



机构经纪投资管理系统机构客户端

机构客户端用户手册 (V1.2)

资产管理事业部

2015 年 09 月

目 录

目 录.....	2
欢迎使用 PB 机构客户端.....	7
系统环境要求.....	7
约定说明.....	8
文档修订记录.....	8
第一章 系统入门.....	9
1.1 系统简介.....	9
1.2 账户结构.....	10
1.3 系统界面介绍.....	11
1.3.1 登录系统.....	11
1.3.2 系统窗口.....	12
1.3.3 工具栏.....	13
第二章 投资前准备.....	16
2.1 账户维护.....	16
2.2 资金调整.....	18
2.3 证券调整.....	20
2.4 人员维护.....	21
2.5 费用维护.....	25
2.6 风险控制.....	26
2.6.1 风控设置.....	26
2.6.1.1 A 证券持仓数量控制.....	32
2.6.1.2 B 证券持仓成本控制.....	33
2.6.1.3 C 证券持仓市值控制.....	35
2.6.1.4 E 资产类别市值控制.....	37
2.6.1.5 F 交易额控制.....	39
2.6.1.6 G 当日交易量/市场成交量控制.....	42
2.6.1.7 H 执行价格控制.....	44
2.6.1.8 I 证券买卖控制.....	46
2.6.1.9 J 同向反向控制.....	47
2.6.1.10 Q 交易频率控制.....	50
2.6.1.11 R 期货保证金控制.....	50
2.6.2 风控预警查询.....	51
2.6.3 证券池管理.....	52
2.7 风险监控与处置.....	53
2.7.1 风险风控设置.....	54
2.7.1.1 执行计划设置.....	55
2.7.1.2 A 类净值监控.....	56
2.7.1.3 C 类盈亏监控.....	57
2.7.1.4 E 类资产市值监控.....	59
2.7.1.5 F 类期货风险率.....	60
2.7.1.6 G 类保证金占用.....	61

2.7.2	风险监控.....	63
2.7.2.1	监控数据.....	63
2.7.2.2	禁买权限设置.....	66
2.7.2.3	监控日志.....	68
2.7.3	强平联系人维护.....	68
第三章	交易管理.....	69
3.1	证券交易 - 单账户交易.....	69
3.1.1	界面.....	69
3.1.1.1	主界面.....	69
3.1.1.2	资金栏.....	70
3.1.1.3	持仓区.....	71
3.1.1.4	行情栏.....	73
3.1.1.5	委托栏.....	74
3.1.1.6	查询区.....	75
3.1.1.7	布局设置.....	77
3.1.2	交易.....	78
3.1.2.1	单账户委托.....	78
3.1.2.2	撤单.....	80
3.1.3	参数设置.....	82
3.2	证券交易 - 多账户交易.....	87
3.2.1	界面.....	87
3.2.1.1	主界面.....	87
3.2.1.2	行情栏.....	88
3.2.1.3	委托栏.....	88
3.2.1.4	持仓区.....	90
3.2.1.5	查询区.....	93
3.2.2	交易.....	95
3.2.2.1	产品组维护.....	95
3.2.2.2	多账户委托.....	96
3.2.2.3	撤单、改单.....	103
3.2.3	参数设置.....	106
3.3	证券交易 - 算法交易.....	108
3.4	新股申购.....	109
3.2.1	申购.....	109
3.2.2	投票.....	109
3.5	期货交易 - 单账户交易.....	112
3.5.1	界面.....	112
3.5.1.1	主界面.....	112
3.5.1.2	资金栏.....	113
3.5.1.3	功能栏.....	114
3.5.1.4	报价栏.....	114
3.5.1.5	持仓区.....	116
3.5.1.6	行情栏.....	116
3.5.1.7	委托栏.....	117

3.5.1.8	查询区.....	120
3.5.1.9	成交栏.....	122
3.5.2	交易.....	123
3.5.2.1	自选合约设置.....	123
3.5.2.2	普通委托.....	126
3.5.2.3	撤单、改单.....	129
3.5.2.4	平仓、一键清仓.....	132
3.5.2.5	反手.....	134
3.5.2.6	埋单委托.....	136
3.5.2.7	批量委托.....	140
3.5.2.8	止盈止损委托.....	143
3.5.2.9	追单.....	147
3.5.3	参数设置.....	149
3.5.3.1	显示设置.....	149
3.5.3.2	下单设置.....	154
3.5.3.3	快捷键设置.....	159
3.6	期货交易 - 多账户交易.....	159
3.6.1	界面.....	159
3.6.1.1	主界面.....	159
3.6.1.2	功能栏.....	160
3.6.1.3	持仓区.....	161
3.6.1.4	行情栏.....	162
3.6.1.5	委托栏.....	163
3.6.1.6	查询区.....	164
3.6.1.7	成交栏.....	165
3.6.2	交易.....	166
3.6.2.1	产品组维护.....	166
3.6.2.2	下多账户委托.....	168
3.6.2.3	撤单、改单.....	174
3.6.2.4	平仓、一键清仓.....	177
3.7	组合交易.....	178
3.7.1	界面.....	179
3.7.1.1	主界面.....	179
3.7.1.2	资金栏.....	179
3.7.1.3	委托栏.....	180
3.7.1.4	价格设置.....	183
3.7.2	交易.....	185
3.7.2.1	模板导入委托.....	185
3.7.2.2	文件导入委托.....	188
3.7.2.3	撤单、改单.....	191
3.7.3	参数设置.....	194
3.8	期货组合单.....	195
3.8.1	界面.....	195
3.8.1.1	主界面.....	195

3.8.1.2	资金栏.....	196
3.8.1.3	功能栏.....	197
3.8.1.4	报价栏.....	197
3.8.1.5	持仓栏.....	199
3.8.1.6	行情栏.....	200
3.8.1.7	委托栏.....	200
3.8.1.8	查询区.....	201
3.8.1.9	成交栏.....	203
3.8.2	交易.....	204
3.8.2.1	标准组合单设置.....	204
3.8.2.2	标准套利委托.....	209
3.8.2.3	手工埋单委托.....	210
3.8.2.4	自定义组合单设置.....	211
3.8.2.5	自定义套利委托.....	213
3.8.2.6	互换.....	216
3.8.2.7	先后套利.....	217
3.8.2.8	追单.....	218
3.8.2.9	撤单、改单.....	220
3.8.2.10	平仓、一键清仓.....	222
3.8.3	参数设置.....	224
3.8.3.1	显示设置.....	225
3.8.3.2	下单设置.....	226
3.9	期现套利.....	228
3.9.1	界面.....	228
3.9.1.1	主界面.....	228
3.9.1.2	行情栏.....	229
3.9.1.3	委托栏.....	230
3.9.1.4	行情设置.....	235
3.9.2	交易.....	236
3.9.2.1	产品组维护.....	236
3.9.2.2	期现套利.....	238
3.9.2.3	撤单、改单.....	244
3.9.3	参数设置.....	249
3.10	模板管理.....	250
3.10.1	界面.....	250
3.10.2	模板类型.....	251
3.10.2.1	期现套利模板.....	251
3.10.2.2	组合交易模板.....	254
3.11	融资融券交易.....	256
3.5.1	业务简介.....	256
3.5.2	融资买入.....	257
3.5.3	融券卖出.....	259
3.5.4	卖券还款.....	261
3.5.5	买券还券.....	262

3.5.6	直接还款.....	263
3.5.7	直接还券.....	264
3.5.8	担保券交存.....	264
3.5.9	担保券提取.....	266
3.5.10	担保券交易.....	267
3.5.11	委托查询.....	268
3.5.12	额度查询.....	269
第四章	信息查询.....	270
4.1	委托成交查询.....	270
4.2	流水查询.....	271
4.3	资产分析.....	274
4.3.1	产品资产查询.....	274
4.3.2	单元资产查询.....	277
4.3.3	现货持仓查询.....	278
4.3.4	交易所回购.....	280
4.3.5	期货资产分析.....	281
4.3.6	标准券查询.....	282
4.3.7	可质押债券.....	283
4.3.8	期货持仓查询.....	284
4.4	基础数据查询.....	286
第五章	财务管理.....	287
5.1	资金管理.....	287
5.2	证券管理.....	291

欢迎使用 PB 机构客户端

机构经纪投资管理系统（简称：PB）机构管理端手册包括以下部分：

第一章 系统入门

系统功能、账户结构及主界面介绍。

第二章 投资前准备

介绍投资前相关基础信息的维护工作。

第三章 交易管理

介绍系统的现货交易（即沪深交易所业务）相关功能，以及期货交易(包括中金所、上期所、郑商所、大商所业务)和组合交易等相关功能。

第四章 信息查询

介绍证券基础数据查询，资产查询，持仓查询，及交易成交流水相关查询。

第五章 财务管理

介绍资金、证券管理等相关操作。

系统环境要求

具体软硬件环境要求请参见《投资各产品软硬件配置信息汇总.xlsx》文档，

文档存放 SVN 路径：

产品部：<https://192.168.57.208/fund/dept1/FM/O32/Management/03> 培训/安装手册/投资各产品软硬件配置信息汇总。

客服部：请向客服总部获取。

约定说明

文档中的符号格式说明

【交易管理】：表示一个菜单。【】中的部分表示菜单的名称。

确定：表示一个按钮，方框中的部分表示按钮的名称。

字段说明：表示字段说明，文字部分是字段名称。

[刷新]：表示右键菜单：[]中的部分是菜单名称。

<委托查询>：表示一个 Tab 页，<>中的部分是 Tab 页的名称。

文档修订记录

日期	版本	修订人	修订说明
2014-09	V1.0	占志滔	创建文档
2014-11	V1.0	占志滔	根据 PB_20141105A 程序修订
2014-12	V1.1	占志滔	1) 之前按模块拆分成多份文档，现合并成一份，按照业务流程修订 2) 根据最新 PB_20141205 程序修订
2015-02	V1.1	占志滔	根据 PB_20150129A 程序修订
2015-05	V1.1	占志滔	增加风险监控与处置模块的说明
2015-06	V1.1	占志滔	根据 PB_20150529 程序修订
2015-9	V1.2	程诗莹	重新修订证券交易、期货交易、组合交易、期货组合单、期现套利、模板管理、资产分析内容

第一章 系统入门

1.1 系统简介

机构经纪投资管理系统采用三层架构设计模型，底层数据访问层采用大型的 Oracle 数据库，支持 oracle10g, oracle11g，数据本身可以保存在存储上，安全稳定；中间服务层业务逻辑计算采用恒生自主研发的 ASAR 中间件，支持 LINUX 或者 AIX 操作系统；数据展示和操作层只需要在使用者电脑上安装客户端连接服务器即可，既可以通过机构客户端程序进行投资交易操作，也可以使用对接的三方系统开展投资业务；整体系统架构安全、稳定，应用广泛。

机构经纪投资管理系统主要包括券商管理端、机构客户端、统一接入平台、交易报盘通道等。其功能结构，如图 1-1-1 所示：

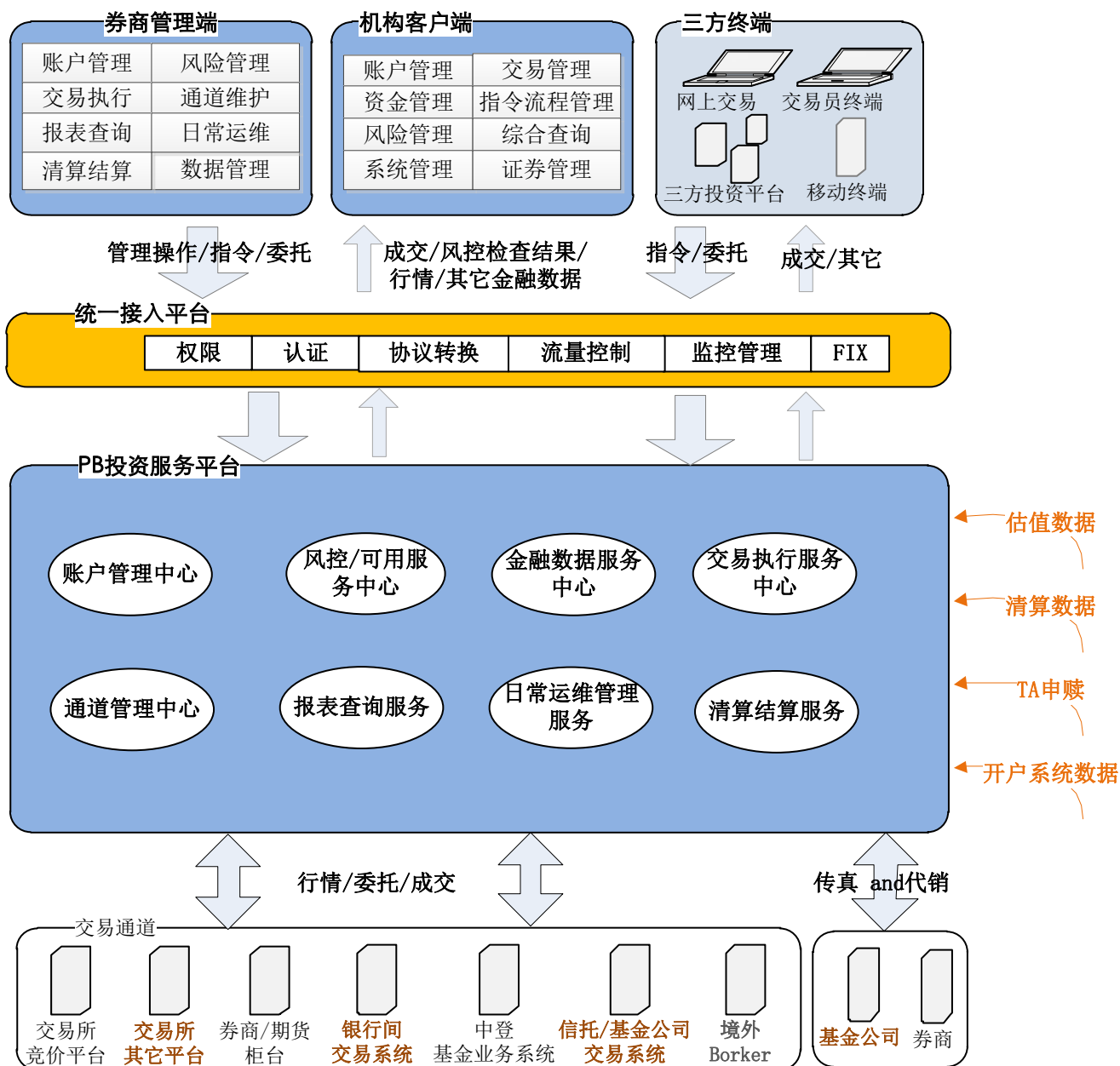


图 1-1-1

1.2 账户结构

机构经纪投资管理系统（简称：PB）的账户结构分为公司层、产品层、资金账户层和单元层，如图 1-2-1 所示。券商端进行账户管理只进行到资金账户层，而单元层的账户管理是由机构端进行。

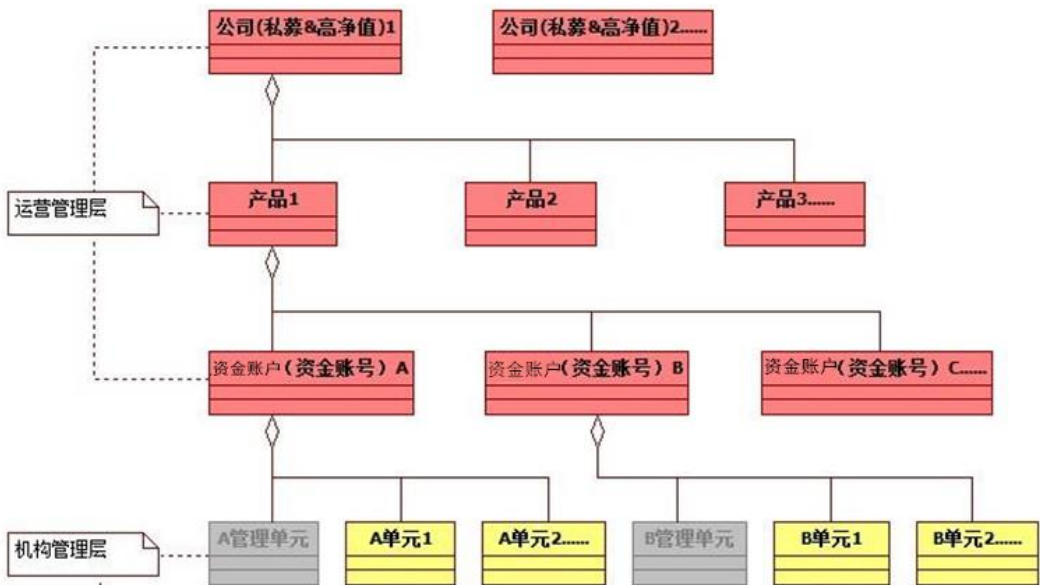


图 1-2-1

1.3 系统界面介绍

1.3.1 登录系统



双击图标，进入机构客户端的登录界面。如图所示：



图 1-3-1

点击 **网络设置**，根据实际网络选择接入的站点，通常建议使用连接速度快的链路。如

图 1-3-2 所示:



图 1-3-2

如需要设置代理才能上网，请在“代理设置”处，设置相关代理，图所示：



图 1-3-3

最后点击确认，回到登录界面。输入相应的操作员代码及操作员密码和验证码后，点击登录按钮，登录系统。

1.3.2 系统窗口

登录系统后，显示主窗口。如图所示：



图 1-3-4

1.3.3 工具栏

在窗口的右上侧，点击按钮，可以看到系统的工具栏。如图所示：

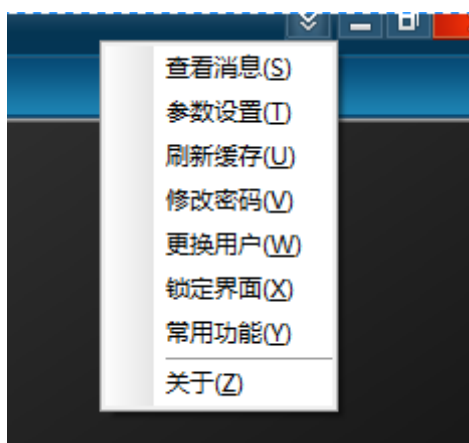


图 1-3-5

1、参数设置：更改锁屏的时间间隔，对锁屏的间隔时间进行设置；修改证券交易参数及交易设置。如图所示：



图 1-3-6

2、修改密码：对登录的用户进行密码的修改并进行密码强度的判定。如图所示：



图 1-3-7

3、更换用户：可以更换成其他用户进行登录。如图所示：

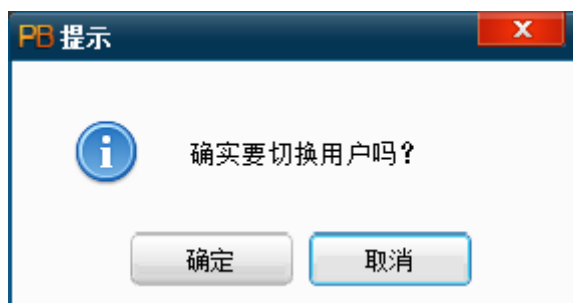


图 1-3-8



图 1-3-10

第二章 投资前准备

投资前准备主要介绍机构端的基础设置，如私募公司的账户、资金、人员、风控维护等私募公司系统管理员所需要做的一些准备工作。

2.1 账户维护

功能介绍

机构经纪投资管理系统（简称：PB）的账户结构分为公司层、产品层、资金账户层和单元层。券商端进行账户管理进行到资金账户层后，机构端则可维护资金账户的资金账号的密码，及可维护单元层。一个资金账户可维护多个单元。如图 2-1-1 所示：

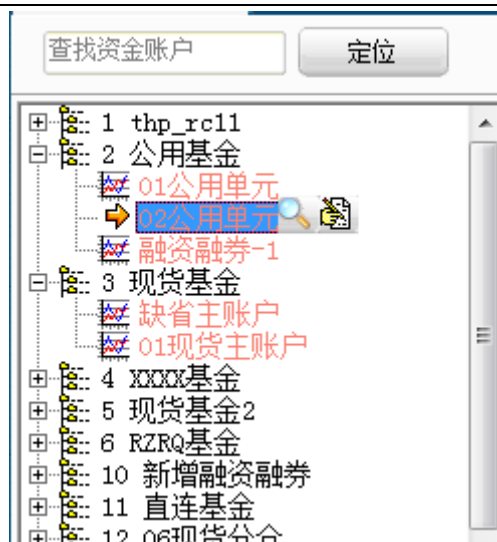


图 2-1-1

操作说明

在【系统管理】→【账户维护】中，维护资金账户的资金账号的密码。

➤ 维护资金账户密码

选中资金账户后，点击鼠标右键，选择密码校验，弹出如图 2-1-2 所示对话框：



输入交易密码，点击“确定”，会提示校验密码成功。密码校验完成后，通知券商总公司维护人员进行账户初始柜台同步。

➤ 维护单元

选中资金账户后，点击界面新增，弹出如图 2-1-4 所示对话框：



图 2-1-4

以下字段为必填项：

单元编号：必填，编号不能重复。

名称：必填，单元名称。

2.2 资金调整

功能介绍

在券商端完成对资金账户添加资金后，和完成同步柜台数据到资金账户及单元新建后，需要从资金账户划转资金到相应单元，用于其投资交易。

操作说明

在【系统管理】→【资金管理】→<资金管理>界面，如图 2-2-1 所示。选中对应需要调整的单元，点击划转资金，弹出如图 2-2-2 所示对话框，将资金从资金账户划转到单元。

资金管理													
资金管理 融资负债 资金冻结查询 资金类操作查询													
调整资金 冻结资金 解冻资金 划转资金													
查询 刷新 打印 导出 布局设置													
日期	产品编号	产品代码	产品名称	单元名称	币种	期初现金余额	交易保证金	当前现金余额	T+0交易可用	T+1交易可用	冻结金额	解冻金额	当日买卖
2013-02-11	605	06055	期货	期货单元	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	605	06055	期货	期货测试_1	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	605	06055	期货	1111	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	605	06055	期货	222	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	基金单元	人民币	0.00	0.00	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	0.00	0.00	
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	zhiy测试账户	人民币	0.00	0.00	1,800,000,000.00	1,800,000,000.00	1,800,000,000.00	0.00	0.00	
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	测试子账户	人民币	0.00	0.00	200,000,000.00	199,626,824.18	199,626,824.18	0.00	0.00	
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	zhiy测试期货	人民币	0.00	0.00	310,799,999,996.00	310,799,999,996.00	310,799,999,996.00	0.00	0.00	
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	期货测试子账户	人民币	0.00	0.00	200,000,000.00	89,998,000.00	89,998,000.00	210,000,000.00	100,000,000.00	
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	zhiy新账户	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	11	11	2221	基金单元	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	11	11	2221	现货分仓	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	11	11	2221	1111	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	11	11	2221	xxxx	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	基金单元	人民币	9,100.00	0.00	9,100.00	8,100.00	8,100.00	1,000.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	22222	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	33333	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	融资融券分仓	人民币	0.00	0.00	90,000,000.00	90,000,000.00	90,000,000.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	融资融券	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	2222	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	融资融券组合	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	测试账户	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	现货分仓	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	现货组合	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
2013-02-11	1	111111	恒生基金	11111	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
						9,100.00	0.00	317,499,999,028.00	317,069,429,475.08	317,069,429,475.08	529,328,912.80	100,000,000.00	
显示管理账户 显示普通账户													

图 2-2-1

PB 资金划转



资金从资金账户划转到单元

账户编号: 444 444

资金账户: 72 55

单元编号: 146 555

币种: CNY 人民币

划转金额:

到期自动返还: 0 否

返还日期: 2013-02-11

返还时点: 1 日初

操作生效时点: 0 立即或复核通过

备注:

资金账户的资金信息

当前现金余额: 0.00

T+0交易可用: 0.00

T+1交易可用: 0.00

预计调整后
当前现金余额: 0.00

单元的资金信息

当前现金余额: 0.00

T+0交易可用: 0.00

T+1交易可用: 0.00

预计调整后
当前现金余额: 0.00

确定

取消

图 2-2-2

划转资金：同一资金账户下的单元与单元之间的资金相互划转。

资金划入：资金账户资金划入到该资金账户下的单元。

资金划出：单元资金划出给该单元的资金账户。

2.3 证券调整

功能介绍

如果券商端有无委托清算，或是进行期初同步柜台数据到资金账户等后，则有持仓信息，那么需要从资金账户划转资金到相应单元。

操作说明

在【系统管理】→【证券管理】→<证券管理>界面，如图 2-3-1 所示。选中对应需要调整的单元，点击**证券划入**，弹出如图 2-3-2 所示对话框，将证券从资金账户划转到单元。

证券管理																
证券管理 融券负债 证券冻结解冻查询 期限调整 证券类操作查询																
冻结解冻 划转证券 证券划入 证券划出 查询 刷新 打印 导出 布局设置																
日期	账户代码	账户名称	单元名称	市场	股东	席位	投资类型	多空标志	证券代码	证券名称	期初数量	当前数量	可用数量	冻结数量	解冻数量	解冻数量
2013-02-11	1	thg_re	缺省单元	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	000001	上证指数	0.00	3.00	3.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	缺省单元	深交所A	0000000000	000001	可交易	多仓	000001	333宝发展	0.00	6.00	6.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	01资产单元	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	000001	上证指数	0.00	1.00	1.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	01交易子账户	上交所A	1000000000	10001	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	01交易子账户	深交所A	0000000000	000001	可交易	多仓	000001	333宝发展	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	03资产单元	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	102.00	2.00	100.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	03资产单元	深交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	706001	齐鲁收购	0.00	100,010,999,999.00	100,010,999,999.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	03资产单元	深交所A	0000000000	000001	可交易	多仓	000001	333宝发展	0.00	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	05交易子账户	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	9,999.00	9,999.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	05交易子账户	深交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	706001	齐鲁收购	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	05交易子账户	深交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	730000	浦发增宏	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	05交易子账户	深交所A	0000000000	000001	可交易	多仓	000001	333宝发展	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	04资产单元	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	100,000.00	100,000.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	04资产单元	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	730000	浦发增宏	0.00	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	04资产单元	深交所A	0000000000	000001	可交易	多仓	000001	333宝发展	0.00	1,010,000.00	1,010,000.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	04资产单元	深交所A	0102699330	200000	可交易	多仓	000001	333宝发展	0.00	4,900.00	4,900.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	04资产单元	深交所A	0102699330	200000	可交易	多仓	000002	万科A	0.00	8,000.00	8,000.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	041交易子账户	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	706001	齐鲁收购	0.00	100,000.00	100,000.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	041交易子账户	深交所A	0102699330	200000	可交易	多仓	000001	333宝发展	0.00	10,000.00	9,900.00	100.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	111	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	1.00	1.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	thg_re	111	上交所A	3000000000	33333	可交易	多仓	706001	齐鲁收购	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	100	KZ80验证	KZ80信用主册	上交所A	E010000089	62003	可交易	多仓	010203	02国债03	0.00	2,000.00	2,000.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	100	KZ80验证	KZ80信用主册	上交所A	E010000089	62003	可交易	多仓	120102	01三峡债	0.00	9,000,000.00	9,000,000.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	100	KZ80验证	KZ80信用主册	上交所A	E010000089	62003	可交易	多仓	500001	基金金泰	0.00	4,999,998.00	4,999,998.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	100	KZ80验证	KZ80信用主册	上交所A	E010000089	62003	可交易	多仓	510050	SOETF	0.00	1,000.00	1,000.00	0.00	0.00	0.00

图 2-3-1



PB 资金账户证券划转

证券划转
证券从资金账户划转到单元

操作类型: 207 证券划转

账户编号: 444 444

操作生效日期: 业务日期 2013-02-11

资金账户: 72 55

单元编号: 555 555

证券代码:

股东代码:

席位代码:

划转数量:

划转单价: 0

划转成本:

划转收益:

备注:

证券数量信息

单元:

持仓数量:	0.00
可用数量:	0.00
网上新股待上市量:	0.00
网下新股待上市量:	0.00

资金账户:

持仓数量:	0.00
可用数量:	0.00
网上新股待上市量:	0.00
网下新股待上市量:	0.00

到期自动返还: 0 否

确定 取消

图 2-3-2

证券划转、证券划入划出等功能与上述资金管理中的类似，此处不再赘述。

2.4 人员维护

功能介绍

在券商端完成对私募公司的超级管理员维护后，那么该超级管理员则需要通过【人员维护】对自己的私募公司其他人员的资料进行增加、修改、删除操作，例如：基本信息、操作菜单权限、操作产品和股票池权限，维护对人员有操作权限的产品、单元等等。

操作说明

新增操作员，在【系统管理】→【人员维护】，点击**增加**以进行人员增加，

如图 2-4-1 所示：



图 2-4-1

选中操作员双击或点击修改，弹出如图 2-4-2 所示对话框：



图 2-4-2

➤ <用户资料>

操作员编号：登录时使用的编号，不能重复。

业务分类权限：选择操作员可以操作的业务类别。缺省不选为全部业务都可以操作。

证券类别权限：选择操作员可以操作的证券类别。缺省不选为全部证券类别都可以操作。

➤ <功能菜单>

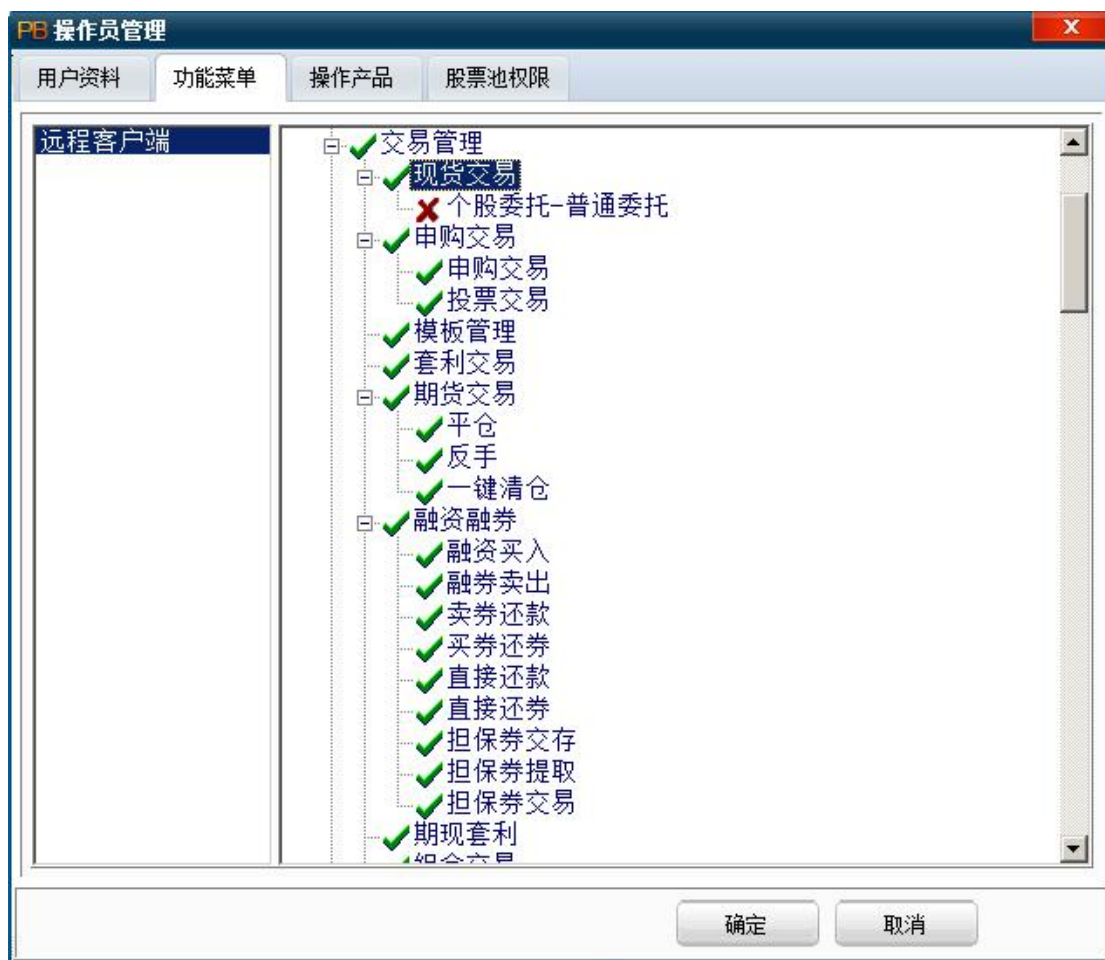


图 2-4-3

显示各菜单下的附加权限，通过左键单击附加权限，来选择是否选中。✔

代表选中状态，✗代表未选中状态。并且可以通过右键功能[全部选中]、[全部取消]进行全选操作，通过[全部展开]、[全部收缩]进行展开收缩操作。

➤ <操作产品>



图 2-4-4

在此界面，设置操作员可以操作的产品和单元的权限。

➤ 〈股票池权限〉

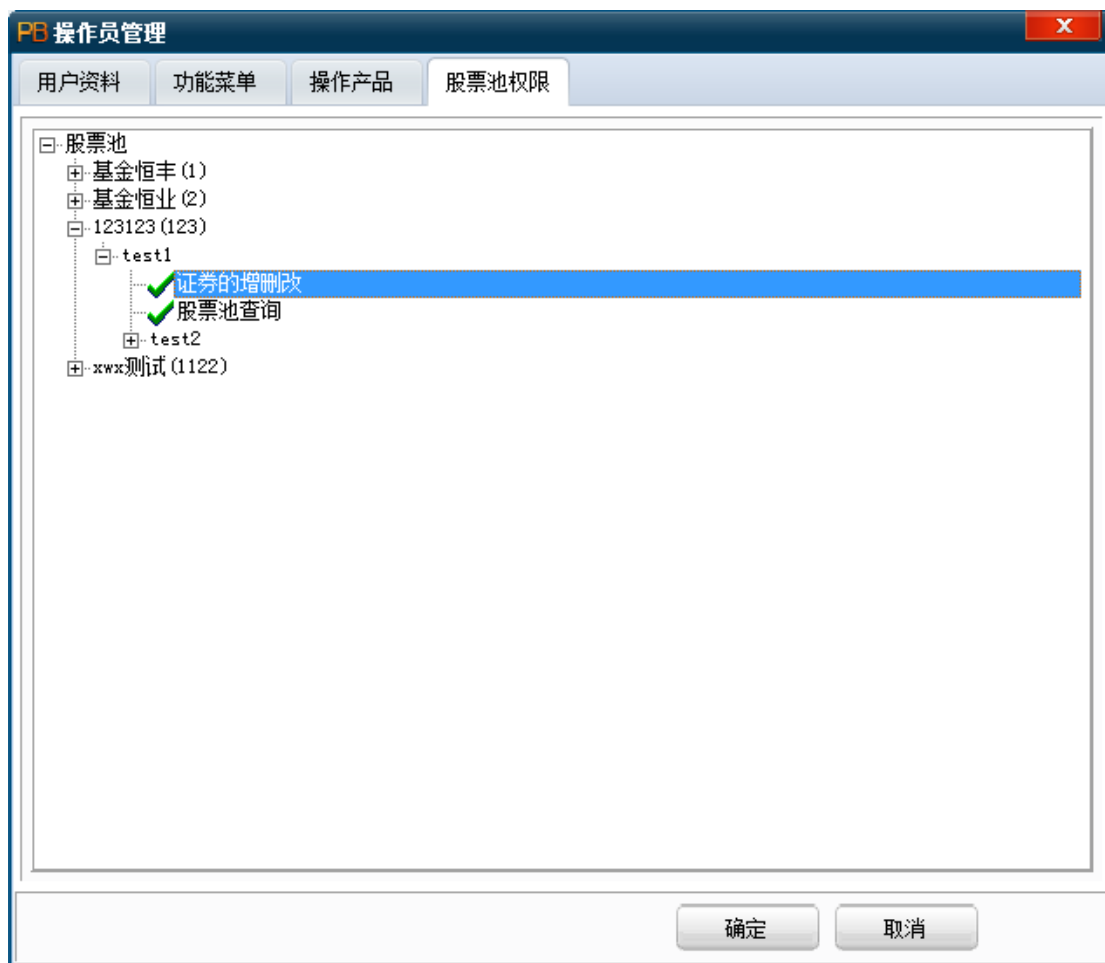


图 2-4-5

在此界面，选择操作员对股票池的操作权限，包括证券增删改和股票池查询权限。

2.5 费用维护

功能介绍

券商总公司在券商端完成对私募公司的费用设置后，如果私募公司有自己客户通过机构端进行投资交易，那么私募公司可按照实际的佣金进行费用维护，以收取客户的佣金，否则无需维护费用。

操作说明

在【系统管理】→【费用维护】中，设置收取的佣金，如图 2-5-1 所示。

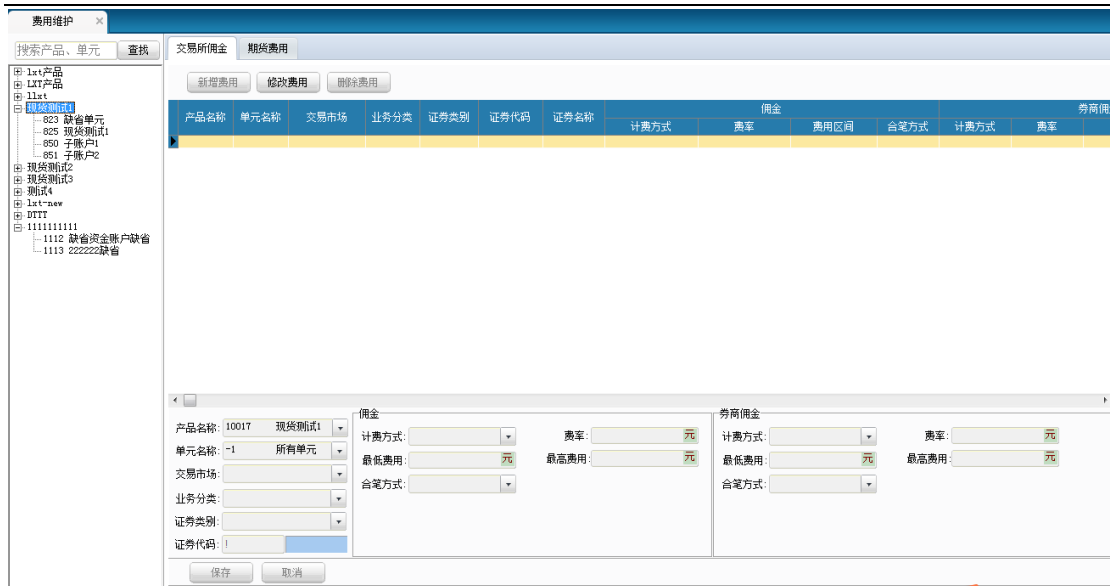


图 2-5-1

最高费用：计算的费用如果超过此值，按此值计算。

最低费用：计算的费用如果低于此值，按此值计算。

分合标志：1-分笔（分笔成交分笔计算）；2-合笔（分笔成交合笔计算）。

2.6 风险控制

功能介绍

机构端的风险控制主要作用针对本私募公司的实时监控委托以及整个产品当前的状况是否违反了在风控系统中设置的规则，并根据风控设置的具体情况进行相应的处理。如果券商总公司的券商端同样设置关于本私募公司的风控，也可对机构端的交易状况实时监控。

2.6.1 风控设置

功能介绍

机构端中的风控模块重在做一些合规性的风险控制，如持仓、市值的占比，以及买卖价格控制等等。目前支持的风控主要有：

- A：证券持仓数量控制
- B：证券持仓成本控制
- C：证券持仓市值控制
- E：证券类别市值控制

- F: 交易额控制
- G: 当日交易量/市场成交量控制
- H: 执行价格控制
- I: 证券买卖控制
- J: 同向反向控制
- Q: 交易频率控制
- R: 期货保证金控制

操作说明

在【风险控制】→【投资风险设置】进行风控设置。该部分主要对各项风控规则的设置，在下达委托时系统都会根据先前设定的风控规则来检查交易的风险大小以做出预警、禁止或需要相关人员审批等提示。

如图 2-6-1 所示，该界面为投资风险监控主界面。左面为树状结构，可以按照风控类别或产品来浏览；右半部分为上下结构，其中上部为具体的风控设置信息，下部为某条风控的关联风控（互斥风控）。当在左侧树状结构选中某个节点时，右侧对应的会查询出对应类别的风控设置项目。

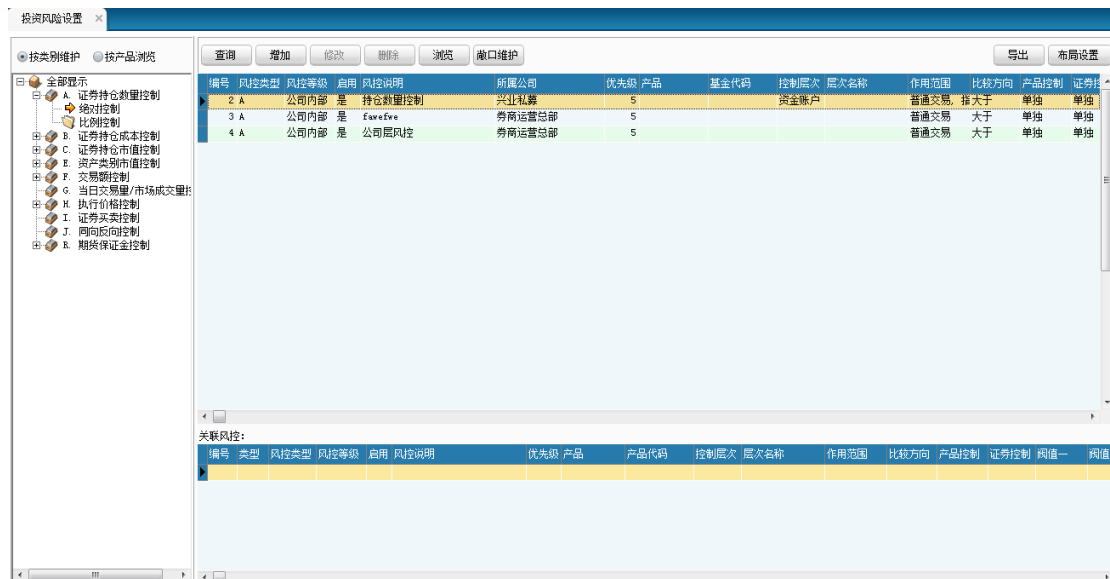


图 2-6-1

新增风控条目：选择相应子类风控后，点击**增加**按钮，弹出如图 2-6-2。风控新增界面，界面中红色方框处属于公共设置区，每类风控都有该设置，绿色方框中的条件设置会根据每类风控的不同而有所区别。

PB 证券持仓数量控制（绝对控制）

风控设置
设置证券持仓数量风险的控制参数，阈值为数量型。
对于股指期货，一股就是一手

风控编号: 自动生成 比较方向: 大于

优先级: 低 高 作用范围: ☐ 普通交易 ☒ 静态查询
☐ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一:		万股	触警操作:	1 预警
阈值二:		万股	触警操作:	
阈值三:		万股	触警操作:	

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号:

排除产品:

产品控制: 0 单产品控制

持仓类型: 1, 2, 3, 4, a, b

☐	1 股票
☐	2 封闭式基金
☐	3 国债
☐	4 企业债
☐	5 可转债
☐	6 政策性金融债
☐	D 央行票据
☐	F 开放式基金
☐	G 非政策性金融债
☐	K 次级债
☐	M 认股权证
☐	N 认沽权证
☐	S 公司债

确定 取消

图 2-6-2

敞口维护: 用户设置的一个指定的数值。例如在设置资产类风控时习惯于“上季度末的总资产”进行比较，“上季度末总资产”是一个特定的值，即可设置为敞口。新增敞口时，点击界面上方的**敞口维护**按钮，弹如图 2-6-3 界面，敞口维护界面分上下两部分，上方为敞口名称，点击**新增**按钮（红色方框），输入敞口所属层级和敞口名称新增敞口。所属层级可选择“全体有效”、“产品层”、“单元层”。以选择选择产品层为例，新增完敞口名称后，需要点击界面下方的**新增**按钮（绿色方框），针对该敞口维护相应敞口数值。可针对不同的产品分别维护敞口值。

PB 敞口类型维护

敞口序号	层次	敞口名称	最后修改人	最后修改日期	最后修改时间	日期	状态
1	0-全体有效	保险机构上季末总资产	超级用户	2006-05-22	11:05:38	2009-01-09	正常
2	1-账户层	万能保险上季末总资产	超级用户	2006-05-22	11:15:26	2009-01-09	正常
3	1-账户层	投连保险上季末总资产	超级用户	2006-05-22	11:16:06	2009-01-09	正常
4	0-全体有效	社保基金上季末总资产	超级用户	2006-06-09	10:32:03	2009-01-09	正常
5	0-全体有效	上季度在途	超级用户	2006-06-09	11:12:52	2009-01-09	正常
6	1-账户层	单笔在途限额	超级用户	2006-06-09	11:18:50	2009-01-09	正常
7	0-全体有效	每日最高交易额	超级用户	2006-06-09	16:19:13	2009-01-09	正常

查询 (S) **新增** 修改 删除 打印 字段选择

敞口序号	层次	敞口值	业务数据日期	最后修改人	最后修改日期	最后修改时间	操作类型
1	0-全体有效	64,073,481,997.72		超级用户	2006-05-22	11:05:38	正常

新增 (A) 修改 (M) 删除 (D) 打印 (P) 字段选择 (F) 导入 (I) 关闭 (C)

图 2-6-3

详细说明

风控编号：由系统自动生成。

比较方向：表示风控是控制大于还是小于某个阈值。比较原则：对于增加方向的变化，与委托方向为“大于”或“大于等于”的风控相关，与委托方向为“小于”或“小于等于”的风控无关，减少方向相反。例如，买入股票，持仓增加，那么与比较方向设置为“大于”或“大于等于”的风控相关，与“小于”或“小于等于”的风控无关。

优先级：每条设置的风控都有一个优先级，优先级实际上是 1—10 中的一个数字，代表一种等级，主要是设置互斥时用来进行判别使用。所以，如果想要设置一条风控能够互斥其它风控，应该把该条风控的优先级设置成比待互斥的风控的优先级别高。（互斥设置：详见下文解释）

作用范围：表示何时进行风控判断，目前有：委托下达时（普通交易）；静态风控查询时（静态查询）和特殊交易（系统参数“60171-风控设置中特殊交易定义”中设置的交易类型）。

启用风控：风控开关，可单独对该条风控开启或关闭。

汇总控制：用来设置是否对所属的证券进行加和控制，以 B 类证券成本控制

为例，若不勾选汇总控制，表示控制单只证券的成本。若勾选则表示控制证券所属类别中所有券的成本。

风控等级：标识风控的类型。目前有，政策性、契约性和公司内部三种。

风控说明：对该条风控的简单描述。

有效日期：表示该条风控的生效日期，不填则始终有效。

阈值：用于风控比较的触发数值，可设置三档阈值。其中 A、B、C、E、F、H、R 类风控的阈值有绝对值控制和比例控制两种。根据实际情况的不同，阈值代表的含义也不同，共分为四种：

1—百分比（%）；

2—金额（万元）；

3—数量（万股）；

4—天数（天）。其中天数必须录入整数，其余三种情况允许录入 2 位小数。

触警操作：目前有，1. 预警、2. 禁止、3. 申请指令审批、4. 申请风险阈值、5 不提示。预警表示系统给予警示，但不做限制，可以继续下委托；禁止表示指令到此终止，不能进行后续委托；申请指令审批表示该指令会出发审批流程，需要有审批权限的领导审批通过后才可进行后续委托；申请阈值审批是在一段时间内将阈值临时放大，在一定时间内（例如一周）只要指令在允许的阈值内都不需要审批，可直接进行分发、委托。

控制方式：设置用来进行风控检查的方式，分为五类：

0—按计算公式，B 类风控特有，可支持按证券类别或按动态维护来控制；

1—按证券控制，可以对录入的特定的证券进行监控，可以录入多只证券；

2—按证券类别控制，对于选中的证券类别进行风险监控，可以多选；

3—按维度控制，对选中的维度进行风险监控。

5—按多维度控制，对选中的多个维度进行风险监控。

控制层次：设置控制到哪个层次，分为三类：

1—产品，可通过产品编号来选择受控制的产品；

2—单元，可按单元层进行控制；

f—资金账户层，可按资金账户进行控制。

产品编号：用来设置受控制的产品，可以多选及“Ctrl+A”快捷键全选。

产品控制：用来设置产品与产品间的控制方式，分为三种控制方式：

- 1—单产品控制，各产品间单独进行控制；
- 2—多产品联合控制，对于所选产品进行联合控制；
- 3—单产品、多产品联合控制，反向交易类风控（J 类）专用的一个控制选项，说明对于产品内、产品间的反向交易都进行控制。

分母类型：对于比例控制，选择用来作为比较的项目，可以用来作为比较的分母有：

- 1—净值：现金资产+股票资产+基金资产+债券资产+回购资产+未回资产+应收资产—应付资产；
- 2—总资产：产品净资产+应付资产；
- 3—敞口：用户设置的一个指定的数值。例如保险公司在设置资产类风控时习惯于“上季度末的总资产”进行比较，“上季度末总资产”是一个特定的值，即可设置为敞口。
- 4—昨日净值：数据库中存储的昨日的产品的净值；
- 5—证券流通股本：交易所公布的证券的流通股本；
- 6—证券总股本：交易所公布的证券的总股本；
- 7—所在证券类别总成本：该证券所在的证券类别的所有证券的成本之和；
- 8—所在证券类别持仓总市值：该证券所在证券类别的所有证券的市值之和；
- 9—该证券流通市值：交易所公布的证券的流通市值；
- 10—该证券总市值：交易所公布的证券的总市值；
- 11—前 N 日市场平均成交量：几天之内市场上成交量的平均值；
- 12—所有证券总市值：交易所公布的所有证券的总市值；

互斥设置：假设风控 A 为恒生产品持有投资池①中的股票市值不得超过产品净值的 10%。风控 B 为恒生产品持有投资池①对应核心池股票市值不得超过产品净值的 15%。那么当恒生产品持有核心池股票市值超过 10%即被拦截。为解决此问题，可以通过设置互斥风控来实现。设置风控 A 和 B 为互斥风控，且 B 优先级高于 A。那么在投资核心池股票时，只判断风控 B，就不会被风控 A 拦截，同时保证投资池中股票也能正常被控制。

联合设置：设置风控 A 和 B 为联合风控，则需 A 风控和 B 风控同时触犯时，才触犯风控。

2.6.1.1 A 证券持仓数量控制

功能介绍

该类风控主要对证券的持仓数量进行监控。既可以控制所选类型的证券的持仓数量（绝对控制），也可以通过设置所选类型的持仓数量与所选分母类型的相关数量的比例关系（比例控制）来进行控制。

用户如果想要控制产品的证券的数量或是控制持仓数量占流通股本或总股本的比例就可以通过该类风控进行控制。

在本类风控中，既能对个别证券进行控制，也可以按照证券类别或证券所在维度进行控制，再结合上证券可以加和（汇总控制开关）以及产品联合控制等选项，就可以组合成多种控制方式。

操作说明

〈高级设置〉页面中可设置按市场来控制持仓数量。同时可设置当产品净值在某一个范围内才启用风控。

详细说明

持仓类型：一般选择“多仓”，“空仓”在开通期货业务时才会用到。

风控举例

同一产品管理人管理的全部产品持有一家公司发行的证券，不能超过该证券总股本的 10%。设置如下图 2-6-4 所示，

PB 证券持仓数量控制（比例控制）

风控设置
设置证券持仓数量风险的控制参数，阈值为比例型

风控编号: 自动生成 比较方向: 1 大于

优先级: 低 作用范围: ☒ 普通交易 ☒ 静态查询
☒ 指令 ☒ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☐ 风控等级: 1 政策性

风控说明: 行的证券, 不能超过该证券总股本的10% ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 10 %	触警操作: 2 禁止
阈值二: %	触警操作:
阈值三: %	触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号: 1, 2, 101, 110, 111, 123,

排除产品:

产品控制: 1 多产品联合控制

持仓类型: -1 所有持仓类型

分子类型: 1 全部持仓

分母类型: C 该证券总股本

- ☒ 1 股票
- ☐ 2 封闭式基金
- ☐ 3 国债
- ☐ 4 企业债
- ☐ 5 可转债
- ☐ 6 政策性金融债
- ☐ D 央行票据
- ☐ F 开放式基金
- ☐ G 非政策性金融债
- ☐ K 次级债
- ☐ M 认股权证
- ☐ N 认沽权证
- ☐ S 公司债
- ☐ T 地方债
- ☐ U 理财产品
- ☐ Z 债券认购

确定 取消

图 2-6-4

2.6.1.2 B 证券持仓成本控制

功能介绍

该类风控主要对证券的持仓成本（购买金额）进行控制，与 A 类风控相似，B 类风控也可以通过绝对控制与比例控制来进行证券的购买成本的控制，如果用户想要对各个产品的证券的持仓成本进行绝对成本或想让绝对成本占指定类型的某一比例范围内，就可以通过该类风控进行设置。如图 2-6-5 所示，

PB 证券持仓成本控制（绝对控制）

风控设置
设置证券持仓成本风险的控制参数，阈值为金额型

风控编号: 自动生成 比较方向: 1 大于

优先级: 低 作用范围: ☒ 普通交易 ☒ 静态查询
☒ 指令 ☒ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☒ 风控等级: 1 政策性

风控说明: 每个产品持有国债的成本不超过10万元 ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 10	万元	触警操作: 2 禁止
阈值二:	万元	触警操作:
阈值三:	万元	触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号: 1, 2, 101, 110, 111, 123,

排除产品:

产品控制: 0 单产品控制

统计范围: 1 全部持仓

☐	1 股票
☐	2 封闭式基金
☒	3 国债
☐	4 企业债
☐	5 可转债
☐	6 政策性金融债
☐	D 央行票据
☐	F 开放式基金
☐	G 非政策性金融债
☐	K 次级债
☐	M 认股权证
☐	N 认沽权证
☐	R 权证

确定 取消

图 2-6-6

2.6.1.3 C 证券持仓市值控制

功能介绍

该类风控主要对所持有的证券的市值进行控制，与 A 类风控相似，C 类风控也可以通过绝对控制与比例控制。如图 2-6-7，进行所持有证券的当前市值的控制，如果用户想要对各个的证券持仓的市值进行绝对市值或想让绝对市值占指定类型的某一比例范围内，就可以通过该类风控进行设置。

PB 证券持仓市值控制（比例控制）

风控设置
设置证券持仓市值风险的控制参数，阈值为比例型

风控编号: 自动生成 比较方向: 1 大于

优先级: 低 作用范围: ☐ 普通交易 ☒ 静态查询
☐ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: % 触警操作: 1 预警

阈值二: % 触警操作:

阈值三: % 触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号: 1, 2, 101, 110, 111, 123,

排除产品:

产品控制: 0 单产品控制

持仓类型: 1, 2, 3, 4, b

统计范围: 1 全部持仓

分母类型: 2 总资产

1 股票
2 封闭式基金
3 国债
4 企业债
5 可转债
6 政策性金融债
D 央行票据
F 开放式基金
G 非政策性金融债
K 次级债
M 认股权证
N 认沽权证
R 股指期货
S 公司债券
T 地方债
U 理财产品
Z 债券认购

确定 取消

图 2-6-7

风控举例

一个产品持有一家上市公司的股票，其市值不能超过基金资产净值的 10%。
设置如下图 2-6-8，

PB 证券持仓市值控制（比例控制）

风控设置
设置证券持仓市值风险的控制参数，阈值为比例型

风控编号: 自动生成 比较方向: 1 大于

优先级: 低 作用范围: ☒ 普通交易 ☒ 静态查询
☒ 指令 ☒ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☐ 风控等级: 2 契约性

风控说明: 一个产品持有一家上市公司的股票，其 ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 10 % 触警操作: 2 禁止

阈值二: % 触警操作:

阈值三: % 触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号: 1, 2, 101, 110, 111, 123,

排除产品:

产品控制: 0 单产品控制

持仓类型: -1 所有持仓类型

统计范围: 1 全部持仓

分母类型: 1 净值

☒ 1 股票
☐ 2 封闭式基金
☐ 3 国债
☐ 4 企业债
☐ 5 可转债
☐ 6 政策性金融债
☐ D 央行票据
☐ F 开放式基金
☐ G 非政策性金融债
☐ K 次级债
☐ M 认股权证
☐ N 认沽权证
☐ R 股指期货
☐ S 公司债
☐ T 地方债
☐ U 理财产品
☐ Z 债券认购

确定 取消

图 2-6-8

2.6.1.4 E 资产类别市值控制

功能介绍

该类风控用来对各产品的资产类别进行控制，既可以设置绝对控制，也可以设置比例控制。如图 2-6-9，用户可以通过对某些资产类别进行操作选择来控制所选资产类别的绝对值或所选资产类别的绝对值与指定分母的比值在一定范围内。

操作介绍

点击**选择**按钮弹出资产类别选择列表，双击资产类别列表内项目，计算方向会发生改变，计算方向包括：不计算—相当于该类别不进行统计；加上一表示该类别对应的计算的值需要加上；减去一表示该类别对应的计算的值需要减去。

PB 资产类别市值控制（比例控制）

风控设置
设置资产类别风险的控制参数，阈值为比例型
提示：B类风控效率较低，C类风控效率较高
对于能用C类风控实现的，推荐用C类风控实现

风控编号: 24 比较方向: 大于

优先级: 低 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☒ 静态查询
☒ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☐ 汇总控制: ☒ 风控等级: 2 契约性

风控说明: 602组合股票的投资比例不超过委托资产 ☐ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 0 % 触警操作: 1 预警
阈值二: 30 % 触警操作: 1 预警
阈值三: % 触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制层次: 1 产品 资产类别 计算方向 资产大类
产品编号: 股票 加上 证券类别
排除产品:
产品控制: 0 单产品控制
分母类型: 1 净值

选择

确定 取消

图 2-6-9

详细说明

适用时段：例 ‘091500, 093000’ —代表上午 9：15—9：30。

‘091500, 093000|145000, 150000’ —代表上午 9：15—9：30 以及下午 14：50—15：00 都进行控制。

风控举例

封闭式产品持有余额超过上季末总资产的 15%。设置如下图 2-6-10，

PB 资产类别市值控制 (比例控制)

风控设置
设置资产类别风险的控制参数，阈值为比例型
提示：B类风控效率较低，C类风控效率较高
对于能用C类风控实现的，推荐用C类风控实现

风控编号: 自动生成 比较方向: 1 大于

优先级: 低 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☒ 静态查询
☒ 指令 ☒ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☒ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 产品持有余额超过上季末总资产的15% ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 15 % 触警操作: 2 禁止

阈值二: % 触警操作:

阈值三: % 触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制层次: 1 产品 资产类别 计算方向 资产大类
产品编号: 1, 2, 101, 110, 111, 123, 封闭式基金 加上 证券类别
排除产品:

产品控制: 1 多产品联合控制

分母类型: 4 敞口

敞口类别: 0 全体有效

敞口序号: 1 保险机构上季末总资产

选择

确定 取消

图 2-6-10

2.6.1.5 F 交易额控制

功能介绍

该类风控用来进行指定人员的每日的交易的控制，可以设置绝对控制也可以设置相对控制。如图 2-6-11，

PB 交易额控制（比例控制）

风控设置
设置当日交易额风险的控制参数，阈值为比例型

风控编号: 自动生成 比较方向: 1 大于

优先级: 低 作用范围: ☐ 普通交易 ☐ 静态查询
☐ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: % 触警操作: 1 预警

阈值二: % 触警操作:

阈值三: % 触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号:

排除产品:

产品控制: 0 单产品控制

额度方式: 1 当日合计

委托方向: 3 买 + 卖

计算方式: 2 按面值计算

分母类型: 1 净值

债券业务: 1 一二级业务均控制

☒ 上市首日进行控制

- ☐ 1 股票
- ☐ 2 封闭式基金
- ☐ 3 国债
- ☐ 4 可转债
- ☐ 5 可转换金融债
- ☐ 6 政策性金融债
- ☐ 8 债券回购
- ☐ D 央行票据
- ☐ F 开放式基金
- ☐ G 非政策性金融债
- ☐ K 次级债
- ☐ M 认股权证
- ☐ N 认沽权证
- ☐ S 公司债
- ☐ T 地方债
- ☐ U 理财产品
- ☐ Z 债券认购
- ☐ a 申购
- ☐ d 增发
- ☐ k 债券申购

确定 取消

图 2-6-11

详细说明

额度方式：可选择 1. 当日合计：表示计算时将当日所有该证券的指令相加计算总和；2. 单笔：表示计算单笔委托；3. 单笔指令：表示计算单个指令；4. 前 N 日合计：表示将前 N 天（选择该项时，可输入具体天数）所有的该证券指令相加计算总和；5. 本周合计：表示将本周所有该证券指令相加计算总和。

委托方向：可选择买、卖、买+卖、买-卖、卖-买。（此处的买卖包括普通的

证券买卖，也包括融资、融券，“买”相当于融资，“卖”相当于融券）

计算方式：可选择“按金额计算”、“按面值计算”，“按数量”和“按金额计算（卖出按成本价）”计算。

上市首日进行控制：部分客户不想在证券的上市首日做交易量控制，因此增加此复选框进行选择，若不勾选，则上市首日不做控制。

债券一级业务进行控制：若不勾选则债券一级市场的交易量不做控制。

风控举例

股票净买金额大于 10% 需要审批。设置如下图 2-6-12，

PB 交易额控制 (比例控制)

风控设置
设置当日交易额度的风险控制参数，阈值为比例型

风控编号: 自动生成 比较方向: 1 大于

优先级: 低 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☒ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☒ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 股票净买金额大于10%需要审批 ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 10 % 触警操作: 3 申请指令审批

阈值二: 触警操作:

阈值三: 触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号: 1, 2, 101, 110, 111, 123,

排除产品:

产品控制: 0 单产品控制

额度方式: 1 当日合计

委托方向: 4 买 - 卖

计算方式: 1 按金额计算

分母类型: 6 上一交易日净值

债券业务: 1 一二级业务均控制

☒ 上市首日进行控制
☐ 银行间债券按全价计算

- ☒ 1 股票
- ☐ 2 封闭式基金
- ☐ 3 国债
- ☐ 4 企业债
- ☐ 5 可转债
- ☐ 6 政策性金融债
- ☐ 8 债券回购
- ☐ D 央行票据
- ☐ F 开放式基金
- ☐ G 非政策性金融债
- ☐ K 次级债
- ☐ M 认股权证
- ☐ N 认沽权证
- ☐ S 公司债
- ☐ T 地方债
- ☐ U 理财产品
- ☐ Z 债券认购
- ☐ a 申购
- ☐ d 增发
- ☐ k 债券申购

确定 取消

图 2-6-12

2.6.1.6 G 当日交易量/市场成交量控制

功能介绍

该类风控主要是控制指定证券类别的证券，其当日的交易量不能超过该证券当日市场成交量的一个设置好的百分比。如图 2-6-13，在该类风控中，既可以

控制证券的单笔交易，也可以对该证券当日的交易数量进行控制。值得注意的是，该类风控可以设定进行风控判断的时间，既可以是一段连续的时间，也可以是多段不连续的时间，当设置多段不连续时间时，各个时间段不能有重叠的时间。

PB 当日交易里/市场成交里控制（比例控制）

风控设置
设置当日交易里风险的控制参数，阈值为比例型

风控编号: 615 比较方向: 大于

优先级: 低 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☐ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 期货当日单笔成交量大于20%时控制 ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 0 %	触警操作: 1 预警
阈值二: 20 %	触警操作: 1 预警
阈值三: %	触警操作:

控制条件 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号:

排除产品:

产品控制: 0 单产品控制

分母类型: H 当日市场成交量

委托方向: 3 买卖都控制

控制模式: 2 单笔数量

适用时段:

☒ 上市首日进行控制
☐ 适用时段做为分子计算条件

1 股票
2 封闭式基金
3 国债
4 企业债
5 可转债
S 公司债
T 地方债

确定 取消

图 2-6-13

详细说明

委托方向: 可选择 1. 只控制买; 2. 只控制卖; 3. 买卖都控制。

控制模式：1. 合计数量；2. 单笔数量。

分母类型：可选择“当日市场成交量”、“前 N 日市场平均成交量”、“max（当日市场成交量，前 N 日市场平均成交量）”，其中 max（当日市场成交量，前 N 日市场平均成交量）表示在当日市场成交量和前 N 日市场平均成交量两者中取大的作为分母。

适用时段做分子计算条件：当勾选该条件时在计算分子“当日交易量”时，只会计算适用时间段内的交易量。

2.6.1.7 H 执行价格控制

功能介绍

该类风控主要控制当日证券交易的指令价格与指定的价格的比值不能超过设定的范围。可以用作比较的价格有：昨收盘、市均价、最新价、参考价格等。如图 2-6-14，

PB 执行价格控制 (绝对控制)

风控设置
设置执行价格风险的控制参数，阈值为金额型

风控编号: 273 比较方向: 1 大于

优先级: 低 [] 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☐ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 买卖600000的价格不能超过55元 ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 0 元 触警操作: 1 预警
阈值二: 55 元 触警操作: 1 预警
阈值三: 元 触警操作:

控制条件 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 1 按证券控制 证券代码 证券名称
控制层次: 1 产品 600000 浦发银行
产品编号: 排除产品:
市场代码: 1, 2 证券代码: 增加
控制价格: 1 指令、委托价格 证券名称: 删除
价格类型: 2 限价指令生效 业务分类: 0 不区分
委托方向: 3 买卖都控制
适用时段: 010000, 230000
☒ 上市首日进行控制

确定 取消

图 2-6-14

详细说明

控制价格: 可选择 1. 指令、委托价格; 2. 复权价格; 3. 最新价 (当选择最新价时, “价格类型” 可选择市价指令生效或限价指令生效。); 4. 最新价 (债券按净价)。

比较价格: 可选择昨收盘、市均价、涨跌停价等价格。

日期类型: 与比较天数结合使用, 可设置于 N 天之前的价格做比较, 比较天

数默认为 0 表示与当天的价格做比较。

风控举例

买卖 600000 的价格不能超过 55 元。设置如下图 2-6-15，

PB 执行价格控制（绝对控制）

风控设置
设置执行价格风险的控制参数，阈值为金额型

风控编号: 273 比较方向: 1 大于

优先级: 低 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☒ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 买卖600000的价格不能超过55元 ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 0 元 触警操作: 1 预警
阈值二: 55 元 触警操作: 2 禁止
阈值三: 元 触警操作:

控制条件 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 1 按证券控制 证券代码 证券名称
控制层次: 1 产品 600000 浦发银行

产品编号: 1, 2, 101, 110, 111, 123, 排除产品:

市场代码: 1, 2 证券代码: 增加
控制价格: 1 指令、委托价格 证券名称: 删除

价格类型: 2 限价指令生效 业务分类: 0 不区分

委托方向: 3 买卖都控制

适用时段: 010000, 230000

☒ 上市首日进行控制

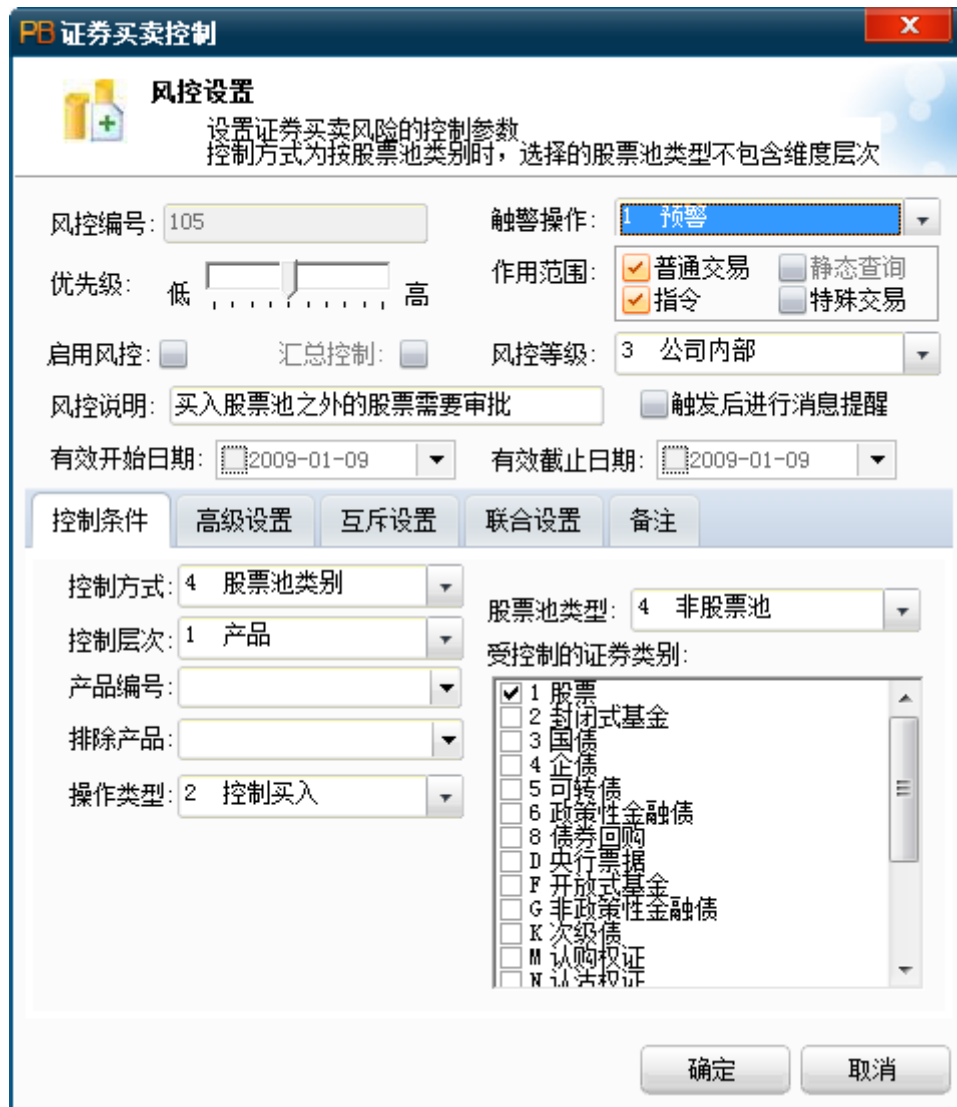
确定 取消

图 2-6-15

2.6.1.8 I 证券买卖控制

功能介绍

该类风控主要控制选定可以进行的证券是否允许买卖的控制。如图 2-6-16，可以设置控制的方式有指定证券、证券类别、维度以及股票池四种方式。买卖方向的控制有：1—不允许买卖；2—只允许卖出；3—只允许买入；4—买卖均可。



PB 证券买卖控制

风控设置
设置证券买卖风险的控制参数
控制方式为按股票池类别时，选择的股票池类型不包含维度层次

风控编号: 105 触警操作: 1 预警

优先级: 低 [] 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☐ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 买入股票池之外的股票需要审批 ☐ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 4 股票池类别 股票池类型: 4 非股票池

控制层次: 1 产品 受控制的证券类别:

产品编号: []

排除产品: []

操作类型: 2 控制买入

- ☒ 1 股票
- ☐ 2 封闭式基金
- ☐ 3 国债
- ☐ 4 企业债
- ☐ 5 可转债
- ☐ 6 政策性金融债
- ☐ 8 债券回购
- ☐ D 央行票据
- ☐ F 开放式基金
- ☐ G 非政策性金融债
- ☐ K 次级债
- ☐ M 认股权证
- ☐ N 认沽权证

确定 取消

图 2-6-16

详细说明

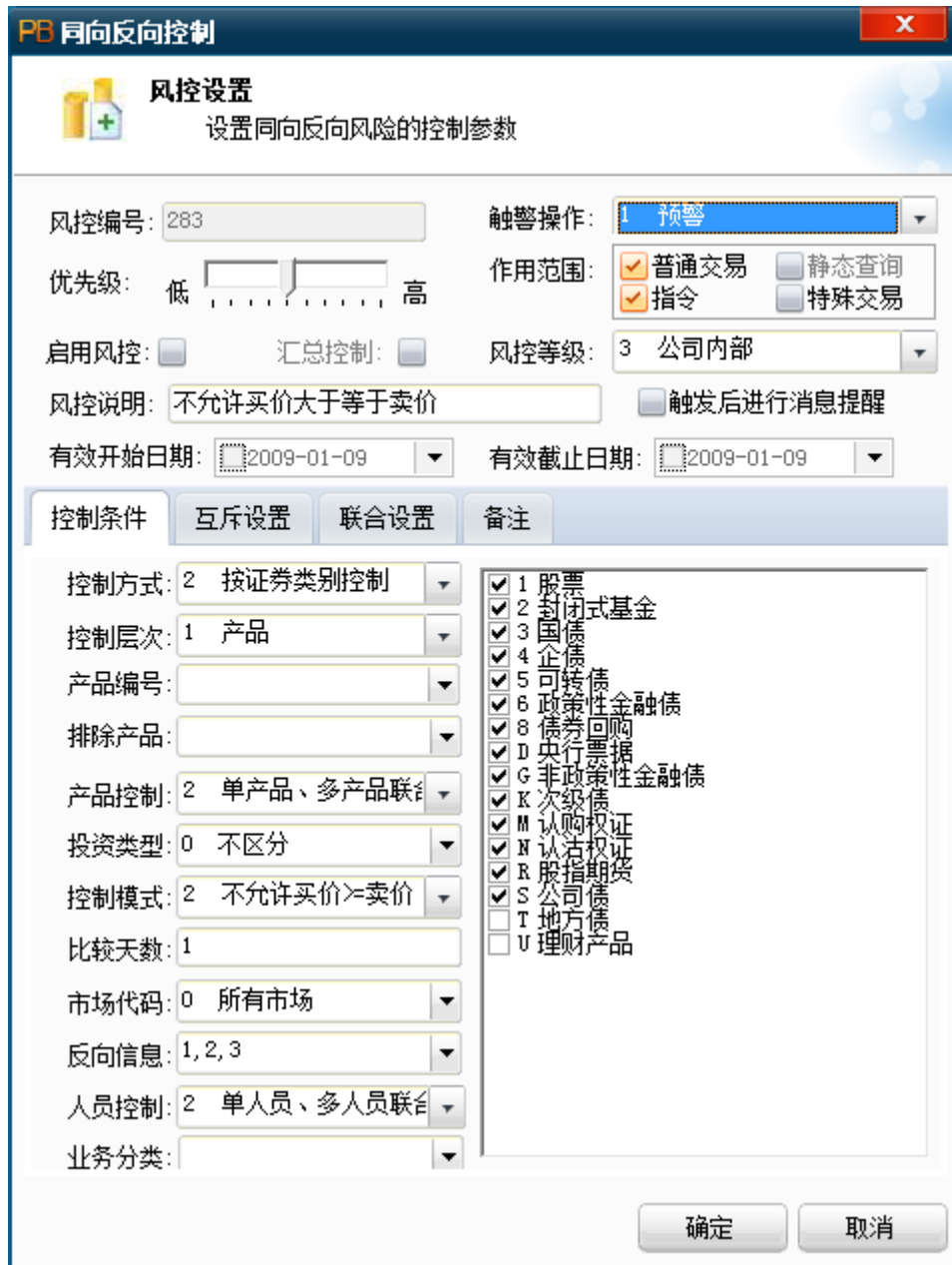
操作类型：1. 不允许有买有卖；2. 只允许卖出；3. 只允许买入；4 允许有买有卖。

2.6.1.9 J 同向反向控制

功能介绍

该类风控主要用来避免产品内或产品间进行反向交易。可以通过选择反向模

式来区分不同的反向交易的概念与范围。如图 2-6-17，可以选择的反向交易的模式有：不控制、不能有买有卖、不能买价大于卖价、已成委托不构成反向交易、挂单部分不允许买价大于卖价、同向控制六项。



PB 同向反向控制

风控设置
设置同向反向风险的控制参数

风控编号: 283 触警操作: 1 预警

优先级: 低 [] 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☐ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 不允许买价大于等于卖价 ☐ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

控制条件 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号: []

排除产品: []

产品控制: 2 单产品、多产品联合

投资类型: 0 不区分

控制模式: 2 不允许买价>=卖价

比较天数: 1

市场代码: 0 所有市场

反向信息: 1, 2, 3

人员控制: 2 单人员、多人员联合

业务分类: []

- ☒ 1 股票
- ☒ 2 封闭式基金
- ☒ 3 国债
- ☒ 4 企业债
- ☒ 5 可转债
- ☒ 6 政策性金融债
- ☒ 8 债券回购
- ☒ D 央行票据
- ☒ G 非政策性金融债
- ☒ K 次级债
- ☒ M 认股权证
- ☒ N 认沽权证
- ☒ R 股指期货
- ☒ S 公司债
- ☐ T 地方债
- ☐ U 理财产品

确定 取消

图 2-6-17

详细说明

排除产品：设置哪些产品可以不受反向交易控制。

控制模式：1. 不能有买有卖；2. 不允许买价>=卖价；3. 已成的指令\委托不形成反向交易：表示若指令或委托已完成，则允许做反向交易；4. 未成部分不允许买价>=卖价；5. 同向控制。

比较天数：表示与前 N 个交易日数据进行比较。

反向信息：选择触犯反向时提示的信息。1. 显示层次信息(表示显示哪个组合发生了反向交易)；2. 显示价格；3. 显示数量。

人员控制：1. 单人员控制，对各个人员进行单独控制 2. 多人员联合控制，对所有人员进行联合控制 3. 单人员、多人员联合控制，对于各人员、人员间的反向交易都进行控制。

风控举例

不允许买价大于等于卖价。设置如下图 2-6-18，

PB 同向反向控制

风控设置
设置同向反向风险的控制参数

风控编号: 283 触警操作: 1 预警

优先级: 低 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☒ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 不允许买价大于等于卖价 ☐ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

控制条件 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号: 1, 2, 101, 110, 111, 123

排除产品:

产品控制: 2 单产品、多产品联合

投资类型: 0 不区分

控制模式: 2 不允许买价 >= 卖价

比较天数: 1

市场代码: 0 所有市场

反向信息: 1, 2, 3

人员控制: 2 单人员、多人员联合

业务分类:

- ☒ 1 股票
- ☒ 2 封闭式基金
- ☒ 3 国债
- ☒ 4 可转债
- ☒ 5 政策性金融债
- ☒ 6 债券回购
- ☒ 7 央行票据
- ☒ 8 非政策性金融债
- ☒ 9 次级债
- ☒ 10 认股权证
- ☒ 11 认沽权证
- ☒ 12 股指期货
- ☒ 13 公司债
- ☐ 14 地方债
- ☐ 15 理财产品

确定 取消

图 2-6-18

2.6.1.10 Q 交易频率控制

功能介绍

该类风控主要用来在设定的时间内对交易频率进行控制。如下图 2-6-19，



PB 交易频率控制

风控设置
控制交易频率, 风控设置变更之后会重新统计委托历史数据.
如果需要查询的数据较多, 则耗时会比较久.

风控编号: 763 比较方向: 1 大于

优先级: 低 [滑块] 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☐ 汇总控制: ☐ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 10周内IF1009买入开仓的次数不超过【0】 ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值	单位	触警操作
阈值一: 0	次	1 预警
阈值二:	次	
阈值三:	次	

控制条件 互斥设置 联合设置 备注

控制方式: 1 按证券控制
产品编号: 1 基金恒丰
排除产品:
产品控制: 0 单产品控制
委托方向: V 买入开仓
控制类型: 2 自然周
控制数量: 10 周

证券代码	证券名称
IF1009	IF1009

证券代码: 增加
证券名称: 删除

确定 取消

图 2-6-19

2.6.1.11 R 期货保证金控制

功能介绍

该类风控主要对期货保证金进行控制，支持绝对控制和比例控制。如下图 2-6-20，

PB 期货保证金控制（比例控制）

风控设置
设置期货保证金风险的控制参数

风控编号: 797 比较方向: 1 大于

优先级: 低 高 作用范围: ☒ 普通交易 ☐ 静态查询
☒ 指令 ☐ 特殊交易

启用风控: ☐ 汇总控制: ☒ 风控等级: 3 公司内部

风控说明: 期货保证金占用不得超过所控范围期货保证金 ☒ 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 2009-01-09 有效截止日期: 2009-01-09

阈值一: 0 % 触警操作: 1 预警
阈值二: 40 % 触警操作: 1 预警
阈值三: % 触警操作:

控制条件 高级设置 备注

控制方式: 2 按证券类别控制
控制层次: 1 产品
产品编号:
排除产品:
产品控制: 0 单产品控制
开仓方向: 0 不区分
分母类型: 25 所控范围期货保证金

☒ R 股指期货
☒ V 商品期货

确定 取消

图 2-6-20

详细说明

分母类型: 1-净值 2-期货保证金, 期货可用保证金+期货占用保证金 3-所控范围期货保证金, 指所选择证券类别的期货保证金, 如股指期货。

2.6.2 风控预警查询

功能介绍

【风控预警查询】位于【风险控制】→【风控预警查询】，是用来查询已经记录下来的触发了的风控以及审批记录的情况。通过查询日期、操作员、产品、

触警操作、风控类型等查询条件，就能正确的缩小查询范围，快速定位到待查询的记录。如图 2-6-21。

在风控预警查询界面中，还可以进行自动刷新，设置好正确的刷新时间后，界面每隔一定时间便会执行自动查询，方便用户及时掌握风控状况。

流水序号	日志来源	业务日期	告警时间	产品名称	控制层次	基金名称	基金代码	交易日期	交易时间	交易地点	交易品种	交易数量	交易价格	交易金额	交易方向	交易类型	交易状态	交易原因
184871	正式下达	20090109	2009-01-11 14:41	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:41	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184870	正式下达	20090109	2009-01-11 14:41	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:41	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184869	正式下达	20090109	2009-01-11 14:41	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:41	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184868	正式下达	20090109	2009-01-11 14:41	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:41	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184867	正式下达	20090109	2009-01-11 14:40	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:40	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184866	正式下达	20090109	2009-01-11 14:40	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:40	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184865	正式下达	20090109	2009-01-11 14:39	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:39	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184864	正式下达	20090109	2009-01-11 14:39	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:39	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184863	正式下达	20090109	2009-01-11 14:33	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:33	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184862	正式下达	20090109	2009-01-11 14:32	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:32	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184861	正式下达	20090109	2009-01-11 14:29	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:29	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184860	正式下达	20090109	2009-01-11 14:29	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:29	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00
184859	正式下达	20090109	2009-01-11 14:29	1-基金恒丰	产品	基金恒丰	730215	20090109	14:29	上交所A	白铜1412	10000	1.0000	10000.00	买入	不区分	正式下达	当前指令/交易的价格=1.0000, 数量=10000.00

图 2-6-21

操作介绍

选择好查询时间、操作员、风控类型等查询条件后点击**查询**按钮即可。

2.6.3 证券池管理

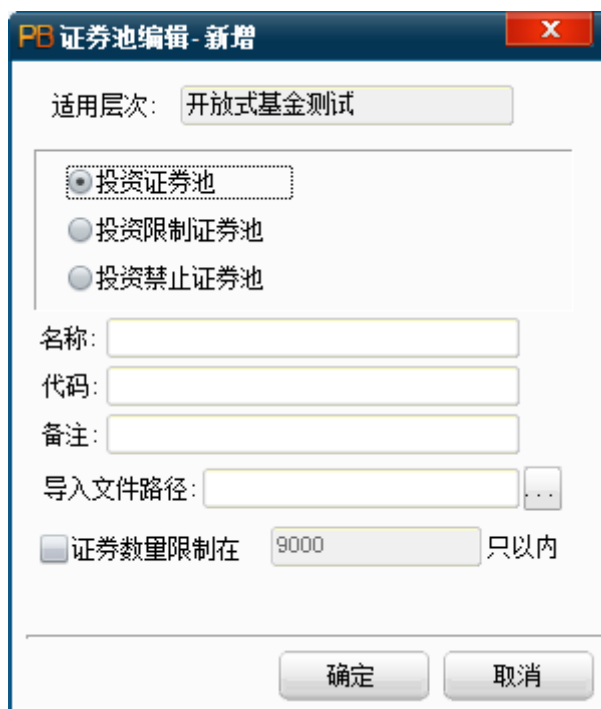
功能介绍

证券池是一种特殊的维度，是将证券进行分类，设置成证券池，用于风控设置。如我们可以设置禁止买卖“禁止证券池”中的股票，就是通过同时设置证券池和风控来实现的。界面分左右两侧，左侧为系统中所有的证券池，右侧为证券池中具体的证券代码。界面上方还提供了查询、新增、删除、修改、转移、导入和导出证券池证券的功能。

操作介绍

具体操作如下：点击【风险控制】→【证券池管理】界面，点击左下角的新增，弹出如图 2-6-22 所示，新增证券池时，先选择证券池类型，包括：投资证券池、投资限制证券池和投资禁止证券池。（注意：股票池类型只是一个简单的

分类,单纯的证券池类型选择不能达到限制投资的效果,需要和风控结合使用)。
依次填入名称、代码、导入文件路径等信息。



该对话框用于新增或编辑证券池。其包含以下元素：

- 标题栏：PB 证券池编辑-新增
- 适用层次：开放式基金测试
- 单选按钮组：
 - ☒ 投资证券池
 - ☐ 投资限制证券池
 - ☐ 投资禁止证券池
- 名称：文本输入框
- 代码：文本输入框
- 备注：文本输入框
- 导入文件路径：文本输入框，右侧有浏览按钮（...）
- 复选框：证券数量限制在 9000 只以内
- 底部按钮：确定、取消

图 2-6-22

字段介绍

证券数量限制在 只以内：证券池证券数量不能超过此处设置的数量。

2.7 风险监控与处置

功能介绍

风险监控主要用于在工作中监控对行情波动比较敏感的高危金融产品进行各类指标的监控,当监控数据达到预警值时系统会自动根据权限给相应的人进行预警提醒。投资经理或投资风控人员还可以对某个产品的开仓、委托权限进行掌控、必要时可以对产品的持仓进行平仓处理。

客户端的风险监控主要作用是针对本公司的实时监控持仓、资金在行情、交易变化的时情况下是否触犯预警的值。如果券商总公司的券商端同样设置了关于本公司的风控,那么也可对本公司进行实时监控。

2.7.1 风险风控设置

目前支持的风控主要有：

- A：净值监控
- C：盈亏监控
- E：资产市值监控
- F：期货风险率监控
- G：保证金监控

操作说明

在【风险控制】→【风险风控设置】进行监控设置，该部分主要对各项风险监控规则的设置。如图 2-7-1 所示，该界面为风险监控设置主界面。左面为树状结构，可以按照产品或风控类别来浏览；右半部分为具体的风控设置信息。当在左侧树状结构选中某个节点时，右侧对应的会查询出对应类别的风控设置项目。

风险监控设置											
按产品		新增(A)	修改(M)	删除(D)	复制(C)	启用(S)	查看(L)	查询(Q)	执行计划设置	打印预览(P)	导出(E)
按风控类型		布局设置									
定位:	序号	风控类型	启用	是否复制	风控说明	执行计划编号	执行计划名称	产品编号	产品名称	预警类型	控制方式
全部显示	114	H-保证金可用监控	是		测试保证金可用	2	默认执行计划	9	现货测试	金额	大于
9 现货测试	111	F-无限制	是		F1	2	默认执行计划	12	期货测试	比例	大于
10 ETF测试	110	A-净值监控	否		testAll	2	默认执行计划	9	现货测试	金额	大于
12 期货测试	109	C-盈亏监控	否		testC	2	默认执行计划	9	现货测试	金额	大于
T4 开放式基金测试	107	A-净值监控	否		testA	2	默认执行计划	9	现货测试	金额	大于
	106	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	10	ETF测试	金额	大于
	105	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	10	ETF测试	金额	大于
	104	A-净值监控	否		2323	2	默认执行计划	9	现货测试	金额	小于
	103	A-净值监控	否		2323	2	默认执行计划	9	现货测试	金额	小于
	102	A-净值监控	否		test开放式基金	2	默认执行计划	74	开放式基金测试	金额	大于
	101	A-净值监控	否		testETF	2	默认执行计划	10	ETF测试	金额	大于
	100	A-净值监控	否		sdad	2	默认执行计划	9	现货测试	金额	大于
	99	A-净值监控	否		testDuoJiJin	2	默认执行计划	9	现货测试	金额	大于
	98	G-保证金占用	否		TESTG	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	97	F-资产市值监控	否		TESTF	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	96	C-盈亏监控	否		testC	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	95	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	94	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	93	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	92	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	91	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	12	期货测试	金额	大于
	90	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	12	期货测试	金额	大于
	89	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	12	期货测试	金额	大于
	88	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	12	期货测试	金额	大于
	87	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	86	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	85	A-净值监控	否		testA	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	84	F-无限制	否		testF	3	23223	9	现货测试	比例	大于
	83	F-无限制	否		testFFF	3	23223	9	现货测试	比例	大于
	82	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	9	现货测试	金额	大于
	81	B-证券收益率监控	否		testB	3	23223	9	现货测试	金额	大于

图 2-7-1

详细说明

新增：添加风控设置。

修改：修改风控设置。

删除：删除选中的风控设置。

复制：弹出复制窗口，可以按产品、单元等条件进行风控设置的复制操作。

启/停用：设置风控为启用/停用状态。可以单个进行停启用，也可以全部一次停启用。

查询：风控数量很多时候，可以用查询进行筛选。

查看：用于查看设置的风控。

执行计划设置：设置风控触发，提醒的执行方式。鼠标点击单选（或按 Ctrl+鼠标进行多选）

选择相应风控后，再点击右键可选择关联设置好的执行计划。

打印预览：打印当前列表内容。

导出：选择导出格式导出当前列表内容。

布局设置：可以设置对当前页面列显示顺序、打印等，详细操作请查看[布局设置](#)页面。

2.7.1.1 执行计划设置

执行计划主要是设置监控时触发预警的提醒方式、提醒间隔，一个计划可以被多个风控使用。完成计划设置后，勾选右上角的“启用计划”按钮，生效该计划。



PB 执行计划

快速定位 序号

序号	计划名称
0	
2	默认执行计划
7	预警方案一

计划序号: 7 启用计划: ☒

计划名称: 预警方案一

未触警检查间隔: 60 秒

预警一检查间隔: 1000 秒 提醒方式: 1 消息提醒 提醒间隔: 5 分钟

预警二检查间隔: 1200 秒 提醒方式: 1 消息提醒 提醒间隔: 5 分钟

预警三检查间隔: 1400 秒 提醒方式: 1 消息提醒 提醒间隔: 5 分钟

计划执行时间: 091500, 093000 | 145000, 150000

计划简介:

确定 (O) 取消 (C)

详细说明

未触警检查间隔：设置检查是否触犯预警的间隔时间。

预警一/二/三检查间隔：如果触犯预警后，在设置时间后再次检查是否继续触犯预警。

提醒方式：触犯风险预警时的提醒方式，可选“消息提醒”、“短信提醒”、“邮件提醒”。

提醒间隔：设置触犯预警后的再次提醒时间间隔。

计划执行时间：设置计划执行的时间段，开始时间和结束时间以逗号分隔，不同时间段以|分隔，最多支持设置 3 个时间段。

2.7.1.2 A 类净值监控

功能介绍

A 类风控主要是用来监控产品层、单元层的净值、单位净值的波动或变化。

绝对控制，用金额来监控基金、资产单元的单位净值和净值的变化，可在高级设置增加净值条件做为触发监控的前置条件。

比例控制，用百分比来监控基金、资产单元的单位净值和净值的变化，可在高级设置增加净值条件做为触发监控的前置条件

PB 【新增】风控操作

监控层次: 1 产品 产品编号: 9 现货测试

全部显示

- A. 净值监控
- 比例控制
- C. 盈亏监控
- E. 资产市值监控
- F. 期货风险率
- G. 保证金占用

A. 净值监控【绝对控制】

风控说明

比较方向 1 大于 执行计划 2 默认执行计划

☒ 是否启用 ☐ 是否强平 (选择后警示线三为强平线)

监控类型 1 净值监控

预警一 万元 预警二 万元 预警三 万元

高级设置

产品净值 0 不控制

净值 0 万元

产品单位净值 0 不控制

单位净值 0 元

确定 (O)

退出 (Q)

详细说明

比较方向: 包括大于、小于、大于等于、小于等于，该选项控制计算结果与设定的预警值比较方向。

执行计划: 设置风控预设的执行计划，触发后按照计划设置提醒。

是否启用: 设置风控是否启用。

预警一、预警二、预警三：用来指定不同预警，比较方向为大于或大于等于，预警应该从小到大，是小于或小于等于，阈值应该从大到小设置。

监控类型：可选择按照“净值监控”、“单位净值监控”。

监控层次：支持产品层、单元层。

分母：包括敞口（用来输入某固定值）、基准日净值、基准日最大净值。设置基准日净值时要输入监控基准日类型即具体的日期，或今天日期前 N 天，系统会根据输入的日期或 N 天计算产品的交易日期。

是否强平：勾选后，该风控预警三必须填写，预警三为强平线。

高级设置：选择设置产品净值，单位净值启用条件。如果该高级设置设置了，其对应的高级设置条件满足了，该条风控才会进行正常监控，否则就不会对该条风控进行计算。

2.7.1.3 C 类盈亏监控

功能介绍

C 类绝对监控监控当日整体盈亏，C 类比例监控是监控当日整体盈亏与基准日整体盈亏之间的差额。

PB【新增】风控操作

监控层次: 1 产品 产品编号: 9 现货测试

全部显示

- A. 净值监控
 - 绝对控制
 - 比例控制
- C. 盈亏监控
 - 绝对控制
 - 比例控制
- E. 资产市值监控
- F. 期货风险率
- G. 保证金占用

C. 盈亏监控【绝对控制】

风控说明

比较方向 1 大于 执行计划 2 默认执行计划

☒ 是否启用 ☐ 是否强平 (选择后警示线三为强平线)

预 警 一 1 万元 预 警 二 2 万元 预 警 三 3 万元

高级设置

产品净值 0 不控制

净值 0 万元

产品单位净值 0 不控制

单位净值 0 元

确定 (Q)

退出 (Q)

详细说明

比较方向: 包括大于、小于、大于等于、小于等于, 该选项控制计算结果与设定的阈值比较方向。

执行计划: 设置风控预设的执行计划, 触发后按照计划设置提醒。

是否启用: 设置风控是否启用。

预警一、预警二、预警三: 用来指定不同预警, 比较方向为大于或大于等于, 预警应该从小到大, 是小于或小于等于, 预警应该从大到小设置。

监控层次: 支持产品层。

分母: 分母包括敞口 (用来输入某固定值)、基准日盈亏。设置基准日盈亏时要输入监控基准日类型即具体的日期, 或今天日期前 N 天, 系统会根据输入的日期或 N 天计算基金的交易日期。

是否强平: 勾选后, 该风控预警三必须填写, 预警三为强平线。

高级设置: 选择设置产品净值, 单位净值启用条件。如果该高级设置设置了, 其对应的控制条件满足了, 该条风控才会进行正常监控, 否则就不会对该条风控进行计算。

2.7.1.4 E 类资产市值监控

功能介绍

E 类是计算系统设定的各类资产类型计算后的值与当前市值的变化情况。

绝对控制，用金额来监某一个基金某一类资产（可以是不同证券的组合）的市值变化，可在高级设置增加净值条件做为触发监控的前置条件。

比例控制，用百分比来监控一个基金某一类资产（可以是不同证券的组合）的市值变化，可在高级设置增加净值条件做为触发监控的前置条件。

PB 【新增】风控操作

监控层次: 1 产品 产品编号: 9 现货测试

全部显示

- A. 净值监控
 - 绝对控制
 - 比例控制
- C. 盈亏监控
 - 绝对控制
 - 比例控制
- E. 资产市值监控
 - 绝对控制
 - 比例控制
- F. 期货风险率
 - 绝对控制
 - 比例控制
- G. 保证金占用
 - 绝对控制
 - 比例控制

E. 资产市值监控【绝对控制】

风控说明

比较方向 1 大于 2 默认执行计划

☒ 是否启用 ☐ 是否强平 (选择后警示线三为强平线)

期货品种轧差 1 按期货合约轧差

预警一 1 万元 预警二 2 万元 预警三 3 万元

高级设置

产品净值 0 不控制 净值 0 万元

产品单位净值 0 不控制 单位净值 0 元

资产类别	计算方向	资产大类
股票	加上	证券类别
1441-剩余期限大于397天?..	加上	动态维度
现金资产	减去	特殊计算

选择

确定 (O)

退出 (Q)

详细说明

比较方向：包括大于、小于、大于等于、小于等于，该选项控制计算结果与设定的阈值比较方向。

执行计划：设置风控预设的执行计划，触发后按照计划设置提醒。

是否启用：设置风控是否启用。

预警一、预警二、预警三：用来指定不同预警值，比较方向为大于或大于等于，预警值应该

从小到大，是小于或小于等于，预警值应该从大到小设置。

控制层次：支持产品层、单元层。

期货品种轧差：否、按期货合约轧差、按期货品种轧差，用来计算控制类别是期货品种时。

分母：分母包括敞口（用来输入某固定值）、净值、账户权益。

是否强平：勾选后，该风控预警三必须填写，预警三为强平线。

高级设置：选择设置产品净值，单位净值，动态维度启用条件。如果该高级设置对应的控制条件满足了，该条风控才会进行正常监控，否则就不会对该条风控进行计算。

2.7.1.5 F 类期货风险率

功能介绍

F 类来监控期货风险度，期货风险度=持仓保证金/账户权益，越高则风险越大。

PB 【新增】风控操作

监控层次: 1 产品 产品编号: 9 现货测试

全部显示

- A. 净值监控
 - 绝对控制
 - 比例控制
- C. 盈亏监控
- E. 资产市值监控
- F. 期货风险率
- G. 保证金占用
 - 绝对控制
 - 比例控制

F. 期货风险率

风控说明

比较方向 1 大于 执行计划 2 默认执行计划

☒ 是否启用 ☐ 是否强平 (选择后警示线三为强平线)

预警一 10 % 预警二 20 % 预警三 30 %

高级设置

产品净值 0 不控制

净值 0 万元

产品单位净值 1 大于

单位净值 1 元

确定 (O)

退出 (Q)

详细说明

比较方向：包括大于、小于、大于等于、小于等于，该选项控制计算结果与设定的阈值比较

方向。

执行计划：设置风控预设的执行计划，触发后按照计划设置提醒。

是否启用：设置风控是否启用。

预警一、预警二、预警三：用来指定不同预警值，比较方向为大于或大于等于，预警值应该从小到大，是小于或小于等于，预警值应该从大到小设置。

控制层次：支持产品层。

是否强平：勾选后，该风控预警三必须填写，预警三为强平线。

高级设置：选择设置产品净值，单位净值启用条件。如果该高级设置设置了，其对应的控制条件满足了，该条风控才会进行正常监控，否则就不会对该条风控进行计算。

2.7.1.6 G 类保证金占用

功能介绍

G 类风控用来监控期货、期权已使用保证金占净值产或者某一个具体值的变化。

绝对控制，用金额来监控期货、期权已使用保证金占净值产或者某一个具体值的变化，可在高级设置增加净值条件做为触发监控的前置条件。

比例控制，用百分比来监控期货、期权已使用保证金占净值产或者某一个具体值的变化，可在高级设置增加净值条件做为触发监控的前置条件。

PB【新增】风控操作

监控层次: 1 产品 产品编号: 9 现货测试

全部显示

- A. 净值监控
 - 绝对控制
 - 比例控制
- C. 盈亏监控
- E. 资产市值监控
- F. 期货风险率
- G. 保证金占用
 - 绝对控制
 - 比例控制

G. 保证金占用【绝对控制】

风控说明

比较方向 1 大于 2 默认执行计划

☒ 是否启用 ☐ 是否强平 (选择后警示线三为强平线)

监控类型 1 期货保证金占用

多空合约轧差 1 按期货合约轧差

预警一 1 万元 预警二 2 万元 预警三 3 万元

高级设置

产品净值 1 大于

净值 10 万元

产品单位净值 0 不控制

单位净值 0 元

确定 (O)

退出 (Q)

详细说明

比较方向: 包括大于、小于、大于等于、小于等于, 该选项控制计算结果与设定的阈值比较方向。

执行计划: 设置风控预设的执行计划, 触发后按照计划设置提醒。

是否启用: 设置风控是否启用。

预警一、预警二、预警三: 用来指定不同预警值, 比较方向为大于或大于等于, 预警值应该从小到大, 是小于或小于等于, 预警值应该从大到小设置。

监控类型: 期货保证金占用, 期权保证金占用, 期货品种保证金占用, 选择不同类型服务端会查询不同对应的风控值。

多空合约轧差: 否, 按期货合约轧差, 按期货品种轧差。

监控层次: 支持产品层、单元层。

分母: 分母包括敞口 (用来输入某固定值), 净值。

是否强平: 勾选后, 该风控预警三必须填写, 预警三为强平线。

高级设置: 选择设置产品净值, 单位净值启用条件。如果该高级设置设置了, 其对应的控制

条件满足了，该条风控才会进行正常监控，否则就不会对该条风控进行计算。

2.7.2 风险监控

功能介绍

【风险监控】位于【风险控制】→【风险监控】，如下图所示，在<监控数据>标签页可以查询计算的监控结果，并能及时更新计算后变化的值，并可以根据计算结果查看相应的持仓明细、强平委托流水等数据，在风控设置平仓选项时，计算结果在满足条件后可进行强制平仓操作；<禁买权限设置>标签页可以增加对产品层、单元层、个股交易权限的控制；<监控日志>标签页可以查询监控过程中有预警的监控数据。

2.7.2.1 监控数据

<监控数据>标签页如下图所示。

该界面分为三个主要部分：

- 监控栏**：包含产品列表、风控类型、筛选条件（所有数据、超过预警一、超过预警二、超过预警三、不显示为0值）、监控查询、参数设置、高级查询、导出excel等。
- 查询栏**：包含持仓明细、融资融券明细、强平委托流水、强平成交流水、委托流水等。
- 权限栏**：包含产品名称、产品编号、交易权限、平仓权限等。

风控序号	风控名称	产品名称	单元	证券代码	交易市场	证券名称	分子值	分母值	当前值	预警一	预警二	预警三
102	A-test开放式基金	T4-开放式基金测试					0.0000	0.0000	0.0000	10.0000	0.0000	20.0000
103	A-2323	9-现货测试					0.0000	80.0000	175.7900	120.0000	0.0000	20.0000
83	F-testFFF	9-现货测试					0.0000	0.0000	0.0000	1.0000		
80	F-testFFF	9-现货测试					0.0000	0.0000	0.0000	1.0000		
79	F-testF	9-现货测试					0.0000	0.0000	0.0000	0.0100		
111	F-F1	12-期货测试					0.0000	11.498	500.0000	0.0000	1.0000	
81	B-testB	9-现货测试	003050	深交所	A	G 联通	2.3600	0.0000	0.0000	1.0000		
81	B-testB	9-现货测试	600583	上交所	A	海油工程	12.1700	0.0000	12.1700	1.0000		
81	B-testB	9-现货测试	003900	深交所	A	G 长电	7.2900	0.0000	7.2900	1.0000		
81	B-testB	9-现货测试	600036	上交所	A	招商银行	14.9200	0.0000	14.9200	1.0000		
81	B-testB	9-现货测试	000024	深交所	A	招商地产	12.2200	0.0000	12.2200	1.0000		

共有记录 70

强平范围: 0 所有 强制平仓

选择	产品名称	单元名称	投资类型	交易市场	证券/合约代码	证券/合约名称	多空标志	持仓数量	强平数量	强平持仓市值	持仓市值
☒	现货测试	现货单元	可交易	上交所A	600000	浦发银行	多仓	1	1,000	1,000	13,870.00
☒	现货测试	现货单元	可交易	上交所A	600017	浦发银行	多仓	1	100	100	7,476.00
☒	现货测试	现货单元	可交易	上交所A	600570	恒生电子	多仓	1	100	100	988.00

合计: 选择4条 22,602.90 22,602.90

客户: test 联系方式1: 13221222 12212121 112 联系方式2:

关闭交易权限 关闭平仓权限

该界面分为<监控栏>、<查询栏>、<权限栏>三个部分。

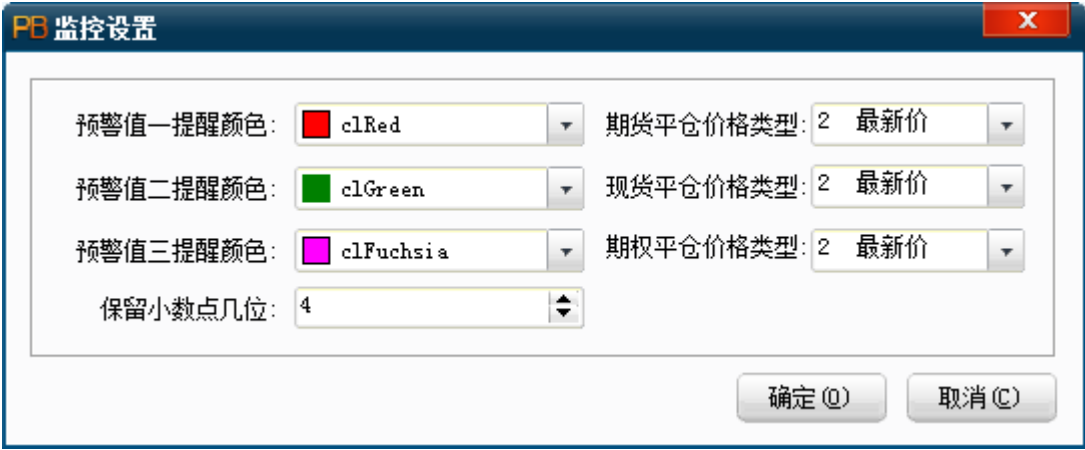
1. <监控栏>：通过指定产品、风控类型、筛选条件获取监控结果，并且实时更新计算后的监控值。

产品列表：选择列表显示的监控产品。

风控类型：选择列表显示的风控类型。

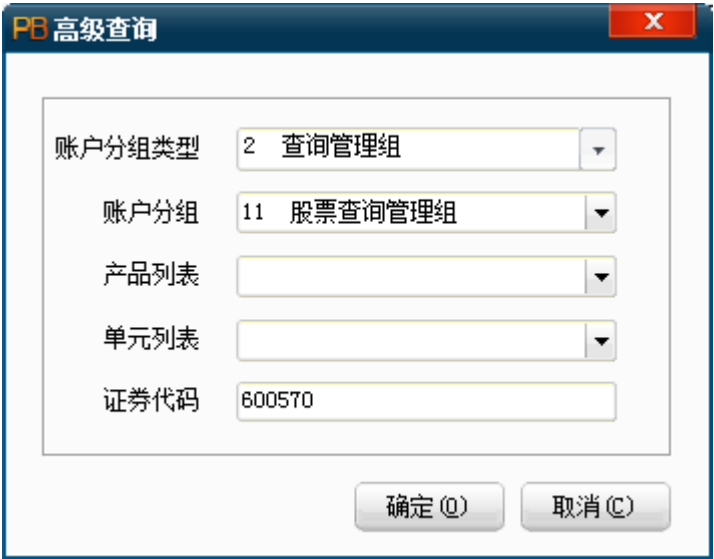
参数设置：参数设置用于设置超预警时的提醒颜色、强平价格以及列表中显示列

保留的小数点位数。

该对话框用于配置监控预警。它包含三个预警设置行，每行有颜色选择器、名称下拉菜单、平仓价格类型下拉菜单和最新价下拉菜单。此外还有一个保留小数点位数的数字输入框。底部有确定和取消按钮。

预警值一提醒颜色:	■ clRed	期货平仓价格类型:	2 最新价
预警值二提醒颜色:	■ clGreen	现货平仓价格类型:	2 最新价
预警值三提醒颜色:	■ clFuchsia	期权平仓价格类型:	2 最新价
保留小数点几位:	4		

高级查询：可以通过高级查询的查询条件筛选<监控栏>列表内容。例如只需要显示证券代码 600570 的证券监控，在高级查询中证券代码查询项输入“600570”即可。

该对话框用于高级查询。它包含五个查询条件：账户分组类型、账户分组、产品列表、单元列表和证券代码。底部有确定和取消按钮。

账户分组类型	2 查询管理组
账户分组	11 股票查询管理组
产品列表	
单元列表	
证券代码	600570

导出 excel：将当前监控数据导出 excel。

2. <查询栏>：查询栏分为<持仓明细>、<融资融券明细>、<强平委托流水>、<强平成交流水>、<委托流水>五个查询界面。接下来将对这五个界面做详细介绍：

- <持仓明细>：显示当前监控包含的证券持仓明细。如下图所示，风控序号 110 的监控是“A 类净值监控”，当前触犯了预警的证券可在持仓明细中查看。如果在【风险风控设置】中勾选了“是否强平（选择后警示线三为强平线）”项，那么可以在<持仓明细>中对触犯了预警三的明细进行强平操作。

产品列表 9, 10, 12, 15, 17, 59, 74 风控类型 ABCEFGH ☒ 所有数据 ☒ 超过预警一 ☒ 超过预警二 ☒ 超过预警三 ☐ 不显示为0值 监控查询 参数设置 高级查询 导出excel

风控序号	风控名称	产品名称	单元	证券代码	交易市场	证券名称	分子值	分母值	当前值	预警一	预警二	预警三
82	B-testB	9-现货测试		000024	深交所A	招商地产	12.2200	0.0000	12.2200	1.0000		
82	B-testB	9-现货测试		600036	上交所A	招商银行	14.9200	0.0000	14.9200	1.0000		
82	B-testB	9-现货测试		000900	深交所A	G 长 电	7.2900	0.0000	7.2900	1.0000		
82	B-testB	9-现货测试		600583	上交所A	海油工程	12.1700	0.0000	12.1700	1.0000		
82	B-testB	9-现货测试		600497	上交所A	驰宏锌锗	10.0800	0.0000	10.0800	1.0000		
110	A-testAll	9-现货测试	20015-缺省单				0.0000	0.0000	00,021,614.9000	10,000.0000	20,000.0000	30,000.0000
94	B-testB	9-现货测试		600000	上交所A	浦发银行	13.8700	0.0000	13.8700	1.0000		
94	B-testB	9-现货测试		600557	上交所A	康缘药业	15.0700	0.0000	15.0700	1.0000		
94	B-testB	9-现货测试		000528	深交所A	柳工	14.9700	0.0000	14.9700	1.0000		
94	B-testB	9-现货测试		000898	深交所A	鞍钢股份	6.7500	0.0000	6.7500	1.0000		
94	B-testB	9-现货测试		000158	深交所A	常山股份	3.0300	0.0000	3.0300	1.0000		
94	B-testB	9-现货测试		000069	深交所A	华侨城A	8.9400	0.0000	8.9400	1.0000		
94	B-testB	9-现货测试		600694	上交所A	大商股份	18.8600	0.0000	18.8600	1.0000		

共有记录 403

客户: 联系方式1: 联系方式2:

持仓明细 强平委托流水 强平成交流水 委托流水

强平范围: 0 所有 强制全平

选择	产品名称	单元名称	投资类型	交易市场	证券/合约代码	证券/合约名称	多空标志	股东	持仓数量	强平数量	强平持仓市值	持仓市值
☒	现货测试	缺省单元	可交易	上交所A	510150	消费ETF	多仓	1	100	100	268.90	268.90
☒	现货测试	缺省单元	可交易	上交所A	600000	浦发银行	多仓	1	1,000	1,000	13,870.00	13,870.00
☒	现货测试	缺省单元	可交易	上交所A	600017	日照港	多仓	1	700	700	7,476.00	7,476.00

合计: 选择3条 21,614.90 21,614.90

强制全平: 在选择项中勾选待强平的持仓，系统根据产品编号显示相应的强平联系人（需要在【强平联系人】界面维护好数据，具体请见本文档 2.7.3 节）。点击**强制全平**按钮后，在弹出的强制平仓明细窗口可以查看本次强平的产品委托数量、委托价格，用户可以在**平仓比例**中输入本次平仓的委托数量，完成后**委托下达**并设置委托设置后即可完成平仓委托申报。如下图所示：

强制平仓明细

平仓比例: 100 委托下达

现货（最新价），期货（最新价），期权（最新价）

产品名称	单元名称	投资类型	交易市场	证券/合约代码	证券/合约名称	多空标志	股东	席位	委托价格	持仓数量	委托数量	委托比例(%)	可用数量
现货测试	缺省单元	可交易	上交所A	510150	消费ETF	多仓	1	1	2.6890	100	100	100.00	100
现货测试	缺省单元	可交易	上交所A	600000	浦发银行	多仓	1	1	13.8700	1,000	1,000	100.00	1,000
现货测试	缺省单元	可交易	上交所A	600017	日照港	多仓	1	1	10.6800	700	700	100.00	700

1,800 1,800

- <融资融券明细>：如果选择的产品有融资融券，在<融资融券明细>列表显示中，若系统数据和营业部数据有差距，点击**调整负债**按钮实现客户端与柜台之间的同步，然后点击**平仓**按钮进行平仓。

- <强平委托流水>：在持仓明细中进行强平处理后，可在<强平委托流水>处查看强平委托的挂单情况。并且可以在该界面撤销强平委托，修改委托价格。如下图所示：

持仓明细																强平委托流水		强平成交流水		委托流水	
撤单		委托修改														☐ 显示已撤单委托		☐ 显示已成交委托			
委托日期	委托时间	委托序号	委托批号	产品名称	单元名称	投资类型	委托方式	证券/合约代码	证券/合约名称	交易市场	委托方向	股东	价格类型	委托价格	委托数量						
2009-01-09	10:35:02	60296	12332	现货测试	缺省单元	可交易	普通委托	510150	消费ETF	上交所A	卖出	1	限价	2.6890	50						
2009-01-09	10:35:03	60297	12332	现货测试	缺省单元	可交易	普通委托	600000	浦发银行	上交所A	卖出	1	限价	13.8700	500						
2009-01-09	10:35:03	60298	12332	现货测试	缺省单元	可交易	普通委托	600017	日照港	上交所A	卖出	1	限价	10.6800	300						

撤单：选中或按 Ctrl 键多选列表中待撤销的委托挂单，点**撤单**即可撤销委托。

委托修改：在列表选中一条委托，点**委托修改**，在弹出的界面中可以查看元委托的情况，在**委托价格**项中填入修改后的委托价格，确定后，系统撤销原委托并根据改后的委托价格重新下强平单。

PB 委托修改

原委托时间: 10:35:02
原委托价格: 2.689

产品名称: 现货测试
委托数量: 50

单元名称: 缺省单元
挂单数量: 50

投资类型: 可交易
委托价格: 51

证券/合约代码: 510150

证券/合约名称: 消费ETF

股东: 1

席位: 1

确定
取消

- <强平成交流水>：在该界面可以查看强平委托的成交情况。
- <委托流水>：在委托流水界面，可以查看当前所有委托的挂单情况。
3. <权限栏>： 右侧权限栏主要用于快速关闭和开通交易员的开仓权限、交易权限，通过选中想要关闭或开启的产品后再点关闭或开启开仓权限、交易权限。开仓权限是对开仓权限的控制，交易权限是对买卖双方交易的控制。

2.7.2.2 禁买权限设置

禁买权限顾名思义是对产品、单元的买入权限进行控制，禁买设置复核通过的才能生效，并且只有记录的创建人才能对已有的记录进行修改和删除操作。如

下图所示：

监控数据 禁买权限设置 监控日志												
增加(A)		删除(D)		修改(E)	日期	2009/ 1/ 9	至	2009/ 1/ 9	控制层次	只显示未复核数据		
									查询	复核通过		
选择	序号	是否复核	日期	控制层次	产品编号	单元编号	控制方式	证券类别	受控证券	最后有效日期	是否有效	创建日期
☐	8	已复核	20090109	产品	9, 10		证券类别	1, (		20090109	是	20090109 hshf
☐	10	已复核	20090109	单元	10, 12	20018, 20023	证券类别	()		20090109	是	20090109 hshf
☐	11	已复核	20090109	产品	10		证券类别	()		20090109	是	20090109 hshf

点击增加按钮，如下图所示，在弹出的界面中依次输入控制要素后，确定并点击复核通过即可完成禁买权限的设置。

增加

增加风控权限设置

控制层次

单元

控制产品

9 现货测试

单元列表

20022 现货单元

控制方式

按证券编号

证券编号

按证券类别

按证券编号

证券代码

增加(A)

☒ 是否有效

最后有效日期

2009/ 1/ 9

确定(Q)

取消(C)

控制层次：禁买权限支持“单元”，“产品”层的控制。

控制产品：在该项填入禁买权限控制产品。

单元列表：如果**控制层次**选择“单元”，在该项输入权限控制的单元。

控制方式：控制方式分为“按证券类别”和“按证券编号”。“按证券类别”即是选择证券大类进行控制，如股票、封闭式基金等；“按证券编号”即是对某些具体的证券进行控制。

是否有效：该禁买权限设置是否有效。

最后有效日期：禁买权限设置审核通过后，即时生效。此处设置该禁买权限的生效截止日期。

2.7.2.3 监控日志

〈监控日志〉主要用于查询风险监控的相关日志。用户可以通过监控日期、产品列表、单元列表、证券编号对列表内容进行筛选。同时该界面还支持导出 excel、打印预览等操作。

监控数据 禁买权限设置 监控日志											
监控日期 2009/1/9		产品列表 9 现货测试		单元列表		证券编号		查询 导出 excel 打印预览			
日期	风控名称	产品	单元	证券编号	证券名称	分子	分母	最终值	预警	触发说明	预警范围
2009-01-09 04-testB	9-现货测试	9-现货测试	600489	中金黄金	26.4200	0.0000	26.4200	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:35
2009-01-09 05-testB	9-现货测试	9-现货测试	600489	中金黄金	26.4200	0.0000	26.4200	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:33
2009-01-09 06-testB	9-现货测试	9-现货测试	600489	中金黄金	26.4200	0.0000	26.4200	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:04:03
2009-01-09 07-testB	9-现货测试	9-现货测试	600489	中金黄金	26.4200	0.0000	26.4200	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:04:00
2009-01-09 08-testB	9-现货测试	9-现货测试	600489	中金黄金	26.4200	0.0000	26.4200	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:36
2009-01-09 09-testB	9-现货测试	9-现货测试	600489	中金黄金	26.4200	0.0000	26.4200	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:36
2009-01-09 10-testB	9-现货测试	9-现货测试	600489	中金黄金	26.4200	0.0000	26.4200	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 13:53:03
2009-01-09 11-testB	9-现货测试	9-现货测试	600570	恒士电子	9.8800	0.0000	9.8800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:35
2009-01-09 12-testB	9-现货测试	9-现货测试	600570	恒士电子	9.8800	0.0000	9.8800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:04:03
2009-01-09 13-testB	9-现货测试	9-现货测试	600570	恒士电子	9.8800	0.0000	9.8800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:04:00
2009-01-09 14-testB	9-现货测试	9-现货测试	600570	恒士电子	9.8800	0.0000	9.8800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:36
2009-01-09 15-testB	9-现货测试	9-现货测试	600570	恒士电子	9.8800	0.0000	9.8800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:35
2009-01-09 16-testB	9-现货测试	9-现货测试	600570	恒士电子	9.8800	0.0000	9.8800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 13:53:03
2009-01-09 17-testB	9-现货测试	9-现货测试	600497	德宏锌业	10.0800	0.0000	10.0800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:35
2009-01-09 18-testB	9-现货测试	9-现货测试	600497	德宏锌业	10.0800	0.0000	10.0800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:33
2009-01-09 19-testB	9-现货测试	9-现货测试	600497	德宏锌业	10.0800	0.0000	10.0800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:04:03
2009-01-09 20-testB	9-现货测试	9-现货测试	600497	德宏锌业	10.0800	0.0000	10.0800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:04:00
2009-01-09 21-testB	9-现货测试	9-现货测试	600497	德宏锌业	10.0800	0.0000	10.0800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:36
2009-01-09 22-testB	9-现货测试	9-现货测试	600497	德宏锌业	10.0800	0.0000	10.0800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:36
2009-01-09 23-testB	9-现货测试	9-现货测试	600497	德宏锌业	10.0800	0.0000	10.0800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 13:53:03
2009-01-09 24-testB	9-现货测试	9-现货测试	600786	东方锅炉	76.7800	0.0000	76.7800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:34
2009-01-09 25-testB	9-现货测试	9-现货测试	600786	东方锅炉	76.7800	0.0000	76.7800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:33
2009-01-09 26-testB	9-现货测试	9-现货测试	600786	东方锅炉	76.7800	0.0000	76.7800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:04:02
2009-01-09 27-testB	9-现货测试	9-现货测试	600786	东方锅炉	76.7800	0.0000	76.7800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:03:59
2009-01-09 28-testB	9-现货测试	9-现货测试	600786	东方锅炉	76.7800	0.0000	76.7800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:37
2009-01-09 29-testB	9-现货测试	9-现货测试	600786	东方锅炉	76.7800	0.0000	76.7800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:35
2009-01-09 30-testB	9-现货测试	9-现货测试	600786	东方锅炉	76.7800	0.0000	76.7800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 14:03:03
2009-01-09 31-testB	9-现货测试	9-现货测试	600786	东方锅炉	76.7800	0.0000	76.7800	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 13:53:03
2009-01-09 32-testB	9-现货测试	9-现货测试	600015	华夏银行	7.4500	0.0000	7.4500	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:34
2009-01-09 33-testB	9-现货测试	9-现货测试	600015	华夏银行	7.4500	0.0000	7.4500	3.0000	按分钟提示	超预警	2015-08-14 17:39:33

每页行数: 50 100 500 1000 下页 1 2 3 4 5 到第 1 页 确定 共有 456 条记录。

2.7.3 强平联系人维护

功能介绍

【强平联系人】位于【风险控制】→【强平联系人】，是用于监控界面显示该产品对应联系人及联系方式等信息，维护后点击风险监控界面查询的数据会根据产品或单元的值来显示相应联系人的名称和联系方式。

A screenshot of a software window titled "PB 【新增】强平联系人". The window contains several input fields for adding a new contact. The fields are arranged in two columns. The first column includes "产品名称" (Product Name) with a dropdown menu showing "6000 神投1号", "公司全称" (Company Name) with a text box containing "恒生电子", "公司简称" (Company Name Abbreviation) with a text box containing "HUNDSUN", "强平联系人" (Strong Liquidation Contact) with a text box, "联系电话" (Contact Phone) with a text box, "手机号码" (Mobile Number) with a text box, and "电子邮箱" (Email) with a text box. The second column includes "单元单元" (Unit) with a dropdown menu showing "168 期货1号", "产品数量" (Product Quantity) with a text box, "强平联系人1" (Strong Liquidation Contact 1) with a text box, "联系电话1" (Contact Phone 1) with a text box, "手机号码1" (Mobile Number 1) with a text box, and "电子邮箱1" (Email 1) with a text box. At the bottom right, there are two buttons: "确定 (Q)" (Confirm) and "取消 (C)" (Cancel).

图 2-7-8

详细说明

公司全称：联系人所在的公司的全称。

产品数量：联系人在所在公司所管理的产品个数。

第三章 交易管理

券商端和机构端均完成投资前准备的相关设置后，那么就可以通过机构端的交易模块进行投资交易了。以下为机构端的各交易模块的详细使用介绍。

3.1 证券交易 - 单账户交易

证券交易单账户委托即是通过委托栏对单只股票、基金、交易所债券等多个证券类型进行投资交易，同时支持配股、债券认购、指定交易等业务。

3.1.1 界面

3.1.1.1 主界面

【个股交易】→<委托栏>用过个人参数设置可分为“委托录入先选择产品”、“委托录入先输入证券代码”两种显示界面，下面以“委托录入先选择产品”为例说明。

进入【交易管理】→【证券交易】→<个股交易>后，会出现如下主界面：



图 3.1.1

- **菜单栏：** 证券交易菜单栏。证券交易分为<个股交易>、<算法监控>、<多账户交易>三个标签页。
- **资金栏：** 该区域显示产品、单元的资产、余额等信息。关于资金栏的详细说明请查看[资金栏](#)页面。
- **持仓区：** 该区域显示产品单元持仓详情，可以通过布局设置对该区域字段顺序、可见进行设置。关于持仓区的详细说明请查看[持仓区](#)页面。
- **行情栏：** 该区域用于显示委托栏汇总填入[证券代码](#)的个股行情。关于行情栏的详细说明请查看[行情栏](#)页面。
- **委托栏：** 用户在这里输入委托要素，进行下单。关于委托栏的详细说明请查看[委托栏](#)页面。
- **查询区：** 该区域将<挂单>、<委托>、<成交>列表以标签页的方式组织起来，供用户查询、撤单，同时为每个查询页提供一些特定的快捷操作方便用户使用。详情请查看[查询区](#)页面。

3.1.1.2 资金栏

<个股交易>资金栏界面如下，显示内容可以在<委托栏>→<选项>→<证券交易参数设置>

“资金栏显示要素”选项处设置，详细操作请见[参数设置](#)界面。

单元净值	期初现金余额	当前现金余额	股票资产	股票浮盈	债券资产	债券浮盈	基金资产	基金浮盈	回购资产
4,443,187,955.40	0.00	3,097,721,114.40	1,344,287,417.00	1,340,608,025.80	0.00	0.00	1,179,424.00	1,179,424.00	0.00

图 3.1.2

资金栏参数如下：

单元净值：当前现金余额-合计应付金额+合计应收金额+股票资产+债券资产+基金资产+回购资产+权证资产+其他资产+期货盈亏+期权资产+应收证券资产+应付证券资产。

期初现金余额：当日日初资金账户余额。

当前现金余额：当前时间点的资金账户余额。

股票资产：股票持仓数量*最新价。

股票成本：（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）-当日卖出数量*（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）/（当前数量+当日卖出数量）。

股票浮盈：股票资产-股票成本。

债券资产：债券持仓数量*最新价。

债券浮盈：债券资产-债券成本。

债券成本：（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）-当日卖出数量*（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）/（当前数量+当日卖出数量）。

基金资产：基金持仓数量*最新价。

基金成本：（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）-当日卖出数量*（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）/（当前数量+当日卖出数量）。

基金浮盈：股票资产-股票成本。

回购资产：回购持仓数量*100。

累计盈亏：累计实现收益 + 当日实现收益（含费用）- 结转后可交易资产总费用。

单位净值：开通分组估值时显示单元单位净值：单元净值/单元份额。

产品净值：不开通分组估值时显示基金单位净值：基金净值/基金份额。

产品总资产：股票资产+债券资产+基金资产+回购资产。

3.1.1.3 持仓区

〈个股交易〉持仓区界面如下，在界面左下角显示持仓区总笔数。

证券代码	证券名称	持仓数量	成本价	最新价	持仓市值	浮动盈亏	单元持仓比例	产品持仓比例	当前成本	累计盈亏(含费用)	当日买入数量	当日卖出数量	交易
601998	中信银行	1,000	4.4645	7.8200	7,820.00	3,355.54	0.0002	0.0002	4,464.45	-4.45	1,000	0	上
601919	中国远洋	43,400	10.2501	10.4900	455,268.00	10,411.38	0.0102	0.0102	444,854.62	-4,230.62	43,400	0	上
601899	紫金矿业	2,100	4.0741	3.9700	8,337.00	-218.55	0.0002	0.0002	8,555.55	-8.55	2,100	0	上
601890	亚星锚链	99,320	0.0443	17.8000	1,767,696.00	1,763,495.85	0.0398	0.0398	4,400.15	7,967.27	500	1,080	上
601886	江河创建	700	44.2928	13.2200	9,254.00	-21,750.97	0.0002	0.0002	44,004.97	-30.97	700	0	上
601866	平煤股份	300	14.6947	5.5100	1,653.00	-2,755.40	0.0000	0.0000	108.40	-4.40	300	0	上
601828	中国人寿	3,400	18.9890	27.7100	94,214.00	29,851.50	0.0021	0.0021	82.50	-64.50	3,400	0	上
601807	上海医药	100	7.8500	19.9200	1,992.00	1,207.00	0.0000	0.0000	85.00	-1.00	100	0	上

图 3.1.3

在持仓区栏上点击右键，可以执行以下操作：

- **刷新 (W)**：可以手动刷新持仓栏内容，现自动刷新频率为 5S。
- **查询 (X)**：在右键菜单栏内选择“查询”，弹出持仓区查询界面如下，可通过多选产品编号、单元编号、交易市场，指定证券代码对持仓区显示的证券持仓信息进行筛选。查询完毕后如要恢复持仓区显示，点击重置，清空或删除查询筛选项即可。



PB 持仓高级查询

设置查询条件
持仓查询条件明细设置

产品编号: 9106, 9107

单元编号: 2, 2

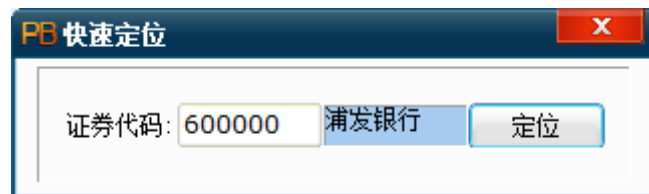
交易市场: 1 上交所A

证券代码: 600000 浦发银行

确定 取消 重置

图 3.1.4

- **布局设置 (Y)**：详细操作见[布局设置](#)页面。
- **定位 (Z)**：在弹出的快速定位栏中，输入证券代码后能够快速定位到证券所在行。



PB 快速定位

证券代码: 600000 浦发银行 定位

图 3.1.5

持仓区参数如下：

成本价：成本 / (当前数量 + 卖出数量)

持仓市值：持仓数量 * 市价

浮动盈亏：持仓市值 - 当前成本

单元持仓比例：持仓数量 / 单元持仓数量 * 100%

产品持仓比例：持仓数量/产品持仓数量*100%

当前成本：成本*（持仓数量/（持仓数量+当日卖出数量））

累计盈亏（含费用）：如果证券类别是股票回购、债券回购或资产类别是回购资产，则累计盈亏为 0；除此之外，如果卖出数量为 0，则累计盈亏为 0；如果卖出金额+当前数量=0，则累计盈亏为 0；否则 累计盈亏=卖出金额-卖出费用-卖出数量*（结转过含费用的期初成本+买入金额+买入费用）/（当前数量+卖出数量），如果投资类型是可交易，还要减去（实际当日买入费用+实际当日卖出费用）。

当日买入数量：当日累计买入数量。

当日卖出数量：当日累计卖出数量。

盈亏率（%）：当前成本为 0，损益率为 0；否则，损益率=浮动盈亏*100/当前成本

3.1.1.4 行情栏

刚进入<个股交易>界面时，个股行情栏显示为 N/A，双击持仓区证券、在委托栏证券代码处录入证券信息时，该界面会显示证券五档盘口行情。

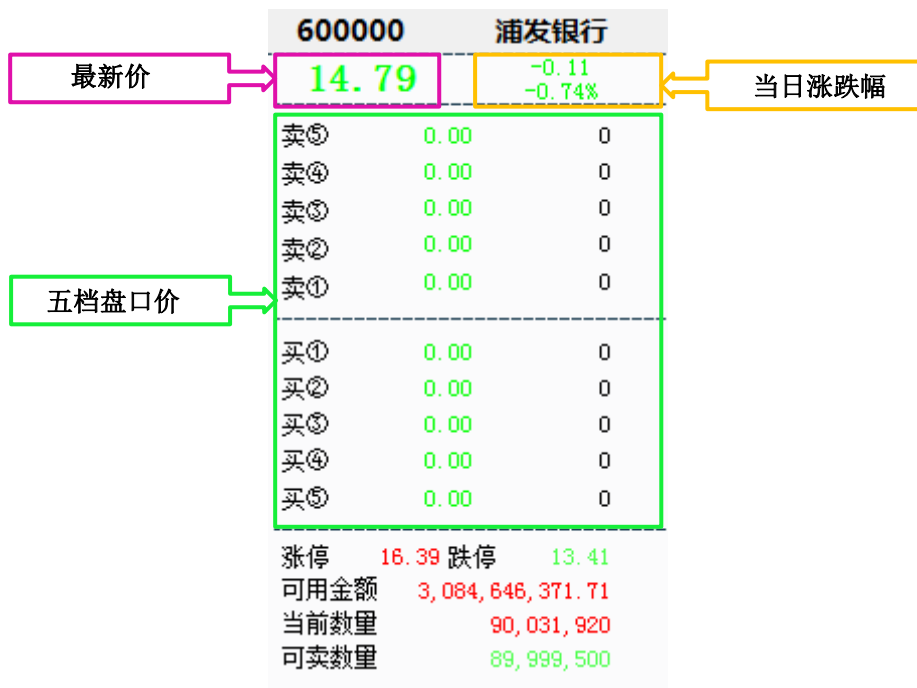


图 3.1.6

- **涨停：**显示证券代码的涨停价。
- **跌停：**显示证券代码的跌停价。

- **可用金额：**显示目前资金账户可用的金额。
- **当前数量：**显示证券代码的当前持仓数量。
- **可卖数量：**显示证券代码的当前可卖的数量。
- **可买数量：**显示证券代码的可买数量，可买数量=可用金额/最新价。

3.1.1.5 委托栏

委托栏界面可以依据“委托录入先选择产品”、“委托录入先输入证券代码”设置字段排列顺序(详细操作请查看[参数设置](#)页面)。委托栏界面如下图：

图 3.1.7

产品编号：该项用于填写下达委托的产品编号，可手工填写，也可通过双击持仓区的任意一行自动填写。

单元编号：产品编号项填写完后，单元编号会自动填上，若有多个编码，可通过下拉菜单选择。

证券代码：填写委托证券代码，可手工填写，也可通过双击持仓区的任意一行自动填写。

委托方向：通过买卖项选择委托方向。选择买入或卖出时，委托区部分字段会以不同颜色显示。

价格类型：依据沪深市场支持市价委托规则差异，价格类型选项略有不同。

上交所有“限价”，“五档即成剩撤”，“五档即成剩转”三个选项，“限价”指填写固定委托价格申报委托；“五档即成剩撤”指该申报在对手方五档盘口价内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分自动撤销；“五档即成剩转”指该申报在对手方实时对手方五档盘口价内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分按本方申报最新价限价申报；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。

深交所所有“限价”，“五档即成剩撤”，“即成剩撤”，“对手方最优”，“本方最优”，“全额成或撤”六个选项。“限价”与“五档即成剩撤”与上交所相同，“即成剩撤”指该申报在对手方申报队列中以对手方价格为成交价逐次成交，未成交部分自动撤销；“对手方最优”以申报时对手方盘口价一作为委托价格进行申报；“本方最优”以申报时本方盘口价一作为委托价格进行申报；“全额成或撤”指申报在对手方申报队列中以对手方价格为成交价逐次成交，能成交的全部成交，若部分无法成交则申报全部撤销。

委托价格：限价委托时，填写买入或卖出的价格，可手工填写，也可通过双击持仓区或个股行情栏盘口价的任意一行自动填写。

可买数量/可卖数量：委托方向是“买入”时，系统根据可用金额和委托价格计算出的最大委托数量，计算结果舍弃零股。可买数量=可用金额/委托价格。如果委托方向是“卖出”，此时显示可卖数量。

委托数量：填写买入或卖出的数量，不可超过可买数量/可卖数量。

委托金额：系统根据委托数量和委托价格计算委托金额。委托金额=委托数量*委托价格。

选项：在选项弹出界面可以进行个人参数设置。

下单：点击下单按钮执行下单操作。

算法：下达算法母单，而且是增值模块，只有开通了算法交易模块并且拥有该权限的用户，才会显示该按钮。

重置：清空委托栏内容，如果想同时清空个股行情栏内容，可在<委托栏>→<选项>→<其它>→勾选“重置按钮需要清空行情”选项进行设置。

3.1.1.6 查询区

查询区主要由<挂单>、<委托>、<成交>三个标签页组成。



图 3.1.8

3.1.1.6.1 挂单

该界面用于显示未成、未撤的委托挂单，页面左下角显示当前委托挂单笔数。

通过右键菜单可以进行布局设置，详细操作见[布局设置](#)页面。

挂单

委托

成交

委托批号	委托序号	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	挂单数量	成交数量	成交(%)	成交均价	产品
70068	101744	600570	恒生电子	买入	限价	74.710	2,000	1,000	1,000	50%	74.710	现货
70287	103696	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70285	103695	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70283	103694	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70281	103693	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70279	103692	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	90	10	10%	9.480	现货
70277	103691	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70275	103690	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	90	10	10%	9.480	现货
70273	103689	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70271	103688	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70269	103687	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70267	103686	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货

17 (笔)

撤单

全部撤单

撤最近一笔

条件撤单

图 3.1.9

3.1.1.6.2 委托

该界面用于显示当日委托，页面左下角显示列表中的委托笔数。

挂单	委托	成交									
委托批号	委托序号	委托状态	成交(%)	产品名称	单元编号	单元名称	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委
70068	101744	部成	50%	现货交易	3	现货交易单元	600570	恒生电子	买入	限价	
68113	98253	待撤	0%	现货交易	3	现货交易单元	000002	万 科A	买入	限价	
68111	98252	待撤	50%	现货交易	3	现货交易单元	000002	万 科A	买入	限价	
68109	98251	待撤	0%	现货交易	3	现货交易单元	000001	平安银行	买入	限价	
68107	98250	待撤	0%	现货交易	3	现货交易单元	000001	平安银行	买入	限价	
68105	98249	待撤	0%	现货交易	3	现货交易单元	000001	平安银行	买入	限价	
68098	98243	待撤	0%	现货交易	3	现货交易单元	000001	国农科技	买入	限价	
68035	98211	待撤	0%	现货交易	3	现货交易单元	000001	平安银行	买入	限价	
68032	98208	待撤	0%	现货交易	3	现货交易单元	000001	平安银行	买入	限价	
70015	101664	待撤	0%	现货交易	3	现货交易单元	150308	体育B	买入	限价	
70287	103696	已报	0%	现货交易	3	现货交易单元	600000	浦发银行	买入	限价	
70285	103695	已报	0%	现货交易	3	现货交易单元	600000	浦发银行	买入	限价	

26 (笔)

☒ 未成 ☐ 已成 ☐ 已撤 ☐ 废单

图 3.1.10

通过列表下方的状态筛选框，列表显示勾选相应状态的委托。

☒ 未成 ☐ 已成 ☐ 已撤 ☐ 废单

图 3.1.11

3.1.1.6.3 成交

该界面用于显示当日已成委托，页面左下角显示列表中的委托笔数。

挂单	委托	成交							
证券代码	证券名称	产品名称	单元编号	单元名称	委托方向	成交价格	成交数量	成交金额	委
600004	白云机场	现货交易	3	现货交易单元	买入	15.440	1,000	15,440.00	
600001	邯郸钢铁	现货交易	3	现货交易单元	买入	8.000	100	800.00	
600001	邯郸钢铁	现货交易	3	现货交易单元	买入	8.000	100	800.00	
600001	邯郸钢铁	现货交易	3	现货交易单元	买入	8.000	100	800.00	
600000	浦发银行	现货交易	3	现货交易单元	买入	9.480	100	948.00	
600000	浦发银行	现货交易	3	现货交易单元	买入				
600000	浦发银行	现货交易	3	现货交易单元	买入				
600000	浦发银行	现货交易	3	现货交易单元	买入				
600000	浦发银行	现货交易	3	现货交易单元	买入				
600000	浦发银行	现货交易	3	现货交易单元	买入				
600000	浦发银行	现货交易	3	现货交易单元	买入	9.480	100	948.00	
600000	浦发银行	现货交易	3	现货交易单元	买入	9.480	100	948.00	

显示成交明细

按委托序号汇总

按证券代码、委托方向汇总

布局设置

165 (笔)

图 3.1.12

通过右键菜单可以进行如下操作：

- **显示成交明细：**一笔委托多次成交，显示每一笔成交详情。
- **按委托序号汇总：**如果一笔委托多次成交会出现多笔成交记录，选择该项是将委托序号相同成交汇总显示。汇总后的成交价格=SUM（明细成交价格）/SUM（明细成交数量）
- **按证券代码、委托方向汇总：**将证券代码、委托方向相同成交的汇总显示。汇总后的成交价格=SUM（明细成交金额）/SUM（明细成交数量）
- **布局设置：**详细操作见[布局设置](#)页面。

3.1.1.7 布局设置

在布局设置界面，可以对当前页面的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置。

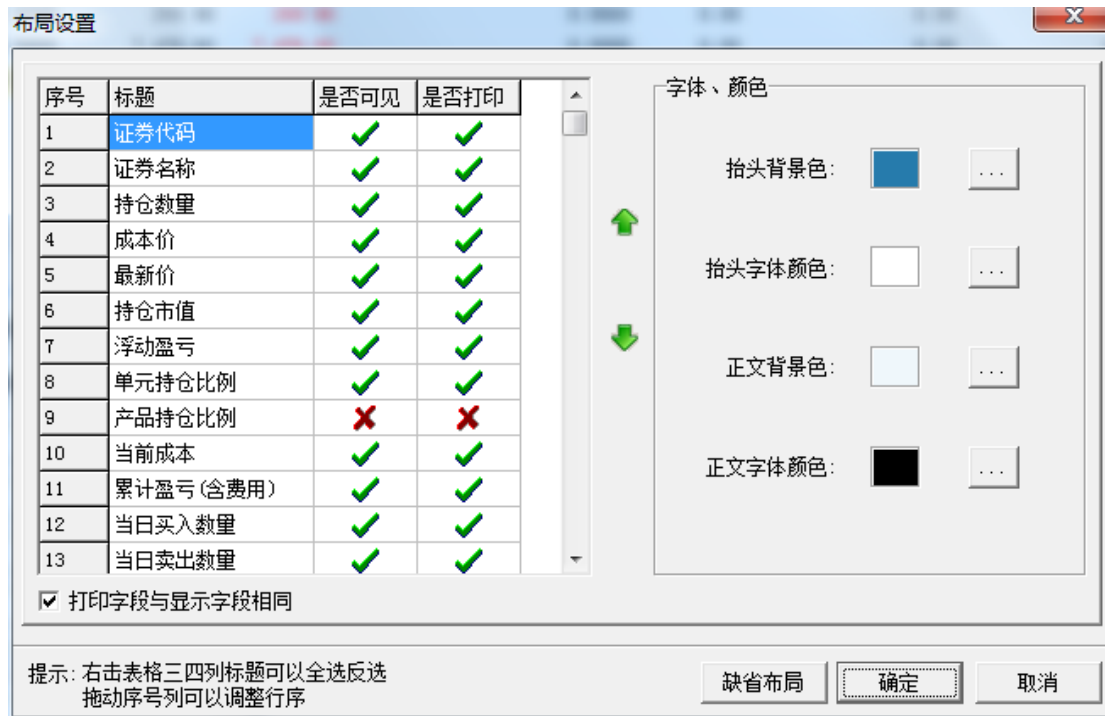


图 3.1.13

- **显示顺序:** 左侧显示顺序为持仓区的默认显示顺序, 使用上下按钮调整字段顺序。也可以点列表表头字段, 对列表内容进行升序降序排列。
- **可见、打印:** “是否可见”列为“✓”表示该列显示可见, “✗”为显示不可见。“是否打印”列为“✓”表示打印可见, “✗”为打印不可见。例如“浮动盈亏”字段, 是否显示为“✓”, 是否打印是“✗”, 说明“浮动盈亏”字段在界面中可见, 但是不可以打印。

“打印字段与显示字段相同”选项默认勾选, 在修改“是否可见”时, “是否打印”会同时修改方向, 如果需要分开设置, 取消勾选。

- **颜色:** 在界面右侧可以设置对抬头字体、颜色, 正文字体颜色。
- **缺省布局:** 点击缺省布局可以恢复系统默认显示设置。

3.1.2 交易

3.1.2.1 单账户委托

单账户委托即是通过委托栏对单只股票、基金、交易所债券等多个证券类型进行投资交易, 同时支持配股、债券认购、指定交易等业务。

图 3.1.14

在<个股交易>委托栏界面依次录入委托要素，点击下单按钮下单。

- **快捷操作：**可以使用上下键进行委托要素间的快速切换，选中委托要素后可以使用左右键在各委托输入项中进行快速切换。
- **锁定：**使用产品编号、单元编号、证券代码、委托方向、价格类型右侧的锁定符对这几项委托要素内容进行锁定，委托要素为灰色，表示不能修改。重新点击锁定符解锁后，才能够修改委托要素内容。
- **行情显示：**输入完证券代码，焦点转移后，系统会自动显示证券名称，并根据当前输入的证券代码刷新左侧个股行情栏的显示内容。
- **价格类型：**输入价格类型，下单后，系统根据价格类型向交易所申报委托。价格类型详细介绍请查看[委托栏](#)页面。
- **委托价格预警：**输入完委托价格，焦点转移后，系统会检查委托价格是否在涨跌停价格区间内，如果价格不符合，会在信息提示栏给出提示。如果价格符合，会计算刷新委托栏中可买数量/可卖数量的数值，可买数量=可用金额/委托价格，可卖数量=持仓数量，计算后的结果舍弃零股。
- **快速输入委托数量：**除手工填写委托数量外，可以使用可买数量右侧的数量控制功能快速确认委托数量，选择“全部”：委托数量=可买数量，选择“1/2”：委托数量=1/2*可买数量，选择“1/3”：委托数量=1/3*可买数量。输入焦点转移后，回计算刷新委托栏中委托金额的数值，委托金额=委托数量*委托价格。

- **快速抓取价格：**点击左侧个股行情栏内的五档盘口价可以快速抓取价格，委托方向和委托价格自动显示在委托栏上。

3.1.2.2 撤单

3.1.2.2.1 普通撤单

如果要撤销某笔挂单委托，在查询区<挂单>页面选中该委托或按住 Ctrl 键多选，点击 **撤单** 按钮即可。也可以双击<挂单>页面中的委托直接撤单。

挂单 委托 成交												
委托批号	委托序号	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	挂单数量	成交数量	成交(%)	成交均价	产品
70068	101744	600570	恒生电子	买入	限价	74.710	2,000	1,000	1,000	50%	74.710	现货
70287	103696	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70285	103695	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70283	103694	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70281	103693	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70279	103692	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	90	10	10%	9.480	现货
70277	103691	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70275	103690	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	90	10	10%	9.480	现货
70273	103689	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70271	103688	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70269	103687	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货
70267	103686	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000	现货

17 (笔) **撤单** 全部撤单 撤最近一笔 条件撤单

图 3.1.15

注意：

双击撤单需要在系统参数设置→<交易设置>中勾选“启用委托双击撤单功能”。

3.1.2.2.2 全部撤单

全部撤单是撤销所有挂单委托，如果要执行该操作，在查询区<挂单>页面点击 **全部撤单** 即可。系统会自动按配置查找相应可撤委托，并发送撤单委托。

挂单		委托		成交								
委托批号	委托序号	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	挂单数量	成交数量	成交(%)	成交均价	产品
	70068	101744	600570	恒生电子	买入	限价	74.710	2,000	1,000	1,000	50%	74.710 现货
	70287	103696	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70285	103695	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70283	103694	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70281	103693	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70279	103692	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	90	10	10%	9.480 现货
	70277	103691	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70275	103690	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	90	10	10%	9.480 现货
	70273	103689	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70271	103688	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70269	103687	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70267	103686	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货

17(笔)

撤单

全部撤单

撤最近一笔

条件撤单

图 3.1.16

3.1.2.2.3 撤最近一笔

撤最近一笔是系统匹配委托批号最大的一笔挂单撤销，直接点击撤最近一笔即可。

挂单	委托	成交										
委托批号	委托序号	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	挂单数量	成交数量	成交(%)	成交均价	产品
	70068	101744	600570	恒生电子	买入	限价	74.710	2,000	1,000	1,000	50%	74.710 现货
	70287	103696	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70285	103695	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70283	103694	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70281	103693	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70279	103692	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	90	10	10%	9.480 现货
	70277	103691	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70275	103690	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	90	10	10%	9.480 现货
	70273	103689	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70271	103688	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70269	103687	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货
	70267	103686	600000	浦发银行	买入	限价	9.480	100	100	0	0%	0.000 现货

17(笔)

撤单

全部撤单

撤最近一笔

条件撤单

图 3.1.17

3.1.2.2.4 条件撤单

条件撤单是对在<挂单>界面内满足条件的委托进行撤单。点击条件撤单，在弹出的窗口中填写产品编号、单元编号、证券代码、委托方向即可，如下图。系统会自动按撤单条件查找相应可撤委托，并发送撤单指令。



该窗口用于设置撤单条件。包含以下字段：

产品编号:	9106 现货交易
单元编号:	3 现货交易单元
证券代码:	600000 浦发银行
委托方向:	1 买入

底部按钮：确定、取消、重置

图 3.1.18

3.1.3 参数设置

用户可以在<委托栏>→<选项>弹出的“证券交易参数设置”界面设置个人参数。



该窗口用于设置个人证券交易参数。包含以下字段：

产品编号:	9106 现货交易	锁
单元编号:	3 现货交易单元	锁
证券代码:	600570 恒生电子	锁
委托方向:	1 买入	锁
价格类型:	0 限价	锁
委托价格:	58.32	元
可买数量:	52,891,700	股 全部
委托数量:	2,000	股
委托金额:	116,640.00	元

底部按钮：选项、下单、算法、重置

图 3.1.19

PB 证券交易参数设置

委托录入顺序

☐ 委托录入先选择产品 ☒ 委托录入先输入证券代码

确认提示

☐ 委托需要二次信息确认
☒ 委托下达成功需要成功提示
☐ 撤单需要二次提示确认

其他

☒ 点击重置按钮需要清空行情

委托方向

☒ 默认为买入 ☐ 默认为卖出

资金栏显示要素: 1, 2, 3, 4, 6, 7, 9, 10, ▾

输完数据后的焦点定位: 1 下单 ▾

下单面板位置: 1 界面左侧 ▾ ☐ 委托下达后, 清空委托面板

买入默认价格: 3 卖一价 ▾ 委托下达后, 光标焦点位置: 3 下单 ▾

卖出默认价格: 2 买一价 ▾

缺省下单数量设置

证券类别: 1 股票 ▾

委托方向: 1 买入 ▾

数量: 0 股

证券类别	委托方向	数量

确定 取消

图 3.1.20

委托录入顺序: 变更委托栏界面委托要素录入顺序, 可选“委托录入先选择产品”, “委托录入先输入证券代码”。

如果输入“委托录入先选择产品”, 委托栏显示如下, 在录入时需要先选择产品编号:



产品编号: 9106 现货交易

单元编号: 3 现货交易单元

证券代码: 600570 恒生电子

委托方向: 1 买入

价格类型: 0 限价

委托价格: 58.32 元

可买数量: 52,891,700 股 全部

委托数量: 2,000 股

委托金额: 116,640.00 元

选项 下单 算法 重置

图 3.1.21

如果输入“委托录入先输入证券代码”，委托显示如下，在录入时需要先选择证券代码：



证券代码: 600000 浦发银行

委托方向: 1 买入

产品编号: 9106 现货交易

单元编号: 1 缺省单元

价格类型: 0 限价

委托价格: 15 元

可买数量: 0 股 全部

委托数量: 10,000 股

委托金额: 150,000.00 元

选项 下单 算法 重置

图 3.1.22

委托需要二次信息确认：选中该项，在委托下单后，弹出确认提示，需要再次确定确认信息，系统才会委托申报。不勾选则不会弹出提示，不需要重复确认。

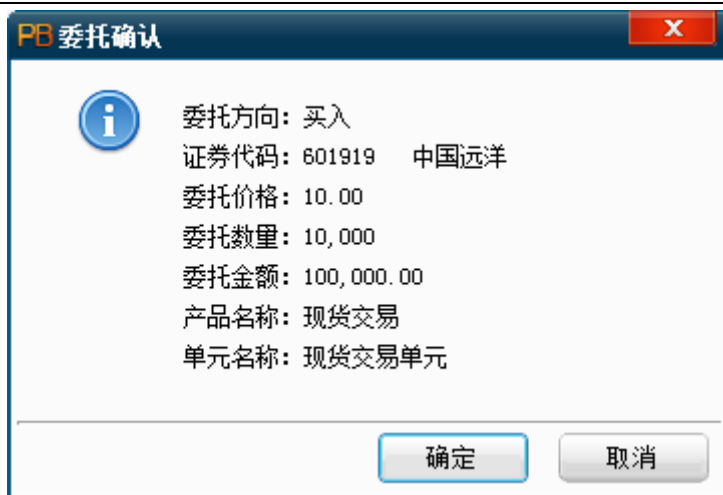


图 3.1.23

委托下达成功需要成功提示：勾选该项，在下单成功后弹出下达成功的信息提示，否则不进行提示。



图 3.1.24

撤单需要二次提示确认：选中该项，在撤单委托正式下达前，弹出“委托撤单确认”信息提示界面，重新确认内容后系统执行撤单申报。否则，撤单后立即执行撤单申报。

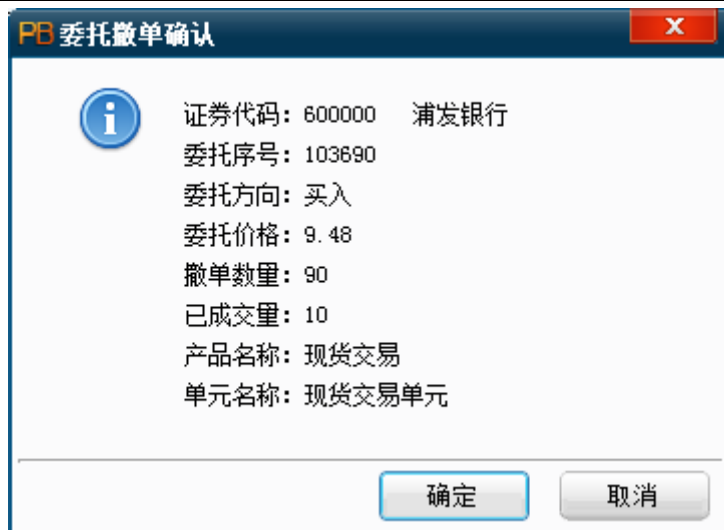


图 3.1.25

点击重置按钮需要清空行情：在<委托栏>使用重置功能时，同时清空<委托栏>和<个股行情栏>的内容。不勾选默认只清空<委托栏>。

委托方向：默认显示的委托方向。

资金栏显示要素：设置资金栏显示列，勾选要素会在资金栏中显示。

下单面板位置：变更<委托栏>和<个股行情栏>的显示位置。默认显示“界面左侧”，【证券交易】模块重新打开后生效。

买入默认价格：买入证券时，委托价格处默认显示的价格，可以设置“最新价”、“买一价”、“卖一价”。

卖出默认价格：卖出证券时，委托价格处默认显示的价格，可以设置“最新价”、“买一价”、“卖一价”。

输完数据后的焦点定位：录入完委托栏数据后，设置焦点位置定位。可以设置在[下单]或[算法]按钮。

委托下达后，清空委托面板：委托成功下达后，清空委托栏未锁定的委托要素。否则，不清空委托栏要素内容。

委托下达后，光标焦点位置：未勾选“委托下达后，清空委托面板”项，可以设置委托成功下达后的光标位置，可以设置在“价格”，“数量”，[下单]要素处。

缺省下单数量设置：设置不同证券类别、买入方向时，委托数量的缺省值。在左侧选择证券类别、委托方向、数量（默认委托数量）选入右侧列表中，下单时根据类别、方向显示委托数量。

缺省下单数量设置

证券类别: F 开放式基金

委托方向: 1 买入

数量: 1100 份

壹仟壹佰

证券类别	委托方向	数量
开放式基金	买入	1,100
股票	卖出	2,000
股票	买入	1,000

图 3.1.26

3.2 证券交易 - 多账户交易

多账户实现用户同时对多个产品下达股票, 基金、债券的普通买卖交易。多账户交易也称批量交易。

3.2.1 界面

3.2.1.1 主界面

进入【交易管理】→【证券交易】→<多账户交易>后, 会出现如下主界面:

菜单栏

行情栏

委托栏

查询区

持仓区

产品组: 0001 现货交易 持仓

证券名称 证券代码 持仓数量 成本价 最新价 持仓市值 浮动盈亏 单元持仓比例 产品名称 单元编号

浦发银行	600000	300,000	0.0000	14.7900	4,437,000.00	437,000.00	100.0000	现货交易	1
浦发银行	600000	100	0.0000	3.7500	375.00	375.00	0.0000	现货交易	3
华菱钢铁	000932	100	0.0000	10.7400	1,074.00	1,074.00	0.0000	现货交易	3
东方锆业	000962	100	7.8500	20.9800	2,098.00	1,313.00	0.0000	现货交易	3
马应龙	600993	100	7.8500	10.2700	1,027.00	242.00	0.0000	现货交易	3
嘉化能源	600273	100	0.0000	6.3000	630.00	630.00	0.0000	现货交易	3
西山煤电	000983	100	0.9812	9.2500	7,400.00	6,615.00	0.0002	现货交易	3
重庆水务	601158	100	7.8500	9.1900	919.00	134.00	0.0000	现货交易	3
杭齿前进	601558	100	7.8500	5.7300	573.00	-212.00	0.0000	现货交易	3
华锐风电	601566	100	7.8500	17.7500	1,775.00	990.00	0.0000	现货交易	3
三丰电气	601587	100	7.8500	12.8900	1,289.00	504.00	0.0000	现货交易	3
鹿港科技	601599	100	7.8500	16.3300	1,633.00	848.00	0.0000	现货交易	3
上海医药	601607	100	7.8500	19.9200	1,992.00	1,207.00	0.0000	现货交易	3

挂单 委托 成交

委托序号	委托代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	挂单数量	成交数量	成交均价	产品名称	单元编号	单元名称
69544	100810	恒生电子	买入	限价	69.400	25,000	24,000	1,000	69.400	现货交易	3	现货交易单元

1 (笔) 撤单 全部撤单 撤最近一笔 条件撤单 改单

图 3.2.1

- **菜单栏:** 证券交易菜单栏。证券交易分为<个股交易>、<算法监控>、<多账户交易>三个标签页。
- **行情栏:** 该区域用于显示委托栏输入的证券代码行情信息。关于行情栏的详细说明请查

看[行情栏](#)页面。

- **委托栏：**用户在这里输入委托要素，进行下单。关于委托区的详细说明请查看[委托栏](#)页面。
- **持仓区：**该区域用于产品组委托比例分配和产品单元持仓查看。关于持仓区的详细说明请查看[持仓区](#)页面。
- **查询区：**该区域将<挂单>，<委托>，<成交>信息以标签页的方式组织起来，供用户查询、撤单。详情请查看[查询区](#)页面。

3.2.1.2 行情栏

进入<多账户交易>界面，个股行情栏默认显示为 N/A，在委托栏录入[证券代码](#)后，该界面会显示证券五档盘口行情。

600000		浦发银行																																		
最新价	14.79	-0.11 -0.74%	当日涨跌幅																																	
五档盘口价 <table><tr><td>卖⑤</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td>卖④</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td>卖③</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td>卖②</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td>卖①</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td colspan="3"> </td></tr><tr><td>买①</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td>买②</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td>买③</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td>买④</td><td>0.00</td><td>0</td></tr><tr><td>买⑤</td><td>0.00</td><td>0</td></tr></table>				卖⑤	0.00	0	卖④	0.00	0	卖③	0.00	0	卖②	0.00	0	卖①	0.00	0				买①	0.00	0	买②	0.00	0	买③	0.00	0	买④	0.00	0	买⑤	0.00	0
卖⑤	0.00	0																																		
卖④	0.00	0																																		
卖③	0.00	0																																		
卖②	0.00	0																																		
卖①	0.00	0																																		
买①	0.00	0																																		
买②	0.00	0																																		
买③	0.00	0																																		
买④	0.00	0																																		
买⑤	0.00	0																																		
涨停	16.39	跌停	13.41																																	

图 3.2.2

- **涨停：**显示证券代码的涨停价。
- **跌停：**显示证券代码的跌停价。

3.2.1.3 委托栏

委托栏根据委托要素选项不同，委托栏界面上的委托要素会变化。

图 3.2.3

产品组：该项用于填写产品组，产品组组合维护操作请查看[产品组维护](#)页面。

证券代码：手工填写委托证券代码。

委托方向：通过买卖项选择委托方向，有“调整到”，“买入”和“卖出”三个选项。选择“买入”或“卖出”时，委托区部分字段会以不同颜色显示。

价格类型：依据沪深市场支持市价委托规则差异，价格类型选项略有不同。

上交所有“限价”，“五档即成剩撤”，“五档即成剩转”三个选项，“限价”指填写固定委托价格申报委托；“五档即成剩撤”指该申报在对手方五档盘口价内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分自动撤销；“五档即成剩转”指该申报在对手方实时对手方五档盘口价内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分按本方申报最新价限价申报；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。

深交所有“限价”，“五档即成剩撤”，“即成剩撤”，“对手方最优”，“本方最优”，“全额成或撤”六个选项。“限价”与“五档即成剩撤”与上交所相同，“即成剩撤”指该申报在对手方申报队列中以对手方价格为成交价逐次成交，未成交部分自动撤销；“对手方最优”以申报时对手方盘口价一作为委托价格进行申报；“本方最优”以申报时本方盘口价一作为委托价格进行申报；“全额成或撤”指申报在对手方申报队列中以对手方价格为成交价逐次成交，能成交的全部成交，若部分无法成交则申报全部撤销。

委托价格：限价委托时，填写买入或卖出的价格。

目标类型：委托方向为“调整到”时，该项只能选择“单元净值比例”。系统通过目标类型计算获得多账户每个资金账户的委托数量。

目标比例：当目标类型为“单元净值比例”，“持仓数量比例”，“可用金额比例”时，计算最终委托数量的基础系数。详细操作参考[多账户委托](#)页面。

委托总量：目标类型为“委托总量”，填写产品组组合多账户委托申报的证券委托总数。

单笔数量：目标类型为“单笔数量”，填写产品组组合下每一个资金账户的委托数量。

委托金额：产品组委托金额，委托金额=SUM（委托数量*委托价格）。

分配策略：目标类型是“委托总量”，填写了委托总数后，系统通过分配策略计算产品组内每个产品的委托数量。分配策略有“平均分配”，“单元净值比例”，“可用金额比例”，“自定义比例”四项可选。

选项：在委托栏<选项>弹出设置界面可以进行个人参数设置。

下单：点击[下单](#)后逐一校验产品组内单元，如果存在不符合委托要求的单元，提示校验失败结果和错误信息。校验成功执行下单委托。

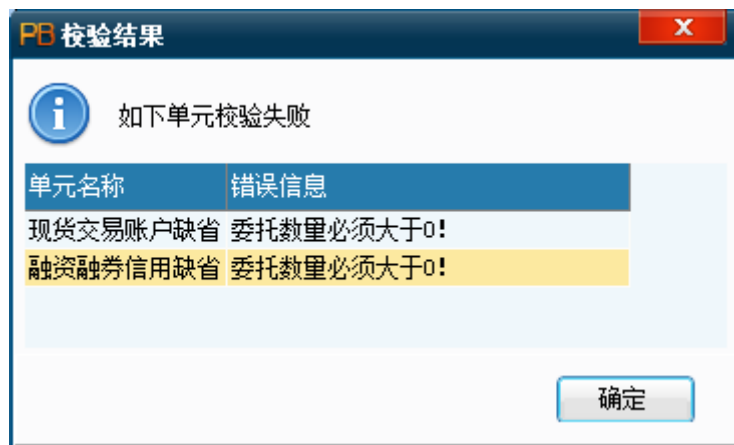


图 3.2.4

重置：同时清空<委托栏>和<行情栏>未锁定内容。

3.2.1.4 持仓区

持仓区由<产品组>和<持仓>两个标签页组成。



图 3.2.5

3.2.1.4.1 产品组

〈产品组〉界面显示如下,用于显示〈委托栏〉选择产品组中包含的所有单元持仓详情和多账户委托下达。〈产品组〉界面中红色背景字段内容可以修改。

产品组		持仓						
选择	产品名称	单元名称	委托方向	目标比例(%)	委托数量	委托金额	持仓数量	可买数量
☐	现货交易	缺省单元		0.0000	0	0.00	300,000	
☐	现货交易	现货交易账户缺省		0.0000	0	0.00	0	
☒	现货交易	现货交易单元	卖出	0.0100	89,999,500	1,259,993,000.00	90,350,320	219,96
☐	融资融券产品	缺省单元					0	
☐	融资融券产品	融资融券普通单元					0	
☐	融资融券产品	融资融券信用单元					0	
☐	融资融券产品	融资融券信用缺省		0.0000	0	0.00	0	
☒	融资融券产品	信用单元	买入	0.0100	6,800	95,200.00	300	71,42
总数:8		选择:2		量:90,006,300				

图 3.2.6

选择: 选中表示该产品组参与本次委托申报。灰色表示该产品、单元基础信息为更新完成,不能申报委托,详细信息可在备注栏中查看。

产品名称: 产品组组合内的产品名称。

单元名称: 产品组组合内的单元名称。

委托方向: 委托栏的委托方向选择“调整到”的时候,委托方向会根据当前持仓的可用和目标持仓比较,当前持仓的可用大于目标持仓委托方向为“卖出”,当前持仓的可用小于目标持仓委托方向为“买入”;如果委托要素中输入的委托方向为“买入”,〈产品组〉委托预览列表中的委托方向显示“买入”。

权重(目标比例): 系统计算委托数量的权重系数,可手工填写。目标类型选项不同,权重显示不同,详细操作请见交易界面。

委托数量: 显示系统根据委托要素计算获得的各产品、单元的委托数量,可手工填写。

委托金额: 显示各产品、单元的委托金额。委托金额=委托数量*委托价格。

持仓数量: 显示委托栏证券代码在各产品、单元中的持仓数量。

可买数量: 系统根据可用金额和委托价格预测出的最大委托数量,计算结果舍弃零股。可买数量=可用金额/委托价格。

可用金额: 各资金账户可用的金额。

备注: 标示资金账户不可交易的原因,不能手工修改。

总数：显示当前界面显示资金账户数量。

选择：显示选中的资金账户数量。

总量：统计本次委托下达的总数量，总量=SUM（委托数量）。

3.2.1.4.2 持仓

〈持仓〉界面显示如下，界面左下角显示当前列表总笔数。

产品组		持仓									
证券名称	证券代码	持仓数量	成本价	最新价	持仓市值	浮动盈亏	单元持仓比例	产品名称	单元编号		
浦发银行	600000	300,000	0.0000	14.7900	4,437,000.00	437,000.00		100.0000 现货交易	1		
华菱钢铁	000932	100	0.0000	3.7500	375.00	375.00		0.0000 现货交易	3		
东方钽业	000962	100	0.0000	10.7400	1,074.00	1,074.00		0.0000 现货交易	3		
马应龙	600993	100	7.8500	20.9800	2,098.00	1,313.00		0.0000 现货交易	3		
嘉化能源	600273	100	7.8500	10.2700	1,027.00	242.00		0.0000 现货交易	3		
西山煤电	000983	100	0.0000	6.3000	630.00	630.00		0.0000 现货交易	3		
重庆水务	601158	800	0.9812	9.2500	7,400.00	6,615.00		0.0002 现货交易	3		
杭齿前进	601177	100	7.8500	9.1900	919.00	134.00		现货交易	3		
华锐风电	601558	100	7.8500	5.7300	573.00	-212.00		现货交易	3		
九牧王	601566	100	7.8500	17.7500	1,775.00	990.00		现货交易	3		
三星电气	601567	100	7.8500	12.8900	1,289.00	504.00		现货交易	3		
鹿港科技	601599	100	7.8500	16.3300	1,633.00	848.00		现货交易	3		
上海医药	601607	100	7.8500	19.9200	1,992.00	1,207.00		0.0000 现货交易	3		

232 (笔)

F5刷新当前数据

图 3.2.7

在界面点击右键，可以执行如下操作：

- **刷新 (W)：**手动刷新列表内容，自动刷新频率为 5S。
- **查询 (X)：**在菜单中选择“查询”，弹出持仓区查询界面如下，可通过多选产品编号、单元编号、交易市场，指定证券代码筛选持仓区显示证券。查询后完毕后如要恢复持仓区显示，点击重置，清空或删除查询筛选项即可。

PB 持仓高级查询

设置查询条件
持仓查询条件明细设置

产品编号: 9106, 9107

单元编号: 2, 2

交易市场: 1 上交所A

证券代码: 600000 浦发银行

确定

取消

重置

图 3.2.8

- **布局设置 (Y)**: 详细操作见[布局设置](#)页面。
- **定位 (Z)**: 在弹出的快速定位栏中, 输入证券代码后能够快速定位到证券所在行。



图 3.2.9

持仓标签页参数如下:

成本价: $(\text{期初含费用成本} + \text{当日买入金额} + \text{实际当日买入费用}) / (\text{当前数量} + \text{卖出数量})$ 。

持仓市值: $\text{持仓数量} \times \text{市价}$ 。

浮动盈亏: $\text{持仓市值} - \text{当前成本}$ 。

单元持仓比例: $\text{持仓市值} / \text{单元净值} \times 100\%$ 。

产品持仓比例: $\text{持仓市值} / \text{产品净值} \times 100\%$ 。

当前成本: $(\text{期初含费用成本} + \text{当日买入金额} + \text{实际当日买入费用}) \times \text{当前数量} / (\text{当前数量} + \text{当日卖出数量})$ 。

累计盈亏 (含费用): 如果证券类别是股票回购、债券回购或资产类别是回购资产, 则累计盈亏为 0; 除此之外, 如果卖出数量为 0, 则累计盈亏为 0; 如果卖出金额+当前数量=0, 则累计盈亏为 0; 否则 $\text{累计盈亏} = \text{卖出金额} - \text{卖出费用} - \text{卖出数量} \times (\text{结转过含费用的期初成本} + \text{买入金额} + \text{买入费用}) / (\text{当前数量} + \text{卖出数量})$, 如果投资类型是可交易, 还会减去当日费用 (实际当日买入费用+实际当日卖出费用)。

当日买入数量: 当日累计买入数量。

当日卖出数量: 当日累计卖出数量。

盈亏率 (%): 当前成本为 0, 盈亏率为 0; 否则, $\text{盈亏率} = \text{浮动盈亏} \times 100 / \text{当前成本}$ 。

3.2.1.5 查询区

查询区主要由<挂单>、<委托>、<成交>三个标签页组成。

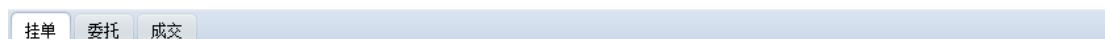


图 3.2.10

3.2.1.5.1 挂单

该界面显示未成、未撤的委托挂单，页面左下角显示当前委托挂单笔数。右键可以进行[布局设置](#)。



图 3.2.11

3.2.1.5.2 委托

<委托>界面显示当日多账户委托，页面左下角显示列表中的委托笔数。

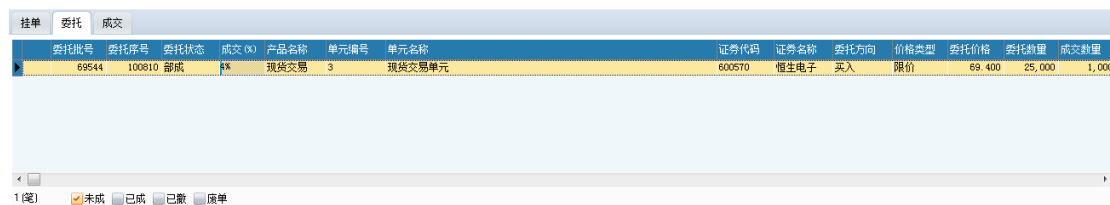


图 3.2.12

可通过列表下方的状态筛选框，列表显示勾选相应状态的委托。



图 3.2.13

3.2.1.5.3 成交

显示当日已成委托，页面左下角显示列表中的委托笔数。

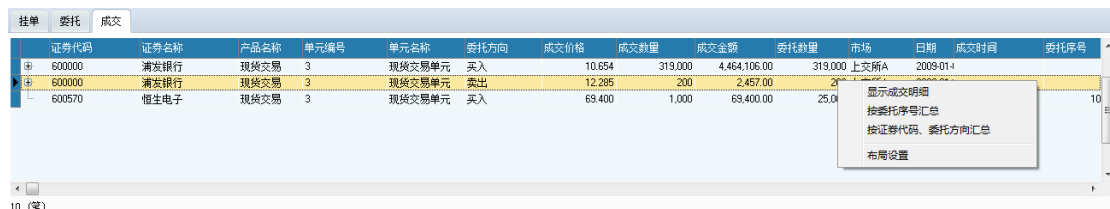


图 3.2.14

通过右键菜单可以进行如下操作：

- **显示成交明细：**显示每一笔成交详情。
- **按委托序号汇总：**同批下达的多账户委托的委托序号相同，将委托序号相同的汇总显示。

- **按证券代码、委托方向汇总：**证券代码、委托方向相同成交的汇总显示。
- **布局设置：**详细操作见[布局设置](#)页面。

注意：

在成交栏汇总显示后，汇总行的成交价格==SUM（明细成交金额）/SUM（明细成交数量）。

3.2.2 交易

3.2.2.1 产品组维护

中国证券登记结算有限公司 4 月 12 日发布通知，明确自 2015 年 4 月 13 日起 A 股市场全面放开“一人一户”限制，自然人与机构投资者均可根据自身实际需要开立多个 A 股账户和封闭式基金账户，上限为 20 户。随着开户的放开，一个人管理多个产品账户的情况将变得更为普遍。

在一个投资经理管理多个产品或者一个投顾在同一个公司内管理多个子产品的情况下，会出现多产品同时操作的情况，减少操作次数，提高下单效率。用户需要在<多账户交易>中，将多个单元维护在同一个产品组内，通过产品组下单，实现多产品多单元同时操作的目的。

在<个股交易>→<委托栏>→<维护>弹出“产品组维护”界面新增、修改、删除产品组。左侧显示当前产品组列表，右侧显示产品、单元明细。



PB 产品组维护

产品组:

产品组编号	产品组名称
0001	现货交易
0002	套利用
1002	套利用1

产品组编号:

产品组名称:

新增组 修改组 删除组

产品组明细:

选择	产品名称	单元名称
☒	现货交易	缺省单元
☒	融资融券产品	缺省单元
☒	融资融券产品	融资融券普通单元
☒	融资融券产品	信用单元
☒	现货交易	现货交易账户缺省
☒	现货交易	现货交易单元
☒	期权产品	期权标的单元
☒	期权产品	期权交易单元
☒	融资融券产品	融资融券信用缺省
☒	融资融券产品	融资融券信用单元
☐	融资融券产品	融资融券单元缺省
☐	融资融券产品	融资融券测试信用单元
☐	融资融券产品	融资融券信用
☐	融资融券产品	融资融券单元

保存明细

图 3.2.15

- **新增产品组:** 输入 产品组编号、产品组名称，产品组编号、产品组名称都必须唯一。在产品组明细列表中勾选产品名称、单元名称，选中的单元将新增产品组中，点击 **新增组** 即可。
- **修改产品组:** 选中<产品组>标签列表中待修改的产品组，调整 产品组编号，产品组名称 或修改产品组明细列表中的勾选项，最后点 **修改组** 按钮即可。
- **删除产品组:** 选中产品组列表中需要删除的产品组，点 **删除组** 按钮即可。

3.2.2.2 多账户委托

多账户是通过产品组对多个产品下达股票，基金、债券的普通买卖交易。

3.2.2.2.1 多账户委托

多账户委托通过用户在委托栏的输入的 目标类型 项，分配产品组内每个单元的委托数量，

以下对多账户委托的基本流程进行说明：



图 3.2.16

在<委托栏>依次录入委托要素，点击下单按钮下单。

- **锁定：**使用产品组、证券代码、委托方向、价格类型、目标类型、分配策略右侧的锁定符对这几项委托要素内容进行锁定，委托要素为灰色，表示不能修改。重新点击锁定符解锁后，才能够修改委托要素内容。
- **是否符合下单要求：**输入证券代码，光标焦点移开后，在<持仓区>→<产品组>列表内显示产品组内明细单元持仓详情。如果单元显示为灰色，表示该单元不满足下单要求并且不可以勾选下单，不满足下单的详细情况可在备注中查看。
- **单元：**在选择栏中勾选<产品组>标签页中的单元，表示这些单元参与本次多账户委托的数量分配和委托申报。
- **价格类型：**输入焦点在价格类型位置上时，选择委托方式。选定下单后，根据价格类型向交易所申报委托。价格类型详细介绍请查看委托栏页面。
- **价格预警：**输入完委托价格，焦点转移后，系统会检查委托价格是否在涨跌停价格区间内，如果价格不符合，会在信息提示栏给出提示。如果委托方向是“买入”，<产品组>明细可买数量=可用金额/委托价格，计算后的结果舍弃零股。
- **分配零股处理：**用户可以手工修改<产品组>标签页内的红色背景列的内容。如果委托数量出现零股，系统根据<委托栏>→<选项>弹出个人参数界面中的“分配时出现零股时处理”选项处理零股，详细介绍请查看【相关参数一】的内容。
- **快速抓取价格：**点击左侧个股行情栏内的五档盘口价可以快速抓取价格，委托方向和委托价格自动显示在委托栏上。

3.2.2.2.2 目标类型设置

系统根据用户输入目标类型的不同，计算产品组中明细单元委托数量的公式存在差异，接下来将对不同目标类型下的数量分配方式做详细说明：

1. 目标类型输入“委托总量”，在委托总量处填写产品组委托总量。

选择	产品名称	单元名称	委托方向	权重	委托数量	委托金额	持仓数量	可买数量
☐	现货交易	缺省单元	买入	1.0000	0	0.00	300,000	0
☐	现货交易	现货交易账户缺省	买入	1.0000	0	0.00	0	0
☒	现货交易	现货交易单元	买入	1.0000	200	3,000.00	90,351,120	205,3
☐	融资融券产品	融资融券信用缺省	买入	1.0000	0	0.00	0	0
☒	融资融券产品	信用单元	买入	1.0000	200	3,000.00	300	66,6

图 3.2.17

委托要素依次输入后，点击下单按钮下单。

- **委托方向：**“委托总量”只在委托方向是“买入”或“卖出”时可以选择，当焦点转移后，<产品组>标签页内委托方向列同时变化。
- **策略：**输入分配策略，焦点转移后，系统根据策略刷新产品组中每个单元的委托数量。

如果分配策略是“平均比例”，是将委托总量平均分配到每个产品单元中。如下图：

选择	产品名称	单元名称	委托方向	权重	委托数量	委托金额	持仓数量	可买数量
☒	现货交易	缺省单元	买入	1.0000	0	0.00	300,000	0
☒	现货交易	现货交易账户缺省	买入	1.0000	0	0.00	0	0
☒	现货交易	现货交易单元	买入	1.0000	2,700	40,500.00	90,351,120	205,3
☐	融资融券产品	融资融券信用缺省	买入	1.0000	0	0.00	0	0
☒	融资融券产品	信用单元	买入	1.0000	2,700	40,500.00	300	66,6

图 3.2.18

如果分配策略是“单元净值比例”，是将委托总量按照单元净值比例分配每个产品单元中，委托数量=（产品 A 单元净值/SUM（产品单元净值））*委托总量。



选择	产品名称	单元名称	委托方向	权重	委托数量	单元净值	委托金额	持仓数量
☒	现货交易	现货单元	买入	0.0008	0	4,437,000.00	0.00	30
☒	现货交易	现货交易账户单元	买入	0.0000	0	0.00	0.00	0
☒	现货交易	现货交易单元	买入	0.8156	10,800	4,443,458,413.40	162,000.00	90,351,120
☐	融资融券产品	融资融券单元	买入	0.0000	0	0.00	0.00	0
☐	融资融券产品	融资融券信用单元	买入	0.0000	0	0.00	0.00	0
☒	融资融券产品	融资融券信用单元	买入	0.0000	0	0.00	0.00	0
☒	融资融券产品	信用单元	买入	0.1836	2,400	1,000,004,683.00	36,000.00	66,666,666.67
总数: 8				选择: 5	总量: 13,200			

图 3.2.19

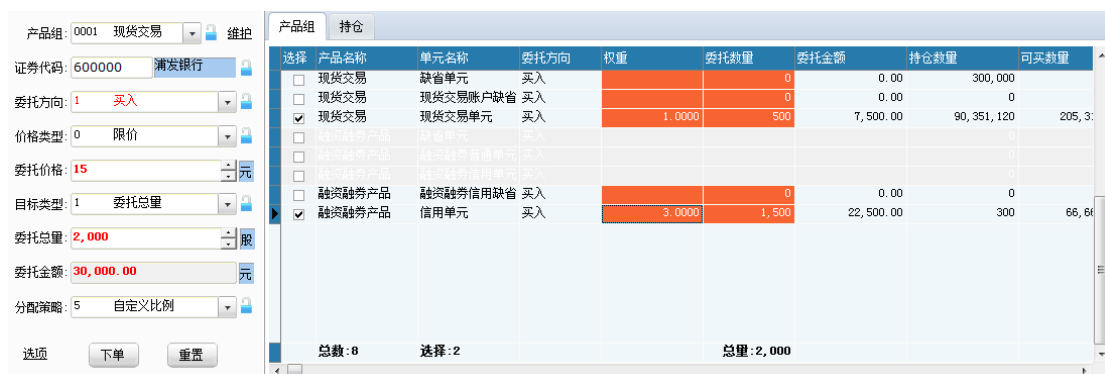
如果分配策略是“可用金额比例”，依据产品组内选中资金账户的可用金额比例，将委托总量分配到每一个产品单元，委托数量=（产品 A 可用金额/SUM（产品可用金额））*委托总量。



选择	产品名称	单元名称	委托方向	权重	委托数量	委托金额	持仓数量	可买数量
☐	现货交易	现货单元	买入	0	0	0.00	300,000	0
☐	现货交易	现货交易账户单元	买入	0	0	0.00	0	0
☒	现货交易	现货交易单元	买入	0.7549	1,500	22,500.00	90,351,120	205,319,148.86
☐	融资融券产品	融资融券单元	买入	0	0	0.00	0	0
☐	融资融券产品	融资融券信用单元	买入	0	0	0.00	0	0
☐	融资融券产品	融资融券信用单元	买入	0	0	0.00	0	0
☒	融资融券产品	信用单元	买入	0.2451	500	7,500.00	300	66,666,666.67
总数: 8				选择: 2	总量: 2,000			

图 3.2.20

如果分配策略选择“自定义比例”，需要用户手工填写<产品组>标签页内的权重，系统根据填入的权重值分配单元委托数量，委托数量=（产品 A 权重/SUM（产品权重））*委托总量。



选择	产品名称	单元名称	委托方向	权重	委托数量	委托金额	持仓数量	可买数量
☐	现货交易	现货单元	买入	0	0	0.00	300,000	0
☐	现货交易	现货交易账户单元	买入	0	0	0.00	0	0
☒	现货交易	现货交易单元	买入	1.0000	500	7,500.00	90,351,120	205,319,148.86
☐	融资融券产品	融资融券单元	买入	0	0	0.00	0	0
☐	融资融券产品	融资融券信用单元	买入	0	0	0.00	0	0
☐	融资融券产品	融资融券信用单元	买入	0	0	0.00	0	0
☒	融资融券产品	信用单元	买入	3.0000	1,500	22,500.00	300	66,666,666.67
总数: 8				选择: 2	总量: 2,000			

图 3.2.21

2. 目标类型输入“单笔数量”，产品组内所有单元委托数量等于单笔数量的值。

选择	产品名称	单元名称	委托方向	委托数量	委托金额	持仓数量	可买数量	可用金额
☐	现货交易	缺货单元	买入	0	0.00	300,000	0	0
☐	现货交易	现货交易账户缺货	买入	0	0.00	0	0	0
☒	现货交易	现货交易单元	买入	13,300	196,707.00	90,351,120	208,232,900	3,079,765
☐	融资融券产品	融资融券普通单元	买入					
☐	融资融券产品	融资融券信用单元	买入					
☒	融资融券产品	融资融券信用缺货	买入	0	0.00	0	0	0
☒	融资融券产品	信用单元	买入	13,300	196,707.00	300	67,613,200	1,000,000

总数: 8 选择: 3 总量: 26,600

图 3.2.22

委托要素依次输入后，点击下单按钮下单。

- **委托方向：**单笔数量模式只在委托方向是“买入”或“卖出”时可以选择，焦点转移后，<产品组>标签页内委托方向列同时变化。
- **委托数量：**输入单笔数量，光标焦点移动后，系统会刷新<产品组>标签页的委托数量、委托金额，<产品组>标签页的**委托数量=单笔数量**，委托金额=单笔数量*委托价格。

3. 目标类型输入“持仓数量比例”，依据单元当前持仓数量比例下达委托。

选择	产品名称	单元名称	委托方向	目标比例 (%)	委托数量	委托金额	持仓数量	可买数量
☒	现货交易	缺货单元	买入	10.0000	30,000	450,000.00	300,000	6,64
☐	现货交易	现货交易账户缺货	买入	10.0000	0	0.00	0	0
☒	现货交易	现货交易单元	买入	10.0000	9,035,100	135,526,500.00	90,351,120	205,3
☐	融资融券产品	融资融券普通单元	买入					
☐	融资融券产品	融资融券信用单元	买入					
☐	融资融券产品	融资融券信用缺货	买入	10.0000	0	0.00	0	0
☐	融资融券产品	信用单元	买入	10.0000	0	0.00	300	66,64

总数: 8 选择: 2 总量: 9,065,100

图 3.2.23

委托要素依次输入后，点击下单按钮下单。

- **委托方向：**可用比例模式只在委托方向是“买入”或“卖出”时可以选择，焦点转移后，<产品组>标签页内委托方向列同时变化。
- **委托数量：**输入目标比例，光标焦点移动后，系统刷新<产品组>标签页内的目标比例，委托数量，委托金额，其中 **委托数量=持仓数量*目标比例**，委托金额=单笔数量*委托价格。

4. 目标类型输入“单元净值比例”。

产品组: 0001 现货交易 维护

证券代码: 600000 浦发银行

委托方向: 1 买入

价格类型: a 五档即成刺激

委托价格: 14.79 元

目标类型: 4 单元净值比例

目标比例: 10

选项 下单 重置

选择	产品名称	单元名称	委托方向	目标比例 (%)	委托数量	单元净值	委托金额	持仓数量
☒	现货交易	缺省单元	买入	10.0000	708,100	104,437,000.00	10,443,219.00	30,043,700
☐	现货交易	现货交易账户缺省	买入	10.0000	0	0.00	0.00	0.00
☒	现货交易	现货交易单元	买入	10.0000	30,043,700	4,443,458,413.40	444,346,323.00	90,346,323.00
☐	融资融券产品	融资融券单元	买入			0.00		
☐	融资融券产品	融资融券单元	买入			0.00		
☐	融资融券产品	融资融券信用缺省	买入	10.0000	0	0.00	0.00	0.00
☐	融资融券产品	信用单元	买入	10.0000	0	1,000,004,683.00	0.00	0.00
总数: 8				选择: 2	量: 30,749,800			

图 3.2.24

委托要素依次输入后，点击下单按钮下单。

- **委托数量：**输入目标比例，光标焦点移动后，系统会刷新<产品组>标签的目标比例，委托数量，委托金额。

如果委托方向填写“买入”或“卖出”，委托数量=（单元净值*目标比例）/委托价格。

如果委托方向填写“调整到”，首先系统会计算资金账户的最终目标数量=（单元净值*目标比例）/委托价格。如果持仓数量<目标数量，则买入数量=目标数量-持仓数量；如果当前持仓>目标数量，则卖出数量=持仓数量-目标数量。

【相关参数一】分配零股处理

多账户委托计算分配数量时，可能会出现单元委托数量是零股的情况。可通过<委托栏>→<选项>→<现货多账户交易参数设置>界面中的“分配时出现零股时的处理”项设置零股处理方式，有“四舍五入”，“零股进位”，“零股截位”三种方式。

“四舍五入”超过 50 进位 100 股，少于 50 股舍弃；“零股进位”即零股无论多少都委托 100 股；“零股截位”即零股多少都舍弃。



图 3.2.25

【相关参数二】可用金额不足的控制方式

在多账户委托下单时，可能出现产品组中的某一个单元委托数量大于可用数量的情况，用户可以在<委托栏>→<选项>→<现货多账户交易参数设置>界面中，可用不足时的控制方式项设置发生此情况时委托数量的取值。如果该项选择“调整到该单元可用”，则可用不足的单元的委托数量=可用数量；选择“自动过滤可用不足的单元”，该资金账户不分配委托数量。

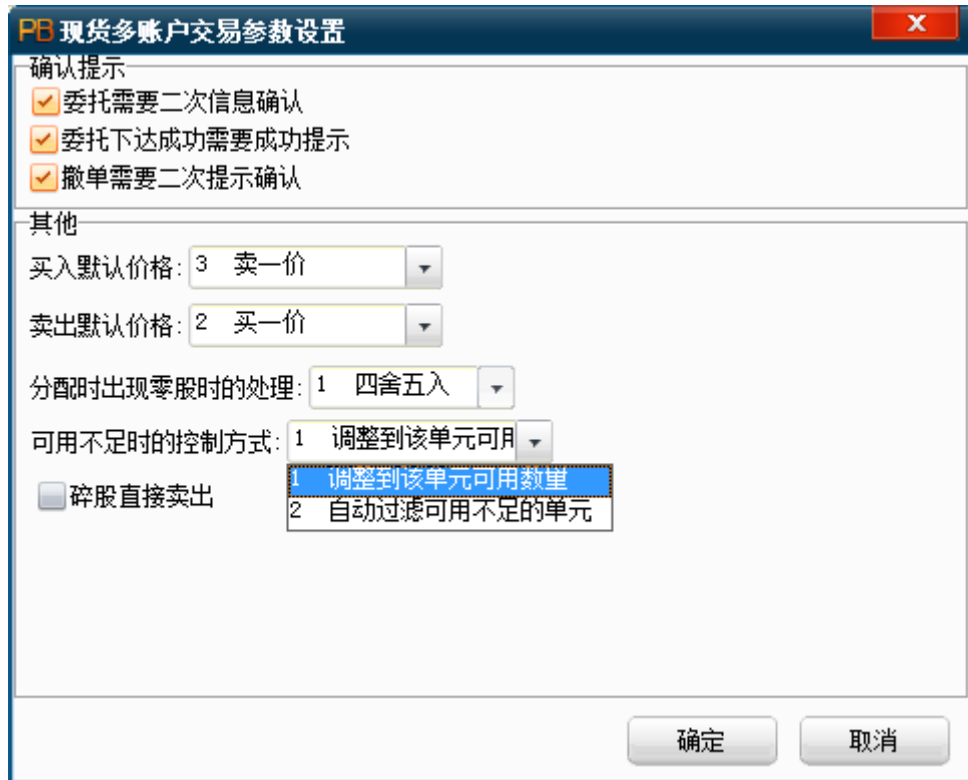


图 3.2.26

3.2.2.3 撤单、改单

3.2.2.3.1 普通撤单

如果要对某笔委托进行撤单，在<挂单>页面选中或按住 Ctrl 键多选委托，点击**撤单**按钮即可，也可以双击<挂单>页面中的委托直接撤单。



图 3.2.27

注意：

双击撤单需要在系统参数设置→<交易设置>中勾选“启用委托双击撤单功能”。

3.2.2.3.2 全部撤单

全部撤单是撤销当前所有挂单，在查询区<挂单>页面点击全部撤单即可。系统会自动按配置查找相应可撤委托，并发送撤单委托。



图 3.2.28

3.2.2.3.3 撤最近一笔

撤最近一笔是撤销委托批号最大的一笔挂单，直接点击撤最近一笔即可。



图 3.2.29

3.2.2.3.4 条件撤单

条件撤单是撤销满足条件的挂单。

在<挂单>界面点击条件撤单后，在弹出的窗口填写产品编号、单元编号、证券代码、委托方向即可。系统会自动按撤单条件查找相应可撤委托，并发送撤单指令。



图 3.2.30

3.2.2.3.5 改单

通过改单可以快速修改未成交的委托价格，改单后系统先撤销原委托，撤单成功后，下达一笔改单后的委托。

在<挂单>界面点击改单后，在弹出界面中显示勾选的挂单。

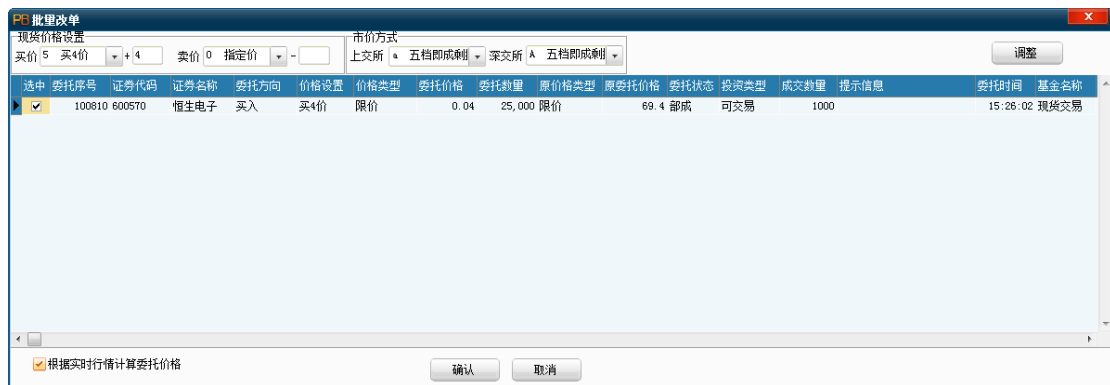


图 3.2.31

依次输入调整要素，确认后系统先发送撤单委托，撤单成功后，在根据改单后的委托价格申报新委托。

- **买价/卖价：**填写买价，光标焦点移动后，列表中委托方向是“买入”的挂单的委托价格会根据设置变化。填写卖价，光标焦点移动后，列表中委托方向是“卖出”的挂单的委托价格会根据设置变化。
- **价格类型：**填写市价方式，分别设置两个交易所的价格类型。
- **实时行情：**勾选“根据实时行情计算委托价格”该项，现货价格设置栏的基数是当前行

情价格，否则是原委托下单时的行情价格。

- **委托价格：**系统会根据输入的调整要素显示改单列表委托价格，用户也可以手工修改列表中的委托价格。

3.2.3 参数设置

用户可以在<委托栏>→<选项>界面设置个人参数。



The image shows a 'Parameter Settings' (参数设置) interface. It contains several input fields and dropdown menus for configuring trading parameters. At the bottom, there are three buttons: '选项' (Options), '下单' (Place Order), and '重置' (Reset). The '选项' button is highlighted with a red rectangle.

产品组:	0001 现货交易	维护
证券代码:	600000	浦发银行
委托方向:	-1 调整到	
价格类型:	a 五档即成剩撤	
委托价格:	14.79	元
目标类型:	4 单元净值比例	
目标比例:	10	%

壹拾

选项 下单 重置

图 3.2.32

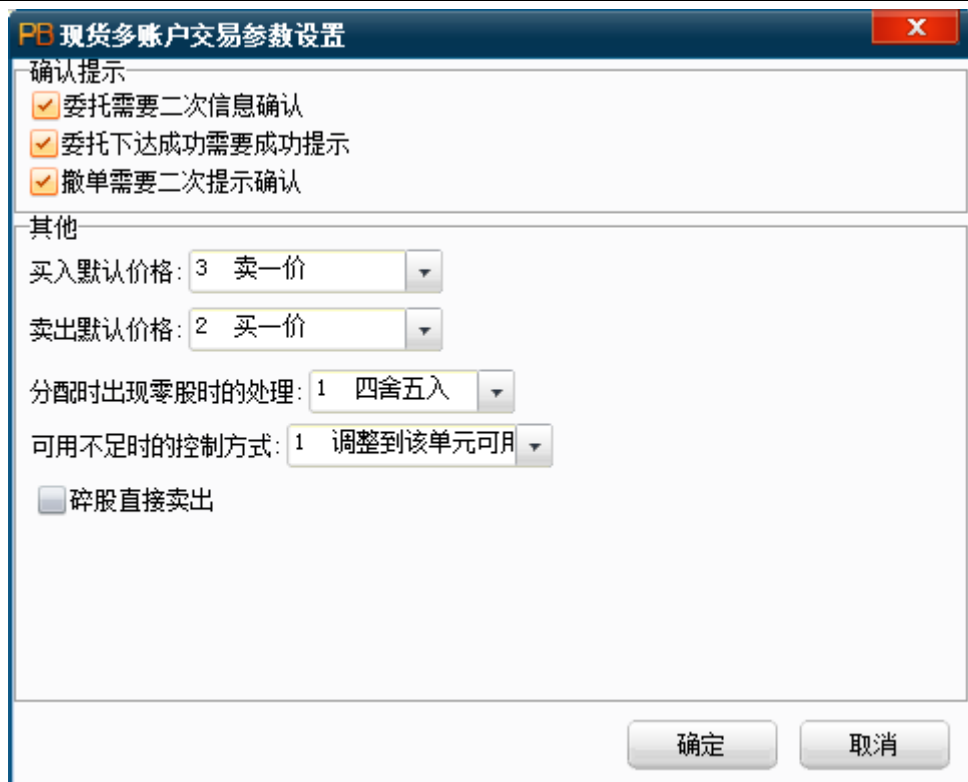


图 3.2.33

委托需要二次信息确认: 选中该项, 在委托下单后, 弹出确认提示, 需要再次确定确认信息, 系统才会委托申报。不勾选则不会弹出提示, 不需要重复确认。



图 3.2.34

委托下达成功需要成功提示: 勾选该项, 在下单成功后弹出下达成功的信息提示, 否则不进行提示。

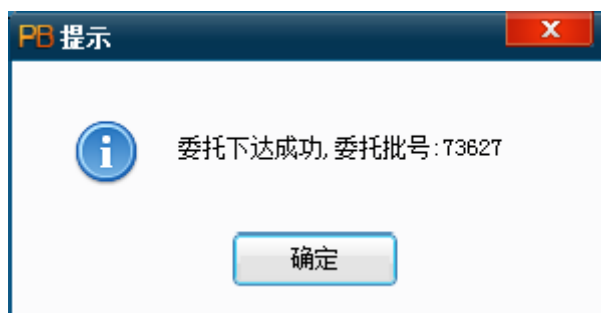


图 3.2.35

撤单需要二次提示确认：选中该项，在撤单委托正式下达前，弹出“委托撤单确认”信息提示界面，重新确认内容后系统执行撤单申报。否则，撤单后立即执行撤单申报。

买入默认价格：委托方向是“买入”时，委托价格的默认显示价格。

卖出默认价格：委托方向是“卖出”时，委托价格的默认显示价格。

碎股直接卖出：选中该项后，如果出现可用数量小于最小手数（100 股）时，允许零股直接卖出。

3.3 证券交易 - 算法交易

功能介绍

算法交易的交易策略是事先经过合理设计的，然后将其使用计算机程序来实现具体算法。利用计算机程序的算法来决定交易下单的时机、价格和数量等，避免人的非理性因素造成的干扰，能更精确地下单，并能同时管理大量的操作。使用此功能前，需要开通对应的算法提供商脚本和算法提供商策略脚本。

操作介绍

具体操作如下：在【交易管理】→【现货交易】→<个股交易>界面，点击**算法**按钮。弹出如**错误!未找到引用源。**所示：

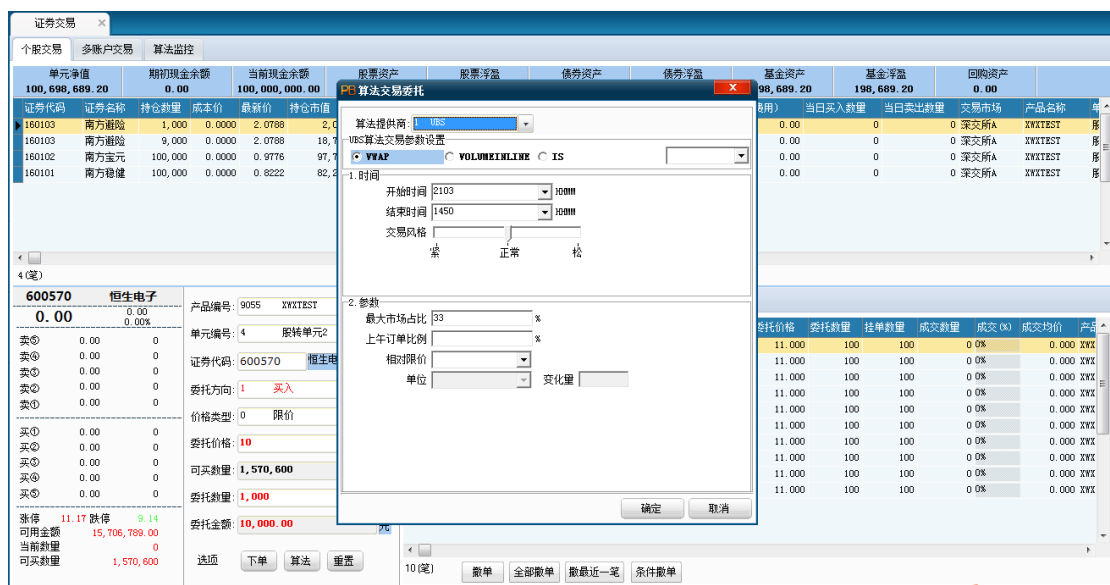


图 3-1-12

选择算法提供商，系统就会自动的调出当前算法服务器上需要设置的策略参数信息提供给操作员设置。设置参数后，点击**确定**按钮，使用算法交易功能委托。

3.4 新股申购

3.2.1 申购

功能介绍

此模块实现上交所、深交所新股申购功能。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【申购交易】→<申购>界面，就进入相应的主界面。如图所示：



图 3-2-1

3.2.2 投票

功能介绍

此模块实现上交所、深交所投票功能。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【申购交易】→<投票>界面，就进入相应的主界面。如图所示：

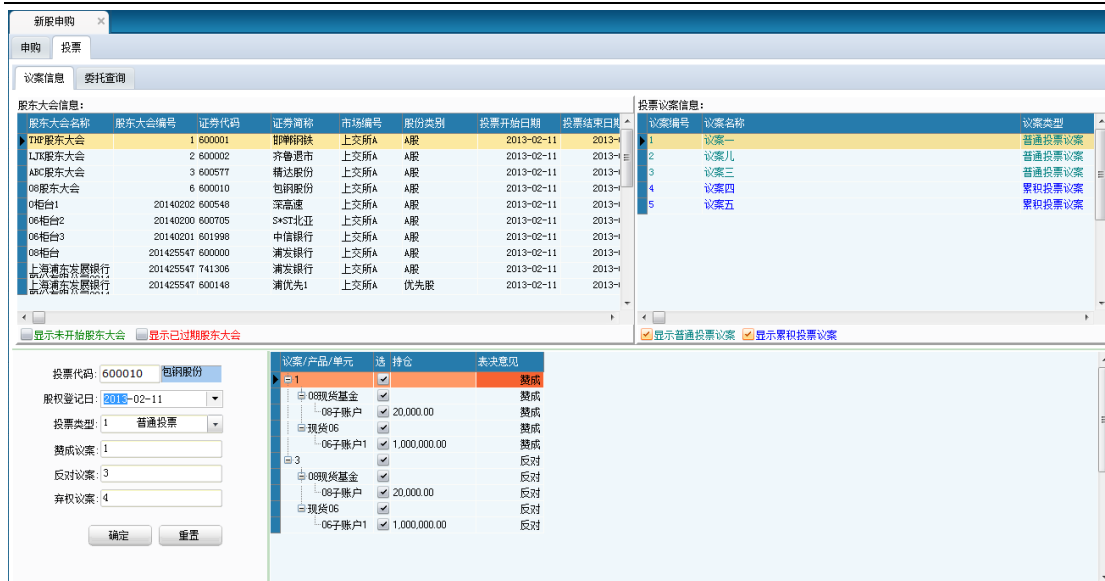


图 3-2-2

通过（上交所或深交所）交易系统进行投票。需要由用户输入的内容主要包括投票代码、股权登记日、投票类型、赞成议案、反对议案、弃权议案等。

大多数情况下，会有多个基金（或股东代码）同时持有某一证券，因此在下达网络投票指令的候，用户可以在右侧选择一个或多个基金（或股东代码）同时作为投票参与者。用户在输入完投票信息之后点击确定按钮，即可下达该投票指令。

注意：

对于上交所的网络投票系统，投票表决不能撤单，对同一议案不能多次进行表决申报，多次申报的将以第一次申报为准。上交所在统计结果时，对单项议案的表决申报优先于对包含该议案的议案组的表决申报，对议案组的表决申报优先于对全部议案的表决申报；对于表决或不符合规定要求的投票申报的议案，按照弃权处理。

对于深交所的网络投票系统，对同一议案的投票只能申报一次，不能撤单；不符合规定的投票申报，视为未参与投票处理。

通过上交所交易系统进行投票与通过深交所交易系统进行投票两者之间有些差别，下面将分别来进行介绍。

✓ 对于通过上交所交易系统进行投票：

指令界面支持显示投票股东大会信息，及其对应的投票议案。

证券代码：输入上交所股票、优先股的正股代码和股票简称。录入证券代码

后自动定位投票股东大会信息，联动带出对应的投票议案。

赞成议案、反对议案、弃权议案：如果股东大会有多个待表决的议案，则“1”代表表决议案一，“2”代表表决议案二，依此类推，“99”代表本次股东大会所有的议案。多个需逐项表决的议案可组成一个议案组，以议案组 2 为例来举例说明：“2.01”代表表决议案组 2 下的第一个议案，“2.02”代表表决议案组 2 下的第二个议案，依此类推。“2.00”代表表决议案组 2 下的所有议案。股东大会有多个待表决议案的，可以按照任意次序对各议案进行表决申报。使用方法如：在**赞成议案**中输入 1 后，以英文逗号“,”隔开，再输入 2，依次类推，那么就表示对议案编号为 1~2 的议案进行投票，指令下达后会生成 2 条投票指令。

投票类型：包括普通投票和累积投票。

- **普通投票：**用于对议案表达意见。与普通投票类型对应的“表决意见”包括三种：赞成、反对和弃权，用户可以根据实际需要进行选择输入。
- **累积投票：**用于对选举进行投票。与普通投票类型对应的是“选举票数”，用户可以根据其所拥有的选举票数为限进行投票，选举票数超过 1 亿票的，规定需通过现场进行表决。

累积投票是指股东大会选举董事或者监事时，每一股份拥有与应选董事或者监事人数相同的表决权，股东拥有的表决权可以集中使用。在累积投票方式下，一个股东在选举董事/监事时可以投的总票数，等于其所持有的股份数乘以待选董事/监事人数。用户可以输入一个投票系数 N，N 与持仓量的乘积即本次投票的票数。

✓ **对于通过深交所交易系统投票：**

投票代码：投票代码为“36+原证券代码的后四位”，投票简称为“XX 投票”。

深交所会在“昨日收盘价”字段设置该次股东大会要讨论的议案总数。

赞成议案、反对议案、弃权议案：“1.00”代表议案一，“2.00”代表议案二，依此类推。对于逐项表决的议案，如议案二中有多个需要逐项表决的议案，则“2.00”代表对议案二下全部子议案进行表决，“2.01”代表议案二下的子议案 1，“2.02”代表议案二下的子议案 2，依此类推。对于选举董事、监事等的议案，假设议案三为选举董事，则“3.01”代表第一位候选人，“3.02”

代表第二位候选人，依此类推。输入方法同上交所。

投票类型：与上交所的情况相似，不再赘述。

3.5 期货交易 - 单账户交易

期货单账户交易是对单个资金账户下达期货交易指令。期货单账户交易除了普通委托外，还支持埋单委托、批量委托和止盈止损监控。

3.5.1 界面

3.5.1.1 主界面

<期货单账户>界面可通过<参数设置>→<显示设置>→<布局设置>“布局方案”参数进行设置，详细操作请见[显示设置](#)界面。下面以系统默认布局方案“布局设置一”为例说明。

进入【交易管理】→<期货交易>→<期货单账户>，会出现如下主界面：

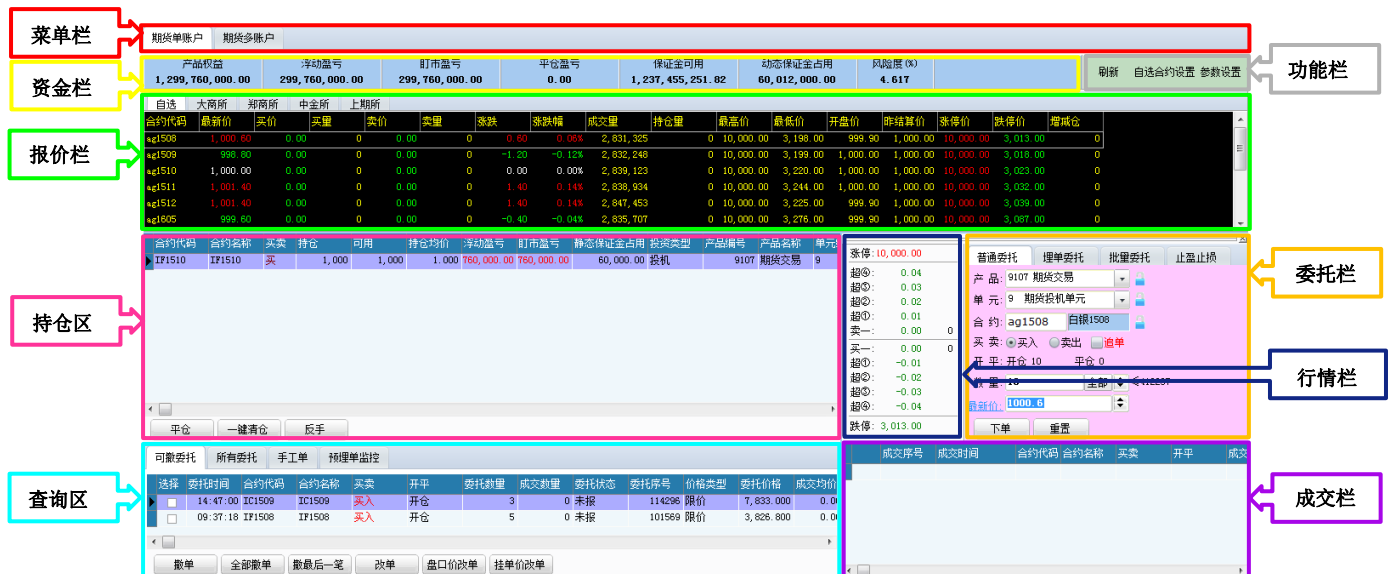


图 3.5.1

- **菜单栏**：期货交易菜单栏，分为<期货单账户>、<期货多账户>两个标签功能页。

- **资金栏：**该区域显示产品权益、盈亏、保证金等信息。关于资金栏的详细说明请查看[资金栏](#)页面。
- **功能栏：**该区域主要用于设置自选合约和个人参数，详细说明请查看[功能栏](#)页面。
- **报价栏：**该区域用于显示期货市场行情。关于报价栏的详细说明请查看[报价栏](#)页面。
- **持仓区：**该区域显示产品单元持仓详情。关于持仓区的详细说明请查看[持仓区](#)页面。
- **行情栏：**显示委托栏输入合约的盘口价详情，请查看[行情栏](#)页面。
- **委托栏：**用户在这里输入委托要素，进行下单。关于委托区的详细说明请查看[委托栏](#)页面。
- **查询区：**该区域显示可撤委托，所有委托，手工单、预埋单监控标签页，供用户查询、撤单和埋单。详情请查看[查询区](#)页面
- **成交栏：**显示期货资金账户的合约成交详情，详情请查看[成交栏](#)页面。

3.5.1.2 资金栏

<期货单账户>资金栏界面如下，显示字段可以在<功能栏>→<参数设置>→<显示设置>→<资金栏设置>界面设置，详细操作请见[显示设置](#)界面。

产品权益	浮动盈亏	盯市盈亏	平仓盈亏	保证金可用	动态保证金占用	风险度(%)
1,299,760,000.00	299,760,000.00	299,760,000.00	0.00	1,237,455,251.82	60,012,000.00	4.617

图 3.5.2

资金栏参数如下：

产品权益：期货保证金余额+盯市盈亏。

浮动盈亏：组合下所有持仓期货的浮动盈亏之和。浮动盈亏=（ $\sum$ （最新价-开仓价）* 合约乘数 * 持仓数量）。

盯市盈亏：组合下所有持仓期货的盯市盈亏之和。盯市盈亏=（ $\sum$ （最新价-X）* 合约乘数 * 持仓数量*多空标示 X：对于今仓，为开仓价；对于昨仓，为昨结算价。多头为正数，空头为负数。）

平仓盈亏：组合下当日平仓合约的盈亏之和。 $\sum$ （（平仓价-开仓价）*平仓数量*合约乘数）。

保证金可用：当前单元保证金可用金额。

动态保证金占用：当前单元保证金占用金额。当前持仓*最新价*合约乘数*保证金比例。

风险度(%)：占用保证金/产品权益。

3.5.1.3 功能栏

〈期货单账户〉功能栏界面如下。

刷新 自选合约设置 参数设置

图 3.5.3

- **刷新：**手工刷新〈期货单账户〉界面。
- **自选合约设置：**在此处设置自选合约，自选合约会在〈报价栏〉内显示为独立标签卡，具体操作请查看[自选合约设置](#)页面。
- **参数设置：**在选项弹出界面可以进行个人参数设置，具体内容请查看[参数设置](#)页面。

3.5.1.4 报价栏

在报价栏界面上分别显示大商所、郑商所、中金所、上期所和自选合约组行情详情。合约上涨显示红色，下跌显示绿色。

自选	大商所	郑商所	中金所	上期所												
合约代码	最新价	买价	卖价	类里	涨跌	涨跌幅	成交量	持仓量	最高价	最低价	开盘价	昨结算价	涨停价	跌停价	增减仓	
ag1508	1,000.80	0.00	0	0.00	0	0.60	0.06%	2,831,325	0	10,000.00	3,198.00	999.90	1,000.00	10,000.00	3,013.00	0
ag1509	999	0	0	0	0	-1	-0.12%	2,832,248	0	10,000	3,199	0	1,000	0	0	0
ag1510	1,000	0	0	0	0	0	0.00%	2,839,123	0	10,000	3,220	0	1,000	0	0	0
ag1511	1,001	0	0	0	0	1	0.14%	2,838,934	0	10,000	3,244	0	1,000	0	0	0
ag1512	1,001	0	0	0	0	1	0.14%	2,847,453	0	10,000	3,225	0	1,000	0	0	0
ag1605	1,000	0	0	0	0	0	-0.04%	2,835,707	0	10,000	3,276	0	1,000	0	0	0

图 3.5.4

在界面右键弹出菜单处，可以执行如下操作：

- **布局设置：**在报价栏上点击右键，在弹出的右键菜单里选择〈布局设置〉项，即可进入布局设置页面，对当前行情页的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置，详细操作请查看[布局设置](#)页面。

自选	大商所	郑商所	中金所	上期所												
合约代码	最新价	买价	卖价	类里	涨跌	涨跌幅	成交量	持仓量	最高价	最低价	开盘价	昨结算价	涨停价	跌停价	增减仓	
ag1508	1,000.50	0.00	0	0.00	0	0.60	0.06%	2,831,325	0	10,000.00	3,198.00	999.90	1,000.00	10,000.00	3,013.00	0
ag1509	999	0	0	0	0	-1	-0.12%	2,832,248	0	10,000	3,199	0	1,000	0	0	0
ag1510	1,000	0	0	0	0	0	0.00%	2,839,123	0	10,000	3,220	0	1,000	0	0	0
ag1511	1,001	0	0	0	0	1	0.14%	2,838,934	0	10,000	3,244	0	1,000	0	0	0
ag1512	1,001	0	0	0	0	1	0.14%	2,847,453	0	10,000	3,225	0	1,000	0	0	0
ag1605	1,000	0	0	0	0	0	-0.04%	2,835,707	0	10,000	3,276	0	1,000	0	0	0

图 3.5.5

3.5.1.5 持仓区

<期货单账户>持仓区界面如下，显示当前投顾的所有期货持仓详情。

合约代码	合约名称	买卖	持仓	可用	持仓均价	浮动盈亏	盯市盈亏	静态保证金占用	投资类型	产品编号	产品名称
IF1508	IF1508	买	100	100	1.000	934,000.00	934,000.00	6,000.00	投机		4 期货组合
IF1508	IF1508	买	100	100	1.000	934,000.00	934,000.00	6,000.00	投机		4 期货组合
IF1508	IF1508	卖	100	100	1.000	934,000.00	934,000.00	6,000.00	投机		4 期货组合
IF1508	IF1508	卖	100	55	1.000	934,000.00	934,000.00	6,000.00	投机		4 期货组合
IF1509	IF1509	买	100	64	1.000	958,000.00	958,000.00				4 期货组合
IF1509	IF1509	卖	100	100	1.000	958,000.00	958,000.00				4 期货组合
ag1508	白银1508	买	50	50	1.000	749,400.00	749,400.00				56 模拟成交2
ag1508	白银1508	买	90	90	793.736	278,727.00	278,727.00	214,308.60	投机		56 模拟成交2
ag1508	白银1508	卖	150	150	1.000	248,200.00	248,200.00	450.00	投机		56 模拟成交2

图 3.5.7

在持仓区界面点击右键，在弹出的右键菜单可以执行如下操作：



PB 查询

请设置持仓查询条件

产品: 9107 期货交易 投资类型: a 投机

单元: 9 期货投机单元 合约: ag1507 白银1507

持仓类型: 1 多仓

确定 取消 重置

图 3.5.8

- **持仓查询：**选择“持仓查询”弹出查询界面，依次输入产品、单元、持仓类型、投资类型、指定合约对持仓区合约进行筛选。查询后完毕后如要恢复持仓区显示，点击重置，清空或删除查询筛选项即可。
- **布局设置：**选择“布局设置”，即可进入布局设置页面，对当前行情页的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置，详细操作请查看[布局设置](#)页面。

3.5.1.6 行情栏

双击报价栏合约，持仓区合约，行情栏，在委托栏输入合约后，该区域会显示合约一档行情，超①行情价格是在一档行情的基础上分别加减最小单位价差获得。

涨停:	10,000	
超④:	1,001	
超③:	1,001	
超②:	1,001	
超①:	1,001	
卖一:	1,001	80
买一:	1,000	71
超①:	1,000	
超②:	1,000	
超③:	1,000	
超④:	1,000	
跌停:	0	

图 3.5.9

涨停: 显示合约涨停价。

跌停: 显示合约跌停价。

3.5.1.7 委托栏

委托栏分为<普通委托>、<埋单委托>、<批量委托>、<止盈止损>四个标签页。

3.5.1.7.1 普通委托

普通委托界面如下图:

涨停: 10,000 超④: 1,001 超③: 1,001 超②: 1,001 超①: 1,001 卖一: 1,001 55 买一: 1,001 93 超①: 1,001 超②: 1,001 超③: 1,001 超④: 1,001 跌停: 0	普通委托 埋单委托 批量委托 止盈止损 产品: 4 期货组合单 单元: 3 期货投机 合约: IF1508 IF1508 买卖: ☒ 买入 ☐ 卖出 ☐ 追单 开平: ☐ 开仓 ☒ 平仓 数量: 1 全部 ≤55 盘口价: 1001 下单 重置
---	--

图 3.5.10

产品: 该项用于填写下达委托的期货产品编号，可手工填写，也可通过双击持仓区的任意一行自动带出。

单元: 产品项填写完后，单元会自动填上缺省单元，若有多个编码，可通过下拉菜单选择。

合约: 填写期货合约代码，可手工填写，也可通过双击持仓区或报价栏的任意一行自动填

写。

买卖：通过买卖项选择合约涨跌方向，有“买入”和“卖出”两个选项。选择买入或卖出时，委托栏底色会以不同颜色显示，买入显示红色，卖出显示绿色。

追单：勾选该项后，系统下达追单委托。追单部分详细操作请查看[追单](#)页面。

开平：选择委托方向，有“开仓”和“平仓”两个选项。

数量：输入委托手数，右侧显示可开、可平数量。当开平项为“开仓”时，数量不能超过右侧显示的可开数量；当开平项为“平仓”时，数量不能超过单元可平数量。

价格类型：点击价格可以在显示栏中选择“盘口价”，“指定价”，“任意价”，“挂单价”，“最新价”，选定价格后会自动填入价格。



图 3.5.11

下单：点击下单按钮执行下单操作。

重置：清空委托栏，和合约栏显示内容。

3.5.1.7.2 埋单委托

埋单委托左侧界面与普通委托相同，如下图：

图 3.5.12

埋单类型：可选择“条件埋单”，“手工埋单”。“手工埋单”时不需要设置埋单参数。

埋单参数：在此处设置条件埋单触发条件。

3.5.1.7.3 批量委托

批量委托右侧界面设置批量委托的数量递增、价格递增参数，如下图：

图 3.5.13

起始价格：批量委托中的第一笔委托的委托价格。

终止价格：批量委托中的最后一笔委托的委托价格。

价格增幅：批量委托中每一笔委托的价格增幅，例如第一笔起始价格是 900，价格增幅为 20，那么第二笔委托的委托价格是 920。

起始数量：批量委托中第一笔委托的委托数量。

终止数量：批量委托中的最后一笔委托的委托数量。

数量增幅：批量委托中每一笔委托的数量增幅，例如第一笔起始数量是 10，价格增幅为 5，那么第二笔委托的委托价格是 15。

委托笔数：由系统根据起始、终止、增幅计算出的批量委托笔数。

委托总量：批量委托总数量。

每笔间隔：批量委托中每一笔委托下达的间隔时间。

3.5.1.7.4 止盈止损

止盈止损右侧界面设置止盈止损参数参数，界面如下图：

图 3.5.14

3.5.1.8 查询区

查询区由<可撤销委托>，<所有委托>，<预埋单监控>，<手工单>四个标签页组成。



图 3.5.15

3.5.1.8.1 挂单

该标签页显示委托状态是“正报”，“未报”，“未成”或“部成”的可撤销委托挂单。

选择	委托时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	委托数量	成交数量	委托状态	委托序号	价格类型	委托价格	成交价格
☐	10:24:00	IH1508	IH1508	卖出	开仓	1	0	未报	21036	限价	2,567.800	
☐	10:10:30	IC1508	IC1508	卖出	开仓	1	0	未报	21033	限价	8,245.200	

图 3.5.16

在界面点击右键弹出菜单，支持如下功能：

- **布局设置：**在布局设置弹出窗口，可以设置界面字段可见、顺序等，详细操作请查看布局设置[布局设置](#)页面。
- **全选：**全部勾选当前界面手工单。

- **反选：**反选当前列表勾选项。

3.5.1.8.2 委托

用户可以在该标签页查看当日所有委托。该界面支持右键[布局设置](#)。

挂单	委托	手工单	预埋单								
委托时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	委托数量	成交数量	委托状态	委托序号	价格类型	委托价格	成交均价
14:59:43	ag1509	白银1509	买入	开仓	500	0	已撤	51764	限价	3,309.000	0.000
14:59:43	ag1509	白银1509	买入	开仓	500	0	已撤	51763	限价	3,309.000	0.000
20:33:27	IF1509	IF1509	买入	开仓	1	0	已撤	21079	限价	3,958.200	0.000
20:33:04	IF1508	IF1508	买入	开仓	1	0	已撤	21078	限价	4,014.800	0.000

图 3.5.17

3.5.1.8.3 手工单

<手工单>界面显示用户当日下达的手工预埋单。

勾选界面右下角“显示委托完成”项，显示当日已下下达的委托，否则不显示。

在页面右键弹出菜单选项可以“全选”列表、“反选”未勾选项和“布局设置”，布局设置操作请查看[布局设置](#)页面。

选择	序号	投资类型	合约代码	合约名称	买卖	开平	价格类型	委托价格	委托数量	执行状态	委托序号	委托信息	产品
☒	230	投机	IF1508	IF1508	买入	开仓	盘口价	N/A	1	未执行	0		模拟

布局设置
 全选
 反选

删除 下达 ☐ 显示委托完成

图 3.5.18

3.5.1.8.4 预埋单

该页面列表显示条件预埋单、止盈止损、批量委托详情，并且提供预埋单暂停、激活、撤销、批量委托明细、右键[布局设置](#)等快捷操作。

用户可以使用界面右下角的预埋单状态筛选框筛选列表内容。

挂单

委托

手工单

预埋单

日期	序号	合约代码	合约名称	委托类型	状态	投资类型	买卖	开平	价格模式	委托价格	委托数量	委托批号
2009-01-09	229	IF1509	IF1509	条件单	未触发	投机	买入	开仓	盘口价	N/A	1	1192
合计		1										

布局设置

暂停

激活

撤销

批量委托明细

☒ 显示已暂停

☒ 显示已触发

☒ 显示已完成

☒ 显示已删除

图 3.5.19

3.5.1.9 成交栏

成交栏显示当日已成交所有委托。如下图：

	成交序号	成交时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	
	31882	09:31:52	ag1602	白银1602	买入	开仓	
	31364	12:47:25	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
	31363	12:40:37	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
	31362	12:38:26	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
▶	31361	12:36:22	布局设置 显示成交明细 按委托序号汇总 按合约代码、委托方向汇总				
	31360	12:35:24					
	31359	12:33:51					
	31358	12:33:07					

图 3.5.20

通过右键菜单可以进行如下操作：

- **布局设置：**详细操作见[布局设置](#)页面。
- **显示成交明细：**如果一笔委托发生多次成交的情况，会出现委托序号相同但成交序号不同的行，此时<成交栏>显示每一笔委托的成交详情。
- **按委托序号汇总：**将委托序号相同成交行汇总成一条显示，树形展开可以查看当前汇总行所包含的成交明细，如下图。

	成交序号	成交时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	
▶	共[1]条	09:31:52	ag1602	白银1602	买入	开仓	
	31882	09:31:52	ag1602	白银1602	买入	开仓	
+	共[1]条	12:47:25	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
+	共[1]条	12:40:37	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
+	共[1]条	12:38:26	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
+	共[1]条	12:36:22	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
+	共[1]条	12:35:24	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
+	共[1]条	12:33:51	ag1509	白银1509	卖出	平仓	

图 3.5.21

- **按证券代码、委托方向汇总：**将证券代码、委托方向相同的成交汇总成一条显示，支持树形展开查看成交明细，如下图。

成交序号	成交时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	
共[1]条	09:31:52	ag1602	白银1602	买入	开仓	
共[25]条		ag1509	白银1509	卖出	平仓	
31364	12:47:25	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
31363	12:40:37	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
31362	12:38:26	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
31361	12:36:22	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
31360	12:35:24	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
31359	12:33:51	ag1509	白银1509	卖出	平仓	

图 3.5.22

注意：

<成交栏>选择“按委托序号汇总”或“按证券代码、委托方向汇总”后，汇总行的成交价格=SUM（成交明细价格）/SUM（成交明细数量）。

3.5.2 交易

3.5.2.1 自选合约设置

中金所、上期所、郑商所、大商所等期货交易所发行和交易的期货合约不相同，在期货交易时，需要分别在【期货单账户】→<报价栏>的不同交易所标签页中查看。投顾在期货投资时，时常会出现多个市场切换下单的情况，在多个标签页中切换会非常不方便。

为方便用户盯市并快速下单，可以通过<自选合约设置>功能将投顾关注的不同市场的合约集中显示在同一个标签页内，新增的自选合约标签页会单独显示在报价栏上。

在【期货交易】→<期货单账户>→<功能栏>→<自选合约设置>设置自选合约。

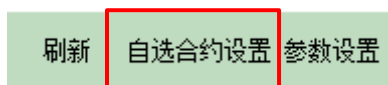


图 3.5.23

- 新增自选合约



图 3.5.24



图 3.5.25

- 1) 在<自选合约设置>界面，点击添加新组弹出<自选合约组>界面，用户输入自选合约组名称，确定后在<自选合约设置>界面查看。
- 2) 用户可以在<自选合约设置>交易所下拉框选择期货交易所，根据交易所过滤“待选合约代码”列的合约。
- 3) 选中合约组，在左侧“待选合约代码”列中双击合约单选或按住键盘 Ctrl 键多选合约后使用“>”功能，合约会移动到“自选合约代码”列表或使用“>>”功能键移动全部合约到自选合约栏中。确定后自选合约组显示在报价列表中。

自选	大商所	郑商所	中金所	上期所					
合约代码	最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	涨跌幅	成交量	
ag1508	1,000.40	999.60	52	1,001.20	5	0.40	0.04%	7,329,956	
ag1509	1,001.40	1,001.20	43	1,001.80	63	1.40	0.14%	7,339,076	
ag1510	999.40	999.40	50	999.40	67	-0.60	-0.06%	7,347,241	
ag1601	999.00	998.80	22	999.80	20	-1.00	-0.10%	7,331,505	
ag1603	1,000.20	999.40	39	1,000.20	67	0.20	0.02%	7,335,346	

图 3.5.26

- **删除自选合约：**在<功能栏>→<自选合约设置>→<自选合约设置>合约组选项处选中合约，点击删除合约组即可。如下图。



图 3.5.27

- **修改自选合约：**可以使用两种方式增减自选合约组内容。
 - 1) 在<自选合约设置>合约组选项处选中合约，使用“<”、“>”、“<<”、“>>”项增减合约内容。
 - 2) 在<行情栏>自选合约组标签页上右键选中合约，在弹出的菜单里选择“删除自选”，确认后该合约在自选组中删除。也可以在交易所合约标签页上选中合约并点击右键，在弹出的右键菜单里选择“加入到...”，确认后该合约增加到指定自选合约组中。

内容。

【相关参数一】智能开平仓

在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<智能开平仓>界面，勾选“开启智能开平仓”选项后，<普通委托>委托栏的开平仓方向由系统自动计算获得。

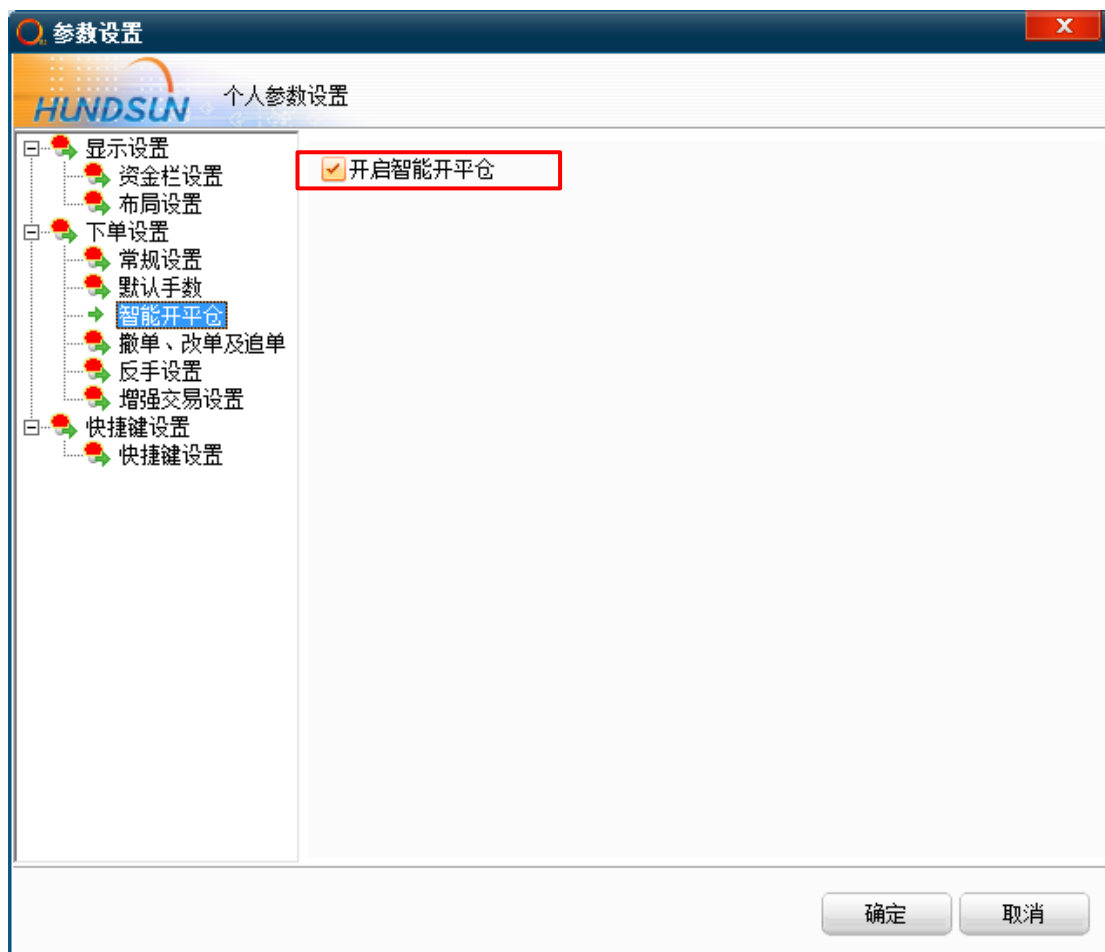


图 3.5.31

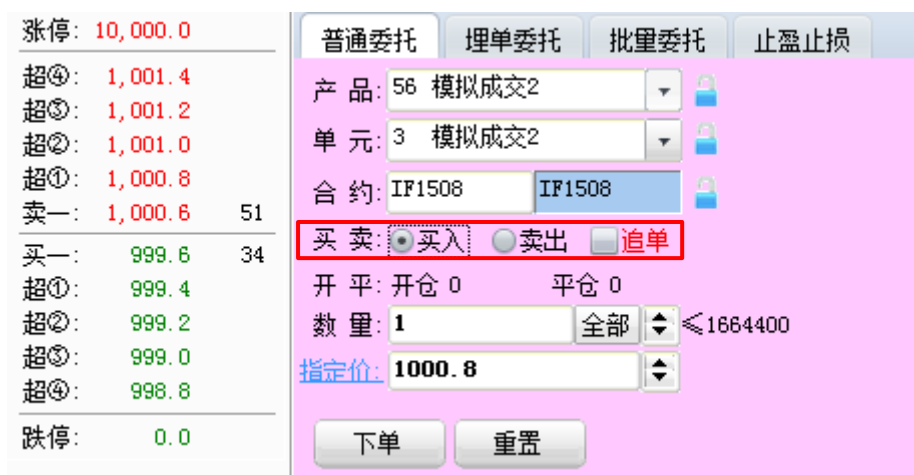


图 3.5.32

如果合约有持仓，双击行情或双击持仓填单，委托方向自动默认平仓，数量默认显示当前持仓数量。

如果用户手工填入数量小于持仓数量，则委托为平仓，平仓数量=填入数量。反之，如果数量大于持仓数量，则系统判断委托为开仓，开仓数量=填入数量-持仓数量。

【相关参数二】行情面板设置

在<常规设置>界面，勾选“点击行情面板价格时买卖方向自动朝相反方向变化”后，双击行情栏的买价或买量字段时，委托栏委托方向显示“卖出开仓”；双击卖价或卖量字段时，委托方向默认显示“买入开仓”。

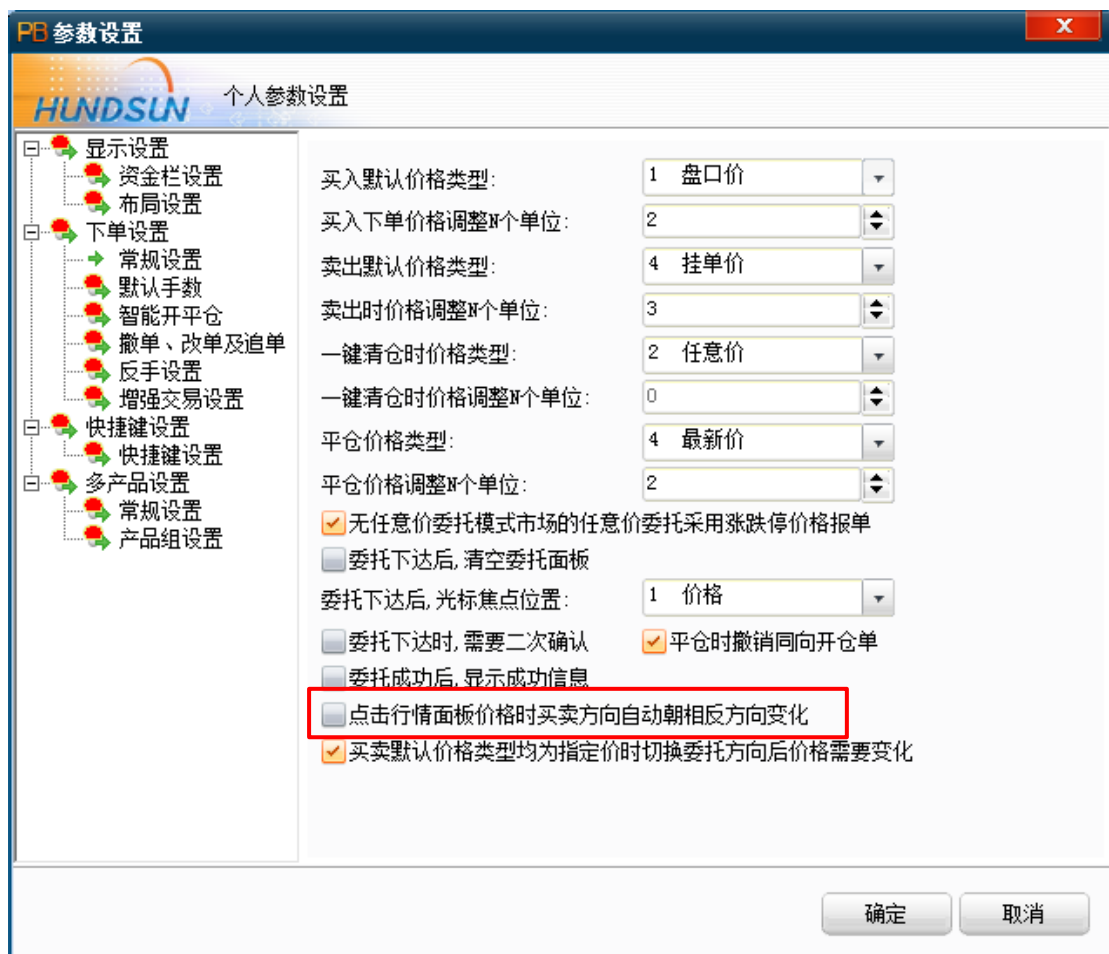


图 3.5.33

【相关参数三】平仓时反向撤单

平仓时反向撤单是指：对持仓合约进行平仓的同时，自动撤销与原持仓合约方向一致的未成交的开仓委托单信息，即在多头平仓时，同时撤销多头开仓委托；同样的空头平仓，则撤销空头开仓。

平仓反向撤单举例

假如 IF1509 合约当前持仓买入开仓 1 手(开仓价 2920), 10:02 分此时行情信息为 3000, 投顾再下一笔买入开仓委托单(价格 2940), 此时委托单还不能成交, 当行情出现急剧下滑, 客户预测行情将出现急速下跌行情, 拟将原先持仓的一手买入开仓进行平仓, 选择了该配置项, 则可在平仓原有的 1 手多仓的同时, 将 10:02 分未成交的多仓委托单进行撤单。

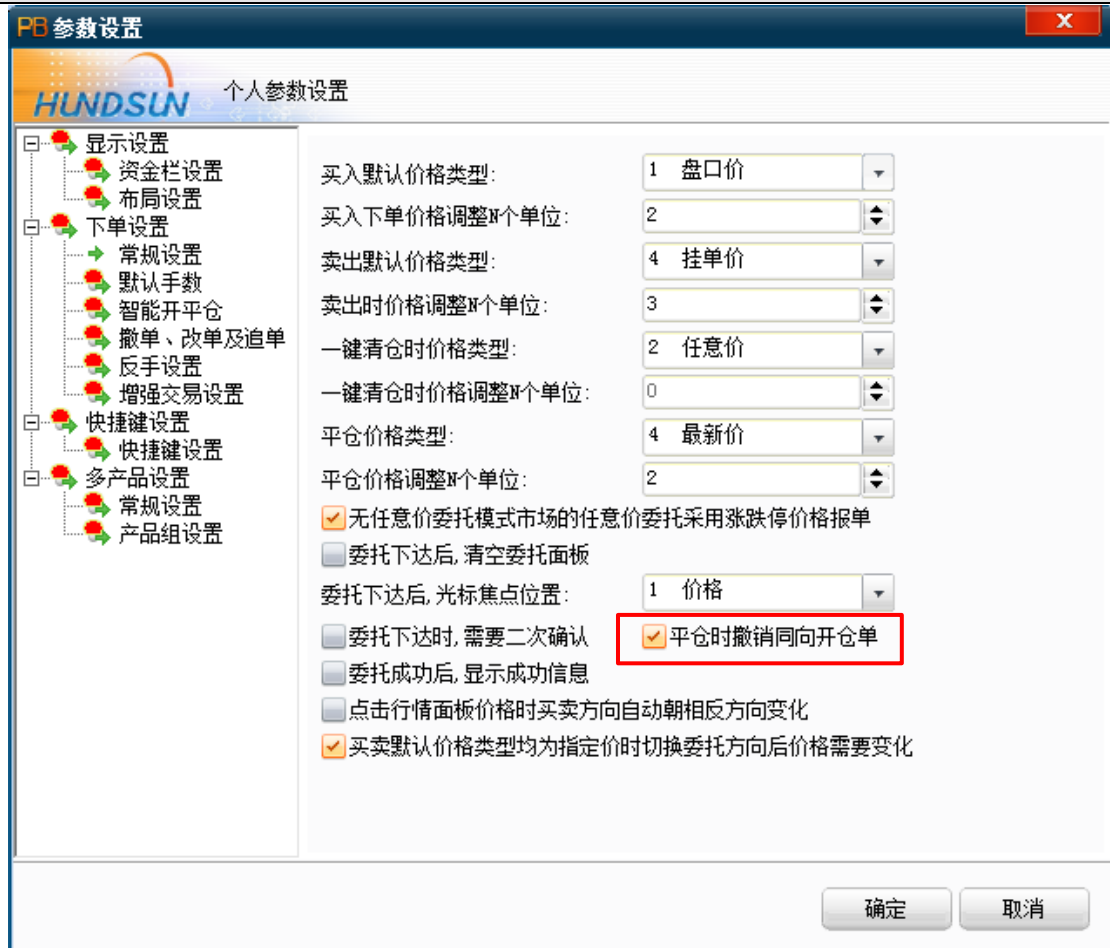


图 3.5.34

注意:

平仓时撤销同向开仓单适用于所有平仓委托, 包括一键平仓、平仓等功能。

3.5.2.3 撤单、改单

用户在<查询区>→<可撤委托>标签页中下达撤单、改单指令。

3.5.2.3.1 普通撤单

如果要对某笔或某些委托撤单, 在查询区<挂单>标签页, 选择一条或多条委托记录, 点

单击**撤单**或双击一条委托记录，即可对委托挂单撤销挂单。



图 3.5.35

注意：

双击撤单需要在系统参数设置→<交易设置>中勾选“启用委托双击撤单功能”。

3.5.2.3.2 全部撤单

全部撤单即撤销当前所有挂单，如果要执行该操作，在查询区<挂单>页面点击**全部撤单**系统会自动发送撤单委托。



图 3.5.36

3.5.2.3.3 撤最后一笔

撤最后一笔是撤销当前最后一笔委托，直接点击**撤最后一笔**，系统自动撤销委托序号最大的一笔挂单。



图 3.5.37

3.5.2.3.4 改单

通过改单功能可以快速修改原委托价格、数量并重新下单。

如果想要修改某合约数量或委托价格，在列表选中委托并点击**改单**，弹出“改单”窗

口带出原委托的合约、方向、实时行情价格和委托数量。用户重新输入改单后的价格或数量，确定后系统撤销原委托，撤单成功后，重新下达一笔改单委托。

挂单	委托	手工单	预埋单									
选择	委托时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	委托数量	成交数量	委托状态	委托序号	价格类型	委托价格	成交
☒	10:24:00	IH1508	IH1508	卖出	开仓	1	0	未报	21036	限价	2,567.600	
☐	10:10:30	IC1508	IC1508	卖出	开仓	1	0	未报	21033	限价	8,245.200	

图 3.5.38

PB 改单


修改委托单

合约: IC1509
方向: 买入开仓
价格: 7834
数量: 3

图 3.5.39

注意：

改单是对原委托修改，委托数量的修改也是对原委托数量的修改。

比如，原委托数量 10 手，成交 6 手，点击“改单”后填 8 手，那么系统认为用户想将原来的 10 手委托改成 8 手，系统会将撤销原委托未成交的 4 手，然后根据改单价重新下达 2 手委托；如果点击“改单”后填 3 手，系统认为用户实际想要下达 3 手委托，但是原来的 10 手已经成交满足用户 3 手要求，那么系统将撤销未成而不补单。

3.5.2.3.5 盘口价改单/挂单价改单

盘口价改单/挂单价改单，是使用盘口价/改单价替换原委托的委托价格。

在<挂单>选择栏勾选一条委托，点击盘口价改单，系统自动撤销未成交委托，并重新下达一笔盘口价委托单，委托数量=撤销的未成交数量。

例如，原期货委托的委托数量 10 手，当前成交了 6 手，此时使用盘口价改单，系统会先撤销未成交的 4 手委托，撤单成功后，以最新的盘口价重新下达 4 手委托。

挂单价改单盘口价改单类似，不同之处在于使用挂单价重新下达委托。

挂单

委托

手工单

预埋单

选择	委托时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	委托数量	成交数量	委托状态	委托序号	价格类型	委托价格	成交价格
☒	10:24:00	IH1508	IH1508	卖出	开仓	1	0	未报	21036	限价	2,567.600	
☐	10:10:30	IC1508	IC1508	卖出	开仓	1	0	未报	21033	限价	8,245.200	

撤单

全部撤单

撤最后一笔

改单

盘口价改单

挂单价改单

图 3.5.40

3.5.2.4 平仓、一键清仓

通过<持仓区>平仓、一键清仓功能可以快速平仓当前持仓合约。

合约代码	合约名称	买卖	持仓	可用	持仓均价	浮动盈亏	盯市盈亏	静态保证金	投资类型	产品编号	产品名称
IF1508	IF1508	买	100	100	1.000	0.000,000.00	0.000,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1508	IF1508	买	100	100	1.000	0.000,000.00	0.000,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1508	IF1508	卖	100	100	1.000	0.000,000.00	0.000,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1508	IF1508	卖	100	55	1.000	0.000,000.00	0.000,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1509	IF1509	买	100	64	1.000	952,000.00	952,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1509	IF1509	卖	100	100	1.000	952,000.00	952,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
ag1508	白银1508	买	50	50	1.000	748,350.00	748,350.00	150.00	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	买	90	90	793.736	276,837.00	276,837.00	214,308.60	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	卖	150	150	1.000	245,050.00	245,050.00	450.00	投机	56	模拟成交2

图 3.5.41

3.5.2.4.1 平仓

平仓即是清空当前持仓合约。如果要平仓账户某一合约的持仓，在<持仓区>选中合约，点击[平仓]，在弹出窗口中确认平仓信息后，系统自动下达该合约的平仓委托。其中，平仓数量=持仓数量，平仓价格设置请在【相关参数】内容中查看。

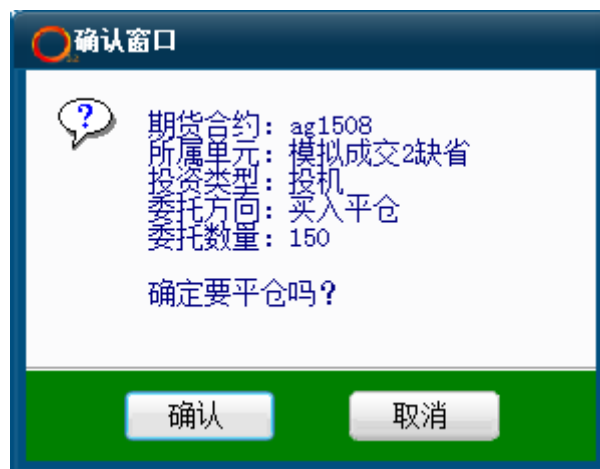


图 3.5.42

3.5.2.4.2 一键清仓

一键清仓的功能与上面的平仓类似,不同之处在于本功能实现的清空当前账户的所有持仓。

【相关参数】平仓、一键清仓价格模式

平仓、一键清仓的委托价格需要在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<常规设置>中“平仓/一键清仓价格类型”和“平仓/一键清仓价格调整 N 个单位”进行设置。

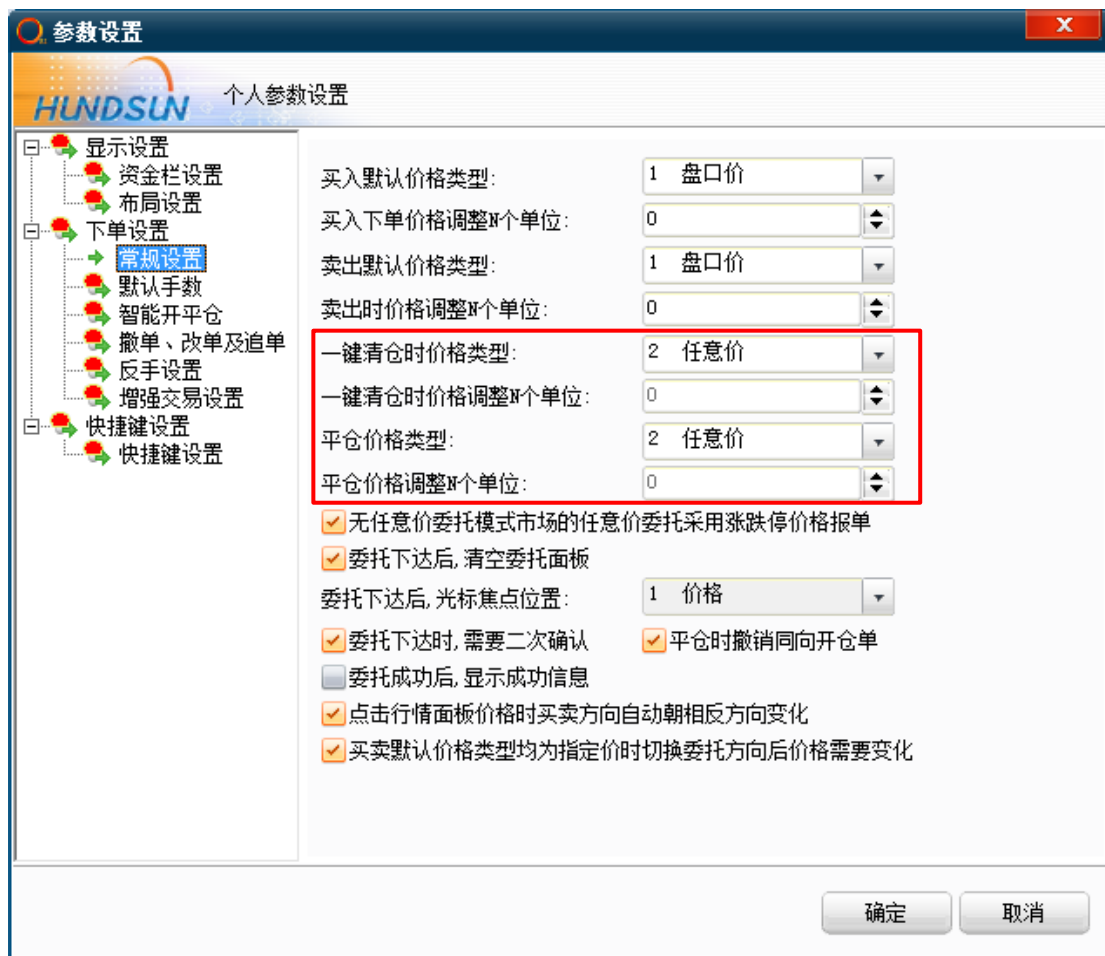


图 3.5.43

平仓/一键清仓价格类型：在下拉框中可以选择“盘口价”、“任意价”、“挂单价”、“最新价”作为平仓/一键清仓委托的价格类型。

平仓/一键清仓价格调整 N 个单位：在该项输入“平仓/一键清仓价格类型”价格类型基础上调整的 N 个最小单位价差。即平仓价格=平仓价格类型-N*最小单位价差，那么一键清仓价格=一键清仓价格类型-N*合约最小单位价差。

3.5.2.5 反手

反手,就是先对当前持仓的合约进行平仓,并按照相反的方向开仓相同数量的期货合约。

当市场出现重大利空或利好的情况下, 合约对应行情剧烈震荡, 此时行情可能未按投资者预想的方向发展, 可进行及时的反手交易, 减少损失, 扩大盈利。

反手举例

投资者在 10:16 分, 卖出开仓 1 手 IF1509(开仓价 2948.4), 在 10:20 分(最新价 2893.2) 预计行情会出现较大变化, 向相反方向转换, 可通过反手交易快速平仓并反向开仓, 实现一键快速操作。最终实现卖出平仓 1 手 IF1509 并下达一手买入开仓 IF1509。

合约代码	合约名称	买卖	持仓	可用	持仓均价	浮动盈亏	盯市盈亏	静态保证金 占用	投资类型	产品编号	产品名称
IF1508	IF1508	买	100	100	1.000	000,000.00	000,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1508	IF1508	买	100	100	1.000	000,000.00	000,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1508	IF1508	卖	100	100	1.000	000,000.00	000,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1508	IF1508	卖	100	55	1.000	000,000.00	000,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1509	IF1509	买	100	64	1.000	952,000.00	952,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
IF1509	IF1509	卖	100	100	1.000	952,000.00	952,000.00	6,000.00	投机	4	期货组合单
ag1508	白银1508	买	50	50	1.000	748,350.00	748,350.00	150.00	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	买	90	90	793.736	276,837.00	276,837.00	214,308.60	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	卖	150	150	1.000	245,050.00	245,050.00	450.00	投机	56	模拟成交2

平仓 一键平仓 反手

图 3.5.44

- **反手委托:** 在<持仓区>选中合约, 点击**反手**, 在弹出窗口中确认反手信息, 系统先下达平仓委托, 平仓委托成交后, 下达同数量的开仓委托。
- **反手价格:** 反手平仓和反手开仓的委托价格设置请在【相关参数】内容中查看。

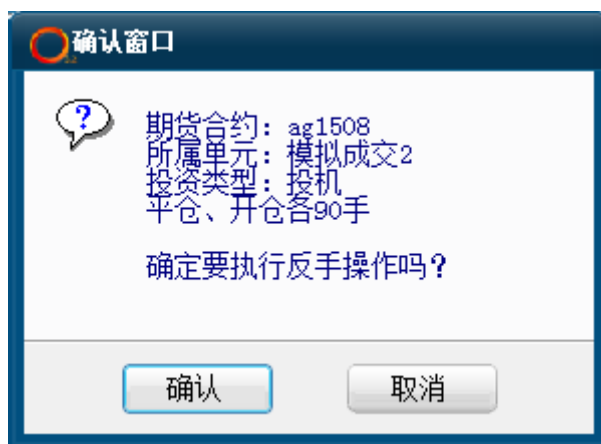


图 3.5.45

【相关参数】反手开平仓价格模式

使用反手功能时, 用户不需要输入平仓、开仓价格。

默认开平仓委托价格需要在使用反手功能前在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<反设置>中依次输入反手参数。

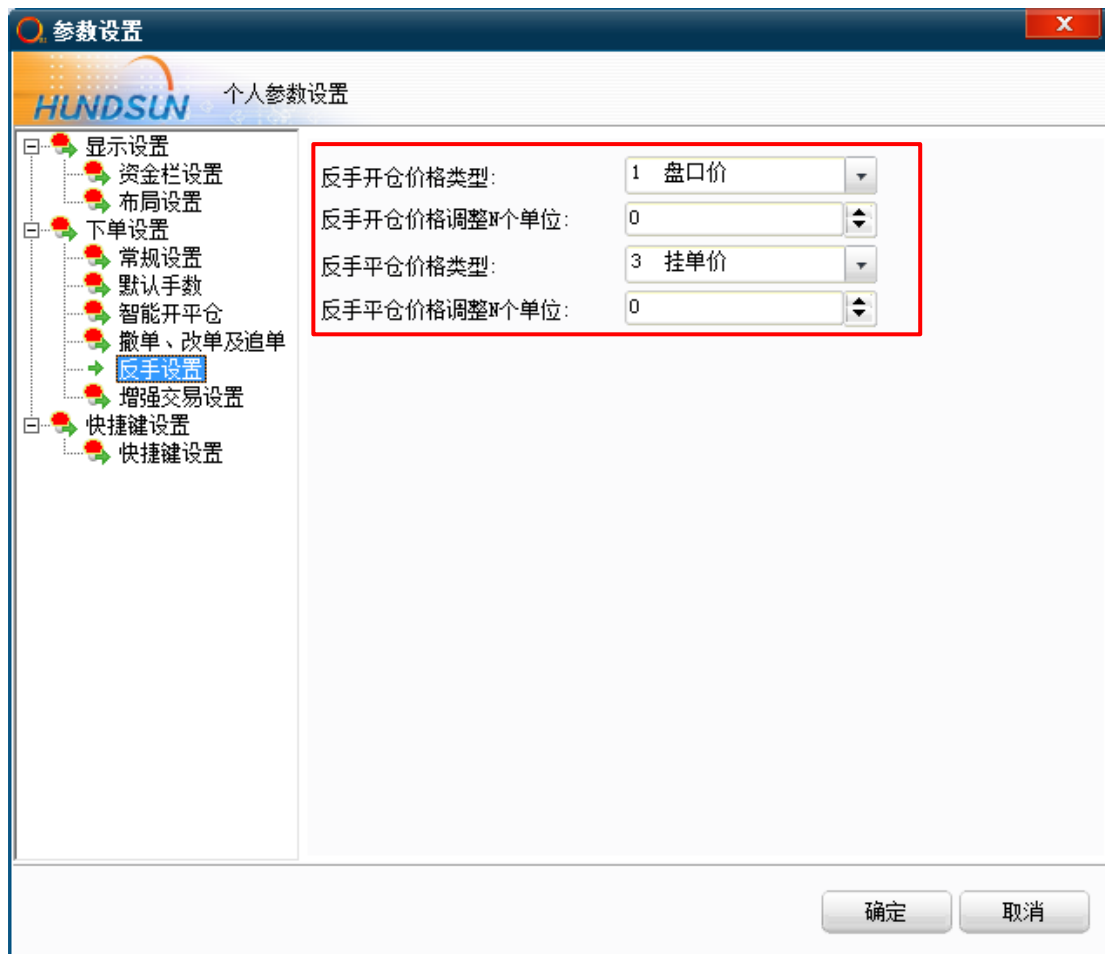


图 3.5.46

反手开仓/平仓价格类型：在此项设置反手开仓/平仓时的委托价格类型，在下拉框中可以选择“盘口价”、“任意价”、“挂单价”、“最新价”。

反手平仓价格调整 N 个单位：在“反手平仓价格类型”价格类型基础上调整 N 个最小单位价差。买入平仓时，在默认的价格基础上浮 N 个单位，平仓价格=反手平仓价格类型+N*最小单位价差；卖出平仓时，在默认的价格基础上下调 N 个单位，平仓价格=反手平仓价格类型-N*最小单位价差。

反手开仓价格调整 N 个单位：与反手平仓价格调整类似。当买入开仓时，在默认的价格基础上浮 N 个单位，开仓价格=反手开仓价格类型+N*最小单位价差；卖出开仓时，在默认的价格基础上下调 N 个单位，开仓价格=反手开仓价格类型-N*最小单位价差。

3.5.2.6 埋单委托

用户在无法及时盯盘的情况下，可以使用埋单委托设置时间条件或者行情条件，在满足条件的情况下由系统自动下单。可以由系统减少由于无法及时盯盘带来的影响。

埋单委托的账户、组合、合约、买卖、开平、数量、价格各控件的控制方式与普通委托相同，这部分操作查看[普通委托](#)页面的操作介绍。下达埋单委托，还需要设置具体埋单条件参数（下图红色框内），埋单委托可分为：条件埋单、手工埋单。

图 3.5.47

3.5.2.6.1 条件埋单

条件埋单即是预先设置委托触发条件，由转换机任务监控埋单条件，当条件满足时，即申报埋单委托。

条件埋单可以使用埋单委托中委托合约价格触发埋单或其他合约设置埋单参数，其他合约价格触发埋单主要针对的是两个合约间有某种价格关系的合约，例如商品期货中大豆及玉米，详细设置请查看【相关参数一】。以下以使用委托合约埋单价格触发为例：

图 3.5.48

- **埋单条件设置：**填写完普通委托部分后，在埋单类型项选择“条件埋单”，依次填写括号内的埋单要素。在交易日时间范围内，当最新价/买一价/卖一价连续 N 次达到或超过指定价位时触发，默认值为 1。

- **埋单条件触发：**下单后，在<查询区>→<预埋单>标签页中，可查看预埋单详情。当埋单条件设置满足时，系统会下达委托。

日期	序号	合约代码	合约名称	委托类型	状态	投资类型	买卖	开平	价格模式	委托价格	委托数量	委托批号
2009-01-09	229	IF1509	IF1509	条件单	未触发	投机	买入	开仓	盘口价	N/A	1	1192
合计		1										

☒ 显示已暂停
 ☒ 显示已触发
 ☒ 显示已完成
 ☒ 显示已删除

图 3.5.49

- **暂停/激活埋单监控：**如果需要暂时暂停对预埋单的监控，在<预埋单>列表选中预埋单并点[暂停]，委托状态变为“暂停”。如果要重新启动预埋单监控，选中暂停预埋单点[激活]按钮即可。

日期	序号	合约代码	合约名称	委托类型	状态	投资类型	买卖	开平	价格模式	委托价格	委托数量	委托批号
2009-01-09	229	IF1509	IF1509	条件单	暂停	投机	买入	开仓	盘口价	N/A	1	1192
合计		1										

☒ 显示已暂停
 ☒ 显示已触发
 ☒ 显示已完成
 ☒ 显示已删除

图 3.5.50

- **撤销埋单：**预埋单未触发前，如果要撤销预埋单。选中列表中的委托，点[撤销]，该预埋单状态变为“删除”。删除后不能在启动监控。

【相关参数一】其他合约条件价格触发

条件预埋单可以使用其他合约设置触发条件，主要针对的是两个合约间有某种价格关系的合约。

商品期货合约的关联

以商品期货中大豆及玉米的关系为例，大豆和玉米同一季节播种，在对耕地面积的占用中存在着竞争关系。在耕地面积总体稳定的情况下，某一种作物播种面积的上升意味另一种作物面积的下降，价格关联度较强。所以在进行埋单策略设置时，如需买入开仓大豆合约，则埋单策略可设置为根据玉米合约的价格进行触发埋单。

在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<增强交易设置>界面启用“埋单委托允许价格触发使用非当前合约代码”后，在条件埋单委托栏，条件要素增加“当（合约）”项，该项填入合约后，埋单触发按照条件填入合约项价格条件触发。

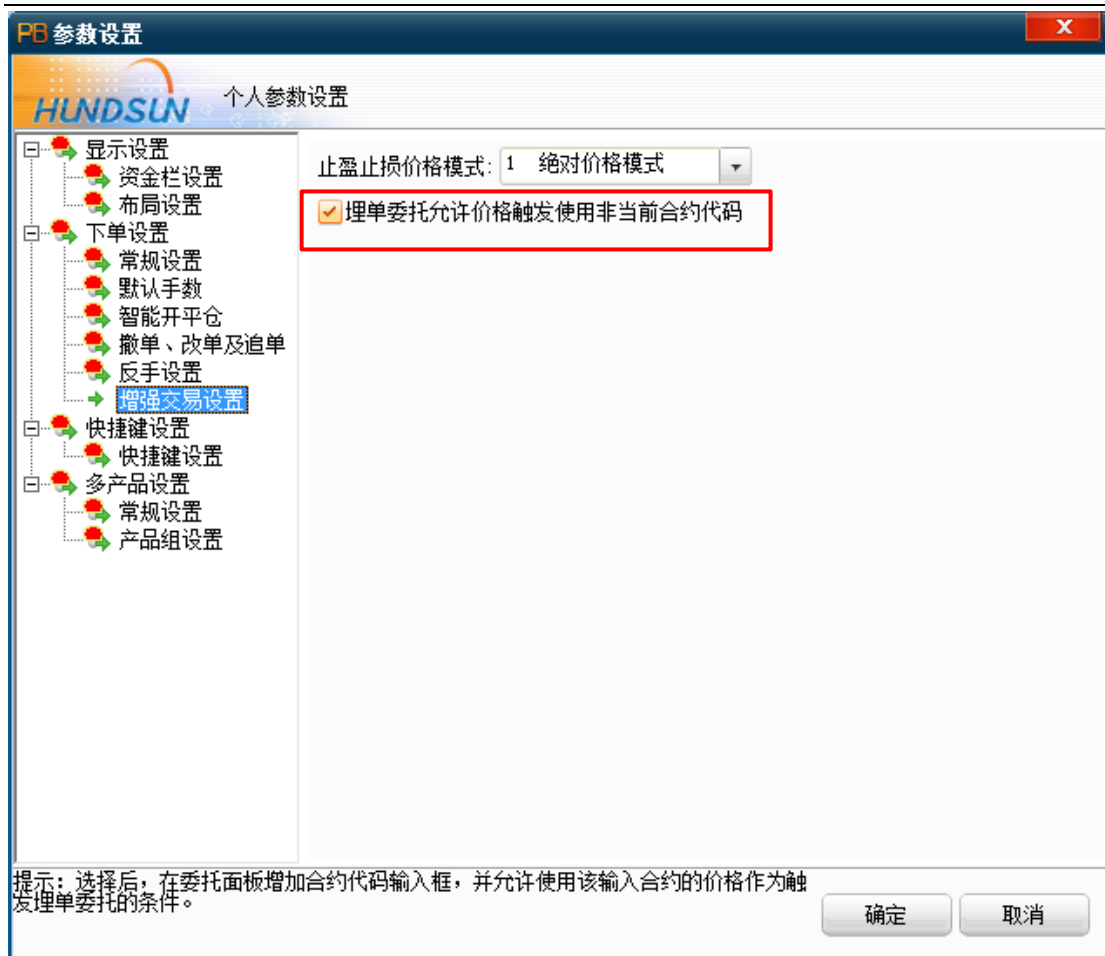


图 3.5.51



图 3.5.52

【相关参数二】转换机“期货增强交易”

条件埋单委托成交后，会把成交消息推送给“期货增强交易”的转换机任务，转换机会生成待监控的预埋单记录。转换机会每隔一段时间检查一下这些预埋单记录是否满足设置的预埋单条件，如果满足就会触发条件预埋单委托。“期货增强交易”转换机任务的设置项如

下图所示：

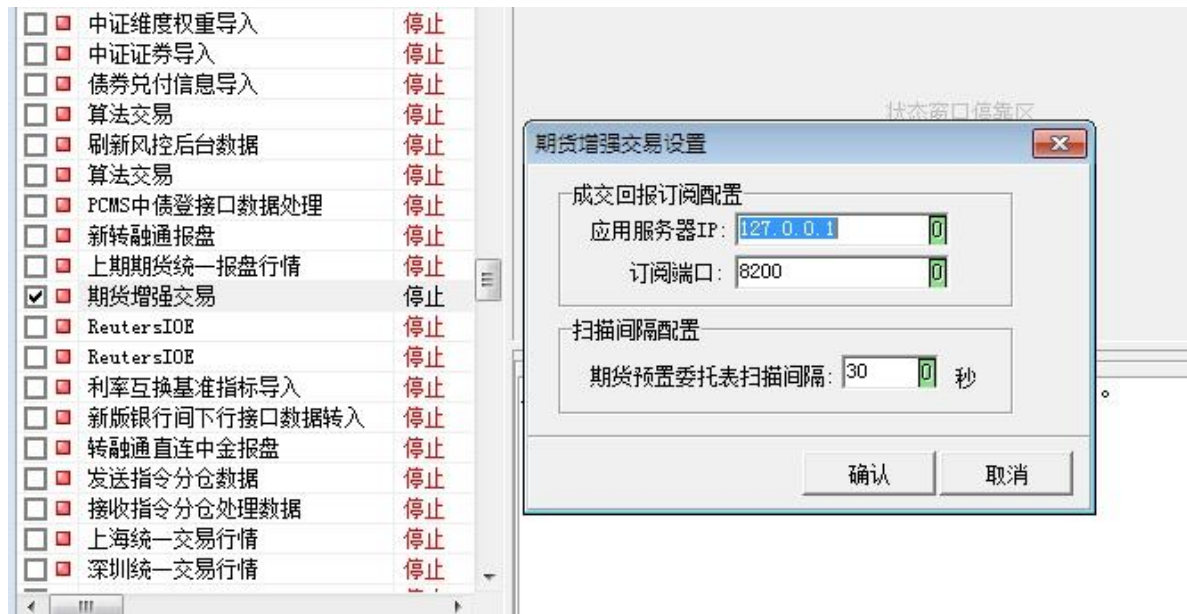


图 3.5.53

应用服务器 IP：消息中心的 IP 地址，由于接收消息中心推送的成交消息。

订阅端口：消息中心的端口，由于接收消息中心推送的成交消息。

扫描间隔：交换机扫描需要监控的预埋单记录的时间间隔。

3.5.2.6.2 手工埋单

手工预埋单是先将要下达的委托要素设置好并保存在<手工单>界面，便于客户快速手工下达埋单。手工预埋单与条件预埋单很类似，不同之处在于，手工预埋单必须由人工下达，条件预埋单由交换机根据条件自动触发。

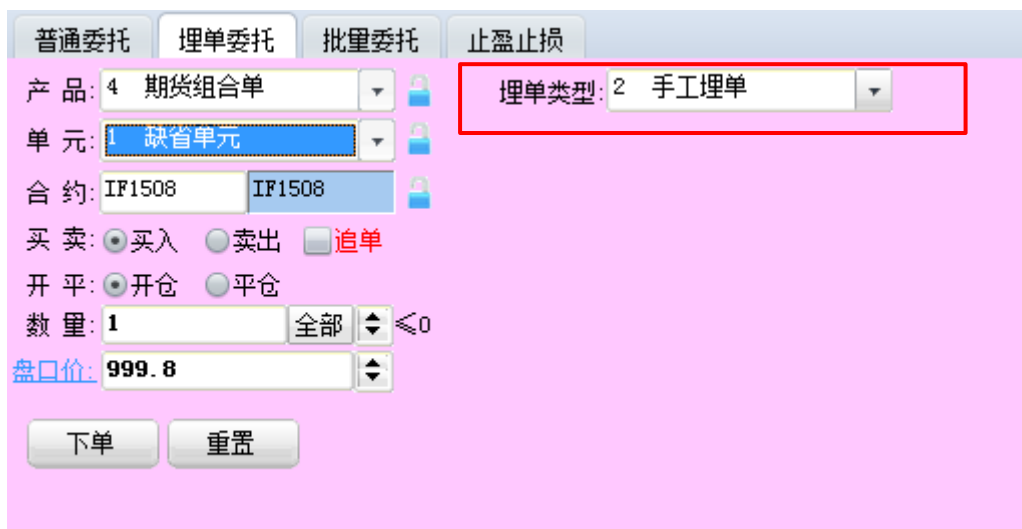


图 3.5.54

- **埋单类型：**填写完普通委托部分后，在埋单类型项选择“手工埋单”并确认下单。下单后，可以在<查询区>→<手工单>标签页查看手工单详情。

挂单		委托		手工单		预埋单							
选择	序号	投资类型	合约代码	合约名称	买卖	开平	价格类型	委托价格	委托数量	执行状态	委托序号	委托信息	产品
	230	投机	IF1508	IF1508	买入	开仓	盘口价	N/A	1	未执行	0		模拟

删除

下达

显示委托完成

图 3.5.55

- **手工埋单下达、删除：**当用户认为时机成熟时，选中要下达的手工单，点**下达**即可。如果要删除手工埋单，同样选中手工单，点击**删除**即可。

3.5.2.7 批量委托

当需要大量下单买入某笔合约时，若采用单一委托价格可能会影响到交易质量，造成成本过高，便可使用批量委托。

批量委托在设置起始价格、终止价格及价格增幅后，系统会自动将一笔委托拆分成多笔下达，每笔的委托价格、委托数量递增或递减以促成成交。

委托栏左侧的**账户**、**组合**、**合约**、**买卖**、**开平**、**数量**、**价格**各控件的控制方式与普通委托相同，可查看**普通委托**页面的操作介绍。下达批量委托，还需要设置具体批量委托参数（下图红色框内），批量委托可分为价格递增、数量递增模式。

涨停：10,000.0 超④：1,001.2 超③：1,001.0 超②：1,000.8 超①：1,000.6 卖一：1,000.4 64 买一：999.8 41 超①：999.6 超②：999.4 超③：999.2 超④：999.0 跌停：0.0	普通委托 埋单委托 批量委托 止盈止损 产 品：56 模拟成交2 单 元：3 模拟成交2 合 约：IF1508 IF1508 买 卖：☒ 买入 ☐ 卖出 ☐ 追单 开 平：☒ 开仓 ☐ 平仓 价 格：2 指定价 下单 重置 起始价格：990 终止价格：990 价格增幅：0 起始数量：10 终止数量：30 数量增幅：5 委托笔数：5 委托总量：100 每笔间隔：5 秒
---	--

图 3.5.56

3.5.2.7.1 价格增幅

价格增幅是用户指定起始价格、终止价格、价格增幅、每笔数量、每笔间隔逐笔下达委

托，价格增幅委托在价格类型为“指定价”时可达。

- **委托笔数：**委托笔数是批量委托下达后的下单次数。输入起始价格、终止价格、价格增幅，焦点转移后，系统自动计算出委托笔数， $\text{委托笔数} = (\text{终止价格} - \text{起始价格}) / \text{价格增幅} + 1$ 。
- **委托总量：**批量委托下达的合约总数。输入起始数量、数量增幅，焦点转移后，系统自动填入委托总量， $\text{委托总量} = \Sigma (\text{开始数量} \pm (\text{委托笔数} * \text{数量增幅}))$ 。
- **报盘间隔：**输入每笔间隔，转换机根据此处设置的时间依次报单。

价格增幅委托举例

普通委托	埋单委托	批量委托	止盈止损
产 品: 56 模拟成交2			起始价格: 990
单 元: 3 模拟成交2			终止价格: 1250
合 约: IF1508 IF1508			价格增幅: 100
买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出 ☐ 追单			起始数量: 10
开 平: ☐ 开仓 ☒ 平仓			终止数量: 0
价 格: 2 指定价			数量增幅: 5
			委托笔数: 3
			委托总量: 45
			每笔间隔: 5 秒
下单 重置			

图 3.5.57

IF1508 下达买入开仓批量委托，起始价格 990，终止价格 1250，价格增幅为 100，起始数量为 10，数量增幅 5，每笔间隔 5 秒，系统计算出下单总笔数为 3 笔，下单后明细流程如下：

1. 第一笔委托下达：委托价格=990，委托数量=10 手；
2. 第一笔委托下达 5 秒后，系统下达第二笔委托。第二笔委托：委托价格=990+100=1090，委托数量=10+5=15 手；
3. 第二笔委托下达 5 秒后，系统下达第三笔委托。第三笔委托：委托价格= 990+2*100=1190，委托数量=10+2*5=20 手

3.5.2.7.2 数量增幅

数量增幅委托与价格增幅委托类似，数量是通过定义起始价格、终止价格、价格增幅、每笔数量、每笔间隔逐笔下达委托，“盘口价”、“挂单价”、“最新价”时下达。

- **委托总量，委托笔数：**输入起始数量、终止数量、数量增幅，焦点转移后，系统自动填入委托总量和委托笔数，委托总量= Σ （起始数量±（委托笔数*数量增幅）），委托笔数=（终止数量-起始数量）/数量增幅+1。
- **报盘间隔：**输入每笔间隔，转换机根据此处设置的时间依次报单。

数量增幅委托举例

普通委托	埋单委托	批量委托	止盈止损
产 品: 56 模拟成交2			起始价格:
单 元: 3 模拟成交2			终止价格:
合 约: IF1508 IF1508			价格增幅:
买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出 ☐ 追单			起始数量: 10
开 平: ☐ 开仓 ☒ 平仓			终止数量: 100
价 格: 1 盘口价			数量增幅: 30
			委托笔数: 4
			委托总量: 220
			每笔间隔: 5 秒
下单 重置			

图 3.5.58

IF1508 下达买入开仓批量委托，起始数量为 10，终止数量 100，数量增幅 30，每笔间隔 5 秒，价格“盘口价”，系统计算出下单总笔数为 3 笔，下单后明细流程如下：

1. 第一笔委托下达：委托价格=当时盘口价，委托数量=10 手；
2. 第一笔委托下达 5 秒后，系统下达第二笔委托。第二笔委托：委托价格=当时盘口价，委托数量=10+30=40 手；
3. 第二笔委托下达 5 秒后，系统下达第三笔委托。第三笔委托：委托价格=当时盘口价，委托数量=10+30*2=70 手；
4. 第三笔委托下达 5 秒后，系统下达第四笔委托。第四笔委托：委托价格=当时盘口价，委托数量=10+30*3=100 手。

3.5.2.8 止盈止损委托

用户可在开仓时同时对该笔开仓设置止盈止损条件。当用户的开仓单成交后，系统会在服务端预埋一笔针对该笔持仓的平仓条件单，当价格波动幅度达到止损（盈）价位时触发，进行平仓，达到止损（盈）的目的。

浮动止损也称追踪止损、跟随止损，它允许用户对持仓合约设定一个根据市场价格变动而变动的止损单，主要用来锁定利润。浮动止损只在市场向着用户判断的方向运行时才有效，其初始参考价格是设定止损（盈）时的合约价格。

浮动止损举例

买入开仓，成交价格 3000，并在 2900 止损，设置浮动止损值为 10。当行情上涨至 3010 时，涨幅超过了浮动止损价，则止损价也由 2900 上调到 2910。行情继续上涨到 3020 时，止损价继续上调到 2920，行情在 3010 到 3020 之间时（即上涨幅度小于 10，止损价格保持不变），止损价保持不变。运行原理示意图如下（红色线代表止损价，深绿色线代表最新价）：

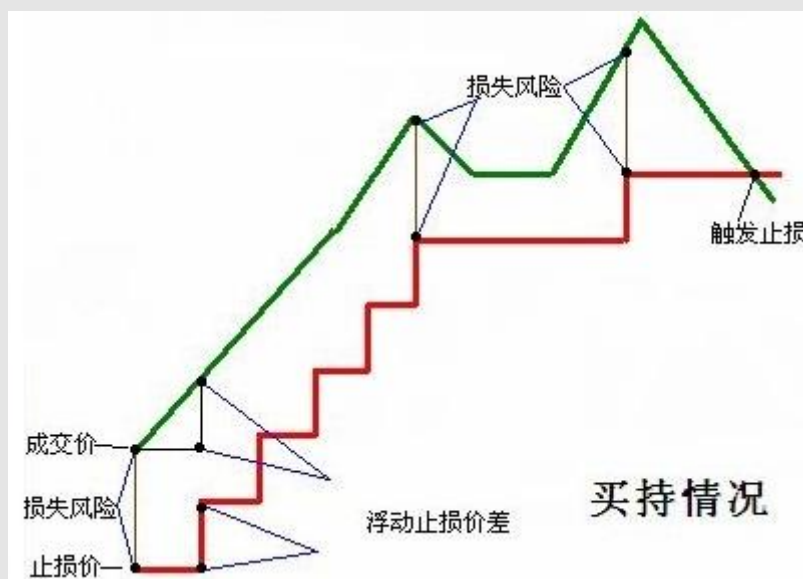


图 3.5.59

卖出开仓，成交价格为 3000，并在 3100 止损，设置浮动止损值为 10。当行情下跌至 2990 时，跌幅超过了浮动止损价，则止损价格也有 3100 下调到 3090。行情继续下跌到 2980 时，止损价格继续下调到 3080，行情在 2980 到 2970 之间时（即下跌幅度小于 10，止损价格保持不变），止损价保持不变。运行原理示意图如下（红色线代表止损价，深绿色线代表最新价）：

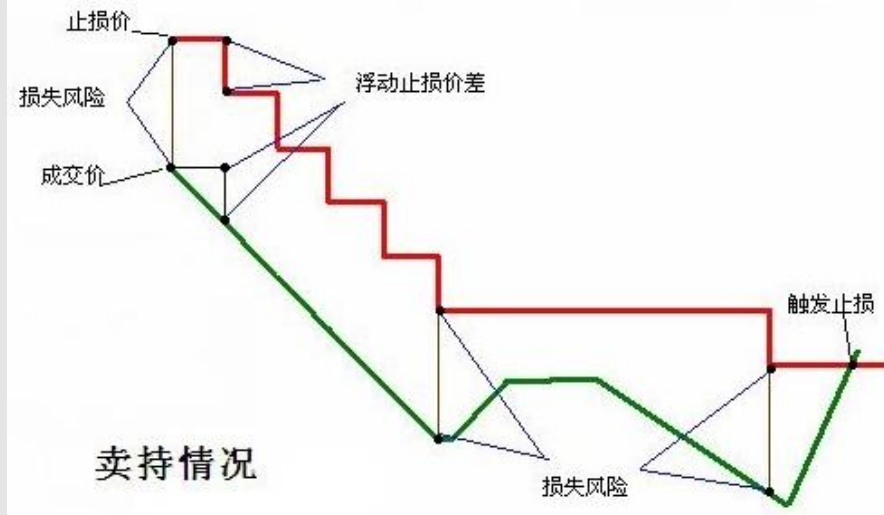


图 3.5.60

在<止盈止损>委托栏界面，对于委托要素录入部分，在下图左半部分，通过选择产品、单元，录入合约代码，选择买卖方向，输入委托数量和委托价格后，就可以做普通委托了。如果下达止盈止损单，则还需要设置止盈止损参数（参见图中红色边框）。

图 3.5.61

注意：

目前远程客户端的止盈止损单是指开仓成交后，针对该笔委托成交的持仓，根据设置的止盈止损参数进行平仓的操作。因此，只有委托成交后，该笔委托成交的持仓才会根据设置的止盈止损参数进入预埋单监控。

止盈止损条件设置部分（图中红色边框），下面做详细介绍。

- **止盈止损触发条件：**当最新价/买一价/卖一价连续 N 次达到或超过指定价位时触发，默认为 1。
- **止盈价差/价格，止损价差/价格：**设置止盈止损触发条件的触发点，当上述设置的价格连续 N 次达到或超过这里设置的价格时，程序就会下达止盈/止损单。

- **浮动止损：**允许用户设定一个根据市场价格变动而变动的止损价，主要用来锁定利润。
浮动止损只在市场向着用户判断的方向运行时才有效，其参考价格是设定“止损止盈”时的合约价格。
- **平仓价格：**即触发止盈止损条件时，委托平仓时的委托价格，支持加减买卖价/加减最新价/任意价，后面的输入框为加减的数值；任意价即为市价，不支持加减。
- **有效日期：**设置止盈止损平仓委托的有效时段。例如：止盈止损委托下达的日期为 1 月 3 日，有效日期为 1 月 10 日，那么在 1 月 3 日到 1 月 10 日之前，只要行情符合止盈止损触发的条件，那么程序就会下达平仓委托。

【相关参数一】止盈止损价格模式

对于止盈价差/价格、止损价差/价格，当前支持两种价格模，即“绝对价格模式”和“价差模式”，可通过界面个人参数设置-增强交易设置，可以选择止盈止损价格模式，如下图所示：

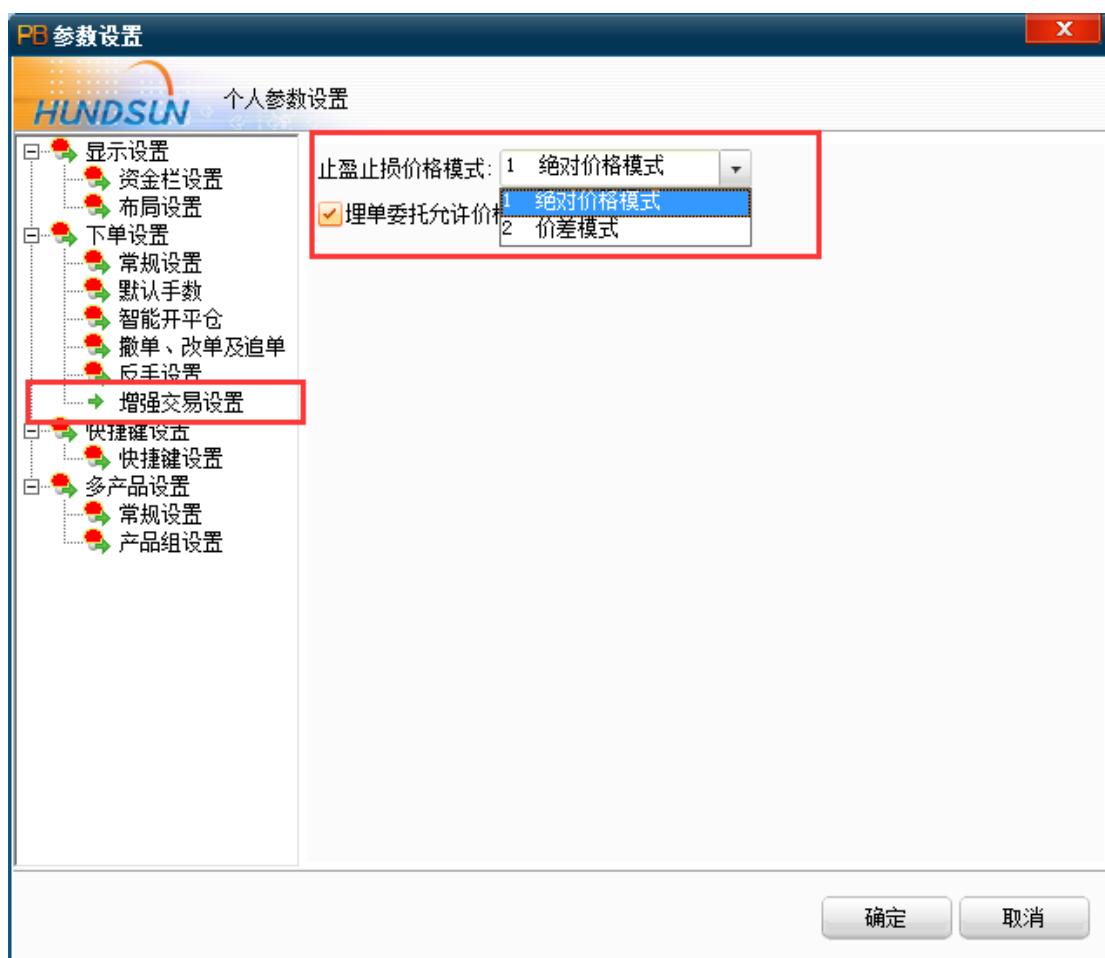


图 3.5.62

当选择“绝对价格模式”时，委托面板显示为止盈价格和止损价格显示，如下图所示：

张停: 4,155.0
超④: 3,768.8
超③: 3,768.6
超②: 3,768.4
超①: 3,768.2
卖一: 3,768.0 21
买一: 3,767.0 1
超①: 3,768.8
超②: 3,768.6
超③: 3,768.4
超④: 3,768.2
跌停: 3,399.8

普通委托 埋单委托 批量委托 止盈止损

产品: 6 期货产品
单元: 3 期货单元
合约: IF1508 IF1508
买卖: 买入 卖出 追单
数量: 1 全部 ≤390
盘口价: 3768

当 最新价 连续: 1 次
达到或超过指定价位时触发

止盈价格: 4000 价差: 232
止损价格: 3500 价差: 268

浮动止损: 0
平仓价格: 任意价 0
有效日期: 2009-01-09

下单 重置

图 3.5.63

输入框中填入理想的止盈止损价格后,系统会计算出止盈止损价格与当前开仓价格的价差。

如果参数设置中选择“价差模式”时,委托栏显示如下所示:

张停: 4,155.0
超④: 3,768.8
超③: 3,768.6
超②: 3,768.4
超①: 3,768.2
卖一: 3,768.0 21
买一: 3,767.0 1
超①: 3,768.8
超②: 3,768.6
超③: 3,768.4
超④: 3,768.2
跌停: 3,399.8

普通委托 埋单委托 批量委托 止盈止损

产品: 6 期货产品
单元: 3 期货单元
合约: IF1508 IF1508
买卖: 买入 卖出 追单
数量: 1 全部 ≤390
盘口价: 3768

当 最新价 连续: 1 次
达到或超过指定价位时触发

止盈价差: 232 价格: 4000
止损价差: 268 价格: 3500

浮动止损: 0
平仓价格: 任意价 0
有效日期: 2009-01-09

下单 重置

图 3.5.64

输入框中输入止盈止损价差,系统会计算出止盈止损价格。

【相关参数二】转换机“期货增强交易”

止盈止损委托成交后,会把成交消息推送给“期货增强交易”的转换机任务,转换机会生成待监控的预埋单记录。转换机会每隔一段时间检查一下这些预埋单记录是否满足设置的止盈止损条件,如果满足就会触发止盈平仓委托或止损平仓委托。“期货增强交易”转换机任务的设置项如下图所示:

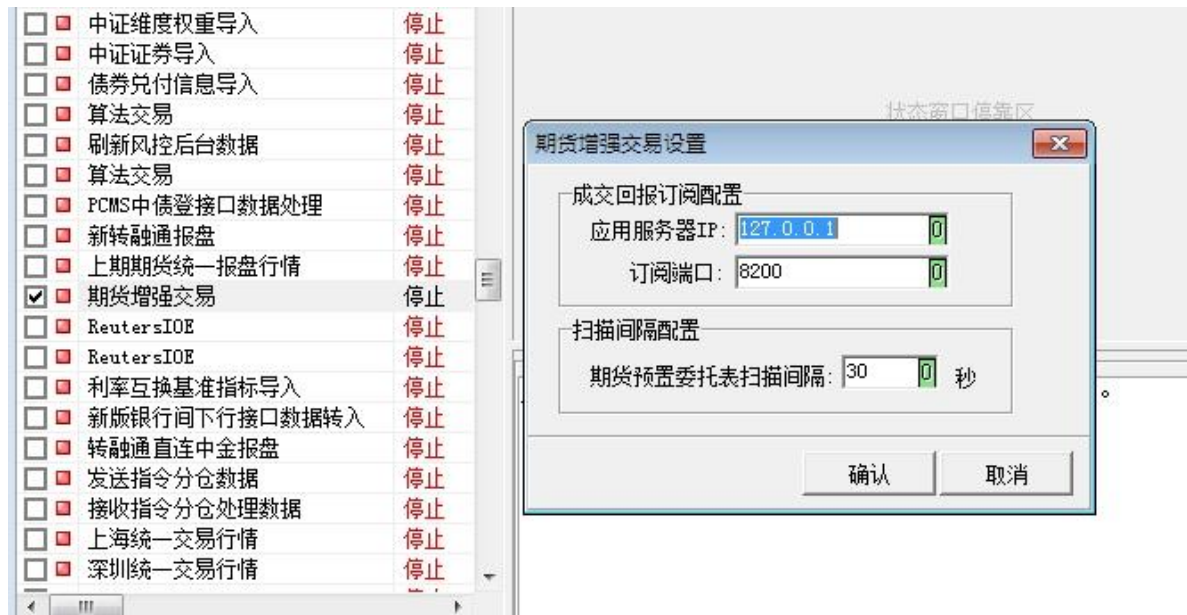


图 3.5.65

应用服务器 IP: 消息中心的 IP 地址，由于接收消息中心推送的成交消息。

订阅端口: 消息中心的端口，由于接收消息中心推送的成交消息。

扫描间隔: 转换机扫描需要监控的预埋单记录的时间间隔。

3.5.2.9 追单

当出现所下单的委托在一定时间内一直未成交的情况下，可通过追单设置，实现自动将原委托信息进行撤单，并产生新的委托单信息。期货追单交易主要是针对于未成委托进行设置策略，由转换机实时监控对应的未成委托，并根据对应的策略完成相关的操作流程。

追单举例

ag1510 下达一笔买入开仓（开仓价格 1800）的追单委托，轮循间隔时 360 秒。委托报单成功后，如果系统监控到在 360 秒内未成交，即撤销原委托，并根据追单设置使用调整后的追单委托价格在原委托基础上下达一笔同数量的新委托。

在下达追单指令前需要在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<撤单、改单及追单>界面的“追单参数”中增加期货品种的追单参数。

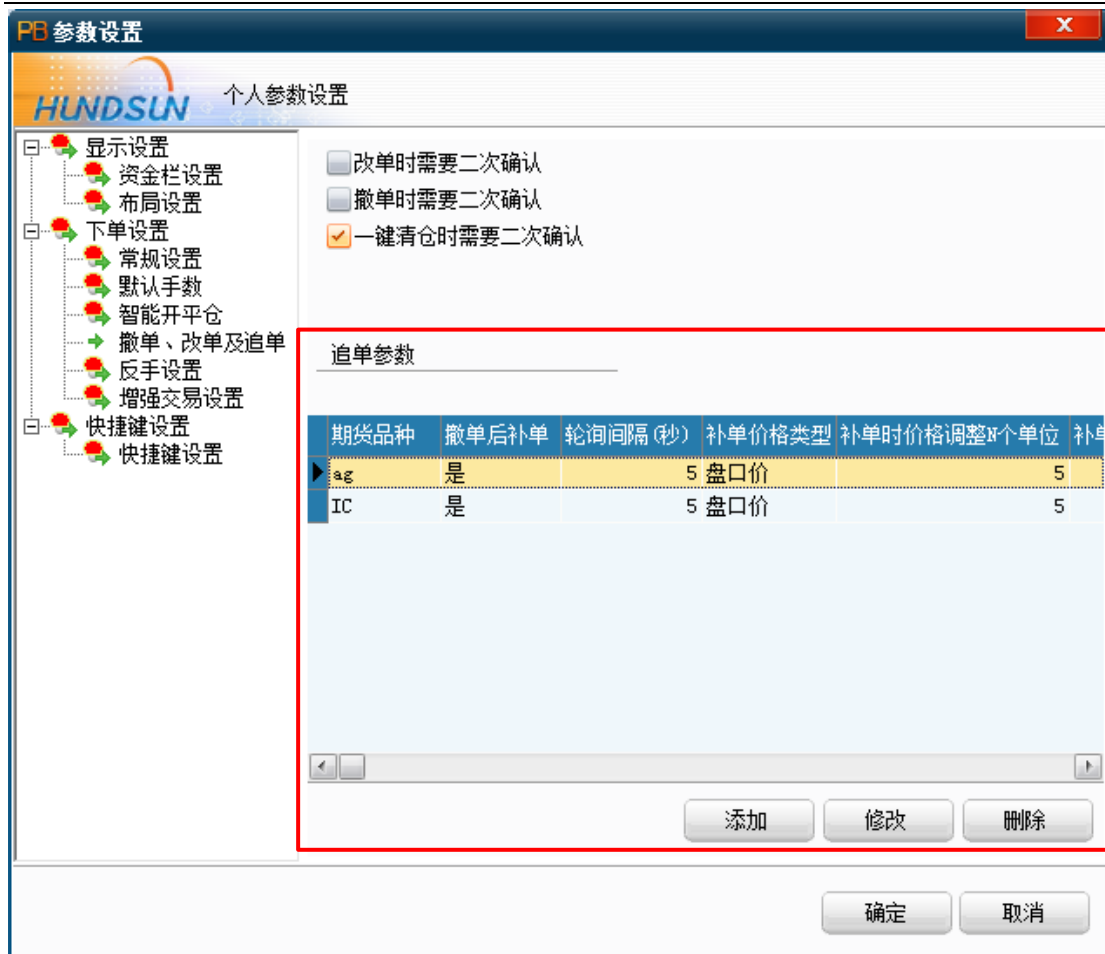


图 3.5.66



图 3.5.67

- **期货品种:** 追单参数中下达选择期货品种。在追单参数中设置的期货品种才能使用追单功能。
- **轮循间隔:** 设置每次补单监控的等待时间。在超过当前设置时间后，系统撤回原委托，

并根据补单设置重新下达委托。

- **撤单后补单：**默认选择，先对原委托进行撤单，撤单成功后再进行补单；如不选择，则仅撤单不补单
- **补单价格：**在补单时价格调整 N 个单位输入补单价格类型，补单时价格调整 N 个单位输入期货补单价格调整单位。在补单时，最终补单价格在补单价格类型上调整 N 个单位。即开仓时，补单价格=价格类型+调整 N 个单位；平仓时，补单价格=价格类型-调整 N 个单位。
- **补单价格上限控制：**使用补单价格不得超过元单位的 N 个价格项设置补单的范围，超过此范围则不再追价。即：开仓时，补单价格上限=价格类型+补单价格不得超过元单位的 N 个价格；平仓时，补单价格上限=价格类型-补单价格不得超过元单位的 N 个价格。

图 3.5.68

在<撤单、改单及追单>界面**添加**追单参数，在弹出追单参数设置界面，依次录入追单要素。完成追单参数设置后，在委托栏勾选**追单**项即可。

注意：

追单适用于【期货单账户】功能下的所有委托类型。

3.5.3 参数设置

3.5.3.1 显示设置

用户在<功能栏>→<参数设置>→<显示设置>界面设置资金栏显示字段和【期货单账户】

界面布局。

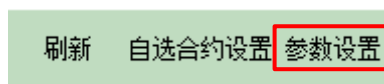


图 3.5.69

3.5.3.1.1 资金栏设置

资金栏设置界面上，选中字段会在资金栏上显示，反之不显示。

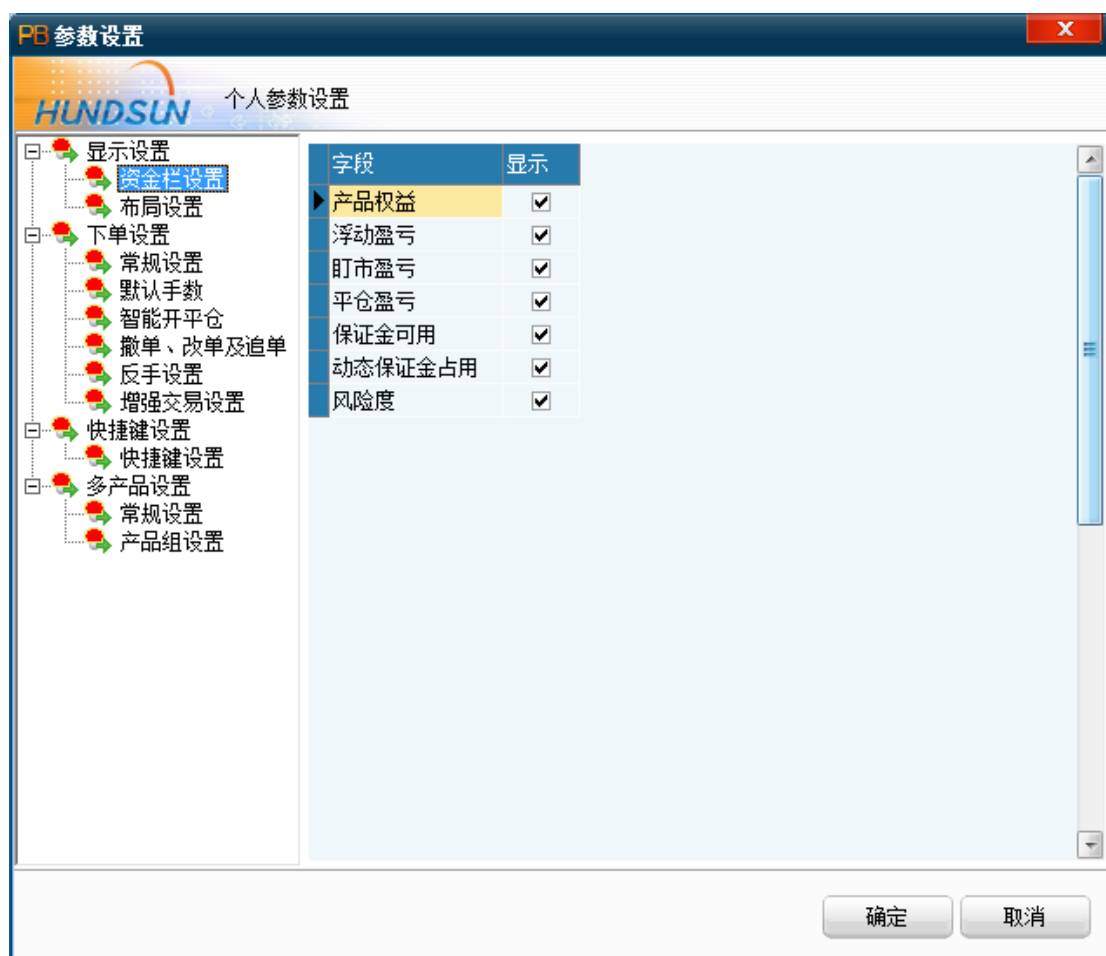


图 3.5.70

3.5.3.1.2 布局设置

在布局设置界面，可选择三种布局方案，更换并确认布局方案后，期货单账户界面会立即刷新。

1) 布局设置一



图 3.5.71



图 3.5.72

2) 布局设置二

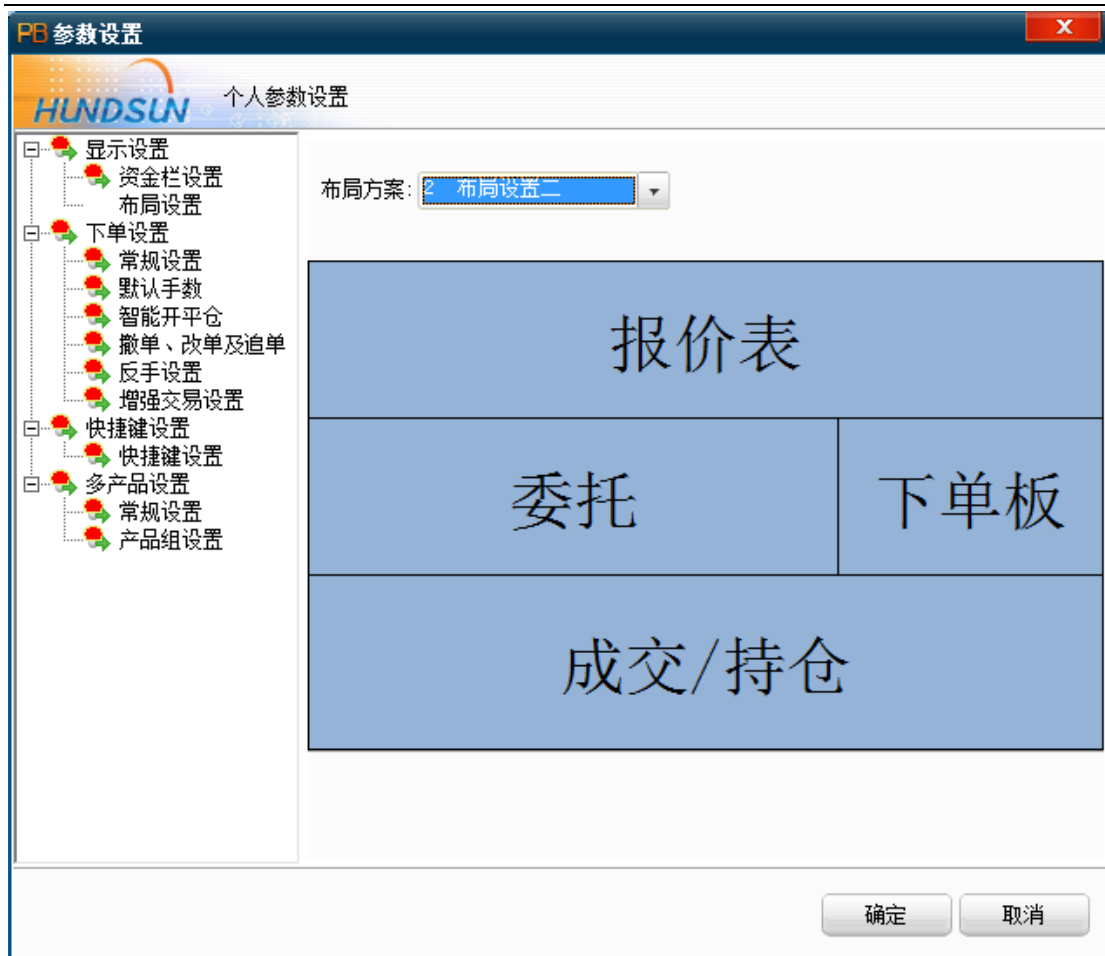


图 3.5.73



图 3.5.74

3) 布局设置三



图 3.5.75



图 3.5.76

3.5.3.2 下单设置

3.5.3.2.1 常规设置

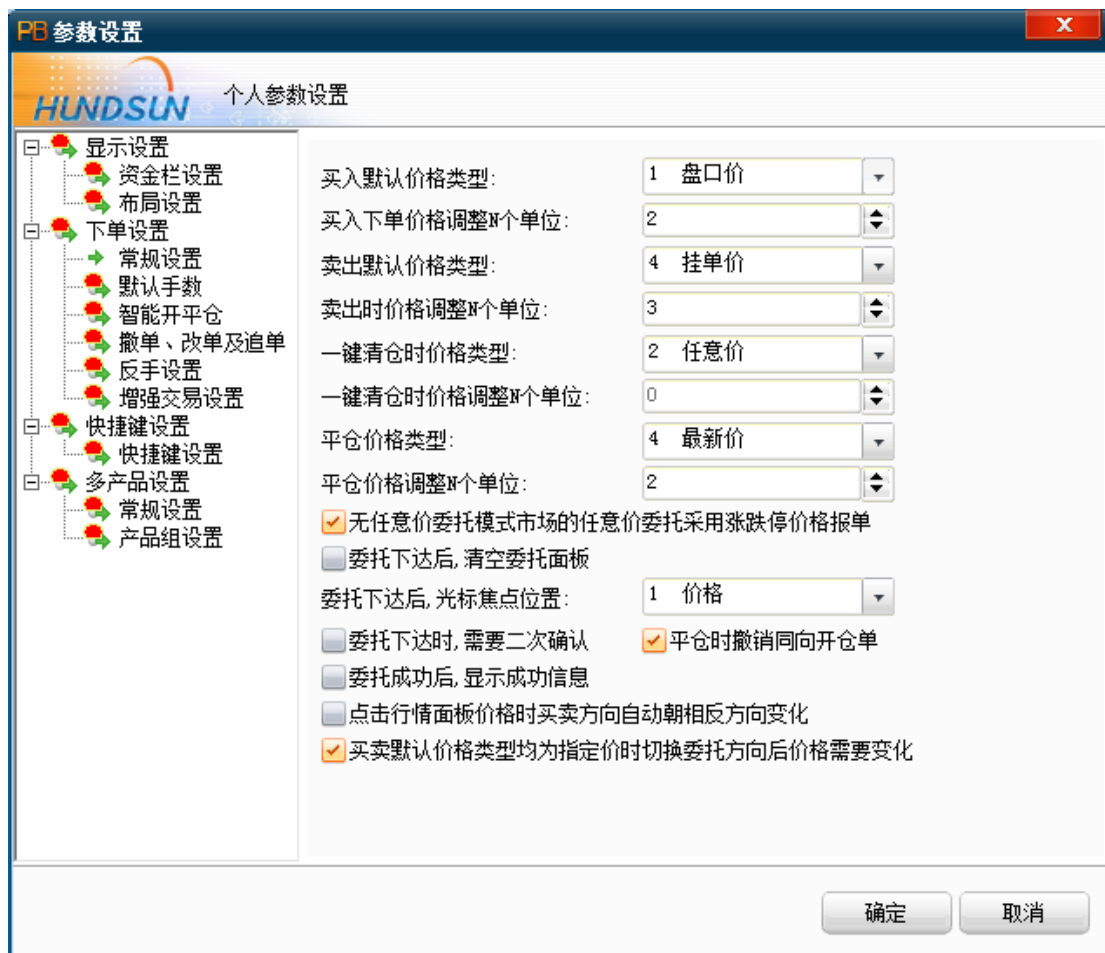


图 3.5.77

买入/卖出默认价格类型：用户在委托栏填写买/卖方向后，价格项默认显示价格类型。“盘口价”是当前行情对手方最优价格；“指定价”默认显示 0；“任意价”即为市价；“挂单价”为当前行情本方最优价格；“最新价”是最新成交价。

买入/卖出下单价格调整 N 个单位：填写买入/卖出默认价格的基础上调整的最小价差数量，
买入默认显示价格=买入默认价格类型+N*最小单位价差，卖出默认显示价格=卖出默认价格类型-N*最小单位价差。

无任意价委托模式的市场的市价采用涨跌停价格报单：对于无任意价模式的市场（如上期所），任意价委托采用涨跌停价格报单。

委托下达完成之后，清空委托面板：委托成功后，清空委托栏和行情栏内容。

委托下达后，光标焦点位置：不勾选“委托下达完成之后，清空委托面板”项，可以配置委

托成功后的焦点位置。

委托下达时，是否二次确认：下单后，是否弹出对话框需要用户二次确认。

委托完成是否显示成功信息：下单成功后，是否弹出成功提示信息。

买卖默认价格类型均为指定价时切换委托方向价格需要变化：勾选后，当买卖默认价格均为指定价时，切换委托方向，则价格调整为对应委托方向的盘口价。

3.5.3.2.2 默认手数

在<默认手数>界面可以对经常交易的合约或品种设置默认手数，提高委托速度。在委托栏填写了合约（品种）、买卖、开平方向后，系统会在<默认手数>设置界面匹配是否有设置合约（品种）、买卖、开平方向的默认手数，如果匹配成功委托栏数量显示默认手数的数量。

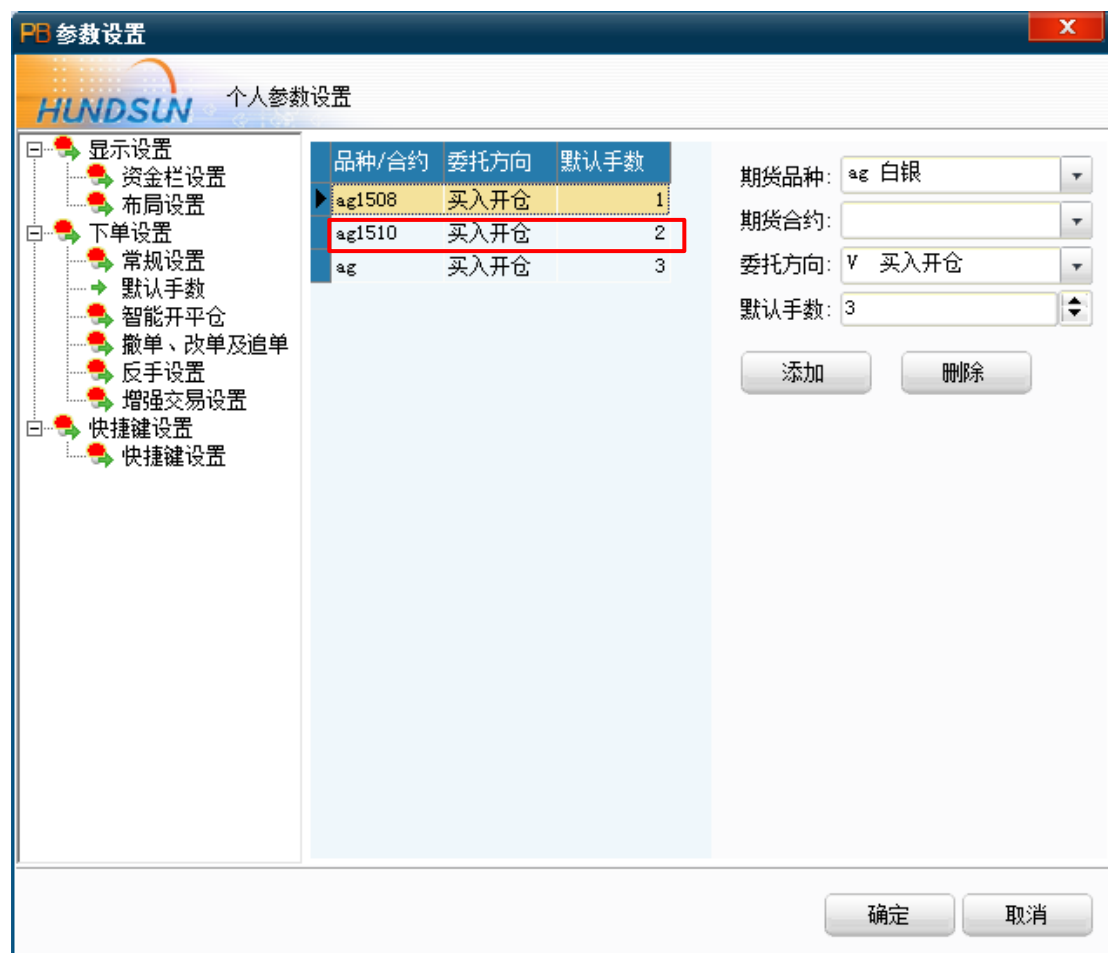


图 3.5.78

普通委托 埋单委托 批量委托 止盈止损

产品: 56 模拟成交2

单元: 3 模拟成交2

合约: ag1510 白银1510

买卖: ☒ 买入 ☐ 卖出 ☐ 追单

开平: 开仓 0 平仓 2

数量: 2 全部

盘口价: 1001

止盈止损: 33281337

下单 重置

图 3.5.79

默认手数举例

如上图在<默认手数>界面设置了一些合约、品种的默认手数，用户在委托栏下单时，输入合约、买卖、开平后，系统匹配到在<默认手数>处已经设置了合约 ag1510 买入开仓的默认手数是 2，系统会在委托栏界面填入 2。

在<默认手数>界面，依次填写参数：

- **期货品种：**填写期货种类。
- **期货合约：**选填项，默认手数支持按品种或合约匹配，如果不填写合约，在该品种下的所有合约都根据该默认手数设置显示默认数量。对于过期的合约，系统自动在默认手数设置和自选行情设置中剔除。
- **委托方向：**选择合约买卖、开平方向。
- **默认手数：**填写默认显示数量。
- **添加：**如果要新增一条默认手数设置，填写完**品种**、**合约**、**方向**、**默认手数**后，点**添加**即可。
- **删除：**如果要删除一条默认手数设置，在默认手数栏中选中设置行，点**删除**即可。

注意：

默认手数可以按合约/合约品种进行设置。当合约和合约品种都设置了默认手数时，以合约设置优先。

3.5.3.2.3 智能开平仓

智能开平仓指在有持仓的情况下优先平仓，如果平仓手数大于持仓手数则反手开仓。在不锁仓的情况下，通过自动开平仓功能提高效率，快捷反手开仓。

智能开平仓功能可用于快速下单，即可省去选择开平方向步骤。如下单手数采用默认，价格根据预先设置，则采用自动开平仓功能，可省去很多操作步骤，很方便的就可完成下单。

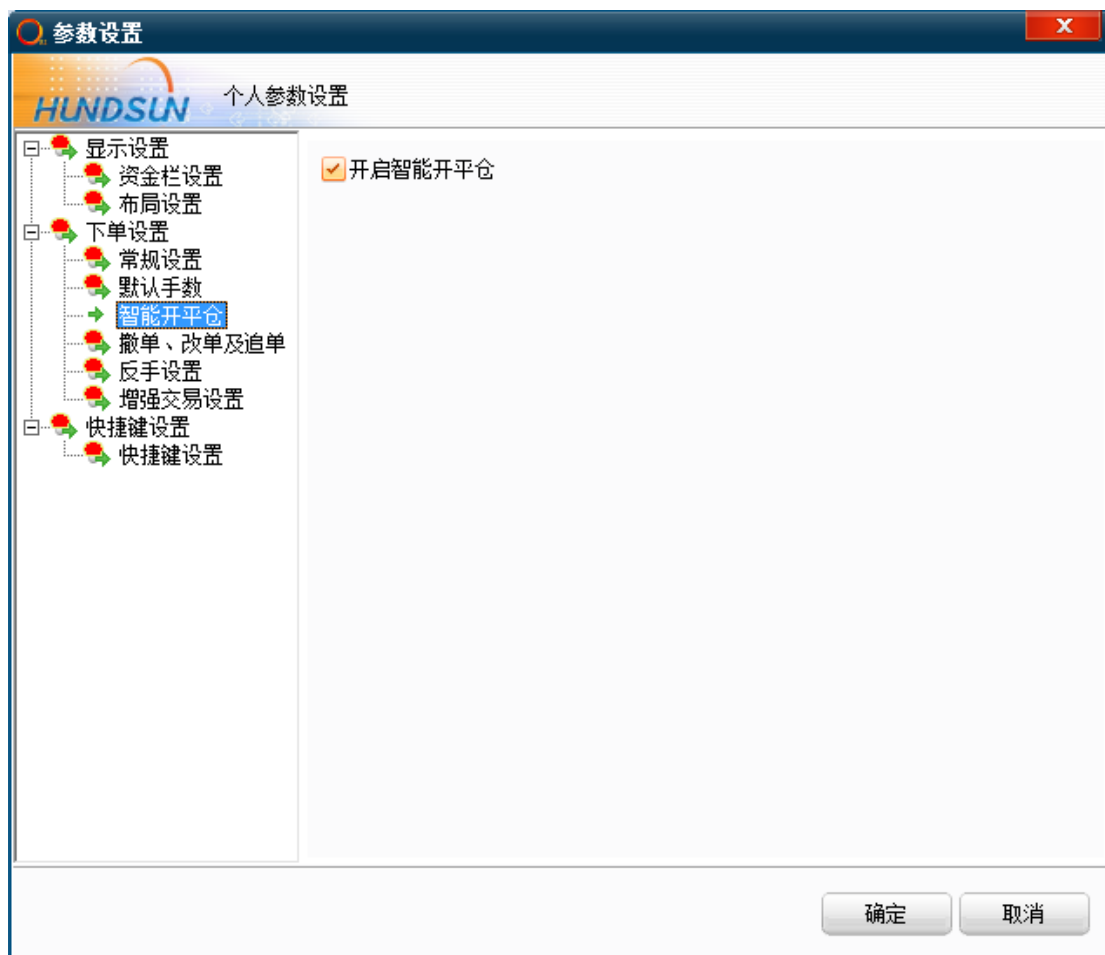


图 3.5.80

涨停: 10,000.0	普通委托	埋单委托	批量委托	止盈止损
超④: 1,001.4	产 品: 56 模拟成交2			
超③: 1,001.2	单 元: 3 模拟成交2			
超②: 1,001.0	合 约: IF1508 IF1508			
超①: 1,000.8	买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出 ☐ 追单			
卖一: 1,000.6 51	开 平: 开仓 0 平仓 0			
买一: 999.6 34	数 量: 1 全部 ≤1664400			
超①: 999.4	指定价: 1000.8			
超②: 999.2	下单 重置			
超③: 999.0				
超④: 998.8				
跌停: 0.0				

图 3.5.81

如果合约有持仓，双击行情或双击持仓填单时，委托栏委托方向自动默认平仓，数量默认为当前持仓数量。

如果用户填入数量小于持仓数量，则委托为平仓并撤销原来的平仓单，平仓数量=填入数量。

如果用户填入数量大于持仓数量，则系统判断委托为开仓，开仓数量=填入数量-持仓数量。

3.5.3.2.4 撤单、改单及追单

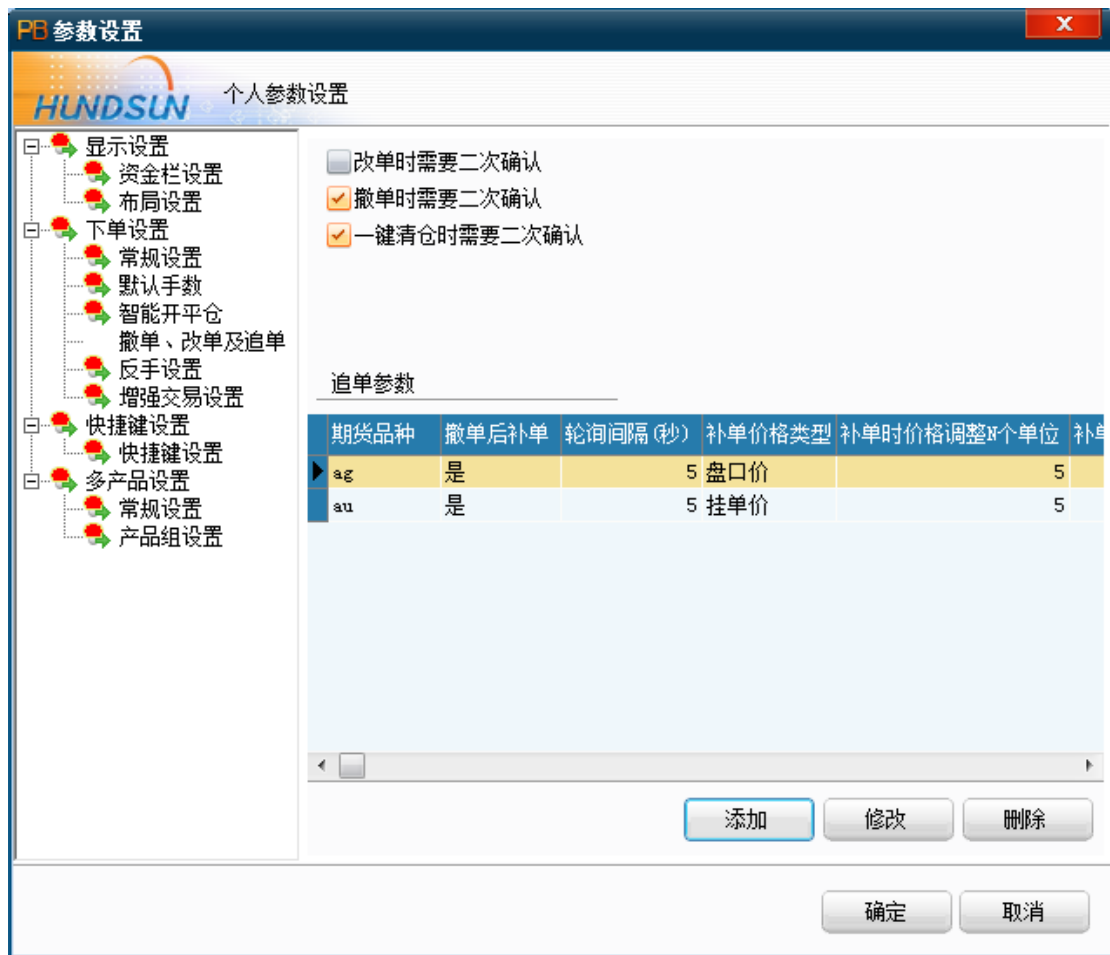


图 3.5.82

改单时是否需要二次确认：在<查询栏>→<挂单>列表执行改单操作时，弹出确认提示框。

撤单时是否需要二次确认：在<查询栏>→<挂单>列表撤单或双击撤单时，弹出确认提示框。

一键清仓时需要二次确认：在<持仓区>使用一键清仓功能时，弹出确认提示框。

3.5.3.3 快捷键设置

在该界面可以设置区域切换、功能、委托方向的快捷键。

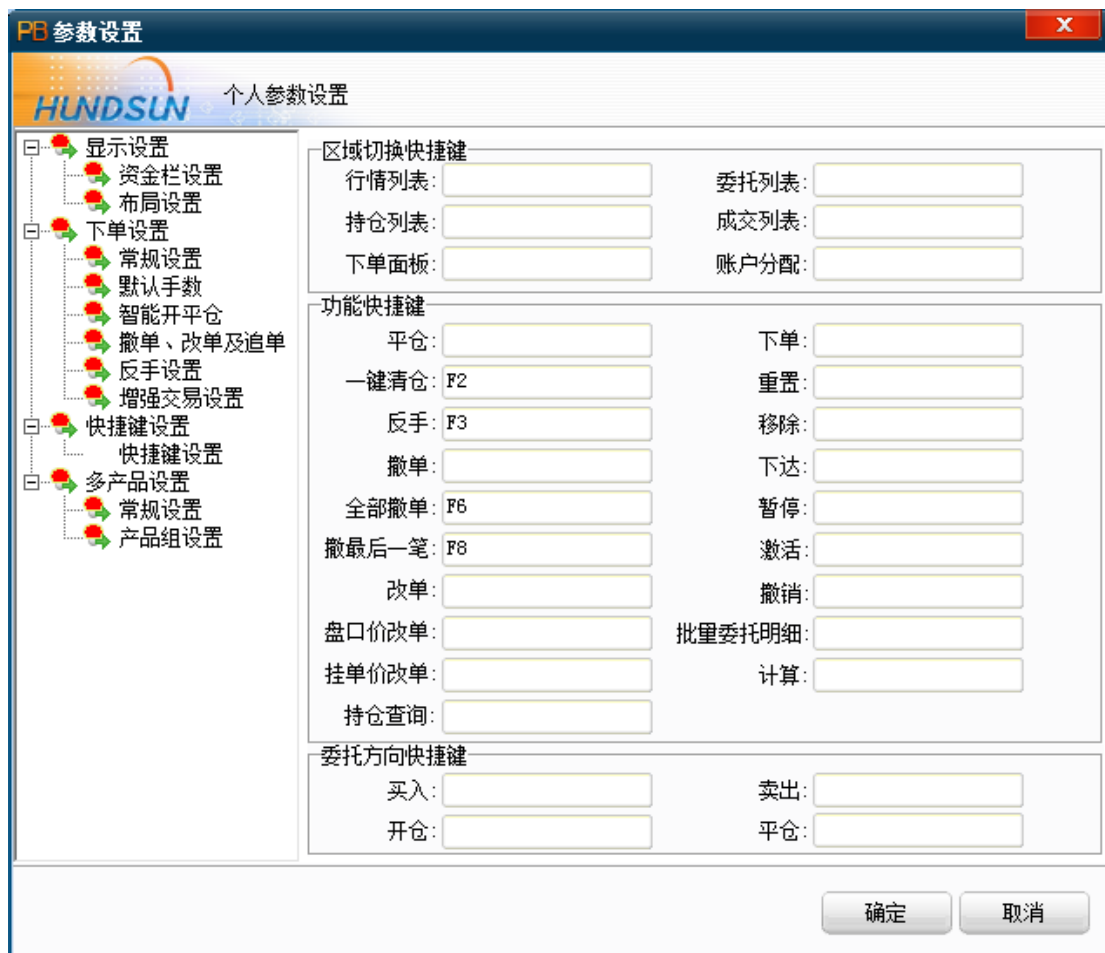


图 3.5.83

3.6 期货交易 - 多账户交易

期货多账户交易与证券多账户交易类似,也是实现用户同时对多个资金账号下达期货委托。

3.6.1 界面

3.6.1.1 主界面

进入【交易管理】→【期货交易】→<期货多账户>后,会出现如下主界面:



图 3.6.1

- **菜单栏**：期货交易菜单栏。期货交易分为<期货单账户>、<期货多账户>两个标签功能页。
- **功能栏**：在该区域中设置自选合约和个人参数设置，详细说明请查看[功能栏](#)页面。
- **报价栏**：该区域用于显示期货行情。关于行情栏的详细说明请查看[报价栏](#)页面。
- **持仓区**：该区域显示产品单元持仓详情，关于持仓区的详细说明请查看[持仓区](#)页面。
- **行情栏**：显示委托栏输入合约的盘口价详情，请查看[合约栏](#)页面。
- **委托栏**：用户在这里输入委托要素，进行下单。关于委托区的详细说明请查看[委托栏](#)页面。
- **查询区**：用户可以在该区查询委托、撤单，详情请查看[查询区](#)页面
- **成交栏**：显示期货单元的合约成交详情，详情请查看[成交栏](#)页面。

3.6.1.2 功能栏

<期货多账户>功能栏界面如下。

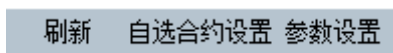


图 3.6.2

- **刷新**：手工刷新<期货多账户>界面。
- **自选合约设置**：在此处设置自选合约，自选合约会在<报价栏>内显示为独立标签卡，具体操作请查看[自选合约设置](#)页面。

- **参数设置：**在选项弹出界面可以进行多账户参数设置

3.6.1.3 持仓区

〈期货多账户〉持仓区界面分为〈账户分配〉、〈持仓查询〉两个标签页。



图 3.6.3

3.6.1.3.1 账户分配

〈账户分配〉界面显示如下，显示〈委托栏〉输入的产品组的所有账户委托详情，显示本次委托每个产品、单元的买卖方向、开平仓数量、下单总量、可平数量、保证金等。

列表中开仓数量和平仓数量字段可以修改，详细操作请见下[多账户委托](#)界面。

选择	产品	单元	权重/倍数	买卖	开仓数量	平仓数量	总下单数量	可平数量	可用保证金	风险度(%)	账户权益
☒	模拟成交2	模拟成交2	1		0	111	111	0	-2,100,000.00	0.000	499,700.00
☒	期货组合单	缺省单元	1		111	0	111	0	-68,934,000.00	0.000	934,000.00
☒	模拟成交2	模拟成交2	2		0	0	0	0.9			101,828,788.00

图 3.6.4

3.6.1.3.2 持仓查询

〈持仓查询〉界面显示〈委托栏〉选择的产品组内所有账户的持仓、详情。

合约代码	合约名称	买卖	持仓	可用	持仓均价	浮动盈亏	盯市盈亏	静态保证金占用	投资类型	产品编号	产品名称
ag1508	白银1508	买	140	140	510.616	1,028,967.00	1,028,967.00	214,458.60	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	买	50	50	1.000	749,700.00	749,700.00	150.00	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	买	90	90	793.736	279,267.00	279,267.00	214,308.60	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	卖	199	196	1.000	-2,983,806.00	2,983,806.00	597.00	投机	56	模拟成交2
ag1509	白银1509	买	21,212	21,199	2,460.267	464,564,121.00	4,564,121.00	156,561,551.40	投机	混合	
ag1509	白银1509	卖	42	42	1,974.176	613,605.00	613,605.00	248,746.20	投机	56	模拟成交2

图 3.6.5

- **按条件汇总：**使用界面右下角“按条件汇总”后，该界面按照合约代码、买卖合并显示，点击加号按钮可以查看汇总行下包含的明细持仓。

账户分配

持仓查询

合约代码	合约名称	买卖	持仓	可用	持仓均价	浮动盈亏	盯市盈亏	静态保证金占用	投资类型	产品编号	产品名称
ag1508	白银1508	买	50	50	1.000	750,150.00	750,150.00	150.00	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	买	90	90	793.736	280,077.00	280,077.00	214,308.60	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	卖	150	150	1.000	-2,250,450.00	2,250,450.00	450.00	投机	56	模拟成交2
ag1508	白银1508	卖	49	46	1.000	-735,147.00	-735,147.00	450.00	投机	56	模拟成交2
ag1509	白银1509	买	10,212	10,199	3,837.366	434,780,937.00	4,780,937.00	117,560.00	投机	56	模拟成交2
ag1509	白银1509	买	11,000	11,000	1,181.818	-30,165,000.00	3,165,000.00	39,000,000.00	投机	4	期货组合单

持仓查询

布局设置

平仓

一键清仓

● 不汇总

● 按合约汇总

图 3.6.6

在界面上点击右键，在弹出的右键菜单里可以执行如下操作：

- **持仓查询：**选择“持仓查询”，在弹出查询界面依次输入查询要素，确认后界面根据条件进行筛选显示。如果需要恢复显示，在查询界面中点**重置**即可。

PB 查询

HUNDSUN 请设置持仓查询条件

产品: 56 模拟成交2 投资类型: a 投机

单元: 2 模拟成交2缺省 合约: ag1508 白银1508

持仓类型: 1 多仓

确定 取消 重置

图 3.6.7

- **布局查询：**详细操作见[布局设置](#)页面。

3.6.1.4 行情栏

双击报价栏合约、持仓区合约或在委托栏输入**合约**后，该区域会显示合约一档行情，超

①行情价格一档行情的基础上分别加减最小单位价差获得。

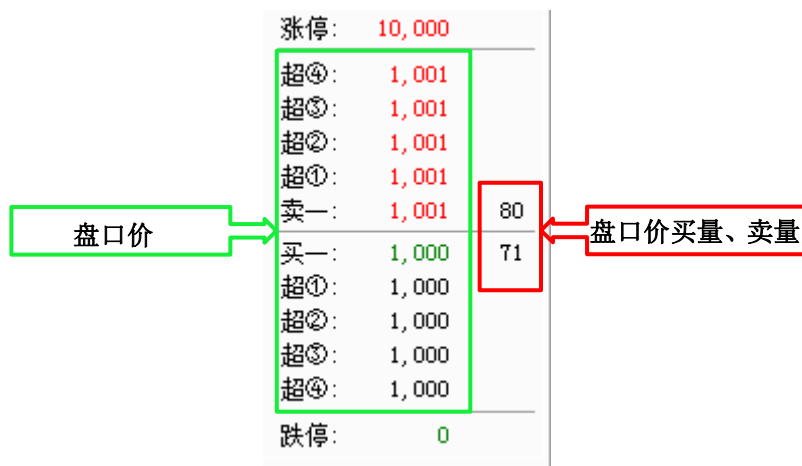


图 3.6.8

涨停: 显示合约涨停价。

跌停: 显示合约跌停价。

3.6.1.5 委托栏

委托栏界面如下:

图 3.6.9

产品组: 在该项填写多账户产品组，产品组操作请查看[产品组维护](#)页面。

策略: 下拉框内可以选择的多账户委托策略方式有“按权重分配”，“按倍数乘”，“按期货权益分配”，“按可用保证金分配”，“按期货权益向首账户对其”。系统根据设置策略分配产品组内每个账户的委托数量。

买卖: 通过买卖项选择合约涨跌方向，有“买入”和“卖出”两个选项。

开平: 通过开平项选择委托方向，有“开仓”和“平仓”两个选项。

数量：输入委托手数。

价格：点击价格可以在显示栏中选择“盘口价”，“指定价”，“任意价”，“挂单价”，“最新价”，选定价格后会自动填入价格。在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<常规设置>

“买入、卖出默认价格类型”处设置默认显示价格类型，详细操作请查看下单设置页面。

计算：根据策略、数量，手工刷新<持仓区>→<账户分配>界面每个资金账户的开仓/平仓数量。

下单：点击下单按钮执行下单操作。

重置：清空委托栏，和合约栏显示内容。

3.6.1.6 查询区

查询区由<可撤委托>,<所有委托>两个标签页组成。

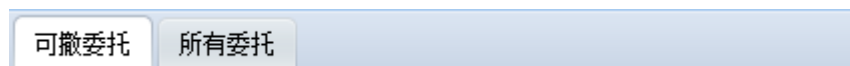


图 3.6.10

3.6.1.6.1 可撤委托

该标签页显示委托状态是“正报”，“未报”，“未成”或“部成”的可撤销委托挂单，详细操作请查看[撤单、改单](#)页面。

在页面右键弹出菜单选项可以“全选”列表、“反选”未勾选项和“布局设置”，布局设置操作请查看[布局设置](#)页面。

可撤委托 所有委托 手工单 预埋单监控												
选择	委托时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	委托数量	成交数量	委托状态	委托序号	价格类型	委托价格	成交均价
☒	14:47:00	IC1509	IC1509	买入	开仓	3	0	未报	114296	限价	7,833.000	0.00
☐	09:37:18	IF1508	IF1508	买入	开仓	5	0	未报	101569	限价	3,826.800	0.00

撤单 全部撤单 撤最后一笔 改单 盘口价改单 挂单价改单

图 3.6.11

3.6.1.6.2 所有委托

用户可以在该标签页查看当日所有委托。通过右键菜单可以进行布局设置，详细操作见[布局设置](#)页面。

可撤委托

所有委托

	委托序号	委托时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	委托数量	成交数量	委托状态	委托批号	价格类型	委托价格	成交均价
	21537	16:52:45	a1601	豆一号1601	买入	开仓	1	0	已撤	9441	限价	4,325.000	0.00
	21536	16:52:45	a1601	豆一号1601	买入	开仓	1	0	已撤	9441	限价	4,325.000	0.00
	21076	18:58:35	a1701	豆一号1701	买入	开仓	1	0	已撤	9441	限价	4,325.000	0.00
	17183	13:39:43	a11508	铝1508	卖出	开仓	2	0	已撤	8657	限价	12,000.000	0.00

布局设置

☒ 不汇总

☐ 按批号汇总

图 3.6.12

3.6.1.7 成交栏

成交栏显示当日已成交的委托。

成交序号	成交时间	合约代码	合约名称	买卖	开平
31882	09:31:52	ag1602	白银1602	买入	开仓
31364	12:47:25	ag1509	白银1509	卖出	平仓
31363	12:40:37	ag1509	白银1509	卖出	平仓
31362	12:38:26	ag1509	白银1509	卖出	平仓
31361	12:36:22	ag1509	白银1509	卖出	平仓
31360	12:35:24	ag1509	白银1509	卖出	平仓
31359	12:33:51	ag1509	白银1509	卖出	平仓
31358	12:33:07	ag1509	白银1509	卖出	平仓

图 3.6.13

通过右键弹出菜单，可以进行如下操作：

布局设置：选择<布局设置>，对当前页面的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置。

详细操作见[布局设置](#)页面。

显示成交明细：如果出现一笔委托多次成交的情况，会出现委托序号相同但成交序号不同的行，系统默认显示每一笔成交详情。

按委托序号汇总：委托序号相同成交行汇总显示，点击打开可以查看汇总的包含的明细。汇总行的成交价格=SUM（明细成交价格）/SUM（明细成交数量）。

成交序号	成交时间	合约代码	合约名称	买卖	开平
共[1]条	09:31:52	ag1602	白银1602	买入	开仓
31882	09:31:52	ag1602	白银1602	买入	开仓
共[1]条	12:47:25	ag1509	白银1509	卖出	平仓
共[1]条	12:40:37	ag1509	白银1509	卖出	平仓
共[1]条	12:38:26	ag1509	白银1509	卖出	平仓
共[1]条	12:36:22	ag1509	白银1509	卖出	平仓
共[1]条	12:35:24	ag1509	白银1509	卖出	平仓
共[1]条	12:33:51	ag1509	白银1509	卖出	平仓

图 3.6.14

按证券代码、委托方向汇总：证券代码、委托方向相同成交的汇总显示。汇总行的成交价格=SUM（明细成交价格）/SUM（明细成交数量）。

	成交序号	成交时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	
+	共[1]条	09:31:52	ag1602	白银1602	买入	开仓	
-	共[25]条		ag1509	白银1509	卖出	平仓	
	31364	12:47:25	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
	31363	12:40:37	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
	31362	12:38:26	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
	31361	12:36:22	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
	31360	12:35:24	ag1509	白银1509	卖出	平仓	
	31359	12:33:51	ag1509	白银1509	卖出	平仓	

图 3.6.15

3.6.2 交易

3.6.2.1 产品组维护

在期货交易时，会出现一个投顾对多个账户下达同一策略委托的情况。使用期货多账户交易可以满足多个账户同时下达的需求。

期货多账户交易支持批量下单、批量撤单、对账户分组管理、多样化的下单分配策略。

在使用<期货多账户>功能下单前，要在<功能栏>→<参数设置>→<多产品设置>→<产品组设置> 界面新增产品组，对产品组批量下单。

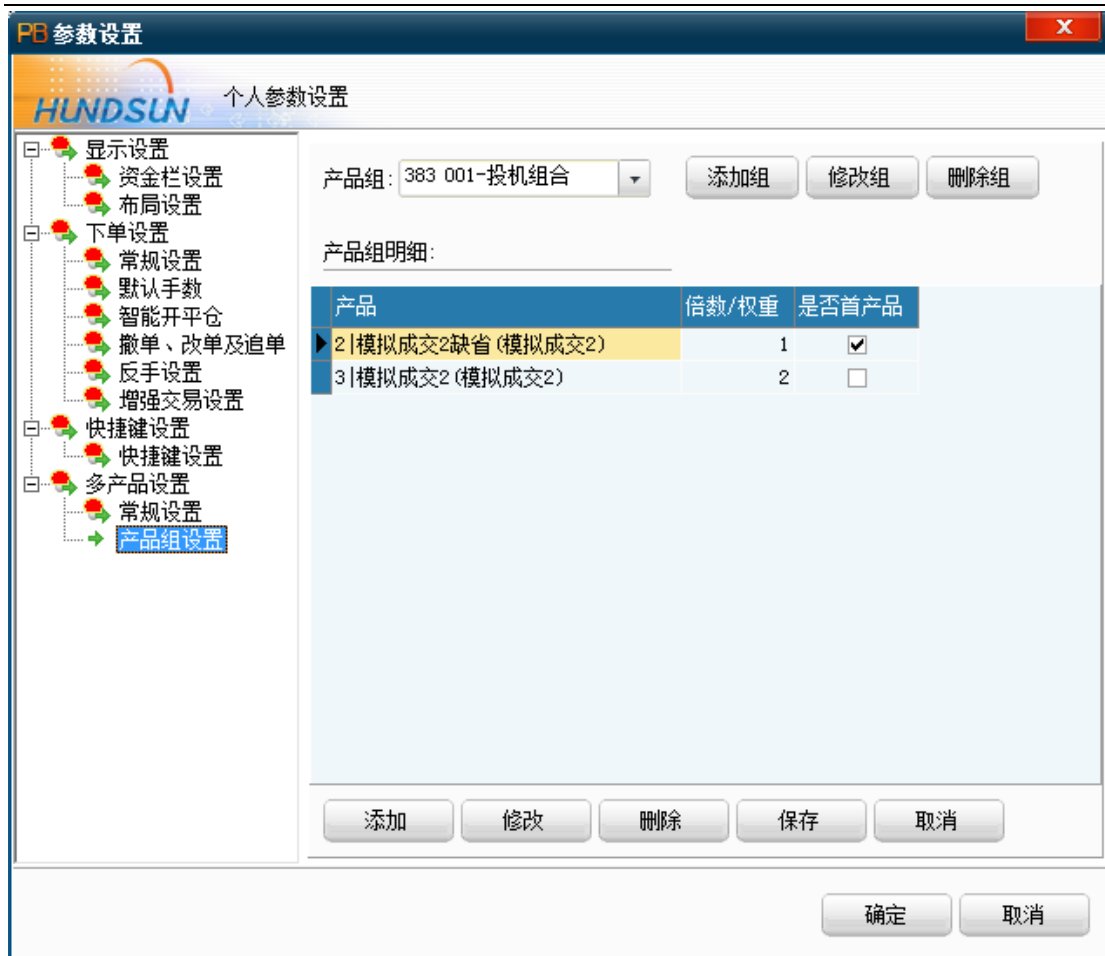


图 3.6.16

- **新增产品组:** 在界面点**添加组**，在弹出账户组窗口输入产品组编号和产品组名称。在产品组下拉框中选择产品组，点击**添加**，依次输入产品组要素，保存后产品组明细不能随意修改。



图 3.6.17

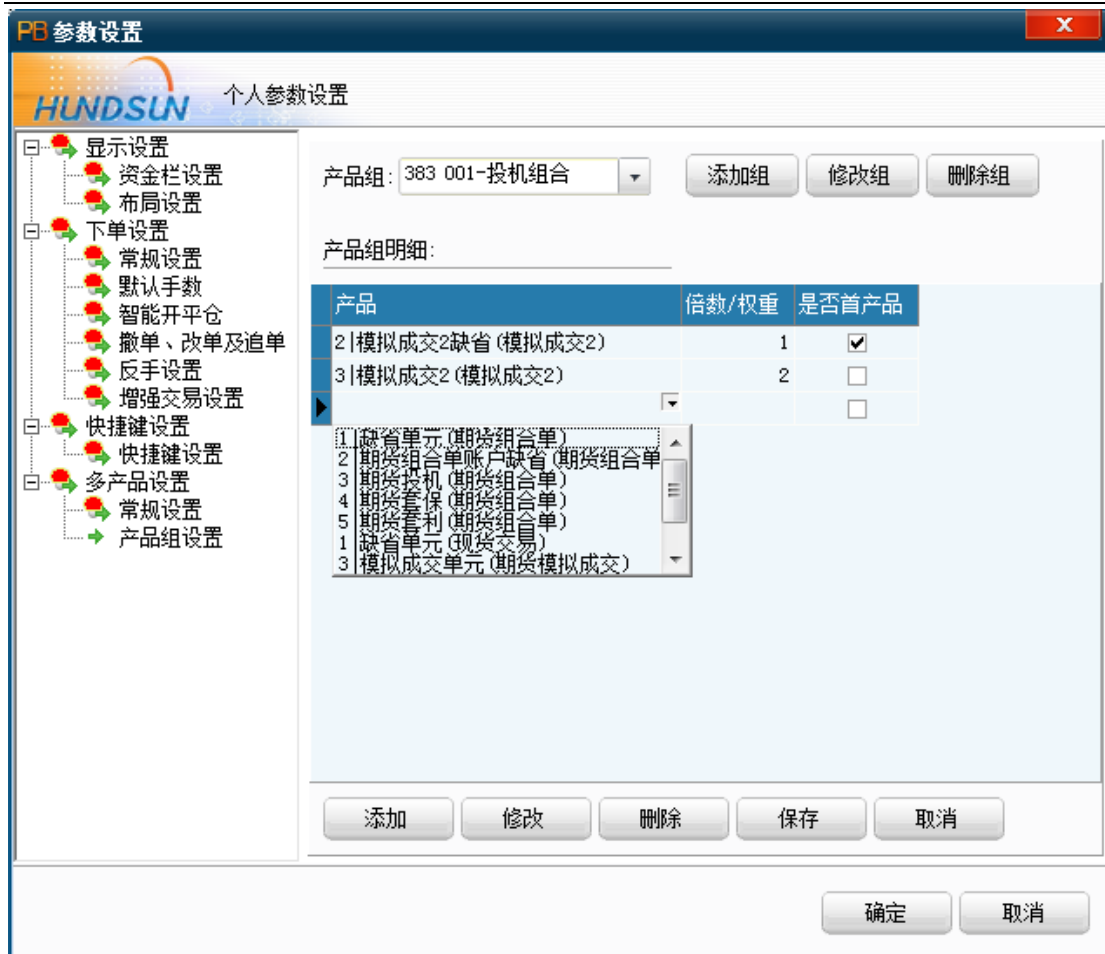


图 3.6.18

- **修改产品组：**在产品组下拉框选中待修改的产品组，点**修改组**，在弹出账户组窗口调整“产品组编号”，“产品组名称”。如果要修改产品组明细，选择产品**修改**，即可修改该行内容。
- **删除产品组：**选中产品组下拉框需要删除的产品组，点**删除组**按钮即可删除产品组。如果要删除产品组明细，选择产品**删除**，即可删除该行。

3.6.2.2 下多账户委托

3.6.2.2.1 多账户委托

期货多账户委托与单账户的普通委托类似，系统通过用户在委托栏设置的**策略**分配产品组内每个单元数量，以下先对多账户委托的基本委托流程进行说明：



图 3.6.19

在<委托栏依>次录入委托要素，点击下单按钮下单。

- **锁定：**可以使用 产品组、策略、合约 右侧的锁定符对这几项委托要素内容进行锁定，委托要素为灰色，表示不能修改。重新点击锁定符解锁后，才能够修改委托要素内容。
- **委托产品、单元：**输入 产品组，光标焦点移开后，在<账户分配>界面选择本次委托单元。
- **行情：**输入完 合约，焦点转移后，系统会自动显示刷新左侧行情栏的显示内容。
- **委托方向：**选中买卖项后，系统自动填入<账户分配>界面中的买卖字段。
- **委托数量：**填写 数量，焦点移动或点 计算，系统依据委托栏的策略分配刷新每个账户的委托数量。用户可以手工修改<账户分配>的开仓数量、平仓数量。
- **价格类型：**单击界面上 价格类型 位置，可下拉选择其他价格类型。如果选择“盘口价”，“挂单价”或“最新价”，价格栏数值会随着行情变化。
- **委托批号：**批量下单成功后，生成多笔委托，同一批多账户委托的委托批号相同。

3.6.2.2.2 委托策略

期货多账户委托根据策略分配产品组内每个单元的开平仓数量，接下来将根据用户输入不同策略的数量分配方式做详细说明。

- **策略输入“按权重分配”。**在委托栏数量项输入总手数，焦点移动后，系统刷新委托数量。如果开平项为开仓，则产品组账户的开仓数量=数量*权重/SUM（权重）；如果开平项为平仓，则平仓数量=数量*权重/SUM（权重）。



图 3.6.20

- **策略输入“按倍数乘”。**在委托栏数量项输入单笔数量，焦点移动后，系统刷新委托数量。如果开平项为开仓，则产品组账户的开仓数量=数量*倍数；如果开平项为平仓，则平仓数量=数量*倍数。



图 3.6.21

- 策略输入“按期货权益分配”。在数量项输入总手数，焦点移动后，系统按照当前账户权益刷新委托数量。如果开平项为开仓，则产品组账户的开仓数量=数量*账户权益/SUM（产品组账户权益）；如果开平项为平仓，则平仓数量=数量*账户权益/SUM（产品组账户权益）。



图 3.6.22

- 策略输入“按可用保证金”，只支持开仓委托，输入策略后开平项不能选择。在委托栏数量项输入总手数，然后按照当前可用保证金进行比例分配。如果开平项为开仓，则产品组账户的开仓数量=数量*可用保证金/SUM（产品组可用保证金）；如果开平项为平仓，则平仓数量=数量*可用保证金/SUM（产品组可用保证金）。



图 3.6.23

- 策略输入“按期货权益向首账户对其”。产品组的首账户的下单手数与委托栏数量相等，其它账户的委托手数=数量*（账户权益/首账户权益）。



图 3.6.24

注意：

1) 目前策略的数量分配时，默认产品组内所有账户参与分配。

2) 下单后，系统自动过滤可用保证金不足的账户。

【相关参数一】小数处理模式

多账户分配数量可能会出现小数，在<参数设置>→<多产品设置>→<常规设置>界面的“分配时小数圆整方式”处可以设置。例如 30.3 手，设置“四舍五入”时显示 30 手，按“舍弃小数”方式为 30 手，按“小数进位”方式为 31 手。

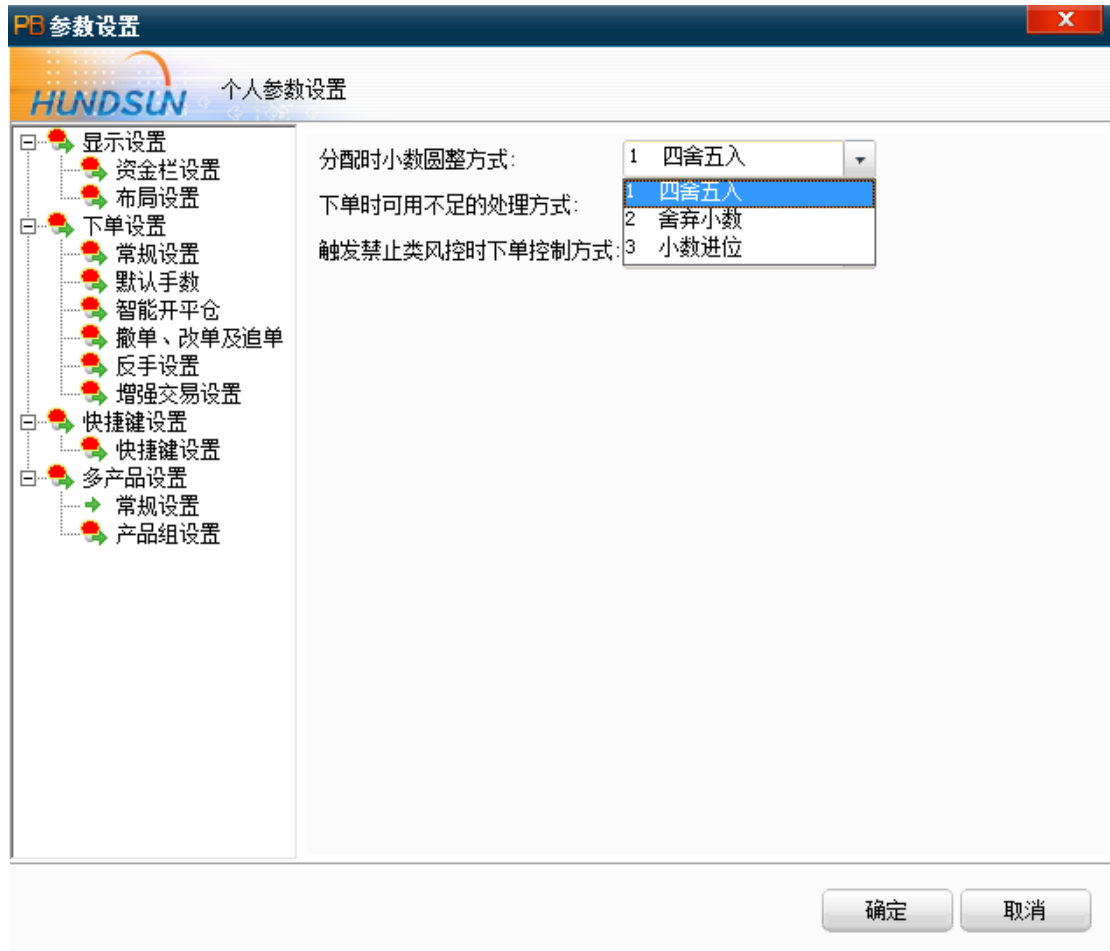


图 3.6.25

【相关参数二】可用不足账户下单

多账户下单时，如果出现某一单元可用金额不足的情况，需要用户在此处设置系统的默认下单方式。如果选择“剔除并下达”，在下单时剔除可用不足的单元，其他单元下达委托。选择“剔除并返回”则是将账户列表中可用不足的单元去掉勾选，但不下达委托。选择“取消”就不做任何操作，直接取消下单。

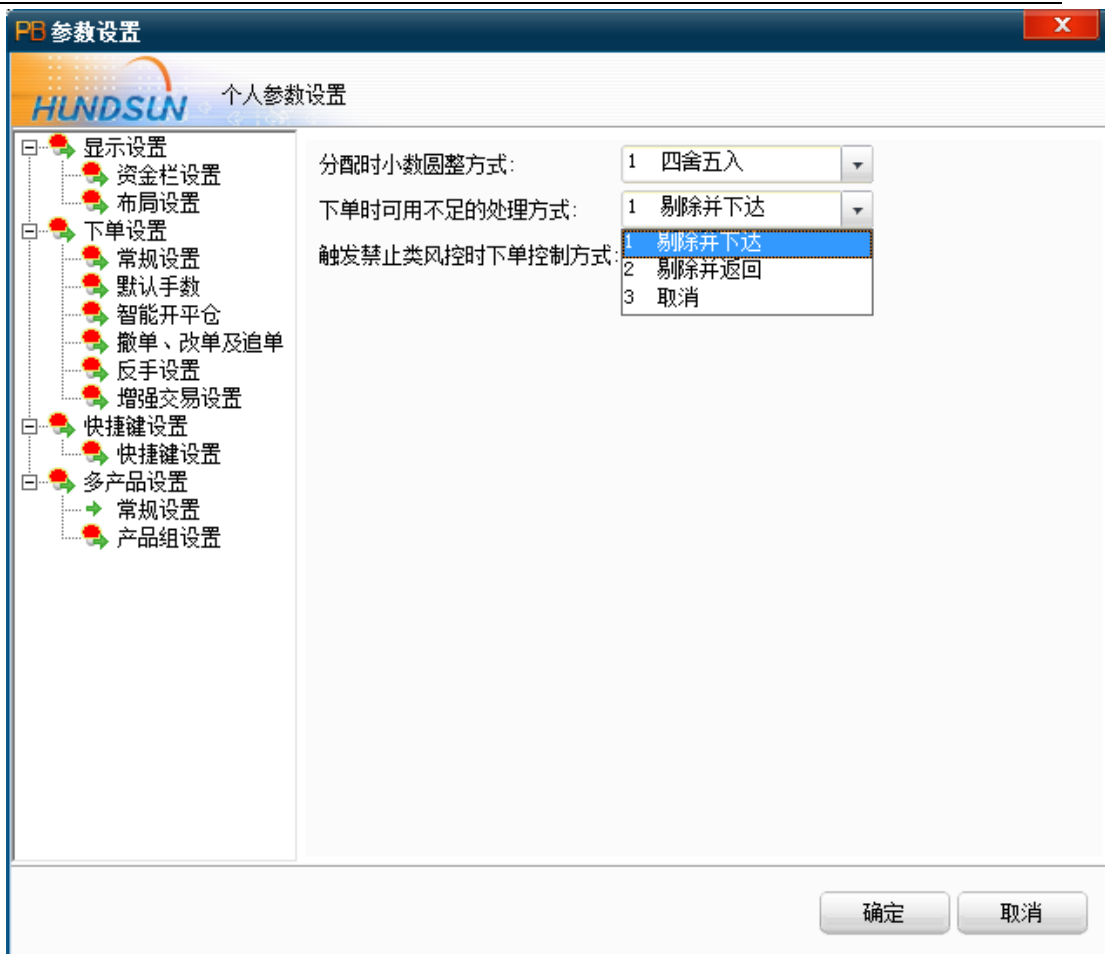


图 3.6.26

【相关参数三】产品组内单元触发禁止类风控

“触发禁止类风控时下单控制方式”主要是为了设置当出现在多账户下单，其中一个单元触发了禁止类风控时，系统对这笔多账户委托的下单处理。可以选择“所有下单都失败”，顾名思义就是其中一条触发，所有单元均无法下单，还可以选择“仅触发禁止风控的委托下单失败”，则是在下单时，剔除触发禁止类风控的单元，其他单元正常下单。

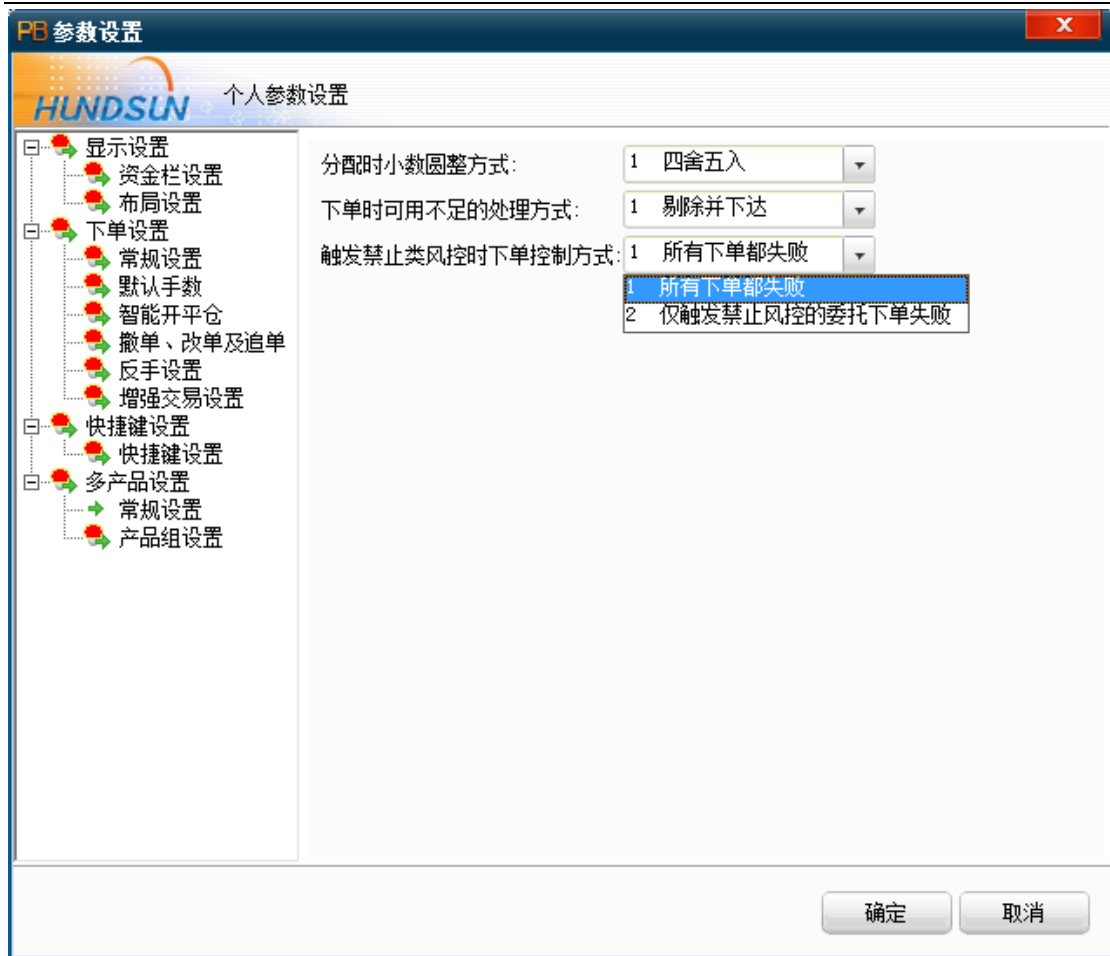


图 3.6.27

【相关参数四】智能开平仓

在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<智能开平仓>界面，勾选“开启智能开平仓”选项后，【期货多账户】委托栏的开仓、平仓按钮不可选。

用户在委托栏填入数量后，系统根据策略计算出每一个单元目标委托数量。如果用户目标委托数量小于持仓数量，则委托为平仓，平仓数量=目标数量，开仓数量是 0。如果用户目标数量大于持仓数量，则系统判断委托为开仓、平仓都有，开仓数量=目标数量-持仓数量，平仓数量=持仓数量。

系统显示的委托栏开仓=SUM（<持仓区>开仓数量），委托栏开仓=SUM（<持仓区>平仓数量）。

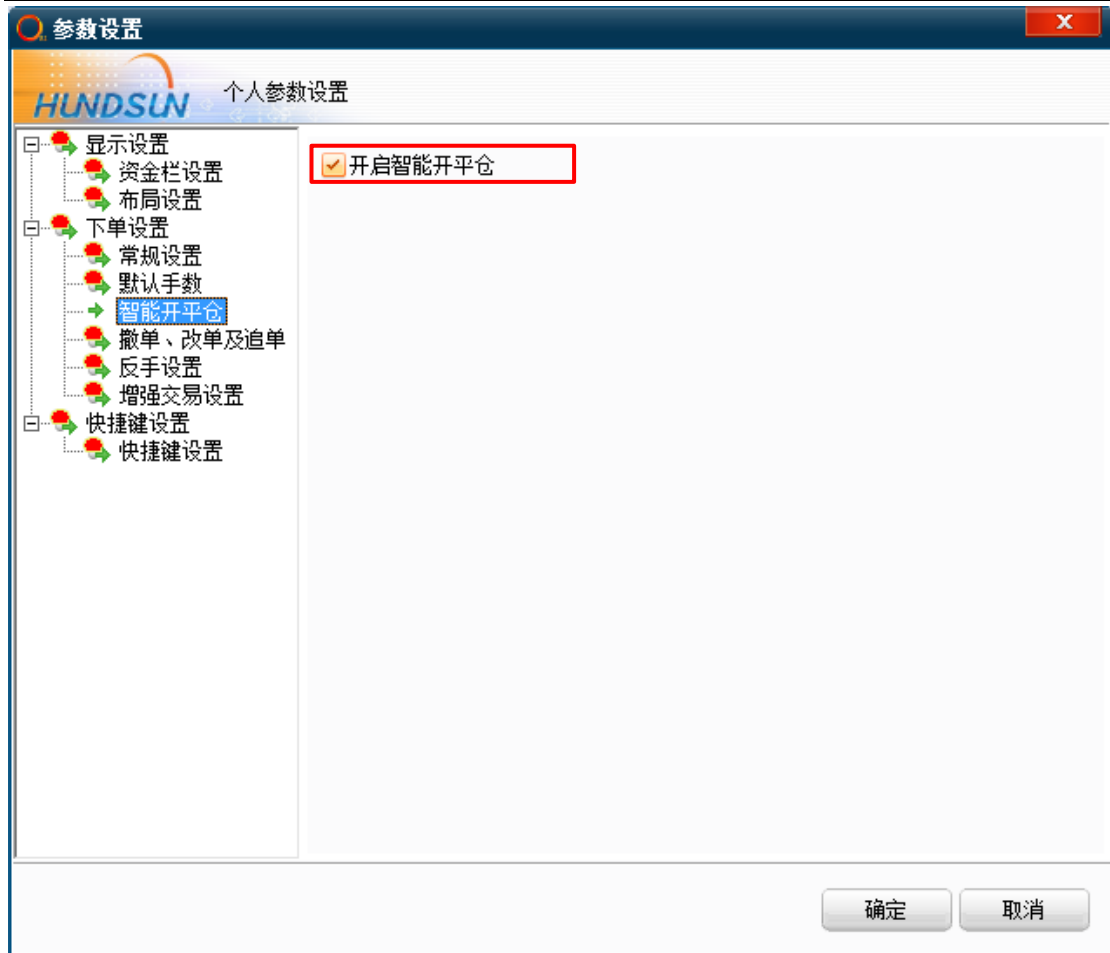


图 3.6.28



图 3.6.29

3.6.2.3 撤单、改单

用户可以在<查询区>→<可撤委托>标签页中下达撤单、改单指令。

3.6.2.3.1 普通撤单

如果要对委托进行撤单，在查询区<可撤委托>页面勾选一条或多条委托记录，点击撤单，或者双击一条委托记录，即可对该条委托挂单进行撤单。



图 3.6.30

注意：

双击撤单需要在系统参数设置→<交易设置>中勾选“启用委托双击撤单功能”。

3.6.2.3.2 全部撤单

全部撤单是撤销列表中的所有挂单，如果要执行该操作，在查询区<可撤委托>页面点击**全部撤单**即可，系统会自动发送撤单委托。



图 3.6.31

3.6.2.3.3 撤最后一批

撤最后一批是撤销最后一批挂单委托，直接点击**撤最近一批**，系统匹配委托批号最大的一批挂单申报撤销。



图 3.6.32

3.6.2.3.4 改单

通过改单功能可以快速修改原委托价格并重新下单。

如果想要修改某合约委托价格，在列表选择栏勾选一条委托，点击该项，在弹出<改

单>界面输入新的委托价格，确定后系统自动撤销选中委托，按照原合约原方向原数量新增一笔改后的限价委托。比如，原委托数量 10 手，成交 6 手，点击“改单”后，系统会将撤销原委托未成交的 4 手，然后根据改单价重新下达 4 手新价格委托。



图 3.6.33



图 3.6.34

3.6.2.3.5 盘口价改单、挂单价改单

盘口价改单/挂单价改单，是使用盘口价/改单价替换原委托的委托价格。

盘口价改单是在<可撤委托>选择栏勾选一条委托，点击该项，系统自动撤销未成原委托，在原合约基础上以对手方最优价格下达新委托。比如，原委托数量 10 手，成交 6 手，点击 **盘口价改单**，那么程序将未成交的 4 手撤销，然后以最新的盘口价重新下达 4 手委托。

挂单价改单，与上面的盘口价改单类似，撤单后使用挂单价重新下达委托。



图 3.6.35

3.6.2.4 平仓、一键清仓

通过<持仓区>平仓、一键清仓按钮可以快速平仓当前持仓合约。

账户分配		持仓查询										
	合约代码	合约名称	买卖	持仓	可用	持仓均价	浮动盈亏	盯市盈亏	静态保证金占用	投资类型	产品编号	产品名称
+	ag1508	白银1508	买	140	140	510.818	1,029,807.00	1,029,807.00	214,458.60	投机	56	模拟成交2
+	ag1508	白银1508	卖	199	196	1.000	-2,985,000.00	2,985,000.00	597.00	投机	56	模拟成交2
+	ag1509	白银1509	买	10,212	10,199	3,837.366	434,811,573.00	4,811,573.00	117,561,551.40	投机	56	模拟成交2
+	ag1509	白银1509	卖	42	42	1,974.176	614,487.00	614,487.00	248,746.20	投机	56	模拟成交2
+	ag1510	白银1510	买	100	100	1.000	1,497,300.00	1,497,300.00	300.00	投机	56	模拟成交2
+	ag1510	白银1510	卖	147	147	562.442	-963,051.00	-963,051.00	248,037.00	投机	56	模拟成交2

☐ 不汇总 ☒ 按合约汇总

图 3.6.36

3.6.2.4.1 平仓

如果要平仓单元中某合约的所有持仓，在<持仓区>选中合约，点击**平仓**，在弹出窗口中确认平仓信息后，系统自动下达该合约的平仓委托，平仓数量=持仓数量。

PB 委托确认

 确定要下达委托吗?

单元	合约代码	委托方向	委托数量	委托价格
模拟成交2	ag1601	买入平仓	1	10000

图 3.6.37

3.6.2.4.2 一键清仓

一键清仓的功能与上面的平仓类似，不同之处在于本功能实现的是将当前所有的持仓一次性平仓。

【相关参数一】平仓、一键清仓价格模式

在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<常规设置>中设置平仓、一键清仓时的委托价格。

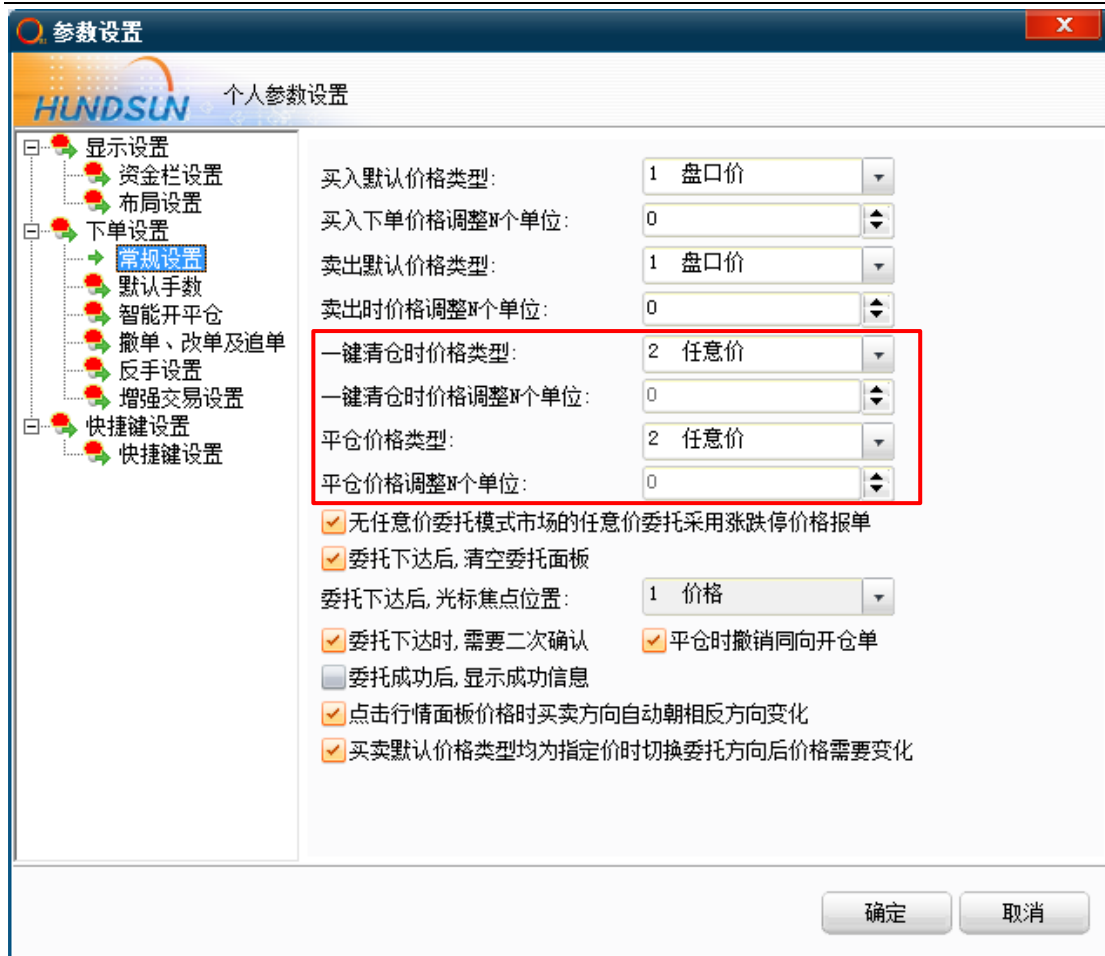


图 3.6.38

平仓/一键平仓价格类型：执行平仓/一键平仓操作时平仓价格的价格类型，在下拉框中可以选择“盘口价”、“任意价”、“挂单价”、“最新价”。

平仓/一键平仓价格调整 N 个单位：该项的含义是在“平仓/一键平仓价格类型”设置的基数基础上调整的 N 个最小单位价差。即平仓价格=平仓价格类型-N*最小单位价差，那么一键平仓价格=一键平仓间隔类型-N*合约最小单位价差。

3.7 组合交易

组合交易主要实现在一个产品上同时下达多笔证券委托，实现批量下单。机构端可以通过模版导入、文件导入方式批量添加证券。组合交易支持的证券类型包括股票，基金。

3.7.1 界面

3.7.1.1 主界面

进入【交易管理】→【组合交易】，会出现如下主界面：



图 3.7.1

- **资金栏：**该区域显示单元净值、可用余额等信息。关于资金栏的详细说明请查看[资金栏](#)页面。
- **委托栏：**委托栏分为<组合下单>、<组合监控>、<模板维护>三个功能标签页，分别用于下单、委托查看、模板管理。关于委托栏的详细说明请查看[委托栏](#)页面。

3.7.1.2 资金栏

<组合交易>资金栏界面如下，显示字段可以在<委托栏>→<组合下单>→<选项>界面设置，详细操作请见[参数设置](#)界面。

单元净值	可用余额	当前现金余额	股票资产	股票成本	股票浮盈	
75,000,000.00	73,148,050.06	75,000,000.00	0.00	0.00	0.00	

图 3.7.2

单元净值：显示当前产品的单元总净值。当前现金余额-合计应付金额+合计应收金额+股票资产+债券资产+基金资产+回购资产+权证资产+其他资产+期货盈亏+期权资产+应收证券资产+应付证券资产。

可用余额：当前产品单元的可用余额。

当前现金余额：就是当前现金资产，包括当天所有增加和减少部分。当前现金余额=期初现金余额+当天业务处理资金变化部分+手工调整部分。

股票资产：当前股票资产市值，股票持仓数量*最新价。

股票成本：股票资产的购买成本，（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）-当日卖出数量*（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）/（当前数量+当日卖出数量）。

股票浮盈：当前股票资产的盈亏情况，股票资产-股票成本

基金资产：显示当前基金市值，基金持仓数量*价格。

基金成本：基金购买成本，（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）-当日卖出数量*（结转过的期初成本+买入金额+买入费用）/（当前数量+当日卖出数量）

基金浮盈：基金资产的盈亏情况，基金资产-基金成本。

累计盈亏：累计实现收益+当日实现收益（含费用）-结转后可交易资产总费用

单位净值：不开通分组估值时显示基金单位净值：基金净值/基金份额；开通分组估值时显示单元单位净值：单元净值/单元份额

产品净值：当前资金余额-合计应付金额+合计应收金额+股票资产+债券资产+基金资产+回购资产+权证资产+其他资产+期货盈亏+期权资产+应收证券资产+应付证券资产。

产品总资产：当前资金余额+合计应收金额+股票资产+债券资产+基金资产+回购资产+权证资产+其他资产+期货盈亏+期权资产+应收证券资产+应付债券资产。

3.7.1.3 委托栏

委托栏分为<组合下单>、<组合监控>、<模板维护>三个标签页。

3.7.1.3.1 组合下单

用户在该界面<委托栏>依次输入委托要素，完成下单操作。在右侧<委托明细栏>中可以查看篮子成份券的委托数量、委托价格、持仓数量、可买数量、可卖数量等信息。



图 3.7.3

产品编号：填写投资产品编号。

单元编号：填写产品中投资单元。

篮子来源：组合交易支持通过组合模板导入篮子成份股或者通过 Excel 文件导入篮子成份股。此项可以选择“组合模板”或“文件导入”。

选择模板：篮子来源选择“组合模板”时，此项可以选择“跟踪指数”，“跟踪 ETF”，“自定义”，其中“跟踪指数”和“跟踪 ETF”模板在券商券设置，“自定义”模板可以在机构端【组合交易】→<模板维护>或【模板管理】页面由用户自己维护，详细操作可以查看[模板管理](#)页面。

选择文件：篮子来源选择“文件导入”时，在此项选择 Excel 文档的存放路径。

委托方向：通过买卖项选择委托方向，有“调整到”，“买入”和“卖出”三个选项。

目标类型：此项用于确定委托数量的计算方式。如果此项输入“按照数量”，则系统根据用户输入的委托份数分配每一个篮子成份股的委托数量；如果输入“按照金额”，则系统根据委托金额和模板中每个成份券的权重，计算每个成份券的委托金额，再根据委托金额/委托价格计算每个成份券的委托数量， $\text{委托数量} = (\text{委托金额} * (\text{权重} / \text{模板总权重})) / \text{委托价格}$ 。

委托份数：在目标类型输入“按照数量”后，需要输入该项确定组合委托篮子数。

委托金额/目标金额：在目标类型输入“按照金额”，在该项输入委托金额/目标金额。

价格设置：价格设置用于计算<委托明细栏>中的成份券价格。详细操作请查看[价格设置](#)页面。

选项：在弹出界面可以进行个人参数设置。

下单：点击下单按钮执行下单操作。

重置：清空委托栏，和合约栏显示内容。

参考价格：选择模板在<委托明细栏>导入标的券后，参考价格显示导入时的最新价。

3.7.1.3.2 组合监控

在<组合监控>标签页可以查看当日委托挂单和成交详情，并可以执行撤单、改单等操作。左侧列表显示当日委托笔数和进度，右侧显示委托明细。

通过<委托>页面下方的委托状态勾选栏，可以筛选列表显示内容。

组合下单

组合监控

模板维护

委托序号

进度

产品

单元

12599

0%

诺亚产品

诺亚A账户

12596

0%

诺亚产品

诺亚A账户

12594

0%

诺亚产品

诺亚A账户

12589

0%

诺亚产品

诺亚A账户

12232

0%

诺亚产品

诺亚A账户

12231

0%

诺亚产品

诺亚A账户

12218

0%

诺亚产品

诺亚A账户

12113

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11921

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11821

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11734

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11689

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11688

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11687

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11642

100%

诺亚产品

诺亚A账户

11641

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11640

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11639

100%

诺亚产品

诺亚A账户

11624

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11576

43%

诺亚产品

诺亚A账户

11567

0%

诺亚产品

诺亚A账户

11469

0%

现货产品

现货A单元

11468

0%

现货产品

现货A单元

11467

0%

现货产品

现货A单元

11447

0%

现货产品

现货A单元

11446

0%

诺亚产品

诺亚A账户

委托

成交

委托序号

委托状态

证券代码

证券名称

委托方向

价格类型

委托价格

委托数量

委托金额

成交均价

成交温度

成交数量

委托时间

35281

正报

600795

国电电力

买入

限价

3.02

3300

9966

0

0%

0

10:34:51

35280

正报

600739

辽宁成大

买入

限价

16.17

1000

16170

0

0%

0

10:34:51

35279

正报

600842

申能股份

买入

限价

4.86

1800

8748

0

0%

0

10:34:51

35278

正报

600950

天威保变

买入

限价

13.39

500

6695

0

0%

0

10:34:51

35277

正报

600519

贵州茅台

买入

限价

187.48

400

74992

0

0%

0

10:34:51

35276

正报

600362

江西铜业

买入

限价

26.61

300

7983

0

0%

0

10:34:51

35275

正报

600177

雅戈尔

买入

限价

9.78

1600

15648

0

0%

0

10:34:51

35274

正报

600104

上汽汽车

买入

限价

17.04

1800

30672

0

0%

0

10:34:51

35273

正报

600050

中国联通

买入

限价

5.17

8700

44979

0

0%

0

10:34:51

35272

正报

600036

招商银行

买入

限价

13.21

11400

150594

0

0%

0

10:34:51

35271

正报

600030

中信证券

买入

限价

11.73

3100

36363

0

0%

0

10:34:51

35270

正报

600029

南方航空

买入

限价

5.27

1800

9486

0

0%

0

10:34:51

35269

正报

600019

宝钢股份

买入

限价

5.51

5400

29754

0

0%

0

10:34:51

35268

正报

600018

上港集团

买入

限价

2.89

4800

13872

0

0%

0

10:34:51

35267

正报

600016

民生银行

买入

限价

7.12

18800

133856

0

0%

0

10:34:51

35266

正报

600009

上海机场

买入

限价

13.48

1400

18872

0

0%

0

10:34:51

35265

正报

600005

武钢股份

买入

限价

3.41

3700

12617

0

0%

0

10:34:51

35264

正报

600000

浦发银行

买入

限价

9.47

5900

55873

0

0%

0

10:34:51

35263

正报

601998

中信银行

买入

限价

4.37

1000

4370

0

0%

0

10:34:51

35262

正报

601988

中国银行

买入

限价

3.29

9000

29610

0

0%

0

10:34:51

35261

正报

601958

金铝股份

买入

限价

14.51

600

8706

0

0%

0

10:34:51

35260

正报

601939

建设银行

买入

限价

5.32

11300

60116

0

0%

0

10:34:51

35259

正报

601899

紫金矿业

买入

限价

4.27

2100

8967

0

0%

0

10:34:51

538, 024.00

撤单

全部撤单

改单

未成交

已成交

已撤单

废单

列表中共有 48 条委托记录。

图 3.7.4

进度：显示当前篮子批量委托的总进度。进度=成交数量/委托数量*100%。

成交均价：一个证券委托多次成交时，可能出现每一次成交价格不同的情况，此处显示当前证券的成交平均价格。成交均价=SUM（成交数量*成交价格）/SUM（成交数量）。

成交进度：显示当前证券委托的成交进展。成交进度=成交数量/委托数量*100%。

3.7.1.3.3 模板维护

<模板维护>标签页如下，在该界面显示当前所有模板，详细操作可以查看[模板管理](#)页面。

组合下单

组合监控

模版维护

模版编号	模版名称	权重类型	修改日期	修改时间	备注
5	125	数量比例	2009-01-09	16:33:39	
6	126	数量比例	2009-01-09	16:33:53	
7	215	数量比例	2009-01-09	10:02:14	
8	515	数量比例	2009-01-09	10:02:21	
1	深数量1	数量比例	2009-01-09	13:44:04	
2	深数量2	数量比例	2009-01-09	13:44:14	
3	深数量3	数量比例	2009-01-09	15:43:28	
4	风控1	数量比例	2009-01-09	14:02:06	
51	tt	数量比例	2009-01-09	15:24:27	
11	11	市值比例	2009-01-09	13:58:55	

操作

新增

修改

复制

删除

模版编号: 5

模版名称: 125

权重类型: 数量比例

修改日期: 2009-01-09

修改时间: 16:33:39

备注:

交易市场	证券代码	证券名称	数值
上交所A	600000	浦发银行	300.000
上交所A	600001	邯郸钢铁	320.000
上交所A	600002	齐鲁证券	300.000
上交所A	600003	ST东北高	300.000
上交所A	600110	中科英华	0.000
上交所A	600123	兰花科创	0.000
上交所A	600232	金鹰股份	0.000
上交所A	600340	国祥股份	0.000
上交所A	600550	天威保变	300.000

合计: 共9条

1,520.000

证券代码:

添加证券

删除证券

导入证券

打印

导出

图 3.7.5

3.7.1.4 价格设置

价格设置位于<组合下单>→<委托栏>界面。

该界面用于设置<委托明细栏>中成份券的委托价格，价格设置完成后，系统即时刷新列表中所有成份券的委托价格。

依据价格模式可以区分为“限价”模式和“市价”模式。

3.7.1.4.1 限价模式：

价格设置

价格模式: 限价

委托价格: 最新价

价格偏移: 按绝对价格控制

0.1 元

图 3.7.6

委托价格：设置限价委托价格。

价格偏移：在限价**委托价格**基础上，最后获得的成份券委托价格向上浮动价格。如果设置“按绝对价格控制”时，成份券委托价格=委托价格+价格偏移。如果设置“按比例控制”，成份券委托价格=委托价格*（1+价格偏移）。

注意：

限价模式下，<价格设置>界面委托价格项选择“买/卖 1 价”，“买/卖 2 价”时，委托价格=成份券委托方向的反方向盘口价格。

例如，委托价格选择“买/卖 1 价”，在委托明细栏，委托方向为“买入”的成份券，委托价格为“卖一价”；委托方向为“卖出”的成份券，委托价格是“买一价”。如下图：

选择	证券代码	证券名称	最新价	委托方向	委托价格	参考价格	委托数量	委托金额	可买数量	可卖数量	当前持仓	目标持仓	提示信息
☒	600016	民生银行	4.5	买入	卖一价	4.5	1,000	4,500.00	16,255,100	0	0	1,000	
☒	002058	威尔泰	7.5	买入	卖一价	7.5	1,000	7,500.00	9,753,000	0	0	1,000	
☒	000850	华茂股份	4.84	买入	卖一价	4.84	1,000	4,840.00	15,113,200	0	0	1,000	
☒	000851	高鸿股份	3.8	买入	卖一价	3.8	1,000	3,800.00	19,249,400	0	0	1,000	
☒	600600	青岛啤酒	15.77	买入	卖一价	15.77	2,000	31,540.00	4,638,400	0	0	2,000	
☐	600600	青岛啤酒	15.77	卖出	买一价	15.77	2,000	31,540.00	14,629,600	0	0	-2,000	可用数量不足:
☐	600880	博瑞传播	10.95	卖出	买一价	10.95	500	5,475.00	6,680,100	0	0	-500	可用数量不足:
☒	150001	瑞福进取	0.547	买入	卖一价	0.547	100	54.70	133,725,800	0	0	100	

图 3.7.7

3.7.1.4.2 市价模式：

价格设置

价格模式：

上海市价：

深圳市价：

图 3.7.8

上海市价：上交所有“五档即成剩撤”，“五档即成剩转”两种市价委托方式。“五档即成剩撤”指该申报在对手方五档盘口价内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分自动撤销；“五档即成剩转”指该申报在对手方实时对手方五档盘口价内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分按本方申报最新价限价申报；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。

深圳市价：深交所所有“五档即成剩撤”，“即成剩撤”，“对手方最优”，“本方最优”，“全额成或撤”五种市价委托方式。“五档即成剩撤”与上交所相同，“即成剩撤”指该申报在对手方申报队列中以对手方价格为成交价逐次成交，未成交部分自动撤销；“对手方最优”以申报时对手方盘口价一作为委托价格进行申报；“本方最优”以申报时本方盘口价一作为委托价格进行申报；“全额成或撤”指申报在对手方申报队列中以对手方价格为成交价逐次

成交，能成交的全部成交，若部分无法成交则申报全部撤销。

3.7.2 交易

3.7.2.1 模板导入委托

组合交易主要实现在一个产品上进行批量委托证券，可以通过模版导入，文件导入方式批量添加证券。组合交易支持的证券类型包括股票，基金。

3.7.2.1.1 模板导入委托

模板导入委托是通过导入跟踪指数、跟踪 ETF 以及自定义篮子模板，选择成份券，对产品下达批量委托，界面显示如下：

组合下单

组合监控

模版维护

产品编号: 38 诺亚产品

单元编号: 3 诺亚A账户

篮子来源: 组合模版 文件导入

选择模版: 跟踪ETF 中 小 板

委托方向: 买入

目标类型: 按照数量

委托份数: 1 份

委托金额: 2,730 元

价格设置

价格模式: 限价

委托价格: 买/卖3价

价格偏移: 按绝对价格控制 0.1 元

选项 下单 重置

证券代码	证券名称	最新价	委托方向	委托价格	参考价格	委托数量	委托金额	可买数量	可卖数量	当前持仓	目标持仓	提示信息
002066	瑞泰科技	15.23	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002003	伟星股份	14.66	买入	卖三价	0.1	300	30.00	463,124,700	0	0	300	
002007	华兰生物	32.2	买入	卖三价	0.1	400	40.00	463,124,700	0	0	400	
002011	盾安环境	6.65	买入	卖三价	0.1	400	40.00	463,124,700	0	0	400	
002015	赛富环保	4.83	买入	卖三价	0.1	500	50.00	463,124,700	0	0	500	
002019	鑫富药业	7.8	买入	卖三价	0.1	300	30.00	463,124,700	0	0	300	
002023	海特高新	4.51	买入	卖三价	0.1	600	60.00	463,124,700	0	0	600	
002027	七喜控股	2.8	买入	卖三价	0.1	1,100	110.00	463,124,700	0	0	1,100	
002031	巨轮股份	3.8	买入	卖三价	0.1	700	70.00	463,124,700	0	0	700	
002035	华帝股份	3.46	买入	卖三价	0.1	500	50.00	463,124,700	0	0	500	
002039	黔源电力	6.8	买入	卖三价	0.1	700	70.00	463,124,700	0	0	700	
002043	兔 宝 宝	3.35	买入	卖三价	0.1	600	60.00	463,124,700	0	0	600	
002047	成霖股份	2.96	买入	卖三价	0.1	500	50.00	463,124,700	0	0	500	
002048	宁波华翔	4.08	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002052	同洲电子	5.43	买入	卖三价	0.1	300	30.00	463,124,700	0	0	300	
002055	得润电子	4.86	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002059	云南旅游	4.3	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002063	远光软件	10.45	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002049	同力国芯	6.55	买入	卖三价	0.1	400	40.00	463,124,700	0	0	400	
002050	三花股份	8.79	买入	卖三价	0.1	200	20.00	463,124,700	0	0	200	
002051	中工国际	10.44	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002053	云南盐化	12.11	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002054	德美化工	7.8	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002056	横店东磁	6.2	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	
002057	中天天津	17.1	买入	卖三价	0.1	100	10.00	463,124,700	0	0	100	

2,730.00

篮子中共有66只证券，当前为第16只证券。

图 3.7.9

在委托栏界面，依次输入委托要素，下单成功后，在<委托栏>→<组合监控>界面可以查看当前挂单。

- **产品单元锁定：**填入产品编号，系统自动带出缺省单元编号，如果该产品下不止一个单元，可以在单元编号下拉框内可以切换单元。并且可以使用右侧的锁定符对委托要素内容进行锁定，委托要素为灰色，表示不能修改。重新点击锁定符解锁后，才能够修改委托要素内容。
- **组合模板：**篮子来源选择“组合模板”。在选择模板项下拉选择模板类型，自定义模板可以在【模板管理】或<模板维护>界面设置，详细操作请查看模板管理页面。

- **模板中的成份股：**填入模板后，右侧<委托明细栏>显示成份股。输入委托方向，光标焦点移开后，系统刷新<委托明细栏>中成份券的委托方向。
- **委托价格：**设置成份券委托价格，详细操作请查看[价格设置](#)页面。

3.7.2.1.2 目标类型、委托方向设置

用户输入的目标类型、委托方向不同，成份券的委托数量的计算方式也存在差异：

1) 如果目标类型输入“按照数量”。

“跟踪 ETF”和“自定义”模板支持“按照数量”的委托数量计算方式。

组合下单

组合监控

模板维护

产品编号: 39 恒生产品

单元编号: 2 恒生A单元

篮子来源: 组合模板 文件导入

选择模板: 跟踪ETF 159902 - 中小

委托方向: 买入

目标类型: 按照数量

委托份数: 1 份

委托金额: 230,424 元

价格设置

价格模式: 限价

委托价格: 最新价

价格偏移: 按绝对价格控制 0.1 元

选项 下单 重置

证券代码	证券名称	最新价	委托方向	委托价格	参考价格	委托数量	委托金额	可买数量	可卖数量	当前持仓	目标持仓	提示信息
002066	瑞泰科技	15.23 买入	最新价	15.33	100	1,533.00	4,771,500	0	0	100		
002003	伟星股份	14.68 买入	最新价	14.78	300	4,434.00	4,949,100	0	0	300		
002007	华兰生物	32.2 买入	最新价	32.3	400	12,920.00	2,264,600	0	0	400		
002011	盾安环境	6.65 买入	最新价	6.75	400	2,700.00	10,836,700	0	0	400		
002015	晋富环保	4.83 买入	最新价	4.93	500	2,465.00	14,837,300	0	0	500		
002019	露富药业	7.8 买入	最新价	7.9	300	2,370.00	9,259,200	0	0	300		
002023	海特高新	4.51 买入	最新价	4.61	600	2,766.00	15,867,200	0	0	600		
002027	七厘控股	2.8 买入	最新价	2.9	1,100	3,190.00	25,223,400	0	0	1,100		
002031	巨轮股份	3.8 买入	最新价	3.9	700	2,730.00	18,755,900	0	0	700		
002035	华帝股份	3.46 买入	最新价	3.56	500	1,780.00	20,547,200	0	0	500		
002039	黔源电力	6.8 买入	最新价	6.9	700	4,830.00	10,601,100	0	0	700		
002043	免宝 宝	3.35 买入	最新价	3.45	600	2,070.00	21,202,300	0	0	600		
002047	成霖股份	2.96 买入	最新价	3.06	500	1,530.00	23,904,500	0	0	500		
002048	宁波华翔	4.08 买入	最新价	4.18	100	418.00	17,499,500	0	0	100		
002052	同洲电子	5.43 买入	最新价	5.53	300	1,659.00	13,227,400	0	0	300		
002055	得润电子	4.86 买入	最新价	4.96	100	496.00	14,747,500	0	0	100		
002059	云南旅游	4.3 买入	最新价	4.4	100	440.00	16,624,500	0	0	100		
002063	远光软件	10.45 买入	最新价	10.55	100	1,055.00	6,933,400	0	0	100		
002049	同力国芯	6.55 买入	最新价	6.65	400	2,660.00	10,999,700	0	0	400		
002050	三花股份	8.79 买入	最新价	8.89	200	1,778.00	8,228,100	0	0	200		
002051	中工国际	10.44 买入	最新价	10.54	100	1,054.00	6,940,000	0	0	100		
002053	云南盐化	12.11 买入	最新价	12.21	100	1,221.00	5,990,800	0	0	100		
002054	德美化工	7.8 买入	最新价	7.9	100	790.00	9,259,200	0	0	100		
002056	桐店东磁	6.2 买入	最新价	6.3	100	630.00	11,610,800	0	0	100		
002057	中钢天源	17.1 买入	最新价	17.2	100	1,720.00	4,252,700	0	0	100		

230,424.00

篮子中共有66只证券，当前为第1只证券。

图 3.7.10

- a. 当委托方向是“买入”或“卖出”：输入篮子委托份数，系统自动刷新<委托明细栏>的委托数量，成份券委托数量=篮子证券数量*委托份数。如下图“跟踪 ETF”中的“159902-中小版”篮子模板中，“002011 盾安环境”的证券数量为 400 股，如果此时委托份数填入 4 即下达 4 份篮子委托，此时<委托明细栏>中“002011 盾安环境”的委托数量刷新为 1600 股。

产品编号: 39 恒生产品
单元/编号: 2 恒生A单元
篮子来源: 组合模板 文件导入
选择模板: 跟踪ETF 159902 - 中 小
委托方向: 买入
目标类型: 按照数量
目标份数: 4 份
目标金额: 910, 776 元

价格设置
价格模式: 限价
委托价格: 买/卖1价
价格偏移: 按比例控制 1 (%)

证券代码 证券名称 最新价 委托方向 委托价格 参考价格 委托数量 委托金额 可买数量 可卖数量 当前持仓 目标持仓 提示信息

002066	瑞泰科技	15.23	买入	15.23	400	6,092.00	4,802,800	0	0	400	
002003	伟星股份	14.68	买入	14.68	1,200	17,616.00	4,982,800	0	0	1,200	
002007	华兰生物	32.2	买入	32.2	1,600	51,520.00	2,271,600	0	0	1,600	
002011	盾安环境	6.65	买入	6.65	1,600	10,640.00	10,999,700	0	0	1,600	
002015	露安环保	4.83	买入	4.83	2,000	9,660.00	15,144,500	0	0	2,000	
002019	鑫富药业	7.8	买入	7.8	1,200	9,360.00	9,377,900	0	0	1,200	
002023	海特高新	4.51	买入	4.51	2,400	10,824.00	16,219,000	0	0	2,400	
002027	七鑫控股	2.8	买入	2.8	4,400	12,320.00	26,124,300	0	0	4,400	
002031	巨轮股份	3.8	买入	3.8	2,800	10,640.00	19,249,400	0	0	2,800	
002035	华帝股份	3.46	买入	3.46	2,000	6,920.00	21,141,000	0	0	2,000	
002039	思源电力	6.8	买入	6.8	2,800	19,040.00	10,757,000	0	0	2,800	
002043	兔宝宝	3.35	买入	3.35	2,400	8,040.00	21,835,200	0	0	2,400	
002047	成霖股份	2.96	买入	2.96	2,000	5,920.00	24,712,100	0	0	2,000	
002048	宁波华翔	4.08	买入	4.08	400	1,632.00	17,928,400	0	0	400	
002052	同洲电子	5.43	买入	5.43	1,200	6,516.00	13,471,000	0	0	1,200	
002055	博润电子	4.86	买入	4.86	400	1,944.00	15,051,000	0	0	400	
002059	云南旅游	4.3	买入	4.3	400	1,720.00	17,011,100	0	0	400	
002063	远光软件	10.45	买入	10.45	400	4,180.00	6,999,800	0	0	400	
002049	同力国芯	6.55	买入	6.55	1,600	10,480.00	11,167,600	0	0	1,600	
002050	三花股份	8.79	买入	8.79	800	7,032.00	8,321,700	0	0	800	
002051	中工国际	10.44	买入	10.44	400	4,176.00	7,006,500	0	0	400	
002053	云南盐化	12.11	买入	12.11	400	4,844.00	6,040,300	0	0	400	
002054	德美化工	7.8	买入	7.8	400	3,120.00	9,377,900	0	0	400	
002056	横店东磁	6.2	买入	6.2	400	2,480.00	11,798,000	0	0	400	
002057	中顺天源	17.1	买入	17.1	400	6,840.00	4,277,600	0	0	400	

910, 776.00

篮子中共有66只证券, 当前为第1只证券。

图 3.7.11

- b. 委托方向是“调整到”时：与“买入”、“卖出”的差别在于，输入篮子委托份数，系统会刷新<委托明细栏>的目标持仓，成份券目标数量=篮子证券数量*委托份数。如果目标持仓-当前持仓>0，系统判断成份券的委托方向是“买入”，委托数量=目标数量-当前持仓；如果目标持仓-当前持仓<0，则成份券的委托方向是“卖出”，委托数量=目标数量-当前持仓；如果目标持仓=当前持仓，则成份券不需要委托，委托数量=0。

2) 如果目标类型输入“按照金额”。

产品编号: 39 恒生产品
单元/编号: 2 恒生A单元
篮子来源: 组合模板 文件导入
选择模板: 跟踪ETF 159902 - 中 小
委托方向: 买入
目标类型: 按照金额
目标份数: 1 份
目标金额: 631, 702 元

价格设置
价格模式: 限价
委托价格: 买/卖1价
价格偏移: 按比例控制 1 (%)

证券代码 证券名称 最新价 委托方向 委托价格 参考价格 委托数量 委托金额 可买数量 可卖数量 当前持仓 目标持仓 提示信息

002066	瑞泰科技	15.23	买入	15.23	300	4,569.00	4,802,800	0	0	300	
002003	伟星股份	14.68	买入	14.68	1,000	14,680.00	4,982,800	0	0	1,000	
002007	华兰生物	32.2	买入	32.2	1,300	41,860.00	2,271,600	0	0	1,300	
002011	盾安环境	6.65	买入	6.65	1,300	8,645.00	10,999,700	0	0	1,300	
002015	露安环保	4.83	买入	4.83	1,700	8,211.00	15,144,500	0	0	1,700	
002019	鑫富药业	7.8	买入	7.8	1,000	7,800.00	9,377,900	0	0	1,000	
002023	海特高新	4.51	买入	4.51	2,000	9,020.00	16,219,000	0	0	2,000	
002027	七鑫控股	2.8	买入	2.8	3,700	10,360.00	26,124,300	0	0	3,700	
002031	巨轮股份	3.8	买入	3.8	2,300	8,740.00	19,249,400	0	0	2,300	
002035	华帝股份	3.46	买入	3.46	1,700	5,882.00	21,141,000	0	0	1,700	
002039	思源电力	6.8	买入	6.8	2,300	15,640.00	10,757,000	0	0	2,300	
002043	兔宝宝	3.35	买入	3.35	2,000	6,700.00	21,835,200	0	0	2,000	
002047	成霖股份	2.96	买入	2.96	1,700	5,032.00	24,712,100	0	0	1,700	
002048	宁波华翔	4.08	买入	4.08	300	1,224.00	17,928,400	0	0	300	
002052	同洲电子	5.43	买入	5.43	1,000	5,430.00	13,471,000	0	0	1,000	
002055	博润电子	4.86	买入	4.86	300	1,458.00	15,051,000	0	0	300	
002059	云南旅游	4.3	买入	4.3	300	1,290.00	17,011,100	0	0	300	
002063	远光软件	10.45	买入	10.45	300	3,135.00	6,999,800	0	0	300	
002049	同力国芯	6.55	买入	6.55	1,300	8,515.00	11,167,600	0	0	1,300	
002050	三花股份	8.79	买入	8.79	600	5,274.00	8,321,700	0	0	600	
002051	中工国际	10.44	买入	10.44	300	3,132.00	7,006,500	0	0	300	
002053	云南盐化	12.11	买入	12.11	300	3,633.00	6,040,300	0	0	300	
002054	德美化工	7.8	买入	7.8	300	2,340.00	9,377,900	0	0	300	
002056	横店东磁	6.2	买入	6.2	300	1,860.00	11,798,000	0	0	300	
002057	中顺天源	17.1	买入	17.1	300	5,130.00	4,277,600	0	0	300	

749, 960.00

篮子中共有66只证券, 当前为第1只证券。

图 3.7.12

- a. 如果委托方向是“买入”或“卖出”：输入本次组合委托的委托金额，系统根据每一只成份券的权重和参考价格，计算委托数量、委托金额，其中委托数量=（目标

金额*(成份券权重/SUM(篮子权重))/参考价格, 委托金额= 委托数量*参考价格。

- b. 如果委托方向是“调整到”: 在目标金额处输入当前篮子要达到的市值, 系统根据每一只成份券的权重和参考价格, 计算出目标持仓、委托金额, 其中目标持仓=(目标金额*(成份券权重/SUM(篮子权重))/参考价格。

如果目标持仓-当前持仓>0, 系统判断成份券的委托方向是“买入”, 委托数量=目标数量-当前持仓;

如果目标持仓-当前持仓<0, 则成份券的委托方向是“卖出”, 委托数量=目标数量-当前持仓;

如果目标持仓=当前持仓, 则成份券不需要委托, 委托数量=0。

最终委托数量以篮子委托金额合计数为准。

注意:

如果篮子中某个证券根据权重计算所分配到的委托金额, 不足以购买该证券的最小买卖单位, 也就是说(委托金额<最小买卖单位*参考价格)时, 该成份券不可下达委托, 委托数量显示为0。如下图:

证券代码	证券名称	最新价	委托方向	委托价格	参考价格	委托数量	委托金额	可买数量	可卖数量	当前持仓	目标持仓	提示信息
002066	瑞泰科技	15.23	买入	15.23	15.23	0	0.00	4,802,800	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002003	伟星股份	14.68	买入	14.68	14.68	0	0.00	4,982,800	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002007	华兰生物	32.2	买入	32.2	32.2	100	3,220.00	2,271,600	0	0	100	
002011	盾安环境	6.65	买入	6.65	6.65	100	665.00	10,999,700	0	0	100	
002015	霞客环保	4.83	买入	4.83	4.83	100	483.00	15,144,500	0	0	100	
002019	鑫富药业	7.6	买入	7.6	7.6	0	0.00	9,377,900	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002023	海特高新	4.51	买入	4.51	4.51	100	451.00	16,219,000	0	0	100	
002027	七喜控股	2.8	买入	2.8	2.8	300	840.00	26,124,300	0	0	300	
002031	巨轮股份	3.8	买入	3.8	3.8	200	760.00	19,249,400	0	0	200	
002035	华帝股份	3.46	买入	3.46	3.46	100	346.00	21,141,000	0	0	100	
002039	黔源电力	6.8	买入	6.8	6.8	200	1,360.00	10,757,000	0	0	200	
002043	兔宝宝	3.35	买入	3.35	3.35	100	335.00	21,635,200	0	0	100	
002047	成霖股份	2.96	买入	2.96	2.96	100	296.00	24,712,100	0	0	100	
002048	宁波华翔	4.08	买入	4.08	4.08	0	0.00	17,928,400	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002052	同洲电子	5.43	买入	5.43	5.43	0	0.00	13,471,000	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002055	得润电子	4.88	买入	4.88	4.88	0	0.00	15,051,000	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002059	云南旅游	4.3	买入	4.3	4.3	0	0.00	17,011,100	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002063	远光软件	10.45	买入	10.45	10.45	0	0.00	6,999,800	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002049	同方国芯	6.55	买入	6.55	6.55	100	655.00	11,167,600	0	0	100	
002050	三花股份	8.79	买入	8.79	8.79	0	0.00	8,321,700	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002051	中工国际	10.44	买入	10.44	10.44	0	0.00	7,008,500	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002053	云南盐化	12.11	买入	12.11	12.11	0	0.00	6,040,300	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002054	德美化工	7.8	买入	7.8	7.8	0	0.00	9,377,900	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002056	横店东磁	6.2	买入	6.2	6.2	0	0.00	11,798,000	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
002057	中钢天源	17.1	买入	17.1	17.1	0	0.00	4,277,600	0	0	0	0 委托数量必须大于0。
							45,172.00					
篮子中共有66只证券, 当前为第1只证券。												委托数量必须大于0。

图 3.7.13

3.7.2.2 文件导入委托

文件导入委托是通过 Excel 文件, 获取篮子委托详细, 界面显示如下:



图 3.7.14

在下达委托前，用户需要在 Excel 中维护本次委托的成份券导入模板。

接着，在委托栏界面，依次输入产品编号、单元编号，篮子来源选择“文件导入”。

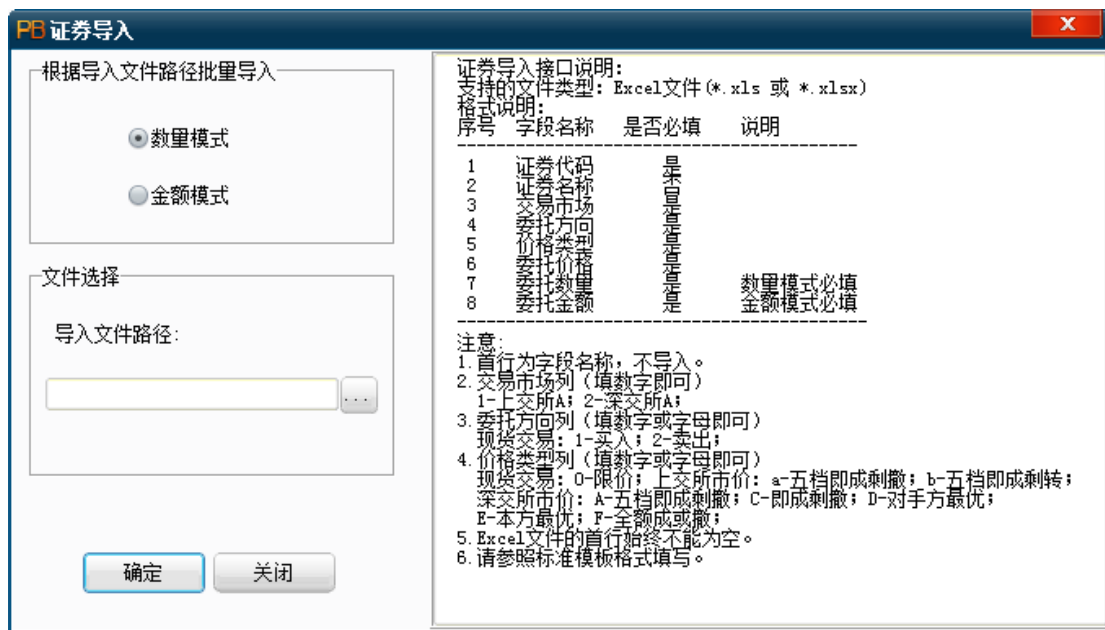


图 3.7.15

- **文件导入模式：**在选择文件弹出证券导入窗口，选择“根据导入文件路径批量导入”模式和 Excel 文件导入路径，确定后将文档内容导入到<委托明细栏>中。

如果选择“数量模式”，成份券委托数量是 Excel 文件中的委托数量，委托金额=委托数量*委托价格。所以委托数量必填。

如果选择“金额模式”，成份券委托金额是 Excel 文件中的委托金额，委托数量=委托金额/委托价格。所以委托金额必填。

- **委托价格：**在<委托栏>价格设置界面可以刷新<委托明细栏>中的成份券参考价格，详细

操作请查看[价格设置](#)页面。

- **下单：**勾选<委托明细栏>中成份券，点下单后勾选证券下单成功，在<委托栏>→<组合监控>界面可以查看当前挂单。

【相关参数】快速增加现货

导入一篮子证券后，在委托过程中可能会出现临时额外增加一只证券的情况，用户可以通过<委托明细栏>[增加证券](#)功能，在弹出窗口中填入证券代码、价格类型、委托价格、委托数量，确定后在列表中快速增加现货。

选择	证券代码	证券名称	最新价	委托方向	委托价格	参考价格	委托数量	委托金额	可买数量	可卖数量	当前持仓	目标持仓	提示信息
☒	600016	民生银行	4.5	买入	五档即成剩数	4.5	1,000	4,500.00	16,255,100	0	0	1,000	
☒	002058	威尔泰	7.5	买入	最新价	7.5	1,000	7,500.00	9,753,000	0	0	1,000	
☒	000850	华茂股份	4.84	买入	全额成或撤	4.84	1,000	4,840.00	15,113,200	0	0	1,000	
☒	000851	高鸿股份	3.8	买入	最新价	3.8	1,000	3,800.00	19,249,400	0	0	1,000	
☒	600600	青岛啤酒	15.77	买入	指定价	17	2,000	34,000.00	4,302,800	0	0	2,000	
☐	600600	青岛啤酒	15.77	卖出	指定价	5	2,000	10,000.00	14,629,600	0	0	-2,000	可用数量不足:
☐	600880	博瑞传播	10.95	卖出	最新价	10.95	500	5,475.00	6,680,100	0	0	-500	可用数量不足:
☒	150001	瑞福进取	0.547	买入	最新价	0.547	100	54.70	133,725,800	0	0	100	
54,694.70													

[增加证券](#) 篮子中共有8只证券，当前为第1只证券。

图 3.7.16

卖⑤

0.00

0

卖④

0.00

0

卖③

0.00

0

卖②

0.00

0

卖①

0.00

0

买①

0.00

0

买②

0.00

0

买③

0.00

0

买④

0.00

0

买⑤

0.00

0

证券代码:

600570

恒生电子

价格类型:

0 限价

委托价格:

10

[9.14 - 11.17]

委托数量:

200

≤ 7939674

五档行情

确定

重置

关闭

图 3.7.17

3.7.2.3 撤单、改单

用户在<组合监控>→<委托>标签页中下达撤单、改单指令。

3.7.2.3.1 普通撤单

如果要对某笔或某些委托撤单,在<委托>页面单选一条或按 Ctrl 键选择多条委托记录,点击**撤单**,或者双击一条委托记录,即可对委托挂单撤销挂单。



图 3.7.18

注意:

已撤单的委托数量不参与篮子成交总进度计算,即成交进度=成交数量/委托数量。

例如,篮子内包含 2 条委托,其中一条 100 股全部成交,另一条 100 股未成交。此时篮子的委托进度是 $100 / (200) * 100\% = 50\%$ 。如果撤销未成交委托,撤单成功后撤销委托不包含在总委托数量中,该篮子委托进度变为 $100 / 100 * 100\% = 100\%$ 。如下图:



图 3.7.19

3.7.2.3.2 全部撤单

全部撤单即撤销当前委托批号下的所有挂单，如果要执行该操作，在<挂单>页面点击

全部撤单系统会自动发送撤单委托。



图 3.7.20

3.7.2.3.3 改单

改单是对多笔委托的未成交部分修改委托价格后重新下单。

点击该项，在弹出批量改单窗口中，勾选需要调整价格的委托并且输入现货价格和市价方式，焦点移开后，系统自动刷新选中的委托价格，确认后撤销委托并按照改单后的委托价格重新下单。如果勾选界面左下角的“根据实时行情计算委托价格”，改单时价格根据行情

价格变更，不勾选则默认为下单时的行情价格。

比如，原委托数量 10 手，成交 6 手，改单后系统将未成交的 4 手撤销，然后以改单后的委托价重新下达 4 手委托。

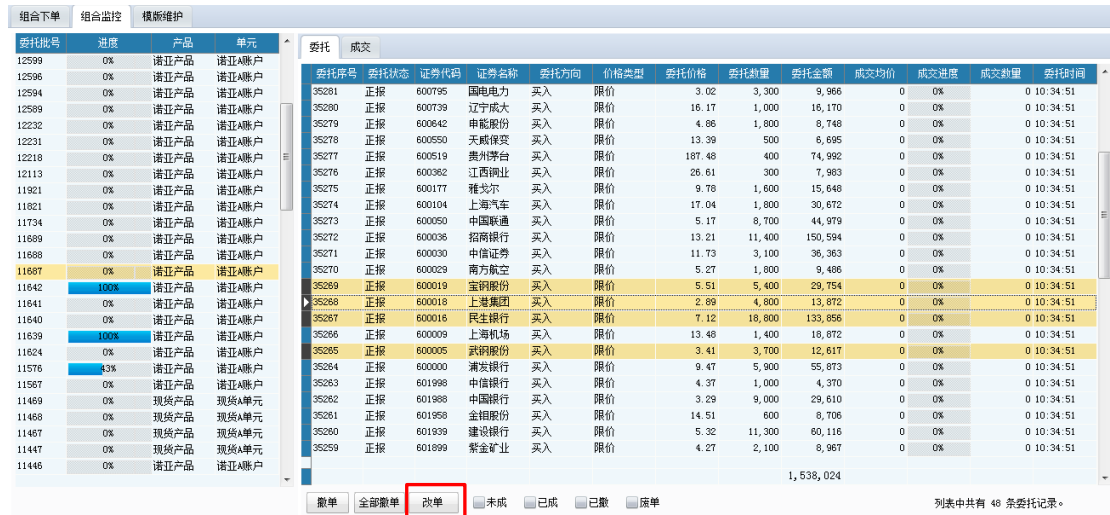


图 3.7.21



图 3.7.22

【相关参数】按百分比调整改单价格

改单设置委托价格时，默认买价=设置价格+调整价格，卖价=设置价格-调整价格；如下图，买价=买一价+200*0.01，卖价=卖一价-200*0.01。



图 3.7.23

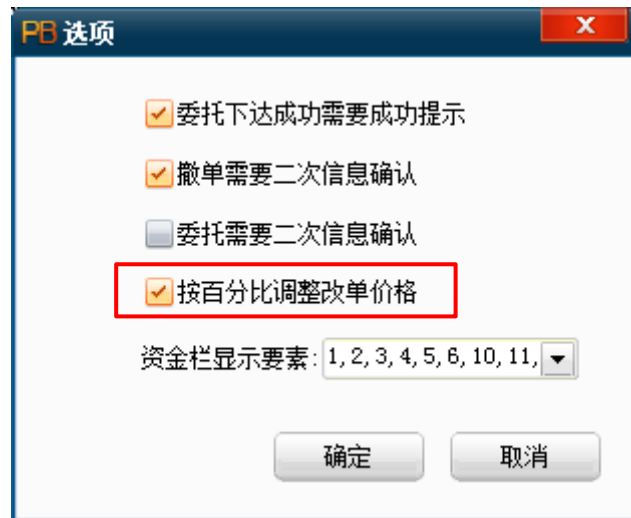


图 3.7.24

如果在<组合下单>→<选项>弹出界面中勾选了“按百分比调整改单价格”，则买价=买一价*（1+2%）；卖价=卖一价*（1-2%）。



图 3.7.25

3.7.3 参数设置

用户可以在<委托栏>→<选项>弹出界面设置个人参数。

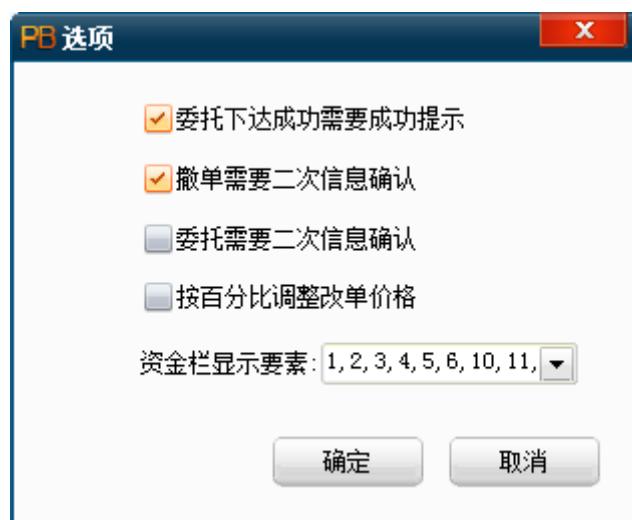


图 3.7.26

委托下达完成之后，清空委托面板：委托成功后，清空委托栏和行情栏内容。

委托下达时，需要二次确认：下单后，是否弹出对话框需要用户二次确认。

委托成功后，显示成功信息：下单成功后，是否弹出成功提示信息。

资金栏显示要素：此处用于设置资金栏界面的显示内容。

3.8 期货组合单

3.8.1 界面

3.8.1.1 主界面

进入【交易管理】→【期货组合单】，会出现如下主界面：

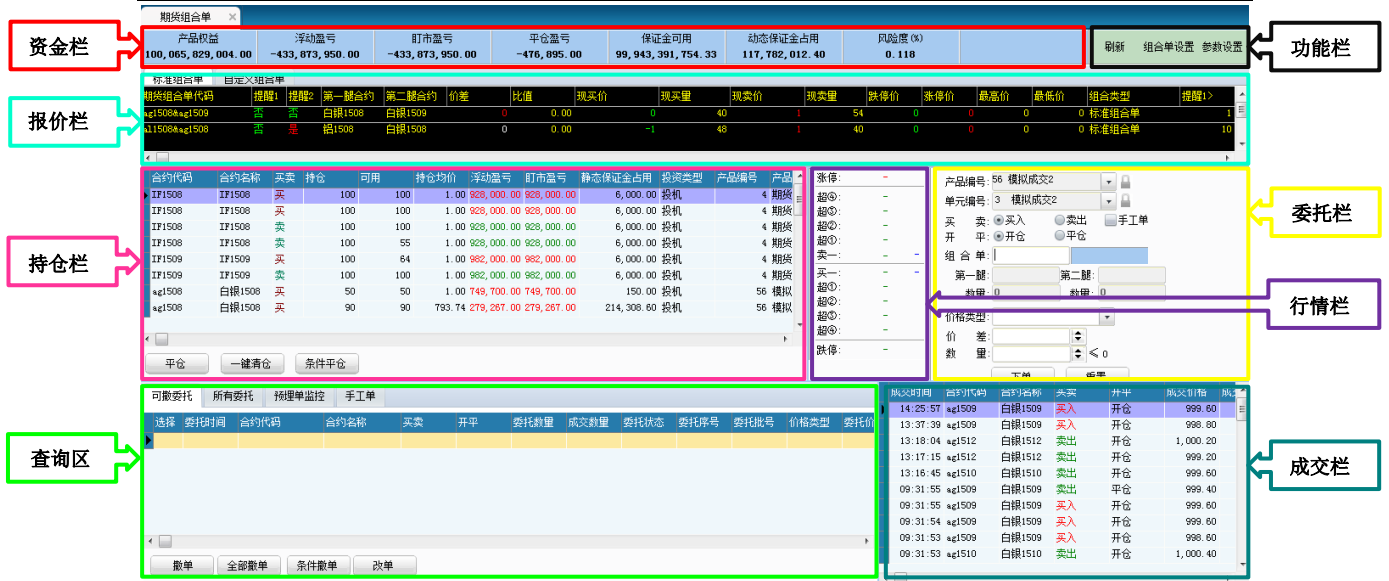


图 3.8.1

- **资金栏**：该区域显示产品权益、盈亏、保证金等信息。关于资金栏的详细说明请查看[资金栏](#)页面。
- **功能栏**：该区域主要用于设置组合单和个人参数，详细说明请查看[功能栏](#)页面。
- **报价栏**：该区域用于显示标准组合单、自定义组合单的第一腿第二腿合约期行情。关于报价栏的详细说明请查看[报价栏](#)页面。
- **持仓栏**：该区域显示产品单元持仓详情。关于持仓区的详细说明请查看[持仓栏](#)页面。
- **行情栏**：显示委托栏输入合约的盘口价详情，请查看[行情栏](#)页面。
- **委托栏**：用户在这里输入委托要素，进行组合下单。关于委托区的详细说明请查看[委托栏](#)页面。
- **查询区**：该区域显示可撤委托，所有委托，手工单、预埋单监控标签页，供用户查询、撤单和埋单。详情请查看[查询区](#)页面。
- **成交栏**：显示期货单元的合约成交详情，详情请查看[成交栏](#)页面。

3.8.1.2 资金栏

〈期货单账户〉资金栏界面如下，显示字段可以在〈功能栏〉→〈参数设置〉→〈显示设置〉→〈资金栏设置〉界面设置，详细操作请见[显示设置](#)界面。

产品权益	浮动盈亏	盯市盈亏	平仓盈亏	保证金可用	动态保证金占用	风险度(%)
1,299,760,000.00	299,760,000.00	299,760,000.00	0.00	1,237,455,251.82	60,012,000.00	4.617

图 3.8.2

资金栏参数如下：

产品权益：当前产品权益之和，期货保证金余额+盯市盈亏。

浮动盈亏：产品下所有持仓期货的浮动盈亏之和（ $\sum$ （最新价-开仓价）* 合约乘数 * 持仓数量）

盯市盈亏：产品下所有持仓期货的盯市盈亏之和（ $\sum$ （最新价-X）* 合约乘数 * 持仓数量 * 多空标示。X：对于今仓，为开仓价；对于昨仓，为昨结算价。多头为正数，空头为负数。）

平仓盈亏：产品下当日平仓合约的盈亏之和。 $\sum$ （（平仓价-开仓价）* 平仓数量 * 合约乘数）

保证金可用：产品下的当前保证金可用余额。

动态保证金占用：产品下的当前保证金占用金额。

风险度（%）：保证金占用/账户权益。

3.8.1.3 功能栏

〈期货组合单〉功能栏界面如下。

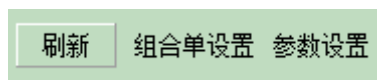


图 3.8.3

- **刷新：**手工刷新〈期货组合单〉界面。
- **组合单设置：**在此处设置自定义组合单，自定义组合单会在〈报价栏〉→〈自定义组合单〉标签页内显示，组合单具体操作请查看[组合单设置](#)页面。
- **参数设置：**在选项弹出界面可以进行个人参数设置，具体内容请查看[参数设置](#)页面。

3.8.1.4 报价栏

在报价栏界面上分为〈标准组合单〉，〈自定义组合单〉两个标签页。

标准组合单	自定义组合单
财经组合单代码	提醒1
IF1508&IF1603	否 是 IF1508 IF1603 -333.1 1.00 -333.1 21 -331.8 25 0.0 0.0 总单 11
IF1508&IF1601	否 是 IF1508 IF1601 -669.7 1.00 -670.1 21 -668.3 49 0.0 0.0 总单 1
IF1508&IF1509	否 是 IF1508 IF1509 -1,002.2 1.00 -1,003.8 21 -1,000.2 2 0.0 0.0 总单 20

图 3.8.4

在界面右键弹出菜单处，可以执行如下操作：

- **布局设置：**在报价栏上点击右键，在弹出的右键菜单里选择〈布局设置〉项，即可进入布

局设置页面，对当前行情页的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置，详细操作请查看[布局设置](#)页面。

- **删除自选:**在报价栏选中合约组合点击右键，在弹出菜单里选择“删除自选”，确认后刷新标签页。

报价栏参数如下：

提醒: 是否触发合约提醒。如果触发提醒该项显示“是”。

第一腿合约: 显示期货组合单第一腿合约。

第二腿合约: 显示期货组合单第二腿合约。

价差: 第一腿合约委托价-第二腿合约委托价*（第二腿合约乘数/第一腿合约乘数）*（第二腿合约配比/第一腿合约配比）。

比值: 第一腿合约委托价/第二腿合约委托价。

现买价: 在<自定义组合单>中，现买价=第一腿合约买一价-第二腿合约卖一价*（第二腿合约乘数/第一腿合约乘数）*（第二腿合约比值/第一腿合约比值）。在<标准组合单>中，如果组合单买量=0时，现买价=第一腿买-第二腿卖价；如果组合单买量>0时，现买价=MAX(第一腿买价 - 第二腿卖价,套利订单买价)。

现买量: 在<自定义组合单>中，现买量是第一腿合约买一量和第二腿合约卖一量较小的值。在<标准组合单>中，如果买量=0时，现买量是第一腿合约买一量和第二腿合约卖一量较小的值；如果组合单买量>0并且套利行情买价>(第一腿买价-第二腿卖价)时，买量 = 套利订单买量；如果组合单买量>0并且套利行情买价=(第一腿买价-第二腿卖价)，买量 = 套利订单买量 + MIN(第一腿买量,第二腿卖量)；如果组合单买量>0且套利行情买价<(第一腿买价-第二腿卖价)，买量 = MIN(第一腿买量,第二腿卖量)。

现卖价: 在<自定义组合单>中，现卖价=第一腿合约卖一价 - 第二腿合约买一价 *（第二腿合约乘数/第一腿合约乘数）*（第二腿合约比值/第一腿合约比值）。在<标准组合单>中，如果组合单卖量 = 0时，组合单卖价=第一腿卖价-第二腿买价；如果组合单卖量 > 0时，卖价 = MIN(第一腿卖价-第二腿买价,套利订单卖价)。

现卖量: 在<自定义组合单>中，现卖量取第一腿合约卖一量和第二腿合约买一量较小的值。在<标准组合单>中，如果组合单卖量 = 0时，卖量=MIN(第一腿卖量,第二腿买量)；如果组合单卖量 > 0且套利行情卖价<(第一腿卖价-第二腿买价)时，卖量 = 套利订单卖量；如果组合单卖量 > 0且套利行情卖价 = (第一腿卖价-第二腿买价)时，卖量 = 套利订单卖量 +

MIN(第一腿卖量,第二腿买量); 如果组合单卖量 > 0 且套利行情卖价 > (第一腿卖价-第二腿买价)时, 卖量 = MIN(第一腿卖量,第二腿买量)。

涨停价: 标准组合的行情涨停价格。

跌停价: 标准组合的行情跌停价格。

最高价: 标准组合的当日合约的历史最高价位。

最低价: 标准组合的当日合约的历史最低价位。

提醒 1>: 显示设置的提醒阈值 1。

提醒 2<: 显示设置的提醒阈值 2。

配比: 指在一份合约中, 第一腿合约有几手, 第二腿合约有几手, 在组合单设置中设置。

3.8.1.5 持仓栏

<期货组合单>持仓栏界面如下, 显示组合下所有合约持仓详情。

合约代码	合约名称	买卖	持仓	可用	持仓均价	浮动盈亏	盯市盈亏	静态保证金占用	投资类型	产品编号	产品
IF1508	IF1508	买	100	100	1.00	928,000.00	928,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1508	IF1508	买	100	100	1.00	928,000.00	928,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1508	IF1508	卖	100	100	1.00	928,000.00	928,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1508	IF1508	卖	100	55	1.00	928,000.00	928,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1509	IF1509	买	100	64	1.00	982,000.00	982,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1509	IF1509	卖	100	100	1.00	982,000.00	982,000.00	6,000.00	投机	4	期货
ag1508	白银1508	买	50	50	1.00	749,700.00	749,700.00	150.00	投机	56	模拟
ag1508	白银1508	买	90	90	793.74	279,267.00	279,267.00	214,308.60	投机	56	模拟

平仓 一键平仓 条件平仓

图 3.8.5

在持仓区界面点击右键, 在弹出的右键菜单可以执行如下操作:

- **快速定位:** 选择“快速定位”弹出快速定位界面, 输入**证券代码**定位持仓栏中的相应合约。

PB 快速定位

证券代码: IF1508 IF1508 定位

图 3.8.6

- **布局设置:** 详细操作请查看[布局设置](#)页面。

3.8.1.6 行情栏

双击报价栏合约或在委托栏输入组合单后，该区域会显示组合单一档行情，超①行情价格是在一档行情的基础上分别加减最小单位价差获得。

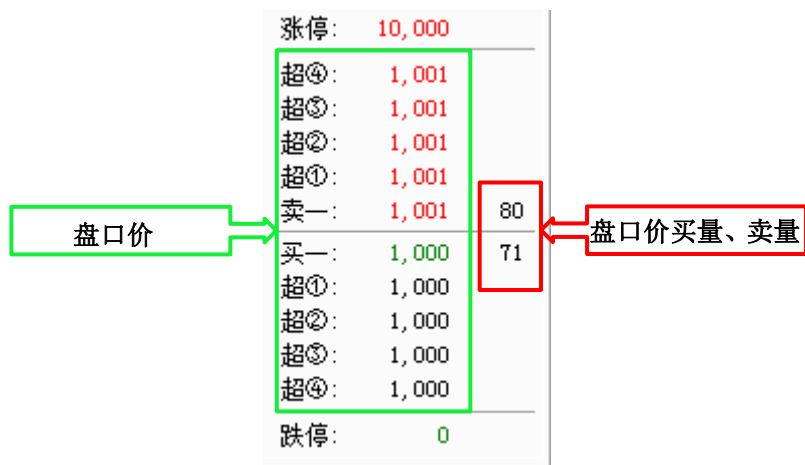


图 3.8.7

3.8.1.7 委托栏

标准套利组合和自定义套利组合的委托界面在功能上有些区别，标准套利组合只支持手工埋单，自定义套利组合支持条件预埋单，自定义套利组合委托栏界面如下：

图 3.8.8

产品编号: 在该项手工填写下达委托的期货组合产品编号。

单元编号: 产品编号填写完后，单元会自动填上缺省单元，若有多个编码，可通过下拉菜单选择。

买卖：通过买卖项选择第一腿合约涨跌方向，有“买入”和“卖出”两个选项。

开平：选择第一腿合约委托方向，有“开仓”和“平仓”两个选项。

手工单：在标准组合单委托时，可勾选并下达手工埋单，该笔委托会在<查询区>→<手工单>界面显示。

组合单：双击报价栏组合或手工填写组合单。

第一腿：显示组合单项的第一腿合约，下方显示第一腿合约下达手数。

第二腿：显示组合单项的第二腿合约，下方显示第二腿合约下达手数。

价差：输入组合套利单条件埋单的触发价差，当组合单价差在用户输入的价差范围内即触发埋单并下达委托。

先后套利：在自定义套利组合下委托时，可勾选并下达条件预埋单，勾选后只有在第一腿委托下达并成交后，第二腿委托才可以下达。

数量：填写套利组合单下达份数。当开平方向是“开仓”时，数量不能大于右侧可委托数量，标准组合单和自定义组合单可委托数量计算方式不同，标准组合单可委托数量=可用保证金余额/价差；自定义组合单可委托数量=可用保证金余额/（第一腿合约最新价*第一腿合约数量+第二腿合约最新价*第二腿合约数量）。当开平方向是“平仓”时，数量不能大于第一腿、第二腿合约的较小持仓数量。

追单：勾选该项后，系统下达追单委托指令。追单部分详细操作请查看[追单](#)页面。

下单：点击下单按钮执行下单操作。

重置：清空委托栏和行情栏显示内容。

3.8.1.8 查询区

查询区由<可撤销委托>,<所有委托>,<预埋单监控>,<手工单>四个标签页组成。



图 3.8.9

3.8.1.8.1 挂单

该标签页显示委托状态是“未报”，“已报”或“部成”的可撤销委托挂单。

在页面右键弹出菜单选项可以“全选”列表、“反选”未勾选项和“布局设置”，布局设

置操作请查看[布局设置](#)页面。

挂单委托预埋单手工单												
选择	委托时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	委托数量	成交数量	委托状态	委托序号	委托批号	价格类型	委托价格
☐	16:40:50	IF1509	IF1509	卖出	平仓	1	0	未报	17234	8719	任意价	999.80
☐	16:40:50	IF1508	IF1508	买入	平仓	1	0	未报	17233	8719	任意价	1,000.60
☐	16:26:56	IF1509	IF1509	卖出	平仓	1	0	未报	17232	8718	任意价	999.80
☐	16:23:13	IF1508	IF1508	买入	平仓	1	0	未报	17228	8715	任意价	1,000.60
☐	15:05:04	IF1508	IF1508	买入	平仓	1	0	未报	17212	8704	任意价	1,000.60
☒	16:46:43			买入	平仓	1	0	未报	8525	8526	限价	65.20

撤单

全部撤单

条件撤单

改单

图 3.8.10

3.8.1.8.2 委托

用户可以在该标签页查看当日所有委托。

挂单	委托	预埋单	手工单									
委托时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	委托数量	成交数量	委托状态	委托序号	委托批号	价格类型	委托价格	投资
18:19:46	ag1509	白银1509	买入	开仓	18	0	未报	65490	12611	限价	1,000.00	投机
11:30:57	ag1508ag1509	ag1508ag1509	买入	开仓	4	0	已报	12499	12500	限价	0.20	投机
22:43:33	ag1509	白银1509	买入	开仓	1	0	正报	60292	12323	限价	998.60	投机
22:29:56	ag1509	白银1509	买入	开仓	1	1	已成	60290	12321	限价	999.60	投机
13:37:22	ag1509	白银1509	买入	开仓	1	1	已成	40056	11803	限价	998.80	投机
13:17:46	ag1512	白银1512	卖出	开仓	1	1	已成	39430	11787	限价	1,000.20	投机
13:17:46	ag1509	白银1509	买入	开仓	1	0	正报	39429	11787	限价	1,000.20	投机
13:16:59	ag1512	白银1512	卖出	开仓	1	1	已成	39366	11785	限价	999.20	投机

图 3.8.11

3.8.1.8.3 预埋单

该界面显示条件预埋单委托详情。用户可以使用界面下方的预埋单状态筛选框筛选列表内容。〈预埋单〉界面还支持预埋单暂停、激活、撤销等快捷操作。在右键弹出菜单进行布局设置，详细操作请查看布局设置[布局设置](#)页面。

挂单 委托 预埋单 手工单													
日期	委托批号	序号	合约代码	合约名称	委托类型	状态	买卖	开平	委托价格	价格模式	价格偏移	预埋数量	已触发数量
2009-01-09	12611	255	ag1510	白银1510	条件单	未触发	卖出	开仓	999.800	挂单价	0.000	1,000	0
2009-01-09	12611	254	ag1509	白银1509	条件单	部分完成	买入	开仓	1,000.000	挂单价	0.000	1,000	18
2009-01-09	12323	242	ag1510	白银1510	条件单	未触发	卖出	开仓	1,000.200	挂单价	0.000	1	0
2009-01-09	12323	241	ag1509	白银1509	条件单	已触发	买入	开仓	998.600	挂单价	0.000	1	1
2009-01-09	12321	237	ag1510	白银1510	条件单	未触发	卖出	开仓	999.400	挂单价	0.000	1	0
合计		80											

暂停

激活

撤销

☒显示已暂停

☒显示已触发

☒显示已完成

☒显示已删除

图 3.8.12

3.8.1.8.4 手工单

〈手工单〉界面显示手工预埋单。勾选界面下面“显示委托完成”项，显示当日已下达的

委托，否则不显示。



图 3.8.13

在界面点击右键弹出菜单，支持如下功能：

- **布局设置：**详细操作请查看[布局设置](#)页面。
- **全选：**全部勾选当前界面手工单。
- **反选：**反选当前列表勾选项。

3.8.1.9 成交栏

成交栏显示当日已成交的委托。通过右键菜单可以进行“布局设置”，对当前页面的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置。详细操作见[布局设置](#)页面。

成交时间	合约代码	合约名称	买卖	开平	成交价格
14:25:57	ag1509	白银1509	买入	开仓	999.
13:37:39	ag1509	白银1509	买入	开仓	998.
13:18:04	ag1512	白银1512	卖出	开仓	1,000.
13:17:15	ag1512	白银1512	卖出	开仓	999.
13:16:45	ag1510	白银1510	卖出		
09:31:55	ag1509	白银1509	卖出		
09:31:55	ag1509	白银1509	买入	开仓	999.
09:31:54	ag1509	白银1509	买入	开仓	999.
09:31:53	ag1509	白银1509	买入	开仓	998.
09:31:53	ag1510	白银1510	卖出	开仓	1,000.

图 3.8.14

3.8.2 交易

3.8.2.1 标准组合单设置

在进行期货套利交易之前，需要先建立套利组合单。套利组合单有两种，一种为交易所规定的套利单，另外一种为自定义的套利单组合。

标准套利单是由交易所定期公布的标准套利单,可享受保证金优惠（如大边优惠：以套利单中保证金占用最大的合约计算的保证金计算该套利单的保证金占用）

以下为大商所应用举例：

大连商品交易所 20150915日套利交易保证金 参数一览表

套利交易策略	品种	套利交易合约	交易保证金额(手)
跨期套利	豆一	SP a1509&a1601	8,054.00
跨期套利	豆一	SP a1509&a1605	8,054.00
跨期套利	豆一	SP a1601&a1605	2,150.50
跨期套利	豆二	SP b1509&b1601	6,000.00
跨期套利	豆二	SP b1509&b1605	6,000.00
跨期套利	豆二	SP b1601&b1605	1,583.00
跨期套利	胶合板	SP bb1509&bb1601	8,845.00
跨期套利	胶合板	SP bb1509&bb1605	8,535.00
跨期套利	胶合板	SP bb1601&bb1605	8,845.00
跨期套利	玉米	SP c1509&c1601	4,280.00
跨期套利	玉米	SP c1509&c1605	4,280.00
跨期套利	玉米	SP c1601&c1605	980.00
跨期套利	玉米淀粉	SP cs1509&cs1601	5,200.00
跨期套利	玉米淀粉	SP cs1509&cs1605	5,200.00

图 3.8.15

在【期货组合单】→<功能栏>→<组合单设置>界面设置交易所、自定义组合套利单。

交易所套利单又称标准组合单，仅支持在同一市场进行套利。在<交易所>标签页左侧可以查看各交易所套利组合，右侧可以查看<报价栏>→<标准组合单>中显示的标准套利单，界面显示如下：

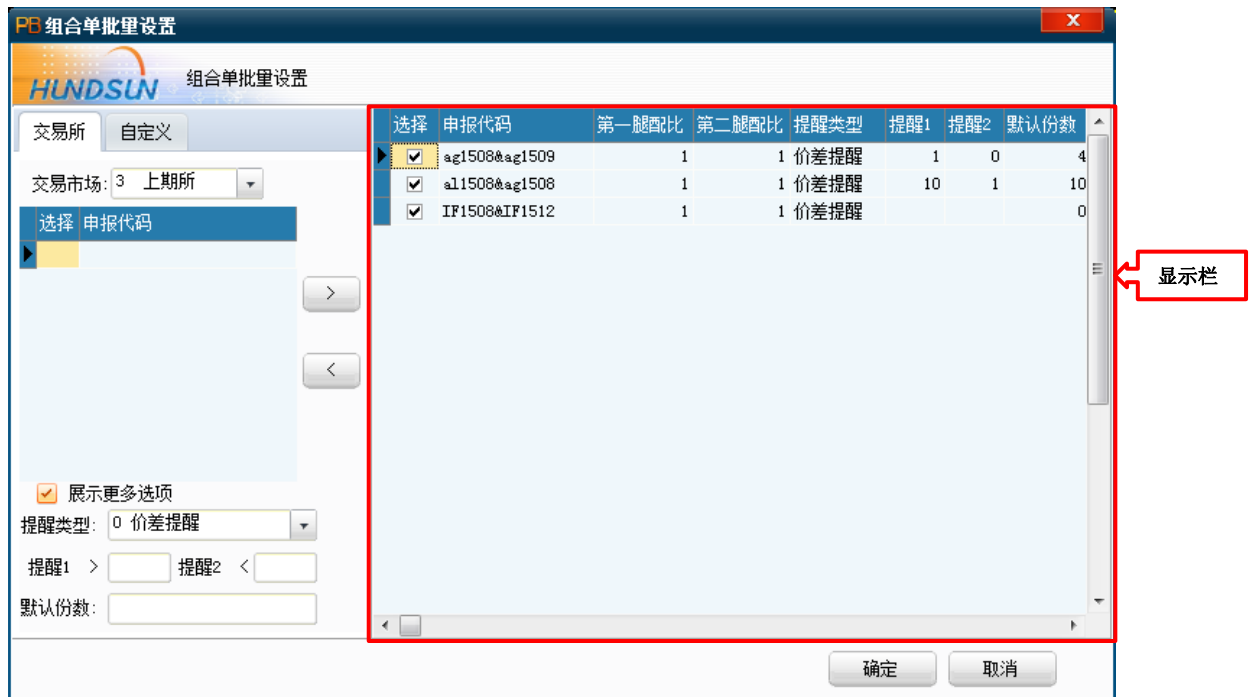


图 3.8.16

- 1) 通过切换交易市场可以在下方列表查看各市场的标准套利单。
- 2) 在提醒类型处可选择“价差提醒”或“比率提醒”，在提醒 1、提醒 2输入提醒阈值。

标准组合单		自定义组合单														
期货组合单代码	提醒1	提醒2	第一腿合约	第二腿合约	价差	比值	现价	现买量	现卖价	现卖量	跌停价	涨停价	最高价	最低价	组合类型	提醒1
ag1508&ag1509	否	否	白银1508	白银1509	0	0.00	0	40	1	54	0	0	0	0	标准组合单	1
al1508&ag1508	否	是	铝1508	白银1508	0	0.00	-1	48	1	40	0	0	0	0	标准组合单	10

图 3.8.17

当提醒类型选择“价差提醒”时，如果标准套利单价差大于提醒 1设置的阈值时，在报价栏显示“是”，小于等于提醒阈值 1 显示“否”。同样的，如果提醒类型选择“比率提醒”，标准套利单比值大于提醒 1设置阈值，报价栏显示“是”。

当提醒类型选择“价差提醒”时，如果标准套利单价差小于提醒 2设置的阈值时，在报价栏显示“是”，大于等于提醒阈值 2 显示“否”。同样的，如果提醒类型选择“比率提醒”，标准套利单比值小于提醒 2设置阈值，报价栏显示“是”。

- 3) 在默认份数处输入套利单委托时默认带出的数量。例如 ag1508&ag1509 在合约设置中的默认份数为 4，下达该套利单委托时，输入组合单后数量项显示 4。

产品编号: 56 模拟成交2
单元编号: 3 模拟成交2
买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出 ☐ 手工单
开 平: ☒ 开仓 ☐ 平仓
组 合 单: ag1508@ag1509 ag1508@ag1509
第一腿: 白银1508 第二腿: 白银1509
数 量: 4 数 量: 4
价 差: 1.00
数 量: 4 ≤ 33294469
下单 重置

图 3.8.18

- 4) 使用左右移动按钮，将各交易所标准套利单移动至显示栏中，显示栏中的套利单会显示在<报价栏>→<标准组合单>标签页中。

【相关参数】转换机“统一期货行情”、“上期期货统一报盘行情”

在做标准套利委托前，首先要通过转换机“统一期货行情”或“上期期货统一报盘行情”从柜台获取标准套利单基础数据。其中“统一期货行情”是从恒生柜台系统获取标准套利单，而“上期期货统一报盘行情”是通过上期所柜台获取，用户根据需要开启相应转换机任务。

➤ “统一期货行情”转换机任务的设置项如下图所示：

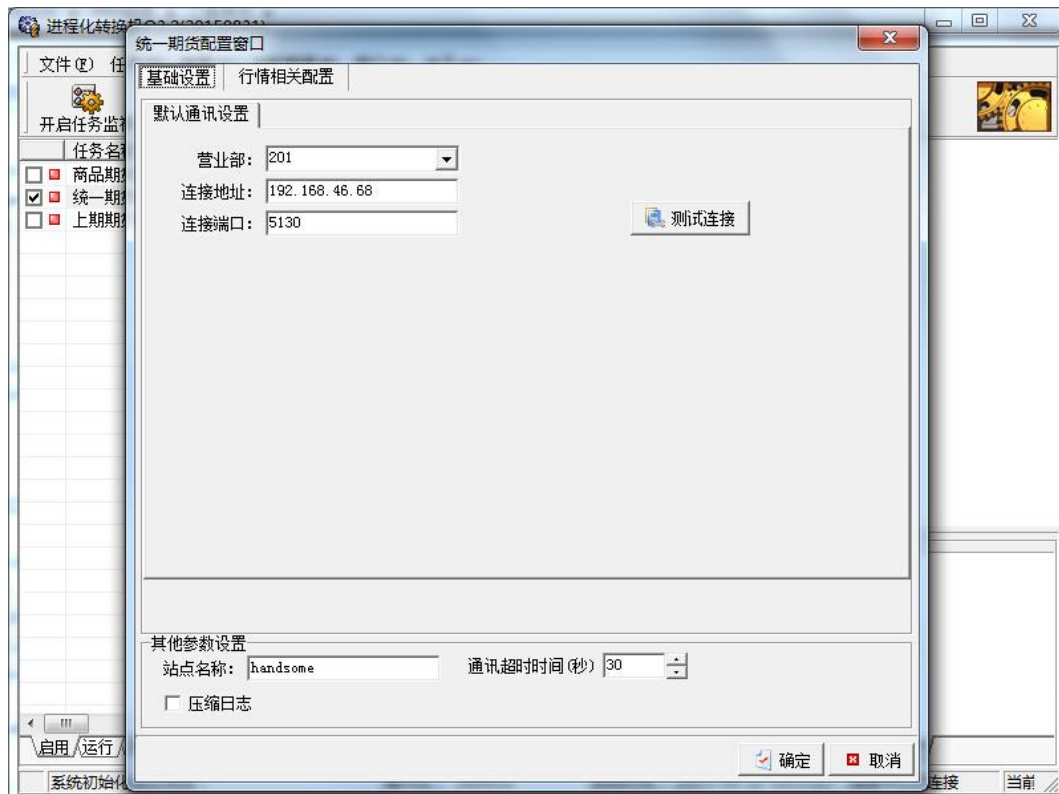


图 3.8.19

在<基础设置>标签页设置恒生柜台名称、IP 和端口。

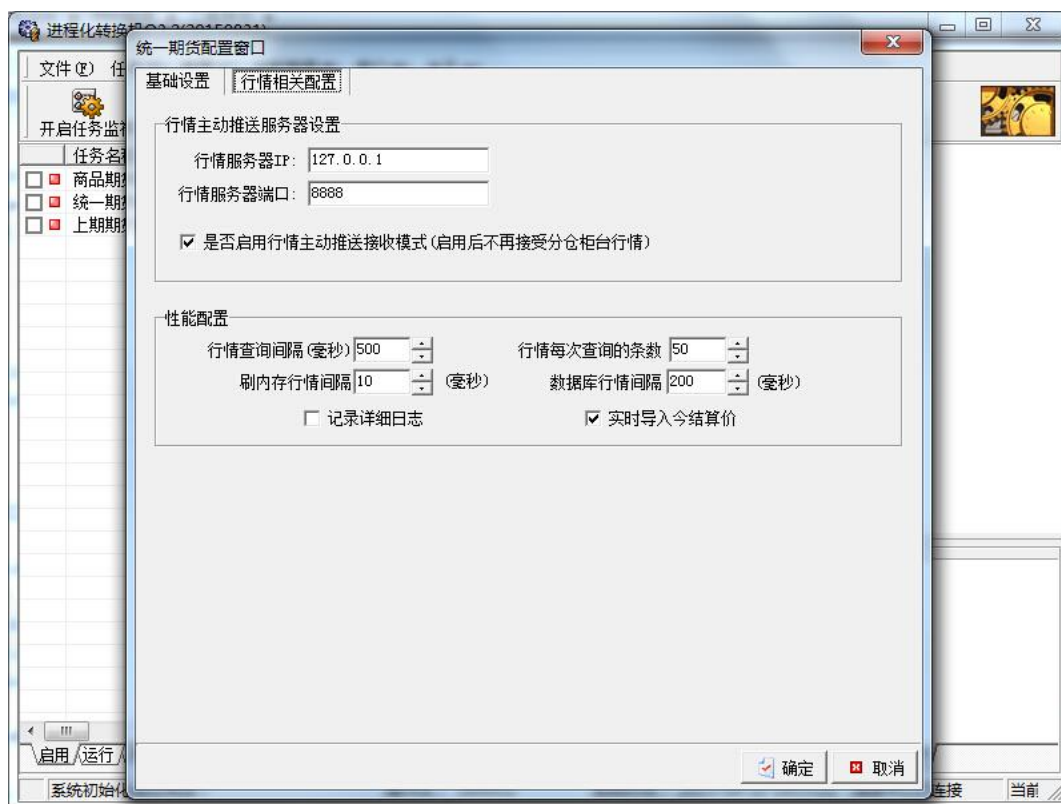


图 3.8.20

在<行情相关配置>标签页中设置行情服务器 IP 地址和行情查询性能。

- “上期期货统一报盘行情”转换机任务的设置项如下图所示：

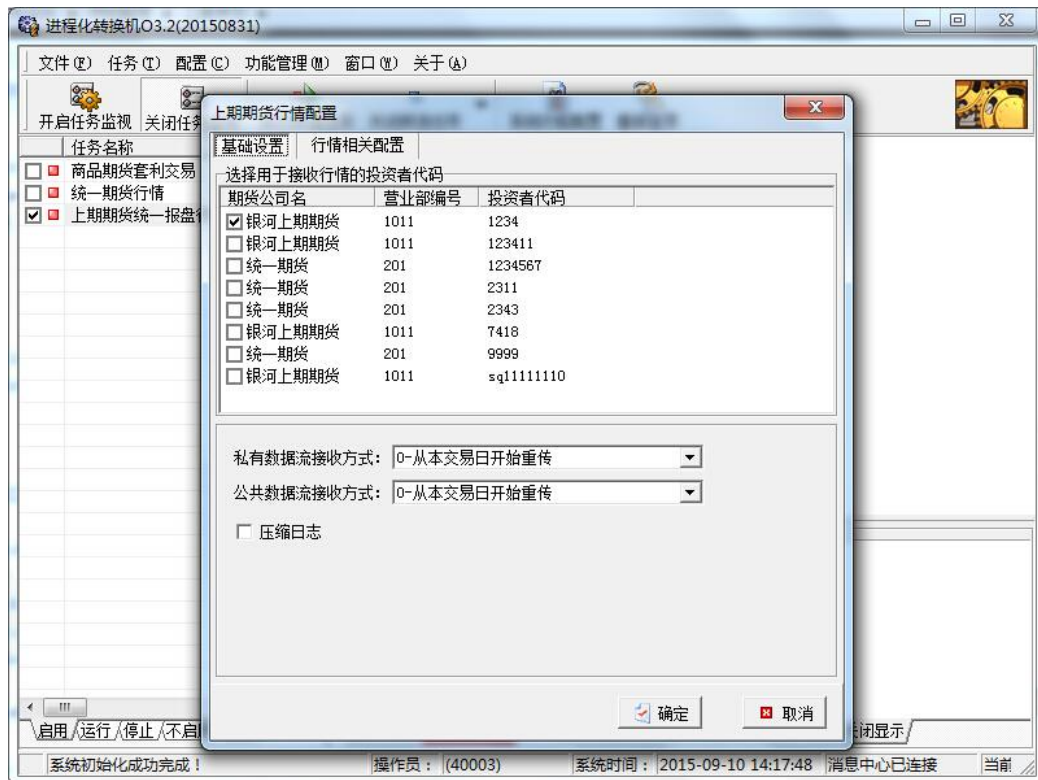


图 3.8.21

在<基础设置>标签页选择转换机连接的客户柜台。

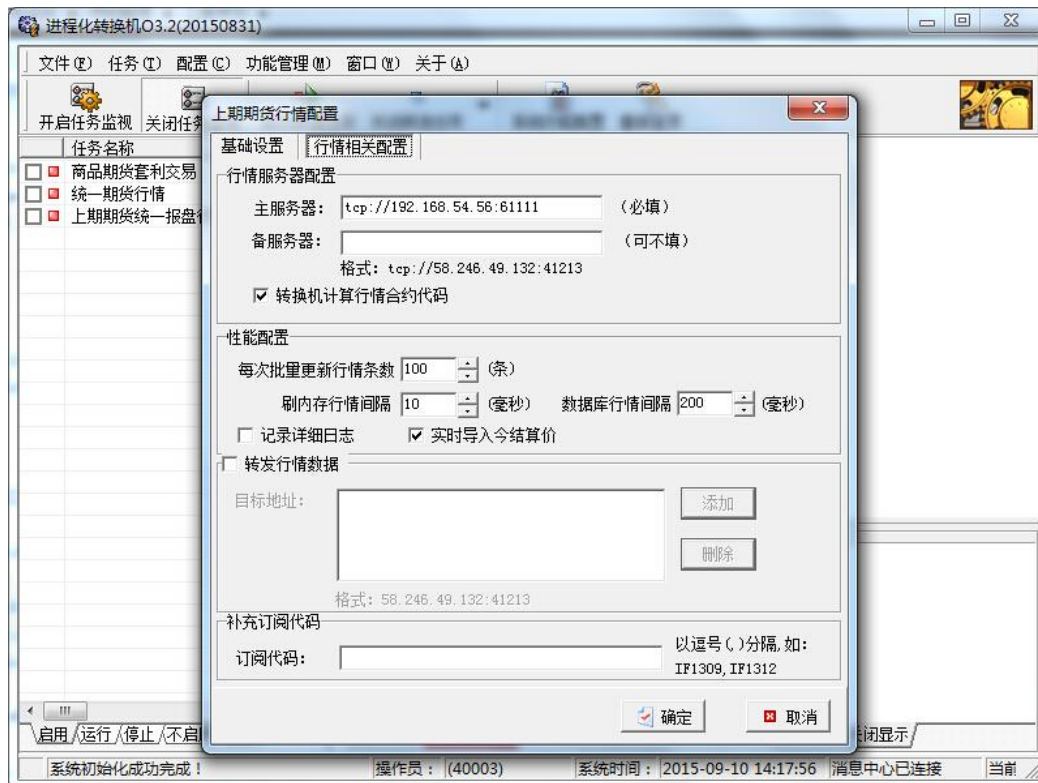


图 3.8.22

在<行情相关配置>标签页中设置行情服务器 IP 地址和性能。

3.8.2.2 标准套利委托

标准套利委托即是下达交易所标准套利单，标准套利委托界面如下：



图 3.8.23

在委托栏界面，依次输入委托要素，下单成功后，在<查询区>→<挂单>界面生成一笔套利组合委托。

- **锁定：**填入产品编号，系统自动带出缺省单元编号，如果该产品下不止一个单元，可以在单元编号下拉框内可以切换单元。并且可以使用右侧的锁定符对委托要素内容进行锁定，委托要素为灰色，表示不能修改。重新点击锁定符解锁后，才能够修改委托要素内容。
- **委托方向：**在买卖、开平项确认套利单第一腿合约的买卖开平方向，第二腿合约默认与第一腿合约买卖方向相反，开平方向相同。例如组合单 ag1508&ag1509，买卖项是“买入”，开平项是“开仓”，那么套利单第一腿 ag1508 合约方向是买入开仓，第二腿 ag1509 合约方向是卖出开仓。
- **快速下单：**双击<报价栏>→<标准组合单>中带出委托栏组合单或手工填入组合单，光标焦点移开后，在左侧<行情栏>界面显示标准套利单的市场行情，并且带出第一腿、第二腿合约和数量。
- **价差：**输入价差。当标准套利单行情价差小于等于委托价差时，当前标准套利委托成交。

注意：

标准套利单第一腿、第二腿合约比值为 1:1，所以套利单的委托数量=第一腿合约委托数量=第二腿合约委托数量。

【相关参数】买卖价格设置

在标准套利委托界面不需要输入委托价格，用户在下单前需要在<功能栏>→<参数设置>

→<下单设置>→<常规设置>中，“买入/卖出默认价格类型”和“买入/卖出价格调整 N 个单位”项设置套利单买入价和卖出价，输入组合单后根据个人参数设置自动带出价差。

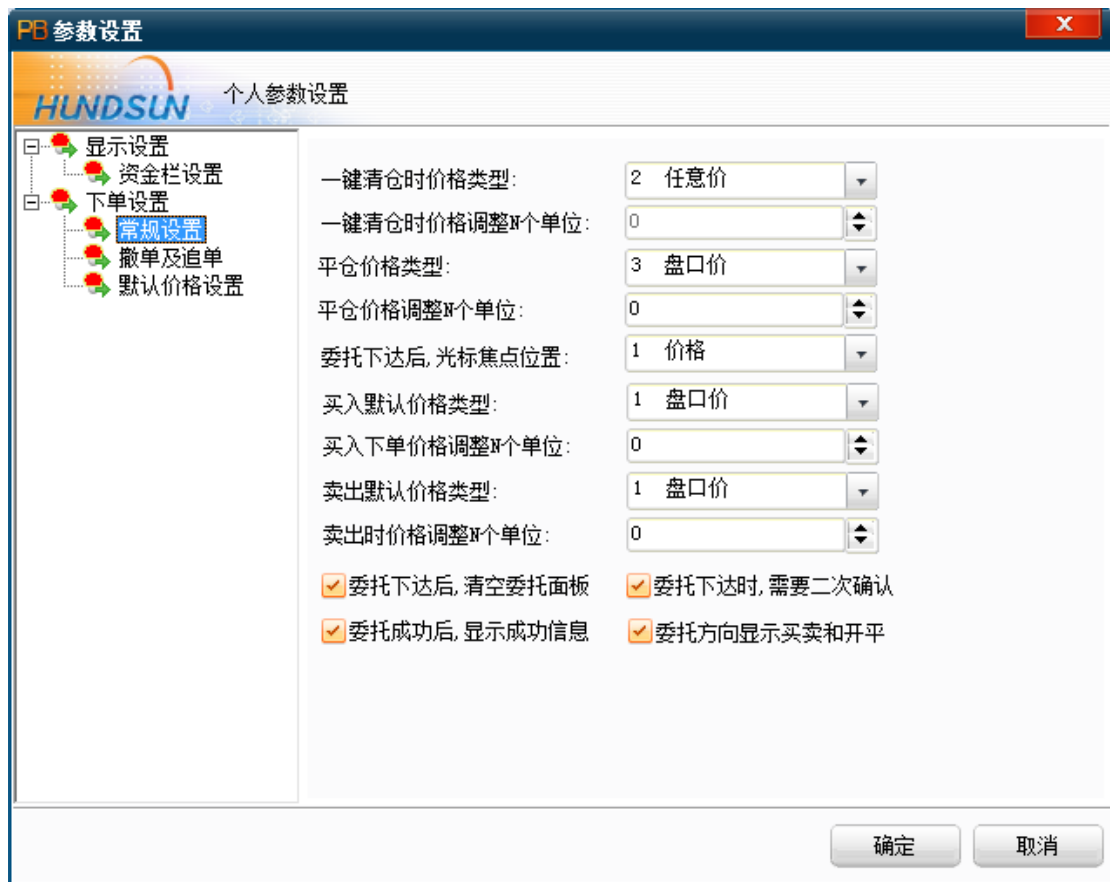


图 3.8.24

买入/卖出价格类型：买卖双方不同，套利单委托价格的价格类型，在下拉框中可以选择“盘口价”、“指定价”、“挂单价”、“最新价”。

买入/卖出价格调整 N 个单位：该项的含义是在“买入/卖出价格类型”设置的基数基础上调整的 N 个最小单位价差。即买入价格=买入价格类型+N*最小单位价差，那么卖出价格=卖出类型-N*最小单位价差。

3.8.2.3 手工埋单委托

手工埋单是预先将要下达的委托要素设置好并保存在<手工单>界面，由用户监控当条件满足时手工下达埋单。手工埋单委托界面如下：

产品编号: 56 模拟成交2

单元编号: 3 模拟成交2

买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出 ☒ 手工单

开 平: ☒ 开仓 ☐ 平仓

组合单: ag1508&ag1509 ag1508&ag1509

第一腿: 白银1508 第二腿: 白银1509

数 量: 4 数 量: 4

价 差: 1.00

数 量: 4 ≤ 33294469

下单 重置

图 3.8.25

- **手工埋单:** 手工埋单委托方式与[标准套利委托](#)相同, 唯一的差别是在下达委托时需要勾选“手工单”要素。下单后, 该埋单委托显示在<查询区>→<手工单>标签页内。

挂单		委托		预埋单		手工单							
选择	序号	投资类型	合约代码	合约名称	买卖	开平	价格类型	委托价格	委托数量	执行状态	委托序号	委托信息	产品编号
☐	258	投机	ag1508	ag1508	买入	开仓	限价	1.020	4	未执行			56
☒	204	投机	ag1508	ag1508	买入	开仓	限价	2.000	4	未执行			56

删除

下达

☐ 显示委托完成

图 3.8.26

- **手工单下达:** 用户发现时机成熟, 要下达手工埋单时, 在<查询区>→<手工单>标签页内勾选手工单, 点击[下达](#)即可完成该笔埋单下达。下达后手工单的执行状态变为“已执行”。

挂单		委托		预埋单		手工单							
选择	序号	投资类型	合约代码	合约名称	买卖	开平	价格类型	委托价格	委托数量	执行状态	委托序号	委托信息	产品编号
☐	258	投机	ag1508	ag1508	买入	开仓	限价	1.020	4	未执行			56
☐	204	投机	ag1508	ag1508	买入	开仓	限价	2.000	4	已执行	12623		56
☐	109	投机			买入	平仓		58.800	1	已执行	8482		4

删除

下达

☒显示委托完成

委托处理完成。成功1条|失败0条|总共1条

图 3.8.27

- **删除手工单:** 如果需要删除手工单, 勾选<手工单>标签页内的埋单, 点击[删除](#)即可。

3.8.2.4 自定义组合单设置

自定义组合套利单是用户依据自己的要求设置套利组合, 相较于标准组合单更为灵活, 支持跨期、跨品种套利。

跨期套利是利用同一品种不同到期月份期货合约的价差变化, 进行买入一个期货合约,

同时卖出另一个期货合约，当价差扩大或缩小到一定幅度而同时将两个合约平仓来获利的操作模式。通常情况下，同品种不同到期日合约价格具有较强的相关性，一般都是同涨同跌。但由于不同合约间季节性供需差异及资金偏好差异等因素影响，其价格并不完全相关，由此导致价差不断发生变化。跨期套利就是通过跟踪并预测这种价差变化来获取利润。

跨品种套利是指利用两种不同的，但相互关联的商品之间的合约价格差异进行套利交易，即买入某一交割月份某种商品合约，同时卖出另一相同交割月份、相互关联的商品合约，以期在有利时机同时将这两种合约对冲平仓获利。跨品种套利的主导思想是寻找两种或多种不同但具有一定相关性的商品间的相对稳定关系（差值、比值或其它），在其脱离正常轨道时采取相关反向操作以获取利润。

自定义组合单界面与标准组合单类似，在<功能栏>→<组合单设置>→<自定义>标签页中设置。左侧设置栏用于自定义套利单第一腿合约、第二腿合约的定义和提醒设置，右侧显示栏显示用户自定义的套利单，界面显示如下：

选择	申报代码	第一腿配比	第二腿配比	提醒类型	提醒1	提醒2	默认份数
☒	ag1509&ag1510	1	1	价差提醒			0
☒	ag1509&ag1512	1	1	价差提醒			0
☒	ag1508&ag1601	1	1	价差提醒			0
☒	ag1509&ag1511	1	1	价差提醒			0
☒	ag1508&ag1603	1	2	价差提醒			0
☒	ag1508&IF1601	1	1	价差提醒			0
☒	ag1509&IF1603	1	2	价差提醒			0
☒	ag1508&ag1511	1	1	价差提醒			0
☒	ag1508&ag1512	1	1	价差提醒			0
☒	IF1508&IF1601	3	5	价差提醒	1	-1	11
☒	IF1508&IF1603	3	4	价差提醒	11	1	3
☒	ag1508&ag1510	2	3	价差提醒	2	-1	2
☒	IF1508&IF1509	1	2	价差提醒	20	10	5

图 3.8.28

- 1) 在第一腿合约、第二腿合约输入期货合约。
- 2) 输入第一腿配比、第二腿配比。配比是指在一份委托中，第一腿合约有几手，第二腿合约有几手，例如 IF1508&IF1603 配比为 3:4，即表示如果下达一份 ag1508&ag1603 自定义套利单，所包含 IF1508 合约 3 手，IF1603 合约 4 手。
- 3) 在提醒类型处可选择“价差提醒”或“比率提醒”，在提醒 1、提醒 2输入提醒阈值。

此处与标准组合单设置一致。

标准组合单	自定义组合单	提醒1	提醒2	第一腿合约	第二腿合约	价差	比值	现价	现买量	现卖价	现卖量	涨停价	跌停价	最高价	最低价	组合类型	提醒1>
ag1508a&1512				白银1508	白银1512	2.00	1.00	1.20	40	2.40	54	0.00	0.00	0.00	0.00	自定义组合单	1
IF1508a&IF1601		否	是	IF1508	IF1601	-669.7	1.00	-670.1	21	-668.9	49	0.0	0.0	0.0	0.0	自定义组合单	11
IF1508a&IF1603		否	是	IF1508	IF1603	-333.1	1.00	-333.1	21	-331.8	25	0.0	0.0	0.0	0.0	自定义组合单	2
ag1508a&1510		否	是	白银1508	白银1510	-497.90	1.00	-499.70	40	-496.60	18	0.00	0.00	0.00	0.00	自定义组合单	20
IF1508a&IF1509		否	是	IF1508	IF1509	-1,002.2	1.00	-1,003.8	21	-1,000.2	2	0.0	0.0	0.0	0.0	自定义组合单	

图 3.8.29

当提醒类型选择“价差提醒”时，如果标准套利单价差大于提醒1设置的阈值时，在报价栏显示“是”，小于等于提醒阈值1显示“否”。同样的，如果提醒类型选择“比率提醒”，标准套利单比值大于提醒1设置阈值，报价栏显示“是”。

当提醒类型选择“价差提醒”时，如果标准套利单价差小于提醒2设置的阈值时，在报价栏显示“是”，大于等于提醒阈值2显示“否”。同样的，如果提醒类型选择“比率提醒”，标准套利单比值小于提醒2设置阈值，报价栏显示“是”。

- 4) 在默认份数处输入套利单委托时默认带出的份数。例如 IF1508&IF1603 在合约设置中的默认份数为3，下达该套利单委托时，输入组合单后数量项显示3。

产品编号: 56 模拟成交2

单元编号: 3 模拟成交2

买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出

开 平: ☒ 开仓 ☐ 平仓

组合单: IF1508&IF1603 IF1508&IF1603

第一腿: IF1508

第二腿: IF1603

数量: 9

数量: 12

价差: -331.8

☒ 先后套利 ☐ 追单

数量: 3

≤ 416930

下单

重置

图 3.8.30

- 5) 使用左右移动按钮，将各自定义套利单移动至显示栏中，显示栏中的套利单会显示在<报价栏>→<自定义组合单>标签页中。

3.8.2.5 自定义套利委托

自定义套利委托即是下达用户自定义的套利组合，通常用于跨品种期货套利，自定义套利委托界面如下：

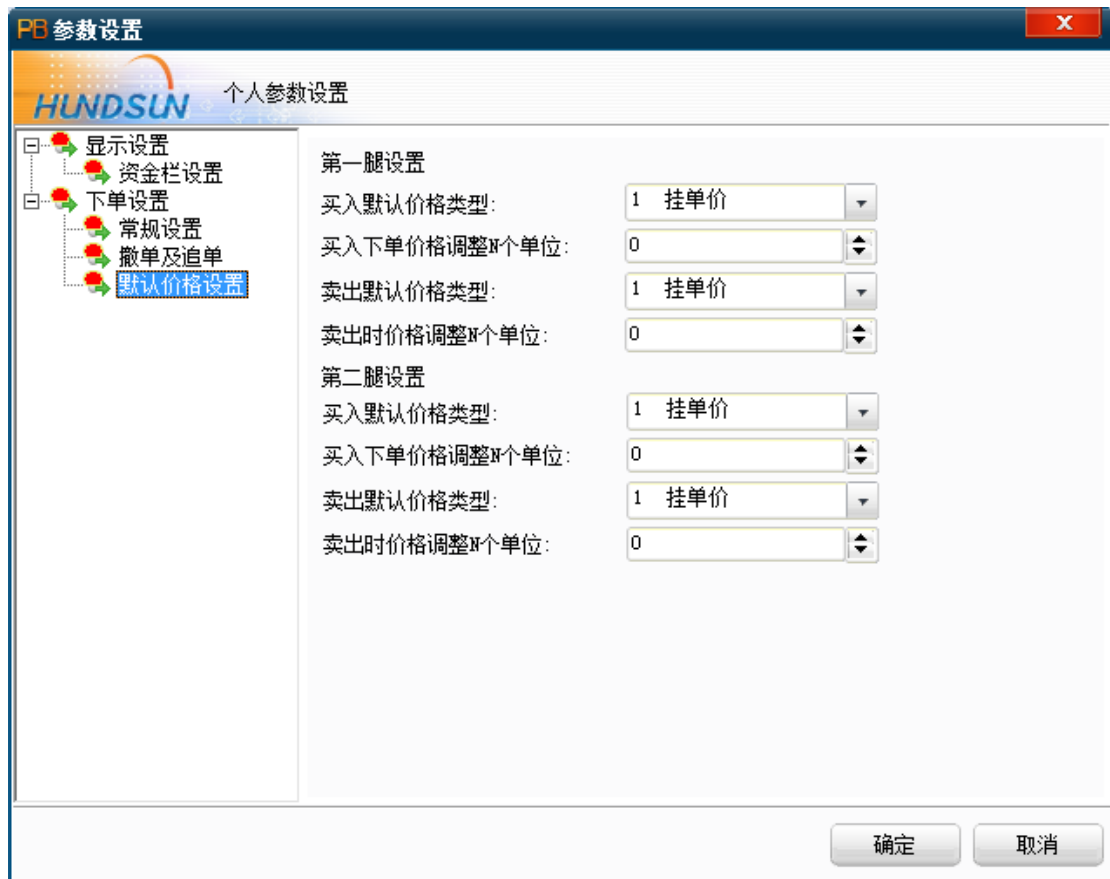


图 3.8.32

买入/卖出价格类型：买卖双方不同，套利单委托价格的价格类型，在下拉框中可以选择“盘口价”、“指定价”、“挂单价”、“最新价”。

买入/卖出价格调整 N 个单位：该项的含义是在“买入/卖出价格类型”设置的基数基础上调整的 N 个最小单位价差。即买入价格=买入价格类型+N*最小单位价差，那么卖出价格=卖出类型-N*最小单位价差。

【相关参数二】转换机“商品期货套利交易”

自定义委托下单后，会把消息推送给“商品期货套利交易”的转换机任务，转换机会生成待监控的预埋单记录。转换机会每隔一段时间检查一下这些预埋单价差是否满足设置的预埋单条件，如果满足就会触发委托。“商品期货套利交易”转换机任务的设置项如下图所示：

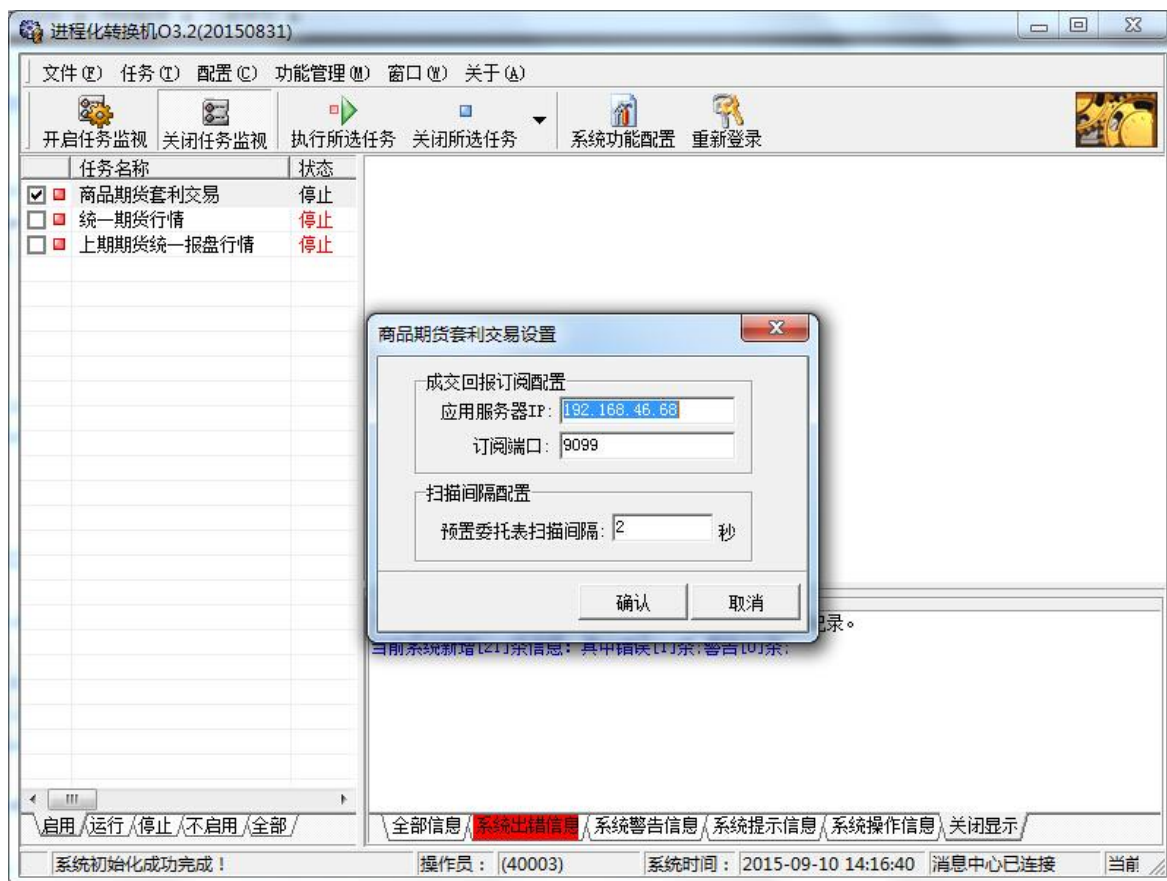


图 3.8.33

应用服务器 IP: 消息中心的 IP 地址，由于接收消息中心推送的成交消息。

订阅端口: 消息中心的端口，由于接收消息中心推送的成交消息。

扫描间隔: 转换机扫描需要监控的预埋单记录的时间间隔。

3.8.2.6 互换

互换可以是同品种不同月份合约之间的互换（或称展期），也可以是不同品种合约之间的互换（或称移仓）。

互换交易指令委托方向有 4 种：买开，卖开、买平、卖平，下单时委托方向是针对第一个合约代码的，例如买开 SP c0707&c0709 表示，玉米 c0707 买入开仓，c0709 卖出平仓。具体委托方向如下表所示：

互换方向	买卖持仓	委托方向	备注
A→B（A 持仓换 B 持仓）	A 买持仓	卖平	A 卖平，B 买开
	A 卖持仓	买平	A 买平，B 卖开
A←B（B 持仓换 A 持仓）	B 买持仓	买开	A 买开，B 卖平

	B 卖持仓	卖开	A 卖开, B 买平
--	-------	----	------------

图 3.8.34

同期货套利单交易, 互换单也包括交易所标准互换单及本地组合的自定义互换单。为方便投资者在不同合约之间移仓交易, 大商所对套利交易指令功能进行了优化, 投资者可利用套利交易指令实现一个合约平仓、同时另一个合约开仓交易。

注意:

目前只有大商所和郑商所支持标准套利单互换功能。

在下达委托选择第一腿的委托方向后, 第二腿委托方向默认为开平相同, 买卖相反。如果勾选了“互换”项, 那么确定了第一腿委托方向后, 第二腿委托方向为开平相反, 买卖相反。

图 3.8.35

互换举例

例如, 如上图 ag1508&ag1509 套利组合, 下达委托时买卖方向为“买入”, 开平方向为“开仓”, 那么, 第一腿合约 ag1508 委托方向即为“买入开仓”。

未勾选“互换”时: 第二腿合约 ag1509 委托方向为“卖出开仓”;

勾选“互换”后: 第二腿合约 ag1509 委托方向为“卖出平仓”。

3.8.2.7 先后套利

因为自定义套利委托实质上是下达了 2 笔开平方向相同, 买卖方向相反的期货委托, 同时下达可能会出现瘸腿的情况。

先后套利是在自定义套利委托的基础上, 对委托顺序进行控制先后套利是在第一腿合约

成交后，再下达第一腿合约委托。保证第一腿主力合约下单成功。

产品编号: 56 模拟成交2
单元编号: 3 模拟成交2
买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出
开 平: ☒ 开仓 ☐ 平仓
组合单: IF1508&IF1603 IF1508&IF1603
第一腿: IF1508 第二腿: IF1603
数 量: 300 数 量: 400
价 差: -331.4 ☒ 先后套利 ☐ 追单
数 量: 100 ≤ 416930
下单 重置

图 3.8.36

先后套利委托下达与自定义套利委托相同，唯一差别是在下单前需要勾选“先后套利”。
下单完成后，第一腿委托在预埋单界面生成，当价差满足下单条件时，第一腿合约根据价差触发委托，第一腿委托成功后，第二腿委托根据第一腿成交数量触发。保证在第一腿委托成功后，再下达第二腿委托。

注意：

使用先后套利功能，第一腿委托部成后，第二腿根据配比下达委托。

例如，套利单 ag1508&ag1509 的配比是 3: 4，委托份数为 100 份。价差触发后，第一腿委托数量是 300 手，如果此时部分成交了 150 手，那么第二腿合约委托即刻下达，根据 3:4 的委托配比，委托数量为 200 手。后续 ag1508 第二次继续成交 120 手，依旧根据成交触发下达一笔第二腿合约，第二腿委托数量根据配比为 160 手。

3.8.2.8 追单

追单是指在价格波动剧烈的时候，顺着价格波动的方向去做单，并在很短的一段时间来完成交易的一种做单方法。

追单举例

合约 ag1510 下达一笔买入开仓，价格 1800 的追单委托，轮循间隔为 360S。委托成功后，在 360s 内未成交，系统撤销原委托，并在原委托基础上下达一笔新委托。

追单交易主要是针对于未成委托进行设置策略，由转换机实时监控对应的未成委托，并

根据对应的策略完成相关的操作流程。在下达追单指令前需要在<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<撤单及改单>界面的“追单参数”中增加期货品种的追单参数。

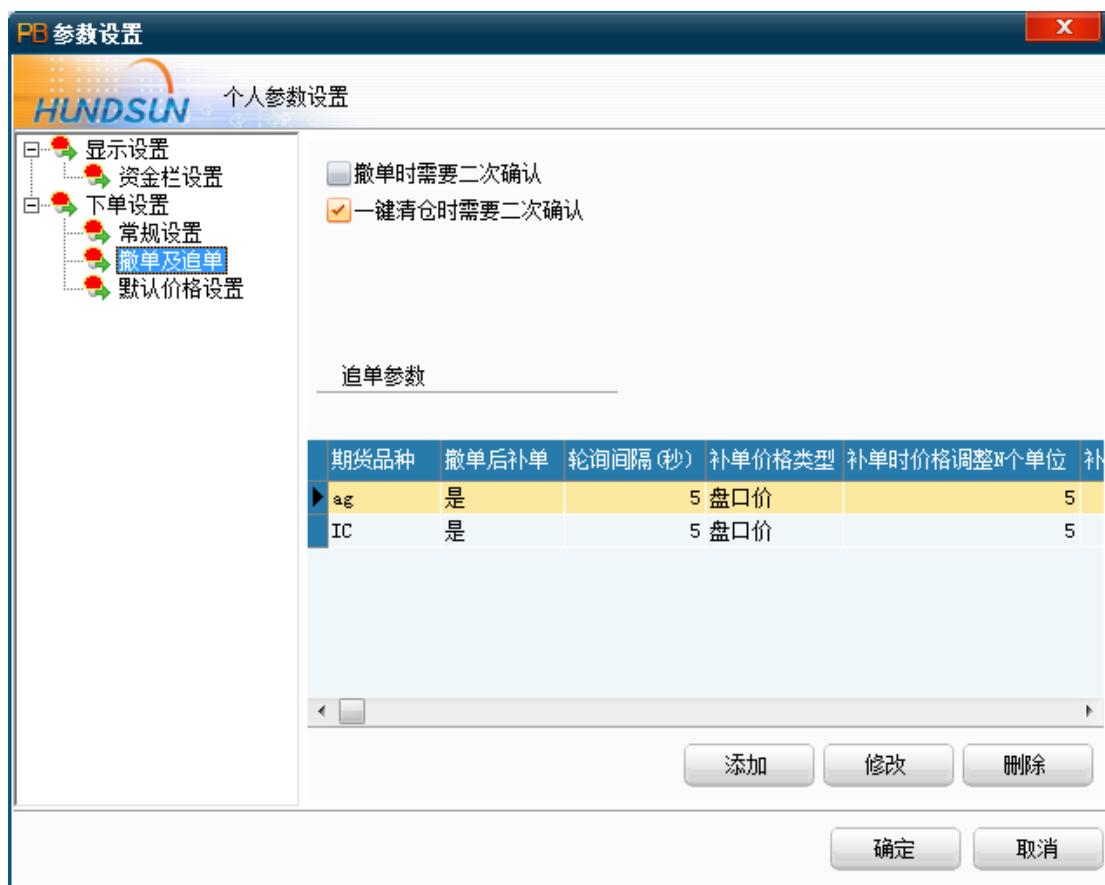


图 3.8.37



图 3.8.38

产品编号: 56 模拟成交2
单元编号: 3 模拟成交2
买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出
开 平: ☒ 开仓 ☐ 平仓
组合单: ag1509@ag1511 ag1509@ag1511
第一腿: 白银1509 第二腿: 白银1511
数 量: 20 数 量: 20
价 差: -0.18
数 量: 20
先后套利 ☐ 追单 ☒
下单 重置

图 3.8.39

在<撤单及追单>界面**添加**追单参数，在弹出追单参数设置界面，依次录入追单要素。
完成追单参数设置后，在已经设置了追单参数的合约委托时勾选“追单”项即可。

- **期货品种：**追单期货品种。
- **轮循间隔：**每次补单的轮循时间。
- **撤单后补单：**默认选择，先对原委托进行撤单，撤单成功后再进行补单；如不选择，则仅撤单不补单
- **补单价格类型：**补单默认的价格类型。
- **补单时价格调整 N 个单位：**补单时，在默认价格基础上调整 N 个单位。即买入时，在默认的价格基础上浮 N 个单位；卖出时，在默认的价格基础上下调 N 个单位。
- **补单价格不得超过原价格的 N 个单位：**在原委托价格基础上可以追价的最大范围，超过此范围则不再追价。即：买入时，在默认的价格基础上允许最高上浮 N 个单位；卖出时，在默认的价格基础上最高下调 N 个单位。

注意：

追单适用于所有自定义套利单的两腿合约，如果只有一腿设置了追单项，那么单腿满足追单条件后，即撤销并补单。

3.8.2.9 撤单、改单

用户可以在<委托栏>→<挂单>标签页中下达撤单、改单指令。

3.8.2.9.1 普通撤单

如果要撤销挂单，在查询区<挂单>页面选择一条或多条委托记录，点击**撤单**，即可对该条撤销该委托。

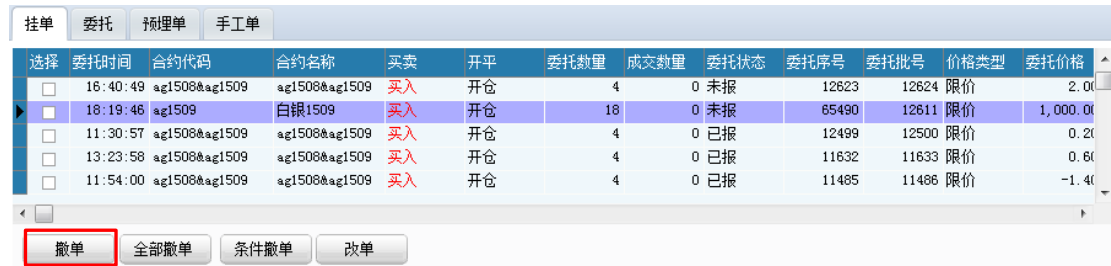


图 3.8.40

3.8.2.9.2 全部撤单

全部撤单是撤销列表中的所有挂单，如果要执行该操作，在页面点击**全部撤单**即可，系统会自动发送撤单委托。

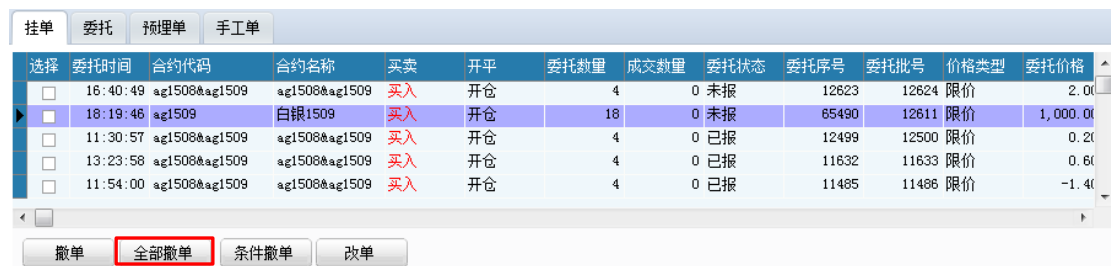


图 3.8.41

3.8.2.9.3 条件撤单

在<挂单>界面点击**条件撤单**后，在弹出的“条件撤单”界面中填写**产品编号**、**单元编号**、**合约代码**、**委托方向**，**查询**可查看待撤委托。确认**撤单**后，系统会自动按撤单条件查找相应可撤委托，并发送撤单指令。

PB 条件撤单

产品编号: 56 模拟成交2 单元编号: 3 模拟成交2

合约代码: ag1508 白银1508 委托方向: 买入

查询 重置

委托时间	证券代码	证券名称	买卖	开平	委托数量	委托价格	委托状态	投资类型	成交数量	成交全
21:20:50	ag1508	白银1508	卖出	开仓	1	1001	已报	投机	0	
21:20:01	ag1508	白银1508	买入	开仓	1	999.2	已报	投机	0	
21:19:33	ag1508	白银1508	买入	开仓	1	1000.2	已报	投机	0	
21:13:55	ag1508	白银1508	买入	开仓	1	999.6	已报	投机	0	
21:05:21	ag1508	白银1508	买入	开仓	5	1001	已报	投机	0	
21:00:55	ag1508	白银1508	买入	开仓	1	999.8	已报	投机	0	
20:54:30	ag1508	白银1508	买入	开仓	1	1000	已报	投机	0	
20:34:46	ag1508	白银1508	卖出	开仓	1	2000	已报	投机	0	
18:19:46	ag1508	白银1508	买入	开仓	18	1000	未报	投机	0	

撤单 取消

图 3.8.42

3.8.2.9.4 改单

在<挂单>界面勾选单笔委托并点击**改单**后，在弹出的“改单”界面可以修改当前委托价格。确定后系统撤销原委托并根据改单价格重新下达委托。

挂单 委托 预埋单 手工单

PB 改单

修改委托单

合约: ag1508
方向: 买入开仓
价格: 1000.00

确定 取消

选择	委托时间	合约代码	合约名称	买卖
☐	16:40:49	ag1508	ag1508	买入
☒	18:19:46	ag1508	白银1508	买入
☒	11:30:57	ag1508	ag1508	买入
☐	13:23:58	ag1508	ag1508	买入
☐	11:54:00	ag1508	ag1508	买入

撤单 全部撤单 条件撤单 改单

委托序号	委托批号	价格类型	委托价格
12623	12624	限价	2.00
65490	12611	限价	1,000.00
12499	12500	限价	0.20
11632	11633	限价	0.60
11485	11486	限价	-1.40

图 3.8.43

3.8.2.10 平仓、一键清仓

通过<持仓区>平仓、一键清仓功能可以快速平仓当前持仓合约。

合约代码	合约名称	买卖	持仓	可用	持仓均价	浮动盈亏	盯市盈亏	静态保证金占用	投资类型	产品编号	产品
IF1508	IF1508	买	100	100	1.00	928,000.00	928,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1508	IF1508	买	100	100	1.00	928,000.00	928,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1508	IF1508	卖	100	100	1.00	928,000.00	928,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1508	IF1508	卖	100	55	1.00	928,000.00	928,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1509	IF1509	买	100	64	1.00	982,000.00	982,000.00	6,000.00	投机	4	期货
IF1509	IF1509	卖	100	100	1.00	982,000.00	982,000.00	6,000.00	投机	4	期货
ag1508	白银1508	买	50	50	1.00	749,700.00	749,700.00	150.00	投机	56	模拟
ag1508	白银1508	买	90	90	793.74	279,267.00	279,267.00	214,308.60	投机	56	模拟

平仓 一键清仓 条件平仓

图 3.8.44

3.8.2.10.1 平仓

平仓即是卖出前持仓合约。如果要平仓账户某合约持仓，在<持仓区>选中合约，点击 **平仓**，在弹出窗口中确认平仓信息，系统自动下达该合约的平仓委托，平仓数量=持仓数量，平仓价格设置请在【相关参数】内容中查看。

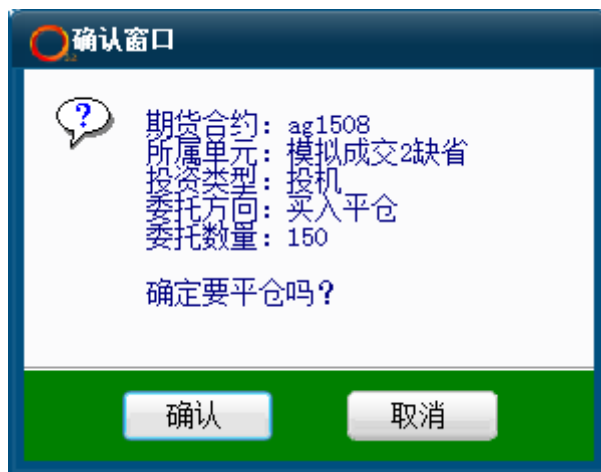


图 3.8.45

3.8.2.10.2 一键清仓

一键清仓的功能与上面的平仓类似，不同之处在于本功能实现的是将当前所有的持仓一次性平仓。

【相关参数】平仓、一键清仓价格模式

使用平仓、一键清仓功能时，并没有输入委托价格。默认平仓、清仓委托价格使用<功能栏>→<参数设置>→<下单设置>→<常规设置>中“平仓/一键清仓价格类型”和“平仓/一键清仓价格调整 N 个单位”进行控制。

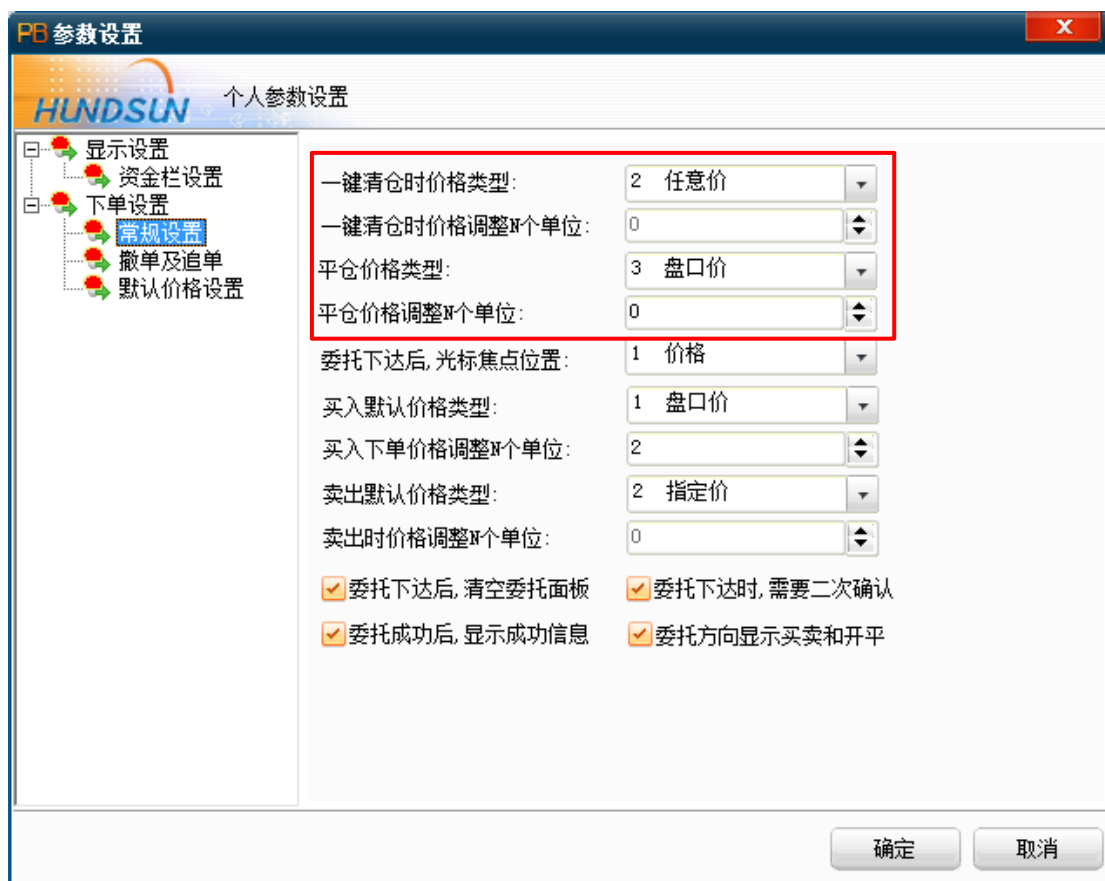


图 3.8.46

平仓/一键平仓价格类型：执行平仓/一键平仓操作时平仓价格的价格类型，在下拉框中可以选择“盘口价”、“指定价”、“任意价”、“挂单价”、“最新价”。

平仓/一键平仓价格调整 N 个单位：该项的含义是在“平仓/一键平仓价格类型”设置的基数基础上调整的 N 个最小单位价差。即平仓价格=平仓价格类型-N*最小单位价差，那么一键平仓价格=一键平仓间隔类型-N*合约最小单位价差。

3.8.3 参数设置

用户可以在<委托栏>→<参数设置>弹出的界面设置个人参数。

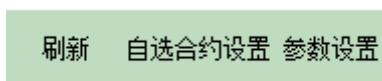


图 3.8.47

3.8.3.1 显示设置

3.8.3.1.1 资金栏设置

资金栏设置界面上，选中字段会在资金栏上显示，反之不显示。

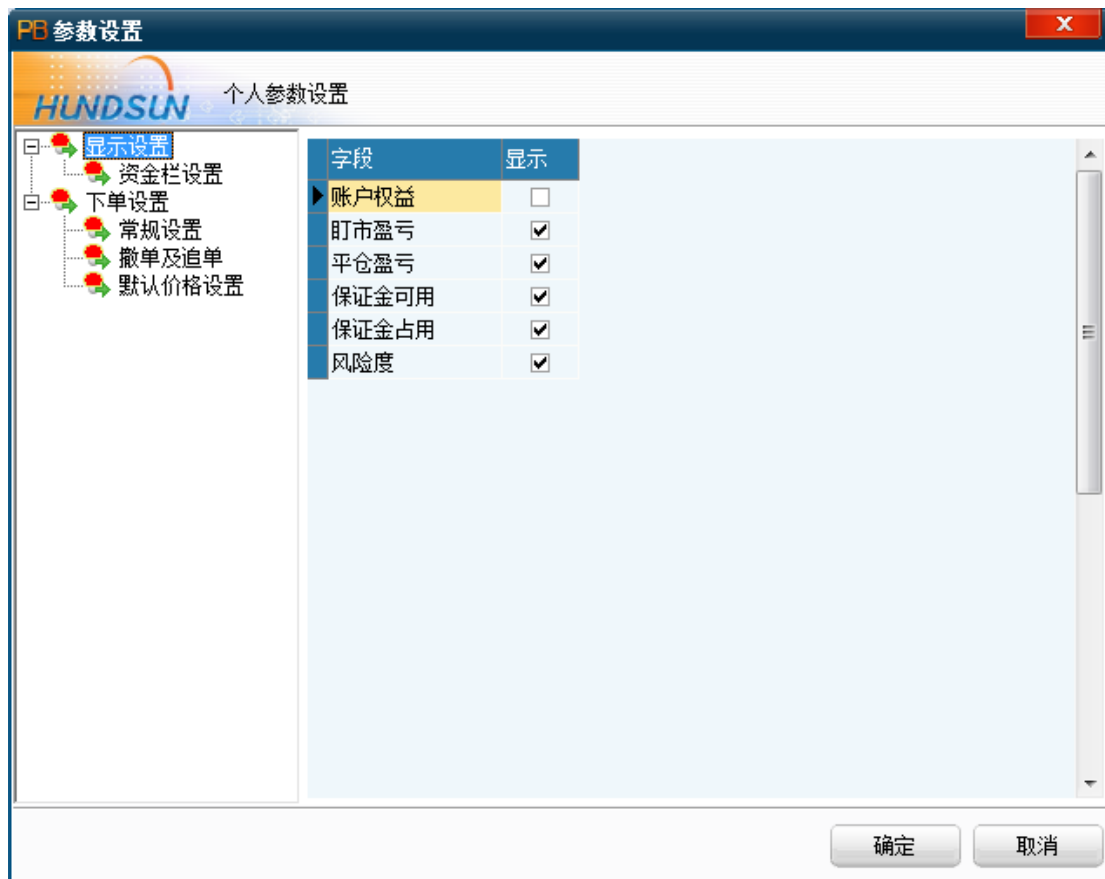


图 3.8.48

3.8.3.2 下单设置

3.8.3.2.1 常规设置



图 3.8.49

买入/卖出默认价格类型：用户在委托栏填写买/卖方向后，价格项默认显示价格类型。“盘口价”是当前行情对手方最优价格；“指定价”默认显示 0；“任意价”即为市价；“挂单价”为当前行情本方最优价格；“最新价”是最新成交价。

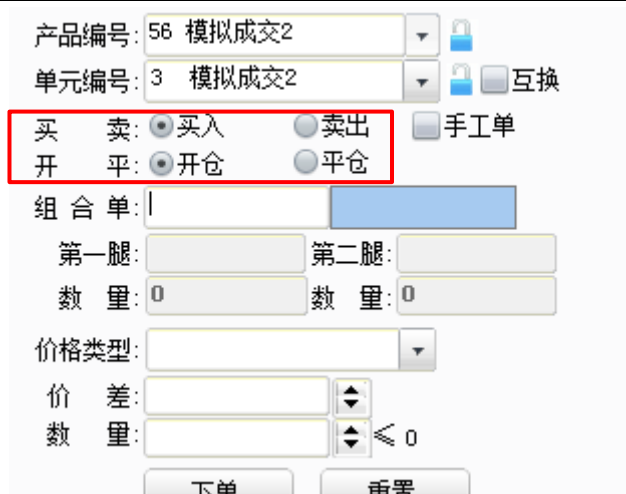
买入/卖出下单价格调整 N 个单位：填写买入/卖出默认价格的基础上调整的最小价差数量，买入默认显示价格=买入默认价格类型+N*最小单位价差，卖出默认显示价格=卖出默认价格类型-N*最小单位价差。

委托下达完成之后，清空委托面板：委托成功后，清空委托栏和行情栏内容。

委托下达时，需要二次确认：下单后，是否弹出对话框需要用户二次确认。

委托成功后，显示成功信息：下单成功后，是否弹出成功提示信息。

委托方向显示买卖和开平：勾选后，委托方向分为“开平”，“买卖”选项，如下图所示。



产品编号: 56 模拟成交2

单元编号: 3 模拟成交2

买 卖: ☒ 买入 ☐ 卖出

开 平: ☒ 开仓 ☐ 平仓

组合单: |

第一腿: 第二腿:

数 量: 0 数 量: 0

价格类型:

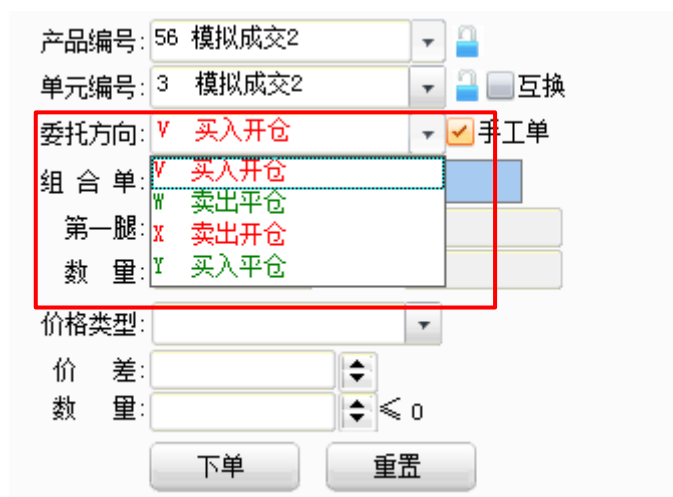
价 差:

数 量: ≤ 0

下单 重置

图 3.8.50

若不勾选该项，委托方向显示为“买入开仓”，“买入平仓”，“卖出开仓”，“卖出平仓”四项，如下图。



产品编号: 56 模拟成交2

单元编号: 3 模拟成交2

委托方向: V 买入开仓

组合单: V 买入开仓

第一腿: W 卖出平仓

数 量: X 卖出开仓

数 量: Y 买入平仓

价格类型:

价 差:

数 量: ≤ 0

下单 重置

图 3.8.51

3.8.3.2.2 撤单及追单

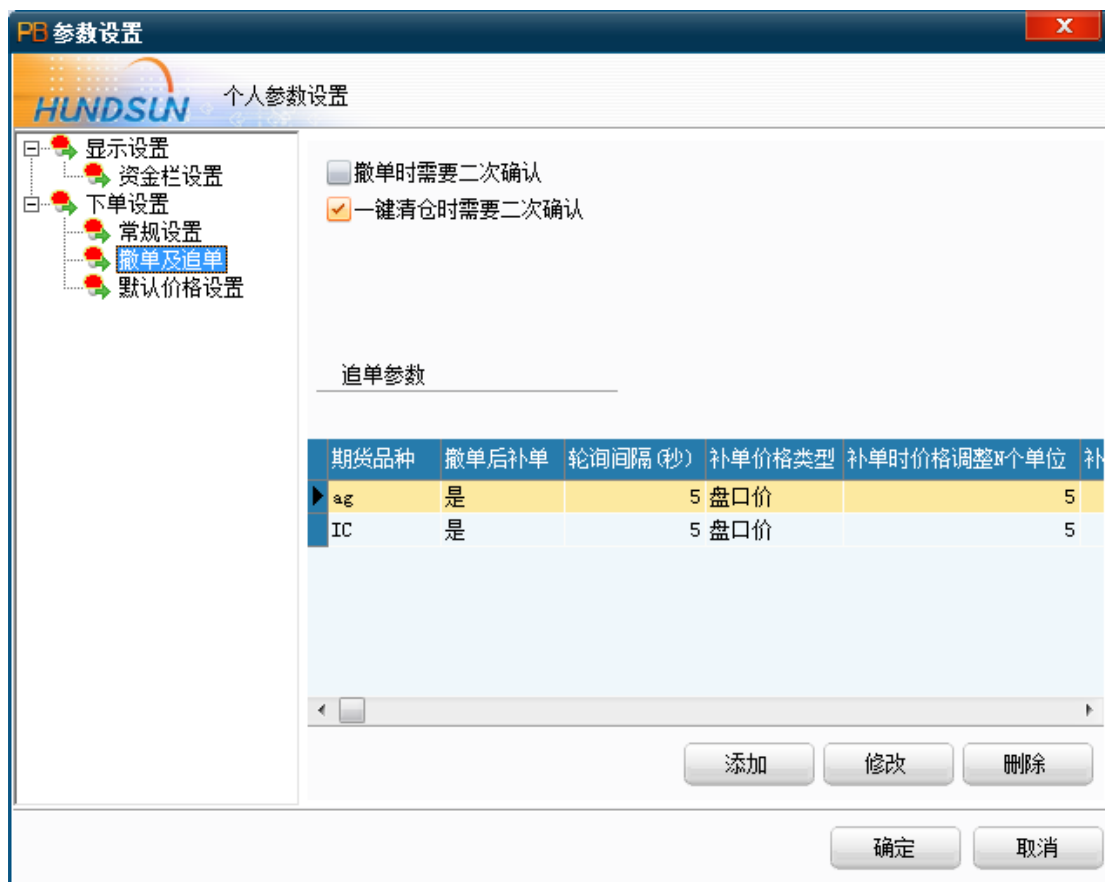


图 3.8.52

撤单时需要二次确认：在<查询区>→<挂单>列表**撤单**或双击撤单时，弹出确认提示框。

一键清仓时需要二次确认：在<持仓栏>使用**一键清仓**功能时，弹出确认提示框。

3.9 期现套利

3.9.1 界面

3.9.1.1 主界面

进入【交易管理】→【期现套利】，会出现如下主界面：



图 3.9.1

- **行情栏**：该区域用于显示期货基差、行情。关于行情栏的详细说明请查看[行情栏](#)页面。
- **委托栏**：委托栏分为<期现套利>、<委托查询>、<成交查询>、<现货持仓>、<期货持仓>五个标签页，用户在这里输入委托要素，进行下单，还可以进行查询、撤单等操作。关于委托区的详细说明请查看[委托栏](#)页面。

3.9.1.2 行情栏

行情栏界面显示用户定制的中金所股指期货行情。用户可以自定义行情，详细操作请查看[行情设置](#)页面。

在页面右键弹出菜单可以对界面进行布局设置，详细操作请查看[布局设置](#)页面。

股指期货行情																	
合约代码	合约名称	交易市场	基差	最新价	涨跌	买价	买量	卖价	卖量	成交量	最高价	最低价	涨停	跌停	昨结算	开盘价	币种
IC1508	IC1508	中金所	8,088.6	8,088.6 ↑	8,088.6 ↑	8,087.8	14	8,089.4	60	37,338,584	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	8,087.9	人民币
IC1509	IC1509	中金所	7,832.6	7,832.6 ↑	7,832.6 ↑	7,832.4	7	7,833.4	83	37,347,504	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	7,834.0	人民币
IC1601	IC1601	中金所	7,544.4	7,544.4 ↑	7,544.4 ↑	7,544.0	72	7,545.2	56	37,299,819	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	7,544.0	人民币
IF1508	IF1508	中金所	1,000.4	1,000.4 ↑	1,000.4 ↑	999.8	93	1,000.6	16	37,306,699	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	999.9	人民币
IF1509	IF1509	中金所	999.8	999.8 ↑	999.8 ↑	999.2	62	1,000.4	50	37,298,417	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	1,000.0	人民币
IF1512	IF1512	中金所	998.8	998.8 ↑	998.8 ↑	998.2	76	998.8	13	37,310,932	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	1,000.0	人民币
行情说明																	

图 3.9.2

基差：期货最新价一现货指数最新价，反映期货市场和现货市场的价格差距。

最新价：合约最新成交价。

涨跌：当日每手合约涨跌金额，最新价-昨结算价。

买价：合约买方向盘口价。

买量：合约买价的当前挂单数量。

卖价：合约卖方向盘口价。

卖量：合约卖价的当前挂单数量。

成交量：当日成交手数。

最高价：当日合约的历史最高价位。

最低价：当日合约的历史最低价位。

涨停：交易所规定的当日合约最高价格。

跌停：交易所规定的当日合约最低价格。

开盘价：当日开盘价。

昨结算：昨天收盘时的结算价格。

3.9.1.3 委托栏

3.9.1.3.1 期现套利

用户在<期现套利>界面输入委托要素，进行下单。

选择	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	委托金额	提示信息	市场
☒	IF1508	IF1508	卖出开仓	限价	999.80	1	59,988.00		中金所
☒	600004	白云机场	买入	限价	11.20	100	1,120.00		上交所A
☒	600005	宝钢股份	买入	限价	6.27	100	627.00		上交所A
☒	600006	东风汽车	买入	限价	2.95	100	295.00		上交所A
☒	600007	中国国贸	买入	限价	7.58	100	758.00		上交所A
☒	600008	首创股份	买入	限价	4.34	100	434.00		上交所A
☒	600009	上海机场	买入	限价	15.15	100	1,515.00		上交所A
☒	600010	包钢股份	买入	限价	2.71	100	271.00		上交所A
☒	600011	华能国际	买入	限价	6.34	100	634.00		上交所A
☒	600012	皖通高速	买入	限价	4.14	100	414.00		上交所A
☒	600015	华夏银行	买入	限价	7.45	100	745.00		上交所A

图 3.9.3

产品组：填写期现单元产品组，产品组操作请查看[产品组维护](#)页面。

产品编号：填写投资产品编号。

期货单元：填写产品的期货投资单元，只有资金账号类型是“期货资金账号”的单元可以进行期货交易。

现货单元：填写产品的现货投资单元，与期货单元类似，资金账号类型是“股票资金账号”的单元可以进行现货交易。

方向：此处方向是指“开平方向”，可以填入“建仓”或“平仓”。当开平方向为“建仓”时，期货的委托方向是“卖出开仓”，现货的委托方向是“买入”。反之，当开平方向为“平仓”时，期货的委托方向是“买入平仓”，现货的委托方向是“卖出”。

合约代码：双击<行情栏>合约可以带出，也可以手工填入套利期货合约。

现货模板：填入期货合约预设现货套利模板，模板设置请查看模板管理页面。

操作份数：填入现货模板下达份数。不能超过右侧的可操作份数，可操作份数=MIN（期货可操作份数，现货可操作份数）；期货可操作份数=可用保证金/委托金额；现货可操作份数=现货可用金额/SUM（勾选的现货委托金额）。

可用保证金：显示期货单元的保证金可用。

可用金额：显示现货单元的资金可用。

参数定制：在弹出界面可以进行个人参数设置。

下单：点击下单按钮执行下单操作。

重置：清空委托栏，和待下达委托列表显示内容。

委托价格：可以在<委托栏>→<参数定制>弹出框内设置期货开平仓默认价格和现货价格。用户可以手工修改<单元委托>中的委托价格。

包含涨停股：是否勾选<单元委托>中的涨停股，默认包含。

包含跌停股：是否勾选<单元委托>中的跌停股，默认包含。

增加证券：使用该功能可以在<单元委托>界面快速增加证券。

3.9.1.3.2 委托查询

用户可以在该界面查询当前挂单委托，并可以撤销或修改委托价格。界面左下角显示当前挂单笔数。通过界面下方的委托状态栏可以筛选列表汇总的委托。

☒ 未成 ☐ 已成 ☐ 已撤 ☐ 废单

图 3.9.4

在页面右键弹出菜单可以调整布局设置，详细操作请查看[布局设置](#)页面。

委托批号	委托序号	委托状态	证券代码	证券名称	委托方向	成交 00	委托数量	委托价格	价格类型	成交数量	成交均价	撤单数量	市场	币种	委托金额	发生日期	委托时
	共(3)条	未报				0%	49,402			0					1,199,051.00		
	共(4)条	未报				0%	301			0					913,011.00		
11925	45243	未报	000002	万科 A	买入	0%	100	8.120	限价	0	0.000	0	深交所A	人民币	812.00	2009-01-09	16
11925	45242	未报	600199	金种子酒	买入	0%	100	8.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	887.00	2009-01-09	16
11925	45241	未报	600004	白云机场	买入	0%	100	12.520	限价	0	0.000	0			252.00	2009-01-09	16
11925	45240	未报	IF1509	IF1509	卖出开仓	0%	1	3,033.800	限价	0	0.000	0			3,033.800	2009-01-09	16
	共(2)条	未报				0%	101			0					1,051,400.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					1,051,400.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					1,051,400.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					1,051,400.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					1,051,400.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					2,792.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					30,812.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					30,812.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					30,812.00		
	共(2)条	未报				0%	101			0					60,812.00		

图 3.9.5

委托批号：同笔期现套利的委托批号相同。

委托状态：委托查询界面显示委托状态。

成交(%)：显示当前挂单的成交百分比。

3.9.1.3.3 成交查询

显示当日委托成交情况。界面左下角显示当前挂单笔数。

证券代码	证券名称	基金名称	单元	组合编号	组合名称	委托方向	成交价格	成交数量	成交金额	委托数量	市场	日期	成交时间
000001	333家发展A	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	12.700	200	2,540.00	200	深交所A	2009-01-	
000001	333家发展A	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	12.700	100	1,270.00	100	深交所A	2009-01-20:25:21	
000001	333家发展A	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	12.700	100	1,270.00	100	深交所A	2009-01-20:19:33	
000002	万科A	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	6.100	200	1,220.00	200	深交所A	2009-01-	
000002	万科A	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	6.100	100	610.00	100	深交所A	2009-01-20:25:18	
000002	万科A	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	6.100	100	610.00	100	深交所A	2009-01-20:19:30	
000004	国农科技	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	3.600	200	720.00	200	深交所A	2009-01-	
000004	国农科技	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	3.600	100	360.00	100	深交所A	2009-01-20:25:20	
000004	国农科技	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	3.600	100	360.00	100	深交所A	2009-01-20:19:32	
000007	零七股份	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	3.900	200	780.00	200	深交所A	2009-01-	
000007	零七股份	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	3.900	100	390.00	100	深交所A	2009-01-20:25:19	
000007	零七股份	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	买入	3.900	100	390.00	100	深交所A	2009-01-20:19:31	
IF1001	IF1001	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	卖出开仓	235,516.981	53	12,482,400.00	53	中金所	2009-01-	
IF1001	IF1001	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	卖出开仓	8.000	1	2,400.00	1	中金所	2009-01-18:16:22	
IF1001	IF1001	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	卖出开仓	800.000	1	240,000.00	1	中金所	2009-01-20:23:38	
IF1001	IF1001	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	卖出开仓	800.000	1	240,000.00	1	中金所	2009-01-20:19:42	
IF1001	IF1001	BC期债基金	非标准中金	1234001	非标准中金投机	卖出开仓	800.000	50	12,000,000.00	50	中金所	2009-01-19:27:19	

图 3.9.6

在页面右键弹出菜单可以进行如下操作：

- **布局设置：**选择<布局设置>，对当前页面的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置。详细操作见[布局设置](#)页面。
- **显示成交明细：**如果出现一笔委托多次成交的情况，会出现委托序号相同但成交序号不同的行，系统默认显示每一笔成交详情。
- **按委托序号汇总：**委托序号相同成交行汇总显示，点击打开可以查看汇总的包含的明细。汇总行的成交价格=SUM（明细成交价格）/SUM（明细成交数量）。
- **按证券代码、委托方向汇总：**证券代码、委托方向相同成交的汇总显示。汇总行的成交价格=SUM（明细成交价格）/SUM（明细成交数量）。

3.9.1.3.4 现货持仓

显示所有现货单元的持仓信息。界面左下角显示现货持仓笔数，使用 F5 快捷键手工刷新该界面。

日期	证券名称	证券代码	证券类别	最新价	成本价	基金名称	单元	组合编号	组合名称	持仓数量	当前成本	持仓市值(净值)	持仓市值(现价)	持仓市值(净值)/单元净值(%)	持
2009-01-09	上海汽车	600104	股票	14.0000	0.0000	14.0000 14.0000 14.0000	单元一	10000001	组合一	100,000	0.00	2,461,000.00	2,461,000.00	0.0000	
2009-01-09	上海汽车	600104	股票	14.0000	0.0000	14.0000 14.0000 14.0000	单元一	10000001	组合一	100,000	0.00	2,461,000.00	2,461,000.00	0.0000	
2009-01-09	上海汽车	600104	股票	14.0000	0.0000	14.0000 14.0000 14.0000	单元一	10000001	组合一	100,000	0.00	2,461,000.00	2,461,000.00	0.0000	
2009-01-09	中国平安	601318	股票	40.0000	0.0000	40.0000 40.0000 40.0000	单元一	10000001	组合一	10,010,000	0.00	461,246,100.00	461,246,100.00	25.3511	
2009-01-09	上海汽车	600104	股票	14.0000	0.0000	14.0000 14.0000 14.0000	单元一	10000001	组合一	100,000	0.00	2,461,000.00	2,461,000.00	0.0000	
2009-01-09	华夏ETF	150306	开放式基金	1.6460	0.0000	1.6460 1.6460 1.6460	单元一	10000001	组合一	1,000,000	0.00	164,555,000.00	164,555,000.00	84.2476	
2009-01-09	深100ETF	159901	开放式基金	2.2000	0.0000	2.2000 2.2000 2.2000	单元一	10000001	组合一	1,000,000	0.00	2,149,000.00	2,149,000.00	1.1002	
2009-01-09	SSEETF	510050	开放式基金	4.0400	0.0000	4.0400 4.0400 4.0400	单元一	10000001	组合一	1,000,000	0.00	4,009,000.00	4,009,000.00	2.0525	
2009-01-09	浦发银行	600000	股票	52.0000	0.9510	52.0000 52.0000 52.0000	单元一	10000001	组合一	15,550	14,797.98	814,820.00	814,820.00	30.3819	
2009-01-09	鲁信高新	600783	股票	8.0900	19.3074	8.0900 8.0900 8.0900	单元一	10000001	组合一	100	1,930.74	795.00	795.00	0.0296	
2009-01-09	保利地产	600048	股票	85.7000	0.0000	85.7000 85.7000 85.7000	单元一	10000001	组合一	-1,400	0.00	116,620.00	116,620.00	4.3484	
2009-01-09	迪安诊断	600177	股票	31.9000	0.0000	31.9000 31.9000 31.9000	单元一	10000001	组合一	-1,600	0.00	51,472.00	51,472.00	1.9192	
2009-01-09	通宝能源	600780	股票	8.9200	7.0700	8.9200 8.9200 8.9200	单元一	10000001	组合一	100	707.00	875.00	875.00	0.0326	
2009-01-09	振华重工	600320	股票	28.9400	0.0000	28.9400 28.9400 28.9400	单元一	10000001	组合一	-2,000	0.00	54,580.00	54,580.00	2.0351	
2009-01-09	贵州茅台	600519	股票	153.7900	0.0000	153.7900 153.7900 153.7900	单元一	10000001	组合一	-400	0.00	61,000.00	61,000.00	2.3043	
2009-01-09	华夏银行	600015	股票	20.3500	0.0000	20.3500 20.3500 20.3500	单元一	10000001	组合一	-2,400	0.00	48,408.00	48,408.00	1.8050	

图 3.9.7

在页面上点击右键，可以执行以下操作：

- **刷新 (W)**：在右键弹出菜单栏内选择“刷新”，手动刷新持仓栏内容，现自动刷新频率为 5S。
- **查询 (X)**：在右键菜单栏内选择“查询”，弹出持仓区查询界面如下，可通过多选 产品编号、单元编号、交易市场、证券类别，指定 证券代码、起始时间、终止时间 对列表显示的证券持仓信息进行筛选。查询完毕后如要恢复持仓区显示，点击 重置，清空或删除查询筛选项即可。

PB 持仓高级查询

设置查询条件
持仓查询条件明细设置

产品编号: 11 现货基金

证券代码: 600570 恒生电子

单元编号: 3 现货单元

起始时间: 2009-01-09

交易市场: 1 上交所A

终止时间: 2009-01-09

证券类别: 1 股票

确定

取消

重置

图 3.9.8

- **布局设置 (Y)**：在菜单中选择“布局设置”，即可进入布局设置页面，对当前行情页的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置，详细操作见 [布局设置](#) 页面。
- **定位 (Z)**：在弹出的快速定位栏中，输入证券代码后能够快速定位到证券所在行。



图 3.9.9

3.9.1.3.5 期货持仓

显示所有期货单元的持仓信息。界面左下角显示期货持仓笔数，使用 F5 快捷键手工刷新该界面。

日期	基金名称	单元	组合编号	组合名称	合约代码	合约名称	买卖	总持仓	持仓	持仓	持仓均价	前结算价	最新价
2009-01-09	IC期货基金	非标准持仓	1234071	非标准持仓组合	CF303	棉花1303	买	0	0	0	0.00	19,480.00	3,000.00
2009-01-09	IC期货基金	非标准持仓	1234071	非标准持仓组合	CF305	棉花1305	买	0	0	0	0.00	15,999.00	3,000.00
2009-01-09	IC期货基金	非标准持仓	1234001	非标准持仓组合	ZF1003	ZF1003	买	0	0	0	0.00	1,000.00	1,000.50
2009-01-09	IC期货基金	非标准持仓	1234061	非标准持仓组合	SI1009	豆一1009	买	0	0	0	0.00	1,000.00	998.50
2009-01-09	IC期货基金	非标准持仓	1234061	非标准持仓组合	ZF1006	ZF1006	买	0	0	0	0.00	1,000.00	999.00
2009-01-09	IC期货基金	非标准持仓	1234001	非标准持仓组合	IC1406	IC1406	买	0	0	0	0.00	3,973.00	3,971.50
合计: 50条								279	0	279			

合约编号	合约代码	合约名称	买卖	持仓手数	持仓手数	持仓手数	持仓价格	持仓类型	持仓类型	持仓日期	持仓时间	浮动盈亏	总市值	当日平仓盈亏	平仓盈亏	总盈亏
合计: 0条																

图 3.9.10

在界面上点击右键，可以执行以下操作：

- **刷新 (W)**：在右键弹出菜单栏内选择“刷新”，手动刷新持仓栏内容，现自动刷新频率为 5S。
- **查询 (X)**：在右键菜单栏内选择“查询”，弹出持仓区查询界面如下，可通过多选产品编号、单元编号、交易市场、证券类别，指定证券代码、起始时间、终止时间对列表显示的证券持仓信息进行筛选，还可以勾选窗口左下角的“显示零持仓记录”栏，显示零持仓但权益大于零的期货持仓。查询完毕后如要恢复持仓区显示，点击重置，清空或删除查询筛选项即可。

PB 期货持仓查询条件设置

设置查询条件
 期货持仓查询条件明细设置

产品编号: 52 期现产品02

合约代码: IF1508 IF1508

单元编号: 8 现货单元02-2

开始日期: 2008-01-09

交易市场: 7 中金所

结束日期: 2009-01-09

期货品种: 52 上证50股指期货

☒ 显示零持仓记录

确定 取消 重置

图 3.9.11

- **布局设置 (Y):** 在菜单中选择“布局设置”，即可进入布局设置页面，对当前行情页的字体、颜色，可见，打印和显示顺序进行设置，详细操作见[布局设置](#)页面。
- **定位 (Z):** 在弹出的快速定位栏中，输入证券代码后能够快速定位到证券所在行。

3.9.1.4 行情设置

用户通过行情设置调整<行情栏>显示期货行情。

在<行情栏>→<行情设置>弹出窗口“是否显示”列勾选在行情栏显示的期货，使用窗口右侧的“合约上移”，“合约下移”功能可以调整行情在列表中的显示顺序。

股指期货行情																	
合约代码	合约名称	交易市场	基差	最新价	涨跌	买价	买量	卖价	卖量	成交量	最高价	最低价	涨停	跌停	昨结算	开盘价	币种
IC1508	IC1508	中金所	8,088.6	8,088.6 ↑	8,088.6 ↑	8,087.8	14	8,089.4	60	37,338,584	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	8,087.9	人民币
IC1509	IC1509	中金所	7,832.6	7,832.6 ↑	7,832.6 ↑	7,832.4	7	7,833.4	83	37,347,504	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	7,834.0	人民币
IC1601	IC1601	中金所	7,544.4	7,544.4 ↑	7,544.4 ↑	7,544.0	72	7,545.2	56	37,299,819	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	7,544.0	人民币
IF1508	IF1508	中金所	1,000.4	1,000.4 ↑	1,000.4 ↑	999.8	93	1,000.6	16	37,306,699	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	999.9	人民币
IF1509	IF1509	中金所	999.8	999.8 ↑	999.8 ↑	999.2	62	1,000.4	50	37,298,417	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	1,000.0	人民币
IF1512	IF1512	中金所	998.8	998.8 ↑	998.8 ↑	998.2	76	998.8	13	37,310,932	10,000.0	0.0	10,000.0	0.0	0.0	1,000.0	人民币

行情设置

图 3.9.12



图 3.9.13

3.9.2 交易

3.9.2.1 产品组维护

在机构客户端进行期现套利投资时，同一个产品的现货单元和期货单元一般都是固定的。

期现套利产品组是将产品、期货单元、现货单元组合成一个固定产品组进行投资，可以减少用户在下单时选择产品、期货单元、现货单元的时间。

期现套利

委托查询

成交查询

现货持仓

其

产品组: -1 所有产品

维护

产品编号: 88 期现产品12

期货单元: 6 期货单元投机12

现货单元: 4 现货单元12-1

方 向: K 建仓

合约代码: IF1508

IF1508

现货模板: 05 期现套利10

操作份数: 0

≤ 828

可用保证金: 49,697,812.48

可用金额: 79,396,743.95

参数定制

下单

重置

图 3.9.14

PB 套利产品组维护

提示: 双击表格中的记录进行修改

套利产品组编号	套利产品组名称	产品名称	期货单元	现货单元
01	期现产品组01	期现产品01	期货单元套利01	现货单元01-2
02	期现产品组02	期现产品12	期货单元投机12	现货单元12-1
02	期现产品组02	期现产品	期货投机单元	现货单元
05	期现产品组5	期现产品	期货投机单元	现货单元
06	期现产品组6	期现产品	期货套保单元	现货单元
07	期现产品组7	期现产品02	期货单元投机02	现货单元02-1

套利产品组编号:

套利产品组名称:

产品编号: 8 期现基金

期货单元:

现货单元: 2 期限基金资金账户

新增

修改

删除

重置

退出

图 3.9.15

〈期现套利〉下单前,通过〈委托栏〉→〈期现套利〉→〈维护〉弹出界面新增期现单元产品组合。“套利产品组维护”界面列表内显示已经设置的产品组信息。

- **新增产品组:** 在“套利产品组维护”界面输入套利产品组编号、套利产品组名称、产品编号、期货单元、现货单元, 新增后,在委托栏产品组可以选择该新增产品组。

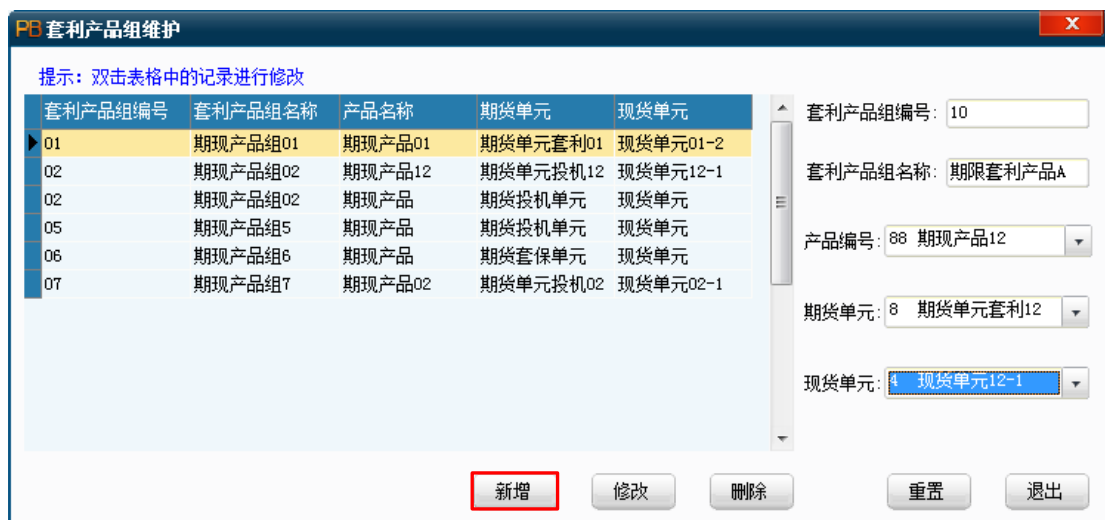


图 3.9.16

产品组: 10 期限套利产品组A 维护

产品编号: 88 期现产品12

期货单元: 8 期货单元套利12

现货单元: 4 现货单元12-1

方向: K 建仓

合约代码: IF1508 IF1508

现货模板: 05 期现套利10

操作份数: 21 ≤ 0

可用保证金: 0.00

可用金额: 0.00

参数定制 下单 重置

图 3.9.17

- **修改产品组:** 在产品组维护列表双击待修改的产品组，系统自动在输入框带出产品组详情，用户可以直接修改产品组内容，完成后点**修改**即可。
- **删除产品组:** 选中列表中的产品组，点**删除**即可。

3.9.2.2 期现套利

期现套利是指某种期货合约，当期货市场与现货市场在价格上出现差距，从而利用两个

市场的价格差距，低买高卖而获利。目前主要通过股指期货的基差变化以及构建现货股票组合的方式进行期现套利。

期现套利举例

当股指期货指数超过了无套利区间的上边界，那么就出现了正向套利机会，买入现货指数成份股，卖出开仓股指期货。

当股指期货指数超过了无套利区间的下边界，那么就出现了反向套利机会。融券卖出现货指数成份股，买入开仓股指期货。当基差回复正常时，双边反向平仓。

在实际的操作中，因为现货融券卖空限制较多，所以以正向套利为主
运行原理示意图如下（绿色线内代表无套利区间，黄色线代表期货价格，蓝色线代表指数现货价格。）：

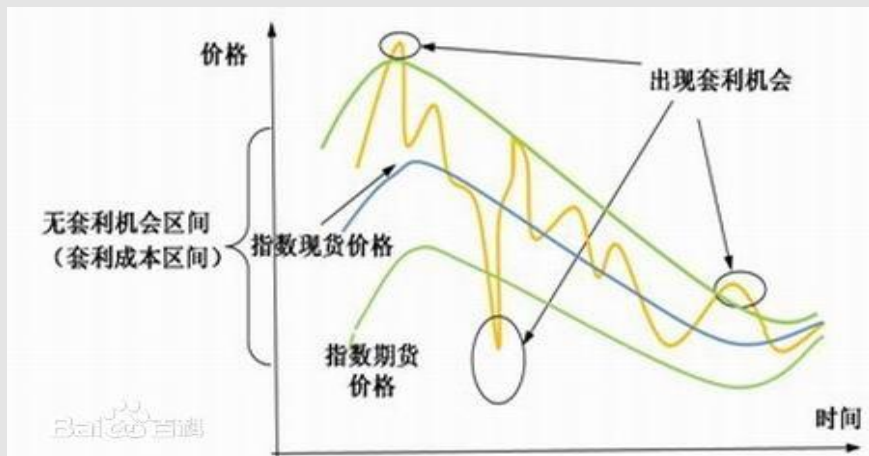


图 3.9.18

产品组	02 期现产品组02	维护
产品编号	88 期现产品12	
期货单元	6 期货单元投机12	
现货单元	4 现货单元12-1	
方向	K 建仓	
合约代码	IF1508 IF1508	
现货模板	05 期现套利10	
操作份数	2 < 828	
可用保证金	49,697,812.48	
可用金额	79,396,743.95	
参数定制	下单 重置	

选择	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	委托金额	提示信息	市场
☒	IF1508	IF1508	卖出开仓	限价	999.40	2	119,928.00	[委托价格]触发跌停预警;	中金所
☒	600004	白云机场	买入	限价	11.20	200	2,240.00		上交所A
☒	600005	武汉股份	买入	限价	6.27	200	1,254.00		上交所A
☒	600006	东风汽车	买入	限价	2.95	200	590.00		上交所A
☒	600007	中国国贸	买入	限价	7.58	200	1,516.00		上交所A
☒	600008	首创股份	买入	限价	4.34	200	868.00		上交所A
☒	600009	上海机场	买入	限价	15.15	200	3,030.00		上交所A
☒	600010	包钢股份	买入	限价	2.71	200	542.00		上交所A
☒	600011	华能国际	买入	限价	6.34	200	1,268.00		上交所A
☒	600012	皖通高速	买入	限价	4.14	200	828.00		上交所A
☒	600015	华夏银行	买入	限价	7.45	200	1,490.00		上交所A

☐ 包含涨停股 ☒ 包含跌停股 增加证券

图 3.9.19

在<期现套利>委托栏界面，依次输入委托要素，批量下单成功后，生成一笔期货委托和多笔现货委托，这些委托的委托批号相同。

- **产品组带出委托要素：**产品组输入“所有产品”，用户可以继续填入产品编号、期货单

元、现货单元；如果输入维护好的产品组，系统自动带出产品编号、期货单元、现货单元，并且这些列显示灰色不可以修改。

- **锁定：**可以使用产品组、产品编号、期货单元、现货单元右侧的锁定符对这几项委托要素内容进行锁定，委托要素为灰色，表示不能修改。重新点击锁定符解锁后，才能够修改委托要素内容。
- **期货：**输入合约代码，光标焦点移开后，在右侧<单元委托>列表新增显示期货行。
- **现货模板：**输入现货模板光标焦点转移后，<单元委托>列表刷新期限套利模板中的现货证券和期货委托数量。根据现货模板类型的不同，委托数量和委托金额的计算方式存在差别，此部分详细说明请查看[期现套利模板](#)页面。
- **限制委托：**如果套利委托中的数量、价格或其他不符合下单要求，现货行显示灰色并且不能勾选，在提示信息栏中可以查看错误信息。
- **涨停股和跌停股显示：**输入现货模板带出现货时，默认包含涨停股和跌停股，但是在现货涨停时，一般不抛售，跌停时一般不买入现货。使用“包含涨停股”和“包含跌停股”可以快速勾选和取消涨停、跌停股。
- **委托下达模板份数：**填写操作份数，焦点移动后，系统刷新期货现货委托数量。

注意：

目前期限套利最多支持同时下达 550 笔期货和现货，期现套利下委托必须有一笔期货，所以现货最多支持 549 笔。

【相关参数一】快速增加现货

在现货模板选出一揽子证券后，在期现委托过程中可能会出现另外增加一只证券的情况，用户可以通过<委托栏>增加证券功能，在弹出窗口中填入证券代码、价格类型、委托价格、委托数量吗，确定后在列表中快速增加现货。

单元委托 (共11条, 选中11条, 其中0条异常)

选择	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	委托金额	提示信息	市场
☒	IC1508	IC1508	卖出开仓	限价	8,068.80	1	323,464.00		中金所
☒	600004	白云机场	买入	限价	11.20	100	1,120.00		上交所A
☒	600005	武钢股份	买入	限价	6.27	100	627.00		上交所A
☒	600006	东风汽车	买入	限价	2.95	100	295.00		上交所A
☒	600007	中国国贸	买入	限价	7.58	100	758.00		上交所A
☒	600008	首创股份	买入	限价	4.34	100	434.00		上交所A
☒	600009	上海机场	买入	限价	15.15	100	1,515.00		上交所A
☒	600010	宝钢股份	买入	限价	2.71	100	271.00		上交所A
☒	600011	华能国际	买入	限价	6.34	100	634.00		上交所A
☒	600012	皖通高速	买入	限价	4.14	100	414.00		上交所A
☒	600015	华夏银行	买入	限价	7.45	100	745.00		上交所A

☐ 包含涨停股 ☒ 包含跌停股 增加证券

图 3.9.20

PB 添加证券

卖⑤	0.00	0	证券代码:	600570	恒生电子
卖④	0.00	0	价格类型:	0 限价	
卖③	0.00	0	委托价格:	10	[9.14 - 11.17]
卖②	0.00	0	委托数量:	200	≤ 7939674
卖①	0.00	0			
买①	0.00	0			
买②	0.00	0			
买③	0.00	0			
买④	0.00	0			
买⑤	0.00	0			

五档行情 确定 重置 关闭

图 3.9.21

【相关参数二】默认委托价格

在下期现套利单时，系统默认现货、期货的委托价格取当前最新价。用户也可以在<委托栏>→<参数定制>→<参数设置>界面的“现货价格设置”和“期货开仓参数设置”、“期货平仓参数设置”处分别设置现货、期货的默认委托价格。

- **现货价格设置：**在<现货价格设置>界面，依次输入交易市场、资产类别、委托方向、价格类型、委托价格，点增加即可新增证券的默认取值。以下图为例，当现货模板带出上交所股票，且委托方向是“建仓”即现货委托方向是“买入”，委托类型采用“五档即成剩撤”的委托方式。

现货价格设置

交易市场: 1 上交所A
 资产类别: 2 股票资产
 委托方向: 1 买入
 价格类型: a 五档即成剩撤
 委托价格: 1 最新 + 价位 价位

市场	资产类别	委托方向	价格类型	委托价格	价位
上交所A	股票资产	买入	五档即成剩撤	最新价	0

添加 删除

图 3.9.22

期货套利 委托查询 成交查询 现货持仓 期货持仓

产品组: 1 所有产品 维护
 产品编号: 88 期货产品12
 期货单元: 6 期货单元投机12
 现货单元: 4 现货单元12-1
 方向: K 建仓
 合约代码: IF1508 IF1508
 现货模板: 05 期货套利10
 操作份数: 0 ≤ 827
 可用保证金: 49,697,812.48
 可用金额: 79,396,743.95
 参数定制 下单 重置

单元委托 (共11条, 选中11条, 其中0条异常)

选择	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	委托金额	提示信息	市场
☒	IF1508	IF1508	卖出开仓	限价	1,000.00	1	60,048.00		中金所
☒	600004	白云机场	买入	五档即成剩撤	11.20	100	1,120.00		上交所A
☒	600005	宝钢股份	买入	五档即成剩撤	6.27	100	627.00		上交所A
☒	600006	东风汽车	买入	五档即成剩撤	2.95	100	295.00		上交所A
☒	600007	中国国贸	买入	五档即成剩撤	7.58	100	758.00		上交所A
☒	600008	首创股份	买入	五档即成剩撤	4.34	100	434.00		上交所A
☒	600009	上海机场	买入	五档即成剩撤	15.15	100	1,515.00		上交所A
☒	600010	宝钢股份	买入	五档即成剩撤	2.71	100	271.00		上交所A
☒	600011	华能国际	买入	五档即成剩撤	6.34	100	634.00		上交所A
☒	600012	皖通高速	买入	五档即成剩撤	4.14	100	414.00		上交所A
☒	600015	华夏银行	买入	五档即成剩撤	7.45	100	745.00		上交所A

☐ 包含涨停股 ☒ 包含跌停股 增加证券

图 3.9.23

这里介绍一下价格类型对于现货委托价格的影响:

上交所有“限价”，“五档即成剩撤”，“五档即成剩转”三个选项，“限价”指填写固定委托价格申报委托；“五档即成剩撤”指该申报在对手方五档盘口价内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分自动撤销；“五档即成剩转”指该申报在对手方实时对手方五档盘口价内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分按本方申报最新价限价申报；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。

深交所有“限价”，“五档即成剩撤”，“即成剩撤”，“对手方最优”，“本方最优”，“全额成或撤”六个选项。“限价”与“五档即成剩撤”与上交所相同，“即成剩撤”指该申报在对手方申报队列中以对手方价格为成交价逐次成交，未成交部分自动撤销；“对手方最优”以申报时对手方盘口价一作为委托价格进行申报；“本方最优”以申报时本方盘口价一作为委托价格进行申报；“全额成或撤”指申报在对手方申报队列中以对手方价格为成交价逐次成交，能成交的全部成交，若部分无法成交则申报全部撤销。

- **期货价格设置：**现在期限套利支持期货“卖出开仓”和“买入平仓”，这里只需要设置买入平仓价格和卖出开仓价格。在<期货开仓参数设置>界面，输入卖出开仓默认价格的基数以及调整价位，平仓价格设置与开仓价格设置一样。

期货开仓参数设置			
买入开仓默认价格:	卖一价	+	0 价位
卖出开仓默认价格:	买一价	-	0 价位
期货平仓参数设置			
买入平仓默认价格:	卖一价	+	0 价位
卖出平仓默认价格:	买一价	-	0 价位

图 3.9.24

【相关参数三】现货触发禁止类风控是否允许下单

期现套利下单时，一般是下达一笔期货委托和多笔现货委托，如果出现其中一笔或多笔现货委托触犯了禁止类风控时，系统通过<委托栏>→<参数定制>→<参数设置>→<其他参数设置>界面的“期现套利中现货部分净值委托市值比例的最小值”选项控制当前委托是否可以下达。如下图，如果该值设置为 5，即（触犯禁止类风控的现货市值/所有现货市值总和）小于等于 5%时，除了触犯禁止类风控的现货以外，其他委托可以下达。如果高于 5%，则整笔期现套利委托都不能下达。

PB 参数设置

现货价格设置

交易市场: 1 上交所A

资产类别: 2 股票资产

委托方向: 1 买入

价格类型: a 五档即成剩

委托价格: 1 最新 + 价位 价位

市场	资产类别	委托方向	价格类型	委托价格	价位
上交所A	股票资产	买入	五档即成剩	最新价	0

添加

删除

期货开仓参数设置

买入开仓默认价格: 卖一价 + 0 价位

卖出开仓默认价格: 买一价 - 0 价位

期货平仓参数设置

买入平仓默认价格: 卖一价 + 0 价位

卖出平仓默认价格: 买一价 - 0 价位

其他参数设置

期现套利中现货部分禁止委托市值比例的最小值: 5.00 %

☐ 委托启用实时行情

☒ 委托下达成功需要成功提示

☒ 撤单需要二次信息确认

☒ 委托需要二次信息确认

☐ 按百分比调整改单价格

确定

取消

图 3.9.25

3.9.2.3 撤单、改单

用户可以在<委托栏>→<委托查询>标签页中下达撤单、改单指令。

3.9.2.3.1 普通撤单

如果要撤销挂单，在查询区<可撤委托>页面选择一条或按 Ctrl 键选择多条委托记录，点击撤单，即可对该条撤销该委托。



The screenshot shows the '委托查询' (Order Query) window. At the bottom, there are several buttons: '撤单' (Cancel), '全部撤单' (Cancel All), '撤最近一批' (Cancel Last Batch), '条件撤单' (Conditional Cancel), and '批量撤单' (Batch Cancel). The '撤单' button is highlighted with a red rectangle.

委托批号	委托序号	委托状态	证券代码	证券名称	委托方向	成交 (%)	委托数量	委托价格	价格类型	成交数量	成交均价	撤单数量	市场	币种	委托金额	发生日期	委托时间
共(11)条 未报																	
12315	60287	未报	600015	华夏银行	买入	OK	100	7.450	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	745.00	2009-01-09	15
12315	60286	未报	600012	皖通高速	买入	OK	100	4.140	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	414.00	2009-01-09	15
12315	60285	未报	600011	华能国际	买入	OK	100	6.340	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	634.00	2009-01-09	15
12315	60284	未报	600010	包钢股份	买入	OK	100	2.710	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	271.00	2009-01-09	15
12315	60283	未报	600009	上海机场	买入	OK	100	15.150	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,515.00	2009-01-09	15
12315	60282	未报	600008	首创股份	买入	OK	100	4.340	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	434.00	2009-01-09	15
12315	60281	未报	600007	中国国贸	买入	OK	100	7.580	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	758.00	2009-01-09	15
12315	60280	未报	600006	东风汽车	买入	OK	100	2.950	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	295.00	2009-01-09	15
12315	60279	未报	600005	武钢股份	买入	OK	100	6.270	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	627.00	2009-01-09	15
12315	60278	未报	600004	白云机场	买入	OK	100	11.200	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,120.00	2009-01-09	15
12315	60277	未报	IF1508	IF1508	卖出开仓	OK	1	1,000.800	限价	0	0.000	0	中金所	人民币	300,240.00	2009-01-09	15
共(11)条 未报																	
共(14)条 未报																	
共(12)条 未报																	
共(12)条 未报																	

1198 (笔) ☒ 未成 ☐ 已成 ☐ 已撤 ☐ 废单

图 3.9.26

3.9.2.3.2 全部撤单

全部撤单是撤销列表中的所有挂单，如果要执行该操作，在页面点击**全部撤单**即可，系统会自动发送撤单委托。



The screenshot shows the '委托查询' (Order Query) window. At the bottom, there are several buttons: '撤单' (Cancel), '全部撤单' (Cancel All), '撤最近一批' (Cancel Last Batch), '条件撤单' (Conditional Cancel), and '批量撤单' (Batch Cancel). The '全部撤单' button is highlighted with a red rectangle.

委托批号	委托序号	委托状态	证券代码	证券名称	委托方向	成交 (%)	委托数量	委托价格	价格类型	成交数量	成交均价	撤单数量	市场	币种	委托金额	发生日期	委托时间
共(11)条 未报																	
12315	60287	未报	600015	华夏银行	买入	OK	100	7.450	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	745.00	2009-01-09	15
12315	60286	未报	600012	皖通高速	买入	OK	100	4.140	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	414.00	2009-01-09	15
12315	60285	未报	600011	华能国际	买入	OK	100	6.340	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	634.00	2009-01-09	15
12315	60284	未报	600010	包钢股份	买入	OK	100	2.710	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	271.00	2009-01-09	15
12315	60283	未报	600009	上海机场	买入	OK	100	15.150	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,515.00	2009-01-09	15
12315	60282	未报	600008	首创股份	买入	OK	100	4.340	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	434.00	2009-01-09	15
12315	60281	未报	600007	中国国贸	买入	OK	100	7.580	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	758.00	2009-01-09	15
12315	60280	未报	600006	东风汽车	买入	OK	100	2.950	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	295.00	2009-01-09	15
12315	60279	未报	600005	武钢股份	买入	OK	100	6.270	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	627.00	2009-01-09	15
12315	60278	未报	600004	白云机场	买入	OK	100	11.200	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,120.00	2009-01-09	15
12315	60277	未报	IF1508	IF1508	卖出开仓	OK	1	1,000.800	限价	0	0.000	0	中金所	人民币	300,240.00	2009-01-09	15
共(11)条 未报																	
共(14)条 未报																	
共(12)条 未报																	
共(12)条 未报																	

1198 (笔) ☒ 未成 ☐ 已成 ☐ 已撤 ☐ 废单

图 3.9.27

3.9.2.3.3 撤最后一批

撤最后一批是撤销最后一批挂单委托，直接点击**撤最近一批**，系统匹配委托批号最大的一批挂单申报撤销。



The screenshot shows the '委托查询' (Order Query) window. At the bottom, there are several buttons: '撤单' (Cancel), '全部撤单' (Cancel All), '撤最近一批' (Cancel Last Batch), '条件撤单' (Conditional Cancel), and '批量撤单' (Batch Cancel). The '撤最近一批' button is highlighted with a red rectangle.

委托批号	委托序号	委托状态	证券代码	证券名称	委托方向	成交 (%)	委托数量	委托价格	价格类型	成交数量	成交均价	撤单数量	市场	币种	委托金额	发生日期	委托时间
共(11)条 未报																	
12315	60287	未报	600015	华夏银行	买入	OK	100	7.450	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	745.00	2009-01-09	15
12315	60286	未报	600012	皖通高速	买入	OK	100	4.140	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	414.00	2009-01-09	15
12315	60285	未报	600011	华能国际	买入	OK	100	6.340	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	634.00	2009-01-09	15
12315	60284	未报	600010	包钢股份	买入	OK	100	2.710	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	271.00	2009-01-09	15
12315	60283	未报	600009	上海机场	买入	OK	100	15.150	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,515.00	2009-01-09	15
12315	60282	未报	600008	首创股份	买入	OK	100	4.340	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	434.00	2009-01-09	15
12315	60281	未报	600007	中国国贸	买入	OK	100	7.580	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	758.00	2009-01-09	15
12315	60280	未报	600006	东风汽车	买入	OK	100	2.950	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	295.00	2009-01-09	15
12315	60279	未报	600005	武钢股份	买入	OK	100	6.270	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	627.00	2009-01-09	15
12315	60278	未报	600004	白云机场	买入	OK	100	11.200	五档即成申报	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,120.00	2009-01-09	15
12315	60277	未报	IF1508	IF1508	卖出开仓	OK	1	1,000.800	限价	0	0.000	0	中金所	人民币	300,240.00	2009-01-09	15
共(11)条 未报																	
共(14)条 未报																	
共(12)条 未报																	
共(12)条 未报																	

1198 (笔) ☒ 未成 ☐ 已成 ☐ 已撤 ☐ 废单

图 3.9.28

3.9.2.3.4 条件改单

条件改单是对符合条件的委托进行撤销。用户在**条件改单**弹出条件撤单界面，输入**产品编号**、**单元编号**、**证券代码**、**委托方向**，确定后系统匹配列表中符合条件的项进行撤单。

委托批号	委托序号	委托状态	证券代码	证券名称	委托方向	成交(%)	委托数量	委托价格	价格类型	成交数量	成交均价	撤单数量	市场	币种	委托金额	发生日期	委托时
共113条 未报																	
12315	60287	未报	600015	华夏银行	买入	0%	100	7.450	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	745.00	2009-01-09	15
12315	60298	未报	600012	皖通高速	买入	0%	100	4.140	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	414.00	2009-01-09	15
12315	60295	未报	600011	华能国际	买入	0%	100	6.340	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	634.00	2009-01-09	15
12315	60294	未报	600010	包钢股份	买入	0%	100	2.710	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	271.00	2009-01-09	15
12315	60293	未报	600009	上海机场	买入	0%	100	15.150	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,515.00	2009-01-09	15
12315	60292	未报	600008	首创股份	买入	0%	100	4.340	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	434.00	2009-01-09	15
12315	60291	未报	600007	中国国贸	买入	0%	100	7.580	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	758.00	2009-01-09	15
12315	60290	未报	600006	东风汽车	买入	0%	100	2.950	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	295.00	2009-01-09	15
12315	60279	未报	600005	武钢股份	买入	0%	100	6.270	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	627.00	2009-01-09	15
12315	60278	未报	600004	白云机场	买入	0%	100	11.200	五档即成单	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,120.00	2009-01-09	15
12315	60277	未报	IF1508	IF1508	卖出开仓	0%	1	1,000.800	限价	0	0.000	0	中金所	人民币	300,240.00	2009-01-09	15
共13条 未报																	
共14条 未报																	
共12条 未报																	
共12条 未报																	

图 3.9.29

条件撤单

设置条件

产品编号: 88 期现产品12
 单元编号: 7 期货单元套保12
 证券代码: IF1508 IF1508
 委托方向: X 卖出开仓

确定 取消 重置

图 3.9.30

3.9.2.3.5 批量改单

批量改单，是对多笔委托的未成交部分修改委托价格后重新下单。

在<委托查询>界面多选委托，点击该项，在弹出批量改单窗口中，勾选需要调整价格的委托并且输入现货价格和市价方式，焦点移开后，系统自动刷新选中的委托价格，确认后撤销委托并按照改单后的委托价格重新下单。如果勾选界面左下角的“根据实时行情计算委托价格”，改单时价格根据行情价格变更，不勾选则默认为下单时的行情价格。

比如，原委托数量 10 手，成交 6 手，改单后系统将未成交的 4 手撤销，然后以改单后的委托价重新下达 4 手委托。

期限套利	委托查询	成交查询	现货持仓	期货持仓														
	委托批号	委托序号	委托状态	证券代码	证券名称	委托方向	成交(%)	委托数量	委托价格	价格类型	成交数量	成交均价	单笔数量	市场	币种	委托金额	发生日期	委托时间
		共111条	未报				0%	1,001			0					307,053.00		
	12315	60287	未报	600015	华夏银行	买入	0%	100	7.450	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	745.00	2009-01-09	15
	12315	60286	未报	600012	皖通高速	买入	0%	100	4.140	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	414.00	2009-01-09	15
	12315	60285	未报	600011	华能国际	买入	0%	100	6.340	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	634.00	2009-01-09	15
	12315	60284	未报	600010	包钢股份	买入	0%	100	2.710	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	271.00	2009-01-09	15
	12315	60283	未报	600009	上海机场	买入	0%	100	15.150	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,515.00	2009-01-09	15
	12315	60282	未报	600008	首创股份	买入	0%	100	4.340	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	434.00	2009-01-09	15
	12315	60281	未报	600007	中国国贸	买入	0%	100	7.580	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	758.00	2009-01-09	15
	12315	60280	未报	600006	东风汽车	买入	0%	100	2.950	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	295.00	2009-01-09	15
	12315	60279	未报	600005	武钢股份	买入	0%	100	6.270	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	627.00	2009-01-09	15
	12315	60278	未报	600004	白云机场	买入	0%	100	11.200	五档即成剩	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,120.00	2009-01-09	15
	12315	60277	未报	IF1508	IF1508	卖出开仓	0%	1	1,000.800	限价	0	0.000	0	中金所	人民币	300,240.00	2009-01-09	15
		共131条	未报				0%	49,402			0					1,199,951.00		
		共141条	未报				0%	301			0					913,011.00		
		共121条	未报				0%	101			0					1,051,400.00		
		共121条	未报				0%	101			0					1,051,400.00		

1198 (笔)

☒未成

☒已成

☒已散

☒报单

撤单

全部撤单

撤最近一批

条件撤单

批量撤单

图 3.9.31

批量改单													
现货价格设置													
买价	12	市价	+	卖价	0	指定价	-	市价方式	上交所	五档即成剩	深交所	五档即成剩	
选中	委托序号	证券代码	证券名称	委托方向	价格设置	价格类型	委托价格	委托数量	原委托价格	委托状态	投资类型	成交数量	提示信息
☒	60280	600006	东风汽车	买入	市价	五档即成剩	2.95	100	五档即成剩	2.95 未报	可交易	0	15:52:46 期现产品12
☒	60281	600007	中国国贸	买入	市价	五档即成剩	7.58	100	五档即成剩	7.58 未报	可交易	0	15:52:46 期现产品12
☒	60282	600008	首创股份	买入	市价	五档即成剩	4.34	100	五档即成剩	4.34 未报	可交易	0	15:52:46 期现产品12
☒	60283	600009	上海机场	买入	市价	五档即成剩	15.15	100	五档即成剩	15.15 未报	可交易	0	15:52:46 期现产品12

图 3.9.32

【相关参数】按百分比调整改单价格

批量改单设置委托价格时，默认买价=设置价格+调整价格，卖价=设置价格-调整价格；

如下图，买价=买一价+200*0.01，卖价=卖一价-200*0.01。

PG 批量改单

现货价格设置

买价 2 买1价

+

200

卖价 7 卖1价

-

200

市价方式

上交所

五档即成剩

深交所

五档即成剩

选中	委托序号	证券代码	证券名称	委托方向	价格设置	价格类型	委托价格	委托数量	原价格类型	原委托价格	委托状态	投资类型	成交数量	提示信息	委托时间	基金名称
☒	60280	600006	东风汽车	买入	买1价	限价	2	100	五档即成剩	2.95	未报	可交易	0		15:52:46	期现产品12
☒	60281	600007	中国国贸	买入	买1价	限价	2	100	五档即成剩	7.58	未报	可交易	0		15:52:46	期现产品12
☒	60282	600008	首创股份	买入	买1价	限价	2	100	五档即成剩	4.34	未报	可交易	0		15:52:46	期现产品12
☒	60283	600009	上海机场	买入	买1价	限价	2	100	五档即成剩	15.15	未报	可交易	0		15:52:46	期现产品12

☒ 根据实时行情计算委托价格

确认

取消

图 3.9.33

PB 参数设置

现货价格设置

交易市场: 1 上交所A
资产类别: 2 股票资产
委托方向: 1 买入
价格类型: a 五档即成剩
委托价格: 1 最新 + 价位 价位

市场	资产类别	委托方向	价格类型	委托价格	价位
上交所A	股票资产	买入	五档即成剩	最新价	0

添加 删除

期货开仓参数设置

买入开仓默认价格: 卖一价 + 0 价位
卖出开仓默认价格: 买一价 - 0 价位

期货平仓参数设置

买入平仓默认价格: 卖一价 + 0 价位
卖出平仓默认价格: 买一价 - 0 价位

其他参数设置

期现套利中现货部分禁止委托市值比例的最小值: 0.00 %

☐ 委托启用实时行情

☒ 委托下达成功需要成功提示 ☒ 委托需要二次信息确认

☒ 撤单需要二次信息确认 ☐ 按百分比调整改单价格

提示: 在撤单时, 是否弹出确认对话框。

确定 取消

图 3.9.34

如果在<委托栏>→<参数定制>中勾选了“按百分比调整改单价格”，则买价=买一价*（1+2%）；卖价=卖一价*（1-2%）。

批量改单

现货价格设置: 买价 2 买一价 + 2 % 卖价 7 卖一价 - 2 % 市价方式: 上交所 A 五档即成剩 深交所 A 五档即成剩

选中	委托序号	证券代码	证券名称	委托方向	价格设置	价格类型	委托价格	委托数量	原价格类型	原委托价格	委托状态	投资类型	成交数量	提示信息	委托时间	基金名称
☐	60280	600006	东风汽车	买入	买一价	限价	2.95	100	五档即成剩	2.95	未报	可交易	0	获取行情价格错误	15:52:46	期现产品12
☐	60281	600007	中国国贸	买入	买一价	限价	7.58	100	五档即成剩	7.58	未报	可交易	0	获取行情价格错误	15:52:46	期现产品12
☐	60282	600008	首创股份	买入	买一价	限价	4.34	100	五档即成剩	4.34	未报	可交易	0	获取行情价格错误	15:52:46	期现产品12
☐	60283	600009	上海机场	买入	买一价	限价	15.15	100	五档即成剩	15.15	未报	可交易	0	获取行情价格错误	15:52:46	期现产品12

☒ 根据实时行情计算委托价格

确认 取消

图 3.9.35

3.9.3 参数设置

用户可以在<委托栏>→<参数定制>弹出的“参数设置”界面设置个人参数。

PB 参数设置

现货价格设置

交易市场: 1 上交所A
 资产类别: 2 股票资产
 委托方向: 1 买入
 价格类型: a 五档即成剩
 委托价格: 1 最新 + 价位 价位

市场	资产类别	委托方向	价格类型	委托价格	价位
上交所A	股票资产	买入	五档即成剩	最新价	0

添加 删除

期货开仓参数设置

买入开仓默认价格: 卖一价 + 0 价位
 卖出开仓默认价格: 买一价 - 0 价位

期货平仓参数设置

买入平仓默认价格: 卖一价 + 0 价位
 卖出平仓默认价格: 买一价 - 0 价位

其他参数设置

期现套利中现货部分禁止委托市值比例的最小值: 0.00 %

☐ 委托启用实时行情

☒ 委托下达成功需要成功提示 ☒ 委托需要二次信息确认

☒ 撤单需要二次信息确认 ☒ 按百分比调整改单价格

确定 取消

图 3.9.36

委托启用实时行情: 选中该项, 当委托价格是最新价或五档盘口价时, 委托价格根据行情价格实时变更。

委托需要二次信息确认: 选中该项, 在委托下单后, 弹出确认提示, 需要再次确定确认信息, 系统才会委托申报。不勾选则不会弹出提示, 不需要重复确认。

委托下达成功需要成功提示: 勾选该项, 在下单成功后弹出下达成功的信息提示, 否则不进行提示。

撤单需要二次提示确认: 示界面, 重新确认内容后系统执行撤单申报。否则, 撤单后立即执

行撤单申报。

3.10 模板管理

【模板管理】主要用于维护组合交易和期现套利模板，可以在组合交易和期现套利界面中直接选择维护好的模板进行使用。

模板是指一组证券的集合，由客户预先维护好，在做组合交易时，可以选择相应的模板，将相应的证券信息自动带入相应的篮子，方便用户在交易时快速调出证券组。

组合交易和期现套利模板都分为两种类型：市值比例和数量比例。

3.10.1 界面

进入【交易管理】→【模板管理】，会出现以下界面：

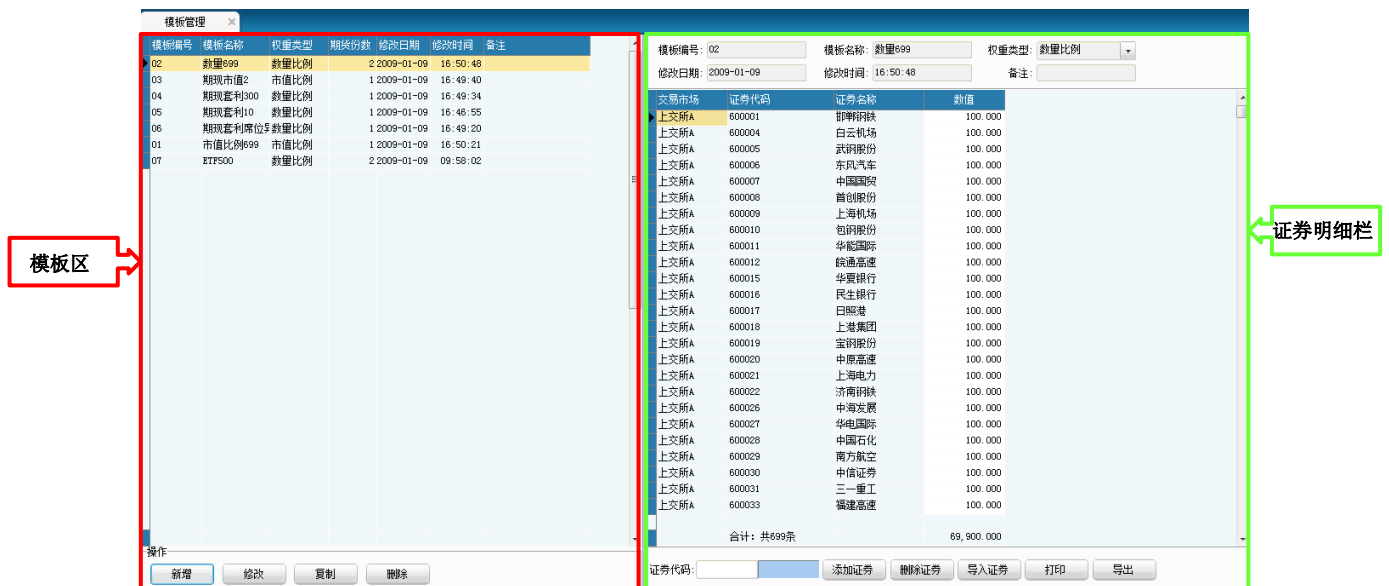
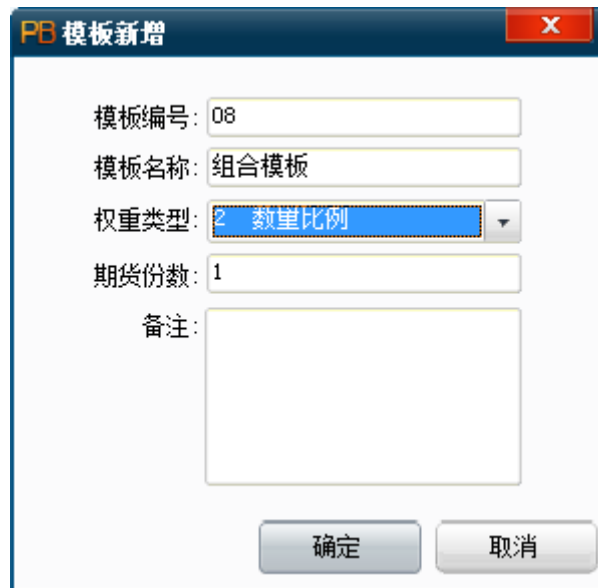


图 3.10.1

1) 用户在<模板区>维护模板和模板类型。在弹出模板维护界面依次输入模板要素。



该对话框用于新增模板，包含以下字段：

- 模板编号：08
- 模板名称：组合模板
- 权重类型：2 数量比例
- 期货份数：1
- 备注：

底部有“确定”和“取消”按钮。

图 3.10.2

- 2) 权重类型可以选择“市值比例”或“数量比例”。
- 3) 期货份数用于控制执行模板时每笔委托的数量，只在【期现套利】交易时使用，【组合交易】忽略该项。
- 4) 在<证券明细栏>维护模板包含的成份券。该界面还支持证券单个新增、批量导入、删除成份券，以及打印和导出证券明细。

3.10.2 模板类型

3.10.2.1 期现套利模板

用户可以在【交易管理】→【模板管理】界面维护期现套利现货模板。

3.10.2.1.1 数量比例

期现套利数值比例模板包含的期货手数和现货数量。在下达期现套利委托时，系统会根据选择的现货模板带出期货手数和现货数量。

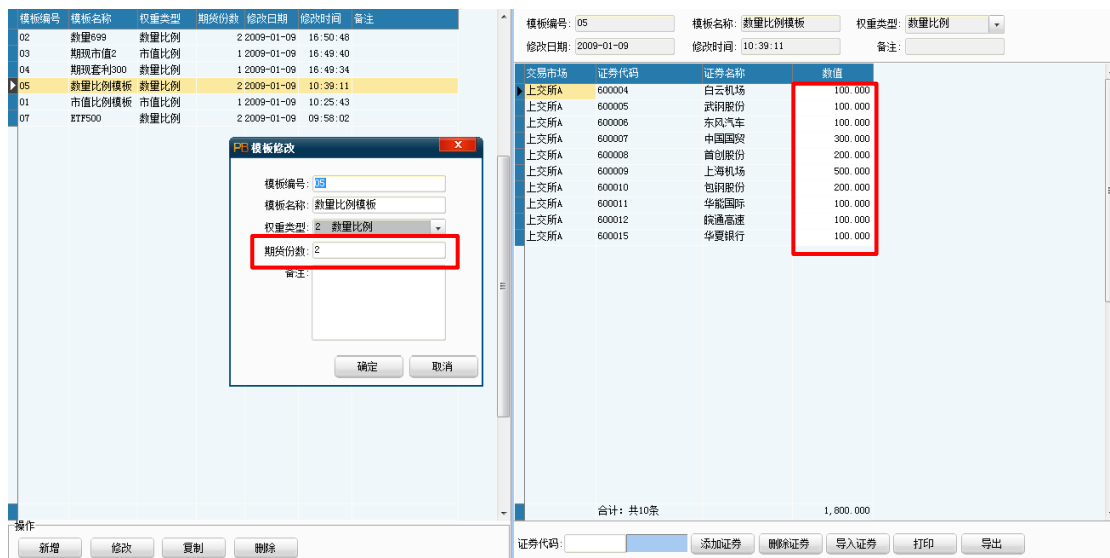


图 3.10.3

- 1) 用户在新增模板时，**权重类型**选择“数量比例”，并在期货份数项输入市值套利模板的期货份数。
- 2) 在现货证券数值处输入数量套利模板中包含的现货数量。如上图，表示这个数量套利模板中，每一份模板组合包含 2 手期货，现货 600004 白云机场 100 股，中国国贸 300 股，上海机场 500 股等。

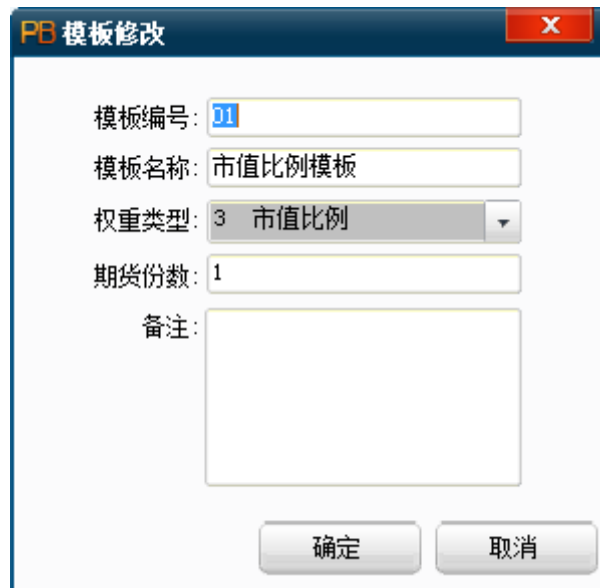


图 3.10.4

- 3) 在【期现套利】委托栏**现货模板**选择数量套利模板后，系统在<单元委托>列表带出组合中的现货，并更新期货委托数量（期货委托数量=【组合模板】中的期货份数）。例如“数量比例模板”中的包含包含 2 手期货，现货 600004 白云机场 100 股，中国国贸 300 股，上海机场 500 股等，此时操作份数输入 2，表示下达 2 分数量套利模板，系统自动刷新委托数量，其中期货委托数量=操作份数*模板期货份数=2*2=4，现货委托数量=操作份数*模板现货数值，如上图。

3.10.2.1.2 市值比例

用户在期现套利市值比例模板中维护期现套利组合中，包含的期货份数和现货权重。在期现套利业务中带出期货份数，并计算现货的目标委托金额。

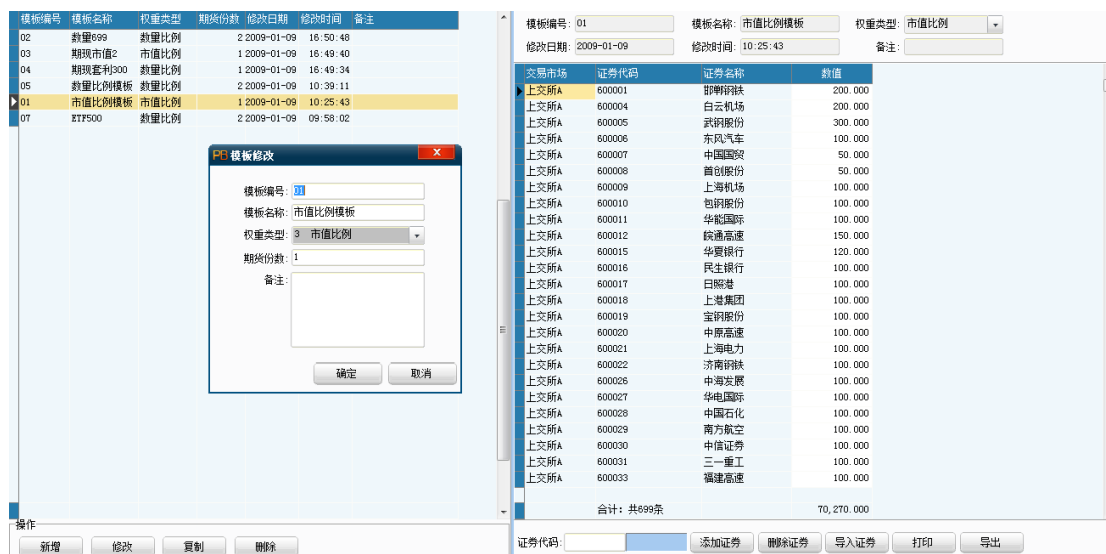


该对话框用于修改PB模板。包含以下字段：

- 模板编号: 01
- 模板名称: 市值比例模板
- 权重类型: 3 市值比例
- 期货份数: 1
- 备注: (空)

底部有“确定”和“取消”按钮。

图 3.10.5



主界面显示模板列表和右侧的模板详情。模板列表如下：

模板编号	模板名称	权重类型	期货份数	修改日期	修改时间	备注
02	数量699	数量比例	2	2009-01-09	16:50:48	
03	期现市值2	市值比例	1	2009-01-09	16:49:40	
04	期现套利300	数量比例	1	2009-01-09	16:49:34	
05	数量比例模板	数量比例	2	2009-01-09	10:39:11	
01	市值比例模板	市值比例	1	2009-01-09	10:25:43	
07	ZTF500	数量比例	2	2009-01-09	09:58:02	

右侧模板详情显示：

- 模板编号: 01
- 模板名称: 市值比例模板
- 权重类型: 市值比例
- 修改日期: 2009-01-09
- 修改时间: 10:25:43
- 备注: (空)

下方表格列出了包含的现货证券代码、名称和数值：

交易市场	证券代码	证券名称	数值
上交所A	600001	邯郸钢铁	200.000
上交所A	600004	白云机场	200.000
上交所A	600005	宝钢股份	300.000
上交所A	600006	东风汽车	100.000
上交所A	600007	中国国贸	50.000
上交所A	600008	首创股份	50.000
上交所A	600009	上海机场	100.000
上交所A	600010	包钢股份	100.000
上交所A	600011	华能国际	100.000
上交所A	600012	皖通高速	150.000
上交所A	600015	华夏银行	120.000
上交所A	600016	民生银行	100.000
上交所A	600017	白猫集团	100.000
上交所A	600018	上港集团	100.000
上交所A	600019	宝钢股份	100.000
上交所A	600020	中原高速	100.000
上交所A	600021	上海电力	100.000
上交所A	600022	济南钢铁	100.000
上交所A	600026	中海发展	100.000
上交所A	600027	华电国际	100.000
上交所A	600028	中国石化	100.000
上交所A	600029	南方航空	100.000
上交所A	600030	中信证券	100.000
上交所A	600031	三一重工	100.000
上交所A	600033	福建高速	100.000

合计: 共699条, 70, 270.000

图 3.10.6

- 1) 用户在新增模板时，权重类型选择“市值比例”，并在期货份数项输入市值套利模板的期货份数。
- 2) 在右侧现货证券代码数值项，输入模板包含现货权重。现货权重比=数值/SUM（模板数值和）。

期现套利 委托查询 成交查询 现货持仓 期货持仓

产品组: -1 所有产品 维护

产品编号: 51 期现产品01

期货单元: 7 期货单元套利01

现货单元: 8 现货单元01-2

方向: K 建仓

合约代码: IF1508 IF1508

现货模板: 01 市值比例模板

操作份数: 2 ≤ 13

可用保证金: 48,769,000.39

可用金额: 920,936.00

参数定制 下单 重置

单元委托 (共700条, 选中200条, 其中500条异常)

选择	证券代码	证券名称	委托方向	价格类型	委托价格	委托数量	委托金额	提示信息	市场
☒	IF1508	IF1508	卖出开仓	限价	999.80	2	119,976.00		中金所
☐	003401	G 申 龙	买入	限价	2.84	300	852.00	该证券已停牌!	深交所A
☐	003403	G 欣 网	买入	限价	5.44	100	544.00	该证券已停牌!	深交所A
☐	003405	G 动力源	买入	限价	7.50	100	750.00	该证券已停牌!	深交所A
☐	003406	G 国电南瑞	买入	限价	21.19	0	0.00	委托数量必须大于0;该证券已停牌!	深交所A
☐	003408	G 安 泰	买入	限价	4.24	200	848.00	该证券已停牌!	深交所A
☐	003409	G 康三友	买入	限价	3.18	200	636.00	该证券已停牌!	深交所A
☐	003502	G 水 利	买入	限价	4.51	100	451.00	该证券已停牌!	深交所A
☐	003503	ST新 智	买入	限价	4.06	200	812.00	该证券已停牌!	深交所A
☐	003507	G 长 力	买入	限价	2.63	300	789.00	该证券已停牌!	深交所A
☒	600001	邯郸钢铁	买入	五档即成刺激	7.84	200	1,568.00		上交所A
☒	600004	白云机场	买入	五档即成刺激	11.20	100	1,120.00		上交所A
☒	600005	武汉股份	买入	五档即成刺激	6.27	400	2,508.00		上交所A
☒	600006	东风汽车	买入	五档即成刺激	2.95	200	590.00		上交所A
☐	600007	中国国贸	买入	五档即成刺激	7.58	0	0.00	委托数量必须大于0;	上交所A
☐	600008	首创股份	买入	五档即成刺激	4.34	0	0.00	委托数量必须大于0;	上交所A

☒ 包含涨停股 ☒ 包含跌停股 增加证券

图 3.10.7

- 在【期现套利】委托栏，现货模板项输入市值比例模板，系统根据套利模板刷新期货委托数量，在<单元委托>列表带出现货并计算现货的委托金额和委托数量。委托金额=模板现货数值/SUM（模板现货数值和）*期货市值，委托数量=委托金额/委托价格，期货市值=期货委托价格×期货委托数量×合约乘数。
- 在委托栏输入操作份数，系统刷新单元列表中现货、期货的委托数量。期货委托数量=操作份数*模板期货份数，现货委托数量=操作份数*委托金额/委托价格。

注意：

使用市值套利模板分配委托金额时，可能出现所分配的委托金额不足够购买 100 股（最小交易单位）的现货，也就是计算获得的委托数量<100 股，此时系统默认该委托不能下达置灰色显示，委托数量显示 0，并显示提示信息。

3.10.2.2 组合交易模板

用户可以在【交易管理】→【模板管理】或者【交易管理】→【组合交易】→<模板维护>界面设置自定义模板。

3.10.2.2.1 数量比例

用户在组合交易数量比例模板中维护每一份篮子的成份券数量。用户在新增模板时，权重类型选择“数值比例”。

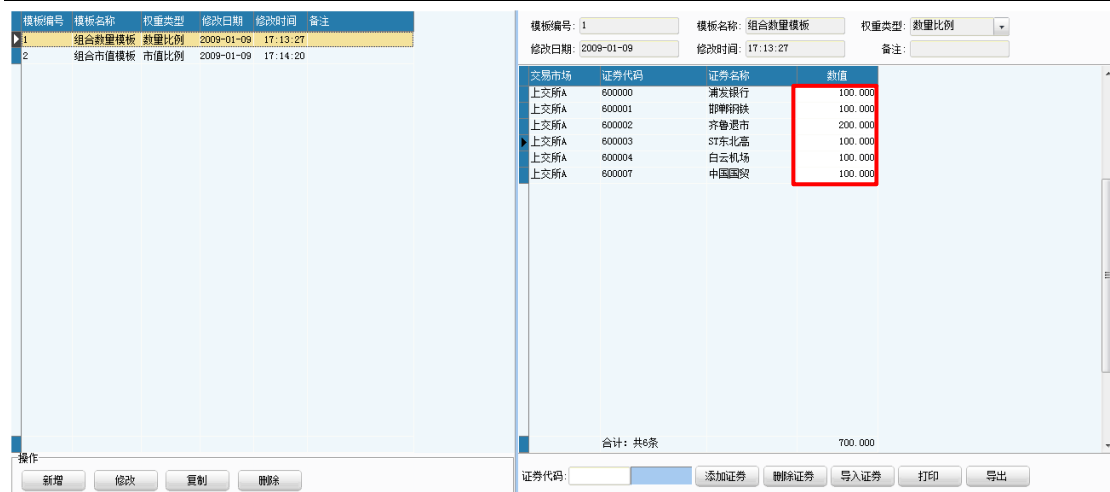


图 3.10.8

- 1) 在成份券数值处输入每一份篮子所包含的成份券数量。
- 2) 在【组合交易】委托栏选择“自定义”选择数量模板后，系统默认目标类型为“按照数量”。输入委托份数后，系统带出每只成份券的目标数量=委托份数*数值，此部分的详细操作和计算方式请查看[模板导入委托](#)页面

3.10.2.2.2 市值比例

用户在组合交易市值比例模板中维护每一份篮子的成份券权重,用于计算每一只成份券的目标委托金额。

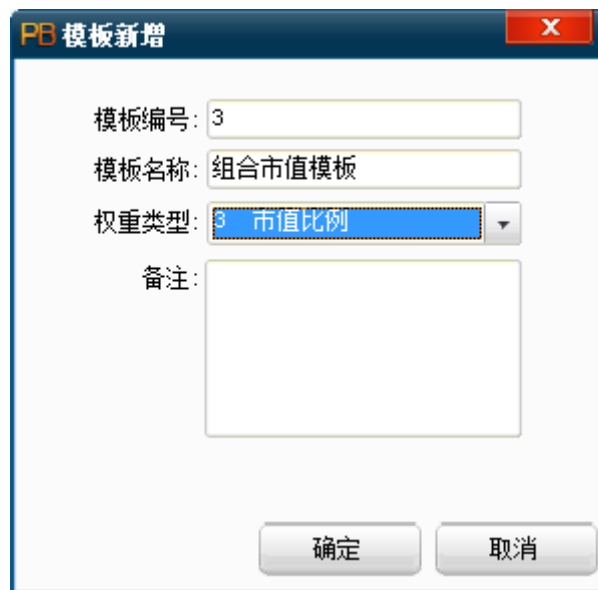


图 3.10.9



图 3.10.10

- 1) 市值比例模板与数量比例模板维护类似，区别在右侧成份券证券代码数值项时，输入的是成份券权重。成份券所占篮子权重比=数值/SUM（篮子数值和）。



图 3.10.11

- 2) 在【组合交易】委托栏选择“自定义”选择市值模板后，系统默认目标类型为“按照金额”。输入委托金额后，每个成份券的目标委托金额=（数值/SUM（篮子数值和））* 委托金额。此部分的详细操作和计算方式请查看[模板导入委托](#)页面

3.11 融资融券交易

3.5.1 业务简介

融资融券业务是指证券公司向客户出借资金供其买入上市证券、出借上市证券供其卖出，并收取担保物的经营活动。

融资融券交易，又称信用交易，分为融资交易和融券交易。投资者以资金或证券作为质押，向券商借入资金用于证券买卖，并在约定的期限内偿还借款本金和利息；融券交易是投资者以资金或证券作为质押，向券商借入证券卖出，在约

定的期限内，买入相同数量和品种的证券归还券商并支付相应的融券费用。

3.5.2 融资买入

功能介绍

融资买入是指，投资者向证券公司交纳一定的保证金，融入一定数量的资金买入股票的交易行为。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<融资买入>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。如图 3-5-1 所示：

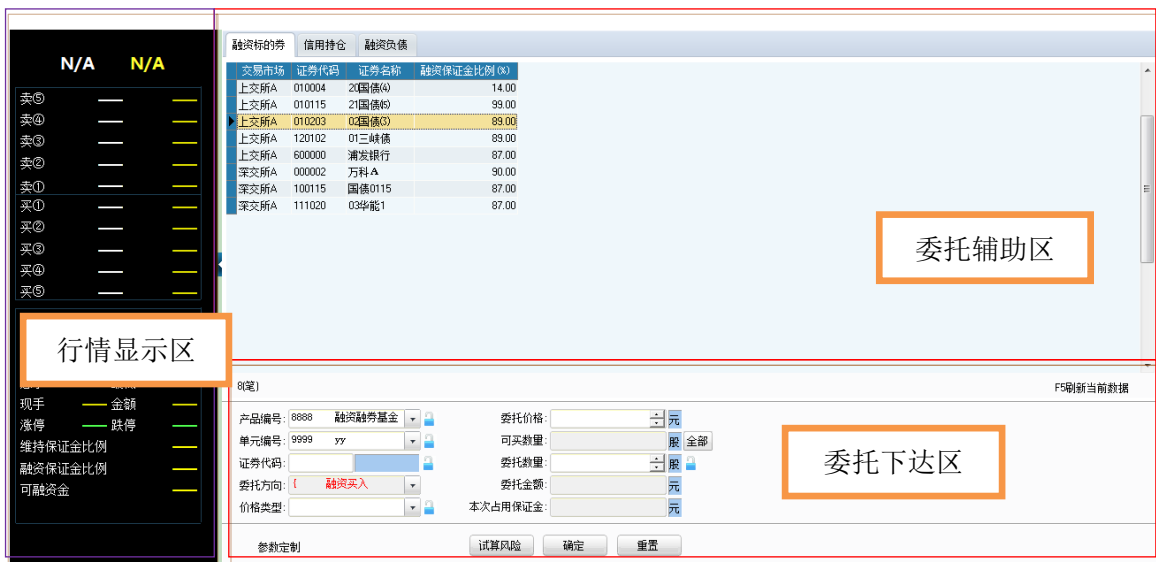


图 3-5-1

1、委托辅助区

委托辅助区可切换到<融资标的的券>、<信用持仓>、<融资负债>Tab 页，分别用于显示有融资标的的券信息、信用产品持仓信息和融券负债信息。信用持仓和融资负债，分别如图 3-5-2、3-5-3 所示：

融资标的券						
信用持仓						
融资负债						
产品名称	单元编号	单元名称	证券代码	证券名称	持仓数量	融资保证金比例(%)
融资融券基金	8889	信用组合	600000	浦发银行	990,500	87.00
融资融券基金	8889	信用组合	000002	万科A	991,100	90.00
融资融券基金	8889	信用组合	010203	02国债(3)	970	89.00

3(笔) ☐ 全部持仓 ☒ 融资标的券持仓 F5刷新当前数据

图 3-5-2

融资标的券										
信用持仓										
融资负债										
产品名称	单元编号	单元名称	证券代码	证券名称	期初融资负债	当日新增融资负债	当日偿还融资负债	期初利息负债	当日偿还利息负债	当前融资负债

0(笔) F5刷新当前数据

图 3-5-3

✧ 融资标的券

主要用于显示可融资标的券信息，包括交易市场、证券代码、证券名称、融资保证金比例(%)，支持双击标的券信息自动带出委托信息。

✧ 信用持仓

主要用于显示信用产品下单元标的券持仓信息，包括：产品、单元、证券代码、证券名称、持仓数量、融资保证金比例(%)等信息，且双击持仓带出来的委托允许融资买入。

✧ 融资负债

主要用于显示融资负债信息，包括：产品、单元、证券代码、证券名称、期初融资负债、当日新增融资负债、当日偿还融资负债、期初利息负债、当日偿还利息负债、当前融资负债等信息，且双击持仓带出来的委托允许融资买入。

2、委托下达区

产品编号：只允许选择包含的产品。

单元编号：只允许选择的单元。

证券代码：只允许输入当前券商规定的标的券范围内的证券。

委托方向：只支持委托方向：融资买入。

价格类型：支持“0-限价”，“a-五档即成剩撤”，“b-五档即成剩转”。

本次占用保证金：委托金额*融资保证金比例。

单击**参数定制**按钮，将弹出参数配置界面，可以选择委托买入默认价格带出配置的选项，方便操作员快速下达，根据“委托下达需要试算风险”复选框来确定是否需要调用风险服务。点击**确定**按钮进行保存。界面如图 3-5-4 所示：

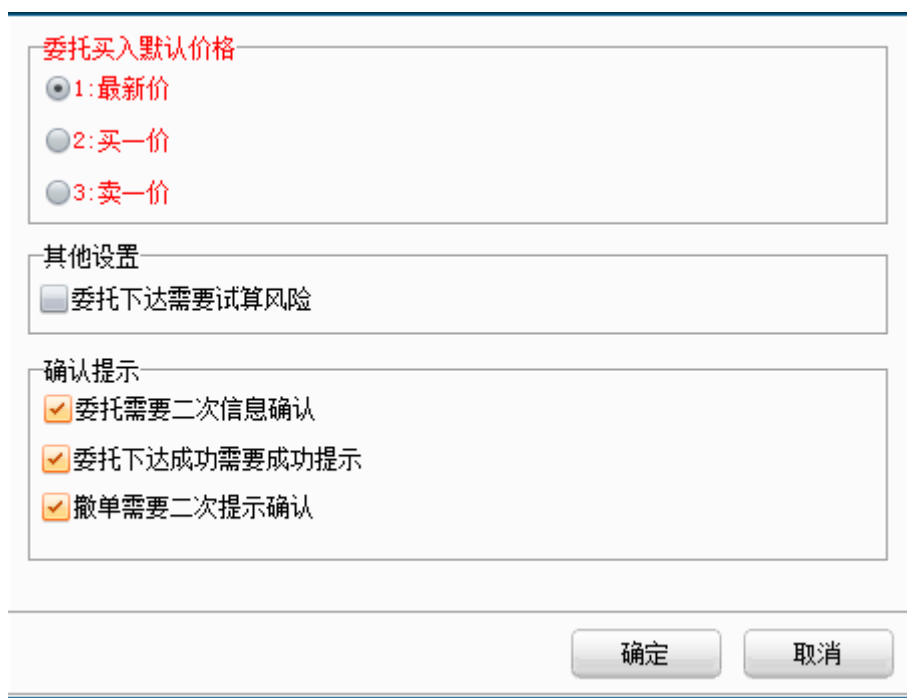


图 3-5-4

3、行情显示区

显示 PB 系统券商管理端的证券行情或者 H5 行情，支持显示可融资金。

3.5.3 融券卖出

功能介绍

融券卖出是指，投资者向证券公司交纳一定的保证金，融入一定数量的股票进行卖出的交易行为。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<融券卖出>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。如图 3-5-5 所示：

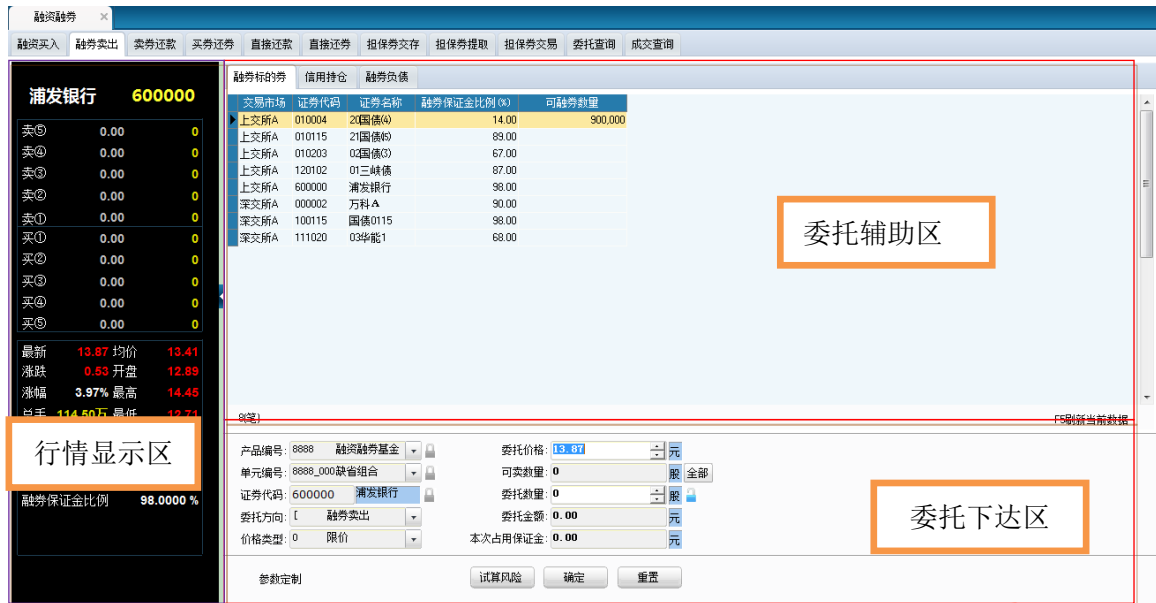


图 3-5-5

1、委托辅助区

委托辅助区可切换到<融券标的券>、<信用持仓>、<融券负债>Tab 页，分别用于显示可融券标的券信息、信用产品持仓信息和融券负债信息。信用持仓和融券负债，分别如图 3-5-6、3-5-7 所示：



图 3-5-6

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<卖券还款>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。如图 3-5-8 所示：

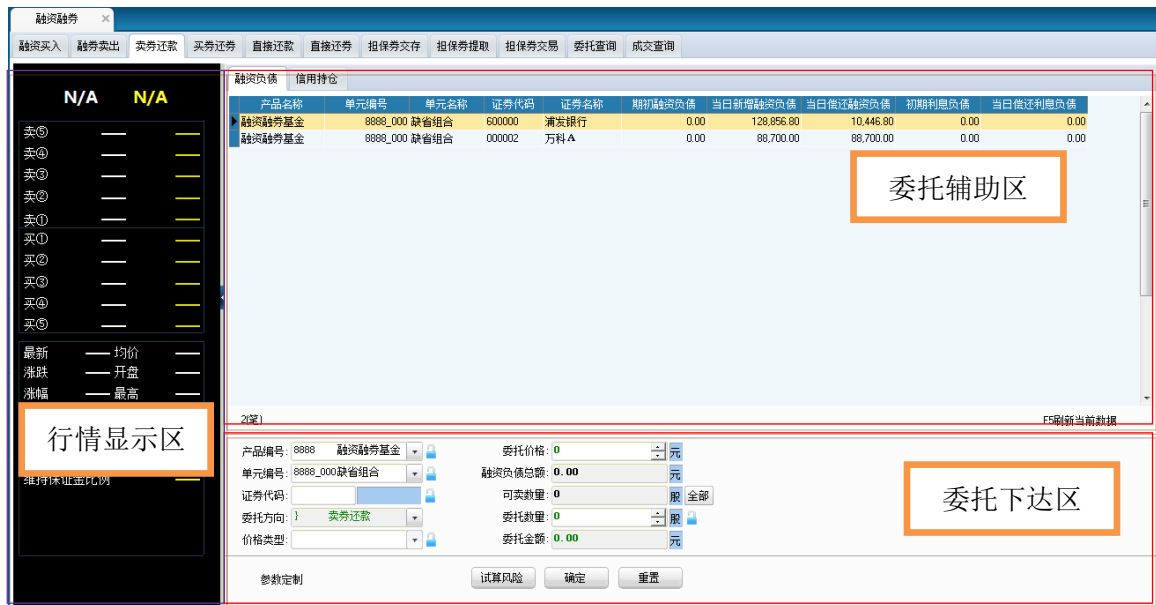


图 3-5-8

注意:

与<融资买入>基本相同，只不过委托方向为“卖券还款”。

3.5.5 买券还券

功能介绍

买券还券偿还融入证券，投资者通过其信用证券产品买入证券，结算时买入的证券直接划转至券商的融券专用证券产品。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<买券还券>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。如图 3-5-9 所示：

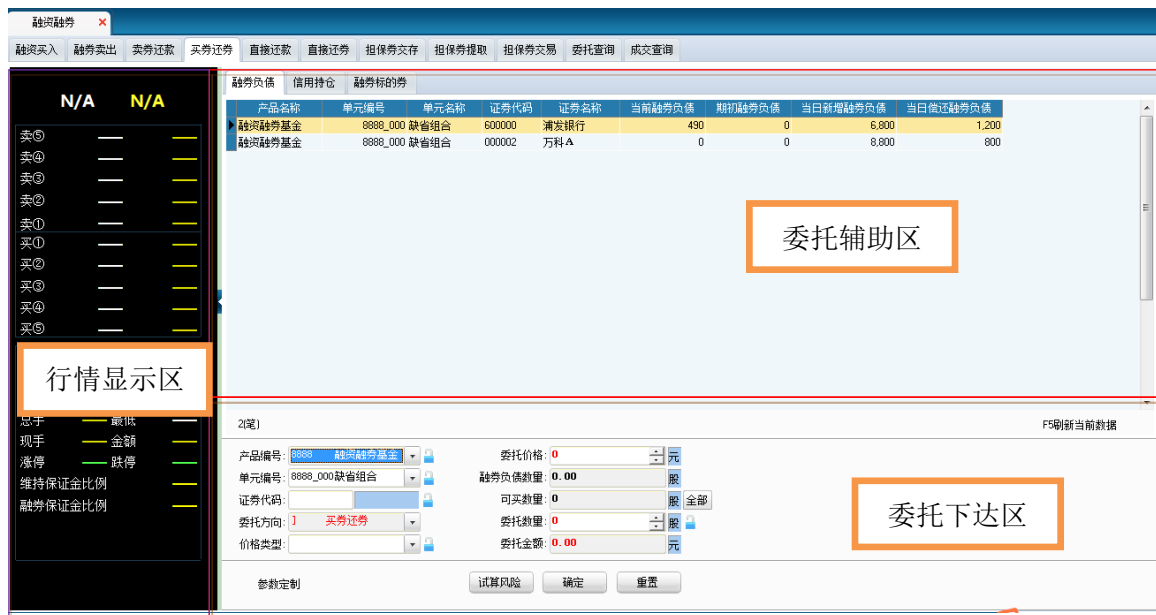


图 3-5-9

注意:

与<融券卖出>基本相同，只不过委托方向为“买券还款”。

3.5.6 直接还款

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<直接还款>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。如图 3-5-10 所示：

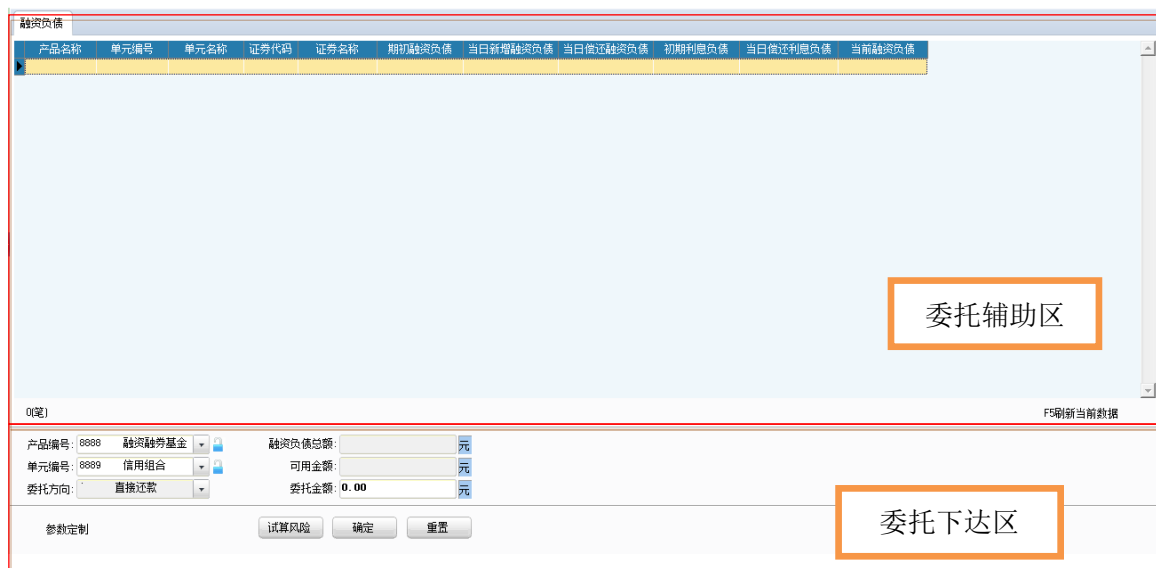


图 3-5-10

在使用此功能时，主要体现在委托下达区，选择产品和单元后，系统会联

动显示其产品下的融资负债总额和可用金额，录入委托金额即可（委托金额小于等于可用金额；委托金额小于等于融资负债总额）。

3.5.7 直接还券

功能介绍

直接还券使用的是信用产品中的券，这个券可以是普通产品转入的担保品，也可以是用信用产品买入的证券。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<直接还券>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。如图 3-5-11 所示：

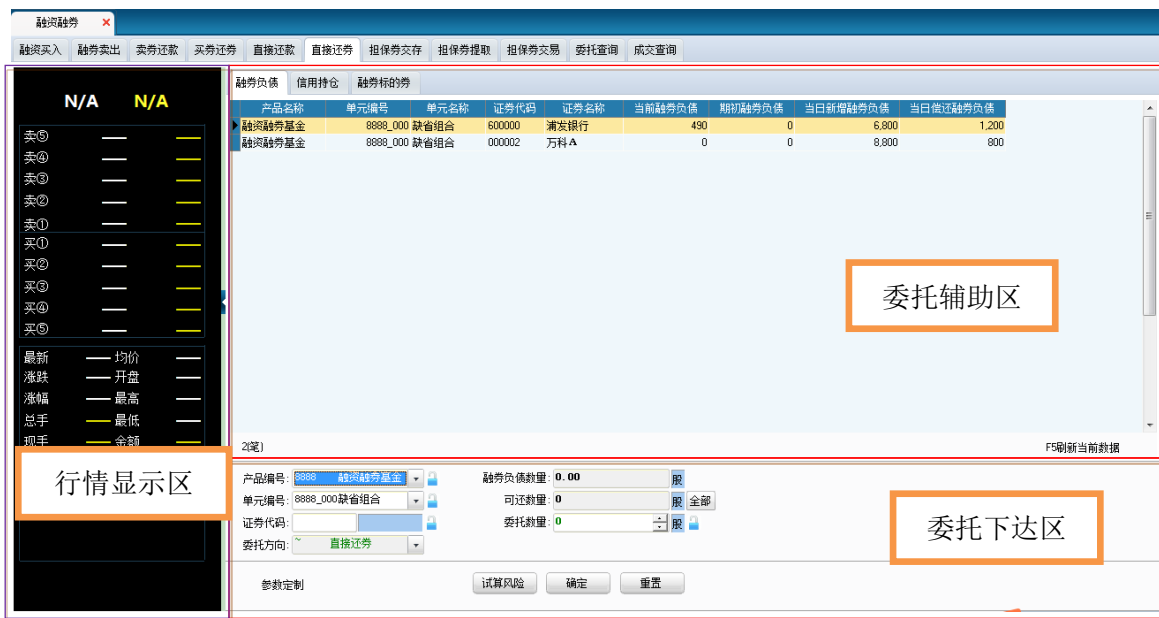


图 3-5-11

注意：

与<融券卖出>基本相同，只不过委托方向为“直接还券”。可还数量为信用产品内的可用标的券数量。

3.5.8 担保券交存

功能介绍

担保券交存的界面主要用于做担保券的交存，需要注意的一点是此处交存委托占用的是普通产品的可用。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<担保券交存>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。具体如图 3-5-12 所示：

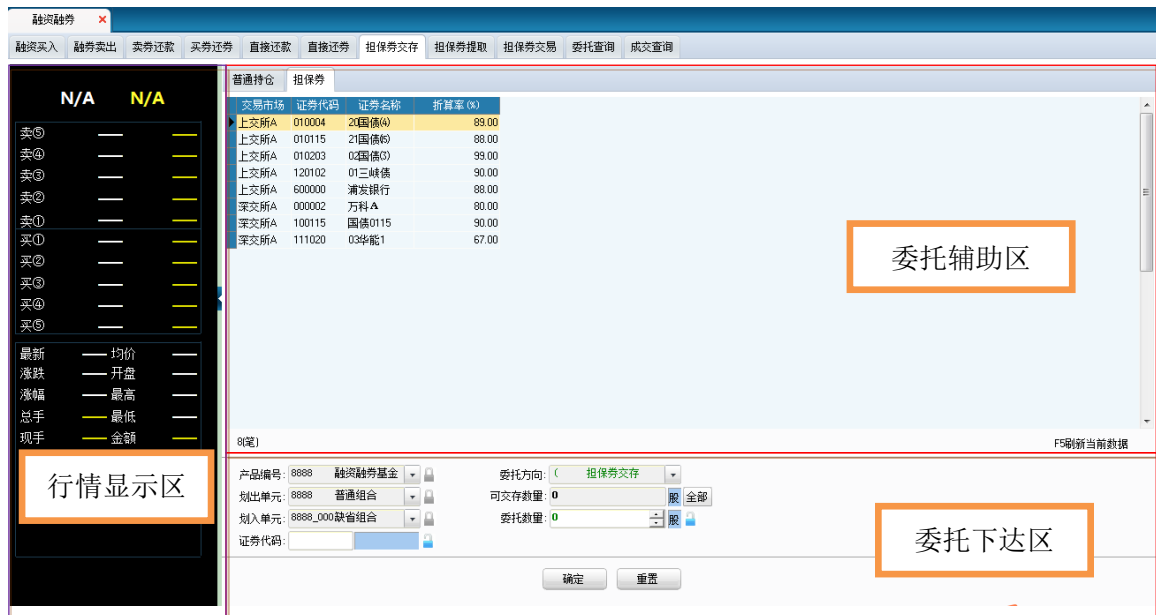


图 3-5-12

1、 委托辅助区：

如上图第一个区域显示普通单元的持仓信息，列表中的单元是包含信用产品下的普通单元，持仓证券为担保券范围内的证券，其中担保券范围是根据当前所选的信用单元（划入单元）所对应券商的所限制的。持仓还支持按担保券持仓来过滤。

持仓列表支持双击持仓记录自动带出委托信息，包括：划出产品、划出单元、证券代码、可交存数量等信息。

2、 行情显示区：

该处的行情信息与<融资买入>界面的相同。

3、 委托下达区

该区域是用于录入委托信息并且进行委托下达。

产品编号：用于选择源单元和目标单元所在的产品，控件下拉列表只带出包含的信用产品。

划出单元：用于选择需要划出的源单元，下拉列表只带出普通产品下的单元。

划入单元：用于选择需要划入的目的单元，下拉列表只带出信用产品下的单

元。

证券代码：选择待交存担保券，控制只能输入当前券商的在担保券范围内的证券。

委托方向：固定为“担保券交存”，只是用于显示。

可交存数量：普通产品内的股票可用数量。

委托数量：小于等于可交存数量。

3.5.9 担保券提取

功能介绍

担保券提取界面用于做担保券的提取。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<担保券提取>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。具体如图 3-5-13 所示：

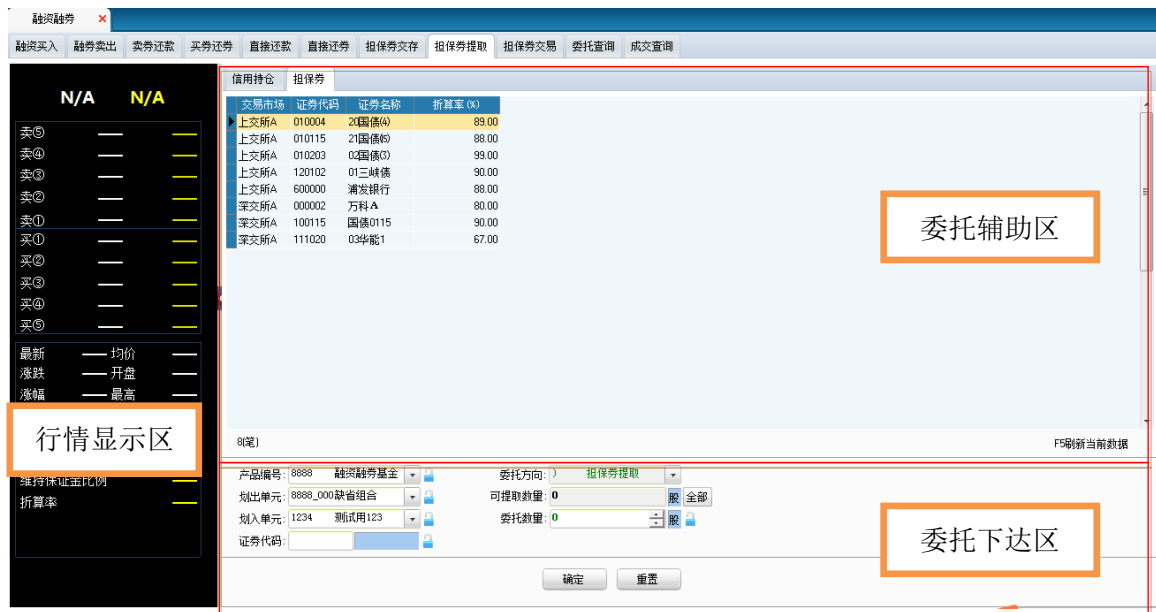


图 3-5-13

该界面与<担保券交存>界面基本相同，可参照担保券交存的介绍。具体不同之处主要有：

1. 委托辅助区

该界面的持仓列表与交存界面的基本相同，只是显示的是信用产品的单元持仓信息。

2. 行情显示区

该界面的行情与<融资买入>界面相同

3. 委托下达区

与交存界面基本相同，只不过划出单元显示的是信用产品下的单元，划入单元显示的是普通单元。“可提取数量”取得是信用产品内的股票可用数量。

3.5.10 担保券交易

功能介绍

担保券买卖界面主要用于为信用产品做担保券的买卖，同交易所的普通证券的买卖操作基本差不多，只不过此处只能买卖担保券范围内的证券，而且占用的是信用产品上的可用。

操作介绍

操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<担保券交易>界面，分为行情显示区、委托辅助区、委托下达区等三个区域。具体如图 3-5-14 所示

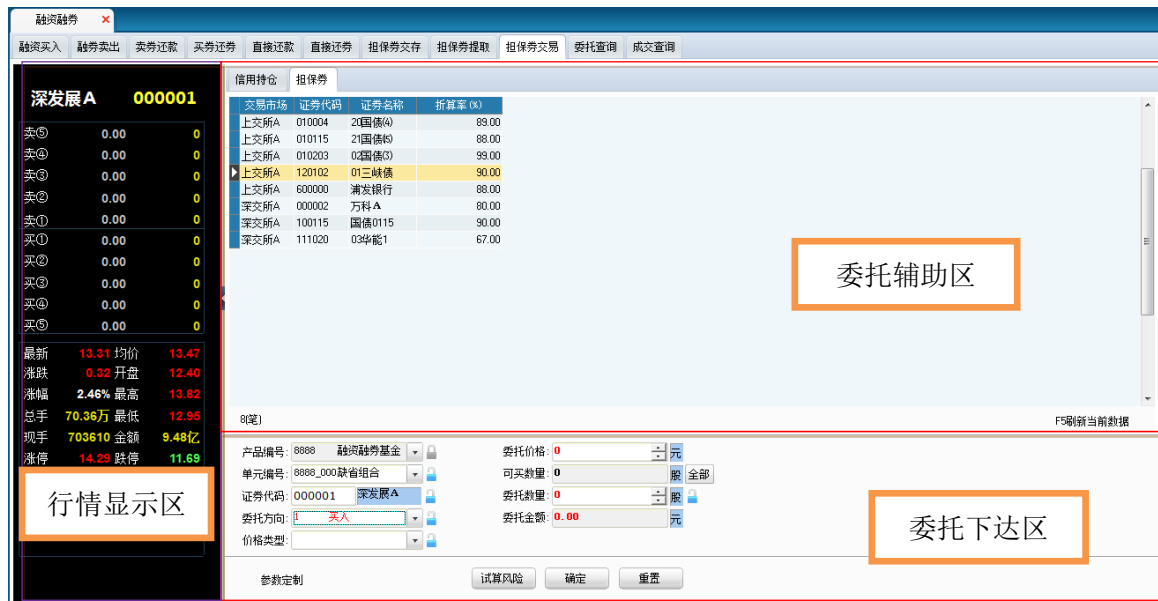


图 3-5-14

1、委托辅助区

担保券买卖的持仓列表与担保券提取的持仓列表显示内容和结构都是相同的，具体参考<担保券交存>说明。

持仓列表支持双击持仓记录自动带出委托信息，包括：产品、单元、证券代码、委托方向、委托价格等信息。

2、行情显示区

该界面的行情与<融资买入>界面相同

3、委托下达区

产品编号：只允许选择包含的信用产品

单元编号：只允许选择信用产品下的单元

证券代码：对于买入只允许输入当前券商规定的担保券范围内的证券；对于卖出的券可以不是担保券

委托方向：只支持相应证券的买卖的委托方向

价格类型：对于上交所，支持“0-限价”、“a-五档即成剩撤”、“b-五档即成剩转”；对于深交所，支持“0-限价”、“A-五档即成剩撤”、“C-即成剩撤”、“D-对手方最优”、“E-本方最优”、“F 全额成或撤”

3.5.11 委托查询

操作介绍

在【交易管理】→【融资融券交易】→<委托查询>界面，如图 3-5-15 所示。

融资融券																			
融资买入		融券卖出		买券还款		买券还券		直接还款		直接还券		担保券交存		担保券提取		担保券交易		委托查询	
委托买入/委托序号	委托状态	证券代码	证券名称	委托方向	成交 (%)	委托数量	委托价格	价格类型	成交数量	成交均价	撤单数量	市场	币种	委托金额	发生日期	委托时间	产品名称	单元	
98821	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	200	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	2,774.00	2009-01-09	15:34:00	融资融券基金 8888		
98820	未报	600000	浦发银行	直接还款	0%	10	0.000	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	0.00	2009-01-09	15:09:20	融资融券基金 8888		
98819	未报	600000	浦发银行	担保券提取	0%	1	0.000	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	0.00	2009-01-09	15:00:35	融资融券基金 8888		
98818	未报	600000	浦发银行	直接还款	0%	100	0.010	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1.00	2009-01-09	14:59:53	融资融券基金 8888		
98817	未报	600000	浦发银行	买券还券	0%	100	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,387.00	2009-01-09	14:58:33	融资融券基金 8888		
98816	未报	600000	浦发银行	卖券还款	0%	1	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	13.87	2009-01-09	14:34:49	融资融券基金 8888		
98815	未报	600000	浦发银行	融资卖出	0%	100	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,387.00	2009-01-09	14:31:53	融资融券基金 8888		
98814	未报	120102	01三株债	融资买入	0%	100	104.530	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	10,453.00	2009-01-09	14:15:25	融资融券基金 8888		
96490	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,387.00	2009-01-09	22:58:29	融资融券基金 8888		
95895	未报	000002	万科A	融资买入	0%	100	8.830	限价	0	0.000	0	深交所A	人民币	883.00	2009-01-09	00:34:07	融资融券基金 8888		
95894	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,387.00	2009-01-09	00:33:47	融资融券基金 8888		
95661	未报	010004	20国债04	融资买入	0%	100	101.500	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	10,150.00	2009-01-09	20:06:56	融资融券基金 8888		
95315	未报	600000	浦发银行	直接还款	0%	10,000	0.010	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	100.00	2009-01-09	18:22:19	融资融券基金 8888		
94712	未报	600000	浦发银行	直接还款	0%	10,000	0.010	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	100.00	2009-01-09	01:01:29	融资融券基金 8888		
94711	未报	600000	浦发银行	直接还款	0%	100	0.010	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1.00	2009-01-09	01:00:58	融资融券基金 8888		
66789	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,387.00	2009-01-09	17:24:40	融资融券基金 8888		
46792	未报	000002	万科A	融资买入	0%	100	12.400	限价	0	0.000	0	深交所A	人民币	1,240.00	2009-01-09	04:13:35	融资融券基金 8888		
46791	未报	000002	万科A	融资买入	0%	100	12.500	限价	0	0.000	0	深交所A	人民币	1,250.00	2009-01-09	04:12:10	融资融券基金 8888		
46790	未报	000002	万科A	融资买入	0%	100	12.500	限价	0	0.000	0	深交所A	人民币	1,250.00	2009-01-09	04:11:37	融资融券基金 8888		
45989	已撤	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	12.400	限价	0	0.000	100	上交所A	人民币	1,240.00	2009-01-09	04:11:31	融资融券基金 8888		
37889	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,387.00	2009-01-09	05:53:23	融资融券基金 8888		
35889	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,387.00	2009-01-09	10:09:11	融资融券基金 8888		
35596	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	13.870	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	1,387.00	2009-01-09	15:46:31	融资融券基金 8888		
35389	已撤	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	13.000	限价	0	0.000	100	上交所A	人民币	1,300.00	2009-01-09	08:05:21	融资融券基金 8888		
31431	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	1,000	13.340	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	13,340.00	2009-01-09	14:02:23	融资融券基金 8888		
31430	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	100	9.250	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	925.00	2009-01-09	13:44:16	融资融券基金 8888		
31429	未报	600000	浦发银行	融资买入	0%	1,000	13.340	限价	0	0.000	0	上交所A	人民币	13,340.00	2009-01-09	13:43:55	融资融券基金 8888		

图 3-5-15

详细说明

- ✧ 点击“未成”、“已成”、“已撤”、“废单”等复选框，可以分别显示相应的委托信息。
- ✧ 点击**撤单**按钮对选中的可撤委托进行撤单，可以多选。
- ✧ 点击**全部撤单**按钮将所有未全部成交的可撤委托进行撤单。
- ✧ 点击**撤最后一笔**按钮对委托序号最大的可撤委托进行撤单。
- ✧ 点击**条件撤单**按钮可以选择按“产品”和“单元”作为条件进行撤单。

界面支持 F5 刷新。

3.5.12 额度查询

功能介绍

主要用于查询融资融券综合信息（包括融资融券负债、授信额度、应还金额等）、保证金可用信息、融资融券申请额度和信用资产信息。

操作介绍

具体操作如下：点击【交易管理】→【融资融券】→<额度查询>界面，分别为融资融券综合信息、保证金可用余额、融资融券申请额度和信用资产信息。如图 3-5-16 所示：

融资融券			
融资买入 融券卖出 卖券还款 买券还券 直接还款 直接还券 担保券交存 担保券提取 担保券交易 委托查询 成交查询 额度查询			
产品编号:		资产单元: 查询	
☒ 显示融资融券综合信息 ☒ 显示保证金可用余额 ☒ 显示融资融券申请额度 ☒ 显示信用资产信息			
融资融券综合信息			
资金帐号:	负债总额:	保证金余额:	现金资产:
授信额度:	融资负债:	T+1可用资金:	可取金额:
融券限额:	融券负债:	可融资金:	
融资融券申请额度			
资金帐号:	融资申请额度:	融券申请额度:	
保证金可用余额			
资金帐号:	融资保证金:	融资盈亏:	融券卖出金额:
利息费用:	融券保证金:	融券盈亏:	担保券市值折算值:
信用资产信息			
现金资产:	可取金额:	担保资产:	证券市值:
可转出资产:	可用保证金:	已用保证金:	负债总额:
现金还款可用:	买担保品可用资金:	买融资标的可用资金:	买券还券可用资金:
融券可用额度:	融券已用额度:	融资可用额度:	融资已用额度:
融资合约金额:	融资合约盈亏:	融资合约利息:	融资合约费用:
融券合约金额:	融券合约盈亏:	融券合约利息:	其他费用:
融资额度上限:	融券额度上限:	维持担保比例:	

图 3-5-16

第四章 信息查询

4.1 委托成交查询

功能介绍

【委托成交查询】分为<委托查询>、<成交查询>和<异常撤单>个三子页面。<委托查询>中用户可以查询当天委托和历史委托数据，能根据条件过滤查询的数据，并能指定数据汇总的维度；<成交查询>中用户可以查询当天和历史的成交数据，能根据条件过滤查询的数据，也能指定数据汇总的维度。委托和成交数据还支持打印和导出功能。<异常撤单>界面中操作员通过机构端下单，如出现异常现象，正常撤单无法撤单的情况下，可用异常撤单进行撤单；允许查询自己在 ufx 下单的可撤委托，并可以做撤单。

操作介绍

具体操作如下：单击【信息查询】→【委托成交查询】主界面。如图 4-1-1 所示：

图 4-1-1

<委托查询>界面中，通过单击刷新按钮，可以加载或刷新委托数据；在汇总维度中可以选择按“委托单笔”、“委托合笔”和“证券代码+委托方向”进行委托数据的树形结点的汇总。

通过委托数据列表下方的“未成”、“已成”、“已撤”和“废单”和“显示所有委托”五个勾选框，可以按委托状态来过滤数据。

单击[查询]按钮可以通过更多的条件来过滤所查数据，其中委托数据在满足设置的所有条件时才会显示。

〈成交查询〉界面中，通过单击[刷新]按钮，可以加载或刷新成交数据；在汇总维度中可以选择按“成交单笔”、“委托序号”、“证券代码”和“证券代码+委托方向”进行成交数据的树形结点的汇总。

单击[查询]按钮可以通过更多的条件来过滤所查数据，查询条件设置界面。如图 4-1-2 所示：



图 4-1-2 展示了“设置查询条件”对话框，标题为“委托查询条件明细设置”。对话框包含以下字段：

产品编号:	委托方向:
单元编号:	委托状态:
交易市场:	起始日期: 2009-01-09
证券代码:	终止日期: 2009-01-09

底部有三个按钮：确定、取消、重置。

图 4-1-2

4.2 流水查询

功能介绍

【流水查询】主要是对资金流水的一个记录功能，可以查询当前操作员有权限的产品的当日或历史的委托流水记录。

操作介绍

具体操作如下：点开【信息查询】→【流水查询】界面，就能根据刷新以及查询来查找出相应的历史记录。如图 4-2-1 所示：

流水查询

刷新

查询

导出

打印

布局设置

发生日期	流水序号	发生业务	证券代码	证券名称	产品名称	单元编号	单元名称	发生金额	发生后余额	委托方向	委托价格	发生数量	交易费	印花税	过户
2009-01-09 13317		银行间费用支付R002	2天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	0.00	85,387,401.58	融资回购	2.7100	10,113.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13318		融资回购R002	2天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	-1,011,450.17	84,375,951.41	融资回购	2.7100	10,113.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13321		融券卖出R002	2天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	200,033.33	84,575,984.74	融券卖出	3.0000	2,000.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13322		融资回购R002	2天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	-100,011.11	84,475,973.63	融资回购	2.0000	1,000.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13325		银行间费用支付R001	1天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	0.00	84,475,973.63	融券卖出	2.7900	8,084.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13326		融券回购R001	1天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	808,461.79	85,284,435.42	融券回购	2.7900	8,084.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13345		增加证券成本010112	21国债02	基金恒丰	1000001		债券组合	0.00	0.00	0.0000		90,000.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13346		增加证券成本010112	21国债02	基金恒丰	1000001		债券组合	9,000,000.00	9,000,000.00	0.0000		0.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13347		增加证券成本010112	21国债02	基金恒丰	1000000		缺省组合	0.00	0.00	0.0000		10,000.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13348		增加证券成本010112	21国债02	基金恒丰	1000000		缺省组合	1,000,000.00	1,000,000.00	0.0000		0.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13349		减少证券成本010112	21国债02	基金恒丰	1000001		债券组合	0.00	0.00	0.0000		10,000.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13350		减少证券成本010112	21国债02	基金恒丰	1000001		债券组合	1,000,000.00	8,000,000.00	0.0000		0.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13351		场外认购成交0200011	华夏精选	基金恒丰	1000000		缺省组合	0.00	0.00	0.00 场外认购	1.0143	23,020.25	0.00	0.00	
2009-01-09 13362		场外认购成交0200011	华夏精选	基金恒丰	1000000		缺省组合	0.00	0.00	0.00 场外认购	1.0143	0.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13363		场外认购退单0200011	华夏精选	基金恒丰	1000000		缺省组合	0.00	0.00	0.00 场外认购	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13365		银行间费用支付R002	2天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	0.00	85,134,435.42	正回购/1	1.3500	10,960.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13366		融资回购R002	2天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	1,096,000.00	86,230,435.42	正回购/1	1.3500	10,960.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13368		银行间费用支付R001	1天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	0.00	86,230,435.42	逆回购/1	2.8100	11,250.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13369		融券回购R001	1天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	-1,125,000.00	85,105,435.42	逆回购/1	2.8100	11,250.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13370		银行间费用支付030228	03国债28	基金恒丰	1000001		债券组合	0.00	85,105,435.42	买入	93.7114	100.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13371		债券卖出030228	03国债28	基金恒丰	1000001		债券组合	-9,400.15	85,096,035.27	卖出	93.7114	100.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13372		银行间费用支付030228	03国债28	基金恒丰	1000001		债券组合	0.00	85,096,035.27	卖出	97.7139	300.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13373		债券卖出030228	03国债28	基金恒丰	1000001		债券组合	29,404.11	85,125,439.38	卖出	97.7139	300.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13376		融资回购成交R002	2天回购	基金恒丰	1000001		债券组合	1,096,000.00	0.00	0.00 正回购/1	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13378		场外申购成交020001	华夏回报	基金恒丰	1000000		缺省组合	0.00	0.00	0.00 场外申购	1.0470	14,233.26	0.00	0.00	
2009-01-09 13379		场外申购退单020001	华夏回报	基金恒丰	1000000		缺省组合	0.00	0.00	0.00 场外申购	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2009-01-09 13380		债券协议交易050001	05国债01	基金恒丰	1000001		债券组合	9,801.13	0.00	0.00 卖出	0.0000	0.00	0.00	0.00	
合计:	3,181							0,161,244,416.35	41,136,214.88			36,725,673,009.48	0.00	0.00	

3181 (第)

页

刷新当前数据

图 4-2-1

点击**查询**按钮我们可以根据起始、终止日期来选择我们所要查询的时间段，具体的产品和单元来过滤所要查询的结果。如图 4-2-2 所示：



流水查询条件设置

流水查询条件明细设置

起始日期:

2009-01-09

▼

终止日期:

2009-01-09

▼

产品编号:

▼

单元编号:

▼

确定

取消

重置

图 4-2-2

点击打印按钮，我们可以对所查询出来的数据进行打印。如图 4-2-3 所示：

打印	打印设置	缩放	第一页	上一页	下一页	最后一页	停止	关闭
----	------	----	-----	-----	-----	------	----	----

账单日期	流水序号	账单业务	账单代码	账单名称	产品名称	账单序号	账单名称	账单余额	账单余额余额	账单序号	账单价格
2020-09-09	13317	银行可消费	0002	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	0.00	84,387,461.89	账单序号	2.7100
2020-09-09	13318	银行可消费	0002	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	-1,511,448.00	84,376,950.89	账单序号	3.0000
2020-09-09	13321	账单业务	000002	账单业务	账单业务	000001	账单业务	200,533.31	84,578,484.19	账单序号	3.0000
2020-09-09	13322	账单业务	000002	账单业务	账单业务	000001	账单业务	-100,011.11	84,478,473.08	账单序号	2.0000
2020-09-09	13323	银行可消费	0001	3元套餐	账单业务	000001	账单业务	0.00	84,478,473.08	账单序号	2.7000
2020-09-09	13323	账单业务	000001	账单业务	账单业务	000001	账单业务	800,447.88	85,278,920.96	账单序号	1.0000
2020-09-09	13345	银行可消费	001012	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13345	银行可消费	001012	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	8,000,000.00	8,000,000.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13347	银行可消费	001012	2元套餐	账单业务	000000	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13348	银行可消费	001012	2元套餐	账单业务	000000	账单业务	1,000,000.00	1,000,000.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13349	银行可消费	001012	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13350	银行可消费	001012	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	1,000,000.00	8,000,000.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13351	银行可消费	000011	账单业务	账单业务	000000	账单业务	0.00	0.00	账单序号	1.6410
2020-09-09	13352	银行可消费	000011	账单业务	账单业务	000000	账单业务	0.00	0.00	账单序号	1.6410
2020-09-09	13353	银行可消费	000011	账单业务	账单业务	000000	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13353	银行可消费	0002	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	0.00	84,134,438.42	账单序号	1.8000
2020-09-09	13358	账单业务	0002	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	1,000,000.00	84,200,438.42	账单序号	2.8000
2020-09-09	13358	银行可消费	0001	3元套餐	账单业务	000001	账单业务	0.00	84,200,438.42	账单序号	2.8000
2020-09-09	13359	账单业务	0001	3元套餐	账单业务	000001	账单业务	-1,128,000.00	84,108,438.42	账单序号	2.8000
2020-09-09	13370	银行可消费	000208	000000	账单业务	000001	账单业务	0.00	84,108,438.42	账单序号	80.7114
2020-09-09	13371	银行可消费	000208	000000	账单业务	000001	账单业务	-9,420.18	84,099,018.27	账单序号	80.7114
2020-09-09	13372	银行可消费	000208	000000	账单业务	000001	账单业务	0.00	84,099,018.27	账单序号	80.7139
2020-09-09	13373	账单业务	000208	000000	账单业务	000001	账单业务	29,424.11	84,128,439.38	账单序号	80.7139
2020-09-09	13376	账单业务	0002	2元套餐	账单业务	000001	账单业务	1,000,000.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13378	银行可消费	000001	账单业务	账单业务	000000	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13379	账单业务	000001	账单业务	账单业务	000000	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13380	账单业务	000001	账单业务	账单业务	000001	账单业务	8,801.11	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13381	账单业务	000208	000000	账单业务	000001	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13382	账单业务	000208	000000	账单业务	000001	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13383	账单业务	000208	000000	账单业务	000001	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13384	账单业务	000208	000000	账单业务	000001	账单业务	0.00	0.00	账单序号	0.0000
2020-09-09	13385	账单业务	000001	账单业务	账单业务	000000	账单业务	8,000.00	84,108,439.38	账单序号	0.0000

打印人: 寇政涛

第1页/共20页

打印时间: 2024-09-12 15:10:32

图 4-2-3

点击**导出**按钮，我们可以对所查询的数据以文件(.xls 的格式)导出保存。如

图 4-2-4 所示:

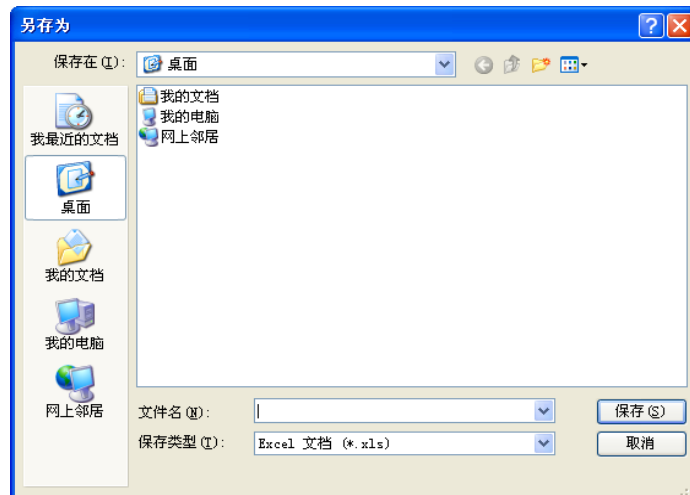


图 4-2-4

点击**布局设置**按钮，我们可以选择我们所要展示的字段。如图 4-2-5 所示：



图 4-2-5

4.3 资产分析

【资产分析】分为<产品资产查询>、<单元资产查询>、<现货持仓查询>、<交易所回购>、<期货资产分析>、<标准券查询>、<可质押债券>和<期货持仓查询>子页面。

4.3.1 产品资产查询

<产品资产查询>界面主要反映产品层的资金可用等情况，可以查询日期、产品、净值、单位净值、期初净值、现金资产、股票资产、债券资产、期货盈亏、回购资产、基金资产、其他资产、累计应付、累计应收、T+0 可用、T+1 可用、可用保证金、占用保证金($\Sigma(\text{合约乘数} * \text{当前数量} * \text{市价} * \text{保证金比例})$)、股票成本、股票浮动盈亏、债券成本、债券浮动盈亏、产品成本、产品浮动盈亏、累计实现收益。

在【信息查询】→【资产分析】→<产品资产查询>界面，输入产品编号、查

询起始日期后，可以查看产品当前资产详情。同时，该界面还支持刷新、打印、导出、布局设置等功能。

产品资产查询

单元资产查询

现货持仓查询

交易所回购

期货资产分析

标准券查询

可质押债券

期货持仓查询

产品编号: 9, 10, 12, 15, 17, 59, 74

2009-01-09

~

2009-01-09

刷新

打印

导出

布局设置

日期	产品名称	产品净值	单位净值	持仓市值 (全价)/产品净值 (%)	现金余额	股票资产	债券资产	期权资产	期货盈亏	回购资产	基金资产
2009-01-09	现货测试	1,280,089,175.79	11,128.0089	0.264	1,000,000,000.00	291,327,309.90	0.00	0.00	0.00	0.00	2,120,268.90
2009-01-09	ETF测试	3,935,756,004.05	1,103,935.7560	0.370	0,000,000,000.00	0.00	4,095,791,530.10	0.00	0.00	-511,179.23	0.00
2009-01-09	期货测试	1,189,426,673.24	111,189.4267	0.091	1,200,010,000.00	0.00	0.00	0.00	1,498,500.00	0.00	0.00
2009-01-09	融资融券测试	0.00	0.0000	0.000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2009-01-09	期权测试	0,005,110,000.00	10,005.1100	0.051	0,000,000,000.00	0.00	0.00	5,110,000.00	0.00	0.00	0.00
2009-01-09	2323	0.00	0.0000	0.000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2009-01-09	开放式基金测试	0.00	0.0000	0.000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
					6,410,381,853.08	2,200,010,000.00	291,327,309.90	4,095,791,530.10	5,110,000.00	1,498,500.00	-511,179.23
					2,120,268.90						

每页行数: 50 100 500

1

到第

1

页

确定

共有 7 条记录。

F5刷新当前数据

图 4.3.1

详细说明

产品净值: 产品净值=现金余额-应付+应收+股票资产+债券资产+基金资产+回购资产+权证资产+其它资产+期货盈亏+期权资产。

单位净值: 产品净值/份额。

持仓市值 (全价)/产品净值 (%): 如果资产类别为回购资产、非资产、其它资产时，证券价值为 0；否则证券价值=当前数量*基金价格，所以持仓市值 (全价)=证券价值+证券利息。

现金余额: 就是当前现金资产，包括当天所有增加和减少部分。=期初现金余额+当天业务处理资金变化部分+手工调整部分。

股票资产: 即该产品下所有股票的市值加和。

债券资产: 该产品上资产类别为债券的所有证券的市值

期权资产: 该产品期权资产类别的所有证券市值。

期货盈亏: 一种资产类别，期货以盈亏记录资产，期货是保证金交易，合约价值不作为基金资产，合约当天的浮动盈亏要记入基金资产（在日终结算时，浮动盈亏要结转成资金）。

回购资产: 该产品上所有回购的市值

基金资产: 基金资产(除货币产品) = 基金资产 - 货币产品 （主要是因为

货币产品一般算作流动性资产, 因此很多时候都不希望统计在基金资产中)

其他资产: 其他资产是指不能包括在流动资产、长期投资、固定资产、无形资产等以外的资产, 主要包括长期待摊费用和其他长期资产。其他长期资产包括特准储备物资, 银行冻结存款、冻结物资、诉讼中财产等。

累计应付: 合计应付金额。

累计应收: 合计应收金额。

T+0 可用: 当日可用金额。

T+1 可用: T+1 日的可用金额。

期货可用保证金: 可用保证金金额 = 当前期货保证金产品余额 - 当前持仓占用保证金(开关) - 未成交的开仓委托需要的保证金 - 未成交委托所需要的手续费 - 最低准备金 + 期货浮动盈亏(开关)。

开仓时, 增加持仓占用的保证金。

平仓时, 按照先进先出的顺序进行处理。将浮动盈亏资产转化为保证金产品余额和当日实现盈亏, 并减少保证金占用。

可用金额是否考虑保证金增加开关。当合约上涨时候, 增加保证金占用, 计算可用是否需要考虑这部分增加部分。

期货浮动盈利是否计入可用开关。亏损部分减少可用, 盈利部分按照不同期货公司要求进行设置。

期货占用保证金: 期货持仓所占用的保证金, 是按照最新价来计算的保证金。
= (Σ 所有合约 (持仓手数 * 该合约的最新价 * 合约乘数 * 保证金比例))。

股票成本: 当前数量 * 成本价。其中, 成本价 = (结转过包含费用的期初成本 + 当日买入金额 + 当日买入费用) / (当前持仓数量 + 当日卖出数量), 是包含费用的单价。股票成本只计算资产类别为“股票资产”的证券的持仓成本

债券成本: 和股票成本计算类似, 只是取资产类别为“债券资产”。

基金成本: 和股票成本计算类似, 只是取资产类别为“基金资产”。

股票浮动盈亏: 股票资产 - 股票成本。

债券浮动盈亏: 债券资产 - 债券成本。

基金浮动盈亏: 持仓产品总市值 - 持仓产品总成本。

累计实现收益: 期初累计实现收益 + 当日实现收益。

1. 如果是回购类证券的持仓，证券资产类别为“回购资产”或者证券类别为“股票回购”或“债券回购”，当日实现收益为 0；

2. 如果是资产类别是“期货盈亏”标的的持仓，当日实现收益为期货当日实现收益；

3. 对于其他情况，当日实现收益=卖出金额-卖出费用-卖出成本，卖出成本=当日卖出数量*(结转过含费用的期初成本+买入金额+买入费用)/(当前数量+当日卖出数量)。

昨日单位净值：上个交易日的单位净值。

单位净值增长率(%)：如果基金类型为开放式基金，并且投资方向为 ETF 基金，则单位净值增长率(%)=(单位净值-昨日单位净值)/昨日单位净值*100。否则，单位净值增长率(%)=单位净值/(昨单位净值-单位分红金额)-1。

累计实现收益(含费用)：如果投资类型是可交易、套保、套利或投机，累计实现收益=卖出金额 - 买入金额 - 买入费用 - 卖出费用，否则为 0。

股票+基金资产：显示股票与基金资产的和。

4.3.2 单元资产查询

【单元资产查询】界面主要反映各交易单元层次的资金可用等情况，具体可以查询日期、产品、单元、T+0 可用、T+1 可用、可用保证金、占用保证金(Σ (合约乘数 * 当前数量 * 市价 * 保证金比例))、股票资产、股票成本、股票浮动盈亏、期货盈亏、回购资产、债券资产、债券成本、债券浮动盈亏、基金资产、产品成本、产品浮动盈亏、累计实现收益、累计收益率(%)等字段。

在【信息查询】→【资产分析】→<单元资产查询>界面，用户可以通过产品编号、单元编号、起始日期对列表内容进行查询。

产品资产查询																
单元资产查询			现货持仓查询		交易所回购		期货资产分析		标准券查询		可质押债券		期货持仓查询			
产品编号: 9, 10, 12, 15, 17, 59, 74			单元编号: 1, 2, 1, 2, 3, 3, 1, 2, 3, 1, 1		2009-01-09		2009-01-09		刷新		打印		导出		布局设置	
日期	产品名称	单元名称	总资产	持仓资产/总资产 (%)	期初现金余额	当前现金余额	T+0可用	T+1可用	期货可用保证金	期货占用保证金	回购资产	持仓资产				
2009-01-09	现货测试	缺省单元	0,000,021,614.90	0.00	0.00	100,000,000,000.00	9,999,200,000.00	9,999,200,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	现货测试	试股票资金账户缺省	9,990,000,000.00	0.00	0.00	9,990,000,000.00	9,990,000,000.00	9,990,000,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	ETF测试	缺省单元	0,000,000,000.00	0.00	0.00	100,000,000,000.00	0,000,000,000.00	0,000,000,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	ETF测试	易测试资金账户缺省	9,900,000,000.00	0.00	0.00	999,900,000,000.00	9,900,000,000.00	9,900,000,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	现货测试	现货单元	1,010,000,988.00	0.00	0.00	1,010,000,000.00	951,251,448.79	951,251,448.79	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	ETF测试	ETF单元	100,000,000.00	0.00	0.00	100,000,000.00	56,400,000.00	56,400,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	期货测试	缺省单元	1,101,498,500.00	0.14	0.00	1,100,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	81,311,220.00	20,328,180.00	0.00	0.00				
2009-01-09	期货测试	货测试资金账户缺省	0,100,010,000.00	0.00	0.00	100,100,010,000.00	0,000,010,000.00	0,000,010,000.00	100,000,000.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	期货测试	期货测试	0,000,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000,000.00	0.00	0.00	9,999,993,935.54	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	融资融券测试	缺省单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	期权测试	缺省单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	期权测试	期权测试	0,004,010,000.00	0.05	0.00	9,999,000,000.00	9,999,000,000.00	9,999,000,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	期权测试	期权测试	1,100,000.00	9.09	0.00	1,000,000.00	817,905.00	817,905.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	Z323	缺省单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	Z323	Z323缺省	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
2009-01-09	开放式基金测试	缺省资金账户单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00				
			2,206,641,102.90		0.00	332,200,010,000.00	1,896,679,353.79	1,896,679,353.79	0,181,305,155.54	20,328,180.00	0.00	0.00				
每页行数: 50 100 500 全部 1 到第 1 页 确定 共有 16 条记录。 F5刷新当前数据																

图 4.3.2

详细说明

累计收益率：期初收益率+本期收益率。本期收益率：（资产单元净资产-日均本金）/日均本金。

持仓资产/总资产：（总资产-当前现金余额-合计应收+合计应付）/总资产。（其他字段参考产品资产查询字段的解释。）

4.3.3 现货持仓查询

【现货持仓查询】支持当前和历史现货持仓数据的查询。

在【信息查询】→【资产分析】→<现货持仓查询>界面，点击[查询]按钮后我们可以通过选择相应的起始、终止时间、产品、单元、市场、证券代码来进行选择。

产品资产查询

单元资产查询

现货持仓查询

交易所回购

期货资产分析

标准券查询

可质押债券

期货持仓查询

证券代码:

定位

刷新

查询

打印

导出

布局设置

日期	证券名称	证券代码	证券类别	最新价	成本价	产品名称	单元编号	单元名称	持仓数量	当前成本	持仓市值(净价)	持仓市值(全价)	持仓市值(净价)/单元净值(元)	持仓市值(全价)/单元净值(元)
2009-01-09	消费ETF	510150	开放式基金	2.6890	0.0000	现货测试	1	缺省单元	100	0.00	268.90	268.90	0.0000	0.0000
2009-01-09	浦发银行	600000	股票	13.8700	0.0000	现货测试	1	缺省单元	1,000	0.00	13,870.00	13,870.00	0.0000	0.0000
2009-01-09	日临港	600017	股票	10.6800	0.0000	现货测试	1	缺省单元	700	0.00	7,476.00	7,476.00	0.0000	0.0000
2009-01-09	恒生电子	600570	股票	9.8800	0.0000	现货测试	3	现货单元	100	0.00	988.00	988.00	0.0001	0.0001
									1,900	0.00	22,602.90	22,602.90		

每页行数: 50100500全部

1页确定

共有 4 条记录。

F5刷新当前数据

图 4.3.3

成本价：如果 当前数量+卖出数量=0，成本价=0；如果 当前数量+卖出数量<>0，成本价=成本/（当前数量+卖出数量）。成本 = 结转过含费用的期初成本+买入金额+实际当日买入费用（远程客户端的成本是包含费用的）

持仓数量：就是当前持仓数量（资产数量），包括新红配，以及当天所有增加和减少部分。
当前期初数量+当天业务处理资产变化部分+手工调整部分

当前成本：如果当前数量+卖出数量=0，当前成本为 0；如果当前数量+卖出数量<>0，当前成本=成本*（当前数量/（当前数量+卖出数量））。成本 = 结转过含费用的期初成本+买入金额+实际当日买入费用（远程客户端的成本是包含费用的）

持仓市值（净价）：当前数量*净价市价，计算后的价格四舍五入，同时取两位小数。

持仓市值（全价）：当前数量）*全价市价，计算后的价格四舍五入，同时取两位小数。

持仓市值（净价）/单元净值（%）：（净价市值/净资产）*100，计算后的价格四舍五入，同时取四位小数。

持仓市值（全价）/单元净值（%）：（全价市值/净资产）*100，计算后的价格四舍五入，同时取四位小数。

累计盈亏：如果证券类别是股票回购、债券回购或资产类别是回购资产，则累计盈亏为 0；如果资产类别为 9（期货盈亏），为今日实现收益-（实际当日买入费用+实际当日卖出费用）。其他情况时，如果卖出数量为 0，则累计盈亏为 0；如果卖出金额+当前数量=0，则累计盈亏为 0；否则=卖出金额-卖出费用-卖出数量*（结转过含费用的期初成本+买入金额+买入费用）/（当前数量+卖出数量）。如果投资类型是可交易，还要减去（实际当日买入费用+实际当日卖出费用）。

浮动盈亏：市值-当前成本。

浮盈率（%）：持仓市值（净价）=0，浮盈率为 0；否则浮盈率=浮动盈亏*100/持仓市值（净价）

盈亏率（%）：当前成本为 0，盈亏率为 0；否则，盈亏率=浮动盈亏*100/当前成本

投资类型：值域有：可交易、持有到期、可供出售、贷款和应收款项。

当日买入数量：当日买入现货合计数量。

当日卖出数量：当日卖出现货合计数量。

保本价：（当前成本-（累计盈亏-结转后可交易资产总费用+卖出金额-卖出费用-卖出成本-（当日实际买入费用+当日实际卖出费用）））/当前数量。

4.3.4 交易所回购

【交易所回购】可以查询交易所回购相关信息。

在【信息查询】→【资产分析】→<交易所回购>界面，点击查询按钮在弹出查询界面选择起始、终止时间、产品、单元、证券代码筛选列表内容。

资产分析

账户资产查询

单元资产查询

现货持仓查询

交易所回购

期货资产分析

标准券查询

质押债券

期货持仓查询

☐ 显示融资

☒ 显示融券

刷新

查询

打印

导出

布局设置

回购日期	产品名称	单元编号	单元名称	回购代码	委托方向	数量	净资金额	返回金额	利润	额外利润	清算速度	购回处理日期	购回生效日期	实际期
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融资买入	100.00	9,999.90	-10,082.19	-82.29	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融资卖出	100.00	9,999.90	-10,082.19	-82.29	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融资买入	100.00	9,999.90	-10,082.19	-82.29	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融资卖出	100.00	9,999.90	-10,082.19	-82.29	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融资买入	100.00	9,999.90	-10,082.19	-82.29	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券卖出	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15	2009-	2009-
2009-01-09	基金恒丰	1000000	融资融券组合	131900	融券买入	100.00	-10,000.10	10,082.19	82.09	81.81	1	2009-01-15</		

图 4.3.4

回购日期：回购的交易日期。

净资金额：如果是融资回购，则净资金额 = 成交金额 - 费用，否则净资金额 = -成交金额 - 费用。

返回金额：如果是融资回购，则返回金额 = 成交金额 + 回购利息，否则返回金额 = 成交金额 + 回购利息。

利润：如果是融资回购，则利润 = 回购利息 - 回购费用，否则利润 = -回购利息 - 回购费用。

额外利润： 回购利息-回购费用-（成交金额+成交费用）*（年利率/年利率天数）*回购天数。

购回处理日期：在购回处理时的日期。

购回交割日期：实际购回日期+清算速度。

实际购回日期：由于工作日关系，实际购回日期和法定购回日期可能不同。

法定购回日期：即回购到期自然日。

计提利息：如果是融资回购，则利润 = -当前已计利息，否则利润 = 当前已计利息。

4.3.5 期货资产分析

【期货资产分析】可以查询日期、产品、单元、可用保证金、期初权益、动态权益、静态权益、期初占用保证金、占用保证金、占用保证金(含挂单)、风险度(%)、风险度(含挂单)、保证金余额、盯市盈亏、当日总平仓盈亏、浮动盈亏、总盈亏、产品出入金等字段。

在【信息查询】→【资产分析】→<期货资产分析>界面，输入产品编号、资产单元、起始日期可以查询列表内容。

产品资产查询

单元资产查询

现货持仓查询

交易所回购

期货资产分析

标准券查询

可质押债券

期货持仓查询

产品编号:

资产单元:

日期: 2009-01-09

~ 2009-01-09

刷新

打印

导出

布局设置

日期	产品编号	产品名称	单元编号	单元名称	可用保证金	期初权益	产品权益	期初占用保证金	占用保证金	占用保证金(含挂单)	风险度(%)	风险度(含挂单)	保证金余额	
2009-01-09	9107	期货交易	1	缺省单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	2	期货交易所资金账户缺省	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	3	期货交易所投机	97,318,920.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	4	期货交易所套保	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	5	期货交易所套利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	6	期货模拟成交流金账户	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	7	投机单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	8	套利单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	9	期货投机单元	37,455,251.82	0.00	0.00	0.00	60,012,000.00	62,260,722.00	4.617	4.790	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	10	期货套保单元	99,060,040.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9107	期货交易	11	期货套利单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9114	期权产品	1	缺省单元	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9114	期权产品	2	期权交易所资金账户缺省	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9114	期权产品	3	期权交易所投机	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
2009-01-09	9114	期权产品	4	期权交易所套保	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.000	0.000	0.000	
					33,834,211.82	0.00	0.00	60,012,000.00	62,260,722.00				100,000,000.00	
可用保证金:					0.00	期初占用保证金:		0.00	风险度(%):		0.000	浮动盈亏:		0.00
占用保证金:					0.00	占用保证金(含挂单):		0.00	盯市盈亏:		0.00	预计日终占用:		0.00
产品出入金:					0.00	期初权益:		0.00	风险度(含挂单):		0.000			
当日总平仓盈亏:					0.00	产品权益:		0.00	保证金余额:		0.00			

每页行数: 50100500

上页下页

1 到第 1 页 确定

共有 15 条记录。

P5刷新当前数据

图 4.3.5

可用保证金: 该单元的可用保证金。可用保证金=当前期货保证金产品余额-当前持仓占用保证金(开关)-未成交的开仓委托需要的保证金-未成交委托所需要的手续费-最低准备金+期货浮动盈亏(开关);

开仓时，增加持仓占用的保证金。

平仓时，按照先进先出的顺序进行处理。将浮动盈亏资产转化为保证金产品余额和当日实现盈亏，并减少保证金占用。

可用金额是否考虑保证金增加开关。当合约上涨时候，增加保证金占用，计算可用是否需要考虑这部分增加部分。

期货浮动盈利是否计入可用开关。亏损部分减少可用，盈利部分按照不同期货公司要求进行设置。

期初权益: 昨日清算结算后的产品权益。

产品权益: 产品权益=期货保证金账户余额+盯市盈亏。

期初占用保证金: T日开市前，该单元占用持仓按照昨日结算价来计算所占用的保证金。

(Σ 所有合约(日初占用持仓手数*该合约的昨日结算价*合约乘数*保证金比例))。

占用保证金：持仓所占用的保证金，是按照最新价来计算的保证金。(Σ 所有合约(持仓手数*该合约的最新价*合约乘数*保证金比例))。

占用保证金(含挂单)：占用保证金+挂单金额，在占用保证金的基础上加上委托占用部分。挂单金额=(委托数量-当天成交数量-撤单数量)*最新价*合约乘数*保证金比例

风险度(%)：占用保证金 / 产品权益 * 100。

风险度(含挂单%)：占用保证金(含挂单) / 产品权益* 100

保证金余额：期货产品的保证金金额。出入金、开仓(减费用)、平仓(加上盈亏)都会影响此金额。

盯市盈亏：当天现有持仓的盯市盈亏的情况。对于不是当天建仓的持仓，盯市盈亏=当天最新价与昨日结算价之间的盈亏情况。对于当天建仓的持仓，盯市盈亏=当天最新价与开仓价格之间的盈亏情况。

盯市盈亏= Σ (当前持仓数量*多空标志*合约乘数*(最新价 - X))。其中 X：今仓取开仓价，昨仓取前结算价。

当日总平仓盈亏：当日做平仓操作的盈亏总和。如果平的是昨日的持仓，成本价是昨日结算价。如果平的是今日新开的持仓，成本价为开仓价。日初始化后清零。

浮动盈亏：又称持仓盈亏，持仓盈亏是从开仓到当前为止的盈亏总额，是没有按日结转的盈亏。 Σ (明细持仓数量 * 多空标志*(最新价-开仓价格)*合约乘数)。

产品出入金：只针对业务操作类型是期货保证金增加、期货保证金减少、期货保证金调增、期货保证金调减的数据进行统计。

预计日终占用：预计日终持仓所占用的保证金，与占用保证金计算类似，不同的是按照结算价来计算的保证金占用。(Σ 所有合约(持仓手数*该合约的结算价*合约乘数*保证金比例))

累计盈亏(含浮动盈亏)：累计盈亏 + 浮动盈亏。

累计盈亏：未结转收益+当日实现收益。

4.3.6 标准券查询

【标准券查询】用于交易所回购业务的标准券数量。

在【信息查询】→【资产分析】→<标准券查询>界面。该界面支持刷新、查询、打印、

导出、布局设置等操作。



图 4.3.6

库存数量（汇总页面）：融券数量 - 融资数量。

可用数量（汇总页面）：债券兑换成标准券的数量 - 融资的数量。

融券数量：取持仓表的冻结数量。

深交所当日转标准券数量：当日质押数量 * 质押比率 取新标准券代码为深交所代码 '131990SZ', '131991SZ' 的数据。

库存数量（明细页面）：即持仓数量。

可用数量（明细页面）：对于老的标准券该字段含义为可抵押数量=当前数量 - 冻结数量 + 解冻数量；对于新的标准券该字段含义为已质押的数量=期初质押数量+当日质押数量 - 当日转回数量。

抵押比率（%）：对于老的标准券该字段表示抵押比率；对于新的标准券该字段表示质押比率。

可转标准券数量：对于老的标准券为 可抵押数量*抵押比率=（当前数量- 冻结数量 + 解冻数量）* 抵押比率；对于新的标准券为 质押数量*质押比率=（期初质押数量 + 当日质押数量 - 当日转回数量）*质押比率。

4.3.7 可质押债券

【可质押债券】用于查询交易所回购业务的可质押债券。

在【信息查询】→【资产分析】→<可质押债券>界面，查询可质押债券相关信息。该界

面支持刷新、查询、导出、打印、布局设置等操作。

刷新

查询

导出

打印

布局设置

产品名称	单元编号	单元名称	债券代码	债券名称	可转标准券名称	抵押比率 (%)	库存数量	已质押数量	可质押数量	已转标准券数量	可转标准券数量
现货产品	4	现货交易单元	010311	03国债(附)	新标准券	90.00	200.00	0.00	200.00	0.00	180.00
							</				

产品资产查询 单元资产查询 现货持仓查询 交易所回购 期货资产分析 标准券查询 可质押债券 期货持仓查询															
合约代码:				定位	刷新	查询	打印	导出	布局设置						
日期	产品名称	单元编号	单元名称	合约代码	合约名称	买卖	总持仓	昨仓	今仓	持仓均价	前结算价	最新价	浮动盈亏	盯市	
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	IF1507	IF1507	卖	0	0	0	0.00	3,825.80	4,008.00	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	IF1508	IF1508	买	0	0	0	0.00	1,000.00	999.80	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	IF1507	IF1507	买	0	0	0	0.00	3,825.80	4,008.00	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	IF1508	IF1508	卖	0	0	0	0.00	1,000.00	999.80	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	ag1601	白银1601	买	0	0	0	0.00	1,000.00	998.60	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	IF1510	IF1510	买	1,000	0	1,000	1.00	1,000.00	1,000.20	299,760,000.00	2	
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	41509	普一号1509	买	0	0	0	0.00	4,107.00	4,170.00	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	TI1512	TI1512	买	0	0	0	0.00	96.54	96.55	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	IH1509	IH1509	卖	0	0	0	0.00	2,765.00	2,765.60	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	IF1509	IF1509	买	0	0	0	0.00	97.37	97.40	0.00		
2009-01-09	期货交易	9	期货投机单元	IF1509	IF1509	买	0	0	0	0.00	1,000.00	999.20	0.00		
合计: 14条							1,000	0	1,000				299,760,000.00	2	
每页行数: 50 100 500 1000 全部 1 到第 1 页 确定 共有 14 条记录。															
成交编号	合约代码	合约名称	买卖	开仓手数	持仓手数	平仓手数	开仓价格	持仓类型	投资类型	开仓日期	浮动盈亏	盯市盈亏	当日平仓盈亏	平仓结算收益	总盈亏

图 4.3.8

总持仓: 就是当前持仓数量(资产数量), 包括新红配, 包括当日所有增加和减少部分。

总持仓=期初数量+当天业务处理资产变化部分+手工调整部分。

昨仓: 昨仓剩余数量, 日初始化后同期初数量, 期货实时成交平昨仓之后减少。

今仓: 总持仓-昨仓。

持仓均价: 当前持仓*开仓价格/总持仓。

前结算价: 昨日的结算价。

最新价: 最新成交价。

浮动盈亏: $\text{SUM}(\text{多空仓标志}) \times \text{合约乘数} \times \text{当前持仓} \times (\text{最新价} - \text{开盘价})$ 。

投资类型: 值域有: 可交易、持有到期、可供出售、贷款和应收款项。

多空标志: 分为多仓和空仓, 用于期货。

盯市盈亏: 当天现有持仓的盯市盈亏的情况。对于不是当天建仓的持仓, 盯市盈亏=当天最新价与昨日结算价之间的盈亏情况。对于当天建仓的持仓, 盯市盈亏=当天最新价与开仓价格之间的盈亏情况。 $\text{盯市盈亏} = \Sigma(\text{当前多头持仓数量} \times (\text{市价} - X) \times \text{合约乘数} - \text{当前空头持仓数量} \times (\text{市价} - X) \times \text{合约乘数})$

其中: X 对于当天开仓的, 则为开仓价格, 否则为前结算价。

当日平仓盈亏: 显示该合约当日平仓盈亏情况。

平仓结算收益: 该合约从开仓以来到目前平仓后所产生的收益。包括未平仓的持仓每日结算产生的盈亏和已平仓产生的平仓收益。

总费用: 显示当前合约的费用和。

总盈亏: 盯市盈亏+平仓结算收益-总费用

动态占用保证金：交易所是上金所、上期所、郑商所、大商所，动态占用保证金=总持仓*基金市价*保证金比例；如果交易所是港期所，则动态占用保证金=GREATEST（总持仓+当日预买数量，总持仓-当日预卖数量）*股指期货基本按金。

静态占用保证金：不随合约点位变化的保证金。对于历史持仓用昨结算价计算，对于今日开仓用开仓价格计算。SUM（当前持仓*合约乘数*decode（开仓日期，发生日期，开盘价，前结算价）*保证金比例）

当日成交次数：当日合约成交总次数。

当日成交手数：当日合约成交总手数。

当日买入数量：当日合约买入数量。

当日卖出数量：当日合约卖出数量。

合约市值：持仓数量*价格*合约乘数，其中价格取结算价，如果结算价为0时，则取最新价。

4.4 基础数据查询

功能介绍

通过打开【基础数据查询】，我们可以查询到券商总公司在券商端已维护的证券的基础信息，如证券资料、债券属性、期货品种、证券发行信息等。

操作介绍

操作如下：单击【信息查询】→【基础数据查询】主界面，进行查询。如图 4-4-1 所示：

图 4-4-1

第五章 财务管理

5.1 资金管理

功能介绍

资金管理主要用于查询账户(包括资金账户和单元)的可用和融资负债信息,及对单元的各类资金的增减操作。

操作说明

如图 5-1-1 所示,界面列表中显示各产品对应下账户(包括资金账户和单元)的资金明细数据。列表下方的“显示管理账户”和“显示普通账户”两个复选框,分别代表显示资金账户的资金明细数据和显示单元的资金明细数据。

资金管理												
资金管理 融资负债 资金冻结解冻查询 资金类操作查询												
调整资金 冻结资金 解冻资金 划转资金												
查询 刷新 打印 导出 布局设置												
日期	产品编号	产品代码	产品名称	单元名称	币种	期初资金余额	交易保证金	当前资金余额	T+0交易可用	T+1交易可用	冻结金额	解冻金额
2013-02-11	605	06055	期货	期货单元	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	605	06055	期货	期货测试_1	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	605	06055	期货	1111	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	605	06055	期货	222	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	期货单元	人民币	0.00	0.00	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	0.00	0.00
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	zhiy测试账户	人民币	0.00	0.00	1,800,000,000.00	1,800,000,000.00	1,800,000,000.00	0.00	0.00
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	测试子账户	人民币	0.00	0.00	200,000,000.00	199,626,824.18	199,626,824.18	0.00	0.00
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	zhiy测试期货	人民币	0.00	0.00	310,799,999,996.00	310,799,999,996.00	310,799,999,996.00	0.00	0.00
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	期货测试子账户	人民币	0.00	0.00	200,000,000.00	89,998,000.00	89,998,000.00	210,000,000.00	100,000,000.00
2013-02-11	9	10086001	zhiy测试基金	zhiy新账户	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	11	11	2221	期货单元	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	11	11	2221	现货分仓	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	11	11	2221	1111	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	11	11	2221	xxx	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	期货单元	人民币	9,100.00	0.00	9,100.00	8,100.00	8,100.00	1,000.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	22222	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	33333	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	融资融券分仓	人民币	0.00	0.00	90,000,000.00	90,000,000.00	90,000,000.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	融资融券	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	2222	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	融资融券组合	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	测试账户	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	现货分仓	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	现货组合	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	1	111111	恒生基金	11111	人民币	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
						9,100.00	0.00	317,499,999,028.00	317,069,429,475.08	317,069,429,475.08	529,928,912.80	100,000,000.00
显示管理账户 显示普通账户												

图 5-1-1

调整资金: 点击**调整资金**按钮,弹出如图 5-1-2 所示界面,选择调整类型可选择期货保证金增加/减少后,再选择产品编号、操作生效日期(默认当天)、单元、可在调增金额内输入需要增加/减少的期货保证金的资金数量,也可点击**调整到金额**后输入目标期货保证金的金额,点击**确定**按钮后完成操作。

调整资金

调整产品的资金

调整类型: 108 期货保证金增加

产品编号:

操作生效日期: 2008-11-01

操作生效时点: 0 立即或复核通过

单元名称:

币种: CNY 人民币

调整到金额:

调整金额:

备注:

资金信息

当前现金余额:

T+0交易可用:

T+1交易可用:

冻结金额:

解冻金额:

期货保证金余额:

可用期货保证金:

预估调整后资金信息

当前现金余额:

期货保证金余额:

冻结金额:

解冻金额:

确定

取消

图 5-1-2

冻结/解冻资金: 冻结/解冻资金不会对系统内的现金资产做调整, 只会改变单元的可用头寸数量 (冻结减少可用, 解冻增加可用)。点击资金冻结按钮, 弹出如图 5-1-3 所示。输入产品编号、单元编号和失效日期, 与资金调整类似, 冻结也可以设置冻结金额和冻结到金额。同时设置到期影响可用标志, “到期影响可用” 表示在冻结到期日计算 T+1 可用时会预先加上之前的冻结金额, 反之“到期不影响可用” 则不增加。



图 5-1-4

融资划转：支持如下三种情况。

- 1) 同一资金账户下的单元与单元之间的融资负债相互划转。
- 2) 资金账户的融资负债划入到该资金账户下的单元。
- 3) 单元的融资负债划出给该单元的资金账户。

〈资金冻结解冻查询〉：用于查询冻结/解冻的记录，如图 5-1-5 所示，并可点击取消冻结解冻按钮，取消相应的冻结解冻记录。



图 5-1-5

〈资金类操作查询〉：用于查询【资金管理】菜单下的所有操作，如图 5-1-6 所示。**删除**按钮用于删除未生效的资金操作记录。



资金管理												
资金管理 融资融券 资金冻结解冻查询 资金类操作查询												
删除												
操作人	操作类型	产品编号	产品代码	产品名称	单元名称	目标产品	目标单元	币种	发生金额	发生份额	操作生效日期	操作生效时点
海通私募 资金划转	2	22222222	22222222	新财富产品	现货主账户1	张三	人民币	9,000,000.00	0.00	2013-02-20	立即或复核通过后生效	2013-02-2
海通私募 资金划转	2	22222222	22222222	新财富产品	现货主账户1	张三	人民币	1,000,000.00	0.00	2013-02-11	立即或复核通过后生效	2013-02-1
系统自动 资金增加	2	22222222	22222222	新财富产品	现货主账户1		人民币	10,000,000.00	0.00	2013-02-11	立即或复核通过后生效	

图 5-1-6

5.2 证券管理

功能介绍

证券管理主要用于查询账户(包括资金账户和单元)的持仓和融券负债信息,及对单元的各类证券的增减操作。

操作说明

如图 5-2-1 所示,界面列表中显示各产品对应下账户(包括资金账户和单元)的证券明细数据。

证券管理												
证券管理 融资融券 证券冻结解冻查询 期货调整 证券类操作查询												
冻结解冻 划转证券												
日期	产品代码	产品名称	单元名称	市场	股东	席位	投资类型	多空标志	证券代码	证券名称	期初数量	当前数量
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 上交所A	A000000009	10001	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	100,010,000.00	100,010,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 上交所A	A000000009	10001	可交易	多仓	600246	万通地产	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 上交所A	D890000000	11111	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	1,000,099.00	1,000,099.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 深交所A	0100000001	100002	可交易	多仓	000002	万科A	0.00	99,999,000.00	99,999,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 深交所A	0100000001	100002	可交易	多仓	125002	万科转债	0.00	1,000.00	1,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 招商所	666666	SEAT4	投机	多仓	CF501	CF501	0.00	10,000.00	10,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 招商所	666666	SEAT4	投机	多仓	CF503	CF503	0.00	10,000.00	10,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 招商所	777777	SEAT9	投机	多仓	a1501	a1501	0.00	210,000.00	210,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 zhi j y 测试账户 招商所	777777	SEAT9	投机	空仓	a1505	a1505	0.00	10,000.00	10,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 上交所A	A000000009	10001	可交易	多仓	510180	180ETF	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 上交所A	A000000009	10001	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 上交所A	A000000009	10001	可交易	多仓	600006	东风汽车	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 上交所A	A000000009	10001	可交易	多仓	600246	万通地产	0.00	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 上交所A	A000000009	10001	可交易	多仓	600570	恒生电子	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 上交所A	A000000009	10001	可交易	多仓	730000	浦发增发	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 上交所A	D890000000	11111	可交易	多仓	600000	浦发银行	0.00	1.00	1.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 深交所A	0100000001	100002	可交易	多仓	000001	深发展A	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 深交所A	0100000001	100002	可交易	多仓	000002	万科A	0.00	1,000.00	1,000.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 深交所A	0100000001	100002	可交易	多仓	070063	中兴发债	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 深交所A	0100000001	100002	可交易	多仓	125002	万科转债	0.00	1,000.00	0.00	1,000.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 招商所	666666	SEAT4	投机	多仓	CF501	CF501	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 招商所	666666	SEAT4	投机	空仓	CF503	CF503	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 招商所	777777	SEAT9	投机	空仓	a1501	a1501	0.00	1.00	1.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 招商所	777777	SEAT9	投机	多仓	a1501	a1501	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 招商所	777777	SEAT9	投机	多仓	a1505	a1505	0.00	0.00	0.00	0.00
2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金 测试子账户 招商所	777777	SEAT9	投机	空仓	a1505	a1505	0.00	0.00	0.00	0.00

☒ 显示管理账户 ☒ 显示普通账户

图 5-2-1

冻结/解冻、证券划转、证券冻结/解冻查询等功能与上述资金管理中的类似，此处不再赘述。

〈期货调整〉：对证券进行调整，支持手工持仓划转的操作，如图 5-2-2 所示。

证券管理														
证券管理 融券负债 证券冻结解冻查询 期货调整 证券类操作查询														
持仓划转 划入单元 划入资金账户														
持仓明细序号	发生日期	产品代码	产品名称	单元名称	市场	原单	席位	持仓标志	投资类型	合约代码	合约名称	持仓数量	未平仓数量	持仓日期
59467	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试账户	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	100,000.00	100,000.00	2013-02
59471	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试账户	郑商所	666666	SEAT4	持仓	投机	CF501	CF501	10,000.00	10,000.00	2013-02
59472	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试账户	郑商所	666666	SEAT4	持仓	投机	CF503	CF503	10,000.00	10,000.00	2013-02
59473	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试账户	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	10,000.00	10,000.00	2013-02
59474	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试账户	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1505	a1505	10,000.00	10,000.00	2013-02
60326	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试账户	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	100,000.00	100,000.00	2013-02
60435	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试期货	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	10,000.00	0.00	2013-02
60436	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试期货	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	10,000.00	0.00	2013-02
60437	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	期货测试子账户	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	10,010.00	10,010.00	2013-02
60438	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	期货测试子账户	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	10,010.00	10,010.00	2013-02
60444	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试期货	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	10.00	0.00	2013-02
60445	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试期货	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	10.00	0.00	2013-02
60446	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试期货	郑商所	666666	SEAT4	持仓	投机	CF501	CF501	100.00	0.00	2013-02
60447	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	zhi j y 测试期货	郑商所	666666	SEAT4	持仓	投机	CF501	CF501	1,000.00	550.00	2013-02
60448	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	期货测试子账户	郑商所	666666	SEAT4	持仓	投机	CF501	CF501	100.00	100.00	2013-02
60449	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	期货测试子账户	郑商所	666666	SEAT4	持仓	投机	CF501	CF501	450.00	450.00	2013-02
65817	2013-02-11	10088001	zhi j y 测试基金	测试子账户	大商所	777777	SEAT9	持仓	投机	a1501	a1501	1.00	1.00	2013-02

☒ 显示管理账户 ☒ 显示普通账户

图 5-2-2