

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。

- 期货公司客户可以使用该界面用交易账户和密码在应急情况下的报撤单
- 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 indicate no need
  to set CPU affinity
19 TCPTradingCPUID=-1
20
21 # Affinity CPU ID for thread to send XTCP trading, -1 indicate 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 indicate 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 indicate 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	2024/7/26 14:59	文件夹	
 log	2024/7/27 20:34	文件夹	
 error_code	2024/7/26 14:59	Microsoft Excel 逗...	72 KB
 mdList	2024/7/27 22:16	文本文档	0 KB
 yd.dll	2024/7/26 14:59	应用程序扩展	1,884 KB
 YDClient	2024/7/26 14:59	应用程序	3,259 KB
 YDClient	2024/7/27 22:16	配置设置	3 KB

运行以后，输入用户名和命令即可登录。



登录

用户名 0001

口令 ****

确定 取消

2.4 升级

请在官网(<https://www.hanlinit.com/downloads/>)下载新的版本包，用新版本包里面的YDClient.exe和yd.dll替换掉原有的即可重新运行。

3 主界面

易达终端:0001 20240731

系统 操作 数据 管理 菜单栏

行情合约	最新价	买入价	买入量	卖出价	卖出量	成交量	更新时间
ag2106	5592	5593	8	5597	10	1032	21:02:13.500

行情窗口

名称	值
账户	0001
风险度	0%
可用	11409637
余额	11437544
平仓盈亏	0
持仓盈亏	-30
保证金	27859
行权保证金	0
手续费	18
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
其他平盈	0
当日盈亏	-48
交易权限	允许
最多报单	
当前报单	2

命令面板

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
ag2106	今多	投机	1	0	2	0	3	5594	27859	-30	9286	0	
ag2106	今空	投机	1	0	0	0	1	5592	9286	0	9286	0	

持仓窗口

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
ag2106	买	开仓	投机	5400	1	0	0	增加	普通	报单	2	挂单	0	21:01:51.000	
ag2106	买	开仓	投机	5587	1	0	0	增加	普通	报价派生	3	挂单	0	21:01:54.000	

挂单窗口

活跃报价合约	买开	买投	买价	买量	卖开	卖投	卖价	卖量	组号	编号	组控	系统号	买单号	卖单号
ag2106	开仓	投机	5587	1	开仓	投机	5592	1	0	0	增加	1	3	4

活跃报价窗口

TCP交易: 连接 17:30:57 TCP行情: 连接 17:31:03 连接面板 会话:0

投资者登录后的主界面有八个区域：菜单栏、行情窗口、资金窗口、持仓窗口、挂单窗口、活跃报价窗口、命令面板和连接面板。管理员登录后的主界面也有八个区域，跟投资者主界面不同的是，行情窗口区域显示的是账户汇总信息窗口。

3.1 资金窗口

在**主界面**的资金窗口中显示了投资者的资金使用明细，具体的内容如下：

- 账户：投资者账户号。
- 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，目前限度设置为100%，因此昨余额全部可用。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%。
- 平仓盈亏：总的平仓盈亏。
 多头平今仓盈亏=（平仓价-开仓价）* 合约乘数 * 平仓手数。
 多头平昨仓盈亏=（平仓价-昨结算）* 合约乘数 * 平仓手数。
 空头平今仓盈亏=（开仓价-平仓价）* 合约乘数 * 平仓手数。
 空头平昨仓盈亏=（昨结算-平仓价）* 合约乘数 * 平仓手数。
- 持仓盈亏会随着该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。
- 保证金为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：总的手续费。
- 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”代表支持，“否”代表不支持。
- 自动组仓：是否支持大商所自动组合持仓。
- 协议报单：“是”表示支持裸协议报单，“否”表示不支持裸协议报单。
- 不查自成交：是否检查自成交。
- 回报插入报单：“是”表示开启柜台回报功能，此时投资者向柜台报单的话，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”表示将持仓盈利计入可用资金。“否”表示不将持仓盈利计入可用资金。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。
- 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：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，动态权益=平仓盈亏+期货持仓盈亏+现金收支-手续费。
- 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于信息量申报费。
- 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。

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，具体内容如下：

- 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。

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“平仓”。
- 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。
- 成交量：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。

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。
- 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。

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。
- 入金：客户从主席柜台入金。
- 出金：客户从易达柜台出金。
- 冻结出金：冻结资金用于出金。
- 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1.486.93.0。

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](#)、[费率信息](#)、[导出数据](#)。

4.4 管理

菜单栏下的【管理】的子菜单包括[交易权限](#)和[超时未知单](#)。

4.5 现货期权

菜单栏下的【现货期权】的子菜单包括[风险监控](#)和[补充现券](#)。

5 系统参数

系统参数

交易所

席位数

用今仓

套利户

先平今

单大边

状态

时间

CZCE

否

是

否

交易所信息

交易所

席位类型

席位清单

CZCE

公共席位

席位信息

对象

名称

值

System

RunType

SmokeTest

System

ClientMinPasswordLen

0

System

ClientMinPasswordCh...

0

System

AdminMinPasswordLen

0

System

AdminMinPasswordCh...

0

柜台参数信息

产品

交易所

类型

子类型

乘数

Tick

基础乘数

市价上

市价下

限价上

限价下

产品组

状态

时间

AP

CZCE

期货

10

1

200

1

1000

1

CF

CZCE

期货

5

5

200

1

1000

1

CJ

CZCE

期货

5

5

20

1

100

1

CY

CZCE

期货

5

5

200

1

1000

1

FG

CZCE

期货

20

1

200

1

1000

1

JR

CZCE

期货

20

1

200

1

1000

1

LR

CZCE

期货

20

1

200

1

1000

1

MA

CZCE

期货

10

1

200

1

1000

1

OI

CZCE

期货

10

1

200

1

1000

1

PF

CZCE

期货

5

2

200

1

1000

1

PK

CZCE

期货

50

1

200

1

1000

1

PX

CZCE

期货

5

2

200

1

1000

1

RJ

CZCE

期货

20

1

200

1

1000

1

RM

CZCE

期货

10

1

200

1

1000

1

产品信息

组合持仓

投保

优先

类型

参数

AP410,AP411

按投

套利

0

AP410,AP411

按投

套利

0

AP410,AP412

按投

套利

0

AP410,AP412

按投

套利

0

AP411,AP412

按投

套利

0

AP411,AP412

按投

套利

0

AP410,AP501

按投

套利

0

AP410,AP501

按投

套利

0

AP411,AP501

按投

套利

0

AP411,AP501

按投

套利

0

AP412,AP501

按投

套利

0

AP412,AP501

按投

套利

0

AP410,AP503

按投

套利

0

AP410,AP503

按投

套利

0

AP411,AP503

按投

套利

0

AP411,AP503

按投

套利

0

AP411,AP503

按投

套利

0

AP417-AP501

按投

套利

0

组合持仓自定义信息

合约

产品

交易所

类型

子类型

乘数

Tick

交割月

市价上

限价上

到期日

剩口

权类

行权价

基础合约

基差

保算

大边

昨结算

昨收盘

涨停板

跌停板

量单位

询价时

询价价

状态

时间

债券利息

现货合约属性

现货合约控制

SPD ZC5038ZC504

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5038ZC505

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5038ZC506

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5038ZC507

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5048ZC505

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5048ZC506

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5048ZC507

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5058ZC506

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5058ZC507

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

SPD ZC5068ZC507

SPD ZC&ZC

CZCE

组合

1

0.2

000000

1-1000

1-1000

0

0

否

0.0

0.0

0.0

-320.8

320.8

1

0.00

合约信息

账户

产品

投保

开仓量

撤单数

持仓

持仓数量

多空持仓

多持仓

空持仓

空持仓

0001

AP

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

CF

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

CJ

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

CY

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

FG

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

JR

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

LR

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

MA

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

OI

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

PF

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

PK

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

PK

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

PM

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

PK

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

RM

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

RS

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

SA

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

SF

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

SH

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

SM

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

SR

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

0001

TA

投机

1

7

9

15

2

10

3

11

产品事前风控

分支合约

买卖

ZC504

买

ZC505

卖

分支合约信息

组合持仓

组投保

买卖

投保

ZC504,ZC505

按投

买

投机

ZC504,ZC505

按投

卖

投机

组合持仓信息

名称

值

AP.intraRateY

.7

AP.fut.cvf

10

AP.fut.AP404.price

7309

AP.fut.AP404.marginRate

.1

AP.fut.AP404.timeRange

BNSP

AP.fut.AP404.lockRateX

.2

AP.fut.AP404.addOnRate

.03

AP.fut.AP405.price

7811

AP.fut.AP405.marginRate

.1

保证金模型信息

账户

合约

投保

开仓量

撤单数

持仓

持仓数量

多空持仓

多持仓

空持仓

空持仓

0001

AP410

投机

4

8

12

16

5

13

6

14

0001

AP411

投机

4

8

12

16

5

13

6

14

0001

AP412

投机

4

8

12

16

5

13

6

14

0001

AP501

投机

4

8

12

16

5

13

6

14

0001

AP503

投机

4

8

12

16

5

13

6

14

0001

AP504

投机

4

8

12

16

5

13

6

14

0001

AP505

投机

4

8

12

16

5

13

6

14

0001

CF409

投机

4

8

12

16

5

13

6

14

合约事前风控

交易所

序号

状态

说明

持仓

CZCE

0

打开

100

前置连接信息

点击菜单栏中的【数据】按键，弹出下拉菜单栏，点击下拉菜单栏中的【系统参数】按键，弹出系统参数对话框。

主要包括12方面的信息：交易所信息；席位信息；柜台参数信息；产品信息；合约信息；组合持仓信息；产品事前风控；合约事前风控；分支合约信息；组合持仓信息；保证金模型信息和前置连接信息。

5.1 交易所信息

[系统参数](#)界面的交易所信息显示交易所相关内容，具体内容如下：

- 交易所：显示交易所情况。
- 席位：当前ydServer连接该交易所使用的席位数量，各席位编号从0开始依次编号。
- 用今仓：是否需要在平仓时明确指示历史仓或者今日新仓，仅SHFE需要此配置。
- 套利户：是否支持套利账户，仅CFFEX需要此配置。
- 先平今：平仓时优先使用今日新仓还是历史仓位。
- 单大边：是否按产品多空方向计算保证金后收取大头。
- 状态：显示交易所状态是否“连续”。
- 时间：时间信息。

双击“交易所信息”窗口，可以调出“交易所席位优选连接”设置。



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：

- 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。
- TradingSegmentDetail:发送交易阶段明细。
- 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。

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。

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：交割月份，例如1代表1月份，12代表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：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 产品事前风控

[系统参数](#)界面的产品事前风控信息子窗口的字段解释如下：

- 账户：投资者账户。
- 产品：产品代码。
- 投保：包括投机、套利（仅CFFEX使用）和套保。
- 开仓量：开仓量限制。
- 撤单数：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。

5.8 合约事前风控

[系统参数](#)界面的合约事前风控信息子窗口的字段解释如下：

- 账户：投资者账户。
- 合约：合约代码。
- 投保：包括投机、套利（仅CFFEX使用）和套保。
- 开仓量：开仓量限制。
- 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 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。

5.12 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。
- 在途流控：控制已经发往交易所但还未收到回报的报撤单指令数量的上限，即在途流控。仅对上期所和中金所有效。缺省是0，表示无限制。

- 状态：报单当前的状态，有拒绝、全成、撤单等。
- 成交量：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。

6.2 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。
- 数量：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。

6.3 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。

6.4 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。

6.5 持仓明细窗口

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

6.6 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。

6.7 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
- 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。
- 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国的“持仓”字段。

6.8 现券窗口

当投资者登录的是上交所和深交所的股票期权系统时，在[账户明细](#)的现券窗口显示现券的一些信息。具体的内容如下：

- 现券：现券代码。
- 持仓：现券持仓量。
- 锁定量：现券锁定量。
- 备兑量：现券备兑量。
- 行权量：现券行权量。

6.9 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。

6.10 命令面板

6.10.1 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。

6.10.2 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](#)

6.10.3 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](#)

6.10.4 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。

6.10.5 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。

6.10.6 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。

6.10.7 过滤显示

点击[账户明细](#)的命令行中的【过滤显示】按键，会弹出行情对话框，选取对应的合约或期权，即可按对应的合约或期权进行筛选。

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。费率信息对话框有三个部分组成，合约费率、信息量费率和新组保费率。

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	撤单手续费	信息费	信息量上限
a2409	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
a2409	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
a2411	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
a2411	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
a2501	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
a2501	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
a2503	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
a2503	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
a2505	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
a2505	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
a2507	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
a2507	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2408	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2408	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2409	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2409	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2410	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2410	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2411	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2411	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2412	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2412	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2501	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2501	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2502	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2502	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2503	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2503	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	
b2504	投机	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	收取	100
b2504	套保	8%	8%	2	2.25	2	0	0	0	0	

产品	OTR	信息量	费率
b	0	0	0.10
b	0	4000	0.00
b	0	8000	0.20
b	2	0	0.00
b	2	4000	0.10
b	2	8000	0.00
c	0	0	0.00
c	0	4000	0.00
c	0	8000	0.00

新保证金模型	平仓验资	保证金系数	适用产品
RULE	验资	1.000	

7.1 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：平仓成交金额手续费率+平仓成交每手手续费。
- 平今手续费：平今成交金额手续费率+平今成交每手手续费。
- 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。

7.2 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

7.3 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。

8 交易

8.1 报单

报单

合约

ag2106

账户

0001

买卖

买

开平

开仓

投保

投机

类型

普通

价格

5591

5593

5590

数量

1

8

40

连接

任意

编号

0

种类

报单

触类

触价

0

属性

用户值

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、编号、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。
- 编号：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。



合约	ag2106		
账户	0001		
买卖	卖	开平	平今
投保	投机	类型	普通
价格	5606	5605	5613
数量	1	8	6
连接	任意	编号	0
可平	1	种类	报单
触类		触价	0
		属性	
用户值			

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。

8.2 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。

8.3 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	ag2106		
账户	0001		
买开	开仓	卖开	开仓
买投	投机	卖投	投机
买价	5615	卖价	5618
买量	1	卖量	1
连接	任意	编号	0
询价	-1	顶单号	
属性		<input type="checkbox"/> 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、编号、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。
- 编号：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 ag2106

账户 0001

买开 开仓 卖开 开仓

买投 投机 卖投 投机

买价 5611 卖价 5615

买量 1 卖量 1

连接 任意 编号 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。

8.4 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。

8.5 询价



报单

合约 ag2106

账户 0001

买卖 买 开平 开仓

投保 投机 类型 普通

价格 5609 5610 5606

数量 1 16 8

连接 任意 编号 0

种类 询价

触类 触价 0

属性

用户值

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。

将【种类】设置为【询价】，点击【报单】按键，即代表发出询价单。

8.6 组合解组合

[illegible]

点击[主界面](#)的命令面板中【账户明细】，在弹出的账户明细窗口中双击“持仓窗口”中的合约行，可以调出持仓的组合和拆分窗口。

如果有现有组合持仓，则双击可以进行组合拆分；如果有可能组合持仓，则可以进行持仓组合。

8.7 股票期权业务

8.7.1 现券锁定与解锁

报单

—

□

×

合约	510050		
账户	0001		
买卖	买	开平	开仓
投保	<div>普通</div>	类型	<div>普通</div>
价格	<div>2.440</div>	2.440	2.439
数量	<div>1</div>	3625800	238300
连接	<div>任意</div>	编号	<div>0</div>
		种类	<div>锁定现券</div>
触类	<div></div>	触价	<div>0</div>
		属性	<div></div>
用户值	<div></div>		

报单

放弃

上交所股票期权备兑开仓和普通转备兑前，需要先锁定现货仓位。在**主界面**的行情窗口的现货合约行双击现货合约，会弹出报单窗口，将【种类】选取【锁定现券】，点击【报单】即可锁定现券；将【种类】选取【解锁现券】，点击【报单】即可解锁现券。本例以510050合约为例，锁定510050合约数量1。

8.7.2 备兑开平仓

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

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			

Buttons at the bottom: 报单 (left), 放弃 (right).

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。

8.7.3 普通与备兑转换

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

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			

Buttons at the bottom: 报单 (left), 放弃 (right).

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。

8.8 行权与履约

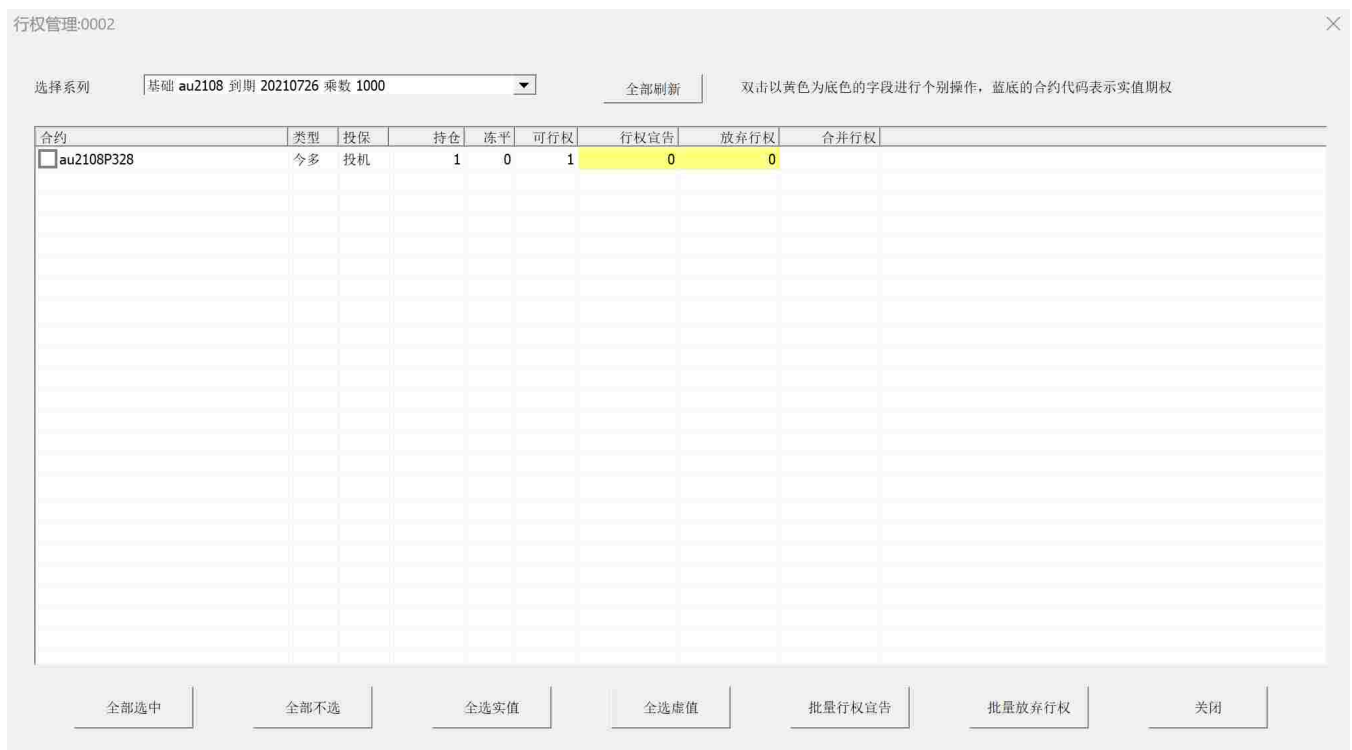
合约	au2108P328		
账户	0002		
买卖	卖	开平	平今
投保	投机	类型	普通
价格	0.08	0.08	0.18
数量	1	7	5
连接	任意	编号	0
可平	1	种类	行权宣告
触类		触价	0
		属性	
用户值			
报单		放弃	

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。

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	

在[主界面](#)的持仓窗口双击空头合约行，弹出报单窗口，可在此窗口中做履约相关操作。本例中以上期所空仓的 au2108P328 合约为例，将【种类】选取为【上海持仓对冲】即可发送上期所双向期权持仓对冲。

9 行权管理



点击[主界面](#)中的菜单栏中的【管理】，在弹出的对话框中点击【行权管理】，如果投资者有可以行权的持仓，将弹出行权管理对话框，投资者可以在此处对行权进行选取、行权、放弃行权等操作。

10 超时未知单



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。

11.1.6 撤单报单比限制

[illegible]

投资者可以在【撤单报单比限制】界面查看撤单报单比风控。本例中0001号投资者在H510050_o产品的起始报单量为4，撤单报单比的比例限制为50%，投资者当前的撤单数为5，报单数为20，当前比例为0.06（（撤单笔数-X）/（报单笔数-X）），风险度为0.12（当前比例/比例限额）。

11.1.7 账户买入额度

[illegible]

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）。

11.1.8 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	10000
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	10000
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。

11.1.9 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	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

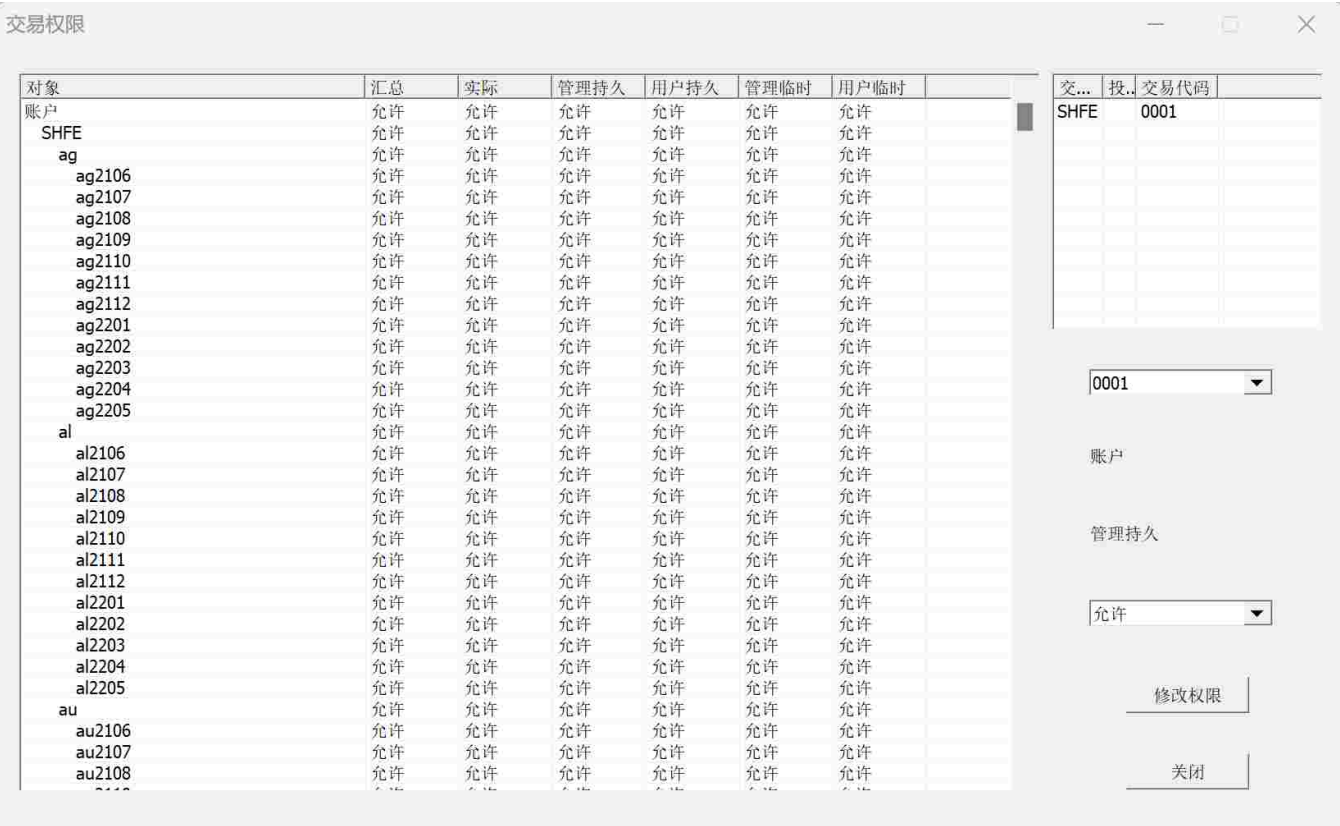
结束本轮强平

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]

如果投资者连接的是股票期权系统，点击[主界面](#)的菜单栏中的【现货期权】，弹出下拉菜单栏，点击下拉菜单栏中的【补充现券】，将弹出补充现券对话框，可以在此处查看现券相关信息。

12 交易权限



如果是投资者登录，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】，会弹出投资者交易权限界面。

如果是管理员登录，在菜单栏中点击【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。

12.1 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。

12.2 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。

13 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。



The dialog box titled "调整资金" (Adjust Funds) contains a table on the left and form fields on the right.

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

On the right side of the dialog box, there are the following controls:

- A dropdown menu showing "0001".
- A dropdown menu labeled "调整资金使用限度" (Adjust Funds Usage Limit).
- An empty text input field.
- "提交" (Submit) and "关闭" (Close) buttons.

13.1 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。

13.2 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%。

13.3 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。

13.4 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。

13.5 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。

13.6 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。

14 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。

15 修改口令

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

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。