**最终说明：**

\*只有上期所合约，区分平今/平昨下单，其他交易所都只支持平仓下单。所以只有上期所合约平今手续费需要单独计算，其他都是用平仓手续费（率）计算。

\*交易员旗下的各委托交易帐号，以下简称为交易帐号。

\*交易终端和服务器要进行小规模的自主撮合交易的工作（收到的平仓单平掉的是哪个持仓明细）。

\*服务器要将自主撮合的平仓明细进行记录

1. 每个交易帐号，都需要在系统内维护各自的持仓明细。（终端和服务器）
2. 每个交易帐号打算进行平仓（平今）操作时，都需要在交易终端判断自身是否拥有相应持仓，符合才允许下单，不符合不能下单。
3. 每个交易帐号的平仓返回后，维护自身持仓明细，减掉同合约最早开仓的持仓明细，并依据自身持仓数据差计算相应的平仓盈亏和手续费。（持仓，持仓明细，资金都维护了）
4. 每日结算时，每个交易帐号根据自身维护的持仓明细，计算持仓盈亏，并进行资金维护。
5. 每日结算时，结算人员判断所有平仓成交报单里，属于平今仓的且平今有优惠的特殊报单。根据报单编号，将返换的手续费，添加到下单的交易帐号下面。（此项功能自动处理，可以手动修改数据）

* 举例说明，A帐号有今持仓，B帐号有昨持仓。不是上期合约，平今有优惠。 A帐号平仓，平掉的是B帐号的持仓。A帐号盘中收平仓手续费，结算时不进行返还。

A帐号平仓，平掉的是A帐号的今仓。A帐号盘中收平仓手续费，结算时返回平今优惠

B帐号平仓，平掉的是B帐号的持仓。B帐号盘中收平仓手续费，结算时不进行返还

B帐号平仓，平掉的是A帐号的今仓。B帐号盘中收平仓手续费，结算时返回平今优惠。

* A帐号有今仓，B帐号有昨仓。是上期合约

A帐号只能平今，盘中就按照平今手续费计算，无返还。

B帐号只能平昨，盘中按照平仓手续费计算，无返还。

1. 我们只从CTP接收报单、成交数据。其他的持仓、持仓明细、资金都自行维护。每日初始登录从服务器（数据库）获取，之后根据报单、成交交易终端自行维护。
2. 结算返还手续费后，交易帐号汇总和TP返回的资金项应该完全一致。

报单、成交中合约、买卖、开平、手数、时间应该一致

持仓中、合约和手数应该一致。

平仓明细，根据服务器维护的为准。

参考资料

1.针对某些品种，平今有优惠的解决方案。

|  |
| --- |
| 哪些交易所的哪些品种或合约  平今有优惠？。。 -----铜、黄金、白银、白糖、玻璃平今免收 |
| 菜粕、菜籽也是平今免收 |
| 焦炭平今，减0.4万分 |

交易所规定是：先平老仓，再平新仓

不是做上海的品种，就不能优先平今仓  
手续费的话，就是盘中还是照收，免收的，结算时会返还

结论：我们只需要针对已经发生的平今仓行为，有优惠的进行手续费返还即可。

对于虚拟子帐号，平今可能没有优惠。可以在说明文档里注明，或者提前声明。这是无法避免的，所以系统内不需解决此问题。