

综合交易平台简明教程

一、综合交易平台功能简介.....	2
1. 综合交易平台——系统管理员.....	2
1.1. 交易参数设置.....	2
1.2. 经济公司管理.....	2
1.3. 系统状态切换.....	2
1.4. 代理经纪公司管理.....	2
1.5. 其他功能.....	2
2. 综合交易平台——经纪公司.....	2
2.1. 交易管理.....	2
2.2. 账户管理.....	2
2.3. 经纪人管理.....	2
2.4. 资金管理.....	3
2.5. 费率设置.....	3
2.6. 日终结算.....	3
2.7. 信息查询.....	3
2.8. 报表管理.....	3
3. 托管交易终端.....	3
4. 托管风险监控终端.....	3
二、特定业务流程说明.....	4
1. 创建操作员	4
2. 客户开户以及设置相关数据.....	6
3. 下单、撤单、删单、银期转账.....	11
4. 查询系统（前置、报盘等）运行状态、管理用户会话.....	14
5. 风险控制.....	16
6. 结算	18

一、综合交易平台功能简介

1. 综合交易平台——系统管理员

系统维护人员通过系统管理员用户登陆综合交易平台后,可维护交易托管系统的基础数据和日常的系统状态切换工作。

1.1. 交易参数设置：为系统设置必须的基础数据，包括支持的交易所信息、产品信息、产品的保证金率和手续费率模版、合约信息等；

1.2. 经纪公司管理：维护托管的经纪公司信息、经纪公司的交易员信息、经纪公司在各个交易所中会员的对照关系；

1.3. 系统状态切换：每天根据时间切换系统的状态，显示系统的当前状态和各经纪公司的结算状态；

1.4. 代理经纪公司管理：可以进入经纪公司的管理页面，为经纪公司代理操作；

1.5. 其他功能：管理员用户的维护、管理员角色管理、系统参数查询。

2. 综合交易平台——经纪公司

经纪公司的操作员登陆此平台后,可维护经纪公司的一些基础数据,进行日常结算工作和生成投资者报表。

2.1. 交易管理：经纪公司的管理操作平台,经纪公司的管理员可为经纪公司创建各种角色的操作员,操作员根据所属角色的权限,进行不同的业务操作。

2.2. 账户管理：经纪公司操作员可为投资者开户,维护投资者资料、密码、权限等信息;也可将投资者分组管理。

2.3. 经纪人管理：维护经纪公司下的经纪人信息,设置经纪人和投资者关系,为

每个经纪人设置返佣方式，维护经纪人之间的关系。

2.4. 资金管理：为投资者或经纪公司进行出入金操作，为投资者设置账户属性和信用额度，设置可质押品信息，记录投资者质入、质出记录，进行银期转账和核对银行流水。

2.5. 费率设置：维护交易所和投资者的保证金率和手续费率属性，可调整某段时间内的保证金率和手续费率；维护当天交易所和投资者的保证金率和手续费率属性，可调整当天交易所和投资者的保证金率和手续费率。

2.6. 日终结算：当天所有交易所完成结算后，经纪公司要进行日终结算工作。

2.7. 信息查询：可以查询投资者历史交易信息，包括：持仓明细、平仓明细、出入金记录、持仓汇总、质押明细、转账流水等；查询经纪公司在各交易所下的各种信息，包括：会员资金、结算、平仓、持仓等情况。还可查询任何一个投资者在某段时间内某交易所下所有的委托单核成交单。

2.8. 报表管理：系统结算后生成投资者结算单和结算月报。

3. 托管交易终端

投资者登陆交易员终端后，可查看各交易所的行情，进行下单操作，并且实时显示返回的报单回报和成交回报。投资者可查询委托单信息、成交信息、资金情况、持仓情况。交易终端还为投资者提供了预埋单的功能，方便了投资者录入报单。投资者还可通过交易终端进行银期转账。

经纪公司的用户也可登陆交易终端，代为其下的投资者进行委托交易；具有权限的经纪公司用户可查询当前经纪公司及其下所有投资者已登陆用户，并可使这些用户强制登出或强制退出；还可查询托管后台的前置状态、交易报盘状态和行情报盘状态。

4. 托管风险监控终端

经纪公司用户可登陆托管风险监控终端查询其下所有客户的资金情况及客户风险度，也可选中个别客户，查看这些客户的持仓明细、报单回报和成交回报，也可为某客户进行平仓操作。经纪公司用户可根据客户风险度过滤投资者。

投资者登陆托管风险监控终端后，可查看自己的资金状况及风险度，还可以查看到报单回报、成交回报和持仓明细，并且在持仓明细中直接平仓操作。

二、特定业务流程说明

1. 创建操作员

业务说明：

创建四种角色：交易、结算、风险控制及系统监控角色；创建四个经纪公司操作员，并将其分别授权交易、结算、风险控制及系统监控角色；建立操作员投资者对应关系

业务流程：

1. 以经纪公司的管理员登陆综合交易平台；
2. 进入交易管理-角色管理，新增交易角色，选择的角色功能为：报单系统-同步经纪公司数据、批量同步经纪公司数据、系统功能、基本查询、交易查询、交易功能、银期转账；如图 5.1.1



图 5.1.1

3. 进入交易管理-角色管理，新增结算角色，选择的角色功能为：综合交易平台；如图 5.1.2



图 5.1.2

4. 进入交易管理-角色管理，新增风险控制角色，选择的角色功能为：报单系统-风险

监控、交易功能；如图 5.1.3



图 5.1.3

5. 进入交易管理-角色管理，新增系统监控角色，选择的角色功能为：报单系统-强制用户登出、变更用户口令、系统监控、全部查询；如图 5.1.4



图 5.1.4

6. 进入交易管理-操作员管理-设置操作员，新增操作员，如图 5.1.5-1；鼠标左键操作员记录，将其授权于对应的交易、结算、风险控制或系统监控角色，如图 5.1.5-2



图 5.1.5-1



图 5.1.5-2

7. 进入交易管理-操作员管理-操作员投资者对应关系，新增 6 中设置的操作员对应的投资者关系，操作员及其设置实时上场。如图 5.1.6



图 5.1.6

2. 客户开户以及设置相关数据

业务说明：

以结算用户登录为客户开户，建立三个客户一个投资者组，其中两个客户属于该投资者组，一个不属于并为所有客户；并为客户入金，设置费率、设置银期转账参数

业务流程：

1. 以结算用户登录综合交易平台；
2. 进入账户管理-投资者组管理，鼠标左击新增投资者组；如图 5.2.1



图 5.2.1

3. 进入账户管理-投资者开户，填写信息创建新投资者，重复此步骤，建立三个新客户，其中两个客户在开户填写信息时选择投资者组为 2 中新创建的投资者组，另一个客户不选择投资者组；如图 5.2.2

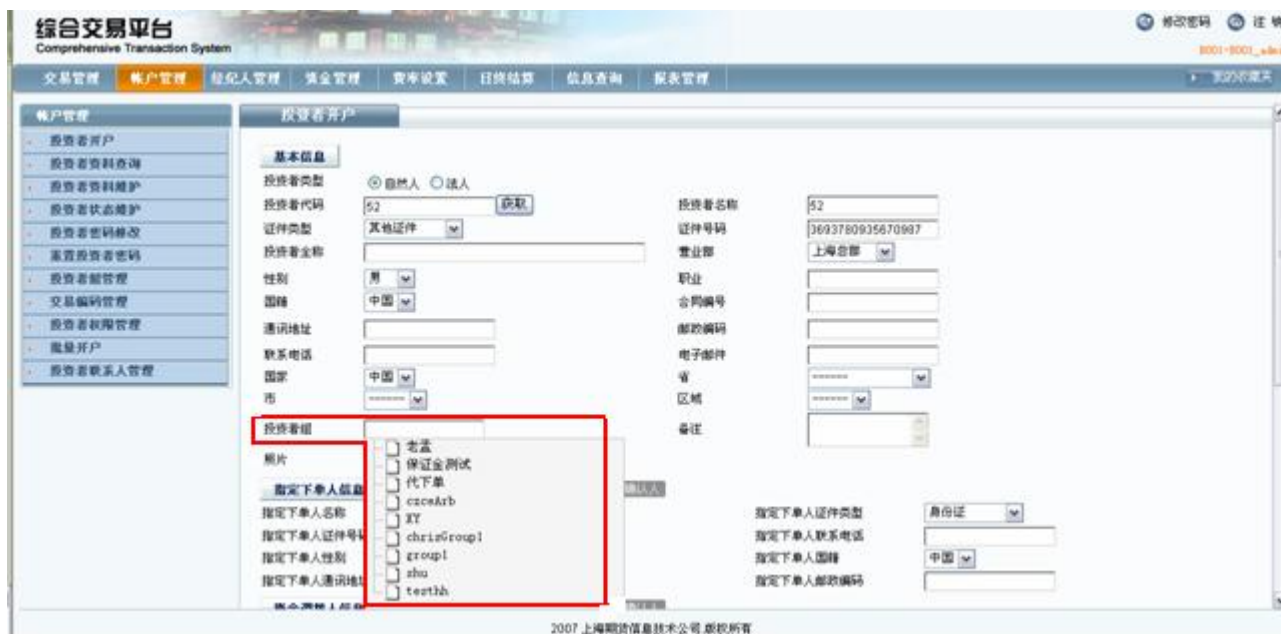


图 5.2.2

4. 进入资金管理-出入金管理-投资者入金，新增入金记录，如图 5.2.3-1，鼠标左击选择对该记录进行复核，复核成功后，入金实时上场；如图 5.2.3-2

综合交易平台
Comprehensive Transaction System

修改密码 注销
B001-B001_admin

交易管理 帐户管理 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 我的收藏夹

资金管理

- 出入金管理
 - 投资者入金
 - 投资者出金
 - 交易所入金
 - 交易所出金
- 资金设置
- 质押管理
- 银期转账

投资者入金

投资者代码: 00048

银行统一标志: 工商银行

资金类型: 银行存款

发生金额: 10000000
大写: 壹千万

操作摘要: 00048 银行存款 入金: 10000000

保存 取消

投资者名称: 00048
是否活跃: 是
资金调拨人: 对私测试-上海
交易可提资金: 84777.67165
可提资金: 266550.5996

证件类型: 身份证
证件号: 320622196405010040
资金调拨人证件: 对私测试-上海
结算可提资金: 266550.5996

图 5.2.3-1

综合交易平台
Comprehensive Transaction System

修改密码 注销
B001-B001_admin

交易管理 帐户管理 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 我的收藏夹

资金管理

- 出入金管理
 - 投资者入金
 - 投资者出金
 - 交易所入金
 - 交易所出金
- 资金设置
- 质押管理
- 银期转账

查询投资者资金变动数据成功

投资者入金

投资者代码: [输入框] 新增 查询

找到: 条记录, 显示 1 到 1

交易日	出入金流水号	投资者代码	投资者帐号	票据号	出入金类型	资金类型	出入金方向	银行统一标识类型	发生金额	操作摘要	资金状态	DB命令序号	录入员代码	复核员代码
20080723	1	00048	00048		出入金	银行存款	入金	工商银行	10,000,000.00	00048 银行存款 入金: 10000000	已录入		B001_admin	
总计:									10,000,000.00					

修改 删除 复核

图 5.2.3-2

5. （费率设置包括：保证金率和手续费率）进入费率设置-费率属性设置，新增手续费、保证金率和保证金调整；保证金调整实时上场；如图 5.2.4

综合交易平台
Comprehensive Transaction System

修改密码 注销
B001-B001_admin

交易管理 帐户管理 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 我的收藏夹

费率设置

- 费率属性设置
 - 交易所保证金率
 - 交易所保证金调整
 - 投资者保证金率
 - 投资者保证金调整
 - 交易所手续费率
 - 投资者手续费率
- 当前费率设置
- 投资者费率复制

交易所保证金费率

交易所: [下拉菜单] 产品代码: [下拉菜单] 新增 查询

新增交易所保证金费率 -- 网页对话框

交易所: 上海期货交易所 产品代码: al-沪铝 起始日期: [输入框]

投机多头保证金率	投机空头保证金率	保值多头保证金率	保值空头保证金率
按金额: [输入框]	按金额: [输入框]	按金额: [输入框]	按金额: [输入框]
按手数: [输入框]	按手数: [输入框]	按手数: [输入框]	按手数: [输入框]

保存 取消

正金费 保值空头保证金率 保值空头保证 0.00

图 5.2.4

6. （如果当日的费率需要特别设置）进入费率设置-当前费率设置，设置当日的费率，新增当日的手续费、保证金和保证金调整；当前费率设置实时上场；如图 5.2.5



图 5.2.5

7. 进入资金管理-银期转账-转账限额，设置银期转账的保证金转入银行的金额以及次数限制；如图 5.2.6



图 5.2.6

8. 进入资金管理-银期转账-增加划转额度，新增划转额度增加记录；（目前只有建设银行提供此项业务接口）如图 5.2.7



图 5.2.7

9. 进入资金管理-银期转账-减少划转额度，新增划转额度减少记录；（目前只有建设银行提供此项业务接口）如图 5.2.8

综合交易平台
Comprehensive Transaction System

修改密码 注销

B001-B001_admin

交易管理 帐户管理 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 我的收藏夹

资金管理

- 出入金管理
- 资金设置
- 质押管理
- 银期转账
 - 特殊限额
 - 银行流水核对
 - 结算帐户管理
 - 签到
 - 密钥获取
 - 签退
 - 增加划转额度
 - 减少划转额度
 - 查询划转额度
 - 查询银期划转结果

减少划转额度

银行代码: 建设银行 银行分中心代码: 0370

结算帐户: 结算帐户名称: 结算联行号: 发生金额:

结算机构号: 结算币别:

减少

没有找到记录。

交易日	交易代码	银行代码	银行分中心代码	结算机构号	结算联行号	结算帐户名称	结算帐户	结算币别	发生金额	服务处理状态	返回码	返回消息
总计:									0.00			

图 5.2.8

10. 进入资金管理-银期转账-签到，对指定银行进行签到；如图 5.2.9

综合交易平台
Comprehensive Transaction System

修改密码 注销

B001-B001_admin

交易管理 帐户管理 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 我的收藏夹

资金管理

- 出入金管理
- 资金设置
- 质押管理
- 银期转账
 - 特殊限额
 - 银行流水核对
 - 结算帐户管理
 - 签到
 - 密钥获取
 - 签退
 - 增加划转额度
 - 减少划转额度
 - 查询划转额度
 - 查询银期划转结果

签到

交易日	签约银行	分支机构	当前状态	操作
20080101	建设银行 (004)	0370	已日终	签到
20080715	交通银行 (005)	005	已签退	签到

找到 7 条记录, 显示 1 到 7

请求ID	交易日	银行代码	银行分中心代码	服务处理状态	返回消息
2088	20070628	005	005	2	交易成功
2072	20070628	005	005	2	交易成功
2068	20070628	005	005	2	期商本日未签退
1626	20070628	004	0370	2	连接北京建设银行总行银期转帐服务器失败
1624	20070628	004	0370	2	连接北京建设银行总行银期转帐服务器失败
1358	20080101	004	0370	2	连接北京建设银行总行银期转帐服务器失败
695	20080715	005	005	2	期商本日未签退

2007 上海期货信息技术有限公司 版权所有

图 5.2.9

11. 进入资金管理-银期转账-签退，对指定银行进行签退；如图 5.2.10



图 5.2.10

3. 下单、撤单、删单、银期转账

业务说明：

交易员登录后为客户下单、撤单、删单、银期转账

业务流程：

1. 以交易用户登录托管交易终端系统；
2. 双击行情栏中的合约，或者点击“报单”按钮，或者进入交易操作-报单进行下单；如图 5.3.1

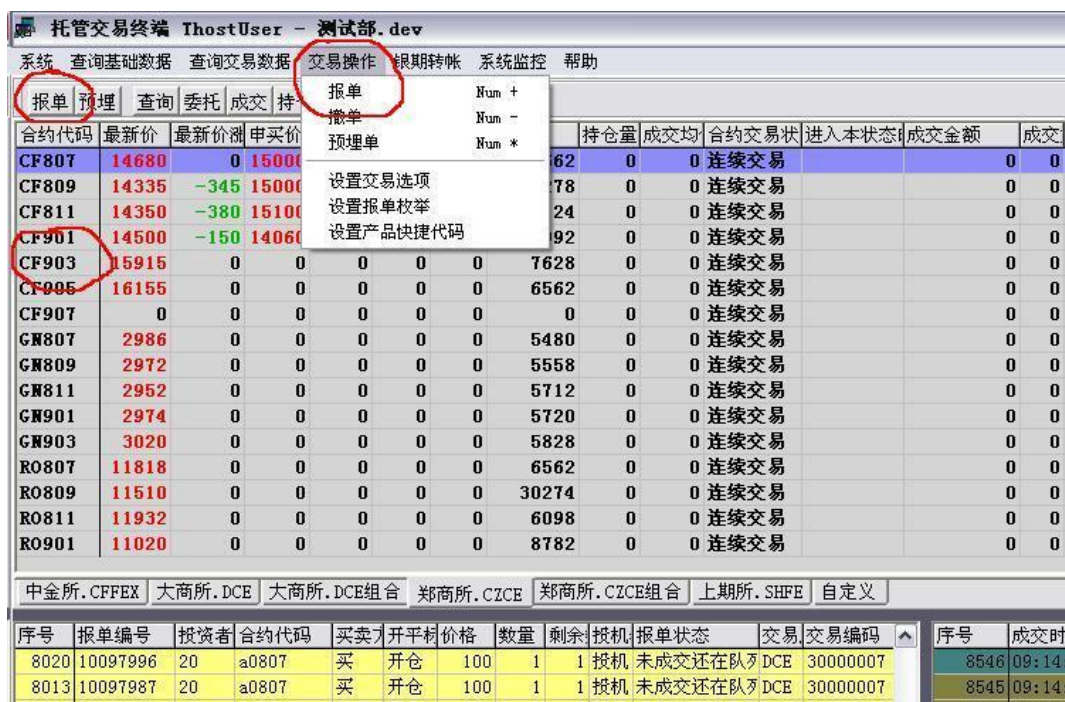


图 5.3.1

3. 双击报单，或者鼠标右击报单选择撤单，或者进入交易操作-撤单进行撤单；如图 5.3.2

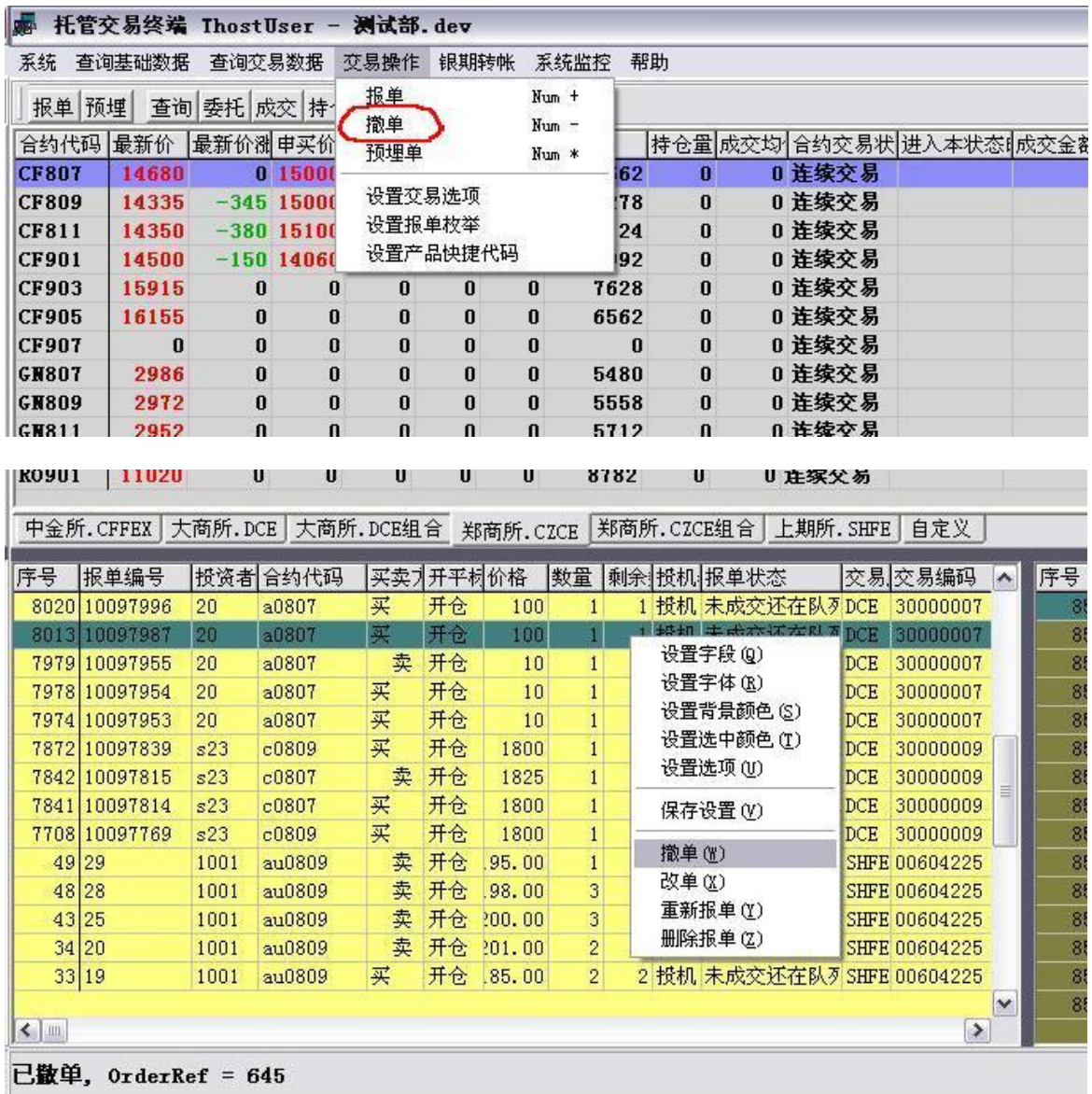


图 5.3.2

4. 鼠标右击报单选择删除报单进行删单；如图 5.3.3

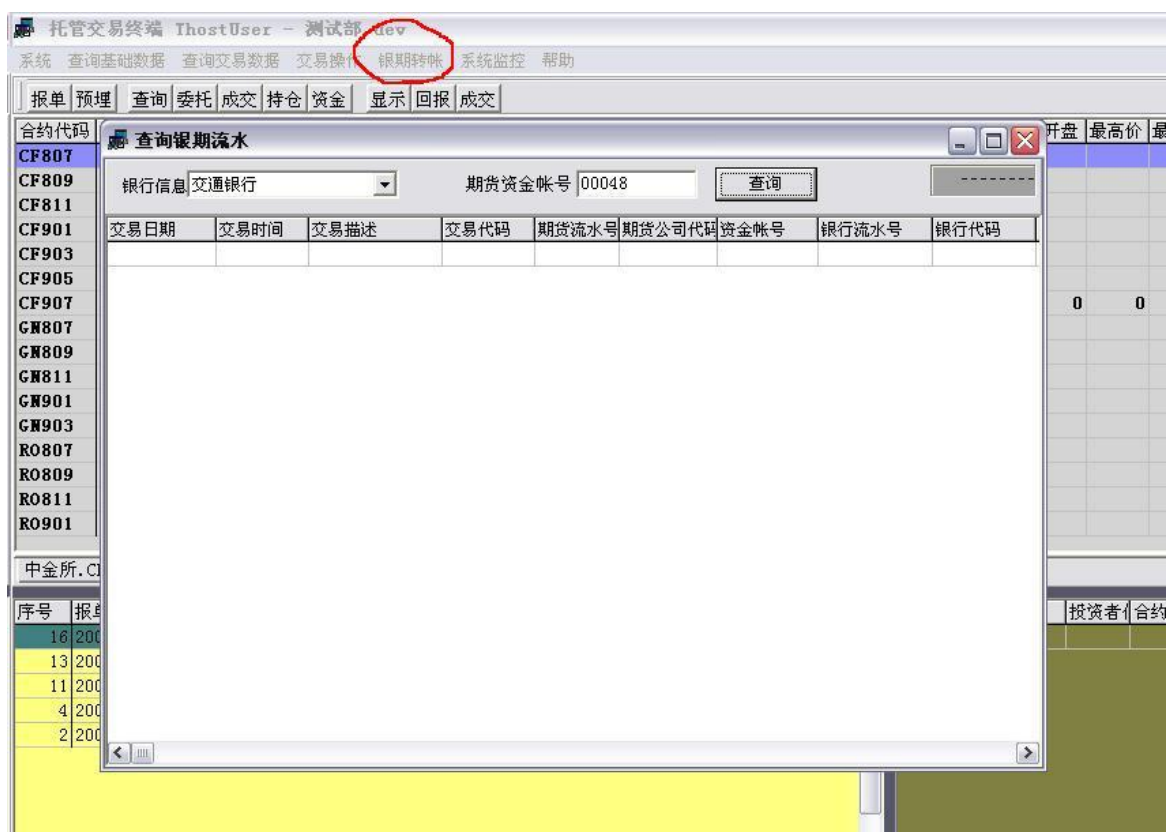


图 5.3.5

4. 查询系统（前置、报盘等）运行状态、管理用户会话

业务说明：

系统监控用户登录查询系统（前置、报盘等）运行状态、查询用户会话、强制用户登出、强制用户退出

业务流程：

1. 以系统监控用户登录托管交易终端系统；
2. 进入系统监控-查询用户会话，查询用户会话、强制用户登出、强制用户退出；如图 5.4.1

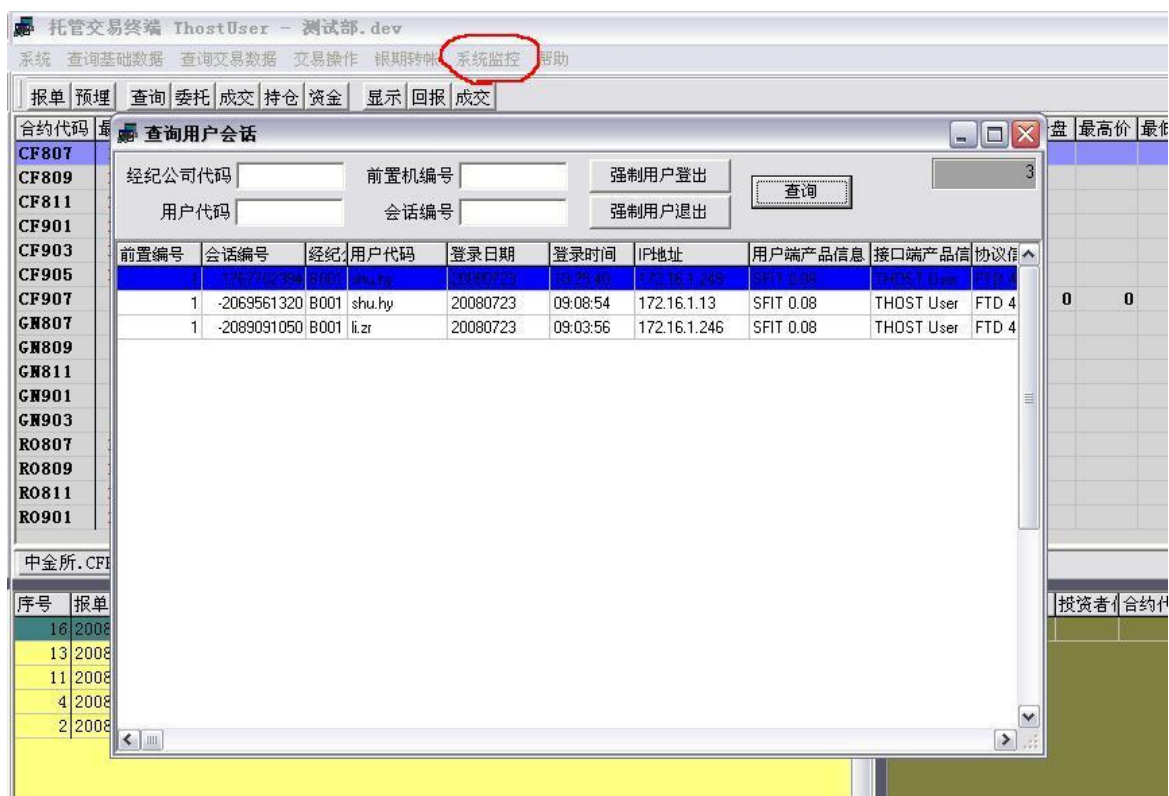


图 5.4.1

3. 进入系统监控-查询前置状态，查询前置状态；如图 5.4.2



图 5.4.2

4. 进入系统监控-查询交易报盘状态，查询交易报盘状态；如图 5.4.3

托管交易终端 ThostUser - 测试部.dev											
系统			查询基础数据			查询交易数据			交易操作		
系统监控			帮助								
报单			预埋			查询			委托		
成交			持仓			资金			显示		
回报											
合约代码	最新价	最新价涨	申买价	申买量	申卖价	申卖量	成交	均价	合约交易状	进入本状态	
CF807	14680	0	15000	2	15200				0	连续交易	
CF809	14335	-345	15000	3					0	连续交易	
CF811	14350	-380	15100	2	15250				0	连续交易	
CF901	14500	-150	14060	10	15240	1			0	连续交易	
CF903	15915	0	0	0	0				0	连续交易	
CF905	16155	0	0	0	0				0	连续交易	
CF907	0	0	0	0	0				0	连续交易	
GN807	2986	0	0	0	0			5480	0	连续交易	
GN809	2972	0	3080	2				5558	0	连续交易	
GN811	2952	0	0	0	0			5712	0	连续交易	
GN901	2974	0	0	0	0			5720	0	连续交易	
GN903	3020	0	0	0	0			5828	0	连续交易	
RO807	11818	0	0	0	0			6562	0	连续交易	
RO809	11510	0	0	0	0			30274	0	连续交易	

图 5.4.3

5. 进入系统监控-查询行情报盘状态，查询行情报盘状态；如图 5.4.4

托管交易终端 ThostUser - 测试部.dev											
系统			查询基础数据			查询交易数据			交易操作		
系统监控			帮助								
报单			预埋			查询			委托		
成交			持仓			资金			显示		
回报											
合约代码	最新价	最新价涨	申买价	申买量	申卖价	申卖量	成交	均价	合约交易状	进入本状态	
CF807	14680	0	15000	2	15200				0	连续交易	
CF809	14335	-345	15000	3					0	连续交易	
CF811	14350	-380	15100	2	15250				0	连续交易	
CF901	14500	-150	14060	10	15240	1			0	连续交易	
CF903	15915	0	0	0	0				0	连续交易	
CF905	16155	0	0	0	0				0	连续交易	
CF907	0	0	0	0	0				0	连续交易	
GN807	2986	0	0	0	0			5480	0	连续交易	
GN809	2972	0	3080	2				5558	0	连续交易	
GN811	2952	0	0	0	0			5712	0	连续交易	
GN901	2974	0	0	0	0			5720	0	连续交易	
GN903	3020	0	0	0	0			5828	0	连续交易	
RO807	11818	0	0	0	0			6562	0	连续交易	
RO809	11510	0	0	0	0			30274	0	连续交易	

图 5.4.4

5. 风险控制

业务说明：

风险监控用户登录风控终端执行风控功能，查询客户风险度、报单、成交、资金持仓及客户信息等，并执行强行平仓及下单委托功能。

业务流程：

1. 以风险监控用户登录风险监控终端；

2. 客户风险信息会自动查询显示到风险度窗口，双击风险度窗口的客户记录，客户相关的资金、持仓、报单、成交信息会显示在相应的分窗口中；点击资金分窗口中的客户记录可以将客户资料信息同步显示到客户资料分窗口中；各分窗口分布如图 5.5.1

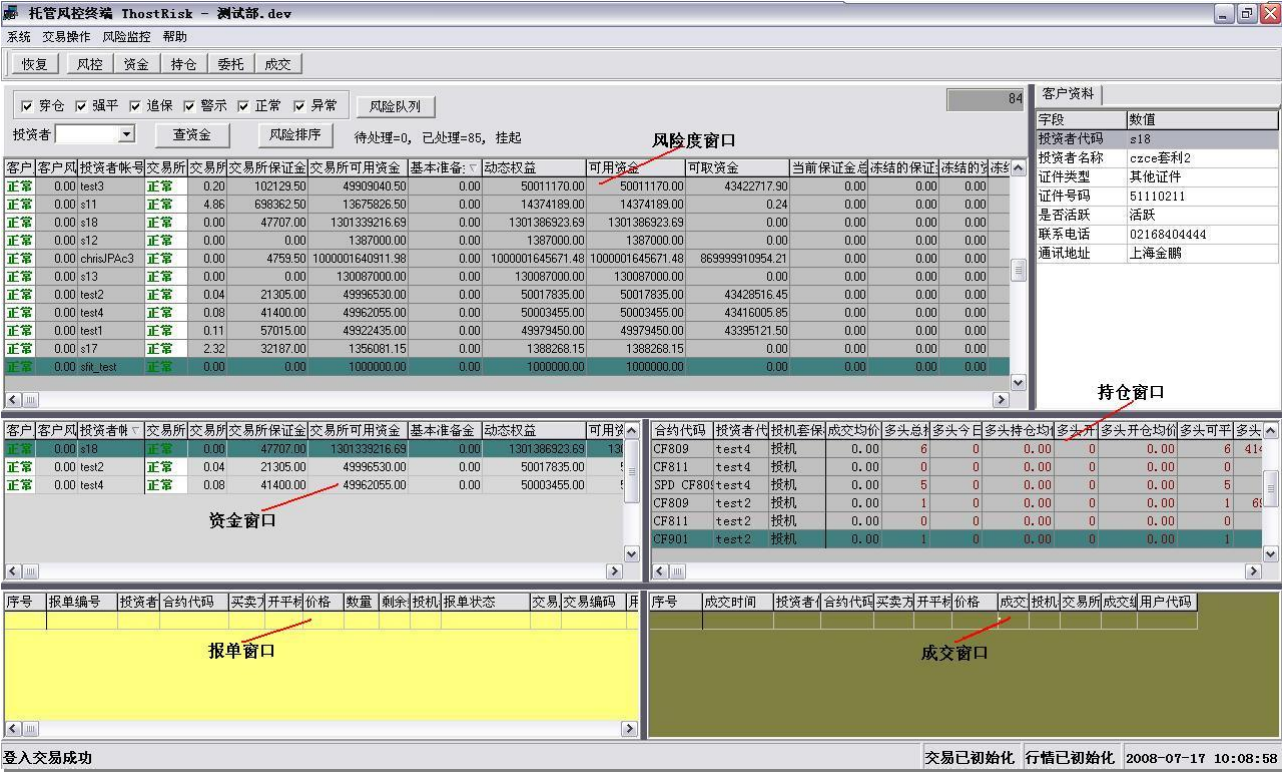


图 5.5.1

3. 双击持仓窗口中的持仓记录中的持仓量，可以对该仓位平仓，实现强行平仓；或者进入交易操作-报单，用下单委托功能实现强行平仓；如图 5.5.2



图 5.5.2

6. 结算

业务说明：

结算用户登录，结算价维护、费率调整（随交易所调整）、结算、结算单发送

业务流程：

1. 以结算用户登陆综合交易平台；
2. 进入日终结算-结算价录入，新增或者修改结算价；如图 5.6.1



图 5.6.1

3. 进入费率设置，费率属性设置用于调整全局费率，当前费率设置用于调整当天结算用的费率；具体详见 [2-5](#)、[2-6](#)
4. 进入日终结算-结算，对所有客户结算，此项操作的前提是当前系统状态为结算；

如图 5.6.2



图 5.6.2

5. 进入报表管理-交易结算单，选择日期、投资者，点击“邮寄”发送指定日期结果单给指定的投资者；如图 5.6.3



图 5.6.3