



上海期货
信息技术有限公司

Shanghai Futures Information Technology Co.,Ltd.

综合交易平台结算平台 业务操作手册

文件状态：	文件标识：	SFIT_综合交易平台管理平台_业务操作手册
<input type="checkbox"/> 草稿	当前版本：	v5.5.4
<input type="checkbox"/> 正式发布	作 者：	
<input checked="" type="checkbox"/> 正在修改	完成日期：	

上海期货信息技术有限公司

Tel: 68400001

Fax: 68400980

目录

1 操作员管理.....	4
1.1 操作员的新增。.....	4
1.2 对操作员授予角色.....	4
1.3 对操作员设置操作员组织架构关系管理.....	4
1.4 对操作员进行其他设置和操作.....	5
2 统一开户流程.....	6
2.1 主席统一开户流程 4 步操作.....	6
2.2 二席开户流程.....	10
2.3 开户完成后续工作：.....	11
2.4 主席销户流程.....	11
2.5 二席销户流程.....	12
2.6 休眠户处理、历史账户规范及逾期未规范账户处理.....	12
3. 费率的设置.....	15
3.1 手续费率设置.....	15
3.2 保证金率设置.....	20
4. 银期转账.....	34
4.1 签约开户.....	34
4.2 银期入金.....	35
4.3 银期出金.....	35
4.4 解约销户.....	36
4.5 银期转账限额控制.....	36
5. CTP 结算与交割流程.....	37
5.1 结算前准备.....	37
1. 维护今日的成交和结算价.....	37
5.2 结算.....	41
5.3 交易所资金对账。.....	42
5.4 投资者资金对账.....	42
5.5 数据报送与结算单邮寄.....	42
5.6 结算确认.....	42
6. 相关参数的说明.....	42
6.1 开户相关参数.....	42
6.2 交易相关参数.....	44
6.3 风控相关参数.....	45
6.4 银期和资金相关参数及操作.....	45
6.5 结算相关参数.....	46
6.6 费率相关参数.....	48
7. QandA	48
1. 操作员与资金管理.....	48
2. 结算.....	50
3 统一开户.....	50
4 费率设置.....	51

前言

亲爱的用户，当你看到这篇文档时，我不敢说你会深深地爱上它，但我敢说你一定对它爱不释手，因为它是如此的详细、简洁，就好像一位不厌其烦的老师，永远指导着你在正确的道路上前进。就算你以前从来没有接触过综合交易平台，只要你认真看，照着文档一步步做，不需要多少时间，你就可以完全熟悉综合交易平台的各项业务。即使你是一个精通综合交易平台的老业务员，在本文档中你也一定会发现你以前忽略的好多细节，而有所收获。本文档从6个方面详细介绍了综合交易平台的各项主要基本业务：操作员管理、统一开户、费率设置、银期转账、结算和交割、结算平台参数的说明。各章各自独立，又相互关联，一气呵成。最开始的操作员管理是后面所有业务的一个基础，而结算平台的参数说明也是贯穿了本文档的始末。最后我们还列举了一些常见问题供大家参考，当你在使用综合交易平台的过程中，遇到问题时，不妨来翻翻这些常见问题，也许答案就在其中，相信会节省你很多解决问题的时间。最后感谢各位参与编写的人员，以及专家领导的批评指导。

1 操作员管理

要使用综合交易平台的各个终端，第一步肯定是要有操作员的账号，其次是要给操作员赋予相应的权限，而权限的获得在综合交易平台中是通过赋予操作员角色和组织架构来实现的。

1.1 操作员的新增。

在设置操作员中“新增”，填入用户代码、用户名称、密码，保存即可。

1.2 对操作员授予角色

角色即可理解为综合交易平台内的一类操作员，比如：风控人员、结算人员、交易人员、稽核人员等都可以分别算成一个角色。同一类角色就具有相同的功能权限，通俗点说也就是在综合交易平台系统内所能看到的菜单和按钮是一样的，即所能做的操作是一样的。

要创建一个完整的角色主要分两个步骤：

✧ **新增角色的基本信息**

✧ **为新增角色分配功能权限**

操作时，在角色管理中点击“新增”按钮，在角色代码、角色名称和角色描述三项信息中按实际情况正确填写即可，应注意角色代码不能与已有角色的角色代码冲突。在角色功能选择中，需要什么权限就在该项权限前方的勾选框中进行选择即可。填写完基本信息并且勾选角色功能权限后，点击保存，一个角色的新增就完成了。查询到该角色，点击“赋权”，勾选相应的操作员，该操作员即拥有了该角色所对应的权限，也可以在设置操作员中，进行授权角色的操作。

1.3 对操作员设置操作员组织架构关系管理

操作员被授权了角色，拥有了功能权限以后，操作员就可以在系统内进行各项操作，但是针对于投资者的很多操作，操作员仍然是无法完成的，因为操作员在系统内尚未拥有数据权限，在任何查询列表下，无法看到投资者的信息。此时就是要通过组织架构来实现操作员对投资者的数据权限的拥有。组织架构其实可以理解为就是对投资者按照期货公司的组织层次结构进行划分，一般是一种“倒立”的树形结构。举例来说，一个期货公司，每一个投资者总是挂靠在组织架构的某一个节点上，表示该投资者是属于该节点的客户。而每一个操作员，也是挂靠在组织架构的某一个节点上，表示该操作员可以对该节点及其子孙节点的投

资者进行管理。

具体的操作员组织架构关系管理设置如下：

首先需要先在“组织架构管理”中设置好组织架构和组织架构下的投资者。然后在“操作员与组织架构关系管理”中，查到相应组织架构，点击“授权”，即可进入操作员与组织架构对应关系的设置页面，该页面中对于操作员与组织架构对应关系的新增主要分为两个部分：一部分是针对组织架构的，一部分是针对单一投资者的；针对组织结构的部分，我们只需要勾选该操作所应该管理的组织架构即可；对于单一投资者部分，我们只需要在单一投资者的投资者代码框内填入投资者代码，然后点击“增加”按钮，即可将单一投资者一个个加入，点击下方的“保存”按钮；就可将操作员与组织架构对应关系进行新增，完成数据权限的分配。

1.4 对操作员进行其他设置和操作

对操作员分配了功能权限和数据权限后，操作员基本就可以正常的使用综合交易平台了，但是对于操作员，在综合交易平台系统中还有一些对于操作员的其它操作。比如操作员的修改、销户、再次激活和操作员查询权限的设置，以及操作员密码的修改和重置等操作。

1. 操作员基本资料修改、销户、激活

对于操作员的基本资料修改，以及销户和激活，所涉及的综合交易平台菜单为“交易管理→操作员管理→设置操作员”。在该菜单中只要对着已经查询出的需要做相关操作的操作员记录进行点击，就会出现功能选项菜单，可以选择进行“授权”、“修改”、“注销”、“激活”等几项操作。

“修改”操作只能修改操作员的名称，修改完成后，点击“修改”按钮即可，比较简单。

“注销”操作就是对操作员进行销户，对操作员进行了注销以后，操作员将无法登录综合交易平台。

“激活”操作只能将列表中“是否活跃”这个字段为“否”的操作员变为活跃状态，即可重新登录综合交易平台。

2. 操作员密码的修改和重置

在系统中，如操作员忘记了密码需要重置或者需要临时修改操作员密码，都是可以进行操作的。这些操作所涉及的菜单为“交易管理→操作员管理→重置操作员密码”或者“交易管理→操作员管理→修改操作员密码”。

修改操作员密码，只需要对着操作员对应记录进行点击“修改”，进入修改页面，输入原密码，同时输入新密码即可，两次新密码的输入必须保持一致即可。

重置操作员密码，也只需要对着操作员对应记录进行点击“重置”，进入重置页面，输入新密码即可，要保证两次新密码的输入要一致。

3. 操作员投资者号段对应设置

在开户的时候，获取投资者代码是随机的，但在投资者号段规则设置中新增规则，可以进行相应规则的限制，在操作员投资者号段对应设置中即可把规则对应给相应的操作员，当该操作员开户时，投资者代码即会按照相应规则获得。具体操作如下：点击“新增”，在弹出界面中，输入操作员代码、投资者 ID 段规则，选择是否启用，点击“添加”即可。

4. 操作员查询权限设置

在实际使用中，我们考虑到系统压力和网络带宽压力，往往会对操作员的查询操作进行一定的限制，比如：我们会在交易时段，限制操作员不能查询时间跨度过大的数据。这时候我们就需要用到“操作员查询权限设置”这项功能，该功能在 FLEX 管理平台中进行操作，涉及的菜单是“交易管理→操作员管理→操作员查询权限设置”。

在该菜单中，可对操作员的查询权限进行对应的设置，可针对全公司的所有操作员，也可只针对单一操作员。点击下方的“新增”按钮，即进入操作员查询权限设置的新增页面，在该页面，我们需要填写的内容包括：“操作员范围”、“开始时间”、“结束时间”、“时间长度”、“是否启用权限”五个字段。“操作员范围”分为所有和单一操作员两类，如果选择了“单一操作员”的话，就需要填写具体的操作员用户代码。“开始时间”和“结束时间”这两个字段主要是对每个交易日操作员查询权限生效的时间范围进行设置。“时间长度（天）”是限制在规定时间内只能查询多少天的交易数据。“是否启用权限”就是该条操作员查询权限设置是否进行生效。只要按照实际情况，对这五个字段进行相关的填写即可。

2 统一开户流程

2.1 主席统一开户流程 4 步操作

统一开户的过程实质就是期货公司向交易所提交相关资料，交易所返回给期货公司相应的交易编码。

完成统一开户操作需要在系统中完成四步操作：

1、“账户管理->投资者资料维护->开户”菜单中进行资料的录入。

- 2、“账户管理->投资者申请管理”菜单中进行审核。
- 3、“账户管理->统一开户管理->统一开户申请管理”菜单中进行电子报送。
- 4、“账户管理->统一开户管理->统一开户应答处理”菜单中进行开户应答文件的应用。

以下对每部操作进行详细介绍：

2.1.1、投资者资料的录入

在“账户管理->投资者资料维护->开户”菜单下进行操作。

资料的录入分为 5 大部分，如下介绍。

1) 选择交易所

(1) 开户最低可用资金：中金所要求新开户的投资者前一交易日的可用资金至少为 50 万，新开户的投资者前一交易日的资金肯定是 0，因此并不能申请中金所的席位。（中金所开户最低可用资金参数需要在“日终结算->结算参数设置->交易所结算参数设置”或者“交易管理->开户参数设置->中金所最低开户金额”中进行设置。）因此新开户的投资者可以申请上期所，郑商所，大商所三家交易所的席位，

(2) 中金所特殊问题：中金所要求开户的时候需要选择开户所在的营业部，在系统中进行开户的时候选择营业部的前提是需要先在“交易管理->开户参数设置->交易所特殊问题管理”中进行设置。

(3) 郑商所特殊问题：郑商所法人开户的时候需要选择经营范围，也需要在“交易管理->开户参数设置->交易所特殊问题管理”中进行设置。

2) 基本信息

(1) 投资者类型为自然人时，字段介绍如下。（打*号的字段是必填字段）

投资者代码：可自动获取（按照操作员的号段规则，在“交易管理->操作员管理->操作员投资者号段对应规则”菜单下进行设置），也可手动输入（也受号段规则的限制）。

组织架构：约束操作员对投资者的数据权限，每个投资者只能唯一属于某一个组织架构节点上。

投资者属性：从不同的维度去描述投资者的特征，建议设置，方便以后报表统计、手续费保证金批量设置等操作。

投资者名称及姓名：投资者名称是简称，姓名是全称，自然人两者可设置成一样。

证件类型及证件号码：自然人要求证件类型必须是个人身份证，因此证件类型默认为身份证并且该输入框是灰色不允许修改。提交的时候系统会对唯一性进行检测。

性别及出身年月：身份证号码输入后系统会根据身份证的规则自动获取。

手机号及电子邮件：填写好后若勾选了后面的是否接收短信和是否接收邮件，则在发送短信通知和邮件通知时会发到相应的手机和邮箱中。

联系地址：该地址只能填写中国大陆的地址。

（2）投资者类型为法人时，字段介绍如下。（打*号的字段是必填字段）

投资者代码、组织架构、投资者属性：同自然人一样。

投资者名称和单位名称：投资者名称是简称，单位名称是全称。

证件类型及证件号码：法人要求证件类型必须是组织机构代码，因此证件类型默认是组织机构代码且输入框是灰色不允许修改。提交的时候系统会对唯一性进行检测。

组织机构号、营业执照号、税务登记号：号码及证件有效期根据实际情况进行填写即可。

法人代表和联系人的证件号码：没有唯一要求，可以为组织机构代码、身份证、军官证、警官证、士兵证、户口簿、护照、台胞证、回乡证、营业执照、税务登记号或者其他证件。

注册资本：默认币种为人民币，若是其他货币，则以当时市场上的汇率进行换算成人民币然后进行填写。

客户分类和经营范围：按照实际情况进行填写，注意此处经营范围不能选择“金融业”---“其他金融机构”。

联系人信息中手机号及电子邮件：填写好后若勾选了后面的是否接收短信和是否接收邮件，则在发送短信通知和邮件通知时会发到相应的手机和邮箱中。

联系人信息中联系地址：该地址只能填写中国大陆的地址。

（3）投资者类型为投资基金时，字段介绍如下。（打*号的字段是必填字段）

各字段介绍与法人的一样，唯一的区别在于，因为一股投资基金可以被多个投资者使用，因此投资基金在开户资料提交的时候不会对组织机构代码进行唯一性检测。

3） 联系人信息

（1）投资者类型为自然人

自然人的联系人分为指定下单人、资金调拨人和结算确认人。因自然人一般联系人也是自己本人，因此在填写联系人信息的时候可以直接同基本信息，则可以实现将基本信息中的资料自动填入联系人信息中，可以减少输入工作量。若联系人不是自己本人也可自行在联系人信息中手动输入。

是否报送联系人：保证金监控中心要求每一类联系人需要报送一个进行报备，因此需要勾选报送联系人前面的框。

1 投资者类型为法人和投资基金

法人和投资基金中的联系人分为开户授权人、指定下单人、资金调拨人和结算确认人。若这联系人与基本信息中填写的联系人信息相同的话，则可以直接**同基本信息**，若不相同，则可自行在联系人信息中手动输入。

是否报送联系人：保证金监控中心要求每一类联系人需要报送一个进行报备，因此需要勾选报送联系人前面的框。

4) 期货结算账户信息

点击新增结算账户，填写好银行账户、银行账户开户人名称、银行账户开户行，填写好后点击确定即可。若填写有误可以进行修改和删除。

5) 密码设置

密码输入有三种方式：手工输入、对话框输入和不可录入。选择哪种方式可以在“交易管理->基本参数设置->开户参数->开户密码录入方式”中进行设置。

默认密码：自然人：身份证后六位数字（除字母）；法人：营业执照后六位数字（除字母及短横线等）。

以上五部分内容填写好后，可以进行提交，若还有资料不确定怎么填写则可以暂存，到资料确定后在进行填写，暂存和提交的资料只能在投资者申请管理中才能查询得到记录。

2.1.2、投资者资料的审核及修改

在“账户管理->投资者申请管理”菜单中进行操作，选中记录，点击审核通过，则在统一开户申请管理中会生成相应的报送记录。

相关按钮介绍：

查询：查询出来所有已提交、未补全（暂存所产生的记录）、已审核和已拒绝的记录。

修改：选中暂存或者已拒绝的记录，点击修改按钮，进入到修改界面，可以对资料进行修改，修改后可以提交或者暂存。

审核：选中需要审核的记录，点击审核，进入审核界面，填写好说明信息，然后点击通过或者拒绝按钮。若勾选了交易所，在审核通过后，会在统一开户申请管理中生成报送记录。若没有勾选交易所，则在统一开户申请管理中不会生成报送记录。

删除：对于暂存的记录，可以进行删除操作。

注意：只有有数据权限的操作员能看到记录，开户的操作员能看到自己开户的记录。

2.1.3、投资者资料的电子报送

在“账户管理->统一开户管理->统一开户申请管理”菜单中进行，选中需要报送的记录，点击电子报送，则系统会把该条记录发送至保证金监控中心。

相关按钮介绍：

修改：只能用于修改流程功能类型，并且只能在修改一般（身份）信息和补报规范资料资料功能类型之间进行修改。如交易编码来源有误，生成的报送记录类型就有可能出现错误，这种情况下会用到该功能。

电子报送：将选中的申请记录报送至保证金监控中心。

文件导出：可以将客户资料导出，然后通过保证金监控中心的网页上进行上传和报送工作。

撤销：对于那些已经在同一开户申请管理中产生的记录，若不需要报送至保证金监控中心，则可以选中记录，进行撤销操作。

重新生成申请：对于以前在统一开户申请管理中有过没处理的记录，现在又对投资者有新的操作，可以用重新生成申请按钮，重新生成后然后再电子报送。

2.1.4、保证金监控中心返回的应答信息应用至本系统

在“账户管理->统一开户管理->统一开户应答处理”菜单中进行，系统在接收到保证金监控中心的应答信息后，会自动应用。

相关按钮介绍：

应用统一开户信息：若保证金监控中心返回回来的信息没有自动应用成功，可以选中记录，点击**应用统一开户信息**达到手工使应答信息应用至本系统。

丢弃：若不想让开户应答信息应用至本系统，可以点击**丢弃**按钮。

2.2 二席开户流程

因二席开户使用的交易编码是在主席中已经存在的，因此不需要报送至保证金监控中心。

完成二席开户操作需要在系统中完成三步操作：

- 1、“账户管理->投资者资料维护->开户”菜单中进行资料的录入。（若不需要在统一开户申请管理中产生记录，则不要勾选交易所）。
- 2、“账户管理->投资者申请管理”菜单中进行审核。
- 3、“账户管理->交易编码管理”菜单中进行交易编码的新增，录入的交易编码为该投

资者在主席上的交易编码。

2.3 开户完成后续工作：

- 1、“账户管理-投资者权限管理-投资者交易权限”菜单中进行设置（权限包括登陆和条件单）。
- 2、“账户管理-投资者权限管理-投资者合约权限”菜单中开通投资者的合约权限。
- 3、投资者开通银期转账功能（到银行开通）
- 4、“交易管理-基本参数设置-银期转账”和“资金管理-银期转账”下相关菜单进行设置对投资者的银期转账限额进行设置。
- 5、“费率设置”菜单下对投资者保证金率和手续费率进行设置。
- 6、对投资者的其他交易参数进行设置。

2.4 主席销户流程

1、统一开户实行之前开户的老投资者销户

因为在统一开户实行之前开户的投资者，并没有去保证金监控中心进行报备，所以销户的时候不需要报送至保证金监控中心。销户流程如下：

- 1、检查投资者当日是否无成交无持仓无资金，（满足这个条件才能销户）；
- 2、检查投资者的银期是否已经注销；
- 3、在“账户管理->投资者状态维护”菜单中对投资者进行注销；
- 4、到交易所会员服务系统注销投资者的交易编码。

2、统一开户后的投资者销户

因为统一开户后的投资者开户向保证金监控中心报备过，所以在销户的时候也需要报送至保证金监控中心。销户流程如下：

- 3、检查投资者当日是否无成交无持仓无资金；
- 4、检查投资者的银期是否已经销户；
- 5、在“账户管理->投资者资料维护->撤销交易编码”菜单中进行申请，在“账户管理->投资者申请管理”菜单中进行审核，生成相应的报送记录，先不要电子报送；
- 6、在“账户管理->投资者状态维护”菜单中对投资者进行注销操作；（之所以放在 5 前面，是为了防止操作员没有检查投资者的资金持仓成交情况）

- 7、在“账户管理->统一开户管理->统一开户申请管理”菜单中进行电子报送；
- 8、在“账户管理->统一开户管理->统一开户应答处理”菜单中应用应答信息。

2.5 二席销户流程

二席的销户不需要报送至保证金监控中心，因此销户流程如下：

- 1、在“账户管理->投资者状态维护”菜单中对投资者进行注销；
- 2、在“账户管理->交易编码管理”菜单中对投资者的交易编码进行注销。

2.6 休眠户处理、历史账户规范及逾期未规范账户处理

1、账户休眠

交易所要求在认定日期时、同时符合开户时间一年以上、最近一年以上无持仓、最近一年以上无交易、认定日的客户权益在 1000 元以下（含 1000 元）四个条件的账户需要进行休眠，并且需要限制其开仓权限。

账户休眠的流程如下：

- 1、因要限制其交易权限，要在休眠操作的过程中实现自动限制的话需要设置权限模板。
在“账户管理->投资者权限管理->权限模板”菜单中设置好模板信息、用户权限、转账限额、合约交易权限，然后进行保存。注：需要勾选是否更新用户权限，否则在进行账户休眠操作的时候权限不会跟着模板变动；
- 2、设置好模板后，在“账户管理->投资者权限管理->权限模板配置”菜单中将设置好的模板和休眠户参数类型进行关联，并保存。
- 3、休眠操作的两入口：（1）“账户管理->投资者资料维护->休眠”菜单中选中投资者，进行休眠，该入口只能对单个投资者进行操作。（2）“账户管理->休眠户批量申请激活”菜单中进行，输入筛选条件，查出来投资者批量选中，然后进行账户休眠；
- 4、在“账户管理->投资者申请管理”菜单中进行审核；
- 5、在“账户管理->统一开户管理->统一开户申请管理”菜单中进行电子报送；
- 6、在“账户管理->统一开户管理->统一开户应答处理”菜单中应用应答信息。

PS：1：当四个交易所的交易编码都休眠成功后，在投资者资料维护中查询的投资者休眠状态则为是。

2：权限跟着模板刷新的两个动作：在投资者申请管理中审核通过和应答信息应用至本系统两个动作的时候权限会跟着设置好的休眠户模板进行变动。

2、休眠账户激活

休眠账户的激活流程如下：

1、因账户激活后要解除不能交易权限的限制，要在激活的时候实现自动解除限制的话需要设置权限模板。在“账户管理->投资者权限管理->权限模板”菜单中设置好模板信息、用户权限、转账限额、合约交易权限，然后进行保存。注：需要勾上是否更新用户权限，否则在进行休眠户激活操作的时候权限不会跟着模板变动；

2、设置好模板后，在“账户管理->投资者权限管理->权限模板配置”菜单中将设置好的模板和激活休眠户参数类型进行关联，并保存。

3、休眠激活操作的两入口：（1）“账户管理->投资者资料维护->激活”菜单中选中投资者，进行激活，该入口只能对单个投资者进行操作。（2）“账户管理->休眠户批量申请激活”菜单中进行，输入筛选条件，查出来投资者批量选中，然后进行激活休眠账户；

4、在“账户管理->投资者申请管理”菜单中进行审核；

5、在“账户管理->统一开户管理->统一开户申请管理”菜单中进行电子报送；

6、在“账户管理->统一开户管理->统一开户应答处理”菜单中应用应答信息。

PS：1：当四个交易所的交易编码都激活成功后，在投资者资料维护中查询的投资者休眠状态则为否。

2：权限跟着模板刷新的动作：应答信息应用至本系统动作的时候权限会跟着设置好的激活休眠户的模板变动。

3、历史账户规范

根据保证金监控中心的认定历史账户的标准，可对符合条件的投资者账户进行账户规范的操作。

历史账户规范的流程如下：

1、在“账户管理->投资者资料维护”菜单中选中投资者进行修改一般信息或者修改身份信息（两者的区别是修改身份信息可以改投资者的证件号等关键信息）；

2、在“账户管理->投资者申请管理”菜单中进行审核；

3、在“账户管理->统一开户管理->统一开户申请管理”菜单中进行电子报送；

4、在“账户管理->统一开户管理->统一开户应答处理”菜单中进行应答信息应用至本系统。

4、逾期未规范账户处理

根据保证金监控中心的要求，对于逾期未规范的账户需要限制其开仓权限，等到规范后需要解除其开仓权限的限制。

逾期未规范账户限制开仓权限的流程如下：

1、因要限制其开仓权限，要实现自动限制的话需要设置权限模板。在“账户管理->投资者权限管理->权限模板”菜单中设置好模板信息、用户权限、转账限额、合约交易权限，然后进行保存。注：需要勾上是否更新用户权限，否则在进行操作的时候权限不会跟着模板变动；

2、设置好模板后，在“账户管理->投资者权限管理->权限模板配置”菜单中将设置好的模板和开仓权限限制参数类型进行关联，并保存。

➤ 在“账户管理->不规范客户批量处理”菜单中上传监控中心下发的文件，然后进行数据比对，若保证金监控中心与系统中的状态不一致则以保证金监控中心的文件为准，在“账户管理->交易编码管理”菜单中进行修改。

➤ 在“账户管理->不规范客户批量处理”菜单中选择好记录点击限制开仓权限按钮。

PS：权限跟着模板刷新的动作：在点击限制开仓权限按钮的动作时，投资者的权限会按照设置好的限制开仓权限限制的模板进行变动。

规范解除开仓权限限制流程如下：

1、在“交易管理->基本参数设置->开户参数设置”里对是否自动解除开仓权限选择是，这样在规范收到交易所应答信息并应用至本系统的时候会自动生成解除开仓权限的申请。

2、在“账户管理->投资者权限管理->权限模板”菜单中设置好模板信息、用户权限、转账限额、合约交易权限，然后进行保存。注：需要勾上是否更新用户权限，否则在进行操作的时候权限不会跟着模板变动。

3、设置好模板后，在“账户管理->投资者权限管理->权限模板配置”菜单中将设置好的模板和解除开仓权限限制参数类型进行关联，并保存。

4、在“账户管理->投资者资料维护->修改一般信息或者修改身份信息”，填写好需要修改的信息后，进行提交；

5、在“账户管理->投资者申请管理”菜单中进行审核；

6、在“账户管理->统一开户管理->统一开户申请管理”菜单中进行电子报送；

7、在“账户管理->统一开户管理->统一开户应答处理”菜单中查看规范客户资料的应答信息，收到回报应用至本系统时，投资者的权限会跟着设置好的模板进行变动，同时会在

“账户管理->统一开户管理->统一开户申请管理”菜单中自动生成一条解除开仓权限限制的记录，然后电子报送至保证金监控中心；

8、在“账户管理->统一开户管理->统一开户应答处理”菜单中看解除开仓权限限制申请的应答信息。

PS：权限跟着模板刷新的动作：在收到保证金监控中心返回回来的规范客户资料成功的信息并应用至本系统的时候，投资者的权限会按照之前设置好的解除开仓权限限制的模板进行变动。

3. 费率设置

3.1 手续费率设置

手续费设置本平台分为交易所手续费率设置和投资者手续费率设置，主要是对期货合约的手续费率按照交易所规定和公司要求进行设置，分为开仓、平仓、平今、结算、交割、移仓等6种手续费率，其中结算、移仓手续费率并未启用，不需要设置。每种手续费率，以按金额、按手数等2种方式取和收取手续费。记按金额手续费率为 $R_{\text{金额}}$ 、按手数手续费率为

$R_{\text{手数}}$ ，手续费 $C_{\text{手续费}}$ 的计算公式如下：

$$C_{\text{手续费}} = R_{\text{金额}} \times \text{成交金额} + R_{\text{手数}} \times \text{成交手数}$$

◆ 交易所手续费率设置：

对于新合约的上市，需要设置交易所手续费率，在flex柜台中进行新增、修改、删除、查询操作,交易所手续费设置，主要用于设置交易所手续费率，以计算每笔成交的上交手续费，分为按产品和合约设置，同一产品和该产品的合约，合约优先级大于产品。在结算柜台中的“手续费率”目录下，“交易所手续费率设置”、“交易所手续费率查询”菜单可以进行交易所手续费率的新增、修改和查询操作。手续费率设置后重新结算，就按新设置的手续费率计算手续费，盘中设置手续费率是否实时上场。

Flex 柜台界面操作：

“费率设置->手续费率->交易所手续费率设置->新增即可”

查询：选择交易所、产品/合约，若均为空的话，则是对所有产品和合约进行查询；

新增：选择交易所；选择产品/合约，合约的优先级高于产品；对开仓、平仓、平今、结算、交割四个手续费率进行添加，结算、移仓手续费率并未启用，不需要设置，

按金额、按手数等 2 种方式取和收取手续费；

修改：选中需要修改的记录，点击“修改”按钮，进入“交易所手续费率（修改）”界面，可以修改费率，不能修改交易所和产品/合约；

删除：选中需要删除的记录，即可进行删除操作。

◆ 投资者手续费率的设置

投资者手续费设置，主要用于设置投资者手续费率，以计算每笔成交的投资者手续费。在结算柜台中的“手续费率”目录下，“投资者手续费率设置”菜单可以进行投资者手续费率的新增、修改和查询操作。投资者手续费率分为公司标准、模板、单一投资者，按照所述对象范围的粒度大小，这 3 种情况对应的保证金率设置存在如下的优先级关系：

单一投资者 > 模板 > 公司标准

系统按照投资者范围优先级的先后关系，三种情况设置分为按品种和按合约。对某一个投资者手续费率生效的优先级别是单一投资者>手续费率模板>公司标准，同一产品和该产品的合约，合约优先级别大于产品，系统依次去寻找投资者的手续费率设置，直到找到相应设置为止。

手续费率设置后重新结算，就按新设置的手续费率计算手续费，盘中设置手续费率是实时上场。 手续费率实时同步的设置 **在 flex 柜台界面**的操作流程：

“费率设置-〉手续费率盘中同步参数设置-〉选择“是”-〉点击确认“。

针对投资者手续费率设置中，分为三种情况，一、设置所有投资者手续费率，二、设置手续费率模板手续费率，三、设置单一投资者手续费率，单一投资者设置与公司标准设置相对比较简单，下面主要介绍一新开户投资者模板手续费率设置步骤。

● 对于新开户投资者手续费率设置步骤（模板）：

1. 设置投资者手续费率之前，要进行一些参数设置；

- 投资者手续费率设置是否启用复核流程，若启动复核流程，设置投资者手续费率时候要进行复核操作，复核通过之后手续费率设置才生效；

Flex 柜台界面操作：

“流程管理-〉复核流程管理-〉流程 ID 选中投资者手续费率设置-〉查询”，

“选中记录-〉修改（流程 ID 不允许修改）-〉保存”

是否启用：“是/否”

最高复核级别：“零级复核”即不需要符合；“一级复核”即需要一次复核；“二级复核”

需要复核两次；

是否允许自复核：“是/否”，即选择一级、二级复核是可否由修改手续费的操作员自己进行复核。

- 投资者手续费率模板对应关系设置是否启动复核流程，若启动复核流程，设置投资者手续费率模板对应关系时候要进行复核操作，复核通过之后投资者手续费率模板对应关系设置才生效；

Flex 柜台界面操作：

“流程管理-〉复核流程管理-〉流程 ID 选中投资者手续费率模板关系设置-〉查询”，
选中记录-〉修改（流程 ID 不允许修改）-〉保存

是否启用：“是/否”

最高复核级别：“零级复核”即不需要符合；“一级复核”即需要一次复核；“二级复核”需要复核两次；

是否允许自复核：“是/否”，即选择一级、二级复核是可否由修改手续费的操作员自己进行复核。

- 手续费率模板数据权限是否启用，若启用，则操作员只能操作和自己有关联关系的手续费率模板；若不启用，操作员可以操作所有手续费率模板；

Flex 柜台界面操作：

“交易管理-〉基本参数设置-〉结算参数-〉手续费模板数据权限-〉启动”

2. 创建投资者手续费率模板；

在实际业务操作中，为每一个投资者都单独设置一套手续费率是不明智的。为了便于管理和操作的简洁性，手续费率设置中可以采用手续费率模板形式为投资者设置手续费率，以简化操作，故需要先创建一个模板。

Flex 柜台界面操作：

“费率设置-〉手续费率-〉手续费率模板设置-〉新增（填写手续费模板代码、手续费模板名称及备注）-〉点击确认”

查询：输入代码可以精确查询，“空”则为查询全部，同时在左下角可以查询模板手续费率及模板对应投资者；

新增：添加手续费率模板；

修改：选中所需修改手续费率模板，点击“修改”按钮，只能修改手续费率模板名称及备注；

删除：选中所需修改手续费率模板，点击“删除”按钮。

3. 建立操作员和手续费率模板对应关系；

模板创建完成之后，需要将某一操作员与此模板建立起对应关系，即此模板只有该操作员有权限。

Flex柜台界面操作：

“费率设置-〉手续费率-〉操作员对应手续费率模板权限管理-〉点击新增（填写之前创建的手续费率模板、操作员代码）-〉点击确认”

查询：选择手续费率模板或操作员代码，点击“查询”，若为“空”则查询所有模板；

新增：添加手续费率模板与对应操作员之间的关系；

删除：选中记录，点击“删除”按钮即可。

4. 建立投资者手续费率模板和投资者对应关系；

需要将投资者归入一个手续费率模板，这样投资者的手续费率会跟随该模板进行变动，且一个投资者只可以属于一个手续费率模板。

Flex柜台界面操作：

“费率设置-〉手续费率-〉投资者手续费率模板对应关系-〉点击新增（填写之前创建的手续费率模板、投资者代码）-〉点击确认”

查询：可以按照投资者代码、手续费率模板、投资者属性进行查询，若为空，则查询全部；

新增：添加投资者手续费率模板对应关系；

修改：只能修改手续费率模板字段，不能修改投资者代码；

删除：选中记录，点击“删除”按钮即可；

批量新增：新开户的同一属性投资者可以同时建立投资者手续费率模板对应关系；

批量修改：同一属性投资者可以实现同步修改手续费率模板；

批量删除：查询到的投资者与模板对应关系可以实现同时删除。

5. 设置模板手续费率；

在flex柜台中进行新增、修改操作，该项内容设置完成后就实现了对同一属性的投资者通过模板进行手续费率的设置。

Flex界面操作流程：

“费率设置-〉手续费率-〉模板手续费率设置-〉新增-〉填写费率模板、产品/合约、选择交易所-〉添加开仓、平仓、平今、交割手续费率（按金额和按手数）-〉点击确认按钮”

查询：可以按照费率模板、交易所进行查询，若为空，则查询全部；

新增：添加模板手续费率的设置；

修改：只能修改相关费率字段，不能修改费率模板、交易所、产品/合约；

删除：选中记录，点击“删除”按钮即可；

批量删除：可以对查询到的记录进行全部删除；

复制：分为投资者复制和交易所复制，投资者复制将某一投资的手续费率设置复制到所创建的模板中；交易所产品复制是将所创建模板中某交易所的产品/合约复制到某交易所的相关产品/合约中。

当然，以上过程的设置也可以通过“投资者手续费率设置-〉新增-〉投资者范围选模板-〉填写费率模板、产品/合约、选择交易所-〉添加开仓、平仓、平今、交割手续费率（按金额和按手数）-〉点击确认按钮”来实现；

按照模板手续费率设置流程，对于单一投资者和公司标准可以分别通过“投资者手续费率设置”和“单一投资者手续费率设置”来实现，步骤同上。

6. 设置完成之后可以到“投资者费率查询”里进行确认投资者的手续费率设置是否正确；在“手续费率修改查询”里能查询修改记录。

◆ 新功能——手续费率模型：

对投资者手续费率进行批量调整时，可以通过手续费率模型来实现。可以通过创建一个模型 A 实现对当前投资者手续费率数据进行备份，同时将数据复制到一个新模型 B，如果手续费率进行批量调整时可以对模型 B 进行批量修改，激活启用，那么投资者手续费率即按照模型 B 来进行收取；若过段时间手续费率需要进行恢复以前设置，则激活模型 A 即可。

手续费率模型应用步骤如下：

- 1、 创建投资者手续费率模型；
- 2、 设置手续费率模型的相关费率；
- 3、 对所创建模型进行激活操作。

在 flex 中界面操作：

➤ “费率设置-〉手续费率模型管理-〉手续费率模型-〉点击新增-〉填写手续费率模型代码、名称、选择交易所和产品、备注-〉从当前数据创建或确认”

注：若点击“确认”，手续费率需要到“模型投资者手续费率”中进行添加设置，添加过程中是与所创建模型是相对应的，包括：交易所选择、产品/合约的选择；若是“从当

前数据创建”，则所创建模型即为当前手续费率数据的设置；注：当交易所为空时，表示该手续费率模型的适用范围为所有交易所所有产品，激活时将覆盖所有手续费率；创建模型时，当交易所不为空，产品为空时，表示该手续费率模型的适用范围为特定交易所所有产品，激活时将覆盖特定交易所的所有产品；当交易所、产品都不为空时，表示该手续费率模型的适用范围为特定交易所特定产品，激活时将覆盖特定交易所特定产品的手续费率。

- “费率设置-〉手续费率模型管理-〉模型手续费率-〉新增-〉填写模型代码、选择交易所、产品/合约、投资者范围、添加开仓、平仓、平今、交割手续费率（按金额和按手数）-〉点击确认按钮”

查询：可以按照模型代码、交易所、产品/合约、投资者范围、组织架构进行查询，若为空，则查询全部；

新增：添加模型手续费率的设置；

修改：只能修改相关费率字段，不能修改费率模板、交易所、产品/合约；

删除：选中记录，点击“删除”按钮即可；

批量修改：可以实现对公司范围、模板、单一投资者进行批量修改，可分为：绝对调整（调整后的值为当前调整）和相对调整（调整后的值为调整值加上原有值），调整完成后，可以进行试算操作，检查是否正确，若正确则点击确认按钮。

批量删除：可以对查询到的记录进行全部删除；

复制：是将一个手续费率模型复制到另一个手续费率模型，可以按照投资者范围、交易所的产品/合约进行复制，则目标的模型手续费率设置将被删除、替换为源的模型手续费率。

- 在“手续费率模型”界面中，选中所需要模型，点击“激活”即可，这样就实现对一个新建模型的启用。

▲交易所手续费率、投资者手续费率设置都是实时生效的。

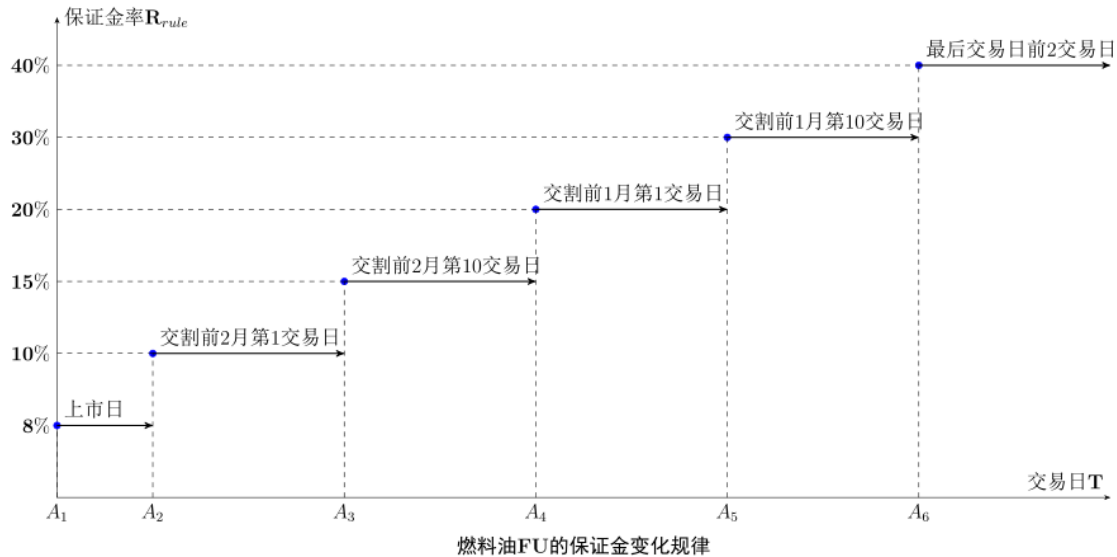
3.2 保证金率设置

保证金率设置 主要是对期货合约的保证金率按照合约文本的既定日期规则和交易所的结算调整要求进行设置。目前，系统里保证金率主要有两套设置，一套是交易所的保证金率设置，另一套是投资者的保证金率设置。

日期表达式：主要是用于期货产品创建以及合约品种的保证金比率设置。就针对合约品

种设置保证金而言，根据合约文本，期货合约品种的保证金遵循一定的日期规则。从上市开始，期货合约需要跨越不同的交易阶段，这个过程中保证金有规律地阶梯式的上浮递增。

例如，燃料油 FU 的保证金变化规律如下图所示：



燃料油 FU 的保证金率，共分成 6 个阶段，每个交易阶段都定义了该阶段的“起始日期” (A1、 A、 A3、 A4、 A5、 A6)。合约一旦进入该阶段，保证金率将上浮。

$$\text{保证金率 } R_{rule} = \begin{cases} 8\% & \text{if } A_1 \leq \text{交易日 } T < A_2 \quad (\text{从上市日起}), \\ 10\% & \text{if } A_2 \leq \text{交易日 } T < A_3 \quad (\text{从交割前2月第1交易日起}), \\ 15\% & \text{if } A_3 \leq \text{交易日 } T < A_4 \quad (\text{从交割前2月第10交易日起}), \\ 20\% & \text{if } A_4 \leq \text{交易日 } T < A_5 \quad (\text{从交割前1月第1交易日起}), \\ 30\% & \text{if } A_5 \leq \text{交易日 } T < A_6 \quad (\text{从交割前1月第10交易日起}), \\ 40\% & \text{if } A_6 \leq \text{交易日 } T \quad (\text{从最后交易日前2交易日起}). \end{cases}$$

燃料油FU保证金率 R_{rule} 与交易日 T 的函数关系

“起始日期”与具体的日期无关，也与具体的合约无关，是一个相对的描述，表示的是合约的生命周期中的每一个阶段的开始日期。日期表达式，就是在合约生命周期中对每个阶段起始日期的进行抽象化的描述。

日期表达式，有 A、B、C 三部分组成，分别是 A-“基准月”、B-相对基准月的“月前/月后”、C-前移或后推的“日期”。

- **A-基准月**：主要有三个参数值“交割月” (DLY)、“上市月” (OPN)、“定制月”（具体月份）
- **B-月前/月后**：相对基准月的月数。“前” (-)、“后”(+)
- **C-日期**：由A和B两部分锁定月份后，再由C部分定位到该月的某一天。“公历日” (DAT)、“交易日” (TRA)、“工作日” (WRK)、“月初” (STR)、“月末” (TAL)、“周

一” (MON)、“周二” (TUE)、“周三” (WED)、“周四” (THR)、“周五” (FRI)、“周六” (SAT)、“周日” (SUN)、“前” (<)、“后” (>)、“前(含)” (-)、“后(含)” (+)。

具体的示例如下：

- **OPN-000+001TRA:** 上市月前0月第1个交易日，即上市当月的第1个交易日。
- **DLX-001+001DAT:** 交割月前1月第1个公历日。
- **OPN-000+003FRI+001TRA>001TRA:** 上市月前0月，后(含)第3周周五，后(含)第1个交易日，后第1个交易日，共4句。首先定位到“上市当月的第3周周五”那一天。如果这一天是交易日，那么“后(含)第1个交易日”就指的是“第3周周五”当天，否则往后顺延。“后第1个交易日”，表示再往后推1个交易日。对于IF合约，前3句就表示了一个IF合约的最后交易日，再加第4句就表示了下一个IF合约的上市日期。
- **DLX-001+001TAL-001TRA<002TRA:** 交割月前1月，后(含)第1个月末，前(含)第1个交易日，前第2个交易日，共4句。首先定位到“交割前1月的月末”那一天。如果这一天是交易日，那么“前(含)第1个交易日”就指的是“月末”当天，否则往前顺延。“前第2个交易日”，表示再往前移2个交易日。对于FU合约，前3句就表示了一个FU合约的最后交易日，再加第4句就表示了一个FU合约最后交易日的前2个交易日。

通过“日期表达式”定义各个交易阶段的“起始日期”，就可以表达出期货合约的**保证金率 r 与交易日 t 的函数关系**，也就是**合约交易保证金率的日期规则**。对于燃料油 FU，其保证金率日期规则共有 6 条，如下图所示：

交易所代码	合约代码	交易日期段名称	投机多头保证金率	投机空头保证金率	套利多头保证金率	套利空头保证金率	保值多头保证金率	保值空头保证金率	保值空头保证金率
SHFE	fu	上市月后含1个交易日	0.08	0.00	0.08	0.00	0.08	0.00	0.08
SHFE	fu	交割月前2个月含1个交易	0.1	0.00	0.1	0.00	0.1	0.00	0.1
SHFE	fu	交割月前2个月含10个交易	0.15	0.00	0.15	0.00	0.15	0.00	0.15
SHFE	fu	交割月前1个月含1个交易	0.2	0.00	0.2	0.00	0.2	0.00	0.2
SHFE	fu	交割月前1个月含10个交易	0.3	0.00	0.3	0.00	0.3	0.00	0.3
SHFE	fu	交割月前1个月含1个月	0.4	0.00	0.4	0.00	0.4	0.00	0.4

这 6 条保证金日期规则，描述每一个 Fu 合约从上市到下市整个生命周期的 6 个阶段的保证金的变化规律。

▲“前第 1 个交易日”与“前(含)第 1 个交易日”区别：以某一公历日为基准日 A 来看，如果 A 日为交易日，那么前者表示 A 日前面的一个交易日，后者表示 A 日；如果 A 日为非交易日，那么两者均表示 A 日前面的一个交易日。

▲“后第 1 个交易日”与“后(含)第 1 个交易日”区别：以某一公历日为基准日 A 来看，如果 A 日为交易日，那么前者表示 A 日后面的一个交易日，后者表示 A 日；如果 A 日为非交易日，那么两者均表示 A 日后面的一个交易日。

◆ 交易所保证金率

交易所的保证金率（简记为 M_{exchange} ），主要是用于期货公司与交易所进行保证金比对检查。由“既定日期规则”部分（简记为 R_{exchange} ）、“结算调整要求”部分（简记为 A_{exchange} ）两部分组成，因此交易所保证金率计算公式如下：

$$M_{\text{exchange}} = R_{\text{exchange}} + A_{\text{exchange}}$$

交易所保证金率设置分为两部分：交易所结算保证金率属性和交易所结算保证金率调整。

1、交易所结算保证金率属性设置分为按产品和合约设置，同一产品和该产品的合约，合约优先级大于产品；按产品交易日期段进行设置。例如设置 cu 和 cu1209 的保证金率，计算 cu1209 的保证金是取 cu1209 的保证金率。交易所保证金率设置不会实时上场，下一交易日生效。

2、当前交易所结算保证金属性：根据“交易所结算保证金率属性”生成“当前交易所结算保证金率属性”，根据上一交易日“当前交易所结算保证金率属性”生成“当前交易所交易保证金率属性”。支持“当前交易所结算保证金属性”增改查操作。不支持“当前交易所交易保证金率属性”增改操作。

3、交易所结算保证金率调整设置也分为按产品和合约设置，同一产品和该产品的合约，合约优先级大于产品；生效方式分为仅当日生效和长期生效；设置的保证金率有交易所保证金率、跟随交易所投资者保证金率，不跟随交易所投资者保证金率三种，三种设置分别用于计算交易所保证金率、跟随交易所的投资者的保证金率和不跟随交易所的投资者的保证金率。

“交易所交易保证金率调整”沿用上一交易日的“交易所结算保证金率调整”。

4、交易所保证金率的计算公式：当前交易所保证金率=当前交易所保证金率属性+交易所保证金率调整。

● 交易所保证金率设置步骤如下：

1. 选择好交易所及产品，进行产品交易日期段划分设置；

Flex柜台界面操作：

“费率设置-）产品交易日期段管理-）产品交易日期段划分-）新增（选择交易所、产品、填写日期表达式-）获取名称-）确认）”

复制：将交易所的产品的交易日期段复制到其他产品上，数据下的交易日期

段复制到目标产品下，目标产品已有的交易日期段不会被覆盖

重新计算：对日期表达式的生效日期进行重新计算；

典型设置：按照交易所保证金日期规则，在系统里进行分段设置；

相对已有交易日期段设置：针对系统中已有的日期表达式，在此基础上进行修改即可；

交易日期段名称：设置完成交易日期段后，点击“获取名称”即可获取日期表达式名称；

试算合约生效日期：通过此字段可以实现对交易日期段的生效日期检查正确与否。

2. 设置交易所保证金率属性；

$R_{exchange}$ 对应flex柜台中交易所保证金率部分，需要根据交易所的日期规则对产品/合约每个交易日期段进行投机多头保证金率、投机空头保证金率、保值空头保证金率、保值空头保证金率的添加。

Flex柜台界面操作：

“费率设置-〉交易所保证金率管理-〉交易所结算保证金率属性-〉新增（选择交易所、产品/合约、产品交易日期段）-〉按照交易所规则填写保证金率的四个字段（按金额或按手数）-〉确认”

查询：按照交易所、产品/合约、产品交易日期段进行查询，若为“空”则查询全部；

新增：添加交易所保证金率属性的设置；

修改：只能对费率设置进行修改；

删除：选中某条记录，即可进行删除；

明细：查询保证金率设置明细，指具体的费率数据；

查询阶段保证金率：对产品的所有合约在该交易日期段的各项保证金率。

3. 交易所结算保证金率调整；

$R_{exchange}$ 对应flex柜台中交易所结算保证金率调整部分，“交易所保证金调整”菜单中一共有3档。第1档是“交易所调整 $A_{exchange}$ ”，第2档是“跟随交易所的投资者的调整 $A_{investor(跟随)}$ ”，第3档是“不跟随交易所的投资者的调整 $A_{investor(不跟随)}$ ”，如图所示：

Flex柜台界面操作：

“费率设置->交易所保证金率管理->交易所结算保证金率调整->新增（选择交易所、产品/合约、生效方式）->添加第1档是“交易所调整 $A_{exchange}$ ”->确认”

4. 查询交易所保证金率

通过“当前交易所保证金率属性”查询交易所保证金基础，且“费率设置->保证金率查询->交易所保证金率查询”中可以查询交易所保证金率， $M_{exchange} = R_{exchange} + A_{exchange}$ ，通过查询“明细”可以查询交易所保证金率基础和交易所保证金率调整值。

◆ 投资者保证金率

在实际业务中，从保证金率的设置情况上看，投资者大概可以分为 A 和 B 两类，A 类是跟随交易所变动的投资者，B 类是不跟随交易所的投资者。A 类投资者的保证金率，以交易所保证金率为基础，略微上浮几个百分点，跟随交易所保证金率变动而变动。B 类投资者的保证金率，并不以交易所保证金率为基础，直接由一个比率数值设定，不受交易所保证金率变动影响。

投资者保证金率设置分为投资者结算保证金率设置和投资者交易保证金率设置。

投资者结算保证金率设置分为投资者结算保证金率属性和投资者结算保证金率调整。

投资者交易保证金率设置分为投资者交易保证金率属性和投资者交易保证金率调整。

1、投资者保证金率设置分三种情况，一：设置公司标准的保证金率，二：设置保证金率模板保证金率，三：设置单一投资者保证金率，这三种情况设置分为按品种和按合约。对

某一个投资者保证金率生效的优先级别是单一设置>保证金率模板设置>公司标准设置,同一产品和产品的合约,合约优先级别大约产品。投资者保证金率属性:支持按产品、合约设置,按产品交易日期段设置。

2、投资者结算保证金率调整:“投资者结算保证金率调整”可设置为“仅当日生效”或“长期生效”。“投资者交易保证金率调整”由上一交易日“投资者结算保证金率调整”生成。

3、当前投资者保证金率属性:根据“投资者结算保证金率属性”生成“当前投资者结算保证金率属性”,根据上一交易日“当前投资者结算保证金率属性”生成“当前投资者交易保证金率属性”。交易和结算费率均可增删改查,对交易费率的变更实时上场。

4、对投资者交易保证金率属性和投资者交易保证金率调整的修改会实时上场。
投资者的保证金率 ($M_{investor}$), 主要是用于期货公司向投资者收取保证金。由“既定日期规则”部分(简记为 $R_{investor}$)、“公司调整要求”部分(简记为 $C_{investor}$)、“结算调整要求”部分(简记为 $A_{investor}$)三部分组成,因此**投资者保证金率计算公式**如下:

$$M_{investor} = R_{investor} + C_{investor} + \begin{cases} R_{exchange} + A_{investor(跟随)} & \text{if 投资者跟随交易所,} \\ A_{investor(不跟随)} & \text{if 投资者不跟随交易所.} \end{cases}$$

● 投资者保证金率设置(对于新开户以模板设置来举例,步骤如下)

1. 设置投资者手续费率之前,要进行模板权限参数设置;

保证金率模板数据权限是否启用,若启用,则操作员只能操作和自己有关联关系的手续费率模板;若不启用,操作员可以操作所有手续费率模板;

Flex 柜台界面操作:

“交易管理->基本参数设置->结算参数->保证金率模板数据权限->启动”

2. 创建保证金率模板

“费率设置->保证金率模板管理->投资者保证金率模板设置->新增(填写保证金率模板代码、模板名称、备注)->确定”

“投资者保证金率模板设置”界面有“查询模板保证金率属性设置”、“模板对应投资者查询”可以分别查询模板的保证金率属性和该模板所对应的投资者。

3. 设置操作员和保证金率模板对应关系

模板创建完成之后,需要将某一操作员与此模板建立起对应关系,即此模板只有该操作

员有权限。

Flex柜台界面操作：

“费率设置-〉保证金率模板管理-〉操作员对应手续费率模板权限管理-〉点击新增（填写之前创建的保证金率模板、操作员代码）-〉点击确认”

查询：选择保证金率模板或操作员代码，点击“查询”，若为“空”则查询所有模板；

新增：添加保证金率模板与对应操作员之间的关系；

删除：选中记录，点击“删除”按钮即可。

4. 设置保证金率模板和投资者对应关系

需要将投资者归入一个保证金率模板，这样投资者的保证金率会跟随该模板进行变动，且一个投资者只可以属于一个保证金率模板。

Flex柜台界面操作：

“费率设置-〉保证金率模板管理-〉投资者保证金率模板对应关系-〉点击新增（填写之前创建的手续费率模板、投资者代码）-〉点击确认”

查询：可以按照投资者代码、保证金率模板、投资者属性进行查询，若为空，则查询全部；

新增：添加投资者保证金率模板对应关系；

修改：只能修改保证金率模板字段，不能修改投资者代码；

删除：选中记录，点击“删除”按钮即可；

批量新增：新开户的同一属性投资者可以同时建立投资者保证金率模板对应关系；

批量修改：同一属性投资者可以实现同步修改保证金率模板；

批量删除：查询到的投资者与模板对应关系可以实现同时删除。

5. 设置投资者结算保证金率（模板）；

在flex柜台中进行新增、修改操作，该项内容设置完成后就实现了对同一属性的投资者通过模板进行手续费率的设置。

Flex界面操作流程：

“费率设置-〉投资者结算保证金率管理-〉投资者保证金率属性-〉新增-〉投资者范围选择模板、填写产品/合约、产品交易日期段、选择交易所、跟随交易所-〉添加一档保证金率（按金额和按手数）-〉点击确认按钮”

查询：可以按照投资者范围、交易所、产品/合约、产品交易日期段、是否跟随交易所进行查询，若为空，则查询全部；

新增：添加模板保证金率的设置；

修改：只能修改相关保证金率字段，不能修改其他；

删除：选中记录，点击“删除”按钮即可；

批量删除：可以对查询到的记录进行全部删除；

复制：分为投资者复制和交易所复制，投资者复制可以将交易所的产品/合约由某一投资者范围下保证金率设置复制到目标投资者（公司标准、模板、单一投资者）中；交易所产品复制是将某一范围下的投资者由某家交易所的产品/合约复制到某交易所的相关产品/合约中。

按照模板保证金率的设置流程，对于单一投资者和公司标准可以分别通过“**费率设置-投资者结算保证金率管理-投资者保证金率属性**”，选择投资者范围单一投资者和公司标准来实现，步骤同上。

● 投资者结算保证金率调整

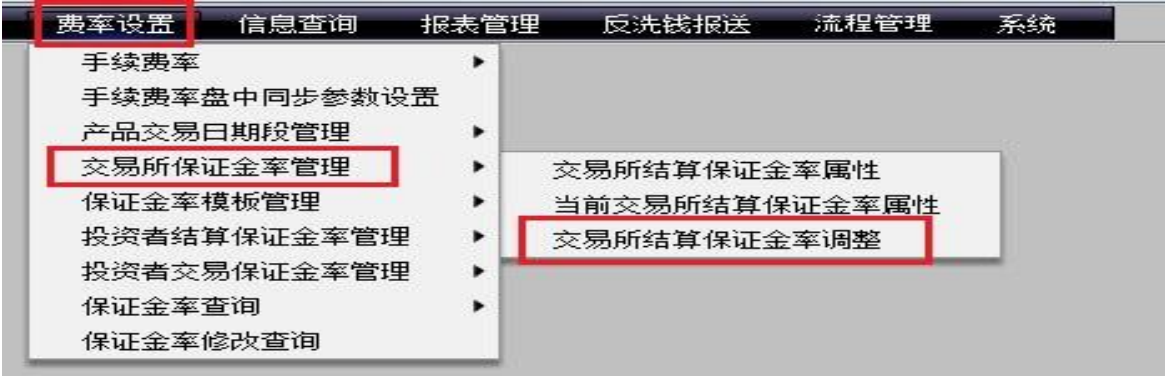
若公司需要对投资者保证金率进行调整，需要在投资者结算保证金率调整中操作，flex操作界面流程：

“**费率设置-投资者结算保证金率管理-投资者结算保证金率调整-新增-投资者范围选择模板、填写产品/合约、产品交易日期段、选择交易所、跟随交易所-添加一档保证金率（按金额和按手数）-点击确认按钮**”如图所示：

针对投资者是否跟随交易所，在系统里分别实现保证金率调整的相关操作流程：

“**跟随交易所调整**”对应flex结算柜台里的“**费率设置→交易所保证金率管理→交易所结算**

“保证金率调整”菜单中“跟随交易所投资者保证金率调整”，如下图：



This screenshot displays the '交易所结算保证金率调整' (Exchange Settlement Margin Rate Adjustment) form. The top navigation bar is identical to the previous image. Below the title bar, there are tabs for 查询 (Query), 新增/修改 (Add/Modify), and 明细 (Details), with '新增/修改' being the active tab. The form includes several input fields: '交易所' (Exchange) set to '大商所' (DCE), '产品/合约' (Product/Contract) set to 'j1212', and '生效方式' (Effective Method) set to '长期生效' (Long-term Effective). The main area contains a grid of 12 margin rate configuration boxes, each with '按金额' (By Amount) and '按手数' (By Lot) input fields. The first two rows of boxes are highlighted with a red border. The first row is labeled '交易所投机多头保证金率' (Exchange Speculation Long Margin Rate) and the second row is labeled '跟随交易所投资者投机多头保证金率' (Follow Exchange Investor Speculation Long Margin Rate). Both rows have identical input values: '按金额' 0.02 and '按手数' 0. The third row is labeled '不跟随交易所投资者投机多头保证金率' (Do Not Follow Exchange Investor Speculation Long Margin Rate) and also has '按金额' 0.02 and '按手数' 0.

“不跟随交易所调整”对应于结算柜台里的“费率设置→交易所保证金率管理→交易所结算保证金率调整”菜单中“不跟随交易所投资者保证金率调整”，如下图：

This screenshot shows the same '交易所结算保证金率调整' form as the previous image. The layout and top navigation are consistent. In this instance, the third row of the configuration grid, labeled '不跟随交易所投资者投机多头保证金率' (Do Not Follow Exchange Investor Speculation Long Margin Rate), is highlighted with a red border. This row contains input fields for '按金额' (By Amount) set to 0.02 and '按手数' (By Lot) set to 0.

● 投资者保证金率查询

对投资者结算保证金率和投资者保证金率调整后，可以在“保证金率查询”中分别进行查询，按照交易日期、投资者范围、交易所、产品/合约及明细进行查询，通过查询检查投资者保证金率设置正确与否。如图所示：

综合交易平台-结算平台-模拟系统-综合交易平台模拟环境aaaaaa(2030)-2030.wang.wx

交易管理 账户管理 经纪人管理 资金管理 费率设置 日终结算 信息查询 报表管理 反洗钱报送 流程管理 系统

投资者保证金率查询 投资者结算保证金率调整

查询指定日保证金率

交易日期: 20120830 投资者范围: 公司标准 投资者代码: 所有

交易所: ----- 产品/合约: ----- ☒ 结算 ☐ 交易

☒ 包含交易所 ☒ 包含交易所调整 ☒ 包含投资者调整 ☐ 包含公司标准

投资者范围	投资者代码	投资者名称	交易所	合约	生效日期	截止日期	交易日期段表达式	交易日期段名称	费率属性	投
-------	-------	-------	-----	----	------	------	----------	---------	------	---

明细(L) 查询(Q) 关闭(C)

● 保证金率模型

在春节、国庆等长假前后，国内期货行情可能会受国外行情的影响而发生剧烈波动，交易风险急剧加大。为了能在节后有效控制投资者的风险，需要在节前提前调整投资者保证金率，通知投资者风险。节后过一段时间，期货行情恢复日常状况后，节前调整的投资者保证金率需要恢复调整前的原值。

系统为此在结算柜台提供了一项便捷的功能，即投资者“保证金率模型”。保证金率模型，其实是先对“费率设置”目录下的“投资者保证金率属性”、“投资者结算保证金率调整”进行备份，然后在需要的时候进行手工恢复。

一、备份

在 flex 结算柜台里，可以“从当前数据创建”一个保证金率模型，保存备份“费率设置”目录下的“投资者保证金”、“投资者保证金调整”设置。

Flex 柜台界面操作流程：

“费率设置-）保证金率模型管理-）保证金率模型-）添加模型代码、名称、说明-）从当前数据创建”



备份之后，在“投资者保证金模型”、“投资者保证金调整模型”菜单下，可以对一个保证金模型的费率设置就行修改，同时也可以在保证金额模型之间进行复制。

投资者保证金率模型修改的 Flex 柜台中界面操作流程：

“费率设置-〉保证金率模型管理-〉投资者保证金率模型-〉修改-〉修改一档保证金率（按金额和按手数）-〉点击确认按钮”

查询：可以按照模型代码、交易所、产品/合约、投资者范围、属性、组织架构进行查询，若为空，则查询全部；

新增：添加模型保证金率率的设置；

修改：只能修改相关保证金率字段，不能修改模板、交易所、产品/合约等字段；

删除：选中记录，点击“删除”按钮即可；

批量修改：可以实现对公司范围、模板、单一投资者进行批量修改，可分为：绝对调整（调整后的值为当前调整）和相对调整（调整后的值为当前调整值加上原有值），调整完成后，可以进行试算操作，检查是否正确，若正确则点击确认按钮。

批量删除：可以对查询到的记录进行全部删除；

模型复制的 flex 柜台界面操作流程：

“费率设置-〉保证金率模型管理-〉保证金率模型复制-〉选择交易所、产品/合约、源模型、目标模型（保证投资者范围一致）-〉复制”

二、恢复

现有的保证金模型，可以灵活地恢复到“费率设置”目录里。恢复时，在“保证金率模型”菜单下，“激活”对应模型进行启用。启用时，先删除“费率设置”目录下已有的“投

投资者保证金”、“投资者保证金调整”中的费率设置，然后再从模型里复制。

模型激活的 Flex 柜台界面操作流程：

“费率设置->保证金率模型管理->保证金率模型->查询->选中记录->激活”



保证金调整规则 综合交易平台保证金设置的钩稽关系见下图：

交易所基础	交易所调整	投资者基础			投资者调整				
		设置值	优先级	是否跟随交易所	设置值	优先级	是否跟随交易所		
交易所基础(A)	交易所调整(H)								
	跟随交易所调整(B)	单一投资者合约	(D)	高	是	单一投资者合约调整	(F)	高	是
		单一投资者产品				单一投资者产品调整			
		模板合约				模板合约调整			
		模板产品				模板产品调整			
		公司标准合约		公司标准合约调整					
		公司标准产品	低	公司标准产品调整		低			
	不跟随交易所调整(C)	单一投资者合约	(E)	高	否	单一投资者合约调整	(G)	高	否
		单一投资者产品				单一投资者产品调整			
		模板合约				模板合约调整			
		模板产品				模板产品调整			
		公司标准合约		公司标准合约调整					
		公司标准产品	低	公司标准产品调整		低			

名词解释:

- 1、交易所基础(A): 根据“费率设置-交易所保证金率管理-交易所结算保证金率属性”设置的产品规则,生成的对应合约今日的交易所保证金率基础,即“费率设置-交易所保证金率管理-当前交易所结算保证金率属性”
- 2、交易所调整(H): “费率设置-交易所保证金率管理-交易所保证金率调整”里的第一行四个“交易所 xxxx 保证金率”
- 3、跟随交易所调整(B): “费率设置-交易所保证金率管理-交易所保证金率调整”里的第二行四个“跟随交易所投资者 xxxx 保证金率”
- 4、跟随交易所调整(C): “费率设置-交易所保证金率管理-交易所保证金率调整”里的第三行四个“不跟随交易所投资者 xxxx 保证金率”
- 5、跟随交易所的“投资者基础”(D): 根据“费率设置-投资者结算保证金率管理-投资者保证金率属性”设置的产品规则(只包含跟随交易所的记录),生成的对应合约今日的投资者保证金率基础,即“费率设置-投资者结算保证金率管理-当前投资者结算保证金率属性”里的“是否跟随交易所收取”为“是”的记录
- 6、不跟随交易所的“投资者基础”(E): 根据“费率设置-投资者结算保证金率管理-投资者保证金率属性”设置的产品规则(只包含不跟随交易所的记录),生成的对应合约今日的投资者保证金率基础,即“费率设置-投资者结算保证金率管理-当前投资者结算保证金率属性”里的“是否跟随交易所收取”为“否”的记录
- 7、跟随交易所的“投资者调整”(F): “费率设置-投资者结算保证金率管理-投资者结算保证金率调整”,“是否跟随交易所”为“是”的记录
- 8、不跟随交易所的“投资者调整”(G): “费率设置-投资者结算保证金率调整”,“是否跟随交易所”为“否”的记录

算法简述:

- 1、交易所保证金率=交易所基础(A)+交易所调整设置中的“交易所调整”(H)
交易所调整设置中的“交易所调整”(H)不用于任何客户保证金比率计算公式,仅仅用于交易所保证金率。
- 2、如果投资者基础设置选择了“跟随交易所”,并且投资者调整设置有值,且也选择了“跟随交易所”,那么最终计算公式为:
客户保证金率=交易所基础(A)+交易所调整设置中的“跟随交易所调整”(B)+投资者基础设置中那些选择了跟随交易所的“投资者基础”(D)+投资者调整设置中

那些选择了跟随交易所的“投资者调整”(F)

- 3、如果投资者基础设置选择了“不跟随交易所”，并且投资者调整设置有值，且也选择了“不跟随交易所”，那么最终计算公式为：

客户保证金比率=投资者基础设置中那些选择了不跟随交易所的“投资者基础”(E)
+交易所调整设置中的“不跟随交易所调整”(C)+投资者调整设置中那些选择了不跟随交易所的“投资者调整”(G)

- 4、如果投资者基础设置选择了“跟随交易所”，并且投资者调整设置有值，且选择了“不跟随交易所”(设置与前面“跟随”不一致，投资者调整无效)，那么最终计算公式为：

客户保证金率=交易所基础(A)+交易所调整设置中的“跟随交易所调整”(B)+
投资者基础设置中那些选择了跟随交易所的“投资者基础”(D)

- 5、如果投资者基础设置选择了“不跟随交易所”，并且投资者调整设置有值，且选择了“跟随交易所”(设置与前面“不跟随”不一致，投资者调整无效)，那么最终计算公式为：

客户保证金率=投资者基础设置中那些选择了不跟随交易所的“投资者基础”(E)+
交易所调整设置中的“不跟随交易所调整”(C)

4. 银期转账

银期转账是指期货投资者直接利用在银行开立的活期储蓄存款账户卡，通过银行的电话银行、网银系统或期货公司的网上交易系统完成在银行个人结算账户与期货保证金账户之间互相调拨资金的金融服务业务。目前，国内有工、农、中、建、交等5家银行支持银期转账业务。

银期转账，主要有4种业务：签约开户、银期入金、银期出金、解约销户

4.1 签约开户

签约开户是银期入金、出金的前提，主要有以下几个步骤：

- 1) 投资者在期货公司开户。开户时，确认姓名、证件类型、证件号码完全无误。
- 2) 投资者签署银期三方协议，并由期货公司确认签章。
- 3) 投资者携带银期三方协议、银行卡、证件原件、期货公司开户资料，到银行开通银期转账业务。系统将以后台接口方式接收从银行发送过来的银期签约信息。

4) 投资者和期货公司在系统中确认银期签约成功。

在结算柜台的“银期转帐”目录下“银期转帐账户信息查询”菜单中，可以查询投资者的签约开户信息。

4.2银期入金

银期入金是指投资者将资金从个人银行账户划拨转入期货保证金账户。银期入金可以分为两种类型：期货端发起、银行端发起。

一、期货端发起

期货端发起，是指投资者使用期货交易终端提供的银期入金功能来做转帐。

从期货交易终端发起的银期入金请求，经投资者提交后，将以“期商流水”形式进入系统后台，可在期商流水管理中查看相应银期流水日志，系统后台将对此请求的期货端信息进行校验检查，并记录在“银期转帐日志”中。

二、银行端发起

银行端发起，是指投资者使用电话银行、网上银行的银期入金功能来做转帐。与期货端发起类似，银行端发起的银期入金，也需要提供一些必要的信息以进行验证。相应的入金请求，也以“期商流水”形式进入系统后台，系统校验检查入金请求，相关日志也记录在“银期转帐日志”中。

4.3银期出金

银期出金是指投资者将资金从期货保证金账户划拨转入个人银行账户。按照发起端的不同，银期出金可以分为两种类型：期货端发起、银行端发起。

一、期货端发起

期货端发起，是指投资者使用期货交易终端提供的银期出金功能来做转帐。

从期货交易终端发起的银期出金请求，经投资者提交后，将以“期商流水”形式进入系统后台。系统后台将对此请求的期货端信息进行校验检查，并记录在“银期转帐日志”中。

二、银行端发起

银行端发起，是指投资者使用电话银行、网上银行的银期出金功能来做转帐。与期货端发起类似，银行端发起的银期出金，也需要提供一些必要的信息以进行验证。相应的出金请求，也以“期商流水”形式进入系统后台，系统校验检查出金请求，相关日志也记录在“银期转帐日志”中。

4.4解约销户

解约销户，通常出现在投资者在期货公司销户后，以解除投资者、期货公司、银行三方的签约关系。主要有以下几个步骤：

- 1) 投资者向期货公司提交银期解约销户申请。
- 2) 期货公司对银期解约申请进行审核签章，然后交还投资者。
- 3) 投资者携带银期解约申请、银行卡、证件原件，到银行关闭银期转帐业务。系统将以后台接口方式接收从银行发送过来的银期解约信息。

4.5银期转账限额控制

投资者提交银期转帐请求后，系统将对请求进行校验检查。其中比较重要的一项检查时转帐额度控制检查。转帐额度控制主要存在以下几个条件，银期出金必须同时满足：

- 银期出金金额 < 可提资金
- $$\text{银期转帐金额} < \begin{cases} \text{当日转帐限额} & \text{if 当日限额存在,} \\ \text{转帐限额} & \text{if 当日限额不存在.} \end{cases} \quad (\text{单笔、单日累计})$$
- 银期转帐金额 < 银行转帐限额（单笔、单日累计）

其中：

可提资金主要与可用资金、可提比例有关，当日转帐限额仅当日有效，银行转帐限额可以针对单家银行进行设置。

在“银期转帐”中的“投资者可提资金比例管理”菜单中，可以设置投资者的可提比例，具体操作如下：先点击“新增”按钮，在投资者范围中可以选择“所有”、“投资者组”、“单一投资者”，在选择投资者组的时候，需要再选择相应的投资者组，选择单一投资者的时候，需要输入投资者代码。最后输入可提资金比例，点击保存，即完成了投资者可提比例的设置。

注：投资者可提资金比例管理中投资者的可提比例优先级高于基本参数中的银期资金可提比例。

在“银期转帐”目录中的“转帐限额”菜单中，可以设置投资者的转帐限额，具体操作如下：点击“新增”，在投资者账户中可选择“所有”、“单一投资者”，选择单一投资者，还需输入投资者代码，在出入金方向中选择出金还是入金，最后输入“单笔最高限额”、“单笔最低限额”、“每日累计转账次数”、“每日累计转账额度”，点击保存即完成转账限额的设置

在“银期转帐”目录中的“当日转帐限额”菜单中，可以设置投资者的当日转帐限额设

置，具体设置同转账限额，区别在于此设置只当日有效。

在“银期转帐”目录中的“当日转帐限额”菜单中，可以设置投资者的当日转帐限额设置，具体设置同转账限额，只是还需在银行代码中选择相应的银行。

5. CTP 结算与交割流程

5.1 结算前准备

下午 CTP 系统已经切换到结算状态，即“日终结算-结算”菜单下“当前结算状态”字段为“结算”时可以开始进行结算前准备工作：

1. 维护今日的成交和结算价。

综合交易平台一般不需要维护结算价和导入成交单。

特殊情况如下：

①郑商所有合约处于最后交易日，此合约当日的结算价需要手工维护，按照交易所网站发布的修改。修改方法：“日终结算-结算价录入”，选择相应的记录修改。

②只有在交易所出现强减和期转现等盘后增加成交的情况下，需要导入交易所的成交文件。导入方法：“日终结算-成交-结算文件上传”，选择相应的文件格式，交易所，上传文件，点击“上传”即可。如果有报错，进入“未处理成交查询”，查询哪些成交未导入。

③若有客户在郑州商品交易所做了跨期套利申请，根据郑商所发布的组合持仓明细文件，在“日终结算-成交-郑商所跨期套利申请”菜单下，将相应的“投资者代码”“左腿合约”“左腿成交编号”“右腿合约”“右腿成交编号”输入，点“保存”即可。

2. 调整交易所和投资者的保证金率。

具体可参考费率设置相关章节

3. 处理质押和交割月仓单折抵。

质押：

1) 在盘中状态时

①设置质押品：在“资金管理-质押管理-设置质押品”中新增需要质押的品种；

②质入/质出：在“质入/质出”中录入变化的数量和金额；

③当质押有变化时，在“质押更新”中查看和调整质押金额。

2) 在盘后状态时

直接进行分项资金导入：在“日终结算-成交-结算文件上传-分项资金文件”中导入分项资金文件，在“日终结算-保证金监控数据报送-分项资金数据管理”中修改质押的记录，点击“数据确认”。结算后，相应的质押会体现在席位资金和客户资金里。

折抵：

在“日终结算-仓单折抵管理-仓单折抵管理”中新增记录，输入交易所，投资者代码，合约，数量（默认为空头持仓）。点击“保存”。

4. 导入分项资金。

在“日终结算-结算控制平台-结算前准备-结算文件上传”或者“日终结算-成交-结算文件上传”导入分项资金，点击“上传”。

5. 处理交割。

①收取交割手续费

在“日终结算-交割-交割处理-交割”中修改实提数量、冻结数量为未交割数量（即三者相同），根据实际情况收取交易所交割手续费和投资者交割手续费。

②处理交割保证金

在“日终结算-交割-交割处理”菜单下点击“交割”，分别对卖方和买方做如下操作：

卖方：修改交割保证金率为 0

买方：修改交割保证金率为指定值（例如 100%或者 70%等）

③了结交割头寸

修改冻结数量为 0，实提数量为待交割数量。

④处理交割货款

可以通过席位划转与银行转帐 2 种方式。采用席位划转方式，可以在“资金管理-出入金管理-投资者出/入金”手工录入，也可以导入分项资金后在“日终结算-保证金监控数据报送-分项资金数据管理”中新增，录入投资者代码、原始金额（即交割货款，卖方直接录入，买方金额前加“-”号），然后复核、确认。

下面对 4 个交易所分别说明。

中金所：

在最后交易日时，结算后台直接将 IF 未平仓头寸转为交割记录，自动实提了结头寸，并完成交割手续费收取，保证金释放，交割盈亏划转等。

在 CTP 结算柜台中不需要做任何操作。

上期所：

1) 最后交易日：对买方和卖方的交割保证金都按照当天的结算保证金率收取，可能需要把结算保证金调整为 100%，即冻结全额货款，当日不做交割处理；

2) 第一个交割日：收取买方和卖方的交割手续费。

①收取交易所交割手续费：

一种方式是 CTP 按交易所规则自动扣除交易所交割手续费，需要在“日终结算—结算参数设置—交易所结算参数设置”中“参数代码”选择“上期所交割手续费收取方式”，“参数代码值”选择“1”。

另一种方式是手工收取，在“日终结算—交割—交割处理”菜单下点击“查询”，左单击需要交割的记录，点击“交割”，修改实提数量（录入未交割数量）、冻结数量（同实提数量），交割手续费率（按手数）改为 0，只收取交易所交割手续费。

②收取投资者手续费：收取投资者的交割手续费操作与手工收取交易所交割手续费操作相同，只是不修改“交割手续费率（按手数）”（即保持交割手续费率的设置值不变）。

③或者同时收取交易所交割手续费和投资者手续费：与手工收取交易所交割手续费操作相同，只是手工录入“交割手续费率（按手数）”和“交易所交割手续费率（按手数）”。

3) 第二个交割日 (配对日): 交易所分配仓单, 不做任何操作。

4) 第三个交割日: 买方付款, 卖方收款, 释放保证金, 了解交割头寸。

①处理交割货款: 可以通过席位划转与银行转帐 2 种方式。采用席位划转方式, 可以在“资金管理-出入金管理-投资者出/入金”手工录入, 也可以导入分项资金后在“日终结算-保证金监控数据报送-分项资金数据管理”中新增, 录入投资者代码、原始金额 (即交割货款, 卖方直接录入, 买方金额前加“—”号), 然后数据复核、确认。

②释放保证金: 在“日终结算—交割—交割处理”菜单下点击“交割”, 分别对卖方和买方做如下操作: 对卖方: 修改交割保证金率为 0。对买方: 修改交割保证金率为指定值 (例如 100%或者 70%等)。

③了结交割头寸: 修改冻结数量为 0, 实提数量为待交割数量 (即两者数量一致)。

5) 第四、五交割日: 卖方交付增值税发票, 买方收取增值税发票。在 CTP 中不需要做任何操作。

大商所:

1) 最后交易日:

①收取交割手续费: 操作同上期所收取方式一样。若 CTP 按交易所规则自动扣除交易所交割手续费, 需要在“日终结算—结算参数设置—交易所结算参数设置”中“参数代码”选择“大商所交割手续费收取方式”, “参数代码值”选择“1”。

②释放保证金:

交易所将买方 30%保证金直接划转为买方货款。在最后交易日不释放买方的交割保证金。保证金划转为买方货款有下面两种方法: 一种是在“日终结算—成交—结算文件上传”菜单下导入大商所的分项资金。然后在“日终结算—保证金监控数据报送—分项资金数据管理”菜单下左键单击记录, 选择“修改—核对交割款”, 填写备注栏“买方付 30%交割款”等字样, 修改完成。另一种是在“资金管理—出入金管理—交易所出金”点击“新增”, 选择交易所、录入交割款金额、填写备注栏后保存。余下的 70%货款要在交收日收取, 这就要求在交收日要冻结这块资金, 实现方法有两种, 第一是把最后

交易日的结算保证金率改为 70%，其二是把最后交易日的结算保证金率改为 0，下一交易日盘中通过资金冻结功能直接冻结这块资金。

对卖方，在“日终结算—交割—交割处理”菜单下点击“交割”，修改交割保证金率为 0。

2) 交收日：卖方收款；买方付余款。

①买方付 70%余款交割货款：通过交易所出金，方法仍然是在“资金管理—出入金管理—交易所出金”点击“新增”，选择交易所、录入交割款金额、填写备注栏后保存。

②卖方收 80%交割货款：交易所通过银行划转，不需要做席位入金（如果发票已上交，收取货款为 100%）。

③导入分项资金，做法如上。（卖方另外 20%交割货款，在卖方交增值税发票完成当日结算划转）

④了结交割头寸：修改冻结数量为 0，实提数量为待交割数量（即两者数量一致）。

郑商所：

流程与上期所基本一致，不同的是席位手续费的收取不是在第一交割日强制完成，而是在交割完成当天与投资者交割手续费一起收取。卖方的交割货款会先打进 80%，等到增值税发票交到交易所后，再打给 20%。对于会员而言，收到第一笔货款，就可以把实提数量改为待交割数量，完成交割，收到第二笔货款，只需做分项资金导入即可。

6. 处理错单。

各个经纪公司根据自己的制度制定错单处理方法。

一般做法经纪公司建立错单账户，当出现错单时，将这笔成交的拥有者更换为错单账户，再手工增加相应的成交单填平客户的损失，并把相关费用损失转移到错单账户里。

5.2 结算

确保银期签退，各个银行都已经做完自动对账或手工对账，打开“日终结算—结算”界面，点击“结算”，开始结算，直到结算按钮变成“回到结算前状态”，

结算完成；

5.3 交易所资金对账。

“日终结算-结算结果核对”界面，上传交易所的资金文件，然后打开会员资金核对，查看各个资金项是否与交易所一致。如果不一致，做相应的调整；

5.4 投资者资金对账

“信息查询-投资者信息-投资者资金对账”，查看客户的资金情况和公司的资金情况；“报表管理-交易结算单”查看个别特殊客户的结算单（交割，质押等等）；

5.5 数据报送与结算单邮寄

确认结算结果没有问题，“日终结算-保证金监控数据报送-保证金监控数据文件下载”，查看今天的报送文件，确认没问题，点“发送”按钮，把报送文件上传到保证金监控中心；在“报表管理-交易结算单”点邮寄，发布结算单至服务器，供下一交易日客户登录系统确认。

5.6 结算确认

在“结算控制平台”中“结算后处理”栏中点击“结算确认”按钮。

6. 相关参数的说明

6.1 开户相关参数

参数名称	参数说明	参数填写方式	参数具体设置说明	上场或生效时间
投资者代码最小长度	限制对投资者进行开户时自动获取投资者代码的代码最小长度。对于开户时手工输入投资者代码的情况不起限制作用。	填写数字	只能输入数字，其他字符无法输入	实时生效
投资者开户默认打开登录权限	对于投资者进行开户时投资者交易权限中的登录权限是否默认打开。	选择选项	在选择框内选择“是”或者“否”	实时生效
投资者代码必须为 0-9 的	投资者进行开户时，所	选择选项	在选择框内选择“是”	实时生效

数字	设置的投资者代码是否一定要为数字。		或者“否”	
开户密码录入方式	投资者进行开户时,密码的输入方式的选择。	选择选项	<p>1、“0-普通录入” 即开户时,直接页面录入。</p> <p>2、“1-对话框录入” 即开户时,弹出对话框进行密码输入,资料页面被锁定,不允许做任何修改,增加密码录入的保密性。</p> <p>3、“2-不可录入” 即开户时,不允许输入密码,只能直接使用默认密码,以后密码由投资者自己修改。</p>	实时生效
是否规范用户才能激活	休眠户激活时是否进行校验的配置。	选择选项	在选择框内选择“是”或者“否”,如果选择“是”,则系统检验只有那些通过统一开户接口规范过的客户才能被激活。	实时生效
是否规范用户才能休眠	用户休眠是是否进行校验的配置	选择选项	在选择框内选择“是”或者“否”,如果选择“是”,则系统检验只有那些通过统一开户接口规范过的客户才能被休眠。	实时生效
自动解除开仓权限限制	在对不规范客户规范以后,是否自动生成解除开仓权限限制的申请	选择选项	在选择框内选择“是”或者“否”,如果选择“是”,则在客户规范后,交易所返回应答文件以后,会自动生成解除开仓权限限制的申请	实时生效
中金所开户最低可用金额	中金所开户时,需要对投资者前一日的结算结果中可用金额进行校验,必须大于规定金额才能进行中金所交易编码的申请。	填写数字	只支持输入数字,输入字符无效	实时生效
会员在保证金监控中心代码	填写期货公司在保证金监控中心的公司代	填写字符	支持任意字符	实时生效

	码。			
保证金监控中心密码	填写期货公司在保证金监控中心的公司账号的密码。	填写字符	支持任意字符	实时生效
统一开户申请自动发送	对统一开户申请的发送程序进行设置,是否可以自动发送申请至保证金监控中心或者是否可以自动接收保证金监控中心的应答文件。	选择选项	1-自动发送并接收; 2-自动发送, 不自动接收; 3-不自动发送, 自动接收; 4-不自动发送, 不自动接收	实时生效
统一开户自动发送间隔时间	统一开户申请自动发送的轮询时间,即间隔多少时间进行一次发送,特别注意:发送的内容是发送队列中的内容,不是全部的统一开户申请。	填写数字	只支持数字,必须大于5秒	实时生效
交易所特殊问题管理->客户所开户的营业部代码	投资者中金所开户所必须提交的信息,需要知道客户开户的营业部。	对应填写相关内容	“选项编号” 输入营业部的代码 “选项说明” 输入营业部的名称	实时生效
交易所特殊问题管理->客户涉及哪些工业产品	法人投资者郑商所开户所必须提交的信息,需要知道投资者必须涉及工业产品的范围。	对应填写相关内容	“选项编号”为“A、B、C、D、E” “选项说明”为“涉棉、涉糖、涉化、涉粮、其他”	实时生效

6.2 交易相关参数

参数名称	参数说明	参数填写方式	参数具体设置说明	上场或生效时间
可用资金	可用资金算法是否包含平仓盈利	选择选项	0-包含平仓盈利; 2-不包含平仓盈利	切换到下一交易日生效
今开仓保证金算法	今开新仓的保证金以什么价格为标准进行计算	选择选项	1-昨结算价; 2-最新价; 3-成交均价; 4-开仓价	切换到下一交易日生效
浮动盈亏算法	对投资者的浮动盈亏是否算入投资者可用资金进行配置。	选择选项	1-浮盈浮亏都计算; 2-浮盈不计, 浮亏计; 3-浮盈计, 浮亏不计; 4-浮盈浮亏都不计算	切换到下一交易日生效

6.3 风控相关参数

参数名称	参数说明	参数填写方式	参数具体设置说明	上场或生效时间
强平比例	系统中暂无任何作用	填写数字	只能填下不超过 1 的正数值，不能填写其他字符	切换到下一交易日生效
追保比例	系统中暂无任何作用	填写数字	只能填下不超过 1 的正数值，不能填写其他字符	切换到下一交易日生效
风险算法全局有效	设置风险度算法是否对该经纪公司所有在用风控终端都强制生效，无法修改。如果选择否，则只对当前终端生效。	选择选项	0-否 非全局有效； 1-是 全局生效。	切换到下一交易日生效
风险算法	风险度定义设置。	选择选项	1-保证金/总权益； 2-总权益/保证金； 3-保证金/总权益*100； 4-总权益/保证金*100。	切换到下一交易日生效

6.4 银期和资金相关参数及操作

参数名称	参数说明	参数填写方式	参数具体设置说明	上场或生效时间
可提资金	可提资金算法是否包含平仓盈利。	选择选项	0-包含平仓盈利； 2-不包含平仓盈利。	切换到下一交易日生效
本日无仓且无成交客户出金	本日无仓且无成交客户出金是否受到所设置的可提比例的影响。	选择选项	0-不受可提比例限制； 2-受可提比例限制。	切换到下一交易日生效
银期可提资金算法	对可提资金的选择进行选择，即是否包含浮动盈亏，根据公司的实际情况进行设置。	选择选项	1-浮盈浮亏都计算； 2-浮盈不计，浮亏计； 3-浮盈计，浮亏不计； 4-浮盈浮亏都不计。	切换到下一交易日生效
银期资金可提比例（公司默认标准）	公司默认标准的银期比例设置，投资者的银期比例可在“投资者可提资金比例管理”中进行设置，其优先级高于公司默认的银期资金可提比例的设置。	填写数字	只能填不超过 1 的正数值，不能填写其他字符。	切换到下一交易日生效
银期入金开始时间	综合交易平台对银期入金开始时间的限制。	填写时间	按照实际入金开始时间进行填写，此处的时间是 24 小时制的，“小时”	切换到下一交易日生效

			的两位只能填写 00-23 的数值，“分钟”的两位只能填写 00-59 的数值；不可填写其他任何字符。	
银期入金结束时间	综合交易平台对银期入金结束时间的限制。	填写时间	按照实际入金结束时间进行填写，此处的时间是 24 小时制的，“小时”的两位只能填写 00-23 的数值，“分钟”的两位只能填写 00-59 的数值；不可填写其他任何字符。	切换到下一交易日生效
银期出金开始时间	综合交易平台对银期出金开始时间的限制。	填写时间	按照实际出金开始时间进行填写，此处的时间是 24 小时制的，“小时”的两位只能填写 00-23 的数值，“分钟”的两位只能填写 00-59 的数值；不可填写其他任何字符。	切换到下一交易日生效
银期出金结束时间	综合交易平台对银期出金结束时间的限制。	填写时间	按照实际出金结束时间进行填写，此处的时间是 24 小时制的，“小时”的两位只能填写 00-23 的数值，“分钟”的两位只能填写 00-59 的数值；不可填写其他任何字符。	切换到下一交易日生效

6.5 结算相关参数

参数名称	参数说明	参数填写方式	参数具体设置说明	上场或生效时间
结算时检查有未复核的出入金和分项资金	点击“结算”按钮时对系统里是否还存在未复核的出入金和分项资金	选择选项	0-否； 1-是	实时生效
结算单成交汇总方式	即在结算单中成交的汇总方式的设置。	选择选项	0-同日同合约； 1-同日同合约同价格； 2-同合约	实时生效
基础保证金	即实际业务中的保底资金, 该部分资金可用但不可取。	填写数字	应输入数值。设置时需要选择投资者范围。	设置后下次结算后生效

最低权益标准	涉及到追保, 低于这个参数值, 进行追保。	填写数字	应输入数值。设置时需要选择投资者范围。	切换到下一交易日生效
保证金算法	对结算时郑州锁仓的保证金算法的设定, 是单边收取还是双边收取。特别注意: 此参数对盘中交易无影响, 盘中均属单边收取。	填写 0 或 1	郑州锁仓保证金 0: 双边收取 1: 单边收取 设置时需要选择投资者范围。	实时生效
结算单结存是否包含质押	对结算单中结存的计算方法进行设置。	填写 0 或 1	0: 结算单权益等于结存; 1: 结算单权益等于结存+质押。 设置时需要选择投资者范围。	实时生效
分项资金导入项	对各交易所的分项资金导入项进行设置, 实际就是设置 A003 交割手续费和 A008 交割盈亏是否导入系统进行设置。目前在本系统中, 交割手续费和交割盈亏都会根据相关费率和价格进行计算, 所以基本不需要导入此两项内容。	填写 0 或 1	0: 分项资金导入时不导入 A003 和 A008; 1: 分项资金导入时导入 A003 和 A008。 设置时需要选择交易所。	实时生效
分项资金入交易所出入金	即分项资金的变化是否会进入席位资金, 引起席位资金的变化。可根据实际情况进行设置, 比如如果是直接和交易所商议好通过银行去往来该部分资金的, 分项资金就不需要进入席位出入金。但是需要特别注意: 分项资金中的质押资金是需要入席位资金变化的。	填写 0 或 1	0: 分项资金导入时, 不入交易所出入金; 1: 分项资金导入时, 入交易所出入金。 设置时需要选择交易所。	实时生效
上期所交割手续费收取方式	上期所交割手续费在综合交易平台的收取方式。是根据交易所标准, 第一交割日收取还是交割处理后才收取。	填写 0 或 1	0: 上期所交易所交割手续费交割处理后收取; 1: 上期所交易所交割手续费第一交割日收取。 设置时需要选择交易所。	实时生效
大商所交割手续费收取方	大商所交割手续费在	填写 0 或 1	0: 大商所交割手续费收	实时生效

式	综合交易平台的收取方式。是根据交易所标准，最后交易日收取还是交割处理后才收取。		取方式交割处理后收取； 1：大商所交割手续费收取方式最后交易日收取。 设置时需要选择交易所。	
---	---	--	--	--

6.6 费率相关参数

参数名称	参数说明	参数填写方式	参数具体设置说明	上场或生效时间
手续费模板数据权限	该参数是否启用，关系到综合交易平台费率设置中的“操作员对应手续费率模板权限管理”中所设置的对应关系是否起作用。	选择选项	0-关闭 如关闭，则所设置的操作员对应手续费率模板的对应关系不起作用。 1-启用 如启用，则所设置的操作员对应手续费率模板的对应关系起作用，能够限制操作员所能使用的模板。	“手续费率盘中同步参数设置”菜单中设置是否实时生效
保证金率模板权限	该参数是否启用，关系到综合交易平台费率设置中的“操作员对应保证金率模板权限管理”中所设置的对应关系是否起作用。	选择选项	0-关闭 如关闭，则所设置的操作员对应保证金率模板的对应关系不起作用。 1-启用 如启用，则所设置的操作员对应保证金率模板的对应关系起作用，能够限制操作员所能使用的模板。	实时生效

7. QandA

1. 操作员与资金管理

1. 给操作员设置好组织机构后，还是看不到投资者

组织架构的设置使次日生效的，明天即可看到

2. 操作员如何管理特定的几个投资者

设置如下:交易管理-操作员管理-操作员组织架构关系管理-授权，在单一投资者中添加投资者代码即可

3. 如何查询操作员历史操作情况？

在 flex 终端里的交易管理-》系统操作业务日志查询里即可查询，若没有这个字段，表明没有权限，不可查询。

4. 在综合交易平台有没有设置使得操作员不能进行数据的导出

没这项设置，可在信息查询中进行文件导出日志的查询

5. 在设置手续费时，想要设置一个营业部下面的操作员只能看到该营业部下面的模板，只能对这些模板进行操作，不能对总部或者其他营业部的进行修改等操作，问应该怎么进行设置？

在操作员对应手续费率模板权限管理中可以对应操作员和手续费率模板的对应关系，对应好后，该操作员只能对这些模板进行操作；但是还是看得到其他营业部的模板但不能对其操作。在设置单个投资者的手续费时，只要操作员没有对这个投资者的数据权限，就看不到其相关设置。

6 在柜台中已经出金并且已经复核，但是投资者的银行卡在银行已经注销，问现在应该怎么操作

在投资者出金菜单下可以对这笔出金进行冲销。

7. 出入金的时候，交易可提资金、结算可提资金、交易可用资金、结算可用资金、可用资金几者的差别，出金的时候应该参照哪个可提资金

告知交易可用资金、结算可用资金、可用资金其实本质是一样的，结算可提咨询，交易可提资金也是一样，之所以分开，是因为我们系统交易系统和结算系统是分开的，在两系统断开连接的时候，会造成两系统中的可用资金、可提资金不一致。

8 金仕达是主席，ctp 是次席, 出入金能否同步

不可以，只能手工出入金

9 在交易员终端可以进行资金冻结吗，怎么删除资金冻结的记录

交易员终端不可以，应在 flex 中进行设置，要删除记录只需要增加一条冻结资金为 0 的记录就可以了

10 客户咨询某一投资者更换银行卡，如何在 CTP 系统里对银期信息进行修改

在银期关系已转签的前提下，告知客户在 flex 终端资金管理-》银期转账帐户信息查询里进行修该即可

11 在银期流水对账中，发现交行入金上期系统比银行多 4 厘钱，怎么回事

这是因为银行不会去识别 4 厘钱的缘故，在期商流水中改为和银行一致即可

2. 结算

1. 结算确认后，可以可以重新结算

可以，在结算控制平台中回到结算前

2 咨询结算时系统报持仓错误是什么原因。

当日有投资者交易，但是交易编码被注销了，结算时会报错。需要将注销的投资者交易编码恢复然后结算。

3.客户导入成交文件如何操作？为何会出现数据错误的提示？

在 flex 柜台中日终结算->结算文件上传进行成交文件导入，出现数据错误的原因是中金所的数据文件要求是 dbf 格式，而其它三所则要求是 txt 格式的

4.二席持仓与主席系统持仓不一致该如何操作

在日终结算->成交管理中进行导入成交单即可

5. 结算时，发现手续费比主用系统差一分钱

在成交单管理中,修改你需要的成交单,把手续费收取方式改成按指定手续费收取，然后把手续费减一分即可

6. 分项资金无法导入的问题，咨询操作上是什么原因，该如何操作

因为没有设置质押品的缘故，在资金管理->质押管理->设置质押品中进行设置即可

7. 因为没有导入郑商所组合持仓，系统提示报持仓明细错误，咨询该如何操作才能完成结算

只能先退回结算前去，然后导入持仓明细文件，重新结算即可完成。

3 统一开户

1 中金所特殊问题中的营业部在哪里添加？

交易管理——开户参数设置——交易所特殊问题管理中，特殊问题选择：客户所开户的营业

部代码，然后点新增，填入选项编号和选项说明（营业部名称）

2 投资者进行统一开户报送时被保证金监控中心打回，报错信息为“资料格式检查失败-经营范围错误”，这是何原因造成的？

不能选择“金融业”---“其他非银行金融业”，否则将被保证金监控中心以异常状态打回

3 开户时的初始密码默认什么规则？

自然人开户的资金密码、交易密码默认为身份证后六位数字，法人开户的资金密码、交易密码默认为营业执照号（特别注意不是主证件组织机构代码）后六位数字，不足六位取全部数字

4 在哪里对“未补全”和“已拒绝”状态下的投资者资料进行“修改”操作？

此修改操作是在投资者申请管理中进行，因为这些记录尚未在综合交易平台正式生效，只能在投资者申请管理列表中查到，在其他列表中无法查到

5 二席开户需要注意哪些事项？

期货公司开户人员必须检查二席开户投资者当前交易日在主席是否有持仓。进入二席的投资者，必须要保证无持仓进入。随后为投资者录入已有的交易编码，打开交易权限与合约权限。二席的开户不需要报送保证金监控中心，只需在本系统完成开户即可。投资者开户完成后，通知相关部门开户成功，为投资者进行初始入金，录入手续费率，录入保证金率。

6 开户审核时报错：生成的交易编码出错，是怎么回事

是因为在基本参数中的保证金监控中心中没有设置

7 客户将投资者资料规范审核后，不能在统一开户申请管理中查询到该投资者，没有办法去进行电子报送。咨询应该怎样做。

该投资者在以前有报送未成功的记录，在“未报送”状态下查询到该投资者，然后点击“重新生成申请”即可，再电子报送。

4 费率设置

1 手续费率设置可不可以进行复核

在复核流程管理中启用手续费率设置的复核功能，就能在复核管理中进行手续费率的复核

2 在综合交易平台手续费率设置多少时，上期是不收成交量的钱的

设置为小于千万分之十时，我司是不收费的