

条件单操作手册

◆ 条件单报单权限设置

条件单报单权限分为：

- 1) 经纪公司允许同时下条件单的最大投资者数量
- 2) 每个投资者允许下条件单的最大数量
- 3) 投资者条件单交易权限

经纪公司允许同时下条件单的最大投资者数量和投资者允许下条件单的最大数量由运维部为经纪公司配置，投资者条件单交易权限由经纪公司在投资者交易权限中自行设置。

位置在：综合交易平台 Web 页面/账户管理/投资者权限管理/投资者交易权限管理



图 1.1

该 3 个参数都是下一交易日生效

如果投资者没有条件单交易权限，则会报错“投资者没有下单权限”

如果经纪公司为配置条件单参数，则会报错“经纪公司不支持条件单”

如果投资者报条件单数量超出单一投资者允许下条件单的最大数量，则会报错“投资者没有足够可用的条件单数量”

如果报条件单投资者数量超过经纪公司允许同时下条件单的最大投资者数量，则会报错“经纪公司没有足够可用的条件单数量”

◆ 条件单报单操作

条件单报单后并不会发送到交易所，只停留在综合交易平台，由交易引擎判断行情是否满足条件单的触发条件。当行情满足触发条件时，触发条件单，生成普通报单至交易所。条件单报单窗口与普通报单窗口基本相似，添加了触发条件和报单价格的输入设置。

图 2.1

投资者代码、合约代码、买卖、开平标记、数量、投机套保与原报单窗口输入完全一致。触发条件的设置，在三个参考价格：最新价、买 1 价、卖 1 价中选择一个，然后设置判断条件为>、>=、<、<=，在判断条件右边的输入框中填写触发价格。当行情中参考价格与触发价格满足判断条件时，触发条件单。

图 2.2

例如：参考价格选“最新价”，判断条件选“>=”，触发价格填写“20000”，则当行情中该合约的最新价满足>=20000时，条件单被触发，生成普通报单发送到交易所。条件单报单价格提供多种选择。

- 1) 选择限价单，在右边的输入框中填写指定价格，触发后生成的报单，以输入的指定价格为报单价格；
 - 2) 选择参考价格加浮动 ticks，则触发后生成的报单，以触发时行情中的参考价格加减浮动的 ticks 作为报单价格。参考价格有最新价、买 1 价、卖 1 价。ticks 即为合约的最小变动价位。浮动 ticks 包括 0ticks、1ticks、2ticks、3ticks。ticks 是上浮还是下浮由报单买卖方向决定，如果是买报单，则统一上浮 ticks；如果是买报单，则统一下浮 ticks。
- 例如：参考价格选择“买 1 价”，浮动 ticks 选择“+2T”，条件单为买方向，则触发时，报单价格为当时行情中该合约的买一价+2 点该合约的最小变动价位；如果条件单为卖方向，

则触发时，报单价格为当时行情中该合约的买一价-2点该合约的最小变动价位。

如果触发时参考价格不存在，则触发出错

3) 选择市价单，则条价单触发时，以市价单报送交易所

报单价	
<input type="radio"/> 限价单	
<input type="radio"/>	
最新价	+ 0T
买1价	+ 1T
卖1价	+ 2T
	+ 3T
<input checked="" type="radio"/> 市价单/任意价	

图 2.3

◆ 条件单触发

1) 如果条件单报单时，行情已满足触发条件，则立即触发条件单；

如：行情中，cu1005 最新价 58000，买一价 57800，卖一价 58020

条件单触发条件为“最新价 \geq 57990”，则报单时立即触发

2) 如果条件单报单时，行情不满足触发条件，则条件单处于尚未触发状态，等待行情满足触发条件后触发；

如：行情中，cu1005 最新价 58000，买一价 57800，卖一价 58020

条件单触发条件为“买一价 $>$ 57900”，则报单后，条件单处于“尚未触发”状态

3) 如果条件单报单时，行情中参考价格不存在，不会触发条件单，等待行情满足触发条件后触发；

如：行情中，cu1005 最新价 58000，买一价为空，没有买方，卖一价 58020

条件单触发条件为“买一价 $<$ 57930”，则报单后，条件单处于“尚未触发”状态

4) 如果条件单处于尚未触发状态，此时行情中参考价格因行情变动不存在了，不会触发条件单，等待行情满足触发条件后触发；

如：行情中，cu1005 从最新价 58000，买一价为 57960，没有买方，卖一价 58020

变动到 最新价 58000，买一价为 57960，没有买方，卖一价为空

条件单触发条件为“卖一价 \leq 57980”，则报单后，条件单处于“尚未触发”状态

5) 如果条件单报单时，行情已满足触发条件，但市场处于非交易时段，则待交易所切换到交易时段再触发条件单；

如：行情中，cu1005 最新价 58000，买一价 57800，卖一价 58020，上期所处于非交易状态

条件单触发条件为“最新价 \geq 57990”，原本可以立即触发，但由于上期所处于非交易状态，条件单不会被触发。当交易所由非交易切换到连续交易状态时，条件单会自动触发。

◆ 条件单查询

如图示例：

报单集成

报单

条件单

预埋单

投资者

7777

姓名

testinvestor

合约

cu1004

涨跌

60660 / 55990

买卖

3= 卖

开平

1=开

☐ 套保

数量

1

触发价

☐ 最新价

☒ 买1价

☐ 卖1价

>=

56000

报单价

☐ 限价单

57000

☒ 最新价

+11

☐ 市价单/任意价

报单

☒ 发送报单后保持窗口

图 3.1

条件单尚未触发时，报单的状态为“尚未触发”，报单交易编号为综合交易平台自行编排的以“TJBD”开头的一串字符，报单中触发条件字段填写触发参考价格和判断条件，触发价为触发价格，价格类型为触发后报单的价格，如果类型为限价，则在委托中填写用户输入的价格。

投资...	委托号	报单引用	合约	价格类型	买卖	委托价	委托手数	触发条件	触发价	委托状态	本地报单编号	系统号
7777	0 256		cu1004	最新价浮动上浮1个ticks	卖	0	1	买1价>=	56000	尚未触发	TJBD_0000019	TJBD_0000019

图 3.2

条件单触发后，报单状态为“已触发”，其余没有变化。触发后生成的普通报单，其相关报单中填写原条件单的报单编号（即“TJBDXXX”），该报单的前置编号、会话编号都为 0，报单引用与预埋单使用同一序列。

报单	委托号	报单引用	合约	价格类型	买卖	委托价	委托手数	触发条件	触发价	委托状态	本地报单编号	系统号	前置报单
7777	746 458		cu1004	限价	卖	58900	1	市价单	0	未成交...	1329	732	TJBD_0000019
7777	0 256		cu1004	最新价浮动上浮1个ticks	卖	0	1	买1价>=	56000	已触发	TJBD_0000019	TJBD_0000019	

图 3.3

◆ 条件单撤单

条件单尚未触发时可以正常撤单，撤单方法与普通报单一样，且无论是交易所处于非交易时段还是连续交易时段都可以撤条件单；但条件单触发后就无法再删除条件单了

◆ 条件单用户事件

记录用户事件的条件单操作有：

- 1) 条件单报单成功；
- 2) 条件单报单失败；（失败原因有：投资者没有条件单报单权限、投资者没有足够可用的条件单数量、经纪公司没有足够可用的条件单数量、经纪公司不支持条件单）
- 3) 条件单触发成功；
- 4) 条件单触发失败；（失败原因为触发时没有对应价格条件的价格；其余出错信息都是生成普通报单后，普通报单经过交易引擎校验返回的出错 ）
- 5) 触发后生成的普通报单按正常报单记录用户事件

◆ 清流重启对条件单的影响

清流重启后，所有尚未触发的条件单被全部清空，有条件单触发的普通报单的相关报单字段被清空，条件单从头编号