



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

件状态:	文件标识:	CTP_交易员终端_用户操作手册
[√] 草稿	当前版本:	V6.0
[] 正式发布	作 者:	用户操作手册文档组
[] 正在修改	完成日期:	2013-04-25

上海期货信息技术有限公司
上海浦东新区浦电路 500 号 上海期货大厦 13 楼
Tel: 50128078
Fax: 50128101

修订历史记录

版本号	版本日期	修订者	修订状态	修改说明
V0.1	20110330	黄玉玲	A	建立
V0.2	20110319	某某某	M	添加业务流程说明
V6.0	20130425	廖超群	M、D	删除用户事件和撤单查询，修改最新版截图

修订状态: A - 增加 M - 修改 D - 删除

- 此文档的正式发布核准

发布版本号	批准人姓名	签字	日期
1.0			

目录

版权说明	5
注意信息	5
联系我们	5
1 用户手册说明	6
1.1 用户手册概述	6
1.2 术语和缩写	6
1.3 符号含义	6
2 交易系统综述	7
2.1 交易系统简介	7
2.2 交易员终端安装与配置	7
2.3 交易员终端功能与角色	9
2.4 交易员终端使用说明	10
3 使用系统--业务流程	12
4 使用系统--操作说明	12
4.1 系统登录与退出	12
4.1.1 系统登录	12
4.1.2 系统退出	13
4.2 修改密码	14
4.3 查询基础数据	16
4.3.1 查询合约	16
4.3.2 查询组合腿	17
4.3.3 查询投资者	18
4.3.4 查询投资者编码	19
4.3.5 查询联系人	20
4.4 查询交易数据	21
4.4.1 查询委托	21
4.4.2 查询资金	22
4.4.3 查询持仓	24
4.4.4 查询成交	25
4.4.5 查询持仓明细	27
4.4.6 查询组合持仓明细	28
4.4.7 查询公司资金	29
4.4.8 显示交易通知	30
4.5 交易操作	32
4.5.1 报单	32
4.5.2 撤单	34
4.5.3 条件单	36

4.5.4 本地预埋单.....	38
4.5.5 服务器预埋单.....	39
4.5.6 服务器预埋撤单.....	41
4.5.7 校验投资者密码.....	43
4.5.8 同步投资者动态密码.....	44
4.6 设置.....	46
4.6.1 通用设置.....	46
4.6.2 风险控制配置.....	47
4.6.3 报单配置.....	48
5 附录.....	51
5.1 综合交易平台交易角色说明	51

版权说明

版权所有,本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。根据本操作手册进行操作前,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操作手册的权利。

注意信息

- 如果您的手册不是最新的,请与上海期货信息技术有限公司金融软件开发部联系以获得最新的手册。
- 本手册的使用对象应该是有基本计算机基础知识的工作人员,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。
- 由于时间仓促,难免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

我们承诺为我们的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,我们欢迎您将想法及问题发给我们,我们将尽最大的努力在最短的时间内对您做出回应。

联系方式:

- 公司网址: <http://www.sfit.com.cn>
- 联系人:
- 电 话: (86)-21-
- 手 机: (86)-
- 传 真: (86)-21-
- 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

1 用户手册说明

1.1 用户手册概述

本手册概述了综合交易平台交易系统的整体架构，同时描述了交易员终端的各项功能及其操作过程。本章介绍手册的编写结构，包括使用到的术语和符号；第二章简要介绍系统结构、系统配置、系统角色以及交易员终端的各功能模块；第三章从业务流程的角度介绍交易员的各项功能；第四章详细说明交易员各项功能的操作流程；第五章附录，对文件接口和数据库接口采集消息的格式进行说明。

1.2 术语和缩写

缩写、术语	解 释
CTP	综合交易平台
RISK	综合交易平台风控系统，一般指风控后台
ThostUser	交易员终端的简称
风险度	资金中某字段，用于提示投资者风险状况
交易通知	从风控后台发出的，针对投资者的风险通知

1.3 符号含义

本手册使用以下符号帮助您轻松阅读：

- 1. 2. 3. 序号表示完成一个功能的多个步骤
- 箭头表示菜单、子菜单（例如，**消息管理** → **单条发送**）
- 楷体** 加粗楷体文字表示出现在界面中的文字，或是菜单名称（如，**消息管理** → **群发发送**），或是按钮名称（如，**添加按钮**），或者窗口名称（如：**修改用户窗口**）等

2 交易系统综述

2.1 交易系统简介

交易系统主要用于实时接收处理报单、成交，实时计算投资者的资金、持仓。交易员终端主要用于查询报单、成交、资金、持仓、合约等信息，提供报单、撤单、改单、预埋单、条件单等功能，根本目的就是为了支持盘中交易。

交易系统是综合交易平台结算、交易、风控三大系统之一，是综合交易平台的核心部分。交易系统与结算系统、风控系统既相互独立又相互联系。交易系统主要由交易核心、查询核心、报盘管理、报盘、初始化程序、数据库、交易前置、交易员终端等组成。日初，交易系统使用初始化程序，将数据库中的数据导入交易核心，进行初始化；完成初始化，驱动报盘登录交易所前置；盘中，交易系统将实时接收处理报单、成交，客户可使用交易员终端登录交易前置，提出报单等请求，查看报单、成交等交易信息。

交易员终端通过交易前置连接交易核心，获取实时交易信息，并将报单、撤单等请求信息实时报入交易后台核心进行后续处理。

<此处补图：交易员终端、风控后台核心、交易系统、结算系统的数据交互关系图，从业务层面概要介绍。>

图 2.1 交易系统与结算、风控系统的交互图

2.2 交易员终端安装与配置

交易员终端 ThostUser 主要运行于 Windows 平台 XP 以上版本，解压缩 ThostUser 程序包即可进行绿色安装。ThostUser 可以通过互联网、专线方式接入交易前置，进而连接交易后台核心。连接方式可以通过 ThostUser 安装目录的 ThostUser2Cfg.xml 文件进行灵活配置。

配置文件 ThostUser2Cfg.xml 文件的说明如下：

```
<!-- ThostUser2Cfg.xml 配置文件说明 --!>
<?xml version="1.0" encoding="GB2312" standalone="no"?>
<ThostUser2>
    <ConnectConfig>
        <SubTitle name="21thost2"/>
        <!--经纪公司代码--!>
        <BrokerID name="8000"/>
        <!-- 上次登录（默认）的操作员 ID --!>
        <UserID name="8000_admin"/>
        <!--默认前置组号--!>
        <DefaultGroup Index="1"/>
        <!--自动升级地址 --!>
        <Update url=""/>
        <!--登录模式，0: 非续传模式，1: 续传模式 --!>
        <LoginMode Mode="0"/>
        <!--每一个 ConnectionGroup 表示一套交易系统的前置配置组--!>
        <!--可配置多个 ConnectionGroup --!>
        <!--IsUsingUdpMd 为 0 表示使用 Tcp 行情，为 1 表示使用 Udp 行情 --!>
        <ConnectionGroup name="31" IsUsingUdpMd="0">
            <!--交易前置地址，格式为：“tcp://地址：端口”--!>
            <TradeFront Address="tcp://172.16.126.31:48205"/>
            <!--行情前置地址，格式为：“tcp://地址：端口”--!>
            <MarketFront Address="tcp://172.16.126.31:48213"/>
        </ConnectionGroup>
        <ConnectionGroup name="zbz2" IsUsingUdpMd="0">
            <TradeFront Address="tcp://172.16.126.103:19505"/>
            <MarketFront Address="tcp://172.16.126.103:19513"/>
        </ConnectionGroup>
    </ConnectConfig>
</ThostUser2>
```

交易员终端所在目录下各文件以及文件夹说明：

|__ 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、dbgHelp: 其他辅助动态链接库;
- |__ set、cfg: 程序设置所在目录;
- |__ log: 日志文件所在目录;
- |__ res、snd: 图片、声音资源所在目录;
- |__ ThxPortTpl: 数据输出模板所在目录;
- |__ cache: 缓存所在目录。

2.3 交易员终端功能与角色

交易员终端提供丰富的查询功能，可以实时查询资金、报单、成交、持仓、行情、交易编码、风险系统通知、用户事件、错单、合约等信息；提供多样报单撤单功能，支持正常普通报单、撤单、改单、服务器预埋单、服务器预埋撤单、本地预埋单、条件单等。除此之外，交易员终端还可以灵活设置交易选项设置、风控级别标准。交易员终端的角色结构如下图 2.3-1。

角色功能	功能名称	是否授权
▼ 报单系统	▶ 强制用户登出	<input type="checkbox"/>
	▶ 变更用户口令	<input type="checkbox"/>
	▶ 同步经纪公司数据	<input type="checkbox"/>
	▶ 批量同步经纪公司数据	<input type="checkbox"/>
	▶ 全部查询	<input type="checkbox"/>
	▶ 系统功能：修改密码等	<input type="checkbox"/>
	▶ 基本查询：查询基础数据，如合约，交易所等常量	<input type="checkbox"/>
	▶ 交易查询：如查成交，委托	<input type="checkbox"/>
	▶ 交易功能：报单，撤单	<input type="checkbox"/>
	▶ 银期转账	<input type="checkbox"/>
	▶ 系统监控：查询会话，踢人等。	<input type="checkbox"/>
	▶ 交易所会员资金查询权限	<input type="checkbox"/>
	▶ 同步动态密钥	<input type="checkbox"/>
	▶ 六日线性应收功能	<input type="checkbox"/>

图 2.3-1 交易员终端的角色结构

根据操作员的角色需要，期货公司用户可以方便地选择需要的权限，对交易角色进行权限设置。具体角色各权限说明，请详见附录“[5.1 综合交易平台交易角色说明](#)”。权限修改实时上场，交易角色的权限设置完毕后，再将该角色赋予需要的操作员，该操作员就可以在交易员终端执行对应的操作。

有关角色设置以及操作员赋权操作流程, 请参阅“CTP-结算柜台-用户操作手册”。

2.4 交易员终端使用说明



图 2.4-1 ThostUser主窗口

ThostUser主窗口见上图2.4-1, 显示实时数据, 包括: 行情列表, 委托回报, 成交回报。

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: 各个交易所的合约交易状态和时间, 最新的交易操作回报, 交易前置连接状态, 行情前置连接状态, 本地时间。

按照登入操作员拥有的权限, 程序显示相应的操作功能界面。

在所有列表界面的记录显示中鼠标右击, 均会弹出基本功能下拉框, 如图 2.4-2 基本功能下拉框示意图。

其中**设置字段**用于设置各表头字段是否显示、显示的顺序; **设置字体**用于设置查询结果的字体显示; **其他设置**用于设置列表表头、表格等配置; **统一设置风格**用于将本界面的设置同步到其他所有列表界面; **最佳匹配列宽**用于将各列宽度根据其内容调整, 以显示出列中完整信息。

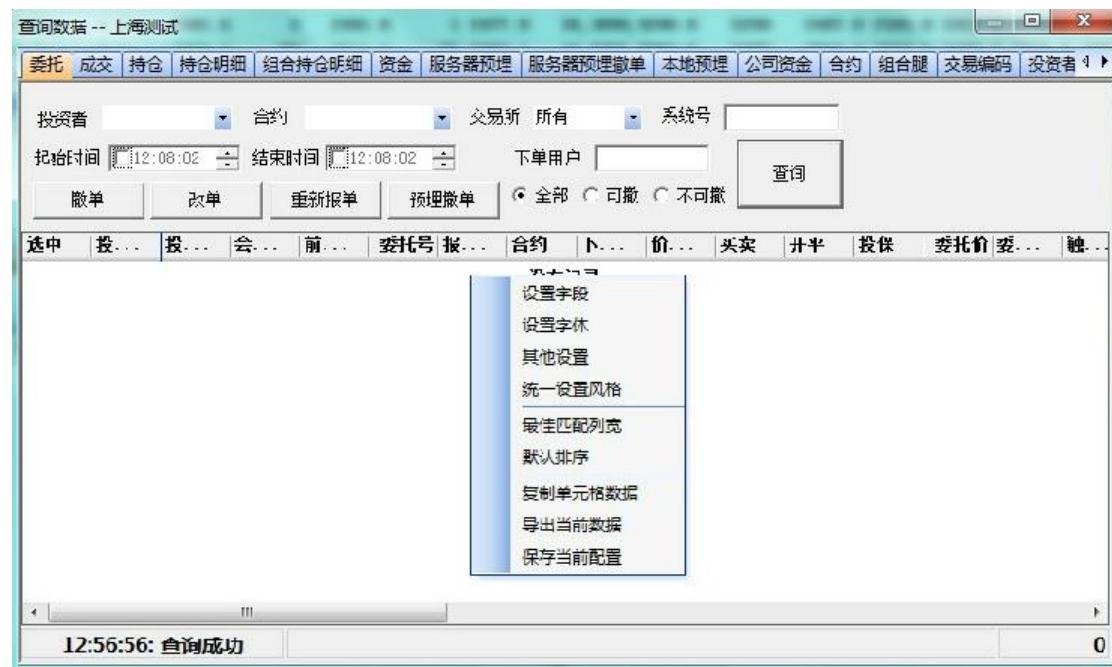


图 2.4-2 基本功能下拉框示意图

3 使用系统--业务流程

4 使用系统—操作说明

4.1 系统登录与退出

4.1.1 系统登录

ThostUser启动后，显示程序封面，包括：程序的全称和英文名称、版本号和发布时间、自动更新的执行进度。如下图4.1-1 ThostUser封面。

停留几秒钟后，程序封面会自动关闭，进入后面流程。

如果用户希望让程序封面停留更多的时间，可以用鼠标点击程序封面的任何位置，或者按下任意键。之后，再要关闭程序封面继续执行后面的流程，再点一下程序封面的任何位置，或者按下任意键。



图 4.1-1 ThostUser封面

然后，显示用户登录对话框，如下图4.1-2 ThostUser登录界面。



图 4.1-2 ThostUser 登录界面

输入操作员账号、密码，选择需要登录的服务器，点击**确定**按钮，即可登录交易员终端系统。登录过程中，程序会查询基础数据，如查询合约、投资者、委托、成交等等。完成上述初始化过程，登录对话框自动关闭进入主页面。

如果需要缓存流文件，勾选续传模式，下次进入时程序会先从缓存读入数据，再继续接收新数据。如需清除缓存，按Ctrl+Del，会弹出提示框，如下图4.1-3 清流对话框，点击**确定**按钮后，本地缓存的流即被清除。



图 4.1-3 清流对话框

4.1.2 系统退出

点击菜单栏的**系统 → 退出系统**，或者右上角的关闭按钮，如下图 4.1-4 退出按钮示意图，弹出对话框，点击**确定**按钮，如下图 4.1-5 退出对话框，即可退出系统。

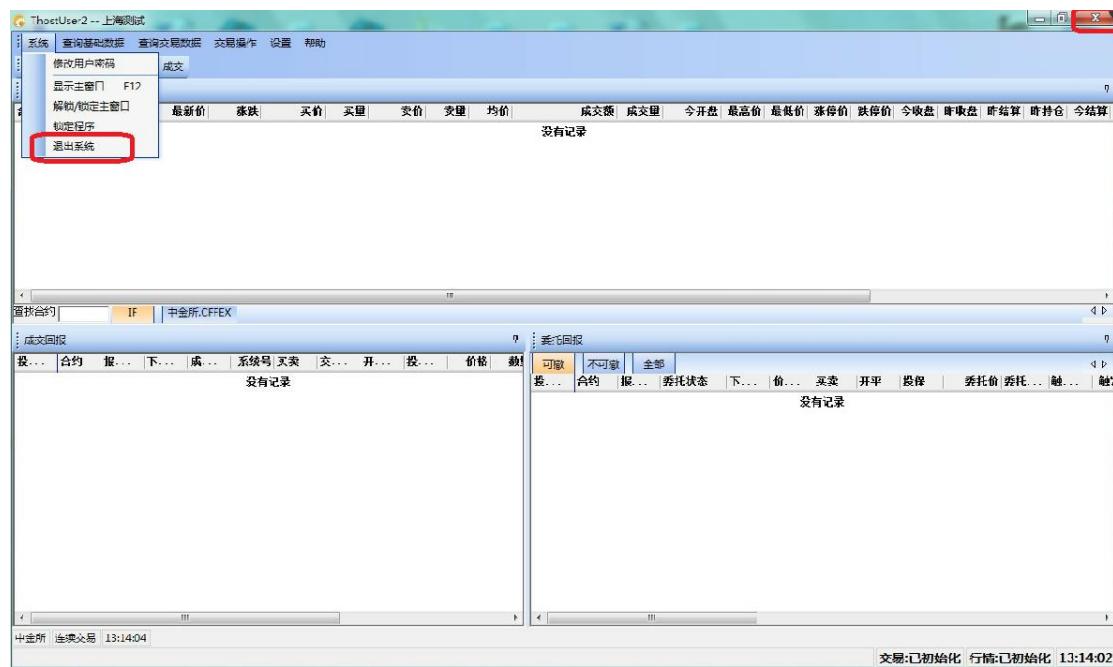


图 4.1-4 退出按钮示意图

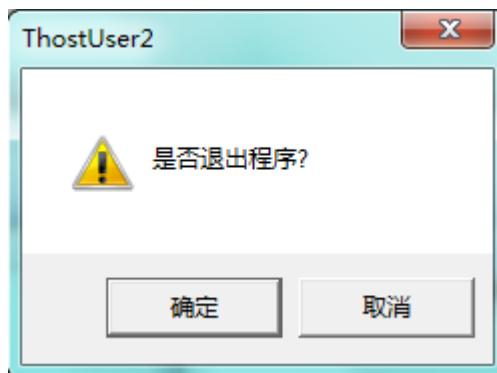


图 4.1-5 退出对话框

4.2 修改密码

点击菜单栏的系统 → 修改用户密码，如下图 4.2-1 修改密码按钮示意图。



图 4.2-1 修改密码按钮示意图

弹出密码修改对话框，如下图 4.2-2 密码修改对话框，输入原始密码、新密码、重复新密码，点击**修改**按钮，即可修改当前操作员的登录密码，密码修改结果显示在**修改**按钮上方的提示框中。

注意：输入的新密码和重复新密码必须一致；密码输入后默认为不可见字符，如果需要将密码显示为可见字符，则勾选【**显示为可见字符**】即可。

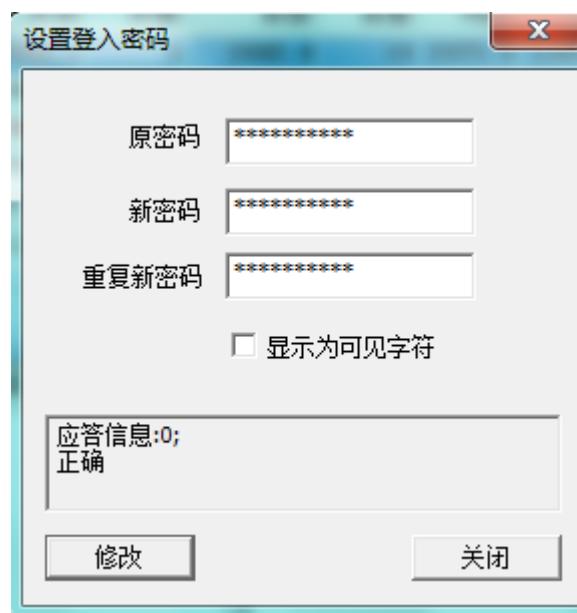


图 4.2-2 密码修改对话框

4.3 查询基础数据

交易员终端提供基础数据的查询，包括查询合约、组合合约分腿、投资者、投资者编码、联系人。

4.3.1 查询合约

点击菜单栏的**查询基础数据** → **查询合约**，如下图 4.3-1 查询合约按钮示意图，或者热键 F9。



图 4.3-1 查询合约按钮示意图

弹出合约查询界面，如下图 4.3-2 合约查询。查询条件有合约名称、产品、交易所，为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件，点击**查询**按钮即可查询出结果。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。



图 4.3-2 合约查询

4.3.2 查询组合腿

点击菜单栏的查询基础数据 → 查询组合腿, 如下图 4.3-3 查询组合腿按钮示意图。



图 4.3-3 查询组合腿按钮示意图

弹出组合腿查询界面, 如下图 4.3-4 组合腿查询。查询条件有组合合约、合约, 为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件, 点击查询按钮即可查询出结果。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

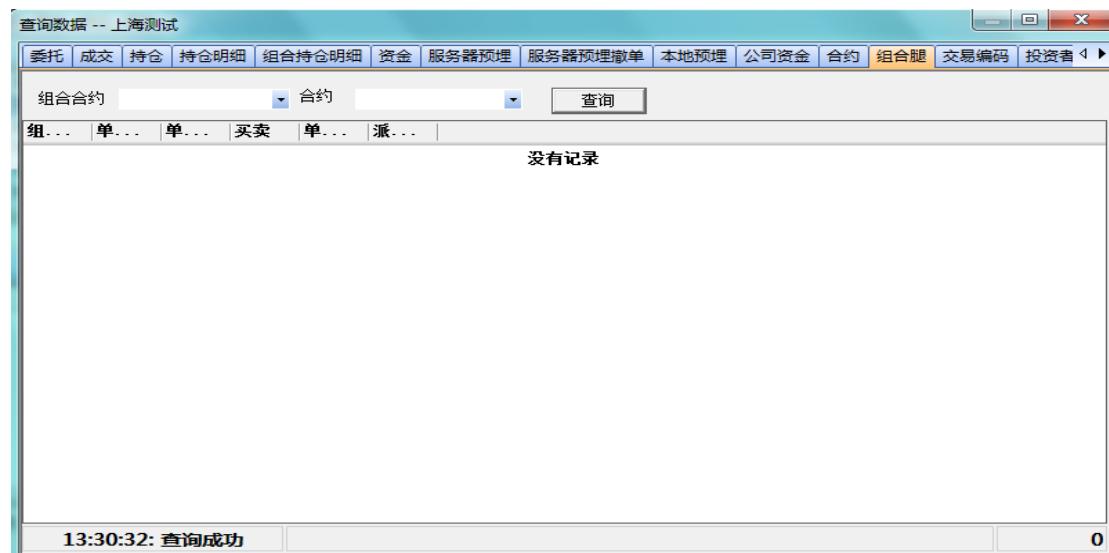


图 4.3-4 组合腿查询

4.3.3 查询投资者

点击菜单栏的**查询基础数据** → **查询投资者**, 如下图 4.3-5 查询投资者按钮示意图, 或者热键 F2。



图 4.3-5 查询投资者按钮示意图

弹出投资者查询界面, 如下图 4.3-6 投资者查询。查询条件有投资者、投资者名称, 为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件, 点击**查询**按钮即可查询出结果。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

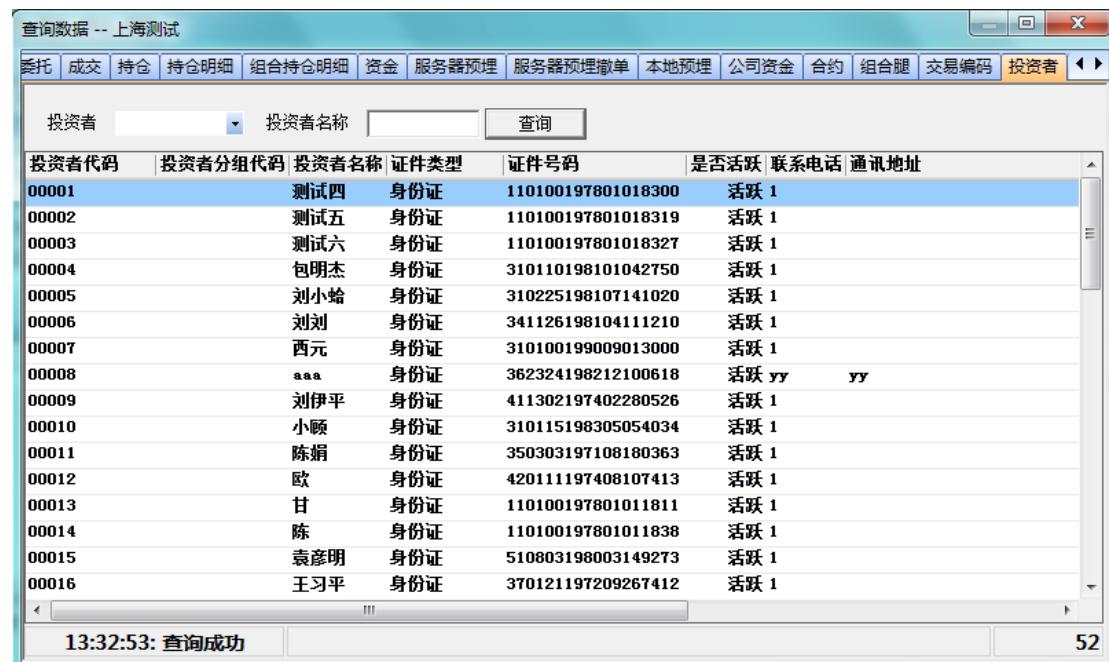


图 4.3-6 投资者查询

4.3.4 查询投资者编码

点击菜单栏的查询基础数据 → 查询投资者编码，如下图 4.3-7 查询投资者编码按钮示意图，或者热键 F11。

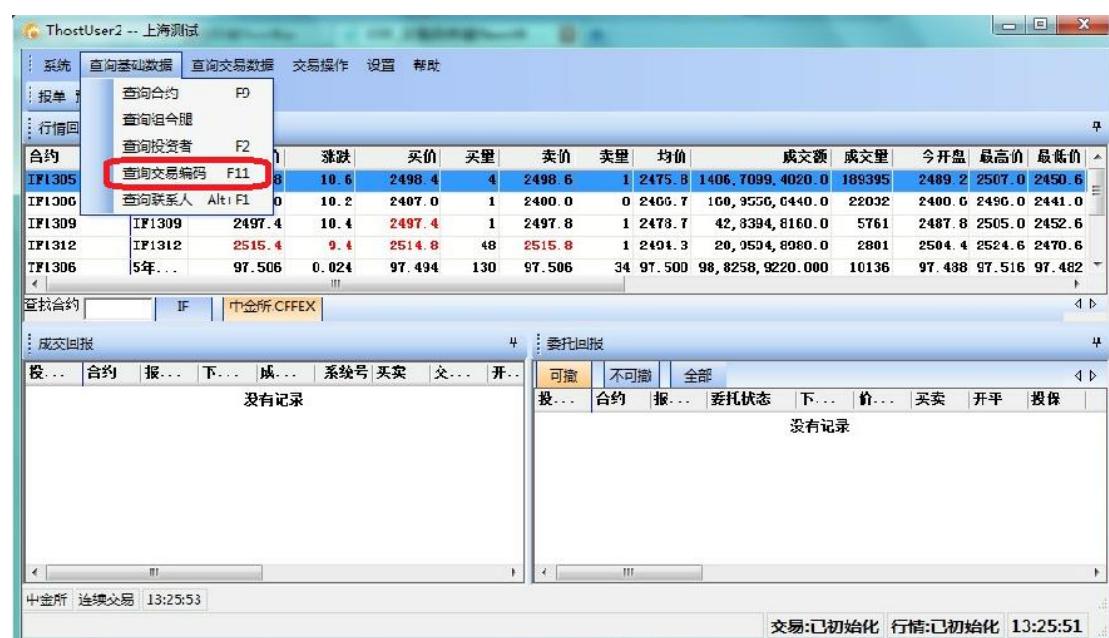


图 4.3-7 查询投资者编码按钮示意图

弹出投资者交易编码查询界面，如下图 4.3-8 交易编码查询。查询条件有投资者、交易所、交易编码、类型，为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件，点击查询按钮即

可查询出结果。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

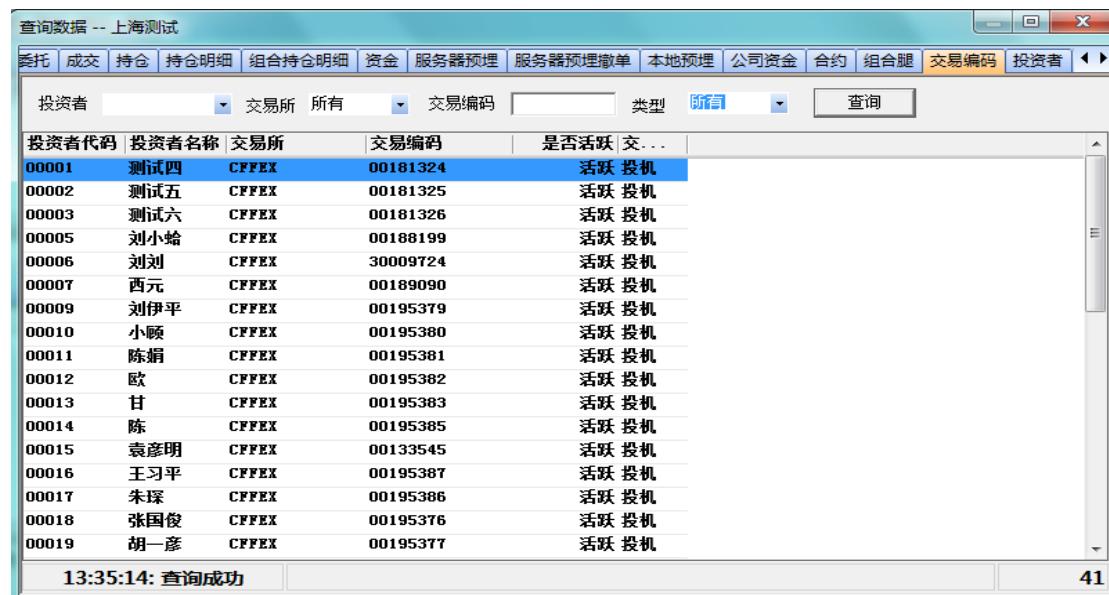


图 4.3-8 交易编码查询

4.3.5 查询联系人

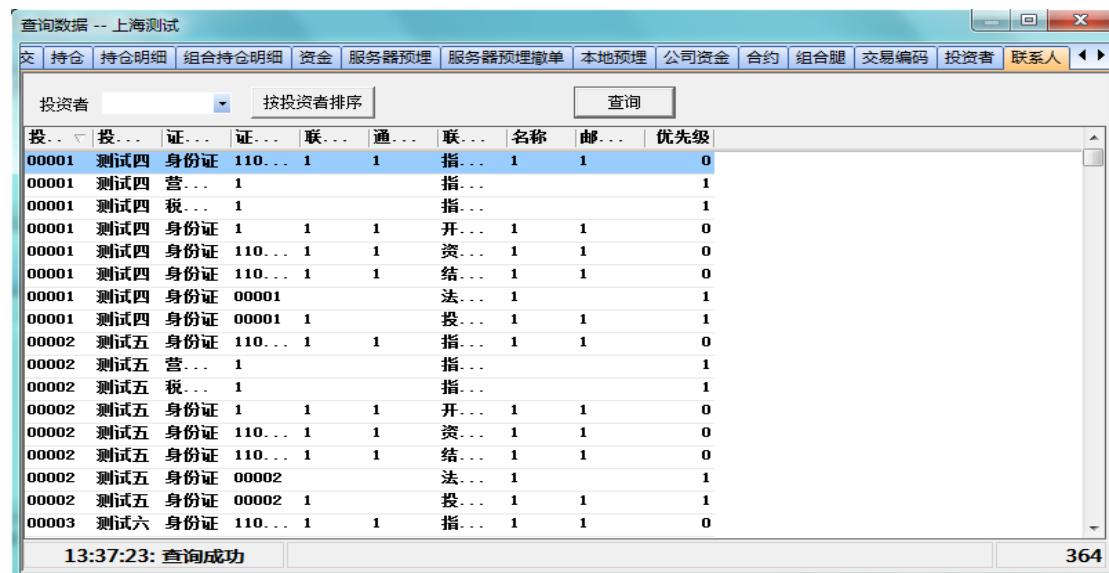
点击菜单栏的查询基础数据 → 查询联系人，如下图 4.3-9 查询联系人按钮示意图，或者热键 Alt+F1。



图 4.3-9 查询联系人按钮示意图

弹出投资者联系人查询界面，如下图 4.3-10 联系人查询。查询条件有投资者，为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件，点击查询按钮即可查询出结果。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。如需对查询结果按照

投资者代码从小到大排序，点击按投资者排序按钮。



The screenshot shows a software interface titled 'Investor Inquiry -- Shanghai Test'. The main area displays a grid of investor information. The columns include: 投... (Investor ID), 投... (Investor Name), 证... (Identity Card), 证... (Card Type), 联... (Phone), 通... (Address), 联... (Email), 名称 (Name), 邮... (Postcode), and 优先级 (Priority). The data is sorted by Investor ID. A message at the bottom left says '13:37:23: Query successful' and the bottom right shows the number '364'.

投...	投...	证...	证...	联...	通...	联...	名称	邮...	优先级
00001	测试四	身份证	110...	1	1	指...	1	1	0
00001	测试四	营...	1			指...			1
00001	测试四	税...	1			指...			1
00001	测试四	身份证	1	1	1	开...	1	1	0
00001	测试四	身份证	110...	1	1	资...	1	1	0
00001	测试四	身份证	110...	1	1	结...	1	1	0
00001	测试四	身份证	00001			法...	1		1
00001	测试四	身份证	00001	1		投...	1	1	1
00002	测试五	身份证	110...	1	1	指...	1	1	0
00002	测试五	营...	1			指...			1
00002	测试五	税...	1			指...			1
00002	测试五	身份证	1	1	1	开...	1	1	0
00002	测试五	身份证	110...	1	1	资...	1	1	0
00002	测试五	身份证	110...	1	1	结...	1	1	0
00002	测试五	身份证	00002			法...	1		1
00002	测试五	身份证	00002	1		投...	1	1	1
00003	测试六	身份证	110...	1	1	指...	1	1	0

图 4.3-10 联系人查询

4.4 查询交易数据

4.4.1 查询委托

点击菜单栏的查询交易数据 → 查询委托，如下图 4.4-1 查询委托按钮示意图，或者热键 F4。

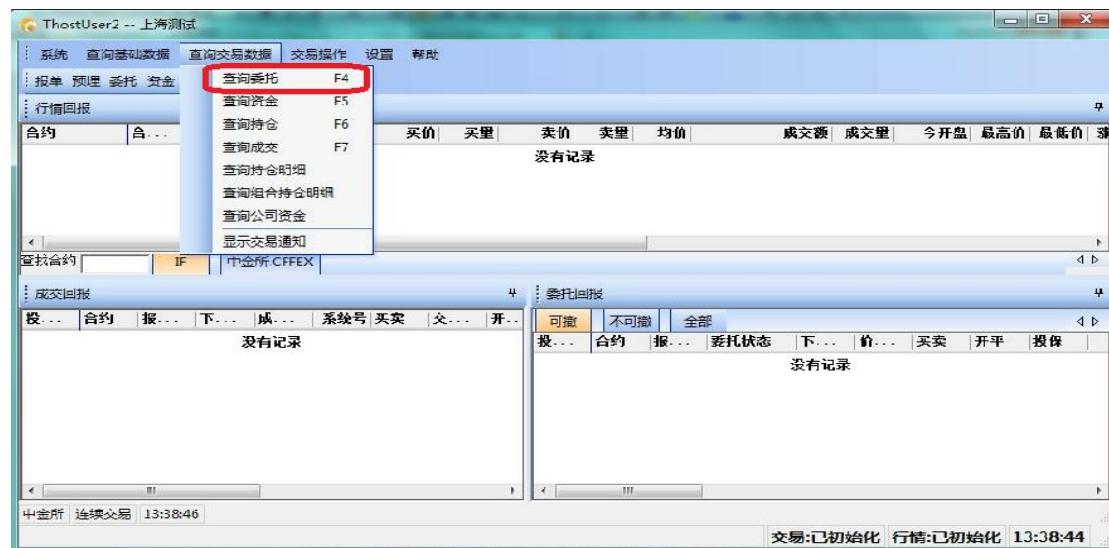


图 4.4-1 查询委托按钮示意图

弹出委托查询界面，如下图 4.4-2 委托查询。查询条件有投资者、合约、交易所、系统号、报单时间段（起始时间、结束时间）、下单用户、报单状态（全部、可撤、不可撤），为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件，点击查询按钮即可查询出结果。如需使用

报单时间段查询条件，用户可以先勾选起始时间、结束时间后面的勾选框，再修改后面的时间，如不勾选，则表示查询时过滤该时间。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

本界面提供撤单、改单、重新报单、预埋撤单功能；勾选记录前的**选中**框，点击对应查询区域中的按钮，即可发送相应功能的交易指令，支持多选；双击记录，可以发送撤单指令。

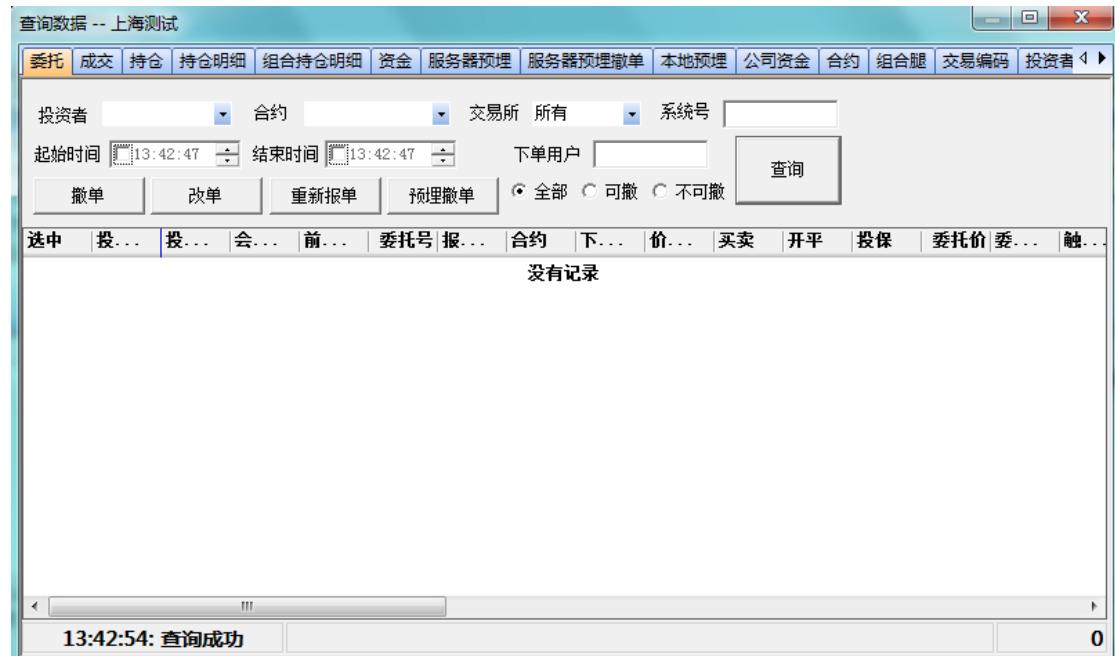


图 4.4-2 委托查询

4.4.2 查询资金

点击菜单栏的**查询交易数据 → 查询资金**，如下图 4.4-3 查询资金账户按钮示意图，或者热键 F5。

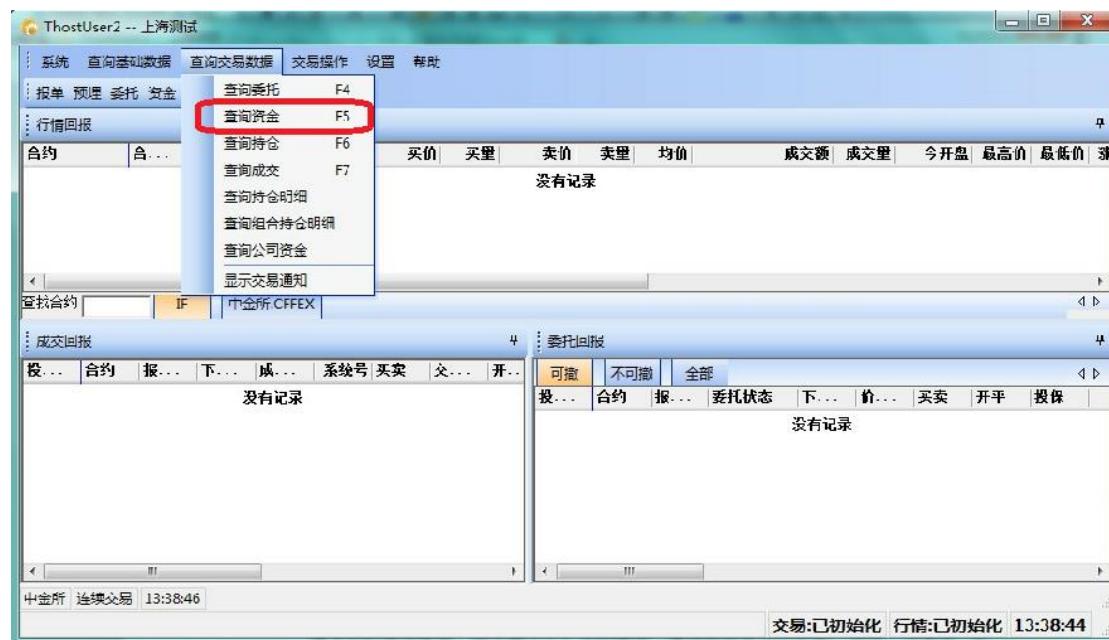


图 4.4-3 查询资金按钮示意图

弹出资金查询界面，如下图 4.4-4 资金查询。查询条件有投资者、风险状态（穿仓、强平、追保、警示、正常、异常），为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件，点击查询按钮即可查询出结果。最后一行为各资金项的汇总数据，左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。风险度可由客户自行设置，具体设置方法详见[设置](#)

查询数据 -- 上海测试															
委托 成交 持仓 持仓明细 组合持仓明细 资金 服务器预埋 服务器预埋撤单 本地预埋 公司资金 合约 组合腿 交易编码 投资者															
投资者		风险排序													
投...	投...	风...	风险度	交...	交...	昨权益	入金	出金	冻...	冻...	保证金	手续费	平...	持...	
00001	测试四	追保	100...	正常	4.947	999...	0.00	0.00	0.00	0.00	1,0...	0.00	0.00	-1,...	95
00002	测试五	正常	0.000	正常	0.000	631...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	63
00003	测试六	正常	0.643	正常	0.585	254...	0.00	0.00	0.00	0.00	16,...	0.00	0.00	306...	25
00004	包明杰	正常	0.000	正常	0.000	100...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100
00005	刘小蛤	正常	0.000	正常	0.000	148...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	148
00006	刘刘	正常	0.000	正常	0.000	905...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	905
00007	西元	正常	0.000	正常	0.000	985...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	985
00008	aaa	正常	0.000	正常	0.000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
00009	刘伊平	正常	0.000	正常	0.000	896...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	896
00010	小顾	正常	0.000	正常	0.000	822...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	822
00011	陈娟	正常	0.000	正常	0.000	100...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	100
00012	欧	异常			-17...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-17
00013	甘	正常	0.000	正常	0.000	196...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	196
00014	陈	正常	0.000	正常	0.000	116...	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	116
1,7... 0.00 0.00 0.00 0.00 1,0... 0.00 0.00 -88... 1...															
13:45:53: 查询成功															
52															

图 4.4-4 资金查询

4.4.3 查询持仓

点击菜单栏的查询交易数据 → 查询持仓, 如下图 4.4-5 查询投资者持仓按钮示意图, 或者热键 F6。

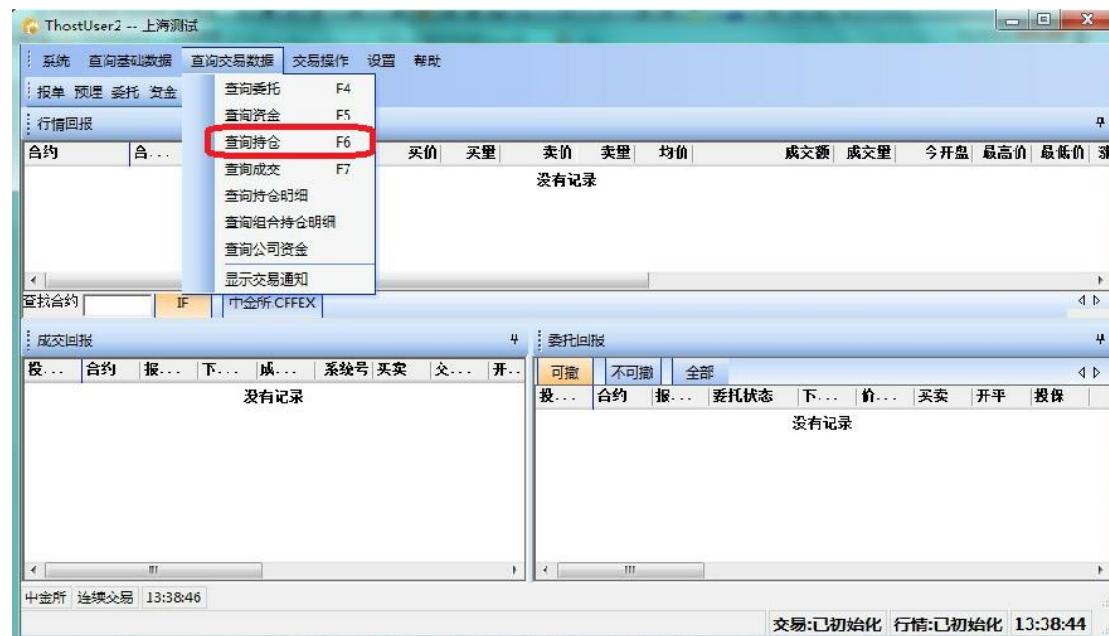


图 4.4-5 查询持仓按钮示意图

弹出投资者持仓查询界面, 如下图 4.4-6 投资者持仓查询。查询条件有投资者、交易所、合约, 为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件, 点击查询按钮即可查询出结果。最后一行为各持仓、资金项的汇总数据, 左下方的状态栏会显示当前查询的情况, 以及持仓量汇总。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

查询数据 -- 上海测试																						
投资者		交易所		合约		查询																
平多头		平空头		显示交易编码																		
投资者...	合约	投...	投...	昨结算	最新价	总买持	今买持	买可平	今买可平	昨买可平	买冻结	买开仓均										
00001	IF1306	投机	测试四	2477.8	2479.8																	
00001	TF1306	投机	测试四	97.482	97.504	100	0	100	0	100	0.00	97.43										
00001	TF1309	投机	测试四	97.418	97.436	4	0	4	0	4	0.00	97.21										
00003	IF1306	投机	测试六	2477.8	2479.8	1	0	1	0	1	0.00	2523										
														105	0	105	0	105	0.00			
汇总: 单一买仓=105, 单一卖仓=141, 组合买仓=0, 组合卖仓=0																						
13:49:01: 查询成功														4								

图 4.4-6 投资者持仓查询

4.4.4 查询成交

点击菜单栏的**查询交易数据 → 查询成交**, 如下图 4.4-7 查询成交按钮示意图, 或者热键 F7。

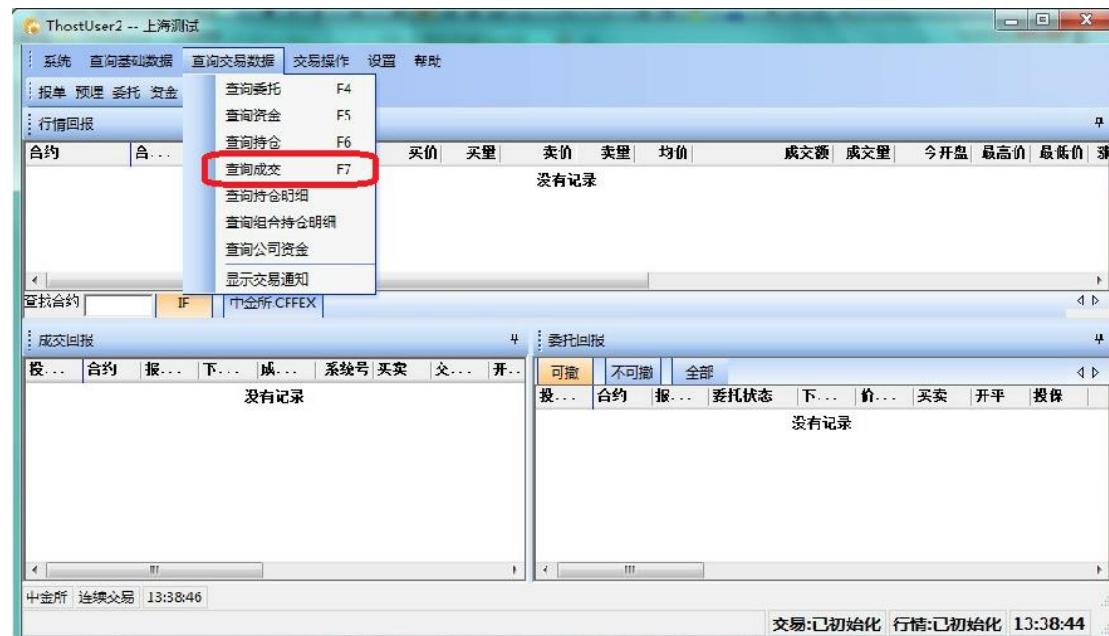


图 4.4-7 查询成交按钮示意图

弹出投资者成交查询界面, 如下图 4.4-8 成交查询。查询条件有投资者、合约、交易所、成交编号、成交时间段（起始时间、结束时间）、下单用户, 为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件, 点击查询按钮即可查询出结果。如需使用报单时间段查询条件, 用户可以先勾选起始时间、结束时间后面的勾选框, 再修改后面的时间, 如不勾选, 则表示查询时过滤该时间。左下方的状态栏会显示当前查询的情况, 以及成交量汇总。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

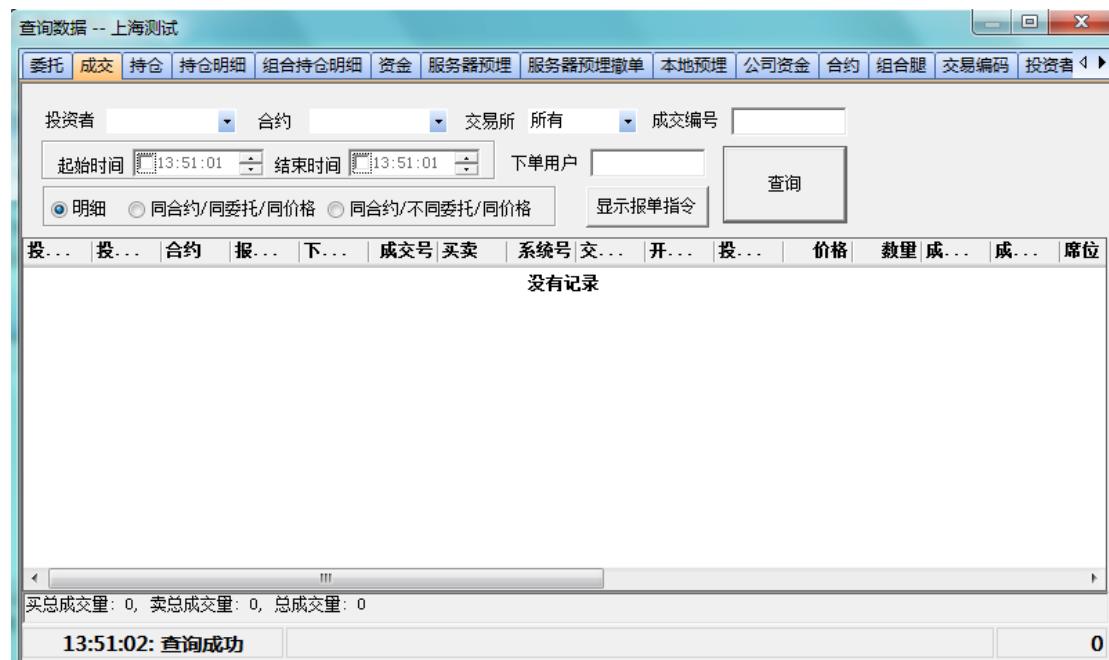


图 4.4-8 成交查询

双击不同的持仓部位，会弹出平仓报单对话框，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**按钮，弹出平仓报单对话框，输入价格等报单信息，发送平仓指令。如下图 4.4-9 平仓报单框。

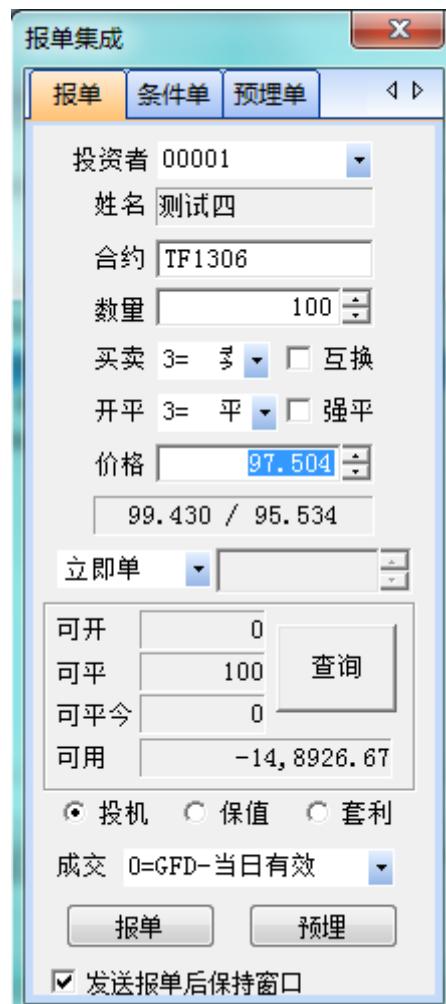


图 4.4-9 平仓报单框

4.4.5 查询持仓明细

点击菜单栏的查询交易数据 → 查询持仓明细，如下图 4.4-10 查询持仓明细按钮示意
图。

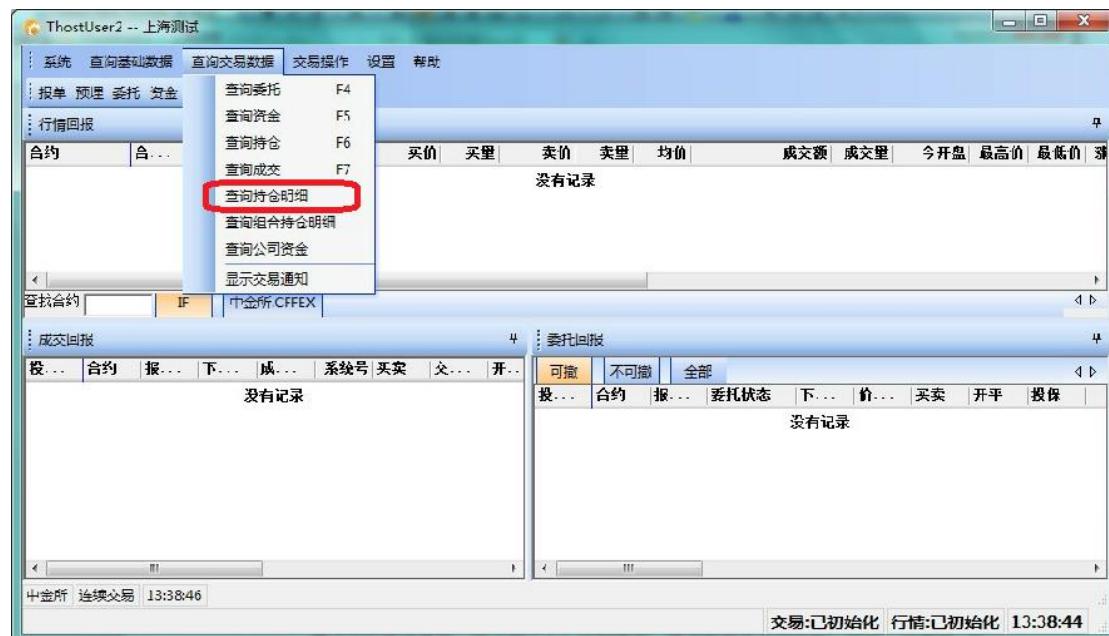


图 4.4-10 查询持仓明细按钮示意图

弹出持仓明细查询界面, 如下图 4.4-11 持仓明细查询。查询条件有投资者、交易所、合约, 为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件, 点击查询按钮即可查询出结果。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

持仓数据 -- 上海测试																		
投资者		交易所		所有		合约		查询										
合约	投...	投...	投保	买卖	开仓日	成...	开仓...	开仓价	成...	组...	逐日平...	逐...	逐...	逐...	逐...	逐...	逐...	
IF1306 00001	测试四	投机	卖	20130423	174595	1	244...	普...			0.00	0.00	0.00	-9				
TF1309 00001	测试四	投机	买	20130417	4	4	97.30	普通成交			7600.00	2,0...	0.00	46				
TF1306 00001	测试四	投机	卖	20130423	188166	7	97.43	普...			0.00	0.00	0.00	-3				
TF1306 00001	测试四	投机	卖	20130423	188165	20	97.43	普...			0.00	0.00	0.00	-1				
TF1306 00001	测试四	投机	卖	20130423	188164	13	97.43	普...			0.00	0.00	0.00	-6				
TF1306 00001	测试四	投机	卖	20130423	187066	97	97.43	普...			0.00	0.00	0.00	-4				
TF1306 00001	测试四	投机	卖	20130423	187033	3	97.43	普...			0.00	0.00	0.00	-1				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	207205	16	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	70				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	207062	1	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	44				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	207044	1	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	44				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	207019	1	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	44				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	206935	3	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	13				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	206933	3	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	13				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	188734	3	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	13				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	188715	6	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	26				
TF1306 00001	测试四	投机	买	20130423	188585	5	97.44	普...			0.00	0.00	0.00	22				

图 4.4-11 持仓明细查询

4.4.6 查询组合持仓明细

点击菜单栏的查询交易数据 → 查询组合持仓明细, 如下图 4.4-12 查询组合持仓明细按钮示意图。

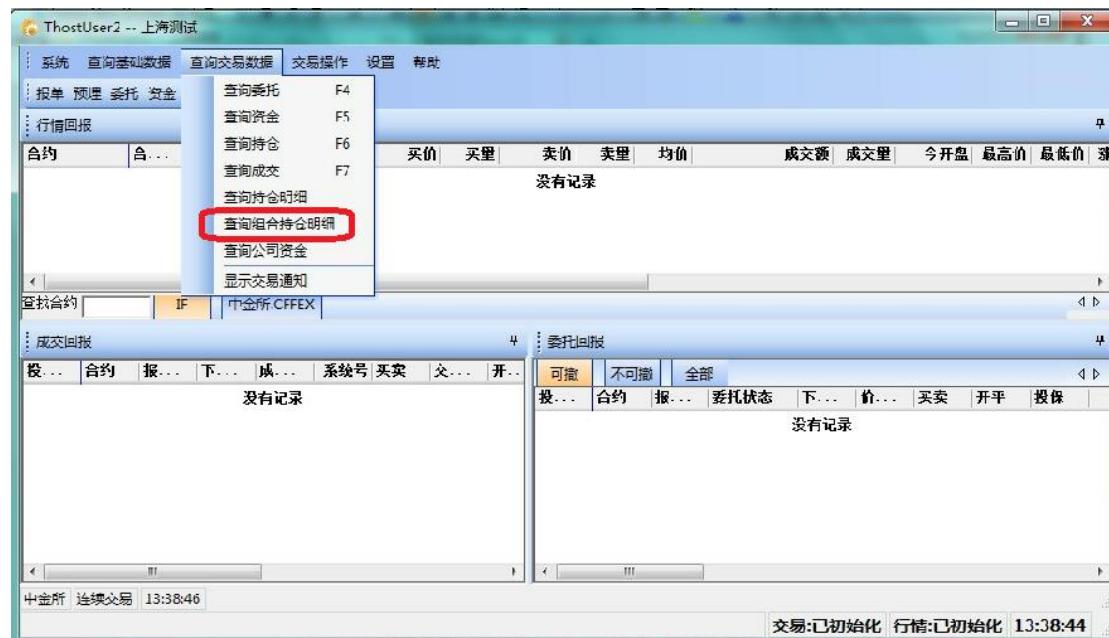


图 4.4-12 查询组合持仓明细按钮示意图

弹出组合持仓明细查询界面，如下图 4.4-13 投资者组合持仓明细查询。查询条件有投资者、交易所、组合合约，为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件，点击查询按钮即可查询出结果。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

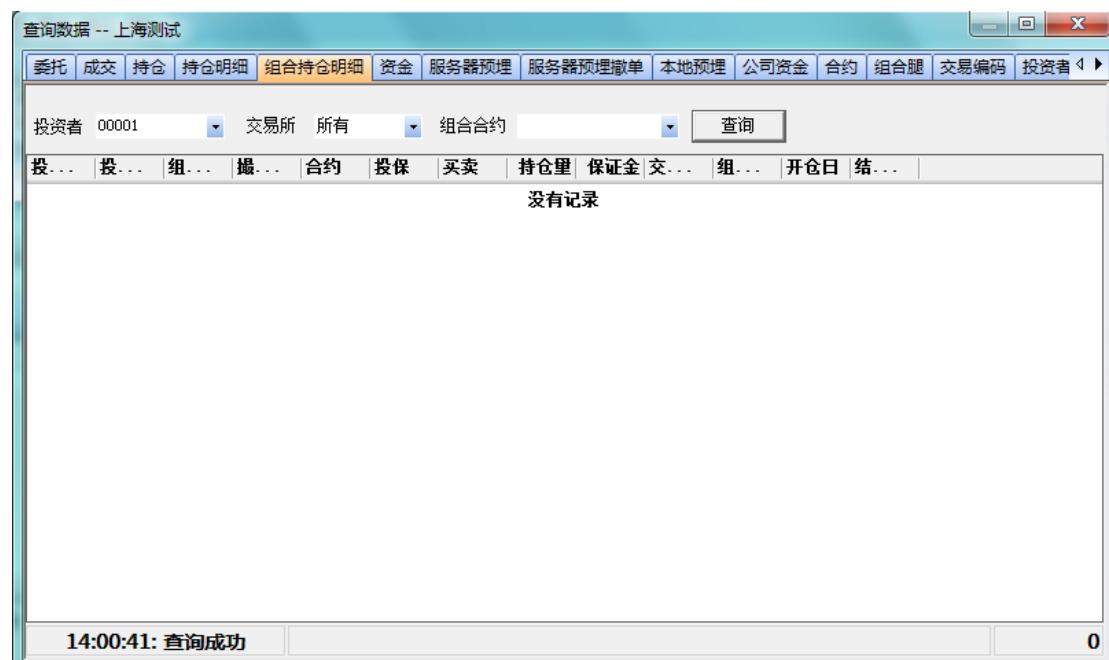


图 4.4-13 组合持仓明细查询

4.4.7 查询公司资金

点击菜单栏的**查询交易数据 → 查询公司资金**，如下图 4.4-14 查询公司资金按钮示意
© 上海期货信息技术有限公司，2009

图。

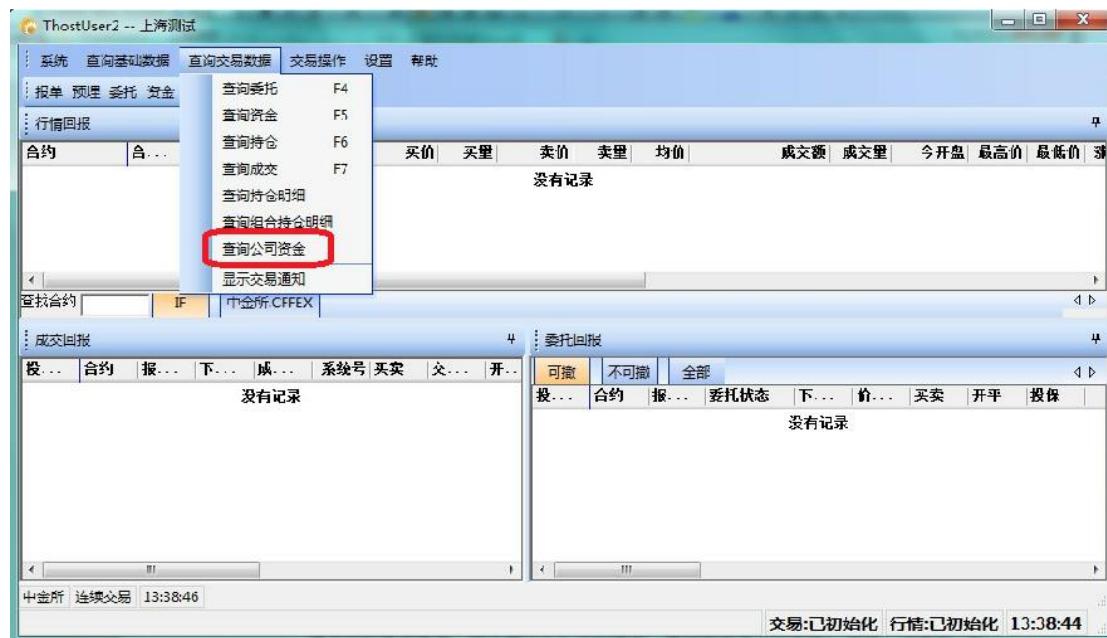


图 4.4-14 查询公司资金按钮示意图

弹出用户事件查询界面，如下图 4.4-15 公司资金查询。查询条件有交易所，为空表示查询所有。选择或者输入需要查询的条件，点击查询按钮即可查询出结果。左下方的状态栏会显示当前查询的情况。右下方的状态栏会显示查询结果的记录数。

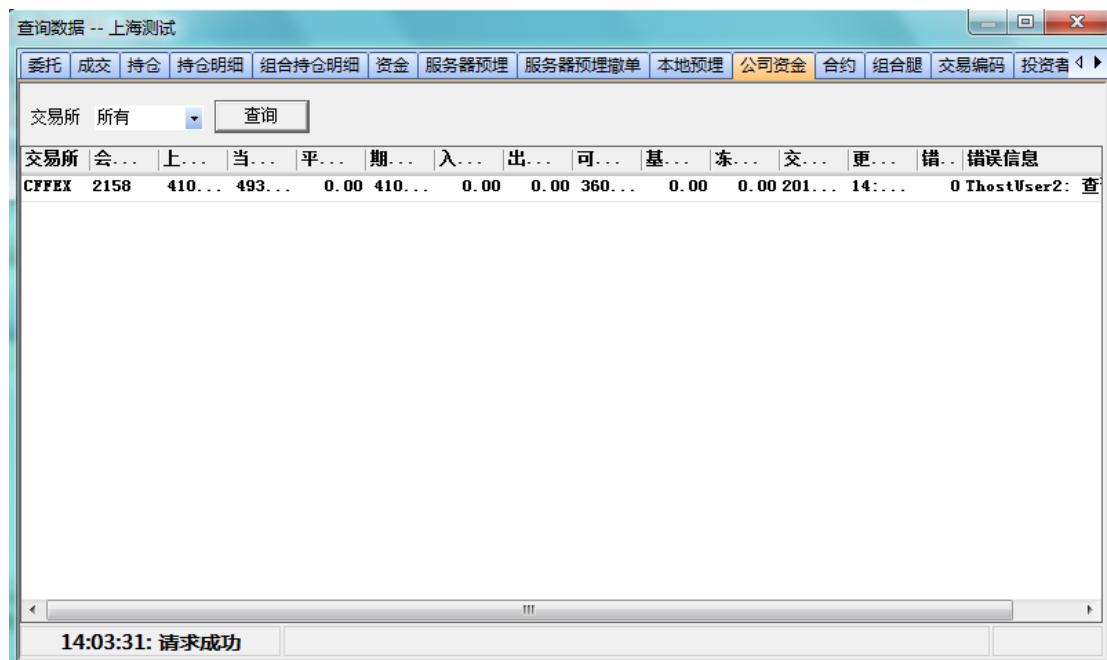


图 4.4-15 公司资金查询

4.4.8 显示交易通知

点击菜单栏的**查询交易数据 → 显示交易通知**，如下图 4.4-16 显示交易通知按钮示意
© 上海期货信息技术有限公司，2009

图。

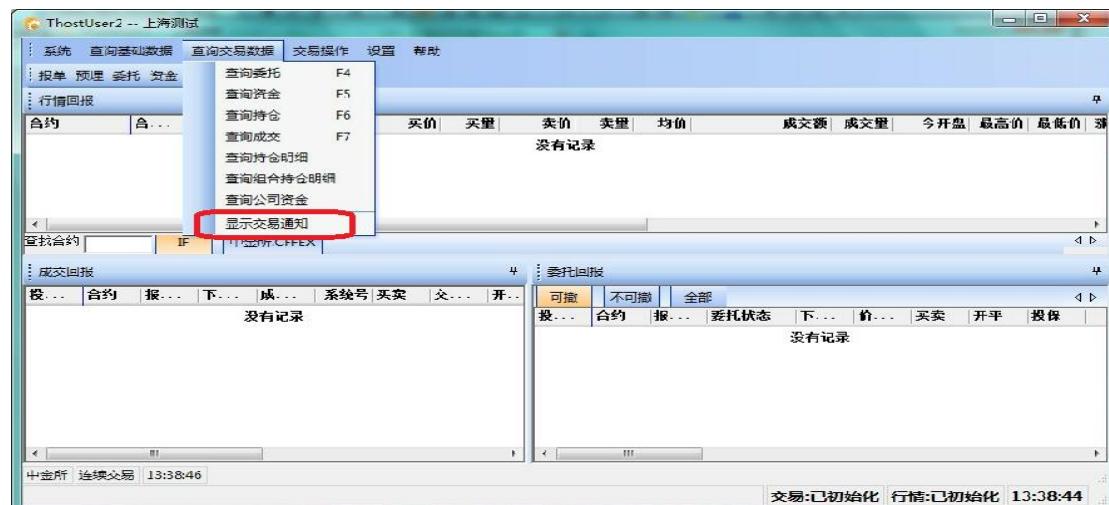


图 4.4-16 显示交易通知按钮示意图

弹出交易通知显示界面, 如下图 4.4-17 交易通知显示。只能查看, 不能查询。此交易通知为从风控系统发送的风控系统通知。

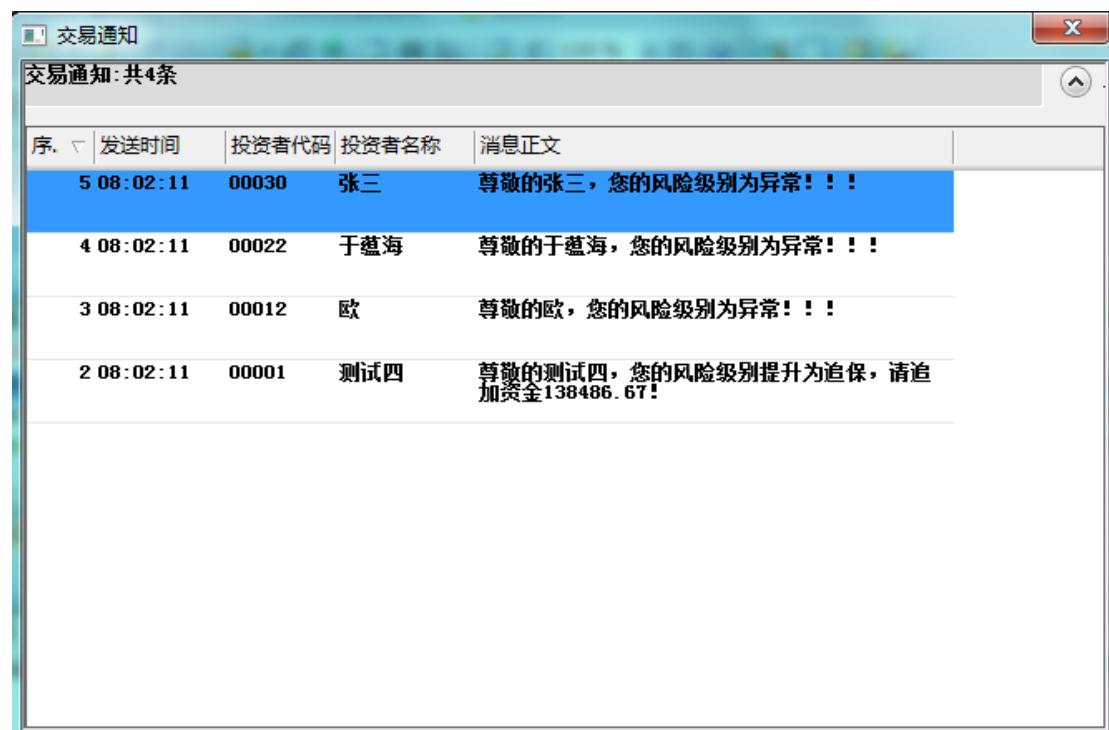


图 4.4-17 交易通知显示

4.5 交易操作

4.5.1 报单

报单界面如下图 4.5-1 报单界面。输入需要的数值后点击**报单**按钮，即可将报入指定的报单。其中**查询**按钮，用于根据输入的投资者、合约、价格、开平，查询可用资金，并计算当前的可开手数、可平手数、可平今手数。

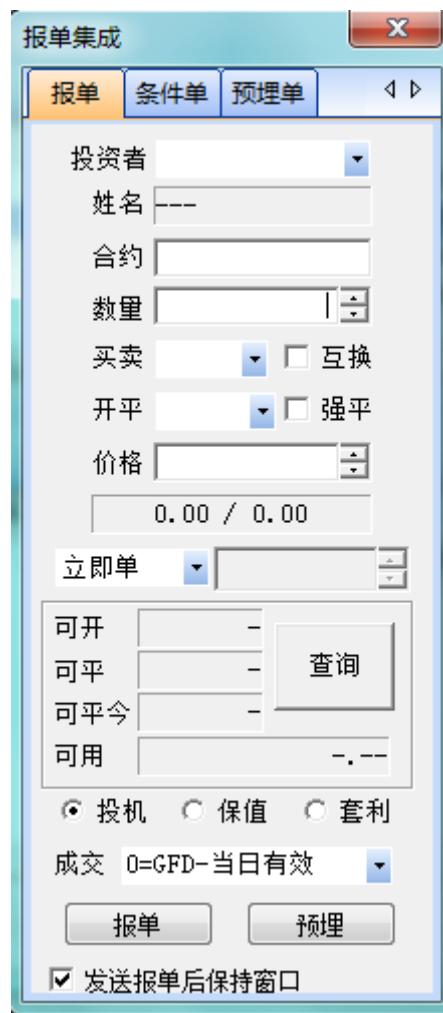


图 4.5-1 报单界面

用户可以通过以下 4 种方法，调出报单界面：

1. ThostUser 客户端左上角的**报单**按钮，如下图 4.5-2 报单按钮示意图 1；



图 4.5-2 报单按钮示意图1

2. 点击菜单栏的**交易操作** → **报单**, 如下图 4.5-3 报单按钮示意图 2;

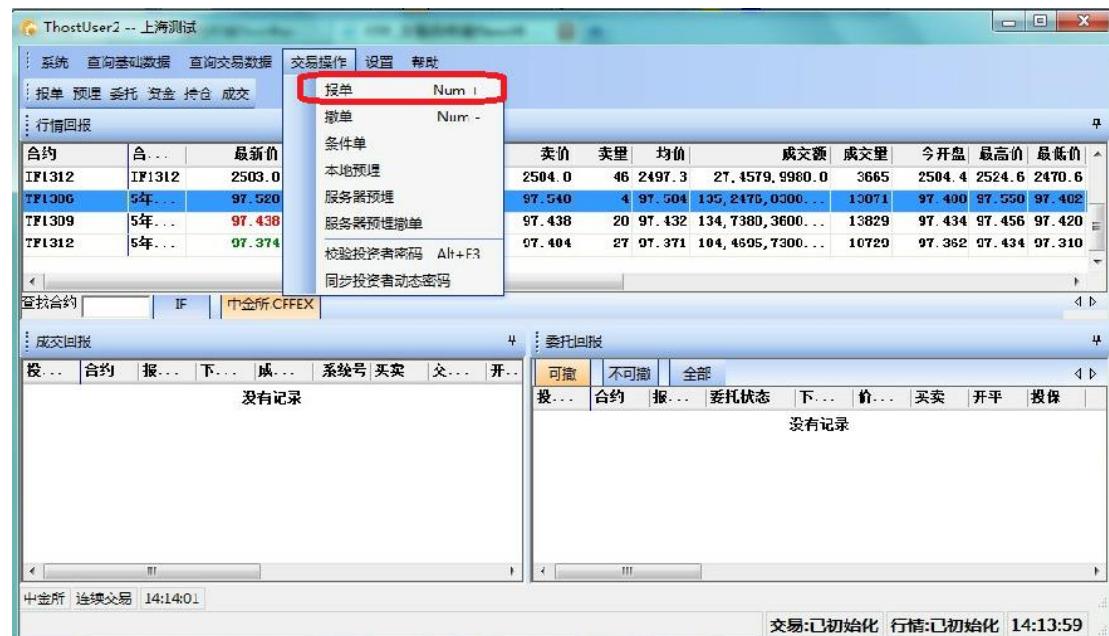


图 4.5-3 报单按钮示意图2

3. 双击主界面中的行情列表中某合约记录;
4. 双击持仓查询界面中的持仓列表中某持仓记录;

4.5.2 撤单

使用撤单功能前, 先需要设置撤单确认相关配置, 点击菜单栏的**设置 → 报单配置**, 如下图 4.5-4 撤单配置按钮示意图, 弹出设置界面, 再点击**其他报单设置** Lable 键, 如下图 4.5-5 撤单配置界面, 通过勾选设置撤单前是否确认, 以及撤单成功后是否确认, 设置完后点击**应用**或者**确定**按钮即可。



图 4.5-4 撤单配置按钮示意图

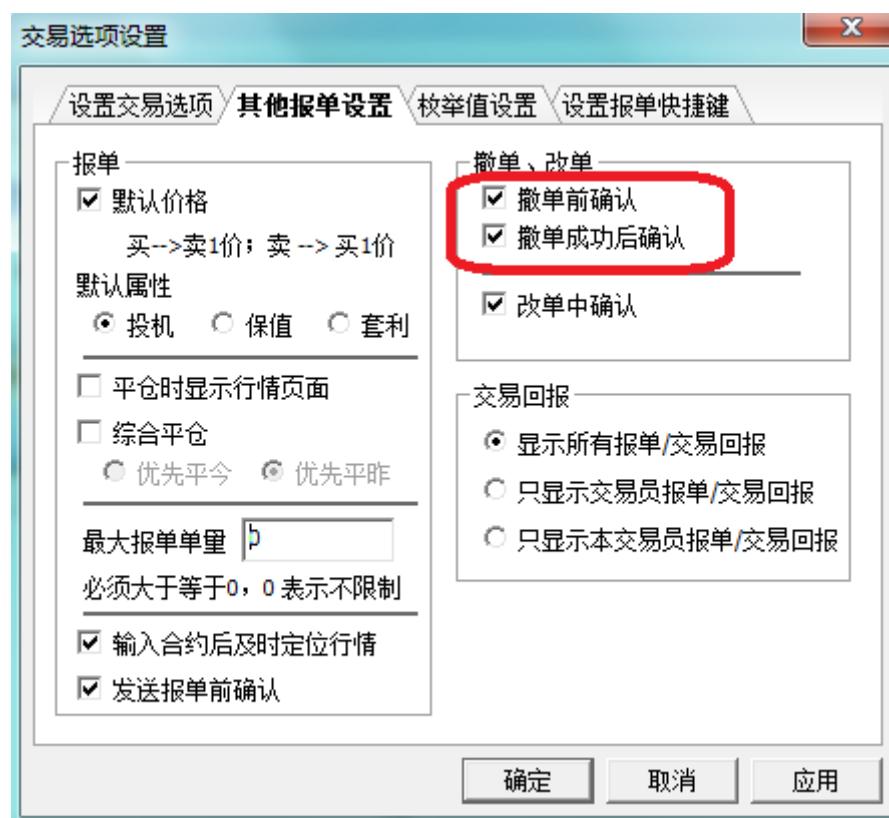


图 4.5-5 撤单配置界面

在双击主界面中的委托列表, 或者委托查询界面中某条可撤报单, 即可发出撤单请求;

如果在上面配置勾选了**撤单前确认**, 则会弹出撤单确认界面, 如下图 4.5-6 撤单确认界面。用户确认该界面中显示的是要撤单的报单, 则点击**确定**按钮, 发送撤单指令, 否则点击**取消**按钮, 取消本次撤单操作。



图 4.5-6 撤单确认界面

如果在上面配置勾选了**撤单成功后确认**, 则会在收到撤单成功回报后, 弹出撤单成功后确认界面, 如下图 4.5-7 撤单成功后确认界面。点击**修改参数**和**重新报单**按钮, 均会弹出报单界面, 可以修改参数后再报单。两个功能的不同点在于, 点击**修改参数**按钮弹出的报单界面中, 光标定在价格上; 点击**重新报单**按钮弹出的报单界面中, 光标定在**报单**按钮上。



图 4.5-7 撤单成功后确认界面

4.5.3 条件单

条件单界面和报单界面是集成在同一个界面中的，点击界面上方相应 Lable 键即可切换，如下图 4.5-8 条件单界面以及 Lable 键示意图。或者点击菜单栏的**交易操作 → 条件单**，如下图 4.5-9 条件单按钮示意图，弹出条件单界面。输入指定参数后，点击**报单**按钮，即可报入条件单。条件单只能在连续交易阶段被触发，其他交易所状态时，不能触发。条件单可在委托查询界面中查询到。

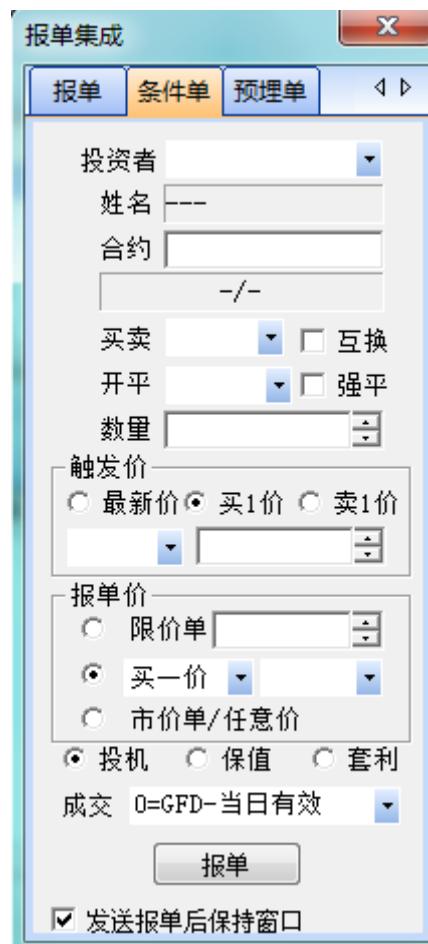


图 4.5-8 条件单界面以及Lable键示意图

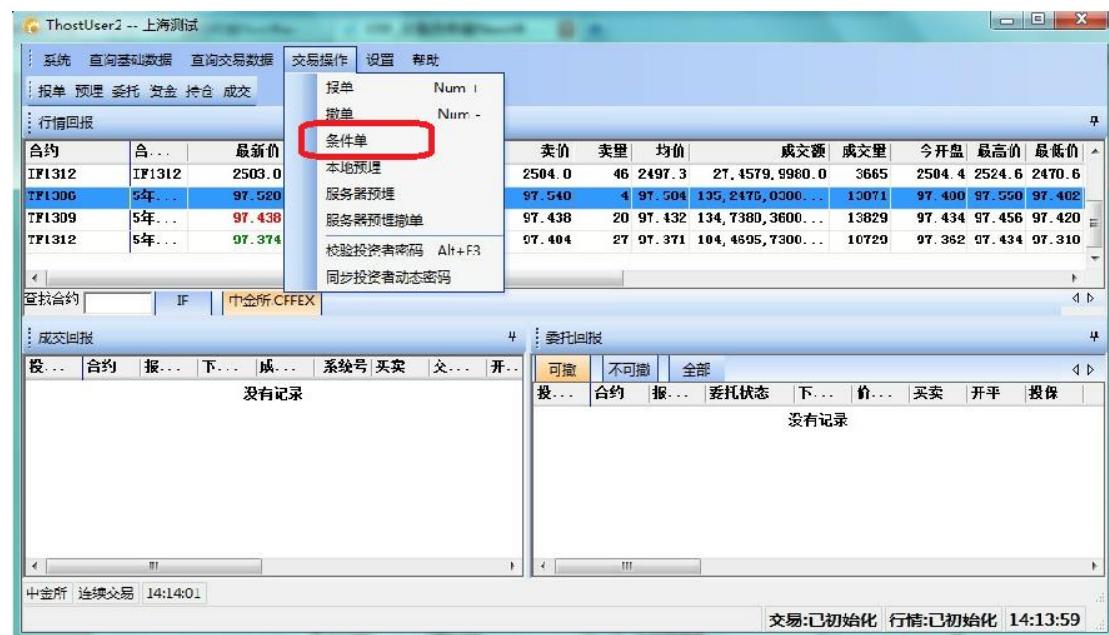


图 4.5-9 条件单按钮示意图

4.5.4 本地预埋单

点击菜单栏的**交易操作** → **本地预埋**, 或者点击菜单栏的**预埋**按钮, 如下图 4.5-10 本地预埋单按钮示意图。进入本地预埋单界面, 如下图 4.5-11 本地预埋单界面。

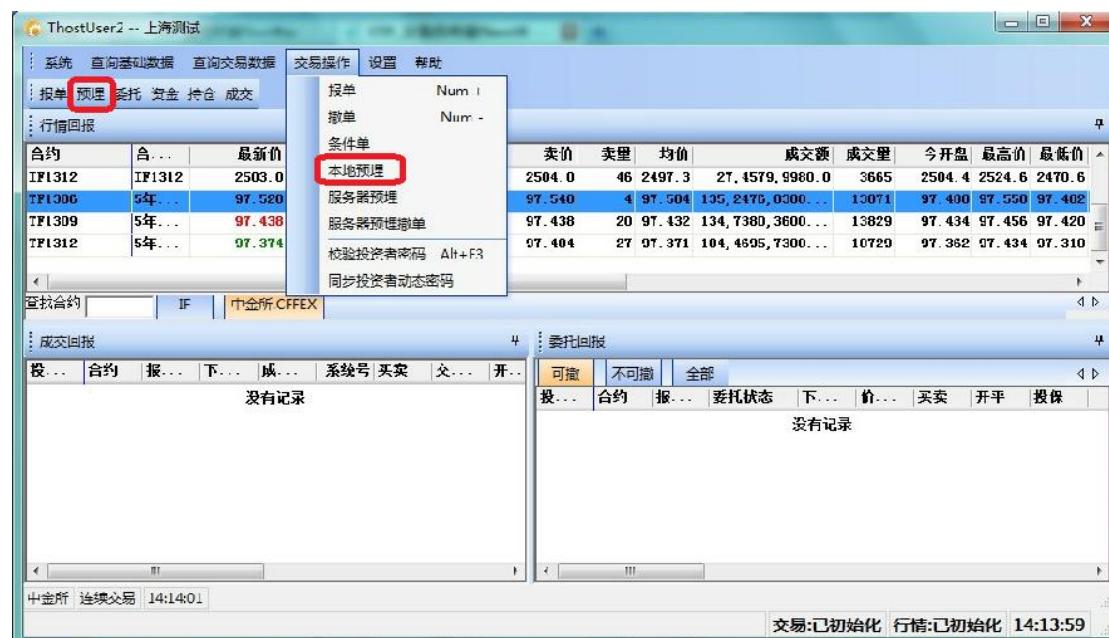


图 4.5-10 本地预埋单按钮示意图

在界面左边输入报单信息, 点击**新增**按钮即可将本预埋单信息插入右边的本地预埋单列表中; 点击右边的本地预埋单列表中某预埋单记录, 在左边修改信息后, 点击**修改**按钮即可对已有记录做修改操作。

选中本地预埋单列表中某预埋单记录前的勾选框, 点击**发送**按钮, 即可将该预埋单作为普通报单发送出去; 点击**删除**按钮, 即可删除该预埋单; 点击**导入/出 Excel**按钮, 即可将本地预埋单列表中所有记录导出至指定目录中, 或者将指定目录中的 Excel 记录导入到本列表中; 勾选自动发送, 本地预埋单列表中所有预埋单均会在下一交易节开始后被触发。

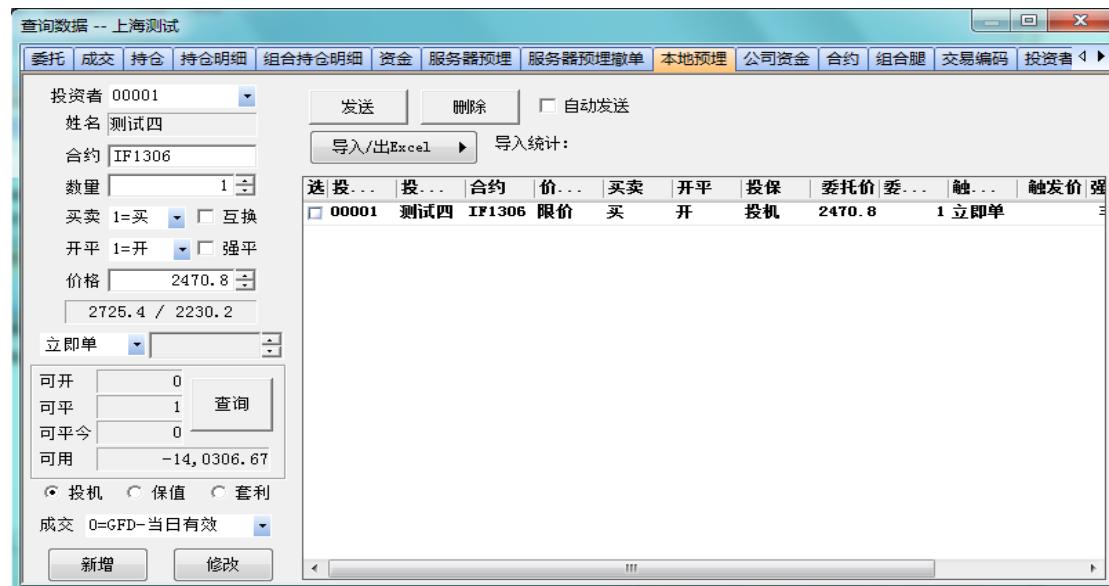


图 4.5-11 本地预埋单界面

4.5.5 服务器预埋单

服务器预埋单界面和报单界面是集成在同一个界面中的，点击界面上方相应 Label 键即可切换，如下图 4.5-12 服务器预埋单界面以及 Label 键示意图。输入指定参数后，点击报单按钮，即可报入服务器预埋单。服务器预埋单只能在开盘前阶段、非交易阶段、集合竞价价格平衡阶段、集合竞价撮合阶段报入，成功报入的服务器预埋单会在下一个交易节开始时被触发。



图 4.5-12 服务器预埋单界面以及Lable键示意图

点击菜单栏的**交易操作** → **服务器预埋单**, 如下图 4.5-13 服务器预埋单查询按钮示意图, 弹出服务器预埋单查询界面, 如下图 4.5-14 服务器预埋单查询界面。查询条件有投资者、合约、交易所, 为空表示查询全部。



图 4.5-13 服务器预埋单查询按钮示意图

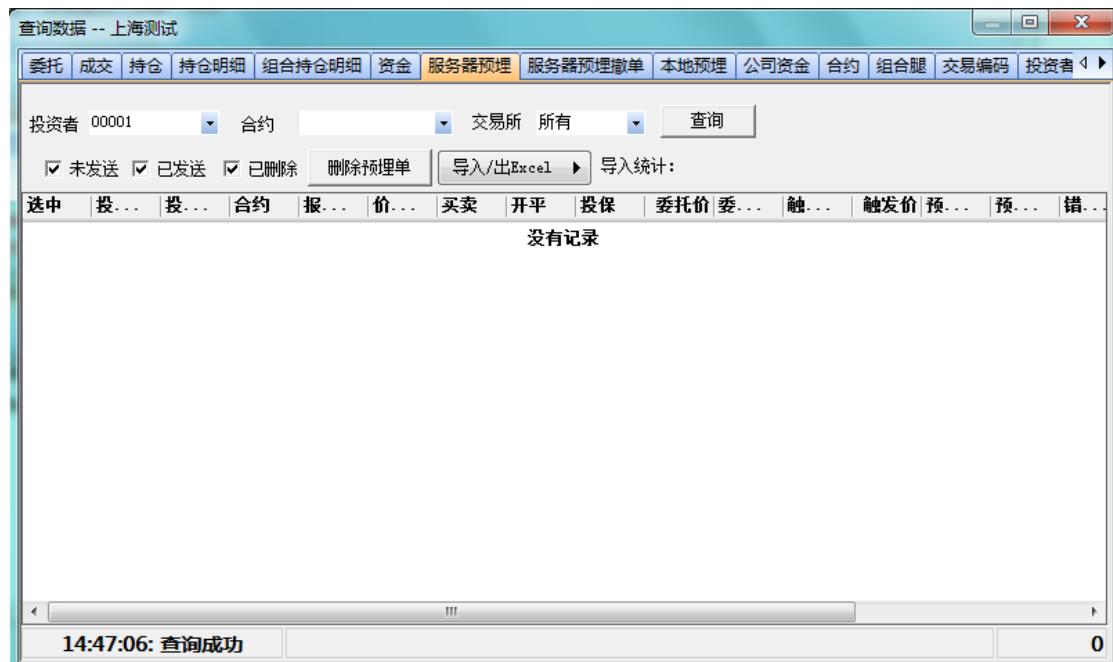


图 4.5-14 服务器预埋单查询界面

4.5.6 服务器预埋撤单

在委托查询界面中，勾选某可撤报单，点击**预埋撤单**按钮，如下图 4.5-15 服务器预埋撤单界面按钮示意图，弹出预埋撤单确认对话框，如下图 4.5-16 服务器预埋撤单确认对话框，确认需要撤单的报单信息，点击**确认**按钮，即可报入预埋撤单。服务器预埋撤单只能在开盘前阶段、非交易阶段、集合竞价价格平衡阶段、集合竞价撮合阶段报入，成功报入的服

务器预埋撤单会在下一个交易节开始时被触发。

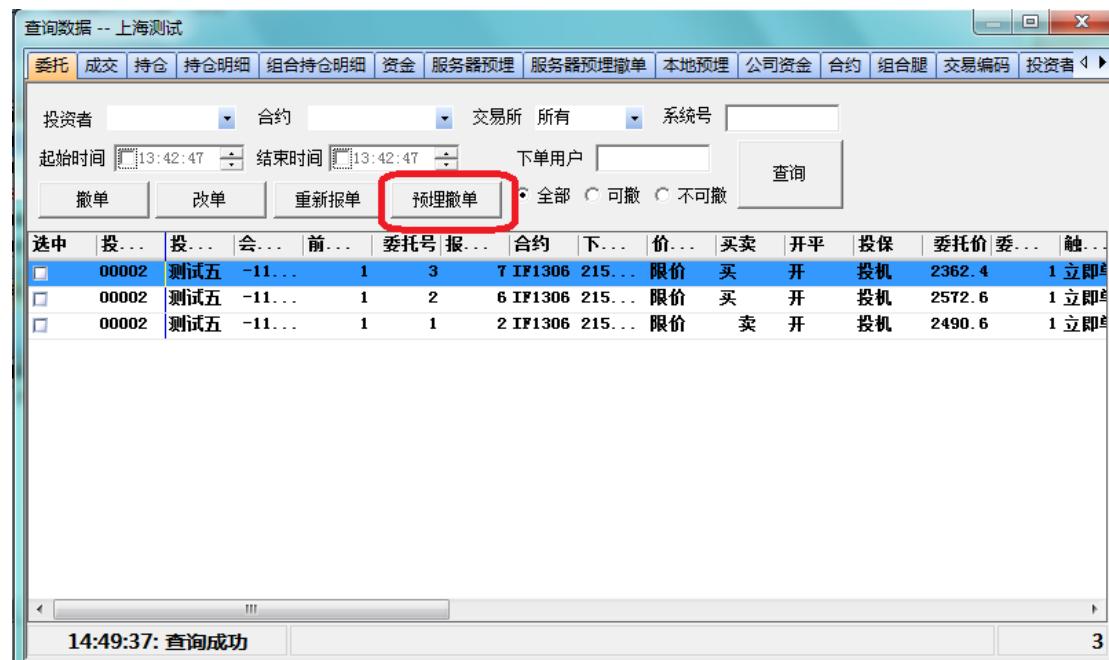


图 4.5-15 服务器预埋撤单界面按钮示意图



图 4.5-16 服务器预埋撤单确认对话框

点击菜单栏的**交易操作** → **服务器预埋撤单**, 如下图 4.5-17 服务器预埋撤单查询按钮示意图, 弹出服务器预埋撤单查询界面, 如下图 4.5-18 服务器预埋撤单查询界面。查询条件有投资者、合约、交易所, 为空表示查询全部。如需删除某服务器预埋撤单, 则勾选改记录, 再点击**删除预埋撤单**按钮即可。



图 4.5-17 服务器预埋撤单查询按钮示意图

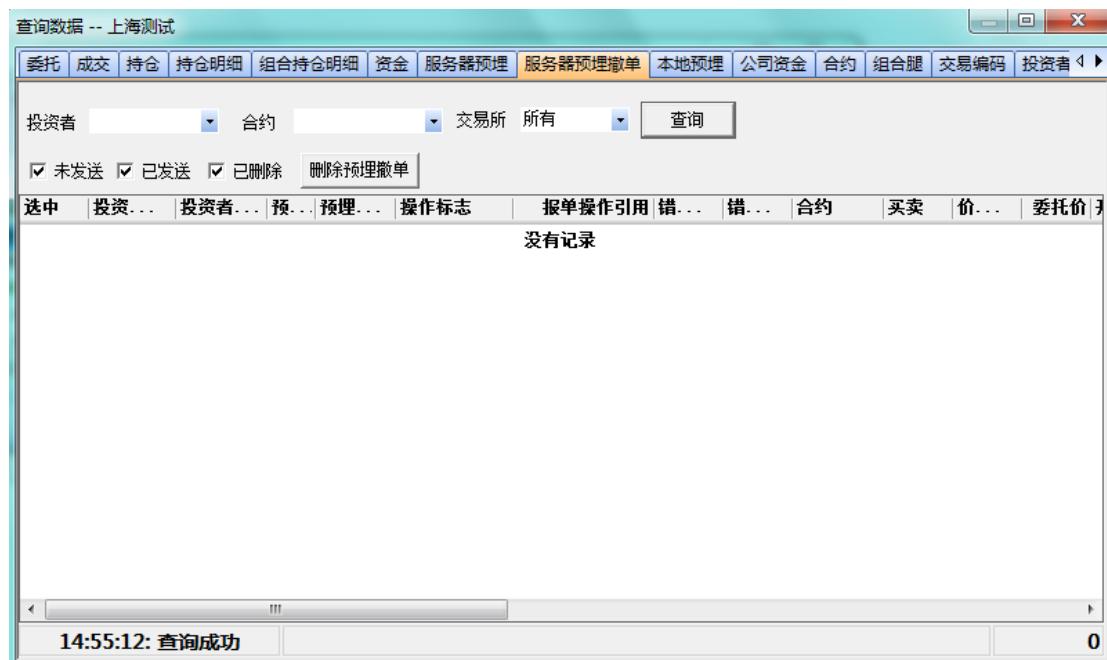


图 4.5-18 服务器预埋撤单查询界面

4.5.7 校验投资者密码

点击菜单栏的**交易操作** → **校验投资者密码**, 如下图 4.5-19 校验投资者密码按钮示意图, 或者热键 Alt+F3, 弹出校验投资者密码界面, 如下图 4.5-20 校验投资者密码界面。输入投资者代码、投资者密码, 点击**校验**按钮, 即可进行该投资者的密码校验操作, 校验结果显示在输入框下方; 点击**关闭**按钮, 退出校验界面。



图 4.5-19 校验投资者密码按钮示意图

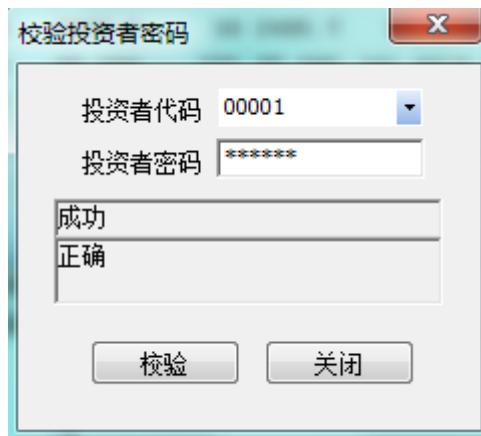


图 4.5-20 校验投资者密码界面

4.5.8 同步投资者动态密码

点击菜单栏的**交易操作** → **同步投资者动态密码**, 如下图 4.5-21 同步投资者动态密码按钮示意图, 弹出同步投资者动态密码界面, 如下图 4.5-22 同步投资者动态密码界面。输入投资者代码、动态密码 1、动态密码 2, 点击**同步**按钮, 即可进行该投资者的动态密码同步操作, 同步结果显示在输入框下方; 点击**关闭**按钮, 退出同步界面。

动态密码 1 和动态密码 2 取值于客户手中的动态令牌生成器, 该功能主要用于解决客户动态令牌登录失败问题, 如果使用该功能后, 客户依旧登录失败, 则请联系动态令牌生成商。



图 4.5-21 同步投资者动态密码按钮示意图

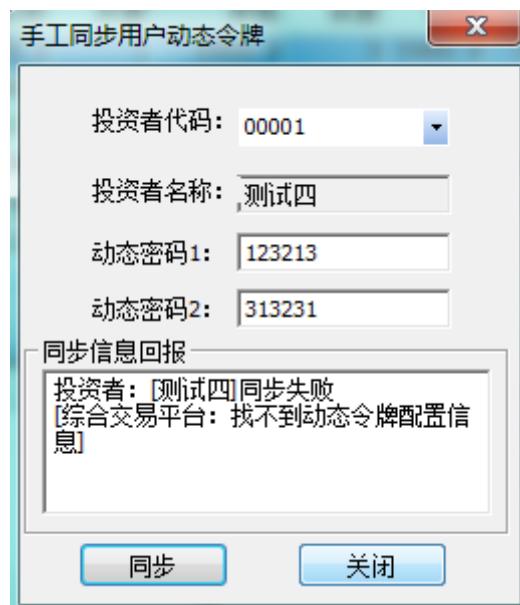


图 4.5-22 同步投资者动态密码界面

4.6 设置

4.6.1 通用设置

点击菜单栏的**设置** → **通用设置**, 如下图 4.6-1 通用设置按钮示意图, 弹出通用设置界面, 如下图 4.6-2 通用设置界面。所有配置点击**确认**按钮后实时生效。



图 4.6-1 通用设置按钮示意图



图 4.6-2 通用设置界面

各配置说明如下:

- *秒后自动锁定程序: 设置后, 程序会在指定秒数后自动锁定, 需要重新输入密码才能恢复;

2. *秒后提示断线超时: 设置后, 当程序和后台系统失去联系超过指定秒数后, 才会提示断线超时信息;
3. 投资者查询: 如选择后匹配, 当用户在投资者代码查询条件中输入 226 回车时, 自动匹配到投资者 000226; 反之如果选择前匹配, 是从前面进行匹配;
4. 数值显示: 影响所有界面的金额显示;
5. 接收交易通知: 勾选后, 该 ThostUser 会接收并显示风控发出的交易通知;
6. 单击委托回报定位行情: 勾选后, 鼠标单击主界面的委托回报列表中某记录, 该记录的合约行情就会显示被选中, 并显示在列表的第一行;
7. 行情页面可排序: 勾选后, 行情列表可按照指定列排序, 否则不能排序;
8. 启动声音提示: 勾选后, 某些操作会有声音提示, 具体配置可在勾选框下方的设置:

4.6.2 风险控制配置

点击菜单栏的设置 → 风险控制配置, 如下图 4.6-3 风险控制配置按钮示意图, 弹出风险控制配置界面, 如下图 4.6-2 风险控制配置界面。其中只有警示阀值和风险度算法能修改, 所有配置点击确认按钮后实时生效。



图 4.6-3 风险控制配置按钮示意图



图 4.6-4 风险控制配置界面

4.6.3 报单配置

点击菜单栏的**设置 → 报单配置**, 如下图 4.6-5 报单配置按钮示意图, 弹出报单配置界面, 其中包括 4 个子界面: 设置交易选项、其他报单设置、枚举值设置、设置报单快捷键。所有配置点击**确认**按钮后实时生效。



图 4.6-5 报单配置按钮示意图

设置交易选项界面如下图 4.6-6 设置交易选项界面, 用来配置报单对话框的外观和其中的字段属性。在**设置交易选项->报单后保留的字段**中, 如想保留价格字段, 需同时勾选**合约**和**买卖**字段, 否则价格字段不会保留。**报单后保留的字段**在用户点击报单按钮, 且报单成功有报单回报时, 才会生效。**报单后保留的字段**对报单和条件单均会生效。



图 4.6-6 设置交易选项界面

其他报单设置界面如下图 4.6-7 其他报单设置界面, 用来配置其他和交易相关的选项。

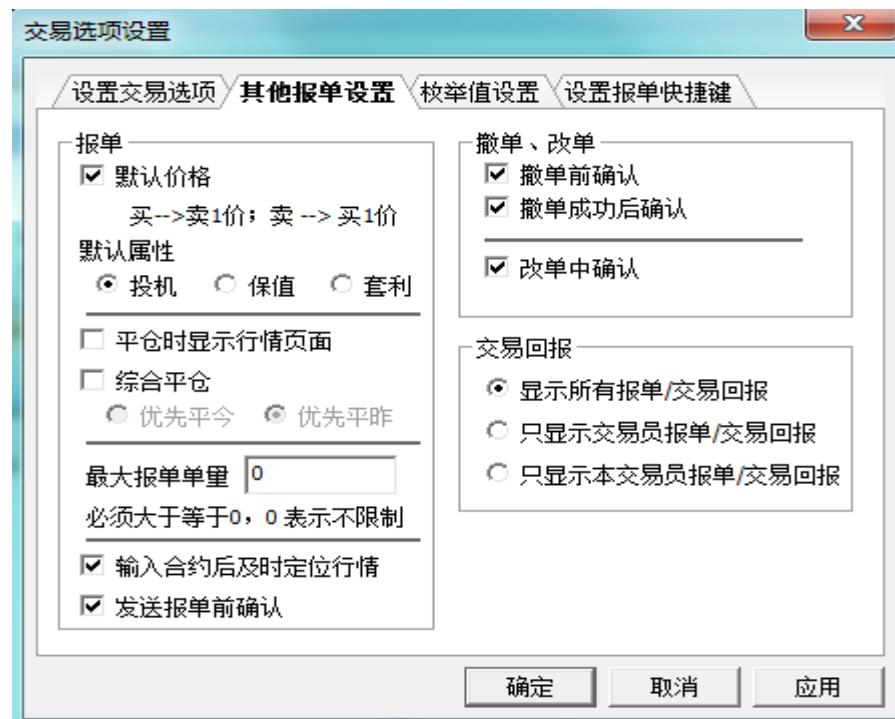


图 4.6-7 其他报单设置界面

枚举值设置界面如下图 4.6-8 枚举值设置界面, 用来配置键盘输入的各报单对话框枚举值。



图 4.6-8 枚举值设置界面

设置报单快捷键界面如下图4.6-9 设置报单快捷键界面, 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”。上述操作在小键盘中就可以完成，能有效加快输入速度。



图 4.6-9 枚举值设置界面

5 附录

5.1 综合交易平台交易角色说明

1. 强制用户登出

权限功能: 操作员登入系统监控终端 thostman 后，在`查询->用户会话`界面，查询到当前连接的用户后，选中某用户，可以点击【强制用户登出】、【强制用户退出】按钮，强制让该用户登出或者退出；强制登出后还能再次登入，但是强制退出后在当天内不能再次登入；

前提是操作员被赋予了全部查询(权限 5)、系统监控(权限 12)权限；

2. 变更用户口令(此功能未开放)

3. 同步经纪公司数据(此功能未开放)

4. 批量同步经纪公司数据(此功能未开放)

5. 全部查询：

权限功能：控制系统监控终端中的查询用户会话、查询交易报盘状态、查询行情报盘状态功能的使用权限；

6. 系统功能：修改密码等

功能权限：操作员登入交易员终端后，可以修改用户密码，查询通知；

7. 基本查询；查询基础数据，如合约，交易所等常量

权限功能：操作员登入交易员终端后，可以查询合约、组合腿、客户信息、交易编码、联系人、用户会话；

8. 交易查询：如查成交，委托

权限功能：操作员登入交易员终端后，可以查询委托、成交、持仓、持仓明细、持仓组合明细、资金、风险通知、错单回报，设置风险警示参数；

9. 交易功能：报单，撤单

权限功能：操作员登入交易员终端后，可以报单、撤单、报服务器预埋单、报服务器预埋撤单、报本地预埋单，可以使用**菜单栏->交易操作**中的所有功能；

10. 银期转账

权限功能：操作员登入银期终端 thostbank 后，可以使用菜单栏中的所有功能；

11. 系统监控：查询会话，踢人等

权限功能：操作员登入监控终端 thostman 后，可以使用**菜单栏->系统监控**中的用户会话、查询用户事件、查询交易报盘状态、查询行情报盘状态、查询前置状态界面功能，以及签约银行查询；

12. 交易所会员资金查询权限

权限功能：操作员登入交易员终端后，可以使用**菜单栏->查询交易数据** 查询公司资金功能；

13. 同步动态密码

权限功能：操作员登入交易员终端后，可以使用**菜单栏->交易操作** 同步投资者动态密码功能。