

# 新 GUI 交易终端系统

## 需求分析报告

<div>文件状态：</div> <div>✓ 草稿</div> <div>正式发布</div> <div>正在修改</div>	文件标识：	
	当前版本：	V0. 2010. 8. 31
	作 者：	高志发
	完成日期：	2010 年 8 月 31 日
	审 定：	

版本历史

版本/状态	作者	起止日期	备注
V0. 2010. 8. 31	高志发	2010/8/27-2010/8/31	初稿

# 目 录

第1章 引言.....	5
1.1 编写目的.....	5
1.2 预期读者和阅读建议.....	5
1.3 产品范围.....	6
1.4 参考文献.....	6
第2章 综合描述.....	6
2.1 系统的功能.....	6
2.2 用户类和特性.....	7
2.3 运行环境.....	7
2.4 设计和实现上的限制约束.....	7
第3章 外部接口需求.....	8
3.1 用户界面.....	8
3.1.1 主界面显示内容.....	9
3.1.2 显示设置.....	9
3.2 软件接口.....	12
第4章 系统功能需求.....	13
4.1 系统登录.....	13
4.2 自动重连.....	13
4.3 结算结果确认.....	14
4.4 密码修改.....	14
4.5 软件锁定.....	15
4.6 合约分组.....	15
4.6.1 合约组信息维护.....	15
4.6.2 自选合约维护.....	16

4.7 品种设置.....	17
4.8 显示列表及设置.....	18
4.8.1 各列表公共功能.....	18
4.8.2 各列表的特性.....	18
4.9 下单选项设置.....	24
4.9.1 常规选项.....	24
4.9.2 自动开平.....	26
4.9.3 竖条下单板.....	27
4.9.4 键盘快速下单.....	28
4.9.5 鼠标快速下单.....	30
4.10 报价块.....	32
4.11 下单.....	33
4.12 预埋单和条件单.....	35
4.13 撤单及改单选项设置.....	36
4.14 键盘快速撤单改单设置.....	37
4.15 风险管理.....	39
4.16 快速配置向导.....	40
4.16.1 期货新手.....	40
4.16.2 有经验的投资人.....	41
4.16.3 专业期货妙手.....	45
4.17 期货帐户资金查询.....	49
4.18 历史结算单查询.....	51
4.19 银期转账（可选择银行，选择币种）.....	52
4.20 报表.....	53
4.21 配置信息维护.....	53
4.21.1 保存当前配置.....	54
4.21.2 删除保存配置.....	54
4.21.3 加载保存的配置.....	54
<b>第5章 用户文档.....</b>	<b>54</b>

# 第1章 引言

期货交易终端系统是提供给用户进行期货交易的软件产品，本次中期集团开发的新 GUI 交易终端系统与目前广为使用的快期功能相似，界面相似，操作方法相似，能快速得到客户认可，迅速推向市场。

新 GUI 交易终端产品是通过综合交易平台接口实现期货交易的终端产品，是与快期交易终端具有同一性质的产品，同时系统与中期集团期货交易平台建立了通讯接口，新 GUI 交易终端产品可以接入到中期集团期货交易平台，用户可以使用新 GUI 交易终端产品在中期集团期货交易平台下进行期货交易。

## 1.1 编写目的

新 GUI 交易终端产品实现期货交易终端的功能，提供给期货交易用户使用。该文档是中期集团新 GUI 交易终端系统的需求设计文档，主要从系统功能、设计风格、设计约束、外部接口等方面对产品进行详细描述，作为新 GUI 产品开发及测试的依据。

## 1.2 预期读者和阅读建议

本软件产品需求分析报告预期读者包括：

- 用户；
- 开发人员；
- 项目经理；
- 测试人员；
- 文档编写人员；

## 1.3 产品范围

新 GUI 交易终端产品是模仿快期交易终端的风格而设计的期货交易终端产品，最终可以完全取代快期交易终端，使期货交易用户可以以快期交易终端使用习惯来使用该产品，并达到更加便利的效果。

## 1.4 参考文献

- 快期交易终端使用文档
- 综合交易平台接口 API 文档

# 第2章 综合描述

## 2.1 系统的功能

新 GUI 交易终端系统通过上期技术提供的综合交易平台，实现交易功能，并可接入中期集团的期货交易系统平台。

系统实现了期货交易终端的软件的各項功能，功能如下：

- 登录功能

客户凭自己的 ID 和密码登录软件。

- 结算确认信息

客户登录后对综合交易平台提供的结算信息进行确认。

- 行情功能

可以实时浏览国内所有期货品种及合约的行情信息。

- 交易功能

可以下单、撤单、处理各种回执、回报信息，实现交易功能。交易功能包括普通交易功能和快速交易功能。

- 查询功能

可以从综合交易平台查询各种信息，包括客户资金信息、报单信息、成交信息、持仓信息等。

- 银期业务

可以查询银行账户，查询期货帐户，期货帐户资金转银行，银行资金转期货帐户，查询转账明细等功能。

- 报表功能

提供交易及帐户等统计报表。

同时提供便捷的操作方式，用户可灵活的自定义操作习惯，设置功能的快捷键，完成一键下单、撤单的快速操作。

## 2.2 用户类和特性

该产品提供给进行期货交易的用户使用。

## 2.3 运行环境

Windows 平台下运行

## 2.4 设计和实现上的限制约束

使用 C++语言

wxWidgets 库进行页面开发

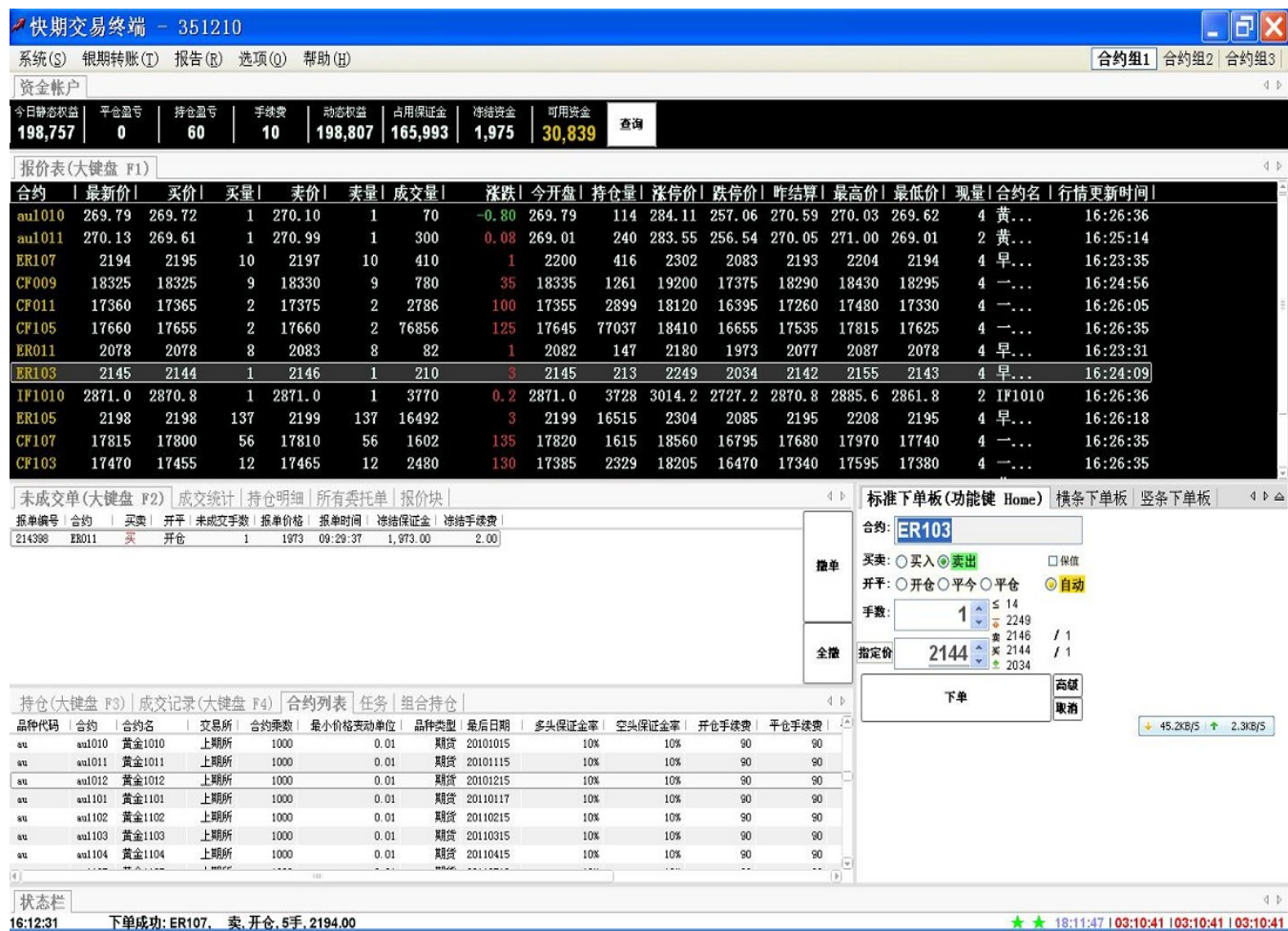
# 第3章 外部接口需求

## 3.1 用户界面

用户界面采用简单易操作的单界面，可以将常用操作和数据显示都集成在同一个页面内，无须手动换页。所有数据实时刷新，无须手动刷新。

界面由系统菜单，资金和通知，操作区三大部分组成。操作区具有板块拖拽功能所以没有固定的布局，用户可以自行调整界面的布局。系统提供默认布局。

主界面设计如图：





### 3.1.1 主界面显示内容

系统主界面可以显示的全部板块如下：

- 资金帐户
- 报价表
- 未成交单列表
- 成交统计列表
- 持仓明细列表
- 所有委托单列表
- 报价块
- 持仓列表
- 成交明细列表
- 合约列表
- 任务列表
- 组合持仓列表
- 下单面板
- 标准下单板
- 横条下单板
- 竖条下单板
- 状态栏

用户可以根据需要选择哪些显示，哪些不显示。

### 3.1.2 显示设置

#### 1. 板块设置

- 用户可以选择是否固定板块位置。

如果用户选择固定板块位置，则各模块将不能够再进行拖拽。

- 用户可以选择板块标题上是否显示快捷键

每一个板块都可以设置快捷键，以便快速切换到该板块，用户可以选择板块标题上是否显示快捷键。如果用户选择了该项，则在板块标题后将显示板块的快捷键。

## 2. 板块信息设置

板块列表中需列出所有提供的板块信息，用户可以设置板块如下信息：

- 是否显示

是否选择“显示”，系统将在主界面中显示该板块，否则不显示。

系统第一次登录显示的板块有：资金帐户、报价表、未成交单、持仓、成交记录、合约列表、标准下单板。

- 隐藏标题

如果选择“隐藏标题”，板块显示时将不显示标题栏。

- 快捷键

用户可以设置板块的快捷键，以便快速切换到该板块。

## 3. 界面风格设置

用户可以选择界面的配置方案，可选择“当前用户设置”的方案和系统默认的方案。

## 4. 其它

- 置顶

用户可以选择将本软件置顶。当选择该项时，系统将总是置于屏幕的最顶端。

- 最小化到托盘

如果选择了该项，当点击最小化按钮时，系统最小化到托盘

- 自动锁定时间

用户可以设置空闲多少秒后自动锁屏，如设置0表示不自动锁屏。

设置界面设计如图：



## 5. 列表颜色设置

用户可以选择或设置列表的配色方案。

系统提供几种默认的配置方案，同时客户可以手动选择列表中底色、文字的的配色。对报价表与其它列表进行分别设置。

用户可选择配色方案：当前配置（用户加载的配置信息中的配色方案），空，全黑，默认。

用户可设置的列表项目：

- 字号：小、中、大
- 文字颜色
- 底色：
- 奇行底色：
- 偶行底色

- 标题文字
- 标题底色

列表颜色设置界面设计如图：

选项设置

品种和合约  
+ 自选合约  
品种设置  
显示  
+ 列表颜色设置  
+ 下单  
+ 撤单及改单  
风险管理  
+ 表格设置

配色方案： 当前配置

报价表字号颜色设置

字号： ☐ 小 ☒ 中 ☐ 大 文字  底色

奇行底色  偶行底色  标题文字

标题底色

其他列表字号颜色

字号： ☒ 小 ☐ 中 ☐ 大 文字  底色

奇行底色  偶行底色  标题文字

标题底色

确定 取消

具体板块涉及到的功能将在“第四章系统功能需求”中介绍。

## 3.2 软件接口

- 综合交易平台 API 接口
- 中期集团期货交易平台接口

系统需与中期集团期货交易平台接口，是新 GUI 可以接入到中期集团期货交易平台，用户可以使用新 GUI 在中期集团期货交易平台下进行期货交易。

## 第4章 系统功能需求

### 4.1 系统登录

系统需对用户身份进行验证，验证正确后，方可允许用户进入系统进行交易等相关操作。

#### 1. 数据输入

##### ● 服务器选择列表框

由于交易系统有多台服务器同时工作，用户可以选择连接到那个服务器进行登录，需提供下拉列表供用户选择服务器。

##### ● 用户帐号及密码输入文本框

用户需输入用户帐号及密码进行身份验证，需提供用户帐号及密码文本框供用户输入。

##### ● 保存帐号选项

系统需提供保存帐号的选项，供用户选择，以免每次登录都需要输入用户帐户。

#### 2. 响应

##### ● 登录或退出

系统需提供“登录”和“退出”等触发接口，供用户触发。

##### ● 登录进度显示

由于登录过程中需要载入许多用户配置等信息，可能造成登录过程有一段延迟，为体现系统的人性化方面，登录过程中显示登录的进度情况。

### 4.2 自动重连

当系统网络中断时，系统可自动进行重新连接。

## 4.3 结算结果确认

系统登录验证成功后，需首先向用户显示交易结算单信息。

显示数据内容如下：

- 基本信息

日期，客户信息（客户号，客户名称），

- 资金状况，

期初结存，交割手续费，交割保证金， 出入金，期末结存，可用资金，平仓盈亏，质押金，风险度，持仓盯市盈亏，客户权益，应追加资金，手续费，保证金占用，基础保证金，质押变化金额

- 成交记录

成交日期，交易所，品种，交割期，买卖，投保，成交价，手数，成交额，开平，手续费，平仓盈亏，成交序号。

及合计信息

- 持仓明细，

交易所，品种，交割期，开仓日期，投/保，买/卖， 持仓量， 开仓价， 昨结算 ， 结算价，浮动盈亏，盯市盈亏，保证金

及合计信息

- 持仓汇总等信息

品种，交割期，买持，买均价，卖持，卖均价，昨结算，今结算，持仓盯市盈亏，保证金占用，投保

及合计信息

## 4.4 密码修改

系统需提供给用户修改密码的功能。

密码修改包括交易密码和资金密码。

需用户输入原密码，新密码，确认新密码。原密码验证正确，同时新密码和确认新密码一致时修改密码才成功。

## 4.5 软件锁定

当用户在“自动锁定时间”设置的时间没有进行任何操作或用户手动点击锁屏功能，系统将进入锁屏，并弹出输入登录密码解锁的对话框，用户只有正确输入密码才可进入系统进行操作。

## 4.6 合约分组

### 4.6.1 合约组信息维护

#### 1. 合约组增加

添加合约组的功能，添加内容可指定合约组名、是否显示（默认显示）切换快捷键设置。

#### 2. 合约组删除

删除合约组的功能，同时清除组下所选的合约的关联。

#### 3. 合约组修改

可对已添加的合约组信息进行修改，可修改合约组名、是否显示、切换快捷键 设置。

界面设计如下：



#### 4.6.2 自选合约维护

当添加合约组后，可向合约组中添加自选合约。

自选合约模块需具备合约检索，合约组信息维护等功能。

##### 1. 合约检索

合约检索可以按照交易所，合约品种进行检索。

合约组自选合约信息维护

##### 2. 增加

检索得到的合约可以添加到合约组中。

##### 3. 删除

在合约组中可以删除已添加的合约。

##### 4. 顺序调整

合约组中的合约可以调整其显示的顺序。



界面设计如下：



## 4.7 品种设置

系统可配置品种的默认参数。

### 1. 增加

系统可增加品种默认参数设置，参数包括默认下单的手数，快捷键。

用户增加某一品种默认参数时，需提供品种的代码（如：cu），默认手数，快捷代码。

### 2. 删除

可删除某一品种的默认参数设置。

## 4.8 显示列表及设置

显示列表包括：报价表，成交记录，持仓，持仓明细，合约列表，所有委托单，未成交单，组合持仓，资金帐户，任务。

### 4.8.1 各列表公共功能

报价表，成交记录，持仓，持仓明细，合约列表，所有委托单，未成交单，组合持仓，资金帐户列表都具有相似的特点。

- 显示的列顺序可以设置。
- 列的显示与否也可以进行设置。
- 点击列标题即可以进行排序。
- 单击鼠标右键可以进行表格列设置。
- 可导出列表信息。

### 4.8.2 各列表的特性

#### 1. 报价表

报价表显示合约的实时行情，报价表中显示定义的某一合约组中的合约实时行情。

报价表的右键菜单中，需包含“设置自选合约”项，用户点击后，进入自选合约维护功能页面（见“合约分组”中“自选合约维护”功能）。

报价表显示的信息内容：

- 合约
- 最新价
- 买价、买量
- 卖价、卖量
- 成交量、持仓量、现量、昨持仓量
- 成交额
- 涨跌、涨跌幅
- 昨收盘、今开盘、今收盘

- 涨停价、跌停价
- 昨结算、结算价
- 最高价、最低价
- 合约名、交易所
- 行情更新时间
- 组合买价、组合买量
- 组合卖价、组合卖量

## 2. 成交记录

成交记录显示的信息内容：

- 成交编码
- 报单编号
- 合约
- 买卖
- 开平
- 成交价格
- 成交手数
- 成交类型
- 成交时间
- 手续费
- 交易所
- 投保

## 3. 成交统计

成交统计显示的信息内容：

- 合约
- 交易所
- 买卖
- 开平
- 成交均价
- 成交手数
- 手续费

#### 4. 持仓

持仓显示的信息内容：

- 合约
- 方向
- 总持仓
- 可平量
- 总可平今量、总可平仓量
- 平今挂单量、平仓挂单量
- 可平今量、可平仓量
- 持仓均价
- 持仓盈亏、平仓盈亏
- 占用保证金
- 投保
- 交易所
- 昨仓、今仓
- 总多仓、总空仓
- 今多仓、今空仓
- 开仓均价、多头开仓价、空头开仓价
- 浮动盈亏、总盈亏
- 今开仓量、今平仓量
- 现价

#### 5. 持仓明细

持仓明细显示的信息内容：

- 成交编号
- 合约
- 买卖
- 手数
- 开仓价
- 占用保证金
- 持仓类型

- 投保
- 交易所
- 开仓时间
- 昨结算
- 平仓量
- 平仓盈亏、持仓盈亏、浮动盈亏
- 最新价
- 组合状态
- 组合合约代码

#### 6. 合约列表

合约列表显示的信息内容：

- 品种代码
- 合约
- 合约名
- 交易所
- 合约乘数
- 最小价格变动单位
- 品种类型
- 最后日期
- 多头保证金率、空头保证金率
- 开仓手续费、平仓手续费、平今手续费
- 开仓手续费率、平仓手续费率、平今手续费率、
- 多头保证金费、空头保证金费

#### 7. 所有委托单

所有委托单显示的信息内容：

- 报单编号
- 合约
- 买卖

- 开平
- 挂单状态
- 报单价格、报单手数
- 成交手数、未成交手数
- 报单时间
- 冻结保证金、冻结手续费
- 详细状态
- 序列号
- 交易所
- 投保
- 报单价格条件
- 有效期类型
- 报单类型
- 最后成交时间
- 成交均价
- 强平原因
- 指令结果
- 客户端信息

#### 8. 未成交单

未成交单显示的信息内容：

- 报单编号
- 合约
- 买卖
- 开平
- 未成交手数
- 报单价格
- 报单时间
- 冻结保证金、冻结手续费
- 序列号

- 交易所
- 投保
- 报单手数、成交手数
- 报单价格条件
- 有效期类型
- 报单类型
- 最后成交时间
- 成交均价
- 强平原因
- 指令结果
- 挂单状态、详细状态
- 客户端信息

#### 9. 组合持仓

组合持仓显示的信息内容：

- 合约
- 开仓均价
- 方向
- 手数
- 投保

#### 10. 资金帐户

资金帐户显示的信息内容：

- 今日静态权益
- 平仓盈亏、持仓盈亏
- 手续费
- 动态权益
- 占用保证金
- 可用资金
- 冻结资金、冻结保证金、冻结手续费
- 风险度
- 信用金额

- 保底资金
- 可取资金
- 上次结算准备金、上次信用额度、上次质押金额
- 质押金额
- 今日出金、今日入金

## 4.9 下单选项设置

系统可以设置下单时的参数，用户可以根据自身情况进行相应的设置。

### 4.9.1 常规选项

#### 1. 合约代码输入选项设置

- 可选择用鼠标输入合约代码

当用户选择该项时，当在下单板中“合约”输入文本框中单击鼠标时系统弹出选择合约品种列表，当用户选择列表中的某一品种时，系统列出属于该合约品种的所有合约。

- 可选择输入缩写和拼音

#### 2. 价格输入选项设置

- 可选择用鼠标输入价格

当用户选择该项时，当在下单板中“报价”输入文本框中单击鼠标时系统弹出数字面板，用户可点击数字面板上的数字来进行价格输入。

- 可选择用键盘快速输入价格

当用户选择该项时，当在下单板中“报价”输入文本框中单击鼠标时系统将光标定位到“报价”的最后一位，通过按键盘数字键按位修改报价。

#### 3. 手数输入

- 可用鼠标输入常用的手数

当用户选择该项时，当在下单板中“手数”输入文本框中单击鼠标时系统将弹出数字面板，用户可点击数字面板上的数字来进行手数输入。



数字面板上只需提供常用的手数即可，如：

1, 2, 3, 4, 5, 10, 15, 20, 50。

#### 4. 下单倍率

功能描述

如果需要以默认手数的几倍下单，可以用快捷键切换手数倍率。

- 增加

用户可以增加下单倍率项，输入项包括快捷键，数量乘数。

- 删除

用户可以删除设置的下单倍率。

- 修改

用户可以单击可编译列表的相应项修改进行修改。

- 界面要求：

显示列表需为可编辑的。

#### 5. 下单反馈

需提供用户下单反馈结果选项，用户选择的项目，在操作完成后，给用户相应的反馈。

需反馈项包括：下单成功，下单失败，挂单成交。

反馈动作包括：弹框，发声。

#### 6. 下单板

- 下单前确认

用户可以设置是否“下单前确认”。

如果用户设置了“下单前确认”，当用户下单时需弹出对话框提示用户，用户确认后再提交下单请求。如果用户没有设置“下单前确认”，当用户下单时不必询问客户，直接提交用户下单请求。

- 固定使用自动开平

用户可以设置是否“固定使用自动开平”。

如果用户设置了“固定使用自动开平”，按自动开平的设置规则（见4.10.2节）自动控制开平及手数。

如果用户没有设置“固定使用自动开平”，用户可以选择“开仓”，“平今”，“平仓”，“自动”来手动控制开平及手数。

界面设计如图：

选项设置

品种和合约  
+ 自选合约  
品种设置  
+ 显示  
- 下单  
常规  
自动开平  
整条下单板  
键盘快速下单  
鼠标快速下单  
+ 撤单及改单  
风险管理  
+ 表格设置

合约代码输入框  
☒ 可以用鼠标输入合约代码  
☒ 可以输入缩写和拼音

价格输入框  
☒ 可以用鼠标输入价格  
☒ 键盘快速输入价格

手数输入框  
☒ 可以用鼠标输入常用手数

1	2	3
4	5	10
15	20	50

下单反馈  
下单成功 ☒ 弹框 ☒ 发声  
下单失败 ☒ 弹框 ☒ 发声  
挂单成交 ☒ 弹框 ☒ 发声

下单倍率  
如果需要以默认手数的几倍下单, 可以用以下快捷键切换手数倍率

快捷键	数量乘数

增加 删除

下单板  
☒ 下单前确认 ☐ 固定使用自动开平

确定 取消

## 4.9.2 自动开平

自动强平是指使用键盘或鼠标快捷下单时，按照设置的选项自动控制开平及手数，键盘快捷下单总是使用自动开平。当无持仓时，按默认手数发开仓单（默认手数在“品种设置”功能中设置）。

用户可以进行的选项设置

### 1. 鼠标下单使用自动强平

如果用户不选择该项，则鼠标快捷下单总是开仓。

### 2. 有持仓时

用户可以选择设置三种情况中的一种

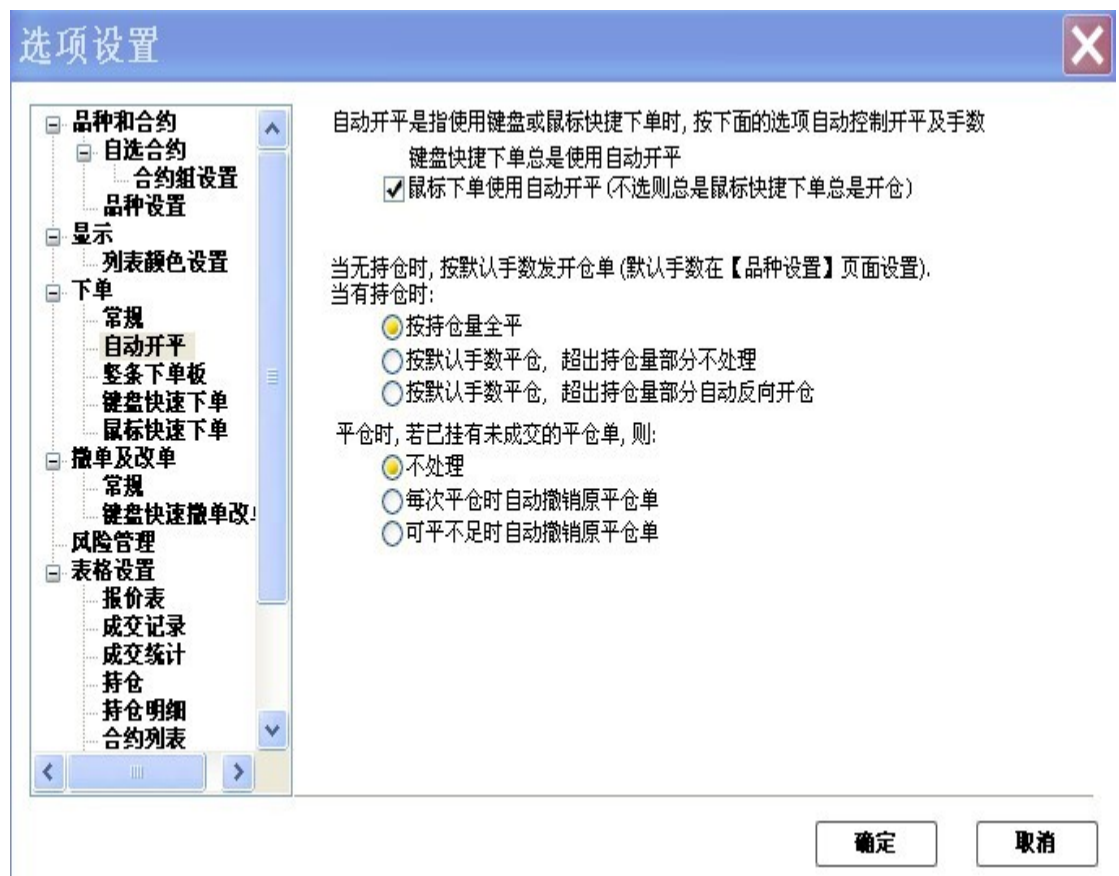
- 按持仓量全平。

- 按默认手数平仓，超出持仓量部分不处理。
  - 按默认手数平仓，超出持仓量部分自动反向开仓。
3. 平仓时，若已挂有未成交的平仓单

用户可以选择设置三种情况中的一种

- 不处理。
- 每次平仓时自动撤销原平仓单。
- 可平不足时自动撤销原平仓单。

界面设计如图：



### 4.9.3 竖条下单板

用户可调整竖条下单板中各控件的顺序

界面设计如图：



#### 4.9.4 键盘快速下单

用户可以只通过键盘进行快速下单。

用户可以选择启用报价表键盘下单，并按照操作习惯添加快捷代码，快捷键设置信息包括：快捷键值，买卖方向，价格，超价，动作。

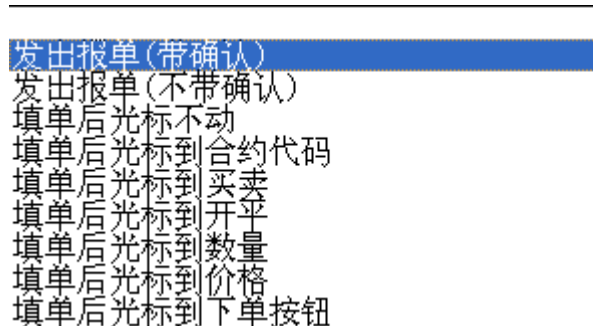
买卖价格可设置为：买一价，卖一价，最新价。

超价：合约指定价相对于设置的价格偏移量。

公式为：合约指定价（下单时价格）=买卖价格+合约最小价格变动单位\*超价。

动作：填单后鼠标动作。

动作内容列表如下：



启用后用户定位到报价表某一合约后，通过按下设置的快捷键进行下单内容填充，并根据“动作”进行操作。

- 增加

用户可以增加新的快速下单快捷键设置

- 删除

用户可以删除已设置的快捷键设置。

界面设计如图：



当用户选择“启动报价表键盘下单”时，“同步到下单板”与“下单后光标回报价表”选择项变为可用，否则为不可用。

当用户添加新快捷键信息时，  
当选择“快捷键”列表项，系统在下拉列表中列出所有可选择的快捷键

当选择“买卖”列表项，系统在下拉列表中列出“买”与“卖”选项。

当选择“价格”列表项，系统在下拉列表中列出“ ”，“买一价”，  
“卖一价”，“最新价”选项。

当选择动作列表项，系统在下拉列表中列出动作的内容（如上：动作  
内容列表）选项。

当用户选择“增加”按钮时，在列表中增加一行供用户设置。

当用户单击列表框时，用户可以对列表框中的内容进行修改。

### 4.9.5 鼠标快速下单

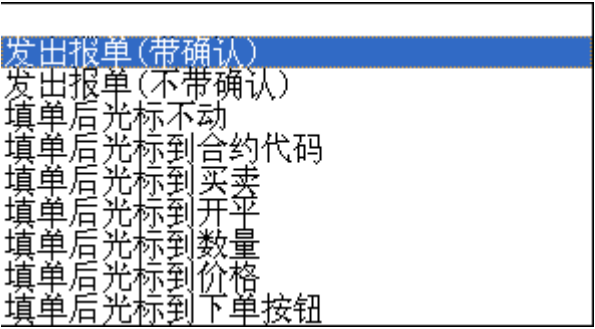
用户可以只通过鼠标进行快速下单。

用户可以选择使用鼠标点击报价表，持仓表进行下单操作。

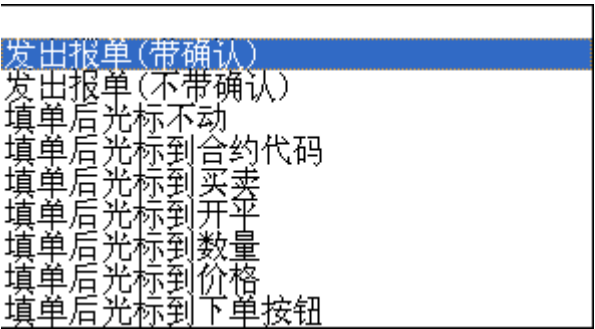
用户可以设置鼠标点击事件动作，同时可以设置下单方向。

#### 1. 报价表鼠标点击设置

● 鼠标“单击”设置，用户可以选择动作如下：

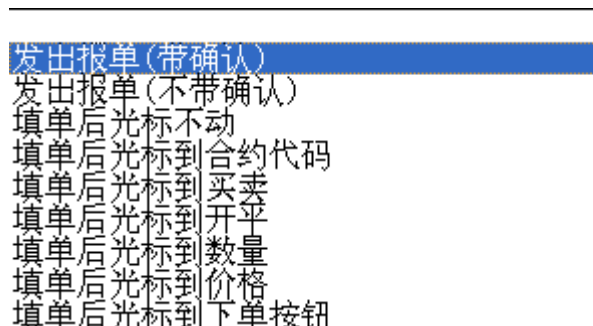


● 鼠标“双击”设置，用户可以选择动作如下：

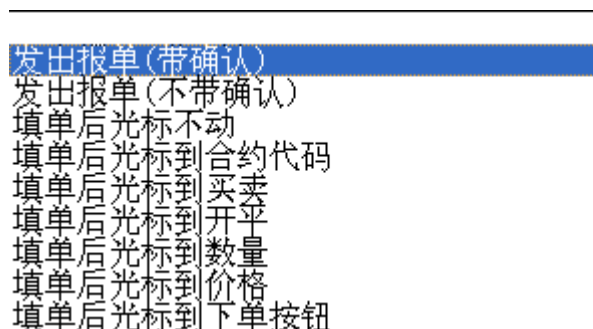


## 2. 持仓表鼠标点击设置

- 鼠标“单击”设置，用户可以选择动作如下：



- 鼠标“双击”设置，用户可以选择动作如下：



## 3. 下单方向设置

- 反向，点卖价下买单，点卖价下卖单
- 同向，点买价下买单，点买价下卖单

可选择是否“允许 Ctrl 点击临时反转方向”。



## 4.10 报价块

对于合约组中每一个合约都要有一个报价块与其对应，显示每个合约的报价信息。根据用户选择的合约组中相关合约的信息，报价块中显示相应的合约报价信息。

报价信息包括：合约编号，最新价，涨跌，最高价，最低价，买价，买量，卖价，卖量，成交量，持仓量，可供用户调整的手数。

用户点击报价块信息时，系统自动用户报价块信息设置下单板上相应项，方便用户操作。

界面设计如图：





## 4.11 下单

下单是交易系统最主要的功能，根据用户的设置可以进行不同的下单方式。

用户下单需填写的项目包括：

### 1. 合约

合约代码用户可手动输入，也可选择

### 2. 买卖方向

- 买入
- 卖出

### 3. 保值或投机

默认为投机。

### 4. 开平

- 开仓
- 平今
- 平仓
- 自动

系统根据自动判断。

## 5. 手数

根据可用资金及指定价格等相关信息，计算显示现可下单的最大手数。

## 6. 指定价或跟盘价

价格可选择指定价、跟盘价。当前为“指定价”时，可单击“指定价”区域切换到“跟盘价”，当前为“跟盘价”时，可单击“跟盘价”区域切换到“指定价”。

如选择指定价，则用户可设置价格。

如选择跟盘价，则系统根据当前报价自动设置价格。

系统需在价格输入框后显示买一价、买量、卖一价、，卖量、涨停价，跌停价，同时用户单击各价格数据可将价格自动填充到价格文本框中。

界面设计如图：

The screenshot displays a trading interface with the following elements:

- 合约:** CF107
- 买卖:** ☐ 买入 ☒ 卖出 ☐ 保值
- 开平:** ☐ 开仓 ☐ 平今 ☐ 平仓 ☒ 自动
- 手数:** 1 (with a range indicator ≤ 6)
- 指定价:** 17985
- Price Data:**
  - 18765 (with a red arrow pointing down)
  - 17995 (with a red arrow pointing down)
  - 17980 (with a green arrow pointing up)
  - 16980 (with a green arrow pointing up)
- Buttons:** 下单, 高级, 取消

## 7. 常规下单

用户通过手动或选择输入合约编号，买卖方向，保值或投机，开平仓手数，指定价进行下单。

## 8. 键盘快速下单

根据下单选项设置中设置的选项进行下单。

## 9. 鼠标快速下单

根据下单选项设置中设置的选项进行下单。

系统同时还提供“竖条下单板”和“横条下单板”，用户可以根据习惯选择使用哪一个下单面板。

竖条下单板界面设计如下：

竖条下单板

合约

ER107

指定价

2204

开平

开仓

买卖

卖出

☐ 保值

手数

1

下单

取消

可用资金：177,767.66

可开手数：81

可平/今：0/0

用户可以设置各控件的顺序。

横条下单板界面设计如下：

横条下单板

合约代码

买卖

开平

报单价格

报单手数

下单

取消

☐ 快速(K)

ER105

卖出

开仓

2208

1

## 4.12 预埋单和条件单

下单时系统需提供高级选项，使用户可以完成预埋单、条件单功能。

预埋和条件单不支持自动开平。

当用户选择下单面板的“高级”选项时，用户可以选择“开始交易时发出”和“行情满足条件时发出”。

- 开始交易时发出

用户可以在交易前预埋单，当交易时系统自动发出。

- 行情满足条件时发出

用户可以设置下单价格的触发条件。当满足用户设定的条件时，系统自动提交用户下单。

界面设计如图：



设置下单条件

下单: 价格 2090.00, 开仓 卖 ER011 2手

☒ 开始交易时发出

☐ 行情满足条件时发出

买一价 等于 0.00

确定 取消

## 4.13 撤单及改单选项设置

### 1. 常规撤单

#### ● 鼠标双击撤单

如果选择该项，鼠标双击未成交单列表中未成交单，即可撤单。

#### ● 撤单前确认

撤单前是否要用户确认，如果选择该项用户确认后方可提交撤单，否则直接提交撤单请求。

#### ● 隐藏撤单按钮

在未成交单中需显示“撤单”和“全撤”按钮，如选择该项，则“撤单”和“全撤”按钮将隐藏（见为成交单设计图）。

### 2. 常规改单

#### ● 启用常规改单

当该功能启用时，用户可以选择未成交单列表中的未成交单的“未成交手数”和“报单价格”进行修改，修改后重新提交下单请求。

#### ● 改单前确认

### 3. 撤单反馈

#### ● 撤单成功

- 弹出提示框，
- 发出声音
- 撤单失败
- 弹出提示框，
- 发出声音

界面设计如图：



## 4.14 键盘快速撤单改单设置

- 启动键盘撤单改单

用户可以选择启动或关闭键盘撤单改单

- 快捷键设置

启动键盘撤单改单后，用户可以进行快捷键设置。

- 增加

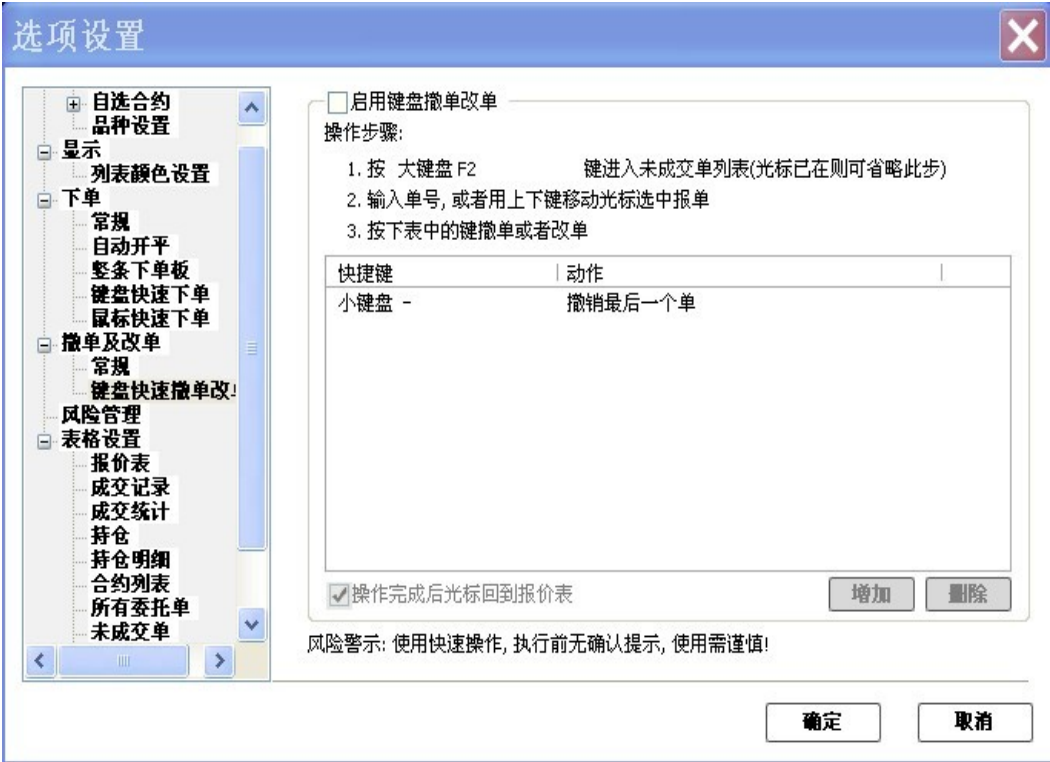
用户可以增加新的快速撤单改单快捷键设置

● 删除

用户可以删除已设置的快捷键设置。

● 光标位置

用户可以选择“操作完成后光标回到报价表”。



当用户添加新快捷键信息时，

当选择“快捷键”列表项，系统在下拉列表中列出所有可选择的快捷键。

当选择“动作”列表项，系统在下拉列表中列出动作的内容选项。

动作内容列表如下：

撤销选中单
撤销最后一个单
撤销最早一个单
按合约撤单
按方向撤单
按合约及方向撤单
全部撤单
改价格
改手数

当用户选择“增加”按钮时，在列表中增加一行供用户设置。

当用户单击列表框时，用户可以对列表框中的内容进行修改。

## 4.15 风险管理

用户可以设置一些操作限制，以控制用户下单或无操作风险。

- 单笔手数限制

用户可以设置单笔手数限制。

- 清空下单板

下单后是否清空下单板，及需要清空的选项。

清空选项为：不清空，全部清空，清空价格和手数，只清空手数。

界面设计如下：

选项设置

自选合约品种设置

显示

列表颜色设置

下单

常规

自动开平

整条下单板

键盘快速下单

鼠标快速下单

撤单及改单

常规

键盘快速撤单改!

风险管理

表格设置

报价表

成交记录

成交统计

持仓

持仓明细

合约列表

所有委托单

未成交单

下单限制

单笔手数限制

0 手

清空下单板

下单后是否清空下单板

☐ 不清空

☐ 全部清空

☐ 清空价格和手数

☒ 只清空手数

确定 取消

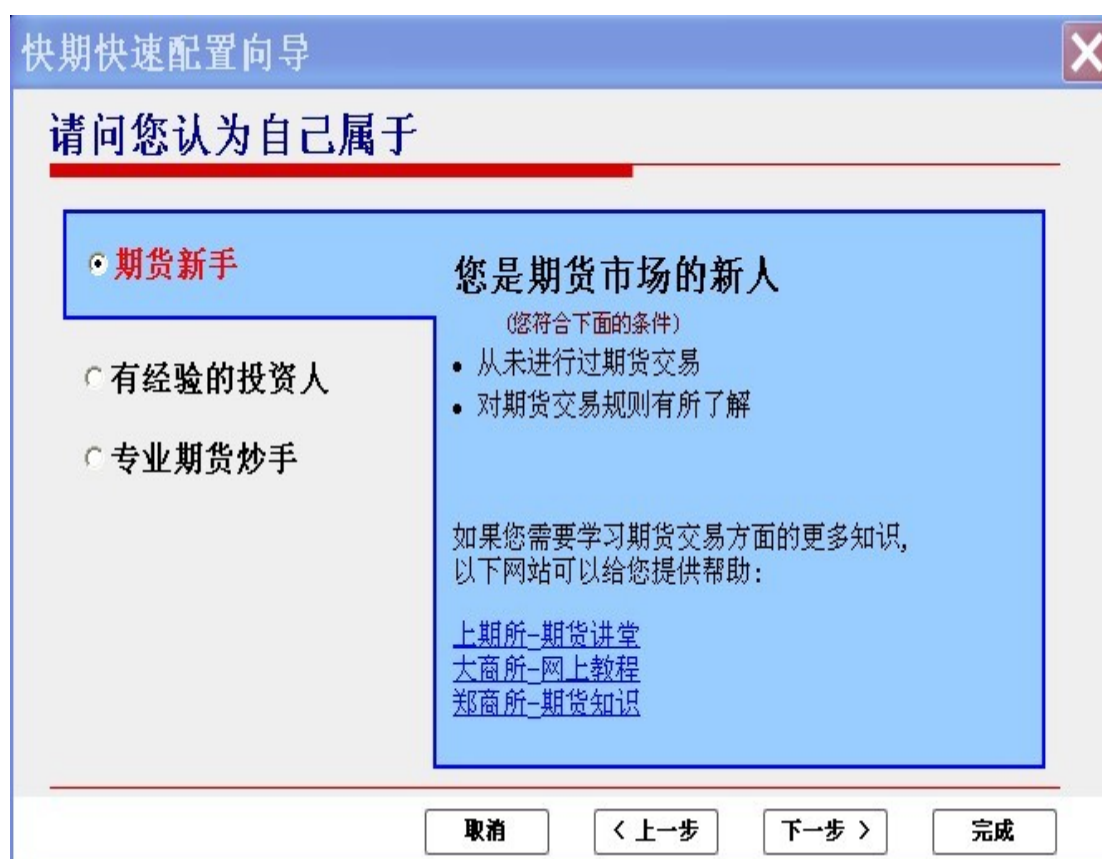
## 4.16 快速配置向导

用户可以通过快速配置向导来对系统进行设置。

快速配置向导将用户分为期货新手、有经验的投资人、专业期货炒手三类来进行不同的向导配置。

对于向导的每一步骤都要有解释说明，每一个选项也需配备相应的说明示例。

界面设计如图：



### 4.16.1 期货新手

1. 期货新手条件
  - 从未进行过期货交易
  - 对期货交易规则有所了解
2. 新手模式配置内容



- 精简界面
- 开启所有下单前确认和成交提示
- 关闭鼠标快速下单，关闭键盘快速下单
- 下单后清空下单板

该部分还需提供新手简单教程，提示设置自选合约的步骤，开仓、平仓的步骤，撤单的步骤，显示系统设置等相关的信息。

#### 4.16.2 有经验的投资人

1. 有经验的投资人条件
  - 熟悉期货交易规则
  - 此前曾经进行过期货交易
  - 平均每日交易不超过 10 次
2. 配置选项

需提供给用户“系统推荐的配置”和“按用户以前系统进行配置”的两种方案。“系统推荐的配置”是本系统自定义的一种配置方案，“按用户以前系统进行配置”是用户可以按以前使用“金仕达”或“易盛”的习惯进行配置。

界面设计如下：



- 1) 系统提供优化设置方案

系统推荐的优化配置方案内容包括：

- 使用系统推荐的页面布局
- 鼠标单击填单
- 鼠标双击下单
- 开启快速改单功能
- 显示资金栏和状态栏

如界面：



#### ● 其它配置

用户可以根据需要选择其它的配置

附加：锁屏，下单后清空下单板，强制置顶

提示弹出框：下单成功提示，下单失败提示，撤单成功提示，撤单失败提示

提示音：下单成功发声，下单失败发声，撤单成功发声，撤单失败发声

界面设计如下：

其它配置

附加：

☒ 锁屏

☒ 下单后清空下单板

☐ 最小化到托盘

☐ 强制置顶

提示弹出框：

☐ 下单成功提示

☒ 下单失败提示

☐ 撤单成功提示

☒ 撤单失败提示

提示音：

☐ 下单成功发声

☐ 下单失败发声

☐ 撤单成功发声

☐ 撤单失败发声

取消

< 上一步

下一步 >

完成

2) 用户要求按以前的习惯进行配置

用户可以按以前使用“金仕达”或“易盛”的习惯进行选择，系统按用户的选择进行页面布局配置。

金仕达界面布局如图：

请问您以前使用何种交易软件

☒金仕达

我以前使用的是金仕达V6系统

☐易盛

报价

委托 持仓 成交

下单板

取消

< 上一步

下一步 >

完成

易盛界面布局如图：

请问您以前使用何种交易软件

☐金仕达

我以前使用的是易盛系统

☒易盛

报价

下单板

委托

持仓

取消

< 上一步

下一步 >

完成

- 增强配置
- 快速价格输入
- 键盘改单
- 鼠标双击直接下单

界面设计如下：

### 增强配置

☒ **快速价格输入**

☒ 键盘改单

☐ 鼠标双击直接下单

#### 功能说明

- 修改价格时只需输入最后几位
- 输入带小数点的价格时免输入小数点

#### 功能示例

比如在下单板中要将价格12345.5改为12336.1，则点击价格后输入361就可以了

指定价格	12345.5	-->	指定价格	12345.3
指定价格	12343.6	-->	指定价格	12336.1

取消

< 上一步

下一步 >

完成

### 4.16.3 专业期货妙手

#### 1. 专业期货妙手条件

- 专业从事期货交易工作
- 平均每日交易超过 10 次

#### 2. 操作习惯选择

- 鼠标填单键盘下单

#### 下单操作

- 1) 用鼠标点击报价中的买价或卖价填单
- 2) 用键盘输入价格

- 3) 按回车到下单按钮,再回车下单

#### 撤单操作

- 1) 用鼠标双击【未成交单】中的委托单撤单

#### 平仓操作

- 1) 用鼠标点击持仓填单
- 2) 用键盘修改价格后下单

#### ● 键盘填单键盘下单

#### 下单操作

- 1) 用上下键选择合约
- 2) 按【1】键填买单,或按【3】键填卖单
- 3) 键盘输入价格,按回车到下单按钮,再回车下单

#### 撤单操作

- 1) 按小键盘【-】键撤最后一个单

或者

- 2) 按【F2】键到未成交单
- 3) 按【Delete】键撤选中单

#### 相关选项

【选项】-【下单】-【键盘快速下单】

【选项】-【撤单及改单】-【键盘快速撤单改单】

【选项】-【下单】-【常规】

【选项】-【品种和合约】-【品种设置】

#### ● 鼠标填单鼠标下单

#### 下单操作

- 1) 用鼠标点击报价中的买价或卖价填单
- 2) 在下单板用鼠标就能修改价格和手数
- 3) 点【下单】按钮下单

## 撤单操作

- 1) 用鼠标双击【未成交单】中的委托单撤单

## 相关选项

【选项】-【下单】-【鼠标快速下单】

【选项】-【下单】-【常规】

【选项】-【品种和合约】-【品种设置】

- 鼠标一键下单

## 下单操作

- 1) 在【报价块】的手数输入框输入手数
- 2) 双击【报价块】的买价或卖价直接下单,有持仓时会自动处理发平仓单

## 撤单操作

- 1) 用鼠标双击【未成交单】中的委托单撤单

## 相关选项

【选项】-【下单】-【鼠标快速下单】

【选项】-【下单】-【常规】

【选项】-【品种和合约】-【品种设置】

- 键盘一键下单

## 下单操作

- 1) 用上下键选择合约
- 2) 按以下键直接下单:
  - 【1键】买价买入 【3键】卖价卖出
  - 【4键】卖价买入 【6键】买价卖出

## 撤单操作

- 1) 按【-】键撤最后一个单

## 相关选项

【选项】-【下单】-【鼠标快速下单】

【选项】-【下单】-【常规】

**【选项】 - 【品种和合约】 - 【品种设置】**

3. 增强功能

- 快速价格输入
- 快速改单
- 自动开平
- 临时反向
- 下单板下单不要确认
- 双击撤单和改单不确认

4. 其它配置

用户可以根据需要选择其它的配置

附加：锁屏，下单后清空下单板，强制置顶

提示弹出框：下单成功提示，下单失败提示，撤单成功提示，撤单失败提示

提示音：下单成功发声，下单失败发声，撤单成功发声，撤单失败发声

界面设计如下：



## 其它配置

附加：

- ☒ 锁屏
- ☒ 下单后清空下单板
- ☐ 最小化到托盘
- ☐ 强制置顶

提示弹出框：

- ☐ 下单成功提示
- ☒ 下单失败提示
- ☐ 撤单成功提示
- ☒ 撤单失败提示

提示音：

- ☐ 下单成功发声
- ☐ 下单失败发声
- ☐ 撤单成功发声
- ☐ 撤单失败发声

取消

< 上一步

下一步 >

完成

## 4.17 期货帐户资金查询

期货帐户资金内容包括：

- 上次结算准备金
- 上次信用额度
- 上次质押金额
- 质押金额
- 今日出金
- 今日入金
- 今日静态权益

今日静态权益 = 上次结算准备金 - 上次信用额度 - 上次质押金额  
+ 质押金额 - 今日出金 + 今日入金

- 平仓盈亏
- 持仓盈亏

- 手续费
- 动态权益

动态权益 = 今日静态权益 + 平仓盈亏 + 持仓盈亏 - 手续费

- 占用保证金
- 冻结保证金
- 冻结手续费
- 信用金额
- 可用资金

可用资金 = 动态权益 - 占用保证金 - 冻结保证金 - 冻结手续费  
+ 信用金额

- 保底资金
- 可取资金

界面设计如图：

期货资金帐户详情	
上次结算准备金：	218,420.16
- 上次信用额度：	0.00
- 上次质押金额：	0.00
+ 质押金额：	0.00
- 今日出金：	0.00
+ 今日入金：	0.00
<hr/>	
= 今日静态权益：	218,420.16
+ 平仓盈亏：	0.00
+ 持仓盈亏：	2,530.00
- 手续费：	0.00
<hr/>	
= 动态权益：	220,950.16
- 占用保证金：	41,577.50
- 冻结保证金：	0.00
- 冻结手续费：	0.00
+ 信用金额：	0.00
<hr/>	
= 可用资金：	179,372.66
<hr/>	
<hr/>	
保底资金：	0.00
可取资金：	123,789.86
<hr/>	
<hr/>	
<input type="button" value="确认"/>	

## 4.18 历史结算单查询

用户可以查询“日结算单”和“月结算单”。

结算单内容包括：

- 日期
- 客户号
- 客户名称
- 资金状况
- 期初结存
- 交割手续费
- 交割保证金，
- 出入金，
- 期末结存，
- 可用资金，
- 平仓盈亏，
- 质押金，风险度，
- 持仓盯市盈亏，
- 客户权益，
- 应追加资金，
- 手续费，
- 保证金占用，
- 基础保证金

显示界面设计如下：

历史结算结果查询

2010- 6- 4

查日结算单

查月结算单

关闭

综合交易平台模拟环境

制表时间: 20091029

交易结算单

客户号: 351210

客户名称: 351210

日期: 20091029

欢迎

资金状况(盯市)

期初结存:	200000.00	交割手续费:	0.00	交割保证金:	0.00
出入金:	0.00	期末结存:	200000.00	可用资金:	200000.00
平仓盈亏:	0.00	质押金:	0.00	风险度:	0.00%
持仓盈亏:	0.00	客户权益:	200000.00	应追加资金:	0.00
手续费:	0.00	保证金占用:	0.00	基础保证金:	0.00

恭喜

## 4.19 银期转账（可选择银行，选择币种）

银期转账需包含以下功能：

- 查询银行帐户
- 查询期货帐户
- 期货帐户资金转银行
- 银行资金转期货帐户
- 查询转账明细

明细信息内容包括：期货流水号，银行账号，交易类型（银行资金转期货、期货资金转银行），发生金额，交易时间，有效标志（无效或失败，有效）。

主界面设计如下：



银期转账

选择银行

资金帐户密码

转账金额 0.00

币种选择 RMB

查询银行帐户 查询期货帐户

期货帐户资金转银行 银行资金转期货帐户

查询转账明细 取消

## 4.20 报表

系统可以统计交易及帐户报告。

1. 报告范围
  - 今日
  - 最近一周
  - 最近一月
  - 指定日期
2. 报告项目
  - 帐户概要
  - 交易统计
  - 期末持仓
  - 平仓记录

## 4.21 配置信息维护

系统的界面，配色等都可由用户自行进行配置，用户可以对自行配置的信息进行保存及载入。系统关闭时，系统自动保存用户的当前配置。

### 4.21.1 保存当前配置

系统需对当前的系统配置进行保存，当前配置信息包括：

- 界面布局
- 自选合约
- 配色方案
- 下单及其他

快速下单、撤单的配置，快捷键的配置。

### 4.21.2 删除保存配置

用户可删除保存的配置信息。

界面设计如下：



用户只需选择要保存的项目，输入保存名称即可保存，

### 4.21.3 加载保存的配置

用户可以加载保存的配置。加载后系统按配置信息进行设置。

## 第5章 用户文档

与软件产品一同交付的用户文档包括：

- 安装指南

- 用户手册