

华融证券期权宝软件（PC 端）操作手册

二〇二一年五月

目录

1. 登录及基本界面元素.....	1
1.1 软件下载及登录.....	1
1.2 基本界面元素.....	2
1.2.1 智能键盘.....	2
1.2.2 状态栏.....	3
1.2.3 通告与提醒.....	3
2. 标的/期权界面.....	4
2.1 画面联动.....	4
2.2 T 型报价及字段介绍.....	4
2.2.1 实时行情.....	5
2.2.2 比值指标.....	5
2.2.3 风险指标.....	6
2.3 传统报价及筛选.....	6
3. 策略交易画面.....	7
3.1 策略分类.....	8
3.1.1 期现策略.....	8
3.1.2 投机策略.....	8
3.1.3 套利策略.....	9
3.2 T 型报价.....	9
3.2.1 调整策略周期.....	9
3.2.2 选择执行价.....	10
3.3 损益模拟显示.....	10
3.3.1 损益图.....	11
3.3.2 附加走势画面.....	11
4. 超级策略.....	12
4.1 超级策略主页面说明.....	12
4.1.1 策略区.....	12
4.1.2 预开仓区.....	13
4.1.3 委托区.....	13
4.1.4 持仓区.....	14
4.1.5 图形分析区.....	14
4.2 超级策略下单按钮功能说明.....	15
4.2.1 一键开仓.....	15
4.2.2 勾选全平.....	16
4.2.3 一键平仓.....	16
4.2.4 一键调仓.....	17
4.3 超级策略自定义策略说明.....	18
5. 市场统计.....	19
6. 委托下单.....	21
6.1 普通交易模式.....	21
6.1.1 页面展示.....	21

6.1.2 委托类型.....	21
6.1.3 三键下单.....	21
6.1.4 四键下单.....	23
6.1.5 快速下单.....	24
6.1.6 下单说明.....	25
6.1.7 盈损开仓.....	26
6.2 闪电下单模式.....	27
6.3 策略下单模式.....	28
6.4 锁定解锁.....	30
6.5 组合申报.....	31
6.6 持仓及资金信息.....	34
6.7 行权.....	35
6.8 合并行权.....	35
6.9 查询.....	36
6.10 银衍转账.....	37
6.11 修改密码.....	37
6.12 账户管理和锁屏按钮.....	37
6.12.1 账户管理.....	38
6.12.2 锁屏.....	39

1. 登录及基本界面元素

1.1 软件下载及登录

请进入华融证券官网-软件下载，下载最新版本的期权宝 PC 版交易客户端和仿真交易客户端，网址：<https://www.hrsec.com.cn/main/rjxz/index.shtml>

生产：

软件名称：华融证券期权宝 软件说明：华融证券期权宝，支持股票期权交易，股票交易等相关功能。	 立即下载 更新时间：2021-04-22
MD5效验值：7716784cebafc3ec28ccb4b1e233a185	

仿真：

软件名称：华融证券乾隆网上交易个股期权测试客户端（仿真） 软件说明：	 立即下载 更新时间：2021-04-22
MD5效验值：fc5a28a22ee3b28dcb601cc611b7d70d	

登录需输入正确的资金账号、密码和验证码：

登录后，默认页面如下：



1.2 基本界面元素

1.2.1 智能键盘

客户端的右上角将智能键盘，可任意输入期权的名称、拼音的首字母、期权代码或期权的标识码，键入后系统会自动显示符合条件的期权合约，如下图：



1.2.2 状态栏

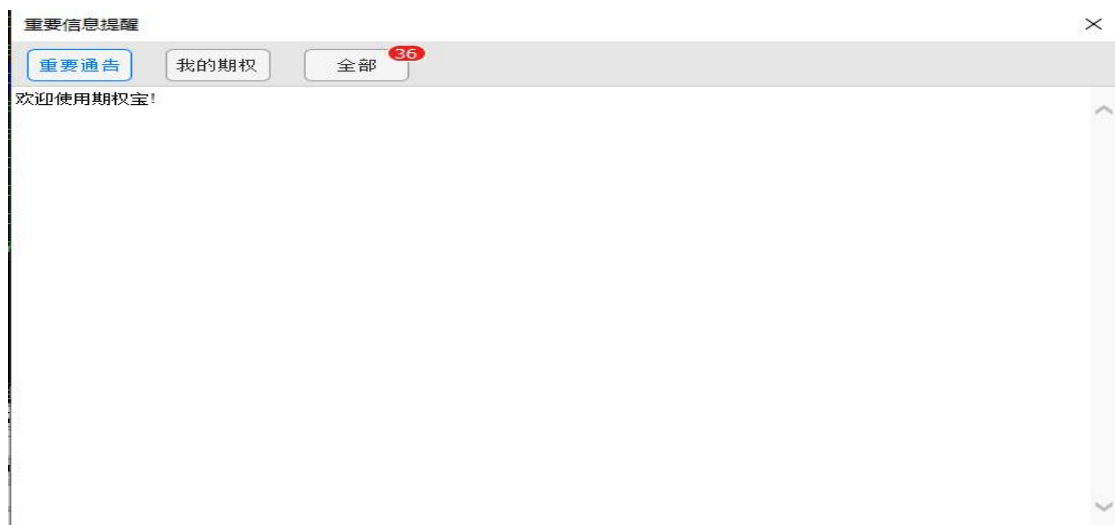
在画面最底端有一行信息，即状态栏，格式为：指数名称、指数点位、涨跌幅、成交金额（亿），鼠标单击此处，即可切换到相应的指数分时走势图画面。如下图：



右侧为系统的链接状态以及系统时间，绿色为成功链接的标志，如果显示黄色惊叹号为链接不成功，请检查您的网络连接是否正常。

1.2.3 通告与提醒

登陆期权宝软件后，系统会自动弹出信息提醒窗口，提醒您的持仓期权相关信息、营业部公告和当日风险通知等内容，如下图：



2. 标的/期权界面

标的/期权页面为期权宝的初始进入画面，点击菜单栏的，进入标的/期权画面，如下图：



2.1 画面联动

点击任意标的的证券，标的的走势/K 线画面和期权 T 型报价画面的联动切换：

- 双击标的的报价的任意证券，可以进入该证券的期权“超级策略”画面。
- 双击标的的走势或 K 线，可以全屏化该走势或 K 线画面。
- 双击期权 T 型报价中的任意期权，可以进入该期权的走势画面。

2.2 T 型报价及字段介绍

T 型报价是按照期权的不同执行价格列示所有期权的成交涨跌情况，主要分为认购和认沽两大类。通过左下角标签可以切换不同 T 型报价类型，查看期权的各类指标。可选择切换的显示标签类型为：自设栏目、实时行情、比值指标、风险指标、按执行价、指标纵览。



2.2.1 实时行情

包含实时：买入（报价）、卖出（报价）、最新（成交价）、涨跌（金额）、（涨跌）幅度、理论价、隐波、总量（成交量）、持仓（量）。如下图：

50ETF购5月3500 10003329 认购								
持仓	总量	隐波%	理论价	幅度%	涨跌	最新	卖出	买入
1238	919	0.01	0.4588	-6.92	-0.0336	0.4518	0.4517	0.4502
2255	2199	0.01	0.3593	-9.29	-0.0360	0.3515	0.3537	0.3514
11389	4812	0.01	0.2615	-11.66	-0.0338	0.2560	0.2553	0.2540
25031	48824	12.39	0.1703	-17.57	-0.0345	0.1619	0.1624	0.1619
100133	148999	15.28	0.0948	-25.91	-0.0299	0.0855	0.0855	0.0853
271693	331419	16.46	0.0432	-33.69	-0.0188	0.0370	0.0370	0.0368
261935	207290	17.29	0.0156	-42.61	-0.0098	0.0132	0.0132	0.0131
149202	63089	18.11	0.0044	-54.44	-0.0049	0.0041	0.0042	0.0041
73558	34822	20.07	0.0010	-57.50	-0.0023	0.0017	0.0017	0.0016
32946	5686	23.08	0.0002	-38.89	-0.0007	0.0011	0.0012	0.0011
22552	2529	26.83	0.0000	-9.09	-0.0001	0.0010	0.0010	0.0009

自设栏目 实时行情 比值指标 风险指标 按执行价 指标纵览

2.2.2 比值指标

包含：最新（成交价），虚实度、投机度、趋势度、内在价值、时间价值、溢价、杠杆、真实杠杆。如下图：

50ETF购5月3400 10003328 认购								
真实杠杆	杠杆	溢价%	时间价值	内在价值	趋势度	投机度	虚实度%	最新
7.68	7.68	-0.03	—	0.4500	-0.284	0.752	15.00	0.4491
9.74	9.80	0.06	0.0020	0.3500	-0.245	0.975	11.29	0.3520
13.20	13.71	0.05	0.0017	0.2500	-0.347	0.424	7.81	0.2517
20.06	21.38	0.33	0.0114	0.1500	-0.311	1.958	4.55	0.1614
27.81	40.54	1.02	0.0351	0.0500	-0.326	1.497	1.47	0.0851
36.69	94.01	2.51	0.0367	—	-0.417	1.225	-1.43	0.0367
45.49	261.36	4.73	0.0132	—	-0.451	0.798	-4.17	0.0132
53.15	802.33	7.37	0.0043	—	-0.655	0.423	-6.76	0.0043
55.13	2029.41	10.19	0.0017	—	-0.808	0.474	-9.21	0.0017
50.23	2875.00	13.08	0.0012	—	-0.600	0.174	-11.54	0.0012
45.32	3450.00	15.97	0.0010	—	0.200	0.112	-13.75	0.0010

自设栏目 实时行情 比值指标 风险指标 按执行价 指标纵览

2.2.3 风险指标

包含：最新（成交价）、隐波、理论价、偏离度、Delta、Gamma、Vega、Theta、Rho。

如下图：

50ETF购5月3500 10003329 认购								
Rho	Theta	Vega	Gamma	Delta	偏离度	理论价	隐波%	最新
0.0017	-0.0004	0.0000	0.0137	0.9994	-0.0068	0.4568	0.01	0.4500
0.0018	-0.0004	0.0001	0.1158	0.9938	-0.0063	0.3573	0.01	0.3510
0.0018	-0.0007	0.0007	0.5389	0.9623	-0.0069	0.2596	0.01	0.2527
0.0018	-0.0006	0.0009	1.0561	0.9487	-0.0089	0.1686	12.05	0.1597
0.0013	-0.0013	0.0029	2.8396	0.6860	-0.0099	0.0935	15.10	0.0836
0.0007	-0.0014	0.0032	2.8179	0.3870	-0.0063	0.0424	16.42	0.0361
0.0003	-0.0009	0.0021	1.7756	0.1721	-0.0023	0.0153	17.36	0.0130
0.0001	-0.0005	0.0010	0.8202	0.0625	-0.0003	0.0043	18.13	0.0040
0.0001	-0.0003	0.0005	0.3845	0.0283	0.0009	0.0009	20.36	0.0018
0.0000	-0.0002	0.0004	0.2221	0.0174	0.0010	0.0002	23.46	0.0012
0.0000	-0.0002	0.0003	0.1430	0.0121	0.0009	0.0000	26.55	0.0009

2.3 传统报价及筛选

用户可在行情/交易功能区左侧选择“传统报价”，并可实现字段排序、条件筛选、标的选择、月份选择等操作。如下图：

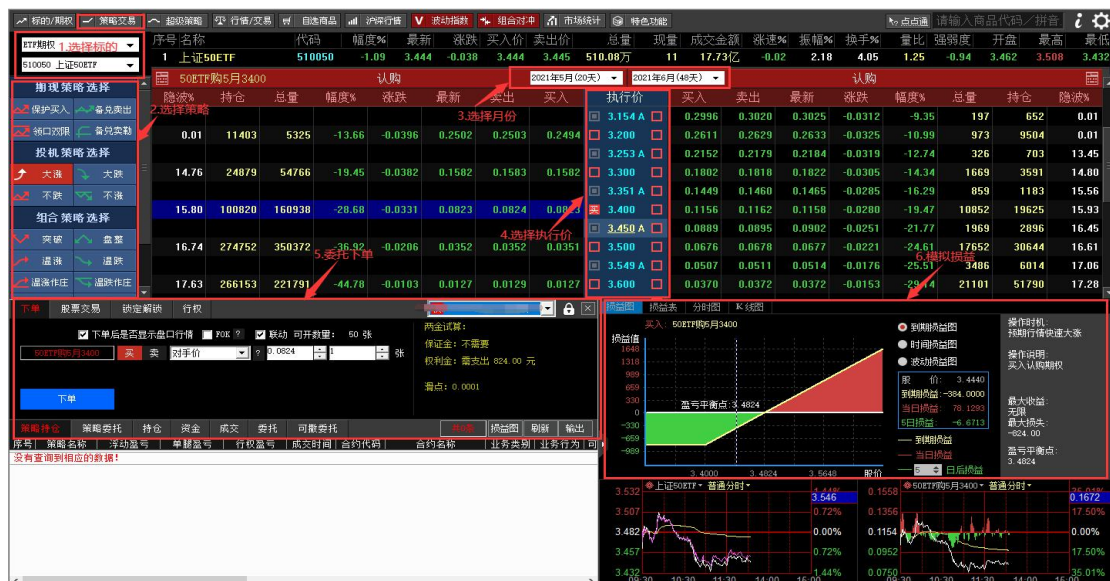
ETF期权 510050 上证50ETF 所有月份 认购 确认 买值 平值 卖值 深度筛选														
序号	名称	代码	最新	涨跌	幅度%	速度%	振幅%	买价	买量	卖价	卖量	总量	持仓	仓差
1	50ETF购5月3000	10003369	0.4471	-0.0383	-7.89	0.00	14.73	0.4460	10	0.4460	10	972	1225	-2431
2	50ETF沽5月3000	10003370	0.0010	-0.0005	-33.33	0.00	46.67	0.0010	6	0.0011	61	3204	13747	12904
3	50ETF购5月3100	10003325	0.3496	-0.0379	-9.70	0.00	18.94	0.3471	1	0.3483	5	2260	2198	43
4	50ETF沽5月3100	10003334	0.0017	-0.0011	-39.29	0.00	53.57	0.0016	74	0.0017	166	12759	33719	30528
5	50ETF购5月3200	10003326	0.2500	-0.0398	-13.73	-0.63	24.98	0.2494	30	0.2507	10	5117	11407	8261
6	50ETF沽5月3200	10003335	0.0037	-0.0022	-37.29	-2.63	59.32	0.0036	139	0.0037	1	39719	80314	67354
7	50ETF购5月3300	10003327	0.1501	-0.0383	-19.50	-0.69	35.08	0.1578	12	0.1585	24	52041	24982	21649
8	50ETF沽5月3300	10003336	0.0120	-0.0007	-5.51	0.84	69.29	0.0119	12	0.0120	65	88821	130054	114993
9	50ETF购5月3400	10003328	0.0020	-0.0326	-28.25	-1.19	46.53	0.0027	24	0.0028	2	155919	100313	88471
10	50ETF沽5月3400	10003337	0.0364	0.0043	13.40	1.11	74.45	0.0365	12	0.0366	35	220197	149256	121459
11	50ETF购5月3500	10003329	0.0350	-0.0200	-35.84	-0.83	57.17	0.0356	30	0.0358	60	343759	273955	239670
12	50ETF沽5月3500	10003338	0.0092	0.0165	22.70	1.01	63.41	0.0092	2	0.0093	34	261218	208302	188032
13	50ETF购5月3600	10003330	0.0129	-0.0101	-43.91	-0.76	66.52	0.0129	48	0.0130	8	210097	265929	244085
14	50ETF沽5月3600	10003339	0.1667	0.0267	19.07	0.36	44.71	0.1665	12	0.1670	21	94698	73825	68162
15	50ETF购5月3700	10003331	0.0044	-0.0046	-51.11	2.32	61.11	0.0042	29	0.0044	86	65217	149176	135693
16	50ETF沽5月3700	10003340	0.2577	0.0315	13.93	0.54	31.21	0.2573	26	0.2580	2	33787	19035	17003
17	50ETF购5月3800	10003332	0.0010	-0.0022	-55.00	0.00	65.00	0.0018	20	0.0019	83	35400	73628	66663
18	50ETF沽5月3800	10003341	0.3540	0.0358	11.22	0.42	22.76	0.3543	15	0.3560	10	2660	6489	5598
19	50ETF购5月3900	10003333	0.0012	-0.0006	-33.33	0.00	55.56	0.0011	134	0.0012	45	6057	33282	26176
20	50ETF沽5月3900	10003342	0.4528	0.0340	8.33	0.00	17.42	0.4535	5	0.4554	20	1017	3427	2874
21	50ETF购5月4000	10003363	0.0010	-0.0001	-9.09	0.00	45.45	0.0009	121	0.0010	44	2660	22547	17925
22	50ETF沽5月4000	10003364	0.5491	0.0303	5.84	0.00	14.03	0.5526	1	0.5557	30	337	3362	1787
23	50ETF购5月2900A	10002995	0.5440	-0.0300	-5.23	0.00	10.42	0.5346	20	0.5385	10	57	5020	-1246
24	50ETF沽5月2900A	10002996	0.0022	-0.0009	-29.03	0.00	48.39	0.0022	61	0.0025	60	1094	41466	32213
25	50ETF购5月2957A	10002959	0.4805	-0.0445	-9.28	0.00	11.26	0.4859	30	0.4905	30	41	1925	-4338
26	50ETF沽5月2957A	10002968	0.0027	-0.0011	-28.95	0.00	100.00	0.0026	60	0.0028	11	604	39244	32870

此外，还能进行深度筛选，点击报价列表上方的“深度筛选”筛选期权品种。如下图：



3. 策略交易画面

通过菜单栏点击 **策略交易**，或快捷键“F11”进入策略交易画面，也可在“标的/期权”画面双击某一标的直接进入该标的的策略交易画面。如下图：



3.1 策略分类

目前钱龙期权宝提供了 20 种策略模型供选择使用，包括期现策略 4 种，单式策略 4 种和复式策略 12 种，共三大类。

3.1.1 期现策略

包含：保护买入、备兑卖出、领口双限、备兑卖勒。需同时登录期权相对应的现货账户才可操作。如下图：



3.1.2 投机策略

包含：大涨、大跌、不涨、不跌。如下图：



3.1.3 套利策略

包含：突破：盘整、温涨、温跌、温涨作庄、温跌作庄、先盘再涨、先盘再跌、先涨再盘、先跌再盘、逆转(多)、转换(空)。如下图：



3.2 T 型报价

策略画面中的 T 型报价基本排列和标的/期权画面基本相同，不同之处在于交易选择框会随着策略变化而调整，并增加了行权价两侧的执行价格选择框。当用户在模型库选中策略模型之后，T 型报价的执行价会出现相应变化。

3.2.1 调整策略周期

在选择好策略模型之后，系统会自动给出默认（以当月为基础）的策略周期，用户可根据自己的实际需求调整策略周期。如下图：

50ETF购5月3400										认购									
隐波%	持仓	总量	幅度%	涨跌	最新	卖出	买入	最新	涨跌	幅度%	总量	持仓	隐波%	最新	涨跌	幅度%	总量	持仓	隐波%
0.01	11394	5991	-10.35	-0.0300	0.2598	0.2614	0.2602	0.3084	0.3107	0.3035	-0.0302	-9.05	202	649	0.01	0.2684	0.2708	-0.0250	-8.45
14.18	25613	60994	-14.71	-0.0289	0.1675	0.1675	0.1674	0.2233	0.2258	0.2179	-0.0324	-12.94	336	697	0.01	0.1875	0.1891	-0.0242	-11.38
15.50	101287	177689	-22.96	-0.0265	0.0889	0.0891	0.0889	0.1512	0.1522	0.1518	-0.0232	-13.26	941	1165	14.85	0.1211	0.1219	-0.0233	-16.20
16.43	274894	370581	-31.00	-0.0173	0.0385	0.0384	0.0383	0.0935	0.0941	0.0936	-0.0217	-18.82	2545	2901	15.91	0.0711	0.0716	-0.0187	-20.82
17.42	265729	231878	-38.26	-0.0088	0.0142	0.0142	0.0141	0.0533	0.0539	0.0533	-0.0157	-22.75	3599	6052	16.60	0.0380	0.0392	-0.0135	-25.71

3.2.2 选择执行价

策略模型会自动给出默认的最优执行价，同时也可以根据自己的实际需求，调整执行价。

不可选 ；买入已选 ；买入可选 ；卖出已选 ；卖出可选 

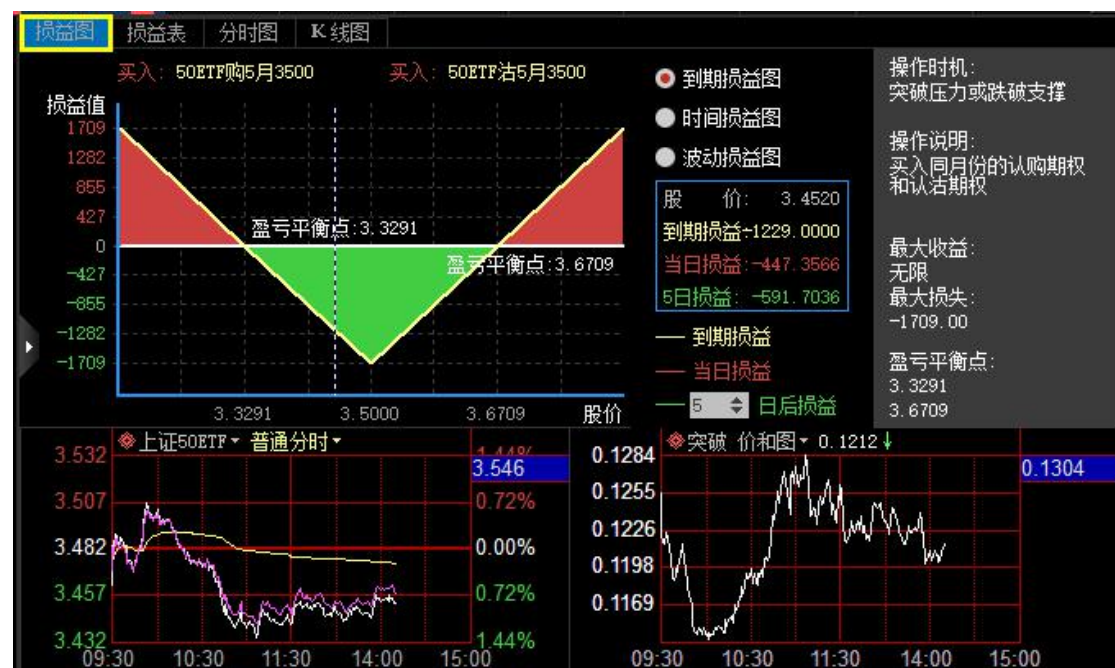
单式策略，只能选择 1 个交易方向：

50ETF购5月3400		认购							2021年6月(49天)		认购							
50ETF购5月3400		隐波%	持仓	总量	幅度%	涨跌	最新	卖出	买入	执行价	买入	卖出	最新	涨跌	幅度%	总量	持仓	隐波%
投机策略选择										3.154 A	0.3073	0.3095	0.3067	-0.0270	-8.09	205	650	0.01
大涨		0.01	11404	6327	-10.49	-0.0304	0.2594	0.2597	0.2586	3.200	0.2674	0.2707	0.2690	-0.0268	-9.06	1149	9622	0.01
大跌										3.253 A	0.2223	0.2246	0.2236	-0.0267	-10.67	337	703	9.18
不跌										3.300	0.1861	0.1877	0.1863	-0.0264	-12.41	1835	3567	12.75
不涨										3.351 A	0.1503	0.1515	0.1508	-0.0242	-13.83	982	1164	14.40
组合策略选择		12.09	25956	63031	-15.27	-0.0300	0.1664	0.1666	0.1657	3.400	0.1202	0.1207	0.1202	-0.0236	-16.41	11795	19654	15.20
突破		14.97	100728	183211	-23.66	-0.0273	0.0881	0.0881	0.0876	3.450 A	0.0929	0.0934	0.0932	-0.0221	-19.17	3154	3311	15.72
盘整										3.500	0.0708	0.0710	0.0710	-0.0188	-20.94	19286	30892	16.17
盘整		16.24	275277	382060	-31.36	-0.0175	0.0383	0.0384	0.0383	3.549 A	0.0531	0.0536	0.0535	-0.0155	-22.46	3700	6132	16.56
退涨作庄										3.600	0.0386	0.0389	0.0387	-0.0138	-26.29	22172	52021	16.82
退跌作庄																		
先平后盘																		
先平再涨		17.20	265443	236494	-39.57	-0.0091	0.0139	0.0140	0.0138									
先盘再涨																		
先盘再跌																		

复式策略，可以选择 2 个交易方向：

50ETF购5月3500		认购										2021年5月(20天)										2021年6月(20天)										认购										50ETF沽5月3600	
隐波%		持仓		总量		幅度%		涨跌		最新		卖出		买入		执行价		买入		卖出		最新		涨跌		幅度%		总量		持仓		隐波%											
大涨	大跌	0.01	1244	1081	-6.06	-0.0294	0.4560	0.4546	0.4524	3.000	0.4524	0.4546	0.4560	-0.0294	-6.06	1081	1244	0.01																									
不跌	不涨	0.01	2174	2357	-8.03	-0.0311	0.3564	0.3544	0.3530	3.100	0.3530	0.3544	0.3564	-0.0311	-8.03	2357	2174	0.01																									
组合策略选择																																											
突破	盘整	0.01	11409	6342	-11.56	-0.0335	0.2563	0.2578	0.2566	3.200	0.2566	0.2578	0.2563	-0.0335	-11.56	6342	11409	0.01																									
暴涨	暴跌	12.72	25961	63319	-16.45	-0.0323	0.1643	0.1643	0.1640	3.300	0.1640	0.1643	0.1641	-0.0323	-16.45	63319	25961	12.72																									
温和上涨	温和下跌	15.11	100839	184069	-25.13	-0.0290	0.0864	0.0864	0.0863	3.400	0.0863	0.0864	0.0864	-0.0290	-25.13	184069	100839	15.11																									
暴涨涨停	暴跌跌停	16.37	276413	385432	-32.80	-0.0183	0.0375	0.0375	0.0374	3.500	0.0374	0.0375	0.0375	-0.0183	-32.80	385432	276413	16.37																									
先涨再跌	先跌再涨	17.27	265104	237236	-41.30	-0.0095	0.0135	0.0136	0.0135	3.600	0.0135	0.0136	0.0135	-0.0095	-41.30	237236	265104	17.27																									
先涨再跌	先跌再涨	18.40	149755	71802	-50.00	-0.0045	0.0045	0.0045	0.0044	3.700	0.0044	0.0045	0.0045	-0.0045	-50.00	71802	149755	18.40																									
先涨再跌	先跌再涨	20.51	73671	37002	-50.00	-0.0020	0.0020	0.0020	0.0020	3.800	0.0020	0.0021	0.0020	-0.0020	-50.00	37002	73671	20.51																									
逆势(多)	转势(空)	22.67	34159	7491	-44.44	-0.0008	0.0010	0.0011	0.0010	3.900	0.0010	0.0011	0.0010	-0.0008	-44.44	7491	34159	22.67																									

3.3 损益模拟显示



3.3.1 损益图和损益表

通过损益图表，可以显示当前所选策略的获利区间、亏损区间以及盈亏平衡点。还可以根据自己的需要选择查看到期损益图或所有损益图。如下图：

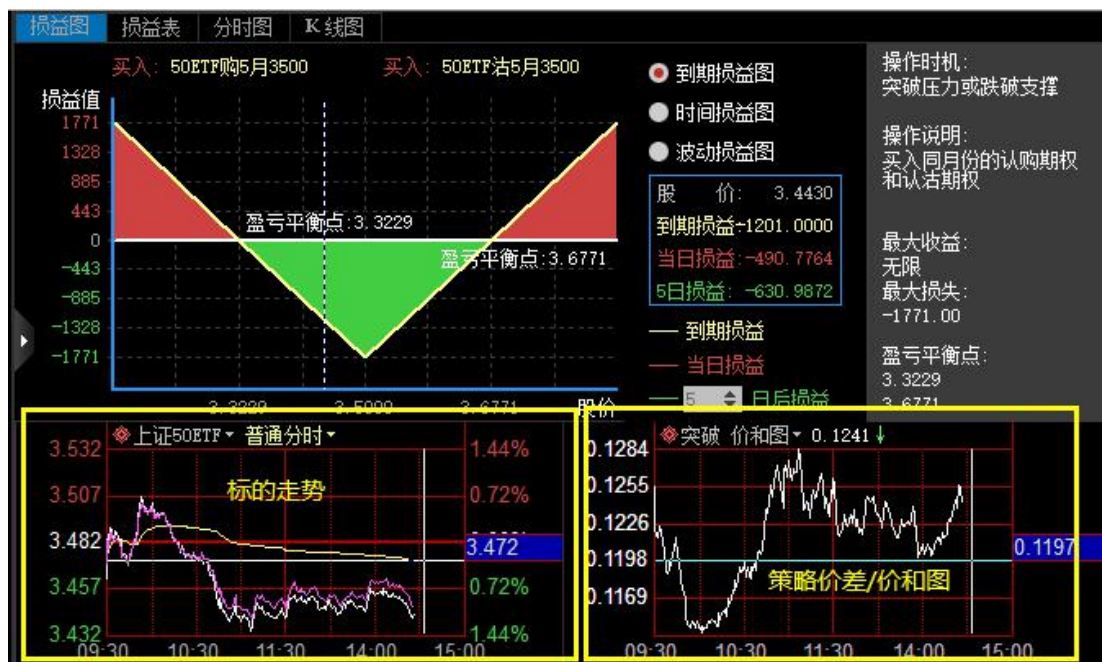


此外，也可选择“损益表”的方式显示损益，包含策略涉及合约的单损益函数和合计损益值。如下图：

上证50ETF价格	50ETF购5月3500买入损益	50ETF沽5月3500买入损益	合计损益
3.16	-871.00	2580.00	1709.00
3.24	-871.00	1725.50	854.50
3.33	-871.00	871.00	0.00
3.41	-871.00	16.50	-854.50
3.50	-871.00	-838.00	-1709.00
3.59	-16.50	-838.00	-854.50
3.67	838.00	-838.00	0.00
3.76	1692.50	-838.00	854.50

3.3.2 附加走势画面

附加走势画面包括标的走势和策略价差/价和图



4. 超级策略

点击菜单栏的  超级策略 图标进入超级策略交易画面，用户可以自由选择同时下单多腿或自由组合策略。

4.1 超级策略主页面说明

4.1.1 策略区

策略区目前涵盖了期限策略、牛市策略、熊市策略、中性策略、波动策略和套利策略共 72 种策略。如下图：



4.1.2 预开仓区

栏目可对已选择合约可进行行权价、类别、条件、价格、张数以及买卖方向的修改。如下图所示：

名称	备兑	类别	条件	FOK	价格	数量	买/卖	隐含%	买一量	卖一量	Delta	Gamma	Vega	Theta
上证50ETF06月	3.450	认购	对手价		0.0881	1	买	16.09	30	10	0.5388	1.9556	0.0050	-0.0010
上证50ETF06月	3.500	认购	对手价		0.0665	1	买	16.49	10	383	-0.4437	-1.8982	-0.0050	0.0010

4.1.3 委托区

栏目内显示用户当日已提交委托单详情，内容包含委托时间、合约代码、合约名称、期权类型、买卖标志、业务类别、委托价格、委托数量、成交数量、委托状态、保证金占用等字段信息。如下图所示：

期 权	持仓	资金	成交	委托	可撤委托	撤单 刷新 输出											
--------	----	----	----	----	------	----------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

4.1.4 持仓区

栏目显示用户目前持仓详情，内容包含：合约代码、合约名称、业务类型、持仓类型、持仓成本、持仓均价、浮动盈亏、浮动盈亏%等字段。同时支持平仓 and 全部平仓操作。如下图：

持仓

资金

成交

委托

可撤委托

持仓

全部

全选

重置

刷新

输出

期权

序号	合约代码	合约名称	合约类型	持仓方向	备兑标志	昨日余额	可用	实际持仓	成本均价	浮动盈亏	合约市值	保证金	Delta	
☐	1	10003006	50ETF购6月3400	认购	权利方	非备兑	0	1	1	0.11473	-5.300	1142.000	0.000	6374.8500
☐	2	10003007	50ETF购6月3500	认购	义务方	非备兑	0	1	1	-0.06600	-6.000	-666.000	5875.680	-4436.3900
	3	统计						2		-11.300	476.000			1938.460

股票

委托区和持仓区，可以根据账户实际情况切换“期权”和“股票”账户。

4.1.5 图形分析区

1) 概率图



2) 损益图



4.2 超级策略下单按钮功能说明

4.2.1 一键开仓

通过左侧策略或是T型报价界面选择合约后，可使用委托框区域下方的“一键开仓”批量下单所有选中合约，如下图：



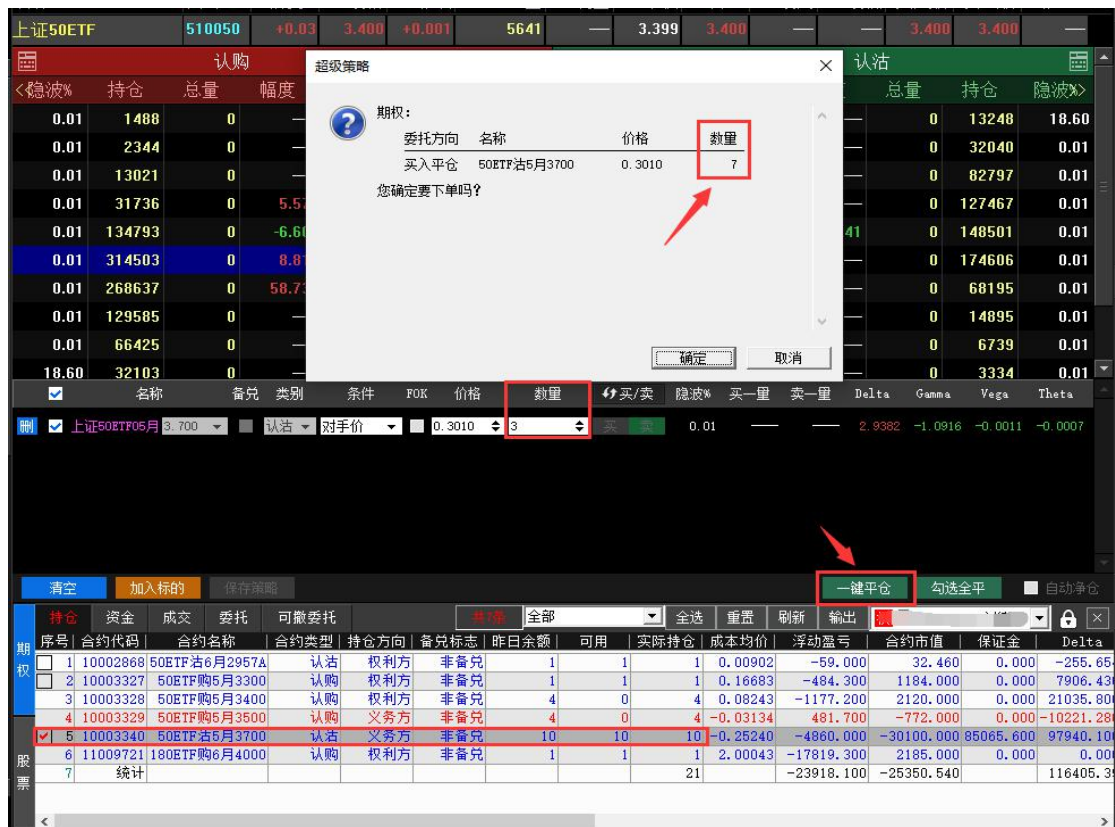
4.2.2 勾选全平

用户可以从持仓报表中选择所持有的合约（与当前标的相同才会有选择框），并使用委托框区域下方的“完全平仓”功能一键平仓所有同一标的的合约。如果选择“勾选全平”功能，无论在预开仓区怎么调整平仓数量，都会以全平的形式向交易所报出合约。如下图：



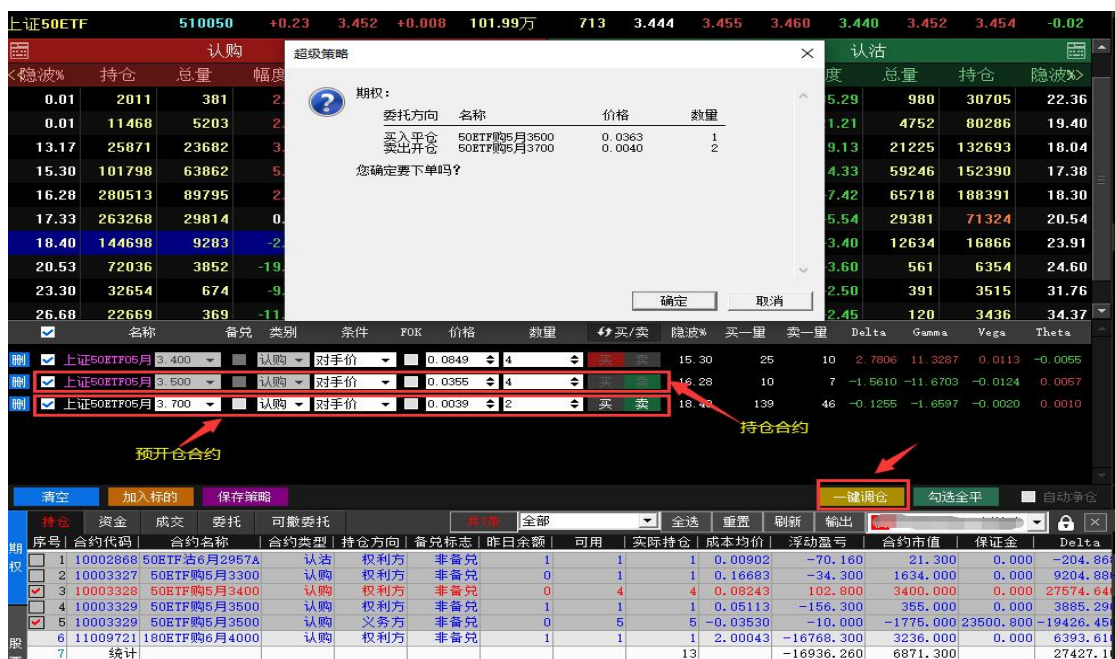
4.2.3 一键平仓

用户可以从持仓报表中任意选择所持有的合约（与当前标的相同才会有选择框），任意调整需平仓合约数量（≤持仓数量），使用委托框区域下方的“一键平仓”功能，实现一键平仓所选合约。平仓合约数量=持仓数量-预开仓区的显示数量，如下图：



4.2.4 一键调仓

当预开仓区内同时出现持仓合约和新开仓合约时，用户可以同步进行调整平仓数量和开仓，使用委托框区域下方的“一键调仓”功能，平仓合约数量=持仓数量-预开仓区的显示数量，如下图：



4.3 超级策略自定义策略说明

用户在超级策略画面左侧栏点击“我的策略”，可以进行自定义策略，并观察策略的执行情况。构建好组合时点击紫色栏“保存策略”菜单，命名该策略并保存。已下单自定义策略会在左侧“我的策略”栏内显示。如下图：

The screenshot displays the 'My Strategies' section of the software. On the left, a sidebar contains a list of strategies (111, 222) and a '我的策略' (My Strategies) button. The main area shows a table of strategies with columns for name, code, amplitude, latest price, change, volume, and more. A 'Save Strategy' dialog box is open, prompting for a strategy name (e.g., '333'). Red annotations indicate the workflow: 1. Clicking the '我的策略' button; 2. Selecting a contract; 3. Clicking the '保存策略' (Save Strategy) button; 4. Entering the strategy name in the dialog box.

用户可以多次构建组合，通过不同名称保存策略，观察不同策略的效果。调用保存的策略就可以进行观察和交易。

我的策略保存信息结构包括标的、月份、行权价、各合约张数，价格从当前最新行情中取值，当策略中有合约到期，则该保存策略自动删除，如下图：

ETF期权

510050 上证50ETF

我的策略

111

222

名称	代码	幅度%	最新	涨跌	总量	现量	昨收	开盘	最高	最低	买入价	卖出价	涨跌%
上证50ETF	510050	+0.32	3.410	+0.011	307.07万	20465	3.399	3.371	3.411	3.367	3.411	3.412	+0.26

认购

2021年05月(15天)

2021年05月(15天)

认沽

<隐波%	持仓	总量	幅度	涨跌	最新	买	卖	执行价	买	卖	最新	涨跌	幅度	总量	持仓	隐波%
0.01	1552	202	0.00	0.0000	0.4031			3.000			0.0006	-0.0001	-14.29	4631	16040	26.68
0.01	2474	1558	4.46	0.0135	0.3160			3.100			0.0010	-0.0004	-28.57	5273	36187	22.22
18.52	14669	25393	6.22	0.0128	0.2187			3.200			0.0026	-0.0014	-35.00	27775	103553	18.82
17.12	49790	116149	9.10	0.0106	0.1271			3.300			0.0109	-0.0025	-18.66	130787	151003	17.29
16.32	185964	228803	12.88	0.0063	0.0552			3.400			0.0388	-0.0068	-14.91	202511	168543	16.43
7.58	401782	206181	17.37	0.0029	0.0196			3.500			0.1027	-0.0103	-9.12	96283	175981	17.58
18.87	271102	49779	9.09	0.0005	0.0060			3.600			0.1909	-0.0108	-5.35	29181	64899	20.40
20.19	123760	14308	-12.50	-0.0003	0.0021			3.700			0.2858	-0.0152	-5.05	14337	14969	22.45
23.27	59560	5338	-10.00	-0.0001	0.0009			3.800			0.3861	-0.0149	-3.72	749	6306	29.10
26.63	31528	649	0.00	0.0000	0.0006			3.900			0.4847	-0.0163	-3.25	273	3405	32.38

名称	合约	类别	条件	FOR	价格	数量	买/卖	隐波%	买一量	卖一量	Delta	Gamma	Vega	Theta
上证50ETF05月	3.400	认购	对手价		0.0553	1	买	16.32	7	40	0.5639	3.3797	0.0028	-0.0017
上证50ETF05月	3.400	认沽	对手价		0.0391	1	买	16.43	1	10	-0.4385	3.3583	0.0028	-0.0013

清空

加入标的

保存策略

一键开仓

勾选全平

自动平仓

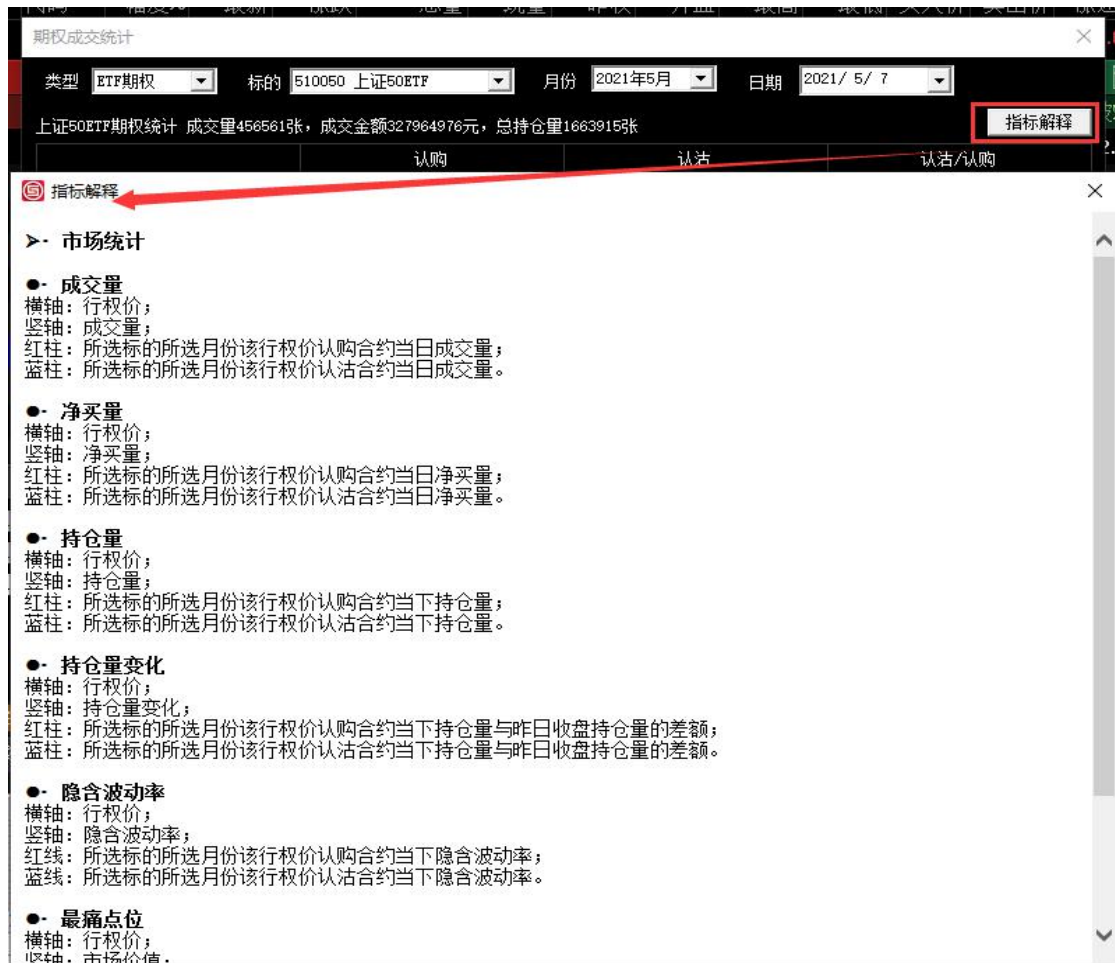
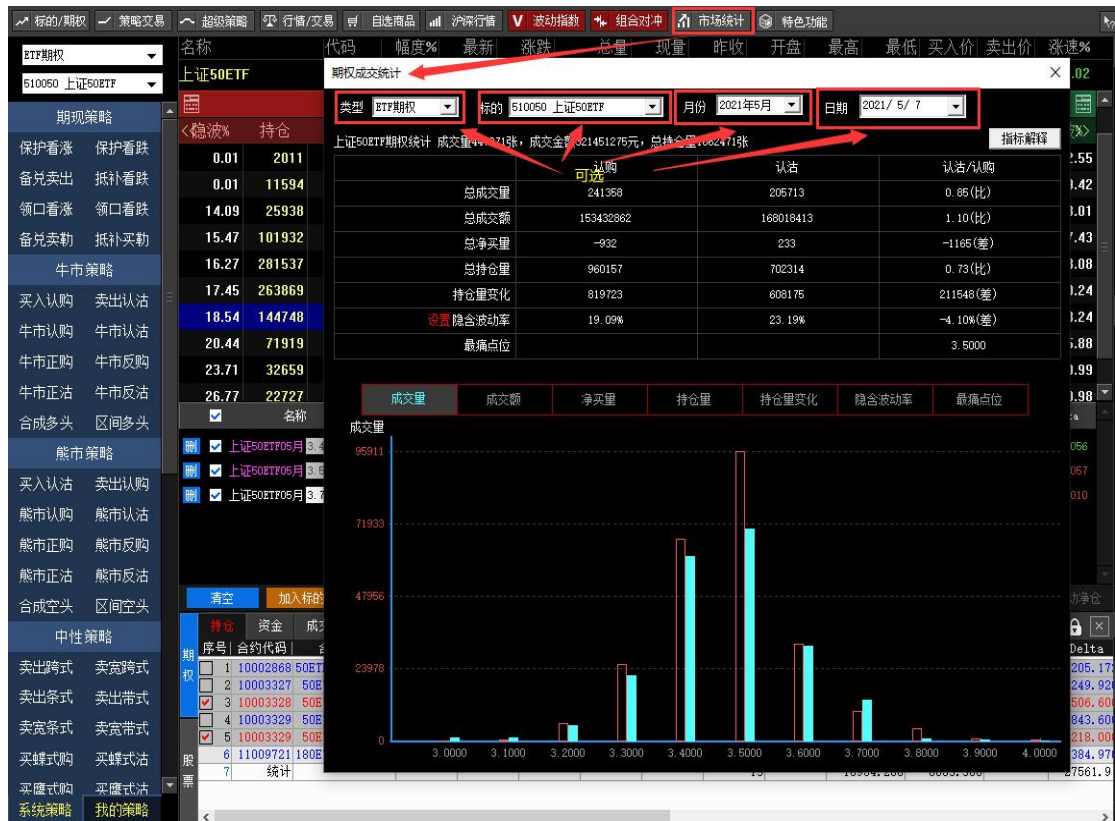
持仓	资金	成交	委托	可撤委托	昨日余额	可用	实际持仓	成本均价	浮动盈亏	合约市值	保证金	Delta
序号 合约代码	合约名称	合约类型	持仓方向	备兑标志	昨日余额	可用	实际持仓	成本均价	浮动盈亏	合约市值	保证金	Delta
1 10002868 50ETF沽6月2957A	50ETF沽6月2957A	认沽	权利方	非备兑	1	1	1	0.00902	-57.980	33.480	0.000	-306.33
2 10003327 50ETF购6月3300	50ETF购6月3300	认购	权利方	非备兑	2	2	2	0.14043	-298.600	2510.000	0.000	16847.44
3 10003328 50ETF购6月3400	50ETF购6月3400	认购	权利方	非备兑	4	0	4	0.08243	-1125.200	2172.000	0.000	22420.48
4 10003328 50ETF购6月3400	50ETF购6月3400	认购	义务方	非备兑	1	1	1	-0.04880	-55.000	-543.000	5469.360	-5605.12
5 10003329 50ETF沽6月3500	50ETF沽6月3500	认沽	义务方	非备兑	4	0	4	-0.03134	481.700	-772.000	0.000	-10430.76
6 10003340 50ETF沽6月3700	50ETF沽6月3700	认沽	义务方	非备兑	10	10	10	-0.25240	-3550.000	-28790.000	85065.600	94755.90
7 11009721 180ETF购6月4000	180ETF购6月4000	认购	权利方	非备兑	1	1	1	2.00043	-18183.300	1821.000	0.000	6606.10
8 统计												

系统策略

我的策略

5.市场统计

点击菜单栏的“市场统计”，能够查看系统实时统计的期权总成交量、成交额、净买量、持仓量、隐含波动率以及最痛点，同时支持追溯这些数据的历史数据。如下图：



6. 委托下单

6.1 普通交易模式

6.1.1 页面展示

点击菜单栏内  按钮，系统界面下方弹出普通模式的交易界面，如下图：



6.1.2 委托类型

交易界面的左侧栏可以选择委托类型，包括：三键下单、四键下单、快速下单、买入开仓、卖出开仓、买入平仓、卖出平仓、备兑开仓、备兑平仓等多种下单模式，如下图：



6.1.3 三键下单

1. 在交易界面的左侧栏选择“三键下单”  ，如下图：



2. 通过选进行查询的合约（如持仓中没有该合约），则三键的状态为：



图中的<=50 为最大开仓张数

如果单击“权利仓”的合约，则三键的状态为：



如果单击“义务仓”的合约，则三键的状态为：



对锁仓状态的合约，则三键的状态为：



“锁仓”的操作跟“平仓”一样，只在持仓栏显示反向操作的合约。

3. 选择三键进行下单确认，如下图：



6.1.4 四键下单

1. 在交易界面的左侧栏选择“四键下单”，如下图：



2. 如果交易（开仓）新合约，则四键的状态为：



图中的<=50 为最大开仓张数

如果单击只是“权利仓”的合约，则四键的状态为：



如果单击只是“义务仓”的合约，则四键的状态为：



如果单击既有“义务仓”又有“权利仓”的合约，则四键的状态为：



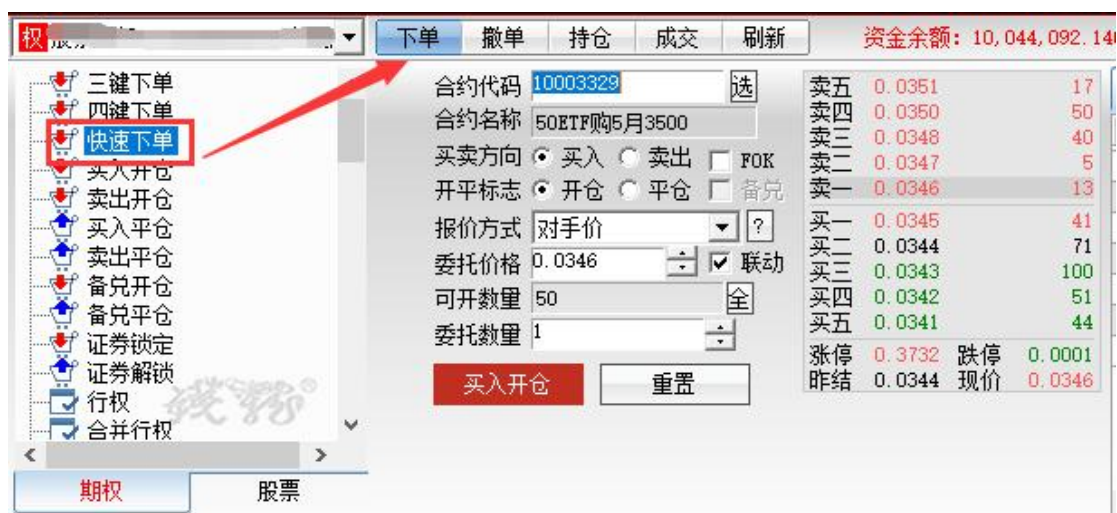
“锁仓”的操作跟“平仓”一样，只在持仓栏显示反向操作的合约。

3. 选择四键进行下单确认，如下图：



6.1.5 快速下单

1. 在交易界面的左侧栏选择“快速下单”  快速下单，如下图：



2. 选择快速下单确认，如下图：



6.1.6 下单说明

1. 对于上述三种下单方式，在下单页面，用户可以直接输入合约代码，也可以点击“选”字按钮，选择合约品种



，然后选择买卖方向、开/平仓。

2. 委托的模式中可以选择：对手价、挂盘价、涨停价、跌停价、限价、市价转限、市价 FOK 和市价 FAK 等方式。



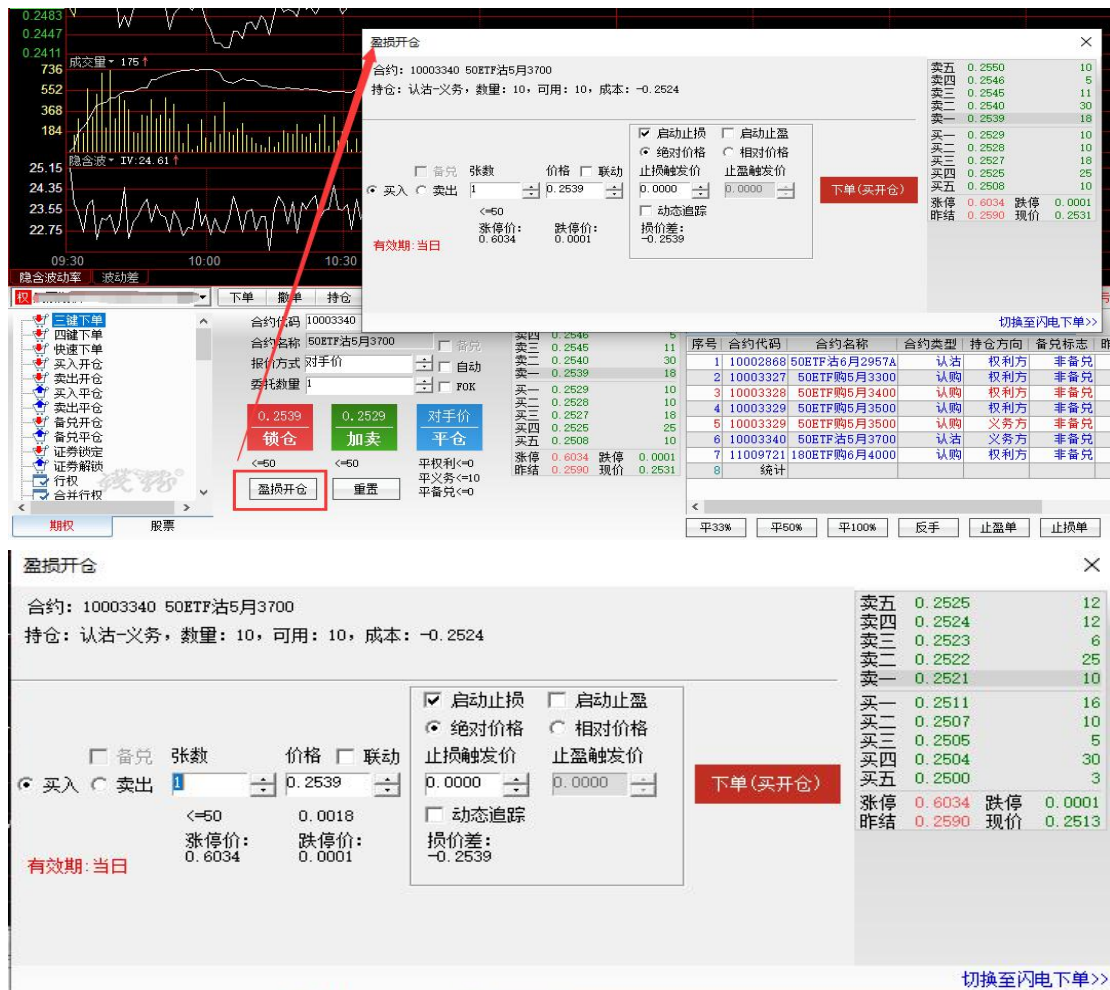
填好委托价格和委托数量之后，点击买入或卖出按钮完成委托。

3. 在普通交易模式的委托界面中，可以随时查看自己账户的持仓、成交、委托、撤单情况。



6.1.7 盈损开仓

1. 三键委托和四键委托下方有“盈损开仓”，用户可以操作“盈损开仓”，勾选启用止损或止盈，对开仓单进行止盈止损设置。如下图：



用户可勾选止损、或止盈、或两者全选来选择止盈止损模式。

盈亏开仓

合约: 10003340 50ETF沽5月3700
持仓: 认沽-义务, 数量: 10, 可用: 10, 成本: -0.2524

☒ 启动止损 ☐ 启动止盈

☒ 绝对价格 ☐ 相对价格

止损触发价: 0.0000 止盈触发价: 0.0000

☐ 动态追踪

止损价: -0.2539

下单(买开仓)

切换至闪电下单>>

卖五	0.2534	10
卖四	0.2514	5
卖三	0.2513	10
卖二	0.2512	32
卖一	0.2510	26
买一	0.2501	1
买二	0.2500	3
买三	0.2499	20
买四	0.2498	18
买五	0.2496	30
涨停	0.6034	跌停 0.0001
昨结	0.2590	现价 0.2514

还可选择动态追踪,此时为了防止追踪止损价与止盈价产生冲突,故不允许设置止盈价。

盈亏开仓

合约: 10003340 50ETF沽5月3700
持仓: 认沽-义务, 数量: 10, 可用: 10, 成本: -0.2524

☒ 启动止损 ☐ 启动止盈

☒ 绝对价格 ☐ 相对价格

回撤价差: 0.0000

☒ 动态追踪

止损价: 0.2539

下单(买开仓)

切换至闪电下单>>

卖五	0.2527	10
卖四	0.2525	5
卖三	0.2524	18
卖二	0.2522	10
卖一	0.2520	20
买一	0.2512	6
买二	0.2511	11
买三	0.2510	10
买四	0.2509	12
买五	0.2506	20
涨停	0.6034	跌停 0.0001
昨结	0.2590	现价 0.2517

勾选“动态追踪”后,止损价变成以“回撤价差”形式确认,需输入回撤价差单位,底部将直观显示出动态计算的止损价。

6.2 闪电下单模式

1. 用户在查看期权分时走势的画面时,用鼠标单击右侧买卖委托栏内的委托价位(买一~买五、卖一~卖五),能直接调出快速下单功能。如下图:

10003340 50ETF沽5月3700			
卖五	0.2575	17	
卖四			
卖三			
卖二			
卖一	0.2565		
买一	0.2558		
买二			
买三	0.2558	16	
买四	0.2557	35	
买五	0.2552	10	
最新	0.2565	开盘	0.2497
涨跌	-0.0025	最高	0.2603
幅度	-0.97%	最低	0.2411
结算	—	昨结	0.2590
现量	13	均价	0.2511
总量	17246	金额	4331.24万
持仓	16857	仓差	14744
涨停	0.6034	跌停	0.0001
外盘	8953	内盘	8293
剩余		19天	
到期		2021-05-26	
类型		未调整	
单位		10000股	
状态		连续交易	
细 价 指			

2. 选择所要进行的相关委托项目进行下单：

期权闪电交易

×

选择账户 100100074575 股票期权

合约代码 10003328 选

合约名称 50ETF购5月3400

买入方向

买入

卖出

FOK

开平标志

开仓

平仓

备兑

报价方式 对手价

?

委托价格 0.0518

未锁

可开数量 50

全

委托数量

保存

买入开仓

重置

卖五 0.0522 18

卖四 0.0521 37

卖三 0.0520 19

卖二 0.0519 15

卖一 0.0518 10

买一 0.0513 34

买二 0.0512 4

买三 0.0510 55

买四 0.0509 28

买五 0.0508 33

涨停 0.3928 跌停 0.0001

昨结 0.0530 现价 0.0518

切换至盈损开仓>>

6.3 策略下单模式

1. 点击菜单栏内  进入策略交易界面，如下图：

28



2. 在左侧选择标的及策略品种。如下图：



3. 在弹出的策略下单窗口，填写委托的价格和数量后点击下单，完成委托。如下图：



6.4 锁定解锁

1. 释义

- 1) 锁定：即锁定标的证券，锁定后的标的证券将被冻结无法卖出，此功能用于期权备兑开仓。锁定证券如果没有被占用，第二日会自动解锁。
- 2) 解锁：即解除锁定标的证券，解除锁定后的证券方可卖出。但已备兑占用部分无法解锁。

2. 锁定解放方式

- 1) 方法一：交易页面中用“证券锁定”/“证券解锁”完成现货的锁定和解锁

- 证券代码：标的证券代码
- 证券名称：证券中文简称
- 可锁定数量：标的证券可用于锁定的数量（右侧“备兑券持仓”内未锁定量）
- 锁定数量：要锁定的证券数量
- 重置：清除输入的内容，还原默认状态



- 可解锁数量：标的证券可被解除锁定的数量（右侧“备兑券持仓”内已锁定量）
- 解锁数量：要解除锁定的证券数量



- 2) 方法二：策略交易页面中，在下单窗口选择“锁定解锁”操作，如下图：

下单

股票交易

锁定解锁

行权

操作类别

锁定

解锁

证券代码

159919

证券名称

300ETF

可锁数量

30000

全

锁定数量

股

锁定

重置

卖五	5.075	70
卖四	5.074	2
卖三	5.073	4000
卖二	5.072	13350
卖一	5.071	3228
买一	5.070	100
买二	5.069	9
买三	5.068	6648
买四	5.067	1000
买五	5.066	400
涨停	5.550	跌停 4.541
昨收	5.045	现价 5.071

6.5 组合申报

组合申报菜单栏，如下图：



1. 组合申报:

该菜单可以用于申报组合策略。点击“组合申报”，先选择市场（上证或深证），再选择策略，目前柜台已根据交易所提供的匹配条件刷选出符合组合策略要求的备选组合，用户可以勾选合适的组合策略，并选择不大于最大可申报数量的张数进行申报。如下图：

期权

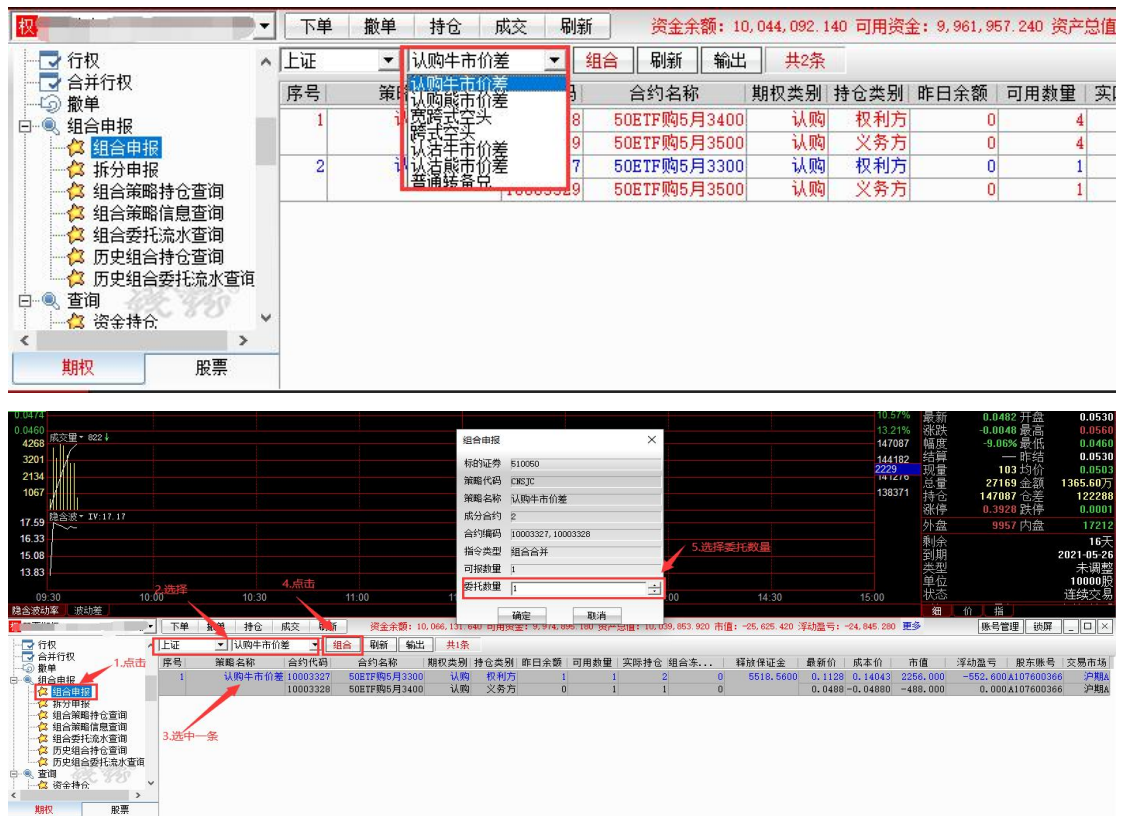
下单 撤单 持仓 成交 刷新

资金余额: 10,044,092.140 可用资金: 9,961,957.240 资产总值: 10,047,961,957.240

组合 刷新 输出 共2条

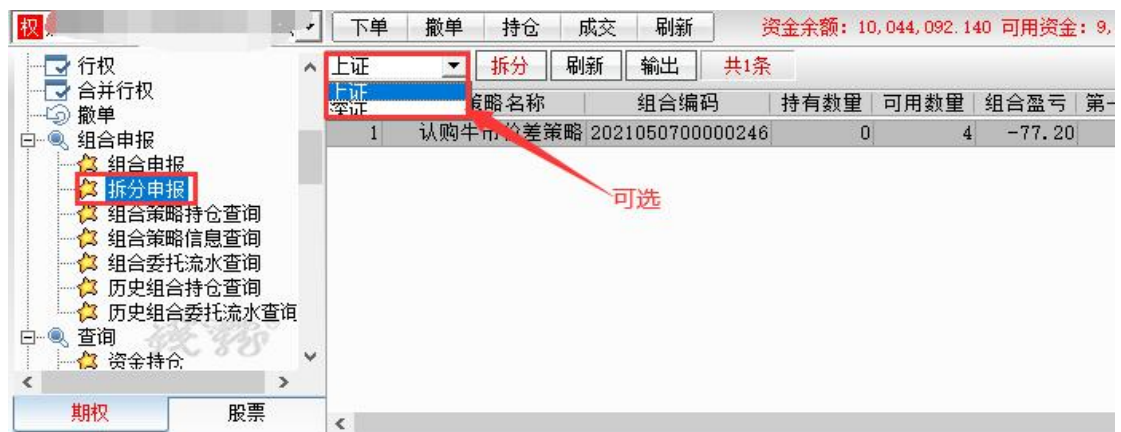
名称	合约代码	合约名称	期权类别	持仓类别	昨日余额	可用数量	实际持仓	持仓
1 认购牛市价差	10003328	50ETF购5月3400	认购	权利方	0	4	4	
2 认购牛市价差	10003329	50ETF购5月3500	认购	义务方	0	4	5	
2 认购牛市价差	10003327	50ETF购5月3300	认购	权利方	0	1	1	
	10003329	50ETF购5月3500	认购	义务方	0	1	5	

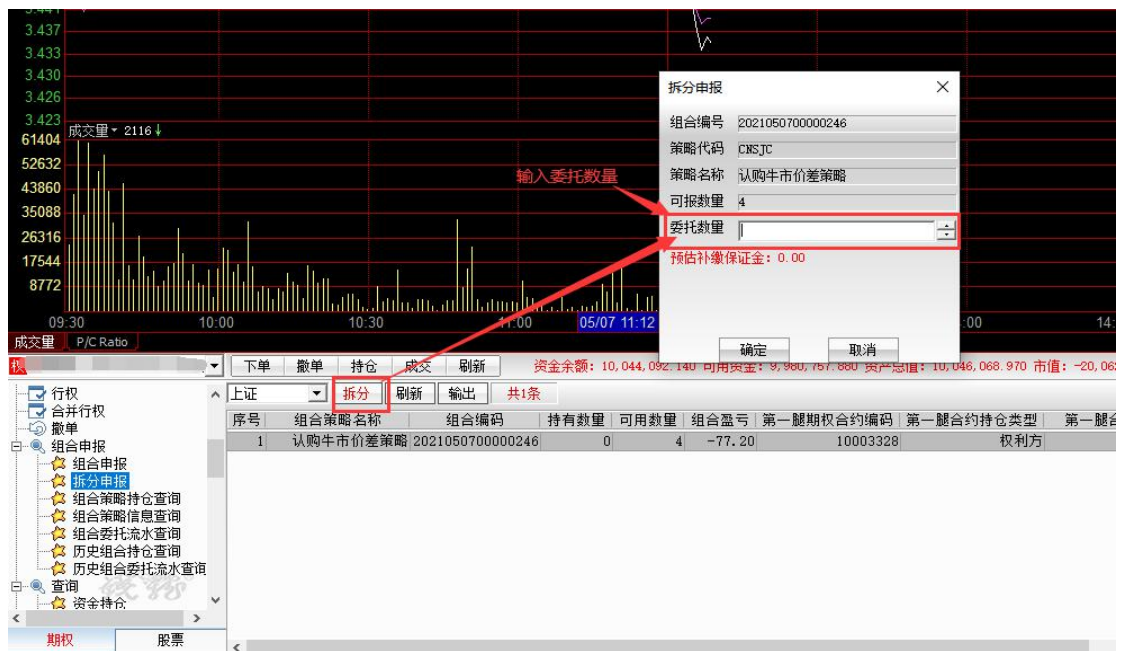
期权 股票



2. 拆分申报:

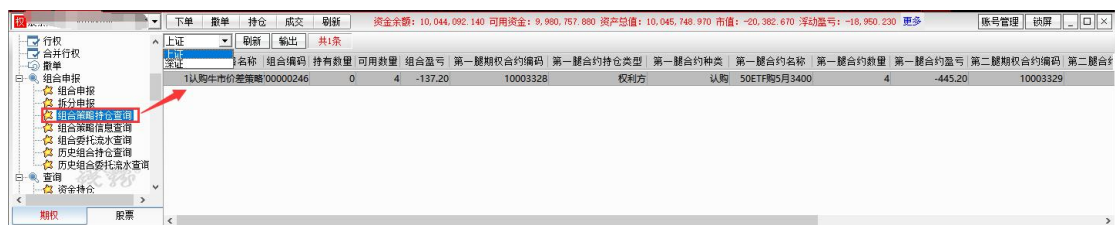
该菜单可以用来查询和解除组合策略。双击可拆分的组合策略，并选择不大于最大可解除组合的数量，提交拆分申报。如下图：





3. 组合策略持仓查询：

该菜单可以用来查询组合策略持仓的详细情况，包括策略名称、组合编码、持有数量、可用数量、回报组合数量、回报拆分数量、委托拆分数量、已用保证金、第一腿期权合约编码、第一腿期权持仓类型、第一腿合约种类、第一腿合约名称、第二腿期权合约编码、第二腿期权持仓类型、第二腿合约种类、第二腿合约名称等必要字段。如下图：



4. 组合策略信息查询：

该菜单可以用来查询交易所对组合策略的组合要求，包括组合策略编码、组合策略名称、到期日是否相同、标的证券是否相同、合约单位是否相同、成分合约个数、第一腿合约种类、第一腿合约行权价价格顺序、第一腿合约数量、第二腿期权持仓类型、第二腿合约种类、第二腿合约行权价价格顺序、第二腿合约数量等必要字段。如下图：



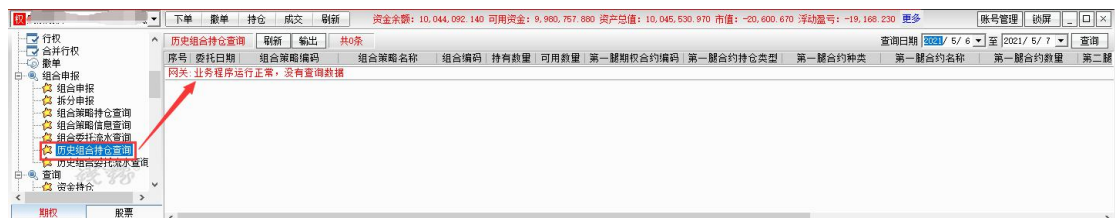
5. 组合策略流水查询：

该菜单可以用来查询当日组合策略的委托流水情况，内容包括委托日期、委托时间、组合策略编码、组合策略名称、操作类型、委托编号、委托数量、成交数量、第一腿期权合约编码、第一腿期权持仓类型、第一腿合约名称、第一腿合约数量、第二腿期权合约编码、第二腿期权持仓类型、第二腿合约名称、第二腿合约数量、委托状态、备注等必要字段。如下图所示：



6. 历史组合委托流水：

该菜单可以用来查询历史组合策略的委托流水情况，内容包括主要显示委托日期、委托时间、组合策略编码、组合策略名称、操作类型、委托编号、委托数量、成交数量、第一腿期权合约编码、第一腿期权持仓类型、第一腿合约名称、第一腿合约数量、第二腿期权合约编码、第二腿期权持仓类型、第二腿合约名称、第二腿合约数量、委托状态等必要字段。如下图所示：



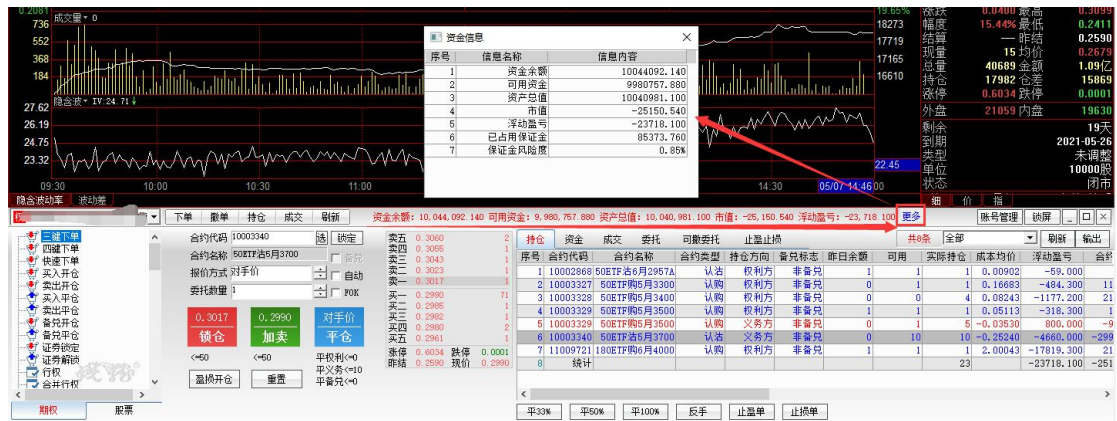
6.6 持仓及资金信息

1. 下单区域右侧分别有：持仓、资金、成交、委托、可撤委托、止盈止损栏；其中，持仓栏下方有快捷平仓按钮，如下图所示：



2. 资金信息查询

1) 方法一：

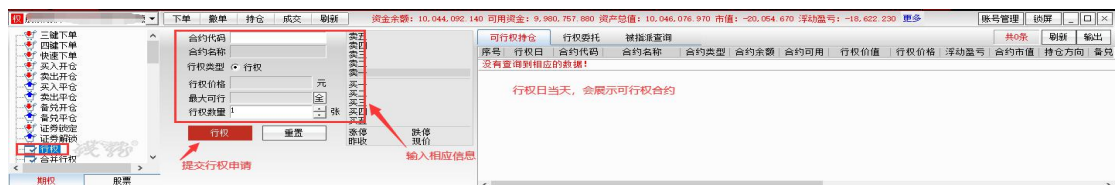


2) 方法二:

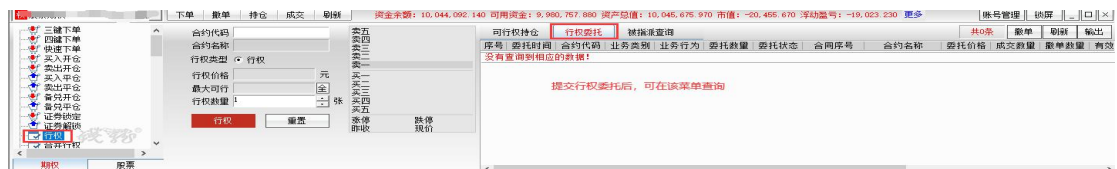


6.7 行权

1. 该菜单在行权日可以用于提交行权申请，在行权当日，“可行权持仓”栏内会展示可行权合约，其他时间该菜单无法操作。双击可行权合约或在下单栏内输入合约代码，选择不高于最大可行权数量，提交行权申请即可。 如下图：



在“行权委托”栏内可查看已提交的行权委托。行权日第二个交易日，通过“被指派查询”查看指派结果，如下图：



6.8 合并行权

1. 该菜单可以用于报送合并行权申请。如下图：



在“可行权持仓”内列出了所有的当月可行权权利仓，用户双击任何一个选中的权利仓，系统会帮助用户自动匹配符合交易所要求的可合并行权合约，用户在下方双击选中的合并行权合约，输入行权数量后点击“行权”提交合并行权委托，并可在“行权委托”栏查询合并行权结果。如下图：

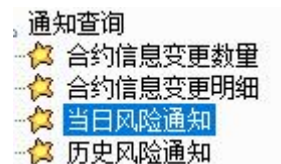


6.9 查询

1. 该菜单可以实现对资金持仓、策略持仓、策略委托、历史策略持仓、备兑股份、当日委托、当日成交、历史委托、历史成交、当日行权被指派、历史行权指派、历史行权被指派、历史对账单合约资产、对账单资金资产、对账单资金流水、期权合约、账号查询和历史交收明细项目等内容的查询。如下图：



2. 通过“通知查询”菜单可以实现对合约信息变更数量、合约信息变更明细、当日风险通知、历史风险通知项目等内容的查询。如下图：



6.10 银衍转账

1. 该菜单可以实现对银转衍、衍转银、银行资金查询、转账查询和历史转账查询等功能和查询。如下图：



6.11 修改密码

1. 该菜单可以实现修改交易密码。如下图：



6.12 账户管理和锁屏按钮

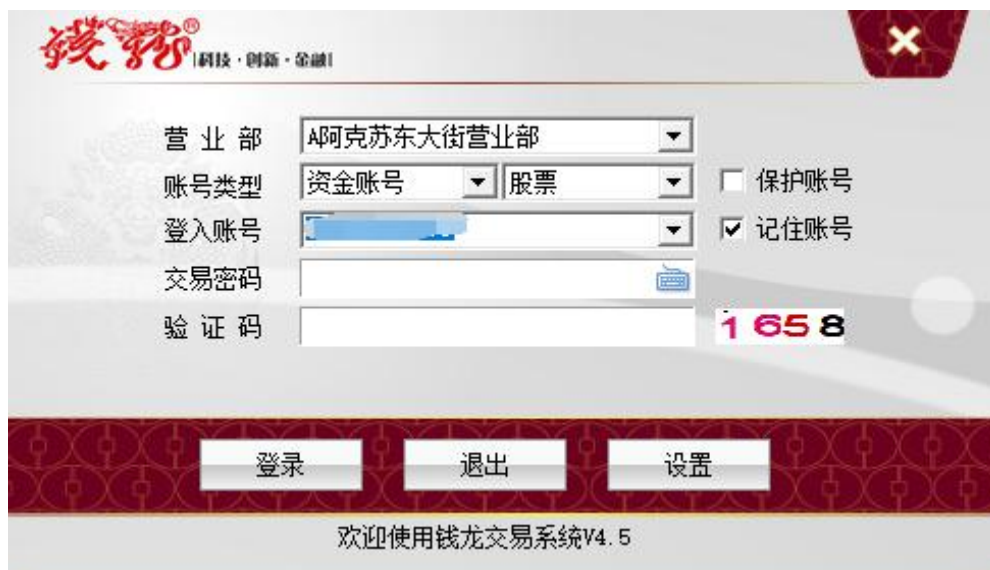
“账户管理”和“锁屏”位于【委托下单】模块的右上角，显示当前投资者操作账户的信息。如下图：





6.12.1 账户管理

点击“账号管理”，选中要登录的股票账户，点击“登入”，可以切换到股票账户的登录界面，如下图：



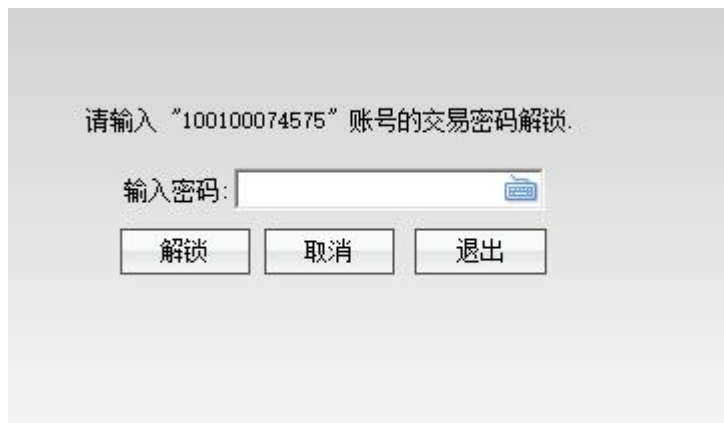
或者，在交易页面点击左下方“股票”按钮，也可以进入股票账户的登录页面，如下图：



6.12.2 锁屏

“锁屏”功能按钮位于账号管理的右侧，用于锁定委托下单模块。

1. 用户操作时直接点击“锁屏”，即可将委托下单界面锁定
2. 委托下单界面解锁有两种输入密码方式，即用户可通过软键盘输入密码或真实键盘敲击输入密码，按 ENTER 键即可解锁委托下单界面。



免责声明：本手册中的内容仅供参考，不构成任何投资建议。我们对本手册所涉及的内容力求准确和完整，但并不对其准确性和完整性做出任何保证，也不对任何因直接或间接使用本手册内容而造成的损失承担任何法律责任。在遵守中国有关法律与本声明的前提下，任何机构或个人可基于非商业目的的浏览或下载本手册的内容。未经书面许可，任何机构或个人不得以向他人出售牟利为目的，使用本手册的任何内容。