

综合交易平台术语解释

交易员终端

交易实时行情窗口术语

合约代码：综合交易平台的合约代码

合约在交易所的代码：期货合约在交易所的代码

交易阶段编号：交易所交易节编号

今虚实度：期权中的今虚实度值，即 Delta 期权价格相对于标的物价格的变化率

昨虚实度：期权中的昨虚实度值

最后修改时间：行情最近一次更新的时间

最后修改毫秒：最后修改时间的毫秒值

交易所代码：SHFE/DCE/CZCE（上期所/大连交易所/郑州交易所）

今收盘：今日收盘价，收盘价是指某一期货合约当日交易日的最后一笔成交价格

进入本状态原因：手动切换，自动切换，熔断

申买价：某一期货合约当日交易所系统中出现的未成交报单的最高申买价

按价格由高到低五级排序，申买价一，申买价二，申买价三，申买价四，申买价五

申卖价：某一期货合约当日交易系统中出现的未成交报单的最低申卖价

按价格由低到高五级排序，申卖价一，申卖价二，申卖价三，申卖价四，申卖价五

申买量：指某一期货合约当日交易所系统中未成交的最高价位申请买入的下单数量。

按和申买价五级排序对应分为五级，申买量一，申买量二，申买量三，申买量四，申买量五

申卖量：指某一期货合约当日交易所系统中未成交的最低价位申请卖出的下单数量。

按和申卖价五级排序对应分为五级，申卖量一，申卖量二，申卖量三，申卖量四，申卖量五

昨持仓量：历史持仓数量

最新价：当前交易日合约最新成交价格

涨跌：最新价 - 昨结算价

持仓量：某一期货合约所有未平仓合约的双边数量

仓差：某一期货合约当日持仓量与上日持仓量相比增加（正值），减少（负值）或不变（0）

合约交易状态：分为集合竞价报单，集合竞价价格平衡，集合竞价撮合，开盘前，连续交易，非交易，收盘；现在该字段为空，各交易所的状态放在左下状态条显示。

进入本状态时间：进入合约交易状态的时间

成交金额：某一期货合约在当日交易日期间的成交量×合约乘数×成交均价

成交量：某一期货合约在当日交易日期间所有成交合约的双边数量

成交均价：某一期货合约 成交金额/成交总量 （成交总量=成交量×合约乘数）

今开盘：今交易日某一期货合约的开盘价。开盘价是指某一期货合约开市前五分钟内经集合竞价产生的成交价格

最高价：一定时间内某一期货合约成交价中最高成交价格

最低价：一定时间内某一期货合约成交价中最低成交价格

涨停板价：某一交易日内某一期货合约报价的最高价格

跌停板价：某一交易日内某一期货合约报价的最低价格

昨收盘：上一交易日的某一期货合约的收盘价。收盘价是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格

今结算：今日结算价；结算价是指某一期货合约当日成交价格按成交量的加权平均价，当日无成交的，以上一交易日的结算价作为当日结算价

昨结算：上一交易日某一期货合约结算价

报单回报窗口

报单提示序号：综合交易平台未使用。

会话编号+请求编号：每次会话的唯一报单编号，报单时需要填写

经纪公司代码+（投资者代码+终端）+报单引用：经纪公司报单的唯一序号，报单时不需要填写

本地报单编号+交易所交易员代码：每个席位的唯一报单编号

报单编号+交易所代码：交易所的唯一报单编号

本地报单编号：如果正常报到交易所，交易所返回编号；如果报单非法被交易所拒绝，此字段为空

业务单元： 报单的席位

用户端产品信息：报入该报单的用户使用的产品

前置编号：该报单报入时经用的前置机编号

GTD 日期：good till date 在有效期类型为 4(指定日期前有效)时输入 GTD 日期

安装编号：报盘的安装编号，即该报单报入时使用的报盘机编号

报单价格条件：限价/最优价/任意价

报单来源：来自参与者/来自管理员

报单类型：正常，报价衍生，组合衍生，组合报单

报单日期：报单时日期

报单提交状态：分为“已经提交、撤单已经提交、修改已经提交、已经接受、报单已经被拒绝、撤单已经被拒绝、改单已经被拒绝”。其中“提交”为综合交易平台已

提交报单指令到交易所，“接受”表示交易所已经接受并进入交易所报单队列，“拒绝”表示报单指令不符合交易所的要求。

操作用户代码：撤单的用户代码，只有撤单时才会填这个字段

用户代码：下单的操作员代码，投资者自己下单时为投资者代码

委托时间：从交易所报单回报里取得的报单插入交易所报单队列时的时间，上期所回报这个字段为空，所以上期所的单子我们插入报单发送到交易所时的交易核心时间。

撤销时间：报单撤销时间，目前为空。

成交量类型：1 任何数量 2 最小数量 3 全部数量

触发条件：1 立即 2 止损，3 止赢

挂起时间：某一期货合约报单被挂起时间

激活时间：某一期货合约报单激活时间

会员代码：经纪公司在交易所的代码

交易日：综合交易平台交易日

结算编号：交易所结算部给出的编号

结算会员编号：交易所结算部给出的结算会员编号

经纪公司代码：在综合交易平台开户的经纪公司代码

强平原因：分为非强平，资金不足，客户超仓，会员超仓，持仓非整数倍，违规，其它几种原因

用户强平标志：是否强平单，分为 强平/非强平

有效期类型：1 立即完成否则撤销 2 本节有效 3 当日有效 4 指定日期前有效
5 撤销前有效 6 集合竞价有效

止损价：是一种保护机制，避免越套越深，当到达设定的止损价格时，系统自动平仓出局

状态信息：全部成交/未成交/已撤单(手动撤)/已撤单报单被拒绝(报单不合法)

自动挂起标志：0 不挂起(当日有效)，1 挂起(指定日期前有效)

最后修改交易所交易员：最后修改的交易员（交易席位）代码

最小成交量：在输入成交量类型 为最小数量时候要设置的最小成交量值

序号：报单时候返回的编号，该序号随报单状态的改变而改变，目前不使用

报单编号：如果报单正常报到交易所，交易所返回编号；如果报单非法，被交易所拒绝，此字段为空

买卖方向：买/卖

价格：报单报价价格

数量：报单时数量

今成交量：报单今日在交易系统中成交的数量

剩余数量：数量—今成交数量

投机套保标志：投机/套保

报单状态：撤单/全部成交/未成交还在队列中/部分成交

交易编码：交易所给投资者开户时指定的唯一编码

单腿编号：0 代表组合合约中前一个合约，1 代表组合合约中后个合约

单腿乘数：组合合约中前一个合约与后一个合约的比值，例如单腿乘数为 2，买 5 手组合合约，单一合约数前一个合约是 10 手，后一单一合约是 5 手

成交回报窗口

本地报单编号：本地报单时分配的编号，该号码是固定的。

成交价来源：前成交价/买委托价/卖委托价

成交类型：普通成交/组合衍生成交/期权执行

成交时间：交易所日期

交易角色：自营/代理

交易所交易员代码：交易报盘席位

结算会员编号：此会员挂的结算会员在交易所的代码

交易编码：投资者在交易所开户的编码

用户代码：下单的操作员代码，投资者自己下单时为投资者代码

投资者代码：综合交易平台投资者开户代码

会员代码：会员在交易所开户的代码

成交时间：报单成交时间

开平标志：开仓，平仓，强平，平今，平昨，上期所分平今/平昨/开仓

成交量：某一期货合约在当日交易日期间成交的数量

投机套保标志：投机/套保

成交编号：成交时交易所返回的编码

价格：某一期货合约在交易系统中成交的价格

持仓窗口

每个投资者的每个合约的持仓分投机、套保 2 条记录显示，左买右卖。

投保：投机/套保

开仓均价：

今买（卖）持：今天开仓买（卖）持仓量

总买（卖）持：总买（卖）持仓量

买（卖）可平：买（卖）可平仓数量

买（卖）开仓成本： Σ （开仓成交价×买（卖）开仓持仓量×合约乘数）

买（卖）持仓成本：昨买（卖）持仓量×昨结算×合约乘数+今买（卖）持仓量×开仓价×

合约乘数

买（卖）开仓均价：买（卖）开仓成本 / (剩余持仓量×合约乘数)

买（卖）冻结：买（卖）冻结保证金 + 买（卖）开仓冻结手续费 + 卖（买）平仓冻结手续费

（买（卖）冻结保证金 = 合约多头（空头）冻结持仓量 * 多头（空头）保证金率 * **保证金价格类型** * 合约乘数

（**保证金价格类型**：依据经纪公司交易保证金算法设置取：成交均价或昨结算价或结算价或开仓价）

买（卖）开冻结手续费 = 多头（空头）有效报单的未成交量 * 成交价 * 开仓手续费率 * 合约乘数

卖（买）平冻结手续费 = 卖（买）平仓冻结量 * 成交价 * 平仓手续费率 * 合约乘数
）

持仓盈亏：历史持仓盈亏+当日开仓持仓盈亏（注意：此处算出的持仓盈亏是实际值，不考虑浮动盈亏算法）

历史持仓盈亏=（当日结算价-上一日结算价）×持仓量

当日开仓持仓盈亏=Σ [（卖出开仓价-当日结算价）×卖出开仓量]+Σ [（当日结算价-买入开仓价）×买入开仓量]

交易所保证金：按照交易所保证金率收取的保证金

= Σ [（合约多头持仓量 * 交易所多头保证金率 * **保证金价格类型** * 合约乘数）] + Σ [（合约空头持仓量 * 交易所空头保证金率 * **保证金价格类型** * 合约乘数）]

占用的保证金 = Σ [（合约多头持仓量 * 多头保证金率 * **保证金价格类型** * 合约乘数）] + Σ [（合约空头持仓量 * 空头保证金率 * **保证金价格类型** * 合约乘数）]

（**保证金价格类型**：依据经纪公司交易保证金算法设置取：可以是成交均价、昨结算价、结算价或开仓价）

手续费 = 成交量 * 成交价 * 开仓手续费率（按金额） * 合约乘数 + 成交量 * 开仓手续费率（按手数）
+ 平仓量 * 平仓价 * 平仓手续费率（按金额） * 合约乘数 + 平仓量 * 平仓手续费率（按手数）

持仓明细窗口

数量：合约当前持仓量

成交类型：分为普通成交和组合衍生成交

逐日盯市持仓盈亏 = （最新价 - 持仓均价）* 多头持仓总量 * 合约乘数 + （持仓均价 - 最

新价) * 空头持仓总量 * 合约乘数

逐笔对冲持仓盈亏 = $\Sigma ((\text{最新价} - \text{开仓价}) * \text{多头持仓} * \text{合约乘数}) + \Sigma ((\text{开仓价} - \text{最新价}) * \text{空头持仓} * \text{合约乘数})$

逐日盯市平仓盈亏 = $\Sigma (\text{多头平昨量} * (\text{平仓价} - \text{昨结算价}) * \text{合约乘数}) + \Sigma (\text{多头平今量} * (\text{平仓价} - \text{开仓价}) * \text{合约乘数})$
 $+ \Sigma (\text{空头平昨量} * (\text{昨结算价} - \text{平仓价}) * \text{合约乘数}) + \Sigma (\text{空头平今量} * (\text{开仓价} - \text{平仓价}) * \text{合约乘数})$

逐笔对冲平仓盈亏 = $\Sigma (\text{多头平仓量} * (\text{平仓价} - \text{开仓价}) * \text{合约乘数}) + \Sigma (\text{空头平仓量} * (\text{开仓价} - \text{平仓价}) * \text{合约乘数})$

资金窗口

出金金额：综合交易平台出金，实时同步

入金金额：综合交易平台入金，实时同步

上次存款额 = 前一交易日结算后的结存现金 = 上次期末结存 - 上次占用保证金

上次结算准备金 = 上次存款额 + 上次占用保证金 + 上次信用额度 + 上次质押
= 上次期末结存 - 上次占用保证金

上次信用额度：前一交易日设置的信用额度

上次质押金额：前一交易日设置的质押金额

客户风险度：当前保证金总额*100/总权益（算法1）；总权益/当前保证金总额（算法2）

客户风险状态：分为“穿仓、强平、追保、警示、正常、异常”六种

穿仓：有持仓，总权益为负

强平：交易所保证金 > 0 AND 交易所保证 > 总权益

追保：客户保证金 > 0 AND 客户保证金 > 总权益

警示：可由用户自行设定风险度在什么范围内为警示

正常：客户风险度 > 0（算法1）或者客户风险度 < 无穷大（算法2）

异常：没有持仓，总权益为负

交易所风险度：交易所保证金*100/总权益（算法1）；总权益/交易所保证金（算法2）

交易所风险状态：分为“强平、异常、正常”三种。

强平：交易所保证金 > 0 AND 交易所保证 > 总权益

正常：交易所风险度 > 0（算法1）或者交易所风险度 < 无穷大（算法2）

异常：没有持仓，总权益为负

投资者帐号：投资者代码与投资者帐号一致

交易所保证金：按照交易所保证金率收取的保证金

冻结的保证金：报单未成交冻结的保证金

= 合约多头冻结持仓量 * 多头保证金率 * 保证金价格类型 * 合约乘数 + 合约空

头冻结持仓量 * 空头保证金率 * 保证金价格类型 * 合约乘数

(保证金价格类型: 依据经纪公司交易保证金算法设置: 可以是成交均价、昨结算价、结算价或开仓价)

冻结的资金: 报单未成交冻结的总资金

冻结的手续费: 报单未成交冻结的手续费

平仓盈亏: 平历史仓盈亏+平当日开仓盈亏

持仓盈亏: 今开仓的持仓盈亏+历史仓的持仓盈亏

(上次) 信用额度: (上一交易日) 综合交易平台设置信用额度, 实时同步

(上次) 质押金额: (上一交易日) 综合交易平台设置质押金额, 实时同步

上次存款额: 前一交易日交易结算单中 (期末结存-保证金占用)

上次占用的保证金: 前一交易日交易结算单中 (保证金占用)

上次结算准备金: 上次存款额 + 上次占用保证金 + 上次质押金额 + 上次信用额度

动态权益: 上次结算准备金+平仓盈亏+持仓盈亏 (忽略浮动盈亏算法) - 手续费+入金-出金-
上次信用额度-上次质押+质押

可用资金: 动态权益 - 当前保证金 - 冻结保证金 - 冻结手续费 + 信用额度+持仓盈亏 (根据浮动盈亏算法计算)

可取资金: 可用资金~ * 可提比例 - max {0, (基础保证金 - (可用资金~ - 可用资金~ * 可提比例))}

其中“可用资金~” = 可用资金 - 质押金额 - 信用额度 - 盈亏 + 出金

可提比例: 在银期转账中“交易可提资金算法”和“投资者可提资金比例管理”中设置, 无交易无持仓客户的可提比例为 1

1. IF (可用资金~ - 可用资金~ * 可提比例 < 基础保证金)

可取资金 = 可用资金~ * 可提比例 - (基础保证金 - (可用资金~ - 可用资金~ * 可提比例)) - 出金

2. IF (可用资金~ - 可用资金~ * 可提比例 > = 基础保证金)

可取资金 = 可用资金~ * 可提比例 - 出金

手续费: 每笔成交手续费之和, 按在综合交易平台设置的手续费收取费率计算

最小变动价位: 指在期货交易所的公开竞价过程中, 对合约标的每单位价格报价的最小变动数值

风险控制终端

当日资金查询/已选投资者列表

投资者代码: 投资者开户时填写的投资者代码, 同交易员终端

投资者名称：投资者开户时填写的投资者名称，同交易员终端

客户风险度： $\text{当前保证金总额} \times 100 / \text{总权益}$ （算法1）； $\text{总权益} / \text{当前保证金总额}$ （算法2）

客户风险状态：分为“穿仓、强平、追保、警示、正常、异常”六种

穿仓：有持仓，总权益为负

强平： $\text{交易所保证金} > 0 \text{ AND } \text{交易所保证金} > \text{总权益}$

追保： $\text{客户保证金} > 0 \text{ AND } \text{客户保证金} > \text{总权益}$

警示：可由用户自行设定风险度在什么范围内为警示

正常： $\text{客户风险度} > 0$ （算法1）或者 $\text{客户风险度} < \text{无穷大}$ （算法2）

异常：没有持仓，总权益为负

交易所风险度： $\text{交易所保证金} \times 100 / \text{总权益}$ （算法1）； $\text{总权益} / \text{交易所保证金}$ （算法2）

交易所风险状态：分为“强平、异常、正常”三种。

强平： $\text{交易所保证金} > 0 \text{ AND } \text{交易所保证金} > \text{总权益}$

正常： $\text{交易所风险度} > 0$ （算法1）或者 $\text{交易所风险度} < \text{无穷大}$ （算法2）

异常：没有持仓，总权益为负

交易所可用资金：同交易员终端

出入金金额：入金-出金

当前保证金总额：同交易员终端

手续费：同交易员终端

平仓盈亏：同交易员终端

持仓盈亏：同交易员终端

总权益：同交易员终端客户权益

可用资金：同交易员终端

质押金额：同交易员终端

交易所保证金：同交易员终端

保底资金：同交易员终端

可取资金：同交易员终端

信用额度：同交易员终端

经纪公司代码：同交易员终端

投资者帐号：同交易员终端

上次质押金额：同交易员终端

上次信用额度：同交易员终端

上次存款额：同交易员终端

上次总权益：同交易员终端

上次占用的保证金：同交易员终端

投资者持仓信息/查询

投资者代码：同交易员终端

合约代码：同交易员终端

总买持：今日多头持仓量 + 上日多头持仓量，即多头总持仓量

今买持：今日多头持仓量

买可平：多头可平量

买均价：多头持仓成本总和 / 多头总持仓量

买冻结：多头冻结保证金 + 多头冻结手续费 + 多头冻结资金
总卖持：今日空头持仓量 + 上日空头持仓量，即空头总持仓量
今卖持：今日空头持仓量
卖可平：空头可平量
卖均价：空头持仓成本总和 / 空头总持仓量
卖冻结：空头冻结保证金 + 空头冻结手续费 + 空头冻结资金
投资者保证金：多头保证金 + 空头保证金
交易所保证金：多头交易所保证金 + 空头交易所保证金
昨结算：同交易员终端
今结算：同交易员终端
手续费：多头手续费 + 空头手续费
平仓盈亏：多头平仓盈亏 + 空头平仓盈亏
持仓盈亏：多头持仓盈亏 + 空头持仓盈亏
交易所代码：同交易员终端
投保：同交易员终端
交易日：同交易员终端
经纪公司代码：同交易员终端

投资者成交信息/查询（同交易员终端）

投资者报单信息/查询（同交易员终端）

投资者持仓排行

品种：同交易员终端
投资者代码：同交易员终端
昨持仓：投机多头上日持仓 + 投机空头上日持仓 + 保值多头上日持仓 + 保值空头上日持仓
总持仓：投机多头总持仓 + 投机空头总持仓 + 保值多头总持仓 + 保值空头总持仓
多头持仓：投机多头总持仓 + 保值多头总持仓
空头持仓：投机空头总持仓 + 保值空头总持仓
净持仓：多头持仓 - 空头持仓
投机多头持仓：同交易员终端
投机空头持仓：同交易员终端
保值多头持仓：同交易员终端
保值空头持仓：同交易员终端
今仓：投机多头今日持仓 + 投机空头今日持仓 + 保值多头今日持仓 + 保值空头今日持仓
总持仓成本：投机多头持仓成本 + 投机空头持仓成本 + 保值多头持仓成本 + 保值空头持仓成本

投资者成交排行

品种：同交易员终端

经纪公司代码：同交易员终端

投资者代码：同交易员终端

总成交量：买成交量 + 卖成交量

总成交额：买成交量*买成交价*合约乘数 + 卖成交量*卖成交价*合约乘数

买成交量：买开仓成交量 + 买平仓成交量 + 买平今成交量

买成交额：买成交量*买成交价*合约乘数

卖成交量：卖开仓成交量 + 卖平仓成交量 + 卖平今成交量

卖成交额：卖成交量*卖成交价*合约乘数

净买入成交量：买成交量 - 卖成交量

净买入成交额：买成交额 - 卖成交额

综合交易平台

报表管理一>交易结算单

● 资金状况

期初结存：上一交易日的期末结存

期末结存：期初结存+持仓盈亏+平仓盈亏+入金-出金-手续费

交割手续费：按设置的交割手续费率（按金额/手数）计算。

交割保证金：进入交割程序的合约保证金

出入金：正数为入金，负数为出金

客户权益：期末结存+质押

可用资金：客户权益-占用保证金

质押：客户质押总额

风险度：客户权益×100/保证金占用

保证金占用：当日结算价×持仓总量×交易保证金比例

应追加资金：如果可用资金为负，就是可用资金的绝对值

基础保证金：改为“保底资金”

● 出入金明细

出入金类型：出入金/银期转帐

资金类型：银行存款/分项资金（投资者入金时候可以选择类型）

方向：出金/入金

● 持仓汇总

买持：买入方向持有的仓位数

买均价：买入仓位的总金额/买入仓位数

卖持：卖出方向上持有的仓位数

卖均价：卖出仓位总金额/卖出仓位数

持仓盈亏：历史持仓盈亏+当日开仓持仓盈亏

保证金占用：同占用的保证金

昨结算：上一交易日的结算价

今结算：今日结算价

平仓盈亏：平历史仓盈亏+平当日仓盈亏

● 持仓明细

保证金：持仓占用的保证金 持仓量×合约乘数×结算价×保证金率