

金仕达系统期权业务 支持情况介绍

2017/01/05

Empowering
the Financial World



内容概要

- ➔ 品种合约及设置
- ➔ 交易
- ➔ 风控
- ➔ 行权
- ➔ 结算

1. 品种合约 及设置



品种合约及设置



合约表

	郑商所
合约标的	白糖期货合约
合约乘数	1手白糖期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
报价单位	元/吨
最小变动价位	0.5元/吨
每日价格最大波动	同白糖期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1、3、5、7、9、11月
交易时间	9:00-11:30, 13:30-15:00
最后交易日	期货交割月份前二个月的倒数第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	以白糖期货前一交易日结算价为基准，按行权价格间距挂出5个实值期权、1个平值期权和5个虚值期权。行权价格 ≤ 3000 元/吨，行权价格间距为50元/吨； 3000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨，行权价格间距为100元/吨；行权价格 > 10000 元/吨，行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可在到期前的任一交易日闭市（15:00）前提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：SR—合约月份—C—行权价格 看跌期权：SR—合约月份—P—行权价格
上市交易所	郑州商品交易所

品种合约设置

» 设置交易品种

柜台管理系统菜单

- 帐户管理
- 开户申请管理
- 资金管理
- 信息查询
- 报表管理
- 费率设置
- 银期业务
- 日终结算
- 系统设置
- 经纪人管理
- 财务接口
- 交易管理
- 数据管理
- 证监会报表
- 反洗钱系统
- 复核管理
- 结算单
- 数据分发
- 交易中心管理
- 历史分库
- 费用账户管理

查找菜单 [F9] 系统工作日期 2018年12月27日 自动锁定 [B] 关闭窗口

向导 设置交易品种

查询 增加

设置交易品种

交易类别 1-期权 执行方式 2-美式

品种代码 SR 保证金算法 3-保证金算法三

品种名称 白糖 手续费算法 0-期货手续费率

币种 1-人民币 涨停板率 0.00

品种类型 1-内盘 跌停板率 0.00

状态 0-正常 报价单位 1-人民币

每手数量 10.00000000 最小变动价格

最小手数 1 小数 1.0000

最大手数 9,999 分数 1/ 1

最大持仓 9,999

交易规则 第五个交易日

交割规则

交割方式 0-实物交割

了结 T+H 0

合约规则

合约跨度 0

☐ 启用外币质押模式

保值

	按金额	按手数
保证金	0.000000	0.00
开平手续费率	0.00000000	0.00
平今手续费率	0.00000000	0.00
交割手续费率	0.00000000	0.00
执行手续费率	0.00000000	0.00
履约手续费率	0.00000000	0.00

投机

	按金额	按手数
保证金	0.000000	0.00
开平手续费率	0.00000000	0.00
平今手续费率	0.00000000	0.00
交割手续费率	0.00000000	0.00
执行手续费率	0.00000000	0.00
履约手续费率	0.00000000	0.00

套利

	按金额	按手数
保证金	0.000000	0.00
开平手续费率	0.00000000	0.00
平今手续费率	0.00000000	0.00
交割手续费率	0.00000000	0.00
执行手续费率	0.00000000	0.00
履约手续费率	0.00000000	0.00

确认 取消

SUNGARD [zj2-系统管理员 [DRTP: 10.253.46.197]] 交割规则, 合约规则

品种合约设置

» 查看保证金算法

期权保证金



(郑州、大连) 保证金算法三

期权卖方交易保证金的收取标准为下列两者中较大者：

- a) 权利金+标的期货合约交易保证金 - $1/2$ *期权虚值额
- b) 权利金+ $1/2$ *标的期货合约交易保证金

看涨期权的虚值额 = $\text{Max} ((\text{期权合约执行价格} - \text{标的期货合约结算价}) * \text{手数} * \text{合约乘数}, 0)$

看跌期权的虚值额 = $\text{Max} ((\text{标的期货合约结算价} - \text{期权合约执行价格}) * \text{手数} * \text{合约乘数}, 0)$

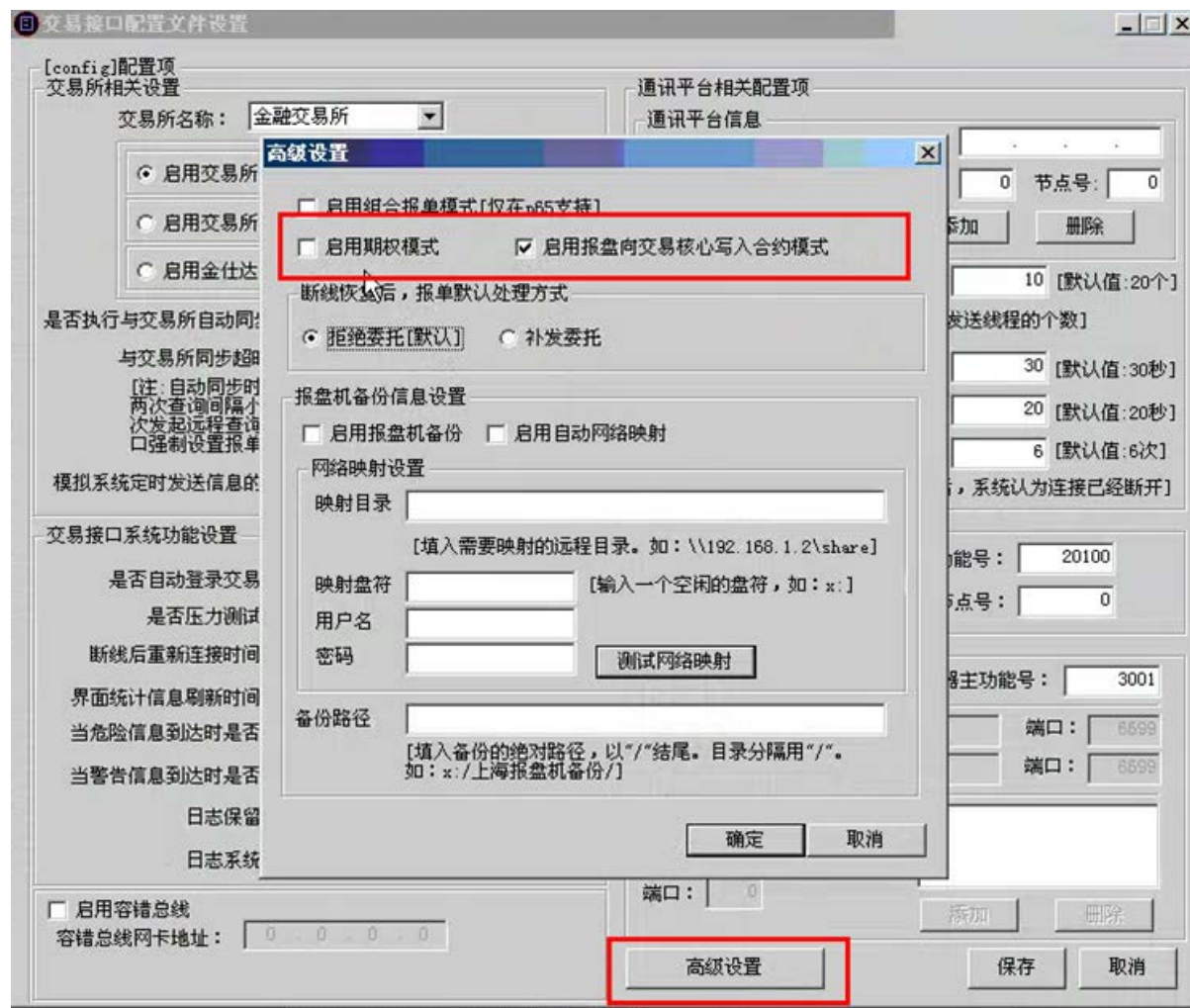
品种合约设置

» 交易接口配置

交易接口配置文件设置→

高级设置：

- 勾选启用期权模式；启用该模式后，将从报盘读取期权合约，支持期权下单及收取成交回报。
- 勾选启用报盘向交易核心写入合约模式：后台不自动生成合约，需要向交易所查。



费率设置

» 费率设置



期权卖方保证金率

期权品种、期权系列、期权合约

期权合约 > 期权系列 > 期权品种



可设置开平、平今、执行、履约手续费率

期权品种、期权系列

期权系列 > 期权品种

费率设置

» 保证金率设置



对于存在期货标的的期权品种，期权保证金率取自标的期货，即完全参照期货保证金率获取标的期货生效的基础保证金率、调整保证金率来计算期权卖保证金率：

郑州、大连、上海

期权品种的保证金率无需额外设置，直接取标的期货品种的基础保证金率、调整保证金率



对于不存在期货标的的期权品种，则直接取期权品种生效的基础保证金率和调整保证金率进行累加：

中金

股指期权品种的保证金率需单独设置（保证金调整系数即保证金率）

费率设置

» 手续费率设置

✓ 针对期权行权，上海、大连、中金均收取行权手续费：
大连、上海、中金

✓ 针对期权行权，郑商所收取标的的开仓手续费。
郑州
将期权合约的行权手续费率设为与标的期货合约的开平
手续费率一致

费率设置

» 手续费率设置

柜台管理系统菜单

费率设置

品种费率设置

客户手续费率

客户保证金率

固定保证金率

手续费模板设置

保证金模板设置

客户手续费率模板

客户保证金率模板

客户类默认手续费

客户类默认保证金

席位手续费率

席位保证金率

保值额度设置

当前费率查询

费率修改查询

投资者保障基金

最低保障系数设置

客户期权最小保值

席位期权最小保值

投资者保障基金

相关功能

客户资料维护

席位手续费率

当前费率查询

费率修改查询

成交单管理

客户手续费率

查询 | 增加 | 复制

客户号 交易所 交易类别 品种 交割期

投机

	按金额	按手数
开平手续费率		
平今手续费率		
交割手续费率		
执行手续费率		
履约手续费率		
开平附加费率1		
开平附加费率2		
平今附加费率1		
平今附加费率2		

保值

☒ 保值手续费率=投机手续费率

	按金额	按手数
开平手续费率		
平今手续费率		
交割手续费率		
执行手续费率		
履约手续费率		
开平附加费率1		
开平附加费率2		
平今附加费率1		
平今附加费率2		

套利

☒ 套利手续费率=投机手续费率

	按金额	按手数
开平手续费率		
平今手续费率		
交割手续费率		
执行手续费率		
履约手续费率		
开平附加费率1		
开平附加费率2		
平今附加费率1		
平今附加费率2		

确认

取消

SUNGARD

132-系统管理员 [DRTP:10.253.46.197]

年月:YYMM (2位年2位月)或年月日:YYMMDD (2位年2位月2位日) 源交易所,源交易类别,源品种,目的交易所,目的交易类别,源交割期,目的交割期,源客户号,目的客户号

2. 交易



交易



交易规则、交易时间

交易所	交易、非交易订单
郑州	• 单腿委托 • 备兑PRT组合以单腿平仓 • 组合委托—STD跨式、STG宽跨式 • 做市商报价 • 投资者询价 • 行权

» 普通交易日

属性	郑商所
交易时间	9:00-11:30, 13:30-15:00

» 最后交易日

属性	郑商所
最后交易日交易时间	9:00-11:30, 13:30-15:00
指令行权时间	延长至15:20

交易指令

限价指令、取消指令、市价指令及交易所规定的其他指令。

组合指令：价差组合、跨式组合、宽跨式组合、备兑组合（按单腿平）

报价指令：做市商的双向报价指令（仅第三方api提供）

询价指令：投资者向做市商请求报价

行权指令：通过交易所接口提交行权申请

规则	郑商所
交易指令	限价指令、市价指令、取消指令、组合指令、交易所规定的其他指令

备兑组合（郑州）

备兑组合：无备兑开仓指令，结算时由交易所根据客户持仓组合，优惠保证金。平仓时分单腿平仓。

名称	说明	例子	保证金
备兑看涨期权 PRT	持有看涨期权空头，同时 持有同数量的标的期货多头	买入SR1303& 卖出SR1303-c-2300	保证金=期权权利 金部分+期货交易 保证金 （结算时，权利 金部分和期货保 证金都用当日结 算价重新计算）
备兑看跌期权 PRT	持有看跌期权空头，同时 持有同数量的标的期货空头	卖出SR1303& 卖出SR1303-P-2300	

跨式、宽跨式组合（郑州）

跨式、宽跨式组合：用组合开仓（STD、STG），平仓时以组合平仓或分单腿平仓都可

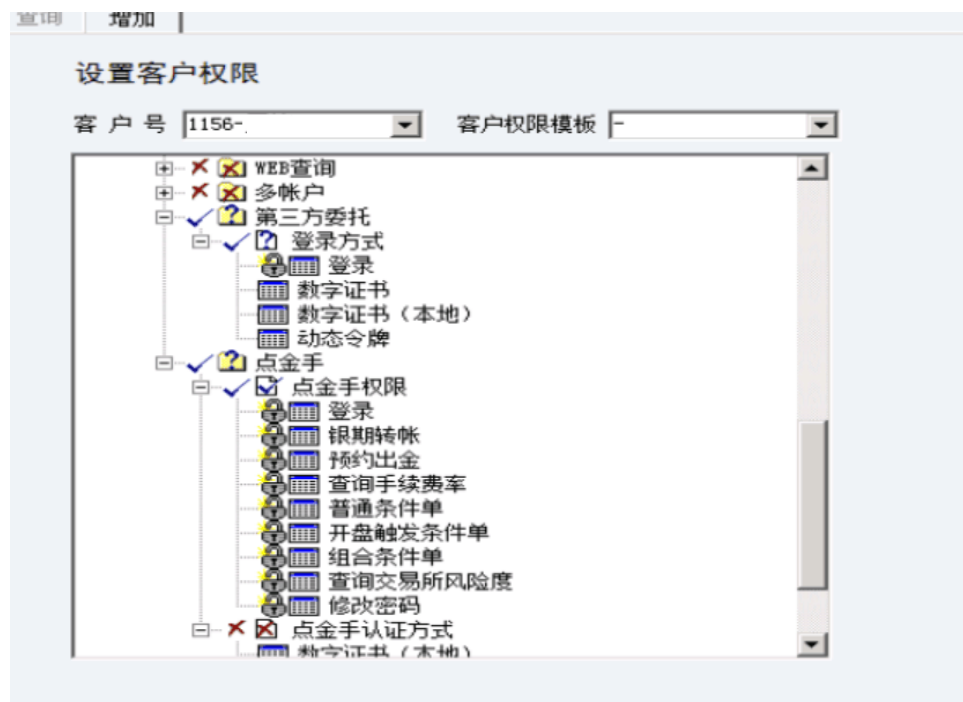
组合策略	方向	第一腿	第二腿	例子	报价	交易保证金
跨式STD	买入	买入看涨期权	买入相同执行价格看跌期权	买入SR1303-c-2300& 买入SR1303-p-2300	价和 = 第一腿+ 第二腿	不收保证金
	卖出	卖出看涨期权	卖出相同执行价格看跌期权	卖出SR1303-c-2300& 卖出SR1303-p-2300		Max（腿一保证金，腿二保证金）+另一腿权利金
宽跨式STG	买入	买入较高执行价格看涨期权	买入较低执行价格看跌期权	买入SR1303-c-3000+ 买入SR1303-p-2300	价和 = 第一腿+第二腿	不收保证金
	卖出	卖出较高执行价格看涨期权	卖出较低执行价格看跌期权	卖出SR1303-c-3000+ 卖出SR1303-p-2300		Max（腿一保证金，腿二保证金）+另一腿权利金

系统功能

» 客户权限管理

帐户管理→客户权限管理

点金手2.0：勾选第三方委托



系统功能

» 客户期权交易管理

系统默认客户无期权交易权限，客户如果需要期权买开/卖平、卖开/买平交易，需要分别向期货公司提出申请，经授权后方能参与交易。

交易管理→客户期权交易管理

柜台管理系统菜单

- 交易管理
 - 交易初始化
 - 交易状态设置
 - 成交写库
 - 设置交易合约
 - 设置特殊合约
 - 设置组合合约
 - 发布信息
 - 客户通知消息维护
 - 查询限制设置
 - 操作员交易限制
 - 客户品种交易限制
 - 客户合约交易控制
 - 客户多点登录设置
 - 网上交易防伪设置
 - 夜盘交易应急初始化
 - 初始化报告
 - 查看保证金算法
 - 客户期权交易管理
 - 客户交易合约限制
 - 批量行权数据管理
 - 组合保证金合约规则
 - 询价限制设置
 - 品种组设置

客户期权交易管理

查询 | 增删改

客户期权交易管理

客户号: [] 客户类: [] 交易所: []

客户号	客户类	客户名称	交易所	期权买开	期权卖开
00001	01	11	上海	是	是
0002	01	0002	上海	是	是
0005	01	0005	上海	是	是
0006	01	0006	上海	是	是
001	01	3600001	上海	是	是
004	01	3600001	上海	是	是
1	01	zyj1	上海	是	是
10000	01	11	上海	是	是
10003	01	10003	上海	是	是
10004	01	10004	上海	是	是
1001	0202020201	Michael	上海	是	是
1004	0101010101	sg	上海	是	是
1006	01	到徽个	上海	是	是
1007	01	1007	上海	是	是
1008611	01	1008611	上海	是	是
1009	01	1009	上海	是	是
1010	01	1010	上海	是	是
1011	01	test	上海	是	是
1012	01	1012	上海	是	是
1013	01	1013	上海	是	是
1014	01	1014	上海	是	是
1015	01	1015	上海	是	是
1016	01	1016	上海	是	是
111	01	111	上海	是	是

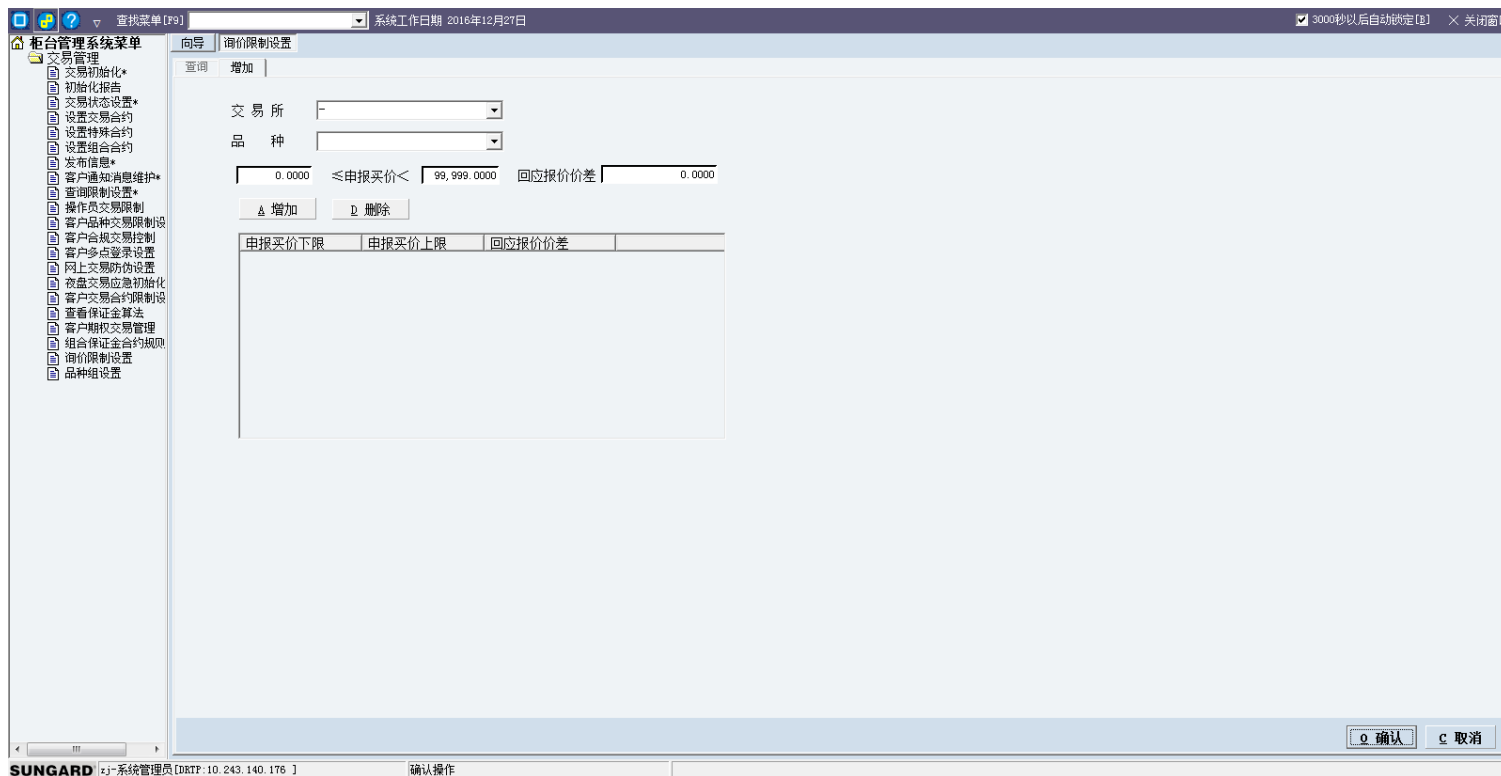
L 细节 ☒ 增加时以选中行为默认值

Q 查询 A 增加 U 修改 D 删除

系统功能

» 询价设置

1. 席位交易参数QUOTE_GAP：控制后一笔询价请求与前一笔询价请求之间的时间间隔。——禁止客户频繁询价功能（时间间隔60秒）
2. 询价限制设置功能：市场买价在预先设定的市场买价区间内且市场买卖价差（绝对值）小于等于预先设定的回应报价价差时，不允许询价。——禁止价差合理时客户询价



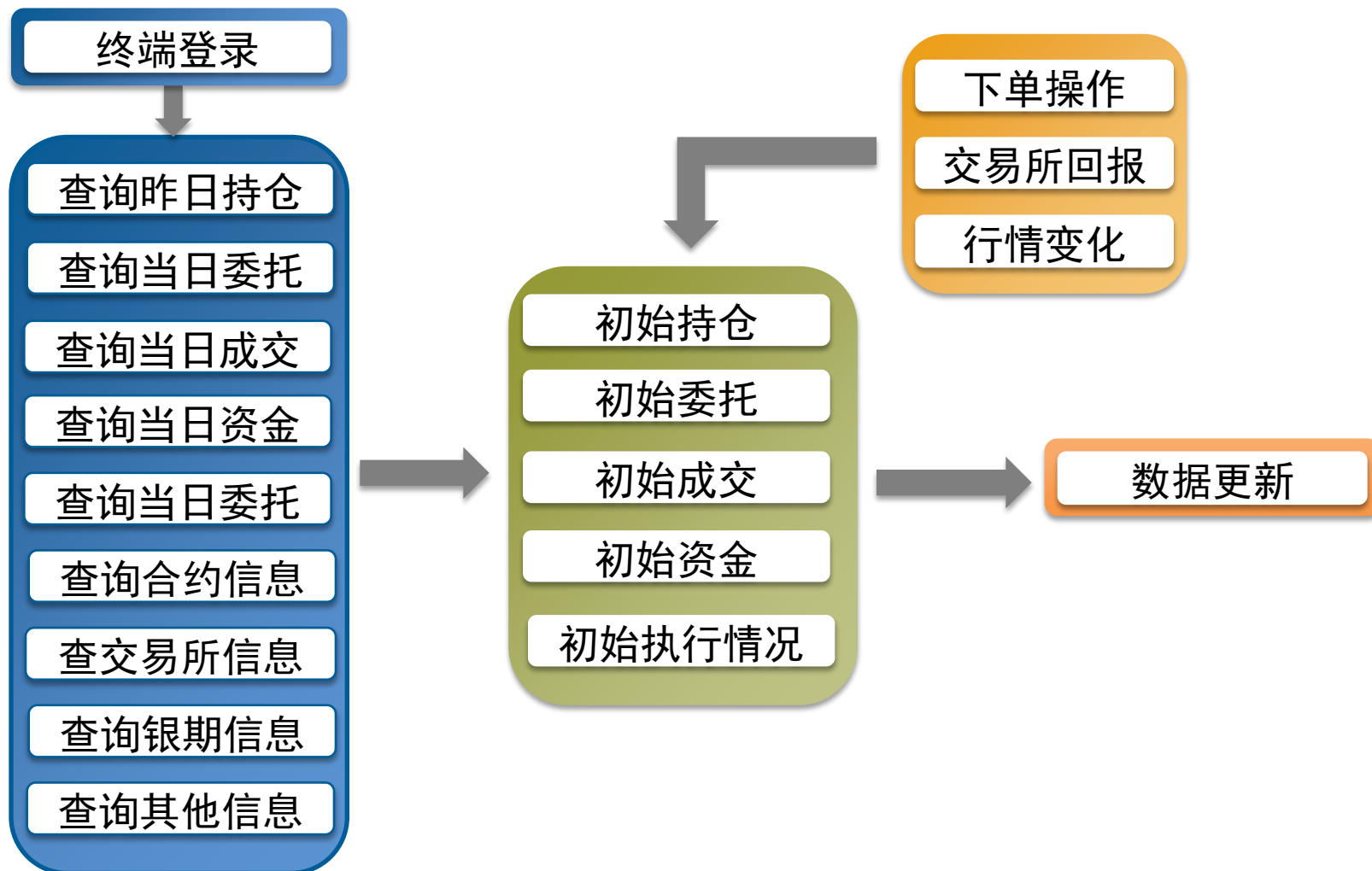
交易

期货合约 期权合约 期货组合 期权组合 自定义组合 商品指数															
合约号	开盘	最新价	买价	卖价	买量	卖量	最高	最低	成交量	本次成交	涨跌	涨跌幅(2)	涨停板	跌停板	历史
SR1709-C-5500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	SR1709-C-6600.czce
SR1709-C-5600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-5700	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-5800	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-5900	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6100	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6200	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6300	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6400	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6700	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6800	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6900	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-7000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5100	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5200	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5300	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5400	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5700	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5800	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5900	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-6000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-6100	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6600.czce															
最新		0	0												
买①		0	0												
买②		0	0												
买③		0	0												
买④		0	0												
买⑤		0	0												
涨停		0													
跌停		0													
全部品种 上海 大连 郑州 中金															
1 普通 2 高级 3 组合 4 询价															
客户号		衍生品类别		合约		看涨看跌		执行价格		Q 下单					
1004		1-期货期权		SR1709		1-看涨		6600		E 刷新					
客户名称 sg 委托密码 111111 可用资金 540021569.97															

期货合约 期权合约 期货组合 期权组合 自定义组合 商品指数															
合约号	开盘	最新价	买价	卖价	买量	卖量	最高	最低	成交量	本次成交	涨跌	涨跌幅(2)	涨停板	跌停板	历史
SR1709-C-5500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	SR1709-C-6600.czce
SR1709-C-5600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-5700	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-5800	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-5900	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6100	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6200	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6300	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6400	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6700	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6800	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-6900	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-C-7000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5100	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5200	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5300	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5400	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5700	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5800	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-5900	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-6000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
SR1709-P-6100	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
最新 0 0															
买① 0 0															
买② 0 0															
买③ 0 0															
买④ 0 0															
买⑤ 0 0															
涨停 0															
跌停 0															
全部品种 上海 大连 郑州 中金															
1 普通 2 高级 3 组合 4 询价															
客户号		衍生品类别		合约	看涨看跌	执行价格	订单类型	成交属性	买卖	价格	手数	开平	投保	强平	Q 下单
1004		1-期货期权		SR1709	1-看涨	6600	0-限价	0-当日有效	1-买		0	1-开	0-投	强平	E 处理
客户名称 sg 委托密码 111111 可用资金 540021569.97 可开/可平/平今 114524/0/0 可用保值/套利额度 0															
B 刷新															



点金手2.0



行情展示

» 普通行情

合约	最新价	买价	买量	卖价	卖量	成交总量	涨跌	今开盘	持仓量	涨停价	跌停价	昨结算价	当日最高	当
SR1409-C-4700	543.0	532.0	24	541.0	24	947667100	-16.0	526.0	778	768.0	350.0	559.0	534.0	3
SR1409-C-4800	695.0	447.0	27	456.0	27	947638800	214.0	445.0	1495	690.0	272.0	481.0	690.0	4
SR1409-C-5000	308.0	310.0	22	311.0	22	947686100	-36.0	304.0	670	553.0	135.0	344.0	304.0	3
SR1409-C-5100	494.0	84.0	37	492.0	37	947692800	208.0	77.0	2624	495.0	77.0	286.0	495.0	

» T型报价

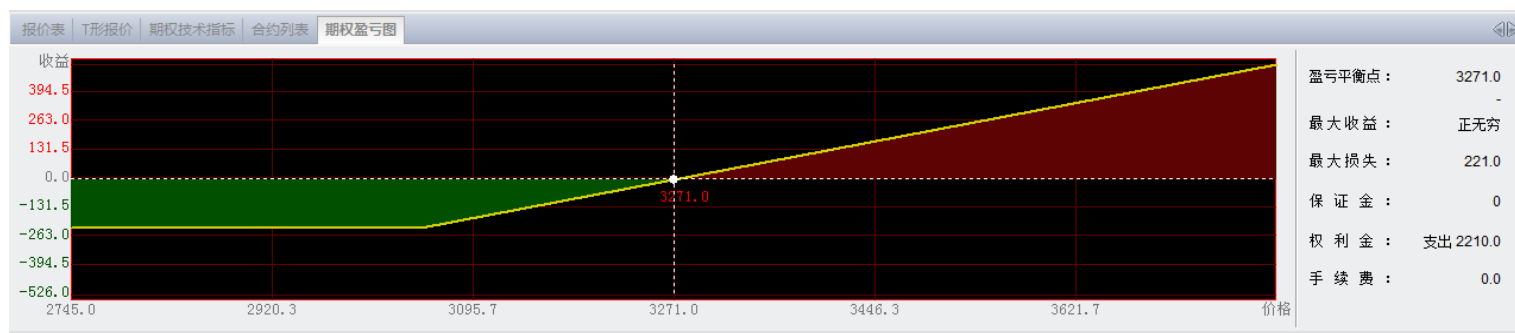
报价表 T形报价 合约列表 期权技术指标 期权盈亏图															
m1411		定位平值期权													
总成交量	总持仓量	涨跌	卖出量	卖出价	买入量	买入价	最新价	执行价	最新价	买入价	买入量	卖出价	卖出量	涨跌	总
0	2146	-20...	3	221.00	3	216.00	0.00	3,050.00	0.00	47.00	3	53.00	3	-57...	42
0	1608	-17...	1	204.00	3	204.00	0.00	3,100.00	0.00	84.00	3	90.00	3	-74...	40
0	2986	-14...	3	175.00	3	170.00	0.00	3,150.00	0.00	100.00	3	105.00	3	-93...	27
2	1908	57.00	3	180.00	2	174.00	174.00	3,200.00	0.00	153.00	3	158.00	3	-116...	83
2	1516	22.00	3	122.00	2	116.00	116.00	3,250.00	0.00	144.00	3	149.00	3	-14...	71
0	4756	-74...	3	112.00	3	106.00	0.00	3,300.00	0.00	183.00	3	188.00	3	-17...	27
0	1646	-58...	3	69.00	3	64.00	0.00	3,350.00	0.00	189.00	3	194.00	3	-20...	51
0	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0.00	3,400.00	0.00	0.00	0	0.00	0	0.00	0
m1405-C-3000															
最新价		363	今开盘												360
涨 跌		14	涨跌幅												0.04
最高价		363	最低价												220
涨停价		482	跌停价												216
昨持仓		0	今持仓												65872
昨收盘		366	今收盘												0
昨结算		349	今结算												-
成交量															

行情展示

» 期权技术指标

报价表 T形报价 期权技术指标 期权盈亏图 合约列表																
m1411 定位平值期权																
型	Rho	Vega	Theta	Gamma	Delta	理论价格	最新价	执行价	最新价	理论价格	Delta	Gamma	Theta	Vega	Rho	期
权	-0.4446	5.5696	-0.8111	0.0008	0.667778	267.5395	0.0	3,050.00	0.0	98.4201	-0.312010	0.0008	-0.8350	5.5422	-0.2424	看i
权	-0.4111	5.9236	-0.8593	0.0008	0.624754	237.7288	0.0	3,100.00	0.0	117.5459	-0.353641	0.0008	-0.8712	5.8936	-0.2895	看i
权	-0.3733	6.1299	-0.8984	0.0009	0.580969	209.8036	0.0	3,150.00	0.0	138.4625	-0.396293	0.0008	-0.8978	6.1016	-0.3410	看i
权	-0.3408	6.1876	-0.9196	0.0009	0.536591	185.0161	174.0	3,200.00	0.0	162.5018	-0.439599	0.0009	-0.9062	6.1497	-0.4002	看i
权	-0.3070	6.2348	-0.9307	0.0009	0.492677	162.0497	116.0	3,250.00	0.0	188.3048	-0.482631	0.0009	-0.9042	6.1976	-0.4637	看i
权	-0.2716	6.1222	-0.9325	0.0009	0.449292	140.7722	0.0	3,300.00	0.0	215.7400	-0.525320	0.0009	-0.8924	6.0808	-0.5313	看i
权	-0.2415	6.1593	-0.9181	0.0009	0.407434	122.3416	0.0	3,350.00	0.0	246.0017	-0.566540	0.0008	-0.8643	6.1266	-0.6058	看i
权	-0.2126	5.8834	-0.8951	0.0008	0.367142	105.5889	0.0	3,400.00	0.0	277.9172	-0.606297	0.0008	-0.8274	5.8515	-0.6844	看i

» 期权盈亏图



委托

SUNGARD期货网上交易点金手2.0—[10003/10003]

系统 选项(O) 期权计算器(C) 帮助(H)

合约组1 合约组2 合约组3

可用资金	占用保证金	冻结保证金	交易冻结权利金	手续费	持仓盈亏	平仓盈亏	期权市值	当日权利金收入	当日权利金支出	动态权益	冻结手续费	浮动保证金	查询(Q)
222,723.66	438,254.00	324,544.00	1,750.50	280.41	0.00	0.00	0.00	3,770.00	15,030.00	988,253.25	981.09	0.00	

报价表 T形报价 合约列表

合约	最新价	买价	买量	卖价	卖量	成交总量	涨跌	今开盘	持仓量	涨停价	跌停价	昨结算价	当日最高	当日最低	合约名
m1405-C-2850	0.000	0.000	0	0.000	0	0	0.000	0.000	0	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	
m1405-C-2900	0.000	0.000	0	0.000	0	0	0.000	0.000	0	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	
m1405-C-3000	0.000	0.000	0	0.000	0	0	0.000	0.000	0	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	
m1405-P-2800	0.000	0.000	0	0.000	0	0	0.000	0.000	0	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	

金仕达下单板 套利下单板

合约 SP-期货跨期 投机

合约 m1405-C-3000

SP m1405-C-3000

开平 自动 开仓 平仓 平今

价类 限 对 挂 新 市

价格 0

手数 0 倍数: 1

买入 卖出

未成交单 所有委托单 行权委托单

委托号	合约	买卖	开平	委托状态	详细状态	未成交手数
1	SR1409-C-5700	卖	开仓	全部成交	全部成交	0
2	SR1409-C-5700	卖	开仓	全部成交	全部成交	0
3	SR1409-C-5700	买	开仓	未成交	等待撤除	1
4	SR1409-C-5700	卖	开仓	已撤单	已经撤销	1
5	SR1409-C-5700	卖	开仓	全部成交	全部成交	0

全部单(A) 挂单(S) 已成交(Q) 已撤销撤单(E) 撤单(X) 全撤(C)

持仓 成交记录

合约	买卖	总持仓	持仓盈亏	持仓均价	浮动盈亏	开仓均价	期权市值	现价	占用保证金	可平今量	平仓挂单量	交易
SR1409-C-57...	卖	4	0.00	27.75	0.00	27.75	0.00	0.0	1110.00	4	0	期
SR1409-P-57...	买	1	0.00	703.00	0.00	703.00	0.00	0.0	0.00	1	0	期
a1401	卖	3	0.00	4493.67	0.00	4493.67	0.00	0	86886.00	3	0	期
a1401	买	12	0.00	4494.42	0.00	4494.42	0.00	0	347598.00	12	0	期
SR1409-P-58...	买	1	0.00	800.00	0.00	800.00	0.00	0.0	0.00	1	0	期
SR1409-P-56	卖	1	0.00	266.00	0.00	266.00	0.00	0.0	2660.00	1	0	期

持仓(S) 持仓明细(D) 可行权持仓(E)

11:14:23 郑商所: 连续交易

上期所 11:26:14 大商所 11:26:14 郑商所 11:26:15 中金所 11:26:15 交易 行情

组合委托

金仕达下单板 套利下单板

合约 STD-期权跨式 投机

合约 SR1303-C-2300 SR1303-P-2300

STD SR1303-C-2300&SR1303-P-2300

开平 ☐ 自动 ☒ 开仓 ☐ 平仓 ☐ 平今

价类 ☒ 限 ☐ 对 ☐ 挂 ☐ 新 ☐ 市

价格 0

手数 0 倍数: 1

0
0
买入

0
0
卖出

期权计算器

期权计算器

参数输入

类型:

美式期权

类型:

期货期权

标的物价格:

6750

执行价格:

5500

无风险利率(%):

2

隐含波动利率(%):

21

到期天数:

☐ 输入天数

计算日期:

2016/12/27

到期日期:

2017/03/27

年股息率(%):

计算

结果输出

	看涨	看跌
期权价格:	1253.3302	5.7753
Delta:	0.9801	-0.0213
Gamma:	0.0001	0.0001
Theta:	-0.1533	-0.2000
Vega:	1.7873	2.0196
Rho:	-0.8384	-0.0142

3. 风控



系统功能

风险度0

- 挂单冻结的资金在风险度中体现

浮动保证金

- 仅针对期权实时试算
- 浮动保证金 = $\sum(\text{实时价格保证金} - \text{持仓保证金})$
- 可用资金 = 可用 - $\max(\text{浮动保证金}, 0)$

行权预测

- 实值期权自动行权模式下，客户资金的可行权数据计算，资金不足提交放弃

强平顺序

- 先平期货、再平期权卖、最后期权买方(可以选择不强平期权买方)

风险度

风险度	解释
风险度1	客户风险度 (保证金+浮动保证金) / 客户动态权益
风险度2	交易所风险度 (交易所保证金+交易所浮动保证金) / 客户动态权益
风险度0	描述当前持仓与挂单的保证金占用客户权益的程度。考虑挂单和期权行权的冻结保证金，起到预测客户风险的作用，为风控人员提供更全面的参考。 (保证金+浮动保证金+保证金冻结+执行冻结) / 客户权益
风险度3	用于揭示期权义务方客户的市值权益风险，以便于风控人员对于可能发生的期权义务方客户在平仓后由于支付的权利金超过释放的占用保证金而发生风险度不降返升的情形提前进行相关处理。 $= \min \left\{ \frac{\text{abs}\{\min\{\text{客户期权总市值}, 0\}\}}{\max\{\text{客户动态权益} - \text{行权冻结净付资金} - \text{行权冻结其他费用}, 0\}}, 1 \right\}$

实时资金

可用资金

- 可用资金 = 上日结存 + 当日出入金 + 期货平仓盈亏 + 权利金收入 - 权利金支出 - 手续费 - 总冻结 - 持仓保证金 + 浮动盈亏 (根据参数设置) - $\max(\text{期权浮动保证金}, 0)$

动态权益

- 上日结存 + 当日出入金 + 期货平仓盈亏 + 权利金收入 - 权利金支出 - 手续费 + 浮动盈亏 (根据参数设置)

动态市值 权益

- 动态权益 + 期权市值

风险监控

文件(F) 监控设置(M) 风险通知(N) 强平设置(S) 强平(Q) 查询(Q) 风险试算(P) 窗口(W) 帮助(H)

☐ 自动锁定[B] ☐ 锁定窗口位置 强平 风险通知 人工通知 恢复默认界面布局

风险监控

客户号	客户名称	币种	风险度0 (%)	风险度1 (%)	风险度2 (%)	客户类
37000004	37000004	人民币	0.00	0.00	0.00	020202 [...]
123456	海绵宝宝	人民币	0.00	0.00	0.00	020202 [...]
1420004	小飞鱼	人民币	0.00	0.00	0.00	020202 [...]
1420003	银鳕鱼	人民币	0.00	0.00	0.00	020202 [...]
717002	717002	人民币	0.00	0.00	0.00	020202 [...]
86000001	86000001	人民币	0.00	1,000.00	1,000.00	030302 [...]
36000168	36000168	人民币	1,000.00	1,000.00	1,000.00	030302 [...]
36000008	36000008	人民币	1,000.00	1,000.00	1,000.00	030302 [...]
00030691	金源铜业	人民币	1,000.00	1,000.00	1,000.00	010303 [...]

期权市值 (买-卖)

风险度0

自定义监控

客户号	客户名称	币种	风险度0 (%)	风险度1 (%)	风险度2 (%)	客户类
-----	------	----	----------	----------	----------	-----

事件监控

时间	客户号	客户名称	币种	事件类型	事件内容
----	-----	------	----	------	------

行权申请

基本信息

客户号 : 昨追加保证金 :
 客户名称 : 出入金 :
 币种 : 追加保证金 :
 交易所追加保证金 :
 电话 : 客户动态权益 :
 通知 : 权利金收支 :
 期权市值 : 动态市值权益 :

权益、市值权益

单客户委托

委托时间	系统号	委托号	客户号	客户名称	组合策略	交易类别	合约1	合约2	状态
------	-----	-----	-----	------	------	------	-----	-----	----

单客户持仓

客户号	客户名称	交易类别	品种	交割期	合约号	投保	总买	今买
-----	------	------	----	-----	-----	----	----	----

单客户行权

行权号	行权状态	客户号	客户简称	交易编码	合约号	行权类型	申报量	行权系统
-----	------	-----	------	------	-----	------	-----	------

单客户事件

客户号	币种	时间	事件类型	事件内容
-----	----	----	------	------

系统时间 [18:43:50] 交易所时间 [cffex 18:35:24|czce 18:39:57|dce 18:40:18|sfe 18:39:38|ine 18:41:19]
 lxh1-系统管理员[DRTP:10.243.140.57] 当日风险品种: 期货al 与风险监控服务器连接正常,当前风险数据时戳: 18:43:45 风险监控客户数[54],总客户数[54] 136分钟内未接收到行情!

34

强平顺序设置

品种合约顺序设置 | 盈亏持仓顺序设置

品种合约增加

交易类别: 1-期权

品种: al-铝

合约号:

品种合约强平顺序

序号	品种	交易类别	合约号
53	COT	期货	
54	LCU	期货	
55	NCA	期货	
56	NCF	期货	
57	NCO	期货	
58	PBD	期货	
59	ooo	期货	
60	IMCI	期货	
61	oooo	期货	
62	a	期权	
63	b	期权	
64	m	期权	
65	IO	期权	
66	ME	期权	
67	SR	期权	
68	al	期权	
69	au	期权	

品种合约顺序设置 | 盈亏持仓顺序设置

持仓排序标准

品种亏损由大到小
合约亏损由大到小
先近月合约再远月合约
先平买期货持仓再平卖期货
持仓量由大到小
持仓保证金由大到小

强平顺序

品种顺序排列：先期货后期权

默认盈亏持仓顺序增加：先期货、后期权卖方、最后期权买方

强平算法设置

强平算法	1-按品种合约顺序强平	强平算法说明
强平标准	1-公司标准	该算法为交易结算系统中针对客户强平时使用，强平原则如下： 1. 合约顺序：按照“品种合约强平顺序设置” 2. 交易编码顺序：升序 3. 平仓顺序：先平投机后平保值，先平买仓后平卖仓
释放资金	1-实时追加资金	
☐ 组合仓不参与强平		
☒ 期权买方不参与强平		

- 勾选“组合仓不参与强平”，期权组合、备兑组合不参与强平。
- 勾选“期权买方不参与强平”，参与手动强平的持仓仅限于非期权买方持仓，否则所有持仓均参与手动强平，且最后才强平期权买方持仓。

手工试算设置

交易类别 1-期权

交易所 A-上海

品 种

现货标的试算价设置:

☒ 一般设置

☐ 设置试算价 0.000

☐ 设定涨跌幅(相对于最近结算价) 0.00 %

最近结算价说明: 交易中取标的昨结算价, 全部席位进入结算取标的今结算价

- 增加期权试算价输入
- 试算期权
 - A、商品期权：录入期权试算价和标的期货试算价，取标的期货品种的试算保证金率
 - B、指数期权：录入标的指数的试算价

手工试算

针对郑州期权组合，如果合约构成组合，则用试算价重新计算该组合保证金。

针对郑州备兑组合，如果合约构成组合，则用试算价重新计算该组合保证金；只考虑现有的备兑组合持仓。

4. 行权



行权



行权规则、行权时间

交易所	行权
郑州 (美式、指令和批量)	• 买方可以在合约到期日及其之前任一交易日行权； • 到期日，交易所对实值期权自动行权。 • 指令行权：交易所接口（执行、放弃）； • 批量行权：交易所接口（执行、放弃）；保留会服系统上报批量行权（执行、放弃）功能

» 普通交易日

属性	郑商所	行权方向
指令行权时间	9:00-11:30, 13:30-15:00	执行

» 到期日

属性	郑商所	行权方向
指令行权时间	9:00-11:30, 13:30-15:20	执行 放弃
批量行权时间	指令行权结束至15:30	执行 放弃

郑州批量行权

郑商所期货期权以实物方式交割，为美式期权，在有效期内的任何一个交易日都接受行权指令报入。在到期日支持放弃指令及撤销放弃指令，且指令行权时间延长至15:20。在到期日接受会员提交批量行权指令，批量行权指令提交截止时间为15:30。

郑商所



到期日结算时，交易所对期权持仓进行处理：

（一）买方未在规定时间内向交易所提交放弃申请的，行权价格小于（大于）当日标的物结算价的看涨（看跌）期权持仓自动行权；

（二）买方未在规定时间内向交易所提交行权申请的，剩余期权持仓自动放弃。

期货期权的买方客户行权时，其资金余额应当满足期货交易保证金要求。

买方客户资金不足的，会员不得接受其行权申请。符合自动行权条件但资金不足的，会员应代买方客户向交易所提交放弃申请。

郑商所行权规则补充

1.期权实、虚值额交易中和闭市后采用不同处理方式

交易期间，实值额设置为可选项（会员可以配置），虚值额计入资金占用项；到期日闭市后，实值额、虚值额均纳入可用资金计算。

2.最新期货和期权结算价、收盘价、停盘价使用

交易期间、到期日闭市，都采用最新期货、期权结算价为实值、虚值及保证金的计算依据，进行行权资金检查和可行权量测算。

3.闭市后释放期货、期权开仓未成交挂单保证金和权利金

到日期闭市后计算可行权数量时，未成交期货、期权开仓挂单所占用的保证金，按释放后剩余资金计算可行权数量。

4.交易形成的对锁仓按大边收取保证金

期货交易中，一般客户交易和到期日闭市，对锁仓均按大边收取保证金。做市商客户，交易期间按大边收取保证金，到期日闭市后按净持仓收取保证金。

5.期货浮动盈亏计算问题

交易期间，期货的浮动盈利不计入客户可用资金项，浮动亏损扣减可用资金项。到期日闭市后，将期货浮动盈亏计入可用资金，然后进行行权资金检查和批量放弃。

系统功能

» 设置交易参数

AUTOEXEC-是否到期日期权自动执行
默认设为1

系统功能

» 设置交易参数

参数	解释	盘中指令行权	到期日闭市后指令行权	到期日闭市后批量行权	到期日批量行权风险分析
ACCFRZ	浮动盈利计入交易的可用资金	生效	生效	不生效，浮动盈利默认计入行权可用资金	不生效，浮动盈利默认计入行权可用资金
EXMGN_ITM	实值额是否计入执行冻结保证金 参数值为0时行权冻结保证金=标的期货保证金+虚值额； 参数值为1时行权冻结保证金=标的期货保证金-实值额+虚值额。	生效	生效	不生效，实值额默认计入执行冻结保证金	不生效，实值额默认计入执行冻结保证金
ZXWT_FRZ	可平手数是否扣除已行权申请手数，可行权手数是否扣除平仓未成交手数	生效	生效	生效	生效
FUND_FRZ	开仓挂单冻结资金盘后是否行权可用	不生效	生效	不生效，开仓挂单冻结资金默认释放计增行权可用资金	不生效，开仓挂单冻结资金默认释放计增行权可用资金

指令行权

期权行权

行权号

状态

客户号

合约号

行权类型

手数

交易所

行权系...

执行冻结

申报时

行权下单

行权撤单

客户号

衍生品类别

合约

看涨看跌

执行价格

买卖

行权类型

手数

投保

保留头寸

免于对冲

1-期货期权

cu1507

3-看跌

47500

1-买

1-执行

0

0-投

☐ 不保留头寸

☐ 不对冲持仓

客户名称

委托密码

可用资金 0.00

可执行数量 0

Q 确认

C 复位

R 刷新

X 退出

指令行权

未成交单 所有委托单 行权委托单

委托号	合约	买卖	开平	委托状态	详细状态
2	SR1405-C-3900	买	开仓	未成交	已经报入
3	SR1405-C-3900	买	开仓	未成交	已经报入
4	SR1405-C-3900	卖	开仓	错单	资金帐号
5	m1405-C-3400	买	开仓	全部成交	全部成交

☒ 全部单(A) ☐ 挂单(S) ☐ 已成交(D) ☐ 已撤销错单(E)

持仓 成交记录

合约	买卖	总持仓	可行权量	已申请执行量	已申
m1405-C-3400	买	1	1	0	

☐ 持仓(S) ☐ 持仓明细(D) ☒ 可行权持仓(E)

上期所 11:05:46 大商所 11:05:46 郑商所 11:05:46 中金所 11:05:46 交易 行情

期权行权申请

合约 m1405-C-3400

买卖 买入

投保 投机

合约标识码 m1405-C-3400

已执行数量 0

已放弃数量 0

可申请数量 1

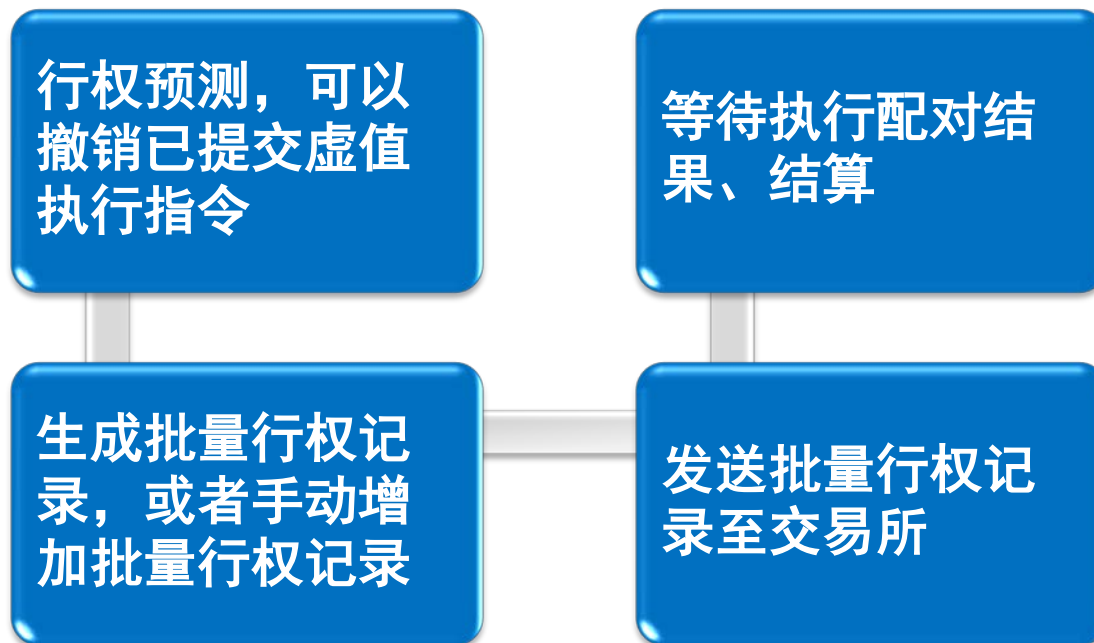
手数 1

执行 放弃 取消

价	标的最新价	平仓挂单量
00	2,125.00	0

批量行权流程

V6T/V8T：风控终端→批量行权风险分析→行权预测→行权数据生成&发送



批量行权风险分析

批量行权风险分析

行权预测 批量行权生成&发送

交易所 席位/通道 品种 交割期 客户号 查询预测

客户资金预警列表

客户号	客户名称	客户类	手机	电话	行权可用资金	实值额	预计保证金	预计行权手续费	预测资金缺口	买冻结	卖冻结	冻结手续费	冻结权

☐ 全选

批量行权·放弃·预测列表

客户号	客户名称	交易所	合约号	投保	持仓数量

已提交指令行权列表

客户号	合约号	申请时间	申请号	行权类型	行权状态	标的今结算价	实虚类型	实

☐ 全选 撤销成功后，应重新执行【查询预测】!

撤销 刷新

已提交批量行权列表

客户号	客户名称	交易合约	行权类型	申请数量	投保	执行冻结保证金	执行冻结手续费	批量生成

刷新

批量行权风险分析



- 行权可用资金:
- 1 . 客户所有期货持仓的浮动盈利均计入行权可用资金，客户所有交易所的开仓挂单冻结资金（期货开仓挂单占用的冻结保证金与期权开仓挂单占用的冻结保证金、冻结权利金、期权买平挂单占用的冻结权利金）均计入行权可用资金
- 2 . 根据期货合约、期权合约的“今结算价”，重算所有交易所期货持仓保证金、期权持仓保证金、期权行权冻结保证金（含标的保证金、实虚值额）、期货浮动盈亏，重算行权可用资金
- 3 . 针对郑州做市商，按净持仓计算所有期货持仓的保证金、平仓手续费并调整行权可用资金。其中，期货与期权形成的备兑持仓（PRT）中的期货持仓与期货组合持仓（SPD、IPS）均不参与净持仓处理

批量行权风险分析



- 行权可用持仓：
- 扣除客户已经自行提交的执行或放弃申请数据；
- 根据交易参数ZXWT_FRZ判断是否包括平仓挂单占用持仓
- 按如下原则对冲，剩下的期权持仓参与进一步预测：
 - 同一期权系列的看涨买方与同一期权系列的看涨卖方，或者是同一期权系列的看跌买方与同一期权系列的看跌卖方对冲；
 - 同一期权系列的看涨买方与期货卖持仓对冲，或者同一期权系列的看跌买方与期货买持仓对冲。

批量行权风险分析



- 根据行权可用资金与行权可用持仓，预测所有实值持仓被交易所默认行权后的资金缺口；如果存在资金缺口，则按照“实值额/保证金”从小到大、每手保证金从大到小排序，计算需要放弃的数量

批量行权

批量行权风险分析

行权预测 批量行权生成&发送

客户号 交易所 品种 批量生成

席位/通道 行权类型 已经撤销

客户号	客户名称	交易编码	交易所	席位号	品种	合约号	投保	申请手数	行权类型	标的今结算价	虚实类型

查询 全客户生成 单客户生成 增加 单条撤销 单客户撤销 发送>>

- 支持全客户生成、单客户生成、增加、单条撤销、单客户撤销、查询、发送。

系统功能

指令行权相关查询：

V6T柜台管理/V8T交易管理的信息查询→实时行权

V6T/V8T交易员、风控系统的查行权/行权查询

V6S数据管理→历史行权查询

批量行权相关查询：

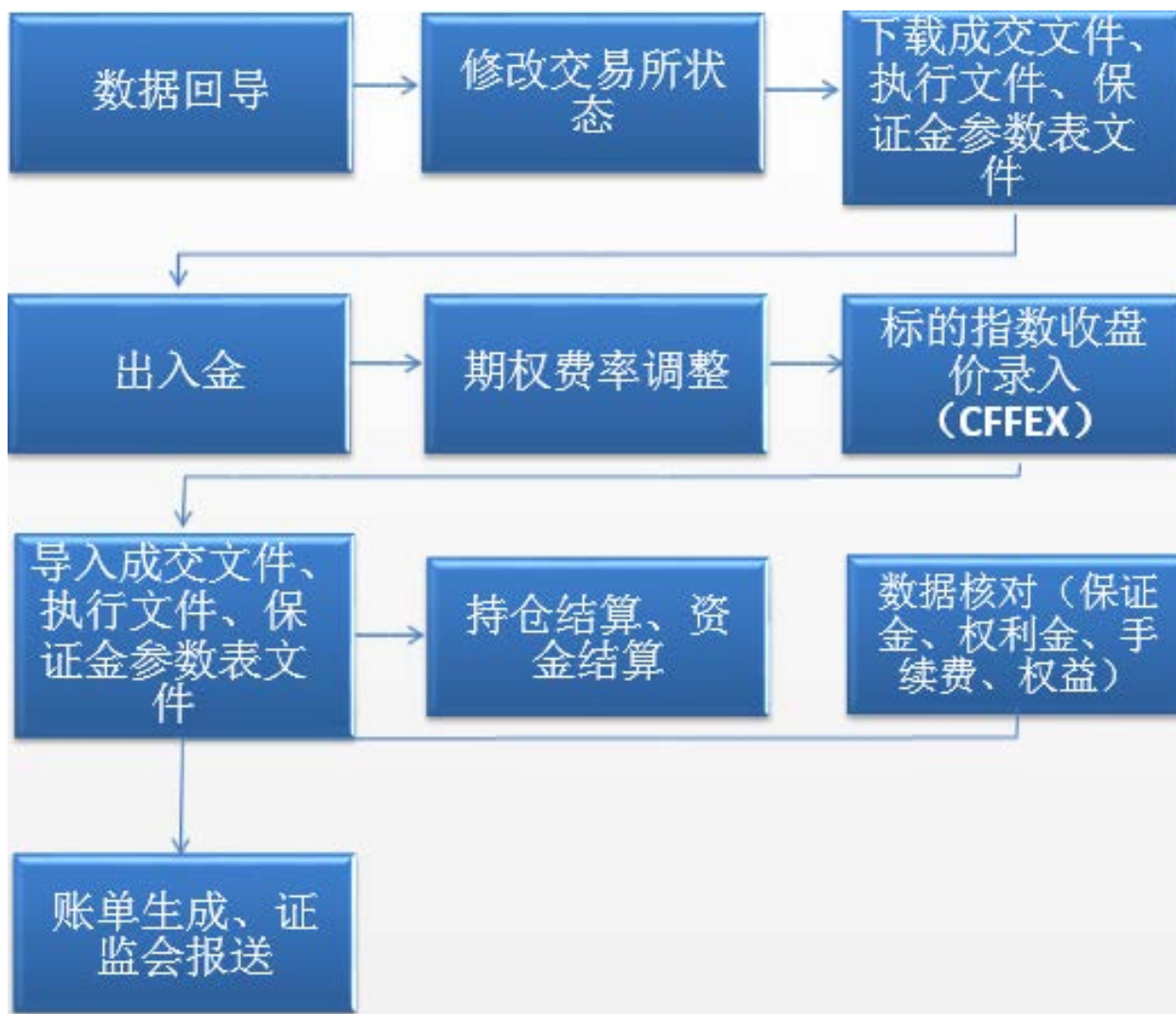
V6T/V8T风控系统的批量行权风险分析的批量行权生成&发送Tab

V6S数据管理→历史批量行权查询

5. 结算



结算流程



结算流程

» 导入交易所成交文件

V6S: 日终结算→导入交易所成交文件



- 启用“导入期权执行与履约文件”，期权执行与履约文件以及合约结算参数文件与成交文件一起导入。导入后可到【期权执行与履约管理】查询执行明细。
- 郑州交易所合约的结算价以保证金参数表中的数据为准，合约的隐含波动率也从该表中获取。

结算流程

» 期权执行履约单管理

V6S: 日终结算→期权执行履约单管理

系统工作日期: 2014年03月25日

自动锁定 [E] × 关闭窗口

柜台管理系统菜单

- 日终结算
- 成交单管理
- 导入交易所成交文件
- 结算价录入
- 持仓结算
- 资金结算
- 结算报告
- 结算结果核对
- 手工交割
- 交割单处理
- 交割通知书
- 置结算完成标志
- 投机转套保处理
- 期权执行履约单管理
- 现货期权标的价格管

向导 | 期权执行履约单管理

查询 | 新增 | 删除

期权执行履约单查询

开始日期: [20140324] 交易编码: [] 交割期: [] 顺序: [按执行顺序]

结束日期: [20140324] 交易所: [] 合约号: [] ☐ 按客户小计

客户号: [] 席位: [] 买卖: [] ☐ 显示执行盈亏

客户类: [] 品种: [] 执行序号: []

交易日期	客户号	客户名称	交易编码	执行序号	交易所	席位	看涨看跌	品种	交割期	合约号	买卖	投保	执行数量	执行价格	交割结算价	执行手
------	-----	------	------	------	-----	----	------	----	-----	-----	----	----	------	------	-------	-----

☐ 细节 ☒ 增加时以选中行为默认值

Q 查询 A 增加 U 修改 D 删除 S 全删

SUNGARD 系统管理员 [DRTF:10.253.46.199] 增加一个项目 交易所, 客户号, 交易编码, 交割期, 执行价格, 看涨看跌, 合约号控件, 执行手数

- 置结算完成标志的日期的执行履约单不允许进行增加、修改、删除操作。
- 增加时同一客户同一期权合约，既有执行记录又有履约记录，则分两笔录入。

结算流程

» 数据核对

项目	数据
日期	20140320
席位号	大连席位
币种	人民币
期初结存	98,585,229.89
出入金	1,000.00
手续费	896.00
平仓盈亏(浮)	0.00
平仓盈亏(盯)	-3,000.00
持仓盈亏(盯)	1,741,000.00
其它收支	0.00
期末结存	100,323,333.89
浮动盈亏	0.00
质押金额	0.00
未交割盈亏	0.00
期末权益	100,323,333.89
持仓保证金	9,515,442.01
可用资金	90,807,891.88
总盈亏	1,738,000.00
交割手续费	620.00
席位交割保证金	5,800,042.00
执行手续费	0.00
权利金收支	0.00
执行盈亏	0.00
期权市值	4,950,000.00

项目	数据
交易日期	20140320
会员号	004
会员名称	3600001
客户类	01
客户类名称	上海
币种	人民币
上日结存	54,426,374.55
出金	0.00
入金	0.00
手续费	0.00
上交手续费	0.00
留存手续费	0.00
附加费1	0.00
附加费2	0.00
净手续费	0.00
返佣	0.00
总盈亏	680,000.00
平仓盈亏(浮)	0.00
平仓盈亏(盯)	0.00
浮动盈亏(盯)	680,000.00
其它收入	0.00
今日结存	55,106,374.55
浮动盈亏	0.00
在途资金	0.00
未交割盈亏	0.00
期末权益	55,106,374.55
客户保证金	1,095,153.49
基础保证金	0.00
可用资金	54,011,221.06
质押金额	0.00
交易所保证金	975,776.49
风险度1	1.99%
风险度2	1.23%
追加保证金	0.00
风险级别	正常
交割保证金	668,885.49
交易所交割保证金	549,376.49
货币质押金额	0.00
外汇换入	0.00
外汇换出	0.00
货币质押可用余额	0.00
执行手续费	0.00
上交执行手续费	0.00
权利金收支	0.0000
执行盈亏	0.0000
期权市值	-300000.0000
客户市值权益	54806374.5500

结算流程

» 客户账单

V6S: 结算单→结算单生成设置

柜台管理系统菜单

结算单

结算数据导出客户设置

结算数据导出

结算单生成设置

结算单生成

结算单补生成

结算单查询

结算数据导出客户组

阶段结算单生成查询

结算单邮件发送

系统工作日期 2016年07月06日

自动锁定 [E]

关闭窗口

查询 增加

结算单生成设置

结算单类型: 1-日结单

结算类型: DC-逐笔对冲

客户对象

☒ 公司标准

☐ 客户类

☐ 客户号

语言

☐ 0-简体中文

☐ 1-英文

强平警告标准: 1-公司标准

是否生成休眠客户: 1-是

打印组成

☒ 资金状况

☐ 成交明细

☐ 平仓明细

☐ 持仓明细

☐ 持仓汇总

☐ 交割记录

☐ 出入金明细

☐ 质押明细

☐ 质押状态

☐ 期权执行

☐ 换汇记录

☐ 货币质押

☐ 合并

☐ 合并

☐ 合并

打印选项

☐ 指令下达人

☐ 质押金

☐ 在途资金

☐ 交割手续费

☐ 基础保证金

☐ 交易所保证金

☐ 结算单确认人

确认 取消

结算流程

» 客户账单

期货产品部

交易结算单(町市)

客户号:36000001

客户名称:36000001

指令下达人:
结算单确认人:

日期:20140306

资金状况 币种:人民币

上日结存:	3131574.79	当日结存:	3171574.79	可用资金:	1962564.74
出入金:	0.00	客户权益:	2291574.79	风险度:	38.12%
手续费:	0.00	保证金占用:	1209010.05	追加保证金:	0.00
权利金收支:	0.00	质押金:	0.00	交割保证金:	0.00
平仓盈亏:	0.00	在途资金:	0.00	交割手续费:	0.00
持仓町市盈亏:	40000.00	基础保证金:	0.00	行权手续费:	0.00
执行盈亏:	0.00	货币质押金额:	19.60	货币质押可用:	19.60
可提资金:	1962564.74	当日期权市值:	-880000.00	交易所保证金:	1160600.00
总盈亏:	40000.00	客户市值权益:	1411574.79		

持仓明细

交易所	品种	合约	开仓日期	买卖	投保	持仓量	成交价	昨结算	今结算	浮动盈亏	持仓町市盈亏	保证金
大连	黄大豆	a1405	20130916	买	投	5	4810.000	1200.000	2000.000	-140500.00	40000.00	21010.05
大连	豆粕	m1405-C-3000	20140303	买	投	10	430.000	1200.000	2000.000	0.00	0.00	0.00
大连	豆粕	m1405-P-2900	20140303	卖	投	33	24.000	1200.000	2000.000	0.00	0.00	726000.00
大连	豆粕	m1405-P-3300	20140303	卖	投	21	120.000	1200.000	2000.000	0.00	0.00	462000.00
共4条						69				-140500.00	40000.00	1209010.05

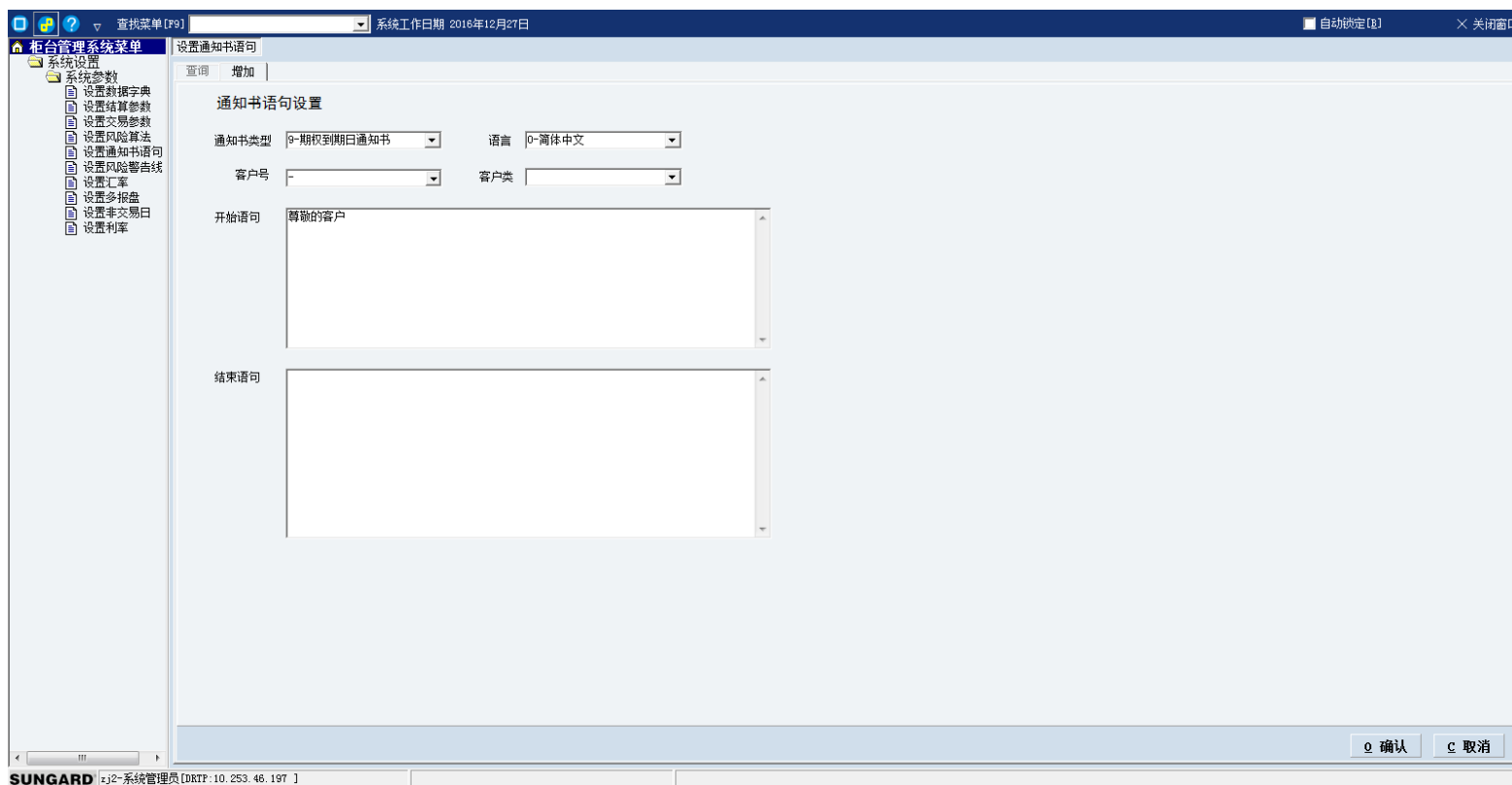
持仓汇总

交易所	品种	合约	买持	买均价	卖持	卖均价	昨结算	今结算	浮动盈亏	持仓町市盈亏	保证金占用	期权市值	投保
大连	黄大豆	a1405	5	4810.000	0	0.000	1200.000	2000.000	-140500.00	40000.00	21010.05	0.00	投
大连	豆粕	m1405-C-3000	10	430.000	0	0.000	1200.000	2000.000	0.00	0.00	0.00	200000.00	投
大连	豆粕	m1405-P-2900	0	0.000	33	24.000	1200.000	2000.000	0.00	0.00	726000.00	-660000.00	投
大连	豆粕	m1405-P-3300	0	0.000	21	120.000	1200.000	2000.000	0.00	0.00	462000.00	-420000.00	投
共4条			15		54				-140500.00	40000.00	1209010.05	-880000.00	

结算流程

» 客户账单

V6S: 系统参数→设置通知书语句



9-期权到期日通知书

V6S: 结算参数QQJDQRTS

结算流程

» 结算数据导出

V6S：结算单→结算数据导出客户设置/结算数据导出客户组设置查询
中金所格式、监控中心格式、金仕达格式，均区分非期权或期权的结算数据版本。

Empowering
the Financial World



THANK YOU