

## 交易所规则——自成交参数配置

我司系统防自成交的相关配置已移至管理平台中供您自行配置。

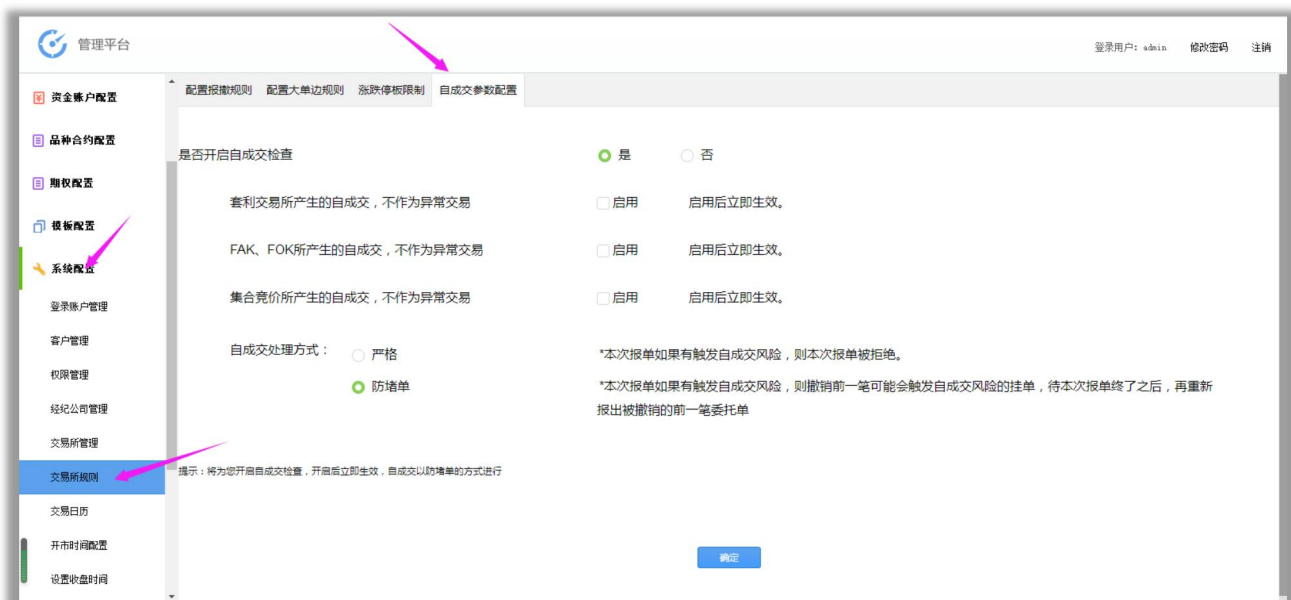
（后续我司系统的防自成交相关配置将以您在管理平台中的配置为准）

且系统新增支持配置将 **标准套利**、**FAK & FOK 指令**、**集合竞价自成交** 不判定为存在自成交风险。

新增的这三项均为手工配置生效（全局生效），否则系统会和升级前保持一致。标准套利之间和 fak、fok 指令的交易，系统将会判定存在自成交风险，会按照系统默认防自成交处理方案进行处理。集合竞价自成交会跟随后台配置。

如有需要,您可以通过管理平台 admin 账户在如下截图中进行相关配置修改。

（目前仅支持 admin 账户配置）



# 配置介绍

是否开启自成交检查

是

否

**是否开启自成交检查：**

该项为全局开启自成交配置，默认均为开启状态（选择“是”）。

如果选择“否”，所有交易时间系统都将不再对自成交进行判定，请谨慎选择。如需关闭，还请知悉关闭自成交后所带来的风险。

套利交易所产生的自成交，不作为异常交易

启用

启用后立即生效。

FAK、FOK所产生的自成交，不作为异常交易

启用

启用后立即生效。

**套利交易所产生的自成交，不作为异常交易：**

此项勾选后，交易所标准套利与标准套利之间所产生的自成交，系统将不会判定为自成交配置。

**FAK、FOK 所产生的自成交，不作为异常交易：**

此项勾选后，以 FAK、FOK 指令报单时所产生的自成交，系统将不会判定为自成交配置。

集合竞价所产生的自成交，不作为异常交易

启用

启用后立即生效。

**集合竞价所产生的自成交，不作为异常交易：**

此项勾选后，每个交易日的集合竞价期间在我司系统报单时，系统不会做任何自成交判定，只会在盘中交易时间判定是否存在自成交风险。

如上三项配置均为盘中实时生效。

但是请勿在系统初始化时间进行配置，避免因后台 server 在初始化，造成管理平台与 server 之间通讯不畅通，导致管理平台上的配置不起作用。

请避开以下时间：夜盘 20 点——20 点 40 分、早盘 8 点——8 点 40 分

自成交处理方式：

☐ 严格

☒ 防堵单

\*本次报单如果有触发自成交风险，则本次报单被拒绝。

\*本次报单如果有触发自成交风险，则撤销前一笔可能会触发自成交风险的挂单，待本次报单终了之后，再重新报出被撤销的前一笔委托单

### 自成交处理方式：

系统全局的自成交处理方案变更，目前我司系统有两种处理方案，具体方案的详细解释可以参考如下：

#### 严格 防止自成交处理方案

当多个交易员登陆各自的操作账户终端同时向一个资金账户发起报单的情况下，产生同一合约、方向相反、价格交叉时：后一笔报单会被拒绝，交易终端提示没有可用席位报单，风控终端提示自成交风险。

#### 防堵单 自成交处理方案

（前一笔挂单撤单，后一笔自成交报单先进场后挂回前一笔挂单）

当多个交易员登陆各自的操作账户终端同时向一个资金账户发起报单的情况下，产生同一合约、方向相反、价格交叉时：前一笔的挂单会被系统后台撤下，把后一笔报单先进场，等后一笔报单成交后，再把前一笔挂单挂回，此时交易终端不会提示撤单信息。