	11000782	买	开仓	全部成交	0.0028	1	1	0	180ET
0010000005	11000782	买	开仓	未成交	0.0028	1	1	0	180ET
0010000004	11000782	买	开仓	全部成交	0.0028	1	0	1	180ET

2、选择银行、币种，输入金额、密码，点击银行转期权/期权转银行实现转账

银行转账

银行代码 银行简称 银行账号 币种名称 期权可取资金 银行可转资金 银行简称

选择银行

选择币种

输入金额

输入密码

刷新转账记录

银行转期权

期权转银行

流水号	银行代码	银行名称	转账金额	操作时间	操作类别	摘要
-----	------	------	------	------	------	----

3、点击刷新转账记录，查看历史转账记录

银行转账

银行代码 银行简称 银行账号 币种名称 期权可取资金 银行可转资金 银行简称

1042597.40 0.00 查

币种 转账金额 资金密码 银行密码

人民币 0

刷新转账记录

银行转期权

期权转银行

流水号	银行代码	银行名称	转账金额	操作时间	操作类别	摘要
-----	------	------	------	------	------	----

转账记录

3.4 结算单查询

点击交易面板右上方的【更多功能】-【结算单查询】，进入结算单查询面板。



3.5 修改密码

1、选择【更多功能】-【修改密码】



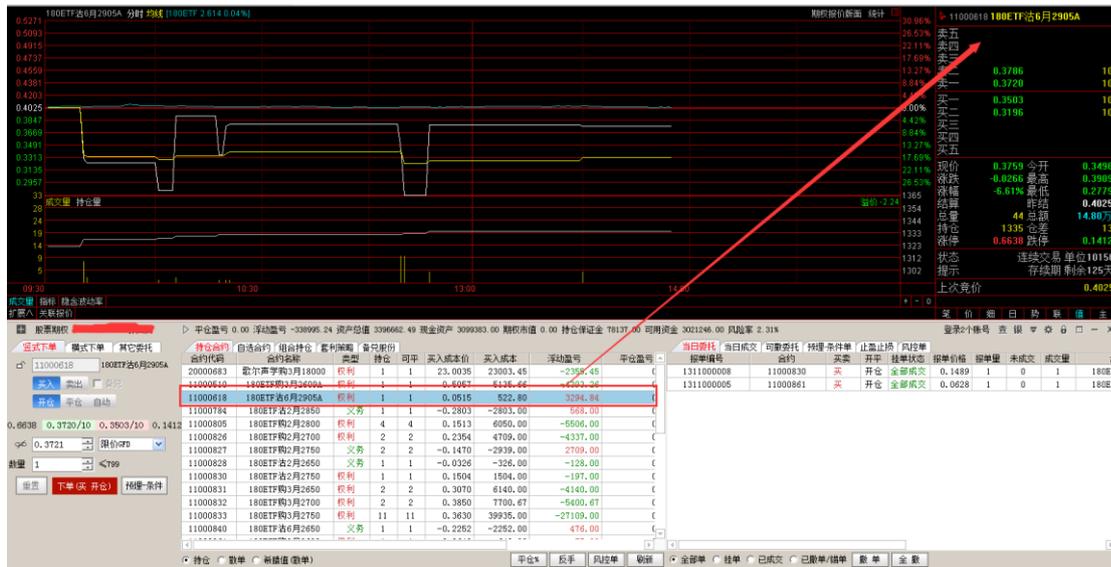
2、选择密码类型，依次输入原密码、新密码、确认密码，点击确定。



3.6 列表联动行情

勾选【更多功能】-【列表联动行情】后，单击交易面板中的合约，将同时联动行情中的合约。





第4节 参数设置

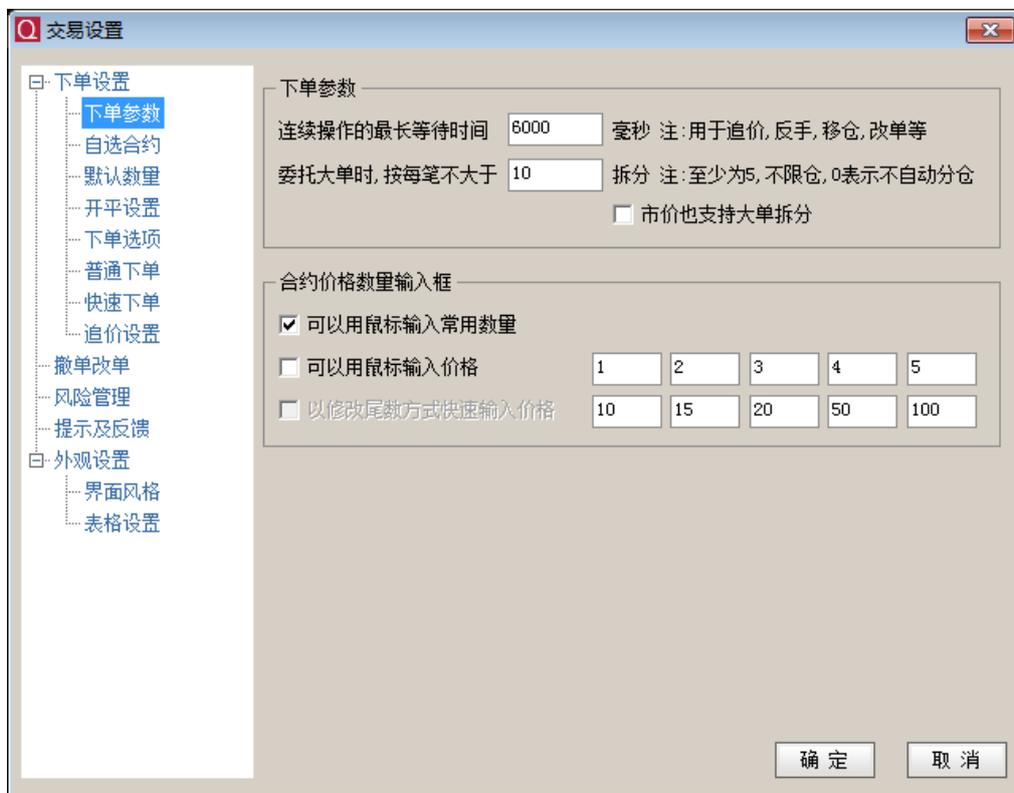
4.1 下单设置

4.1.1 下单参数

连续操作的最长等待时间：当启用追价、反手、移仓、改单等功能时，若等待时间超过所设置的时间，则该操作的后续步骤将不再进行。

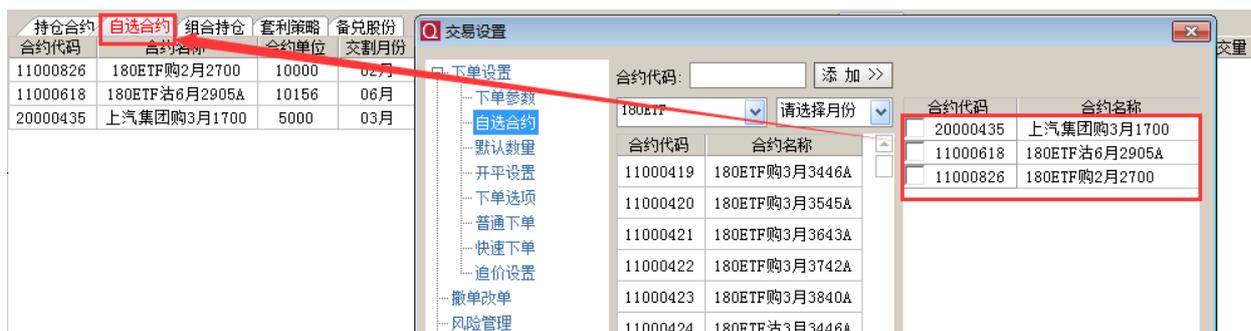
大单拆分，当下单数量大于设定数量时，将下单数量按设置进行拆分。

键盘输入，勾选之后可以在横式下单和竖式下单中通过鼠标选择合约的下单数量和委托价格。



4.1.2 自选合约

自选合约设置之后会显示在“自选合约”列表中，可以通过单击自选合约列表，将合约代码快速输入到下单面板的代码框中。



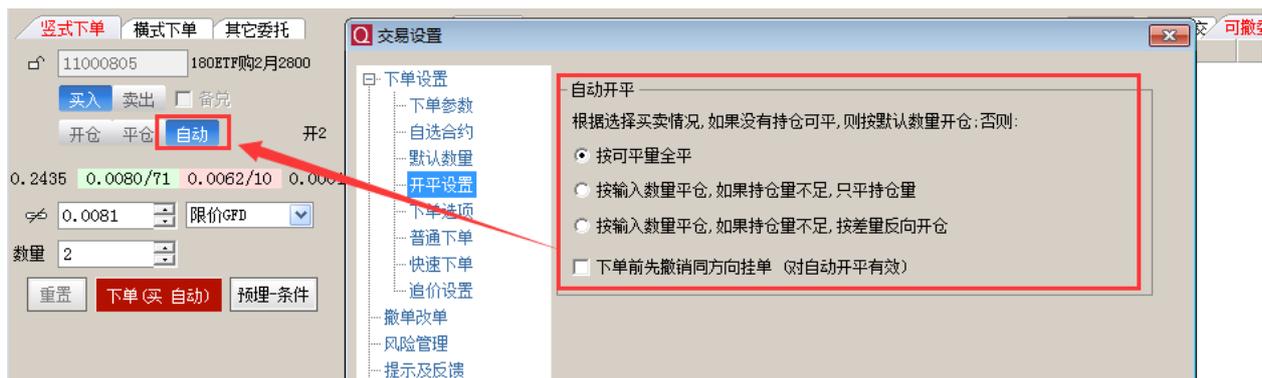
4.1.3 默认数量

通过设置默认数量和快捷代码可以快速输入合约和手数。

输入 cc，自动转换为合约代码



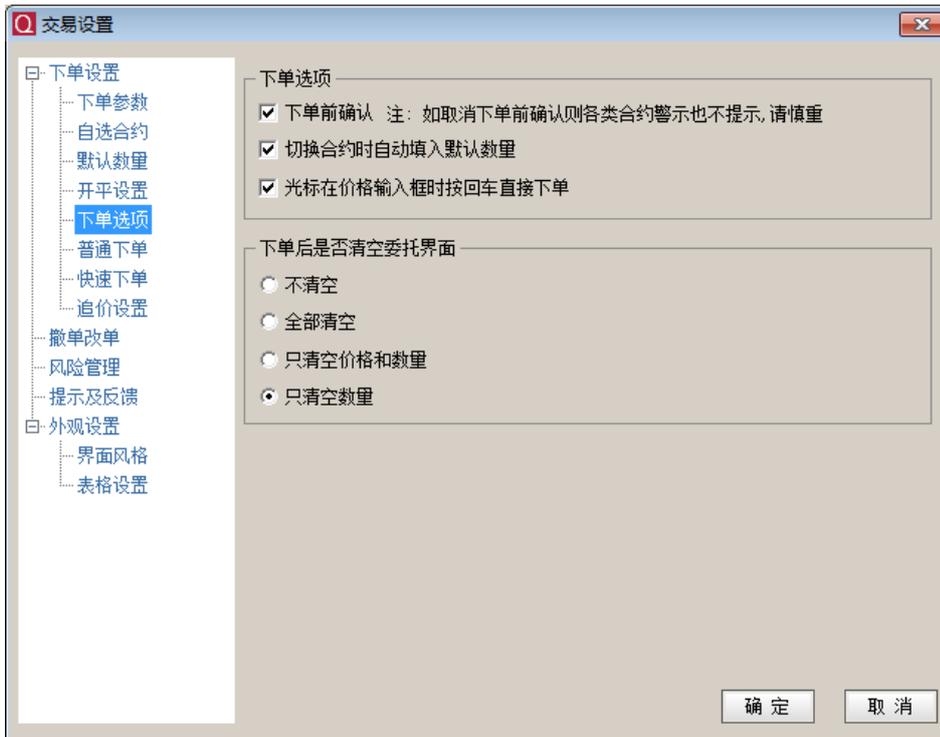
4.1.4 开平设置



4.1.5 下单选项

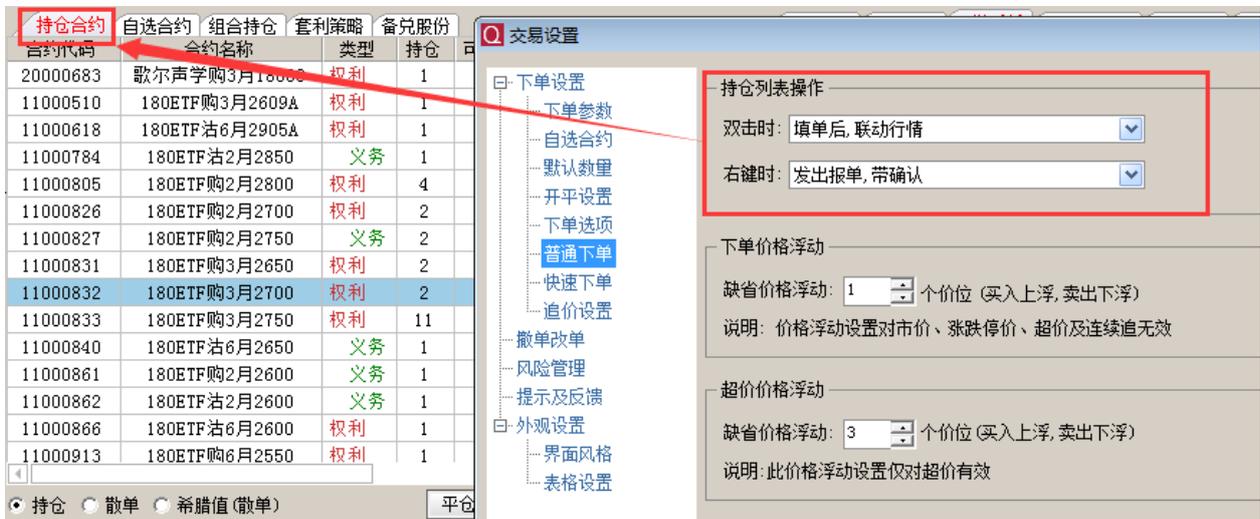
可选择下单前确认、切换合约时自动填入默认数量、光标在价格输入框时按回车直接下单。

可选择下单后是否清空委托界面。

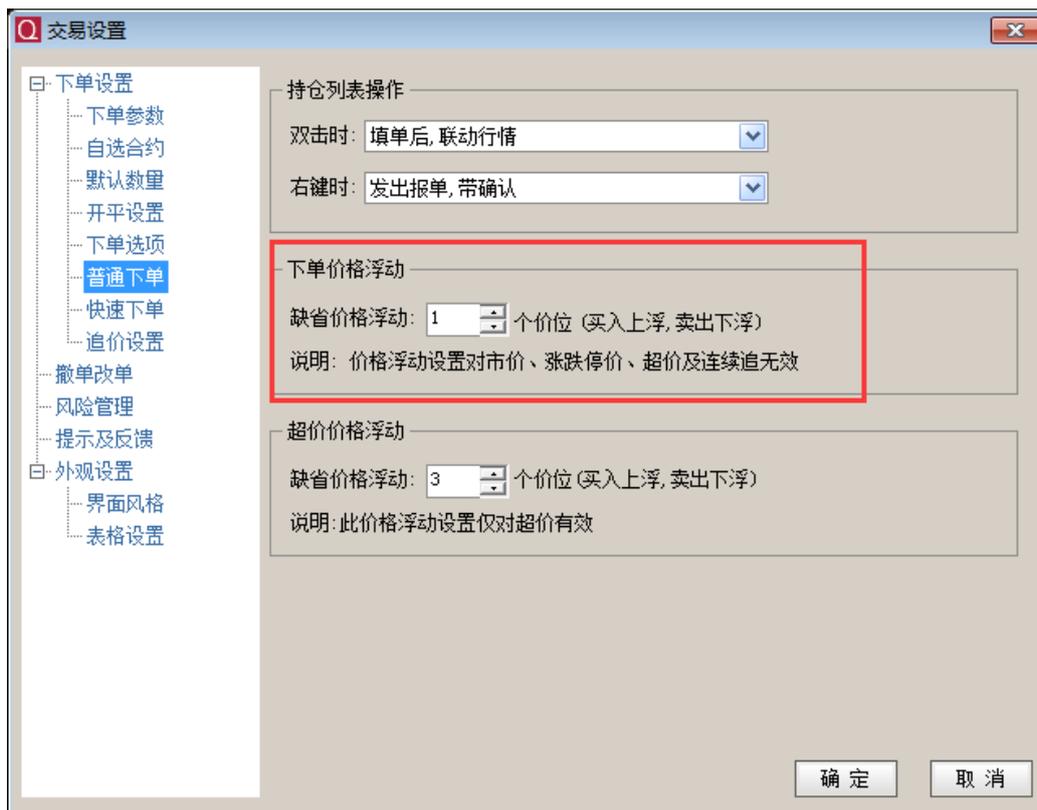


4.1.6 普通下单

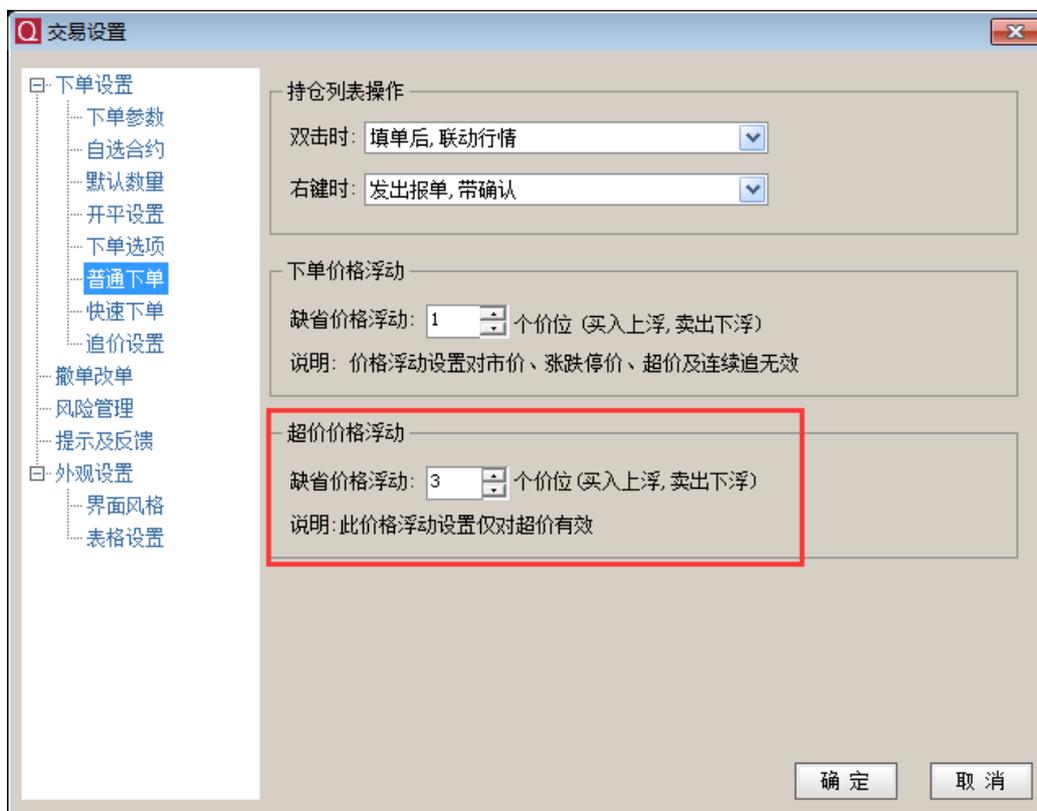
通过设置持仓列表操作，可以使用鼠标单击或者双击持仓列表快速填单。



下单价格浮动的设置对于横式下单、竖式下单、条件单、套利下单等方式下的最新价、排队价和对手价都起作用。例，当前期权合约买1价为3.000，设置缺省价格浮动1个价位，当以排队价下多单的时候，系统会以3.001发送委托。



超价价格浮动的设置对于横式下单、条件单、套利下单等方式下的超价都起作用。例，当前期权合约买 1 价为 3.000，设置缺省价格浮动 3 个价位，当以超价下空单的时候，系统会以 2.997 发送委托。



4.2 风险管理

通过对单笔下单的数量、委托价格、买卖价差的设置实现风险管理功能，避免过度交易和下单失误。

