

交易所规则——自成交参数配置

目录

前言	2
第一章：配置介绍	2
1.是否开启自成交检查	3
2.套利交易所产生的自成交，不作为异常交易	4
3.FAK、FOK 所产生的自成交，不作为异常交易	4
4.FAK、FOK 造成自成交，不作为异常交易	4
5.集合竞价所产生的自成交，不作为异常交易	4
6.自成交处理方式	5
（1）严格 防止自成交处理方案	5
（2）防堵单 自成交处理方案	5
7.高级	5
第二章：实控组自成交配置	6
1. 建立账户实控组	6
2. 实控组自成交方案	7

前言

由于交易所规定，即一个法人名下关联账户，一个交易日内部不允许出现三次以上自成交，否则对该账户进行相关处罚甚至封停的情况。

交易所规则——自成交参数配置

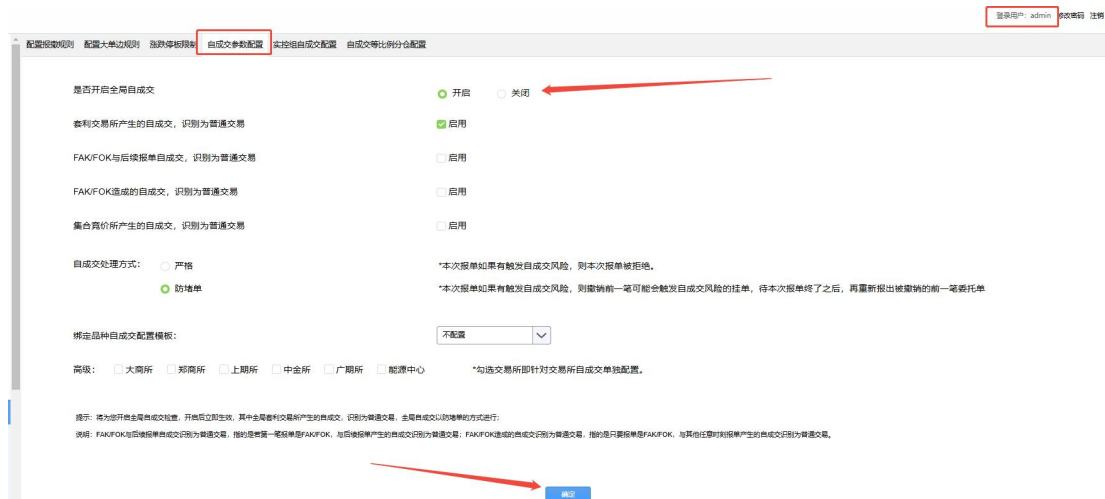
第一章：配置介绍

系统针对防自成交报单的处理系统是针对有相关配置项的，您可以在 **admin** 或具备对应的权限的账户下。（仅超户 **admin** 可以进行登录修改）

点击**系统配置**——选择**交易所规则配置**——**交易所规则**



点击自成交参数配置，可针对对应参数进行调整



下面正对对应配置项逐个进行下讲解：

1.是否开启自成交检查

是否开启全局自成交

☒ 开启 ☐ 关闭

此配置项默认均为开启状态（选择“开启”）。

如果选择“关闭”，则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。

2. 套利交易所产生的自成交，不作为异常交易

套利交易所产生的自成交，识别为普通交易

☒ 启用

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。

3. FAK、FOK 所产生的自成交，不作为异常交易

FAK/FOK与后续报单自成交，识别为普通交易

☒ 启用

此项勾选后，以 FAK、FOK 指令挂单状态下，与后续报单所产生的自成交风险，系统将不会判定为自成交配置。

4. FAK、FOK 造成自成交，不作为异常交易

FAK/FOK造成的自成交，识别为普通交易

☒ 启用

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

5. 集合竞价所产生的自成交，不作为异常交易

集合竞价所产生的自成交，识别为普通交易

☒ 启用

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

6.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：

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

（1）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。

（2）防堵单 自成交处理方案

系统对先前的反向挂单撤单，想允许后一笔自成交报单先进场，待成交后再挂回反向报单。资金账户层面存在，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，后续再有挂单，则每次都将反向报单撤销，同向挂单挂回。此时交易终端不会提示撤单信息。

7.高级

该配置项可以 可针对不同交易所单独设置自成交单配置，由于各家交易所对于自成交防范要求略有差异，为保证正常且稳定的交易，融航系统可独立针对不同交易所进行自成交方案配置，以此提供客户更全面的交易。

高级：☐ 大商所 ☒ 郑商所 ☐ 上期所 ☐ 中金所 ☐ 广期所 ☐ 能源中心

*勾选交易所即针对交易所自成交单独配置。

郑商所

是否开启交易所自成交☒ 开启 ☐ 关闭

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

套利交易所产生的自成交，识别为普通交易☒ 启用

FAK/FOK与后续报单自成交，识别为普通交易☐ 启用

FAK/FOK造成的自成交，识别为普通交易☐ 启用

集合竞价所产生的自成交，识别为普通交易☐ 启用

自定义自成交次数：单日允许郑商所单合约 次自成交。达到后，开启自成交保护。

提示：将开启自全局自成交配置，开启后立即生效。其中全局套利交易、FAK/FOK与后续报单、FAK/FOK、集合竞价所产生的自成交，识别为普通交易；全局自成交以防堵单的方式进行；郑商所套利交易所产生的自成交，识别为普通交易；自成交以严格的方式进行；

说明：FAK/FOK与后续报单自成交识别为普通交易，指的是将前一笔报单是FAK/FOK，与后续报单产生的自成交识别为普通交易；FAK/FOK造成的自成交识别为普通交易，指的是只要报单是FAK/FOK，与其他任意时刻报单产生的自成交识别为普通交易。

确定

第二章：实控组自成交配置

上述第一章节配置是针对全局层面，所有账户生效。目前融航系统也可以通过实控组在对关联资金账户进行独立配置。

1. 建立账户实控组

对需要设置为实控组的资金账户设置相同的**账户编码**，具体配置如下：
点击**资金账户配置——资金账户管理**





找到刚才设置了相同账户编码的资金账户（例如：fyqzj，fyqstzj），点击自定义

资金账户	交易所	规则类型
hczcj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
jhhzj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
FA	郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
dzcszj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
zmlscszj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
fyqzj、fyqstzj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
hyqstzj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
simzj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
swzftzj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
ys9753	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局
anlzj	中金所、郑商所、大商所、广期所、能源中心、上期所	<input type="radio"/> 自定义 <input checked="" type="radio"/> 跟随全局

点击自定义后可看到针对该两个资金账户可以独立进行配置自成交规则并且独立优先于全局

实控组自成交配置

是否开启全局自成交

☒ 开启 ☐ 关闭

套利交易所产生的自成交，识别为普通交易

☐ 启用

FAK/FOK与后续报单自成交，识别为普通交易

☐ 启用

FAK/FOK造成的自成交，识别为普通交易

☐ 启用

集合竞价所产生的自成交，识别为普通交易

☐ 启用

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。

绑定品种自成交配置模板：

不配置

高级：☐ 大商所 ☐ 郑商所 ☐ 上期所 ☐ 中金所 ☐ 广期所 ☐ 能源中心

*勾选交易所即针对交易所自成交单独配置。

设置完对应的自成交参数配置后，点击确定即实控组配置完成。

