**交易辅助软件（TSS）需求（一期）**

# 1本期要点

由于资管业务的迫切性时间上的紧蹙，因此一期项目必须在时间和功能性上做一定取舍，将尽量缩短开发时间，在春节前打造出一款能符合主管交易模式的最小需求的软件，在功能的实现上作出一定省略，但可以满足初步的交易限制和持仓盈亏、日内最大盈亏的强行平仓功能。

本次按照资管要求的最核心需求：

1 MC策略发布服务

2客户端的交易指令跟随

3 客户端单笔持仓盈/亏限制，持仓时间限制，日内最大亏损限制。

# 2数据属性

1【输出的数据记录格式】文件名称定义：策略名称+品种名称

字段间用’,’隔开 日期时间,策略名称（全局唯一）,期货合约,交易控制（1 只能做多， -1只能做空， 0不限制），日内新记录已追加形式加入（fileappend）

文名举例：jianciIF.inf

内容举例： 20130118091500,jianciIF,if1301,1

2【策略信息】策略名称，策略id，期货合约

3【交易员】交易员名称、id、登陆密码、绑定的指导策略、交易商品，交易账户,理财金额限制（金额）、单笔止盈止损（点数）、持仓时间限制、当日最大亏损额度（金额）。

数据关联，本采用最简单形式，交易策略和交易员1对1关系，交易员和交易账户1对1关系。

# 3策略端

1读取MC交易日志，该日志中逐行描述了当前交易，每当有交易产生时MC在此文件中增加一行记录，格式按照【输出的数据记录格式】中约定书写，读取该条信息后使用其中的策略名称字段通过某种方式得到对应的客户端，向这些客户端发送开仓方向指示。

2基本数据的组织，本期只包括【策略信息】【交易员】，要求服务端提供录入这些内容

3策略信号和对应交易员的匹配，要求客户端登陆到服务端，记录登陆客户端的交易账户id、IP地址及端口，当策略产生信号后可在【交易员】记录中查询到策略对应的交易员id，在客户端登陆表中查询到真实的客户端地址，向这些地址发送策略方向消息。

# 4交易客户端

1单账户下单版即可

2客户端登陆后向服务端发送交易账户,IP地址和端口

3持仓时间限制、持仓盈亏限制、日内最大亏损限制、交易合约限制、最大持仓手数，客户端设置。

4持仓盈亏限制说明：采用每笔成交的单独跟踪记录，达到盈亏限制后平仓并且界面提醒交易员。

5日内最大亏损说明：当交易员达到当日最大亏损额时，如果当前有持仓，交易员可以不马上平仓，但是只能下平仓单不能再下开仓单，当前仓位仍然按照单笔止损的设置处理，达到止损之后强行平仓；如果当前持仓亏损没有达到单笔亏损，则从交易员累计亏损达到当日最大亏损额的那一刻开始计时，弹出倒计时窗口，超过3分钟没有回归到当日最大亏损额以下则强行平仓。如果该笔交易帮助交易员把亏损挽回到最大亏损额之下，并且，保持在最大亏损额之下30秒钟，则倒计时终止，交易员之后还可以正常做单。

6交易方向限制说明：

* 用例 1 登陆后查询用户所属的交易策略信号，如果有多或空信号，则交易端只能根据信号方向开仓；
* 用例2 登陆后查询用户所属的交易策略信号，如果策略没有提出指示（[无]状态），则要根据【群组设置】默认交易方向权限设置的方向开仓交易，默认设置为空的情况下交易员可以自由决定开仓方向；
* 用例3当交易员开仓后，持仓过程中如果接收到策略端的相反操作指令，当前持仓可以继续持有，但如果要开新的仓位，则只能顺应服务端的开仓方向限制信号；

7界面要求：持仓时间限制、持仓盈亏限制、日内最大亏损限制、交易合约限制等在界面上有提示，持仓时间倒计时、持仓盈亏显示、当前平仓+持仓的盈亏、当前持仓手数，当由于莫原因强制平仓后要在界面提示。