



Qwin 期权策略交易平台使用说明

文档状态	<input checked="" type="checkbox"/> 初稿	文档标识	Qwin 期权策略交易系统使用手册
	<input type="checkbox"/> 评审通过	文档作者	上海钱育信息科技有限公司
	<input type="checkbox"/> 修改	公司部门	测试部
	<input type="checkbox"/> 发布	更新日期	2024-8-9
	<input type="checkbox"/> 作废	版本	V1920

目录

1. 系统介绍	4
2. 如何开启 Qwin	4
3. 基本设定	5
3.1 期权序列风控参数设定	6
3.2 投资组合设定	8
3.3 价差组合设定	9
3.5 商品价格调整	11
3.6 系统警示设定	13
3.7 系统设置	14
3.8 登录密码修改	30
3.9 账号组设置	30
3.10 公告信息	36
3.11 新增窗口	37
3.12 行情委托设定	37
3.13 系统退出	38
3.14 交易数据刷新	39
3.15 交易数据导出	39
4. 系统交易功能	40
4.1 闪电下单	40
4.2 一般委托	60
4.3 智慧委托	61
4.4 成交回报	62
4.5 序列期权手动下单	62
4.6 序列期权手动下单自定义	67
4.7 T 型报价	70
4.8 价差交易	72
4.9 合成期货	74
4.10 合成价差	76
4.11 自选股监控	77
4.12 无可用账号交易界面	79
4.13 策略下单	80
4.14 组合自动交易	85
4.15 TWAP 交易	100
4.16 组合保证金申报	104
4.17 组合保证金拆解	107
4.18 组合保证金管理	109
4.19 序列期权自动下单	111
4.20 备兑锁定解锁	122
4.21 T 型报价快捷组合交易	123
4.22 波动率差下单	126
4.23 条件单	128
4.24 篮子交易	134

4.25 场外 delta 对冲	146
5. 系统分析功能	155
5.1 总持仓分析	155
5.2 资金查询	158
5.3 波动率分析	161
5.4 高级波动率分析	164
5.5 图形分析	169
5.6 Rtd 行情	173
5.7 策略监控	176
5.8 风险矩阵	177
5.9 二次开发接口	178
6. 范例说明	178
6.1 波动率方向交易	178
6.2 同月份价差交易	179
6.3 跨月份价差交易	179
6.4 期权策略交易	180
6.5 对冲交易	180

1. 系统介绍

Qwin 期权策略交易平台是一款集行情、委托、策略、风控为一体的策略交易系统。系统中各功能模块都可独立运行，支持多屏操作，完美满足交易员各种需求。Qwin 期权策略交易平台目前支持多市场多品种（股票、基金、期货、期权等）的手动、半自动与自动交易，由于 Qwin 系统的复杂程度较高，故编写此使用手册以供使用者参考。

本使用手册分为三部分，一是基本设定，主要讲解本系统中计算模块各参数的设定、投资组合设定、价差组合设定、系统警示等功能；二是交易模块，该部分主要介绍系统中多种下单交易的模式，既包括常用的闪电下单、序列手动下单，也包括一些常用小工具，比如合成期货、合成价差、价差下单、T 型报价等，实现了多种下单模式的整合；三是系统分析模块，该模块将资金、风控、情景分析、波动率分析有机的结合在一起，可有效实现风险控管。

2. 如何开启 Qwin

用户开启 Qwin 期权策略交易平台，立即可以看到以下登录画面。



用户输入“用户名”，“密码”和“验证码”点击登录，即可进入柜台账号登录设置。



点击左上角“新增”按钮，会跳出“新增账号”框。选择相应的证券和柜台，输入登录账号和投资账号后点击

确认，输入密码和通讯密码，选择“记住账号和密码”，相关证券柜台账号会自动保存，如需删除相关账号，选择所要删除账号，点击左上角“删除”。



选中一个输入的交易账号，点击编辑按钮，出现编辑账号弹窗，可点击更换输入的交易账号。

点击选中一个交易账号密码输入框。即可清空之前输入的密码，再次进行密码的输入。



账号设置完成以后，选择所要登录账号，点击右下角“登录”，就可以进入 Qwin 期权策略交易平台。

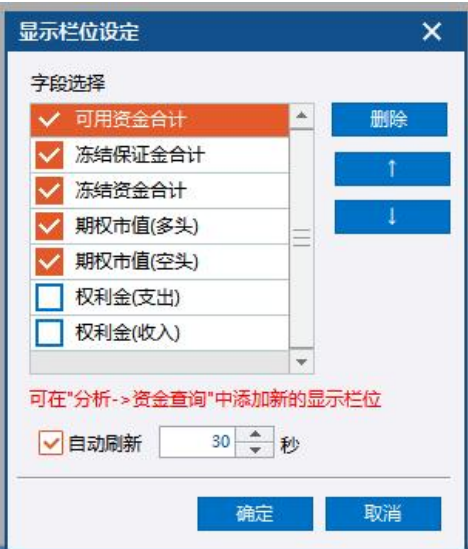
3. 基本设定

资金栏位显示设置

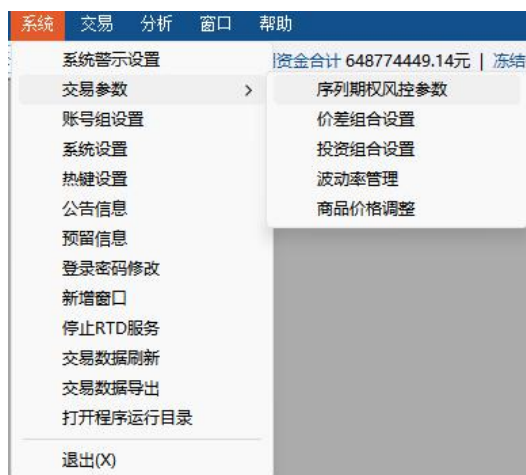
导航窗口显示栏位，可进行账号选择、刷新及设置



点击设置弹出窗口进行设定，可勾选进行字段选择、设定时间勾选 CheckBox 框设置完成后，将自动刷新



3.1 期权序列风控参数设定



用户选择“系统/交易参数/期权风控参数设定”会进入参数设定画面。



使用者可以依照自己需求设定计算期权 Greeks 值时所使用的参考标的、日期、评价模型与无风险利率等相关参数。

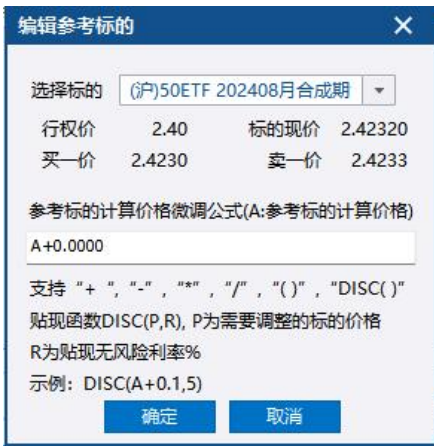
参考标的的设定：建议使用各月份的合成期货作为标的价格计算相关数据。

理由：将同执行价格 Call 和 Put 的 IV 数据计算一致

可以用一条曲线来描述每个月份的波动率变化（波动率曲面只有一个）

合成期货价格与期权价格相关性最高，到期期限一致。

参考标的是期货或者期权的时候，可以使用贴现函数对标的价格进行调整，

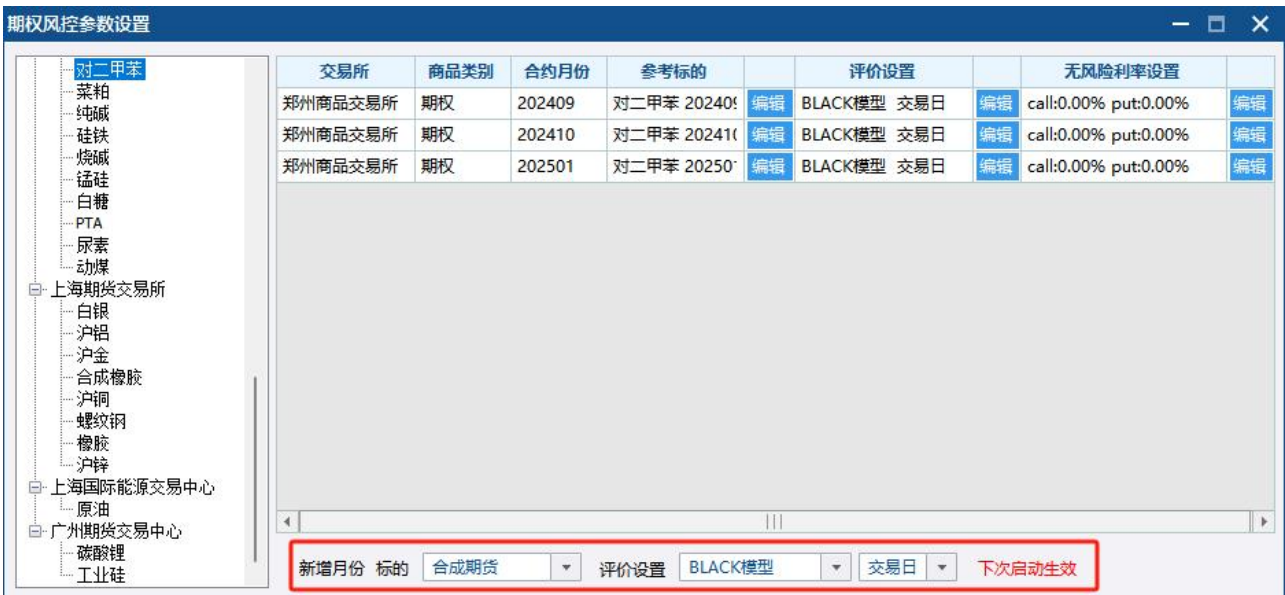


在参考标的计算价格微调公式中新增贴现函数 DISC (P,r)，P 和 r 为函数的参数

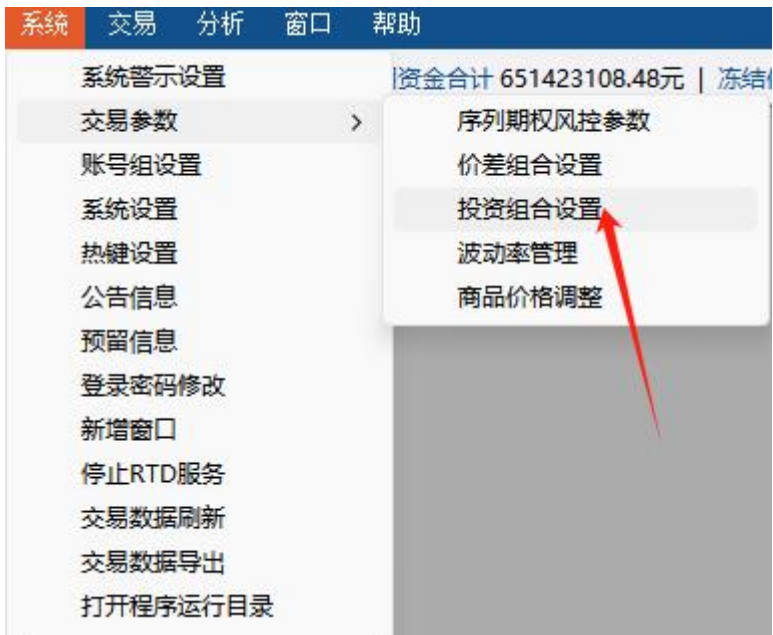
P 为需要贴现的价格，可以为调整后的价格

r 为贴现使用的无风险利率

1. 序列风控参数中可以指定新月份默认的定价模型和日期类型。



3.2 投资组合设定

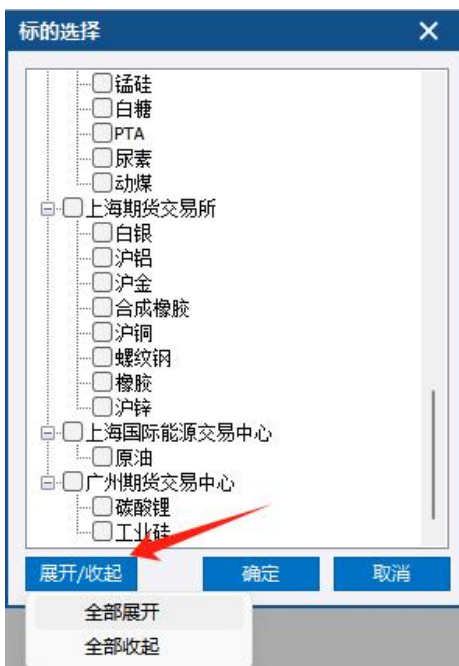


(1) 选择“系统/交易参数/投资组合设定”，即可打开投资组合设定，如下图。



(2) 点击新增投资组合，会弹出窗口供使用者新增投资组合，用户可以输入组合名称（必填）、组合说明（非必填），选择账号、市场中的标的和月份（月份默认全选），点击确定即可新建投资组合。

投资组合设定中增加一个全部展开或者折叠的按钮。



3.3 价差组合设定

(1) 选择“系统/交易参数/价差投资组合设定”，即可打开价差组合设定，价差组合设定主要应用在交易-价差下单画面的配置项。如下图。



组合名称	A标的交易所	A标的名称	B标的交易所	B标的名称	价差计算方式	状态	编辑	删除
MMM	上海证券交易所	包钢股份	上海证券交易所	380ETF	$\ln(A/B)*1000$	正常	编辑	删除
AAAAA	上海证券交易所		上海证券交易所	50ETF购2月28	A-B	过期	编辑	删除
AAA	上海证券交易所	50ETF购2月28	上海证券交易所	50ETF购3月28	A-B	正常	编辑	删除

(2) 点击增加组合可以创建任意两个商品的价差组合



组合名称 商品的单位

A商品 A商品名称 1

B商品 B商品名称 1

A商品与B商品计算

公式

支持 "+" "-" "*" "/" "0" "ln"

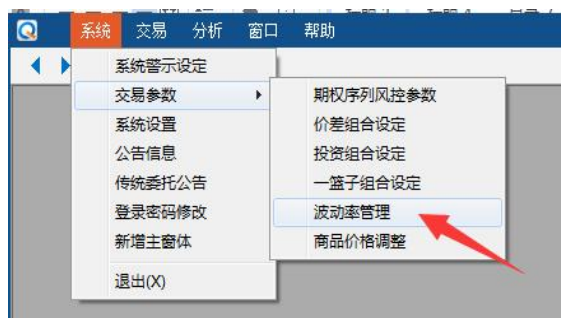
试算结果:

说明：选择 A 商品、选择 B 商品，即可创建一个两个商品的组合

输入商品的单位，在下单时，按照这个单位配比进行下单，其中 B 商品可以输入负值。输入负值的情况下代表可以对 AB 两个商品同买同卖

编辑公式：对价差下单画面两个商品的价格显示按照该公式进行计算。

3.4 波动率管理



选择“系统/交易参数/波动率管理”，使用者即可进入波动率管理。该模块可以实现用户依照自己选取的波动率来计算系统中的 Greeks 值，增加波动率设定的弹性，同时支持用户导入自设的波动率到系统中。

合约月份	系统波动率	预设值	设置
2024年8月	QWin波动率	35.00	设置
2024年9月	Mid波动率	35.00	设置
2024年12月	自定义波动率	35.00	设置
2025年3月	现价波动率	35.00	设置

用户可以依据需求，自行选取波动率来计算系统中的 greeks 值，目前提供 Qwin 波动率、Mid 波动率、自定义波动率、现价波动率、外部波动率可供选择。



导入：用户点击导入会弹出四个选项：外部 Excel、QWin 波动率、MID 波动率、现价波动率。



选择外部 Excel 会弹出文件选择的窗体，选择相应的外部文件后点击确认即可将外部波动率导入，绘制在图上，对应名称为自订波动率；选择 MID 波动率，会将目前 MID 波动率快照记录下来作为自订波动率；选择 Qwin 波动率，点击导入，会将目前 Qwin 波动率快照记录下来作为自订波动率。

步长：每次点击波动率调整按钮   时，波动率变动的最小单位。



: 每次点击后波动率会按照输入的步长逐渐增大



: 每次点击后波动率会按照输入的步长逐渐减小



: 如果选中单一行权价，每次点击后，选中焦点将会切到低执行价。比如如果点击前选中的为 1 月份的行权价为 2.45 的合约，点击后选中变为 1 月份的行权价为 2.40 的合约。



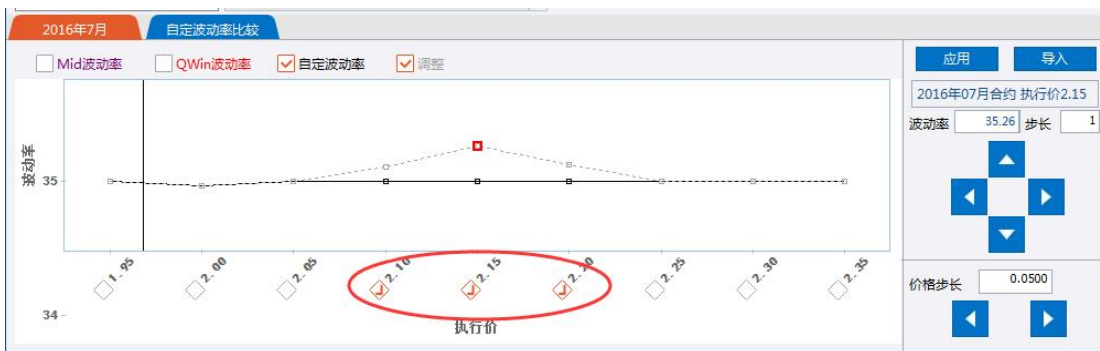
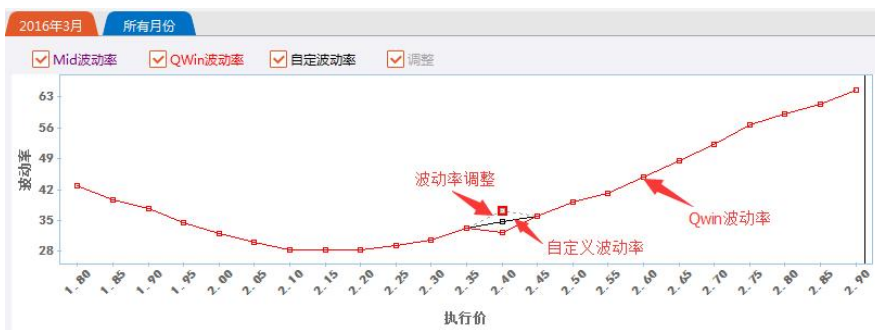
: 如果选中单一行权价，每次点击后，选中焦点将会切到高执行价。比如如果点击前选中的为 1 月份的行权价为 2.45 的合约，点击后选中变为 1 月份的行权价为 2.50 的合约。

应用

: 用户点击应用后，自定义波动率将套用经过调整的导入波动率。

同样，使用者可以在波动率曲线上按照自己所需拖拽某一行权价的波动率来实现调整。对于波动率的调整完成后，

点击 **应用** 按钮，调整曲线覆盖自定义波动率曲线。



自定义波动率支持多个行权价同时勾选统一调整。

3.5 商品价格调整

通过“系统”--“交易参数”--“商品价格调整”可以进入商品价格调整模块。模块可以控制参考标的价格，用户可以在极端情况下输入商品价格，比如熔断时。本页面只有打开时才会生效，关闭后所有设置恢复到原系统选项，以原有计算逻辑进行计算。

点击“新增商品”，会弹出商品选择窗口，用户选择需要价格调整的商品，点击确定即可添加。



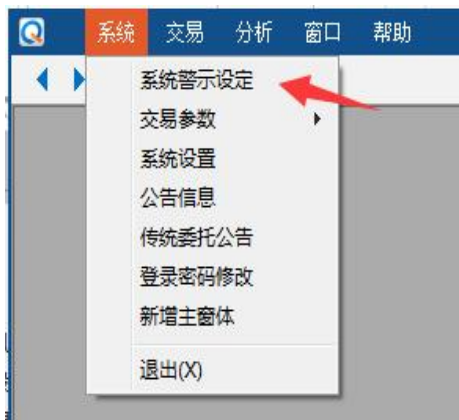
在商品价格调整设置中，增加“调整价格”栏位，价格类型中可以选择“全部”、“买价”、“卖价”、“现价”。



运行逻辑：

- 1、每次打开页面运用类型都默认为原系统。
- 2、当选择自定值：选择的 调整价格 类型的价格=自定价格（调整价格选择全部时，则系统的该商品的买价=卖价=成交价=自定价格）。
- 3、当选择自动转换：选择的 调整价格 类型的价格=自定价格（调整价格选择全部时，则系统的该商品的买价=卖价=成交价=自定价格）。并且系统会记录下点击时刻的该商品的中价价格快照，当该记录的价格与系统计算的中价的差值有变动时，系统开关自动跳到原系统开关。如果无变动，开关停留在自动转换开关。

3.6 系统警示设定



通过“系统”--“系统警示设定”可以进入系统警示机制来进行警示设置。

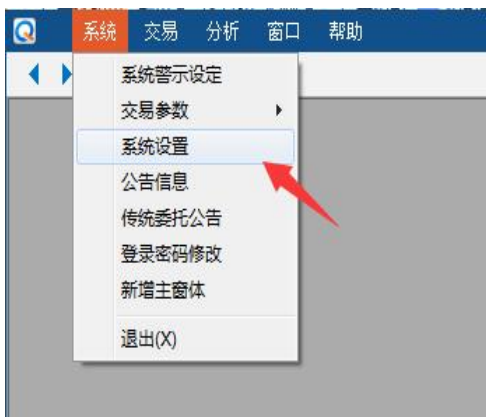


目前系统提供四种警示器：时限内成交张数未变化、时限内委托未回报、瞬间成交笔数上限、瞬间委托笔数上限。

如果市场行情出现异常造成警示器报警，相关讯息会在系统讯息栏中提示。



3.7 系统设置



通过“系统”--“系统设置”，可以分别对下单类型、开平仓类型、委托设置、声音设置、计算损益设置、安全设置、闪电下单打开设置、流控设置、风控设置等内容进行配置。



1、下单类型设置

点击“系统设置”，默认进入“下单类型设置”，根据所选择的账号，对相应交易所对应的交易品种进行“限价指令”、“市价指令”、“市价限价幅度%”设置，设置完成以后可以在右上角“保存设置”。



如需要改变“保存设置”，在指令下拉重新选择相应的下单类型，重新点击“保存设置”。

2、开平仓处理设定



点击“开平仓处理设定”，选择设置账号栏相应账号，对所交易品种进行平仓逻辑设置。

股票期权：可以下拉选择“优先开仓”、“优先平仓”。

期货期权：① 大商所、郑商所、广期所：可以下拉选择“优先开仓”、“优先平仓”。

② 中金所：可以下拉选择“优先开仓”、“优先平仓”、“不平今仓”。

③ 上期所、上海能源：可以下拉选择“优先平今”、“优先平昨”、“优先开仓”。

选择“不平今仓”时，在今天没有反方向的开仓成交记录前，优先平仓，今天有反方向的开仓成交记录后，只开仓不平仓。例：持有中金所某期权昨仓 100 张，选择“不平今仓”。在当日没有买入开仓的成交记录之前，在卖出数量不大于 100 张时执行卖出平仓操作，在卖出数量大于 100 张时执行卖出开仓操作；在当日有买入开仓的成交记录之后，所有的卖出委托，都执行卖出开仓操作。

选择“优先平今”时，先检查今仓数量是否足够，足够的话下平今委托单，不足的话检查昨仓数量是否足够，足够的话下平昨委托单，否则下开仓单；选择“优先平昨”时，先检查昨仓数量是否足够，足够的话下平昨委托单，不足的话检查今仓数量是否足够，足够的话下平今委托单，否则下开仓单。

2.1 开平仓逻辑：

假设：可用买：A，可用卖：B，下单量：C

I、设置：买平仓逻辑：优先平仓，卖平仓逻辑：优先开仓

1、客户端进行买入 C 时，因为是优先平仓，

判断：①、 $C \leq A$ ，数量满足则平仓，下单：买入平仓：C，此时：可用买：A-C，可用卖：B

②、 $C > A$ ，因为平仓数量不足则开仓，则下单：买入开仓：C，此时：可用买：A，可用卖：B+C

2、客户端进行卖出 C 时，因为是优先开仓，

不需要判断，直接下单卖出开仓：C，此时：可用买：A+C，可用卖：B

II、设置：买平仓逻辑：优先开仓，卖平仓逻辑：优先平仓

1、客户端进行买入 C 时，因为是优先开仓

不需要判断，直接下单：买入开仓：C，此时：可用买：A，可用卖：B+C

2、客户端进行卖出 C 时，因为是优先平仓，

判断：①、 $C \leq B$ ，数量满足条件则进行平仓，下单：卖出平仓：C，此时：可用买：A，可用卖：B-C

②、 $C > B$ ，数量不满足条件则进行开仓，则下单：卖出开仓：C，此时：可用买：A+C，可用卖：B

2.2 中金期货期权设置“不平今仓”逻辑：

I、假设：中金期货期权可用买：A，今日未买开过。点击买量=C。设置买平仓逻辑：不平今仓

1、客户端买入 C 时，因为是不平今仓，

判断：①、 $C \leq A$ ，数量满足则平仓，下单：买入平仓：C，此时：可用买：A-C

②、 $C > A$ ，因为平仓数量不足则开仓，则下单：买入开仓：C，此时：可用买：A，可用卖：C

II、假设：中金期权可用买：A，今日已买开过。点击买量=C。设置买平仓逻辑：不平今仓

2、客户端买入 C 时，因为是不平今仓，

判断：①、 $C \leq A$ ，下单：买入开仓：C，此时：可用买：A，可用卖：C

②、 $C > A$ 下单：买入开仓：C，此时：可用买：A，可用卖：C

2.2 上期所、上海能源设置“优先平今”逻辑：

假设：上期所期权 可用买今：A，可用买昨：B。点击买量：C。开平设置：系统开平（设置为优先平今）

1、客户端买入 C 时，因为是优先平今仓，

判断：①、 $C \leq A$ ，今仓数量足则优先平今仓。下单：买入平今仓：C，

②、 $B > C > A$ ，因为今仓数量不足，则检查昨仓，昨仓数量足够下平昨单。下单：买入平昨仓：C，

③、 $C > A$ 且 $B > A$ ，因为今仓和昨仓数量都不足，则下开仓单。下单：买开仓：C。

3、委托设置



(1) 拆单设置：可以对系统中各品种的拆单策略进行统一设置，应用在闪电下单、价差下单、合成价差、合成期货页面

(2) 闪电下单默认数量设置：可以设置闪电下单委托数量输入框中的默认数量。

4、声音设置

点击“声音设置”，可以对成交提示音进行设置，系统默认关闭状态，点击“浏览”，可以选择系统自带的几种提示音文件，点击“试听”可以对声音进行试听。切换到“开启”状态，选择相应的声音文件，则系统所有委托单成交后都会有相应的提示声音。



GREEKS 风险提示音设置，主要是针对“总持仓分析”模块里的“风险监控设定”，系统默认为关闭状态，切换

到“开启”状态，选择相应的声音文件，则能对风险监控设定里的 GREEKS 栏位提示相应的声音。

合计	市值	估算浮动盈亏	估算今日损益	[\$Delta]	1%\$Gamma	\$Vega	\$Theta	避险数量	\$时
合计									
各类小计									

5、计算损益设置

点击计算损益设置，可以对系统计算今日损益、理论损益和当冲损益时采用收盘价还是结算价计算进行控制。

对于期货来说，以收盘价计算损益更符合部分客户的需求。

以收盘价计算损益 (今日损益, 理论损益和当冲损益) 和昨结波动率

自然日天数/年

交易日天数/年

6、安全设置

秒无操作后锁屏,0秒表示不自动锁屏

密码输入错误 次退出系统,0次表示不限制错误次数

显示回报信息

- (1) 锁屏设置：勾选后，达到设定时间进行自动锁屏
- (2) 密码输入错误次数限制，输入超过限定次数，系统将被锁定无法登录，需要后台进行解锁。
- (3) 登录信息设置：勾选后，系统会自动弹出上次登录地址和时间、以及柜台预留信息等安全信息。

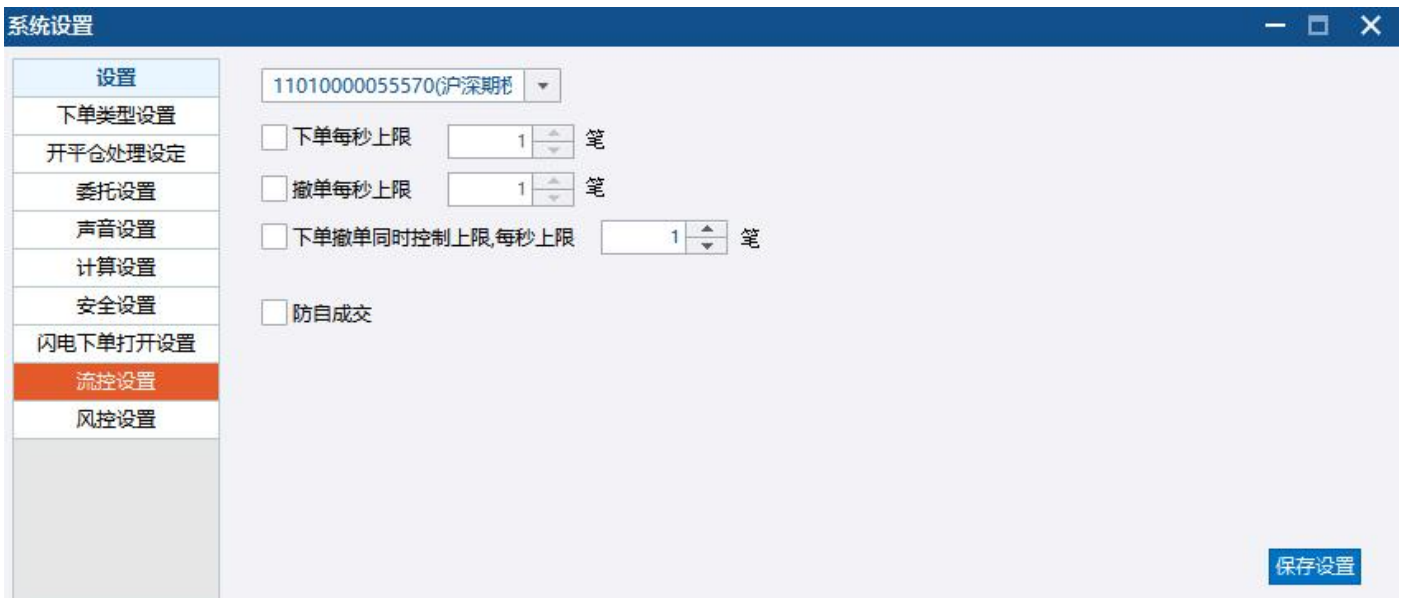
7、闪电下单打开设置



在特定画面打开闪电下单的方式可以选择：覆盖打开和在新窗口打开两种方式，覆盖打开方式将只打开一个闪电下单的画面，新窗口打开将打开多个闪电下单画面。

8、流控设置

1). 点系统→系统设置→流控设置，界面如下：



用户可针对指定的账号进行下单每秒上限、撤单每秒上限、下单撤单同时控制上限每秒上限、防自成交设置。

9、风控设置

风控设置是 Qwin 软件进行交易时增加风险控制的功能，主要由三个部分构成，分别为交易控制、Greeks 控制、报撤控制。

点系统→系统设置→风控设置，界面如下：



① 新增交易风控规则：

点击新增交易风控规则\新增 Greeks 风控规则，弹出参数设定界面如下：



新增步骤：

- (1) 点击新增交易风控规则
- (2) 编辑基础配置类别、交易所、品种、月份、商品、单笔下单量上限、净持仓上限、净持仓下限。（品种在股票和基金时默认--、月份在基金、股票、期货时默认--）。
- (3) 点击确定。

单笔下单量上限，当交易时，单笔的委托量大于设置上限值时触发该规则。

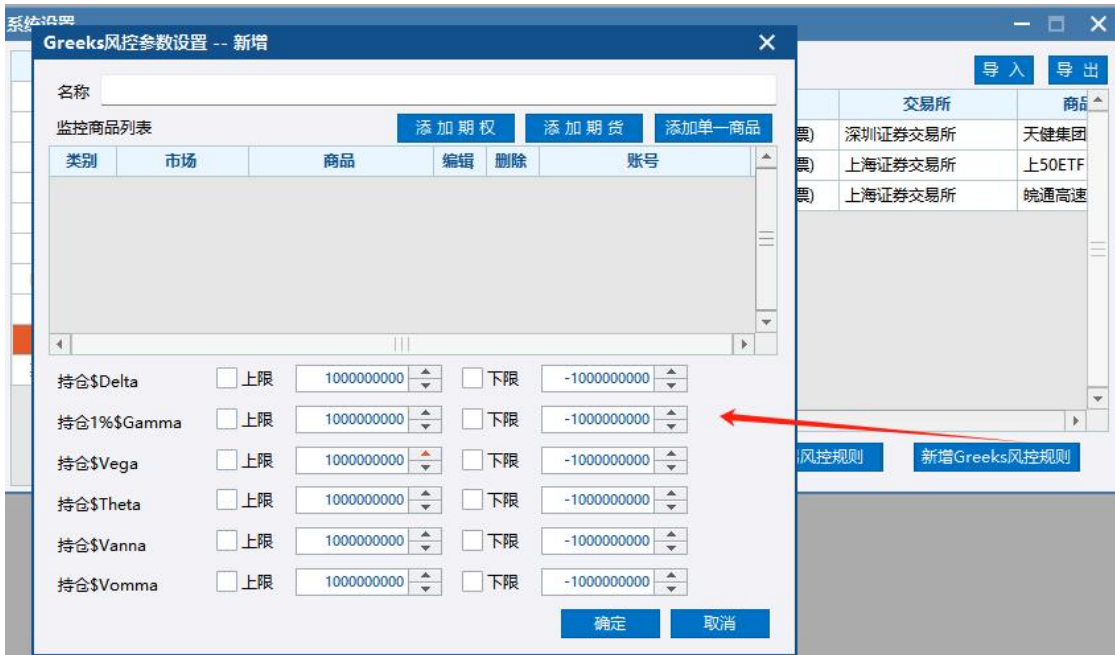
净持仓上下限，当交易时：

交易时持仓量增加，且最终持仓量大于设定上限，触发风控规则。

交易时持仓量减少，且最终持仓量小于设定下限，触发风控规则。

例如：当前持仓量 30 设定警示上限为 60 下限为 40，交易后持仓变为 70 时触发风控条件，交易后持仓量变为 35 时不触发风控条件。

②新增 Greeks 风控规则：



新增步骤:

- (1). 点击新增 Greeks 风控规则
- (2). 编辑基础配置, 输入名称、添加监控商品列表期权、期货、单一商品 (交易所、品种、月份、账号), Greeks 上下限参数。不同类别设置的根据对应界面设置。
- (3). 点击确定, 列表展示如下

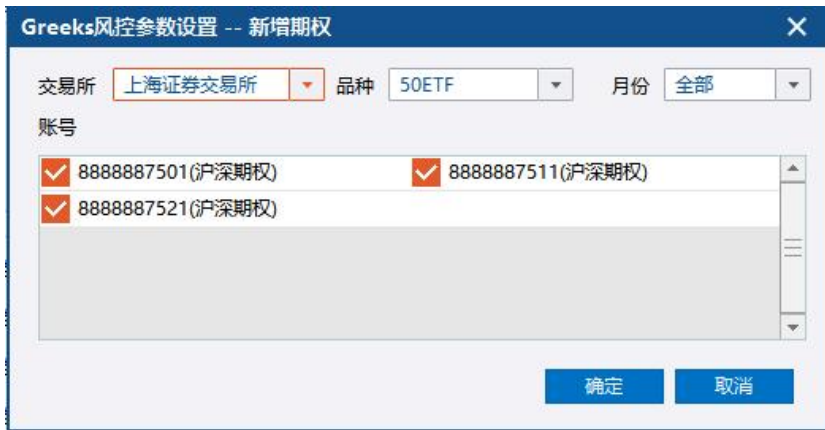


注:

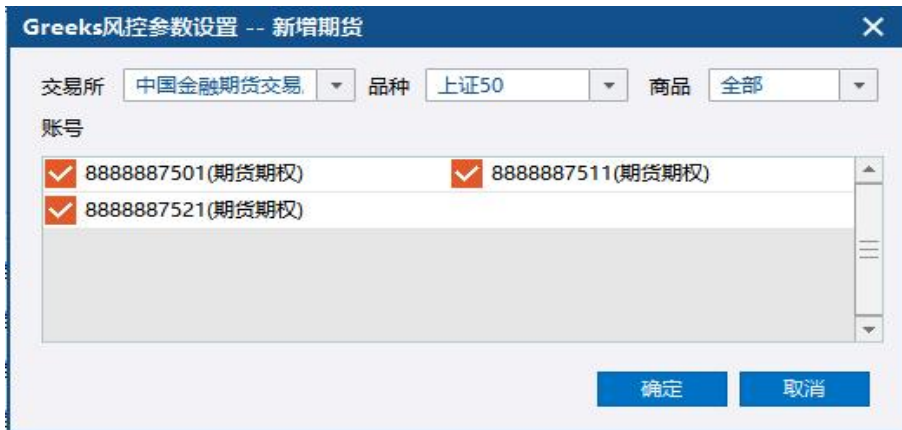
GREEKS 计算是所设定的范围内的所有持仓的 greeks+单笔委托 GREEKS 之和。各条范围规则不能包含相同的商品。例如: 已有规则 1 为 50ETF 10 月所有期权时, 再新增 50etf 全部月份的规则 2 会有异常提示, 在规则 1 监控商品列表加入 50etf 10 月中的一个单独期权合约时也会异常提示。

监控商品列表中可添加规则分为: 添加期权、添加期货、添加单一商品。

点击添加期权, 在期权设定中, 交易所和品种只能单选, 月份可选择全部\具体月份。



点击添加期货，在期货设定中，交易所和品种只能单选，商品可以选择全部\具体商品。



单机添加单一商品，在单一商品设定中，商品可根据代码、简称、挑选商品弹框来进行选择。



Greeks 风控有十二条规则，显示如下：

持仓\$Delta	<input type="checkbox"/> 上限	1000000000	<input type="checkbox"/> 下限	-1000000000
持仓1%\$Gamma	<input type="checkbox"/> 上限	1000000000	<input type="checkbox"/> 下限	-1000000000
持仓\$Vega	<input type="checkbox"/> 上限	1000000000	<input type="checkbox"/> 下限	-1000000000
持仓\$Theta	<input type="checkbox"/> 上限	1000000000	<input type="checkbox"/> 下限	-1000000000
持仓\$Vanna	<input type="checkbox"/> 上限	1000000000	<input type="checkbox"/> 下限	-1000000000
持仓\$Vomma	<input type="checkbox"/> 上限	1000000000	<input type="checkbox"/> 下限	-1000000000

当交易时:

交易时 greek 值增加, 且最终 greeks 值大于设定上限, 触发风控规则

交易时 greek 值减少, 且最终 greeks 值小于设定下限, 触发风控规则

例如: 当前持仓 Δ 30W 设定警示上限为 60W 下限为 40w, 交易后 Δ 变为 70W 时触发风控条件. 交易后 Δ 变为 35W 时不触发风控条件.

2) 导入导出

支持导入、导出风控规则设置功能。导出导入为 .CSV 文件格式, 其中需要导入的 CSV 格式文件中, 必须符合规则。可以新增后用导出的 csv 模板进行添加删除操作。导入后会清空掉当前设置界面的原有规则。Greeks 风控导入时按导入文件上的规则的先后次序依次排列。



3) 删除

点删除, 列表中该条规则消失, 点击否则返回列表。



4). 规则保存

关闭系统设置窗口保存、关闭 QWIN 客户端保存. 编辑已有规则后保存。

5). 规则生效

触发规则会生成一条拦截日志，和警示日志，其中警示日志根据触发的规则有几条则记录几条，单条规则中的详细规则项在触发后会再警示日志中拼接显示。

勾选启用时该规则生效否则不生效，勾选委托拦截如果触发规则，该笔委托会被拦截并警示，不勾选只有警示不拦截委托。

交易控制		Greeks控制		报撤控制		名称	Sdelta上限	Sdelta下限	STheta下限	SThe
编号	启用	委托拦截	编辑	删除						
3866	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	期货期权-沪深300	10000	1000	--		
5082	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	单一基金-510050	880000	800000	10		
5556	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	中金所	100000	10000	--		
7244	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	单一股票-平安银行	3410000	3400000	10		
12365	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	单一商品期权-IO	33320000	33300000	--		
15303	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	商品期权-玉米	--	--	--		
17747	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	期货-上证50	10000	1000	--		
18356	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	单一期权-50ETF	26250000	26200000	-2000		
19784	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	单一期货-IC2112	181850000	181800000	10		

委托价格	剩余量	成交量	委托状态	委托时间	追踪	委托消息	委托类型	委托量	柜台状态消息
17.67	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3232757.50+-1767.50=3230990.00]<下限[3400000]
17.67	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3232757.50+-1767.50=3230990.00]<下限[3400000]
17.67	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3232757.50+-1767.50=3230990.00]<下限[3400000]
17.66	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3230928.50+-1766.50=3229162.00]<下限[3400000]
17.66	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3230928.50+-1766.50=3229162.00]<下限[3400000]
17.66	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3230928.50+-1766.50=3229162.00]<下限[3400000]
17.66	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3230928.50+-1766.50=3229162.00]<下限[3400000]
17.65	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3229099.50+-1765.50=3227334.00]<下限[3400000]
17.65	100	0	客户端流控制		--	客户端流控制限制	限价	100	触发客户端greeks风险控制(7244):账号[888887511 888887511](股票)商品[000001.SZSE]委托量[-100]:delta金额[3229099.50+-1765.50=3227334.00]<下限[3400000]

风控的警示信息落盘记录成一个 CSV 文件，按日期每天一个。

Event log	ErrorEvent log	VarnEvent.log
[2024-04-25 08:54:14]	总持仓风险警示: \$Theta达到或超过警示上限 (\$Theta=21,925,970; 警示上限=10万)	
[2024-04-25 08:55:45]	行情服务已关闭!	
[2024-04-25 08:57:58]	总持仓风险警示: 估算今日损益达到或超过警示上限 (估算今日损益=60,360; 警示上限=1万)	
[2024-04-25 08:57:58]	总持仓风险警示: \$Delta达到或超过警示上限 (\$Delta=96,526,381; 警示上限=1万)	
[2024-04-25 09:15:06]	总持仓风险警示: 估算今日损益达到或超过警示上限 (估算今日损益=29,516; 警示上限=1万)	
[2024-04-25 09:18:11]	行情服务已关闭!	
[2024-04-25 09:24:41]	行情服务已关闭!	
[2024-04-25 09:26:21]	行情服务已关闭!	
[2024-04-25 13:50:24]	总持仓风险警示: 估算今日损益达到或超过警示上限 (估算今日损益=585,372; 警示上限=1万)	
[2024-04-25 13:50:24]	总持仓风险警示: \$Delta达到或超过警示上限 (\$Delta=96,662,298; 警示上限=1万)	
[2024-04-25 15:00:03]	总持仓风险警示: \$Theta达到或超过警示上限 (\$Theta=22,547,885; 警示上限=10万)	
[2024-04-25 16:18:02]	行情服务已关闭!	
[2024-04-25 16:18:38]	行情服务已关闭!	
[2024-04-25 17:40:00]	总持仓风险警示: 估算今日损益达到或超过警示上限 (估算今日损益=441,134; 警示上限=1万)	
[2024-04-25 17:40:00]	总持仓风险警示: \$Delta达到或超过警示上限 (\$Delta=97,050,469; 警示上限=1万)	

```

Event.log x ErrorEvent.log x
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)
[2024-04-28 17:00:51]下单失败[ErrMsg=客户端流控限制], (商品代码:10007145)

```

③ 报撤风控规则

在“系统设置”-“风控设置”中新增加”报撤风控规则”。可以设置报撤单笔数、撤单笔数、报单笔数、成交笔数、成交持仓比、撤单申报比六种类型的风控规则。

序号	名称	启用	委托拦截	编辑	删除	账号	交易所	标的	报撤单笔数	撤单笔数
1	报撤单笔数一	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	大于等于5笔	--
2	撤单笔数二	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	大于
3	报单笔数三	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
4	成交笔数四	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
5	成交持仓比五	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
6	撤单申报比六	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	--

名称: 规则一
 账号: 8888899501(沪深期权) | 交易所: 上海证券交易所 | 类别: 期权 | 标的: (沪)500ETF

报撤单笔数 大于等于 1
 撤单笔数 大于等于 1
 报单笔数 大于等于 1
 成交笔数 大于等于 1
 成交量 大于 1000 时,成交持仓比 大于等于 3.00
 撤单笔数 大于 20000 时,撤单申报比 大于等于 0.80

确定 取消

注：除【撤单笔数】外其他风控规则触发后，后续报单将进行拦截、并增加警示讯息及错误讯息提醒（规则启用，且勾选了委托拦截）。



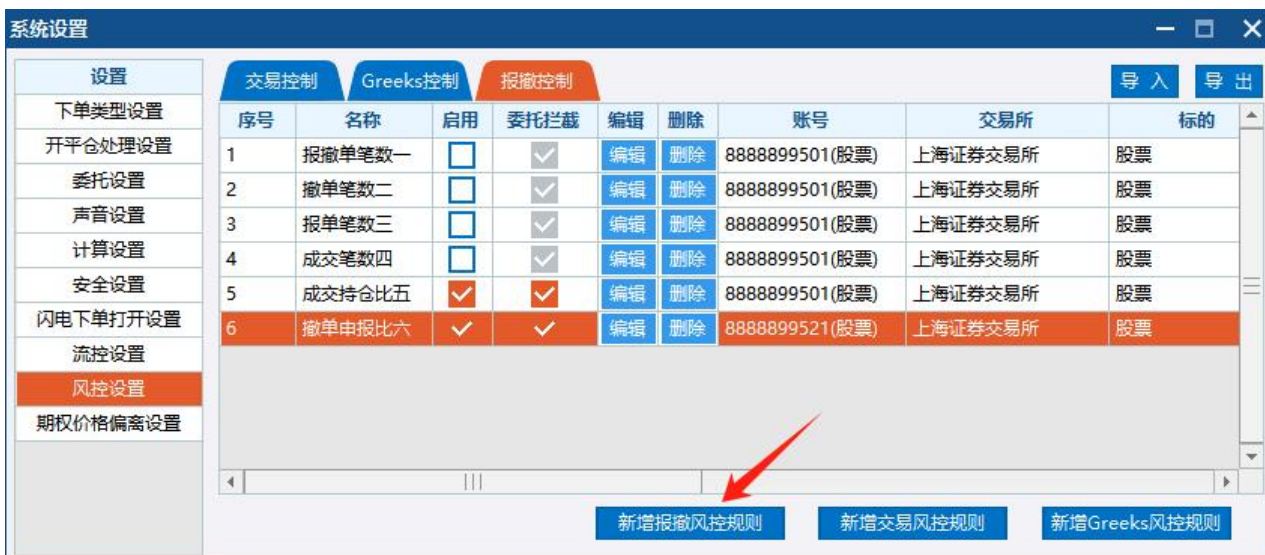
【撤单笔数】和【撤单申报比】风控规则触发后，后续撤单将增加警示讯息，但是不进行撤单拦截（规则启用）。



1. 新增报撤规则步骤

1.1 手动新增

点击新增报撤风控规则按钮。出现委托报撤风险控制弹窗，再此界面编辑新增报撤风险控制规则。



委托报撤风险控制

名称 控制规则一

账号 8888899501(沪深期权) 交易所 上海证券交易所 类别 期权 标的 (沪)50ETF

报撤单笔数 大于等于 1 撤单笔数 大于等于 1

报单笔数 大于等于 1 成交笔数 大于等于 1

成交量 大于 1000 时,成交持仓比 大于等于 3.00

撤单笔数 大于 20000 时,撤单申报比 大于等于 0.80

确定 取消

手动添加策略步骤如下：

I) 设置策略名称

II) 选择交易账号

点击“账号”设定账号，将按照指定的账号进行监控。

III) 选择交易所

IV) 选择类别

根据选择的交易账号，可以选择对应类别。账号为股票类型时，类别选项为股票/ETF 基金；账号为沪深期权类型时，类别选项为期权；账号为期货期权类型时，类别选项为期货/期权。

V) 选择标的

将根据选择的账号、交易所、类别，标的展示可选择的所有标的。

委托报撤风险控制

名称 控制规则一

账号 8888899511(期货期权) 交易所 郑州商品交易所 类别 期权 标的 苹果

报撤单笔数 大于等于 1 撤单笔数 大于等于 1

报单笔数 大于等于 1 成交笔数 大于等于 1

成交量 大于 1000 时,成交持仓比 大于等于 3.00

撤单笔数 大于 20000 时,撤单申报比 大于等于 0.80

苹果
郑棉
红枣
玻璃
甲醇

确定 取消

VI) 选择风控规则类型

在需要进行监控的风控规则类型前进行打钩选中。并设置对应详细规则。

委托报撤风险控制

名称 控制规则一

账号 8888899511(期货期权) 交易所 郑州商品交易所 类别 期权 标的 苹果

报撤单笔数 大于等于 10
 撤单笔数 大于等于 1
 报单笔数 大于等于 1
 成交笔数 大于等于 1
 成交量 大于 10 时,成交持仓比 大于等于 2.00
 撤单笔数 大于 20000 时,撤单申报比 大于等于 0.80

确定 取消

点击确定按钮。在规则列表处可以查看到新添加的规则。规则默认启用，且进行委托拦截。

系统设置

设置 交易控制 Greeks控制 报撤控制 导入 导出

设置	序号	名称	启用	委托拦截	编辑	删除	账号	交易所	标的	报撤单笔数	撤单
下单类型设置	1	报撤单笔数一	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	大于等于5	--
开平仓处理设置	2	撤单笔数二	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	大于
委托设置	3	报单笔数三	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
声音设置	4	成交笔数四	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	大于5笔	--
计算设置	5	成交持仓比	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
安全设置	6	撤单申报比	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899521(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
闪电下单打开设置	7	控制规则一	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899511(期货期权)	郑州商品交易所	苹果期权	--	--

新增报撤风控规则 新增交易风控规则 新增Greeks风控规则

VII) 变更是否启用以及是否委托拦截

系统设置

设置 交易控制 Greeks控制 报撤控制 导入 导出

设置	序号	名称	启用	委托拦截	编辑	删除	账号	交易所	标的	报撤单笔数	撤单
下单类型设置	1	报撤单笔数一	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	大于等于5	--
开平仓处理设置	2	撤单笔数二	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	大于
委托设置	3	报单笔数三	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
声音设置	4	成交笔数四	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	大于5笔	--
计算设置	5	成交持仓比	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899501(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
安全设置	6	撤单申报比	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899521(股票)	上海证券交易所	股票	--	--
闪电下单打开设置	7	控制规则一	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	编辑	删除	8888899511(期货期权)	郑州商品交易所	苹果期权	--	--

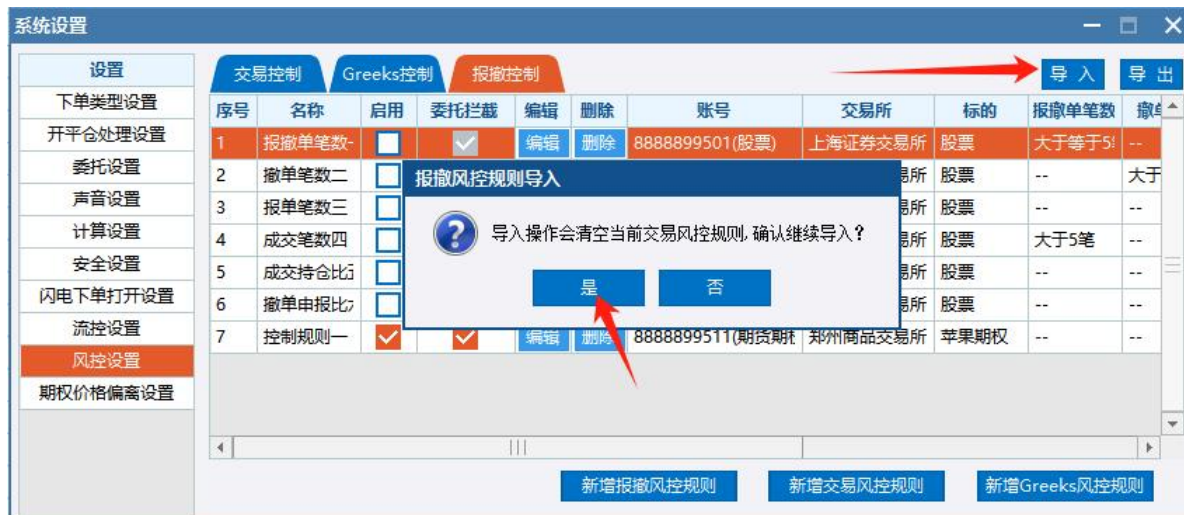
新增报撤风控规则 新增交易风控规则 新增Greeks风控规则

不勾选启用时，则该规则不会生效。

不勾选委托拦截时，则只会进行警示讯息及错误讯息提醒，但不会拦截报单。

1.2 批量新增

也可以点击右上角的导入按钮。从文件中批量导入规则。

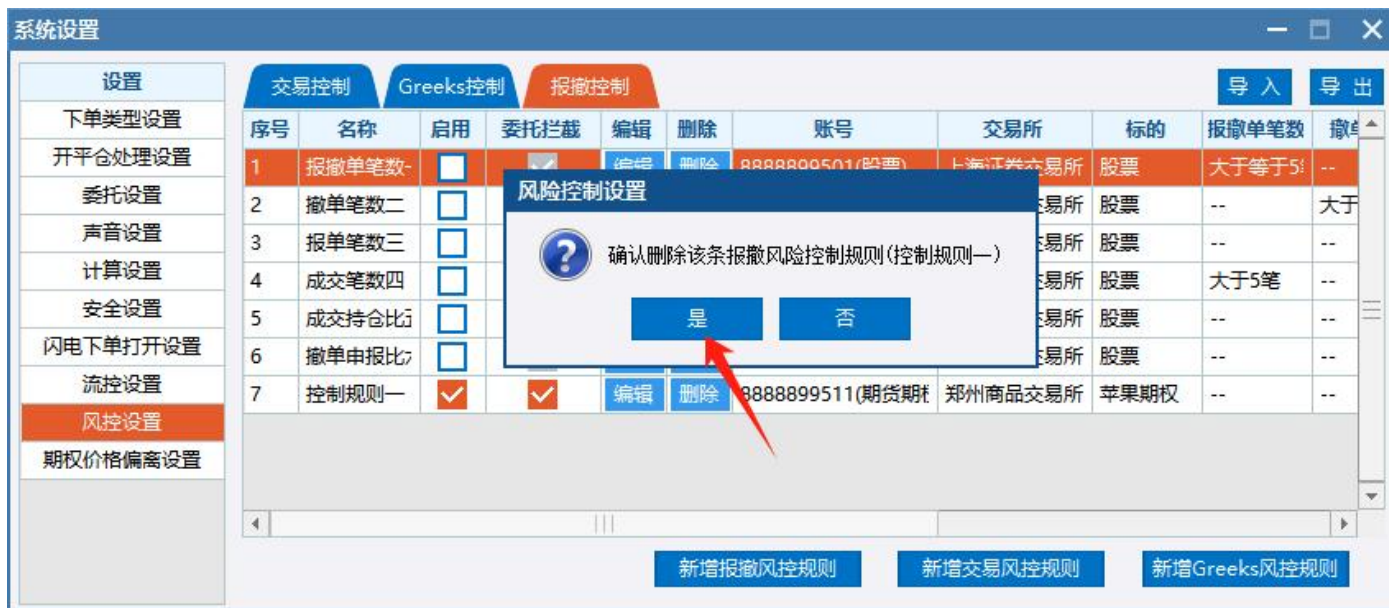


2. 编辑报撤规则

在报撤控制列表点击规则后面的编辑按钮，进入编辑页面，编辑规则相关信息。

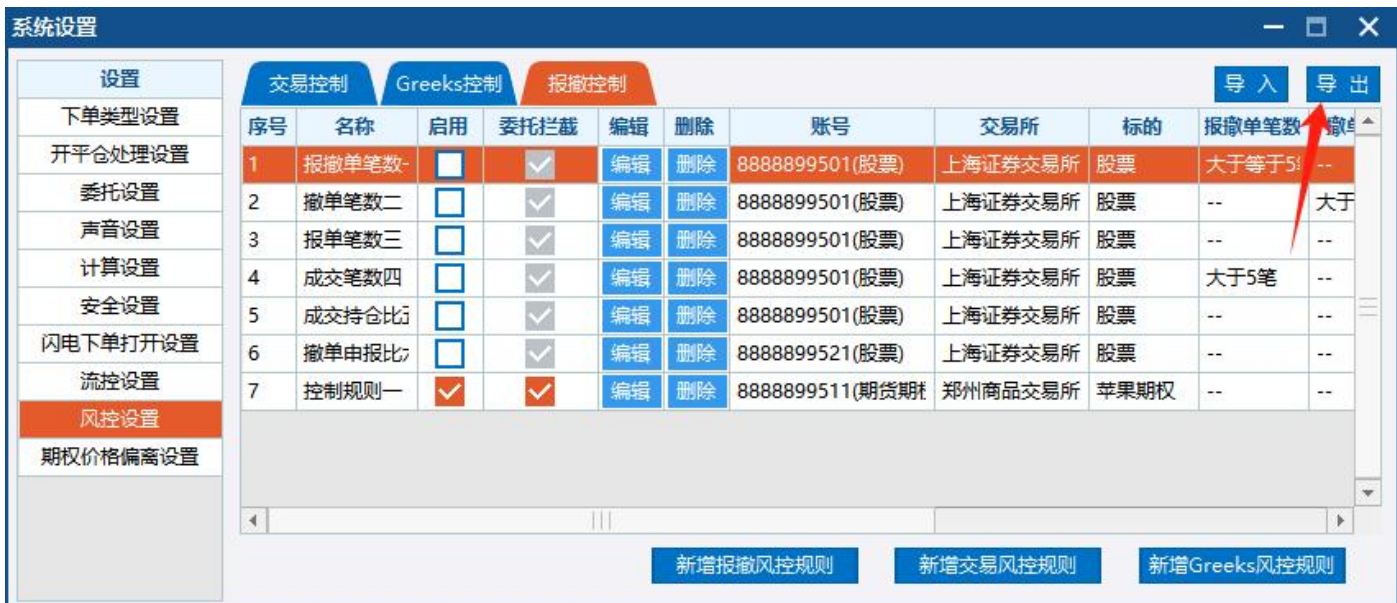
3. 删除报撤规则

在报撤控制列表点击规则后面的删除按钮，在出现的二次确认弹窗选择是，则规则删除完成。



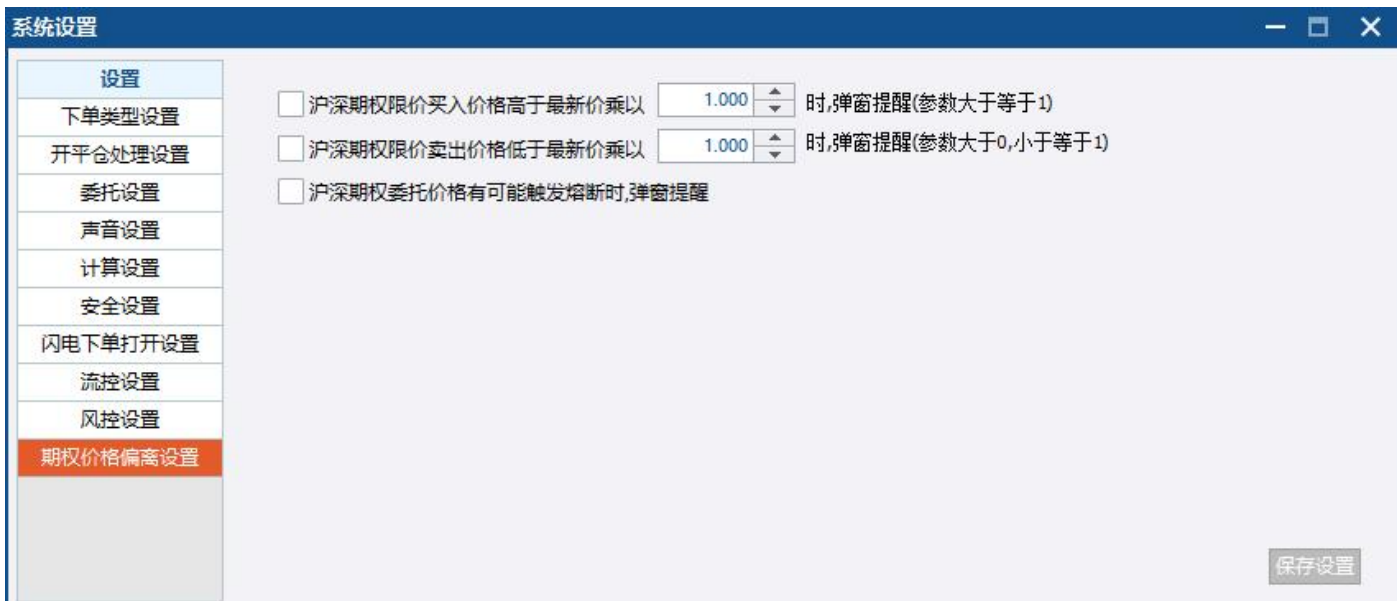
4. 报撤规则导入导出

点击右上角导出按钮，可以将页面所有规则导出到 csv 文件中。



点击右上角导入按钮，可以从 csv 文件中批量导入规则。

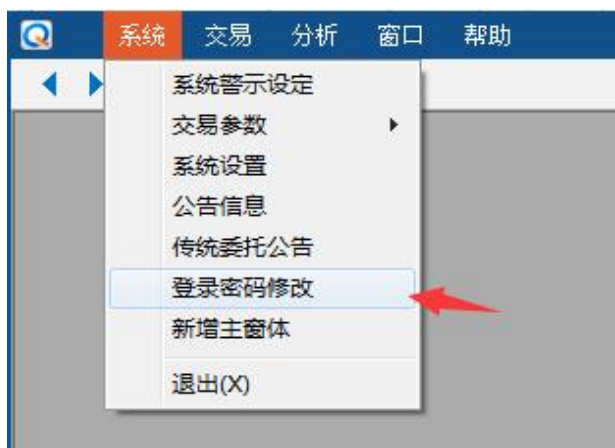
11、期权价格偏离设置



勾选并保存后闪电下单中，采用限价进行买入卖出沪深期权时，如果价格不在设定范围内，会进行弹窗提醒。

沪深期权熔断提醒：交易价格较最近参考价格上涨、下跌达到或者超过 50%，且价格涨跌绝对值达到或者超过该合约最小报价单位 10 倍的会进行弹窗提醒。

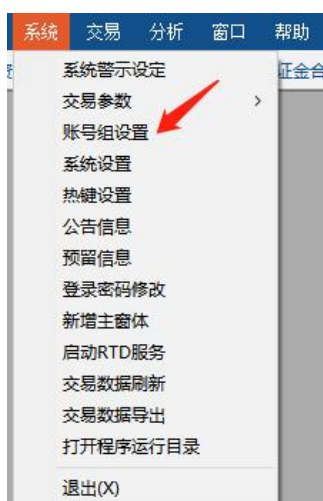
3.8 登录密码修改



通过“系统”--“登录密码修改”，用户可以对系统登录密码进行更改，如下图显示，输入旧密码和新密码，按确定键就可以进行密码更改。



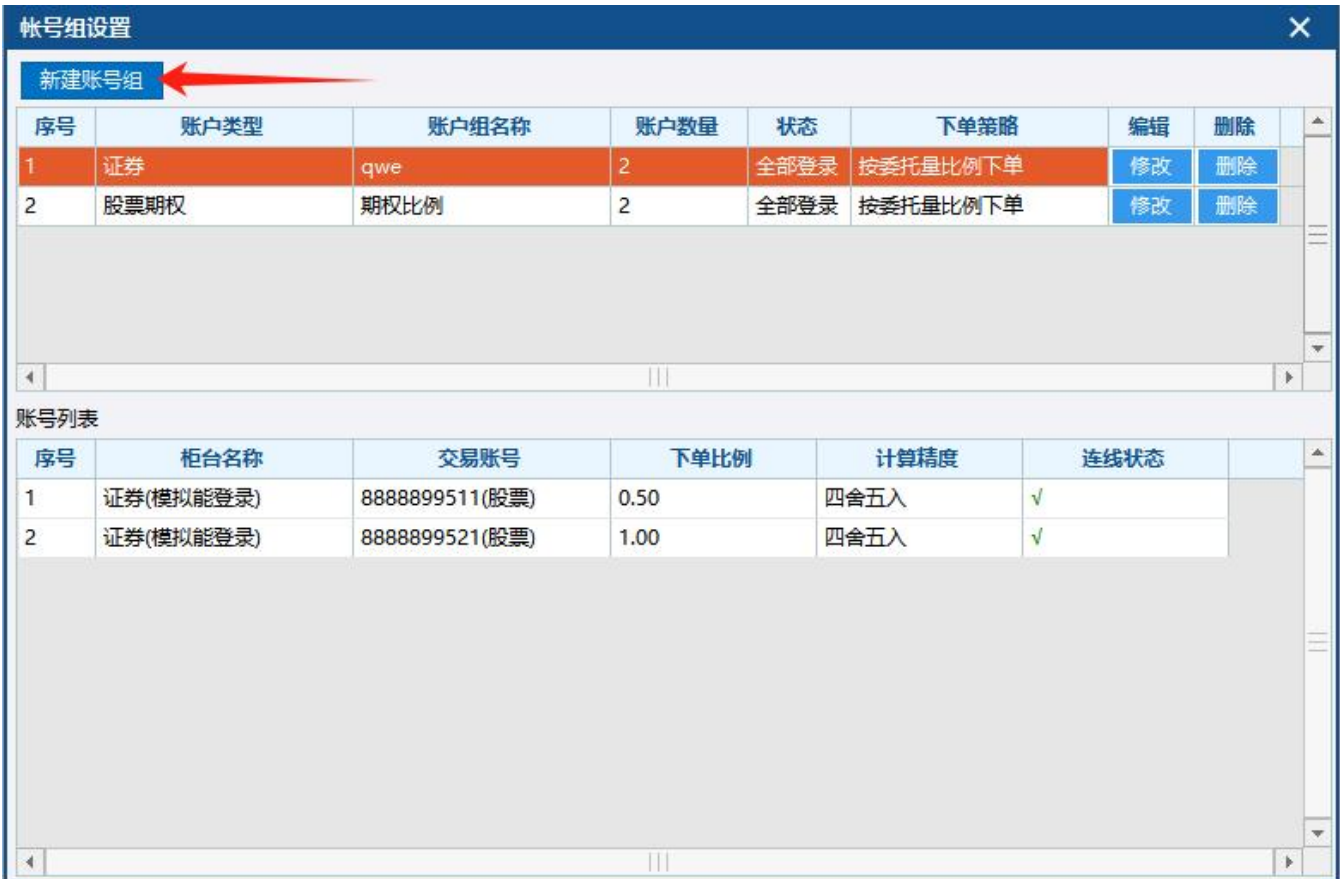
3.9 账号组设置





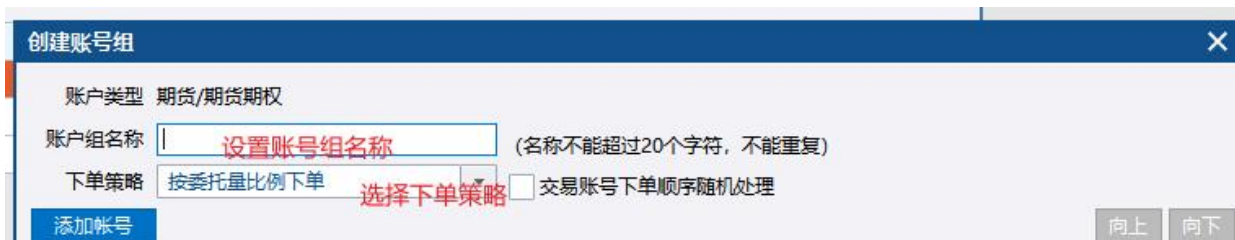
通过“系统”-“账号组设置”，用户可新建账号组添加多个账号，可选中一组账号组可查看“账号列表”下的设定及账号连线状态

3.9.1 新建账号组





通过“新建账号组”，选择“新建的账号组类型”点击“弹出弹框”，如下图所示



使用者输入账号组名称，下拉框勾选下单策略（按委托量比例下单”或按“委托量拆分下单”）及账号委托下单顺序处理设定（例：如果勾选了委托顺序交替变化选项，则如下流程

则第一次调用顺序为 A、B、C

第二次为 B、C、A

第三次为 C、A、B

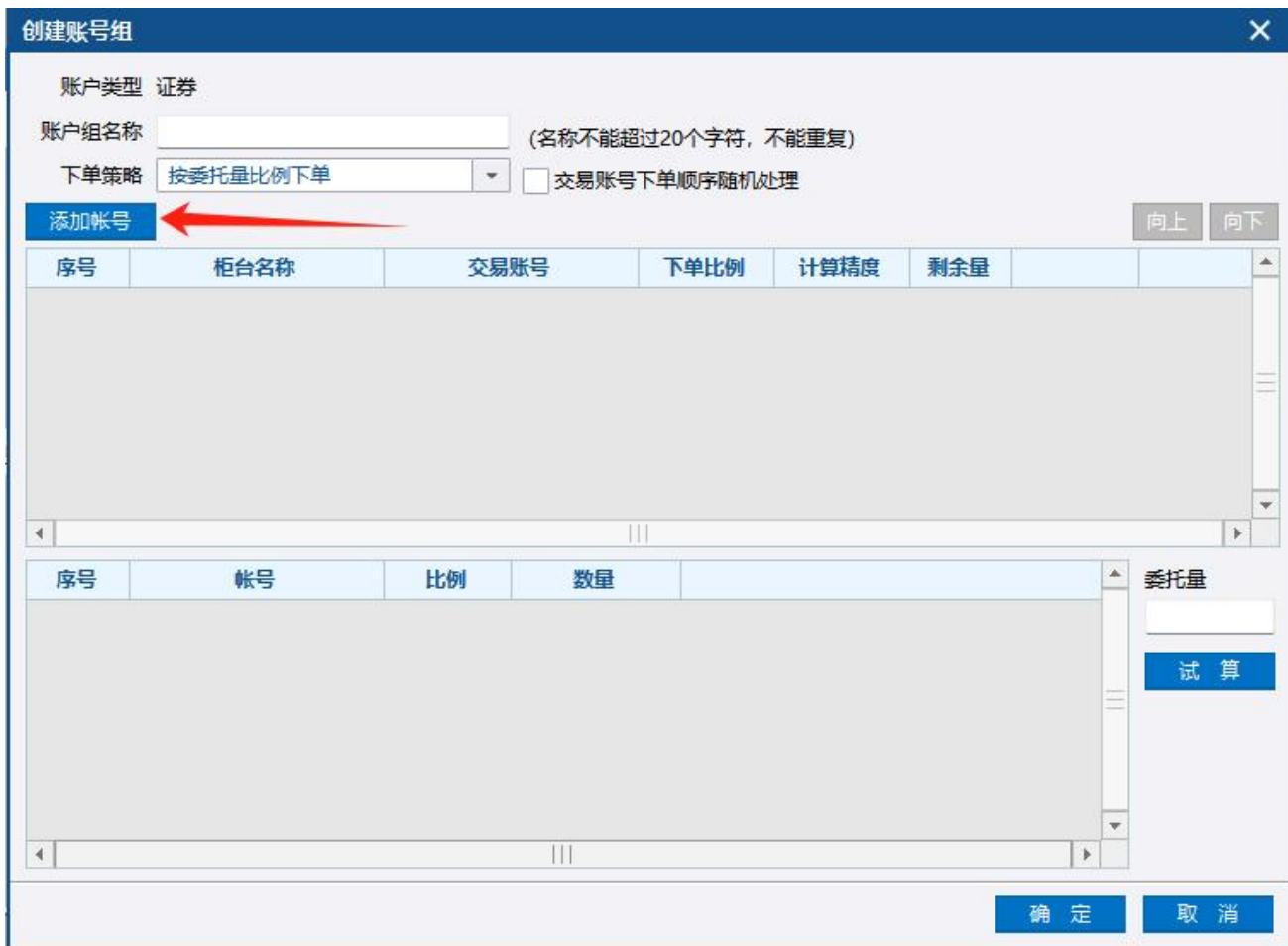
第四次为 A、B、C

依次这样循环）

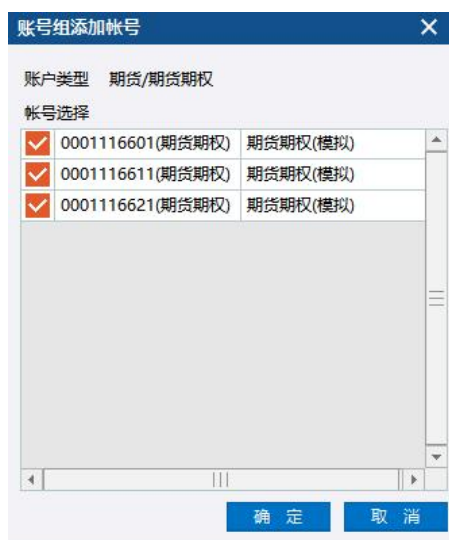
设定账号组之后需要重启相关画面才能应用新的配置

3.9.1.1 添加账号

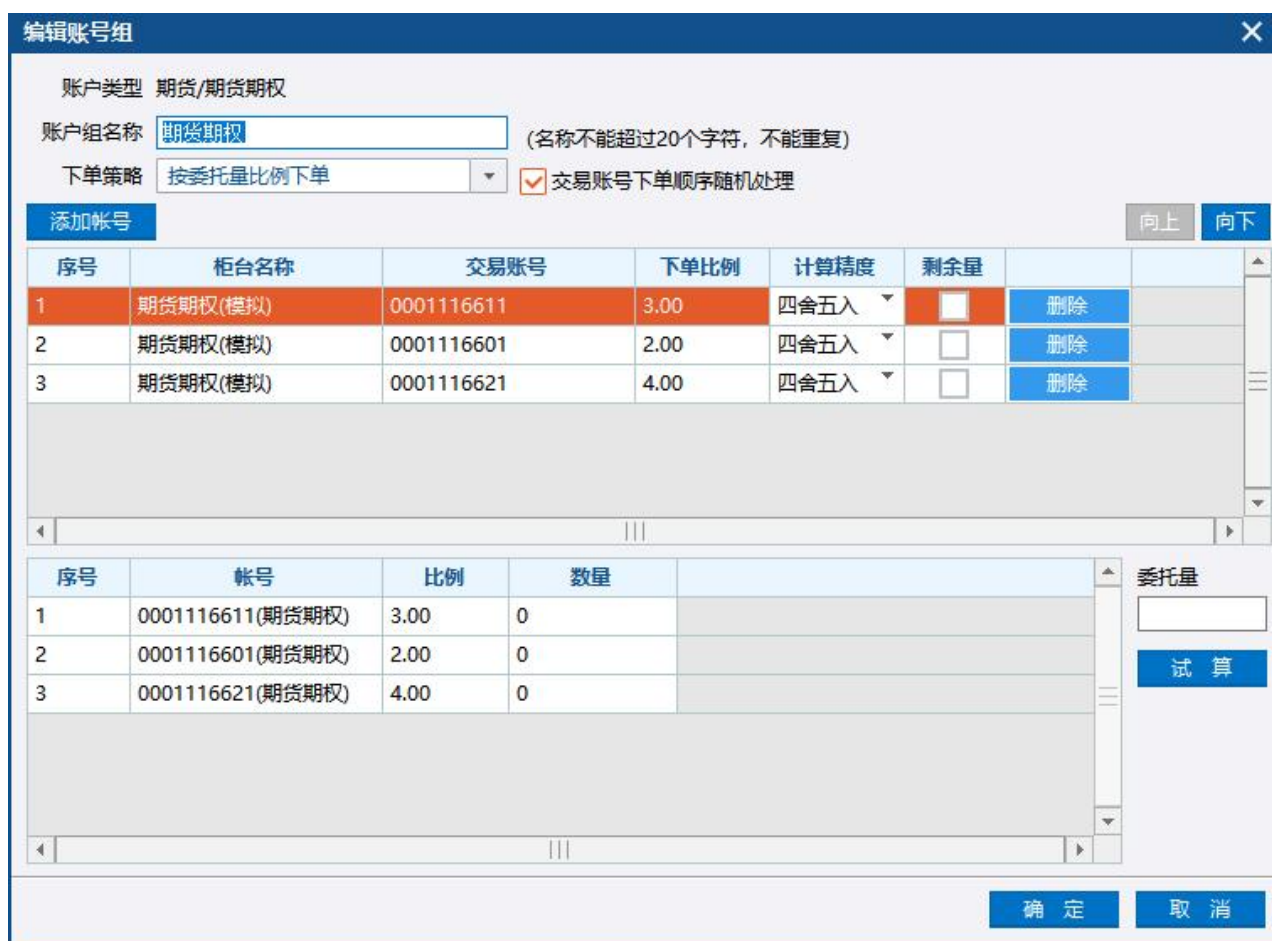
使用者通过点击“添加账号”弹出弹框



根据账户类型选择要添加的账号勾选 CheckBox 框。(例如：账号组有 A、B、C 三个账号，在下单中（如：在合成期货、合成价差、价差下单、策略下单选择设定账号组），下单时（按照设定规则调用 A 账号、B 账号、C 账号下单）



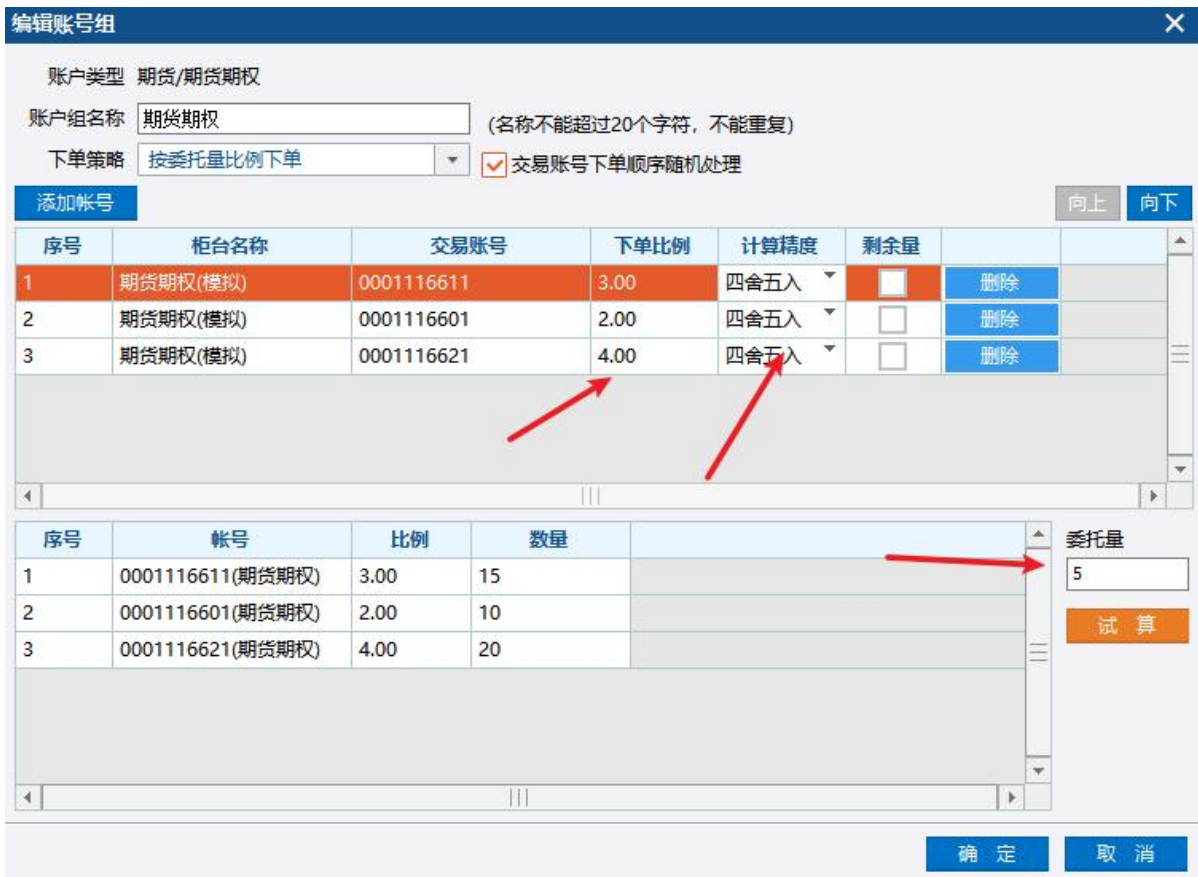
界面呈现当前账号组添加的账号



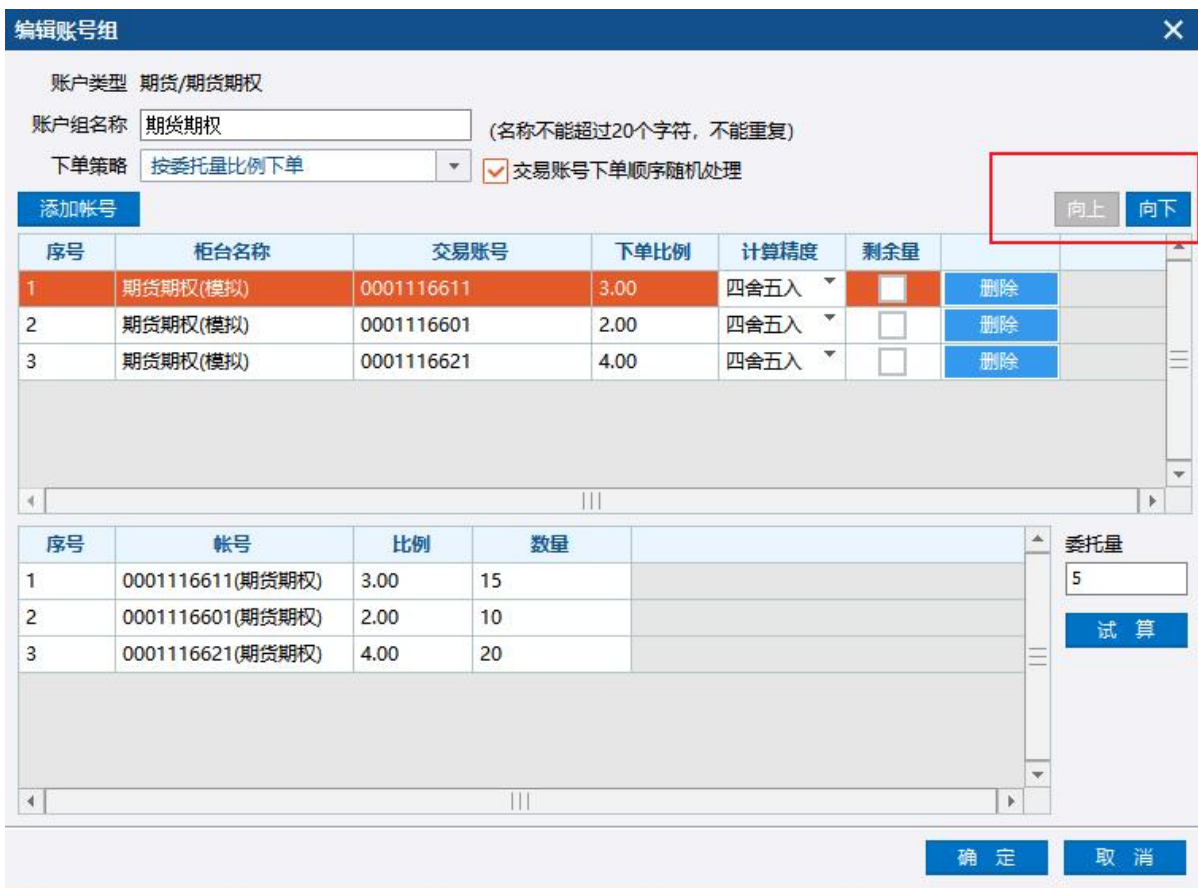
使用者可选择账号，输入“下单比例”，或下拉选择设定“计算精度”

①点击试算，比例根据下单比例设定同步

②输入“委托量”，试算之后账号根据比例以及委托量，数量同步

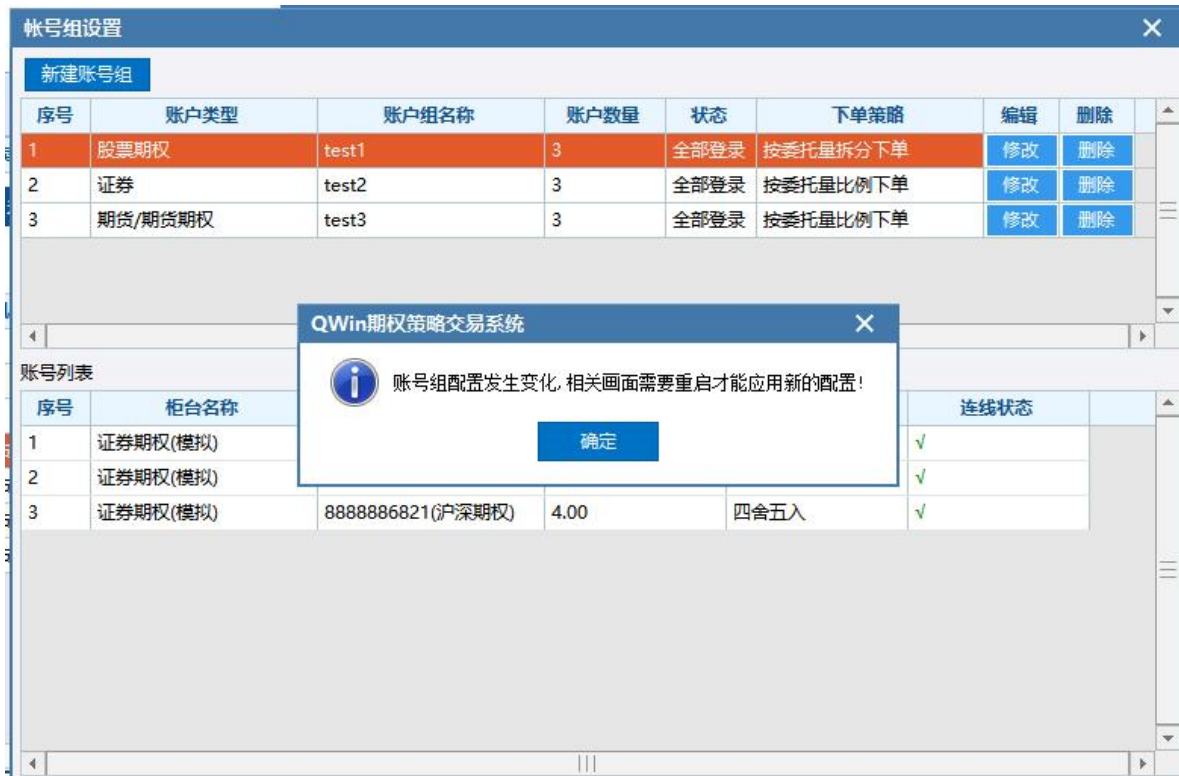


账号组编辑中新增向上、向下的调整按钮，用户可以选中自定义账号组中账号使用按钮进行下单的先后次序调整

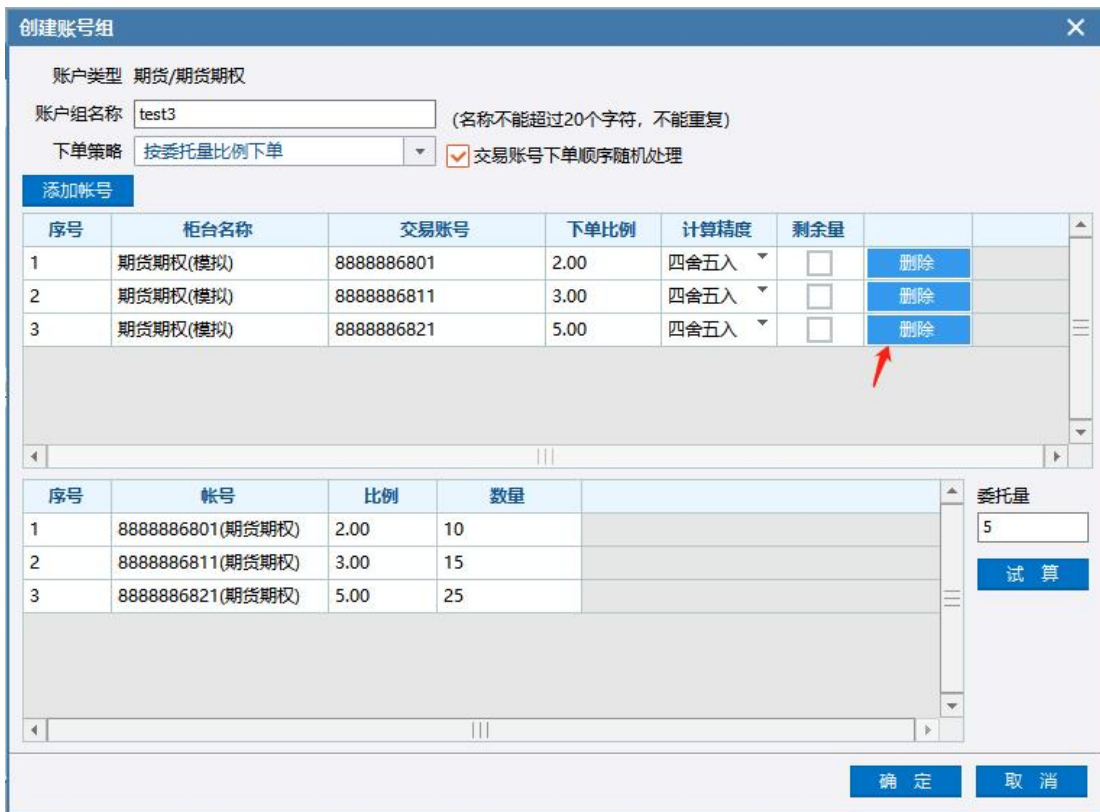


①不勾选“交易账号下单顺序随机处理”时，使用账号组交易时，按照设定的账号顺序下单交易

②勾选“交易账号下单顺序随机处理”时，使用账号组交易时，账号随机下单交易设定完成之后点击确定，需要重启相关画面才能应用新的配置。如下图所示



3.9.1.2 删除账号



使用者可通过当前账号组界面下“删除”账号

3.9.2 修改账号组



序号	账户类型	账户组名称	账户数量	状态	下单策略	编辑	删除
1	股票期权	test1	3	全部登录	按委托量比例下单	修改	删除
2	证券	test2	3	全部登录	按委托量比例下单	修改	删除
3	期货/期货期权	test3	3	全部登录	按委托量比例下单	修改	删除

使用者通过修改可进行编辑账号组设置

3.9.3 删除账号组

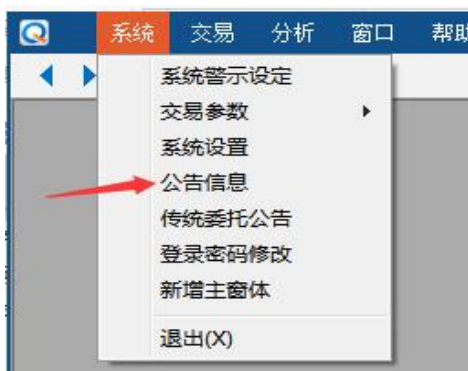


序号	账户类型	账户组名称	账户数量	状态	下单策略	编辑	删除
1	股票期权	test1	3	全部登录	按委托量比例下单	修改	删除
2	证券	test2	3	全部登录	按委托量比例下单	修改	删除
3	期货/期货期权	test3	3	全部登录	按委托量比例下单	修改	删除

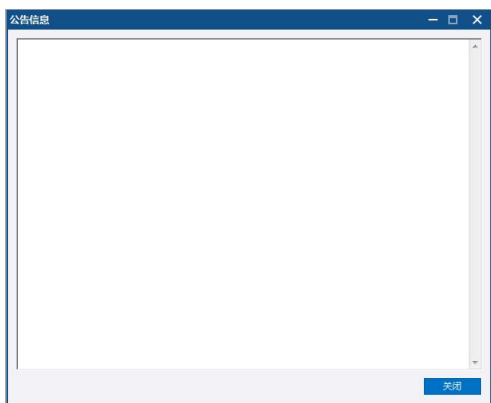


使用者可通过该界面删除当前选中的账号组

3.10 公告信息



通过“系统”——“公告信息”，用户可以查询相关公告信息，如下图显示，相关公告内容会显示在公告栏。



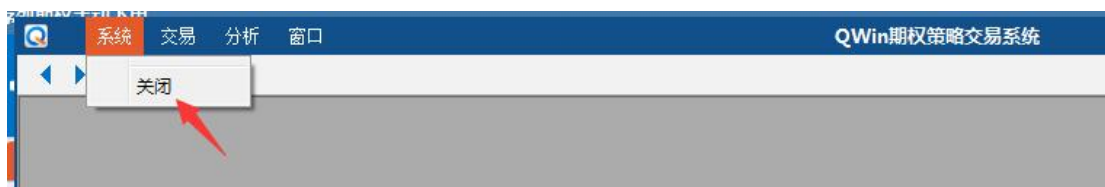
3.11 新增窗口



打开“系统”-“新增主窗体”，系统会再增加一个子窗口，便于多屏用户使用，拖动窗口，拓展桌面限制，更加方便进行下单、分析、风控的统一管理。



如需要关闭新增子窗口，在新增子窗口点击“系统”下拉菜单中点击“关闭”，新增子窗口立即关闭。



3.12 行情委托设定





Qwin 系统状态栏，主要有“静态文件日期”“委托连线”“行情连线”

委托连线状态：行情连接正常，显示绿色背景的“√”，行情连接异常“×”

行情连线状态：委托连接正常，显示绿色背景的“√”，委托连接异常“×”

账号类型	交易账号	线路	连线状态	错误原因
证券账户	yangyh(股票)	3	√	
证券期权账户	yangyh(沪深期权)	1	√	
期货和期权账户	yangyh(期货期权)	2	√	

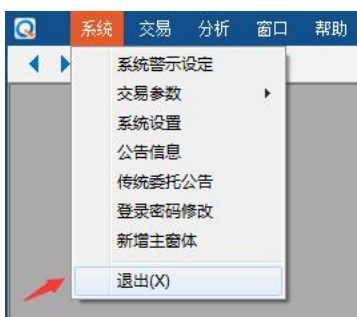
断线帐号重连 重新登录

点击“委托连线状态”，显示账号和通信状态以及连接异常的错误原因，点击“断线账号重连”可以重新连接，点击“重新登录”则系统退出后重新登录。

行情服务器	站点	连线状态
上海证券行情	qwin.qianlong.com.cn:7880	√
上海期权行情	42.51.11.12:8811	√
中金期货行情	qwin.qianlong.com.cn:8019	√
中金期权行情	qwin.qianlong.com.cn:8822	√
深圳证券行情	qwin.qianlong.com.cn:7880	√
商品期货行情	qwin.qianlong.com.cn:7020	√

点击“行情连线状态”，显示各行情服务器和站点连线状态。

3.13 系统退出





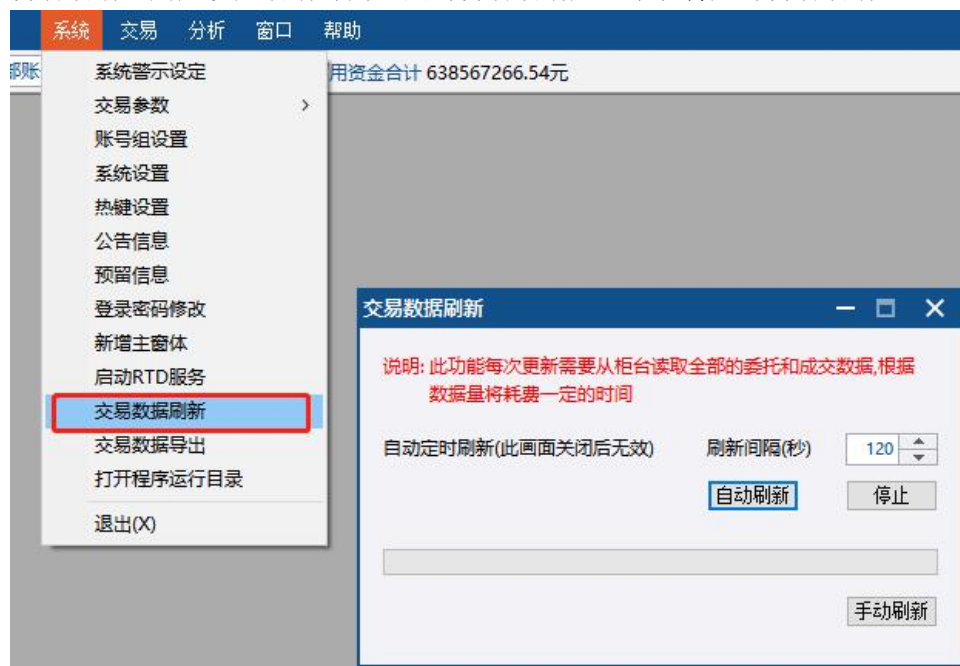
如上图所示，通过“系统/退出”或者系统右上角“x”，系统退出。

3.14 交易数据刷新

打开“系统”-“交易数据刷新”弹出窗口，主要有手动刷新、交易刷新

手动刷新：直接点击“手动刷新”进行刷新

自动刷新：用户设定刷新时间，点击自动刷新后，系统将定时自动刷新



注：使用交易数据自动刷新功能，由于有些柜台有流量控制（如CTP柜台），可能会造成请求阻塞，进而影响报撤单操作，请谨慎使用！

新版本交易数据刷新和交易数据导出功能增加权限控制。

3.15 交易数据导出

在qwin软件中可以把“委托数据”，“成交数据”，“持仓数据”，“资金数据”定时的导出成为csv文件，方便数据的处理。打开“系统”-“交易数据导出”弹出窗口，可以选择需要导出的数据，文件保存的路径，以及导出间隔。

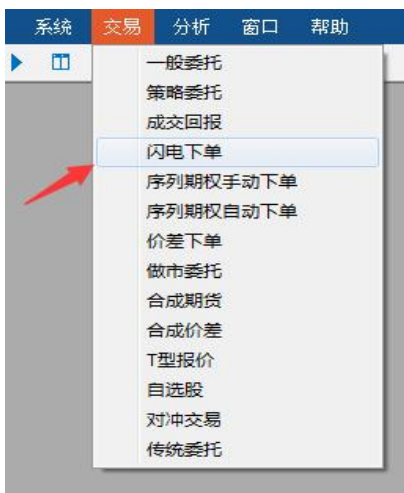


4. 系统交易功能

4.1 闪电下单

4.1.1 开启闪电下单

使用者在工具列上选择交易/闪电下单即可看到闪电下单视窗；使用者必须先选定品种，此时默认选择一个可交易此品种的帐户，用户再通过选择账号后，就可以通过该帐户进行委托。



4.1.2 挑选商品



按下“商品”后即可看到挑选商品视窗；选定所需要交易的商品（支持股票、期货、期权）后；按下”确定”

即完成商品选择。

选择期权类商品时，在执行价中标注平值价格，对应选择框标为黑底显示。



4.1.3 锁定账号



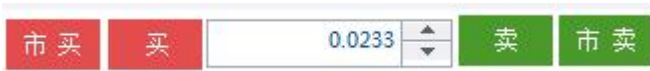
点击锁定账号的控制件后，可锁定当前闪电下单页面后续选择的各分类（分为股票、沪深期权、期货期权三类）的交易账号，同种类标的使用相同的交易账号。锁定账号后，当切换标的种型相同时，显示的锁定账号不会变化。锁定后再次点击控件可解锁。

4.1.4 送出普通委托单

市场买	价格	市场卖
+	0.0238	+
+	0.0237	+
+	0.0236	+
+	0.0235	+
+	0.0234	+
+	0.0230	+
+	0.0229	+
+	9	0.0227
+	19	0.0226
+	20	0.0223
+	30	0.0221
+	83	0.0220
+	0.0219	+
+	0.0218	+

委买数 全删 委卖数

方法(1) 使用者可以按下”市场买”则会依所选择的价位与量送出买单;”市场卖”则会依所选择的价位与量送出卖单。



方法(2) 按下” 买” 依” 委托价” 送出买单；按下” 卖” 依委托价送出卖单。(按下” 市买” 以市价买进、” 市卖” 以市价卖出)

价格类型选择详细价格时，可选择一种价格置中。



4.1.5 送出智慧委托单

智慧委托单包括：触价单、hit 单、passive 单、分量单、VOL 单等

1、触价单



用户设定好触价后委托价格（市价单/触发价+/-Tick(值域为 1-99)）以及“量”，点击“触买”或“触卖”列中某一价格的“+”，可以预埋单。

触买单	触买	自买单	市场买	价格
	+		+	0.0177
	+		+	0.0176
	+		+	0.0175
	+		+	0.0174
	+		+	0.0173
	+		+	0.0170
	+		+	0.0167
	+		+	0.0165
	+		+	0.0162
	+		+	0.0161
	+		+	0.0160
2	+		+	0.0159
	+		+	0.0158
	+		+	0.0157
2		--	委买数	全删

该账号下实现预埋买单的数量

举例说明：

假设现价：2.35，触发价 1：2.38，触发价 2：2.31，送出委托方式：触发价+1tic

以触发价 1 买入：当市场价格上穿 A：2.38 时，触发触价单，送出委托：2.39(2.38+1tick)买入委托

以触发价 2 买入：当市场价格下穿 A：2.31 时，触发触价单，送出委托：2.32(2.31+1tick)买入委托

以触发价 1 卖出：当市场价格上穿 A：2.38 时，触发触价单，送出委托：2.37(2.38-1tick)卖出委托

以触发价 2 卖出：当市场价格下穿 A：2.31 时，触发触价单，送出委托：2.30(2.31-1tick)卖出委托

PS：加 tick 为向有利于成交的方式送出委托，减 tick：向不利于成交的方向送出委托

2、hit 单

当对手价触及设定的委托价时，送出设定委托价的 IOC 单（交易所无 IOC 单时，收到委托成功后直接在送一个撤单指令来模拟 IOC 单）。

举例说明：

盘口情况如下图

+		0.1354	+	10
+		0.1353	+	3
+	20	0.1344	+	
+	10	0.1343	+	

此时送出：买入 0.1354 的 hit 单：20 张；市场能满足的量为：13 张，则立即成交 13 张，剩余的 7 张会立即发送撤单指令进行撤单！

The screenshot shows a trading window titled '闪电下单(50ETF购2月2800 - 10001142)'. The interface includes a search bar with 'm88888826_sopt(沪)' and '最新: 0.0817 幅度: -50.45%'. Below this are buttons for '商品' (set to 'Hit单(H)'), '现价置中', '自动置中', '盘口价格', and '智慧单标识'. The main data area shows '50ETF购2月2800' with a quantity of '201802'. A summary bar displays '理论价: 0.0980', 'delta数量: 5221.6', '持仓: 87', '今买: 0', '今卖: 0', '可用买: 2', and '可用卖: 89'. The order book table below has columns for 'Hit买单', 'H买', '自买单', '市场买', '价格', '市场卖', '自卖单', 'H卖', and 'Hit卖单'. The table shows several rows of market orders with prices ranging from 0.0821 to 0.0832.

3、passive 单

以设定 passive 单的委托价和市场买一或卖一相比，当委托价大于等于买一价+1 tick 或卖价小于等于卖一价-1tick 时，就挂出市场卖一+1tick 或卖一价-1tick 的限价单出去，直到已挂出的委托价等于或小于市场市场买一或卖一价时，则不会再往前 1 tick;直接以 passive 单的委托价挂出限价单。

举例说明：

盘口情况如下图

+		0.1375	+	10
+		0.1371	+	10
+	10	0.1364	+	
+	10	0.1363	+	

假如送出买入 0.1375 的 passive 单：20 张；因为挂单价格比市场的买一价：0.1364 高 1 个 tick；所以实际送出：0.1364+1tick=0.1365 的 20 张实体单出去。假如 20 张没有全部成交，市场买一价变为：0.1368,因为买一价大于原委托的物理单但小于 passive 的委托单价格：0.1375；因此将未成交委托撤单，以新的委托价：0.1369(0.1368+1tick)送出新的未成交单子，依次循环，直到市场的买一价格等于或大于 0.1375 时，系统不再撤单，直接以 0.1375 挂出限价单。

4、分量单

每次送出设定的“分次委托量”，当全成交完，再送出下一笔，直到设定的“总委托量”都成交或删单为止。

举例说明：

盘口情况如下图

+		0.1354	+	10
+		0.1353	+	3
+	20	0.1344	+	
+	10	0.1343	+	

假设委托在 0.1354 价格委托 30 张分量单，分次委托量为：5 则首先挂 5 张 0.1354 的实体单出去，当这 5 张完全成交后，在送出 5 张 0.1354 的实体单，直到全部 100 张成交完毕为止（最后一次不足 5 张，按照不足的数量送出委托）。

5、TWAP 被动

在指定时间内将大笔委托分拆为多笔分散成交，并尽量用本方价成交

举例说明：

盘口情况如下图

+		0.1627	+	1
+		0.1625	+	1
+	1	0.1601	+	
+	1	0.1472	+	

假设设定总时长为 300 秒，总量为 10 张，单笔上限为 3，单笔下限为 2，价格检查间隔为 5 秒。

TWAP 被动单启动后，根据单笔上下限，生成下单列表 2, 3, 2, 2,1, 共 5 个批次，每批次间隔 60 秒，以本方价挂单

当前批次运行间隔中，每 5 秒检查盘口价，如果本方价发生变化，那么撤单，以新的本方价重挂

如果下一批次启动时，本批次还没有完全成交的话，那么本批次未成交挂单立刻撤单，以对手价重挂以
保证成交

6、TWAP 主动

在指定时间内将大笔委托分拆为多笔分散成交，成交价格紧盯对手价

举例说明:

盘口情况如下图

+		0.1627	+	1
+		0.1625	+	1
+	1	0.1601	+	
+	1	0.1472	+	

假设设定总时长为 300 秒，下单间隔为 60 秒，下单次数=总时长/下单间隔=5 次，总量为 10 张，挂在盘
口 0.1627 上（也可以设定下单次数，根据下单次数和总时长计算下单间隔）

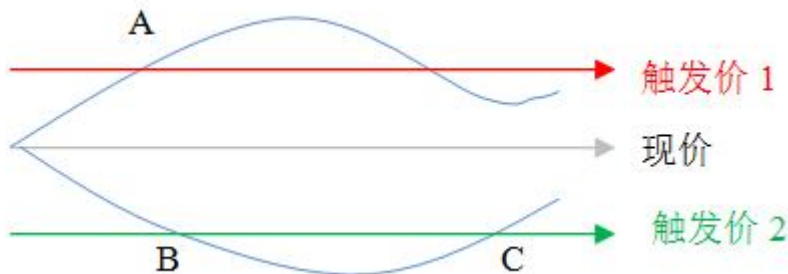
TWAP 主动单启动后，每隔 60 秒检查对手价，如果对手价（买入时小于等于，卖出时大于等于）0.1627，那
么以对手价挂单，挂单量=未成交量/剩余下单次数

7、触价 TWAP 被动

当最新价上穿或下穿触发价时，送出设定的 TWAP 被动单。

举例说明:

假设现价：2.35，触发价 1：2.38，触发价 2：2.31



以触发价 1 买入：当市场价格上穿 A：2.38 时，触发触价，送出买入 TWAP 被动单

以触发价 2 买入：当市场价格下穿 A：2.31 时，触发触价，送出买入 TWAP 被动单

以触发价 1 卖出：当市场价格上穿 A：2.38 时，触发触价，送出卖出 TWAP 被动单

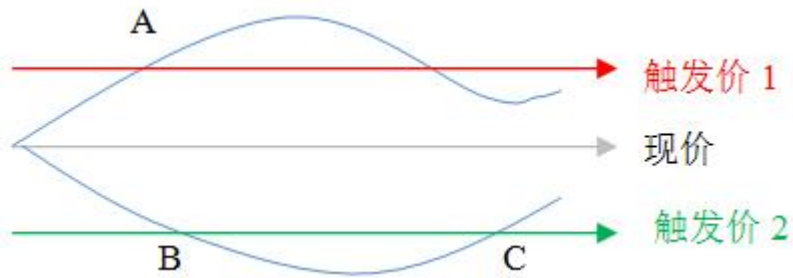
以触发价 2 卖出：当市场价格下穿 A：2.31 时，触发触价，送出卖出 TWAP 被动单

8、触价 TWAP 主动

当最新价上穿或下穿触发价时，送出设定的 TWAP 主动单。

举例说明:

假设现价：2.35，触发价 1：2.38，触发价 2：2.31，限价为触发价+2tick



以触发价 1 买入：当市场价格上穿 A: 2.38 时，触发触价，送出买入 TWAP 主动单，TWAP 主动单的买入限价为 2.40

以触发价 2 买入：当市场价格下穿 A: 2.31 时，触发触价，送出买入 TWAP 主动单，TWAP 主动单的买入限价为 2.33

以触发价 1 卖出：当市场价格上穿 A: 2.38 时，触发触价，送出卖出 TWAP 主动单，TWAP 主动单的卖出限价为 2.36

以触发价 2 卖出：当市场价格下穿 A: 2.31 时，触发触价，送出卖出 TWAP 主动单，TWAP 主动单的卖出限价为 2.29

9、VOL 单

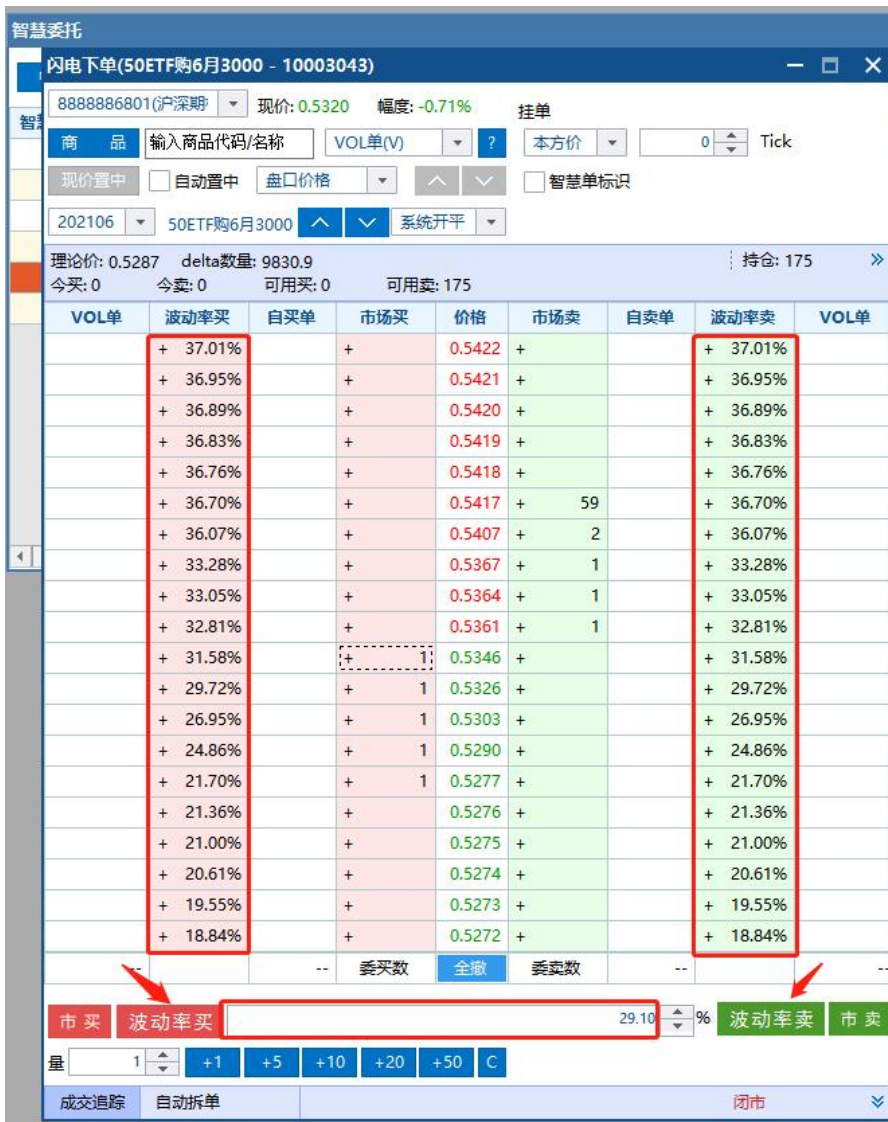
使用者以波动率挂单、及看到具体合约价格对应波动率，依据波动率进行委托，当波动率上穿或下穿触发波动率时，送出设定的波动率对应的委托价和委托量的限价单

举例说明：

盘口情况如下图

+	0.5364	+	1
+	0.5361	+	1
+	1	0.5346	+
+	1	0.5326	+

(1) 波动率下单方式：



A: 点击下载

选择 vol 单后，在分类中会展示闪电下单中价格对应的波动率，使用者在买边或卖边上的波动率点击后，则依据对应的波动率进行委托

B: 输入波动率下单:

选择 vol 单后，使用者输入波动率后（29.10%），依据按下波动率买或波动率卖进行委托

(2) 委托单呈现方式

A: 闪电下单

VOL买单	波动率买	自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单	波动率卖	VOL卖单
	+ 41.60%		+	0.4074	+		+ 41.60%	
	+ 41.46%		+	0.4073	+		+ 41.46%	
	+ 41.32%		+	0.4072	+		+ 41.32%	
	+ 41.18%		+	0.4071	+		+ 41.18%	
	+ 41.03%		+	0.4070	+		+ 41.03%	
	+ 40.89%		+	0.4069	+		+ 40.89%	
	+ 40.75%		+	0.4068	+		+ 40.75%	
	+ 40.60%		+	0.4067	+		+ 40.60%	1(40.50%)
	+ 40.45%		+	0.4066	+		+ 40.45%	
	+ 40.30%		+	0.4065	+		+ 40.30%	
2(40.25%)	+ 40.15%		+	0.4064	+		+ 40.15%	
	+ 40.00%		+	0.4063	+		+ 40.00%	
	+ 39.85%		+	0.4062	+		+ 39.85%	
	+ 39.69%		+	0.4061	+		+ 39.69%	
	+ 39.54%		+	0.4060	+		+ 39.54%	
	+ 39.38%		+	0.4059	+		+ 39.38%	
	+ 39.22%		+	0.4058	+		+ 39.22%	
	+ 39.06%		+	0.4057	+		+ 39.06%	
	+ 38.90%		+	0.4056	+		+ 38.90%	
	+ 38.73%		+	0.4055	+		+ 38.73%	
2		--	委买单	全撤	委卖单	--		1

假设波动率：40.15%，触发波动率 1：40.18，触发波动率 2:40.25%，送出委托方式：本方价（对手价）±1tick。

①以触发波动率 1 买入：当新计算得到的 ask 波动率小于等于 40.18%时，触发波动率下单，送出限价委托单。
本方价买入+1tick=市场 bid 价+1tick。

②以触发波动率 1 卖出：当新计算得到的 bid 波动率大于等于 40.18 时，触发波动率下单，送出限价委托单。
本方价卖出+1tick=市场 ask 价-1tick。

③以触发波动率 2 买入：当新计算得到的 ask 波动率小于等于 40.25%时，触发波动率下单，送出限价委托单。
本方价买入+1tick=市场 bid 价+1tick。

④以触发波动率 2 卖出：当新计算得到的 bid 波动率大于等于 40.25%时，触发波动率下单，送出限价委托单。
本方价卖出+1tick=市场 ask 价+1tick。

(a1) :

如果委託的 vol 单的波动率正好在显示的区间，则在 vol 单上显示委托单，如果有多笔则合并显示；如波动率买触发是 40.15%，但对应行只有 40.15%和 40.30%，则该笔委托单挂单显示在 40.15%；如波动率卖触发是 40.50%，但对应行只有 40.60%和 40.45%，则该笔委托单挂单显示在 40.60%

ex 有两笔买 vol 单，一笔 1@40.18 一笔 1@40.25，显示是 2@40.25

(a2): 在下方分别展示，买入与卖出委托总委托张数

4.1.6 删单

目前闪电下单成交追踪有三种状态，不处理、止盈止损、移动止损。

4.1.7.1 不处理

成交追踪默认状态为不处理，成交后系统对于成交部分不处理。

4.1.7.2 止损/止盈追踪

如果选择止盈/止损追踪，等于将用户的盈利与损失控制在一定范围内。

画面如下图：

用户可以设置“止盈”、“止损”，确定 tick 值，选择触价类型（可选择现价、卖一价、买一价）。当选择的触价类型触及到“止盈”或“止损”线时，会按照设定的触价后委托价格（默认为市价单）。

例：买入成交价为 6.00。设定止损 10 tick（该品种 1 tick 为 0.01），买一价触价后委托价格为触发价+2 tick。

那么当买一价格小于等于 5.90 的时候触发止损，假设当时买一价格为 5.89，会发出一个 5.87（向利于成交方向移动 2tick）的卖平委托。

4.1.7.2 移动止损

移动止损，就是选择的触价类型追随该触价类型的最新价格设置一定点数的止损，只随价格朝仓位有利方向变动而触发，且只止损不止盈。对于委托买入成交后，移动止损单跟涨不跟跌，对于委托卖出成交后，移动止损单跟跌不跟涨。

1. 触价类型可选择现价、卖一价、买一价。
2. 触价后委托价格可选择市价、触发价+ n tick。

例：买入成交价为 0.4383。设定止损 3 tick（该品种 1 tick 为 0.0001），触发价格选择卖一价。触价后委托价格为触发价+2 tick。

则在智慧委托可以查看到移动止损价：0.4380。

① 当卖一价变更为：0.4379，由于 $0.4379 < 0.4380$ （触及止损价），则送出一单卖平委托单，委托价格 $0.4379 - 0.0002 = 0.4377$

(向利于成交方向移动 2tick);

② 当卖一价变更为: 0.4381, 由于 $0.4381 > 0.4380$ (未触及止损价), 但是 $0.4381 < 0.4383$ (则最优价依然是 0.4383), 则不会送出卖平委托, 且在智慧委托查看到的最新止损价不会变更。

③ 当卖一价变更为: 0.4384, 由于 $0.4384 > 0.4380$ (未触及止损价), $0.4384 > 0.4383$ (最优价变为 0.4384), 则不会送出卖出委托。但是在智慧委托查看, 最新移动止损价会跟随最优价趋势变动, 从 0.4380 变为 0.4381。依次循环, 直到当卖一价变为小于止损价, 则送出价格为触发价-0.0002 (向利于成交方向移动 2tick) 的卖平委托。

4.1.8 自动拆单



单笔委托超过 X 张自动拆单: 只有当使用者单笔委托超过设定 X 张时触发自动拆单。

单笔上限: 系统报出单笔委托的上限。

单笔下限: 系统报出单笔委托的上限。

当触发自动拆单时, 系统会按照上限与下限区间的随机张数送出委托单, 如果上限与下限相同, 按照设定的固定张数送出。

送出委托 X 笔停止 Y 秒: 用户在送出 X 笔委托之后, 停止 Y 秒钟, 然后在送出 X 笔委托, 然后再停止 Y 秒, 周而复始, 直到将所有的委托送出。

该功能只有当勾选“是否自动拆单”时激活。

4.1.9 一键平净仓

1、平净仓使本商品多头头寸和空头头寸相同, 平掉多余的头寸; 锁净仓使本商品多头头寸和空头头寸相同, 增加不足的头寸;

功能界面显示如下:



举例说明:

平净仓: 如商品多单 20 张, 空单 10 张, 平净仓后使持有多单 10 张, 空单 10 张。既需要平掉 10 张多单 (卖平)

价格类型 对手价		价格类型 对手价	
平净仓 锁净仓		平净仓 锁净仓	
当前帐号	全部帐号	当前帐号	全部帐号
持仓	10	持仓	0
今买	21	今买	21
今卖	11	今卖	21
可用买	10	可用买	10
可用卖	20	可用卖	10
冻结买	0	冻结买	0
冻结卖	0	冻结卖	0
平均成本	0.0176	平均成本	--
今日损益	-147	今日损益	-147
当冲损益	-147	当冲损益	-147
理论价格	0.0165	理论价格	0.0165
Delta	0.0592	Delta	0.0592
Gamma	0.1735	Gamma	0.1735
Vega	0.0034	Vega	0.0034
Theta	-0.0006	Theta	-0.0006
Vanna	0.8337	Vanna	0.8337
Vomma	3.7004	Vomma	3.7004
到期天数	71.00天	到期天数	71.00天
年化时间	0.29098	年化时间	0.29098

锁净仓：如某商品多单 20 张，空单 10 张，锁净仓后使持有多单 20 张，空单 20 张。即需要开仓 10 张空单（买开）

价格类型 对手价		价格类型 对手价	
平净仓 锁净仓		平净仓 锁净仓	
当前帐号	全部帐号	当前帐号	全部帐号
持仓	10	持仓	0
今买	36	今买	36
今卖	26	今卖	36
可用买	10	可用买	20
可用卖	20	可用卖	20
冻结买	0	冻结买	0
冻结卖	0	冻结卖	0
平均成本	0.0186	平均成本	--
今日损益	-252	今日损益	-252
当冲损益	-252	当冲损益	-252
理论价格	0.0165	理论价格	0.0165
Delta	0.0592	Delta	0.0592
Gamma	0.1735	Gamma	0.1735
Vega	0.0034	Vega	0.0034
Theta	-0.0006	Theta	-0.0006
Vanna	0.8337	Vanna	0.8337
Vomma	3.7004	Vomma	3.7004
到期天数	71.00天	到期天数	71.00天
年化时间	0.29098	年化时间	0.29098

注意：仅支持期货、期权

2、平净仓时有冻结买卖，则弹出提示，终止平净仓。

4.1.10 拖动追单

使用者可选择拖动某价位未成交预埋委托单单元格到另外一个单元格，价位上选择的价位、未成交委托将自动撤单、重报

一般委托举例说明：

盘口情况如下图：

+		0.4804	+	1
+		0.4780	+	1
+	1	0.4712	+	
+	1	0.4699	+	

假如买入 0.4712 的委托单：20 张；委托单未成交，挂单显示，拖动价格 0.4712 的未成交量为 20 的预埋单单元格拖动至 0.4804，则未成交委托将自动撤单、重报

ex：一般单只能拖动到一般单

商品代码	委托时间	委托消息	商品名称	买卖类别	开平标识	撤单	委托价格	剩余量	成交量	委托状态	追单	委托类型	委托量
90000498	15:06:03	委托单OK	(深)300ETF购6月4800	卖	开仓	撤单	0.4804	20	0	委托成功	追单	限价	20
90000498	15:06:01	委托单已撤	(深)300ETF购6月4800	买	开仓	--	0.4712	20	0	已撤单	--	限价	20 报单撤销

智慧委托举例说明：

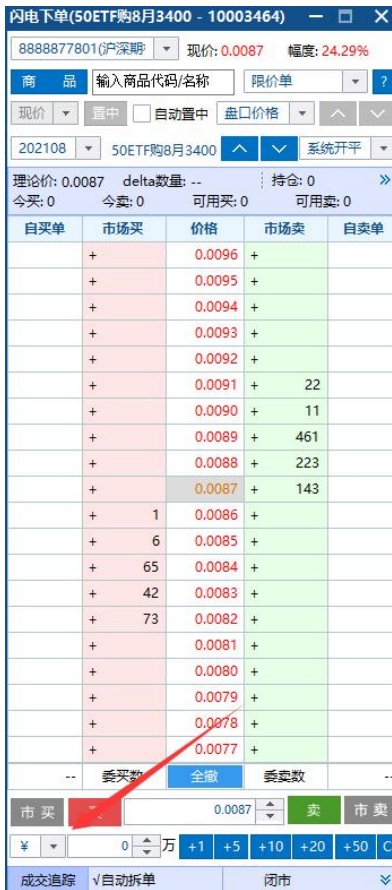
假如买入 0.3890 的智慧委托单：3 张；委托单未成交，挂单显示，拖动价格 0.3890 的未成交量为 3 的预埋单单元格拖动至 0.3895，则未成交委托将自动撤单、重报

ex: 不支持 passive 单和分量单、智慧单只能拖动到智慧单

111	10003004	50ETF购6月3200	Hit单	买	--	[买入]市场卖一价<=0.3890,送出IOC单	1	已执行	14:07:40	14:11:10	8888886801(沪深期权)
110	10003004	50ETF购6月3200	Hit单	买	--	[买入]市场卖一价<=0.3890,送出IOC单	1	已执行	14:07:39	14:11:10	8888886801(沪深期权)
109	10003004	50ETF购6月3200	Hit单	买	--	[买入]市场卖一价<=0.3890,送出IOC单	1	已执行	14:07:38	14:11:10	8888886801(沪深期权)

4.1.11 以总金额计算委托量

新增可以输入金额计算委托总量的委托交易模式，其中市价单和 vol 单，不支持使用总金额委托的模式，其他智慧单，使用委托使用总金额时，根据当前选择的触发价格计算实际委托量。计算得到的委托量，向下取整。



4.1.12 闪电下单持仓信息和委托明细功能

1. 闪电下单右侧下拉菜单功能：包含持仓信息和委托明细。

1.1 其中持仓信息，如下图：



1.2 委托明细

闪电下单右侧下拉委托明细，并选择相应的自买单档位，会显示当前该档位挂单价格商品的有效委托，委托明细按时间倒序排序。

闪电下单账号选择是单一账号时，显示委托价格、委托时间，委托量；

闪电下单账号选择是账号组时，显示委托价格、委托时间，委托量，委托明细中额外增加委托的账号信息。

如下图分别展示单账号、账号组：

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单
	+	8.74	+	
	+	8.73	+	
	+	8.72	+	
	+	8.71	+	
	+	8.70	+	
	+	8.69	+	53.20万
	+	8.68	+	51.08万
	+	8.67	+	48.67万
	+	8.66	+	104.88万
	+	8.65	+	6900
	+	8.64	+	
	+	8.63	+	
	+	8.62	+	
	+	8.61	+	
	+	8.60	+	
300	+	8.59	+	
100	+	8.58	+	
100	+	8.57	+	
	+	8.56	+	
	+	8.55	+	

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单
	+	8.74	+	
	+	8.73	+	
	+	8.72	+	
	+	8.71	+	
	+	8.70	+	
	+	8.69	+	53.20万
	+	8.68	+	51.98万
	+	8.67	+	48.67万
	+	8.66	+	104.88万
	+	8.65	+	6900
	+	8.64	+	
	+	8.63	+	
	+	8.62	+	
	+	8.61	+	
	+	8.60	+	
900	+	8.59	+	
400	+	8.58	+	
100	+	8.57	+	
	+	8.56	+	
	+	8.55	+	

当行情变动时，委托明细不发生变化。

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单
	+	3.226	+	
	+	3.225	+	
	+	3.224	+	
	+	3.223	+	
	+	3.222	+	
	+	3.221	+	104.73万
	+	3.220	+	121.87万
	+	3.219	+	124.12万
	+	3.218	+	300.93万
	+	3.217	+	52.96万
500	+	3.215	+	
	+	3.214	+	
	+	3.213	+	
	+	3.212	+	
	+	3.211	+	
	+	3.210	+	
	+	3.209	+	
	+	3.208	+	
	+	3.207	+	
	+	3.206	+	

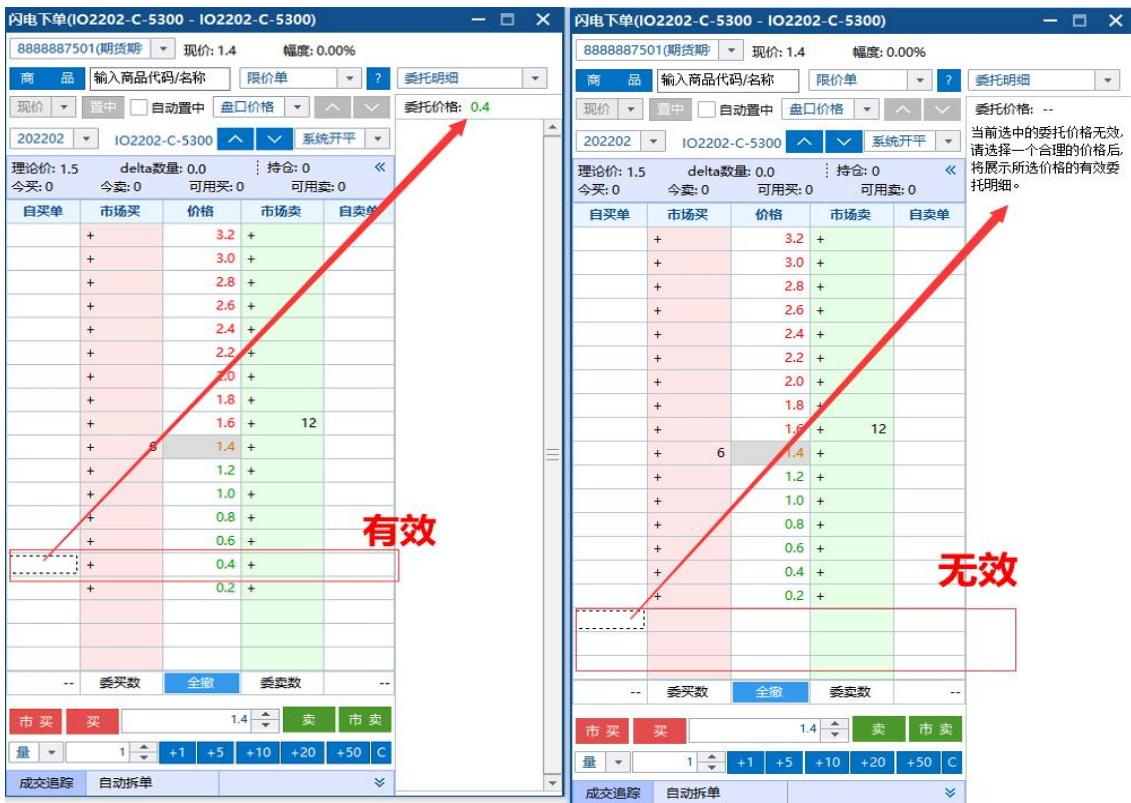
只有当鼠标点击选中新的自买单对应价格时，才根据新的价自买单格重新筛选委托明细并展示。

选中变动

当委托发生变动时，同步刷新委托明细的内容。

当选中框当前位置是个无效价格时，比如“--”，委托明细显示提示信息：“当前选中的委托价格无效，请选择

一个合理的价格后，将展示所选价格的有效委托明细”。



鼠标双击委托量，可对该笔委托进行撤单操作和原有闪下双击撤单一致。

可以通过 ctrl+鼠标点击，或者鼠标拖动的方式（仅单账号），选取多个委托明细，进行批量撤单



4.1.13 开平仓处理设定

点击“开平仓处理设定”，对所交易品种进行开平仓逻辑设置，系统默认“系统开平”。

选择“系统开平”时，则按照系统设置-开平仓处理设定中所设置的开平仓逻辑。

沪深期权：可选择系统开平、开仓、平仓、先平再开。

大商所、郑商所、广期所：可选择系统开平、开仓、平仓、先平再开。

上期所、上海能源交易所：可选择系统开平、开仓、平今、平昨、先平再开。

中金所：可选择系统开平、开仓、平仓、先平再开、不平今仓。



中金所期货期权增加“不平今仓”选项。选择“不平今仓”时，在今天没有反方向的开仓成交记录前，优先平仓，今天有反方向的开仓成交记录后，只开仓不平仓。

例：持有中金所某期权昨仓 100 张，选择“不平今仓”。

在当日没有买入开仓的成交记录之前，在卖出数量不大于 100 张时执行卖出平仓操作，在卖出数量大于 100 张时执行卖出开仓操作；在当日有买入开仓的成交记录之后，所有的卖出委托，都执行卖出开仓操作。



4.1.14 沪深期权备兑交易的功能

上海市场在进行备兑开仓前，需要先手动对该期权标的进行对应数量的锁仓（锁仓步骤 4.20）。

标的商品锁仓数量不足时备兑开仓失败。

被锁仓的该部分标的在解锁之前不能交易，也不可进行二次锁仓，处于冻结状态。

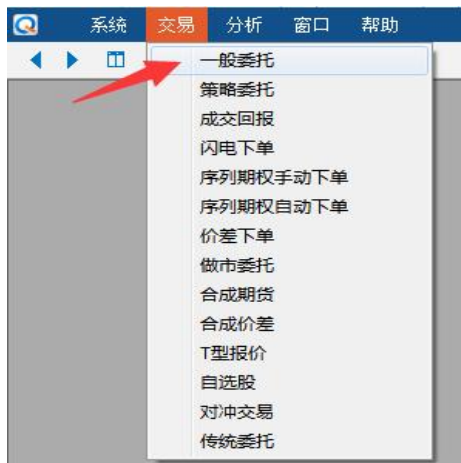
例：要对科创 50 期权进行备兑开仓 1 张，需要先对其标的科创 50（588000）进行锁仓。

锁仓成功后备兑开仓才能成功。

打开闪电下单模块，开平仓方向选择【备兑】，即可点击进行备兑交易。

注：深圳市场不需要手动进行锁仓操作，但是需要有可自动锁定的对应数量的标的商品。备兑交易操作同上。

4.2 一般委托



使用者通过“交易/一般委托”路径即可看到下图视窗；使用者可以对特定账号进行委托单筛选；使用者也可以使用“显示委托”、“最近 N 笔委托”与“商品过滤”简易的筛选出需要分析的委托单；分析委托情况与进行删单、追单管理；如下图委托管理。

The screenshot shows the '一般委托' (General Order) management window. The title bar indicates '一般委托 (未成张数: 6 未成股数: 0 未成\$Delta: -7879)'. The interface includes filters for '帐号过滤' (Account Filter), '最近N笔委托' (Recent N Orders), and '商品过滤' (Product Filter). A table displays the following data:

序号	商品代码	帐号	商品名称	买卖类别	委托时间	开平标识	委托价格	剩余量	成交量	委托来源	委托状态	委托讯息	撤单	追单	委托类型	委托量	柜台状态讯息
7	SA409C1760	8888899621(期货期权)	纯碱409买权	买	16:58:33	平仓	347.0	0	1	闪电下单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	
8	SA409C1760	8888899621(期货期权)	纯碱409买权	卖	16:58:31	开仓	52.5	0	1	闪电下单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	
9	SA409C1760	8888899621(期货期权)	纯碱409买权	卖	16:58:28	平仓	52.5	0	1	闪电下单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	
10	SA409C1760	8888899621(期货期权)	纯碱409买权	卖	16:58:00	开仓	52.5	0	1	闪电下单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	
11	SA403P1500	8888899621(期货期权)	纯碱403卖权	买	16:56:06	开仓	167.0	0	1	闪电下单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	
12	SA403P1500	8888899621(期货期权)	纯碱403卖权	卖	16:55:59	开仓	1.5	0	1	闪电下单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	
13	SA403P1500	8888899621(期货期权)	纯碱403卖权	买	16:55:56	开仓	167.0	0	1	闪电下单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	
14	PK403P9600	8888899621(期货期权)	花生403卖权	买	16:55:33	开仓	1302.0	0	1	闪电下单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	
15	SA409C1760	8888899621(期货期权)	纯碱409买权	买	16:52:54	开仓	347.0	0	1	条件单(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价	1	

在一般委托中点击导出，可选择导出一般委托文件、导出成条件单文件或导出到条件单。

导出成条件单文件：将当前筛选出的委托单导出成为条件单模板文件，导入条件单后状态为未启动，自动追单类型为不追单。

导出到条件单：将当前筛选出的委托单导出到条件单中，状态为未启动，自动追单类型为不追单。

The screenshot shows the '一般委托' (General Order) management window with the '导出' (Export) menu open. The title bar indicates '一般委托 (未成张数: 0 未成股数: 100 未成\$Delta: 285)'. The '导出' menu is open, showing options: '导出一般委托文件', '导出成条件单文件', and '导出到条件单'. The table below shows the following data:

序号	商品代码	帐号	商品名称	买卖类别	委托时间	开平标识	委托价格	剩余量	成交量	委托来源	委托状态	委托讯息	撤单	追单	委托类型	委托量	柜台状态讯息
1	600017	8888899601(股票)	日照港	买	10:57:23	--	2.81	100	0	未定义(一般)	委托成功	委托单OK	--	--	限价		
2	600017	8888899601(股票)	日照港	买	10:57:23	--	2.81	100	0	未定义(一般)	已撤单	委托单已撤	--	--	限价		
3	90002866	8888899601(沪深期权)	中证500ETF沽6月65	买	10:57:04	开仓	0.7022	0	1	未定义(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价		
4	000016	8888899601(股票)	深康佳A	买	10:57:04	--	4.34	0	100	未定义(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价		
5	10005771	8888899601(沪深期权)	(沪)50ETF购3月2750	买	10:57:04	开仓	0.0226	0	1	未定义(一般)	全部成交	委托单全部	--	--	限价		
6	600017	8888899601(股票)	日照港	买	10:57:04	--	2.81	100	0	未定义(一般)	已撤单	委托单已撤	--	--	限价		

一般委托单筛选可以过滤“有效委托”、“未回应委托”、“失败委托”、“已撤单”、“所有委托”、“全部成交”、“部分成交”、“已报”状态的功能。

一般委托 (未成张数: 0 未成股数: 0 未成\$Delta: 0)

帐号过滤 全撤 筛选 所有委托 最近N笔委托 全部委托 商品过滤 包含自动单 追单Tick 10 栏位设置 导出

委托来源	委托时间	有效委托 未回应委托 失败委托 已撤单	帐号	序号	柜台委托号	商品名称	买卖类别	开平标识	撤单	委托价格	剩余量	成交量	委托状态	追单	委托类型	委托量	柜台状态讯息
TWAP自动下单	10:31:08	MO	888899601(期货期权)	1	OD-00000172	MO2412-P-3800	买	开仓	--	35.0	0	1	全部成交	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:31:08	MO	888899601(期货期权)	2	OD-00000171	MO2412-P-3800	买	开仓	--	35.0	0	1	全部成交	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:31:07	1	888899601(沪深期权)	3	OC-00000284	FJ50ETF购9月250	买	开仓	--	0.0497	0	1	全部成交	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:31:05	MO	888899601(期货期权)	4	OD-00000170	MO2412-P-3800	买	开仓	--	34.0	1	0	已撤单	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:31:05	MO	888899601(期货期权)	5	OD-00000169	MO2412-P-3800	买	开仓	--	34.0	1	0	已撤单	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:31:05	1	888899601(沪深期权)	6	OC-00000283	FJ50ETF购9月250	买	开仓	--	0.0493	1	0	已撤单	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:31:05	HO2409-C-2375	888899601(期货期权)	7	OD-00000168	HO2409-C-2375	买	开仓	--	61.6	1	0	已撤单	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:30:57	10006737	888899601(沪深期权)	8	OC-00000282	FJ50ETF购9月250	买	开仓	--	0.0493	1	0	已撤单	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:30:54	MO2412-P-3800	888899601(期货期权)	9	OD-00000167	MO2412-P-3800	买	开仓	--	34.6	0	1	全部成交	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:30:54	10006737	888899601(沪深期权)	10	OC-00000281	FJ50ETF购9月250	买	开仓	--	0.0496	0	1	全部成交	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:30:52	MO2412-P-3800	888899601(期货期权)	11	OD-00000166	MO2412-P-3800	买	开仓	--	33.8	1	0	已撤单	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:30:52	10006737	888899601(沪深期权)	12	OC-00000280	FJ50ETF购9月250	买	开仓	--	0.0493	1	0	已撤单	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:30:52	HO2409-C-2375	888899601(期货期权)	13	OD-00000165	HO2409-C-2375	买	开仓	--	61.6	1	0	已撤单	--	限价	1	
TWAP自动下单	10:30:43	MO2412-P-3800	888899601(期货期权)	14	OD-00000164	MO2412-P-3800	买	开仓	--	34.6	0	2	全部成交	--	限价	2	
TWAP自动下单	10:30:41	MO2412-P-3800	888899601(期货期权)	15	OD-00000163	MO2412-P-3800	买	开仓	--	33.8	2	0	已撤单	--	限价	2	
闪电下单(一般单)		c2501-C-2340	888899621(期货期权)	16		c2501-C-2340	买	开仓	--	45.0	1	0	委托失败	--	限价	1	资金不足
闪电下单(一般单)		c2501-C-2340	888899621(期货期权)	17		c2501-C-2340	买	开仓	--	44.5	1	0	委托失败	--	限价	1	资金不足
闪电下单(一般单)	10:11:53	c2501-C-2340	888899611(期货期权)	18	OD-00000125	c2501-C-2340	买	开仓	--	44.5	0	1	全部成交	--	限价	1	
闪电下单(一般单)	10:11:51	c2501-C-2340	888899601(期货期权)	19	OD-00000124	c2501-C-2340	买	开仓	--	44.5	0	1	全部成交	--	限价	1	

4.3 智慧委托



使用者通过“交易→智慧委托”路径即可看到下图视窗：

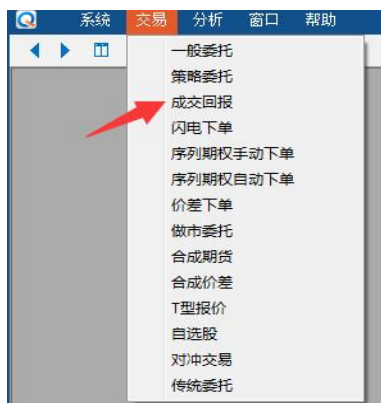
目前支持触价单、止盈止损单、移动止损单等智慧单；使用者可以对特定账号进行智慧单筛选；使用者也可以使用“显示委托”、“最近N笔委托”与“商品过滤”简易的筛选出需要分析的委托单；分析委托情况与进行删单管理；如下图：

智慧委托

帐号过滤 全撤 显示类型 所有委托 最近N笔委托 500 商品过滤 导出

智慧单序号	商品代码	商品名称	委托类型	买卖类别	撤单	条件描述	预埋量	执行状态	委托时间	执行时间
34	90000933	沪深(深)300ETF购2月4700	Hit单	买	撤单	[买入]市场卖一价<=0.0415,送出IOC单	1	未执行	13:47:26	
33	90000933	沪深(深)300ETF购2月4700	Hit单	买	撤单	[买入]市场卖一价<=0.0415,送出IOC单	1	未执行	13:47:26	
32	90000933	沪深(深)300ETF购2月4700	Hit单	买	撤单	[买入]市场卖一价<=0.0415,送出IOC单	1	未执行	13:47:26	
30	90000933	沪深(深)300ETF购2月4700	Hit单	买	--	[买入]市场卖一价<=0.0420,送出IOC单	1	失败	13:47:25	
29	90000933	沪深(深)300ETF购2月4700	Hit单	买	撤单	[买入]市场卖一价<=0.0418,送出IOC单	1	未执行	13:47:23	

4.4 成交回报



使用者通过“交易→成交回报”路径即可看到下图视窗；使用者可以使用此视窗分析成交委托单，并提供以账号与商品方式进行筛选成交部位；

成交回报的汇总栏目商品代码点击“+”可以展开按账号显示汇总信息。



合计	总成交金额	总买金额	总卖金额	期货净买入	股票净买入	期权净买入	当冲损益				
合计	-1,000,050	41,010	1,041,060	-1	-1	11	-1,916.00				

商品/交易账号	总买数量	总卖数量	买均价	卖均价	净买入	当冲损益	买成交平均波动率	卖成交平均波动率
- 10007139.SSE (沪)50ETF购12月2250	8	0	0.2818	0	0	24.00	15.48	--
8888899601(沪深期权)	5	0	0.2818	0	0	15.00	15.39	--
8888899611(沪深期权)	1	0	0.2818	0	0	3.00	15.65	--
8888899621(沪深期权)	2	0	0.2818	0	0	6.00	15.65	--
+ 10007437.SSE (沪)50ETF购7月2250	2	0	0.2603	0	0	-40.00	--	--
+ HO2503-C-2400.CFFEX HO2503-C-2400	1	0	132.6000	0	0	-700.00	15.19	--
+ IF2503.CFFEX IF2503	0	1	--	1,041,060	1,470.2000	-1	-1,200.00	--

柜台委托号	成交号	帐号	商品代码	商品名称	买卖类别	开平标识	成交价格	成交数量	成交金额	成交波动率	成交时间
OD-00000286	TD-00000296	8888899601(国)	IF2503	IF2503	卖	开仓	3470.2	1	1,041,060	--	15:04:58
OD-00000285	TD-00000295	8888899601(国)	HO2503-C-2400	HO2503-C-2400	买	开仓	132.6	1	13,260	15.19	15:04:53
OC-00000652	TC-00000863	8888899621(国)	10007139	(沪)50ETF购12月225	买	开仓	0.2818	1	2,818	15.65	14:53:09
OC-00000651	TC-00000862	8888899621(国)	10007139	(沪)50ETF购12月225	买	开仓	0.2818	1	2,818	15.65	14:53:08
OC-00000650	TC-00000861	8888899611(国)	10007139	(沪)50ETF购12月225	买	开仓	0.2818	1	2,818	15.65	14:53:06
OC-00000610	TC-00000817	8888899601(国)	10007437	(沪)50ETF购7月2250	买	开仓	0.2603	1	2,603	--	14:48:56
OC-00000609	TC-00000816	8888899601(国)	10007437	(沪)50ETF购7月2250	买	开仓	0.2603	1	2,603	--	14:48:55
OC-00000560	TC-00000767	8888899601(国)	10007139	(沪)50ETF购12月225	买	开仓	0.2816	1	2,816	15.33	14:40:11
OC-00000559	TC-00000766	8888899601(国)	10007139	(沪)50ETF购12月225	买	开仓	0.2816	1	2,816	15.33	14:40:11

4.5 序列期权手动下单

4.5.1 手动序列期权设置

点击界面左上角“设置”按钮后弹出以下菜单选项



标的设定

当鼠标左键点击“标的设定”时，会弹出选择框，通过勾选不同交易所和不同标的的商品后，界面标的的标签页即新增标的的显示。

用户通过选择不同标的的标签，序列期权画面即可显示该标的下所有的期权行情信息。



波动率变化与量警示

当鼠标左键点击“选择波动率变化与量警示”时，会弹出以下窗体。



用户可以在该对话框中设置波动率变动的上下限和成交量。

波动率监控的上下限：

目前市场波动率-重设波动率快照值>波动率上限设定，在序列期权实时行情栏中，该期权会用红色虚线框出。

重设波动率快照值-目前市场波动率<波动率下限设定，在序列期权实时行情栏中，该期权会用绿色虚线框出。

2.5500	2.6000	2.6500	2.7000	2.7500
-0.72	-0.65	-0.66	-0.63	0.00
-0.75	-0.72	-0.72	-0.70	-0.66
10.96	-75.36	0.00	20.18	0.00
1.14	10.15	3.84	4.45	12.33

目前市场最近一笔成交的张数>成交量设定，序列期权实时行情栏中，该期权会用黄色背景标出。

4.5.2 行情切换

用户可以鼠标点击切换不同的期权序列字段，可选择波动率、市场价、成交价、时间价值、持仓部位。



4.5.3 序列期权拖拽下单

序列期权行情区支持鼠标拖拽多选，用户可以同时对于多个期权合约进行操作。

2.4000	2.4500	2.5000	2.5500
-0.48	-0.71	-0.70	-0.69
-0.91	-0.75	-0.72	-0.71
10.90	6.44	61.53	12.50
5.46	9.47	5.09	-0.32

2.05	2.10	2.15	2.20	2.25
26.95	27.51	27.41	29.55	30.69
27.56	27.89	27.81	29.85	31.05
31.86	32.96	33.36	35.20	37.66
32.22	33.44	34.12	38.97	43.33

用户选择设置“价格类型”、“价格”、“张数”，在行情栏中拖拽所要的期权合约（支持多选），后点击“下单”，即完成下单委托，如果勾选“快速下单”，则也可以“鼠标左键”拖拽+“Enter”进行下单。

账号 8888886801(沪深) 张数 10

本方价 6 tick(s) 快速下单

✓ 下单

委托结果显示在委托管理区中，同时如果该合约单委约未成交，在序列期权行情区该份合约会被红色粗线标注出来。

29.58	28.21	27.64
30.04	28.78	28.20

通过快速下单送出委买（卖）委托单且未成交，如果对相同期权的同一持仓再次送出委买（卖）委托单，则默认为追单，即以当前委托条件重新下单并撤销原委托单(先撤单再挂单)。

4.5.4 单一合约操作

双击序列期权行情区某一委买（卖），弹出闪电下单窗口，用户可对单一合约进行快速下单。

	1.95	2.00	2.05	2.10	2.15	2.20	2.25	2.30
	0.2251	0.1761	0.1274	0.0808	0.0446	0.0193	0.0081	0.0030
	0.2256	0.1762	0.1275	0.0810	0.0447	0.0195	0.0082	0.0031
	0.0006	0.0010	0.0021	0.0067	0.0194	0.0453	0.0827	0.1274
	0.0007	0.0012	0.0022	0.0068	0.0195	0.0454	0.0828	0.1286

注：蓝色底色的价格为平值期权执行价

4.5.5 委托试算和下单试算显示

序列期权手动下单								
⚙️	已委				下单试算			
	委买VEGA	724	委卖VEGA	0	委买VEGA	-237	委卖VEGA	0
	委买DELTA	-36.57万	委卖DELTA	0	委买DELTA	15.94万	委卖DELTA	0

提供使用者委托试算与下单试算功能，已委统计未成交委托风险敞口，下单试算统计拖拽合约（未委托）总风险敞口。

4.5.6 五档盘口下单操作

用户点击序列期权行情区的期权时，五档下单区中会自动显示该期权的即时五档报价及其他行情，如 greeks 值。

50ETF购3月2200				合约联动	
五档价格	盘口	IV	挂单	涨跌	-0.0009(-11.69%)
0.0078	2	30.82		成交量	0.0068
0.0072	1	30.06		最高价	0.0149
0.0071	10	29.94		最低价	0.0068
0.0070	10	29.81		重量	12048
0.0069	10	29.85		单笔	21
0.0068	1	29.55		lot	7.5072
0.0066	3	29.46		Delta	0.1332
0.0063	1	29.06		Vega	0.0008
0.0061	1	28.79		Gamm	2.0543
0.0059	1	28.51		Theta	-0.0016

价格	0.0068	买进	市价买	买全撤
张数	10	卖出	市价卖	卖全撤

用户通过序列期权行情区选定特定期权，选择所需的价格、张数，即可点击买入、卖出、市价买、市价卖进行委托下单，下单详情会显示在委托管理区，同时未成交的合约数量会在五档下单区的“挂单”一栏中显示（所有界面触发的下单未成交都会在此显示）。“挂单”栏中如果有未成交合约，鼠标左键双击该数字所在表框区域，可删除撤销该委托单。

4.5.7 委托管理

使用者可以通过委托管理区对所有账号下的委托单进行管理，目前提供“账号过滤”、“委托类型”与“最近 N 笔委托”等简易过滤条件，用户还可实现委托管理区快速追单功能。

委托管理															合约联动
账号过滤	全撤	筛选撤	撤买单	撤卖单											
序号	柜台委托号	商品名称	买卖类别	开平标识	撤单	委托价格	剩余量	成交量	委托状态	追单	委托类型	委托量	柜台状态讯息	帐号	
14	C-00000398	(沪)50ETF购6月2650	买	开仓	--	0.0701	1	0	已撤单	--	限价	1		8888899601(沪深期权)	
15	C-00000395	(沪)50ETF购6月2650	买	开仓	--	0.0700	1	0	已撤单	--	限价	1		8888899601(沪深期权)	
16	C-00000388	(沪)50ETF购6月2650	买	开仓	--	0.0696	1	0	已撤单	--	限价	1		8888899601(沪深期权)	
17	C-00000387	(沪)50ETF购6月2650	买	开仓	--	0.0697	1	0	已撤单	--	限价	1		8888899601(沪深期权)	
18	C-00000386	(沪)50ETF购6月2650	买	开仓	--	0.0696	1	0	已撤单	--	限价	1		8888899601(沪深期权)	
19	C-00000385	(沪)50ETF购6月2650	买	开仓	--	0.0697	1	0	已撤单	--	限价	1		8888899601(沪深期权)	
20	C-00000351	(沪)50ETF购11月2250	买	开仓	--	0.2316	0	5	全部成交	--	限价	5		8888899601(沪深期权)	
21	C-00000353	(沪)50ETF购11月2250	买	开仓	--	0.2316	0	3	全部成交	--	限价	3		8888899621(沪深期权)	
22	C-00000352	(沪)50ETF购11月2250	买	开仓	--	0.2316	0	2	全部成交	--	限价	2		8888899611(沪深期权)	

4.5.8 双击打开闪电下单

在序列期权手动下单的界面中，如果页签为波动度，双击鼠标打开闪电下单时，默认为 VOL 单，否则双击打开闪电下单默认为“限价单”。

4.5.9 增加拆单选项

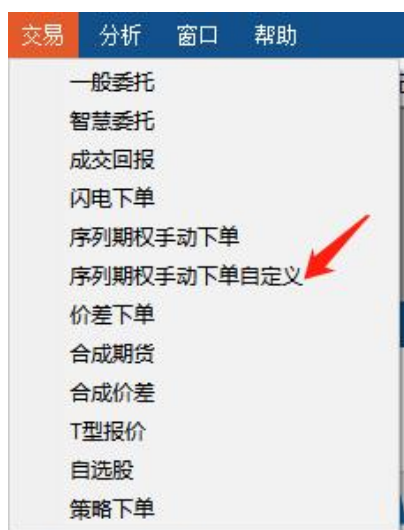
通过勾选指定使用系统拆单设置，触发拆单功能时将所有的拆单看做一个整体，重新下单时，将上一个拆单中的委托单，已经成交的不处理，已经挂单的做撤单处理，没有下单的取消掉。例如：使用序列期权手动下单，下单 100 手，拆单成 10 笔，每隔 1 秒下一笔，其中一笔已成交，挂单 3 笔，还有 6 笔待下。这时，重下一单，已挂的 3 笔撤单，剩余 6 笔取消掉。已成交的不处理。

4.5.10 增加锁定账号控件



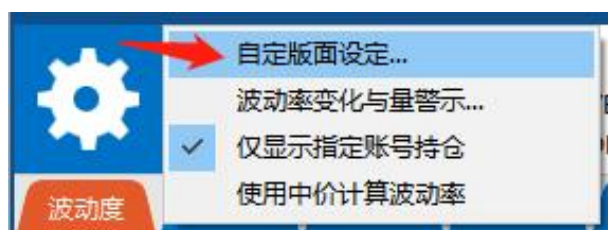
序列期权手动下单界面增加一个锁定账号的控件。锁定账号后，序列期权手动窗口同类标签页使用相同的交易账号。在切换相同种类标的时候，显示的锁定账号不会变化，且不受其他序列期权手动下单窗口中账号切换的影响。序列期权手动窗口默认打开时不加锁，加锁状态不保留。

4.6 序列期权手动下单自定义



点击交易→序列期权下单自定义进入该功能页面

4.6.1 自定义版面设定

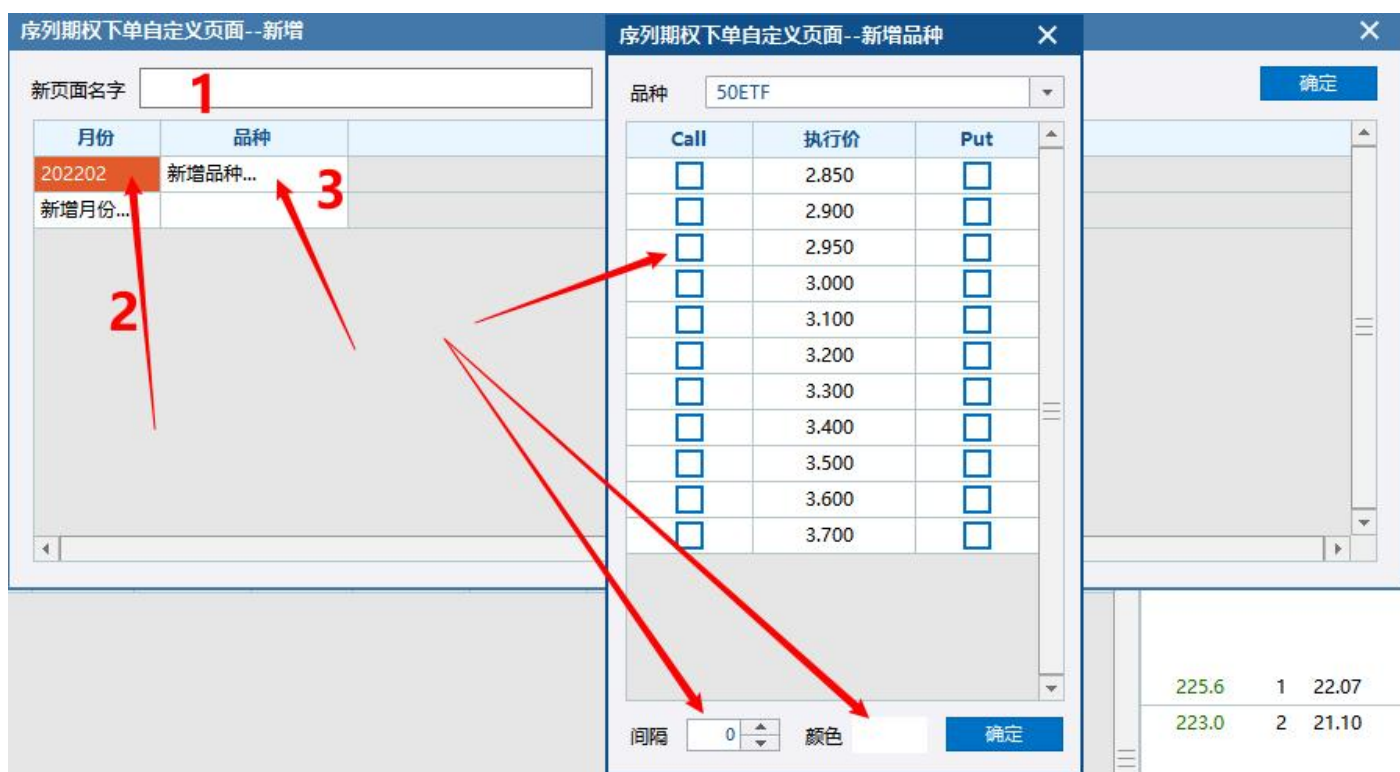


点击界面左上角“设置”按钮后，弹出菜单选项，鼠标点击“自定义版面设定”时，弹出窗口

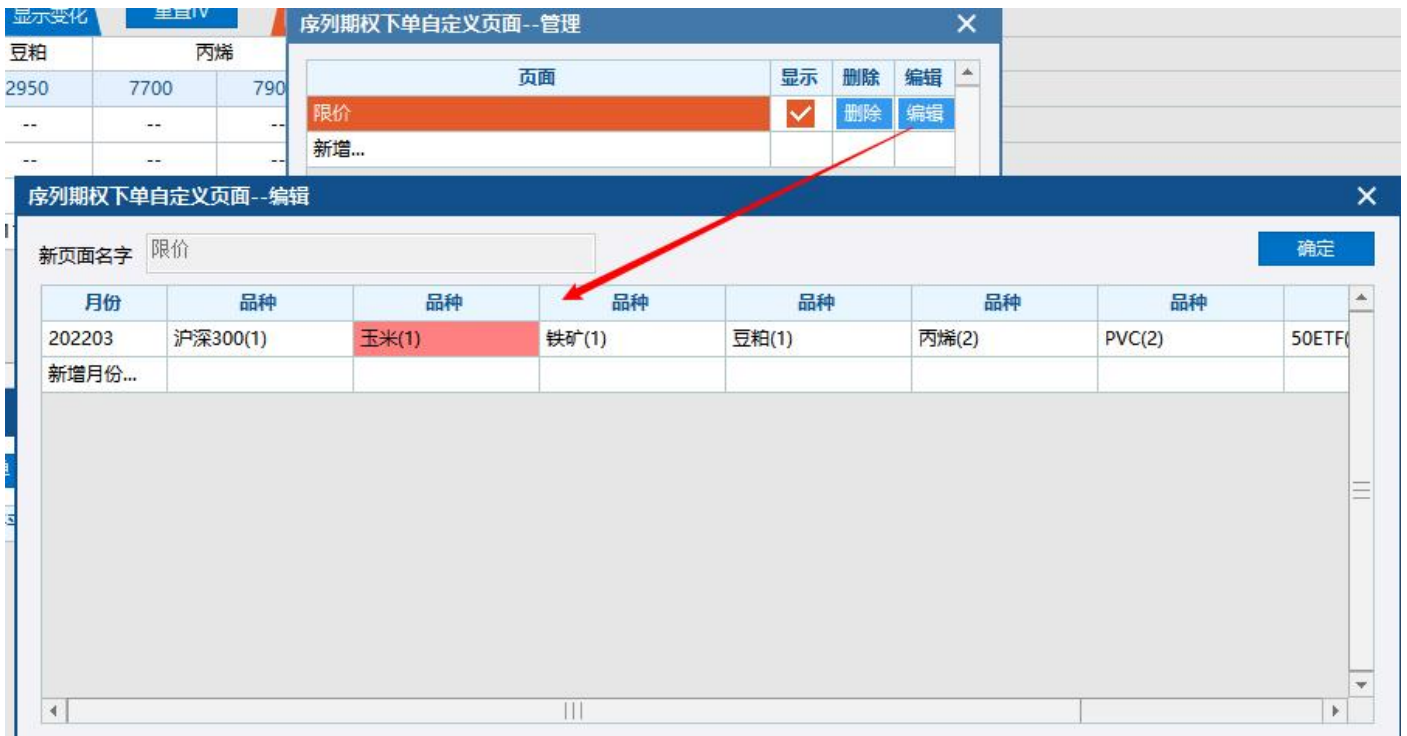


1. 点击新增，根据需求输入页面名称

2. 点击新增月份并选择品种。点击“新增品种”进行设定，用户可自定义设定执行价、call 和 put 的买卖，可设定间隔值在每一个品种空出空间作为分隔，点击颜色自定义可设定每个月份期权品种的底色



3. 点击“编辑”，弹出窗口，使用者可通过当前界面选择月份进行编辑品种

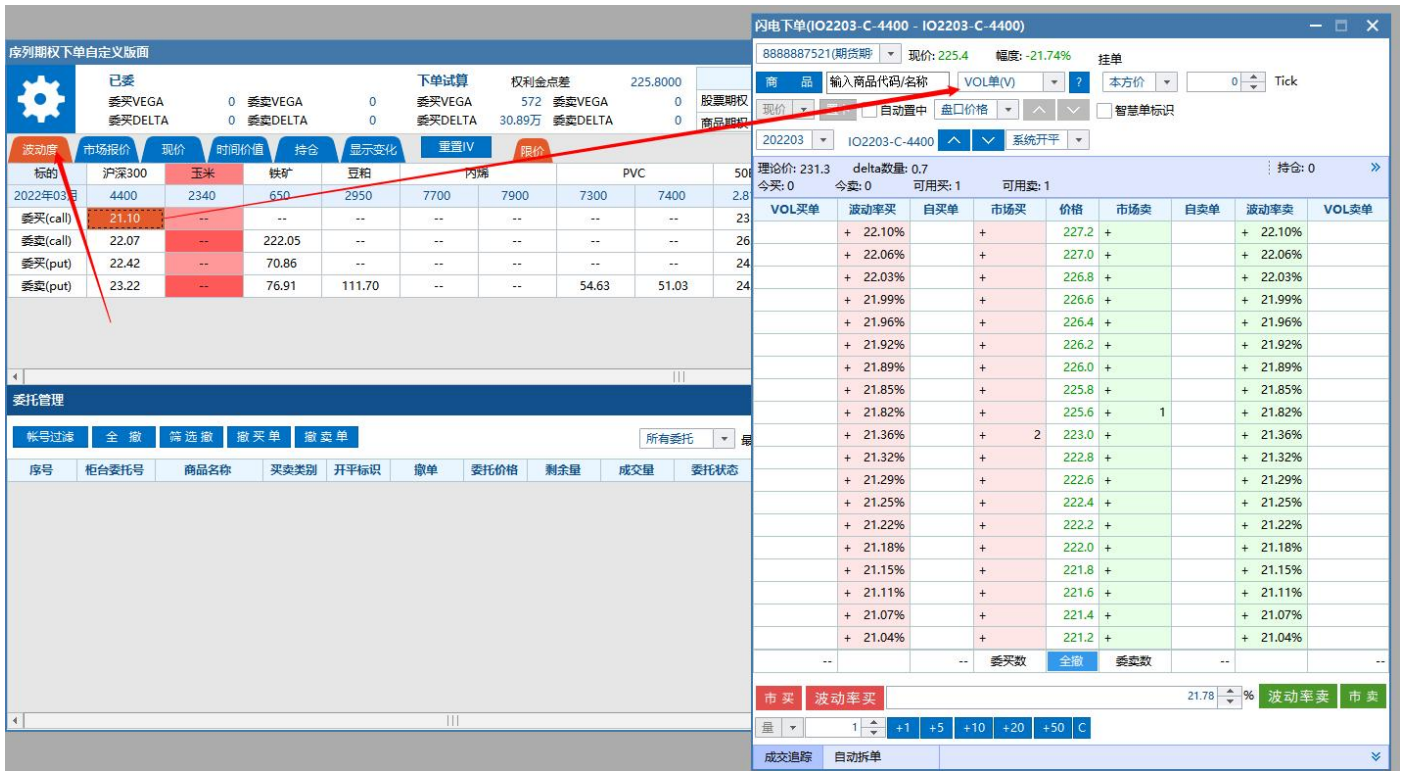


4.删除,使用者点击“删除”，通过弹窗选择是否删除



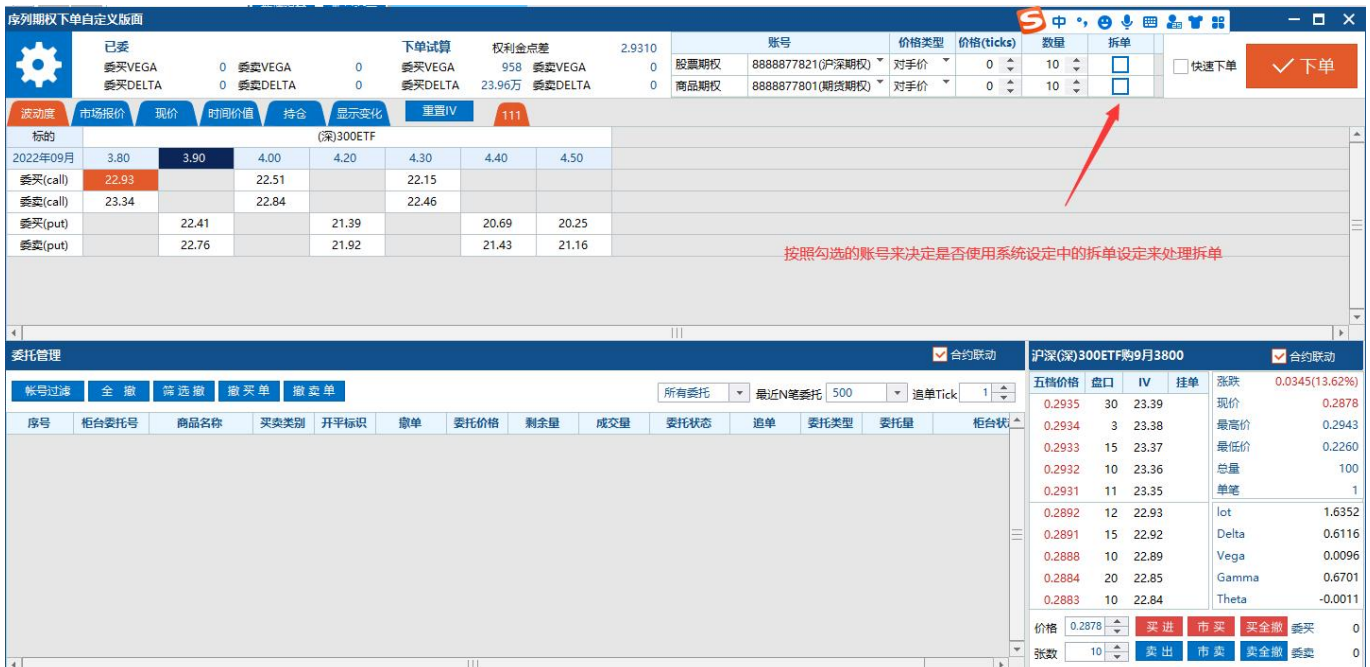
4.6.2 双击弹出闪电下单

1.在序列期权手动下单-自定义的界面中，如果页签为波动度，双击鼠标打开闪电下单时，默认为 VOL 单，否则双击打开闪电下单默认为“限价单”。



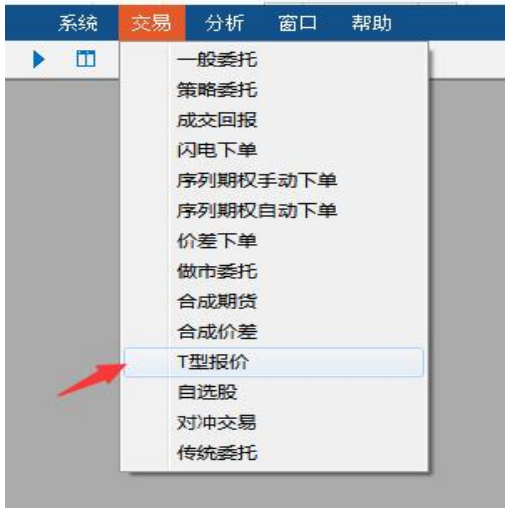
4.6.3 自定义界面增加拆单选项

通过按账号勾选指定使用系统拆单设置，触发拆单功能时将所有的拆单看做一个整体，重新下单时，将上一个拆单中的委托单，已经成交的不处理，已经挂单的做撤单处理，没有下单的取消掉。例如：使用序列期权手动下单，下单 100 手，拆单成 10 笔，每隔 1 秒下一笔，其中一笔已成交，挂单 3 笔，还有 6 笔待下。这时，重下一单，已挂的 3 笔撤单，剩余 6 笔取消掉。已成交的不处理



4.7 T 型报价

4.7.1 开启 T 型报价



使用者通过路径“交易/T型报价”可以打开T型报价。

4.7.2 添加标的

用户点击“添加标的”按钮，弹出标的选择的画面（与做市场画面“选择期权”相一致）

用户勾选需要的期权后，点击确定，则标签页上会增加新选择的期权。每个期权会带出可以交易的账号，切换期权标签时会自动切换账号

买价	卖价	交易	执行价	交易	买价	卖价
0.2699	0.2724	交易	1.80	交易	0.0014	0.0015
0.2207	0.2252	交易	1.85	交易	0.0023	0.0025
0.1723	0.1749	交易	1.90	交易	0.0045	0.0050
0.1283	0.1292	交易	1.95	交易	0.0089	0.0090
0.0864	0.0880	交易	2.00	交易	0.0173	0.0178
0.0533	0.0535	交易	2.05	交易	0.0323	0.0324

4.7.3 账号选择

T型报价界面的交易账号，所有的股票期权使用同一交易账号，所有的期货期权使用同一交易账号。如客户端未登录上次设定的账号，T型报价账号显示发生变化时，账号区域闪烁变色提示。人为操作则不提示

T型报价

添加标的 全部合约 栏位设置

50ETF-202207 (沪)300ETF-202212 (深)300ETF-202207 沪深300-202207 玉米-202209 8888887501(沪深期权)

标的	代码	交易	现价	涨跌	涨跌幅	买一价	卖一价	昨收价	昨结价	开盘价	最高价	最低价	现量	总量
50ETF	510050	交易	3.017	0.015	0.50%	3.017	3.018	3.002	--	3.022	3.039	3.010	300	1.48亿
3行权价合成期货	SE-510050-20	交易	3.0207	0.0167	0.56%	3.0203	3.0207	3.0040	3.0040	--	--	--	--	--

金额	涨幅	涨跌	状态	卖量	卖价	买量	买价	交易	执行价	交易	买价	买量	卖价	卖量	状态	涨跌	涨幅	金额	总量
68.77万	2.65	0.0121	连续交易	45	0.4718	3	0.4688	交易	2.55	交易	0.0005	171	0.0006	187	连续交易	0.0000	0.00	8843	1381
83.30万	4.10	0.0166	连续交易	53	0.4218	17	0.4192	交易	2.60	交易	0.0007	617	0.0008	94	连续交易	-0.0002	-20.00	30221	3471
56.52万	3.48	0.0124	连续交易	15	0.3719	3	0.3700	交易	2.65	交易	0.0011	121	0.0012	1	连续交易	-0.0002	-14.29	9995	878
101.31万	3.89	0.0119	连续交易	15	0.3228	45	0.3207	交易	2.70	交易	0.0019	35	0.0020	164	连续交易	-0.0005	-20.83	59099	3117
122.77万	4.62	0.0119	连续交易	2	0.2739	3	0.2725	交易	2.75	交易	0.0031	11	0.0032	200	连续交易	-0.0009	-21.95	11.80万	4135
809.09万	6.79	0.0143	连续交易	1	0.2260	1	0.2257	交易	2.80	交易	0.0057	126	0.0059	106	连续交易	-0.0015	-20.27	50.59万	9064
1462.28万	7.86	0.0131	连续交易	15	0.1806	43	0.1799	交易	2.85	交易	0.0098	6	0.0099	84	连续交易	-0.0023	-18.85	158.53万	16774
3453.43万	9.32	0.0117	连续交易	1	0.1378	8	0.1377	交易	2.90	交易	0.0173	21	0.0175	119	连续交易	-0.0041	-18.98	925.35万	55263
6343.70万	11.02	0.0099	连续交易	21	0.0999	5	0.0997	交易	2.95	交易	0.0291	4	0.0293	23	连续交易	-0.0060	-17.00	2024.27万	71494
9345.56万	13.00	0.0078	连续交易	10	0.0678	46	0.0676	交易	3.00	交易	0.0471	9	0.0473	62	连续交易	-0.0089	-15.89	5869.33万	129264
3882.48万	18.14	0.0041	连续交易	2	0.0268	23	0.0267	交易	3.10	交易	0.1055	53	0.1057	5	连续交易	-0.0126	-10.60	7143.51万	69864
554.69万	18.52	0.0015	连续交易	92	0.0097	12	0.0096	交易	3.20	交易	0.1881	15	0.1885	3	连续交易	-0.0140	-6.90	3480.89万	18877
65.18万	16.13	0.0005	连续交易	103	0.0037	223	0.0035	交易	3.30	交易	0.2818	15	0.2828	23	连续交易	-0.0152	-5.10	581.54万	2101
12.55万	0.00	0.0000	连续交易	94	0.0019	133	0.0018	交易	3.40	交易	0.3790	45	0.3809	23	连续交易	-0.0172	-4.32	68.91万	186
50178	-12.50	-0.0001	连续交易	50	0.0007	216	0.0006	交易	3.50	交易	0.4781	45	0.4810	66	连续交易	-0.0173	-3.47	15.78万	34

T型报价

添加标的 全部合约 栏位设置

50ETF-202207 (沪)300ETF-202212 (深)300ETF-202207 沪深300-202207 玉米-202209 8888887511(沪深期权)

标的	代码	交易	现价	涨跌	涨跌幅	买一价	卖一价	昨收价	昨结价	开盘价	最高价	最低价	现量	总量
50ETF	510050	交易	3.020	0.018	0.60%	3.019	3.020	3.002	--	3.022	3.039	3.010	16600	1.49亿
3行权价合成期货	SE-510050-20	交易	3.0216	0.0176	0.59%	3.0211	3.0216	3.0040	3.0040	--	--	--	--	--

金额	涨幅	涨跌	状态	卖量	卖价	买量	买价	交易	执行价	交易	买价	买量	卖价	卖量	状态	涨跌	涨幅	金额	总量
92.20万	2.79	0.0127	连续交易	45	0.4729	1	0.4710	交易	2.55	交易	0.0005	121	0.0006	207	连续交易	0.0000	0.00	8843	1381
83.30万	4.10	0.0166	连续交易	45	0.4230	5	0.4204	交易	2.60	交易	0.0007	616	0.0008	104	连续交易	-0.0002	-20.00	30221	3471
56.52万	3.48	0.0124	连续交易	15	0.3735	30	0.3712	交易	2.65	交易	0.0011	70	0.0012	1	连续交易	-0.0002	-14.29	9995	878
102.92万	5.52	0.0169	连续交易	15	0.3240	30	0.3220	交易	2.70	交易	0.0018	181	0.0019	45	连续交易	-0.0005	-20.83	60049	3167
123.32万	6.45	0.0166	连续交易	15	0.2755	1	0.2740	交易	2.75	交易	0.0029	140	0.0031	65	连续交易	-0.0011	-26.83	11.83万	4147
836.06万	7.74	0.0163	连续交易	20	0.2276	23	0.2263	交易	2.80	交易	0.0056	150	0.0057	20	连续交易	-0.0018	-24.32	50.74万	9091
1474.71万	8.76	0.0146	连续交易	20	0.1815	23	0.1805	交易	2.85	交易	0.0096	40	0.0097	23	连续交易	-0.0025	-20.49	159.26万	16848
3477.87万	10.35	0.0130	连续交易	20	0.1384	94	0.1377	交易	2.90	交易	0.0170	50	0.0172	91	连续交易	-0.0047	-21.76	932.48万	55676
6400.29万	12.03	0.0108	连续交易	15	0.1003	10	0.0998	交易	2.95	交易	0.0287	39	0.0290	93	连续交易	-0.0065	-18.41	2043.24万	72148
9451.39万	13.50	0.0081	连续交易	30	0.0682	153	0.0678	交易	3.00	交易	0.0466	30	0.0467	64	连续交易	-0.0095	-16.96	5956.86万	131123
3921.56万	19.47	0.0044	连续交易	10	0.0270	103	0.0268	交易	3.10	交易	0.1049	31	0.1054	132	连续交易	-0.0139	-11.69	7213.07万	70521
557.53万	19.75	0.0016	连续交易	10	0.0097	198	0.0096	交易	3.20	交易	0.1873	35	0.1880	25	连续交易	-0.0157	-7.74	3519.90万	19084
65.49万	19.35	0.0006	连续交易	105	0.0038	68	0.0036	交易	3.30	交易	0.2811	20	0.2823	23	连续交易	-0.0172	-5.77	585.78万	2116
12.64万	-5.26	-0.0001	连续交易	158	0.0019	53	0.0018	交易	3.40	交易	0.3784	15	0.3801	23	连续交易	-0.0172	-4.32	68.91万	186
50248	-12.50	-0.0001	连续交易	40	0.0007	193	0.0006	交易	3.50	交易	0.4774	45	0.4788	1	连续交易	-0.0173	-3.47	15.78万	34

4.8 价差交易

4.8.1 价差设定

开启“价差组合设定”画面

使用者通过路径“系统/交易参数/价差组合设定”；即可出现下面画面

增加组合

组合名称	A标的交易所	A标的名称	B标的交易所	B标的名称	价差计算方式	状态	编辑	删除
组合1	上海证券交易所	10000035	上海证券交易所	10000080	LOG(A/B)*1000	正常	编辑	删除
组合2	上海证券交易所	000016	中国金融期货交易所	IF1512	LOG(A/B)*1000	正常	编辑	删除

新增或编辑价差组合设定

按下“增加组合”可以跳出“价差编辑”画面，让使用者设定价差组合相关参数，需要设定的内容包含：组合

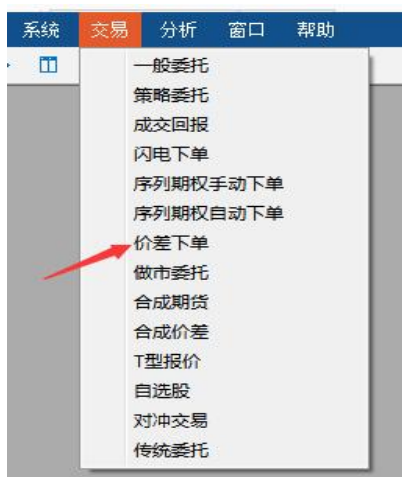
名称、A 商品、B 商品 (A B 商品的设定方式提供与闪电下单相同的商品选择功能, 让使用者选择), 各商品的商品单位 (AB 商品的比例关系), 编辑结束后, 按下确定, 则将所设定的”组合名称”、AB 商品名称、AB 商品单位数、价差组合关系式, 储存并显示在”价差组合设定”内。



4.8.2 价差下单

4.8.2.1 打开价差下单画面

使用者通过路径交易/价差下单, 即可进入价差下单页面



4.8.2.2 选择价差商品组合

在“价差组合”的选单中, 使用者可以选择要交易的价差组合(价差组合来源为“价差设定”内的组合内容)



4.8.2.3 单腿交易

在选定 A 商品, 仅点击“交易”按钮时跳出 A 商品账号下的“闪电下单”画面 (调用“闪电下单”功能模块)

在选定 B 商品, 仅点击“交易”按钮时跳出 B 商品账号下的“闪电下单”画面 (调用“闪电下单”功能模块)



4.8.2.4 调整组数

目前默认组数为 1 组，支持上下按钮调整和手动直接输入组数)

设定在画面上点选买进或卖出价差组合时的委托组数

4.8.2.5 默认价差 tick

由于价差商品价格是由使用者定义出来，因此价格上并非真实市场价格，因此需要设定“价差商品”的 tick 单位，使用者可以透过最小 tick 设定选定。

系统可以预设 A 商品与 B 商品的 TICK 单位换算%乘以 spread 商品价格当作预设 tick。

4.8.2.6 一般价差交易

使用者可以在“市场买”栏位中，点选买进，点选买进时，会依设定的“组数”、“委托单类型”、个商品的委托账号进行送单。

市场买	价格	市场卖
+	2152.8	+
+	2082.8	+
+	2012.8	+
+	1942.8	+
+	1872.8	+
+	1802.8	+
+	1732.8	+
+	1662.8	+
+	1592.8	+
+	1522.8	+
+	1452.8	+
+	1382.8	+
+	1312.8	+
+	1242.8	+

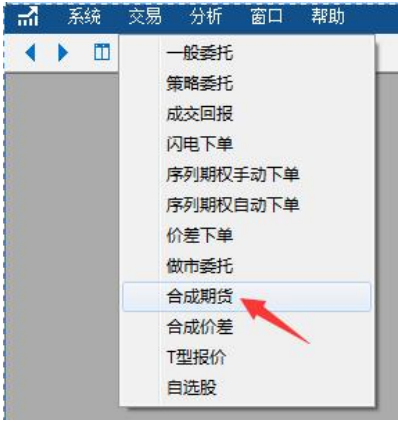
4.8.2.6 账号联动

增加“账号连接”按钮点击可关联 AB 商品账号。当账号为连接状态时，AB 两个商品的交易账号保持一致，改变其中一个交易账号，另一个交易账号也会改变。当 AB 商品两个是同类型商品时，“账号连接”的图标可用，当 AB 商品两个是不同类型商品时，“账号连接”图标显示为灰色断开状态，且不可连接。



4.9 合成期货

使用者通过“交易/合成期货”路径进入合成期货界面，如下图：



用户可选择市场、标的、无风险利率、账号（买卖账号下拉可支持账号组，需在账号组设置设定规则）、期权月份确定需要合成的期货，然后依自己需要对合约进行排序，选择盘口深度。

用户选中需要合成的期货，点击买进或卖出按钮，或者勾选启用快速下单情况下，敲键盘回车键快速买卖。

合约	买量	买价	卖价	卖量
2.2500	4	2.3094	2.3103	9
2.1500	1	2.3108	2.3119	10
2.3500	2	2.3093	2.3114	6
2.2000	2	2.3077	2.3104	5
2.3000	1	2.3079	2.3089	2
1.8500	1	2.3073	2.3112	1
1.9000	1	2.3054	2.3114	1
1.9500	1	2.3090	2.3118	1
2.0000	1	2.3067	2.3112	1
2.0500	1	2.3085	2.3108	1
买(SF)			卖(SF)	

商品 执行价@2.3000

使用者买入卖出合成期货后，可以通过风险统计区查看成交的 Delta 金额与未成交 Delta 金额，还可以对未成交部分进行追价成交。

自动合约：

使用者可进行是否自动合约选择，勾选后启用，可以设定 Delta 区间绝对值最小值、绝对值最大值，合约选择

方式：流动性、最佳买、最佳卖



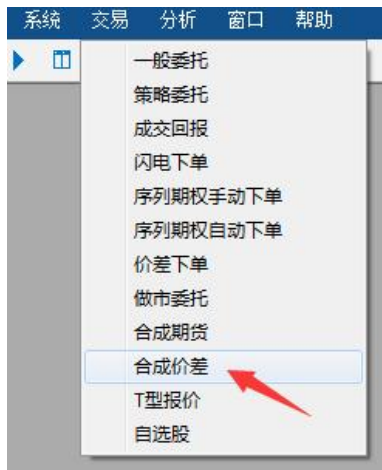
账号联动：

增加一个“账号连接”图标，当图标处于不连接的状态时，买交易账号和卖交易账号都可以分别设置。点击“账号连接”图标，当图标处于连接的状态时，买交易账号可以设置，卖交账号信息和买交易账号保持一致、且显示为灰色不可设置状态。



4.10 合成价差

用户通过“交易/合成价差”路径进入，会弹出合成价差视窗：



用户选择“市场”和“标的名称”后，系统会带出“期权”“期权账号”“对冲”“对冲账号”，期权默认为当月，对冲默认为标的，比如 50ETF 期权默认为 50ETF，并设定无风险利率。用户可以依自己需要对合约进行排序。

合成价差交易

市场: 上海证券交易所 标的名称: 50ETF

期权: 202107 期权账号: 8888886801(沪深)

对冲: 50ETF 对冲账号: 8888886801(股票)

标的价格: 3.571 涨跌: -0.022(-0.61%) 无风险利率: 0.00 %

对冲价格: 3.571 涨跌: -0.022(-0.61%) 价差(%): 0.00(0.00%)

盘口深度: 一档盘口 合约排序: 最佳买 更新 置中

用户可以选择存在套利机会的合成价差（紫色背景），点击买进或卖出按钮，或者勾选启用快速下单情况下，敲键盘回车键实现快速卖买。程序为了实时跟踪最佳买卖价格，最高买价与最低卖价分别用红色与绿色标出。

合约	买量	买价	卖价	卖量
50ETF	62500	2.319	2.320	109600
2.2500	4	-0.0106	-0.0087	6
2.1500	1	-0.0092	-0.0071	6
2.3500	2	-0.0107	-0.0076	6
2.2000	2	-0.0123	-0.0086	5
2.3000	1	-0.0121	-0.0101	2
1.8500	1	-0.0127	-0.0078	1
1.9000	1	-0.0146	-0.0076	1
1.9500	1	-0.0110	-0.0072	1
2.0000	1	-0.0133	-0.0078	1
2.0500	1	-0.0115	-0.0082	1
2.1000	1	-0.0101	-0.0077	1
2.4000	1	-0.0100	-0.0073	1
买(对冲)			卖(对冲)	

使用者买入卖出合成价差后，可以通过风险统计区查看成交的 Delta 金额与未成交 Delta 金额，还可以对未成交部分进行追价成交。

成交delta(L) 未成交delta(L)

0 0

未成交追价

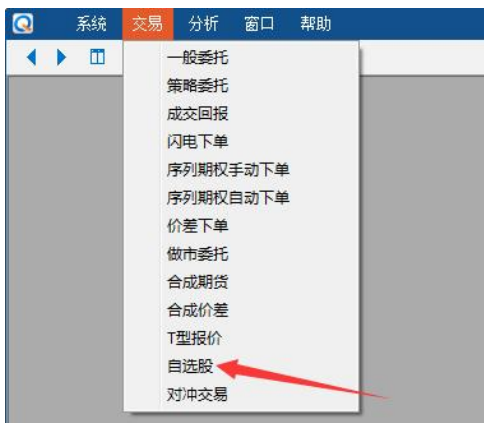
对冲追价: 1

期权追价: 1

4.11 自选股监控

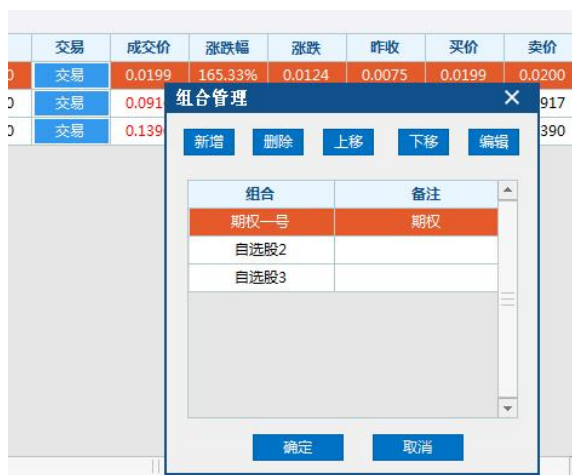
4.11.1 进入自选股

使用者通过路径“交易/自选股”进入自选股的画面。



4.11.2 组合管理

用户可以点击“组合管理”按钮，会弹出以下窗口来设定组合：



用户可以新增、删除、调整组合的顺序。

4.11.3 自选管理

用户可以对各个组合内的自选股进行加入、删除、上移、下移、全加等操作。用户双击商品可以实现加入自选，双击组合中的自选股可以实现将该商品移除自选组合。



4.11.4 删除组合、删除自选股

组合内的自选股，用户可以复选多个自选股，点击删除自选股按钮即可将选中的自选股从组合中删除；对于鼠标选定的组合，点击删除组合即可将该组合删除。

自选股---期权一号

组合管理 自选管理 **删除组合** **删除自选股** 警示设定

期权一号 自选股2 自选股3

<input type="checkbox"/>	商品代码	商品名称	交易	成交价	涨跌幅	涨跌	昨收
<input checked="" type="checkbox"/>	10000346	50ETF购3月2200	交易	0.0199	165.33%	0.0124	0.0075
<input checked="" type="checkbox"/>	10000376	50ETF购3月2100	交易	0.0916	69.63%	0.0376	0.0540
<input type="checkbox"/>	10000375	50ETF购3月2050	交易	0.1390	44.79%	0.0430	0.0960

4.11.5 监控

用户点击所需要监控的商品，点击警示设定，即弹出以下画面让用户设定警示条件。

警示设定

价格 警示上限 警示下限

涨跌幅 警示上限 % 警示下限 %

最新单笔 成交量

确定 取消

4.11.6 闪电交易

用户点击每一行的交易，即可弹出闪电下单进行交易。

期权一号 自选股2 自选股3

<input type="checkbox"/>	商品代码	商品名称	交易	成交价	涨跌幅	涨跌
<input checked="" type="checkbox"/>	10000346	50ETF购3月2200	交易	0.0199	165.33%	0.0124
<input checked="" type="checkbox"/>	10000376	50ETF购3月2100	交易	0.0916	69.63%	0.0376
<input type="checkbox"/>	10000375	50ETF购3月2050	交易	0.1390	44.79%	0.0430

4.12 无可用账号交易界面

价差下单

下单设置

商品A 商品B

A商品账号 交易

价差组合 组数

委托类型 间隔

价差置中 自动置中

自买	市场买	价格	市场卖	自卖
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---

当所有交易模块界面突然出现边框为红色状态，如上图所示，则表示该交易模块功能目前无可用账号状态，需要重新设置账号登录，边框显示为蓝色状态则表示账号正常。

4.13 策略下单

提供批量策略一键下单功能，客户根据需要可以创建任意组合的策略满足一键下单的需求

策略名称	拆单	价格类型	下单组数	送出	策略理论价	策略买价	SDelta	1%Gamma
全部策略					84,592.4202	04,852.8135	232,592,724	-78,80
韩式策略11月2800	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	0
垂直价差2750-2	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	0
未命名	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	0
未命名_1	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	0
总持仓避险批单	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	0
总持仓避险单	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	660,493.750	555,597.100	970,186,613	
未命名_2	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0479	0.0595	123	-43
日限价订单避险单	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	351,245.50	351,509.00	351,246	
日限价订单避险单	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	351,245.50	351,509.00	351,246	
日限价订单避险单	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	351,245.50	351,509.00	351,246	
总持仓避险单_1	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	444,089.300	204,377.100	157,467,509	
未命名_3	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0479	0.0595	123	-43
总持仓避险单_2	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	405,284.400	277,899.900	384,885,476	
未命名_4	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0479	0.0595	123	-43
总持仓避险单_3	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	28,461.6139	21,505.8920	721,107,231	-77.43

4.13.1 批量导入

使用者点击批量导入，可以选择多个导出的策略文件，导入成为新的策略

序号	策略名称	拆单	价格类型	下单组数	送出	策略理论价	策略买价	SDelta	1%
	全部策略					30,116.9116	31,151.9607	7,358,634	
1	123	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0116	0.0116	-2,943	
2	111	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0942	0.0948	-22,894	
3	123_0001	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.1258	0.1261	-19,644	
4	123_0001_0001	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.2346	0.2353	-9,917	
5	123_0002	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.2346	0.2353	-9,917	
6	123_0003	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0942	0.0948	-22,894	
7	1111111	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	21.9585	21.9800	3,699,807	
8	2222222	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0405	0.0407	-16,389	
9	test01	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.1491	0.1491	-17,536	
10	test01_0001	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.1491	0.1491	-17,536	
11	test1	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	28,205.2554	29,231.0001	2,387,322	
12	test21	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.2440	0.2438	15,735	
13	test123	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	472.1	474.4	348,860	
14	test123_0001	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	472.1	474.4	348,860	
15	test123_0002	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	472.1	474.4	348,860	
16	test123_0002_000	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	472.1	474.4	348,860	

4.13.2 全部导出

①使用者点击全部导出，导出全部策略文件

策略下单

我的策略 批量导入 全部导出 新增策略 拆单设定 帐号设定 下单档位设定

序号	策略名称	拆单	价格类型	下单组数	送出	策略理论价	策略买价	SDelta	1%
全部策略									
1	123	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0117	0.0117	-2.960	
2	111	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0948	0.0951	-23.067	
3	123_0001	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.1264	0.1267	-19.752	
4	123_0001_0001	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.2346	0.2348	-10.261	
5	123_0002	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.2346	0.2348	-10.261	
6	123_0003	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0948	0.0951	-23.067	
7	111111	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	21.7845	21.8300	3,688,531	
8	222222	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.0410	0.0411	-16.557	
9	test01	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.1500	0.1503	-17.603	
10	test01_0001	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.1500	0.1503	-17.603	
11	test1	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	28,175.6929	29,203.3971	2,385,936	
12	test21	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0.2436	0.2438	15.653	
13	test123	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	469.4	472.0	347,681	
14	test123_0001	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	469.4	472.0	347,681	
15	test123_0002	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	469.4	472.0	347,681	
16	test123_0002_0001	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	469.4	472.0	347,681	

②使用者可根据选择选一条单个策略，“导出”单个策略文件

策略下单

我的策略 批量导入 全部导出 新增策略 拆单设定 帐号设定 下单档位设定

序号	1%SGamma	SVega	STheta	SVanna	SVomma	修改	删除	账号	导出
1	313,144	4,528	-2,758	-835	250				
1	634	20	-6	-3	1	编辑	删除	设置	导出
2	4,579	82	-31	-5	1	编辑	删除	设置	导出
3	3,311	91	-22	-3	0	编辑	删除	设置	导出
4	9,732	132	-67	-16	3	编辑	删除	设置	导出
5	9,732	132	-67	-16	3	编辑	删除	设置	导出
6	4,579	82	-31	-5	1	编辑	删除	设置	导出
7	191,663	1,918	-1,455	-495	133	编辑	删除	设置	导出
8	5,227	50	-36	-9	2	编辑	删除	设置	导出
9	1,609	125	-13	-4	1	编辑	删除	设置	导出
10	1,609	125	-13	-4	1	编辑	删除	设置	导出
11	15,860	277	-377	-50	19	编辑	删除	设置	导出
12	1,920	76	-15	-5	1	编辑	删除	设置	导出
13	15,672	354	-156	-55	21	编辑	删除	设置	导出
14	15,672	354	-156	-55	21	编辑	删除	设置	导出
15	15,672	354	-156	-55	21	编辑	删除	设置	导出
16	15,672	354	-156	-55	21	编辑	删除	设置	导出

4.13.3 新建策略

方法一：选择任意策略组合进行加入

策略管理

市场类别 上海证券交易所 商品标的 50ETF 策略名称

商品类型	认购-月份				执行价	认沽-月份			
	9	6	3	2		2	3	6	9
全部	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.455A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
期权	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.504A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
基金	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.553A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
指数	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.602A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
股票	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.650	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.651A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.700	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.700A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.749A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	2.750	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.798A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.800	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2.847A	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

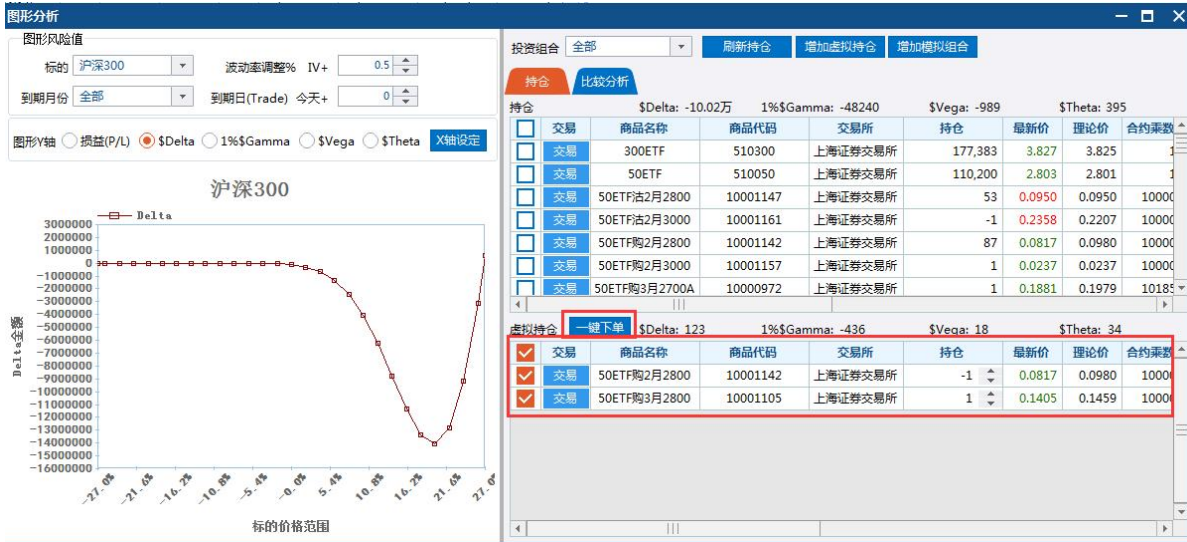
商品过滤

策略名称	商品代码	商品名称	数量	状态
	10001129	50ETF购3月2750	1	正常
	10001141	50ETF购2月2750	1	正常
	10001138	50ETF沽3月2700	1	正常

全加 加入 删除 上移 下移

确定 取消

方法二：通过图形分析的虚拟持仓分析加入新策略，新策略名称默认为：未命名



方法三、策略监控的反向下单按钮生成反向下单策略

删除	反向下单	拆单	策略下单时间	策略名称	展开	商品名称	状态	策略成本价	策略理论价	策略卖价	买卖	浮动盈亏
			2018-02-05 16:06:24	未命名_4	展开		正常	0.0193	0.0479	0.0588		
			2018-01-30 11:07:39	未命名_3	展开		正常	0.0200	0.0479	0.0588		
			2018-01-25 11:17:35	未命名_2	展开		异常	0.0952	0.1917	0.2352		1
			2018-01-25 11:17:35	未命名_2	展开		正常	0.0237	0.0479	0.0588		
			2017-12-01 14:14:54	总持仓避险批次单	展开		异常	--	--	--		
			2017-12-01 14:14:25	总持仓避险批次单	展开		异常	716,220.648	675,341.684	675,253.392		-40
			2017-11-14 15:52:04	垂直价差2750-2	展开		异常	--	--	--		
			2017-11-14 15:52:00	垂直价差2750-2	展开		异常	--	--	--		

方法四、总持仓分析选择依标的的统计时，点击一键下单生成总持仓避险策略单

方法五、今日 OTC 订单点击一键下单生成自动避险单

今日OTG订单信息										
今日限价订单	今日收盘价订单	今日到期订单	今日平仓订单	一键避险	合计栏位设定	明细栏位设定				
标的	标的价格	标的涨跌幅%	\$Delta	1%\$Gamma	0.1%\$Gamma	\$Vega	\$Theta	Delta张数	避险商品	避险数量
合计	--	--	0	0	0	0	0	--	--	--

明细数据										
订单编号	审核时间	商品代码	商品名称	期权类型	起始日	买卖方向	成交数量	权利金	标的	标的参考价

4.13.4 拆单设定

设置好拆单规则，当送出策略委托时，勾选拆单复选框，将自动按照拆单规则进行拆单处理。

策略下单

我的策略 新增策略 拆单设定 帐号设定 下单栏位设定

序号	策略名称	拆单	价格类型	下单组数	送出	策略
全部策略						
1	bspd	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	1
2	50etf-4400	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
3	郑州棉花	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
4	上海金	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
5	深300	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
6	深3004700	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
7	大连玉米	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
8	账号组测试	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
9	tt	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
10	test2	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	
11	test3	<input checked="" type="checkbox"/>	对手价	1	送出	

拆单设定

期权拆单

单笔委托超过 张自动拆单

单笔上限: 张 单笔下限: 张

送出委托 笔停止 秒

期货拆单

单笔委托超过 张自动拆单

单笔上限: 张 单笔下限: 张

送出委托 笔停止 秒

股票基金拆单

单笔委托超过 股自动拆单

单笔上限: 股 单笔下限: 股

送出委托 笔停止 秒

策略是否默认拆单 保存 取消

4.13.5 帐号设定

不同交易所组合单下单的帐号配置，将依据设定的帐号或设定的帐号组下单到不同的帐号中。送出委托前请检查送出的帐号配置以及帐号组设置的配置

帐号设定

上交所股票	8888886801(股票)
上交所期权	8888886801(股票)
深交所股票	8888886811(股票)
深交所期权	8888886821(股票)
中金所期货	8888886801(期货期权)
中金所期权	8888886801(期货期权)
上期所期货	8888886801(期货期权)
上期所期权	8888886801(期货期权)
大商所期货	8888886801(期货期权)
大商所期权	8888886801(期货期权)
郑商所期货	8888886801(期货期权)
郑商所期权	8888886801(期货期权)
能交所期货	8888886801(期货期权)
能交所期权	8888886801(期货期权)

保存 取消

4.13.6 下单步骤

步骤 1、选择送出的价格类型，可以按照对手价、本方价、买卖五档价格或者涨跌停价或市价进行送单。

策略名称	拆单	价格类型	下单组数	送出	策略理论价	策略买价	\$Delta	1%\$Gamma
全部策略					84,592.4202	04,852.8135	232,592,724	-78,80
美式策略11月280	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	
垂直价差2750-2	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	
未命名	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	
未命名_1	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	
总持仓避险批次单	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	0	0	0	
总持仓避险单	<input type="checkbox"/>	对手价	1	送出	660,493.750	555,597.100	970,186,613	

步骤 2：勾选是否拆单、并调整下单组数，点击送出送出委托单

步骤 3、查看右侧下单序列，对下单组合进行价格调整

总持仓避险单_3
(14:56:39 未执行)

全部下单 全部撤单 全部追价 追单Tick: 1

合计 \$Delta: -19,721,107 1%\$Gamma: -77,495 \$Vega: -1,137 \$Theta: 3,176

商品名称	价格类型	价格	买卖	数量	送单时间	已成交	未成交
黄豆1号1803	对手价	3161	卖	624486	0秒	0	624486
180ETF	对手价	3.332	买	9993800	0秒	0	9993800
铝1803	对手价	14105	买	93	0秒	0	93
ag1803	对手价	3508	卖	86	0秒	0	86
上海机场	对手价	44.25	卖	33600	0秒	0	33600
50ETF购2月3100	对手价	0.0120	卖	116	0秒	0	116
300ETF	对手价	3.824	卖	177400	0秒	0	177400

步骤 4、点击全部下单进行一键委托，未成交部分可以进行再次下单或撤单，追单的操作

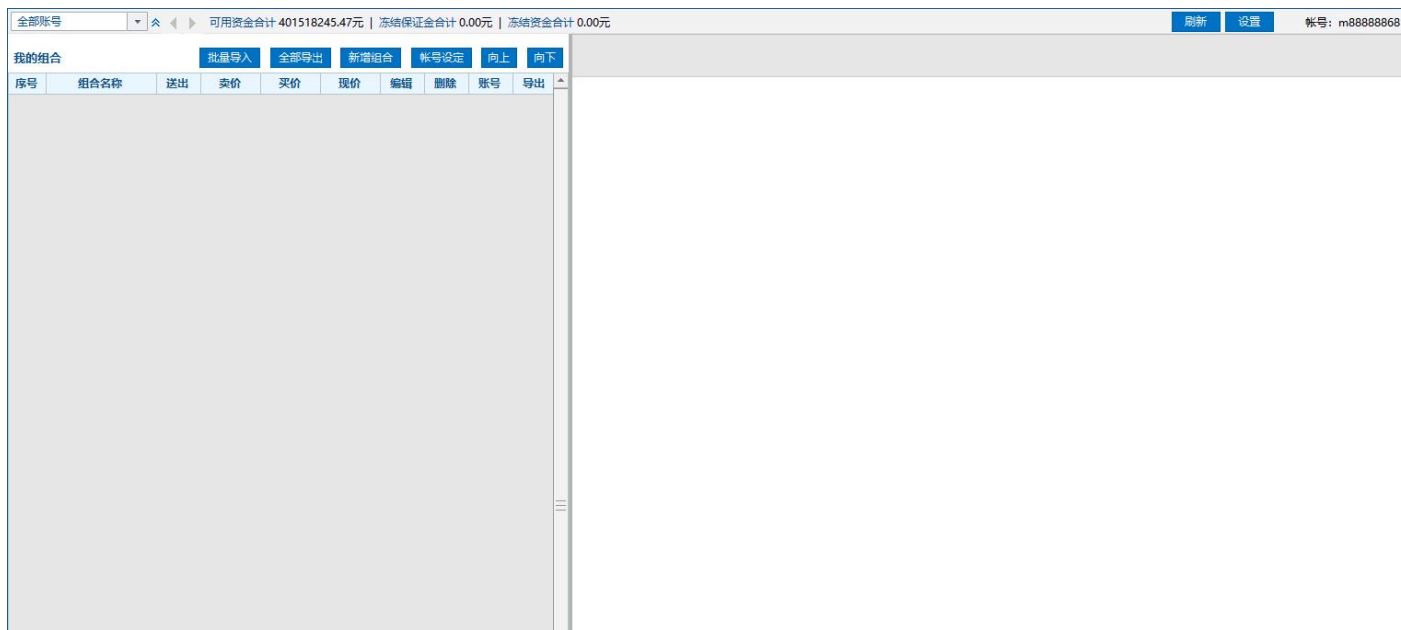
全部下单 全部撤单 全部追价 追单Tick 1

合计 \$Delta: -19,721.10' 1%\$Gamma: -77,495 \$Vega: -1,137 \$Theta: 3,176

商品名称	价格类型	价格	买卖	数量	送单时间	已成交	未成交	委托状态	现价	成交均价	撤单	再下单	追价
大豆1号1803	对手价	3161	卖	624486	0秒	624486	0	全部成交	3162	3161	撤单	再下单	追价
180ETF	对手价	3.332	买	9993800	0秒	9993800	0	全部成交	3.326	3.332	撤单	再下单	追价
铝1803	对手价	14105	买	93	0秒	93	0	全部成交	14100	14105	撤单	再下单	追价
ag1803	对手价	3508	卖	86	0秒	86	0	全部成交	3608	3508	撤单	再下单	追价
上海机场	对手价	44.25	卖	33600	0秒	33600	0	全部成交	44.22	44.25	撤单	再下单	追价
50ETF购2月3100	对手价	0.0120	卖	116	0秒	0	116	委托成功	0.0121	--	撤单	再下单	追价
300ETF	对手价	3.824	卖	177400	0秒	0	177400	委托失败	3.827	--	撤单	再下单	追价
ni1803	对手价	93430	卖	5	0秒	5	0	全部成交	98590	93430	撤单	再下单	追价
工商银行	对手价	6.66	卖	51900	0秒	51900	0	全部成交	6.68	6.66	撤单	再下单	追价
聚乙烯1803	对手价	9230	卖	5	0秒	0	5	委托成功	9230	--	撤单	再下单	追价
50ETF	对手价	2.801	买	78500	0秒	78500	0	全部成交	2.803	2.801	撤单	再下单	追价
铁矿石1803	对手价	491.0	卖	3	0秒	3	0	全部成交	494.0	491.0	撤单	再下单	追价
豆粕1803	对手价	2793	卖	4	0秒	4	0	全部成交	2806	2793	撤单	再下单	追价
棉纱803	对手价	22550	卖	1	0秒	0	1	委托成功	22550	--	撤单	再下单	追价
皖通高速	对手价	10.39	卖	7100	0秒	7100	0	全部成交	10.39	10.39	撤单	再下单	追价
华能国际	对手价	5.82	卖	3000	0秒	3000	0	全部成交	5.82	5.82	撤单	再下单	追价

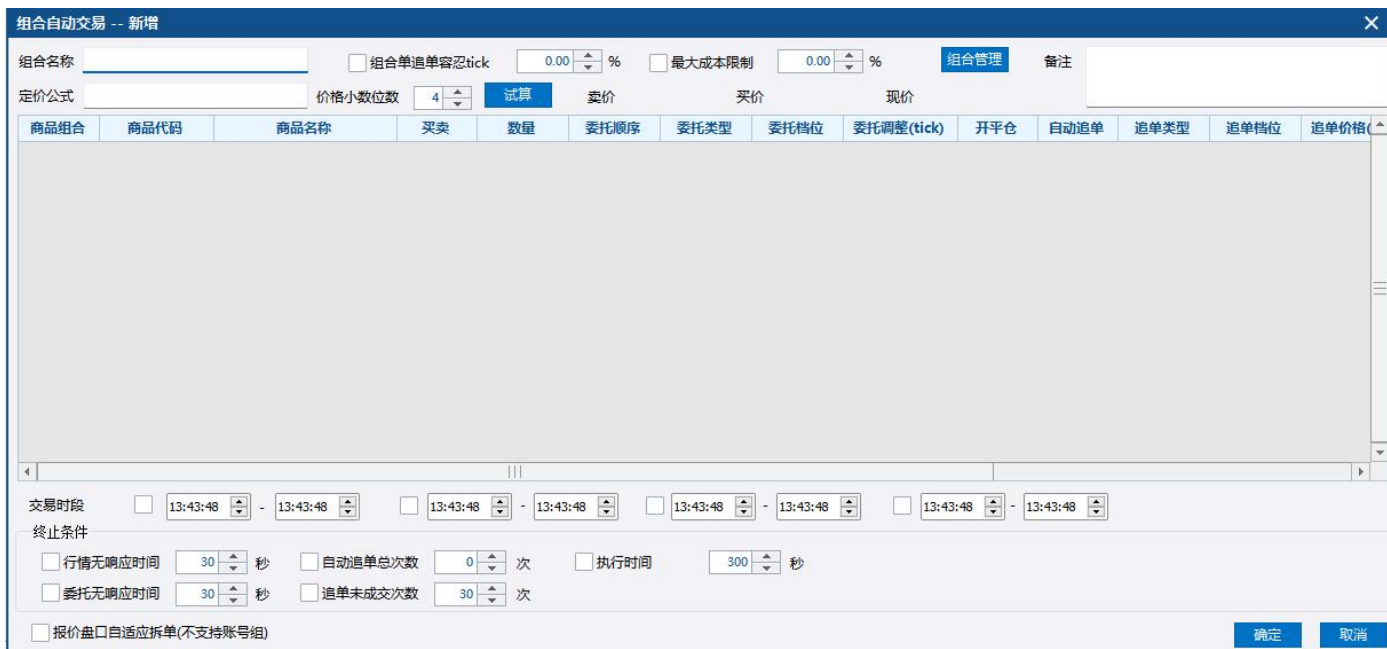
4.14 组合自动交易

使用者在工具列上选择“交易/组合自动交易”，即可打开组合自动交易画面，如下图所示：



4.14.1 新增组合

点击“新增组合”，弹出弹窗：



4.14.2 账号设定

点击“账号设定”弹出弹窗，选择不同交易所、组合下单的账号配置，将依据设定的账号或设定的账号组下单到不同的账号中，按照设定的账号进行交易。送出委托前请检查送出的账号配置以及账号组设置的配置



4.14.3 新增组合

在新增组合自动交易界面下：

(1) 使用者手动输入“组合名称” ，已建组合编辑可修改未送出组合的组合名称

(2) 点击 组合管理弹出视窗，选择任意商品加入组合：



(3) 设定定价公式 **定价公式**

(4) 设定调整 **价格小数位数** 价格小数位数设定

(5) 组合具体商品参数说明及设定:



- 1) 商品组合栏位依次用 A、B、C... 表示每一个商品（主要用于定价公式）
- 2) 买卖栏位点击下拉按钮选择设定买卖方向
- 3) 数量栏位点击上下调整按钮设定商品委托数量
- 4) 委托顺序栏位点击上下调整按钮设定顺序
- 5) 委托类型栏位点击下拉按钮设定下单委托时使用的价格类型，本方价、对手价、理论价
- 6) 委托档位栏位点击下拉按钮设定下单委托时使用的价格类型的档位
- 7) 委托调整（tick）栏位点击上下调整按钮设定“+”“-” tick（委托时由价格类型+价格档位确定基准价格，在基准价格的基础上再进行调整）
- 8) 开平仓栏位点击下拉按钮设定下单（委托或追单）时决定开、平仓标志、自动标志
- 9) 自动追单栏位勾选是否自动追单
 - ①勾选，则后面的选项会启用
 - ②不勾选，系统则不进行追单逻辑
- 10) 追单类型栏位点击下拉按钮设定设定追单时使用的价格类型，本方价、对手价、理论价
- 11) 追单档位栏位点击下拉按钮设定追单时使用的价格类型的档位
- 12) 追单价格（tick）栏位点击上下调整按钮设定“+”“-” tick（追单时由价格类型+价格档位确定基准价格，在基准价格的基础上再进行调整），设定 0 为不启用

13) 追单容忍 tick 栏位点击上下调整按钮设定 “+” “-” tick, 设定 0 为不启用

14) 追单时间 (秒) 栏位点击上下调整按钮设定追单时间 (上一次下单距离现在已经超过了设置的时间 (秒), 且没有全部成交) 则触发追单, 设定 0 为不启用

15) 追单次数限制栏位点击上下调整按钮设定追单次数限制, 触发追单后, 再次对追单次数进行检查, 如果该商品总的追单次数超过了该设置, 则不进行追单, 设定 0 为不启用

16) 追单价差保护栏位点击上下调整按钮设定追单价差保护, 触发追单后, 检查该商品的市场盘口, 如果超过了该设置, 则不进行追单, 设定 0 为不启用

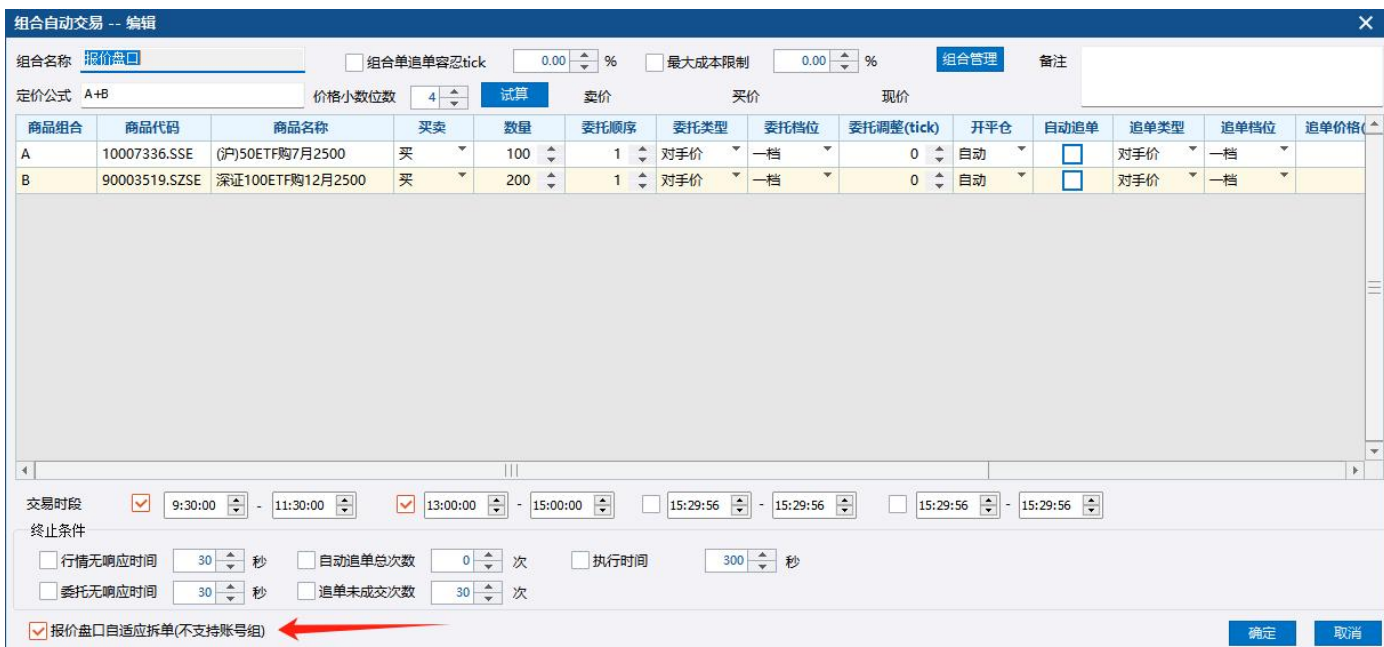
17) 自动组合交易中盘口自适应拆单。作用: 在自动交易策略中将同一批次的多个商品按市场盘后可以容纳的最大量进行下单:

具体计算方法为: 将同一批次中所有商品的盘口量/剩余量, 大于 1 的话取值为 1, 选择比值最小值, 将所有商品乘以这个比值 4 舍 5 入后作为下单量。

例如: 组合中有商品 A 100 张, 商品 B 200 张, 他们的最小比例是 1:2。

如果当前盘口商品 A 对手盘口为 2, 商品 B 对手盘口为 2, 那么当前报单商品 A 1 张, 商品 B 2 张。

商品 A 对手盘口为 50, 商品 B 对手盘口为 80, 那么当前报单商品 A 40 张, 商品 B 80 张。



(6) 组合追单容忍 tick 设定:

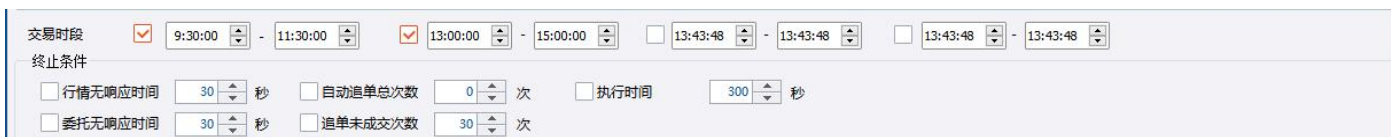
用户可选择决定是否设定组合追单容忍 TICK, 组合追单容忍 tick 0.00 % 勾选设定则当组合价格变化超过该值则触发追单; 不勾选设定则不做处理

(7) 最大成本限制设定: 用户可选择决定是否设定最大成本限制 最大成本限制 0.00 % 勾选设定则当下单时 (委托或追单) 重新计算组合价格, 超过此价格时不下单等待; 不勾选设定则不处理

(8) 点击 **试算** 按钮, 用户可查看根据输入的定价公式及组合商品, 界面试算出的卖价、买价、现价

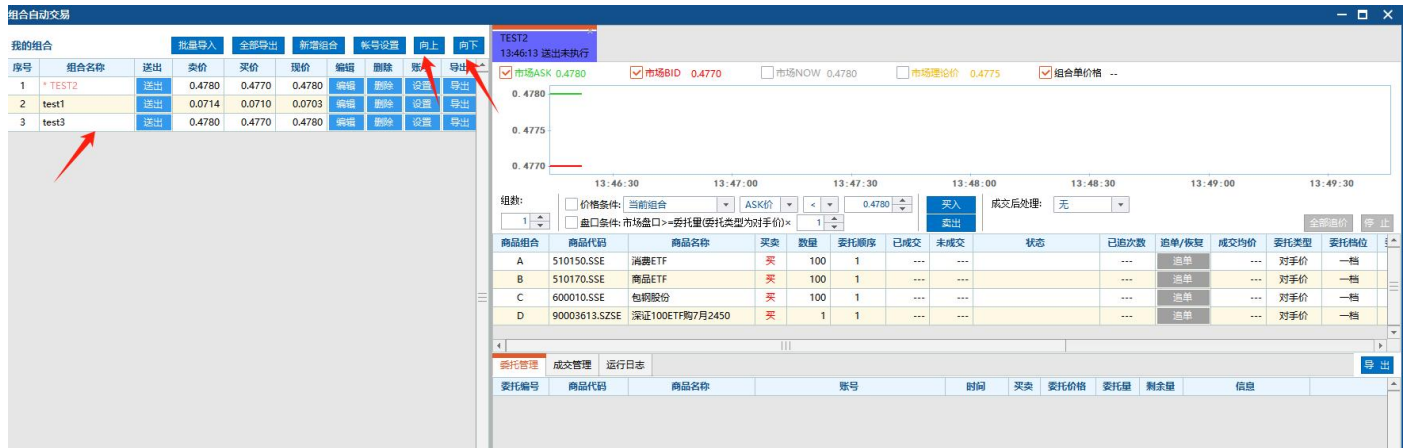
(9) 点击备注文本框用户能自由编辑输入备注

(10) 交易时段设定, 用户自行选择要交易的时间段及终止条件设定



4.14.4 组合顺序支持调整

点击向上、向下按钮可以调整组合顺序



4.14.5 全部导出

①使用者点击全部导出，导出全部组合文件



②使用者可根据选择选一条单个组合，“导出”单个组合文件

组合自动交易									
我的组合		批量导入	全部导出	新增组合	帐号设定	向上	向下		
序号	组合名称	送出	卖价	买价	现价	编辑	删除	帐号	导出
1	*test111	送出	0.0401	0.0399	0.0399	编辑	删除	设定	导出
2	111	送出	0.3179	0.3117	0.3109	编辑	删除	设定	导出
3	1112	送出	0.3179	0.3117	0.3109	编辑	删除	设定	导出

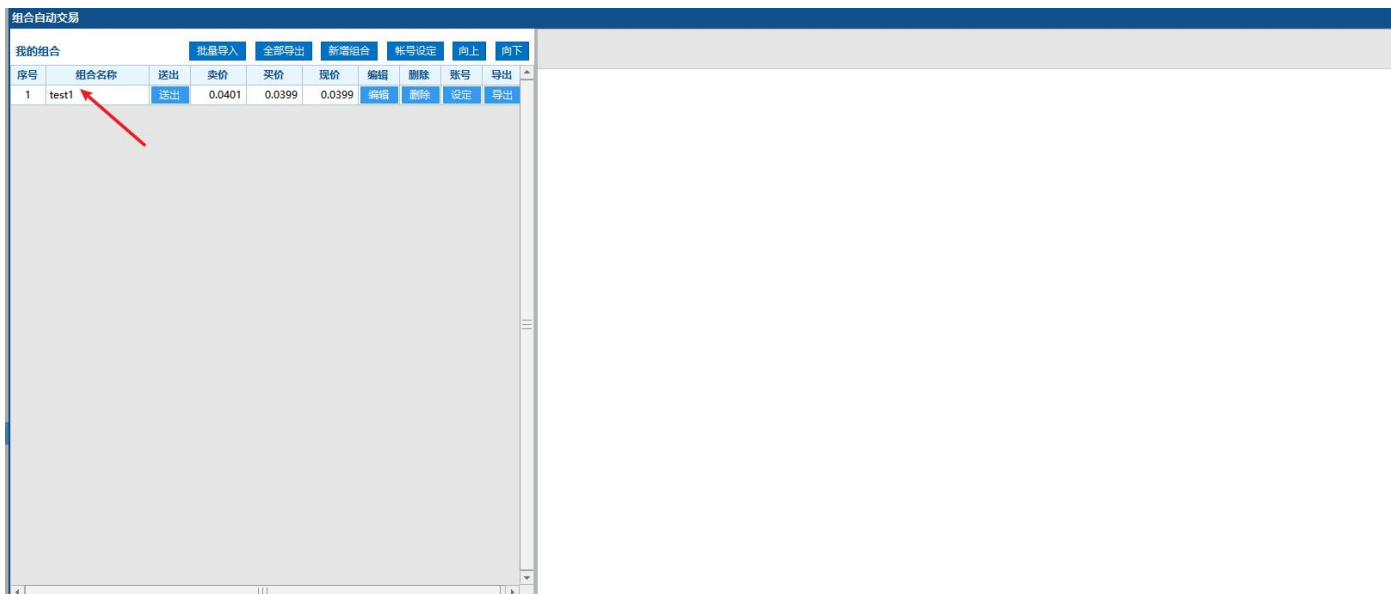
4.14.6 批量导入

使用者点击批量导入，可以选择多个导出的组合文件（修改组合文件内的组合名称），导入成为新的组合

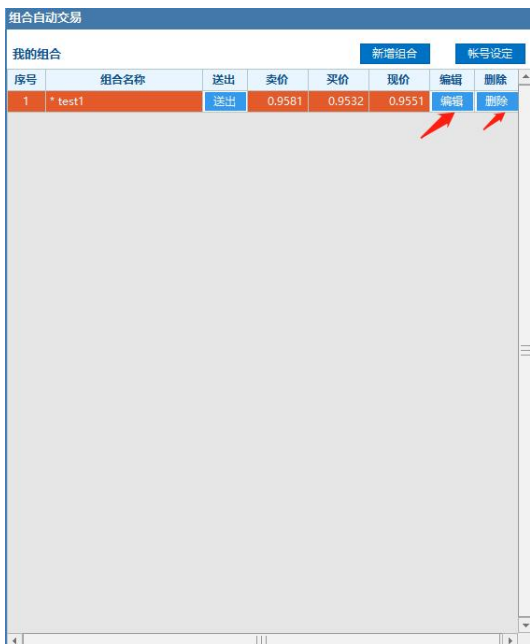
组合自动交易									
我的组合		批量导入	全部导出	新增组合	帐号设定	向上	向下		
序号	组合名称	送出	卖价	买价	现价	编辑	删除	帐号	导出
1	*test111	送出	0.0401	0.0399	0.0399	编辑	删除	设定	导出
2	111	送出	0.3179	0.3117	0.3109	编辑	删除	设定	导出
3	1112	送出	0.3179	0.3117	0.3109	编辑	删除	设定	导出

4.14.7 组合交易下单功能及监控管理操作

设定完成后点击“确定”，组合自动交易新增窗口关闭，界面新增组合显示如下画面：

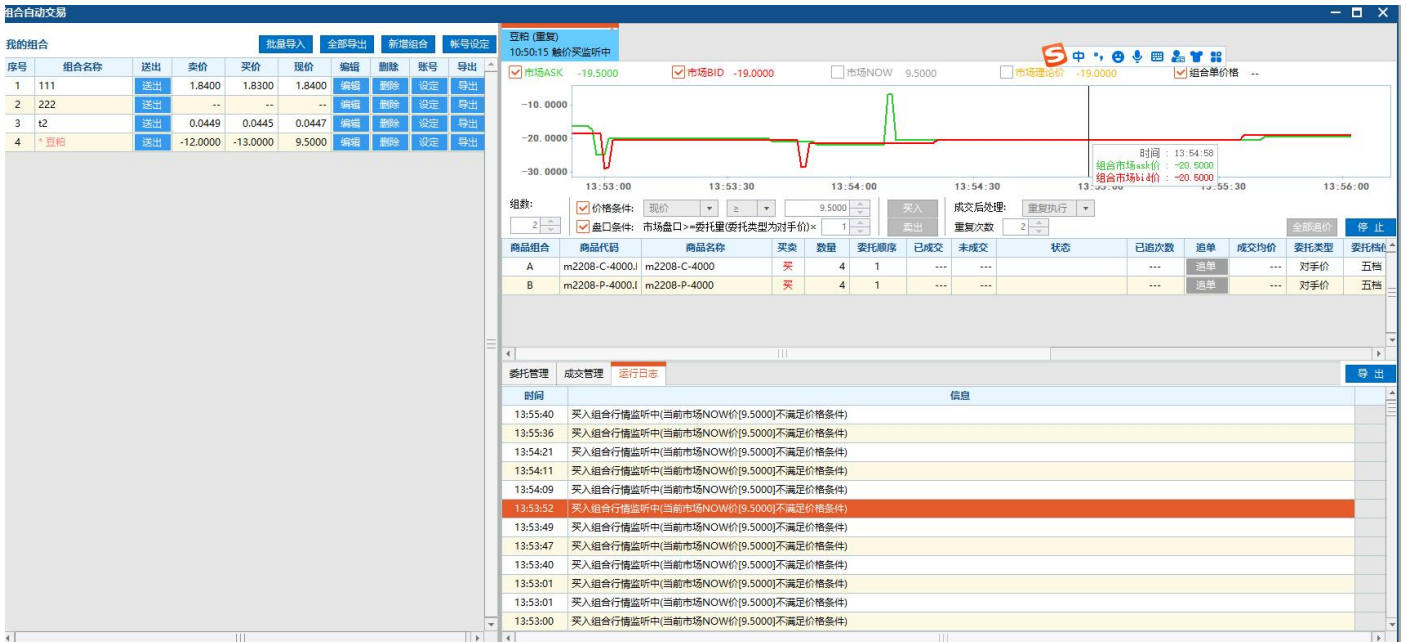


在我的组合界面，用户可进行编辑、删除组合操作



4.14.7.1 送出组合单：

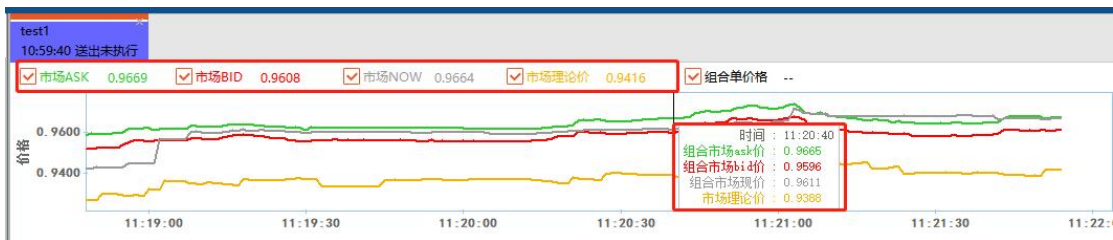
选择组合点击“送出”按钮，界面如下图所示：



4.14.7.2 组合价格监控图：

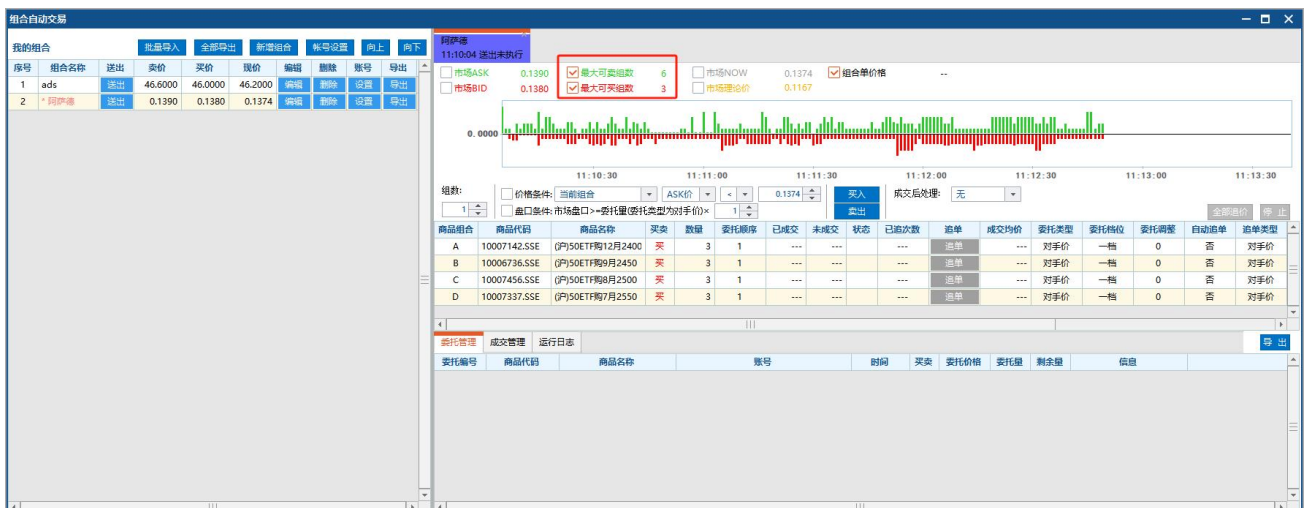
①组合价格监控图显示，监控图可选择组合市场 ASK 价格曲线、组合市场 BID 价格曲线、组合市场 NOW 价格曲线、组合市场理论价格曲线、勾选 CheckBox 则展示

②点击曲线界面显示具体的信息框，信息框显示根据勾选的监控图显示



③监听数据中增加买量，卖量

组合自动交易监听数据中增加买量，卖量显示目前最大可以下单的组数。



例如，组合中有需要买入商品 A，1 手，商品 B，2 手，商品 C，100 手，市场当前行情商品 A 的对手盘位 5 手，商品 B，5 手，商品 C，300 手，那么组合最大可以买入 2 组，市场 ask 显示 2

4.14.7.3 组合交易执行功能区：

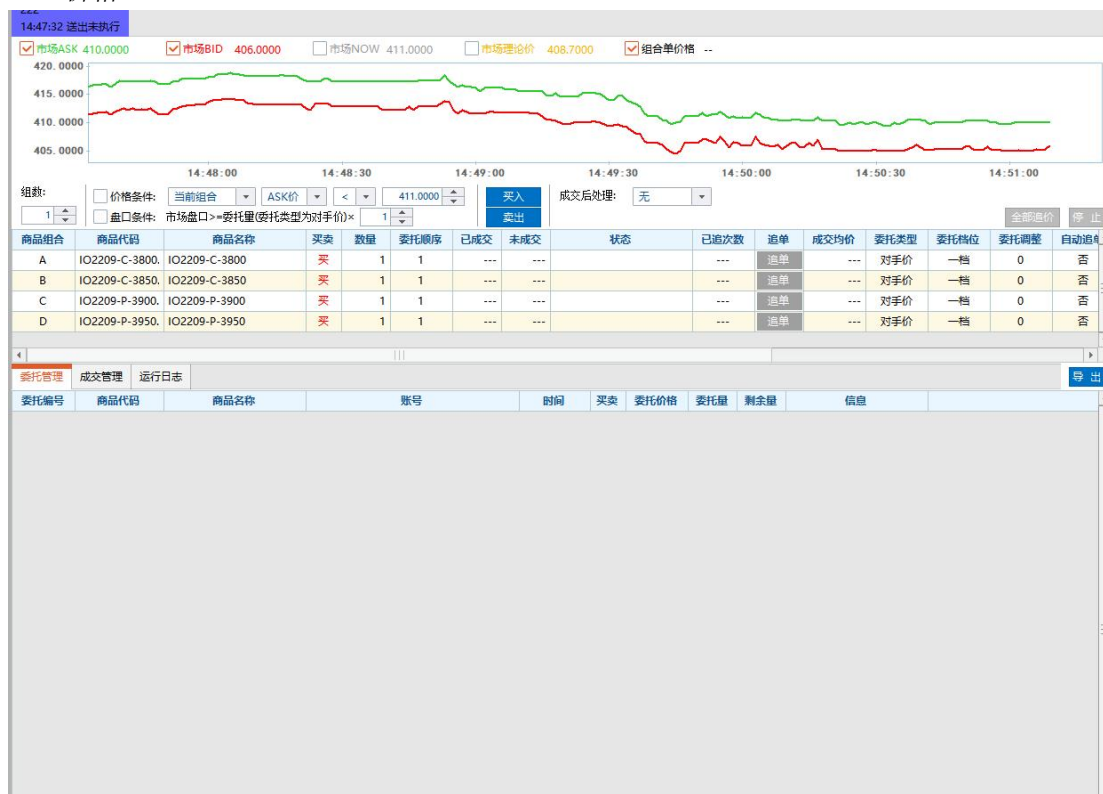


组合交易执行：

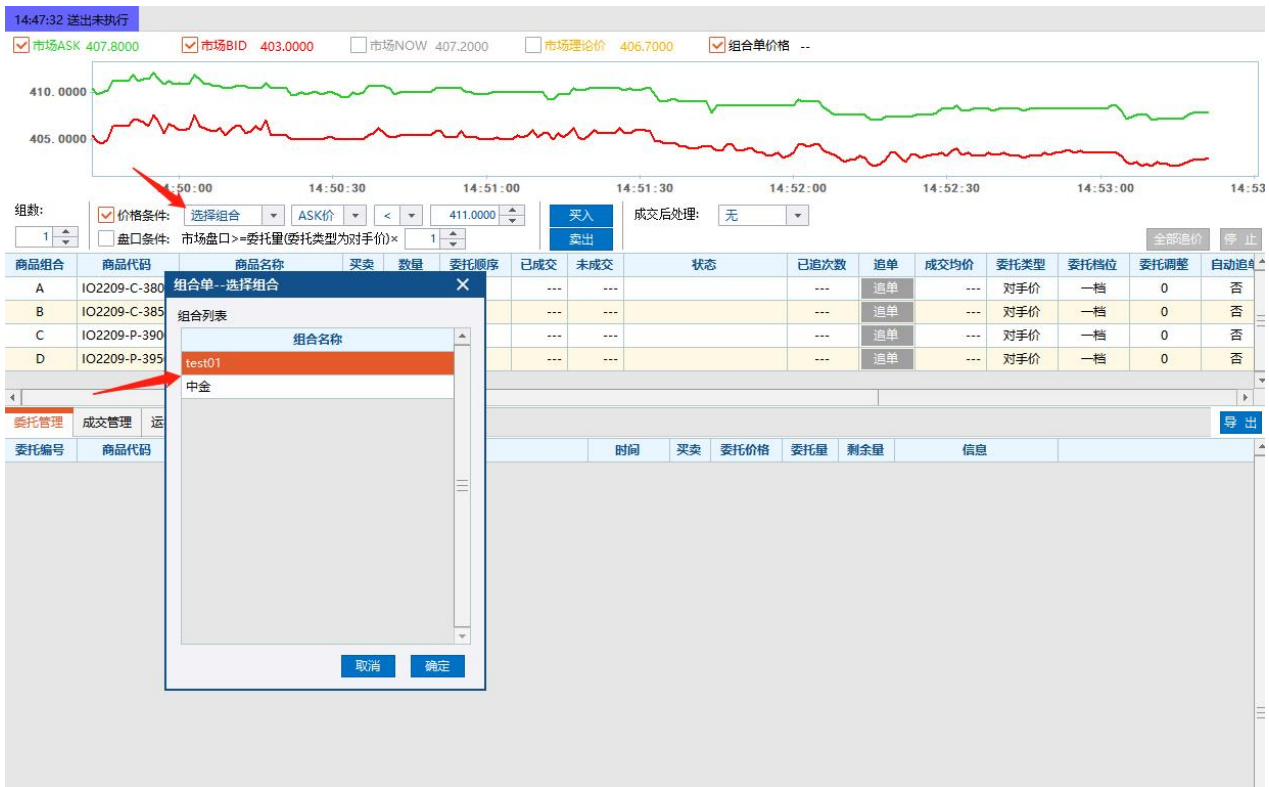
- 1、点击上下 按钮调整需要交易多少组该组合，设定组数
- 2、点击“买”、“卖”
 - a) 买入组合，点击“买”按钮，按钮点击后开始执行，执行后买卖按钮、触价按钮都失效
 - b) 卖出组合，点击“卖”按钮，按钮点击后开始执行，执行后买卖按钮、触价按钮都失效
- 3、选择触发条件，触发条件有两类，一类是价格条件，一类是盘口条件，两者可以分别勾选或者同时勾选：
 - (1) 价格条件：

用来作为监控标的的价格类型分为 3 种

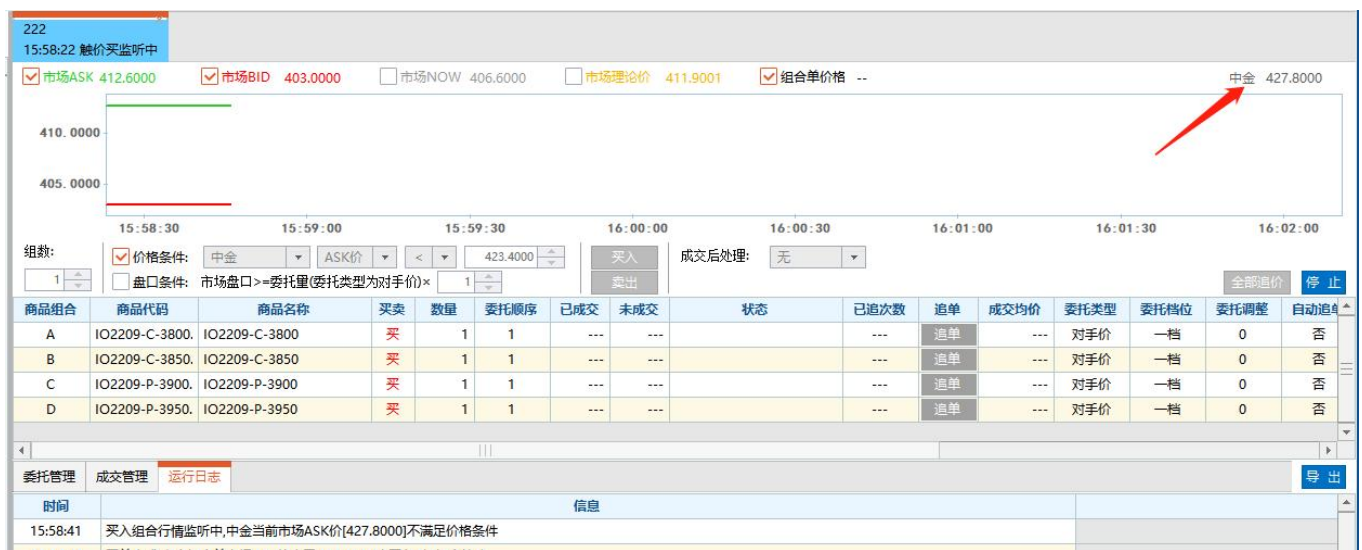
①当前组合 可以使用当前组合的“ASK 价”，“BID 价”，“现价”，“理论价”作为监控价格。不显示额外的监控价格



②选择组合可以使用已经创建过组合的“ASK 价”，“BID 价”，“现价”，“理论价”作为监控价格



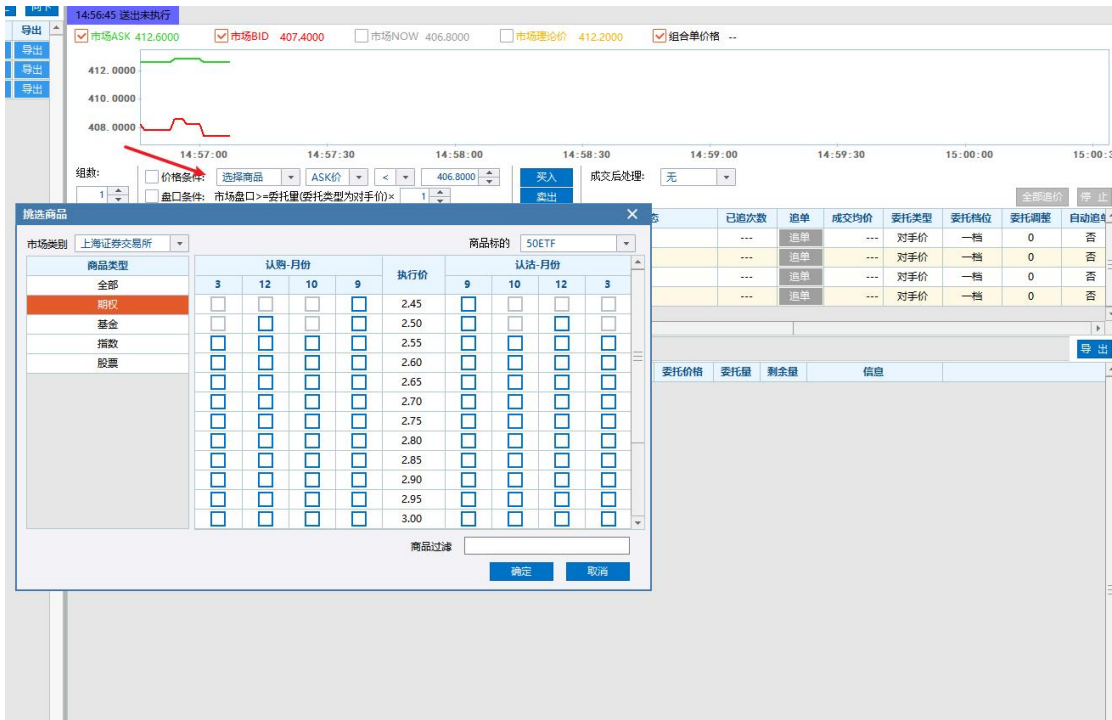
行情界面显示所监控的价格：



当组合被监控的时候，该组合不能被编辑和删除

③选择商品，可以选择其他商品的价格作为监控价格，商品主要分为三类：

- (1) 指数类 只能选择“现价”作为监控价格
 - (2) 期权类 可以选择“ASK价”，“BID价”，“现价”，“理论价”作为监控价格
 - (3) 其他类别（包括基金，股票，期货）可以选择“ASK价”，“BID价”，“现价”作为监控价格
- 商品选择界面同闪电下单的商品选择界面：



④价格选择:

ask 价 (<, <=, >, >=)

bid 价 (<, <=, >, >=)

现价 (<, <=, >, >=)

理论价 (<, <=, >, >=) 指定设定价格,

点击价格上下按钮进行调整设定价格, 当价格条件满足时, 才开始整个组合的交易

(2) 盘口条件

盘口条件只针对组合中“价格类型”为“对手价”的商品进行校验

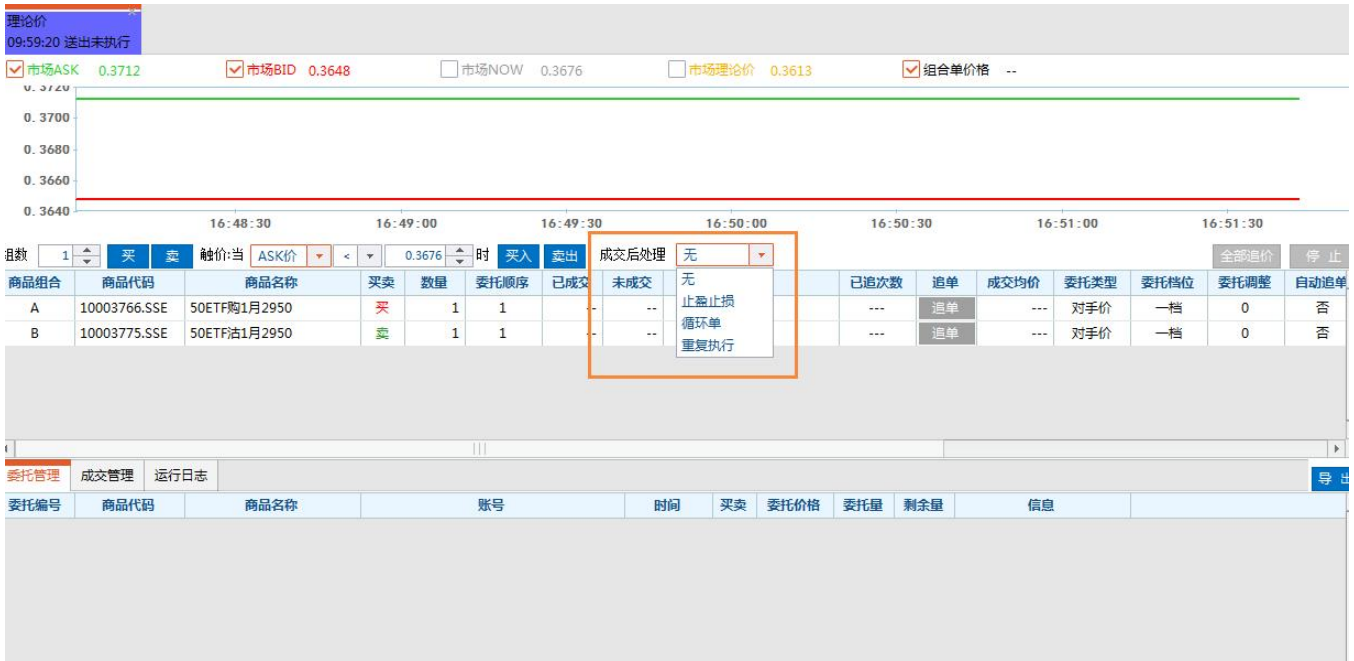
组合买入的时候, 计算每个商品的挂单量是否小于等于市场的总挂单量, 如果委托价格是对手价, 那么根据档位计算盘口的总挂单量, 比如: 选择对手价三挡, 对手价一档挂单量为 10, 二挡挂单量为 5, 三挡挂单量为 15, 那么总挂单量为 30。如果是本方价的时候则不需要考虑盘口挂单量。只有当前组合中所有的商品都满足条件才开始整个组合的交易

4、组合执行当前批次所有未成交的委托单, 点击“追单”按钮, 当前合约按照追单设定进行追单操作; 点击“全部追价”按钮, 全部依具体商品设定进行追单操作。

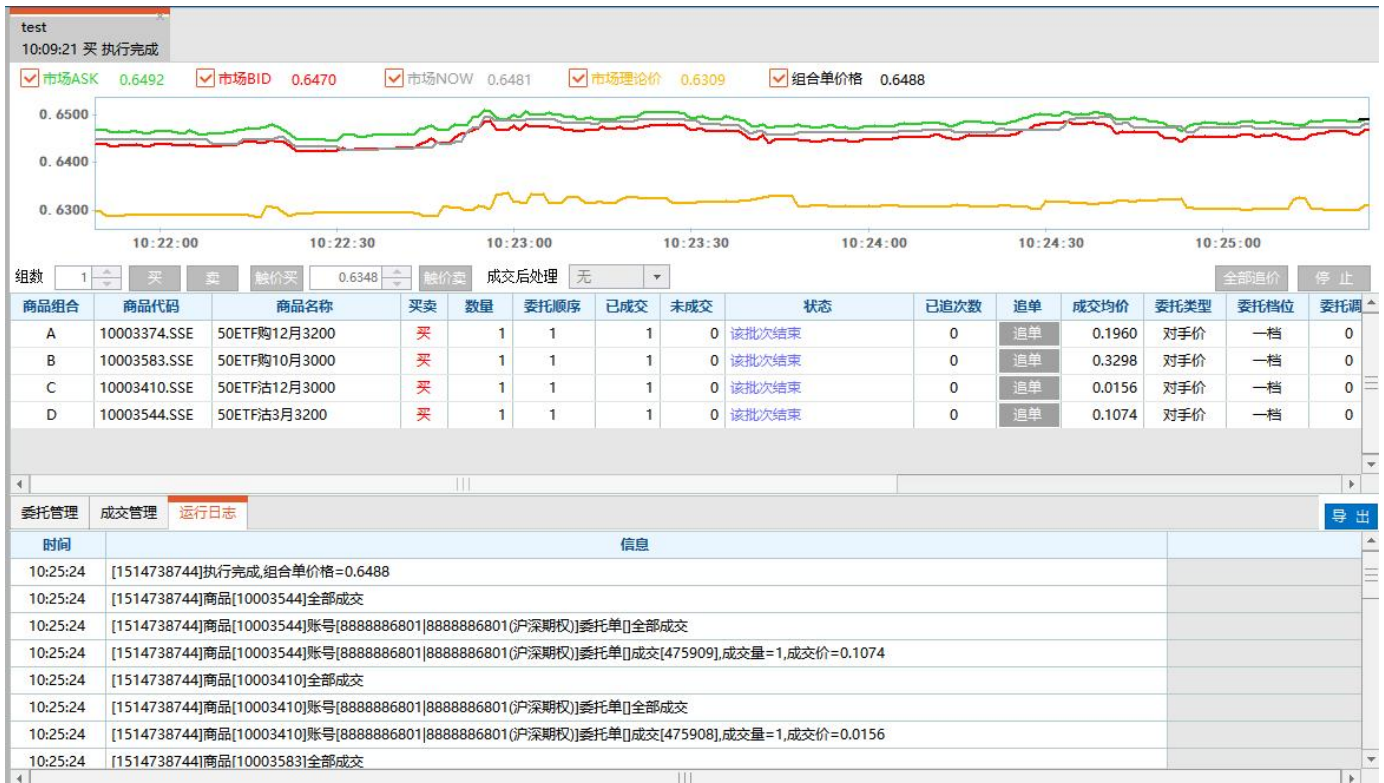
5、组合执行当前批次未执行完成的委托单, 点击“停止”按钮, 则执行终止(撤单)操作

成交后处理设定:

组合交易完成后可操作, 成交后处理追踪分为四种: 1、无, 2、止盈止损, 3、循环单, 4、重复执行; 所有成交后处理操作的前提条件是组合正常执行完成, 组合异常停止后不进入成交追踪的流程

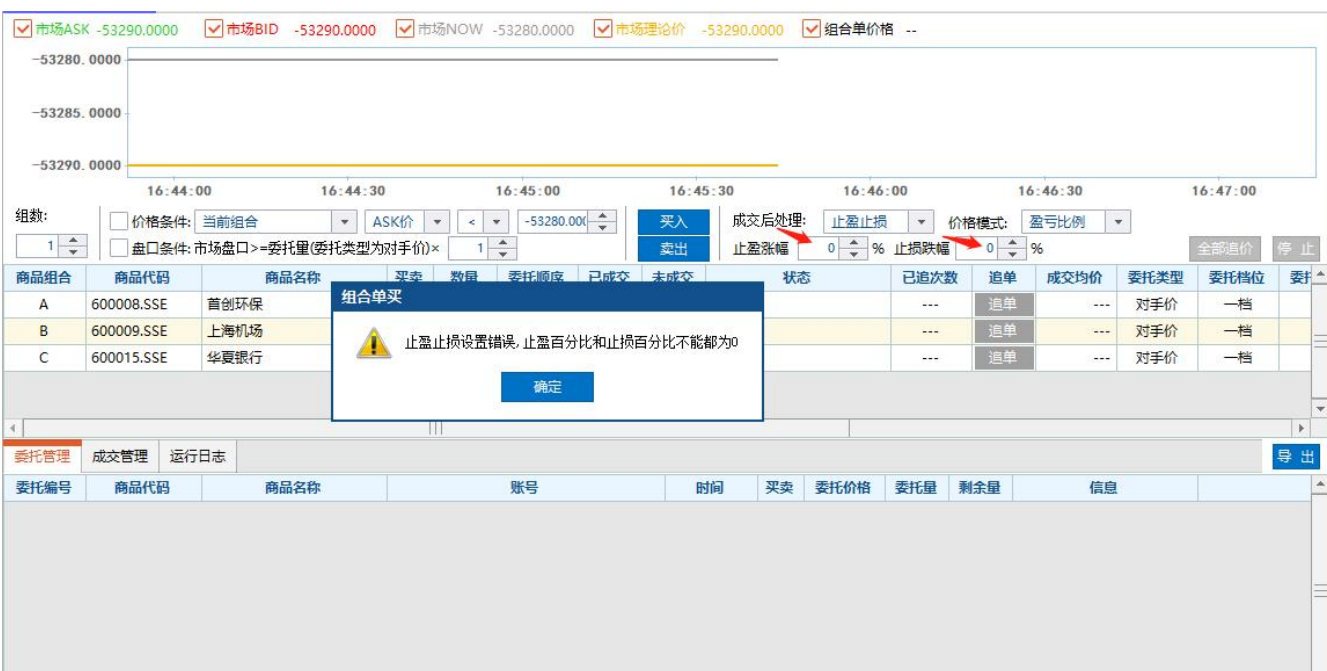
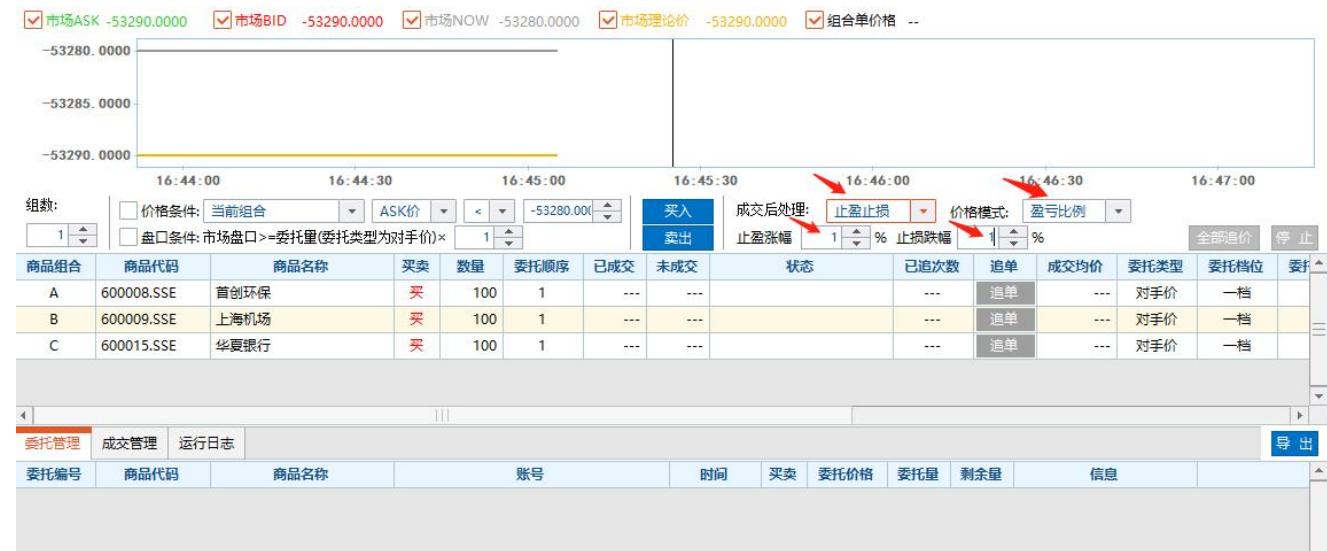


(1) 送出的组合默认选中“无”不做后续处理，组合全部批次成交后进入“执行完成状态”



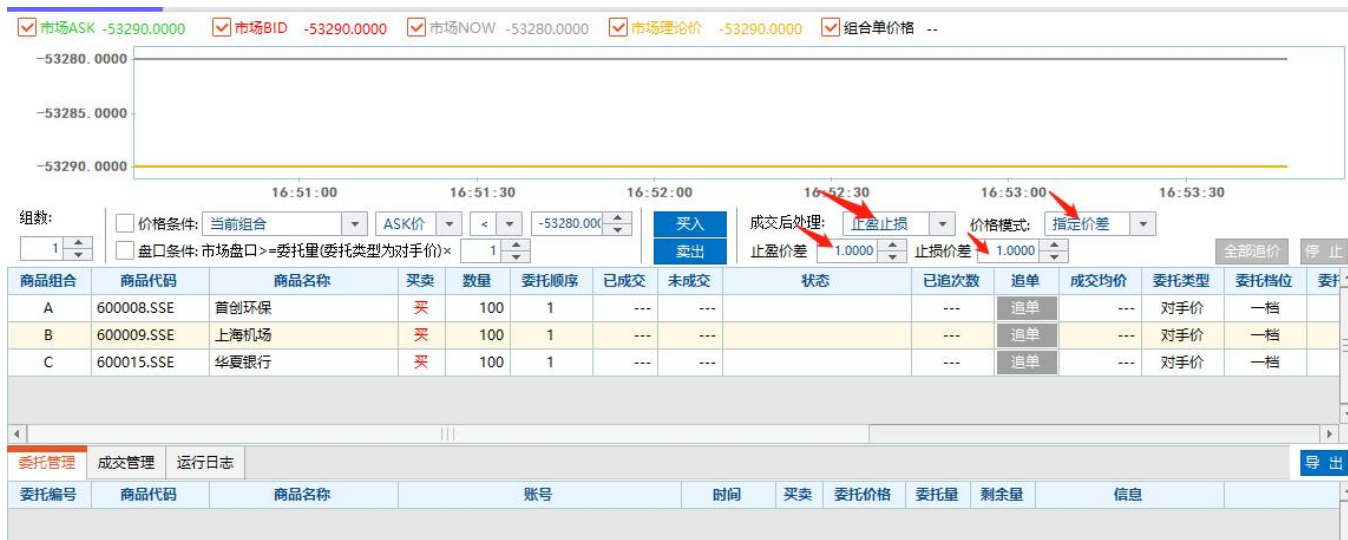
(2) ①送出的组合选中“止盈止损”，设定价格模式为“盈亏比例”，“止盈涨幅”、“止损跌幅”

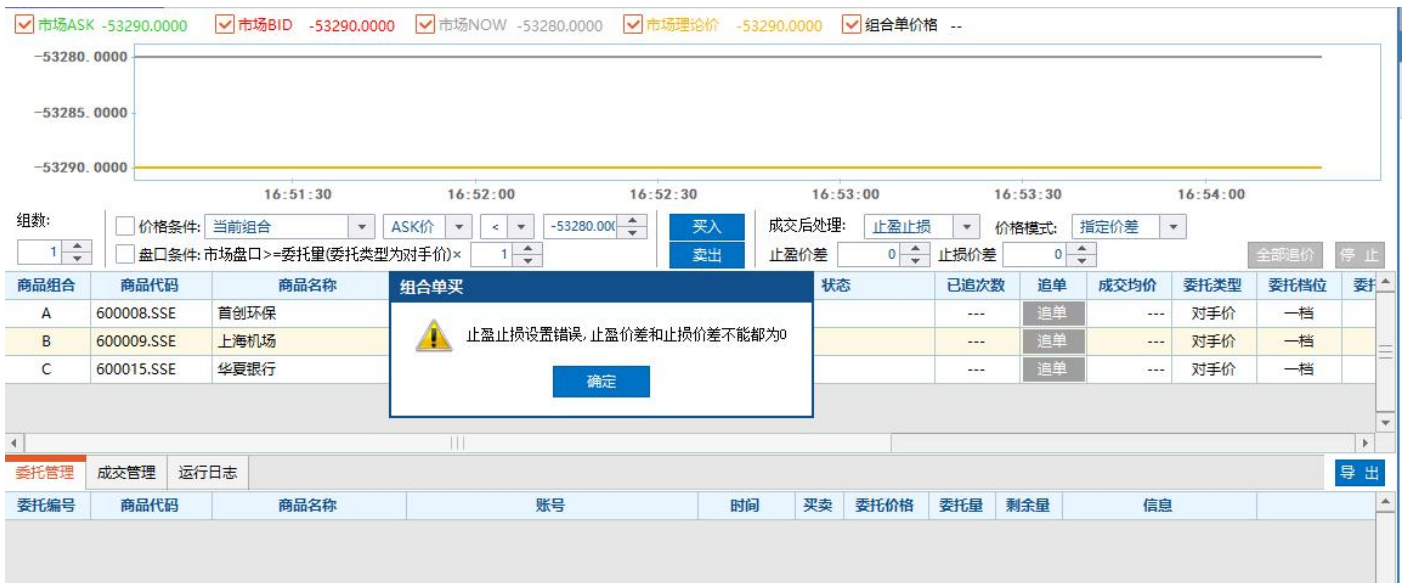
组合全部批次成交后进入“止盈止损监听状态”，根据组合全部成交后的组合成交价计算止盈和止损价格。组合市场现价与止盈价、止损价进行比较，触发止盈或止损执行。止盈（或止损）成交追踪只触发一次。止盈和止损幅度不能都设置为0。止盈幅度为0时不触发止盈监控，止损幅度为0时不触发止损监控。



②送出的组合选中“止盈止损”，设定价格模式为“指定价差”，“止盈价差”、“止损价差”

组合全部批次成交后进入“止盈止损监听状态”，根据组合全部成交后的组合成交价计算止盈和止损价格。组合市场现价与止盈价、止损价进行比较，触发止盈或止损执行。止盈（或止损）成交追踪只触发一次。止盈和止损价差不能都设置为0。止盈价差为0时不触发止盈监控，止损价差为0时不触发止损监控。

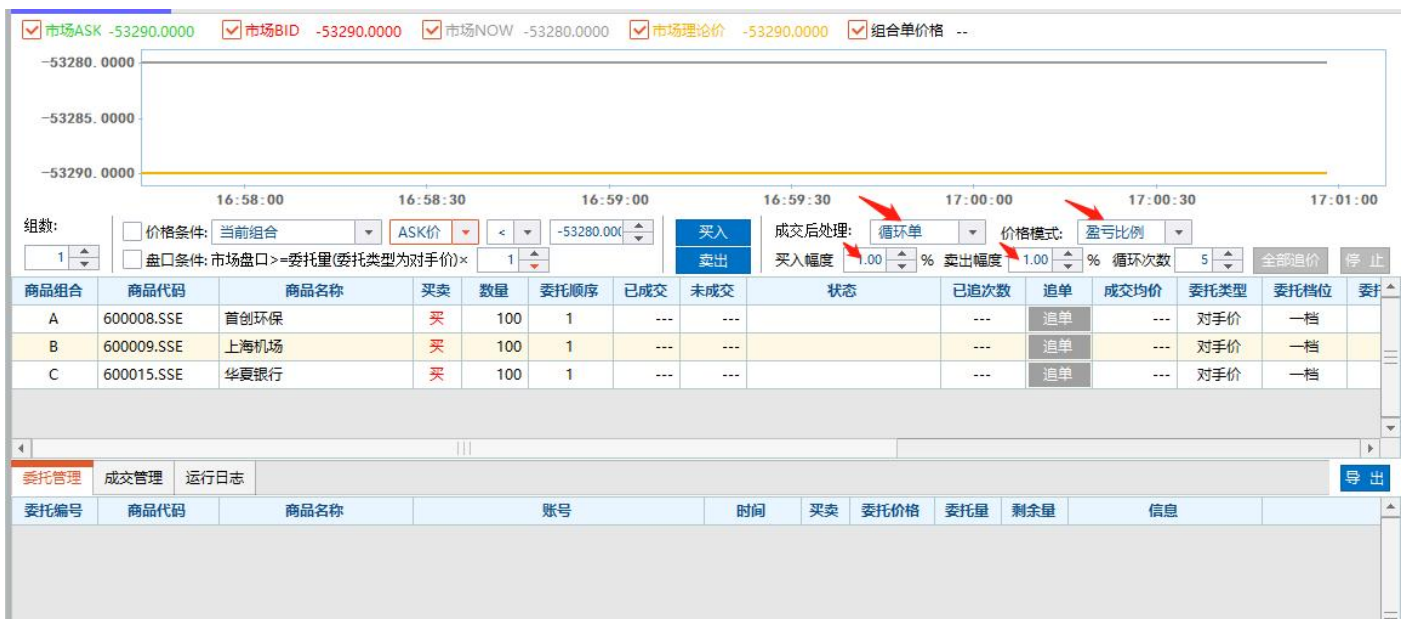




说明:

- ① 组合成交价格为 0 时，不进入止盈止损监听阶段直接结束。
- ② 如果只设置了止盈条件（止损幅度设置 0%或止损价差设置 0），组合执行完成进行成交后处理时，组合现价如果达到设置止盈条件，就进行后处理下单；如果没有达到设置的止盈条件，就处于监听状态，直到达到止盈条件下单或者组合终止条件停止组合。
- ③ 如果只设置了止损条件（止盈幅度设置 0%或止盈价差设置 0），组合执行完成进行成交后处理时，组合现价如果达到设置止损条件，就进行后处理下单；如果没有达到设置的止损条件，就处于监听状态，直到达到止损条件下单或者组合终止条件停止组合。

(3) ① 送出的组合选中“循环单”，设定价格模式为“盈亏比例”，“买入幅度”、“卖出幅度”、“循环次数”组合全部批次成交后进入“循环单监听状态”，根据组合全部成交后的组合成交价，继续处理循环单，触发后，循环单买入或卖出组合计数一次，计数大于循环单次数时，结束。买入幅度，卖出幅度，循环单次数都不可以为 0。组合成交价格为 0 时，不进入循环单监听阶段直接结束。

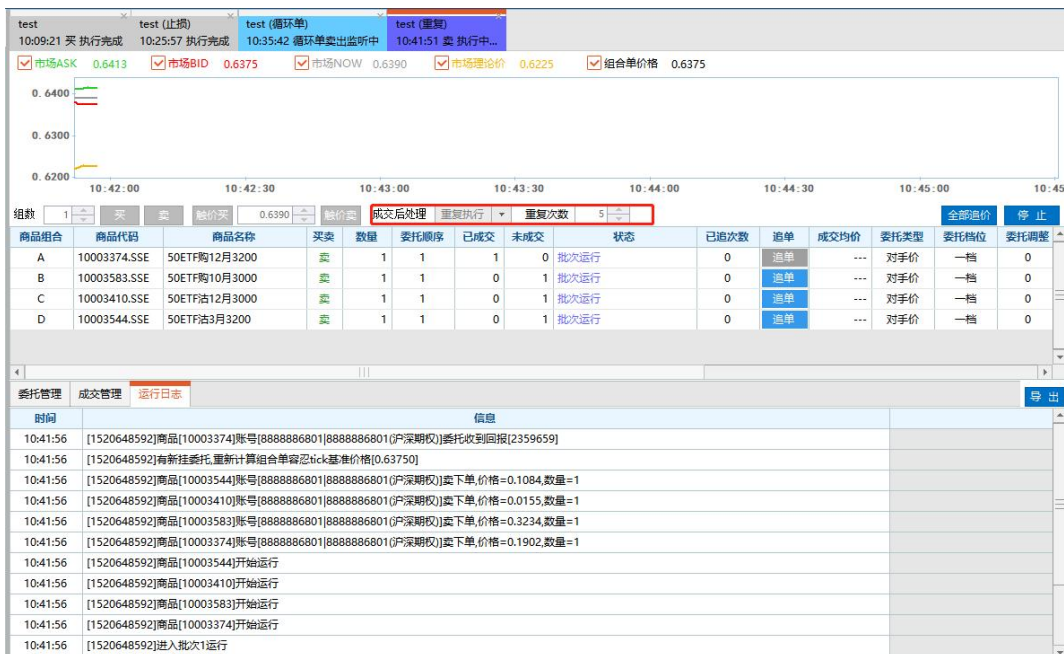


② 送出的组合选中“循环单”，设定价格模式为“指定价差”，“买入价差”、“卖出价差”、“循环次数”组合全部批次成交后进入“循环单监听状态”，根据组合全部成交后的组合成交价，继续处理循环单，触发后，循环单买入或卖出组合计数一次，计数大于循环单次数时，结束。买入价差，卖出价差，循环单次数都不

可以为0。组合成交价格为0时，不进入循环单监听阶段直接结束。



(4) 送出的组合选中“重复执行”，如果初始组合是买入或者卖出，那么直接根据原有买卖方向，继续买入或者卖出组合。



4.14.8 商品执行情况

(1) 委托管理：

TAB 页面显示该组合自动交易策略所下的委托单状态信息

委托编号	商品代码	商品名称	账号	时间	买卖	委托价格	委托量	剩余量	信息
2346254	10003544.SSE	50ETF沽3月3200	8888886821 8888886821(沪深期权)	13:23:59	买	0.1615	4	0	委托单全部成交
2346245	10003544.SSE	50ETF沽3月3200	8888886811 8888886811(沪深期权)	13:23:59	买	0.1615	3	0	委托单全部成交
2346250	10003544.SSE	50ETF沽3月3200	8888886801 8888886801(沪深期权)	13:23:59	买	0.1615	2	0	委托单全部成交
2346253	10003410.SSE	50ETF沽12月3000	8888886821 8888886821(沪深期权)	13:23:59	买	0.0405	4	0	委托单全部成交
2346244	10003410.SSE	50ETF沽12月3000	8888886811 8888886811(沪深期权)	13:23:59	买	0.0405	3	0	委托单全部成交
2346249	10003410.SSE	50ETF沽12月3000	8888886801 8888886801(沪深期权)	13:23:59	买	0.0405	2	0	委托单全部成交
2346251	10003634.SSE	50ETF沽11月3000	8888886821 8888886821(沪深期权)	13:23:59	买	0.0265	4	0	委托单全部成交
2346243	10003634.SSE	50ETF沽11月3000	8888886811 8888886811(沪深期权)	13:23:59	买	0.0265	3	0	委托单全部成交

(2) 成交管理:

TAB 页面显示该组合自动交易所成交的委托单

成交编号	委托编号	商品代码	商品名称	账号	时间	方向	开平	成交价格	成交量
469591	2346254	10003544.SSE	50ETF沽3月3200	13:23:59	13:23:59	买	平仓	0.1615	4
469590	2346253	10003410.SSE	50ETF沽12月3000	13:23:59	13:23:59	买	平仓	0.0404	4
469589	2346252	10003584.SSE	50ETF购10月3100	13:23:59	13:23:59	买	平仓	0.1682	4
469588	2346251	10003634.SSE	50ETF沽11月3000	13:23:59	13:23:59	买	平仓	0.0265	4
469585	2346248	10003582.SSE	50ETF购10月2950	13:23:59	13:23:59	买	平仓	0.3023	4
469587	2346250	10003544.SSE	50ETF沽3月3200	13:23:59	13:23:59	买	开仓	0.1615	2
469586	2346249	10003410.SSE	50ETF沽12月3000	13:23:59	13:23:59	买	开仓	0.0405	2
469584	2346247	10003634.SSE	50ETF沽11月3000	13:23:59	13:23:59	买	开仓	0.0265	2

(3) 运行日志:

TAB 页面显示输出每一步操作的日志

时间	信息
13:23:23	[1607233936]执行完成,组合单价=0.9732
13:23:23	[1607233936]商品[10003544]全部成交
13:23:23	[1607233936]商品[10003544]账号[8888886821]8888886821(沪深期权)委托单[2346254]全部成交
13:23:23	[1607233936]商品[10003544]账号[8888886821]8888886821(沪深期权)委托单[2346254]成交[469591],成交量=4,成交价=0.1615
13:23:23	[1607233936]商品[10003544]账号[8888886821]8888886821(沪深期权)委托单收到回报[2346254]
13:23:23	[1607233936]商品[10003410]全部成交
13:23:23	[1607233936]商品[10003410]账号[8888886821]8888886821(沪深期权)委托单[2346253]全部成交
13:23:23	[1607233936]商品[10003410]账号[8888886821]8888886821(沪深期权)委托单[2346253]成交[469590],成交量=4,成交价=0.0404

4.15 TWAP 交易

使用者在工具列上选择“交易/TWAP 交易”，即可打开 TWAP 交易画面，如下图所示：

The screenshot displays the TWAP trading interface. On the left, there is a table titled "我的TWAP单" (My TWAP Orders) with columns: 序号 (No.), 操作 (Action), 停止 (Stop), TWAP名称 (TWAP Name), 完成率 (Completion Rate), 状态 (Status), 买卖方向 (Buy/Sell Direction), 编辑 (Edit), and 删除 (Delete). The table contains 6 rows of orders, with the second row (ID 2) highlighted in red, indicating it is "正在执行" (Executing).

On the right, there is a chart for "10006737.SSE" showing "价格" (Price) in red, "均价" (Average Price) in green, and "TWAP均价" (TWAP Average Price) in grey. The y-axis ranges from 0.0500 to 0.0580, and the x-axis ranges from 0930 to 1500. The chart shows a flat line at approximately 0.0500.

At the bottom, there is a table with columns: 委托编号 (Order ID), 商品代码 (Product Code), 商品名称 (Product Name), 时间 (Time), 买卖 (Buy/Sell), 委托价格 (Order Price), 委托量 (Order Quantity), and 剩余量 (Remaining Quantity).

4.15.1 新增 TWAP 单

点击新增 TWAP 单，弹出参数设定界面如下：

新增步骤:

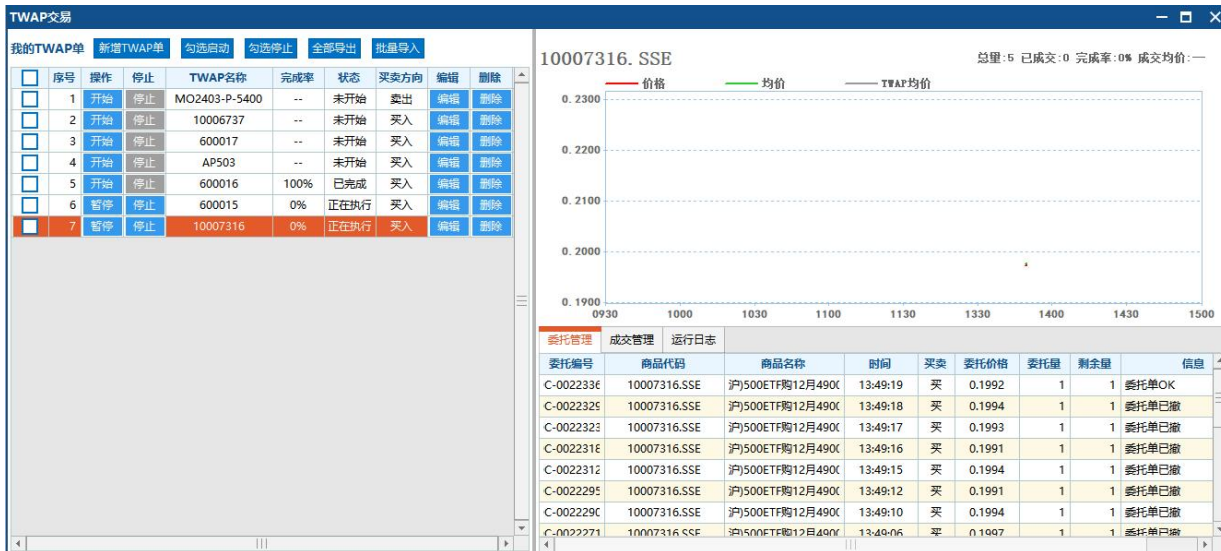
- ①选择商品, 可输入代码选择、输入简称选择、点击商品按钮选择, 只能选择单个商品。
 - ②基础设置: 根据需要设置相应的价格类型、盘口、价格调整、开平仓、总数量、下单间隔、单笔上限、单笔下限、买入\卖出参数。下单间隔支持设置 $\geq 0.1s$, 考虑到由于柜台交互, 有无撤单等影响, 实际下单时间可能达不到预期下单量。
 - ③交易时段: 默认根据对应的商品所在市场勾选交易时段, 也可以手动设置。
 - ④自动追单: 不勾选无效, 勾选生效. 注: 勾选后追单时间间隔设定需小于下单时间间隔。
 - ⑤风控参数设定: 不勾选无效, 勾选生效. 注: 买入最高价格限制, 委托价格或追单价格大于等于此价格则不进行委托. 卖出最高价格限制, 委托价格或追单价格小于等于此价格则不进行委托。
 - ⑥选择涨停不卖、跌停不买选项。
- 选中涨停不卖: 则当行情处于涨停的情况下, TWAP 不发起卖出交易;
选中跌停不买: 则在行情处于跌停的情况下, TWAP 不发起买入交易。
- ⑥点确定, 在我的 TWAP 单展示, 取消则退出配置界面

4.15.2 编辑

未开始、用户终止、已完成可编辑并修改成功, 正在执行、用户暂停内部不可编辑. 配置同新建.

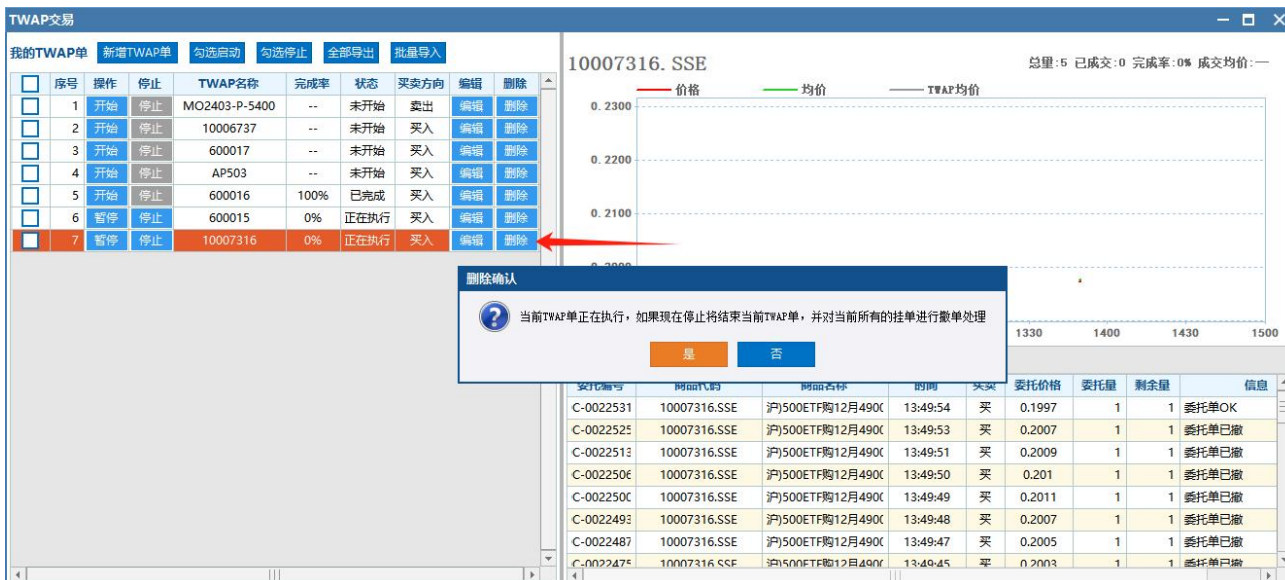
4.15.3 开始

- 点击开始, 按钮变更为暂停, 状态变更为正在执行, 停止按钮可用.
- 点击暂停, 按钮变更为恢复, TWAP 单暂停运行, 状态变更为用户暂停.
- 点击恢复, TWAP 单恢复运行, 状态变更为正在执行.
- 点击停止, 按钮变为开始, 状态变更为用户终止, TWAP 单停止运行, 停止按钮置灰.
- 全部成交后该 TWAP 单状态变更为已完成. 暂停按钮变更为开始.



4.15.4 删除

1、点击删除，列表该 TWAP 单消失 2. 正在执行、用户暂停弹框提示正在运行，点击是删除并撤掉未成交委托单

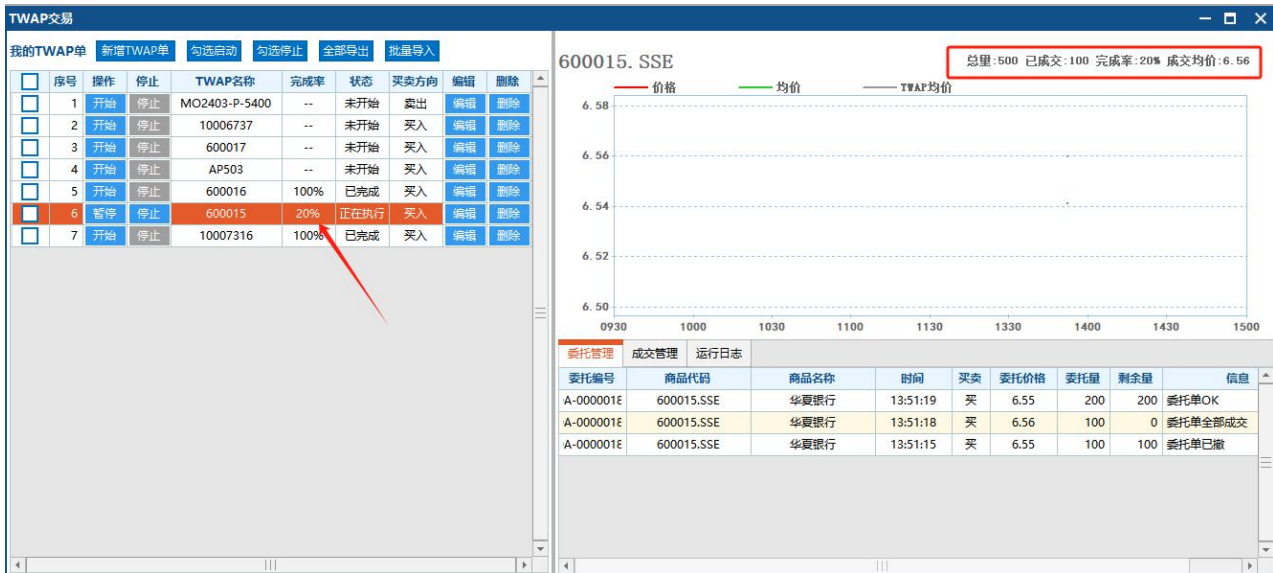


4.15.5 TWAP 单保存

关闭 TWAP 交易窗口保存、关闭 QWIN 客户端保存。

4.15.6 TWAP 计算

根据设定和实时成交数据计算出对应的完成率、成交均价. 总量会根据设定直接展示.



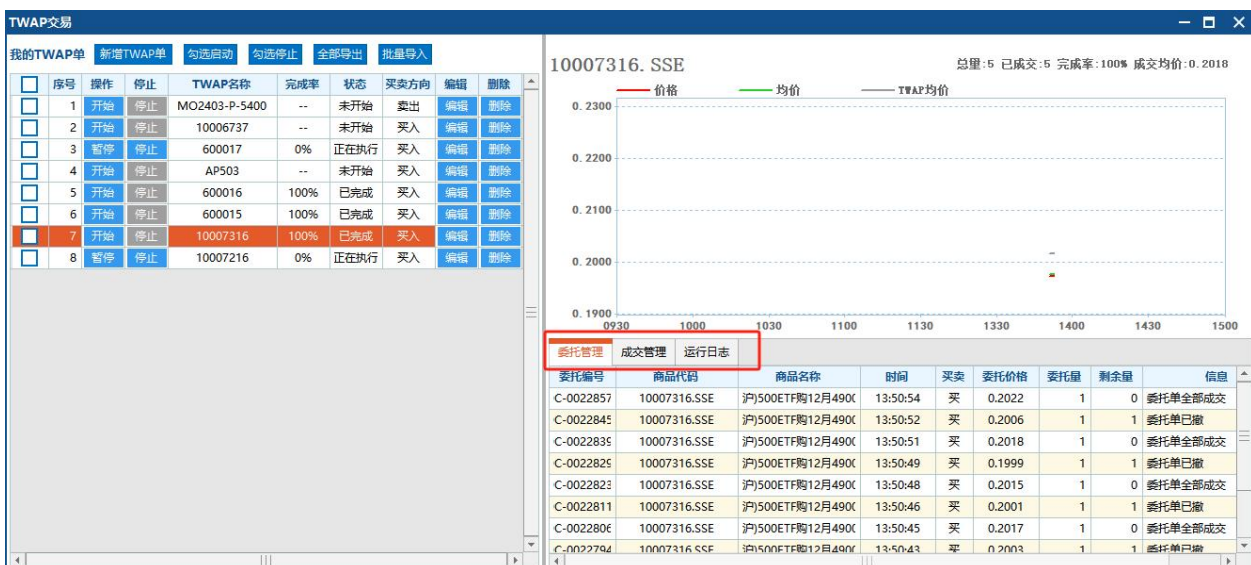
4.15.7 图形展示

根据行情和成交绘制相应的价格、均价、TWAP 均价曲线。



4.15.8 交易执行情况

使用者可在右侧 “委托管理”、“成交管理”、“运行日志” 页面查看执行情况



4.15.9 TWAP 单导入导出

点击全部导出：将当前所有 TWAP 策略导出成 CSV 文件（一条策略一个文件）。

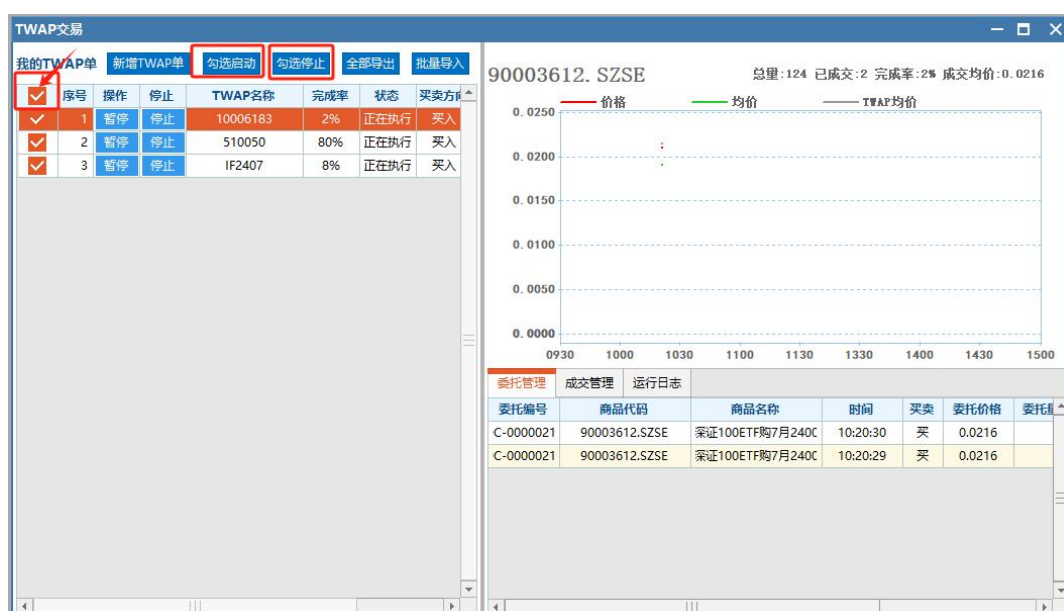
点击批量导入：将选中的批量的 CSV 文件导入成为 TWAP 策略。



The screenshot shows the 'TWAP交易' (TWAP Transaction) interface. At the top, there are buttons for '新增TWAP单' (Add TWAP Order), '勾选启动' (Select Start), '勾选停止' (Select Stop), '全部导出' (Export All), and '批量导入' (Batch Import). Below these is a table with columns: '序号' (Serial Number), '操作' (Action), '停止' (Stop), 'TWAP名称' (TWAP Name), '完成率' (Completion Rate), '状态' (Status), '买卖方向' (Buy/Sell Direction), '编辑' (Edit), and '删除' (Delete). The table contains 8 rows of data, with the 7th row highlighted in red.

序号	操作	停止	TWAP名称	完成率	状态	买卖方向	编辑	删除
1	开始	停止	MO2403-P-5400	--	未开始	卖出	编辑	删除
2	开始	停止	10006737	--	未开始	买入	编辑	删除
3	暂停	停止	600017	0%	正在执行	买入	编辑	删除
4	开始	停止	AP503	--	未开始	买入	编辑	删除
5	开始	停止	600016	100%	已完成	买入	编辑	删除
6	开始	停止	600015	100%	已完成	买入	编辑	删除
7	开始	停止	10007316	100%	已完成	买入	编辑	删除
8	暂停	停止	10007216	0%	正在执行	买入	编辑	删除

4.15.10 TWAP 单支持批量勾选运行



在 TWAP 交易界面中新增了“勾选启动”和“勾选停止”按钮，可以批量启动或者停止 TWAP 策略

点击勾选启动时，可批量启动被勾选的 TWAP 策略（可以启动的策略）

点击勾选停止时，可批量停止被勾选的 TWAP 策略（可以停止的策略）

勾选左上“序号”前的勾选框，可将全部策略进行勾选。

4.16 组合保证金申报

使用者通过“交易/组合保证金申报”路径进入组合保证金申报界面，如下图：

- 一般委托
- 智慧委托
- 成交回报
- 闪电下单
- 序列期权手动下单
- 序列期权手动下单自定义
- 价差下单
- 合成期货
- 合成价差
- T型报价
- 自选股
- 策略下单
- 循环单
- 组合自动交易
- TWAP交易
- 组合保证金申报
- 组合保证金拆解
- 组合保证金管理

用户可以使用下拉框选择账号，市场，标的后表格中默认显示对应标的的所有月份的期权，执行价左边是认购，右边是认沽，每个期权显示所有权利仓和义务仓的可用数量，权利仓为红色，义务仓为绿色

组合保证金申报									
010010002223(沪深)		上海证券交易所		50ETF		0		申请组合	
标准合约									
202212	202209	202207	202206	执行价	202206	202207	202209	202212	
				2.450					
				2.500					
				2.550					
	50			2.600					
				2.650					
50	41		7 10	2.700	34		8		
				2.750	9				
				2.800					
				2.850			50		
			1	2.900					
				2.950					
				3.000					
				3.100					

选择了组合保证金其中一腿以后，显示已经选择一腿的代码，界面上只剩下可以组成组合保证金另一腿的持仓数量。

组合保证金申报

010010002223(沪深) 上海证券交易所 50ETF 9 申请组合

标准合约 10004104-权利仓

202212	202209	202207	202206	执行价	202206	202207	202209	202212
				2.450				
				2.500				
				2.550				
				2.600				
				2.650				
50	41		10	2.700	94		8	
				2.750	9			
				2.800				
				2.850			50	
				2.900				
				2.950				
				3.000				
				3.100				

选择另一腿后，显示形成的组合策略，默认填写可申请的最大组合数量

组合保证金申报

010010002223(沪深) 上海证券交易所 50ETF 9 申请组合

标准合约 10004104-权利仓 10004080-义务仓 认沽牛市价差策略

202212	202209	202207	202206	执行价	202206	202207	202209	202212
				2.450				
				2.500				
				2.550				
				2.600				
				2.650				
50	41		10	2.700	94		8	
				2.750	9			
				2.800				
				2.850			50	
				2.900				
				2.950				
				3.000				
				3.100				

点击“申请组合”，如果组合条件满足，那么发起组合申报，如果没有满足条件，提示“不满足组合条件”，如果组合所需持仓不足，“组合量不在合理范围内”

组合申请后刷新当前持仓量

组合保证金申报

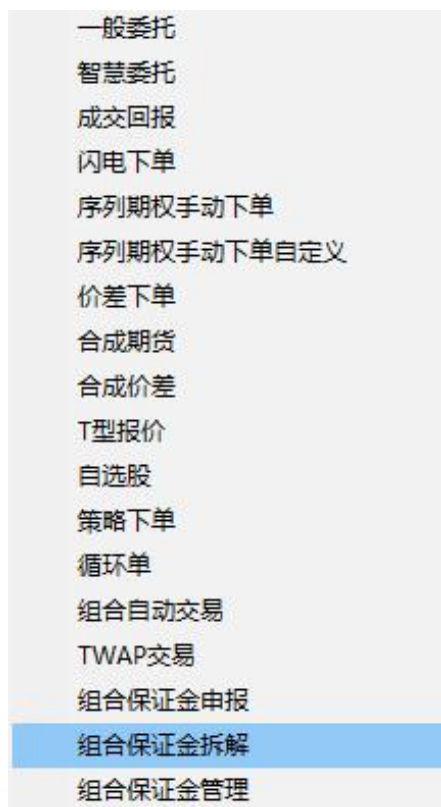
010010002223(沪深) 上海证券交易所 50ETF 0 申请组合

标准合约

202212	202209	202207	202206	执行价	202206	202207	202209	202212
				2.450				
				2.500				
				2.550				
	50			2.600				
				2.650				
50	41		7	2.700	25		8	
				2.750				
				2.800				
				2.850			50	
			1	2.900				
				2.950				
				3.000				
				3.100				

4.17 组合保证金拆解

使用者通过“交易/组合保证金拆解”路径进入组合保证金申报拆解，如下图：



202212	202209	202207	202206	执行价	202206	202207	202209	202212
				2.450				
				2.500				
				2.550				
				2.600				
				2.650				
				2.700				
				2.750				
				2.800				
				2.850				
				2.863A				
				2.900				
				2.912A				
				2.950				

使用者通过下拉框选择账号，市场，标的后表格中默认显示对应标的的所有月份的期权，执行价左边是认购，右边是认沽，每个期权显示在组合中的权利仓和义务仓数量，权利仓为红色，义务仓为绿色。

组合保证金拆解

010010002223(沪深) 上海证券交易所 50ETF 0 解除组合

全部合约

202212	202209	202207	202206	执行价	202206	202207	202209	202212
				2.450				
				2.500				
				2.550				
				2.600				
				2.650				
				2.700	9			
				2.750	9			
				2.800				
				2.850				
				2.863A				
				2.900				
				2.912A				
				2.950				

选择了组合保证金其中一腿以后，显示已经选择一腿的代码，界面上只剩下已经组成组合保证金另一腿的持仓数量。

组合保证金拆解

010010002223(沪深) 上海证券交易所 50ETF 9 解除组合

全部合约 **10004104-权利仓**

202212	202209	202207	202206	执行价	202206	202207	202209	202212
				2.450				
				2.500				
				2.550				
				2.600				
				2.650				
				2.700	9			
				2.750	9			
				2.800				
				2.850				
				2.863A				
				2.900				
				2.912A				
				2.950				

选择另一腿后，显示形成的组合策略，默认填写可拆分的最大组合数量

组合保证金拆解

010010002223(沪深) 上海证券交易所 50ETF 9 解除组合

全部合约 **10004104-权利仓** **10004080-义务仓** 认沽牛市价差策略

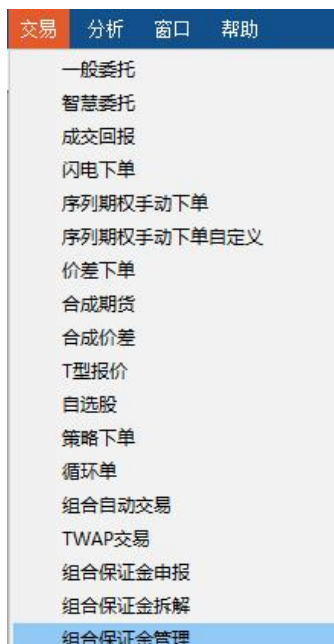
202212	202209	202207	202206	执行价	202206	202207	202209	202212
				2.450				
				2.500				
				2.550				
				2.600				
				2.650				
				2.700	9			
				2.750	9			
				2.800				
				2.850				
				2.863A				
				2.900				
				2.912A				
				2.950				

点击“解除组合”，如果组合条件满足，那么发起组合拆分，如果没有满足条件，提示“不满足组合条件”，如果拆分所需组合量不足，“拆分量不在合理范围内”

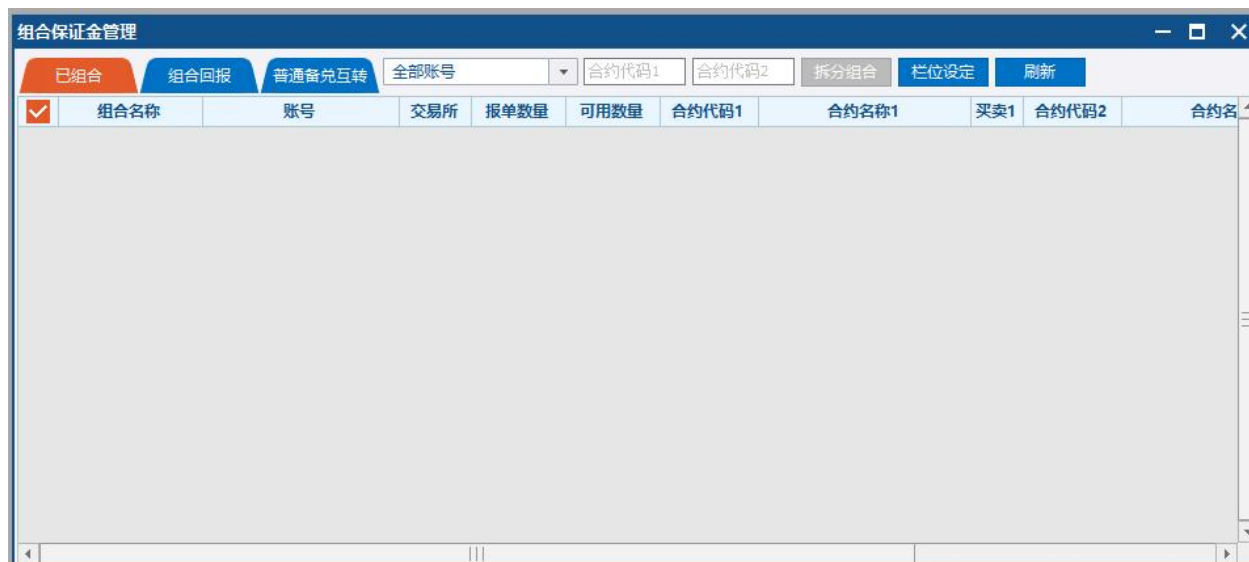
组合拆分后刷新当前界面显示持仓量

4.18 组合保证金管理

使用者通过“交易/组合保证金管理”路径进入组合保证金申报管理，如下图：



默认显示已组合，界面如下：



列出已选账号的所有已申报组合，可以根据合约代码筛选。

<input type="checkbox"/>	组合名称	账号	交易所	报单数量	可用数量	合约代码1	合约名称1	买卖1	合约代码2	合约名称2	买卖2	组合编码	占用保证金
<input type="checkbox"/>	认购牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	15	15	10004105	50ETF购9月2700	买	10004121	50ETF购9月2650	卖	2022061500000228	0.0000
<input type="checkbox"/>	认购牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	7	7	10004103	50ETF购6月2700	买	10004079	50ETF购6月2750	卖	2022061500000154	0.0000
<input type="checkbox"/>	认沽牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	9	9	10004104	50ETF沽6月2700	买	10004080	50ETF沽6月2750	卖	2022061500000152	0.0000

点击其中一个组合，数量框中默认填写最大可拆分数量，点击“拆分组合”，执行组合拆分操作。

组合名称	账号	交易所	报单数量	可用数量	合约代码1	合约名称1	买卖1	合约代码2	合约名称2	买卖2	组合编码	占用保证金
<input checked="" type="checkbox"/> 认购熊市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	15	15	10004105	50ETF购9月2700	买	10004121	50ETF购9月2650	卖	2022061500000228	0.0000
<input checked="" type="checkbox"/> 认购牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	7	7	10004103	50ETF购6月2700	买	10004079	50ETF购6月2750	卖	2022061500000154	0.0000
<input type="checkbox"/> 认沽牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	9	9	10004104	50ETF沽6月2700	买	10004080	50ETF沽6月2750	卖	2022061500000152	0.0000

在使用多选框多选组合的情况下，数量框不可编辑，显示所有组合的最大可拆分数量，点击“拆分组合”，对所有选中组合执行组合操作。

组合名称	账号	交易所	报单数量	可用数量	合约代码1	合约名称1	买卖1	合约代码2	合约名称2	买卖2	组合编码	占用保证金
<input checked="" type="checkbox"/> 认购熊市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	15	15	10004105	50ETF购9月2700	买	10004121	50ETF购9月2650	卖	2022061500000228	0.0000
<input checked="" type="checkbox"/> 认购牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	7	7	10004103	50ETF购6月2700	买	10004079	50ETF购6月2750	卖	2022061500000154	0.0000
<input type="checkbox"/> 认沽牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	9	9	10004104	50ETF沽6月2700	买	10004080	50ETF沽6月2750	卖	2022061500000152	0.0000

点击组合回报，界面如下：

显示当前所选账号所有当日组合申请和拆分的回报信息（包括普通转备兑），可以根据合约代码筛选。

点击“申请组合”，打开组合保证金申报界面

序号	组合名称	账号	交易所	报单数量	组合方法	合约代码1	合约名称1	买卖1	合约代码2	合约名称2	买卖2	委托编号	组合编码	委托日期	委托时间	委托状态
1	认购熊市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	7	组合	10004103	50ETF购6月2700	买	10004079	50ETF购6月2750	卖	88	2022061500000154	20220615	13:14:41	全部成交
2	认沽牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	9	组合	10004104	50ETF沽6月2700	买	10004080	50ETF沽6月2750	卖	78	2022061500000152	20220615	13:13:59	全部成交
3	认沽牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	9	拆分	10004104	50ETF沽6月2700	买	10004080	50ETF沽6月2750	卖	77	2022061500000000	20220615	13:13:28	全部成交
4	认购牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	15	组合	10004143	50ETF购9月2600	买	10004121	50ETF购9月2650	卖	76	2022061500000116	20220615	13:13:02	全部成交
5	认沽牛市价差策略	010010002223(沪深期权)	SSE	9	组合	10004104	50ETF沽6月2700	买	10004080	50ETF沽6月2750	卖	59	2022061500000000	20220615	13:04:50	全部成交

点击普通备兑互换，界面如下：

显示当前账号下所有义务仓的持仓（包括已经执行过备兑的持仓），可以根据合约代码筛选。

备兑转普通按钮灰显，选中已经执行过备兑的持仓时，普通转备兑按钮灰显。

账号	交易所	合约代码	合约名称	类型	买卖	持仓	可平量
010010002223(沪深期权)	SSE	10004121	50ETF购9月2650	非备兑	卖	15	15
010010002223(沪深期权)	SSE	10004103	50ETF购6月2700	非备兑	卖	10	10
010010002223(沪深期权)	SSE	10004079	50ETF购6月2750	非备兑	卖	7	0

选中未执行过备兑的持仓，点击“普通转备兑”，执行普通转备兑操作。

账号	交易所	合约代码	合约名称	类型	买卖	持仓	可平量
010010002223(沪深期权)	SSE	10004079	50ETF购6月2750	非备兑	卖	7	0
010010002223(沪深期权)	SSE	10004103	50ETF购6月2700	非备兑	卖	10	10
010010002223(沪深期权)	SSE	10004121	50ETF购9月2650	非备兑	卖	15	0

4.19 序列期权自动下单

设定不同标的的各个期权的总交易张数和单笔交易张数，以当前的期权波动率计算出的理论价作为指导价来进行自动交易。在自动交易时还可以通过预先设定的标的对应风险敞口，自动对避险商品进行交易，从而达到自动对冲的目的。

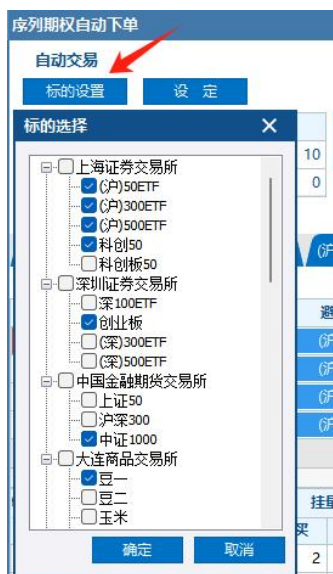
序列期权自动下单主界面：设定区，标的显示区，期权显示区

设定区：设定标的、自动避险参数、自动交易停止参数、标的和期权的栏位设置、自动委托参数、委托价格参数

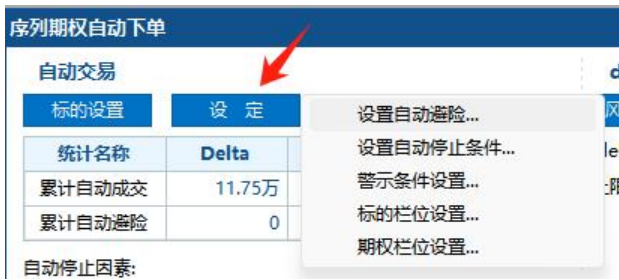
标的显示区：按不同页签显示不同的标的，每个标的的页签列表中显示当前标的的不同月份。

期权显示区：以 T 型报价显示当前选中月份的的所有合约信息以及自动下单参数

1. 标的设置：选择序列期权自动下单的标的，可以多选，每个标的在标的显示区分不同的页签显示



2. 设定：可以进行设定“自动避险设定”，“自动单停止条件”，“警示条件设置”、“标的栏位设置”，“期权栏位设置”。



自动避险：避险委托单数量计算方式，报价方式，避险单 tick 调整数量可根据实际需要设置



自动交易停止参数：可以设定“累计自动交易 delta”，“累计自动交易 Vega 金额”，“累计自动避险张数”，还可以添加系统警示条件作为自动交易停止条件。



标的显示区和期权显示区的栏位设定



警示条件设置：用来勾选盘口量警示设定。该设置针对不同的标的，保留各自的设定。满足警示条件时，期权显示区对应的期权“市量”红色显示。

警示条件

认购期权买方盘口量大于 时,红色显示

认购期权卖方盘口量大于 时,红色显示

认沽期权买方盘口量大于 时,红色显示

认沽期权卖方盘口量大于 时,红色显示

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场买量	市场卖	市场卖量	期权持仓	SD
202402	---	(P)50ETF	交易	0	否		100	0.01	生效	2.424	2.423	2206400	2.424	144000	310	17
202403	---	(P)50ETF	交易	0	否		0	0.00	生效	2.424	2.423	2206400	2.424	144000	16	1
202406	---	(P)50ETF	交易	0	否		1	0.00	生效	2.424	2.423	2206400	2.424	144000	419	49
202409	---	(P)50ETF	交易	0	否		0	0.00	生效	2.424	2.423	2206400	2.424	144000	94	9

tick	买	卖	市量	挂量	市价	挂价	执行价	挂价	市价	挂量	市量	避险	调整tick
13	20.34	14	198	2	0.0257	0.0258	2.500	0.0997	0.0995	0.0995	0.0998	2	19.22
13	20.66	13	2	2	0.0234	0.0238	2.510A	0.1077	0.1075	0.1043	0.1078	2	19.50
13	20.97	15	2	2	0.0155	0.0156	2.550	0.1378	0.1377	0.1361	0.1384	2	18.82
13	21.29	4	4	2	0.0145	0.0146	2.559A	0.1477	0.1477	0.1436	0.1483	2	20.13
13	22.01	149	158	2	0.0096	0.0098	2.600	0.1839	0.1839	0.1800	0.1847	2	20.65
13	22.11	1	5	2	0.0089	0.0090	2.608A	0.1901	0.1901	0.1870	0.1910	2	19.88
13	23.27	10	52	2	0.0063	0.0065	2.650	0.2283	0.2283	0.2259	0.2295	2	19.02
13	24.20	15	4	2	0.0069	0.0070	2.657A	0.2369	0.2369	0.2328	0.2380	2	21.35
13	24.67	1	64	2	0.0040	0.0042	2.706A	0.2813	0.2815	0.2797	0.2828	2	0.50
13	27.10	20	1	2	0.0035	0.0037	2.756A	0.3313	0.3315	0.3288	0.3306	2	0.50
13	27.69	1	1	2	0.0022	0.0023	2.805A	0.3807	0.3808	0.3767	0.3822	2	20.84
13	29.22	168	30	2	0.0018	0.0019	2.854A	0.4293	0.4295	0.4249	0.4305	2	0.50
13	28.98	4	107	2	0.0009	0.0010	2.903A	0.4783	0.4785	0.4730	0.4788	2	0.50

3. 显示当前标的自动成交的 delta 数值和成交张数，以及自动避险的 delta 数值和成交张数

统计名称	Delta	张数
累计自动成交	23490	2
累计自动避险	0	0

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场买量	市场卖	市场卖量	期权持仓	SD
202403	停止下单	(P)50ETF	交易	0	是		0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	28	3
202404	---	(P)50ETF	交易	0	否		0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	0	0
202406	---	(P)50ETF	交易	0	否		1	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	412	52
202409	---	(P)50ETF	交易	0	否		0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	94	9

tick	买	卖	市量	挂量	市价	挂价	执行价	挂价	市价	挂量	市量	避险	调整tick
3	10	11	20.14	2	0.1150	0.1151	2.350	0.0138	0.0114	0.0119	0.0120	2	17.82
3	10	11	19.65	2	0.1044	0.1050	2.362A	0.0161	0.0137	0.0142	0.0143	2	17.68
3	10	11	18.85	2	0.0765	0.0766	2.400	0.0258	0.0236	0.0238	0.0239	2	17.17
3	10	11	18.86	2	0.0691	0.0697	2.411A	0.0301	0.0279	0.0280	0.0282	2	17.32
3	10	11	18.47	2	0.0471	0.0472	2.450	0.0467	0.0446	0.0446	0.0448	2	17.00
3	10	11	18.63	2	0.0428	0.0429	2.460A	0.0523	0.0502	0.0498	0.0504	2	17.12
3	10	11	18.88	2	0.0278	0.0279	2.500	0.0760	0.0741	0.0740	0.0744	2	16.75
3	10	11	18.86	2	0.0242	0.0247	2.510A	0.0827	0.0808	0.0811	0.0812	2	16.65
3	10	11	19.01	2	0.0149	0.0150	2.550	0.1144	0.1126	0.1125	0.1132	2	17.10

4. delta 对冲设置

可以设定 delta 暴露的上限金额。当交易中暴露的 delta 值大于设定上限时触发避险（已经勾选启动避险），根据设定的避险委托参数交易避险商品。

点击风险暴露清零后，清除当前的 delta 暴露金额。

The screenshot shows the 'Delta Hedging Settings' (delta对冲设置) panel. It includes a 'Risk Exposure Clearing' (风险暴露清零) button and a 'Delta Exposure Limit' (delta暴露金额) set to 50,000. The 'Automatic Trading' (自动交易) panel shows 'Delta' and 'Quantity' settings. The 'Order Settings' (下单设置) panel shows 'Order Type' (委托类型) and 'Order Amount' (下单金额) settings. The 'Volatility Settings' (波动率设置) panel shows 'Volatility Adjustment' (波动率调整) settings.

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场买量	市场卖	市场卖量	期权持仓	SD
202403	---	(沪)50ETF	交易	0	否	■	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	36	4
202404	---	(沪)50ETF	交易	0	否	□	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	0	4
202406	---	(沪)50ETF	交易	0	否	□	1	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	412	52
202409	---	(沪)50ETF	交易	0	否	□	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	94	9

5. 下单设置

可以单独对（委买/委卖）设定一次委托的量和需要委托的总量, 选择交易时的委托类型, 点击“更新委托参数”时, 将当前选中的标的当前月份所有合约的下单设定变更为“下单设定”中的参数。

The screenshot shows the 'Order Settings' (下单设置) panel. It includes a 'Update Order Parameters' (更新委托参数) button and 'Order Type' (委托类型) settings. The 'Automatic Trading' (自动交易) panel shows 'Delta' and 'Quantity' settings. The 'Delta Hedging Settings' (delta对冲设置) panel shows 'Risk Exposure Clearing' (风险暴露清零) and 'Delta Exposure Limit' (delta暴露金额) settings. The 'Volatility Settings' (波动率设置) panel shows 'Volatility Adjustment' (波动率调整) settings.

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场买量	市场卖	市场卖量	期权持仓	SD
202403	---	(沪)50ETF	交易	0	否	■	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	36	4
202404	---	(沪)50ETF	交易	0	否	□	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	0	4
202406	---	(沪)50ETF	交易	0	否	□	1	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	412	52
202409	---	(沪)50ETF	交易	0	否	□	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	94	9

6. 下单检查设定

(1) 下单间隔设置

设置下单间隔功能生效后，每次下单成交且延迟到下单间隔时间后，再继续下单。

该设置针对各个期权合约，保留各自的设定。

可以通过下单设置来统一设置，修改后，点击【更新限价单下单检查】按钮，该内容对当前页面期权合约生效。

也可以在单个期权合约界面右键修改。最小可以为0，最大100，保留1位小数，设置为0时则不间隔。

The screenshot displays the '下单设置' (Order Settings) window and a table of contracts. The '下单设置' window has a title '通过下单设置统一设置' (Unified Settings via Order Settings) and a red arrow pointing to the '更新限价单下单检查' (Update Limit Order Check) button. The settings include '委托类型' (Order Type) set to '限价单' (Limit Order), '下单间隔(秒)' (Order Interval) set to 5, and '条件设置' (Conditions) for '委买' (Buy) and '委卖' (Sell) both set to 2. The '下单行情检查' (Order Market Check) is set to '盘口满足下单量' (Order quantity satisfied by the order book).

The table below shows contract details for '创业板' (ChiNext) options. A red arrow points to the '下单间隔' (Order Interval) column, with the text '在单个期权合约界面右键修改' (Right-click to modify in the individual option contract interface).

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场卖	市场买量	市场卖量	期权持仓	SD
202403	---	创业板	交易	0	否		0	0.00	生效	1.733	1.733	2629700	1.734	379200	53	
202404	---	创业板	交易	0	否		0	0.00	生效	1.733	1.733	2629700	1.734	379200	0	
202406	---	创业板	交易	0	否		0	0.00	生效	1.733	1.733	2629700	1.734	379200	0	
202409	---	创业板	交易	0	否		0	0.00	生效	1.733	1.733	2629700	1.734	379200	0	

(2) 下单前价格检查和盘口检查

下单前价格检查和盘口检查针对各个期权合约，保留各自的设定。

可以通过下单设置来统一设置，修改后，点击【更新限价单下单检查】按钮，该内容对当前页面期权合约生效。

也可以在单个期权合约界面右键修改。

The screenshot shows the '下单设置' (Order Settings) window for a specific contract. The '更新限价单下单检查' (Update Limit Order Check) button is highlighted with a red box. The settings include '委托类型' (Order Type) set to '限价单' (Limit Order), '下单间隔(秒)' (Order Interval) set to 1.5, and '条件设置' (Conditions) for '委买' (Buy) set to 2 and '委卖' (Sell) set to 10. The '下单行情检查' (Order Market Check) is set to '对手价满足下单价' (Order price satisfied by the counterparty price).

买	卖	下单间隔	盘口检查	容忍tick	调整tick	交易波动率	避险	挂量	挂价	执行价	挂价	挂量	避险	交易波动率	调整tick	容忍
0.1385	0.1391	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	29.99	0.1384	0.1387	1.60	0.0157	0.0135	5	10	4
0.0990	0.0998	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	28.96	0.0996	0.0998	1.65	0.0268	0.0247	5	10	4
0.0670	0.0672	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	28.14	0.0670	0.0672	1.70	0.0442	0.0421	5	10	4
0.0436	0.0437	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	28.45	0.0436	0.0437	1.75	0.0707	0.0687	5	10	4
0.0271	0.0272	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	28.87	0.0271	0.0272	1.80	0.1042	0.1022	5	10	4
0.0167	0.0169	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	29.72	0.0168	0.0168	1.85	0.1438	0.1419	5	10	4
0.0105	0.0106	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	30.90	0.0106	0.0106	1.90	0.1876	0.1857	5	10	4
0.0068	0.0069	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	32.29	0.0069	0.0068	1.95	0.2338	0.2320	5	10	4
0.0044	0.0045	5.5	盘口量满足	2	3	0	0	33.58	0.0045	0.0044	2.00	0.2814	0.2796	5	10	4

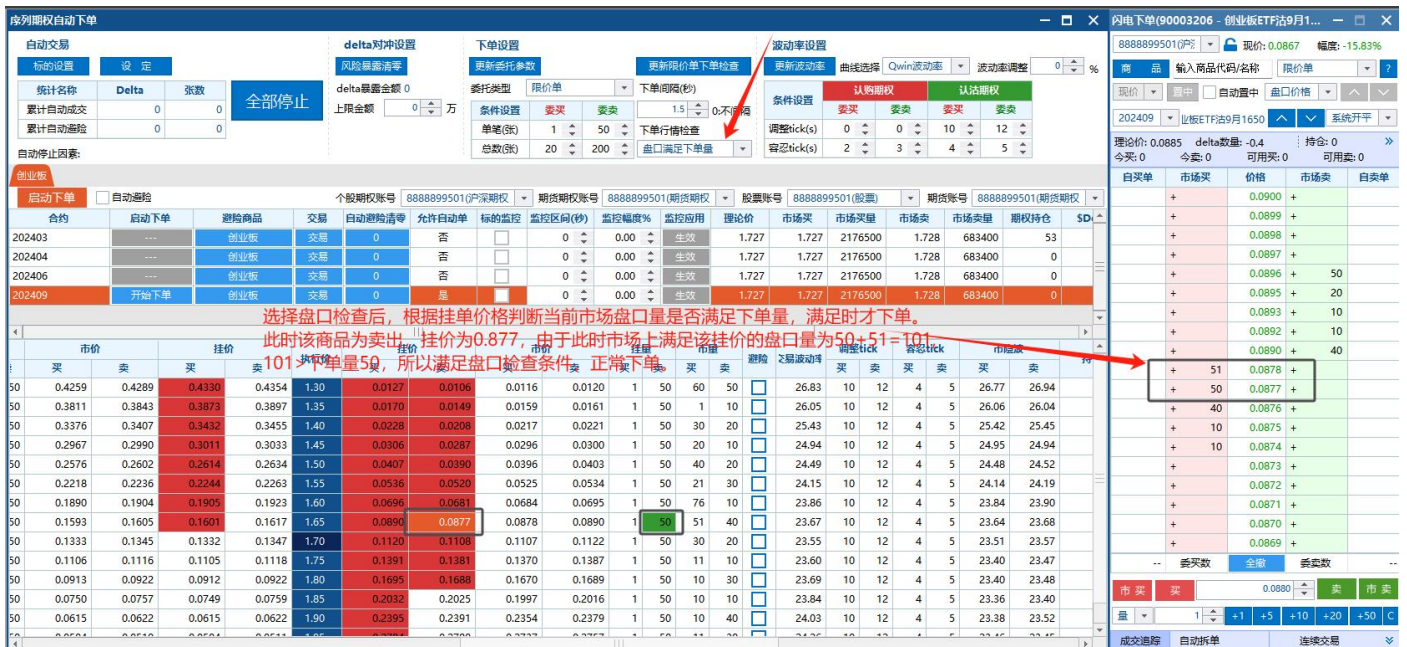
① 价格检查

当勾选【对手价满足下单价】时，进行价格检查。价格检查的逻辑为：下单前检查挂单价和对手价，对手价满足挂单价格时，才进行下单。

买	卖	下单间隔	盘口检查	容忍tick	调整tick	交易波动率	避险	挂量	挂价	执行价	挂价	挂量	避险	交易波动率	调整tick	容忍	
3	-7	0	0.50	5	10	0.3011	0.312	0.3034	0.3046	1.45	0.0029	0.0003	0.0016	0.0020	5	10	4
3	-7	0	0.50	5	10	0.2533	0.2631	0.2534	0.2546	1.50	0.0043	0.0017	0.0030	0.0032	5	10	4
3	-7	0	29.75	5	10	0.2079	0.2189	0.2075	0.2086	1.55	0.0069	0.0043	0.0055	0.0062	5	10	4
3	-7	0	27.56	5	10	0.1609	0.1750	0.1607	0.1618	1.60	0.0119	0.0094	0.0103	0.0109	5	10	4
3	-7	0	28.17	5	10	0.1201	0.1222	0.1201	0.1211	1.65	0.0208	0.0183	0.0190	0.0193	5	10	4
3	-7	0	28.09	5	10	0.0844	0.0846	0.0846	0.0856	1.70	0.0338	0.0314	0.0319	0.0320	5	10	4
3	-7	0	29.18	5	10	0.0580	0.0582	0.0582	0.0583	1.75	0.0556	0.0533	0.0536	0.0539	5	10	4
3	-7	0	29.29	5	10	0.0369	0.0370	0.0370	0.0372	1.80	0.0870	0.0847	0.0850	0.0853	5	10	4
3	-7	0	30.01	5	10	0.0231	0.0233	0.0233	0.0241	1.85	0.1187	0.1165	0.1168	0.1170	5	10	4
3	-7	0	30.29	5	10	0.0136	0.0138	0.0136	0.0143	1.90	0.1591	0.1569	0.1574	0.1580	5	10	4
3	-7	0	31.10	5	10	0.0081	0.0085	0.0080	0.0086	1.95	0.2022	0.2000	0.2007	0.2101	5	10	4
3	-7	0	33.52	5	10	0.0060	0.0061	0.0057	0.0064	2.00	0.2464	0.2444	0.2454	0.2586	5	10	4
3	-7	0	33.64	5	10	0.0033	0.0035	0.0029	0.0036	2.05	0.2964	0.2944	0.2924	0.3068	5	10	4

② 盘口检查

当勾选【对手价满足下单价】时，进行盘口检查。盘口检查的逻辑为：当下单前根据挂单价格判断当前市场盘口总量是否满足下单量，满足时才下单。



7. 波动率设定

可以使用“曲线选择”设置不同的波动率，并根据需要进行“波动率调整”。

下单时可以通过“调整 tick”进行挂价的调整，如果当前的挂单价格和已挂单的价格的差值（绝对值）超过设置“容忍 tick”，那么就撤单重新挂单。

点击更新时，将当前选中的标的中当前选中月份所有合约的波动率设定（容忍 tick，调整 tick，交易波动率，理论价等）变更为“波动率设定”中的参数。



8. 不同的标的可以设置不同的交易账号

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场买量	市场卖	市场卖量	期权持仓	SD
202403	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	36	4
202404	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	0	---
202406	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	1	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	412	52
202409	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	94	9

9. 标的区的前半部分栏位显示的是操作和信息，按不同月份，分别设置

启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场买量	市场卖	市场卖量	期权持仓	SD
开始下单	50ETF	交易	0	是	<input checked="" type="checkbox"/>	0	0.00	生效	3.0360	3.0360	200	3.0370	881400	7	---
---	50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	3.0360	3.0360	200	3.0370	881400	55	---
---	50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	3.0360	3.0360	200	3.0370	881400	42	---
---	50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	3.0360	3.0360	200	3.0370	881400	0	---

某个月份中选中某个合约的挂量或挂价栏位选中后，点击右键设置“允许自动交易”，启动下单栏显示为“开始下单”，否则显示为“---”。

点击“开始下单”启动该月份的自动交易流程，点击后可以手动停止该月份的自动交易流程。

“避险商品”栏位显示当前选中的避险商品，该月份没有进行自动交易时，点击可以更换避险商品。

点击“交易”按钮弹出闪电下单界面，默认选择当前的避险商品。

“自动避险清零”栏位中显示当前月份的累计交易 delta 值，点击按钮后清零，并更新总避险金额。当前月份的有合约被设置为“允许自动交易”时，“允许自动单”显示为“是”，否则显示为“否”。

勾选“标的监控”后，标的在设定的“监控区间（秒）”内，涨跌幅度大于“监控幅度”时，自动停止交易。“标的监控”只有在“监控区间（秒）”和“监控幅度”都不为 0 时才可以勾选。当编辑“监控区间（秒）”和“监控幅度”后，需要点击“监控应用”中的“生效”按钮才生效。

10. 标的区的后半部分栏位显示的是每个月份的相关信息

标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场买量	市场卖	市场卖量	期权持仓	SDelta	1%Gamma	SVega	STheta	距到期日	计算日期标准
<input checked="" type="checkbox"/>	0	0.00	生效	3.0360	3.0360	200	3.0370	881400	7	75944	13018	183	-185	13.00	交易日
<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	3.0360	3.0360	200	3.0370	881400	55	63.59万	51065	1628	-584	33.00	交易日
<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	3.0360	3.0360	200	3.0370	881400	42	46.15万	30219	2447	-287	92.00	交易日
<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	3.0360	3.0360	200	3.0370	881400	0	0	0	0	0	161.00	交易日

11. 期权显示区，以 T 型报价显示当前选中月份的所有合约信息以及自动下单参数

在期权显示区可以显示调整的参数有“累交 MAX”，“容忍 tick”，“调整 tick”，“交易波动率”，“避险”，“挂量”。

合约	启动下单	启动避险	避险商品	交易	自动避险清算	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场卖	市场量	市场委	期权持仓	\$Delta	1%Gamma	\$Vega	\$Theta	距到期日	计算日期标准
202206	开始下单	---	50ETF	交易	0	是	0	0.00	生效	2.886	2.884	791300	2.885	126200	6806	340.45万	199.00万	10296	-42089	4.00	交易日	
202207	---	---	50ETF	交易	0	否	0	0.00	生效	2.886	2.884	791300	2.885	126200	0	0	0	0	0	29.00	交易日	
202209	---	---	50ETF	交易	0	否	0	0.00	生效	2.886	2.884	791300	2.885	126200	-8	-12.37万	-8043	-500	71	73.00	交易日	
202212	---	---	50ETF	交易	0	否	0	0.00	生效	2.886	2.884	791300	2.885	126200	0	0	0	0	0	133.00	交易日	

调整参数时，可以在需要调整参数的参数格中输入参数，回车后保存；也可以选中参数单元格右键使用套用功能。手动调整参数后，该合约自动停止处于非自动交易状态。

在“挂量”或者“挂价”上鼠标拖动选择，右键选择“允许自动交易”或“清除自动交易”来决定相应的合约是否参与自动交易，绿色表示参与自动交易，白色表示不参与自动交易。（橙色只代表选中单元格）

市价	市量	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价				
0	72.40	1	1	0.4290	0.4390	5	10	0	0	47.22	0.4352	0.4353	2.450	0.0002	0.0001	1	2	47.22	0	0	3	1	0.0001	0.0002	428	246	45.89
0	56.85	1	2	0.3785	0.3870	5	10	0	0	45.15	0.3854	0.3855	2.500	0.0004	0.0003	1	2	45.15	0	0	3	1	0.0002	0.0003	404	124	44.52
0	55.90	1	1	0.3295	0.3385	5	10	0	0	39.36	0.3354	0.3355	2.550	0.0004	0.0003	1	2	39.36	0	0	3	1	0.0002	0.0003	3	7	38.77
0	27.24	48.00	10	1	0.2850	0.2883	5	10	0	35.60	0.2855	0.2856	2.600	0.0005	0.0004	1	2	35.60	0	0	3	1	0.0004	0.0005	45	1	35.16
0	32.14	1	1	0.2320	0.2360	5	10	0	0	29.76	0.2355	0.2356	2.650	0.0005	0.0004	1	2	29.76	0	0	3	1	0.0004	0.0005	189	20	29.36
0	23.56	33.86	1	1	0.1854	0.1885	5	10	0	26.66	0.1860	0.1861	2.700	0.0010	0.0009	1	2	26.66	0	0	3	1	0.0008	0.0009	828	504	26.47
0	22.21	25.54	43	10	0.1365	0.1381	5	10	0	25.21	0.1378	0.1379	2.750	0.0008	0.0007	1	2	25.21	0	0	3	1	0.0027	0.0028	66	46	25.12

12. 启动下单

设置完成后，点击对应月份的“开始下单”按钮并满足下单检查后，当前月份选中合约开始自动下单。

自动交易

统计名称: Delta 张数

累计自动成交: 0

累计自动避险: 0

全部停止

delta对冲设置

风险暴露清零

delta暴露金额: 0

上限金额: 0

下单设置

更新委托参数

更新限价单下单检查

委托类型: 限价单

下单间隔(秒): 5.0

条件设置: 委买 委卖

单笔(张): 2

总数(张): 10

波动率设置

更新波动率

曲线选择: 市场委卖

波动率调整: 0.50

条件设置: 认购期权 认沽期权

调整tick(s): -1 10 -3 0

容忍tick(s): 2 3 4 5

合约	启动下单	启动避险	避险商品	交易	自动避险清算	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场卖	市场量	市场委	期权持仓	\$Delta	1%Gamma	\$Vega	\$Theta	距到期日	计算日期标准
202403	---	---	(F)50ETF	交易	0	否	0	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	36						
202404	---	---	(F)50ETF	交易	0	否	0	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	0						
202406	开始下单	---	(F)50ETF	交易	0	是	0	1	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	412						
202409	开始下单	---	(F)50ETF	交易	0	是	0	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	94						

量	理论价	持仓	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价	市价
0	100	100	0.4079	0	27.66	29.72	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	22.05	3	12	0.4186	0.4250	0.4090	0.4078		
0	100	100	0.3608	0	26.15	27.90	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	21.09	3	12	0.3720	0.3781	0.3619	0.3607		
0	100	100	0.3149	0	24.93	26.08	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	20.22	3	12	0.3270	0.3317	0.3160	0.3147		
0	100	100	0.2707	0	23.81	24.87	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.53	3	12	0.2835	0.2883	0.2718	0.2706		
0	100	100	0.2588	0	23.64	24.31	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.37	3	12	0.2721	0.2755	0.2599	0.2587		
0	100	100	0.2292	0	23.04	23.59	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.04	3	12	0.2429	0.2459	0.2303	0.2290		
0	100	100	0.2180	0	22.82	23.65	10	1	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.92	3	12	0.2318	0.2362	0.2192	0.2179		
0	100	100	0.1907	15	22.37	22.75	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.67	3	12	0.2049	0.2074	0.1919	0.1905		
0	100	100	0.1807	0	22.14	22.44	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.46	3	12	0.1952	0.1973	0.1819	0.1805		

点击左侧“启动下单”按钮，对当前标的的所有选择自动下单的月份中的执行价同时执行自动下单功能。

序列期权自动下单

自动交易

统计名称: Delta, 张数

全部停止

累计自动成交: 0, 0

累计自动避险: 0, 0

自动停止因素:

delta对冲设置

风险暴露清零

delta暴露金额: 0

上限金额: 0 万

下单设置

更新委托参数

更新限价单下单检查

委托类型: 限价单

下单间隔(秒): 5.0

条件设置: 委买, 委卖

单笔(张): 2, 2

总数(张): 10, 10

对手价满足下单价

波动率设置

更新波动率

曲线选择: 市场委卖

波动率调整: 0.50 %

条件设置: 认购期权, 认沽期权

调整tick(s): -1, 10, -3, 0

容忍tick(s): 2, 3, 4, 5

启动下单

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场卖	市场委买	市场委卖	市场委买	市场委卖	期权持仓	\$Delta
202403	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	36	40.51万		
202404	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	0	0		
202406	开始下单	(沪)50ETF	交易	0	是	<input checked="" type="checkbox"/>	1	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	412	525.00万		
202409	开始下单	(沪)50ETF	交易	0	是	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	94	98.82万		

量	成交MAX	理论价	持仓	市价	市量	下单间隔	盘口检查	容忍tick	调整tick	交易波动	避险	挂量	市价	挂价	执行价						
0	100	0.4079	0	27.66	29.72	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	22.05	3	12	0.4186	0.4250	0.4090	0.4078	2.050
0	100	0.3608	0	26.15	27.90	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	21.09	3	12	0.3720	0.3781	0.3619	0.3607	2.100
0	100	0.3149	0	24.93	26.08	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	20.22	3	12	0.3270	0.3317	0.3160	0.3147	2.150
0	100	0.2707	0	23.81	24.87	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.53	3	12	0.2835	0.2883	0.2718	0.2706	2.200
0	100	0.2588	0	23.64	24.31	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.37	3	12	0.2721	0.2755	0.2599	0.2587	2.214A
0	100	0.2292	0	23.04	23.59	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.04	3	12	0.2429	0.2459	0.2303	0.2290	2.250
0	100	0.2180	0	22.82	23.65	10	1	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.92	3	12	0.2318	0.2362	0.2192	0.2179	2.264A
0	100	0.1907	15	22.37	22.75	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.67	3	12	0.2049	0.2074	0.1919	0.1905	2.300
0	100	0.1807	0	22.14	22.44	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.46	3	12	0.1952	0.1973	0.1819	0.1805	2.313A

13. 停止下单

启动自动下单后，可以手动对标的某个月份停止自动单下单，也可以对当前标的停止下单，或者停止全部标的的自动单。

已委托成功单进行撤单,未送出的限价单和智慧单都不在送出。点击对应月份的“停止下单”按钮，停止当前月份合约的自动单下单。

1) 对标的某个月份停止自动单下单:

序列期权自动下单

自动交易

统计名称: Delta, 张数

全部停止

累计自动成交: 0, 0

累计自动避险: 0, 0

自动停止因素:

delta对冲设置

风险暴露清零

delta暴露金额: 0

上限金额: 0 万

下单设置

更新委托参数

更新限价单下单检查

委托类型: 限价单

下单间隔(秒): 5.0

条件设置: 委买, 委卖

单笔(张): 2, 2

总数(张): 10, 10

对手价满足下单价

波动率设置

更新波动率

曲线选择: 市场委卖

波动率调整: 0.50 %

条件设置: 认购期权, 认沽期权

调整tick(s): -1, 10, -3, 0

容忍tick(s): 2, 3, 4, 5

停止下单

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场卖	市场委买	市场委卖	市场委买	市场委卖	期权持仓	\$
202403	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	36			
202404	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	0			
202406	停止下单	(沪)50ETF	交易	0	是	<input checked="" type="checkbox"/>	1	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	412			
202409	开始下单	(沪)50ETF	交易	0	是	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	94			

量	成交MAX	理论价	持仓	市价	市量	下单间隔	盘口检查	容忍tick	调整tick	交易波动	避险	挂量	市价	挂价	执行价						
0	100	0.4079	0	27.66	29.72	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	22.05	3	12	0.4186	0.4250	0.4090	0.4078	2.050
0	100	0.3608	0	26.15	27.90	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	21.09	3	12	0.3720	0.3781	0.3619	0.3607	2.100
0	100	0.3149	0	24.93	26.08	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	20.22	3	12	0.3270	0.3317	0.3160	0.3147	2.150
0	100	0.2707	0	23.81	24.87	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.53	3	12	0.2835	0.2883	0.2718	0.2706	2.200
0	100	0.2588	0	23.64	24.31	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.37	3	12	0.2721	0.2755	0.2599	0.2587	2.214A
0	100	0.2292	0	23.04	23.59	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.04	3	12	0.2429	0.2459	0.2303	0.2290	2.250
0	100	0.2180	0	22.82	23.65	10	1	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.92	3	12	0.2318	0.2362	0.2192	0.2179	2.264A
0	100	0.1907	15	22.37	22.75	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.67	3	12	0.2049	0.2074	0.1919	0.1905	2.300
0	100	0.1807	0	22.14	22.44	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.46	3	12	0.1952	0.1973	0.1819	0.1805	2.313A

2) 对当前标的的所有自动单执行停止自动下单功能:

The screenshot shows the 'Sequence Automatic Order' (序列期权自动下单) interface. The '全部停止' (All Stop) button is highlighted in blue. The interface includes several sections: '自动交易' (Automatic Trading) with 'Delta' and '张数' (Quantity) fields; 'delta对冲设置' (Delta Hedging Settings) with '风险暴露清零' (Clear Risk Exposure) and '上限金额' (Limit Amount) fields; '下单设置' (Order Settings) with '更新委托参数' (Update Order Parameters) and '更新限价单下单检查' (Update Limit Order Check) buttons; and '波动率设置' (Volatility Settings) with '更新波动率' (Update Volatility) and '曲线选择' (Curve Selection) options. Below these are tabs for '创业板', '(沪)50ETF', '(沪)300ETF', '(沪)500ETF', and '科创50'. A table lists contracts with columns for '合约', '启动下单', '避险商品', '交易', '自动避险清零', '允许自动单', '标的监控', '监控区间(秒)', '监控幅度%', '监控应用', '理论价', '市场买', '市场卖', '市场买量', '市场卖量', and '期权持仓'. The '全部停止' button is highlighted in blue in the table for contract 202406.

3) 设定区中的“全部停止”按钮，对当前自动下单界面的所有自动单停止自动下单:

This screenshot is identical to the previous one, showing the 'Sequence Automatic Order' interface. The '全部停止' (All Stop) button is highlighted in red. The interface includes the same sections for settings and a table of contracts. The '全部停止' button is highlighted in red in the table for contract 202406.

14. \$delta 对冲

需要自动避险时，1) 对应执行价勾选“避险”，2) 设定避险\$delta“上限金额”，3) 勾选“自动避险”（需要3个条件的都设置），点击当前月份的“开始下单”或左侧“启动下单”按钮，自动单下单达到设置的\$delta“上限金额”后，依照（设定自动避险）设置自动进行避险单下单。

序列期权自动下单

自动交易: 标的设置, 设定, 全部停止

统计名称: Delta, 张数

累计自动成交: 0, 0

累计自动避险: 0, 0

自动停止因素: 创业板, (沪)50ETF, (沪)300ETF, (沪)500ETF, 科创50

停止下单: 自动避险

个股期权账号: 8888899521(沪深期权), 期货期权账号: 8888899521(期货期权), 股票账号: 8888899521(股票), 期货账号: 8888899521(期货期权)

合约	启动下单	避险商品	交易	自动避险清零	允许自动单	标的监控	监控区间(秒)	监控幅度%	监控应用	理论价	市场买	市场卖	市场买量	市场卖量	期权持仓	\$
202403	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	36	
202404	---	(沪)50ETF	交易	0	否	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	0	
202406	停止下单	(沪)50ETF	交易	0	是	<input checked="" type="checkbox"/>	1	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	412	
202409	开始下单	(沪)50ETF	交易	0	是	<input type="checkbox"/>	0	0.00	生效	2.448	2.448	67100	2.449	91500	94	

自动下单MAX

类	买		理论价	持仓	市隐波		市量		下单间隔	盘口检查	容忍tick		调整tick	交易波动率	避险	挂量		市价		挂价		
	买	卖			买	卖	买	卖			买	卖				买	卖	买	卖	买	卖	买
0	100	100	0.4079	0	27.66	29.72	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	22.05	<input type="checkbox"/>	3	12	0.4186	0.4250	0.4090	0.4078
0	100	100	0.3608	0	26.15	27.90	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	21.09	<input checked="" type="checkbox"/>	3	12	0.3720	0.3781	0.3619	0.3607
0	100	100	0.3149	0	24.93	26.08	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	20.22	<input checked="" type="checkbox"/>	3	12	0.3270	0.3317	0.3160	0.3147
0	100	100	0.2707	0	23.81	24.87	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.53	<input type="checkbox"/>	3	12	0.2835	0.2883	0.2718	0.2706
0	100	100	0.2588	0	23.64	24.31	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.37	<input checked="" type="checkbox"/>	3	12	0.2721	0.2755	0.2599	0.2587
0	100	100	0.2292	0	23.04	23.59	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	19.04	<input type="checkbox"/>	3	12	0.2429	0.2459	0.2303	0.2290
0	100	100	0.2180	0	22.82	23.65	10	1	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.92	<input type="checkbox"/>	3	12	0.2318	0.2362	0.2192	0.2179
0	100	100	0.1907	15	22.37	22.75	1	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.67	<input type="checkbox"/>	3	12	0.2049	0.2074	0.1919	0.1905
0	100	100	0.1807	0	22.14	22.44	10	10	100.0	盘口量满足	1	2	15	5	18.46	<input type="checkbox"/>	3	12	0.1952	0.1973	0.1819	0.1805

4.20 备兑锁定解锁

上海市场增加期权标的商品的锁定和解锁功能。上海市场在进行备兑开仓前，需要先对标的商品进行锁仓，比如要对50ETF期权进行备兑开仓10张，先要对510050进行锁仓操作，锁仓后备兑开仓才能成功。

(1) 期权标的锁定

点击交易->备兑锁定解锁菜单，即可打开沪市期权的标的锁定和解锁功能模块。可在该页面进行标的锁定。

锁定解锁

账号选择: 183400029430(沪深期权)

期权标的代码选择: 510300

证券代码	证券名称	可锁定数量	可解锁数量	待锁定数量
510050	(沪)50ETF	454774	4390000	0
510300	(沪)300ETF	62500	0	0
510500	(沪)500ETF	2950	30750	0
588000	科创50	0	20000	0
588080	科创板50	21400	0	0

数量输入: 10000

查询 锁定 解锁

选择交易账户和标的代码，点击【查询】按钮即可展示该交易账号下该标的【可锁定】数量。

在数量输入X (X小于等于【可锁定】)，点击锁定按钮。即可锁定数量X的标的。

被锁定的这部分标的在解锁之前不能交易也不能进行二次锁仓，处于冻结状态。

锁定标的后，可以进行该标的期权的备兑交易。详情参照闪电下单模块下4.1.14 沪深期权备兑交易的功能。

(2) 期权标的解锁

点击交易->备兑锁定解锁，即可打开沪市期权的标的锁定和解锁功能模块。可在该页面进行标的解锁。



选择对应交易账户和标的代码。点击【查询】按钮即可展示该交易账号下该标的【可解锁】数量。

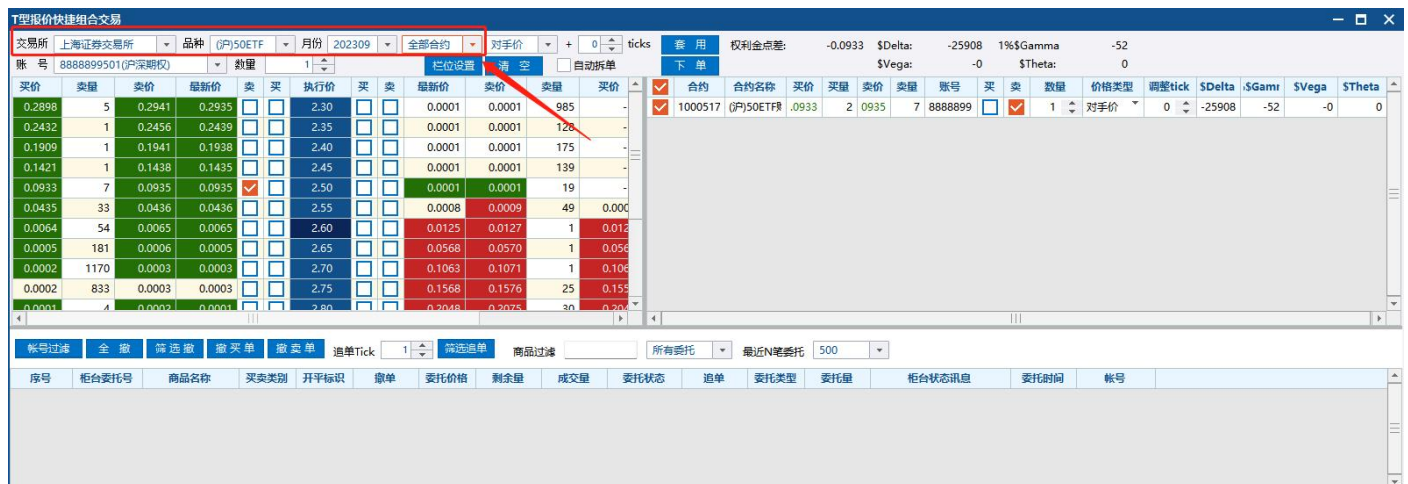
在数量输入 Y (Y 小于等于【可解锁】), 点击解锁按钮。即可解锁数量 Y 的标的。

4.21 T 型报价快捷组合交易

使用者通过路径“交易/T 型报价快捷组合交易”可打开 T 型报价快捷组合交易模块。

4.21.1 筛选标的

点击筛选交易所、品种、月份、合约种类, 筛选后, 底部左侧表格中将显示对应标的的所有执行价的期权以及波动率等相关信息(可通过栏位设置指定需要显示的信息)。



4.21.2 账号设定

点击“账号”设定交易账号。将按照指定的账号或账号组进行交易。送出委托前请检查账号及账号组的配置。



4.21.3 下单步骤

(1) 筛选标的, 选择交易账号

(2) 设定下单数量

数量栏位点击上下调整按钮、或者手动输入设定选中合约的初始委托数量。

T型报价快捷组合交易

交易所 品种 月份 全部合约 对手价

账号 数量

(3) 设定委托价格

可设定选中合约的初始委托价格。在委托类型栏位点击选择委托时可使用的价格类型：本方价、对手价、市价。委托调整（tick）栏位点击上下调整按钮设定“+”“-” tick。

T型报价快捷组合交易

交易所 品种 月份 全部合约 + ticks 权重

账号 数量 自动拆单

(4) 选择合约

在底部表格中打勾选择合约，选中合约将自动展示在右侧待下单区。

T型报价快捷组合交易

交易所 品种 月份 全部合约 + ticks 套用 权利金点差: -0.0059 \$Delta: -12557 1%\$Gamma: -5484

账号 数量 自动拆单 \$Vega: -6 \$Theta: 61

合约	合约名称	买价	买量	卖价	卖量	账号	买	卖	数量	价格类型	调整tick
<input checked="" type="checkbox"/>	10005159 (沪)50ETF购9月260C	0.0059	51	0.0061	1	8888899501(沪深期权)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	对手价	0
<input type="checkbox"/>	10005105 (沪)50ETF购9月265C	0.0003	227	0.0004	467	8888899501(沪深期权)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	对手价	0

待下单区

序号	柜台委托号	商品名称	买卖类别	开平标识	撤单	委托价格	剩余量	成交量	委托状态	追单	委托类型	委托量	柜台状态信息	委托时间	帐号
1	C-000001194	(沪)50ETF购9月260	卖	开仓	--	0.0072	0	1	全部成交	--	限价	1		10:29:34	8899501(沪深)

可通过切换交易所及标的，增加选择其他合约展示在右侧待下单区。

T型报价快捷组合交易

交易所 品种 月份 全部合约 + ticks 套用 权利金点差: -24823.9202 \$Delta: -132.257 1%\$Gamma: -1107

账号 数量 自动拆单 \$Vega: -7 \$Theta: 57

合约	合约名称	买价	买量	卖价	卖量	账号	买	卖	数量	价格类型	调整tick	\$Delta	\$Gamma	\$Vega	\$Theta
<input checked="" type="checkbox"/>	100051 (沪)50ETF	0.1153	30	0.1157	11	88888995	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	34	对手价	0	38.88万	-526	-0	5
<input checked="" type="checkbox"/>	CF311C 棉花311号	2186	1	4966	1	88888995	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	5	本方价	2	13.38万	-581	-7	52

可通过切换交易所及标的，同时选中多个不同交易所及标的的合约，展示在待下单区。

序号	柜台委托号	商品名称	买卖类别	开平标识	撤单	委托价格	剩余量	成交量	委托状态	追单	委托类型	委托量	柜台状态信息	委托时间	帐号
----	-------	------	------	------	----	------	-----	-----	------	----	------	-----	--------	------	----

(5) 调整待下单区合约价格

批量变更：在顶部委托类型栏设定价格类型及调整 ticks。在对应的合约打勾，点击套用。则打勾选中的合约其价格类型及调整 tick 将自动变更为设置值。

对手价	+ 0 ticks	套用	权利金点差: -0.1500	\$Delta: -72517	1%\$Gamma -8007										
清空	<input type="checkbox"/> 自动拆单	下单	\$Vega: -4	\$Theta: 201											
合约	合约名称	买价	买量	卖价	卖量	账号	买	卖	数量	价格类型	调整tick	\$Delta	\$Gamma	\$Vega	\$Theta
<input checked="" type="checkbox"/>	10005171 (沪)50ETF购9月2550	0.0500	10	0.0502	10	8888899501(沪深期权)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	3	对手价	0	-72517	-80		
<input type="checkbox"/>	10005172 (沪)50ETF沽9月2550	0.0001	25	0.0002	132	8888899501(沪深期权)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	3	对手价	0	5468	-80		

单条变更：在右侧待下单区，手动调整价格类型及调整 tick 即可。

对手价	+ 0 ticks	套用	权利金点差: -0.0722	\$Delta: 6995	1%\$Gamma 802										
自动拆单	<input type="checkbox"/>	下单	\$Vega: 8	\$Theta: -5											
合约	合约名称	买价	买量	卖价	卖量	账号	买	卖	数量	价格类型	调整tick	\$Delta	\$Gamma	\$Vega	\$Theta
<input checked="" type="checkbox"/>	10005927 (沪)50ETF沽10月260	0.0488	15	0.0489	8	8888899601(沪深期权)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	对手价	0	-14117	2243	24	-18
<input checked="" type="checkbox"/>	10005929 (沪)50ETF沽10月270	0.1211	3	0.1217	2	8888899601(沪深期权)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	对手价	0	21112	-1441	-16	13

(6) 调整待下单区合约数量

在右侧待下单区手动调整下单数量即可。

(7) 拆单

点击选中自动拆单，下单时将按照系统委托设置，该市场该期权对应的拆单设置进行拆单。

(8) 快速下单

在右侧待下单区对想进行下单的合约打勾，点击下单按钮，可进行快速下单。下单后委托记录将展示在底部委托管理区。

Delta	系统波动率	买	卖	执行价	买	卖	系统波动率	Delta	Gamma	对手价	+ 0 ticks	套用	权利金点差: 0.4238	\$Delta: -89732	1%\$Gamma -1020
清空	<input type="checkbox"/>	自动拆单	<input type="checkbox"/>	栏位设置	清空	<input type="checkbox"/>	自动拆单	清空	<input type="checkbox"/>	自动拆单	清空	<input type="checkbox"/>	下单	\$Vega: -9	\$Theta: 5
合约	合约名称	买价	买量	卖价	卖量	账号	买	卖	数量	价格类型	调整tick	\$Delta	\$Gamma	\$Vega	\$Theta
<input checked="" type="checkbox"/>	10005933 (沪)300ETF购10月30	0.1776	1	0.1784	1	8888899621(沪深期权)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	对手价	0	-32558	-1897	-19	
<input checked="" type="checkbox"/>	10006000 科创板50沽10月100	0.0935	1	0.0961	1	8888899621(沪深期权)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	对手价	0	-7988	240	4	
<input checked="" type="checkbox"/>	90002538 创业板ETF购10月18	0.1100	3	0.1138	7	8888899621(沪深期权)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	对手价	0	-17083	-797	-9	
<input checked="" type="checkbox"/>	90002589 (深)中证500ETF沽10	0.5999	1	0.6014	1	8888899621(沪深期权)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	对手价	0	-57174	877	10	

(9) 清空待下单区选中合约

点击清空按钮，可快速清空待下单区选中合约。

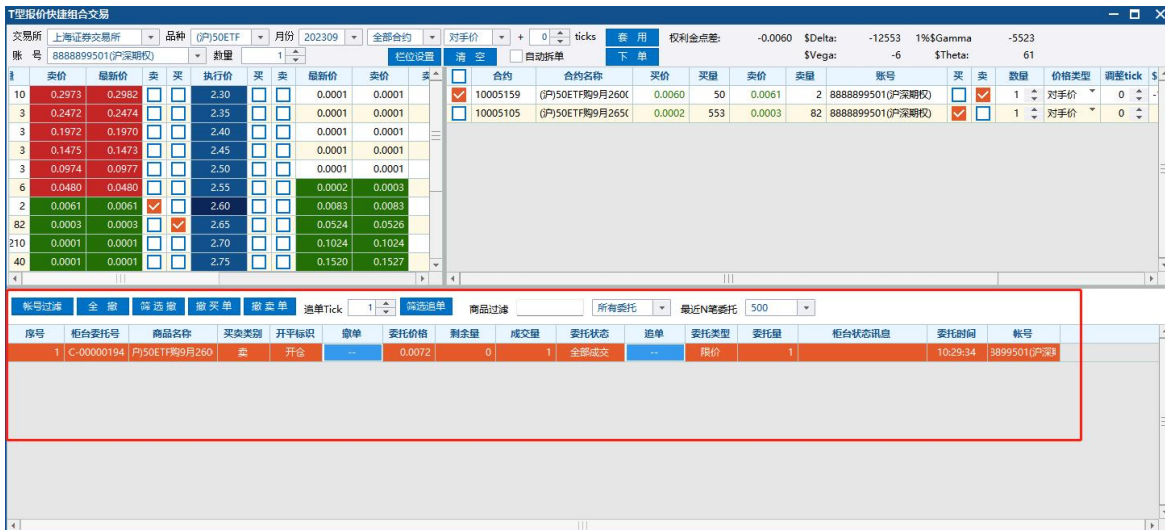
4.21.4 下单试算显示

对手价	+ 0 ticks	套用	权利金点差: -0.0079	\$Delta: -13206	1%\$Gamma -5465										
清空	<input type="checkbox"/> 自动拆单	下单	\$Vega: -6	\$Theta: 80											
合约	合约名称	买价	买量	卖价	卖量	账号	买	卖	数量	价格类型	调整tick	\$Delta	\$Gamma	\$Vega	\$Theta
<input checked="" type="checkbox"/>	10005159 (沪)50ETF购9月260	0.0079	28	0.0080	20	8888899501(沪深期权)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	对手价	0				
<input type="checkbox"/>	10005105 (沪)50ETF购9月265	0.0003	372	0.0004	367	8888899501(沪深期权)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	对手价	0				

提供使用者下单试算功能，统计待下单区打勾选中合约委托风险敞口。

4.21.5 委托管理

使用者可以通过委托管理区对所有账号下的委托单进行管理，目前提供“账号过滤”、“委托类型”、“商品过滤”、“最近 N 笔委托”等过滤条件。用户还可实现委托管理区快速追单、撤单功能。

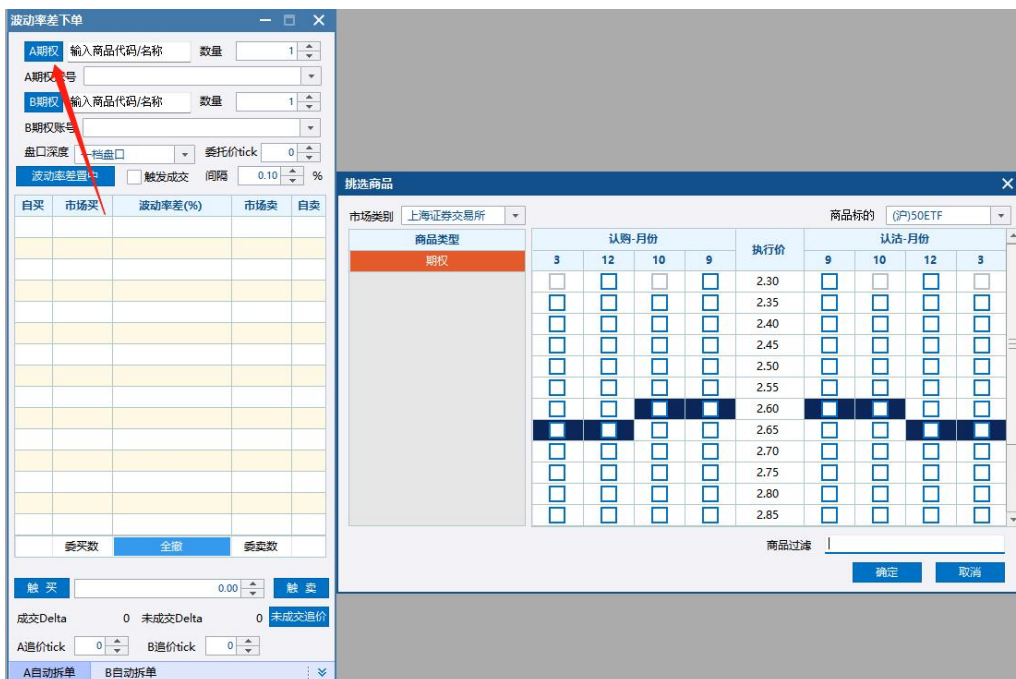


4.22 波动率差下单

使用者通过路径交易/波动率差下单，即可进入波动率差下单页面。

4.22.1 选择期权

点击 A 期权，在出现的弹窗中切换市场类别及商品标的，对要进行交易的期权进行打勾选中。选定 A 期权后，再点击 B 期权，可选择与 A 期权相同标的 B 期权进行交易。



4.22.2 选择交易账号

点击 A 期权账号和 B 期权账号，分别切换选择 A 期权和 B 期权要进行交易的账号或账号组。

4.22.3 调整组数

目前默认数量为 1 组，支持上下按钮调整和手动输入组数。设定在画面上买进或卖出时的委托组数。

当 B 期权数量>0：进行波动率差买入下单时，为买入 A 期权，卖出 B 期权；

进行波动率差卖出下单时，为卖出 A 期权，买入 B 期权。

当 B 期权数量<0：进行波动率差买入下单时，为买入 A 期权，买入 B 期权；

进行波动率差卖出下单时，为卖出 A 期权，卖出 B 期权。



4.22.4 委托价 tick

使用者可以通过委托价 tick 设定发出委托时的调整 tick。

4.22.5 调整间隔

使用者可以透过设定间隔，调整底部展示的价格相邻两个档位之间的差值。



4.22.6 一般波动率差交易单

使用者可以在“市场买”“市场卖”栏位中，点选“+”进行买进或卖出。将依设定的“组数”、“委托单类型”以及各商品的委托账号进行送单。

自买	市场买	波动率差(%)	市场卖	自卖
	+	6.60	+	
	+	6.46	+	
	+	6.32	+	
	+	6.18	+	
	+	6.04	+	
	+	5.90	+	
	+	5.76	+	
	14	5.62	5	
	+	5.48	+	
	+	5.34	+	
	+	5.20	+	
	+	5.06	+	
	+	4.92	+	
	+	4.78	+	
	+	4.64	+	
委买数	全数		委卖数	

4.22.7 触发成交单

① 使用者选中触发成交按钮后，可在“市场买”“市场卖”栏位中，点选“+”进行买进或卖出，发出预埋单。

波动率差置中 <input checked="" type="checkbox"/> 触发成交 间隔 0.14 %				
自买	市场买	波动率差(%)	市场卖	自卖
	+	6.95	+	
	+	6.81	+	
	+	6.67	+	
	+	6.53	+	
	+	6.39	+	
	+	6.25	+	
	+	6.11	+	3
	+	5.97	+	
	+	5.83	+	
	+	5.69	+	
	+	5.55	+	
	+	5.41	+	
	+	5.27	+	
	+	5.13	+	
	+	4.99	+	
委买数	全撤			委卖数

② 也可通过底部输入波动率差值，点击触买或触卖，发出预埋单。

触买	5.25	触卖		
成交Delta	155221	未成交Delta	0	未成交追价
A追价tick	0	B追价tick	0	
A自动拆单		B自动拆单		

买入时，当 ask 波差上穿或下穿预设值时，将依设定的“数量”、“委托价 tick”、期权账号进行送单。
 卖出时，当 bid 波差上传或下穿预设值时，将依设定的“数量”、“委托价 tick”、期权账号进行送单。

4.22.8 未成交追单

已发出但未成交的委托单，可点击未成交追价进行一次追单。将按照设置的 A 追价 tick、B 追价 tick 追单。

4.23 条件单

条件单模块新增预埋单功能，可以从触发时间、触发条件、下单策略、追单策略等方面控制进行交易。

使用者通过路径“交易/条件单”打开条件单模块。

4.23.1 添加条件单

点击添加按钮，出现新增条件单的界面。可在此界面编辑添加一条条件单策略。



添加步骤：

- (1) 选择商品。点击商品按钮，在出现的弹窗选择商品。或者根据输入的商品代码/商品名称过滤选择商品。
- (2) 选择交易账号。点击“账号”设定交易账号，将按照指定的账号或账号组进行交易。
- (3) 设置时间条件

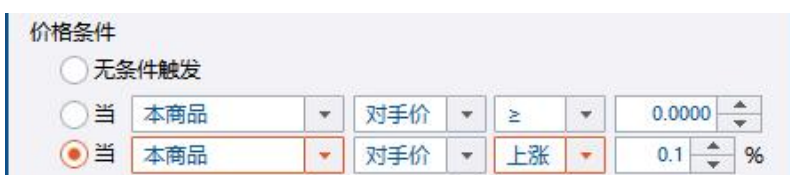
设置条件单启动的时间条件。

可选项：①启动后直接触发、②启动后进入可交易时段触发、③启动后指定时间触发（条件单启动后，到达指定时间触发）。



- (4) 设置价格条件

设置条件单启动的价格条件。



可选项：①无条件触发、②行情指定价格触发（本商品/其他商品所选择的价格类型大于/大于等于/小于/小于等于指定价格时触发。价格类型可以选择对手价、本方价、现价）、③行情变化指定百分比触发（本商品/其他商品所选择的价格类型上涨/下跌指定百分比触发。价格类型可以选择对手价、本方价、现价）。

注：行情指定价格触发中，填写触发价格后会自动四舍五入到价格的小数位数。

- (5) 设置盘口条件

设置条件单启动的盘口条件。

盘口条件

无条件触发

当 对手一档 ≥ 0

可选择项：①无条件触发（不需要考虑盘口）、②盘口条件触发（选择的档位类型挂单数量大于/大于等于/小于/小于等于指定数量时触发。例如：选择当本方三档大于 1500，则当本方三档挂单量之和大于 1500 时触发）

注：必须同时满足设置的时间条件、价格条件、盘口条件，才会进行下单。

（6）设置下单策略

设置下单的价格类型、调整 tick、买卖方向、开平仓方向以及下单数量。

下单策略

对手价 调整tick 2

卖 开仓

指定数量 2 张

注：商品选择股票/股票期权/期货/期货期权时，下单数量可选择按照持仓的倍数进行填写。倍数可以是小数，仅保留两位小数。

（7）设置追单策略

勾选“启动自动追单”后，如果下单后未成交那么执行追单策略。

追单策略

启动自动追单

10 秒未成交追单 追单价格 对手价 调整tick 2

追单次数 1 (追单次数在1~99之间)

设置下单和追单策略后，在条件单列表处展示的调整 tick 为实际交易时增加或减少的 tick。

例：如设置买卖方向为卖，追单策略的追单价格为对手价，调整 tick 为 2。则在条件单列表处追单策略展示为以对手价-2tick 卖；如设置买卖方向为买，追单策略的追单价格为对手价，调整 tick 为 2。则在条件单列表处追单策略展示为以对手价+2tick 买。

条件单 -- 编辑

商品 (沪)50ETF购3月2903A 账号 8888899601(沪深期权)

时间条件

启动后直接触发

启动后进入可交易时段触发

启动后指定时间触发 17:40:00

价格条件

无条件触发

当 本商品 对手价 \geq 0.0040

当 本商品 对手价 上涨 1.00 %

盘口条件

无条件触发

当 对手一档 \geq 0

下单策略

对手价 调整tick 2

指定数量 2 张

追单策略

启动自动追单

10 秒未成交追单 追单价格 对手价 调整tick 2

追单次数 1 (追单次数在1-99之间)

确定 取消

条件单

添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤	序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作
<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	10005862	(沪)50ETF购3月2903A	8888899601(沪深期权)	17:40:00触发	直接触发	直接触发	对手价-2ticks卖(开仓)2张	10秒未成交 以对手价-2ticks追单 最多执行1次	未启动	启动 编辑 删除

注：到达追单时间，如果设置的追单价格与已挂委托单价格一样，则不会撤单重挂。但是追单次数会减少1。

(8) 以上设置完成后，点击确定，则新增一条条件单策略完成。

4.23.2 删除条件单

批量删除：勾选要删除的条件单，点击【勾选删除】并确定，可以批量删除条件单。

条件单

添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤	序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	自单策略	状态	操作	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	1	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	-- -- 删除	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	-- -- 删除	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已执行	停止 -- --	
<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	4	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动 编辑 删除	
<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	5	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动 编辑 删除	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	6	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深期)	09:30:00	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81备兑开仓	不追单	已停止	-- -- 删除
<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	7	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深期)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81备兑开仓	不追单	未启动	启动 编辑 删除	

删除条件单

确定要删除勾选的条件单?

是 否

单条删除：点击条件单右侧的删除按钮，可以逐条删除条件单。

条件单											
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤		
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作	
<input type="checkbox"/>	1	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	-- -- 删除
<input type="checkbox"/>	2	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	-- -- 删除
<input type="checkbox"/>	3	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已执行	停止 -- --
<input type="checkbox"/>	4	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动 编辑 删除
<input type="checkbox"/>	5	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动 编辑 删除
<input type="checkbox"/>	6	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深期)	09:30:00	直接触发	直接触发	指定价2.81备兑开仓	不追单	已停止	-- -- 删除
<input type="checkbox"/>	7	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深期)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81备兑开仓	不追单	未启动	启动 编辑 删除

删除条件单

确定要删除本条件单?

是 否

4.23.3 导出条件单

勾选要导出的条件单，点击【勾选导出】，可以批量导出条件单成为条件单文件。

条件单											
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤		
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作	
<input checked="" type="checkbox"/>	1	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)100张	不追单	未启动	启动 编辑 删除
<input type="checkbox"/>	2	600017	日照港	8888899601(股票)	10:30:00触	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)100张	不追单	未启动	启动 编辑 删除
<input type="checkbox"/>	3	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动 编辑 删除
<input checked="" type="checkbox"/>	4	10006257	(沪)50ETF购	8888899601(沪深期)	直接触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	未启动	启动 编辑 删除
<input checked="" type="checkbox"/>	5	10006229	科创50购6月	8888899601(沪深期)	交易时段触	(沪)50ETF沽12月24	对手一档挂单量大于	对手价买(开仓)1张	10秒未成交,以对手价	未启动	启动 编辑 删除

4.23.4 导入条件单

点击导入，并选择符合规则的对应条件单文件，可以批量导入条件单。

条件单											
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤		
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作	
<input type="checkbox"/>	1	600016	民生银行	8888899601(股票)	11:00:00触	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)100股	不追单	执行中	停止 -- --
<input type="checkbox"/>	2	600016	民生银行	8888899601(股票)	直接触发	本商品现价大于等于3.9	直接触发	对手价买(开仓)100股	不追单	执行中	停止 -- --
<input type="checkbox"/>	3	600016	民生银行	8888899601(股票)	直接触发	本商品对手价上涨1%	直接触发	对手价买(开仓)100股	不追单	执行中	停止 -- --
<input type="checkbox"/>	4	10006265	(沪)50ETF购	8888899601(沪深期)	09:00:00触	本商品对手价上涨1%	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止 -- --
<input type="checkbox"/>	5	90002448	(深)沪深300E	8888899601(沪深期)	直接触发	直接触发	对手一档挂单量	对手价买(开仓)1张	不追单	已停止	-- -- 删除

4.23.5 启动条件单

批量启动：勾选未启动状态的条件单，点击勾选启动，可以批量启动条件单。

条件单											
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤		
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作	
<input type="checkbox"/>	1	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	-- -- 删除
<input type="checkbox"/>	2	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	-- -- 删除
<input type="checkbox"/>	3	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已执行	停止 -- --
<input checked="" type="checkbox"/>	4	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动 编辑 删除
<input checked="" type="checkbox"/>	5	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动 编辑 删除
<input type="checkbox"/>	6	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深期)	09:30:00触	直接触发	直接触发	指定价2.81备兑开仓	不追单	已停止	-- -- 删除
<input checked="" type="checkbox"/>	7	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深期)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81备兑开仓	不追单	未启动	启动 编辑 删除

单条启动：也可以点击条件单右侧的启动按钮，逐条启动条件单。

条件单													
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤				
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作			
<input type="checkbox"/>	1	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	--	--	删除
<input type="checkbox"/>	2	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	--	--	删除
<input type="checkbox"/>	3	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已执行	停止	--	--
<input type="checkbox"/>	4	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动	编辑	删除
<input type="checkbox"/>	5	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动	编辑	删除
<input type="checkbox"/>	6	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深期)	09:30:00触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	已停止	--	--	删除
<input type="checkbox"/>	7	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深期)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)1	不追单	未启动	启动	编辑	删除

4.23.6 停止条件单

批量停止：勾选执行中/已执行状态的条件单，点击【全部停止】，则可以批量停止对应条件单。

条件单													
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤				
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作			
<input type="checkbox"/>	1	CF403	一号棉花403	8888899601(期货期权)	直接触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	失败	--	--	删除
<input type="checkbox"/>	2	CF405	一号棉花405	8888899601(期货期权)	09:00:00触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--	--
<input type="checkbox"/>	3	000016	深康佳A	8888899601(股票)	交易时段触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)100股	不追单	执行中	停止	--	--
<input checked="" type="checkbox"/>	4	10006250	科创板50沽6	8888899601(沪深期权)	直接触发	本商品本方价大于0.0078	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--	--
<input type="checkbox"/>	5	10006257	(沪)50ETF购	8888899601(沪深期权)	交易时段触发	本商品对手价上涨1%	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--	--
<input checked="" type="checkbox"/>	6	ag2410	白银2410	8888899601(期货期权)	直接触发	本商品对手价下跌1%	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--	--
<input checked="" type="checkbox"/>	7	rb2401C4600	rb2401C46C	8888899601(期货期权)	直接触发	本商品对手价上涨1%	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--	--

单条停止：点击条件单右侧的停止按钮，逐条停止条件单。

条件单													
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤				
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作			
<input type="checkbox"/>	1	600016	民生银行	8888899601(股票)	11:00:00触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)100股	不追单	执行中	停止	--	--
<input type="checkbox"/>	2	600016	民生银行	8888899601(股票)	直接触发	本商品现价大于等于3.9	直接触发	对手价买(开仓)100股	不追单	执行中	停止	--	--
<input type="checkbox"/>	3	600016	民生银行	8888899601(股票)	直接触发	本商品对手价上涨1%	直接触发	对手价买(开仓)100股	不追单	执行中	停止	--	--
<input type="checkbox"/>	4	10006265	(沪)50ETF购	8888899601(沪深期)	09:00:00触发	本商品对手价上涨1%	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--	--
<input type="checkbox"/>	5	90002448	(深)沪深300E	8888899601(沪深期)	直接触发	直接触发	对手一档挂单	对手价买(开仓)1张	不追单	已停止	--	--	删除

4.23.7 栏位设置

点击【栏位设定】可以根据需要调整显示的栏位和栏位顺序。

4.23.8 条件单过滤

可以根据账号过滤（按照交易账户或账号组进行过滤）、状态过滤、商品过滤（根据商品代码/商品名称过滤）。

条件单											
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤		
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作	
1	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)	不追单	已停止	--	删除
2	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)	不追单	已停止	--	删除
3	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)	不追单	已执行	停止	--
4	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)	不追单	未启动	启动	编辑
5	600017	日照港	8888899601(股票)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81买(自动)	不追单	未启动	启动	编辑
6	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深深期)	09:30:00触发	直接触发	直接触发	指定价2.81备兑开仓	不追单	已停止	--	删除
7	90002803	深证100ETF	8888899601(沪深深期)	直接触发	直接触发	直接触发	指定价2.81备兑开仓	不追单	未启动	启动	编辑

4.23.9 编辑条件单

点击条件单右侧的编辑按钮，可以打开编辑界面进行编辑。

条件单											
添加	勾选删除	勾选导出	导入	勾选启动	全部停止	栏位设定	账号过滤	全部条件单	商品过滤		
序号	商品代码	商品名称	账号	时间条件	价格条件	盘口条件	下单策略	追单策略	状态	操作	
1	CF403	一号棉花403	8888899601(期货期权)	直接触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	失败	--	删除
2	CF405	一号棉花405	8888899601(期货期权)	09:00:00触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--
3	000016	深康佳A	8888899601(股票)	交易时段触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)100股	不追单	执行中	停止	--
4	10006250	科创板50沽6	8888899601(沪深深期)	直接触发	本商品本方价大于0.0078	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--
5	10006257	(沪)50ETF购	8888899601(沪深深期)	交易时段触发	本商品对手价上涨1%	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--
6	ag2410	白银2410	8888899601(期货期权)	直接触发	本商品对手价下跌1%	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--
7	rb2401C4600	rb2401C46C	8888899601(期货期权)	直接触发	本商品对手价上涨1%	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	执行中	停止	--
8	10006175	(沪)50ETF购	8888899601(沪深深期)	直接触发	直接触发	直接触发	本方价买(开仓)1张	不追单	已执行	停止	--
9	10006175	(沪)50ETF购	8888899601(沪深深期)	直接触发	直接触发	直接触发	对手价买(开仓)1张	不追单	未启动	启动	编辑

4.24 篮子交易

使用者可以设定一篮子股票，并进行手动批量下单，监控统计一篮子股票的交易进程，并对一篮子股票成交后的状态进行监控，同时可以进行反向下单。

使用者通过路径“交易/篮子交易”：即可打开篮子交易模块。

4.24.1 篮子的导入

使用者点击“批量导入”，可以选择多个导出的篮子文件，导入成为新的篮子

篮子交易											
我的篮子	批量导入	全部导出	新增篮子	10	秒内最多委托	5	单	确认修改			
序号	名称	账号	价格类型	调整tick	比例类型	下单组数	金额(万)	补足	买	卖	删除
1	000300	8888899521(股票)	对手价	0	按数量	50	1.00	送出	送出	送出	编辑
2	沪深300指数	8888899501(股票)	对手价	0	按数量	1	1.00	送出	送出	送出	编辑
3	上证50	8888899501(股票)	对手价	0	按数量	5	1.00	送出	送出	送出	编辑
4	中证500	8888899501(股票)	对手价	0	按数量	1	1.00	送出	送出	送出	编辑
5	中证小盘500指数	8888899521(股票)	对手价	0	按数量	3	1.00	送出	送出	送出	编辑
6	沪500ETF	8888899501(股票)	对手价	0	按数量	1	30.00	送出	送出	送出	编辑

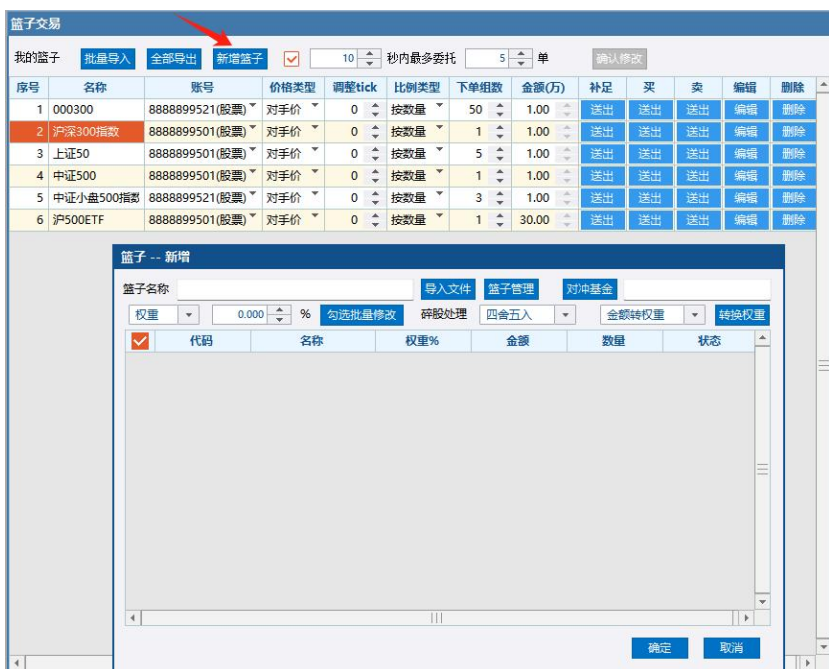
4.24.2 篮子的导出

使用者点击“全部导出”，将当前所有篮子策略导出成为CSV文件，每个篮子一个文件



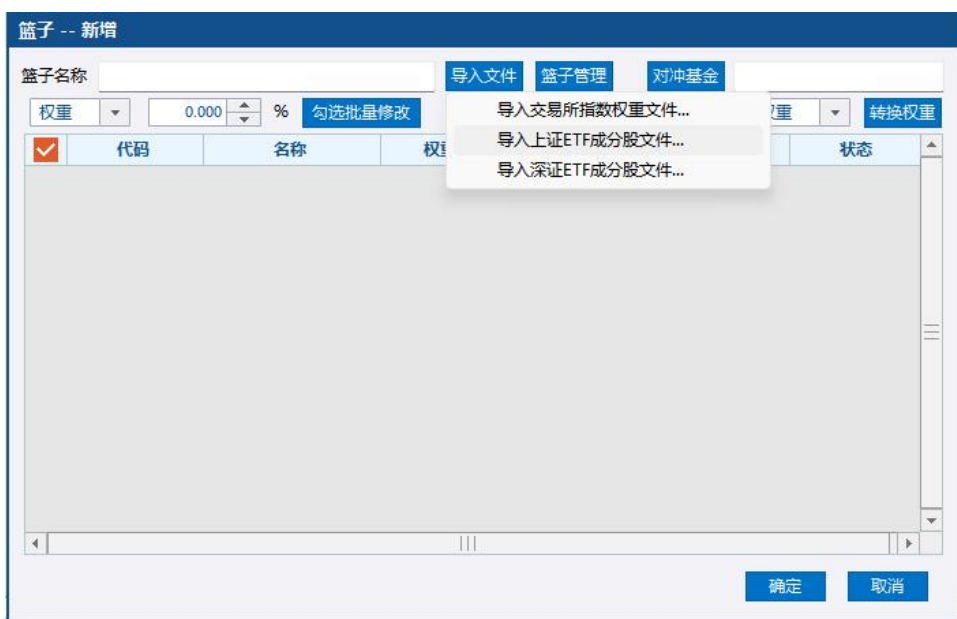
4.24.3 新增篮子

点击“新增篮子”，开启“新增篮子”界面，可以新增篮子，并同时设置对冲基金及调整其他相关配置：



新增篮子商品有三种方式：

(1) 点击“导入文件”，可选择“导入交易所指数权重文件”、“导入上证ETF成分股文件”、“导入深证ETF成分股文件”。



选择“导入交易所指数权重文件”，点击“继续”，导入*.csv格式文件（指数权重*.csv格式文件信息，请点击“导入说明”查看）。



选择“导入上证ETF成分股文件”，点击“继续”，导入*.ETF格式文件（上海ETF成分股*.ETF格式文件信息，请点击“导入说明”查看）。



选择“导入深证ETF成分股文件”，点击“继续”，导入*.xml格式文件（深证ETF成分股*.xml格式文件信息，请点击“导入说明”查看）。



(2) 点击“篮子管理”，选择任意篮子组合进行加入（只能添加沪深市场的股票和基金）



(3) 篮子监控的反向下单按钮生成反向篮子

删除	反向下单	建仓时间	名称	买卖	成本	浮动盈亏	盈亏	卖出价	状态
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>		合计		45810	3270	0		
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	202302/08-09:57:34	510050	买	7140	6.70		7147.30	正常
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	202302/06-14:48:41	1	卖	1096	5.20		1101.20	正常
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	202302/06-14:48:24	1	卖	723	-1.00		724.00	正常
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	202302/06-14:48:15	1	买	724	0.00		725.00	正常
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	202301/03-17:45:36	000913	买	33050	2839.00		35894.00	正常
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	202301/03-17:15:26	000913	买	4523	420.00		4944.00	正常

4.24.4 设置单位时间内最多委托数量规则

篮子交易中可设置单位时间内最多可委托数量规则。设置完成后，该篮子交易所有未发出的委托均将按照此规则进行委托。且各个账号分别按照此规则委托，不会互相影响。

序号	名称	账号	价格类型	调整tick	比例类型	下单组数	金额(万)	补足	买	卖	编辑	删除
1	000300	8888899521(股票)	对手价	0	按数量	50	1.00	送出	送出	送出	编辑	删除
2	沪深300指数	8888899501(股票)	对手价	0	按数量	1	1.00	送出	送出	送出	编辑	删除
3	上证50	8888899501(股票)	对手价	0	按数量	5	1.00	送出	送出	送出	编辑	删除
4	中证500	8888899501(股票)	对手价	0	按数量	1	1.00	送出	送出	送出	编辑	删除
5	中证小盘500指数	8888899521(股票)	对手价	0	按数量	3	1.00	送出	送出	送出	编辑	删除
6	沪500ETF	8888899501(股票)	对手价	0	按数量	1	30.00	送出	送出	送出	编辑	删除

(1) 新增规则步骤

填写时间条件与下单数量，并勾选



点击【确认修改】，则设置完成



设置完成后，送出一个或多个篮子交易策略并勾选下单时，单位时间内最多可委托数量与设置的一致。且各个账号均分别按照该规则委托，不受其他账号影响。

例1:设置规则为10秒内最多委托5单。策略A先勾选下单4单(账号为8888899501),策略B也立马勾选下单5单(账号为8888899501)。则10秒内,策略A发起委托4单,策略B发起委托1单。10秒后,策略B再委托4单。且均使用账号8888899501。

委托时间	商品代码	帐号	序号	柜台委托号	商品名称	买卖类别	开平标识	撤单	委托价格	剩余量	成交量	委托状态	追单	委托类型	委托量	柜台状态
09:32:06	600012	8888899501(股票)	1	OA-00000042	皖通高速	买	--	--	11.20	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:32:06	510180	8888899501(股票)	2	OA-00000041	180ETF	买	--	--	3.152	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:32:06	600011	8888899501(股票)	3	OA-00000040	华能国际	买	--	--	8.00	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:32:06	600016	8888899501(股票)	4	OA-00000039	民生银行	买	--	--	3.76	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:31:57	510150	8888899501(股票)	5	OA-00000038	消费ETF	买	--	--	0.521	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:31:56	600019	8888899501(股票)	6	OA-00000037	宝钢股份	买	--	--	6.03	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:31:56	600018	8888899501(股票)	7	OA-00000036	上港集团	买	--	--	2.77	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:31:56	600017	8888899501(股票)	8	OA-00000035	日照港	买	--	--	2.77	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:31:56	600016	8888899501(股票)	9	OA-00000034	民生银行	买	--	--	3.77	0	100	全部成交	--	限价	100	

例2:设置规则为10秒内最多委托5单。策略A先勾选下单4单(账号为8888899501),策略B也立马勾选下单9单(账号为8888899511)。则10秒内,策略A发起委托4单,策略B发起委托5单。10秒后策略B再委托剩下的4单。策略A使用账号为8888899501,策略B使用账号为8888899511。

委托时间	商品代码	帐号	序号	柜台委托号	商品名称	买卖类别	开平标识	撤单	委托价格	剩余量	成交量	委托状态	追单	委托类型	委托量	柜台状态
09:49:13	600019	8888899511(股票)	1	OA-00000068	宝钢股份	买	--	--	6.03	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:13	600020	8888899511(股票)	2	OA-00000067	中原高速	买	--	--	3.77	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:13	600022	8888899511(股票)	3	OA-00000066	华能国际	买	--	--	1.38	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:13	600021	8888899511(股票)	4	OA-00000065	上海电力	买	--	--	8.54	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:03	600012	8888899511(股票)	5	OA-00000064	皖通高速	买	--	--	11.34	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:03	510180	8888899511(股票)	6	OA-00000063	180ETF	买	--	--	3.155	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:03	600011	8888899511(股票)	7	OA-00000062	华能国际	买	--	--	7.94	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:03	600016	8888899511(股票)	8	OA-00000061	民生银行	买	--	--	3.76	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:03	510150	8888899511(股票)	9	OA-00000060	消费ETF	买	--	--	0.522	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:02	600019	8888899501(股票)	10	OA-00000059	宝钢股份	买	--	--	6.03	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:02	600018	8888899501(股票)	11	OA-00000058	上港集团	买	--	--	5.04	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:02	600017	8888899501(股票)	12	OA-00000057	日照港	买	--	--	2.78	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:49:02	600016	8888899501(股票)	13	OA-00000056	民生银行	买	--	--	3.76	0	100	全部成交	--	限价	100	
09:48:34	600019	8888899501(股票)	14	OA-00000055	宝钢股份	买	--	--	6.03	0	100	全部成交	--	限价	100	

注:新增或修改委托数量规则完成后,篮子交易所有还未发出的委托都将按照最新规则进行委托。

(2) 取消规则步骤

取消勾选并点击【确认修改】，则取消规则成功



取消规则后,篮子交易下单顺序与之前一致,不再对下单数量进行限制。

注:取消委托数量规则完成后,篮子交易页面所有还未发出的委托都将立即去掉委托数量限制。

4.24.5 篮子的设置

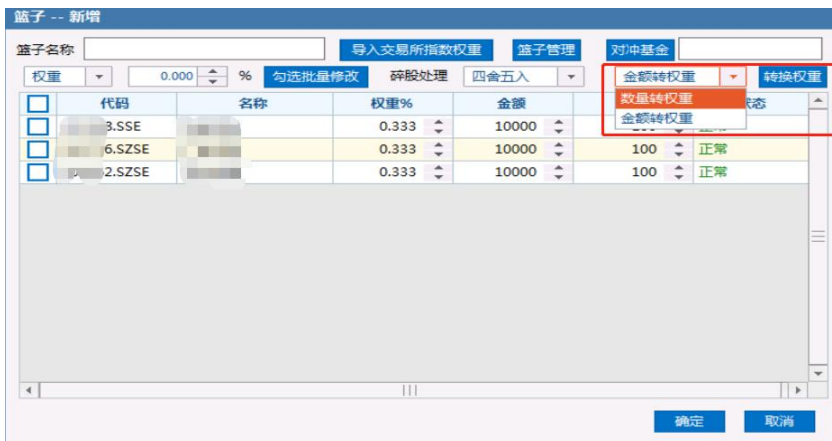
(1) 勾选批量修改

成功导入权重文件后如下图，金额和数量默认显示为0，可通过设置“权重/金额/数量”点击“勾选批量修改”按钮进行调整。



(2) 转换权重

手动添加的商品权重默认为0，可以通过设置“金额转权重或数量转权重”，点击“转换权重”按钮计算商品的权重。



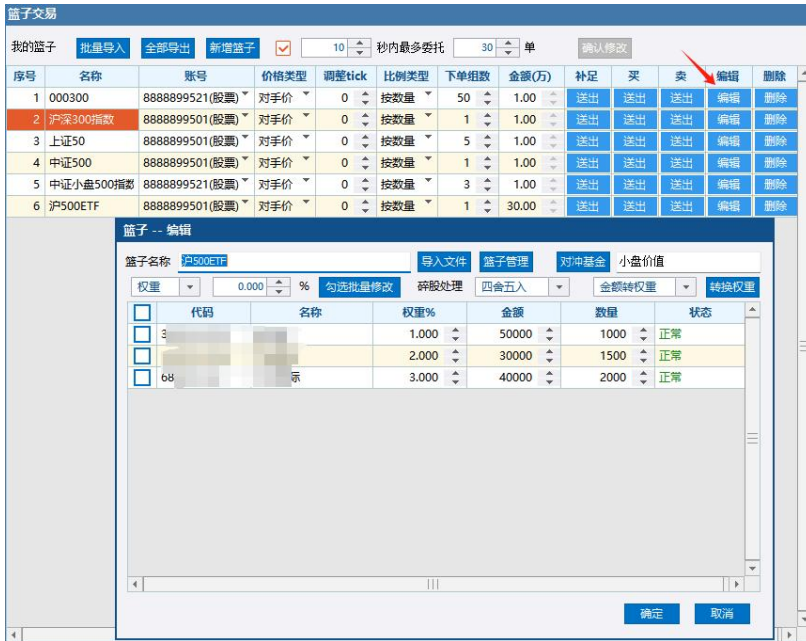
(3) 碎股处理

根据金额和权重计算出的委托数量，或者直接调整数量时出现不是整数（股票不是100的整数倍）时，主要有：四舍五入，无条件进位和无条件舍弃三种方式进行处理



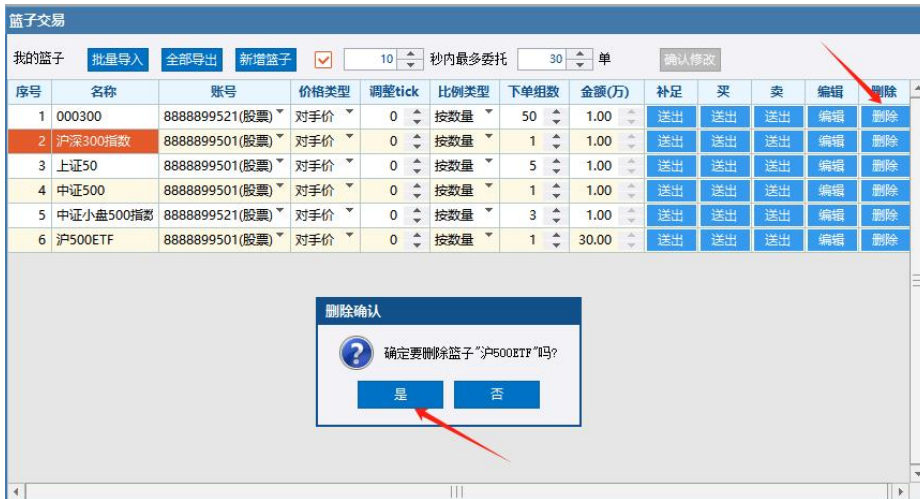
4.24.6 篮子的编辑

点击编辑按钮可以对当前篮子中的商品，商品权重，金额，数量进行调整



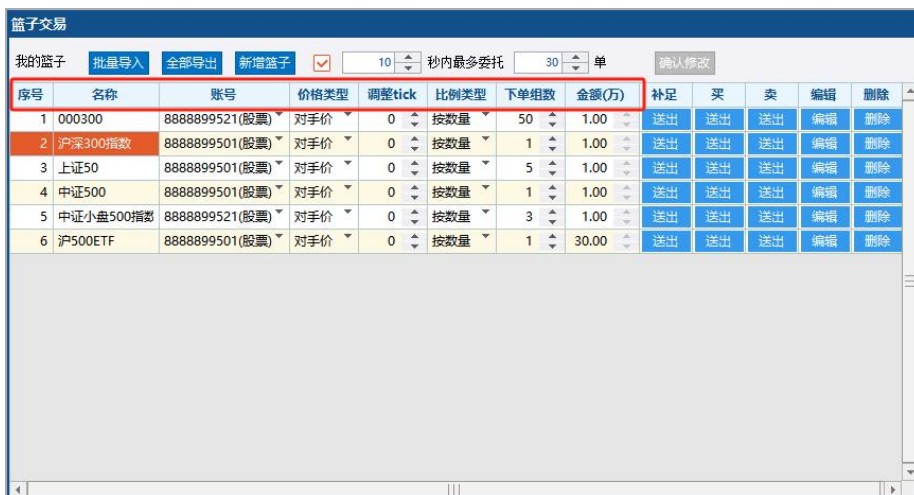
4.24.7 篮子的删除

点击删除后，删除该条篮子策略



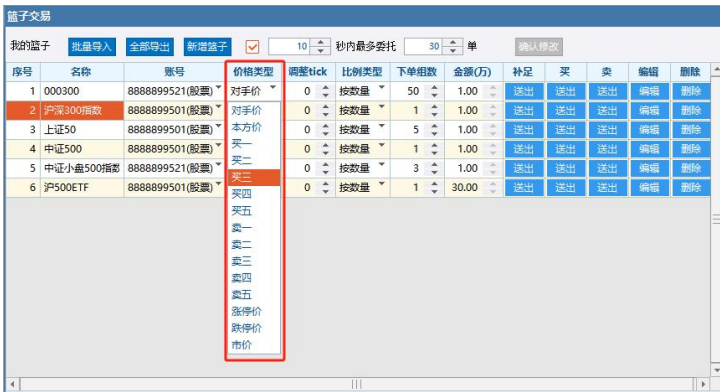
4.24.8 买卖单下单步骤

步骤 1: 使用者送出篮子委托前，可以设定账号，价格类型，调整 tick，比例类型，下单组数，金额。



(1) 交易账号：可下拉选择可用的交易账号。

(2) 价格类型：可选择送出的价格类型，可以按照对手价、本方价、买卖五档价格或者涨跌停价或市价进行送单。



(3) 调整 tick：在选择的类型的基础上，可进行价格调整。

(4) 比例类型：可选择按权重，按金额，按数量。每次交易只能选择一种比例类型。

当下单比例选择“按权重”下单时，“金额（万）”栏位可编辑，“下单组数”栏位不可编辑。

当下单比例选择“按金额或按数量”下单，“金额（万）”栏位不可编辑，“下单组数”栏位可编辑。

通过不同的比例类型所填写的参数，最终的计算交易委托数量不同。

例：对某一资金账号所设立的篮子“300033”、“000001”、“600000”为例子

	300033	000001	600000
设置资金权重	1	2	3
设置委托金额	50000	30000	40000
设置委托数量	1000 股	1500 股	2000 股

比例类型	输入参数	300033 计算委托数量	000001 计算委托数量	600000 计算委托数量
按权重	委托金额 120000	=120000 / (1+2+3) * 1 / 基准价格	=120000 / (1+2+3) * 2 / 基准价格	=120000 / (1+2+3) * 3 / 基准价格
按数量	篮子份数 2	=1000 股 * 2	=1500 股 * 2	=2000 股 * 2
按金额	篮子份数 3	=50000 * 3 / 基准价格	=30000 * 3 / 基准价格	=40000 * 3 / 基准价格

点击“买”、“卖”、“补足”按钮送出委托单。

(1) 篮子买入

交易数量=计算委托数量。

(2) 篮子卖出

篮子中所有商品均可用卖仓位足（计算委托数量>=可用卖），点击卖“送出”，交易数量=计算委托数量。

篮子中有商品存在可用卖仓位不足，点击卖“送出”，提示“当前篮子中有部分商品仓位不足”，可选择按钮为“依旧送出”和“送出残余篮子”。



如果选择“依旧送出”，则交易数量=计算委托数量，则按篮子原有下单数量送出。



如果选择“送出残余篮子”，则持仓不足部分的商品仅送出当前商品可用卖量的下单数量。



注：通过“送出残余篮子”操作送出的篮子，全部成交后不记入篮子监控

(3) 篮子补足

篮子补足功能，用于补足该篮子中各商品持仓量不足设定值的部分。



点击补足按钮，如篮子中存在持仓量不足设定值的商品，则送出对应数量的该商品的买单来补足商品持仓。

如当前篮子中不存在持仓量不足设定值的商品，点击补足按钮不会送出补足单并提示“所有商品交易数量都为0”。



补足篮子送出的买单数量根据【比例类型】的选择有不同的计算方式。使用者可选择按权重，按金额，按数量。

不同类型计算方式如下：

按权重：根据篮子中配置的总金额和权重计算下单数量-当前持仓数量计算应该送出的数量

按数量：根据篮子中配置的单个商品的数量*下单组数-当前持仓数量计算应该送出的数量

按金额：根据篮子中配置的单个商品的金额计算下单数量*下单组数-当前持仓数量计算应该送出的数量

计算补足数量的时候先根据篮子中本身的碎股处理，计算单个篮子的商品数量。

注：减去当前持仓数量后如果还留有碎股，那么使用向上取整来处理。

举例：

对某一资金账号所设立的篮子“300033”、“000001”、“688981”为例子，计算补足量（碎股处理设置：四舍五入）。

	300033	000001	688981
资金权重	1	2	3
委托金额	50000	30000	40000
委托数量	1000 股	1500 股	2000 股
基准价格	132.42	10.5	45.56
初始持仓量	300 股	400 股	2228 股

选择比例类型	设置参数
按权重	委托金额 300000
按数量	下单组数 2
按金额	下单组数 4

(1) 点击补足，300033 的补足量

① 按权重：

篮子中配置的总金额和权重计算的总数量为： $300000 / (1+2+3) * 1 / 132.42 = 377.59$ 。碎股处理：四舍五入为整手，为 400
则需要补足的数量为： $400-300=100$

② 按数量：

篮子中配置的总数量为：篮子中配置的单个商品的数量*下单组数 = $1000 * 2 = 2000$ 。
则需要补足的数量为： $2000-300 = 1700$

③ 按金额：

篮子中配置的单个商品的金额计算下单数量： $50000 / 132.42=377.58$ 。碎股处理：四舍五入为整手，为 400
篮子中配置的总数量为： $400 * 组数 = 400 * 4 = 1600$

则需要补足的数量为： $1600 - 300 = 1300$

(2) 点击补足，688981 的补足量

① 按权重：

篮子中配置的总金额和权重计算的总数量为： $300000 / (1+2+3) * 3 / 45.56 = 3292.36$ 。碎股处理：四舍五入为整手，为 3300

则需要补足的数量为：3300 - 2228=1012

减去当前持仓数量后还留有碎股，向上取整。则需要补足 1100 股。

② 按数量：

篮子中配置的总数量为：篮子中配置的单个商品的数量 * 下单组数 = 2000 * 2 = 4000。

则需要补足的数量为：4000 - 2228 = 1772

减去当前持仓数量后还留有碎股，向上取整。则需要补足 1800 股。

③ 按金额：

篮子中配置的单个商品的金额计算下单数量：40000 / 45.56=877.96。碎股处理：四舍五入为整手，为 900

篮子中配置的总数量为：900 * 组数 = 900 * 4 = 3600

则需要补足的数量为：3600 - 2228 = 1372

减去当前持仓数量后还留有碎股，向上取整。则需要补足 1400 股。

注：通过补足操作送出的篮子，全部成交后不记入篮子监控

步骤 3：查看右侧下单篮子信息，对下单篮子进行价格调整

商品名称	状态	买卖	交易数量	已成交	未成交	价格类型	调整Tick	价格	现价	成交均价	可用卖	撤单	追单	再下单	浮动盈亏
沪深300	正常	买	1500	0	1500	对手价	0	2.151	2.153	0.0000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	500	0	500	对手价	0	6.33	6.32	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	400	0	400	对手价	0	8.63	8.62	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	1100	0	1100	对手价	0	2.77	2.76	0.000		撤单	追单	再下单	

篮子默认过滤涨停、停牌及 ST 过滤的勾选，如下图

商品名称	状态	买卖	交易数量	已成交	未成交	价格类型	调整Tick	价格	现价	成交均价	可用卖	撤单	追单	再下单	浮动盈亏
沪深300	正常	买	1500	0	1500	对手价	0	2.152	2.153	0.0000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	500	0	500	对手价	0	6.33	6.32	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	400	0	400	对手价	0	8.63	8.62	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	1100	0	1100	对手价	0	2.77	2.77	0.000		撤单	追单	再下单	

如需要对涨停、停牌及 ST 商品进行勾选，请手动勾选即可，右侧有橙色提示信息。

商品名称	状态	买卖	交易数量	已成交	未成交	价格类型	调整Tick	价格	现价	成交均价	可用卖	撤单	追单	再下单	浮动盈亏
沪深300	正常	买	700	0	700	对手价	0	5.21	5.21	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	6500	0	6500	对手价	0	6.28	6.27	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	200	0	200	对手价	0	32.62	32.61	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	涨停	买	500	0	500	对手价	0	0.00	9.65	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	5500	0	5500	对手价	0	6.32	6.31	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	300	0	300	对手价	0	7.26	7.26	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	4500	0	4500	对手价	0	6.10	6.09	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	600	0	600	对手价	0	25.07	25.07	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	800	0	800	对手价	0	18.23	18.22	0.000		撤单	追单	再下单	
沪深300	正常	买	200	0	200	对手价	0	10.14	10.13	0.000		撤单	追单	再下单	

步骤 4：点击“勾选下单”进行一键委托，未成交部分可以进行再次下单或撤单，追单的操作。

特殊标识
13:59:09 执行中 成交16.39%

勾选下单 全部撤单 勾选撤单 勾选追单 追单Tick 0 总成交 14.70万 总盈亏 -88(-0.06%) 对冲剩余未成交

过滤涨停 过滤跌停 过滤停牌 过滤ST

商品名称	状态	买卖	交易数量	已成交	未成交	价格类型	调整Tick	价格	现价	成交均价	可用卖	撤单	追单	再下单	浮动盈亏
...	正常	买	700	0	700	对手价	0	6.01	6.01	0.000		撤单	追单	再下单	
...	正常	买	3700	3700	0	对手价	0	6.21	6.20	6.210		撤单	追单	再下单	(-0.16%)
...	正常	买	1200	0	1200	对手价	0	13.93	13.92	0.000		撤单	追单	再下单	
...	正常	买	2400	0	2400	对手价	0	31.83	31.82	0.000		撤单	追单	再下单	
...	正常	买	1400	0	1400	对手价	0	9.51	9.50	0.000		撤单	追单	再下单	
...	正常	买	3700	3700	0	对手价	0	4.85	4.85	4.850		撤单	追单	再下单	0(0%)
...	正常	买	100	100	0	对手价	0	20.28	20.26	20.280		撤单	追单	再下单	(-0.10%)
...	正常	买	1000	1000	0	对手价	0	15.00	14.99	14.990		撤单	追单	再下单	0(0%)
...	正常	买	900	0	900	对手价	0	14.99	14.99	0.000		撤单	追单	再下单	
...	正常	买	500	500	0	对手价	0	9.08	9.08	9.080		撤单	追单	再下单	0(0%)
...	正常	买	100	100	0	对手价	0	25.98	25.98	25.980		撤单	追单	再下单	0(0%)
...	正常	买	100	100	0	对手价	0	65.32	65.31	65.320		撤单	追单	再下单	(-0.02%)
...	正常	买	400	400	0	对手价	0	35.47	35.46	35.460		撤单	追单	再下单	0(0%)
...	正常	买	300	300	0	对手价	0	20.90	20.89	20.900		撤单	追单	再下单	(-0.05%)
...	正常	买	500	500	0	对手价	0	9.99	9.98	9.990		撤单	追单	再下单	(-0.10%)
...	正常	买	200	200	0	对手价	0	17.40	17.40	17.400		撤单	追单	再下单	0(0%)
...	正常	买	300	300	0	对手价	0	25.96	25.95	25.980		撤单	追单	再下单	(-0.12%)
...	正常	买	200	0	200	对手价	0	24.70	24.67	0.000		撤单	追单	再下单	
...	正常	买	1400	0	1400	对手价	0	3.12	3.12	0.000		撤单	追单	再下单	

如果设置了“对冲基金”，未成交部分可以点击“对冲剩余未成交”使用设定得对冲基金下单，选择“是”按钮后，增加一条对冲基金的信息，选择“否”按钮不送出对冲基金。

沪深300指数_2 沪深300指数_2
13:53:39 未执行 14:00:33 执行中 成交57.20%

勾选下单 全部撤单 勾选撤单 勾选追单 追单Tick 0 总成交 9676 总盈亏 -5(-0.05%) 对冲剩余未成交

过滤涨停 过滤跌停 过滤停牌 过滤ST

商品名称	状态	买卖	交易数量	已成交	未成交	价格类型	调整Tick	价格	现价	成交均价	可用卖	撤单	追单	再下单	浮动盈亏
ESG建信	正常	买	1500	2	1498	对手价	0	2.155	2.153	2.1550		撤单	追单	再下单	(-0.09%)
华夏银行	正常	买	500	500	0	对手价	0	6.33	6.32	6.330		撤单	追单	再下单	(-0.16%)
华能国际	正常	买	400	400	0	对手价	0	8.65	8.650			撤单	追单	再下单	0(0%)
日照港	正常	买	1100	1100	0	对手价	0	2.77	2.770			撤单	追单	再下单	0(0%)

篮子交易
是否所有未完成交易，将剩余金额转为对冲基金“产业升级”？
是 否

可对对冲基金商品进行价格调整后，点击“再下单”按钮送出委托单。

沪深300指数_2 沪深300指数_2
13:53:39 未执行 14:00:33 执行中 成交57.43%

勾选下单 全部撤单 勾选撤单 勾选追单 追单Tick 0 总成交 9694 总盈亏 -20(-0.21%) 对冲剩余未成交

过滤涨停 过滤跌停 过滤停牌 过滤ST

商品名称	状态	买卖	交易数量	已成交	未成交	价格类型	调整Tick	价格	现价	成交均价	可用卖	撤单	追单	再下单	浮动盈亏
ESG建信	正常	买	1500	10	1490	对手价	0	2.154	2.153	2.1550		撤单	追单	再下单	(-0.09%)
华夏银行	正常	买	500	500	0	对手价	0	6.33	6.32	6.330		撤单	追单	再下单	(-0.16%)
华能国际	正常	买	400	400	0	对手价	0	8.65	8.64	8.650		撤单	追单	再下单	(-0.12%)
日照港	正常	买	1100	1100	0	对手价	0	2.77	2.76	2.770		撤单	追单	再下单	(-0.36%)
产业升级	正常	买	4400	0	4400	对手价	0	0.737	0.736	0.0000		撤单	追单	再下单	

4.24.9 篮子的计算

根据设定和实时成交数据计算出对应的完成度、当前成交总金额、浮动盈亏、总盈亏会根据设定直接展示。
总成交金额=所有商品的已成交的总金额的汇总

特殊标识
13:59:09 执行中 成交17.08%

勾选下单 全部撤单 勾选撤单 勾选追单 追单Tick 0 总成交 18.23万 总盈亏 402(0.22%) 对冲剩余未成交

勾选涨停 勾选跌停 勾选停牌 勾选ST

商品名称	状态	买卖	交易数量	已成交	未成交	价格类型	调整Tick	价格	现价	成交均价	可用类	撤单	追单	再下单	浮动盈亏
浦发行	正常	买	2300	2300	0	对手价	0	7.12	7.11	7.120		撤单	追单	再下单	-23.00(-0.14%)
浦发行	正常	买	0	0	0	对手价	0	8.65	8.64	0.000		撤单	追单	再下单	
浦发行	正常	买	500	500	0	对手价	0	5.37	5.37	5.360		撤单	追单	再下单	5.00(0.19%)
浦发行	正常	买	1700	1700	0	对手价	0	6.70	6.69	6.670		撤单	追单	再下单	34.00(0.30%)
浦发行	正常	买	800	800	0	对手价	0	5.29	5.28	5.280		撤单	追单	再下单	0(0%)
浦发行	正常	买	300	300	0	对手价	0	13.49	13.49	13.410		撤单	追单	再下单	24.00(0.60%)
浦发行	正常	买	700	0	700	对手价	0	6.00	6.00	0.000		撤单	追单	再下单	
浦发行	正常	买	3700	3700	0	对手价	0	6.21	6.21	6.210		撤单	追单	再下单	0(0%)
浦发行	正常	买	1200	0	1200	对手价	0	13.97	13.97	0.000		撤单	追单	再下单	
浦发行	正常	买	2400	0	2400	对手价	0	31.88	31.88	0.000		撤单	追单	再下单	
浦发行	正常	买	1400	0	1400	对手价	0	9.56	9.56	0.000		撤单	追单	再下单	
浦发行	正常	买	3700	3700	0	对手价	0	4.86	4.86	4.850		撤单	追单	再下单	37.00(0.21%)
浦发行	正常	买	100	100	0	对手价	0	20.32	20.31	20.280		撤单	追单	再下单	3.00(0.15%)
浦发行	正常	买	1000	1000	0	对手价	0	15.02	15.02	14.990		撤单	追单	再下单	30.00(0.20%)
浦发行	正常	买	900	0	900	对手价	0	15.02	15.01	0.000		撤单	追单	再下单	
浦发行	正常	买	500	500	0	对手价	0	9.14	9.14	9.080		撤单	追单	再下单	30.00(0.66%)
浦发行	正常	买	100	100	0	对手价	0	26.05	26.04	25.980		撤单	追单	再下单	6.00(0.23%)
浦发行	正常	买	100	100	0	对手价	0	65.58	65.58	65.320		撤单	追单	再下单	26.00(0.40%)
浦发行	正常	买	400	400	0	对手价	0	35.54	35.53	35.460		撤单	追单	再下单	28.00(0.20%)

总价测算=下单金额*下单数量

上证50
11:24:05 未执行

勾选下单 全部撤单 勾选撤单 勾选追单 追单Tick 0 总成交(元) 总盈亏(元) 对冲剩余未成交

勾选涨停 勾选跌停 勾选停牌 勾选ST 总价测算 10082元

商品名称	状态	买卖	交易数量	已成交	未成交	价格类型	调整Tick	价格	现价	成交均价	可用类	撤单	追单	再下单	浮动盈亏
ESG建信	正常	买	500	0	500	对手价	0	2.204	2.206	0.0000		撤单	追单	再下单	
华夏银行	正常	买	500	0	500	对手价	0	6.38	6.37	0.000		撤单	追单	再下单	
XD华能国	正常	买	500	0	500	对手价	0	8.85	8.84	0.000		撤单	追单	再下单	
日照港	正常	买	500	0	500	对手价	0	2.73	2.73	0.000		撤单	追单	再下单	

注：市价用当前对手价代替。

4.25 场外 delta 对冲

目的：（1）提供使用者通过参数设定产生批量智慧单进行对冲 delta 风险，可以通过系统设定一次在不同价位挂出对应价格所需要的买单与卖单。

（2）可以通过导入方式更快设定 delta 风险对冲。使用者可以将原本需要手动设定的标的、对冲参数、暂停条件、下单条件等使用导入方式一次设定完成，然后按下试算进行设算所需要委托。

（3）提供使用者可以依据实时行情进行主要对冲参数修改。

4.25.1 新增策略

点击新增策略按钮，出现新增策略的界面。

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.96万	1248	0	溢价0笔,等待触价10笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略二	董大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0		启动 -- 编辑 删除 导出
delta对冲策略三	艾为电子	8888899501(股票)	56.43	-2.45	1256.96万	5644	0		启动 -- 编辑 删除 导出

可在此界面编辑手动添加一条 delta 对冲策略。

也可以点击从文件导入按钮，通过导入方式更快设定 delta 风险对冲参数，添加一条策略单。

新增策略

名称: [] 投资组合: 全部 [] 从文件导入...

标的: [] 账号: [] 金额: [] 仓位设置

标的现价	涨跌幅(%)	delta金额	1%gamma金额	最近距到期日	最近订单号
--	--	1.58亿	80584	55.49	otc0013

参数自动插件设置...

对冲风险: delta方向: 0.00 [] 万元; delta偏离: 0.00 [] -- 0.00 [] 万元; 价格变动: 0.00 [] % 区间数: 0 []; 委托区间: 0.00 [] %

暂停条件: 价格变动: 0.00 [] %

停止条件: 0.00 [] 秒内成交: 0 [] 笔

交易时间: [] 新增

手动添加策略步骤如下：

(1) 投资组合及标的设置

新增策略

名称: delta对冲策略一 投资组合: 沪市delta对冲 [] 从文件导入...

标的: 中国国贸 账号: 8888899501(股票) [] 张数: [] 仓位设置

标的现价	涨跌幅(%)	delta张数	1%gamma张数	最近距到期日	最近订单号
22.83	-0.70	547228.18	-81.10	60.00	otc0013

① 设置策略名称

② 选择投资组合

设定要进行对冲的投资组合。

③ 选择标的

选择用来进行对冲的标的，选择标的后，后续将通过买卖该商品进行对冲。

点击标的按钮，在出现的弹窗选择标的，或者根据输入的商品代码/商品名称过滤选择标的。

新增策略

名称: [] 投资组合: 全部 [] 从文件导入...

标的: [] 账号: [] 金额: [] 仓位设置

④ 选择交易账号

点击“账号”设定交易账号，将按照指定的账号进行交易。

⑤ 选择风险单位

可选择金额/张数，设置后，将影响后续标的风险显示以及对冲参数设定。

选择金额：底部 delta 金额将显示投资组合的当前 delta 金额。在设定对冲参数时，delta 方向则需要设定目标 delta 金额。后续对冲时将按照该目标 delta 金额进行对冲。

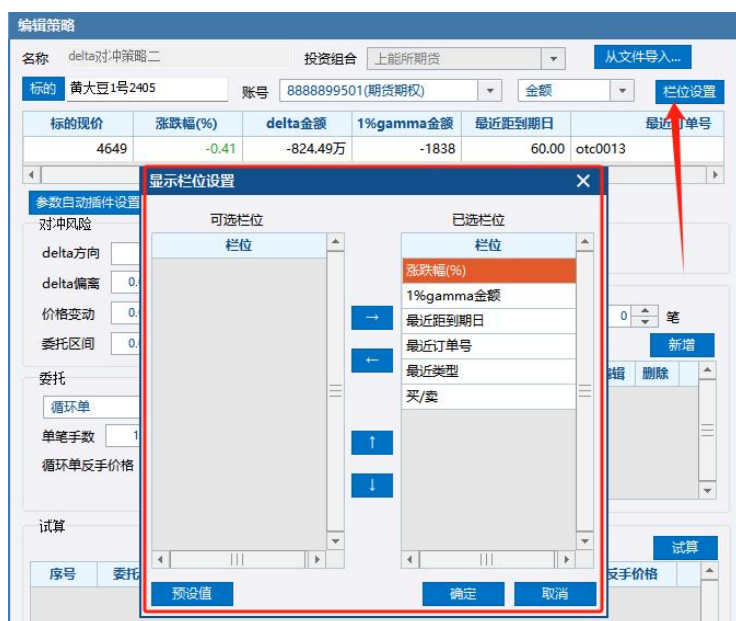


选择张数：底部 delta 张数将显示投资组合的当前 delta 张数。在设定对冲参数时，delta 方向则需要设置目标 delta 张数。后续对冲时将按照该目标 delta 张数进行对冲。



⑥ 栏位设置

点击栏位设置，可以在出现的弹窗进行栏位设置。



(2) 显示标的风险

将依据设置的标的和投资组合和风险单位，显示标的目前的风险值。

新增策略

名称: delta对冲策略一 投资组合: 沪市delta对冲 从文件导入...

标的: 中国国贸 账号: 8888899501(股票) 张数: 栏位设置

标的现价	涨跌幅(%)	delta张数	1%gamma张数	最近距到期日	最近订单号	最近类型	买/卖
22.83	-0.70	547228.07	-81.09	60.00	otc0013	自动赎回	卖

(3) 设定对冲参数

设定对应多少价格变化需要进行对冲与允许的 delta 风险值。

新增策略

名称: delta对冲策略一 投资组合: 沪市delta对冲 从文件导入...

标的: 中国国贸 账号: 8888899501(股票) 张数: 栏位设置

标的现价	涨跌幅(%)	delta张数	1%gamma张数	最近距到期日	最近订单号	最近类型	买/卖
22.83	-0.70	547227.55	-81.02	60.00	otc0013	自动赎回	卖

参数自动插件设置...

对冲风险

delta方向: 540000 张

delta偏离: 500 -- 1000 张

价格变动: 3 % 区间数: 3

委托区间: 0.5 %

暂停条件

价格变动: 0.00 %

停止条件

0.00 秒内成交: 0 笔

交易时间

新增

delta 方向: 使用者预设风险值

价格变动: 设置在每单位价格变动后计算对应风险值与交易

(4) 设定委托单条件

新增策略

名称: delta对冲策略一 投资组合: 沪市delta对冲 从文件导入...

标的: 中国国贸 账号: 8888899501(股票) 张数: 栏位设置

标的现价	涨跌幅(%)	delta张数	1%gamma张数	最近距到期日	最近订单号	最近类型	买/卖
22.83	-0.70	547227.78	-81.05	60.00	otc0013	自动赎回	卖

参数自动插件设置...

对冲风险

delta方向: 540000 张

delta偏离: 0.00 -- 0.00 张

价格变动: 0.00 % 区间数: 0

委托区间: 0.00 %

委托

触价单

单笔手数: 1

0.00 秒未成交: 0 tick追单

止损价格: 0.00 %

暂停条件

价格变动: 0.00 %

停止条件

0.00 秒内成交: 0 笔

交易时间

新增

序号	时间	编辑	删除

依据买/卖方设定委托的智慧单类型与条件。可以选择委托单为触价单/循环单。

① 委托单为触价单

需要设置单笔下单数量。

可以选择设置 X 秒未成交 Y tick 追单。设置后当委托单触价但 X 秒未成交时，将按照设置的追单 tick 撤单重挂。

委托

触价单

单笔手数 1

5.00 秒未成交 1 tick追单

停损价格 1.00 %

可以选择设置停损价格。设置后当标的行情变动，与已成交的委托单成交均价相比达到停损价格时，将下出停损单。

委托

触价单

单笔手数 1

5.00 秒未成交 1 tick追单

停损价格 1.00 %

② 委托单为循环单

需要设置单笔下单数量和循环单反手价格。

委托

循环单

单笔手数 1

循环单反手价格 1.00 %

(5) 设定委托组暂停/或停止等条件

设定委托组需要暂停/停止条件。

暂停条件

价格变动 0.02 %

停止条件

5 秒内成交 30 笔

交易时间 新增

序号	时间	编辑	删除
1	11:14:51	编辑	删除
2	11:16:53	编辑	删除

勾选并设置暂停条件后，策略运行中当价格变动对应百分比时，策略将暂停。

(6) 试算委托单

按下试算后，将产生按照设置的参数以及当前标的行情所产生的对应的价格与量的委托单。

试算

生成2笔智慧买单(12张),1张智慧卖单(1张), $\Delta=51.35$ 万元

序号	委托价格	价格比例	数量	买/卖	委托类型	反手价格
1	4648	-0.02%	6	买	循环单	4648
2	4649	0.00%	1	卖	循环单	4649
3	4650	0.02%	6	买	循环单	4650

试算

4.25.2 编辑策略

非运行中状态的策略单，点击策略单后面的编辑按钮，即可以进入编辑页面，编辑策略的相关信息。

4.25.3 删除策略

非运行中状态的策略单，点击策略单后面的删除按钮，即可以删除策略单。

4.25.4 启动策略

设置完成后，在场外 Δ 避险列表处可以查看到新增的一条策略单。点击该策略后面的启动按钮即可启动单条策略下单。

场外 Δ 避险

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓 Δ	成交 Δ	已委 Δ	状态	操作
delta对冲策略一	中国国贸	8888899501(股票)	22.83	-0.70	1249.32万	0	0	启动	编辑 删除 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0	启动	编辑 删除 导出

也可以点击页面顶部的 全部启动，即可批量启动所有策略下单。

场外 Δ 避险

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓 Δ	成交 Δ	已委 Δ	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.40万	5740	0	老追价0笔,等待触价4笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 编辑 删除 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0	启动	编辑 删除 导出

策略单	委托	成交	日志
<input type="checkbox"/> 所有策略	<input type="checkbox"/> 包含成交后处理		

序号	策略名称	标的代码	标的名称	账号	价格	价格比例	数量	买卖	委托类型	反手价格	状态
1	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.472	-0.96%	200	卖	触价单	--	已执行完成
2	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.479	-0.68%	200	卖	触价单	--	已执行完成
3	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.486	-0.40%	200	卖	触价单	--	已执行完成
4	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.493	-0.12%	200	卖	触价单	--	已执行完成
5	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.499	0.12%	200	卖	触价单	--	等待触价
6	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.506	0.40%	200	卖	触价单	--	等待触价
7	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.513	0.68%	200	卖	触价单	--	等待触价
8	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.520	0.96%	200	卖	触价单	--	等待触价

启动后，可以在底部策略单页签查看到启动后生成的策略单，以及策略单状态。

场外delta避险

新增策略 全部启动 全部停止 全部暂停

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.40万	5740	0	老,追价0笔,等待触价4笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0		启动 -- 编辑 删除 导出

策略单 委托 成交 日志 所有策略 包含成交后处理

序号	策略名称	标的代码	标的名称	账号	价格	价格比例	数量	买卖	委托类型	反手价格	状态
1	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.472	-0.96%	200	委	触价单	--	已执行完成
2	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.479	-0.68%	200	委	触价单	--	已执行完成
3	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.486	-0.40%	200	委	触价单	--	已执行完成
4	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.493	-0.12%	200	委	触价单	--	已执行完成
5	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.499	0.12%	200	委	触价单	--	等待触价
6	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.506	0.40%	200	委	触价单	--	等待触价
7	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.513	0.68%	200	委	触价单	--	等待触价
8	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.520	0.96%	200	委	触价单	--	等待触价

委托页签可以查看到已经触价的策略单下出的委托单。

场外delta避险

新增策略 全部启动 全部停止 全部暂停

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.40万	5740	0	老,追价0笔,等待触价4笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0		启动 -- 编辑 删除 导出

策略单 委托 成交 日志 所有策略 包含成交后处理

委托编号	策略名称	商品代码	商品名称	账号	时间	买卖	委托价格	委托量	剩余量	信息
OA-00000157	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501 8888899501(股票)	13:12:36	委	2.493	200	0	委托单全部成交
OA-00000156	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501 8888899501(股票)	13:12:36	委	2.486	200	0	委托单全部成交
OA-00000155	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501 8888899501(股票)	13:12:36	委	2.479	200	0	委托单全部成交
OA-00000154	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501 8888899501(股票)	13:12:36	委	2.472	200	0	委托单全部成交
OA-00000153	delta对冲策略一	600007.SSE	中国国贸	8888899501 8888899501(股票)	13:11:22	买	23.07	200	0	委托单全部成交
OA-00000152	delta对冲策略一	600007.SSE	中国国贸	8888899501 8888899501(股票)	13:11:22	买	23.05	200	0	委托单全部成交
OA-00000151	delta对冲策略一	600007.SSE	中国国贸	8888899501 8888899501(股票)	13:11:22	买	23.04	300	0	委托单全部成交
OA-00000150	delta对冲策略一	600007.SSE	中国国贸	8888899501 8888899501(股票)	13:11:22	买	23.03	300	0	委托单全部成交

成交页签可以查看到已经成交的委托单。

场外delta避险

新增策略 全部启动 全部停止 全部暂停

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.40万	5740	0	老,追价0笔,等待触价4笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0		启动 -- 编辑 删除 导出

策略单 委托 成交 日志 所有策略 包含成交后处理

成交编号	委托编号	策略名称	商品代码	商品名称	账号	时间	方向	开平	成交价格	成交量
TA-00000142	OA-00000157	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	13:12:36	委	自动	2.495	200
TA-00000141	OA-00000156	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	13:12:36	委	自动	2.495	200
TA-00000140	OA-00000155	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	13:12:36	委	自动	2.495	200
TA-00000139	OA-00000154	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	13:12:36	委	自动	2.495	200
TA-00000138	OA-00000153	delta对冲策略一	600007.SSE	中国国贸	8888899501(股票)	13:11:22	买	自动	22.87	200
TA-00000136	OA-00000151	delta对冲策略一	600007.SSE	中国国贸	8888899501(股票)	13:11:22	买	自动	22.87	300
TA-00000137	OA-00000152	delta对冲策略一	600007.SSE	中国国贸	8888899501(股票)	13:11:22	买	自动	22.87	200
TA-00000135	OA-00000150	delta对冲策略一	600007.SSE	中国国贸	8888899501(股票)	13:11:22	买	自动	22.87	300

日志页签可以查看运行日志。

场外delta避险

新增策略 全部启动 全部停止 全部暂停

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.40万	5740	0	老,追价0笔,等待触价4笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0		启动 -- 编辑 删除 导出

策略单 委托 成交 日志 所有策略 包含成交后处理

时间	策略名称	信息
13:12:37	delta对冲策略一	策略[delta对冲策略一][价格2.493][数量:-200]不需停损,该智慧单结束
13:12:37	delta对冲策略一	策略[delta对冲策略一][价格2.493][数量:-200]主单全成交
13:12:37	delta对冲策略一	策略[delta对冲策略一][价格2.493][数量:-200]收到主单成交推送,成交号[TA-00000142]委托号[OA-00000157]成交[200]
13:12:37	delta对冲策略一	策略[delta对冲策略一][价格2.493][数量:-200]收到成交推送,成交号[TA-00000142]委托号[OA-00000157]成交[200(2.495)]
13:12:37	delta对冲策略一	策略[delta对冲策略一][价格2.493][量:-200]主单委托回报全成交
13:12:37	delta对冲策略一	策略[delta对冲策略一]收到委托推送,本地委托单号=215,柜台委托编号=OA-00000157,剩余量=0,状态=全部成交
13:12:37	delta对冲策略一	策略[delta对冲策略一][价格2.486][数量:-200]不需停损,该智慧单结束
13:12:37	delta对冲策略一	策略[delta对冲策略一][价格2.486][数量:-200]主单全成交

选中一个页签，勾选所有策略可以查看到所有策略的对应页签信息。

场外delta避险

新增策略 全部启动 全部停止 全部暂停

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.532	0.08	1307.28万	3542	0	老,追价0笔,等待触价0笔,进入成交后处理0笔	停止 继续 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4688	0.32	-832.36万	373.96万	0	老,追价0笔,等待触价8笔,进入成交后处理8笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略三	民生银行	8888899501(股票)	3.90	-0.51	1307.28万	-9408	0	老,追价0笔,等待触价6笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出

策略单 委托 成交 日志 所有策略 包含成交后处理

序号	策略名称	标的代码	标的名称	账号	价格	价格比例	数量	买卖	委托类型	反手价格	状态
10	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.541	0.36%	200	买	触价单	--	已执行完成
11	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.545	0.51%	200	买	触价单	--	已执行完成
12	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.549	0.67%	200	买	触价单	--	已执行完成
13	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.553	0.83%	200	买	触价单	--	已执行完成
14	delta对冲策略一	510050.SSE	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.557	0.99%	200	买	触价单	--	已执行完成
15	delta对冲策略二	a2405.DCE	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4687	-0.02%	10	买	循环单	4687	等待触价
16	delta对冲策略二	a2405.DCE	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4687	-0.02%	10	买	循环单	4687	等待触价
17	delta对冲策略二	a2405.DCE	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4687	-0.02%	10	买	循环单	4687	等待触价
18	delta对冲策略二	a2405.DCE	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4687	-0.02%	10	买	循环单	4687	等待触价
19	delta对冲策略二	a2405.DCE	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4687	-0.02%	10	买	循环单	4687	等待触价
20	delta对冲策略二	a2405.DCE	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4687	-0.02%	10	买	循环单	4687	等待触价
21	delta对冲策略二	a2405.DCE	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4687	-0.02%	10	买	循环单	4687	等待触价
22	delta对冲策略二	a2405.DCE	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4687	-0.02%	2	买	循环单	4687	等待触价

勾选包含成交后处理，则列表中将包括成交后处理的订单

场外delta避险

新增策略 全部启动 全部停止 全部暂停

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.530	0.00	1308.19万	2783	0	老,追价0笔,等待触价0笔,进入成交后处理0笔	停止 继续 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4688	0.32	-831.45万	710.52万	0	老,追价0笔,等待触价9笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略三	民生银行	8888899501(股票)	3.89	-0.77	1307.89万	-21168	0	老,追价0笔,等待触价0笔,进入成交后处理0笔	启动 -- 编辑 删除 导出

策略单 委托 成交 日志 所有策略 包含成交后处理

序号	策略名称	标的代码	标的名称	账号	价格	价格比例	数量	买卖	委托类型	反手价格	状态
1	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	已执行完成
2	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	已执行完成
3	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	已执行完成
4	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
5	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
6	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
7	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
8	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
9	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
10	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
11	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
12	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止
13	delta对冲策略三	600016.SSE	民生银行	8888899501(股票)	3.87	-0.77%	1000	卖	触价单	--	委托失败停止

4.25.5 停止策略

策略单启动后，可以点击该策略后面的停止按钮即可停止单条策略单。策略单会变为停止状态，已经下出但是未成交的委托单会变为撤单状态。



策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.40万	5740	0	老,追价0笔,等待触价4笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0		启动 -- 编辑 删除 导出
delta对冲策略三	艾为电子	8888899501(股票)	56.43	-2.45	1256.96万	5644	0		启动 -- 编辑 删除 导出

序号	策略名称	标的代码	标的名称	账号	价格	价格比例	数量	买卖	委托类型	反手价格	状态
1	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	54.75	-2.98%	900	买	循环单	54.75	主动停止
2	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	55.87	-0.99%	600	卖	循环单	55.87	主动停止
3	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	56.99	0.99%	1000	卖	循环单	56.99	主动停止
4	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	56.99	0.99%	1000	买	循环单	56.99	已撤单
5	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	58.11	2.98%	600	卖	循环单	58.11	主动停止

也可以点击页面顶部的 全部停止，即可批量停止所有策略单。



策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.40万	5740	0	老,追价0笔,等待触价4笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0		启动 -- 编辑 删除 导出
delta对冲策略三	艾为电子	8888899501(股票)	56.43	-2.45	1256.96万	5644	0		启动 -- 编辑 删除 导出

序号	策略名称	标的代码	标的名称	账号	价格	价格比例	数量	买卖	委托类型	反手价格	状态
1	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	54.75	-2.98%	900	买	循环单	54.75	主动停止
2	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	55.87	-0.99%	600	卖	循环单	55.87	主动停止
3	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	56.99	0.99%	1000	卖	循环单	56.99	主动停止
4	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	56.99	0.99%	1000	买	循环单	56.99	已撤单
5	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	58.11	2.98%	600	卖	循环单	58.11	主动停止

4.25.6 暂停策略

策略单启动后，可以点击该策略后面的暂停按钮即可暂停单条策略单。策略单会变为停止状态，已经下出但是未成交的委托单会变为撤单状态。

也可以点击页面顶部的 全部暂停，即可批量暂停所有策略单。

注：暂停后恢复功能暂未支持。

4.25.7 导出策略

点击策略后面的导出按钮即可导出单条策略单。

场外delta避险

新增策略 全部启动 全部停止 全部暂停

策略名称	标的	账号	标的现价	标的涨幅	持仓\$Delta	成交\$Delta	已委\$Delta	状态	操作
delta对冲策略一	(沪)50ETF	8888899501(股票)	2.496	1.22	1256.96万	1248	0	溢价0笔,等待触价10笔,进入成交后处理0笔	停止 暂停 -- -- 导出
delta对冲策略二	黄大豆1号2405	8888899501(期货期权)	4649	-0.41	-824.49万	0	0		启动 -- 编辑 删除 导出
delta对冲策略三	艾为电子	8888899501(股票)	56.43	-2.45	1256.96万	5644	0		启动 -- 编辑 删除 导出

策略单 委托 成交 日志 所有策略 包含成交后处理

序号	策略名称	标的代码	标的名称	账号	价格	价格比例	数量	买卖	委托类型	反手价格	状态
1	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	54.75	-2.98%	900	买	循环单	54.75	主动停止
2	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	55.87	-0.99%	600	卖	循环单	55.87	主动停止
3	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	56.99	0.99%	1000	卖	循环单	56.99	主动停止
4	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	56.99	0.99%	1000	买	循环单	56.99	已撤单
5	delta对冲策略三	688798.SSE	艾为电子	8888899501(股票)	58.11	2.98%	600	卖	循环单	58.11	主动停止

4.25.8 导入策略

点击新增策略，在新增策略页面点击从文件导入按钮，即可以导入文件中相关内容。

新增策略

名称 投资组合 全部

标的 账号 金额

标的现价	涨跌幅(%)	delta金额	1%gamma金额	最近距到期日	最近订单号
--	--	9836.23万	11.34万	60.00	otc0013

已经存在的策略，也可以通过点击编辑按钮，在编辑页面点击从文件导入按钮，导入文件中相关内容。但是无法改变该策略的策略名称和投资组合。

编辑策略

名称 delta对冲策略二 投资组合 上能所期货

标的 黄大豆1号2405 账号 8888899501(期货期权) 金额

标的现价	涨跌幅(%)	delta金额	1%gamma金额	最近距到期日	最近订单号
4649	-0.41	-824.49万	-1839	60.00	otc0013

参数自动填充

对冲风险 **QWin期权策略交易系统**

delta方向 ? 编辑模式不能改变策略名称和投资组合,只导入配置数据,是否继续从文件导入?

delta偏离

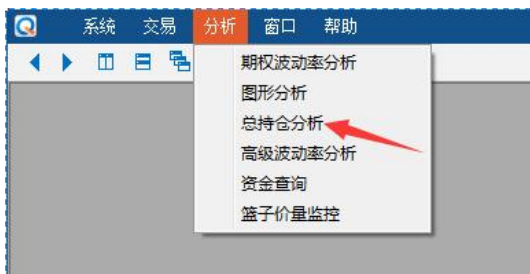
价格变动

委托区间 % 交易时间

5. 系统分析功能

5.1 总持仓分析

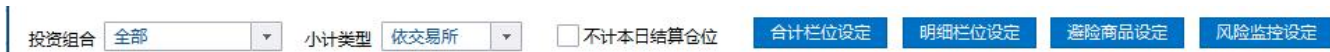
5.1.1 开启总持仓分析



使用者通过路径“分析/总持仓分析”进入总持仓分析画面。

5.1.2 选择所需要分析的账号与市场组合

选择”组合名称”，使用者可用预设的账号与表单类型进行分析



用户可以下拉选择“组合名称”、“表单类型”（选择每一列所要呈现的分类方式）可以将所选择的部位进行分类与重要风险参数进行统计分析。

合计	市值	股票持仓	期货持仓	期权持仓	ΔDelta	1%SGamma	SVega	STheta	SVanna	SVomma	估算今日损益	估算理论损益	当冲损益
合计	38,640	0	0	2	666,539	52,395	607	-857	-60	7	-13,000	-12,620	0
各类小计													
IF2202	38,640	0	0	2	666,539	52,395	607	-857	-60	7	-13,000	-12,620	0

交易	商品名称	商品代码	持仓	可用买	可用卖	到期日	Delta张数	ΔDelta	1%SGamma	SVega	STheta	SVanna	SVomma	估算今日损益	估算
交易	IO2202-C-4400	IO2202-C-4400	2	0	2	2022年02月18日	1	666,539	52,395	607	-857	-60	7	-13,000	
交易	IO2202-C-5600	IO2202-C-5600	0	1	1	2022年02月18日	0	0	0	0	-0	0	0	--	

如果用户有某一投资组合，可以查看该组合的具体部位风险与收益。

合计	估算浮动盈亏	估算今日损益	
合计	575	-412	-274
各类小计			
上海证券交易所	575	-412	-274

系统支持用户按照不同类别进行小计，可以依照交易所、账号、合约、标的进行分别统计。

估算浮	日损益	
575	-274	
575	-412	-274

5.1.3 设定表单栏位及避险商品设定

合计栏位设定	明细栏位设定	避险商品设定
\$Vega	\$Theta	避险数量(50ETF)
114	681	92,765股
114	681	92,765股

设定选择”合计栏位设定”(分析表上半部)与”持仓明细栏位设定”(下半部栏位)可以选择表单栏位项目。用户也可以通过避险商品设定来计算不同避险商品对应的避险张数,方便用户进行避险。



警示设定 ✕

估算浮动盈亏
 警示上限 万 警示下限 万

估算今日损益
 警示上限 万 警示下限 万

\$Delta
 警示上限 万 警示下限 万

1%\$Gamma
 警示上限 万 警示下限 万

\$Vega
 警示上限 万 警示下限 万

\$Theta
 警示上限 万 警示下限 万

如上图所示“风险监控设定”,系统默认警示设定的复选框未选状态,如勾选相应警示指标的复选框,当警示指标超过上限或低于下限的情况下,总持仓分析相应栏位以红色背景颜色进行提示,如果设置了相关警示声音提示,则可参照前文“基本设定”-“系统设置”-其他设置,当指标超出上下限制的时候,同时声音提示。

5.1.4 总持仓分析界面展示场外理论损益和今日损益

合计	na	日成交\$Delt	日成交1%\$Gamr	今日成交\$Vega	今日成交\$Theta	期权持仓Delt	期权持仓Gamr	避险商品	避险数量	\$时间价值	股票持仓	期货持仓
合计	0	0	0	0	0	--	--	选择商品	--	0	0	0
各类小计												
(沪)50ETF	0	0	0	0	0	87,842.5062	38,407.4500	(沪)50ETF	-17033264.64股	0	0	0

交易	商品名称	估算今日损益	估算理论损益	当冲损益	理论当冲损益	\$Delta	持仓	调整\$Delta	1%\$Gamma	\$Vega	\$Theta
✓	otc0001	54,988	54,988	--	--	25,355,000	00,000.0000	25,355,000	0	0	0
✓	otc0003	54,879	54,879	--	--	25,355,000	00,000.0000	25,355,000	0	0	0
✓	otc0010	-5,355	-5,355	--	--	-2,535,390	00,000.0000	-2,535,390	-24	-0	-0
✓	otc0009	-5,303	-5,303	--	--	-2,531,311	00,000.0000	-2,531,311	-697	-1	-1
✓	otc0011	-5,303	-5,303	--	--	-2,531,311	00,000.0000	-2,531,311	-697	-1	-1
✓	otc0008	157	157	--	--	75,856	00,000.0000	75,856	35	0	0
✓	otc0095	-33	-33	--	--	0	00,000.0000	0	0	0	0
✓	otc0096	-33	-33	--	--	0	00,000.0000	0	0	0	0
✓	otc0005	-33	-33	--	--	0	00,000.0000	0	0	0	0

5.1.5 在总持仓分析中“避险商品”栏位上鼠标右键点击“避险”菜单后打开闪下界面时,默认把避险数量填写在交易数量中(不区分买卖方向)

总持仓分析

投资组合: 全部 | 小计类型: 依标的 | 不计本日结算仓位 | 刷新持仓 | 一键避险 | 合计栏位设置 | 明细栏位设置 | 避险统一设置 | 风险监控设置 | 导出

合计	避险商品	避险数量	股票持仓	期货持仓	期权持仓	市值	估算今日损益	估算理论损益	当冲损益	理论当冲损益	[Delta]	1%Gamma
新雷能	日新港	-89247.48股	21,897	0	0	241,305	-15,766	-15,766	0	0	241,414	0
辰奕智能	日新港	-81361.74股	4,900	0	0	220,108	-10,437	-10,437	0	0	220,084	0
液化石油气	日新港	80602.59股	0	-2	0	-217,960	-4,140	-4,140	0	0	-218,030	0
华熙生物	上海机场	-11497.00股	0	0	0	205,331	-4,089	-4,089	0	0	205,558	0
鸡蛋	日新港	0	0	5	0	200,600	-1,200	-1,200	0	0	200,550	0
上海沿浦	上海沿浦	0	0	0	0	196,430	1,495	1,495	0	0	196,495	0
铁矿	日新港	-70900.49股	0	0	5	24,550	0	0	1,264	0	191,786	8,280
露格矿业	露格矿业	-6500.00股	6,500	0	0	162,630	-520	-520	0	0	162,598	0

持仓明细 (本页面涉及损益, 成本的计算全部不包含税费, 如需查看确切数据, 请在资金查询中查看)

交易	商品名称	估算今日损益	估算理论损益	当冲损益	理论当冲损益	[Delta]	1%Gamma	SVega	STheta	SVanna	SVomma	今日成交\$Del
交易	华熙生物	-4,089	-4,089	0	0	205,558	0	0	0	0	0	0

闪电下单 (600009 - 上海机场)

888899521 (股票) | 现价: 33.75 | 幅度: -1.11%

商品: 输入商品代码/名称 | 限价单

现价 | 盘中 | 自动盘中 | 盘口价格 | ^ | v

持仓: 2100 | 可用买: 0 | 可用卖: 2100

自买单	市场买	价格	市场卖	自卖单
	+	33.85	+	
	+	33.84	+	
	+	33.83	+	
	+	33.82	+	
	+	33.81	+	
	+	33.80	+	24900
	+	33.79	+	7000
	+	33.78	+	10900
	+	33.77	+	6700
	+	33.76	+	9600
	+	33.75	+	
	+	33.74	+	
	+	33.73	+	
	+	33.72	+	
	+	33.71	+	
	+	33.70	+	
	+	33.69	+	
	+	33.68	+	
	+	33.67	+	
	+	33.66	+	
	+	33.65	+	

自动填入 避险数量

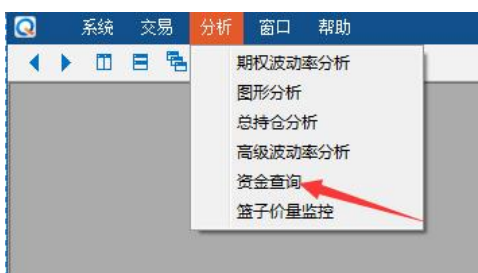
市买 买 33.75 卖 市卖

量 6100 +100 +500 +1000 +2000 +5000 C

成交追踪 | 自动拆单

5.2 资金查询

5.2.1 柜台资金持仓查询



使用者通过路径“分析/总资金分析”点击进入该模块, 资金管理与总持仓分析采用相类似的结构, 用户点击

资金管理后，界面上部分会将该用户登陆的交易账号及资金情况展示出来，而下面持仓明细与用户的账号联动，选择合计时会将所有的持仓明细列出，选择具体账号，会将该账号下的持仓明细列出。用户点击刷新按钮，会将数据更新

资金查询						
刷新 导出 资金栏位设置 持仓栏位设置						
帐号	交易收入	用户代码	交易支出	当日手续费		
8888899501(股票)	240.70	8888899501	1330.80	20.00		
	昨结资金	账户资金	可用资金	用户代码		
8888899501(沪深期权)	98442657.14	98425880.14	97823367.16	8888899501		
	用户代码	当日权利金收入	昨结资金	账户资金	可用资金	占用保证金
8888899501(期货期权)	8888899501	2380724.49	7087009.32	8064290.21	4334848.91	3729441.30
	交易收入	用户代码	交易支出	当日手续费		

资金查询增加显示“净资产”字段，分资金账号显示。

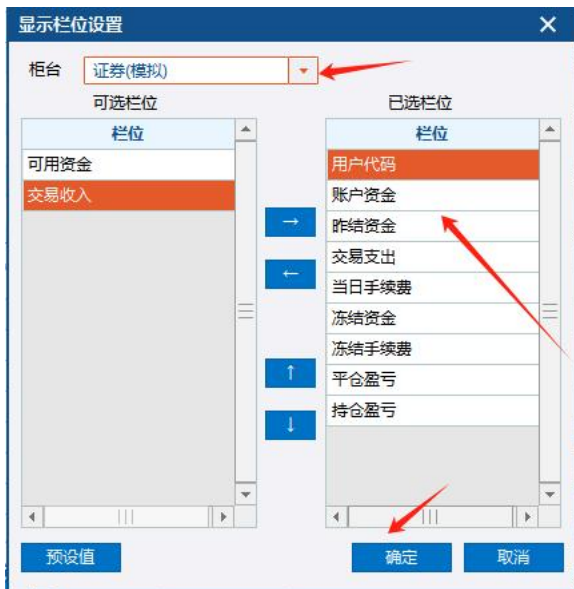
帐号	净资产	风险监控类别	缺口资金	对冲风险度	组合拆分后保证金	组合拆分后风险度	净资产				
70200704359(沪深期权)	1.24	正常	0.00	0.00	940145.40	0.00	98666859.96				
	预计利息	预计罚息	预计利息税	资产修正金额	总资金余额	开基市值	利率类别	回报买入金额	回报卖出金额	净资产	
170200704359(股票)	0.00	0.29	0.00	0.00	0.00	667.67	0.00	普通	807.60	0.00	0.00
	净资产	风险监控类别	缺口资金	对冲风险度	组合拆分后保证金	组合拆分后风险度	净资产				
83400029430(沪深期权)	9.64	正常	0.00	0.00	1332764.76	0.00	100443049.27				

资金查询中，资金明细和持仓明细可以编辑选择显示栏位及栏位顺序

资金查询								
刷新 导出 资金栏位设置 持仓栏位设置								
帐号	账户资金	昨结资金	可用资金	交易收入	交易支出	当日手续费	冻结资金	
8888899601(股票)	53409594.82	53412364.82	53409594.82	0.00	2720.00	50.00	0.00	
	账户资金	昨结资金	可用资金	占用保证金	当日权利金收入	当日权利金支出	当日手续费	
8888899601(沪深期权)	99854174.15	99854174.15	99766522.64	87651.51	0.00	0.00	0.00	
	账户资金	昨结资金	可用资金	占用保证金	当日权利金收入	当日权利金支出	当日手续费	
8888899601(期货期权)	96179820.04	96217335.04	93523378.27	2656441.77	0.00	0.00	0.00	
	账户资金	昨结资金	可用资金	交易收入	交易支出	当日手续费	冻结资金	

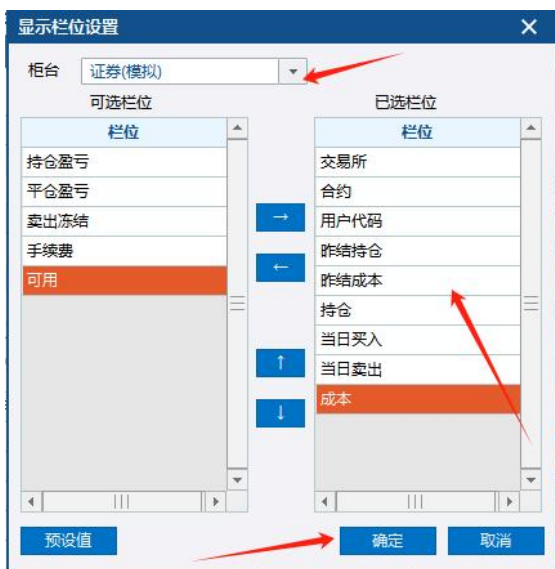
持仓明细 帐号: 8888899601(股票)							
交易所	合约	用户代码	昨结持仓	昨结成本	持仓	当日买入	当日卖出
深证	000008	8888899601	400	2.0000	400	0	0
深证	000011	8888899601	200	7.9300	200	0	0
深证	000016	8888899601	100	2.2900	100	0	0
深证	159922	8888899601	150000	5.0240	150000	0	0
上证	510050	8888899601	22600	2.5369	22600	0	0
上证	510090	8888899601	9000	2.2532	9000	0	0
上证	510180	8888899601	70900	3.3190	70900	0	0

1. 资金明细栏位设置



选择柜台，从可选栏位中选择想展示的栏位到已选栏位中。在已选栏位中调整栏位显示的先后顺序后。点击确定。则设置内容生效。

2. 持仓明细栏位设置



选择柜台，从可选栏位中选择想展示的栏位到已选栏位中。在已选栏位中调整栏位显示的先后顺序后。点击确定。则设置内容生效。

5.2.2 资金、保证金实时监控

将需要监控的资金持仓字段放到系统状态栏进行实时监控

可用资金合计 30000000.00元 | 冻结保证金合计 0.00元 | 冻结资金合计 0.00元 | 刷新 | 设置

总持仓分析

资金查询

刷新 导出

说明:选中若干单元格右键可加入工具栏监控(支持Ctrl多选)

帐号	可用资金	冻结资金	币种
m8888826_stk(股票)	10000000.00	0.00	1
8888826_sopt(沪深期)	10000000.00	0.00	0.00
8888826_fopt(期货期)	10000000.00	0.00	0.00

持仓明细 帐号: m8888826_stk(股票)

说明:选中单元格右键可加入工具栏监控,右键表头可将该列数据累加后加入监控

交易所	代码	持仓	持仓成本	冻结数量
1	510050	188700	2.834	78500
1	600012	0	0.000	0
1	600009	0	0.000	0
1	510300	177383	4.055	0
1	600011	0	0.000	0
1	601398	700	61.514	0
1	510180	9993800	3.332	9993800

显示栏位设定

字段选择

- 可用资金合计
- 冻结保证金合计
- 冻结资金合计

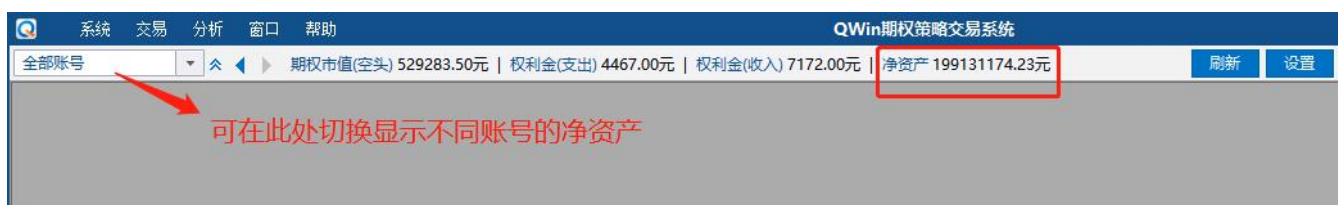
可在“分析->资金查询”中添加新的显示栏位

自动刷新 30 秒

确定 取消

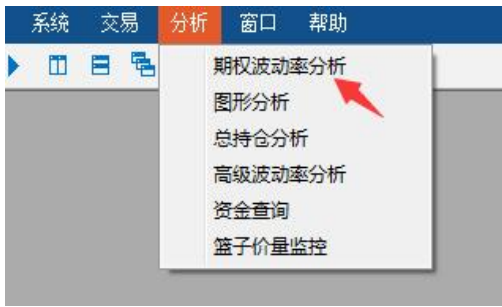
注：使用自动刷新功能时，由于有些柜台有流量控制（如 CTP 柜台），可能会造成请求阻塞，进而影响报撤单操作，请谨慎使用！

在顶部显示栏位中增加可显示“净资产”字段。在显示栏位设定，勾选“净资产”字段，可添加显示该字段。可以分账号显示各账号对应的净资产数额，也可以选择【全部账号】选项，显示所有账号的净资产加总数额。



5.3 波动率分析

5.3.1 开启波动率分析



使用者通过路径分析“分析/波动率分析”进入该模块：

5.3.2 全局设定

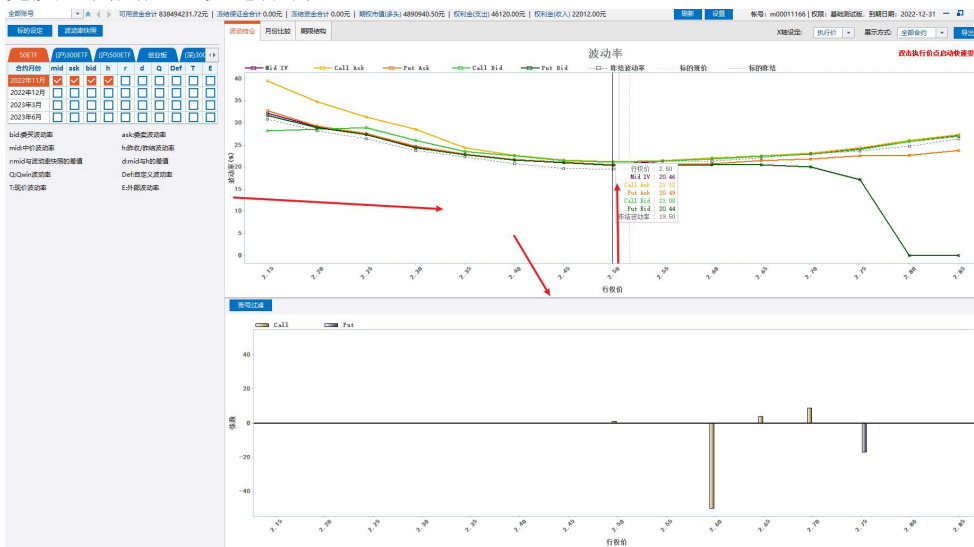


当鼠标左键点击“标的设定”时，会弹出标的的选择窗体。用户可以选择需要分析的标的（与序列选择期权手动交易的标的相同），选定标的的期权后，该期权会添加到该 TAB 页面上。

当鼠标左键点击“波动率快照”时，系统会记录当时选中标的的隐含波动率；当鼠标左键点击“刷新”时，系统会刷新选中需要显示的期权及曲线种类在右边图中。

5.3.3 标的名称与选项说明

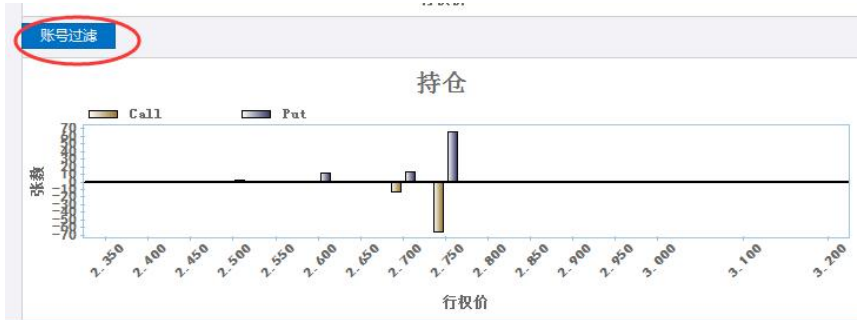
用户可以任意勾选所需标的及曲线，选中的曲线会在右边波动率曲线图中绘制出，波动率曲线和持仓界面显示宽度比例用户可以进行调整



5.3.4 波动率与持仓

当使用者选择好需要显示的标的名称及曲线后，点击预览，波动率二维曲线会在右上方显示，持仓二维曲线会在右下方显示。

账号过滤功能类似于期权手动交易中的账号组过滤，过滤内容为持仓数据。



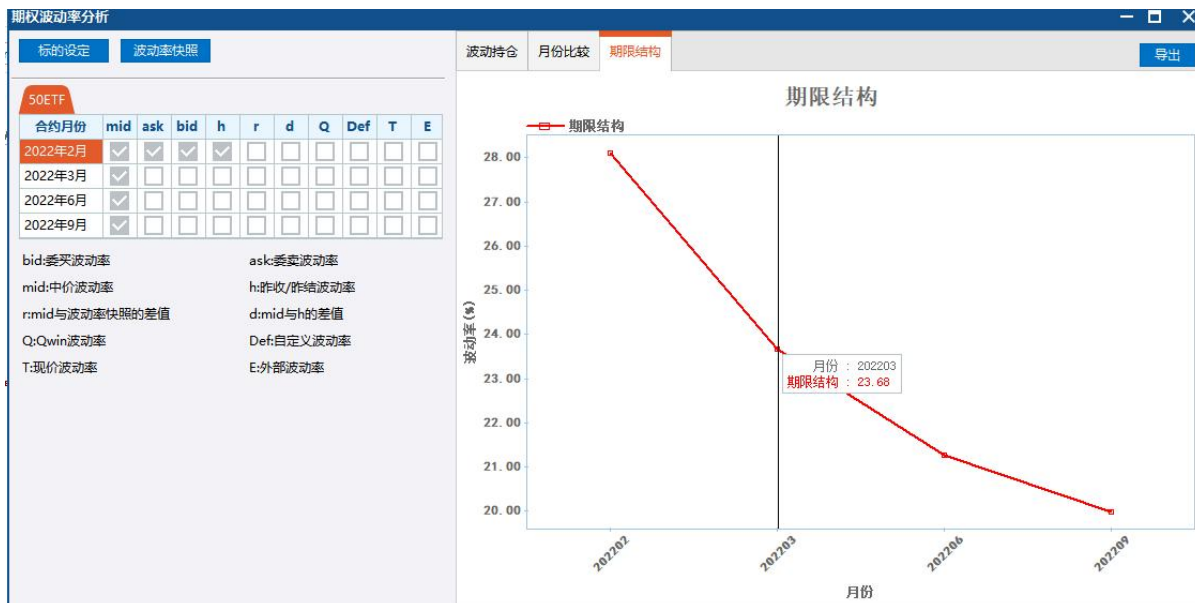
5.3.5 月份比较

当鼠标左键点击“月份比较”，再点击“预览”，会将该标的下的所有月份 MID IV 对比图展示出来。



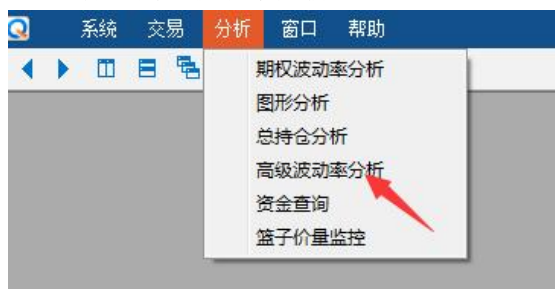
5.3.6 期限结构

选中标的，点击期限结构，可以获得期限结构图，横坐标为月份，纵坐标为波动率%，如图所示：



5.4 高级波动率分析

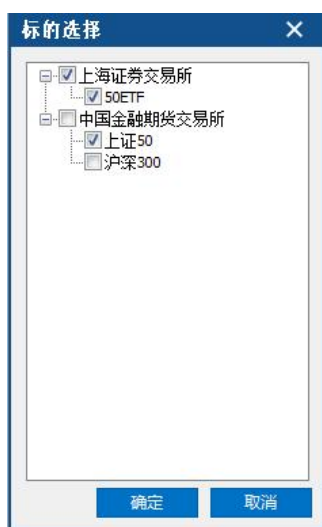
5.4.1 打开高级波动率分析



使用者可以通过“分析” -> “高级波动率分析”进入该功能界面。

5.4.2 标的设定

使用者可以点击“标的设定”，进行添加标的，用户勾选需要监控的标的后点击“确定”，即可修改标的。



5.4.3 月份选择

使用者进入当前页面



选择	月份	波动	putd	calld
<input checked="" type="checkbox"/>	2021年4月	19.04	2.18%(3.4227)	-0.86%(3.6803)
<input type="checkbox"/>	2021年5月	20.30	2.41%(3.3655)	-1.23%(3.7422)
<input type="checkbox"/>	2021年6月	21.86	0.35%(3.3257)	-2.45%(3.8023)
<input type="checkbox"/>	2021年9月	22.14	1.58%(3.2342)	0.35%(3.9766)

使用者可选择勾选多个月份的 CheckBox 框，（右侧上图和下图）则显示相应月份的曲线，以不同颜色的曲线呈现，鼠标可拖拽右侧坐标轴，修改波动率曲线显示范围



5.4.4 各月份波动率价差设定

使用者选中某一标的后，点击“各月份设定”（该设定只对选中标的的有效），系统弹出以下画面进行设定：

月份	putd下限%	putd上限%	call下限%	call上限%
2016年4月	0.00	0.00	0.00	0.00
2016年5月	-1.00	1.00	-1.00	1.00
2016年6月	0.00	0.00	0.00	0.00
2016年9月	0.00	0.00	0.00	0.00

用户可以自己输 putd 和 calld 上下限，也可以通过微调按钮进行调整（默认上限为 1%，下限为-1%），点击“确定”后即生效。

putd 的定义为价平波动率和 put 转折点波动率之差，put 转折点的行权价显示在接续此差值后面的括号内。call 的定义为价平波动率和 call 转折点波动率之差，call 转折点的行权价显示在接续此差值后面的括号内。

当 putd 或 calld 小于个别设定月份的下限时以绿色警示，如果高于上限以红色警示。

月份	波动	putd	calld
2016年4月	28.60	-0.25%(2.0047)	1.62%(2.2412)
2016年5月	30.08	-0.74%(1.9561)	-2.05%(2.2945)
2016年6月	31.59	-0.81%(1.9174)	-3.68%(2.3506)
2016年9月	29.13	-1.10%(1.8590)	-5.01%(2.4292)

5.4.5 跨月份波动率价差设定

使用者点击“跨月份设定”，会弹出以下画面进行设定：

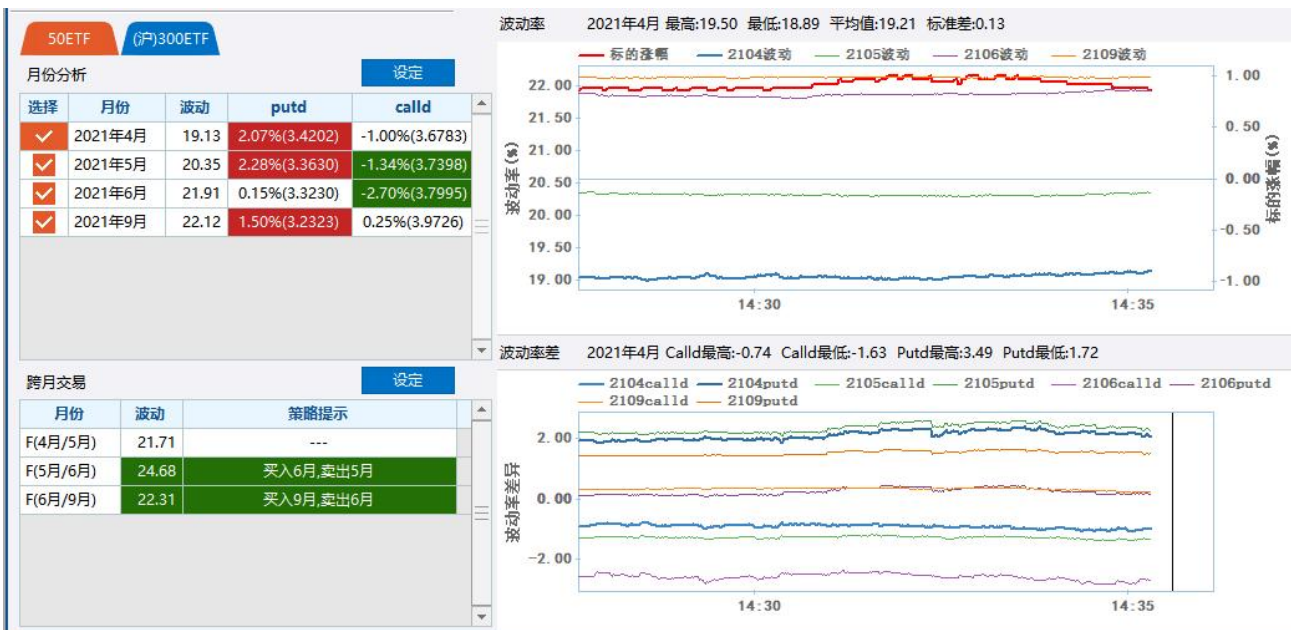


使用者可以自己输入波动率上下限，也可以通过微调按钮进行调整，点击“确定”后即生效。当 $F(x \text{ 月}/y \text{ 月}) > \text{上限}$ ，显示为红色，策略提示显示为“买入 x 月，卖出 y 月”（x 为近月，y 为远月） $F(x \text{ 月}/y \text{ 月}) < \text{下限}$ ，显示为绿色，策略提示显示为“买入 y 月，卖出 x 月”（x 为近月，y 为远月）

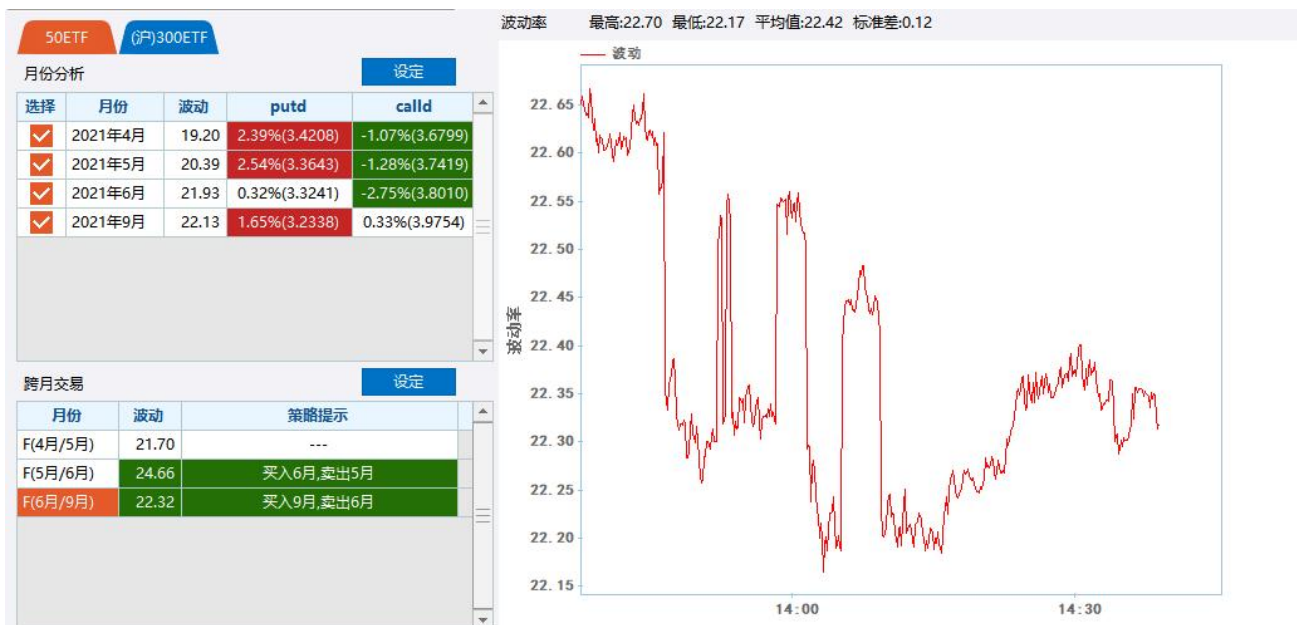
月份	波动	策略提示
F(4月/5月)	31.65	买入4月, 卖出5月
F(5月/6月)	34.68	----
F(6月/9月)	26.91	买入9月, 卖出6月

5.4.6 实时图形

用户选中月份分析中勾选多个月份的 CheckBox 框或单个某一月份时，画面右边会将“波动”，当日变化%（当日变化为目前波动率-昨结价计算出来的波动率）与“putd”“calld”分别在波动率图和波动率差异图中实时画出，每秒钟计算一次描一个点。（该画面打开时为横轴时间的起始点，开始画图。目前在画面上仅保留最近半小时的波动率，关闭该画面后再打开重新画图。）



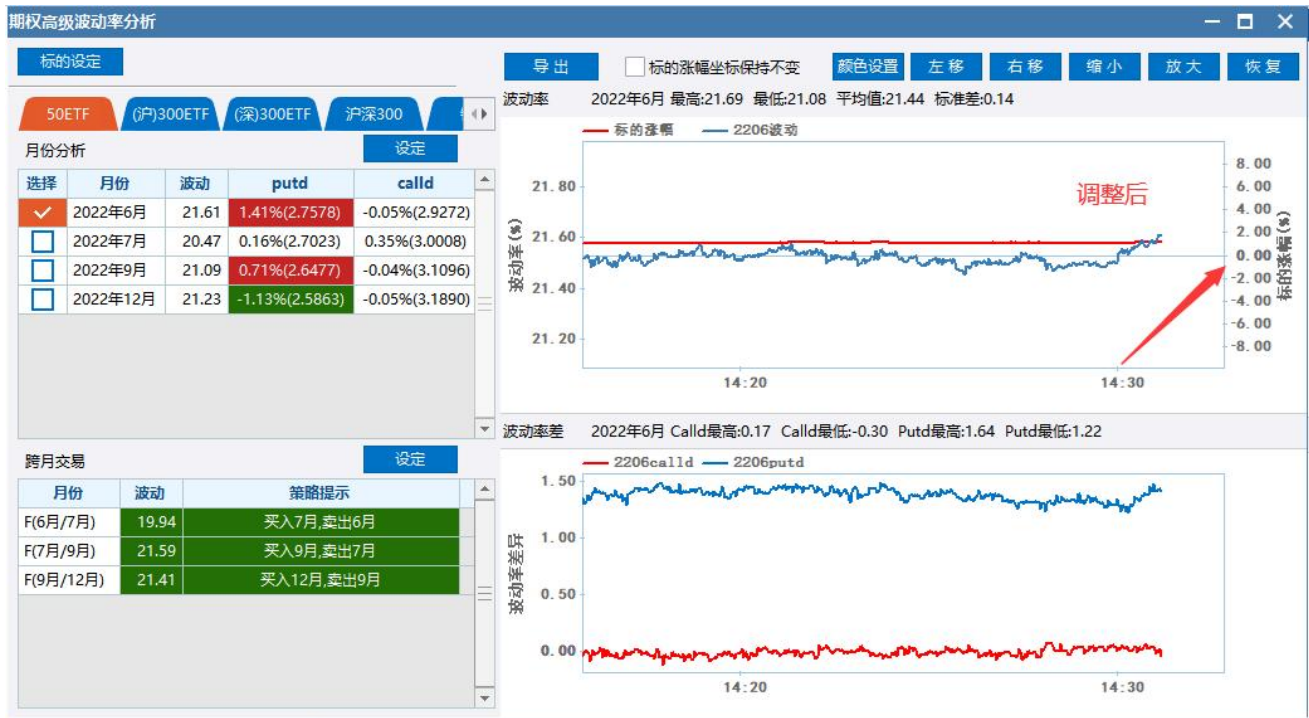
用户选中跨月交易中的某一行时，画面右方波动图会将相应的远期波动实时画出，如下图所示。



栏位(月份分析)	说明
月份	期权合约月份
波动	各月份波动率
putd	put 转折点与价平波动率之差(括号内显示转折点), 此为监控波动率 skew 的重要参考点
calld	call 转折点与价平波动率之差(括号内显示转折点) 此为监控波动率 skew 的重要参考点

栏位(跨月交易)	说明
月份	期权跨月月份
波动	远期波动度
策略提示	如果小于下限显示“卖近月,买远月”,绿色底 如果大于上限显示“买近月,卖远月”,红色底 其他则为“---”,白色底

鼠标放置在箭头处出现 \updownarrow , 可按住鼠标进行上下拖动调整选中区域标的涨幅的放大和缩小。如下图
(勾选“标的涨幅坐标保持不变”选项后, 鼠标上下拖动改变坐标系时, 标的走势和涨跌幅度保持不变, 不改变比例)

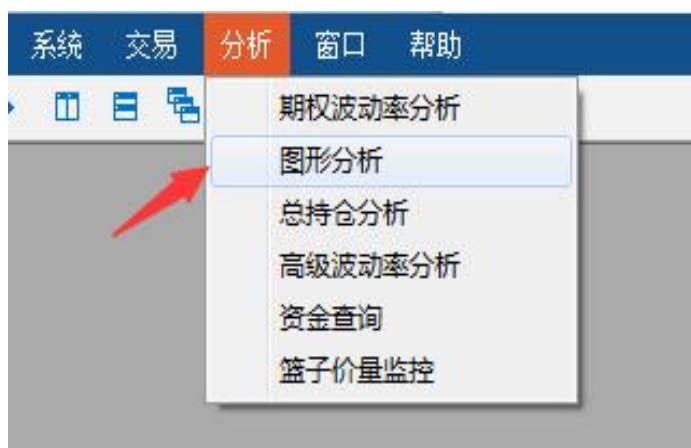


颜色设置: 有 2 中默认方案可选, 且可以点击颜色条自定义颜色, 保存后生效。



5.5 图形分析

5.5.1 开启“图形分析”画面



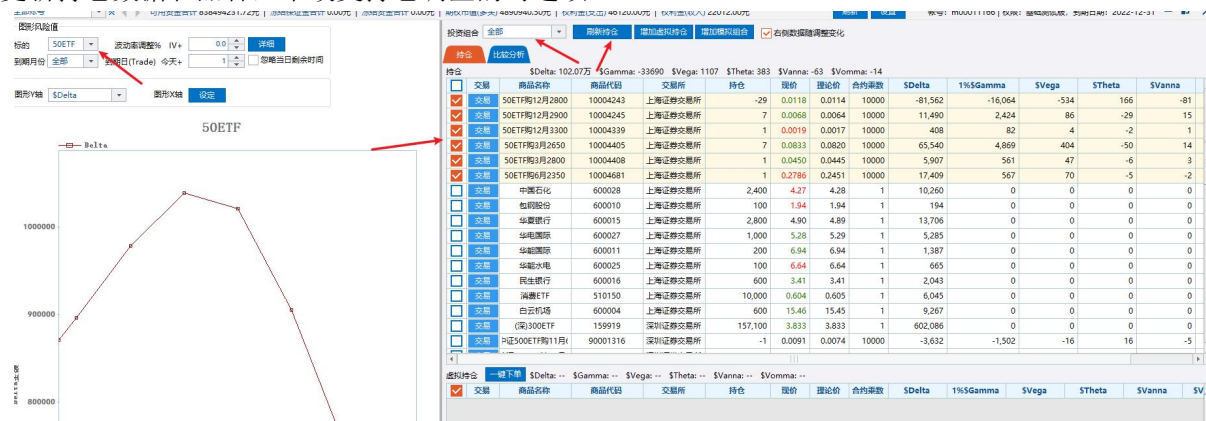
使用者在工具菜单栏的“分析”的选单中选择“图形分析”，即可弹出图形分析画面：

5.5.2 设定分析组合



使用者可以通过“投资组合”下拉框筛选出需要分析的投资组合，将自己该组合的仓位加载到图形分析中，目前用户可以对组合中的各部位进行情景分析，也可以增加虚拟持仓，对真实持仓与虚拟持仓整体进行情景分析
真实持仓组合设定：

在持仓区域，用户通过下拉选单选择所需要分析的持仓组合，根据左侧选择标的，右侧显示相应标的持仓和虚拟持仓会勾选显示。用户也可以通过勾选其它标的品种来编辑调整想要展示的持仓，点击“刷新持仓”之后，只更新持仓数据和品种，不改变持仓调整的勾选项。



使用者可以通过持仓中的复选框选择需要分析的部位，如若交易某一商品，点击交易按钮即可弹出闪电交易画面：



虚拟持仓设定:

按下“增加虚拟持仓”后，跳出“挑选商品”弹出框供使用者选择虚拟持仓品种:



选择品种后，按下确定，即可在“虚拟持仓”页签上看到新的品种

选	交易	商品名称	交易所	持仓	最新价	\$Delta	1%\$Gamma	\$Vega	\$Theta	删除
<input type="checkbox"/>	交易	50ETF沽9月2200	上海证券交易所	2	0.0369	-3,776	799	25	-10	删除
<input type="checkbox"/>	交易	50ETF购9月2600	上海证券交易所	2	0.0924	16,358	2,024	64	-25	删除

5.5.3 设定分析情境

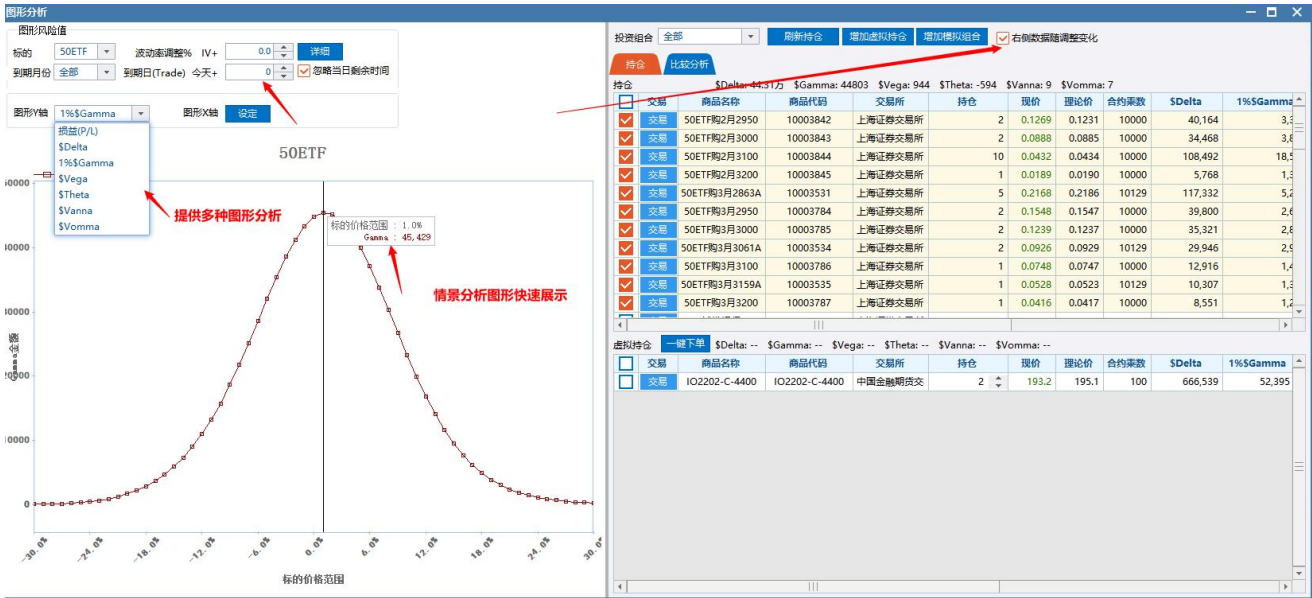
设定的内容分为 4 类:

- ① 分析标的的选择: 选择”持仓设定”内的标的进行分析, 选项的来源为设定持仓内的标的种类
- ② 风险参数设定: 设定的内容包含波动率与评价日
- ③ X 轴设定标的价格范围、间距
- ④ 风险值选择: 选择图型 Y 轴内容



5.5.4 图形显示

使用者设定好“持仓设定内容”(持仓设定、“标的”、“月份”所决定)、“风险参数”(波动率 iv+、今天+), 选择不同的情景分析类型即可在画面画出各种风险图形:



5.5.5 组合比较分析

使用者也可以对于不同持仓、风险参数的组合进行在不同价格下的风险值比较，即进行组合间风险分析比较。

使用者选择持仓与风险参数后，按下“增加模拟组合”，弹出框“新增组合”，在对话框可输入自定义新增组合的名称。如下图：设定持仓与风险参数后，填写名称”组合 A”，按下确定，就可以看到增加新的”组合 A”。



用户可以在比较分析画面对于组合的 IV+、今天+进行微调，也可以用拾色器对图形曲线颜色进行设置：



假定用户根据持仓、虚拟持仓和风险参数不同设定不同投资组合，如下图设定了投资组合 A、B、C。

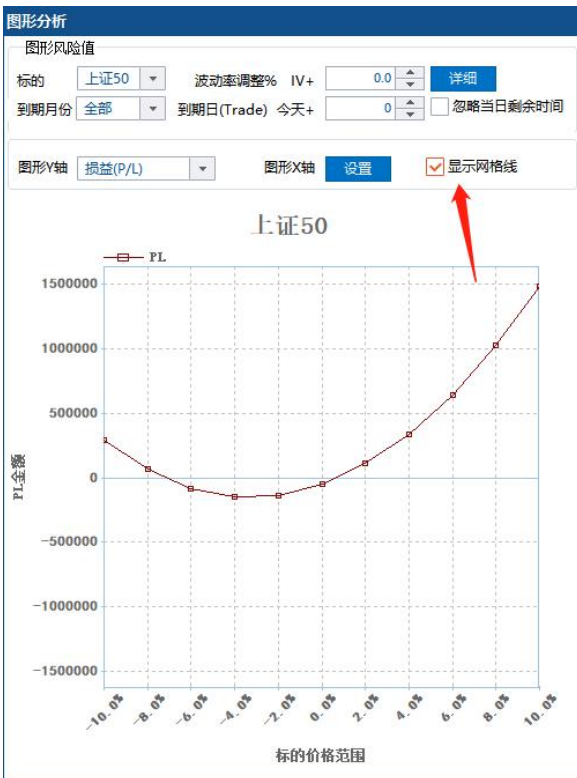
选	组合名称	IV+	今天+	颜色	删除
<input checked="" type="checkbox"/>	组合A	1.8	3		删除
<input checked="" type="checkbox"/>	组合B	0.5	2		删除
<input checked="" type="checkbox"/>	组合C	1.5	6		删除

设定好组合后，用户即可进行不同组合的风险值比较，如下图：选择比较组合 A、B、C delta 的分布状态。



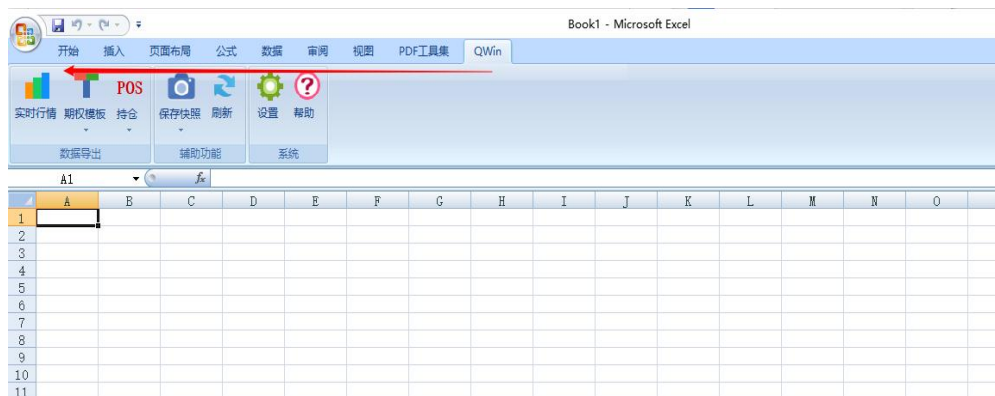
5.5.6 增加网格线

勾选“显示网格线”后，在图形界面显示淡灰色虚线的网格线，默认不勾选。



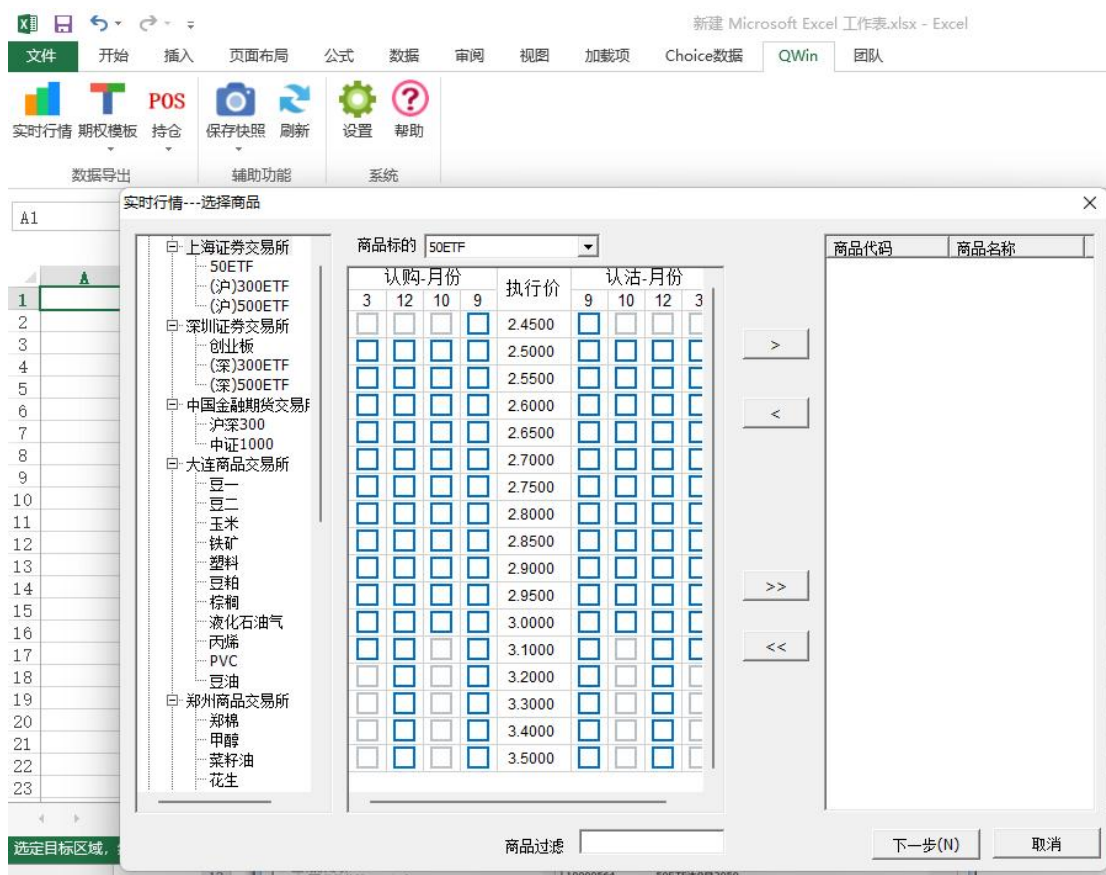
5.6 Rtd 行情

5.6.1 开启 QWin Rtd

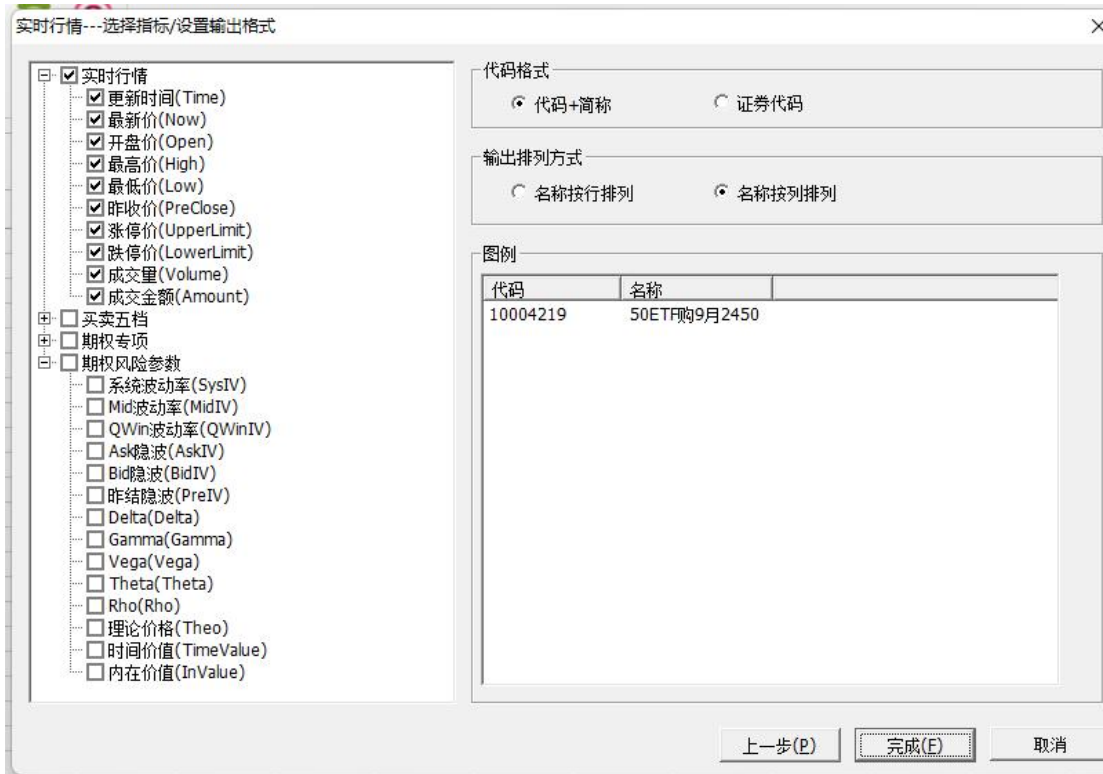


打开 Excel 软件，鼠标焦点移到“QWin”，点击后展示如上界面，用户根据需要选择相应的设置。

5.6.2 实时行情输出



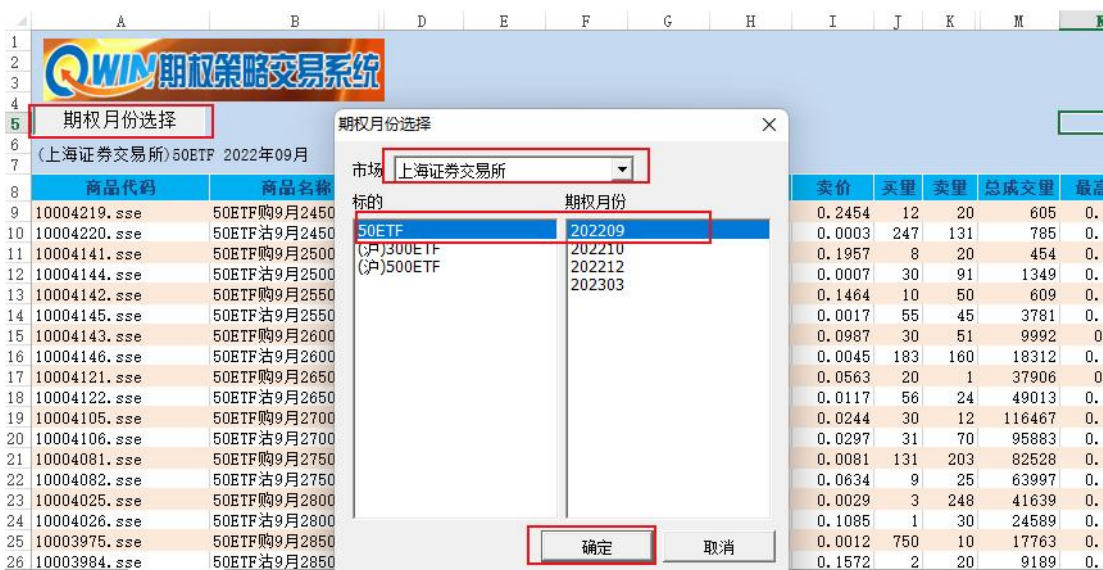
点击“实时行情”，跳出选择商品对话框，选择相应的商品种类和指标类型，点击下一步和完成，即可把所选的商品和指标类输出到 Excel。



5.6.2 行情模板选择



点选“期权模板”，选择相应的系统保存的期权模板类型，即可输出到 Excel.

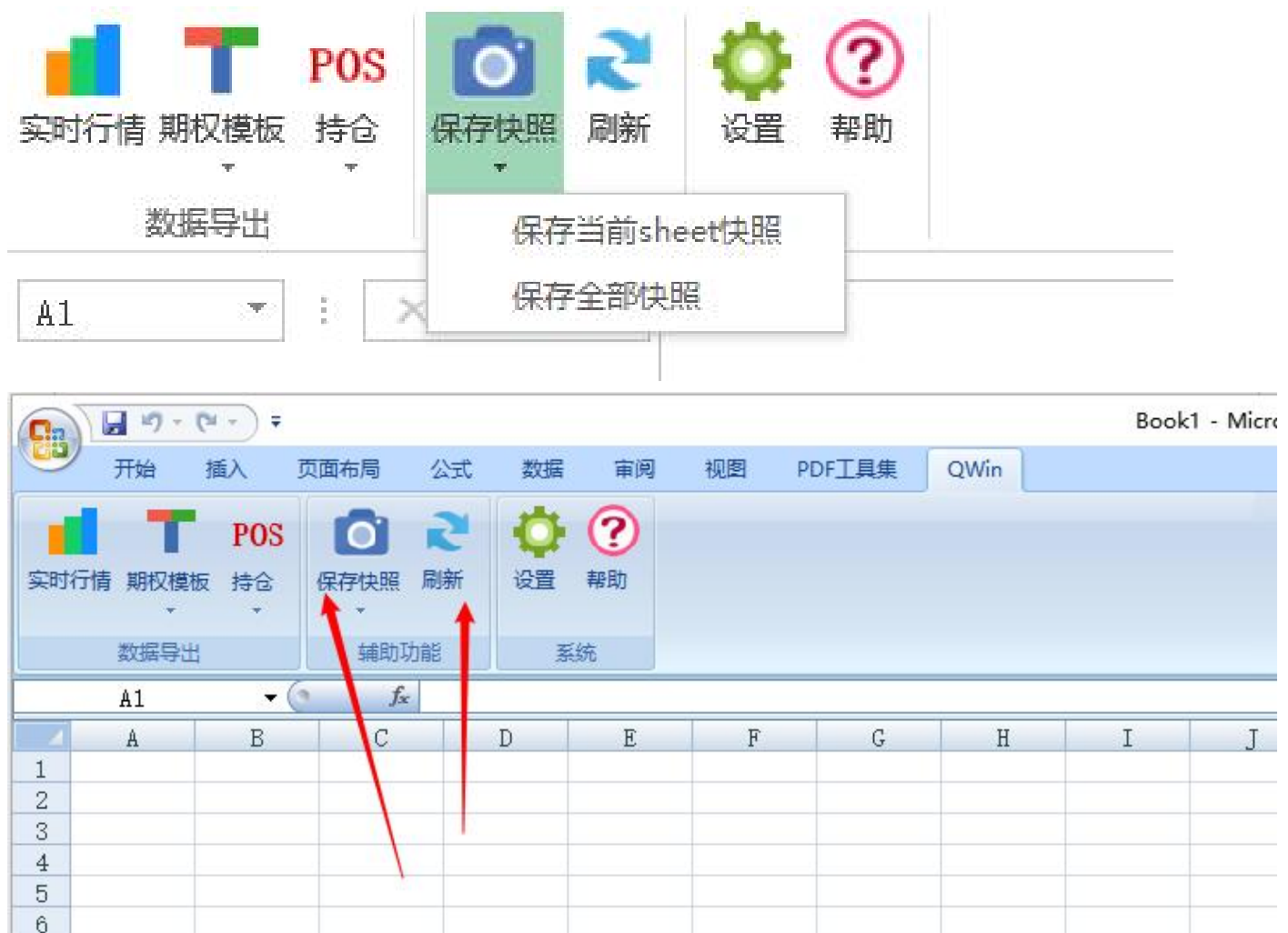


5.6.3 持仓信息

点击“持仓”，选择相应的持仓类型，根据对话框选择需要输出的信息，即可将 QWIN 总持仓数据输出到 Excel



5.6.4 保存快照和刷新



点击“保存快照”，有两种模式，分别是“保存当前 sheet 快照”和“保存全部快照”，点击“刷新”，对行情数据进行手动刷新。

5.6.5 Rtd 设置



点击“设置”，可以对系统 Rtd 刷新设置的时间间隔进行调整，如上图所示，选择间隔，按确定键。

5.7 策略监控

1、依策略监控各策略盈亏情况

帐号	删除	反向下单	拆单	策略下单时间	策略名称	展开	商品名称	状态	策略成本价	策略理论价	策略卖价	买卖	SDelta	1%SGamma	SVega	STheta	SVanna	SVomma
合计									987.5320	732.7336	732.4320		1,022,646	80,731	2,542	-1,199	-36	8
				2022-01-29 10:41:49	IO2202-C-4400	展开	IO2202-C-4400	正常	386.8	390.2	386.0		666,539	52,395	607	-857	-60	7
				2022-01-18 17:16:00	10003844	展开		正常	0.5660	0.2168	0.2160	买	54,246	9,299	130	-132	9	1
				2022-01-18 17:13:52	10003844	展开		正常	0.5660	0.2168	0.2160		54,246	9,299	130	-132	9	1
				2022-01-04 15:01:40	IC2112	展开		正常	599.6	342.1	346.0		247,615	9,738	1,674	-77	6	-1

2、依时间和策略名称进行筛选

帐号	删除	反向下单	拆单	策略下单时间	策略名称	展开	商品名称	状态	策略成本价	策略理论价	策略卖价	买卖	SDelta	1%SGamma	SVega	STheta	SVanna	SVomma
合计									987.5320	732.7336	732.4320		1,022,646	80,731	2,542	-1,199	-36	8
				2022-01-29 10:41:49	IO2202-C-4400	展开		正常	386.8	390.2	386.0		666,539	52,395	607	-857	-60	7
				2022-01-18 17:16:00	10003844	展开		正常	0.5660	0.2168	0.2160		54,246	9,299	130	-132	9	1
				2022-01-18 17:13:52	10003844	展开		正常	0.5660	0.2168	0.2160		54,246	9,299	130	-132	9	1
				2022-01-04 15:01:40	IC2112	展开		正常	599.6	342.1	346.0		247,615	9,738	1,674	-77	6	-1

3、策略复制：复制一个选中的策略，创建一个新策略，弹出策略编辑框，应用选中策略中的参数，可编辑。

策略新增：创建一个新策略，弹出策略编辑框，可编辑。

删除	反向下单	拆单	策略下单时间	策略名称	展开	商品名称	状态	成交金额	策略成本价	策略理论价	策略卖价	买卖	浮动盈亏
合计									--	--	--		
			2023-02-24 16:29:10	123-复制	展开		异常	0	0.200	608.000	602.200		60
			2023-02-23 15:09:44	啊哈	展开		异常	5,372	5,372.00	5,576.50	5,575.00		20
			2023-02-23 14:41:37	啊哈-复制	展开		异常	5,413	5,413.400	5,950.750	5,943.700		53
			2023-02-23 14:32:48	啊哈-复制	展开		策略已平	5,037	--	--	--		--
			2023-02-09 09:53:46	RRR	展开		异常	--	--	--	--		--

4、多策略 Greeks 和盈亏合计统计

策略名称	删除	反向下单	拆单	策略下单时间	策略名称	展开	商品名称	状态	策略成本价	策略理论价	策略实价	买卖	\$Delta	1%\$Gamma	\$Vega	\$Theta	\$Vanna	\$Vomma
合计									987.5320	732.7336	732.4320		1,022,646	80,731	2,542	-1,199	-36	8
IO2202-C-4400	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2022-01-29 10:41:49	IO2202-C-4400	展开		正常	386.8	390.2	386.0		666,539	52,395	607	-857	-60	7
10003844	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2022-01-18 17:16:00	10003844	展开		正常	0.5660	0.2168	0.2160		54,246	9,299	130	-132	9	1
10003844	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2022-01-18 17:13:52	10003844	展开		正常	0.5660	0.2168	0.2160		54,246	9,299	130	-132	9	1
IC2112	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2022-01-04 15:01:40	IC2112	展开		正常	599.6	342.1	346.0		247,615	9,738	1,674	-77	6	-1

5、策略状态监控和反向下单

策略名称	删除	反向下单	拆单	策略下单时间	策略名称	展开	商品名称	状态	策略成本价	策略理论价	策略实价	买卖	\$Delta	1%\$Gamma	\$Vega	\$Theta	\$Vanna	\$Vomma
合计									987.5320	732.7336	732.4320		1,022,646	80,731	2,542	-1,199	-36	8
IO2202-C-4400	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2022-01-29 10:41:49	IO2202-C-4400	展开		正常	386.8	390.2	386.0		666,539	52,395	607	-857	-60	7
10003844	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2022-01-18 17:16:00	10003844	展开		正常	0.5660	0.2168	0.2160		54,246	9,299	130	-132	9	1
10003844	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2022-01-18 17:13:52	10003844	展开		正常	0.5660	0.2168	0.2160		54,246	9,299	130	-132	9	1
IC2112	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2022-01-04 15:01:40	IC2112	展开		正常	599.6	342.1	346.0		247,615	9,738	1,674	-77	6	-1
IO2112-C-4450	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2021-12-15 14:52:15	IO2112-C-4450	展开		异常	--	--	--		--	--	--	--	--	--
IC2112	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2021-12-15 14:51:56	IC2112	展开		异常	--	--	--		--	--	--	--	--	--
000001	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2021-12-15 14:50:47	000001	展开		正常	174,800.00	158,350.00	158,300.00		158,350	--	--	--	--	--
IO2112-C-4450	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2021-12-14 14:20:46	IO2112-C-4450	展开		异常	--	--	--		--	--	--	--	--	--
IC2112	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	2021-12-14 14:20:38	IC2112	展开		异常	--	--	--		--	--	--	--	--	--

点击反向下单会生成新的策略单。

5.8 风险矩阵

通过三维表格的方式计算价格和波动率同时变动时的 gamma、delta 等 MAP 的极值情况，方便客户做好避险准备。

投资组合	全部	标的	全部	全部	到期日(Trade)	今天+	0	忽略当日剩余时间	
持仓	新增持仓	\$Delta:886.38万	1%\$Gamma:56.83万	\$Vega:17930	\$Theta:-3356	\$Vanna:465	\$Vomma:198		
虚拟持仓	一键下单	添加虚拟持仓	\$Delta:-14678	1%\$Gamma:5513	\$Vega:171	\$Theta:-27	\$Vanna:-4	\$Vomma:	
交易	商品名称	商品代码	交易所	持仓	现价	理论价	合约乘数	\$Delta	%\$C
交易	治理ETF	510010	上海证券	400	1.313	1.313	1	525	
交易	超大ETF	510020	上海证券	400	2.543	2.543	1	1,017	
交易	价值ETF	510030	上海证券	400	0.761	0.760	1	304	
交易	(沪)50ETF	510050	上海证券	16,700	2.327	2.327	1	38,853	
交易	央企ETF	510060	上海证券	700	1.935	1.936	1	1,355	
交易	ESG建信	510090	上海证券	300	2.021	2.017	1	605	
交易	SZ50ETF	510100	上海证券	98,200	1.133	1.134	1	111,310	
交易	中盘ETF	510130	上海证券	1,600	4.889	4.888	1	7,820	
交易	消费ETF	510150	上海证券	6,700	0.522	0.522	1	3,494	
交易	产业升级	510160	上海证券	6,900	0.680	0.681	1	4,695	
交易	商品ETF	510170	上海证券	800	0.817	0.816	1	653	

价格/波动率	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta	\$Delta
-15.0%	-276,226	3,536.66	-238,041	3,902.54	-195,861	4,334.52	-147,697	5,279.86	-90,203	6,084.62	-27,459	6,619.78
-10.0%	-309,229	4,631.18	-255,808	5,722.70	-192,061	6,736.03	-119,264	7,680.44	-37,452	8,706.10	54,013	9,786.23
-5.0%	-252,419	5,727.50	-189,362	6,510.85	-118,640	7,354.04	-40,080	8,204.16	46,032	9,024.68	139,145	9,795.27
0.0%	-167,319	6,531.27	-97,166	7,156.77	-21,189	7,815.34	60,716	8,484.91	148,442	9,146.23	241,719	9,785.38
5.0%	-93,709	7,039.03	-18,503	7,561.32	61,352	8,103.71	145,914	8,656.15	235,143	9,209.41	328,916	9,755.86
10.0%	-3,916	7,451.61	75,167	7,905.09	158,127	8,372.40	244,997	8,848.27	335,759	9,327.69	430,350	9,806.23
15.0%	89,768	7,783.44	172,005	8,188.62	257,575	8,604.00	346,498	9,026.45	438,763	9,452.99	534,330	9,880.79

选择监控指标:

\$P/L	\$Delta	K¥
价格/波动率	\$Delta	
	1%\$Gamma	\$P
-15.0%	\$Vega	6.66
-10.0%	\$Theta	1.18
-5.0%	\$Vanna	1.50
	\$Vomma	-1

选择价格和波动率变动区间

SP/L	-3.0%		-2.0%		-1.0%		0.0%		1.0%		2.0%		3.0%	
价格/波动率	SP/L	\$Delta	SP/L	\$Delta	SP/L	\$Delta	SP/L	\$Delta	SP/L	\$Delta	SP/L	\$Delta	SP/L	\$Delta
-15.0%	-276,226	3,536.66	-238,041	3,902.54	-195,861	4,334.52	-147,697	5,279.86	-90,203	6,084.62	-27,459	6,619.73	43,741	8,265.08
-10.0%	-309,229	4,631.18	-255,808	5,722.70	-192,061	6,736.03	-119,264	7,680.44	-37,452	8,706.10	54,013	9,786.23	154,933	10,810.11
-5.0%	-252,419	5,727.50	-189,362	6,510.85	-118,640	7,354.04	-40,080	8,204.16	46,032	9,024.68	139,145	9,795.27	238,586	10,507.31
0.0%	-167,319	6,531.27	-97,166	7,156.77	-21,189	7,815.34	60,716	8,484.91	148,442	9,146.23	241,719	9,785.38	340,180	10,394.59
5.0%	-93,709	7,039.03	-18,503	7,561.32	61,352	8,103.71	145,914	8,656.15	235,143	9,209.41	328,916	9,755.86	427,050	10,289.90
10.0%	-3,916	7,451.61	75,167	7,905.09	158,127	8,372.40	244,997	8,848.27	335,759	9,327.69	430,350	9,806.23	528,667	10,280.15
15.0%	89,768	7,783.44	172,005	8,188.62	257,575	8,604.00	346,498	9,026.45	438,763	9,452.99	534,330	9,880.79	633,134	10,307.38

价格区间与波动率区间

价格区间 3%

价格间距 %

波动率区间 15%

波动率间距 %

设置显示单位

SP/L	\$Delta	K¥	M¥
¥	¥	K¥	M¥

5.9 二次开发接口

目前系统支持 C++、PYTHON 等二次开发接口下单方式。二次开发只允许本地调用。

二次开发 demo 和接口的下载地址为

<https://www.iqwin.com.cn/download/downlistetc.html>

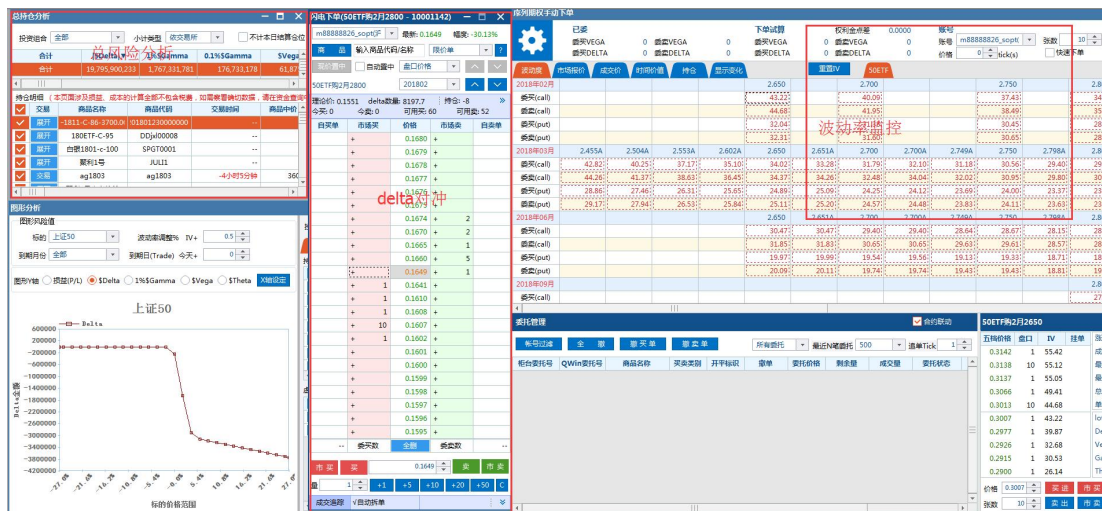
6. 范例说明

6.1 波动率方向交易

使用者预期市场波动率目前 $iv=32\%$ ，预期波动将下跌，使用者建立 10 万 vega 金额。

步骤:

- (1) 监控波动率
- (2) 总风控分析
- (3) Delta 对冲



6.2 同月份价差交易

市场预期未来将大涨，因此 call 价外合约明显高于价平合约的波动率，价平合约 $iv=30\%$ ，价外 $delta=0.25$ 处合约 $iv=33\%$ ，使用者透过卖出价外合约 $VEGA=10$ 万与买进价平合约 $VEGA=10$ 万赚取波动率价差。

步骤:

- (1) 监控 Skew 情况
- (2) 选择适合的期权合约



6.3 跨月份价差交易

目前市场近月份波动率=30%，次月份波动率=38%，使用者预期未来波动率并不会明显上升，因此要透过卖出远月份波动率买进近月份波动率，赚取波动率价差。

步骤:

- (1) 监控远期月份波动率
- (2) 选择交易合约



6.4 期权策略交易

使用者预期区间上涨，如果买进 2.00 合约，卖出 2.1 的合约在付出权利金低于 0.05 时具有投资价值。

步骤:

- (1) 设定价差组合
- (2) 监控价差组合



6.5 对冲交易

- 使用者预期未来市场反弹，小型股涨幅会大于大型股涨幅，因此想建立买进沪深 300 卖出上证 50 方式赚取价差
- 使用者目前有 50ETF 持仓，市场 50 期货贴水 1%，使用者认为未来贴水将会收敛，因此想买进 50 期货卖出 50ETF 进行价差交易

步骤:

- (1) 编辑价差组合
- (2) 监控价差组合
- (3) 分析对冲风险

