

1 简介

YDClient是在Windows环境下使用ydApi开发的客户端应用程序，可以实现交易终端和风控终端双重目的。

- 期货公司客户使用该界面可以用交易账户和密码在应急情况下报撤单
- 期货公司的管理员和风控人员使用该界面可以在应急情况下为普通用户撤单，设置交易权限，实施出入金等资金管理，查看使用ydServer的普通用户的账户交易情况和风险度。

2 安装和配置

2.1 安装

请在官网 (<https://www.hanlinit.com/downloads/>) 下载版本包，将下列文件拷贝到目标机器的Windows环境下。

目录或者文件名	说明
YDClient.exe	风控终端主程序。
yd.dll	ydApi的Windows DLL封装链接库。
YDClient.ini	风控终端运行的配置程序，主要定义ydServer的通信参数。
log	ydClient.exe运行中生成日志使用的目录，每日一个文件，txt格式。
mdList.txt	ydClient从ydServer订阅行情的合约列表。
export	ydClient.exe运行中数据导出目录，所有信息导出到export目录。
error_code	ydClient.exe运行中的错误参考文件

2.2 配置

请将TradingServerIP修改为期货公司提供的ip地址，TradingServerPort修改为期货公司提供的tcp端口。

```

1 #####
2 ##### Network configurations #####
3 #####
4
5 # IP address of yd trading server
6 TradingServerIP=127.0.0.1
7
8 # TCP port of yd trading server, other ports will be delivered after logged in
9 TradingServerPort=51000
10
11 #####
12 ##### Trading configurations #####
13 #####
14
15 # Choose trading protocol, optional values are TCP, UDP, XTCP
16 TradingProtocol=TCP
17
18 # Affinity CPU ID for thread to receive order/trade notifications, -1 indicates no need
  to set CPU affinity
19 TCPTradingCPUID=-1

```

```

20
21 # Affinity CPU ID for thread to send XTCP trading, -1 indicates no need to set CPU
    affinity
22 XTCPTradingCPUID=-1
23
24 # Timeout of select() when receiving order/trade notifications, in millisec. -1
    indicates running without select()
25 TradingServerTimeout=10
26
27 # work mode for recalculation of margin and position profit. Valid when using
    ydExtendedApi.
28 #     auto(default): subscribe market data and automatically recalculate in proper
    time.
29 #     subscribeOnly: subscribe market data and recalMarginAndPositionProfit should be
    called explicitly
30 #     off: never do recalculation
31 RecalcMode=auto
32
33 # Gap between recalculations, in milliseconds. Valid when RecalcMode is set to auto.
34 # It will be adjusted to 1000 if less than 1000
35 RecalcMarginPositionProfitGap=1000
36
37 # Delay of recalculation after market data arrives to avoid collision with input order,
    in milliseconds.
38 # Valid when RecalcMode is set to auto. Should be between 0 and 100.
39 RecalcFreeGap=100
40
41 # Affinity CPU ID for timer thread used to refresh capital, -1 indicates no need to set
    CPU affinity
42 TimerCPUID=-1
43
44 #####
45 ##### MarketData configurations #####
46 #####
47
48 # Whether need to connect to TCP market data server
49 ConnectTCPMarketData=yes
50
51 # Timeout of select() when receiving TCP market data, in millisec. -1 indicates running
    without select()
52 TCPMarketDataTimeout=10
53
54 # Affinity CPU ID for thread to receive TCP market data, -1 indicates no need to set
    CPU affinity
55 TCPMarketDataCPUID=-1
56
57 # Whether need to receive UDP multicast market data
58 ReceiveUDPMarketData=no

```

字段解释可参见yd_c++_api_programming_guide文档。

2.3 运行

请用鼠标双击YDClient.exe即可运行。

export	2025/7/23 9:51	文件夹	
log	2025/7/25 14:06	文件夹	
error_code	2025/7/23 9:51	Microsoft Excel 逗...	93 KB
error_code_en	2025/7/23 9:51	Microsoft Excel 逗...	116 KB
mdList	2025/7/25 15:24	文本文档	0 KB
yd.dll	2025/7/23 9:51	应用程序扩展	835 KB
YDClient	2025/7/23 9:51	应用程序	3,565 KB
YDClient	2025/7/25 15:23	配置设置	3 KB

运行以后，输入用户名和口令即可登录。

登录

用户名

0001

口令

确定

取消

空头平昨仓盈亏= (昨结算-平仓价) * 合约乘数 * 平仓手数。

- 持仓盈亏：随着客户的持仓以及最新行情实时计算并显示。等于持仓明细中的【仓盈】之和。持仓盈亏为负代表亏损，需要从可用中减去；为正代表盈利，但不能用于新开仓，因此可用中并不增加。
- 保证金：持仓明细中的保证金之和。
- 行权保证金：期权行权保证金。
- 手续费：总手续费。
- 现金收支：期权权利金和现货收支计入现金收支。
- 昨余额：昨日余额。
- 使用限度：资金使用限度，易达支持通过设置资金使用限度分隔多套系统的日初权益，只要每套柜台的资金使用限度加总不超过100%，就可以保证金不会透支。
- 入金：累计入金金额，单个交易日是单调递增的。
- 出金：累计出金金额，单个交易日是单调递增的。
- 冻结出金：冻结用于出金的资金量，冻结出金金额会随着经纪商执行冻结出金操作而不断累加。
- 其他平盈：非逐日盯市合约的平仓盈亏。
- 当日盈亏：获取当日盈亏信息。
- 交易权限：管理员可以在盘中修改交易账户是否可以交易、只可平仓或者不能交易。即使不能交易，该账户也可进行撤单操作，但不能开仓或者平仓。
- 最多报单：投资者的最多报单次数。
- 当前报单：投资者当前已发送到柜台的报单数量。
- 最多撤单：投资者的最多撤单次数。
- 最多登录：投资者并行登录最大连接数。
- 当前登录：当前api登录数。
- 连接优选：是否支持投资者将席位优选结果上报柜台。“是”表示支持，“否”表示不支持。
- 自动组仓：是否支持大商所自动组合持仓。“是”表示支持，“否”表示不支持。
- 协议报单：是否支持裸协议报单。“是”表示支持，“否”表示不支持。
- 不查自成交：是否检查自成交。“是”表示不检查，“否”表示检查。
- 回报插入报单：是否开启柜台回报功能。“是”表示开启柜台回报功能，此时若投资者向柜台报单，柜台会向投资者发送柜台回报，以通知投资者柜台已收到报单。“否”表示未启动柜台回报功能。
- 检查报单号：如果投资者使用了0号报单组，“是”代表检查报单号，“否”表示不检查报单号。
- 持仓盈亏可用：是否将持仓盈利计入可用资金。“是”表示计入。“否”表示不计入。无论是否设置，持仓浮亏始终计入可用。
- 放松报价自成交检查：中金所支持多层次报价，自成交判断会比较复杂，“是”表示启用中金所报价宽松自成交检查功能，启用后，中金所顶最后一单报价不再与其他报价检查是否构成自成交，但仍需检查与普通报单是否构成自成交，这与其他支持顶单的交易所检查自成交的逻辑一致。“否”表示不启动中金所报价宽松自成交检查功能。
- 忽略动态价格停板：是否在下单时忽略动态价格停板的限制。“是”表示忽略限制，“否”表示仍受限制。
- 允许客户中继：是否支持客户通过中继方式转发订单至柜台。“是”表示支持，“否”表示不支持。
- 期权多仓成本：买入额度（期权多头持仓总成本）。
- 期权多仓限额：买入额度限额（期权多头持仓总成本限额）。
- 昨权益：昨资金权益= 昨余额 * 资金使用限度。
- 昨持仓市值：昨持仓市值 = 期权昨买持仓 * 昨结算价 * 合约乘数 - 期权卖昨持仓 * 昨结算价 * 合约乘数。
- 昨市值：昨市值 = 昨权益 * 使用限度 + 昨持仓市值。

- 静态权益：静态权益 = 昨余额 + 出入金净额。
- 动态权益：动态权益 = 平仓盈亏 + 期货持仓盈亏 + 现金收支 - 手续费。
- 持仓市值：持仓市值 = 期权买持仓 * 最新价 * 合约乘数 - 期权卖持仓 * 最新价 * 合约乘数。
- 权益：今资金权益 = 静态权益 * 资金使用限度 + 动态权益。
- 市值：市值 = 静态权益 * 使用限度 + 动态权益 + 持仓市值。
- 净行权分配金：净行权分配金额，正值代表收钱，负值代表交钱，仅E+1日有意义。
- 行权分配冻结金：行权分配冻结金额，仅E+1日有意义。
- 信息量手续费：当前信息量手续费，交易所采取提高信息量申报费的措施，对程序化交易作出监管，信息量手续费方便投资者关注信息量申报费。
- 每秒最大请求：投资者每秒向柜台发送指令的速度。同一个资金账户多个登录连接加总计算。投资者向柜台发送的以下指令会被计入，包括报撤单、询价、组合与解组合、行权履约指令，无论指令是否被柜台拒绝均会被计入。
- 最小风险度：一个交易日内的风险度最小值。
- 账户状态：允许交易或禁止交易。
- 断线次数：账户断线次数。
- 失败登录：账户登陆失败次数。

3.2 持仓窗口

在[主界面](#)的持仓窗口中显示了投资者现有持仓信息，可点击“显示现货仓”或“显示衍生品仓”进行持仓内容的切换，具体内容如下：

衍生品仓：

- 类型：如果在多空之前有今，代表的是当日新开仓位。
- 投保：普通合约，显示“投机”、“套利”（仅CFFEX使用）和“套保”；股票期权备兑业务，显示“备兑”和“普通”。
- 持仓：当前仓位。
- 昨仓：历史仓位。
- 冻开：当前在挂报单的开仓数量。
- 冻平：当前在挂报单的平仓数量。
- 开量：今日开仓成交量。
- 价格：持仓均价。
- 保证金：冻结保证金金额。
- 仓盈：根据最新对手价计算的持仓盈亏。
- 报单仓：根据交易所的报单回报中的成交量所计算出的持仓量，此值理应等于“持仓”字段。
- 基准价：动态基准价格。
- 手保金：持仓合约每手保证金。
- 组合仓：组合持仓编号。
- 待行权：待行权仓位数。
- 弃行权：放弃行权仓位数。

现货仓：

- 昨仓：历史仓位。

- 昨仓成本：昨仓成本 = (历史买入金额 - 已实现盈亏) ÷ 持仓数量。
- 今仓：当日新仓。
- 今仓成本：今仓成本 = (当日买入成交金额 + 手续费) ÷ 当日买入数量。
- 申赎仓：ETF基金申购获得或待赎回的份额。
- 申赎仓成本：基金公司确认的当日净值。

3.2.1 整理持仓

点击菜单栏中的【操作】，在弹出的对话框中点击【整理持仓】，可以将场上的持仓信息进行整理，使得场上持仓信息变得规整。

3.3 挂单窗口

在[主界面](#)的挂单窗口中显示了投资者挂单信息，具体内容如下：

- 买卖：普通报单报价，显示“买”和“卖”方向；组合与解组合，显示“建立”和“拆分”；现货的锁定与解锁，显示“锁定”和“解锁”。
- 开平：普通合约，显示“开仓”和“平仓”；组合合约，显示“开仓”、“平仓”、“开平”和“平开”。
- 投保：普通合约，显示“投机”、“套利”（仅CFFEX使用）和“套保”；股票期权备兑业务，显示“备兑”和“普通”。
- 价格：挂单价格。
- 报量：挂单数量。
- 组号：挂单所属报单组编号。
- 编号：投资者报单编号。
- 组控：投资者要求柜台对报单OrderRef的单调递增性检查方式，单调递增时显示增加，严格单调递增时显示加一。
- 类型：包括普通报单、FAK报单、FOK报单和市价报单。
- 种类：挂单种类，有报单、报价派生等。
- 系统号：表示ydServer的报单编号。只有有效报单才有报单编号，否则为-1。
- 状态：表示报单状态，在挂报单已被交易所确认且有效，可能部分成交，也可能未成交。
- 成量：挂单成交量。
- 时间：报单时间。
- 实连：实际报单席位。
- 组仓号：组合持仓编号。
- 触类：触发单类型，包括无触发条件、止盈和止损。
- 触发价：触发单触发价格。
- 触态：报单触发状态，包括未触发、已触发。
- 入产品日：投资者挂单委托进入交易所交易系统的日期。

3.4 活跃报价窗口

在[主界面](#)的活跃报价窗口中显示了投资者尚未完全成交的报价信息，具体内容如下：

- 活跃报价合约：处于挂单状态的报价合约名称。
- 买开：买开平标志，包括开仓、平仓、平今和平昨。
- 买投：买投保标志，包括投机、套利（仅CFFEX使用）和套保。

- 买价：买价格。
- 买量：买量。
- 卖开：卖开平标志，包括开仓、平仓、平今和平昨。
- 卖投：卖投保标志，包括投机、套利（仅CFEX使用）和套保。
- 卖价：卖价格。
- 卖量：卖量。
- 组号：报价所属组编号。
- 编号：客户报单编号。
- 组控：投资者要求柜台对编号的单调递增性检查方式，单调递增时显示增加，严格单调递增时显示加一。
- 系统号：交易所返回的系统号。
- 买单号：报价衍生出的报单买单号。
- 卖单号：报价衍生出的报单卖单号。
- 实连：实际连接的席位编号。
- 类型：报价标志，包括应价（上期所、能源所、大商所、广期所、郑商所）、顶最近单（中金所）、顶指定单（中金所）。
- 应价号：应价的询价编号。

3.5 行情窗口

在**主界面**的行情窗口中显示了行情相关信息，投资者可在此处订阅、退订行情。对应管理员用户，请在菜单栏中点击【数据】，在弹出的下拉菜单中点击【显示行情】即可弹出行情对话框。

3.5.1 订阅行情

订阅行情有两种方式，第一种方式是在菜单栏中点击【操作】，弹出下拉菜单，点击【订阅行情】，另一种方式是在行情显示窗口的空白处，用鼠标左键双击会弹出【选择订阅行情的合约】界面。

在左上角的【输入合约】栏目输入待订阅的合约，可以起到筛选的效果。左下角有【期货】、【现货】、【期权】、【组合】和【其他】类别，勾选以后可以起到筛选的效果。中间上侧有【期权系统】下拉菜单，下拉以后可选择想要订阅的期权系列。选择想要订阅的合约和期权以后，用鼠标左键双击一下，想要订阅的合约或期权便会显示在右侧的【已选中合约】中，点击【选择】即可订阅合约或期权，点击【放弃】即可回到主界面。

如果想要订阅持仓合约的行情，在【选择订阅行情的合约】界面点击【持仓合约】，所有持仓的合约就会显示在右侧的【已选中合约】中，点击【选择】即可订阅持仓合约，点击【放弃】即可回到主界面。

选择后的合约信息会记录在ydClient运行目录的mdList.txt文件中，退出后重新登录将无需再次选择合约。

3.5.2 退订行情

退订行情有两种方式，第一种方式是在指定合约行鼠标右键双击即可，另一种方式是在菜单栏中点击【操作】，弹出下拉菜单，点击【退订所有行情】。

3.6 投资者列表

易达终端:admin 20250730

系统 操作 数据 管理

账户	风险度	可用	余额	保证金	净入金	最低风险	登录
0001	102.57%	-17,365	1,143,754	693,826	0	95.55%	4
0002	21.61%	612,195	805,724	168,768	0	6.49%	3
0003	5.05%	3,007,928	3,401,093	159,948	0	1.85%	3
0004	16.08%	2,281,408	2,952,526	441,139	0	10.89%	2
0005	6.91%	14,918,854	16,320,592	1,108,683	0	5.22%	2
0006	1.34%	17,510,256	17,772,484	237,486	0	0.65%	1
0007	0.11%	17,372,722	17,418,685	19,877	0	0.11%	1
0008	2.15%	9,737,520	10,158,472	213,669	0	0.35%	1
0009	0.85%	19,717,551	19,893,035	169,724	0	0.00%	1
0010	0.09%	17,297,695	17,338,672	16,258	0	0.00%	1
0011	0.06%	15,424,837	15,469,017	9,870	0	0.02%	1
0012	0.96%	10,567,395	10,699,065	102,467	0	0.41%	1
0013	0.36%	10,477,227	10,575,059	38,070	0	0.36%	1
0014	0.01%	16,753,357	16,794,700	2,342	0	0.00%	1
0015	0.07%	13,004,105	13,026,195	9,541	0	0.00%	1
0016	0.40%	18,580,518	18,784,145	75,175	0	0.08%	1
0017	0.97%	14,030,794	14,212,299	136,860	0	0.68%	1
0018	0.77%	16,486,887	16,647,755	128,509	0	0.58%	1
0019	0.00%	11,372,115	11,420,148	0	0	0.00%	1
0020	0.30%	12,203,785	12,296,825	36,200	0	0.18%	1

投资者列表是管理员特有的窗口，如果是管理员登录，跟投资者登录不同的是，在投资者的行情信息显示窗口区域显示的是账户汇总信息窗口，可在此查看交易柜台所有账户的信息，管理员可双击账户行，可在资金窗口、持仓窗口、挂单窗口和活跃报价窗口看到该账户的相关内容。具体内容如下：

- 账户：投资者的交易账户。
- 风险度：风险度 = 保证金 / 权益 * 100%。
- 可用：可用 = 余额 + 平仓盈亏（盈为正，亏为负） - 手续费 + 权利金 - 保证金 - 持仓亏损。
- 余额：余额 = （昨余额 + 入金 - 出金 - 冻结出金） * 使用限度。
如果该账户在多家交易所的多柜台系统使用，需要分配使用限度。总限度不得超过100%。
- 保证金：保证金为持仓明细中的保证金之和。
- 净入金：总入金金额 - 总出金金额。
- 最低风险：一个交易日内风险度的最小值。
- 登录：当前账户登录数。

3.7 命令面板

在**主界面**的命令面板中展示了一些快捷键，投资者可以通过快捷键进行相关操作。

3.7.1 全撤报单

全撤报单有三种方式，第一种方式是在菜单栏中点击【操作】，在弹出下拉菜单中，点击【全撤报单】；第二种方式点击命令面板中的【全撤报单】按键；第三种方式是点击命令面板中的【账户明细】，在弹出的账户明细界面中点击命令面板中的【全撤报单】，即可撤销掉当前处于挂单状态中的所有报单。

3.7.2 全撤报价

全撤报价有三种方式，第一种方式是在菜单栏中点击【操作】，在弹出下拉菜单中，点击【全撤报价】；第二种方式点击命令面板中的【全撤报价】按键；第三种方式是点击命令面板中的【账户明细】，在弹出的账户明细界面中点击命令面板中的【全撤报价】，即可撤销掉当前处于挂单状态中的所有报价。

3.8 连接面板

在[主界面](#)的连接面板中显示了【tcp交易】的连接状态和【tcp行情】的连接状态，可以在此检查交易和行情连接是否正常，同时【会话】显示当前连接会话数。

4 菜单栏

4.1 系统

4.1.1 关于



点击菜单栏中【系统】下的【关于】，可以看到终端的版本号等信息，这里的api版本号是1.502.51.0。

4.1.2 退出

点击菜单栏中【系统】下的【退出】，可以退出易达终端系统。

4.2 操作

菜单栏下的【操作】的子菜单包括[修改口令](#)、[账户明细](#)、[行权管理](#)、[全撤报单](#)、[全撤报价](#)、[整理持仓](#)、[订阅行情](#)、[退订所有行情](#)。

4.3 数据

菜单栏下的【数据】的子菜单包括[系统参数](#)、[风控参数](#)、[费率信息](#)、[导出数据](#)。



从待选连接窗口中逐一双击对应的席位即可排定席位优选顺序，优选席位的顺序将出现在右侧的优选连接窗口中，点击【确认】即可设置优选席位连接。

5.2 席位信息

[系统参数](#)界面的席位信息子窗口显示了席位相关的内容，具体内容如下：

- 交易所：交易所代码。
- 席位类型：“公共席位”表示所有柜台投资者都可以使用，若是专用席位则显示投资者的资金账号。
- 席位清单：第一个席位的编号是0，最后一个席位的编号是ConnectionCount-1。

5.3 柜台参数信息

[系统参数](#)界面的柜台参数信息子窗口显示了柜台相关的设置参数，具体内容如下：

参数适用对象为System：

- MarketMaker：是否是做市商，yes代表是做市商，no代表非做市商。
- Test：是否是测试版本，yes代表是测试版本，no代表非测试版本。
- NG：是否是新一代版本，yes代表是新一代版本，no代表不是新一代版本。
- ServerVersion：柜台版本号。
- ConnectionMode：交易所连接模式。
- MinApiVersion：api最小版本号。
- MaxApiVersion：api最大版本号。
- MinSelectConnectionGap:席位优选上报最小间隔。
- MaxSelectConnectionGap:席位优选上报最大间隔。
- MissingOrderGap:未知单超时时间。
- UDPTTradingPort：UDP报单接口。若柜台未开启UDP服务，则为0。
- XTCPTradingPort：XTCP报单接口。若柜台未开启XTCP服务，则为0。

- TradingSegmentDetail:是否发送交易阶段明细。yes代表是，no代表否。
- ClientMinPasswordLen:投资者最小口令长度，0表示没有最小长度限制。
- ClientMinPasswordCharSet:投资者口令字符集数量，0表示没有字符集数量限制。
- AdminMinPasswordLen:管理员最小口令长度，0表示没有最小长度限制。
- AdminMinPasswordCharSet:管理员口令字符集数量，0表示没有字符集数量。

参数适用对象为期货或期权：

- 保证金基础价：计算期货或期权空头的保证金时使用的基础价格，常用规则期货为开仓价，期权为最新价和昨结算价之间的较大值。
- 报单保证金基础价：计算期货或者卖出期权的开仓报单的冻结保证金时使用的基础价格，常用规则期货为报单价，期权为昨结算价。

参数适用对象为期权：

- 基础合约保证金基础价：计算卖出期权保证金时使用的基础产品的价格。常用规则为昨结算价。
- 卖单权利金基础价：计算卖出开仓期权时反向冻结权利金使用的基础价格。常用规则为不反向冻结。

参数适用对象为买期权：

- 组合保证金优惠：对于大商所和广期所包含期权多仓的传统组合持仓，是否优惠计算保证金。“是”表示优惠，“否”表示不优惠。

参数适用对象为账户：

- 使用质押金：是否将质押品获得的质押资金计入昨权益供开仓使用。“是”表示使用，“否”表示不使用。

5.4 产品信息

[系统参数](#)界面的产品信息中显示了产品的相关内容，具体内容如下：

- 产品：产品代码。
- 交易所：产品所属交易所。
- 类型：产品类型，如期货、现货、期权、组合和其他。
- 子类型：子类型，如股票、基金、债券和其他。
- 乘数：合约乘数，股票期权可能会受到分红影响而调整其保证金率。
- Tick：最小变动价位。
- 基础乘数：基础乘数，期权相对于其基础合约的倍率，只有当合约是期权时有效，对于其他非期权合约始终为1。
- 市价上：市价报单的最大报单量。
- 市价下：市价报单的最小报单量，报单量必须是其倍数。
- 限价上：限价报单的最大报单量。
- 限价下：限价报单的最小报单量，报单量必须是其倍数。
- 产品组：新组保业务中的产品组。
- 状态：显示产品信息是否“连续”。
- 时间：显示产品信息时间。
- 币种：产品币种信息。
- 汇率：汇率信息。
- 交易日：交易日期。

5.5 合约信息

[系统参数](#)界面的合约信息子界面显示了合约的相关信息，具体内容如下：

- 合约：合约代码。
- 产品：产品代码。
- 交易所：合约所属交易所。
- 类型：合约类型，如期货、现货、期权、组合和其他。
- 子类型：子类型，如股票、基金、债券和其他。
- 乘数：合约乘数，股票期权可能会受到分红影响而调整其保证金率。
- Tick：最小变动价位。
- 交割月：交割年月，例如202508代表2025年8月份，202512代表2025年12月份。
- 市价单：市价报单的报单量范围。
- 限价单：限价报单的报单量范围。
- 到期日：合约到期日，例如20220808的整数。
- 剩日：当前交易日距离合约到期日的交易日天数（不含周末和假期），由于该剩余天数的计算依赖于交易日历，因此对于到期日在明年的合约，只有当年底交易所正式发布了明年的交易日历以后才能计算正确，否则计算所需的交易日历是易达自行推算的，可能与根据正式交易日历计算出来的剩余天数有差异。如果是最后交易日，这个值是0。
- 权类：期权类型，有非期权、看涨期权和看跌期权。
- 行权价：行权价格，只有当合约是期权时有效。
- 基础合约：基础合约。
- 基乘：基础乘数，期权相对于其基础合约的倍率，只有当合约是期权时有效，对于其他非期权合约始终为1。
- 保算：保证金算法，内部使用。
- 大边：是否为参与单向大边保证金计算的合约。
- 昨结算：昨天结算价。
- 昨收盘：昨天收盘价。
- 跌停板：跌停板价格。
- 涨停板：涨停板价格。
- 量单位：度量标的的标准单位。
- 询价时：合约询价请求的时间。
- 询价号：合约询价请求的编号。
- 状态：显示合约信息是否“连续”。
- 时间：显示合约信息时间。
- 债券利息：债券利息，用于计算现货收支。
- 现货合约属性：现货合约属性标志位。
- 现货合约控制：现货交易投资者适当性控制标志位。

5.6 组合持仓定义信息

[系统参数](#)界面的组合持仓定义信息子界面中显示了组合持仓的相关信息，具体内容如下：

- 组合持仓：传统组合持仓定义名称。

- 投保：传统组合持仓定义投保标志。
- 优先：传统组合持仓定义优先级，数字越小优先级越高。可能是-1，表示该交易所的传统组合持仓不使用优先级管理，例如郑商所。
- 类型：传统组合持仓定义类型。
- 参数：参数，不同交易所的含义不同。目前仅用于大商所和广期所的期权对锁、买入期权垂直套利、买入期权期货组合，表示组合保证金折扣，0.2表示组合后的保证金是原两腿保证金总和的20%。

5.7 分支合约信息

双击[系统参数](#)界面的合约信息窗口中的组合合约行，会在分支合约信息窗口显示相关的分支合约信息。【分支合约】展示组合合约的分支合约信息，【买卖】展示组合合约的买卖方向。本例以组合合约SPD ZC504&ZC505为例，该组合的分支合约是ZC504和ZC505。

5.8 组合持仓信息

双击[系统参数](#)界面的合约信息窗口中的组合合约行，会在组合持仓信息窗口显示相关的对应组合持仓。【对应组合持仓】展示组合合约的对应组合持仓，【组投保】展示组合合约的组合投保标志，【买卖】展示组合合约的买卖方向，【投保】展示相应的投保标志。本例以组合合约SPD ZC504&ZC505为例，该组合的对应组合持仓有两种，如上面的系统参数界面中组合持仓信息。

5.9 保证金模型信息

在[系统参数](#)界面的【保证金模型参数】此处选择对应的保证金模型，可以看到相应的名称和值。本例中选取的保证金模型参数是RULE，对应的保证金模型参数如上面的系统参数界面中保证金模型信息。

5.10 前置连接信息

在[系统参数](#)界面的前置连接信息窗口显示前置连接的相关信息，具体内容如下：

- 交易所：交易所名称。
- 连号：交易所席位号。
- 状态：交易所席位连接状态。
- 说明：交易所席位说明。
- 报单流控：在报单或者报价时检查时间窗口内每接口报单数量上限。
- 撤单流控：在撤单或者撤报价时检查时间窗口内每接口撤单数量上限。

- 撤单量：撤单笔数的控制。
- 限仓：持仓量限制。
- 限成交量：成交量限制。
- 多开仓量：买开仓量限制。
- 多限仓：多头持仓限制。
- 空开仓量：卖开仓量限制。
- 空限仓：空头持仓限制。

6.3 通用风控参数

通用风控参数子窗口的字段解释如下：

- 类型：风控规则类型。
- 账号：账户序号，-1表示对所有用户生效，其他值表示对本用户生效。
- 范围：根据规则定义，可以表示合约、产品、交易所等。
- 浮点参数名：浮点参数名称。
- 值：浮点参数值。
- 整数一参数名：整数一参数名称。
- 值：整数一参数值。
- 整数二参数名：整数二参数名称。
- 值：整数二参数值。

7 费率信息

点击菜单栏中【数据】按键，点击弹出下拉菜单栏中的【费率信息】，弹出费率信息对话框。费率信息对话框有四个部分组成，合约费率、信息量费率、新组保费率和产品群费率。

费率信息

合约	投保	多头保证金	空头保证金	开仓手续费	平仓手续费	平今手续费	行权手续费	报单手续费
bc2508	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2508	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2509	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2509	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2510	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2510	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2511	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2511	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2512	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2512	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2601	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2601	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2602	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2602	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2603	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2603	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2604	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2604	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2605	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2605	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2606	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2606	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2607	投机	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
bc2607	套保	10%	10%	0.11%%+1	0.11%%+1	0	0	0
ec2508	投机	20%	20%	6.3%%	6.3%%	12%%	0	0
ec2508	套保	20%	20%	6.3%%	6.3%%	12%%	0	0
ec2510	投机	20%	20%	6.3%%	6.3%%	12%%	0	0
ec2510	套保	20%	20%	6.3%%	6.3%%	12%%	0	0
ec2512	投机	20%	20%	6.3%%	6.3%%	12%%	0	0
ec2512	套保	20%	20%	6.3%%	6.3%%	12%%	0	0

产品

OTR

信息量

费率

新保证金模型

平仓验资

保证金系数

适用产品

产品群

保证金系数

信息量费率

新组保费率

产品群费率

关闭

7.4 合约费率

[费率信息](#)的合约费率窗口显示合约费率信息，如果没有%，只有数字，则按照成交或者报单手数来收保证金，每手保证金等于该数字。如果既有%，又有数字，则表示上述两种保证金的和，两个连续%%，代表万分之几，具体的内容如下：

- 合约：合约代码
- 投保：合约投保标志，包括投机、套利（仅CFFEX使用）和套保。
- 多头保证金：基于金额的多头保证金率+基于手数的多头保证金率。
- 空头保证金：基于金额的空头保证金率+基于手数的空头保证金率。
- 开仓手续费：开仓成交金额手续费率+开仓成交每手手续费。
- 平仓手续费：平昨仓成交金额手续费率+平昨仓成交每手手续费。
- 平今手续费：平今仓成交金额手续费率+平今仓成交每手手续费。
- 行权手续费：行权金额手续费率+行权每手手续费。
- 报单手续费：报单每笔手续费。
- 撤单手续费：撤单每笔手续费。
- 信息费：是否收取信息费。
- 信息量上限：信息量上限额度。

7.5 信息量费率

[费率信息](#)的信息量费率窗口显示信息量信息，这里的“OTR”表示OTR档位，“信息量”表示信息量档位，“费率”表示信息量申报费率。假设b产品的合约b1信息量为9000，OTR为3，那么按照分段累计方式计算的信息量申报费为：

第一段：共4000张，申报费为0元

第二段：共4000张，申报费为 $4000 * 0.1 = 400$ 元

第三段：共1000张，申报费为 $1000 * 0.5 = 500$ 元

信息量申报费共计900元

7.6 新组保费率

[费率信息](#)的新组保费率窗口显示交易所相关的新组保业务的费率信息，具体内容如下：

- 新保证金模型：新组合保证金模型名称。
- 平仓验资：平仓时是否检查可用资金。
- 保证金系数：保证金倍率。
- 适用的产品范围。用空格分隔，表示适用于对应组合保证金模型的产品子集。为空表示不限制使用产品范围，与组合保证金模型一致。

7.7 产品群费率

[费率信息](#)的产品群费率窗口显示产品群组合的费率信息，具体内容如下：

- 产品群：产品群

- 保证金系数：产品群保证金系数

8 导出数据

在[主界面](#)的菜单栏中点击【数据】，弹出下拉菜单，在下拉菜单中点击【导出数据】，即可将数据导出,数据将导出到export目录下。

9 交易

9.1 报单

The screenshot shows a '报单' (Order) window with the following fields and values:

合约	lu2509		
账户	0002		
买卖	卖	开平	开仓
投保	投机	类型	普通
价格	3560	3560	3568
数量	1	1	1
连接	任意	连号	0
触类		触价	0
		属性	
用户值			
种类	报单		

Buttons: 报单, 放弃

在[主界面](#)的行情窗口中，在指定合约显示行的【买入价】/【买入量】上双击鼠标左键，即可弹出卖出报单窗口；如果在【卖出价】/【卖出量】上双击鼠标左键，即可弹出买入报单窗口。

投保、类型、价格、数量、连接、连号、种类、触类、触价、属性、用户值可手工修改。

- 投保：普通合约，显示“投机”、“套利”（仅CFFEX使用）和“套保”；股票期权备兑业务，显示“备兑”和“普通”。
- 类型：包括普通报单、FAK报单、FOK报单和市价报单。
- 价格：报单价格。
- 数量：报单数量。
- 连接：席位连接方式，包括任意、指定、倾向。
- 连号：席位连接编号。
- 种类：包括报单、询价。
- 触类：包括止盈、止损。
- 属性：交易所报单属性，大商所GIS当前小节有效报单标志。
- 用户值：报单和报价中填写的字段，存放分类性、标识性信息，例如策略号。

在价格和数量字段右侧的两列数字分别代表该合约最新的买入卖出最新的价格，会随着行情改变而改变。

点击【报单】即可向系统发送报单请求。【放弃】则回到主界面。

持仓合约	类型	投保	持仓	昨仓	冻开	冻平	开量	价格	保证金	仓盈	手保金	组合仓	待行权	弃行权
ag2106	今多	投机	1	0	0	0	1	5603	9286	-30	9286	0	0	0

本例中以5603的价格开仓买入了1手投机仓位的ag2106的报单，报单成功后在持仓明细窗口显示了持仓信息：合约ag2106的持仓量1手，开仓量1手，保证金为9286，持仓盈亏为-30。

挂单合约	买卖	开平	投保	价格	报量	组号	编号	组控	类型	种类	系统号	状态	成量	时间	实连	组仓号	触类	触发价	触态
ag2106	买	开仓	投机	5500	1	0	0	增加	普通	报单	3	挂单	0	21:06:00.000	0			0	

本例中以5500的价格开仓买入了1手投机仓位的ag2106的挂单，挂单成功后在挂单明细窗口中显示了挂单的情况：状态为挂单，报单的系统编号为3，报单时刻为21:06:00.000。

报单

合约

lu2509

账户

0002

买卖

买

开平

平昨

投保

投机

类型

普通

价格

3568

3568

3560

数量

3

1

1

连接

任意

连号

0

可平

3

触类

触价

0

属性

用户值

种类

报单

报单

放弃

在持仓窗口中鼠标左键双击持仓合约可以弹出报单窗口用于快速平仓：其买卖方向、开平仓标志、投保标志已经设置为仓位的相反值。

9.2 撤单

在**主界面**的挂单窗口中选中挂单合约左键双击，就会弹出撤单窗口，并询问是否确认，确认后该报单的撤单请求会送往服务器。

9.3 报价

在**主界面**的行情窗口找到指定合约，在指定合约上双击鼠标左键，即可弹出报价窗口。

报价

×

合约	lu2509	
账户	0002	
买开	开仓	卖开 开仓
买投	投机	卖投 投机
买价	3560	卖价 3568
买量	1	卖量 1
连接	任意	连号 0
询价	-1	顶单号
属性		☐ 顶最近单
用户值		
报价		放弃

买开、买投、买价、买量、卖开、卖投、卖价、卖量、连接、连号、询价、订单号、属性、顶最近单、用户值可手工修改。

- 买开：包括开仓、平仓、平今和平昨。
- 买投：包括投机、套利（仅CFFEX使用）和套保。
- 买价：买方价格。
- 买量：买方数量。
- 卖开：包括开仓、平仓、平今和平昨。
- 卖投：包括投机、套利（仅CFFEX使用）和套保。
- 卖价：卖方价格。
- 卖量：卖方数量。
- 连接：席位连接方式，包括任意、指定、倾向。
- 连号：席位连接编号。
- 询价：填1表示自动填写询价号表示应价，支持的有上期所、能源所、大商所、广期所、郑商所。
- 顶单号：中金所顶指定报价时，被顶单的QuoteSysID。
- 属性：交易所报单属性，大商所GIS当前小节有效报单标志。
- 顶最近单：顶最后发送的报价，只对中金所生效。
- 用户值：报单和报价中填写的字段，存放分类性、标识性信息，例如策略号。

报价

合约 lu2509

账户 0002

买开 开仓 卖开 开仓

买投 投机 卖投 投机

买价 3560 卖价 3568

买量 1 卖量 1

连接 任意 连号 0

询价 1 顶单号

属性 顶最近单

用户值

报价 放弃

在[主界面](#)的行情窗口中，在指定合约显示行的【行情合约】上双击鼠标左键，即可弹出报价对话框，在【询价】框中填写1，代表自动应价。

9.4 撤报价

在[主界面](#)的挂单窗口用鼠标左键双击报价单会弹出撤报价窗口，并询问是否确认，确认后该报单的撤单请求会送往服务器。

9.5 询价

报单

合约 lu2509

账户 0002

买卖 买 开平 开仓

投保 投机 类型 普通

价格 3568 3568 3560

数量 1 1 1

连接 任意 连号 0

触类 触价 0

属性

用户值

种类 询价

报单 放弃

9.7.2 备兑开平仓

合约	10007563(510050C2408M02200)		
账户	0001		
买卖	卖	开平	开仓
投保	备兑	类型	普通
价格	0.2414	0.2414	0.2428
数量	1	20	30
连接	任意	编号	0
触类		种类	报单
		触价	0
		属性	
用户值			
报单		放弃	

在[主界面](#)的行情窗口的股票期权行的【买入价】/【买入量】，会弹出股票期权的报单窗口，将【投保】标志设置为【备兑】，可以实现备兑开平仓的功能。本例以10007563合约为例，发送备兑开仓交易信息。

9.7.3 普通与备兑转换

合约	10007455(510050C2408M02450)		
账户	0001		
买卖	买	开平	平仓
投保	普通	类型	普通
价格	0.0336	0.0336	0.0335
数量	2	35	10
连接	任意	编号	0
可平	2	种类	普通转备兑
触类		触价	0
		属性	
用户值			
报单		放弃	

在[主界面](#)的持仓窗口的空头的期权持仓合约行双击，弹出报单窗口，将【种类】设置为【普通转备兑】即可实现普通转备兑功能。如果是深交所还支持备兑转普通功能，将【种类】设置为【备兑转普通】即可。

9.8 行权与履约

报单

合约

au2108P328

账户

0002

买卖

卖

开平

平今

投保

投机

类型

普通

价格

0.08

0.08

0.18

数量

1

7

5

连接

任意

编号

0

可平

1

种类

行权宣告

触类

触价

0

属性

用户值

报单

放弃

在[主界面](#)的持仓窗口双击多头合约行，弹出报单窗口，可在此窗口中做行权相关操作。本例以上期所多仓的au2108P328合约为例，将【种类】选取为【行权宣告】即可发送行权申请。

报单

合约

au2108P328

账户

0002

买卖

买

开平

平今

投保

投机

类型

普通

价格

0.18

0.18

0.08

数量

1

5

7

连接

任意

编号

0

可平

1

种类

上海持仓对冲

触类

触价

0

属性

用户值

报单

放弃

10 修改口令

投资者修改口令	管理员修改口令
修改口令 原 口 令 ***** 新 口 令 ***** 确认口令 ***** 提交 放弃	修改口令 用 户 名 admin 新 口 令 ***** 确认口令 ***** 提交 放弃

点击主界面的菜单栏中【操作】，将弹出下拉菜单，在下拉菜单中点击【修改口令】，将弹出修改口令对话框。

左图显示的是投资者修改口令的界面，投资者可以修改自己的口令。

右图显示的是管理员修改口令的界面，管理员可以设置交易账户的口令；管理员可以修改自己的口令，但不能修改其他管理员的口令。

11 账户明细

账户明细0002

报单窗口

报单合约	买卖	开平	投保	价格	报量	组号	编号	指令	类型	连接	连号	系统号	状态	成交量	时间	实连	种类	组合号	手佣金	手税金	手佣金	信息
ag2509C9000	买	平昨	投机	176.0	1	0	4	增加	FAK	任意	0	1	全成	1	09:05:02.000	0	报单		0	0	0.00	0:正确
ag2509C9000	买	开仓	投机	173.5	5	0	8	增加	FAK	任意	0	25	撤单	1	09:05:07.000	0	报单	21666	0	0	2.00	0:正确
ag2509C9000	卖	平昨	投机	173.5	4	0	-1	增加	FAK	任意	0	40	撤单	1	09:05:09.000	-1	报单		0	0	0.00	0:正确
ag2509C9000	买	开仓	投机	176.0	2	0	12	增加	FAK	任意	0	45	全成	2	09:05:12.000	0	报单		0	2640	2.00	0:正确
ag2509C9000	买	平今	投机	176.0	1	0	-1	增加	FAK	任意	0	58	全成	1	09:05:14.000	-1	报单		0	0	0.00	0:正确
ag2509C9000	买	开仓	投机	173.5	5	0	16	增加	FAK	任意	0	62	撤单	2	09:05:17.000	1	报单	21666	0	0	2.00	0:正确
lu2510	买	平昨	投机	3552	1	0	22	增加	FAK	任意	0	72	全成	1	09:05:18.000	0	报单		0	0	0.00	0:正确
ag2509C9000	卖	平昨	投机	173.5	3	0	-1	增加	FAK	任意	0	77	撤单	2	09:05:19.000	-1	报单		0	0	0.00	0:正确
ag2509C9000	买	平今	投机	176.0	2	0	20	增加	FAK	任意	0	82	全成	2	09:05:22.000	1	报单		0	0	0.00	0:正确

成交窗口

成交合约	买卖	开平	投保	价格	成交量	组号	编号	系统号	成交号	时间	手续费	交易所成交号
ag2509C9000	买	平昨	投机	176.0	1	0	4	1	1	09:05:02.000	2.00	1
ag2509C9000	买	开仓	投机	173.5	1	0	8	25	24	09:05:07.000	2.00	24
ag2509C9000	卖	平昨	投机	173.5	1	0	-1	40	39	09:05:09.000	2.00	39
ag2509C9000	买	开仓	投机	176.0	2	0	12	45	44	09:05:12.000	4.00	44
ag2509C9000	买	平今	投机	176.0	1	0	-1	58	57	09:05:14.000	0.00	57
ag2509C9000	卖	开仓	投机	173.5	2	0	16	62	61	09:05:17.000	4.00	61

持仓窗口

持仓合约	类型	投保	持仓	昨仓	冻开	冻平	开量	价格	保证金	仓量	报单仓	基准价	手佣金	组合仓	待行权
lu2509	空	投机	3	3	0	0	0	3572	11788	300	3	3572	3929	0	0
lu2510	空	投机	1	0	0	0	3834	3559	3915	10	1	3588	3947	0	0
lu2510	空	今多	0	5	0	0	2150	3560	19580	-0	5	3588	3947	0	0
lu2510	空	投机	0	0	0	0	0	0	0	0	0	3588	3947	0	0
lu2510	空	投机	0	0	0	0	0	0	0	0	0	3588	3947	0	0
ag2509C8900	多	投机	3	3	0	0	0	242.0	0	0	3	242.0	0	0	0
ag2509C8900	空	投机	1	1	0	0	0	242.0	22513	0	1	242.0	22513	0	0
ag2509C9000	空	今多	4	0	0	0	1042	171.9	0	0	4	189.5	0	0	0

持仓明细窗口

	价格	数量	成交号	类型
--	----	----	-----	----

产品层汇总信息

持仓产品	投保	持仓	冻开	撤单数	成交量	可成交量	可开量	保证金	多仓	多佣金	空仓	空佣金
lu	投机	9	0	36	11968	11968	5984	31368	1	3915	8	31368
ag_o	投机	17	0	1003	4553	4553	2276		14			

合约层汇总信息

统计合约	投保	撤单数	成交量	可成交量	可开量
lu2509	投机	0	0	0	0
lu2510	投机	36	11968	11968	5984
ag2509C8900	投机	0	0	0	0
ag2509C9000	投机	1003	4553	4553	2276
ag2509C9200	投机	0	0	0	0
ag2509C9400	投机	0	0	0	0

报价窗口

报价合约	买开	买投	买价	买量	卖开	卖投	卖价	卖量	组号	编号	指令	连接	连号	系统号	买单号	卖单号	买单	卖单	实连	类型	应答号	信息
------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----	-----	-----	-----	----	----	----	----	-----	----

全撤报单

全撤报价

查询对冲

查询放弃行权

输出表格

过滤显示

命令面板

有两种方式获取账户明细窗口，第一种是点击菜单栏中【操作】，将弹出下拉菜单，点击下拉菜单中的【账户明细】，将弹出账户明细对话框；第二种是点击主界面命令面板中的【账户明细】。

账户明细主要包括9个方面的信息：报单窗口；成交窗口；错误撤单窗口；持仓窗口；持仓明细窗口；产品层汇总信息；合约层汇总信息；报价窗口和命令行。

11.1 报单窗口

在[账户明细](#)中的报单窗口显示报单详情信息，具体信息可以查看下面的内容：

- 报单合约：报单合约代码。
- 买卖：普通报单报价，显示“买”和“卖”方向；组合与解组合，显示“建立”和“拆分”；现货的锁定与解锁，显示“锁定”和“解锁”。
- 开平：普通合约，显示“开仓”和“平仓”；组合合约，显示“开仓”、“平仓”、“开平”和“平开”。
- 投保：普通合约，显示“投机”、“套利”（仅CFFEX使用）和“套保”；股票期权备兑业务，显示“备兑”和“普通”。
- 价格：报单价格。
- 报量：报单数量。
- 组号：报单所属报单组编号。指定报单和报价所属的逻辑组，可以用于区分报单所属的策略、连接以及其他逻辑分组,投资者可以使用0-255号报单组。
- 编号：投资者报单编号。
- 组控：投资者要求柜台对报单OrderRef的单调递增性检查方式，单调递增时显示增加，严格单调递增时显示加一。
- 类型：报单类型，包括普通报单、FAK报单、FOK报单和市价报单。
- 连接：报单选择的席位连接方式，包括任意、指定、倾向。
- 连号：报单选择的席位连接编号。
- 系统号：交易所返回的系统号。
- 状态：报单当前的状态，有拒绝、全成、撤单等。
- 成量：报单的累计成交量。
- 时间：报单时间。
- 实连：实际使用的席位连接编号。
- 种类：包括报单、询价。
- 组仓号：组合持仓编号。
- 手保金：报单每手保证金。
- 手权金：报单每手权利金。
- 手佣金：报单每手佣金。
- 信息：报单成功与否的信息，报单成功，显示正确，报单失败，显示对应错误码。
- 交易所报单号：交易所返回的报单号。
- 触类：触发单类型，包括无触发条件、止盈和止损。
- 触发价：触发单触发价格。
- 触态：报单触发状态，包括未触发、已触发。
- 撤时：撤单时间。
- 会话：会话id。
- 属性：交易所报单属性，大商所GIS当前小节有效报单标志。

- 用户值：报单和报价中填写的字段，存放分类性、标识性信息，例如策略号。
- 入产品日：报单成功进入交易所系统的日期。
- 撤产品日：撤单请求被交易所系统确认接收的日期。
- 交易所信息：交易所回报信息。

11.2 成交窗口

在[账户明细](#)的成交窗口显示成交合约详情，具体内容如下：

- 成交合约：成交合约代码。
- 买卖：普通报单报价，显示“买”和“卖”方向；组合与解组合，显示“建立”和“拆分”；现货的锁定与解锁，显示“锁定”和“解锁”。
- 开平：普通合约，显示“开仓”和“平仓”；组合合约，显示“开仓”、“平仓”、“开平”和“平开”。
- 投保：普通合约，显示“投机”、“套利”（仅CFFEX使用）和“套保”；股票期权备兑业务，显示“备兑”和“普通”。
- 价格：成交价格。
- 成量：成交数量。
- 组号：成交合约所属报单组编号。
- 编号：报单所属报单组编号。指定报单和报价所属的逻辑组，可以用于区分报单所属的策略、连接以及其他逻辑分组,投资者可以使用0-255号报单组。
- 系统号：交易所返回的系统号。
- 成交号：交易所返回的成交号。
- 时间：成交时间。
- 手续费：成交手续费，成交后按设置的手续费率计算并显示。
- 交易所成交号：交易所返回的成交号。
- 用户值：报单和报价中填写的字段，存放分类性、标识性信息，例如策略号。
- 类型：成交类型为普通或特殊。
- 产品日：交易所确认该笔成交的日期。
- 交易所信息：交易所回报信息。

11.3 撤单窗口

在[账户明细](#)的错误撤单窗口显示错误撤单信息，具体内容如下：

- 种类：报单类型。
- 编号/类型：报单编号。
- 交易所/合约：交易所以及合约信息。
- 撤单错误：撤单错误的原因。
- 次数：撤单错误的次数。

11.4 持仓窗口

在[账户明细](#)的持仓窗口显示持仓合约详情，具体内容如下：

- 持仓合约：持仓合约代码。
- 类型：显示多空类型。如果在多空之前有今，代表的是当日新开仓位。

- 投保：普通合约，显示“投机”、“套利”（仅CFFEX使用）和“套保”；股票期权备兑业务，显示“备兑”和“普通”。
- 持仓：持仓数。
- 昨仓：昨仓数。
- 冻开：冻结开仓数。
- 冻平：冻结平仓数。
- 开量：开仓量。
- 价格：持仓合约价格。
- 保证金：保证金。
- 仓盈：持仓盈亏。
- 报单仓：报单仓数。
- 基准价：基准价格。
- 手保金：持仓合约每手保证金。
- 组合仓：持仓合约组合仓。
- 待行权：待行权仓位数。
- 弃行权：放弃行权仓位数。

11.5 持仓明细窗口

在[账户明细](#)的持仓窗口双击合约行，可以在右侧的持仓明细窗口看到对应合约详情，包括：价格、数量、成交号和类型。

11.6 产品层汇总信息

在[账户明细](#)的产品层汇总信息显示投资者产品层汇总产品信息，具体的内容如下：

- 持仓产品：持仓产品代码。
- 投保：普通合约，显示“投机”、“套利”（仅CFFEX使用）和“套保”；股票期权备兑业务，显示“备兑”和“普通”。
- 持仓：当前仓位。
- 冻开：当前在挂报单的开仓手数。
- 撤单数：当前在挂报单笔数和已经撤单笔数之和。
- 成交量：当日成交手数。
- 可成量：所有在挂报单和已经成交（或部分成交并撤单）报单的可能成交量。
- 可开量：所有在挂开仓报单和已经成交（或部分成交并撤单）开仓报单的可能成交手数。
- 保证金：当前使用的保证金额。
- 多仓：多头持仓手数。
- 多保金：当前多头持仓使用的保证金额。
- 空仓：空头持仓手数。
- 空保金：当前空头持仓使用的保证金额。

11.7 合约层汇总信息

在[账户明细](#)的合约层汇总信息显示的是投资者合约层汇总的信息，具体的内容如下：

- 统计合约：统计的合约名称

- 投保：普通合约，显示“投机”、“套利”（仅CFFEX使用）和“套保”；股票期权备兑业务，显示“备兑”和“普通”。
- 撤单数：限价报单使用的撤单笔数。
 - 客户报入一笔限价报单时，如果校验成功，ydServer会将撤单数加1；
 - 如果交易所拒绝该笔报单，ydServer会根据回报将撤单数减1；
 - 如果该笔报单全部成交，ydServer会根据最后一笔成交回报或者报单回报将撤单数减1。
 - 但如果报单在挂状态，则维持此撤单数，因为客户可能在最后时刻撤单。
- 成交量：当日成交手数。
- 可成交量：所有在挂报单和已经成交（或部分成交并撤单）报单的可能成交手数。
 - 如果目前没有在挂报单，该字段等于“成交量”字段。
- 可开量：所有在挂开仓报单和已经成交（或部分成交并撤单）开仓报单的可能成交手数。
 - 如果目前没有在挂报单，该字段等于对应持仓明细记录中的“持仓”字段。

11.8 报价窗口

在[账户明细](#)的报价窗口显示报价合约的相关信息，具体的内容如下：

- 报价合约：报价合约名称。
- 买开：买开平标志，包括开仓、平仓、平今和平昨。
- 买投：买投保标志，包括投机、套利（仅CFFEX使用）和套保。
- 买价：买价格。
- 买量：买量。
- 卖开：卖开平标志，包括开仓、平仓、平今和平昨。
- 卖投：卖投保标志，包括投机、套利（仅CFFEX使用）和套保。
- 卖价：卖价格。
- 卖量：卖量。
- 组号：报价所属组编号。
- 编号：客户报单编号。
- 组控：投资者要求柜台对编号的单调递增性检查方式，单调递增时显示增加，严格单调递增时显示加一。
- 连接：报价选择的席位连接方式，包括任意、指定、倾向。
- 连号：报价选择的席位连接编号。
- 系统号：交易所返回的系统号。
- 买单号：报价衍生出的报单买单号。
- 卖单号：报价衍生出的报单卖单号。
- 买单：报价衍生出的买单的状态。
- 卖单：报价衍生出的卖单的状态。
- 实连：报价实际使用的席位编号。
- 类型：报价标志，包括应价（上期所、能源所、大商所、广期所、郑商所）、顶最近单（中金所）、顶指定单（中金所）。
- 应价号：应价的询价编号。
- 信息：报价成功与否的信息，报价成功，显示正确，报价失败，显示对应错误码。
- 交易所报价号：交易所返回的报价号。

- 会话：会话id。
- 属性：交易所报单属性，大商所GIS当前小节有效报单标志。
- 顶单号：中金所顶指定报价时，被顶单的QuoteSysID。
- 用户值：报单和报价中填写的字段，存放分类性、标识性信息，例如策略号。
- 交易所信息：交易所回报信息。

11.9 命令面板

11.9.1 活跃报单

点击[账户明细](#)的命令行中的【活跃报单】按键，即可筛选出当前处于挂单状态的报单。

11.9.2 全撤报单

点击[账户明细](#)的命令行中的【全撤报单】按键，即可撤销掉当前处于挂单状态中的所有报单，具体内容参见：[全撤报单](#)

11.9.3 全撤报价

点击[账户明细](#)的命令行中的【全撤报价】按键，即可撤销掉当前处于挂单状态中的所有报价，具体内容参见：[全撤报价](#)

11.9.4 查询对冲

点击[账户明细](#)的命令行中的【查询对冲】按键，即可查询设置持仓对冲的合约信息。

11.9.5 查询放弃行权

点击[账户明细](#)的命令行中的【查询放弃行权】按键，即可查询设置取消自动行权标志的合约信息。

11.9.6 输出表格

点击[账户明细](#)的命令行中的【输出表格】按键，会弹出选择表格对话框，选取对应的表格【报单】、【成交】、【持仓】、【报价】，即可导出对应的表格。

投资者可以在【账户买入额度】界面查看账户买入额度，本例中投资者的买入额度的值为5，此时买入金额已经达到了2177，风险度达到了435.4（买入金额/买入额度）。

13.1.8 压力测试

压力测试

菜单栏

结 算 价最新价组合持仓解除当日到期行 权当日卖值行权持仓对冲对冲执行

账户	前余额	用限	入金	出金	收支	手续费	余额	保证金	行权金	被行权金	行权分配	组合节约	可用	风险度	基础仓
0001	11437543.66	14%	0.00	0.00	3241.00	5117.28	1622254.92	15280.32	0.00	0.00	5.00	3113.44	1606974.60	0.01	不足
0002	13428728.40	10%	0.00	0.00	-15167.00	4981.20	1322724.64	0.00	0.00	0.00	5.00	0.00	1322724.64	0.00	足够
0003	18894961.98	50%	0.00	0.00	-3393.00	2617.00	9441470.99	6116.40	0.00	0.00	5.00	0.00	9435354.59	0.00	足够
0004	18453287.16	10%	0.00	0.00	-6636.00	5.04	1838687.68	0.00	0.00	0.00	5.00	0.00	1838687.68	0.00	足够
0005	19200896.73	10%	0.00	0.00	-23992.00	18.48	1896059.19	0.00	0.00	0.00	5.00	0.00	1896059.19	0.00	足够
0006	17772484.47	10%	0.00	0.00	-202832.00	154.56	1574261.89	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1574261.89	0.00	足够
0007	17418685.37	10%	0.00	0.00	-2177.00	1.68	1739689.86	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1739689.86	0.00	足够
0008	10158471.88	10%	0.00	0.00	0.00	0.00	1015847.19	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1015847.19	0.00	足够
0009	19893035.22	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	19893035.22	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	19893035.22	0.00	足够
0010	17338671.89	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	17338671.89	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	17338671.89	0.00	足够
0011	15469016.95	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	15469016.95	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	15469016.95	0.00	足够
0012	10699065.26	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	10699065.26	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10699065.26	0.00	足够
0013	10575058.70	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	10575058.70	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10575058.70	0.00	足够
0014	16794699.81	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	16794699.81	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	16794699.81	0.00	足够
0015	13026194.65	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	13026194.65	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	13026194.65	0.00	足够
0016	18784144.70	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	18784144.70	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	18784144.70	0.00	足够
0017	14212398.55	100%	0.00	0.00	0.00	0.00	14212398.55	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	14212398.55	0.00	足够

投资者列表

持仓合约	类型	投保	持仓	组合	行权	对冲	到期	结算价	基础价	保证金	每手保证金	行权金	被行权金	行权价	乘数
10007563(510050C2408M02200)	多	普通	3	1	0	1	0	0.2230	2.4170	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10000
10007563(510050C2408M02200)	空	普通	1	0	0	1	0	0.2230	2.4170	0.00	5643.44	0.00	0.00	0.00	2200
10007563(510050C2408M02200)	空	备兑	1	0	0	0	0	0.2230	2.4170	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10000
10007451(510050C2408M02250)	空	普通	3	0	0	0	0	0.1730	2.4170	15280.32	5093.44	0.00	0.00	0.00	2250
10007455(510050C2408M02450)	多	普通	4	0	0	1	0	0.0260	2.4170	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10000
10007455(510050C2408M02450)	空	普通	2	1	0	1	0	0.0260	2.4170	0.00	3113.44	0.00	0.00	0.00	10000

投资者持仓窗口

组合持仓类型	持仓	组合号	每套保证金	每套节约	保证金	节约 交易所组合号
CNSJC 10007563,-10007455	1	2	0.00	3113.44	0.00	3113.44

投资者组合持仓窗口

基础	持仓	实量	空量	备兑	分配量	分配额
510050	0	0	0	10000	5	5.00
510300	0	0	0	0	0	0.00
510500	0	0	0	0	0	0.00
588000	0	0	0	0	0	0.00
588080	0	0	0	0	0	0.00

投资者基础现券窗口

管理员可以在【压力测试】界面查看投资者的风控信息，管理员通过菜单栏设定【结算价】、【组合持仓】、【行权】和【持仓对冲】的参数值，然后点击【执行】来进行压力测试。

管理员可以在【投资者列表】中单击投资者行，可在【投资者持仓窗口】查看投资者持仓信息，在【投资者组合持仓窗口】查看投资者组合持仓信息，在【投资者基础现券窗口】查看投资者基础现券信息。本例以0001号投资者为例，单击0001号投资者行，可查看0001号投资者持仓信息、组合持仓信息和基本现券信息。

13.1.9 强行平仓

强行平仓:0001

账户	余额	权利金	手续费	保证金	行权保证金	可用	买入额度	买入金额	后权利金	后保证金	后可用	后买入金额
0001	1624131.20	2911.00	5117.28	35693.90	0.00	1586231.02	0.00	7739.62	7345.00	35693.90	1590665.02	3280.62

资金窗口

持仓合约	类型	投保	持仓	冻平	保证金	手续费	组合仓	待行权	强平量	后持仓	后组合仓	后保证金
10007563(510050C2408M02200)	多	普通	3	1	0.00	0.00	1	0	2	1	1	0.00
10007563(510050C2408M02200)	空	普通	1	0	5828.90	5828.90	0	0	0	1	0	5828.90
10007563(510050C2408M02200)	空	备兑	1	0	0.00	0.00	0	0	0	1	0	0.00
10007451(510050C2408M02250)	空	普通	5	0	26466.00	5293.20	0	0	0	5	0	26466.00
10007455(510050C2408M02450)	多	普通	4	0	0.00	0.00	0	0	0	4	0	0.00
10007455(510050C2408M02450)	空	普通	2	1	6798.00	3399.00	1	0	0	2	1	6798.00

持仓窗口

产品	权利仓限额	权利仓数量	后权利仓数量
H5	50	0	0
H510050_0	50	7	5
H510300_0	50	0	0
H510500_0	50	0	0
H588000_0	50	0	0
H588080_0	50	0	0

产品权利仓限额窗口

产品	总持仓限额	总持仓数量	后总持仓数量
H510050_0	50	16	14

产品总持仓限额窗口

现券	持仓	锁定	可备兑	备兑	后备兑
510050	0	10006	10006	10000	10000

现券窗口

组合持仓类型	组合号	持仓	每套节约	节约金	强解量	后持仓	后节约金
CNSJC 10007563,-10007455	2	1	3399.00	3399.00	0	1	3399.00

组合持仓窗口

类型	投保	合约	数量	状态	完成量
卖平	普通	10007563(510050C2408M02200)	2	等待	0

强行平仓状态窗口

开始本轮强平

命令面板

结束本轮强平

管理员可以在【强行平仓】界面对投资者进行强行平仓操作。本例以0001号投资者为例，在持仓窗口双击合约，在弹出的窗口中输入强平量，强制平仓信息将显示在强行平仓状态窗口，点击命令面板的【开始本轮强平】可以进行强行平仓操作，点击【结束本轮强平】可以结束强行平仓操作。同时管理员可以在持仓窗口查看投资者的持仓信息，在组合持仓窗口查看投资者组合持仓信息，在产品权利仓限额窗口查看权利仓限额风控信息，在产品总持仓限额窗口查看

[illegible]

14 交易权限

交易权限

对象	汇总	实际	管理持久	用户持久	管理临时	用户临时
账户	允许	允许	允许	允许	允许	允许
SHFE	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2106	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2107	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2108	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2109	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2110	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2111	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2112	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2201	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2202	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2203	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2204	允许	允许	允许	允许	允许	允许
ag2205	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2106	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2107	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2108	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2109	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2110	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2111	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2112	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2201	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2202	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2203	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2204	允许	允许	允许	允许	允许	允许
al2205	允许	允许	允许	允许	允许	允许
au	允许	允许	允许	允许	允许	允许
au2106	允许	允许	允许	允许	允许	允许
au2107	允许	允许	允许	允许	允许	允许
au2108	允许	允许	允许	允许	允许	允许

交...投..交易代码

SHFE0001

0001

账户

管理持久

允许

修改权限

关闭

38 / 43

如果是管理员登录，在**主界面**的菜单栏中点击【管理】，弹出下拉菜单，在下拉菜单中点击【交易权限】，会弹出管理员交易权限界面。

详细解释如下：

- 对象：设置交易权限的对象。
- 汇总：汇总以后的交易权限。
- 实际：实际的交易权限。
- 管理持久：管理员设置永久交易权限的列表。
- 用户持久：用户设置永久交易权限的列表。
- 管理临时：管理员设置临时交易权限的列表，当前交易日生效，切换交易日失效。
- 用户临时：用户设置临时交易权限的列表，当前交易日生效，切换交易日失效。

14.1 投资者交易权限

投资者可以在【账户】、【交易所】、【产品】和【合约】四个层级进行交易权限的修改，同时投资者可以修改【用户持久】和【用户临时】交易权限，【用户持久】的交易权限修改之后永久生效，【用户临时】的交易权限修改以后单个交易日生效。

举个例子：如果投资者想要修改永久修改账户的交易权限，可以双击【用户持久】列和【账户】行的交叉的部分进行交易权限的修改。

14.2 管理员交易权限

管理员可以在【账户】、【交易所】、【产品】和【合约】四个层级进行交易权限的修改，同时管理员可以修改【管理持久】、【用户持久】、【管理临时】和【用户临时】交易权限，【用户持久】的交易权限修改之后永久生效，【用户临时】的交易权限修改以后单个交易日生效。【管理持久】的交易权限修改之后永久生效，【管理临时】的交易权限修改以后单个交易日生效。

举个例子：如果管理员想要修改永久修改账户的交易权限，可以双击管理持久列和账户行的交叉的部分进行交易权限的修改。

15 超时未知单

超时未知单管理

时间	种类	账号	合约	买卖	开平	投保	价格	报量	组号	编号	组控	类型	本地号	实连	组仓号
09:29:31.310	报价派生	0032	IC2409	买	开仓	投机	4638.4	1	0	3	增加	普通	6	0	
09:29:31.310	报价派生	0032	IC2409	卖	开仓	投机	4640.0	1	0	3	增加	普通	7	0	

YDClient

 真的要内部拒绝所有超时未知单吗？（如果目前有席位无法连接交易所，请不要做此操作）

在**主界面**中菜单栏中点击【管理】按键，会弹出下拉菜单栏，在下拉菜单栏中点击【超时未知单】即可打开超时未知单对话框。

如果是投资者登录的话，遇到超时未知单，需要跟期货公司联系。

如果是管理员登录的话，遇到超时未知单，可以点击【全部内部拒绝】将超时未知单拒绝掉。

16 登录信息

在[主界面](#)中菜单栏中点击【管理】按键，会弹出下拉菜单栏，在下拉菜单栏中点击【登录信息】即可打开登录信息，具体内容如下：

-
- IP：当前登录ip地址。
- 登陆权限：是否允许登录。
- 当前登录：当前登录数量。
- 累计登录：累计登陆数量。
- 当前失败：当前登陆失败数量。
- 累计失败：累计登录失败数量。

17 调整资金

【调整资金】只能由管理员使用。点击[主界面](#)中的菜单栏的【管理】菜单，点击弹出下拉菜单的【调整资金】进入界面。

名称	值
账户	0001
风险度	0%
可用	11409591
余额	11437544
平仓盈亏	0
持仓盈亏	-75
保证金	27859
手续费	19
现金收支	0
昨余额	11437544
使用限度	100%
入金	0
出金	0
冻结出金	0
交易权限	允许

17.1 选择账户

如上图所示，在调整资金界面的右侧选择不同的账户，调整资金界面左侧会显示该账户的资金明细情况。

17.2 调整资金使用限度

点击菜单栏中【管理】，将弹出下拉菜单，点击下拉菜单中的【调整资金】，弹出调整资金对话框。选取调整资金使用限度选项，填入调整资金使用参数，点击【提交】即可调整对应账户的资金使用限度。

资金使用限度填写范围介于0至1之间。资金使用限度会影响余额资金，对应的公式如下：

余额 = (昨余额 + 入金 - 出金 - 冻结出金) * 使用限度。

举个例子，如果投资者资金窗口原有资金使用限度显示100%，通过调整资金使用限度为50%的操作，现有资金使用限度将显示50%。

17.3 入金

点击菜单栏【管理】，将弹出下拉菜单，点击下拉菜单中的【调整资金】，弹出调整资金对话框，选取入金选项，输入入金金额，点击【提交】即可上传服务器。举个例子，如果投资者资金窗口原有入金显示0，通过入金100的操作，现有入金将显示100。

17.4 冻结出金

点击菜单栏【管理】，将弹出下拉菜单，点击下拉菜单中的【调整资金】，弹出调整资金对话框，选取冻结出金选项，输入冻结出金，点击【提交】即可上传服务器。举个例子，如果投资者资金窗口原有冻结出金显示0，通过冻结出金100的操作，现有冻结出金将显示100。

17.5 取消冻结出金

点击菜单栏【管理】，将弹出下拉菜单，点击下拉菜单中的【调整资金】，弹出调整资金对话框，选取取消冻结出金选项，输入取消冻结出金，点击【提交】即可上传服务器。举个例子，如果投资者资金窗口原有冻结出金显示100，通过取消冻结出金100的操作，现有冻结出金将显示0。

17.6 出金

点击菜单栏【管理】，将弹出下拉菜单，点击下拉菜单中的【调整资金】，弹出调整资金对话框，选取出金选项，输入出金金额，点击【提交】即可上传服务器。举个例子，如果投资者资金窗口原有出金显示0，通过出金100的操作，现有出金将显示100。

18 调整账户状态

【调整账户状态】只能由管理员使用。点击[主界面](#)中的菜单栏的【管理】菜单，点击弹出下拉菜单的【调整账户状态】进入界面。



在弹出界面可选择是否调整账号为禁止交易。

19 调整账户最大报单量

【调整账户最大报单量】只能由管理员使用。点击[主界面](#)中的菜单栏的【管理】菜单，点击弹出下拉菜单的【调整账户最大报单量】进入界面。



在弹出界面可调整账户的最大报单量。

20 调整账户最大撤单量

【调整账户最大撤单量】只能由管理员使用。点击[主界面](#)中的菜单栏的【管理】菜单，点击弹出下拉菜单的【调整账户最大撤单量】进入界面。

调整账户0001的最大撤单量



最大撤单量

确认

取消

在弹出界面可调整账户的最大撤单量。