



恒生系统郑州期权支持情况

目录



- 期货06版



- 期货UFT2.0



- 期货UF2.0



- 网上交易5.0

期货06版

1-权限控制

期货06版

交易编码限制修改

交易所	开户会员	交易编码	编码类型	主帐标志	状态	账户限制
郑州交易所	0010	34340457	投机	主帐	正常	
大连交易所	0109	10000001	投机	主帐	正常	
金融交易所	2488	248801595144	投机	主帐	正常	

客户编号: 10000001

资产账号: 10000001

客户姓名: 恒生维护

客户分类: 散户

客户分组: 总部客户

账户状态: 正常

证件类型: 身份证

证件号码: 62022229830729352X

资产账号: 10000001

交易所: F1 郑州交易所

交易编码: 34340457

开户会员: 0010

编码类型: A 投机

主帐标志: 1 主帐

账户限制:

开通业务: 12

柜员备注:

- ☒ 1 传统业务
- ☒ 2 期权业务
- ☐ 7 做市商业业务

确认

取消

开通业务中勾选了
2-期权业务该交易
帐号才能进行期权
交易等期权相关业
务

2-期权参数-合约代码

期货06版

代码设置

郑州交易所

甲醇N

白糖

白糖期权

大连交易所

上海交易所

金融交易所

能源交易所

合约类别	合约系列	合约代码	合约名称	期权类型	标的物	执行方式	固定保证金	合约乘数	申报单位	价
白糖期权	SR709	SR709C5200	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C5300	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C5400	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C5500	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C5600	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C5700	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C5800	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C5900	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6000	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6100	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6200	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6300	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6400	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6500	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6600	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6700	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6800	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C6900	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709C7000	白糖期权709...	看涨	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5100	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5200	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5300	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5400	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5500	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5600	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5700	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5800	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P5900	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按
白糖期权	SR709	SR709P6000	白糖期权709...	看跌	SR709	美式	0	10	按手	按

设置期货合约代码

合约参数 | 其他参数

合约代码 SR709C6500

交易类别 F1 郑州交易所

品种名称 白糖期权709C6500

执行方式 2 美式

品种类别 V 白糖期权

交易状态 1 运行

合约系列 SR709

产品类别 2 期权

标的物 SR709

期权类型 1 看涨

固定保证金 0

交易限制

合约乘数 10

开仓最小单位 1

价格单位 2 按吨

平仓最小单位 1

申报单位 1 按手

市价单最大下单量 200

最小价差 0.5

市价单最小下单量 1

挂牌基准价 0

限价单最大下单量 1000

执行价 6500

限价单最小下单量 1

查找

确定

取消



3-期权参数-交易所手续费

期货06版

音首字母>

期货代码设置 | 交易所保证金设置 | 交易所费用设置

结算会员费用	合约类别	合约系列	合约代码	套保标识	期权类型	费用类型	买成交金...	买每手金额	买今仓成交...	买今仓
郑州交易所	绿豆	!	!	!	非期权	开仓费用	0.00	10.00	0.00	10.00
大连交易所	绿豆	!	!	!	非期权	平仓费用	0.00	10.00	0.00	10.00
上海交易所	小麦	!	!	!	非期权	开仓费用	0.00	10.00	0.00	10.00
金融交易所	小麦	!	!	!	非期权	平仓费用	0.00	10.00	0.00	10.00
能源交易所	小麦	!	!	!	非期权	交割费用	0.00	10.00	0.00	10.00
					期权	开仓费用	0.06	0.00	0.05	0.00
					期权	平仓费用	0.05	0.00	0.05	0.00
					期权	开仓费用	0.00	5.00	0.00	4.00
					期权	平仓费用	0.00	5.00	0.00	4.00
					期权	开仓费用	0.00	10.00	0.00	10.00
					期权	平仓费用	0.00	10.00	0.00	10.00
					期权	开仓费用	0.10	1.00	0.10	1.00
					期权	平仓费用	0.10	1.00	0.10	1.00
					期权	开仓费用	0.01	10.00	0.00	10.00
					期权	平仓费用	0.02	10.00	0.00	10.00
					期权	开仓费用	0.005	10.00	0.005	10.00
					期权	平仓费用	0.002	10.00	0.002	10.00
					期权	开仓费用	0.0054567	14.00	0.0054567	10.00
					期权	平仓费用	0.0054567	10.00	0.0054567	10.00

添加期货交易所费用

设置条件

会员类型 0 结算会员

交易类别 F1 郑州交易所

合约类别 V

合约系列 !

费用类型 1 开平费用

套保标志 !

合约代码 !

期权类型 1,2

开仓费用参数

☒ 开仓买卖相等

成交金额比例 0.00003000

每手手续费金额 0.00

平今仓对应开仓费用参数

成交金额比例 0.00003000

每手手续费金额 0.00

平仓费用参数

☒ 平仓买卖相等

成交金额比例 0.00003000

每手手续费金额 0.00

平今仓对应平仓费用参数

成交金额比例 0.00003000

每手手续费金额 0.00

☐ 校验提醒

确定

取消

增加

导出到Excel

4-期权参数-交易所保证金

期货06版

期货代码设置 交易所保证金设置

郑州交易所
大连交易所
上海交易所
金融交易所
能源交易所

合约类别	合约系列	合约代码	期权类型	买投机 比例	买投机 每手	卖投机 比例	卖投机 每手	买套保 比例	买
白糖	!	!	非期权	0.05112345	32.12	0.09299292	45.32	0.11881881	10
白糖期权	!	!	期权	0.05112345	32.12	0.09299292	45.32	0.11881881	10

Hsclient

因商品期权的保证金实际上使用的是其【标的期货】的保证金，
故这里不提供商品期权的保证金设置。仅提供查看，数据来自其【标的期货】的保证金。

如有需要，请设置、修改或删除其【标的期货】的保证金。

期权【白糖期权(V)】对应的标的期货是：【白糖(e)】。

OK

5-期权参数-行权时间设置

期货06

期货交易时间设置

- 大连交易所
 - 郑州交易所
 - 盘后行权
 - 盘后会员端行权
 - 当日委托
 - 结算时间
- 上海交易所
- 金融交易所
- 能源交易所

时间名称	开始时间	结束时间	撤单允许
------	------	------	------

盘后行权	150001	152000	允许
------	--------	--------	----

- 大连交易所
 - 郑州交易所
 - 盘后行权
 - 盘后会员端行权
 - 当日委托
 - 结算时间
- 上海交易所
- 金融交易所
- 能源交易所

时间名称	开始时间	结束时间	撤单允许
------	------	------	------

盘后会员端行权	152001	153000	允许
---------	--------	--------	----

6-期权交易

期货06版

期货交易委托 | 普通委托[F6] | 委托查询[F7] | 可撤单委托[F12] | 成交查询[F8] | 持仓查询[F9] | 撤单记录[F11] | 预埋委托[F2] | 报价查询[10] | 组合委托查询

自选行情 上海 大连 郑州 中金 套利 能源 期权

看涨期权										看跌期权									
最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量	执行价	最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量			
0	0	0	0	0	0	78	0	4900	0	0	0	0	0	0	0	0			
1000	0	0	0	0	199.5	144	22	5000	0	0	0	0	0	0	0	0			
0	0	0	0	0	0	20	0	5100	0	0	0	0	0	0	0	0			
0	0	0	0	0	0	20	0	5200	0	0	0	0	0	0	0	0			

期权类别: V白糖期权 合约系列: SR611

合约: SR611C5000

最新价	1000	今开盘	1000
涨跌幅	-	最低价	1000
成交量	22	涨停价	1032.5

委托号 委托状态 资产帐号 合约代码 合约代... 买/卖 开/平 投机套保 委托价格 委托数量 成交数量

资产帐号: 10000001 通用委托

客户简称: 南红军 双边报价

合约代码: SR611C5000 账户锁定

交易编码: 34340457 周边可撤

委托数量: 1

买卖方向: 2 卖出

开/平 仓: 1 开仓

投机套保: 0 投机 确定

委托价格: 1000 取消

涨停板: 1032.5 跌停板: 568.5

郑州时间: 11:23:30 大连时间: 11:21:26 上海时间: 10:50:36 中金时间: 10:47:49 能源时间: 11:22:58

合约信息 白糖期权611C5000 资产帐号 10000001 客户简称 南红军 可用余额 100475208.96 可开/最大可开 200/7584手 可用/可平 0手 交易编码 34340457

支持期权行情
以T型报价模
式显示

期权交易指令
下达同普通期
货，使用相同
的界面和功能

7-期权交易—做市商

期货06版

期货交易委托 |

普通委托[F6] | 委托查询[F7] | 可撤单委托[F12] | 成交查询[F8] | 持仓查询[F9] | 撤单记录[F11] | 预埋委托[F2] | 报价查询[10] | 组合委托查询

自选行情 | 上海 | 大连 | 郑州 | 中金 | 套利 | 能源 | 期权

看涨期权								SR611	看跌期权							
最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量	执行价	最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌		
0	0	0	0	0	0	78	0	4900	0	0	0	0	0	0		
1000	0	0	0	0	199.5	144	22	5000	0	0	0	0	0	0		
0	0	0	0	0	0	20	0	5100	0	0	0	0	0	0		
0	0	0	0	0	0	20	0	5200	0	0	0	0	0	0		

委托号 | 委托状态 | 资产帐号 | 合约代码 | 合约代... | 买/卖 | 开/平 | 投机套保 | 委托价格 | 委托

在通用委托中支持做市商业
业务的询价和报价指令

通用委托

合约代码1
SR611C5000

交易市场
F1 郑州交易所

资产帐号
10000001

客户密码

委托属性
0 限价单

成交量属性
0 无

0 限价单

1 市价单

6 止损

7 组合定单

A 跨期套利确认

B 持仓套保确认

C 请求询价

有效日期
3 当日有效

有效日期

触发价格

委托数量

委托价格

确定

取消

郑州时间: 11:25:04 大连时间: 11:23:01 上海时间: 10:52:10 中金时间: 10:49:23 能源时间: 11:24:33

8-行权与履约

期货06版

期权执行与履约 |

客户行权 | 批量行权 |

资产帐号10000001

交易类别F1 郑州交易所

查询

可用资金475208.96

配置

行权持仓

资产帐号	交易类别	交易编码	合约代码	到期日	交割价	执行价	期权类型	执行类型	买未平	买可用	卖未平	投机/套保	席位号
10000001	郑州交易所	10000001	SR711C5500	20170925	5573.000	0.000	看涨	美式	1	1	1	投机	285
10000001	郑州交易所	10000001	SR711F5500	20170925	5573.000	0.000	看跌						

行权申请与放弃申请

行权试算

行权申请

委托编号	资产帐号	交易类别	合约代码	委托数量	合约乘数	期货委托属性	交易
------	------	------	------	------	------	--------	----

执行试算

试算选项

☒ 1-全部执行

☐ 2-最大对冲

☐ 3-已申请数量

☐ 4-任意放弃量

放弃量

试算价5573.00

试算

买/卖未平里0/0

买/卖执行里0/0

买/卖执行盈亏0.00/0.00

买总可执行0

放弃数量0

行权保证金0.00

交易所/客户

执行手续费0.00/0.00

履约手续费0.00/0.00

最大盈利0.00/0.00

最小盈利0.00/0.00

申请放弃

申请执行

取消申请

修改执行标准

9-风险监控

期货06版

期货风险监控

☐ 按上下方式新开窗口
☐ 按查询条件排序 显示信息 刷新时间 秒 记录行数

全部网点

客户分类	客户分组	币种类别	客户风险率	昨日客户...	交易所...	昨日交...	期权权利金...	客户市值	客户风险1	客户风险2	客户风险3
------	------	------	-------	---------	--------	--------	----------	------	-------	-------	-------



增加期权权利金、客户市值、
风险率1等字段以支持期权风控

版

单客户保证金试算 (New)

恒生电子股份有限公司 www.hundsun.com

增加结算文件：非平仓了结表、平仓盈亏表、(保证金参数表)

交易类别	文件子类	会员编号	文件路径	处理模式	导出机构
郑州交易所	郑州非平仓了结文本	0008	D:\清算文件\ZZ\YYYYMMDD非平仓了结表.txt	数据转入	0

交易类别	文件子类	会员编号	文件路径	处理模式	导出机构
郑州交易所	郑州平仓盈亏表	0100	D:\qhrzfile\ZZ\YYYYMMDD平仓表.txt	数据转入	0

交易类别	文件子类	会员编号	文件路径	处理模式	导出机构
郑州交易所	郑州保证金参数表文本	0100	D:\qhrzfile\ZZ\YYYYMMDD保证金参数表.txt	数据转入	0

12-期权结算

期货06版

客户账单、报表中增加期权相关字段显示

89000896 期货测试1 期货测试1 20160819 20160819 人民币

期货客户账单_资金清单_人民币

期初权益:	600,080.00	持仓保证金:	0.00
期间入金:	0.00	当日质押金:	0.00
期间出金:	0.00	可用资金:	600,080.00
期间出入金合计:	0.00	期间手续费:	0.00
平仓盈亏:	0.00	追加保证金:	0.00
盯市持仓盈亏:	0.00	交易所可用:	600,080.00
浮动持仓盈亏:	0.00	上日质押金:	0.00
期末权益:	600,080.00	质押变动金额:	0.00
期初结存:	600,080.00	当日结存:	600,080.00
现金余额:	0.00	浮动交割盈亏:	0.00
风险率:	0.00%	盯市盈亏合计:	0.00
浮动盈亏合计:	0.00	交割手续费:	0.00
权利金收支:	0.00	期权执行盈亏:	0.00

汇总模式 1 汇总模式

营业部号 8888,58,90,100,101,102

客户分类

客户分组

资金账号

资产账号串

机构标志 0,1,2,3

交易类别 F1,F2,F3,F4,F5

合约类别

合约代码

期权类型 0,1,2

期权系列

买卖方向 1,2

开平方向 1,2,3,4

套保标志

查询日期 20161227 20161227

成交时间

成交金额 0.00 0.00

显示字段 开仓上缴手续费,执行

分类字段

小计字段

- ☒ 卖期权成交收入权利金
- ☒ 期权权利金
- ☒ 期权平仓浮动盈亏
- ☒ 期权执行手续费

确认(O)

取消(C)

模板配置(S)

☐ 显示打印设置

☒ 显示打印浏览

13-期权报送

期货06版

报送数据保存路径	
D:\	
选择路径	
报送文件目录	
营业部号	
起始日期	20161227
截止日期	20161227
查询方式	0 按资产账号区间查询
文件命名格式	0 前缀为会员号
起始资产账号	
结束资产账号	
使用者是期货全面结算会员， 请选择“打印全面结算会员”。	
☒ 打印全面结算会员	
☒ 上海交易所的最后交易日模式	
勾选该模式：对于上海交易所最后交易日品种的合约，不体现在[持仓明细]、[持仓数据]中，体现在[待交割结算合约文件]中，盈亏体现在[客户其它分项资金数据文件]的A008中；	
确认(O)	取消(C)
☒ [客户期货结算账户文件]-----cusaccount ☒ [客户编码文件]-----cuscode ☒ [客户基本资金数据文件]-----cusfund ☒ [客户基本资料文件]-----customer ☒ [期货交割明细文件]-----delivdetails ☒ [客户出入金记录文件]-----fundchg ☒ [期货持仓数据文件]-----holddata ☒ [期货持仓明细文件]-----holddetails ☒ [期货平仓明细文件]-----liquiddetails ☒ [非货币充抵明细文件]-----mortgagedetails ☒ [客户其它分项资金数据文件]-----otherfund ☒ [其它需要说明的信息或数据文件]-----otherinfo ☒ [期货成交明细文件]-----trddata ☒ [期货待交割结算合约文件]-----delivcontractdata ☒ [汇兑明细文件]-----exchangedetails ☒ [货币充抵资金文件]-----currencymortgage ☒ [单一客户综合类资管业务账户文件]-----amaccounts ☒ [资产管理非期货类资金数据文件]-----amassets ☒ [综合类资产管理业务托管账户文件]-----amcustodyaccount ☒ [期权持仓数据文件]-----optholddata ☒ [期权成交明细文件]-----opttrddata ☒ [期权行权明细文件]-----optexerdata ☒ [期权平仓明细文件]-----optliquiddetails ☒ [期权持仓明细文件]-----optholddetails ☒ [资管非本公司经纪业务资金明细文件]-----amassetsdetails	
全选	
不选	

期货UFT2.0

1-开通期权业务交易权限

期货UFT2.0

通过交易编码限制修改，可以开通期权交易权限。菜单：“期货—期货账户—交易编码信息设置—开通权限”，具体界面及操作步骤如下：

交易编码信息设置 管理查询

交易编码信息设置

资产账号: 100101198

交易市场: F1 郑州交易所

交易编码: 34364694

开户会员: 0011

编码类型: D 做市商

主账标识: 1 主账

账号限制:

开通业务: 12

二级代理编号: ☒ 1 传统业务 ☒ 2 期权业务

监控中心编号:

问题回答:

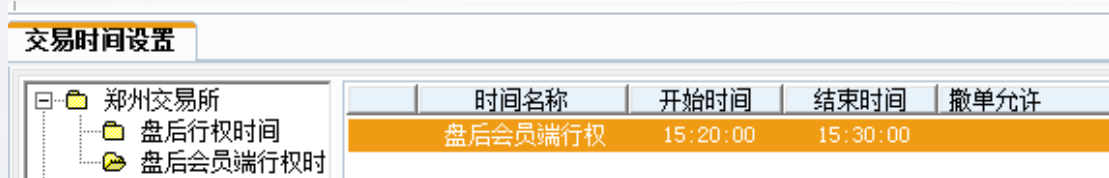
备注:

资产账号	交易类别	交易编码	会员编号	主账标识	编码类型	状态	账号限制	开通业务	二级代理编号
100101198	郑州交易所	34364694	0011	主账		正常		传统业务, 期权业务	
100101198	大连交易所	99301198	0302	主账		正常		传统业务, 期权业务	
100101198	上海交易所	60011198	0681	主账		正常		传统业务, 期权业务	
100101198	金融交易所	202910000583	2029	主账	套保	正常		传统业务, 期权业务	
100101198	金融交易所	202910000587	2029	副账	套利	正常		传统业务, 期权业务	
100101198	金融交易所	202910000581	2029	副账	投机	正常		传统业务, 期权业务	
100101198	能源交易所	86811198	8681	主账		正常		传统业务, 期权业务	

确定 关闭

郑商所盘后支持通过交易通道申报，系统中需要设置盘后行权时间，如果未设置，交易所状态是闭市之后，期权执行的报单不会报送交易所。

菜单：系统-期货基本参数-期货交易时间设置



3-期权交易-期权T型行情

期货UFT2.0

菜单：“期货—期货UFT交易—期货订单一期货委托”

选择期权T型行情，通过右上侧的查询条件，找到标的对应的一系列期权合约。

普通委托[F6] | 委托查询[F7] | 可撤单委托[F8] | 成交查询[F9] | 持仓查询[F10] | 撤单记录[F11] | 组合委托查询

自选行情 郑州 大连 上海 中金 套利 能源 主力 期权															
看涨期权								看跌期权							
最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量	最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量
352.5	0	0	352.5	0	0	0	0	3300	864	0	0	864	0	0	0
327	0	0	327	0	0	0	0	3350	680	0	0	779.5	0	0	0
297	0	0	297	0	0	0	0	3400	939	0	0	939	0	0	0
316.5	0	0	0	0	0	0	0	3450	756	0	0	899	0	0	0
293.5	0	0	293.5	0	0	0	0	3500	1017	800	0	1017	0	0	0
292	0	0	292	0	0	0	0	3550	1056	835	0	1056	0	0	0

期权类别	0m0豆粕	合约系列	m1703
合约：m1703-P-3150			
最新价	540	今开盘	0
涨跌	0	最高价	0
涨跌幅	-	最低价	0
成交量	0	涨停价	758
成交额	0	跌停价	536
昨持仓	0	今持仓	0
昨收盘	0	今收盘	0

委托查询									
委托号	委托状态	资产账号	合约代码	合约代码2	买/卖	开/平	投机套保	委托价格	委
成交查询									
委托号	委托状态	资产账号	合约代码	买/卖	开平方向	投机套保	成交价格	成交数量	

委托确认			
授权码：	资产账号：	100101183	投机套保：
交易编码：	99302011	合约代码：	m1703-C-2300
客户简称：	宋仲基	买卖方向：	1 买入
涨停板：	778	开/平 仓：	1 开仓
跌停板：	556	委托数量：	1
		委托价格：	7666
确定			

郑州时间：7:05:00 大连时间：7:05:00 上海时间：7:05:00 中金时间：6:31:34 能源时间：7:05:00

4-期权交易-委托下单

期货UFT2.0

期权开平仓委托下单同普通委托下单相同：

委托交易 错单修改 管理查询

普通委托[F6] 委托查询[F7] 可撤单委托[F8] 成交查询[F9] 持仓查询[F10] 撤单记录[F11] 组合委托查询

自选行情 郑州 大连 上海 中金 套利 能源 主力 期权

看涨期权								看跌期权							
最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量	最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量
0	0	0	0	0	0	0	0	5000	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0	5100	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0	5200	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0	5300	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0	5400	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0	5500	0	0	0	0	0	0	0

期权类别: SR0白糖 合约系列: SR705

合约: SR705C5300

最新价	0	今开盘	0
涨跌	0	最高价	0
涨跌幅	-	最低价	0
成交量	0	涨停价	695.5
成交额	0	跌停价	251.5
昨持仓	0	今持仓	0
昨收盘	0	今收盘	0

提示

确认下单?

确定 取消

委托查询

委托号	委托状态	资产账号	合约代码	合约代码
2	未报	100101183	SR705C5200	
1	未报	100101183	SR703C4800	SR703P4800

成交查询

委托号	委托状态	资产账户	合约代码	买/卖	开平
-----	------	------	------	-----	----

授权密码: 资产账号: 100101183 投机套保: 0 投机

交易编码: 34339492 合约代码: SR705C5300 通用委托

客户简称: 宋仲基 买卖方向: 1 买入 账户锁定

涨停板: 695.5 开/平 仓: 1 开仓 强平

跌停板: 251.5 委托数量: 1 确定

委托成功: 委托号2 委托价格: 260.000

16:59:06->委托号: 2 下单成功 委托单: 合约SR705C5200 | 买入 | 0 | 开仓 | 价格: 700 | 数量: 1 委托类型: 基本定单

合约代码 白糖705买权 资产账号 100101183 客户简称 宋仲基 可用资金 1050711.500000000 委托数量 1 可用/最大可用 402/402

5-期权交易-组合委托下单

期货UFT2.0

菜单：“期货—期货UFT交易—期货订单一期货委托—通用委托”

由于期权组合只能是有限制行订单（IOC或FOK），所以期权组合是没有行情的并且也没有组合合约代码，由客户自己根据组合规则，自己选择两腿合约和组合类型下单，如图所示：

菜单拼音首字母 委托交易 错单修改 管理查询

最近使用

管理查询
错单修改
委托交易
期货UFT客户系统设置
交易编码信息设置
资产账户限制设置
客户基本信息修改
资产账户扩展信息设置
节点子系统设置
多客户查询
单客户查询
配置参数设置
数据字典设置
合约模板设置
客户手续费直接导入
合约代码设置
客户保证金模板设置
客户保证金设置
客户保证金品种设置
交易所手续费设置
交易所保证金设置
交易行情设置
交易时间设置
资金银行卡设置
运维监控
运维操作

自选行情 郑州 大连 上海 中金 套利 能源 主力 期权

看涨期权 SR703

最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量	执行价
0	0	0	0	0	0	0	0	4800
0	0	0	0	0	0	0	0	4900
0	0	0	0	0	0	0	0	5000
0	0	0	0	0	0	0	0	5100
0	0	0	0	0	0	0	0	5200
0	0	0	0	0	0	0	0	5300

看跌期权

最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0

委托查询

委托号	委托状态	资产账号	合约代码	合约代码2	买/卖	开/平	投机套保	委托价格
1	未报	100101183	SR703C4800	SR703P4800	买入	开仓	投机	275.000

成交查询

委托号	委托状态	资产账号	合约代码	买/卖	开平方向	投机套保	成交价格	成交数量
-----	------	------	------	-----	------	------	------	------

16:19:38->委托号: 1 下单成功 委托单: 合约1 SR703C4800 | 合约2: SR703P4800 | 1|买入 | 0|投机 | 1|开仓 | 价格: 275 | 数量: 1

合约代码 SR703C4800SR70: 资产账号 100101183 客户简称 宋仲基 可用资金 1057721.50 委托数

郑州时间: 16:19:47 大连时间: 16:19:47 上海时间: 16:19:47 中金时间: 16:19:47 能源时间: 16:19:47

通用委托

交易市场 F1 郑州交易所

委托属性 F7 组合单

买/卖 1 买入

投机/套保 0 投机

合约代码1 SR703C4800

合约代码2 SR703P4800

触发价格

委托价格

最小成交数量

有效日期

资产帐号 100101183

组合属性 D 期权跨式套利

开/平 1 开仓

授权密码

合约代码2 SR703P4800

委托数量 1

指令类别 1 FOK

强/平 1 强

张停板: 1484.5

跌停板: 274.5

确定 取消

委托成功: 委托号1

期货UFT2.0系统支持做市商询价、报价业务，但是柜员端未支持下单。

菜单：“期货—期货UFT交易—期货订单一期权执行与履约—单客户期权行权”
单客户期权行权界面可以对单个客户行权，申报方式默认报盘申报方式，可以选择会服申报，单客户期权行权使用会服申报方式仅仅用于盘中柜员冻结客户的保证金和持仓，柜员需要到会服系统做行权操作。

单客户期权行权界面

资金帐号: 101090183 交易类别: F1 郑州交易所 可用资金: 1438071459.68

序号	资产帐号	交易类别	交易编码	合约代码	到期日	交割价	执行价	期权类型	执行类型	买未平	买可用	卖未平	投机/套保
1	101090183	郑州交易所	00506566	SR705C5200	20170327	5925.0000...	5200.000000	看涨	美式	20.00	10.00	0	投机
2	101090183	郑州交易所	00506566	SR705P5300	20170327	5925.0000	5300.000000	看跌	美式	10.00	10.00	0	投机

申请执行对话框:

请输入手数: 10
 申报方式: 0 报盘申报 (选中)
 1 会服申报
 确定 取消

执行试算:

试算选项: 1-全部执行 (选中) 3-已申请数量
 2-最大对冲 4-任意放弃量

放弃量: 试算价: 试算

买/卖未平量: 买总可执行: 放弃数量: 行权保证金:
 买/卖执行量: 执行手续费: 最大盈利: 最小盈利:
 买/卖执行盈亏: 履约手续费:

交易所/客户

申请放弃 申请执行 取消申请

正常运行 恒生期货 - uft操作员 操作员 (操作密码) 没有新消息 更多 交易时间 2016-12-27 20:26:44

8-单客户行权-区分虚实值持仓

期货UFT2.0

客户期权持仓支持根据颜色区分虚实值持仓，颜色可自行设置。

委托交易

管理查询

错单修改

期权执行与履约

批量行权

客户行权

批量查询

客户查询

资金帐号：

101090183

交易类别：

F1 郑州交易所

行权持仓

序号	资产帐号	交易类别	交易编码	合约代码	到期日
1	101090183	郑州交易所	00506566	SR705C5200	20170327
2	101090183	郑州交易所	00506566	SR705P5300	20170327

行权申请

行权编号	委托状态	委托属性	资产账号	交易类别	合约代码	申请数量	合约乘数	交易
5	待报	期权权力行使	1010901...	郑州交易所	SR705C5...	10.00	10	00

虚值颜色配置

虚值期权

平值期权

实值期权A

实值期权B

实值期权C

虚值期权：实值小于零的买方期权
平值期权：实值等于零的买方期权
实值期权A：实值小于等于交易所执行手续费的买方期权
实值期权B：实值大于交易所执行手续费且小于等于客户执行手续费的买方期权
实值期权C：实值大于客户执行手续费的买方期权

确定

取消

配置

可用	卖未平	投机/套保
0.00	0	投机
0.00	0	投机

试算选项

☐ 1-全部执行

☒ 3-已申请数量

☐ 2-最大对冲

☐ 4-任意放弃量

放弃量：试算价：

试算

买/卖未平仓：买总可执行：

买/卖执行量：放弃数量：

买/卖执行盈亏：行权保证金：

交易所/客户

执行手续费：最大盈利：

履约手续费：最小盈利：

申请放弃

申请执行

取消申请

恒生

正常运行

恒生期货 - uft操作员 (操作员 (操作密码)

没有新消息

更多

交易时间 2016-12-27 20:37:45



9-单客户行权-试算功能

期货UFT2.0

委托交易

管理查询

错单修改

期权执行与履约

批量行权

客户行权

批量查询

客户查询

资金帐号：

101090183

交易类别：

F1 郑州交易所

查询

可用资金：

1438071459.68

配置

行权持仓

序号	资产帐号	交易类别	交易编码	合约代码	到期日	交割价	执行价	期权类型	执行类型	买未平	买可用	卖未平	投机/套保
1	101090183	郑州交易所	00506566	SR705C5200	20170327	5925.0000...	5200.000000	看涨	美式	20.00	10.00	0	投机
2	101090183	郑州交易所	00506566	SR705P5300	20170327	5925.0000...	5300.000000	看跌	美式	10.00	10.00	0	投机

行权申请

行权编号	委托状态	委托属性	资产账号	交易类别	合约代码	申请数量	合约乘数	交易
5	待报	期权权力行使	1010901...	郑州交易所	SR705C5...	10.00	10	00

执行试算

试算选项

☒ 1-全部执行

☐ 3-已申请数量

☐ 2-最大对冲

☐ 4-任意放弃量

放弃量：试算价：

试算

买/卖未平量：

10.00/0

买/卖执行量：

10.00/0

买/卖执行盈亏：

530000.00/0

买总可执行：

10.00

放弃数量：

0

行权保证金：

106217.00

交易所/客户

执行手续费：

30.00/30.00

履约手续费：

0/0

最大盈利：

529970/529970

最小盈利：

529970/529970

申请放弃

申请执行

取消申请

批量行权操作界面分实值期权放弃和虚值期权行权界面，批量操作只能在合约到期日当天进行；实值期权查询结果按照实值额/保证金比例从大道小排列。按照该比值排序，行权资金不足时，系统优先放弃单位实值额占用保证金较大的期权持仓。

期权执行与履约
管理查询
委托交易
错单修改
修改内存表数据

批量行权
客户行权
批量查询
客户查询

分支机构: ! 全部 ▼
 交易类别: F1 郑州交易所 ▼
 资金帐号:
 合约代码:
 持仓类型: 0 实值 ▼
查询
计算净持仓
全部撤单

实值期权放弃
虚值期权行权

向	到期日	结算价	行权价格	期权合约类型	合约执行方式	可用数量	需要放弃手数	实际放弃手数	投机/套保类型	结算会员号	行权差额资金	实值额/保证金
	20161225	0	5200.000	看涨	美式	10	0	0	投机	0174	0	1.7438
	20161225	0	4900.000	看涨	美式	10	0	0	投机	0174	0	1.7094
	20161225	0	5100.000	看涨	美式	20	0	0	投机	0174	0	1.1976

资产帐号: 101090183
 买卖方向: 买入
 实际放弃手数: 0
 执行前自动对冲期权持仓: 是 ▼

合约代码: SR705C5200
 投机/套保类型: 投机
修改数量
 执行成功后自动对冲期货持仓: 是 ▼
批量放弃

正常运行
恒生期货 - uft操作员 (C) 操作员 (操作密码)
没有新消息
更多
交易时间 2016-12-27 06:23:23

11-批量行权-净持仓功能

期货UFT2.0

支持郑商所做市商盘后净持仓功能。

批量行权 | 客户行权 | 批量查询 | 客户查询

分支机构: ! 全部 ▼ 交易类别: F1 郑州交易所 ▼ 资金帐号: 合约代码: 持仓类型: 0 实值 ▼ 查询 计算净持仓 全部撤单

实值期权放弃 | 虚值期权行权

序号	分支机构	资产帐号	交易类别	交易编码	币种	合约代码	买卖方向	到期日	结算价	行权价格	期权合约类型	合约执行方式
1	1010	101090183	郑州交易所	00506566	人民币	SR705C5200	买入	20161225	0	5200.000	看涨	美式
2	1010	101090183	郑州交易所	00506566	人民币	SR705C5200	买入	20161225	0	4900.000	看涨	美式
3	1010	101090183	郑州交易所	00506566	人民币	SR705C5200	买入	20161225	0	5100.000	看涨	美式

提示

功能号514574处理失败
错误号:514717, 错误信息:交易所[F1]闭市前不允许当前操作

确定

12-批量行权-全部撤单功能

期货UFT2.0

支持闭市后撤销挂单，释放资金和持仓

期权执行与履约

管理查询

委托交易

错单修改

修改内存表数据

批量行权

客户行权

批量查询

客户查询

分支机构: ! 全部

交易类别: F1 郑州交易所

资金帐号:

合约代码:

持仓类型: 0 实值

查询

计算净持仓

全部撤单

实值期权放弃

虚值期权行权

序号	分支机构	资产帐号	交易类别	交易编码	币种	合约代码	买卖方向	到期日	结算价	行权价格	期权合约类型	合约执行方式
1	1010	101090183	郑州交易所	00506566	人民币	SR705C5200	买入	20161225	0	5200.000	看涨	美式
2	1010	101090183	郑州交易所	00506566	人民币	SR703C4900	买入	20161225	0	4900.000	看涨	美式
3	1010	101090183	郑州交易所	00506566	人民币	SR703C5100	买入	20161225	0	5100.000	看涨	美式

Hsrcp

执行成功

OK

资产帐号: 101090183

买卖方向: 买入

实际放弃手数 0

合约代码: SR705C5200

投机/套保类型: 投机

修改数量

执行前自动对冲期权卖持仓: 是

执行成功后自动对冲期货持仓: 是

批量放弃

正常运行

恒生期货 - uft操作员 (操作员 (操作密码))

没有新消息

更多

交易时间 2016-12-27 07:56:45

系统导出数据菜单：报表-期货导出平台-期权行权申报文件生成：



期货UF2.0

风控模块

- 风险监控界面针对期权提供**市值权益、实时保证金、客户市值风险率、实时市值风险率、客户实时风险率**五个监控字段。

[illegible]

风控模块

- 风险监控界面双击对应客户右边资金详细信息界面会显示客户权利金(权利金收支轧差值)与期权浮动盈亏

The screenshot displays a software interface for risk monitoring. On the left, a table lists client data with columns for contract code, product type, trade direction, investment type, initial quantity, and available balance. The bottom of the table shows a summary row with all values set to 0.00. Below the table, a status bar indicates the current position (100) and subscription status (100, 100.00%).

On the right, a '资金信息' (Financial Information) panel provides detailed data for a selected client. The panel includes fields for available funds, income, expenses, margin, and various profit/loss calculations. Two specific fields are highlighted with red boxes: '期权浮动盈亏' (Option Floating Profit/Loss) and '权利金' (Premium).

合约代码	产品类别	买卖方向	投机/套保	期初数量	可用数
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

当前位置: 100 已订阅资产账号数: 100, 完成100.00%

资金信息

可用: 0.00 可取: 0.00
入金: 0.00 出金: 0.00
费用: 0.00 交易所费用: 0.00
保证金: 0.00 交易所保证金: 0.00
平仓盈亏: 0.00 持仓盈亏: 0.00
资金权益: 0.00 **权利金: 0.00**
期权浮动盈亏: 0.00
股票期权保证金: 0.00
股票期权交易所保证金: 0.00

- 单客户保证金试算与多客户保证金试算支持根据自定义期权合约价格计算对应的客户风险率。（此处客户风险率为客户总体的风险，包含期货持仓与期权持仓两部分）

单客户保证金试算

资产账号100117000012 查询

客户基本信息

客户姓名: 红枣呀红枣

营业部: 1001营业部

E_MAIL:

办公电话:

家庭电话: 11111111111

传真:

资金流水

委托信息

保证金组合委托信息

委托信息-股票期权

持仓信息

持仓信息-股票期权

试算合约设置

股票期权试算合约设置

交易所类别	合约代码	买卖方向

试算合约设置

交易类别

合约代码

买卖方向

投机套保

试算价格0

客户比例0%

交易所比例0%

当前汇率0

标的期货合约设置

标的物0

试算价格0

客户比例0%

交易所比例0%

保证金系数0

虚值额系数0

红色的持仓信息已设置指定的保证金比例

删除

清空

保存

取消

客户资金信息

通用试算

特殊试算

资金权益: 0.00

可用资金: 0.00

交易所可用: 0.00

可取资金: 0.00

权利金: 0.00

客户保证金: 0.00

交易所保证金: 0.00

持仓浮动盈亏: 0.00

持仓盯市盈亏: 0.00

客户风险率(%): 0.00%

交易所风险率(%): 0.00%

自定义风险率: 0.00%

预冻结保证金: 0.00

交易所预冻结: 0.00

股票期权客户保证金: 0.00

股票期权交易所保证金: 0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

通用保证金试算

今结算价

最新价

均价

最新价涨跌幅

%

恒生电子股份有限公司 www.hundsun.com

HUNDSUN

风控模块

- **强平模块：**（默认买方期权不参与强平预算）对于客户持仓有卖方期权的情况，选择以下持仓策略（2、持仓定时亏损最大除外）时均会考虑计算期权合约。**注：计算期权合约保证金时使用静态保证金**

[illegible]

网上交易5.0

登录

jieru

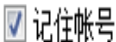
123

4123

长安测试
测试测试

交易帐号:

10000001



交易密码:

软键盘

☒ 期权

勾选期权复选框登录才能进行期权相关业务

登录

站点测试

通讯配置

退出

网上交易5.0

委托下单 其他查询 系统配置 显示 特色服务 帮助

自选行情 郑州 大连 上海 中金 能源 期权 组合行情 交易卡

合约系列: m1709

定位平值期权

看涨期权								m1709	看跌期权							
最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量	执行价	最新价	买价	买量	卖价	卖量	涨跌	持仓量	成交量
429	425	20	430	30	3	31868	10948	2500	104.5	101.5	40	105	10	-26.5	14996	8778
392	392	47	392.5	10	-3	17576	9728	2550	124.5	123.5	10	127	20	-25.5	18832	6866
356	354.5	20	359.5	30	-10	16918	9224	2600	130.5	131.5	20	135.5	10	-40	15854	7772
321	318.5	30	323.5	50	-17.5	13582	8616	2650	156.5	156.5	25	158.5	30	-36	16150	9554
310.5	307	20	312	40	-1.5	13510	10256	2700	154.5	153	80	155	20	-1.5	13074	8420

期初权益	当前权益	可用资金	平仓盈亏	持仓盈亏
301,728,973.93	301,728,973.93	294,455,653.68	0.00	133,625.00

F3委托挂单 F4委托查询 F6成交查询 资金查询 F7持仓查询 预埋挂单 F8流水查询 F9银期转账 结算单查询

交易类别 全部 查询 申请递交 取消申请 申请修改

期权合约	交易类别	执行价	交割结算	标的指数	期权类型	执行方式	买持仓
m1705-C-2850	大连	2850	0	0	看涨	美式	1
m1705-C-2900	大连	2900	0	0	看涨	美式	3
m1705-P-2550	大连	2550	0	0	看跌	美式	2

期权申请

合约代码 m1705-C-2850

交易编码 01942404

交易类别 大连

剩余可申請 1

申請手数 1

期权执行 放弃执行

金风险率
2.41%

套保	执行交易所手续费	执行客户手续费	期权虚实类型
投机	0.00	0.00	
投机	0.00	0.00	
投机	0.00	0.00	

流水号	交易类别	期权合约	委托数量	合约乘数	期货委托属性	中金行权标准	保留期货头寸	自动平仓头寸
-----	------	------	------	------	--------	--------	--------	--------

滨江网通

期市 查资金 返回成功!

郑州时间: 22:02:47 大连时间: 22:02:36 上海时间: 22:02:44 中金时间: 22:02:44 能源时间: 22:02:46

期货周边支持期权情况

提供周边接口支持期权相关业务

恒生统一接入ufx接口 支持：期权委托、期权通用委托、期权套利委托、期权委托相关查询、期权行权/放弃行权、期权撤销行权、期权行权流水查询、做市商（询价、报价）；

恒生期货周边接入hsfutusdk接口 支持：期权委托、期权通用委托、期权套利委托、期权委托相关查询、期权行权/放弃行权、期权撤销行权、期权行权流水查询。



恒生电子官方微信

THANKS

[附件：会员端期权功能确认表.xlsx](#)