咏春大师 2 软件使用手册

V2.0 版

2021 年 11 月 16 日

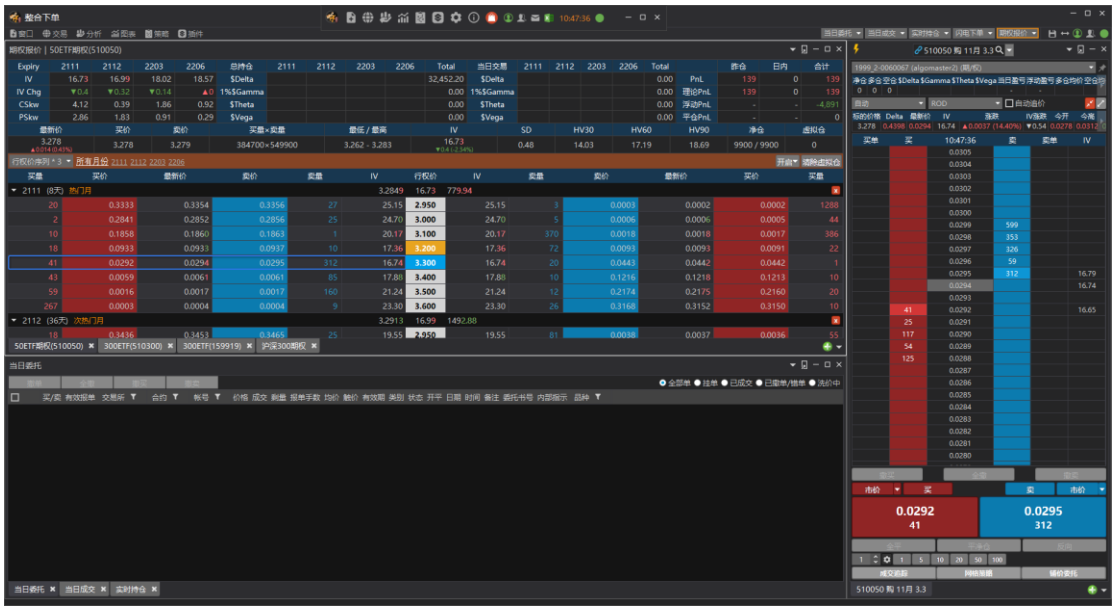
星策（上海）投资咨询有限公司

目录

咏春大师 2 软件使用手册 1
软件概述 4
开始使用咏春大师 2 软件 5
运行环境 5
下载安装 5
启动登入 5
迷你模式与标准模式 6
迷你模式与标准模式切换 6
关闭程序 7
功能菜单 8
窗口设置 10
交易功能 15
期权报价 15
期权矩阵 19
期货报价 22
证券报价 23
期权量能数据 24
分时表 25
闪电下单 26
下单盒 34
当日委托 39
当日成交 42
当日委托成交 43
实时持仓 43
实时资金 46
分析功能 47
期权总持仓分析 47
期权持仓监控 52
期权盈亏分析 53
期权投组盈亏分析 59
波动率图形分析 62
期权波动率曲面管理 64
图表功能 67
技术线图 67
期权参考标的走势图 69
平值隐含波动率走势图 70
跨式组合权利金走势图 71
跨式组合时间价值走势图 72
期权波动率走势 73
策略功能 76
策略管理 77
策略下单 78

策略监控 78
期权策略管理 79
插件功能 80
咏春 80
资金转账 126
交易总管 126
设置 127
交易连线 127
群组帐号 128
报价连线 134
通用设定 135
交易安全设定 136
拆单委托设定 137
交易偏好设定 139
市价转换设定 140
期权序列参数设定 140
自动追价设定 141
期权估算手续费设定 142
系统设定 143
帮助 144
加购权限 144

软件概述



咏春大师 2 软件是一款专业期权交易晋级工具，为期权交易者提供更专业的期权波动率及盈亏分析、更智能的期权闪电交易功能、更稳定快速的内核处理速度、更优化的操作动线及 UI 视觉，专为期权交易者而来。

特色功能：

- 期权盈亏分析

  结合现有持仓及虚拟持仓，分析不同维度的时间和波动率变化，沙盘推演未来的各种损益情境，实时预判全局风险。

- 期权波动率分析

  实时监控各月份波动率曲线动态,掌控不同行权价间波动率套利机会,到期日及行权价的偏度分析，大幅提升交易者对波动率交易的敏感度。

- 期权波动率走势

  结合即时日内 VIX 波动率指数走势,及 Vol skew 的偏斜程度,观察分析市场波动率交易机会,进而协助使用者构建波动率套利,波动率均值回归等相关交易策略，晋升专业期权交易必备。

- 期权矩阵下单

  搭配买卖价盘口数据、Greeks、波动率，快捷期权批量下单，波动率策略、各式期权价差、转仓等交易皆能一键搞定。

开始使用咏春大师 2 软件

运行环境

硬件建议规格：Intel Core i5 四核 CPU，内存 8G 以上。

操作系统支持：Windows 7 （Service Pack 1）； Windows 10。

系统类型：64 位操作系统

下载安装

在策略星官网 https://www.algostars.com.cn/index.html，下载最新版本咏春大师 2 软件安装包，以管理员身份运行咏春大师 2 软件安装包，按提示进行安装即可。

注：咏春大师 2 软件安装包内含软件运行所需的.Net Framework 4.6 和 Microsoft Visual C++2010-2017 可转发套件安装包，在安装过程中部分操作系统(如 win7)会自动重启电脑。

启动登入

咏春大师 2 软件是 Client/Server 架构的系统，咏春大师 2 软件客户端如下

- AlgoMaster.exe
  交易主程式，利用这个程序登入交易系统进行交易，开启时需使用管理员身份运行。

- 主程式开启后，会看到如下的登入画面：

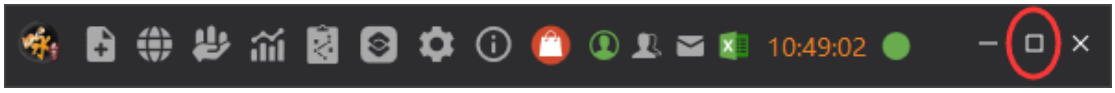
- 提供注册新会员功能，可获得 30 天免费试用！
- 填入手机号或会员账号、密码后，按下登录按钮即可登入交易系统。
- 点击下方的“选择其他登入模式”，可切换到会员账号登录

迷你模式与标准模式

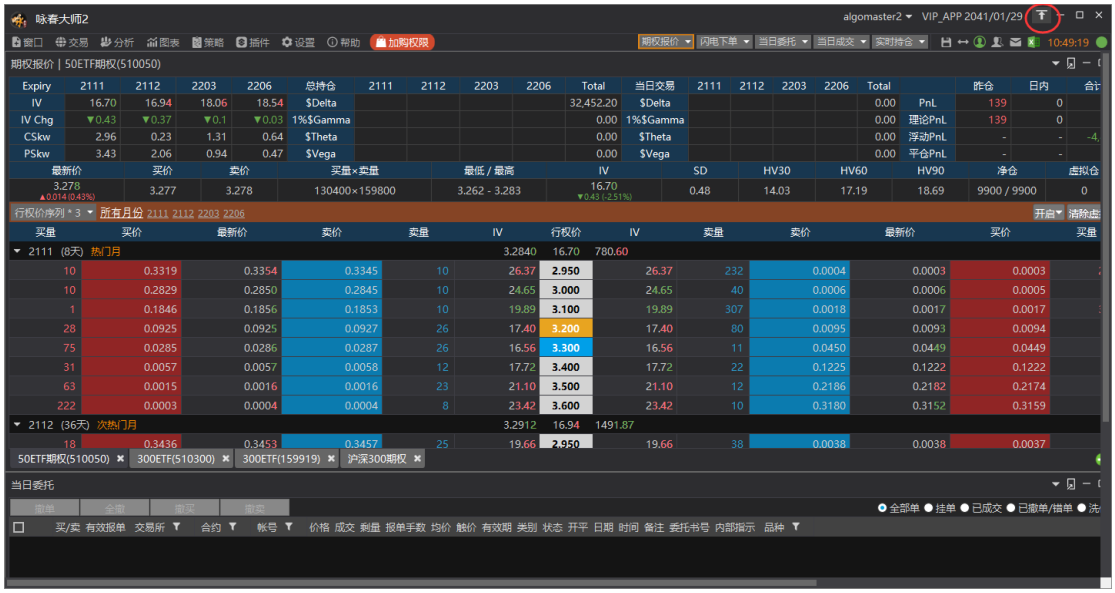
完成登录后，进入系统，预设为迷你模式。
迷你模式下，在屏幕顶部会显示工具栏。

迷你模式与标准模式切换

在迷你模式下，通过顶部工具栏的放大按钮，可以切换到标准模式的主窗口。

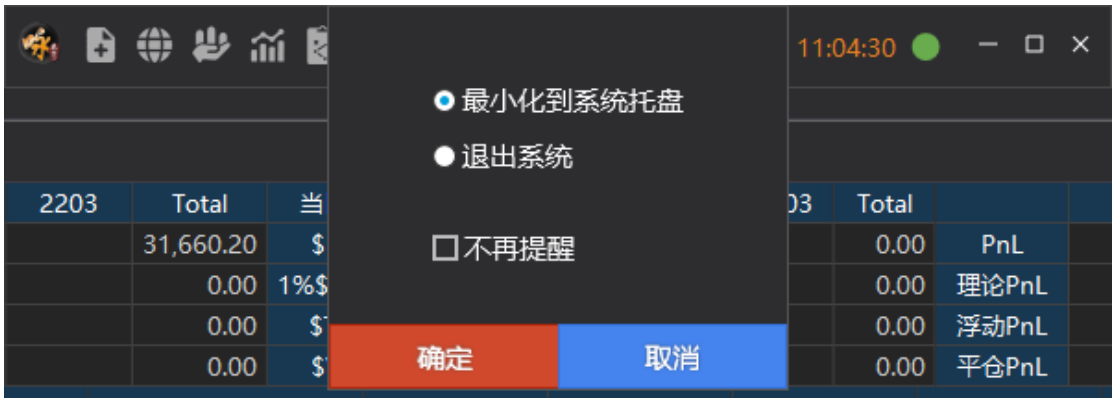


在标准模式下，通过主窗口的按钮，可以切换到迷你模式的工具栏。



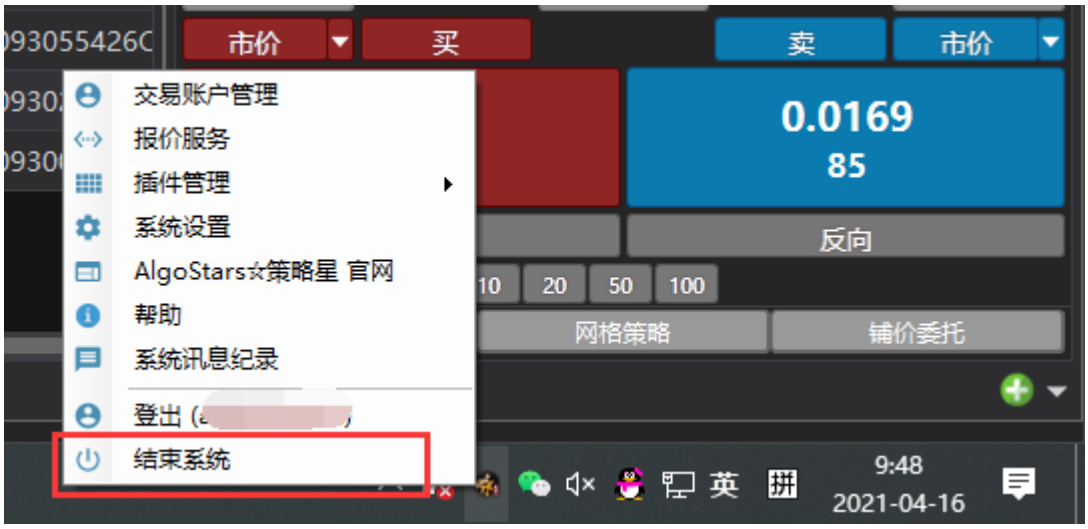
关闭程序

迷你模式下，通过工具栏关闭按钮，可选择最小化到系统托盘，或者退出系统。



标准模式下，通过主窗口的关闭按钮，可选择最小化到系统托盘，或者退出系统。

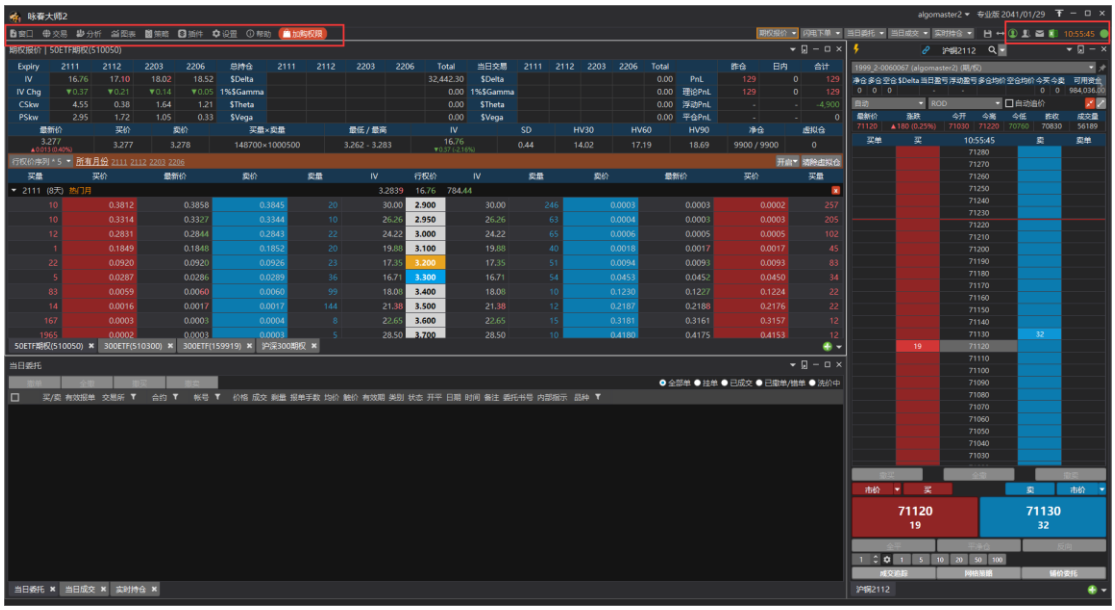
当选择最小化到系统托盘，可通过桌面右下角任务栏，图标右键菜单结束系统。



功能菜单

在迷你模式中，顶部工具栏提供窗口、交易、分析、图表、策略、插件、设置、帮助、交易连线、系统讯息记录、Excel 实时数据传输、连线灯号等功能菜单按钮。

在标准模式中，主窗口的上方菜单栏提供窗口、交易、分析、图表、策略、插件、设置、帮助、交易连线、系统讯息记录、Excel 实时数据传输、连线灯号等功能菜单。

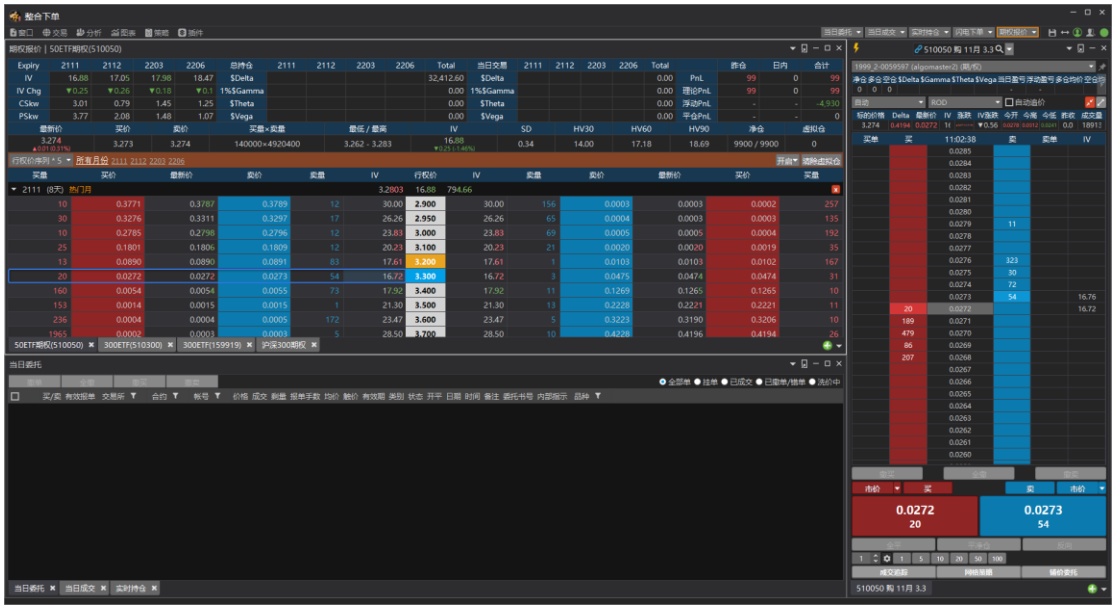


- 窗口：
  - 提供四个预设窗口：整合下单、分析、期权波动率走势、期货下单。
  - 使用新增、开启 保存所有窗口选单可管理自定窗口，可打开“近期使用”的窗口。
- 交易：提供期权报价、期权矩阵、期货报价、证券报价、期权量能数据、分时表等行情数据功能；提供闪电下单、下单盒、当日委托、当日成交、当日委托成交、实时持仓、实时资金等下单回报与账务功能。
- 分析：提供期权总持仓分析、期权持仓监控、期权盈亏分析、期权投组盈亏分析、波动率图形分析、期权波动率曲面管理功能
- 图表：提供技术线图、期权参考标的走势图、平值隐含波动率走势图、跨式组合权利金走势图、跨式组合时间价值走势图、期权波动率走势功能
- **(*此为加值功能)**策略：提供策略管理、策略下单、策略监控、期权策略管理功能
- 插件：提供 咏春、交易总管、资金转账 插件功能
- 设置：提供通用设定、交易偏好设定、市价转换设定、拆单委托设定、交易安全设定、期权序列参数设定、自动追价设定、期权估算手续费设定、系统设定选单。
- 帮助：
  - 提供使用手册、官网与学院捷径；
  - “导出日志”将必要日志存在桌面；
  - “帮助”打开查看当前客户端版本信息，相关网站。
- 加购权限：进入网页了解或购买软件加值功能
- 交易连线：
  - 显示当前交易连线状态：灰色表示尚无交易账号登录；绿色表示连线正常；红色表示连线异常；黄色表示交易登入中。
  - 点击开启交易连线设置，可登入、登出交易账号，或者绑定资金账号。
- **(*此为加值功能)**群组账号：提供群组账号设定功能，将多个交易账号加入群组，群组内账号可同时下单同种商品。
- 系统讯息记录：点击打开系统讯息记录
- ExcelRTD 实时数据传输：点击可关闭或启动 ExcelRTD 实时数据传输，在使用 ExcelRTD 功能时启动，确保 RTD 行情数据实时传输。

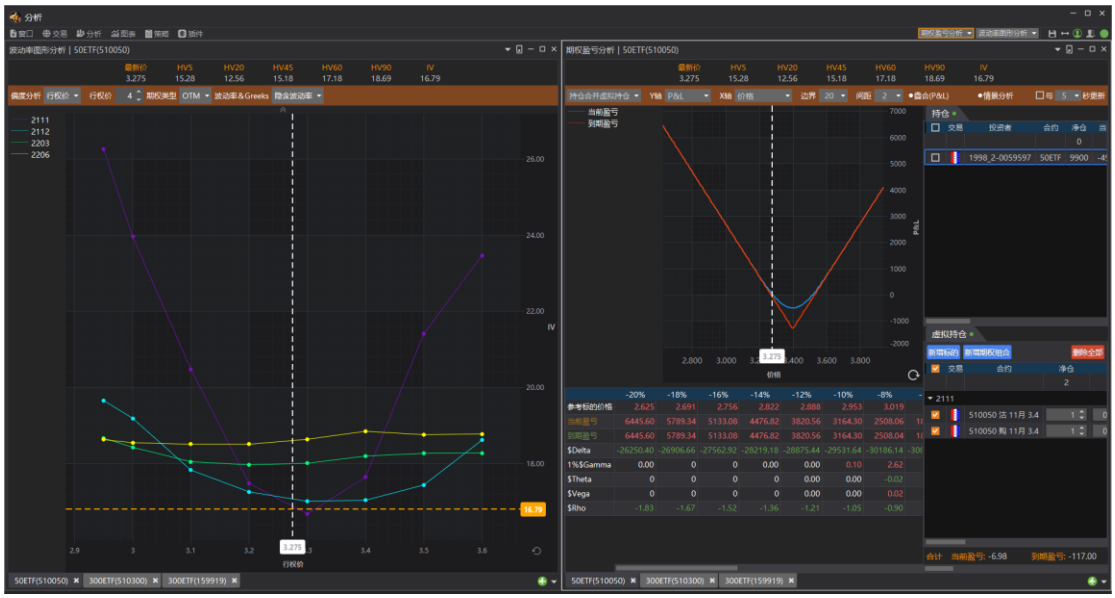
- 系统时间：显示行情服务器时间
- 行情连线：显示当前行情连线状态：绿色表示连线正常；红色表示连线异常；黄色表示连线中或部分连线异常。

窗口设置

- 预设窗口：在窗口菜单中，提供四个预设的窗口，分别是
  - 整合下单：提供期权报价、闪电下单、当日委托成交回报、实时持仓功能

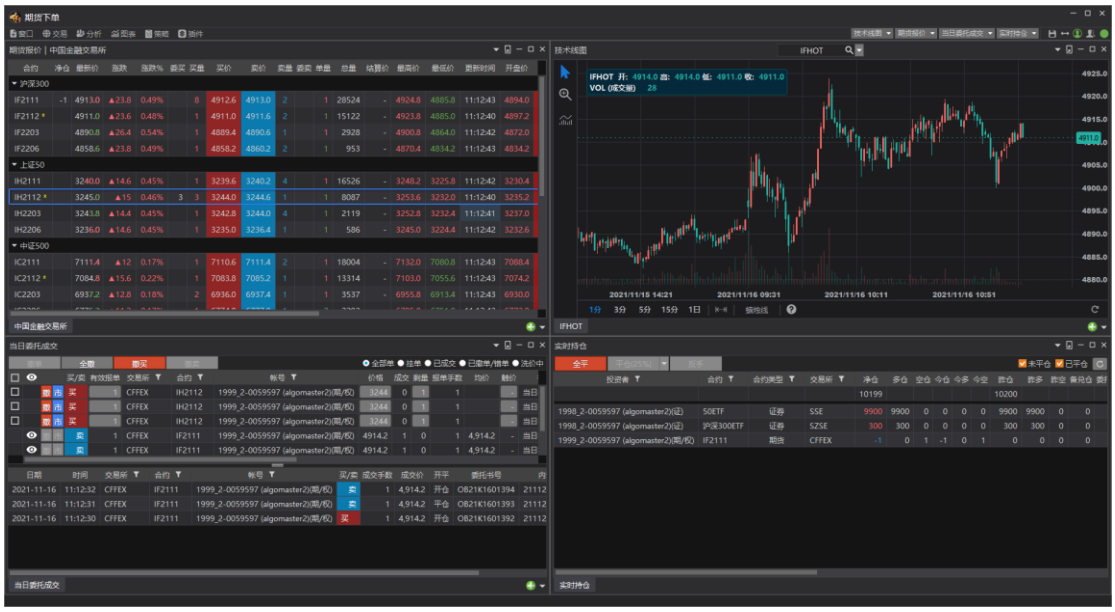


  - 分析：提供波动率图形分析、期权盈亏分析功能

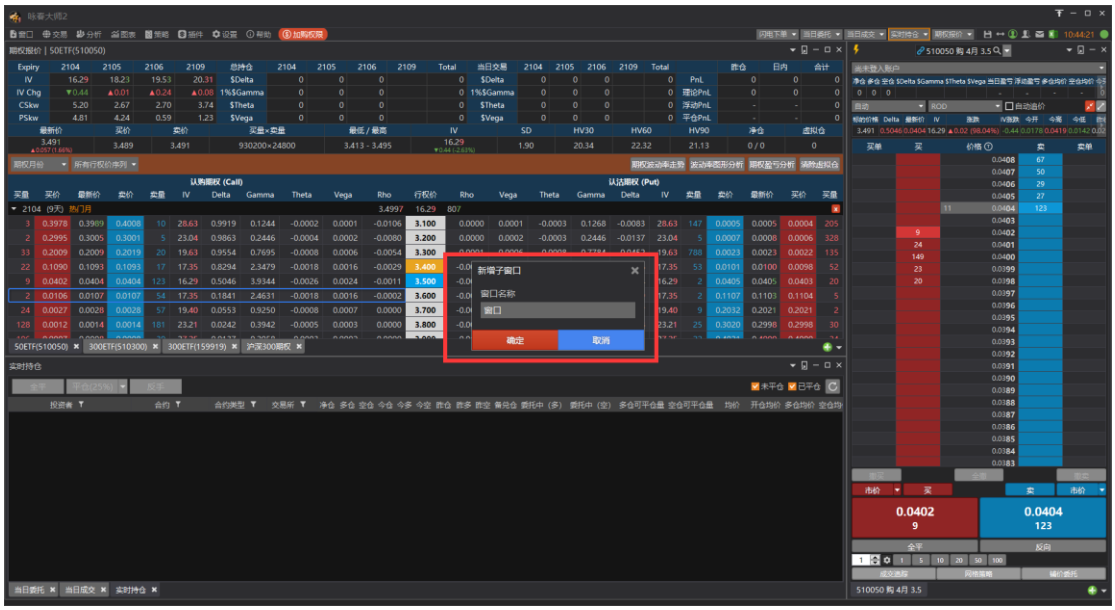


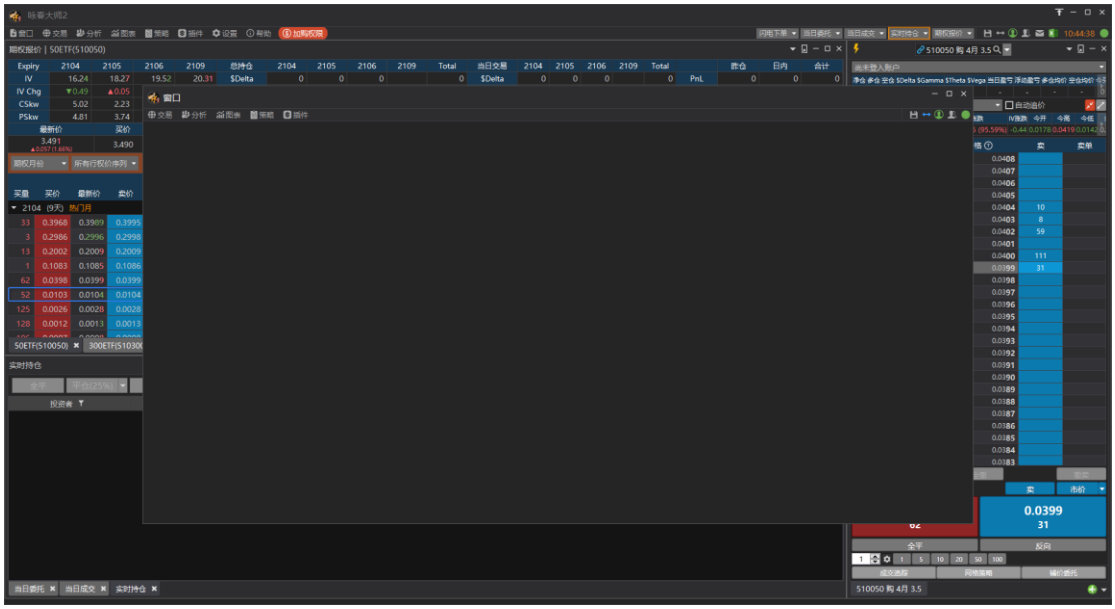
  - 期权波动率走势：提供期权各月份的波动率走势、CSkw、PSkw 走势数据。

- 期货下单：期货报价、K 线图、当日委托成交、实时持仓功能。



- 管理窗口：
  - 新增窗口：
    - 从“窗口”菜单中点击“新增”，输入窗口名称，然后按确定即可打开一个空白的子窗口。



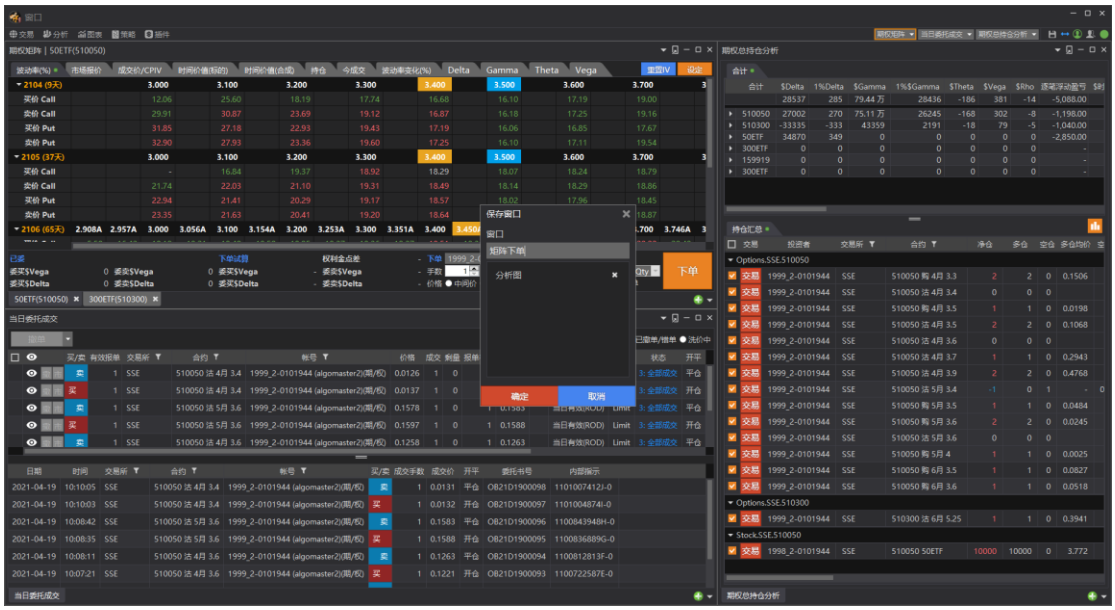


◆ 在新窗口中开启功能，自定窗口内功能布局。

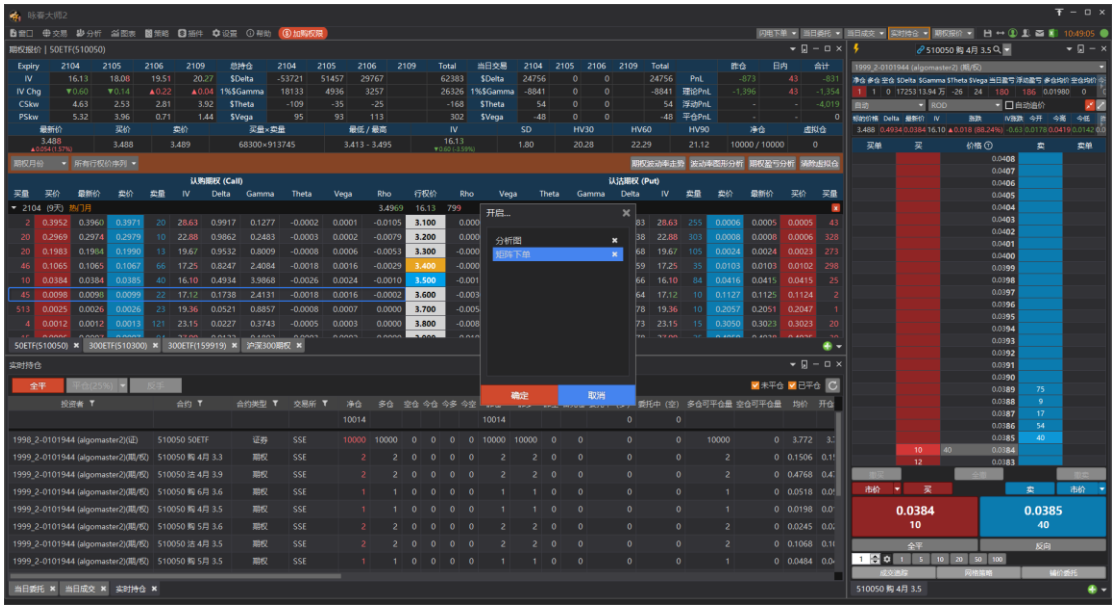
■ 保存窗口&保存所有窗口

◆ 设定好窗口功能之后，点击窗口右上角的保存按钮，或者“窗口->保存窗口、保存所有窗口”，输入自定窗口名称，按确定保存。

◆ 已保存的窗口会出现在”开启...”子窗口列表中。

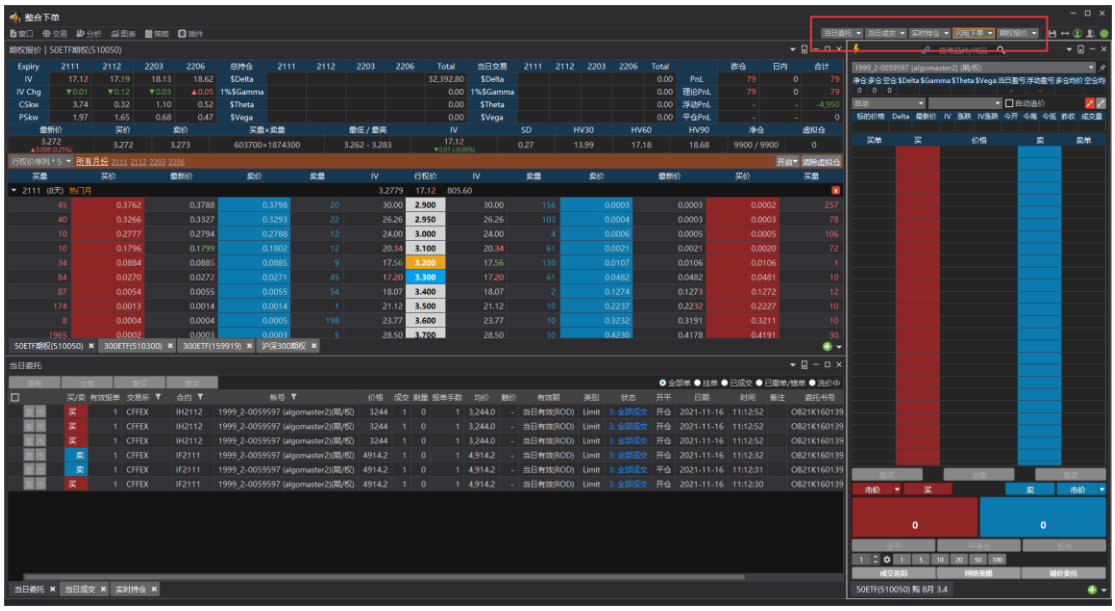


- 开启...:
  - 在“窗口”菜单中点击“开启...”打开自定义的子窗口列表，选择要开启的窗口名称，按确定即可开启子窗口。



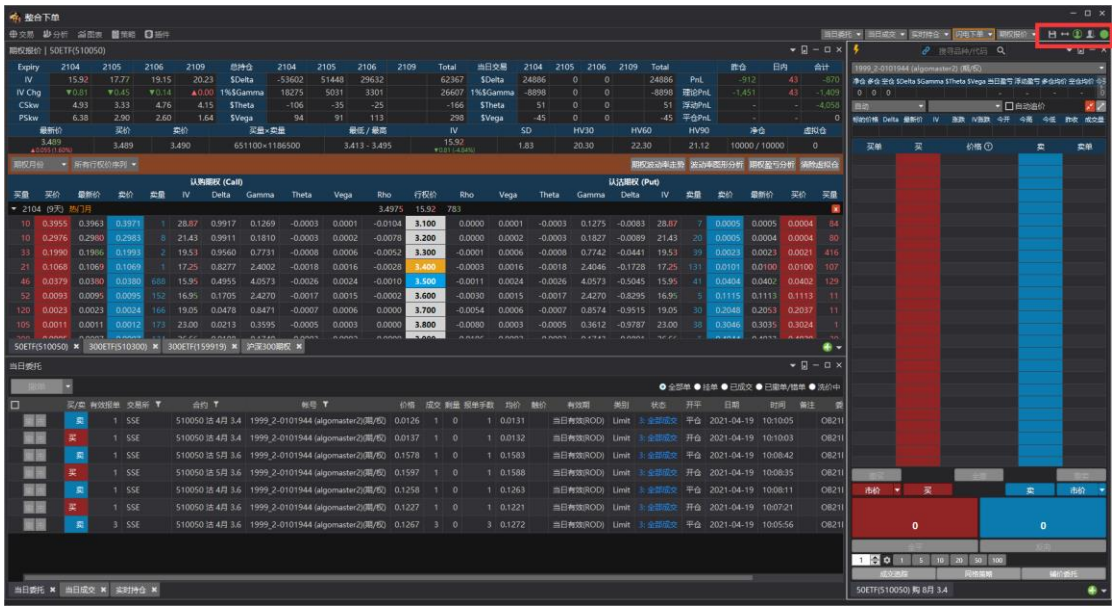
- 恢复预设
  - 将 4 个预设窗口恢复到出厂状态。
- 近期使用
  - 显示近期使用过的窗口列表，可以点击列表名称快速开启
- 窗口排列
  - 可以将窗口中的视图功能快速排列，可设定
    - 排列全部
    - 水平排列
    - 垂直排列
    - 层叠排列

- 功能页签



  - 在窗口中打开功能视图后，在右上角形成对应的页签菜单，点击页签菜单可以快速切换功能。

- 其他图标按钮

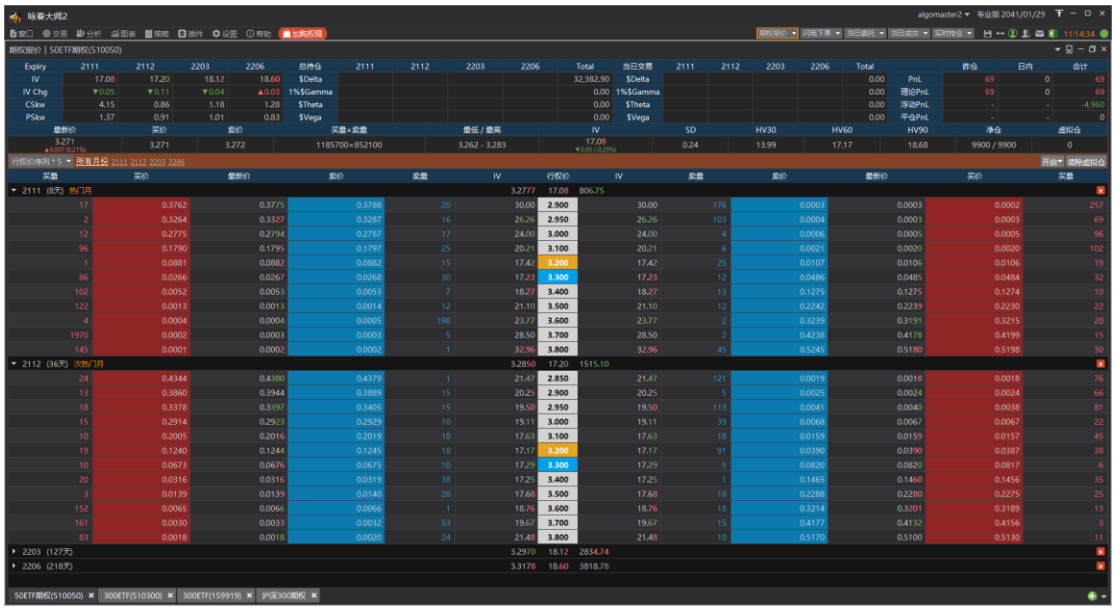


- 保存窗口
  - 点击保存窗口
- 自动缩放
  - 点击开启自动缩放，则调整窗口大小时，窗口内功能视图随着窗口缩放。
- 交易连线
  - 显示交易连线状态，点击打开交易连线设置
- 群组账号:
  - 点击打开群组账号设置。
- 连线灯号
  - 显示当前交易连线、行情连线、讯息连线状态灯，绿色表示连线正常，红色表示连线异常。

交易功能

期权报价

期权报价功能提供上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融交易所的期权品种报价功能。



- 期权损益及 Greeks 损益分析
  - 提供期权各月份的 IV、IV 涨跌、CSkew、PSkew 报价
  - 提供期权各月份(以及合计)总持仓 Greeks 损益：$Delta、1%$Gamma、$Theta、$Vega。
  - 提供期权各月份(以及合计)当日交易 Greeks 损益：$Delta、1%$Gamma、$Theta、$Vega。
  - 提供期权昨仓、日内、以及合计的盈亏、理论盈亏、浮动盈亏、平仓盈亏。
- 标的报价
  - 提供期权标的合约的最新价、买价、卖价、买量╳卖量、最高/最低报价。
  - 提供 IV、SD、HV30、HV60、HV90，即波动率，标准差，以及过去 30、60、90 天的历史波动率平均值。
  - 净仓：显示当前资金账号的净仓数量
  - 虚拟仓：设置标的虚拟仓数量
- 控制列
  - 设定行权价序列、切换期权月份
  - 开启：期权波动率走势、波动率图形分析、期权盈亏分析，开启对应功能。
  - 清除虚拟仓：清除期权合约以及标的合约的虚拟仓栏位设置
- T 字报价
  - T 字报价中，报价可按照期权月份收起/展开显示
    每个期权月份合约表头显示合约到期剩余天数，热门月/次热门月的期权月份显示对应标签，表头提供关闭按钮，点击可以移除该月份显示。
  - 在期权报价中，提供基本的报价栏位：
    买量、买价、最新价、卖价、卖量、涨跌、涨跌幅、现量、成交量、结算价、持仓量、更新时间、昨结算、今开盘、最高价、最低价、昨收盘、昨量、涨停价、跌停价、昨持仓量、持仓量变动、合约编码、标志码、到期日、报价状态中间价。
  - 在期权报价中，提供风险参数栏位：
    IV、Delta、Gamma、Theta、Vega、Rho、理论价、时间价值、时间价值(标的)、

时间价值(合成)、内在价值、BIV、SIV、昨结 IV、昨收 IV、IV 涨跌、IV 涨跌幅、杠杆率、实质杠杆、、溢价率、到期盈亏两平概率、裸卖报酬率、CIV/PIV、MIV、Charm、Vanna、Vomma、Speed、Zomma。

- 净仓、委买、委卖

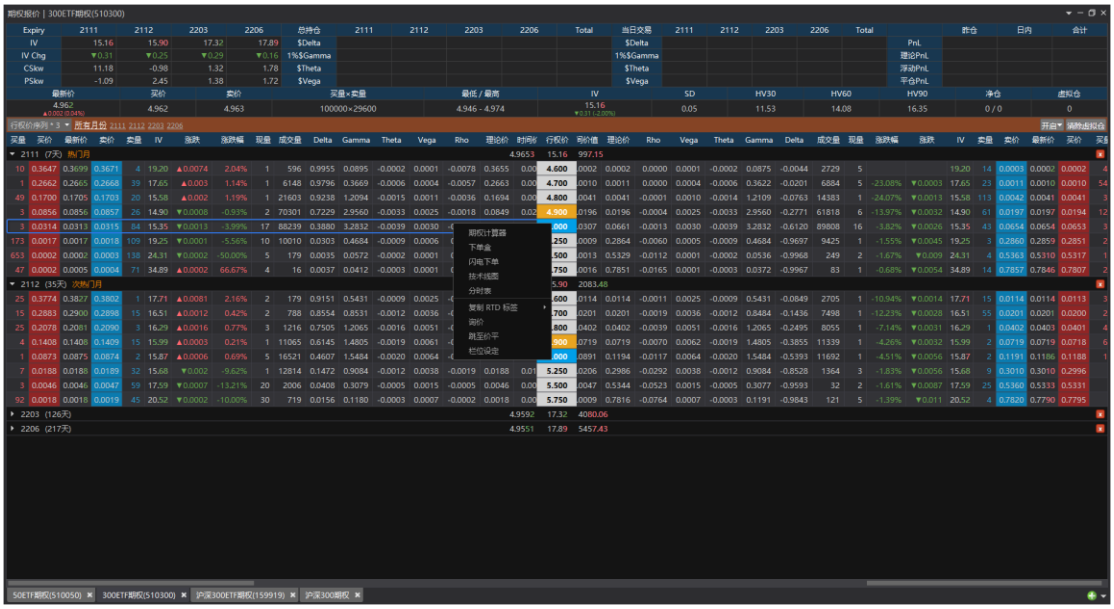
  在期权报价中，提供净仓、委买、委卖栏位，显示已登入的交易账号信息：合约的净仓数量，委托中的买单数量和委托中的卖单数量。

- 报价打开下单工具

  通过点击报价买价、买量、卖价、卖量栏位可打开下单盒或闪电下单

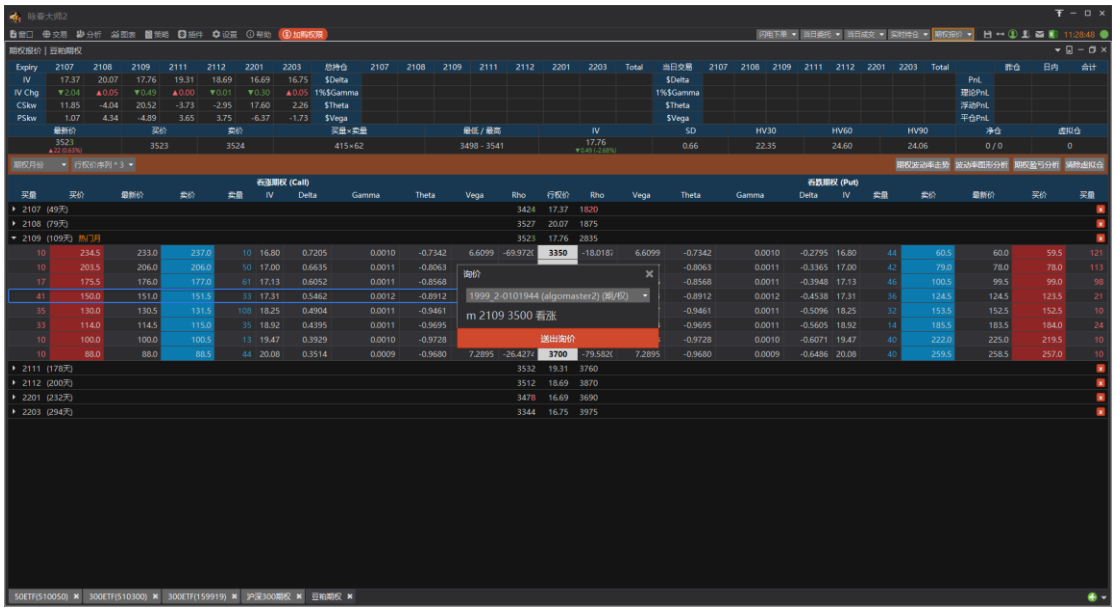
- 右键菜单

  在期权报价中，右击鼠标出现以下菜单：

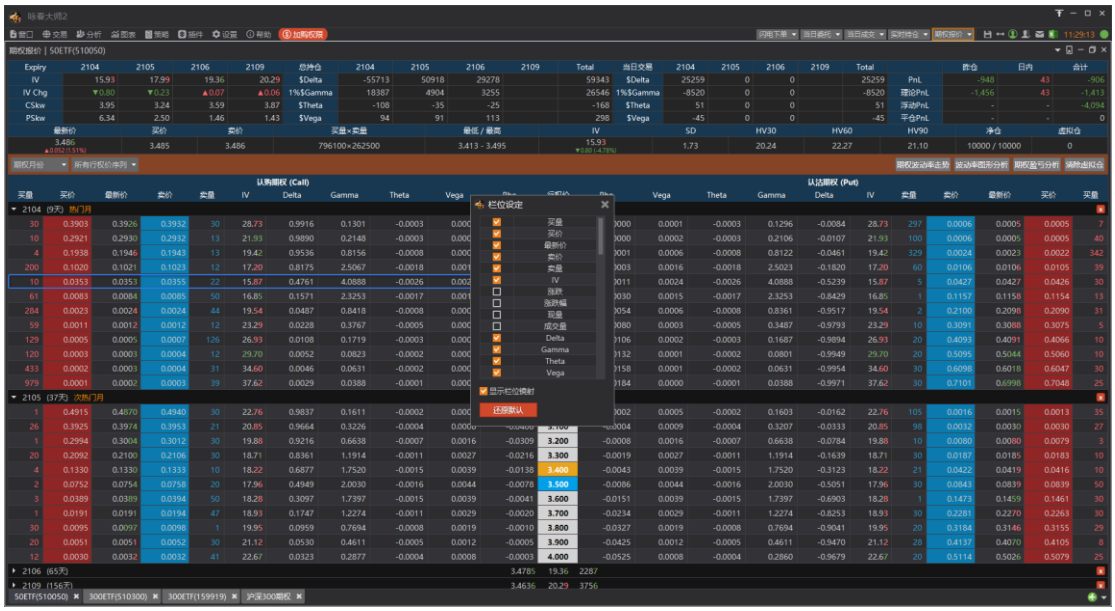


- 开启功能：期权计算器、下单盒、闪电下单、分时表、技术线图
- 复制 RTD 标签：可将报价的 RTD 标签复制到 excel 中。
- 询价

  商品期权对买价卖价有缺失或买卖价间隔过大的合约可送出询价

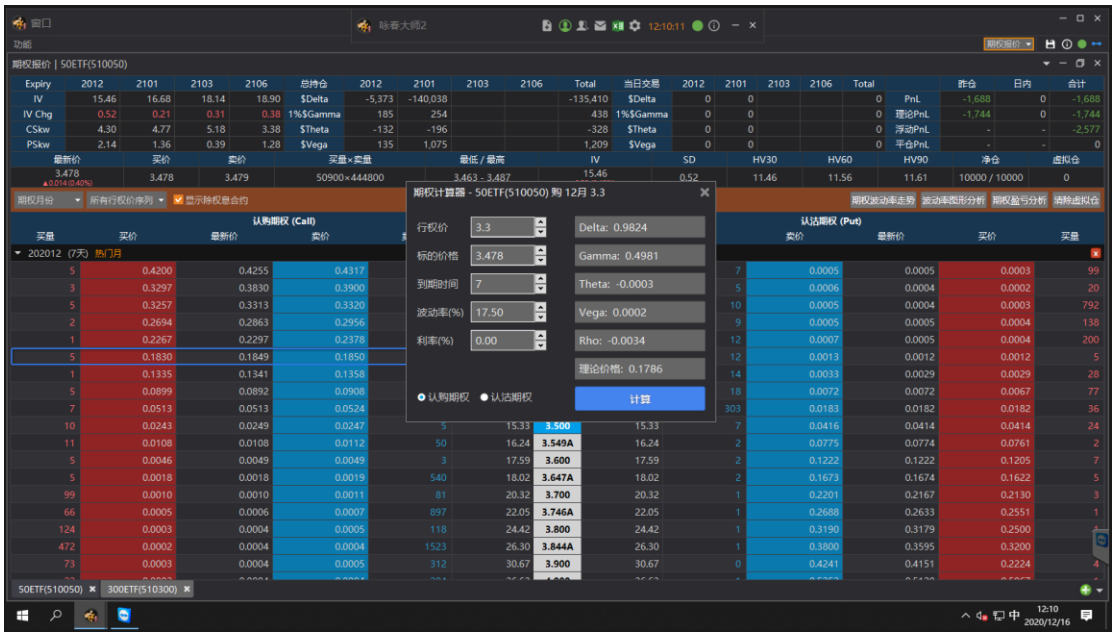


- 跳至价平：让价平位置居中显示。在行权价序列上双击鼠标也有同样的效果。
- 栏位设定：勾选要显示的报价栏位，可设定 T 字报价是否显示栏位镜像。



- 设置虚拟仓
  - 在标的报价、T 字报价中，提供“虚拟仓“栏位，可以设定对应期权合约以及标的合约的虚拟仓数量。
  - 虚拟仓数量用于期权盈亏分析。
  - 控制列提供“清除虚拟仓“按钮，点击可以清除当前画面品种的虚拟仓设定。
- 期权计算器

  通过期权报价的右键菜单打开期权计算器：



设定好行权价、标的价格、到期时间(天数)、波动率(%)、利率、认购/认沽之后，点击“计算”按钮，则根据期权定价模型计算出对应的 Delta、Gamma、Theta、Vega、Rho、理论价格。

- 标题栏设置
  - 过滤资金账号：
    - 设定过滤资金账号后，期权报价中的$Greeks、Pnl、净仓、委买委卖栏位将按账号过滤。
  - 显示当日交易
    - 设定是否显示当日交易的$Greeks 数据
  - 显示行情与持仓监控
    - 设定是否显示 T 字报价上方的行情与持仓监控功能
  - 显示除权息合约
    - 设定是否显示除权息合约报价

期权矩阵

期权矩阵报价中，各品种期权报价依矩阵排列显示。

通过交易->期权矩阵菜单打开功能，在商品选择器中设定期权品种。

期权矩阵报价

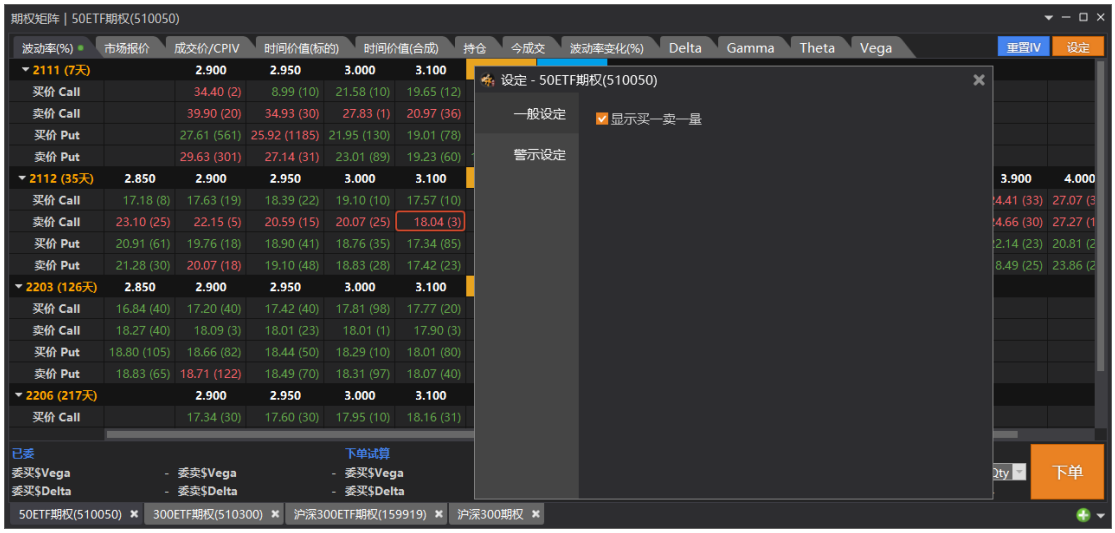
提供页签切换行情字段：

- 行情字段
  - 波动率(%)：BIV、SIV

- 市场报价：买价、卖价
- 成交价/IV：成交价、CPIV
- 时间价值(标的)：原生标的计算的时间价值
- 时间价值(合成)：合成期货标的计算的时间价值
- 持仓：多仓、空仓、
- 今成交
- 波动率变化(%)
  - 买价：（BIV-昨 IV）*100%/昨 IV
  - 卖价：（SIV-昨 IV）*100%/昨 IV
- Delta
- Gamma
- Theta
- Vega

- 在行情页中，双击可以打开下单工具
- 右键菜单：可通过右键菜单打开下单盒、闪电下单、技术线图、分时表

设定



- 一般设定：显示买一卖一量
  - 勾选后，在波动率(%)、市场报价、波动率变化(%)页签中，会显示买一卖一量

- 警示设定
  - 勾选合约
  - 设定警示指标
    - 波动率变化上限（%）
    - 波动率变化下限（%）
    - 现量
  - 行情警示
    - 市场波动率(BIV、SIV) 减去 重置波动率快照值，结果大于波动率变化上限设定，该合约会以红色虚线框出
    - 市场波动率(BIV、SIV) 减去 重置波动率快照值，结果小于波动率变化下限设定，该合约会以绿色虚线框出
    - 当期权合约现量大于警示设定的现量值，该合约会用黄色背景标出
- 注：一般设定与警示设定，只针对当前品种生效。
- 重置 IV：
  - 计算波动率变化上下限警示，初始状态使用昨 IV 计算
  - 盘中点击“重置 IV”按钮，将当前 IV 作为重置波动率快照值，重新计算行情警示。

期权矩阵下单

- 可在行情区块中选取合约，合约将以红色边框显示
  - 使用鼠标左键点选单个合约
  - 使用鼠标左键拖曳选取多个合约
  - 使用 Ctrl+鼠标左键点选多个合约

- 下单设置
  - 账号：设定下单账号
    - 勾选“过滤”则报价持仓、今成交页签数据依所选账号过滤
  - 手数：设定下单手数
  - 价格：设定下单价格
    - 价格可切换中间价、对方价
    - 追价 ticks：设定追价跳数，对方价/中间价加减设定的跳数，即为报单价

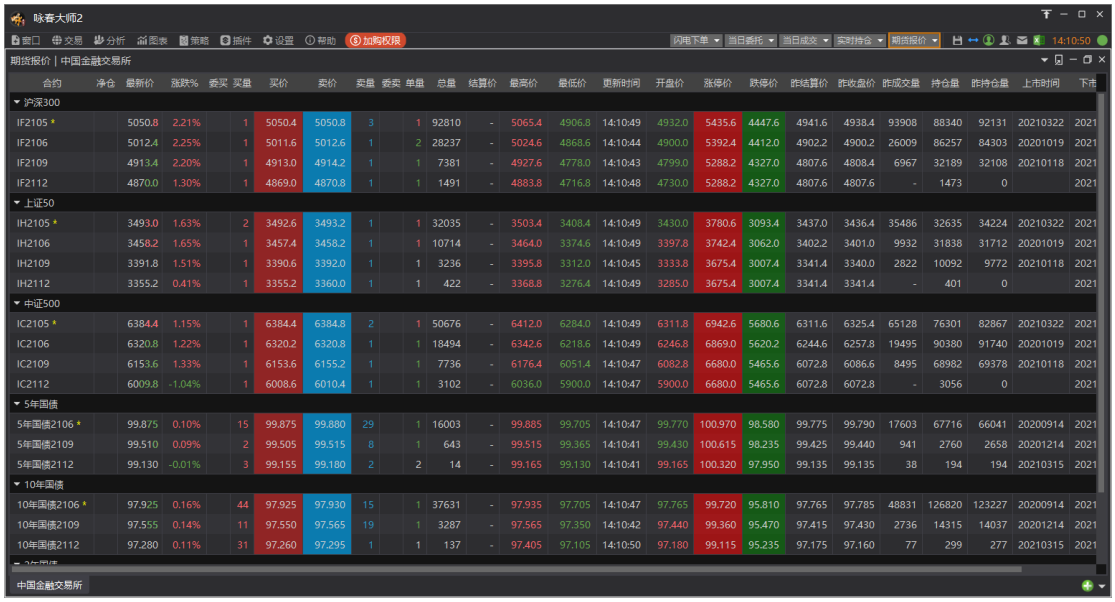
格。

- ◆ 中间价%：当选择中间价时可设定追价%，计算中间价与对方价价差的百分比，再用中间价加减该值，即为报单价格。
- ■ 快速下单：勾选快速下单时
  - ◆ 点击下单按钮，会略过下单确认窗口，直接送单。
  - ◆ 可直接按“Enter”回车键快捷送单。
- ■ 勾选“拆单”选项时，如果单笔下单手数超过拆单设定逐笔委托最大数量，则自动 拆单。

- ● 委托试算与下单试算
  - ■ 已委：计算委托中报单风险敞口
    - ◆ 委买$VEGA
    - ◆ 委买$DELTA
    - ◆ 委卖$VEGA
    - ◆ 委卖$DELTA
  - ■ 下单试算：计算行情页中所选合约（未委托）的总风险敞口
    - ◆ 委买$VEGA
    - ◆ 委买$DELTA
    - ◆ 委卖$VEGA
    - ◆ 委卖$DELTA
    - ◆ 权利金点差
  - ■ 计算公式
    - ◆ $DELTA = Delta × 合约乘数 × 合约数量 × 参考标的价格
    - ◆ $VEGA = Vega × 合约乘数 × 合约数量
    - ◆ 权利金点差 = 委托价格 × 合约单位 × 合约数量

期货报价

期货报价功能预设提供中国金融交易所期货品种的报价功能。



合约	净仓	最新价	涨跌%	委买	买量	买价	卖价	卖量	委卖	单量	总量	结算价	最高价	最低价	更新时间	开盘价	涨停价	跌停价	昨结算价	昨收盘价	昨成交量	持仓量	昨持仓量	上市时间	下市
沪深300																									
IF2105 *		5050.8	2.21%	1	5050.4	5050.8	3	1	92810	-	5065.4	4906.8	14:10:49	4932.0	5435.6	4447.6	4941.6	4938.4	93908	88340	92131	20210322	2021
IF2106		5012.4	2.25%	1	5011.6	5012.6	1	2	28237	-	5024.6	4868.6	14:10:44	4900.0	5392.4	4412.0	4902.2	4900.2	26009	86257	84303	20201019	2021
IF2109		4913.4	2.20%	1	4913.0	4914.2	1	1	7381	-	4927.6	4778.0	14:10:43	4799.0	5288.2	4327.0	4807.6	4808.4	6967	32189	32108	20210118	2021
IF2112		4870.0	1.30%	1	4869.0	4870.8	1	1	1491	-	4883.8	4716.8	14:10:48	4730.0	5288.2	4327.0	4807.6	4807.6	-	1473	0		2021
上证50																									
IH2105 *		3493.0	1.63%	2	3492.6	3493.2	1	1	32035	-	3503.4	3408.4	14:10:49	3430.0	3780.6	3093.4	3437.0	3436.4	35486	32635	34224	20210322	2021
IH2106		3458.2	1.65%	1	3457.4	3458.2	1	1	10714	-	3464.0	3374.6	14:10:49	3397.8	3742.4	3062.0	3402.2	3401.0	9932	31838	31712	20201019	2021
IH2109		3391.8	1.51%	1	3390.6	3392.0	1	1	3236	-	3395.8	3312.0	14:10:45	3333.8	3675.4	3007.4	3341.4	3340.0	2822	10092	9772	20210118	2021
IH2112		3355.2	0.41%	1	3355.2	3360.0	1	1	422	-	3368.8	3276.4	14:10:49	3285.0	3675.4	3007.4	3341.4	3341.4	-	401	0		2021
中证500																									
IC2105 *		6384.4	-1.15%	1	6384.4	6384.8	2	1	50676	-	6412.0	6284.0	14:10:49	6311.8	6942.6	5680.6	6311.6	6325.4	65128	76301	82867	20210322	2021
IC2106		6320.8	1.22%	1	6320.2	6320.8	1	1	18494	-	6342.6	6218.6	14:10:49	6246.8	6869.0	5620.2	6244.6	6257.8	19495	90380	91740	20201019	2021
IC2109		6153.6	1.33%	1	6153.6	6155.2	1	1	7736	-	6176.4	6051.4	14:10:47	6082.8	6680.0	5465.6	6072.8	6086.6	8495	68982	69378	20210118	2021
IC2112		6009.8	-1.04%	1	6008.6	6010.4	1	1	3102	-	6036.0	5900.0	14:10:47	5900.0	6680.0	5465.6	6072.8	6072.8	-	3056	0		2021
5年国债																									
5年国债2106 *		99.875	0.10%	15	99.875	99.880	29	1	16003	-	99.885	99.705	14:10:47	99.770	100.970	98.580	99.775	99.790	17603	67716	66041	20200914	2021
5年国债2109		99.510	0.09%	2	99.505	99.515	8	1	643	-	99.515	99.365	14:10:41	99.430	100.615	98.235	99.425	99.440	941	2760	2658	20201214	2021
5年国债2112		99.130	-0.01%	3	99.155	99.180	2	2	14	-	99.165	99.130	14:10:41	99.165	100.320	97.950	99.135	99.135	38	194	194	20210315	2021
10年国债																									
10年国债2106 *		97.925	0.16%	44	97.925	97.930	15	1	37631	-	97.935	97.705	14:10:47	97.765	99.720	95.810	97.765	97.785	48831	126820	123227	20200914	2021
10年国债2109		97.555	0.14%	11	97.550	97.565	19	1	3287	-	97.565	97.350	14:10:42	97.440	99.360	95.470	97.415	97.430	2736	14315	14037	20201214	2021
10年国债2112		97.280	0.11%	31	97.260	97.295	1	1	137	-	97.405	97.105	14:10:50	97.180	99.115	95.235	97.175	97.160	77	299	277	20210315	2021

期货报价的页签按照交易所分类，交易所下的品种报价可收起/展开。

- 在期货报价中，提供基本的报价栏位：

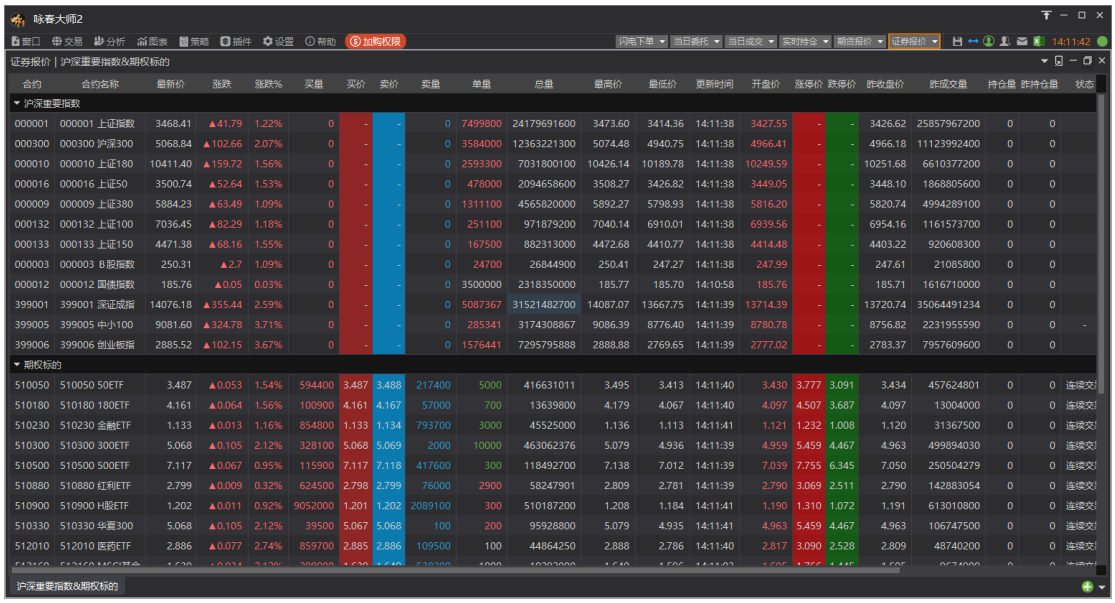
  合约、最新价、涨跌、涨跌%、买量、买价、卖价、卖量、单量、总量、结算价、最高价、最低价、更新时间、开盘价、涨停价、跌停价、昨结算价、昨收盘价、昨成交量、持仓量、昨持仓量、上市时间、下市时间。
- 净仓、委买、委卖

  在报价中，提供净仓、委买、委卖栏位，显示已登入的交易账号信息：合约的净仓数量，委托中的买单数量和委托中的卖单数量。
- 报价打开下单工具

  通过点击报价买价、买量、卖价、买量栏位可打开下单盒或闪电下单
- 右键菜单
  - 开启：提供开启下单盒、闪电下单、分时表、技术线图的功能
  - 复制 RTD 标签：可将报价的 RTD 标签复制到 excel 中。
  - 栏位设定：勾选要显示的报价栏位。

证券报价

证券报价功能提供重要指数和期权标的证券报价功能。



- 在证券报价中，提供基本的报价栏位：

  合约、合约名称、最新价、涨跌、涨跌%、买量、买价、卖价、卖量、单量、总量、最高价、最低价、更新时间、开盘价、涨停价、跌停价、昨收盘价、昨成交量、持仓量、昨持仓量、报价状态、成交金额、交易所代码。
- 净仓、委买、委卖

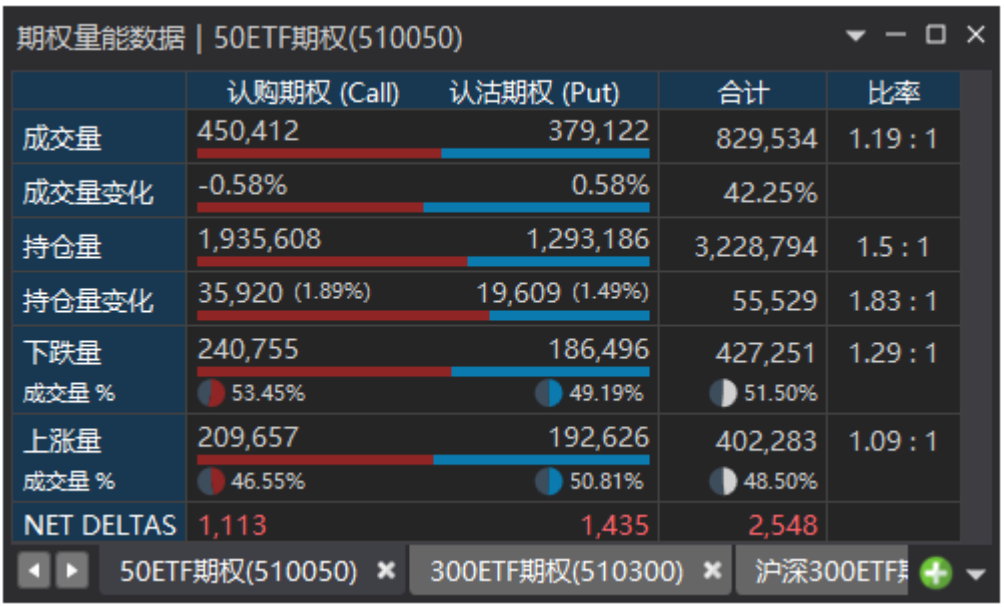
  在报价中，提供净仓、委买、委卖栏位，显示已登入的交易账号信息：合约净仓数量，委托中的买单数量和委托中的卖单数量。
- 报价打开下单工具

  通过点击报价买价、卖价栏位可打开下单盒或闪电下单
- 右键菜单

- 开启在报价中点击鼠标右键，提供开启下单盒、闪电下单、分时表、技术线图的功能
- 复制 RTD 标签
  若使用 ExcelRTD 功能，可以通过右键菜单直接复制 RTD 标签到 excel 中。
- 栏位设定
  在栏位设定中，勾选要显示的报价栏位。
- 指标设定
  勾选要显示的 HV 指标栏位

期权量能数据

期权量能数据提供期权品种 Call、Put 成交量、成交量变化、持仓量、持仓量变化等数据。



- 成交量：
  - 认购期权(Call)：Call 合约的总成交量
  - 认沽期权(Put)：Put 合约的总成交量
  - 合计：Call 合约 + Put 合约的总成交量
  - 比率：Call / Put 成交量比例
- 成交量变化
  - 认购期权(Call)：Call 合约总成交量变化（变化比例）
  - 认沽期权(Put)：Put 合约总成交量变化（变化比例）
  - 合计：Call 合约 + Put 合约总成交量变化
- 持仓量
  - 认购期权(Call)：Call 合约总持仓量
  - 认沽期权(Put)：Put 合约总持仓量
  - 合计：Call 合约 + Put 合约总持仓量
  - 比率：Put/Call 持仓量比例
- 持仓量变化
  - 认购期权(Call)：Call 合约总持仓量变化（变化比例）

- ◆ 认沽期权(Put)：Put 合约总持仓量变化（变化比例）
- ◆ 合计：Call 合约 + Put 合约总持仓量变化
- ◆ 比率：Put/Call 持仓量比例变化

■ 下跌量

- ◆ 认购期权(Call)：Call 合约总下跌量；并显示下跌量占总成交量比例饼状图
- ◆ 认沽期权(Put)：Put 合约总下跌量；并显示下跌量占总成交量比例饼状图
- ◆ 合计：Call 合约 + Put 合约总下跌量；并显示下跌量占总成交量比例饼状图
- ◆ 比率：Put/Call 下跌量比例变化

■ 上涨量

- ◆ 认购期权(Call)：Call 合约总上涨量；并显示上涨量占总成交量比例饼状图
- ◆ 认沽期权(Put)：Put 合约总上涨量；并显示上涨量占总成交量比例饼状图
- ◆ 合计：Call 合约 + Put 合约总上涨量
- ◆ 比率：Put/Call 上涨量比例变化

■ NET DELTAS

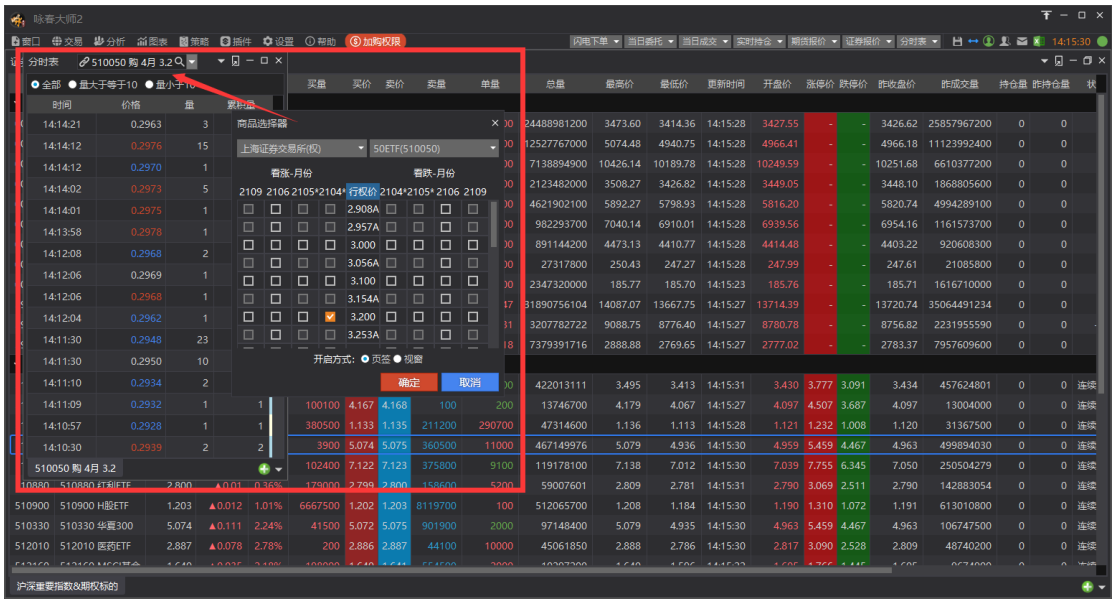
- ◆ Net Deltas = Netted of Long & Short deltas
  - ● Long deltas
    - ■ call trades on the ask price
    - ■ put trades on the bid price
  - ● Short deltas
    - ■ call trades on the bid price
    - ■ put trades on the ask price

分时表

分时表功能提供合约当日分时成交明细。

通过交易->分时表菜单打开功能，使用“搜寻品种/合约”设定分时表合约。

也可以通过报价的右键菜单打开对应合约的分时表。

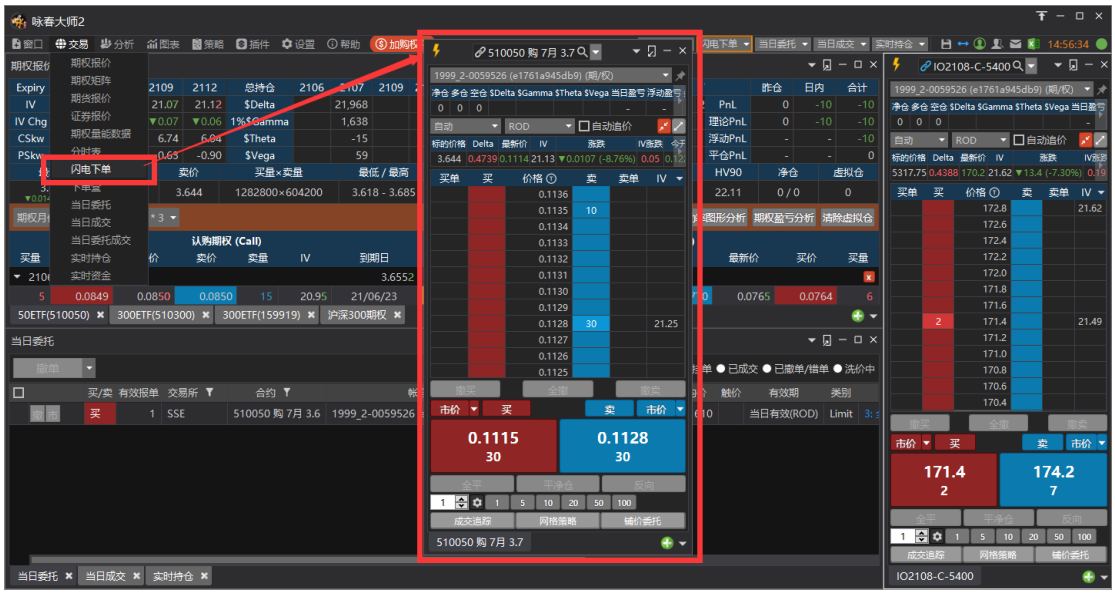


- 分时表栏位：时间、价格、量、累积量(连续相同价格的单量累积)、柱状条。
- 合约连动
  - 合约框中提供连动按钮，按钮显示灰色表示不连动，点击切换蓝色则合约连动，此时若在报价中点击任意合约，分时表将连动切换为该合约。
- 按量筛选资料
  - 分时表提供按量筛选功能：全部、量大于等于 10、量小于 10。

闪电下单

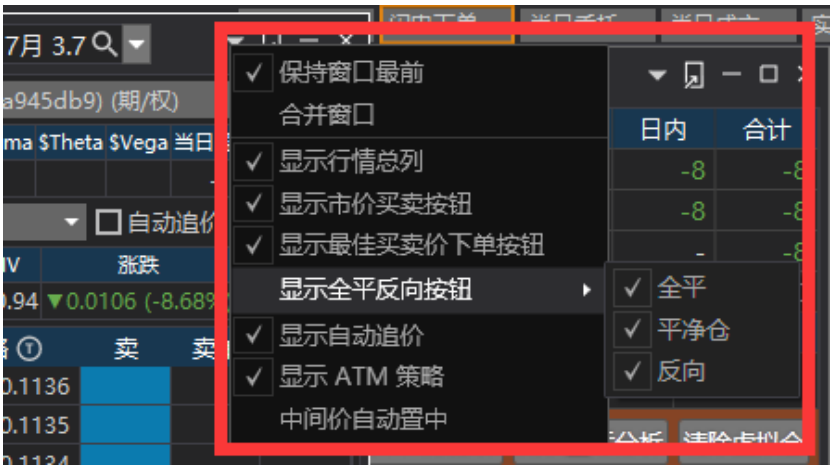
提供使用者进行商品的委托下单：下单画面报价以价格序列显示，可以通过点选方式快速进行委托和撤单。

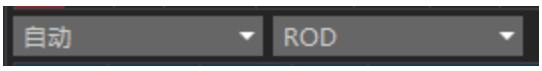
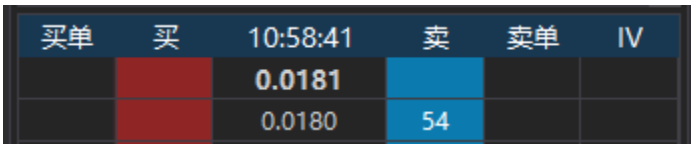
通过交易->闪电下单打开，然后使用搜寻品种/代码设定闪电下单合约，即可看到下图窗口，使用者必须选定好合约、下单账号与下单类型、数量之后方可开始进行商品委托。

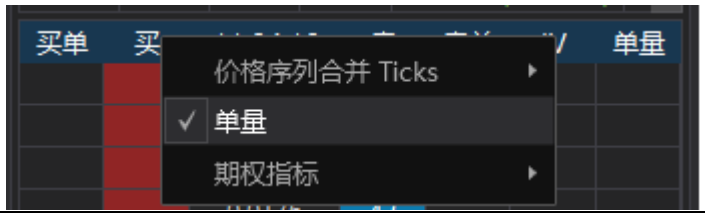
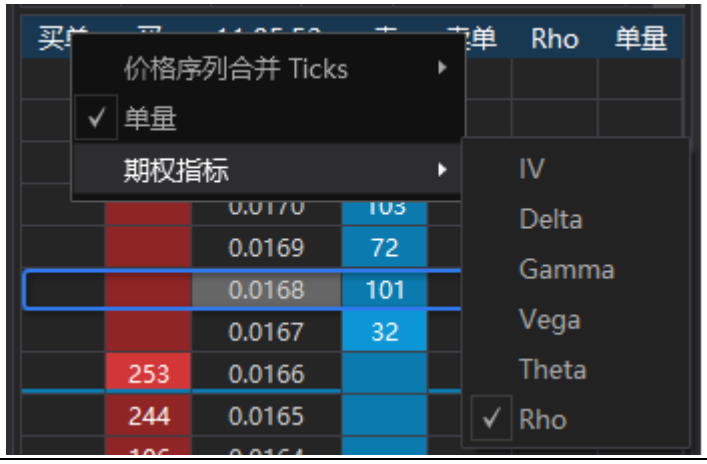


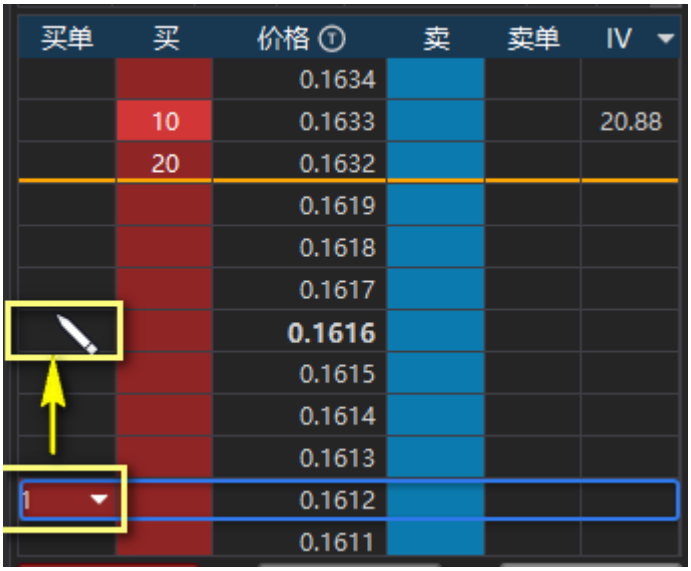
闪电下单功能说明：

标题栏	1、 搜寻合约：在合约输入合约名称或代码可以搜寻合约 2、 商品选择器：点击放大镜按钮，打开商品选择器，通过交易所和商品选单列表选择商品。 3、 合约连动：按钮显示灰色时表示不连动，点击切换为蓝色表示连动合约，此时在报价中点击任意合约可以将闪电切换为该合约。 4、 快速切换合约：通过合约下拉选单，可快速切换 Call/Put、合约月份。 5、 保持视窗最前：闪电下单预设勾选“保持窗口最前“

	6、 显示功能：预设勾选显示行情总列、市价买卖按钮、最佳买卖价下单按钮、全平反向按钮、自动追价、显示 ATM 策略 7、 中间价自动置中：勾选后，闪电价格序列实时将中间价置中显示 
账号选单	提供交易账号选单列表，当设定好合约之后，会按证券、期权、期货筛选出对应类型的账号显示在选单中。 可以按按钮将所选账号锁定。
持仓列	显示合约净仓、多仓、空仓数量，$Delta、$Gamma、$Theta、$Vega、当日盈亏、浮动盈亏、多仓均价、空仓均价、今买、今卖数量、可用资金。 净仓 多仓 空仓 $Delta $Gamma $Theta $Vega 当日盈亏 浮动盈亏 4 4 0 97,796 656,388 -184 56 960 960 $Vega 当日盈亏 浮动盈亏 多仓均价 空仓均价 今买 今卖 可用资金 56 964 964 0.02680 0 4 0 9,998,888 在持仓列点击鼠标右键可以设定栏位：

仓别和有效期	 1、 仓别：预设为自动单，可以切换设定：自动(自定卖开)、开仓、平仓 2、 有效期：预设为 ROD 当日有效单，可以切换为： FOK 全成或全撤、自动拆单 ROD、冰山拆单 ROD。
自动追价	勾选可以开启自动追价功能，通过设置->自动追价设定，设定未成交自动追价条件。
价格序列压缩	点击按钮可以压缩价格序列、解除压缩价格序列
行情总列	显示合约的标的价格、Delta、最新价、IV、涨跌、IV 涨跌、今开、今高、今低、昨收、成交量： 在行情列点击鼠标右键可以设定栏位：
	
买单	此栏位显示当前账号下的买挂单数量标记，点击数量可以撤单
卖单	此栏位显示当前账号下的卖挂单数量标记，点击数量可以撤单
买	此栏位显示合约报价买量，点击此栏位可以送出限价买入委托
卖	此栏位显示合约报价卖量，点击此栏位可以送出限价卖出委托
更新时间	此栏位显示合约报价更新时间，对应栏位显示合约价格序列，双击价格序列，跳回最新价位置。

价格序列合并 ticks	 在栏位上右击鼠标，可设置价格序列合并 Ticks：将价格序列按照设置跳数合并显示
单量	在栏位上右击鼠标，可勾选显示单量栏位 
期权指标	在栏位上右击鼠标，可勾选期权指标：IV、Delta、Gamma、Vega、Theta、Rho 栏位 
委托改价	在“买单”“卖单”栏位中，鼠标点击挂单数量，待鼠标指针变为✎指针后，再次点击欲改价的价格所对应“买单”“卖单”栏位，即可完成改价。

<table>
<tr><td></td><td> 
</td></tr>
<tr><td colspan="2">
</td></tr>
<tr><td>撤买</td><td>按下撤买按钮，将闪电所选账号、合约的全部买单撤销</td></tr>
<tr><td>撤卖</td><td>按下撤卖按钮，将闪电所选账号、合约的全部卖单撤销</td></tr>
<tr><td>全撤</td><td>按下全撤按钮，将闪电所选账号、合约的全部买挂单和卖挂单撤销</td></tr>
<tr><td colspan="2">
</td></tr>
<tr><td>市价买 按钮</td><td>按下红色 市价 按钮，送出市价买入委托，右侧下拉按钮可设定有效期</td></tr>
<tr><td>买 按钮</td><td>按下红色 买 按钮，以买一价送出限价买入委托</td></tr>
<tr><td>卖 按钮</td><td>按下蓝色 卖 按钮，以卖一价送出限价卖出委托</td></tr>
<tr><td>市价卖 按钮</td><td>按下蓝色 市价 按钮，送出市价卖出委托，右侧下拉按钮可设定有效期</td></tr>
<tr><td>最佳买卖价下单按钮</td><td>1、 按钮显示闪电下单所选合约的买一价、买一量、卖一价、买一量；红色表示买入、蓝色表示卖出。

2、 在价格序列上，没有点选价格的情况下，鼠标移到最佳买卖价下单按钮上，显示 4 个按钮，图例：
a) S1@0.0937 LMT
b) B1@0.0937 LMT
c) B1@0.0940 LMT
d) S1@0.0940 LMT
S 表示卖、B 表示买，1 表示下单数量，@0.0937 表示委托价格为买一价，@0.0940 表示委托价格为卖一价，LMT 表示限价单类型。</td></tr>
</table>

	 3、 在价格序列上，点选价格（0.0944）高于卖一价的情况下，鼠标移到最佳买卖价下单按钮上，提供 3 个按钮，图例： a) B1@0.0944 LMT b) B1@0.0944 STP c) S1@0.0944 LMT S 表示卖、B 表示卖，1 表示下单数量，@0.0944 表示委托价格为点选价格（0.0944），LMT 表示限价单类型，STP 表示停损单类型 4、 在价格序列上，点选价格（0.0940）介于买一价和卖一价之间，鼠标移到最佳买卖价下单按钮上，提供 2 个按钮，图例： a) B1@0.0940 LMT b) S1@0.0940 LMT S 表示卖、B 表示买，1 表示下单数量，@0.0940 表示委托价格为点选价格（0.0940），LMT 表示限价单类型 5、 在价格序列上，点选价格（0.0935）低于买一价的情况下，鼠标移到最佳买卖价下单按钮上，提供 3 个按钮，图例： a) B1@0.0935 LMT b) S1@0.0935 LMT c) S1@0.0935 STP S 表示卖、B 表示买，1 表示下单数量，@0.0935 表示委托价格为点选价格（0.0935），LMT 表示限价单类型，STP 表示停损单类型
全平 按钮	按下全平按钮，将闪电所选账号、合约的持仓全部平仓。在“交易偏好设定”中提供平仓快捷按钮价格设置。
平净仓 按钮	按下平净仓按钮，将闪电下单所选账号、合约的净仓数量平仓。在“交易偏好设定”中提供平仓快捷按钮价格设置。
反向 按钮	按下反向按钮，将闪电所选账号、合约，按照净仓数量平仓，并反向开仓相应数量。在“交易偏好设定”中提供反向快捷按钮价格设置。
委托数量	1、 在输入框中输入委托数量，或者点击右侧的数量按钮填入数量

2、 在闪电的持仓列中点击“净仓“栏位，会将净仓数填入委托数量输入框中。

3、 设定：数量按钮可以切换取代、累加两种设定方式；“持仓”按钮表示将闪电上的账号合约净仓数量填入委托数量设定。

闪电下单 ATM 策略：

- 成交追踪

  - 触价止损：委托进场后根据预设定的止损点 触发止损后委托出场。

    闪电下单点击成交追踪按钮使其变为黄色后展开触价止损参数设定如下图

根据上图举例：勾选启用后

如下图在 510050 2103 C3.4 在 0.12 价格买入，同时使用触价止损策略，止损点设定为 10，则委托时会送出两笔委托，第一笔 Limit 买入，状态为委托成。第二笔 Stop 卖出，状态为等待中。假设第一笔成交在 0.1186，第二笔状态由等待中边为洗价中，触价价格为 0.1186-0.001=0.1176。当行情条件触发 0.1176 后 Stop 止损单以 Market 价格出场。

  - 追踪止损：委托进场后根据预设的的损点 触发后止损点位后委托出场。盈利达到追踪步长时将止损点上移。

    闪电下单点击成交追踪按钮使其变为黄色后展开，点选追踪止损显示参数设定如下图

根据上图举例：勾选启用后

在 510050 购 3 月 3.4 合约限价买入 0.1155 使用追踪止损策略。此策略会送出两笔委托，第一笔 Limit 买入 0.1155，状态委托成功。第二笔为追踪止损委托，委托有效期为 Traling Stop，状态为 等待中，。若第一笔成交在 0.1150 则第二笔状态变为洗价中，触发价格为 0.1140=0.1150-0.001。若行情满足触发条件，发送 Market 出场单。若行情上涨到 0.1160（0.1155+追踪步长 5 跳）时，第二笔触发价格变为 0.1145(0.1140+追踪步长 5 跳)，满足触发条件发送 Market 出场单。

		买/卖	有效报单	交易所	合约	帐号	价格	成交	剩量	报单手数	均价	触价	有效期	类别	状态
撤	市 停止	卖	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)		0	1	1		0.1140	当日有效(ROD)	Traling Stop	13: 洗价中
撤	市	买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1155	1	0	1	0.1150		当日有效(ROD)	Limit	3: 全部成交

- 网格策略:
  - 参数设定说明
    - 参数设定值单位为最小跳动点。
    - 上行参数/下行参数：若第一笔进场委托为买开，则上行参数为出场卖平，价格为第一笔买开报单价格 + 设定数值。下行参数为循环时再次买开进场，价格为第二笔报单价格 - 设定数值 。
    - 循环次数：循环委托买卖次数总和

闪电下单点击网格测试按钮使其变为黄色后展开触价止损参数设定如下图

根据上图举例：勾选启用后

买入 510050 购 4 月 3.4 合约，委托价格 0.1232，则委托时会送出 7 笔委托：第一笔委托成功，其余 6 笔等待中。第一笔委托成交后，第二笔状态由“等待中”转为“委托成功”，卖出报单价格为 0.1243（0.1232 + 上行参数 11），第二笔委托成交后，第三笔状态由“等待中”转为“委托成功”，买入报单价格为 0.1234（0.1243 - 下行参数 9）。依次类推至 7 笔委托完全成交。

委托回报如下图：

		买/卖	有效报单	交易所	合约	帐号	价格	成交	剩量	报单手数	均价	触价	有效期	类别	状态	开平	日期	时间	备注	委托书号	内部指示
撤	市	买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1238	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329472C
撤	市	卖	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1247	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329469B
撤	市	买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1236	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329410A
撤	市	卖	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1245	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329407Z
撤	市	买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1234	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329404Y
撤	市	卖	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1243	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	15: 等待中	自动	2021-03-22	11:23:29			1112329402X
撤	市	买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (艾生辉)(权)	0.1232	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	11:23:29		101300020-000070208	1112329369W

总结:

1.委托笔数=循环次数+1

2. 循环委托卖出价格带入上行参数，买入价格带入下行参数。

- 铺价委托:
  - 参数设定说明
    - 笔数：铺价委托的笔数
    - 档位：铺价委托的价格递增或递减数
    - 增量：铺价委托手数的递增量

闪电下单点击网格测试按钮使其变为黄色后展开触价止损参数设定如下图

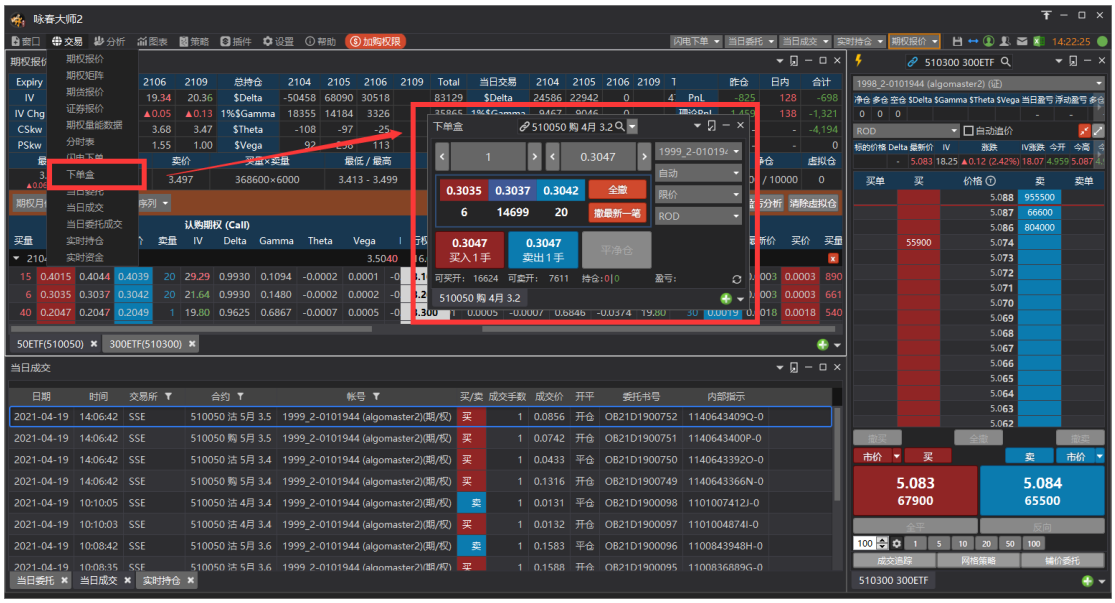
如上图设定，510050 购 4 月 3.4 买入 1 手，委托价格 0.1121，

启用铺价委托，则实际送出 11 手委托单，第一笔委托数量 1，委托价格 0.1121，第二笔委托数量 2（1＋ 增量），委托价格 0.1116（0.1121＋ 档位）。依此类推总共委托 11 笔。

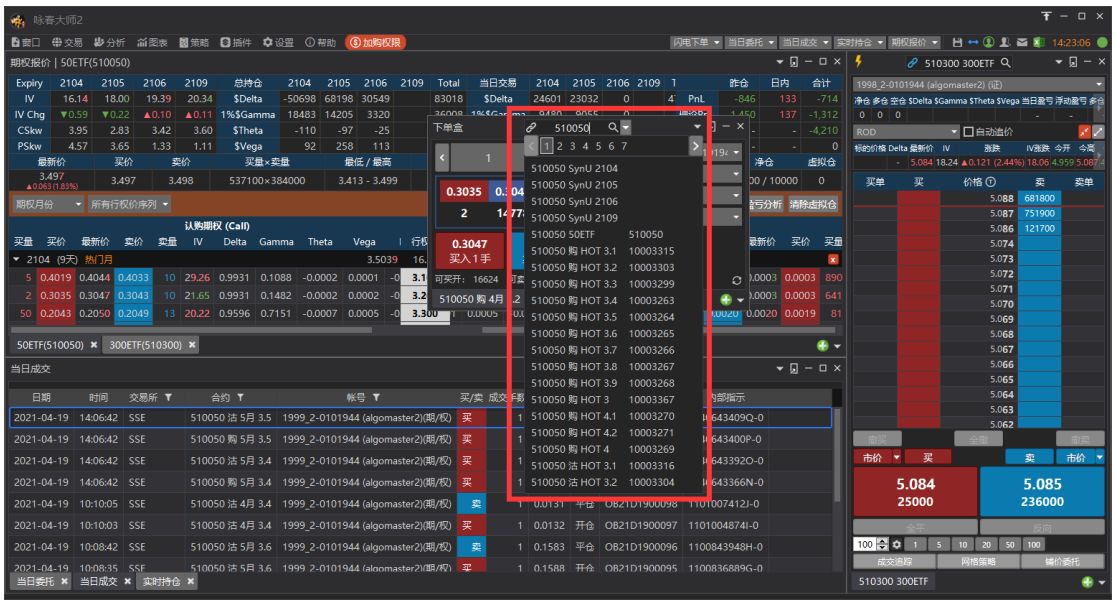
买/卖	有效报单	交易所	合约	帐号	价格	成交	剩量	报单手数	均价	触价	有效期	类别	状态	开平	日期	时间	备注	委托书号	内部指示
买	11	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1071	0	11	11			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070238	1141538861P
买	10	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1076	0	10	10			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070236	1141538848O
买	9	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1081	0	9	9			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070235	1141538827N
买	8	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1086	0	8	8			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070237	1141538813M
买	7	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1091	0	7	7			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070234	1141538806L
买	6	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1096	0	6	6			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070233	1141538797K
买	5	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1101	0	5	5			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070232	1141538768J
买	4	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1106	0	4	4			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:39		101300020-000070231	1141538762I
买	3	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1111	0	3	3			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:38		101300020-000070230	1141538747H
买	2	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1116	0	2	2			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:38		101300020-000070229	1141538714G
买	1	SSE	510050 购 3月 3.4	1013-101300020 (汉生辉)(权)	0.1121	0	1	1			当日有效(ROD)	Limit	0: 委托成功(包含改价改量)	开仓	2021-03-22	14:15:38		101300020-000070228	1141538671F

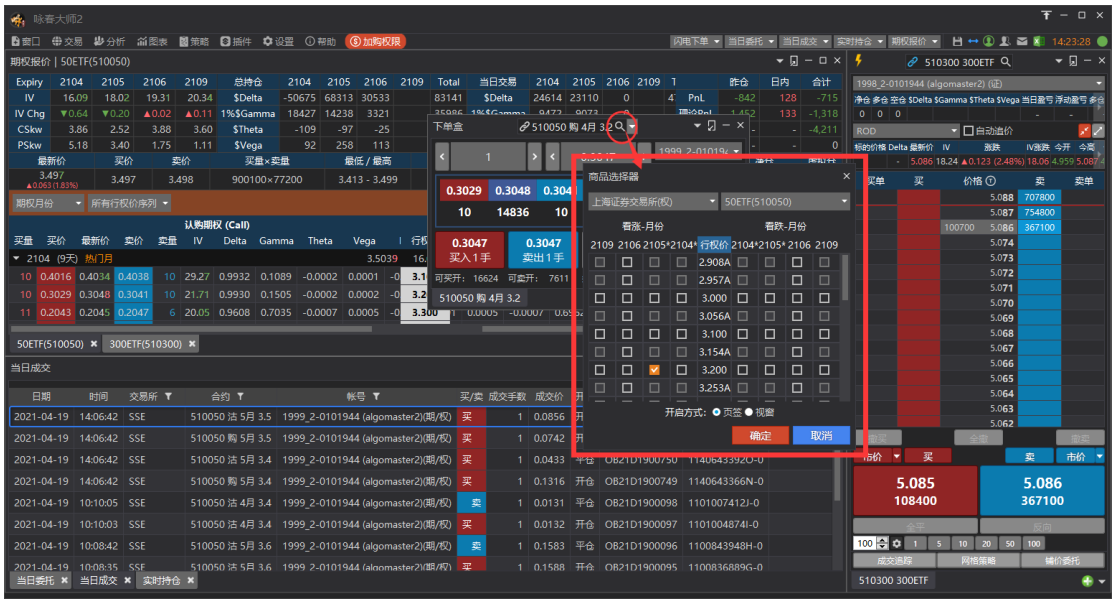
下单盒

提供基本的下单功能。



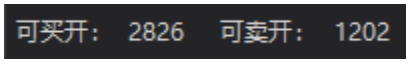
在上方合约框可以通过搜寻品种/代码设置下单合约；或者通过放大镜按钮打开“商品选择器”，通过交易所&品种选单选择下单合约。





下单盒功能说明

标题栏	1、 搜寻合约：在合约输入合约名称或代码可以搜寻合约 2、 商品选择器：点击放大镜按钮，打开商品选择器，通过交易所和商品选单列表选择商品。 3、 合约连动：按钮显示灰色时表示不连动，点击切换为蓝色表示连动合约，此时在报价中点击任意合约可以将闪电切换为该合约。 4、 快速切换合约：通过合约下拉选单，可快速切换 Call/Put、合约月份。 5、 保持视窗最前：闪电下单预设勾选保持窗口最前
委托数量	可以输入委托数量，或者按<>按钮修改委托数量 1
委托价格	可以输入委托价格，或者按<>按钮修改委托价格 0.0667
合约市况	显示下单盒合约的买 1 价、买 1 量、最新价、成交量、卖 1 价、卖 1 量报价，使用鼠标点击价格可代入委托价格设定

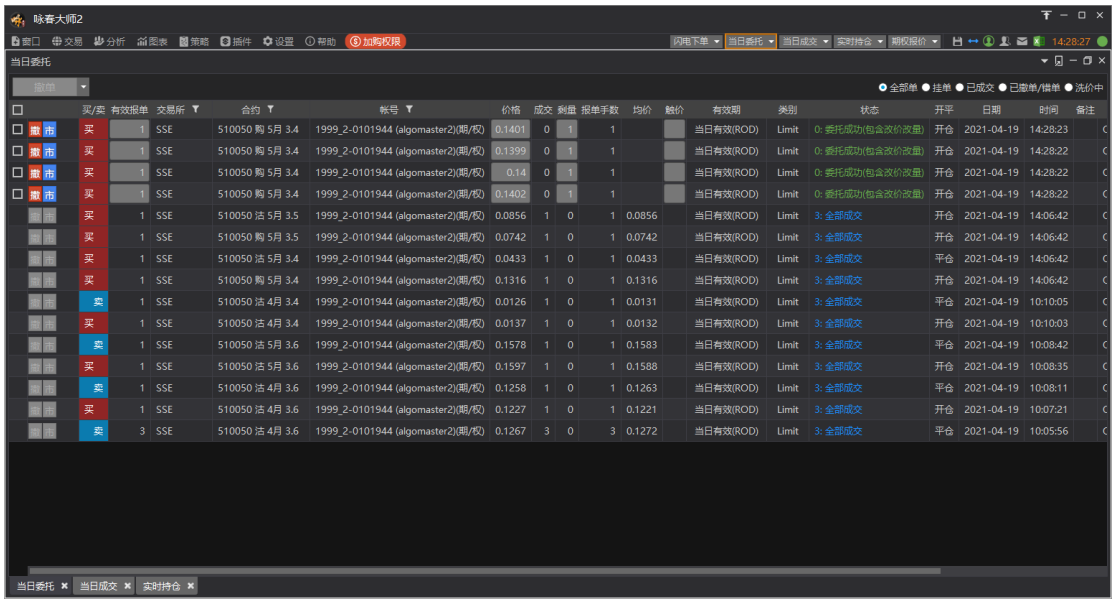
下单设定	 1、 账号：提供交易账号选单列表，当设定好合约之后，会按证券、期权、期货类型筛选出对应的账号显示在选单中。 2、 仓别：预设为“自动”单，可以切换设定为开仓、平仓，对于股票期权 call 合约，可以设定备兑开仓、备兑平仓。 3、 价格类型：预设为“限价”，可以切换为市价、对方价、本方价、最新价，或者交易系统支持的其他报单价格类型 4、 有效期：预设为“ROD 当日有效”，可以切换为 IOC 立即成交剩余取消、或 FOK 立即全部成交否则取消，或者交易系统支持的其他有效期。
买入按钮	点击买入按钮，会按照所显示的价格和数量委托买入
卖出按钮	点击卖出按钮，会按照所显示的价格和数量委托卖出
平净仓按钮	点击平净仓按钮，则按照下单盒中所选账号和合约的净仓数量平仓。平净仓的价格使用“交易偏好设定->平仓快捷按钮价格”设定。
全撤按钮	点击全撤按钮，会将下单盒中所选账号和合约的未成交委托全部撤单
撤最新一笔	点击撤最新一笔，会将下单中所选账号和合约的最新一笔未成交委托单撤销。
可买开&可卖开	根据下单盒中设定的下单账号可用资金和合约价格，试算出相应的可买开、可卖开数量。 
持仓&盈亏	根据下单盒中设定的下单账号和合约，显示对应的持仓多、空仓数量；显示持仓的逐日浮动盈亏。
刷新	点击按钮，重新查询可买开、可卖开数量。

注：下单盒报单类型对照表

下单盒报单选项		对应交易所申报指令类型
深圳现货	五档市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：最优五档即时成交剩余撤销市价申报
	市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：即时成交剩余撤销市价申报
	市价，全成或全撤(FOK)	交易所指令：全额成交或撤销市价申报
	限价，当日有效(ROD)	交易所指令：普通限价申报
	对方价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约最新价
深圳期权	限价，当日有效(ROD)	交易所指令：普通限价申报
	限价，全成或全撤(FOK)	交易所指令：全额成交或撤销限价申报
	五档市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：最优五档即时成交剩余撤销市价申报
	市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：即时成交剩余撤销市价申报
	市价，全成或全撤(FOK)	交易所指令：全额成交或撤销市价申报
	对方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托； 申报价格取委托送出时的合约对方价
	对方价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托； 申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托； 申报价格取委托送出时的合约本方价
	本方价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托； 申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约最新价
	最新价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额成交或撤销限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约最新价
上海现货	限价，当日有效(ROD)	交易所指令：普通限价
	五档市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：市价：最优 5 档即时成交剩余撤销申报
	五档市价转限价， 当日有效(ROD)	交易所指令：市价：最优 5 档即时成交剩余转限价申报
	市价，剩余即撤销(IOC)	在设置->市价转换设定中，上交所 股票/基金市价指令替换指令类型为“五档市价 IOC” 替换为市价：最优 5 档即时成交剩余撤销申报送出
	市价，当日有效(ROD)	在设置->市价转换设定中，上交所 股票/基金市价指令替换指令类型为“五档市价转限价 ROD” 替换为市价：最优 5 档即时成交剩余转限价申报送出
	对方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约对方价

	本方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型； 申报价格取委托送出时的合约最新价
上海期权	限价，当日有效(ROD)	交易所指令：普通限价委托
	市价转限价，当日有效(ROD)	交易所指令：市价剩余转限价委托
	市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令：市价剩余撤销委托
	限价，全成或全撤(FOK)	交易所指令：全额即时限价委托
	市价，全成或全撤(FOK)	交易所指令：全额即时市价委托
	对方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托； 申报价格取委托送出时的合约对方价
	对方价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托； 申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托； 申报价格取委托送出时的合约本方价
	本方价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托； 申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托； 申报价格取委托送出时的合约最新价
	最新价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托； 申报价格取委托送出时的合约最新价

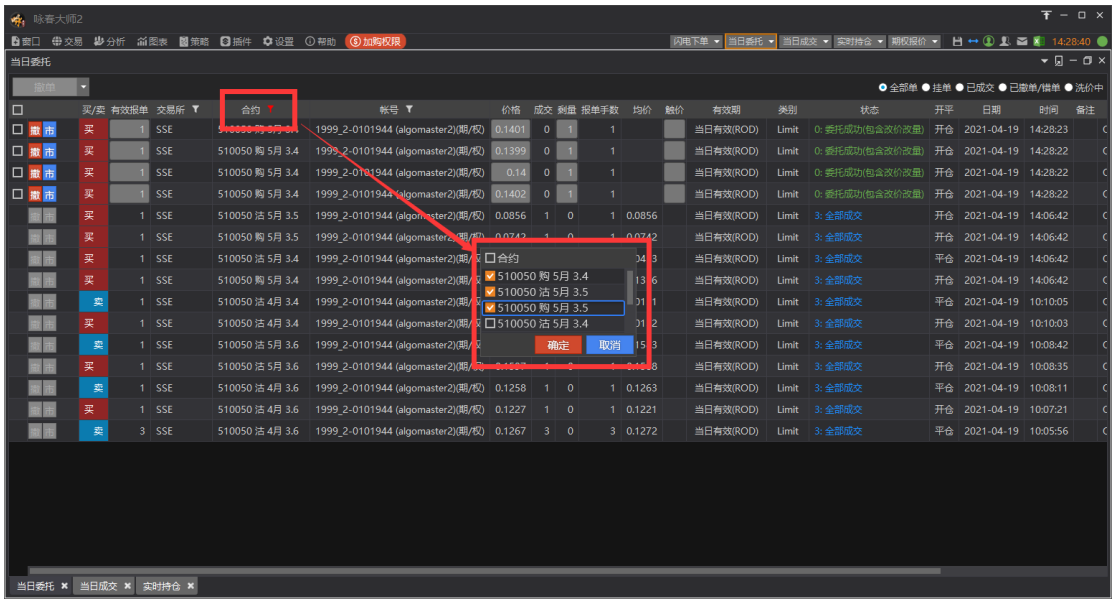
当日委托



提供投资者账号下的当日委托回报资料。

- 栏位筛选：

  合约、账号栏位提供筛选功能，勾选要查看的合约、账号报单信息。



- 功能列
  - 撤单
    - 未成交挂单可以勾选后点击“撤单”按钮撤销该笔挂单
    - 全撤：将全部未成交挂单撤销
    - 撤买：将全部未成交买入挂单撤销
    - 撤卖：将全部未成交卖出挂单撤销

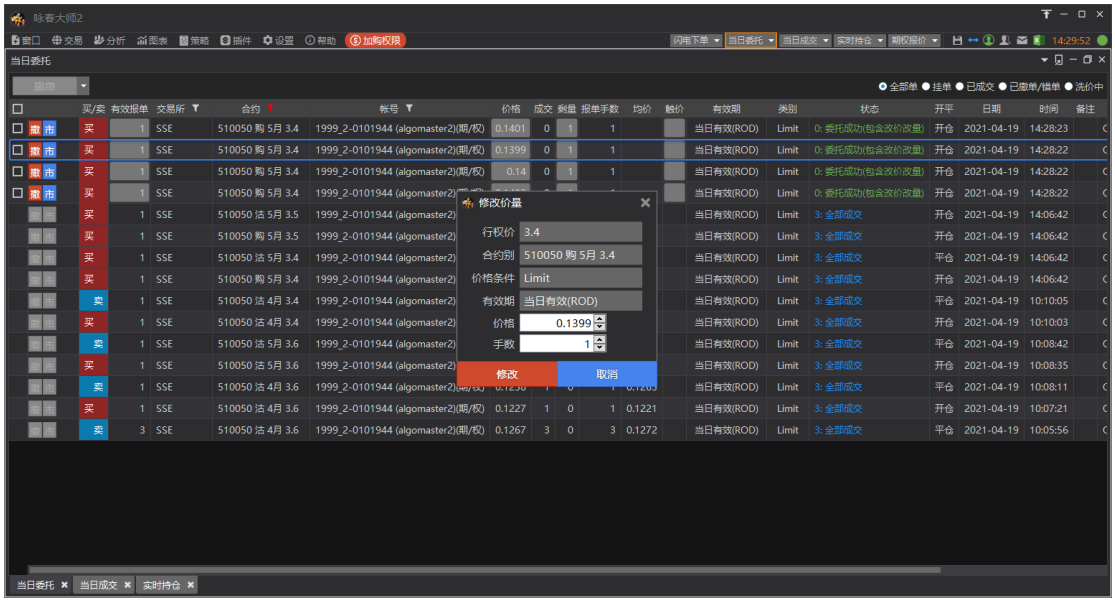
  - 分类显示

    可以按照“全部单”“挂单”“已成交”“已撤单/错单”“洗价中”几种状态分类将报单回报筛选后显示。

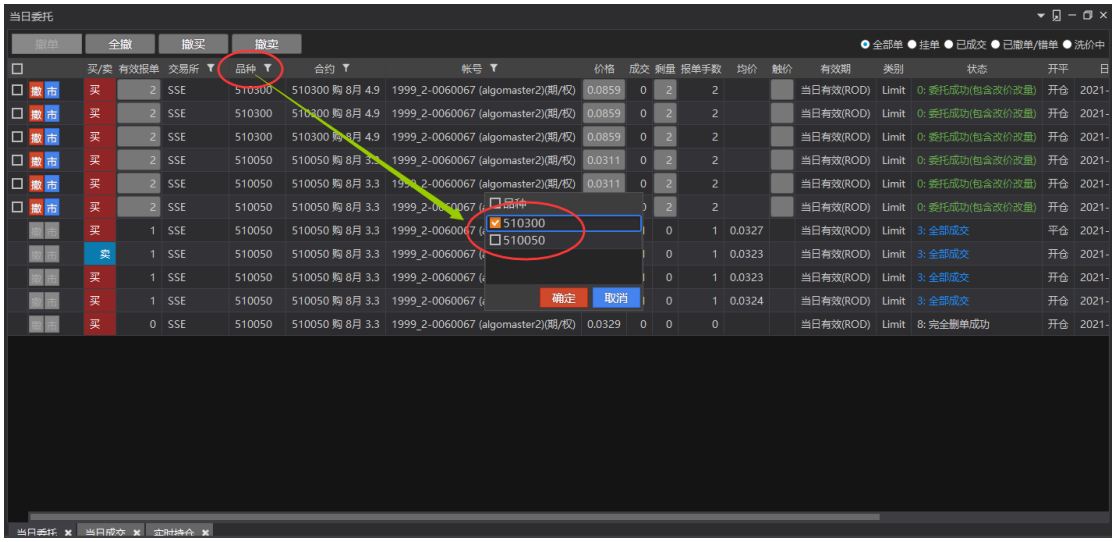
- “撤”按钮：

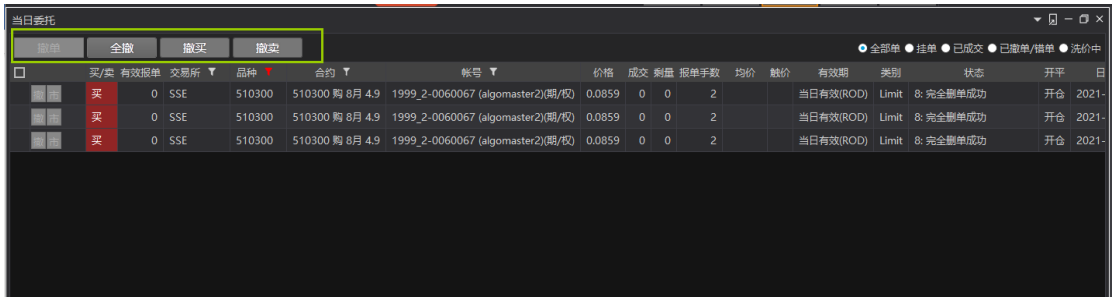
- 回报的“撤”按钮，点击可以将该未成交挂单撤销。

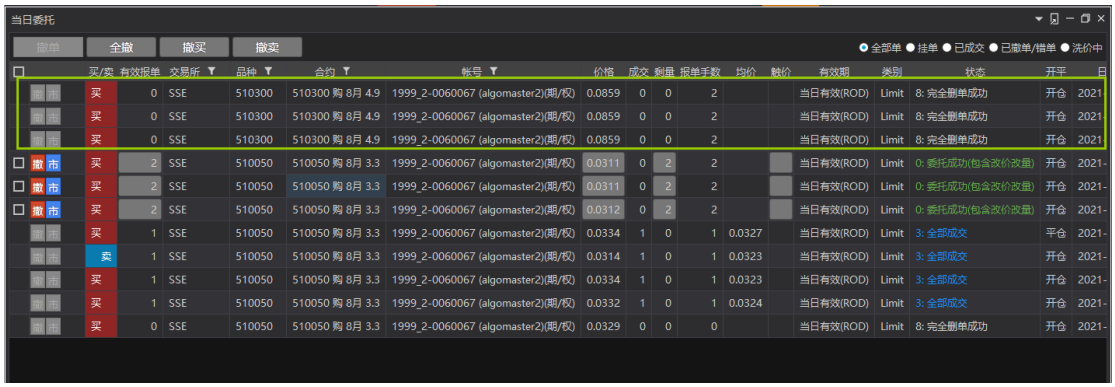
- “市”按钮：
  - 回报的“市”按钮，点击可以将未成交挂单撤单，并转为市价单重新委托。
- 改价改量
  - 回报的价格和数量栏位，可以点击打开改价改量窗口，修改报单价格和数量



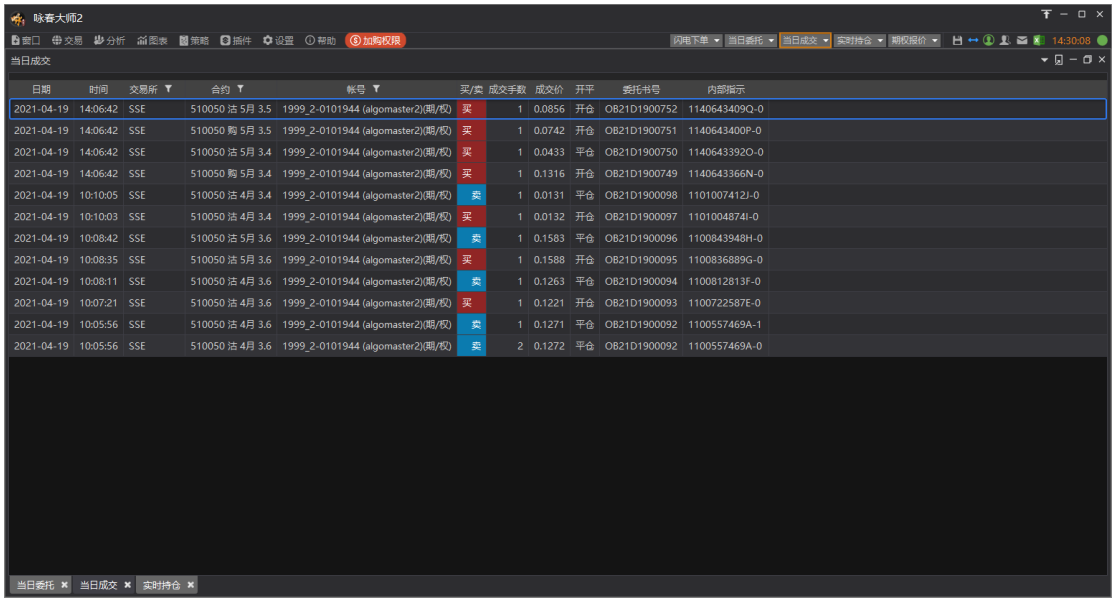
- 按“品种“撤单
  - “品种“栏位，筛选品种以后，再使用全撤、撤买、撤卖按钮则只对当前品种撤单。





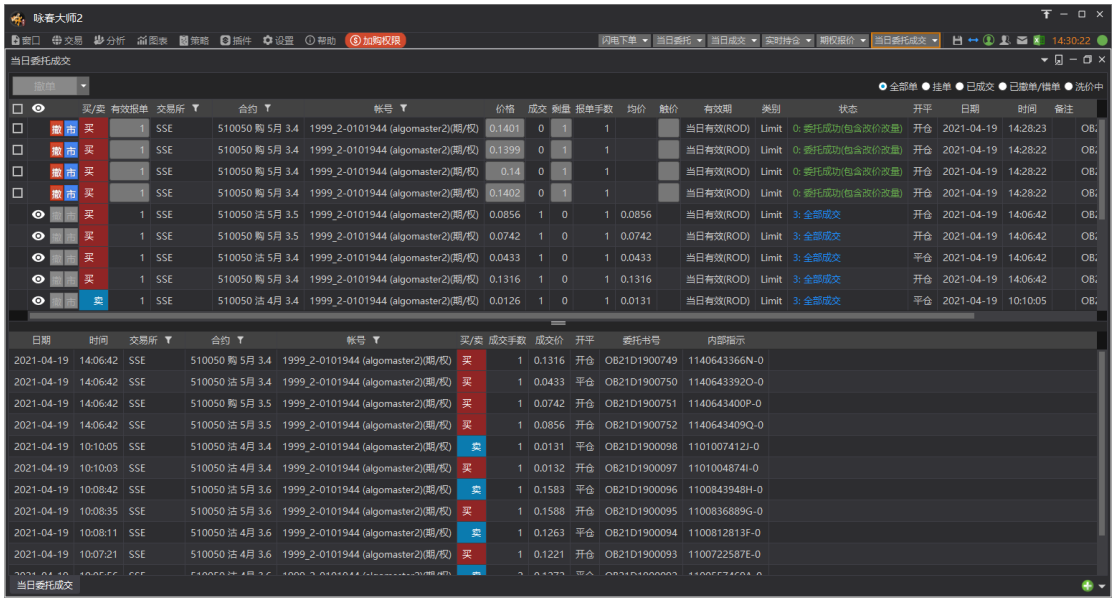


当日成交



提供投资者账号下的当日成交回报资料。

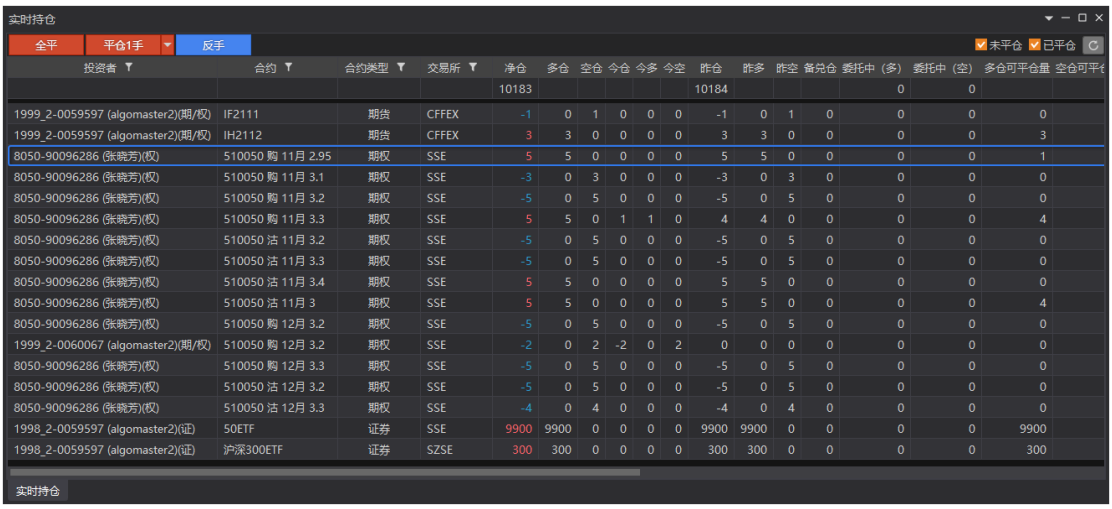
当日委托成交



提供投资者账号下的当日委托回报及成交回报资料。此功能是“当日委托”“当日成交”两个视图功能的组合。

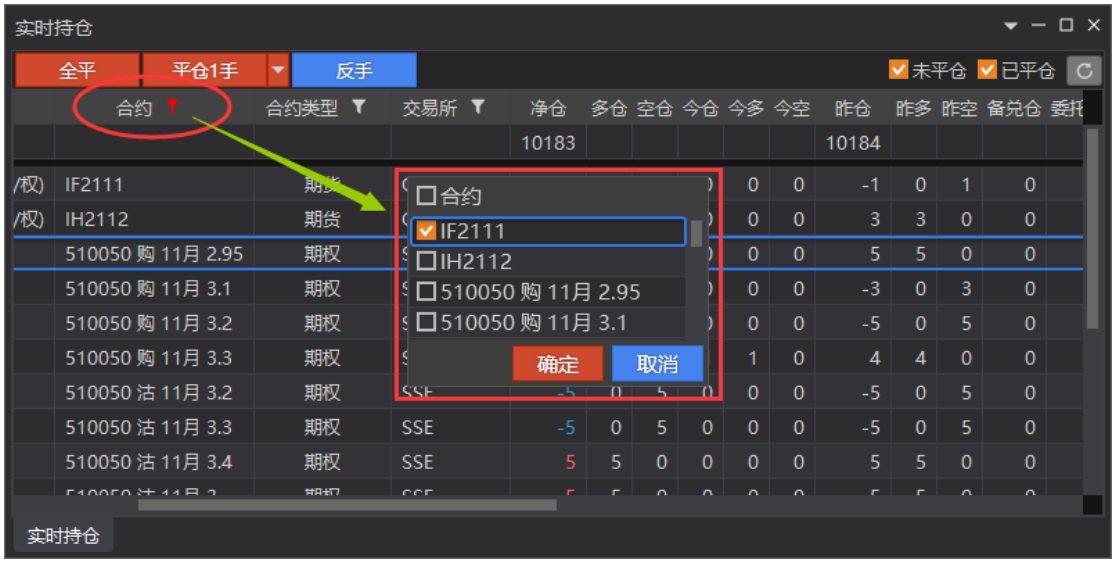
在委托回报中，点击按钮，白色变为灰色时，可隐藏该笔委托对应的成交明细资料。

实时持仓



提供投资者账号下的全部持仓资料。

- 持仓首列加总：
  在持仓第一列提供以下栏位的加总信息：净仓、昨仓、买成、卖成、今成、净成、委托中(多)、委托中(空)、逐日浮动盈亏、逐步浮动盈亏、逐日平仓盈亏、逐笔平仓盈亏、估算当日盈亏。
- 投资者、合约、合约类型、交易所栏位可设置筛选。



- 持仓连动下单工具
  在持仓资料中，点击“净仓”“多仓”“空仓”栏位数量，可以连动打开下单功能。
- 功能列
  - 全平：持仓使用全平功能，会将全部的持仓合约送出平仓申请。平仓委托价格为交易偏好设定的“平仓快捷按钮价格”
  - 指定平仓：选择一笔持仓之后，可以输入指定数量、或者设定按%计算平仓数量。计算出的平仓数量显示在按钮上，点击该按钮送出平仓委托。

  - 反手：选择一笔持仓之后，使用反手功能，会将所选合约的全部未成交委托单撤单，再发出平仓单以及数量相同方向相反的开仓单。反手完成后，原持仓变为买卖方向相反数量相等的持仓。反手委托使用价格为交易偏好设定的“反向快捷按钮价格”
  - 未平仓：显示当日未平仓的持仓资料
  - 已平仓：显示当日已平仓的合约资料
  - 刷新数据：点击刷新数据按钮，则从后台重新查询持仓资料并刷新显示数据。
- 右键菜单

- 可开启闪电下单、下单盒、技术线图功能。
- 汇出文件：将持仓资料汇出一份.csv 文件保存到本地电脑
- 复制 RTD 标签：若开启使用 ExcelRTD 功能，可以通过复制 RTD 标签将持仓资料的 RTD 标签复制到 excel 中。
- 栏位设定：勾选要显示的栏位
- 锁定/解锁栏位
- 显示/隐藏首列加总

● 标题栏下拉设定选单，可设定是否显示功能：

- 显示全平按钮
- 显示指定平仓
- 显示反向按钮

实时资金

提供交易账号的资金栏目。

投资者栏位选单提供全部已登录交易账号，可以切换查看。

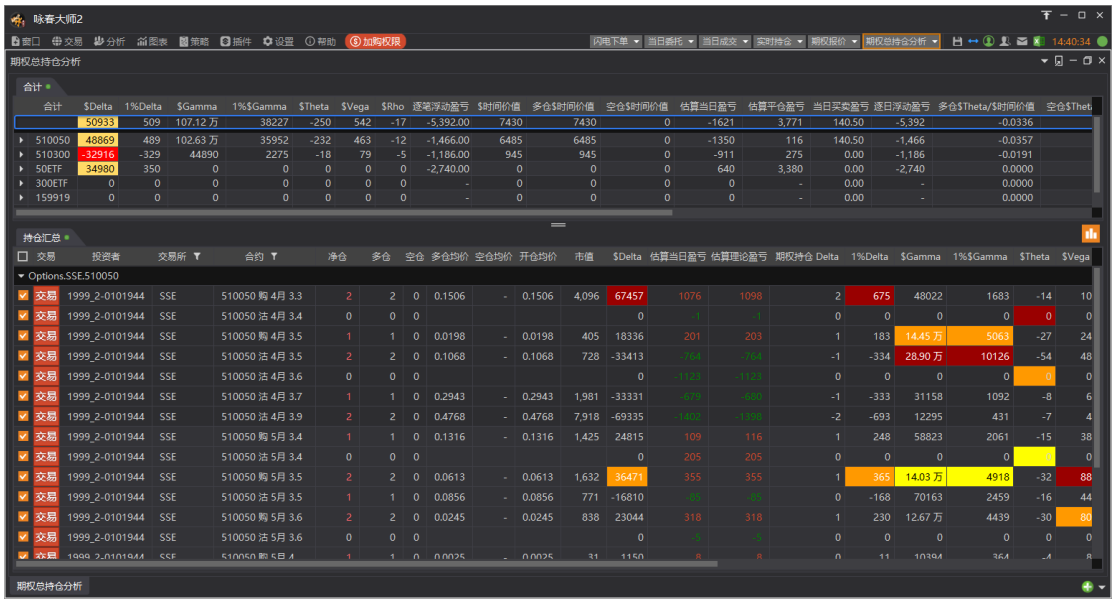
- 右键菜单，可以勾选显示栏位。

- 每 N 秒更新:
  - 默认不启用，勾选秒数后，则按设定秒数自动更新重查资金。

分析功能

期权总持仓分析

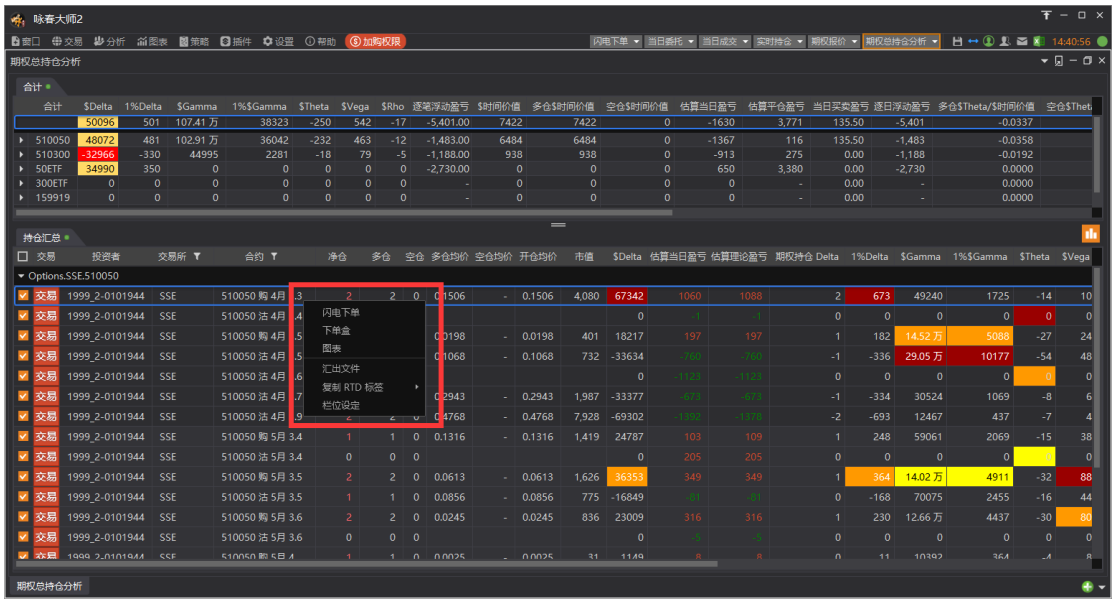
提供使用者账号的持仓风险分析计算，可针对风险参数进行监控并设定警示，帮助使用者有效管理持仓风险。



- 持仓汇总资料栏位

  持仓汇总除了一般的数量、价格、盈亏等资料栏位，还提供了特色的风险参数栏位

  - 期权持仓 Delta
  - $Delta
  - 1%$Delta
  - $Gamma
  - 1%$Gamma
  - $Theta
  - $Vega
  - $Rho
  - $Charm
  - $Vanna
  - $Vomma
  - $Speed
  - $Zooma
  - $时间价值
  - 估算当日盈亏
  - 估算理论损益

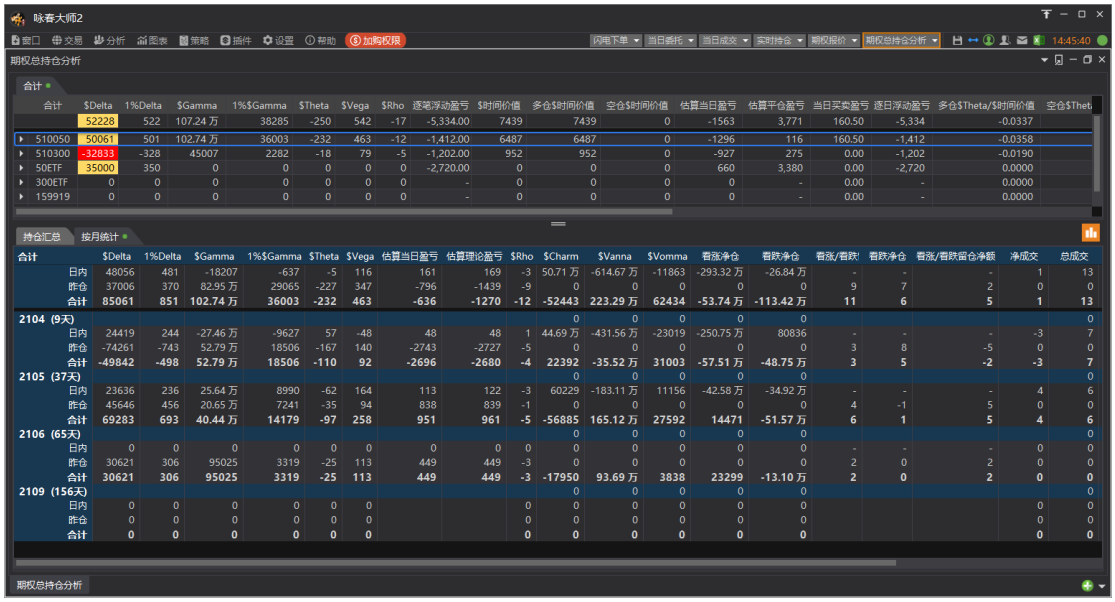


- 持仓汇总右键菜单
  - 点选持仓合约之后，通过右键菜单，可开启：闪电下单、下单盒、图表。
  - 汇出文件：将持仓汇总资料汇出.csv 格式文件保存。
  - 栏位设定：勾选要显示的栏位
- 开启交易
  - 在持仓中，点击的净仓栏位数量，可弹出下单工具
  - 持仓中，提供「交易」按钮功能，点击弹出下单工具。
- 合计

  根据期权品种分类合计风险参数及损益。
  - 合计栏位包括：
    - 品种
    - $Delta
    - 1%$Delta
    - $Gamma
    - 1%$Gamma
    - $Theta
    - $Vega
    - $Rho
    - 逐笔浮动盈亏
    - $时间价值
    - 多仓$时间价值
    - 空仓$时间价值
    - 估算当日盈亏
    - 估算平仓盈亏
    - 当日买卖盈亏
    - 逐日浮动盈亏
    - 多仓$Theta/$时间价值
    - 空仓$Theta/$时间价值
    - 估算理论盈亏

- $Charm
- $Vanna
- $Vomma
- $Speed
- $Zomma
- 净成交
- 总成交
- 权利仓
- 总持仓
- 总开仓
- 昨净留仓
- 成交持仓比
- 委托笔数
- 成交笔数
- 删单笔数

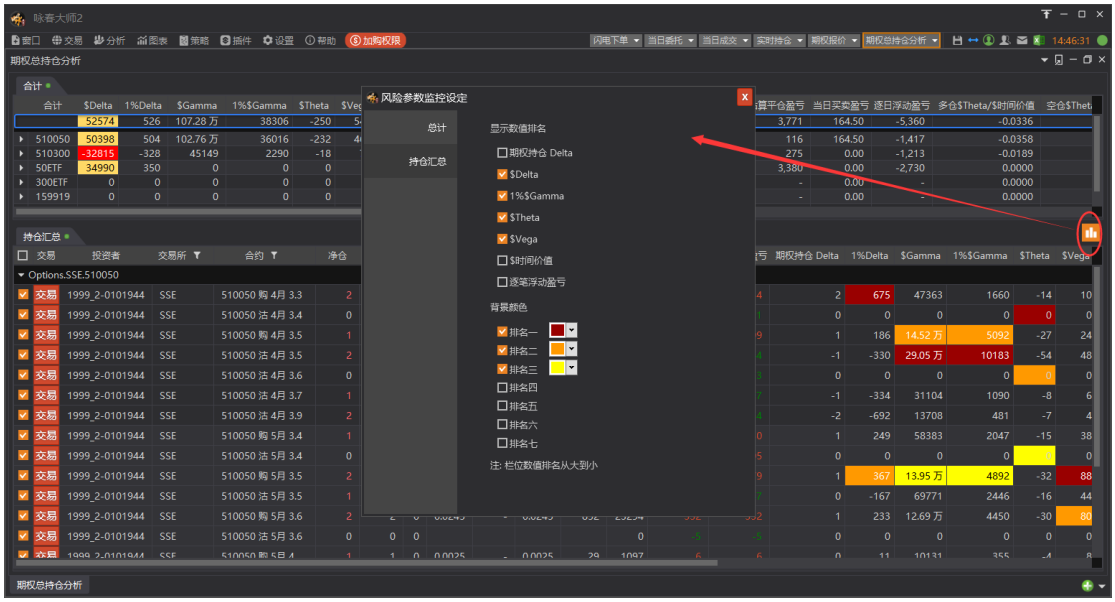
- 按月统计



从合计中，点选期权品种，下方会出现该品种的按月统计资料。

- 风险参数监控设定

■ 提供总计的风险参数监控设定



■ 提供持仓汇总的栏位数值排名监控设定。

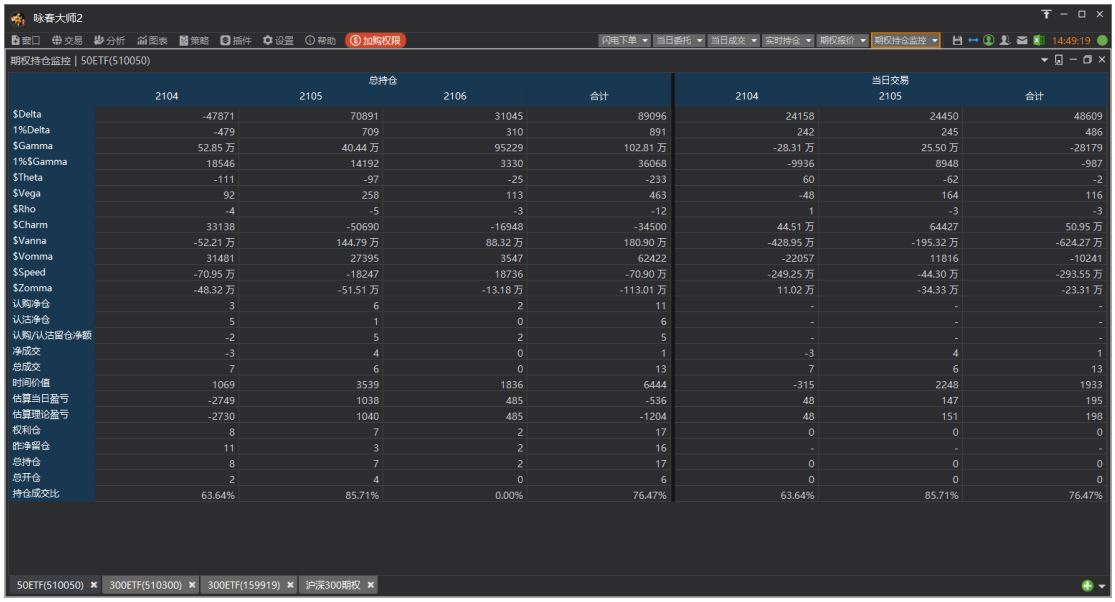
- **风险参数计算**

  在总计、持仓汇总中，各项风险参数栏位的计算说明如下：

风险值名称	定义
期权持仓 Delta	Delta × 持仓数量
$Delta	Delta × 合约单位 × 净仓数量 × 参考标的价格
1%$Delta	0.01 × Delta × 合约单位 × 净仓数量 × 参考标的价格
$Gamma	Gamma × 合约单位 × 净仓数量 × 参考标的价格

1%$Gamma	0.01 × Gamma × 合约单位 × 净仓数量 × 参考标的价格 × 参考标的价格
$Theta	Theta × 合约单位 × 净仓数量
$Vega	Vega × 合约单位 × 净仓数量
$Rho	Rho × 合约单位 × 净仓数量 × 0.01
$Charm	净仓数量 × Charm × 参考标的价格 ×合约单位
$Vanna	净仓数量 × Vanna × 100 × 合约单位
$Vomma	净仓数量 × Vomma × 合约单位
$Spedd	净仓数量 × Speed × 参考标的价格 ×合约单位
$Zomma	净仓数量 × Zomma × 参考标的价格 × 合约单位
$时间价值	时间价值 × 合约单位 × 持仓数量
多仓$时间价值	多仓的$时间价值加总
空仓$时间价值	空仓的$时间价值加总
多仓$Theta/$时间价值	多仓的$Theta 加总 / 多仓的$时间价值加总
空仓$Theta/$时间价值	空仓的$Theta 加总 / 空仓的$时间价值加总
逐笔浮动盈亏	以开仓价格计算的浮动盈亏
逐日浮动盈亏	以持仓价格计算的浮动盈亏
估算当日盈亏	逐日浮动盈亏 + 估算平仓盈亏
估算理论盈亏	理论浮动盈亏 + 估算平仓盈亏

期权持仓监控



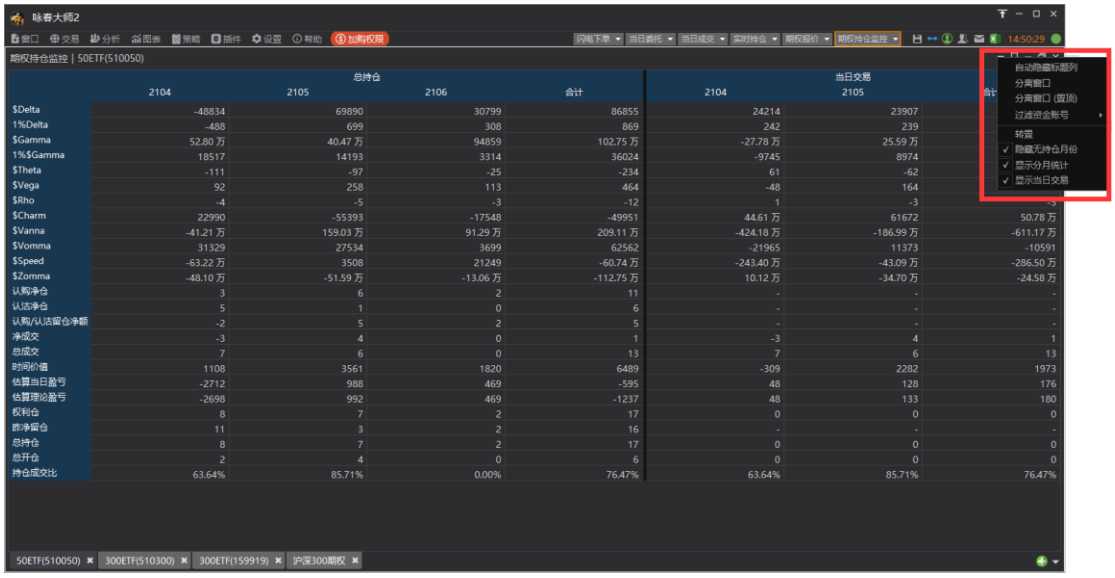
	总持仓				当日交易		
	2104	2105	2106	合计	2104	2105	合计
$Delta	-47871	70891	31045	89096	24158	24450	48609
1%Delta	-479	709	310	891	242	245	486
$Gamma	52.85 万	40.44 万	95229	102.81 万	-28.31 万	25.50 万	-28179
1%$Gamma	18546	14192	3330	36068	-9936	8948	-987
$Theta	-111	-97	-25	-233	60	-62	-2
$Vega	92	258	113	463	-48	164	116
$Rho	-4	-5	-3	-12	1	-3	-3
$Charm	33138	-50690	-16948	-34500	44.51 万	64427	50.95 万
$Vanna	-52.21 万	144.79 万	88.32 万	180.90 万	-428.95 万	-195.32 万	-624.27 万
$Vomma	31481	27395	3547	62422	-22057	11816	-10241
$Speed	-70.95 万	-18247	18736	-70.90 万	-249.25 万	-44.30 万	-293.55 万
$Zomma	-48.32 万	-51.51 万	-13.18 万	-113.01 万	11.02 万	-34.33 万	-23.31 万
认购净仓	3	6	2	11	-	-	-
认沽净仓	5	1	0	6	-	-	-
认购/认沽留仓净额	-2	5	2	5	-	-	-
净成交	-3	4	0	1	-3	4	1
总成交	7	6	0	13	7	6	13
时间价值	1069	3539	1836	6444	-315	2248	1933
估算当日盈亏	-2749	1038	485	-536	48	147	195
估算理论盈亏	-2730	1040	485	-1204	48	151	198
权利仓	8	7	2	17	0	0	0
昨净留仓	11	3	2	16	-	-	-
总持仓	8	7	2	17	0	0	0
总开仓	2	4	0	6	0	0	0
持仓成交比	63.64%	85.71%	0.00%	76.47%	63.64%	85.71%	76.47%

提供各个期权品种的风险参数按月统计资料。(与期权总持仓分析的按月统计功能相同)

- 监控栏位：可以通过右键菜单设定显示栏位，以及栏位排序
  - $Delta
  - 1%$Delta
  - $Gamma
  - 1%$Gamma
  - $Theta
  - $Vega
  - $Rho
  - $Charm
  - $Vanna
  - $Vomma
  - $Speed
  - $Zomma
  - 认购净仓
  - 认沽净仓
  - 认购/认沽留仓净额
  - 期权净成交
  - 期权总成交
  - 时间价值
  - 估算当日盈亏
  - 估算理论盈亏
  - 权利仓
  - 昨净留仓
  - 总持仓
  - 总开仓

- 成交持仓比
- 委托笔数
- 成交笔数
- 删单笔数

- 在标题栏提供下拉菜单
  - 保持窗口最前
  - 过滤资金账号：可设定过资金账号，期权持仓监控以过滤后的账号计算。
  - 转置：将期权持仓监控的栏位显示转置
  - 隐藏无持仓月份：期权持仓监控将无持仓的月份隐藏
  - 显示分月统计：可设定是否显示分月统计数据。
  - 显示当日交易：可设定是否显示当日交易数据



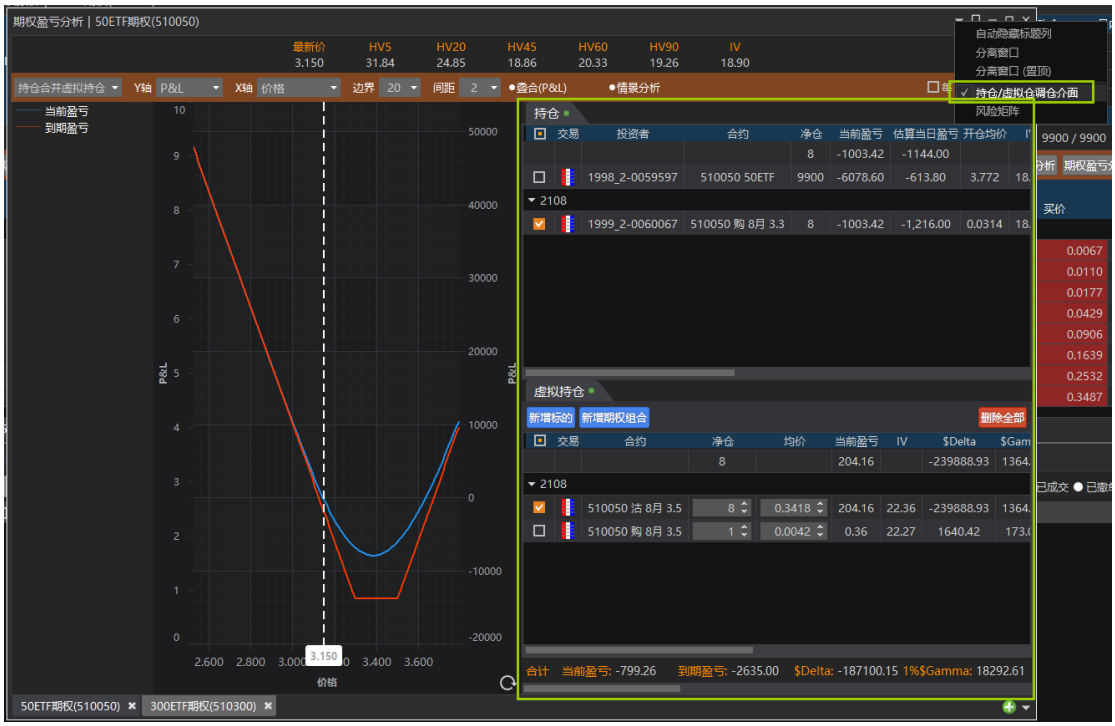
	总持仓				当日交易		
	2104	2105	2106	合计	2104	2105	合计
$Delta	-48834	69890	30799	86855	24214	23907	
1%Delta	-488	699	308	869	242	239	
$Gamma	52.80 万	40.47 万	94859	102.75 万	-27.78 万	25.59 万	
1%$Gamma	18517	14193	3314	36024	-9745	8974	
$Theta	-111	-97	-25	-234	61	-62	
$Vega	92	258	113	464	-48	164	
$Rho	-4	-5	-3	-12	1	-3	-3
$Charm	22990	-55393	-17548	-49951	44.61 万	61672	50.78 万
$Vanna	-41.21 万	159.03 万	91.29 万	209.11 万	-424.18 万	-186.99 万	-611.17 万
$Vomma	31329	27534	3699	62562	-21965	11373	-10591
$Speed	-63.22 万	3508	21249	-60.74 万	-243.40 万	-43.09 万	-286.50 万
$Zomma	-48.10 万	-51.59 万	-13.06 万	-112.75 万	10.12 万	-34.70 万	-24.58 万
认购净仓	3	6	2	11	-	-	-
认沽净仓	5	1	0	6	-	-	-
认购/认沽留仓净额	-2	5	2	5	-	-	-
净成交	-3	4	0	1	-3	4	1
总成交	7	6	0	13	7	6	13
时间价值	1108	3561	1820	6489	-309	2282	1973
估算当日盈亏	-2712	988	469	-595	48	128	176
估算理论盈亏	-2698	992	469	-1237	48	133	180
权利仓	8	7	2	17	0	0	0
昨净留仓	11	3	2	16	-	-	-
总持仓	8	7	2	17	0	0	0
总开仓	2	4	0	6	0	0	0
持仓成交比	63.64%	85.71%	0.00%	76.47%	63.64%	85.71%	76.47%

期权盈亏分析

提供期权持仓和虚拟仓的盈亏分析、风险分析功能。

通过“分析->期权盈亏分析“菜单打开期权盈亏分析，选定品种之后就可以看到对应品种的期权盈亏分析。

- 持仓/虚拟持仓调仓界面



- 右上角的下拉选单可以设定显示或隐藏持仓/虚拟仓调仓界面
  - 持仓：
    - ✓ 显示当前品种的持仓资料，可以勾选持仓合约加入盈亏分析
    - ✓ 在持仓中点击右键打开栏位设定，提供持仓栏位：
      - 投资者
      - 交易所
      - 合约
      - 净仓
      - 多仓
      - 空仓

- 多仓均价
- 空仓均价
- 市值
- 当前盈亏
- 到期盈亏
- 估算当日盈亏
- 开仓均价
- IV
- $Delta
- $Gamma
- 1%$Gamma
- 1%$Delta
- $Charm
- $Vanna
- $Vomma
- $Speed
- $Zomma
- $Theta
- $Vega
- $Rho
- 合约类型
- 行权价
- 到期日
-

✓ 合计栏位：净仓、当前盈亏、到期盈亏、估算当日盈亏、$Delta、$Gamma、1%$Gamma、1%$Delta、$Charm、$Vanna、$Vomma、$Speed、$Zomma、$Theta、$Vega、$Rho 栏位，会根据勾选持仓合约的数据计算出合计值。

◆ 虚拟持仓

✓ 可以通过“新增标的“、”新增期权组合“按钮，添加合约到虚拟持仓中。

✓ 已加入虚拟持仓的合约可以通过 “删除“按钮，或者”删除全部“按钮移除。

✓ 在虚拟持仓列表，可以勾选要加入盈亏分析的合约

✓ 虚拟持仓的“净仓“、“均价”栏位，可以手动修改，设定虚拟持仓合约净仓数量，均价。

✓ 在虚拟持仓中，右键打开栏位设定，提供栏位：

- 交易所
- 合约
- 净仓
- 均价
- 当前盈亏
- 到期盈亏
- IV
- $Delta

- $Gamma
- 1%$Gamma
- 1%$Delta
- $Charm
- $Vanna
- $Vomma
- $Speed
- $Zomma
- $Theta
- $Vega
- $Rho
- 合约类型
- 行权价
- 到期日

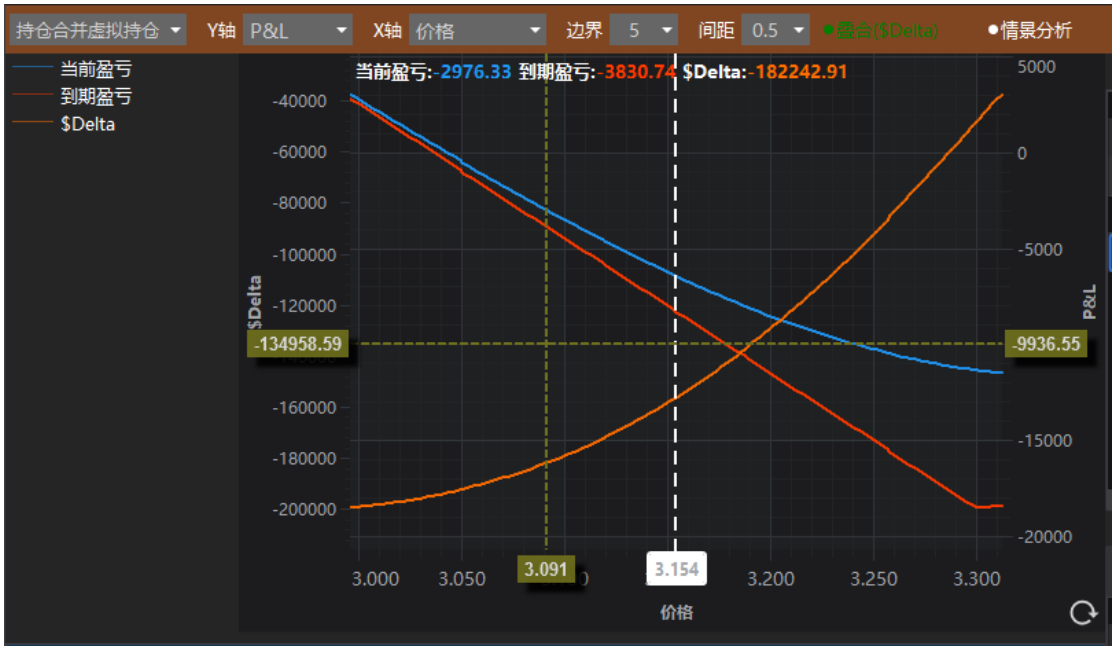
✓ 合计栏位: 净仓、当前盈亏、到期盈亏、$Delta、$Gamma、1%$Gamma、1%$Delta、$Charm、$Vanna、$Vomma、$Speed、$Zomma、$Theta、$Vega、$Rho 栏位，会根据勾选的虚拟持仓合约的数据计算出合计值。

◆ 在持仓/虚拟持仓的调仓界面下方，提供持仓+虚拟持仓的合计栏位，包括: 当前盈亏、到期盈亏、$Delta、1%$Gamma、$Theta、$Vega、$Rho、$Gamma、1%$Delta、$Charm、$Vanna、$Vomma、$Speed、$Zomma、

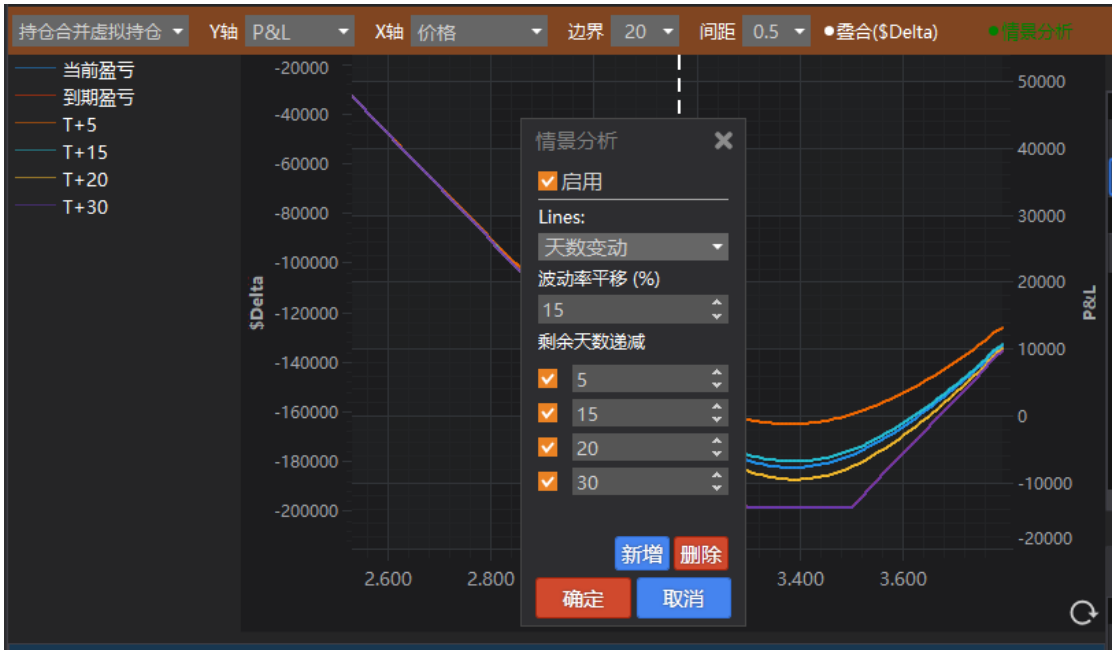
- 盈亏分析设定:
  - 持仓范围
    - ◆ 持仓合并虚拟持仓：绘图显示该品种持仓和虚拟持仓加总的分析结果
    - ◆ 持仓 vs.虚拟持仓：绘图显示该品种持仓 vs. 虚拟持仓各自的分析结果。
  - Y 轴:
    - ◆ P&L：绘图 Y 轴显示当前盈亏、到期盈亏
    - ◆ $Delta
    - ◆ 1%$Gamma
    - ◆ $Theta
    - ◆ $Vega
    - ◆ $Rho
  - X 轴:
    - ◆ 价格
    - ◆ 价格变化(%)
  - 边界
    - ◆ 按照标的价格作为中心点，按设定的边界比例计算横轴范围
  - 间距
    - ◆ 参考标的价格的间隔设置。
  - 叠合:
    - ◆ 添加一组 Y 轴的数据叠合显示，使用左侧 Y 轴坐标刻度。
    - ◆ 启用后，勾选要叠合显示图表中的数据，可选:
      - ✓ P&L
      - ✓ $Delta

- ✓ 1%$Gamma
- ✓ $Theta
- ✓ $Vega
- ✓ $Rho

◆ 如图所示，叠合显示$Delta：



■ 情境分析



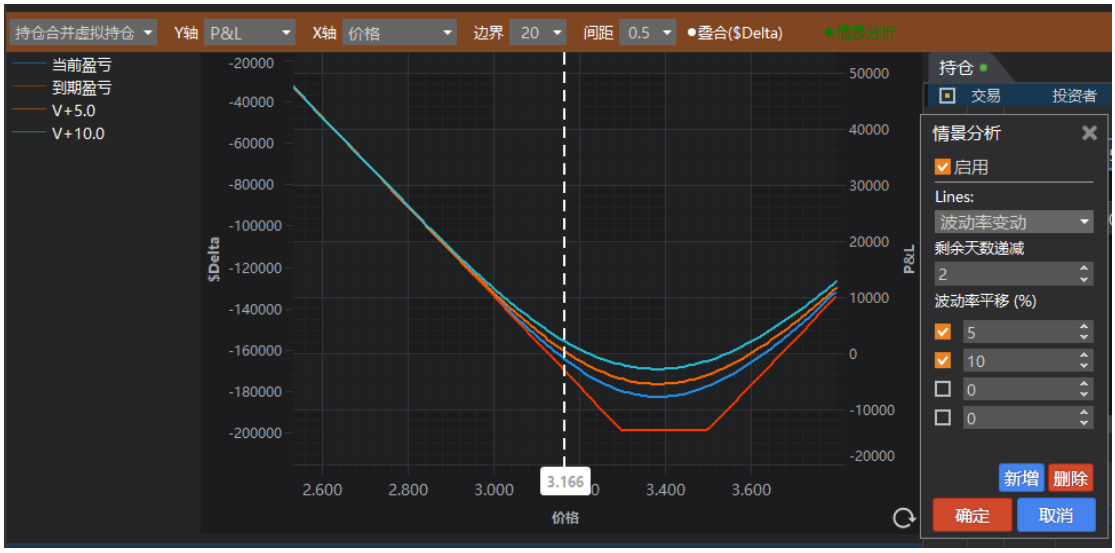
◆ 添加多种情况分析，可设定 天数变动、波动率变动

- ✓ 天数变动：
  - ■ 设定波动率平移(%)
  - ■ 设定剩余天数递减，可勾选多组
- ✓ 波动率变动
  - ■ 设定剩余天数递减

■ 设定波动率平移(%)，可勾选多组

✓ 启用情境分析后，对应情境分析曲线显示在图表中。

◆ 如图所示，分别为两天后波动率平移 5%、10%的情境分析曲线。



■ 设定自动更新频率

◆ 勾选后，盈亏分析按设定时间间隔重新计算并刷新

◆ 可选时间间隔：5 秒、15 秒、30 秒、60 秒

■ 手动刷新：

◆ 可按 按钮，手动刷新盈亏分析。

● 风险矩阵

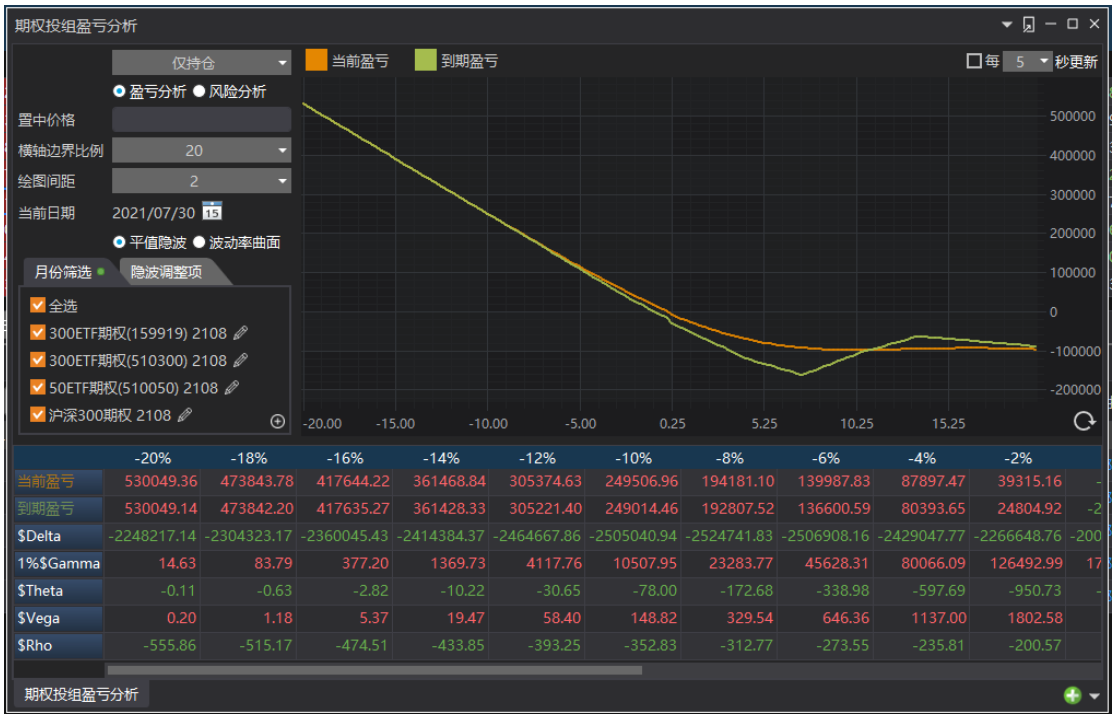
	4%	-12%	-10%	-8%	-6%	-4%	-2%	0%	2%	4%	6%	8%	10%	12%	14%
参考标的价格	2.717	2.781	2.844	2.907	2.970	3.033	3.097	3.160	3.223	3.286	3.349	3.412	3.476	3.539	3.602
当前盈亏	753.97	27700.06	22651.82	17623.41	12652.32	7819.21	3266.60	-799.26	-4134.55	-6509.35	-7763.06	-7837.97	-6779.82	-4712.12	-1800.69
到期盈亏	753.64	27698.12	22642.60	17587.08	12531.56	7476.04	2420.52	-2635.00	-7690.52	-12746.04	-13859.00	-13859.00	-13859.00	-10749.88	-5694.36
$Delta	360.55	-222301.57	-226892.11	-230407.57	-231250.44	-226669.78	-213059.56	-187100.15	-147350.44	-95318.94	-35233.10	27372.09	87351.96	141063.04	186624.68
1%$Gamma	20.13	95.41	364.42	1136.42	2930.67	6330.88	11605.15	18292.61	25137.82	30557.69	33364.33	33231.72	30642.55	26484.62	21645.19
$Theta	-0.15	-0.74	-2.82	-8.81	-22.79	-49.54	-91.63	-146.26	-204.33	-253.60	-283.87	-290.84	-276.30	-245.87	-206.24
$Vega	0.30	1.40	5.36	16.72	43.17	93.53	172.18	273.04	378.21	464.42	513.35	518.58	485.46	425.91	352.85
$Rho	-45.37	-41.71	-38.06	-34.41	-30.80	-27.30	-24.00	-21.06	-18.64	-16.93	-16.01	-15.96	-16.73	-18.22	-20.34

■ 以矩阵方式列出不同价格变化的盈亏、风险参数数据：

- 当前盈亏
- 到期盈亏
- Delta ¥
- Gamma ¥
- Theta ¥
- Vega ¥
- Rho ¥

期权投组盈亏分析

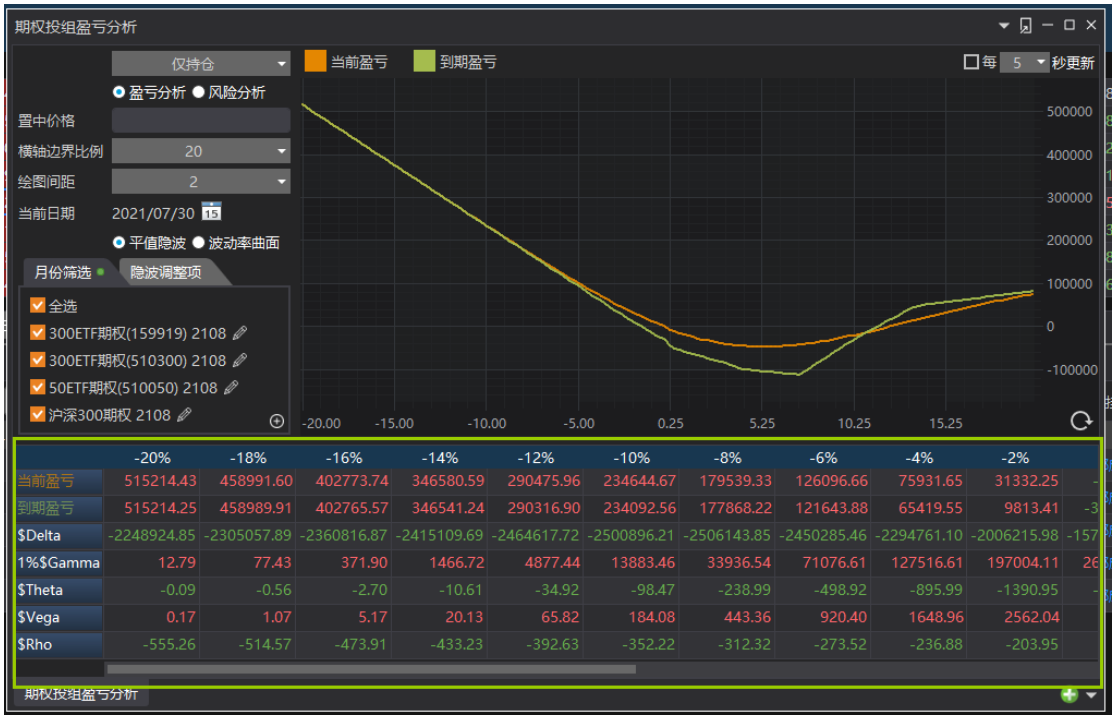
期权投组盈亏分析。提供投资组合模式，可以实现跨品种的盈亏分析。



- 盈亏分析设定：
  - 选单提供选择持仓范围
    - 仅持仓：绘图只显示该品种所有登入账号持仓的分析结果
    - 持仓合并虚拟持仓：绘图显示该品种所有登入账号持仓&虚拟持仓加总的分析结果
    - 仅虚拟持仓：绘图只显示该品种 虚拟持仓的分析结果
    - 持仓 vs.虚拟持仓：绘图显示该品种所有登入账号持仓和虚拟持仓各自的分析结果。
  - 虚拟仓设定：
    - 在期权标的报价、T 字报价中，提供“虚拟仓”栏位，可以设定对应期权合约的虚拟仓数量。
  - 分析类型：
    - 盈亏分析：显示当前盈亏、到期盈亏的图形。

- ◆ 风险分析：显示 Delta￥ Gamma￥ Theta￥ Vega￥ Rho￥ 风险参数图形分析
- ■ 置中价格：
  - ◆ 图形绘制的中心点价格，默认使用参考标的的最新价。
- ■ 横轴边界比例
  - ◆ 按照置中价格作为中心点，按设定的边界比例计算横轴范围
- ■ 绘图间距
  - ◆ 绘图横轴计算点的间隔设置。
- ■ 设定日期
  - ◆ 模型时间参数切换，默认使用当天日期
- ■ 波动率
  - ◆ 平值隐波：使用平值隐含波动率计算参考标的价格变动时的盈亏和 Greeks
  - ◆ 波动率曲面：使用波动率曲线计算参考标的价格变动时的盈亏和 Greeks
- ■ 月份筛选
  - ◆ 筛选期权品种、到期月份。
- ■ 隐波调整项
  - ◆ 指定特定月份设定波动率上下变动比例

- 风险矩阵

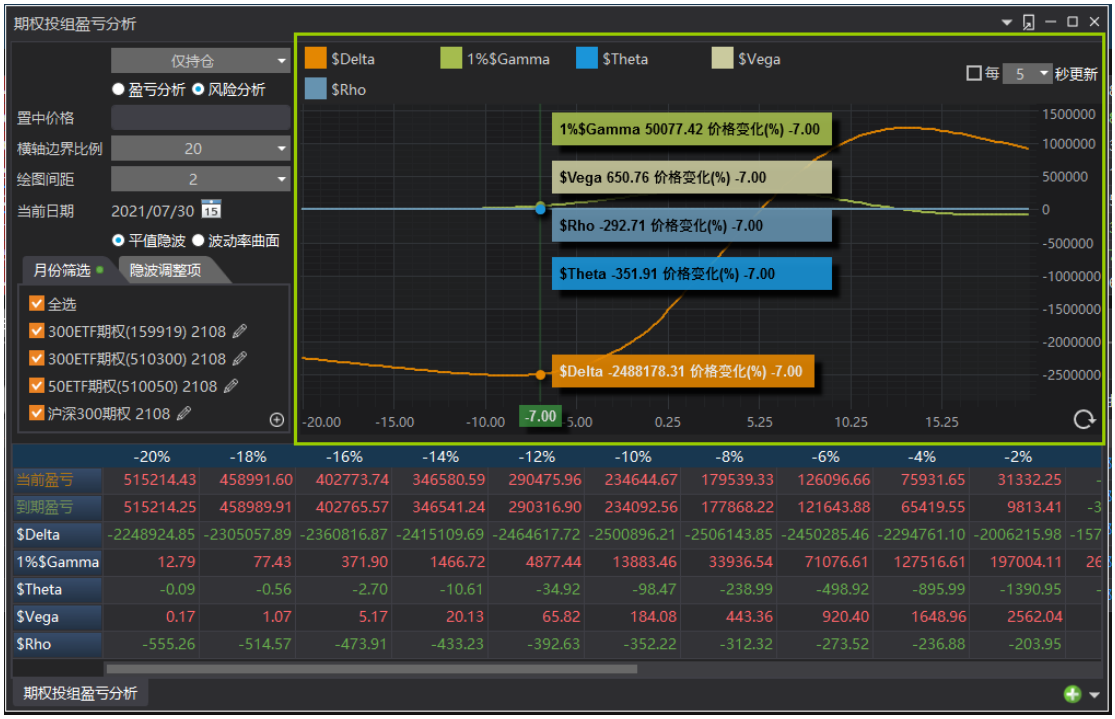


已矩阵方式显示不同参考标的的价格变动%时的盈亏和风险数据。

- ■ 参考标的的价格变化%：投资组合模式，横轴只支持价格变化%刻度显示。
- ■ 数据：
  - ◆ 当前盈亏
  - ◆ 到期盈亏
  - ◆ 当前盈亏(隐波上升)
  - ◆ 当前盈亏(隐波下降)

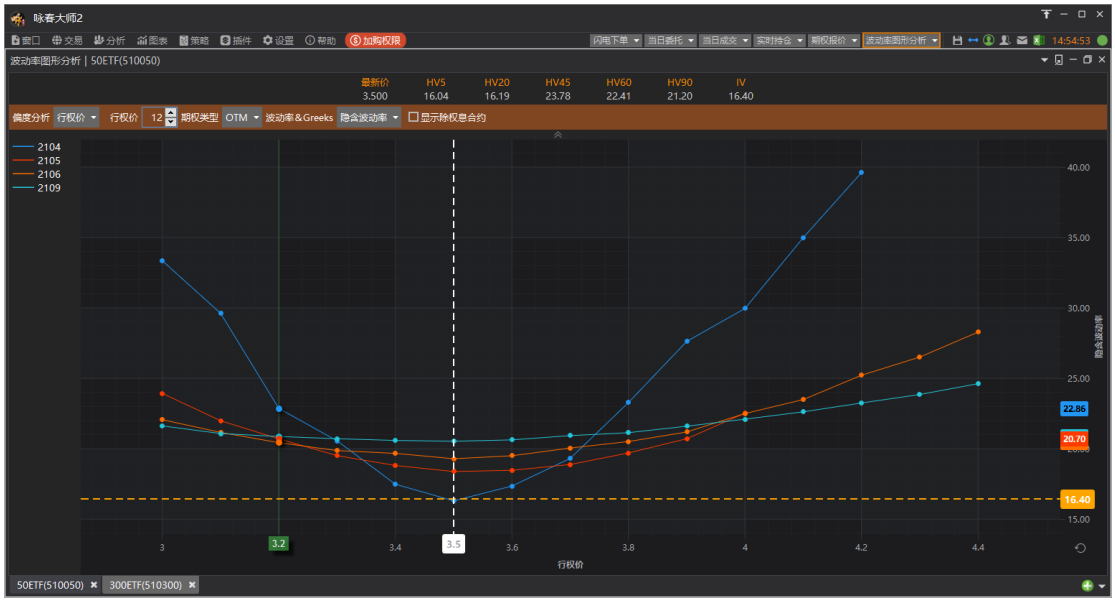
- Delta ¥ (隐波上升)
- Delta ¥
- Delta ¥ (隐波下降)
- Gamma ¥ (隐波上升)
- Gamma ¥
- Gamma ¥ (隐波下降)
- Theta ¥ (隐波上升)
- Theta ¥
- Theta ¥ (隐波下降)
- Vega ¥ (隐波上升)
- Vega ¥
- Vega ¥ (隐波下降)
- Rho ¥ (隐波上升)
- Rho ¥
- Rho ¥ (隐波下降)

- 绘图区



- Y 轴数据：点击可以显示/隐藏该项数据画线。
- 每 n 秒更新：勾选后图表可以按照设定秒数更新
- 重新载入：点击按钮，重新计算并绘图。

波动率图形分析



提供使用者监看期权合约不同月份和行权价的隐含波动率&Greeks 分布图。

通过“分析->波动率图形分析”菜单打开波动率图形分析，选定品种之后就可以看到对应的波动率图形分析。

- 标的报价：提供期权标的（热门月）的最新价、HV5、HV20、HV45、HV60、HV90、IV。

- 控制列

- ◆ 偏度分析：设定依行权价、到期日作为图表的横向坐标
- ◆ 行权价/到期日数量：设定横向坐标行权价或者到期日的数量。

■ 期权类型

- ◆ OTM：使用 call/put 价外合约的数据。
- ◆ 认购 Call：使用 call 合约的数据
- ◆ 认沽 Put：使用 put 合约的数据
- ◆ 认购&认沽：使用 call 和 put 合约的数据

■ 波动率&Greeks：

- ◆ 隐含波动率：以合约隐含波动率作为图表的纵向坐标分析
- ◆ Delta：以期权合约 Delta 作为图表的纵坐标
- ◆ Theta：以期权合约 Theta 作为图表的纵坐标

■ 显示除权息合约：可设定是否显示股票期权除权息合约的数据。

■ 隐藏/显示控制列：在箭头上点击可以隐藏、显示控制列

● 数据系列

■ 在图表的左侧显示数据系列。

■ 行权价偏度分析，数据系列为各期权月份，鼠标点击标签可将图表上对应月份的数据曲线隐藏

- 到期日偏度分析，数据系列为各行权价，鼠标点击标的可将图表上对应行权价的数据隐藏。

- 图表区：
  - 完成控制列的设定，在图表区绘制对应的数据图表。
- Reset
  - 按下 reset 按钮，刷新图表中的数据。

期权波动率曲面管理

提供期权品种，各月份波动率曲线与 ATM 波动率走势数据。

- 期权月份：显示各月份的实时、昨结或自定义 IV 结构数据。
  - 合成期货
  - IV：ATM IV 数值
  - PSkw

- CSkw
- 期货升贴水(%)
- 涨跌(涨跌%)
- STD TV
- STD TV Chg(%)
- CIV10
- PIV10
- CIV25
- PIV25
- FIV
- FCIV25
- FPIV25
- CTail
- PTail
- STD
- STD Chg(%)
- HV5 ~ HV245
- 交易日天数
- 自然日天数
- 年化交易日
- 年化自然日
- 显示月份

- 自定义波动率曲线

  - 可通过锁定/解锁图标，打开设置自定义 IV 类型，可以选择快照当前 IV 结构，或者快照 昨结 IV 结构。

- 波动率曲线
  - 显示月份：可设定各期权月份的波动率（OTM IV）叠加显示
  - 点选期权月份栏，显示该月份的波动率曲线，包括以下数据
    - MIV：中间价计算的 IV 值
    - BIV：买价计算的 IV 值

- ◆ SIV：卖价计算的 IV 值
- ◆ 昨 IV：昨结算价计算的 IV 值
- ◆ 自定义：快照当前 IV 或者昨结 IV，也可以不设定
- ◆ 期权月份：各期权月份的 OTM IV 叠加显示
- ■ 点击上方图例可以隐藏/显示绘图。

- ● 实时（历史）ATM 波动率走势图
  - ■ 提供当日的实时和历史 ATM 波动率走势图
    - ● 可设定 1 秒、5 秒、15 秒、30 秒、60 秒周期
    - ● 鼠标操作：
      - ■ 鼠标拖曳走势数据；
      - ■ 鼠标滚轮左右滑动数据；
      - ■ Crtl+鼠标滚轮缩放数据
    - ● 设定“一天”可查看当天全部数据
    - ● 设定“%”可切换为百分比刻度

在上方期权月份中可勾选显示月份，叠加显示多月份的 ATM 波动率走势

图表功能

技术线图

提供合约分钟、日线的技术线图功能。

- 线图类型:
  - 蜡烛线
  - 美国线
  - 山形图
  - 线形
- 周期:
  - 1 分、3 分、5 分
  - 1 日
- 鼠标操作:
  - 鼠标左键：左右拖动线图
  - 鼠标滚轮：左右滑动线图
  - Ctrl+鼠标滚轮：缩放线图
- 放大线图:
  - 点击左侧放大镜🔍按钮，进入放大模式：在图表中选取放大区间，可将数据放大显示。
  - 点击指针 按钮，退出缩大模式。
- 指标 中提供以下几种指标，点选即可加入到图表中:
  - 一般指标
    - SMA(简单移动平均)
    - EMA(指数移动平均)

- BOLL(布林通道)
- MACD(平滑异同移动平均)
- DMI(动向指标)
- RSI(相对强弱指标)
- SKD(慢速随机指标)
- VOL(成交量)

■ 期权标的商品，提供指标：

- ATM IV
- 未平仓量 P/C Ratio
- 成交量 P/C Ratio

■ 设置指标

- 点击设置按钮，修改参数
- 点击删除按钮，将指标移除。

期权参考标的走势图

提供期权各品种原生标的合约，以及合成期货标的的走势数据。

- 上方点击栏目可以显示/隐藏该栏目走势。
- 可设定走势数据周期为 1 秒、5 秒、15 秒、30 秒
- 可设定显示“1 天”，或“2 天”的全部数据
- 设定“%” 可切换为百分比刻度
- 鼠标操作：
  - 鼠标左键拖曳走势数据；
  - 鼠标滚轮左右滑动数据；
  - Crtl+鼠标滚轮缩放数据

平值隐含波动率走势图

提供期权各品种各月份的平值隐含波动率走势数据，可以添加多月份数据比较分析。

- 上方栏目提供期权品种预设的月份 ATM 行权价，点击栏目可以显示/隐藏该栏目走势。
  - 通过下拉选单可以切换月份、行权价，或者删除栏目。
- 可设定走势数据周期为 1 秒、5 秒、15 秒、30 秒
- 可设定显示“1 天”，或“2 天”的全部数据
- 设定“%” 可切换为百分比刻度
- 鼠标操作：
  - 鼠标左键拖曳走势数据；
  - 鼠标滚轮左右滑动数据；
  - Crtl+鼠标滚轮缩放数据

跨式组合权利金走势图

提供期权各品种各月份的跨式组合权利金走势图，可以添加多月份数据比较分析。

- 上方栏目提供期权品种预设的月份 ATM 行权价，点击栏目可以显示/隐藏该栏目走势。
  - 通过下拉选单可以切换月份、行权价，或者删除栏目。
- 支持自选跨式组合合约

- 可设定走势数据周期为 1 秒、5 秒、15 秒、30 秒；1 分、3 分、5 分、15 分、30 分
- 可设定显示最长 30 天分钟周期数据，最长 5 天秒周期数据
- 设定“%”可切换为百分比刻度
- 鼠标操作：
  - 鼠标左键拖曳走势数据；

- 鼠标滚轮左右滑动数据；
- Crtl+鼠标滚轮缩放数据

跨式组合时间价值走势图

提供期权各品种各月份的跨式组合时间价值走势数据，可以添加多月份数据比较分析。

- 上方栏目提供期权品种预设的月份 ATM 行权价，点击栏目可以显示/隐藏该栏目走势。
  - 通过下拉选单可以切换月份、行权价，或者删除栏目。
- 支持自选跨式组合合约

- 可设定走势数据周期为 1 秒、5 秒、15 秒、30 秒；1 分、3 分、5 分、15 分、30 分

- 可设定显示最长 30 天分钟周期数据，最长 5 天秒周期数据
- 设定“%”可切换为百分比刻度
- 鼠标操作：
  - 鼠标左键拖曳走势数据；
  - 鼠标滚轮左右滑动数据；
  - Crtl+鼠标滚轮缩放数据

期权波动率走势

提供期权各个月份的标的涨幅&VIX、Call / Put Skew、合成期货-标的价差变化的实时数据，以及近 30 日的历史分钟数据。

- 期权月份：
  - 在图表右侧，显示各月份的实时、昨结或自定义 IV 结构数据。
    - 合成期货
    - IV：OTM IV 数值
    - IV 涨跌(%)
    - PSkw
    - CSkw
    - 期货升贴水(%)
    - 涨跌(涨跌%)
    - STD TV
    - STD TV Chg(%)
    - CIV10
    - PIV10
    - CIV25
    - PIV25
    - FIV
    - FCIV25

- FPIV25
- CTail
- PTail
- STD
- STD Chg(%)
- HV5 ~ HV245
- 交易日天数
- 天数
- 年化交易日
- 显示月份

■ 通过图表左上角的按钮可以设置展开或收起右侧的期权月份栏位

● 显示月份设定

■ 勾选“显示月份”，图表数据可以叠加多个月份显示。

● 图表走势

■ 主图提供 IV 走势数据。

■ 子图 1 提供”Call/Put Skew”走势数据

■ 子图 2 提供“合成期货/标的价差”走势数据

■ 通过图表右上的按钮，打开设置，再用鼠标拖曳指标上下移动，可以调整三个图表显示顺序。

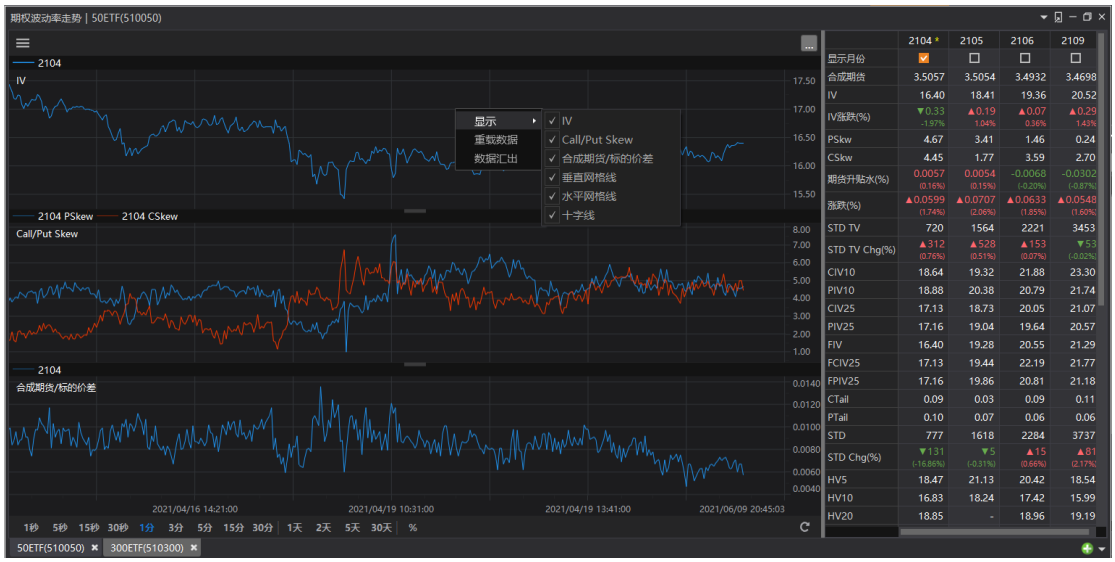
- 数据周期和区间
  - 默认提供 30 天分钟数据
  - *开通加值服务，提供 5 天秒线数据
  - 通过左下角按钮，可设定数据周期、数据区间。

- 鼠标操作
  - 鼠标左键拖曳，可左右移动查看走势数据
  - 鼠标放置在图表中，使用滚轮滑动走势。
  - 鼠标放置在图表中，使用 Ctrl+滚轮缩放走势
- 坐标设置
  - 缩放纵坐标刻度：鼠标放置在纵坐标上，变为 时，可以拖曳缩放纵坐标刻度。
  - 百分比刻度：点击 按钮可以切换百分比坐标。
- 图表右键菜单
  - 显示菜单

- ◆ 可勾选要显示的指标
- ◆ 勾选显示：垂直网格线、水平网格线、十字线

■ 可设定重载数据

■ 可将数据汇出，保存一份.xlsx 格式数据到本地电脑



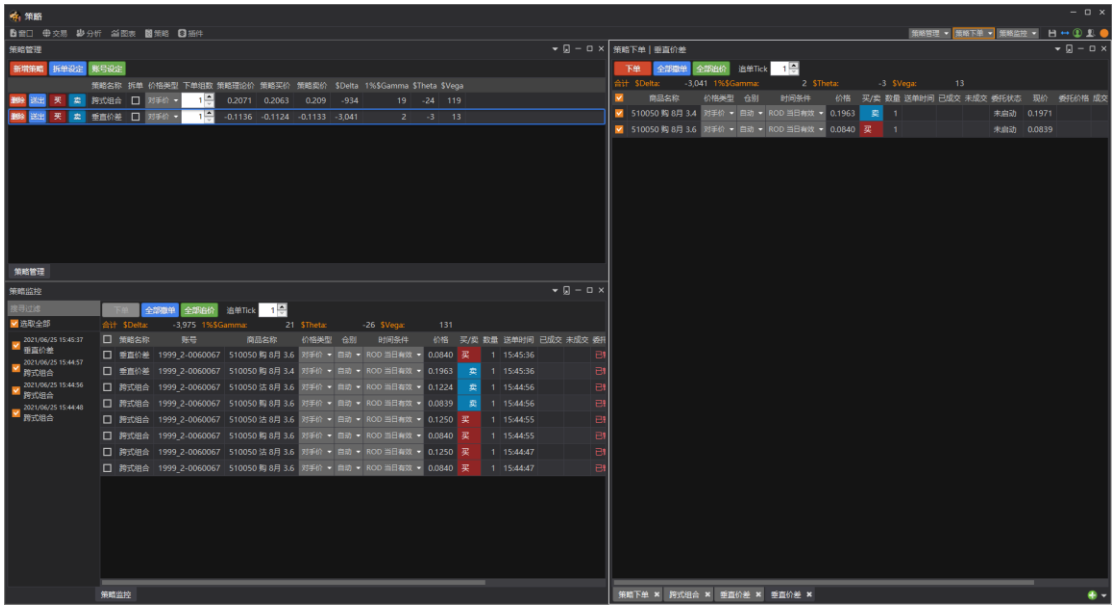
● 重新载入

■ 点击按钮，会将坐标恢复预设，重新回补数据并画图。

策略功能

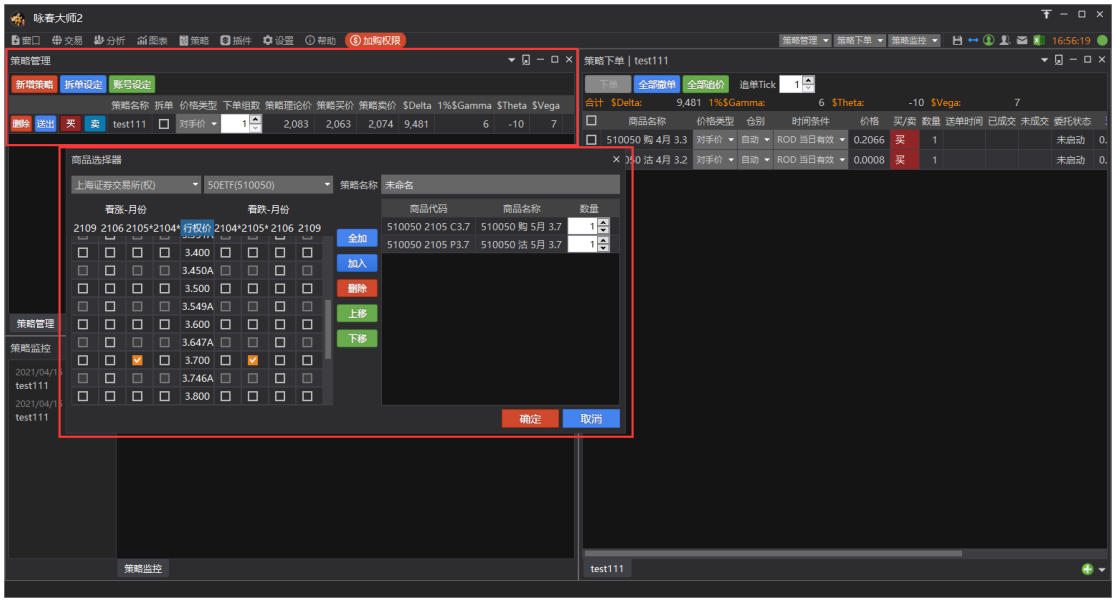
（*此为加值功能）

可以通过策略 选单，打开策略管理、策略下单、策略监控功能。



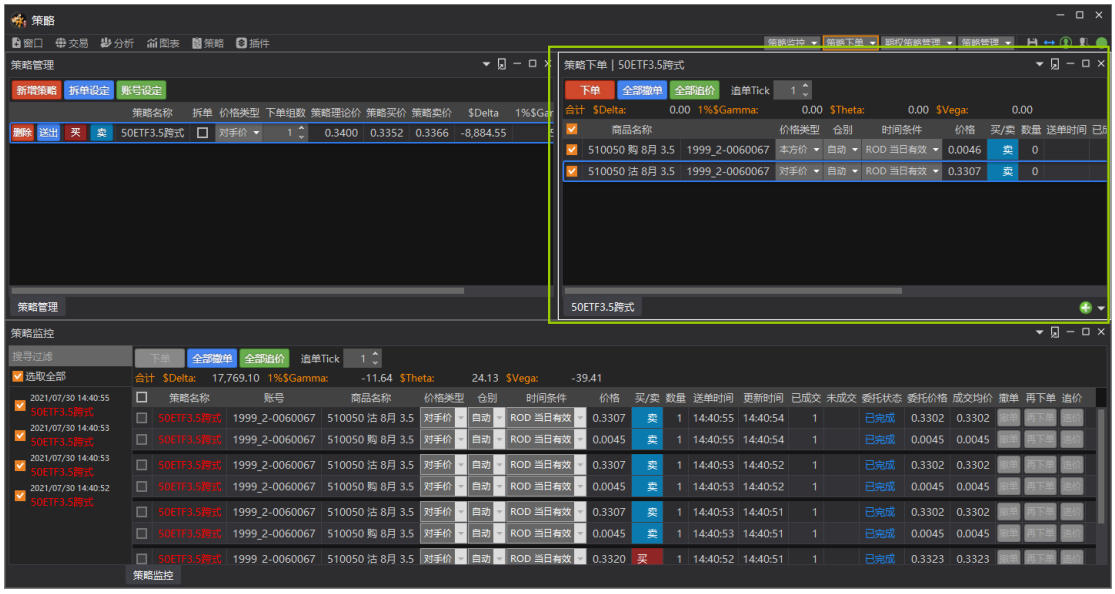
提供使用者创建任意组合的策略，实现一键下单功能。

策略管理



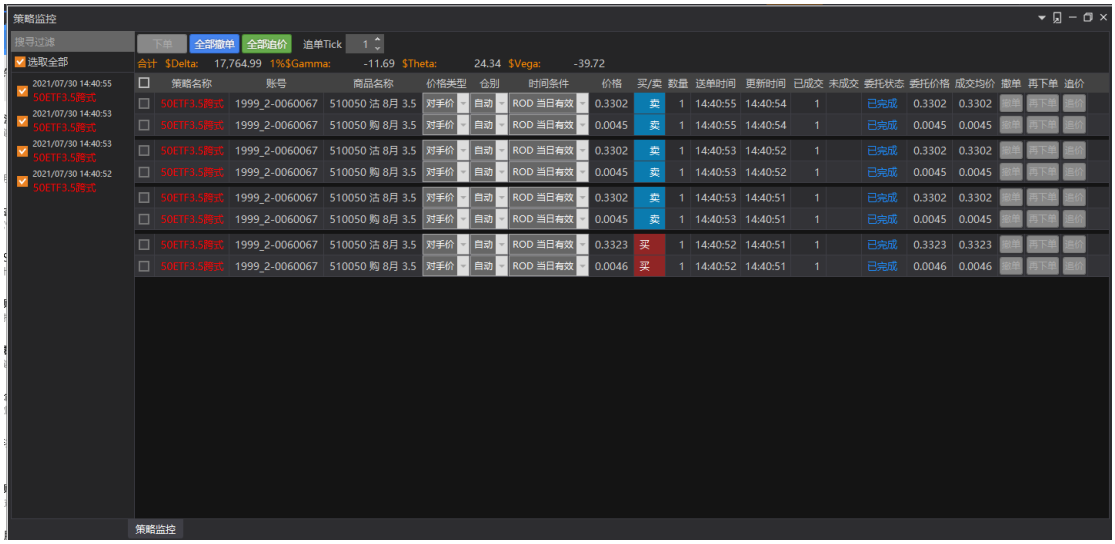
- 新增策略
  - 可通过[商品选择器]选取任意合约，加入策略，可设定策略名称和商品数量。
  - 策略数量：正数表示买；负数表示卖
- 账号设定
  - 不同交易所商品的下单账号设定。根据账号设定，策略中商品会下单到不同账号，在策略下单前必须先设定好账号。
- 删除：删除策略
- 送出：不直接下单，而是将策略送出到“策略下单”界面中。
- 设定价格类型
  - 对方价
  - 本方价
  - 市价
- 设定下单组数
- 快速买卖：点击“买”“卖”按钮直接将策略送出下单。
- 拆单：
  - 勾选“拆单”，送出策略下单将套用拆单设定。
- 拆单设定：
  - 提供 拆单、冰山拆单、自动拆单设定。

策略下单



- 下单步骤
  - 在策略管理中，设定好策略之后，选择价格类型，可选对手价、本方价、市价
  - 设定下单组数
  - 点击“送出”，将策略送出到“策略下单”视图
  - 再从“策略下单”视图中检查是否设定好价格类型、仓别、时间条件，勾选商品，一键下单
- 未成交的部分，可以进行全部撤单、全部追单、再下单、追单操作
- 策略追价时，追价价格为策略委托价格加挂设定的“追单 tick“数。

策略监控

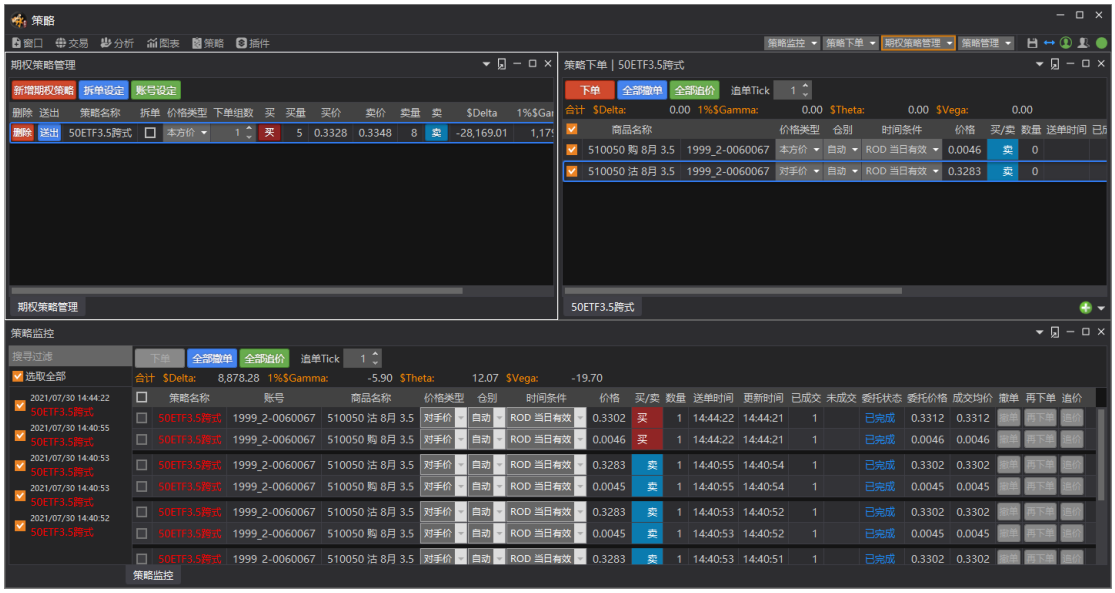


通过策略下单后，下单记录将保存在策略监控中。当退出系统重启软件后，会清除之前的策

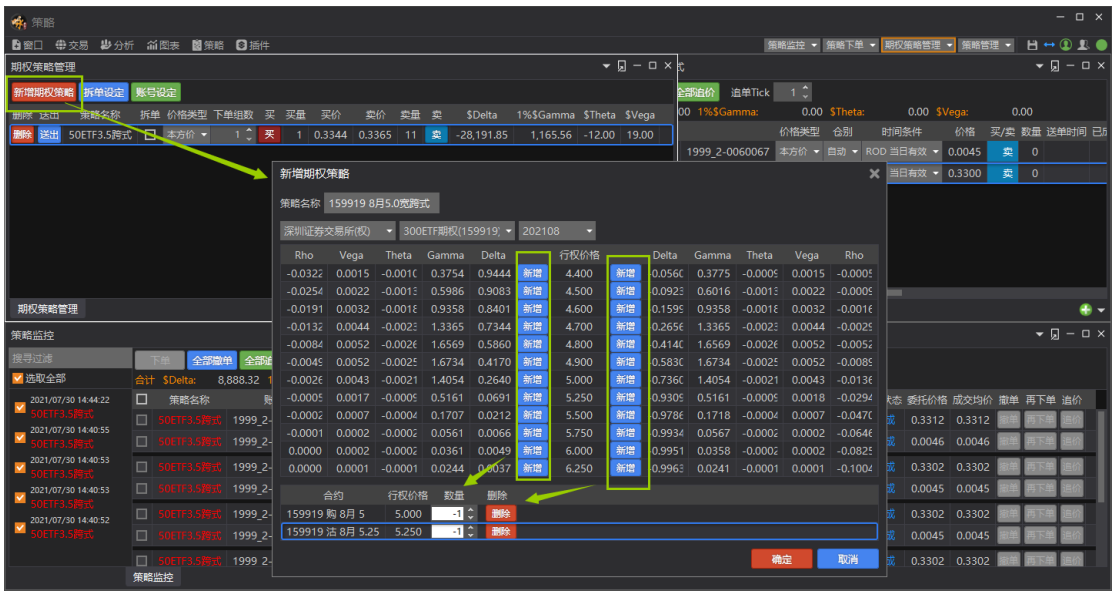
略监控记录。

可以在策略监控中对策略未成交部分进行撤单、再下单、追单操作。

期权策略管理



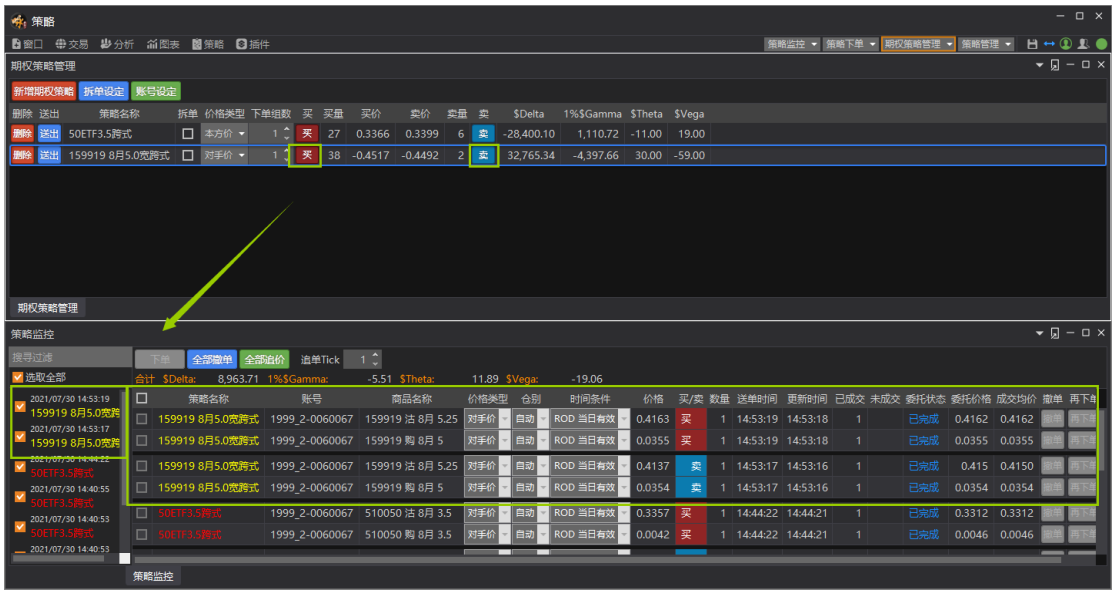
针对期权相关品种，提供的策略管理功能



- 新增期权策略
  - 通过新增期权策略，设定策略名称、新增策略合约、数量，加入策略
  - 合约数量：正数表示买；负数表示卖
- 期权策略提供试算的买卖价量、$Delta、1%$Gamma、$Theta、$Vega 试算数据。
- 账号设定
  - 不同交易所商品的下单账号设定。根据账号设定，期权策略中商品会下单到不同账

号，在策略下单前必须先设定好账号。

- 删除：删除策略
- 送出：不直接下单，而是将期权策略送出到“策略下单”界面中。
- 设定价格类型：
  - 对方价
  - 本方价
  - 市价
- 设定下单组数
- 快速买卖：点击“买”“卖”按钮直接将策略送出下单，下单记录显示在策略监控中。



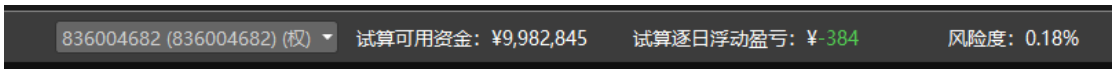
- 拆单：
  - 勾选“拆单”，送出策略下单将套用拆单设定。
- 拆单设定：
  - 提供 拆单、冰山拆单、自动拆单设定。

插件功能

提供“咏春”、“交易总管”、“资金转账”三个插件功能。

咏春

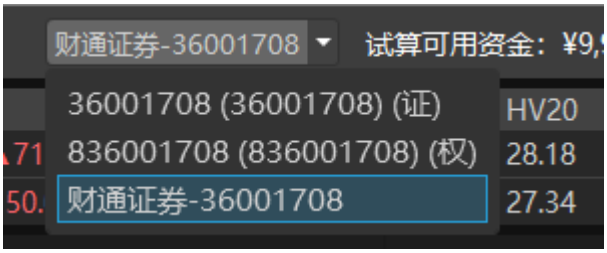
交易账户



- 在咏春主界面顶栏显示当前所选的交易账号，并显示出该账号的试算可用资金、试算逐

日浮动盈亏、风险度信息。

- 如果在交易连线中登录了多个账号，可以通过账号选单切换交易账号，同时账务信息也会随之更新。
- 在交易连线中，同时登录期权+现货账号，可关联为群组账号，选择群组账号，则可在咏春主界面同时交易期权&标的现货。



选择合约

- 交易所列表
  - 上海证券交易所
  - 深圳证券交易所
  - 中国金融期货交易所
- 商品
  - 选定交易所下的期权商品。
- 合约月份
  - 切换期权合约月份并显示于期权报价。

期权报价

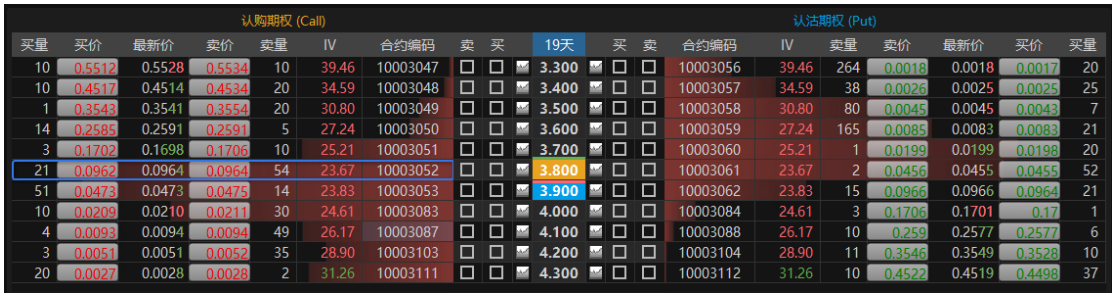
- 合成期货/标的报价

合成期货/标的	最新价	涨跌	IV	HV20	买价	卖价	挂单量	最高价	最低价	成交量	净仓	更新时间	线图
510050 2102	3.8469	▲0.0623(1.65%)	19.04	20.37	-	-	-	3.8483	3.7949	-		11:06:20	
510050 50ETF	3.857	▲0.07(1.85%)	20.99	18.85	3.857	3.858	12394×21288	3.858	3.799	1891519	0/0	11:06:19	

  - 提供期权合约的合成期货报价和标的报价。
  - 报价栏位：最新价、涨跌（涨跌幅）、IV、HV20、买价、卖价、挂单量、最高价、最低价、成交量、净仓、更新时间、线图。

- 买价、卖价按钮突出显示，点击可以打开下单盒窗口，下单盒连动设置标的合约。

- T 型报价



认购期权 (Call)									19天			认沽期权 (Put)						
买量	买价	最新价	卖价	卖量	IV	合约编码	卖	买		买	卖	合约编码	IV	卖量	卖价	最新价	买价	买量
10	0.5512	0.5528	0.5534	10	39.46	10003047			3.300			10003056	39.46	264	0.0018	0.0018	0.0017	20
10	0.4517	0.4514	0.4534	20	34.59	10003048			3.400			10003057	34.59	38	0.0026	0.0025	0.0025	25
1	0.3543	0.3541	0.3554	20	30.80	10003049			3.500			10003058	30.80	80	0.0045	0.0045	0.0043	7
14	0.2585	0.2591	0.2591	5	27.24	10003050			3.600			10003059	27.24	165	0.0085	0.0083	0.0083	21
3	0.1702	0.1698	0.1706	10	25.21	10003051			3.700			10003060	25.21	1	0.0199	0.0199	0.0198	20
21	0.0962	0.0964	0.0964	54	23.67	10003052			3.800			10003061	23.67	2	0.0456	0.0455	0.0455	52
51	0.0473	0.0473	0.0475	14	23.83	10003053			3.900			10003062	23.83	15	0.0966	0.0966	0.0964	21
10	0.0209	0.0210	0.0211	30	24.61	10003083			4.000			10003084	24.61	3	0.1706	0.1701	0.17	1
4	0.0093	0.0094	0.0094	49	26.17	10003087			4.100			10003088	26.17	10	0.259	0.2577	0.2577	6
3	0.0051	0.0051	0.0052	35	28.90	10003103			4.200			10003104	28.90	11	0.3546	0.3549	0.3528	10
20	0.0027	0.0028	0.0028	2	31.26	10003111			4.300			10003112	31.26	10	0.4522	0.4519	0.4498	37

- T 型报价行情页面横向为合约信息栏位，纵向中轴为行权价序列，形状为 T 字，所以称之为 T 型报价。T 型报价显示所选的交易所、某一品种、某一到期月份下，一系列不同行权价格的所有看涨期权和看跌期权的行情信息。
- 上图以 50ETF 为例，图中为同系列的 50ETF 合约报价，中轴为期权合约行权价从小到大顺序纵向排列（也可以设置为从大到小），左边为看涨期权（Call）合约，右边为看跌期权（Put）合约。
- 背景柱状图，在 T 型报价中，背景以柱状图显示各期权合约的某一特定栏位数值。预设[持仓量]背景柱状图。
- 合约到期日，横向栏中间显示了期权合约到期日的天数，鼠标移动到该位置，会显示期权合约到期日提示框。

- 价平显示
  - 期权合约较多，T 型报价无法显示全部行权价时，会默认将价平位置显示在中间，可以通过滚动鼠标查看全部行权价合约。
  - 行权价列表中，在最接近价平的位置分别以黄色/蓝色标示，黄色表示看涨期权价平位置，蓝色表示看跌期权价平位置。
- 可以通过以下 2 个方式回至价平位置：
  - 鼠标单击行权价列表顶部[到期日]栏位，报价自动跳回价平。

◆ 鼠标右键单击 T 型报价框内任意部位，再左键点击菜单栏中的[跳至价平]，可快速跳至平值行权价位置。

● 买/卖栏位

■ 使用者可以通过买卖栏位手动调整组合商品。

◆ [情境]模式下，选择内置的情境策略后，可以切换勾选的买卖栏位调整使用不同行权价合约。

◆ [自组]模式下，使用者可以手动勾选买卖栏位选择要加入组合的期权合约。

勾选买卖栏位后，[情境/自组]中的组合商品将连动设置，右侧的盈亏分析、风险分析也会连动改变。

● 开启走势图

- T 型报价的行权价两侧提供走势图按钮图标，点击开启对应期权合约的走势图。
- 走势图提供期权合约近两日的一分钟价量数据。

● 栏位设定

- 看涨期权与看跌期权的报价栏位左右对称（在栏位设定中可以修改为不对称）。
- 当新增、移除看涨期权（看跌期权）某一栏位时，另一侧的报价栏位会同步对应新增或移除。
- 可拖拽栏位，移动该栏位的位置，同时另一侧栏位也会同步对应移动。
- 在 T 型报价框内右击鼠标，在菜单栏中选择[栏位设定]打开设定窗口。

- 栏位设定窗口包含以下内容:

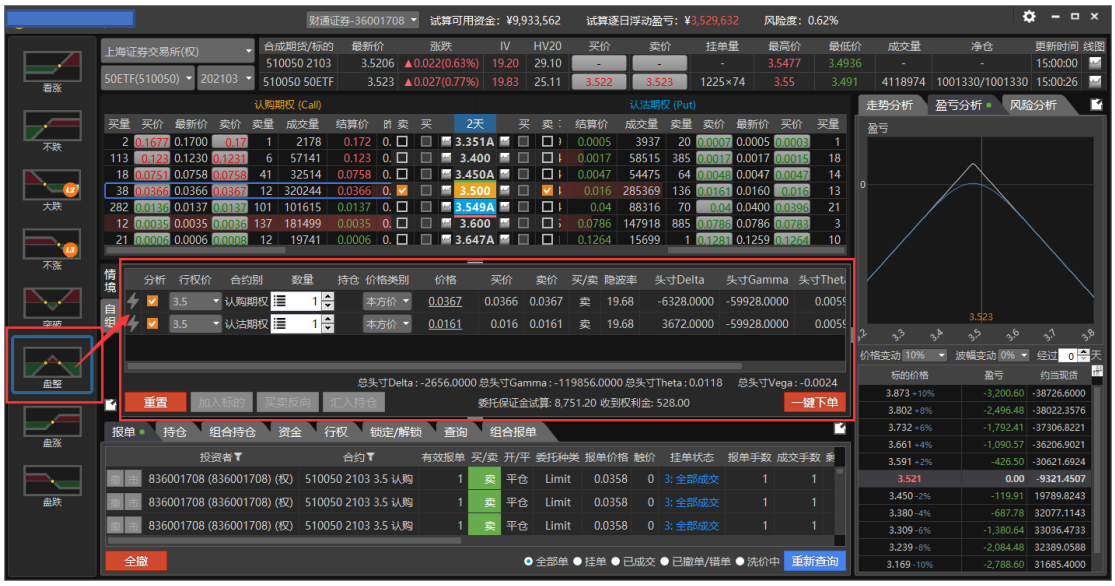
- 在“认购期权”、“认沽期权”列勾选对应栏位，勾选中会在期权报价的“认购期权”、“认沽期权”中显示该栏位。
- 在“背景”点对应栏位，则背景条形图依据选择的栏位数值绘制。
- 自订栏位包括：买量、买价、最新价、卖价、卖量、IV、涨跌、涨跌幅、现量、成交量、Delta、Gamma、Theta、Vega、Rho、理论价、时间价值、内在价值、结算价、持仓量、更新时间、昨结算、今开盘、最高价、最低价、昨收盘、昨量、涨停价、跌停价、昨持仓量、持仓量变动、BIV、SIV、昨 IV、净仓、IV 涨跌、杠杆率、实质杠杆、溢价率、到期盈亏与两平概率、裸卖报酬率、合约编码、标志码、到期日、状态、CIV/PIV、委买、委卖。
- 可设定报价栏位及报价数值的字型大小。
- 可设定行权价排序方式：渐增、渐减。
- 可取消勾选“显示栏位同步”，取消勾选“显示栏位镜像”，则 T 型报价栏位不会对称显示，新增、移除、拖拽栏位时，另一侧报价栏位不会同步被修改。
- 可勾选“不显示背景柱状图”，勾选后报价栏位的条形图消失。
- 可设定报价数值更新是颜色闪烁。
- 可还原默认，将栏位设定修改还原到出厂设置。

情境下单

- 策略选择器

情境模式提供8组14个[情境策略]，通过策略选择器给予「引导和建议」，提供使用者快速选择商品交易组合功能。

当使用者选择「策略」时，「策略」自动代入选择的商品合约中，并立即计算出合理的交易行权价和交易方向，同时显示在「情境 / 自组」的列表框中，并在右侧显示对应的盈亏分析图以及风险分析图。



■ 策略说明：

◆ 看涨，认沽止损

保护性认沽组合策略预计后市有大幅度下跌或回档的可能性，在持有或买入标的的同时，买入相对应数量的认沽期权，来对冲后市标的价格可能急剧下跌的风险，而代价是要支付认沽期权的权利金，策略在期权有效期内，限定了头寸价格下跌的风险，以及价格上涨时的盈利的无限可能性，能够在不稳定的市场里对持有标的提供有效保护。

◆ 大涨

买入认购期权。市场受到利多题材刺激，多头气势如虹，预计后续还有一波不小的涨幅。

◆ 不跌，备兑止盈

备兑开仓策略预计标的价格进入整理或者小幅度盘涨，在持有或买入标的同时，卖出相对应数量的认购期权，使用百分之百的标的现券担保，不需额外缴纳现金保证金，策略设定了持有标的的止盈价位，以此锁定了操作的最大收益，同时透过卖出认购期权获得权利金的额外收入，降低持有标的成本。

◆ 不跌

卖出认沽期权。预期后市不看跌，切 2 市场以向多或牛皮盘整的成分居多，属于温和看多的交易策略。

◆ 大跌

买入认沽期权。市场受到利空消息打击或技术性转空，预计后市还有一波不小的跌幅。

◆ 不涨

卖出认购期权。标的物价格经过一段上涨面临前期高点或技术阻力位，预期后市转空或者进行调整。

◆ 突破 - 原点突破

同时买进看涨和看跌期权，即买入跨式策略。当前价格趋势不明，波动率低，预期会有明显价格突破，后市波动率越大对头寸越有利，适合于预期盘整突破或者重大宏观数据和事件发生前。

◆ 突破 - 区间突破

同时买进相同数量、相同到期日，但行权价不同的看涨和看跌期权（通常看涨期权的行权价大于现货价，看跌期权和行权价小于现货价），即买入勒式策略。区间突破和原点突破的买进跨式交易策略相似，预期标的物价格在到期日前会有重大的变化，不是大涨、就是大跌。不同的地方在于买进勒式交易策略所买进的期权通常为虚值，因此采用区间突破的交易策略成本比较便宜，交易风险较低，但相对的，价格必须有更大的波动，买进勒式才会获利。

◆ 盘整 - 原点盘整

同时卖出相同数量、到期日、行权价的看涨和看跌期权，即卖出跨式策略。使用时机在于预期期权标的在行权日前不会有重大的价格变动，处盘整格局时所采用。卖出跨式策略常见于市场将揭晓重大事件，但明朗化时间在行权日之后，研判在该日期之前属盘整待变，或研判市场上有套牢卖压，下有强力支撑时所采用。该原点突破策略最大获利有限，最多就是卖出看涨及看跌期权所收取的权利金，但风险无限，操作时应善设停损点位。

◆ 盘整 - 区间盘整

同时卖出看涨期权和看跌期权，即卖出跨式策略。当前无法判断标的物价格变动方向，但价格趋于盘整，波幅收窄，波动率下降。到达盈亏平衡点慢，适合供需平衡，政策信息相对真空期。

- 盘涨 - 盘涨 Call

买进低行权价的看涨期权和卖出高行权价的看涨期权，即牛市看涨期权垂直价差策略。预测标的即将盘涨，隐波率偏低，但信心不足，所以买入看涨期权的同时卖出看涨期权降低权利金成本。

- 盘涨 - 盘涨 Put

买进低行权价的看跌期权和卖出高行权价的看跌期权，即牛市看跌期权垂直价差策略。预测标的即将盘涨，隐波率偏低，但信心不足，所以买入看跌期权的同时卖出看跌降低权利金成本。

- 盘跌 - 盘跌 Put

买进高行权价的看跌期权和卖出低行权价的看跌期权，即熊市看跌期权垂直价差策略。预期标的物即将下跌，隐波率不高，买入看跌期权，但执行价格偏高，权利金贵，所以卖出看跌期权减少权利金支出。

- 盘跌 - 盘跌 Call

买进高行权价的看涨期权和卖出低行权价的看涨期权，即熊市看涨期权垂直价差策略。预期标的物即将下跌，隐波率不高，买入看涨期权，但执行价格偏高，权利金贵，所以卖出看涨期权减少权利金支出。

- 情境模式设置如下图:

■ 单一商品下单

点击闪电状图标，可打开下单盒，进行单一商品下单。

■ 分析

加入合约后默认勾选分析，右侧的分析指标为多个期权合约的组合分析结果。可取消勾选，分析结果也会随之刷新。

■ 行权价

策略会自动计算并加入合理的行权价，在行权价栏位，可以通过下拉菜单切换行权价。

■ 合约别

显示加入组合策略的期权合约别，为认购期权或认沽期权。

■ 数量

设置策略下单数量。组合策略如果修改其中一个合约的数量，则组合中的其他合约会连动调整。

■ 价格类别与价格:

中间价：即限价单，价格为合约中间价。

对方价：即限价单，买进价格使用卖价，卖出价格使用买价。

本方价：即限价单，买进价格使用买价，卖出价格使用卖价。

最新价：即限价单，价格为合约最新价。

指定价：即限价单，可手动调整设定价格。

■ 买/卖

根据所选策略加入期权合约，并设定好买卖方向，买/卖方向不可手动修改。

■ 买价 / 卖价 / Greeks 栏位

提供买价、卖价、隐波率、头寸 Delta、头寸 Gamma、头寸 Theta、头寸 Vega 栏位，随报价实时跳动。

■ 总头寸 Greeks

提供组合策略中合约加总的头寸 Delta、头寸 Gamma、头寸 Theta、头寸 Vega 数据。

■ 委托保证金试算、收到/付出权利金

根据加入组合策略的期权合约手数、买卖方向、价格等设置，套用公式计算出组合下单所需保证金和收到/付出权利金。注：此为试算值，实际成交后的占用保证金及权利金以资金查询结果为准。

■ 重置

点击重置按钮，将情境中已加入的组合合约清空。

■ 一键下单

通过一键下单按钮送出策略组合报单。

切换情境/自组模式

情境与自组列表框即时显示使用者在期权报价的交易动作，依使用者选择「情境」或「自组」判定为该使用者使用情境策略或自组策略，选择模式为「情境或自组」的操作方式有不同限制，两个模式的列表框互相独立不影响各自操作行为。

■ [情境]模式

- 只能通过策略选择器代入商品，无法通过手动方式新增商品情景模式下的商品列表框。
- 切换策略选择时，即清空[期权报价]与[情境]列表框中已代入的商品组合。
- 只能调整代入商品的[行权价、数量、价格类别]，调整时会同步更新[期权报价与分析图表]。
- 例如：选择大涨时，预设代入列表框中的商品，只能调整[买进认购期权]的行权价、买进数量、价格类别。
- 如果要移除列表框中已选择的商品，可通过[重置]功能，清空商品，同时连动[期权报价与分析图表]，还原为初始状态。
- 决定下单时，则按下[一键下单]按钮。
- 情景模式下无法 加入标的现货，设定买卖反向。
- 勾选合约之后会同时计算出占用保证金以及收到/付出权利金。
- 勾选合约之后会同时计算出所选合约的总头寸 Greeks 值。

■ 「自组」模式

- 可通过期权报价的右键菜单，选择买入策略、卖出策略代入商品，或通过勾选期权报价买、卖栏位新增商品至「自组」列表框中。
- 能移除单一商品，调整代入商品的「行权价、合约别、数量、价格类型以及切换买卖方向」，调整完成后同步更新「期权报价与分析图表」。
- 例如：选择买入策略-看涨期权时，预设代入买进认购期权于「自组」列表框，使用者可由期权报价手动选择加入/移除商品，或是由「自组」列表框删除商品，调整后的结果，连动更新「期权报价与分析图表」。
- 使用者如果要移除「自组」列表框中商品内容，可以通过「重置」功能，清空列表框中的商品，同时连动「期权报价与分析图表」，还原为初始状态，也可以手动移除单笔商品。
- 确定下单时，则按下「一键下单」按钮。
- 可以加入标的、设定买卖反向。

- 勾选合约之后会同时计算出占用保证金以及收到/付出的权利金。
- 勾选合约之后会同时计算出所选合约的总头寸 Greeks 值

■ 分析筛选

可以勾选欲显示于分析图表的商品，选择的结果影响右侧分析图表的结果显示。

■ 「汇入持仓」

对持仓进行分析，条件是只会汇入到当前选择的合约品种和月份。

■ 「重置」

删除已选择商品

■ 「加入标的」

加入标的，可以同时下单标的合约和期权合约，或作为期权下单的参考

注意：只有在自组模式下可用

■ 「买卖反向」

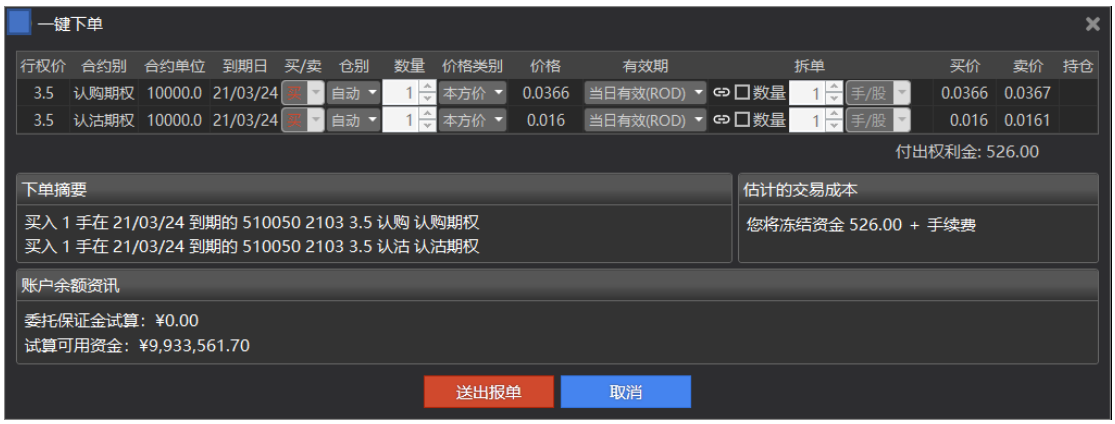
加入标的合约或者期权合约后，点击买卖反向，可以对下单的方向进行快速更改。

注意：只有在自组模式下可用

■ 「一键下单」

- 使用一键下单按钮，将商品资讯代入一键下单
- 点选“送出报单“后，自动“关闭”该视窗，可在委托回报及持仓查看资讯。
- 点选“取消“，返回情境 / 自组，可修改商品/策略选择及下单设定。

一键下单



- 「商品列表显示栏位」
  - 行权价
  - 合约别
  - 合约单位
  - 到期日
  - 买/卖
  - 仓别
  - 数量
  - 价格类别
    - 中间价
    - 对方价
    - 本方价
    - 最新价
    - 指定价
  - 价格：委托价格（价格类别为指定价时可修改价格）
  - 有效期
    - ROD：当日有效单
    - FOK：全成或者全撤
  - 拆单
  - 买价
  - 卖价

- 持仓
- 下单摘要
  - 描述各商品买卖规格，到期时间
- 估计交易成本：计算在该笔交易所指定价位下预估的交易成本
- 账户余额资讯
  - 委托保证金试算
  - 试算可用资金

下单盒

- 可以通过以下方式打开下单盒:
  - T 型报价点击“买价 / 卖价”按钮、“净仓”栏位
  - 标的报价中点击“买价 / 卖价”按钮
  - T 型报价中，除“买价 / 卖价”的其他报价栏位双击，打开下单盒
  - 「情境 / 自组」中点击闪电状图标
  - 持仓中点击“净仓/多仓/空仓/备兑仓”按钮

- 下單盒功能说明:
  - 下单盒右上角按钮为状态时，表示下单后下单盒窗口关闭。状态为时。表示下单后下单盒窗口不关闭。
  - 「账户」: 下单商品对应的资金账户
  - 「合约」: 「买价」或「卖价」按钮对应的合约
  - 「买进/卖出」:
    - 买进: 买进按钮显示为红色
    - 卖出: 卖出按钮显示为绿色
  - 「仓别」:
    - 自动: 当前账号的当前合约有持仓时，委托自动判别为平仓
    - 开仓: 无论当前账号的当前合约是否有持仓，委托均为开仓
    - 平仓: 无论当前账号的当前合约是否有持仓，委托均为平仓
    - 备兑开仓: 选择 50ETF 期权下单时会显示出仓别，委托时期权账户对应证券账户需要手动锁券（上交所）。
    - 备兑平仓: 选择 50ETF 期权下单时会显示出仓别，委托时期权账户对应证券账户会自动解锁券。
  - 「今/昨」: 今仓和昨仓的持仓量
  - 「市价买进」: 点击后以市价买入
  - 「市价卖出」: 点击后以市价买卖出
  - 「开/高/低/量」:分别为当日开盘价，当日最高价，最低价以及当日成交量。

- 「买一/卖一/中间」:分别为市场挂单买一价，卖一价及中间价，点击价格会对应映射到下方价格输入框处。
- 「报单」:
  - 市价
  - 限价
  - 中间价
  - 对方价
  - 本方价
  - 最新价
  - 停损价：需交易所支持该单别
  - 停损限价：需交易所支持该单别
- 「有效期」:
  - 当日有效(ROD)
  - 剩余即撤销(IOC)
  - 全成或全撤(FOK)
  - 冰山拆单(IceBerg)
- 「价格」：委托价格，点击价格按钮可以快速选择[涨停价][跌停价][买一价][卖一价] [最新价]
- 「加挂」：在设定的委托价格的基础上 ± 跳发送委托
- 「手数」：单笔委托数量
- 「拆单」：根据设定逐笔委托最大数量，将总下单手数拆分委托。

例：合约 50ETF 201910 C2.95，买进市价开仓 5 手，勾选拆单后下单，会拆成 2 手 2 手 1 手的委托。

- 「止盈」：委托进场的同时委托出止盈单
- 「止损」：委托进场的同时委托出止损单
- 「冰山拆单」:根据设定预设逐笔委托数量与逐笔委托变动区间，将总下单手数拆分委托，使用冰山拆单，后一笔委托会在前一笔委托成交前一直等待。

例：合约 50ETF 201910 C2.95，买进限价开仓 5 手，选择冰山拆单，会拆成 3 手 2 手的委托，2 手的委托会在 3 手委托成交前一直等待，直至 3 手委托成交。

- [注]:
  - 中间价释义

    例如:假设一跳是 1 点买价 240 卖价 245 最新价 243(240+245)/2=242.5,依跳动点数取值，可以是 242 或 243 取最接近最新价的价格 243。
  - 报价中买卖价颜色含义

    红色:当前合约最新价相于昨结算价有上涨

    绿色:当前合约最新价相于昨结算价有下跌
  - 行权价栏位中黄色与蓝色的区分

    黄色:相当于认购期权的平值

    蓝色:相当于认沽期权的平值
  - 行权价栏位中红色线与绿色线区分

    红色线:标的现货当天最高价所在的行权价区间

    绿色线:标的现货当天最低价所在的行权价区间
  - 行权价上方天数的含义

    代表期权合约的离到期日剩余天数
  - 止盈止损设定点数最小单位

    采用的是以跳为最小单位

    例如 510050 期权一跳为 0.0001，1 点即为 10000 跳
  - 报单条件中标识红色的区分

    红色的报单类型表示挂在本地客户端洗价，交易断线时，洗价单可能“继续”“取消”“暂停”（依设置->通用设定）

    其他报单类型挂在柜台，交易断线或重启客户端不影响挂单。
  - 拆单设定，逐笔委托最大数量[Qty]与[%]释义

    Qty：按照固定设定的委托数值拆分委托。

    %：按照总下单手数的%拆分委托。

◆ 下单盒报单选项对应:

咏春 下单盒报单选项		对应交易所申报指令类型
深圳现货	对方价，当日有效(ROD)	交易所指令:对手方最优价格市价申报
	本方价，当日有效(ROD)	交易所指令:本方最优价格市价申报
	五档市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令:最优五档即时成交剩余撤销市价申报
	市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令:即时成交剩余撤销市价申报
	市价，全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额成交或撤销市价申报
	限价，当日有效(ROD)	交易所指令:普通限价申报
	中间价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约中间价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约最新价
	停损市价，剩余即撤销(IOC)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以即时成交剩余撤销市价申报
	停损市价，全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以全额成交或撤销市价申报
	停损限价，当日有效(ROD)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以普通限价申报
深圳期权	限价，当日有效(ROD)	交易所指令:普通限价申报
	限价，全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额成交或撤销限价申报
	对方价，当日有效(ROD)	交易所指令:对手方最优价格市价申报
	本方价，当日有效(ROD)	交易所指令:本方最优价格市价申报
	五档市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令:最优五档即时成交剩余撤销市价申报
	市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令:即时成交剩余撤销市价申报
	市价，全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额成交或撤销市价申报
	中间价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约中间价
	中间价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额成交或撤销限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约中间价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约最新价
	最新价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额成交或撤销限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约最新价
	停损市价，剩余即撤销(IOC)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以即时成交剩余撤销市价申报
	停损市价，全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以全额成交或撤销市价申报
	停损限价，当日有效(ROD)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以普通限价申报

	停损限价，全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以全额成交或撤销限价申报

上海现货	限价，当日有效(ROD)	交易所指令:普通限价
	五档市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令:市价,最优 5 档即时成交剩余撤销申报
	五档市价转限价，当日有效(ROD)	交易所指令:市价,最优 5 档即时成交剩余转限价申报
	市价，剩余即撤销(IOC)	在设置->市价转换设定中，上交所 股票/基金的市价指令替换指令类型为“五档市价 IOC” 替换为市价：最优 5 档即时成交剩余撤销申报送出
	市价，当日有效(ROD)	在设置->市价转换设定中，上交所 股票/基金的市价指令替换指令类型为“五档市价转限价 ROD” 替换为市价：最优 5 档即时成交剩余转限价申报送出
	中间价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约中间价
	对方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价申报指令类型；申报价格取委托送出时的合约最新价
	停损市价，剩余即撤销(IOC)	在设置->市价转换设定中，上交所 股票/基金的市价指令替换指令类型为“五档市价 IOC” 客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以市价：最优 5 档即时成交剩余撤销申报送出
	停损市价，当日有效(ROD)	在设置->市价转换设定中，上交所 股票/基金的市价指令替换指令类型为“五档市价转限价 ROD”， 客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以市价：最优 5 档即时成交剩余转限价申报送出
	停损限价，当日有效(ROD)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以普通限价送出

上海期权	限价，当日有效(ROD)	交易所指令:普通限价委托
	市价转限价，当日有效(ROD)	交易所指令:市价剩余转限价委托
	市价，剩余即撤销(IOC)	交易所指令:市价剩余撤销委托
	限价，全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额即时限价委托
	市价，全成或全撤(FOK)	交易所指令:全额即时市价委托
	中间价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托；申报价格取委托送出时的合约中间价

	中间价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托；申报价格取委托送出时的合约中间价
	对方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托；申报价格取委托送出时的合约对方价
	对方价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托；申报价格取委托送出时的合约对方价
	本方价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托；申报价格取委托送出时的合约本方价
	本方价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托；申报价格取委托送出时的合约本方价
	最新价，当日有效(ROD)	使用交易所普通限价委托；申报价格取委托送出时的合约最新价
	最新价，全成或全撤(FOK)	使用交易所全额即时限价委托；申报价格取委托送出时的合约最新价
	停损市价，剩余即撤销(IOC)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以市价剩余撤销委托送出
	停损市价，全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以全额即时市价委托送出
	停损限价，当日有效(ROD)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以普通限价委托送出
	停损限价，全成或全撤(FOK)	客户端本地洗价，设定停损价触发条件，触价后以全额即时限价委托送出

报单

提供当日报单回报资料，提供撤单、改单等功能。

点击右上方按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在报单框内右击鼠标调出报单栏的栏位设置。

- [撤]：撤销当前委托，红色为可撤销。
- [市]：将当前委托改为用市价委托，蓝色为可改市价委托。

- 栏位
  - 投资者：显示当前资金账户。
  - 合约：式：合约代码+合约月份+行权价+认购/认沽（Call/Put），例如：510050 1910 2.85 认购
  - 有效报单
  - 买/卖：买卖方向
  - 开/平
  - 委托种类
  - 报单价格：委托时的报单价格。
  - 挂单状态
  - 成交手数
  - 成交均价
  - 报单编号
  - 日期
  - 时间：该笔委托回报插入的时间。
  - 时间条件:即为有效期。
  - 履约价
  - C/P
  - 当冲
  - 内部指示
  - 交易单号
  - 条件
  - 备注：委托失败，失败原因会在此处显示。
  - 合约名称
  - 触发条件
  - 报单手数

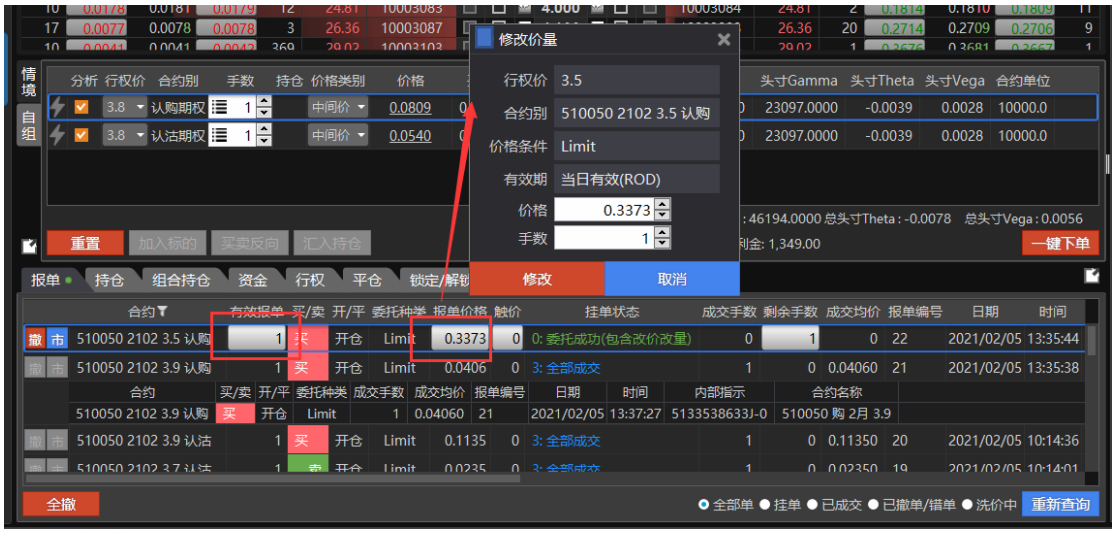
- 策略名称
- 策略 ID

■ 「全撤」:一键撤销所有挂单

■ 「重新查询」：重新查询当前报单

■ 「改价改量」：点击“有效报单/报单价格/触价/剩余手数”按钮可以进行改价改量。

- 适用条件:仅对委托成功单没有成交的单别有效。
- 操作:点击委托回报中报单价格调出改价改量窗口。选择好价格和手数只有确认后重新委托一笔限价单。原委托会立即删单。如下图:



■ 「分类显示」

- 全部单：列表中显示所有报单
- 挂单：列表中只显示未成交的挂单
- 已成交：列表中只显示已成交的委托单
- 已撤销/错单：列表中只显示已撤销或错误的委托单
- 洗价中：列表中只显示在洗价的委托单

■ 筛选投资者/合约

- 点击该栏位上的按钮，如下图:

持仓

提供交易账号的持仓资料。

点击右上方按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在持仓框内右击鼠标调出持仓栏的栏位设置。

- [平]：点击可平掉对应行持仓
- 分析：勾选时，可将该持仓加入到自组，和所选合约组合分析

  注：只有当当前 T 型报价所选月份与此持仓月份相同时才可勾选
- [全平]：一键平仓所有仓位
- [平净仓]：一键平仓净仓位
- [建组合]：将持仓构建为组合持仓
- [重新查询]：重新查询当前持仓
- 栏位
  - 投资者：显示交易账户数字账户
  - 合约：显示合约英文代码
  - 合约名称：显示合约中文代码

- 行权：点击按钮 即可行权， 显示到期日天数提醒
- 净仓：显示该合约净仓数量
- 多仓：显示该合约多头持仓数量
- 空仓：显示该合约空头持仓数量
- 今仓；显示该持仓合约当天开仓数量
- 今多：显示该持仓合约当天开多仓数量
- 今空：显示该持仓合约当天开空仓数量
- 昨仓：显示该持仓合约历史开仓数量
- 昨多：显示该持仓合约历史开多仓数量
- 昨空：显示该持仓合约历史开空仓数量
- 委托中(多)：显示该持仓合约买委托中数量
- 委托中(空)：显示该持仓合约卖委托中数量
- 备兑仓：显示该持仓合约为备兑仓数量
- 最新价：显示给持仓合约最新价
- 均价：显示持仓合约均价
- 涨跌：改持仓合约相对于昨结算的涨跌
- 多仓均价：显示持有多仓合约均价（今仓为开仓价，昨仓均价为昨结算价）
- 空仓均价：显示持有空仓合约均价（今仓为开仓价，昨仓均价为昨结算价）
- 市值：显示持仓期权市值(市值计算使用最新价或者中间价计算，依设置->交易偏好设定)
- 持仓成本:根据持仓均价计算出的成本
- 逐日浮动盈亏：按照持仓均价计算出的浮动盈亏参考值
- 逐日浮动盈亏%：按照持仓均价计算出的浮动盈亏%参考值
- 开仓成本：根据开仓均价计算出的成本
- 逐笔浮动盈亏：按照开仓均价计算出的浮动盈亏参考值
- 逐笔浮动盈亏%：按照开仓均价计算出的浮动盈亏%参考值

- 买价
- 卖价
- 买量
- 卖量
- 中间价
- 昨结算价
- 结算价
- 结算价涨跌：按照结算价计算出的涨跌
- 结算价涨跌幅%：按照结算价计算出的涨跌%
- 标的：期权合约对应标的现货价格
- 标的涨跌：期权合约对应标的现货涨跌
- 标的涨跌幅：期权合约对应标的现货涨跌幅
- 占用保证金：显示该持仓所占用的保证金
- 冻结保证金：显示该持仓(行权，平仓，对冲)时所冻结的保证金
- 手续费
- Delta
- Gamma
- Theta
- Vega
- Rho
- 隐波率
- 多仓冻结：显示该持仓多仓(行权，平仓，对冲)时所冻结的保证金
- 空仓冻结：显示该持仓空仓(行权，平仓，对冲)时所冻结的保证金
- 开仓量
- 平仓量
- 今日开仓金额

- 今日平仓金额
- 逐日盯市平仓盈亏
- 逐笔对冲平仓盈亏
- 上次占用保证金
- 冻结资金（权利金）
- 当日资金差额
- 执行冻结：显示该持仓(行权，平仓，对冲)时所冻结持仓的手数
- 执行冻结金额：显示该持仓(行权，平仓，对冲)时所冻结持仓的金额
- 放弃执行冻结：显示该持仓放弃行权时所冻结的手数
- 组合多仓：显示该持仓部位为组合仓且为多仓的手数
- 组合空仓：显示该持仓部位为组合仓且为空仓的手数
- 组合多头冻结
- 组合空头冻结
- 锁券/执行冻结
- 多仓可平仓量：显示该持仓多仓(行权，平仓，对冲)的可用数量
- 空仓可平仓量：显示该持仓空仓(行权，平仓，对冲)的可用数量
- 买成
- 卖成
- 今成交
- 实值度
- 实(虚)值额：显示该期权合约实值，虚值金额
- 币别
- 更新时间：记录该持仓更新时间
- 持仓杠杆率
- 多头开仓均价
- 空头开仓均价

- 估算当日盈亏
- 当日平均买进
- 当日平均卖出
- 投机套保标志
- 合约编码

资金

点击右上方按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在资金框内右击鼠标调出资金栏的栏位设置。

- 结算单：查看选中资金账号的结算资讯，在资金栏位下选中资金账号后可以点击结算单按钮查看此账号的结算单。

可以在结算资讯中查询结算历史。

- 「重新查询」: 重新查询当前持仓
- 栏位
  - 投资者
  - 试算可用资金
  - 试算动态权益
  - 试算市值权益
  - 未冲销权利金市值
  - 逐笔浮动盈亏
  - 期货平仓盈亏
  - 期货当日盈亏
  - 占用保证金
  - 昨日余额
  - 上次信用额度
  - 上次质押金额
  - 质押金额
  - 入金金额
  - 出金金额
  - 静态权益
  - 手续费
  - 冻结保证金
  - 冻结手续费
  - 权利金收支
  - 冻结资金
  - 交割保证金
  - 信用额度

- 保底结算准备金
- 可取资金
- 上次占用保证金
- 证券资金收支
- 风险度
- 证券参考市值
- 可用资金
- 动态权益
- 参考风险度
- 上海限购额度
- 上海剩余额度
- 深圳限购额度
- 深圳剩余额度
- 币别
- 上次货币质入金额
- 上次货币质出金额
- 货币质入金额
- 货币质出金额
- 货币质押金额
- 可质押货币金额
- 特殊产品占有保证
- 特殊产品冻结保证金
- 特殊产品手续费
- 特殊产品冻结手续费
- 特殊产品持仓盈亏
- 特殊产品平仓盈亏

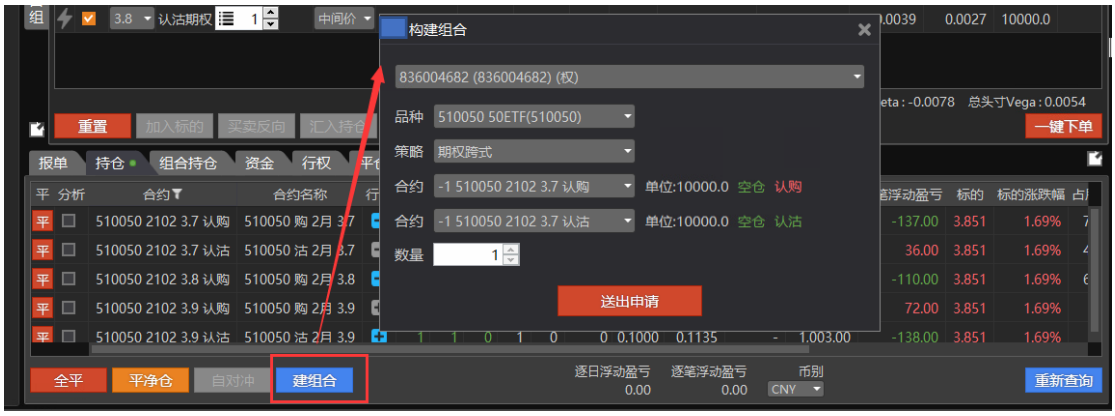
- 根据持仓盈亏算法计算的特殊产品持仓盈亏
- 特殊产品交易所保证金
- 总市值
- 资金杠杆率
- 净市值
- 资金多空比率
- 逐日浮动盈亏

注:

【可用资金】【动态权益】【占用保证金】【静态权益】【手续费】【冻结收付费】【权利金收支】【可取资金】【冻结保证金】【证券资金收支】【期货平仓盈亏】【昨日余额】【冻结权利金】取值于柜台

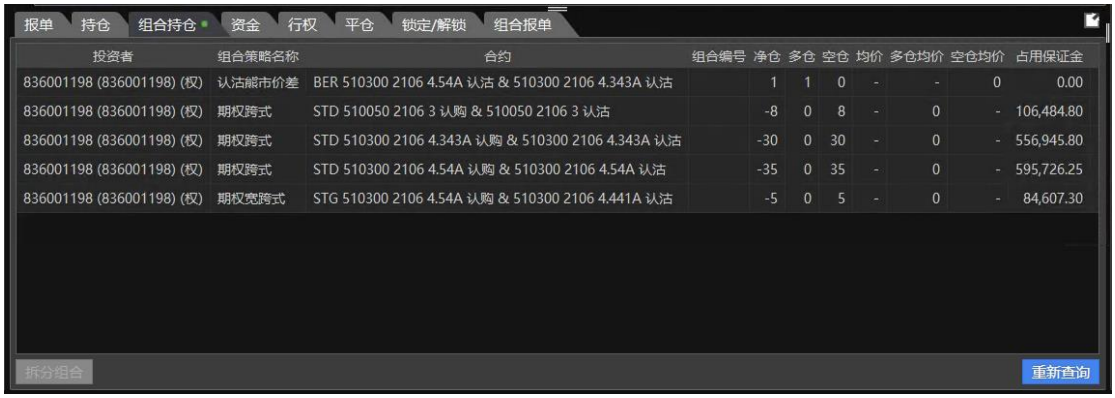
- 试算可用资金=试算动态权益-占用保证金-冻结保证金-冻结手续费-交割保证金-冻结权利金+信用金额
- 浮动盈亏=期货浮动盈亏+期权浮动盈亏
- 期货当日盈亏=期货持仓浮动盈亏+期货当日平仓盈亏
- 试算动态权益=静态权益+期货平仓盈亏+期货浮动盈亏+权利金收支+证券收支-手续费
- 试算市值权益=试算动态权益+未冲销权利金市值
- 市值权益=动态权益+持仓权利金市值 (权利金市值买方为正/卖方负值)
- 风险度=占用保证金*100%/试算动态权益
- 参考风险度=占用保证金*100%/试算市值权益
- 未冲销权利金市值=持仓期权市值

构建组合



- 点击持仓下的[建组合]按钮，即可进入构建组合页面
- 账号：可以选择想要构建组合的账号
- 品种：选择构建的商品品种
- 策略：选择组合策略
  - 股票期权的组合合约规则
    - 认购牛市价差策略：相同到期日、相同标的证券、相同合约单位的认购期权；腿 1 为 行权价较低的 多仓 & 腿 2 为行权价较高的 空仓。
    - 认沽熊市价差策略：相同到期日、相同标的证券、相同合约单位的认沽期权；腿 1 为 行权价较高的 多仓 & 腿 2 为行权价较低的 空仓。
    - 认沽牛市价差策略：相同到期日、相同标的证券、相同合约单位的认沽期权；腿 1 为 行权价较低的 多仓 & 腿 2 为行权价较高的 空仓。
    - 认购熊市价差策略：相同到期日、相同标的证券、相同合约单位的认购期权；腿 1 为 行权价较高的 多仓 & 腿 2 为行权价较低的 空仓。
    - 跨式空头策略：相同标的、相同到期日、相同行权价格；腿 1 为 认购期权 空仓 & 腿 2 为 认沽期权 空仓。
    - 宽跨式空头策略：相同标的、相同到期日；腿 1 为 高行权价 认购期权 空仓 & 腿 2 为 低行权价 认沽期权 空仓。
    - 认购期权保证金开仓转备兑开仓。
    - 认购期权备兑开仓转保证金开仓，不记为组合持仓。

组合持仓



点击右上方按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在组合持仓框内右击鼠标调出组合持仓栏的栏位设置。

- [拆分组合]: 将已经构建的组合进行拆分，在组合持仓中选取要拆分的组合持仓，然后点击拆分组合按钮，设定好拆分数量即可送出申请
- 「重新查询」：重新查询当前组合持仓。

- 栏位
  - 投资者：显示交易账户数字账户。
  - 组合策略名称：显示该组合策略的名称。
  - 合约：显示该组合持仓合约代码。规格为(组合类型-合约代码-月份-期权类型-&-合约代码-合约月份-月份-期权类型)。
  - 净仓：显示账户下该笔组合持仓的净持仓数量（为多仓，空仓之和，多仓为正、空仓为负）。
  - 多仓：显示账户下该笔组合持仓多仓数量。

- 空仓：显示账户下该笔组合持仓空仓数量。
- 均价：显示该组合持仓的持仓均价(双腿的均价之和，多仓为正、空仓为负)。
- 多仓均价：显示账户下该笔组合持仓多仓均价。
- 空仓均价：显示账户下该笔组合持仓空仓均价。
- 占用保证金：显示该组合持仓所占用保证金。

组合报单

显示当日组合/拆分的记录。

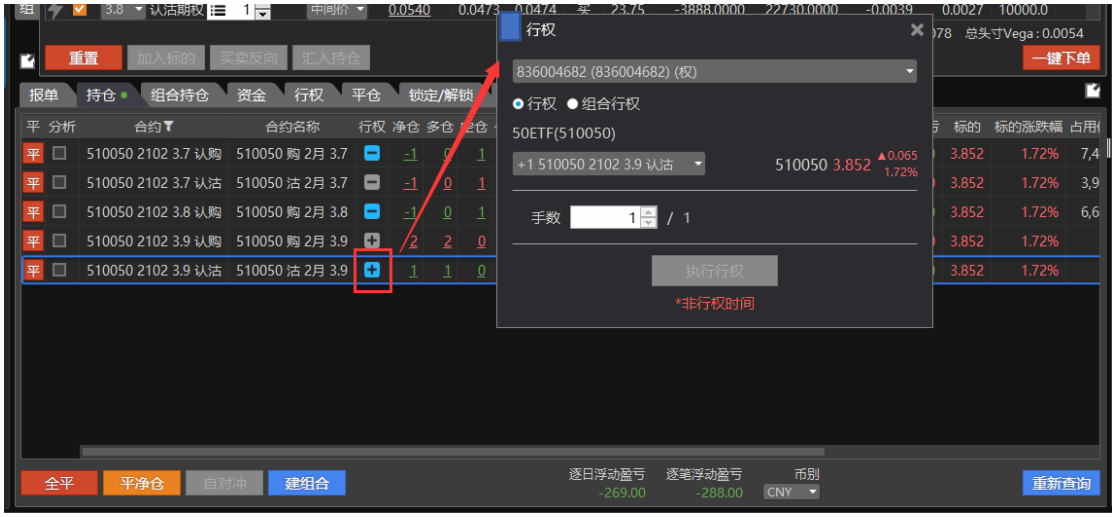
点击右上方按钮，可以成为独立窗口，此外可通过在组合报单框内右击鼠标调出组合报单栏的栏位设置。

- 栏位
  - 投资者：显示交易账户数字账户。
  - 委托时间：进行组合或拆分的委托时间。
  - 委托编号
  - 组合策略代码
  - 组合策略名称：显示该组合策略的名称。
  - 合约：显示该组合持仓合约代码。规格为(组合类型-合约代码-月份-期权类型-&-合约代码-合约月份-月份-期权类型)。
  - 组合方向：组合/拆分。
  - 委托状态
  - 委托数量

- 成交时间
- 成交数量
- 成交编号

行权/组合行权

在持仓中，点击行权按钮 ，可进行行权、组合行权申请。



送出行权申请后可通过[行权]页签查看当日行权申请记录。

- 行权资料栏位
  - 登入账号
  - 登入账号名称
  - 期货商
  - 期货商名称
  - 账号
  - 账号名称
  - 合约
  - 合约名称
  - 数量
  - 投机套保标志

- 执行类型
- 持仓方向
- 标的头寸
- 标的自动平仓
- 行权编号
- 结算编号
- 行权状态
- 备注
- 插入时间
- 撤销时间
- 更新时间
- 交易日
- 交易所
- 合约在交易所代码
- 日期
- 期权的头寸是否自对冲

■ [取消行权]：取消此未行权的合约。

■ [全部取消]：一键取消未行权的合约。

■ 行权记录筛选：

- 全部：查看所有期权合约。
- 行权中：查看所有行权中的期权合约。

■ [行权指派]:行权日下个交易日，可点击查看行权指派信息。

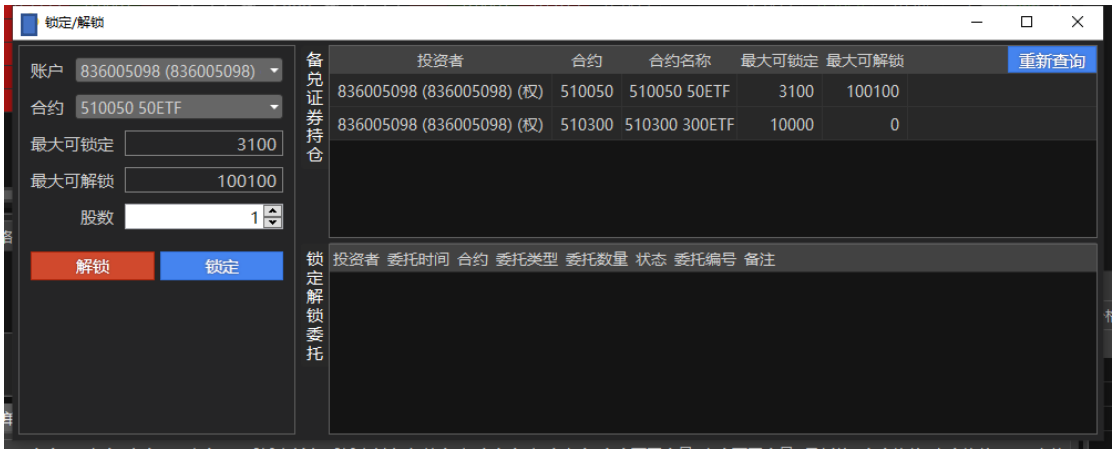
行权指派

帐号	合约	期权持仓类别	行权价格	行权数量
又(仿真)	159901	非备兑	5.75	1
又(仿真)	159901	非备兑	4.90	1
又(仿真)	159901	非备兑	4.80	1

- 行权指派栏位

- ✓ 账号
- ✓ 合约
- ✓ 期权持仓类别
- ✓ 行权价格
- ✓ 行权数量
- ✓ 行权冻结资金
- ✓ 交收数量
- ✓ 交收金额

锁定/解锁



注：仅显示上交所合约

- ■ 设置锁定解锁
  - ◆ 账户：设置资金账号。
  - ◆ 合约：设置要锁定/解锁的标的证券持仓合约。
  - ◆ 最大可锁定：显示当前合约的最大可锁定数量。
  - ◆ 最大可解锁：显示当前合约的最大可解锁数量。
  - ◆ 股数：想要锁定/解锁的数量。
- ■ 备兑证券持仓
  - ◆ 投资者：显示交易账户数字账户。

- 合约：显示证券持仓代码。
- 合约名称
- 最大可锁定：证券持仓-锁定股数。
- 最大可解锁：由锁定数量决定。

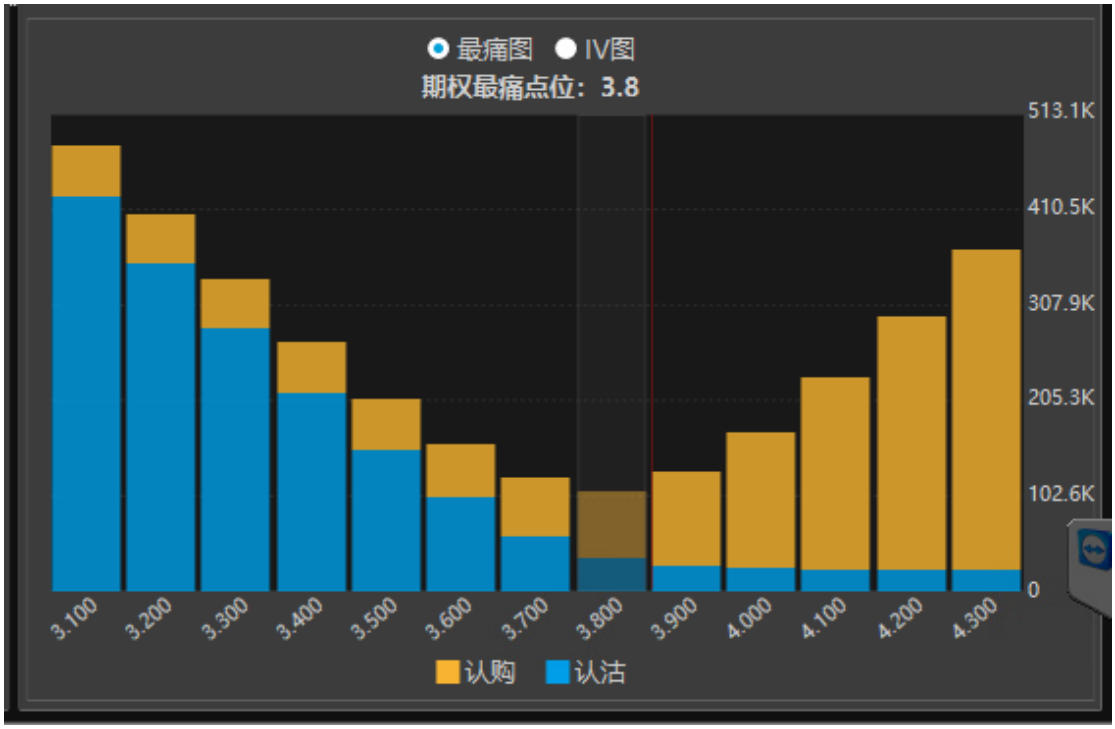
- 锁定解锁委托
  - 投资者
  - 委托时间：锁定/解锁的委托时间。
  - 合约
  - 委托类型：锁定/解锁。
  - 状态
  - 委托编号
  - 备注：委托失败的信息在此显示。

分析功能

- 走势分析
  - 走势图

- 标的 实时分 K 走势图
- 标的 实时分 K VIX 指标走势图
- 标的 实时分 K 成交量柱状图

■ 期权最痛位置



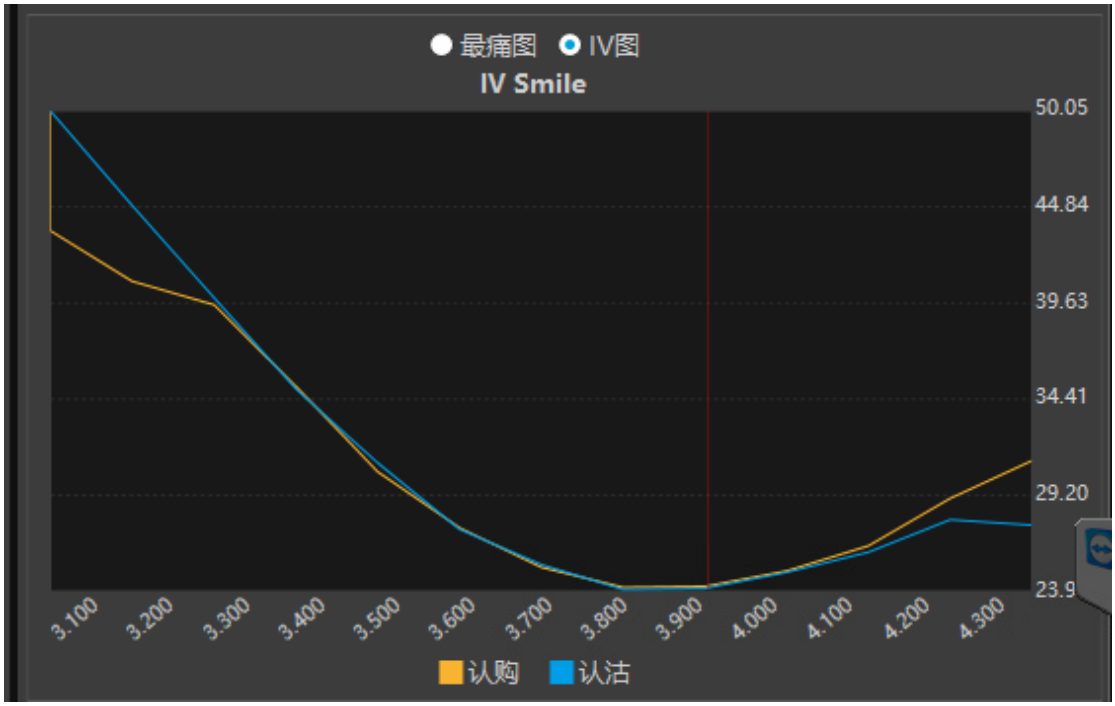
期权最痛位置：期权最痛理论是用来计算期权买家最为痛苦的到期行权价。假设期权买方散户为大多数，卖方以庄家或者机构为主，具有较大的资金规模跟讯息优势，可将结算价推向对自己有利的价格位置，即结算价会趋向于期权市场价值最低水平点位。

计算方式：

1.X 轴为当月期权各行权价价位

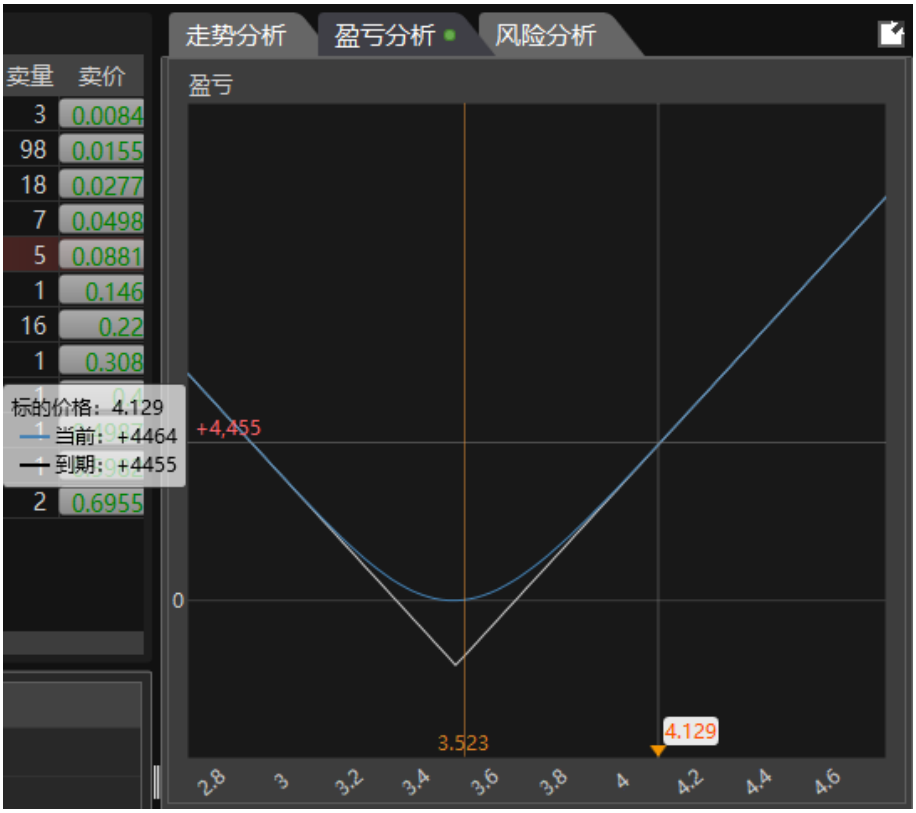
2.Y 轴为当月 所有 call 、put 合约 未平仓量*内在价值的加总，加总的 call 和 put 分别以不同颜色长度条叠加表示。

- IV 图



- 盈亏分析

  - 盈亏图：盈亏图表主要用来显示对「情景/自组」列表框中商品分析预测的结果。依据「情景/自组」列表框中的商品内容绘制出下列图表。



  - 「图表更新方式」

当「情境 / 自组」的商品变动时

当「情境 / 自组」的商品下列项目变动时:

①行权价格变动时

②手数变动时

③买/卖别变动时

④看涨期权/看跌期权变动时

当盈亏图参数变动时(只更新未到期损益图形)

①使用者调整合约到期日间隔时间（t）时

②使用者调整合约波动度（sigma）时

◆ 「多商品图形绘制」

依据「情境 / 自组」列表框中所有勾选商品绘制对应图。

◆ 「标的商品价格」

于 X 轴显示「商品连结标的」的即时价格。

◆ 「绘制图表」

①横轴为期权标的物价格的可能数值。

②纵轴为「情境 / 自组」商品盈亏金额数值。

◆ 图表上标示

「情境 / 自组」商品计算后的线图与表格。

①图表标示

盈亏平衡点

行权价

标的期货价格

②输出的计算结果

最大收益

最大亏损

权利金

■ 盈亏分析数据

价格变动 10%　　波幅变动 0%　　经过 0 天

标的价格	盈亏	约当现货
3.858 +10%	467.36	1136.3478
3.788 +8%	439.22	1994.7464
3.718 +6%	390.35	3318.9140
3.648 +4%	498.00	0.0000
3.577 +2%	184.59	7780.5031
3.507	0.00	10944.1693
3.437 -2%	-257.10	14547.8902
3.367 -4%	-595.91	18296.7987
3.297 -6%	-1,019.11	21826.4003
3.227 -8%	-1,521.81	24794.7610
3.157 -10%	-2,092.37	26975.0197

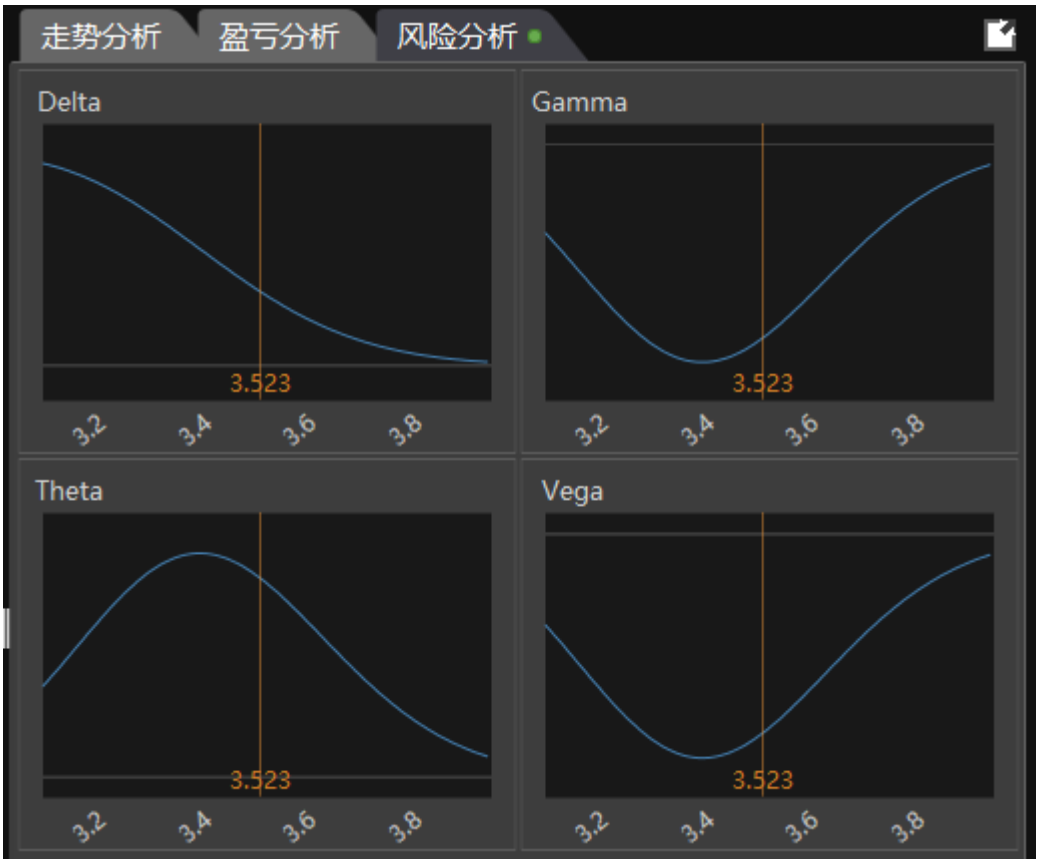
- 价格变动：标的价格变化时，盈亏和约当现货对应的变化情况。
- 波幅变动：隐波变化百分比后，盈亏和约当现货对应的变化情况。
- 经过多少天：距离到期日时间，盈亏和约当现货对应的变化情况。

例：下图当标的价格变动 25%，波动率变动 2%，经过 2 天的盈亏情况。

价格变动 25%　　波幅变动 2%　　经过 2 天

标的价格	波幅	盈亏	约当现货
	-2%	488.36	0.0000
	+2%	348.05	4942.3215
3.683 +5%	-	389.17	4193.9119
	-2%	424.38	3395.2776
	+2%	-13.07	11403.2888
3.507	-	61.63	10944.1693
	-2%	134.62	10390.1075
	+2%	-808.16	19734.8326
3.332 -5%	-	-730.59	20112.1035
	-2%	-653.79	20556.7757
	+2%	-2,092.65	0.0000

- 风险分析



- 指标公式说明
  - Delta (Ä) = 期权价格的变动/标的资产价格的变动

    即期权价格变动相对于标的资产价格变动的比率
  - Gamma (Ã) = Delta 的变动/标的资产价格的变动

    Delta 变动相对于标的资产价格变动的比率
  - Theta (È) = 期权价格的变动/距到期日剩余天数的变动期权价格变动相对于距到期日剩余天数变动的比率
  - Vega (Ë) = 期权价格的变动/标的资产价格波动率的变动即期权价格变动相对于标的资产价格波动率变化的比率
- 指标含意说明
  - Delta：期权头寸的波动与标的资产价格的变化关系。
  - Gamma：Delta 的二阶微分，是指期权头寸相对于标的期货价格的加速度或者是说该头寸到期时变成实值期权的可能性。

- Theta：是指期权头寸对于时间损耗的敏感性，购买期权具有负的 Theta 值，意味着你拥有一天的期权，时间损耗都在侵蚀期权价格中的时间价值。反之卖空期权时，Theta 值是正值，表明时间对期权空头持有者有利。
- Vega：是指期权头寸对波动率（IV）的敏感性，当标的的波动率增加时,期权价值会增加，因此，波动率对期权多头持有者有利，Vega 为正，反之空头为负值，对空头持有者不利。
- Rho：是指期权头寸对于利率水平的敏感性，正的 Rho 表示对较高的利率水平对于买方头寸有利，反之成立。

价格变动 10%　波幅变动 0%　经过 0 天

标的价格	$Delta	1%$Gamma	$Theta	$Vega
3.718 +6%	3,318.91	-880.71	7.86	-19.63
3.648 +4%	0.00	0.00	10.81	-26.98
3.577 +2%	7,780.50	-1,544.36	13.79	-34.42
3.507	10,944.17	-1,821.15	-40.59	16.26
3.437 -2%	14,547.89	-1,975.10	17.63	-44.02
3.367 -4%	0.00	0.00	0.00	0.00

- ✓ 价格变动是指：标的价格变化时 greeks 值对应的合约资金的变化情况。
- ✓ 波幅变动是指：隐波率变化百分比时 greeks 值对应的合约资金的变化情况。
- ✓ 经过多少天是指：距离到期日时间对 greeks 值引起的资金变化情况。
- ✓ 例：下图反映了当标的价格变动 25%，波动率变动 2%，经过 2 天对 greeks 值引起的资金变化情况。

价格变动 25%　波幅变动 2%　经过 2 天

标的价格	波幅	$Delta	1%$Gamma	$Theta	$Vega
3.683 +5%	-	4,193.91	-1,041.82	9.30	-23.22
	-2%	3,395.28	-988.42	7.21	-19.91
	+2%	11,403.29	-1,690.61	18.13	-41.30
3.507	-	10,944.17	-1,821.15	-40.59	16.26
	-2%	10,390.11	-1,968.47	14.36	-39.66
	+2%	0.00	0.00	0.00	0.00

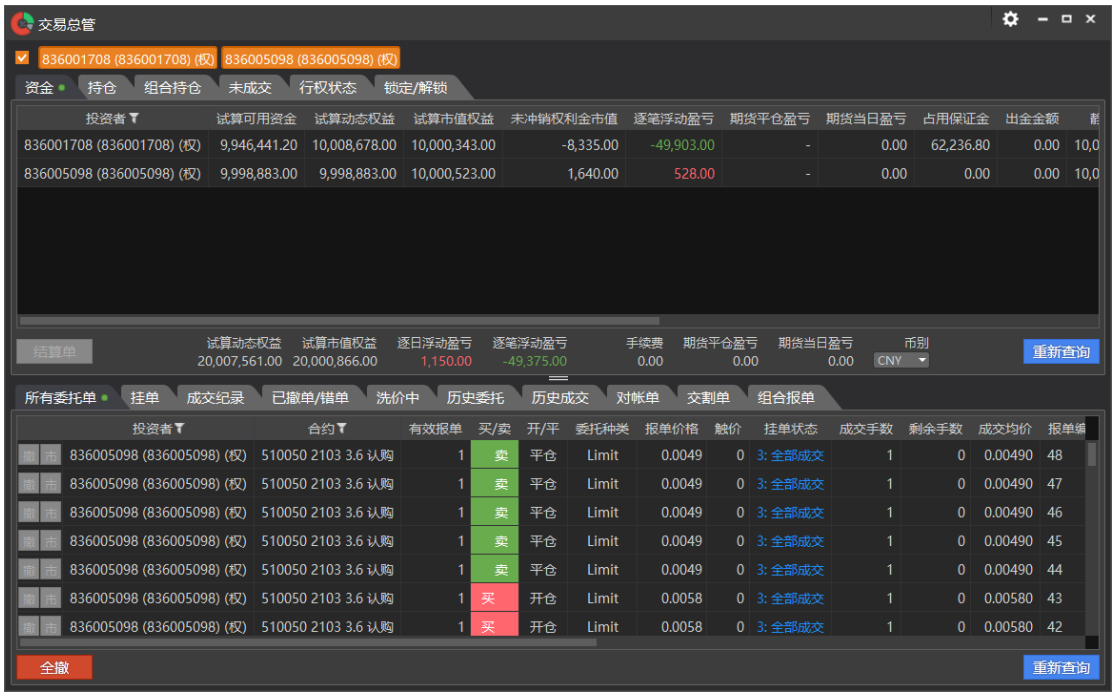
资金转账

提供交易账号转账功能。

- 转账设置
  - 交易账号：选择交易账号
  - 选择银行：选择银行
  - 资金密码：输入交易账号资金密码
  - 银行密码：输入银行密码
  - 转账金额：设置转账金额
  - 币别
  - 资金账号转银行：点击按钮则将资金账号资金转出到银行账号
  - 银行转资金账号：点击按钮则将银行资金转入到资金账号
- 查询账号可取资金
- 查询银行余额：先输入密码后点击查询按钮
- 修改资金密码：输入原密码、新密码后确定即可修改资金密码
- 查询转账记录：
  - 提供当日转账记录

交易总管

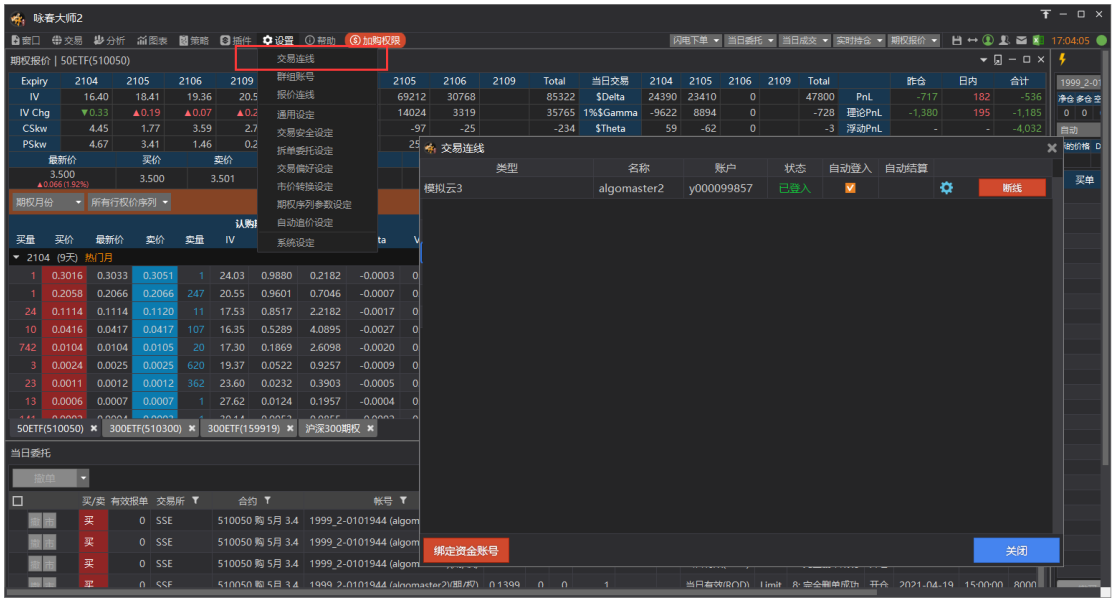
交易总管主要提供交易相关功能，如资金、持仓等查询，所有委托单、挂单、成交记录等回报资料。



交易总管功能与咏春插件的交易模块功能一致，可参考“咏春”插件章节说明。

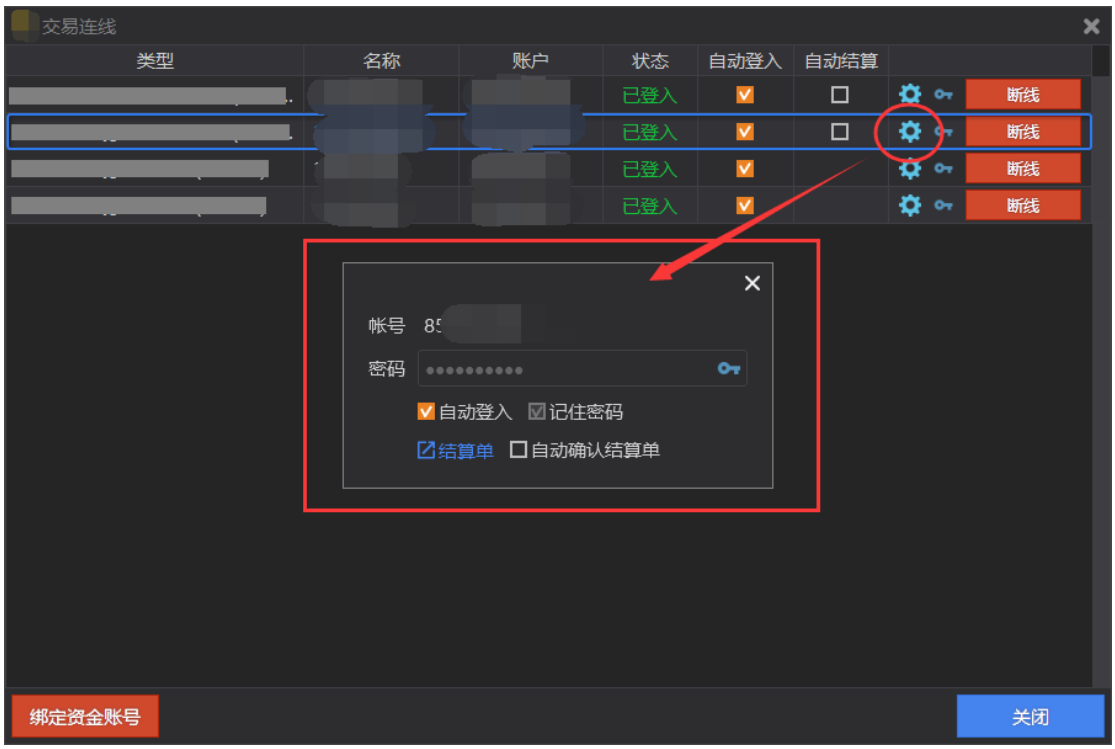
设置

交易连线



- 交易连线列表
  - 显示当前已绑定交易账号列表：账号类型、账号名称、账号、状态

- ◆ 管控交易账号的登入、登出、结算单查询、修改密码等
- ■ 自动登入
  - ◆ 勾选后，当程序登录会员账号后，会自动登录该交易账号。
- ■ 自动结算
  - ◆ 勾选后，交易账号登录时会自动确认结算单
- ■ 设置
  - ◆ 点击设置按钮，已登入的账号可以查询结算单、勾选自动确认结算单和修改密码。



- ■ 删除账号
  - ◆ 账号未登入状态下，点击按钮，将该资金账号从会员账号下删除绑定。
- ■ 连线/断线
  - ◆ 点击连线、断线按钮，将交易账号登入或登出。
- ■ 绑定资金账号
  - ◆ 点击按钮可绑定新的交易账号。

群组帐号

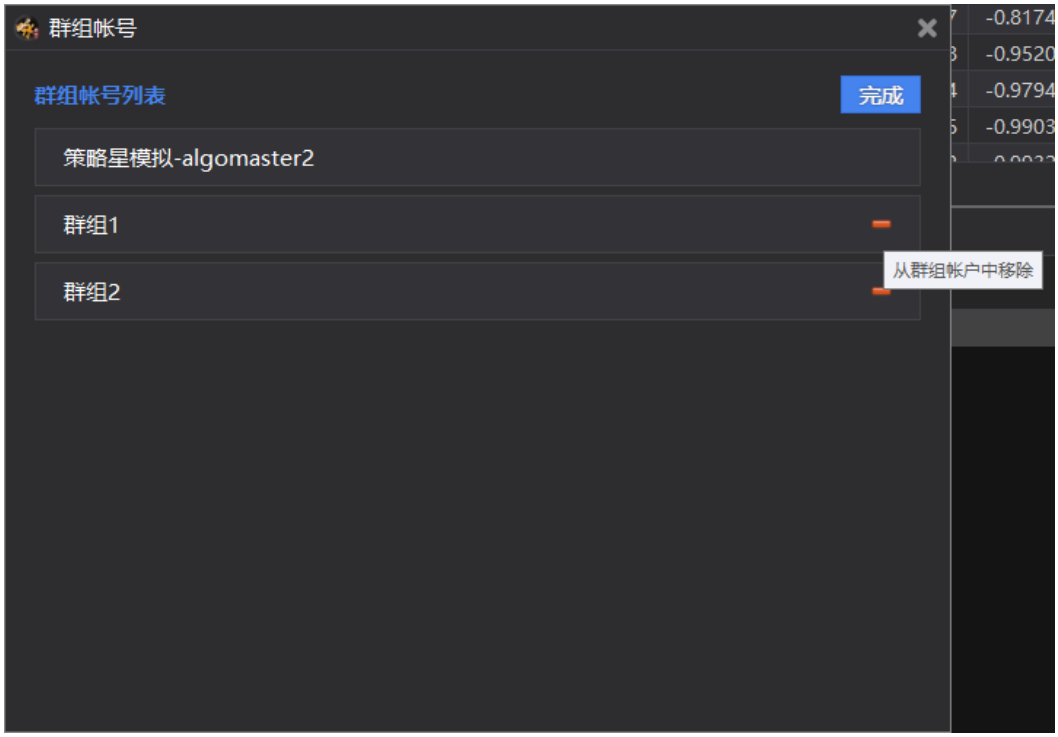
（*此为加购功能）

对多个资金账户进行状态有效的分组勾选，可以将用户设置为群组账号

- ● 新增群组账号：
  - ■ 注意：各账号可交易合约与可使用单别有所不同，请确认建立群组的各交易账号具有相同交易权限。

- 按“确定”后，新增群组出现在列表中。

- 群组帐号列表
  - 从列表点击群组账号名称，进入设定
  - 点击“编辑”后，出现 按钮，可将群组账号从列表中移除。



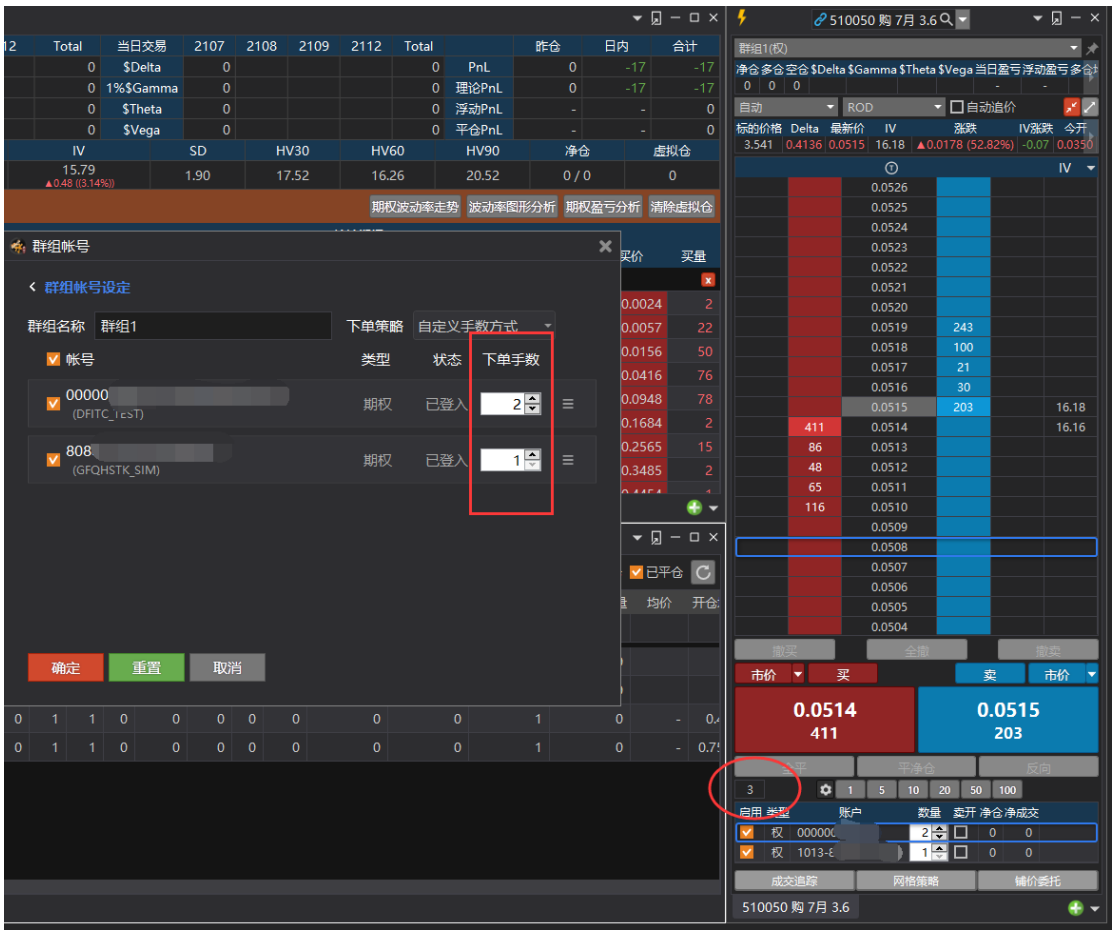
群组帐户设定

设置账户是否参与下单、设置该群组的下单策略

- 设定群组名称
- 勾选参与群组下单的账号
- 指定下单策略。不同下单策略，单账号对应不同设置内容：
  - 自定义手数方式
    - 设置“下单手数”
    - 可以拖曳调整下单账号顺序
  - 基数乘数方式
    - 设置“下单乘数”
    - 可以拖曳调整下单账号顺序
  - 总数分配按可用资金比
    - 不设置数量，依资金比例计算下单数量
    - 不设置下单账号顺序，依资金比例由大到小送出
  - 总数分配按设定参数
    - 设置“下单参数“，依设定参数计算下单数量
    - 不设置下单账号顺序，依参数比例由大到小送出。

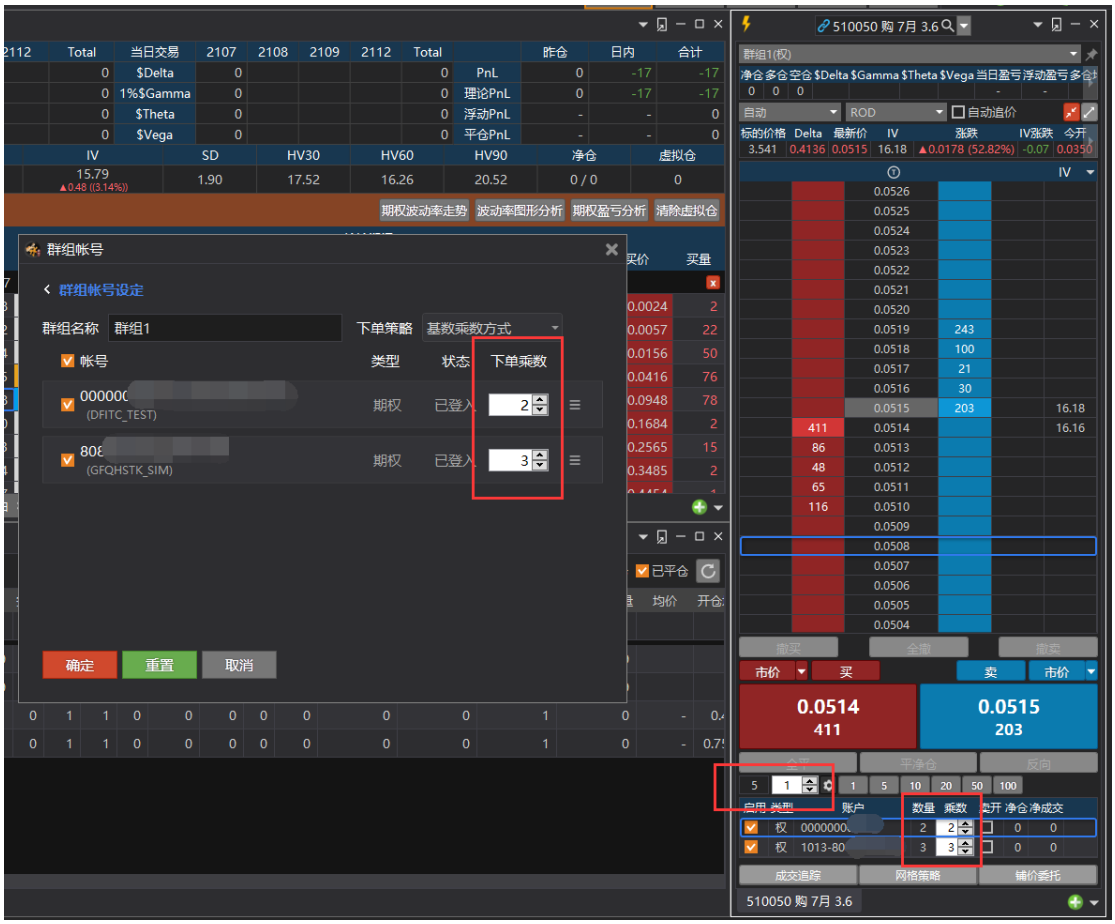
下单策略

自定义手数方式



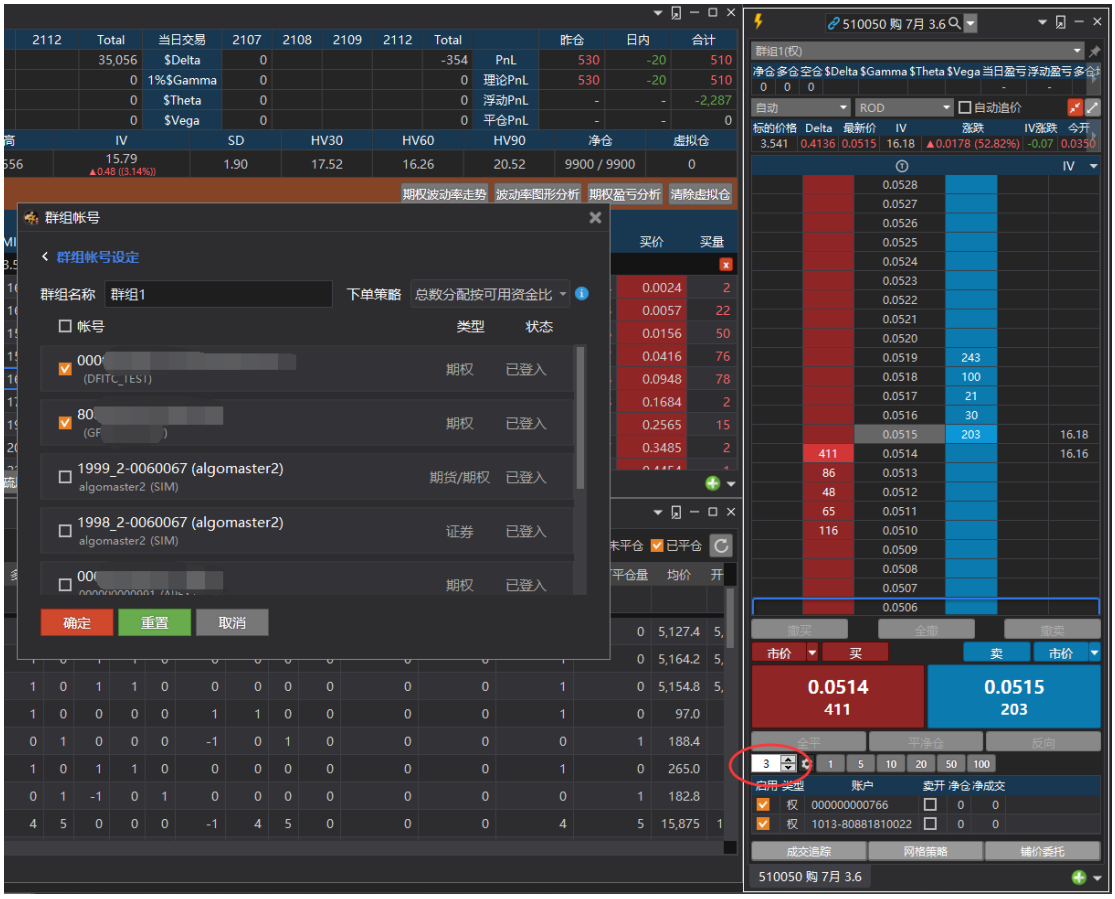
- 闪电下单选取群组账号，下方显示账号列表
  - 预设数量为群组账号设定中自定义下单手数
  - **总下单手数**为群组中各账号的下单手数加总
  - 可调整各账号的下单数量，总手数随着变化。

基数乘数方式



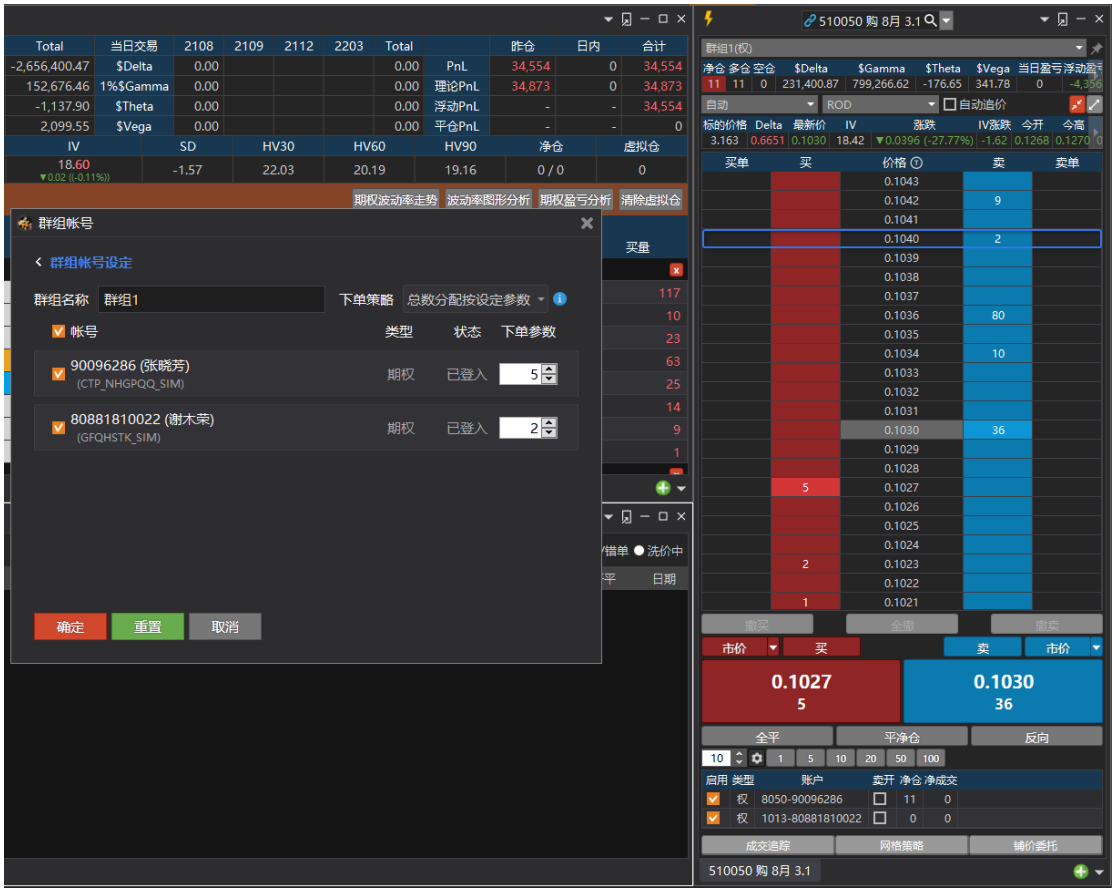
- 闪电下单，每个账号的下单数量 = 下单板手数 * 设置的下单乘数
  [如上图，下单板手数设置为 1，下单乘数分别为 2、3，下单数量为 2、3]
- 闪电下单显示数量
  - 账号列表显示“乘数”设定
    - 从群组账号设定取默认值
    - 可调整各账号下单乘数，各账号下单数量以及总下单手数随着变化
  - 下单板 数量 设置
    - 显示 **总下单手数**（不可手动调整）
    - 下单板设置 数量，各账号的下单数量=下单板数量*乘数
    - 总下单手数 = 各账号下单数量加总

总数分配按可用资金比



- 下单板输入的手数为下单总数，每个账户的下单手数=下单总数*（每个账户可用资金/各个账号可用资金之和）
- 群组内资金账号委托顺序依比例由大到小依序送出

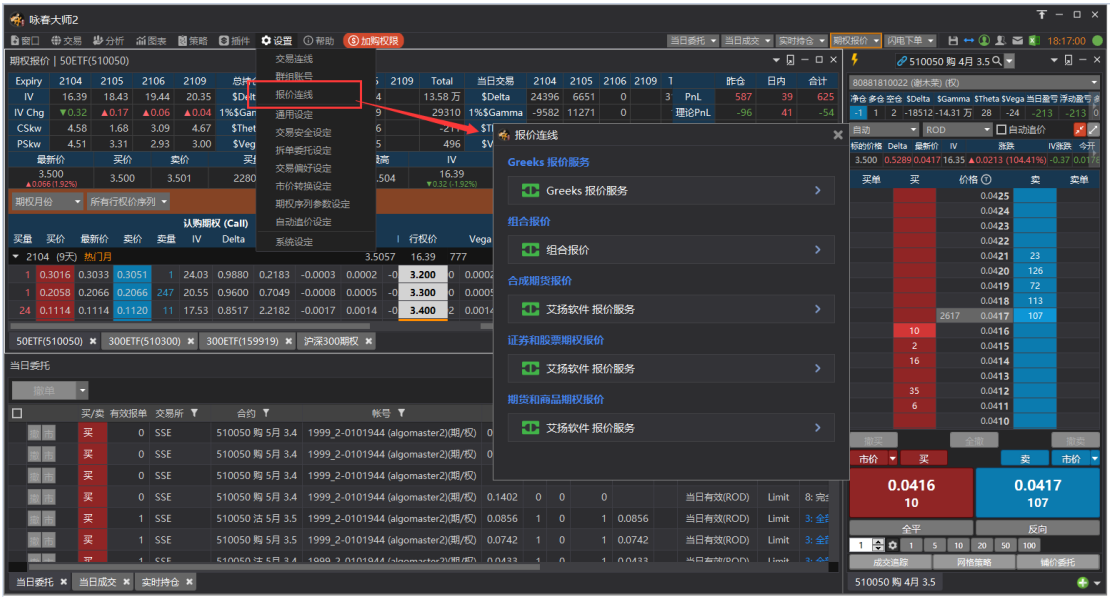
总数分配按设定参数



- 下单板输入的手数为下单总数，每个账户的下单手数=下单总数*（每个账户设置的下单参数/各个账号设置参数之和）
- 群组内资金账号委托顺序依参数比例由大到小依序送出。

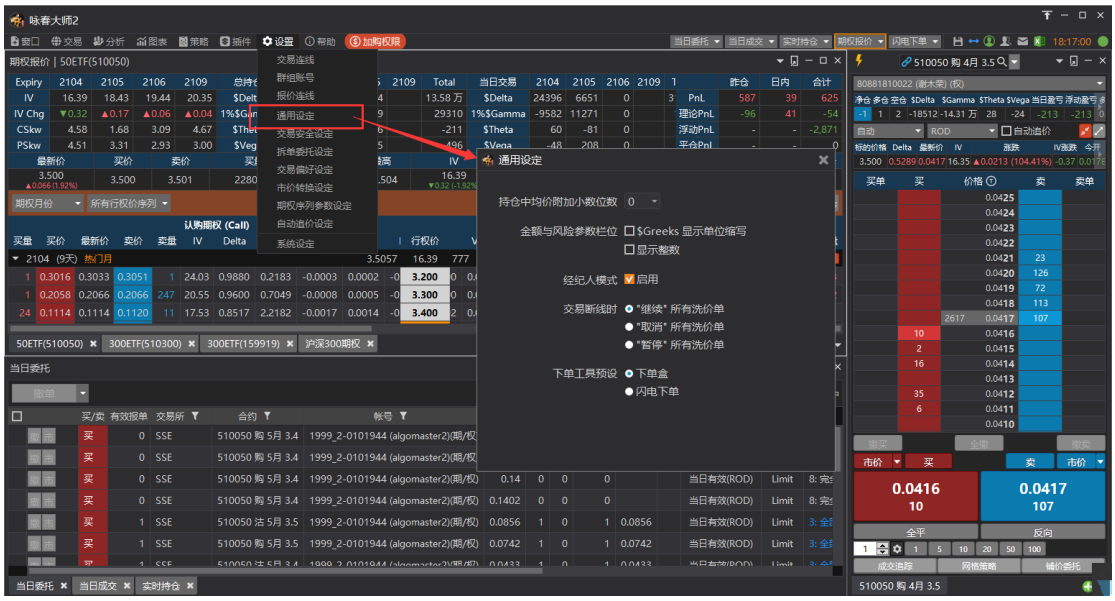
报价连线

显示当前报价连线状态。



通用设定

对所有交易账号有效:



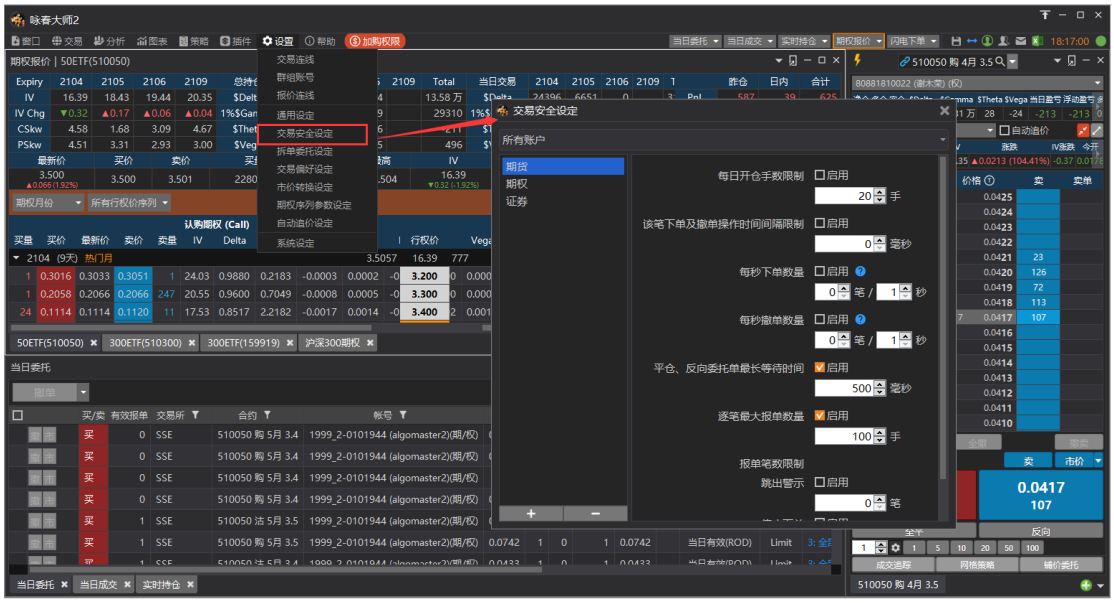
- 持仓中均价附加小数位数:0 表示不附加小数位数,1 表示附加 1 位小数位数。
- 金额与风险参数栏位:
  - $Greeks 显示单位缩写:影响$Greeks 以及盈亏栏位,数值超过 10 万则以"万"单位缩写显示。
  - 显示整数:影响$Greeks 以及盈亏栏位,数值显示整数。
- 经纪人模式:
  - 启动经纪人模式,客户端不主动查询持仓明细资料,避免查询资料量过多时软件运行拖慢。
- 洗价单设定:

- ◆ 当交易断线时，客户端本地的洗价单可以设定继续洗价、暂停或取消。

■ 下单工具预设

- ◆ 设定报价、持仓等栏位点击开启下单工具预设“下单盒”或“闪电下单”

交易安全设定



交易安全设定提供下单时的限制项目，启动限制后，下单时如果超过设定上限则会下单失败或者延迟送出申请：

- ◆ 每日开仓手数限制
- ◆ 该笔下单及撤单操作间隔时间限制
- ◆ 每秒下单数量
- ◆ 每秒撤单数量
- ◆ 平仓、反向委托单最长等待时间
- ◆ 逐笔最大报单数量
- ◆ 报单笔数限制
  - ● 跳出警示
  - ● 禁止下单

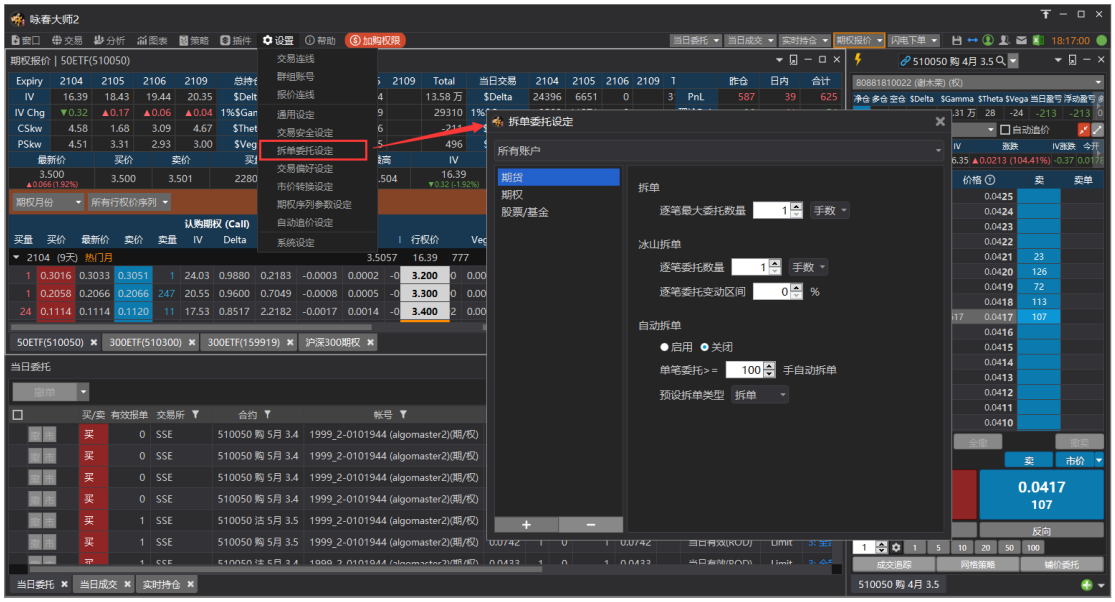
■ 设置账号范围

- ◆ 交易安全设定预设套用于所有账号，可以通过+按钮新增要管控的交易账号。

■ 设置商品范围：

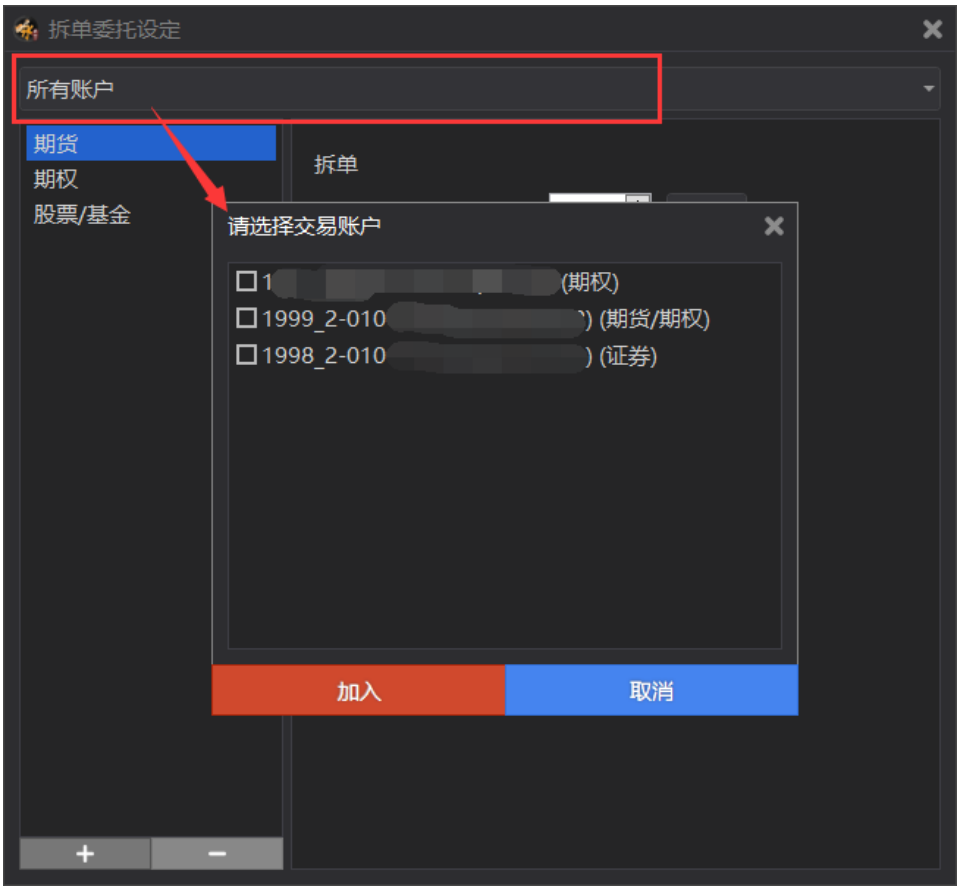
- ◆ 交易安全设定预设管控 3 种类型商品：期货、期权、证券
- ◆ 可以通过 ＋ 按钮新增商品，在选择商品窗口中选取要管控的商品范围
- ◆ 加入后的商品可以通过 – 按钮移除。

拆单委托设定



提供拆单、冰山拆单、自动拆单功能

- 拆单：设定逐笔最大委托数量。启用拆单下单时数量如果超过逐笔最大委托数量数量则按设定数量拆分下单。
- 冰山拆单：设定逐笔委托数量，和逐笔委托变动区间。计算出逐笔委托数量的上限和下限。启用冰山拆单下单时，数量如果超过逐笔委托数量则按照区间内随机数量拆分下单。
- 自动拆单：可以启用或关闭自动拆单。启用自动拆单时，单笔委托超过设定数量则自动拆单，预设拆单类型可选：拆单、冰山拆单、定时拆单。
- 设置账号范围

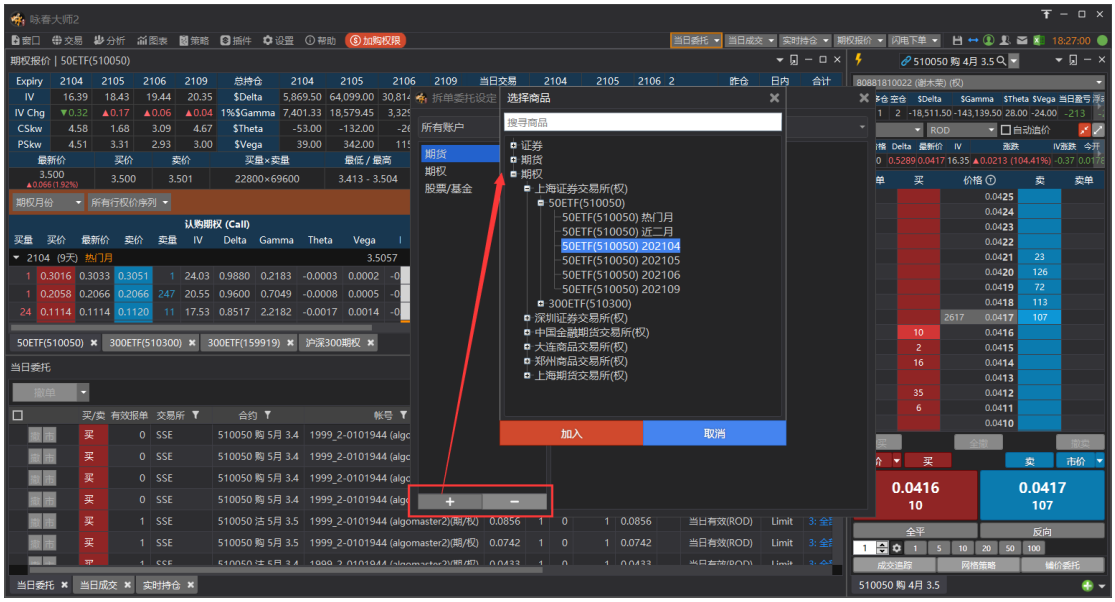


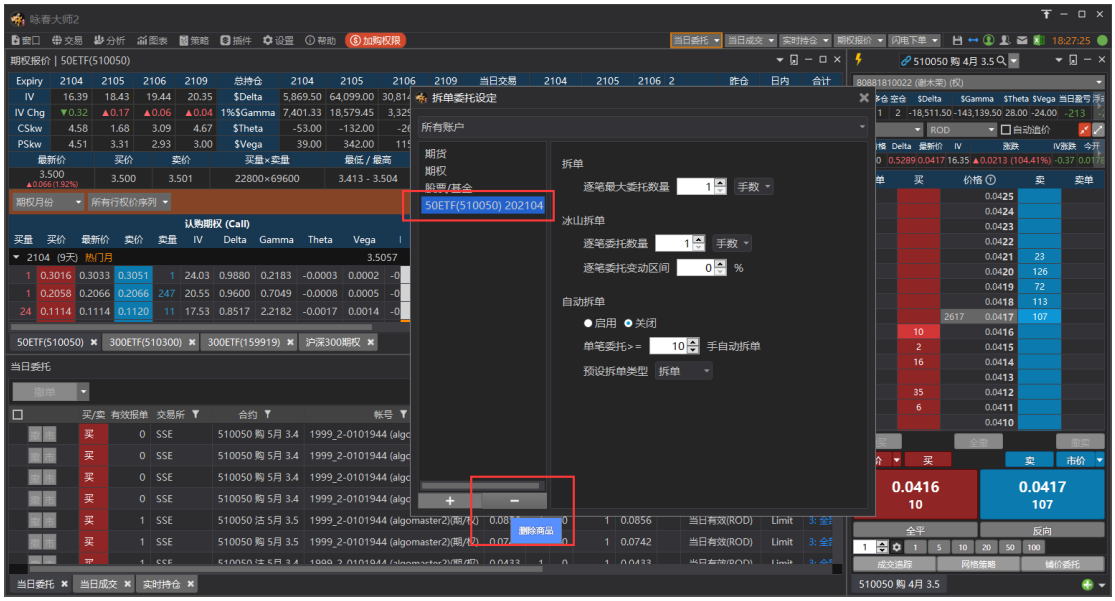
◆ 交易安全设定预设套用于所有账号，可以通过+按钮新增要管控的交易账号。

■ 设置商品范围：

◆ 拆单委托设定预设分 3 种类型：期货、期权、股票/基金

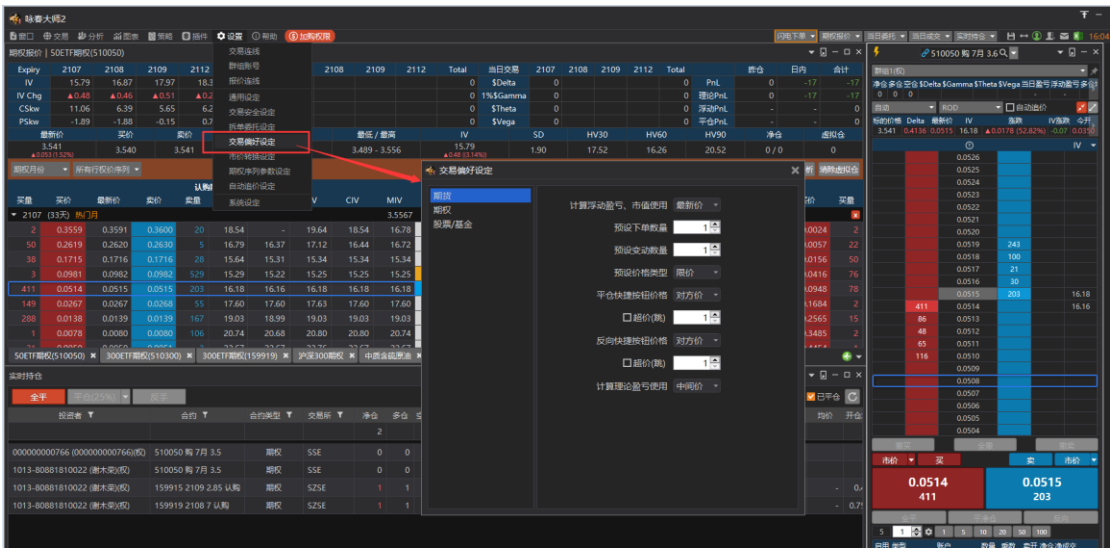
◆ 可以通过 ＋ 按钮新增商品，在选择商品窗口中选取商品范围





◆ 加入后的商品可以通过 – 按钮移除。

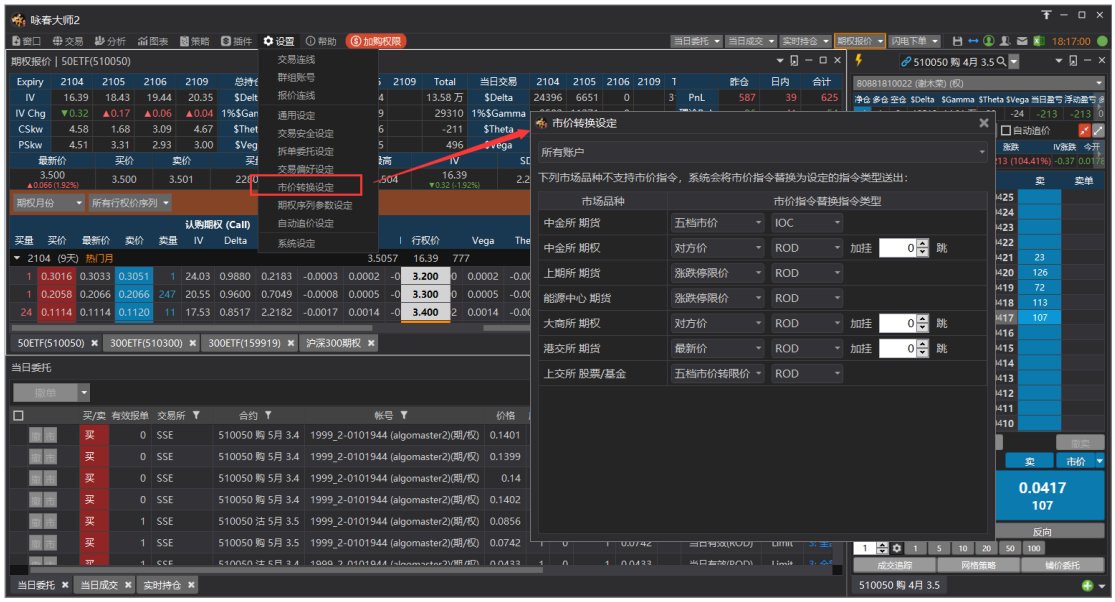
交易偏好设定



设定不同类型商品的盈亏市值参考价格、下单数量、价格类型等。

- 计算浮动盈亏、市值使用：最新价、中间价
- 预设下单数量
- 预设变动数量
- 预设价格类型：限价、本方价、对方价、最新价
- 平仓快捷按钮价格：对方价、最新价、本方价；勾选超价跳数
- 反向快捷按钮价格：对方价、最新价、本方价；勾选超价跳数
- 计算理论盈亏使用价格：预设为“中间价”

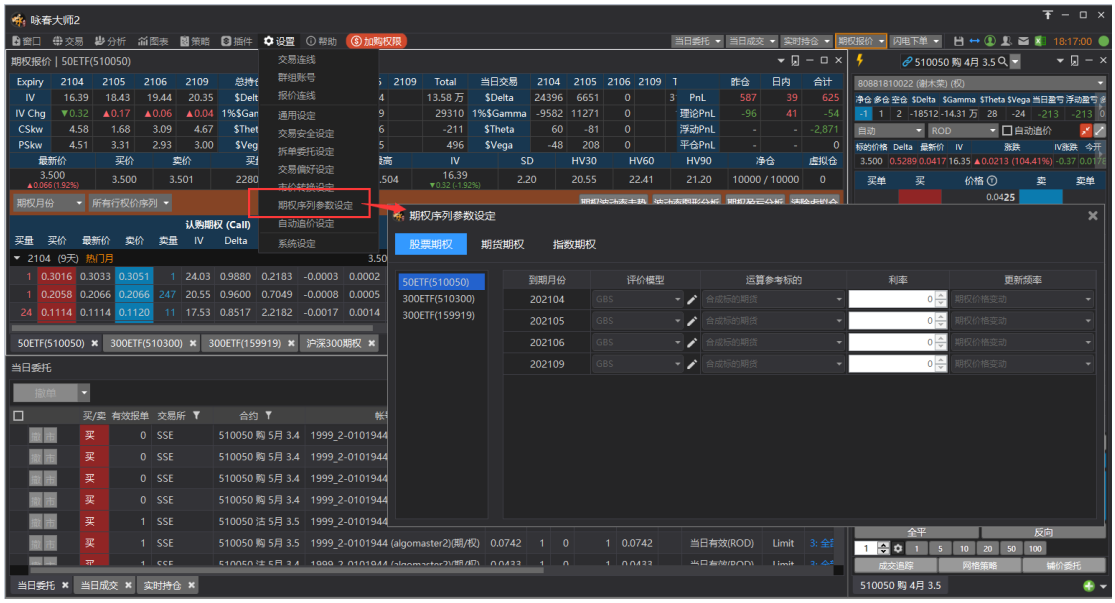
市价转换设定



对于不支持市价指令的市场品种，可以设定市价转换类型，将市价指令替换为设定的指令类型送出。

- 设定账号范围：默认为所有账号。按 + 按钮添加账号
- 设定价格类型
- 设定有效期
- 设定加挂跳数

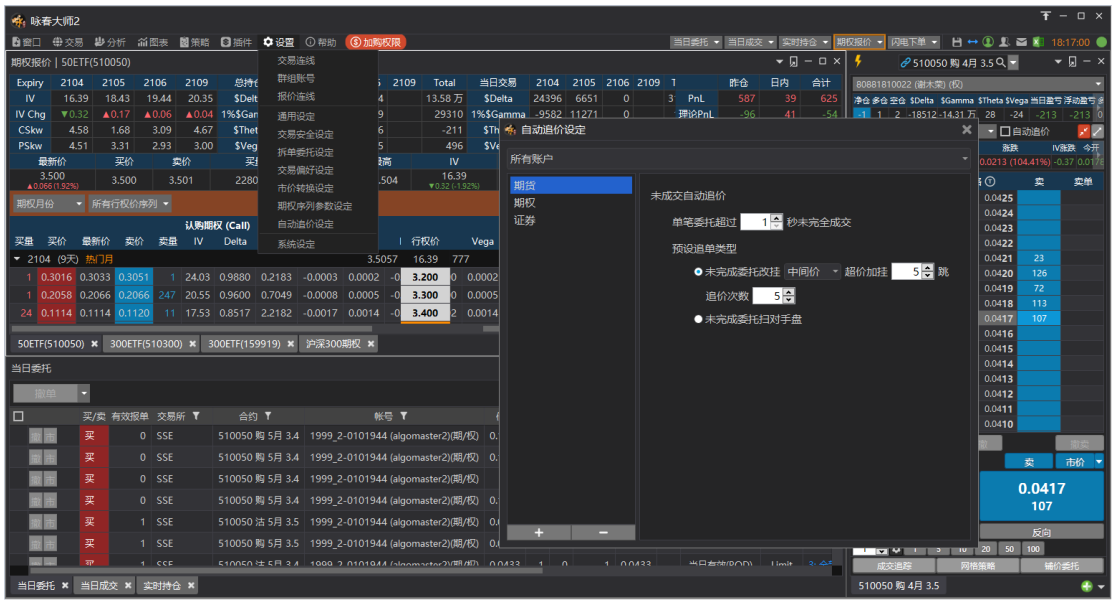
期权序列参数设定



*注：
软件预设使用行情服务器订阅希腊字母报价，期权序列参数设定不可调整。
可开通加值服务，提供本地计算的希腊字母报价，期权序列参数设定可调整。
参数设定说明：
期权序列评价参数设定可以按照各个期权品种，不同的到期月份序列，设定评价参数。

- 分类
  - 股票期权
  - 期货期权
  - 指数期权
- 评价模型：
  - GBS：使用 Black Scholes 期权定价模型
  - 日期类型：使用交易日、日历日、自定义(年交易日天数)计算时间参数
- 运算参考标的
  - 合约原生标的
  - 交易所&合成标的期货
  - 合成标的期货
- 利率
  - 输入自定义利率值
- 更新频率
  - 期权价格变动
  - 参考标的价格变动

自动追价设定



提供自动追价设定，可设定未成交自动追价。
（注：自动追价仅适用闪电下单，需要在闪电下单中勾选“自动追价”才启用。）

- 未成交时间间隔：
  - 当单笔委托超过设定秒数未完全成交时，自动追价

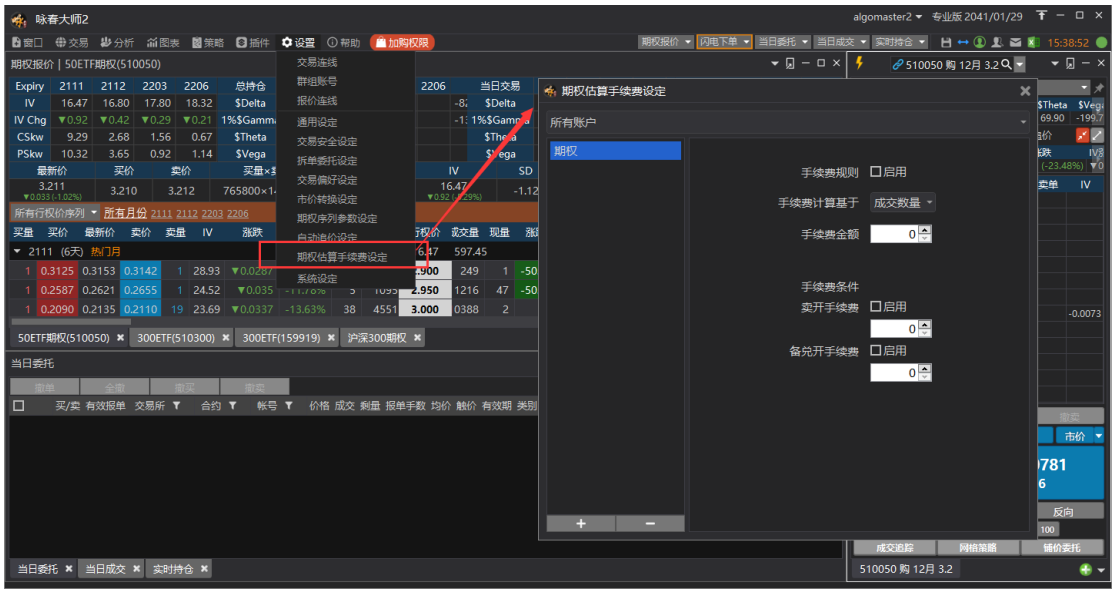
- 预设追单类型
  - 未完成委托改挂：[中间价、本方价、对方价]
  - 超价加挂跳数
  - 追价次数
- 未完成委托扫对手盘

举例：

图例中设定：单笔委托超过 1 秒未完全成交，预设追单类型：未完成委托改挂中间价超价加挂 5 跳，追价次数 5 次。

则使用闪电下单勾选“自动追价”，当闪电委托单超过 1 秒未完全成交时，会自动将原委托删掉，以合约最新的中间价加挂 5 跳的价格重新委托，第一次追价 1 秒后，若已成交则不继续追价，若仍未成交，继续第二次追价，第二次追价价格为合约当前最新的中间价加挂 5 跳。依次类推，直到追价次数用尽不继续追价。

期权估算手续费设定

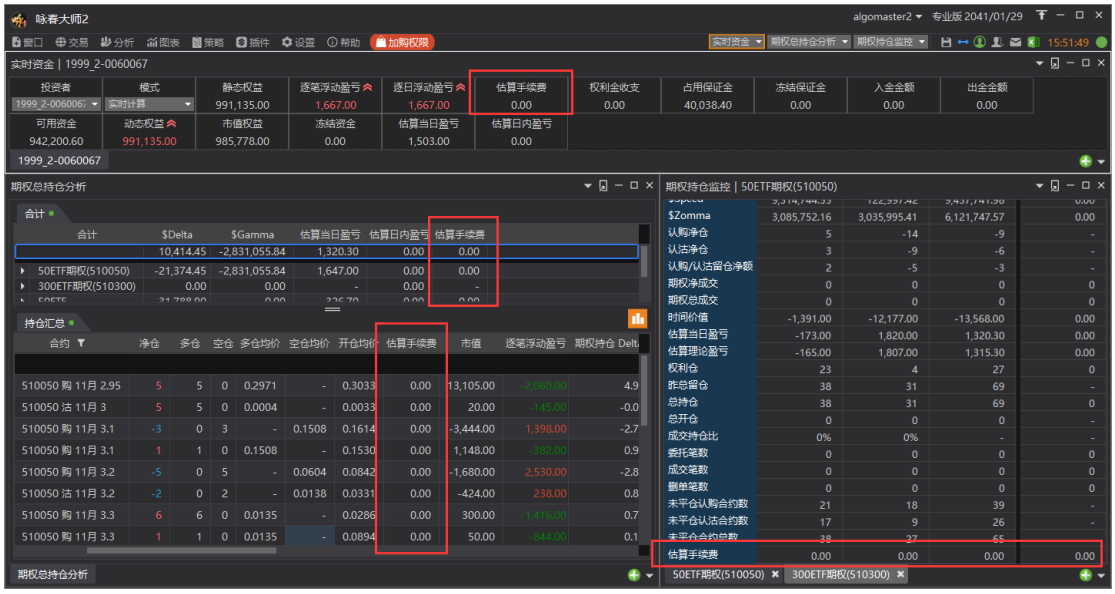


期权品种估算手续费功能，提供以下设定：

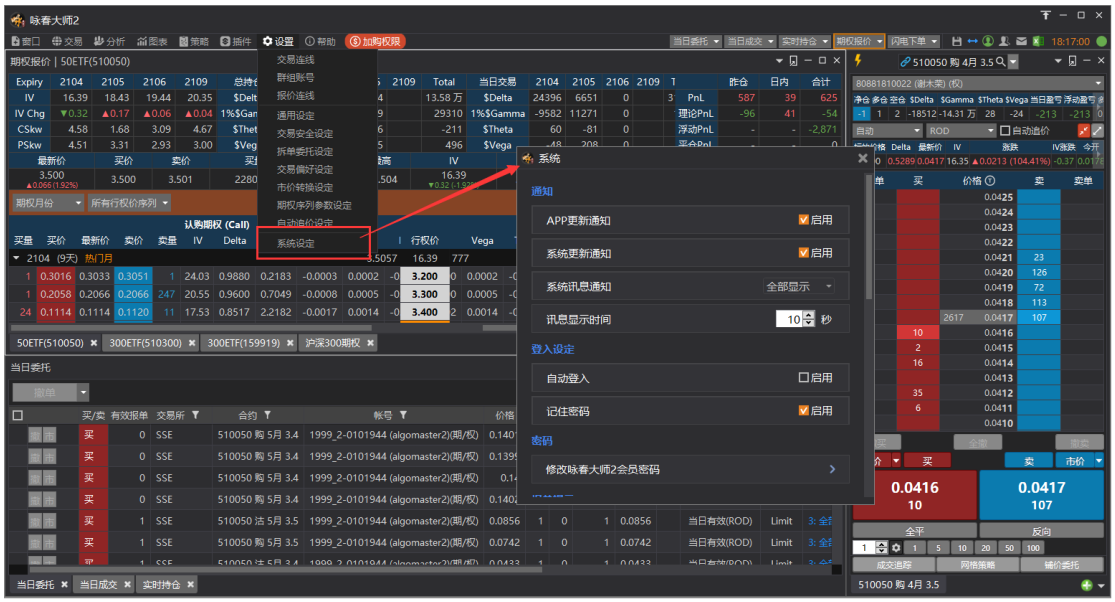
- 手续费规则：
  - 手续费计算基于成交数量
  - 手续费金额可设定每手手续费金额
- 手续费条件：
  - 针对卖开、备兑开仓的成交数量可以单独设定手续费

计算公式为：估算手续费=∑（(今买成+今卖平）*手续费金额）+ ∑（今卖开*卖开手续费）+ ∑（今备兑开*备兑开手续费）

估算手续费数据显示在实时持仓、期权总持仓分析、期权持仓监控中：



系统设定



系统设定下可以设置系统通知、登入设定、会员密码、报单提示、其他安全保护设置。

- 通知:
  - 可以设定 APP 的更新通知、系统更新通知、系统讯息通知、讯息显示时间。
- 登入设定:
  - 设定会员账号是否自动登录、记住密码
- 密码:
  - 修改会员账号密码
- 报单提示:
  - 完全成交、报单成功、报单失败提供音效提示和讯息提示,
  - 部分成交、报单超时无应答、市价单超时未成交提供讯息提示。

- 其他：
  - 可以选择是否自动更新 APP、清除缓存资料、清除使用者资料、避免系统进入休眠、避免进入荧幕保护、系统闲置等候时间和锁定系统、侦测交易连线异常自动断线重连。

帮助

在帮助菜单，提供操作手册、官网等

- 操作手册
- AlgoStars*策略星 官网
- 策略星学院
- 远程桌面助手
- 导出日志：
  - 将必要的日志档案导出保存在桌面，可提供给客服以便查看问题。
- 帮助：
  - 查看软件版本信息、版权信息。

加购权限

点击进入官网，可了解或升级专业版、量化版功能。
https://school.algostars.com.cn/algom2

专业版加值功能：

- 走势图表功能提供秒线
- 策略管理、策略下单、策略监控、期权策略管理
- 群组账号功能
- 期权序列参数设定自定义

量化版加值功能：

- API 接口功能：ExcelVBA、Python、C++&C#