上海期货
信息技术有限公司
Shanghai Futures Information Technology Co.,Ltd.

综合交易平台交易员终端
用户操作手册

文件状态：	文件标识：	
[　　] 草稿	当前版本：	
[√] 正式发布	作　　者：	
[　　] 正在修改	完成日期：	

上海期货信息技术有限公司
上海浦电路 500 号期货交易大厦 13 楼
Tel：68400001
Fax：68400980

修订历史记录

修 改 记录编号	修改状态	修改页码及条款	修改人	审核人	批准人	修改日期

版权说明

版权所有，本使用手册中的任何信息未经上海期货信息技术有限公司的同意不得以任何方式（包括纸张、印刷品、电子出版物、电子文档等信息传播媒介）复制、传播、摘抄、再发表。就像我们一直保证我们的产品的高质量一样，我们一直竭力保证本手册的精确性，虽然如此，我们仍无法绝对保证手册中没有偏差信息存在，根据本手册进行操作前，请确定您要做的每一步都经过了确认。我们保有将来根据产品的升级而修改本使用手册的权利。

注意信息

本手册讲述的内容随着综合交易品产品的升级将不断地更新，如果您的手册是过时的，请与上海期货信息技术有限公司以获得最新的手册。

本手册的使用对象应该是有基本计算机知识的工作人员，虽然我们产品的易用性使得工作人员对本手册的需求不是很迫切，但是它会使有经验的工作人员更加得心应手地使用本产品。

在进行删除操作以前请先确认执行的操作是否是您所希望的。

虽然发生错误的可能性很小，但我们不能保证全部文档都不存在任何一点小错误，因此如果您有疑问，请联系我们，将您的问题发给我们，我们将会在最短的时间内给您答复。

联系我们

我们承诺我们将为客户提供一流的服务和技术支持。如果您有任何建议和疑问，我们欢迎您将您的想法及问题发到我们这里，我们将尽最大的努力在最短的时间内对您的问题做出回应。

我们的联系方式：

· 公司网址：

http://www.sfit.com.cn

· 电子邮件：

商业联系：market@sfit.com.cn

技术支持：surpport@sfit.com.cn

· 服务热线：800-9880020

· 电　话：**(86)-21－68400001**

· 传　真：**(86)-21－68400980**

· 通讯地址：中国上海 浦东新区浦电路 500 号上海期货大厦 13 楼

邮政编码：200122

目　录

1　概述 6
2　文件清单 6
3　安装过程 6
4　配置参数 7
5　程序外观 8
6　操作流程 8
6.1　用户登入 8
6.2　修改用户密码 9
6.3　查询数据 9
6.4　报单 11
6.5　撤单 12
6.6　本地预埋单 13
6.7　核对版本 14
7　界面设置 15
8　功能清单 18
8.1　系统 18
8.1.1　用户登入 18
8.1.2　修改用户密码 18
8.1.3　关闭 19
8.2　查询基础数据 19
8.2.1　查询合约 19
8.2.2　查询组合合约 20
8.2.3　查询投资者 20
8.2.4　查询投资者编码 21
8.3　查询交易数据 21
8.3.1　查询报单，过滤，撤单，预埋撤单，重新报单，改单 21
8.3.2　查询成交，分组汇总 22
8.3.3　查询投资者持仓，买/卖汇总，平仓 23
8.3.4　查询资金账户 24
8.3.5　查询预埋单，增删改，发送 24
8.3.6　查询持仓，持仓汇总，平仓 ..... 错误！未定义书签。
8.3.7　查询持仓明细 25
8.3.8　查询组合持仓明细 25
8.3.9　查询交易通知 26
8.4　交易操作 26
8.4.1　报单 26

8.4.2 撤单 28
8.4.3 查询服务器预埋单，删除操作 28
8.4.4 查询服务器预埋撤单，删除操作 30
8.4.5 本地预埋单 30
8.4.6 校验投资者密码 30
8.5 设置 31
8.5.1 通用设置 31
8.5.2 查询选项 à 风险控制配置 31
8.5.3 交易选项 à 设置报单配置项 32
8.5.4 交易选项 à 设置投资者组 ..... 错误！未定义书签。
8.6 帮助 33
8.6.1 关于 33

用户操作手册

1 概述

托管交易员终端ThostUser2的用户是经纪公司中的交易员。

主要特点和功能包括：

- 采用广大用户习惯的操作风格，便于上手。
- 可以按照登入用户的操作权限显示不同的界面，保障数据安全。
- 交易员可以用程序了解属下投资者的报单、成交、资金、持仓等相关数据。
- 交易员可以用程序为投资者进行报单、平仓、撤单等交易操作。

2 文件清单

ThostUser2：交易员终端所在目录。

|___ ThosetUser2.exe：交易员终端执行程序。

|___ ThostUser2Cfg.xml：交易员终端配置文件。

|___ ThostUserApi.dll：综合交易平台UserApi。

|___ ThostXPort.dll/CLogger.dll/：其他辅助动态链接库。

|___ set：程序设置所在目录。

|___ cfg：程序配置所在目录。

|___ log：日志文件所在目录。

|___ ThxPortTpl：数据输出模板所在目录。

3 安装过程

复制ThostUser2目录到用户指定路径。

如果你的计算机缺少必要的系统部件，可能还需要安装msxml6.exe。

4 配置参数

配置参数在ThostUser2Cfg.xml中

```xml
<?xml version="1.0" encoding="gb2312"?>
<ThostUser2>
 <ConnectConfig>
   <!-- 程序描述 -->
   <SubTitle name="simu"/>
   <!-- 经纪公司代码 -->
   <BrokerID name="2030"/>
   <!-- 交易员代码 -->
   <UserID name="wang.yc"/>
   <!-- 默认的前置机组号 -->
   <DefaultGroup Index="0"/>
   <!-- 前置机组，名称“电信Tcp”，使用Tcp行情 -->
   <ConnectionGroup name="电信Tcp" IsUsingUdpMd="0">
     <!-- 交易前置机地址，可以输入多个 -->
     <TradeFront Address="tcp://asp-sim2-front1.financial-trading-platform.com:26205"/>
     <!-- 行情前置机地址，可以输入多个 -->
     <MarketFront Address="tcp://asp-sim2-md1.financial-trading-platform.com:26213"/>
   </ConnectionGroup>
   <!-- 前置机组，名称“电信Udp”，使用Udp行情 -->
   <ConnectionGroup name="电信Udp" IsUsingUdpMd="1">
     <TradeFront Address="tcp://58.246.49.133:26205"/>
     <MarketFront Address="tcp://58.246.49.133:18213"/>
   </ConnectionGroup>
 </ConnectConfig>
</ThostUser2>
```

5 程序外观

程序主窗口显示实时数据，包括：行情列表（上方），委托回报（左下方），成交回报（右下方）。

菜单栏包括：所有的业务功能，如系统登入，修改密码，查询数据，交易操作等。

工具栏包括：交易过程中常用的业务功能。

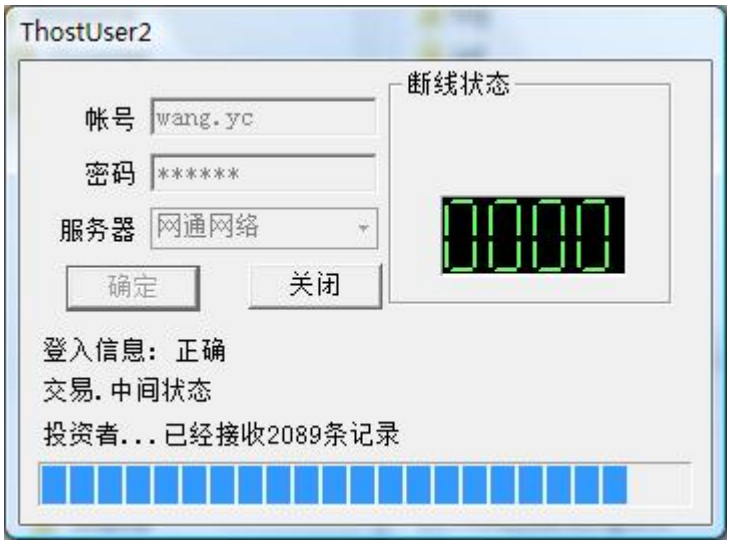
状态栏包括：各个交易所的交易状态和时间，交易连接状态，行情连接状态，最新的交易操作回报，本地时间。

按照登入用户的不同权限，程序可以显示相应的操作功能。如以投资者身份登入，就不会有什么操作菜单。

6 操作流程

6.1 用户登入

程序启动后，显示用户登入对话框。



用户输入各项参数，点击“确认”，登入托管交易系统。

登入过程中，程序会查询不少基础数据，如查询合约、投资者、委托、成交等等。完成上述初始化过程，登入对话框自动关闭，可以进入主页面开始操作。

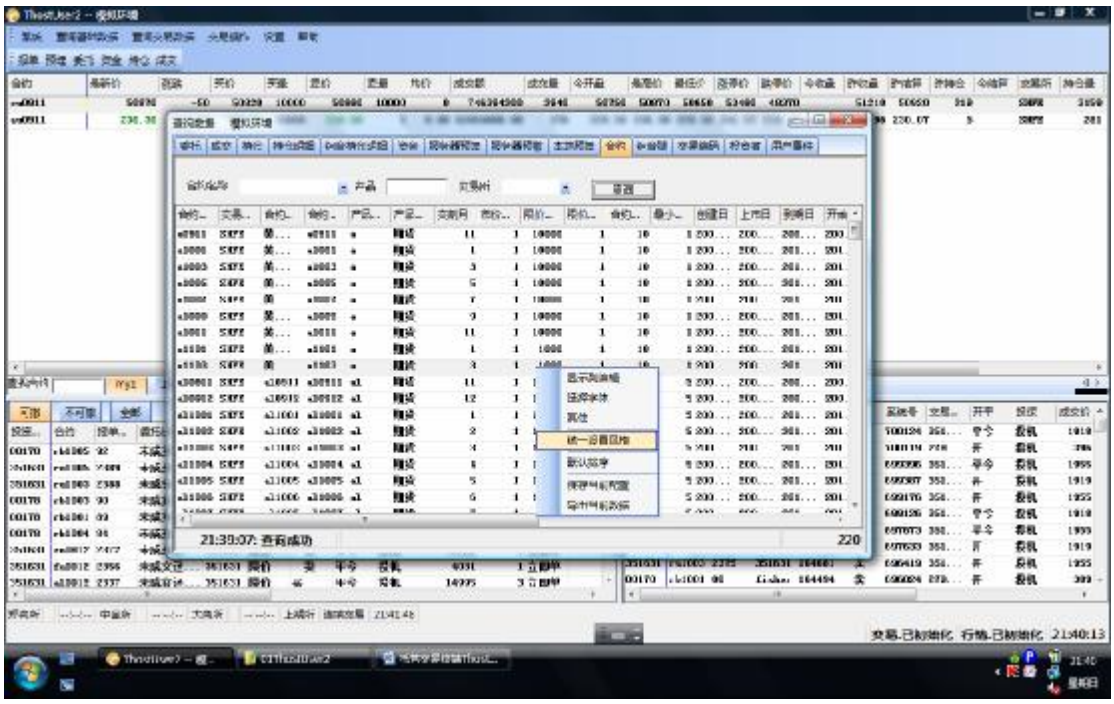
6.2 修改用户密码

选择菜单项“系统->修改用户密码”。

6.3 查询数据

点击工具栏上按钮（除了“报单”按钮），显示集成的数据查询窗口。其中包括：查

询委托、成交、持仓、持仓明细、组合持仓明细、资金、合约、交易编码、投资者、用户事件等页面。



每个查询页面基本包括3部分：

最上方是托管系统提供的各项过滤参数，选择某一过滤参数，查询出符合条件的记录。

中间是查询数据结果显示表格。

最下方是查询状态，显示查询是否成功，收到记录的数量。

- 注意：如果参数为空，表示查询全部记录。

  如果参数末尾带有“*”，表示模糊查询，如投资者“35*”表示查询投资者代码是35开头的记录。目前模糊查询只支持末尾“*”的模式。

  如果参数末尾不带“*”，表示精确查询，如果投资者“35”表示查询投资者代码是35的记录。

- 注意：很多查询页面都有“投资者”“合约”“交易所”查询输入字段。用户可以在一个查询页面中输入这些字段，切换到其他查询页面时，这些字段也会带入新的查询页面，避免用户重复输入。

选择菜单项、点击工具条按钮、使用快捷键，都可以直接打相关的查询页面。如选择工具栏上“成交”按钮或者菜单项“查询交易数据->查询成交”后者按下“F7”可以直接显示查询成交页面。

每个数据表中还包括了如下共同的功能：

“保存当前配置”，设置好当前页面的外观或者字段显示属性后把设置保存到文件中，用于下次显示。

“默认排序”，可以恢复数据表的默认字段排序设置。一般情况下，默认排序是第一个字段的升序。某些特定的页面有着自己的排序方式，如用户事件的默认排序是按照时间顺序从新到老排序。

“导出当前数据”，可以把当前页面的数据，包括查询参数和查询结果导出到文件中。可以导出的文件类型有csv、txt、html。

在查询窗口中，还特有“统一设置风格”功能，可以把当前页面的设置，包括字体、颜色等外观属性复制到查询窗口的其他页面，避免用户逐个页面地去设置。

6.4 报单

按“+”键触发或者按工具栏中“报单”按钮或者选择菜单项“交易操作->报单”均可显示标准报单对话框。

用户可以使用回车键或者向下键，跳转到下一个输入框。如果是数字代码，用户输入选项代码后，该选项的文字描述随即会显示，如上图的“卖”“开”。

输入合约后，程序会提示涨跌停板。

依次输入买卖方向、开平标志、投机套保标志后，程序会提示可用资金及可开、可平、可平今数量。在操作途中，可以点击“查询”，手工刷新上述参考数据。

点击“报单”按钮，可以发送报单。

点击“预埋”按钮，可以发送服务器预埋单，等到交易所状态切换到“集合竞价报单”或者“连续交易”时，由服务器把这些报单发送到交易所。

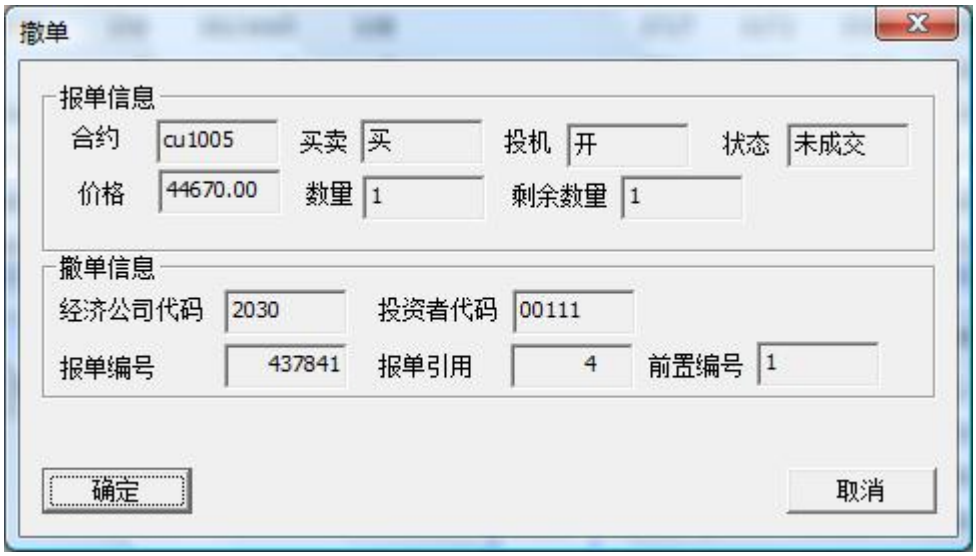
报单对话框还包括“条件单”、“本地预埋单”页面。

6.5 撤单

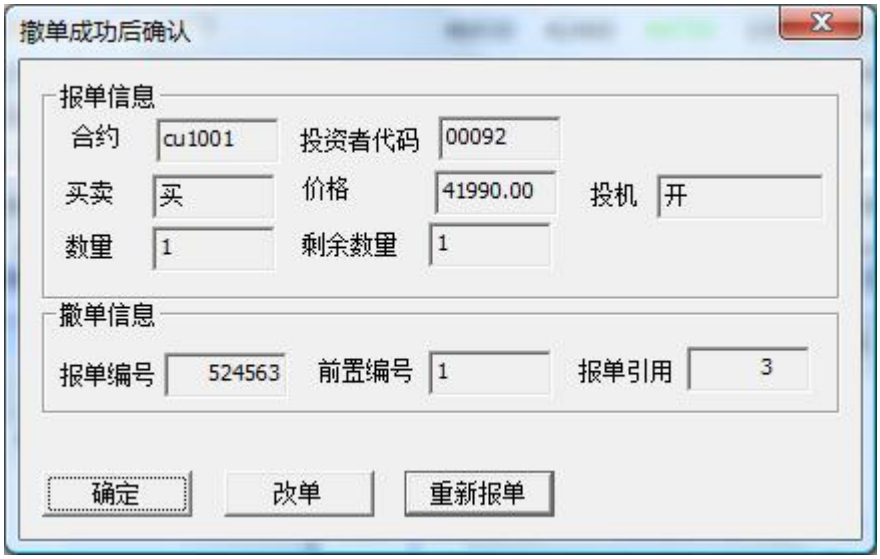
双击委托回报或者委托查询中的记录，显示撤单确认窗口，点击“确认”按钮就可以

发送撤单指令了。

如果设置“撤单时确认”，就会显示如下对话框，否则可以直接撤单。



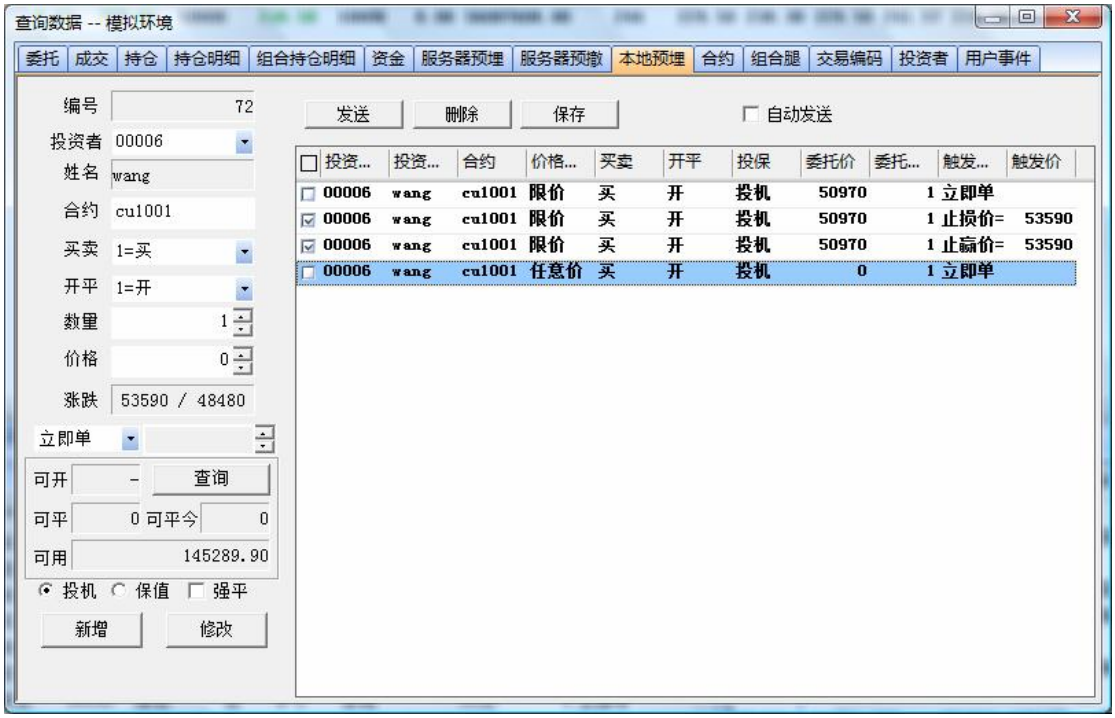
如果设置了“撤单成功时确认”，撤单成功后，会显示如下窗口，提示用户撤单成功。



收到撤单确认后，用户还可以参考撤单参数，进行“重新报单”或者“改单”。

6.6 本地预埋单

按工具栏中“预埋”按钮或者选择菜单项“交易操作->本地预埋单”，显示本地预埋单操作界面。



在左面面板上，可以输入/修改预埋单，功能和报单界面一致。

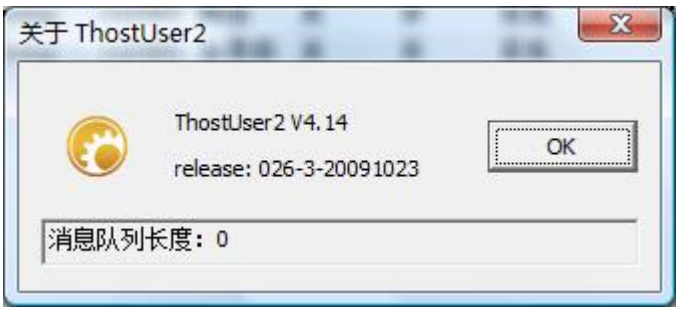
在右面面板上，可以删除、发送已保存的预埋单。

本地预埋单保存在本地目录中，如果选择了“自动发送”，程序开启后，检测到交易所状态进入“集合竞价报单”或者“连续交易”。程序就会把这些预埋单发送到综合交易平台。

- 注意：本地预埋单是当天有效。

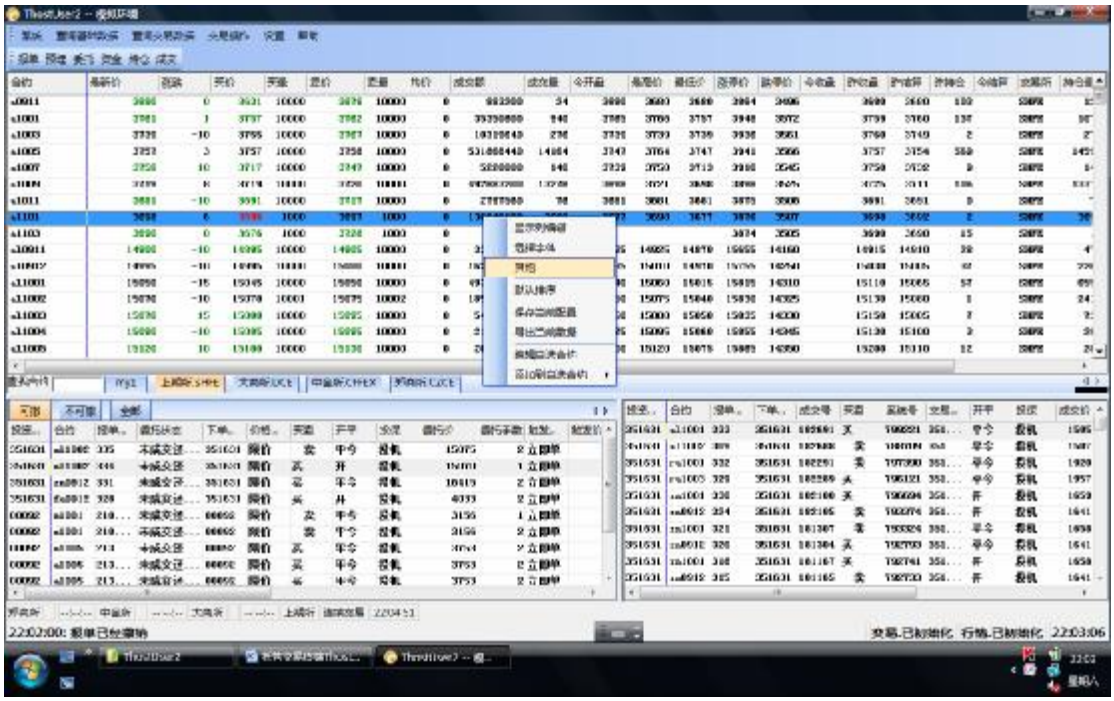
6.7 核对版本

选择菜单项“帮助->ThostUser2”，显示程序版本信息。



7 界面设置

用户可以定制所有的数据表格的外观。选中数据表格，单击右键，在弹出菜单中选择设置显示字段，设置字体，设置背景颜色，设置选中颜色，设置其他等选项。

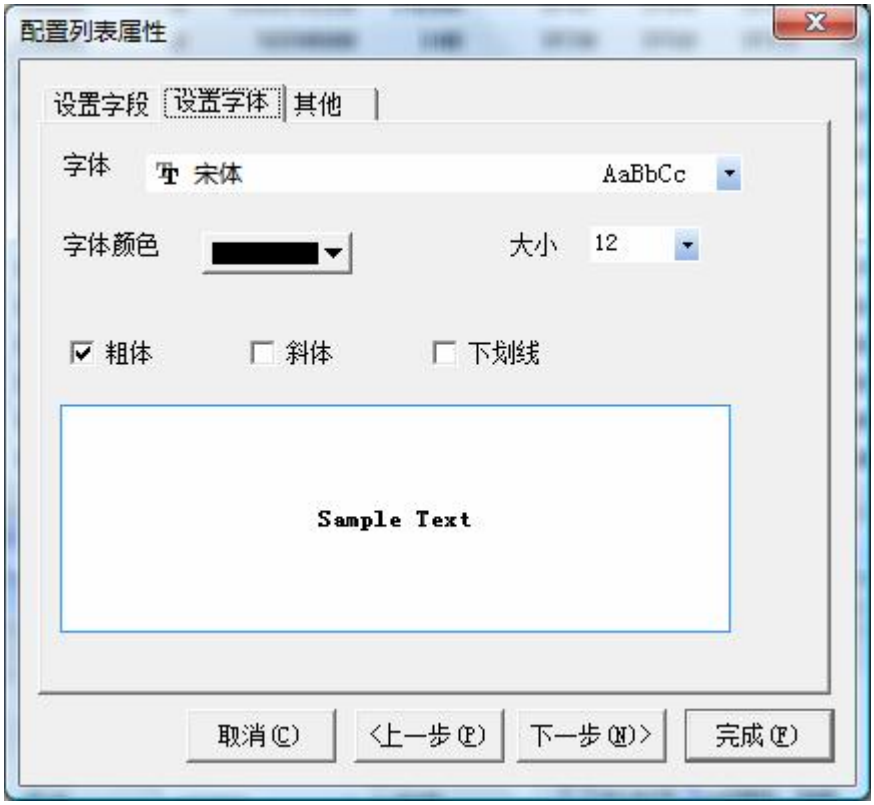


如设置显示字段：

确认设置完成后，程序会自动保存设置。

使用鼠标拖动数据表格的标题栏字段，可以改变字段排列顺序和宽度。操作完成后，程序会自动保存设置。

其他设置包括：字体设置和其他设置。



- 注意：对于行情回报、资金查询页面，需要用颜色来表示业务涵义。建议设置“选中时不反色显示”，避免选中记录的所有字体都显示为白色。

8 功能清单

下述功能清单以菜单顺序编排，所以不再描述进入功能的路径了。

8.1 系统

8.1.1 用户登入

请参考6.1 用户登入。

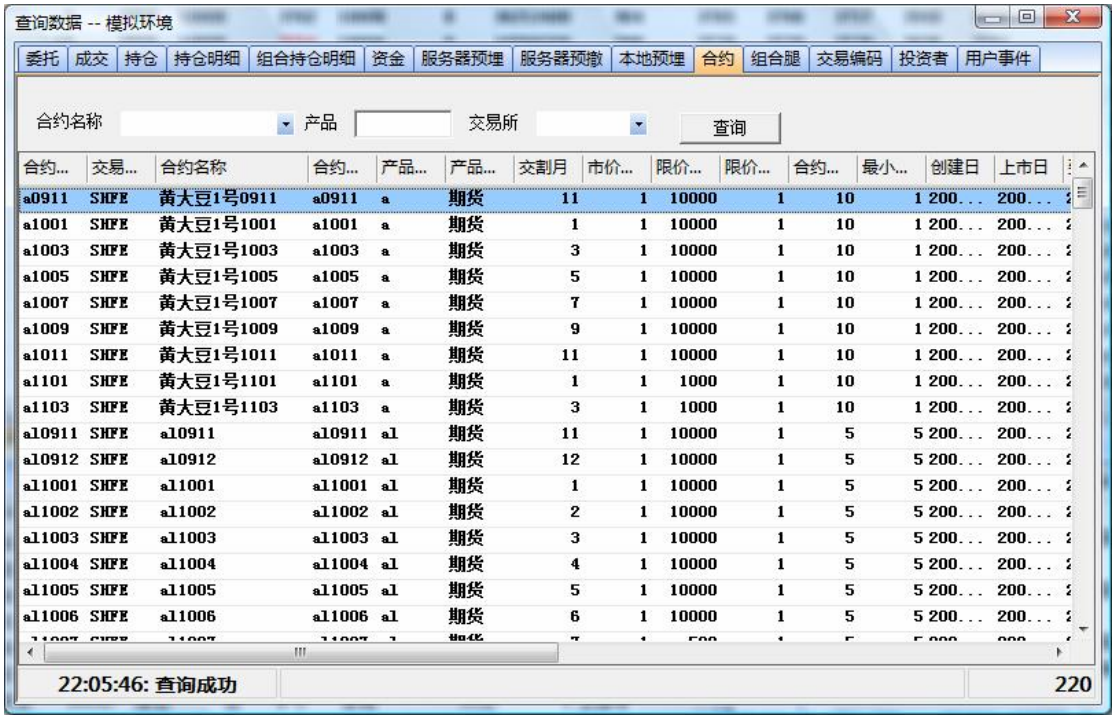
8.1.2 修改用户密码

请参考6.2 修改用户密码。

8.1.3 关闭

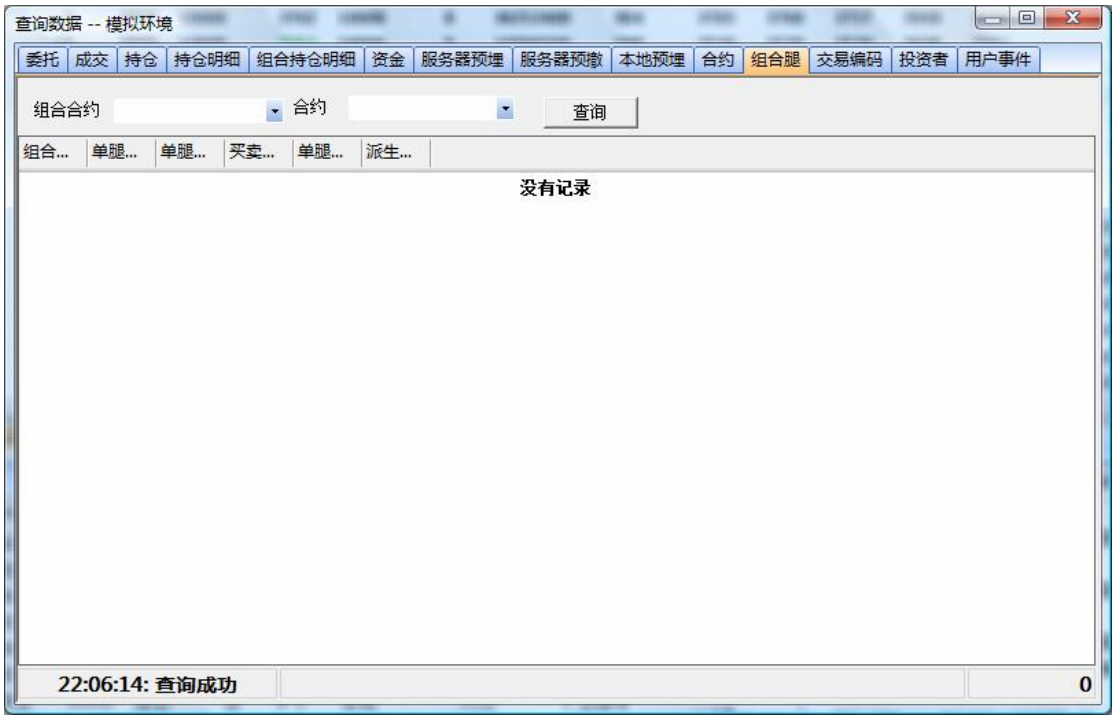
8.2 查询基础数据

8.2.1 查询合约

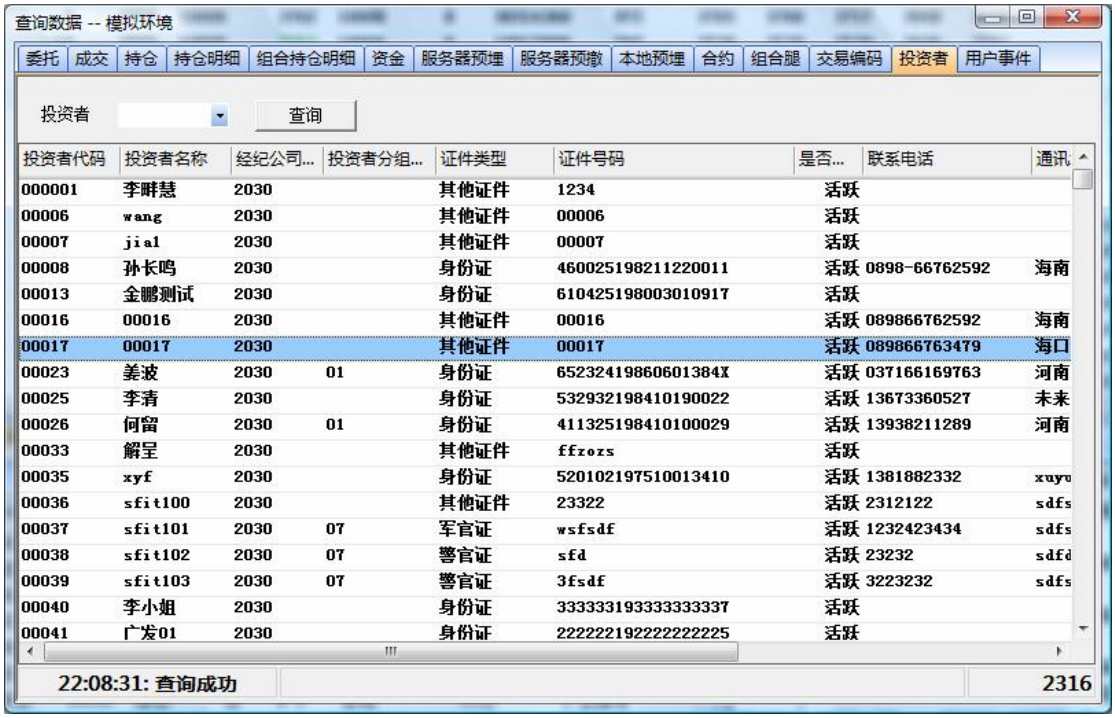


合约...	交易...	合约名称	合约...	产品...	产品...	交割月	市价...	限价...	限价...	合约...	最小...	创建日	上市日
a0911	SHFE	黄大豆1号0911	a0911	a	期货	11	1	10000	1	10	1	200...	200...
a1001	SHFE	黄大豆1号1001	a1001	a	期货	1	1	10000	1	10	1	200...	200...
a1003	SHFE	黄大豆1号1003	a1003	a	期货	3	1	10000	1	10	1	200...	200...
a1005	SHFE	黄大豆1号1005	a1005	a	期货	5	1	10000	1	10	1	200...	200...
a1007	SHFE	黄大豆1号1007	a1007	a	期货	7	1	10000	1	10	1	200...	200...
a1009	SHFE	黄大豆1号1009	a1009	a	期货	9	1	10000	1	10	1	200...	200...
a1011	SHFE	黄大豆1号1011	a1011	a	期货	11	1	10000	1	10	1	200...	200...
a1101	SHFE	黄大豆1号1101	a1101	a	期货	1	1	1000	1	10	1	200...	200...
a1103	SHFE	黄大豆1号1103	a1103	a	期货	3	1	1000	1	10	1	200...	200...
al0911	SHFE	al0911	al0911	al	期货	11	1	10000	1	5	5	200...	200...
al0912	SHFE	al0912	al0912	al	期货	12	1	10000	1	5	5	200...	200...
al1001	SHFE	al1001	al1001	al	期货	1	1	10000	1	5	5	200...	200...
al1002	SHFE	al1002	al1002	al	期货	2	1	10000	1	5	5	200...	200...
al1003	SHFE	al1003	al1003	al	期货	3	1	10000	1	5	5	200...	200...
al1004	SHFE	al1004	al1004	al	期货	4	1	10000	1	5	5	200...	200...
al1005	SHFE	al1005	al1005	al	期货	5	1	10000	1	5	5	200...	200...
al1006	SHFE	al1006	al1006	al	期货	6	1	10000	1	5	5	200...	200...

8.2.2 查询组合腿



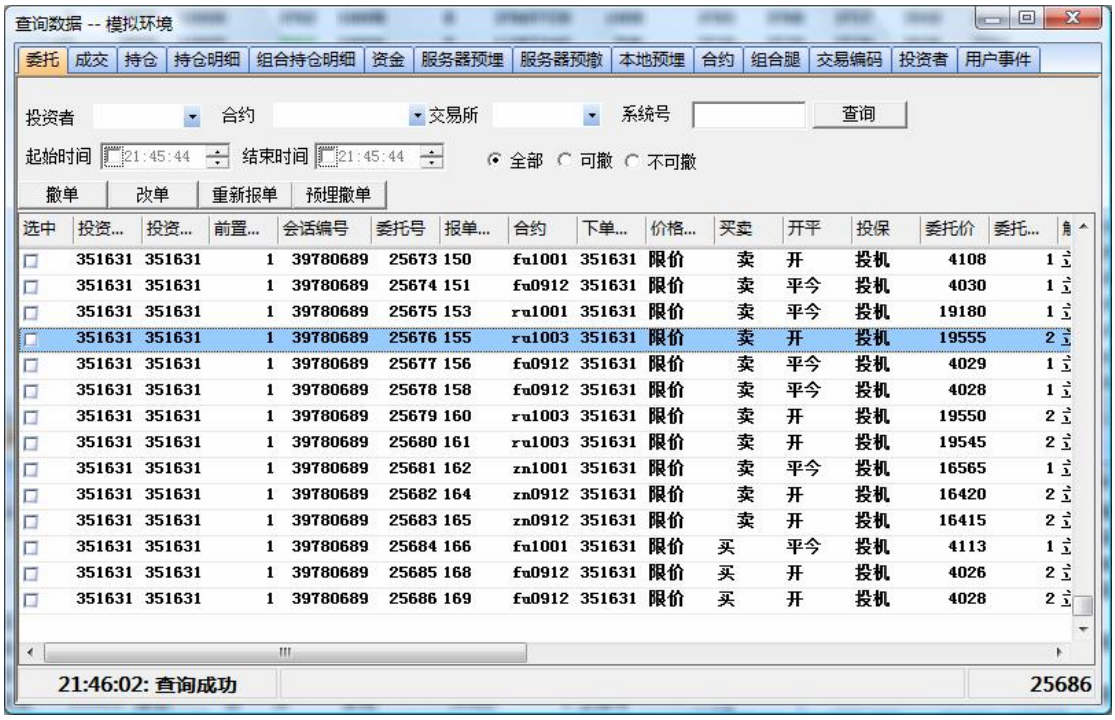
8.2.3 查询投资者



8.2.4 查询交易编码

8.3 查询交易数据

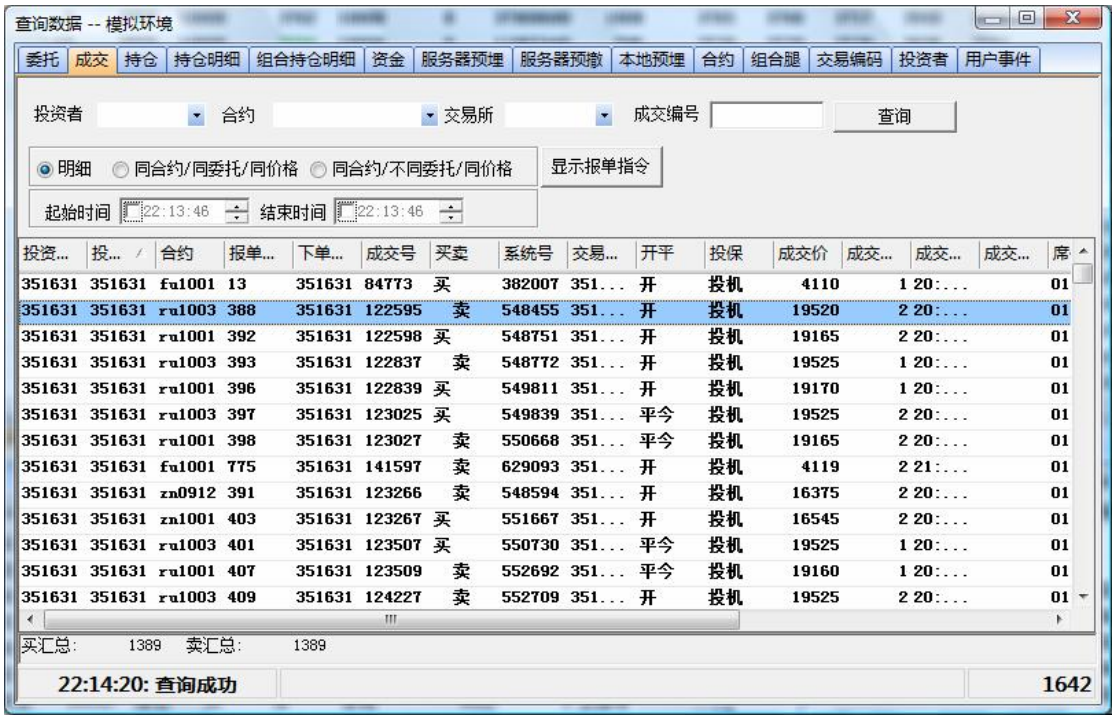
8.3.1 查询报单，过滤，撤单，预埋撤单，重新报单，改单

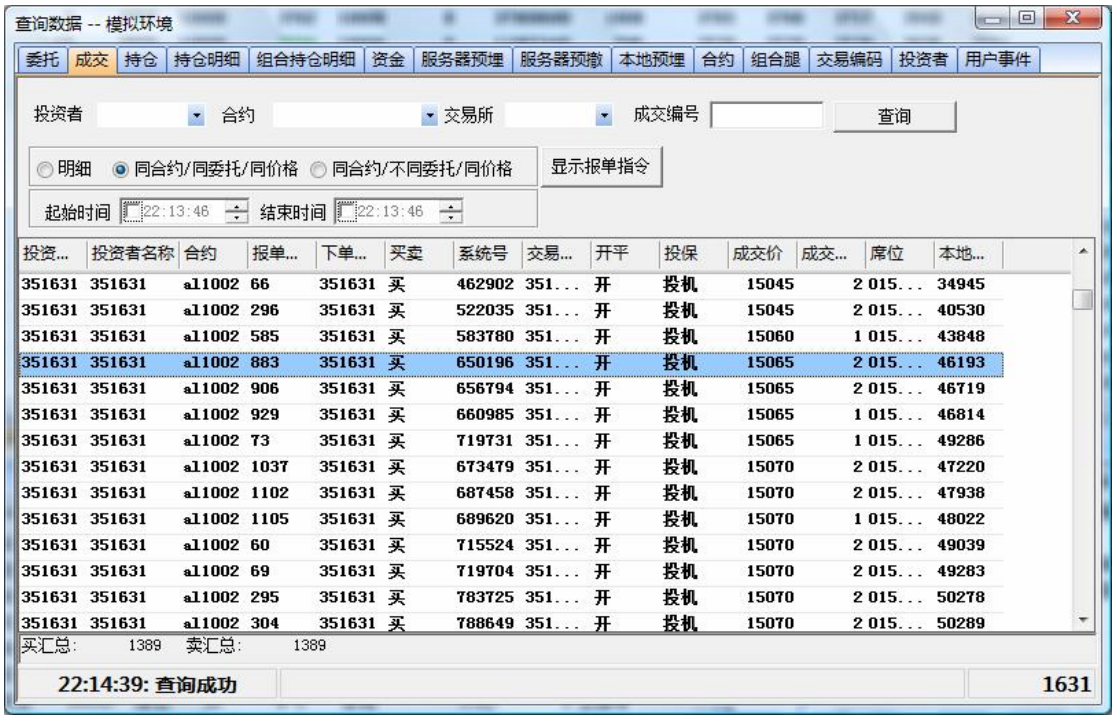


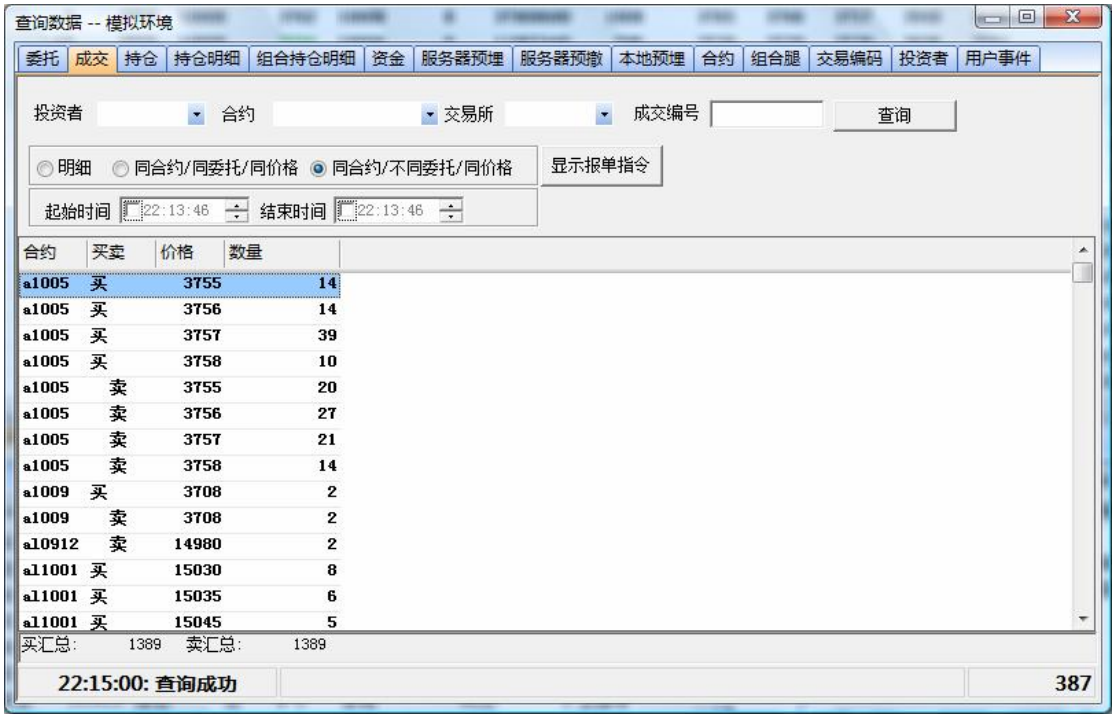
双击记录，可以发送撤单指令。其他交易指令可以从查询区域中的按钮发送，也可以从记录的右键发送。

钩选多条记录，然后点击查询区域中的按钮，可以批量地发送交易指令。

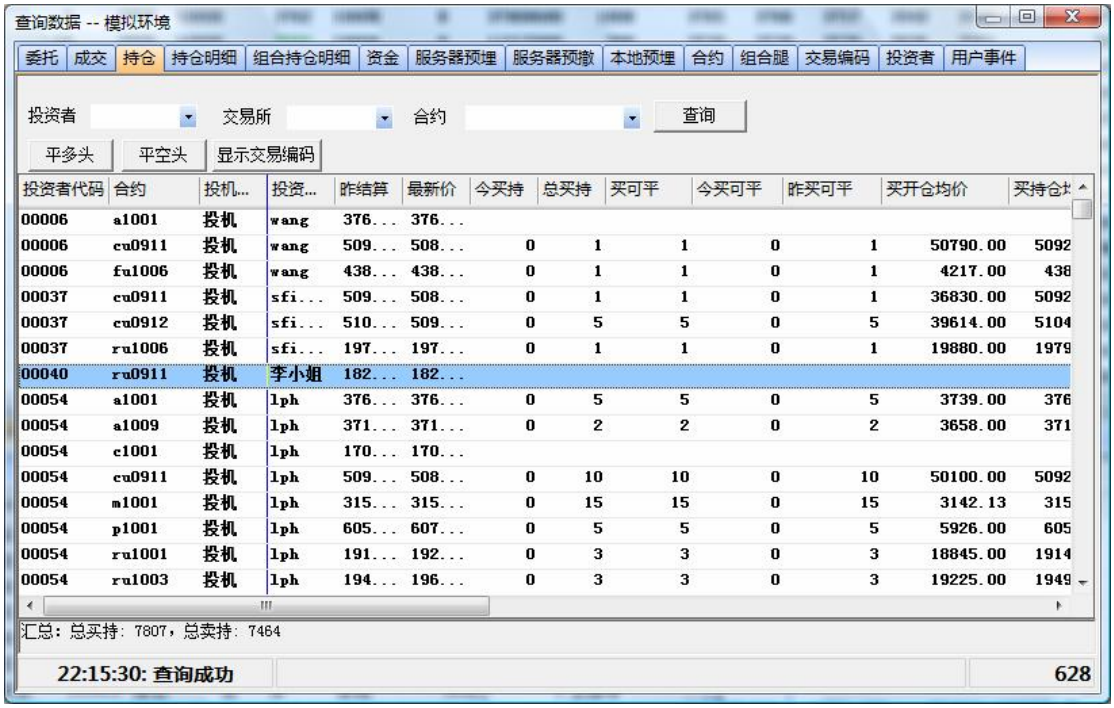
8.3.2 查询成交，分组汇总







8.3.3 查询持仓，买/卖汇总，平仓



每行持仓记录包括 3 部分：持仓描述字段：投资者、合约、投机属性。这是持仓记录的关键字。另外包括空头持仓和多头持仓。

双击不同的持仓部位，会在报单对话框里显示相关的平仓指令。也可以选中持仓记录，在查询区域中点击“平多头”或者“平空头”，发送平仓指令。

用户需要在交易选项中设置平仓方式。请参考“8.5.3 交易选项->设置报单”。

8.3.4 查询资金

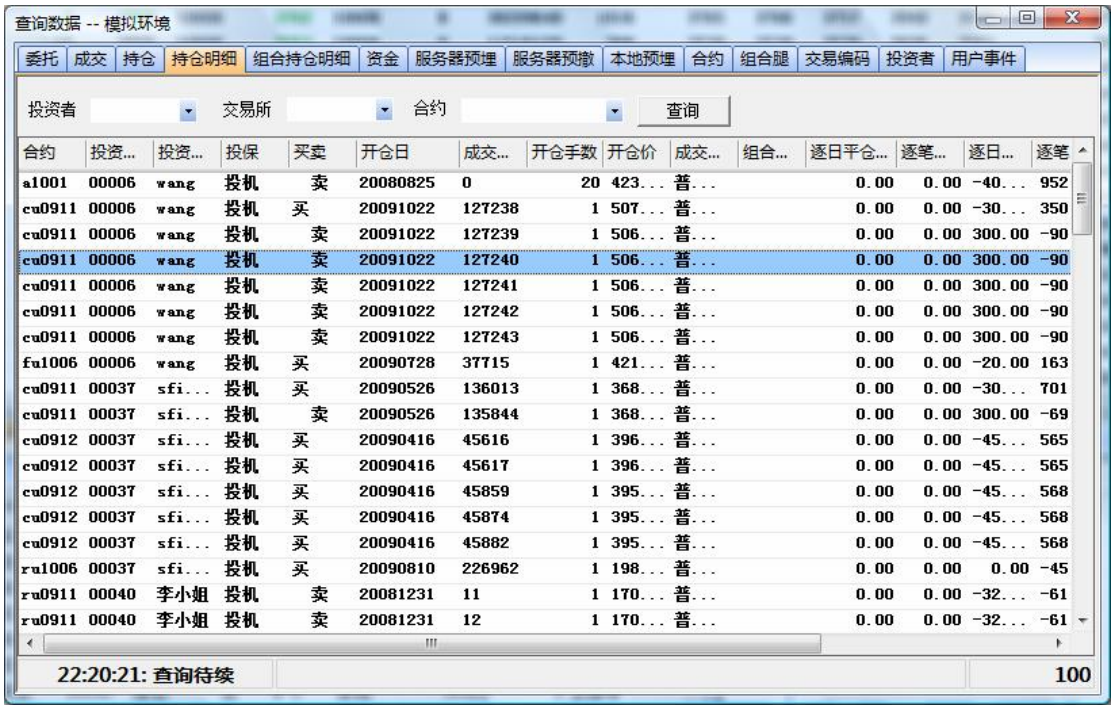
投资者帐号	投资...	风...	风险度	交易...	交易所风...	昨权益	入金	出金	冻结保...	冻结手续费	保证金
00171	sfi...	追保	139.61	正常	71.45	11960188.00	0.00	0.00	0.00	0.00	15859760.0
351542	351542	追保	127.57	正常	91.12	75844.53	0.00	0.00	0.00	0.00	98539.0
351541	351541	追保	100.57	正常	75.43	254412.93	0.00	0.00	0.00	0.00	254600.0
351561	351561	追保	100.07	正常	58.38	150760.00	0.00	0.00	0.00	0.00	153120.0
351598	351598	警示	97.70	正常	56.99	252758.00	0.00	0.00	0.00	0.00	244992.0
351560	351560	警示	96.36	正常	52.58	180042.70	0.00	0.00	0.00	0.00	171863.5
351581	351581	警示	92.17	正常	48.08	234701.28	0.00	0.00	0.00	0.00	217105.9
00088	zho...	警示	89.20	正常	70.38	42670.00	0.00	0.00	0.00	0.00	38035.5
350004	350004	警示	79.54	正常	46.40	760990.00	0.00	0.00	0.00	0.00	612480.0
00084	sfi...	警示	78.60	正常	51.06	10405776.22	0.00	0.00	0.00	0.00	8176667.6
351529	351529	警示	72.16	正常	42.57	344895.00	0.00	0.00	0.00	0.00	247792.0
351562	351562	警示	69.33	正常	40.99	174080.00	0.00	0.00	0.00	0.00	122019.0
351592	351592	警示	68.66	正常	44.11	2221279.62	0.00	0.00	0.00	0.00	1524089.6
351582	351582	警示	66.65	正常	40.76	287668.17	0.00	0.00	0.00	0.00	191136.1
00083	sfi...	警示	66.51	正常	42.72	10235349.55	0.00	0.00	0.00	0.00	6770293.2
351912	351912	警示	65.20	正常	38.04	237079.39	0.00	0.00	0.00	0.00	153120.0
351580	351580	警示	64.84	正常	45.87	280386.36	0.00	0.00	0.00	0.00	181929.4

投资者的风险度可以由用户自己配制。请参考8.5.2。

8.3.5 查询预埋单，增删改，发送

请参考6.6 本地预埋单

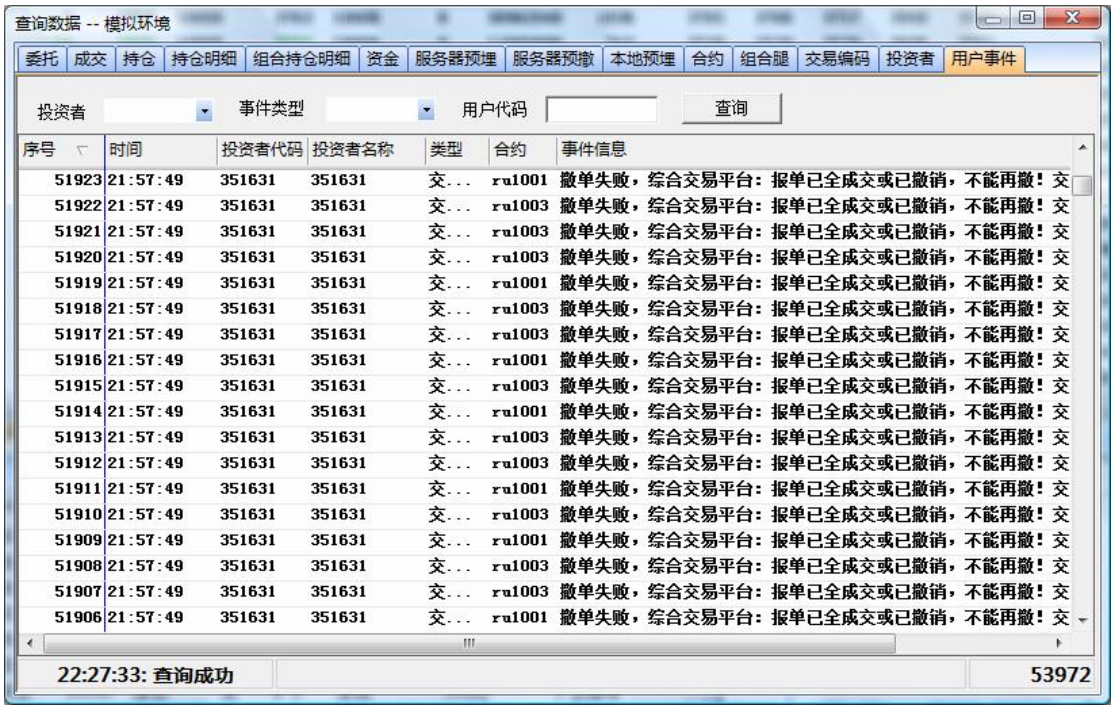
8.3.6 查询持仓明细



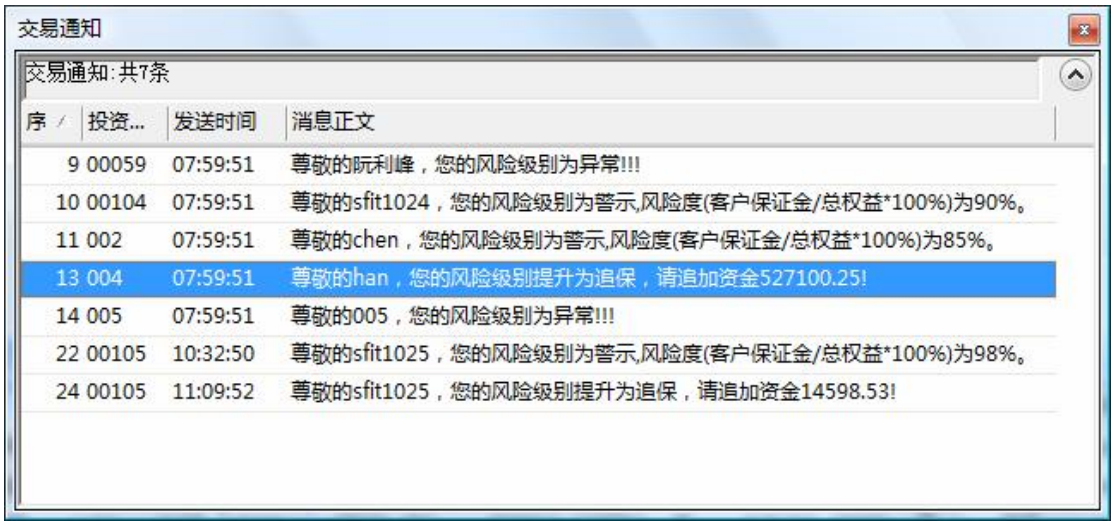
合约	投资...	投资...	投保	买卖	开仓日	成交...	开仓手数	开仓价	成交...	组合...	逐日平仓...	逐笔...	逐日...	逐笔
a1001	00006	wang	投机	卖	20080825	0	20	423...	普...		0.00	0.00	-40...	952
cu0911	00006	wang	投机	买	20091022	127238	1	507...	普...		0.00	0.00	-30...	350
cu0911	00006	wang	投机	卖	20091022	127239	1	506...	普...		0.00	0.00	300.00	-90
cu0911	00006	wang	投机	卖	20091022	127240	1	506...	普...		0.00	0.00	300.00	-90
cu0911	00006	wang	投机	卖	20091022	127241	1	506...	普...		0.00	0.00	300.00	-90
cu0911	00006	wang	投机	卖	20091022	127242	1	506...	普...		0.00	0.00	300.00	-90
cu0911	00006	wang	投机	卖	20091022	127243	1	506...	普...		0.00	0.00	300.00	-90
fu1006	00006	wang	投机	买	20090728	37715	1	421...	普...		0.00	0.00	-20.00	163
cu0911	00037	sfi...	投机	买	20090526	136013	1	368...	普...		0.00	0.00	-30...	701
cu0911	00037	sfi...	投机	卖	20090526	135844	1	368...	普...		0.00	0.00	300.00	-69
cu0912	00037	sfi...	投机	买	20090416	45616	1	396...	普...		0.00	0.00	-45...	565
cu0912	00037	sfi...	投机	买	20090416	45617	1	396...	普...		0.00	0.00	-45...	565
cu0912	00037	sfi...	投机	买	20090416	45859	1	395...	普...		0.00	0.00	-45...	568
cu0912	00037	sfi...	投机	买	20090416	45874	1	395...	普...		0.00	0.00	-45...	568
cu0912	00037	sfi...	投机	买	20090416	45882	1	395...	普...		0.00	0.00	-45...	568
ru1006	00037	sfi...	投机	买	20090810	226962	1	198...	普...		0.00	0.00	0.00	-45
ru0911	00040	李小姐	投机	卖	20081231	11	1	170...	普...		0.00	0.00	-32...	-61
ru0911	00040	李小姐	投机	卖	20081231	12	1	170...	普...		0.00	0.00	-32...	-61

8.3.7 查询组合持仓明细

8.3.8 查询用户事件



8.3.8 查询交易通知



8.4 交易操作

8.4.1 报单

报单窗口中包括了：报单、条件单、本地预埋单 3 个子窗口。

报单集成
报单
条件单
预埋单
编号 18
投资者 00376
姓名 sfit376
合约 m0912
买卖 1=买
开平 1=开
数量 2
价格 3254
涨跌 3433 / 3106
立即单
可开 2343
查询
可平 0
可平今 0
可用 7625913.89
投机
保值
强平
报单
预埋
发送报单后保持窗口

报单集成
报单
条件单
预埋单
编号 57
投资者 00376
姓名 sfit376
合约 R0003
买卖 3= 卖
开平 1=开
数量 2
价格 7872
涨跌 8332 / 7538
立即单
可开 1291
查询
可平 0
可平今 0
可用 7624248.89
投机
保值
强平
本地预埋
发送报单后保持窗口

8.4.2 撤单

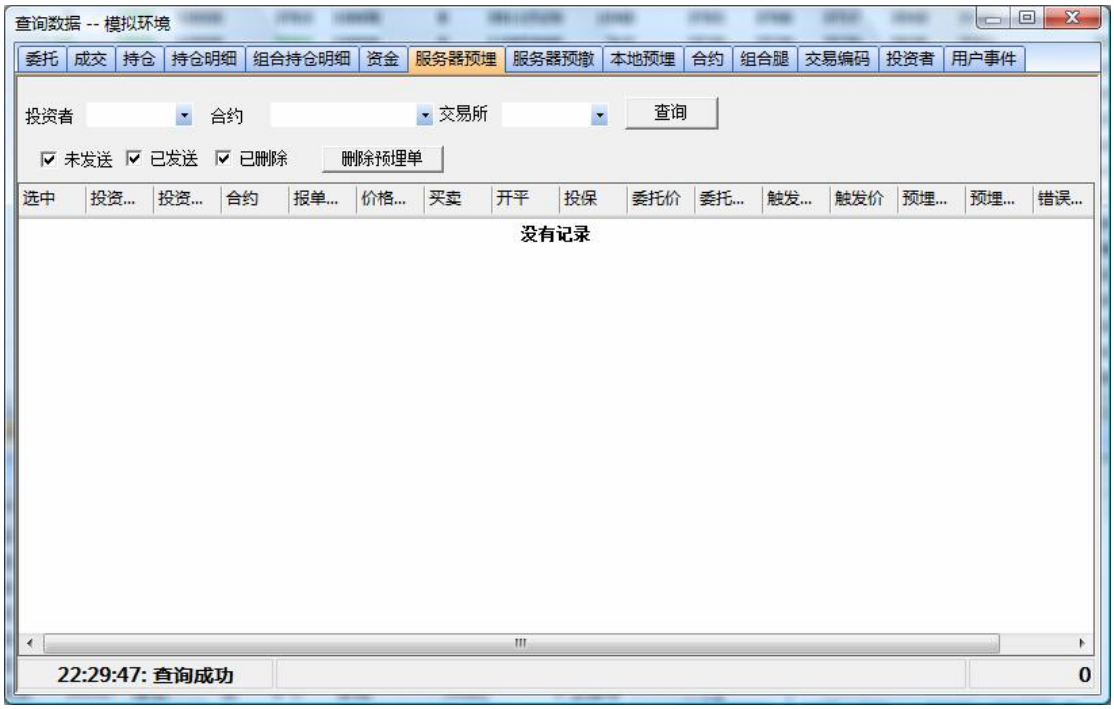
从委托回报和查询委托中触发。

请参考6.5 撤单。

8.4.3 改单

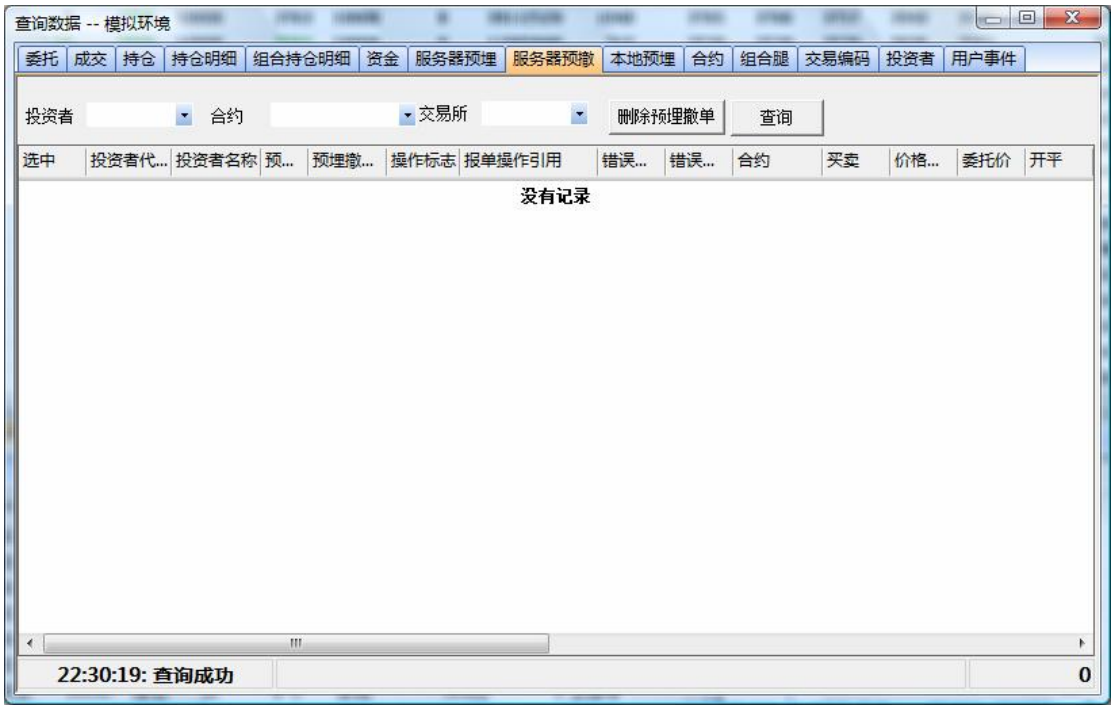
改单指令只可以从委托回报和查询委托页面触发。服务器本身不支持改单功能，需要在客户端完成改单功能。首先，客户端撤销未成交的委托记录，保存用户编辑的报单指令。如果撤单成功，客户端才发送之间报单指令。如果撤单失败，就放弃保存的报单指令。

8.4.4 查询服务器预埋单，删除操作



删除预埋单支持批量操作功能。

8.4.5 查询服务器预埋撤单，删除操作

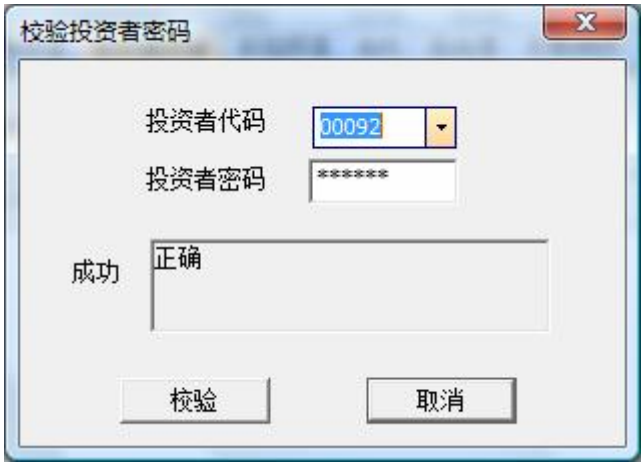


删除服务器预埋撤单也支持批量操作功能

8.4.6 本地预埋单

请参考6.6 本地预埋单。

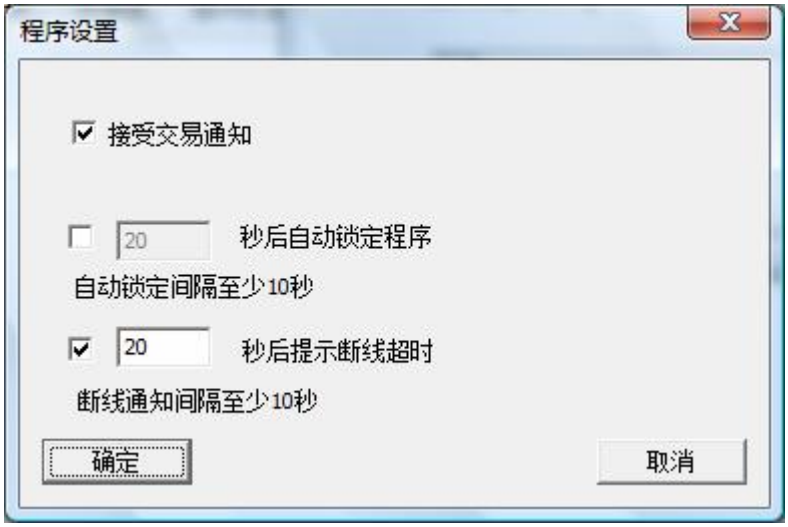
8.4.7 校验投资者密码



有些时候，交易员需要为投资者代理报单，可以使用这个功能到综合交易平台上校验投资者的密码。确认了投资者身份后才可以为他报单。

8.5 设置

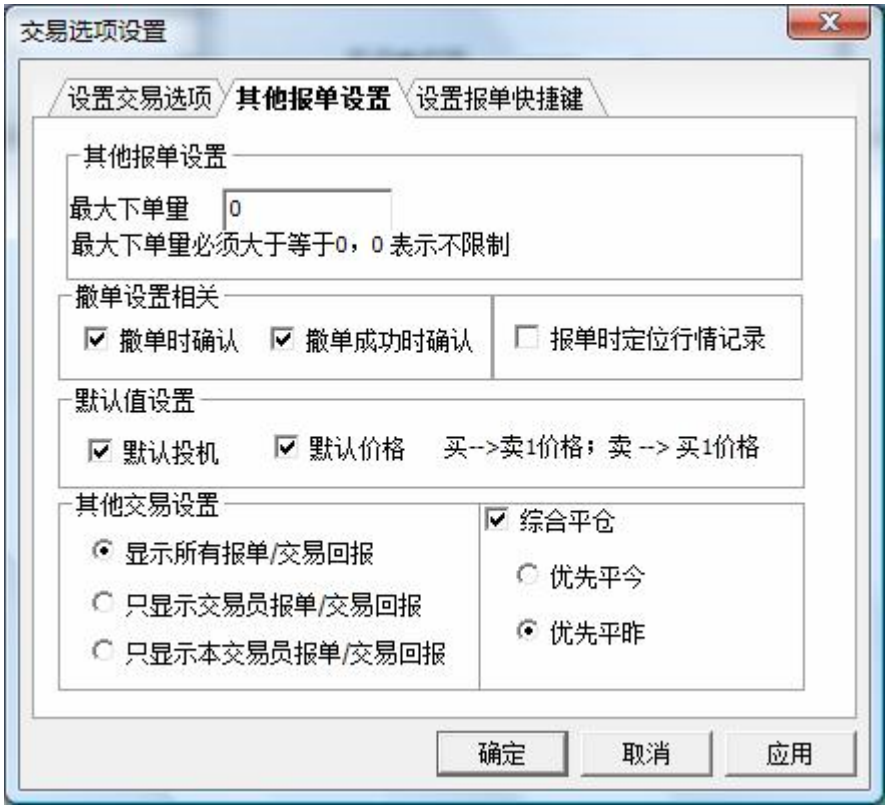
8.5.1 通用设置



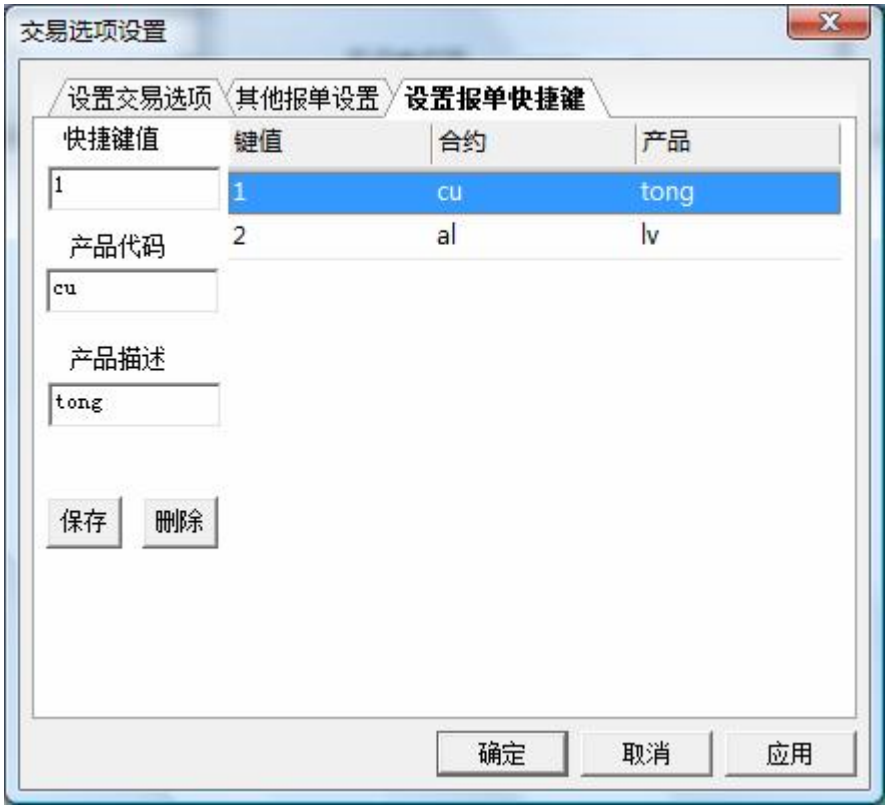
8.5.2 查询选项 à 风险控制配置

8.5.3 交易选项 à 设置报单配置项

上述页面用来配置报单对话框的外观和其中的字段属性。



上述页面用来配置其他和交易相关的选项。



上述页面用来配置合约快捷键。如快捷键“1”表示合约中“cu”这2个字符。在报单对话框中，如果用户想输入“cu1001”时，只要输入“11001”。上述操作只要在小键盘中就可以完成，加快了输入速度。

8.6 帮助

8.6.1 关于

请参考6.7 核对版本