

目录

一、	系统基本界面及操作	3
(一)	界面简介	3
(二)	登录界面	3
	账户冻结	3
(三)	退出系统	4
(四)	系统消息	4
(五)	版本更新	5
二、	软件主要功能	5
(一)	下单信息查询	5
1.	委托信息	5
2.	成交查询	5
3.	所有挂单	6
4.	持仓查询	6
(二)	普通下单	6
1.	限价	7
2.	市价	7
3.	限价止损	7
4.	市价止损	7
(三)	改单	8
1.	常规改单	8
2.	快速改单	8
(四)	快速下单	9
1.	选择快速模式	9
2.	快速下单超价设置	9
3.	快速下单默认开平仓数量设置	9
(五)	止损止盈单	10
1.	新增止损止盈单	10
2.	追价止损	11
3.	止损止盈设置注意点	12
4.	修改止损止盈单	12
5.	撤销止损止盈单	13
6.	查询止盈止损单	13
7.	止盈止损单状态说明	13
(六)	条件单	13
1.	新增条件单	13
2.	修改条件单	14
3.	删除条件单	15
4.	条件单状态说明	15
(七)	炒单手	15
1.	使用炒单手	15
2.	条件自动下单	17
(八)	自定义策略	18
1.	新增自定义策略合约	18

2. 修改自定义策略合约	23
3. 删除自定义策略合约	23
(九) 下单参数设置	24
1. 下单设置	24
2. 撤单设置	25
3. 状态与提示设置	25
(十) 下单默认量设置	26
(十一) 下单快捷键	26
1. 快速超价	26
2. 快速平仓	27
3. 快速撤单	27
三、服务器重连功能	27
(一) 交易服务器重连	27
(二) 行情服务器重连	27
(三) 内盘连接	28
四、其他功能	28
(一) 锁定	28
1. 立即锁屏	28
2. 定时锁屏	29
(二) 密码更改	29
(三) 显示挂单/成交	29
(四) 显示挂单/持仓	29
(五) 自适应列宽	30
(六) 显示隐藏报价	30
(七) 设置显示合约	30
(八) 列表风格设置	31
(九) 显示设置	32
五、行情显示	32
(一) 显示五档行情	33
(二) 五档自动填单	33
六、常用操作快捷键	33
七、问题解决	34

一、系统基本界面及操作

提供了软件辅助界面介绍,包括主界面、登录退出界面、系统消息界、版本更新界面等。

(一) 界面简介

下图为鼎赢交易系统的主界面。从上至下包括了菜单栏、行情栏、下单栏、信息栏以及账户信息等。

The screenshot displays the main interface of the Dingying Trading System. At the top, there is a title bar with the text '交易系统 V1.8.136 交易服务器正常 行情服务器正常 内盘服务器断开 模拟盘 当前登录ID: 001011 客户: 测试001011'. Below the title bar is a menu bar with options like '连接(L)', '交易查询(Q)', '其他查询(O)', '系统设置(S)', '内盘交易(I)', and '系统帮助(H)'. The main area is dominated by a large table of market data with columns for '交易所', '名称', '货币', '合约', '最高价', '前收盘', '最新价', '买价', '卖价', '买量', '卖量', '成交量', '最低价', '持仓量', '现手', and '前结算'. Below the table is an order entry section with dropdown menus for '交易市场', '商品', '合约代码', and '买/卖', along with input fields for '限价止价', '委托数量', '委托价格', and '有效日期'. There are also buttons for '买入(B)' and '卖出(S)'. At the bottom, there is a status bar with system time and account information.

(二) 登录界面

1. **登录**: 打开客户端用户登录界面;

The screenshot shows a '用户登录' (User Login) dialog box. It contains the following fields and options:

- 用户帐号: 001003
- 用户密码: (empty)
- 行情服务器: 10.0.0.80(上海电信)
- 交易服务器: 192.168.1.139(上海三网合一)
- 复选框: 模拟盘, 记住帐号
- Buttons: 登录, 取消, 检查更新

2. **输入信息**: 选择实盘或者模拟盘 (不勾选即进入实盘), 输入用户名以及密码, 选择行情服务器;
账户冻结: 输入正确用户名后密码连续输入错误 5 次立即自动冻结该账户, 冻结后请联系公司客服解冻。
3. **保存账号**: 勾选记住账号即在下次打开登录界面时, 用户账号自动显示之前保存的登录用户账号;

4. **进入系统**: 点击**登录**进入系统, 点击取消退出登录;
5. **重新登录**: 进入客户端主界面后点击左上角**连接**菜单, 选择**重新连接**, 则重连交易服务器。



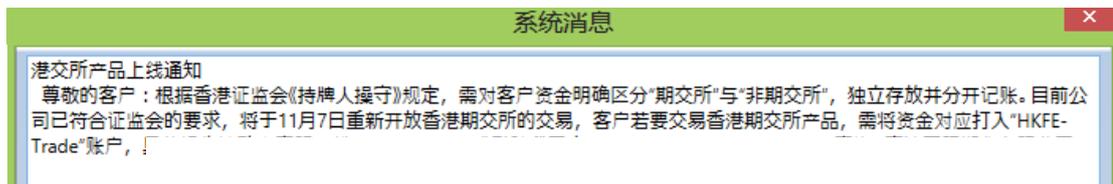
(三)退出系统

1. **退出系统**: 进入客户端主界面后点击左上角连接菜单, 选择**退出系统**或者在客户端界面点击右上角×键直接退出。



(四)系统消息

1. **显示**: 登录客户端后自动弹出系统消息框;



2. **不显示**: 勾选左下角**启动时不再显示**则后关闭则下次登录时不会弹出;

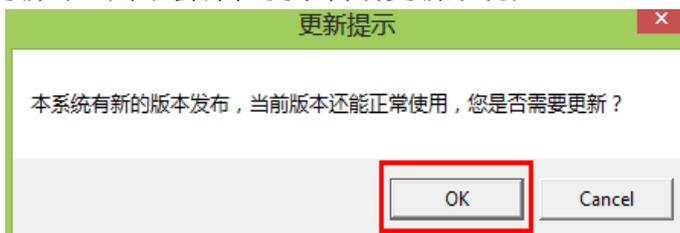


3. **显示设置**: 在客户端菜单栏中点击其他查询->**系统消息**, 则上图中系统消息框会弹出, 左下角启动时不再显示框可勾选或者取消勾选; 在客户端菜单栏中点击其他查询->**个人消息**, 则显示个人消息。

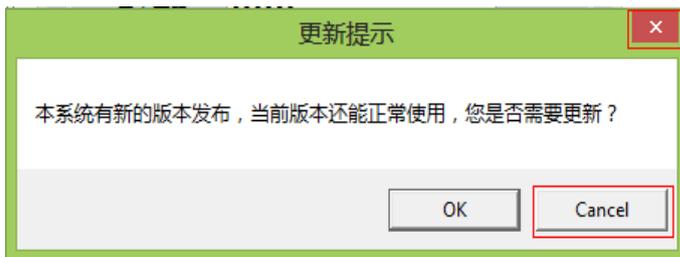


(五) 版本更新

1. **版本更新**: 当有新版本发布时会弹出更新提示框, 点击 **OK** 即自动更新后进入系统; 有些版本必须更新时, 则不会弹框提示自动更新系统;



2. **退出更新**: 无需更新则点击 **Cancel** 键或者右上角×键, 则不做更新直接登录系统。



二、软件主要功能

(一) 下单信息查询

1. 委托信息

委托信息: 该查询页面可查询所有下单信息, 包括完全成交、部分成交、已排队、已撤销、资金不足、指令失败等状态的下单, 重新载入数据后只会显示**完全成交**、**部分成交**、**已排队**、**已撤销**状态的单子。

交易市场	商品	合约代码	买卖	定单类型	委托价格	委托数量	触发价格	买入(B)	卖出(S)
<input type="checkbox"/> 快速(K)	CME	英镑	6B1303	买	限价	1.6211	50		

合约	合约名称	买卖	委托价	委托量	成交均价	成交量	委托状态	委托时间	委托日期	撤单时间	反馈信息	系统号	本地号	定单类型	下单类型	交易所	货币	资金账号	定单编号	合约
6A1212	澳元1212	买	1.0540	50	1.0540	50	完全成交	17:48:38	2012-12-17		报单成功	00000018100004	20121217000004	限价单	电子单	CME	美元	00000018	1000016	
6A1212	澳元1212	买	1.0540	50	1.0540	50	完全成交	17:48:37	2012-12-17		报单成功	00000018100003	20121217000003	限价单	电子单	CME	美元	00000018	1000015	
6B1212	英镑期货1212	卖	1.6201	2	1.6201	2	完全成交	18:26:39	2012-12-17		报单成功	00000018100002	20121217000002	限价单	电子单	CME	美元	00000018	1000014	
6A1212	澳元1212	买	1.0534	50	1.0534	50	完全成交	18:05:02	2012-12-17		报单成功	00000018100001	20121217000001	限价单	电子单	CME	美元	00000018	1000013	

持买: 0 持卖: 0

F9委托信息 | F1成交查询 | F4所有挂单 | F5持仓查询 | F7资金查询

2. 成交查询

成交查询: 包括合计、小计、明细、自成交以及调期明细页面。

交易市场	商品	合约代码	买卖	定单类型	委托价格	委托数量	触发价格	买入(B)	卖出(S)
<input type="checkbox"/> 快速(K)	CME	英镑	6B1303	买	限价	1.6211	50		

合约	合约名称	买卖	价格	数量	交易所	货币	合约类型	权利金
6B1212	英镑期货1212	卖	1.6201	2	CME	美元	期货	
6A1212	澳元1212	买	1.0538	150	CME	美元	期货	

合计: 分客户、分合约、分买卖进行合计

合计 | 小计 | 明细 | 自成交 | 调期明细

F9委托信息 | F1成交查询 | F4所有挂单 | F5持仓查询 | F7资金查询

- 合计：按合约以及买卖方向显示所有成交信息；
- 小计：按合约、买卖方向以及价格显示成交信息；
- 明细：默认成交时间由近至远排序显示每一个成交信息；
- 调期明细：针对 LME 市场合约，显示所有调过期的 LME 持仓。

3. 所有挂单

所有挂单：该页面显示所有排队中的挂单信息，还提供显示挂单/成交以及显示挂单/持仓的显示方式。

合约	合约名称	买卖	委托价	委托量	成交量	剩余数量	成交均价	委托状态	委托时间	本地号	系统号	下单人	反馈信息	交易所	货币	定单编号
6B1306	英镑期货1306	卖	1.6202	1	0	1	0.0000	已排队	15:13:44	20121218000002	00000018100006	demo000	报单成功	CME	美元	1000018
6B1303	英镑期货1303	买	1.6198	50	0	50	0.0000	已排队	15:13:35	20121218000001	00000018100005	demo000	报单成功	CME	美元	1000017

- 显示挂单：显示所有排队状态单，可在该页面撤销排队单；
- 显示挂单/成交：同时显示挂单信息以及成交明细信息页面；
- 显示挂单/持仓：同时显示挂单信息以及持仓合计信息页面。

4. 持仓查询

持仓查询：该页面包括合计、明细以及止损止盈设置页面。

合约	合约名称	总持买	总持卖	买均价	卖均价	现价	浮动盈利	盯市盈亏	开仓均价	交易所	合约类型	货币	资金账号	期权价值	期权净盈亏
CA3M	铜3M	2	0	0.7650	0	0.008060	7	5237.5000	20537.50	7956.00	LME	期货	美元	00000018	
AH3M	铝3M	0	7	0.0000	1957.1	2109.5	-3443.7550	-26656.2	2089.821	LME	期货	美元	00000018		
AH3M	铝3M	3	0	1961.2	0.0000	2109.5	1500.0000	11118.75	2089.500	LME	期货	美元	00000018		
HG1212	铜1212	1	0	3.6445	0.0000	3.6610	-725.0000	412.5000	3.6900	CME	期货	美元	00000018		
6B1212	英镑期货1212	0	2	0.0000	1.6201	1.6168	412.5000	412.5000	1.6201	CME	期货	美元	00000018		
6A1212	澳元1212	150	0	0.5338	0.0000	1.0561	34500.0000	34500.00	1.0538	CME	期货	美元	00000018		
合计	明细	止损止盈设置	总持买157	总持卖9											

- 合计：按合约，买卖方向显示所有持仓总数；
- 明细：按合约，买卖方向，单笔成交显示持仓信息；
- 止损止盈设置：显示所有设置的止盈损单，结算前盈损单均可显示，结算后仅显示未触发状态的永久止盈损单。

(二) 普通下单

下单类型：在系统主界面的委托下单中下单，定单类型分为限价、市价、限价止损以及止损单
普通下单设置：

交易市场	商品	合约代码	买/卖	开/平	定单类型	委托价格	委托数量	触发价格	有效日期	买入(B)	卖出(S)
<input type="checkbox"/> 快速(K)	策略组合	自定义策略	SI1403-SQ-ag	买	开仓	限价		1	当日有效	146.000	144.000
										<input type="checkbox"/> 跟价	

买入键下方显示行情买入价格
 卖出键下方显示行情卖出价格

买入(B)	卖出(S)
*3.3505	*3.3550

交易市场/商品/合约代码：可从下拉菜单中选择，也可直接双击行情合约自动获取合约；
买/卖：键盘“1”为买；键盘“2”为卖；也可双击买/卖框切换买卖方向；
定单类型：限价/市价/限价止损/止损；
委托价格：手动输入委托价格；双击行情自动获取；鼠标滚轮调整价位；
委托数量：手动输入委托数量；鼠标滚轮调整数量；
触发价格：手动输入触发价格；鼠标滚轮调整价位；
买入(B)：买/卖方向选择买，按**买入(B)**下单或者使用快捷键“B”下单；
卖出(S)：买/卖方向选择卖，按**卖出(S)**下单或者使用快捷键“S”下单。

1. 限价

限价：委托下单界面中，定单类型选择**限价**，即以设置的委托价格下单；
 限价下可设置委托价格以及委托数量。

The screenshot shows the order entry form with the following fields: 交易市场 (Market): 策略组合; 商品 (Commodity): 自定义策略; 合约代码 (Contract Code): SI1403-SQ-ag; 买/卖 (Buy/Sell): 买; 开/平 (Open/Close): 开仓; 定单类型 (Order Type): 限价; 委托价格 (Order Price): [empty]; 委托数量 (Order Quantity): 1; 触发价格 (Trigger Price): [empty]; 有效日期 (Valid Date): 当日有效. There is a checkbox for '跟价' (Follow Price) which is unchecked.

2. 市价

市价：委托下单界面中，定单类型选择**市价**，即委托价格为空，以当前能够成交的最优价格成交；
 市价下可设置委托数量。

The screenshot shows the order entry form with the following fields: 交易市场 (Market): CME; 商品 (Commodity): 澳元; 合约代码 (Contract Code): 6A1406; 买/卖 (Buy/Sell): 卖; 开/平 (Open/Close): [empty]; 定单类型 (Order Type): 市价; 委托价格 (Order Price): [empty]; 委托数量 (Order Quantity): 1; 触发价格 (Trigger Price): [empty]; 有效日期 (Valid Date): 当日有效. There is a checkbox for '跟价' (Follow Price) which is unchecked.

3. 限价止损

限价止损：委托下单界面中，定单类型选择限价止损后设置**委托价格**以及**触发价格(触发价格为最新价)**；
 限价止损下可设置委托价格、委托数量以及触发价格。

The screenshot shows the order entry form with the following fields: 交易市场 (Market): CME; 商品 (Commodity): 澳元; 合约代码 (Contract Code): 6A1406; 买/卖 (Buy/Sell): 卖; 开/平 (Open/Close): [empty]; 定单类型 (Order Type): 限价止损; 委托价格 (Order Price): [empty]; 委托数量 (Order Quantity): 1; 触发价格 (Trigger Price): [empty]; 有效日期 (Valid Date): 当日有效. There is a checkbox for '跟价' (Follow Price) which is unchecked.

注意：如为买方向，则要求**委托价格** \geq **触发价格**，**触发价格** $>$ **最新价**，即下单后该笔委托单可在（触发价格,委托价格）区间内最优的可成交价格成交；

如为卖方向，则要求**委托价格** \leq **触发价格**，**触发价格** $<$ **最新价**，即下单后该笔委托单可在（委托价格,触发价格）区间内最优的可成交价格成交。

4. 市价止损

市价止损：委托下单界面中，定单类型选择止损后设置**触发价格**（止损即市价止损）；
 止损下可设置触发价格、委托数量。

The screenshot shows the order entry form with the following fields: 交易市场 (Market): CME; 商品 (Commodity): 澳元; 合约代码 (Contract Code): 6A1406; 买/卖 (Buy/Sell): 卖; 开/平 (Open/Close): [empty]; 定单类型 (Order Type): 市价止损; 委托价格 (Order Price): [empty]; 委托数量 (Order Quantity): 1; 触发价格 (Trigger Price): [empty]; 有效日期 (Valid Date): 当日有效. There is a checkbox for '跟价' (Follow Price) which is unchecked.

注意：到达触发价格后即以市价去成交。

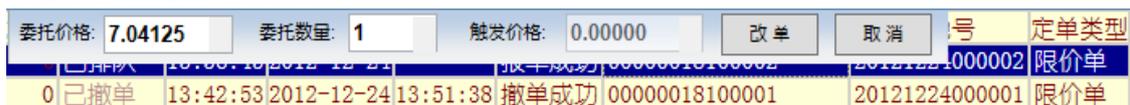
(三) 改单

1. 常规改单

改单：对已排队状态的委托单可进行改单，可更改下单的委托价格、委托数量以及触发价格等，撤销原先排队单并且以改单后设置的重新下单。



- ①在委托下单页面或者所有挂单页面中选中一个排队单，单击鼠标右键；
- ② 选择改单，即在该笔委托单上方弹出改单窗口；
- ③ 修改委托价格、委托数量以及触发价格（如果设置的是限价止损或者止损单），点击改单；
- ④ 无需修改则直接点击取消退出。



2. 快速改单

快速改单：下单参数设置->常规->撤单改单设置中勾选双击排队单则改单的选项，保存退出设置后如需改单可直接双击该排队单



注：当同时勾选了双击排队单则撤销该笔委托以及双击排队单则改单，当双击一个排队单时，先执行撤单

(四) 快速下单

1. 选择快速模式

快速下单：委托下单界面勾选“**快速(K)**”框切换至快速下单模式,或者使用键盘“**K**”键切换至快速模式。

The screenshot shows an order entry form with the following fields: 交易市场 (Market): CME; 商品 (Commodity): 英镑 (GBP); 合约代码 (Contract Code): 6B1303; 买/卖 (Buy/Sell): 买 (Buy); 定单类型 (Order Type): 限价 (Limit); 委托价格 (Order Price): 1.6055; 委托数量 (Order Quantity): 8; 触发价格 (Trigger Price): (empty). A checkbox labeled '快速(K)' is checked. Below the fields, it says '最大可委托数: 29'.

2. 快速下单超价设置

超价设置：进入系统设置->下单参数设置->下单快捷键，在“快速超价”中对快速下单快捷键进行设置。
比如：设置**卖价买进 1:1**；**买价卖出 1:3**，**超价点数 1:2**

The screenshot shows the '下单参数设置' dialog box with the '下单快捷键' tab selected. The '快速超价' section contains a grid of input fields for setting order parameters. The first row is highlighted with a red box and contains: 卖价买进1: 1, 买价卖出1: 3, 超价点数1: 2.

说明：在快速模式下，使用“**1**”键以当前行情卖价作为委托价下单买入该合约，超价点数设置为“**2**”则表示下单时以高于当前行情卖价 2 个跳点的价格作为委托价格下单买入，使其更易成交。

超价点数：为空，即以当前行情价格进行买卖

正数，即以更易成交的价格进行买卖。买进则以高于当前行情价买入，卖出则以低于当前行情价卖出

负数，即以不易成交的价格进行买卖。买进则以低于当前行情价买入，卖出则以高于当前行情价卖出

3. 快速下单默认开平仓数量设置

默认开平仓数量设置：进入系统设置->下单默认量设置，输入品种/合约、开仓数量以及平仓数量

The screenshot shows the '下单默认量设置' dialog box with a table of contract settings and input fields for custom settings.

品种/合约	开仓量	平仓量
6A1212	50	1
6B1212	2	3
6B1303	50	1
6J1303	50	1
AH3M	3	2

品种/合约: [input]
开仓数量: [input]
平仓数量: [input]
保存 [button]
删除 [button]
关闭 [button]

开仓数量：当对所设置合约快速下单时，如为开仓单则会使用设置的开仓数量

平仓数量：当对所设置合约快速下单时，如为平仓单则会使用设置的平仓数量

注：快速下单模式下针对合约采用先平后开规则，不可直接开反手。
比如某合约持买 1 手，平仓默认量设置为 2，使用快速下单平仓只会下 1 手卖单。

(五) 止损止盈单

1. 新增止损止盈单

止盈止损设置：

① 进入系统设置->止损止盈设置；

合约	合约名称	总持买	买均价	总持卖	卖均价	开仓均价	现价	浮动盈利	期权净盈亏	合约类型	币种
6A1403	澳元1403	4	0.9248	0	0.0000	0.9248	0.9264	640.0000		期货	美
6A1312	澳元1312	0	0.0000	2	0.9312	0.9312	0.9295	340.0000		期货	美
XC1312	小玉米1312	0	0.00000	1	4.54875	4.54875	4.56250	-13.7500		期货	美

选择的持仓数据

交易所: _____ 商品: _____ 合约代码: _____ 最新价: _____
持仓方向: _____ 持仓数: _____ 已设置数: _____ 开仓均价: _____

止损止盈设置

触发类型: 按最新价触发 止盈损类型: 普通 下单控制: 触发时持仓不足按持仓数下单
下单类型: 市价 止损触发价: _____ 止损超价点数: _____
下单数: _____ 平仓触发价: _____ 平仓超价点数: _____
有效期: 当日 开仓价: _____ 追踪回撤价差: _____

已设置的止损止盈列表:

状态	合约代码	合约名称	持仓方向	触发类型	止损触发价	平仓触发价	下单数	下单类型	止
----	------	------	------	------	-------	-------	-----	------	---

② 两种止损止盈类型：**普通**和**追价止损**。普通即为常规止损止盈设置，追价止损是一种止损策略，让盈利跟随最新价自动调整价格，最新价回撤超过追价止损则触发止损。

③ 双击选中持仓，选择止盈损类型：**普通**

④ **价格设置：**

双击选中持仓，输入**止损触发价**以及**平仓触发价**

买方向持仓：止损触发价必须<最新价/买价/卖价，平仓触发价必须>最新价/买价/卖价；

卖方向持仓：止损触发价必须>最新价/买价/卖价，平仓触发价必须<最新价/买价/卖价。

⑤ **设置下单控制**

三种选项：触发时持仓不足不下单、触发时持仓不足按持仓数下单、触发时按委托数量下单。

触发时持仓不足不下单：当最新价到达触发价时，若持仓数<盈损单下单数，盈损单失效。若持仓数>=盈损单下单数，自动按下单数下单。

触发时持仓不足按持仓数下单：触发时，若持仓数<盈损单下单数，按实际持仓数下单。若持仓数>=盈损单下单数，自动按下单数下单。

触发时按委托数量下单：触发时无论持仓数是否满足下单数，都按盈损单中设置的下单数下单。

⑥ **设置超价点数：**

对止损触发价以及平仓触发价设置相应的超价点数：

超价点数即在止损/平仓触发价的基础增加或减去相应跳点。

比如，持买1手，设置止损触发价为1.0，最小跳点为0.1，止损超价点数设置为2，则表示该条止盈损单触发后会以0.8的委托价格下单，低于设置的止损触发价2个跳点，使其更易成交，如设置超价点数为-2，则会以1.2的委托价格下单，使其不易成交；持卖则相反。（注：盈损单触发后的下单委托价格只由止损/平仓触发价及其相应超价点数确定）

设置成功后该止盈止损单状态应为**未触发**。

2. 追价止损

追价止损：一种止损策略，让止损价格跟随最新价自动调整价格，最新价超过实时更新的止损触发价则触发止损，这样可以帮助您不断减低风险之余也不会错失更高利润。

双击选中持仓，选择止盈损类型：**追价止损**

止损触发价：最原始的止损触发价格，同常规止损止盈的止损触发价。

止损超价点数：行情到达止损触发价时，下单委托价 = 止损触发价 + 或 - 止损超价点数。

盈利追价触发点数：以设置时行情价格为基准(根据触发类型设置的最新价、买价、卖价)，当触发类型价格(如最新价)移动点数 = 盈利追价触发点数设置值，

止损触发价才会被更新。

止损追踪点数：以设置时行情价格为基准(根据触发类型设置的最新价、买价、卖价)，当触发类型价格(如最新价)和设置时的行情价格相比，移动点数到达盈利追价触发点数，则止损触发价在原止损触发价的基础上移动止损追踪点数；移动多少倍(取整)的盈利追价触发点数，就移动多少倍(取整)的止损追踪点数，止损触发价实时更新在下图所示红色区域内。

已设置的止盈止损列表：

状态	合约代码	合约名称	持仓方向	触发类型	止损触发价	平仓触发价	下单数	下单类型
未触发	6A1312	澳元1312	卖	按最新价触发	0.9308		1	限价

等待触发过程中最新价(MAX)比设置追价止损单时的最新价上涨或下跌 N 点，盈利追价触发点数设 X，止损追踪点数设 Y，止损超价点数设 E

则：**止损触发价 = A * Y * 合约最小变动单位 + 设置时止损价**；**触发后的委托价 = A * Y * 合约最小变动单位 + 设置时止损价 + 或 - 止损超价点数 E**，其中 **A = N / X** 取整数位。

例 1：

持仓方向：卖，设置触发类型为最新价，设置盈利止损单时的最新价为 0.9300，止损触发价为 0.9308，止损超价点数 2，止损追踪点数 3，盈利追价触发点数 5；设置如下图：

合约名称	止损触发价	平仓触发价	持仓方向	触发类型	止损超价点数	平仓超价	下单数	有效期	已成交数	已平	下	下	止损追踪点数	盈利追价触发点数
澳元1312	0.9308		卖	按最新价触发	2		1	当日有效	0	0	20	限触	3	5

若最新价 ≥ 0.9308 ，则触发止损，委托价为 $0.9310 = 0.9308 + \text{止损超价点数 } 2$ ；若当前最新价 ≤ 0.9295 ，设置追价止损时的最新价 $0.9300 - \text{当前最新价 } 0.9295 = \text{盈利追价点数 } 5$ ，则止损触发价自动更新为原止损触发价 $0.9308 - \text{止损追价点数 } 3 * \text{合约最小变动单位 } 0.0001 = 0.9305$ ；如下图：

合约名称	止损触发价	平仓触发价	持仓方向	触发类型	止损超价点数	平仓超价	下单数	有效期	已成交数	已平	下	下	止损追踪点数	盈利追价触发点数
澳元1312	0.9305	从0.9308自动变为0.9305	卖	按最新价触发	2		1	当日有效	0	0	20	限触	3	5

若当前最新价 ≥ 0.9305 ，则触发止损，委托价为 $0.9307 = \text{当前止损触发价 } 0.9305 + \text{止损超价点数 } 2$ ；若当前最新价 ≤ 0.9290 (当前最新价与设置追价止损时的最新价相比满足 2 倍的盈利追价触发点数)；则止损触发价自动更新 = 上个止损触发价 $0.9305 - 3 * 0.0001 = 0.9302$ ；

依此类推。

例 2：

持买1手，英镑1312，最新价从1.5948上涨至1.5955跌至1.5953再上涨至1.5965再跌至1.5955

- 常规止损止盈：

设置止盈触发价=1.5953，止损触发价=1.5946，最新价一旦超过1.5953立刻触发止盈价，下单委托价=1.5953

- 追价止损：

设置止损触发价=1.5946，盈利追价触发点数=3，止损追踪点数=2，止损超价点数=0，设置追价止损单时最新价=1.5948；

止损触发价=5*2*0.0001+1.5946=1.5956，下单委托价=1.5956，其中(设置后到触发期间最新价 max1.5965-设置时最新价 1.5948) /3 取整=5，

当行情到达1.5955时，止损触发价更新为1.5950；

当行情跌至1.5953时，止损触发价仍维持1.5950；

当行上涨至1.5965时，止损触发价更新为1.5956；

当行情跌至1.5955时，止损单触发，下单委托价为1.5956

结论：当最新价不超过止损价格时，止损价效果同常规止损止盈，反之，最新价一旦满足盈利追价点数设置，止损触发价则按止损追价点数设置变动，从而提高客户盈利程度。

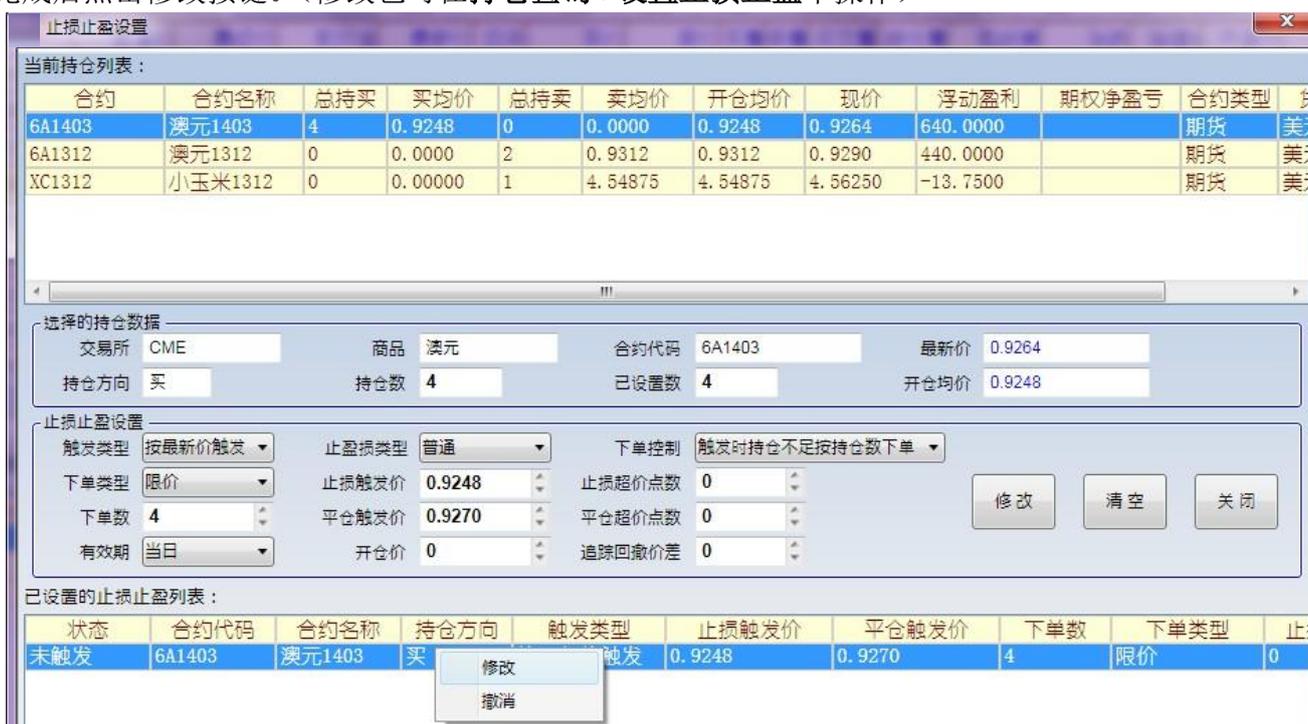
3. 止损止盈设置注意点

1. LME 合约不支持；
2. 只能对**持仓**进行止损止盈设置；
3. **未触发**的止盈损单可进行修改、撤销等操作；
4. **永久有效**止盈损单只要未被触发则会一直存在并且有效；
5. 止损止盈单触发时所设下单数大于当时持仓数，则该条盈损单触发后为**已清除**状态，不会下单；
6. 同一持仓可设置多个盈损单，最小下单量设为**1**，对其设置的未触发盈损单下单量之和必须<=持仓量。

4. 修改止损止盈单

修改盈损单：

- ①在止损止盈设置界面，选中状态为“未触发”的止损止盈单；
- ② 单击鼠标右键选择修改或者直接双击该盈损单后在**止损止盈设置**框中对已有数据进行修改；
- ③完成后点击修改按钮。（修改也可在**持仓查询->设置止损止盈**中操作）



5. 撤销止损止盈单

撤销盈损单：

- ① 止损止盈设置界面，选中状态为“未触发”的止损止盈单；
- ② 单击鼠标右键选择撤销。（撤销也可在持仓查询->设置止损止盈中操作）；
- ③ 撤销后该止损止盈单状态为已撤销。

已设置的止损止盈列表：

状态	合约代码	合约名称	持仓方向	触发类型	止损触发价	平仓触发价	下单数	下单类型	
未触发	XW1303	小型小麦130	买		8.00125	0.00000	1	限价单	0
已撤销	XW1303	小型小麦130	买		8.18000	8.19125	1	限价单	0
已撤销	XW1303	小型小麦130	买		8.53000	0.00000	1	限价单	0
已完全成交	6A1212	澳元1212	买	按最新价触发	1.0469	0.0000	16	限价单	1
已撤销	6A1212	澳元1212	买	按最新价触发	1.0466	1.0466	132	限价单	1
已完全成交	6A1212	澳元1212	卖	按最新价触发	1.0468	1.0468	50	市价单	1

6. 查询止损止盈单

查询盈损单：

止损止盈编号	状态	交易所	合约代码	合约名称	持仓方向	止损触发价	平仓触发价	触发类型	止损起价点数	平仓起价点数	下单数	有效期	已成交数	已撤单数	本地号	下单类型
123	未触发	CME	CF XW1303	小型小麦	买	8.00125	0.00000	按最新价触发	0	0	1	当天有效	0	0	201212130006	限价单
122	已撤销	CME	CF XW1303	小型小麦	买	8.18000	8.19125	按委价触发	0	0	1	当天有效	0	0	201212120002	限价单
121	已撤销	CME	CF XW1303	小型小麦	买	8.53000	0.00000	按最新价触发	0	0	1	当天有效	0	0	201212070002	限价单
116	已完全成交	CME	6A1212	澳元1212	买	1.0469	0.0000	按最新价触发	1	0	16	当天有效	16	0	201212040007	限价单
115	已撤销	CME	6A1212	澳元1212	买	1.0466	1.0466	按最新价触发	1	-1	132	当天有效	116	16	201212040006	限价单
114	已完全成交	CME	6A1212	澳元1212	卖	1.0468	1.0468	按最新价触发	1	-1	50	当天有效	50	0	201212040005	市价单
112	已完全成交	CME	6A1212	澳元1212	买	1.0400	1.0428	按最新价触发	2	-2	300	当天有效	300	0	201212040004	限价单

合计 明细 止损止盈设置 总持买13 总持卖17

持买：1 持卖：0

F9委托信息 F1成交查询 F4所有挂单 F5持仓查询

- ① 在持仓查询->设置止损止盈中查看设置的止损止盈单
- ② 对于未触发状态的止损止盈单可进行修改，撤销操作。
- ③ 当日操作过的所有盈损单都可查询，结算后只能查询到未触发的永久有效盈损单。

7. 止盈止损单状态说明

未触发：设置成功还未到达触发价位的盈损单；可做修改、撤销操作

平仓指令成功：已触发单下单指令发送成功但还未成交盈损单；无法更改

平仓指令失败：已触发单但下单指令发送失败；无效

已撤销：手动撤销的未触发盈损单或者撤销该盈损单触发的排队单；无法更改

已清除：盈损单触发时所设下单数量>当时实际持仓数量；无效

已部分成交：触发的盈损单部分成交；无法更改

已完全成交：触发的盈损单完全成交；无法更改

(六) 条件单

1. 新增条件单

条件单查询中,点击左下方**新增**,或者在该页面单击右键,在菜单选择**新增**。

交易市场	商品	合约代码	买/卖	开/平	定单类型	委托价格	委托数量	触发价格	有效日期	买入(B)	卖出(S)
<input type="checkbox"/> 快速(K)	CME	澳元	6A1403	卖	开仓	限价	3		当日有效		
<input type="checkbox"/> 限价 <input type="checkbox"/> 跟价											
条件单编号	状态	合约	合约名称	触发条件	触发下单	止损设置					
1	未触发	6A1312	澳元1312	最新价>=0.9261	以限价0.9259买入3手	行情最新价<=0.9254美元时,以市价卖出3手					

刷新条件单信息 **新增** 修改 删除

持买：0 持卖：0

F2委托信息 F3成交查询 F4所有挂单 F5持仓查询 F6资金查询 **F7条件单查询**

新增条件单：

- ① **触发条件设置：**填入合约代码；设置触发条件，包括最新价、对盘价以及挂单价。(必填)
比如：澳元 1312，条件设置最新价 ≥ 0.9261 ，即当澳元 1312 行情最新价等于或者大于 0.9261 时触发下单。
- ② **触发后下单设置：**设置条件单触发后的下单信息，包括买卖方向、订单类型、委托价格、委托数量以及有效期，与普通下单设置相同。(必填)
- ③ **下成交后止损止盈设置：**(可选填)当条件单触发后的下单完全成交，即可触发止损止盈设置；填入触发类型、定单类型、委托数量、有效期、下单控制、止损止盈触发价位等，详细设置可参照止损止盈。
- ④ **保存：**点击**设置**，新增条件单设置。

条件单编号	状态	合约	合约名称	触发条件	触发下单	止损设置
1	未触发	6A1312	澳元1312	最新价 ≥ 0.9261	以限价0.9259买入3手	行情最新价 ≤ 0.9254 美元时,以市价

2. 修改条件单

条件单查询中选中未触发状态条件单，点击左下方**修改**，或者在该页面单击右键,在菜单选择**修改**。

条件单编号	状态	合约	合约名称	触发条件	触发下单	止损
1	未触发	6A1312	澳元1312	最新价 ≥ 0.9261	以限价0.9259买入3手	行情最新价 ≤ 0.9254 美元

修改条件单：

- ① **修改：**在条件单设置页面对该条件单的设置进行修改，除了合约外所有值均可做修改操作；
- ② **保存：**修改完成后点击修改按钮进行保存。

条件单编号	状态	合约	合约名称	触发条件	触发下单	止损设置
1	未触发	6A1312	澳元1312	最新价 > 0.9261	以限价0.9259买入3手	行情最新价 ≤ 0.9254 美元时,以市价

3. 删除条件单

条件单查询中选中未触发状态条件单，点击左下方**删除**，或者在该页面单击右键,在菜单选择**删除**。

删除条件单：

- ① **删除：** 点击删除确认后直接删除该条件单。



4. 条件单状态说明

未触发： 设置成功但还未到达设置触发价位的条件单，可做修改、删除操作；

下单成功： 已触发并且成功下单的条件单(只要触发，不论触发后下单状态)；

已删除： 手动删除的未触发条件单，无法更改；

(七)炒单手

炒单手功能是针对单个合约，根据客户已设置好的下单条件，在行情达到时以最快速度进行交易。

1. 使用炒单手

- ① 在行情页面选中任意合约；
- ② 进入系统设置->炒单手；
- ③ 炒单手界面中：

合约数据：

显示选中的合约代码及合约名称；



最新价、买价及卖价与当前最新行情同步。

委托下单：

有效期：只支持当日有效；

委托价格：可手动输入调整，或使用市价、跟价方式；

跟价：以实时买价、卖价或最新价作为委托价格(根据用户自定义设置)；

下单超价：在委托价格基础上进行下单超价的调整以确定下单时委托价格；

市价：以市价作为委托价格；

无效：勾选无效则关闭止损止盈设置功能；

止损点数：委托下单成交后，以实际成交价格为基础，根据止损点数计算止损价位；

止盈点数：委托下单成交后，以实际成交价格为基础，根据止盈点数计算止盈价位；

超价点数：到达止盈止损触发点位后，在盈损触发价基础上加上超价点数作为下单价格；

委托数量：下委托单时的数量设置；

保持设定：下单成功后是否保存盈损之前的下单信息。

买入：点击买入该合约，并且要与买卖方向设置一致；不启用买卖方向时无需考虑一致性；

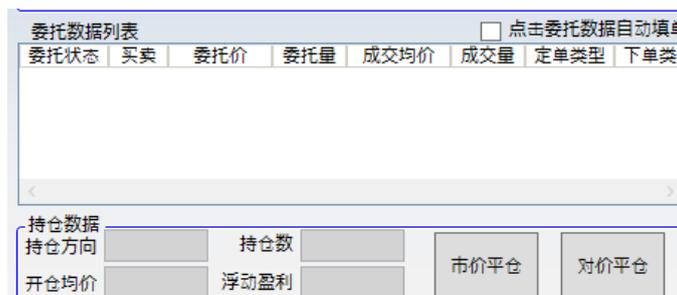
卖出：点击卖出该合约，并且要与买卖方向设置一致；不启用买卖方向时无需考虑一致性；

清除：一键清空所有委托信息；

关闭：退出炒单手功能。

委托数据列表：

委托数据列表：委托数据列表中显示该选中合约的所有状态下单信息。



持仓数据：

点击委托数据自动填单：勾选时则支持单击委托数据列表中的合约则自动填入该单信息；

持仓方向：有持仓情况下显示该选中合约的持仓方向；

持仓数：有持仓情况下显示该选中合约的持仓数量；



开仓均价：有持仓情况下显示该选中合约的开仓均价；

浮动盈利：有持仓情况下显示该选中合约相对于最新价格的浮动盈利。

市价平仓：对于有持仓的选中合约，点击市价平仓则默认撤销所有平仓方向排队单并且以市价下平仓单对所有持仓做平仓操作；

对价平仓：对于有持仓的选中合约，点击市价平仓则默认撤销所有平仓方向排队单并且以持仓方向对盘价格下限价平仓单对所有持仓做平仓操作；

注：使用市价平仓或者对价平仓后，默认撤销该合约平仓方向所有挂单以及该合约所有未触发盈损单。

2. 条件自动下单

条件自动下单是根据客户设置的开仓以及平仓条件，系统自动进行下单的功能。

(1) 条件设置

条件可设置买入以及卖出两个条件，也可以只设置其中一个；而针对买入或者卖出条件可设置对应的止盈止损条件。

① 条件自动买入：

当**最新价/买价/卖价**(自定义设置)**>=**或者**<=**某个价位时，即触发该下单，自动以**限价/市价**(自定义设置)买入__手。

止盈止损设置：

触发类型：触发类型可以选择按最新价/买价/卖价；

下单类型：可以选择市价/限价；

止损点数：1 个数代表该合约的 1 个最小跳点，成交价格-止损点数*合约最小跳点即为止损触发价格；

止盈点数：1 个数代表该合约的最小跳点，成交价格+止盈点数*合约最小跳点即为止盈触发价格；

超价点数仅在下单类型为限价时适用；

超价点数：1 个数代表该合约的最小跳点，止盈损价格触发后可控制委托下单价格；设置为正数，则更易于成交；为负数，则更易挂单。

② 条件自动卖出：

当**最新价/买价/卖价**(自定义设置)**>=**或者**<=**某个价位时，即触发该下单，自动以**限价/市价**(自定义设置)卖出__手。

止盈止损设置：

触发类型：触发类型可以选择按最新价/买价/卖价；

下单类型：可以选择市价/限价；

止损点数：1 个数代表该合约的最小跳点，成交价格+止损点数*合约最小跳点即为止损触发价格；

止盈点数：1 个数代表该合约的最小跳点，成交价格-止盈点数*合约最小跳点即为止盈触发价格；

超价点数仅在下单类型为限价时适用；

超价点数：1 个数代表该合约的 1 个最小跳点，止盈损价格触发后可控制委托下单价格；设置为正数，

则更易于成交；为负数，则更易挂单。

(2) 启动

设置条件后点击**启动**按钮运行自动下单。

需注意事项：

1. 启动条件自动下单时必须确保该合约无持仓；
2. 每次触发下单后必须等到盈损单也触发并且成交后才记做一轮，之后将触发下一轮下单；
3. 不设置赢损条件的情况下，启动后只会触发一次开仓，由于不会自动平仓程序则无法继续。
4. 自动下单运行过程中不允许进行手动操作，必须先按**停止**后手动操作；
5. 暂不支持策略组合合约。

(八) 自定义策略

自定义策略功能允许对不同市场、不同商品、不同月份的各合约进行差价以及比价的组合。

系统可将 2 个或 3 个合约组合成一个策略合约，当策略合约的价格满足时，则会触发策略下单，先下主动腿（即设置的第一个合约），成交后立即按比例下被动腿（即设置的第二三条腿）。

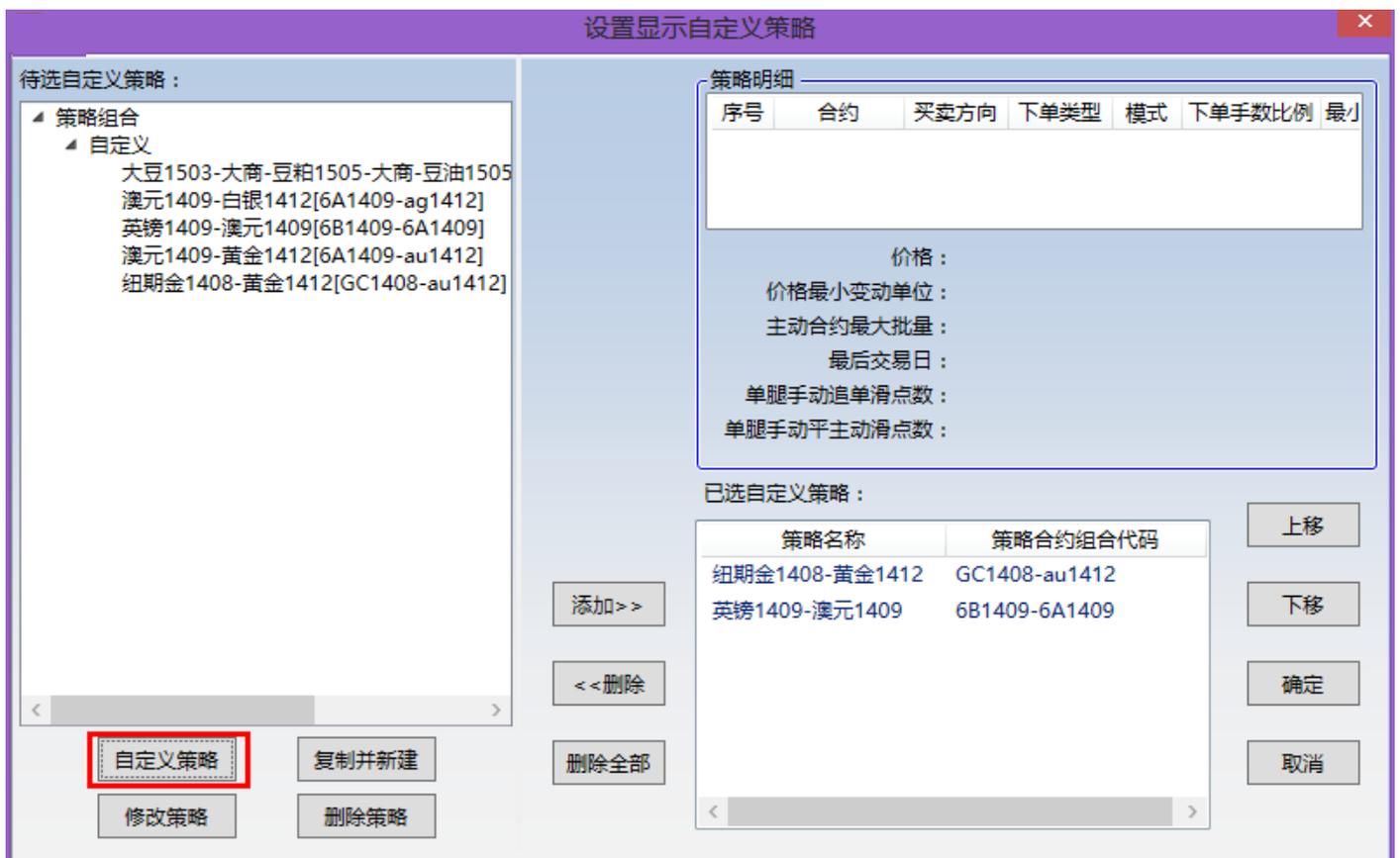
注：使用自定义内外盘策略前请先登录内盘交易账户，点击菜单栏内盘交易->开启内盘交易登录。

1. 新增自定义策略合约

- ① 在策略组合行情页面中单击鼠标右键，选中“设置显示组合策略”选项：



- ② 在设置显示策略页面点击左边自定义，再点击左下方自定义策略按钮进入自定义策略设置界面；



- ③ 从左侧待选合约列表选中合约，点击添加按键或者双击该合约，添加至右侧策略合约明细中；
(自定义策略支持左侧中所有显示的合约，任意市场以及任意商品合约)

待选合约：

- 马来西亚衍生品交易所[BMD]
- 中国金融期货交易所[CFEX]
- 芝加哥商品交易所[CME]
 - 期权
 - 期货
 - 澳元
 - 英镑
 - 加元
 - 欧元
 - 日元
 - 比索
 - 纽元
 - 瑞郎
 - CME布兰特原油
 - 原油
 - 欧元-美元
 - 小标普
 - 纽期金**
 - 纽期金1502[GC1502]
 - 纽期金1503[GC1503]
 - 纽期金1504[GC1504]
 - 纽期金1505[GC1505]
 - 纽期金1506[GC1506]
 - 纽期金1507[GC1507]
 - 纽期金1508[GC1508]
 - 纽期金1509[GC1509]
 - 纽期金1510[GC1510]
 - 纽期金1511[GC1511]
 - 纽期金1512[GC1512]
 - 纽期金1601[GC1601]
 - 纽期金1602[GC1602]
 - 纽期金1604[GC1604]
 - 纽期金1606[GC1606]

策略合约明细：

序号	合约	买卖方向	下单类型	模式	下单手数比例	最小对盘
1	GC1504	买	限价	主动	1	0
2	au1502	卖	限价	被动	1	0

策略参数设置：

策略代码：GC1504-au1502
 策略名称：纽期金1504-黄金1502
 价格类型：双腿套利 | 差价 | 主动-被动
 价格公式：1*p1-1*p2
 价格公式中用p1代表第一个合约,p2代表第二个合约,p3代表第三个合约
 例：0.9*p1-1.1*p2+1.2345

价格最小变动单位：0.01
 主动合约最大批量：0 * 为空或者0时无限制
 预计一手占用资金：20358.2185美元

单腿手动追单滑点数：5
 单腿手动平主动滑点数：5
 被动腿触发时下单价格：基于公式推算

包含内盘合约时，休盘前一分钟自动撤销主动腿挂单和部分成交单
 包含内盘合约时，收盘前一分钟自动撤销策略单
 策略单腿时声音提示

预设 保存 关闭

说明：

- 自定义策略如果包含内盘合约，由于本地时间和服务器时间可能存在误差，在内盘休盘前一分钟停止触发，在重新开盘后一分钟重新开始触发
- 自定义策略如果包含内盘合约，开平方向请在策略下单时指定，默认为根据持仓自动判断
- 请务必详细了解该功能后再进行设置和下单操作，自定义策略如果出现任何问题，本公司不承担任何责任
- 请务必保证有足够的资金下单，否则造成单边持仓的情况本公司概不负责

- ④ 点击**预设**，策略参数设置中自动对该组合策略进行命名，默认价格类型为差价；
 ⑤ 预设后点**保存**即可保存新建的策略。

价格最小变动单位：0.0001
 主动合约最大批量：* 为空或者0时无限制
 预计一手占用资金：
 单腿手动追单滑点数：5
 单腿手动平主动滑点数：5
 被动腿触发时下单价格：基于公式推算

包含内盘合约时，休盘前一分钟自动撤销主动腿挂单和部分成交单
 包含内盘合约时，收盘前一分钟自动撤销策略单
 策略单腿时声音提示

预设 保存 关闭

- ⑥ 在**策略合约明细**中可设置买卖方向、模式、下单类型、下单手数比例、最小对盘挂单量、价格容忍度、安全深度、主动区域、定时追单、定时追单滑点数、定时平仓、定时平仓滑点数、止损追单、止损追单滑点数、定时追价、定时追价滑点数以及定时追价最大触发次数；

买卖方向：单腿合约下单时的买卖方向；

下单类型：单腿合约的下单类型，可选择限价或者市价；

注：部分交易市场不支持市价下单，设置保存时会提示。

下单手数比例：即下 1 手策略时该单腿合约的下单数量，支持小数；当设置主动腿下单比例大于被动腿时，必须均为正数，不可设置小数；

模式：分主动以及被动两种,一个两腿策略必须有一个主动以及一个被动；

最小对盘挂单量：该值设置的是盘面买卖量。有时由于主动腿成交后被动腿行情买卖量不足导致单腿挂单的情况，为此，设置市场买卖量来确保只有当盘面买量/卖量达到设定值才会触发策略下单。如设置为 3，则只有当行情买量或者卖量(视单腿买卖方向)大于等于 3 的时候，才会触发下单。

序号	合约	买卖方向	下单类型	模式	下单手数比例	最小对盘挂单量
1	GC1504	买	限价	主动	1	0
2	au1508	卖	限价	被动	1	0

价格容忍度：该合约下单时委托价格超价点数，输入正整数，1 代表 1 个最小跳点；

安全深度：设置合约的最小跳点，为正整数。考虑到国内合约只有一档行情，其成交量有限，当被动腿最小对盘挂单量不满足的情况下，为确保其作为被动腿时单量足够成交，可在盘面价格基础上扩大可成交价格范围，使其更易成交。相应地这个安全深度会计入策略行情中。

主动区域：针对主动腿，设置 1 表示主动腿合约的 1 个最小跳点。主动区域范围则是主动腿行情价格再加减主动区域值的区间。策略挂单价格还未到达行情可触发价格时，如果根据被动腿行情价格与策略下单价格推算出的主动腿价格在主动区域范围内则会触发策略主动腿下单。当行情价格变化时，系统会自动对主动腿进行改单；如主动腿价格超出主动区域，则自动撤单。

价格容忍度	安全深度	主动区域
0	0	0
-30	0	0

定时追单：该值设置单位是秒。当被动腿挂单时间到达设定秒数时，立即修改挂单委托价格，以能够成交的价格下单。（被动腿为内盘时为撤单后再下单；被动腿为外盘时为直接改单）

定时追单滑点数：触发定时追单后控制被动腿下单价格。比如设置 10，被动腿下买单时则以对盘价格再加上 10 个跳点价格下单，使其更容易成交。

定时平仓：该值设置单位是秒，当被动腿挂单时间到达设定秒数时，立即撤单并且平主动腿下单。（被动腿为内盘时为撤单后再下单；被动腿为外盘时为直接改单）

定时平仓滑点数：触发定时平仓后控制被动腿下单价格。比如设置 10，主动腿下买单平仓时则以对盘价格再加上 10 个跳点价格下单，使其更容易成交。

注：定时追单与定时平仓二者选一，无法同时设置。

定时追单	定时追单滑点数	定时平仓	定时平仓滑点数
0		0	
20	1	0	

止损追单：该值设置的是合约最小跳点。针对被动腿挂单时，当行情价格与挂单价格之间的价位差达到设置的止损追单点数后，即立即撤单后以能够立即成交的价格下单。比如，止损追单设置为 5，则当行情价格不断变动直至与挂单价格相差 5 个点位的时候自动撤单并下单。

止损追单滑点数：触发止损追单后控制被动腿下单价格。比如设置 10，被动腿下买单时则以对盘价格再加上 10 个跳点价格下单，使其更容易成交。

定时追价：设置当被动腿挂单时间超过 n（设置值）秒后，自动修改被动腿挂单价格后下单。

定时追价滑点数：即当定时追价时间到达后，自动在原来的被动腿挂单价格上调整 n 个最小跳点后下单。

定时追价最大触发次数：该值限制了被动腿最多能自动修改价格下单的次数。

止损追单	止损追单滑点数	定时追价	定时追价滑点数	定时追价最大触发次数
0	0	2	2	5

价格类型： 双腿套利以及三腿套利； 分别支持差价以及比价类型。

价格公式： 该公式是确定该组合策略行情显示价格的公式，可使用差价或者比价两种；差价可设置**主动-被动**以及**被动-主动**；比价可设置**主动/被动**以及**被动/主动**。

注意： 价格公式中 **p1** 为主动腿价格，**p2** 为被动腿价格；价格公式中乘数可编辑，并且可以添加多个乘数以及自定义加减参数，比如 $0.3*8*3.2*p1-45*1.8*p2+5.6$ 。

价格最小变动单位： 默认为系统自动计算的最小变动单位。可自定义编辑该值控制行情显示价格。

主动合约最大批量： 即每次主动腿下单量。如一次策略下单 10 手，主动合约最大批量设置为 2 手，则该策略分 5 次下单，每一次主被动腿都成交后触发下一次下单。

被动腿触发时下单价格：

基于公式推算： 根据主动腿实际成交价格与策略委托价格去推算被动腿的委托价格后下单。

基于行情对盘价： 被动腿下单使用当时行情对盘价作为委托价格下单。

对含有内盘合约的策略，系统根据国内交易市场交易时间，提供休盘前一分钟撤销策略主动腿挂单并且在开盘一分钟后会继续触发策略；在收盘前一分钟撤销策略单。

下图设置的单腿手动追单以及手动平主动滑点数是针对此种情况生效：策略触发后，被动腿下单 10s 仍未完全成交，系统自动弹出单腿提示，可对该单进行追单、平主动以及不处理操作。

单腿手动追单滑点数：手动点击追单功能，则系统自动撤销被动腿挂单，立即以行情对盘价计入滑点数的价格下单，使其更易成交。(若被动腿为外盘合约，则采用直接改单替代撤单)

单腿手动平主动滑点数：手动点击平主动，则系统会针对该笔被动腿单所对应的主动腿委托量下主动腿平仓单，并且计入滑点数，使其更易成交。

如被动腿出现异常状态，比如资金不足、指令失败等状态，则无法做追单，只能采用平主动方式或不处理。

注意：

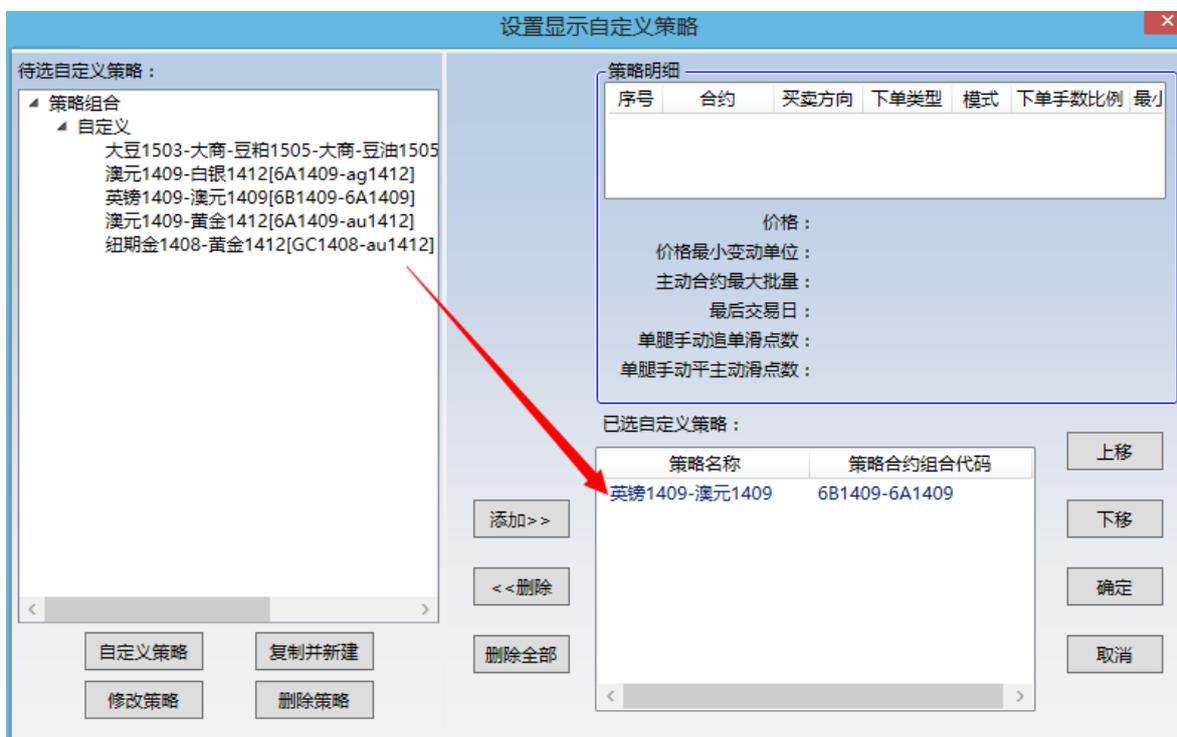
1. 只要策略中出现异常状态，处理后(平主动或不处理)策略都将自动终止；
2. 被动腿若为排队状态，做追单操作后策略继续正常运行；使用平主动将自动终止策略，不处理或者关闭即忽略该提示，对策略不做任何操作。

设置完毕后点击**保存**；

- ⑦ 在**系统设置->下单参数设置->常规->下单设置**中，勾选**自定义策略单被动腿下单失败时自动平主动腿**，则当被动腿下单后直接返回比如资金不足、指令失败等下单失败信息后直接平主动腿。



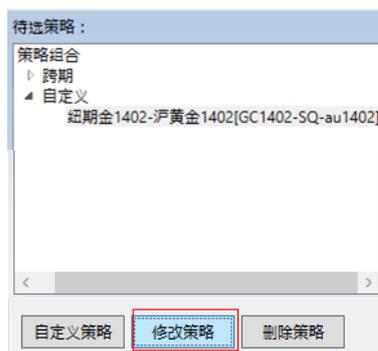
- ⑧ 在**设置显示策略**中将添加的自定义合约加至右侧已选策略列表中即可在策略组合页面中加入显示。



- ⑨ 加入自选，在**策略组合行情**页面中显示的策略合约可添加至自选行情中。

2. 修改自定义策略合约

① 在**设置显示策略**中，选中任一自定义策略，点击**修改策略**即可对该策略进行修改。

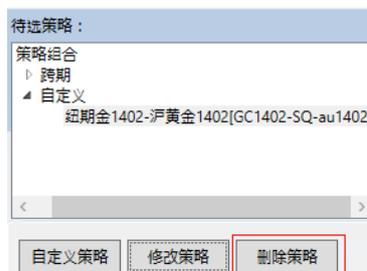


② 在行情页面中选中策略合约后，单击鼠标右键选中**修改自定义策略**，直接进入修改界面。

注：策略参数修改后实时生效，如果此时该策略有下单未完成，那么修改保存后以修改后参数继续运行。

3. 删除自定义策略合约

① 在**设置显示策略**中，选中任一自定义策略，点击**删除策略**即删除该策略。



4. 自定义策略交易设置注意点：

1. 自定义策略最多支持三腿；
2. 必须一主动一被动或者一主动二被动；
3. 主被动腿买卖方向必须相反；
4. 最小对盘挂单量、安全深度、定时追单、定时追单滑点数、定时平仓、定时平仓滑点数、止损追单、止损追单滑点数仅适用于被动腿设置；
5. 主动区域只针对主动腿设置；
6. 策略运行过程中如果触发了定时平主动或者下单参数中的平主动腿选项，该策略即视为结束，不再下单。

5. 自定义策略交易下单细则：

1. 单腿下单价格计算：基于下单时被动腿对盘价格、策略委托价格根据公式计算主动腿下单价格；
2. 主动腿成交后下被动腿，一个策略如出现分笔成交情况，则主动腿第一笔成交后按照设置下单手数比例推算四舍五入推算被动腿下单量，主动腿第二笔成交后则按照总的主动腿成交量同样推算出被动腿下单量后减去上之前被动腿下单总量，以此类推；

6. 自定义策略风险提示：

1. 策略可能出现滑点，请设置好参数有效降低风险；

(九) 下单参数设置



1. 下单设置

(1) 双击行情获取买卖量

勾选并保存设置后，双击行情可以自动在下单栏委托数量中填写上对应的行情中的买卖量。

(2) 单击行情或持仓即自动填单

勾选框：勾选并保存设置后，使单击行情或是持仓获得与双击同样的效果，可以在下单栏自动完成填单操作。

(3) 委托价格与行情对盘价同步刷新

勾选框：勾选并保存设置后，自动填单时，委托价格会与行情中的价格同步刷新，保持一致。

(4) 合约代码改变时同步选中相应行情

勾选框：勾选并保存设置后，在下单栏中修改合约代码，行情界面会自动选中并显示该合约行情。

(5) 切换行情时自动填单是否使用默认下单数

勾选框：勾选并保存设置后，双击行情自动填单时，使用下单默认量填写委托数量。

注：优先级低于“双击行情获取买卖量”，即如果需要此项生效，请不要勾选“双击行情获取买卖量”。

(6) 买价卖价等于最新价时加上红色框提示

勾选框：勾选并保存设置后，行情中的“买价”或是“卖价”等于“最新价”时，相应“买价”或是“卖价”会加上红色边框标注。

(7) 点击五档行情时使用设置的下单默认量填单

使用双击五档行情填单时，委托数量默认填入该合约已设置的默认下单量。

(8) 默认价格：自动填单时委托价格的填写

- 选择框：
- a.最新价，使用行情中的最新价；
 - b.对盘价，买单使用行情中的卖价，卖单使用行情中的买价；
 - c.不默认，保持上次的委托价格
 - d.挂单价，买单使用行情中的买价，卖单使用行情中的卖价。

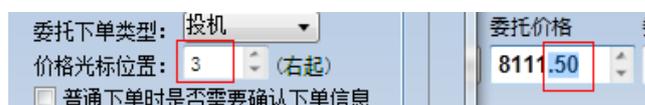
(9) 委托下单模式

委托下单栏的显示位置可设置为上下或者左右形式。

(10) 委托下单类型

选择框：a.投机；b.保值。

(11) 价格光标位置



填写框：必须是大于0的整数，填写x，就是当选中下单栏中委托价格时，会自动选中从右起x位的数字，如下图，x=3。

(12) 普通下单时是否需要确认下单信息

勾选框：勾选并保存设置后，每次下单会弹出一个对话框显示出下单的具体信息，点击确定后，才可以完成下单，防止误操作的产生。

(13) 普通下单后是否要保留下单数据

勾选框：勾选并保存设置后，每次下单后，下单栏会保留你下单前的数值填写，不勾选并保存后，每次下单都会清空下单栏中的数值。

(14) 下单后总是返回委托查询界面

勾选框：勾选并保存设置后，每次下单后，不论界面在哪个标签栏（持仓查询、成交查询等），都会自动切换到“委托信息”标签栏。

(15) 普通下单时是否自动修正买卖方向

勾选框：勾选并保存设置后，委托填单处买/卖显示方向允许与实际买入、卖出按键方向相反；不勾选则当买入、卖出按键与买/卖显示方向不同时不允许下单。

交易市场	商品	合约代码	买/卖	开/平	定单类型	委托价格	委托数量	触发价格	有效日期
<input type="checkbox"/> 快速(K)	CME	美精铜	HG1402	买	限价	3.3585	1		当日有效

最大可买数: 65; 最大可卖数: 65

买入(B) *3.3560 卖出(S) *3.3590

2. 撤单设置

(1) 开满自动撤单

勾选框：勾选并保存设置后，可开数量不足时，自动撤单未成交且同方向同品种的开仓单。

(2) 双击排队单则撤销该笔委托

勾选框：勾选并保存设置后，双击排队单可以完成自动撤单。

(3) 双击排队单撤销是否需要提示

勾选框：勾选并保存设置后，使用双击撤单时，会弹出确认框，点击“是”，才可以完成撤单，以防止手误导致的异常撤单。

(4) 平仓自动撤单

勾选框：勾选并保存设置后，平仓时，按照“平仓撤单方式”自动撤单未成交的同品种同方向的平仓单。

(5) 平仓撤单方式

选择框：
a.逐笔撤单，每下一笔平仓单都会触发“平仓自动撤单”；
b.平满撤单，当可平的手数不足时，触发“平仓自动撤单”。

3. 状态与提示设置

(1) 成交是否需要声音提示

勾选框：勾选并保存设置后，委托单成交时会有声音提示。

(2) 挂单成功是否需要声音提示

勾选框：勾选并保存设置后，委托单排队时会有声音提示。

(3) 撤单成功是否需要声音提示

勾选框：勾选并保存设置后，委托单撤单成功时会有声音提示。

(4) 显示标签栏标签项的快捷键

勾选框：勾选并保存设置后，每个标签栏前就会显示出相应的快捷键，如 F9、F1（使用这些快捷键就可以方便的切换各标签栏）。

(5) 离开 x 分钟后锁定系统

离开30 分钟后锁定系统

勾选框/填写框：勾选并填写相应的分钟数，保存设置后，停止在电脑上的任何操作，会弹出锁定系统的对话框，必须输入密码，点击确定后才可以继续操作，保证客户做盘的安全。

(6) 上下键=TAB 键

勾选框：勾选并保存设置后，就可以在下单栏中，使用上下键切换焦点，作为 tab 键使用，如果不勾选的话，可以使用上下键切换合约代码，调整委托价格、委托数量。

(7) 左右键=TAB 键

勾选框：勾选并保存设置后，就可以在下单栏中，使用左右键切换焦点，作为 tab 键使用，如果不勾选的话，可以使用左右键切换合约代码，调整委托价格、委托数量。

(8) 状态栏资金信息显示期权净盈亏

勾选框：勾选并保存设置后，在状态栏中会显示“期权净盈亏”的值。

(9) 状态栏持仓量

选择框：a.单笔持仓，选中一个合约时，标签栏左侧的持仓数量显示为当前合约的总的持买持卖量；

b.全部持仓，标签栏左侧的持仓数量显示为客户所有合约的总的持买持卖量；

c.不显持仓，标签栏中不显示合约的持买持卖量。

(10) 连接状态报警：系统与交易服务器或是行情服务器连接状态报警

选择框：a.声音报警，如任一个服务器断开的话，会有声音提示，且在一段时间后会有弹框提示；

b.无需报警，没有任何声音和弹框，只有界面左上角有服务器断开的信息。

(十) 下单默认量设置

下单默认量设置：

1. 进入系统设置->下单默认量设置

2. 在下单默认量设置页面输入品种，开仓数量以及平仓数量后保存。（可参考[快速下单->快速下单默认开平仓数量](#)说明）



(十一) 下单快捷键

1. 快速超价

使用设置的快捷键自动下单，使用超价点数对委托价进行调整控制。

(1) **卖价买进/买价卖出**：可以有三套设置，设置完后都可以正常使用。

该项设置为，使用该品种行情中的卖价（加上超价点数）下买的委托单，或是使用该品种行情中的买价（加上超价点数）下卖的委托单；

(2) **买价买进/卖价卖出**：可以有四套设置，设置完后都可以正常使用。

该项设置为，使用该品种行情中的买价（加上超价点数）下买的委托单，或是使用该品种行情中的卖价（加上超价点数）下卖的委托单；

(3) **超价点数**：调整自动下单委托价，使其更易于成交或者不易成交，最小设置为 1 个跳点，即输入 1

a.正的超价点数：易于成交，下买单时即调高委托价，下卖单时即降低委托价；

b.负的超价点数：难于成交，下买单时即降低委托价，下卖单时即调高委托价。

2. 快速平仓

快速平仓方式：快速平仓时平仓数量设置

- 选择框：**a.**分笔，使用下单默认量作为平仓时委托单的下单数量；
b.全部，使用可平数量作为平仓时委托单的下单数量。

3. 快速撤单

(1) 撤单快捷键

填写框：选择一个字母或是数字，作为撤单的快捷键。使用其直接完成撤单操作；

(2) 撤单选项：用快捷键撤单

- 选择框：**a.**撤选中，对于选中的委托单，点击撤单快捷键完成对其的撤单；
b.不需要选中，点击撤单快捷键完成所有挂单的撤单。

三、服务器重连功能

(一) 交易服务器重连

断开交易服务器：当交易服务器连接正常时，可使用断开交易服务器断开客户端；

连接交易服务器：当交易服务器断开时，可使用连接交易服务器重新加载数据。



(二) 行情服务器重连

断开行情服务器：当行情服务器连接正常时，可使用断开行情服务器断开客户端；

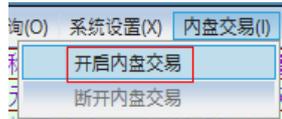
连接行情服务器：当行情服务器断开时，可使用连接行情服务器重新加载数据。



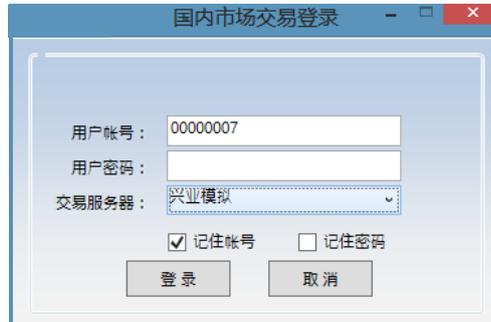
(三) 内盘连接

内盘连接、断开与重连

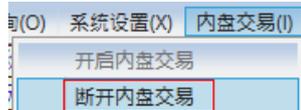
① 点击菜单栏内盘交易->开启内盘交易；



② 在内盘登录界面输入用户名以及密码，选择交易服务器后点击登录；



③ 点击菜单栏内盘交易->断开内盘交易，即断开与内盘连接；



注意：在不关闭客户端的情况下内盘只允许登录一次，如果退出后需要再次登录则需重启交易客户端后方可再登录。

四、其他功能

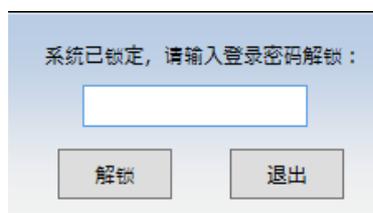
(一) 锁定

1. 立即锁屏

① 进入系统设置->系统锁定，或者使用 **Ctrl+L** 快捷键组合直接锁屏。



② 解锁时须输入客户登陆密码解锁，按退出直接退出交易系统。



2. 定时锁屏

- ① 进入系统设置->下单参数设置->状态与设置提示;
- ② 勾选“离开分钟后锁定系统”，输入数值（分钟，最小有效时间为0.1分钟）;
- ③ 定时锁屏生效后须输入客户密码解锁。

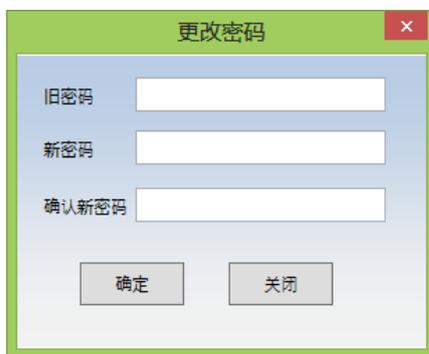
(二) 密码更改



1. 进入系统设置->更改密码;



2. 在更改密码页面输入旧密码;
3. 输入两次新密码，密码至少6个字符;
4. 确定后保存。



(三) 显示挂单/成交

所有挂单页面，点击**显示挂单/成交**，即左边显示挂单信息，右边显示成交明细信息。

合约	合约名称	买卖	委托价	委托量	成交量	剩余数量	成交均价	委托状态	合约	合约名称	买卖	委托价	成交价	成交数量	交易所	货币	定单
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0168	12	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0168	51	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0168	18	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0167	3	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0167	7	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0167	5	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0167	3	CME	美元	

显示挂单 | **显示挂单/成交** | 显示挂单/持仓

持买: 1 持卖: 0

F9委托信息 F1成交查询 F4所有挂单 F5持仓查询 F7资金查询

(四) 显示挂单/持仓

所有挂单页面，点击**显示挂单/持仓**，即左边显示挂单信息，右边显示持仓合计信息。

合约	合约名称	买卖	委托价	委托量	成交量	剩余数量	成交均价	委托状态	合约	合约名称	买卖	委托价	成交价	成交数量	交易所	货币	定单
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0168	12	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0168	51	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0168	18	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0167	3	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0167	7	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0167	5	CME	美元	
HG1212	铜1212	买	3.7100	1	0	1	0.0000	已排队	6C1212	加元1212	买		1.0167	3	CME	美元	

显示挂单 | **显示挂单/成交** | 显示挂单/持仓

持买: 1 持卖: 0

F9委托信息 F1成交查询 F4所有挂单 F5持仓查询 F7资金查询

(五) 自适应列宽

自适应列宽：根据字符长度自动调整所有列宽至最小宽度。

1. 在行情窗口以及各个查询页面中单击鼠标右键选择自适应列宽。



(六) 显示隐藏报价

在行情窗口中单击鼠标右键，在选项菜单中勾选显示隐藏报价。如不需要，则去掉其勾选即可。



注：只有当该合约行情中有优于买①或者卖①的价格才会显示隐藏价格，否则不显示隐藏价格。

(七) 设置显示合约

1. 在自选行情页面单击右键，选择设置显示合约选项；

成交量	最新价	持仓量	货币	买量	卖量	合约	交易所	名称	最高价	最低
10870	86.71		美元	4	4	CL1301	CME	原油1301	87.25	86.1
342	86.650		美元	13	8	QM1301	CME	小型原油1301	87.300	86.6
153	15.08625		美元	11	12	XK1301	CME_CBT	小型大豆1301	15.08625	14.936
39	15.410		美元					米1301	15.410	15.3
616	1.0130		美元	1				元1212	1.0148	1.01
177	1.3164		美元					型欧元1212	1.3189	1.31

A screenshot of a context menu overlaid on the table above. The menu items are: 显示五档行情 (checked), 显示网格线 (checked), 显示隐藏报价, 自适应列宽, 设置列头显示, 设置显示合约 (highlighted with a red box), 查看合约定义, 列表风格设置, 删除自选行情(选中), and 删除自选行情(全部).

2. 在设置显示合约页面从左侧选择合约至右侧栏内（可使用“添加>>”按键或者双击该合约）；
3. 在右侧已选合约中选择合约使用“<<删除”或者双击该合约不显示；
4. 使用**确认**按键保存。



(八) 列表风格设置

1. 在行情窗口或者列表页面单击右键显示选项菜单；
2. 选择列表风格设置，四种默认风格可选择，单击即可；
3. 选择列表风格设置->自定义设置；
4. 在列表风格设置->行情列表中行情窗口显示进行设置。



在列表风格设置->其他列表中委托界面显示进行设置



(九) 显示设置

包括**显示标签栏**、**显示状态栏**、**显示行情**、**显示下单栏**以及**前端显示**选项。



勾选**显示标签栏**即可在客户端右下方显示各个查询标签，分别为委托查询、成交查询、所有挂单、持仓查询以及资金查询

勾选**显示状态栏**即可在客户端下方显示各状态信息，包括各交易所时间、客户币种账户资金信息

合约	合约名称	买卖	价格	数量	交易所	货币	合约类型	权利金
6B1212	英镑期货1212	卖	1.6201	2	CME	美元	期货	
6A1212	澳元1212	买	1.0538	150	CME	美元	期货	

合计 小计 明细 自成交 调期明细 合计: 分客户、分合约、分买卖进行合计

F9委托信息 F1成交查询 F4所有挂单 F5持仓查询 F7资金查询

本地系统时间:13:25:19 韩国交易所系统时间:14:25:19 CME交易所系统时间:1:25:19 账户:基币账户 货币:美元 可用:\$ 339448.9648 浮盈:\$ 37764.9950 平盈:\$ 0.0000 保证金:\$ 111310.0000 期权净盈亏:\$ 0.0000

勾选**显示行情**即可显示行情窗口

涨跌	前收盘	买价	卖价	成交量	最新价	持仓量	货币	买量	卖量	合约	交易所	名称	最高价	最低价	现手	前结算	涨幅%	子
0.0017	1.0544			0	1.0561	58480	美元			6A1212	CME	澳元1212			1	1.0544	0.16	
-0.0007	1.0474	1.0467	1.0469	11989	1.0467	202931	美元	102	36	6A1303	CME	澳元1303	1.0487	1.0466	1	1.0474	-0.07	1
-0.0004	1.0407	1.0394	1.0411	0	1.0403	120	美元	4	4	6A1306	CME	澳元1306			2	1.0407	-0.04	
	1.0342			0			美元			6A1309	CME	澳元1309				1.0342		
	1.0277			0			美元			6A1312	CME	澳元1312				1.0277		
-0.0034	1.6202			0	1.6168	63867	美元			6B1212	CME	英镑期货1212			3	1.6202	-0.21	
0.0011	1.6199	1.6214	1.6211	4580	1.6210	180160	美元	6	12	6B1303	CME	英镑期货1303	1.6214	1.6199	1	1.6199	0.07	1
-0.0036	1.6194	1.6202	1.6209	0	1.6158	74	美元	5	5	6B1306	CME	英镑期货1306			1	1.6194	-0.22	
	1.6189	1.6163	1.6215	0			美元			6B1309	CME	英镑期货1309				1.6189		
	1.6184	1.6148	1.6246	0			美元			6B1312	CME	英镑期货1312				1.6184		
0.0000	1.0159	1.0168	1.0170	70	1.0159	78469	美元	14	26	6C1212	CME	加元1212	1.0169	1.0159	1	1.0159	0.00	1
0.0009	1.0139	1.0149	1.0150	3247	1.0148	144993	美元	6	42	6C1303	CME	加元1303	1.0150	1.0142	1	1.0139	0.09	1
0.0003	1.0117	1.0123	1.0132	1	1.0120	1060	美元	4	4	6C1306	CME	加元1306	1.0120	1.0120	1	1.0117	0.03	1
0.0011	1.0093	1.0093	1.0114	0	1.0104	937	美元	4	4	6C1309	CME	加元1309			4	1.0093	0.11	
-0.0023	1.0067	1.0067	1.0088	0	1.0044	316	美元	6	6	6C1312	CME	加元1312			1	1.0067	-0.23	
-0.0011	1.3171			0	1.3160	69888	美元			6B1212	CME	欧元1212			6	1.3171	-0.08	

勾选**显示下单栏**显示委托下单信息界面。

交易市场	商品	合约代码	买/卖	定单类型	委托价格	委托数量	触发价格	买入(B)	卖出(S)
<input type="checkbox"/> 快速(K)	CME	英镑	6B1303	买	限价	1.6211	50		

勾选**前端显示**即客户端界面置顶，其他程序打开后也不会显示在交易客户端上方。

五、行情显示

(一) 显示五档行情

现手	前结算	涨幅%	开盘	CME 日元期货1212		
1	3.6445	0.85	3.67	卖⑤	0.011944	52
1	85.89	1.09	86.	卖④	0.011943	66
1	32.280	1.08	32.4	卖③	0.011942	66
				卖②	0.011941	63
				卖①	0.011940	3
				买①	0.011938	12
				买②	0.011937	70
				买③	0.011936	67
				买④	0.011935	59
				买⑤	0.011934	62

<input checked="" type="checkbox"/>	显示五档行情
<input checked="" type="checkbox"/>	显示网格线
<input type="checkbox"/>	显示隐藏报价
<input type="checkbox"/>	自适应列宽
<input type="checkbox"/>	设置列头显示
<input type="checkbox"/>	设置显示合约
<input type="checkbox"/>	查看合约定义
<input type="checkbox"/>	列表风格设置
<input type="checkbox"/>	删除自选行情(选中)
<input type="checkbox"/>	删除自选行情(全部)

1. 在行情窗口任意位置单击鼠标右键勾选显示五档行情；
2. 不需显示时去掉显示五档行情勾选；
3. 在五档行情界面中直接单击鼠标右键选择关闭五档行情。

(二) 五档自动填单

双击五档行情自动填单。

CME 英镑期货1303		
卖⑤	1.6251	81
卖④	1.6250	68
卖③	1.6249	50
卖②	1.6248	16
卖①	1.6247	13
买①	1.6246	37
买②	1.6245	49
买③	1.6244	59
买④	1.6243	67
买⑤	1.6242	43

规则：双击五档行情中任一档行情数据则自动在委托下单界面填入所有信息。

比如：双击五档行情中买①，则在委托下单中，填入该合约交易市场、商品、合约代码，买卖方向为其**卖**，委托价格即**买①**价格，委托数量**1**。

六、常用操作快捷键

软件中快捷操作键列表：

Alt+L：打开**连接**菜单；

Alt+T：打开**交易查询**菜单；

Alt+O：打开**其他查询**菜单；

Alt+X：打开**系统设置**菜单；

Alt+H：打开**系统帮助**菜单；

F2: 显示委托信息页面;

F3: 显示成交查询页面;

F4: 显示所有挂单页面;

F5: 显示持仓查询页面;

F6: 显示资金查询页面;

F7: 显示条件单查询页面;

K: 普通快速下单切换;

Ctrl+L: 立即锁屏;

另可设置快速撤单键、快速下单键(系统设置->下单参数设置->下单快捷键)。

七、问题解决

1. 账户冻结了怎么办?

由于登录时密码连续输入错误 5 次自动冻结账户, 冻结后请立即打电话至公司。

2. 账户使用过程中被踢怎么办?

- 1) 您的账户可能在其他处被登录, 如担心安全问题, 可退出系统后立即再次登录, 登录成功后会将其他登录账户踢掉, 然后立即更改交易密码以确保其他处无法再登录账号, 再拨打客服电话;
- 2) 如被踢后退出客户端重新登录提示密码错误, 有可能您的密码已被修改, 请立即拨打客服。