

# ATP 交易系统

## V4.0

# 使用说明书

(客户端版)

ATPlatform Technology Limited

2017 年 5 月 11 日

## 目录

系统入门.....	5
1.1 登陆 .....	5
1.2 注销 .....	5
1.3 退出 .....	5
1.4 修改密码 .....	5
1.5 系统界面 .....	6
资金栏.....	7
2.1 账户信息 .....	7
2.2 切换账户 .....	8
2.3 资金显示 .....	8
报价区.....	9
3.1 报价区显示 .....	9
3.2 合约组管理 .....	9
3.2.1 合约添加/删除/调整顺序 .....	10
3.2.2 合约组添加/删除/重命名 .....	10
3.3 切换报价档数 .....	10
3.4 切换合约组 .....	10
3.5 多视图报价 .....	10
3.6 二十档报价 .....	10
3.7 合约报价区 .....	11
合约区.....	11
4.1 合约区展示 .....	11
4.2 添加合约到报价区 .....	12
4.3 合约表设置 .....	12
策略区.....	13
5.1 策略展示 .....	13
5.2 策略添加\修改\删除\调整顺序 .....	13
5.3 策略单模式 .....	14
5.4 快速下单 .....	15
5.5 多视图策略 .....	15
下单区.....	16
6.1 限价单 .....	16
6.2 市价单 .....	16
6.3 市价止损单 .....	17
6.4 限价止损单 .....	17

6.5 Iceberg 单.....	18
6.6 策略单 .....	19
6.7 Stop 单 .....	20
6.8 Gain Best 单 .....	20
6.9 止盈止损单 .....	21
6.10 快速下单 .....	22
6.11 批量下单 .....	23
挂单区.....	24
7.1 挂单区展示 .....	24
7.2 普通单 .....	24
7.3 自动单 .....	25
7.4 所有挂单区 .....	26
自动单区.....	27
成交单区.....	28
9.1 明细 .....	28
9.2 按单 .....	28
9.3 合并 .....	28
9.4 锁定滚动条 .....	29
持仓区.....	30
经纪行持仓.....	31
日志区.....	32
状态栏.....	33
菜单.....	33
14.1 窗口 .....	33
14.2 帮助 .....	33
系统设置.....	34
15.1 默认选项 .....	34
15.2 声音设置 .....	35
15.2.1 系统默认 .....	35
15.2.2 用户自定义 .....	36
15.3 快捷键 .....	36
15.4 字体设置 .....	38
界面布局.....	39
16.1 布局展示 .....	39
16.2 改变布局 .....	40
16.3 界面管理 .....	41
16.3.1 新建布局 .....	41
16.3.2 重置布局 .....	41

16.3.3 切换布局 .....	41
16.3.4 删除布局 .....	42

# 系统入门

## 1.1 登陆



- 选择**系统语言**。(注：切换语言后登陆框将重新打开)
- 输入**用户名**、**密码**。
- **新密码**：勾选密码框旁边的方框，支持登录时修改密码
- 点击**登陆**，进入系统。

## 1.2 注销

- 点击菜单**系统->注销**。
- 弹出确认框，点击**确定**，系统返回登录界面

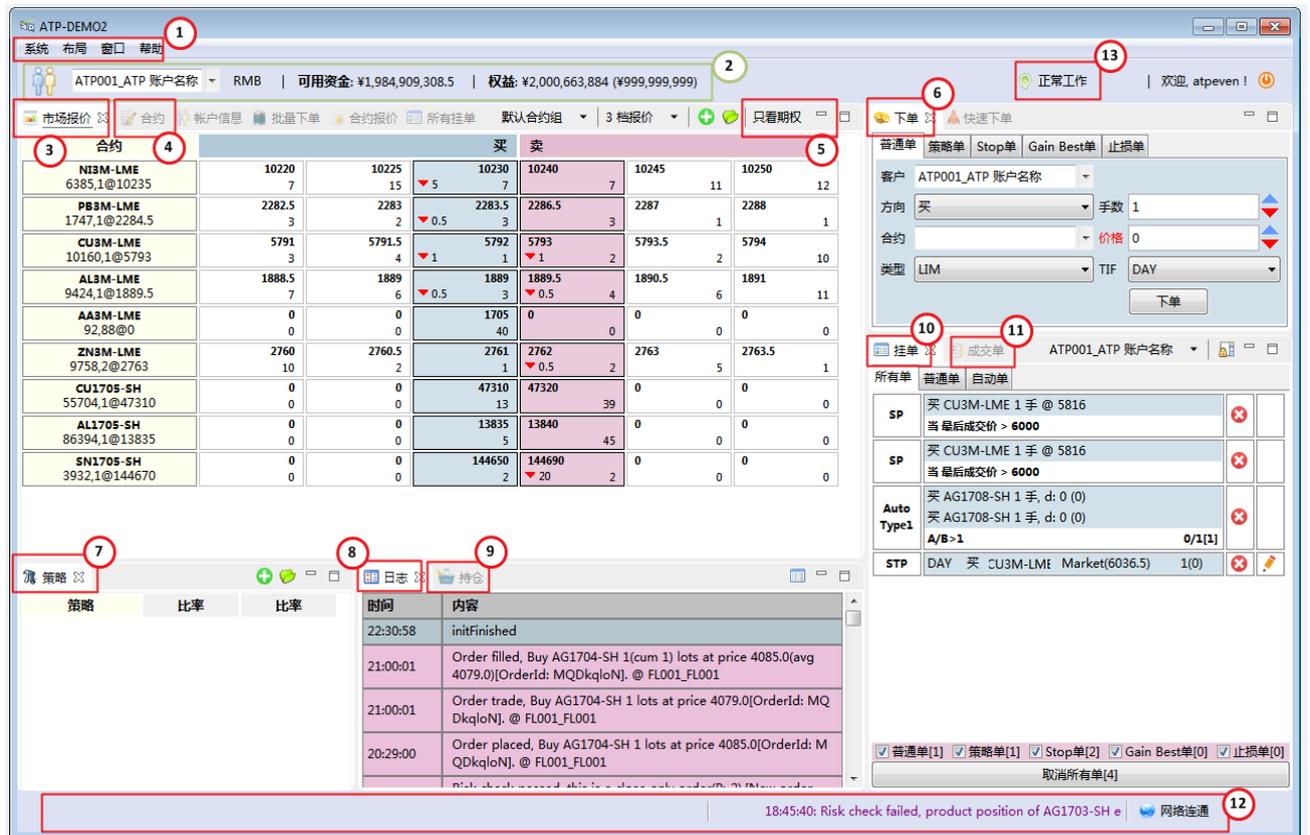
## 1.3 退出

- 点击菜单**系统->退出**。
- 弹出确认框，点击**确定**，系统关闭。(注：可在确认框中选择下次不再弹出)

## 1.4 修改密码

- 点击菜单**系统->设置**。
- 弹出选项对话框，切换到**登录设置**页面。
- 分别输入**新旧密码**。
- 点击**确认**，修改成功。

## 1.5 系统界面



上图是交易系统的主界面，交易过程涉及到的操作都在这里进行，该界面主要分为 13 块区域：

- ①菜单栏：系统各类设置入口。
- ②资金栏：展示当前客户名称、其对应的可用资金、权益。
- ③报价区：展示用户添加合约的多档买卖价格和 1 档动态。
- ④合约区：展示合约的详细信息。
- ⑤只看期权：支持期权合约 T 型报价模式。
- ⑥下单板：创建交易单。
- ⑦策略区：展示策略以及策略实时计算结果。
- ⑧日志区：展示用户的操作日志和服务器端反馈的日志。
- ⑨持仓区：展示用户的持仓。
- ⑩挂单区：展示普通单与自动单，并支持单的修改、撤销操作。
- ⑪成交单区：展示已成单。
- ⑫状态栏：展示通告信息、错误日志、网络状况。
- ⑬工作状态：当系统与经纪行连接出错或自动单可能出现缺腿时，*工作状态*处会进行报错，提醒用户及时解决相关问题。

# 资金栏

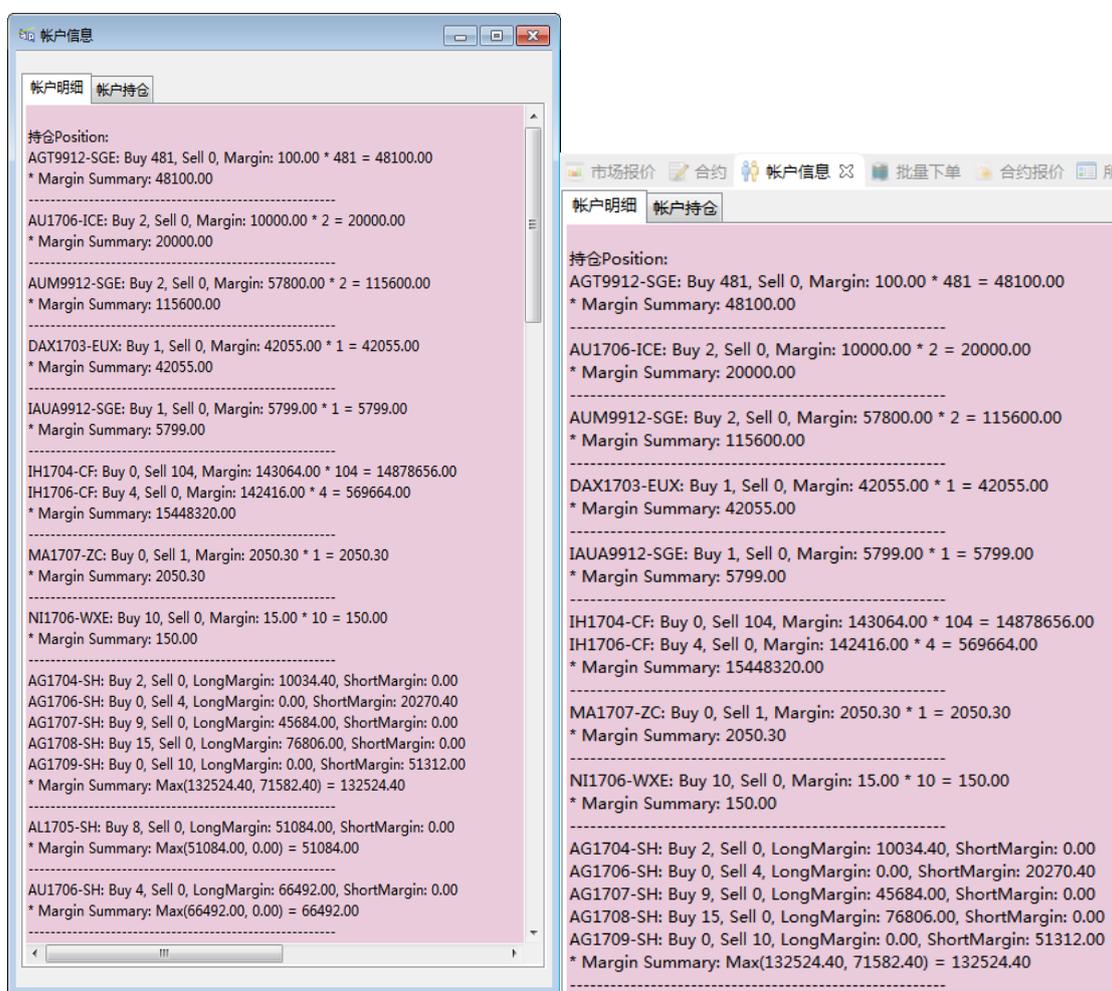


资金栏界面，从左到右分别是账户信息、切换账户、资金状况。

## 2.1 账户信息

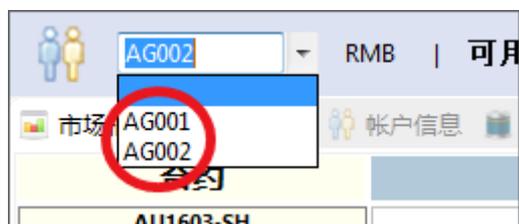
账户信息主要用于显示当前账户的资金、挂单以及持仓的相关信息，包括了账户明细和账户持仓两个页面。

- 单击**账户信息** (👤)，或单击  **帐户信息** ⓘ，显示账户信息页面。



## 2.2 切换账户

- 单击账户名切换账户



## 2.3 资金显示

- 显示资金包括可用资金和权益(当金额为负值时，文字颜色高亮成红色)。

# 报价区

## 3.1 报价区显示

报价区包括**合约信息区**、**买盘报价区**、**卖盘报价区**。报价区可添加多个合约组并切换查看，每个合约组单独进行合约的增删等管理。另外可根据需要切换各种档数报价。

**合约信息区域**

合约	买	卖
AU1603-SH 0.1@239.1	0 0	239.4 4
LRC1604-HKE 0.0@0	0 0	30590 5
CU3M-LME 2025.1@4561.5	4560 18	4560.5 3
SI1605-CME 54.7@14.31	14.28 6	14.305 1
CT1701-ICE 0.0@0	0 0	0 0
ZN3M-LME 1948.1@1673.5	1673 4	1673 7

**买盘报价区域，从右到左分别是，1档，2档，3档**

**卖盘报价区域，从左到右分别是，1档，2档，3档**

合约	买	卖
AL3M-LME 455.4@1804.5	1803.5 1	1804 1
		1804.5 4
		1805 1
		1805.5 2
		1806 1

该交易目前成交手数  
最后一笔成交的价格与手数  
与上次报价的差价，蓝色表上升，红色表下降  
该档位买卖价  
该价格可成交手数

## 3.2 合约组管理

**设置**

默认选项  
登陆设置  
声音设置  
字体设置  
快捷键  
合约组

**合约树**

- ▶ CN\_CFFE
- ▶ CN\_CZCE
- ▶ CN\_DCE
- ▶ CN\_SHFE
- ▶ HK\_HKEX
- ▶ JP\_TOCOM
- ▶ MY\_BMD
- ▶ SG\_SGX
- ▶ UK\_LME
- ▶ US\_CME
- ▶ US\_eCBOT
- ▶ US\_ICE
- ▶ US\_NYMEX

**合约树过滤**

type filter text

**已选合约列表**

- Contract Group
- AU1603-SH
- LRC1604-HKE
- CU3M-LME
- SI1605-CME
- CT1701-ICE
- ZN3M-LME

**合约组操作区**

当前操作合约组名

**合约操作区**

提示：  
在鼠标点击同时按Ctrl键  
可同时添加多个合约

恢复默认值(D) 应用(A)

确定 取消

合约组管理页面进入方式有：

- 点击报价区工具栏**添加合约组**()。
- 点击菜单**系统->设置->合约组**。

### 3.2.1 合约添加/删除/调整顺序

- 添加：在合约树中选择所希望添加到当前合约组的对象，点击合约操作区**添加合约**()完成添加。
- 删除：在合约组列表中选中合约，点击合约操作区**删除合约**()完成删除，点击**删除全部合约**()完成全部删除。
- 调整顺序：在合约组列表中选中合约，点击合约操作区**调整合约**( / )完成调整。
- 操作完成后，点击**应用**。

### 3.2.2 合约组添加/删除/重命名

- 添加：点击合约组操作区添加合约组()完成添加。
- 删除：点击合约组操作区删除合约组()完成删除。
- 重命名：点击合约组操作区重命名合约组()完成命名。
- 操作完成后，点击**应用**。

## 3.3 切换报价档数

- 单击报价区工具栏**切换档位**，可从下拉列表中选择切换各价格档（或在报价区内右击操作）。

## 3.4 切换合约组

- 单击报价区工具栏**切换合约组**，可从下拉列表中选择合约组（或在报价区内右击操作）。

## 3.5 多视图报价

- 单击报价区工具栏**添加报价视图**()。
- 弹出对话框，输入**新视图名称**。

## 3.6 二十档报价

- 竖向二十档报价：单击报价区**合约名**，弹出该合约的竖向二十档报价。
- 横向二十档报价：按住 Shift，单击报价区**合约名**，弹出该合约的横向二十档报价。

## 3.7 合约报价区

**合约报价**是市场报价的另一种显示方式，通过点击**合约报价**（）切换至该页面。



合约代码

帐户信息 批量下单 **合约报价** 所有挂单

合约组管理

Contract Group + 显示价格面板

合约	描述	买手数	买价	卖价	卖手数	总成交量	最后成交价	最后成交手数
1	AU1603-SH	3	247.3	0	0	0	257.95	1
2	LRC1604-HKE	10	30630	30670	10	0	0	0
3	CU3M-LME	1	4648.5	4650	1	2424	4648	1
4	SI1605-CME	6	14.93	14.935	6	3494	14.935	2
5	CT1701-ICE	0	0	0	0	0	0	0
6	ZN3M-LME	1	1738	1739.5	1	967	1738	1

买盘一档报价及手数 卖盘一档报价及手数 市场成交动态

注：买/卖价列中的数字若为红色，则代表最新市场报价较上一个报价有下跌；若为蓝色，则代表最新市场报价较上一个报价有上涨。

- 在未开启**显示价格面板**（）时，点击报价，用户可以通过**下单区**对该合约进行下单。
- 在开启**显示价格面板**（）时，点击报价，系统会弹出以1个最小变动价格为间隔的价格列（如下图）。点击报价，用户可在弹出的下单框中进行下单。



697 | 权 买 CU3M-LME

报价 

卖价

4656
4655.5
4655
4654.5
4654

0 30700 4654 1 2439

## 合约区

### 4.1 合约区展示

合约区包括**合约树**、**合约表**两个区域。选择合约树中的各层节点，合约表将显示其对应合约的详细信息。也可通过关键字进行查找合约详情。

交易所	产品...	合约代码	合约描述	币种	合约...	最小价格变动	默认...	过期信息
1	CN_SHFE	上海...	AG1509-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2015...
2	CN_SHFE	上海...	AG1510-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2015...
3	CN_SHFE	上海...	AG1511-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2015...
4	CN_SHFE	上海...	AG1512-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2015...
5	CN_SHFE	上海...	AG1601-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
6	CN_SHFE	上海...	AG1602-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
7	CN_SHFE	上海...	AG1603-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
8	CN_SHFE	上海...	AG1604-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
9	CN_SHFE	上海...	AG1605-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
10	CN_SHFE	上海...	AG1606-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
11	CN_SHFE	上海...	AG1607-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
12	CN_SHFE	上海...	AG1608-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
13	CN_SHFE	上海...	AG1609-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...
14	CN_SHFE	上海...	AG1610-SH	人民币(...	15	1	12600	YMD2016...

（注：双击合约表中的**固定手数**可更改创建普通单时系统生成的默认手数。当**固定手数**设置为0时，默认手数不固定，系统将根据报价信息生成**手数**；当**固定手数**设置为-1时，系统将在**手数**处留空。此处**固定手数**设置的手数判定优先于**系统 - 设置 - 默认选项 - 固定手数**。）

## 4.2 添加合约到报价区

合约表中右击，点击**添加合约到**，选择具体合约组。该合约将在报价区对应的合约组中显示报价。

## 4.3 合约表设置

- 左键单击每列表头可修改合约表中合约的升降序排序；右键点击可隐藏该列或自动调整列宽至可以显示该列全部内容。

交易所	产品	合约代码	合
1	CN_SHFE	上	
2	CN SHFE	上海...	AG1510-SH

- 单击 并输入过滤条件后可对当前显示的合约进行筛选，单击 取消筛选。
- 单击 (问号) 可进行以下操作：显示所有列，调整所有列至同一宽度，自动调整列宽至可以显示每列所有内容，快速清除所有过滤条件。

交易所	产品...	合约代码	合
1			
2			
3			
4			
5	CN SHFE	上海	AG1601-S

## 策略区

### 5.1 策略展示

策略区提供展示策略公式的实时计算结果。

策略名称		比率	
U	策略		
U	S1	-33069	-33149
U	S2	3890	3180

根据策略中合约所设置的初始买卖方向的1档报价计算的结果

根据策略中合约所设置的相反买卖方向的1档报价计算的结果

例：如上图中的策略 S2，参与的 A 合约为 CU1605-SH，方向为买入，参与的 B 合约为 AG1604-SH，方向为卖出。公式为  $A-10*B$ 。在某一时刻，A 的一档买价为 36390，一档卖价 36400。B 的一档买价为 3251，一档卖价为 3321。

那么，S2 蓝色区域表示“买 A - 10 \* 卖 B”，将与该策略设置的合约买卖方向一致的一档价格代入计算，数值为  $36400-10*3251=3890$ 。S2 红色区域表示“卖 A - 10 \* 买 B”，将与该策略设置的合约买卖方向相反的一档价格代入计算，数值为  $36390-10*3321=3180$ 。

### 5.2 策略添加\修改\删除\调整顺序

- 添加：点击合约组操作区 **添加策略** (+)，弹出 **添加策略** 对话框，按照说明填入相关数据，点击 **确定** 完成添加。

添加说明：

- 至少需要包含 A、B 两个品种。
- C 和 D 为可选项，用户可按实际需要使用时，先使用 C 才可以使用 D。
- 公式合法字符为：AB、数字 0-9、括号、加减乘除、小数点；当使用 C 和 D 时，C 和 D 也为合法字符。(注：3A/2B 为非法公式，(3\*A)/(2\*B)为合法公式)

4. 策略名建议用户填写有代表意义的名称，方便识别，长度最好不要超过 7 个中文或 15 个英文。
  5. D 为策略单对应合约默认价差，L 为策略单对应合约默认手数，执行次数为策略单默认执行次数。
- 修改和删除：在策略区中点击策略名，弹出策略编辑对话框，点击 **删除** 完成策略的删除，点击 **修改** 完成策略的修改。
  - 调整：点击策略区第一列 **U**，该策略会向上移动。

策略		比率	比率
U	-AU+ZN	260.75	260.8
U	A-B SP.AL	11062276	10445824
U	CU-ZN	11062276	10445824
U	AU(SH)	11062276	10445824
U	ZN.RB	0	0

### 5.3 策略单模式

策略单支持两种模式：

- 默认模式：系统默认的策略单模式，通过点击策略左右两侧的计算结果进行下单，用户可选择四种运算方式： $>$ 、 $>=$ 、 $<$ 、 $<=$ 。

- 买/卖模式：系统将把策略看成一个组合单，左侧的比率视为买盘报价，右侧的视为卖盘报价，点击左侧可以下卖/卖止损单，点击右侧可以下买/买止损单（注：如果出现左侧值大于右侧值，需将策略中各品种方向交换）。

- 买： 公式 $\leq$  价格；
- 买止损： 公式 $>$  价格；
- 卖： 公式 $>$  价格；
- 卖止损： 公式 $\leq$  价格。

## 5.4 快速下单

系统可通过策略区的入口直接对相关合约当前市场价进行快速下单(限价单)。

- 将**系统-设置-默认选项**中的选项打开，并选择是否需要下单确认（建议选择需要）。



- 点击对应策略区计算结果后方的蓝色按钮。

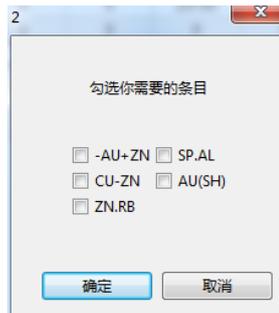
	策略	比率		比率	
U	-AU+ZN	-1481.75	*	-1495.1	*
U	SP.AL	68249.475	*	68249.475	*

- 对弹出的确认框信息进行确认，点击**确定**完成下单。



## 5.5 多视图策略

- 单击报价区工具栏**添加策略视图**()。
- 弹出对话框，输入新视图名称。
- 在新视图点击**调整策略**()，可选择该视图需要查看的策略。



## 下单区

下单分为普通单，自动单两个类型。普通单即限价单、市价单、止损单、限价止损单和 Iceberg 单，自动单包括策略单、Stop 单、Gain Best 单、止损止盈单。点击切换按钮至对应页面可分别下单。

注：下单支持全键盘操作，可用 **Tab** 键遍历下单板各项，**Enter** 键或 **Space** 键确定下单。

单有效期（TIF）说明：

DAY：当天有效。

GTC：一直有效直到被取消。

GTD：指定日期前有效。

### 6.1 限价单

限价单是以指定的或优于指定价格买或卖一个合约的定单。

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单。（双击则弹出下单对话框）
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 **DAY**。
- 在价格与手数区域，输入你希望定单的价格与手数。
- 发送定单，点击 **下单**。

普通单	策略单	Stop单	Gain Best单	止盈止损单
客户	ATP001_ATPO			
方向	买	手数	1	
合约	W1712-ICE	价格	0	
类型	LIM	TIF	DAY	
下单				

### 6.2 市价单

市价单是以当前市场的最优价格买或卖一个合约的定单。

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单。
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 **DAY**。
- 在手数的编辑区域，输入你希望定单执行的交易手数。
- 在单类型选择 **Market**。

- 发送订单，点击 **下单**。



The screenshot shows the '下单' (Order Entry) window with the '普通单' (Standard Order) tab selected. The order details are as follows:

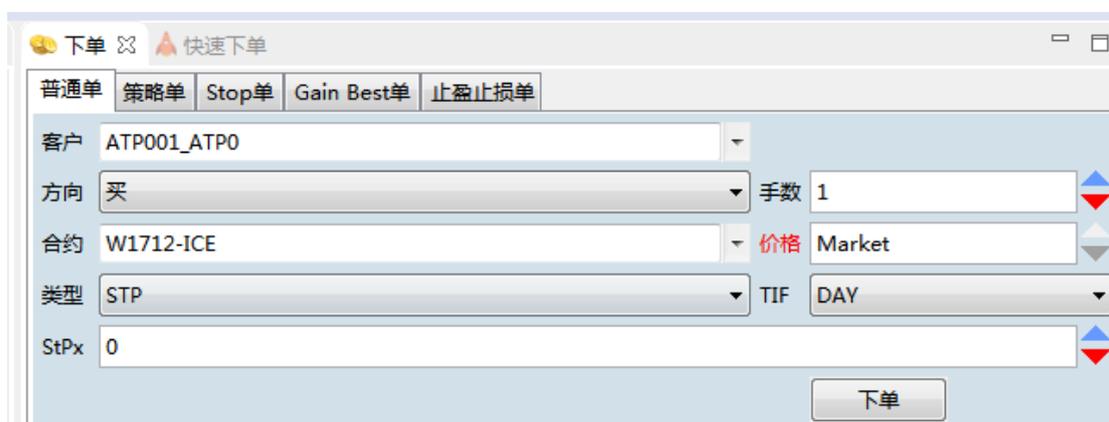
客户	ATP001_ATP0		
方向	买	手数	1
合约	W1712-ICE	价格	Market
类型	Market	TIF	DAY

A '下单' (Place Order) button is located at the bottom right of the form.

### 6.3 市价止损单

市价止损单是当市场价格达到止损点时，系统便会发出市价单。

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单。
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 **DAY**。
- 输入交易手数及止损点，价格默认为市场价。
- 在单类型选择 **STP**。
- 发送订单，点击 **下单**。



The screenshot shows the '下单' (Order Entry) window with the '止盈止损单' (Stop Order) tab selected. The order details are as follows:

客户	ATP001_ATP0		
方向	买	手数	1
合约	W1712-ICE	价格	Market
类型	STP	TIF	DAY
StPx	0		

A '下单' (Place Order) button is located at the bottom right of the form.

### 6.4 限价止损单

限价止损单是当市场价格达到止损点时，系统便会发出限价单。

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单。
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 **DAY**。
- 输入交易手数、止损点和价格。
- 在单类型选择 **STL**。
- 发送订单，点击 **下单**。



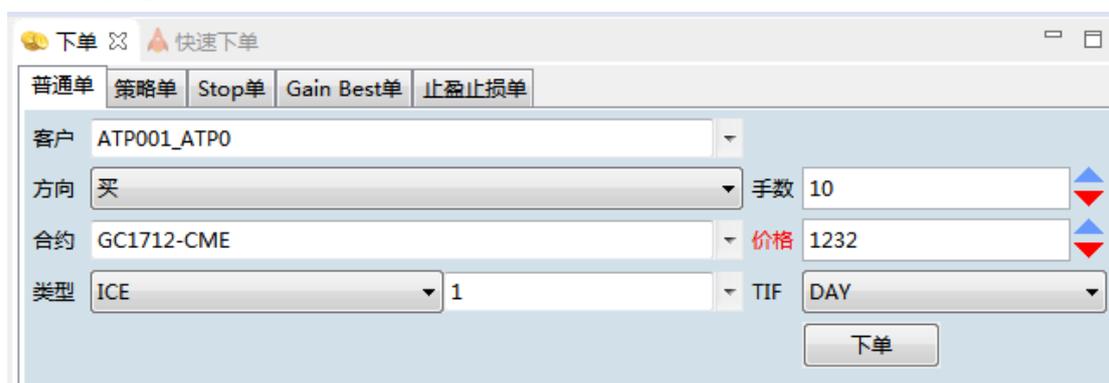
The screenshot shows a trading window titled "下单" (Place Order) with a sub-tab "快速下单" (Quick Order). The window contains several input fields and a "下单" (Place Order) button. The fields are:

客户	ATP001_ATP0		
方向	买	手数	1
合约	W1712-ICE	价格	0
类型	STL	TIF	DAY
StPx	0		

## 6.5 Iceberg 单

Iceberg 单是在限价单的基础上设置了可见手数，在发出交易单后，系统会按指定价格发出一个限价定单，交易手数等于可见手数；待该笔限价定单成交，系统便会以同样的价格再发出一笔同等数量的限价定单，等待成交，以此类推，直至交易结束。

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单。
- 在价格与手数区域，输入你希望定单执行的价格与手数。
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 **DAY**。
- 在单类型选择 ICE 和选择 Iceberg 单的可见手数。
- 发送订单，点击 **下单**。



The screenshot shows the same trading window as above, but with the order type set to "ICE" and the quantity set to 10. The price is set to 1232. The "下单" (Place Order) button is visible at the bottom right.

客户	ATP001_ATP0			
方向	买	手数	10	
合约	GC1712-CME	价格	1232	
类型	ICE	1	TIF	DAY

## 6.6 策略单

策略单是当多个合约之间的价格关系满足用户设置的策略时，触发各个合约以当前市场价格的下单，可设置调整单价差（D）、手数（L）、策略类型、是否拆单、是否创建循环单、数量和单次触发数量。

客户	策略单		Stop单	Gain Best单	止盈止损单
ATP001_ATP0					
A: 卖 M1709-DC [投机]	<input type="checkbox"/>	追单, 价差: 0	手数: 1		
B: 买 M1705-DC [投机]	<input type="checkbox"/>	追单, 价差: 0	手数: 1		
类型: 普通	<input type="checkbox"/>	拆单	数量: 1		
公式: A-B < -26	单次触发数量: 1				
公式: A-B >					下单

- 点击策略区中对应策略的公式结果，填充策略下单板。（双击则弹出下单对话框）
- 根据需要对交易单的相关参数进行修改。
- 发送定单，点击 **下单**。

### 参数名词解释：

**D：** 价差，设置之后下单价格为市场价+/-价差，买方向+价差，卖方向-价差，设置的数值应为产品最小变动价格的整数倍。

**L：** 手数，策略单执行时对应合约的下单手数。

**追单：** 满足条件下单后，若当前价格无法促成交易，则撤销原挂单，再以最新对手价+/-价差重新挂单。

**小数位：** 策略区数值显示的小数位。

**数量：** 策略单需执行的总次数。

**单次触发数量：** 对于一次触发下单，最多可同时完成的执行次数，单次触发数量应小于或等于数量。

**拆单：** 每次按照合约的手数比例自动拆分为最小单位手数进行下单。

**主动腿：** 主动腿主要用于钓鱼，以满足客户期望的价格将主动腿挂于市场，吸引别人成交；当主动腿的挂单成交后（可部分成交），被动腿的合约才会进行下单。主动腿的挂单价格根据被动腿的对手价、策略单公式及其他逻辑推算得出。

**先手：** 先手策略主要用于设定合约的成交先后顺序。当策略单条件达到后，先下先手合约的挂单，当先手合约成交后（可部分成交），其他合约才会进行下单。

**循环单：** 勾选循环单后，相当于多建一个策略 2，策略 2 的买卖方向与策略 1 的方向相反，公式为填入的循环单公式。一次执行周期为先执行策略 1，全部成交后再执行策略 2，待策略 2 全部成交后才会进入下一周期的执行周期。

## 6.7 Stop 单

Stop单是当合约价格达到或超过（买方向-高于、卖方向-低于）特定价格后，触发的下单。

- 切换下单区到 Stop 单面板下。
- 输入该单的相关数据。
- 发送订单，点击 **下单**。

普通单	策略单	Stop单	Gain Best单	止盈止损单
客户	ATP001_ATP0			
方向	买	手数	1	
合约	6C1712-CME	价格	0.73355	
Stop @	最后成交价			
		价格		
<input type="button" value="下单"/>				

## 6.8 Gain Best 单

Gain Best 单，目的是为了有效的控制市场变动导致的盈利损失或亏损。通过设定相关参数（基准价、Step 值和 Gap 值），系统会监测市场报价并据此不断调整基准价，使基准价一直向盈利增加的方向调整。即使价格走势向反向回调，系统也会根据 Step 值的设置及时触发自动单，从而减少盈利的损失甚至是亏损。

### 参数名词解释：

**基准价：**当市场价第一次达到自动单设置的下单价格时，初始基准价设置为该价格。

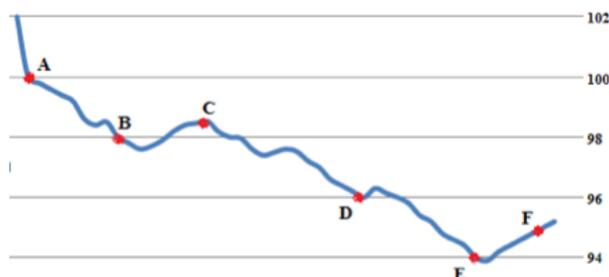
**Price Gap：**当市场价相较基准价更优于该数值时，将基准价往更优方向调整与该数值相等的价格。

**Step：**当市场价相较基准价回调该数值时，该自动单被触发。

普通单	策略单	Stop单	Gain Best单	止盈止损单
客户	ATP001_ATP0			
方向	买	手数	1	
合约	6C1712-CME	价格	0.7326	
Gap	0.0003			
		Step	0.0002	
<input type="button" value="下单"/>				

- 切换下单区到 Gain Best 单面板下。
- 输入该单的相关数据。
- 发送定单，点击 **下单**。

例：假设用户发送 Gain Best 单,买入 1 手 CU160505-LME,预设价格：102,gap：2,step：1。下单后 CU160505-LME 的市场卖价变化如下。



1. 价格第一次到达预设价格 102,此时设置基准价格 102。
2. 价格一路往有利方向移动到 100,到达 A 点时,基准价格(102)-A 当前价格(100)  $\geq$  gap(2),此时调整新的基准价格 100。
3. 同样,价格继续波动移动到 B 点,基准价格(100)-B 当前价格(98)  $\geq$  gap(2), 此时调整新的基准价格 98。
4. 过了 B 点之后,价格一度波动回调到 C 点,但是 C 当前价格(98.5)-基准价格 (98)  $<$  step(1),所以该单条件未被触发。
5. 同样,价格继续波动移动到 D 点,基准价格(98)-D 当前价格(96)  $\geq$  gap(2),此时调整新的基准价格 96。
6. 同样,价格继续波动移动到 E 点,基准价格(96)-E 当前价格(94)  $\geq$  gap(2),此时调整新的基准价格 94。
7. 最后,价格回调到 F 点,F 当前价格(95)-基准价格(94)  $\geq$  step(1),此时该单条件被触发。以预设价格 102 发送买单。

## 6.9 止盈止损单

止盈止损单挂单后，系统首先以指定价格下一个普通单，一旦这个普通单有部分成交或全部成交，止盈止损单开始监控市场价格变动。当市场价格相对于成交均价达到止盈/止损点后，自动单将触发下单，把已成交部分的平仓。

- 切换下单区到止盈止损单面板下。
- 输入该单的相关数据。
- 发送订单，点击 **下单**。

止盈/止损：相对于成交均价，盈利/亏损的价位，需为合约最小价格变动单位的整数倍。

平仓价格：触发价格+/- 10 个最小价格变动单位。

## 6.10 快速下单

快速下单是为了客户能够更简单、快速的建立限价单。



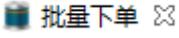
- 切换至快速下单界面。
- 选择需要下单的客户名、合约和方向。
- 选择下单价格类型（若选择指定价类型需设置定单的执行价格和手数）。
- 发送订单，点击 **下单**。

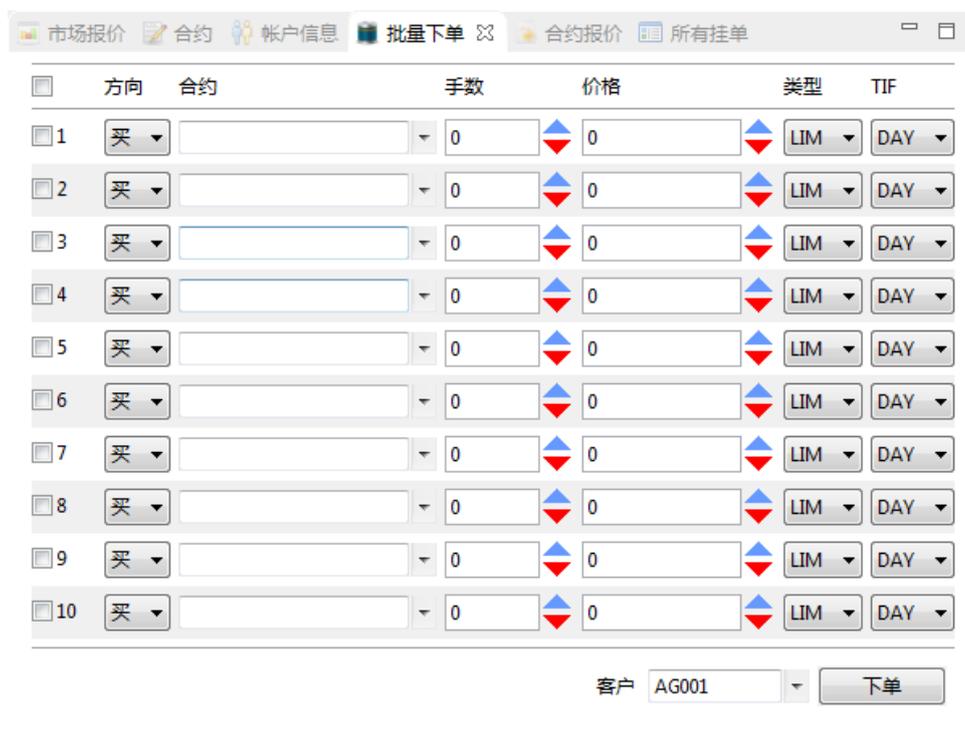
下单价格类型分为 **跟踪价**、**指定价** 和 **涨跌停价** 三种，用户可以通过点击类型名称完成类型间的切换。

- **跟踪价**：选择之后，快速下单区中的价格和手数会与市场最新报价同步，实时自动更改。
- **指定价**：客户可以更改快速下单区的价格和手数，与下单区功能类似。
- **涨跌停价**：选择之后，快速下单区中的价格会根据该合约的昨日结算价和交易所规定的涨跌停幅度计算出来。

## 6.11 批量下单

批量下单提供一次发送多个限价单的功能，方便用户操作。

- 点击**批量下单**（）。
- 在表格中设置方向、合约、手数、价格、类型及有效时间，并勾选前面的复选框。
- 选择客户号,点击**下单**按钮完成下单。



批量下单界面截图，显示了10行订单输入表格。每行包含复选框、方向（买）、合约、手数（0）、价格（0）、类型（LIM）和TIF（DAY）。底部有客户号选择（AG001）和下单按钮。

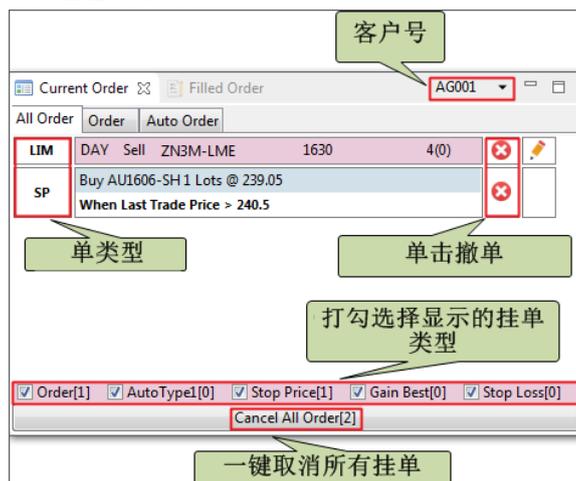
<input type="checkbox"/>	方向	合约	手数	价格	类型	TIF
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY
<input type="checkbox"/>	买		0	0	LIM	DAY

客户 AG001

# 挂单区

## 7.1 挂单区展示

挂单区展示用户当前未完成的订单。分**普通单**、**自动单**、**所有单**三个页面。普通单可进行修改与撤销，自动单只能进行撤销。



## 7.2 普通单

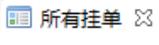
- 查看：普通单和所有单页面都可查看。
- 修改：直接点击限价单手数、价格进行编辑，光标离开编辑区，自动弹出确认对话框，点击**确定**，或点击**修改**().
- 撤销：点击对应挂单左边的**删除**()，弹出确认对话框，点击**确定**。

### 7.3 自动单

自动单不可修改，只能查看和删除，见下表。

类型	查看	删除
策略单		
Stop 单		<p>单击 左边</p> 
Gain Best 单		<p>删除 该单</p> 
止损止盈单		

## 7.4 所有挂单区

所有挂单区可以显示该用户所有账户（即**客户**）实时的挂单情况，并支持挂单信息的导出（Excel 格式文件）。点击**所有挂单**（）进入所有挂单区。



截图显示了“所有挂单”窗口的顶部菜单栏，包含“撤销选中单”和“导出”按钮。下方是一个数据表格，列出了挂单的各项信息。

撤单	改单	客户	类型	状态	条件	合约1	方向1	手数1	信息1	合约2	方向2	手数2	信息2	合约
		<input type="checkbox"/> AG...	LIM		DAY	AU160...	买	1(0)	价格: ...					
		<input type="checkbox"/> AG...	策略单	0/1	A-B<-1510.35	AU160...	卖	1(0)	价差: 6	ZN3M...	买	1(0)	价差: 0	
		<input type="checkbox"/> AG...	止损单			AU160...	买	1	价格: ...					

- **撤单列**：点击可以进行撤单。
- **改单列**：有标志的挂单可以进行改单，点击，在弹出框中修改数值即可。
- **客户列**：显示拥有该挂单的客户。在客户列中的复选框中打勾可以通过进行批量的撤单。



截图显示了“撤销选中单”窗口的顶部菜单栏，包含“撤销选中单”和“导出”按钮。下方是一个数据表格，列出了挂单的各项信息。

撤单	改单	客户	类型
		<input checked="" type="checkbox"/> AG...	LIM
		<input type="checkbox"/> AG...	策略单 0/

- **状态列**：可查看自动单的执行次数。
- **条件列**：普通单显示单有效期；策略单显示策略单公式。
- **合约信息区域**：显示合约代码、方向、手数（以及成交状态）和单创立时需要的其他数值。
- **挂单信息区域**：显示该挂单的挂单时间、最后运行时间和挂单 ID。

## 自动单区

自动单区用于显示用户所有策略单的运行状态。

- 点击 **自动单** (  ) 进入自动单区。



- 点击放大镜标志 (  ) 可进入单详情界面。

**自动单** **单详情**

策略单: (id = PeFMbgI)

A: 买 AG1603-SH	手数: 1	价差: 0	-
B: 卖 CUI1603-SH	手数: 1	价差: 0	-
F: A-B > -33691	执行次数上限: 1	已执行次数: 0	-

执行情况: 不拆单

品种	执行手数	成交手数	最后执行手数
A: 买 AG1603-SH	0	0	0
B: 卖 CUI1603-SH	0	0	0

成交列表:

客户	方向	品种	手数	价格	时间
----	----	----	----	----	----

单状态:

方向	品种	手数 (成交手数)	价格 (成交均价)	状态
----	----	-----------	-----------	----

- **策略单**: 显示该策略单 ID、参数详情与成交均价及其代入策略公式后的运算结果。
- **执行情况**: 显示各合约执行手数、成交手数和最后执行手数。
- **成交列表**: 显示策略单各合约的成交详情。
- **单状态**: 显示策略单触发的下单状态: 方向、品种、下单手数 (成交手数)、下单价格 (成交均价) 和成交状态。

## 成交单区

系统提供三种方式查看已成交单：明细、合并、按单成交单区，通过控制工具栏的下拉列表进行切换。



### 9.1 明细

对每笔在交易所完成的交易单独一个记录展示其买卖方向、合约代号、成交手数、成交价格，表格按照成交单发生时间先后排序。

### 9.2 按单

对同一下单同一方向完成的交易合并为一个记录展示其买卖方向、合约代号、成交手数、成交均价。

### 9.3 合并

对同一合约同一方向完成的交易合并为一个记录展示其买卖方向、合约代号、成交手数、成交均价。

例：假设用户针对同一客户发送了 4 个普通单：a 买入 10 手合约 A，价格不高于 1200；b 买入 5 手合约 B，价格不高于 1000，买入 4 手合约 A，价格不高于 1500；卖出 10 手合约 A，价格不低于 1000；

经过一段时间，该客户在交易所一共促成 6 笔交易，分别为：a 买入 3 手合约 A，价格为 1000；b 买入 2 手合约 A，价格为 750；c 卖出 2 手合约 A，价格为 900；d 买入 2 手合约 B，价格为 1200，e 买入 2 手合约 B，价格为 1400；f 买入 2 手合约 A，价格为 1400。

每笔成交方式查看，表格展示：

方向	手数	合约	价格
买	3	A	1000
买	2	A	750
卖	2	A	900
买	2	B	1200
买	2	B	1400
买	2	A	1400

按单合并方式查看，表格展示：

方向	手数	合约	价格
买	5	A	$(3*1000+2*750)/5=900$
卖	2	A	900
买	4	B	$(2*1200+2*1400)/4=1300$
买	2	A	1400

按合约合并方式查看，表格展示：

方向	手数	合约	价格
买	7	A	$(3*1000+2*750+2*1400)/7=1428.57$
卖	2	A	900
买	4	B	$(2*1200+2*1400)/4=1300$

## 9.4 锁定滚动条



挂单及成交单支持锁定滚动条。

**锁定状态：**当成交单实时刷新时，滚动条锁定在当前查看内容；

**未锁定状态：**当成交单实时刷新时，滚动条始终保持置顶。

## 持仓区

持仓区用于显示用户通过 ATP 交易和结算系统操作后的持仓情况。

品种	净持仓		今买		今卖		最后成交价	盈亏	持仓盈亏	平仓盈亏
JD1601-DC	2	3340	2	3340	-	-	-	-	-	-
JD1602-DC	-3	3214	-	-	3	3214	-	-	-	-
AL150930-LME	-10	1000	-	-	10	1000	1565	-141250	-141250	-
CU150930-LME	-10	55555	-	-	10	55555	4672	12720750	12720750	-
NIL150930-LME	-	-	10	123	10	120.3	8450	-162	-	-162
PB160310-LME	5	2000	5	2000	-	-	1735.5	-33062.5	-33062.5	-
PB160317-LME	-5	2010	-	-	5	2010	1735.5	34312.5	34312.5	-
ZN160526-LME	-8	1571.87	11	1595.73	19	1571.87	1751.5	-42487.5	-35926	-6561.5
PL1601-NYM	3	1000	3	1000	-	-	-	-	-	-
PL1603-NYM	-5	1100	-	-	5	1100	-	-	-	-
AG1601-SH	1	15	1	15	-	-	-	-	-	-
AG1603-SH	-5	3310	-	-	5	3310	3265	3375	3375	-
AU1506-SH	2	240.106	18	240.106	16	240.366	238.45	848	-3312	4160
AU1603-SH	-1	242.833	2	247.3	3	242.833	253.6	-19701	-10767	-8934
AU1606-SH	18	235.86	92	235.86	74	235.644	258.75	396036	412020	-15984

- 持仓信息显示各个合约的净持仓、成交均价及盈亏情况。
- 点击合并（**合并**）后，系统会将相同种类且相同交易所的产品持仓信息合并，并计算出买/卖价的加权均价以及各盈亏信息。

例：

合并前：

品种	净持仓		今买		今卖		最后成交价	盈亏	持仓盈亏	平仓盈亏
GC1603-CME	5	555	5	555	-	-	-	-	-	-
GC1604-CME	6	666	6	666	-	-	1228.2	337320	337320	-
AL160526-LME	-	-	3	1464	3	1460.5	1565.5	-262.5	-	-262.5
CU160526-LME	-	-	8	4364	8	4362	4667	-400	-	-400
ZN160526-LME	-	-	10	1474.4	10	1468	1750	-1600	-	-1600
RB1602-NYM	-	-	10	1.01741	10	1.03685	-	-	-	-
RB1603-NYM	-	-	42	1.04278	42	1.03684	-	-	-	-
RB1604-NYM	-	-	45	1.24637	45	1.2423	1.301	-7692.3	-	-7692.3
RB1605-NYM	-	-	17	1.25662	17	1.25518	-	-	-	-
AG1603-SH	-8	3300.19	19	3256.58	27	3300.19	3258	17491.65	5062.8	12428.85
AU1506-SH	-	-	1	239.35	1	239.85	-	-	-	-
AU1606-SH	-	-	74	235.682	74	235.733	259.6	3774	-	3774

合并后：

品种	净持仓		今买		今卖		最后成交价	盈亏	持仓盈亏	平仓盈亏
GC-CME	11	615.55	11	615.55	-	-	-	337500	337500	-
AL-LME	-	-	3	1464	3	1460.5	1565.5	-262.5	-	-262.5
CU-LME	-	-	8	4364	8	4362	4666.5	-400	-	-400
ZN-LME	-	-	10	1474.4	10	1468	1750	-1600	-	-1600
RB-NYM	-	-	114	1.15281	114	1.1505	-	-7692.3	-	-7692.3
AG-SH	-8	3300.19	19	3256.58	27	3300.19	3258	17491.65	5062.8	12428.85
AU-SH	-	-	75	235.731	75	235.788	-	3774	-	3774

**一键强平：**该操作将强制平掉所有持仓并撤销所有工作单，强平完成前挂单将会被拒绝。

品种	净持仓		今买		今卖		量
RU1703-SH	2	18215	-	-	-	-	

## 经纪行持仓

**经纪行持仓**显示系统通过经纪行直接获取的账户持仓信息，从而准确显示客户的持仓状态。

COM	NET	BUY	SELL
SR1609-ZC	-55	-	55
SR1605-ZC	55	55	-
A1609-DC	10	10	-
AG1606-SH	-126	-	126
A1701-DC	-10	-	10
TA1609-ZC	-37	-	37
M1609-DC	75	75	-
AG1612-SH	-14	-	14
TA1605-ZC	30	30	-
CS1701-DC	-10	-	10
M1701-DC	-75	-	75
TA1701-ZC	7	7	-

Last Update Time: 2016-02-22 15:46:32

## 日志区

日志区展示用户对交易单的操作与来自服务器端的反馈日志，详细地记录了每一交易单从开始到结束的完整周期。

注：若单被拒绝，原因将在此处显示，系统页面底部**状态栏**区域中也会显示最新的一条错误信息。



时间	内容
11:23:06	Order status, Sell ZN3M-LME 4(3) lots at price 2027.0(2027.166666666667). @ TS001
11:23:06	Order trade, Sell ZN3M-LME 1 lots at price 2027.5. @ TS001
11:22:59	Order filled, Buy CU1508-SH 2(2) lots at price 42790.0(42785.0). @ TS001
11:22:59	Order trade, Buy CU1508-SH 1 lots at price 42780.0. @ TS001
11:22:41	Order status, Buy CU1508-SH 2(1) lots at price 42790.0(42790.0). @ TS001
11:22:41	Order trade, Buy CU1508-SH 1 lots at price 42790.0. @ TS001

点击工具栏更多日志弹出日志对话框，可按对象进行查看或者根据关键词进行过滤查看。



时间	内容
11:23:06	Order status, Sell ZN3M-LME 4(3) lots at price 2027.0(2027.166666666667). @ TS001
11:23:06	Order trade, Sell ZN3M-LME 1 lots at price 2027.5. @ TS001
11:22:59	Order filled, Buy CU1508-SH 2(2) lots at price 42790.0(42785.0). @ TS001
11:22:59	Order trade, Buy CU1508-SH 1 lots at price 42780.0. @ TS001
11:22:41	Order status, Buy CU1508-SH 2(1) lots at price 42790.0(42790.0). @ TS001
11:22:41	Order trade, Buy CU1508-SH 1 lots at price 42790.0. @ TS001
11:22:41	Order placed, Buy CU1508-SH 2 lots at price 42790. @ TS001
11:22:41	New order, Buy 2 lots CU1508-SH at price 42790.0. @ TS001
11:22:35	Order status, Sell ZN3M-LME 4(2) lots at price 2027.0(2027.0). @ TS001
11:22:35	Order trade, Sell ZN3M-LME 2 lots at price 2027.0. @ TS001
11:22:35	Order placed, Sell ZN3M-LME 4 lots at price 2027. @ TS001
11:22:35	New order, Sell 4 lots ZN3M-LME at price 2027.0. @ TS001
11:22:21	Order filled, Buy ZN3M-LME 1(1) lots at price 2028.5(2028.5). @ TS001
11:22:21	Order trade, Buy ZN3M-LME 1 lots at price 2028.5. @ TS001
11:22:21	Order placed, Buy ZN3M-LME 1 lots at price 2028.5. @ TS001
11:22:21	New order, Buy 1 lots ZN3M-LME at price 2028.5. @ TS001
11:00:39	Order cancelled, Buy CU3M-LME 1(0) lots at price 5760.0(0.0). @ 10000
11:00:37	Order placed, Buy CU3M-LME 1 lots at price 5760. @ 10000
11:00:32	价格(1747.5)超出[1,775.98,1,776.02]的限制! @ 10000
11:00:29	Order cancelled, Buy PB3M-LME 1(0) lots at price 1722.5(0.0). @ 10000
11:00:27	Order placed, Buy PB3M-LME 1 lots at price 1722.5. @ 10000

## 状态栏

状态栏从左到右的信息依次为通知信息、错误日志、网络状况。

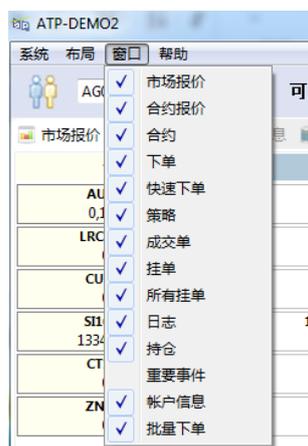
- 通知信息：通知信息提示客户关于交易的重要信息。内容比较多时，鼠标经过会悬浮显示所有内容。
- 错误日志：日志区最后一条错误日志。
- 网络状况：网络状况反应当前网络连通性。

## 菜单

客户端有 **系统**，**布局**，**窗口**，**帮助** 4 个主菜单。

### 14.1 窗口

点击菜单区中的 **窗口** 可快速显示/隐藏主界面中各功能窗口。



### 14.2 帮助

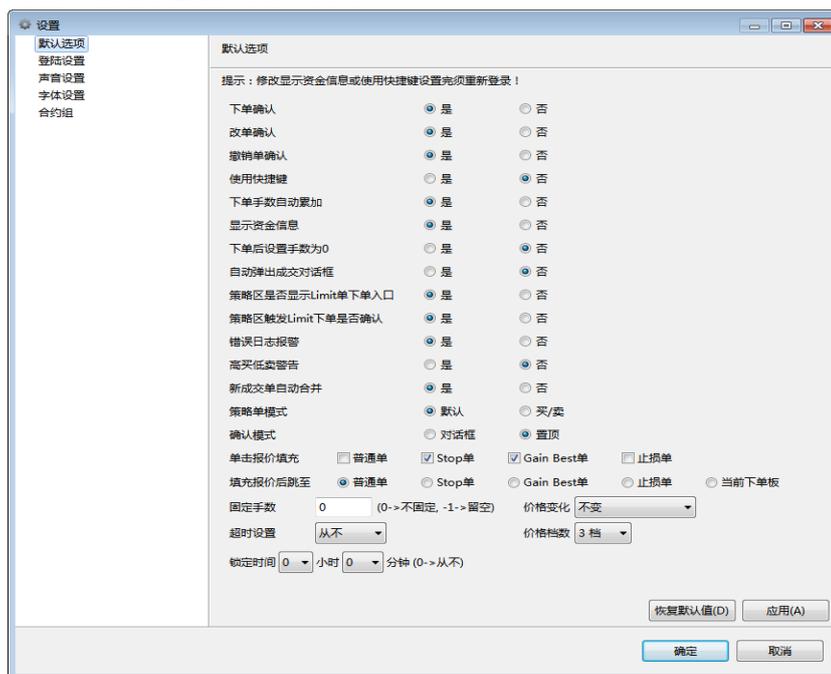
点击菜单 **帮助**>**关于** 后，弹出框中将显示软件版本信息、网络连接状态、网络延迟以及版权声明。

# 系统设置

点击菜单 **系统->设置**，进入 **设置** 页面。

## 15.1 默认选项

切换到 **默认选项** 页面如下图：



配置的具体内容如下表：

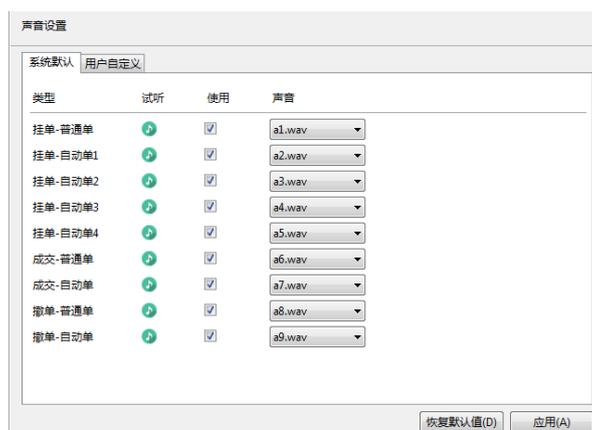
	选项	内容
1	下单确认	发送下单前是否弹出确认对话框
2	改单确认	修改挂单前是否弹出确认对话框
3	撤销单确认	撤销挂单前是否弹出确认对话框
4	使用快捷键	是否使用键盘快捷键
5	下单手数自动累加	创建普通单时，是否自动将低于及等于当前档的手数总和作为新下单的手数
6	显示资金信息	是否显示客户资金
7	下单后手设置手数为0	创建普通单后，是否将手数设定为0
8	自动弹出成交对话框	服务器发送新的成交单时是否自动弹框提醒
9	策略区是否显示Limit单下单入口	是否在策略区显示Limit单的快速下单入口
10	策略区触发Limit下单是否确认	策略触发Limit下单时是否自动弹框提醒
11	暂停/开始自动单是否需要确认	暂停/开始自动单时是否自动弹框提醒
12	错误日志报警	是否有错误日志时弹出重要事件提醒
13	高买低卖警告	是否在出现普通单出现高买低卖时发出警告

14	新成交单自动合并	是否设置为有新成交单时自动合并
15	策略单模式	选择策略单模式
16	确认模式	选择确认信息是以对话框方式弹出还是弹出在顶部位置
17	单击报价填充	选择单击报价后下单信息填充到哪种类型的单，可多选
18	填充报价后跳至	选择填充报价后跳至哪种类型的单，单选
19	固定手数	创建普通单时，是否固定手数数值，此选项优先于 <b>下单手数自动累加</b> ， <b>合约区</b> 中的 <b>固定手数</b> 优先于此选项
20	价格变化	创建普通单，是否自行调整价格的尺度，买价加，卖价减
21	价格档数	选择报价区显示的价格档数
22	超时设置	界面没有任何操作时系统自动登出的超时时间
23	锁定时间	界面没有任何操作时系统锁定界面的锁定时间

## 15.2 声音设置

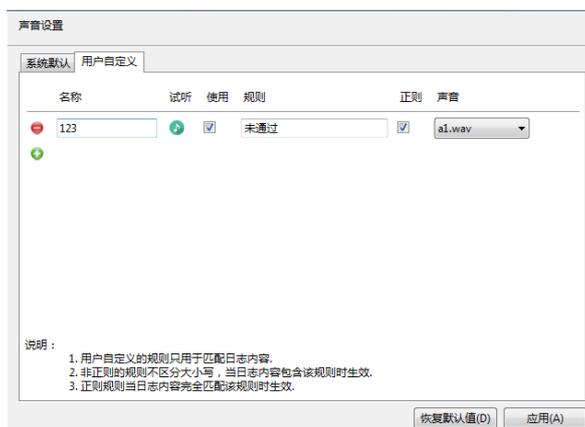
声音设置主要应用于两个方面：1.系统默认功能触发时的提示音设置；2.用户自定义的字样出现在日志信息中时的提示音设置。

### 15.2.1 系统默认



- 在**使用**复选框中，选择是否打勾来启用或停用相应的提示音。
- 点击声音名称，选择所需提示音（可通过点击试听）。
- 单击**应用**完成提示音修改。

### 15.2.2 用户自定义



- 输入用户自定义规则的名称。
- 选择是否启用**正则**（非正则的规则不区分大小写，当日志内容包含该规则时生效；而正则规则需要当日志内容完全匹配该规则时才会生效）。
- 点击声音名称，选择所需提示音（可通过点击试听按钮试听）。
- 在**使用**复选框中打勾，点击**应用**完成修改用户自定义。

## 15.3 快捷键

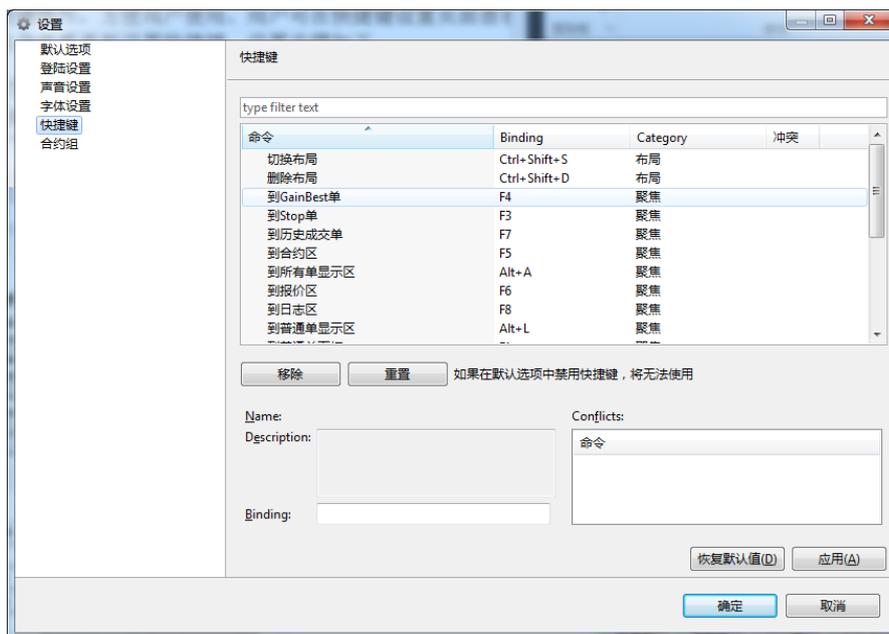
系统支持对软件进行快捷键操作，方便用户使用。用户可在快捷键设置页面查看命令对应的快捷键，也可根据自身需要重新设置快捷键。

选择使用快捷键：



设置步骤如下：

- 点击选中表格中希望改变快捷键的命令
- 在下方绑定的编辑框中输入新的快捷键。
- 点击下方的**应用**，快捷键生效。

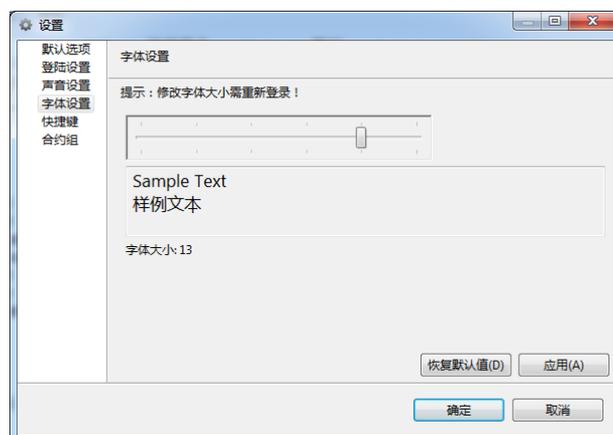


默认快捷键：

命令	Binding	Category
切换布局	Ctrl+ Shift+S	布局
删除布局	Ctrl+ Shift+D	布局
新建布局	Ctrl+ Shift+N	布局
重置布局	Ctrl+ Shift+R	布局
客户中心	Ctrl+ Shift+U	打开
打开设置	Ctrl+ Shift+P	打开
更多日志	Ctrl+ Shift+L	打开
到GainBest单	F4	聚焦
到Stop单	F3	聚焦
到历史成交单	F7	聚焦
到合约区	F5	聚焦
到所有单显示区	Alt+A	聚焦
到报价区	F6	聚焦
到日志区	F8	聚焦
到普通单显示区	Alt+L	聚焦
到普通单面板	F1	聚焦
到策略区	F9	聚焦
到策略单面板	F2	聚焦
到自动单显示区	Alt+U	聚焦

## 15.4 字体设置

- 通过拉动方块调节字体大小。
- 点击**应用**。
- 重新登录系统后，修改生效。

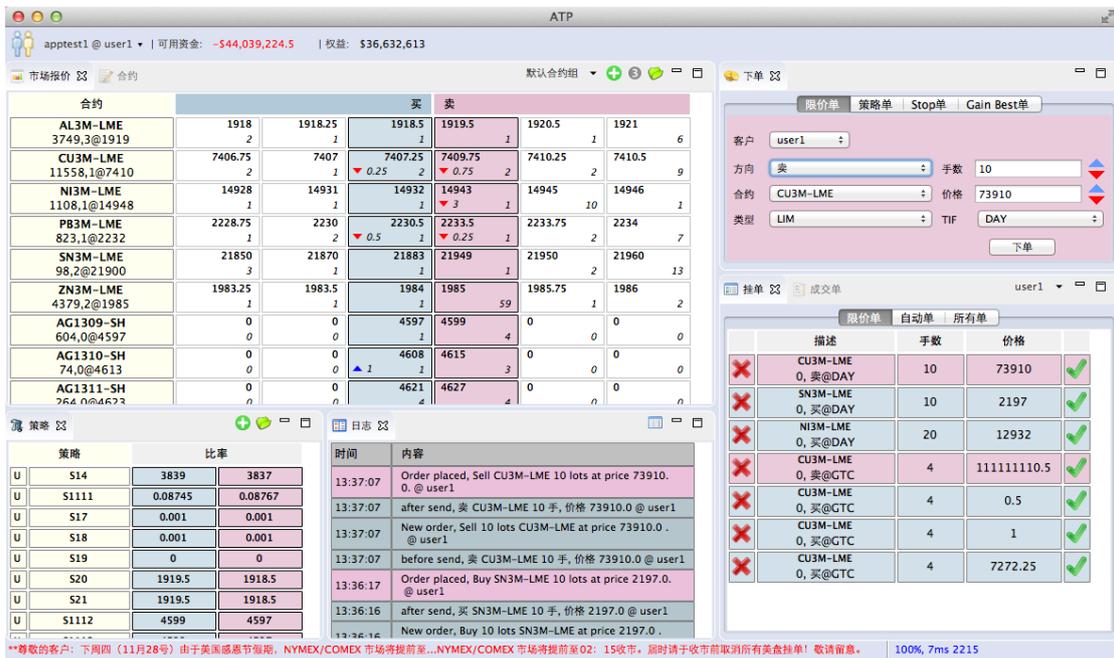


# 界面布局

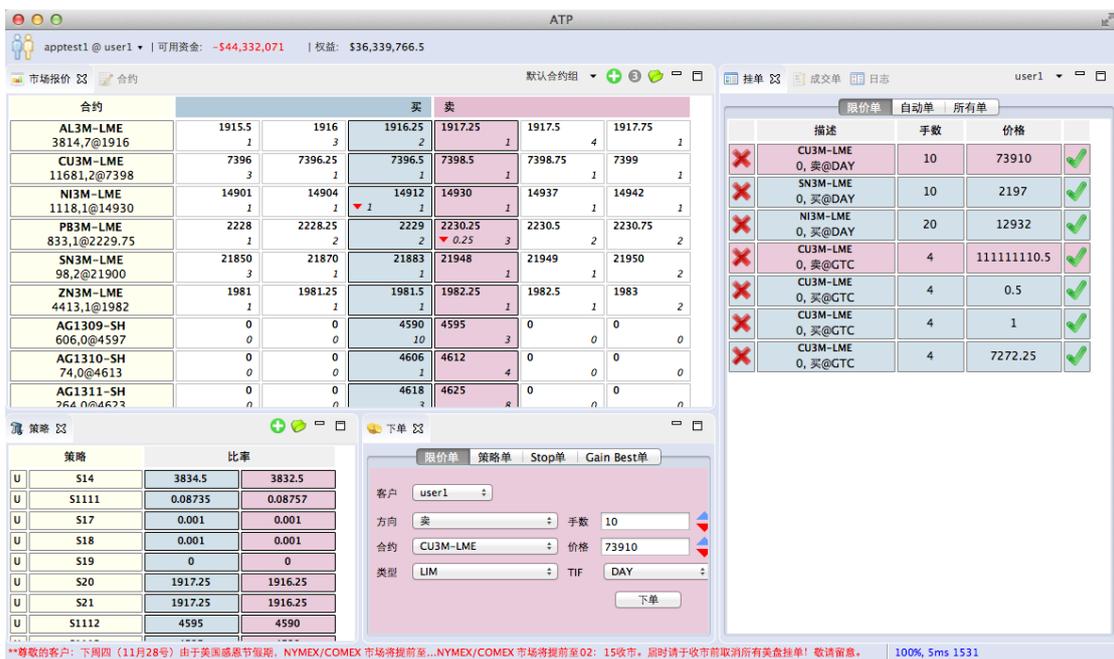
## 16.1 布局展示

系统支持用户根据自身需要对视图进行**组合、拆分、拉出、改变大小**从而形成新的界面布局，并可以对布局进行**新建、重置、切换、删除**操作。

布局例一：



布局例二：

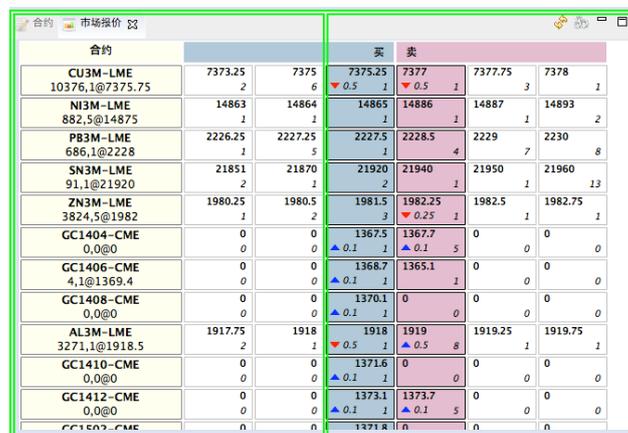


## 16.2 改变布局

- 组合：鼠标左键点击希望移动的视图名称，长按并拖动至希望与该视图进行组合的视图名称位置，放开，组合操作完成。



- 拆分：鼠标左键点击希望移动的视图名称，长按拖至理想位置放开，拆分操作完成。
  - 若希望将原有视图拆分有上下两个视图区，则长按并拖动至目标视图的下半部位置。
  - 若希望将原有视图拆分有左右两个视图区，则长按并拖动至目标视图的右半部位置。



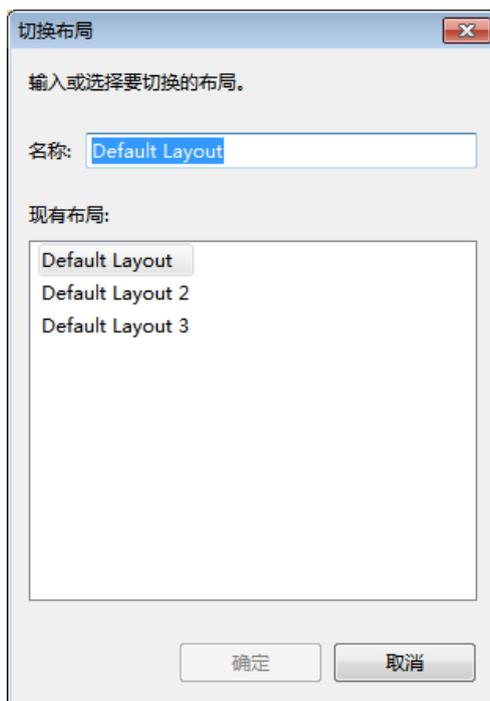
- 拉出：鼠标左键点击希望移动的视图名称，长按并拉动至主界面之外的区域，放开，此时可以看到视图已经作为一个独立的小窗口在界面之外，可更自由的放置并调整大小。
- 改变大小：将鼠标放置视图的边缘区域，直到出现调整大小的图标，此时长按鼠标左键，根据需要选择放大或者缩小。

## 16.3 界面管理

系统支持对用户自定义布局进行管理，可保存多个布局，删除自定义布局，在布局之间自由切换，重置恢复到当前布局的默认状态。

### 16.3.1 新建布局

- 按需求调整好布局。
- 点击菜单区 **布局->新建布局**，弹出对话框。
- 输入新布局名称或者选择已有布局进行覆盖。
- 点击 **确定**，完成操作。



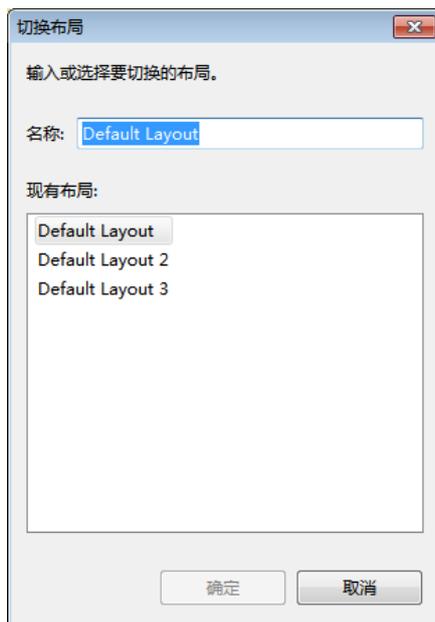
### 16.3.2 重置布局

- 点击菜单 **布局->重置布局**，弹出确认对话框。
- 点击 **确定**，完成操作。

### 16.3.3 切换布局

- 点击菜单 **布局->切换布局**，弹出布局列表。

- 选择希望切换的布局。
- 点击**确定**，完成操作。



#### 16.3.4 删除布局

- 点击菜单**布局->删除布局**，弹出布局列表。（注：默认界面不能被删除）
- 选择希望删除的布局。
- 点击**确定**，完成操作。

