

# 恒生电子股份有限公司

<MT 专业交易终端>

## 操作手册

<期货发展部>

2018 年 5 月



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

## 文档修改记录

版本	修订说明	批准人	发布日期
1.0	初稿	***	2018.05.04
1.1	增加组合策略参数说明		2019.12.31
1.2	1、增加拆单、追单价格类型说明； 2、增加组合下单支持策略类型说明； 3、增加价格监控说明； 4、整体更新；		2020.07.13
1.3	1、更新菜单栏说明； 2、增加点价下单和交易卡片说明 3、增加账户组交易说明 4、整体界面更新		2021.02.26
1.4	1、更新账户组报单；		2021.04.09
1.5	1、更新菜单栏说明； 2、更新自设套利页签说明 3、更新下单板交易策略说明 4、整体界面更新		2023.01.16

本方案模板的主要用途：新增业务时，对已有产品或系统进行修改的方案。



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

---

## 说 明

本文档中所包含的信息属于商业机密信息，如无恒生电子股份有限公司的书面许可，任何  
人都无权复制或利用

模板版本信息

编辑部门：EPG

批准日期：2014/11/20

## 目录

目录 .....	I
1 产品介绍 .....	1
2 用户登录 .....	1
2.1 单账号登录 .....	1
2.2 多账号登录 .....	2
3 基础功能 .....	3
3.1 菜单栏 .....	3
3.1.1 账户按钮 .....	3
3.1.2 交易按钮 .....	4
3.1.3 查询按钮 .....	7
3.1.4 策略按钮 .....	8
3.1.5 系统按钮 .....	8
3.2 资金 .....	13
3.2.1 资金 .....	13
3.3 行情 .....	14
3.3.1 实时行情 .....	14
3.3.2 T 型报价 .....	15
3.3.3 行情 K 线 .....	15
3.3.4 合约搜索 .....	16
3.3.5 价格监控 .....	16
3.3.6 自设套利 .....	17
3.4 标准交易 .....	23
3.5 交易信息 .....	25
4 策略交易 .....	26
4.1 条件单、止盈止损 .....	26
4.2 冰山单 .....	27

4.3	循环单 .....	27
4.4	批量委托 .....	28
4.5	账户组报单 .....	29
4.5.1	账户组设置 .....	29
4.5.2	账户组报单 .....	31
4.5.3	账户组套利报单 .....	32
4.6	TWAP .....	33
4.7	狙击单 .....	33
4.8	标准网格:.....	34
4.9	下单板条件单 .....	34
4.10	文件下单(需要申请).....	34
5	组合策略交易 .....	36
5.1	组合设置 .....	36
5.2	参数说明 .....	37
5.2.1	组合参数 .....	37
5.2.2	策略参数 .....	40
5.3	组合行情 .....	41
5.3.1	实时行情 .....	41
5.3.2	组合 K 线.....	41
5.4	组合下单 .....	41
5.5	组合委托 .....	42
5.6	汇总统计 .....	42
6	期权交易 .....	44
6.1	组合交易 .....	44
6.2	期权行权 .....	44
6.3	锁定解锁 .....	45
6.4	组合拆分 .....	46
7	其他 .....	46



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

---

7.1	表格调整 .....	46
7.2	自定义布局 .....	47
7.3	选项及配置 .....	48
7.4	日志信息 .....	49
7.5	意见反馈 .....	50

# 1 产品介绍

MT(MultiTrade)专业交易终端，针对机构和专业投资者，提供多市场、多账户、多策略的综合交易管理服务，让交易变简单。

1. 支持多市场交易，包括：境内期货、股票期权、证券、境外期货、外汇、黄金交易所等多市场行情及交易；
2. 支持多账户一键登录、灵活的组合交易、多种智能算法策略、专业期权交易功能，为机构和专业投资提供便捷可靠的交易。

## 2 用户登录

### 2.1 单账号登录

选择接入站点，通过资金账号、密码进行一键登录。



单账号登录

## 2.2 多账号登录

支持多通道、多账号同时登录。切换至“组合登录”，勾选需要登录的账号，进行一键多账号登录。



单账号/多账号登录切换



多账号登录



## 3 基础功能

资金、行情、下单、交易信息直观呈现，操作便捷。



软件界面

### 3.1 菜单栏

菜单栏功能分工明确。

1. 【账户列表】支持多账号登录，以及账号切换；
2. 【账户按钮】账户相关操作、资金转账；
3. 【交易按钮】提供多种下单方式；
4. 【查询按钮】交易数据当日和历史查询；
5. 【策略按钮】提供各种策略交易；
6. 【系统按钮】配置客户端各种操作设置；



菜单栏

#### 3.1.1 账户按钮

按照功能分类，将账户功能菜单整合在“账户按钮”中，如：

支持修改密码、账单确认、重新登录、银行转账、账户转账、资金划拨、账号备注、账户组设置、换汇申请。

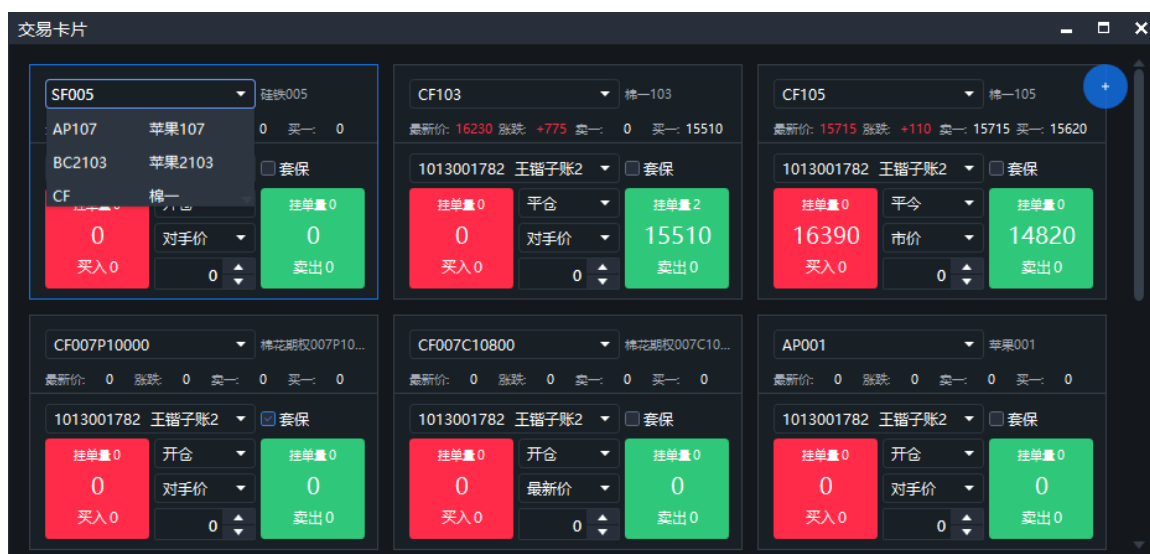


账户按钮

### 3.1.2 交易按钮

照功能分类，将功能菜单整合在“组件列表”中，如：

1. 下单：交易所普通下单按钮，调出下单版；
2. 通用下单：交易所指令下单五档市价、FAK、FOK、套利确认、期权跨式交易等
3. 交易卡片：支持添加多个下单版



#### 4. 点价下单：支持点价下单功能

点价下单

1013001782 王锴子账2

CF107&CF109 郑州组合合约

1

☐ 套保
 ☐ 移仓

自动

多头: 0 0.00

空头: 0 0.00

平净仓

撤买 (3)	买入	价格	卖出	撤卖
		875		
		870		
		865		
		860		
		855		
		850		
		845		
		840		
		835		
		830		
		825		
		820		
		815		
		810		
		805		
		800		
		795		
		790		
		785		
		780		

#### 5. 行权：支持期货期权和股票期权行权



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

期权行权

标准

组合

账户 期 1013001782(王...)

交易所 郑商所

开平 平仓

合约

数量 <=0

行权 放弃

☒ 实值 ☐ 虚值 ☐ 全部

交易所 合约代码 合约名称 实/虚值 净仓 总持仓 可用持仓

报单编号	行权日期	行权时间	交易所	合约代码	合约名称	行权方式	行权数量	报单状态	标的代码	错误信息	冻结保证金	冻结手续费

6. 组合拆分:支持大连和广州交易所组合拆分交易

组合拆分

组合

拆分

账户 期 941000035(C)

合约1

合约2

组合策略

数量 0 <=0

组合

持仓列表

交易所	合约代码	合约名称	总持仓	可组合	买卖	持仓均价	最新价	持仓盈亏	保证金	投机套保	资金账号
大商所	b2301	豆二2301	1	1	卖出	0.00	5052	-230.00	0.00	投机	941000035
大商所	c2301	玉米2301	1	1	卖出	0.00	2861	-110.00	0.00	投机	941000035

组合预览

合约1	投机套保1	持仓量1	可组合1	买卖1	组合代码	组合策略	合约2	投机套保2	持仓量2	可组合2	买卖2

流水

委托时间	委托号	合约1	合约2	买卖	委托数量	占用保证金	状态	组合类型	组合/拆分	投机套保1	投机套保2

7. T 型报价: 支持股票期权和期货期权 T 型报价显示

行情		自选行情	K线	T型报价	自选套利		委托												
行情	用标	风险	信息	自定义	标的	PTA	TA303(18天)		标的	TA303	最新价 5486	涨跌 6	涨幅 0.11%	参数设置	询价				
预估保证金	交易状态	总量	持仓量	卖量	买价	卖价	买量	涨跌	涨幅%	最新价	持仓信息	行权价	持仓信息	最新价	涨幅%	涨跌	买量	买价	卖价
6,737.40	未知	-	45	1	699.5	664.5	1	-	0.00	-		4800.0		1.5	-25.00	-0.5	266	1.5	2.0
6,492.40	未知	-	67	1	650.0	618.5	1	-	0.00	-		4850.0		2.0	-20.00	-0.5	344	2.0	2.5
6,247.40	未知	-	101	1	602.0	565.5	1	-	0.00	-		4900.0		3.0	-14.29	-0.5	170	3.0	3.5
6,004.90	未知	-	211	1	555.0	520.0	1	-	0.00	-		4950.0		4.0	-20.00	-1.0	175	4.0	4.5
5,764.90	未知	2	215	1	532.5	476.5	1	-6.0	-1.23	480.5		5000.0		6.0	-14.29	-1.0	90	6.0	6.5
5,297.40	未知	224	523	10	399.0	396.0	16	-3.0	-0.76	390.0		5100.0		11.5	-14.81	-2.0	105	11.0	11.5
4,857.40	未知	298	428	30	310.5	307.0	17	6.5	2.13	311.5		5200.0		21.0	-17.65	-4.5	226	20.5	21.0
4,459.90	未知	2141	2573	40	228.0	224.0	22	-2.5	-1.11	223.0		5300.0		40.0	-12.09	-5.5	103	39.5	40.5
4,122.40	未知	2030	5877	20	157.5	155.0	24	-2.0	-1.27	156.0		5400.0		71.0	-8.97	-7.0	166	69.0	70.0

8. 期权对冲设置:支持期货期权对冲业务

期权对冲设置

期 941000035(GT... ▾

设置

删除

对冲结果

资金账号	交易所	合约	对冲类型	对冲数量
------	-----	----	------	------

对冲流水

委托号	资金账号	交易所	合约	对冲类型	对冲数量	操作类别	提示信息	状态
-----	------	-----	----	------	------	------	------	----

交易

查询

标准下单

通用下单

双向下单

交易卡片

点价下单

键盘下单

普通行权

组合拆分

T型报价

对冲设置

手续费

0.00

停

36

29

72

55

30

10

45

50

8

8

8

14

14

14

10

10

交易菜单

3.1.3 查询按钮

支持当日查询、历史查询、系统消息查询。支持挂单、委托、成交、持仓多页签显示。



查询菜单

### 3.1.4 策略按钮

支持策略下单功能。

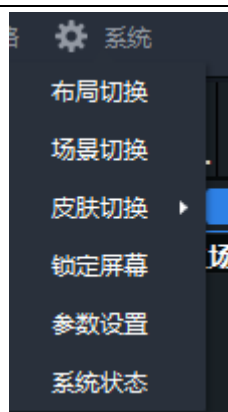
1. 组合策略：支持组合策略下单；
2. 条件单：支持本地条件单
3. 冰山单：支持大单随即拆分下单
4. 批量下单：支持价格 T 度的大单拆分下单
5. 账户组报单：支持多账户登录的账户组报单



### 3.1.5 系统按钮

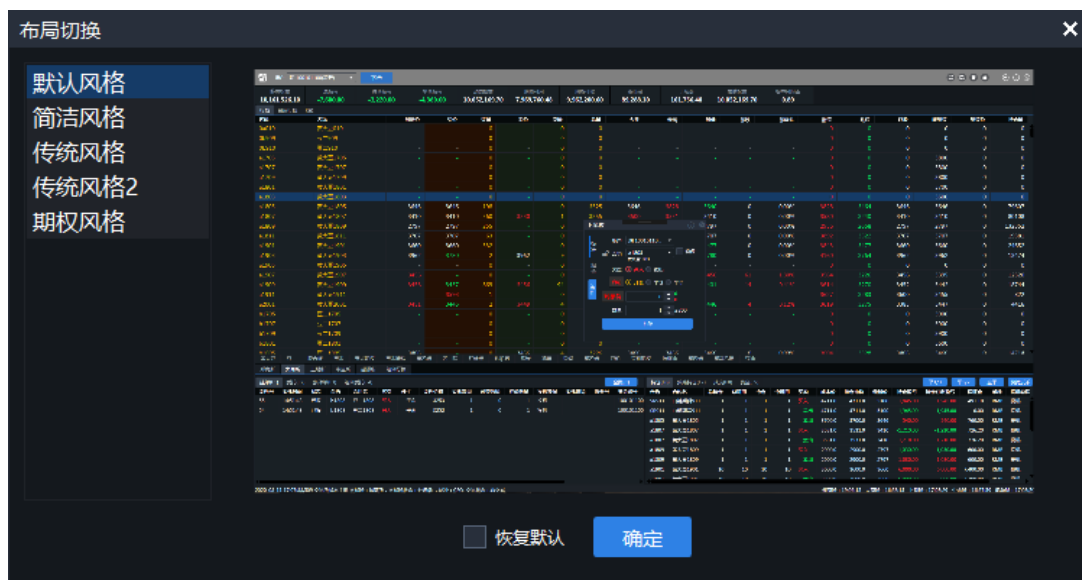
支持系统配置设置

编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

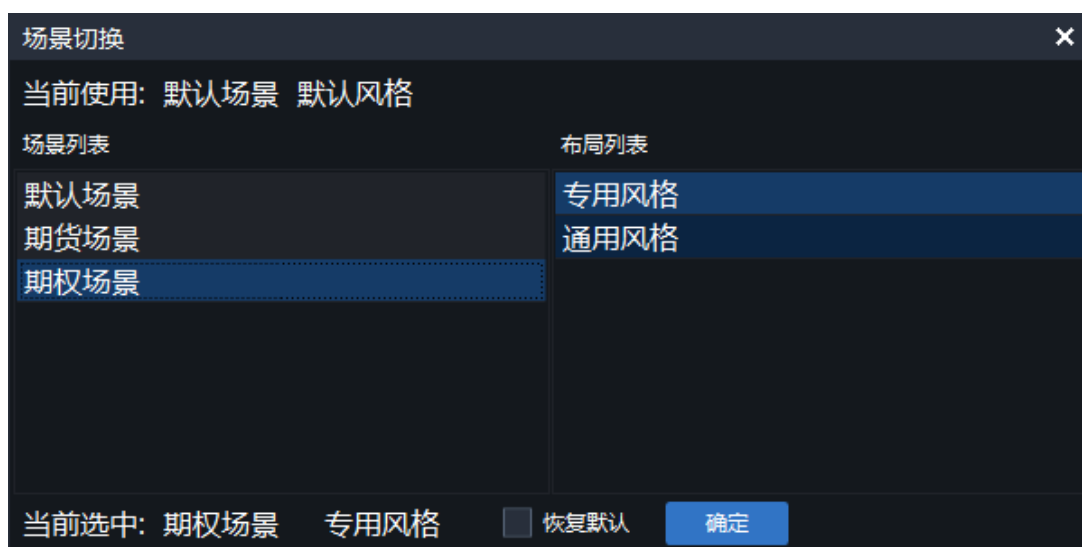


设置按钮

1. 布局切换: mt 支持五种风格的布局切换



2. 场景切换: 切换期货和期权场景





编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

### 3. 皮肤切换：支持深色和浅色皮肤切换

账户

期 1013001782(王耀...)

下单

账户

交易

查询

策略

系统

—

□

×

静态权益

23,753,302.80

总盈亏

-9,350.00

持仓盈亏

-9,350.00

平仓盈亏

0.00

动态权益

23,757,202.80

期货可用

23,697,045.30

期货可取

23,670,901.30

保证金

39,817.50

手续费

0.00

市值权益

23,757,202.80

挂单冻结

16,440.00

行情

自选行情

K线

自选合约

2

新窗口----

新窗口3

新窗口4

+

代码	名称	最新价	买价	卖价	买量	卖量	总量	今开	最高	最低	涨跌	涨幅%	涨停	跌停	昨收	昨结算	结算价	持仓量
NI2001-2002	NI2001-2002	-	-	0	-	0	0	0	-	-	-	-	-	0	0	0	0	0
CF101&CF105	郑州组合合约	-	-	0	-	0	0	0	-	-	-	-	-	0	0	0	0	0
CF105	棉—105	-	15700	7	15900	6	0	-	-	-	-	-	-	16575	15000	15790	0	15790
CF103	棉—103	-	15700	7	15905	6	0	-	-	-	-	-	-	16575	15000	15790	0	15790
CF_S103-105	CF_S103-105	-	-200	6	205	6	0	-	-	-	-	-	-	0	0	0	0	0

挂单(F1)

委托(F2)

条件单(F3)

组合委托(F4)

导入

导出

指令汇总

全部

持仓(F6)

成交(F8)

资金(F9)

平1/3

平1/2

全平

快捷反手

001782(王耀子张2)	投机 投机	备注	委托日期	委托时间	更新时间	提示信息	合约	合约名	总持仓	持仓盯市盈亏	总可用	今仓	今可用	买卖	成本价
001782(王耀子张2)	投机 投机		2021-02-26	10:53:09	11:03:26	[514622]输入价格%0,超出涨跌幅	SR103C4900		1	0.00	1	0	0	买入	470.00
001782(王耀子张2)	投机 投机		2021-02-26	10:52:33	10:52:33	[514672]当前委托单存在可自	CF103	棉—103	3	5,025.00	3	0	0	买入	16178.33
001782(王耀子张2)	投机 投机		2021-02-26	10:51:16	10:51:43	[514672]当前委托单存在可自	CF105	棉—105	5	-148,625.00	5	3	3	卖出	9803.00
001782(王耀子张2)	投机 投机		2021-02-26	10:50:22	10:50:52		CF103	棉—103	3	-11,625.00	3	0	0	卖出	15793.33
							CF107	棉—107	4	145,425.00	4	3	3	买入	8500.00
							CF105	棉—105	2	6,925.00	1	2	1	买入	15022.50
							CF109	棉—109	1	1,875.00	1	1	1	卖出	15235.00
							CF107	棉—107	3	-3,575.00	3	3	3	卖出	15446.67

全部

运行

复核

2021-02-26 11:03:26.748 委托号 214 代码 CF105 方向 卖出 开平 平仓 委托数量 1 成交数量 0 撤单数量 0 委托状态 未报 委托时间 11:03:26 投机套保 投机 郑商所: 11:25:04 大商所: 11:25:02 上期所: 11:25:05 中金所: 11:25:05 能源所: 11:25:05

深色

账户

期 1013001782(王耀...)

下单

账户

交易

查询

策略

系统

—

□

×

静态权益

23,753,302.80

总盈亏

-9,350.00

持仓盈亏

-9,350.00

平仓盈亏

0.00

动态权益

23,757,202.80

期货可用

23,697,045.30

期货可取

23,670,901.30

保证金

39,817.50

手续费

0.00

市值权益

23,757,202.80

挂单冻结

16,440.00

行情

自选行情

K线

自选合约

2

新窗口----

新窗口3

新窗口4

+

代码	名称	最新价	买价	卖价	买量	卖量	总量	今开	最高	最低	涨跌	涨幅%	涨停	跌停	昨收	昨结算	结算价	持仓量
NI2001-2002	NI2001-2002	-	-	0	0	-	0	-	-	-	-	-	0	0	0	0	0	0
CF101&CF105	郑州组合合约	-	-	0	0	-	0	-	-	-	-	-	0	0	0	0	0	0
CF105	棉—105	-	15700	7	15900	6	0	-	-	-	-	-	16575	15000	15790	0	15790	0
CF103	棉—103	-	15700	7	15905	6	0	-	-	-	-	-	16575	15000	15790	0	15790	0
CF_S103-105	CF_S103-105	-	-200	6	205	6	0	-	-	-	-	-	0	0	0	0	0	0

挂单(F1)

委托(F2)

条件单(F3)

组合委托(F4)

导入

导出

指令汇总

全部

持仓(F6)

成交(F8)

资金(F9)

平1/3

平1/2

全平

快捷反手

委托单(F1)	委托单(F2)	条件单(F3)	组合委托(F4)	导入	导出	指令汇总	全部	持仓(F6)	成交(F8)	资金(F9)	平1/3	平1/2	全平	快捷反手		
委托单(F1)	委托单(F2)	条件单(F3)	组合委托(F4)	导入	导出	指令汇总	全部	持仓(F6)	成交(F8)	资金(F9)	平1/3	平1/2	全平	快捷反手		
001782(王耀子张2)	投机 投机	备注	委托日期	委托时间	更新时间	提示信息		合约	合约名	总持仓	持仓盯市盈亏	总可用	今仓	今可用	买卖	成本价
001782(王耀子张2)	投机 投机		2021-02-26	10:53:09	11:03:26	[514622]输入价格%0,超出涨跌幅		SR103C4900		1	0.00	1	0	0	买入	470.00
001782(王耀子张2)	投机 投机		2021-02-26	10:52:33	10:52:33	[514672]当前委托单存在可自		CF103	棉—103	3	5,025.00	3	0	0	买入	16178.33
001782(王耀子张2)	投机 投机		2021-02-26	10:51:16	10:51:43	[514672]当前委托单存在可自		CF105	棉—105	5	-148,625.00	5	3	3	卖出	9803.00
001782(王耀子张2)	投机 投机		2021-02-26	10:50:22	10:50:52			CF103	棉—103	3	-5,025.00	3	0	0	卖出	15793.33
								CF107	棉—107	4	145,425.00	4	3	3	买入	8500.00
								CF105	棉—105	2	7,675.00	1	2	1	买入	15022.50
								CF109	棉—109	1	1,875.00	1	1	1	卖出	15235.00
								CF107	棉—107	3	-3,575.00	3	3	3	卖出	15446.67

全部

运行

终结

2021-02-26 11:03:26.748 委托号 214 代码 CF105 方向 卖出 开平 平仓 委托数量 1 成交数量 0 撤单数量 0 委托状态 未报 委托时间 11:03:26 投机套保 投机 郑商所: 11:26:32 大商所: 11:26:30 上期所: 11:26:33 中金所: 11:26:33 能源所: 11:26:33

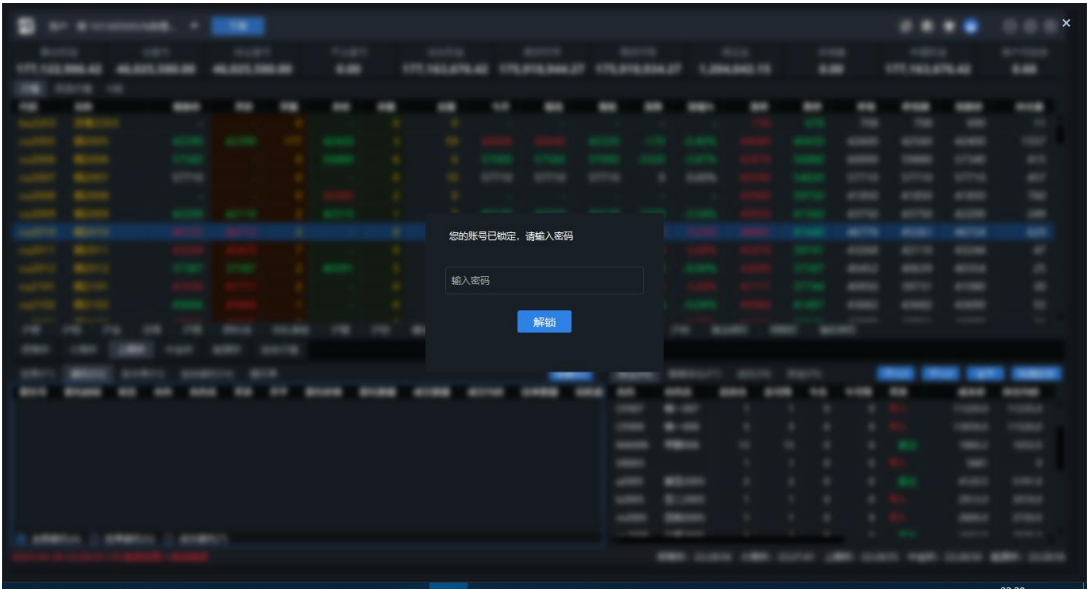
浅色

### 4. 锁屏：锁定屏幕





编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14



解锁

5. 参数设置：基础交易设置

编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

设置

+

交易设置

+

风控设置

+

策略设置

声音设置

程序设置

[止损盈]报单价

市价

[止损盈]超价(Tick)

0

报单前提示

是

市价单提示

是

撤单前提示

是

策略报单前提示

是

按对手价改单前提示

是

恢复默认

保存

6. 系统状态:显示系统连接状态



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

系统状态

程序名

MT (8.24.1.1285)

程序启动时间

2023-01-16 13:17:24

程序启动位置

D:\Users\lvpf24620\AppData\Roaming\MT专业版2204A-T3A\

交易日期

2023-01-16

交易站点

941000035(GTN000035全) 恒生期货UAT(7\*24) 101.71.132.51:9006 (已...

行情站点

101.71.132.51:9006 (已连接)

3.2 资金

3.2.1 资金

主界面上方显示资金栏，支持设置资金显示字段，右键资金栏，打开资金栏设置，选择需要显示的资金信息。

账户权益	总资产	持仓盈亏	平仓盈亏	账户权益	期货可用	保证金	手续费	市值权益	净利润	客户风险率
4,402,178.94	0.00	0.00	0.00	4,402,178.94	4,402,178.94	0.00	0.00	4,402,178.94	0.00	0.00

资金栏



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

<input checked="" type="checkbox"/>	静态权益	
<input checked="" type="checkbox"/>	平仓盯市盈亏	
<input checked="" type="checkbox"/>	持仓盯市盈亏	
<input checked="" type="checkbox"/>	盯市总盈亏	
<input checked="" type="checkbox"/>	动态权益	
<input checked="" type="checkbox"/>	保证金	
<input checked="" type="checkbox"/>	期货可用	
<input checked="" type="checkbox"/>	市值权益	
<input checked="" type="checkbox"/>	期初权益	
<input type="checkbox"/>	浮动平仓盈亏	
<input type="checkbox"/>	浮动持仓盈亏	
<input type="checkbox"/>	浮动总盈亏	
<input type="checkbox"/>	资金权益	
<input type="checkbox"/>	质押金额	
<input type="checkbox"/>	可取资金	
<input type="checkbox"/>	挂单冻结	
<input type="checkbox"/>	手续费	
<input type="checkbox"/>	客户风险率	
<input type="checkbox"/>	转入金额	
<input type="checkbox"/>	转出金额	
<input type="checkbox"/>	权利金	

资金设置

### 3.3 行情

#### 3.3.1 实时行情

按交易所、品种分类，显示实时行情报价。

行情		自选行情		K线																
代码	名称	最新价	买价	买量	卖价	卖量	总量	今开	最高	最低	涨跌	涨幅%	涨停	跌停	昨收	昨结算	结算价	持仓量		
ag2005	白银2005	-	2025	1	-	0	0	-	-	-	-	-	-	2146	1903	2142	2025	0	687	
ag2006	白银2006	3640	3631	1	3640	1	99	3695	3695	3618	-66	-1.78%	3928	3483	3695	3706	0	3959		
ag2007	白银2007	1787	1860	2	-	0	8	1787	1787	1787	-73	-3.92%	1971	1748	1784	1860	0	1103		
ag2008	白银2008	2382	2433	5	-	0	4	2378	2382	2378	5	0.21%	2590	2163	2464	2377	0	217		
ag2009	白银2009	2381	2381	25	-	0	5	2381	2381	2381	0	0.00%	2523	2238	2381	2381	0	1225		
ag2010	白银2010	1558	-	0	-	0	5	1549	1558	1549	0	0.00%	1651	1464	1549	1558	0	55		
ag2011	白银2011	1390	-	0	-	0	9	1390	1390	1390	-86	-5.83%	1564	1387	1471	1476	0	86		
ag2012	白银2012	2180	-	0	2219	23	21	2180	2219	2180	-39	-1.76%	2418	2019	2158	2219	0	159		
ag2101	白银2101	1718	1694	4	-	0	9	1718	1718	1718	0	0.00%	1872	1563	1741	1718	0	63		
ag2102	白银2102	1826	1826	2	-	0	20	1826	1826	1826	34	1.90%	1899	1684	1792	1792	0	6056		
ag2103	白银2103	-	-	0	1616	69	0	-	-	-	-	-	1761	1470	1592	1616	0	144		
沪银	沪铝	沥青	沪铜	燃料油	热轧卷板	沪镍	沪铅	螺纹钢	橡胶	沪锡	纸浆	不锈钢	线材	沪锌	黄金期权	铜期权	橡胶期权			
郑商所	大商所	上期所	中金所	能源所	组合行情															

实时行情



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

右键弹出菜单添加自选或者询价。

代码	名称	最新价	买价	买量	卖价	卖量	总量	今开	最高	最低	涨跌	涨幅%	涨停	跌停	昨收	昨结算	结算价	持仓量
AP303	苹果303	8742	8738	2	8741	1	2009	8895	8900	8706	-34	-0.39%	9566	7986	8885	8776	0	25198
AP304	苹果304	8717	8716	1	8721	1	608	8853	8853	8652	3	0.03%	9499	7929	8866	8714	0	18726
AP305	苹果305	8613	8613	2	8614	13	12.04万	8785	8785	8580	-38	-0.44%	9430	7872	8786	8651	0	196453
CF303	棉花303	14295	14290	468	14295	19	4.30万	14375	14390	14270	-30	-0.21%	15185	13465	14385	14325	0	153575
CF305	棉花305	14285	14280	819	14285	146	27.14万	14375	14410	14265	-60	-0.42%	15210	13480	14405	14345	0	738970
CF307	棉花307	14320	14310	196	14310	14	1.06万	14410	14435	14295	-55	-0.38%	15240	13510	14445	14375	0	78561
CJ303	干制红枣303	10150	10115	3	10115	10	19	10085	10150	10020	-15	-0.15%	11185	9145	10110	10165	0	1661
CJ305	干制红枣305	10380	10380	20	10380	10	1.73万	10405	10440	10250	-25	-0.24%	11450	9360	10365	10405	0	46894
CJ307	干制红枣307	10525	10495	2	10535	3	75	10550	10550	10400	-5	-0.05%	11585	9475	10525	10530	0	632
CY302	棉纱302	-	20325	1	-	0	0	-	-	-	-	-	20920	18550	19735	19735	0	0
CY303	棉纱303	-	20895	1	21990	1	0	-	-	-	-	-	21990	19500	20745	20745	0	1
CY304	棉纱304	-	20635	1	21700	2	0	-	-	-	-	-	22425	19885	21155	21155	0	3
CY305	棉纱305	21015	21000	2	21015	2	163	21055	21085	21055	55	0.26%	22300	20550	21070	21070	0	2014

右击菜单

支持自定义自选页签。

代码	名称	最新价	买价	买量	卖价	卖量	总量	今开	最高	最低	涨跌	涨幅%	涨停	跌停	昨收	昨结算	结算价	持仓量
CF_S0...	CF_S009-011	-300	-310	49	-295	7	599	0	0	0	0	-	0	0	0	0	0	0
CF009	棉—009	11415	11415	53	11420	193	2.82万	11440	11480	11290	-105	-0.91%	11985	11055	11460	11520	0	18828
CF011	棉—011	11715	11715	7	11725	49	599	11730	11770	11595	-130	-1.10%	12320	11370	11760	11845	0	1724

自选行情

### 3.3.2 T 型报价

期权合约支持 T 型报价。

代码	名称	最新价	买价	买量	卖价	卖量	总量	今开	最高	最低	涨跌	涨幅%	涨停	跌停	昨收	昨结算	结算价	持仓量
3561	4373	1	0.3436	0.3408	3	0.0000	0.00	0.3408	2.4500	0.0030	0.00	0.0000	25	0.0030	0.0031	257	69467	10693
2073	4875	1	0.2936	0.2909	5	0.0000	0.00	0.2936	2.5000	0.0042	0.00	0.0000	3	0.0040	0.0042	12	67296	10155
2660	2745	1	0.2469	0.2435	1	0.0000	0.00	0.2436	2.5500	0.0060	0.00	0.0000	64	0.0060	0.0062	56	52818	15982
10546	10610	10	0.1995	0.1980	47	0.0000	0.00	0.1980	2.6000	0.0098	0.00	0.0000	28	0.0093	0.0098	39	62502	44511
38767	18685	10	0.1533	0.1530	5	0.0000	0.00	0.1533	2.6500	0.0145	0.00	0.0000	22	0.0145	0.0146	184	71993	54852
90031	50599	5	0.1125	0.1122	102	0.0000	0.00	0.1122	2.7000	0.0238	0.00	0.0000	318	0.0238	0.0239	1	94380	93958
179165	75904	20	0.0764	0.0763	82	0.0000	0.00	0.0763	2.7500	0.0376	0.00	0.0000	114	0.0376	0.0377	57	97247	173658
229425	108939	79	0.0478	0.0477	31	0.0000	0.00	0.0477	2.8000	0.0589	0.00	0.0000	40	0.0588	0.0589	2	87984	184040
120421	102647	1	0.0279	0.0277	859	0.0000	0.00	0.0279	2.8500	0.0881	0.00	0.0000	34	0.0881	0.0882	2	28504	61420
67785	96868	4	0.0146	0.0145	55	0.0000	0.00	0.0146	2.9000	0.1253	0.00	0.0000	5	0.1253	0.1263	4	42539	24943
34742	73112	10	0.0073	0.0072	196	0.0000	0.00	0.0072	2.9500	0.1680	0.00	0.0000	1	0.1673	0.1680	4	10728	5211
12405	38523	89	0.0038	0.0037	15	0.0000	0.00	0.0037	3.0000	0.2139	0.00	0.0000	3	0.2139	0.2146	5	3626	3160

T 型报价

### 3.3.3 行情 K 线

双击打开行情 K 线信息。



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14



K 线

### 3.3.4 合约搜索

主界面直接输入合约代码，回车后，行情界面定位到指定合约行情。

代码	名称	最新价	买价	买量	卖价	卖量	总量	今开	最高	最低	涨跌	涨幅%	涨停	跌停	昨收	持仓
bu2203	沥青2203	-	-	0	-	0	0	-	-	-	-	-	-	736	678	70
cu2005	铜2005	42390	42390	178	-	0	52	42600	42640	42320	-170	-0.40%	44680	40430	4260	cu2005
cu2006	铜2006	57560	-	0	-	0	6	57000	57560	57000	-2320	-3.87%	62870	56880	6000	cu2006
cu2007	铜2007	-	-	0	-	0	0	-	-	-	-	-	60590	54820	5771	cu2007
cu2008	铜2008	-	-	0	-	0	0	-	-	-	-	-	43940	39750	4185	cu2008
cu2009	铜2009	42200	42110	2	42310	1	5	42120	42310	42120	-1550	-3.54%	45930	41560	4375	cu2009
cu2010	铜2010	-	-	0	-	0	0	-	-	-	-	-	48881	41640	4677	cu2010
cu2011	铜2011	43227	-	0	-	0	1	43227	43227	43227	1117	2.65%	45478	38741	4326	cu2011
cu2012	铜2012	-	-	0	-	0	0	-	-	-	-	-	43890	37387	4045	cu2012
cu2101	铜2101	40997	-	0	-	0	11	40950	40997	40950	1266	3.19%	41717	37744	4095	cu2101
cu2102	铜2102	43682	43682	5	-	0	24	43682	43682	43682	0	0.00%	45866	41497	4368	cu2102
cu2103	铜2103	42095	-	0	-	0	1	42095	42095	42095	44	0.10%	44153	39948	4208	cu2103
cu2104	铜2104	-	-	0	-	0	0	-	-	-	-	-	-	-	-	cu2104
cu2006C40000	铜2006C40000	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	cu2006C40000
cu2006C41000	铜2006C41000	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	cu2006C41000
cu2006C42000	铜2006C42000	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	cu2006C42000

合约搜索

### 3.3.5 价格监控

不管是标准合约、自定义套利合约，都可设置行情监控条件，系统自动监测行情，满足条件后合约行情变换背景色，进行预警提示，避免错过行情机会。



行情监控设置

### 3.3.6 自设套利

#### 3.3.6.1 设置套利组合

新增套利组合：自设套利页签→右击→新建



进入设置界面：输入合约（可检索双击，也可直接输入）



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

组合策略设置

切换 简易模式

输入合约

合约

上移

下移

删除

☐ 拆单

项目

所属策略

合约

方向

投机套保

手数乘数

容忍度

报单类型

高级设置

郑商所

大商所

上期所

中金所

能源所

广期所

快捷检索

参数名称

值

策略名称

品种名

到期日期

价格公式

最小价差

主动最小批量

主动最大批量

预设

取消

确定



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

点击预设完成参数填充；

组合策略设置

简易模式

合约

上移

下移

删除

拆单

项目

所属策略

郑商所

大商所

上期所

沪银

沪铝

沪金

沥青

沪铜

燃料油

热轧卷板

沪镍

沪铅

螺纹钢

橡胶

ru2209

ru2210

ru2211

ru2301

ru2303

ru2304

ru2305

ru2306

合约	方向	投机套保	手数乘数	容忍度	报单类型	高级设置
ru2210	同向	投机	1	0	GFD	编辑
ru2211	反向	投机	1	0	GFD	编辑

参数名称	值
策略名称	ru_S2210-2211
品种名	ru_S
到期日期	2210-2211
价格公式	p1-p2
最小价差	5
主动最小批量	1
主动最大批量	5

预设

取消

确定

点击预设填充参数

点击确定完成组合设置；

编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

组合策略设置

≡ 简易模式

合约

上移

下移

删除

☐ 拆单

郑商所

大商所

上期所

沪银

沪铝

沪金

沥青

沪铜

燃料油

热轧卷板

沪银

沪铅

螺纹钢

橡胶

ru2209

ru2210

ru2211

ru2301

ru2303

ru2304

ru2305

ru2306

项目

所属策略

合约	方向	投机套保	手数乘数	容忍度	报单类型	高级设置
ru2210	同向	投机	1	0	GFD	<div>编辑</div>
ru2211	反向	投机	1	0	GFD	<div>编辑</div>

参数名称

值

策略名称

ru\_S2210-2211

品种名

ru\_S

到期日期

2210-2211

价格公式

p1-p2

最小价差

5

主动最小批量

1

主动最大批量

5

预设

取消

确定

点击确定

**请注意：**→

以上设置为最简单的，**双被动模式**：即当行情满足时，策略同步把每一腿发出成交；

当套利中出现有一腿合约为**非活跃合约**时，请使用**主被动模式**；

点击编辑→模式主动→主动区域-1（减少撤单次数）



### 3.3.6.2 套利组合下单

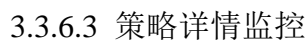
完成设置步骤后，可以在自设套利页签看到设置的组合：



双击买卖盘口，可快速同步策略至下单板：



选择买卖，输入价格，委托数量，选择账户即可完成下单；




组合委托：只显示自设套利策略下单，允许双击修改价格；

挂单	委托	条件单	组合委托	全部策略							
<input type="checkbox"/>	详情	指令号	合约代码	策略名称	运行状态	交易状态	买卖	开	合约		
<input type="checkbox"/>		L20220830002	sp S2209-2301	组合策略	运行中	已报	买入	自			
<input type="checkbox"/>		L20220830001	sp S2209-2301	组合策略	运行中	已报	买入	自			

点击详情，可以实时关注策略运行状态

编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

详情	指令号	合约代码	策略名称	运行状态	交易状态	买卖	开平	委托价格
	L202...	rb S22...	组合策略	已停止	已成	卖...	自动...	13

点击详情

详情显示框

L20221010001执行详情										
挂单详情		委托详情								
委托号	委托时间	状态	合约	买卖	开平	委托价格	委托数量	成交数量	撤单数量	投机套保
显示挂单										
成交详情		成交汇总								
成交编号	成交时间	合约	买卖	开平	成交价格	成交数量	投机套保	资金账号	委托号	
2	13:46:33	rb2301	买入	开仓	3824	1	投机	941000035	11	
3	13:46:33	rb2210	卖...	开仓	3960	1	投机	941000035	12	
显示成交										

请注意：

策略正常运行下无颜色提示，目前主要在以下情况出现颜色背景：

**绿色**：策略不满足运行情况。如：非交易时间，非交易状态，盘口数量不满足等；

**黄色**：策略单边成交，另一腿处于挂单状态。注意：黄色只为警示状态，策略仍可正常运行追单；

**红色**：策略异常废单。如：资金不足，仓位不足；

### 3.4 标准交易

标准下单板支持证券、期货、股票期权下单，包括标准下单、标准组合套利下单、套

保下单、移仓下单、备兑下单。



下单板

标准 三键 组合 条件

账户 期 941000035(GTN...

合约 CF303 套保

棉花303

买卖 买入 卖出

自动 开仓 平仓 平今

对手价 14305

数量 23

15185

14305 / 22

14300 / 251

13465

≤23

下单 追单

标准下单板



下单板

标准 三键 组合 条件

账户 000035(GTN000035全)

期 941000035(GTN000035全)

合约 CF303 套保

棉花303

对手价 14310

数量 23

15185

14310 / 204

14305 / 68

13465

≤1000

14310 买开 23 手

14305 卖开 23 手

14305 平仓

三键下单板

下单板策略交易:下单板整合策略方便下单



系统->交易设置->下单面板->启用策略单

### 3.5 交易信息

实时显示交易信息，包括挂单、委托、成交、持仓等信息。

1. 挂单、委托信息：支持按挂单委托、成交委托等类型切换委托信息，支持撤单、全撤便捷操作；
2. 成交信息：支持按明细、合约、委托、成交价等多种方式汇总，支持选中需要统计的数据，进行汇总统计；
3. 持仓信息：支持快捷平仓、快捷反手等功能。

挂单(F1) 委托(F2) 条件单(F3) 组合委托(F4) 循环单											全仓(G)		持仓(F6)		策略持仓(F7)		成交(F8)		资金(F9)		平1/3		平1/2		全平		快捷操作	
委托号	委托时间	状态	合约	合约名	买卖	开平	委托价格	委托数量	成交数量	成交均价	挂单数量	合约	合约名	总持仓	总可用	今仓	今可用	买卖	成本价	持仓均价	最新价							
CF007			棉—007			1	1	0	0	买入									11220.0	11235.0	11095							
CF009			棉—009			5	5	0	0	买入									13950.0	11520.0	11390							
MA006			甲酯006			13	13	0	0	卖出									1860.2	1652.0	1661							
SR003						1	1	0	0	买入									5881		0	0						
a2005			黄豆2005			2	2	0	0	卖出									4120.5	5191.0	5185							
b2005			豆二2005			1	1	0	0	买入									2913.0		3019.0	0						
m2005			豆粕2005			1	1	0	0	买入									2800.0		2720.0	2531						
z2005			玉米2005			1	1	0	0	卖出									1613.0		2032.0	1800						
全部委托(A) 挂单委托(G) 成交委托(T)																												

## 4 策略交易

## 4.1 条件单、止盈止损

条件单

×

合约

AP912

账户

期 6662306(F2—资个人... ▼)

条件

☒ 价格条件单

最新价 > 0

☐ 时间条件单

☐ 开盘触发单

☐ 手动触发单

该品种当前已连续交易

订单

买 ▼

开仓 ▼

1 手

对手价 ▼

☐ 超价(Tick)

0

时效

当天有效 ▼

☐ 附加条件

价格 < 0

止损

止损止盈 ▼

\*止盈止损单永久有效

止损价差 0

止盈价差 0

确定

取消

## 条件单、止盈止损





编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

挂单(F1)		委托(F2)	条件单(F3)	组合委托(F4)										
时间	编号		类型	状态	合约	条件	买卖	开平	数量	委托价格	超价(Tick)	开仓价格	止损盈类型	止
2019-11-01 13:44:46	CE20191101134446563		价格条件单	运行	AP912	价格>0	买入	开仓	1	对手价	-		不设置	
										发送				
										停止				
										删除				
										刷新				
<div><input checked="" type="radio"/> 条件单(R) <input type="radio"/> 止损盈单(I)</div>														



下单板

标准 合约 ag S2006-2007 ☐ 云指令

买卖 ☐ 买入 ☒ 卖出

组合 对手价 1557 数量 1

合约	方向	账户	开平	投保	乘数
ag2006	卖	135400-002 快期simnow	自动	投机	1
ag2007	买	135400-002 快期simnow	自动	投机	1

策略类型 循环单 反向价格 1560 次数 1

下单

循环单

## 4.4 批量委托

将大单拆分成  $n$  个批次，支持按一定的价差，进行批量一键委托。



批量委托

账户 期 6662307(...)

合约 sc2011 套保 ☐

原油2011

买卖 ☒ 买入 ☐ 卖出

自动 ☒ 开仓 ☐ 平仓 ☐ 平今

对手价 312.2 312.2 288.1

数量 10

拆分笔数 2

价差 1

下单

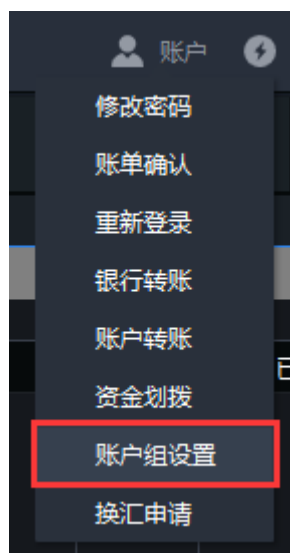
批量委托

## 4.5 账户组报单


账户组报单是将多个账户编为一组，每个账号按照一定的倍率或者权重来进行报单的下单方式，可以提高交易员要对多个相关性较高的账户报单的效率。

### 4.5.1 账户组设置

通过页面右上角菜单账户-》账户组设置进入账户设置界面：





账户组设置

也可以通过策略-》账户组报单打开下单面板，点击账户组报单面板上的设置按钮打开账户组设置界面。



账户组报单

设置界面操作步骤：

- 点击新增，会新增一个账户组，输入组名后回车。
- 可选账户是所有登录的账户，账户组报单我们通常使用多账户登录多个交易账号或者登录机构版账号。勾选所有将要编成一组的账号。
- 然后点击按钮，添加到已选账户列表。
- 点击，可以切换模式



目前有以下两种模式：

1) 倍率模式：已选账户的报单数量=下单数量\*各已选账户的倍率，例如下单 100 手，某已选账户倍率为 1.333，则报单数量=100\*1.333，向下取整为 133 手。

2) 权重模式：已选账户的报单数量=下单数量\*各已选账户的权重占总权重的百分比，报单数量向下取整。例如有两个已选账户权重依次为 1 和 2，报单数量为 4，则两个子账户分别报单  $4 \times \frac{1}{3} = 1$  手和  $4 \times \frac{2}{3} = 2$  手。

优先级是指每个账户在账户组报单时的报单顺序，可以双击优先级列的单元格设置每个账户的优先级，优先级的数值越小，报单优先级越高。

设置完毕后点击确定就会保存设置。

## 4.5.2 账户组报单

在账户组报单面板上选择要交易的账户组，剩下的几乎和普通报单一致，点击下单后会出现下单确认窗口，点击确定即可进行报单。



The screenshot displays the 'Order Management' (订单管理) interface. The top navigation bar includes tabs for '挂单(F1)', '委托(F2)', '条件单(F3)', '组合委托(F4)', and '循环单'. The '组合委托(F4)' tab is active, showing a table of orders. The table has columns for '详情', '指令号', '合约代码', '策略名称', '运行状态', '交易状态', '买卖', '委托价格', '委托数量', and '成交'. A red box highlights the first row of data.

详情	指令号	合约代码	策略名称	运行状态	交易状态	买卖	委托价格	委托数量	成交
🏠	L20210402001	CF107	Group...	运行	已报	卖出	14060	3	

Below the table, there are buttons for '全部', '运行', and '结束'. The right-hand panel shows the '账户' (Account) section with 'ctp账户组' selected. It displays '合约' (Contract) as 'CF107' and '品种-107'. The '买卖' (Buy/Sell) section shows '卖出' (Sell) selected. The '开平' (Open/Close) section shows '开仓' (Open) selected. The '对手价' (Opponent Price) section shows '14060' and '14065'. The '数量' (Quantity) section shows '3'. A green '下单' (Place Order) button is at the bottom. The '资金(F9)' (Funds) section on the far right shows a table of '目' (Item), '今仓' (Today's Position), '今可用' (Today's Available), and '买卖' (Buy/Sell).

目	今仓	今可用	买卖
5	0	0	买入
1	0	0	卖出
1	0	0	卖出
2	0	0	卖出
2	0	0	买入
1	0	0	买入
2	0	0	卖出
2	0	0	买入

[illegible]

### 4.5.3 账户组套利报单

在账户组报单面板上选择要交易的账户组，合约选择组合合约，可以修改组合参数；

编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

账户组报单

账户

test

合约

bu\_S2304-2305

买卖

☐ 买入
☒ 卖出

对手价

-4

数量

1

下单

合约	买卖	开平	投机套保	乘数	容忍度
bu2304	卖出	自动(默认优先平今)	投机	1	0
bu2305	买入	自动(默认优先平今)	投机	1	0

## 4.6 twap

时间均价策略，设置固定间隔时间下单；

数量

23

策略

TWAP

1;6;12

下单

单笔数量

1

报单间隔

6

撤单间隔

12

开始时间

13 : 18 : 55

结束时间

00 : 00 : 00

重置

## 4.7 狙击单

价格狙击策略：行情对手价格到达指定价格时按盘口比例下单直至完全成交；

对手价

14315

数量

23

策略

狙击单

50

下单

狙击比例

50

重置

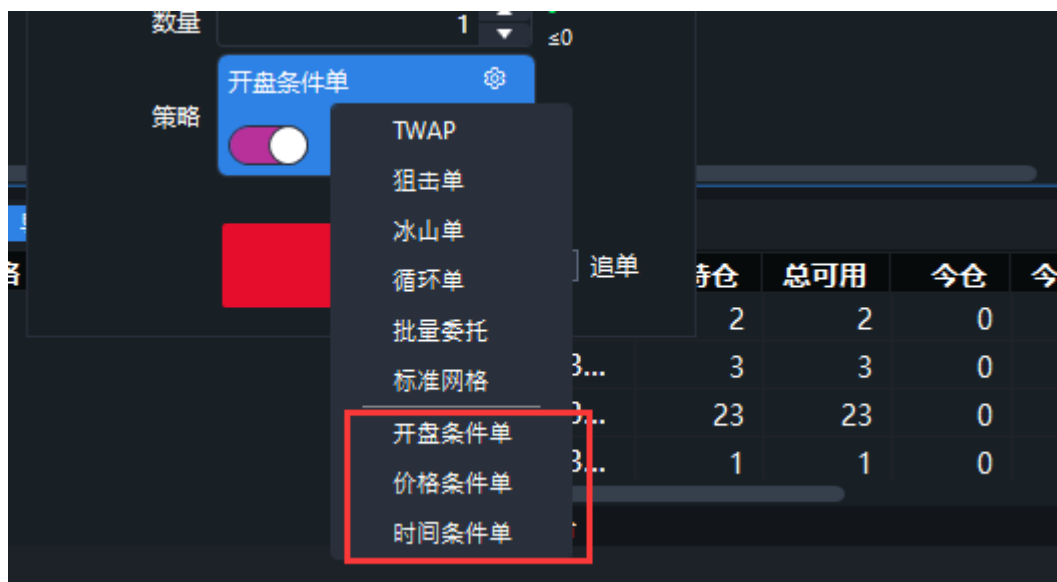
## 4.8 标准网格:

网格交易策略，指定网格数量和价差实现，低买高卖循环套利策略



## 4.9 下单板条件单

支持开平、价格、时间条件单



## 4.10 文件下单(需要申请)

设置固定格式 excel 文件，通过 twap 策略下单





编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

文件跟单

基准持仓

合约代码

请输入合约

净持仓

0

下单

账号

合约代码

合约名

交易所

数量

文件信息

文件名:

记录数量:

读取状态:

最近更新:

文件设置

☐

定时刷新:

1

增减范围:

10

TWAP参数

报单比例:

20

最小报单:

5

报单间隔:

6

撤单间隔:

12

允许报单

资金账号

名称

倍率

盯市总盈亏

平仓盯市盈亏

持仓盯市盈亏

跟单监控

手动同步

持仓管理

资金账号

合约代码

合约名

基准持仓

综合倍率

目标持仓

持仓数量

多头持

资金账号

合约代码

合约名

持仓数量

多头持仓

空头持仓

## 5 组合策略交易

组合策略为满足用户自定义交易组合而设计，具有设置灵活，交易方便，能很好的满足用户多品种交易的需要。用户可以把不同交易所，不同品种，同品种不同期限的品种定义成一个组合策略，并设置合约、手数配比、价差公式、追单等策略参数，进行一键下单，系统自动监控行情，进行策略触发及执行，异常信息实时提示，提供导入、导出、统计分析等功能，便于盘后复盘和次日的交易。

### 5.1 组合设置

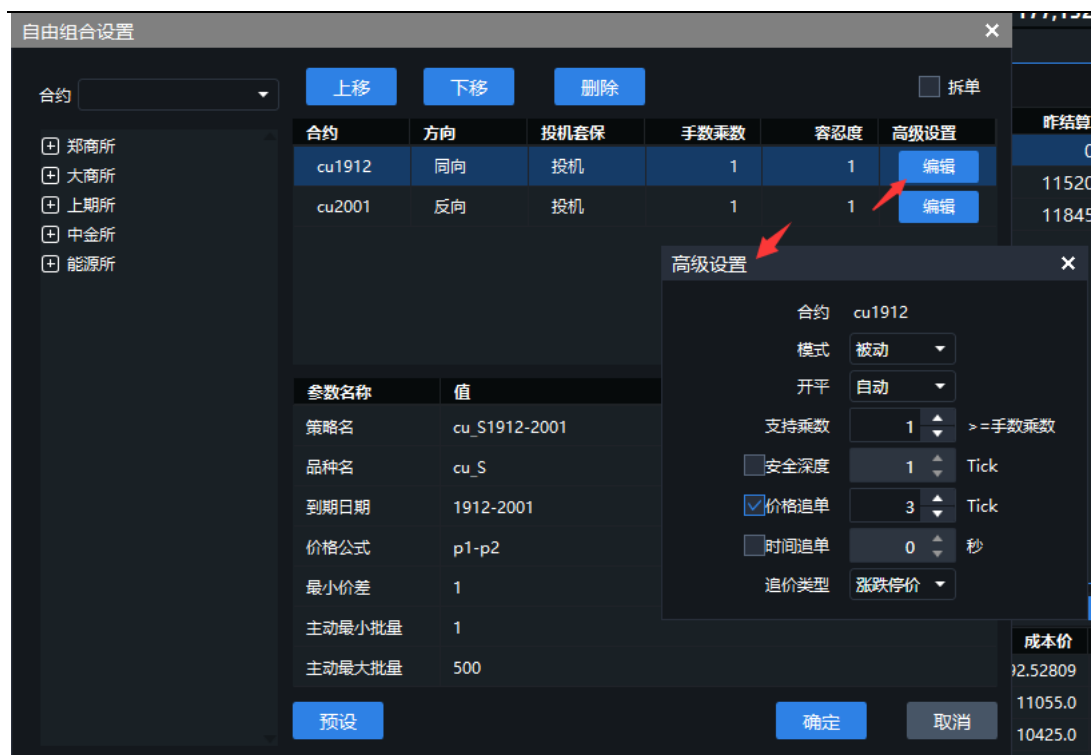
在组合策略界面中可以增加新的组合策略，或者修改、删除已经存在的组合策略策略。

自由组合						
<div> <span>全部</span> <span>新增</span> <span>修改</span> <span>删除</span> <span>导入</span> <span>导出</span> </div>						
	自由组合合约	各腿名称	价差公式	最小价差	最小批量	最大批量
CF_S	CF_S009-011	CF009&CF011	p1-p2	1	1	500
cu_S	cu_S1912-2001	cu1912&cu2001	p1-p2	1	1	500
MA_S	MA_S001-002	MA001&MA002	p1-p2	1	1	500
rb	rb1911-2002	rb1911&rb2002	p1-p2	1	1	3
rb_S	rb_S1912-2003	rb1912&rb2003	p1-p2	1	1	5
股指	股指IF IC T	IF1908&IC1908&T19...	p1+p3-2*p2	1	1	3
锌-境内外套利	锌-境内外套利12-03	zn1912&LME/zs/3M...	(p1-120)/1.1...	0.5	1	5

组合策略列表

点击‘增加’或‘修改’可进行组合策略合约的设置。如果是修改已有组合策略的参数，那么新修改的值不会影响当前已经运行（下单）的策略。

一组组合策略中最多支持设置 9 腿合约。组合策略中的合约顺序跟价差公式息息相关，需注意，避免价差计算错误，第一腿合约为‘p1’、第二腿合约为‘p2’以此类推。



组合策略设置

## 5.2 参数说明

### 5.2.1 组合参数

#### ◆ 方向

可以选择“同向”或者“反向”。组合下单时，买卖方向为“买”时，组合设置中“同向”合约为“买”，“反向”合约为“卖”；组合下单时，买卖方向为“卖”时，组合设置中“同向”合约为“卖”，反向合约为“买”。

组合下单买卖方向	各腿合约设置方向	各腿合约报单买卖方向
买入	A 合约：同向	A 合约：买入
	B 合约：反向	B 合约：卖出
卖出	A 合约：同向	A 合约：卖出
	B 合约：反向	B 合约：买入

#### ◆ 手数乘数

组合策略中合约的下单比例，可设置为大于等于 0 的整数、小数，其中设置为 0，表

示该合约不发生实际交易，可用于价格公式计算的参考合约。

组合策略按照手数乘数的倍数成交，组合策略执行完后，各腿合约成交数量=组合下单量\*手数乘数，按整数成交，若为小数，进行四舍五入。

#### ◆ 支持乘数

为了保证组合策略成交，被动腿的盘口必须满足支持乘数设置的值，主动腿才发单，

如：主被动手数乘数 1:3，避免主动腿成交后，被动腿盘口量可能不足 3 手，为了保证成交，可设置被动腿支持乘数 5，当被动腿盘口满足 5 手时，主动腿才发单。

设置得越大，单腿几率越小，滑点几率越小，但是相应成交几率也越小。

#### ◆ 模式

可以选择“主动”或“被动”两种模式，组合策略中最多只能有一个合约设置为“主动”。“主动”指策略行情满足后，“主动腿”优先发单，“主动腿”成交后，“被动腿”再按对应手数比例，以对手价±容忍度发单，保证成交；全被动模式，指策略行情满足后，组合策略中的“被动腿”同时以对手价±容忍度进行发单。

#### ◆ 开平

可以选择“开仓”、“平仓”或“自动”。“自动”：下单手数小于等于持仓手数，则优先平仓，若下单手数大于持仓手数则直接开仓不平仓；不支持超出部分反向开仓，如：买 6 手，空仓 5 手，选择“自动”，由于下单手数大于持仓手数，则直接买开 6 手。

#### ◆ 容忍度（被动腿选项）

被动腿合约的成交价可以接受的滑点范围，用正整数 N 设定，指价格向较差方向的 N 个 tick 进行挂单，成交价格可能存在一定滑点。

设置得越大，滑点可能越大，成交机会越大。

#### ◆ 安全深度（被动腿选项）

设置正整数 N。当被动腿不满足支持乘数时，主动腿的挂单价格向更不利于成交的价格变动 N 个 tick 以获得更好的主动腿成交价。

#### ◆ 最小移动（主动腿选项）

针对主动腿有效，限定被动腿价格变化的幅度。设置正整数 N，默认为 1，即被动腿价格变化 1tick，则主动腿改单；如设为 2，则被动腿价格变化 2tick，则主动腿改单，以此类推。

设置得越大，撤改次数相应减少，但可能增加滑点。

#### ◆ 主动区域（主动腿选项）

设置正整数 N，根据被动腿对手价及策略价差算出的主动腿挂单价格和主动腿市场价格相差 N 个 tick 范围之内，主动腿才会挂单。设置为 0，则表示主动腿只会在最好的价格才发单，如果设置为 1，则表示主动腿只会在市场上的最好价格和比最好价格差 1 个 tick 的时候发单，以此类推，主动区域最大可设置为 5。

设置得越小，撤改次数相应减少。

#### ◆ 价格追单（被动腿选项）

设置正整数 N。被动腿下单后立即没有成交，当市场价格朝不利于成交的方向变动超过 N 个 tick 时，系统将被动腿挂单撤回，内盘合约以涨跌停价、外盘合约以对手价进行追单，确保被动腿挂单全部成交，避免策略单边。

成交价格可能存在一定滑点，但可避免策略单边。

#### ◆ 时间追单（被动腿选项）

设置正整数 N，单位为秒，超过 N 秒，单腿的挂单还未成交，系统将被动腿挂单撤回，内盘合约以涨跌停价、外盘合约以对手价进行追单，确保被动腿挂单全部成交，避免策略出现死单现象，即：被动腿行情稳定，挂单未成交，但组合策略价差出现更好机会，但因为挂单未成交，下一批次未触发，此时设置时间追单，到达时间后，通过追单完成上一批次挂单，并开始执行下一批次策略；

成交价格可能存在一定滑点，但可避免策略单边。

#### ◆ 追价类型（被动腿选项）

可设置被动腿追单时的价格类型，包括‘涨跌停价’、‘对手价’、‘对手价+容忍度’；

一定程度上可控制滑点的范围。

## 5.2.2 策略参数

### ◆ 价格公式

策略价差以价格公式及对应合约的对手价为基础计算；

价格公式中可包含“+、-、\*、/、（）”；

价格公式中的合约用 p1、p2...等表示，p1 表示第一腿合约、p2 表示第二腿合约，以此类推。

### ◆ 最小价差

设置相关组合策略价差的显示精度，如：保留小数点后三位，设置为：0.001。如数值设置过大，则买/卖价可能相同。

### ◆ 主动最小批次

可设定为任意正整数，表示限定每组策略挂单数量的下限，如：设定主动最小批次为 3，那么成交以至少 3 手及以上成交，以此类推。

### ◆ 主动最大批次

可设定为任意正整数，表示每组策略挂单的最大数量，如：希望成交 50 手，但不想同时挂单进市场。此时，若设定最大批次为 5，系统将分至少 10 次挂单，每次最多挂 5 手。

### ◆ 拆单

勾选‘拆单’，组合下单时，会根据乘数的最小比例，进行拆单；

如：A、B 两个合约，乘数分别为 100、100，主动最小批次为 1，主动最大批次为 5，勾选‘拆单’，组合策略下单 1 组，当行情满足时，A、B 分别以 5 手、5 手一批进行发单，策略执行完，A、B 分别下满 100 手；

不勾选，按照设置的乘数，进行发单；

如：A、B 两个合约，乘数分别为 1、1，主动最小批次为 1，主动最大批次为 5，不勾选‘拆单’，组合策略下单 100 组，当行情满足时，A、B 分别以 5 手、5 手一批进行发



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

单，策略执行完，A、B 分别下满 100 手；

## 5.3 组合行情

### 5.3.1 实时行情

可将组合策略合约添加至自选行情页签中，便于查看实时行情报价。

行情		自选行情		K线														
自选合约		铜		铜期铜		+												
代码	名称	最新价	买价	卖价	买量	卖量	总量	今开	最高	最低	涨跌	涨幅%	涨停	跌停	昨收	昨结算	结算价	持仓量
CF_S0...	CF_S009-011	-310	-310	29	-295	43	611	0	0	0	0	-	0	0	0	0	0	0
CF009	棉-009	11455	11440	185	11445	74	326万	11440	11480	11290	-65	-0.56%	11985	11055	11460	11520	0	19246
CF011	棉-011	11765	11740	43	11750	29	611	11730	11770	11595	-80	-0.68%	12320	11370	11760	11845	0	1726

组合行情

### 5.3.2 组合 K 线

支持自定义组合套利合约的行情 K 线，便于观察行情、趋势分析。



组合 K 线

## 5.4 组合下单

下单板切换至‘组合’，选择组合策略合约，支持对组合合约参数进行修改，确认后，进行一键下单。

下单板

标准

合约

CF\_S105-107

▼

☐ 云指令

买卖

☒ 买入
 ☐ 卖出

三键

对手价

45

▲▼

数量

0

▲▼

组合

合约	方向	账户	开平	投保	乘数	容忍度
CF105	买	期 1013 ▼	自动 ▼	投机 ▼	1	0
CF107	卖	期 1013 ▼	自动 ▼	投机 ▼	1	0

条件

策略类型

无

▼

下单

组合下单

## 5.5 组合委托

组合策略下单后，可以切换到组合策略委托面板查看该策略执行情况。可点击‘详情’查看其详细委托、成交执行情况。

挂单

委托

条件单

组合委托

全部策略

详情

指令号

L20230116001

合约代码

bu S2304-2305

策略名称

组合策略

运行状态

运行中

交易状态

已报

买卖

卖出

开平

自动(默认优先平今)|自动(默认优先平今)

组合委托

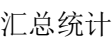
## 5.6 汇总统计

在‘组合委托’界面，点击‘指令汇总’，弹出汇总界面，选中需要统计的委托信息，点击‘汇总’，系统按照合约、策略维度进行汇总统计成交价格、成交数量，便于做统计





分析。



## 汇总统计

## 6 期权交易

### 6.1 组合交易

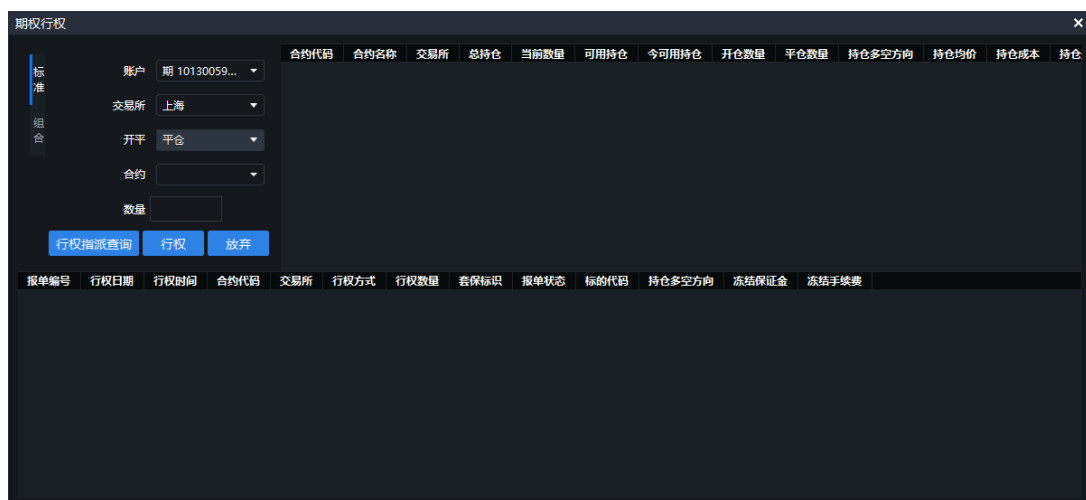
支持期权组合监控图绘制，支持分析期权行情，构建期权组合，借助分析指标对期权组合进行下单，同时可以对已有的期权组合进行对冲操作。



期权组合交易

### 6.2 期权行权

支持期权行权、期权组合行权、行权指派查询等功能。



期权行权



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

行权指派查询

账户

账号	交易所	对应标的合约	合约代码	持仓类别	期权类型	行权价	行权数量	交易
----	-----	--------	------	------	------	-----	------	----

行权指派记录[0]条

行权指派查询

6.3 锁定解锁

支持对证券持仓进行备兑锁定解锁，便于期权的备兑开仓。

备兑转换

账户 权 921650377(测试0377)

证券代码

数量 0

锁定 解锁

证券代码	可锁定	可解锁
------	-----	-----

锁定报单编号	账户	交易所	标的代码	锁定类型	锁定数量	报单状态	交易日	锁定时间	错误信息	报单发起方
--------	----	-----	------	------	------	------	-----	------	------	-------

锁定解锁



编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

## 6.4 组合拆分

支持期权组合拆分业务，进行保证金释放。

1. 组合：通过组合策略、两腿合约，进行期权策略组合；
2. 拆分：通过“组合持仓编号”将组合持仓拆分为单腿持仓。

组合

拆分

账户

权 94100003...

交易所

上海

组合策略

认购牛市价差

合约1

合约2

数量

0

<=0

组合

合约	合约名	总持仓	总可用	今仓	今可用	买卖	成本价	最新价	持仓盈亏	持仓盯市盈亏	保证金	币种	投机
10001991	50ETF购6月2853A	1	1	0	0	买入	0	0.0489	32.57	0.00	0.00		投机
10001995	50ETF购6月3149A	1	1	0	0	买入	0	0.006	-5.03	0.00	0.00		投机

委托号

委托时间

状态

交易所

组合持仓编号

合约名1

合约名2

组合指令类型

组合策略

委托数量

投机名称

委托详情

资金账号

期权组合策略-组合

组合

拆分

账户

权 94100003...

交易所

上海

组合策略

认购牛市价差

组合持仓编号

数量

0

<=0

拆分

组合持仓编号	合约1	合约名1	合约2	合约名2	组合策略	昨持仓量	总可用	今持仓量	今拆分量	保证金	资金账号
--------	-----	------	-----	------	------	------	-----	------	------	-----	------

委托号

委托时间

状态

交易所

组合持仓编号

合约名1

合约名2

组合指令类型

组合策略

委托数量

投机名称

委托详情

资金账号

期权组合策略-拆分

## 7 其他

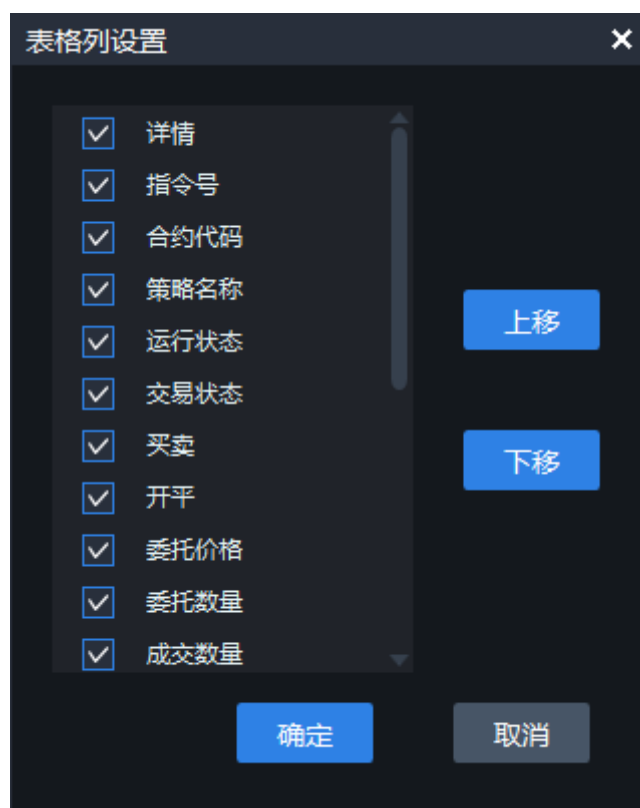
### 7.1 表格调整

交易信息、行情等表格，支持自适应列宽、表格列设置，通过鼠标右键选择。

1. 自适应列宽：根据表格内容自适应，显示全部表格内容；
2. 表格列设置：选择显示隐藏列，调整列顺序。



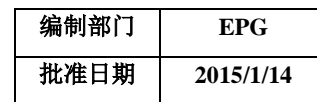
表格属性



表格列设置

## 7.2 自定义布局

支持自定义布局，满足个性化布局需求。鼠标选中需要拖动的面板，将面板拖动至其他区域即可。



## 自定义布局

支持交易设置、策略设置、声音设置、程序设置等选项设置，设置全局起效。



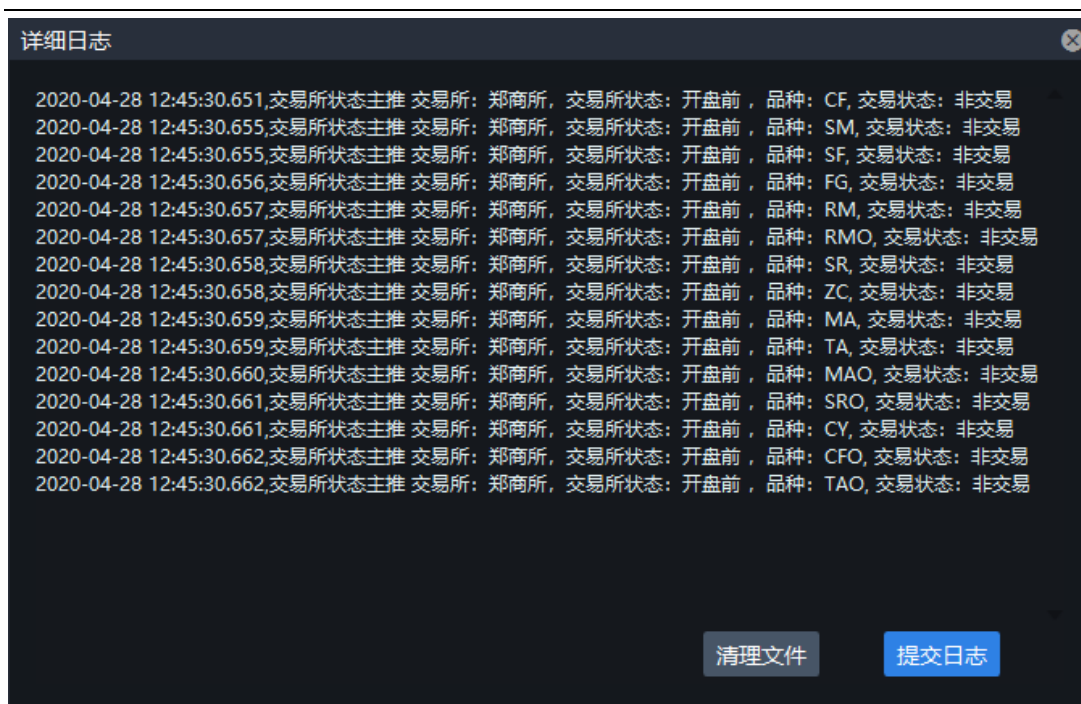
选项设置

## 7.4 日志信息

支持详细日志查看及提交。

1. “详细日志”可以通过双击主界面左下角日志提示区，将弹出详细日志界面；
2. 如果遇到系统问题可以通过“提交日志”，MT 终端产品团队会及时分析解决问题。

编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14



详细日志

## 7.5 意见反馈

关闭系统时会提示意见反馈，反馈信息将及时传达到 MT 终端产品团队，以便后续提供更好的产品服务。

意见

感谢使用MT专业版投资工具，热线电话: 0571-26693435

如有任何意见和建议，请在下面反馈

联系方式:

意见和建议:

提交并退出

直接退出





编制部门	EPG
批准日期	2015/1/14

---

意见反馈