

第一节、交易所规则配置

为了响应交易所层面实行的各项规则，在我们系统中，您可以对交易所规则进行一定的提前量设定以达到提前预警的效果，避免由于触发交易所层面的规则。

在采用首先您可以使用超级账户管理员登录管理平台，在系统配置中的交易所规则配置项中对相应规则进行配置



目前您可以在我们平台上在配置报撤规则和配置大单边中配置报撤、大单边规则的约束条件。



接下来，我们就两种规则的配置项逐一进行介绍

一、配置报撤规则

在配置报撤规则中，您可以针对郑商所、大商所、上期所、中金所及能源交易所五个

交易所分别进行报撤规则的配置

您可以进行**大额报撤限制**和**频繁报撤限制**的设定

郑商所

大额报撤限制

交易所：郑州商品交易所

采用限制方式：

☐ 使用撤单绝对值方式限制大额报撤

单笔撤单手数：

☐ 使用单笔报单中撤单量百分比方式限制大额报撤

单笔撤单手数：

单笔撤单百分比：%

触发大额报撤阈值后可报撤次数上限：

大额报撤阈值提醒预警线：%

频繁报撤限制

频繁报撤阈值次数：

频繁报撤阈值提醒预警线：%

1. 大额报撤限制

首先您需要**选择采用限制方式中对大额撤单的界定条件**。

您可以勾选**使用撤单绝对值方式限制大额报撤**和**使用单笔报单中撤单量百分比方式限制大额报撤**两种界定方式，并填入对应界定阈值

采用限制方式：

☐ 使用撤单绝对值方式限制大额报撤

单笔撤单手数：

☐ 使用单笔报单中撤单量百分比方式限制大额报撤

单笔撤单手数：

单笔撤单百分比：%

下面我们对两种界定方式的配置方式进行一下介绍：

使用撤单绝对值方式限制大额报撤：选择该配置后，系统会根据下方**单笔撤单手数**中设置的阈值来界定大额撤单，当撤单数量大于或等于阈值时，即判定为触发大额报撤阈值。当达到后续所设定的**触发大额报撤阈值后可报撤次数上限**后即会判定该账户后续将无法进行大额报撤操作。

使用单笔报单中撤单量百分比方式限制大额报撤：该配置是由**两个界定条件**组成的，当您**单笔报单手数大于或等于单笔报单手数**中设置的阈值，且**该笔报单的撤单手数占报单手数的百分比达到单笔撤单百分比**中设置的百分比阈值时，即判定为触发大额报撤阈值。同样当达到后续所设定的**触发大额报撤阈值后可报撤次数上限**后即会判定该账户后续将无法进行大额报撤操作。

这里需要特别说明的是**若您无需对单笔报单手数**阈值进行约束，您可直接填写为**0**，此时系统会根据**该合约最大报数量**作为界定阈值进行界定。

如图中示例：

当撤单手数达到 400 手，即视为大额报撤。

☒ 使用撤单绝对值方式限制大额报撤

单笔撤单手数：

当单笔报单数量达到 600 手，且该笔报单撤单手数占报单手数的百分之 50 或以上时即视为大额撤单。

☒ 使用单笔报单中撤单量百分比方式限制大额报撤

单笔撤单手数：

单笔撤单百分比：

%

在设置完大额撤单的界定条件后，您可以对**触发大额报撤阈值后可报撤次数上限**及**大额报撤阈值提醒预警线**进行设置。

触发大额报撤阈值后可报撤次数上限：即指**大额报撤的触发次数上限**。如果在一个交易日内资金账户触发大额报撤的次数达到上限时，那么该账户在当日就无法向对应交易所进行大额报操作。

大额报撤阈值提醒预警线：该配置主要用作于在**临近触发次数上限前**，系统会**向风控端推送对应预警提示信息**。

如图中示例：

当一个交易日内资金账户大额撤单次数达到 20 次时，即该账户当日无法向对应交易所进行大额报单，当次数达到 $20 \times 80\% = 18$ 次时，风控端异常提示信息面板会向您提示该资金账户即将达到大额报撤上限。

触发大额报撤阈值后可报撤次数上限：

大额报撤阈值提醒预警线：

%

2. 频繁报撤限制

频繁报撤限制即指在一个交易日内资金账户撤单次数撤单次数达到您所设置的**频繁报撤阈值次数**时，系统就认为该账户触发频发报撤，**达到频繁报撤次数后**，账户无法向对应交易所进行任何报单。

同样在频繁报撤规则中，您也可以设置**频繁报撤阈值提醒预警线**，在达到频繁报撤前**向风控端推送对应预警提示信息**，以达到警示作用。

频繁报撤限制

频繁报撤阈值次数：

频繁报撤阈值提醒预警线：

%

二、配置大单边规则

由于在操作账户层面**默认会对上期所和中金所持仓进行大单边优惠规则的认定**，但在交割月前交割月会取消对应品种的大单边认定，恢复保证金双边收取。

据了解，上期所和中金所针对交割合约的大单边优惠规则进行认定时，有存在特殊的认定规则，且不同的交易所，认定规则也存在一定差异，故您可以在该配置中参照目前的交易所规则进行配置，以确保操作账户与资金账户体现的规则一致。

如下图所示，您可以对上期所和中金所分别进行设置，

上海期货交易所

- ☐ 最后交易日前第 个交易日收盘后,交割月合约不计算大单边
☐ 交割月合约不计算大单边
☐ 计算大单边

中国金融交易所

- ☐ 最后交易日前第 个交易日收盘后,交割月合约不计算大单边
☐ 交割月合约不计算大单边
☐ 计算大单边

在认定规则配置中，有三种认定规则供您进行选择，您只需要勾选对应规则即表示对其进行采用

下面我们就三种规则分别进行介绍

1. **最后交易日前第 X 个交易日收盘后，交割月合约不计算单边**：您可以设置在交割日前的某一天收盘开始对即将交割的合约持仓进行大单边优惠规则取消。

如图中所示，当持仓在交割日前第 5 个交易日收盘后，系统会自动解除对该持仓的大单边优惠认定，并收取对应的保证金。

☒ 最后交易日前第 个交易日收盘后,交割月合约不计算大单边

2. **交割月合约不计算大单边**：该规则指当持仓进入交割月时，系统会自动解除对该持仓的大单边优惠认定，并收取对应的保证金。

☒ 交割月合约不计算大单边

3. **计算大单边**：该规则即指交割持仓的大单边规则不会进行任何处理，该持仓会依旧保持大单边规则直至该持仓被进行交割

☒ 计算大单边