



SUNGARD 金仕达

期货 KSFT_API 条件单操作手册

■ 文档标识

文档名称	期货 KSFT_API 条件单操作手册
版本号	<V1.0>
状况	<input checked="" type="checkbox"/> 草案 <input type="checkbox"/> 评审过的 <input type="checkbox"/> 更新过的 <input checked="" type="checkbox"/> 定为基线的

■ 文档修订历史

版本	日期	描述	文档所有者
V1.0	<2012-03-08>	1. 创建 KSFT_API 条件单操作手册	沈明明

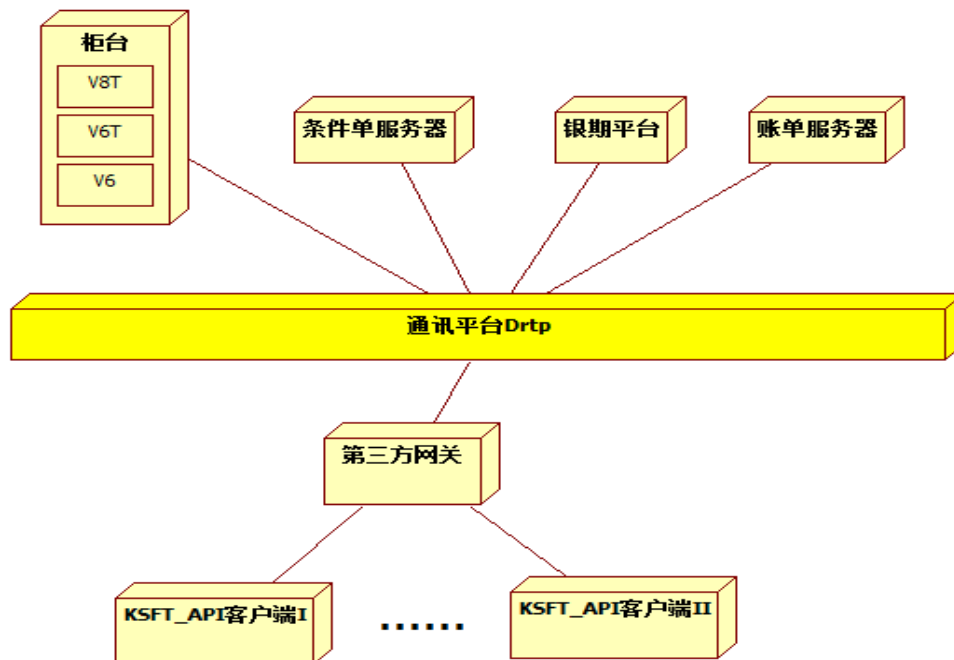
■ 此版本文档的正式核准

姓名	签字	日期

■ 分发控制

副本	接受人	机构

条件单系统结构图



条件单功能说明

◆ 条件单报单权限

条件单报单权限暂时区分：

1) 投资者条件单交易权限

投资者条件单交易权限由经纪公司在投资者交易权限中自行设置。

如果投资者没有条件单交易权限，则会报错“投资者没有下单权限”。

◆ 条件单类型

1. 行情触发：根据投资者设定的行情参考价格触发；
2. 开盘触发：根据交易所开盘信号触发条件单；
3. 时间触发：根据投资者设定的时间条件触发；
4. 行情和时间触发：根据投资者设定的行情参考价格和设定的时间条件双重判断触发。

◆ 条件单触发条件设置

触发条件的参考价格分为最新价、买一价、卖一价，判断条件分为 \geq 、 \leq ，触发价格由用户输入，当参考价格和触发价格满足判断条件时触发报单。

条件单更可设置报单触发次数、报单有效时间、失效时间。

◆ 条件单触发

如果条件单报单时，行情已满足触发条件，则立即触发条件单；

如果条件单报单时，行情不满足触发条件，则条件单处于尚未触发状态，等待行情满足触发条件后触发；

如果条件单报单时，行情中参考价格不存在，不会触发条件单，等待行情满足触发条件后触发；

如果条件单处于尚未触发状态，此时行情中参考价格因行情变动不存在了，不会触发条件单，等待行情满足触发条件后触发；

如果条件单报单时，行情已满足触发条件，但市场处于非交易时段，则在条件单服务器设定的超时时间内待交易所切换到交易时段再触发条件单，否则条件单触发超时；

◆ 条件单修改

条件单尚未触发时，投资者可进行条件单条件修改，这样可方便投资者无需撤除条件单再次录入新的条件单。

◆ 条件单暂停激活

条件单初始报单默认为“激活”状态，在条件单未触发前，投资者可“暂停”条件单，当再次需启用此条件单时可进行“激活”操作。

◆ 条件单撤单

条件单尚未触发时可以正常撤单，无论是处于非交易时段还是连续交易时段；

条件单触发后无法再删除条件单

◆ 条件单选择

条件单触发成功，但委托报单失败后返回“客户请求选择”通知，投资者可进行条件单选择相应操作，可“重试”、“跳过”、“终止”。

◆ 盈损单触发条件设置

盈损单的平仓方式参考价格为市价、买卖价、最新价，投资者可针对买卖价、最新价进行价差（最小变动价的倍数）调整。

盈损单止损价、止盈价的设置：当按指定值来设置时，止损价、止盈价直接填写价格；当根据开仓成交价的相对偏移值来设定时，止损价、止盈价直接填写价差即可。

投资者还可针对止损单进行浮动浮动止损价设定：投资者设定浮动止损价后，条件单服务器根据投资者预想的止损价与行情最新价进行比较，当止损价与最新价的价差大于浮动止损价时，**服务器将从投资者最低损失的角度考虑自动进行止损价的调整**[投资者需考虑到相应的风险]。

当参考价格和触发价格满足判断条件时触发盈损单。投资者可设置止盈单的触发次数，止损单的触发次数默认为1。

◆ 盈损单录入、查询、修改、删除

盈损单可只设定止盈价或止损价，若只设定止损价，条件满足触发后只生成止损条件单；若只设定止盈价，条件满足触发后将只生成止盈条件单；若止损价、止盈价都已设定，盈损单触发

后将生成两条条件单，一条止损单、一条止盈单，这两个条件单是互斥关系，当设置的条件触发时，要么止盈单触发、止损单废弃，要么止损单触发、止盈单废弃。当条件触发后，盈损单后面的流程将进入触发的条件单流程。

◆ 清流重启对条件单、盈损单的影响

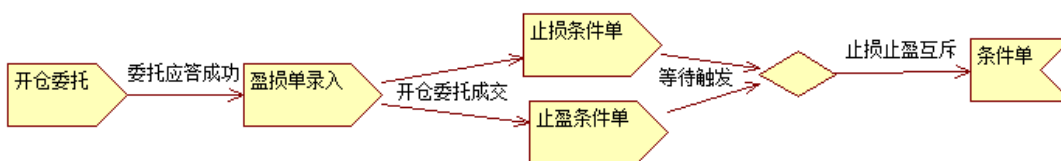
清流重启后，所有条件单都被全部清空。

✚ 关键业务说明

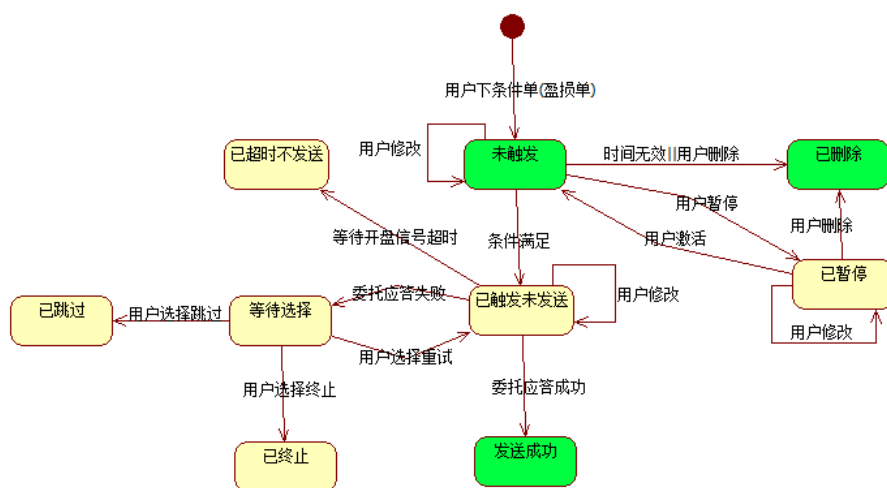
◆ 条件单流程



◆ 盈损单流程



◆ 条件单(盈损单)状态图



注：盈损单的状态仅为以上状态图中绿色三种状态，“未触发”至“已删除”的条件为：开仓委托撤单回报||系统撤单回报||主机拒绝||用户删除