

咏春大师 2 软件使用手册

V2.0 版

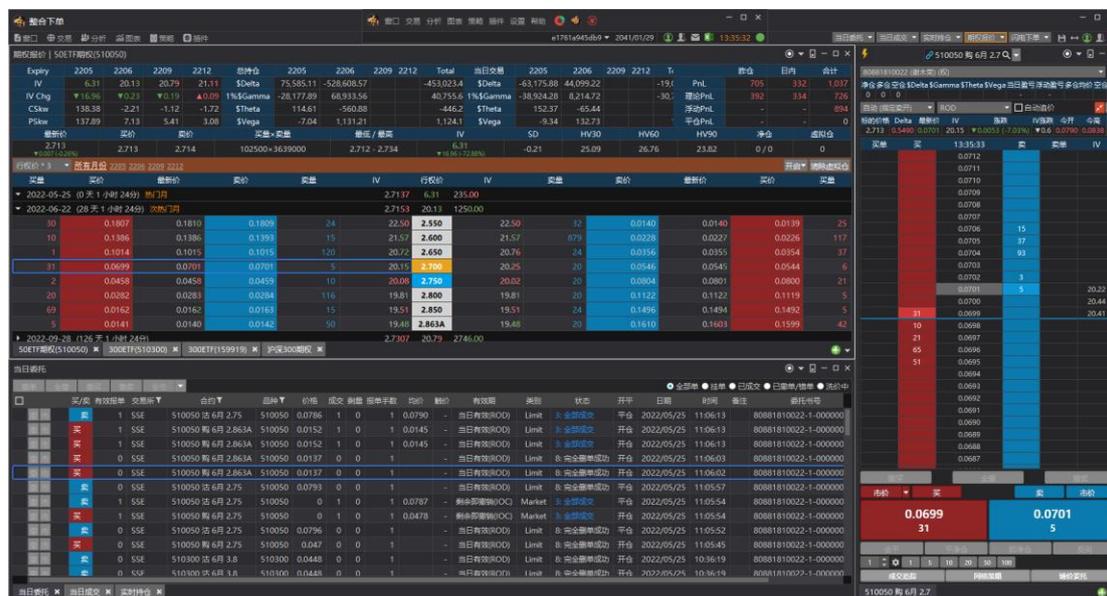
2024 年 4 月 2 日

星策（上海）投资咨询有限公司

咏春大师 2 软件使用手册	1
软件概述	4
开始使用咏春大师 2	5
运行环境	5
下载安装	5
启动登入	6
迷你模式与标准模式	7
关闭程序	8
窗口	9
管理窗口	9
预设子窗口	13
页签菜单	15
其他按钮功能	16
交易	16
报价功能	16
下单工具	28
报单回报	41
实时持仓	45
实时资金	47
组合策略保证金	48
平仓明细	50
锁定解锁	50
行权与自对冲	51
查询	56
分析	59
期权总持仓分析	59
期权持仓监控	64
期权盈亏分析	66
期权投组盈亏分析	72
波动率图形分析	75
期权波动率曲面管理	78
图表	82
技术线图	82
期权参考标的走势图	86
平值隐含波动率走势图	87
跨式组合权利金走势图	89
跨式组合时间价值走势图	91
跨品种平值隐波价差分析	93
跨品种的参考标的价差分析	96
期权波动率走势	98
策略	103
策略管理	103
策略下单	105
策略监控	105

期权策略管理	106
插件	108
咏春	108
资金转账	153
交易总管	154
设置	155
交易连线	155
群组帐号	156
报价连线	162
通用设定	163
交易安全设定	164
拆单委托设定	166
交易偏好设定	169
市价转换设定	170
期权序列参数设定	170
自动追价设定	172
期权估算手续费设定	173
系统设定	174
帮助	175

软件概述



咏春大师 2 软件是一款专业期权交易晋级工具，为期权交易者提供更专业的期权波动率及盈亏分析、更智能的期权闪电交易功能、更稳定快速的内核处理速度、更优化的操作动线及 UI 视觉，专为期权交易者而来。

特色功能：

- 期权盈亏分析**
 结合现有持仓及虚拟持仓，分析不同维度的时间和波动率变化，沙盘推演未来的各种损益情境，实时预判全局风险。
- 期权波动率分析**
 实时监控各月份波动率曲线动态,掌控不同行权价间波动率套利机会,到期日及行权价的偏度分析，大幅提升交易者对波动率交易的敏感度。
- 期权波动率走势**
 结合即时日内 IV 波动率指数走势,及 Vol skew 的偏斜程度,观察分析市场波动率交易机会,进而协助使用者构建波动率套利,波动率均值回归等相关交易策略，晋升专业期权交易必备。
- 期权矩阵下单**
 搭配买卖价盘口数据、Greeks、波动率，快捷期权批量下单，波动率策略、各式期权价差、转仓等交易皆能一键搞定。

开始使用咏春大师 2

运行环境

硬件建议规格：Intel Core i5 四核 CPU，内存 8G 以上。

操作系统支持：Windows 10；Windows 11。

系统类型：64 位操作系统

下载安装

以管理员身份运行咏春大师 2 软件安装包，按提示进行安装即可。

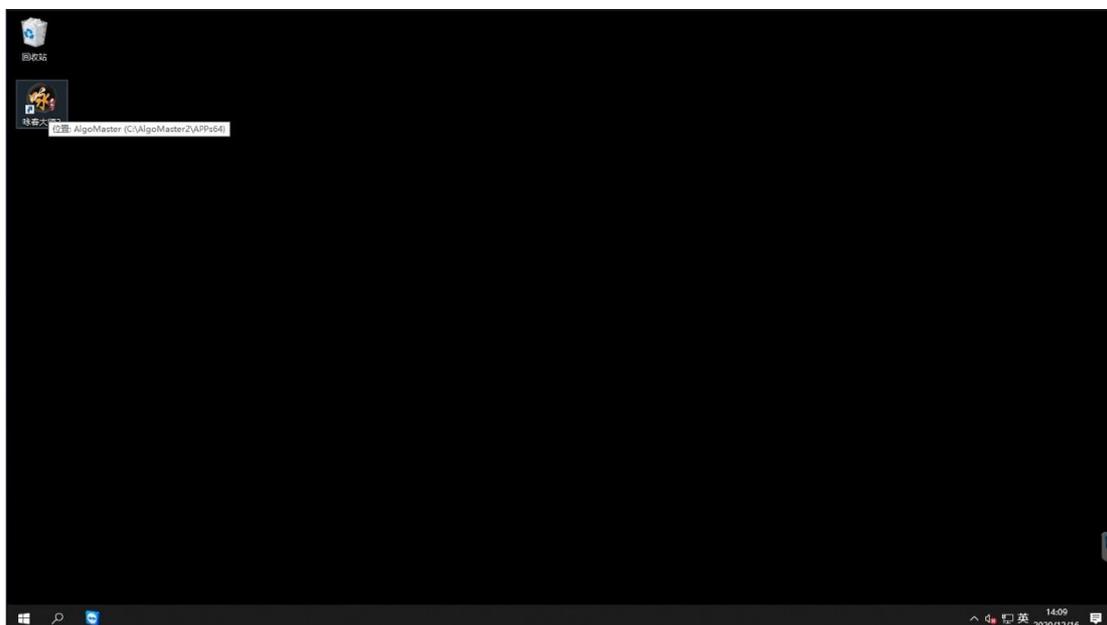


注 1: 为避免非预期的错误，软件默认安装路径为 C 盘

注 2: 安装包内含软件运行所需的 .Net Framework 4.6 和 Microsoft Visual C++2010-2017 可转发套件安装包，在安装过程中部分操作系统(如 win7)会自动重启电脑。

启动登入

咏春大师 2 软件是 Client/Server 架构的系统，软件开启时需使用管理员身份运行。



在登入画面中

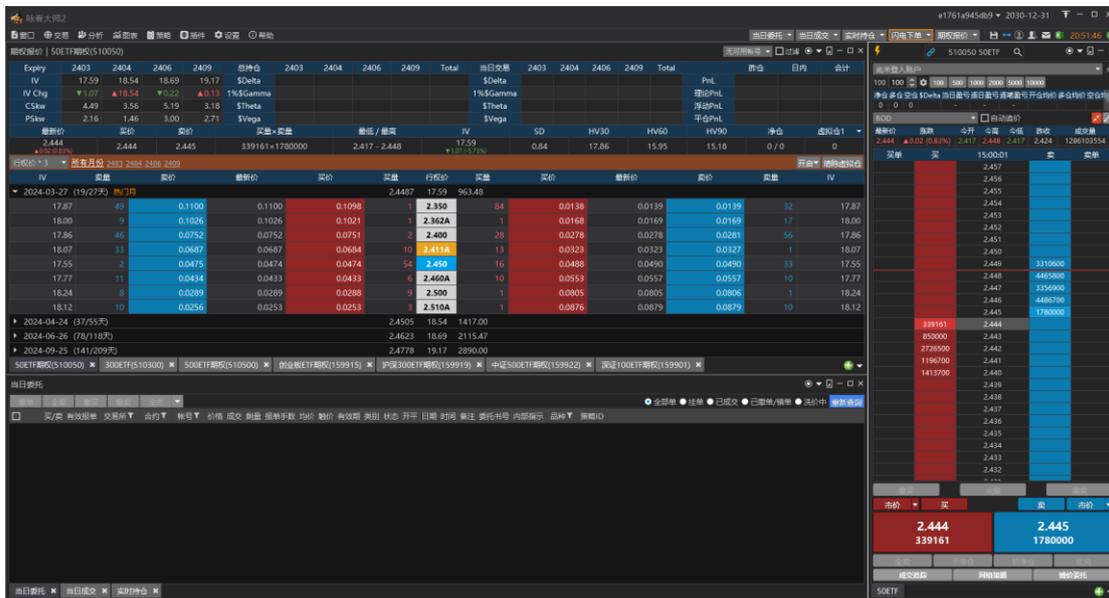
提供注册新会员功能，可获得 30 天免费试用。

提供重设密码功能，可通过短信验证找回密码。

输入手机号或会员账号、密码，登入交易系统。

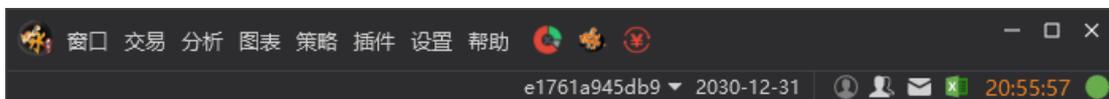


迷你模式与标准模式



完成登录后，进入系统，预设为标准模式的主窗口。

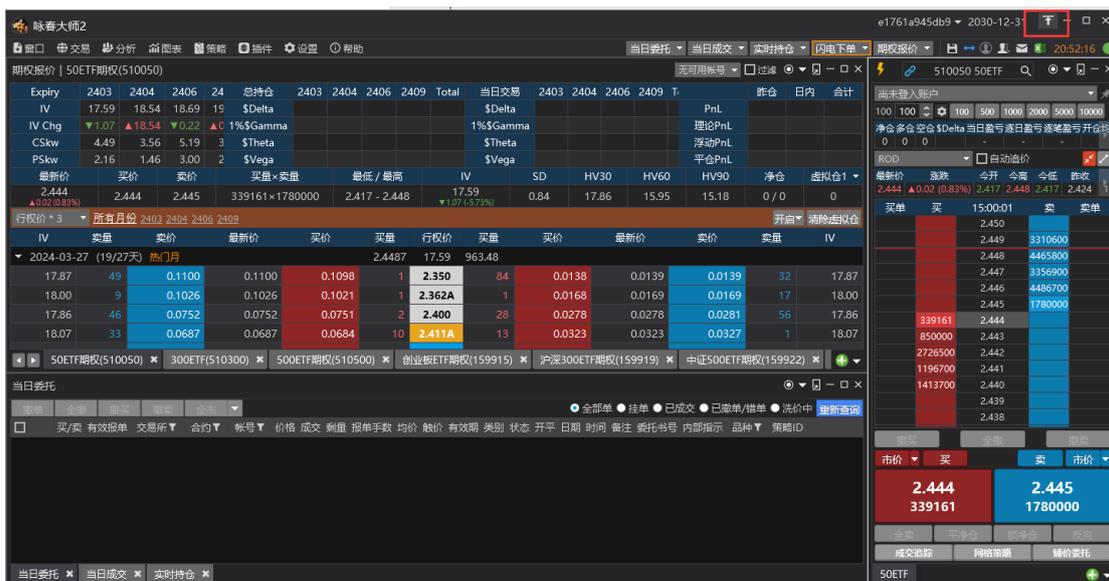
标准模式主窗口，菜单栏提供窗口、交易、分析、图表、策略、插件、设置、帮助功能菜单，并显示交易、行情、讯息连线状态，Excel 实时数据传输状态，系统时间。



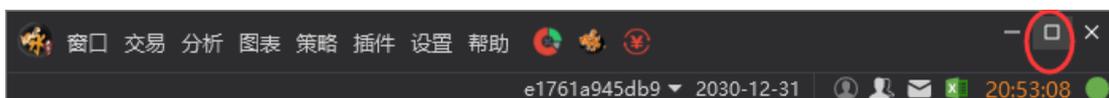
迷你模式工具栏提供窗口、交易、分析、图表、策略、插件、设置、帮助功能菜单，并显示交易、行情、讯息连线状态，Excel 实时数据传输状态，系统时间。

● 迷你模式与标准模式切换

通过主窗口的  按钮，可以切换到 mini 模式的工具栏。



在迷你模式下，通过顶部工具栏的  放大按钮，可以切换到标准模式的主窗口。



关闭程序

标准模式或 minii 模式下，通过关闭按钮，可选择最小化到系统托盘，或者退出系。



- 最小化到系统托盘：关闭主插件，核心程序仍在运行，可在系统托盘中的图标右键菜单结束系统。



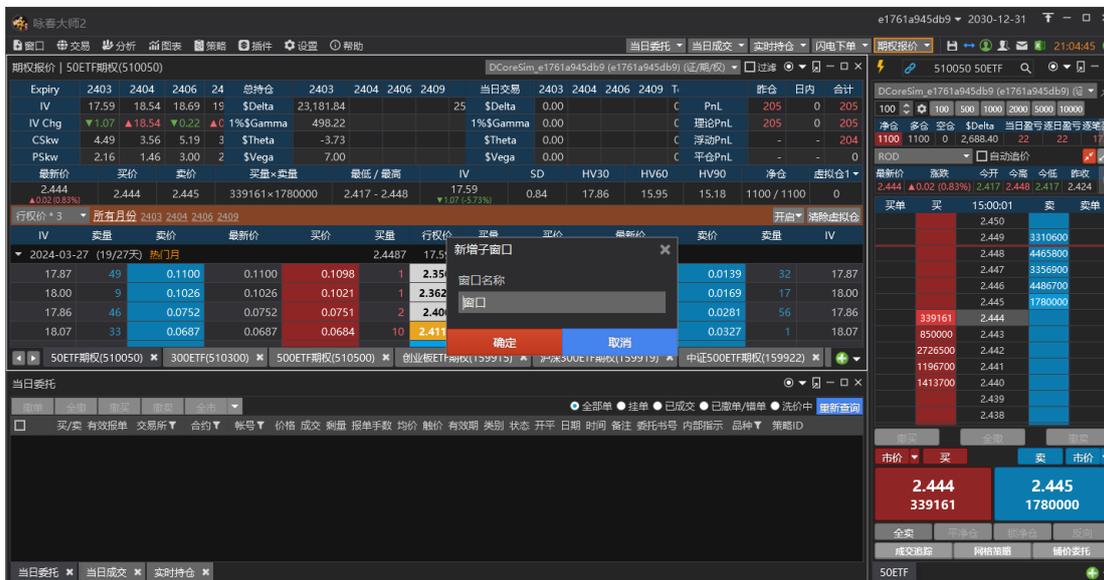
- 退出系统：关闭所有插件，以及核心程序

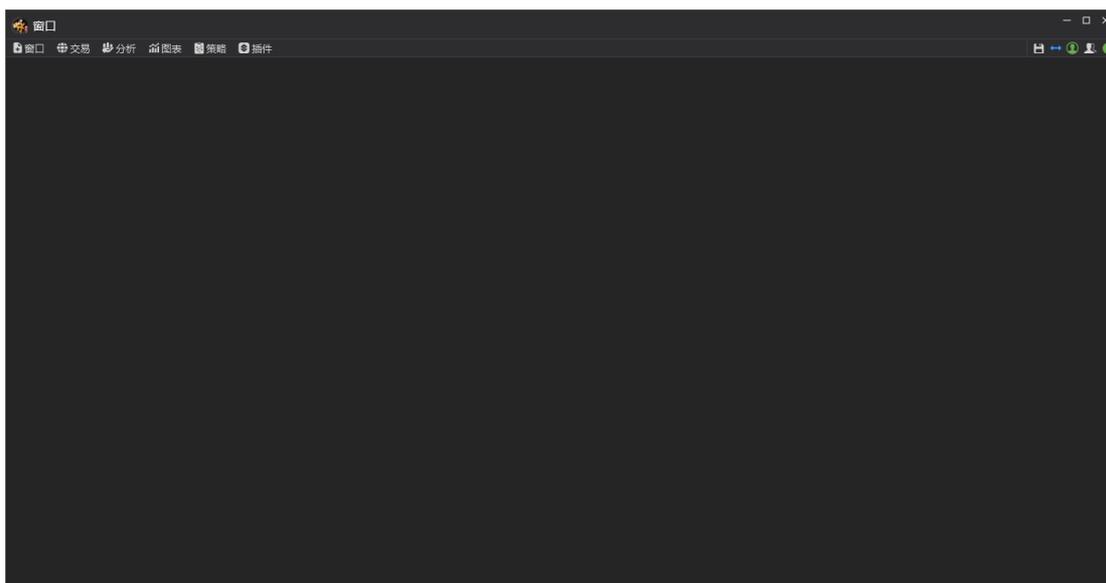
窗口

管理窗口

- 新增子窗口：

从“窗口”菜单中点击“新增”，输入窗口名称，然后按确定即可打开一个空白的子窗口。



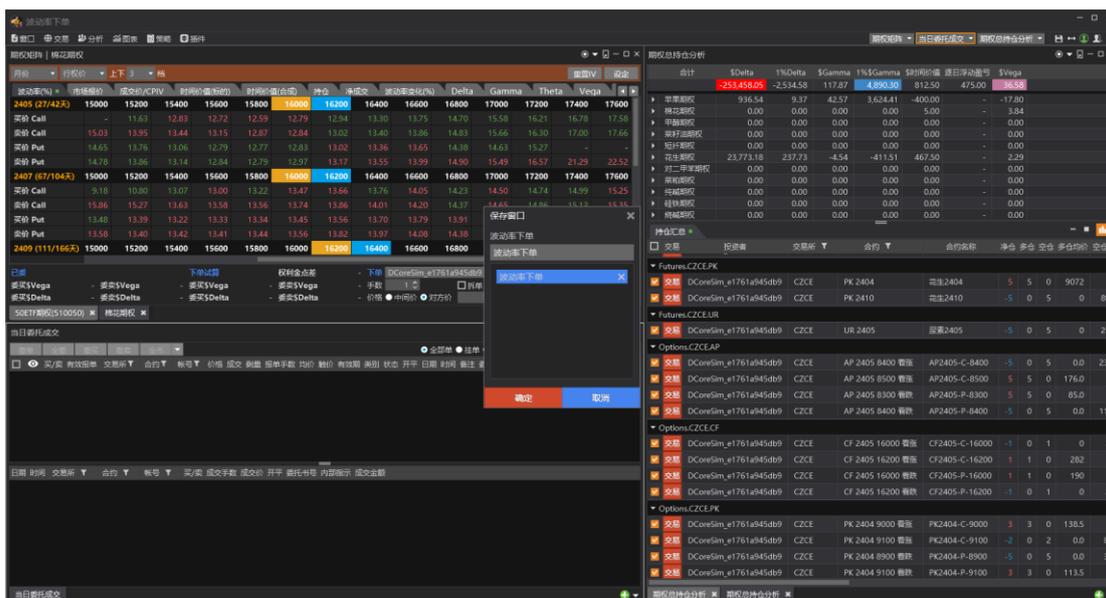


点击子窗口中的功能菜单，将功能加入到子窗口中，完成排列。

- 保存子窗口



点击保存窗口按钮，输入窗口名称，按确定保存。



- 保存窗口

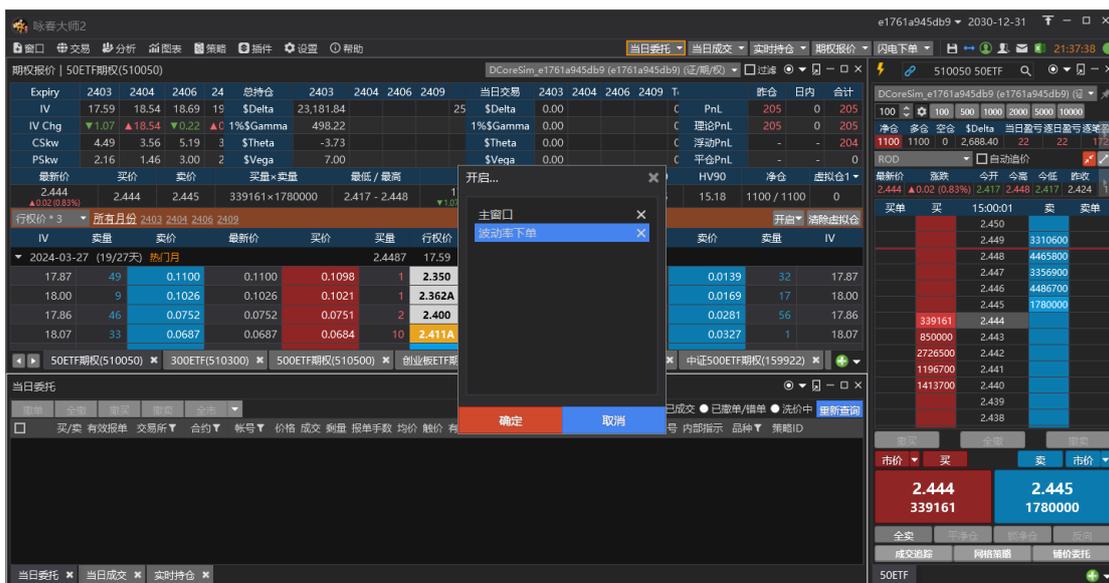
点击窗口->“保存窗口”，将当前的主窗口布局保存为一个子窗口。

- 保存所有窗口

点击窗口->“保存所有窗口”，将当前的主窗口、及所有开启着的子窗口，依次保存。

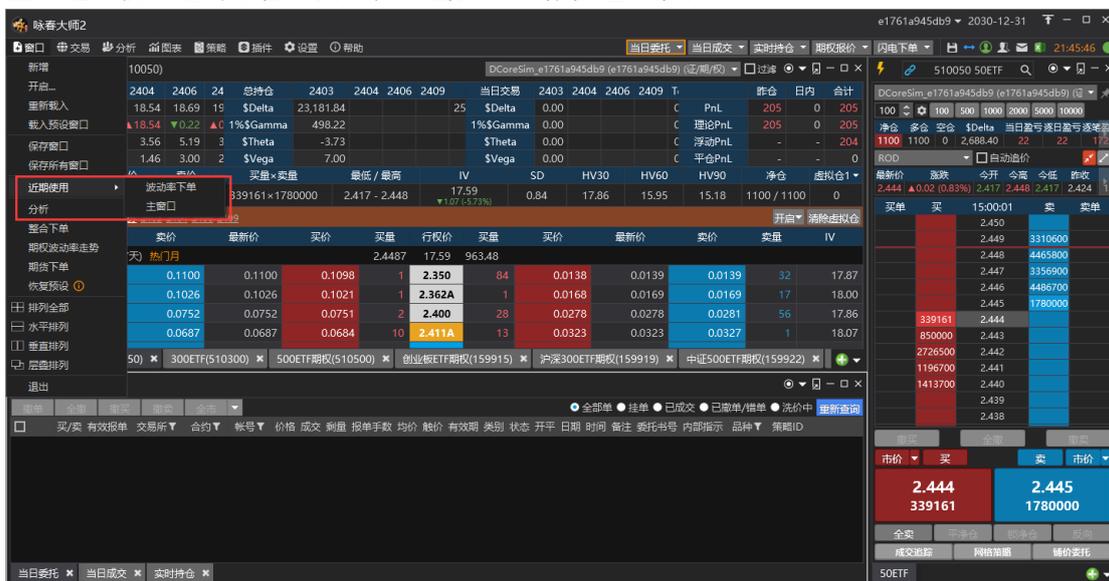
- 开启...:

点击窗口->“开启...”，显示已存储的子窗口列表，选择后按确定即可开启。



● 近期使用

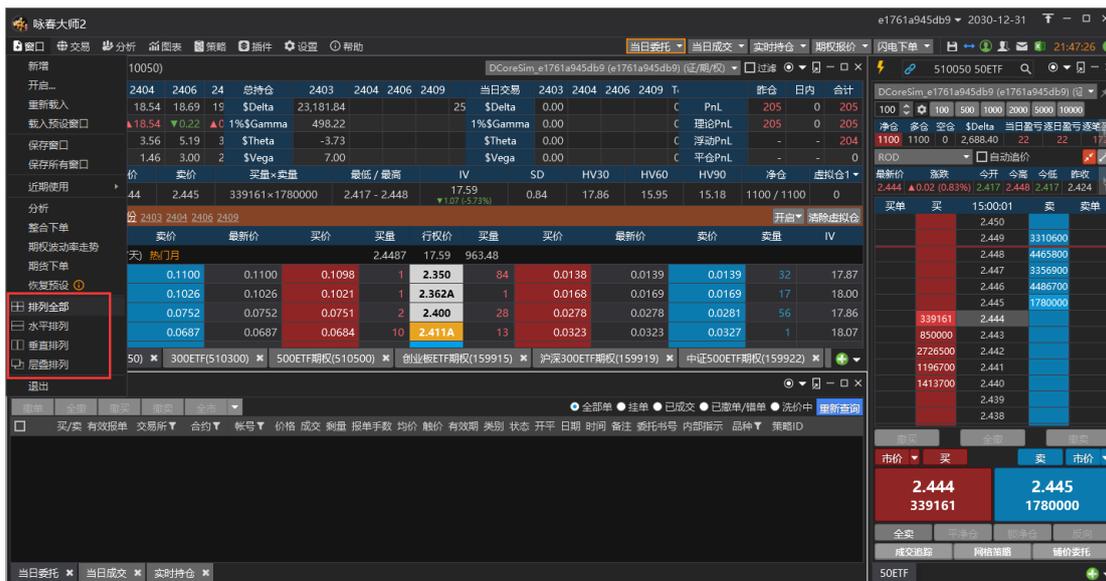
显示近期使用过的子窗口列表，点击列表名称快速开启。



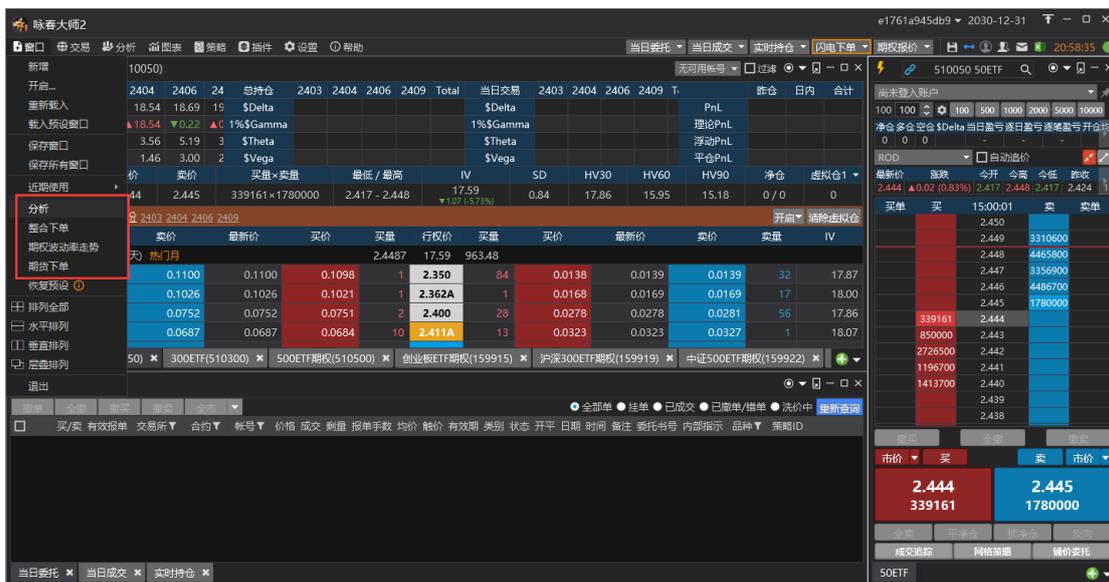
● 窗口排列

可以将窗口中的功能快速排列，可设定

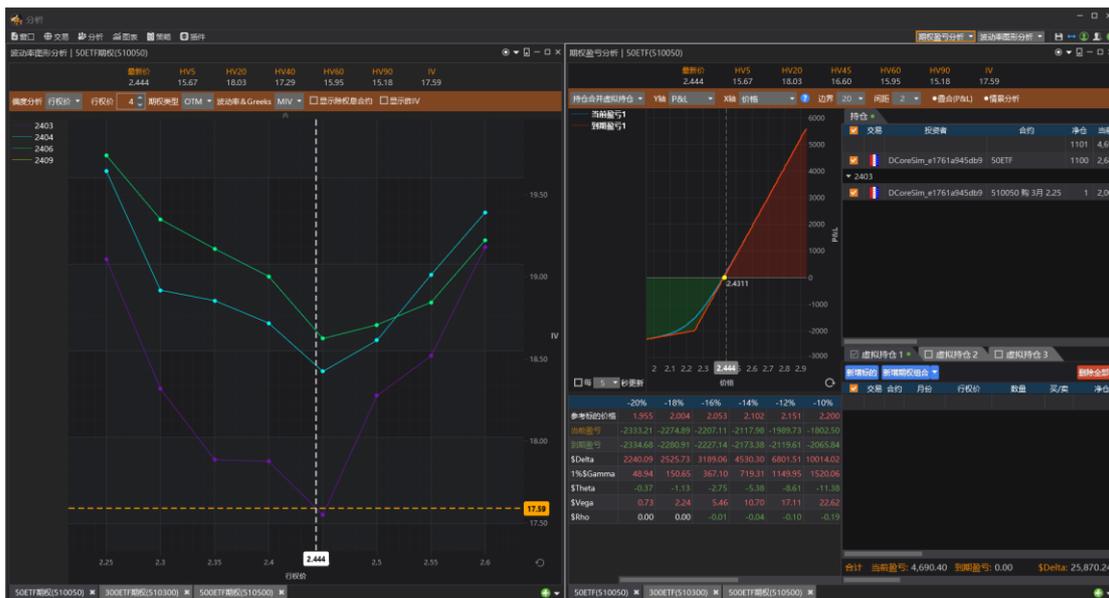
- 排列全部
- 水平排列
- 垂直排列
- 层叠排列



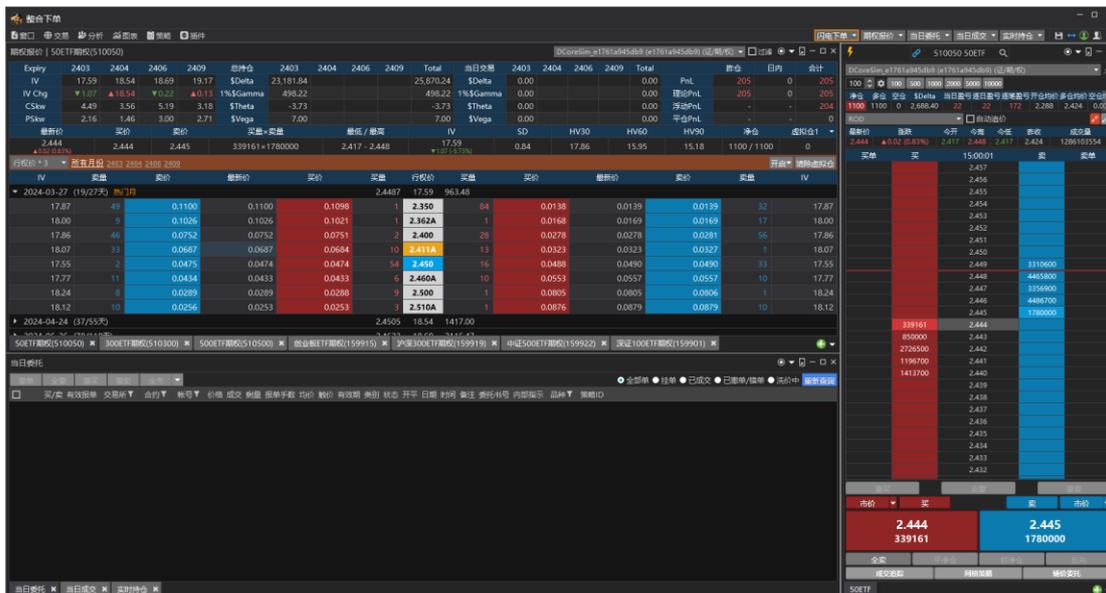
预设子窗口



在窗口菜单中，提供四个预设的窗口。



- 分析：
提供波动率图形分析、期权盈亏分析功能



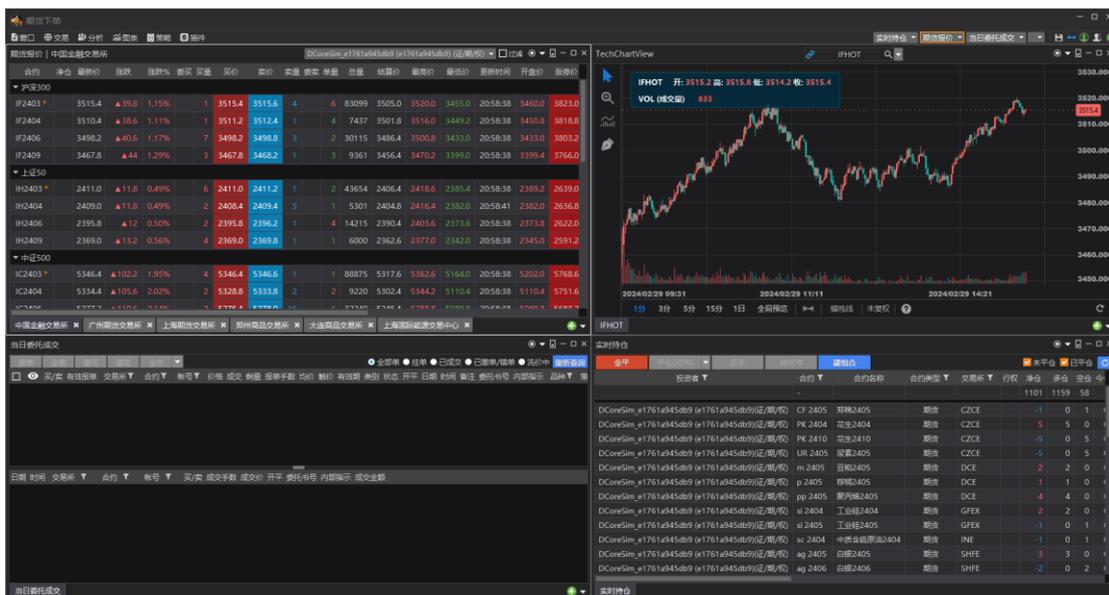
● 整合下单:

提供期权报价、闪电下单、当日委托成交回报、实时持仓功能



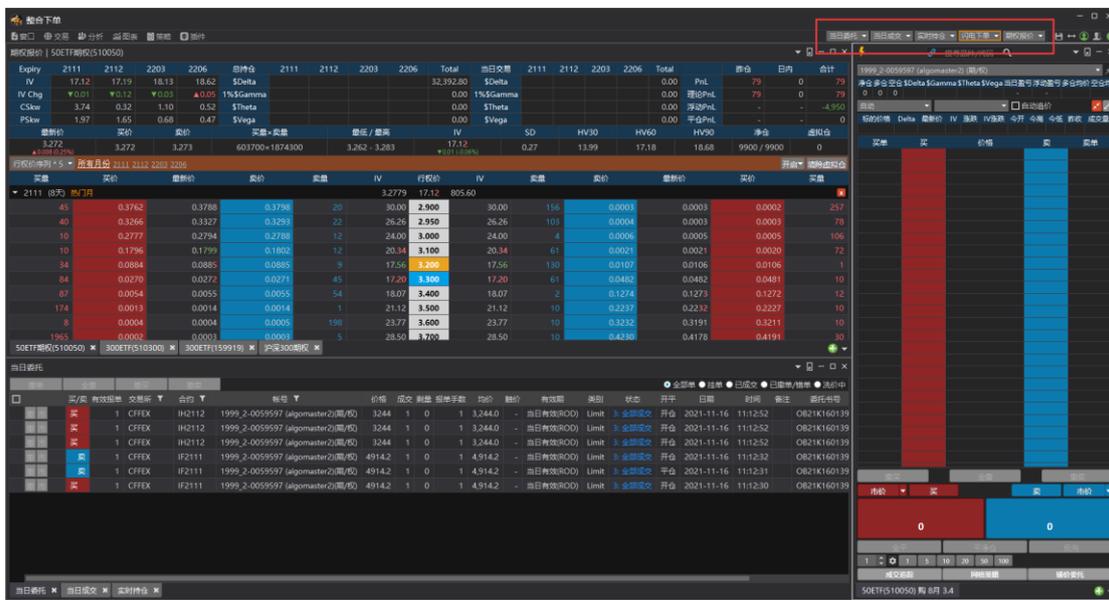
● 期权波动率走势:

提供期权各月份的波动率走势、CSkw、PSkw 走势数据。



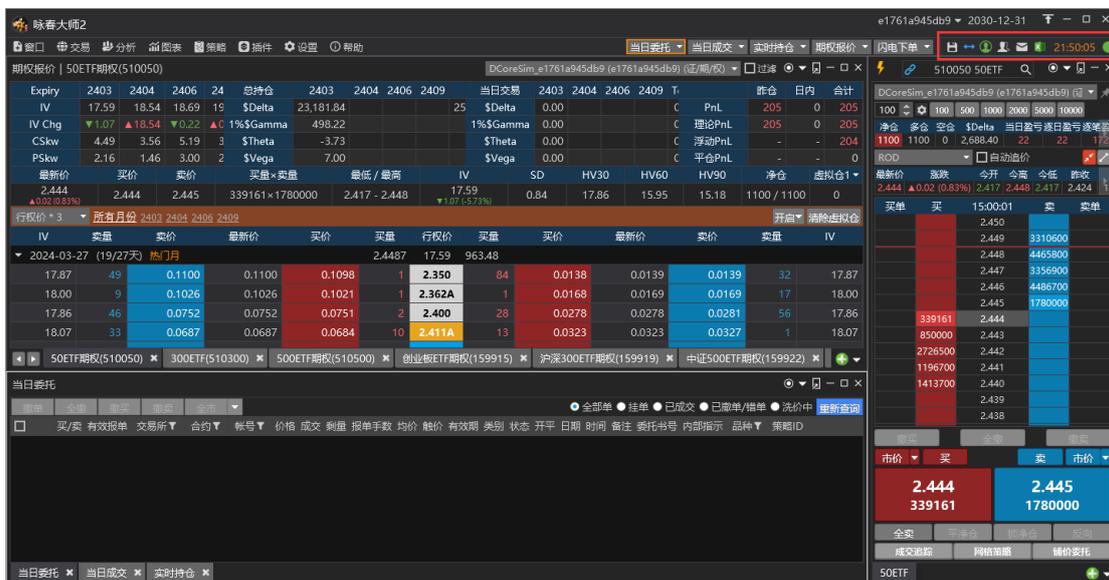
- 期货下单：
提供期货报价、技术线图、当日委托成交回报、实时持仓功能。
- 恢复预设
将四个预设子窗口恢复到出厂设置。

页签菜单



窗口中打开功能视图后，在右上角形成对应的页签菜单，点击页签菜单可以快速切换功能。

其他按钮功能



- 保存窗口：点击保存窗口
- 自动缩放：点击开启自动缩放，则调整窗口大小时，窗口内功能视图随着窗口缩放。
- 交易连线：显示交易连线状态，点击打开交易连线设置
- 群组账号：点击打开群组账号设置。
- 系统讯息记录：点击打开系统讯息记录
- Excel 实时数据传输
 - 关闭实时数据传输
 - 修改实时数据刷新频率
- 系统时间：显示系统时间
- 连线灯号：显示当前交易连线、行情连线、讯息连线状态灯，绿色表示连线正常，红色表示连线异常。

交易

报价功能

期权报价

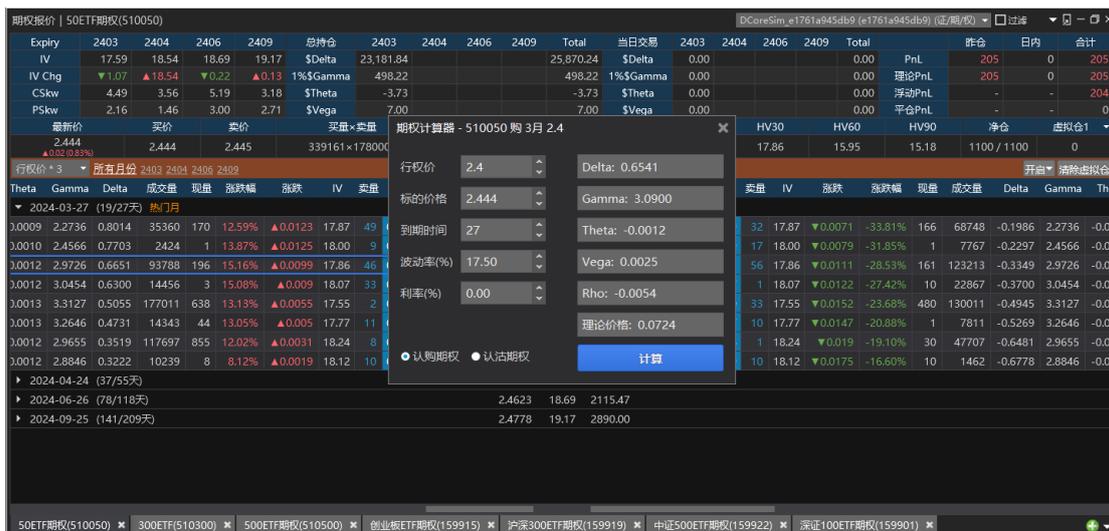
期权报价功能提供期权的 T 字报价功能。包含基础报价、风险参数报价、标的报价以

及行情与持仓监控。

- 期权行情与持仓监控
 - 提供期权各月份的 IV、IV 涨跌、CSkew、PSkew 报价
 - 提供期权各月份以及合计（合计包含标的现货）总持仓 Greeks 损益：\$Delta、1%\$Gamma、\$Theta、\$Vega。
 - 提供期权各月份以及合计（合计包含标的现货）当日交易 Greeks 损益：\$Delta、1%\$Gamma、\$Theta、\$Vega。
 - 提供期权以及标的现货昨仓、日内、以及合计的盈亏、理论盈亏、浮动盈亏、平仓盈亏。
- 标的报价
 - 提供期权标的合约的最新价、买价、卖价、买量×卖量、最高/最低报价。
 - 提供 IV、SD、HV30、HV60、HV90，即波动率，标准差，过去 30、60、90 天的历史波动率平均值。
 - 提供标的合约的净仓数量：净仓数量/净仓可平仓数量
 - 虚拟仓：设置标的虚拟仓数量
- 控制列
 - 设定行权价序列、切换期权月份
 - 开启：期权波动率走势、波动率图形分析、期权盈亏分析，开启对应功能。
 - 清除虚拟仓：清除期权合约以及标的合约的虚拟仓栏位设置
- T 字报价
 - T 字报价中，报价可按照期权月份收起/展开显示
 - 每个期权月份合约表头显示合约到期剩余天数，“热门月”期权月份，合成标的期货最新价、期权月份 IV、Straddle。
 - 在期权报价中，提供基本的报价栏位：
 - 买量、买价、最新价、卖价、卖量、涨跌、涨跌幅、现量、成交量、结算价、持仓量、更新时间、昨结算、今开盘、最高价、最低价、昨收盘、昨量、涨停价、跌停价、昨持仓量、持仓量变动、合约编码、标志码、到期日、报价状态、中间价、成交额、合约单位、当日均价、熔断参考价、内盘量、外盘量、内盘单量、外盘单量。
 - 在期权报价中，提供风险参数栏位：

- 标题栏设置
 - 资金账号列表：
 - ◆ 预设下单账号：从期权报价开启的下单工具预设所选的账号。
 - ◆ 勾选“过滤”后，期权报价中的\$Greeks、Pnl、净仓、委买委卖栏位将按所选账号过滤。
 - 显示当日交易
 - ◆ 设定是否显示当日交易的\$Greeks 数据
 - 显示行情与持仓监控
 - ◆ 设定是否显示 T 字报价上方的行情与持仓监控功能
 - 显示除权息合约
 - ◆ 设定是否显示除权息合约报价

- 设置虚拟仓
 - 在标的报价、T 字报价中，提供“虚拟仓”栏位，可以设定对应期权合约以及标的合约的虚拟仓数量。
 - 虚拟仓数量用于期权盈亏分析、期权投组盈亏分析。
 - 控制列提供“清除虚拟仓”按钮，点击可以清除当前画面品种的虚拟仓设定。



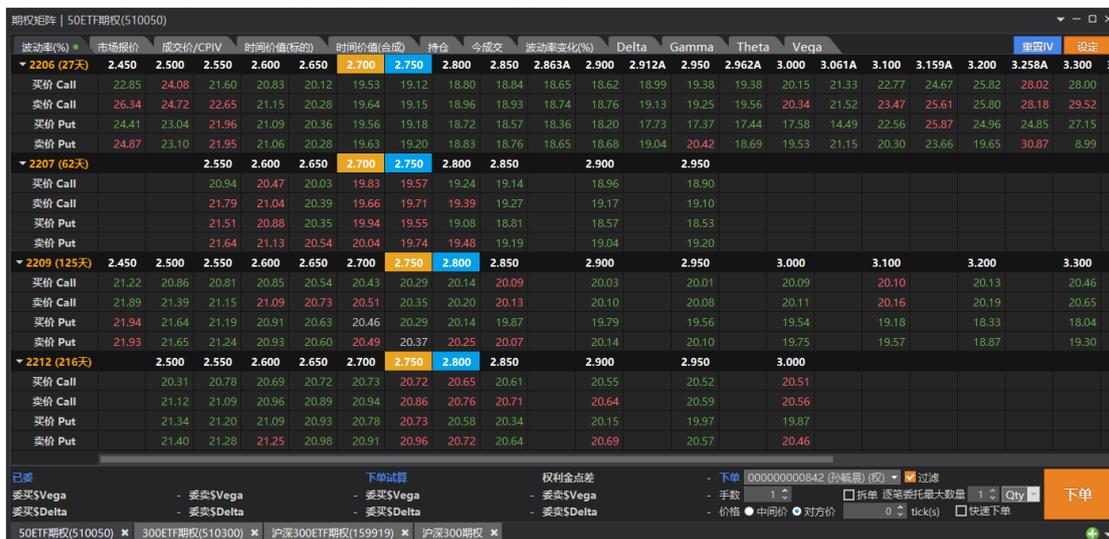
● 期权计算器

通过期权报价的右键菜单打开期权计算器：

- 设定好行权价、标的价格、到期时间(天数)、波动率(%)、利率、认购/认沽之后，点击“计算”按钮，则根据期权定价模型计算出对应的 Delta、Gamma、Theta、Vega、Rho、理论价格。

期权矩阵

期权矩阵报价中，各品种期权报价依矩阵排列显示。



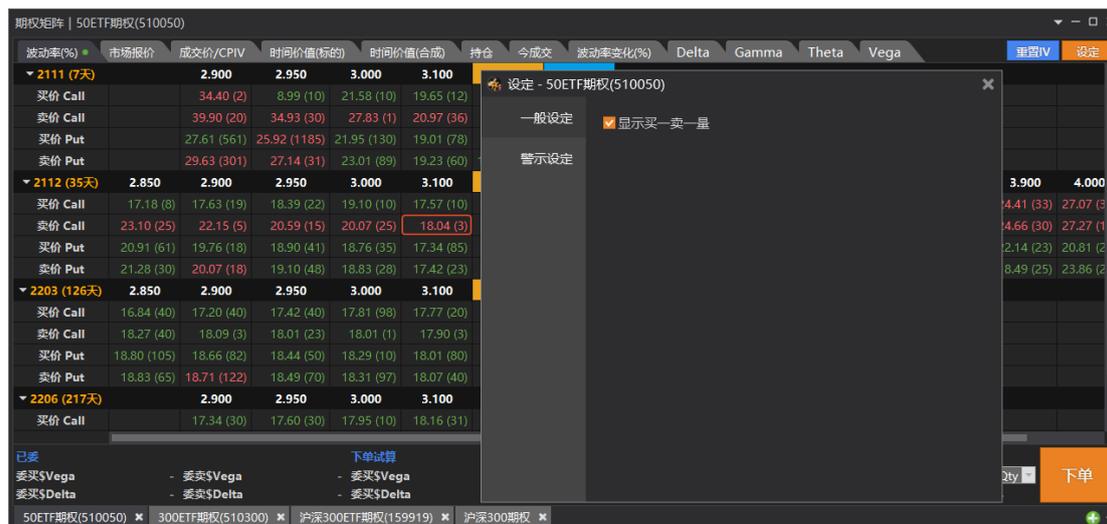
期权矩阵报价

提供页签切换行情字段：

- 行情字段
 - 波动率(%): BIV、SIV
 - 市场报价: 买价、卖价
 - 成交价/IV: 成交价、CPIV
 - 时间价值(标的): 原生标的计算的时间价值

- 时间价值(合成): 合成期货标的计算的时间价值
 - 持仓: 多仓、空仓、
 - 净成交
 - 波动率变化(%)
 - ◆ 买价: BIV-昨 IV
 - ◆ 卖价: SIV-昨 IV
 - Delta
 - Gamma
 - Theta
 - Vega
 - Charm
 - Vanna
 - Vomma
 - Speed(%)
 - Zomma
- 在行情页中, 双击可以打开下单工具
 - 右键菜单: 可通过右键菜单打开下单盒、闪电下单、技术线图、分时表

设定



- 一般设定: 显示买一卖一量
 - 勾选后, 在波动率(%), 市场报价, 波动率变化(%)页签中, 会显示买一卖一量
- 警示设定
 - 勾选合约
 - 设定警示指标
 - ◆ 波动率变化上限 (%)
 - ◆ 波动率变化下限 (%)
 - ◆ 现量
 - 行情警示
 - ◆ 市场波动率(BIV、SIV) 减去 重置波动率快照值, 结果大于波动率变化上限设定, 该合约会以红色虚线框出
 - ◆ 市场波动率(BIV、SIV) 减去 重置波动率快照值, 结果小于波动率变化下限设定, 该合约会以绿色虚线框出

- ◆ 当期权合约现量大于警示设定的现量值，该合约会用黄色背景标出
- 注：一般设定与警示设定，只针对当前品种生效。
- 重置 IV：
 - 计算波动率变化上下限警示，初始状态使用昨 IV 计算
 - 盘中点击“重置 IV”按钮，将当前 IV 作为重置波动率快照值，重新计算行情警示。

期权矩阵下单

- 可在行情区块中选取合约，合约将以红色边框显示
 - 使用鼠标左键点选单个合约
 - 使用鼠标左键拖曳选取多个合约
 - 使用 Ctrl+鼠标左键点选多个合约

The screenshot displays the 'Option Matrix' for SOETF options (510050). The table lists various contracts with columns for '波动率(%)', '市场报价', '成交价/CPIV', '时间价值(标的)', '时间价值(合成)', '持仓', '今成交', '波动率变化(%)', 'Delta', 'Gamma', 'Theta', and 'Vega'. The interface also features a bottom control panel with fields for '已委' (Orders), '下单' (Place Order), and '过滤' (Filter), along with a '下单' button.

- 下单设置
 - 账号：设定下单账号
 - ◆ 勾选“过滤”则报价持仓、今成交页签数据依所选账号过滤
 - 手数：设定下单手数
 - 价格：设定下单价格
 - ◆ 价格可切换中间价、对方价
 - ◆ 追价 ticks: 设定追价跳数，对方价/中间价加减设定的跳数，即为报单价格。
 - ◆ 中间价%: 当选择中间价时可设定追价%，计算中间价与对方价价差的百分比，再用中间价加减该值，即为报单价格。
 - 快速下单：勾选快速下单时
 - ◆ 点击下单按钮，会略过下单确认窗口，直接送单。
 - ◆ 可直接按“Enter”回车键快捷送单。
 - 勾选“拆单”选项时，如果单笔下单手数超过拆单设定逐笔委托最大数量，则自动拆单。
- 委托试算与下单试算
 - 已委：计算委托中报单风险敞口
 - ◆ 委买\$VEGA
 - ◆ 委买\$DELTA

- ◆ 委卖\$VEGA
- ◆ 委卖\$DELTA
- 下单试算：计算行情页中所选合约（未委托）的总风险敞口
 - ◆ 委买\$VEGA
 - ◆ 委买\$DELTA
 - ◆ 委卖\$VEGA
 - ◆ 委卖\$DELTA
 - ◆ 权利金点差
- 计算公式
 - ◆ $\$DELTA = \Delta \times \text{合约乘数} \times \text{合约数量} \times \text{参考标的价格}$
 - ◆ $\$VEGA = \text{Vega} \times \text{合约乘数} \times \text{合约数量}$
 - ◆ 权利金点差 = 委托价格 × 合约单位 × 合约数量

期货报价

提供期货商品的基础报价功能。

合约	净仓	最新价	涨跌	涨跌%	委买	买量	买价	卖价	卖量	委卖	单量	总量	结算价	最高价	最低价	更新时间	开盘价	涨停价
▼ 沪深300																		
IF2404 *		3581.8	▼16.8	-0.47%	33	3581.8	3582.0	2	1	18703	-	3604.2	3581.4	14:34:30	3595.2	3958.4		
IF2405		3577.0	▼16	-0.45%	3	3576.0	3578.0	2	1					34:28	3594.8	3952.2		
IF2406		3561.0	▼14.8	-0.41%	2	3560.6	3561.6	4	1					34:30	3574.8	3933.2		
IF2409		3518.6	▼11.4	-0.32%	3	3518.6	3519.0	6	5					34:29	3530.0	3883.0		
▼ 上证50																		
IH2404 *		2437.2	▼7.4	-0.30%	69	2437.2	2438.0	4	1					34:30	2444.2	2689.0		
IH2405		2437.4	▼7.6	-0.31%	1	2437.2	2438.2	7	1					34:10	2446.2	2689.4		
IH2406		2424.0	▼7.8	-0.32%	1	2424.0	2425.0	11	1					34:30	2433.6	2674.8		
IH2409		2391.0	▼6.6	-0.28%	1	2391.0	2392.0	2	1	2468	-	2404.2	2390.0	14:34:26	2400.8	2637.2		
▼ 中证500																		
IC2404 *		5366.8	▼29.2	-0.54%	10	5365.8	5366.8	1	1	16971	-	5410.8	5320.0	14:34:29	5392.8	5935.6		
IC2405		5346.8	▼29.2	-0.54%	4	5345.8	5347.8	3	1	3215	-	5391.8	5332.6	14:34:30	5378.0	5913.6		
IC2406		5308.4	▼25	-0.47%	2	5308.2	5309.2	6	1	12550	-	5349.0	5291.0	14:34:30	5331.6	5866.6		
IC2409		5248.0	▼22.6	-0.43%	7	5247.0	5249.0	8	1	5908	-	5286.0	5230.0	14:34:26	5280.0	5797.6		

期货报价的页签按照交易所分类，交易所下的品种报价可收起/展开。

- 在期货报价中，提供基本的报价栏位：
 - 合约、最新价、涨跌、涨跌%、买量、买价、卖价、卖量、单量、总量、结算价、最高价、最低价、更新时间、开盘价、涨停价、跌停价、昨结算价、昨收盘价、昨成交量、持仓量、昨持仓量、上市时间、下市时间。
- 净仓、委买、委卖
 - 在报价中，提供净仓、委买、委卖栏位，显示已登入的交易账号信息：合约的净仓数量，委托中的买单数量和委托中的卖单数量。
- 预设下单账号
 - 从期货报价开启的下单工具预设为所选的账号。
 - ◆ 勾选“过滤”后，期货报价中净仓、委买委卖栏位将按所选账号过滤。
- 报价打开下单工具

通过点击报价买价、买量、卖价、卖量栏位可打开下单盒或闪电下单

- 右键菜单
 - 开启：提供开启下单盒、闪电下单、分时表、技术线图的功能
 - 复制 RTD 标签：可将报价的 RTD 标签复制到 excel 中。
 - 栏位设定：勾选要显示的报价栏位。
 - 缩放：调整报价的字体大小

证券报价

证券报价功能提供重要指数和期权标的的证券报价功能。

合约	合约名称	最新价	涨跌	涨跌%	买量	买价	卖价	卖量	单量	总量	最高价	最低价	更新时间	开盘价	涨停价	跌停价
沪深重要指数																
期权标的																
510050	50ETF	2.466	▼0.009	-0.36%	459600	2.466	2.467	7398800	900	572278089	2.481	2.465	14:36:43	2.476	2.723	2.228
510180	180ETF	3.333	▼0.021	-0.63%	495300	3.332	3.335	452200	6000	19723775	3.358	3.331	14:36:34	3.358	3.689	3.019
510230	金融ETF	1.000	▼0.005	-0.50%	1513700	1.000	1.001	881500	380000	33595400	1.008	0.999	14:36:34	1.004	1.106	0.905
510300	300ETF	3.566	▼0.018	-0.50%	481300	3.565	3.566	2746900	102400	494357582	3.587	3.564	14:36:35	3.583	3.942	3.226
510500	500ETF	5.449	▼0.035	-0.64%	215700	5.449	5.451	150200	9200	305984102	5.489	5.431	14:36:34	5.483	6.032	4.936
510880	红利ETF	3.085	▲0.018	0.59%	978600	3.085	3.086	43300	7000	86389697	3.095	3.066	14:36:34	3.067	3.374	2.760
510900	H股ETF	0.751	▲0.006	0.81%	5559600	0.751	0.752	15577300	3800	503742390	0.756	0.747	14:36:33	0.748	0.820	0.671
512160	MSCI基金	1.068	▼0.004	-0.37%	320000	1.067	1.068	772300	206900	5834800	1.074	1.068	14:36:29	1.073	1.179	0.965
513500	标普500	1.843	▼0.006	-0.32%	445500	1.843	1.844	1420600	11600	251931000	1.848	1.831	14:36:33	1.844	2.034	1.664
588000	科创50	0.803	▼0.01	-1.23%	74882400	0.802	0.803	23754859	35200	1636597999	0.813	0.802	14:36:34	0.813	0.976	0.650
588080	科创板50	0.784	▼0.01	-1.26%	8602400	0.783	0.784	3438300	10000	333432742	0.794	0.783	14:36:33	0.794	0.953	0.635
600104	上汽集团	15.27	0	0.00%	18900	15.27	15.28	87600	600	18101743	15.41	15.24	14:36:35	15.35	16.80	13.74
600519	贵州茅台	1708.66	▼12.67	-0.74%	100	1708.49	1708.66	1100	200	2206213	1724.99	1705.05	14:36:33	1722.00	1893.46	1549.20
601318	中国平安	40.96	▼0.29	-0.70%	9600	40.95	40.96	4400	7900	35999170	41.46	40.91	14:36:34	41.19	45.38	37.13

- 在证券报价中，提供基本的报价栏位：
 - 合约、合约名称、最新价、涨跌、涨跌%、买量、买价、卖价、卖量、单量、总量、最高价、最低价、更新时间、开盘价、涨停价、跌停价、昨收盘价、昨成交量、持仓量、昨持仓量、报价状态、成交金额、交易所代码。
- 净仓、委买、委卖
 - 在报价中，提供净仓、委买、委卖栏位，显示已登入的交易账号信息：合约净仓数量，委托中的买单数量和委托中的卖单数量。
- 预设下单账号
 - 从证券报价开启的下单工具预设为所选的账号。
 - ◆ 勾选“过滤”后，证券报价中净仓、委买委卖栏位将按所选账号过滤。
- 报价打开下单工具
 - 通过点击报价买价、卖价栏位可打开下单盒或闪电下单
- 右键菜单
 - 开启在报价中点击鼠标右键，提供开启下单盒、闪电下单、分时表、技术线图的功能
 - 复制 RTD 标签
 - 若使用 ExcelRTD 功能，可以通过右键菜单直接复制 RTD 标签到 excel 中。
 - 栏位设定
 - 在栏位设定中，勾选要显示的报价栏位。

■ 指标设定

勾选要显示的 HV 指标栏位

合成期货

提供期权合成期货报价。利用相同到期日、相同行权价的两腿期权合约，合成期货多头、空头。

合成期货 沪深300期权						
期权月份	2404 热门月	合约排序	行权价			
合约	买量	买价	卖价	卖量	涨跌	涨跌幅
2850	6	3584.0	3587.4	6	▲0.2	0.01%
2900	6	3584.2	3587.2	6	▲0.2	0.01%
2950	6	3584.4	3587.6	12	▲0.2	0.01%
3000	6	3584.6	3587.6	6	▲0.2	0.01%
3050	6	3584.6	3587.6	12	▲0.2	0.01%
3100	6	3584.6	3587.4	12	▲5.8	0.16%
3150	18	3584.4	3586.8	6	▲1.4	0.04%
3200	12	3584.6	3587.2	6	▼0.6	-0.02%
3250	6	3585.2	3587.8	6	▲7.8	0.22%
3300	7	3585.8	3588.0	12	▲5.6	0.16%
3350	1	3587.0	3587.8	6	▲5.2	0.15%
3400	7	3586.0	3588.0	13	▲4.8	0.13%
3450	6	3586.6	3588.0	12	▲4.8	0.13%
3500	3	3586.6	3587.6	7	▲4.4	0.12%
3550	3	3587.4	3587.4	31	▲5.2	0.15%
3600	4	3587.4	3586.8	7	▲5.6	0.16%
3650	4	3588.0	3587.4	6	▲4.8	0.13%
3700	7	3588.0	3586.8	6	▲5	0.14%
3750	1	3588.2	3586.4	6	▲4.4	0.12%
3800	6	3588.4	3586.6	12	▲4.8	0.13%
3850	6	3588.8	3586.6	6	▲12	0.33%
3900	6	3589.4	3587.0	12	▲8	0.22%
3950	10	3589.6	3587.0	12	▲12.4	0.35%
4000	6	3589.6	3587.2	6	▲11.2	0.31%

合约排序:

行权价: 行权价由低到高排序

隐含最佳买价: 合成期货买价最高到最低排序

隐含最佳卖价: 合成期货卖价最低到最高排序

期权量能数据

期权量能数据提供期权品种 Call、Put 成交量、成交量变化、持仓量、持仓量变化等数据。

期权量能数据 50ETF期权(510050)				
	认购期权 (Call)	认沽期权 (Put)	合计	比率
成交量	450,412	379,122	829,534	1.19 : 1
成交量变化	-0.58%	0.58%	42.25%	
持仓量	1,935,608	1,293,186	3,228,794	1.5 : 1
持仓量变化	35,920 (1.89%)	19,609 (1.49%)	55,529	1.83 : 1
下跌量	240,755	186,496	427,251	1.29 : 1
成交量 %	53.45%	49.19%	51.50%	
上涨量	209,657	192,626	402,283	1.09 : 1
成交量 %	46.55%	50.81%	48.50%	
NET DELTAS	1,113	1,435	2,548	

- 成交量:
 - ◆ 认购期权(Call): Call 合约的总成交量
 - ◆ 认沽期权(Put): Put 合约的总成交量
 - ◆ 合计: Call 合约 + Put 合约的总成交量
 - ◆ 比率: Call / Put 成交量比例
- 成交量变化
 - ◆ 认购期权(Call): Call 合约总成交量变化 (变化比例)
 - ◆ 认沽期权(Put): Put 合约总成交量变化 (变化比例)
 - ◆ 合计: Call 合约 + Put 合约总成交量变化
- 持仓量
 - ◆ 认购期权(Call): Call 合约总持仓量
 - ◆ 认沽期权(Put): Put 合约总持仓量
 - ◆ 合计: Call 合约 + Put 合约总持仓量
 - ◆ 比率: Put/Call 持仓量比例
- 持仓量变化
 - ◆ 认购期权(Call): Call 合约总持仓量变化 (变化比例)
 - ◆ 认沽期权(Put): Put 合约总持仓量变化 (变化比例)
 - ◆ 合计: Call 合约 + Put 合约总持仓量变化
 - ◆ 比率: Put/Call 持仓量比例变化
- 下跌量
 - ◆ 认购期权(Call): Call 合约总下跌量; 并显示下跌量占总成交量比例饼状图
 - ◆ 认沽期权(Put): Put 合约总下跌量; 并显示下跌量占总成交量比例饼状图
 - ◆ 合计: Call 合约 + Put 合约总下跌量; 并显示下跌量占总成交量比例饼状图
 - ◆ 比率: Put/Call 下跌量比例变化
- 上涨量
 - ◆ 认购期权(Call): Call 合约总上涨量; 并显示上涨量占总成交量比例饼状图
 - ◆ 认沽期权(Put): Put 合约总上涨量; 并显示上涨量占总成交量比例饼状图
 - ◆ 合计: Call 合约 + Put 合约总上涨量
 - ◆ 比率: Put/Call 上涨量比例变化

- NET DELTAS
 - ◆ Net Deltas = Netted of Long & Short deltas
 - Long deltas
 - call trades on the ask price
 - put trades on the bid price
 - Short deltas
 - call trades on the bid price
 - put trades on the ask price

分时表

分时表功能提供合约当日分时成交明细。

通过交易->分时表菜单打开功能，使用“搜寻品种/合约”设定分时表合约。

也可以通过报价的右键菜单打开对应合约的分时表。

The screenshot shows the '分时表' window for the contract '510050 购 6月 2.7'. The table displays the following data:

时间	价格	量	累积量
15:00:00	0.0699		
14:56:59	0.0700		
14:56:58	0.0700		
14:56:58	0.0701		
14:56:57	0.0701		
14:56:54	0.0701		
14:56:53	0.0701		
14:56:51	0.0701		
14:56:50	0.0704		
14:56:50	0.0701		
14:56:49	0.0705		
14:56:48	0.0704		
14:56:47	0.0704	26	26
14:56:47	0.0703	3	25
14:56:46	0.0703	1	22

The '商品选择器' dialog is open, showing a grid of options for different strike prices and months. The grid has columns for '看涨-月份' (Call - Month) and '看跌-月份' (Put - Month). The '行权价' (Strike Price) column is highlighted. The dialog has '确定' (OK) and '取消' (Cancel) buttons at the bottom.

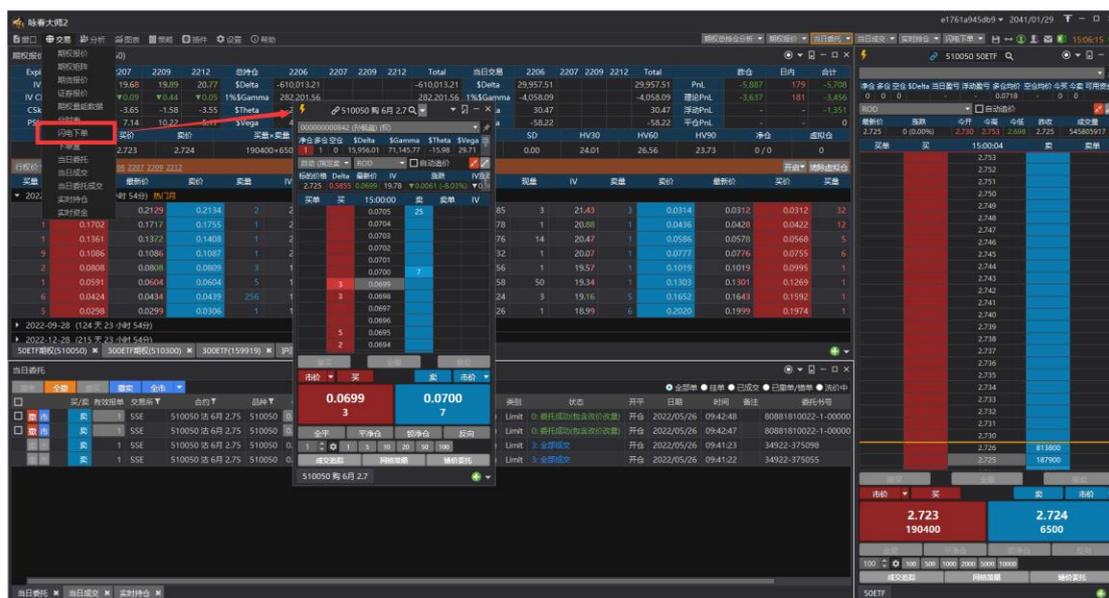
- 分时表栏位：时间、价格、量、累积量(连续相同价格的单量累积)、柱状条。
- 合约连动
 - ◆ 合约框中提供连动按钮，按钮显示灰色表示不连动，点击切换蓝色则合约连动，此时若在报价中点击任意合约，分时表将连动切换为该合约。

- 按量筛选资料
 - ◆ 分时表提供按量筛选功能：全部、量大于等于 10、量小于 10。

下单工具

闪电下单

提供使用者进行商品的委托下单：下单画面报价以价格序列显示，可以通过点选方式快速进行委托和撤单。

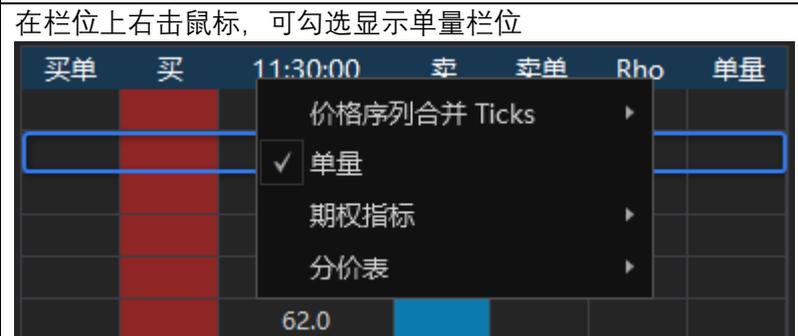


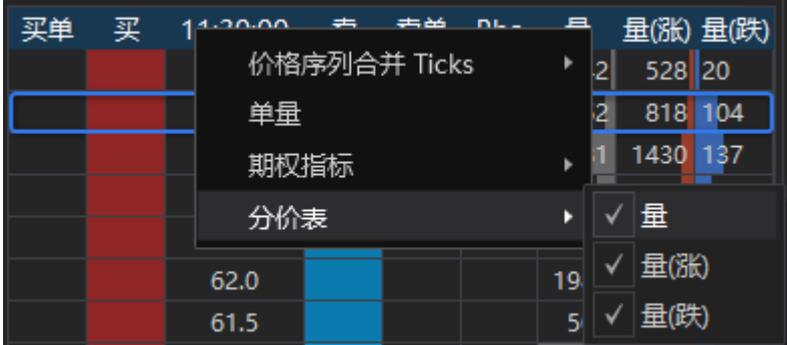
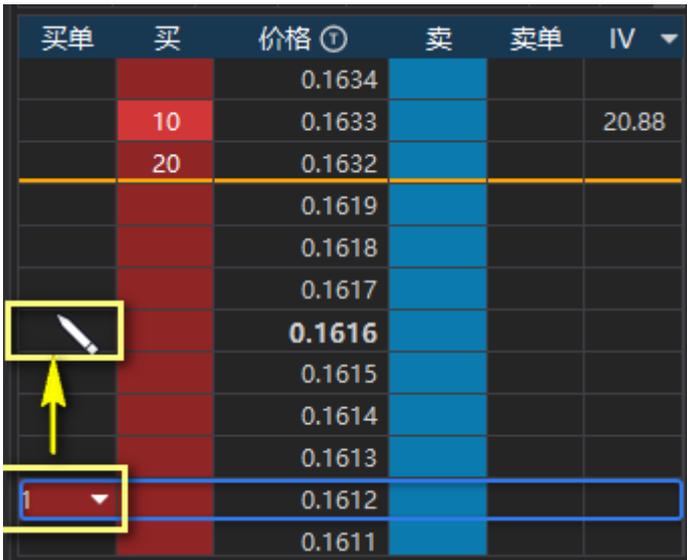
闪电下单功能说明：

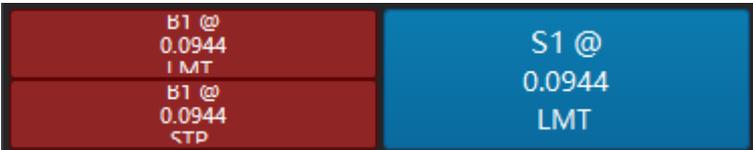
标题栏	<ol style="list-style-type: none"> 1、 搜寻合约：在合约输入合约名称或代码可以搜寻合约 2、 商品选择器：点击放大镜按钮，打开商品选择器，通过交易所和商品选单列表选择商品。 3、 合约连动：按钮显示灰色时表示不连动，点击切换为蓝色表示连动合约，此时在报价中点击任意合约可以将闪电切换为该合约。 4、 快速切换合约：通过合约下拉选单, 可快速切换 Call/Put、合约月份。 5、 保持视窗最前：闪电下单预设勾选“保持窗口最前” 6、 显示功能：预设勾选显示行情总列、市价买卖按钮、最佳买卖价下单按钮、全平反向按钮、自动追价、显示 ATM 策略 7、 中间价自动置中：勾选后，闪电价格序列实时将中间价置中显示 8、 显示下单确认视窗：勾选后，下单时显示确认提示 9、 设置为默认：将当前的闪电下单界面的设定和大小设置为默认设定，下次新开的闪电下单按此默认界面开启。 10、 还原默认：将 9 的默认设定还原为出厂设定。
-----	---

	
<p>账号选单</p>	<p>提供交易账号选单列表，当设定好合约之后，会按证券、期权、期货筛选出对应类型的账号显示在选单中。</p> <p>可以按  按钮将所选账号锁定。</p>
<p>委托数量</p>	<p>1、在输入框中输入委托数量，或者点击右侧的数量按钮填入数量</p>  <p>2、在闪电的持仓列中点击“净仓”栏位，会将净仓数填入委托数量输入框中。</p> <p>3、设定：数量按钮可以切换取代、累加两种设定方式；“持仓”按钮表示将闪电上的账号合约净仓数量填入委托数量设定。</p> 
<p>持仓列</p>	<p>显示合约净仓、多仓、空仓数量，\$Delta、\$Gamma、\$Theta、\$Vega、当日盈亏、浮动盈亏、多仓均价、空仓均价、今买、今卖数量、可用资金。</p>  <p>在持仓列点击鼠标右键可以设定栏位：</p>

	
<p>仓别和有效期</p>	 <p>1、仓别：支持自动、自动(自定卖开)、开仓、平仓、备兑开仓、备兑平仓 2、有效期：支持 ROD 当日有效、FOK 全成或全撤、自动拆单 ROD、冰山拆单 ROD。</p>
<p>自动追价</p>	<p>勾选可以开启自动追价功能，通过设置->自动追价设定，设定未成交自动追价条件。</p>
<p>价格序列压缩</p>	 <p>点击按钮可以压缩价格序列、解除压缩价格序列</p>
<p>行情总列</p>	<p>显示合约的标的价格、Delta、最新价、IV、涨跌、IV 涨跌、今开、今高、今低、昨收、成交量、理论价：</p>  <p>在行情列点击鼠标右键可以设定栏位：</p> 

	
<p>买单</p>	<p>此栏位显示当前账号下的买挂单数量标记，点击数量可以撤单</p>
<p>卖单</p>	<p>此栏位显示当前账号下的卖挂单数量标记，点击数量可以撤单</p>
<p>买</p>	<p>此栏位显示合约报价买量，点击此栏位可以送出限价买入委托</p>
<p>卖</p>	<p>此栏位显示合约报价卖量，点击此栏位可以送出限价卖出委托</p>
<p>更新时间</p>	<p>此栏位显示合约报价更新时间，对应栏位显示合约价格序列，双击价格序列，跳回最新价位置。</p>
<p>价格序列合并 ticks</p>	 <p>在栏位上右击鼠标，可设置价格序列合并 Ticks：将价格序列按照设置跳数合并显示</p>
<p>单量</p>	 <p>在栏位上右击鼠标，可勾选显示单量栏位</p>
<p>期权指标</p>	 <p>在栏位上右击鼠标，可勾选期权指标：IV、Delta、Gamma、Vega、Theta、Rho 栏位</p>
<p>分价表</p>	<p>分价表指当天的成交量在每个价位的分布。 在栏位上右击鼠标，可勾选：量、量(涨)、量(跌)，分别表示总成交量、上涨成交量、下跌成交量的累积量，以柱状图显示。</p>

	
<p>委托改价</p>	<p>在“买单”“卖单”栏位中，鼠标点击挂单数量，待鼠标指针变为  指针后，再次点击要改价的价格所对应“买单”“卖单”栏位，即可完成改价。</p> 
<p>撤买(1) 全撤(1) 撤卖</p>	
<p>撤买</p>	<p>按下撤买按钮，将闪电所选账号、合约的全部买单撤销</p>
<p>撤卖</p>	<p>按下撤卖按钮，将闪电所选账号、合约的全部卖单撤销</p>
<p>全撤</p>	<p>按下全撤按钮，将闪电所选账号、合约的全部买挂单和卖挂单撤销</p>
<p>市价 ▾ 买 卖 市价 ▾</p>	
<p>市价买 按钮</p>	<p>按下红色 市价 按钮，送出市价买入委托，右侧下拉按钮可设定有效期</p>
<p>买 按钮</p>	<p>按下红色 买 按钮，以买一价送出限价买入委托</p>
<p>卖 按钮</p>	<p>按下蓝色 卖 按钮，以卖一价送出限价卖出委托</p>
<p>市价卖 按钮</p>	<p>按下蓝色 市价 按钮，送出市价卖出委托，右侧下拉按钮可设定有效期</p>
<p>最佳买卖价下单按钮</p>	<p>1、按钮显示闪电下单所选合约的买一价、买一量、卖一价、卖一量；红色表示买入、蓝色表示卖出。</p>  <p>2、在价格序列上，没有点选价格的情况下，鼠标移到最佳买卖价下单按钮上，显示 4 个按钮，图例：</p> <p>a) S1@0.0937 LMT</p>

	<p>b) B1@0.0937 LMT c) B1@0.0940 LMT d) S1@0.0940 LMT S 表示卖、B 表示买，1 表示下单数量，@0.0937 表示委托价格为买一价，@0.0940 表示委托价格为卖一价，LMT 表示限价单类型。</p>  <p>3、在价格序列上，点选价格 (0.0944) 高于卖一价的情况下，鼠标移到最佳买卖价下单按钮上，提供 3 个按钮，图例：</p> <p>a) B1@0.0944 LMT b) B1@0.0944 STP c) S1@0.0944 LMT S 表示卖、B 表示买，1 表示下单数量，@0.0944 表示委托价格为点选价格 (0.0944)，LMT 表示限价单类型，STP 表示止损单类型</p>  <p>4、在价格序列上，点选价格 (0.0940) 介于买一价和卖一价之间，鼠标移到最佳买卖价下单按钮上，提供 2 个按钮，图例：</p> <p>a) B1@0.0940 LMT b) S1@0.0940 LMT S 表示卖、B 表示买，1 表示下单数量，@0.0940 表示委托价格为点选价格 (0.0940)，LMT 表示限价单类型</p>  <p>5、在价格序列上，点选价格 (0.0935) 低于买一价的情况下，鼠标移到最佳买卖价下单按钮上，提供 3 个按钮，图例：</p> <p>a) B1@0.0935 LMT b) S1@0.0935 LMT c) S1@0.0935 STP S 表示卖、B 表示买，1 表示下单数量，@0.0935 表示委托价格为点选价格 (0.0935)，LMT 表示限价单类型，STP 表示止损单类型</p> 
全平 按钮	按下全平按钮，将闪电所选账号、合约的持仓全部平仓。在“交易偏好设定”中提供平仓快捷按钮价格设置。
平净仓 按钮	按下平净仓按钮，将闪电下单所选账号、合约的净仓数量平仓。在“交易偏好设定”中提供平仓快捷按钮价格设置。
锁净仓 按钮	按下锁净仓按钮，将闪电下单所选账号、合约的净仓数量锁仓。
反向 按钮	按下反向按钮，送出一笔反向的【自动】单，数量为净仓*2，自动单会根据

	当时的持仓来自动判断开平。在“交易偏好设定”中提供反向快捷按钮价格设置。

闪电下单 ATM 策略：

- 成交追踪

- 触价止损：委托进场后根据预设定的止损点 触发止损后委托出场。

闪电下单点击成交追踪按钮使其变为黄色后展开触价止损参数设定如下图



根据上图举例：勾选启用后

如下图在 510050 2103 C3.4 在 0.12 价格买入，同时使用触价止损策略，止损点设定为 10，则委托时会送出两笔委托，第一笔 Limit 买入，状态为委托成。第二笔 Stop 卖出，状态为等待中。假设第一笔成交在 0.1186，第二笔状态由等待中边为洗价中，触价价格为 $0.1186 - 0.001 = 0.1176$ 。当行情条件触发 0.1176 后 Stop 止损单以 Market 价格出场。

买/卖	有效限单	交易所	合约	账号	价格	成交	数量	原单手数	均价	触价	有效期	类别	状态	开平	日期	时间	备注	委托序号	内部序号
买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (双生瑞)00	0.12	0	1	1	0.1176	当日有效(ROD)	Stop	13: 洗价中	自动	2021-03-22	10:26:09			1102609637W	
买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (双生瑞)00	0.12	1	0	1	0.1186	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	开仓	2021-03-22	10:26:09			101300020-000070104	1102609630V

- 追踪止损：委托进场后根据预设的的损点 触发后止损点位后委托出场。盈利达到追踪步长时将止损点上移。

闪电下单点击成交追踪按钮使其变为黄色后展开，点选追踪止损显示参数设定如下图



根据上图举例：勾选启用后

在 510050 购 3月 3.4 合约限价买入 0.1155 使用追踪止损策略。此策略会送出两笔委托，第一笔 Limit 买入 0.1155，状态委托成功。第二笔为追踪止损委托，委托有效期为 Trailing Stop，状态为等待中。若第一笔成交在 0.1150 则第二笔状态变为洗价中，触发价格为 $0.1140 = 0.1150 - 0.001$ 。若行情满足触发条件，发送 Market 出

场单。若行情上涨到 0.1160 (0.1155+追踪步长 5 跳) 时，第二笔触发价格变为 0.1145(0.1140+追踪步长 5 跳) · 满足触发条件发送 Market 出场单。

买/卖	有效报单	交易所	合约	帐号	价格	成交	剩量	报单手数	均价	触价	有效期	类别	状态	
撤市	停止	卖	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)		0	1	1	0.1140	当日有效(ROD)	Trailing Stop	13: 洗价中
撤市	买	买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1155	1	0	1	0.1150	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交

● 网格策略：

■ 参数设定说明

- ◆ 参数设定值单位为最小跳动点。
- ◆ 上行参数/下行参数：若第一笔进场委托为买开，则上行参数为出场卖平，价格为第一笔买开报单价格 + 设定数值。下行参数为循环时再次买开进场，价格为第二笔报单价格 - 设定数值。
- ◆ 循环次数：循环委托买卖次数总和

闪电下单点击网格测试按钮使其变为黄色后展开触价止损参数设定如下图



根据上图举例：勾选启用后

买入 510050 购 4 月 3.4 合约，委托价格 0.1232，则委托时会送出 7 笔委托：第一笔委托成功，其余 6 笔等待中。第一笔委托成交后，第二笔状态由“等待中”转为“委托成功”，卖出报单价格为 0.1243 (0.1232 + 上行参数 11)，第二笔委托成交后，第三笔状态由“等待中”转为“委托成功”，买入报单价格为 0.1234 (0.1243 - 下行参数 9)。依次类推至 7 笔委托完全成交。

委托回报如下图：

买/卖	有效报单	交易所	合约	帐号	价格	成交	剩量	报单手数	均价	触价	有效期	类别	状态	开平	日期	时间	备注	委托序号	内部指示	
买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1238	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329472C	
卖	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1247	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329469B	
买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1236	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329410A	
卖	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1245	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329407Z	
买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1234	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329404Y	
卖	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1243	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329402X	
撤市	买	买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1232	0	1	1		当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价止损)	开合	2021-03-22	11:23:29		101300020-000070208	1112329369W

总结：

1. 委托笔数=循环次数+1

2. 循环委托卖出价格带入上行参数， 买入价格带入下行参数。

● 铺价委托：

■ 参数设定说明

- ◆ 笔数： 铺价委托的笔数
- ◆ 档位： 铺价委托的价格递增或递减数
- ◆ 增量： 铺价委托手数的递增量

闪电下单点击网格测试按钮使其变为黄色后展开触价止损参数设定如下图



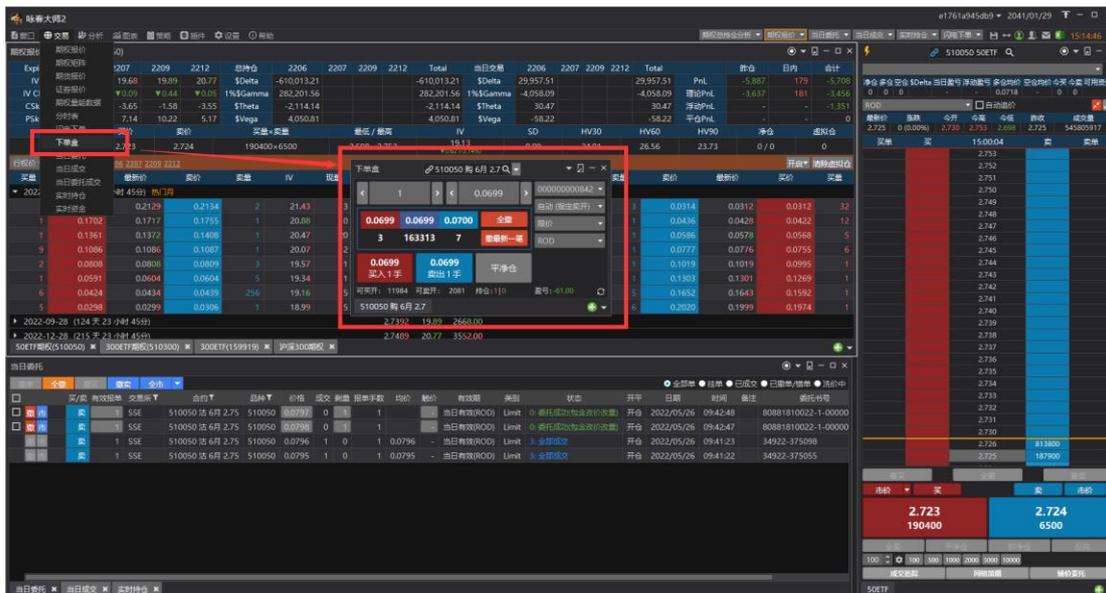
如上图设定 · 510050 购 4 月 3.4 买入 1 手， 委托价格 0.1121 ·

启用铺价委托， 则实际送出 11 手委托单 · 第一笔委托数量 1 · 委托价格 0.1121 · 第二笔委托数量 2 (1 + 增量) · 委托价格 0.1116 (0.1121 + 档位)。依此类推总共委托 11 笔。

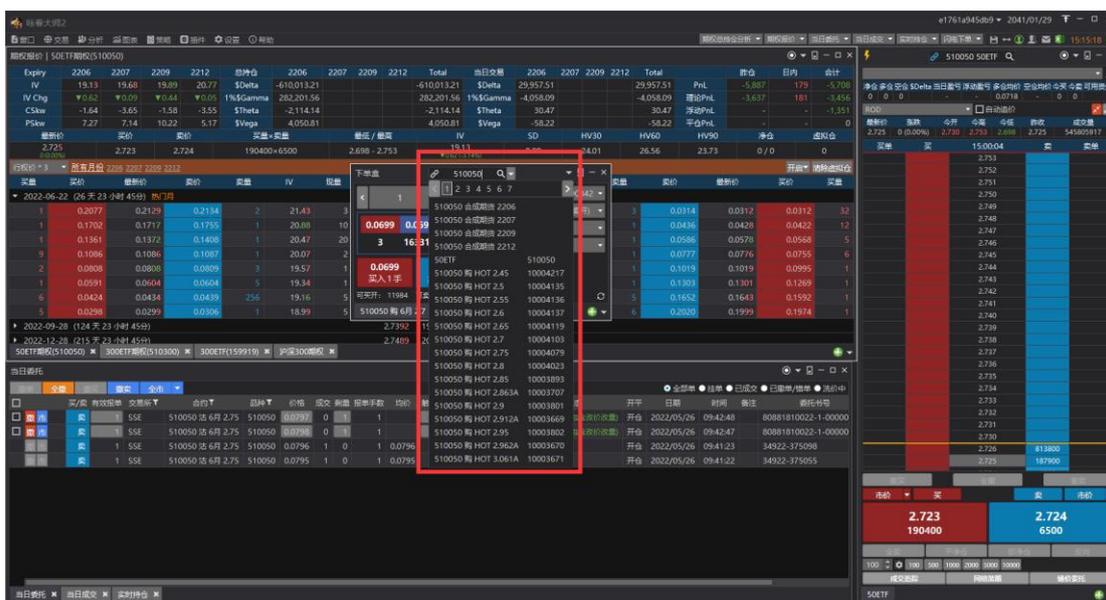
买/卖	有效报单	交易所	合约	帐号	价格	成交	剩量	报单手数	均价	均价	有效期	类别	状态	开平	日期	时间	备注	委托序号	内部展示
买	11	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1071	0	11	11			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070238	1141538861P
买	10	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1076	0	10	10			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070236	1141538848D
买	9	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1081	0	9	9			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070235	1141538827N
买	8	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1086	0	8	8			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070237	1141538813M
买	7	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1091	0	7	7			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070234	1141538806L
买	6	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1096	0	6	6			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070233	1141538797K
买	5	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1101	0	5	5			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070232	1141538786J
买	4	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1106	0	4	4			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070231	11415387762
买	3	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1111	0	3	3			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:38		101300020-000070230	1141538747H
买	2	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1116	0	2	2			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:38		101300020-000070229	1141538714G
买	1	SSE	510050 购 3 月 3.4	1013-101300020 (文生局/成)	0.1121	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	0 委托成功(包含止损价改单)	开台	2021-03-22	14:15:38		101300020-000070228	1141538671F

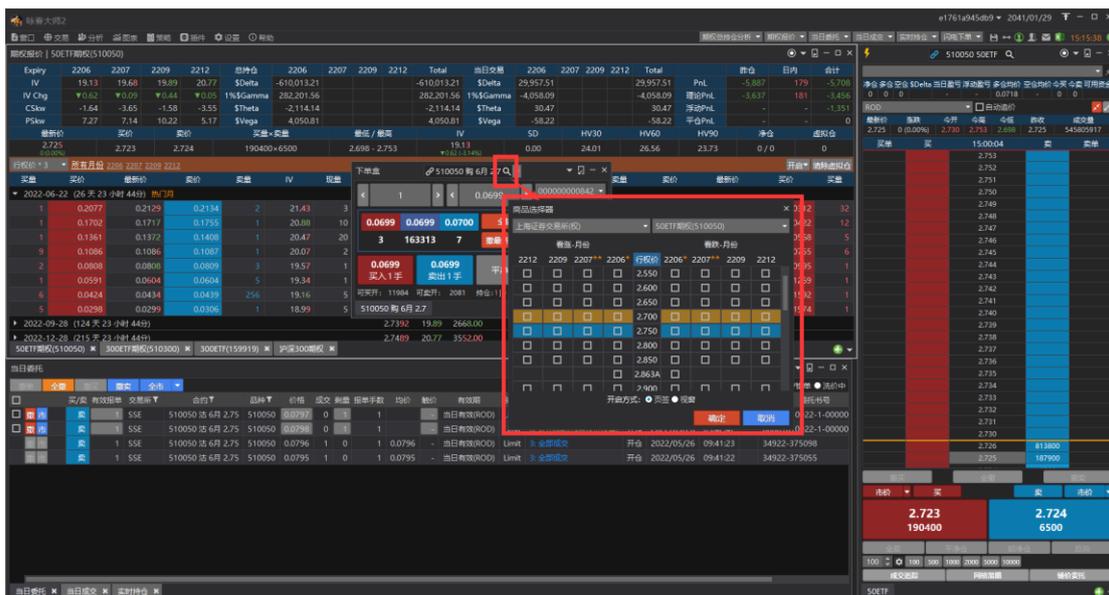
下单盒

提供基本的下单功能。

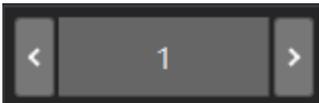
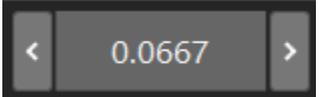


在上方合约框可以通过搜寻品种/代码设置下单合约；或者通过放大镜按钮打开“商品选择器”，通过交易所&品种选单选择下单合约。





下单盒功能说明

<p>标题栏</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1、 搜寻合约：在合约输入合约名称或代码可以搜寻合约 2、 商品选择器：点击放大镜按钮，打开商品选择器，通过交易所和商品选单列表选择商品。 3、 合约连动：按钮显示灰色时表示不连动，点击切换为蓝色表示连动合约，此时在报价中点击任意合约可以将闪电切换为该合约。 4、 快速切换合约：通过合约下拉选单，可快速切换 Call/Put、合约月份。 5、 保持视窗最前：闪电下单预设勾选保持窗口最前
<p>委托数量</p>	<p>可以输入委托数量，或者按<>按钮修改委托数量</p> 
<p>委托价格</p>	<p>可以输入委托价格，或者按<>按钮修改委托价格</p> 
<p>合约市况</p>	<p>显示下单盒合约的买 1 价、买 1 量、最新价、成交量、卖 1 价、卖 1 量报价，使用鼠标点击价格可代入委托价格设定</p>
<p>下单设定</p>	 <ol style="list-style-type: none"> 1、 账号：提供交易账号选单列表，当设定好合约之后，会按证券、

	<p>期权、期货类型筛选出对应的账号显示在选单中。</p> <p>2、仓别：支持自动、自动(指定卖开)、开仓、平仓，对于股票期权认购合约，可以设定备兑开仓、备兑平仓。</p> <p>3、价格类型：支持限价、市价、对方价、本方价、最新价，或者交易系统支持的其他报单价格类型</p> <p>4、有效期：支持 ROD 当日有效、IOC 立即成交剩余取消、FOK 立即全部成交否则取消，或者交易系统支持的其他有效期。</p>
	<div style="display: flex; justify-content: space-around; align-items: center;"> <div style="background-color: #800000; color: white; padding: 5px; text-align: center;">0.0450 买入1手</div> <div style="background-color: #000080; color: white; padding: 5px; text-align: center;">0.0450 卖出1手</div> <div style="background-color: #808080; color: white; padding: 5px; text-align: center;">平净仓</div> </div>
买入按钮	点击买入按钮，会按照所显示的价格和数量委托买入
卖出按钮	点击卖出按钮，会按照所显示的价格和数量委托卖出
平净仓按钮	点击平净仓按钮，则按照下单盒中所选账号和合约的净仓数量平仓。平净仓的价格使用“交易偏好设定->平仓快捷按钮价格”设定。
全撤按钮	<p>点击全撤按钮，会将下单盒中所选账号和合约的未成交委托全部撤单</p> <div style="background-color: #800000; color: white; padding: 5px; text-align: center; width: fit-content; margin: 5px auto;">全撤</div>
撤最新一笔	<p>点击撤最新一笔，会将下单中所选账号和合约的最新一笔未成交委托单撤销。</p> <div style="background-color: #800000; color: white; padding: 5px; text-align: center; width: fit-content; margin: 5px auto;">撤最新一笔</div>
可买开&可卖开	<p>根据下单盒中设定的下单账号可用资金和合约价格，试算出相应的可买开、可卖开数量。</p> <div style="background-color: #333; color: white; padding: 5px; text-align: center; width: fit-content; margin: 5px auto;">可买开： 2826 可卖开： 1202</div>
持仓&盈亏	<p>根据下单盒中设定的下单账号和合约，显示对应的持仓多、空仓数量；显示持仓的逐日浮动盈亏。</p> <div style="background-color: #333; color: white; padding: 5px; text-align: center; width: fit-content; margin: 5px auto;">持仓：10 0 盈亏：-3,460.00</div>
刷新	点击 按钮，重新查询可买开、可卖开数量。

注：下单盒报单类型对照表

下单盒报单选项		对应交易所申报指令类型
深圳 现货	五档市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：最优五档即时成交剩余撤销市价申报
	市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：即时成交剩余撤销市价申报
	市价，全成或全撤(FOK)	交易所指令：全额成交或撤销市价申报
	限价，当日有效(ROD)	交易所指令：普通限价申报
	对方价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约最新价
深圳 期	限价，当日有效(ROD)	交易所指令：普通限价申报
	限价，全成或全撤(FOK)	交易所指令：全额成交或撤销限价申报
	五档市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：最优五档即时成交剩余撤销市价申报

权	市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令: 即时成交剩余撤销市价申报
	市价, 全成或全撤(FOK)	交易所指令: 全额成交或撤销市价申报
	对方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托; 申报价格取委托送出时的合约对方价
	对方价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托; 申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托; 申报价格取委托送出时的合约本方价
	本方价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托; 申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价, 当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约最新价
	最新价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额成交或撤销限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约最新价
上海 现货	限价, 当日有效(ROD)	交易所指令: 普通限价
	五档市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令: 市价: 最优 5 档即时成交剩余撤销申报
	五档市价转限价, 当日有效(ROD)	交易所指令: 市价: 最优 5 档即时成交剩余转限价申报
	市价, 剩余即撤销(IOC)	在设置->市价转换设定中, 上交所 股票/基金市价指令 替换指令类型为“五档市价 IOC” 替换为市价: 最优 5 档即时成交剩余撤销申报送出
	市价, 当日有效(ROD)	在设置->市价转换设定中, 上交所 股票/基金市价指令 替换指令类型为“五档市价转限价 ROD” 替换为市价: 最优 5 档即时成交剩余转限价申报送出
	对方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约最新价
上海 期权	限价, 当日有效(ROD)	交易所指令: 普通限价委托
	市价转限价, 当日有效 (ROD)	交易所指令: 市价剩余转限价委托
	市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令: 市价剩余撤销委托
	限价, 全成或全撤(FOK)	交易所指令: 全额即时限价委托
	市价, 全成或全撤(FOK)	交易所指令: 全额即时市价委托
	对方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托; 申报价格取委托送出时的合约对方价
	对方价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托; 申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托; 申报价格取委托送出时的合约本方价
	本方价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托; 申报价格取委托送出时的合约本方价

最新价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托； 申报价格取委托送出时的合约最新价
最新价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托； 申报价格取委托送出时的合约最新价

报单回报

当日委托

撤单	全撤	撤买	撤卖	全市	交易所	合约	买/卖	价格	报单手数	有效报单	成交	剩量	均价	限价	有效期	类别	状态	开平	日期	时间	备注
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	DCE	eb2405-C-9500	买	58.5	1	1	0	1	-	-	当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价设置)	平仓	2024-04-02	10:50:36	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	DCE	m2405-C-3000	卖	237	1	1	0	1	-	-	当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价设置)	平仓	2024-04-02	10:50:27	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	DCE	m2405-P-2800	卖	0.5	1	1	0	1	-	-	当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价设置)	平仓	2024-04-02	10:50:17	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	DCE	m2405-P-3350	卖	110.5	1	1	0	1	110.5	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:53	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 沽 4月 3.8	买	0.2244	1	1	1	0	0.2241	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:21	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 沽 4月 3.8	买	0.2209	1	1	1	0	0.2227	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:18	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 购 4月 3.6	卖	0.0406	1	1	0	0	-	-	当日有效(ROD)	Limit	21: 下单锁定	平仓	2024-04-02	10:49:09	下单锁定(100
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 购 4月 3.6	卖	0.0392	1	1	1	0	0.0401	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:08	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 购 4月 3.6	卖	0.0392	1	1	1	0	0.0401	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:08	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 购 4月 3.6	买	0.0408	1	1	1	0	0.0403	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:07	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 购 4月 3.6	买	0.0393	1	1	1	0	0.0398	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:00	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 购 4月 3.6	买	0.0407	1	1	1	0	0.0401	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:48:59	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 沽 4月 3.2	卖	0.0004	1	1	0	0	-	-	当日有效(ROD)	Limit	21: 下单锁定	平仓	2024-04-02	10:34:56	下单锁定(100
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 沽 4月 3.2	卖	0.0003	1	1	0	0	0.0009	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:34:56	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	SSE	510300 购 4月 3.4	卖	0.1842	1	1	1	0	0.1850	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:34:21	

提供投资者账号下的当日委托回报资料。

- 栏位筛选：
交易所、合约、账号、品种栏位提供筛选功能。

- 功能列
 - 撤单
 - ◆ 未成交挂单可以勾选后点击“撤单”按钮撤销该笔挂单
 - ◆ 全撤：将全部未成交挂单撤销
 - ◆ 撤买：将全部未成交买入挂单撤销

◆ 撤卖：将全部未成交卖出挂单撤销



■ 全市&全部追价

- ◆ 全市：将全部未成交挂单撤销后，转成市价单送出委托
- ◆ 全部追价：将全部未成交挂单撤销后，改委托价格为[对放价+/-追价 Tick]送出委托，追价 Tick 可设定。

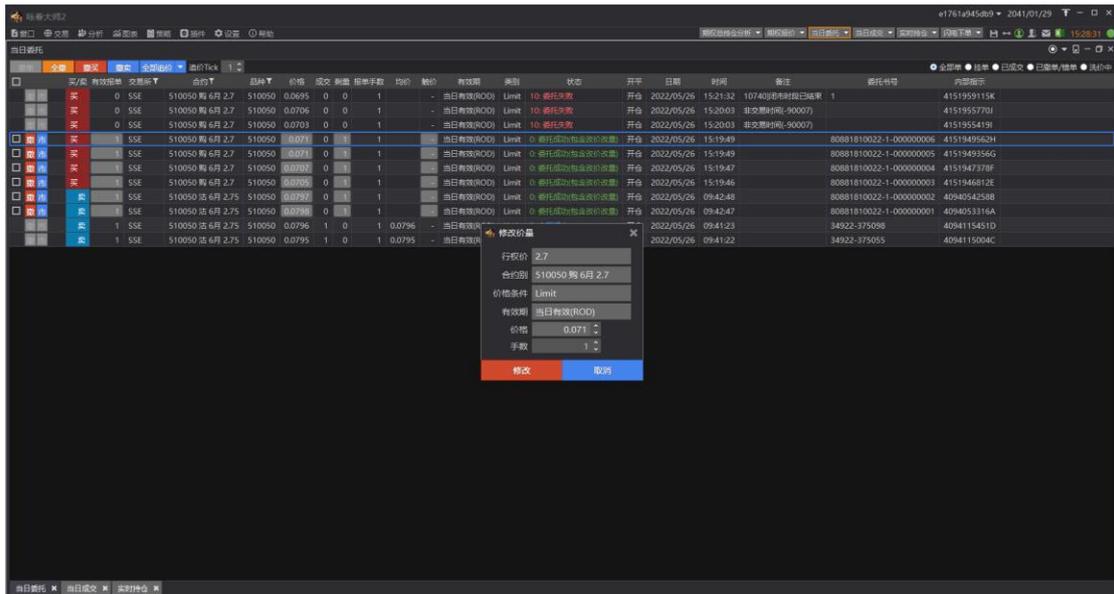


■ 分类显示

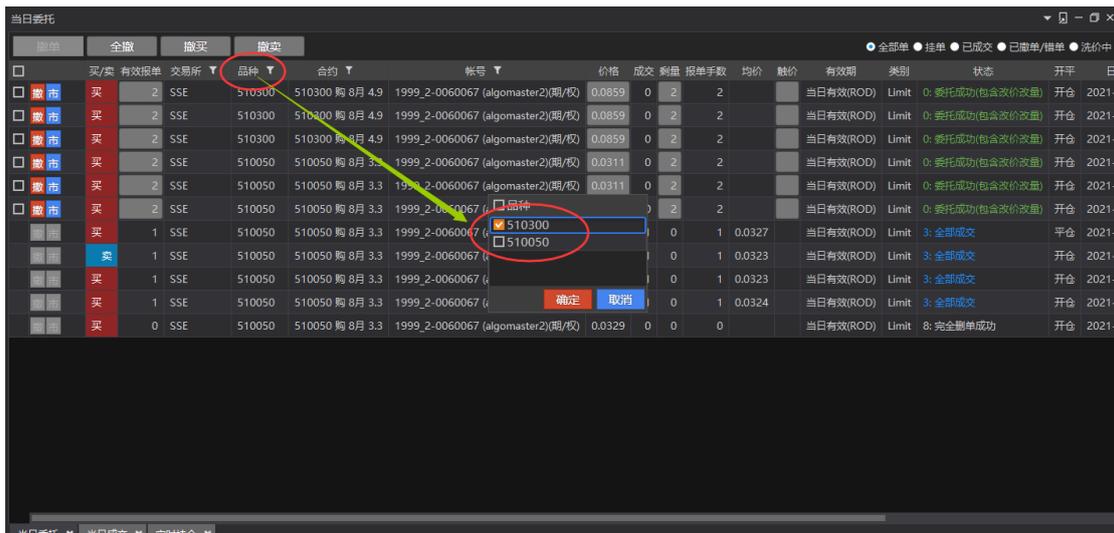
可以按照“全部单”“挂单”“已成交”“已撤单/错单”“洗价中”几种状态分类将报单回报筛选后显示。



- “撤”按钮：
 - 回报的“撤”按钮，点击可以将该未成交挂单撤销。
- “市”按钮：
 - 回报的“市”按钮，点击可以将未成交挂单撤单，并转为市价单重新委托。
- 改价改量
 - 回报的价格和数量栏位，可以点击打开改价改量窗口，修改报单价格和数量



- 按“品种”撤单
 - “品种”栏位，筛选品种以后，再使用全撤、撤买、撤卖按钮则只对当前品种撤单。



当日成交

日期	时间	交易所	合约	帐号	买/卖	成交手数	成交价	开平	委托序号	内部提示	成交金额
2024-04-02	10:49:53	DCE	m2405-P-3350	8000-41009986 (刘明阳)(限/成)	买	1	110.5	平仓	DCE-100040100	2104951807C-0	-
2024-04-02	10:49:21	SSE	510300 沽 4月 3.8	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	1	0.2241	平仓	34922-476407	2104920792B-0	-
2024-04-02	10:49:18	SSE	510300 沽 4月 3.8	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	1	0.2227	开仓	34922-476343	2104917771A-0	-
2024-04-02	10:49:09	SSE	510300 购 4月 3.6	8050-90096286 (张婉芳)(成)	卖	1	0.0401	开仓	34922-476126	2104908798Y-0	-
2024-04-02	10:49:08	SSE	510300 购 4月 3.6	8050-90096286 (张婉芳)(成)	卖	1	0.0401	平仓	34922-475937	2104907766X-0	-
2024-04-02	10:49:07	SSE	510300 购 4月 3.6	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	1	0.0403	开仓	34922-475919	2104906705W-0	-
2024-04-02	10:49:00	SSE	510300 购 4月 3.6	1013-202100207 (张婉芳)(成)	买	1	0.0398	平仓	202100207-1-000070001	2104859543V-0	-
2024-04-02	10:48:59	SSE	510300 购 4月 3.6	1013-202100207 (张婉芳)(成)	买	1	0.0401	开仓	202100207-1-000070000	2104858185U-0	-
2024-04-02	10:34:56	SSE	510300 沽 4月 3.2	8050-90096286 (张婉芳)(成)	卖	1	0.0009	开仓	34922-413717	2103455193S-0	-
2024-04-02	10:34:21	SSE	510300 购 4月 3.4	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	1	0.1850	开仓	34922-411519	2103420341R-0	-
2024-04-02	10:34:19	SSE	510300 购 4月 3.4	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	1	0.1850	开仓	34922-411481	2103419017Q-0	-
2024-04-02	10:34:17	SSE	510300 购 4月 3.5	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	1	0.0999	开仓	34922-411397	2103416616P-0	-
2024-04-02	10:34:15	SSE	510300 购 4月 3.7	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	1	0.0118	开仓	34922-411241	2103414399O-0	-
2024-04-02	10:34:12	SSE	510300 沽 4月 3.7	8050-90096286 (张婉芳)(成)	卖	1	0.1317	开仓	34922-411155	2103411455N-0	-
2024-04-02	10:34:10	SSE	510300 沽 4月 3.6	8050-90096286 (张婉芳)(成)	卖	1	0.0601	开仓	34922-411105	2103409247M-0	-
2024-04-02	10:34:07	SSE	510300 沽 4月 3.5	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	1	0.0203	开仓	34922-411017	2103406671L-0	-

提供投资者账号下的当日成交回报资料。

当日委托成交

日期	时间	交易所	合约	帐号	买/卖	价格	报单手数	有效报单	成交	剩量	均价	触价	有效期	类别	状态	开平	日期	时间	备注	委
2024-04-02	10:50:36	DCE	eb2405-C-9500	8000-41009986 (刘明阳)(限/成)	买	58.5	1	1	0	1	-	-	当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功/包含改价(改量)	平仓	2024-04-02	10:50:36	DCE-10004	
2024-04-02	10:50:27	DCE	m2405-C-3000	8000-41009986 (刘明阳)(限/成)	买	237	1	1	0	1	-	-	当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功/包含改价(改量)	平仓	2024-04-02	10:50:27	DCE-10004	
2024-04-02	10:50:17	DCE	m2405-P-2800	8000-41009986 (刘明阳)(限/成)	买	0.5	1	1	0	1	-	-	当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功/包含改价(改量)	平仓	2024-04-02	10:50:17	DCE-10004	
2024-04-02	10:49:53	DCE	m2405-P-3350	8000-41009986 (刘明阳)(限/成)	买	110.5	1	1	0	1	110.5	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:53	DCE-10004	
2024-04-02	10:49:21	SSE	510300 沽 4月 3.8	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	0.2244	1	1	0	0.2241	-	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:21	34922-476	
2024-04-02	10:49:18	SSE	510300 沽 4月 3.8	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	0.2209	1	1	0	0.2227	-	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	开仓	2024-04-02	10:49:18	34922-476	
2024-04-02	10:49:09	SSE	510300 购 4月 3.6	8050-90096286 (张婉芳)(成)	卖	0.0406	1	1	0	0	-	-	当日有效(ROD)	Limit	21: 下单锁定	平仓	2024-04-02	10:49:09	下单锁定(-108)	
2024-04-02	10:49:09	SSE	510300 购 4月 3.6	8050-90096286 (张婉芳)(成)	卖	0.0392	1	1	0	0.0401	-	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	开仓	2024-04-02	10:49:09	34922-476	
2024-04-02	10:49:08	SSE	510300 购 4月 3.6	8050-90096286 (张婉芳)(成)	买	0.0408	1	1	0	0.0403	-	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	开仓	2024-04-02	10:49:08	34922-475	
2024-04-02	10:49:07	SSE	510300 购 4月 3.6	1013-202100207 (张婉芳)(成)	买	0.0393	1	1	0	0.0398	-	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	平仓	2024-04-02	10:49:07	202100207	
2024-04-02	10:48:59	SSE	510300 购 4月 3.6	1013-202100207 (张婉芳)(成)	买	0.0407	1	1	0	0.0401	-	-	当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交	开仓	2024-04-02	10:48:59	202100207	

提供投资者账号下的当日委托回报及成交回报资料。此功能是“当日委托”“当日成交”两个视图功能的组合。

在委托回报中，点击按钮，白色变为灰色时，可隐藏该笔委托对应的成交明细资料。

实时持仓

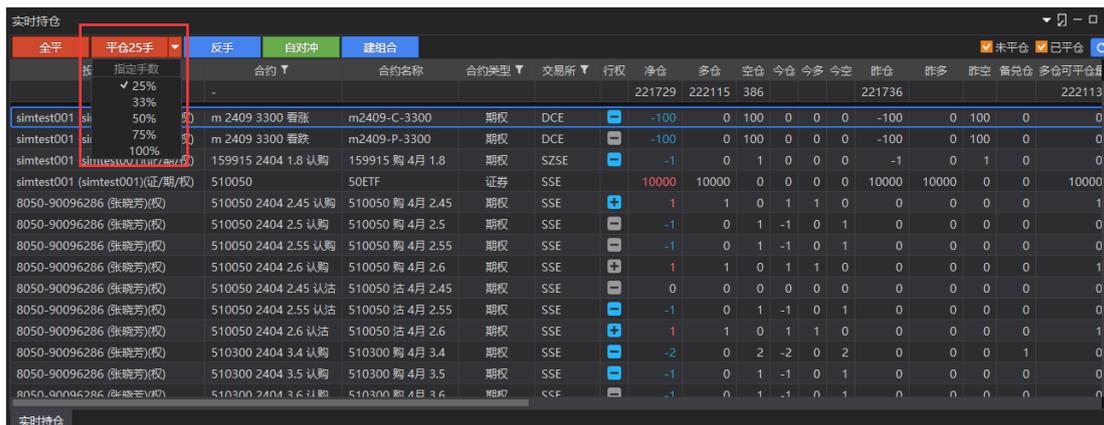
合约名称	合约类型	交易所	净仓	多仓	空仓	持仓	昨仓	委托中(多)	委托中(空)	逐日平仓盈亏	逐笔平仓盈亏
8000-41009987 (张积芳/期/权)	花生2404	CZCE	-1	0	1	0	0	0	0	0	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	TA 2404	CZCE	5	5	0	0	0	0	0	5	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	TA 2405	CZCE	3	3	0	0	0	0	0	3	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	TA 2409	CZCE	-10	0	10	0	0	0	0	-10	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	eb 2405	DCE	-1	0	1	0	0	0	0	0	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	j 2405	DCE	4	4	0	0	0	0	0	4	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	ni 2407	SHFE	-3	0	3	0	0	0	0	-3	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	TA 2405-C-5300	CZCE	-1	0	1	0	0	0	0	0	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	TA 2407-C-5600	CZCE	5	5	0	0	0	0	0	5	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	TA 2409-C-5700	CZCE	-10	0	10	0	0	0	0	-10	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	eb 2405-9300	DCE	-4	0	4	0	0	0	0	-4	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	eb 2405-9500	DCE	5	5	0	0	0	0	0	5	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	m 2405 3000	DCE	1	1	0	0	0	0	0	1	0
8000-41009987 (张积芳/期/权)	m 2405 3300	DCE	-1	0	1	0	0	0	0	0	0
8050-000001380 (张积芳/证)	50ETF	SSE	91822	91822	0	0	0	0	0	91822	0
8050-000001380 (张积芳/证)	300ETF	SSE	10214	10214	0	0	0	0	0	10214	0
8050-000001380 (张积芳/证)	500ETF	SSE	110000	110000	0	0	0	0	0	110000	0
simtest001 (simtest001/证/期/权)	m 2409 3300 看涨	DCE	-100	0	100	0	0	0	0	100	0
simtest001 (simtest001/证/期/权)	m 2409 3300 看跌	DCE	-100	0	100	0	0	0	0	100	0
simtest001 (simtest001/证/期/权)	159915 2404 1.8 认购	SZSE	-1	0	1	0	0	0	0	1	0
simtest001 (simtest001/证/期/权)	50ETF	SSE	10000	10000	0	0	0	0	0	10000	0
1013-202106880 (张积芳/期/权)	PK 2404	CZCE	1	1	0	0	0	0	0	1	0
1013-202106880 (张积芳/期/权)	a 2405	DCE	-2	0	2	0	0	0	0	2	0

提供投资者账号下的全部持仓资料。

- 持仓首列加总：
在持仓第一列提供以下栏位的加总信息：净仓、多仓、空仓、昨仓、委托中(多)、委托中(空)、多仓可平仓量、空仓可平仓量、逐日浮动盈亏、逐笔浮动盈亏、市值、占用保证金、逐日平仓盈亏、逐笔平仓盈亏、估算当日盈亏、买成、卖成、今成、净成、昨留仓、估算日内盈亏。
- 投资者、合约、合约类型、交易所栏位可设置筛选。

合约名称	合约类型	交易所	净仓	多仓	空仓	持仓	昨仓	委托中(多)	委托中(空)	逐日平仓盈亏	逐笔平仓盈亏
simtest001 (simtest001/证/期/权)	m 2409 3300 看涨	DCE	-100	0	100	0	0	0	0	100	0
simtest001 (simtest001/证/期/权)	m 2409 3300 看跌	DCE	-100	0	100	0	0	0	0	100	0
simtest001 (simtest001/证/期/权)	159915 2404 1.8 认购	SZSE	-1	0	1	0	0	0	0	1	0
simtest001 (simtest001/证/期/权)	50ETF	SSE	10000	10000	0	0	0	0	0	10000	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510050 2404 2.45 认购	CS	1	1	0	0	0	0	0	1	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510050 2404 2.5 认购	CS	-1	0	1	-1	0	0	0	0	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510050 2404 2.55 认购	CS	-1	0	1	-1	0	0	0	0	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510050 2404 2.6 认购	CS	1	1	0	0	0	0	0	1	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510050 2404 2.65 认购	CS	0	0	0	0	0	0	0	0	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510050 2404 2.55 认沽	CS	-1	0	1	-1	0	0	0	0	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510050 2404 2.6 认沽	CS	1	1	0	0	0	0	0	1	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510050 2404 3.4 认购	CS	-2	0	2	-2	0	0	0	2	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510300 2404 3.5 认购	SSE	-1	0	1	-1	0	0	0	1	0
8050-90096286 (张积芳/证)	510300 2404 3.6 认购	CSF	-1	0	1	-1	0	0	0	1	0

- 持仓连动下单工具
在持仓资料中，点击“净仓”“多仓”“空仓”栏位数量，可以连动打开下单功能。
- 功能列
 - 全平：持仓使用全平功能，会将全部的持仓合约送出平仓申请。平仓委托价格为交易偏好设定的“平仓快捷按钮价格”
 - 指定平仓：选择一笔持仓之后，可以输入指定数量、或者设定按%计算平仓数量。计算出的平仓数量显示在按钮上，点击该按钮送出平仓委托。



- 反手：选择一笔持仓之后，使用反手功能，会将所选合约的全部未成交委托单撤单，再发出平仓单以及数量相同方向相反的开仓单。反手完成后，原持仓变为买卖方向相反数量相等的持仓。反手委托使用价格为交易偏好设置的“反向快捷按钮价格”
- 未平仓：显示当日未平仓的持仓资料
- 已平仓：显示当日已平仓的合约资料
- 刷新数据：点击刷新数据按钮，则从后台重新查询持仓资料并刷新显示数据。

- 行权：点击按钮 即可行权， 显示到期日天数提醒
- 右键菜单



- 可开启闪电下单、下单盒、技术线图功能。
- 汇出文件：将持仓资料汇出一份.csv 文件保存到本地电脑
- 复制 RTD 标签：若开启使用 ExcelRTD 功能，可以通过复制 RTD 标签将持仓资料的 RTD 标签复制到 excel 中。
- 栏位设定：勾选要显示的栏位
- 锁定/解锁栏位
- 显示/隐藏首列加总
- 标题栏下拉设定选单，可设定是否显示功能：
 - 显示全平按钮

- 显示指定平仓
- 显示反向按钮

实时持仓

合约	合约类型	交易所	净仓	多仓	空仓	今仓	今多	今空	昨仓	昨多	昨空	备注
			10185						10185			
IF2111	期货	CFEX	-1	0	1	0	0	0	-1	0	1	0
IH2112	期货	CFEX	3	3	0	0	0	0	3	3	0	0
50ETF	证券	SSE	9900	9900	0	0	0	0	9900	9900	0	0
沪深300ETF	证券	SZSE	300	300	0	0	0	0	300	300	0	0
510050 沽 11月 3.4	期权	SSE	5	5	0	0	0	0	5	5	0	0
510050 沽 11月 3.3	期权	SSE	-5	0	5	0	0	0	-5	0	5	0
510050 沽 11月 3.2	期权	SSE	-5	0	5	0	0	0	-5	0	5	0
510050 沽 11月 3	期权	SSE	5	5	0	0	0	0	5	5	0	0
510050 购 11月 3.3	期权	SSE	5	5	0	0	0	0	5	5	0	0

保持窗口最前
 显示全平按钮
 显示指定平仓
 显示反手按钮

实时资金

实时资金 | 1013-80881810022

投资者	币别	平仓盈亏	逐笔浮动盈亏	逐日浮动盈亏	手续费	权利金收支	占用保证金
80881810022	港币(CNY)	0.00	-3,634.70	-746.80	-	0.00	14,846.40
可用资金	动态权益	风险率(%)	市值权益	期权市值	估算当日盈亏	估算日内盈亏	
8,985,457.98	9,003,155.58	170669.46%	9,018,392.75	15,237.17	-746.80	0.00	

1013-80881810022

提供交易账号的资金栏目。

投资者栏位选单提供全部已登录交易账号，可以切换查看。

- 右键菜单，可以勾选显示栏位。

实时资金 | 1013-80881810022

投资者	币别	平仓盈亏	逐笔浮动盈亏	逐日浮动盈亏	手续费	权利金收支	占用保证金
80881810022	港币(CNY)	0.00	-3,634.70	-746.80	-	0.00	14,846.40
可用资金	动态权益	风险率(%)	市值权益	期权市值	估算当日盈亏	估算日内盈亏	
8,985,457.98	9,003,155.58	170669.46%	9,018,392.75	15,237.17	-746.80	0.00	

1013-80881810022

- 模式
- 静态权益
- 平仓盈亏
- 逐笔浮动盈亏
- 逐日浮动盈亏
- 手续费
- 估算手续费
- 冻结手续费
- 权利金收支
- 占用保证金
- 冻结保证金
- 可用资金
- 动态权益
- 风险率(%)
- 市值权益
- 期权市值
- 冻结资金
- 估算当日盈亏
- 估算日内盈亏
- 币别
- 期权理论市值
- 理论市值权益

- 复制 RTD 标签：若开启使用 ExcelRTD 功能，可以通过复制 RTD 标签将实时资金的 RTD 标签复制到 excel 中
- 每 N 秒更新：
 - ◆ 默认不启用，勾选秒数后，则按设定秒数自动更新重查资金。



组合策略保证金

构建组合

在实时持仓中，点击【建组合】按钮进入构建组合窗口。可构建的组合包括：

上交所	认购牛市价差、认沽牛市价差、认沽熊市价差、认购熊市价差、跨式空头、宽跨式空头、认购期权保证金转备兑策略
深交所	认购牛市价差、认沽牛市价差、认沽熊市价差、认购熊市价差、跨式空头、宽跨式空头、认购期权保证金转备兑、认购期权备兑转保证金策略
大商所	期货对锁、期货跨期、期货跨品种、卖出期货期权组合、期权跨式、期权宽跨式、期权对锁、买入垂直价差、卖出垂直价差、买入期货期权组合
广期所	期货对锁、期货跨期、期权跨式、期权宽跨式、卖出期权期货、期权对锁、买入垂直价差、卖出垂直价差

选择构建组合所需的信息：账号、品种、策略名称、合约、数量



设定好之后，点击确定按钮后可以发出构建组合的申请。报单记录可以在组合报单视图中查看。

组合持仓

已经构建的交易所组合持仓，展示组合策略名称，成分合约，持仓数量、组合策略已用保证金，组合拆分后保证金和组合持仓\$Greeks等。

投资者	组合策略名称	合约	组合编号	持仓	多仓	空仓	组合策略已用保证金	组合拆分后保证金	\$Delta	\$Gamma	\$Theta	\$Vega	\$Rho	\$Charm	\$Vanna	\$Vomma	\$Speed	\$Zomma
8050-90096286 (张睿芳)(和)	认购牛市的差	BUL 510050 购 4月 2.45 & 510050 购 4月 2.5	2024040200000936	1	1	0	0.00	2,947.60	5772.02	-1659.05	0.27	-1.00	-0.16	190.67	-16402.00	0.03		9324.00
8050-90096286 (张睿芳)(和)	认购熊市的差	BER 510050 购 4月 2.55 & 510050 购 4月 2.6	2024040200000943	-1	0	1	625.00	2,303.60	-3694.11	-36172.33	3.07	-7.00	0.04	14.86	-2261.00	0.34		17.75
8050-90096286 (张睿芳)(和)	认购熊市的差	BER 510050 沽 4月 2.6 & 510050 沽 4月 2.55	2024040200000937	1	1	0	0.00	3,786.60	-3694.11	-36172.33	3.07	-7.00	-0.27	14.86	-2261.00	0.34		17.75
8050-90096286 (张睿芳)(和)	期权宽式	STD 510300 购 4月 3.7 & 510300 沽 4月 3.7	2024040200000983	-1	0	1	7,174.00	8,715.00	23003.70	-15.72	22.18	-46.00	0.88	608.75	-35264.00	-2.87		35974.00
8050-90096286 (张睿芳)(和)	认购牛市的差	BUL 510300 沽 4月 3.4 & 510300 沽 4月 3.3	2024040200000979	-1	0	1	1,250.00	2,594.00	2180.77	-26770.81	4.33	-9.00	0.02	-114.59	6714.00	-0.46		3680.00
8050-90096286 (张睿芳)(和)	期权宽式	STG 510300 购 4月 3.5 & 510300 沽 4月 3.2	2024040200000986	-1	0	1	6,706.50	7,616.00	-26136.99	-97042.39	16.35	-31.00	0.64	-340.19	17544.00	-1.52		68251.00

拆分组合

在组合持仓中，选择已经构建的组合策略，然后点击【拆分组合】按钮发出拆分组合申请并弹出确认窗口

🔍 拆分组合
✕

策略 认购牛市价差

合约 BUL 510050 购 4月 2.45 & 510050 购 4月 2.5

多仓 数量 / 1

空仓 数量 / 0

送出申请

点击送出申请可发出拆分组合指令，报单记录可在组合报单视图中查看

组合报单

可查看构建组合、拆分组合的报单记录，包括：委托时间，委托编号，组合策略名称，组合成分合约，组合编号，组合方向，委托状态，成交数量等信息：

投资者	委托时间	委托编号	组合策略名称	合约	组合编号	组合方向	委托状态	委托数量	成交时间	成交数量
90096286 (张晓芳) (权)	10:46:44	AA00000366_2	期权宽跨式	STG 510300 2404 3.5 认购 & 510300 2404 3.2 认沽	2024040200000986	拆分	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:46:40	AA00000365_2	认沽牛市价差	BUL 510300 2404 3.4 认沽 & 510300 2404 3.3 认沽	2024040200000979	拆分	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:46:37	AA00000364_2	期权跨式	STD 510300 2404 3.7 认购 & 510300 2404 3.7 认沽	2024040200000983	拆分	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:46:35	AA00000363_2	认沽熊市价差	BER 510050 2404 2.6 认沽 & 510050 2404 2.55 认沽	2024040200000937	拆分	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:46:33	AA00000362_2	认购熊市价差	BER 510050 2404 2.55 认购 & 510050 2404 2.6 认购	2024040200000943	拆分	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:46:30	AA00000361_2	认购牛市价差	BUL 510050 2404 2.45 认购 & 510050 2404 2.5 认购	2024040200000936	拆分	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:39:29	AA00000353_1	普通转备兑	510300 2404 3.4 认购	2024040200001056	组合	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:35:04	AA00000341_1	期权宽跨式	STG 510300 2404 3.5 认购 & 510300 2404 3.2 认沽	2024040200000986	组合	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:34:35	AA00000339_1	期权跨式	STD 510300 2404 3.7 认购 & 510300 2404 3.7 认沽	2024040200000983	组合	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:34:28	AA00000338_1	认沽牛市价差	BUL 510300 2404 3.4 认沽 & 510300 2404 3.3 认沽	2024040200000979	组合	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:33:46	AA00000327_1	认购熊市价差	BER 510050 2404 2.55 认购 & 510050 2404 2.6 认购	2024040200000943	组合	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:33:37	AA00000326_1	认沽熊市价差	BER 510050 2404 2.6 认沽 & 510050 2404 2.55 认沽	2024040200000937	组合	1: 已接受(已接受)	1		1
90096286 (张晓芳) (权)	10:33:31	AA00000325_1	认购牛市价差	BUL 510050 2404 2.45 认购 & 510050 2404 2.5 认购	2024040200000936	组合	1: 已接受(已接受)	1		1

平仓明细

可以查看所有的持仓合约的平仓记录。一条平仓的成交记录产生一条平仓明细。

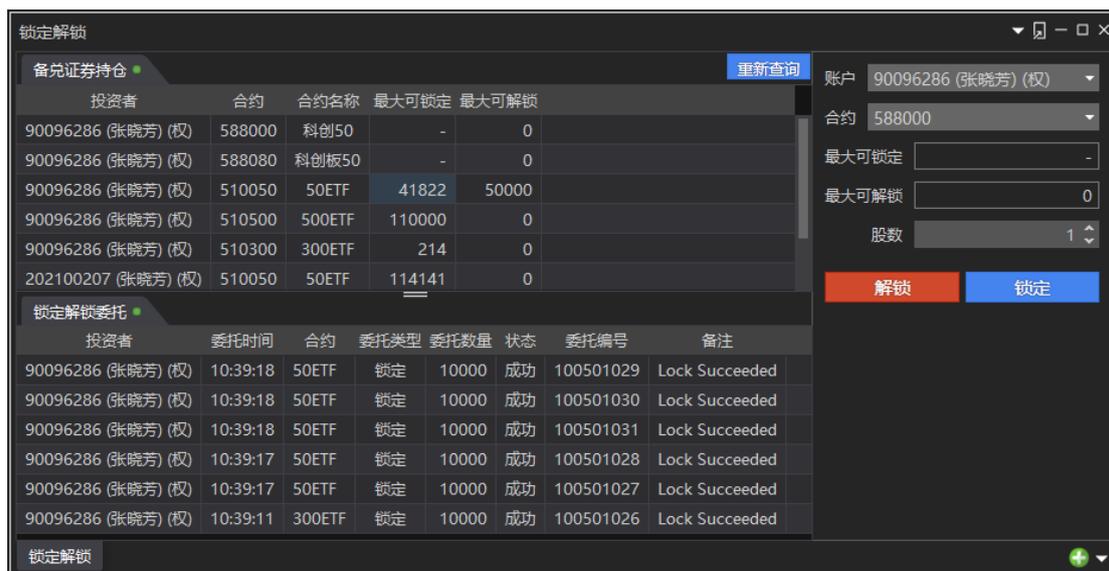
交易帐户	合约	买入量	卖出量	买入均价	卖出均价	逐日平仓盈亏	逐笔平仓盈亏	估算当日盈亏
90096286 (张晓芳) (权)	510050 2404 2.45 认沽		1	0.0231	0.0230	0.00	0.00	-1.00
90096286 (张晓芳) (权)	510300 2404 3.6 认购		1	0.0403	0.0401	0.00	0.00	-6.00
90096286 (张晓芳) (权)	510300 2404 3.8 认沽	1		0.2241	0.2227	0.00	0.00	-14.00
41009986 (刘明阳) (期/权)	m 2405 3350 看跌		1	350.0	110.5	105.00	-2,395.00	630.00
	进场日期	出场日期	买入均价	卖出均价	平仓量	平多/空	逐日平仓盈亏	逐笔平仓盈亏
	2024/01/30	2024/04/02	350.0	110.5	1	平多	105.00	-2,395.00

锁定解锁

在交易时段，投资者进行上交所(SSE)的备兑开仓下单操作时，需先手动锁定对应的标的证券(含当日买入，仅限标的证券)作为备兑开仓的保证金。对备兑仓进行平仓之后，可解锁释放被锁定的合约标的。

注：

1. 上交所 SSE 备兑开仓需要手动锁定标的
2. 深交所 SZSE 备兑开仓会自动锁定标的，无需手动操作锁定标的



在锁定解锁 模块中，

【备兑证券持仓】可查询最大可锁定数量，最大可解锁数量。（部分柜台不显示）。

【锁定/解锁】功能：指定账户、标的证券后可查询最大可锁定数量，最大可解锁数量。指定数量，点击锁定、解锁按钮，可执行锁定或解锁操作。

【锁定解锁委托】列表内为锁定委托或解锁委托的委托列表。

行权与自对冲

行权与自对冲都属于期权合约的结算业务，申请后当天交易日结算后生效。

行权

手动行权申请，通过后会产生并保留标的合约头寸。



在实时持仓中，点击  行权按钮，选择『执行行权』。

行权申请记录，可以在『行权状态』中查看。

放弃行权

在实时持仓中，点击  行权按钮，选择『放弃行权』。

注*到期日才可以申请放弃行权。

中金所 (CFFEX)、广期所 (GFEX)、郑商所 (CZCE)、上期所 (SHFE)、能源中心 (INE) 手动放弃行权申请。



注：大商所 (DCE)，到期日可 提交 0 手的行权申请来实现取消自动申请行权。(即放弃行权)



放弃行权申请记录，可以在『行权状态』中查看。

自对冲

大商所 (DCE)、广期所 (GFEX)、上期所 (SHFE)、能源中心 (INE) 可在软件上进行自对冲申请。

- 买方期权仓位自对冲

同时有同一交易编码期权合约的买仓、卖仓，申请后，这两笔期权仓位进行对冲平仓。



The screenshot shows a dialog box titled '自对冲' (Self-Hedge) with a close button (X) in the top right corner. The dialog contains a text input field with the value 'sc2405-P-430'. Below the input field are two radio button options: '买方期权仓位自对冲' (Buyer's option position self-hedge) which is selected, and '卖方履约后的期货仓位自对冲' (Self-hedge of futures position after seller's fulfillment). Below these options is a label '自对冲数量' (Self-hedge quantity) followed by a spinner control showing the value '1'. At the bottom of the dialog is a red button labeled '确定' (Confirm).

在实时持仓中，选择多头持仓之后，点击『自对冲』按钮，选择『买方期权仓位自对冲』。上期所 (SHFE)、能源中心 (INE) 最后交易日才可申请。

- 卖方履约后的期货仓位自对冲

期权卖方可以申请对其同一交易编码下履约后的双向期货持仓进行对冲平仓，也可以申请对其同一交易编码下履约获得的期货持仓与期货市场原有持仓进行对冲平仓。



The screenshot shows a dialog box titled '自对冲' (Self-Hedge) with a close button (X) in the top right corner. The dialog contains a text input field with the value 'sc2405-P-430'. Below the input field are two radio button options: '买方期权仓位自对冲' (Buyer's option position self-hedge) which is unselected, and '卖方履约后的期货仓位自对冲' (Self-hedge of futures position after seller's fulfillment) which is selected. Below these options is a label '自对冲数量' (Self-hedge quantity) followed by a spinner control showing the value '2'. At the bottom of the dialog is a red button labeled '确定' (Confirm).

在实时持仓中，选择空头持仓之后，点击『自对冲』按钮，选择『卖方履约后的期货仓位自对冲』。

上期所 (SHFE)、能源中心 (INE) 最后交易日才可申请。

- 买方行权后生成的期货头寸自动平仓

期权买方可以申请对其同一交易编码下行权后的双向期货持仓进行对冲平仓，可以申请对其同一交易编码下行权获得的期货持仓与期货市场原有持仓进行对冲平仓。



在实时持仓中，点击  行权按钮，选择行权后生成的期货头寸『自动平仓』。

上期所 (SHFE)、能源中心 (INE) 最后交易日才可申请。

自对冲申请记录，可以在『行权状态』中查看。

组合行权

注：仅上交所 (SSE)、深交所 (SZSE) 股票期权支持组合行权功能。



在实时持仓中，点击  行权按钮，选择『组合行权』，在合约的下拉框中选择好组合行权的 2 腿合约，下方会显示出可行权数量，输入指定数量后，点击执行行权按钮，发出组合行权申请。

组合行权申请记录，可以在『行权状态』中查看。

行权状态

在『行权状态』中可查看行权、放弃行权、自对冲、组合行权的委托状态记录。

投资者	合约	数量	执行类型	行权编号	结算编号	行权状态	备注	插入时间	撤销时间	更新时间	交易日
41009987 (张晓芳) (明/权)	sc2405-P-430	1	执行放弃行权		1	-1:申请失败	149:已取消报单被拒绝放弃行权申请只能在期权到期日提交	13:44:45		13:44:45	20240402
41009987 (张晓芳) (明/权)	m2405-C-3000	0	执行放弃行权		1	-1:申请失败	30009:已取消报单被拒绝非到期日不能进行设置	13:44:39		13:44:39	20240402
41009986 (刘明阳) (明/权)	TA2409-C-5700	5	执行行权	2024040200004416	1	4:正在申报	未执行	14:17:10		14:17:11	20240402
41009986 (刘明阳) (明/权)	eb2405-C-9300	1	执行行权	14	1	4:正在申报	未执行	14:17:06		14:17:07	20240402
41009986 (刘明阳) (明/权)	eb2405-C-9300	1	执行行权	13	1	4:正在申报	未执行	14:17:03		14:17:05	20240402
41009986 (刘明阳) (明/权)	m2405-C-3000	1	执行行权	11	1	4:正在申报	未执行	14:16:10		14:16:11	20240402
41009986 (刘明阳) (明/权)	ru2405-C-3200	3	执行放弃行权		1	-1:申请失败	149:已取消报单被拒绝放弃行权申请只能在期权到期日提交	13:44:30		13:44:30	20240402
41009986 (刘明阳) (明/权)	DCE_ALL_INST	1	自对冲			-1:申请失败	CTP:期权对冲,履约对冲不能重复设置,只能先撤销再设置				
41009986 (刘明阳) (明/权)	DCE_ALL_INST	0	自对冲		1	3:正在申报	未执行				20240402

点击取消行权、取消自对冲按钮，即可撤销该笔行权、自对冲申请。

点击全部取消，即可撤销全部行权和自对冲申请

行权指派：

行权日下个交易日，可点击查看行权指派信息。

帐号	合约	期权持仓类别	行权价格	行权数量
2(仿真) 1013-101300155	159901	非备兑	5.75	1
2(仿真) 1013-101300155	159901	非备兑	4.90	1
2(仿真) 1013-101300155	159901	非备兑	4.80	1

注：仅上交所 (SSE)、深交所 (SZSE) 股票期权可查询行权指派信息。

自动行权

可以开启和关闭自动行权

按照策略类别设置自动行权，到期日可以按照设定的行权策略进行行权

交易所	合约代码	合约名称	协议编号	策略名称	策略值	数量	控制类别	行权日期
撤 上海	默认策略	默认策略	2018051800000002	实值百分比即行权	2%	-	开启	2999-12-31
撤 深圳	默认策略	默认策略	2018051800000003	实值百分比即行权	2%	-	开启	2999-12-31

合约	到期日(天)	持仓数量	可用数量	行权价值	开仓均价	持仓均价	最新价	交易所
510050 2406 2.35 认购		85	1	1	-1,190.00	0.1841	0.0247	0.0254 SSE
510050 2406 2.3 认购		85	1	1	1,690.00	0.0988	0.2058	0.2001 SSE

注：仅上交所 (SSE)、深交所 (SZSE) 股票期权支持组合行权功能，且不同柜台提供的自动行权策略类别不一致，详情请咨询券商人员。

查询

可以查询历史委托、历史成交、对账单、交割单、持仓限额等情况。

注：不同的柜台，支持的查询项目会有差异，柜台不支持的项目在菜单中不显示。

历史委托

可查询某一指定历史时期内的委托信息。例如：

委托日期	委托时间	委托序号	交易所	商品名称	订单名称	买卖	委托形态	开平仓	备注	委托状态	委托价格	委托数量	成交价格	成交数量
2024-03-11	09:32:21	70000	上海	50ETF购3月2350	限价GFD买入开仓	买	委托	开仓	非备兑	已成	0.1208	1	0.1202	1
2024-03-11	09:32:22	70001	上海	50ETF购3月2350	限价GFD买入开仓	买	委托	开仓	非备兑	已成	0.121	1	0.1202	1
2024-03-11	09:32:59	70002	上海	50ETF沽3月2300	限价GFD买入开仓	买	委托	开仓	非备兑	已成	0.0023	1	0.0015	1
2024-03-27	11:46:44	70000	上海	50ETF购3月2350	行权	卖	OFE		非备兑	已报	0	1	0	0
2024-03-27	11:51:41	70001	上海	50ETF购3月2350	行权	卖	OFE		非备兑	已撤	0	1	0	0
2024-03-27	11:52:01	70002	上海	50ETF沽3月2300	行权	卖	OFE		非备兑	已撤	0	1	0	0
2024-03-27	11:53:10	70003	上海	50ETF沽3月2300	撤单	卖	OFE		非备兑	已成	0	1	0	0
2024-03-27	11:53:14	70004	上海	50ETF购3月2350	撤单	卖	OFE		非备兑	已成	0	1	0	0
2024-03-27	13:25:21	70005	上海	50ETF购3月2400	限价GFD卖出开仓	卖	委托	开仓	非备兑	已成	0.0384	1	0.0388	1
2024-03-27	13:25:22	70006	上海	50ETF购3月2400	限价GFD卖出开仓	卖	委托	开仓	非备兑	已成	0.0383	1	0.0388	1
2024-03-27	13:25:23	70007	上海	50ETF购3月2400	限价GFD卖出开仓	卖	委托	开仓	非备兑	已成	0.0383	1	0.0388	1
2024-03-27	13:25:23	70008	上海	50ETF购3月2400	限价GFD卖出开仓	卖	委托	开仓	非备兑	已成	0.0383	1	0.0388	1
2024-03-27	13:25:23	70009	上海	50ETF购3月2400	限价GFD卖出开仓	卖	委托	开仓	非备兑	已成	0.0383	1	0.0388	1
2024-03-27	13:25:23	70010	上海	50ETF购3月2400	限价GFD卖出开仓	卖	委托	开仓	非备兑	已成	0.0383	1	0.0388	1
2024-03-27	13:25:24	70011	上海	50ETF购3月2400	限价GFD卖出开仓	卖	委托	开仓	非备兑	已成	0.0383	1	0.0388	1

历史成交

可查询某一指定历史时期内的历史成交情况。例如：

成交日期	成交时间	成交序号	交易所	商品名称	买卖	开平仓	成交价格	成交数量	成交金额	手续费	备注	委托序号
2024-03-11	09:32:21	1519	上海	50ETF购3月2350	买	开仓	0.1202	1	1202	3.4	36301期权买入开仓	70000
2024-03-11	09:32:22	1521	上海	50ETF购3月2350	买	开仓	0.1202	1	1202	3.4	36301期权买入开仓	70001
2024-03-11	09:32:59	1672	上海	50ETF沽3月2300	买	开仓	0.0015	1	15	3.4	36301期权买入开仓	70002
2024-03-27	13:25:21	37307	上海	50ETF购3月2400	卖	开仓	0.0388	1	388	0	36303期权卖出开仓	70005
2024-03-27	13:25:22	37308	上海	50ETF购3月2400	卖	开仓	0.0388	1	388	0	36303期权卖出开仓	70006
2024-03-27	13:25:23	37309	上海	50ETF购3月2400	卖	开仓	0.0388	1	388	0	36303期权卖出开仓	70007
2024-03-27	13:25:23	37312	上海	50ETF购3月2400	卖	开仓	0.0388	1	388	0	36303期权卖出开仓	70008
2024-03-27	13:25:23	37313	上海	50ETF购3月2400	卖	开仓	0.0388	1	388	0	36303期权卖出开仓	70009
2024-03-27	13:25:23	37314	上海	50ETF购3月2400	卖	开仓	0.0388	1	388	0	36303期权卖出开仓	70010
2024-03-27	13:25:24	37315	上海	50ETF购3月2400	卖	开仓	0.0388	1	388	0	36303期权卖出开仓	70011
2024-03-27	16:00:06		上海	50ETF购3月2350	卖	平仓	0	1	0	0	36310期权到期注销	0
2024-03-27	16:00:06		上海	50ETF沽3月2300	卖	平仓	0	1	0	0	36310期权到期注销	0
2024-03-27	16:00:06		上海	50ETF购3月2400	买	平仓	0	6	0	0	36310期权到期注销	0
2024-03-27	16:00:06	0	上海	50ETF购3月2350	买	行权	2.35	1	23500	0	36309期权行权指派合约注销	0
2024-03-27	16:00:06	0	上海	50ETF购3月2400	卖	行权	2.4	1	24000	0	36309期权行权指派合约注销	0

对账单

可查询某一指定历史时期内的历史对账单情况。例如：

交易日期	业务类型	业务名称	资产账户	银行名称	币种类别	交易类别	成交金额	清算金额	衍生品合约账户	期权合约简称	成交数量	标准佣金	佣金	印花税	过
2024-03-11	个股期权	买入开仓	202100207	内部银行	人民币	上海	2404	-2414	A102435978888	50ETF购3月2350	2	10	10	0	
2024-03-11	个股期权	买入开仓	202100207	内部银行	人民币	上海	15	-20	A102435978888	50ETF沽3月2300	1	5	5	0	
2024-03-27	个股期权	行权指派	202100207		人民币	上海	23500	0	A102435978888	50ETF购3月2350	1	0	0	0	
2024-03-27	个股期权	期权持仓到期注销	202100207		人民币	上海	0	0	A102435978888	50ETF购3月2350	1	0	0	0	
2024-03-27	个股期权	卖出开仓	202100207	内部银行	人民币	上海	2716	2716	A102435978888	50ETF购3月2400	7	0	0	0	
2024-03-27	个股期权	行权指派	202100207		人民币	上海	24000	0	A102435978888	50ETF购3月2400	1	0	0	0	
2024-03-27	个股期权	期权持仓到期注销	202100207		人民币	上海	0	0	A102435978888	50ETF购3月2400	6	0	0	0	
2024-03-27	个股期权	期权持仓到期注销	202100207		人民币	上海	0	0	A102435978888	50ETF沽3月2300	1	0	0	0	
2024-03-28	个股期权	行权资金拨出	202100207	内部银行	人民币	上海	23500	-23500.60	A102435978888	50ETF购3月2350	1	0.60	0.6	0	
2024-03-28	个股期权	行权资金拨入	202100207	内部银行	人民币	上海	24000	24000	A102435978888	50ETF购3月2400	1	0	0	0	

交割单

可查询某一指定历史时期内的历史交割单情况。例如：

交易日期	委托日期	申报时间	成交时间	业务类型	业务名称	交易类别	衍生品合约账户	席位编号	期权持仓类别	期权合约简称	证券名称	买卖方向	开平仓方向
2024-03-11	2024-03-11	09:32:21	09:32:21	个股期权	买入开仓	上海	A102435978888	58001	权利方	50ETF购3月2350	50ETF	买	开仓
2024-03-11	2024-03-11	09:32:22	09:32:22	个股期权	买入开仓	上海	A102435978888	58001	权利方	50ETF购3月2350	50ETF	买	开仓
2024-03-11	2024-03-11	09:32:59	09:32:59	个股期权	买入开仓	上海	A102435978888	58001	权利方	50ETF沽3月2300	50ETF	买	开仓
2024-03-27	2024-03-27	13:25:22	13:25:21	个股期权	卖出开仓	上海	A102435978888	58001	义务方	50ETF购3月2400	50ETF	卖	开仓
2024-03-27	2024-03-27	13:25:22	13:25:22	个股期权	卖出开仓	上海	A102435978888	58001	义务方	50ETF购3月2400	50ETF	卖	开仓
2024-03-27	2024-03-27	13:25:23	13:25:23	个股期权	卖出开仓	上海	A102435978888	58001	义务方	50ETF购3月2400	50ETF	卖	开仓
2024-03-27	2024-03-27	13:25:23	13:25:23	个股期权	卖出开仓	上海	A102435978888	58001	义务方	50ETF购3月2400	50ETF	卖	开仓
2024-03-27	2024-03-27	13:25:23	13:25:23	个股期权	卖出开仓	上海	A102435978888	58001	义务方	50ETF购3月2400	50ETF	卖	开仓
2024-03-27	2024-03-27	13:25:23	13:25:23	个股期权	卖出开仓	上海	A102435978888	58001	义务方	50ETF购3月2400	50ETF	卖	开仓
2024-03-27	2024-03-27	13:25:24	13:25:24	个股期权	卖出开仓	上海	A102435978888	58001	义务方	50ETF购3月2400	50ETF	卖	开仓
2024-03-27	2024-03-27	00:00:00	16:00:06	个股期权	期权持仓到期注销	上海	A102435978888		权利方	50ETF沽3月2350	50ETF	卖	平仓
2024-03-27	2024-03-27	00:00:00	16:00:06	个股期权	期权持仓到期注销	上海	A102435978888		义务方	50ETF购3月2400	50ETF	买	平仓
2024-03-27	2024-03-27	00:00:00	16:00:06	个股期权	行权指派	上海	A102435978888	58001	权利方	50ETF购3月2350	50ETF	买	行权
2024-03-27	2024-03-27	00:00:00	16:00:06	个股期权	行权指派	上海	A102435978888	58001	义务方	50ETF购3月2400	50ETF	卖	行权

持仓限额

可查询账户的持仓限额，例如：

持仓限额

99026686 (孙贵妙) (权) 查询

交易所	标的代码	当日多头开仓限额	总持仓限额	多头持仓限额	当日多头开仓冻结	总持仓冻结	多头持仓冻结
SZSE	159629	400	200	100	0	0	0
SZSE	159633	400	200	100	0	0	0
SZSE	159845	400	200	100	0	0	0
SZSE	159901	400	200	100	0	0	0
SZSE	159902	400	200	100	0	0	0
SZSE	159915	400	200	100	0	4	0
SZSE	159919	400	200	100	0	0	0
SZSE	159922	400	200	100	0	0	0
SSE	510050	400	200	100	0	5	0
SSE	510180	400	200	100	0	0	0
SSE	510210	400	200	100	0	0	0
SSE	510300	400	200	100	0	0	0

持仓限额

分析

期权总持仓分析

提供使用者账号的持仓风险分析计算，可针对风险参数进行监控并设定警示，帮助使用者有效管理持仓风险。

合计	\$Delta	1%Delta	\$Gamma	1%\$Gamma	\$时间价值	逐日浮动盈亏	\$Vega
	-611,472.44	-6,114.72	10,308,194.47	281,046.65	63,053.17	-1,353.80	4,042.25
50ETF期权(510050)	-612,312.35	-6,123.12	10,299,675.06	280,707.34	63,035.17	-1,350.80	4,037.08
300ETF期权(510300)	839.92	8.40	8,519.41	339.30	18.00	-3.00	5.17
50ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
300ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
沪深300ETF期权(159919)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
沪深300ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
沪深300期权	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00

交易	投资者	交易所	合约	净仓	持仓	空仓	持仓均价	空仓均价	开仓均价	市值	逐笔浮动盈亏	期权持仓	Delta
交易	1999_2-0059526	SSE	510050 2205 2.75 认购	15	15	0	0.0239	-	0.0239	15.00	0.0000	-	-
交易	1999_2-0059526	SSE	510050 2205 2.75 认沽	17	17	0	0.0126	-	0.0126	5,100.00	2,950.00	-	-
交易	1999_2-0059526	SSE	510050 2205 2.8 认购	17	17	0	0.0047	-	0.0047	17.00	0.0000	-	-
交易	1999_2-0059526	SSE	510050 2205 2.8 认沽	17	17	0	0.0441	-	0.0441	13,651.00	6,149.00	-	-
交易	1999_2-0059526	SSE	510050 2205 3.2 认购	1	1	0	0.0001	-	0.0001	1.00	0.0000	-	-
交易	000000000842	SSE	510050 购 6月 2.7	1	1	0	0.0760	-	0.0864	699.00	0.0000	0.58	15
交易	1999_2-0059526	SSE	510050 购 6月 2.75	52	52	0	0.0682	-	0.0682	23,400.00	13,980.00	23.42	638
交易	1013-80881810022	SSE	510050 购 6月 2.75	12	12	0	0.0498	-	0.0657	5,400.00	0.0000	5.40	147
交易	000000000842	SSE	510050 购 6月 2.75	2	2	0	0.0498	-	0.0883	900.00	0.0000	0.90	24
交易	8050-90096286	SSE	510050 购 6月 2.75	7	7	0	0.0498	-	0.0656	3,150.00	0.0000	3.15	85
交易	1999_2-0059526	SSE	510050 沽 6月 2.75	52	52	0	0.0578	-	0.0578	36,712.00	6,634.00	-28.58	-778
交易	8050-90096286	SSE	510050 沽 6月 2.75	1	3	2	0.0718	0.0796	0.0587	706.00	536.00	-0.55	-14

- 持仓汇总资料栏位
 - 持仓汇总除了一般的数量、价格、盈亏等资料栏位，还提供了特色的风险参数栏位
 - 期权持仓 Delta
 - \$Delta
 - 1%\$Delta
 - \$Gamma
 - 1%\$Gamma
 - \$Theta
 - \$Vega
 - \$Rho
 - \$Charm
 - \$Vanna
 - \$Vomma
 - \$Speed
 - \$Zooma
 - \$时间价值
 - 估算当日盈亏
 - 估算理论损益

期权总持仓分析

合计	\$Delta	1%Delta	\$Gamma	1%\$Gamma	\$时间价值	逐日浮动盈亏	\$Vega
	-611,472.44	-6,114.72	10,308,194.47	281,046.65	63,053.17	-1,353.80	4,042.25
▶ 50ETF期权(510050)	-612,312.35	-6,123.12	10,299,675.06	280,707.34	63,035.17	-1,350.80	4,037.08
▶ 300ETF期权(510300)	839.92	8.40	8,519.41	339.30	18.00	-3.00	5.17
▶ 50ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
▶ 300ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
▶ 沪深300ETF期权(159919)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
▶ 沪深300ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
▶ 沪深300期权	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00

持仓汇总

a	\$Vomma	\$Speed	\$Zomma	\$时间价值	估算当日盈亏	估算理论盈亏	合约类型	行权价	到期日	逐日浮动盈亏	昨持仓	估算手续费	昨持损益
10.01	2,413.39	260,589.39	-973,812.01	3,150.00	130.00	130.00	Call	2.75	20220622	-336.00	7	0.00	-336.00
18.62	17,928.05	1,935,806.89	-7,234,032.00	87,600.00	142.00	142.00	Put	2.75	20220622	6,634.00	52	0.00	-624.00
12.86	344.77	37,227.06	-139,116.00	142.00	142.00	142.00	Put	2.75	20220622	143.00	3	0.00	-36.00
10.01	4,826.78	521,178.78	-1,947,624.00	142.00	142.00	142.00	Put	2.75	20220622	-168.00	14	0.00	-168.00
14.00	-34,089.04	-1,265,122.21	97,952.83	120.00	120.00	120.00	Call	2.85	20220622	120.00	-4	0.00	120.00
18.00	-68,178.08	-2,530,244.42	195,905.77	240.00	240.00	240.00	Call	2.85	20220622	240.00	-8	0.00	240.00
12.00	-17,044.52	-632,561.10	48,976.44	60.00	60.00	60.00	Call	2.85	20220622	60.00	-2	0.00	60.00
5.04	19,653.22	668,548.68	-9,829.21	249.17	62.80	62.80	Call	2.863	20220622	-62.80	2	0.00	-62.80
8.25	207,656.07	4,504,526.44	1,048,057.56	810.00	72.00	468.00	Put	2.95	20220622	72.00	18	0.00	72.00
19.90	11,041.31	71,721.90	32,449.87	18.00	-3.00	-3.00	Call	4.5	20220622	-3.00	1	0.00	-3.00
19.51	-11,027.45	-71,626.35	-32,428.52	-6.00	172.00	120.00	Put	4.5	20220622	104.00	-1	0.00	172.00
19.51	11,027.45	71,626.35	32,428.52	6.00	-172.00	-120.00	Put	4.5	20220622	-104.00	1	0.00	-172.00

- 持仓汇总右键菜单
 - 点击持仓合约之后，通过右键菜单，可开启：闪电下单、下单盒、图表。
 - 汇出文件：将持仓汇总资料汇出.csv 格式文件保存。
 - 栏位设定：勾选要显示的栏位
- 开启交易
 - 在持仓中，点击的净仓栏位数量，可弹出下单工具
 - 持仓中，提供「交易」按钮功能，点击弹出下单工具。
- 合计

根据期权品种分类合计风险参数及损益。

- 合计栏位包括：
 - ◆ 品种
 - ◆ \$Delta
 - ◆ 1%\$Delta
 - ◆ \$Gamma
 - ◆ 1%\$Gamma
 - ◆ \$Theta
 - ◆ \$Vega
 - ◆ \$Rho
 - ◆ 逐笔浮动盈亏
 - ◆ \$时间价值
 - ◆ 多仓\$时间价值
 - ◆ 空仓\$时间价值
 - ◆ 估算当日盈亏
 - ◆ 估算平仓盈亏
 - ◆ 当日买卖盈亏

- ◆ 逐日浮动盈亏
- ◆ 多仓\$Theta/\$时间价值
- ◆ 空仓\$Theta/\$时间价值
- ◆ 估算理论盈亏
- ◆ \$Charm
- ◆ \$Vanna
- ◆ \$Vomma
- ◆ \$Speed
- ◆ \$Zomma
- ◆ 期权净成交
- ◆ 期权总成交
- ◆ 权利仓
- ◆ 总持仓
- ◆ 总开仓
- ◆ 昨总留仓
- ◆ 成交持仓比
- ◆ 委托笔数
- ◆ 成交笔数
- ◆ 删单笔数
- ◆ 昨留仓
- ◆ 估算手续费
- ◆ 昨持损益

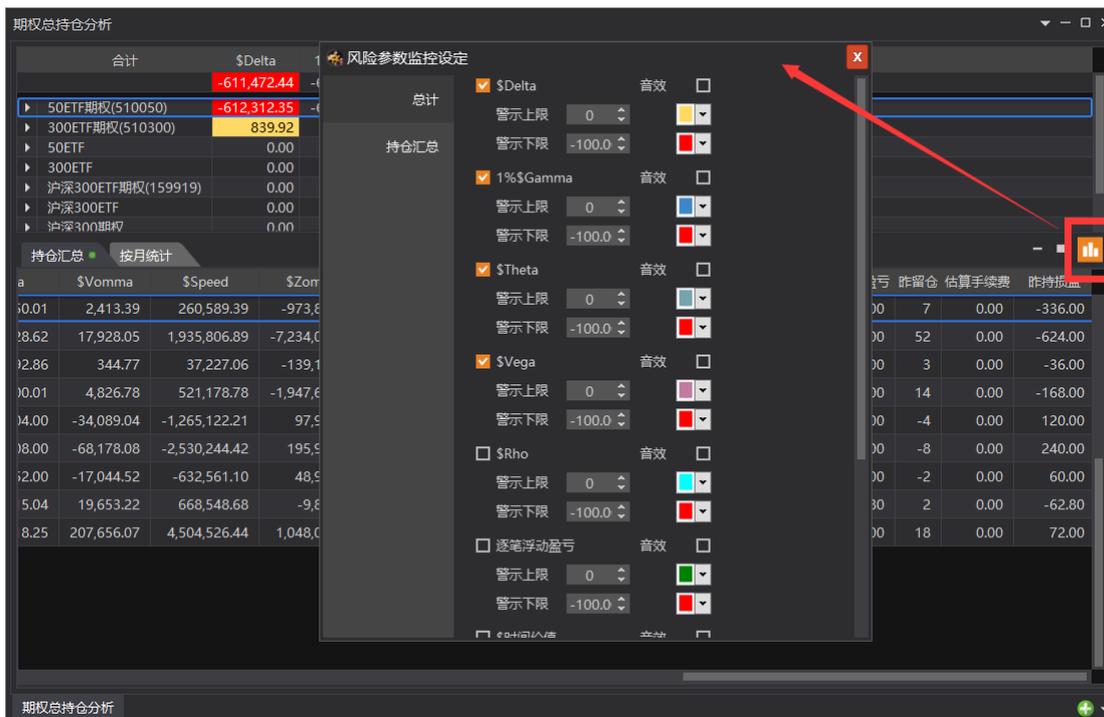
● 按月统计

合计	\$Delta	1%Delta	\$Gamma	1%\$Gamma	\$时间价值	逐日浮动盈亏	\$Vega
	-611,472.44	-6,114.72	10,308,194.47	281,046.65	63,053.17	-1,353.80	4,042.25
▶ 50ETF期权(510050)	-612,312.35	-6,123.12	10,299,675.06	280,707.34	63,035.17	-1,350.80	4,037.08
▶ 300ETF期权(510300)	839.92	8.40	8,519.41	339.30	18.00	-3.00	5.17
▶ 50ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
▶ 300ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
▶ 沪深300ETF期权(159919)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
▶ 沪深300ETF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
▶ 沪深300期权	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00

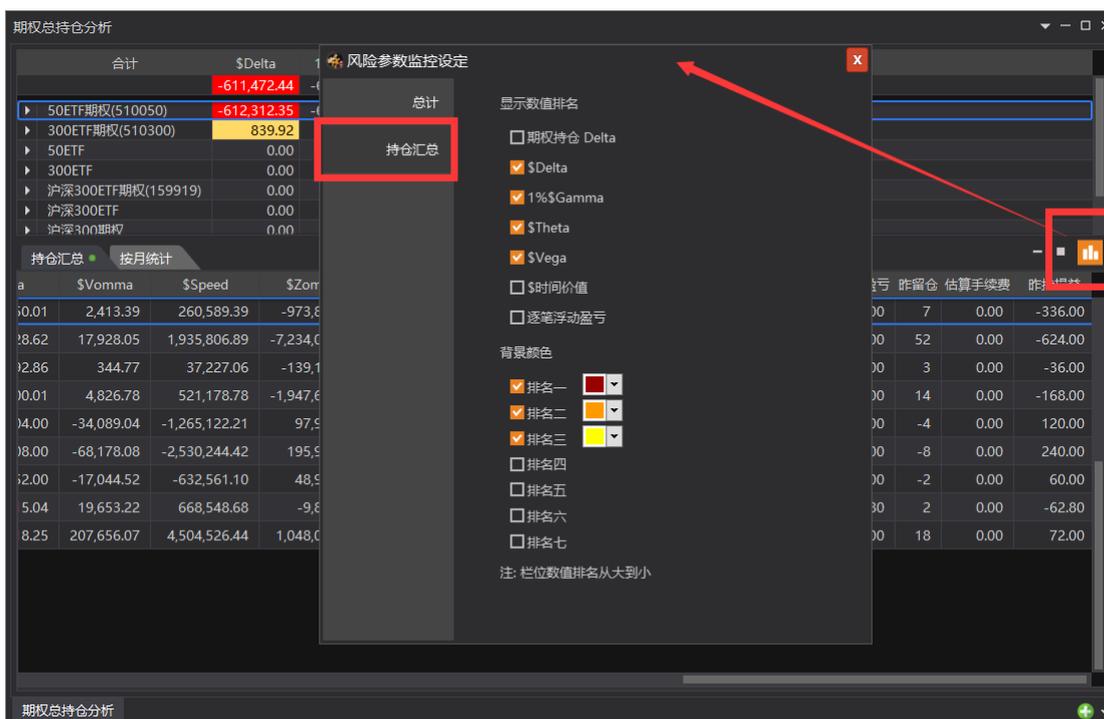
合计	\$Delta	1%Delta	\$Gamma	1%\$Gamma	\$Theta	\$Vega	\$Rho	\$Charm	\$Vanna	\$Vomma
日内	29,957.51	299.58	-148,898.73	-4,058.09	30.47	-58.22	1.06	25,057.65	-732,985.72	-689.54
昨仓	-642,269.86	-6,422.70	10,448,573.79	284,765.43	-2,134.45	4,095.30	-92.41	0.00	0.00	0.00
合计	-612,312.35	-6,123.12	10,299,675.06	280,707.34	-2,103.98	4,037.08	-91.35	-1,882,415.36	54,164,338.92	156,694.01
2206 (216天)										
日内	29,957.51	299.58	-148,898.73	-4,058.09	30.47	-58.22	1.06	25,057.65	-732,985.72	-689.54
昨仓	-642,269.86	-6,422.70	10,448,573.79	284,765.43	-2,134.45	4,095.30	-92.41	0.00	0.00	0.00
合计	-612,312.35	-6,123.12	10,299,675.06	280,707.34	-2,103.98	4,037.08	-91.35	-1,882,415.36	54,164,338.92	156,694.01
2207										
日内	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
昨仓	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2209										
日内	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
昨仓	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2212										
日内	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
昨仓	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

从合计中，点击期权品种，下方会出现该品种的按月统计资料。

● 风险参数监控设定



- 提供总计的风险参数监控设定



- 提供持仓汇总的栏位数值排名监控设定。

- 风险参数计算

在总计、持仓汇总中，各项风险参数栏位的计算说明如下：

风险值名称	定义
期权持仓 Delta	$\Delta \times \text{持仓数量}$
\$Delta	$\Delta \times \text{合约单位} \times \text{净仓数量} \times \text{参考标的价格}$
1%\$Delta	$0.01 \times \Delta \times \text{合约单位} \times \text{净仓数量} \times \text{参考标的价格}$
\$Gamma	$\Gamma \times \text{合约单位} \times \text{净仓数量} \times \text{参考标的价格}$
1%\$Gamma	$0.01 \times \Gamma \times \text{合约单位} \times \text{净仓数量} \times \text{参考标的价格} \times \text{参考标的价格}$
\$Theta	$\Theta \times \text{合约单位} \times \text{净仓数量}$
\$Vega	$\text{Vega} \times \text{合约单位} \times \text{净仓数量}$
\$Rho	$\text{Rho} \times \text{合约单位} \times \text{净仓数量} \times 0.01$
\$Charm	$\text{净仓数量} \times \text{Charm} \times \text{参考标的价格} \times \text{合约单位}$
\$Vanna	$\text{净仓数量} \times \text{Vanna} \times 100 \times \text{合约单位}$
\$Vomma	$\text{净仓数量} \times \text{Vomma} \times \text{合约单位}$
\$Spedd	$\text{净仓数量} \times \text{Speed} \times \text{参考标的价格} \times \text{合约单位}$
\$Zomma	$\text{净仓数量} \times \text{Zomma} \times \text{参考标的价格} \times \text{合约单位}$
\$时间价值	$\text{时间价值} \times \text{合约单位} \times \text{持仓数量}$
多仓\$时间价值	多仓的\$时间价值加总
空仓\$时间价值	空仓的\$时间价值加总
多仓\$Theta/\$时间价值	多仓的\$Theta 加总 / 多仓的\$时间价值加总
空仓\$Theta/\$时间价值	空仓的\$Theta 加总 / 空仓的\$时间价值加总
逐笔浮动盈亏	以开仓价格计算的浮动盈亏
逐日浮动盈亏	以持仓价格计算的浮动盈亏
估算当日盈亏	逐日浮动盈亏 + 估算平仓盈亏
估算理论盈亏	理论浮动盈亏 + 估算平仓盈亏

期权持仓监控

	总持仓		当日交易	
	2206	合计	2206	合计
\$Delta	-612,312.35	-612,312.35	29,957.51	29,957.51
1%Delta	-6,123.12	-6,123.12	299.58	299.58
\$Gamma	10,299,675.06	10,299,675.06	-148,898.73	-148,898.73
1%\$Gamma	280,707.34	280,707.34	-4,058.09	-4,058.09
\$Theta	-2,103.98	-2,103.98	30.47	30.47
\$Vega	4,037.08	4,037.08	-58.22	-58.22
\$Rho	-91.35	-91.35	1.06	1.06
\$Charm	-1,882,415.36	-1,882,415.36	25,057.65	25,057.65
\$Vanna	54,164,338.92	54,164,338.92	-732,985.72	-732,985.72
\$Vomma	156,694.01	156,694.01	-689.54	-689.54
\$Speed	5,831,963.86	5,831,963.86	-74,454.11	-74,454.11
\$Zomma	-18,225,029.13	-18,225,029.13	278,232.00	278,232.00
认购净仓	62	95	-	-
认沽净仓	85	119	-	-
认购/认沽留仓净额	-23	-24	-	-
期权净成交	-2	-2	-2	-2
期权总成交	2	2	2	2
时间价值	63,035.17	63,035.17	-918.00	-918.00
估算当日盈亏	-3,784.80	-5,707.80	179.00	179.00
估算理论盈亏	-3,455.80	-3,455.80	181.00	181.00
权利仓	163	230	0	0
昨净留仓	177	244	-	-
总持仓	179	246	2	2
总开仓	2	2	-	-
成交持仓比	11%	11%	-	-
委托笔数	6	6	6	6
成交笔数	2	2	2	2
撤单笔数	0	0	0	0
未平仓认购合约数	90	123	-	-
未平仓认沽合约数	85	119	-	-
未平仓合约总数	175	242	-	-
估算手续费	0.00	0.00	0.00	0.00

提供各个期权品种的风险参数按月统计资料。(与期权总持仓分析的按月统计功能相同)

- 监控栏位：可以通过右键菜单设定显示栏位，以及栏位排序
 - \$Delta
 - 1%\$Delta
 - \$Gamma
 - 1%\$Gamma
 - \$Theta
 - \$Vega
 - \$Rho
 - \$Charm
 - \$Vanna
 - \$Vomma
 - \$Speed
 - \$Zomma
 - 认购净仓
 - 认沽净仓
 - 认购/认沽留仓净额
 - 期权净成交
 - 期权总成交
 - 时间价值
 - 估算当日盈亏
 - 估算理论盈亏
 - 权利仓
 - 昨净留仓
 - 总持仓
 - 总开仓

- 成交持仓比
- 委托笔数
- 成交笔数
- 删单笔数
- 在标题栏提供下拉菜单
 - 保持窗口最前
 - 过滤资金账号：可设定过滤资金账号，期权持仓监控以过滤后的账号计算。
 - 转置：将期权持仓监控的栏位显示转置
 - 隐藏无持仓月份：期权持仓监控将无持仓的月份隐藏
 - 显示分月统计：可设定是否显示分月统计数据。
 - 显示当日交易：可设定是否显示当日交易数据

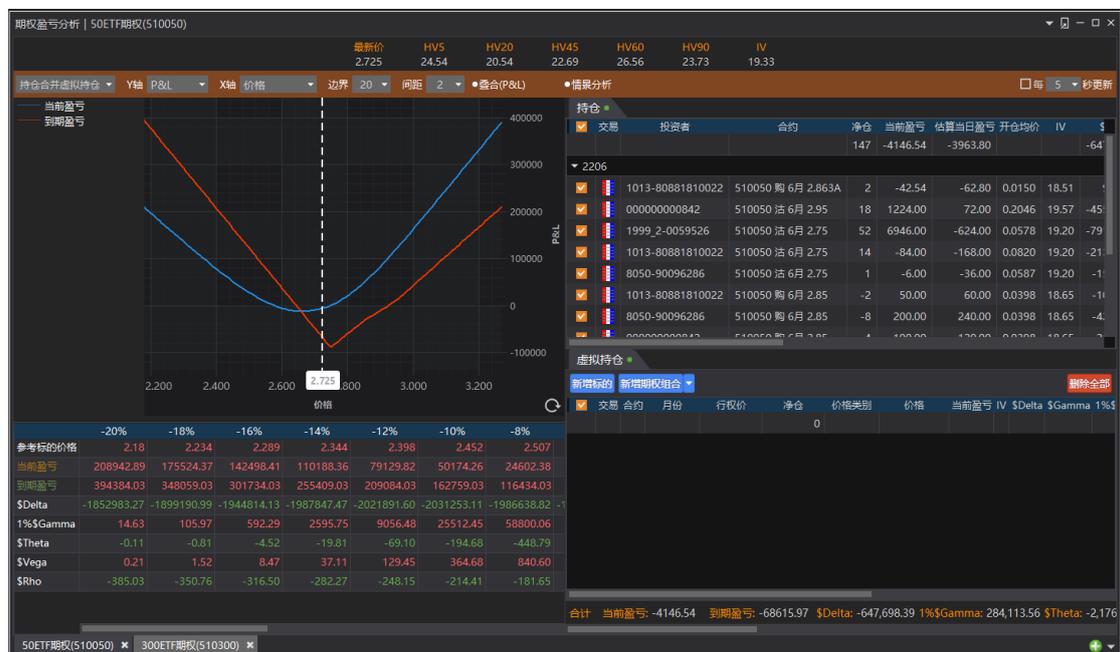
期权持仓监控 50ETF期权(510050)		总持仓		当日交易	
	2206	合计	2206	合计	
\$Delta	-612,312.35	-612,312.35	29,957.51		
1%Delta	-6,123.12	-6,123.12	299.58		
\$Gamma	10,299,675.06	10,299,675.06	-148,898.73		
1%\$Gamma	280,707.34	280,707.34	-4,058.09		
\$Theta	-2,103.98	-2,103.98	30.47		
\$Vega	4,037.08	4,037.08	-58.22		
\$Rho	-91.35	-91.35	1.06		
\$Charm	-1,882,415.36	-1,882,415.36	25,057.65	25,057.65	
\$Vanna	54,164,338.92	54,164,338.92	-732,985.72	-732,985.72	
\$Vomma	156,694.01	156,694.01	-689.54	-689.54	
\$Speed	5,831,963.86	5,831,963.86	-74,454.11	-74,454.11	
\$Zomma	-18,225,029.13	-18,225,029.13	278,232.00	278,232.00	
认购净仓	62	95	-	-	
认沽净仓	85	119	-	-	
认购/认沽净仓净额	-23	-24	-	-	
期权净成交	-2	-2	-2	-2	
期权总成交	2	2	2	2	
时间价值	63,035.17	63,035.17	-918.00	-918.00	
估算当日盈亏	-3,784.80	-5,707.80	179.00	179.00	
估算理论盈亏	-3,455.80	-3,455.80	181.00	181.00	
权利金	163	230	0	0	
昨总持仓	177	244	-	-	
总持仓	179	246	2	2	
总开仓	2	2	-	-	
成交持仓比	11%	11%	-	-	
委托笔数	6	6	6	6	
成交笔数	2	2	2	2	
删单笔数	0	0	0	0	
未平仓认购合约数	90	123	-	-	
未平仓认沽合约数	85	119	-	-	
未平仓合约总数	175	242	-	-	
估算手续费	0.00	0.00	0.00	0.00	

- 保持窗口最前
- 合并窗口
- 过滤资金账号
- 转置
- 隐藏无持仓月份
- 显示分月统计
- 显示当日交易

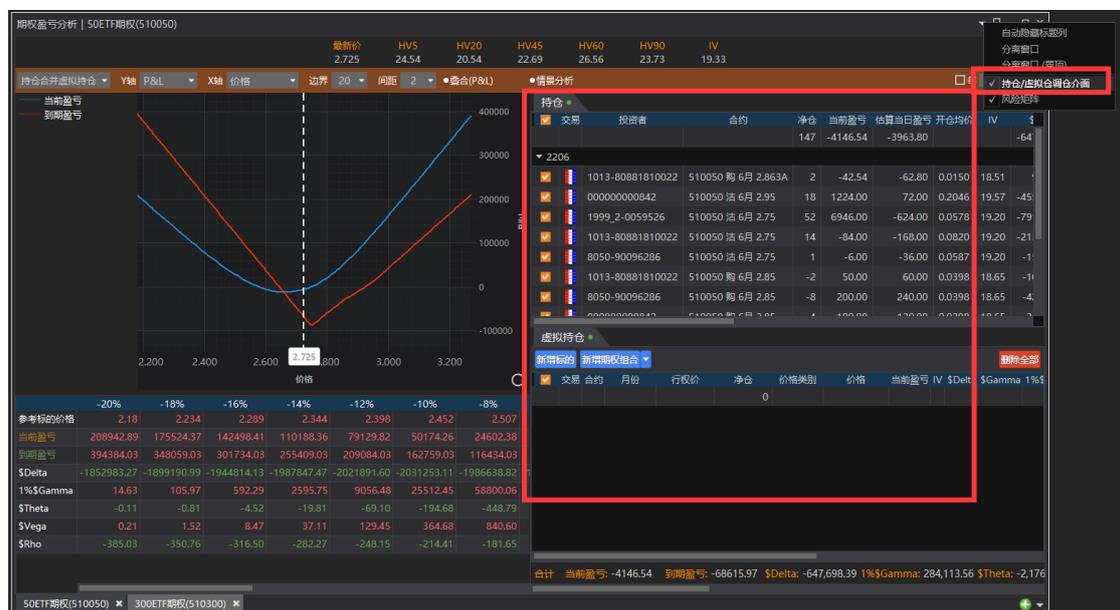
期权盈亏分析

提供期权持仓和虚拟仓的盈亏分析、风险分析功能。

通过“分析->期权盈亏分析”菜单打开期权盈亏分析，选定品种之后就可以看到对应品种的期权盈亏分析。



● 持仓/虚拟持仓调仓界面



- 右上角的下拉选单可以设定显示或隐藏持仓/虚拟仓调仓界面

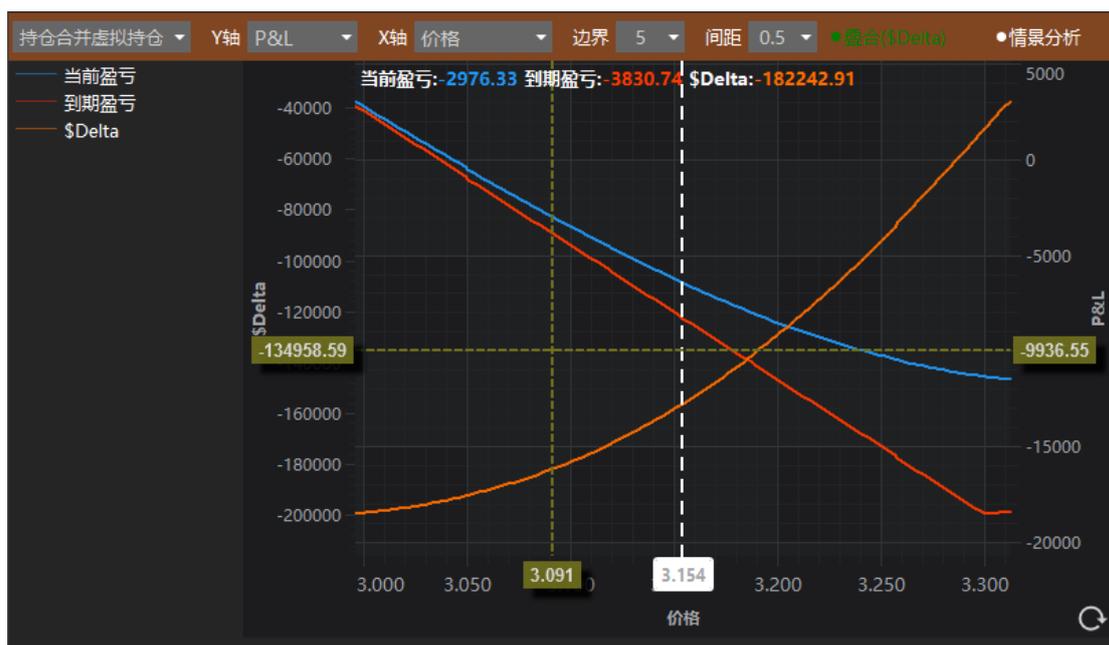
◆ 持仓：

- ✓ 显示当前品种的持仓资料，可以勾选持仓合约加入盈亏分析
- ✓ 在持仓中点击右键打开栏位设定，提供持仓栏位：
 - 投资者
 - 交易所

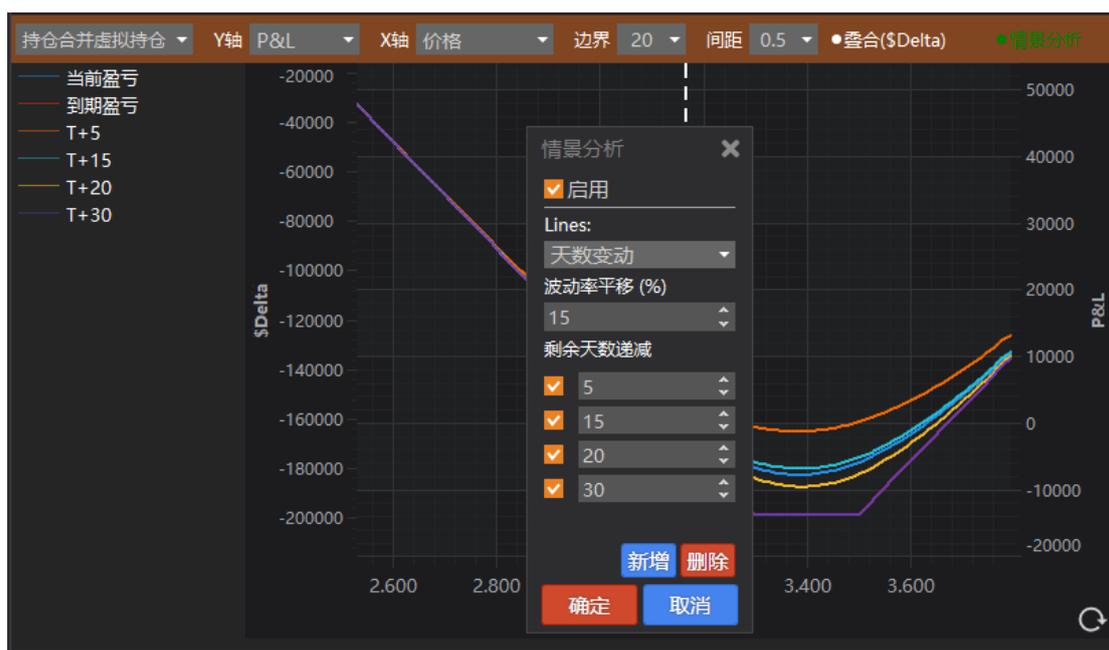
- 合约
- 净仓
- 多仓
- 空仓
- 多仓均价
- 空仓均价
- 市值
- 当前盈亏
- 到期盈亏
- 估算当日盈亏
- 开仓均价
- IV
- Δ
- Γ
- $1\% \Gamma$
- $1\% \Delta$
- Charm
- Vanna
- Vomma
- Speed
- Zomma
- Theta
- Vega
- Rho
- 合约类型
- 行权价
- 到期日
-
- ✓ 合计栏位：净仓、当前盈亏、到期盈亏、估算当日盈亏、 Δ 、 Γ 、 $1\% \Gamma$ 、 $1\% \Delta$ 、 Charm 、 Vanna 、 Vomma 、 Speed 、 Zomma 、 Theta 、 Vega 、 Rho 栏位，会根据勾选持仓合约的数据计算出合计值。
- ◆ 虚拟持仓
 - ✓ 可以通过“新增标的”、“新增期权组合”按钮，添加合约到虚拟持仓中。
 - ✓ 已加入虚拟持仓的合约可以通过“删除”按钮，或者“删除全部”按钮移除。
 - ✓ 在虚拟持仓列表，可以勾选要加入盈亏分析的合约
 - ✓ 虚拟持仓的“净仓”、“均价”栏位，可以手动修改，设定虚拟持仓合约净仓数量，均价。
 - ✓ 在虚拟持仓中，右键打开栏位设定，提供栏位：
 - 交易所
 - 合约
 - 净仓
 - 均价

- 当前盈亏
 - 到期盈亏
 - IV
 - Δ
 - Γ
 - $1\% \Gamma$
 - $1\% \Delta$
 - Charm
 - Vanna
 - Vomma
 - Speed
 - Zomma
 - Θ
 - Vega
 - Rho
 - 合约类型
 - 行权价
 - 到期日
- ✓ 合计栏位：净仓、当前盈亏、到期盈亏、 Δ 、 Γ 、 $1\% \Gamma$ 、 $1\% \Delta$ 、 Charm 、 Vanna 、 Vomma 、 Speed 、 Zomma 、 Θ 、 Vega 、 Rho 栏位，会根据勾选的虚拟持仓合约的数据计算出合计值。
- ◆ 在持仓/虚拟持仓的调仓界面下方，提供持仓+虚拟持仓的合计栏位，包括：当前盈亏、到期盈亏、 Δ 、 $1\% \Gamma$ 、 Θ 、 Vega 、 Rho 、 Γ 、 $1\% \Delta$ 、 Charm 、 Vanna 、 Vomma 、 Speed 、 Zomma 、
- 盈亏分析设定：
 - 持仓范围
 - ◆ 持仓合并虚拟持仓：绘图显示该品种持仓和虚拟持仓加总的分析结果
 - ◆ 持仓 vs. 虚拟持仓：绘图显示该品种持仓 vs. 虚拟持仓各自的分析结果。
 - Y 轴：
 - ◆ P&L：绘图 Y 轴显示当前盈亏、到期盈亏
 - ◆ Δ
 - ◆ $1\% \Gamma$
 - ◆ Θ
 - ◆ Vega
 - ◆ Rho
 - X 轴：
 - ◆ 价格
 - ◆ 价格变化(%)
 - 边界
 - ◆ 按照标的价格作为中心点，按设定的边界比例计算横轴范围
 - 间距
 - ◆ 参考标的价格的间隔设置。

- 叠合：
 - ◆ 添加一组 Y 轴的数据叠合显示，使用左侧 Y 轴坐标刻度。
 - ◆ 启用后，勾选要叠合显示图表中的数据，可选：
 - ✓ P&L
 - ✓ \$Delta
 - ✓ 1%\$Gamma
 - ✓ \$Theta
 - ✓ \$Vega
 - ✓ \$Rho
 - ◆ 如图所示，叠合显示\$Delta：



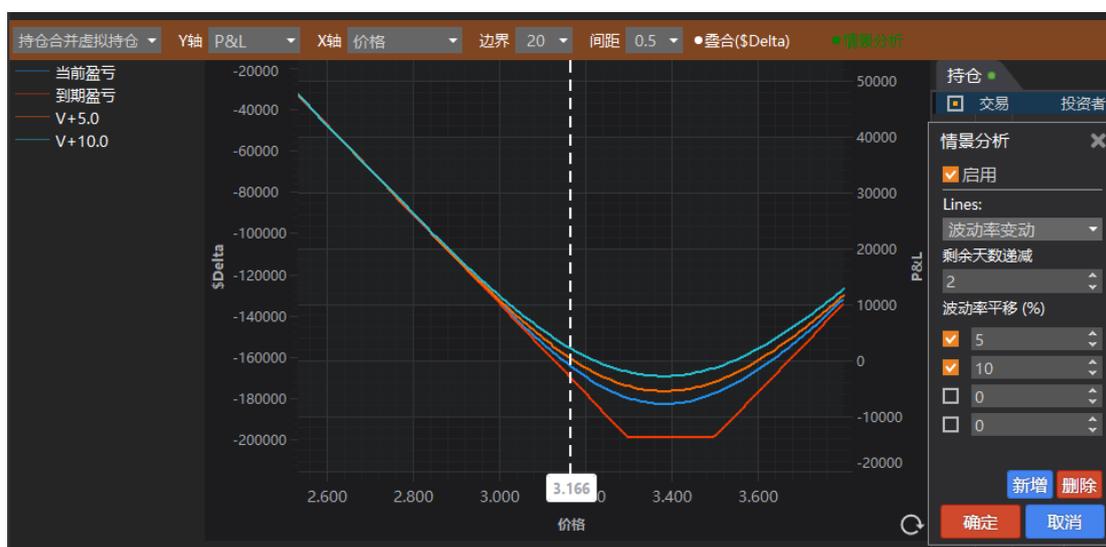
■ 情境分析



- ◆ 添加多种情况分析，可设定 天数变动、波动率变动、波动率期限结构变

动

- ✓ 天数变动：
 - 设定波动率平移(%)
 - 设定剩余天数递减，可勾选多组
- ✓ 波动率变动
 - 设定剩余天数递减
 - 设定波动率平移(%)，可勾选多组
- ✓ 波动率期限结构变动
 - 使用新增按钮，新增组合，可新增多个组合
 - 每个组合提供天数设定、各月份隐波调整项(%)设定
- ✓ 启用情境分析后，对应情境分析曲线显示在图表中。
- ◆ 如图所示，分别为两天后波动率平移 5%、10%的情境分析曲线。



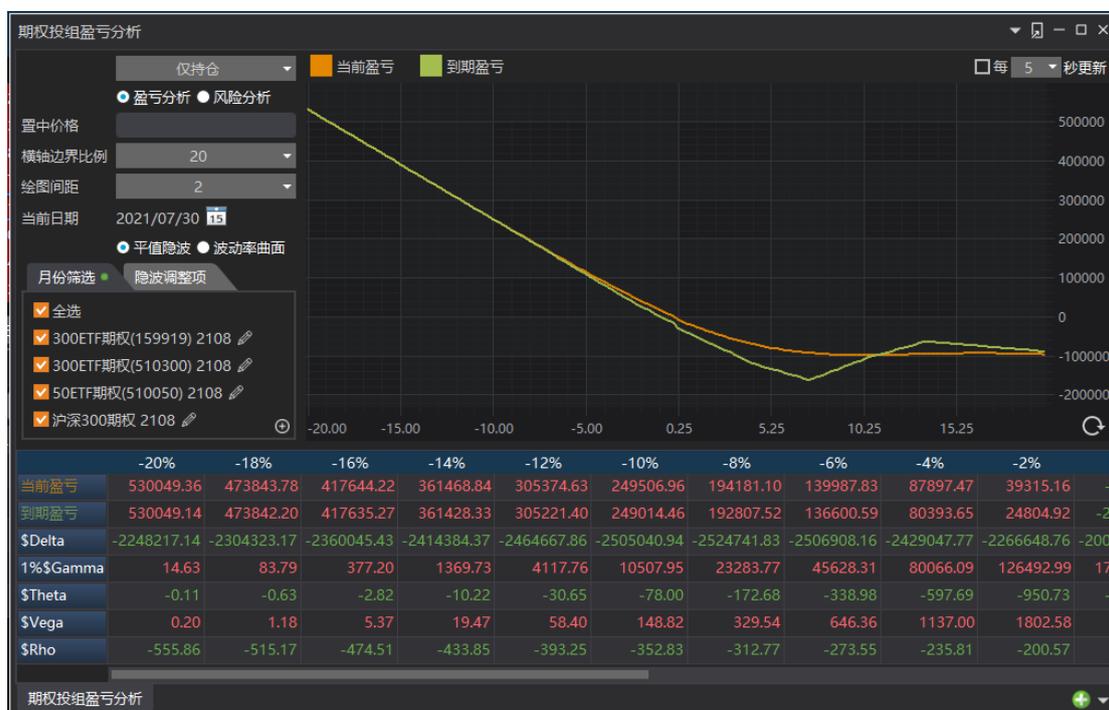
- 设定自动更新频率
 - ◆ 勾选后，盈亏分析按设定时间间隔重新计算并刷新
 - ◆ 可选时间间隔：5 秒、15 秒、30 秒、60 秒
- 手动刷新：
 - ◆ 可按  按钮，手动刷新盈亏分析。
- 风险矩阵



- 以矩阵方式列出不同价格变化的盈亏、风险参数数据：
 - ◆ 当前盈亏
 - ◆ 到期盈亏
 - ◆ Delta ¥
 - ◆ Gamma ¥
 - ◆ Theta ¥
 - ◆ Vega ¥
 - ◆ Rho ¥

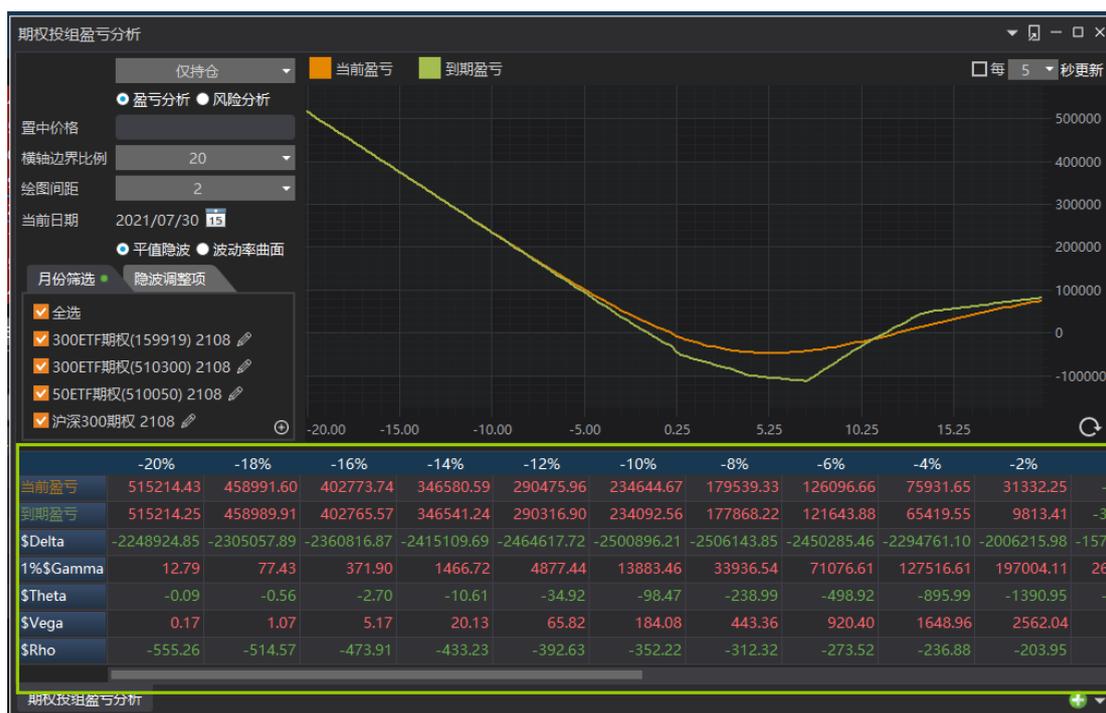
期权投组盈亏分析

期权投组盈亏分析。提供投资组合模式，可以实现跨品种的盈亏分析。



- 盈亏分析设定：
 - 选单提供选择持仓范围
 - ◆ 仅持仓：绘图只显示该品种所有登入账号持仓的分析结果
 - ◆ 持仓合并虚拟持仓：绘图显示该品种所有登入账号持仓&虚拟持仓加总的分析结果
 - ◆ 仅虚拟持仓：绘图只显示该品种 虚拟持仓的分析结果
 - ◆ 持仓 vs.虚拟持仓：绘图显示该品种所有登入账号持仓和虚拟持仓各自的分析结果。
 - 虚拟仓设定：
 - ◆ 在期权标的报价、T 字报价中，提供“虚拟仓”栏位，可以设定对应期权合约的虚拟仓数量。
 - 分析类型：
 - ◆ 盈亏分析：显示当前盈亏、到期盈亏的图形。
 - ◆ 风险分析：显示 Delta ¥ Gamma ¥ Theta ¥ Vega ¥ Rho ¥ 风险参数图形分析
 - 置中价格：
 - ◆ 图形绘制的中心点价格，默认使用参考标的的最新价。
 - 横轴边界比例
 - ◆ 按照置中价格作为中心点，按设定的边界比例计算横轴范围
 - 绘图间距
 - ◆ 绘图横轴计算点的间隔设置。
 - 设定日期

- ◆ 模型时间参数切换，默认使用当天日期
- 波动率
 - ◆ 平值隐波：使用平值隐含波动率计算参考标的价格变动时的盈亏和 Greeks
 - ◆ 波动率曲面：使用波动率曲线计算参考标的价格变动时的盈亏和 Greeks
- 月份筛选
 - ◆ 筛选期权品种、到期月份。
- 隐波调整项
 - ◆ 指定特定月份设定波动率上下变动比例
- 风险矩阵

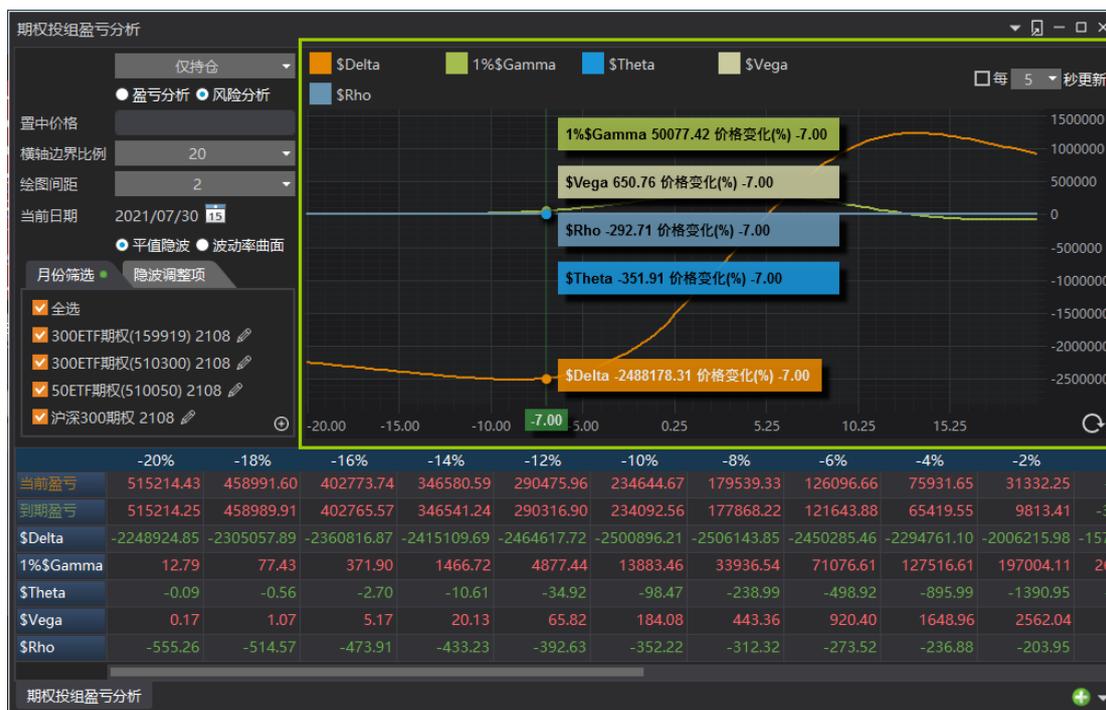


已矩阵方式显示不同参考标的价格变动%时的盈亏和风险数据。

- 参考标的价格变化%：投资组合模式，横轴只支持价格变化%刻度显示。
- 数据：
 - ◆ 当前盈亏
 - ◆ 到期盈亏
 - ◆ 当前盈亏(隐波上升)
 - ◆ 当前盈亏(隐波下降)
 - ◆ Delta ¥ (隐波上升)
 - ◆ Delta ¥
 - ◆ Delta ¥ (隐波下降)
 - ◆ Gamma ¥ (隐波上升)
 - ◆ Gamma ¥
 - ◆ Gamma ¥ (隐波下降)
 - ◆ Theta ¥ (隐波上升)
 - ◆ Theta ¥
 - ◆ Theta ¥ (隐波下降)

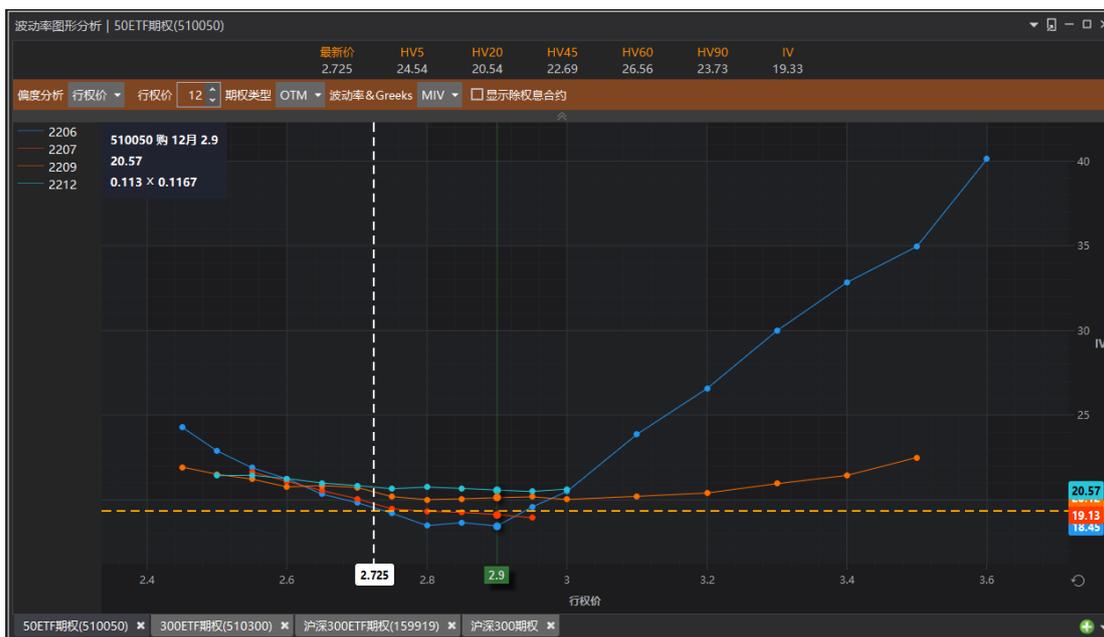
- ◆ Vega ¥ (隐波上升)
- ◆ Vega ¥
- ◆ Vega ¥ (隐波下降)
- ◆ Rho ¥ (隐波上升)
- ◆ Rho ¥
- ◆ Rho ¥ (隐波下降)

● 绘图区



- Y 轴数据：点击可以显示/隐藏该项数据画线。
- 每 n 秒更新：勾选后图表可以按照设定秒数更新
- 重新载入：点击  按钮，重新计算并绘图。

波动率图形分析



提供使用者监看期权合约不同月份和行权价的隐含波动率&Greeks 分布图。

通过“分析->波动率图形分析”菜单打开波动率图形分析，选定品种之后就可以看到对应的波动率图形分析。

- 标的报价：提供期权标的（热门月）的最新价、HV5、HV20、HV45、HV60、HV90、IV。
- 可通过右键菜单勾选更多标的报价栏位



- 控制列



◆ 偏度分析:

- ✓ 行权价: 图表以行权价为横向坐标, 可以设定行权价数量(预设 4)
- ✓ 到期日(年): 图表以年化的到期剩余天数为横向坐标, 可设定到期日(年)数量
- ✓ Delta: 图表以 Delta 作为横向坐标, 可设定 Delta 范围
- ✓ 标准化行权价偏度分析: 图表以标准化行权价作为横向坐标, 可设定标准化行权价数量。

■ 提供四种标准化行权价

- ◆ 行权价/合成期货
- ◆ $\text{Log}(\text{行权价}/\text{合成期货})$
- ◆ $\text{Log}(\text{行权价}/\text{合成期货})/\sqrt{\text{剩余时间}}$
- ◆ $\text{Log}(\text{行权价}/\text{合成期货})/(\text{平值加权 IV}*\sqrt{\text{剩余时间}})$

◆ 行权价/到期日数量: 设定横向坐标行权价或者到期日的数量。

■ 期权类型

- ◆ OTM: 使用 call/put 价外合约的数据。
- ◆ 认购 Call: 使用 call 合约的数据
- ◆ 认沽 Put: 使用 put 合约的数据
- ◆ 认购&认沽: 使用 call 和 put 合约的数据

■ 波动率&Greeks:

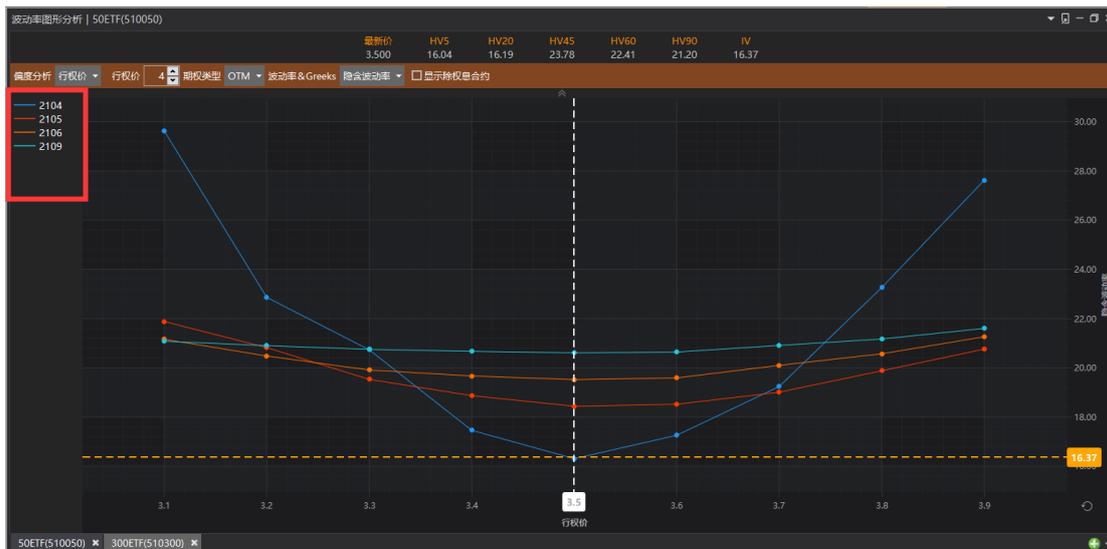
- ◆ 隐含波动率: 以合约隐含波动率作为图表的纵向坐标分析
- ◆ Delta: 以期权合约 Delta 作为图表的纵坐标
- ◆ Theta: 以期权合约 Theta 作为图表的纵坐标

■ 显示除权息合约: 可设定是否显示股票期权除权息合约的数据。

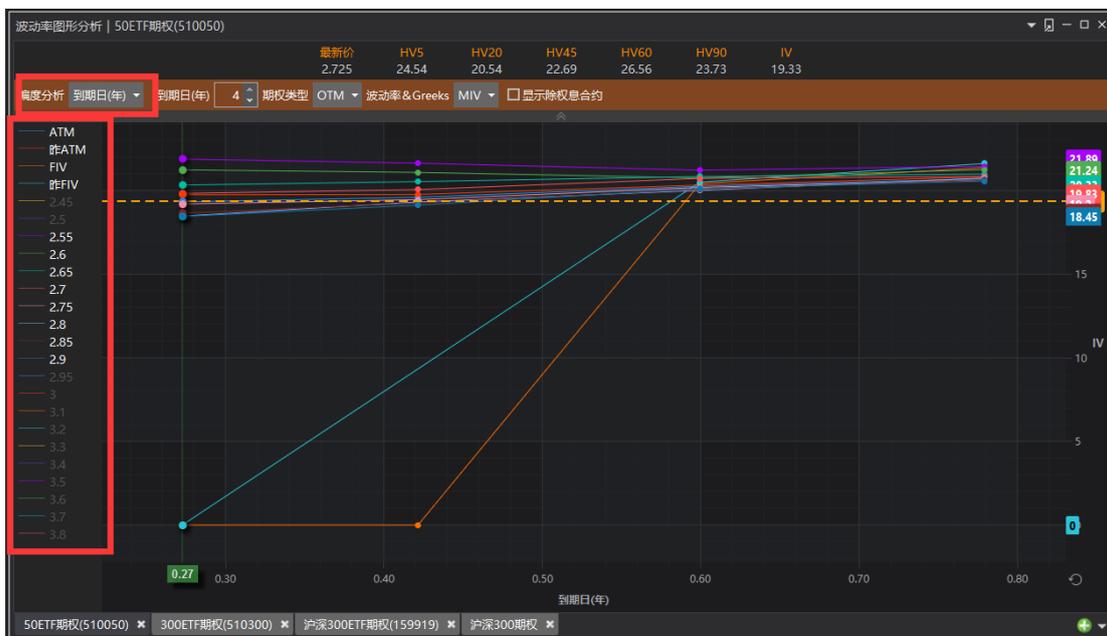
■ 隐藏/显示控制列: 在箭头上点击可以隐藏、显示控制列

● 数据系列

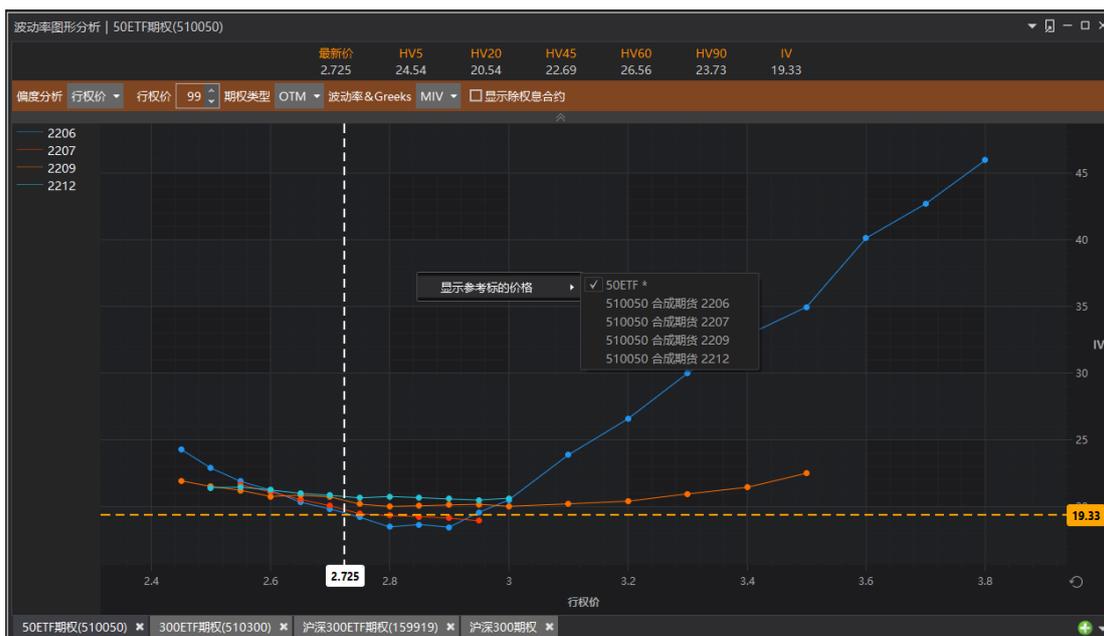
- 在图表的左侧显示数据系列。
- 偏度分析为行权价、Delta 和标准化行权价时, 数据系列为各期权月份, 鼠标点击标签可将图表上对应月份的数据曲线隐藏



- 偏度分析到期日(年)时，数据系列为 ATM、昨 ATM、FIV、昨 FIV 以及行权价序列，鼠标点击标的可将图表上对应行权价的数据隐藏。



- 图表区：
 - 完成控制列的设定，在图表区绘制对应的数据图表。
 - 显示参考标的价格：使用行权价偏度分析时，图表中显示参考标的价格垂直虚线，可以在图表中右击设定参考标的价格。



- Reset
 - 按下 reset 按钮，刷新图表中的数据。

期权波动率曲面管理

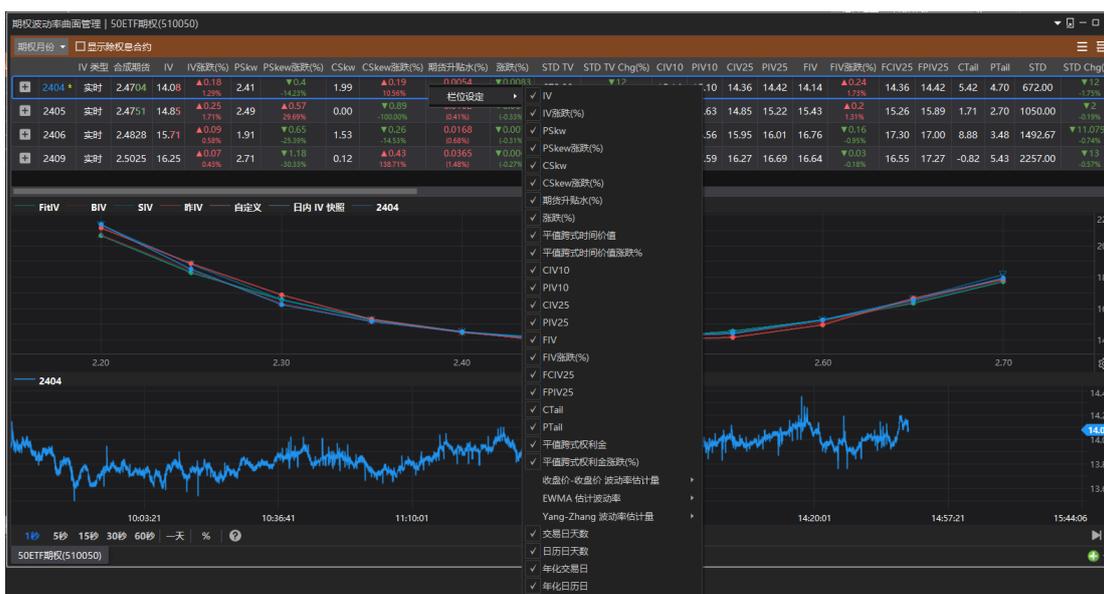


提供各期权月份波动率分析数据，各月份波动率曲线图表与平值隐含波动率走势数据。

- 期权月份：显示各月份的实时、昨结或自定义 IV 结构数据。
 - 数据栏目：
 - ◆ 合成期货
 - ◆ IV：ATM IV 数值
 - ◆ IV 涨跌(%)
 - ◆ PSkw

- ◆ PSkw 涨跌(%)
- ◆ CSkw
- ◆ CSkw 涨跌(%)
- ◆ 期货升贴水(%)
- ◆ 涨跌(%)
- ◆ STD TV: 平值跨式时间价值
- ◆ STD TV Chg(%): 平值跨式时间价值涨跌(%)
- ◆ CIV10
- ◆ PIV10
- ◆ CIV25
- ◆ PIV25
- ◆ FIV
- ◆ FIV 涨跌(%)
- ◆ FCIV25
- ◆ FPIV25
- ◆ CTail
- ◆ PTail
- ◆ STD: 平值跨式权利金
- ◆ STD Chg(%): 平值跨式权利金涨跌(%)
- ◆ HV5 ~ HV245: 收盘价-收盘价 波动率估计量
- ◆ HV5_EWMA~HV245_EWMA: EWMA 估计波动率
- ◆ HV5_YZ~HV245_YZ: Yang-Zhang 波动率估计量
- ◆ 交易日天数
- ◆ 日历日天数
- ◆ 年化交易日
- ◆ 年化日历日
- ◆ 显示月份

■ 栏位设定: 在期权月份数据中右击可勾选显示栏位



■ 折叠/展开期权月份

- ◆ 每个期权月份展开后，可查看该月份的实时、昨结、自定义 IV 结构

IV 类型	合成期货	IV	IV 涨跌(%)	PSkew	PSkew 涨跌(%)	CSkew	CSkew 涨跌(%)	期货升贴水(%)	涨跌(%)	STD TV	STD TV Chg(%)	CIV10	PIV10	CIV25	PIV25	FIV	FIV 涨跌(%)	FCIV25	FPIV25	CTail	PTail	STD	STD Chg(%)	HV5
2206	实时	2.7254	19.33	7.43	▲1.07	-3.98	▼1.17	0.0004	▼0.0096	910.48	▼69.25	18.96	22.44	18.56	20.77	0.00	0.00	0.00	0.00	2.16	8.05	1160.00	▼61	26.21
	昨结	2.7290	19.75	6.36	-2.81	0.0040	▼0.96	979.71	19.59	22.63	19.13	21.12	0.00	19.53	21.47	2.38	7.13	1221.00	-	-	-	-	-	-
	自定义	2.7249	19.44	6.94	-2.93	0.002	▼0.80	0.00	18.96	22.44	18.56	20.77	0.00	0.00	0.00	2.16	8.05	1160.00	-	-	-	-	-	-
2207	实时	2.7317	19.60	8.67	▲1.17	-2.35	▼0.11	0.0047	▼0.0096	1596.50	-	18.68	22.61	19.14	21.30	0.00	-	-	-	-2.43	6.13	1829.00	-	-
	昨结	2.7285	-	-	-	0.0093	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

■ 自定义 IV 结构

TV	STD TV Chg(%)	CIV10	PIV10	CIV25	PIV25	FIV	FIV 涨跌(%)	FCIV25	FPIV25	CTail	PTail	STD	STD Chg(%)	HV5	EWMA	HV10	EWMA	HV5_YZ	HV10_YZ	HV20_YZ	交易日天数	日历日天数	年化交易日	年化日历日
00	▼15	15.01	15.10	14.23	14.38	14.08	▲0.16	14.23	14.38	5.49	4.97	669.00	▼15	7.42	6.81	12.73	12.29	11.81	14	22	0.0581	0.0628	-	-
00	-	15.12	15.16	14.15	14.29	13.90	-	14.15	14.29	6.83	6.07	684.00	-	-	-	-	-	-	-	-	23	-	-	-
.00	▼9	15.01	15.57	14.73	15.12	15.30	▲0.07	15.16	15.74	1.93	2.95	1043.00	▼9	-	-	-	-	-	-	-	31	50	0.1284	0.1393
.00	-	15.13	15.41	14.73	14.88	15.23	-	15.25	15.42	2.74	3.53	1052.00	-	-	-	-	-	-	-	-	51	-	-	-

- ◆ 点击锁定图标，解锁后，可通过快照按钮设定：
 - 快照当前 IV 结构：自定义波动率显示当前 IV 结构
 - 快照昨结 IV 结构：自定义波动率显示昨结 IV 结构
 - 快照日内指定时间 IV 结构：先从下方的波动率走势图中选一个时间点，然后设定快照日内指定时间 IV 结构，则自定义波动率显示所选时间点的 IV 结构

● 波动率曲线图表

- 点击期权月份栏，对应显示该月份的以下几种波动率曲线图：
 - ◆ MIV：中间价计算的 IV 值
 - ◆ BIV：买价计算的 IV 值
 - ◆ SIV：卖价计算的 IV 值
 - ◆ 昨 IV：昨结算价计算的 IV 值
 - ◆ 自定义：快照当前 IV 结构、昨结 IV 结构，或者日内指定时间 IV 结构，也可以不设定
 - ◆ 日内 IV 快照：日内指定时间的 IV 结构
 - ◆ 期权月份：各个期权月份的 OTM CPIV 值



- 点击波动率图例文字可以隐藏/显示绘图。

- 点击波动率图例横线可以打开颜色设置
- 点击波动率曲线图右下角的设置按钮，出现设置选单，可以
 - ◆ 重置图表
 - ◆ 设置图表横向坐标使用：
 - 行权价
 - Delta
 - 标准化行权价
 - ◆ 自动调整刻度
- 当日平值隐含波动率走势图
 - 提供当日平值隐含波动率走势图
 - 可设定 1 秒、5 秒、15 秒、30 秒、60 秒周期
 - 鼠标操作：
 - 鼠标拖曳走势数据；
 - 鼠标滚轮左右滑动数据；
 - Crtl+鼠标滚轮缩放数据
 - 设定“一天”可查看当天全部数据
 - 设定“%”可切换为百分比刻度

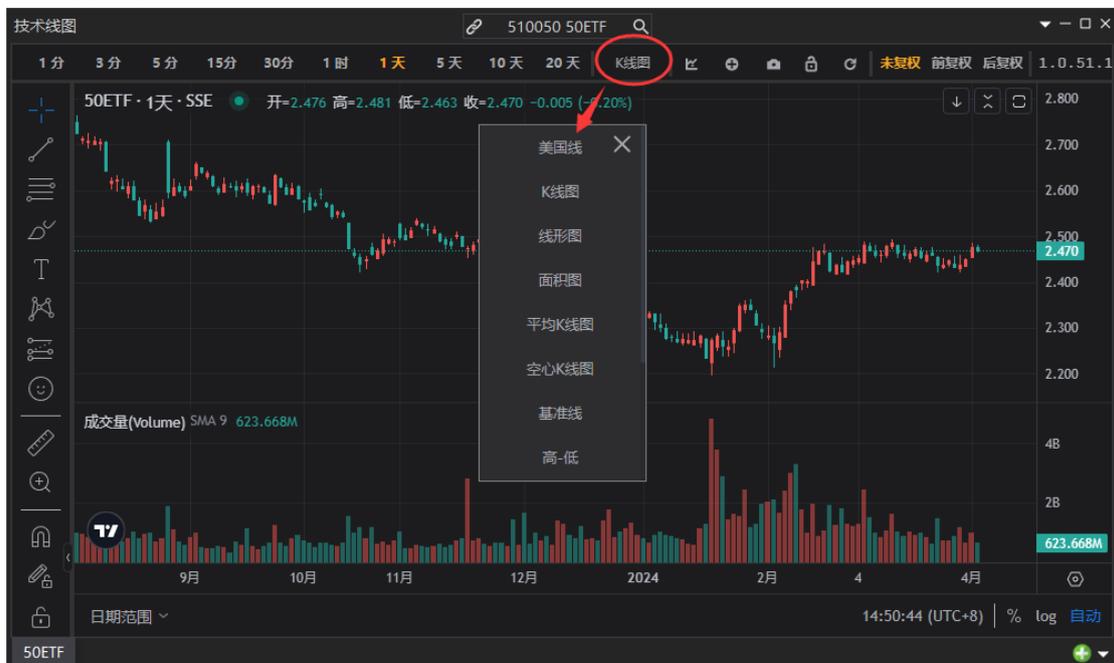
图表

技术线图



提供商品历史和实时数据的技术线图功能。

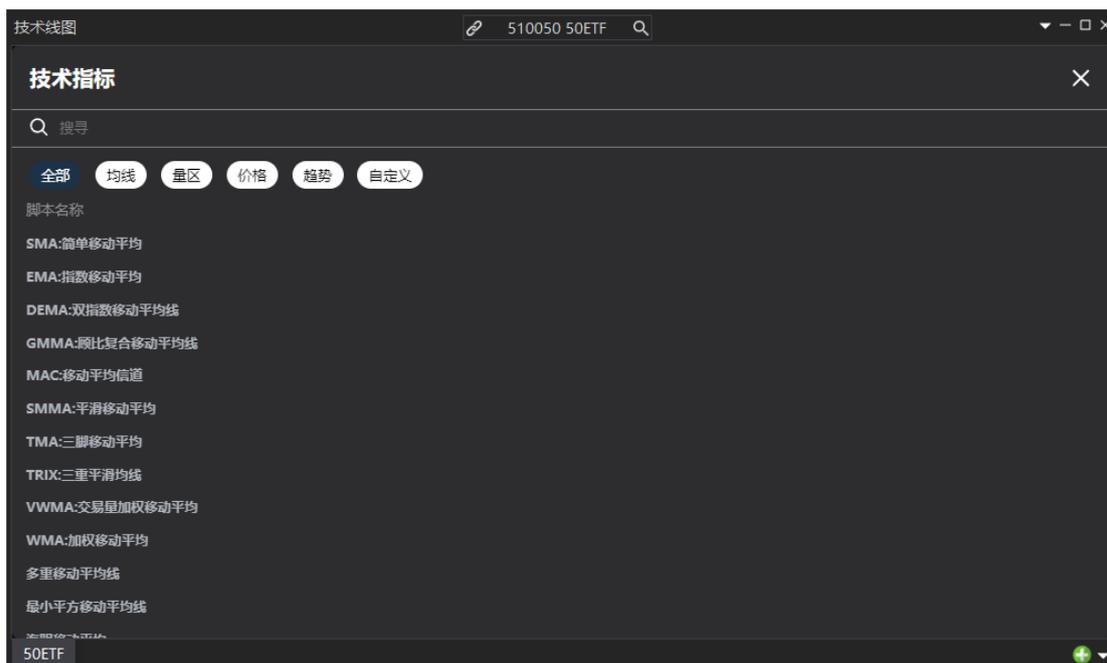
● 线图类型:



● 周期:



- 技术指标：点击  按钮，选择技术指标，可添加到图表中



- 叠加商品：点击  按钮，选择要叠加的商品到图表中



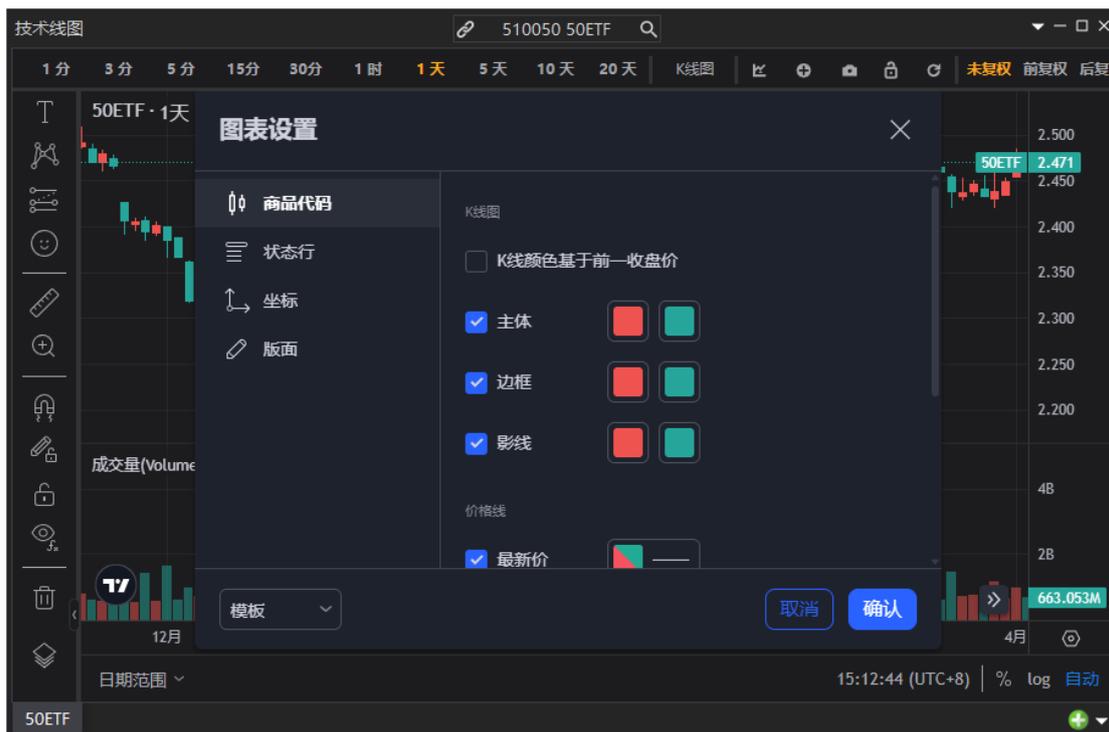
- 快照：点击  按钮，保存当前图表快照。
- 锁定：点击  按钮，将图表锁定，无法修改设定。
- 恢复预设：点击  按钮，将技术线图所有设定 指标恢复到出厂状态。
- 连续行权价&交易所代码连续：
 - 股票期权除权息合约，设定连续行权价，则可回补自合约调整日起的数据；设定交易所代码连续，则可回补自合约上市起的数据。

- 未复权&前复权&后复权:
 - 标的证券合约, 可设定回补未复权、前复权、或者后复权数据
- 工具功能

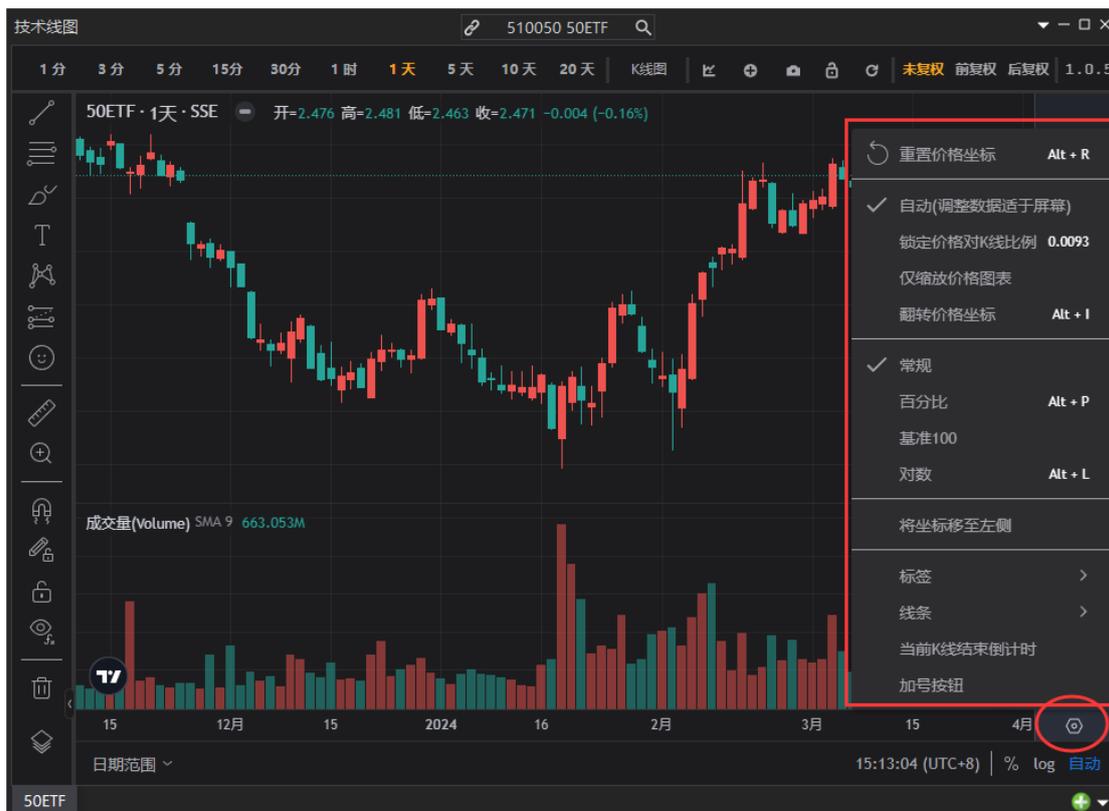


- 绘图工具
 - ◆ 指针工具
 - ◆ 趋势线工具
 - ◆ 江恩和斐波那契工具
 - ◆ 几何形状
 - ◆ 注释工具
 - ◆ 形态工具
 - ◆ 预测和测量工具
 - ◆ 图标
- 测量
- 放大
- 磁铁: 绘图自动吸附在 K 线上
- 保持绘图模式
- 锁定所有绘图
- 隐藏绘图、隐藏指标、隐藏全部
- 删除绘图、删除指标、删除全部

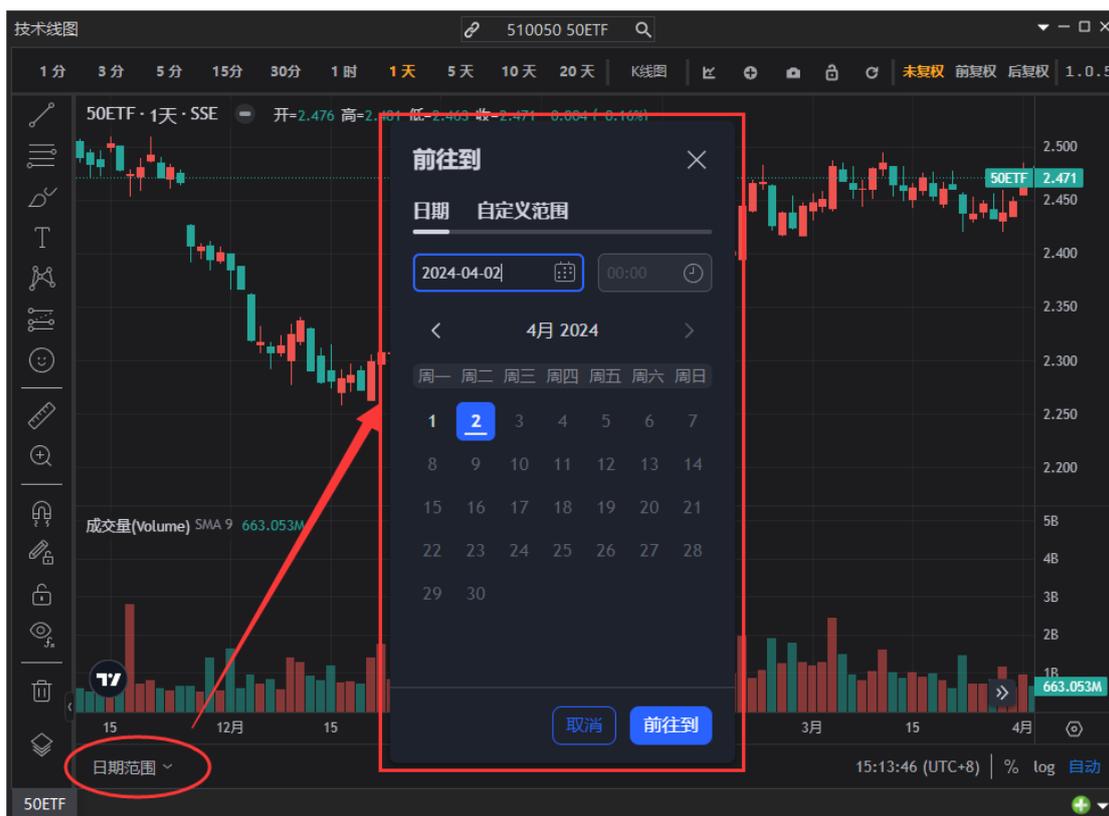
● 图表设置



● 坐标设置



● 日期范围



期权参考标的的走势图

提供期权各品种原生标的，以及合成期货标的的走势数据。



- 点击上方栏目文字可以设置显示/隐藏该栏目走势;
- 点击上方栏目色块可修改走势图线图颜色、线条粗细。

- 提供当日分时、2 日分时、5 日分时走势数据
- 可设定走势数据周期：1 秒、5 秒、15 秒、30 秒、1 分、3 分、5 分、15 分、30 分
- 可设定数据范围：
 - 分钟周期：1 天、2 天、5 天、30 天
 - 秒周期，可设定 1 天、2 天、5 天
- 可设定坐标刻度：“%” 百分比刻度、Chg 涨跌刻度
- 图表设置：可以自定义交易时段，勾选自定义交易时段后，图表显示该时段数据
- 重载数据：按  重新回补数据
- 右键菜单：
 - 显示：水平网格线、垂直网格线、十字线
 - 重载数据
- 鼠标操作：
 - 鼠标左键拖曳走势数据；
 - 鼠标滚轮左右滑动数据；
 - Crtl+鼠标滚轮缩放数据

平值隐含波动率走势图

提供期权各品种各月份的平值隐含波动率走势数据，可以添加多月份数据比较分析。



- 点击上方栏目文字可以显示/隐藏该栏目走势。
- 点击上方栏目色块可修改走势线图颜色、线条粗细。

- 提供当日分时、2 日分时、5 日分时走势数据
- 可设定走势数据周期：1 秒、5 秒、15 秒、30 秒、1 分、3 分、5 分、15 分、30 分
- 可设定数据范围：
 - 分钟周期：1 天、2 天、5 天、30 天
 - 秒周期，可设定 1 天、2 天、5 天
- 可设定坐标刻度：“%” 百分比刻度、Chg 涨跌刻度
- 图表设置：可以自定义交易时段，勾选自定义交易时段后，图表显示该时段数据
- 重载数据：按  重新回补数据
- 右键菜单：
 - 显示：水平网格线、垂直网格线、十字线
 - 重载数据
- 鼠标操作：
 - 鼠标左键拖曳走势数据；
 - 鼠标滚轮左右滑动数据；
 - Crtl+鼠标滚轮缩放数据

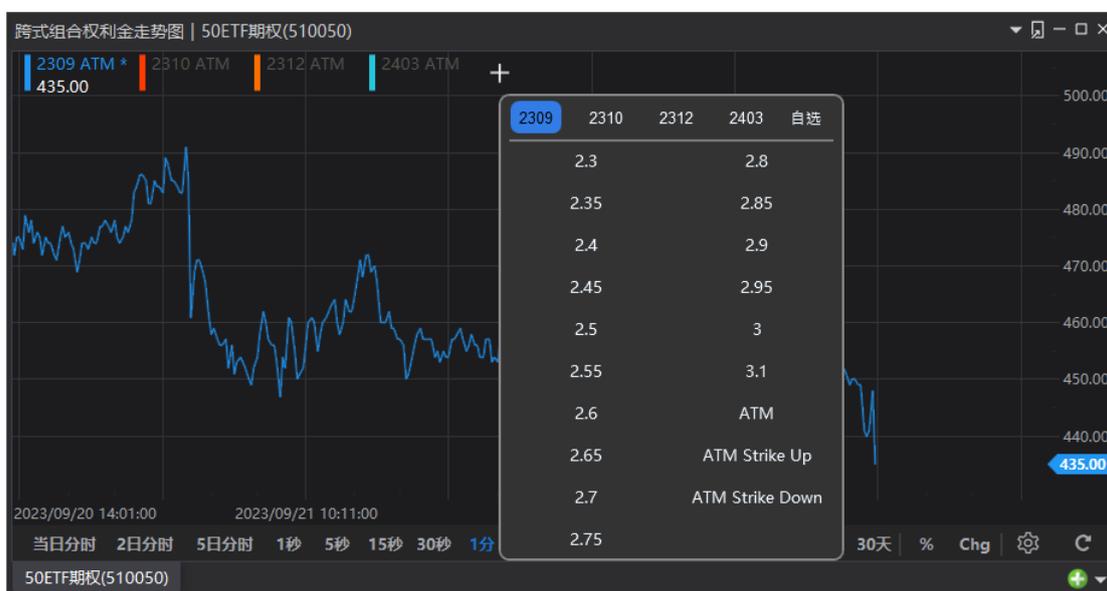
跨式组合权利金走势图

提供期权各品种各月份的跨式组合权利金走势图，可以添加多月份数据比较分析。



- 点击上方栏目文字可以显示/隐藏该栏目走势。
- 点击上方栏目色块可修改走势图颜色、线条粗细。
- 提供当日分时、2日分时、5日分时走势数据
- 可设定走势数据周期：1秒、5秒、15秒、30秒、1分、3分、5分、15分、30分
- 可设定数据范围：
 - 分钟周期：1天、2天、5天、30天
 - 秒周期，可设定1天、2天、5天
- 可设定坐标刻度：“%”百分比刻度、Chg 涨跌刻度
- 图表设置：可以自定义交易时段，勾选自定义交易时段后，图表显示该时段数据
- 重载数据：按  重新回补数据
- 右键菜单：
 - 显示：水平网格线、垂直网格线、十字线
 - 重载数据
- 鼠标操作：

- 鼠标左键拖曳走势数据；
- 鼠标滚轮左右滑动数据；
- Crtl+鼠标滚轮缩放数据
- 添加/删除跨式组合
 - 添加跨式组合：点击  按钮
 - ◆ 通过各月份行权价选单，可以直接添加跨式组合
 - ◆ 使用“自选”，可打开商品选择器，选取要添加的跨式组合合约



- 删除跨式组合：鼠标移到上方栏目位置，出现垃圾桶图示，点击删除该跨式组合。



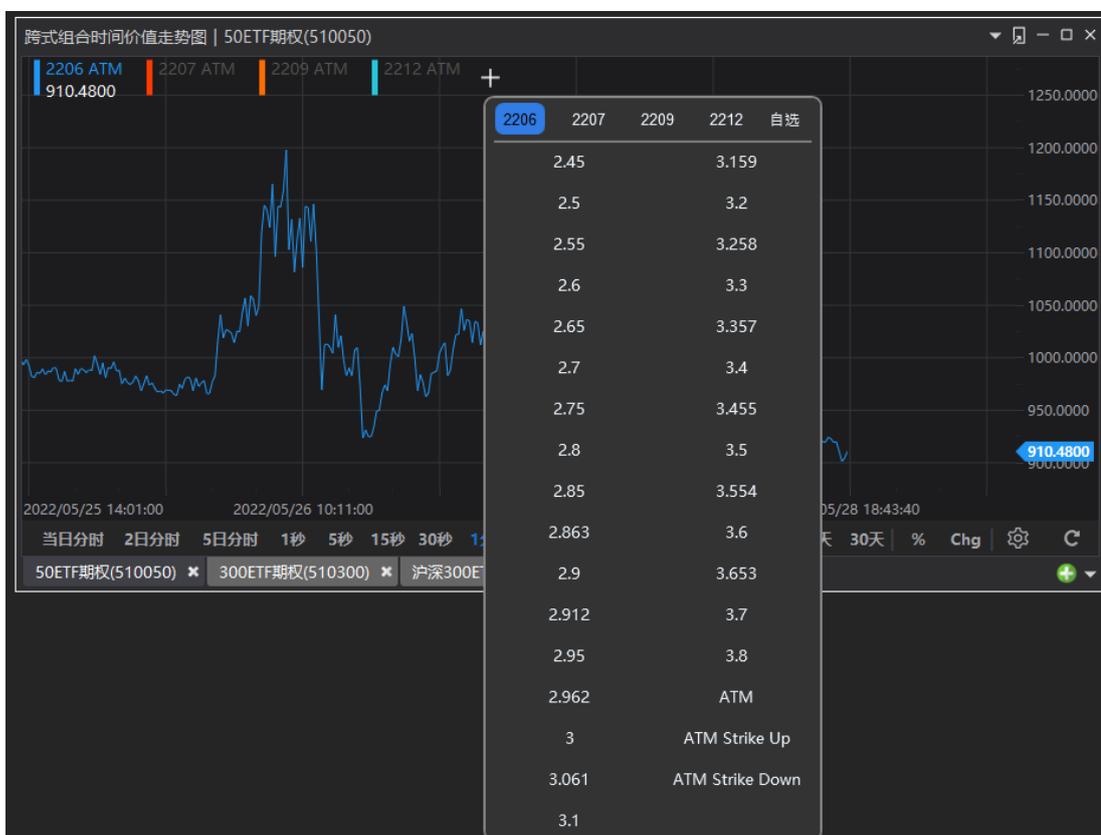
跨式组合时间价值走势图

提供期权各品种各月份的跨式组合时间价值走势数据，可以添加多月份数据比较分析。



- 点击上方栏目文字可以显示/隐藏该栏目走势。
- 点击上方栏目色块可修改走势图颜色、线条粗细。
- 提供当日分时、2日分时、5日分时走势数据
- 可设定走势数据周期：1秒、5秒、15秒、30秒、1分、3分、5分、15分、30分
- 可设定数据范围：
 - 分钟周期：1天、2天、5天、30天

- 秒周期，可设定 1 天、2 天、5 天
- 可设定坐标刻度：“%” 百分比刻度、Chg 涨跌刻度
- 图表设置：可以自定义交易时段，勾选自定义交易时段后，图表显示该时段数据
- 重载数据：按  重新回补数据
- 右键菜单：
 - 显示：水平网格线、垂直网格线、十字线
 - 重载数据
- 鼠标操作：
 - 鼠标左键拖曳走势数据；
 - 鼠标滚轮左右滑动数据；
 - Ctrl+鼠标滚轮缩放数据
- 添加/删除跨式组合
 - 添加跨式组合：点击  按钮
 - ◆ 通过各月份行权价选单，可以直接添加跨式组合
 - ◆ 使用“自选”，可打开商品选择器，选取要添加的跨式组合合约



- 删除跨式组合：鼠标移到上方栏目位置，出现垃圾桶图示，点击删除该跨式组

合。



跨品种的平均值隐波价差分析

提供多个期权品种的平均值隐波走势图叠加显示，支持自定义价差公式以辅助套利分析。



- 切换品种月份：将鼠标移到上方栏目数据位置，显示  按钮，点击可切换品种月份



- 新增价差走势图

- 点击  按钮，打开公式设定
- 选择品种月份和+ - × ÷完成公式设定，然后点击“确定”



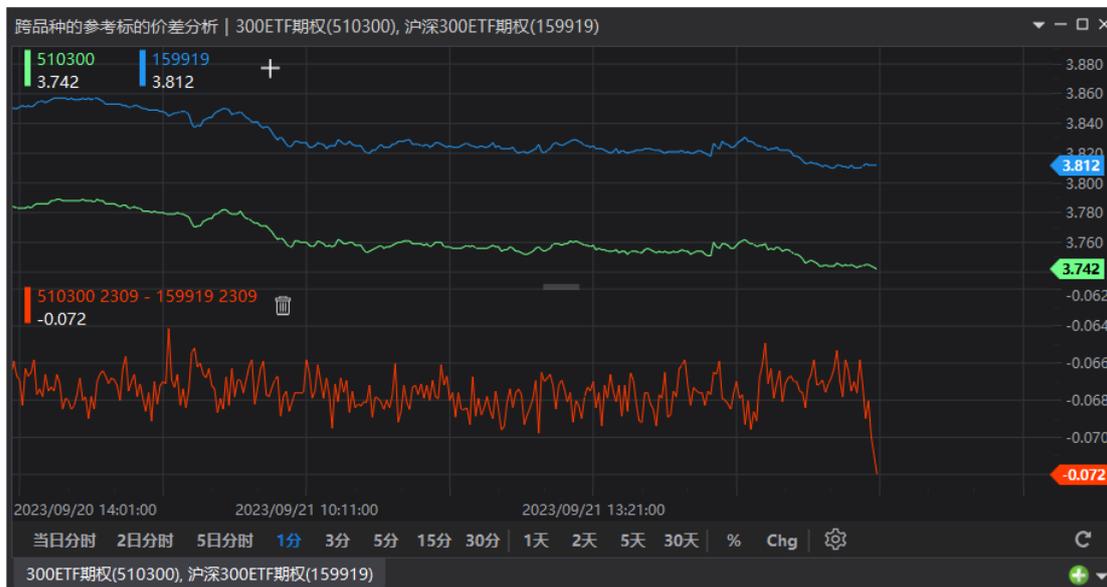
- 设定好的价差走势图显示在副图中，点击  按钮可将价差走势图移除。



- 点击上方栏目文字可以显示/隐藏该栏目走势。
- 点击上方栏目色块可修改走势线图颜色、线条粗细。
- 提供当日分时、2日分时、5日分时走势数据
- 可设定走势数据周期：1分、3分、5分、15分、30分
- 可设定数据范围：1天、2天、5天、30天
- 可设定坐标刻度：“%”百分比刻度、Chg 涨跌刻度
- 图表设置：可以自定义交易时段，勾选自定义交易时段后，图表显示该时段数据
- 重载数据：按  重新回补数据
- 右键菜单：
 - 显示：水平网格线、垂直网格线、十字线
 - 重载数据
 - 数据汇出
- 鼠标操作：
 - 鼠标左键拖曳走势数据；
 - 鼠标滚轮左右滑动数据；
 - Ctrl+鼠标滚轮缩放数据

跨品种的参考标的价差分析

提供多个期权品种的参考标的走势图叠加显示，支持自定义价差公式以辅助套利分析。

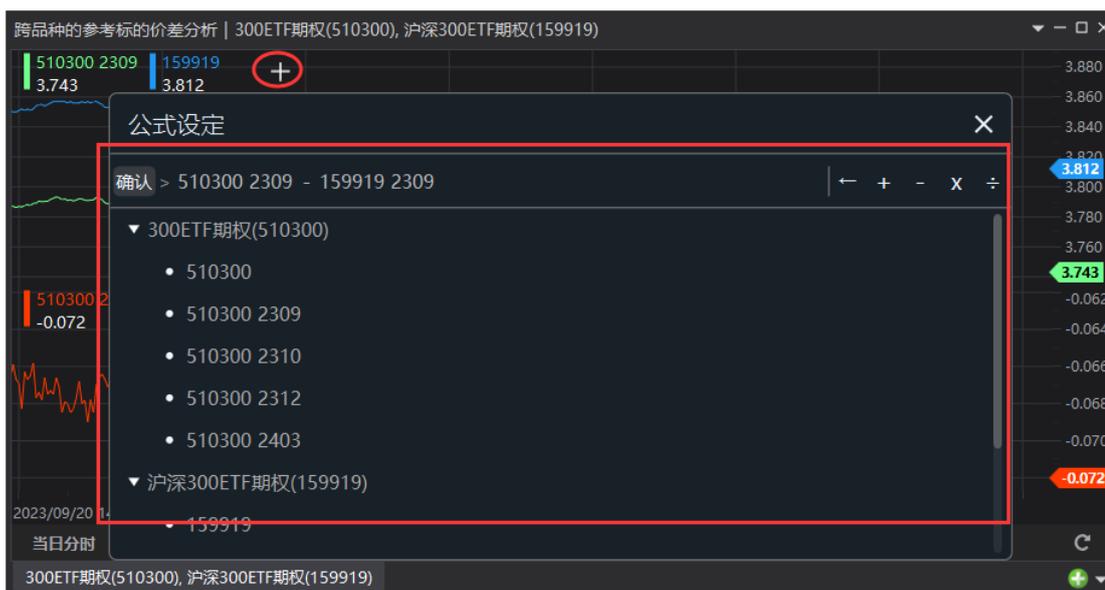


- 切换品种月份：将鼠标移到上方栏目数据位置，显示  按钮，点击可切换品种月份

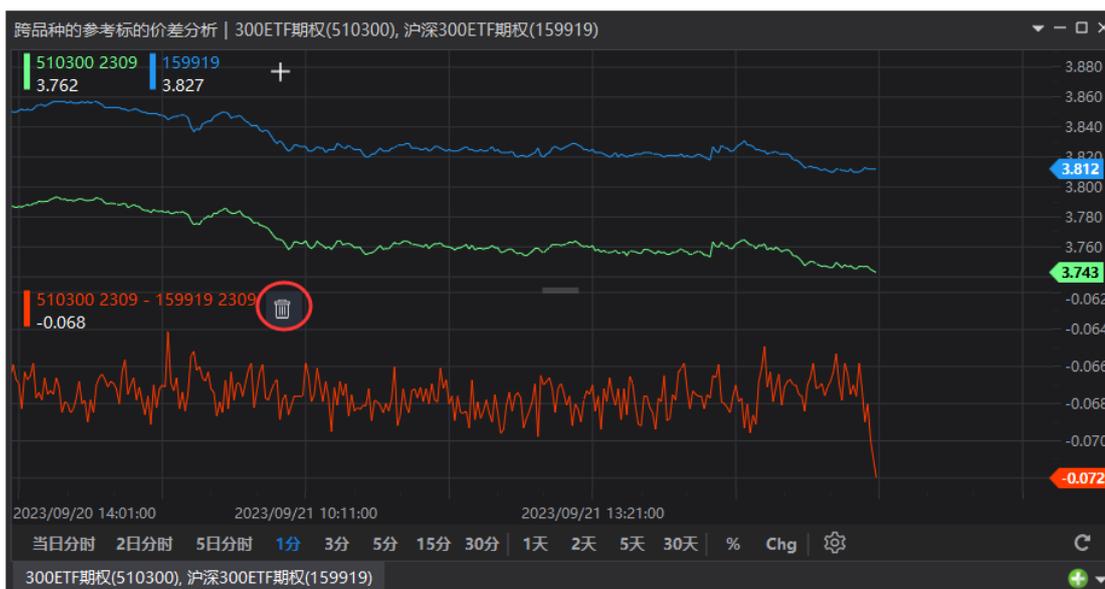


- 新增价差走势图
 - 点击  按钮，打开公式设定

- 选择品种月份和+ - × ÷完成公式设定，然后点击“确定”



- 设定好的价差走势图显示在副图中，点击按钮可将价差走势图移除。



- 点击上方栏目文字可以显示/隐藏该栏目走势。
- 点击上方栏目色块可修改走势线图颜色、线条粗细。
- 提供当日分时、2日分时、5日分时走势数据
- 可设定走势数据周期：1分、3分、5分、15分、30分
- 可设定数据范围：1天、2天、5天、30天
- 可设定坐标刻度：“%”百分比刻度、Chg 涨跌刻度
- 图表设置：可以自定义交易时段，勾选自定义交易时段后，图表显示该时段数据

- 重载数据：按  重新回补数据
- 右键菜单：
 - 显示：水平网格线、垂直网格线、十字线
 - 重载数据
 - 数据汇出
- 鼠标操作：
 - 鼠标左键拖曳走势数据；
 - 鼠标滚轮左右滑动数据；
 - Crtl+鼠标滚轮缩放数据

期权波动率走势

提供期权各个月份参考标的、波动率、Skew、平值跨式组合权利金、平值跨式组合时间价值、合成期货/标的价差、相关系数等指标的走势数据。



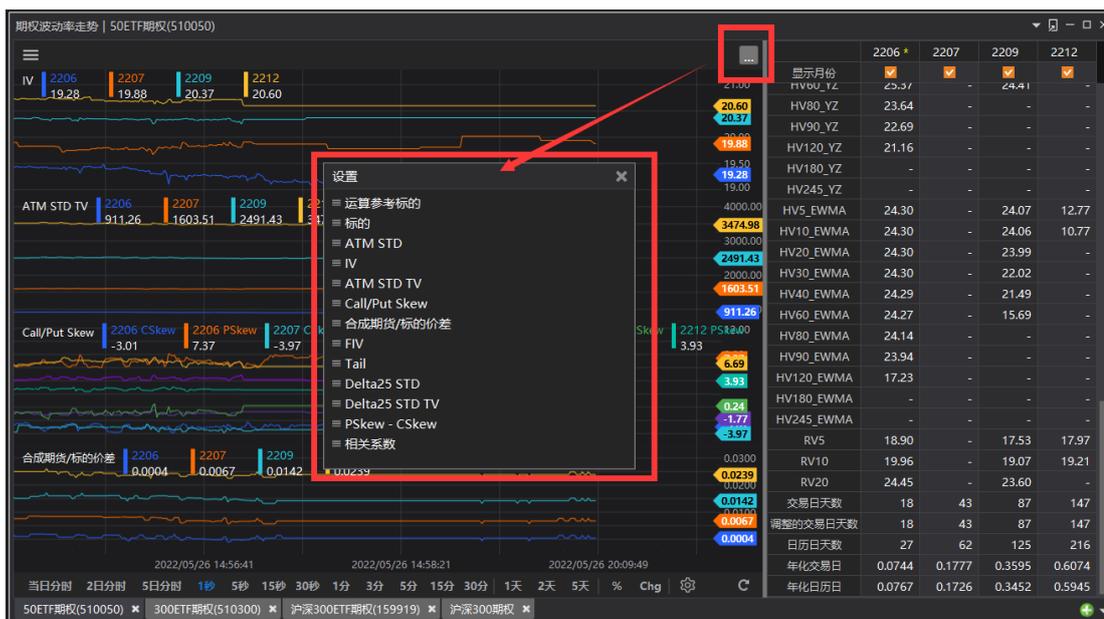
- 期权月份：
 - 在图表右侧，显示各月份波动率分析数据。
 - ◆ 合成期货

- ◆ IV: OTM IV 数值
- ◆ IV 涨跌(%)
- ◆ PSkw
- ◆ PSkw 涨跌(%)
- ◆ CSkw
- ◆ CSkw 涨跌(%)
- ◆ 期货升贴水(%)
- ◆ 涨跌(%)
- ◆ STD TV: 平值跨式时间价值
- ◆ STD TV Chg(%): 平值跨式时间价值涨跌(%)
- ◆ CIV10
- ◆ PIV10
- ◆ CIV25
- ◆ PIV25
- ◆ FIV
- ◆ FIV 涨跌(%)
- ◆ FCIV25
- ◆ FPIV25
- ◆ CTail
- ◆ PTail
- ◆ STD: 平值跨式权利金
- ◆ STD Chg(%): 平值跨式权利金涨跌(%)
- ◆ HV5 ~ HV245: 收盘价-收盘价 波动率估计量
- ◆ HV5_EWMA~HV245_EWMA: EWMA 估计波动率
- ◆ HV5_YZ~HV245_YZ: Yang-Zhang 波动率估计量
- ◆ RV5~RV20: 已实现波动率
- ◆ 交易日天数
- ◆ 调整的交易日天数
- ◆ 日历日天数
- ◆ 年化交易日
- ◆ 年化日历日
- ◆ 年化交易日

- 通过图表左上角的  按钮可以设置展开或收起右侧的期权月份栏位
- 显示月份设定
 - 勾选“显示月份”，图表数据可以叠加多个月份显示。



- 走势图指标：可通过右键菜单勾选要显示的指标
 - 运算参考标的
 - 标的
 - ATM STD
 - ATM STD TV
 - IV
 - FIV
 - Tail
 - Delta25 STD
 - Delta25 STD TV
 - Call/Put Skew
 - PSkew-CSkew
 - 合成期货/标的价差
 - 相关系数
- 通过图表右上的  按钮，打开设置，再用鼠标拖曳指标上下移动，可以调整图表显示顺序。



- 走势图设定：
 - 可切换当日分时、2 日分时、5 日分时走势数据
 - 可设定走势数据周期：1 秒、5 秒、15 秒、30 秒、1 分、3 分、5 分、15 分、30 分
 - 可设定数据范围：
 - ◆ 分钟周期：1 天、2 天、5 天、30 天
 - ◆ 秒周期，可设定 1 天、2 天、5 天
 - 可设定坐标刻度：“%” 百分比刻度、Chg 涨跌刻度
 - 图表设置：可以自定义交易时段，勾选自定义交易时段后，图表显示该自定时段数据
 - 重载数据：按  重新回补数据



● 鼠标操作

- 鼠标左键拖曳，可左右移动查看走势数据
- 鼠标放置在图表中，使用滚轮滑动走势。
- 鼠标放置在图表中，使用 Ctrl+滚轮缩放走势

● 坐标设置

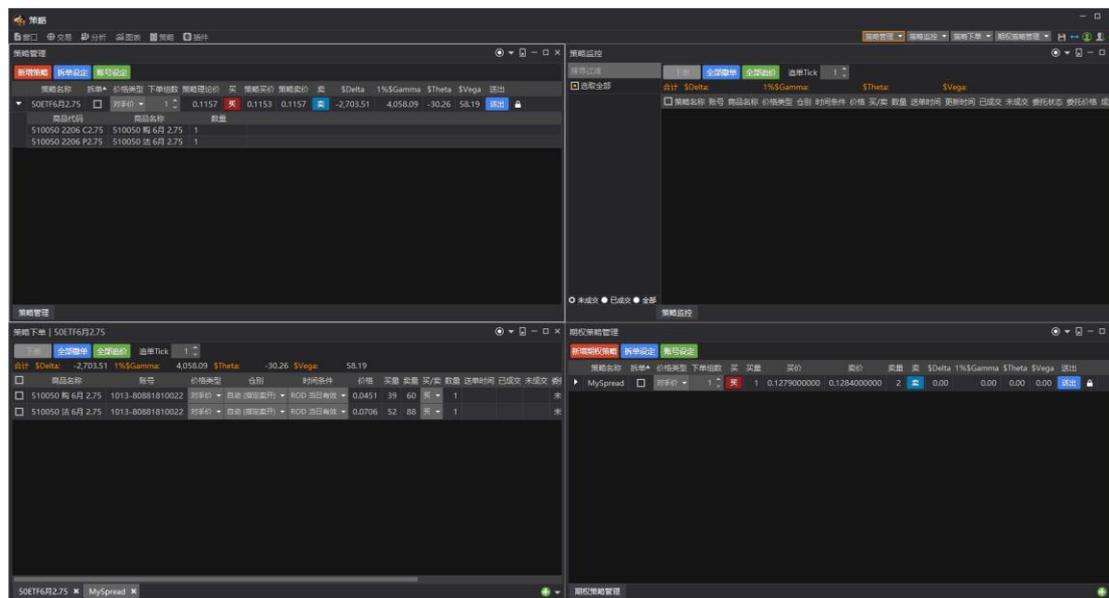
- 缩放纵坐标刻度：鼠标放置在纵坐标上，变为  时，可以拖曳缩放纵坐标刻度。

● 图表右键菜单

- 独立图表：
 - ◆ 将所选指标显示在独立图表中
- 显示：
 - ◆ 可勾选要显示的指标
 - ◆ 勾选显示：垂直网格线、水平网格线、十字线
- 重载数据
 - ◆ 点击重新回补数据
- 数据汇出：
 - ◆ 勾选要汇出的指标后点击汇出，保存一份.xlsx 格式数据到本地电脑
- 主题颜色：
 - ◆ 可选暗色或亮色

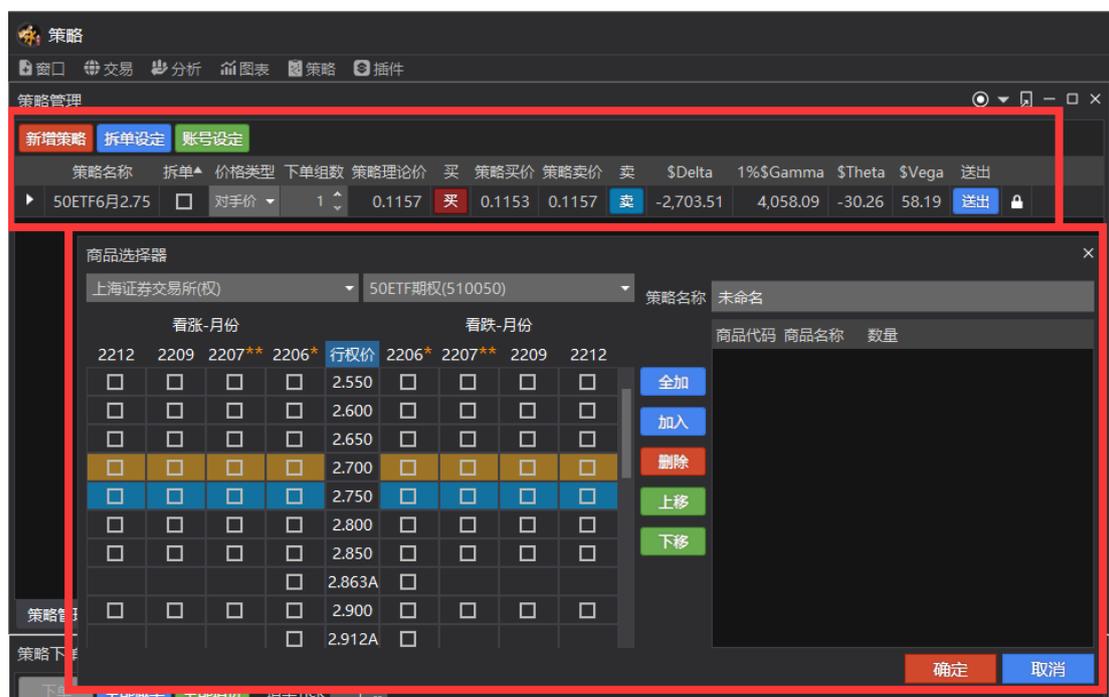
策略

可以通过策略 选单，打开策略管理、策略下单、策略监控、期权策略管理功能。



提供使用者创建任意组合的策略，实现一键下单功能。

策略管理

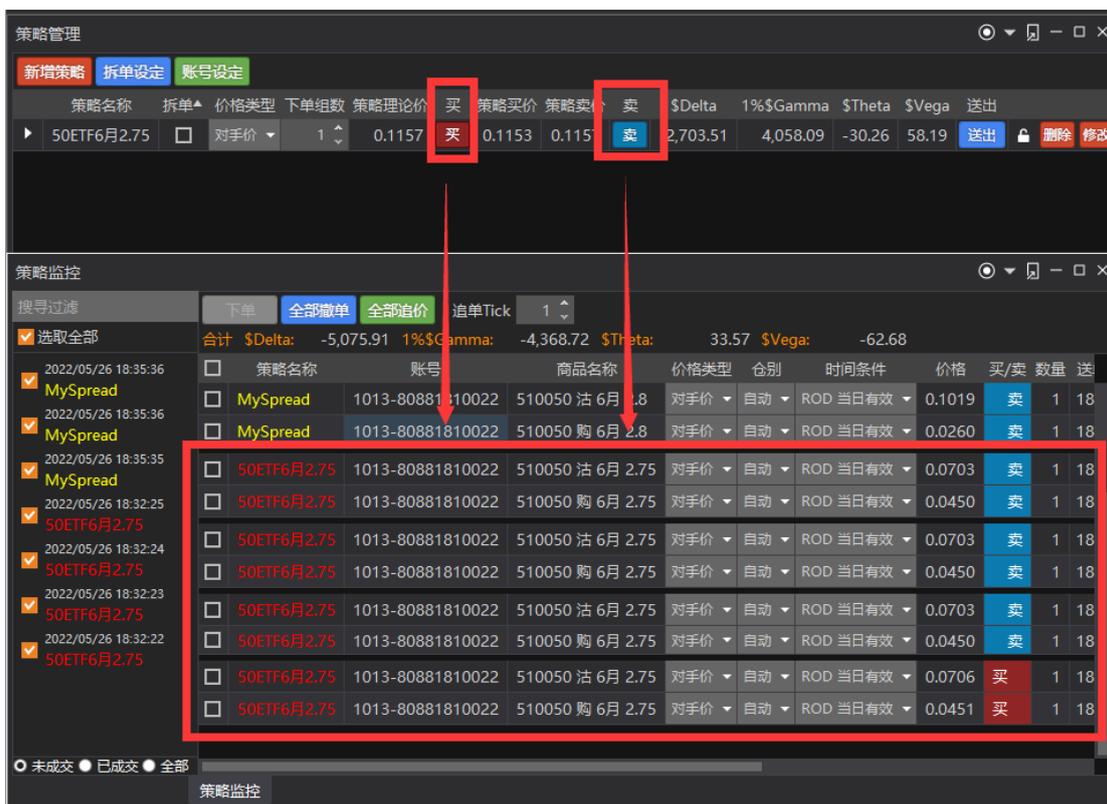


- 新增策略
 - 可通过[商品选择器]选取任意合约，加入策略，可设定策略名称和商品数量。
 - 策略数量：正数表示买；负数表示卖

- 策略列表中显示策略买价、策略卖价、 Δ 、 $1\% \Gamma$ 、 Θ 、 $\text{\$Vega}$ 试算数据。
- 账号设定
 - 不同交易所商品的下单账号设定。根据账号设定，策略中商品会下单到不同账号，在策略下单前必须先设定好账号。
- 删除或修改策略
 - 点击解锁后，显示删除、修改功能

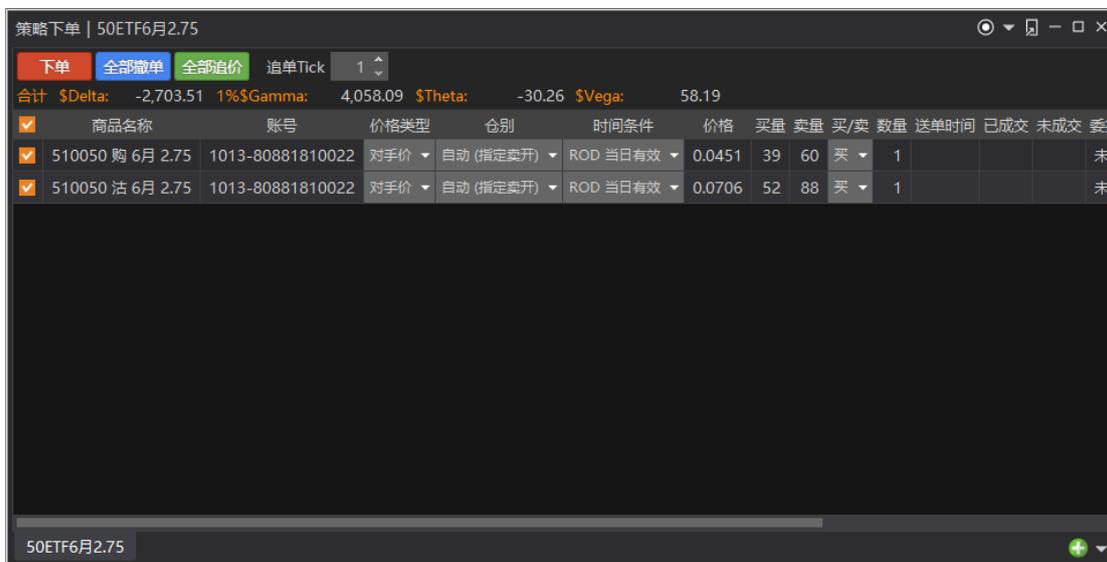


- 送出：不直接下单，而是将策略送出到“策略下单”界面中。
- 设定价格类型
 - 对方价
 - 本方价
 - 市价
- 设定下单组数
- 快速买卖：点击“买”“卖”按钮直接将策略送出下单。



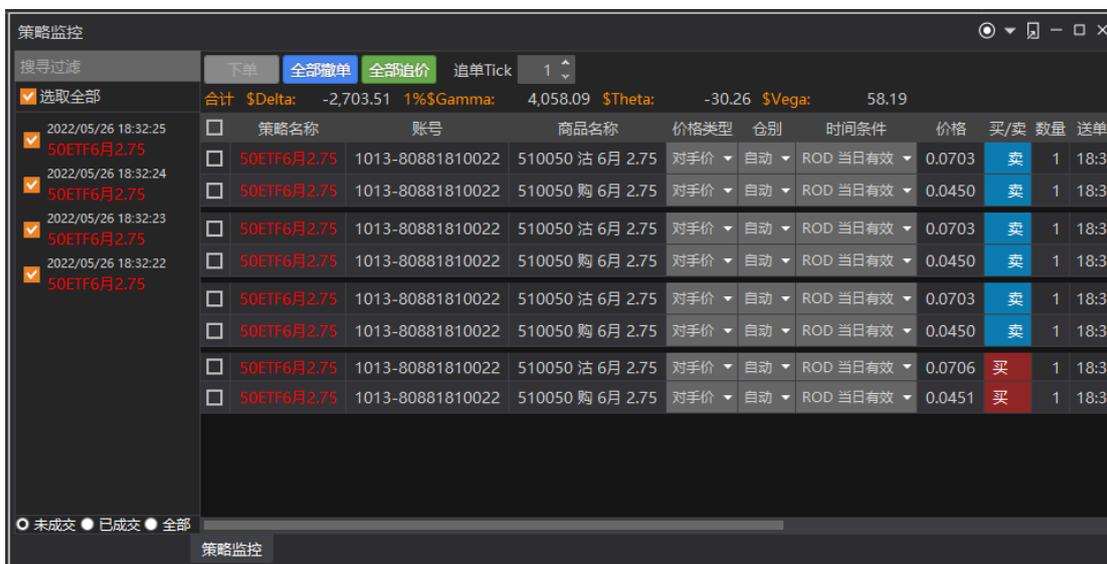
- 拆单：
 - 勾选“拆单”，送出策略下单时将套用拆单设定。
- 拆单设定：
 - 提供拆单、冰山拆单、自动拆单设定。

策略下单



- 下单步骤
 - 在策略管理或期权策略管理中，设定好策略之后，选择价格类型，可选对手价、本方价、市价
 - 设定下单组数
 - 点击“送出”，将策略送出到“策略下单”视图
 - 再从“策略下单”视图中检查是否设定好价格类型、仓别、时间条件，勾选商品，一键下单
- 未成交的部分，可以进行全部撤单、全部追单、再下单、追单操作
- 策略追价时，追价价格为对手价加挂“追单 tick”数。

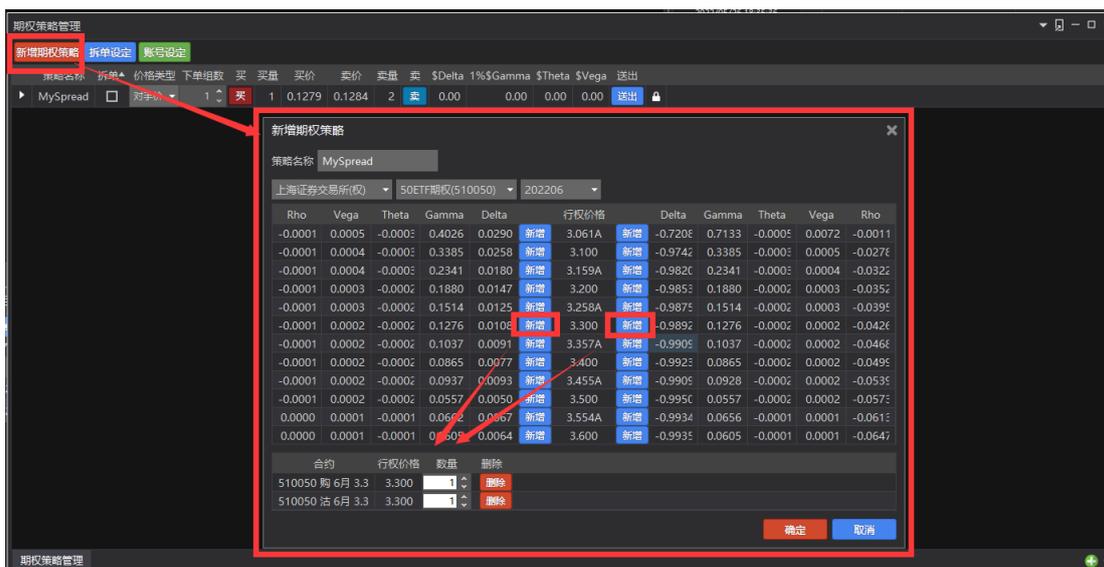
策略监控



- 通过策略下单后，下单记录将保存在策略监控中。当退出系统重启软件后，会清除之前的策略监控记录。
- 可以在策略监控中对策略未成交部分进行撤单、再下单、追单操作。
- 可过滤显示“未成交”、“已成交”、“全部”策略
- 可搜寻过滤策略

期权策略管理

针对期权相关品种，提供的策略管理功能

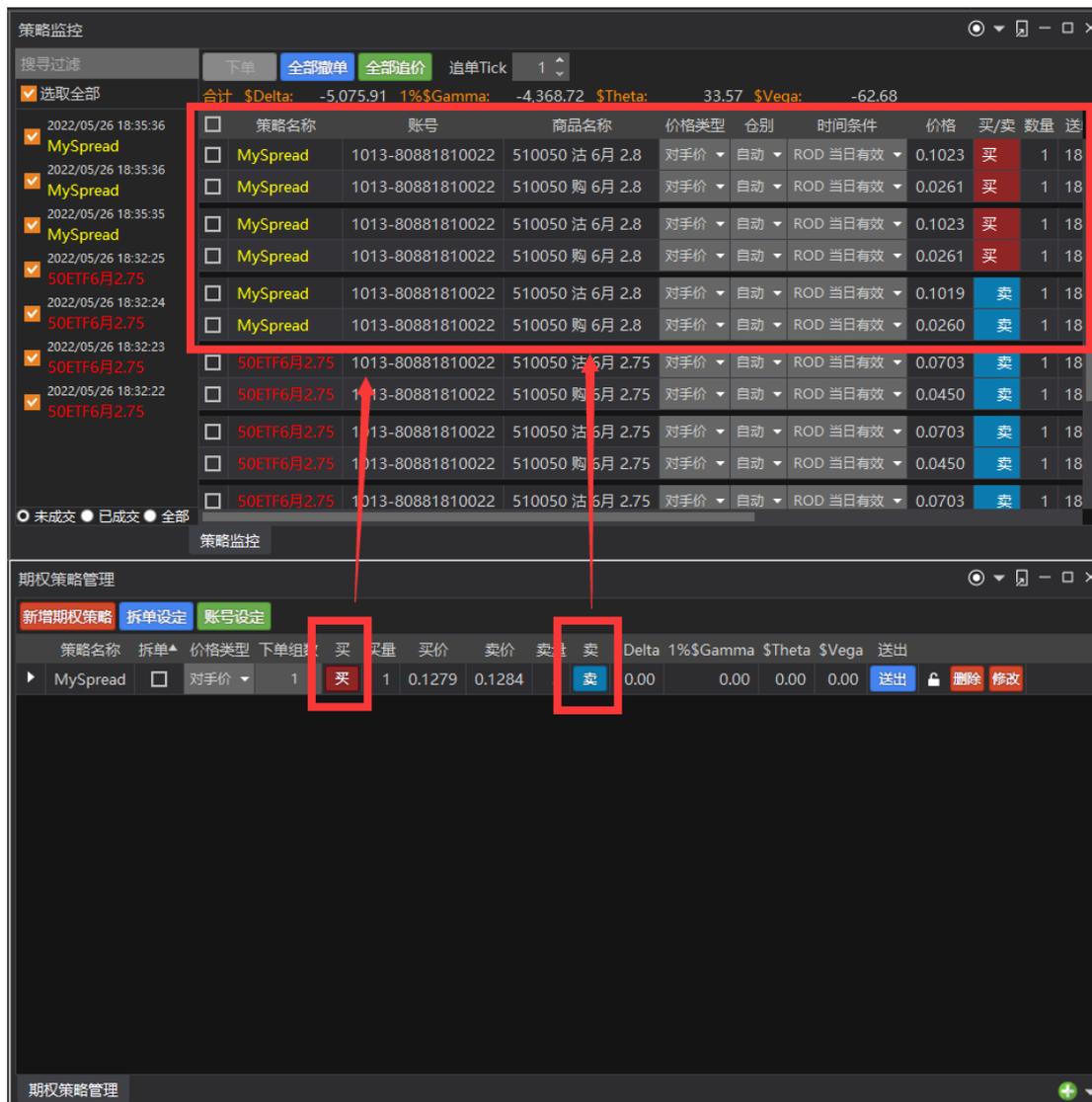


- 新增期权策略
 - 通过新增期权策略，设定策略名称、新增策略合约、数量，加入策略
 - 新增期权策略时，可加入最少 2 个商品，最多 5 个商品。
- 期权策略提供试算的买卖价量、 Δ 、 $1\% \Delta$ 、 Θ 、 V 试算数据。
- 账号设定
 - 不同交易所商品的下单账号设定。根据账号设定，期权策略中商品会下单到不同账号，在策略下单前必须先设定好账号。
- 删除或修改策略：
 - 解锁后，显示删除、修改功能



- 送出：不直接下单，而是将期权策略送出到“策略下单”界面中。
- 设定价格类型：
 - 对方价
 - 本方价
 - 市价
- 设定下单组数

- 快速买卖：点击“买”“卖”按钮直接将策略送出下单，下单记录显示在策略监控中。



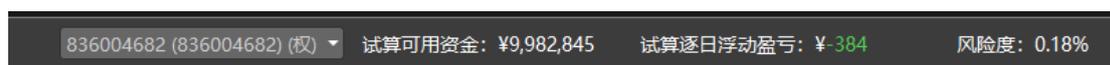
- 拆单：
 - 勾选“拆单”，送出策略下单将套用拆单设定。
- 拆单设定：
 - 提供 拆单、冰山拆单、自动拆单设定。

插件

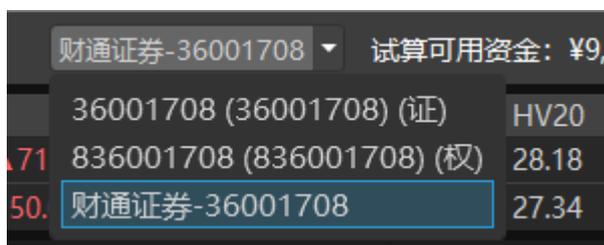
提供“咏春”、“交易总管”、“资金转账”三个插件功能。

咏春

交易账户



- 在咏春主界面顶栏显示当前所选的交易账号，并显示出该账号的试算可用资金、试算逐日浮动盈亏、风险度信息。
- 如果在交易连线中登录了多个账号，可以通过账号选单切换交易账号，同时账务信息也会随之更新。
- 在交易连线中，同时登录期权+现货账号，可关联为群组账号，选择群组账号，则可在咏春主界面同时交易期权&标的现货。



选择合约



- 交易所列表
 - 上海证券交易所
 - 深圳证券交易所
 - 中国金融期货交易所
- 商品
 - 选定交易所下的期权商品。

- 合约月份
 - 切换期权合约月份并显示于期权报价。

期权报价

- 合成期货/标的报价

合成期货/标的	最新价	涨跌	IV	HV20	买价	卖价	挂单量	最高价	最低价	成交量	净仓	更新时间	线图
510050 2102	3.8469	▲0.0623(1.65%)	19.04	20.37	-	-	-	3.8483	3.7949	-	-	11:06:20	
510050 50ETF	3.857	▲0.07(1.85%)	20.99	18.85	3.857	3.858	12394*21288	3.858	3.799	1891519	0/0	11:06:19	

- 提供期权合约的合成期货报价和标的报价。
- 报价栏位：最新价、涨跌（涨跌幅）、IV、HV20、买价、卖价、挂单量、最高价、最低价、成交量、净仓、更新时间、线图。
- 买价、卖价按钮突出显示，点击可以打开下单盒窗口，下单盒连动设置标的合约。

- T 型报价

认购期权 (Call)										认沽期权 (Put)									
买量	买价	最新价	卖价	卖量	IV	合约编码	卖	买	19天	买	卖	合约编码	IV	卖量	卖价	最新价	买价	买量	
10	0.5512	0.5528	0.5534	10	39.46	10003047	□	□	3.300	□	□	10003056	39.46	264	0.0018	0.0018	0.0017	20	
10	0.4517	0.4514	0.4534	20	34.59	10003048	□	□	3.400	□	□	10003057	34.59	38	0.0026	0.0025	0.0025	25	
1	0.3543	0.3541	0.3554	20	30.80	10003049	□	□	3.500	□	□	10003058	30.80	80	0.0045	0.0045	0.0043	7	
14	0.2585	0.2591	0.2591	5	27.24	10003050	□	□	3.600	□	□	10003059	27.24	165	0.0085	0.0083	0.0083	21	
3	0.1702	0.1698	0.1706	10	25.21	10003051	□	□	3.700	□	□	10003060	25.21	1	0.0199	0.0199	0.0198	20	
21	0.0962	0.0964	0.0964	54	23.67	10003052	□	□	3.800	□	□	10003061	23.67	2	0.0456	0.0455	0.0455	52	
51	0.0473	0.0473	0.0473	14	23.83	10003053	□	□	3.900	□	□	10003062	23.83	15	0.0966	0.0966	0.0964	21	
10	0.0209	0.0210	0.0211	30	24.61	10003083	□	□	4.000	□	□	10003084	24.61	3	0.1706	0.1701	0.17	1	
4	0.0093	0.0094	0.0094	49	26.17	10003087	□	□	4.100	□	□	10003088	26.17	10	0.259	0.2577	0.2577	6	
3	0.0051	0.0051	0.0052	35	28.90	10003103	□	□	4.200	□	□	10003104	28.90	11	0.3546	0.3549	0.3528	10	
20	0.0027	0.0028	0.0028	2	31.26	10003111	□	□	4.300	□	□	10003112	31.26	10	0.4522	0.4519	0.4498	37	

- T 型报价行情页面横向为合约信息栏位，纵向中轴为行权价序列，形状为 T 字，所以称之为 T 型报价。T 型报价显示所选的交易所、某一品种、某一到期月份下，一系列不同行权价格的所有看涨期权和看跌期权的行情信息。
- 上图以 50ETF 为例，图中为同系列的 50ETF 合约报价，中轴为期权合约行权价从小到大的顺序纵向排列（也可以设置为从大到小），左边为看涨期权（Call）合约，右边为看跌期权（Put）合约。
- 背景柱状图，在 T 型报价中，背景以柱状图显示各期权合约的某一特定栏位数值。预设[持仓量]背景柱状图。
- 合约到期日，横向栏中间显示了期权合约到期日的天数，鼠标移动到该位置，会显示期权合约到期日提示框。

合约编码	卖	买	19天	买	卖	合约编码
10003047	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.3	21/02/24	<input type="checkbox"/>	10003056
10003048	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.4		<input type="checkbox"/>	10003057
10003049	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.500		<input type="checkbox"/>	10003058
10003050	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.600		<input type="checkbox"/>	10003059

■ 价平显示

- ◆ 期权合约较多，T 型报价无法显示全部行权价时，会默认将价平位置显示在中间，可以通过滚动鼠标查看全部行权价合约。
- ◆ 行权价列表中，在最接近价平的位置分别以黄色/蓝色标示，黄色表示看涨期权价平位置，蓝色表示看跌期权价平位置。

■ 可以通过以下 2 个方式回至价平位置：

- ◆ 鼠标单击行权价列表顶部[到期日]栏位，报价自动跳回价平。
- ◆ 鼠标右键单击 T 型报价框内任意部位，再左键点击菜单栏中的[跳至价平]，可快速跳至平值行权价位置。

● 买/卖栏位

认购期权 (Call)										认沽期权 (Put)									
买量	买价	最新价	卖价	卖量	IV	合约编码	卖	买	19天	买	卖	合约编码	IV	卖量	卖价	最新价	买价	买量	
78	0.5495	0.5495	0.5512	10	39.46	10003047	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.300	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003056	39.46	429	0.0018	0.0018	0.0017	70	
10	0.4498	0.4498	0.4517	10	34.59	10003048	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.400	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003057	34.59	33	0.0026	0.0025	0.0025	46	
6	0.352	0.3520	0.3532	10	30.82	10003049	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.500	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003058	30.82	10	0.0045	0.0045	0.0044	20	
10	0.2562	0.2579	0.2573	20	27.07	10003050	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.600	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003059	27.07	11	0.0085	0.0084	0.0084	45	
10	0.1678	0.1679	0.1679	9	25.18	10003051	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	3.700	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003060	25.18	9	0.0203	0.0203	0.0202	16	
25	0.0941	0.0943	0.0943	1	23.65	10003052	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	3.800	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003061	23.65	9	0.0465	0.0465	0.0463	10	
12	0.0461	0.0460	0.0462	50	23.74	10003053	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	3.900	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003062	23.74	1	0.098	0.0980	0.0976	23	
10	0.0201	0.0201	0.0202	180	24.43	10003083	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	4.000	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003084	24.43	10	0.1722	0.1717	0.1713	10	
16	0.0087	0.0088	0.0088	10	25.94	10003087	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	4.100	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003088	25.94	1	0.2605	0.2603	0.2593	10	
79	0.0053	0.0053	0.0053	79	29.09	10003103	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	4.200	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003104	29.09	2	0.356	0.3550	0.3547	20	
149	0.0027	0.0027	0.0028	41	31.23	10003111	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	4.300	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	10003112	31.23	40	0.454	0.4519	0.4518	27	

情境	分析	行权价	合约别	手数	持仓	价格类别	价格	买价	卖价	买/卖	隐波率	头寸Delta	头寸Gamma	头寸Theta	头寸Vega	合约单位
自组	<input checked="" type="checkbox"/>	3.7	认购期权	1		中间价	0.1683	0.1678	0.1679	买	25.18	8034.0000	15220.0000	-0.0029	0.0020	10000.0
自组	<input checked="" type="checkbox"/>	4	认沽期权	1		中间价	0.1712	0.1713	0.1722	卖	24.43	7939.0000	-16138.0000	0.0029	-0.0021	10000.0

总头寸Delta: 15973.0000 总头寸Gamma: -918.0000 总头寸Theta: 0.0000 总头寸Vega: -0.0001
 委托保证金试算: 6,894.40 收到权利金: 29.00

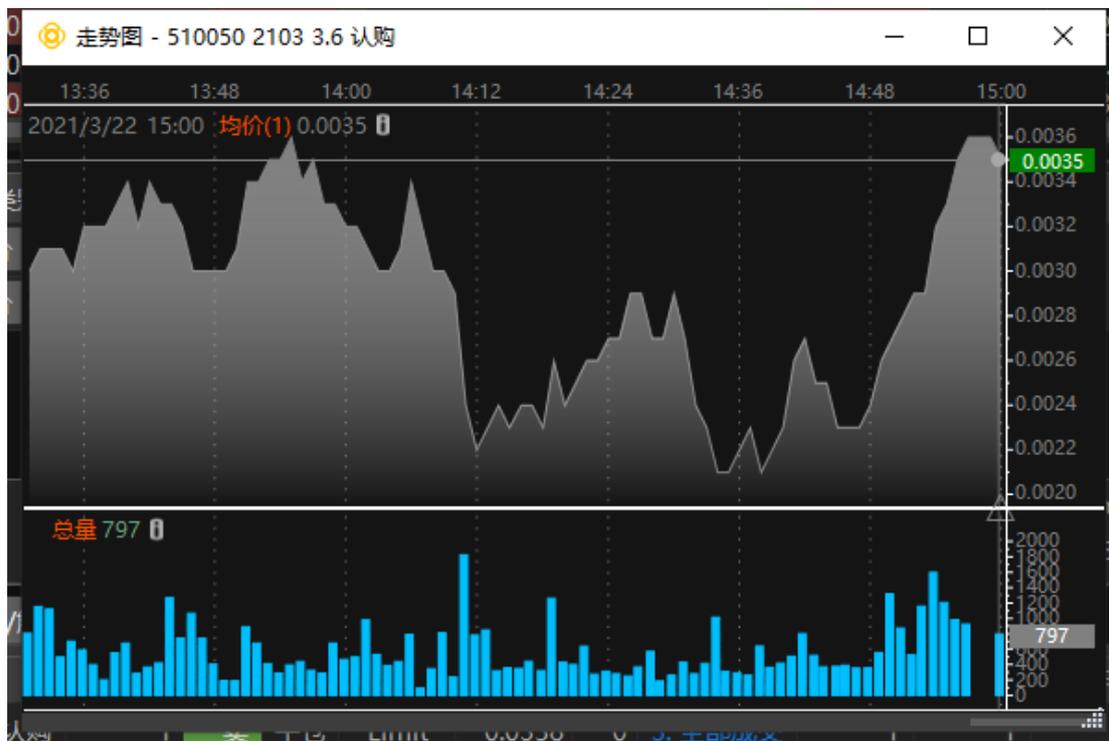
■ 使用者可以通过买卖栏位手动调整组合商品。

- ◆ [情境]模式下，选择内置的情境策略后，可以切换勾选的买卖栏位调整使用不同行权价合约。
- ◆ [自组]模式下，使用者可以手动勾选买卖栏位选择要加入组合的期权合约。

勾选买卖栏位后，[情境/自组]中的组合商品将联动设置，右侧的盈亏分析、风险分析

也会连动改变。

- 开启走势图



- T 型报价的行权价两侧提供走势图按钮图标, 点击开启对应期权合约的走势图。
- 走势图提供期权合约近两日的一分钟价量数据。

- 栏位设定

- 看涨期权与看跌期权的报价栏位左右对称（在栏位设定中可以修改为不对称）。
- 当新增、移除看涨期权（看跌期权）某一栏位时，另一侧的报价栏位会同步对应新增或移除。
- 可拖拽栏位，移动该栏位的位置，同时另一侧栏位也会同步对应移动。
- 在 T 型报价框内右击鼠标，在菜单栏中选择[栏位设定]打开设定窗口。



- 栏位设定窗口包含以下内容：
 - ◆ 在“认购期权”、“认沽期权”列勾选对应栏位，勾选中会在期权报价的“认购期权”、“认沽期权”中显示该栏位。
 - ◆ 在“背景”点对应栏位，则背景条形图依据选择的栏位数值绘制。
 - ◆ 自订栏位包括：买量、买价、最新价、卖价、卖量、IV、涨跌、涨跌幅、现量、成交量、Delta、Gamma、Theta、Vega、Rho、理论价、时间价值、内在价值、结算价、持仓量、更新时间、昨结算、今开盘、最高价、最低价、昨收盘、昨量、涨停价、跌停价、昨持仓量、持仓量变动、BIV、SIV、昨 IV、净仓、IV 涨跌、杠杆率、实质杠杆、溢价率、到期盈亏与两平概率、裸卖报酬率、合约编码、标志码、到期日、状态、CIV/PIV、委买、委卖。
 - ◆ 可设定报价栏位及报价数值的字型大小。
 - ◆ 可设定行权价排序方式：渐增、渐减。
 - ◆ 可取消勾选“显示栏位同步”，取消勾选“显示栏位镜像”，则 T 型报价栏位不会对称显示，新增、移除、拖拽栏位时，另一侧报价栏位不会同步被修改。
 - ◆ 可勾选“不显示背景柱状图”，勾选后报价栏位的条形图消失。
 - ◆ 可设定报价数值更新是颜色闪烁。
 - ◆ 可还原默认，将栏位设定修改还原到出厂设置。

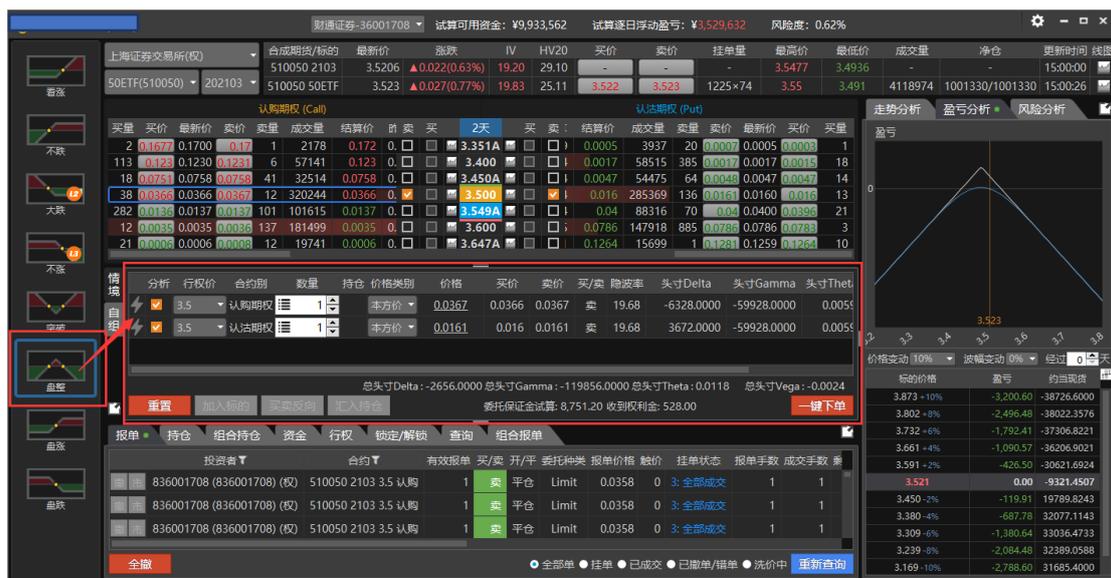


情境下单

- 策略选择器

情境模式提供8组14个[情境策略]，通过策略选择器给予「引导和建议」，提供使用者快速选择商品交易组合功能。

当使用者选择「策略」时，「策略」自动代入选择的商品合约中，并立即计算出合理的交易行权价和交易方向，同时显示在「情境 / 自组」的列表框中，并在右侧显示对应的盈亏分析图以及风险分析图。



■ 策略说明:

◆ 看涨，认沽止损

保护性认沽组合策略预计后市有大幅度下跌或回档的可能性，在持有或买入标的的同时，买入相对应数量的认沽期权，来对冲后市标的价格可能急剧下跌的风险，而代价是要支付认沽期权的权利金，策略在期权有效期内，限定了头寸价格下跌的风险，以及价格上涨时的盈利的无限可能性，能够在不稳定的市场里对持有标的提供有效保护。

◆ 大涨

买入认购期权。市场受到利多题材刺激，多头气势如虹，预计后续还有一波不小的涨幅。



◆ 不跌，备兑止盈

备兑开仓策略预计标的价格进入整理或者小幅度盘涨，在持有或买入标的的同时，卖出相对应数量的认购期权，使用百分之百的标的现券担保，不需额外缴纳现金保证金，策略设定了持有标的的止盈价位，以此锁定了操作的最大收益，同时透过卖出认购期权获得权利金的额外收入，降低持有标的的成本。

◆ 不跌

卖出认沽期权。预期后市不看跌，一切 2 市场以向多或牛皮盘整的成分居多，属于温和看多的交易策略。



◆ 大跌

买入认沽期权。市场受到利空消息打击或技术性转空，预计后市还有一波不小的跌幅。



◆ 不涨

卖出认购期权。标的物价格经过一段上涨面临前期高点或技术阻力位，预期后市转空或者进行调整。



◆ 突破 - 原点突破

同时买进看涨和看跌期权，即买入跨式策略。当前价格趋势不明，波动率低，预期会有明显价格突破，后市波动率越大对头寸越有利，适合于预期盘整突破或者重大宏观数据和事件发生前。

◆ 突破 - 区间突破

同时买进相同数量、相同到期日，但行权价不同的看涨和看跌期权（通常看涨期权的行权价大于现货价，看跌期权和行权价小于现货价），即买入勒式策略。区间突破和原点突破的买进跨式交易策略相似，预期标的物价格在到期日前会有重大的变化，不是大涨、

就是大跌。不同的地方在于买进勒式交易策略所买进的期权通常为虚值，因此采用区间突破的交易策略成本比较便宜，交易风险较低，但相对的，价格必须有更大的波动，买进勒式才会获利。



◆ 盘整 - 原点盘整

同时卖出相同数量、到期日、行权价的看涨和看跌期权，即卖出跨式策略。使用时机在于预期期权标的在行权日前不会有重大的价格变动，处盘整格局时所采用。卖出跨式策略常见于市场将揭晓重大事件，但明朗化时间在行权日之后，研判在该日期之前属盘整待变，或研判市场上有套牢卖压，下有强力支撑时所采用。该原点突破策略最大获利有限，最多就是卖出看涨及看跌期权所收取的权利金，但风险无限，操作时应善设停损点位。

◆ 盘整 - 区间盘整

同时卖出看涨期权和看跌期权，即卖出跨式策略。当前无法判断标的物价格变动方向，但价格趋于盘整，波幅收窄，波动率下降。到达盈亏平衡点慢，适合供需平衡，政策信息相对真空期。



◆ 盘涨 - 盘涨 Call

买进低行权价的看涨期权和卖出高行权价的看涨期权，即牛市看涨期权垂直价差策略。预测标的即将盘涨，隐波率偏低，但信心不足，所以买入看涨期权的同时卖出看涨期权降低权利金成本。

◆ 盘涨 - 盘涨 Put

买进低行权价的看跌期权和卖出高行权价的看跌期权，即牛市看跌期权垂直价差策略。预测标的即将盘涨，隐波率偏低，但信心不足，所以买入看跌期权的同时卖出看跌降低权利金成本。



◆ 盘跌 - 盘跌 Put

买进高行权价的看跌期权和卖出低行权价的看跌期权，即熊市看跌期权垂直价差策略。预期标的物即将下跌，隐波率不高，买入看跌期权，但执行价格偏高，权利金贵，所以卖出看跌期权减少权利金支出。

◆ 盘跌 - 盘跌 Call

买进高行权价的看涨期权和卖出低行权价的看涨期权，即熊市看涨期权垂直价差策略。预期标的物即将下跌，隐波率不高，买入看涨期权，但执行价格偏高，权利金贵，所以卖出看涨期权减少权利金支出。



● 情境模式设置如下图：

情境	分析	行权价	合约别	数量	持仓	价格类别	价格	买价	卖价	买/卖	隐波率	头寸Delta	头寸Gamma	头寸Theta
自组	<input checked="" type="checkbox"/>	3.5	认购期权	1		本方价	0.0367	0.0366	0.0367	卖	19.68	-6328.0000	-59928.0000	0.0055
	<input checked="" type="checkbox"/>	3.5	认沽期权	1		本方价	0.0161	0.016	0.0161	卖	19.68	3672.0000	-59928.0000	0.0055

总头寸Delta: -2656.0000 总头寸Gamma: -119856.0000 总头寸Theta: 0.0118 总头寸Vega: -0.0024

委托保证金试算: 8,751.20 收到权利金: 528.00

■ 单一商品下单

点击  闪电状图标，可打开下单盒，进行单一商品下单。

■ 分析

加入合约后默认勾选分析，右侧的分析指标为多个期权合约的组合分析结果。可取消勾选，分析结果也会随之刷新。

■ 行权价

策略会自动计算并加入合理的行权价，在行权价栏位，可以通过下拉菜单切换行权价。

■ 合约别

显示加入组合策略的期权合约别，为认购期权或认沽期权。

■ 数量

设置策略下单数量。组合策略如果修改其中一个合约的数量，则组合中的其他合约会连动调整。

■ 价格类别与价格：

中间价：即限价单，价格为合约中间价。

对方价：即限价单，买进价格使用卖价，卖出价格使用买价。

本方价：即限价单，买进价格使用买价，卖出价格使用卖价。

最新价：即限价单，价格为合约最新价。

指定价：即限价单，可手动调整设定价格。

■ 买/卖

根据所选策略加入期权合约，并设定好买卖方向，买/卖方向不可手动修改。

■ 买价 / 卖价 / Greeks 栏位

提供买价、卖价、隐波率、头寸 Delta、头寸 Gamma、头寸 Theta、头寸 Vega 栏位，随报价实时跳动。

■ 总头寸 Greeks

提供组合策略中合约加总的头寸 Delta、头寸 Gamma、头寸 Theta、头寸 Vega 数据。

■ 委托保证金试算、收到/付出权利金

根据加入组合策略的期权合约手数、买卖方向、价格等设置，套用公式计算出组合下单所需保证金和收到/付出权利金。注：此为试算值，实际成交后的占用保证金及权利金以资金查询结果为准。

■ 重置

点击重置按钮，将情境中已加入的组合合约清空。

■ 一键下单

通过一键下单按钮送出策略组合报单。

切换情境/自组模式



情境与自组列表框即时显示使用者在期权报价的交易动作，依使用者选择「情境」或「自组」判定为该使用者使用情境策略或自组策略，选择模式为「情境或自组」的操作方式有不同限制，两个模式的列表框互相独立不影响各自操作行为。

■ [情境]模式

- ◆ 只能通过策略选择器代入商品，无法通过手动方式新增商品情景模式下的商品列表框。
- ◆ 切换策略选择时，即清空[期权报价]与[情境]列表框中已代入的商品组合。
- ◆ 只能调整代入商品的[行权价、数量、价格类别]，调整时会同步更新[期权报价与分析图表]。
- ◆ 例如：选择大涨时，预设代入列表框中的商品，只能调整[买进认购期权]的行权价、买进数量、价格类别。
- ◆ 如果要移除列表框中已选择的商品，可通过[重置]功能，清空商品，同时联动[期权报价与分析图表]，还原为初始状态。
- ◆ 决定下单时，则按下[一键下单]按钮。
- ◆ 情景模式下无法加入标的现货，设定买卖反向。
- ◆ 勾选合约之后会同时计算出占用保证金以及收到/付出权利金。
- ◆ 勾选合约之后会同时计算出所选合约的总头寸 Greeks 值。

- 「自组」模式
 - ◆ 可通过期权报价的右键菜单，选择买入策略、卖出策略代入商品，或通过勾选期权报价买、卖栏位新增商品至「自组」列表框中。
 - ◆ 能移除单一商品，调整代入商品的「行权价、合约别、数量、价格类型以及切换买卖方向」，调整完成后同步更新「期权报价与分析图表」。
 - ◆ 例如：选择买入策略-看涨期权时，预设代入买进认购期权于「自组」列表框，使用者可由期权报价手动选择加入/移除商品，或是由「自组」列表框删除商品，调整后的结果，连动更新「期权报价与分析图表」。
 - ◆ 使用者如果要移除「自组」列表框中商品内容，可以通过「重置」功能，清空列表框中的商品，同时连动「期权报价与分析图表」，还原为初始状态，也可以手动移除单笔商品。
 - ◆ 确定下单时，则按下「一键下单」按钮。
 - ◆ 可以加入标的、设定买卖反向。
 - ◆ 勾选合约之后会同时计算出占用保证金以及收到/付出的权利金。
 - ◆ 勾选合约之后会同时计算出所选合约的总头寸 Greeks 值

■ 分析筛选

可以[勾选](#)欲显示于分析图表的商品，选择的结果[影响右侧分析图表](#)的结果显示。

■ 「汇入持仓」

对持仓进行分析，条件是只会汇入到当前选择的合约品种和月份。

■ 「重置」

删除已选择商品

■ 「加入标的」

加入标的，可以同时下单标的的合约和期权合约，或作为期权下单的参考

注意：只有在自组模式下可用

■ 「买卖反向」

加入标的合约或者期权合约后，点击买卖反向，可以对下单的方向进行快速更改。

注意：只有在自组模式下可用

- 「一键下单」
 - 使用一键下单按钮，将商品资讯代入一键下单
 - 点选“送出报单”后，自动“关闭”该视窗，可在委托回报及持仓查看资讯。
 - 点选“取消”，返回情境 / 自组，可修改商品/策略选择及下单设定。

一键下单

行权价	合约别	合约单位	到期日	买/卖	仓别	数量	价格类别	价格	有效期	拆单	买价	卖价	持仓
3.5	认购期权	10000.0	21/03/24	买	自动	1	本方价	0.0366	当日有效(ROD)	<input type="checkbox"/> 数量	1	0.0366	0.0367
3.5	认沽期权	10000.0	21/03/24	买	自动	1	本方价	0.016	当日有效(ROD)	<input type="checkbox"/> 数量	1	0.016	0.0161

付出权利金: 526.00

下单摘要

买入 1 手在 21/03/24 到期的 510050 2103 3.5 认购 认购期权
 买入 1 手在 21/03/24 到期的 510050 2103 3.5 认沽 认沽期权

估计的交易成本

您将冻结资金 526.00 + 手续费

账户余额资讯

委托保证金试算: ¥0.00
 试算可用资金: ¥9,933,561.70

- 「商品列表显示栏位」
 - 行权价
 - 合约别
 - 合约单位
 - 到期日
 - 买/卖
 - 仓别
 - 数量
 - 价格类别
 - ◆ 中间价
 - ◆ 对方价
 - ◆ 本方价

- ◆ 最新价
- ◆ 指定价
- 价格：委托价格 (价格类别为指定价时可修改价格)
- 有效期
 - ◆ ROD: 当日有效单
 - ◆ FOK: 全成或者全撤
- 拆单
- 买价
- 卖价
- 持仓
- 下单摘要
 - ◆ 描述各商品买卖规格，到期时间
- 估计交易成本：计算在该笔交易所指定价位下预估的交易成本
- 账户余额资讯
 - ◆ 委托保证金试算
 - ◆ 试算可用资金

下单盒

下单盒

账户 836004682 (836004682) (权)

合约 510050 购 2月 3.5

开 0.3001	高 0.3558	低 0.3001	量 13940
5	买一 0.3411	卖一 0.3438	1
▲0.0493			16.90%
市价 买进	中间价 0.3424		市价 卖出
5	0.3407	0.3498	1
10	0.3383	0.35	1
10	0.338	0.3508	2
1	0.335	0.3525	1

仓别 自动 今: 0 昨: 0

报单 限价 当日有效(ROD)

价格 0.3438 加挂 0 跳

手数 1

拆单 逐笔委托最大数量 1 手数

止损 0 跳 止盈 0 跳

买进 卖出

- 可以通过以下方式打开下单盒：
 - T型报价点击“买价 / 卖价”按钮、“净仓”栏位
 - 标的报价中点击“买价 / 卖价”按钮
 - T型报价中，除“买价 / 卖价”的其他报价栏位双击，打开下单盒
 - 「情境 / 自组」中点击  闪电状图标
 - 持仓中点击“净仓/多仓/空仓/备兑仓”按钮

- 下单盒功能说明：

- 下单盒右上角按钮为  状态时，表示下单后下单盒窗口关闭。状态为  时。表示下单后下单盒窗口不关闭。
- 「账户」：下单商品对应的资金账户
- 「合约」：「买价」或「卖价」按钮对应的合约
- 「买进/卖出」：
 - ◆ 买进: 买进按钮显示为红色
 - ◆ 卖出: 卖出按钮显示为绿色
- 「仓别」：
 - ◆ 自动: 当前账号的当前合约有持仓时，委托自动判别为平仓
 - ◆ 开仓: 无论当前账号的当前合约是否有持仓，委托均为开仓
 - ◆ 平仓: 无论当前账号的当前合约是否有持仓，委托均为平仓
 - ◆ 备兑开仓: 选择 50ETF 期权下单时会显示出仓别，委托时期权账户对应证券账户需要手动锁券（上交所）。
 - ◆ 备兑平仓: 选择 50ETF 期权下单时会显示出仓别，委托时期权账户对应证券账户会自动解锁券。
- 「今/昨」：今仓和昨仓的持仓量
- 「市价买进」：点击后以市价买入
- 「市价卖出」：点击后以市价买卖出
- 「开/高/低/量」：分别为当日开盘价，当日最高价，最低价以及当日成交量。
- 「买一/卖一/中间」：分别为市场挂单买一价，卖一价及中间价，点击价格会对应映射到下方价格输入框处。
- 「报单」：
 - ◆ 市价
 - ◆ 限价
 - ◆ 中间价
 - ◆ 对方价
 - ◆ 本方价
 - ◆ 最新价
 - ◆ 止损价：需交易所支持该单别

◆ 止损限价：需交易所支持该单别

■ 「有效期」：

◆ 当日有效(ROD)

◆ 剩余即撤销(IOC)

◆ 全成或全撤(FOK)

◆ 冰山拆单(IceBerg)

■ 「价格」：委托价格，点击价格按钮可以快速选择[涨停价][跌停价][买一价][卖一价][最新价]

■ 「加挂」：在设定的委托价格的基础上 ± 跳发送委托

■ 「手数」：单笔委托数量

■ 「拆单」：根据设定逐笔委托最大数量，将总下单手数拆分委托。

例：合约 50ETF 201910 C2.95，买进市价开仓 5 手，勾选拆单后下单，会拆成 2 手 2 手 1 手的委托。

■ 「止盈」：委托进场的同时委托出止盈单

■ 「止损」：委托进场的同时委托出止损单

■ 「冰山拆单」：根据设定预设逐笔委托数量与逐笔委托变动区间，将总下单手数拆分委托，使用冰山拆单，后一笔委托会在前一笔委托成交前一直等待。

例：合约 50ETF 201910 C2.95，买进限价开仓 5 手，选择冰山拆单，会拆成 3 手 2 手的委托，2 手的委托会在 3 手委托成交前一直等待，直至 3 手委托成交。

■ [注]:

◆ 中间价释义

例如：假设一跳是 1 点 买价 240 卖价 245 最新价 243 $(240+245)/2=242.5$ ，依跳动点数取值，可以是 242 或 243 取最接近最新价的价格 243。

◆ 报价中买卖价颜色含义

红色:当前合约最新价相于昨结算价有上涨

绿色:当前合约最新价相于昨结算价有下跌

◆ 行权价栏位中黄色与蓝色的区分

黄色:相当于认购期权的平值

蓝色:相当于认沽期权的平值

◆ 行权价栏位中红色线与绿色线区分

红色线:标的现货当天最高价所在的行权价区间

绿色线:标的现货当天最低价所在的行权价区间

◆ 行权价上方天数的含义

代表期权合约的离到期日剩余天数

◆ 止盈止损设定点数最小单位

采用的是以跳为最小单位

例如 510050 期权一跳为 0.0001, 1 点即为 10000 跳

◆ 报单条件中标识红色的区分

红色的报单类型表示挂在本地客户端洗价, 交易断线时, 洗价单可能“继续”
“取消”“暂停”(依设置->通用设定)

其他报单类型挂在柜台, 交易断线或重启客户端不影响挂单。

◆ 拆单设定, 逐笔委托最大数量[Qty]与[%]释义

Qty: 按照固定设定的委托数值拆分委托。

%: 按照总下单手数的%拆分委托。

◆ 下单盒报单选项对应:

咏春 下单盒报单选项		对应交易所申报指令类型
深圳 现货	对方价, 当日有效(ROD)	交易所指令:对手方最优价格市价申报
	本方价, 当日有效(ROD)	交易所指令:本方最优价格市价申报
	五档市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令:最优五档即时成交剩余撤销市价申报
	市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令:即时成交剩余撤销市价申报
	市价, 全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额成交或撤销市价申报
	限价, 当日有效(ROD)	交易所指令:普通限价申报
	中间价, 当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约中间价
	最新价, 当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约最新价

	停损市价, 剩余即撤销(IOC)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以即时成交剩余撤销市价申报
	停损市价, 全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以全额成交或撤销市价申报
	停损限价, 当日有效(ROD)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以普通限价申报
深圳 期权	限价, 当日有效(ROD)	交易所指令:普通限价申报
	限价, 全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额成交或撤销限价申报
	对方价, 当日有效(ROD)	交易所指令:对手方最优价格市价申报
	本方价, 当日有效(ROD)	交易所指令:本方最优价格市价申报
	五档市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令:最优五档即时成交剩余撤销市价申报
	市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令:即时成交剩余撤销市价申报
	市价, 全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额成交或撤销市价申报
	中间价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约中间价
	中间价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额成交或撤销限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约中间价
	最新价, 当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约最新价
	最新价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额成交或撤销限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约最新价
	停损市价, 剩余即撤销(IOC)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以即时成交剩余撤销市价申报
	停损市价, 全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以全额成交或撤销市价申报
	停损限价, 当日有效(ROD)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以普通限价申报
停损限价, 全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以全额成交或撤销限价申报	
上海 现货	限价, 当日有效(ROD)	交易所指令:普通限价
	五档市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令:市价,最优 5 档即时成交剩余撤销申报
	五档市价转限价, 当日有效(ROD)	交易所指令:市价,最优 5 档即时成交剩余转限价申报
	市价, 剩余即撤销(IOC)	在设置->市价转换设定中, 上交所 股票/基金的市价指令替换指令类型为“五档市价 IOC” 替换为市价: 最优 5 档即时成交剩余撤销申报送出
	市价, 当日有效(ROD)	在设置->市价转换设定中, 上交所 股票/基金的市价指令替换指令类型为“五档市价转限价 ROD” 替换为市价: 最优 5 档即时成交剩余转限价申报送出

中间价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约中间价
对方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约对方价
本方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约本方价
最新价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型; 申报价格取委托送出时的合约最新价
停损市价, 剩余即撤销(IOC)	在设置->市价转换设定中, 上交所 股票/基金的市价指令替换指令类型为“五档市价 IOC” 客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以市价: 最优 5 档即时成交剩余撤销申报送出
停损市价, 当日有效(ROD)	在设置->市价转换设定中, 上交所 股票/基金的市价指令替换指令类型为“五档市价转限价 ROD”, 客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以市价: 最优 5 档即时成交剩余转限价申报送出
停损限价, 当日有效(ROD)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以普通限价送出
上海期权	
限价, 当日有效(ROD)	交易所指令:普通限价委托
市价转限价, 当日有效(ROD)	交易所指令:市价剩余转限价委托
市价, 剩余即撤销(IOC)	交易所指令:市价剩余撤销委托
限价, 全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额即时限价委托
市价, 全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额即时市价委托
中间价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托; 申报价格取委托送出时的合约中间价
中间价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托; 申报价格取委托送出时的合约中间价
对方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托; 申报价格取委托送出时的合约对方价
对方价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托; 申报价格取委托送出时的合约对方价
本方价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托; 申报价格取委托送出时的合约本方价
本方价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托; 申报价格取委托送出时的合约本方价
最新价, 当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托; 申报价格取委托送出时的合约最新价
最新价, 全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托; 申报价格取委托送出时的合约最新价
停损市价, 剩余即撤销(IOC)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以市价剩余撤销委托送出
停损市价, 全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以全额即时市价委托送出

停损限价, 当日有效(ROD)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以普通限价委托送出
停损限价, 全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价, 设定停损价触发条件, 触价后以全额即时限价委托送出

报单

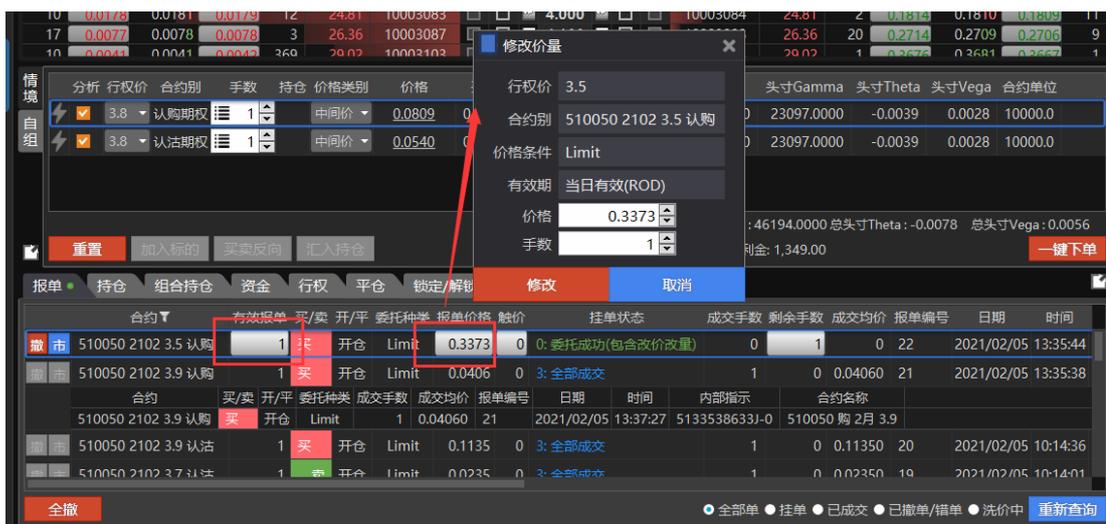
提供当日报单回报资料, 提供撤单、改单等功能。

合约	有效报单	买/卖	开/平	委托种类	报单价格	触价	挂单状态	成交手数	剩余手数	成交均价	报单编号	日期	时间
510050 2102 3.9 认沽	1	买	开仓	Limit	0.1135	0	3: 全部成交	1	0	0.11350	20	2021/02/05	10:14:36
510050 2102 3.7 认沽	1	卖	开仓	Limit	0.0235	0	3: 全部成交	1	0	0.02350	19	2021/02/05	10:14:01
510050 2102 3.7 认购	1	卖	开仓	Limit	0.1484	0	3: 全部成交	1	0	0.14840	18	2021/02/05	10:13:56
510050 2102 3.8 认购	1	卖	开仓	Limit	0.0794	0	3: 全部成交	1	0	0.07940	17	2021/02/05	10:13:46
510050 2102 3.9 认购	1	买	开仓	Limit	0.0377	0	3: 全部成交	1	0	0.03770	16	2021/02/05	10:13:36
510050 2102 3.8 认购	0	买	开仓	Limit	0.0796	0	10: 委托失败	0	0	0	0	2021/02/05	10:13:15
510300 2103 5.75 认购	0	买	开仓	Limit	0.0829	0	8: 完全删单成功	0	0	0	5	2021/02/05	09:51:06
510300 2102 5.5 认购	0	买	开仓	Limit	0.1724	0	8: 完全删单成功	0	0	0	4	2021/02/05	09:51:04

点击右上方  按钮, 可以成为独立窗口, 此外可通过在报单框内右击鼠标调出报单栏的栏位设置。

- [撤]: 撤销当前委托, 红色为可撤销。
- [市]: 将当前委托改为用市价委托, 蓝色为可改市价委托。
- 栏位
 - ◆ 投资者: 显示当前资金账户。
 - ◆ 合约: 式: 合约代码+合约月份+行权价+认购/认沽 (Call/Put), 例如:
510050 1910 2.85 认购
 - ◆ 有效报单
 - ◆ 买/卖: 买卖方向
 - ◆ 开/平
 - ◆ 委托种类
 - ◆ 报单价格: 委托时的报单价格。
 - ◆ 挂单状态
 - ◆ 成交手数

- ◆ 成交均价
- ◆ 报单编号
- ◆ 日期
- ◆ 时间：该笔委托回报插入的时间。
- ◆ 时间条件:即为有效期。
- ◆ 履约价
- ◆ C/P
- ◆ 当冲
- ◆ 内部指示
- ◆ 交易单号
- ◆ 条件
- ◆ 备注：委托失败，失败原因会在此处显示。
- ◆ 合约名称
- ◆ 触发条件
- ◆ 报单手数
- ◆ 策略名称
- ◆ 策略 ID
- 「全撤」：一键撤销所有挂单
- 「重新查询」：重新查询当前报单
- 「改价改量」：点击“有效报单/报单价格/触价/剩余手数”按钮可以进行改价改量。
 - ◆ 适用条件:仅对委托成功单没有成交的单别有效。
 - ◆ 操作:点击委托回报中报单价格调出改价改量窗口。选择好价格和手数只有确认后重新委托一笔限价单。原委托会立即删单。如下图：



- 「分类显示」
 - ◆ 全部单：列表中显示所有报单
 - ◆ 挂单：列表中只显示未成交的挂单
 - ◆ 已成交：列表中只显示已成交的委托单
 - ◆ 已撤销/错单：列表中只显示已撤销或错误的委托单
 - ◆ 洗价中：列表中只显示在洗价的委托单
- 筛选投资者/合约
 - ◆ 点击该栏位上的  按钮，如下图：



持仓

提供交易账号的持仓资料。

平仓	分析	合约	合约名称	行权	净仓	多仓	空仓	今仓	昨仓	备兑仓	最新价	多仓均价	空仓均价	市值	逐笔浮动盈亏	标的	标的涨跌幅	占
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	510050 2102 3.7 认购	510050 购 2月 3.7		-1	0	1	-1	0	0	0.1563	-	0.1484	-1,560.00	-76.00	3.844	1.51%	7
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	510050 2102 3.7 认沽	510050 沽 2月 3.7		-1	0	1	-1	0	0	0.0215	-	0.0235	-216.00	19.00	3.844	1.51%	4
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	510050 2102 3.8 认购	510050 购 2月 3.8		-1	0	1	-1	0	0	0.0854	-	0.0794	-854.00	-60.00	3.844	1.51%	6
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	510050 2102 3.9 认购	510050 购 2月 3.9		2	2	0	2	0	0	0.0406	0.0392	-	810.00	14.00	3.844	1.51%	8
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	510050 2102 3.9 认沽	510050 沽 2月 3.9		1	1	0	1	0	0	0.1058	0.1135	-	1,057.00	-84.00	3.844	1.51%	10

点击右上角 按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在持仓框内右击鼠标调出持仓栏的栏位设置。

- [平]: 点击可平掉对应行持仓
- 分析: 勾选时, 可将该持仓加入到自组, 和所选合约组合分析
 - 注: 只有当当前 T 型报价所选月份与此持仓月份相同时才可勾选
- [全平]: 一键平仓所有仓位
- [平净仓]: 一键平仓净仓位
- [建组合]: 将持仓构建为组合持仓
- [重新查询]: 重新查询当前持仓
- 栏位
 - ◆ 投资者: 显示交易账户数字账户
 - ◆ 合约: 显示合约英文代码
 - ◆ 合约名称: 显示合约中文代码
 - ◆ 行权: 点击按钮 即可行权, 显示到期日天数提醒
 - ◆ 净仓: 显示该合约净仓数量
 - ◆ 多仓: 显示该合约多头持仓数量
 - ◆ 空仓: 显示该合约空头持仓数量
 - ◆ 今仓: 显示该持仓合约当天开仓数量
 - ◆ 今多: 显示该持仓合约当天开多仓数量
 - ◆ 今空: 显示该持仓合约当天开空仓数量
 - ◆ 昨仓: 显示该持仓合约历史开仓数量

- ◆ 昨多：显示该持仓合约历史开多仓数量
- ◆ 昨空：显示该持仓合约历史开空仓数量
- ◆ 委托中(多)：显示该持仓合约买委托中数量
- ◆ 委托中(空)：显示该持仓合约卖委托中数量
- ◆ 备兑仓：显示该持仓合约为备兑仓数量
- ◆ 最新价：显示给持仓合约最新价
- ◆ 均价：显示持仓合约均价
- ◆ 涨跌：改持仓合约相对于昨结算的涨跌
- ◆ 多仓均价：显示持有多仓合约均价（今仓为开仓价，昨仓均价为昨结算价）
- ◆ 空仓均价：显示持有空仓合约均价（今仓为开仓价，昨仓均价为昨结算价）
- ◆ 市值：显示持仓期权市值(市值计算使用最新价或者中间价计算，依设置->交易偏好设定)
- ◆ 持仓成本:根据持仓均价计算出的成本
- ◆ 逐日浮动盈亏：按照持仓均价计算出的浮动盈亏参考值
- ◆ 逐日浮动盈亏%：按照持仓均价计算出的浮动盈亏%参考值
- ◆ 开仓成本：根据开仓均价计算出的成本
- ◆ 逐笔浮动盈亏：按照开仓均价计算出的浮动盈亏参考值
- ◆ 逐笔浮动盈亏%：按照开仓均价计算出的浮动盈亏%参考值
- ◆ 买价
- ◆ 卖价
- ◆ 买量
- ◆ 卖量
- ◆ 中间价
- ◆ 昨结算价
- ◆ 结算价
- ◆ 结算价涨跌：按照结算价计算出的涨跌

- ◆ 结算价涨跌幅%: 按照结算价计算出的涨跌%
- ◆ 标的: 期权合约对应标的现货价格
- ◆ 标的涨跌: 期权合约对应标的现货涨跌
- ◆ 标的涨跌幅: 期权合约对应标的现货涨跌幅
- ◆ 占用保证金: 显示该持仓所占用的保证金
- ◆ 冻结保证金: 显示该持仓(行权, 平仓, 对冲)时所冻结的保证金
- ◆ 手续费
- ◆ Delta
- ◆ Gamma
- ◆ Theta
- ◆ Vega
- ◆ Rho
- ◆ 隐波率
- ◆ 多仓冻结: 显示该持仓多仓(行权, 平仓, 对冲)时所冻结的保证金
- ◆ 空仓冻结: 显示该持仓空仓(行权, 平仓, 对冲)时所冻结的保证金
- ◆ 开仓量
- ◆ 平仓量
- ◆ 今日开仓金额
- ◆ 今日平仓金额
- ◆ 逐日盯市平仓盈亏
- ◆ 逐笔对冲平仓盈亏
- ◆ 上次占用保证金
- ◆ 冻结资金 (权利金)
- ◆ 当日资金差额
- ◆ 执行冻结: 显示该持仓(行权, 平仓, 对冲)时所冻结持仓的手数
- ◆ 执行冻结金额: 显示该持仓(行权, 平仓, 对冲)时所冻结持仓的金额

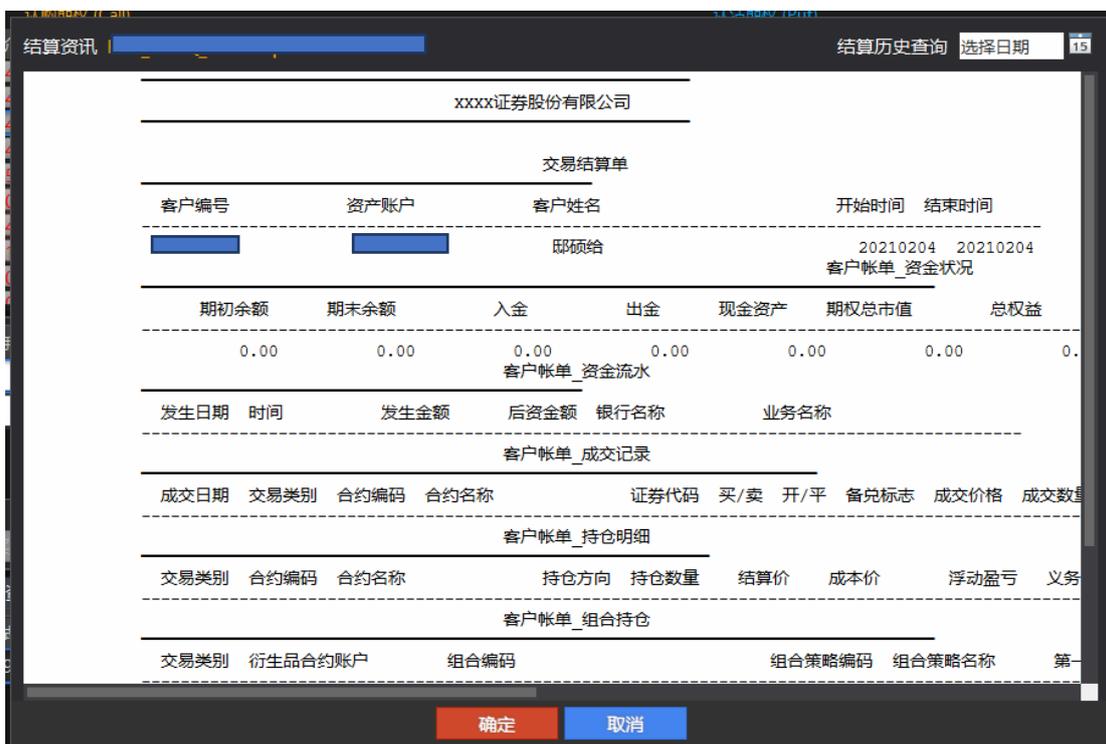
- ◆ 放弃执行冻结：显示该持仓放弃行权时所冻结的手数
- ◆ 组合多仓：显示该持仓部位为组合仓且为多仓的手数
- ◆ 组合空仓：显示该持仓部位为组合仓且为空仓的手数
- ◆ 组合多头冻结
- ◆ 组合空头冻结
- ◆ 锁券/执行冻结
- ◆ 多仓可平仓量：显示该持仓多仓(行权，平仓，对冲)的可用数量
- ◆ 空仓可平仓量：显示该持仓空仓(行权，平仓，对冲)的可用数量
- ◆ 买成
- ◆ 卖成
- ◆ 今成交
- ◆ 实值度
- ◆ 实(虚)值额：显示该期权合约实值，虚值金额
- ◆ 币别
- ◆ 更新时间：记录该持仓更新时间
- ◆ 持仓杠杆率
- ◆ 多头开仓均价
- ◆ 空头开仓均价
- ◆ 估算当日盈亏
- ◆ 当日平均买进
- ◆ 当日平均卖出
- ◆ 投机套保标志
- ◆ 合约编码

资金



点击右上角  按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在资金框内右击鼠标调出资金栏的栏位设置。

- 结算单：查看选中资金账号的结算资讯，在资金栏位下选中资金账号后可以点击结算单按钮查看此账号的结算单。



可以在结算资讯中查询结算历史。

- 「重新查询」：重新查询当前持仓
- 栏位
 - ◆ 投资者
 - ◆ 试算可用资金
 - ◆ 试算动态权益

- ◆ 试算市值权益
- ◆ 未冲销权利金市值
- ◆ 逐笔浮动盈亏
- ◆ 期货平仓盈亏
- ◆ 期货当日盈亏
- ◆ 占用保证金
- ◆ 昨日余额
- ◆ 上次信用额度
- ◆ 上次质押金额
- ◆ 质押金额
- ◆ 入金金额
- ◆ 出金金额
- ◆ 静态权益
- ◆ 手续费
- ◆ 冻结保证金
- ◆ 冻结手续费
- ◆ 权利金收支
- ◆ 冻结资金
- ◆ 交割保证金
- ◆ 信用额度
- ◆ 保底结算准备金
- ◆ 可取资金
- ◆ 上次占用保证金
- ◆ 证券资金收支
- ◆ 风险度
- ◆ 证券参考市值

- ◆ 可用资金
- ◆ 动态权益
- ◆ 参考风险度
- ◆ 上海限购额度
- ◆ 上海剩余额度
- ◆ 深圳限购额度
- ◆ 深圳剩余额度
- ◆ 币别
- ◆ 上次货币质入金额
- ◆ 上次货币质出金额
- ◆ 货币质入金额
- ◆ 货币质出金额
- ◆ 货币质押金额
- ◆ 可质押货币金额
- ◆ 特殊产品占有保证
- ◆ 特殊产品冻结保证金
- ◆ 特殊产品手续费
- ◆ 特殊产品冻结手续费
- ◆ 特殊产品持仓盈亏
- ◆ 特殊产品平仓盈亏
- ◆ 根据持仓盈亏算法计算的特殊产品持仓盈亏
- ◆ 特殊产品交易所保证金
- ◆ 总市值
- ◆ 资金杠杆率
- ◆ 净市值
- ◆ 资金多空比率

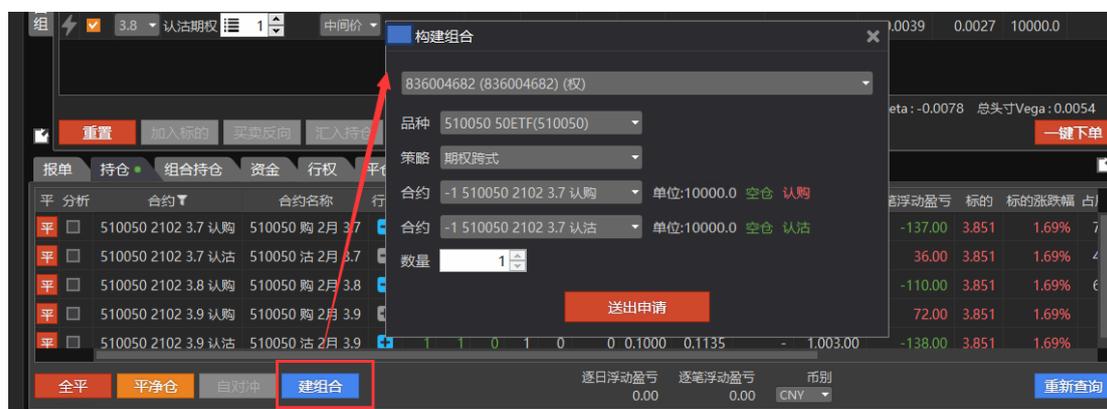
◆ 逐日浮动盈亏

注:

【可用资金】 【动态权益】 【占用保证金】 【静态权益】 【手续费】 【冻结收付费】
 【权利金收支】 【可取资金】 【冻结保证金】 【证券资金收支】 【期货平仓盈亏】 【昨日
 余额】 【冻结权利金】 取值于柜台

- ◆ 试算可用资金=试算动态权益-占用保证金-冻结保证金-冻结手续费-交割保证金-冻结权利金+信用金额
- ◆ 浮动盈亏=期货浮动盈亏+期权浮动盈亏
- ◆ 期货当日盈亏=期货持仓浮动盈亏+期货当日平仓盈亏
- ◆ 试算动态权益=静态权益+期货平仓盈亏+期货浮动盈亏+权利金收支+证券收支-手续费
- ◆ 试算市值权益=试算动态权益+未冲销权利金市值
- ◆ 市值权益=动态权益+持仓权利金市值 (权利金市值买方为正/卖方负值)
- ◆ 风险度=占用保证金*100%/试算动态权益
- ◆ 参考风险度=占用保证金*100%/试算市值权益
- ◆ 未冲销权利金市值=持仓期权市值

构建组合



- 点击持仓下的[建组合]按钮，即可进入构建组合页面
- 账号：可以选择想要构建组合的账号
- 品种：选择构建的商品品种
- 策略：选择组合策略
 - 股票期权的组合合约规则
 - ◆ 认购牛市价差策略：相同到期日、相同标的证券、相同合约单位的认购期权；腿 1 为行权价较低的多仓 & 腿 2 为行权价较高的空仓。
 - ◆ 认沽熊市价差策略：相同到期日、相同标的证券、相同合约单位的认沽期权；腿 1 为行权价较高的多仓 & 腿 2 为行权价较低的空仓。
 - ◆ 认沽牛市价差策略：相同到期日、相同标的证券、相同合约单位的认沽期权；腿 1 为行权价较低的多仓 & 腿 2 为行权价较高的空仓。
 - ◆ 认购熊市价差策略：相同到期日、相同标的证券、相同合约单位的认购期权；腿 1 为行权价较高的多仓 & 腿 2 为行权价较低的空仓。
 - ◆ 跨式空头策略：相同标的、相同到期日、相同行权价格；腿 1 为认购期权空仓 & 腿 2 为认沽期权空仓。
 - ◆ 宽跨式空头策略：相同标的、相同到期日；腿 1 为高行权价认购期权空仓 & 腿 2 为低行权价认沽期权空仓。
 - ◆ 认购期权保证金开仓转备兑开仓。
 - ◆ 认购期权备兑开仓转保证金开仓，不记为组合持仓。

组合持仓

投资者	组合策略名称	合约	组合编号	净仓	多仓	空仓	均价	多仓均价	空仓均价	占用保证金
836001198 (836001198) (权)	认沽熊市价差	BER 510300 2106 4.54A 认沽 & 510300 2106 4.343A 认沽		1	1	0	-	-	0	0.00
836001198 (836001198) (权)	期权跨式	STD 510050 2106 3 认购 & 510050 2106 3 认沽		-8	0	8	-	0	-	106,484.80
836001198 (836001198) (权)	期权跨式	STD 510300 2106 4.343A 认购 & 510300 2106 4.343A 认沽		-30	0	30	-	0	-	556,945.80
836001198 (836001198) (权)	期权跨式	STD 510300 2106 4.54A 认购 & 510300 2106 4.54A 认沽		-35	0	35	-	0	-	595,726.25
836001198 (836001198) (权)	期权宽跨式	STG 510300 2106 4.54A 认购 & 510300 2106 4.441A 认沽		-5	0	5	-	0	-	84,607.30

点击右上角按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在组合持仓框内右击鼠标调出组合持仓栏的栏位设置。



- [拆分组合]: 将已经构建的组合进行拆分，在组合持仓中选取要拆分的组合持仓，然后点击拆分组合按钮，设定好拆分数即可送出申请
- 「重新查询」: 重新查询当前组合持仓。

● 栏位

- 投资者: 显示交易账户数字账户。
- 组合策略名称: 显示该组合策略的名称。
- 合约: 显示该组合持仓合约代码。规格为(组合类型-合约代码-月份-期权类型-&-合约代码-合约月份-月份-期权类型)。
- 净仓: 显示账户下该笔组合持仓的净持仓数量 (为多仓，空仓之和，多仓为正、空仓为负)。
- 多仓: 显示账户下该笔组合持仓多仓数量。
- 空仓: 显示账户下该笔组合持仓空仓数量。
- 均价: 显示该组合持仓的持仓均价(双腿的均价之和，多仓为正、空仓为负)。
- 多仓均价: 显示账户下该笔组合持仓多仓均价。
- 空仓均价: 显示账户下该笔组合持仓空仓均价。
- 占用保证金: 显示该组合持仓所占用保证金。

组合报单

显示当日组合/拆分的记录。

投资者	委托时间	委托编号	组合策略名称	合约	组合方向	委托状态	委托数量	成交时间	成交数量
836004682 (836004682) (权)	13:38:33	23	期权跨式	STD 510050 2102 3.7 认购 & 510050 2102 3.7 认沽	组合	0: 已提交	1	13:38:33	0

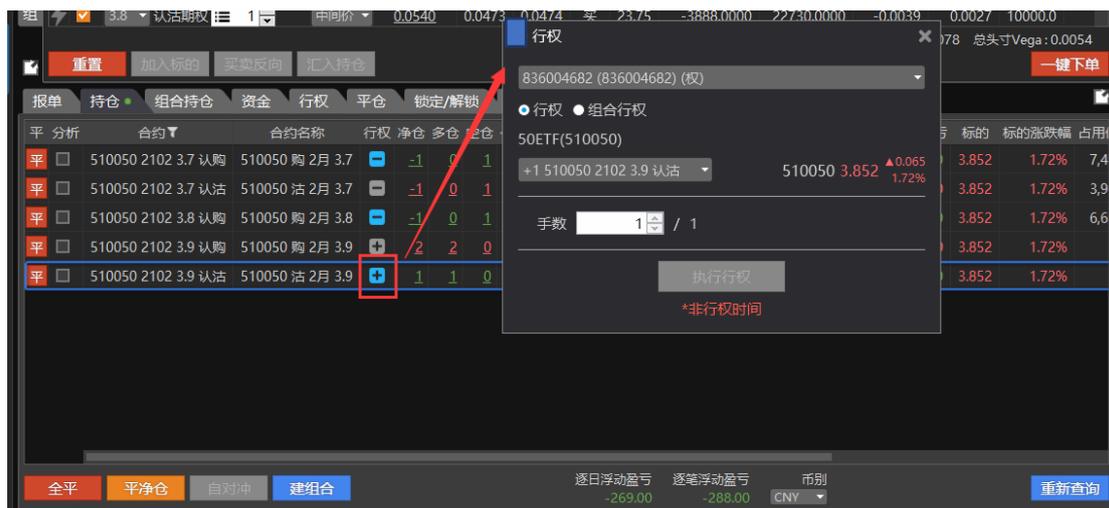
点击右上方  按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在组合报单框内右击鼠标调出组合报单栏的栏位设置。

● 栏位

- 投资者：显示交易账户数字账户。
- 委托时间：进行组合或拆分的委托时间。
- 委托编号
- 组合策略代码
- 组合策略名称：显示该组合策略的名称。
- 合约：显示该组合持仓合约代码。规格为(组合类型-合约代码-月份-期权类型-&-合约代码-合约月份-月份-期权类型)。
- 组合方向：组合/拆分。
- 委托状态
- 委托数量
- 成交时间
- 成交数量
- 成交编号

行权/组合行权

在持仓中，点击行权按钮  ，可进行行权、组合行权申请。



送出行权申请后可通过[行权]页签查看当日行权申请记录。

- 行权资料栏位
 - ◆ 登入账号
 - ◆ 登入账号名称
 - ◆ 期货商
 - ◆ 期货商名称
 - ◆ 账号
 - ◆ 账号名称
 - ◆ 合约
 - ◆ 合约名称
 - ◆ 数量
 - ◆ 投机套保标志
 - ◆ 执行类型
 - ◆ 持仓方向
 - ◆ 标的头寸
 - ◆ 标的自动平仓
 - ◆ 行权编号
 - ◆ 结算编号

- ◆ 行权状态
- ◆ 备注
- ◆ 插入时间
- ◆ 撤销时间
- ◆ 更新时间
- ◆ 交易日
- ◆ 交易所
- ◆ 合约在交易所代码
- ◆ 日期
- ◆ 期权的头寸是否自对冲
- [取消行权]: 取消此未行权的合约。
- [全部取消]: 一键取消未行权的合约。
- 行权记录筛选:
 - ◆ 全部: 查看所有期权合约。
 - ◆ 行权中: 查看所有行权中的期权合约。
- [行权指派]: 行权日下个交易日, 可点击查看行权指派信息。

行权指派				
帐号	合约▲	期权持仓类别	行权价格	行权数量
?(仿真)	159901	非备兑	5.75	1
?(仿真)	159901	非备兑	4.90	1
?(仿真)	159901	非备兑	4.80	1

- ◆ 行权指派栏位
 - ✓ 账号
 - ✓ 合约
 - ✓ 期权持仓类别
 - ✓ 行权价格
 - ✓ 行权数量
 - ✓ 行权冻结资金

- ✓ 交收数量
- ✓ 交收金额

锁定/解锁



注：仅显示上交所合约

- 设置锁定解锁
 - ◆ 账户：设置资金账号。
 - ◆ 合约：设置要锁定/解锁的标的证券持仓合约。
 - ◆ 最大可锁定：显示当前合约的最大可锁定数量。
 - ◆ 最大可解锁：显示当前合约的最大可解锁数量。
 - ◆ 股数：想要锁定/解锁的数量。
- 备兑证券持仓
 - ◆ 投资者：显示交易账户数字账户。
 - ◆ 合约：显示证券持仓代码。
 - ◆ 合约名称
 - ◆ 最大可锁定：证券持仓-锁定股数。
 - ◆ 最大可解锁：由锁定数量决定。
- 锁定解锁委托
 - ◆ 投资者

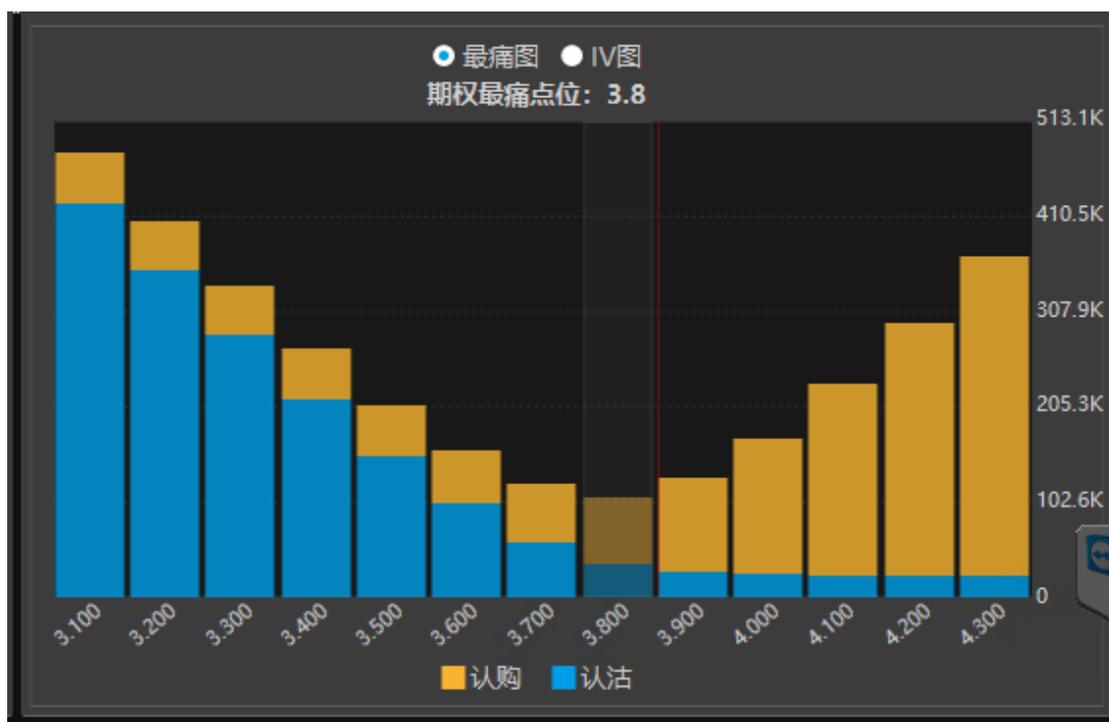
- ◆ 委托时间：锁定/解锁的委托时间。
- ◆ 合约
- ◆ 委托类型：锁定/解锁。
- ◆ 状态
- ◆ 委托编号
- ◆ 备注：委托失败的信息在此显示。

分析功能

- 走势分析
 - 走势图



- ◆ 标的 实时分 K 走势图
- ◆ 标的 实时分 K VIX 指标走势图
- ◆ 标的 实时分 K 成交量柱状图
- 期权最痛位置



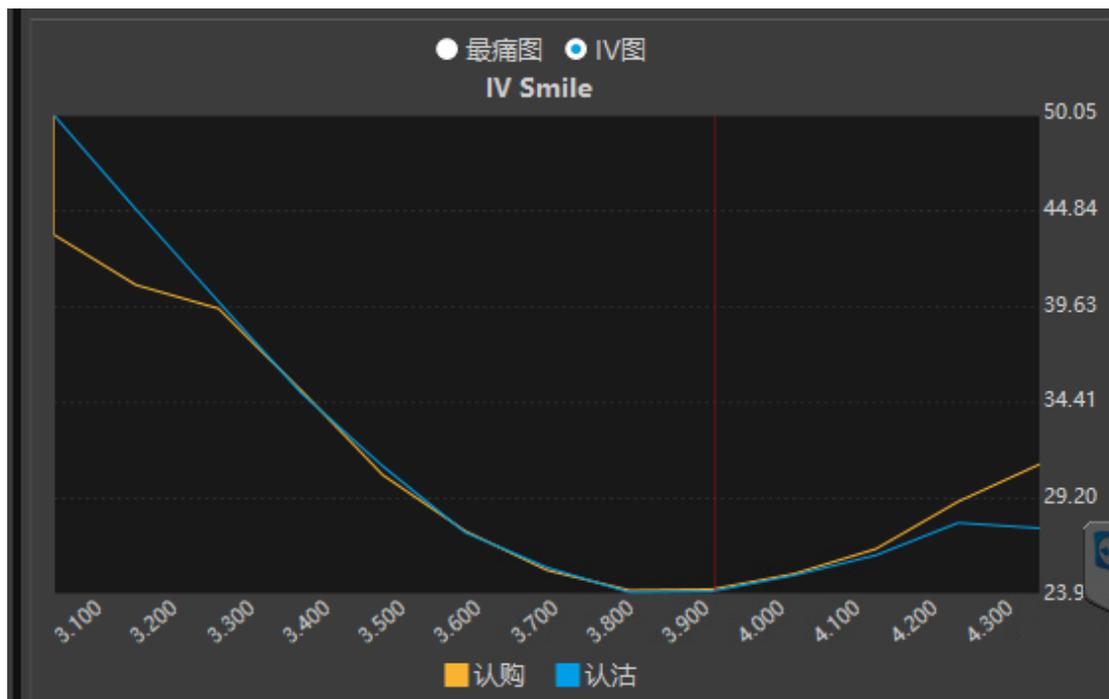
期权最痛位置：期权最痛理论是用来计算期权买家最为痛苦的到期行权价。假设期权买方散户为大多数，卖方以庄家或者机构为主，具有较大的资金规模跟讯息优势，可将结算价推向对自己有利的价格位置，即结算价会趋向于期权市场价值最低水平点位。

计算方式：

1.X 轴为当月期权各行权价价位

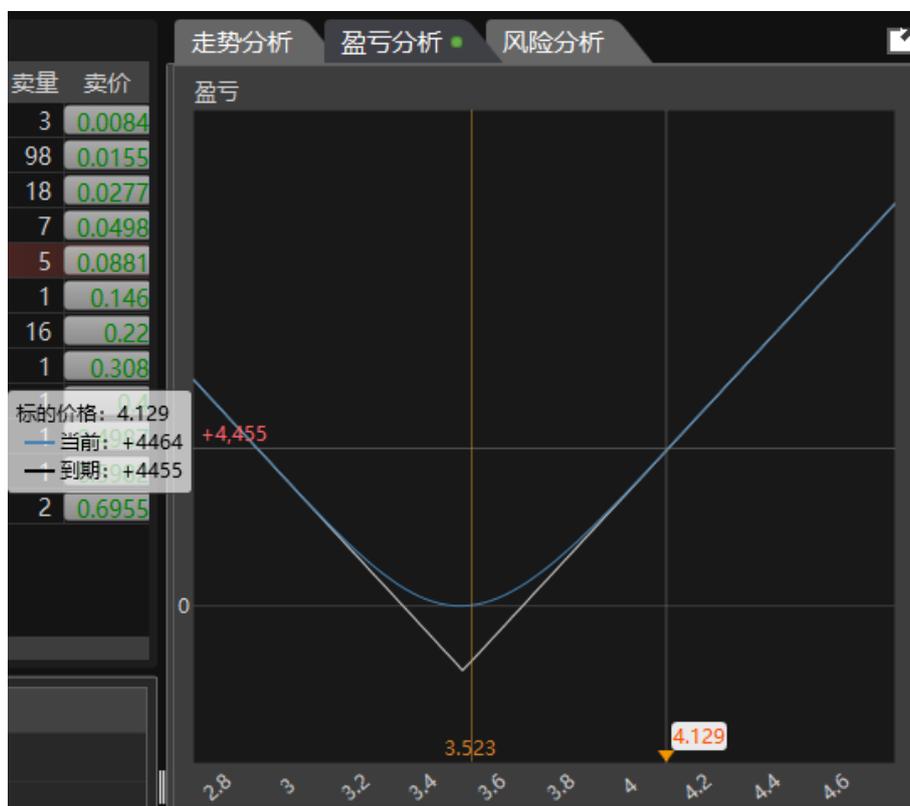
2.Y 轴为当月 所有 call 、put 合约 未平仓量*内在价值的加总，加总的 call 和 put 分别以不同颜色长度条叠加表示。

■ IV 图



● 盈亏分析

- 盈亏图：盈亏图表主要用来显示对「情景/自组」列表框中商品分析预测的结果。依据「情景/自组」列表框中的商品内容绘制出下列图表。



◆ 「图表更新方式」

当「情境 / 自组」的商品变动时

当「情境 / 自组」的商品下列项目变动时:

- ①行权价格变动时
- ②手数变动时
- ③买/卖别变动时
- ④看涨期权/看跌期权变动时

当盈亏图参数变动时(只更新未到期损益图形)

- ①使用者调整合约到期日间隔时间 (t) 时
- ②使用者调整合约波动度 (sigma) 时

◆ 「多商品图形绘制」

依据「情境 / 自组」列表框中所有勾选商品绘制对应图。

◆ 「标的商品价格」

于 X 轴显示「商品连结标的」的即时价格。

◆ 「绘制图表」

- ①横轴为期权标的物价格的可能数值。
- ②纵轴为「情境 / 自组」商品盈亏金额数值。

◆ 图表上标示

「情境 / 自组」商品计算后的线图与表格。

①图表标示

盈亏平衡点

行权价

标的期货价格

②输出的计算结果

最大收益

最大亏损

权利金

■ 盈亏分析数据

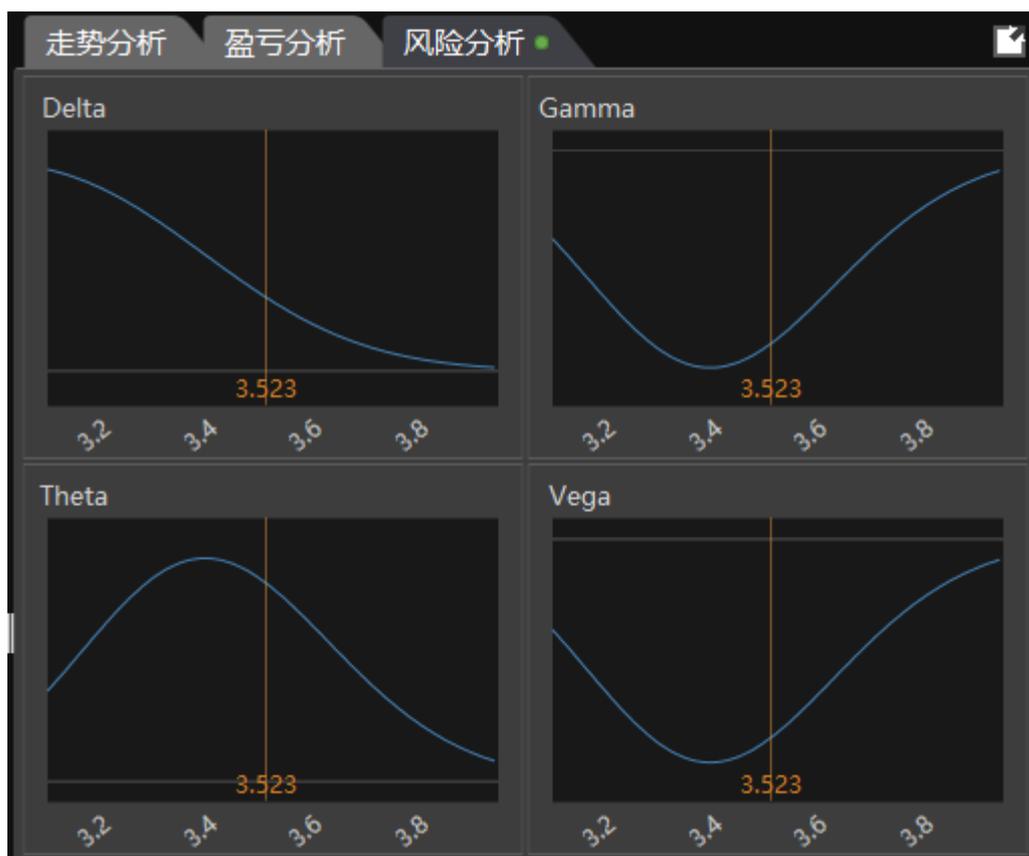
价格变动 10%	波幅变动 0%	经过 0 天
标的价格	盈亏	约当现货
3.858 +10%	467.36	1136.3478
3.788 +8%	439.22	1994.7464
3.718 +6%	390.35	3318.9140
3.648 +4%	498.00	0.0000
3.577 +2%	184.59	7780.5031
3.507	0.00	10944.1693
3.437 -2%	-257.10	14547.8902
3.367 -4%	-595.91	18296.7987
3.297 -6%	-1,019.11	21826.4003
3.227 -8%	-1,521.81	24794.7610
3.157 -10%	-2,092.37	26975.0197

- ◆ 价格变动：标的价格变化时，盈亏和约当现货对应的变化情况。
- ◆ 波幅变动：隐波变化百分比后，盈亏和约当现货对应的变化情况。
- ◆ 经过多少天：距离到期日时间，盈亏和约当现货对应的变化情况。

例：下图当标的价格变动 25%，波动率变动 2%，经过 2 天的盈亏情况。

价格变动 25%	波幅变动 2%	经过 2 天	
标的价格	波幅	盈亏	约当现货
	-2%	488.36	0.0000
	+2%	348.05	4942.3215
3.683 +5%	-	389.17	4193.9119
	-2%	424.38	3395.2776
	+2%	-13.07	11403.2888
3.507	-	61.63	10944.1693
	-2%	134.62	10390.1075
	+2%	-808.16	19734.8326
3.332 -5%	-	-730.59	20112.1035
	-2%	-653.79	20556.7757
	+2%	-2,092.65	0.0000

● 风险分析



■ 指标公式说明

- ◆ Δ = 期权价格的变动/标的资产价格的变动
即期权价格变动相对于标的资产价格变动的比率
- ◆ Γ = Δ 的变动/标的资产价格的变动
 Δ 变动相对于标的资产价格变动的比率
- ◆ Θ = 期权价格的变动/距到期日剩余天数的变动
期权价格变动相对于距到期日剩余天数变动的比率
- ◆ ν = 期权价格的变动/标的资产价格波动率的变动
即期权价格变动相对于标的资产价格波动率变化的比率

■ 指标含意说明

- ◆ Delta: 期权头寸的波动与标的资产价格的变化关系。
- ◆ Gamma: Δ 的二阶微分, 是指期权头寸相对于标的期货价格的加速度或者说该头寸到期时变成实值期权的可能性。

- ◆ Theta: 是指期权头寸对于时间损耗的敏感性, 购买期权具有负的 Theta 值, 意味着你拥有一天的期权, 时间损耗都在侵蚀期权价格中的时间价值。反之卖空期权时, Theta 值是正值, 表明时间对期权空头持有者有利。
- ◆ Vega: 是指期权头寸对波动率 (IV) 的敏感性, 当标的的波动率增加时, 期权价值会增加, 因此, 波动率对期权多头持有者有利, Vega 为正, 反之空头为负值, 对空头持有者不利。
- ◆ Rho: 是指期权头寸对于利率水平的敏感性, 正的 Rho 表示对较高的利率水平对于买方头寸有利, 反之成立。

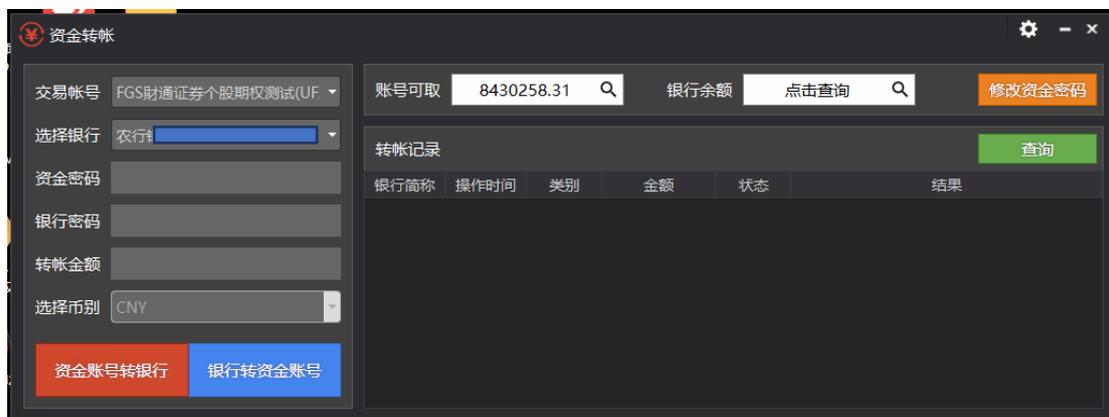
标的价格	\$Delta	1%\$Gamma	\$Theta	\$Vega
3.718 +6%	3,318.91	-880.71	7.86	-19.63
3.648 +4%	0.00	0.00	10.81	-26.98
3.577 +2%	7,780.50	-1,544.36	13.79	-34.42
3.507	10,944.17	-1,821.15	-40.59	16.26
3.437 -2%	14,547.89	-1,975.10	17.63	-44.02
3.367 -4%	0.00	0.00	0.00	0.00
3.297 -6%	21,826.40	-1,769.81	15.70	-30.42

- ✓ 价格变动是指: 标的价格变化时 greeks 值对应的合约资金的变化情况。
- ✓ 波幅变动是指: 隐波率变化百分比时 greeks 值对应的合约资金的变化情况。
- ✓ 经过多少天是指: 距离到期日时间对 greeks 值引起的资金变化情况。
- ✓ 例: 下图反映了当标的价格变动 25%, 波动率变动 2%, 经过 2 天对 greeks 值引起的资金变化情况。

标的价格	波幅	\$Delta	1%\$Gamma	\$Theta	\$Vega
3.683 +5%	-	4,193.91	-1,041.82	9.30	-23.22
	-2%	3,395.28	-988.42	7.21	-19.91
	+2%	11,403.29	-1,690.61	18.13	-41.30
3.507	-	10,944.17	-1,821.15	-40.59	16.26
	-2%	10,390.11	-1,968.47	14.36	-39.66
	+2%	0.00	0.00	0.00	0.00

资金转账

提供交易账号转账功能。



- 转账设置
 - 交易账号：选择交易账号
 - 选择银行：选择银行
 - 资金密码：输入交易账号资金密码
 - 银行密码：输入银行密码
 - 转账金额：设置转账金额
 - 币别
 - 资金账号转银行：点击按钮则将资金账号资金转出到银行账号
 - 银行转资金账号：点击按钮则将银行资金转入到资金账号
- 查询账号可取资金
- 查询银行余额：先输入密码后点击查询按钮
- 修改资金密码：输入原密码、新密码后确定即可修改资金密码
- 查询转账记录：
 - 提供当日转账记录

交易总管

交易总管主要提供交易相关功能，如资金、持仓等查询，所有委托单、挂单、成交记录等回报资料。

投资者	试算可用资金	试算动态权益	试算市值权益	未冲销权利金市值	逐笔浮动盈亏	期货平仓盈亏	期货当日盈亏	占用保证金	出金金额	能
836001708 (836001708) (权)	9,946,441.20	10,008,678.00	10,000,343.00	-8,335.00	-49,903.00	-	0.00	62,236.80	0.00	10,0
836005098 (836005098) (权)	9,998,883.00	9,998,883.00	10,000,523.00	1,640.00	528.00	-	0.00	0.00	0.00	10,0

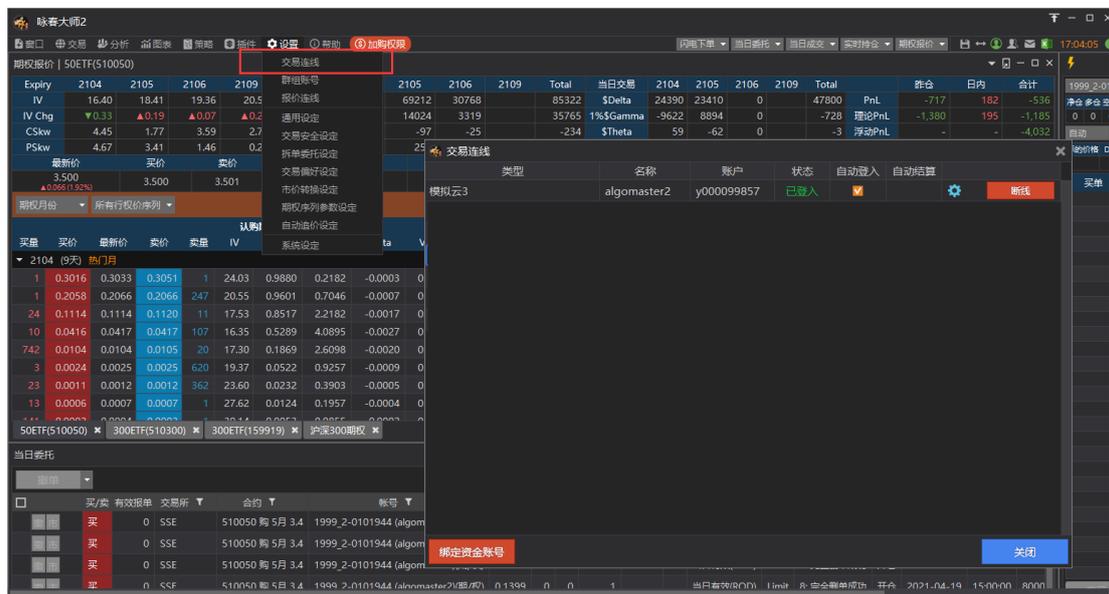
结算单	试算动态权益	试算市值权益	逐日浮动盈亏	逐笔浮动盈亏	手续费	期货平仓盈亏	期货当日盈亏	币别	重新查询
	20,007,561.00	20,000,866.00	1,150.00	-49,375.00	0.00	0.00	0.00	CNY	

投资者	合约	有效报单	买/卖	开/平	委托种类	报单价格	现价	挂单状态	成交手数	剩余手数	成交均价	报单编
836005098 (836005098) (权)	510050 2103 3.6 认购	1	卖	平仓	Limit	0.0049	0	3: 全部成交	1	0	0.00490	48
836005098 (836005098) (权)	510050 2103 3.6 认购	1	卖	平仓	Limit	0.0049	0	3: 全部成交	1	0	0.00490	47
836005098 (836005098) (权)	510050 2103 3.6 认购	1	卖	平仓	Limit	0.0049	0	3: 全部成交	1	0	0.00490	46
836005098 (836005098) (权)	510050 2103 3.6 认购	1	卖	平仓	Limit	0.0049	0	3: 全部成交	1	0	0.00490	45
836005098 (836005098) (权)	510050 2103 3.6 认购	1	卖	平仓	Limit	0.0049	0	3: 全部成交	1	0	0.00490	44
836005098 (836005098) (权)	510050 2103 3.6 认购	1	买	开仓	Limit	0.0058	0	3: 全部成交	1	0	0.00580	43
836005098 (836005098) (权)	510050 2103 3.6 认购	1	买	开仓	Limit	0.0058	0	3: 全部成交	1	0	0.00580	42

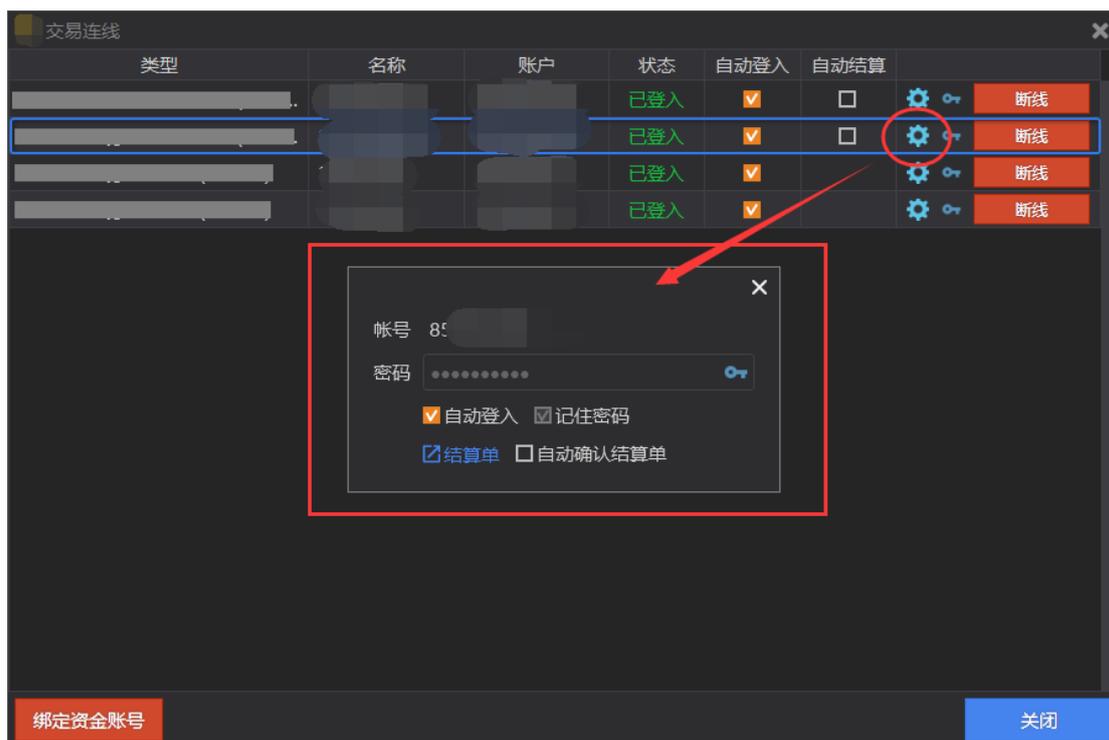
交易总管功能与咏春插件的交易模块功能一致，可参考“咏春”插件章节说明。

设置

交易连线



- 交易连线列表
 - ◆ 显示当前已绑定交易账号列表：账号类型、账号名称、账号、状态
 - ◆ 管控交易账号的登入、登出、结算单查询、修改密码等
- 自动登入
 - ◆ 勾选后，当程序登录会员账号后，会自动登录该交易账号。
- 自动结算
 - ◆ 勾选后，交易账号登录时会自动确认结算单
- 设置
 - ◆ 点击设置  按钮，已登入的账号可以查询结算单、勾选自动确认结算单和修改密码。



- 删除账号
 - ◆ 账号未登入状态下，点击按钮，将该资金账号从会员账号下删除绑定。
- 连线/断线
 - ◆ 点击连线、断线按钮，将交易账号登入或登出。
- 绑定资金账号
 - ◆ 点击按钮可绑定新的交易账号。

群组帐号

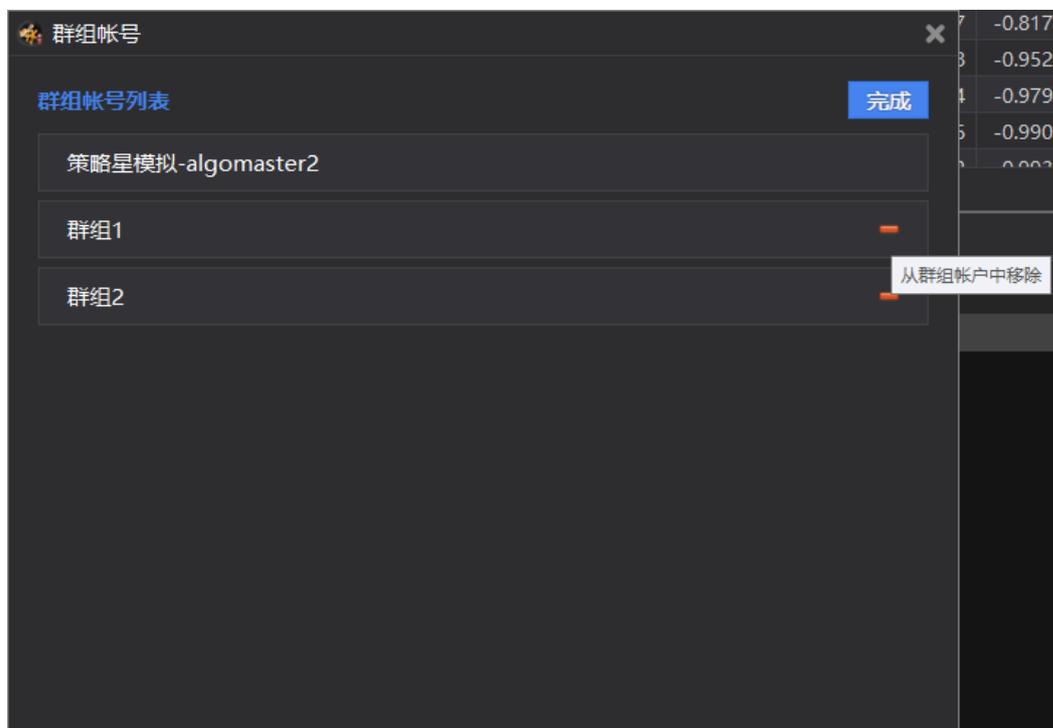
对多个资金账户进行状态有效的分组勾选，可以将用户设置为群组账号

- 新增群组账号：
 - 注意：各账号可交易合约与可使用单别有所不同，请确认建立群组的各交易账号具有相同交易权限。
 - 按“确定”后，新增群组出现在列表中。



● 群组帐号列表

- 从列表点击群组账号名称，进入设定
- 点击“编辑”后，出现  按钮，可将群组账号从列表中移除。



群组帐户设定

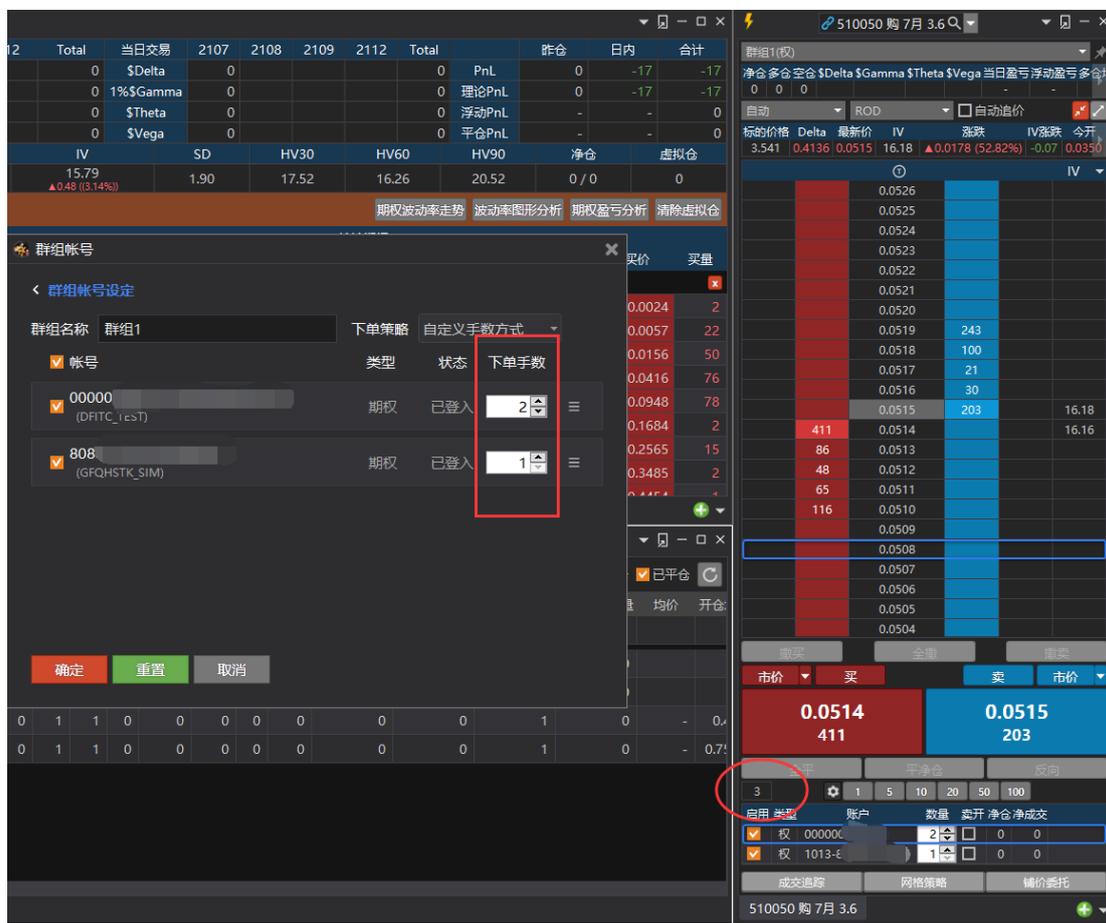
设置账户是否参与下单、设置该群组的下单策略

- 设定群组名称
- 勾选参与群组下单的账号
- 指定下单策略。不同下单策略，单账号对应不同设置内容：
 - 自定义手数方式
 - ◆ 设置“下单手数”
 - ◆ 可以拖曳调整下单账号顺序
 - 基数乘数方式
 - ◆ 设置“下单乘数”
 - ◆ 可以拖曳调整下单账号顺序
 - 总数分配按可用资金比
 - ◆ 不设置数量，依资金比例计算下单数量
 - ◆ 不设置下单账号顺序，依资金比例由大到小送出
 - 总数分配按设定参数
 - ◆ 设置“下单参数”，依设定参数计算下单数量
 - ◆ 下单顺序可设定：
 - 依可用资金比由大到小
 - 手动调整顺序：拖曳调整下单账号顺序



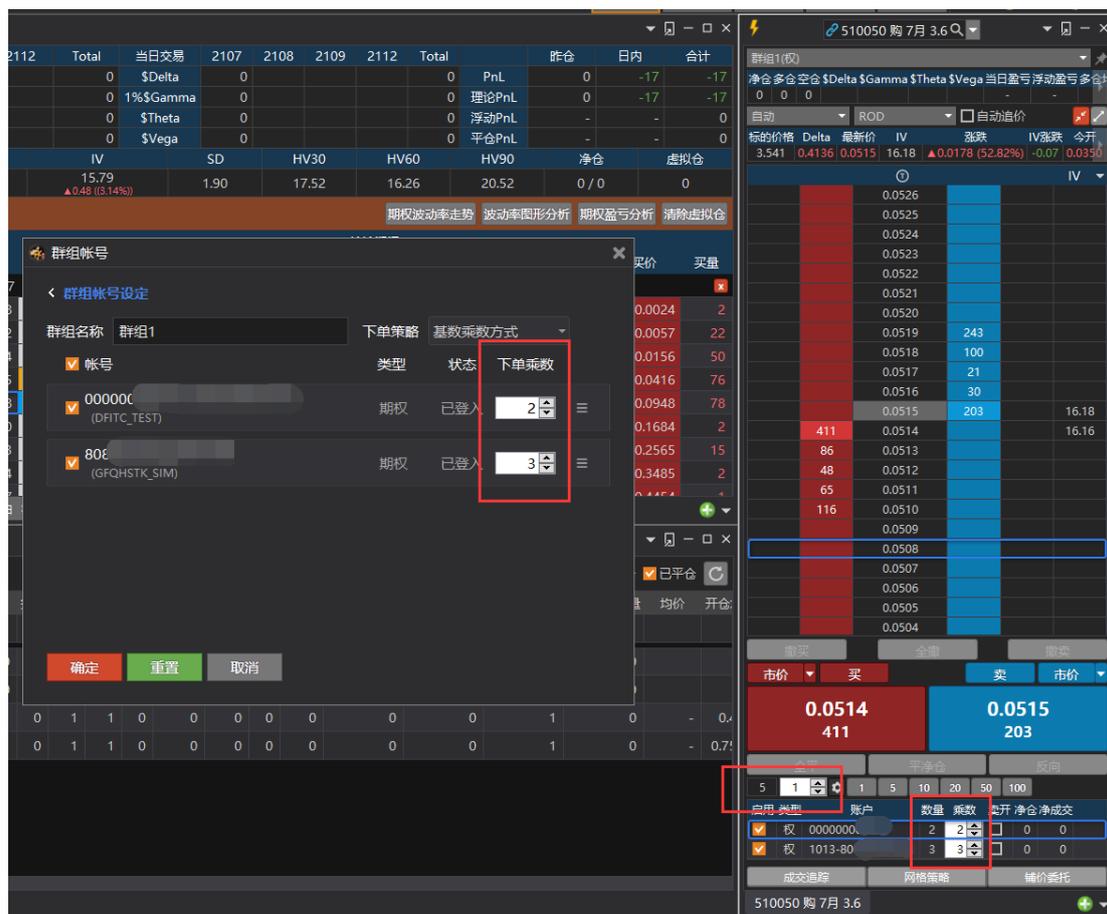
下单策略

自定义手数方式



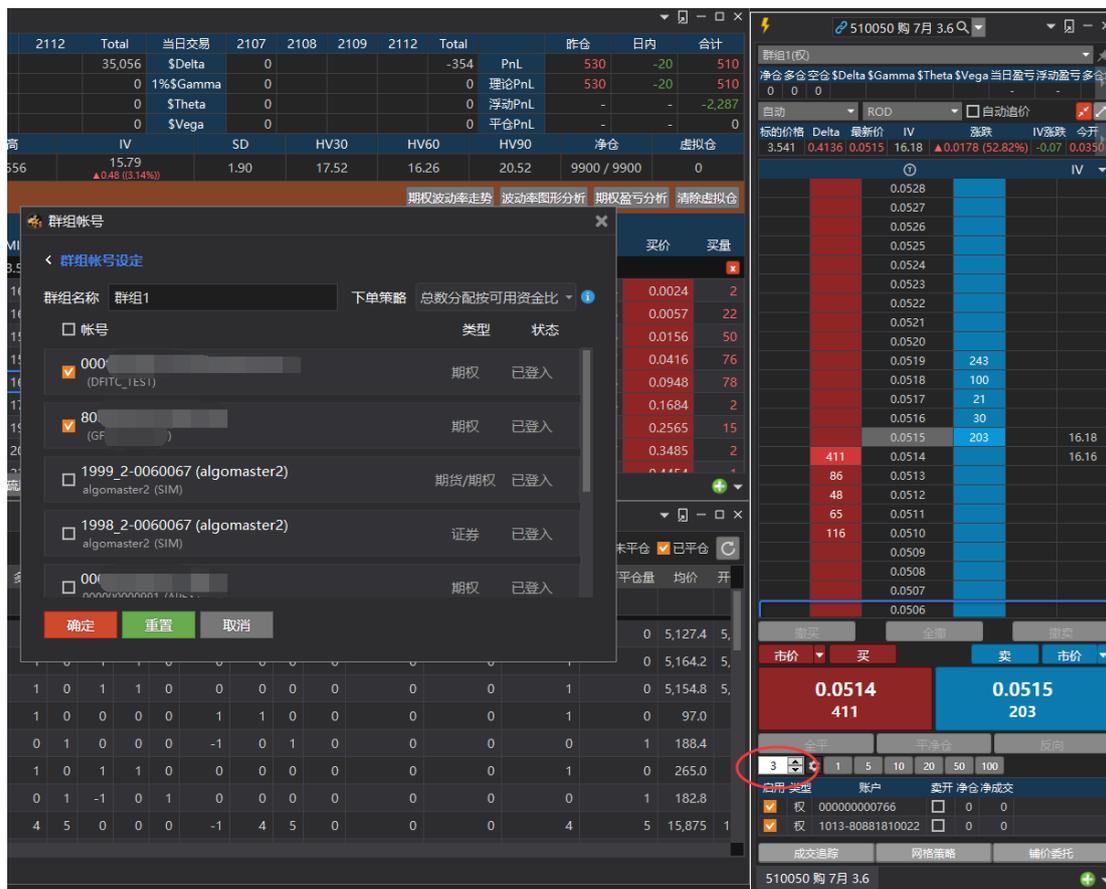
- 闪电下单选取群组账号，下方显示账号列表
 - 预设数量为群组账号设定中自定义下单手数
 - 总下单手数为群组中各账号的下单手数加总
 - 可调整各账号的下单数量，总手数随着变化。

基数乘数方式



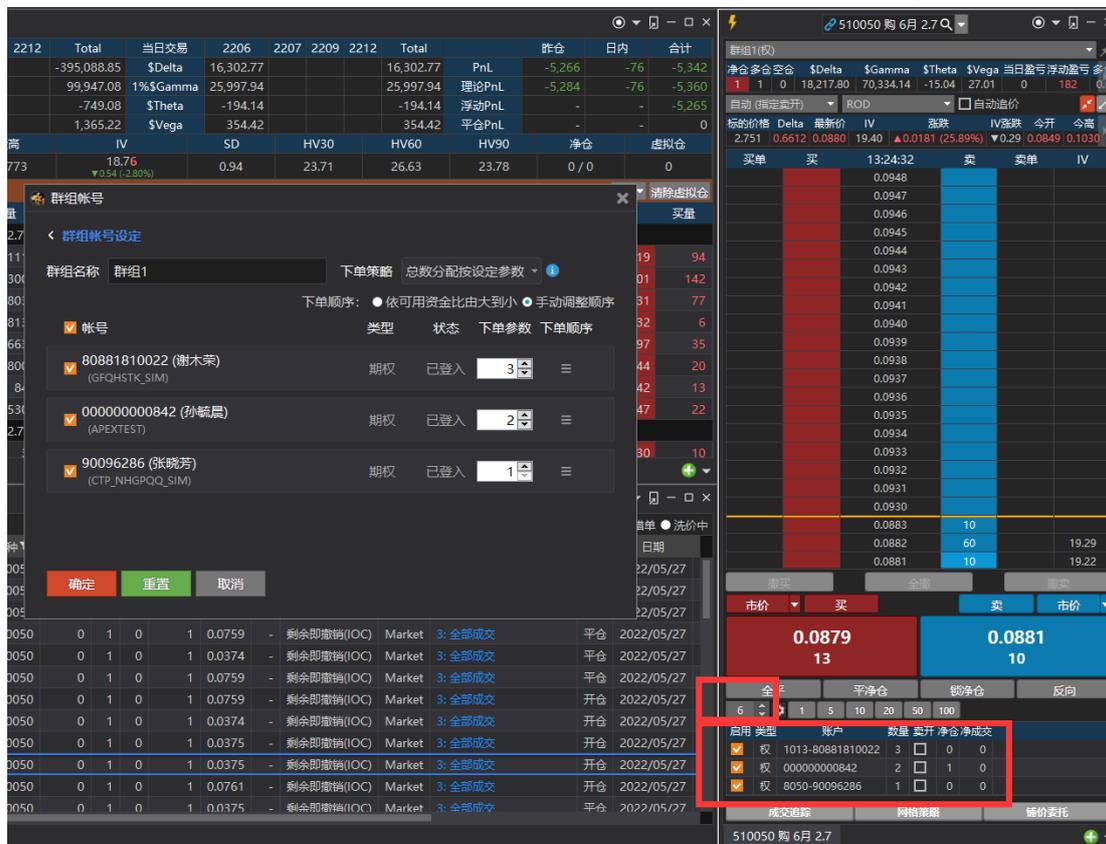
- 闪电下单，每个账号的下单数量 = 下单板手数 * 设置的下单乘数
[如上图，下单板手数设置为 1，下单乘数分别为 2、3，下单数量为 2、3]
- 闪电下单显示数量
 - 账号列表显示“乘数”设定
 - ◆ 从群组账号设定取默认值
 - ◆ 可调整各账号下单乘数，各账号下单数量以及总下单手数随着变化
 - 下单板数量设置
 - ◆ 显示 **总下单手数**（不可手动调整）
 - ◆ 下单板设置数量，各账号的下单数量=下单板数量*乘数
 - ◆ 总下单手数 = 各账号下单数量加总

总数分配按可用资金比



- 下单板输入的手数为下单总数，每个账户的下单手数=下单总数* (每个账户可用资金/各个账号可用资金之和)
- 群组内资金账号委托顺序依比例由大到小依序送出

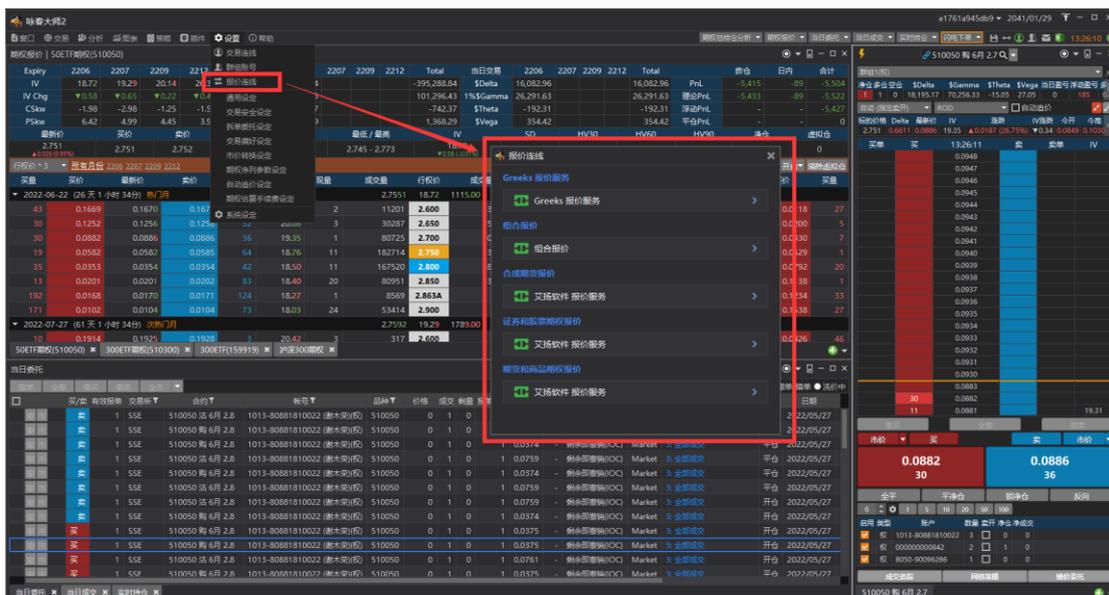
总数分配按设定参数



- 下单板输入的手数为下单总数，每个账户的下单手数=下单总数*（每个账户设置的下单参数/各个账号设置参数之和）
- 群组内资金账号委托顺序可设定：
 - 依可用资金比例由大到小依序送出。
 - 依手动调整顺序

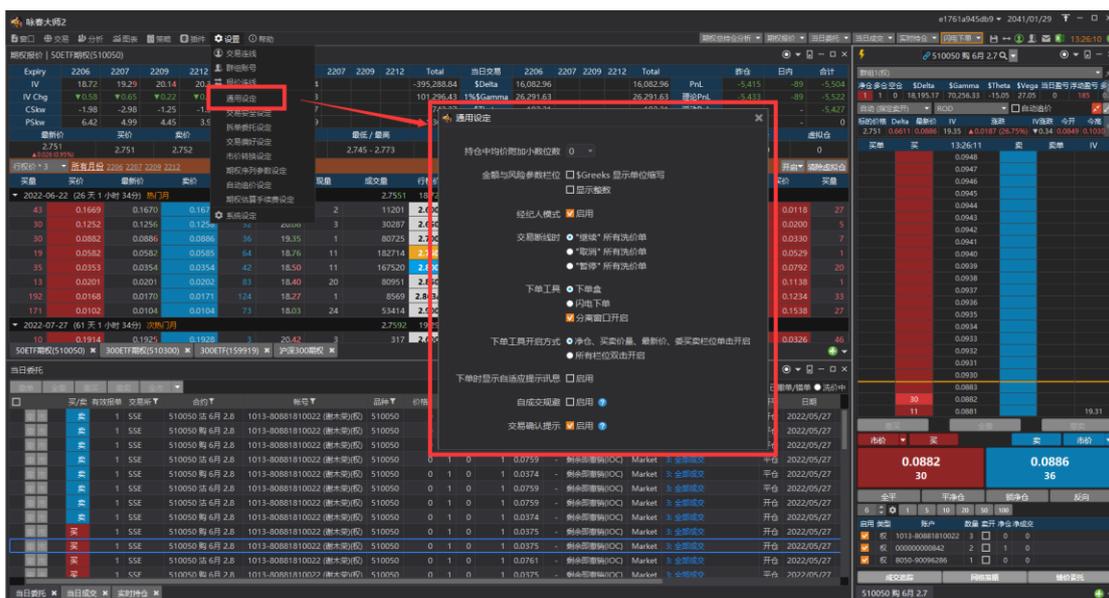
报价连线

显示当前报价连线状态。



通用设定

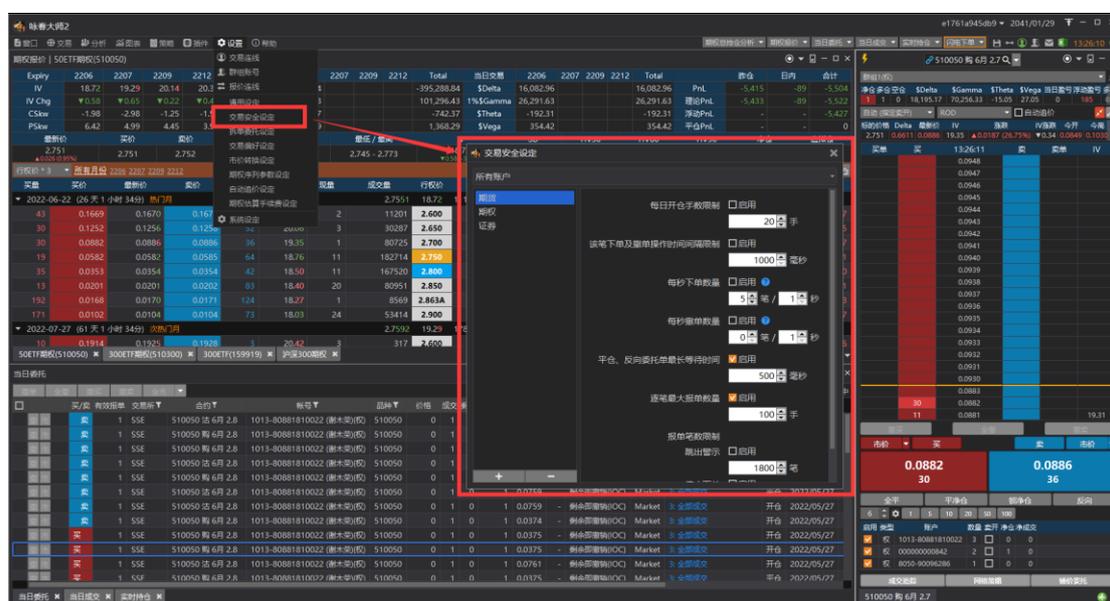
对所有交易账号有效:



- 持仓均价附加小数位数: 0 表示不附加小数位数, 1 表示附加 1 位小数位数。
- 金额与风险参数栏位:
 - ◆ \$Greeks 显示单位缩写: 影响\$Greeks 以及盈亏栏位, 数值超过 10 万则以“万”单位缩写显示。
 - ◆ 显示整数: 影响\$Greeks 以及盈亏栏位, 数值显示整数。
- 经纪人模式:
 - ◆ 启动经纪人模式, 客户端不主动查询持仓明细资料, 避免查询资料量过多时软件运行拖慢。

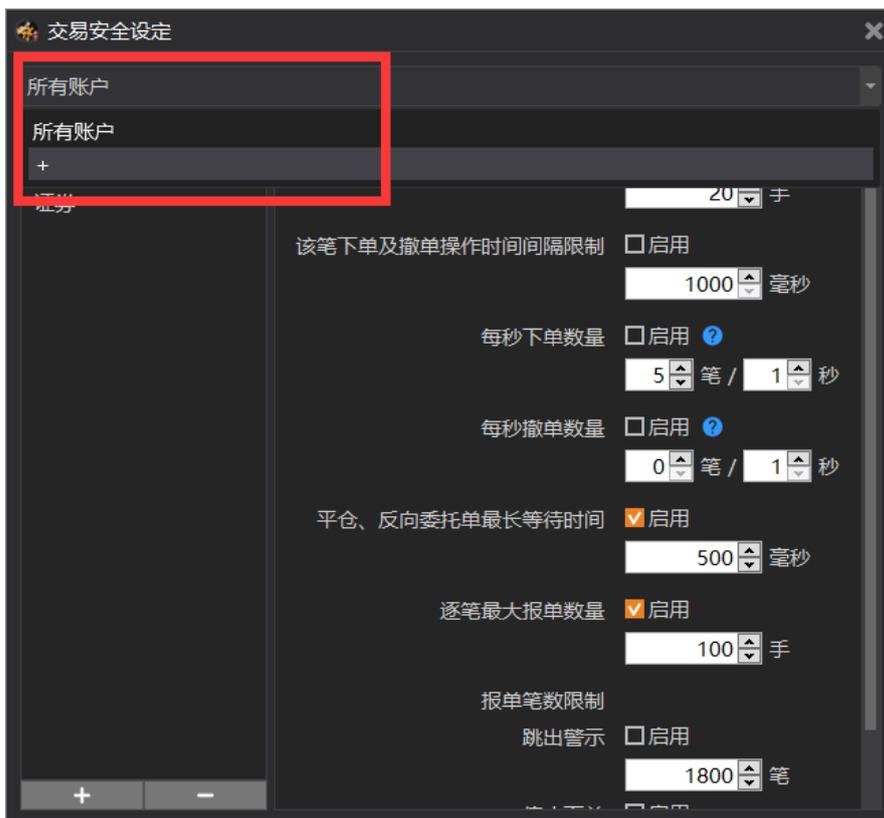
- 洗价单设定:
 - ◆ 当交易断线时, 客户端本地的洗价单可以设定继续洗价、暂停或取消。
- 下单工具
 - ◆ 设定预设开启的下单工具为“下单盒”或“闪电下单”
 - ◆ 设定是否用分离窗口开启下单工具
- 下单工具开启方式
 - ◆ 净仓、买卖价量、最新价、委买卖栏位单击开启
 - ◆ 所有栏位双击开启
- 下单时显示自适应提示讯息: 启用后, 批量下单功能会弹出自适应提示讯息。
- 自成交规避: 启用后, 委托时若有自成交可能, 返回错误报单。
- 交易确认提示: 启用后, 全平、平净仓、反向操作时, 显示确认窗口。

交易安全设定

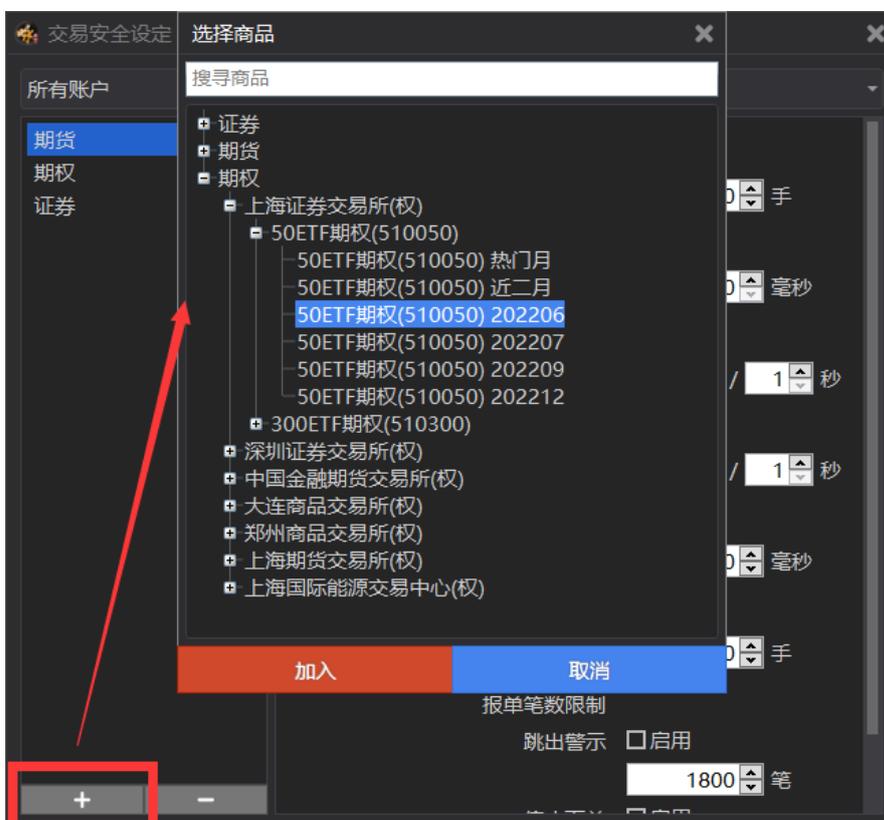


交易安全设定提供下单时的限制项目, 启动限制后, 下单时如果超过设定上限则会下单失败或者延迟送出申请:

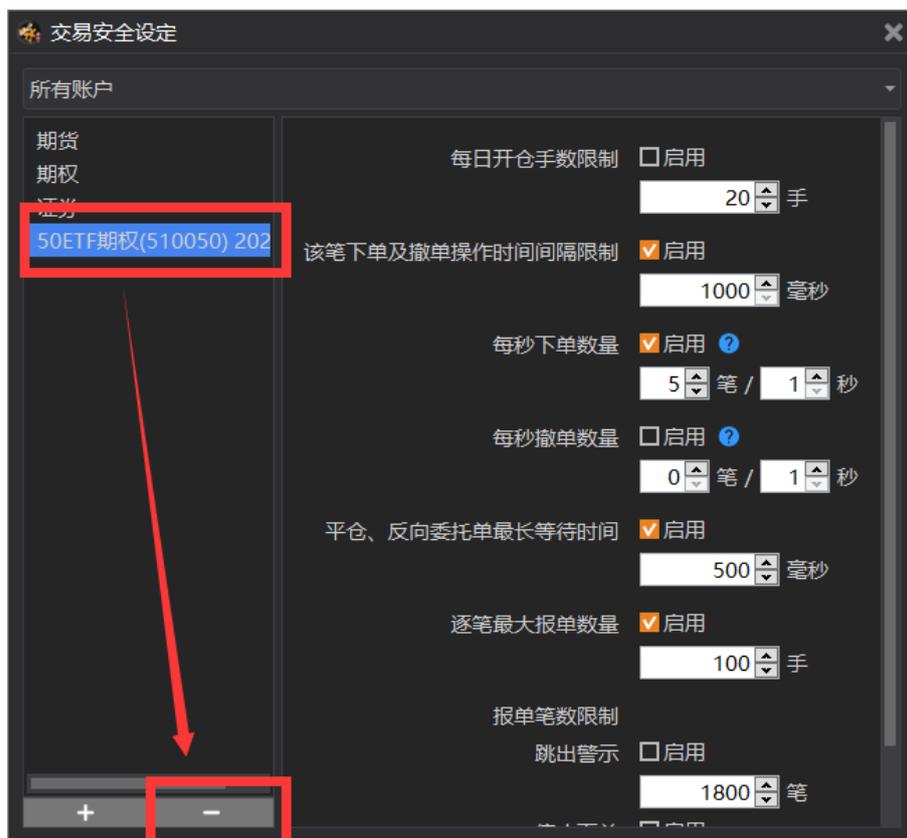
- ◆ 每日开仓手数限制
- ◆ 该笔下单及撤单操作间隔时间限制
- ◆ 每秒下单数量
- ◆ 每秒撤单数量
- ◆ 平仓、反向委托单最长等待时间
- ◆ 逐笔最大报单数量
- ◆ 报单笔数限制
 - 跳出警示
 - 禁止下单
- 设置账号范围
 - ◆ 交易安全设定预设套用于所有账号, 可以通过+按钮新增要管控的交易账号。



- 设置商品范围：
 - ◆ 交易安全设置预设管控 3 种类型商品：期货、期权、证券

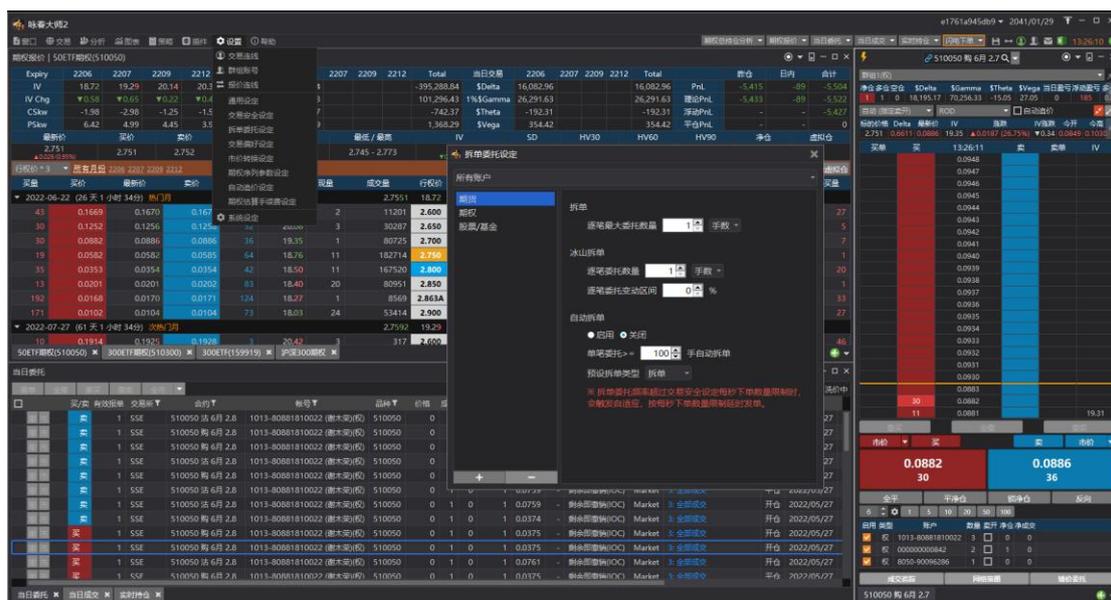


- ◆ 可以通过 + 按钮新增商品，在选择商品窗口中选取要管控的商品范围



◆ 加入后的商品可以通过 - 按钮移除。

拆单委托设定

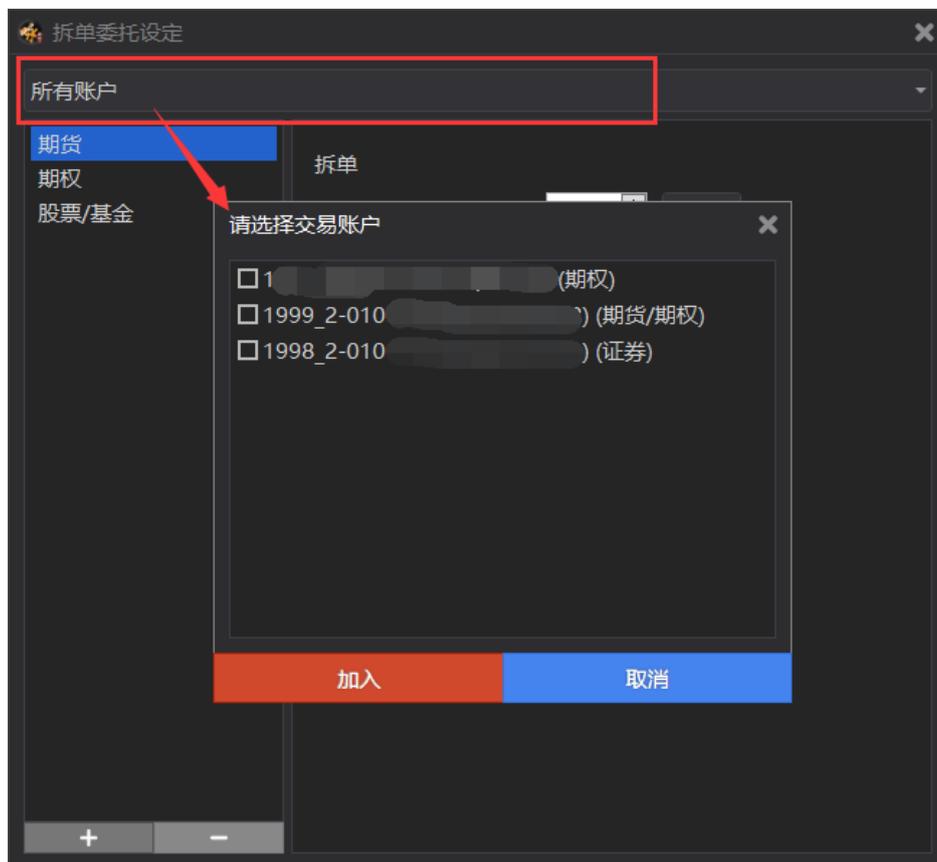


提供拆单、冰山拆单、自动拆单功能

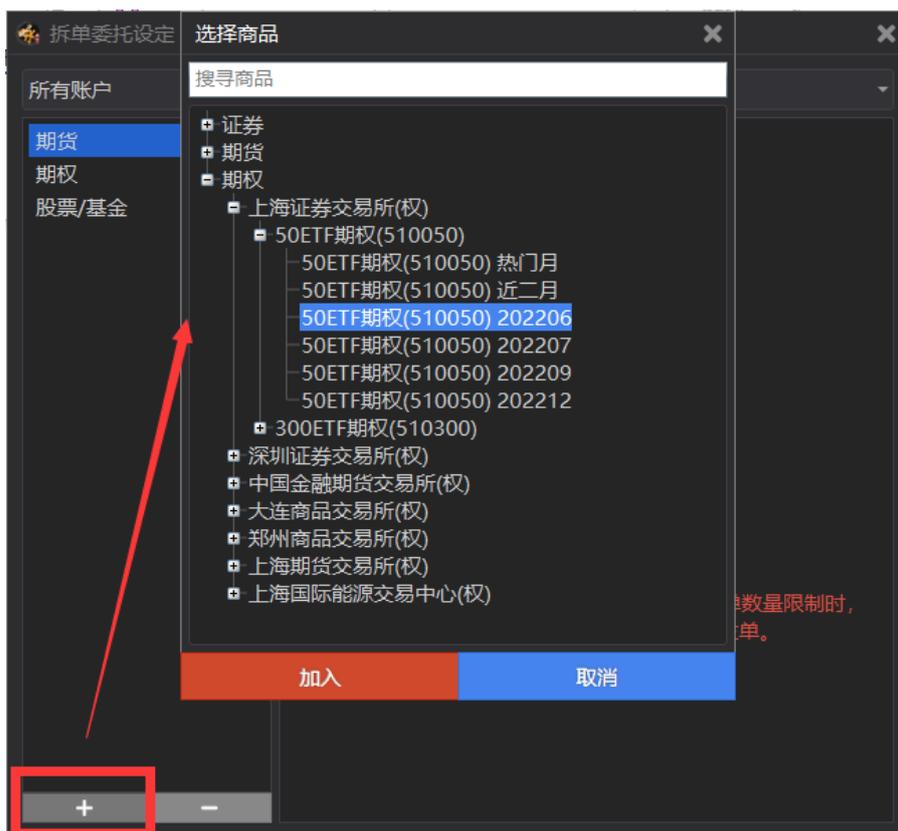
- 拆单：设定逐笔最大委托数量。启用拆单下单时数量如果超过逐笔最大委托

数量数量则按设定数量拆分下单。

- 冰山拆单：设定逐笔委托数量，和逐笔委托变动区间。计算出逐笔委托数量的上限和下限。启用冰山拆单下单时，数量如果超过逐笔委托数量则按照区间内随机数量拆分下单。
- 自动拆单：可以启用或关闭自动拆单。启用自动拆单时，单笔委托超过设定数量则自动拆单，预设拆单类型可选：拆单、冰山拆单、定时拆单。
- 设置账号范围



- ◆ 交易安全设定预设套用于所有账号，可以通过+按钮新增要管控的交易账号。
- 设置商品范围：
 - ◆ 拆单委托设定预设分 3 种类型：期货、期权、股票/基金

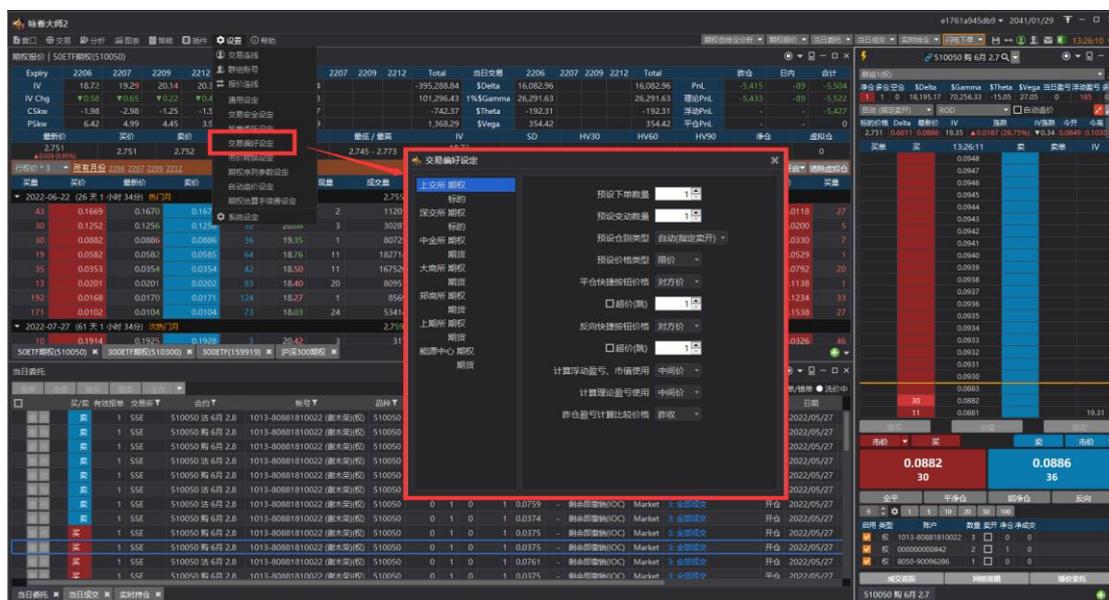


◆ 可以通过 + 按钮新增商品，在选择商品窗口中选取商品范围



◆ 加入后的商品可以通过 - 按钮移除。

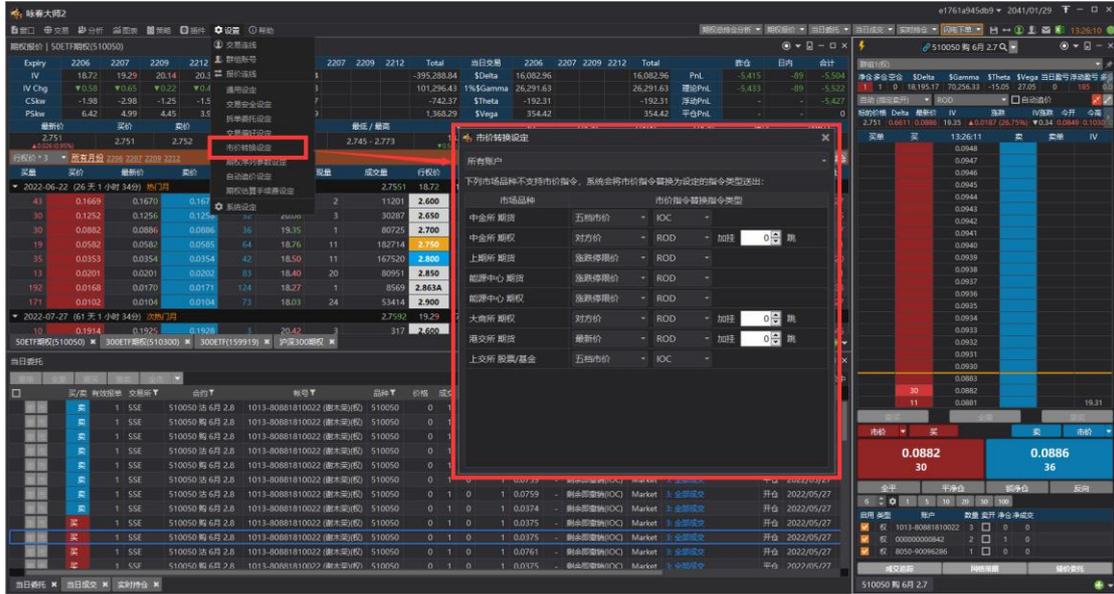
交易偏好设定



设定不同交易所商品的盈亏市值参考价格、下单数量、价格类型等。

- 预设下单数量
- 预设变动数量
- 预设仓别类型：自动(指定卖开)、自动
- 预设价格类型：限价、本方价、对方价、最新价
- 平仓快捷按钮价格：对方价、最新价、本方价；勾选超价跳数
- 反向快捷按钮价格：对方价、最新价、本方价；勾选超价跳数
- 计算浮动盈亏、市值使用：最新价、中间价
- 计算理论盈亏使用价格：中间价、 $(10 \times \text{买一价} + 10 \times \text{卖一价} + \text{最新价}) / 21$ 、 $(\text{买一价} + \text{卖一价} + \text{最新价}) / 3$ 、理论价、最新价、对手价，预设为“中间价”
- 昨仓盈亏计算比较价格：昨收、昨结

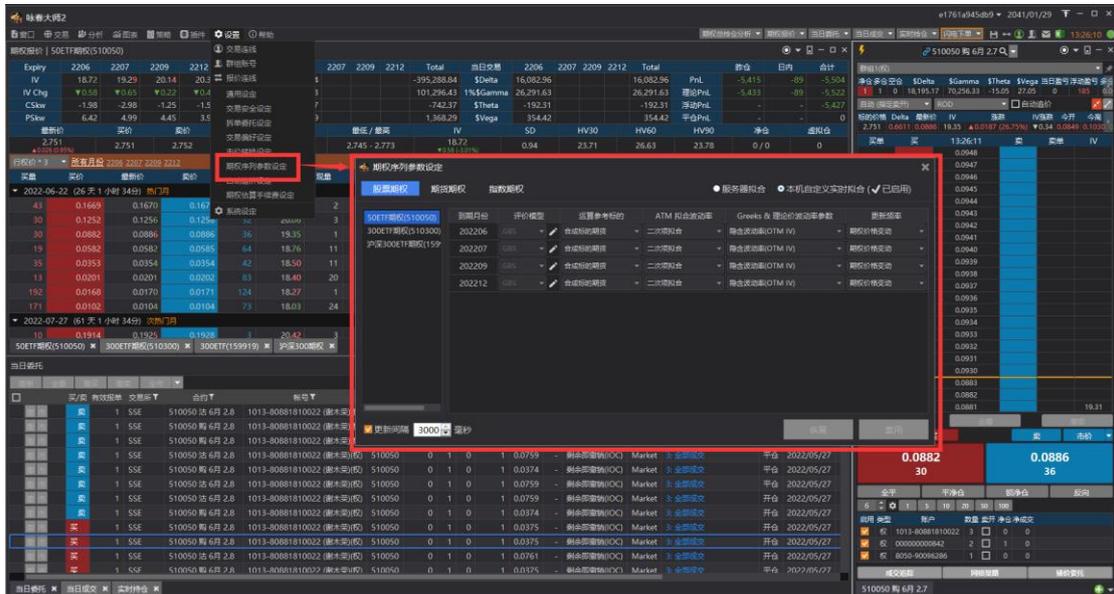
市价转换设定



对于不支持市价指令的市场品种，可以设定市价转换类型，将市价指令替换为设定的指令类型送出。

- 设定账号范围：默认为所有账号。按 + 按钮添加账号
- 设定价格类型
- 设定有效期
- 设定加挂跳数

期权序列参数设定



期权序列参数设定提供服务器拟合和本机自定义实时拟合两种方式

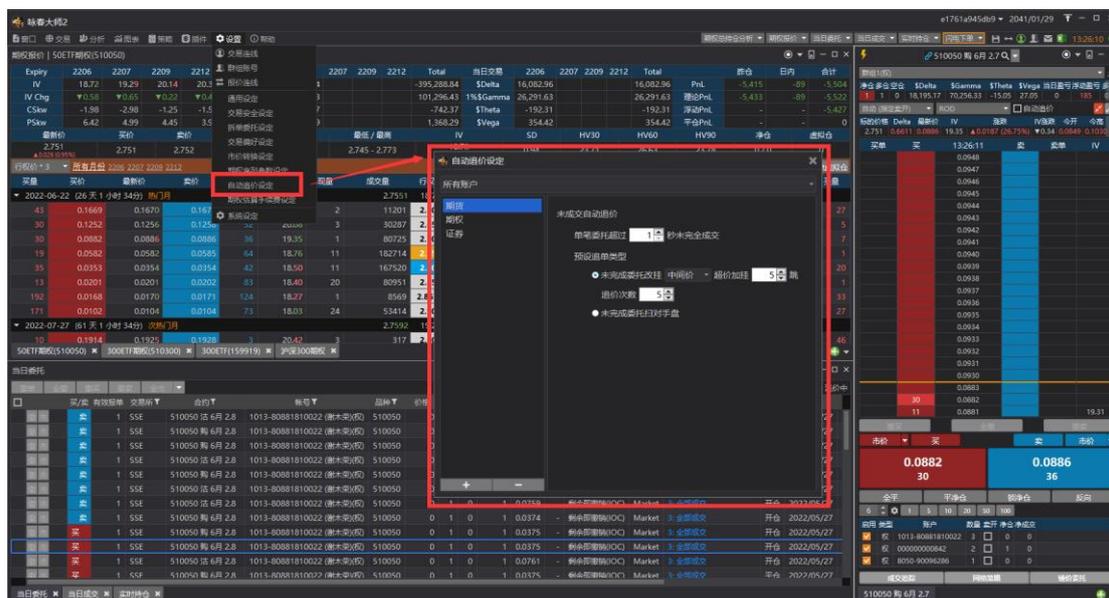
- 使用服务器拟合，期权序列参数设定不可调整。
- 使用本机自定义实时拟合，期权序列参数设定可调整。

参数设定说明：

期权序列评价参数设定可以按照各个期权品种，不同的到期月份序列，设定评价参数。

- 分类
 - 股票期权
 - 期货期权
 - 指数期权
- 评价模型：
 - GBS: 使用 Black Scholes 期权定价模型
 - 日期类型：使用交易日、日历日、自定义(年交易日天数)计算时间参数
 - 利率：可输入自定义利率值，预设 0
 - 交易时间抵扣：
 - ◆ 当日交易时间抵扣：设定百分比，依设定比例调整当日剩余时间
 - ◆ 周末交易时间抵扣：设定百分比，单位：周末数
 - ◆ 长假交易时间抵扣：设定百分比，单位：天
 - ◆ 例：当日交易时间抵扣 25%，周末交易时间抵扣 10%，长假交易时间抵扣 30%，则对于特定月份：
 - 剩余到期日 $t = \text{实际剩余交易日} + \text{到期前剩余周末数} \times 0.1 + \text{到期前剩余长假天数} \times 0.3$
 - 总交易日 $T = \text{实际年交易日} + 52 \times 0.1 + \text{平均每年长假天数} \times 0.3$
- 运算参考标的
 - 合约原生标的
 - 交易所&合成标的期货
 - 合成标的期货
- ATM 拟合波动率
 - 行权价
 - Delta
 - 二次项拟合
- Greeks & 理论价波动率参数
 - 隐含波动率(OTM IV)
 - ATM 拟合波动率(ATM Vol.)
 - 仅 Greeks 使用 OTM IV：理论价使用 ATM Vol.
- 更新频率
 - 期权价格变动
 - 参考标的价格变动
- 更新间隔时间：
 - 勾选启用，则按照设定的间隔时间计算和刷新波动率以及希腊字母数据

自动追价设定



提供自动追价设定，可设定未成交自动追价。

(注：自动追价仅适用闪电下单，需要在闪电下单中勾选“自动追价”才启用。)

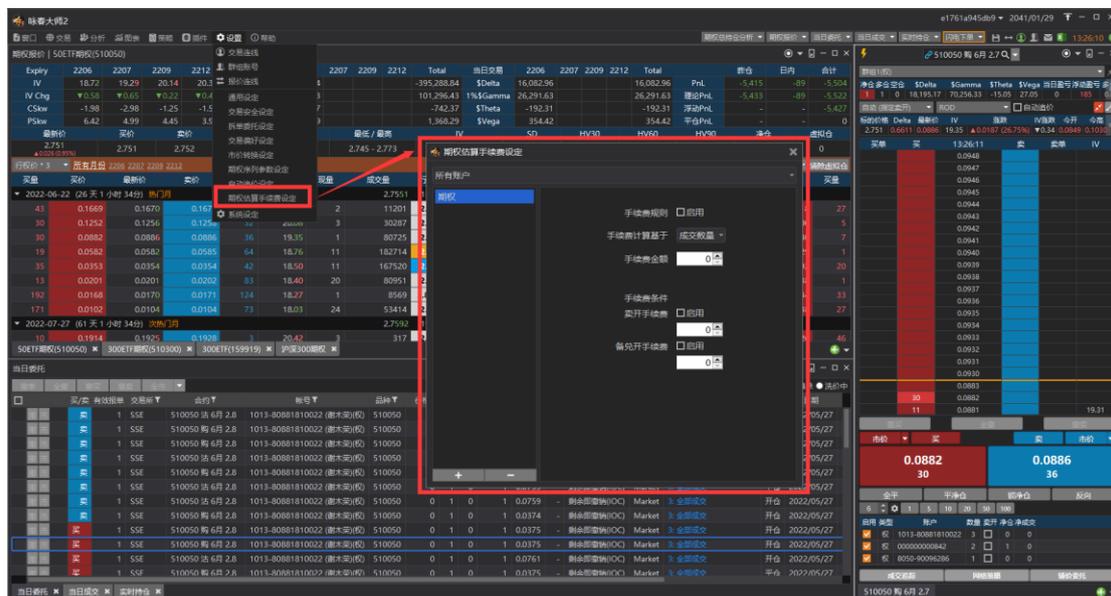
- 未成交时间间隔：
 - 当单笔委托超过设定秒数未完全成交时，自动追价
- 预设追单类型
 - 未完成委托改挂：[中间价、本方价、对方价]
 - 超价加挂跳数
 - 追价次数
- 未完成委托扫对手盘

举例：

图例中设定：单笔委托超过 1 秒未完全成交，预设追单类型：未完成委托改挂中间价超价加挂 5 跳，追价次数 5 次。

则使用闪电下单勾选“自动追价”，当闪电委托单超过 1 秒未完全成交时，会自动将原委托删掉，以合约最新的中间价加挂 5 跳的价格重新委托，第一次追价 1 秒后，若已成交则不继续追价，若仍未成交，继续第二次追价，第二次追价价格为合约当前最新的中间价加挂 5 跳。依次类推，直到追价次数用尽不继续追价。

期权估算手续费设定

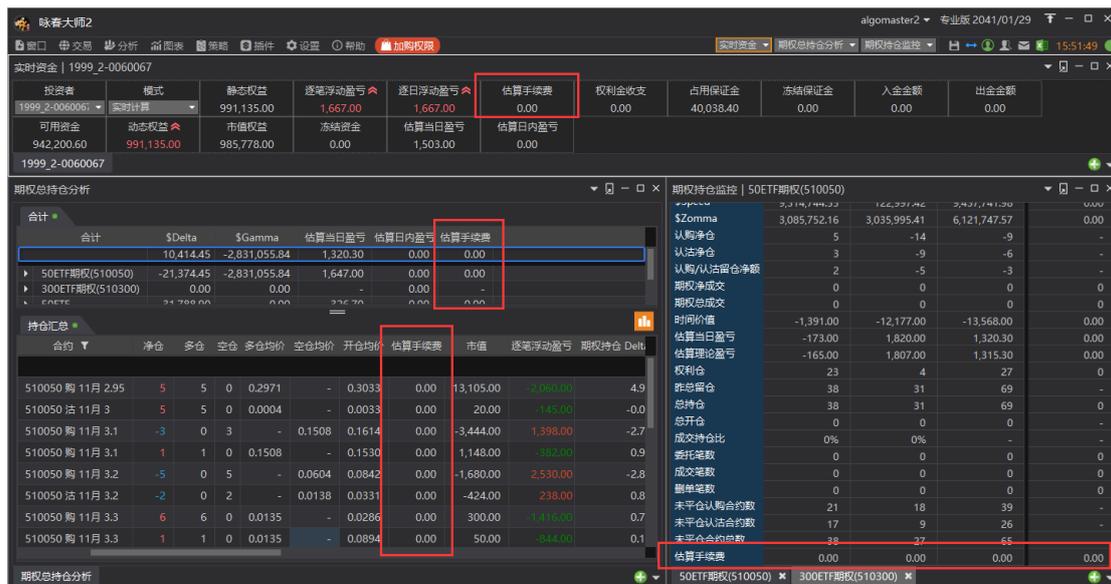


期权品种估算手续费功能，提供以下设定：

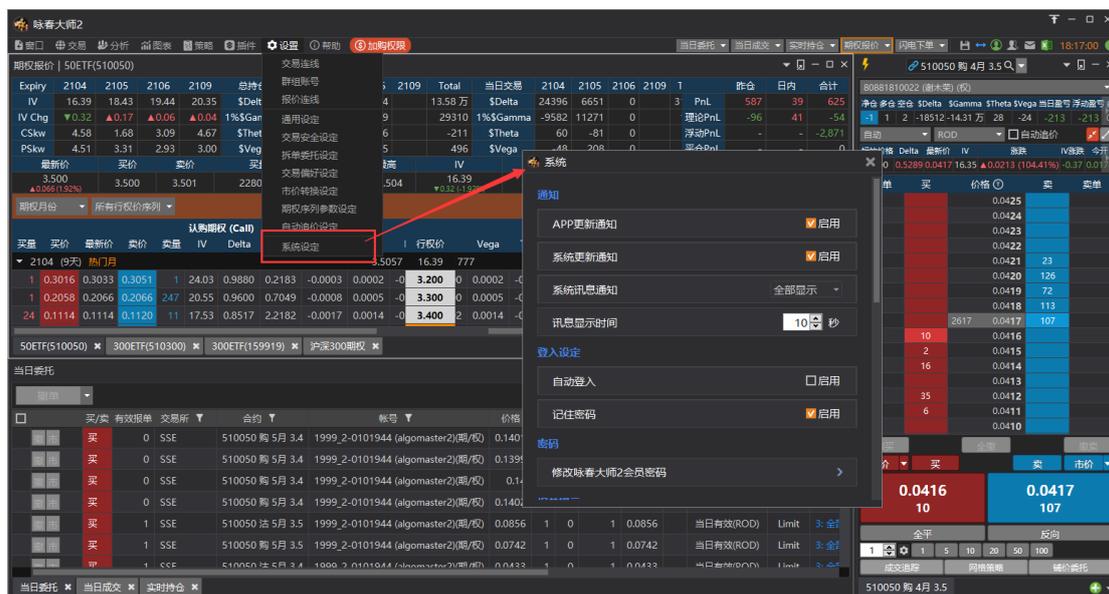
- 手续费规则：
 - 手续费计算基于成交数量
 - 手续费金额可设定每手手续费金额
- 手续费条件：
 - 针对卖开、备兑开仓的成交数量可以单独设定手续费

计算公式为：估算手续费 = \sum ((今买成 + 今卖平) * 手续费金额) + \sum (今卖开 * 卖开手续费) + \sum (今备兑开 * 备兑开手续费)

估算手续费数据显示在实时资金、期权总持仓分析、期权持仓监控中：



系统设定



系统设定下可以设置系统通知、登入设定、会员密码、报单提示、其他安全保护设置。

- 通知：
 - 可以设定 APP 的更新通知、系统更新通知、系统讯息通知、讯息显示时间。
- 登入设定：
 - 设定会员账号是否自动登录、记住密码
- 密码：
 - 修改会员账号密码
- 报单提示：
 - 完全成交、报单成功、报单失败提供音效提示和讯息提示，
 - 部分成交、报单超时无应答、市价单超时未成交提供讯息提示。
- 其他：
 - 可以选择是否自动更新 APP、清除缓存资料、清除使用者资料、避免系统进入休眠、避免进入荧幕保护、系统闲置等候时间和锁定系统、侦测交易连线异常自动断线重连。

帮助

在帮助菜单，提供操作手册、官网等

- 操作手册
- AlgoStars*策略星 官网
- 策略星学院
- 远程桌面助手
- 导出日志：
 - 将必要的日志档案导出保存在桌面，可提供给客服以便查看问题。
- 问题回报：
 - 提交问题，并传送日志。
- 帮助：
 - 查看软件版本信息、版权信息。