

# ATP 交易系统

## V6.0

# 使用说明书

(客户端版)

ATPlatform Technology Limited

2021 年 07 月 19 日

## 目录

系统入门.....	4
1.1 登陆.....	4
1.2 注销.....	5
1.3 退出.....	5
1.4 修改密码.....	5
1.5 语言.....	5
1.6 系统界面.....	5
资金栏.....	6
2.1 账户信息.....	6
2.2 切换账户.....	7
报价区.....	7
3.1 报价区显示.....	7
3.2 合约组管理.....	8
3.2.1 合约添加/删除/调整顺序.....	8
3.2.2 合约组添加/删除/重命名/导入.....	9
3.3 切换报价档数.....	9
3.4 切换合约组.....	9
3.5 多视图报价.....	9
3.6 二十档报价.....	9
3.7 合约报价区.....	10
3.8 打开 K 线图.....	10
3.9 添加价格监控.....	11
3.10 打开市场深度.....	13
合约区.....	14
4.1 合约区展示.....	14
4.2 添加合约到报价区.....	15
4.3 合约表设置.....	15
策略区.....	15
5.1 策略展示.....	15
5.2 策略添加\修改\删除\调整顺序\导入&导出.....	16
5.3 策略单模式.....	17
5.4 策略区 Limit 单快速下单入口.....	18
5.5 多视图策略.....	18
下单区.....	19
6.1 普通单下单方向模式.....	19
6.2 限价单.....	20
6.3 市价单.....	20
6.4 市价止损单.....	21
6.5 限价止损单.....	21
6.6 Iceberg 单.....	22
6.7 策略单.....	22

6.8 Stop 单.....	24
6.9 Gain Best 单.....	24
6.10 止盈止损单.....	26
6.11 定时单.....	28
6.12 TWAP 单.....	29
6.13 快速下单.....	30
6.14.批量下单.....	32
挂单区.....	32
7.1 挂单区展示.....	32
7.2 普通单.....	32
7.3 自动单.....	33
7.4 所有挂单区.....	34
自动单区.....	34
成交单区.....	35
9.1 明细.....	36
9.2 按单.....	36
9.3 合并.....	36
9.4 锁定滚动条.....	37
持仓区.....	37
连接状态、经纪行持仓.....	38
日志区.....	38
状态栏.....	39
菜单.....	40
14.1 窗口.....	40
14.2 帮助.....	40
系统设置.....	41
15.1 默认选项.....	41
15.2 声音设置.....	43
15.2.1 系统默认.....	43
15.2.2 用户自定义.....	44
15.3 字体设置.....	45
界面布局.....	45
16.1 布局展示.....	45
16.2 改变布局.....	46
16.3 界面管理.....	47
16.3.1 新建布局.....	47
16.3.2 重置布局.....	47
16.3.3 切换布局.....	48
16.3.4 删除布局.....	48

# 系统入门

## 1.1 登陆

The image shows a login window titled "ATP-DEMO2". At the top, there is a red error icon and the text "请输入动态密码" (Please enter dynamic password). Below this, there are several input fields: "服务器:" (Server) with a dropdown menu showing "ATP-DEMO2" and a "代理" (Proxy) checkbox; "用户名:" (Username) with the text "wuzh003"; "密码:" (Password) with masked characters "\*\*\*\*\*" and a checkmark; "新密码:" (New Password) with two sub-fields "请输入新密码" (Please enter new password) and "请确认新密码" (Please confirm new password); and "动态密码:" (Dynamic Password) with a checkmark. At the bottom, there are radio buttons for "English" and "中文" (Chinese), and a "登录" (Login) button.

- 选择**系统语言**; (注：切换语言后登陆框将重新打开)
- 输入**用户名、密码**;
- **新密码**: 勾选密码框旁边的方框，支持登录时修改密码;
- **动态密码**: 若交易员需要进行二次认证，登录时需要输入动态密码;
  - ✧ 首次点击登录时需要通过手机端的动态口令应用 APP 扫描 ATP 交易端的二维码，绑定 ATP 账户；获取密码令牌，点击令牌查看动态密码，输入动态密码完成二次认证的登录；
  - ✧ 完成绑定后，再次登录需输入 APP 上的动态密码；
  - ✧ 推荐使用的动态口令应用为 FreeOTP、Google Authenticator，可直接在应用商店下载。

The image shows a window titled "您需要完成二次认证的设置" (You need to complete secondary authentication settings). It features a blue shield icon with a checkmark. Below the icon, the text "第一步：请打开手机APP扫描屏幕下方二维码" (Step 1: Please open your mobile app and scan the QR code below) is displayed. A large QR code is shown in the center. Below the QR code, there is a link "无法扫描?" (Cannot scan?). At the bottom, there is a section titled "第二步：请输入动态密码" (Step 2: Please enter dynamic password) with an input field containing the number "877372". Below the input field, there is a note "\*请从手机APP里面获取登录所需的动态密码" (\*Please get the dynamic password needed for login from the mobile app). At the very bottom, there is a "确定" (Confirm) button.

- 点击**登陆**，进入系统。

## 1.2 注销

- 点击菜单**系统>注销**;
- 弹出确认框，点击确定，系统返回登录界面。

## 1.3 退出

- 点击菜单**系统>退出**;
- 弹出确认框，点击确定，系统关闭。(注：可在确认框中选择下次不再弹出)

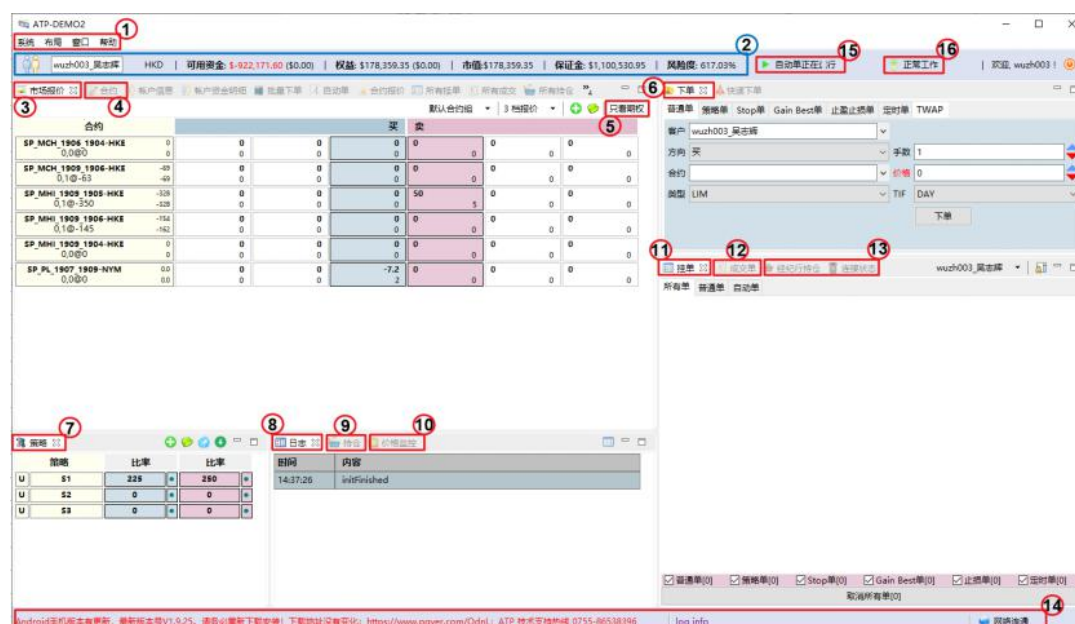
## 1.4 修改密码

- 点击菜单**系统>设置**;
- 弹出选项对话框，切换到**登录设置**页面;
- 分别输入**新旧密码**;
- 点击**确认**，修改成功。

## 1.5 语言

- 点击菜单**系统>语言**，可以修改系统的语言，修改语言后会回到登录界面重新登录。

## 1.6 系统界面

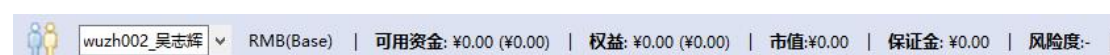


上图是交易系统主界面，交易过程涉及到的操作都在这里进行，该界面主要分为 16 块区域：

- ①菜单栏：系统各类设置入口。
- ②资金栏：展示当前客户名称、其对应的可用资金、权益、保证金等数据。

- ③**报价区**：展示用户添加合约的市场行情。
- ④**合约区**：展示合约的详细信息。
- ⑤**只看期权**：支持期权合约 T 型报价模式。
- ⑥**下单板**：创建交易单。
- ⑦**策略区**：添加策略、展示策略以及策略实时计算结果。
- ⑧**日志区**：展示用户的操作日志和服务器端反馈的日志。
- ⑨**持仓区**：展示用户的持仓。
- ⑩**价格监控区**：显示进行价格监控的合约和策略以及对监控状态的修改。
- ⑪**挂单区**：展示普通单与自动单，并支持单的修改、撤销操作。
- ⑫**成交单区**：展示已成交单。
- ⑬**连接状态、经纪行持仓**：展示系统和经纪行之间的链接情况以及经纪行账户的持仓。
- ⑭**状态栏**：展示通告信息、错误日志、网络状况。
- ⑮**自动单状态**：显示自动单的运行状态是否正在运行。
- ⑯**工作状态**：进行报错提醒。

## 资金栏



- 资金栏界面，从左到右分别是**账户信息**、**切换账户**、**币种** | **可用资金（额度）** | **权益（今日出入金）** | **市值** | **保证金** | **风险度**。

### 2.1 账户信息

- 账户信息主要用于显示当前账户的资金、挂单以及持仓的相关信息，包括了账户明细和账户持仓两个页面。

✧ 单击**账户信息** ()，或单击  **帐户信息** ，显示账户信息页面；

✧ 账户明细页面可查看保证金、账户市值、权益、可用资金的计算方式&结果。

帐户信息

帐户明细

帐户持仓

帐户基础币种BaseCurrency: USD  
持仓Position:  
SS2112-SH: Buy 1, Sell 0, LongMargin: 8,014.5, ShortMargin: 0  
\* Margin Summary: Max(8,014.5, 0) = 8,014.5  
-----  
CU211019-LME: Buy 0, Sell 2, Margin: SPAN  
CU211027-LME: Buy 0, Sell 1, Margin: SPAN  
CU211029-LME: Buy 0, Sell 4, Margin: SPAN  
\* Combined Margin Summary: 110,238.25, NOV Summary: 0  
PB211029-LME: Buy 2, Sell 0, Margin: SPAN  
\* Combined Margin Summary: 7,643.9, NOV Summary: 0  
\*\* Segment Margin Summary: Max(TotalMargin(117,882.15) - TotalNOV(0), 0) = 117,882.1  
-----  
持仓保证金PositionInitMargin: \$119,123.227 (RMB: ¥8,014.5 USD: \$117,882.15)  
挂单保证金OrderMargin: \$0  
---合计InitMargin: \$119,123.227 (RMB: ¥8,014.5 USD: \$117,882.15)  
---合计MaintMargin: \$119,123.227 (RMB: ¥8,014.5 USD: \$117,882.15)  
-----  
期初现金BeginningBalance: \$239,830.714 (RMB: -¥534 USD: \$94,990.071 HKD: \$1,125,856  
+ 押金Collateral: \$0  
+ 出入金CashMovement: \$0  
+ 持仓盈亏UPL: -\$4,382.415 (RMB: ¥275 USD: -\$4,425)  
+ 已平仓PL: -\$710 (USD: -\$710)  
+ 期权权利金OptionPremium: \$0  
+ 期权多头持仓市值LongOptionValue: \$0  
+ 期权空头持仓市值ShortOptionValue: \$0  
+ 手续费Commission: \$15.335 (USD: \$15.335)  
-----  
= 帐户市值MarketValue: \$234,722.963 (RMB: -¥259 USD: \$89,839.736 HKD: \$1,125,856 JPY  
-----  
期初现金BeginningBalance: \$239,830.714 (RMB: -¥534 USD: \$94,990.071 HKD: \$1,125,856  
+ 押金Collateral: \$0  
+ 出入金CashMovement: \$0

市场报价

合约

帐户信息

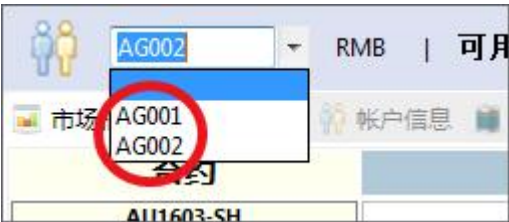
自动单

帐户明细

帐户持仓

帐户基础币种BaseCurrency: USD  
持仓Position:  
SS2112-SH: Buy 1, Sell 0, LongMargin: 8,014.5, ShortMargin: 0  
\* Margin Summary: Max(8,014.5, 0) = 8,014.5  
-----  
CU211019-LME: Buy 0, Sell 2, Margin: SPAN  
CU211027-LME: Buy 0, Sell 1, Margin: SPAN  
CU211029-LME: Buy 0, Sell 4, Margin: SPAN  
\* Combined Margin Summary: 110,238.25, NOV Summary: 0  
PB211029-LME: Buy 2, Sell 0, Margin: SPAN  
\* Combined Margin Summary: 7,643.9, NOV Summary: 0  
\*\* Segment Margin Summary: Max(TotalMargin(117,882.15) - TotalNOV  
-----  
持仓保证金PositionInitMargin: \$119,123.227 (RMB: ¥8,014.5 USD: \$117,882.15)  
挂单保证金OrderMargin: \$0  
---合计InitMargin: \$119,123.227 (RMB: ¥8,014.5 USD: \$117,882.15)  
---合计MaintMargin: \$119,123.227 (RMB: ¥8,014.5 USD: \$117,882.15)  
-----  
期初现金BeginningBalance: \$239,830.714 (RMB: -¥534 USD: \$94,990.071  
+ 押金Collateral: \$0  
+ 出入金CashMovement: \$0  
+ 持仓盈亏UPL: -\$6,037.172 (RMB: ¥325 USD: -\$6,087.5)  
+ 已平仓PL: -\$710 (USD: -\$710)  
+ 期权权利金OptionPremium: \$0

2.2 切换账户



➤ 单击账户名切换账户。

报价区

3.1 报价区显示

➤ 报价区包括合约信息区、买盘报价区、卖盘报价区，报价区可添加多个合约组并切换查看，每个合约组单独进行合约的增删等管理，另外可根据需要切换各种档数报价。

合约信息区域

买盘报价区域，从右到左  
分别是，1 档，2 档，3 档

默认合约组

卖盘报价区域，从左到右  
分别是，1 档，2 档，3 档

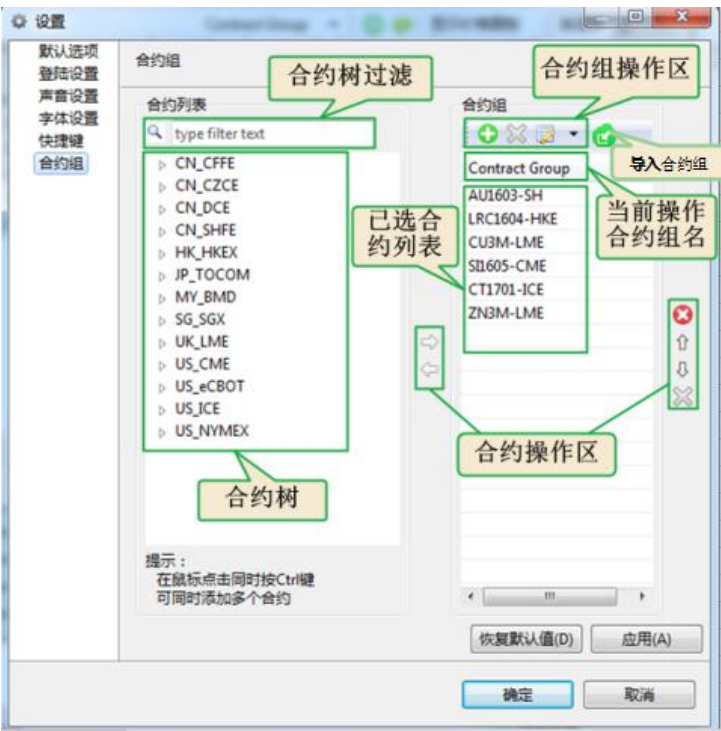
期权

合约	买	卖	期权
CU3M-LME 153,1@9464.5 9473.0 9436.0	9466 2	9466.5 1 ▲ 0.5 9467 2	9470 4 9471 1 9472 1
6B2108-CME 0,0@0 0.0000	1.3826 3	1.3827 1 1.3828 1	1.3831 1 1.3832 3 1.3833 3
HG2108-CME 2,2@4.3305 4.3305	4.24 20	4.278 2 4.33 2	4.331 2 ▼ 0.0005 4.37 1 4.427 4
GC2108-CME 6908,2@1831.9 1832.7 1829.4	1831.6 12	1831.7 7 1831.8 2	1831.9 4 ▼ 0.1 1832 9 1832.1 12
CU2108-SH 42467,1@69240 69410 68670	69200 28	69210 7 69220 12	69240 33 69250 8 69260 13
UC2108-SGX 48,1@6.4815 6.4815 6.4773	6.4803 22	6.4804 12 6.4805 1	6.4811 10 6.4812 11 6.4813 11



合约		买		卖	
合约编码	该交易日目前的最高、最低价			该档位买卖价	
CUSM-LME 811.1@9474.5	9507.0 9436.0	9473.5 2	9474 2	9474.5 2	9478.5 2
			▲ 0.5	▲ 0.5	9479 1
					9479.5 2
该交易日目前的成交手数		与上次报价的差价，蓝色代表上升，红色代表下降		该价格可成交手数	
最后一笔成交的价格与手数					

3.2 合约组管理








- 合约组管理页面进入方式有：
  - ✧ 点击报价区工具栏 **添加合约组** (📁);
  - ✧ 点击菜单 **系统>设置>合约组**;
  - ✧ 在已有的合约组的报价区内鼠标右击，然后选择“添加合约”。

3.2.1 合约添加/删除/调整顺序

- 添加：在合约树中选择所希望添加到当前合约组的对象，点击合约操作区 **添加合约** (➡) 或鼠标左键双击选中的合约完成添加（可 **Ctrl/Shift** 键+鼠标左击同时添加多个合约，鼠标左键双击只能添加单个合约）；
- 删除：在合约组列表中选中合约，点击合约操作区 **删除合约** (✖) 或鼠标左键双击合约完成删除，点击 **删除全部合约** (✖) 完成全部删除（可 **Ctrl/Shift** 键+鼠标左击同时删除多个合约，鼠标左键双击只能删除单个合约，也可在报价区内鼠标右击某个合约后选择删除它）；
- 调整顺序：在合约组列表中选中合约，点击合约操作区 **调整合约** (⬆ / ⬇) 完成调整；
- 操作完成后，点击 **应用**。



3.2.2 合约组添加/删除/重命名/导入

- 添加：点击合约组操作区添加合约组()完成添加；
- 删除：点击合约组操作区删除合约组()完成删除；
- 重命名：点击合约组操作区重命名合约组()完成命名；
- 切换合约组：点击合约组操作区切换合约组(  )切换显示的合约组；
- 导入合约组：点击合约组操作区导入合约组()进行导入，只接受.prefs 格式的文件。  
到源客户端左上角点击 **帮助->关于->Open Log Directory-> config ->.settings**，找到文件 ContractGroups.Prefs 进行拷贝，到新的客户端进行导入即可；
- 操作完成后，点击 **确定**。


3.3 切换报价档数

- 单击报价区工具栏 **3 档报价**，可从下拉列表中选择切换各价格档（或在报价区内鼠标右击操作）。

3.4 切换合约组

- 单击报价区工具栏 **默认合约组**，可从下拉列表中选择合约组（或在报价区内右击操作）。

3.5 多视图报价

- 单击报价区工具栏添加 **报价视图**() ；
- 弹出对话框，输入 **新视图名称**。

3.6 二十档报价

20档报价

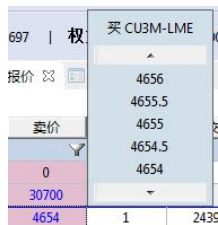
切换方向												
HSI1902-HKE	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	LTP	
卖	7@27610	4@27611	2@27612	5@27613	2@27614	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0		
买	1@27608	3@27607	3@27606	4@27605	3@27604	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0		
HSI1902-HKE	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20		
卖	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0		
买	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0	0@0		
											3088	1@27608

- 鼠标右击报价区的合约，在弹出对话框选择“打开 20 档报价”可显示此合约的 20 档报价；
- 点击“切换方向”按钮可分别显示横向和纵向 20 档报价。

3.7 合约报价区



- **合约报价**是市场报价的另一种显示方式，通过点击**合约报价**（）切换至该页面；
- 注：买/卖价列中的数字若为红色，则代表最新市场报价较上一个报价有下跌；若为蓝色，则代表最新市场报价较上一个报价有上涨。
- 在未开启**显示价格面板**（）时，点击报价，用户可以通过下单区对该合约进行下单；
- 在开启**显示价格面板**（）时，点击报价，系统会弹出以 1 个最小变动价格为间隔的价格列（如下图）。点击报价，用户可在弹出的下单框中进行下单。



3.8 打开 K 线图



- 鼠标右击报价区某合约，选择“打开 K 线图”可打开此合约的 K 线图。
- 注：合约 K 线图是以此合约的最后成交价来画的，可在 K 线图界面的工具栏对此界面进行颜色切换、标记、擦除、截图操作。

3.9 添加价格监控

价格监控				
对象: CU3M-LME 查询				
	对象	条件	最近触发时间	触发价
	CU3M-LME	成交价 > 6367.0	2017-08-07 19:50:07	6367.5
▶	CU3M-LME	卖1档 > 6368.0		
	CU3M-LME	买1档 > 6364.5	2017-08-07 19:46:56	6365.0

价格监控用于当合约或策略的价格达到设定值时发出提示信息。

➤ 添加价格监控

✧ 在 **价格监控** 面板下，左键点击(+)或者右键点击空白处，可添加价格监控；

添加价格监控

对象: 合约 CU3M-LME

条件: 买1档 > 6380.0

确定 取消

✧ 右键点击选定的合约或者策略，可添加价格监控；

AG1711-SH  
16,1@3818

切换合约组  
添加合约  
切换报价档数  
添加价格监控

策略

策略 比率 比率

U S1 -227

U S2 0

添加策略  
添加价格监控

✧ 价格监控条件：买 1 档/卖 1 档/成交价(价格监控对象为策略时无“成交价”选项)。

添加价格监控

对象: 合约 AG1710-SH

条件: 买1档 > 3703.0

买1档  
卖1档  
成交价

确定 取消

➤ 编辑/删除价格监控

✧ 右键点击已添加的价格监控对象，可编辑或删除价格监控；

	对象	条件
	AG1710-SH	
<div>添加价格监控 编辑价格监控 删除价格监控 暂停价格监控</div>		

➤ 切换价格监控状态

- ✧ 价格监控状态有三种：监控、停止、警告；
- ✧ 右键点击价格监控对象或者左键点击状态图标，可切换价格监控状态。

	对象	条件
	CU3M-LME	
	NI3M-LME	
	S1	
<div>添加价格监控 编辑价格监控 删除价格监控 暂停价格监控</div>		

点击状态图标

➤ 价格监控警报

当监控的合约或者策略报价满足监控条件时，会触发监控警报

- ✧ 价格监控面板上相应监控条目有闪动提示；

	对象	条件
	CU3M-LME	买1档 > 6420
	NI3M-LME	买1档 > 10285
	S1	买1档 > -3000

- ✧ 合约区/策略区相应的合约/策略有闪动提示；

CU3M-LME	6436.0	6414.5
2084,1@6416.5	6394.0	2
NI3M-LME	10380	10325
1564,1@10340	10280	11

策略	比率	比率
U S1	-2649	-2639.5
U S2	-34	-16

- ✧ **重要事件**面板有信息警报，点击**详情**可跳转至价格监控面板；点击左上角的可标记所有信息为已读，标记后，状态从“详情”变为“完成”。

	时间	信息	操作
1	11:27:41	价格监控: NI3M-LME 买1档 > 19550,触发价:19580.0	详情
2	11:27:04	价格监控: NI3M-LME 买1档 > 19540,触发价:19565.0	完成
3	11:26:35	价格监控: NI3M-LME 买1档 > 19540,触发价:19580.0	完成

- ✧ 在**系统>设置>声音**设置页面可设置价格监控的声音提示。
- 价格监控

☒

b5.wav
- 取消监控警报
    - ✧ 在**合约/策略区**，右键点击警报的**合约/策略**，取消警报状态，同时对应条目的监控状态由“警告”变为“停止”；



- ✧ 在**价格监控面板**，左键点击()，或者右键点击报警的对象，取消警报状态，同时对应条目的监控状态由“警告”变为“停止”。
- |   | 对象       | 条件         |
|---|----------|------------|
|   | CU3M-LME | 买1档 > 6420 |
|  | NI3M-LME |            |
|  | NI3M-LME |            |
|  | S1       |            |
- 添加价格监控

编辑价格监控

删除价格监控

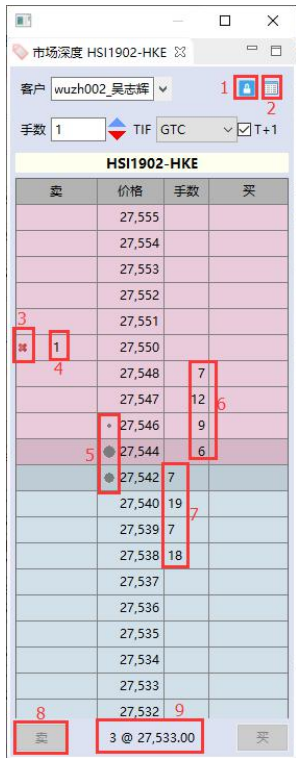
取消报警

### 3.10 打开市场深度

- 市场深度界面用于查看单个合约的市场深度（可打开多个市场深度界面），以及在此界面进行下单、撤单等操作。
- #### 3.10.1 打开市场深度界面
- 鼠标右击市场报价区需要查看市场深度的合约，选择打开**市场深度**即可打开此界面。



3.10.2 界面介绍



- 1.选择是否锁定页面（锁定后不能下单、撤单）；
- 2.代表是否切换显示模式，有两种模式：
  - 将市场上有报价的行情紧缩在一起显示；
  - 每个 Tick 都显示出来；
- 3.合约的挂单可以点击此处撤单；
- 4.此合约此价格的挂单手数；
- 5.代表最后成交价，成交时间越近的价格前面的点越大；
- 6.市面卖盘对应的手数；
- 7.市面买盘对应的手数；
- 8.当合约支持市价单类型，可以点击此处的卖/买，直接下市价单；
- 9.代表客户现在的持仓及持仓均价；
- 10.红色区域为Offer报价；蓝色区域为Bid报价。

合约区

4.1 合约区展示



- 合约区包括**合约树**，**合约表**两个区域。选择合约树中的各层节点，合约表将显示其对应合约的详细信息。也可通过关键字进行查找合约详情。

（注：双击合约表中的**固定手数**可更改创建普通单时系统生成的默认手数。当**固定手数**设置为0时，默认手数不固定，系统将根据报价信息生成**手数**；当**固定手数**设置为-1时，系统将在**手数**处留空。此处**固定手数**设置的手数判定优先于**系统 - 设置 - 默认选项 - 固定手数**。）




## 4.2 添加合约到报价区

- 合约表中右击，点击**添加合约到**，选择具体合约组。该合约将在报价区对应的合约组中显示报价。

## 4.3 合约表设置

- 左键单击每列表头可修改合约表中合约的升降序排序；右键点击可隐藏该列或自动调整列宽至可以显示该列全部内容。

	交易所	产品	合约代码	合
1	CN_SHFE	上	AG1510-SH	
2	CN SHFE	上海...	AG1510-SH	

- 单击（）并输入过滤条件后可对当前显示的合约进行筛选，单击（）取消筛选。
- 单击**问号**（）可进行以下操作：显示所有列，调整所有列至同一宽度，自动调整列宽至可以显示每列所有内容，快速清除所有过滤条件。

	交易所	产品...	合约代码
1			9-S
2			0-S
3			1-S
4			2-S
5	CN SHFE	上海	AG1601-S

# 策略区

## 5.1 策略展示

策略区提供展示策略公式的实时计算结果。

策略名称		根据策略中合约所设置的初始买卖方向的1档报价计算的结果	
策略		比率	
U	S1	-33069	-33149
U	S2	3890	3180

根据策略中合约所设置的相反买卖方向的1档报价计算的结果

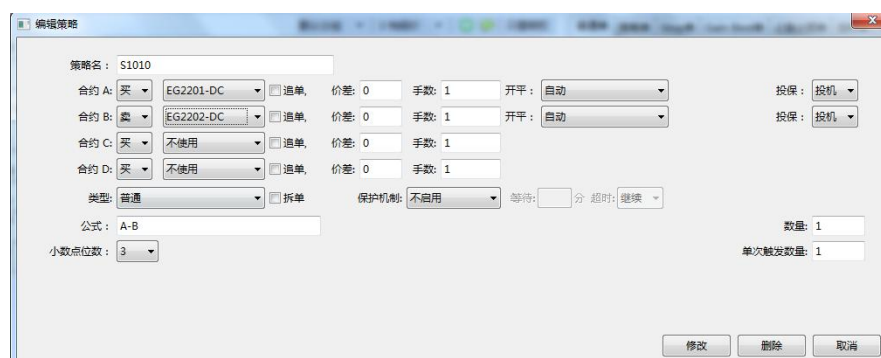
例：如上图中的策略 S2，参与的 A 合约为 CU1605-SH，方向为买入，参与的 B 合约为 AG1604-SH，方向为卖出。公式为 A-10\*B。在某一时刻，A 的一档买价为 36390，一档卖价 36400。B 的



一档买价为 3251，一档卖价为 3321。

那么，S2 蓝色区域表示"买 A - 10 \* 卖 B"，将与该策略设置的合约买卖方向一致的一档价格代入计算，数值为  $36400 - 10 * 3251 = 3890$ 。S2 红色区域表示"卖 A - 10 \* 买 B"，将与该策略设置的合约买卖方向相反的一档价格代入计算，数值为  $36390 - 10 * 3321 = 3180$ 。

## 5.2 策略添加\修改\删除\调整顺序\导入&导出



- 添加：点击合约组操作区 **添加策略** (+)，弹出 **添加策略** 对话框，按照说明填入相关数据，点击 **确定** 完成添加。

添加说明：

1. 至少需要包含 A、B 两个品种；
2. C 和 D 为可选项，用户可按实际需要使用，先使用 C 才可以使用 D；
3. 公式合法字符为：AB、数字 0-9、括号、加减乘除、小数点；当使用 C 和 D 时，C 和 D 也为合法字符；(注：3A/2B 为非法公式，(3\*A) / (2\*B) 为合法公式)
4. 策略名建议用户填写有代表意义的名称，方便识别，长度最好不要超过 7 个中文或 15 个英文；
5. D 为策略单对应合约默认价差，L 为策略单对应合约默认手数，执行次数为策略单默认执行次数；
6. 小数点位数：添加好策略后，策略区的比率显示的小数点位数；
7. 开平/投保标志：指定策略触发后下单的开平和投保标志；
8. 保护机制：可以根据需求选择是否启用保护机制，保护机制有以下三种类型：
  - ✧ 不启用：公式条件满足则允许触发自动单；
  - ✧ 类型 1：本轮触发的所有合约都挂单成功，才允许触发下一轮检查。超过等待时长，策略单可继续运行或自动暂停，由用户自行设置等待时长；
  - ✧ 类型 2：本轮触发的所有合约全部成交后，才允许触发下一轮检查。超过等待时长，策略单可继续运行或自动暂停，由用户自行设置等待时长。
9. 追单、价差、手数、数量等参数在后文 **策略单** 处介绍；

- 修改和删除：在策略区中点击策略名，弹出策略编辑对话框，点击 **删除** 完成策略的删除，点击 **修改** 完成策略的修改；
- 调整：点击策略区第一列U，该策略会向上移动；

	策略	比率	比率
U	BRN12-11	-0.71	-0.68
U	cu-zn	6499	6505
U	S3	0	0
U	S4	0	0

- 策略导入和导出。点击上图中 按钮可导出策略；点击 按钮可将导出的策略导入到客户端。

5.3 策略单模式

策略单支持两种模式：

- 默认模式：系统默认的策略单模式，通过点击策略左右两侧的计算结果进行下单，用户可选择四种运算方式：> , >= , < , <=;

- 买/卖模式：系统将把策略看成一个组合单，左侧的比率视为买盘报价，右侧的视为卖盘报价，点击左侧可以下卖/卖止损单，点击右侧可以下买/买止损单（注：如果出现左侧值大于右侧值，需将策略中各品种方向交换）。

- 买：公式<= 价格；
- 买止损：公式>= 价格；

- 卖：公式>= 价格；
- 卖止损：公式<= 价格。

5.4 策略区 Limit 单快速下单入口

系统可通过策略区的入口直接对相关合约当前市场价进行快速下单(限价单)。

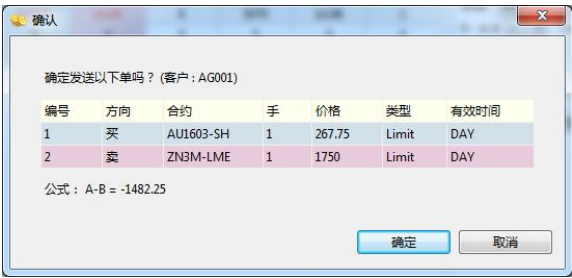
- 将系统-设置-默认选项中的选项打开，并选择是否需要下单确认；



- 点击对应策略区计算结果后方的蓝色按钮；

策略		比率		比率	
U	-AU+ZN	-1481.75	✱	-1495.1	✱
U	SP.AL	68249.475	✱	68249.475	✱

- 对弹出的确认框信息进行确认，点击确定完成下单。



5.5 多视图策略

- 单击报价区工具栏添加策略视图(📊)；
- 弹出对话框，输入新视图名称；
- 在新视图点击调整策略(⚙️)，可选择该视图需要查看的策略。



## 下单区

- 下单分为普通单，自动单两个类型。普通单即限价单、市价单、市价止损单、限价止损单和 Iceberg 单，自动单包括策略单、Stop 单、Gain Best 单、止盈止损单、定时单、TWAP 单。点击切换按钮至对应页面可分别下单。

注：下单支持全键盘操作，可用 Tab 键遍历下单板各项，Enter 键或 Space 键确定下单。

- 单有效期（TIF）说明：
  - DAY：当天有效。
  - GTC：一直有效直到被取消。
  - GTD：指定日期前有效。

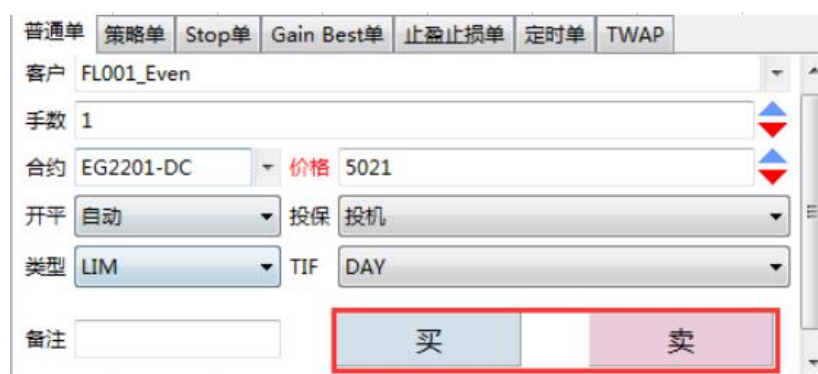
### 6.1 普通单下单方向模式

普通单下单方向有两种模式：

- 买/卖下拉框模式：普通单界面合约的买卖方向以下拉框的方式进行选择；



- 买/卖按钮模式：下单方向的选择以按钮的方式进行选择，在 **系统-设置-默认选项 - 下单方向模式** 中选择 **买/卖按钮**，点击 **确定** 生效。



下文以买/卖下拉框模式进行各普通单的介绍。

## 6.2 限价单

限价单是以指定的或优于指定价格买或卖一个合约的定单。

普通单 策略单 Stop单 Gain Best单 止盈止损单 定时单 TWAP

客户 FL001\_Even

方向 买 手数 1

合约 EG2201-DC 价格 5021

开平 自动 投保 投机

类型 LIM TIF DAY

备注

下单

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单；（双击则弹出下单对话框）
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 **DAY**；
- 在价格与手数区域，输入你希望定单的价格与手数；
- 添加备注（备注为可选项，可留空）；
- 发送定单，点击 **下单**。

## 6.3 市价单

市价单是以当前市场的最优价格买或卖一个合约的定单。

普通单 策略单 Stop单 Gain Best单 止盈止损单 定时单 TWAP

客户 FL001\_Even

方向 买 手数 1

合约 BRN2111-ICE 价格 Market

类型 Market TIF DAY

备注

下单

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单；
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 **DAY**；
- 在手数的编辑区域，输入你希望定单执行的交易手数；
- 在单类型选择 **Market**；
- 发送订单，点击 **下单**。

## 6.4 市价止损单

市价止损单是当市场价格达到止损点时，系统便会发出市价单。

普通单 策略单 Stop单 Gain Best单 止盈止损单 定时单 TWAP

客户 FL001\_Even

方向 买 手数 1

合约 BRN2111-ICE 价格 Market

类型 STP TIF DAY

StPx 69.34

备注 下单

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单；
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 DAY；
- 输入交易手数及止损点，价格默认为市场价；
- 在单类型选择 STP；
- 发送订单，点击下单。

## 6.5 限价止损单

限价止损单是当市场价格达到止损点时，系统便会发出限价单。

普通单 策略单 Stop单 Gain Best单 止盈止损单 定时单 TWAP

客户 FL001\_Even

方向 买 手数 1

合约 BRN2111-ICE 价格 69.51

类型 STL TIF DAY

StPx 69.5

备注 下单

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单；
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 DAY；
- 输入交易手数、止损点和价格；
- 在单类型选择 STL；
- 发送订单，点击下单。



6.6 Iceberg 单

Iceberg 单是在限价单的基础上设置了可见手数，在发出交易单后，系统会按指定价格发出一个限价定单，交易手数等于可见手数；待该笔限价定单成交，系统便会以同样的价格再发出一笔同等数量的限价定单，等待成交，以此类推，直至交易结束。

普通单策略单Stop单Gain Best单止盈止损单定时单TWAP

客户FL001\_Even

方向买手数100

合约BRN2111-ICE价格69.51

类型ICE1TIFDAY

备注

下单

- 点击报价区中的卖价创建买单，或买价创建卖单；
- 在价格与手数区域，输入你希望定单执行的价格与手数；
- 在有效时间类型区域选择你所希望的类型，默认为 DAY；
- 在单类型选择 ICE 和选择 Iceberg 单的可见手数；
- 发送订单，点击下单。

6.7 策略单

策略单是当多个合约之间的价格关系满足用户设置的策略时，触发各个合约以当前市场价格的下单，可设置调整定单价差（D）、手数（L）、策略类型、是否拆单、是否创建循环单、数量和单次触发数量。

普通单策略单Stop单Gain Best单止盈止损单定时单TWAP

客户FL001\_Even

A: 卖 EG2201-DC [投机]

☐ 追单, 价差: 0 手数: 1 开平: 自动

B: 买 EG2202-DC [投机]

☐ 追单, 价差: 0 手数: 1 开平: 自动

类型: 主动腿 - 卖 A ☐ 拆单 保护机制: 不启用 等待: 分 超时: 继续

☒ 只挂1档 有利: 1 不利: 1 区间: 5

公式: A-B > 5 单次触发数量: 1 数量: 1

公式: A-B < 备注:

下单

\* 本指令在服务器上执行

- 点击策略区中对应策略的公式结果，填充策略下单板；（双击则弹出下单对话框）
- 根据需要对交易单的相关参数进行修改；
- 发送定单，点击下单。



**参数名词解释：**

**D：**价差，设置之后下单价格为市场价+/-价差，买方向+价差，卖方向-价差，设置的数值应为产品最小变动价格的整数倍。

**L：**手数，策略单执行时对应合约的下单手数。手数支持输入分数，格式为 X/Y, X 与 Y 必须为正整数，如 354/80。

**追单：**满足条件下单后，若当前价格无法促成交易，则撤销原挂单，再以最新对手价+/-价差重新挂单。

**小数位：**策略区数值显示的小数位。

**数量：**策略单需执行的总次数。

**单次触发数量：**对于一次触发下单，最多可同时完成的执行次数，单次触发数量应小于或等于数量。

**拆单：**每次按照合约的手数比例自动拆分为最小单位手数进行下单。

**主动腿：**主动腿主要用于钓鱼，以满足客户期望的价格将主动腿挂于市场，吸引别人成交；当主动腿的挂单成交后（可部分成交），被动腿的合约才会进行下单。主动腿的挂单价格根据被动腿的对手价、策略单公式及其他逻辑推算得出。

**只挂 1 档、有利、不利、区间：**用于主动腿扩大下单范围，用户可根据需要设置主动腿下单区间及改单范围：

- ✧ 只挂 1 档：主动腿是否只挂一档价格；
- ✧ 区间：距离对手价的有效 TickSize 的倍数，处于这个区间才会下单。区间的有效值为 1~500, 默认值为 5；
- ✧ 有利改单范围：当满足条件的主动腿价格需变动时，在已有挂单有利于盈利的情況下，主动腿价格至少变动了指定 ticks 才会改单；
- ✧ 不利改单范围：当满足条件的主动腿价格需变动时，在已有挂单不利于盈利的情況下，主动腿价格至少变动了指定 ticks 才会改单。

例：以上图设置的主动腿策略单为例，假设目前：

CL1904-NYM 的买一档价格为 50.34，卖一档价格为 50.50；

CL1903-NYM 的卖一档价格为 50.18，

此时主动腿 CL1904-NYM 以价格 50.43 挂单到市场，即主动腿价格 50.43 满足公式  $50.43 - 50.18 = 0.25 > 0.24$ ，且满足在下单区间  $[50.34, 50.34 + 15\text{tick} = 50.49]$  内。

如果行情变化，使得满足公式的主动腿挂单价格应为 50.41，此时继续维持 50.43 的挂单价格是有利于交易者盈利的（不利于成交），但因价格变动小于有利改单范围 3tick，因此不会撤单；

如果行情变化，使得主动腿挂单价格应为 50.39，此时价格变动大于等于有利改单范围 3tick，主动腿撤掉原挂单并以价格 50.39 重新挂单。

**先手：**先手策略主要用于设定合约的成交先后顺序。当策略单条件达到后，先下先手合约的

挂单，当先手合约成交后（可部分成交），其他合约才会进行下单。

**循环单：**勾选循环单后，相当于多建一个策略 2，策略 2 的买卖方向与策略 1 的方向相反，公式为填入的循环单公式。一次执行周期为先执行策略 1，全部成交后再执行策略 2，待策略 2 全部成交后才会进入下一次的执行周期。

**备注：**策略单触发后成交的普通单会显示相应的备注信息，该备注信息与策略单的备注相同。

## 6.8 Stop 单

Stop单是当合约最后成交价/市场买价/市场卖价超过（买方向-高于、卖方向-低于）止损价后，以设定的下单价挂单。

- 切换下单区到 Stop 单面板下；
- 输入该单的相关数据；
- 发送定单，点击 **下单**。

## 6.9 Gain Best 单

Gain Best 单，目的是为了有效的控制市场变动导致的盈利损失或亏损。通过设定相关参数（基准价、Step 值和 Gap 值），系统会监测市场报价并据此不断调整基准价，使基准价一直向盈利增加的方向调整。即使价格走势向反向回调，系统也会根据 Step 值的设置及时触发自动单，从而减少盈利的损失甚至是亏损。

**参数名词解释：**

**基准价：**当市场价第一次达到自动单设置的下单价格时，初始基准价设置为该价格。

**Price Gap：**当市场价相较基准价更优于该数值时，将基准价往更优方向调整与该数值相等的价格。

**Step：**当市场价相较基准价回调该数值时，该自动单被触发。

普通单

策略单

Stop单

Gain Best单

止盈止损单

定时单

TWAP

客户

wuzh002\_吴志辉

方向

买

手数

1

合约

CT1903-ICE

价格

0.7326

Gap

0.0003

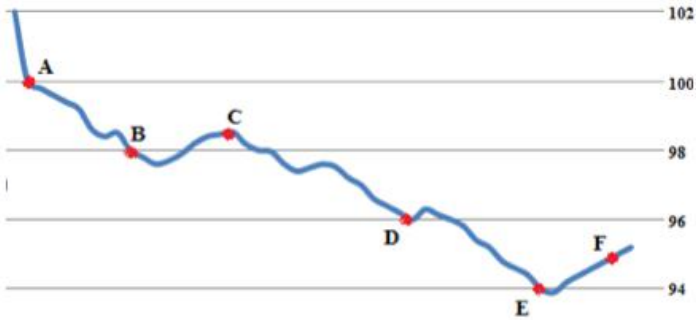
Step

0.0002

下单

- 切换下单区到 Gain Best 单面板下；
- 输入该单的相关数据；
- 发送定单，点击 **下单**。

例：假设用户发送 Gain Best 单,买入 1 手 CU160505-LME,预设价格：102,gap：2, step：1。  
下单后 CU160505-LME 的市场卖价变化如下。



1. 价格第一次到达预设价格 102,此时设置基准价格 102。
2. 价格一路往有利方向移动到 100,到达 A 点时,基准价格(102)-A 当前价格(100)  $\geq$  gap(2), 此时调整新的基准价格 100。
3. 同样,价格继续波动移动到 B 点,基准价格(100)-B 当前价格(98)  $\geq$  gap(2), 此时调整新的基准价格 98。
4. 过了 B 点之后,价格一度波动回调到 C 点,但是 C 当前价格(98.5)-基准价格 (98)  $<$  step(1), 所以该单条件未被触发。
5. 同样,价格继续波动移动到 D 点,基准价格(98)-D 当前价格(96)  $\geq$  gap(2),此时调整新的基准价格 96。
6. 同样,价格继续波动移动到 E 点,基准价格(96)-E 当前价格(94)  $\geq$  gap(2),此时调整新的基准价格 94。
7. 最后,价格回调到 F 点,F 当前价格(95)-基准价格(94)  $>$  step(1),此时该单条件被触发。以预设价格 102 发送买单。

## 6.10 止盈止损单

止盈止损单支持两种模式：按开仓均价止盈止损和按自定义价止盈止损（不开仓）

- 按开仓均价止盈止损：挂单后，系统首先以指定下单价格下一个普通单，一旦这个普通单有部分成交或全部成交，止盈止损单开始监控市场价格变动。当市场价格相对于成交均价达到止盈/止损点后，自动单将触发下单，把已成交的部分平仓。

客户 ATP001\_用于自动测试

模式 按开仓均价止盈止损

方向 买

手数 1

合约

下单价 0

止损 按价格 请输入相对于价格的价差

止盈 按Tick 0

类型 LIM ☐ 交易所市价指令

平仓价差 按价格 0

数量 1

下单

\* 本指令在服务器上执行

### 参数名词解释

**止盈/止损：**相对于开仓均价，盈利/亏损的价位，可直接填入价格（按价格）或者多少个 Tick （按 Tick）；

**类型：**选 Limit，将以指定的下单价格下开仓单；选 Market，以 Market 单开仓，并支持设置

**开仓价差：**即下单价=对手价+/-价差，开仓价差默认设置为 10 个 Tick。

**交易所市价指令：**使用交易所的 Market 指令下单，需要上手/交易所都支持该指令；

**平仓价差：**以对手价为基准价，往有利于成交的方向+/-价差，买方向+价差，卖方向-价差，支持选择按价格或者 Tick 填入价差。

**数量：**总执行次数

### 触发条件

✧ 买方向：

当市场价格 $\geq$ （开仓）成交均价+止盈价差时，进行止盈；

或者当市场价格 $\leq$ （开仓）成交均价-止损价差时，进行止损。

✧ 卖方向：

当市场价格 $\leq$ （开仓）成交均价-止盈价差时，进行止盈；

或者当市场价格 $\geq$ （开仓）成交均价+止损价差时，进行止损。

- 按自定义价止盈止损(不开仓)：允许客户自行设置基准价。挂止盈止损单后不进行开仓，而是直接监控市场价格变动。当市场价格相对于基准价达到止盈/止损点后，自动单将触发下单。

### 参数名词解释

**基准价：**允许用户自行填写基准价格；

**止盈/止损：**相对于基准价，盈利/亏损的价位，可直接填入价格(按价格)或者多少个 Tick（按 Tick）；

**交易所市价指令：**使用交易所的 Market 指令下单，需要上手/交易所都支持该指令；

**平仓价差：**以对手价为基准价，往有利于成交的方向+/-价差，买方向+价差，卖方向-价差，支持选择按价格或者 Tick 填入价差；

**数量：**总执行次数

### 触发条件

✧ 买方向：

当市场价格 $\leq$ 基准价-止盈价差时，进行止盈；

或者当市场价格 $\geq$ 基准价+止损价差时，进行止损。

✧ 卖方向：

当市场价格 $\geq$ 基准价+止盈价差时，进行止盈；

或者当市场价格 $\leq$ 基准价-止损价差时，进行止损。

6.11 定时单

定时单是指在指定的时间段内，每隔一定时间，以指定的价格和手数去下单。

普通单策略单Stop单Gain Best单止盈止损单定时单TWAP

客户wuzh002\_吴志辉

方向买

合约AG1906-SH

开始GMT+8:002019-01-30-0:0:0

结束GMT+8:002019-01-31-0:0:0

开平自动

类型LIM

手数20

单次2

价格0

间隔0:0:0

投保投机

下单

- 切换下单区到定时单面板。
- 输入该单的相关数据。
- 点击 **下单**，发送订单。
- 自动单运行结束条件：
  - ✧ 时间到达设定的结束时间；
  - ✧ 下单总手数到达设定值。

参数名词解释

**手数：**输入下单总手数。

**单次：**输入每次下单手数

**开始、结束：**下单时间区间，该时间区间用北京时区表示。

**间隔：**下单间隔时间，每隔此时间后下单一次，下单间隔用时，分，秒表示

**查看详情：**可在下图定时单界面查看定时单详情。

定时单单历史查询详情

记录: 0/1

	撤单	详情	编号	客户	状态	品种	方向	总手数	单次数	价格	类型	开始时间	结束时间
1			SgK...	FL001	正在...	CU3...	买	10	1	945...	LIM	2021-08...	2021-08...

**单历史查询：**可查询一个月以内的定时单，查询时间间隔不能超过一周。

定时单单历史查询详情

客户: 所有 状态: 所有 今天 昨天 最近一周 自定义查询时间

开始: 2021-07-13 -0:0:0 结束: 2021-07-15 -23:59:59 查询

编号	详情	创建用户	客户	状态	品种	方向	总手数	单次数	价格	类型	开始时间	结束时间
----	----	------	----	----	----	----	-----	-----	----	----	------	------



## 6.12 TWAP 单

Time-Weighted Average Price，该自动单主要实现每隔指定的“下单时间间隔”，若上一张单已撤单或全成，则挂限价单出去；每隔指定的“撤单时间间隔”，就撤掉挂单。当达到设定的撤单条件后，自动单自动撤单。

- 切换下单区到 TWAP 面板；
- 输入相关数据；
- 点击下单，发送订单。

### 参数名词解释：

**手数：** 成交手数上限，当自动单的总成交手数达到该上限，自动单将停止运行，进行撤单；

**单次：** 每次下单最大手数；

\*注意：单次手数≤总手数

**价格：** 可选择最后成交价/市场买价（即买一档报价）/市场卖价（即卖一档报价）；

**价差：** 下单价格=价格+/-设置的价差。价差可以设置正数和负数。输入正数，则价格往有利于成交的方向加或者减价差后进行下单；输入负数则价格往不利于成交的方向加或者减价差后进行下单。可以选择按价格还是 Tick 填入价差；

- ✧ 系统默认值是按价格展示，需要设置为按 Tick 展示时，请到默认选项页面修改设置。



**\*注意：**如果下单价格超过涨跌停价，则使用涨跌停价下单。

**下单间隔：**请输入秒数，时间间隔从最后下单时间开始计算；

**撤单间隔：**请输入秒数，时间间隔从最后下单时间开始计算；

**\*注意：**撤单时间间隔 $\leq$ 下单时间间隔

**开始：**勾选时，可设置指定的开始时间；

不勾选时，代表立刻下单；

**结束：**勾选时，可设置指定的结束时间；

不勾选时，代表不限制结束时间；

**撤单上限：**勾选时，可设置指定的撤单次数上限，设置的撤单次数限制仅针对该笔自动单。

撤单次数达到该上限时，自动单停止运行，进行撤单。

不勾选时，代表撤单次数没有限制；

**限价：**设置指定的限制价格，市场价格需满足以下限制才会下单，否则不下单：

买方向的下单价格 $\leq$ 限制价格；

卖方向的下单价格 $\geq$ 限制价格。

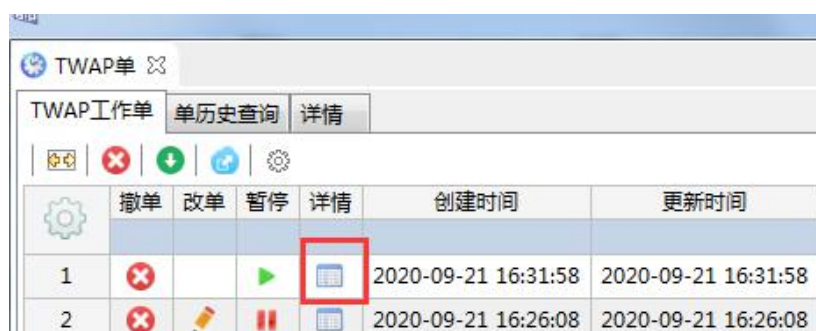
**自动单撤单条件：**满足以下任一条件，自动单停止运行，进行撤单。

- ✧ 撤单次数达到上限
- ✧ 结束时间达到
- ✧ 总成交手数达到

**注意：**1) 保险起见，收盘前会把挂单撤掉。

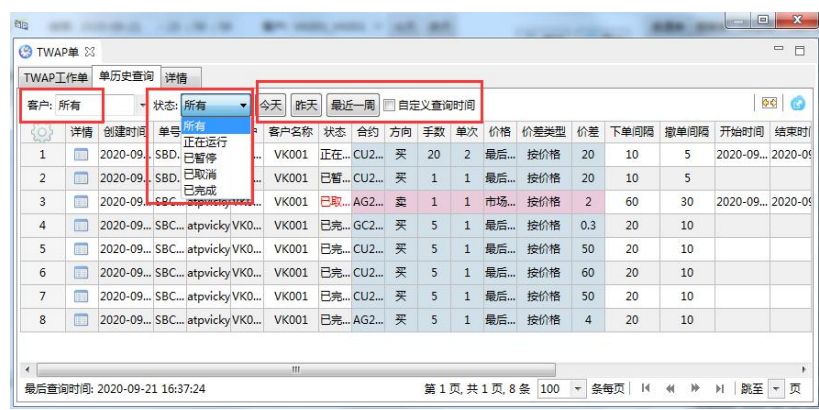
2) 下单时遇到收盘后再开盘的情况，不会重新计算间隔时间，如果满足条件开盘会直接挂单。

**查看详情：**可在下图 TWAP 单界面查看 TWAP 单详情。



	撤单	改单	暂停	详情	创建时间	更新时间
1	✖		▶	📅	2020-09-21 16:31:58	2020-09-21 16:31:58
2	✖	✏	⏸	📅	2020-09-21 16:26:08	2020-09-21 16:26:08

**单历史查询：**可查询一个月以内的 TWAP 单，查询时间间隔不能超过一周。



6.13 快速下单

快速下单是为了客户能够更简单、快速的建立限价单。



- 切换至快速下单界面。
- 选择需要下单的客户名、合约和方向。
- 选择下单价格类型（若选择指定价类型需设置定单的执行价格和手数）。
- 发送订单，点击 **下单**。

下单价格类型分为 **跟踪价**、**指定价** 和 **涨跌停价** 三种，用户可以通过点击类型名称完成类型间的切换。

**跟踪价：**选择之后，快速下单区中的价格和手数会与市场最新报价同步，实时自动更改。

**指定价：**客户可以更改快速下单区的价格和手数，与下单区功能类似。

**涨跌停价：**选择之后，快速下单区中的价格会根据该合约的昨日结算价和交易所规定的涨跌停幅度计算出来。

6.14.批量下单

批量下单提供一次发送多个限价单的功能，方便用户操作。

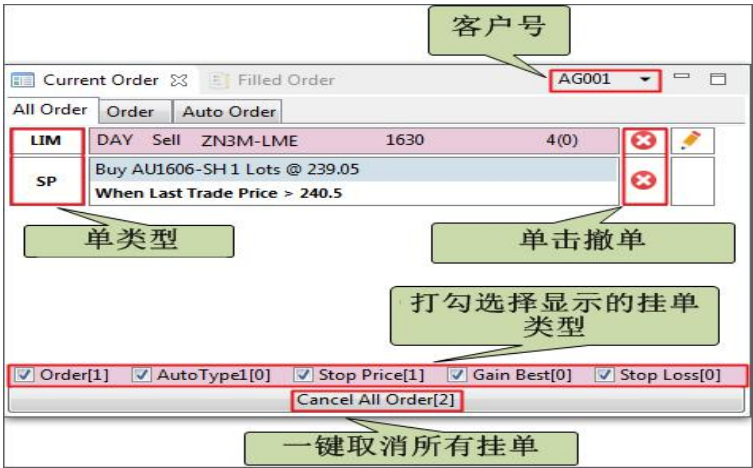


- 点击**批量下单** ( 批量下单 );
- 在表格中设置方向、合约、手数、价格、类型及有效时间，并勾选前面的复选框；
- 选择客户号,点击 **下单**按钮完成下单。

挂单区

7.1 挂单区展示

挂单区展示用户当前未完成的定单，分**普通单**、**自动单**、**所有单**三个页面。



7.2 普通单

- 查看：普通单和所有单页面都可查看；
- 修改：直接点击限价单手数、价格进行编辑，光标离开编辑区，自动弹出确认对话框，点击**确定**，或点击**所有单**中对应挂单右边的**修改**();
- 撤销：点击对应挂单右边的**删除**(), 弹出确认对话框，点击**确定**。

## 7.3 自动单







类型	查看	管理
策略单		点击  删除 点击  暂停 点击  修改
Stop 单		点击  删除 点击  修改
Gain Best 单		点击  删除
止盈止损单		点击  删除
定时单		点击  删除
TWAP 单		点击  删除 点击  暂停 点击  修改

## 7.4 所有挂单区

所有挂单区可以显示该用户所有账户（即**客户**）实时的挂单情况，并支持挂单信息的导出（Excel 格式文件）。点击**所有挂单**（）进入所有挂单区。

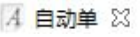


撤单	改单	暂停	创建时间	更新时间	客户	单号	自动单号	上手单号	类型	状态	条件	合约1	方向1	手数1	信息1	合约2	方
1				2021-08...	2021-08...	FL001_...	MS...		SgK5uKt	LIM	工作...	DAY	BRN...	买	1(0)	价格: ...	
2				2021-08...	2021-08...	FL001_...	AOS...			定时...	正在...		CU3...	买	1/10(0)	价格: ...	
3				2021-08...	2021-08...	FL001_...	AOS...			策略...	0/1[1]	A-B...	EG22...	卖	1(0)	价差: ...	EG22...

- **撤单列：** 点击可以进行撤单。
- **改单列：** 有标志的挂单可以进行改单，点击，在弹出框中修改数值即可。
- **暂停列：** 有标志的挂单可以暂停，暂停后出现，可进行改单，改完后点击重新运行。
- **客户列：** 显示账户号。
- **状态列：** 可查看自动单的执行次数。
- **条件列：** 普通单显示单有效期；策略单显示策略单公式。
- **合约信息区域：** 显示合约代码、方向、手数（以及成交状态）和单创立时需要的其他数值。
- **挂单信息区域：** 显示该挂单的挂单时间、最后运行时间和挂单 ID。
- **备注列：** 显示单子的备注信息。可修改备注，改完后按回车键生效。

## 自动单区

自动单区用于显示用户所有策略单的运行状态。

- 点击**自动单**（）进入自动单区。



编号	详情	创建用户	客户	策略	状态	品种	手数	价差	类型	最后运行	创建时间	备注
SgJloxL		atpeven	FL001	A-B > 20	0/1[1] 正在运行	A: 卖 EG2201-DC B: 买 EG2202-DC	A: 1 B: 1	A: 0 B: 0		2021-08-17 11:07:40	2021-08-17 11:03:31	S

- 点击放大镜标志（）可进入单详情界面。



自动单	单详情
策略单: (id = SgJloXL) 备注: S	
A: 卖 EG2201-DC [投机] [自动]	手数: 1      价差: 0      -
B: 买 EG2202-DC [投机] [自动]	手数: 1      价差: 0      -
策略: A-B > 20 保护机制: 不启用	数量: 1      已执行数量: 0      - 单次触发数量: 1
执行情况: 不拆单	
品种	执行手数      成交手数      最后执行手数
A: 卖 EG2201-DC	0      0      0
B: 买 EG2202-DC	0      0      0
成交列表:	
客户	方向      品种      手数      价格      时间      开平标志      投保标志
单状态:	
方向	品种      手数 (成交手数)      价格 (成交均价)      状态      开平标志      投保标志

- 策略单：显示该策略单 ID、备注信息、参数详情与成交均价及其代入策略公式后的运算结果；
- 执行情况：显示各合约执行手数、成交手数和最后执行手数；
- 成交列表：显示策略单各合约的成交详情；
- 单状态：显示策略单触发的下单状态：方向、品种、下单手数（成交手数）、下单价格（成交均价）成交状态。

## 成交单区

系统提供三种方式查看已成交单：明细、合并、按单成交单区，通过控制工具栏的下拉列表进行切换。



## 9.1 明细

- 对每笔在交易所完成的交易单独一个记录展示其买卖方向、合约代号、成交手数、成交价格，表格按照成交单发生时间先后排序。

## 9.2 按单

- 对同一下单同一方向完成的交易合并为一个记录展示其买卖方向、合约代号、成交手数、成交均价。

## 9.3 合并

- 对同一合约同一方向完成的交易合并为一个记录展示其买卖方向、合约代号、成交手数、成交均价。

例：假设用户针对同一客户发送了 4 个普通单：a 买入 10 手合约 A，价格不高于 1200；b 买入 5 手合约 B，价格不高于 1000，买入 4 手合约 A，价格不高于 1500；卖出 10 手合约 A，价格不低于 1000；

经过一段时间，该客户在交易所一共促成 6 笔交易，分别为：a 买入 3 手合约 A，价格为 1000；b 买入 2 手合约 A，价格为 750；c 卖出 2 手合约 A，价格为 900；d 买入 2 手合约 B，价格为 1200，e 买入 2 手合约 B，价格为 1400；f 买入 2 手合约 A，价格为 1400。

每笔成交方式查看，表格展示：

方向	手数	合约	价格
买	3	A	1000
买	2	A	750
卖	2	A	900
买	2	B	1200
买	2	B	1400
买	2	A	1400

按单合并方式查看，表格展示：

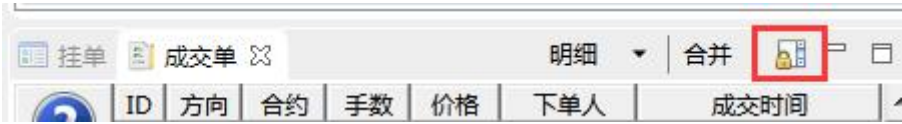
方向	手数	合约	价格
买	5	A	$(3*1000+2*750)/5=900$
卖	2	A	900
买	4	B	$(2*1200+2*1400)/4=1300$
买	2	A	1400

按合约合并方式查看，表格展示：

方向	手数	合约	价格
买	7	A	$(3*1000+2*750+2*1400)/7=1428.57$
卖	2	A	900
买	4	B	$(2*1200+2*1400)/4=1300$



9.4 锁定滚动条



挂单及成交单支持锁定滚动条。

**锁定状态：**当成交单实时刷新时，滚动条锁定在当前查看内容；

**未锁定状态：**当成交单实时刷新时，滚动条始终保持置顶。

持仓区

持仓区用于显示用户通过 ATP 交易和结算系统操作后的持仓情况。

品种	净持仓		今买		今卖		最后成交价	盈亏	持仓盈亏	平仓盈亏
JD1601-DC	2	3340	2	3340	-	-	-	-	-	-
JD1602-DC	-3	3214	-	-	3	3214	-	-	-	-
AL150930-LME	-10	1000	-	-	10	1000	1565	-141250	-141250	-
CU150930-LME	-10	55555	-	-	10	55555	4672	12720750	12720750	-
NI150930-LME	-	-	10	123	10	120.3	8450	-162	-	-162
PB160310-LME	5	2000	5	2000	-	-	1735.5	-33062.5	-33062.5	-
PB160317-LME	-5	2010	-	-	5	2010	1735.5	34312.5	34312.5	-
ZNI60526-LME	-8	1571.87	11	1595.73	19	1571.87	1751.5	-42487.5	-35926	-6561.5
PL1601-NYM	3	1000	3	1000	-	-	-	-	-	-
PL1603-NYM	-5	1100	-	-	5	1100	-	-	-	-
AG1601-SH	1	15	1	15	-	-	-	-	-	-
AG1603-SH	-5	3310	-	-	5	3310	3265	3375	3375	-
AU1506-SH	2	240.106	18	240.106	16	240.366	238.45	848	-3312	4160
AU1603-SH	-1	242.833	2	247.3	3	242.833	253.6	-19701	-10767	-8934
AU1606-SH	18	235.86	92	235.86	74	235.644	258.75	396036	412020	-15984

- 持仓信息显示各个合约的净持仓、成交均价及盈亏情况。
- 点击合并（**合并**）后，系统会将相同种类且相同交易所的产品持仓信息合并，并计算出买/卖价的加权均价以及各盈亏信息。

例：

合并前：

品种	净持仓		今买		今卖		最后成交价	盈亏	持仓盈亏	平仓盈亏
GC1603-CME	5	555	5	555	-	-	-	-	-	-
GC1604-CME	6	666	6	666	-	-	1228.2	337320	337320	-
AL160526-LME	-	-	3	1464	3	1460.5	1565.5	-262.5	-	-262.5
CU160526-LME	-	-	8	4364	8	4362	4667	-400	-	-400
ZNI60526-LME	-	-	10	1474.4	10	1468	1750	-1600	-	-1600
RB1602-NYM	-	-	10	1.01741	10	1.03685	-	-	-	-
RB1603-NYM	-	-	42	1.04278	42	1.03684	-	-	-	-
RB1604-NYM	-	-	45	1.24637	45	1.2423	1.301	-7692.3	-	-7692.3
RB1605-NYM	-	-	17	1.25662	17	1.25518	-	-	-	-
AG1603-SH	-8	3300.19	19	3256.58	27	3300.19	3258	17491.65	5062.8	12428.85
AU1506-SH	-	-	1	239.35	1	239.85	-	-	-	-
AU1606-SH	-	-	74	235.682	74	235.733	259.6	3774	-	3774

合并后：

品种	净持仓	今买	今卖	最后成交价	盈亏	持仓盈亏	平仓盈亏
GC-CME	11	615.55	11	615.55	-	-	-
AL-LME	-	-	3	1464	3	1460.5	1565.5
CU-LME	-	-	8	4364	8	4362	4666.5
ZN-LME	-	-	10	1474.4	10	1468	1750
RB-NYM	-	-	114	1.15281	114	1.1505	-
AG-SH	-8	3300.19	19	3256.58	27	3300.19	3258
AU-SH	-	-	75	235.731	75	235.788	-

➤ **一键强平:** 该操作将强制平掉所有持仓并撤销所有工作单, 强平完成前挂单将会被拒绝。

品种	净持仓	今买	今卖	最后成交价	盈亏	持仓盈亏	平仓盈亏
RU1703-SH	2	18215	-	-	-	-	-

➤ **连接状态、经纪行持仓,** 可以查看 ATP 到经纪行的连接是否正常以及经纪行的持仓。

✧ **连接状态**显示 ATP 到经纪行的连接是否在线;

经纪行	时间	状态
LocalExchange	2019-01-31 17:57:13	在线

✧ **经纪行持仓**显示系统通过经纪行接口查询到的账户持仓信息。

品种	净持仓	买持仓	卖持仓
DX1903-ICE	2	2	-

日志区

日志区展示用户对交易单的操作与来自服务器端的反馈日志, 详细地记录了每一交易单从开始到结束的完整周期。

注: 若单被拒绝, 原因将在此处显示, 系统页面底部**状态栏**区域中也会显示最新的一条错误信息。

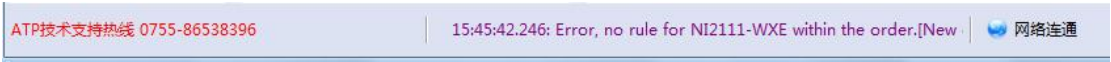
时间	内容
11:23:06	Order status, Sell ZN3M-LME 4(3) lots at price 2027.5. @ TS001
11:23:06	Order trade, Sell ZN3M-LME 1 lots at price 2027.5. @ TS001
11:22:59	Order filled, Buy CU1508-SH 2(2) lots at price 42790.0(42785.0). @ TS001
11:22:59	Order trade, Buy CU1508-SH 1 lots at price 42780.0. @ TS001
11:22:41	Order status, Buy CU1508-SH 2(1) lots at price 42790.0(42790.0). @ TS001
11:22:41	Order trade, Buy CU1508-SH 1 lots at price 42790.0. @ TS001

➤ 点击工具栏更多日志弹出日志对话框, 可按对象进行查看或者根据关键词进行过滤查看。



## 状态栏

状态栏从左到右的信息依次为通知信息、错误日志、网络状况。



- 通知信息：通知信息提示客户关于交易的重要信息。内容比较多时，鼠标经过会悬浮显示所有内容。
- 错误日志：日志区最后一条错误日志。
- 网络状况：网络状况反应当前网络连通性。

# 菜单

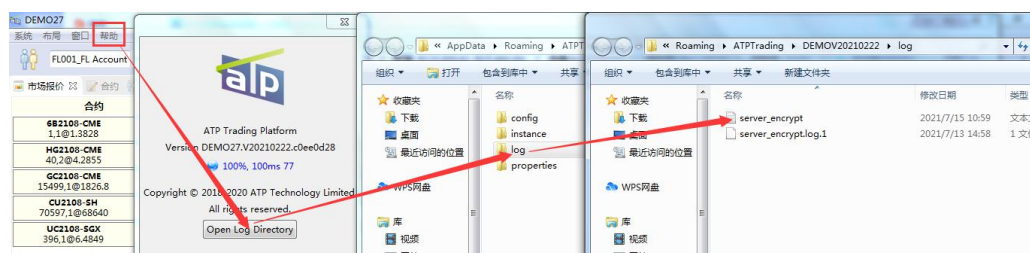
客户端有 **系统**，**布局**，**窗口**，**帮助** 4 个主菜单。

## 14.1 窗口

- 点击菜单区中的 **窗口** 可快速显示/隐藏主界面中各功能窗口。



## 14.2 帮助



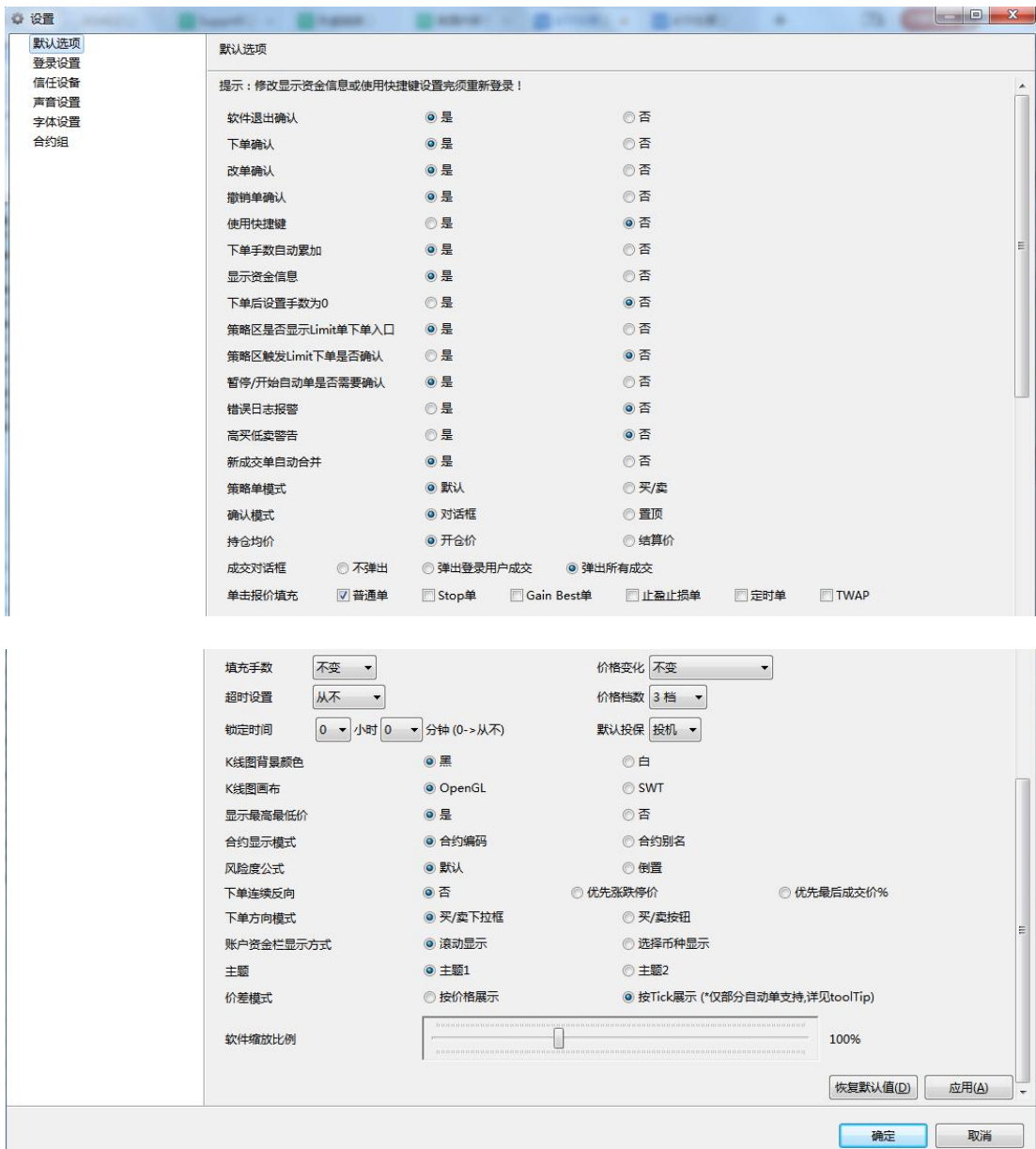
- 点击 **帮助>关于**，弹出框中会显示软件版本信息、网络连接状态、网络延迟以及版权声明；
- 点击 **Open Log Directory** 按照上图路径可提取客户端日志，必要时可将日志发送至 ATP Support Team 查看问题。

# 系统设置

点击菜单 **系统->设置**，进入 **设置** 页面。

## 15.1 默认选项

切换到 **默认选项** 页面如下图：





配置的具体内容如下表：

1	软件退出确认	是否在关闭软件时弹出确认关闭的窗口
2	下单确认	发送下单前是否弹出确认对话框
3	改单确认	修改挂单前是否弹出确认对话框
4	撤销单确认	撤销挂单前是否弹出确认对话框
5	使用快捷键	是否使用键盘快捷键
6	下单手数自动累加	创建普通单时，是否自动将低于及等于当前档的手数总和作为新下单的手数
7	显示资金信息	是否显示客户资金
8	下单后手设置手数为0	创建普通单后，是否将手数设定为0
9	策略区是否显示Limit单下单入口	是否在策略区显示Limit单的快速下单入口
10	策略区触发Limit下单是否确认	策略触发Limit下单时是否自动弹框提醒
11	暂停/开始自动单是否需要确认	暂停/开始自动单时是否自动弹框提醒
12	错误日志报警	是否有错误日志时弹出重要事件提醒（重要事件面板，显示错误日志、价格监控警报等重要事件）
13	高买低卖警告	是否在普通单出现高买低卖时发出警告
14	新成交单自动合并	是否设置为有新成交单时自动合并
15	策略单模式	选择策略单模式
16	确认模式	选择确认信息是以对话框方式弹出还是弹出在顶部位置
17	持仓均价	选择显示为开仓价还是结算价
18	成交对话框	选择不弹出/弹出登录用户成交/弹出所有成交
19	单击报价填充	选择单击报价后下单信息填充到哪种类型的单，可多选
20	填充报价后跳至	选择填充报价后跳至哪种类型的单，单选
21	填充手数	不固定：按照盘面手数自动填充 固定：手工输入固定填充的手数 留空：填充后手数为空，用户需自行输入 不变：手数输入或自动填充后不再变化，除非手工更改
22	价格变化	创建普通单，是否自行调整价格的尺度，买价加，卖价减
23	超时设置	界面没有任何操作时系统自动登出的超时时间
24	价格档数	最多可选20档
25	锁定时间	界面没有任何操作时系统锁定界面的锁定时间
26	默认投保	选择默认投机/套利/套保
27	K线图背景颜色	选择K线图的背景颜色



28	K线图画布	选择K线图画布类型
29	显示最高最低价	是否在报价区合约信息处显示合约的最高、最低价
30	合约显示模式	选择合约显示的模式
31	风险度公式	选择风险度公式，默认风险度=保证金/权益
32	下单连续反向	是否开启下单连续反向以及下单连续反向的类型；
33	下单方向模式	选择下普通单时下单方向的模式
34	账户资金栏显示方式	滚动显示：不同的币种在资金栏滚动显示； 选择币种显示：可选择某一币种固定显示在资金栏
35	主题	Win10操作系统出现按钮闪烁时，可选主题2解决
36	价差模式	选择按价格展示还是按Tick展示
37	软件缩放比例	根据不同的屏幕选择合适的软件尺寸

## 15.2 声音设置

➤ 声音设置主要应用于两个方面：

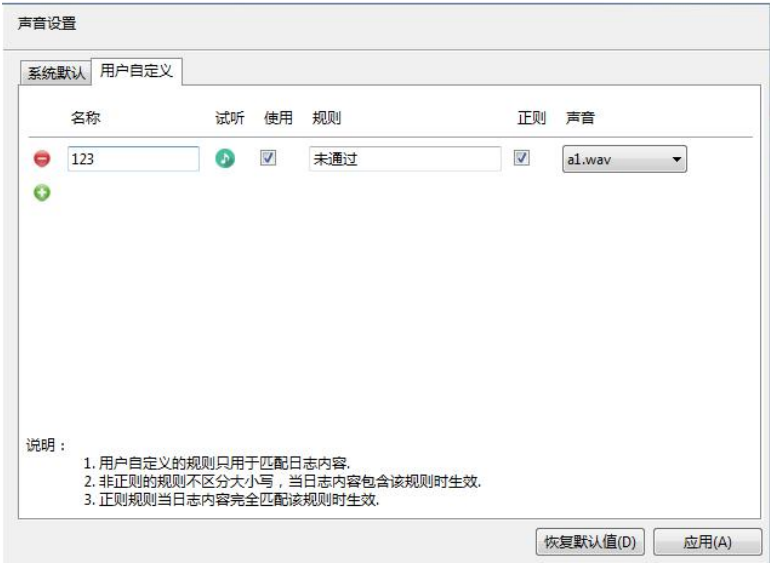
- ✧ 系统默认功能触发时的提示音设置；
- ✧ 用户自定义的字样出现在日志信息中时的提示音设置。

### 15.2.1 系统默认



- 在**使用**复选框中，选择是否打勾来启用或停用相应的提示音；
- 点击声音名称，选择所需提示音（可通过点击🔊试听）；
- 单击**应用**完成提示音修改。

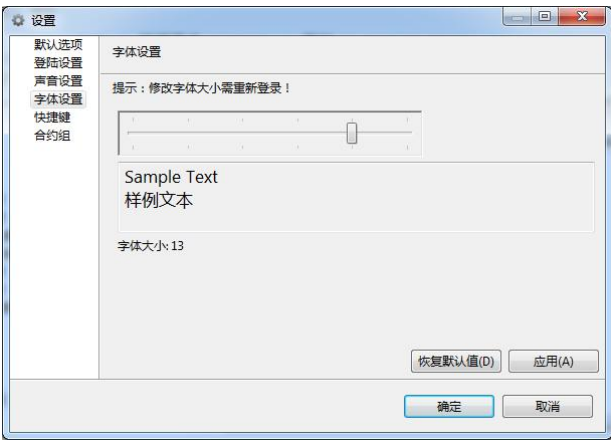
15.2.2 用户自定义



- 输入用户自定义规则的名称；
- 选择是否启用**正则**（非正则的规则不区分大小写，当日志内容包含该规则时生效；而正则规则需要当日志内容完全匹配该规则时才会生效）；
- 点击声音名称，选择所需提示音（可通过点击试听）；
- 在**使用**复选框中打勾，点击**应用**完成修改用户自定义。

命令	Binding	Category
切换布局	Ctrl+ Shift+ S	布局
删除布局	Ctrl+ Shift+ D	布局
新建布局	Ctrl+ Shift+ N	布局
重置布局	Ctrl+ Shift+ R	布局
客户中心	Ctrl+ Shift+ U	打开
打开设置	Ctrl+ Shift+ P	打开
更多日志	Ctrl+ Shift+ L	打开
到GainBest单	F4	聚焦
到Stop单	F3	聚焦
到历史成交单	F7	聚焦
到合约区	F5	聚焦
到所有单显示区	Alt+ A	聚焦
到报价区	F6	聚焦
到日志区	F8	聚焦
到普通单显示区	Alt+ L	聚焦
到普通单面板	F1	聚焦
到策略区	F9	聚焦
到策略单面板	F2	聚焦
到自动单显示区	Alt+ U	聚焦

15.3 字体设置



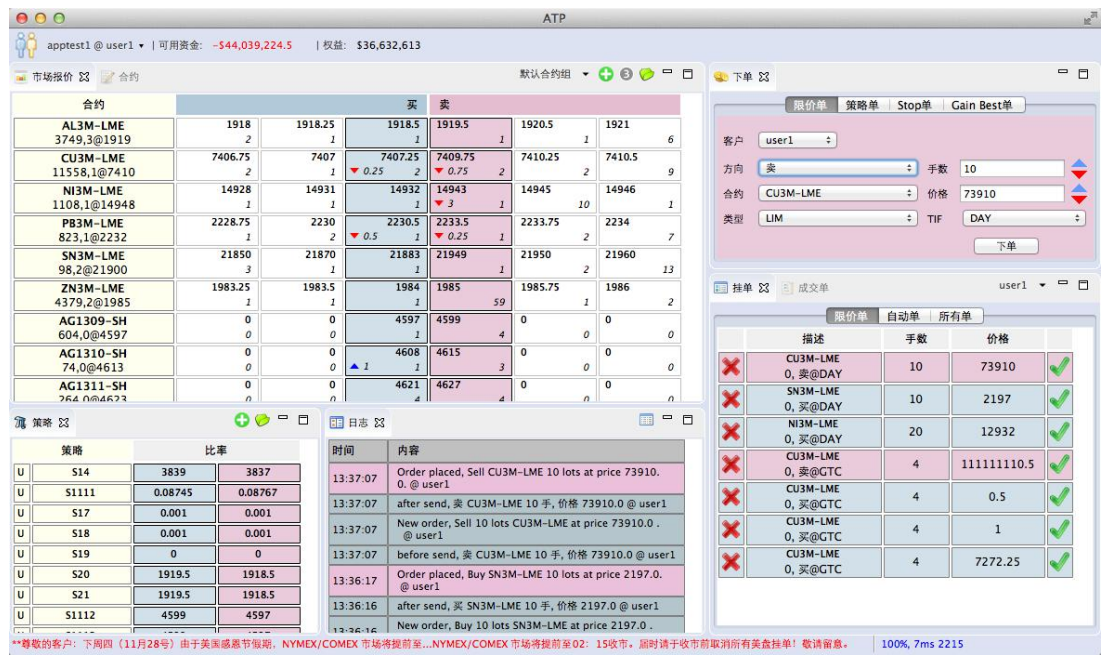
- 通过拉动方块调节字体大小；
- 点击**应用**；
- 重新登录系统后，修改生效。

界面布局

16.1 布局展示

系统支持用户根据自身需要对视图进行**组合、拆分、拉出、改变大小**从而形成新的界面布局，并可以对布局进行**新建、重置、切换、删除**操作。

布局例一：



布局例二：

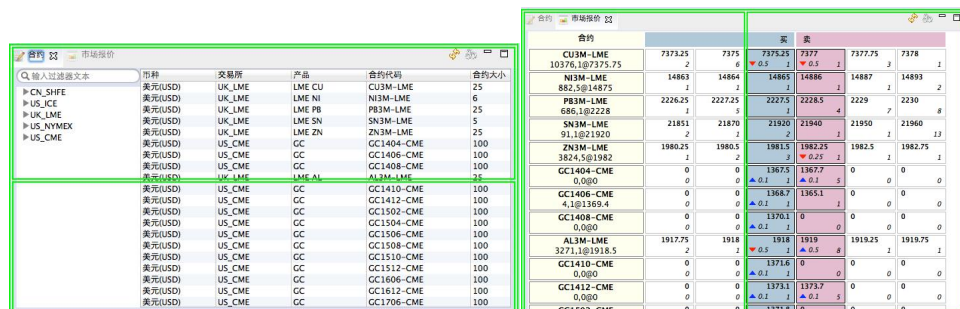


## 16.2 改变布局

- 组合：鼠标左键点击希望移动的视图名称，长按并拖动至希望与该视图进行组合的视图名称位置，放开，组合操作完成；



- 拆分：鼠标左键点击希望移动的视图名称，长按拖至理想位置放开，拆分操作完成。
  - ✧ 若希望将原有视图拆分有上下两个视图区，则长按并拖动至目标视图的下半部位置；
  - ✧ 若希望将原有视图拆分有左右两个视图区，则长按并拖动至目标视图的右半部位置。



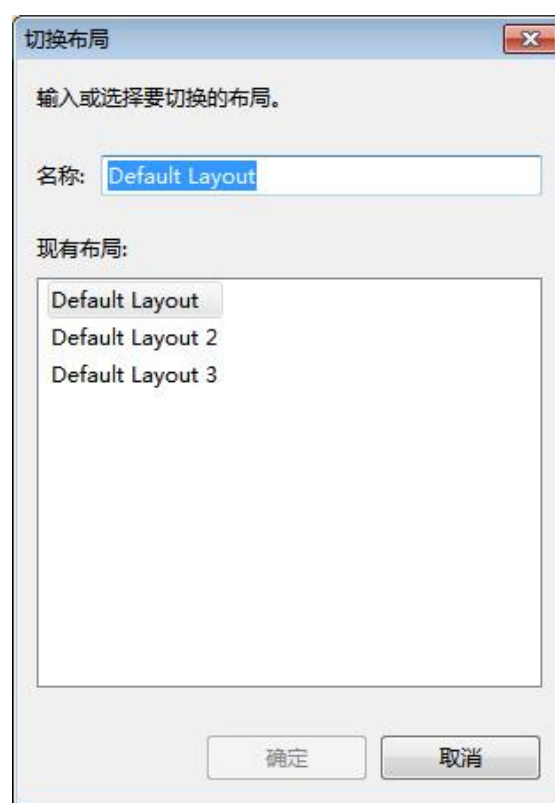
- 拉出：鼠标左键点击希望移动的视图名称，长按并拉动至主界面之外的区域，放开，此时可以看到视图已经作为一个独立的小窗口在界面之外，可更自由的放置并调整大小；
- 改变大小：将鼠标放置视图的边缘区域，直到出现调整大小的图标，此时长按鼠标左键，根据需要选择放大或者缩小。

## 16.3 界面管理

系统支持对用户自定义布局进行管理，可保存多个布局，删除自定义布局，在布局之间自由切换，重置恢复到当前布局的默认状态。

### 16.3.1 新建布局

- 按需求调整好布局；
- 点击菜单区 **布局->新建布局**，弹出对话框；
- 输入新布局名称或者选择已有布局进行覆盖；
- 点击 **确定**，完成操作。

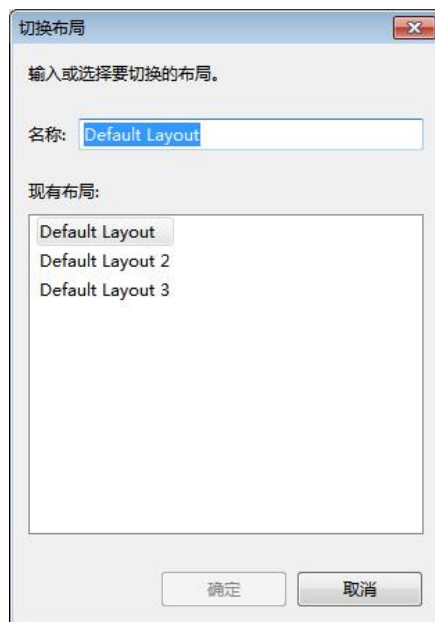


### 16.3.2 重置布局

- 点击菜单 **布局->重置布局**，弹出确认对话框；
- 点击 **确定**，完成操作。

### 16.3.3 切换布局

- 点击菜单 **布局->切换布局**，弹出布局列表；
- 选择希望切换的布局；
- 点击 **确定**，完成操作。



### 16.3.4 删除布局

- 点击菜单 **布局->删除布局**，弹出布局列表；（注：默认界面不能被删除）
- 选择希望删除的布局；
- 点击 **确定**，完成操作。

