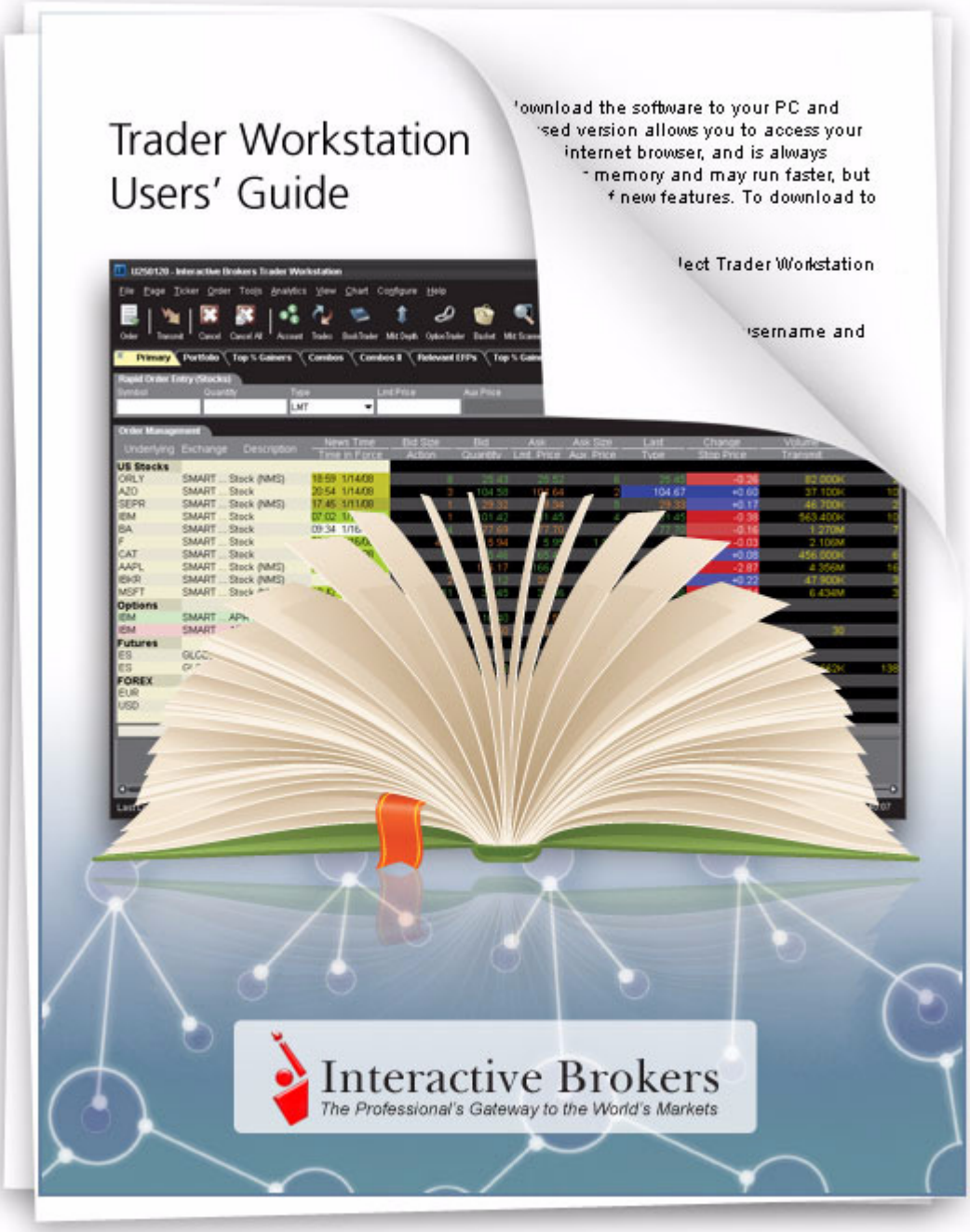

Trader Workstation
Users' Guide
Interactive Brokers
The Professional's Gateway to the World's Markets

交易平台用户指南

© 2008 年盈透证券有限责任公司。所有权利保留。

Sun、Sun Microsystems、Sun 标识和 Java 是 Sun Microsystems 公司在美国和其它国家的商标或注册商标。Excel、Windows 和 Visual Basic （VB）是微软公司在美国和 / 或其它国家的商标或注册商标。2009 年 2 月交易平台 892 版本 Javahelp。

在这些页面内显示的任何代码只用于说明目的，不旨在作出任何推荐。

内容

1 入门 1

登录交易平台 2
添加市场数据 4
在代码模式下添加市场数据 6
使用快速数据 7
从文件中导入代码 8
创建定单 10
修改定单 11
传递定单 12
取消定单 14
使用定单向导 16
使定单失效 17
交易债券和国库券 18
交易共同基金 21

2 定单输入工具 23

发送篮子定单 25
在交易平台中创建篮子文件 27
手动创建篮子文件 29
关于创建篮子文件的注释: 29
篮子区域 30
样本 Excel 篮子文件 33
指数交易者 34
打开在册交易者 36
使用在册交易者进行交易 38
在册交易者默认点击行动 39
在册交易者定单处理 40
在册交易者热键 42
在册交易者按钮 45
定单类型选择按钮 45
基本按钮面板 45
深层在册按钮 46

在册交易者颜色 47
市场数据颜色 47
价格区域 — 背景颜色 47
打开图表交易者 50
创建并传递定单 51
关于组合定单 53
创建组合定单 56
关于使用期货边的注释 57
使用组合交易者 58
多个组合 58
单个组合 59
一般组合 60
传递组合定单 63
组合定单注释 64
集成市场深度窗口 66
市场深度按钮面板 68
从市场深度窗口创建定单 69
外汇交易者窗口 72
外汇交易者交易单元格 74
报价面板 76
在册数据面板 77
定单输入面板 （OEP） 79
自动定单 80
ISW 定单输入子面板 81
ISW 按钮面板 83
使用期权交易者 85
创建期权链 87
期权交易者统计数据 88
创建 / 编辑工具栏按钮 90
对美国期权的美分定价 92
要在 IB 系统中显示美分期权定单，您必须理解并同意： 92
美分定价的期权扫描仪页面 94
基本 96
可调整定单 99
分段定单 101
挂钩定单 104

波动率交易 106
条件 108
杂项 110
决定定单数量 114
计算定单数量 116
使用快速定单输入来输入定单 119
制表键次序 119
更新限价 120
创建 “立刻传递”热键 121
相关期货转现货 122
使用差价交易者创建期货差价 124
报价面板中的背景颜色 126
EFP 期货差价 127
在差价交易者中创建期权差价 128
您在看什么？ 129
关于分段交易者 131
分段交易者获利定单 133
关于获利定单的注释 134
查看分段进程 135
分段进程框 135
分段定单举例 137
例 1：基本分段定单 137
例 2：带有获利回吐定单的分段定单 137
例 3：带有获利回吐定单和恢复尺寸说明的分段定单 137
例 4：重启分段交易者 138
例 5：重启带有已执行的初始组成部分尺寸的分段交易者 138
合并套利组合 — 举例 140

3 定单类型 143

限价 145
市价 146
止损 147
限价止损 148
触及限价 149
触及市价 150
收盘限价 151

收盘市价 152
有保护的市价 153
国际证券交易所中点匹配 154
市价转限价 155
挂钩股票 156
挂钩市场 158
挂钩中点 159
盒顶 160
价格改善竞价 161
相对 / 挂钩首要 163
追踪止损 165
追踪限价止损 166
交易量加权平均价格 167
自动追踪止损 169
括号 170
波动率交易 173
对波动率定单的动态管理 175
定单的有效时间 177
到时后有效 179
全数执行或立刻取消 181
竞价 182
开盘市价 183
开盘限价 184
隐藏 186
全权委托 187
冰山 / 保留 188
全或无 （AON） 189
最低数量 190
大额 191
一扫光 192
一取消全 （OCA） 193

4 算法 195

入门 197
定义算法 199
基本算法举例 202

定义算法条件 203
创建多个算法定单 205
积累 / 分配小结 205
传递和修改算法 207
监控定单进程 208
入门 210
定义查询 212
限制查询结果 214
评估解决方案 215
创建 IB 算法定单 217
到达价格 218
交易量百分比策略 219
交易量加权平均价格 220
时间加权平均价格 221
最小化影响 （对期权） 222
平衡影响和风险 （对期权） 223
Crossfinder 225
Float 226
Guerrilla 227
Pathfinder 228
Reserve 229
Strike 230
Tex 231
时间加权平均价格 232
交易量加权平均价格 233
Work It 234
Work It IW 235
10B 18 236
回购 238
Post 239
Seek 240
Strike 241
时间加权平均价格 242
交易量参与 243
交易量加权平均价格 244

5 交易窗口 245

添加交易页面 246
编辑交易页面 247
在交易页面上删除行 248
恢复和保存页面设置 249
将设置保存到 IB 服务器 249
整理页面上的数据 250
客户化数据显示 250
在交易窗口中创建标题行 251
使用功能搜索 252
创建交易平台窗口组 255
举例 255
启用快速股票输入 257
在您能够使用快速股票输入功能之前，您必须： 257
编辑股息安排 259
价格和尺寸向导 261

6 实时活动监控 265

查看账户余额 269
实时保证金监控 271
监控保证金要求 271
尝试投资组合保证金 272
软边缘保证金设定 272
查看可用于交易的价值 274
查看市场价值 276
查看外汇投资组合价值 277
查看投资组合价值 279
右键点击投资组合菜单 280
菜单 282
交易标签 284
导出交易报告 285
交易小结 287
利润和损失 289
待处理的定单页面 290
待处理的定单 — 过滤和分类 291
再平衡窗口 293

导入和导出头寸 294
交易者控制板 297
布告栏和系统状态 299
审计追踪 300
使用智能路径 SM 的期权的最优价格 301
文本颜色 303
市场数据线背景颜色 304
定单管理行背景颜色 305
定单状态颜色 306
设定时间警报 308
警报持续时间 309
设定价格警报 310
警报持续时间 311
设定保证金警报 312
保证金警报 312
警报持续时间 313
设定交易量警报 314
警报持续时间 315
设定基于执行的警报 316
警报持续时间 317
将行动分配给警报 318
将消息行动分配给警报 318
将定单行动分配给警报 319
将声音行动分配给警报 320
警报持续时间 321
将声音分配给事件 321
更改事件的通知声音 322
设定价格移动警钟 324
设定交易量变化激活警钟 326

7 价格 / 风险分析 329

打开 IB 风险漫游 331
使用报告查看器 333
使用报告选择器 335
投资组合相对损益图表 337
创建如果怎样投资组合 339

投资组合报告 342
根据头寸的风险报告 344
根据底层证券的风险报告 346
根据行业的风险报告 348
根据底层证券和到期日的测量 350
根据价格变化和波动率变化的测量 352
市场情形钻取 353
投资组合统计报告 355
风险价值报告 356
报告中的希腊字母集合 358
报告指标 360
期权分析窗口 363
使用模型导航 366
合约描述窗格 368
波动率模型窗格 369
编辑波动率图像 370
修改图表显示设置 373
波动率曲线表格 375
编辑利率 376
编辑股息 378
模型价格颜色键 380

8 基本分析 383

合约描述中的路透社数据 385
路透社基本页面 386
基本报告 386
将路透社区域添加到交易窗口 388
盈余估计 390
公司简介 391
新闻和评论 392
历史图表 393
公司财务报表 394
内部交易信息 395
分析师信息 396
证券交易委员会档案 397

9 技术分析 401

创建实时图表 403
要显示的补充数据 405
图表时间选项 405
为多个资产绘制图表 406
添加新图表至现有的图表窗口 408
将图表版式保存为模板 410
为到期的合约绘制图表 412
图表工具栏 414
编辑图表 418
图表显示 420
图表计算 422
自动拟合合并的图表 423
图表交易者 426
创建条形图 428
创建线形图 429
创建烛形图 430
时间和销售数据 431
查看历史图表 432
应用斐波纳契趋势线 433
应用 ADX/DMI 指标 436
应用积累 / 分配线 438
应用平均真实极差指标 439
应用蔡金资金流摆动指标 440
应用商品通道指标 （CCI） 441
应用肯特纳通道指标 442
应用动量指标 444
应用资金流指数研究 445
应用 MACD 指标 446
应用能量潮指标 447
应用变动率指标 448
应用相对强弱指标 449
应用随机摆动指标 450
应用终极摆动指标 451
应用威廉姆斯摆动指标 452
应用保力加通道指标 453

应用轨道线指标 455
应用指数滑动平均指标 456
应用抛物转向系统指标 457
支点 458
应用简单滑动平均指标 459
应用加权滑动平均指标 460
创建市场扫描仪 462
市场扫描仪类型 464

10 配置交易平台 469

使用全局配置 471
一般配置 473
一般 473
浏览器 474
语言 474
表格编辑 474
定单向导 474
分配热键 475
分配鼠标快捷方式 479
客户化热键 480
显示交易平台消息 481
配置波动率和分析设定 482
配置智能传递指令 484
被排除的交易所 485
被排除的报价 485
传递选项 485
将声音分配给事件 487
快速股票输入交易所配置 489
启用 API 连接 490
一般 490
受信任的 IP 地址 491
配置自动导出 492
eSignal 市场数据. 494
连接性 494
市场数据 495
配置锁定和退出参数 496

锁定交易平台 496
退出选项 497
显示设定 499
配置风格设定 501
代码行设定 503
已实现的损益栏 504
工具栏配置 505
积累 / 分配 508
配置篮子交易者 509
配置在册交易者 510
配置外汇交易者 514
设置页面 515
配置 ISW 516
设定 517
配置期权投资组合 520
配置期权交易者 521
设定 521
配置投资组合窗口 523
配置再平衡窗口 524
配置差价交易者 526
设定页面 527
配置交易窗口 528
配置按钮面板 528
显示定单 — 关于如何处理定单显示的页面水平指示 530
页面版式 531
配置新闻播报 533
配置市场深度 535
设定 535
配置图表 537
设定 538
时间和销售 540
交易者控制板 541
重命名控制板区域标签 542
配置警报 543
设定 543
创建页面版式 546

应用页面版式 548
编辑页面版式 550
显示市场数据栏 552
配置栏 555
显示定单管理栏 556
重新安排交易页面栏 558
更改背景和文本颜色 559
修改快速定单输入设定 561
快速定单输入设定 561
市场数据栏 564
定单管理栏 572
打开功能选择器 579
通过菜单启用功能 581
定单 — 默认设定 583
创建定单预设 586
设置 588
默认定单尺寸 589
默认定单抵消金额 590
目标分段定单 590
预防设置 591
OCA （一取消全）组 592
显示设置 593
附加定单 593
从交易窗口中使用预设 598
修改默认抵消金额 600
修改止损触发方式 601
管理工作空间 604
报价面板 605
定单面板 606
日志面板 607
交易面板 608
投资组合面板 609

11 菜单 611

文件菜单 612
页面菜单 614

代码菜单 616
定单菜单 618
交易菜单 621
信息菜单 623
分析菜单 625
视图菜单 626
图表菜单 628
配置菜单 629
帮助菜单 630
在空白行上点击右键 632
在市场数据线上点击右键 633
在定单管理行上点击右键 634

12 执行和再投资 637

自动期货再投资 638
执行期权 — 手动文件 640
执行期权 641

13 交易前分配 643

为多个客户创建定单 644
分配股票 646
顾问的再平衡 647
为股票分配创建账户组 649
创建股票分配方式 652
编辑股票分配方式 654
创建账户化名 655
设置默认分配 656

14 转移 659

IB 执行服务 660
从定单行进入 IB 执行服务 662
创建 DVP/RVP 说明 663
卖空确认 664
使用 DVP/RVP 转移头寸 666

1

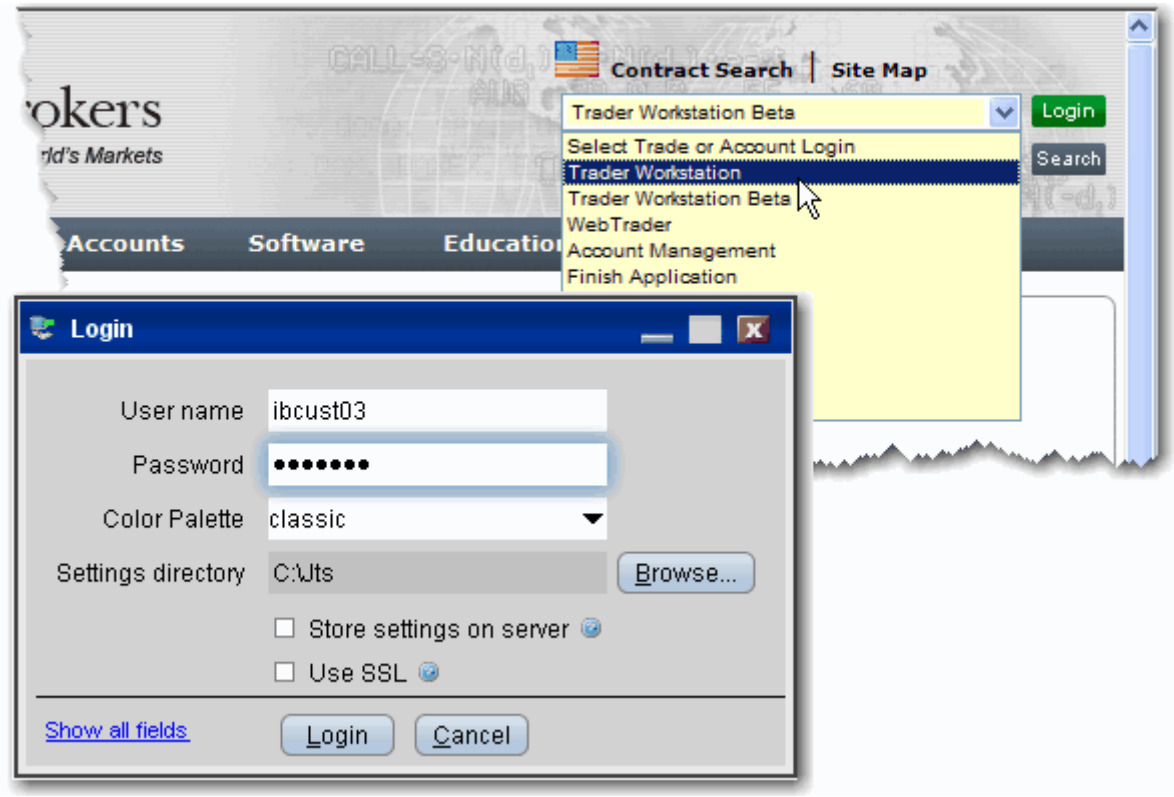
入门

该部分提供了您开始使用交易平台所需要的基本信息，包括如何：

- 登录交易平台
- 添加市场数据
- 在代码模式下添加市场数据
- 使用快速数据
- 从文件中导入代码
- 创建定单
- 修改定单
- 传递定单
- 取消定单
- 使用定单向导
- 使定单失效
- 交易债券和国库券
- 交易共同基金

登录交易平台

您能够从您的 Internet 浏览器运行交易平台，或者将软件下载到您的计算机上并直接从桌面启动。基于浏览器的版本允许您进入您的账户，并从任何启用了 Java ™的 internet 浏览器执行交易，它总是运行最新的发布，并允许您将您的设置从主机器保存到服务器上，这样它们将下载到任何机器，无论您使用什么 internet 机器登录，您的交易平台看上去都将是完全一样的。本地安装的版本使用较少的内存，可能运行得更快，但要求您下载每个发布以利用新功能。要下载到您的计算机，参见网站上的安装说明。



从您的浏览器登录

1 在主页右上角的登录框中，从下拉列表中选择*交易平台*。

Note: 如果您是初次使用者，选择账户管理，输入您的用户名和密码，然后点击登录。

2 在登录框中，输入您的用户名和密码。

选项：

- 调色板允许您为交易平台选择新的颜色皮肤。如果您选定了一个颜色并想在一登录时就更改它，使用**全局配置**中的风格页面。
- 设定文件目录 — 默认情况下，交易平台文件被保存在 C:\Jts。如果您想要更改您的交易平台设置文件的位置，使用浏览器按钮来指定新的文件目录。
- 在服务器上保存设置 — 该选项允许您将包括市场数据、页面等在内的交易平台设置，保存在我们的服务器而不是您的本地机器上。如果选中，不管您在什么位置登录，您的交易平台都将

有相同的数据和外观。如果未选中，设置将只被保存在您当前使用的计算机上。在恢复和保存设置话题中查看细节。

- 使用 SSL — 您的身份和交易信息一直都受到保护。对*使用 SSL* 选项打勾，能够在您的定单信息沿因特网传输时对其提供额外的隐私和完整性。根据计算机的性能，您有可能受到不理想表现的影响。
- 点击显示所有设置来为交易平台选择不同的语言。

从您的桌面登录

1. 在您的桌面双击应用程序图标。
2. 输入您的用户名和密码。
3. 如果您被提示安装免费的 Java™ Runtime 插件，参见 Java ™插件安装文档。

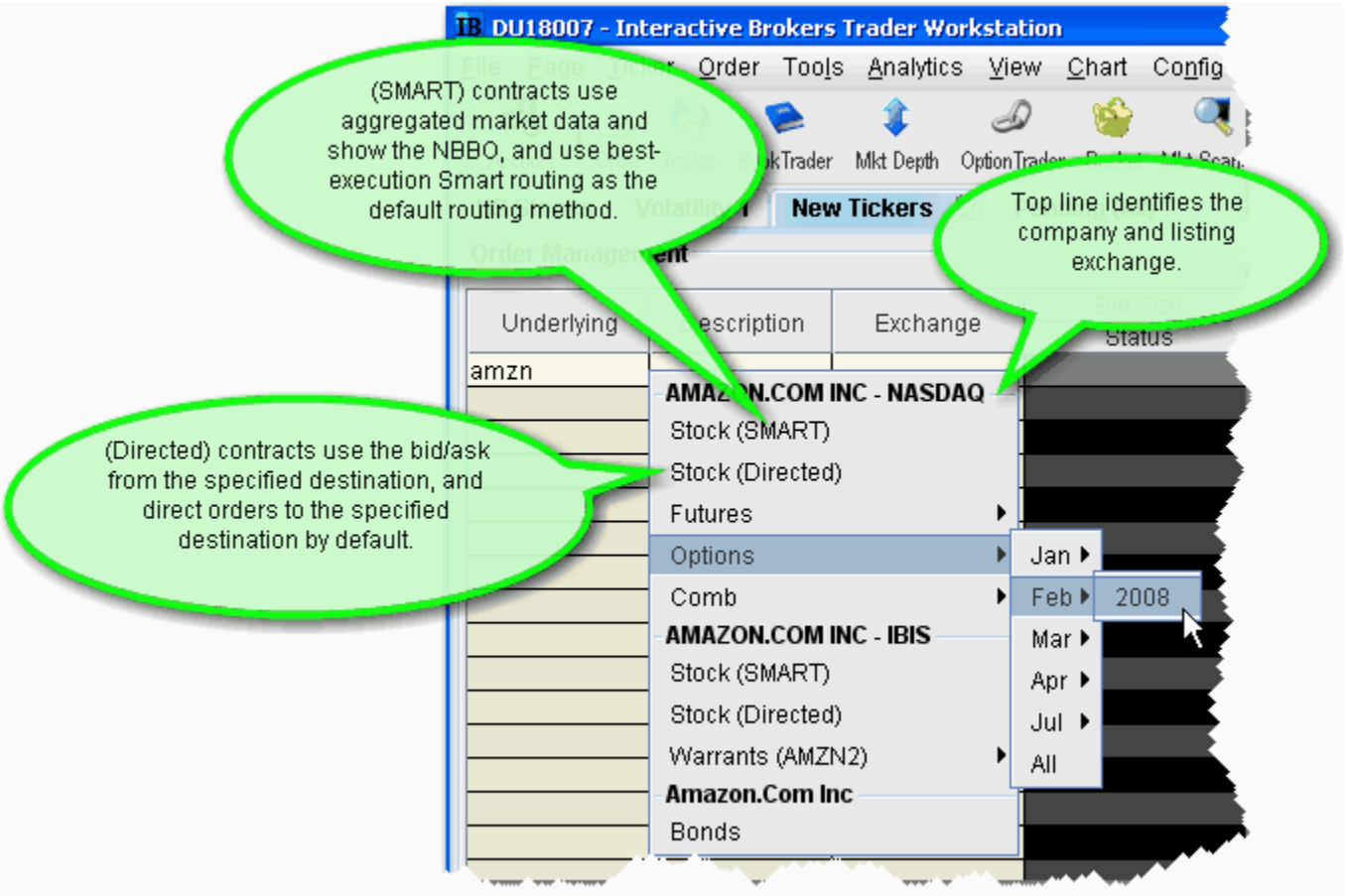
添加市场数据

在您能够交易之前，您需要为您的资产添加市场数据线。一条市场数据线代表了一个单独的代码，它显示产品类型、定单目的地、买卖报价以及其他定义的属性。 要添加市场数据线，您能够在交易屏幕的底层证券栏直接键入，或者根据底层证券框使用请求代码。

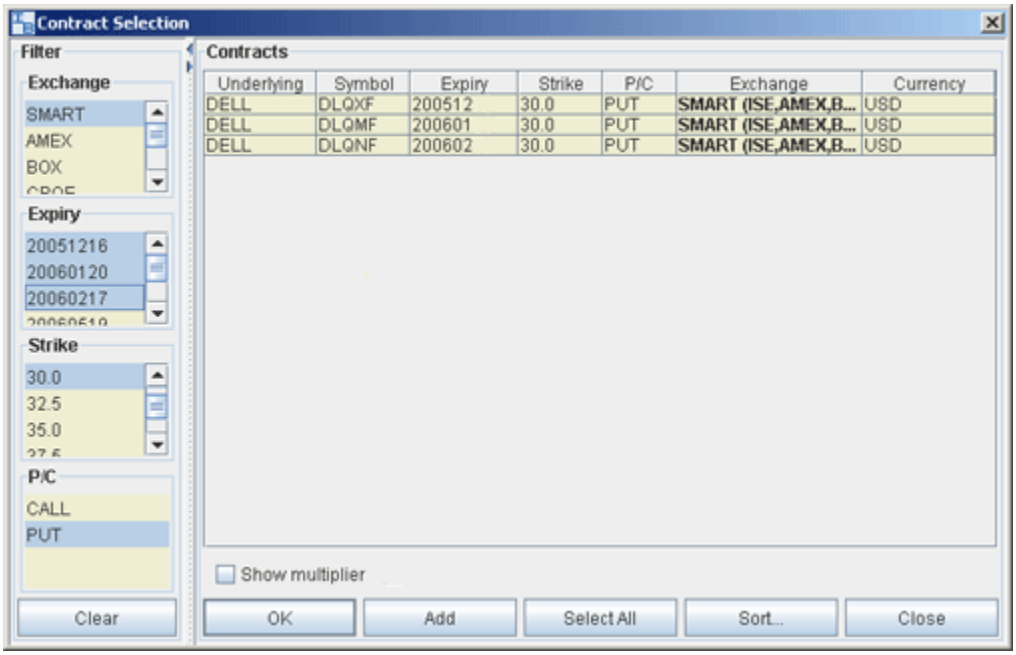
Note: 高级 / 期权交易者能够通过输入交易所合约类别或合约代码来添加安全定义。

将市场数据添加到交易屏幕

1. 在空白行中点击*底层证券*区域。
2. 输入一个底层证券代码并按下**回车**。
3. 从交易屏幕的列表中选择合约。对要求到期日的工具，选择月份和年，或者选择*全部*来打开合约选择框。注意重要的一点，在这一步选择*智能或直接*会同时影响市场数据和默认定单传递，解释如下图所示。您能够使用*目的地*定单区域，在每份定单基础上修改传递目的地。



4 在**合约选择**框中，选择合约并点击确定。您能够通过从过滤器部分选择标准，来限定右侧窗格中显示的合约。选择智能作为交易所，从而使用智能传递。



- 市场数据线在可见时即为活动的，无论它们来自何处。
- 每个警报总是使用一条市场数据线，无论您是否在查看包含该警报的资产。
- 通过 API 请求的市场数据拥有最高的优先级，之后是用警报请求的数据，最后是基本的市场数据显示。这意味着如果您在查看包含 100 条市场数据线的交易页面，并且您还对 6 份其他合约设定了价格激活的警报，那 6 份合约将收到市场数据，您的交易页面将只显示 94 份合约的数据。
- 期权交易者上的期权链不计入可用的市场数据线。

要获取关于市场数据费用和分配规则的细节，参见 IB 网站上的市场数据和新闻订阅总括。

根据底层证券框使用请求代码来添加一个资产

1 在交易工具栏中点击**添加代码**图标，或者从**代码**菜单中选择*添加代码*。

2 输入一个代码并遵照上面的第 2 步。

Note: 如果您要对衍生工具添加市场数据线，交易平台将询问您是否想要将底层代码添加到页面中。如果您回答是，那么它将被包括在页面的底部如果它还没有被添加到那里。

在代码模式下添加市场数据

高级期权交易者能够使用代码模式，将期权的证券定义直接输入到市场数据线中。代码模式要求您输入由合约交易的交易所定义的合约代码或类别。要更改为代码模式，在配置菜单上选择视图，然后选择合约显示。通过使用页面版式添加市场数据代码栏，同时查看底层证券和合约代码。

将期权证券定义直接添加到交易屏幕

1 在**代码**栏中点击一个空白行。

2 根据合约类别或合约代码输入证券定义，然后按下**回车**。使用下表中的格式。

代码输入格式		
合约类别	@	交易所首字母缩略词
合约代码	#	交易所首字母缩略词

使用请求代码表格来添加证券定义

1 在代码模式下，使用以下方法当中的一种来打开根据交易所代码请求代码表格：

- 在交易工具栏上点击**代码**图标。
- 在代码菜单上选择添加代码。
- 在交易屏幕上的任何位置右键点击并选择**插入代码**。

2 在工具类型区域选择期权。

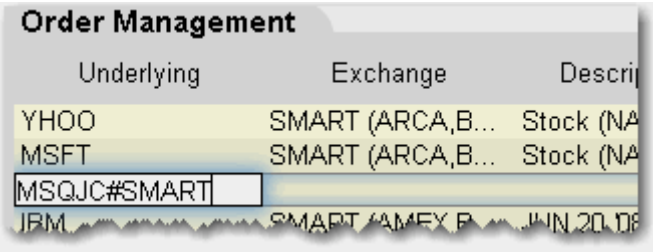
3 选择代码类型。

如果您选择	这么做
类别	输入合约类别代码、交易所、到期日期和执行价格，然后选择该权利。
合约	输入交易所本地代码和交易所。

Note: 如果您要对衍生工具添加市场数据线，交易平台将询问您是否想要将底层代码添加到页面中。如果您回答是，那么它将被包括在页面的底部 （除非该底层证券已经在页面上）。

使用快速数据

您能够使用市场数据速记，对股票、期权或期货合约快速地请求数据。



对股票使用快速数据

- 在底层证券区域使用格式*代码* ***垂直线*** *交易所*，如下所示：
  IBM|SMART 或 DELL|ISLAND。

Note: 对在纳斯达克挂牌的合约，使用 ISLAND 作为目的地。

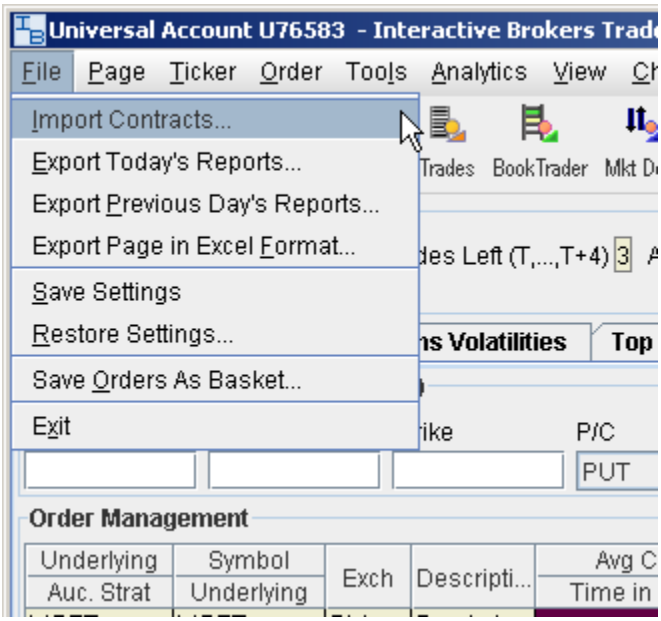
对期权和期货使用快速数据

- 使用格式*交易所代码* ***井号*** *交易所*，在底层证券区域输入速记，如下所示：
  MSQJC#SMART （期权）或

  MSFT1CU8#ONE （期货）

从文件中导入代码

您现在能够通过导入一个文本文件，该文件包含了以逗号划分界线的代码描述列表，从而把市场数据放在交易页面上。使用任何文字处理程序来创建列表，并以文件扩展名 .txt 保存文件。



创建一个用来导入的股票代码的文本文件

1. 创建一个扩展名为 .txt 的文件，例如 twsTickers.txt。

2. 在文件中，使用下面描述的排列法，对每条您想要的市场数据线创建一个以逗号划分界线的行。注意，第一个区域名称为行的类型：DES、SYM 和 CON。

   DES, UNDERLYING, SECTYPE, EXCHANGE, EXPIRATION, STRIKE, PUT/CALL, MULTIPLIER

   SYM, SYMBOL, EXCHANGE

   CON, CONID, EXCHANGE

DES 行类型需要信息或信息占位符，执行价格、看跌 / 看涨和乘数区域是可选的。到期日的格式为 YYYYMM，或 YYYYMMDD。所有输入必须为大写字母。一份期权合约 XYZ 的例子为：

DES, XYZ, OPT, ISE, 200607, 75, CALL,

在这种行类型下，代码 XYZ 的一份股票合约看上去将是这样的：

DES, XYZ, STK, SMART,,,,

逗号为您没有对股票定义的区域的占位符。

对股票使用 SYM 行类型看上去将是这样的：

SYM, XYZ, SMART

使用 CON 类型来快速输入带有 conid 的合约，例如

CON, 12348765, SMART 来导入一个合约文件。

当您导入一个文件，合约行将被输入在活动的交易页面的底部，除非您选择在新页面上输入它们。

1. 在**文件**菜但单上，选择*导入合约*。
2. 使用*浏览*按钮来查找您创建的 .txt 文件。
3. 要将这些合约放到一个新页面上，对*新页面方*框打勾并输入页面名称；否则合约将出现在当前选定页面的底部。
4. 点击确定。

创建定单

在交易平台中创建定单有多种方法。本话题向您显示如何从交易窗口发送定单。

从交易窗口创建并传送定单

1 点击资产的 “要价” 或 “出价”（或者在选定的市场数据行上使用您的买入或卖出热键），直接在选定的资产下创建一个定单管理行。

- 点击**要价**来创建一份**买入**定单。
- 点击**出价**来创建一份**卖出**定单。

2 在定单管理行上，如果需要，修改定单参数：有效时间、行为、数量、价格、定单类型或目的地。

Note: 为了更有效地交易，在全局配置中使用定单预设策略创建带有默认定单设置的定单预设。

3 要传递您的定单，在状态区域点击 “T”。

Note: 默认情况下，工作中的定单将显示在任何有代码的页面上，无论该定单是在哪个页面上被创建的。您能够从特定页面的设置中修改您想让工作中的定单显示在哪里。从全局配置中，选择交易窗口，然后选择页面，再选择一个特定的页面。选择以下当中的一种：

对该页面上的代码显示所有定单 — 对该页面上的所有代码显示工作中的定单，无论它们是在哪里被创建的。

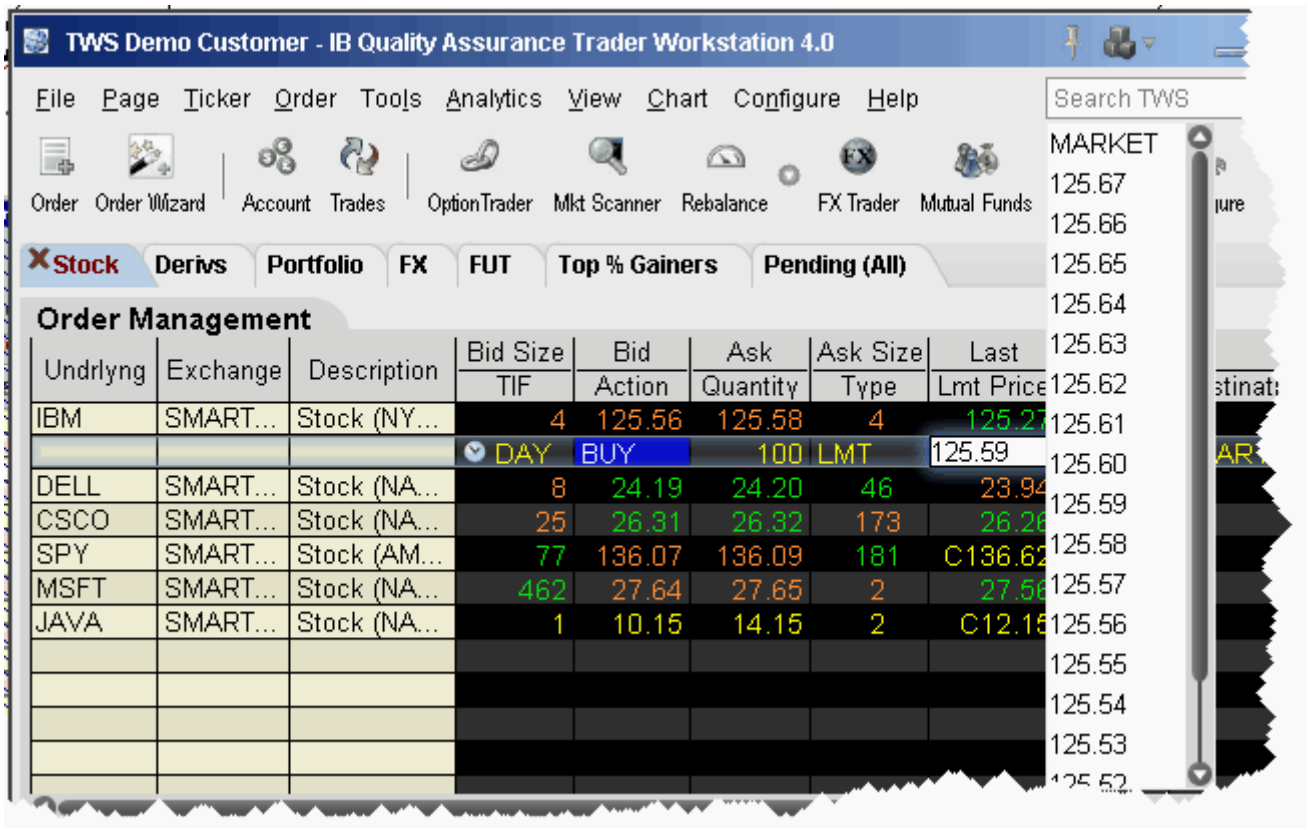
只显示在该页面上创建的定单 — 在该页面上创建的定单将只出现在该页面。

只显示不活动的定单，将活动的定单移动到待处理的页面 — 只显示失效的或非传递的定单。从该页面上创建的工作中的定单将只显示在待处理的页面上。

修改定单

直到定单在定单目的地被执行之前，您都能够修改它。直到执行发生前，在资产的定单管理行和**待处理**页面中，定单都保持为可见的和可编辑的。如果定单状态是绿色的，那么定单是“工作中的”。**注意 VWAP 定单是立刻被接受的且不能被修改。**

Note: 如果您想要修改除了价格和数量以外的参数，您必须取消该工作中的定单，并创建和传递一个新定单。这种做法是被定单目的地普遍要求的。



对工作中的定单修改价格和数量

1. 在定单管理行上，点击**价格**或**数量**区域并作出您的更改。
2. 使用右键点击菜单并选择*传递*，在交易工具栏上点击**传递**图标或使用您的传递热键来传递您修改后的定单。

要在传递前撤销更改，右键点击并选择*恢复*。

Note: 在交易所用您修改后的定单替换最初的定单之前，最初的定单就可能已经被执行了。请参见客户协议获取关于修改和取消定单的特定细节。

传递定单

一旦您在定单管理行上证实了定单参数，您就做好了传递定单的准备。

传递一份定单

- 在状态区域中点击 “T”，或
- 在定单管理行上使用右键点击菜单并选择*传递*。

在传递的定单被定单目的地接受之后，它变为 “工作中的” 定单。所有工作中的定单出现在待处理页面和显示资产的每个页面上。任何显示资产的页面，其名称将变为红色。

传递多份定单

- 要传递一个页面上的全部定单，在**定单**菜单上选择*传递页面*。

  Note: 圆括号中的美元值反映了活动页面上所有定单的价值。

- 要通过交易平台传递所有定单，在**定单**菜单上选择*传递全部*。

将您的鼠标放在*状态*区域上，查看对显示颜色的区域水平帮助。要获取有关状态颜色的信息，参见定单状态颜色话题。

取消定单

对非传递的定单，**取消**命令从您的交易屏幕删除选中的定单。对工作中的定单，**取消**命令发送一个取消请求到定单目的地。参见下面的表格获取定单管理行上的状态颜色含义。

工作中的定单，直到其在定单目的地被执行之前您都能够将其取消。您同样能够选择取消页面上的所有定单或您的交易平台中的所有定单。当您选择 “取消全部” 命令时，非传递的和工作中的定单都将被取消。

取消一个工作中的定单

- 在状态区域点击黄色的 “C”。

取消一个交易页面上的所有定单 （工作中的和非传递的）

1. 打开包含您想要取消的定单的页面。
2. 在**定单**菜单上，选择*取消页面*。
3. 当提示询问您是否想要取消页面上的所有定单时，点击**是**。

取消交易平台中的所有定单 （工作中的和非传递的）

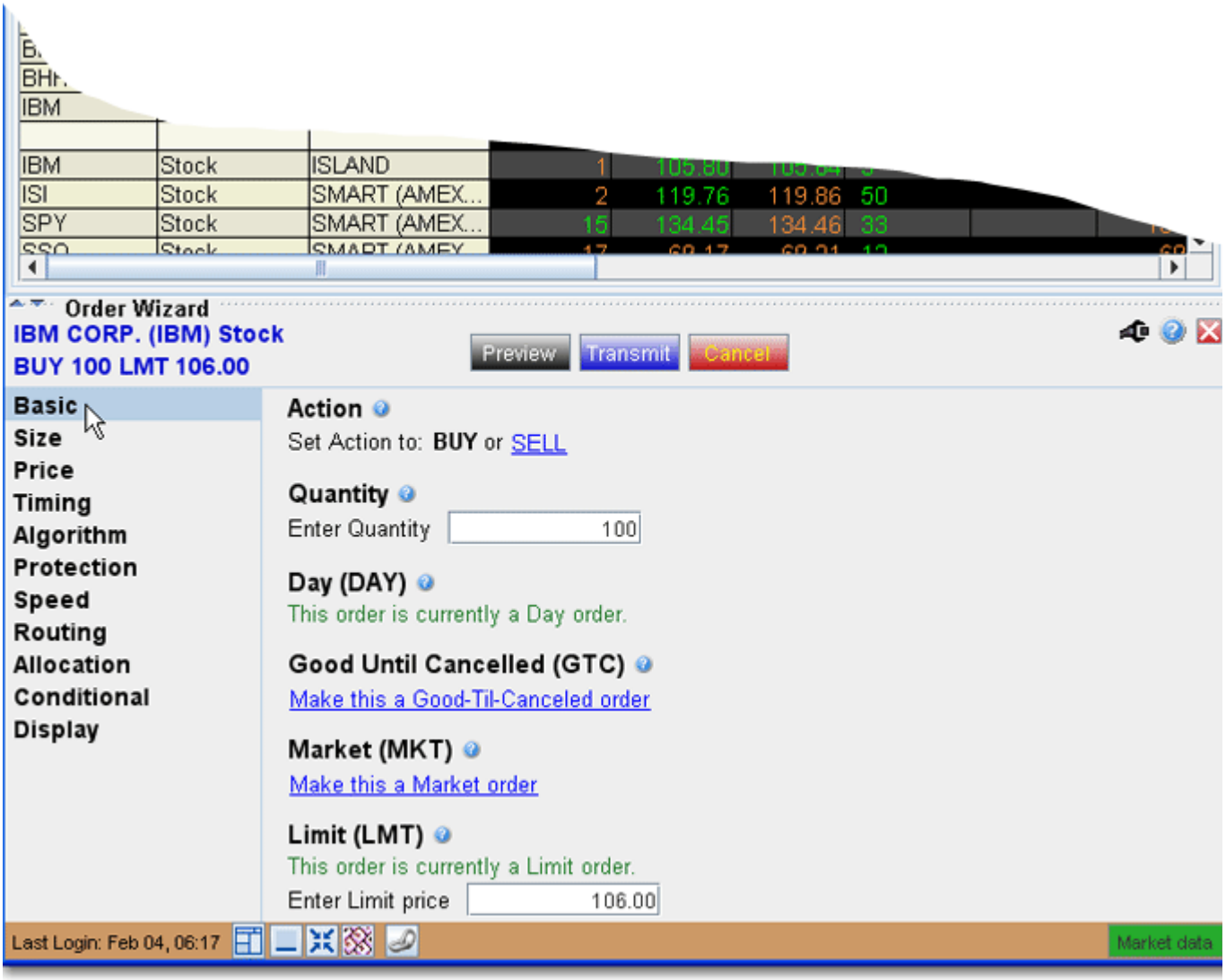
1. 在**定单**菜单上，选择*取消全部*。
2. 当提示询问您是否想要取消所有定单时，点击**是**。

要获取关于状态区域中显示的颜色的信息，参见定单状态颜色话题。

Note: 您的工作中的定单，要直到状态区域变为红色才被确认取消。请参见客户协议获取关于定单确认 / 取消的进一步信息。

使用定单向导

定单向导是一个位于交易底部的实况定单创建面板，它将定单按类别整理，并通过对您选择的每种定单类型展示有效的属性来帮助您创建定单。



使用定单向导

1 在交易工具栏上点击**定单向导**图标来显示或隐藏定单向导面板。定单向导在您的交易窗口下打开。

Note: 您能够使用全局配置中的一般页面，指导向导在您每次创建定单时打开。

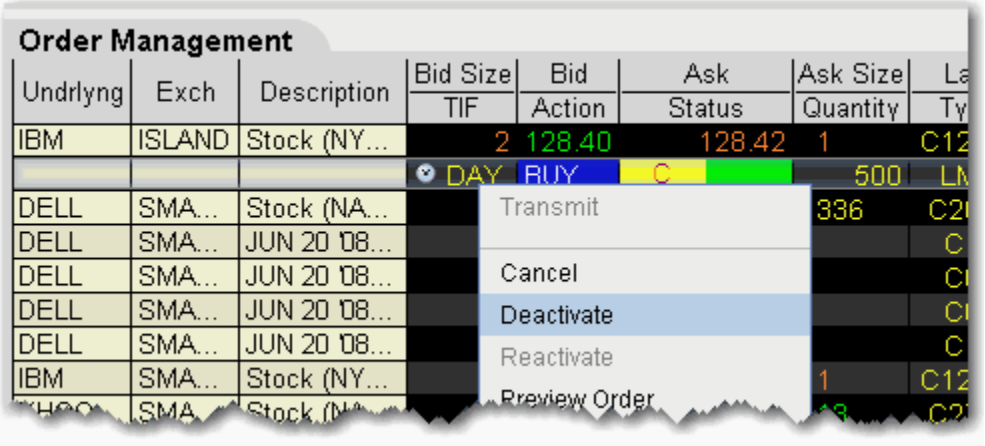
2 在左边的窗格中点击一个类别，并在右边的窗格中使用关联的属性来客户化您的定单。

沿着定单向导面板顶部的总结部分，总是显示当前的定单描述，并立刻反映对活动的定单所作的任何更改。更改也被反映在您的交易窗口中的定单行。

3 使用**预览**按钮来查看您的完整定单描述。使用**传递**按钮来发送定单，使用**取消**按钮来取消定单。

使定单失效

当您使定单失效，定单在交易所被取消，但仍保留在您的交易屏幕上以备提交。



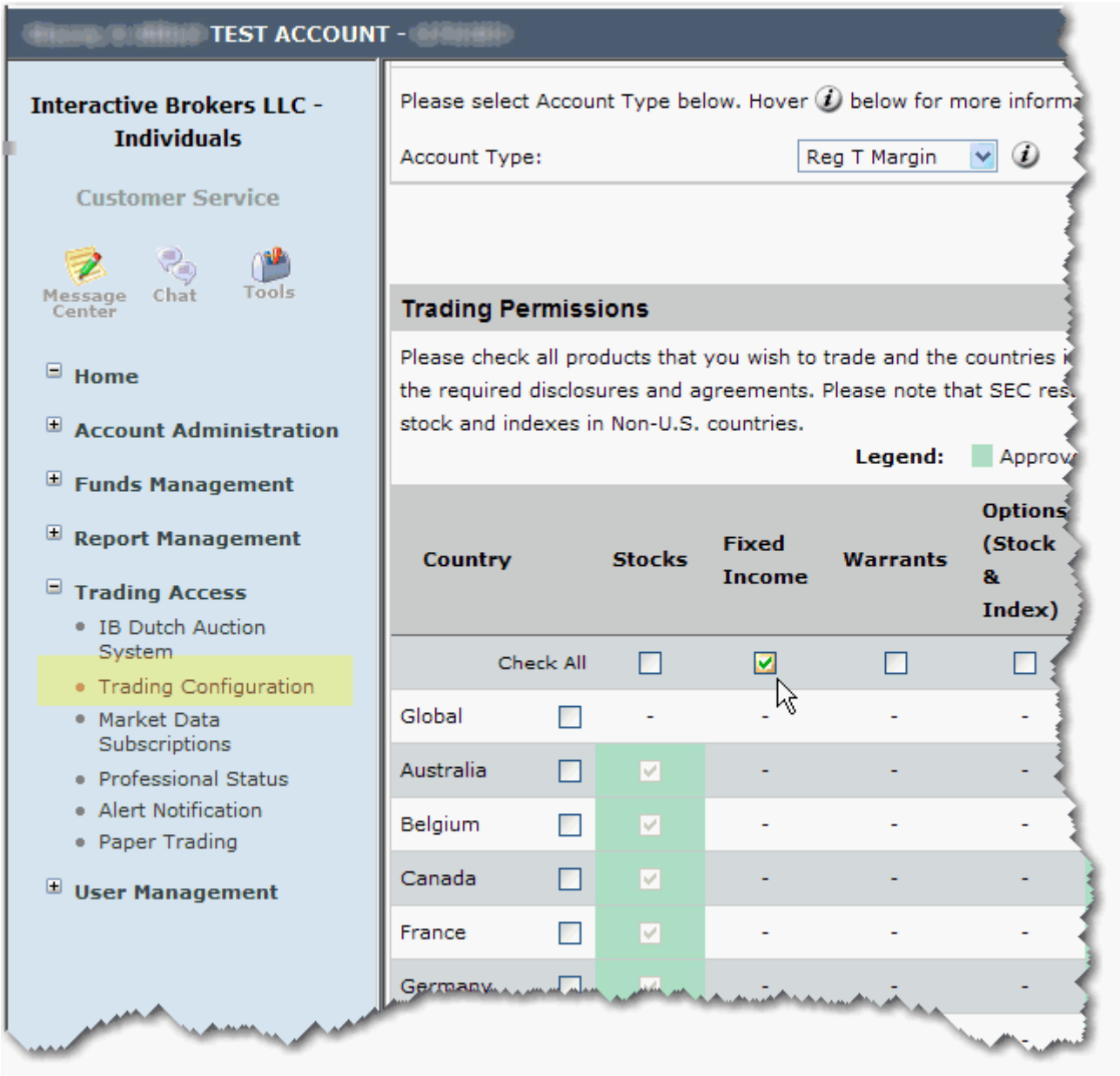
使定单失效

- 右键点击定单管理行并选择*使失效*。

您同样能够使用DTC 有效时间来使截止到市场收盘时没有执行的当日定单失效。

交易债券和国库券

交易平台让您交易智能传递的美国长期、中期和短期国债，以及在美国交易的公司债券。



在您能够交易债券之前，您必须升级您的交易许可。要进入账户管理，在**视图**菜单上选择*账户管理*。在**交易使用**下选择*交易设置*。在页面的交易许可部分，对**固定收益**打勾。

要交易债券和国库券

该过程假设您对您的交易页面上的合约拥有市场数据。如果您没有，参见下面的过程来添加数据。

1 要从您的交易页面交易合约，点击**要价**来创建一份买入定单；点击**出价**来创建一份卖出定单。

2 如有必要，修改包括有效时间 （TIF）、行为、数量、定单类型和价格在内的定单参数。

3 点击 “T”来传递您的定单。

将国库券市场数据添加到您的交易页面

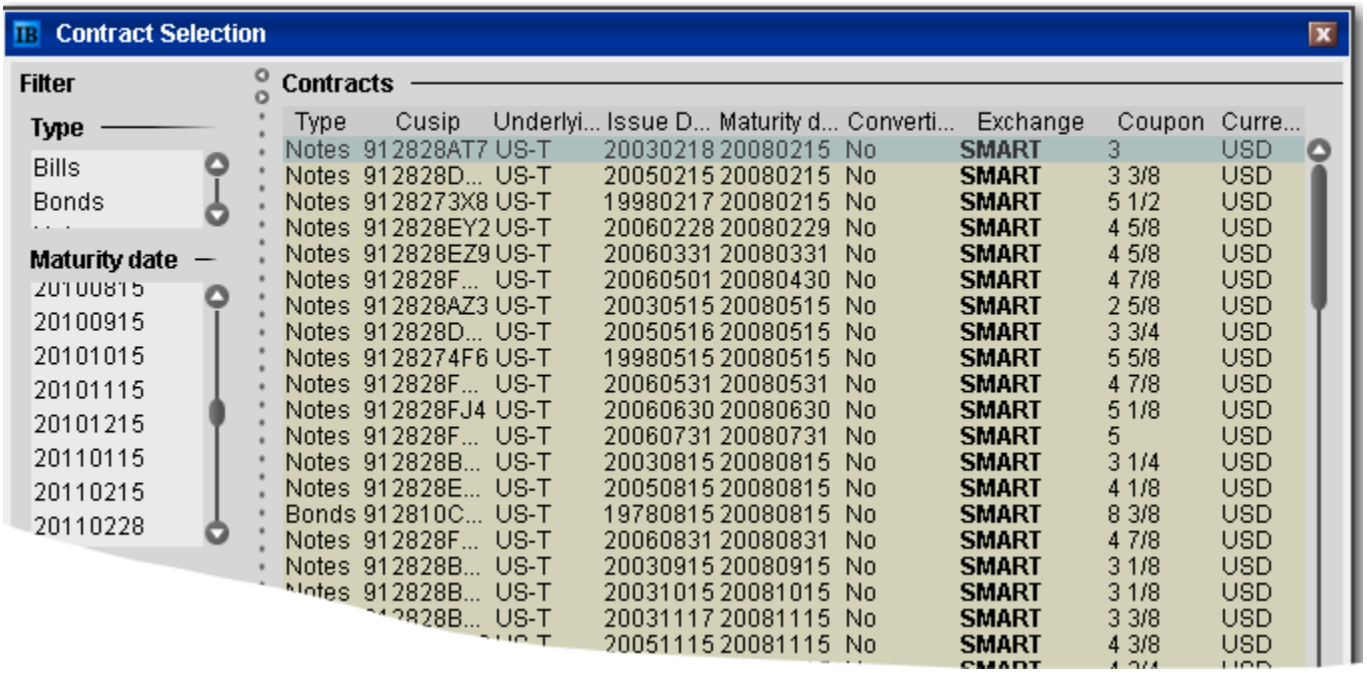
1 在交易工具栏上点击**国库券**图标，或者使用**视图**菜单并选择*国库券*。

2 在合约选择框中，在左侧窗格中使用类型列表来选择短期、长期或中期债券。

3 使用到期日期、发行日期和息票过滤器列表来过滤您的合约。

4 从右侧窗格中选择合约并点击**确定**。

如果您想要添加多个类型的国库券到您的屏幕，单击**添加**而不是确定。这将添加选定的合约到您的交易屏幕，然后允许您选择不同的类型并添加更多的合约。点击确定来关闭选择框。



将公司债券市场数据添加到您的交易页面

1 输入一个底层证券代码并按下回车，然后从选择列表中选择*债券*工具。

2 在合约选择框中，使用到期日期、发行日期和息票过滤器列表来缩小您的显示选择范围。

3 从右侧窗格中选择合约并点击**确定**。

如果您想要添加多份有不同到期日的合约，点击**添加**而不是确定。这将添加选定的合约至您的交易屏幕，然后允许您选择不同的到期日期并添加更多的合约。点击确定来关闭选择框。

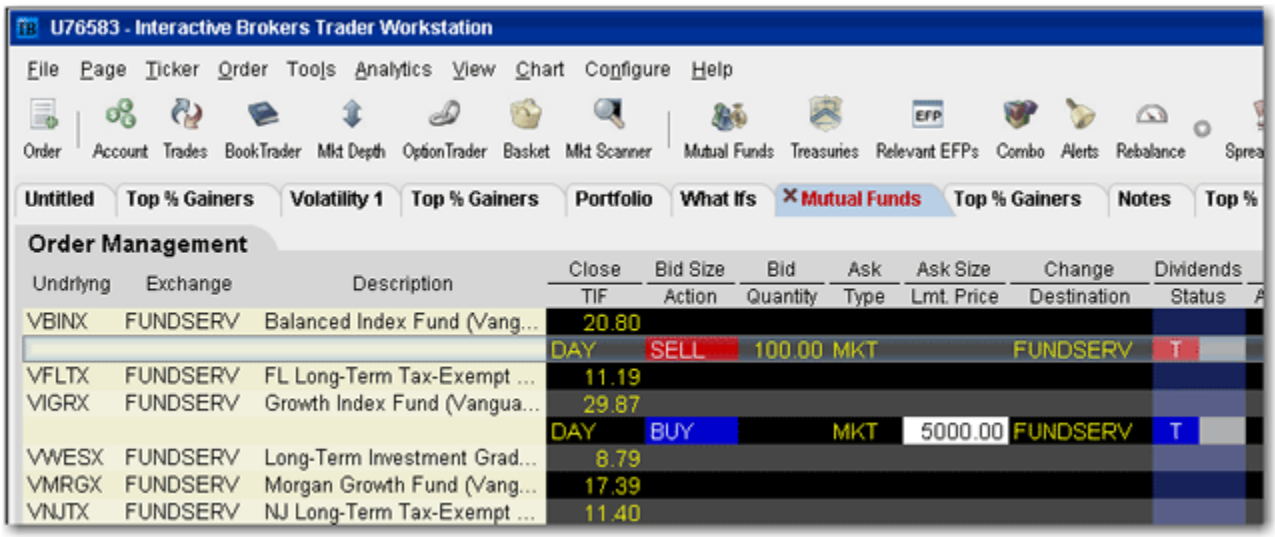
债券的市场数据被显示在交易页面上。以下信息在市场数据线的描述区域中有所指明：

- 工具类型 — 针对国库券。被标记为长期、中期或短期。
- 息票 — 使用该利率计算您在一年的时间中作为利息支付将收到的金额。
- 到期日期 — 发行者必须在改日期偿还债券的面值。
- 库斯普 （CUSIP）号码 — 一个针对特定证券的九位数字代码。
- 债券评级 — 对公司债券。确定发行者的信用评级。较高的信用评级通常表明投资的风险较低。债券评级分别来自穆迪和标准普尔。

Note: 要查看合约细节，右键点击市场数据线并选择合约信息，然后选择描述。

交易共同基金

从我们的免佣基金家族中选择一只基金，并从交易窗口或定单卡片进行交易。



在您能够交易基金之前，您必须升级您的交易许可。要进入账户管理，在**视图**菜单上选择*账户管理*。在**交易使用**下选择*交易配置*。在页面的交易许可部分，对**共同基金**打勾。

交易基金

1 将基金合约添加至您的交易窗口。

a 从交易工具栏中点击**共同基金**图标，或者从**视图**菜单中选择*共同基金*。

b 在**合约选择**框中，从左侧窗格中选择一个基金家族，然后选择您想要在右侧窗格中交易的合约。点击确定。

Note: 基金的数据仅出现在最后或收盘价格区域。共同基金在整个交易日内累积，并于 15:59 被传递至基金以获得定价。

2 从交易窗口，对卖出定单点击*出价*区域而对买入定单点击*要价*区域。

a 对卖出定单，通过在限价区域输入美元值或在数量区域输入股数，来定义您想要卖出的股数。

如果您输入了美元值，股数使用前一个交易日的收盘价格进行计算。

b 对买入定单，在价格区域中输入美元值。购买的股数在基金定价以后被计算。

3 点击“T”来传递您的定单。

Note: 只有市价定单类型可用于基金，并且 FUNDSERV 是唯一可用的传递目的地。

要获取关于共同基金的更多信息，以及要查看电子招股说明书，转到 IB 网站的**交易**菜单，并选择*产品列举*，然后点击*基金*页面。

定单输入工具

2

交易平台提供提供一套全面的专用交易工具，它们作为独立的窗口分别发挥作用，也可以与其他交易平台工具一道起作用。我们扩大的定单管理应用程序家族成员包括：

- 篮子交易者
- 在册交易者
- 图表交易者
- 组合交易者
- 深度交易者
- 外汇交易者
- 集成股票窗口（ISW）
- 期权交易者
- 期权美分定价
- 定单标签
- 数量计算器
- 快速定单输入
- 相关期货转现货
- 差价交易者
- 分段交易者
- 合并套利窗口

篮子交易者

引言

使用篮子交易者来管理多个产品的定单组，并轻松地创建对流行指数建模的定单组。该部分向您显示如何：

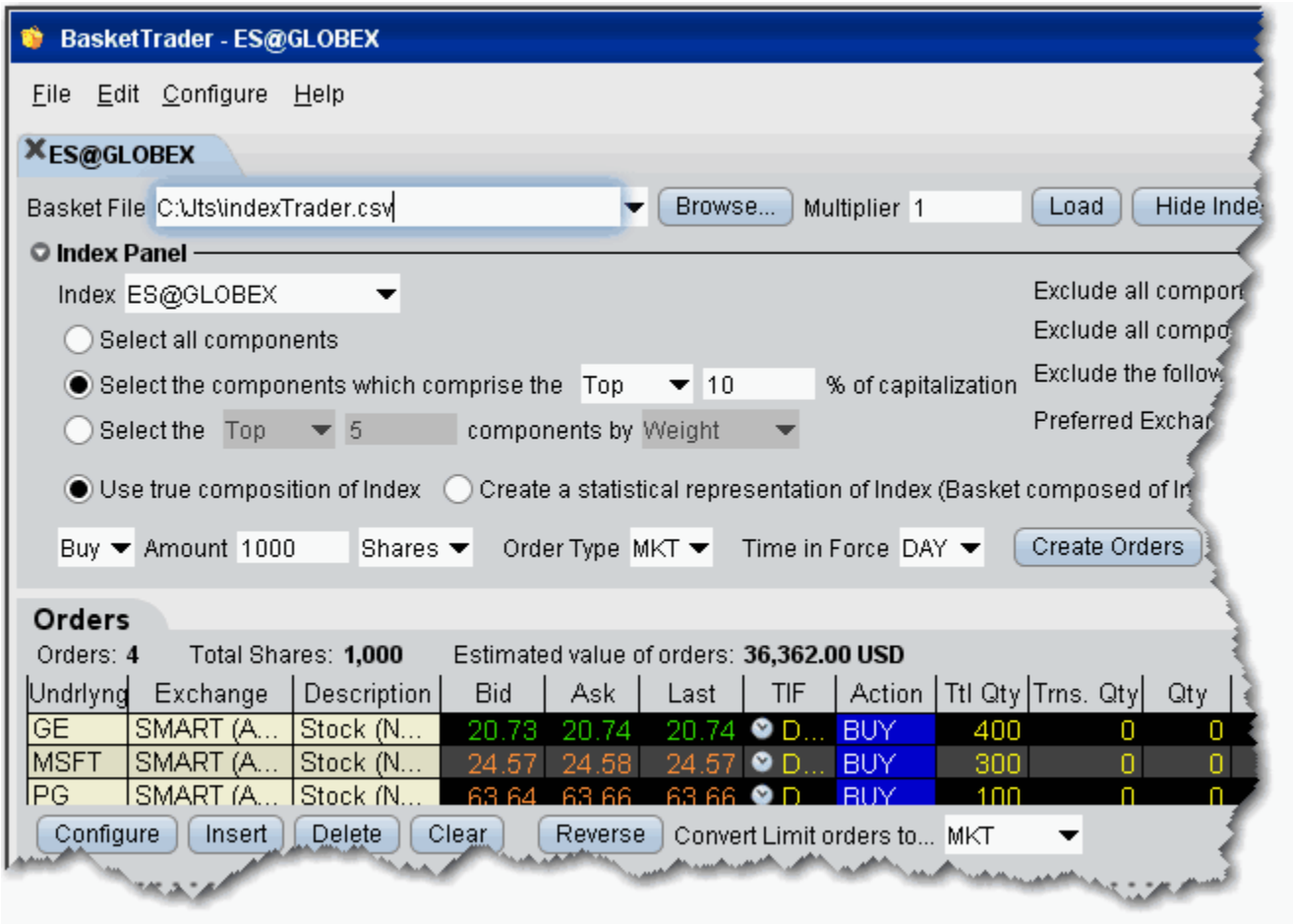
- 发送篮子定单
- 在交易平台中创建篮子文件
- 手动创建篮子文件
- 样本 Excel 篮子文件
- 指数交易者

发送篮子定单

在您能够选择并传递篮子定单之前，您必须创建和保存篮子文件。

在发送篮子定单之前，您能够通过添加或删除资产、更改乘数和数量、以及互换定单方并将限价定单转换为市价或相对定单，来修改篮子定单。您同样能够选择使用指数组成或统计组成，根据选定的**指数**来创建篮子文件。使用选择标准来微调您的指数篮子。如果您选择让您的指数篮子基于指数组成，那么系统会自动地使篮子随着指数组成的变化与其保持一致。

当您发送一个篮子定单，篮子中的每个定单被单独地清算。如果您的账户不满足保证金要求，有可能篮子定单只有一部分将执行。



发送篮子定单

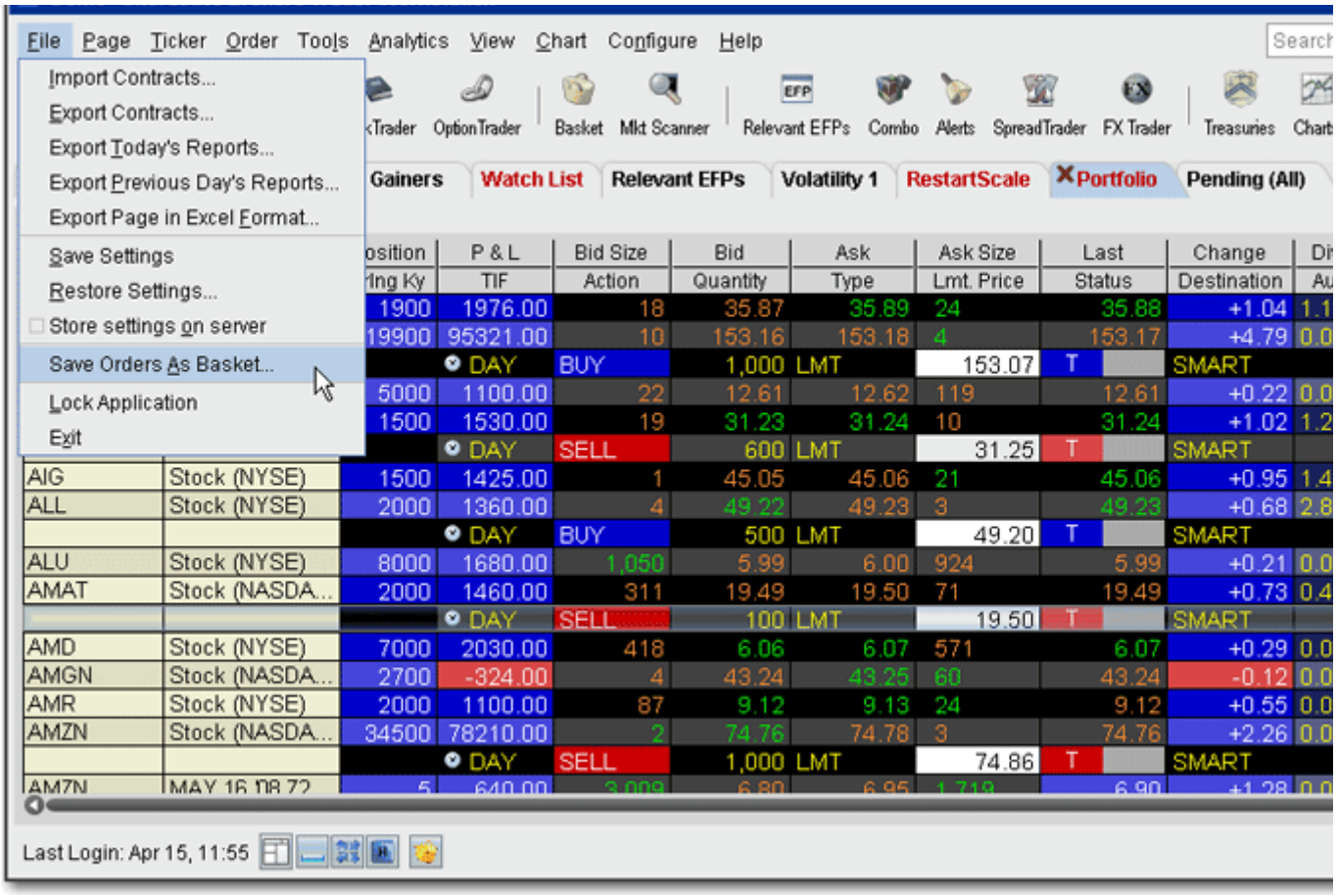
1. 在**工具**菜单上，选择*篮子交易者*，或者点击交易工具栏上的篮子图标。
2. 在**篮子文件**区域，使用下拉列表来选择一个篮子，或者点击*浏览*按钮来找到没有出现在列表中的篮子文件。使用指数交易面板，根据指数或指数的一部分来创建篮子。
3. 如有必要，修改**乘数**。该数值与篮子中每个定单的数量相乘。

4 点击**加载**，用篮子中的定单占据定单标签。

5 如有必要，修改定单参数，并在**执行篮子**面板中点击传递来传递整个篮子定单。您能够在**定单**标签上使用市场数据线并点击状态区域中的 “T”，从而传递篮子内部的单个定单。

在交易平台中创建篮子文件

交易平台将自动地从交易页面上的一组未传递的定单创建篮子文件。当您想要交易或管理篮子，从篮子交易者打开篮子。您同样能够在交易平台之外手动地创建篮子文件，但我们推荐使用交易平台的自动化进程来启动文件。



Note: 交易平台从单个页面上的定单创建篮子文件。您能够使用 MS Excel，轻松地将来自多个文件的定单组合到一个文件中。

自动创建篮子文件

1. 创建定单将其包括在篮子文件中。
   - 在市场数据线上点击要价来创建一笔买入定单。
   - 在市场数据线上点击出价来创建一笔卖出定单。
2. 修改定单参数并定义定单属性。
3. 在**文件**菜单上，选择*将定单另存为篮子*。
4. 在对话框中，查看或重命名文件，并使用 .csv 扩展名 （即 stocks.csv）并点击确定。

Note: 系统使用交易页面名称作为默认的篮子名称。

5 取消您创建的定单。使用**定单**菜单并选择*取消页面*。

手动创建篮子文件

我们强烈推荐您首先从交易页面使用若干不同的定单类型和产品，创建一个交易平台篮子文件。然后在 Excel 中打开样本文件，并使用其作为您编辑区域以及创建新行的起始点。篮子文件的关键在于标题行与定单行之间的关系。标题区域能够出现在任何定单中，只要定单行中的数值与标题区域相对应。

篮子文件被如下格式化，当中顶行为标题行，随后的行为定单行。标题行包括了每个定单值的区域标题。定单行包括了与该定单类型需要的区域标题相对应的定单值。如果定单不需要某个区域值，您能够将定单行中的该区域留作空白。

区域 1	区域 2	区域 3	区域 4	区域 5	区域 6	区域 7	区域 8
值	值	值		值	值		值
值	值	值	值	值		值	值
值	值	值	值	值	值	值	值

样本 Excel 篮子文件话题向您展示了有多种定单类型的篮子文件在 Excel 中看起来将是怎样的。

关于创建篮子文件的注释：

- 子定单行区域中的值必须在内容上与母标题行区域相匹配。例如，如果您的标题行区域是*代码*，而您在定单行的该区域输入了值 STK，您的文件将不可读。
- 在文本编辑器中创建的篮子文件必须被另存为 .csv （优先考虑）或 .bsk 文件。

  Note: 尽管对新文件不推荐 .bsk 文件扩展名，新的篮子版式仍然支持该格式。

- 对在文本编辑器中创建的篮子文件，在其值和逗号之间不要留空白，否则交易平台将无法读取文件。
- 如果您在 Excel 中创建篮子文件，那么对每个单元格只输入一个值 （或不输入值），并且不要使用逗号。
- 将您的 Excel 篮子文件另存为 .csv 文件。
- 标题行中的区域不需要在任何特定的定单中，只要它们在定单行区域中有相应的正确值即可。

最初的篮子文件格式与改善后的篮子文件格式之间的主要区别包括：

旧篮子文件	新篮子文件
就版本仅支持有限数量的预定义区域。	新版本支持所有交易平台区域。
就版本要求您以特定的顺序输入定单值。	新版本对区域不要求任何特定的定单顺序。
就版本只要求定单值 （因为 “标题” 区域是被硬编码到交易平台中的）。	新版本要求带有特定定单区域标题的标题行。在单个篮子内，对需要不同区域值的定单类型使用多个标题行。
就版本对不需要的值要求空白占位符。	新版本要求标题区域与定单值之间确切的一对一关系；如果定义了标题区域，您就不能够将定单区域留为空白。

旧篮子文件	新篮子文件
旧版本被保存为 .bsk （交易平台特定）文件。	新版本使用 .csv （一般）文件扩展名。

篮子区域

下表列举了一些您能够在篮子定单中指定的区域。我们推荐使用交易平台篮子创建过程来创建样本文件行，以查看您可能有疑问的任何区域。

一些篮子文件标题区域 / 定单值	
合约描述区域	
标题区域	**定单值**
代码	例如，IBM、AMZN
证券类型	证券类型包括 stk、opt、fut、fop、war、cash、fund、efp、bag* * 对差价和组合定单使用 bag 证券类型。
到期	YYYYMM 例如，200910 （对 2009 年 10 月到期）
行权价	例如，42.5 或 37.0
权利	P 或 C
币种	例如，USD
交易所	任何有效的目的地，例如 Smart 或 NYSE 或 PHLX 或 VWAP 或 IBEFP。 **Note:** 为了澄清智能传递合约的任何不明确之处，将首要交易所与 Smart 一道包括在目的地中，例如：Smart/NYSE。
基本定单区域	
标题区域	**定单值**
行动	买入或卖出
数量	例如，100 或 1
定单类型	交易平台支持的定单类型。
限价	例如，96.47 或 96 对 EFP，为原始价格使用小数，或者百分比值后面跟着 A 或 C 来指明年利率或复合利率，例如，5.200%A。
辅助价格	例如，.05 或 1.25 或 2
百分比抵消	0 到 1 之间的任何小数值，例如 .05
篮子标签	用来识别篮子定单的任何独特的字母或数字串。该标签出现在交易报告的定单参考区域中。
有效时间区域	
标题区域	**定单值**
有效时间	例如，day、gtc、gtd、ioc、fok、opg、auc
到期前有效	YYYYMMDD hh:mm:ss [zzz] 当中的 zzz 为可选的时区。如果您不指定时区，那么交易平台将使用定单发源的时区。

一些篮子文件标题区域 / 定单值	
到期后有效	YYYYMMDD hh:mm:ss [zzz] 当中的 zzz 为可选的时区。如果您不指定时区，那么交易平台将使用定单发源的时区。
顾问区域	
标题区域	**定单值**
账户	现有的账户号。
组	现有的组名称。
方式	分配方式，如果组被命名则有效。 • 百分比变化 • 可用权益 • 净清算价值 • 相等数量 • 投资组合百分比
百分比	在方式＝百分比变化时使用。
简介	现有的分配简介名称。
非清算区域	
标题区域	**定单值**
账户	账户号。
建仓平仓	例如，建仓、平仓
卖空地点	第三方的 MPID （市场参与者标识符）。
卖空	-1 （顾客拥有股份） -2 （股份在第三方）
清算	识别您的清算选择。
清算账户	定单的真实受益者身份。
波动率区域	
标题区域	**定单值**
参考价格类型	A （最佳出价 / 要价平均值）或者 B （当买入看涨期权或卖出看跌期权时使用 NBB ；当卖出看涨期权或买入看跌期权时使用 NBO）
对冲定单类型	Lmt、Mkt 或 Rel
对冲辅助价格	如果对冲定单类型被使用，则使用其来设定价格。
股票范围低端	股票价格范围的低端，当底层证券价格跌到该价格以下时，用来取消定单。
股票范围高端	股票价格范围的高端，当底层证券价格涨到该价格以上时，用来取消定单。
连续更新	真。如果您不想使用连续更新，就不要将该区域包括在标题行中。
杂项区域	
标题区域	**定单值**
交易量最大百分比算法	期权交易量的最大百分比算法。

一些篮子文件标题区域 / 定单值	
风险回避算法	完成、积极、中性、被动
强制完成算法	真
全权委托金额	偏离限价的价格，用来创建全权委托定单。
显示尺寸	定义定单被公开的数量，创建冰山定单。
常规交易时段之外	真，允许定单触发或在常规交易时段之外执行。
大额定单	真
一扫光	真
隐藏	真
全或无	真
最小数量	对要执行的定单的可接受的最小执行数量。
一取消全组	将定单识别为组的一部分的值。

样本 Excel 篮子文件

创建篮子文件最简单的方法是从您通过交易平台创建的格式化的样本定单开始。使用样本版式作为起始点，来添加您自己的标题 / 定单行篮子组成部分。下图向您展示了定单在 Excel 文件中看上去将是怎样的。注意，不同的定单类型要求不同的区域，且定单行中的空白区域是被接受的。

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N
1	**Action**	**Quantity**	**Symbo**	**SecTyp**	**Exchan**	**Curre**	**Timeln**	**OrderTyp**	**Hidden**	**LmtPric**	**Discre**	**AuxPri**	**Trigger**	**Expir**
2	BUY	100	ABC	STK	SMART	USD	DAY	MKT	TRUE					
3	BUY	5000	ABU	STK	SMART	GBP	DAY	LMT		0.235				
4	SELL	100	AMZN	STK	SMART	USD	DAY	LMT		74.43	0.25			
5	SELL	100	ARBA	STK	SMART	USD	DAY	STP LMT		16.36		16.16	Default	
6	BUY	1	IBM	OPT	ISE	USD	DAY	LMT		0.45				2E+0
7														

文件标题行的粗体字只用于说明目的，将不会显示在您的 Excel 篮子文件中。

Note: 交易平台创建的篮子文件只包括来自单个交易页面的定单。通过使用 Excel，您能够轻松地将不同的 .cvs 篮子定单组合到一个文件中。

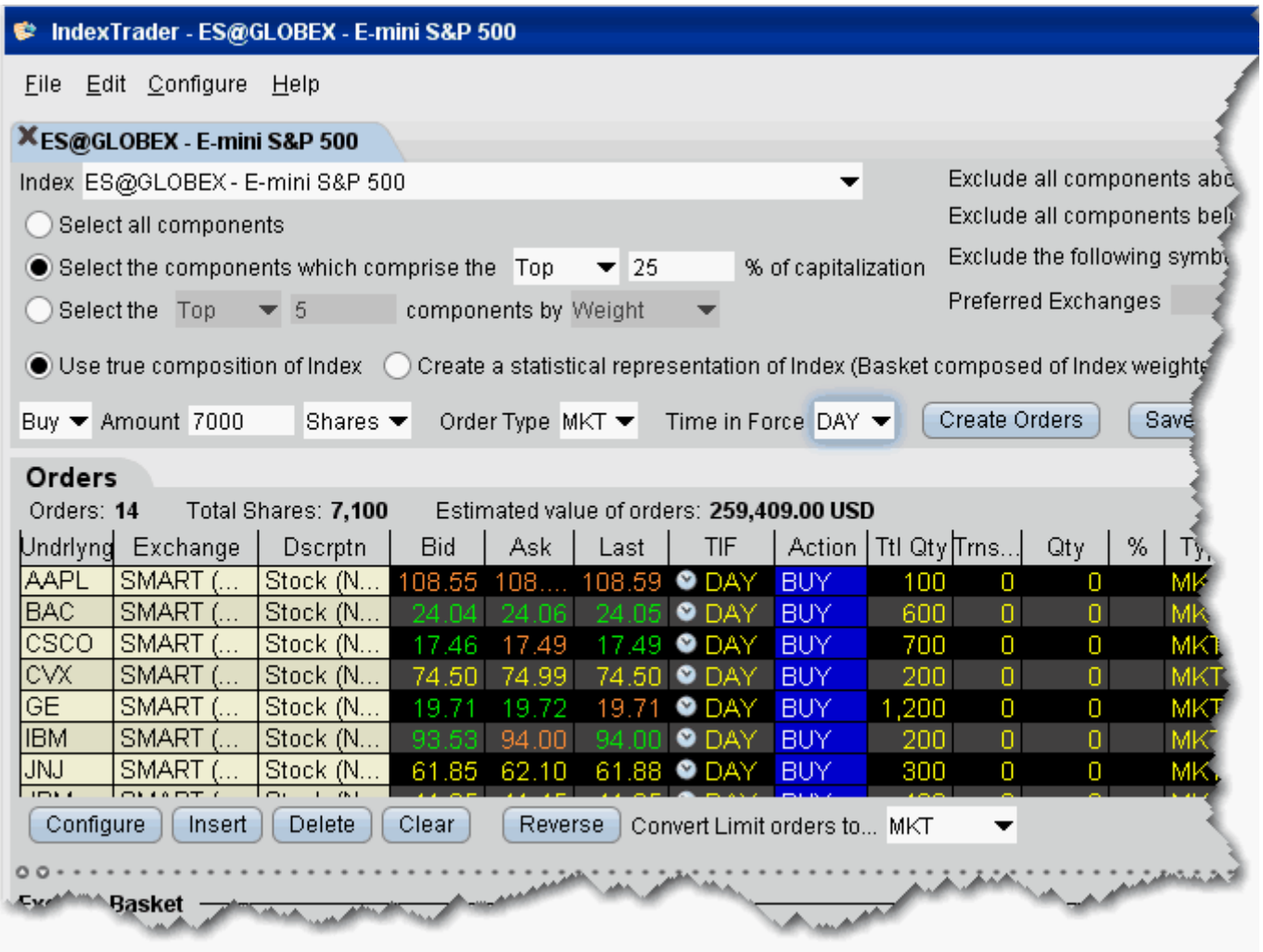
在 Excel 中组合篮子文件

1. 在 Excel 中打开一个 .csv 篮子文件。
2. 强调所有被占据的行，点击 Ctrl ＋ C 来复制这些行。
3. 打开另一个 .csv 篮子文件，并将您的光标放在页面底部的空白行上。
4. 点击 Ctrl ＋ P，将所有定单从第一个文件粘贴到第二个文件中。

要获取关于 .csv 篮子文件格式的更多细节，参见手动篮子文件话题。

指数交易者

指数交易者帮助您根据指数来创建篮子定单。将指数交易者作为独立的窗口使用，或作为篮子交易者窗口中的指数面板。



打开指数交易者

- 在**交易**菜单中，从高级工具组中选择*指数交易者*。

在册交易者

引言

使用在册交易者，通过单击以选定的价格立刻传递定单。

- 打开在册交易者
- 使用在册交易者进行交易
- 在册交易者定单处理
- 在册交易者热键
- 在册交易者按钮
- 在册交易者颜色

打开在册交易者

通过单击，以任何价格，包括最佳出价和要价来传递定单。对您选择的无论哪个合约，**在册交易者**都作为单独的窗口显示。它在价格阶梯中显示一系列高于和低于最佳出价和要价的价格。

打开和配备在册交易者

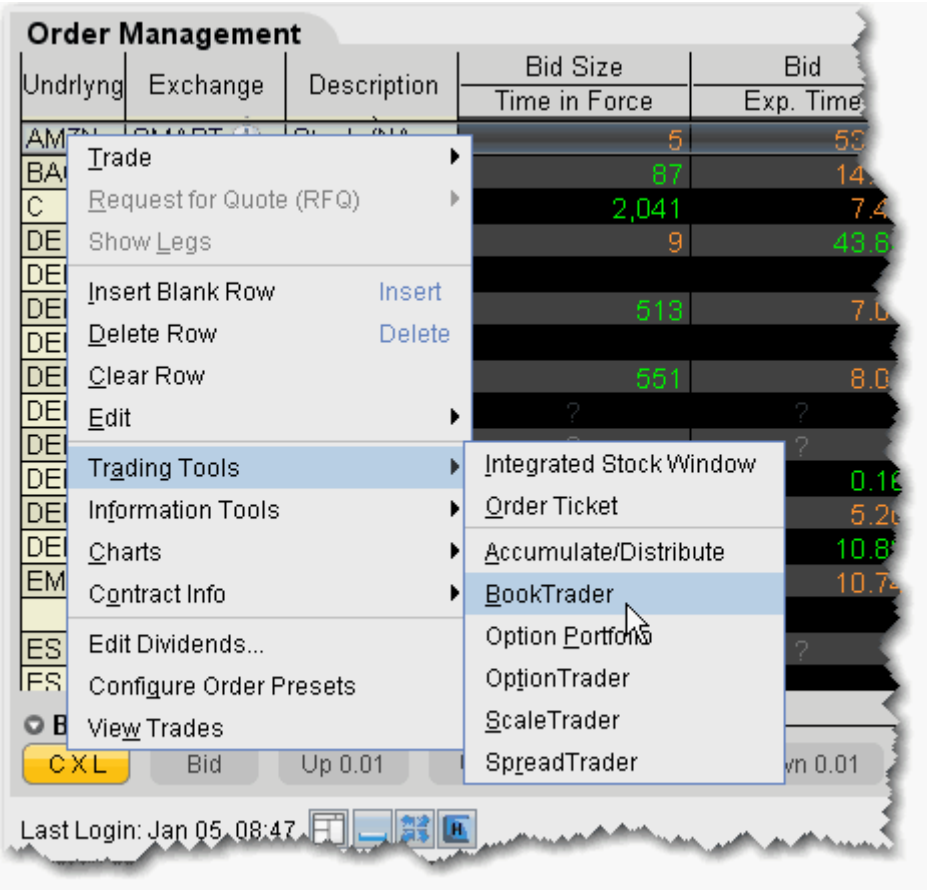
1 在交易页面上选择一个合约。

2 点击右键并选择**交易工具**，然后选择*在册交易者*。

Note: 在册交易者打开了但还没有被配备。要使用在册交易者进行交易，您必须首先 “配备” 它。

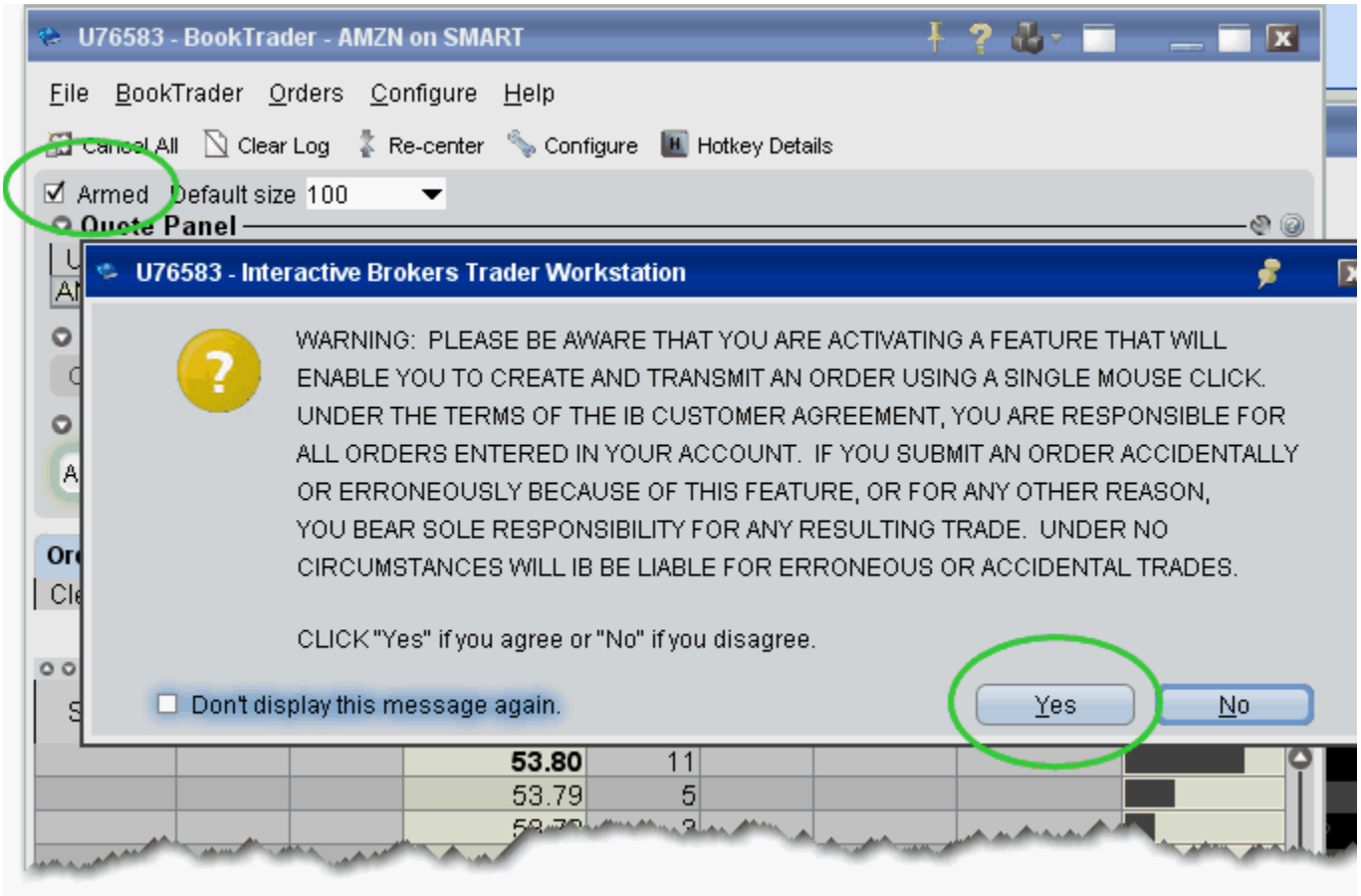
3 在左上角，选中*配备*。

Note: 阅读激活合约，其声明您理解在出价或要价区域中单击会将定单直接传递至交易所，点击*是*来配备**在册交易者**。



如果您没有选中配备选项，那么您能看见价格和尺寸但不能交易。当前最佳要价在价格区域中显示**绿色**背景；当前最佳出价显示**黄色**背景。

从在册交易者传递的定单被显示在**待处理**页面上，以及在册交易者的定单面板中。



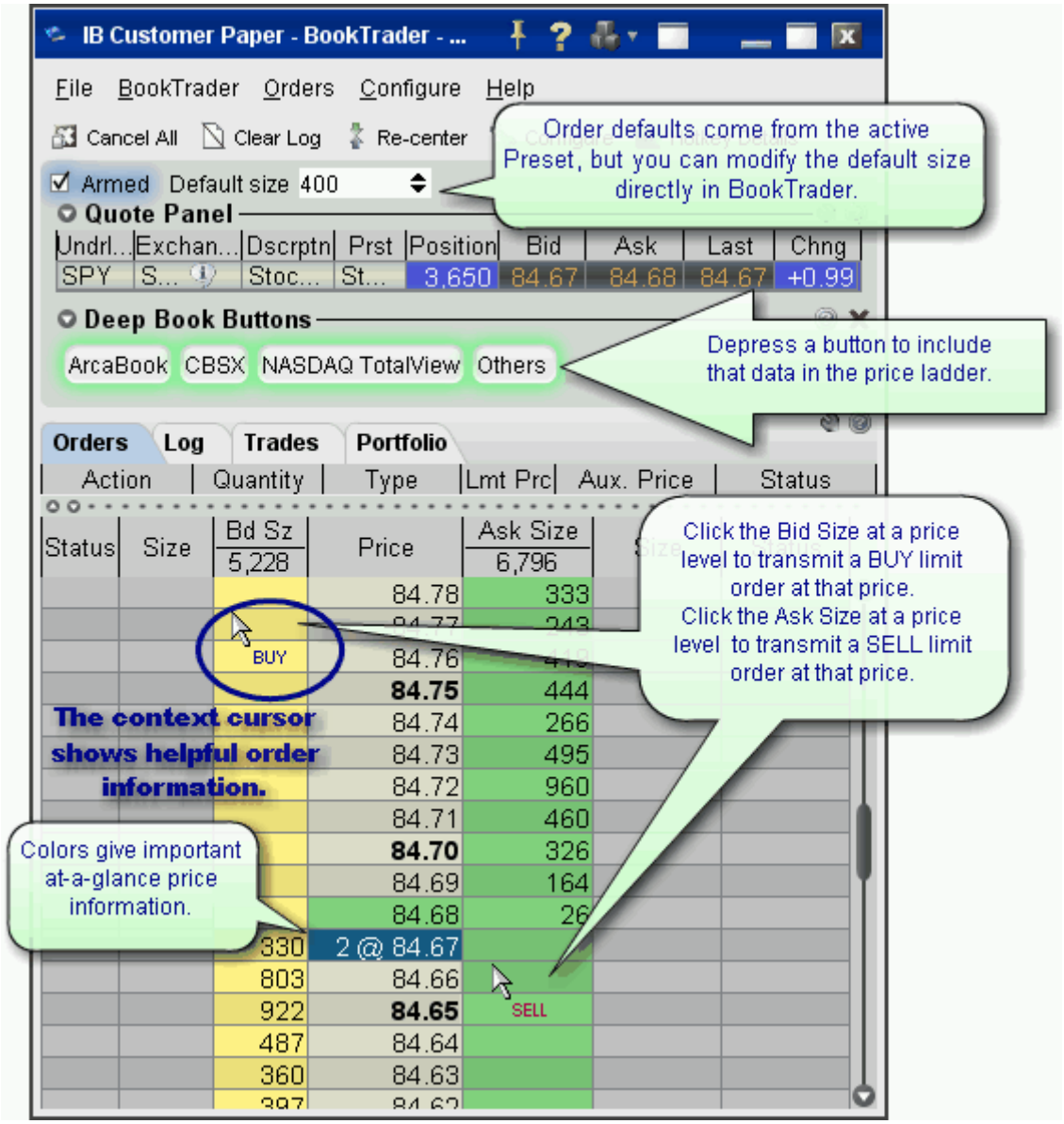
注释：

- 您一次只能使用三 （3）个深层在册订阅。这些订阅包括在册交易者、市场深度、NYSE 深层在册以及纳斯达克第二级窗口。尽管您能打开许多在册交易者窗口，您一次将只能看见 3 个实时数据 （假设您没有打开其他的深层在册窗口）。
- 默认情况下，在册交易者使用特定的颜色来传达信息。您能够通过点击工具栏上的配置按钮，然后选择在册交易者颜色来客户化这些颜色。
- 当前累积的出价和要价尺寸被显示在出价和要价栏的顶部。要关闭该功能，使用**配置** > *设定*页面。
- 默认情况下，点击一个尺寸来发起定单。如果您点击另一个尺寸，当前未执行的定单将被取消并被新定单替换。您能够从在册交易者配置的设定页面，修改同一方的多笔定单处理。
- 您能够通过在交易工具栏上点击在册交易者图标来打开一个空白的在册交易者窗口。使用底层证券区域来发起合约选择。

使用在册交易者进行交易

要使用在册交易者进行交易，您应当在价格阶梯中点击特定价格水平的出价尺寸或要价尺寸，一笔定单将立刻被传递。在您能够使用**在册交易者**进行交易之前，您必须通过选中*配备*复选框并同意激活合约，使应用程序为立刻定单传递作好准备。一旦被配备，**在册交易者**将通过鼠标单击立刻传递您的定单。默认鼠标行动被描述如下。您能够使用**在册交易者**配置中的*设定*页面，来修改控制定单被如何处理的默认设定。

默认情况下，在册交易者设定配置页面上的*在配备模式下使用上下文光标*选项被激活。该功能当您在价格阶梯中的出价尺寸或要价尺寸区域握住光标时，会显示与定单相关的有帮助的信息。



在在册交易者中创建卖出限价定单

- 在价格阶梯中，在需要的价格水平点击**要价尺寸**。

Note: 限价定单在选定的价格水平被创建和提交。您能够从价格阶梯顶部的定单面板来管理定单。

在在册交易者中创建买入限价定单

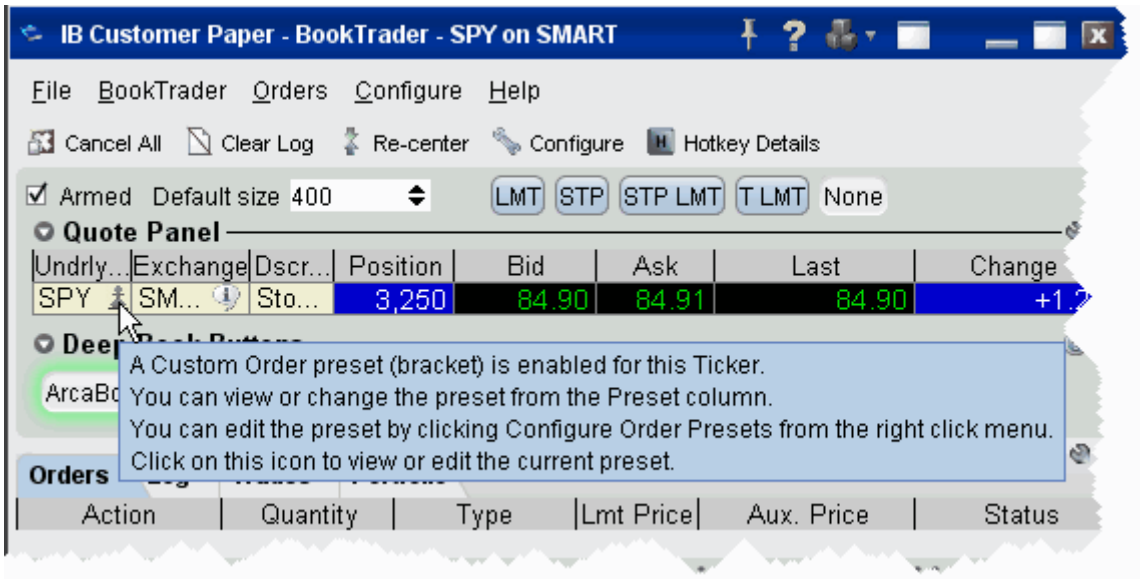
- 在价格阶梯中，在需要的价格水平点击**出价尺寸**。

Note: 限价定单在选定的价格水平被创建和提交。您能够从价格阶梯顶部的定单面板来管理定单。

在册交易者默认点击行动

- 点击任何**出价尺寸**，以选定的价格发送一笔**买入限价**定单。
- 点击任何**要价尺寸**，以选定的价格发送一笔**卖出限价**定单。
- **右键点击**任何**出价尺寸**来发送一笔**买入止损**定单。
- **右键点击**任何**要价尺寸**来发送一笔**卖出止损**定单。
- 按住 Alt 键并点击任何**出价**或**要价**尺寸来创建一笔**括号**定单。

要获取关于所有由系统配置的在册交易者快捷方式的细节，在全局配置中打开**在册交易者***热键*窗口。



默认的定单信息来自合约或工具的活动定单预设。要获取关于使用预设的信息，参见配置定单预设话题。

在册交易者定单处理

您能够使用**在册交易者**中的**配置** > *设定*区来更改定单被处理以及定单状态被显示的方式。要获取细节，请参见配置在册交易者话题。

当您在设定配置页面的状态区中选择*对每笔定单分别显示状态栏*时，在册交易者将以高级模式工作。这会启用两项关键的功能：

- 首先，它允许您只使用键盘来控制在册交易者。鼠标仍将起到导航的作用，但对不想花时间从键盘切换到鼠标再切换回来的用户，高级模式为您提供 100%的键盘控制。
- 其次，当您创建一笔定单，一个新的*定单*栏被创建，当中定单 （母定单和子定单）的所有部分都是可见的且能够被修改。新的*定单*栏出现在卖出定单 （您通过点击*要价尺寸*区域将其发起）价格栏的右侧，以及买入定单 （您通过点击*出价尺寸*区域将其发起）价格栏的左侧。

每个新的定单栏可能包含多达 4 个元素：

- 母定单 （LMT）
- 止损定单 （STP）
- 限价止损定单 （SLMT）
- 目标限价定单 （TLMT） — 这是作为括号定单一部分被创建的限价定单，或独立的反向限价定单。

修改定单的价格有三种方式：通过键盘，通过以鼠标拖动，或者通过使用鼠标点击。

通过键盘来修改定单价格

1. 用 Tab 键在应用程序中选择区域，直到您到达价格阶梯。
2. 使用向上 / 向下箭头，在价格阶梯中强调定单行。
3. 使用向左 / 向右箭头移动到您想要修改的定单。
4. 压下 Shift 键来拖动定单，并使用向上 / 向下箭头将定单移动到新的价格水平。
5. 放开 Shift 键来传递新定单。

Note: 要一起移动母定单和子定单，例如括号或限价止损定单，压下并按住 Alt 键而不是 Shift 键。

通过以鼠标拖动来修改定单价格

1. 在定单上握住鼠标，直到其变为一个双头箭头。
2. 点击定单或子定单，并将其拖动到新的价格水平。
3. 释放鼠标键来提交定单。

Note: 要一起移动母定单和子定单，例如括号或限价止损定单，在您点击和拖动时按下并按住 Alt 键。

通过以鼠标点击来修改定单价格

1. 点击定单，按下并按住 Shift 键。

2 点击想要的价格水平并放开 Shift 键来提交定单。

Note: 要一起移动母定单和子定单，例如括号或限价止损定单，按下并按住 Alt 键，而不是上面 1) 中的 Shift 键。

定单尺寸能够通过点击行标题并输入一个新的数量来被修改，如上所示。

子定单能够通过右键点击它们（默认）或使用热键来被取消。括号能够通过在行标题上点击 C 来被取消。

在册交易者热键

该话题讨论了在册交易者特有的热键，或者具有在册交易者特有的可客户化选项的热键。要获取有关那些出现在在册交易者热键框中但可用于所有交易平台窗口的热键信息，参见一般热键话题。

热键行动	描述
在册交易者	
取消子定单	该热键将取消价格阶梯中的定单。
减小在册交易者定单尺寸	为特定的区域设定左键或右键点击事件，该区域将以您定义的不管什么数量的最小报价单位来减小任何在册交易者定单的定单尺寸。
增大在册交易者定单尺寸	为特定的区域设定左键或右键点击事件，该区域将以您定义的不管什么数量的最小报价单位来增大任何在册交易者定单的定单尺寸。
回到中心位置	设定热键，让注意力中心回到最后交易价格，或出 / 要价中点。使用在册交易者配置区域中的*设定*页面来设定注意力中心。
创建定单	
添加自动止损定单	对选定的定单附加一笔反向止损定单。
添加追踪止损定单	对选定的定单附加一笔反向追踪止损定单。
附加括号定单	附加一对定单 （限价和止损定单），为选定的定单添加括号。
买入	对选定的资产创建一笔买入定单。
买入或卖出特定的产品	创建热键，使用特定产品自己的默认定单类型、限价、止损抵消、有效时间等，买入或卖出该产品。使用配置热键框的客户化标签来设定特定产品的细节。 如果您对任何价格配置选择了在册交易者价格，您将只能够设定鼠标点击快捷方式，原因是使用在册交易者价格要求您点击价格阶梯中的价格。
关闭头寸	创建一笔反向定单来关闭选定合约的头寸。默认情况下您需要手动地传递定单，但您能够选择让该热键立刻传递平仓定单，方法是在**配置热键**框的*客户化*区域中选中该功能。
逆转头寸	创建一笔反向定单来逆转选定合约的头寸。默认情况下您需要手动地传递定单，但您能够选择让该热键立刻传递逆转头寸定单，方法是在**配置热键**框的*客户化*区域中选中该功能。
卖出	对选定的资产创建一笔卖出定单。
修改 / 传递定单	
将定单更改为市价定单	将选定定单的类型更改为市价定单。
降低价格或减少尺寸	将定单价格或定单数量降低或减少一个指定的值。
提高价格或增加尺寸	将定单价格或定单数量提高或增加一个指定的值。
修改定单类型	显示**类型**下拉列表，让您对活动的定单选择一个不同的定单类型。

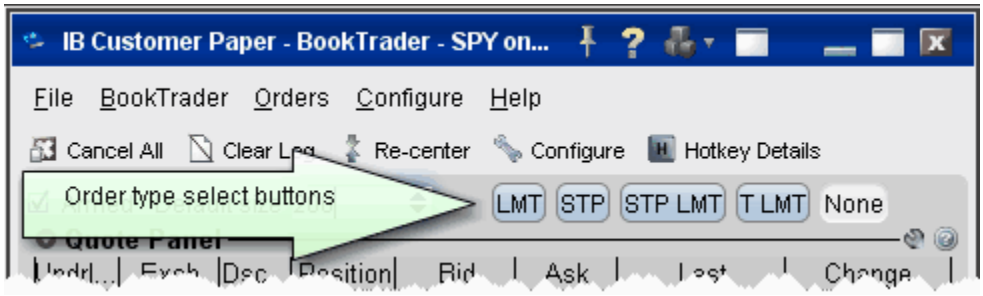
热键行动	描述
有效时间	显示**有效时间**下拉列表，让您对活动的定单选择一个不同的有效时间。
定单标签	打开定单标签。如果您已经强调了一个代码，那么定单标签将被该产品占据。
传递定单	传递选定的定单。
更新限价	更新活动的未执行定单的限价，反映您在**配置热键**框的*客户化*页面中定义的价格 / 抵消金额。
取消定单	
取消全部定单	取消交易平台所有页面上的全部定单。
取消合约的定单	取消与特定资产相关的全部定单。
清除定单	将定单从页面上删除。使用配置热键框的客户化区域，来定义是否将被取消、被执行和 / 或未传递的 （包括失效的）定单从活动的页面或者所有页面中删除
使失效	失效的定单被取消，但仍停留在页面中以备传递。
删除行 / 取消定单	该热键能够被配置用来删除行，或者删除和取消定单。
工具	
添加至再平衡窗口	被用来将合约添加至再平衡窗口。该热键不建仓、平仓或调整任何头寸。
套利表	为活动的指数市场数据线打开套利表。
集成股票窗口	打开集成股票窗口。
显示外汇交易者	打开外汇交易者模块。
显示市场深度	打开市场深度模块。
显示期权交易者	打开期权交易者。
显示再平衡窗口	打开投资组合再平衡窗口。
显示差价交易者	打开差价交易者。
实时活动监控	
警报	为活动的合约打开警报设定框。
查看警报	打开警报窗口，您能够从中查看、编辑或创建警报。
分析	
模型导航	打开模型导航窗口。
显示基本	为合约打开路透基本页面。

热键行动	描述
显示 IB 风险漫游 SM	打开 IB 风险漫游 SM，我们的实时价格 / 风险分析工具。
显示期权分析	打开期权分析，注意力集中于选定的期权合约。
显示实时图表	当您选定了一个合约，该热键会打开新图表窗口，您能够对活动的合约设定参数来创建实时图表。
杂项	
清除日志	清除日志面板。
配置定单预设	为活动的策略打开预设配置页面。
帮助聊天	打开账户管理屏幕的客户服务聊天区。
最小化所有窗口	最小化所有打开的窗口，将它们放到状态条的底部。
消息中心	打开客户服务消息中心。
请求交易取消	将您登录到账户管理屏幕的客户服务区。
搜索交易平台	显示搜索区域，您能够使用它来找到合约以及应用程序信息。
显示描述	对选定的合约显示描述框。
显示细节	对选定的合约显示合约细节。
显示盈余估计	对选定的合约显示盈余估计。
显示头寸	对选定的合约，显示账户号和盈余估计。
查看账户	打开账户窗口。
查看交易	打开交易窗口。

在册交易者按钮

定单类型选择按钮

当您从设定配置页面，将定单状态配置为*对每笔定单分别显示状态栏*时，定单类型选择按钮功能变为可用的。

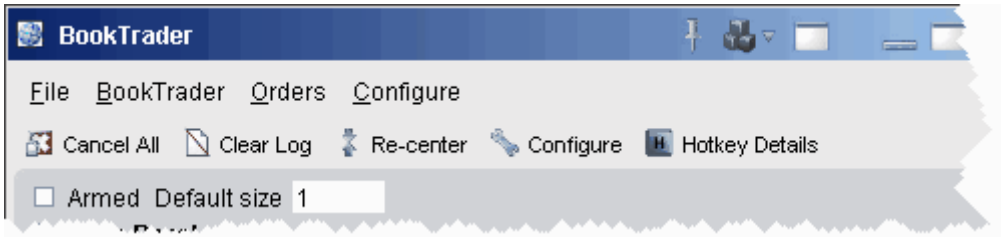


这些按钮覆盖了在册交易者的默认鼠标点击功能，只创建选定的定单类型。例如，如果您点击 LMT 定单类型选择按钮，那么您在价格阶梯中执行的任何鼠标点击，甚至右键点击都将创建一笔限价定单。

要释放定单类型功能并返回到默认的点击行动，点击*无*。

基本按钮面板

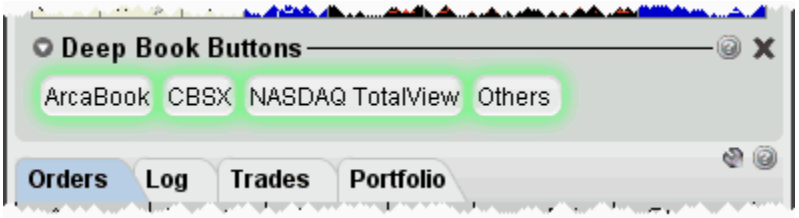
在册交易者工具栏同样包括了下面的基本按钮面板。要创建客户化的按钮，使用按钮面板。



- **取消全部** — 取消活动的在册交易者上的全部定单。
- **清除日志** — 从按钮上方的白色日志区清除全部定单信息。
- **回到中心位置** — 点击让最佳出 / 要价或最后交易价格总是保持可以在在册交易者屏幕的中心看见。使用确认菜单选择让出 / 要价中点或最后价格回到价格阶梯的中心位置。
- **配置** — 打开配置对话框。
- **热键细节** — 显示在册交易者全部当前热键的列表。
- **配备** — 选中来配置在册交易者进行立刻传递。
- **默认尺寸** — 根据对工具的预设显示默认的定单尺寸，并允许您不需要重新配置预设就能够对在册交易者定单更改默认的定单尺寸。

深层在册按钮

使用深层在册按钮过滤来自价格阶梯的市场数据。对按钮取消选定将数据过滤掉。



“其他”按钮包括了来自不提供深层数据的交易所的数据；来自您选择过滤掉的深层交易所的第一级数据；以及提供深层数据但您没有订阅的交易所的第一级数据。在按钮上握住鼠标来查看被包括的交易所数据。

在册交易者颜色

在册交易者使用颜色和数字，在小空间中显示了大量的信息。

市场数据颜色

市场数据颜色在在册交易者被配备之后，但在任何定单被传递之前显示。

- **出价尺寸**栏为黄色直到您创建一笔定单。该栏的值代表了特定价格的定单尺寸，并帮助显示市场深度。
- **要价尺寸**栏为绿色直到您创建一笔定单。当一个尺寸出现在要价尺寸区域时，其表明当前的最佳要价。
- **状态**区域保持为灰色直到您提交定单。

价格区域 — 背景颜色

- **当前最佳出价**以**黄色**背景被显示，尺寸被显示在其旁边的*出价尺寸*区域。
- **当前最佳要价**以**绿色**背景被显示，尺寸被显示在其旁边的*要价尺寸*区域。
- **最后**交易以**石蓝色**背景被强调。
- **最高**价格以**亮蓝色**背景被强调。
- **最低**价格以**红色**背景被强调。
- **平均成本** （包括佣金）以对整行的强调来表明。如果您在活动的合约中持有头寸，您将只能看见这一项。

在册交易者颜色		
栏名称	**可能的颜色**	**注释**
状态		一旦您传递定单，状态颜色将改变。参见下面的**定单状态颜色**表格。
出价尺寸		表明当前最佳出价的尺寸。
		表明限价定单已经被传递 （通过点击区域）。
		表明止损定单已经被传递 （通过右键点击区域）。

在册交易者颜色		
价格	无色	为合约显示的一个范围当中的某个价格。
		当前最佳出价。
		当前最佳要价。
		最后一笔定单被执行的价格，以及该定单的尺寸。
		当前最高价格。
		当前最低价格。
要价尺寸		表明当前最佳要价的尺寸。
		表明限价定单已经被传递 （通过点击区域）。
		表明止损定单已经被传递 （通过右键点击区域）。

图表交易者

引言

使用图表交易者，直接从任何实时图表中发送定单。

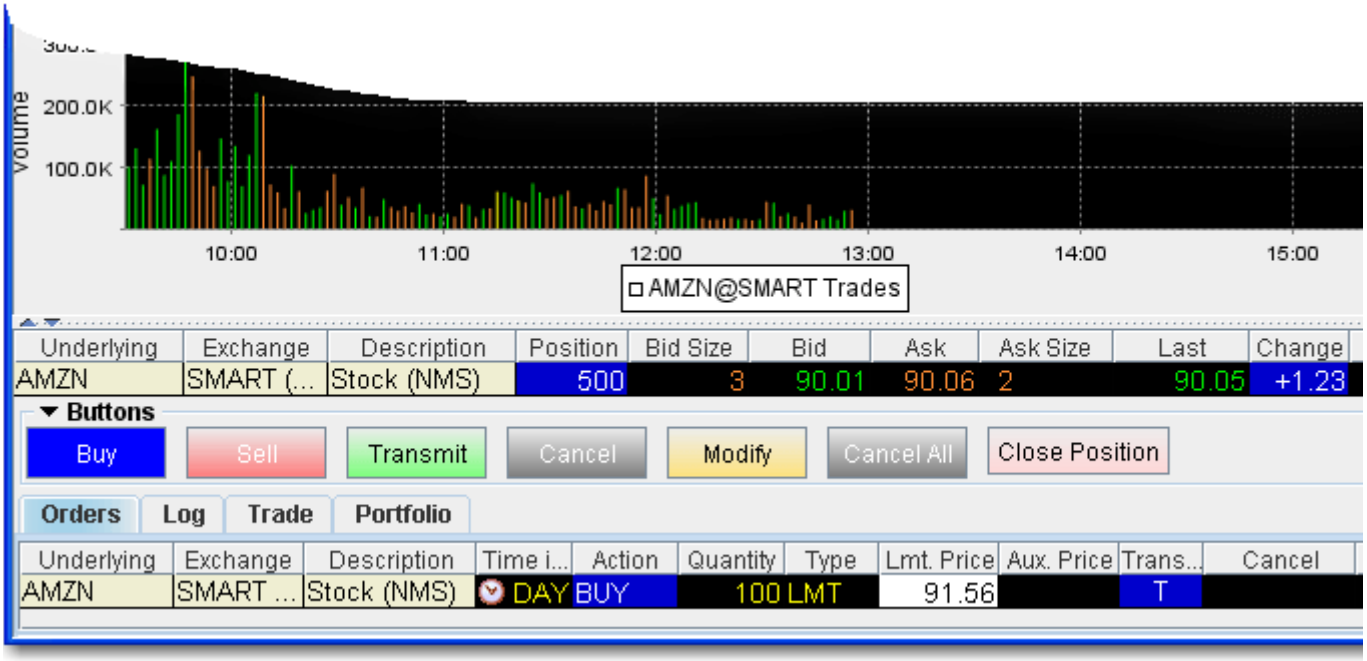
- 打开图表交易者
- 创建并传递定单

打开图表交易者

您能够使用图表交易者直接从实时图表中交易，图表交易者是您从图表菜单中显示的。一旦您创建了一笔定单，您能够直接在图表上，或者使用**定单**标签上的定单管理行来传递、取消或修改它。

打开图表交易者

1. 通过在交易屏幕上选择合约并点击交易工具栏上的图表图标，打开一个交互式图表。
2. 在图表菜单上，选择**图表交易者**，然后选择*显示／隐藏图表交易者*。
3. 图表交易者工具直接显示在图表的报价行下方。



创建并传递定单

使用图表交易者创建定单

1. 点击蓝色的**买入**按钮来创建一笔买入定单，或者点击红色的**卖出**按钮来创建一笔卖出定单。
2. 将您的光标移动到图表中，并将蓝色的虚线放到您想要的定单价格上。注意，您的确切价格位置以蓝色沿着价格轴被显示在虚线的左侧。
3. 点击以创建定单。定单管理行出现在报价行下方，图表交易者的定单部分中，虚线变为实线。定单参数默认值与您使用定单默认窗口为您的交易窗口设定的默认值相同。
4. 在传递区域中点击 “T” 来提交定单。您也能够直接从图表中提交定单。

从图表中传递定单

1. 要直接从图表中传递，点击绿色的传递按钮，并将 IB 光标放在您想要发送的定单上。当实线定单行变为虚线，您就能够知道定单已被恰当地选中了。
2. 点击定单来将其传递。

Note: 在您从图表中传递定单之前，您能够在定单管理行中修改定单参数。

从图表中修改定单价格

1. 您能够直接从图表中修改定单价格，方法是点击修改按钮，并将修改光标放到选定的定单定单上直到实现定单行变为虚线。
2. 点击定单并向上或向下将其拖动到想要的价格。

您使用图表交易者创建的定单也会显示在显示了合约数据的交易页面上。拥有定单的交易页面以红色显示页面标题。

组合交易者

引言

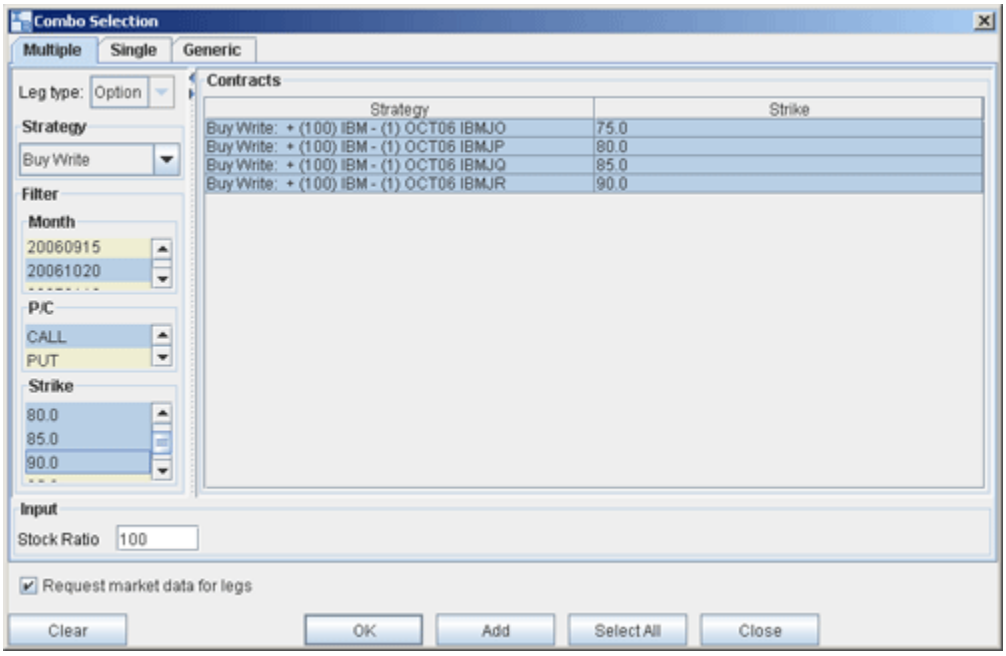
创建包括期权、股票和期货边在内的组合定单 （如果定单通过智能路径被传递，那么股票边能够被包括）。

- 关于组合定单
- 创建组合定单
- 使用组合交易者
- 传递组合定单
- 组合定单注释

关于组合定单

创建包括期权、股票和期货边在内的组合定单 （如果定单通过智能路径被传递，那么股票边能够被包括）。尽管组合 / 差价定单是由不同的边构建的，如果它被直接传递至一个交易所，它将作为单笔交易被执行。对智能传递的组合定单，每条边可以被分别执行以确保最佳执行。您还能够创建期货 EFP （期货转现货）差价。

组合定单能够作为市价、限价或波动率定单被传递。要获取有关对组合定单使用 VOL 定单类型的细节，参见波动率交易话题中的标准列表。



您能够通过在**一般**标签上手动地逐边定义定单来创建独特的组合，或者在**单个**或**多个**标签上使用模板以命名策略创建一个或一组定单。您能够找到一个模板来构建以下命名的组合策略：

- **盒式** — 同时以相同数量买入和卖出两个不同行权价格的合成期权的定单。
  例如：买入 1 份 April02 95 看涨期权，卖出 1 份 April02 95 看跌期权，卖出 1 份 April02 100 看涨期权，买入 1 份 April02 100 看跌期权。
- **蝶式** — 同时以一个行权价买入一个期权，以第二个行权价买入一个期权，以第三个行权价 （该价格位于前两个期权价格的中间位置）卖出两个期权的定单。蝶式期权的比率通常为 1 × 2 × 1。
  例如：买入 10 份 March02 95 看涨期权，卖出 20 份 March02 100 看涨期权，买入 10 份 March02 105 看涨期权。
- **买进出售** — 同时买入 （卖出）股票和卖出 （买入）相同底层证券的看涨期权的定单。
  买入 “买进出售”：卖出 1 份 XYZ April06 95 看涨期权，买入 100 股 XYZ
  卖出 “买进出售”：买入 1 份 XYZ April06 95 看涨期权，卖出 100 股 XYZ
- **日历差价** — 同时买入和卖出到期日期不同的期权，两个期权有相同的底层证券、权利 （看涨或看跌）和行权价格。该差价有时候被称作*时间差价*。有不同到期日期和不同行权价格的日历差价有时候被称作*对角差价*。
  例如：买入 1 份 June02 100 看涨期权，卖出 1 份 March02 100 看涨期权。

- **转换 —** 同时卖出（或买入）一个看涨期权并以相同的数量买入（或卖出）一个有相同底层证券、到期日期和行权价格的看跌期权，并买入相同底层证券股票的定单。
  买入转换期权：卖出 1 份 XYZ April04 75 看涨期权，买入 1 份 XYZ April04 75 看跌期权，买入 100 股 XYZ。
  卖出转换期权：买入 1 份 XYZ April04 75 看涨期权，卖出 1 份 XYZ April04 75 看跌期权，卖出 100 股 XYZ。
- **Delta 中性** — 同时买入（或卖出）期权合约并卖出（或买入）delta 数量的底层证券。报价计算如下：*有效期权价格＝期权价格＋ delta ×（输入股票价格－股票价格）。*
- **对角差价** — 同时买入和卖出有不同到期日期和不同行权价格的期权的定单，两个期权有相同的底层证券和权利（看涨或看跌）。
  例如：买入 1 份 June03 100 看涨期权，卖出 1 份 Sept03 105 看涨期权。
- **铁鹰** — 同时买入价外看跌牛市差价并卖出价外看涨熊市差价的定单，所有的边有相同的到期日期。
  买入铁鹰：买入 1 份 XYX JAN08 25.0 看跌期权，卖出 1 份 XYZ JAN08 27.5 看跌期权，卖出 1 份 JAN08 30.0 看涨期权，买入 1 份 JAN08 32.5 看涨期权。
  卖出铁鹰：卖出 1 份 XYX JAN08 25.0 看跌期权，买入 1 份 XYZ JAN08 27.5 看跌期权，买入 1 份 JAN08 30.0 看涨期权，卖出 1 份 JAN08 32.5 看涨期权。
- **逆转** — 同时买入（或卖出）一个看涨期权并以相同的数量卖出（或买入）一个有相同底层证券、到期日期和行权价格的看跌期权，并卖出相同底层证券股票的定单。
  买入逆转期权：买入 1 份 XYZ April04 75 看涨期权，卖出 1 份 XYZ April04 75 看跌期权，卖出 100 股 XYZ。
  卖出逆转期权：卖出 1 份 XYZ April04 75 看涨期权，买入 1 份 XYZ April04 75 看跌期权，买入 100 股 XYZ。
- **风险逆转** — 同时买入（或卖出）一个看跌期权并以相同的数量卖出（或买入）一个看涨期权的定单，两个期权有相同的底层证券和到期日期，但看涨期权通常有更高的行权价格。
  买入风险逆转：买入 1 份 XYZ April04 75 看跌期权，卖出 1 份 XYZ April04 95 看涨期权。
  卖出风险逆转：卖出 1 份 XYZ April04 75 看跌期权，买入 1 份 XYZ April04 95 看涨期权。
- **单一股票期货 / 期权** — 同时买入（或卖出）一份单一股票期货合约（SSF）并买入（或卖出）相同底层证券的一份股票期权的定单。
  例如：卖出 1 份 Oct06 60.0 看涨期权，卖出 1 份 Aug06 单一股票期货。
- **跨式** — 同时买入（或卖出）相同数量的看涨期权和看跌期权的定单，两个期权有相同的底层证券、到期日期和行权价格。
  例如：卖出 1 份 Dec02 90 看涨期权，卖出 1 份 Dec02 90 看跌期权。
- **宽跨式** — 同时买入有不同行权价格的一个看涨期权和一个看跌期权，两个期权有相同的底层证券和到期日期。在看涨期权和看跌期权都在价外的情况下，该定单被称作内部宽跨式。
  例如：买入 1 份 June02 95 看跌期权，买入 1 份 June02 105 看涨期权。
- **股票 / 期权** — 同时买入（或卖出）一份股票合约并买入（或卖出）一份期权合约的定单。
  例如：卖出 1 份 Jan07 55.0 看跌期权，卖出 100 股底层证券。
- **合成** — 同时买入看涨期权并以相同的数量卖出一个看跌期权（或者卖出一个看涨期权并以相同的数量买入一个看跌期权）的定单，两个期权有相同的底层证券、到期日期和行权价格。
  买入合成：买入 1 份 April02 100 看涨期权，卖出 1 份 April02 100 看跌期权。
  卖出合成：卖出 1 份 April02 100 看涨期权，买入 1 份 April02 100 看跌期权。
- **合成看跌期权** — *同时买入*（或卖出）一个看涨期权并卖出（或买入）股票的定单，两者有相同的底层证券。
  买入合成看跌：买入 1 份 XYZ April03 75 看涨期权，卖出 100 股 XYZ。
  卖出合成看跌：卖出 1 份 XYZ April03 75 看涨期权，买入 100 股 XYZ。
- **合成看涨期权** — 同时买入（或卖出）一个看涨期权并买入（或卖出）股票的定单，两者有相同的底层证券。

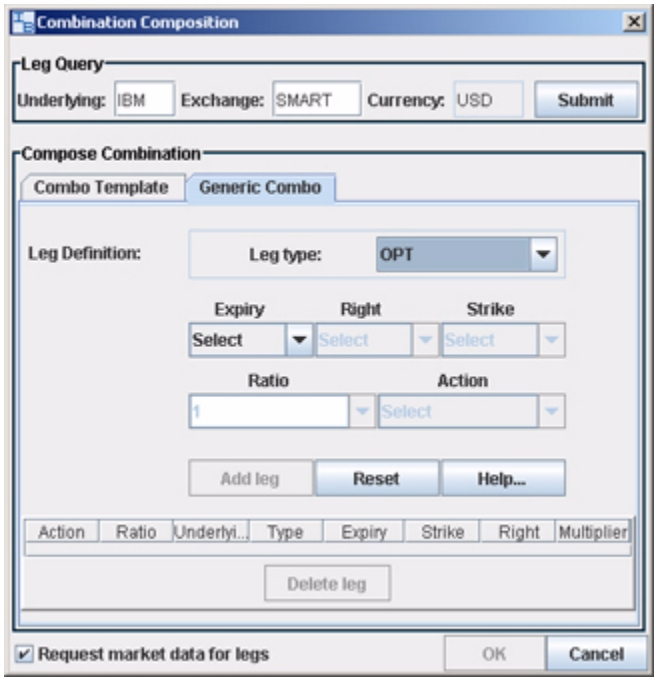
买入合成看涨：买入 1 份 XYZ April03 75 看跌期权，买入 100 股 XYZ。
卖出合成看跌：卖出 1 份 XYZ April03 75 看跌期权，卖出 100 股 XYZ。

- **垂直差价** — 同时买入和卖出有不同行权价格的期权的定单，两个期权有相同的底层证券、权利（看涨或看跌）和到期日期。该差价有时被称为价格差价。
  看涨垂直差价举例：买入 1 份 June02 100 看涨期权，卖出 1 份 June02 105 看涨期权。
  看跌垂直差价举例：买入 1 份 March02 105 看跌期权，卖出 1 份 March02 95 看跌期权。

要获取有关组合定单以及组合定单保证金要求的更多信息，参见 IB 网站上的美国权益期权保证金要求页面。

创建组合定单

您能够使用**组合构成**框来创建任何种类的组合差价定单，包括期货差价和 EFP，以及市场间智能组合。



创建市场间或智能组合定单

1. 在空白行上输入一个底层证券并选择组合，或者右键点击空白行 （在底层证券区域之外）并选择一*般组合*。
2. 在**边查询**部分中，对定单的第一条边输入底层证券代码。
3. 使用**边定义**部分来定义边的参数。当完成后点击*添加边*。

   Note: 或者简单地将市场数据线从交易屏幕拖动到边定义区域的底部。

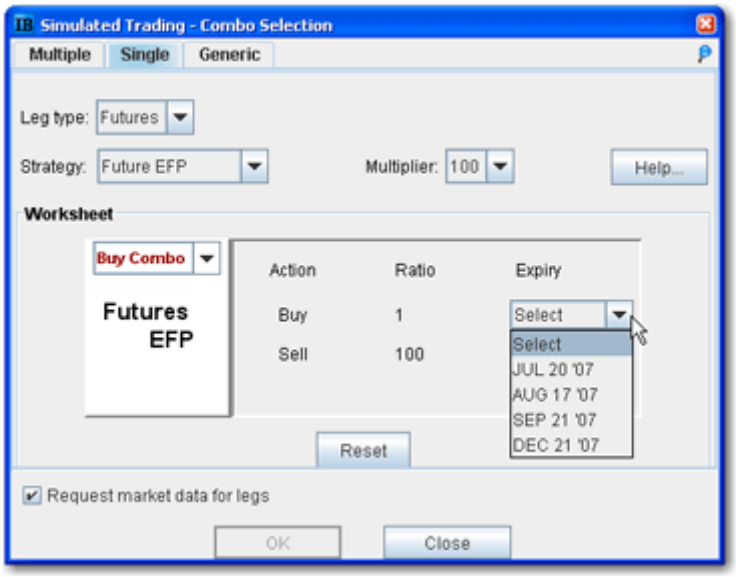
4. 在您添加了所有想要的边之后点击确定，差价作为市场数据线出现在您的交易屏幕上。

内在价格根据每条边的底层证券价格被计算，并随着每个底层证券的价格变动而改变。根据内在价格，智能路径将分别地传递定单的每条边以获得最优价格。

Note: 要查看组合或差价定单的单条边价格，通过点击交易工具栏上的交易图标来打开**执行**报告窗口。在**执行**窗口中双击想要的组合执行报告行 （或右键点击行并选择*显示边*）来打开**边的执行窗口**。

创建 EFP 组合

1. 在底层证券区域中输入一个底层证券代码并选择**组合** > *智能*。
2. 点击组合选择框顶部的单个标签。



3 选择*期货*作为边类型，*期货 EFP* 作为策略。

4 选择期货边的到期日并点击确定。

Note: 使用模板创建的 EFP 组合是智能传递的。

创建组合策略

1 右键点击空白行并选择*一般组合*，或者用工具类型*组合*创建一条市场数据线。

2 在**边查询**部分中，对定单的第一条边输入底层证券代码。

3 使用**组合模板**标签来选择策略。

4 对定单的所有边选择数据并点击确定。组合定单策略作为一条市场数据线出现在您的交易屏幕上。

关于使用期货边的注释

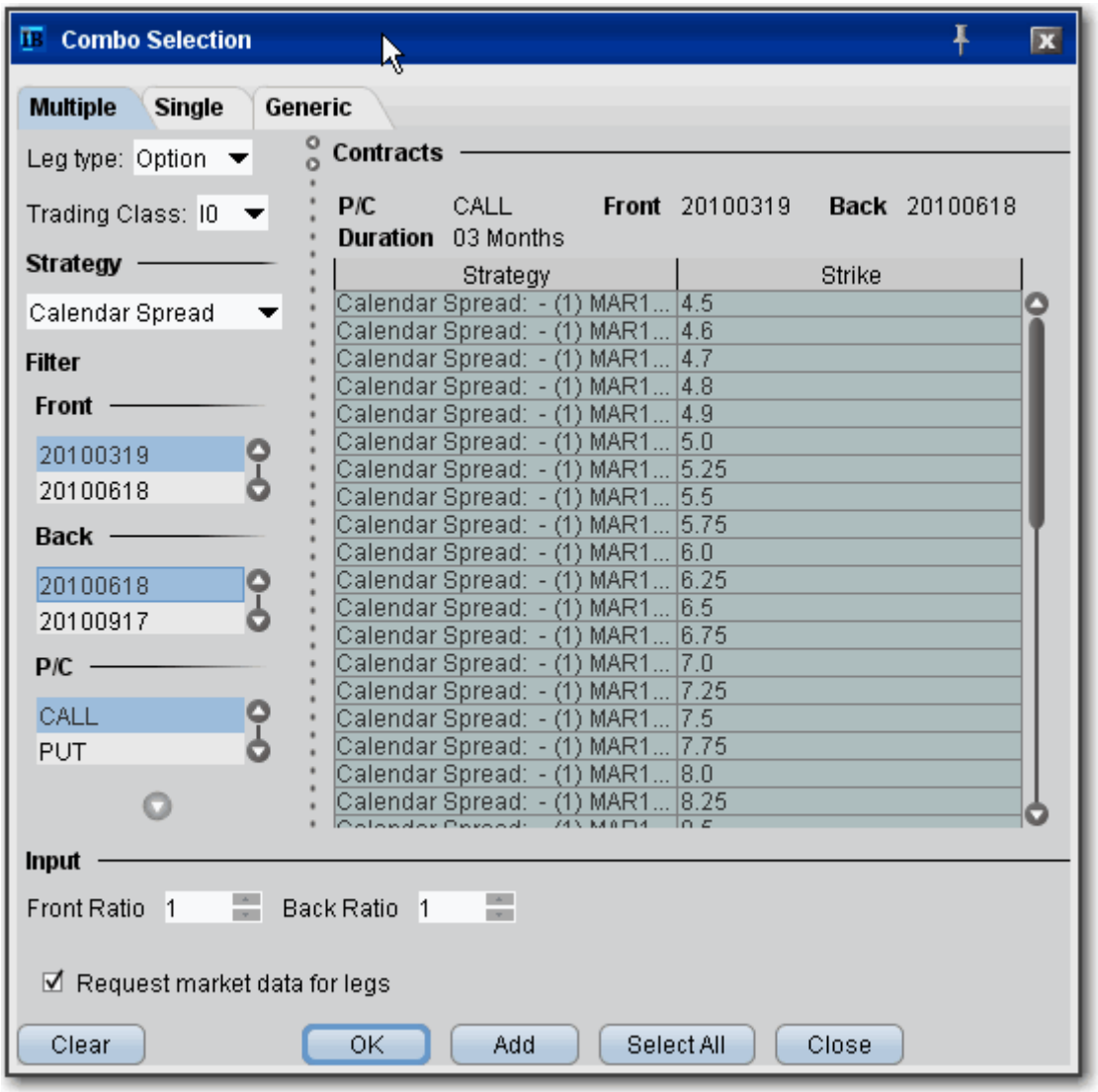
- 对在以下交易所的合约，包含期货边的市场间组合是被支持的：Globex、One Chicago、CFE、EurexUS。
- 对智能组合，只有美国合约被支持。

使用组合交易者

组合交易者提供了三个标签的界面来帮助您为期货和期权创建多边差价。

多个组合

使用**多个**标签，同时为相同的底层证券创建一组单个的组合定单。

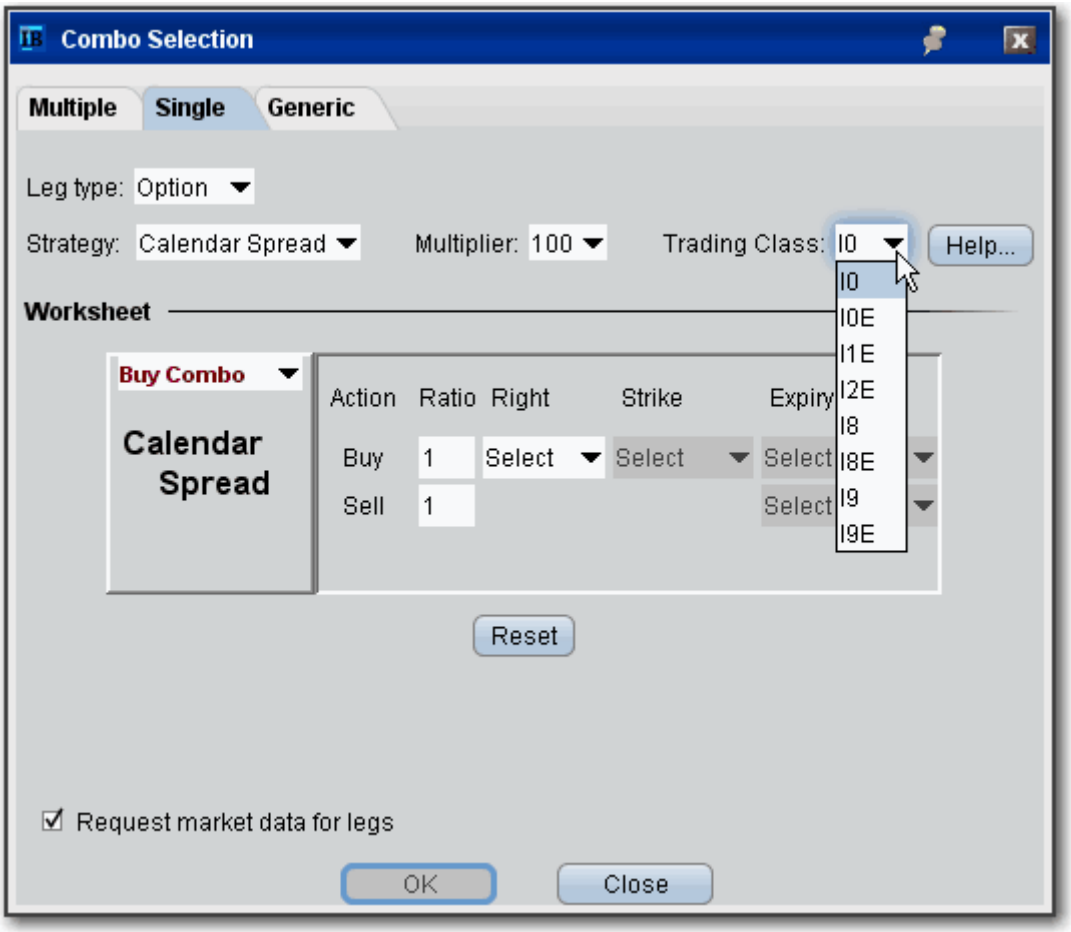


区域名称	描述
边类型	显示的工具类型是基于您输入的底层证券和交易所的。如果两个选项都是活动的，选择您想要创建的定单类型。如果多于一个输入是活动的，您可以选择一个工具类型。

区域名称	描述
交易类别	如果交易所同时列举了美式和欧式期权，则显示用来区分二者的可用交易类别列表。
策略	组合策略根据您选择的**边类型**被列举出来。要获取对所有组合策略的描述，参见组合定单话题。使用交易平台帮助按钮获取策略描述。
过滤器	使用过滤标准来定义您的组合。过滤器根据您选择的策略，与上下文有关。例如，对日历差价，过滤器标准包括了前后月到期日、权利、持续期间和行权价。对蝶式差价，过滤器标准包括了到期、权利以及对定单每条边的行权价选择。 随着您定义标准，右侧窗格中的合约会调整以满足它们。使用鼠标 + Ctrl 键，从右侧窗格中的列表中选择多个组合。
输入	如果您想要修改默认比率，则使用该区域。
对所有边要求市场数据	选中对定单的每条边创建市场数据线，显示在交易屏幕上。

单个组合

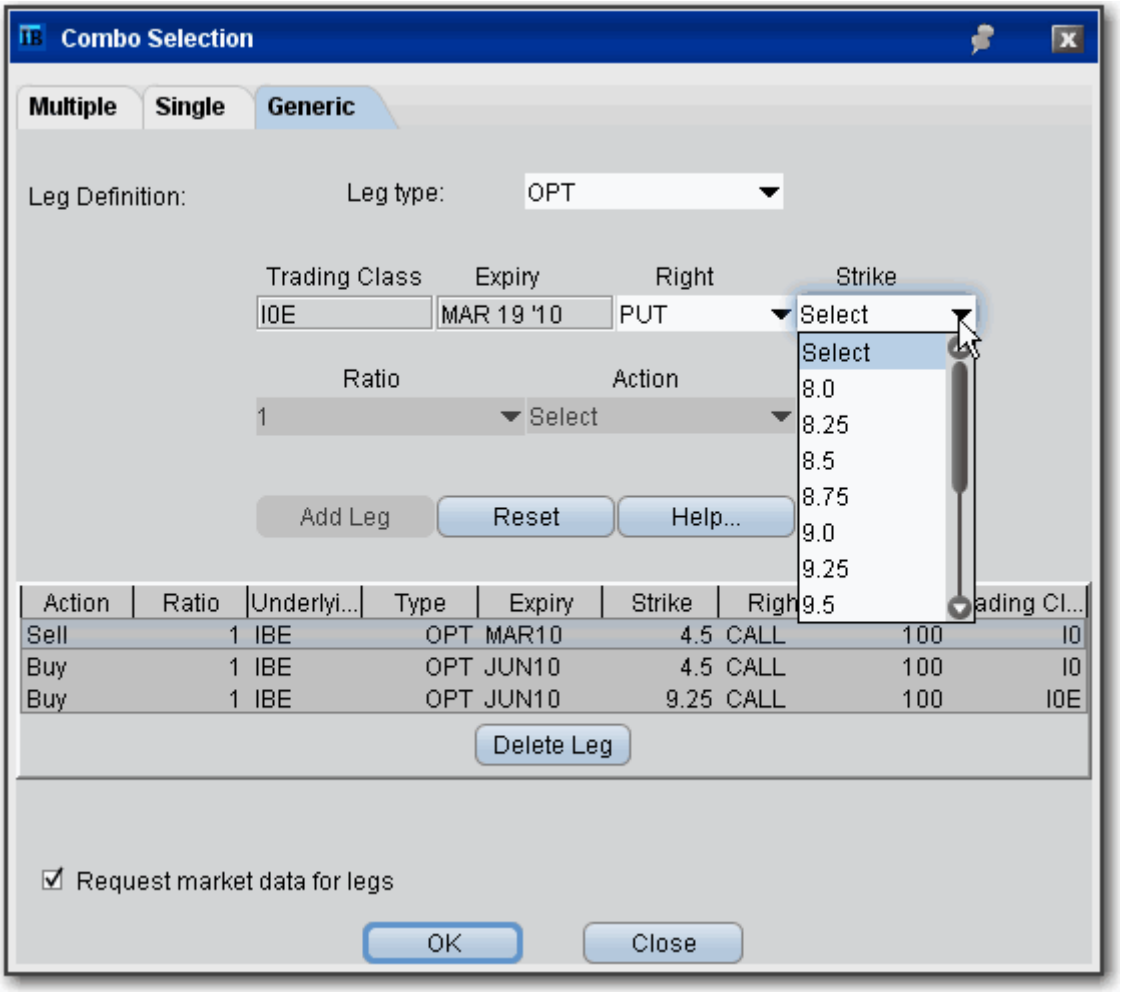
使用**单个**标签来选择一个被认可的组合定单，并定义必要的参数。注意，对同时列举了美式和欧式期权的交易所，*交易类别*区域展示了可用类别的下拉列表。



区域名称	描述
边类型	显示的工具类型是基于您输入的底层证券和交易所的。如果两个选项都是活动的，选择您想要创建的定单类型。如果多于一个输入是活动的，您可以选择一个工具类型。
策略	组合策略根据您选择的**边类型**被列举出来。要获取对所有组合策略的描述，参见组合定单话题。使用帮助按钮获取策略描述。
乘数	选择合约乘数。
交易类别	如果交易所同时列举了美式和欧式期权，则显示用来区分二者的可用交易类别列表。
工作表	在下拉图表中选择*卖出组合*或*买入组合*，以查看组合定单看上去是什么样的。 工作表类别在每次您需要作出选择的时候显示下拉列表框。在整个工作表中移动并根据需要选择选项。
重设	点击重设以重新开始，既可以通过选择另一个策略，也可以通过编辑被选定策略的边。
对所有边要求市场数据	选中对定单的每条边创建市场数据线，显示在交易屏幕上。

一般组合

使用**一般**标签，每次一条边地创建组合。



区域名称	描述
边定义	选择值来定义组合定单的特定边。显示在选择区域中的值与上下文有关。要确保全部信息是有效的，当您移动到下一个区域时，每个区域的值会被锁定。要修改标准，点击**重设**。 *边类型* — 工具类型。 *交易类别* — 如果交易所同时列举了美式和欧式期权，则显示用来区分二者的可用交易类别列表。 *到期* — 为当前边选择到期日。 *权利* — 为当前边选择权利 （看涨或看跌）。 *行权* — 为当前边选择行权价。 *比率* — 为您构建的边选择相对数量的合约。 *行动* — 选择买入或卖出作为对当前边的行动。
添加边	将您刚才定义的边添加到组合定单中。边被显示在按钮下方的表格中。
重设	从上面的边定义区域中清除所有值。
帮助	显示按钮帮助。
删除边	从边表格中删除被强调的边。

区域名称	描述
对所有边要求市场数据	选中对定单的每条边创建市场数据线，显示在交易屏幕上。
确定 / 取消	点击**确定**来保存组合定单。如果您创建的组合是被认可的策略，那么当前定单将被强调在交易页面上并被命名。

传递组合定单

创建组合定单

在您传递组合定单之前，您应当在定单管理行上，或是通过点击**接受**从定单标签窗口中仔细地审查您的定单参数。

1. 从市场数据线上，对您想要创建的组合定单点击 “要价” 或 “出价”。
   - 点击**要价**来创建一笔**买入**定单。
   - 点击**出价**来创建一笔**卖出**定单。
2. 在定单管理行上，如有需要，修改定单参数。

关于定价的注释：如果您买入一个差价并且您欠现金 （借方差价），输入一个正的限价。如果您买入一个差价并且您收到现金 （贷方差价），**您必须输入一个负的限价。**相反地，如果您卖出一个差价并且收到现金，输入一个正的限价。如果您卖出一个差价并且欠现金，**您必须输入一个负的限价。**
例如，一份 April 20 xyz 看涨期权显示 BID 价格为 6.60 而 ASK 价格为 6.70。一份 April 30 xyz 看涨期权显示 BID 价格为 0.15 而 ASK 价格为 0.20。

如果您买入一份带有以下边的 “借方” 看涨垂直差价：
买入 1 份期权 APR02 20.0 看涨 （6.70）
卖出 1 份期权 APR02 30.0 看涨 （0.15）
对该交易您支付 6.55 （一笔借方交易）。

如果您买入一份带有以下边的 “贷方” 看涨垂直差价：
卖出 1 份期权 APR02 20.0 看涨 （6.60）
买入 1 份期权 APR02 30.0 看涨 （0.20）
对该交易您收到 6.40 （一笔贷方交易；输入负的限价）。

3. 传递该定单。

组合定单注释

该页面包含了关于创建和传递组合定单的注释和提示。

- 使用智能路径分别地执行边，以确保您对定单的所有边获得最佳的价格。
- 一些当前支持本地组合定单的交易所 （这意味着它们将边作为一笔交易一起执行）包括：
  - ISE
  - ONE
  - DTB （欧元）
- 为帮助确定特殊组合定单的比率，使用我们的价格 / 风险分析工具。首先，使用期权建模者编辑模型，然后使用期权分析查看模型输出结果。
- **关于定价的注释：**如果您买入一个差价并且您欠现金 （借方差价），输入一个正的限价。如果您买入一个差价并且您收到现金 （贷方差价），**您必须输入一个负的限价。**相反地，如果您卖出一个差价并且收到现金，输入一个正的限价。如果您卖出一个差价并且欠现金，**您必须输入一个负的限价。**

  例如，一份 April 20 xyz 看涨期权显示 BID 价格为 6.60 而 ASK 价格为 6.70。一份 April 30 xyz 看涨期权显示 BID 价格为 0.15 而 ASK 价格为 0.20。

  如果您买入一份带有以下边的 “借方”看涨垂直差价：
  买入 1 份期权 APR02 20.0 看涨 （6.70）
  卖出 1 份期权 APR02 30.0 看涨 （0.15）
  对该交易您支付 6.55 （一笔借方交易）。

  如果您买入一份带有以下边的 “贷方”看涨垂直差价：
  卖出 1 份期权 APR02 20.0 看涨 （6.60）
  买入 1 份期权 APR02 30.0 看涨 （0.20）
  对该交易您收到 6.40 （一笔贷方交易；输入负的限价）。

- 当您使用**定单标签**窗口来创建组合定单时，点击**接受** （而不是传递）来证实您的定单参数。
- 在您传递组合定单之前，从定单管理行中仔细地审查定单参数。

深度交易者

引言

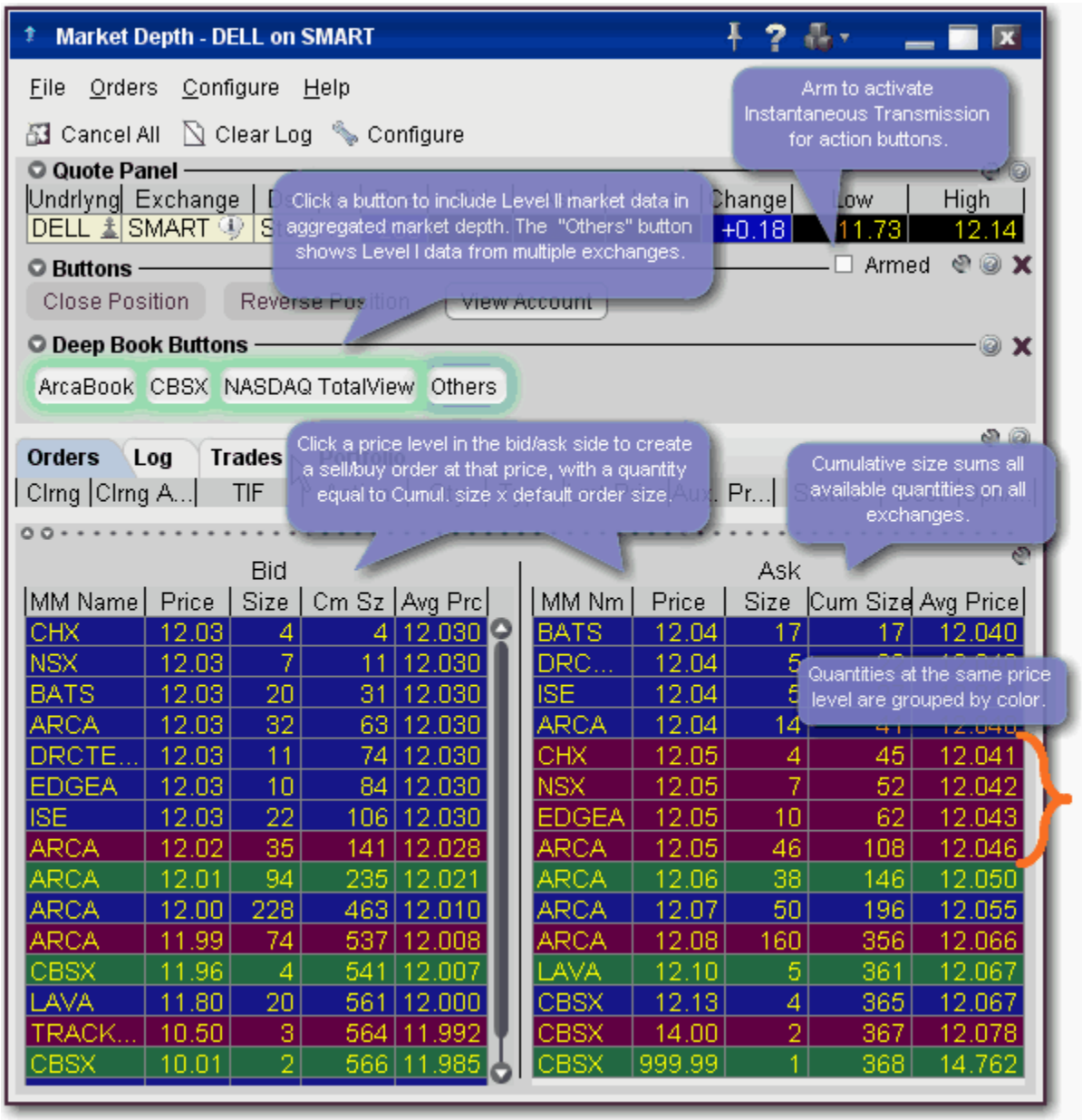
查看偏离内部报价的替代出价和要价，从而帮助您更好地测量市场流动性。

- 集成市场深度窗口
- 市场深度按钮面板
- 从市场深度窗口创建定单

集成市场深度窗口

集成市场深度窗口显示了偏离内部报价的替代出价和要价，从而允许您更好地测量市场流动性。通过点击出价或要价栏中的价格水平来创建定单。从定单面板中传递定单。

使用深层在册按钮来添加或删除第二级数据。*其他*按钮显示来自不提供深层数据的交易所的第一级数据，您对这些深层数据没有市场数据许可，或者您订阅了但没有选择这些数据。



- 我们不能保证对特定证券 / 商品的每个报价都将被显示在市场深度窗口中。
- **累积尺寸**代表了在特定或更好价格可用的总合约尺寸。在上图中，可用于 $12.03 出价的累积尺寸为 106。

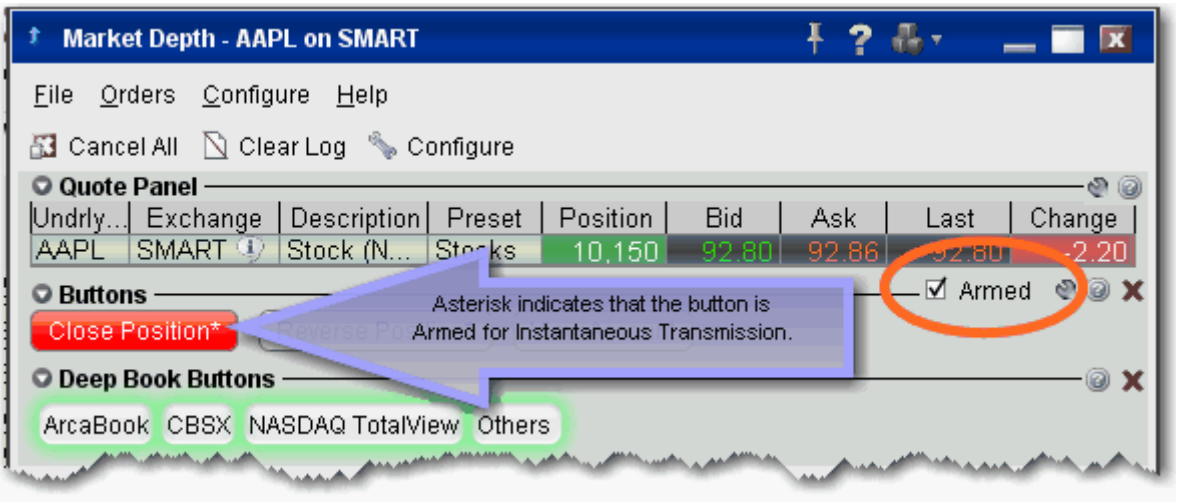
- **平均价格**是当交易累积合约尺寸时收到的平均执行价格。随着您的定单穿过定单册，您将收到多次执行。执行将出现在交易面板中。

市场深度按钮面板

按钮面板提供了行动按钮，它们允许您：

- **关闭头寸** — 在报价面板中选择一个底层证券，然后点击*关闭头寸*让反向平仓定单在定单面板中自动被创建。传递定单或修改任何定单参数然后传递。
- **逆转头寸** — 创建一个有充足数量的反向定单，将您的头寸从多头逆转为空头或从空头逆转为多头。
- **查看账户** — 打开账户信息窗口。

您能够通过配备按钮面板，将按钮设定为立刻传递定单。立刻传递被打开的按钮将在其标题中显示一个星号。



激活立刻传递

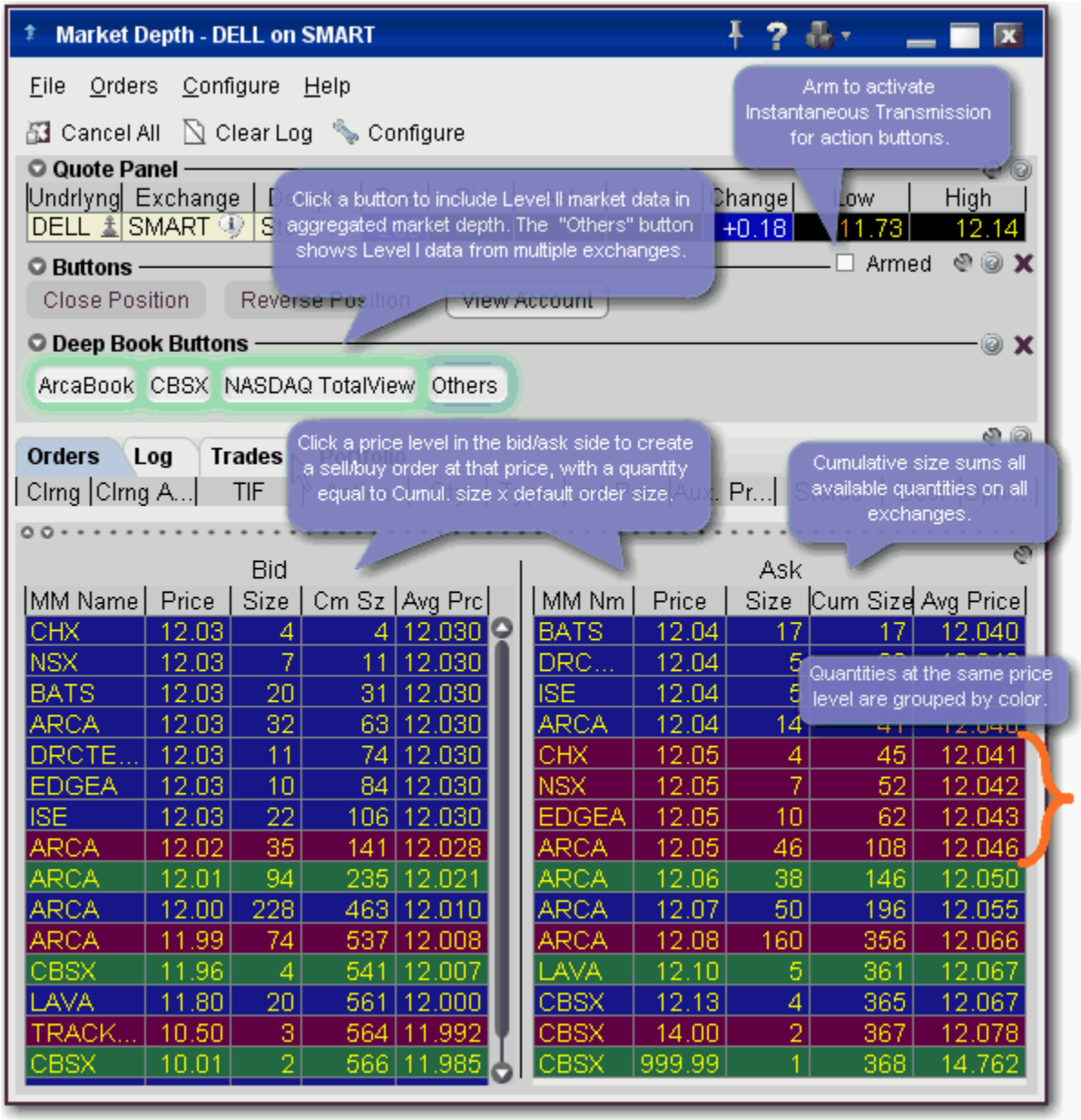
1. 在按钮面板的右上角选中*配备*复选框。
2. 阅读并同意披露消息。

按钮标题中的星号表明，当这些行动按钮被使用时，它们将立刻传递定单。

从市场深度窗口创建定单

通过点击特定价格水平的出价 / 要价，从市场深度窗口中创建定单。确保在传递深度交易者定单之前确认定单尺寸。

定单尺寸是基于与合约预设相关的默认设定的。如果预设使用了*对市场深度使用累积尺寸*，那么定单尺寸等于该行的累积尺寸×默认定单尺寸。例如，如果定单尺寸为 100，您点击了 ISE $12.03 价格水平 （如下），那么定单尺寸将为 10,600。如果您点击了 ARCA 行上的相同价格水平，那么定单尺寸将为 6,300。如果以上方框未被选中，定单尺寸将为默认的定单尺寸。您能够在传递定单之前修改定单尺寸。



从市场深度中创建定单

1. 对卖出定单点击出价栏中的价格水平，对买入定单点击要价栏中的价格水平。
2. 定单显示在定单面板中。如有必要则修改参数，并通过点击状态栏中的“T”来传递定单。
3. 要传递您的定单，在定单行的状态区域中点击“T”。

外汇交易者

引言

特别为外汇交易者设计，可客户化的外汇交易者窗口以强调关键价格组成部分来显示报价对。

- 外汇交易者窗口
- 外汇交易者交易单元格

外汇交易者窗口

外汇交易者显示一个 3 × 3 的“交易单元格”网格，被设计为以被提供在顶部的定单管理模块（定单、日志、执行和投资组合页面）的标准元素来补充外汇交易者工作的方式。页面是完全可客户化的，允许您增加或减少网格中单元格的数量，颠倒报价，更改颜色，以及修改价格和尺寸被显示的方式。

打开外汇交易者

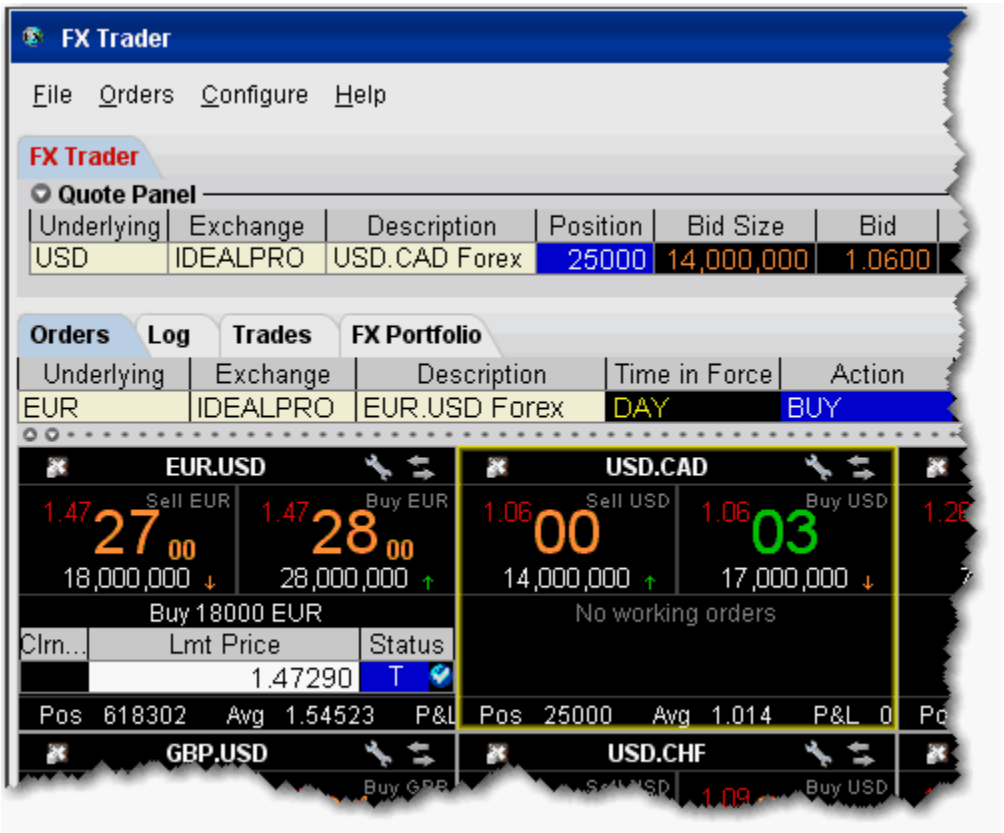
1 在交易工具栏上点击外汇交易者图标。

要配置外汇交易者，在交易工具栏上或在任何交易单元格中点击配置图标。

要了解关于您能为外汇交易者设定的多水平配置细节，参见外汇交易者配置话题。

外汇交易者交易单元格

外汇交易者中的交易单元格包括许多有用的功能，包括用来区分向上和向下价格以及尺寸变动的颜色加注，用来取消货币对的所有定单的取消图标，对外汇交易者配置窗口的快速进入，快速点击来查看颠倒的报价，用来描述定单细节的消息行，带有鼠标悬停信息的图书图标（该信息在小定单有价格改善机会时显示），对头寸和损益信息的可选择的显示，以及进入从合约标签区域右键点击交易平台功能。



打开外汇交易者

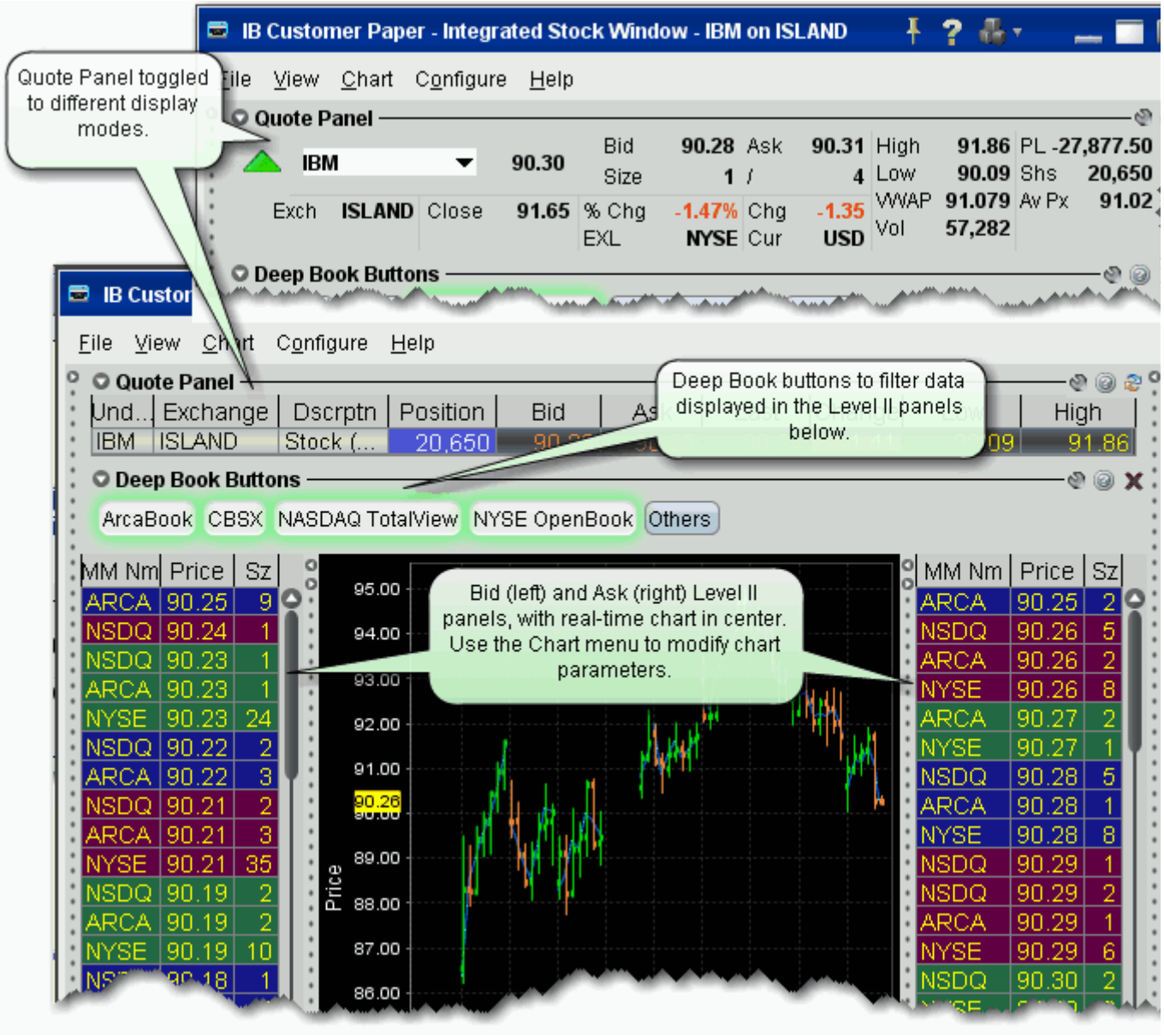
1 在交易工具栏上点击外汇交易者图标。

要了解关于您能为外汇交易者设定的多水平配置细节，参见外汇交易者配置话题。

集成股票窗口 （ISW）

引言

- 报价面板
- 在册数据面板
- 定单输入面板 （OEP）
- ISW 定单输入子面板
- ISW 按钮面板

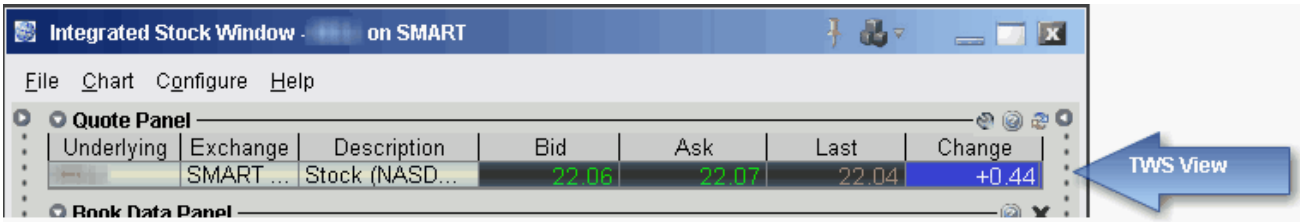


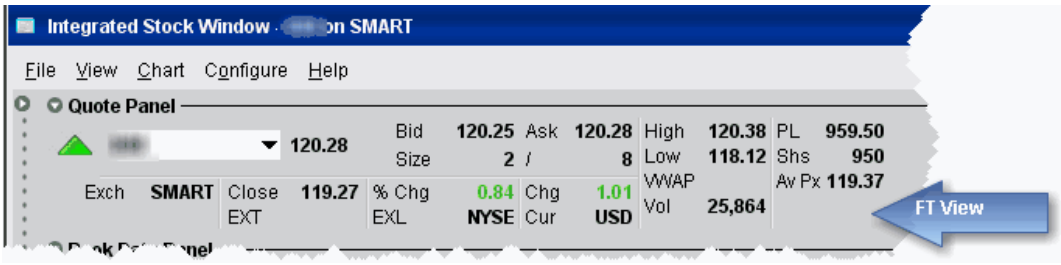
报价面板

交易平台集成股票窗口，或 ISW 是一个中心化的单代码窗口，其提供带有单击定单输入的完整市场数据和图表。

报价面板对选定的股票代码显示市场数据。默认情况下，报价面板使用单行视图，其被用来显示所有的交易平台代码行。

- 要隐藏报价面板，在**视图**菜单上去掉对*报价面板*的打勾。
- 使用面板左上角的*切换视图*图标，在单行视图和外汇代码视图之间进行切换。





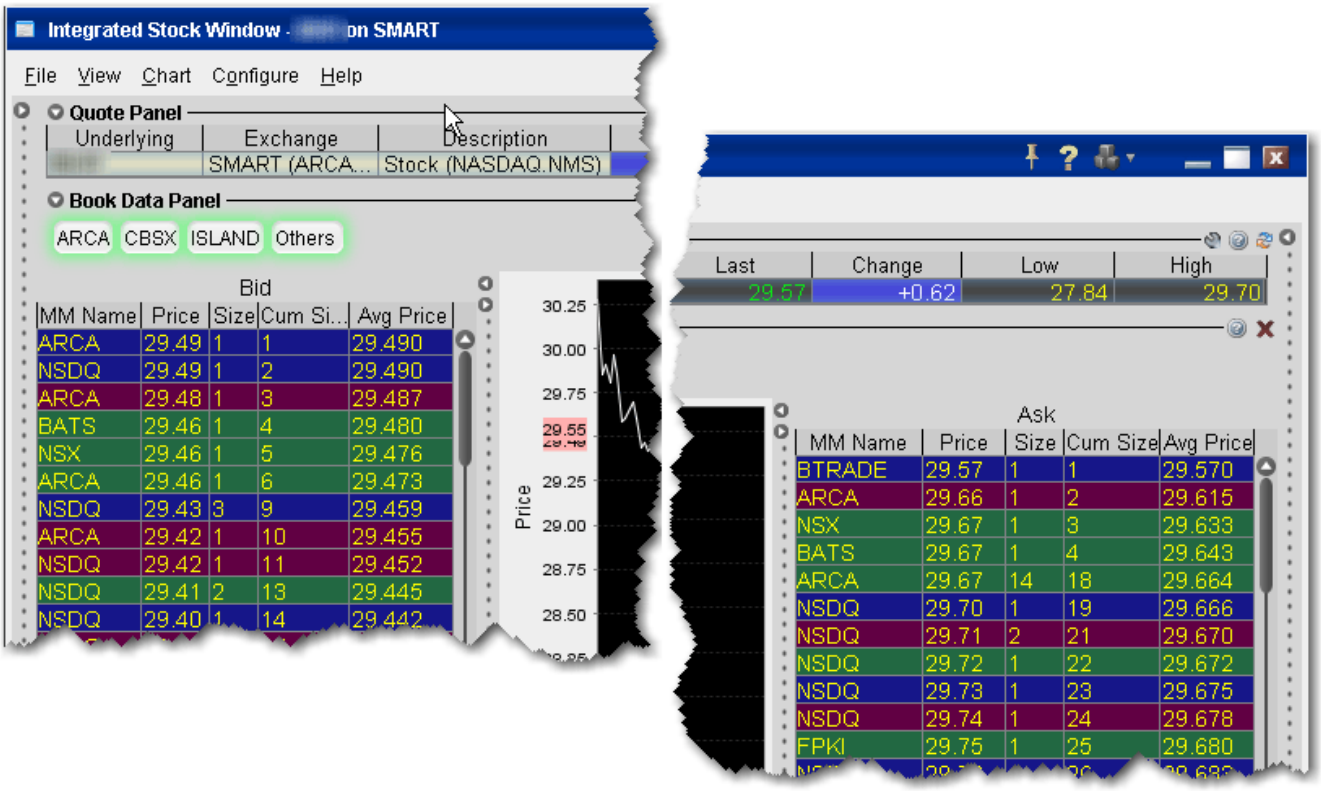
添加代码至报价面板

1 在**底层证券**区域输入一个代码并按下回车。

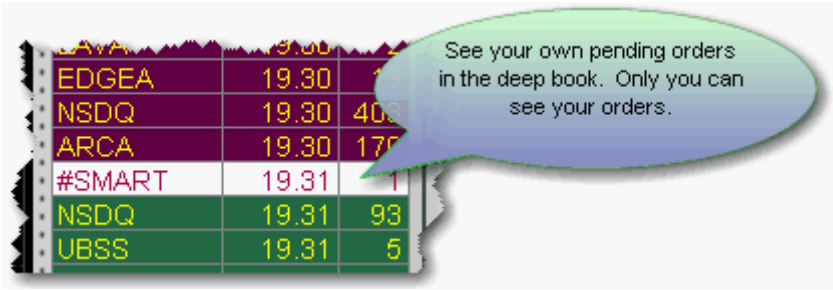
2 从合约列表中选择一只股票。

在册数据面板

在册数据面板在实时、可配置图表的任何一方同时显示第一级和第二级订阅以及非订阅报价。点击按钮将数据从市场中心添加到在册数据面板。



- 要添加数据，点击一个市场中心按钮。*出价*被显示在图表左侧，*要价*被显示在右侧。
- 通过在 ISW 配置**设定**页面上选中*在交易册中显示待处理的定单*，来查看在深层数据中被强调的您自己的定单。



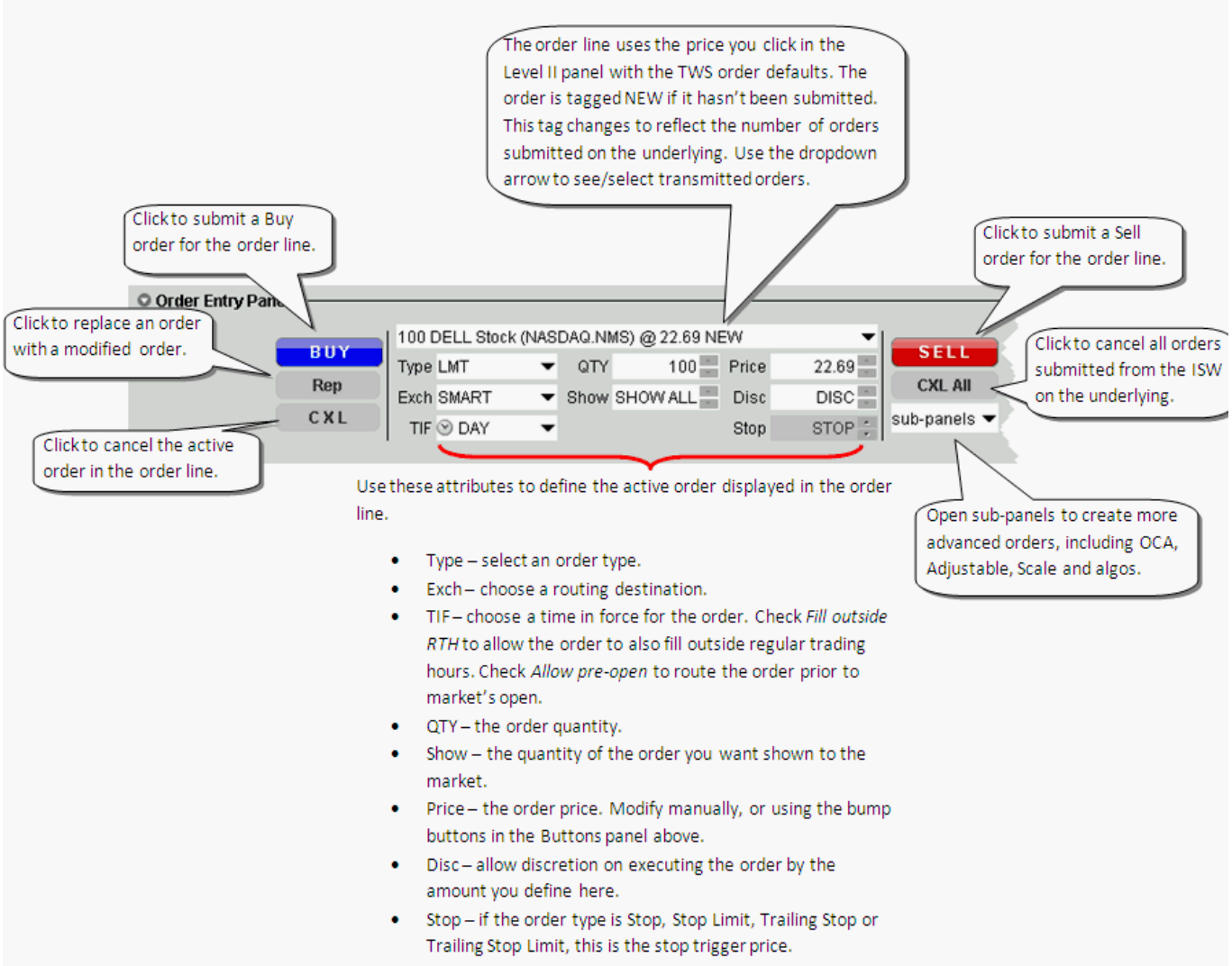
- 当您从在册数据组成部分中点击出价 / 要价时，价格数据被反映在定单输入面板中的定单行上，您从该定单行传递定单。
- 使用图表菜单修改图表参数。选择图表参数来更改时间段、栏间隔以及其他数据选项。

- 如果您选择显示“其他”按钮，点击它来包括第一级数据，这些数据来自不提供第二级数据的市场中心，您不持有第二级订阅的市场中心，以及被订阅但按钮当前未被选定的交易所。从设定页面的深层在册按钮部分显示或隐藏“其他”按钮。

定单输入面板 （OEP）

通过在第二级面板上点击一个价格水平来输入定单，然后使用买入或卖出按钮来传递。使用定单输入面板来：

- 创建并提交基本定单；
- 修改工作中的定单；
- 应用定单属性，例如隐藏、全权委托、OCA；
- 创建并提交高级定单，例如算法、分段、可调整和括号。



在 ISW 中创建定单

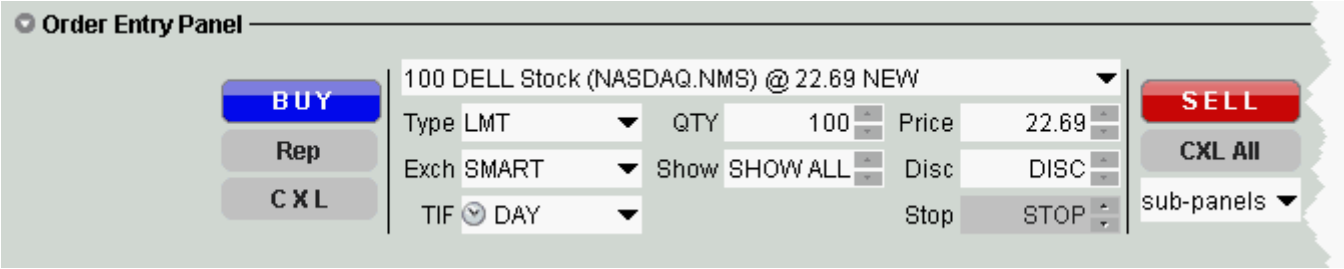
1 在第二级的一个组成部分中点击价格水平。

2 使用定单行下方的下拉框和文本输入区域来编辑定单参数。

3 点击买入或卖出按钮来传递定单。

修改工作中的定单

1 使用定单行上的下拉列表来选择您想要修改的定单。



2 使用下拉列表和文本输入区域或者突出按钮来修改定单参数。

3 点击**替换**来取消当前工作中的定单，并以被修改的定单来替换它。

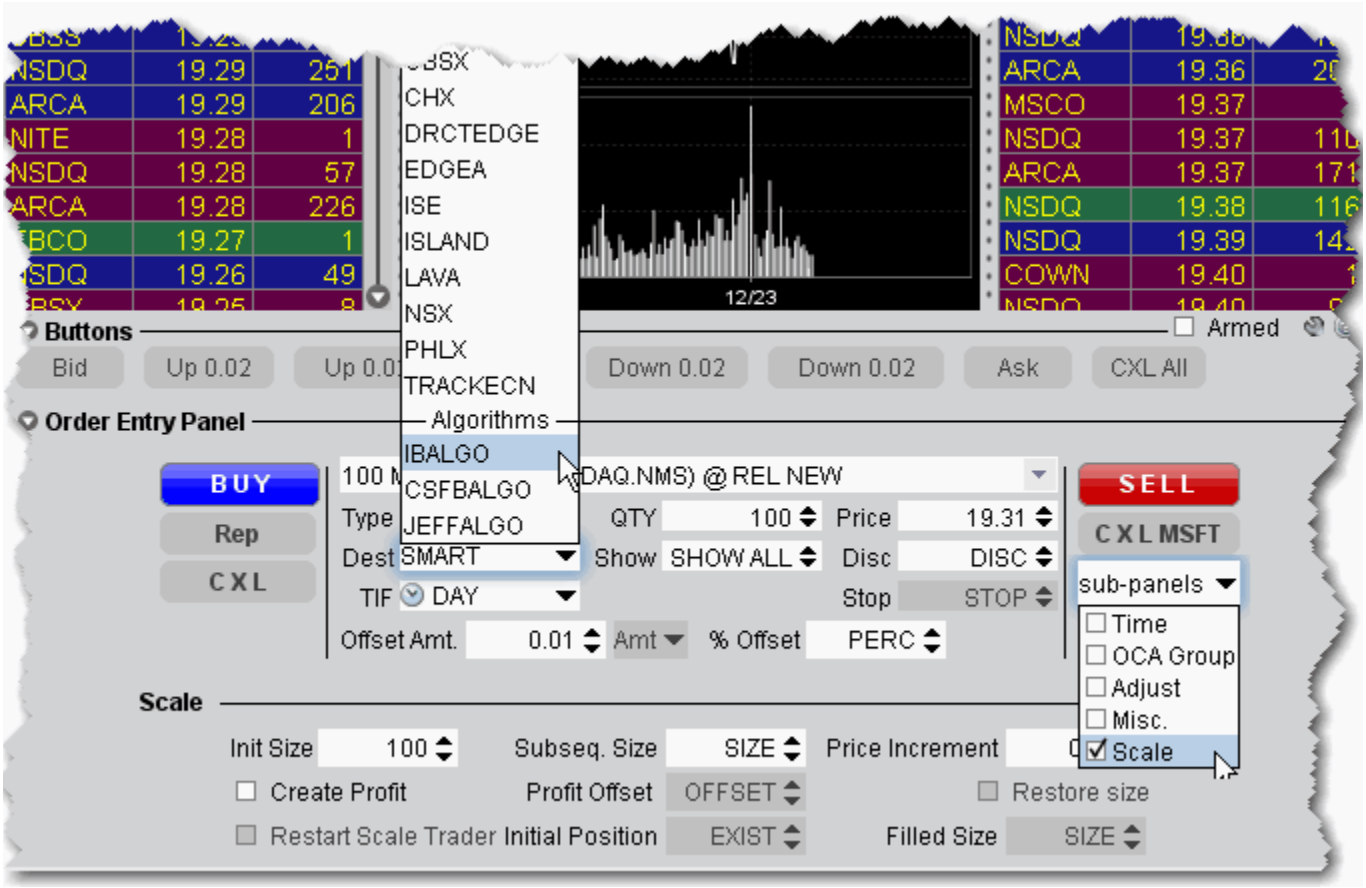
自动定单

在 ISW 中使用自动定单，让交易平台根据您输入的定单区域值，找到执行您目标的最佳定单类型。

当您从类型区域中选择 （自动）时，可能被使用的潜在定单类型列表将会出现在自动输入下方。我们当前支持限价、市价、止损和限价止损自动定单。

ISW 定单输入子面板

使用子面板来创建高级定单并应用定单属性。使用目的地列表来选择算法交易所并定义算法定单。



使用子面板

1 点击子面板下拉选项来显示可用属性列表以及高级定单类型。

Note: 注意，菜单与上下文有关，只有那些对您定义的定单参数有效的定单类型才会被显示。例如，如果您的定单类型是止损，那么分段子面板将不会被显示在该定单的下拉列表中，因为分段属性只能被应用于限价和相对定单。

2 选中您想要应用的定单属性，为该定单类型打开子面板。

3 为选定的定单类型输入值。

Note: 注意，子面板中的值反映了定单标签中的相同区域。要获取有关使用子面板的细节，参考用户指南中相应的话题。

- 分段定单
- 可调整定单

- 杂项

输入算法定单

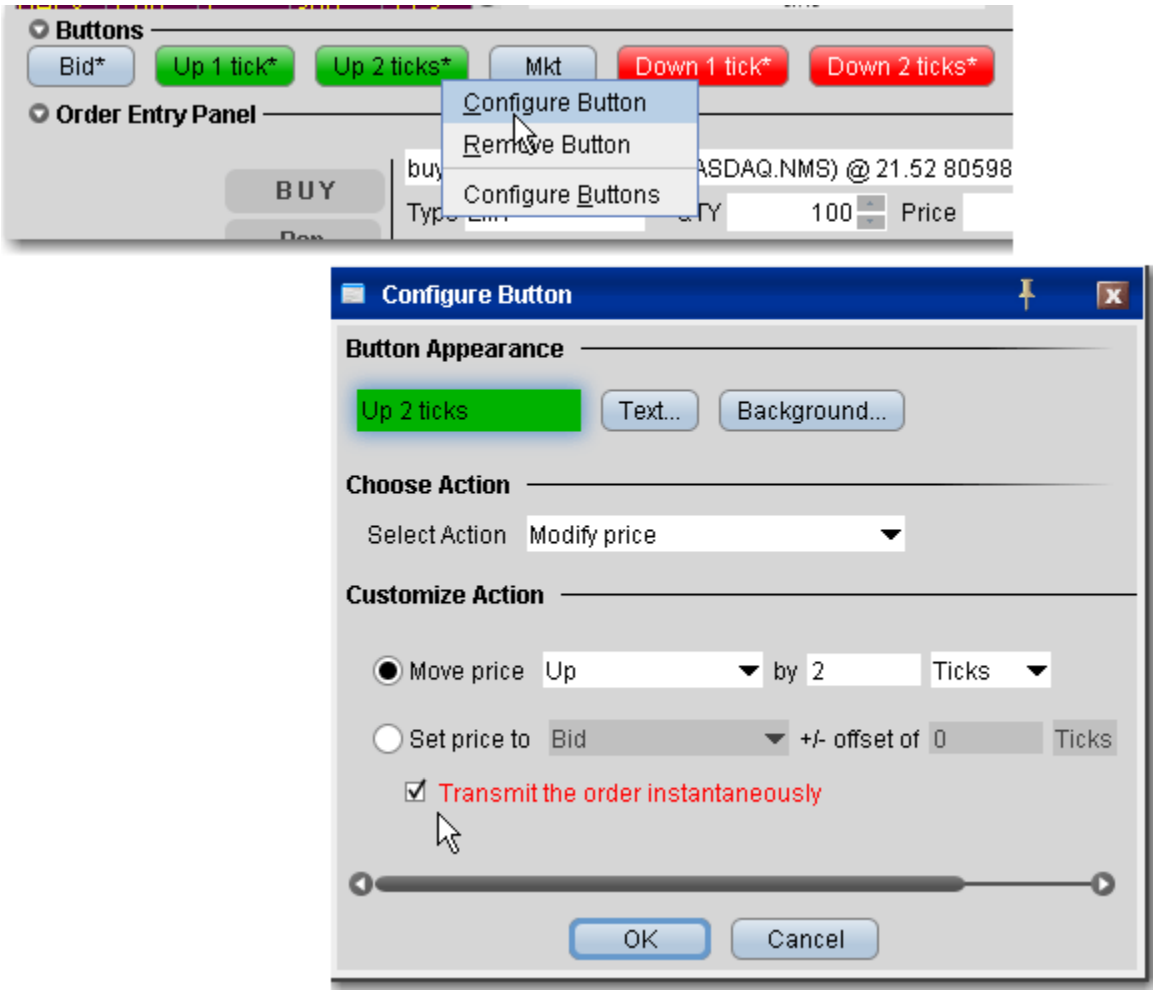
1. 从目的地下拉列表中，在算法部分下选择一个新的算法目的地。
2. 在新的特定算法面板中，输入算法参数。

参见交易平台用户指南话题以获取有关设置算法定单的细节：

- IB 算法
- CSFB 算法
- Jefferies 算法

ISW 按钮面板

ISW 包括三个按钮面板，您能够使用**视图**菜单来隐藏或显示它们。左侧的面板在定单输入面板 （OEP）的定单行上创建新定单，右侧的面板为其他 TWS 交易工具提供单击进入，下面的面板被用来在定单行中修改新定单和工作中的定单。所有按钮都是可配置的并能被配备用来**立刻传递**，方法是点击配备复选框并同意警告披露。



Note: 当按钮被设置为在被点击时**立刻传递**定单，其名称会包括一个星号 （*）。要删除该属性，在按钮面板中不要选择*配备*复选框。

期权交易者

引言

该可配置的独立屏幕显示了底层证券的市场数据，让您根据底层证券设定期权链，给您进入期权定单、执行以及投资组合信息的权利，为模型导航和期权分析窗口驱动数据，并让您创建组合差价定单。

- 使用期权交易者
- 创建期权链
- 期权交易者统计数据
- 创建 / 编辑工具栏按钮

使用期权交易者

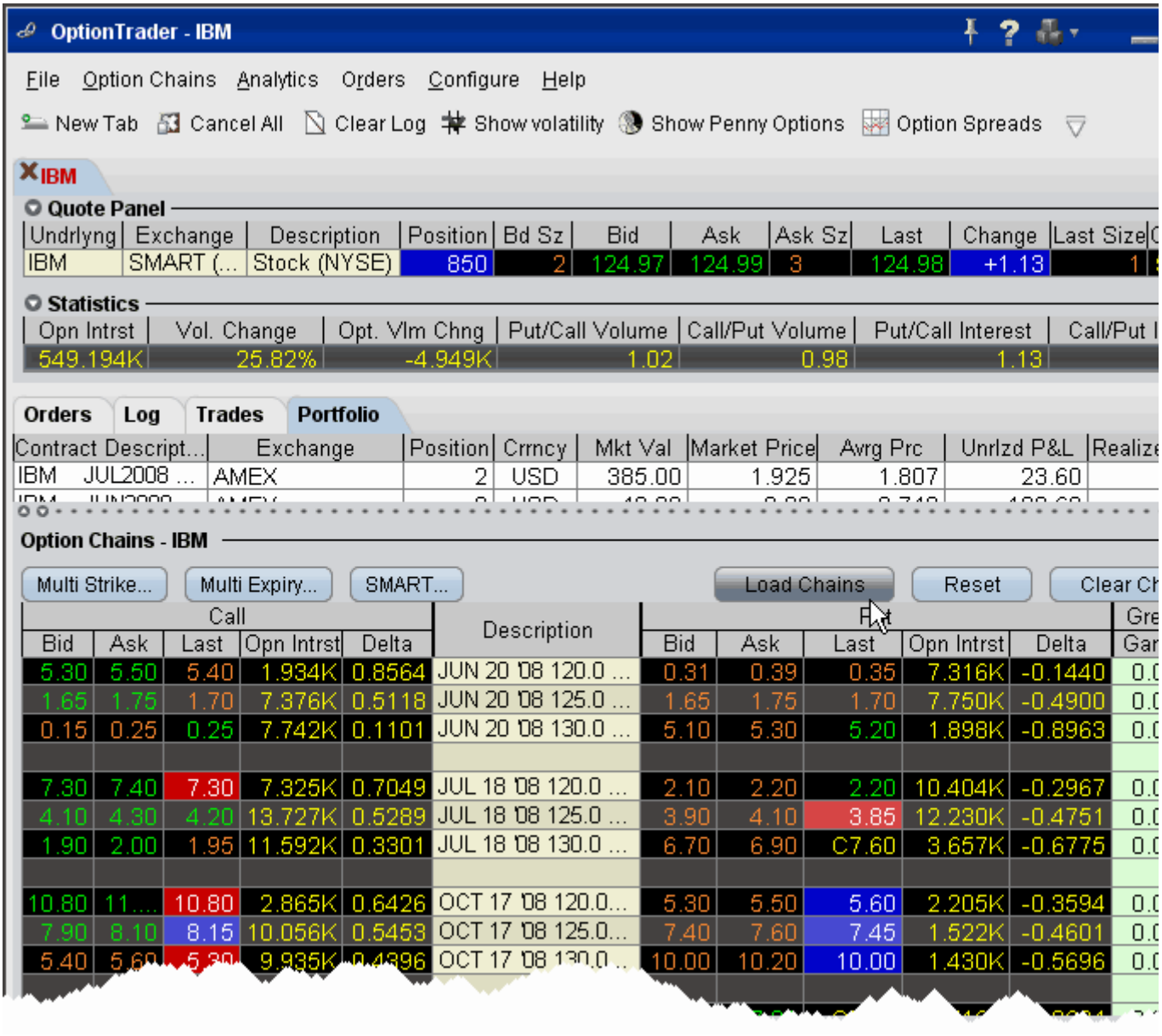
期权交易者是一个单独的、强健的窗口，您可以从选定的股票底层证券的右键*工具*菜单将其打开。希腊字母风险尺度值以绿色被显示给每个期权。使用期权模型编辑器来修改用来计算期权价格以及这些风险尺度的值。对实时市场风险管理，使用 IB 风险漫游 SM。

打开期权交易者

1. 在交易页面上点击需要的股票底层证券，从而将行选定。
2. 右键点击并选择*工具*，然后选择*期权交易者*。

期权交易者窗口为选定的底层证券打开。**报价面板**显示底层证券资产。统计面板对带有股票底层证券的合约显示与期权相关的统计数据。

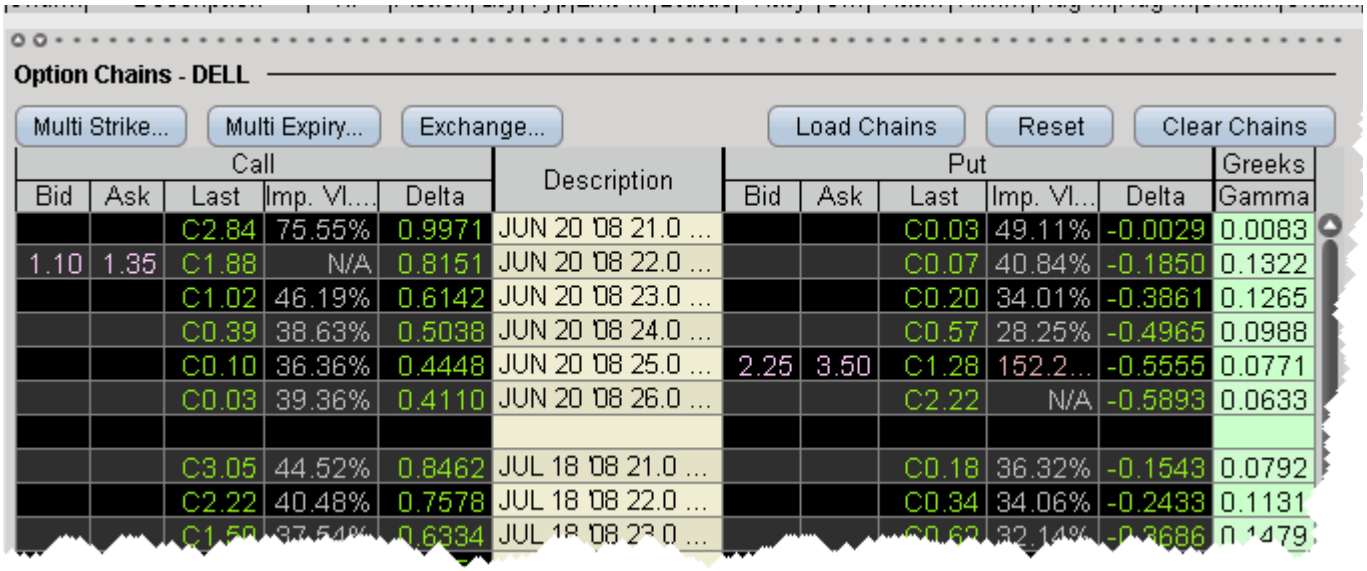
使用工具栏中的*新建标签*图标来添加多个合约。



要获取有关加载期权链以及配置按钮和面板的信息，参见交易平台用户指南话题。

创建期权链

使用期权交易者来创建并管理期权链。通过从配置页面中显示栏来查看期权链中的未平仓合约数。



创建期权链

点击**加载链**对一个底层证券的所有期权加载数据，或者定义行权价、到期日期和交易所来限制返回的期权数量。

1. 使用**行权价**、**到期日期**和**交易所**按钮来定义要被包括到期权链中的期权。

   如果您选择了单个行权价格和到期日期，按钮标签将改变以显示信息。如果您选择了多个行权价格或到期日期，按钮标签将变为 “多个”。

2. 点击**加载链**来查看市场数据。使用**清除链**来删除数据和清除屏幕。点击**重设**来删除客户化按钮标签。

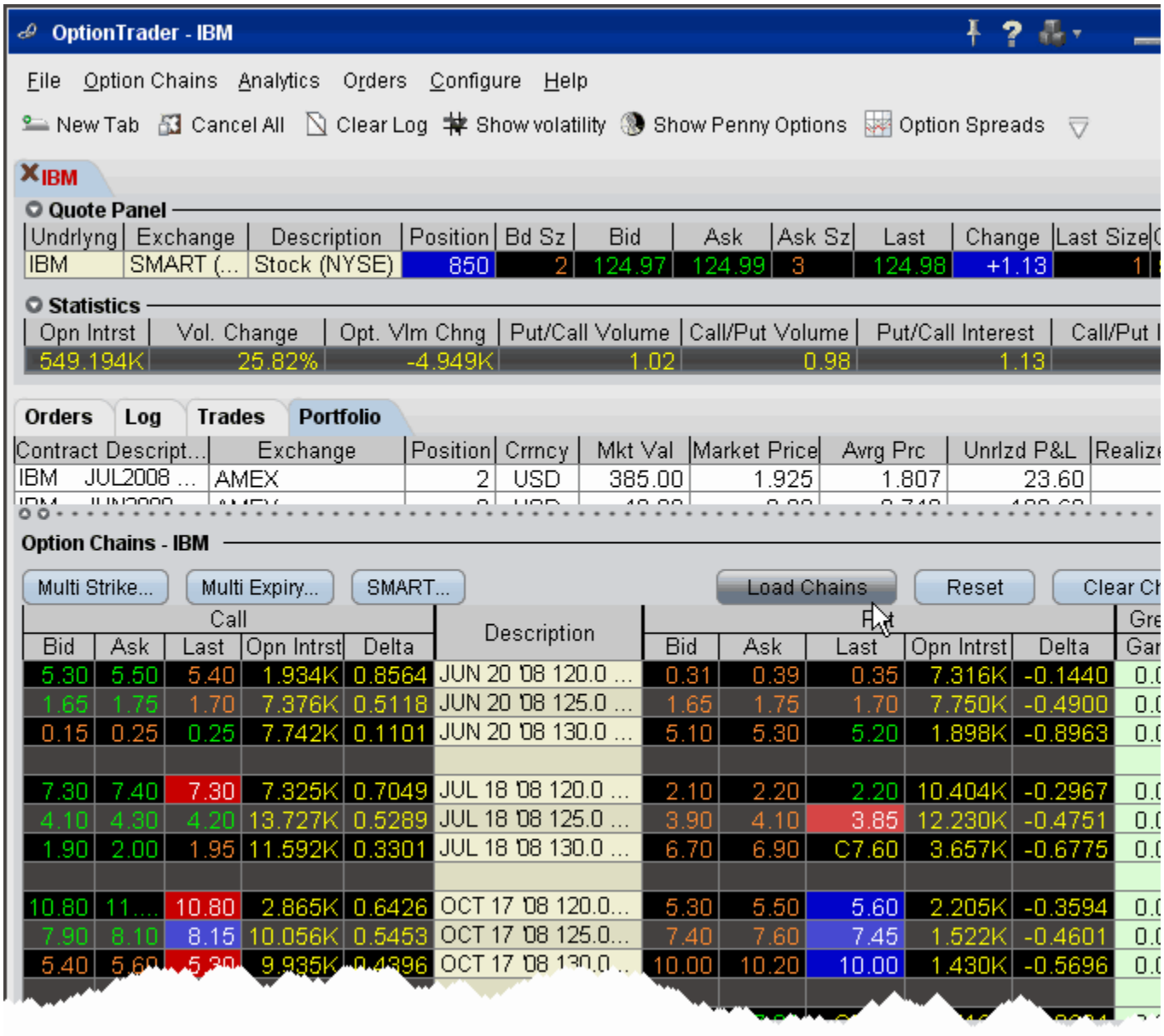
3. 要创建定单，在市场数据线上点击出价或要价。

您能够通过点击工具栏上的**新标签**图标来为其他合约添加页面。在您点击**新标签**按钮后，通过在报价面板上的底层证券区域中输入一个代码来定义底层证券。按下回车，然后选择一个工具类型，再选择特定的合约。新的底层证券将被反映在标签名称上。

Note: 不同于在交易页面上创建的定单，期权链定单被显示在市场数据屏幕上方的活动面板的**定单**部分中。

期权交易者统计数据

可选的*统计数据*面板对带有股票底层证券的合约显示了与期权相关的统计数据。您能够选择显示以下统计数据：



区域名称	描述
出价交易所	识别对期权合约发布最佳出价的交易所。
模型	期权模型价格是使用模型导航，根据底层证券价格、利率、股息和其他数据计算的。
要价交易所	识别对期权合约发布最佳要价的交易所。

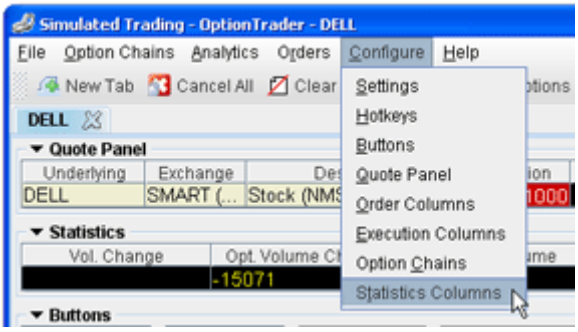
区域名称	描述
历史波动率	显示期权的实际历史波动率。
期权内在波动率	对底层证券未来波动程度的预测。IB30 天波动率是对当前交易日向前 30 个日历日到期估计的市场波动率，并且是基于来自两个连续到期月份的期权价格的。
期权未平仓合约数	为未平仓的期权总数绘制图表。
期权交易量	在特定时间段内交易的合约总数。
波动率变化	波动率与前一日收盘时相比的变化。
期权交易量变化	期权交易量与前一日收盘时相比的变化。
看跌 / 看涨交易量	当日的看跌期权交易量除以当日的看涨期权交易量。
看涨 / 看跌交易量	当日的看涨期权交易量除以当日的看跌期权交易量。
看跌 / 看涨未平仓合约数	当日的看跌期权未平仓合约数除以当日的看涨期权未平仓合约数。
看涨 / 看跌未平仓合约数	当日的看涨期权未平仓合约数除以当日的看跌期权未平仓合约数。
未平仓合约数变化	未平仓合约数与前一日收盘时相比的变化。

显示期权交易者统计面板

1. 在期权交易者工具栏上，点击**配置**扳手图标。
2. 选中*显示统计数据*并点击**确定**。

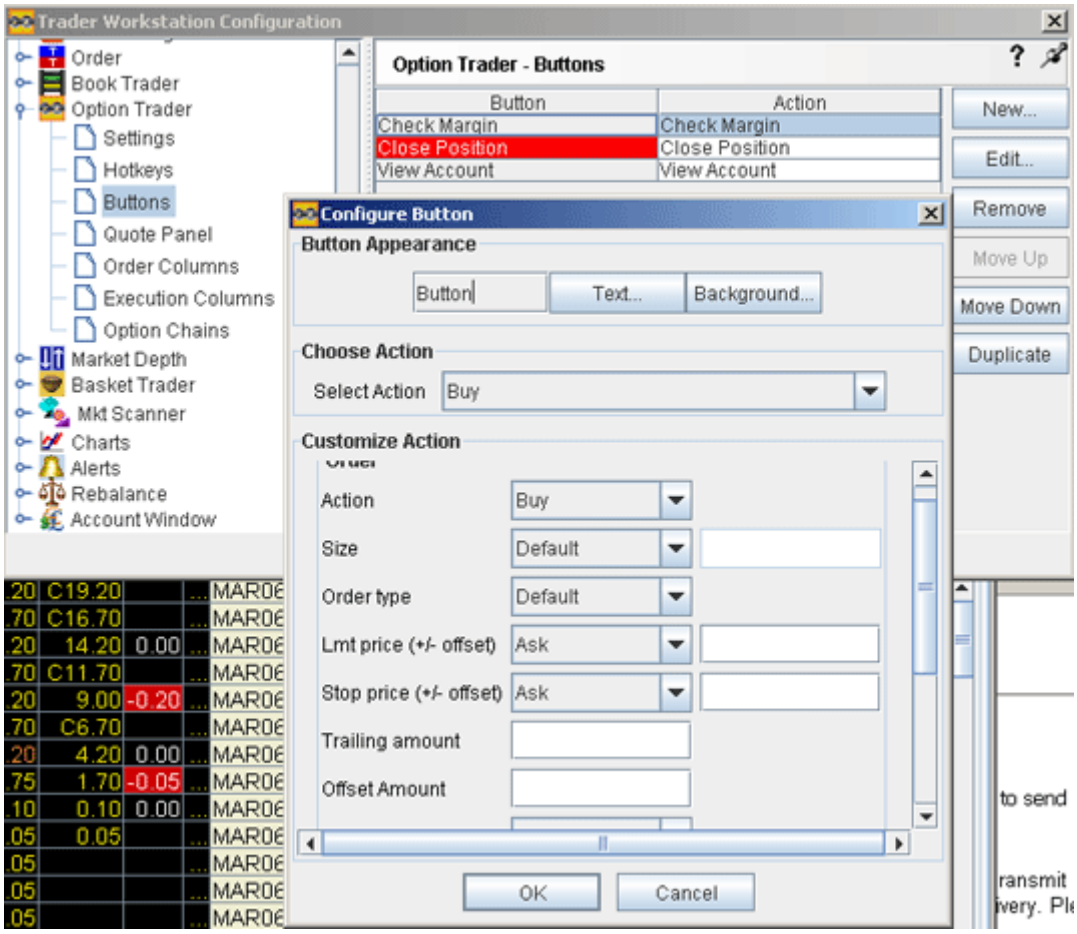
配置期权交易者统计面板

1. 在期权交易者**配置**菜单上，选择*统计数据栏*。
2. 在右侧的*可用栏*列表中点击一个栏，然后点击**添加**按钮。
3. 点击**确定**。



创建 / 编辑工具栏按钮

使用**配置**菜单上的*按钮*选项来添加、编辑和删除被直接显示在*定单 / 日志 / 执行 / 投资组合*标签集上方的行动按钮。



创建或编辑按钮

1. 点击**配置**然后点击*按钮*。
2. 点击*新建*，或者选择一个按钮并点击*编辑*。*新建*添加一个按钮，*编辑*修改选定的按钮。
3. 使用按钮外观部分来更改标签、文本颜色和背景颜色。
4. 使用选择行动下拉选项来选择一个与按钮相关联的行动。
5. 通过在**客户化行动**区域中输入数据来微调行动。例如，对行动*增加价格或尺寸*，您能够指定按钮所应用于的价格或尺寸区域，并设定以什么间隔来增大区域的值。

期权美分定价

引言

- 对美国期权的美分定价
- 美分定价的期权扫描仪页面

对美国期权的美分定价

为努力帮助实现价格改善，我们允许客户以美分交易在 BOX 或 ISE 交易的智能传递的美国期权。美分价格是由客户以及其他流动性提供者发布的，并且当它们可用时会被被显示在期权的 SMART 代码行上。

您能够将您自己的美分价格发布到 IB 的系统中，方法是通过交易窗口提交一个美分定价的全权委托定单。如果您的价格是最优的价格，它将显示在**美分期权**页面。

针对已发布的美分价格进行交易

1. 点击*要价*（来创建买入定单）或者*出价*（来创建卖出定单）。
2. 传递定单。

以美分提交价格

1. 为您的交易页面上的期权合约创建一条市场数据线。

   期权必须在 BOX 或 ISE 上交易，并且您必须选择 SMART 作为数据交易所。

2. 点击*要价*（来创建买入定单）或者*出价*（来创建卖出定单）。
3. 将*限价*修改为优于 NBBO 的美分价格。您能够手动地修改限价，或者使用价格向导来修改。注意，在给定的时间内，只有 IB 系统中最优的美分价格才会被发布。
4. 传递定单。如果您提交了最佳的美分价格，您的价格将显示在合约的市场数据线上，将被发布在 IB 网站的美分页面上，并将出现在美分定价的美国期权扫描仪中。

   与此同时，我们将把定单取整到最近的五分（或一角）增量（对出价为向下，对要价为向上），并将取整后的定单提交到期权交易所，这样您的定单就能够在对您更有利的价格交易，前提是取整的版式是可交易的。

举例：假设 NBBO 为 $2.05 — $2.15。如果您在 IB 系统中输入一笔以 $2.08 买入 10 份 XYZ 期权合约的定单，IB 将以 $2.05 发送一笔买入定单至期权交易所。如果 $2.08 是 IB 系统中最佳的美分定价出价，您的 $2.08 出价将被显示。

如果您不想让您的美分价格被广播到 IB 网站上和交易平台中，您能够通过选中定单行上的*隐藏美分*属性来选择隐藏您定单的美分价格。注意，即使您隐藏了您的美分价格，您的定单的取整版本（对出价**向下**取整到五分和一角增量，对要价**向上**取整）仍将被传递到期权交易所来显示。

隐藏定单的美分价格

1. 右键点击交易窗口的区域标题区，并选择*客户化版式*。
2. 点击**定单栏**标签，并将可用的栏列表向下拉动到*定单属性*部分。
3. 强调**隐藏美分**，并点击*添加*按钮。*隐藏美分*栏被添加到您的交易窗口。

要在 IB 系统中显示美分期权定单，您必须理解并同意：

- **您的美分价格（带尺寸）将通过 IB 网站和交易平台被公开地显示，除非您有其他指示。**对您的美分价格指示的显示不只被限于其他 IB 客户，而是面向广大的公众的。您能够指示我们不要显示您的美分价格，但那样会使您更不可能交易。

- **您对美分价格的兴趣将不会被显示在期权交易所或通过期权价格报告权利机构被显示。**如果您发送一笔美分价格定单，IB 将把您的定单取整到五分或一角 （对出价向下取整而对要价向上取整）来发送到期权交易所，但您的美分价格将只被显示在 IB 系统中。就此而言，您的美分价格定单是一笔全权委托定单。
- **IB 不是一个期权交易所，并且 IB 的美分期权定价系统不能执行期权定单，只是将它们传递到期权交易所来执行。**
- **当 IB 将潜在匹配的定单发送至期权交易所时，竞价过程将被使用，从而您有可能会无法开始交易。**其他交易者将有机会进入并以相同价格参加交易，或者提供更好的价格。
- **显示在 IB 系统中的美分价格不是 “稳固的”，而且将不会总是导致交易。**通过 IB 显示的美分价格是对兴趣的不稳固指示，并且可能在您能针对它们进行交易之前就被取消，或者情况可能改变从而 IB 将不能在期权交易所启动需要的竞价。
- **以美分交易可能会导致更优的价格，但可能会让执行变慢。**当期权交易所的美分竞价进行时，您将必须等待至少三秒钟。

请点击此处获取有关美分期权定价系统的重要细节。

美分定价的期权扫描仪页面

美分期权页面允许您扫描 IB 系统拥有能够被显示的美分定价的出价或要价的全部合约。页面显示了可用于每个底层证券的合约总数。

使用美分期权市场扫描仪

1. 在**页面**菜单上，选择*创建市场扫描仪*，然后在**工具**下拉列表中选择*美国期权*。或者，在**视图**菜单上，选择*美分期权*。

   页面的左侧显示了 IB 系统拥有能够被显示的美分定价的出价或要价的全部合约，以及可用于每个底层证券的合约数量。

2. 要对一个底层证券查看所有美分定价的合约，双击代码（或者右键点击代码然后选择*订阅*）。一个标签为底层证券被创建出来，美分定价的期权被显示在页面上。

当有市场扫描仪时，该页面实时地更新，是只读的且不允许您提交定单。您必须从您的交易页面创建定单。如果您在交易页面上对显示美分定价的合约没有市场数据线，您能够从扫描仪页面将其拖动到您的交易页面上。

将合约拖动到您的交易页面

1. 在**美分期权**页面标签上点击右键，然后选择*分离页面*（这使得拖动合约并将其放到您的交易页面上变得容易）。

2. 在*描述*区域上点击并握住鼠标，将合约拖动到您的交易页面上的空白行，然后松开鼠标将合约放下。

请点击此处获取有关美分期权定价系统的重要信息和细节。

定单标签

引言

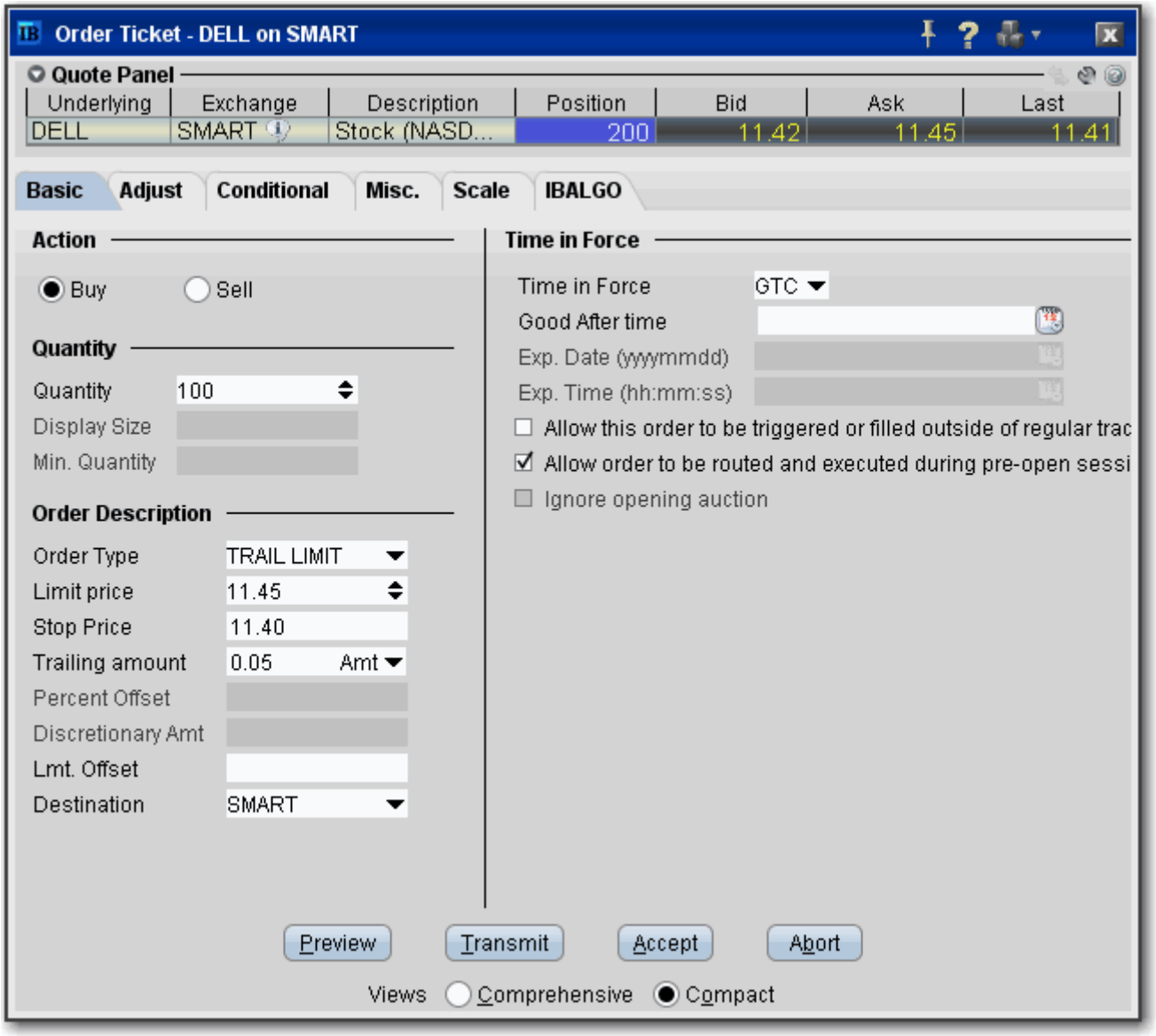
对倾向于从单表格的窗口设置所有定单属性的用户，定单标签可被用作定单输入的一个替代表格。

- 基本
- 可调整定单
- 分段定单
- 挂钩定单
- 波动率交易
- 条件
- 杂项

基本

基本标签包括了基本定单和有效时间信息，全部根据报价面板中显示的合约。区域对内容敏感，这意味着只有有效的选择才会是活动的。例如，如果您选择 TRAIL LIMIT 作为定单类型，那么止损价格、追踪金额和限价抵消将变为活动的。另外，您在该页面上作出的选择将会影响标签集的组成。例如，如果您选择止损或追踪定单类型，那么*调整*标签将变为可用的；如果您选择 VOL 作为定单类型，*波动率*标签将被显示，等。

Note: 当您点击分段标签时，分段定单属性将从定单标签中分离出来。



要删除标签并在单个大页面上查看全部区域，选择*全面*视图。

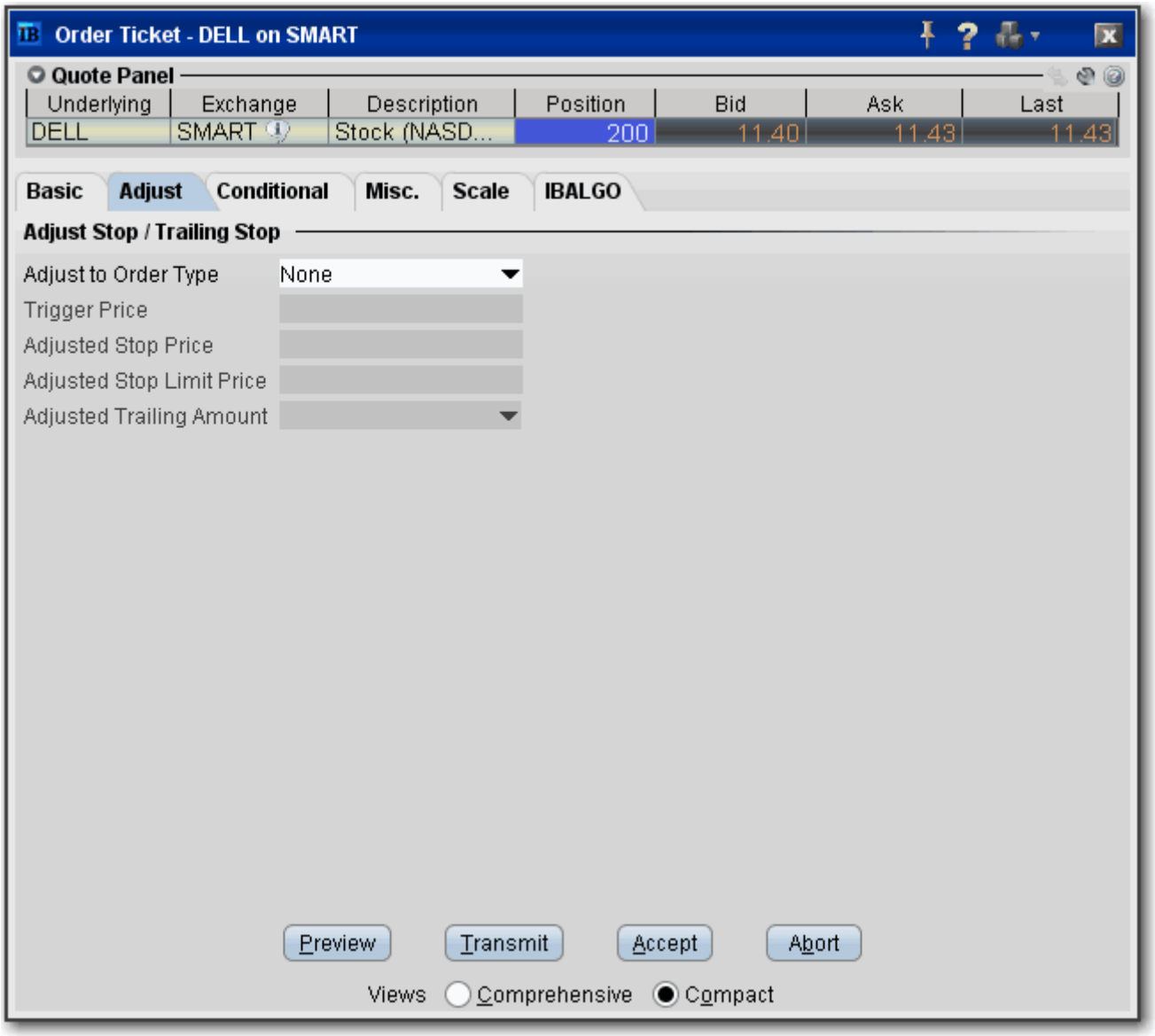
区域	描述	注释
行动	选择买入或卖出	

区域	描述	注释
数量		
数量	定单中的单元数量。	
显示尺寸	输入一个显示尺寸来创建冰山定单。	
最小数量	输入最小数量，其必须可用于定单执行。	对通过 Smart 传递的期权。
定单描述		
定单类型	选择一个定单类型。有效的定单类型是由底层证券、交易所和选择的证券类型决定的。	
限价	如果定单类型需要限价，则输入它。	
辅助价格	对止损和限价止损定单，该定单为止损选择价格。 对与股票定单相关的期权，该价格为起始价格。 对追踪止损定单，该价格为追踪金额。	
追踪金额	与市场价格一起被用来计算初始止损价格的金额。	
百分比抵消	对相对定单，根据出价百分比对买入定单设定抵消金额，或者根据要价百分比对卖出定单设定抵消金额。	
全权委托金额	偏离限价的金额，定单在该价格仍旧有资格执行。	输入一个金额来创建全权委托定单。
目的地	指定定单目的地。	要创建 CSFB 或 Jefferies 算法，从该列表中选择 CSFBALGO 或 JEFFALGO。
有效时间		

区域	描述	注释
有效时间	您的定单将保持活动的时间段。从显示的选项中选择，包括： • DAY 当日 （当日定单）。 • GTC （定单保持为活动的直到其被取消）。 • OPG （开盘市价或开盘限价定单）。 • IOC （立刻执行或取消）。 • GTD （定单保持为工作的直到以下两个区域中指定的日期 / 时间）。 • DTC （取消前当日定单，像当日定单一样在交易日结束时被取消，虽然失效，但仍保留在您的交易屏幕上，让您能够容易地再次提交）。	根据产品、定单类型和目的地，只对每笔定单显示有效的有效时间。
到时后有效	设定一个日期 / 时间，在这之后定单将被提交。	
到期日期	为定单输入到期日期。使用格式 yyyymmdd。定单继续工作直到该日市场收盘时。	对 GTD/GTT 有效时间有效。
到期时间	为定单输入到期时间。使用格式 hh:mm:ss。定单继续工作直到指定的时间和日期。	对 GTD/GTT 有效时间有效。
交易时间属性 接下来三个设置允许您指定定单有资格执行的时间。默认情况下，定单被设置为只在常规交易时间内执行。 **Note:** **在常规交易时间之外进行交易的选项，对未在交易所列举的特定产品可能是不可用的。IB 客户只有责任确保这些参数对涉及地产品是有效地。**		
允许该定单在常规交易时间之外被执行。	如果您想要允许定单在常规时间之外触发或执行，那么选中该方框。	您同样能够在交易窗口中，从定单行的 TIF 下拉列表中设定该功能。 对列举在主要交易所的美国股票有效。不可用于 IOC、OPG（MOO 和 LOO）、FOK、MOC 或 LOC 定单。
允许定单在预开市时段被传递和执行。	选中从而允许定单参与从早上 4:00 — 8:00 的预开市时段。	能够被应用于设定为只在常规交易时段交易的定单。
忽略开盘竞价。	选中从而忽略开盘竞价，该竞价发生在开盘时。	能够被应用于设定为只在常规交易时段交易的定单。 如果您已经配置了智能路径来参与预开市再传递，那么该属性不能被使用。
VWAP 时间	如果需要，通过点击*日历*选择工具来修改 VWAP 截止时间。否则，*最快*截止时间将被使用。	VWAP 定单被自动地传递，并在传递之后被立刻接受。WAP 定单不能被取消。

可调整定单

使用调整标签来定义对止损、限价止损、追踪止损或追踪限价止损定单的一次性调整。只有当那些定单类型当中的一个被选定时，该标签才将变为活动的。

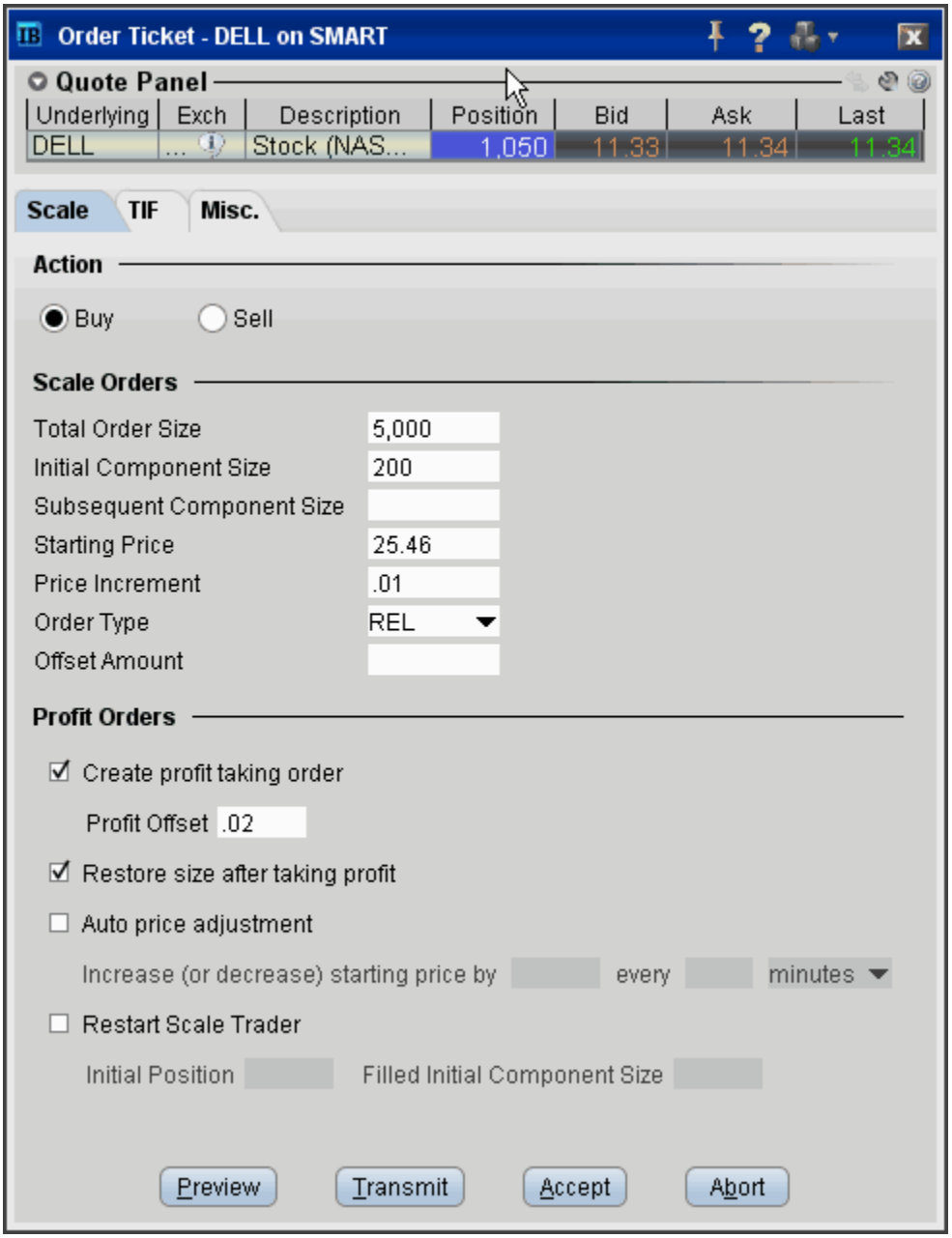


要删除标签并在单个大页面上查看所有区域，选择*综合*视图。

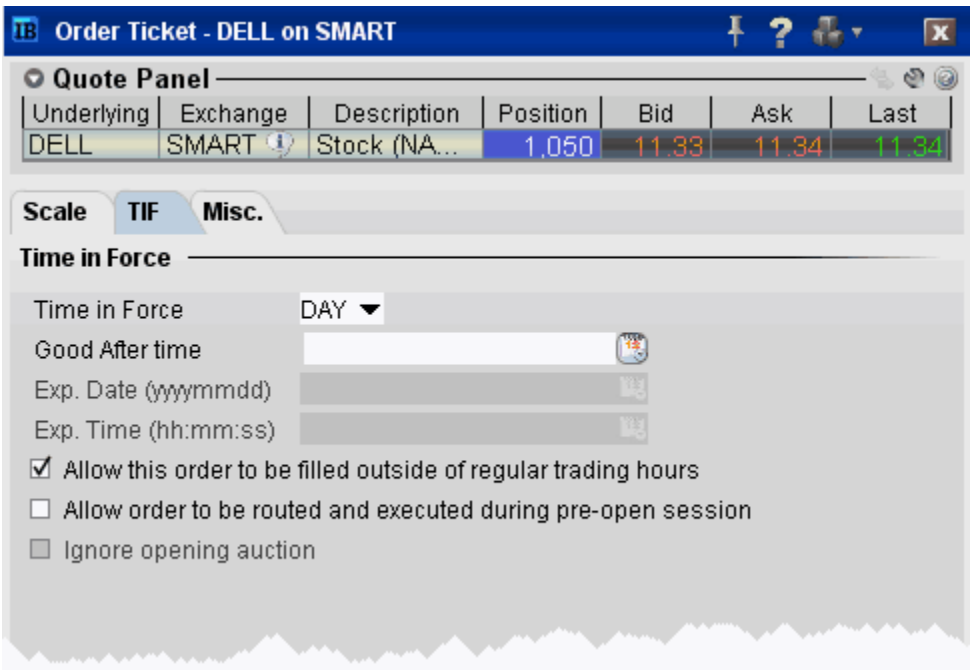
区域	描述	注释
调整为定单类型	当您选择一个调整的定单类型，您调整的止损定单在止损价格被触及时将不会触发。反而，它将被更改为该定单类型，并使用下面的定单参数。 选择一个止损定单类型。当您当前的止损价格被击穿时，它将变为该定单类型，并使用您在以下区域中设定的说明。	以下例子继续对每个区域展开。 您以 31.00/ 股买入 100 股 XYZ，并提交一笔触发价格为 $30.00 的卖出止损定单。这意味着如果价格触及 $30.00，交易平台将发送一笔卖出市价定单至交易所。 现在让我们来修改该情形。除了上面的止损定单，您决定创建一个可调整的**限价止损**定单，在股票价格开始上涨时帮助锁定利润。现在假设价格开始上升。当它触及触发价格 （参加下一个区域）时，交易平台将取消止损定单，并创建一个带有您在以下区域中设定的特征的新的限价止损定单。
触发价格	该价格将触发您在调整的定单类型中定义的调整定单。	将可调整触发价格设定为 $34.00。
调整的止损价格	当触发价格被触及时，将对新定单实施调整止损价格。	将调整止损价格设定为 $33.50。当股票涨到您在上面设定的触发价格 $34.00 之上时，您最初的止损定单被取消，并被止损触发价格为 $33.50 的限价止损定单替换。
调整的限价止损价格	被用于限价止损和追踪限价止损定单。如果定单被触发和提交，该值将为定单的限价。	将止损限价设定为 $33.00 来确保您的定单将不会在该价格之下执行。
调整的追踪金额	被用于追踪止损和追踪限价止损定单。如果调整定单被触发，那么该值将替代最初追踪金额。	如果您有一笔追踪金额为 $1.00 的追踪止损定单，您可以将调整追踪金额设定为 $.50。如果调整触发价格被触及，那么追踪金额将被修改。

分段定单

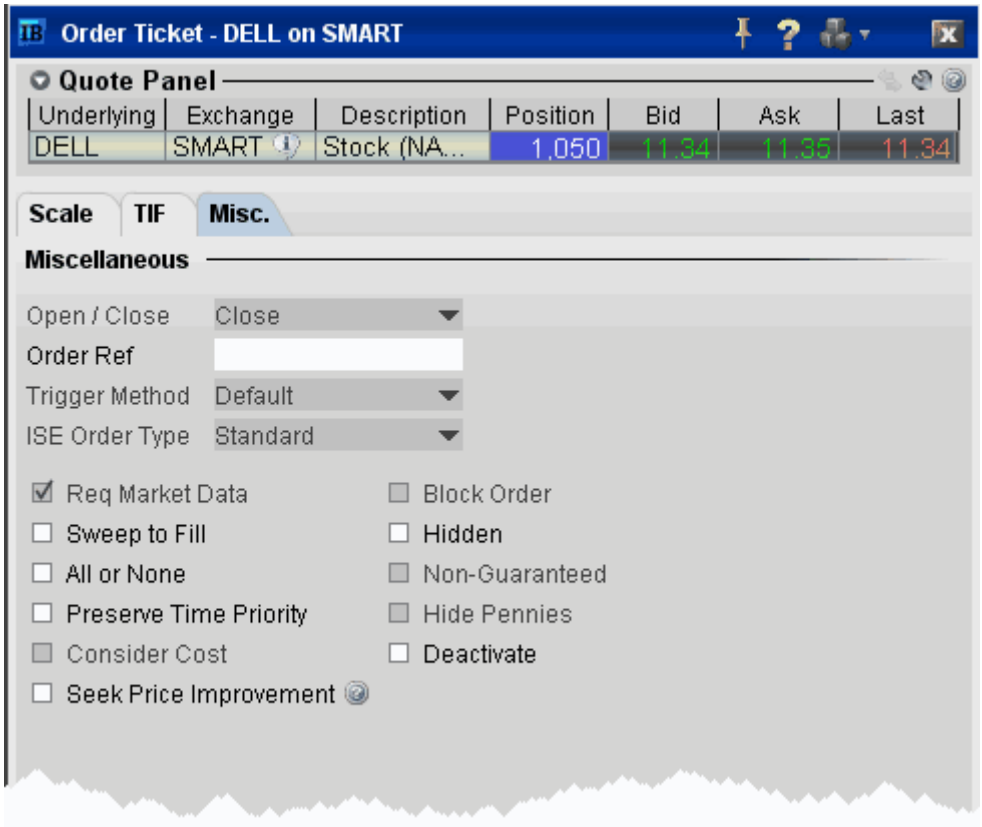
当您在定单标签上点击分段定单时，它会散开从而让您分别地定义分段属性。



分段定单被设计用来帮助使较大尺寸的交易避免受到不断恶化的价格的影响，方法是根据用户指定的价格和尺寸说明，将您的定单分割成较小的、逐级定价的组成部分。除了将您的定单分段，您还能够定义一个利润抵消金额，其指导交易平台自动地对最初定单的单个组成部分提交反向获利回吐定单。



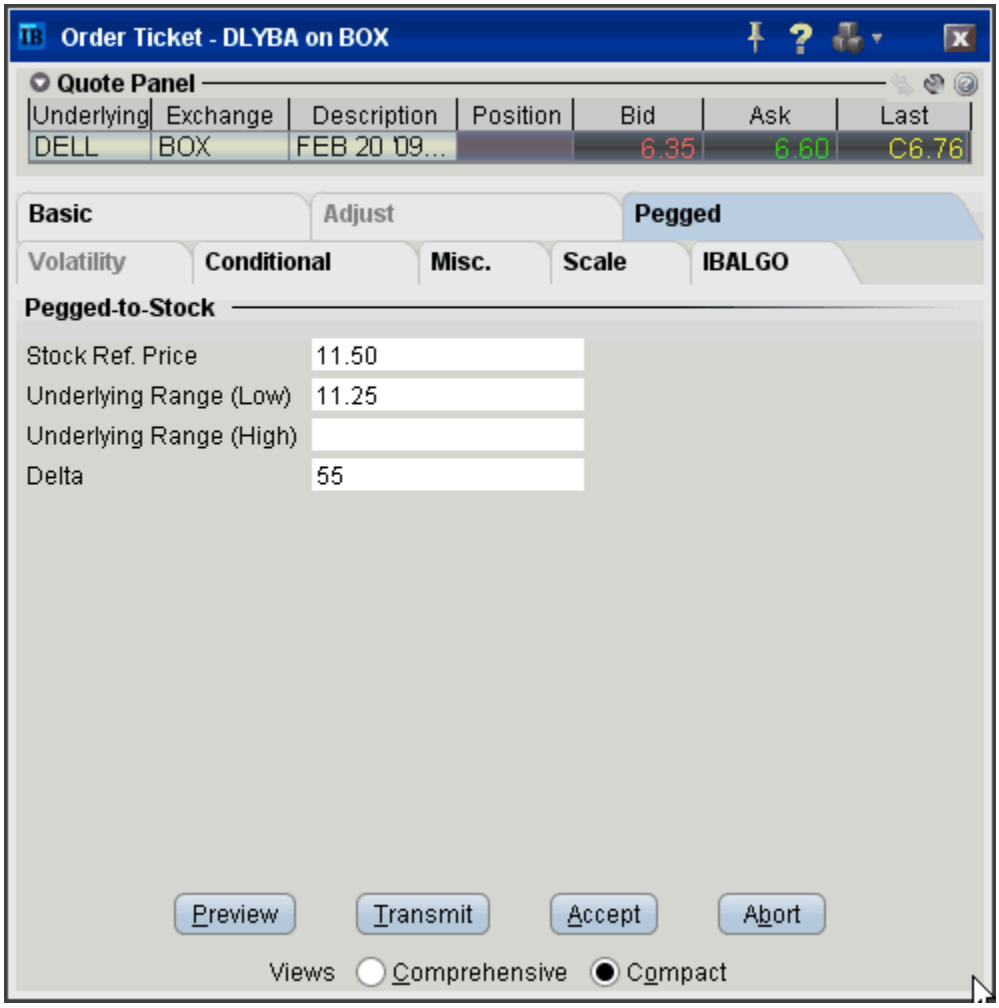
为分段定单设置有效时间参数。参见基本页面获取细节。



参见杂项定单标签页面获取细节。

挂钩定单

从可用区域中选择来创建定单。区域对内容敏感，这意味着只有有效的选择才将是活动的。例如，如果您创建的是通过 BOX 传递的挂钩股票期权定单以外的任何种类的定单，该页面将为不活动的。

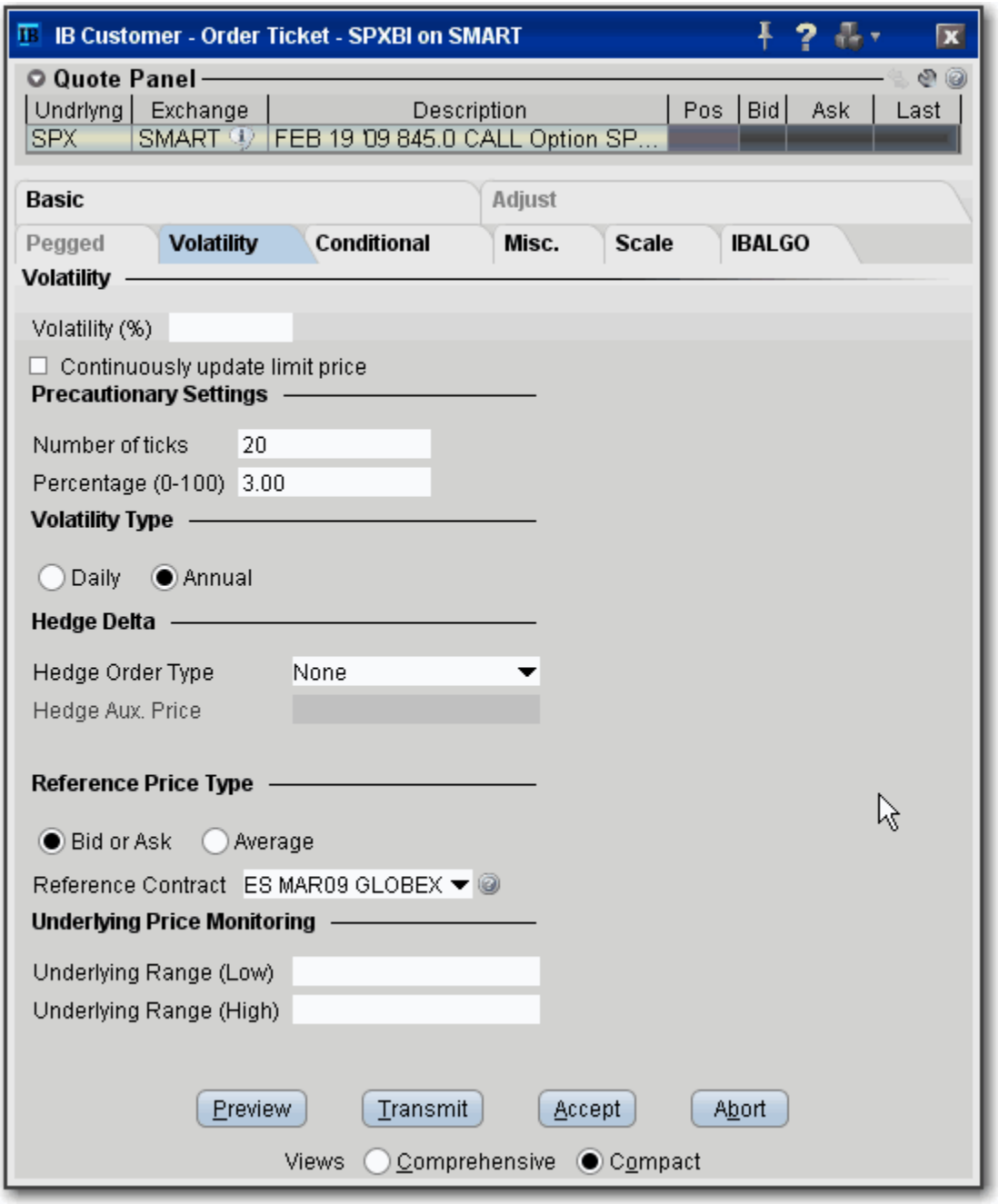


区域	描述	注释
股票参考价格	输入一个股票价格。	如果您不输入值，那么定单提交时的 NBBO 中点价格将被使用。
底层证券范围（低）	定义股票价格范围的较低部分，在这范围之外您的定单将被取消。	
底层证券范围（高）	定义股票价格范围的较高部分，在这范围之外您的定单将被取消。	

区域	描述	注释
Delta	输入一个值（其将被用作百分比，即“.5”等于50%），该值将被乘以底层股票价格的改变量。乘机被加到起始价格中，用来决定期权价格。	

波动率交易

VOL 定单类型让您创建期权定单，当中限价被计算为您能够修改的期权波动率的函数。要激活波动率标签，在基本标签上选择 VOL 作为定单类型。

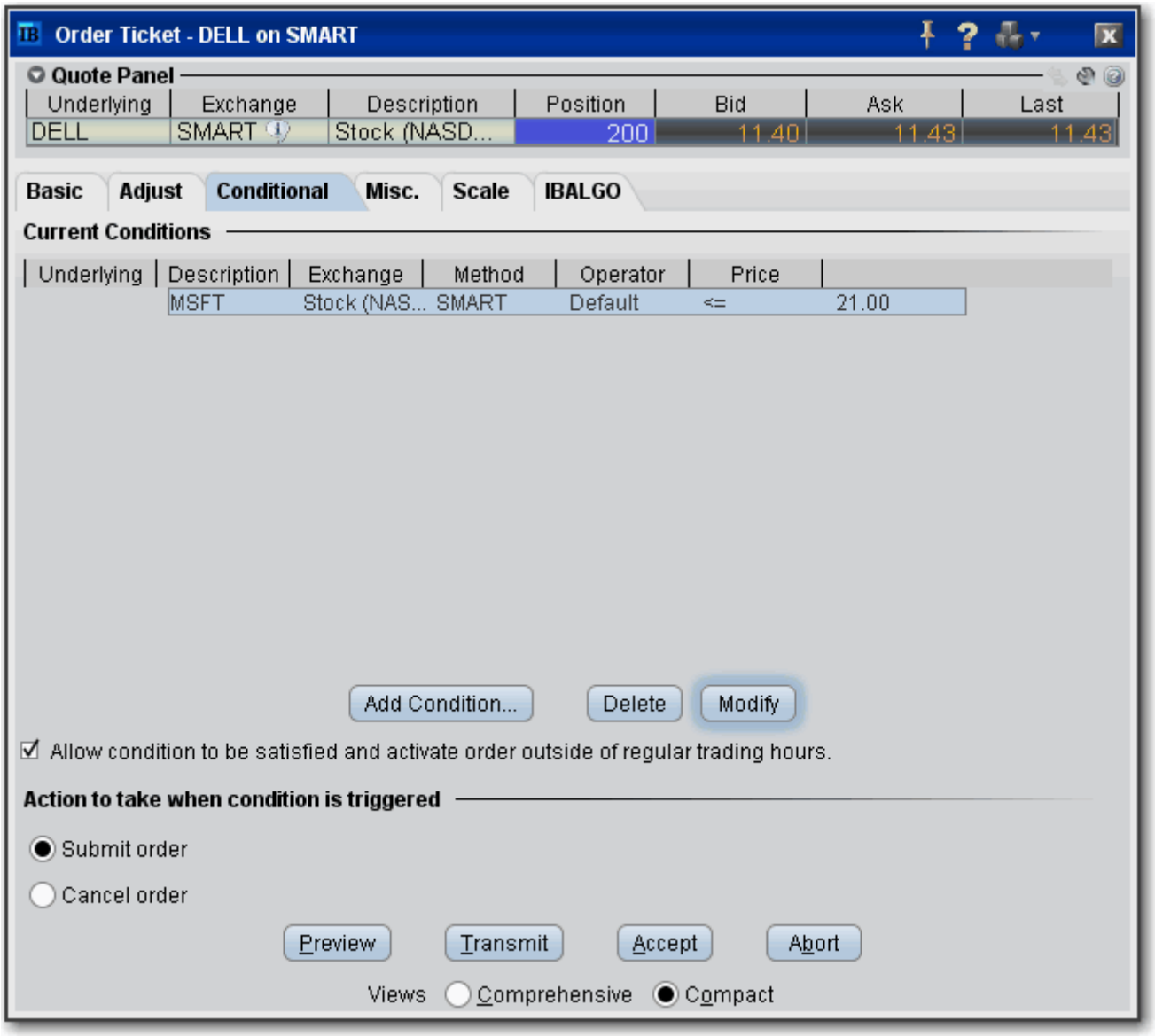


要删除标签并在单个大页面上查看所有区域，选择*综合*视图。

区域	描述
波动率	显示被用来计算期权限价的波动率。被显示在内在波动率区域中的值是通过模型导航计算的。
预防设置	将这些价格封顶 “复查”设置为一种预防措施，用来确保您的定单价格保持在相距市价的可接受距离之内。
波动率类型	选择查看每日或每年波动率。
对冲 Delta	选择对冲定单类型。一笔定单将针对已执行的期权交易被提交，从而维持 delta 中性头寸。
	使用对冲辅助价格区域，为要求辅助价格的定单设定该价格，例如为相对定单设置抵消金额。
连续更新限价	当被选中，期权价格随着底层股票价格移动被自动地更新。
参考价格类型	出价或要价 — 如果被选定，在买入看涨期权或卖出看跌期权时使用 NBB （出价），在卖出看涨期权或买入看跌期权时使用 NBO （要价）。 平均 — 使用最佳出价和要价的平均价格。该价格也被用于计算发送至交易所的限价 （无论连续更新是否被选定），以及被用于底层证券价格范围监控。
参考合约	选择一个用来计算指数价值的期货合约。定单价格随后从该指数价值被推导出来。
底层证券价格监控	底层证券范围 （低） — 输入一个与选定的期权定单相关的低端可接受股票价格。如果底层证券工具的价格跌至股票价格范围的低端以下，期权定单将被取消。 仅仅触到价格将不会取消定单。 底层证券范围 （高） — 输入一个与选定的期权定单相关的高端可接受股票价格。如果底层证券工具的价格涨至股票价格范围的低端以上，期权定单将被取消。 仅仅触到价格将不会取消定单。

条件

条件定单是这样一种定单，其只有当一个或多个被定义合约的特定标准被满足时才将被自动地提交或取消。您能够使用股票、期权、期货或证券指数来触发条件定单。



创建条件定单

1. 选择一个定单管理行。
2. 从右键点击菜单中，选择*修改*，然后选择*条件*。
3. 从定单标签的条件标签中点击**添加条件**。
4. 在条件定单框中为或有资产输入合约信息。

5 为或有资产输入触发信息：

a 选择触发方式。

b 选择或有资产的价格是否应当小于或等于（<=）或者大于或等于（>=）触发价格。

c 输入触发价格。

Note: 如果您选择双重出价 / 要价触发方式，大于或等于操作符（>=）将使用出价，而小于或等于操作符（<=）将使用要价。

6 点击**确定**。条件出现在当前条件列表中。

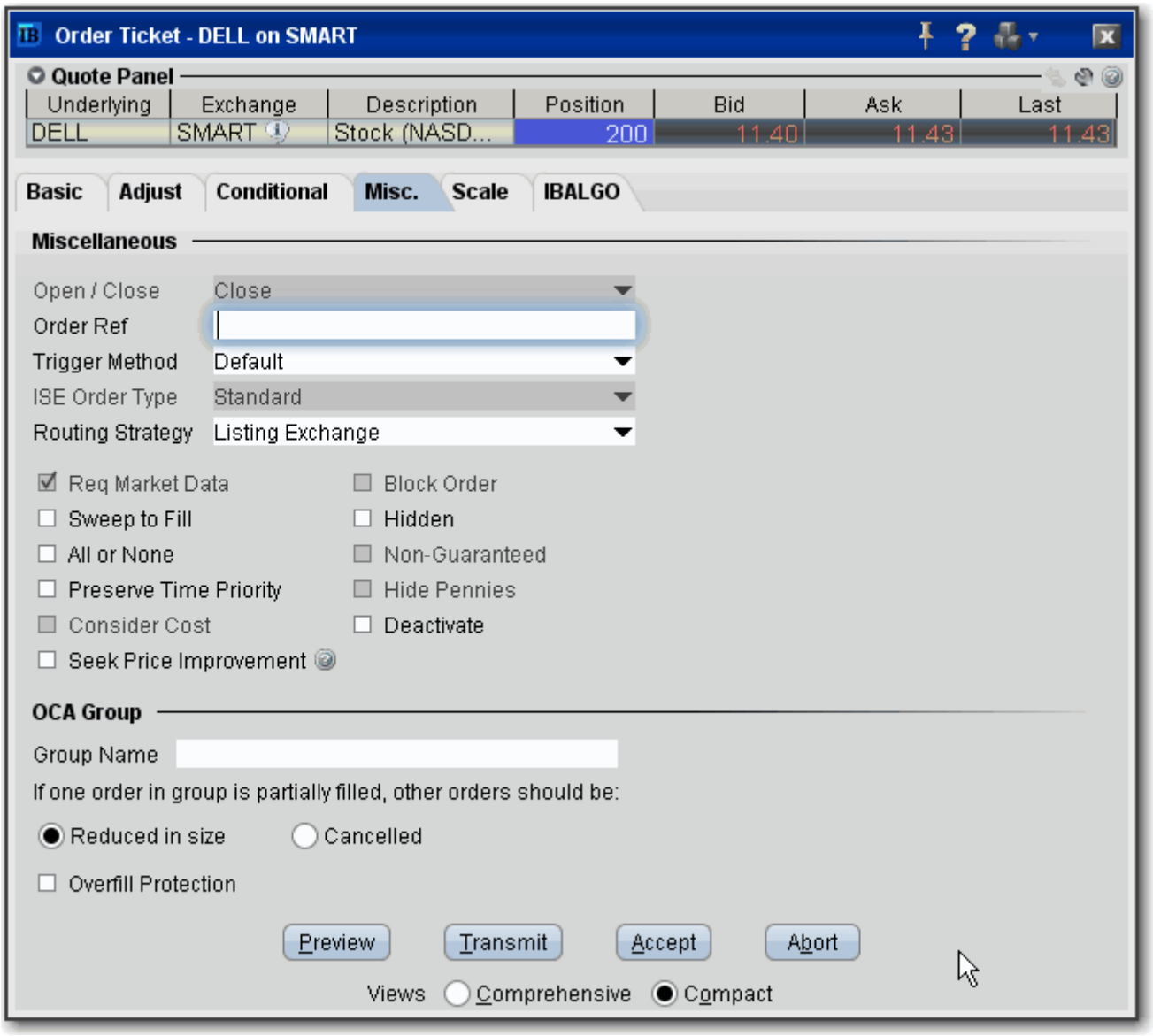
要设定多个条件，使用添加条件按钮，并在当前条件区域中点击“和”或“或”。

区域 / 按钮	描述
添加条件	产生条件定单输入框。
删除	删除选定的条件。
修改	对选定的条件打开条件定单输入框，从而允许您作出更改。
允许条件被满足……	如果选定的条件在常规交易时段之外被满足，那么让它激活定单。
要采取的行动……	如果选定的条件定单被满足，您能够选择让首要定单被提交或者被取消。

杂项

使用杂项定单区域来应用定单属性，并对 OCA 组设置特定的规则。

Note: OCA 组名称必须是独特的，以确保对 OCA 定单的恰当处理。一旦您使用了一个名称，您就不能再次使用它，即使是在定单执行或被取消之后。



区域	描述
定单参考	一个您创建的用来追踪您的定单的识别码。

区域	描述
大股东	对交易加拿大产品的大股东。使用下拉选项列表来正确地标记您的定单。
触发方式	为定单选择一个新的触发方式。要修改默认触发方式，使用**全局配置**工具，然后选择*定单 > 定单默认*。
ISE 中点匹配	对 ISE 中点匹配定单，从标准或 SOI 中选择。
要求市场数据	选中以对定单要求市场数据。
大额定单	选中以创建大额定单。
一扫光	选中以创建一扫光定单。
隐藏	选中以创建隐藏定单。
全或无	选中以创建全或无定单。
非保障的	选中该方框表明您将对部分传递的智能传递组合定单承担所有的风险。
保留时间优先	选中以将您的定单保持在队列中，并阻止间歇性地取消和再提交定单。该功能在某些交易所被使用，这些交易所对停留在定单册中一定时间段的定单收取处理费。
隐藏美分	当被选中，将隐藏您的期权定单的美分定价。
考虑成本	只对在 SWB/FWB 交易的智能传递的非美国股票有效。 如被选中，智能路径在决定把定单传递到哪里时，将会考虑执行定单的总成本，包括佣金和其他费用。如果不被选中，将只有交易所价格被考虑。
使失效	选中以使定单失效，其将取消定单。
寻求价格改善	如被选中，智能传递的定单将扫描特定的交易所，从而获得在更加有利的价格上的隐藏流动性，然后像往常一样在传递到一个交易所之前检查暗池。注意，激活该功能可能会导致更慢的执行。
OCA 组	
组名称	如果定单是一取消全定单的一部分，在该区域中输入 OCA 名称。OCA 区域中有相同名称的所有定单将变为 OCA 定单的一部分。一旦您使用了一个名称，您就不能再次使用该名称，即使是在定单执行或被取消之后。
部分执行说明	设置说明来指导在定单被部分执行时该如何行动。默认的做法是，让 OCA 组中的其他定单根据已执行部分的数量，按比例地减小尺寸。

区域	描述
过度执行保护	规定每一次组里将只有一个定单被传递至一个交易所。这会完全地去除过度执行的可能性。

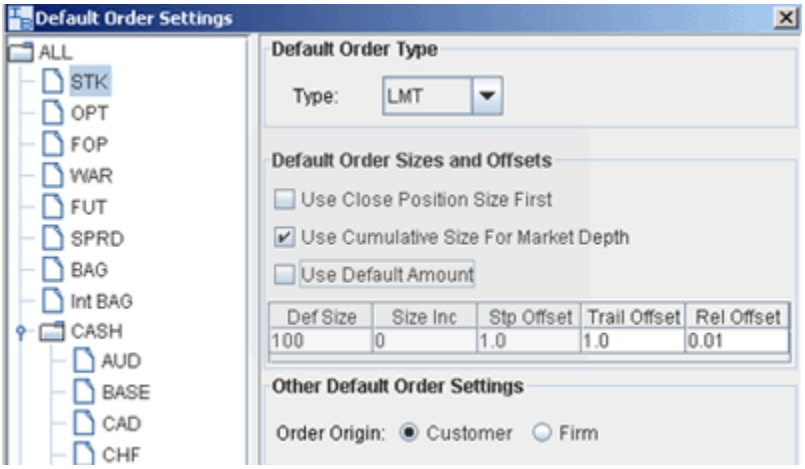
数量计算器

引言

- 决定定单数量
- 计算定单数量

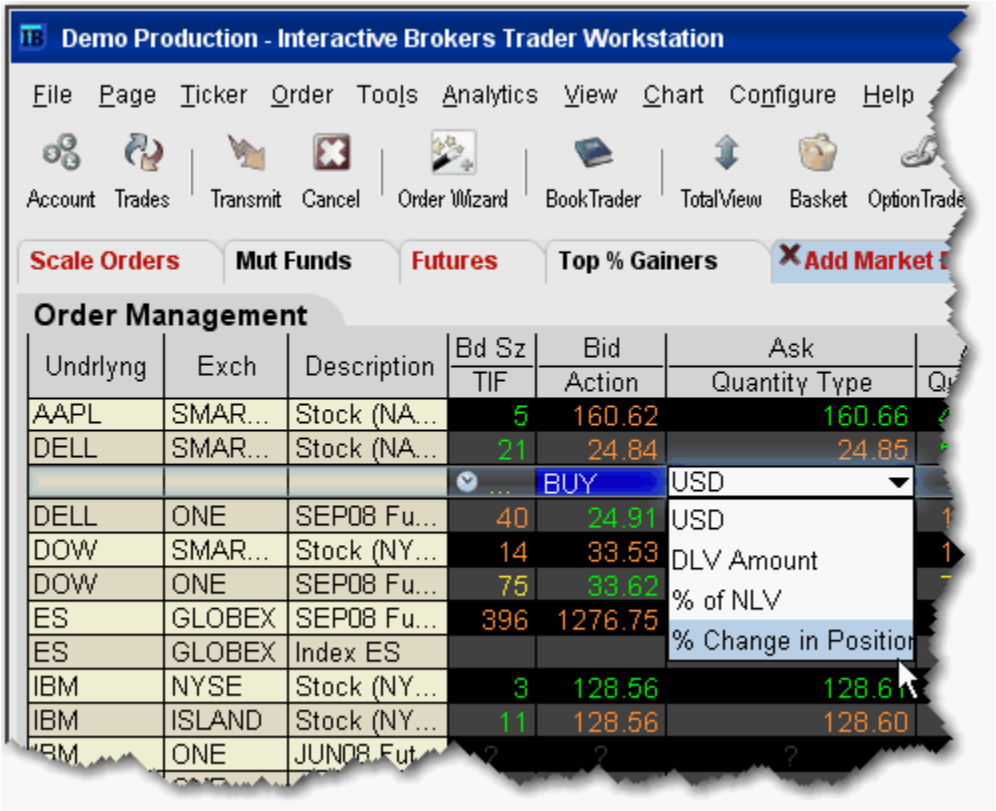
决定定单数量

当您创建一个定单，您能够以几种不同的方式来定义定单尺寸。您能够设定用于所有定单的一般默认定单尺寸。您能够对工具类型设定特定的默认尺寸，例如将所有股票定单的数量设定为 500。您甚至能够做得更加具体，对特定的合约设置定认定单尺寸，例如将底层证券 XYZ 的所有股票定单的数量设定为 1000。



或者，您能够设定将被用于计算定单尺寸的默认货币金额。例如，将股票的默认金额设定为 $5000.00。定单数量随后根据股票价格被计算，对美国股票被取整到最近的 100 股。

您还能够让交易平台根据可交割价值的金额、您的净清算价值的百分比，或者根据您的当前头寸的百分比来计算定单数量。


Demo Production - Interactive Brokers Trader Workstation
File Page Ticker Order Tools Analytics View Chart Configure Help
Account Trades Transmit Cancel Order Wizard BookTrader TotalView Basket OptionTrade
Scale Orders
Mut Funds
Futures
Top % Gainers
Add Market
Order Management
Undrlyng Exch Description Bd Sz Bid Ask
TIF Action Quantity Type
AAPL SMAR... Stock (NA... 5 160.62 160.66
DELL SMAR... Stock (NA... 21 24.84 24.85
BUY USD
USD
DLV Amount
% of NLV
% Change in Position
DELL ONE SEP08 Fu... 40 24.91
DOW SMAR... Stock (NY... 14 33.53
DOW ONE SEP08 Fu... 75 33.62
ES GLOBEX SEP08 Fu... 396 1276.75
ES GLOBEX Index ES
IBM NYSE Stock (NY... 3 128.56 128.61
IBM ISLAND Stock (NY... 11 128.56 128.60
IBM ONE JUN08 Fut

计算定单数量

使用**数量类型**和**数量值**区域，根据以下几项来计算您的定单数量：

- 货币 — 假设基本货币。
- DLV 金额 — 可交割的价值。
- NLV 的% — 净清算价值的百分比。
- 头寸的%变化 — 您的底层证券头寸的百分比变化。

例如，假如说您有 40,000 的净清算价值。XYZ 显示了当前的要价 80.00。如果您对 XYZ 创建一笔买入定单，选择 “NLV 的百分比”作为数量类型，并在数量值区域中输入 “20”，您在告诉应用程序根据要价 $80.00 来计算您能够以 $40,000 的 20%或 $8000.00 买入的股票数量。被计算出的定单数量值 “100”随后被显示在数量区域中。

显示数量类型和数量值区域

1. 在交易屏幕的定单管理部分中，右键点击任何栏名称，然后点击*客户化版式*。
2. 点击定单栏标签。在数量部分的可用的栏列表中，选择*数量类型*和数量值，并将它们添加到已显示的栏列表中。

根据币种计算定单数量

1. 通过点击出价或要价来创建定单。
2. 在**数量类型**区域中，选择货币类型。该区域假设基本货币。
3. 在**数量值**区域中，输入一个货币金额。对买入定单，输入您想要花费的金额。对卖出定单，输入您想要获得的金额。根据当前的出价 / 要价，您的值被向上或向下取整。

定单数量被计算并被显示在**数量**区域中。

根据可交割价值来计算定单数量 （DLV 金额）

1. 通过点击出价或要价来创建定单。
2. 在**数量类型**区域中，选择 *DLV 金额*。

   对股票，可交割价值是换算为基本货币的股票价值。对期权，该价值是以基本货币表示的底层股票价值 （即，股票价格×期权乘数）。
3. 在**数量值**区域中，输入您想要用来计算定单数量的可交割价值的货币金额。

定单数量被计算并被显示在**数量**区域中。

将定单数量计算为您的净清算价值的百分比 （NLV 的百分比）

1. 通过点击出价或要价来创建定单。
2. 在**数量类型**区域中，选择 *NLV 的百分比* 。

   净清算价值是**账户**窗口左上角的*余额*区域的第一个值。

3 在**数量值**区域中，输入一个百分比值，该值将被乘以您的 NLV 来计算货币金额。

定单数量被计算并被显示在**数量**区域中。

将定单数量计算为头寸变化的百分比

1 通过点击出价或要价来创建定单。

2 在**数量类型**区域中，选择*头寸%变化*。

如果您在选定的底层证券中不持有头寸，您将不会看见该选项。

3 在**数量值**区域中，输入一个百分比值，该值将被乘以您的头寸来计算定单数量。

Note: 如果您的头寸为负，您必须输入一个负的百分比值来计算正的定单数量。

定单数量被计算并被显示在**数量**区域中。

快速定单输入

引言

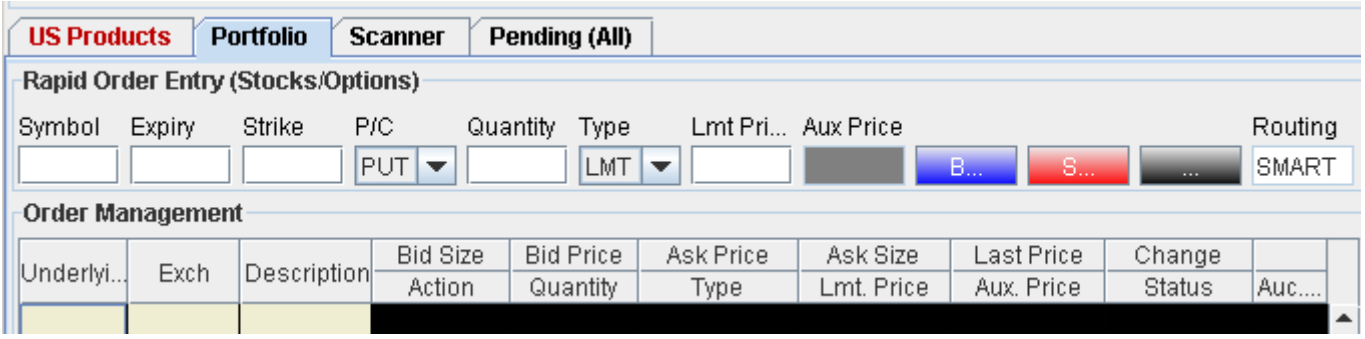
使用快速定单输入面板，在不需要打开定单标签或点击市场数据线的情况下快速地传递定单。

- 使用快速定单输入来输入定单
- 更新限价
- 创建 “立刻传递” 热键

使用快速定单输入来输入定单

默认情况下，**快速定单输入**面板在每个交易页面的顶部都是可见的，它允许您在不需要打开定单标签或点击市场数据线的情况下快速地传递定单。您只要用制表键选择区域，输入您的定单参数，并按下**买入**或**卖出**即可。您同样能够输入本地或根底层证券代码，就像您能够在交易屏幕中输入一样。

Note: 快速定单输入能够被个人交易者和顾问用于权益、权益期权和组合定单。



使用快速定单输入面板

1. 如果面板被隐藏，右键点击标签集区域。否则，在快速定单输入面板中点击右键。
2. 选择**快速定单输入**。
   - 在第一部分中，使用*显示*或*隐藏*来显示或删除面板。
   - 在第二部分中，选择您想要交易的工具类型 / 定单类型。

     Note: 您能够使用快速定单输入年面板，每次只提交一种类型的定单。例如，当您正在使用面板提交股票定单，如果您想要输入差价定单或组合策略，您必须切换到组合子菜单选项。

   - 选择*配置*来执行以上步骤，并为定单输入面板设定默认值、制表键次序以及其他参数。

一旦您使用快速定单输入传递了定单，定单的细节将出现在交易页面的定单管理面板中。对您的定单的任何修改必须在该定单管理行上作出。

制表键次序

制表键次序允许您通过使用用制表键选择区域，在手指不离开键盘的情况下输入定单信息。您能够使用版式管理器上的快速定单输入标签，在制表键次序中添加 / 删除区域。智能的制表键次序机制通过让你只在那些完成定单所必需的区域移动，提高了您能够输入键盘定单的速度。

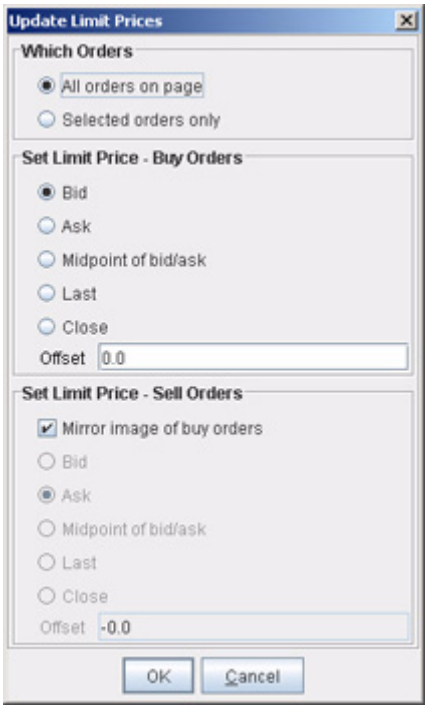
更新限价

您能够对一笔定单 （或所有定单）自动地更新限价，使其与要价、出价、中点价格、收盘价格或最后价格保持一致。

自动地更新限价

1 在**定单**菜单上选择*更新限价*。

2 设定更新参数：



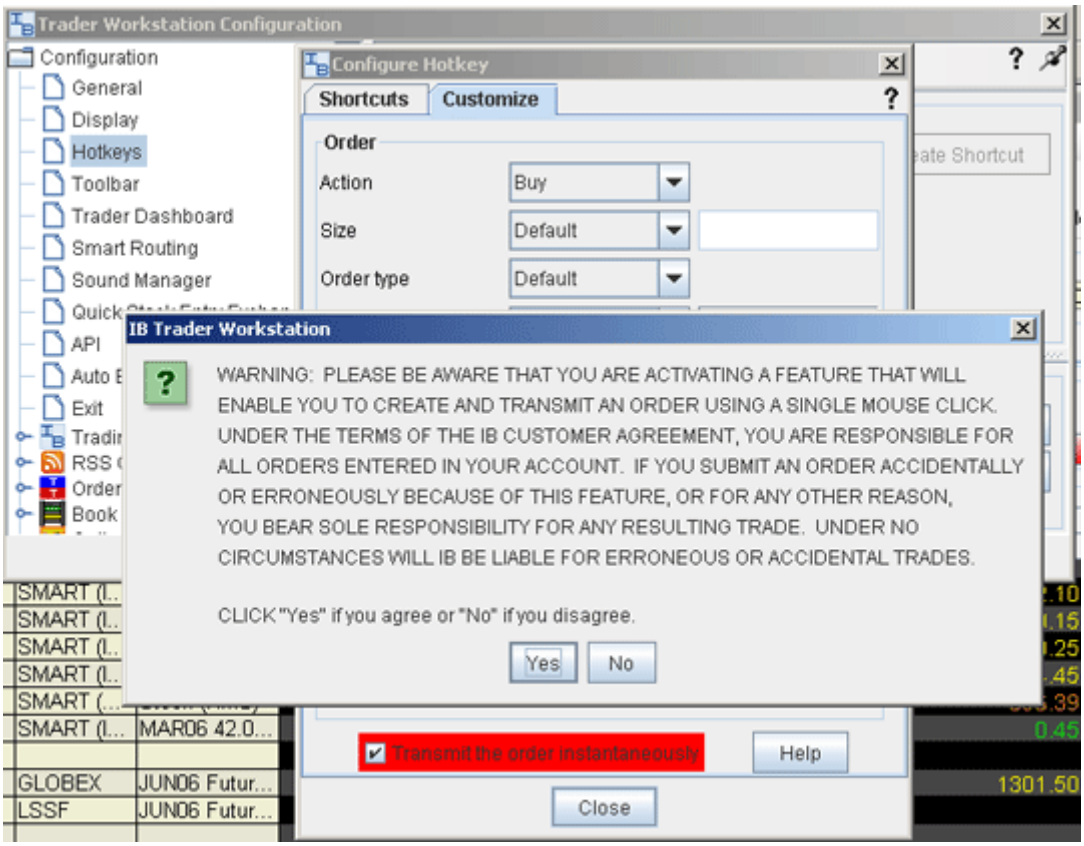
- 更新单个定单或当前所有定单的价格。
- 为买入定单设定更新参数，如果需要，将抵消金额包括在内。
- 为卖出定单设定更新参数。如果您选中*买入定单的镜像*，那么参数将被设定为与买入定单的选择相反。中点价格、最后价格和收盘价格的镜像将为这些价格各自的负值。

创建 “立刻传递” 热键

您使用热键来执行普通的交易功能，例如创建特定的定单类型。一旦您创建了一笔定单，您必须仍然选择*传递*来发送定单。您现在有权利选择通过添加 “立刻传递” 功能来增强*买入*和*卖出*热键。

将立刻传递功能添加至热键

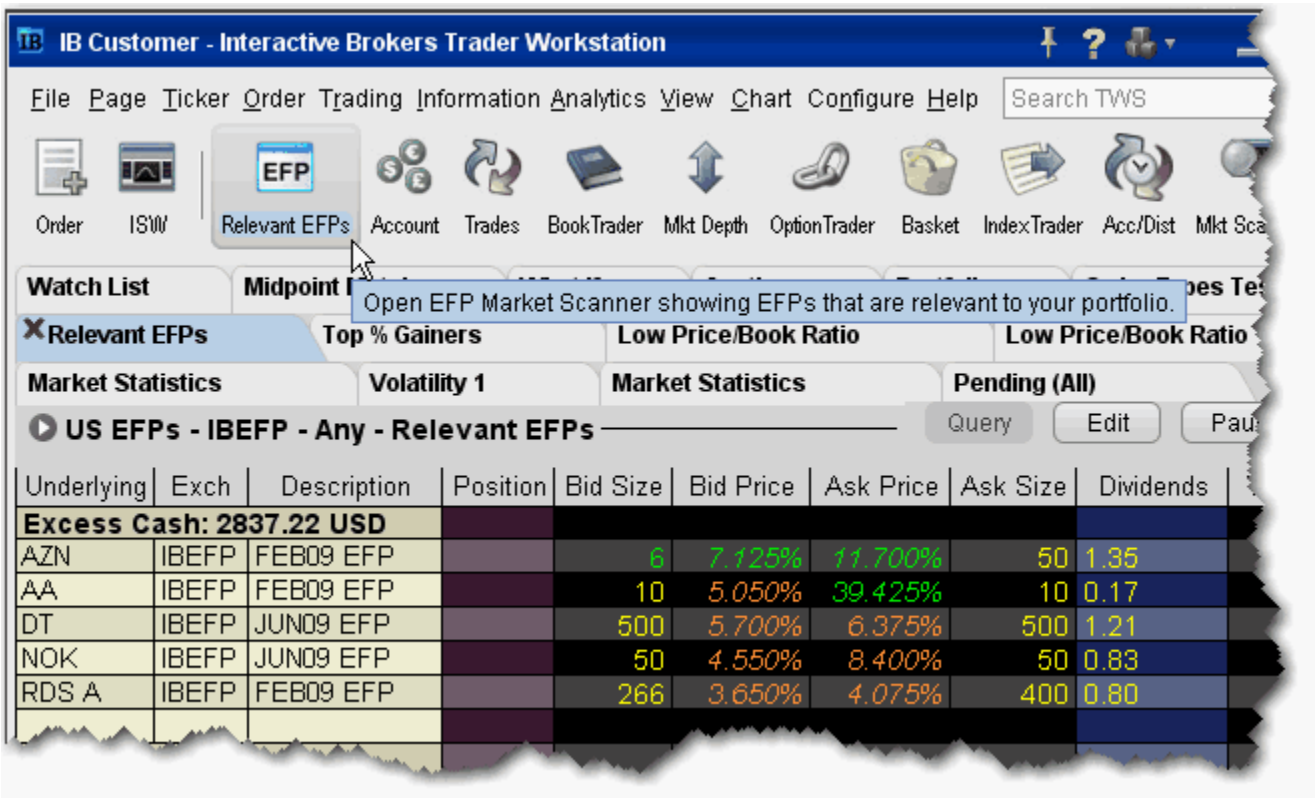
1. 在**配置**菜单上，选择*热键*。
2. 在快捷方式区域中，选择*买入*或*卖出*行动并按下**配置**。
3. 点击**客户化**标签。
4. 在页面底部选中*立刻传递定单*并点击确定。



Note: 要使用该功能，您将被要求签署一项协议，声明您理解其含义。在客户协议的条款下，您将对在您的账户中输入的所有定单负责。仔细考虑设定热键来立刻传递定单对您的交易方式是否是最好的选择。

相关期货转现货

期货转现货 （EFP）允许将单一股票期货与多头或空头股票头寸进行互换，使用它能够有助于减少您的交易成本。相关期货转现货市场扫描仪扫描美国市场，并根据您当前持有的股票以及单一股票期货头寸，返回与您相关的所有 EFP。您能够从工具栏进入该工具，或者通过在市场扫描仪页面中选择美国期货转现货作为工具类型，然后选择相关期货转现货作为参数来进入该工具。



要获取关于使用 EFP 能够如何减少您的交易成本的更多细节，参见期货转现货产品举要。

查看相关 EFP

1. 在交易工具栏上，点击**相关期货转现货**图标。

   相关期货转现货扫描仪页面打开，所有区域被填入了正确的 EFP 选项。

2. 如果没有返回任何值，点击*查询*。

   注意，该页面仅用于显示。要交易这些 EFP 中的一个，点击并握住鼠标，然后将其拖动到您的交易页面，或者点击右键并选择**编辑**，然后选择*复制*。打开一个交易页面，使用右键点击菜单来选择**编辑**，然后选择*粘贴*。

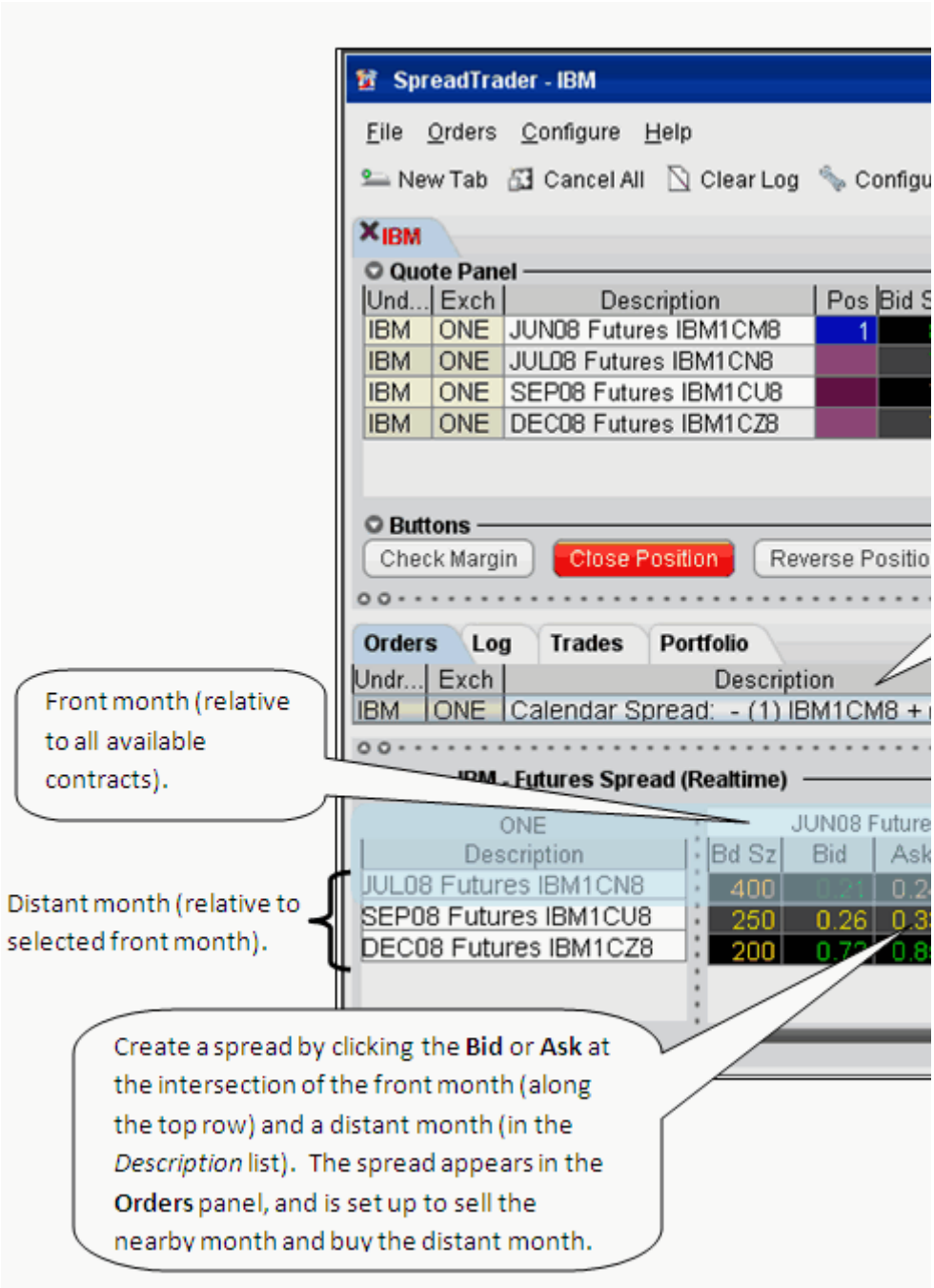
差价交易者

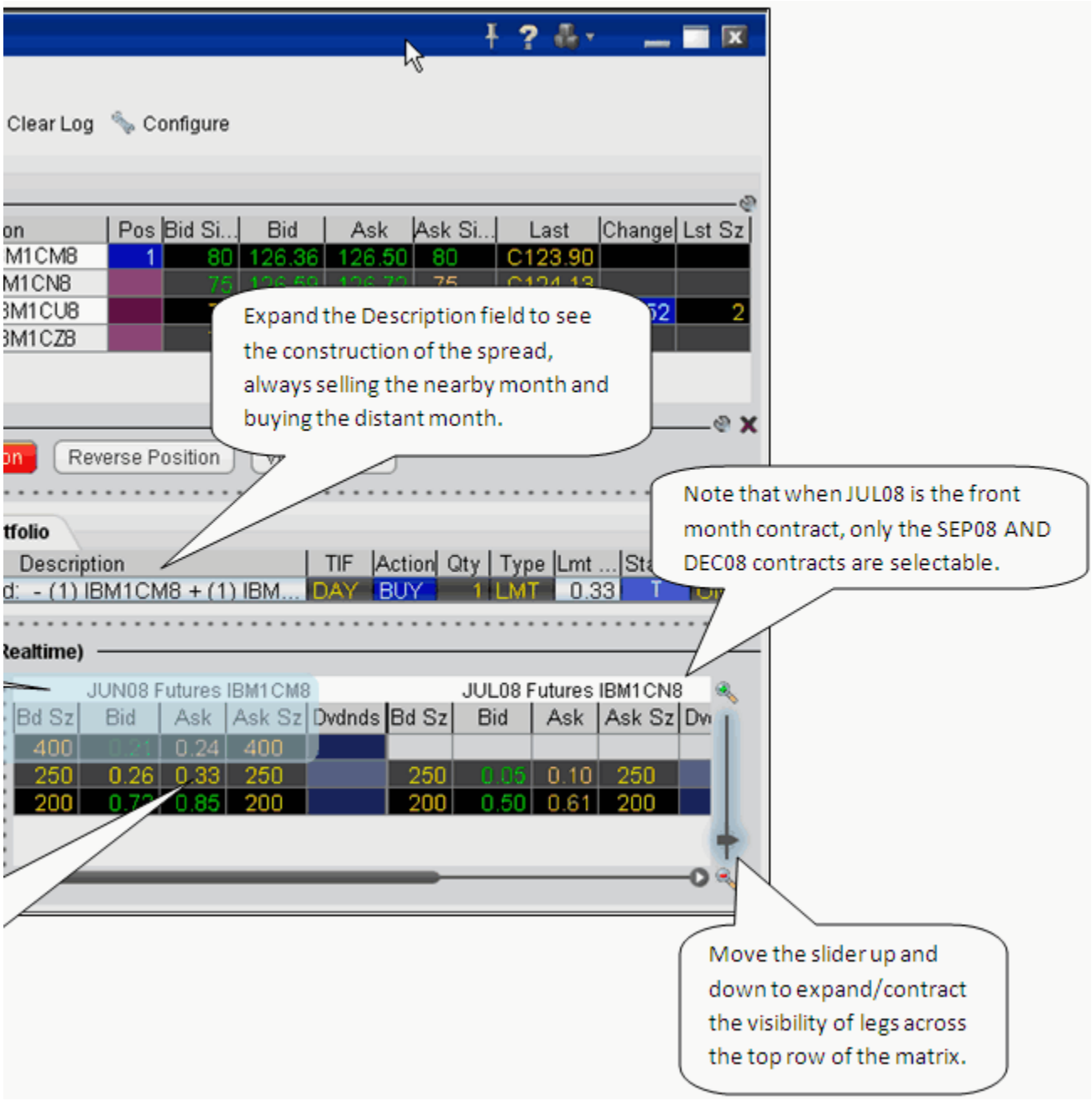
引言

- 使用差价交易者创建期货差价
- EFP 期货差价
- 在差价交易者中创建期权差价

使用差价交易者创建期货差价

使用差价交易者，对期货快速地创建并交易日历差价。





创建期货差价

1. 通过在交易屏幕上右键点击合约，选择**工具**，然后选择*差价交易者*来打开**差价交易者**。
2. 从差价交易者的下拉菜单中，选择*对 xxx 的期货差价*。
3. 在屏幕底部的**差价交易者**边矩阵中，在两条边的交点处点击一个出价或要价来创建日历差价。

Note: 差价交易者矩阵自动地将差价构造为卖出近月和买入远月。

4 通过在状态区域中点击“T”，将定单从定单面板中传递。

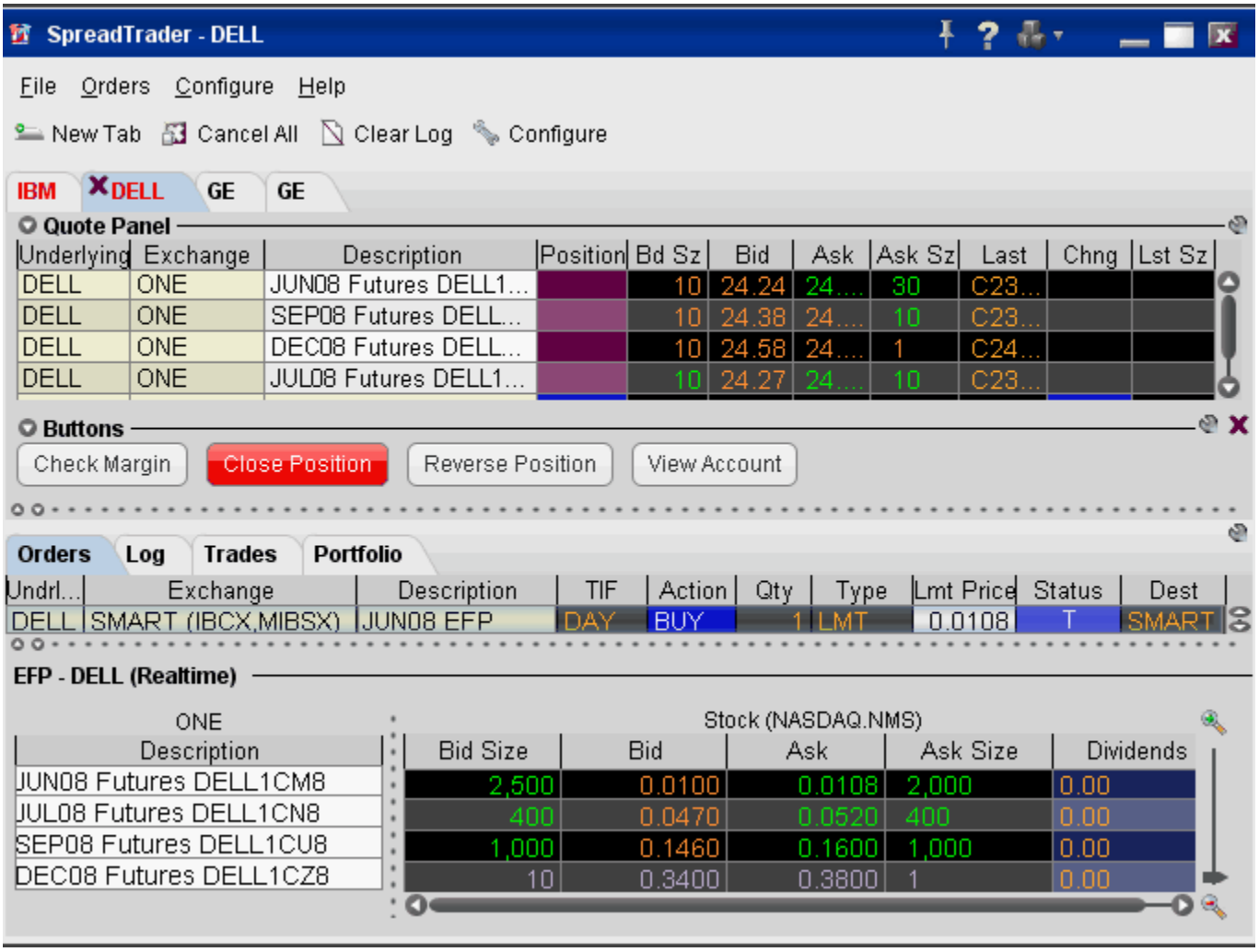
报价面板中的背景颜色

报价面板的描述区域中的颜色向您显示了合约的到期日期距离当前年份有多远，一览如下。行业标准颜色被定义如下：

相距年数	背景颜色
第 1 年	白色
第 2 年	红色
第 3 年	绿色
第 4 年	蓝色
第 5 年	金色
第 6 年	紫色
第 7 年	橙色
第 8 年	粉色
第 9 年	银色
第 10 年	铜色

EFP 期货差价

EFP （期货转现货）是一种卖出 / 买入股票并买入 / 卖出 SSF （单一股票期货）的组合定单。



创建 EFP 定单

1. 输入一个底层证券并敲下**回车**。
2. 选择*对 xxx 的 EFP*。窗口底部的差价矩阵左侧被填入了所有单一股票期货边的列表，顶部被填入了股票。
3. 在两条边的交点处点击一个出价或要价来创建 EFP 差价。
4. 要传递该定单，在定单面板的*状态*区域中点击 “T”。

Note: 从差价交易者发送的 EFP 是智能传递的，所以可能被征收更高的非捆绑式佣金。要接收 IBEFP 捆绑式佣金，您必须从主交易窗口中创建您的 EFP，并选择 IBEFP 作为 COMB 目的地。品红色的报价表明组合的内在价格，该价格是使用单条边的价格计算的。

在差价交易者中创建期权差价

使用差价交易者中的期权组合设施，对单个底层证券的期权策略创建一个变量矩阵，从中您能够通过点击鼠标两次来创建和传递多个组合定单。期权向导通过允许您将栏头寸、行头寸或固定值分配给每个参数，帮助您精确地定义您想让组合行如何被显示在矩阵中。您同样能够使用过滤器来帮助精确地指定您想将哪些合约显示在矩阵中。

创建期权差价矩阵

1 通过在交易工具栏中点击差价交易者图标来打开**差价交易者**。

如果您没有看见差价交易者图标，您可能已经将该功能关闭了。要重新激活，转到配置菜单，然后选择功能选择器。在定单管理下，选择复杂定单类型，再选择组合 / 差价。确保方框被打勾，然后点击确定。

2 在**底层证券**区域中输入一个底层证券代码，然后敲下*回车*。

3 用您的鼠标，选择*对 XXX 的期权组合*，然后再选择一个交易所 / 币种。

4 在期权差价窗口中，选择一个组合策略。一旦您这么做了，该底层证券的每个可用的差价都将被显示在右侧的面板中。

Note: 被显示在过滤器部分下的参数数量：一些有两个 （例如转换或买进出售），而其他的，比如蝶式，有 5 个或更多。您能够使用这些过滤器来限制出现在右侧面板中的组合数量。

5 在窗口底部按下*下一步*按钮来查看**配置表格变量**框。

每个变量由方框中的一个部分来表示，有*栏变量*、*行变量*或*固定值*可供选择。变量意味着该组合参数能够使用多个有效的值。例如，对日历差价，权利有两个变量：看跌和看涨。如果您选择看涨 （其过滤掉看跌），它就不再是一个变量，而是一个固定的值。在那种情况下，您将不会在变量列表中看见 P/C。

6 对每个变量，选中一个单选框来指示其作为行或栏显示，或被作为固定值使用。选中*行*将对行变量的每个可能的组合创建一个行。选中*栏*将对栏变量的每个可能的组合显示一个栏。选中固定值将产生另一个选择矿，从中您对参数选择单个值。

例如，我们的日历差价有五个参数：**前**月、**后**月、P/C、**久期**以及**行权价**。我们过滤掉所有**前**月只保留两个 （20061020 和 20061117），过滤掉所有**后**月只保留两个 （20061117 和 20070119），并过滤掉所有可能的有效行权价格只保留六个，其他都保持不变。由于唯一有效的久期是一个月，因此**久期**参数不再被看作是变量。这样在 P/C 类别中留下了两个变量 （看跌和看涨），在行权价类别中留下了多个变量。

点击*下一步*，使用四个变量来设计我们的矩阵，对**前**月和**行权价**选择*栏变量*，对**后**月和权利选择*行变量*。当您点击*完成*，您将看见这样的东西，当中后月和权利构成行，前月和行权价构成栏。

您在看什么？

每一行被划分为您选择的不同栏变量的市场数据部分，在本例中为前月和行权价。如果您能够在该图片中来回移动，您将会看见我们选择的两个前月的前一个（20061020）出现在六个方块中，每次有一个不同的行权价格。然后您将会看见第二个前月，也是每次有一个不同的行权价格。

您会看见所有可用的行，因为我们的变量只包括了两个后月和看涨 / 看跌。如果您想要对版式和显示的组合作出任何更改，在工具栏上点击期权向导按钮。

Note: 如果您收到消息，说您有太多的组合从而不能订阅市场数据，且如果您不进入以进一步过滤您的结果，那么价格将不会更新，且矩阵标题将读作“……快照”而不是“……实时”。

分段交易者

引言

使用分段交易者来帮助避免大尺寸定单的不断恶化的价格。

- 关于分段交易者
- 分段交易者获利定单
- 查看分段进程
- 分段定单举例

关于分段交易者

分段交易者能够与限价或相对定单一起使用，其被设计用来帮助使较大尺寸的交易避免受到不断恶化的价格的影响，方法是根据用户定义的价格和尺寸说明，将您的定单分割成较小的、逐级定价的组成部分。除了将您的定单分段，您还能够定义一个利润抵消金额，其指导交易平台自动地对最初定单的单个组成部分提交反向获利回吐定单。

使用分段交易者

1. 创建一笔定单 （点击**要价**来创建买入定单；点击**出价**来创建卖出定单）。
2. 在类型区域中，选择限价或相对。
3. 设定分段属性：
   - **a** **分段初始** — （初始组成部分尺寸）该值定义了首个或初始定单组成部分的尺寸。例如，如果您以分段初始值 1000 提交了一笔 10,000 股的定单，那么首个组成部分将为 1000 股。（如果您选择不在**分段子**区域中输入值，该值将被用于您定单的剩余部分。在本例中，您的 10,000 股定单将在其 10 个组成部分的每一个中包括 1000 股。）
   - **b** **分段后续** — （后续组成部分尺寸） 与**分段初始**区域一道使用的可选区域，该值定义了后续的分段定单组成部分的定单尺寸。如果留为空白，所有定单组成部分将根据分段初始值来被决定尺寸。
   - **c** **分段层级** — （价格层级）该金额被用于计算价格阶梯中的每个组成部分的每单位价格。注意，价格层级不能够为负数。
   - **d** **分段利润抵消** — 该区域中的值指导交易平台提交获利回吐定单，并定义您将接受用来退出头寸的最低获利金额。分段交易者将使用母组成部分的限价加上 / 减去利润抵消，提交一笔针对最初定单的反向获利定单。例如，如果您以 $65.00 提交一笔 10,000 股的买入限价定单，组成部分为 1000，并输入 $15.00 作为**分段利润抵消**，第一个组成部分一执行，交易平台就将以 $80.00 提交一笔 1000 股的卖出限价定单。使用定单标签上的分段标签来设定高级获利定单说明。
4. 如有必要，修改**限价**，其被用作定单组成部分系列的起始价格。

5 传递定单。

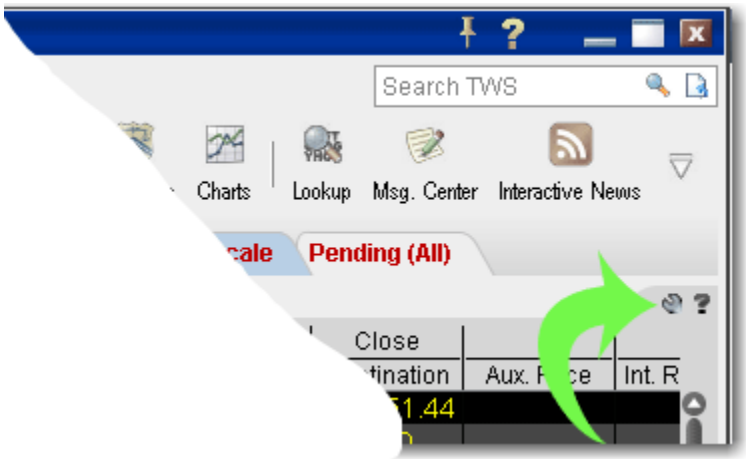
您能够通过右键点击定单行并选择*查看分段进程*来监控您的分段定单进程。

要获取关于分段定单的更多信息，访问定单类型信息页面。

分段交易者获利定单

在定单行上输入一个利润抵消金额。使用定单标签上的分段标签获利定单部分来指定高级的获利定单说明。当您在您的交易页面上创建了分段定单之后，遵照以下的说明。

激活分段获利定单

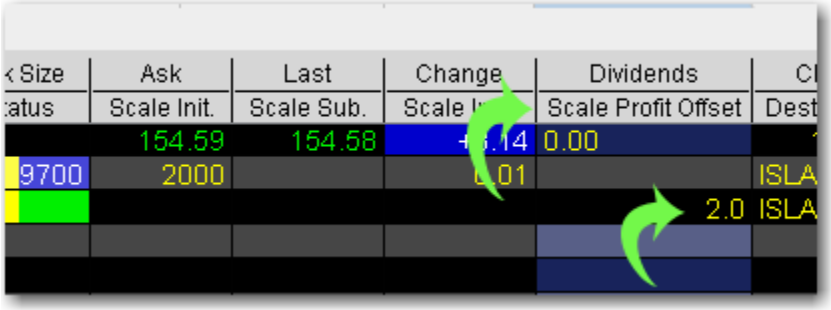


1 从分段定单行中，确保*分段利润抵消*区域是可见的。

- **a** 在交易窗口的右侧远端点击配置扳手图标，打开交易窗口配置。
- **b** 点击定单栏标签。
- **c** 在可用的栏列表中，向下滚动分段定单部分，并选择分段利润抵消。
- **d** 点击添加按钮，将区域移动到已显示的栏列表中。点击确定。

2 在*分段利润抵消*区域中输入一个值。

该金额被添加到 （买入分段定单）组成部分每单位价格中，或从组成部分每单位价格中被扣除 （卖出分段定单），从而创建用于退出头寸的您的最低可接受利润。例如，假设您的分段利润抵消为 $2.00。如果一个 500 单位的买入组成部分以 28.26 执行，那么分段交易者将以限价 30.26 提交一个 500 单位的卖出组成部分。

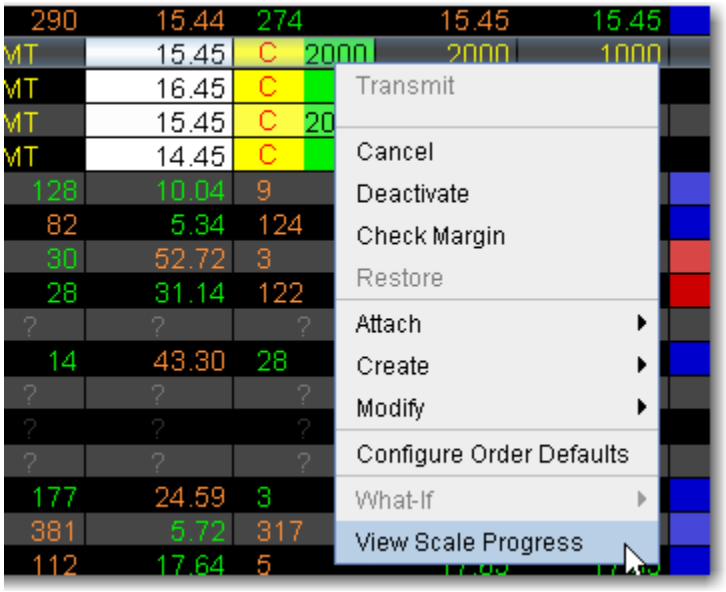


关于获利定单的注释

- 直到最初分段组成部分，或组成部分的一部分执行之后，分段交易者才会提交获利定单。
- 获利定单通常按照后续组成部分尺寸（如果其与初始组成部分尺寸不同）被分段。例如，对一笔初始组成部分尺寸为 2000、后续组成部分尺寸为 1000 的 10,000 股批量定单，作为对 2000 初始定单执行的回应而被提交的获利定单，其 1000 股将以执行价格＋／－利润抵消被提交，另 1000 股将以下一个价格层级＋／－利润抵消被提交。
- 一旦被传递，您就不能修改获利定单的任何部分。

查看分段进程

您能够使用**分段进程**框来监控您的分段定单进程。

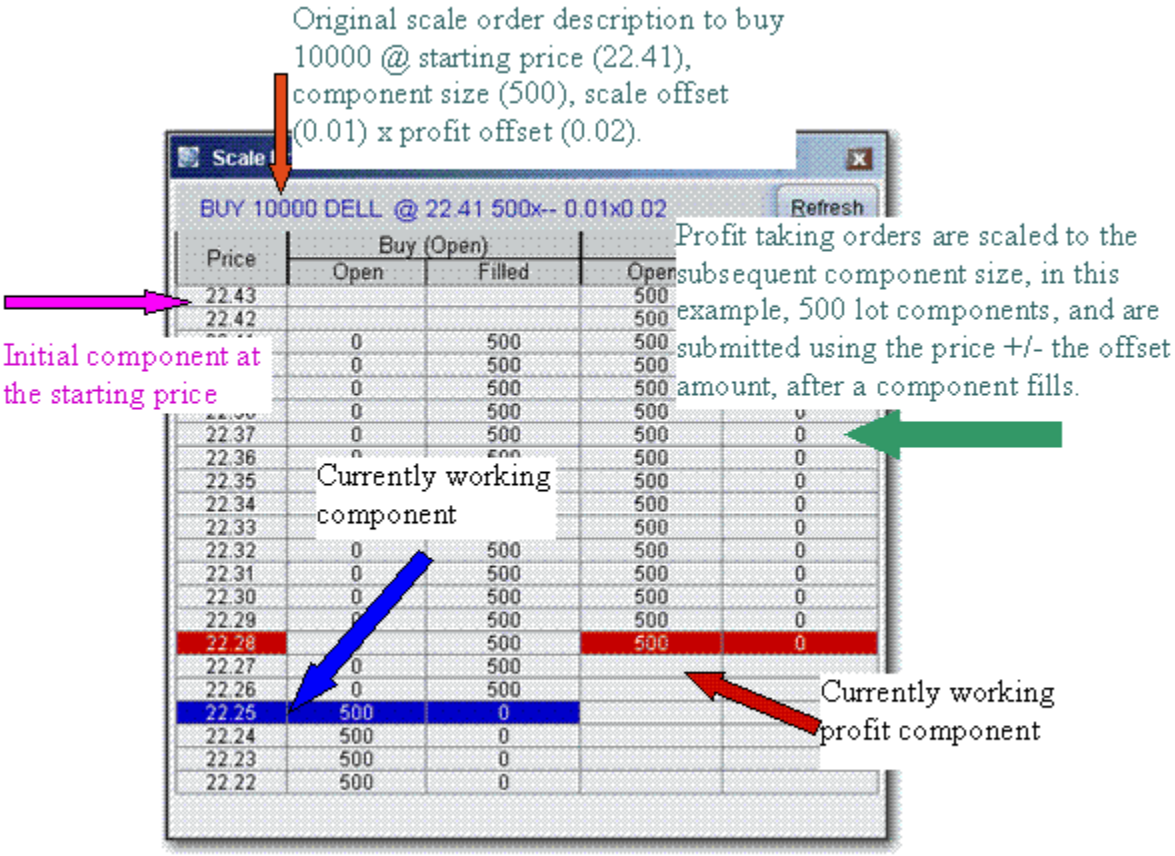


查看分段进程

- 右键点击分段定单行并选择*查看分段进程*。

分段进程框

分段进程框显示了完整的分段价格阶梯，母分段定单的未平仓 / 已执行组成部分列表，以及子获利定单的未平仓 / 已执行组成部分列表。


Original scale order description to buy 10000 @ starting price (22.41), component size (500), scale offset (0.01) x profit offset (0.02).
Scale
BUY 10000 DELL @ 22.41 500x-- 0.01x0.02
Refresh
Profit taking orders are scaled to the subsequent component size, in this example, 500 lot components, and are submitted using the price +/- the offset amount, after a component fills.
Initial component at the starting price
Currently working component
Currently working profit component
Price
Buy (Open)
Open
Filled
Open

分段定单举例

对所有五个例子使用相同的定单信息，下面的情形说明了分段交易者定单的基本行为。这些例子不涵盖将发生在部分执行的组成部分水平上的所有可能的算法结果。

非变量分段定单值

NBBO：$10.12 — $10.15

定单尺寸：10,000

行动：买入限价

初始分段组成部分尺寸：2000

后续组成部分尺寸：1000

价格层级：$0.01

起始价格：$10.15

有效时间：GTC

例 1：基本分段定单

定单被分段为 9 个组成部分 2000、1000、1000、1000 等。第一个数量为 2000 的组成部分以 $10.15 被提交。在该水平执行后，下一个组成部分 （1000）限价定单以 $10.14 被提交。下一个组成部分以 $10.13 被提交，但价格移动使得该定单不可交易。定单的剩余部分继续等待。定单变为可交易的，执行了，下一个组成部分随后被提交。该模式继续直到所有组成部分执行，或者您取消定单。

例 2：带有获利回吐定单的分段定单

利润抵消：$1.00
注意，获利定单按后续组成部分尺寸被分段。如果初始组成部分尺寸更大，那么获利定单价格使用价格层级和利润抵消金额来计算。

定单被分段为 9 个组成部分 2000、1000、1000、1000 等。第一个数量为 2000 的组成部分以 $10.15 被提交。在该水平执行后，下一个 1000 批量组成部分以 $10.14 被提交，数量为 1000 的获利定单以 $11.15 （执行价格＋利润抵消）被提交，数量为 1000 的获利定单以 $11.16 （执行价格＋价格层级＋利润抵消）被提交。限价买入定单在 $10.14 执行，下一个组成部分以 $10.13 被提交，而一笔 1000 批量限价卖出定单以 $11.14 被提交。注意因为您已经将有效时间设定为 GTC，卖出定单将一直工作，直到您用于退出头寸的最低可接受获利金额被满足。

您能够从交易窗口来设定利润抵消，或者在**定单标签**的*分段*标签上使用*创建获利回吐定单*复选框来设定。

例 3：带有获利回吐定单和恢复尺寸说明的分段定单

利润抵消：$0.02

在获利回吐后恢复尺寸：在定单标签的*分段*标签上选中方框

定单被分段为 9 个组成部分 2000、1000、1000、1000 等。第一个数量为 2000 的组成部分以 $10.15 被提交。在该水平执行后，下一个数量为 1000 的限价定单以 $10.14 被提交，数量为 1000 的获利定单以 $11.15 （执

行价格＋利润抵消）被提交，数量为 1000 的获利定单以 $11.16 （执行价格＋价格层级＋利润抵消）被提交。卖出定单在 $10.17 执行，获取利润，并将已执行的 1000 数量以 $10.15 放回到最初的定单中，而 $10.14 组成部分被取消。

使用**定单标签**的*分段*标签上的复选框，激活*在获利回吐后恢复尺寸*说明。该功能只有当获利回吐定单功能被使用时才可用。

例 4：重启分段交易者

*重启*功能帮助您从分段交易者定单被破坏的时点重新开始。破坏导致分段和获利定单进程之间失去联系，留下两个独立的分段定单。您能够取消这些定单并创建一个新的分段交易者*重启*定单。

利润抵消：$0.02

在获利回吐后恢复尺寸：在定单标签的*分段*标签上选中方框

重启分段交易者：在定单标签的*分段*标签上选中方框

现有头寸值：3000

现有头寸值 3000 告诉分段交易者初始组成部分 2000 和第一个后续组成部分 1000 都执行了，分别在 $10.15 和 $10.14。因此其 “重启” 了以第 3 个组成部分开始的分段定单。第一个买入定单数量为 1000，以 $10.13 被提交。获利回吐定单被设置为 1000 在 $10.17、1000 在 $10.18 以及 1000 在 $10.16 被提交。

使用**定单标签**的*分段*标签上的复选框，激活*重启分段交易者*说明。该功能只有当获利回吐定单和恢复尺寸说明被使用时才可用。

例 5：重启带有已执行的初始组成部分尺寸的分段交易者

被破坏的分段定单导致分段和获利定单进程之间失去联系，留下两个独立的分段定单。*重启*说明被设计用来帮助您从分段序列中断的时点起，重新开始被取消或被破坏的分段交易者定单。首先，取消两个不相关的分段定单。其次，通过确定您的当前头寸并告诉分段交易者初始组成部分的尺寸有多少在被破坏的分段定单中执行了，从而创建一个新的分段交易者*重启*定单。分段定单将在合适组成部分和价格水平重新开始定单。

Note: *已执行的初始组成部分尺寸*区域只有当**现有头寸**值小于**初始组成部分尺寸**时才会变为活动的。

利润抵消：$0.02

在获利回吐后恢复尺寸：在定单标签的*分段*标签上选中方框

重启分段交易者：在定单标签的*分段*标签上选中方框

现有头寸值：500

已执行的初始组成部分尺寸：1200 （该数值必须*大于*或*等于***现有头寸**值，最大为**初始组成部分尺寸**）。

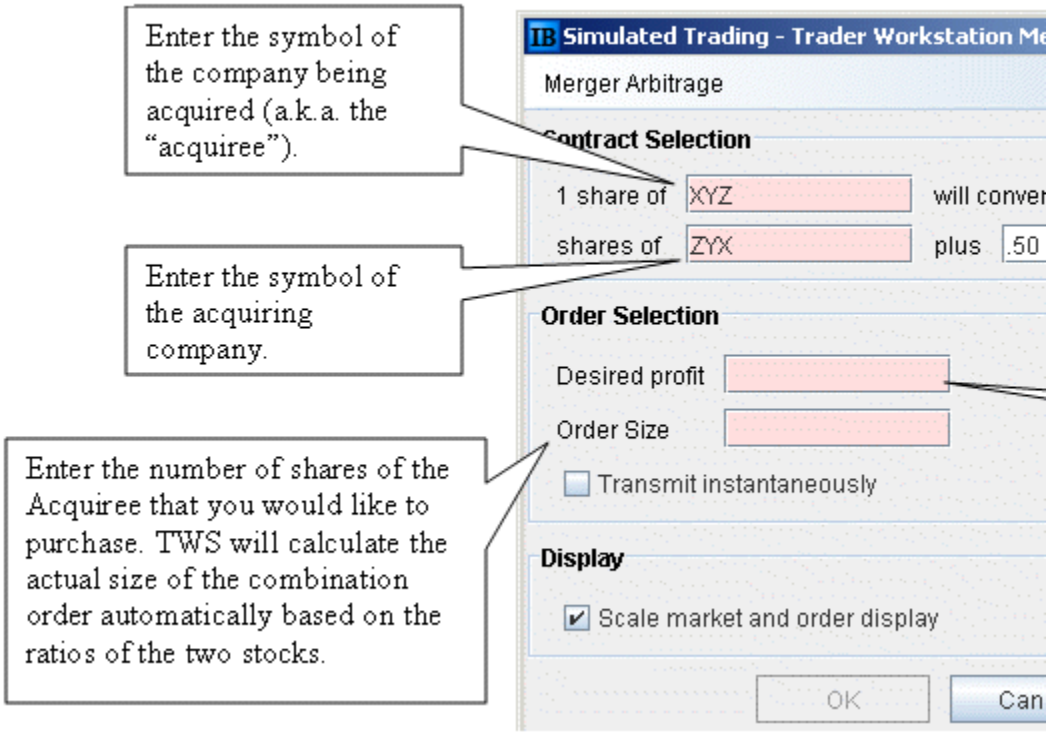
已执行的初始组成部分尺寸 1200 告诉分段交易者，有 800 数量 （在 2000 初始组成部分中）没有被执行。第一个数量为 800 的买入定单以 $10.15 被提交，数量为 1000 和 200 的获利回吐定单被分别设定为 $10.17 和 $10.18。

使用**定单标签**的*分段*标签上的复选框，激活*重启分段交易者*说明。该功能只有当获利回吐定单和恢复尺寸说明被使用时，以及现有头寸区域中的值小于初始组成部分尺寸时才可用。

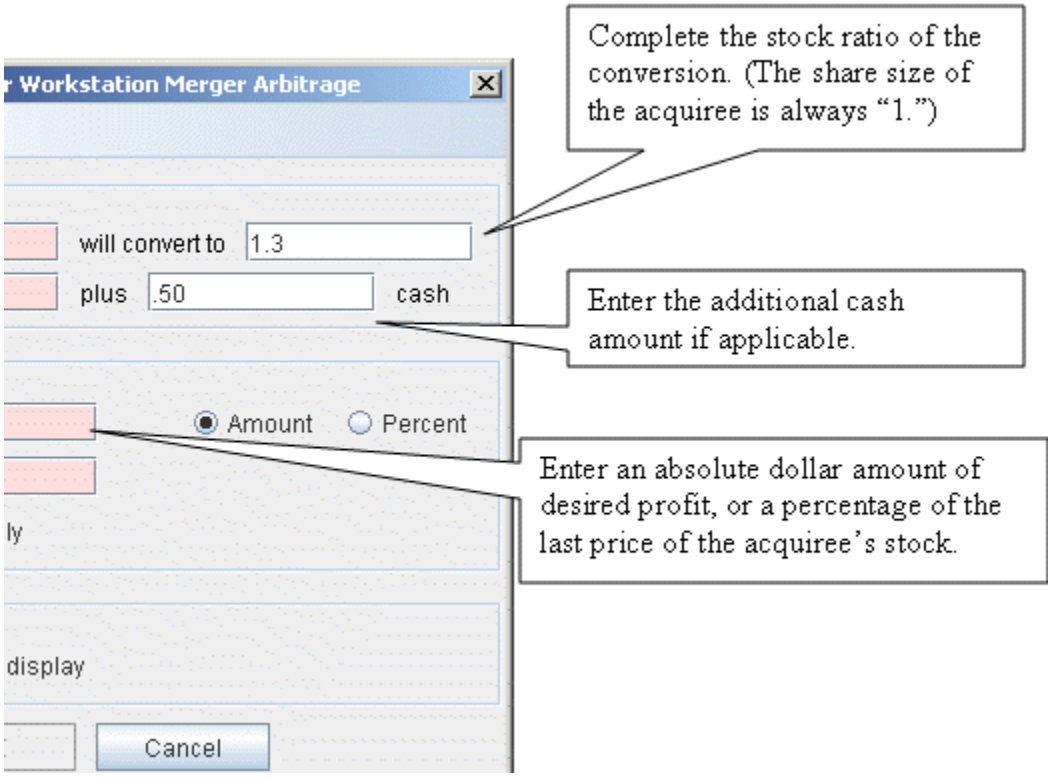
合并套利窗口

创建套利组合

使用合并套利窗口，对两个公司之间预期的合并创建组合定单。



分段市场和定单显示功能将市场数据分段，来显示被收购方的每股组合价格，定单价格也将被输入和显示在这些单元中。其在默认情况下是被选中的。注意，如果计算的收购方的尺寸是一，那么该复选框将不具有影响。



设置合并套利组合定单

1. 右键点击一个空白行并选择*合并套利*。
2. 在**合约选择**区域中输入合约转换信息。
3. 在**合约选择**区域中，以绝对金额或被收购的公司 （acquiree）的最后股票价格的百分比输入想要的利润。

   Note: 您必须在任何粉红色的区域中输入数值，**确定**按钮才将变为活动的。

4. 点击**确定**。交易平台将在交易屏幕上创建一个组合定单行。

合并套利组合 — 举例

以下是合并套利组合的一个例子：

- 目标公司 （买入）： LU
- 目标公司数量： 10,000
- 收购方公司 （卖空）： ALA
- 收购方公司 NBB： $12.20
- 交换比率： 0.1952
- 现金组成部分： $0.50
- 差价： $.05

根据本例，以下卖空将首先被执行以确保卖空测试被满足：

卖空	1,952	ALA	12.20

我们将计算目标公司的买入限价，然后提交买入定单：

$12.20 × 0.1952 = 2.38 + 0.50 = 2.88 − 0.05 = $2.83（限价）

买入	10,000	LU	2.83

3

定单类型

交易平台提供超过 40 种不同的定单类型，包括基本和高级定单、以及算法、属性和有效时间。该部分的信息被分为：

- 基本定单类型
- 高级定单类型
- 波动率定单
- 有效时间
- 定单属性

基本定单类型

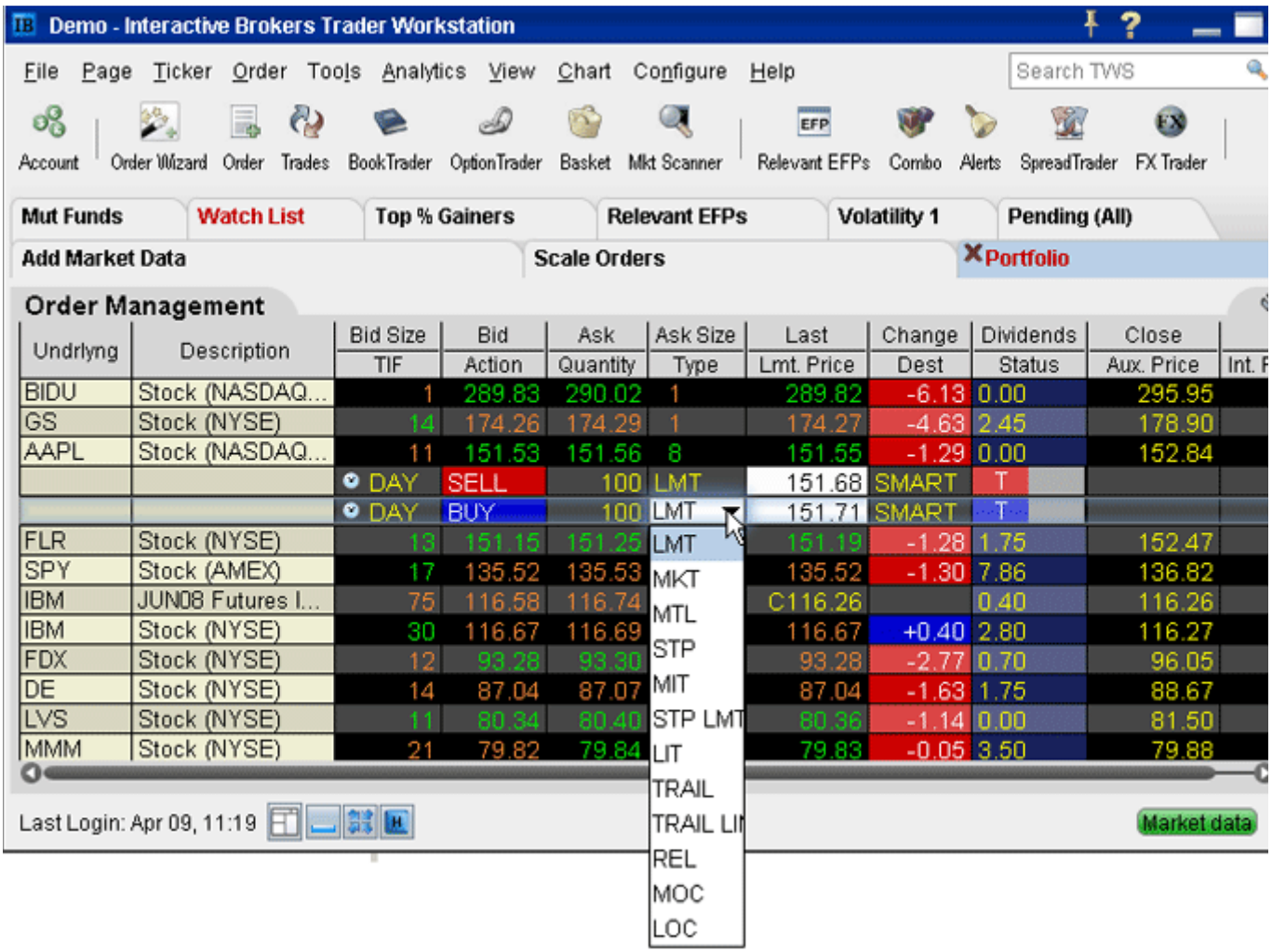
- 限价
- 市价
- 止损
- 限价止损
- 触及限价
- 触及市价
- 收盘限价
- 收盘市价
- 有保护的市价
- 国际证券交易所中点匹配
- 市价转限价
- 挂钩股票
- 挂钩市场
- 挂钩中点
- 盒顶
- 价格改善竞价
- 相对 / 挂钩首要
- 追踪止损
- 追踪限价止损
- 交易量加权平均价格

限价

限价定单是一种仅在特定或更优价格买入或卖出合约的定单。

创建限价定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中选择 LMT 作为定单类型。
3. 在*限价*区域中，输入您想要定单执行的价格。
4. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。



要获取关于限价定单更详细的描述，以及支持它们的产品和交易所，访问定单类型信息页面。

市价

市价定单是一种以市场上当前可用的出价或要价买入或卖出资产的定单。当您提交一笔市价定单，您不能保证该定单将以任何特定的价格执行。

创建市价定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中选择 MKT 作为定单类型。
3. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

要获取关于市价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

止损

一旦特定的止损价格被达到或击穿，止损定单将变为市价定单来买入或卖出证券或商品。止损定单不被保证特定的执行价格。

创建止损定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中选择 STP 作为定单类型。
3. 在*辅助价格*区域中输入止损选择价格。
4. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

要获取关于止损定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

限价止损

限价止损定单与止损定单的相似之处在于止损价格将激活定单。然而，不同于在被选中时作为市价定单被提交的止损定单，**限价止损**定单是作为限价定单被提交的。在交易屏幕上使用**限价**和**辅助价格**区域，输入需要多个价格或数值的定单。

输入限价止损定单

1. 点击**要价**区域来发起买入定单，或者点击**出价**区域来发起卖出定单。
2. 点击*类型*区域并选择 STP LMT 作为定单类型。
3. 在*限价*区域中，输入限价。
4. 在*辅助价格*区域中输入止损选择价格。

Note: 您能够使系统在您更改止损价格时自动地调整限价。要激活该功能，在**配置**菜单上选择*定单*，然后选择*自动调整止损限价*。当您设定最初限价和止损选择价格时，限价将根据内在抵消金额移动。

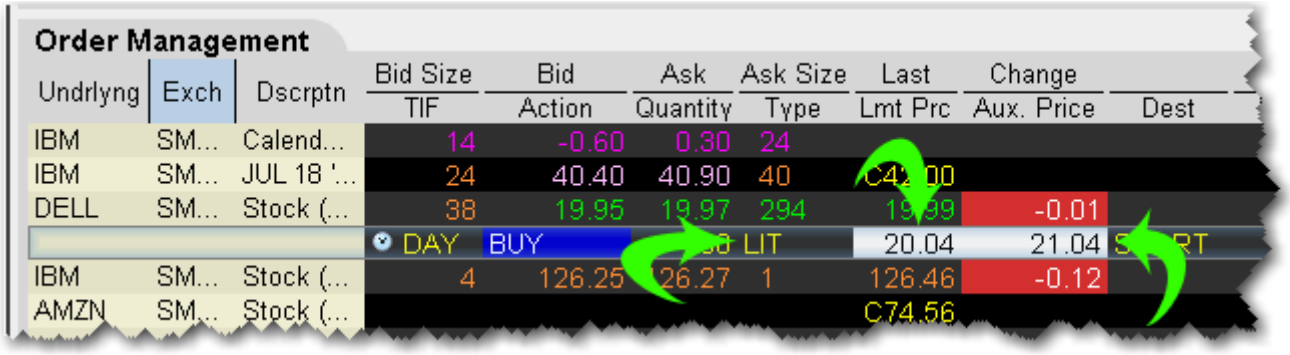
要获取关于限价止损定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

触及限价

触及限价定单被设计为以低于（或高于）市价，在限价或更优的价格来买入（或卖出）合约。辅助价格值是以特定限价提交限价定单的触发价格。

创建触及限价定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中选择 LIT 作为定单类型。
3. 在*限价*区域中，输入您想要定单执行的价格。
4. 在*辅助价格*区域中，输入“触及”价格来触发定单。
5. 要传递定单，在状态区域中点击“T”。



要获取关于触及限价定单更详细的描述，以及支持它们的产品和交易所，访问定单类型信息页面。

触及市价

触及市价定单是一种市价定单，只有当辅助价格触发值被触及时才被提交。

创建触及市价定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中选择 MIT 作为定单类型。
3. 在*辅助价格*区域中，输入“触及”价格来触发定单。
4. 要传递定单，在状态区域中点击“T”。

要获取关于触及市价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

收盘限价

如果收盘价格等于或优于提交的限价，那么 LOC （收盘限价）定单将在该价格执行。否则，定单将被取消。

创建收盘限价定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中，选择 LOC 作为定单类型。
3. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

要获取关于收盘限价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

收盘市价

MOC（收盘市价）定单将作为市价定单，尽可能地靠近收盘价格执行。

创建收盘市价定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中，选择 MOC 作为定单类型。
3. 要传递定单，在状态区域中点击“T”。

要获取关于收盘市价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

有保护的市价

有保护的市价定单 （可用于 Globex 的期货）作为市价定单被发送，以当前最优的价格执行。如果整个定单没有立刻以市场价格执行，那么定单的剩余部分将作为限价定单被重新提交，限价被 Globex 设定为稍高于 / 低于当前最优价格的价格。

创建有保护的市价定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中，选择 MKT PRT 作为定单类型。
3. 要传递定单，在传递区域中点击红色的 “T”。

要获取关于有保护的市价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

国际证券交易所中点匹配

国际证券交易所以 NBB （全国最佳出价）和 NBO （全国最佳要价）之间的中点价格来执行股票交易。他们提供两种中点匹配 （MPM）定单类型：*标准*和利息筹集 （SOI）。标准 MPM 定单能够是任何尺寸，并且既能被设定为限价定单，也能被设定为市价定单。您同样能够将 IOC （立刻执行或取消）有效时间添加到该定单类型。标准定单被完全地从市场中隐藏起来。

创建标准 MPM 定单

1. 使用 ISE 作为市场目的地来创建一条市场数据线。
2. 创建定单。点击**出价**区域 （对卖出定单）或**要价**区域 （对买入定单）。
3. 在**类型**区域中，从*市价*或*限价*之间选择。
4. 如果您选择*限价*，则证实或修改限价。
5. 点击 “T” 来传递定单。

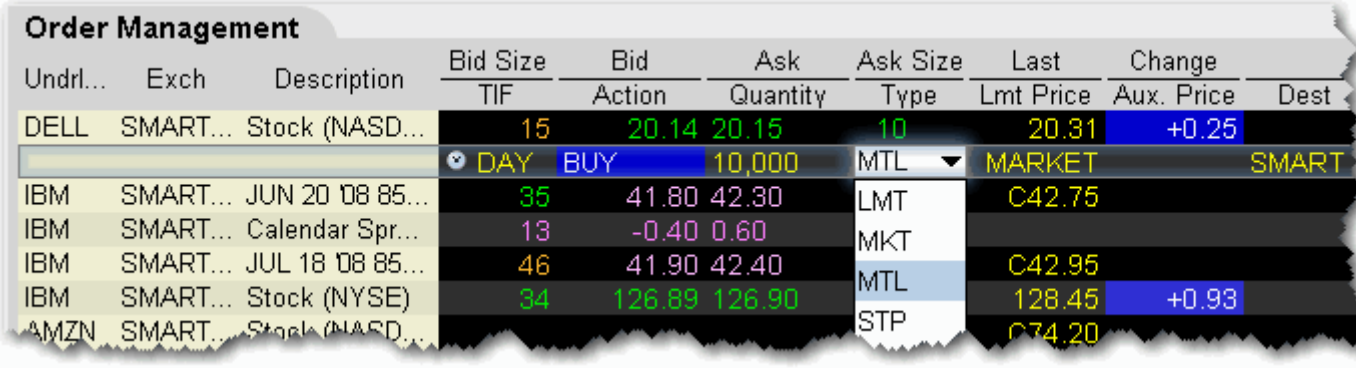
要获取关于 ISE MPM 定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

市价转限价

市价转限价定单作为市价定单被发送，以当前最优的价格执行。如果整个定单没有立刻以市场价格执行，那么定单的剩余部分将作为限价定单被重新提交，限价被设定为定单的市价定单部分执行的价格。

创建市价转限价定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中，选择 MTL 作为定单类型。
3. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

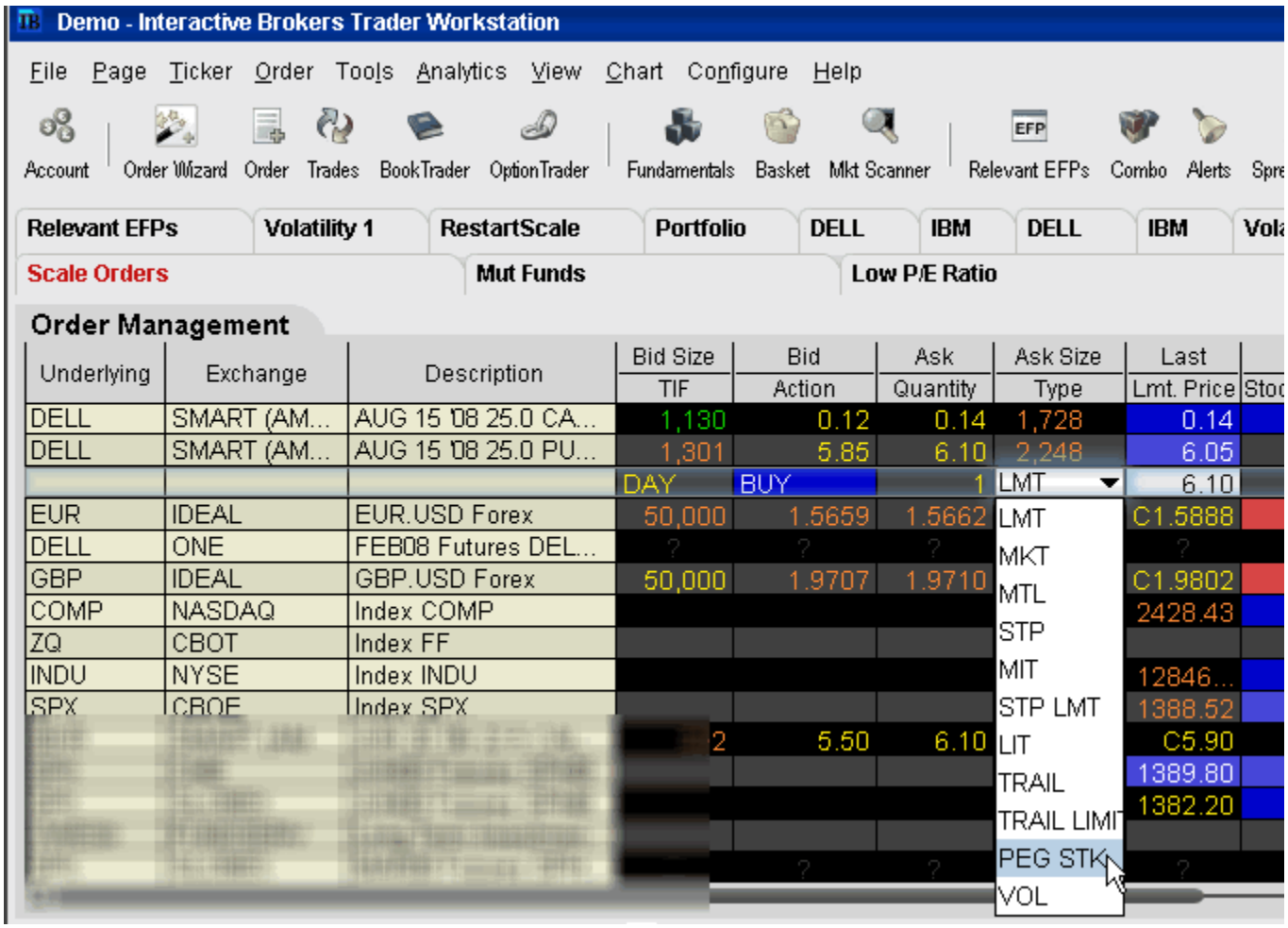


要获取关于市价转限价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

挂钩股票

挂钩股票定单有时候被称为*相对股票*定单，其指定了期权价格将使用根据您输入的数据计算出的值，自动地相对于股票价格进行调整。

Note: 被直接传递至 BOX 的挂钩股票定单将您放入 BOX 的价格改善竞价中。



创建挂钩股票定单

1. 点击**要价**来创建买入期权定单，或者点击**出价**来创建卖出期权定单。
2. 在**类型**区域中选择 PEG STK。*确保支持的挂钩定单区域是可见的。*

如果您在类型列表中没有看见 PEG STK，检查以确定您的期权是被传递至 SMART （或者支持该定单类型的交易所）的。该定单类型只对美国权益期权有效。

3. 在 Delta 区域中，输入一个将以百分比被使用的绝对值，例如 “5” 等于 5%。

该百分比数值对看涨期权为正，对看跌期权为负。该数值被乘以底层股票价格的改变量，乘积被添加到起始价格用于决定期权价格。

4 使用的股票参考价格为定单下达时的 NBBO 中点。如果需要，您能够更改该数值。

5 如果需要，定义一个可选的高 / 低股票范围。如果股票价格移动到了范围之外，您的定单将被取消。使用*底层证券范围（高）*和*底层证券范围（低）*区域。

6 期权定单的起始价格为定单下达时的期权 NBBO 中点。如果需要，您能够更改该数值。

当您使用定单标签创建挂钩股票定单时，使用基本标签来选择定单类型并设定起始价格。使用挂钩标签来设定股票参考价格、底层证券高低范围限制以及 Delta 值。

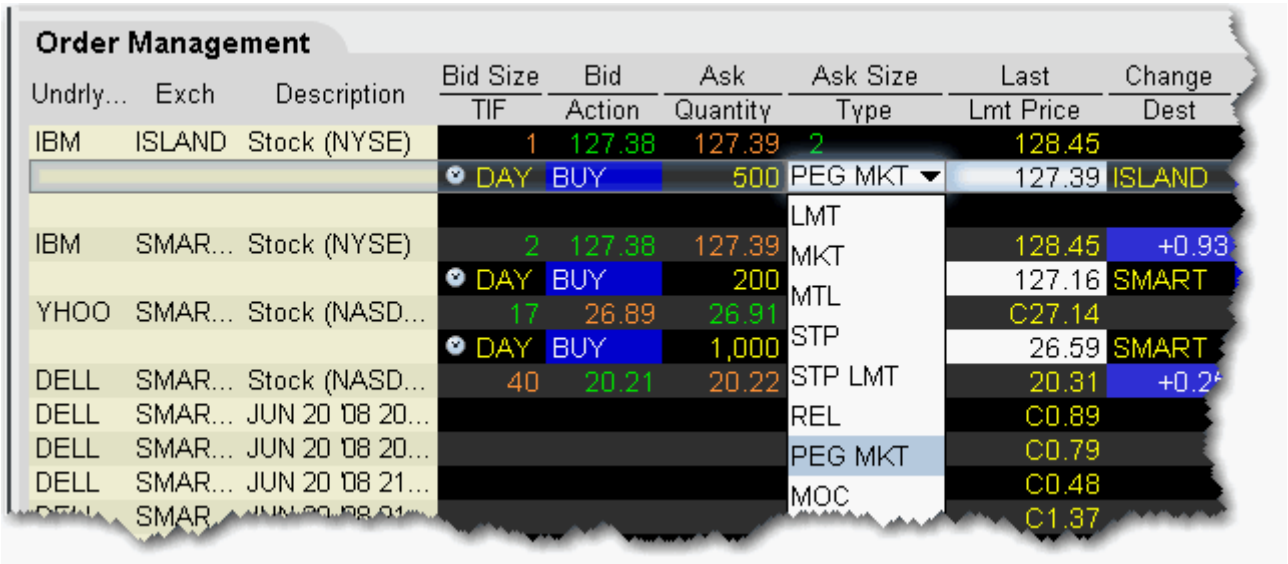
要获取关于挂钩股票定单的更多细节和例子，访问定单类型信息页面。

挂钩市场

提交一个积极的定单，其被挂钩以最佳出价买入并以最佳要价卖出。

创建挂钩市场定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在**目的地**区域中确保目的地为 Island。
3. 在**类型**下拉列表中选择 PEG MKT。
4. 如果需要，在**辅助价格**区域中修改抵消金额。
5. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。



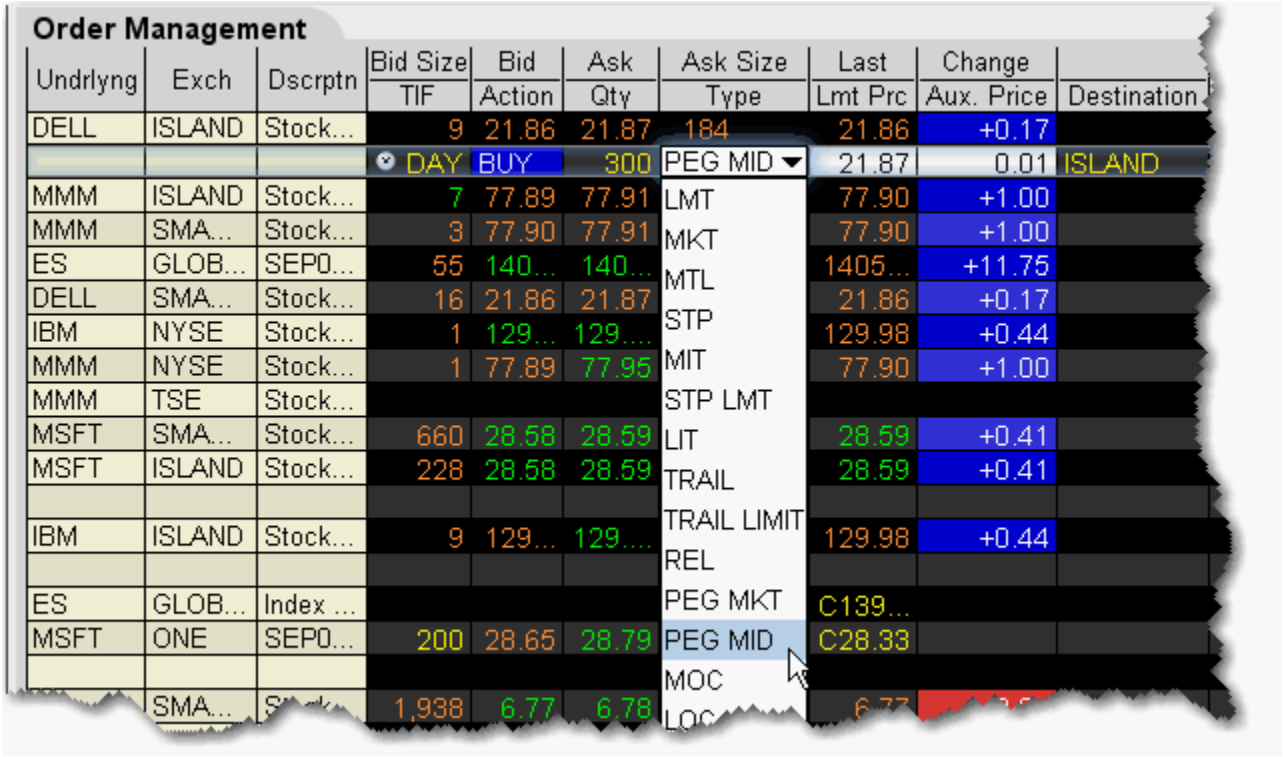
可用于直接传递至 Island 的股票定单。

要获取关于挂钩市场定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

挂钩中点

挂钩中点定单寻求以全国最佳买卖报价 （NBBO）的中点执行，有权选择通过使用抵消金额来使定单变得不那么积极。对买入定单，抵消金额从 NBBO 中点被扣除，对卖出定单，则是被添加至 NBBO 中点。挂钩中点定单的抵消金额使得定单价格变得不那么积极。如果市场移动，那么定单价格将自动地调整以挂钩中点。价格只会调整变得更加积极。如果市场以相反方向移动，那么定单将执行。

除了抵消金额，限价起到了价格封顶的左右，将阻止您的定单以高于或低于特定水平的价格被执行。



创建挂钩中点定单

1. 点击**要价**区域来发起买入定单，或者点击**出价**区域来发起卖出定单。
2. 点击**类型**区域并选择 PEG MID 作为定单类型。
3. 如果需要，在**辅助价格**区域中输入抵消金额。

该定单类型只可用于直接传递至 Island 的美国股票定单。

要获取关于挂钩中点定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

盒顶

盒顶定单作为市价定单被发送，以当前最优的价格执行。如果整个定单没有立刻以市场价格执行，那么定单的剩余部分将作为限价定单被重新提交，限价被设定为定单的市价定单部分执行的价格。

创建盒顶定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中选择 BOX TOP 作为定单类型。
3. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

可用于传递至波士顿期权交易所的期权。

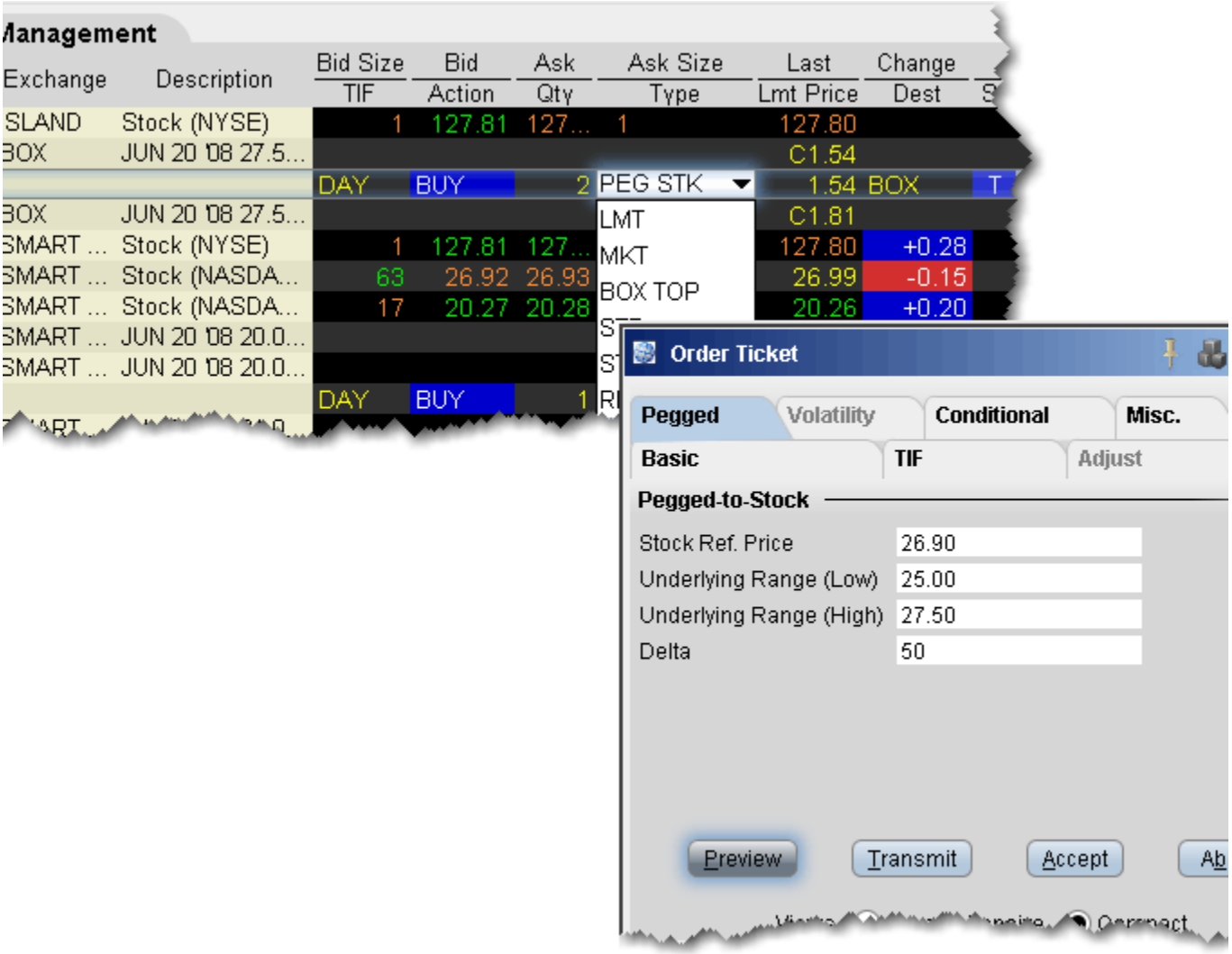
要获取关于盒顶定单的细节，访问定单类型信息页面。

价格改善竞价

对传递至 BOX 的期权，您可以选择参与价格改善竞价来改善您的价格。

提交价格改善竞价定单

1. 创建传递至 BOX 的期权定单。
2. 在*类型*区域中，选择 LMT、REL、或 PEG STK。
   - 对限价定单，在*限价*区域中以美分层级输入限价。
   - 对相对定单，在*辅助价格*区域中设定一个相对抵消金额 （以美分层级）。
   - 对挂钩股票定单，您在*辅助价格*区域中输入起始价格，在 *Delta* 区域中输入 delta，在*股票参考价格*区域中输入可选的股票参考价格，在*底层证券范围 （低）*区域中输入可选的股票范围低端，在*底层证券范围 （高）*区域中输入可选的股票范围高端。使用定单标签，或者从页面版式的定单栏标签显示这些区域。
3. 通过在状态区域中点击 “T” 来传递定单。



要获取关于波士顿期权交易所竞价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

相对 / 挂钩首要

相对定单为交易者提供了一种方式，来寻求比全国最佳买卖报价 （NBBO）更积极的价格。通过变为流动性提供者，并将出价或要价下达至比当前报价更积极的交易册中，交易者增加了其执行的可能性。当其他的市场参与者变得更积极时，报价将被自动地调整。对买入定单，您的出价以更积极的抵消金额 * 被挂钩至 NBB，而如果 NBB 上升，您的出价也将上升。对卖出定单，您的出价以更积极的抵消金额被挂钩至 NBO，而如果 NBO 下降，您的要价也将下降。除了抵消金额，您还能够定义一个绝对封顶，其作用与限价类似，并将阻止您的定单以高于或低于特定水平的价格被执行。

对抵消金额为 “0” 的相对定单，定单作为限价定单以最佳出价 / 要价被提交，并将与市场一道上升和下降，从而与内部报价相匹配。

Note: 如果您启用了工具提示，您能够在相对定单的限价上握住鼠标，查看该定单的**当前交易所价格**。

* 抵消金额为将被添加至最佳出价 （对买入定单）以及从最佳要价中被扣除 （对卖出定单）的金额，用来创建相对定单将被提交的限价。

输入相对定单

1. 点击**要价**区域来发起买入定单，或者点击**出价**区域来发起卖出定单。
2. 点击**类型**区域并选择 REL 作为定单类型。
3. 在**辅助价格**区域中输入抵消金额，或者使用**百分比抵消**区域来设定一个百分比。如果两个区域都有数值，那么两者当中较高的那个将被用作抵消金额。要显示百分比抵消区域：
   - **a** 在**页面**菜单上，点击*版式*。
   - **b** 在页面右侧的**栏 — 定单行**部分，选中百分比抵消，点击确定。

您一次能够在相同的交易页面上对若干笔相对定单修改抵消金额。要这么做，通过握住 Ctrl 键并点击每笔定单来选择多笔相对定单。在您选择了所有相对定单之后，右键点击选定的定单当中的一个并选择修改。在**相对定单修改**框中，定义一个抵消金额或百分比抵消金额并点击确定。所有选定的定单将被更改。

请注意，您能够在**全局配置**中使用*显示*组的设定页面，将*相对*定单的名称更改为*挂钩首要*。要获取关于相对定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

追踪止损

追踪止损卖出定单将初始止损价格设定为以固定金额低于市场价格。随着市场价格上涨，止损价格的上涨幅度将为追踪金额，但如果股票价格下跌，止损价格将维持不变。当止损价格被触及时，市价定单将被提交。对买入追踪止损定单反之。该策略可以允许投资者在不限制可能收益的情况下，限制最大的可能损失。

创建追踪止损定单

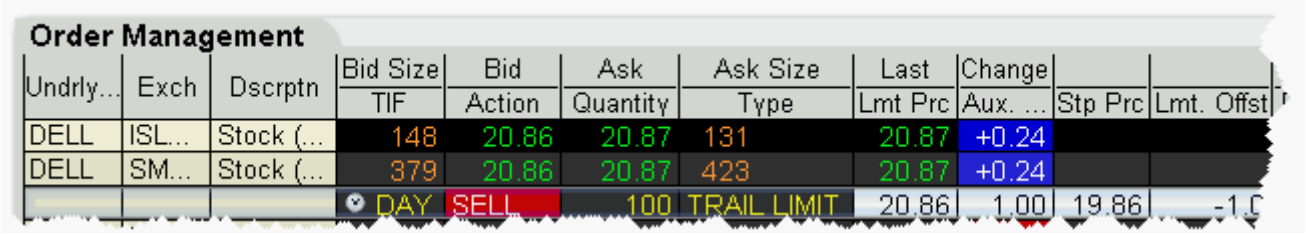
1. 点击**要价**区域来发起买入定单，或者点击**出价**区域来发起卖出定单。
2. 点击**类型**区域，并从定单类型下拉列表中选择 TRAIL。
3. 在**追踪金额**区域中输入一个值。这是被用于计算初始止损价格的金额，您想要限价以该金额来追踪止损价格。要将绝对值更改为最佳出价 / 要价的百分比，点击区域来产生一个下拉箭头，并随后选择*金额*或*百分比*。
   a. **止损价格 — 该区域是可选的。**默认情况下，初始止损价格被计算为*市价－追踪金额*。您能够修改止损价格，但如果它低于计算的值，当定单被提交时它将被丢弃。注意，即使您输入的值没有被使用，它也可能显示在止损价格区域中。
   b. **限价** — 该数值默认为当前的最佳出价 / 要价。限价将根据两个价格之间的 delta（初始止损价格－初始限价＝限价 delta），与追踪止损价格一起移动。如果限价与止损价格相同，它们将以零 delta 一起移动。
4. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

要获取关于追踪止损定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

追踪限价止损

追踪限价止损定单让您创建一个与动态更新的限价定单一道工作的追踪止损定单。当止损定单触发，限价定单将以最后计算的价格被提交（不同于市价定单将与常规追踪止损定单一起被提交）。

追踪限价止损定单使用四个组成部分：止损价格、追踪金额、限价和限价抵消金额。



输入追踪限价止损卖出定单

1. 点击**出价**来发起卖出定单。
2. 点击**类型**区域并选择 TRAIL LIMIT。
3. 如果还不可见，显示**止损价格**和**限价抵消金额**区域（右键点击栏标题并选择*客户化版式*，然后使用定单栏标签来添加区域）。
4. 在以下区域中输入值：
   - **a** **辅助价格**（追踪金额）— 如果市场价格上升，该数值从出价中被扣除用以连续地重新计算止损价格。使用下拉菜单来选择*金额*或*百分比*。追踪百分比按当前最佳出价 / 要价被计算。注意，您能够在定单默认值的默认定单抵消金额区域定义一个默认的追踪金额。
   - **b** **止损价格** — 您必须输入一个初始止损价格。不同于追踪止损定单，当您传递定单时，初始止损价格不会被交易平台自动地计算，因为计算限价或限价抵消金额需要止损价格。当市场价格上升时，止损价格被连续地重新计算。如果初始止损价格高于市场价格减去追踪金额，那么它将不会被修改。
   - **c** **限价或限价抵消金额** — 一旦止损价格被击穿，追踪限价止损的限价定单部分将被提交。当市场价格和止损价格继续上升，限价同样会被重新计算（根据可选的抵消金额），并随着止损价格一起移动。如果您想要指定一个限价抵消金额，在限价抵消区域将其输入。当定单被提交，该数值从止损价格中被扣除来计算限价。如果您想要输入一个限价，当定单被提交时，限价将从止损价格中被扣除来计算限价抵消金额。如果限价与止损价格相同，它们将无抵消金额地一起移动。
5. 要传递定单，在状态区域中点击“T”。

要获取关于追踪限价止损定单更详细的说明和例子，访问定单类型信息页面。

交易量加权平均价格

只有对大市值证券，VWAP （交易量加权平均价格）定单才被支持。您同样能够使用不保证的 VWAP 算法。

创建 VWAP 定单

1. 点击**要价**来创建买入定单，或者点击**出价**来创建卖出定单。
2. 在*类型*区域中选择 **VWAP** 作为定单类型。
3. 如果需要，使用 TIF （有效时间）区域来更改 VWAP 截止时间。

默认情况下，VWAP 从最近的截止时间计算到市场收盘时。要更改，点击时间输入日历图标来选择一个新的 VWAP 截止或起始时间。如果没有选定任何值，那么最近的截止时间将被使用。此外，您能够使用*到期时间*区域来修改计算的结束时间。要显示到期时间区域，使用页面配置上的定单栏标签。

4. 要传递定单，在状态区域点击 “T”。

Note: 传递的 VWAP 定单立刻被接受且不能被取消。

VWAP 定单被自动地传递。

要获取关于 VWAP 定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

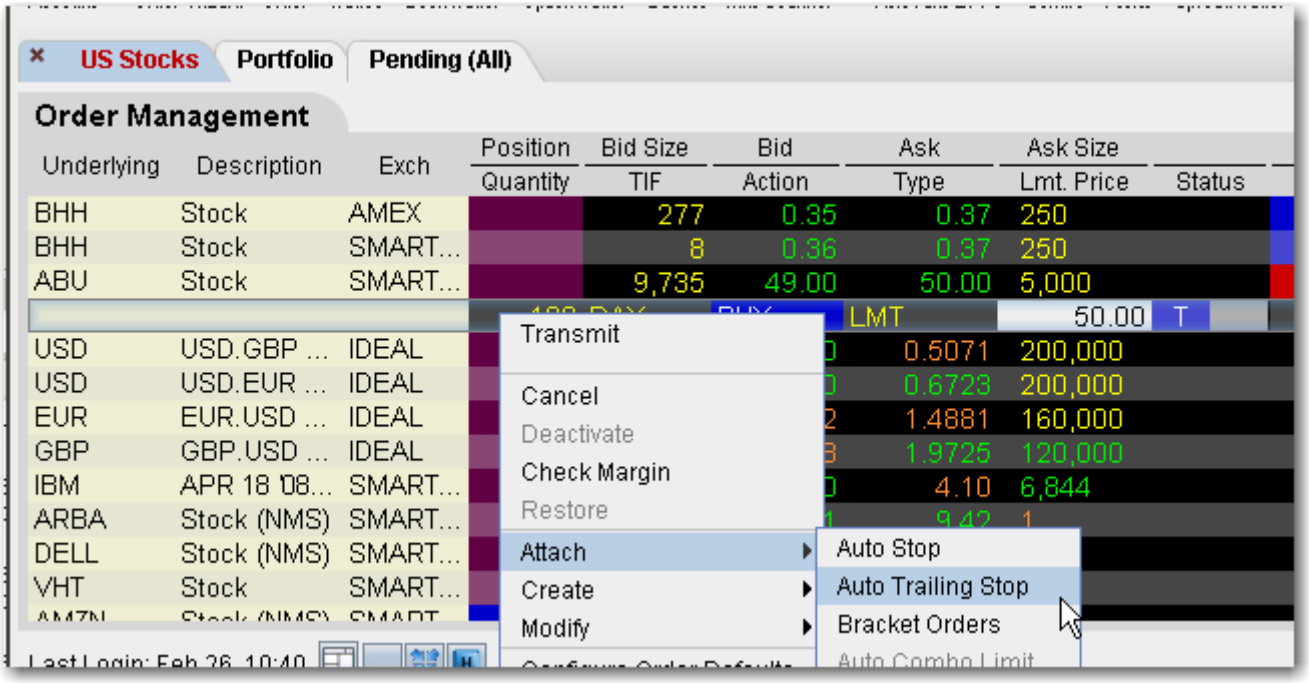
高级定单类型

引言

- 自动追踪止损
- 括号
- 条件

自动追踪止损

您能够将追踪止损定单附加到限价定单。当限价定单被执行时，附加的追踪止损定单被自动地激活。



附加自动追踪止损

1 右键点击一个限价定单并选择**附加**，然后选择*自动追踪止损*。

- 要修改追踪金额，更改**辅助价格**区域中的值。

要更改用来计算止损选择价格的默认追踪金额，使用全局配置的定单 > 定单默认值页面。

2 当限价定单执行时，追踪止损定单被提交。对**买入**定单，止损选择价格将使用 *（母定单限价＋追踪金额）*被计算，而对**卖出**定单则使用 *（母定单限价－追踪金额）*。

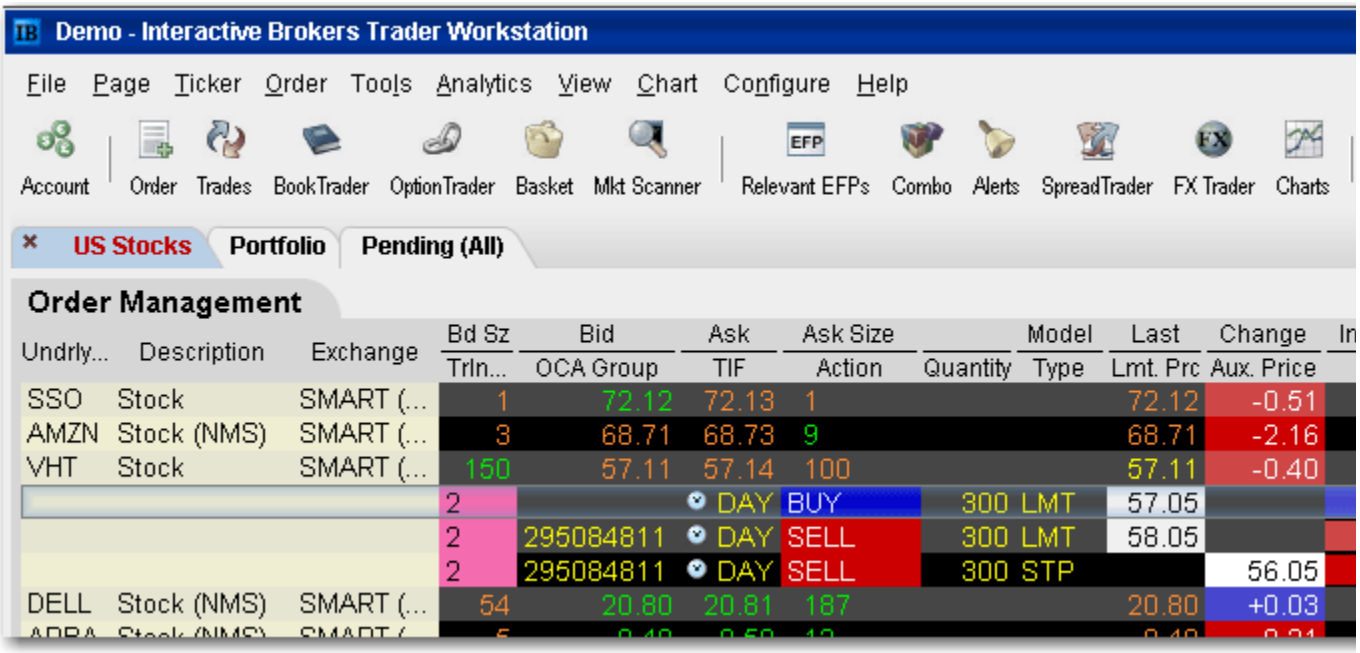
母定单和附加定单之间的关系能够在追踪键区域中看见。相关的定单被分配了相同的追踪键。

括号

括号定单被设计用来帮助限制您的损失并锁定利润，方法是使用两份位置相反的定单来给定单 “加括号”。给买入定单加括号，使用的是一份高位卖出限价定单和一份低位卖出止损 （或限价止损）定单。给卖出定单加括号，使用的是一份高位买入止损 （或限价止损）定单和一份低位买入限价定单。

用作括号的定单的定单数量与最初的定单数量相同。默认情况下，从括号定单被设定的当前价格抵消的金额是 1.0。对特定的定单，该抵消金额能够在定单管理行上被手动地更改，或者您能够使用**全局配置**的定单 > 定单默认值页面来修改默认抵消金额。

另外，如果您在您的定单行上显示 **OCA 组**区域，您将会看见两个子括号定单被自动地放入到一个 OCA 组中。这意味着当其中的一个定单执行时，另一个将自动地被取消。

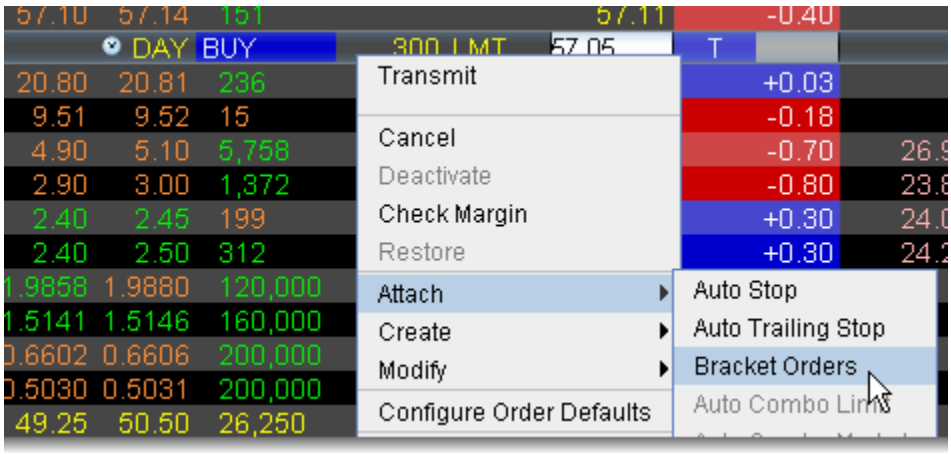


Note: 如果您将括号定单附加到工作中的定单，您将需要手动地传递子定单。然而，系统能够认出母定单和子定单被设计用来像绑定的组一样工作，如果您在您的定单行上显示了追踪键区域，那么您能够通过该区域中的匹配值来看到这一点。如果您将括号定单附加到工作中的定单并修改了母定单，那么当您再传递母定单时，子定单将被自动地提交。

创建括号定单

1 点击资产的 “要价” 或 “出价” 来创建一个定单管理行。

- 点击**要价**来创建一份**买入**定单。
- 点击**出价**来创建一份**卖出**定单。



2 在**右键点击**菜单上，选择附加，然后选择*括号定单*。

3 证实定单参数是正确的。

4 传递定单。

要获取关于括号定单的更多信息，访问定单类型信息页面。

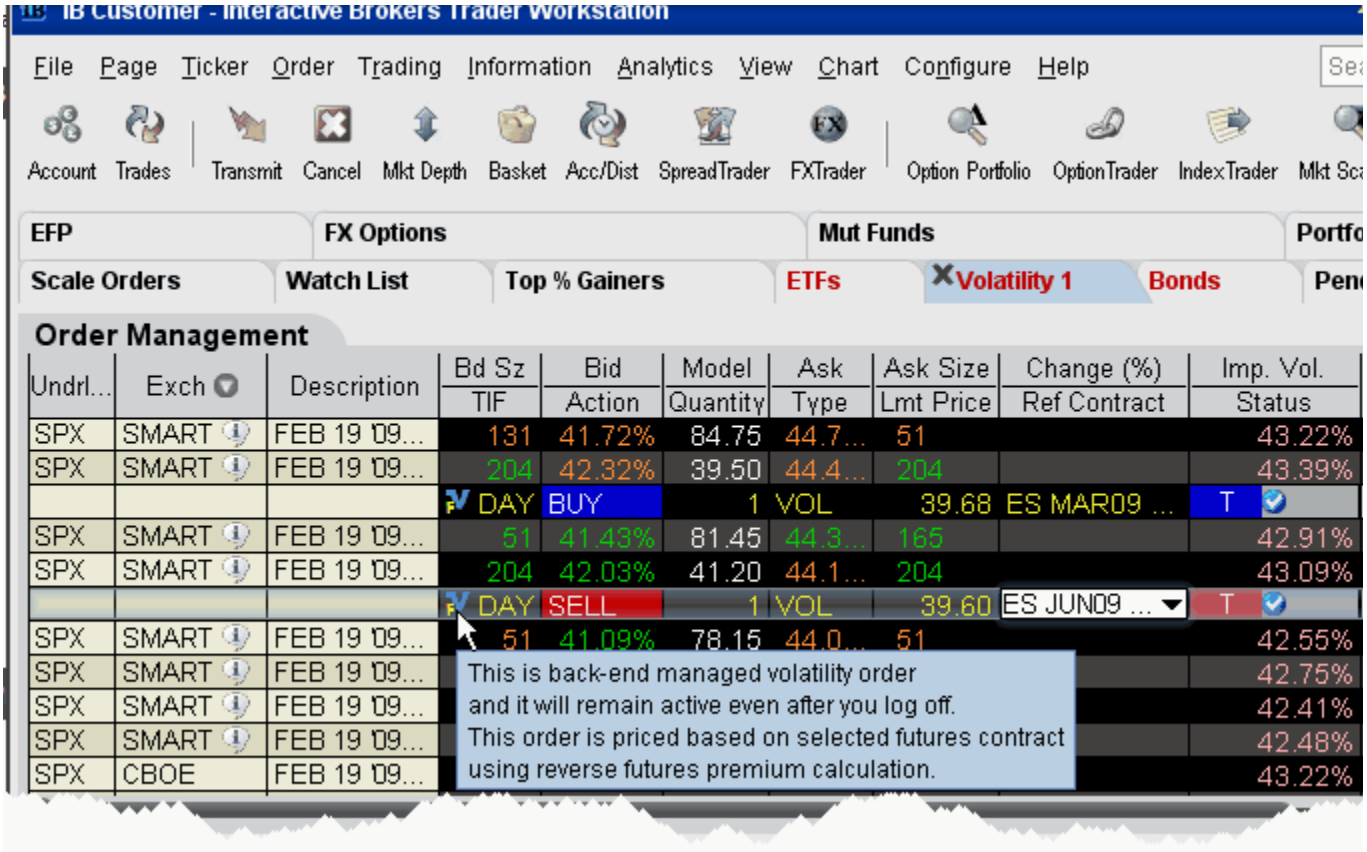
波动率定单

引言

- 波动率交易
- 对波动率定单的动态管理

波动率交易

VOL （波动率）定单类型允许您交易波动率，并为您提供了动态地管理您的期权定单的方法。



交易波动率

1. 从**页面**菜单中，选择*创建波动率页面*。被用来定义和动态地管理波动率定单的区域位于新页面上。
2. 创建市场数据线。注意，出价和要价以波动率而不是货币金额显示。股票代码的市场数据将仍然显示出价和要价。
3. 使用**波动率类型**下拉列表来选择*每年*或*每日*波动率。
4. 对买入定单通过点击**要价**波动率来创建定单，或者对卖出定单通过点击**出价**波动率来创建定单。定单类型默认为 VOL。

Note: 您能够对期权、指数期权和组合定单使用 VOL 定单类型。在期权的波动率上握住您的光标，来查看基于该波动率的期权价格。

请注意对传递波动率组合定单的以下要求：

- 组合波动率定单必须是智能传递的。

- 所有的边必须在相同的底层证券上，并且每条边必须独立地有资格使用波动率定单类型。例如，买进出售 （BuyWrite）定单不能作为波动率定单被发送，因为其股票边不允许该定单类型。
- 所有波动率定单必须为当日定单。
- 您能够使用逆期货权利金计算来选择对智能传递的指数期权定单定价，方法是从参考合约区域中选择一个期货合约。

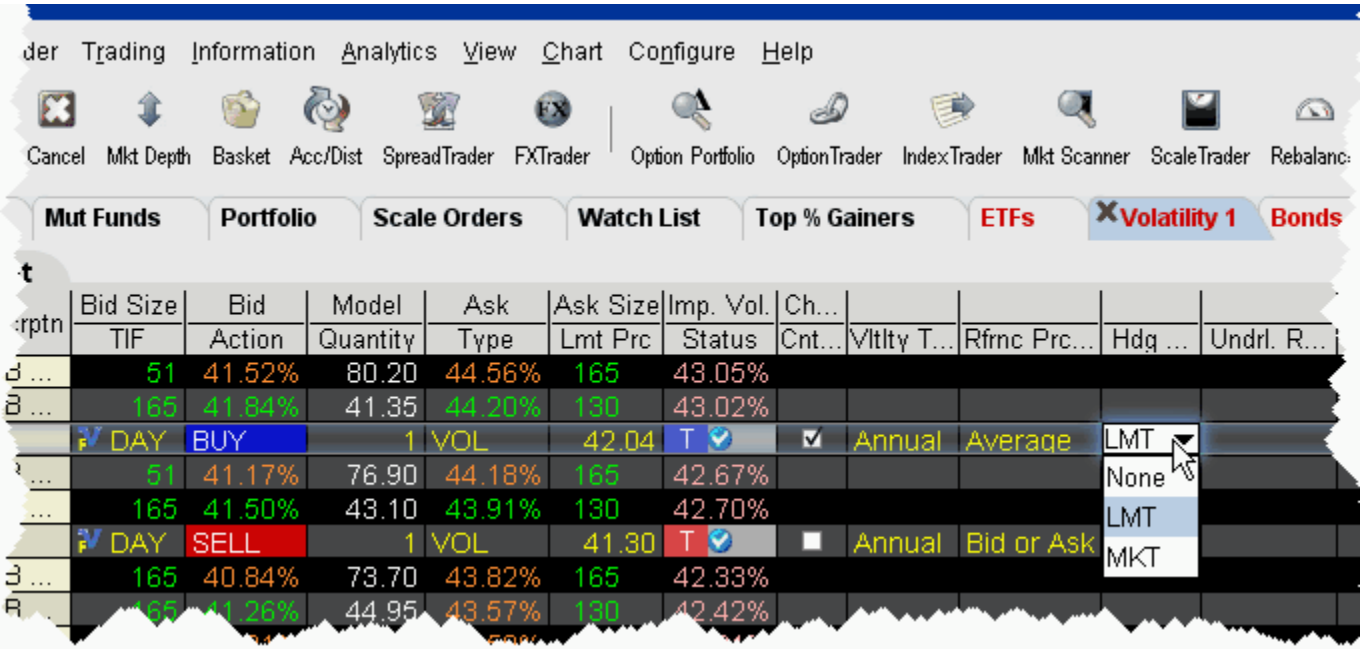
5 要让交易平台根据您的波动率输入，对期权或组合定单计算限价，在**定单波动率**区域中输入一个值。内在波动率区域中显示的值是通过期权建模者计算的。

6 要传递定单，在**传递**区域中点击 “T”，或者在交易工具栏上点击*传递*图标。

区域	描述
波动率	如果需要，输入一个波动率，用来计算期权的限价。如为空白，计算将使用经期权分析推导出的波动率。
波动率类型	从每日或每年波动率中选择。
对冲定单类型	选择一个定单类型。应用程序将针对已执行的期权定单发送一笔定单，以维持 delta 中性头寸。使用对冲辅助价格区域，对要求该区域的定单设定一个价格。注意对指数期权，您将需要选择一个用于对冲 delta 交易的期货合约。
对冲辅助价格	与对冲定单类型区域一道使用。如果您选择了一个要求您定义价格的定单类型，例如相对定单，那么使用该区域来设定价格。
连续更新	选中该选项，当底层证券工具的价格显著地变化时，连续地更新定单的价格。**注意您一次只能对三个活动的定单选中连续更新。** 当您启用了连续更新模式时，对由系统作出的定单修改，您将被征收取消费。
参考价格类型	选择当买入看涨期权或卖出看跌期权时使用 NBB （出价），当卖出看涨期权或买入看跌期权时使用 NBO （要价），或者使用最佳要价和出价的平均值。该价格也被用来计算被发送至交易所的限价 （无论连续更新是否被选中），以及股票价格范围监控。
股票价格监控	**底层证券范围 （低）** — 输入一个与选中的期权定单相关的低端可接受的股票价格。如果底层证券工具的价格跌至低端股票价格范围以下，那么期权定单将被取消。仅仅触及价格不会取消定单。 **底层证券范围 （高）** — 输入一个与选中的期权定单相关的高端可接受的股票价格。如果底层证券工具的价格涨至高端股票价格范围以上，那么期权定单将被取消。仅仅触及价格不会取消定单。
参考合约	用于智能传递的指数期权波动率定单。该区域允许您选择用于计算定单价格的期货合约。要激活该功能，在**全局配置**中使用*波动率和分析*页面，并选择*与期货合约相关的价格指数期权*。

对波动率定单的动态管理

使用动态管理区域来让交易平台创建和管理 delta 对冲定单。



动态地管理波动率定单

1 从波动率定单管理行上，从**对冲定单类型**下拉列表中选择一个定单类型。

Note: 交易平台将根据您输入的参数来创建和管理对冲定单。

2 使用底层证券范围 （低）和 / 或底层证券范围 （高）区域，对底层证券定义一个价格范围 （如有需要）。

有效时间

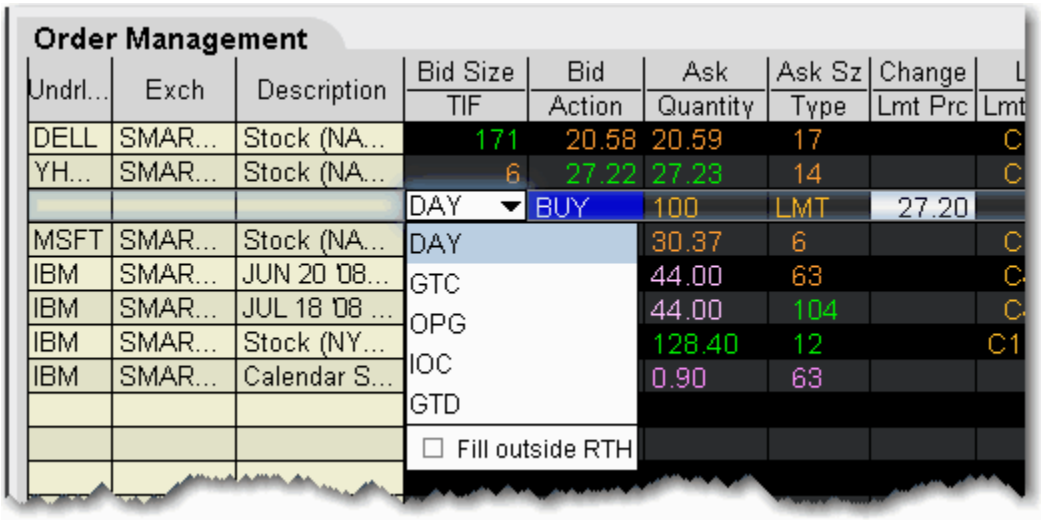
引言

- 定单的有效时间
- 到时后有效
- 全数执行或立刻取消
- 竞价
- 开盘市价
- 开盘限价

定单的有效时间

定单的有效时间定义了在定单被取消之前它将继续工作的时间长度。我们支持多种有效时间选择，包括以下描述的那些。

Note: 对任何定单可用的选择是否有效，根据的是合并的定单类型、交易所以及产品。不是所有的有效时间都可用于所有定单。



- DAY — **当日**定单如果在交易日结束时还没有执行，那么它将被取消。除非另有指定，每个定单都是**当日**定单。
- GTC — **取消前有效**定单将继续在系统中和市场上工作直到其执行或被取消。GTC 定单在以下条件下将被自动地取消：
  - 如果证券的公司行动导致了股票的交换或分配。
  - 如果您 90 天不登录您的 IB 账户。

  GTC 定单将不会被减少股息。如果您想要在除息日调整您的定单，我们推荐您使用到期 / 到时前有效（GTD）或到时 / 到期后有效 （GAT）定单类型。

Note: 对不接受 “天然的” GTC 定单的市场中心，定单类型是通过每个工作日在市场中心开盘时重新提交相关的定单被模拟的。

- OPG — 使用 OPG 来发送开盘市价 （MOO）或开盘限价 （LOO）定单。
- IOC — **立刻执行或取消**定单当其在市场中变为可用时没有被执行的任何部分将被取消。
- GTD — **到期前有效**定单将在系统中和市场上保持工作，直到其执行或直到指定日期的市场收盘时。当您选择 GTD 作为有效时间，*到期日期*和*到期时间*区域都被显示在定单管理行上。输入您想要定单继续工作到的时间，格式为 *YYYYMMDD*。要设定时间，以格式 *HH:MM(:SS)* 输入时间。如果需要，使用公认的三个字母的首字母缩略词来输入一个时区。注意，如果您不输入特定的时区，那么您的电脑被设定的时区将被使用。
- FOK — 如果整个**全数执行或立刻取消**定单当其变为可用时没有立刻执行，那么整个定单将被取消。

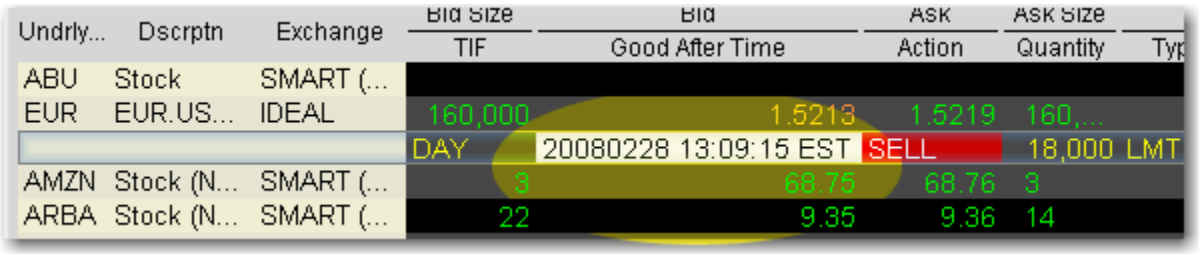
- DTC — **取消前当日**定单与当日定单类似，但不同于在交易日结束时被取消并从交易屏幕中被删除，定单只是失效。这意味着定单在交易所被取消了，但仍然保留在您的交易屏幕中，无论何时您点击*传递*按钮都将被再传递。

在常规交易时间之外执行 / 触发 — 当被显示，选中该选项给了定单在常规交易时间之内和在常规交易时间之外执行（在止损以及其他触发定单的情况下为和 / 或触发）的可能性。

Note: 该选项可能不能用于未被列举在交易所的特定产品。IB 客户个人有责任确保该参数可用于涉及的产品。

到时后有效

“到时后有效”定单被持有在系统中，并在您输入的日期和时间被发送至交易所。



创建 “到时后有效”定单

1 在定单管理行上显示**到时后有效**区域：

a 在**页面**菜单上，点击*版式*。

b 点击**定单栏**标签，在页面的右侧，从**有效时间**类别中选择*到时后有效*，然后将其添加到已显示的栏当中。

2 在交易屏幕上，创建一笔定单 （点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单）。

3 在*到时后有效*区域中，点击日历图标来打开日期 / 时间设定器。

4 从日期区域中选择月、年和日，从时间区域中选择时间和时区。点击确定。

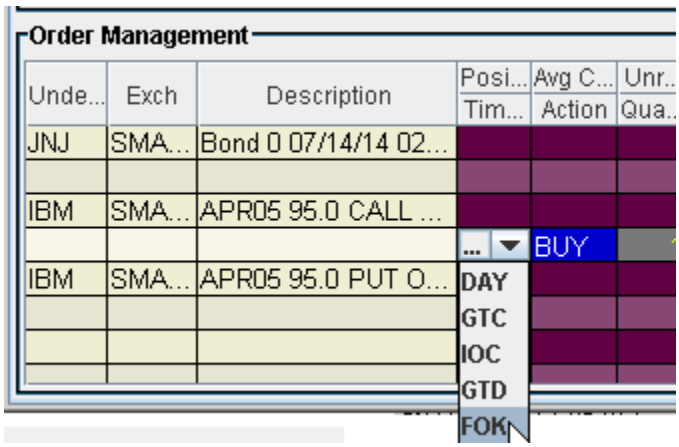
注意时间使用 24 小时制，而不是 “AM” 和 “PM”。

5 传递定单。定单被持有在 IB 系统中直到您设定的时间和日期。

要获取关于到时后有效定单更详细的描述，以及支持它们的产品和交易所，访问定单类型信息页面。

全数执行或立刻取消

期权定单的一种有效时间，指定了定单必须立刻并以其完整数量执行，否则将被取消。



对定单应用 FOK 有效时间

1. 创建一笔期权定单 （点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单）。
2. 在*有效时间*区域中，选择 FOK。

   Note: 如果 FOK 没有被显示在下拉列表中，那么它对您正在创建的定单不适用。
3. 通过在状态区域中点击 “T” 来传递定单。

要获取关于全数执行或立刻取消定单的更多信息，访问定单类型信息页面。

竞价

竞价定单以计算的开盘价格 （COP）被提交。如果定单没有执行，它将作为限价定单以 COP 或最优的出价 / 要价被重新提交。

创佳竞价定单

1. 点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单。该行动将打开**定单标签**窗口。
2. 在类型区域中选择一个定单类型。
3. 在*有效时间*区域中，选择 AUC （竞价）。
4. 通过在状态区域中点击 “T” 来传递定单。

可用于有限的产品和交易所，包括 HKFE 的期货和 LSE、IBIS 以及 VSE 的股票。

要获取关于竞价和其他定单类型更详细的描述，访问定单类型信息页面。

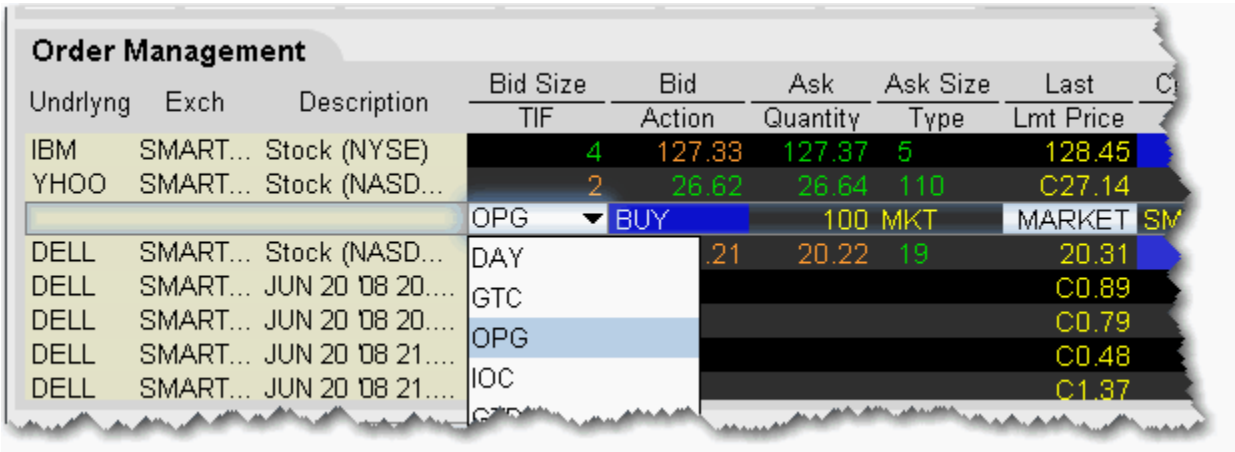
开盘市价

MOO （开盘市价）定单是一种在市场开盘时以市价执行的市价定单。

创建开盘市价定单

1. 点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单。
2. 在*类型*区域中，选择 MKT 作为定单类型。
3. 在*有效时间*区域中，选择 OPG 作为有效时间。
4. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

要获取关于开盘市价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。



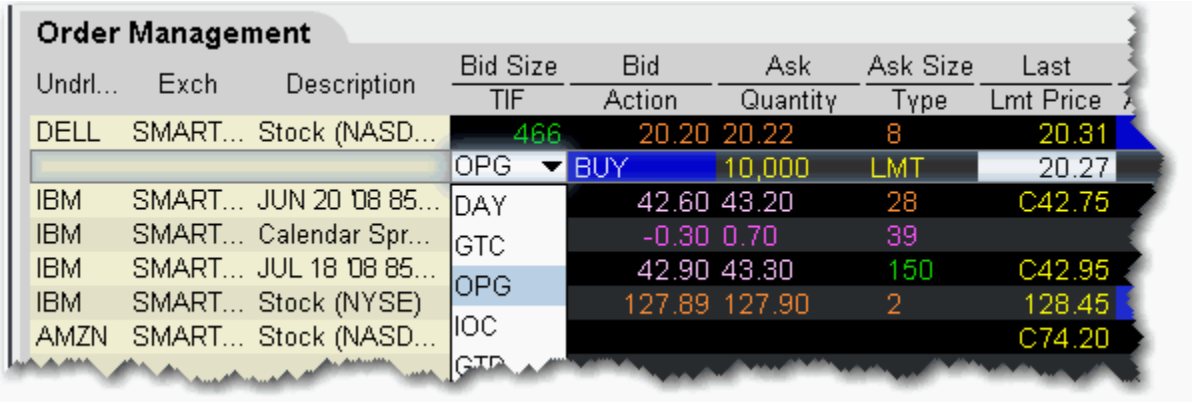
开盘限价

LOO （开盘限价）定单是一种在市场开盘时执行的限价定单，前提是开盘价格等于或优于限价。

创建开盘限价定单

1. 点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单。
2. 在*类型*区域中，选择 LMT 作为定单类型。
3. 在*有效时间*区域中，选择 OPG 作为有效时间。
4. 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

要获取关于开盘限价定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。



定单属性

引言

定单属性通过定单标签，或者通过在交易窗口上显示相关的属性区域，从而被应用于交易平台定单类型。

- 隐藏
- 全权委托
- 冰山 / 保留
- 全或无 （AON）
- 最低数量
- 大额
- 一扫光
- 一取消全 （OCA）

隐藏

隐藏定单 （通常为大交易量定单）既不在市场数据中也不在深层交易册中显示其存在的证据。

创建隐藏定单

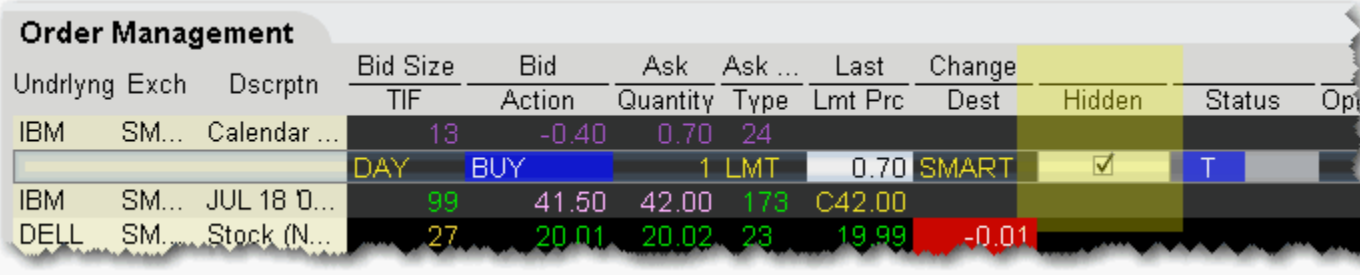
1 在定单管理行上，对股票显示**隐藏**区域，以及 / 或者对美分定价的权益期权显示**隐藏美分**区域：

   a 在**页面**菜单上，点击*版式*。

   b 在页面右侧的**栏 — 定单行**部分中，选中*隐藏*和 / 或*隐藏美分*，并点击**确定**。

2 在交易屏幕上，创建一笔定单 （点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单）。

3 选中*隐藏*或*隐藏美分*（对权益期权）区域。



4 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

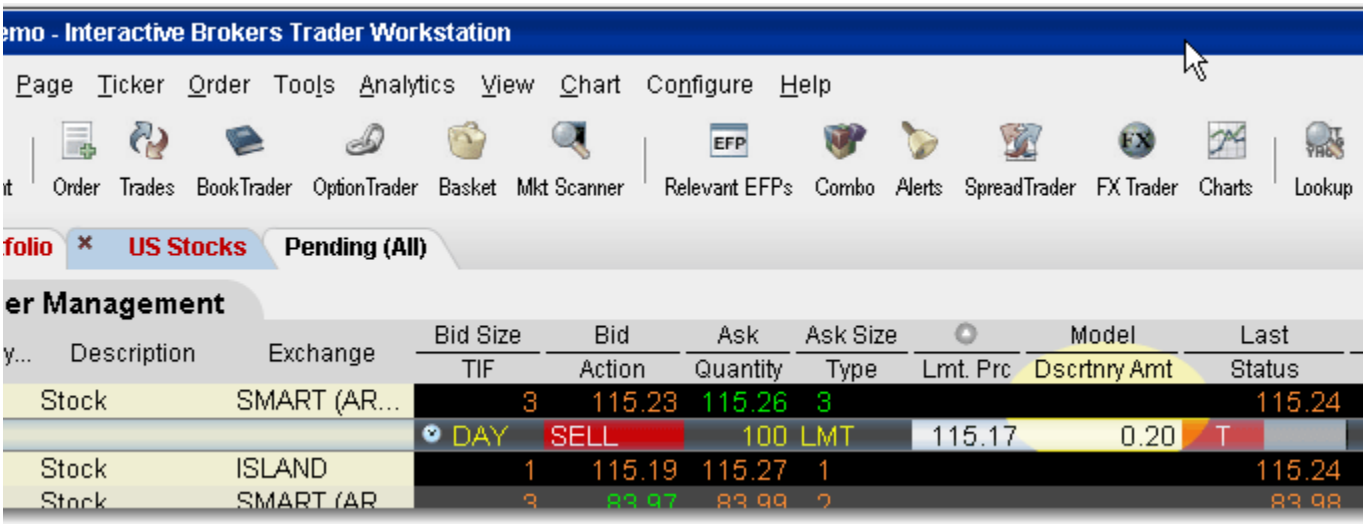
要获取关于隐藏定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

全权委托

全权委托定单属性能够被应用于智能传递的限价定单。您定义一个全权委托金额，它被添加到限价或从限价中被扣除，它增大了定单有资格执行的价格范围。只有最初的限价被显示给市场。

创建全权委托定单

1. 在定单管理行上显示**全权委托**区域：
   - **a** 在**页面**菜单上，点击*版式*。
   - **b** 点击**定单栏**标签，并在页面右侧，选择*全权委托金额*，并将其*添加*至已显示的栏。
2. 点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单。
3. 在*类型*区域中，选择 LMT 作为定单类型。
4. 在定单行的*全权委托金额*区域中输入一个全权委托金额。
5. 要传递定单，在状态区域中点击“T”。



要获取关于全权委托定单的更多信息，访问定单类型信息页面。

冰山 / 保留

冰山 / 保留定单允许您提交一笔定单 （通常是大交易量定单），而只公开地透露被提交的定单的一部分。

创建冰山 / 保留定单

1 在定单管理行上显示**显示尺寸**区域：

   a 右键点击栏标题并选择*客户化版式*。

   b 点击定单栏标签。

   c 在*可用的栏*列表中，打开数量类别并选择**显示尺寸**。

   d 点击**添加**将栏移动到*已显示的栏*列表中。

2 在交易屏幕上，创建一个定单 （点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单）。

3 在**显示尺寸**区域中，输入您想要公开透露的数量。

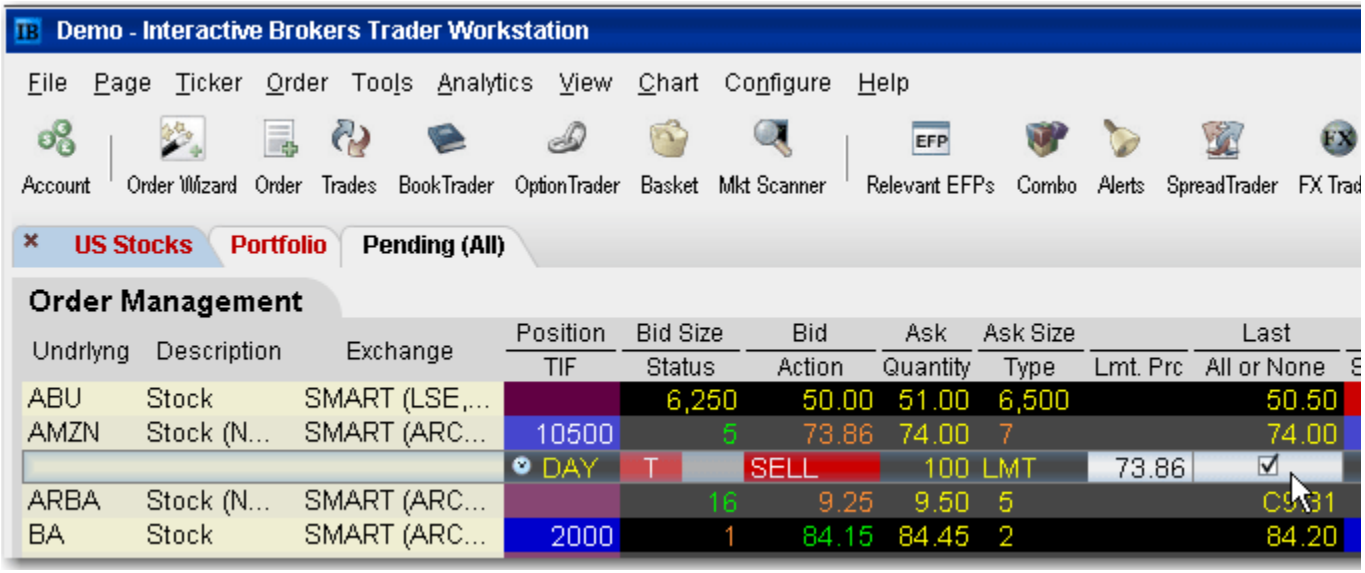
要获取关于冰山 / 保留定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

全或无（AON）

将定单标记为“全或无”来指定只有当整个定单数量可用时，定单才执行，并且它能够以其全部数量执行。该属性能够被应用于所有的定单类型。

将定单标记为全或无

1. 在您的交易窗口上显示**全或无**区域：
   - **a** 在**页面**菜单上，点击*版式*。
   - **b** 打开**定单栏**标签，并向下移动到*可用的栏*列表中的属性部分。
   - **c** 强调**全或无**并点击*添加*按钮。
2. 创建一笔定单（点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单）。
3. 选中**全或无**复选框来给定单加标签。



Note: 您同样能够从定单标签上的*杂项*标签来应用定单属性。

要获取使用**全或无**定单的例子，访问定单类型信息页面。

最低数量

使用最低数量定单属性来确保您的定单至少有最低指定数量的单位被执行了。

创建最低数量定单

1 在定单管理行上显示**最低数量**区域：

   a 右键点击栏标题并选择*客户化版式*。

   b 点击定单栏标签。

   c 在*可用的栏*列表中，打开数量类别并选择**最低数量**。

   d 点击**添加**将栏移动到*已显示的栏*列表中。

2 在交易屏幕上，创建一笔定单 （点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单）。

3 在最低数量区域中，输入必须可用于定单任何部分执行的最低合约数量。

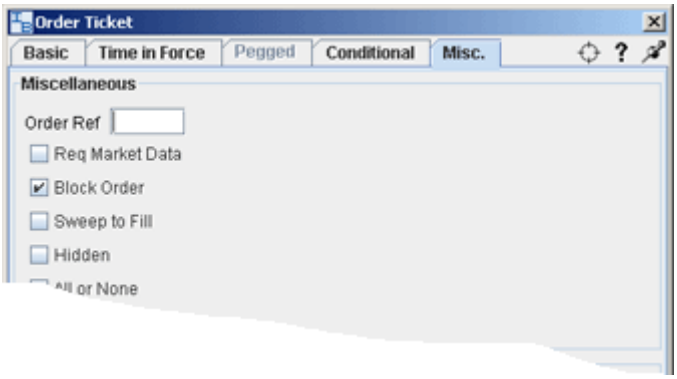
可用于智能传递的期权定单。

大额

大额定单是一种高数量定单，它由特定限价的最低 50 份合约组成。

提交大额定单

1. 选择您想要为其提供大额定单的期权。
2. 在**定单**菜单上选择*标签*。



3. 在*交易所*区域中，选择 ISE。
4. 在*价格*区域中输入一个限价。
5. 转到*杂项*标签。
6. 选中**大额定单**。
7. 选择**传递**来发送，或者选择**接受**在您传递之前在交易屏幕上显示定单。

要获取关于大额定单更详细的描述，以及支持它们的产品和交易所，访问定单类型信息页面。

一扫光

一扫光定单识别最佳的价格以及在该价格提供的 / 可用的确切数量，并传递您定单的相应部分以获得立刻执行。同时，它识别下一个最佳的价格以及提供的 / 可用的数量，并提交您定单的匹配数量以获得立刻执行。

创建一扫光定单

1 对定单管理行显示**一扫光**区域：

- **a** 右键点击栏标题并选择*客户化版式*。
- **b** 点击定单栏标签。
- **c** 在*可用的栏*列表中，打开*定单属性*类别并选择**一扫光**。
- **d** 点击**添加**将栏移动到*已显示的栏*列表中。

2 在交易屏幕上，点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单。

3 选中*一扫光*区域。

4 要传递定单，在状态区域中点击 “T”。

要获取关于一扫光定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

一取消全（OCA）

一取消全（OCA）定单是单独的定单的组合，它们在市场中互相之间一起工作。客户输入定单作为 OCA 组的一部分，当一笔定单被执行时，组里剩余的定单将被取消。如果定单被部分执行，组里剩余的定单将根据已执行的数量成比例地被减少。如果定单在执行前被取消，那么组里剩余的定单将被取消。

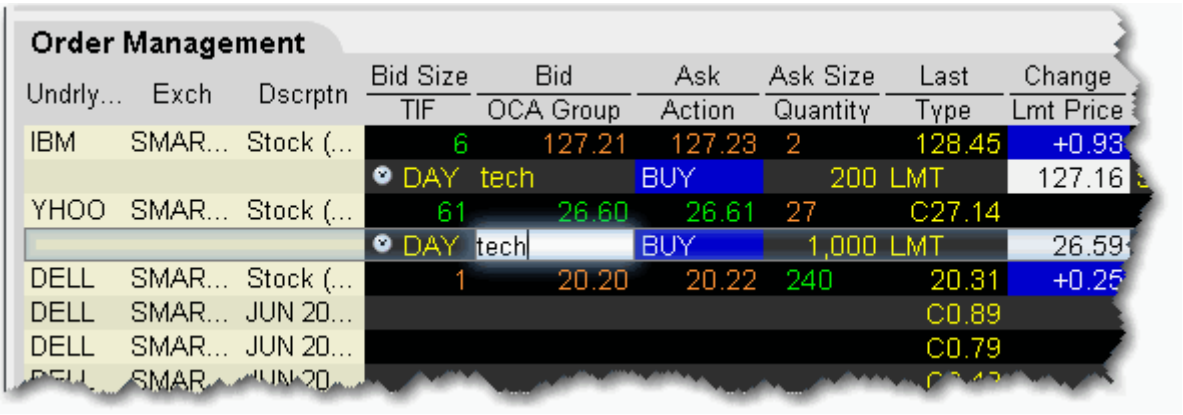
创建一取消全定单

1 在定单管理行上显示 OCA 组：

- **a** 右键点击栏标题并选择*客户化版式*。
- **b** 点击定单栏标签。
- **c** 在*可用的栏*列表中，打开定单属性类别并选择 OCA 组。
- **d** 点击**添加**将栏移动到*已显示的栏*列表中。

2 在交易屏幕上，创建定单（点击**要价**来创建一笔买入定单，或者点击**出价**来创建一笔卖出定单）。

3 通过在 OCA 组区域中输入组名称（您能够使用任何您想要的描述名称），将定单识别为 OCA 组的一部分。



4 继续创建定单，并通过在 OCA 组区域中对您创建的每个定单输入相同的名称，来将它们都识别为组的一部分。

5 当您对一个组创建了所有定单之后，通过在**定单**菜单中点击*传递页面*来传递 OCA 定单。

Note: 由于 OCA 过程是一个自动化的过程，因此不能保证要求的取消和修改将在定单被执行之前到达特定的交易所。

要获取关于一取消全定单更详细的描述，访问定单类型信息页面。

算法

4

引言

算法帮助平衡市场影响和风险，从而帮助获得对大交易量定单的最佳价格。我们日益壮大的算法家族包括以下内容：

- 积累分配
- 期权投资组合
- IB 算法
- CSFB 算法
- Jefferies 算法

积累分配

引言

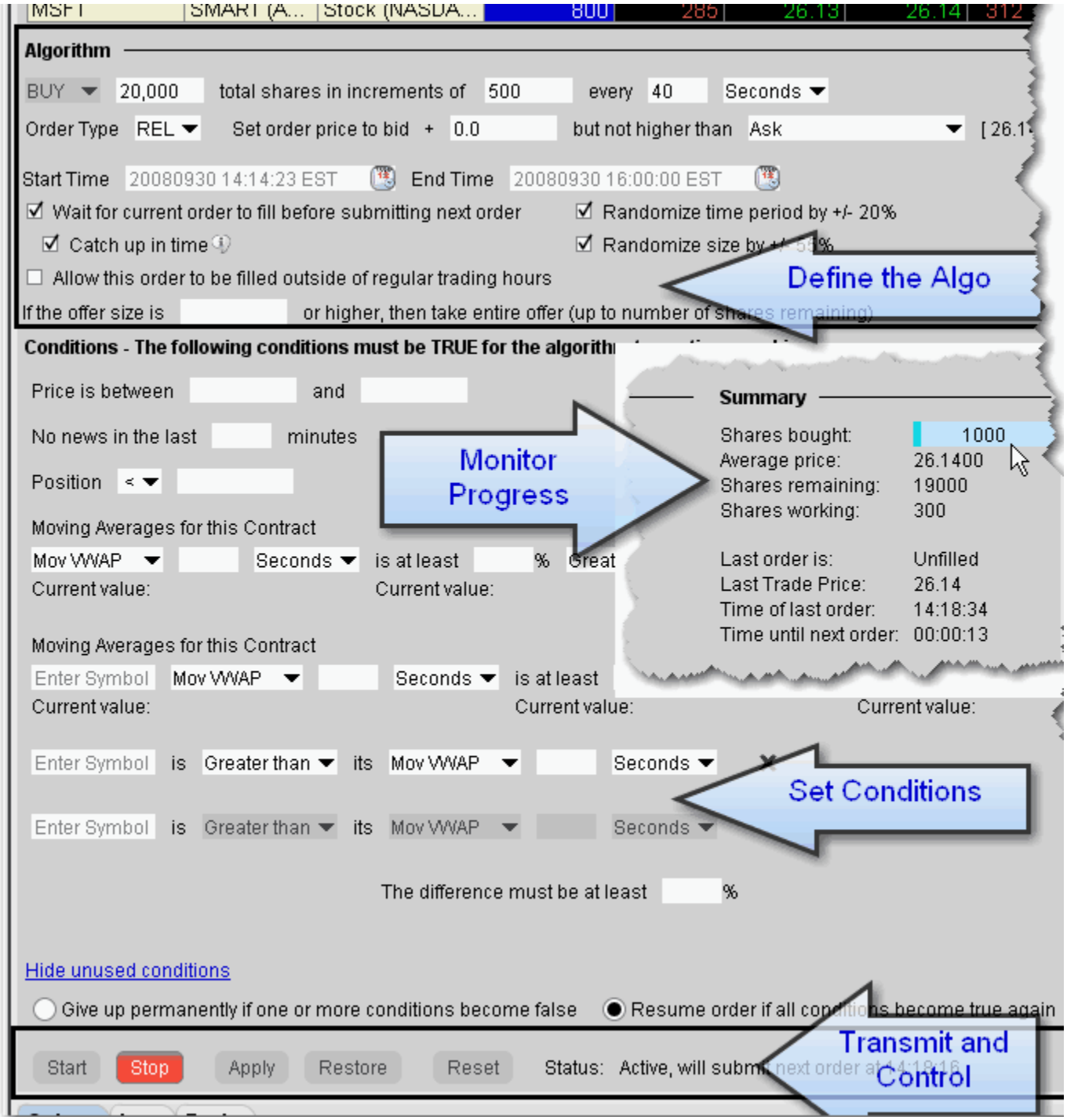
使用积累 / 分配算法，在一段时间内以小层级来买入或卖出大定单，最小化市场影响。该算法支持多种资产类别，包括股票、期权、期货、外汇和组合定单。

用条件客户化基本的算法，从而满足您对市场的特定视图。

- 入门
- 定义算法
- 基本算法举例
- 定义算法条件
- 创建多个算法定单
- 传递和修改算法
- 监控定单进程

入门

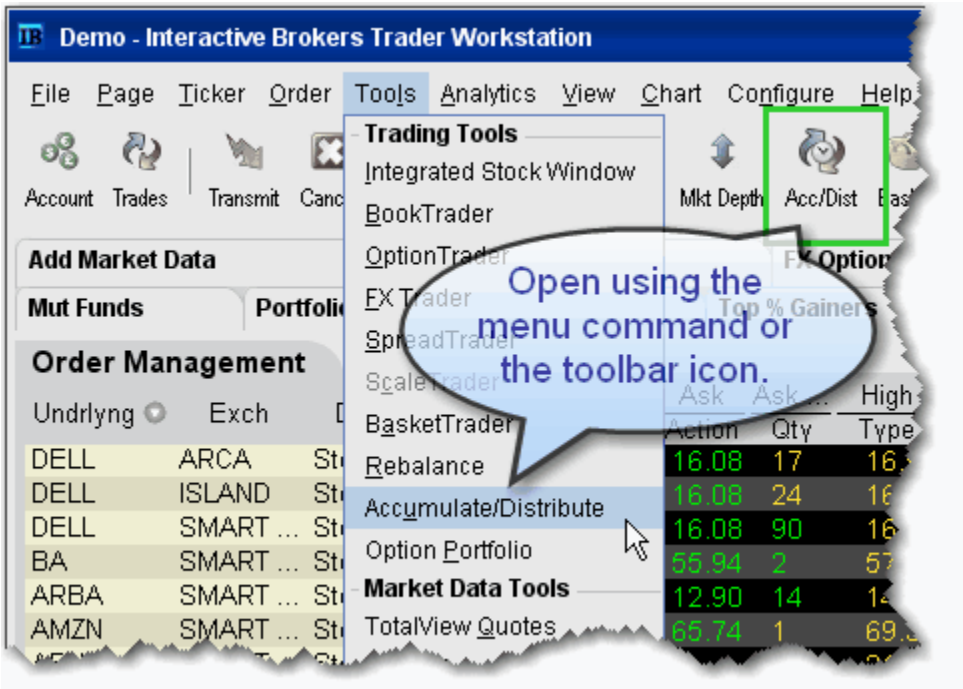
积累 / 分配算法的作用在于为您的大额定单获取最优的价格，同时最小化市场影响。它通过将大定单切分为较小的组成部分，并根据您预定义的定单参数在时间范围内累积或分配来实现该目标。



算法窗口被划分为四个主要的部分：

- **算法**区域，从中您定义定单的基本参数。
- **条件**区域，从中您指定关于价格、头寸和市场行为的条件，它们必须保持为真，您的定单才会是有效的。
- 定单**小结**，其显示了连续的实时定单进程。
- **控制**按钮，您使用它来启动和停止算法并应用更改。

它还包括定单、交易和日志面板，以及报价面板来定义合约。

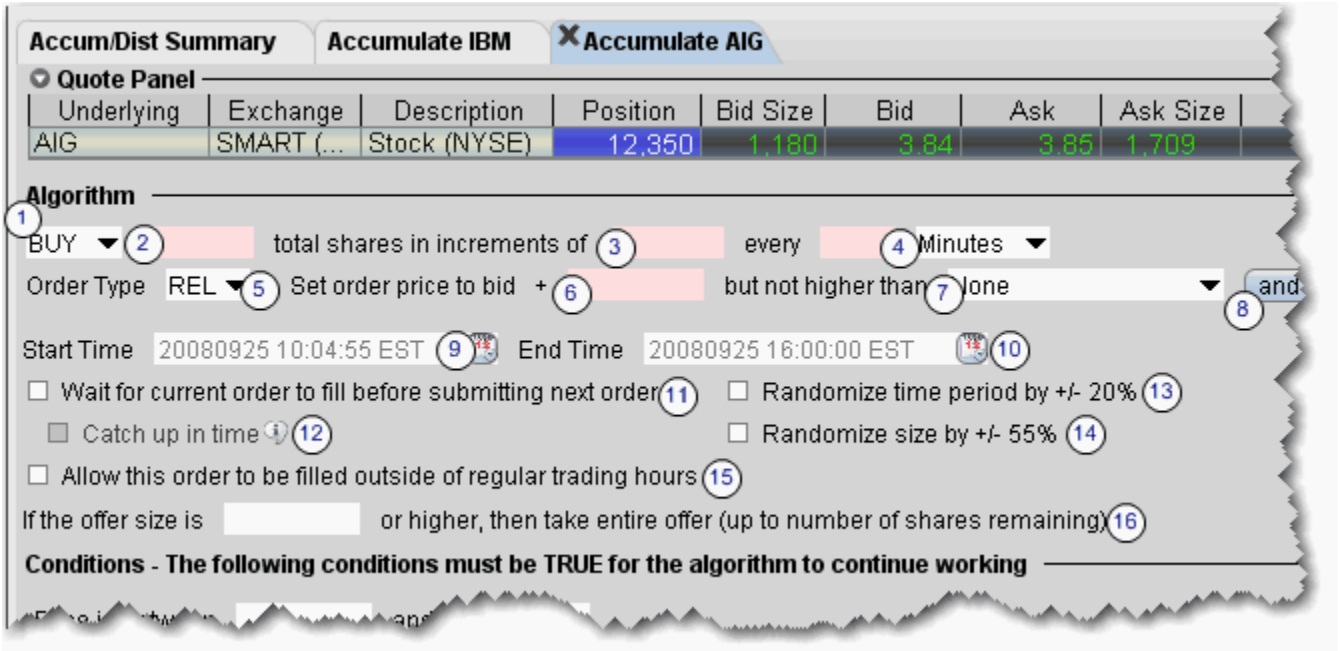


打开积累 / 分配窗口

- 强调您想要交易的合约，并从**工具**菜单中选择*积累 / 分配*，或者
- 点击工具栏上的**积累 / 分配**图标。

定义算法

算法区域是您设定算法的基本参数的地方。被粉色覆盖的区域是必需的。



以下编号的描述对应的是上图中编号的区域。

1 选择行动，买入或卖出。

2 输入总定单数量，例如 5000。

3 定义每个组成部分的层级。例如，您可能想要以 200 股的层级来交易该 5000 股定单。

4 指定组成部分的定单提交时机，以秒、分或小时表示。例如，您可能想要每 2 分钟以 200 股层级累积 5000 股 XYZ。

5 选择定单定单类型。设定价格的区域根据的是您选择的定单类型。对股票定单，从以下当中选择：

- 相对 — 使用相对定单，通过下达比当前最佳出价或要价更为积极的出价或要价，将流动性添加到市场。设定一个可选的抵消金额，并指定封顶。报价根据您的标准，随着市场移动来自动地调整。
- 限价 — 设定一个带抵消金额的限价，必须达到或优于该价格定单才会被执行。
- 市价 — 定单将尝试以当前市场价格执行。

6 **将定单价格设定为……**（对相对定单）— 对买入定单，使用出价加上任何金额。对卖出定单，使用要价减去任何金额。要只使用不带抵消金额的出价 / 要价，您必须输入 “0”。该区域只有对相对定单才是可见的，并和以下区域一起工作：

7 **但不高于……** — 对相对定单，这是价格封顶，它与在前一个区域中设定的价格计算一道工作。
对限价定单，该区域为 **“设定限价为……”**
对市价定单，该区域不显示。
从以下计算中选择来确保限价将不会被设为高于 （对买入）或低于 （对卖出）：

- *无* — 只对相对定单。价格没有封顶。
- *值* — 打开一个区域来设定绝对的限价。
- *出价* — 出价加上 / 减去一个可选的抵消金额。 输入一个负值来使负抵消金额生效。
- *要价* — 要价加上 / 减去一个可选的抵消金额。 输入一个负值来使负抵消金额生效。
- *最后* — 最后交易价格加上 / 减去一个可选的抵消金额。输入一个负值来使负抵消金额生效。
- *VWAP* — VWAP 加上 / 减去一个可选的抵消金额。输入一个负值来使负抵消金额生效。
- *滑动 VWAP* — 过去 [*指定时间段*] 的 （当前合约的）滑动 VWAP 加上 / 减去一个可选的抵消金额。输入一个负值来使负抵消金额生效。
- *滑动平均* — 过去 [*指定时间段*] 的 （当前合约的）滑动平均加上 / 减去一个可选的抵消金额。输入一个负值来使负抵消金额生效。
- *指数滑动平均* — 过去 [*指定时间段*] 的 （当前合约的）指数滑动平均加上 / 减去一个可选的抵消金额。输入一个负值来使负抵消金额生效。
- *我的最后交易* — 算法中最后交易的价格，被显示为定单小结框中的最后交易价格。注意，该值不能被单独用于限价，因为它没有第一笔交易的价格。
- *与交易的尺寸相关* — 将价格封顶计算为：*用户定义的基础价格*减去与算法中交易的总尺寸相关的每*股数*的*用户定义的抵消值*，该股数被反映在算法小结框的**买入的股数**区域中。例如，如果值为：$5.50 —每 100 股 .02，那么对第一个 100 股定单交易尺寸＝ 0 的价格封顶将为 $5.50。假设交易继续以 100 股的层级执行，价格封顶将会如下变化：交易的尺寸＝ 100，封顶＝ $5.48 ；交易的尺寸＝ 200，封顶＝ $5.46 ；交易的尺寸＝ 300，封顶＝ $5.44。
- *与头寸相关* — 对价格封顶的计算与*相对交易的尺寸*相同，除了计算是与在账户窗口和头存栏中指定的头寸相关的，而交易的尺寸与仅在积累 / 分配算法中发生的相关。

8 对**相对**和**限价**定单，点击***添加***来添加更多的价格条件至 “但不高于 / 不低于” 价格封顶计算。当您添加多个价格边界条件时，一个新的 “最大 / 最小” 选项将出现，让您确保定单价格将不会高 （低）于*条件 A* 和*条件 B* 和*条件 C* 等的最大值 / 最小值。

9 **开始时间** — 默认情况下，开始时间被设定为当前时间，或者如果市场当前是关闭的则被设定为下一次开盘时间。点击该区域来设定新的开始时间，但注意，直到您按下*开始*按钮后，算法才会开始。

10 **结束时间** — 默认情况下，结束时间被设定为当前日的收盘时间，或者如果算法是在常规交易时间之外被启动的则被设定为下一次收盘时间。点击该区域来设定新的结束时间。

11 **在提交下一笔定单之前等待当前定单执行** — 如被选中，下一个组成部分将被持有直到当前数量执行。当算法等待当前定单执行时，对下一笔定单的倒计时将停止。一旦其执行，如果指定的时间间隔过去，那么下一笔定单将被提交。

12 **赶上时间** — 如被选中且算法落后，下一笔定单将在当前定单执行后被立刻下达，无论时间间隔是多少。该过程将重复直到算法赶上来。*缺失的定单*在算法**小结**框中被追踪。

Note: 在一笔定单执行后，到下一笔定单被提交之前通常有两秒钟的延迟。

13 **通过＋ / — 20％来随机化时间段** — 如被选中，您指定的时间间隔将被随机化地增加或减少，任何一个方向最多为 20％，以帮助保持定单在市场中不被注意到。例如，如果您定义的时间间隔是 40 秒，

随机化允许算法以 32、33、34、35、36、37、38、39、40、41、42、43、44、45、46、47 或 48 秒的间隔来提交定单。

14 **通过＋／－55％来随机化尺寸** － 如被选中，您指定的层级尺寸将随机化地增加或减少，任何一个方向最多为 55％（近似到最近的 100），以帮助保持定单在市场中不被注意到。例如，如果您定义的层级是 500 股，随机化允许算法以 200、300、400、500、600、700 或 800 股的随机层级来提交定单。

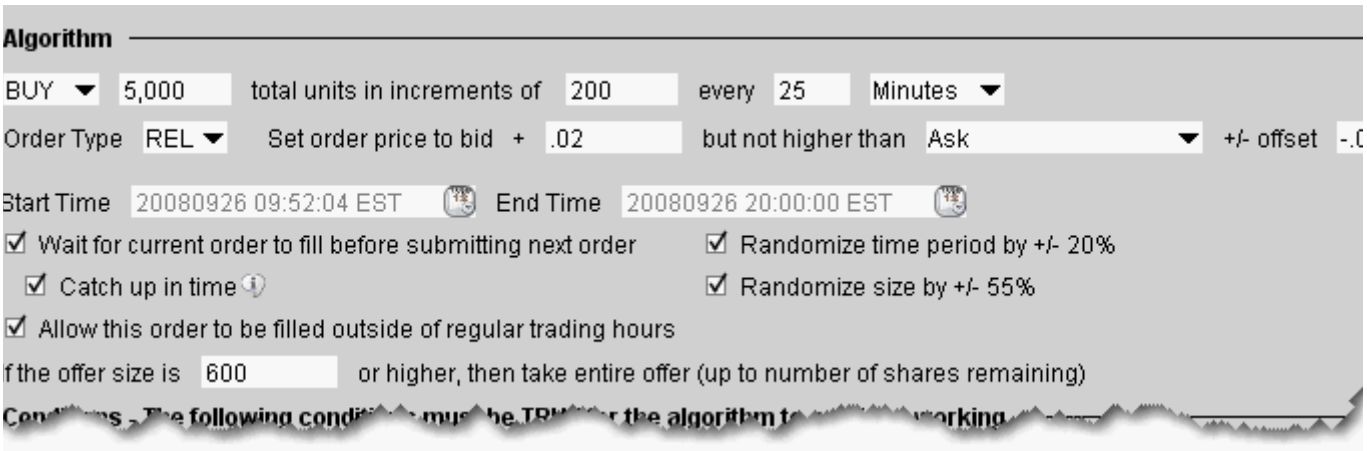
15 **允许该定单在常规交易时间之外执行** － 如被选中，定单可以在常规交易时间之外执行。

16 **如果出价／要价是 ____ 或更高** － 对买入定单，如果当前要价尺寸大于或等于此处输入的尺寸，那么算法将采用整个尺寸，或者最多将不超过整个定单数量。该定单作为 IOC（立刻执行或取消）被提交。

基本算法举例

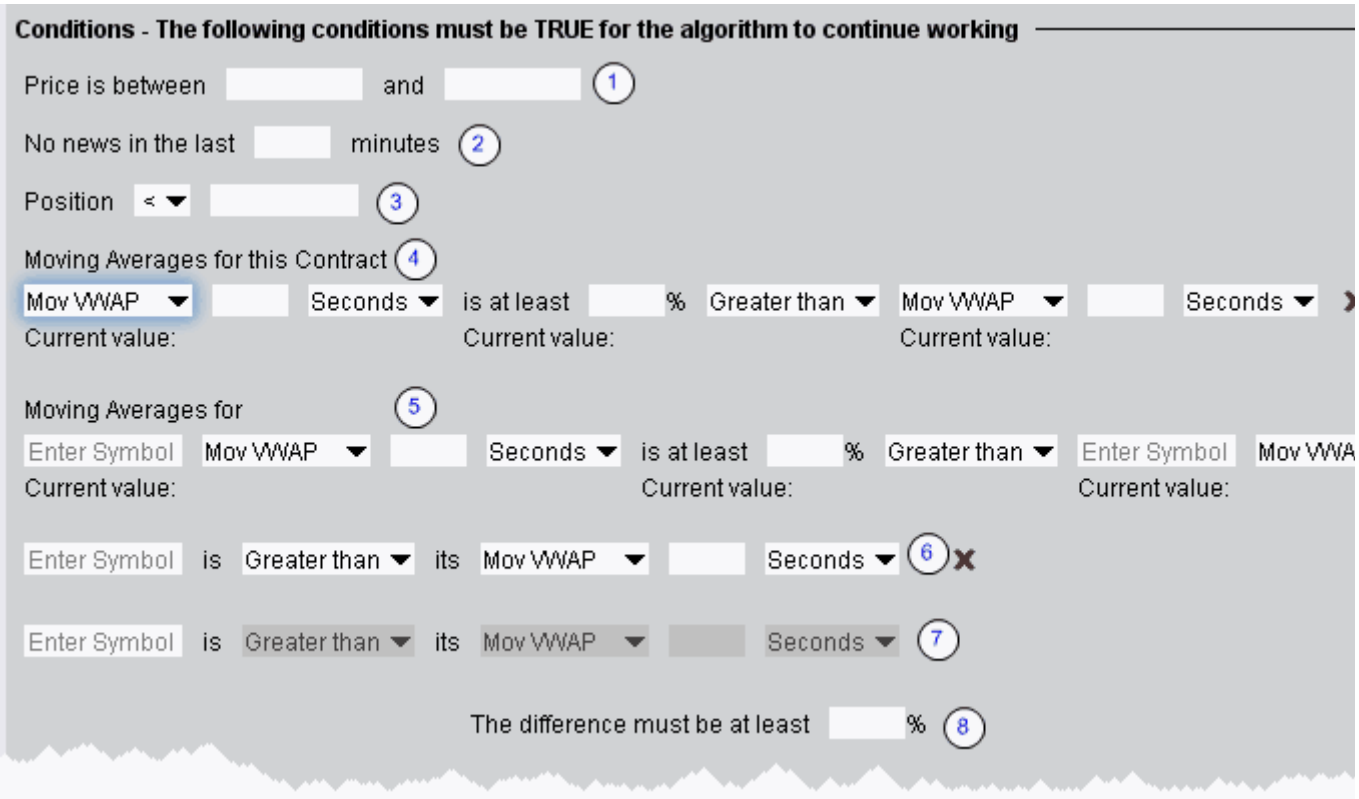
下图中被填入了内容的区域表示了以下意思：

每 25 秒以 200 的层级买入 5000 股 *ABC*。将价格设定为当前最佳出价加上 2 分，但不要将定单的价格设为高于要价减去 1 分。现在 （东部时间上午 09:52:04）启动算法，并在市场收盘时结束它。在提交下一笔定单之前等待当前定单执行，如果算法落后，那么通过在一笔执行完成之后不等待时间间隔而立刻提交定单来赶上时间。通过加上和减去 20％来变化时间间隔，通过对每笔定单加 / 减 55％来使定单尺寸不那么一致，取整以确保无零股。只在常规交易时间内交易，并且如果要价尺寸为 600 或更高，采用整个尺寸但不超过我最初的总定单数量。



定义算法条件

注意，要被满足的条件越多，您的定单要完整地执行就越困难。



所有条件都是可选的，但如果您选择设定一个条件，那么定义中任何未填写的区域将变为必需的，并被粉色覆盖。

要从条件中清除值，在行末点击 “×”。“×”只有当您在一个区域中输入了数据之后才会出现。

以下编号的描述对应的是上图中编号的区域。

1 定义一个范围，合约价格必须停留在该范围内定单才能继续工作。

2 通过在分钟当中输入一个值来确保价格变动将不受新闻事件影响。直到您定义的时间段内没有新闻，算法才将工作。新闻被您在交易平台中设置的新闻提供器监控，包括 Google News、Yahoo! Headlines 和路透社订阅服务。

3 指定被反映在账户窗口和头寸栏中的您的头寸，必须大于或小于一个指定的值。它扮演了头寸底线和封顶的角色。交易平台不仅在头寸条件被违背时**不会**下达定单，而且它将不会执行任何可能违背条件的定单。

4 **该合约的滑动平均** — 为当前合约定义滑动平均标准。指定当前合约的：在过去 [*指定时间段*] 的**滑动 VWAP**、**滑动平均**、**指数滑动平均**或**最后**为至少 [*指定的百分比*] 大于或小于在 [*指定时间段*] 的另一组滑动平均 （对当前合约）。要清除值，在行末点击 “×”。

5 **滑动平均** — 比较两组滑动平均，它们可以是对相同的合约或者对不同的合约，对相同的时间段或者对不同的时间段。指定底层证券，然后按照上述第 4 项来设定值。要清除值，在行末点击“×”。

6 被标记为 6、7 和 8 的区域一起工作，根据股票的价格与其滑动平均之间的差来比较在指定的时间段内两只股票价格的变动。算法根据您的输入来完成计算。要清除值，在行末点击“×”。

7 输入一个代码。该行使用在上述第 6 项中为第一只股票定义的参数。

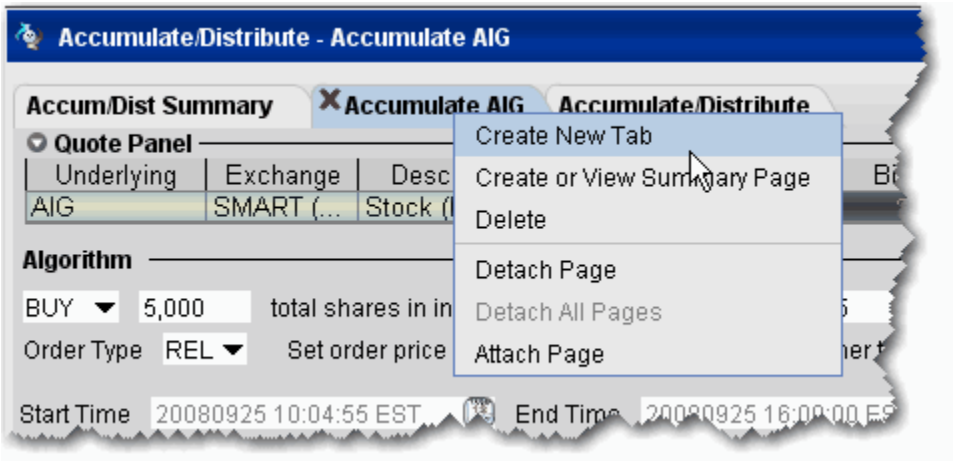
8 输入一个百分比值，两只股票之间差额的计算必须满足该值。

如果您设定的任何条件变为假，定单通常将停止工作。使用这些选项来指示一旦定单已经停止，算法应当如何表现：

- 一旦一个或多个条件变为假，则永久地放弃，或者
- 如果所有条件再次变为真，则恢复定单。

创建多个算法定单

您能够在多个标记页面上创建和监控多个积累 / 分配算法，全部从相同的窗口实现。每个新算法有其自己的标记页面。

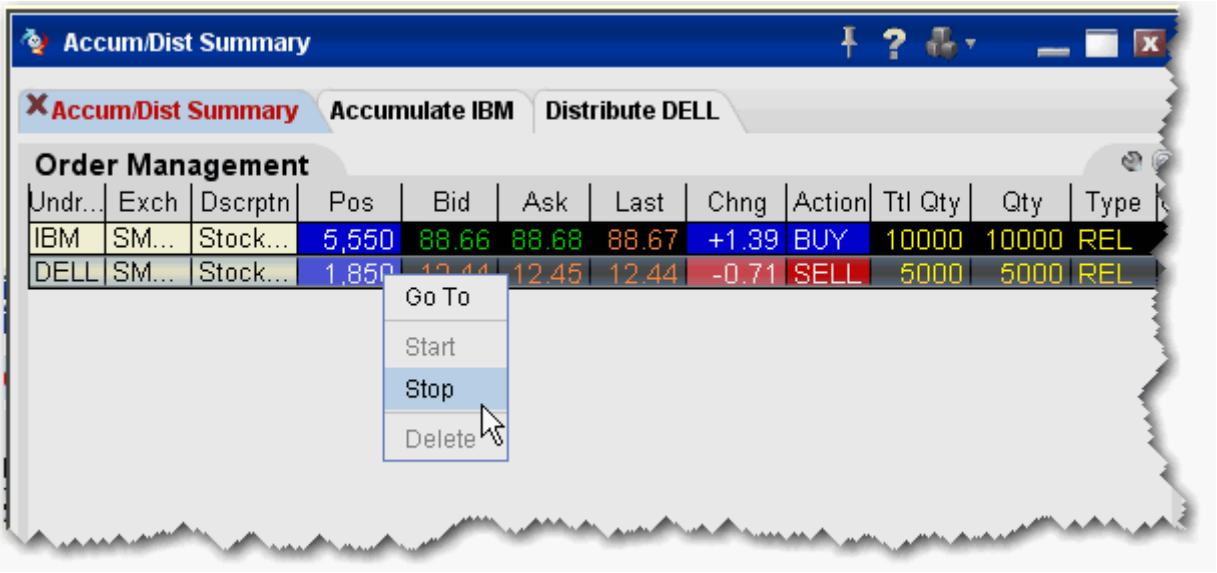


添加另一个算法

1. 右键点击标记页面标题并选择*创建新标签*。
2. 在新页面上，在报价面板的**底层证券**区域中输入一个代码并选择一个合约。
3. 定义算法。

积累 / 分配小结

一旦您创建了第二个算法标签，**积累 / 分配小结**将被创建，并作为第一个标签被显示在标签集上。

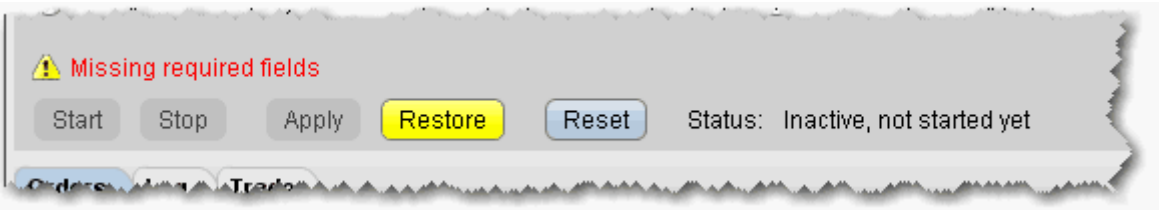


该页面集成了所有算法的定单，每个算法一条定单行。您能够通过右键点击一条定单行并选择以下选项来转到特定的算法或者从该**小结**标签来启动、停止和删除算法：

- *转到*来打开定单的算法标签。
- *启动*来启动算法。
- *停止*来停止算法。
- *删除*来**删除**算法标签并删除选定的定单行。

传递和修改算法

使用沿着**条件**区域底部的按钮来控制算法。



直到所有必需的区域都被完成，您才能够激活算法。缺失的区域被粉色覆盖。

一旦所有区域都完成您就能够激活算法。按钮按以下描述工作：

启动 — 激活算法。该按钮只有当所有必需的区域都被完成后才会是活动的，并且任何时候算法被停止时也会变为活动的。如果您手动地停止了算法，点击**启动**从其中断的地方将其恢复。

停止 — 停止算法。一旦算法被启动，该按钮将变为活动的。

应用 — 点击将更改应用于工作中的定单。例如，如果您将股数层级从 200 改为 500，更改将直到您点击应用按钮后才会被确认。

恢复 — 点击将未应用的更改恢复到初始值。例如，如果您将股数层级从 200 改为 500，您能够通过点击**恢复**来撤销您的更改。一旦您*应用*了更改，**恢复**按钮将不再是可用的。

重设 — 如果算法被停止，不管是因为其已经完成还是因为您手动地停止了它，**重设**按钮将忽略所有算法进程并从起点来启动算法。如果您偏好从算法中断的地方来恢复它，那么使用*启动*按钮。

状态文本：该注释告诉您当前算法屏幕上正在发生什么。

监控定单进程

定单小结提供了实时的数据来让您监控积累 / 分配定单的进程。该数据仅适用于该页面上的算法。使用总**小结**标签来查看您所有的积累 / 分配算法的定单管理行。

小结框中的数据实时地监控定单并告诉您：

1. **买入的股数** — 这是算法中截止到目前买入或卖出的股票总数。另外，滑动的阴影说明了定单完成的百分比；在上图中，5000 股的定单完成了不到 50%，由深蓝色的阴影显示。
2. **平均价格** — 这是定单已完成部分截止到目前的平均价格。
3. **剩余的股数** — 未完成的数量。
4. **工作中的股数** — 当前工作的数量，也被显示在窗口底部的定单面板中。
5. **最后定单是** — 告诉您最后定单组成部分的执行状态，无论是已执行或是未执行。
6. **最后交易价格** — 算法中最后交易执行的价格。
7. **最后定单时间** — 告诉您最后定单执行的时间。
8. **直到下一笔定单的时间** — 计数器倒数时间直到下一笔定单被提交。
9. **缺失的定单** — 如果算法不能下达额外的定单，因为前一笔定单还没有执行或者因为一个或多个条件为假，并且*赶上时间*复选框被选中，该计数器追踪缺失的定单数量，并继续追踪直到算法赶上。

失效的股数 — 如果一笔定单因为一个条件变为假或者算法被用户停止而被取消，那么曾经工作的股数被反映在这里。当算法被再次启动和 / 或条件全部变为真时，一笔该数量的定单将被下达。

期权投资组合

引言

使用期权投资组合来选择、分析和交易任何美国股票或指数期权的组合，以实现用户指定的希腊字母值，包括 delta、gamma、vega 和 theta。

- 入门
- 定义查询
- 限制查询结果
- 评估解决方案

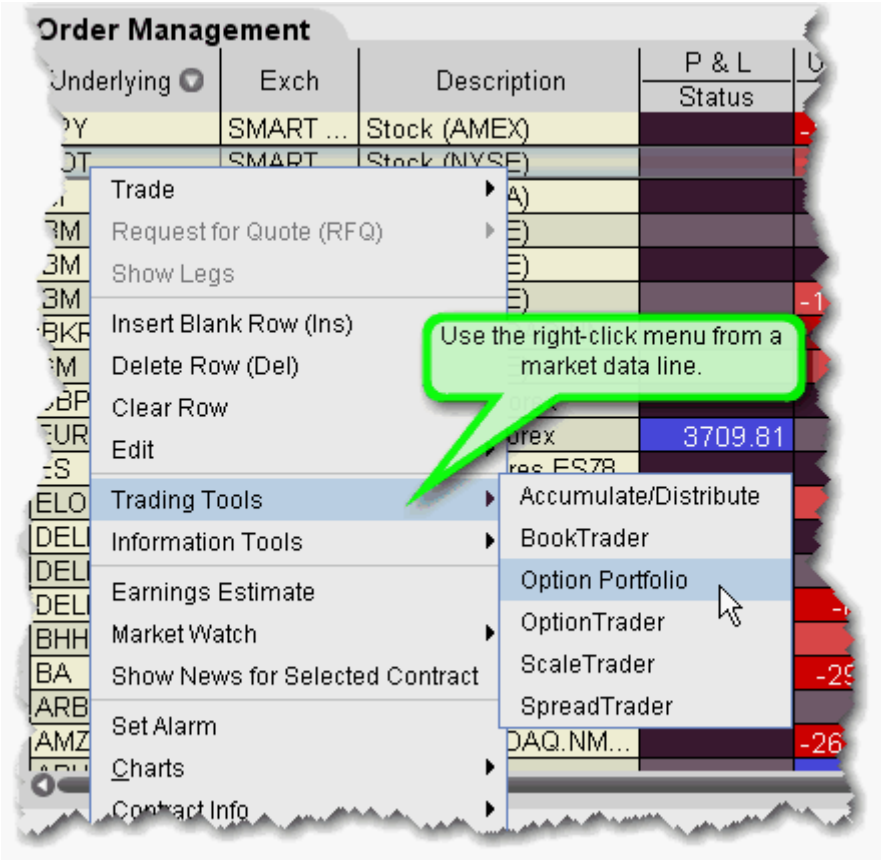
入门

期权投资组合窗口运行复杂的后端算法，其使用您通过交易平台输入的定义标准和限制以及相关的经济标准来数学地优化期权投资组合。

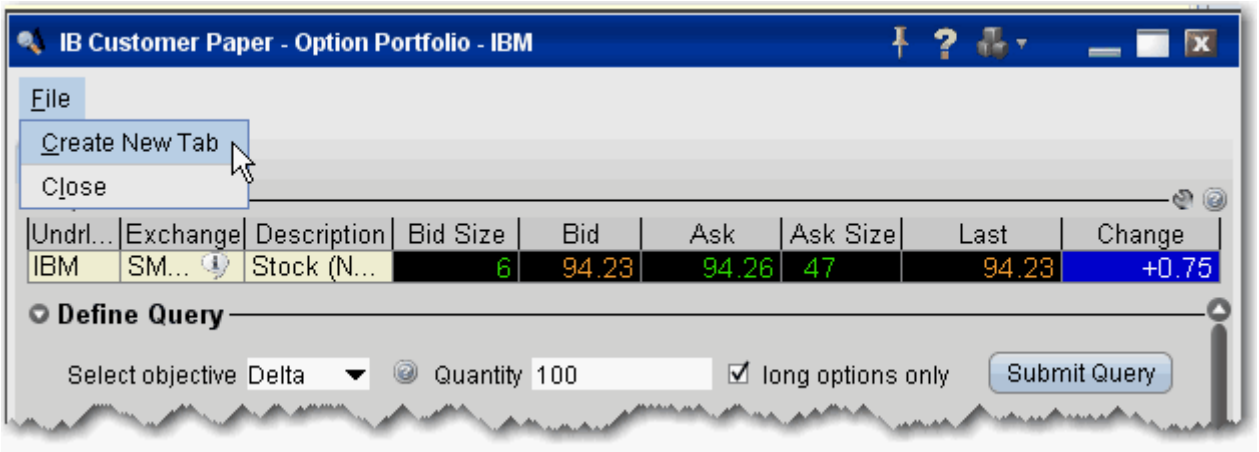
打开期权投资组合窗口

1 在交易页面上选择一个底层美国股票或指数。

2 使用右键点击菜单来选择**交易工具**，然后选择*期权投资组合*。



期权投资组合窗口打开，您可以定义查询了。要将另一个底层证券的标签添加到投资组合窗口，使用**文件**菜单来选择*创建新标签*。



期权投资组合算法在用户定义的查询限制范围内工作，并使用期权市场数据 （包括出价和要价以及尺寸）来**最小化**以下各项的和，并找到最低成本的解决方案：

- **执行成本**，由查询结果列表中的每个期权的出价 / 要价差价来表示，具体为：

  （要价－出价）× （合约乘数）×数量

  将查询列表中的所有定单加总；

- 用来完全地执行查询结果列表中的所有定单而收取的**佣金**；
- **在给定的时间段内持有查询结果列表的成本。**只有当*持有直到*日期被设定为除当前日期之外的值时，该术语才是相关的。在这种情况下，持有成本被计算为：

  ［（“持有直到”日期的期权价值）－ （期权的解决方案价格）］× （合约乘数）× （带符号的数量）

  将查询列表中的所有定单加总。

算法继续工作，并每 30 秒钟重新评估查询结果列表中的解决方案，直到用户提交定单组以备执行，冻结更新来更详细地评估解决方案，或者更改查询标准。

定义查询

通过输入您想要的风险维度数量，以及指定到期日范围和行权价范围（如有必要）来定义查询。您能够指定的额外限制包括底层证券参考价格和*持有直到*日期。

定义查询

1 选择想要的目标，并输入您想要获取的头寸数量。

头寸数量等于：

希腊字母值×头寸×乘数

例如，20 份 delta 为 .4989 的多头看涨期权将显示近似为 1000 的头寸 Delta。头寸 Delta 计算为：

.4989 × 20 × 100 = 997.8

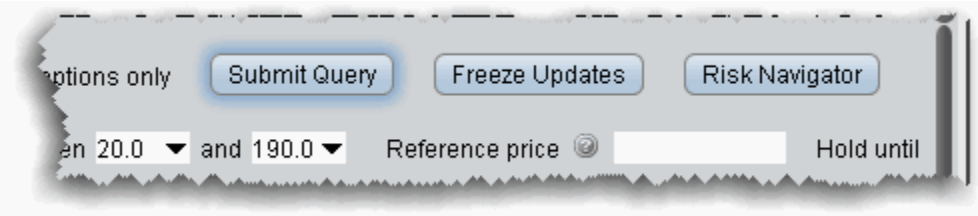
2 定义任何可选的查询参数，例如到期日范围、行权价范围、新的参考价格或者持有直到日期，根据需要而定。

可用的查询参数被定义如下：

参数	描述
仅多头 / 空头期权	默认情况下被选中。限制解决方案仅包括多头或空头期权交易，酌情而定。例如，当买入或卖出 Delta 时，多头期权将更适合用来避免做空期权的风险。文本将根据目标和带符号的数量而变化。当要求负 gamma、负 vega 或正 theta 时，文本将读作 “仅空头期权”。
到期日范围	选择您愿意交易的到期日范围。 Expiry(s) between FEB 20 '09 and FEB 20 '09
行权价范围	选择您愿意交易的行权价范围。 Strike(s) between 20.0 and 190.0

参数	描述
参考价格	默认情况下，底层证券价格的出价 / 要价中点被用来计算目标。 如果您偏好使用除底层证券价格中点之外的值，那么输入一个参考价格。如果*价格介于*限制条件被使用，那么替代的参考价格就不能被使用。
持有直到	如果您想要持有查询结果列表中的解决方案直到特定的日期，那么输入一个日期。

3 通过点击*提交查询*按钮来提交查询。



要以除目标之外的一个或多个风险维度来限制查询结果列表，使用**限制**选项。

限制查询结果

期权投资组合允许您以目标维度之外的风险维度来限制查询结果。因此，如果您的目标是实现特定的 Gamma 头寸，您将能够限制由此引起的 Delta、Vega 和 Theta。算法施行了以下默认的限制：

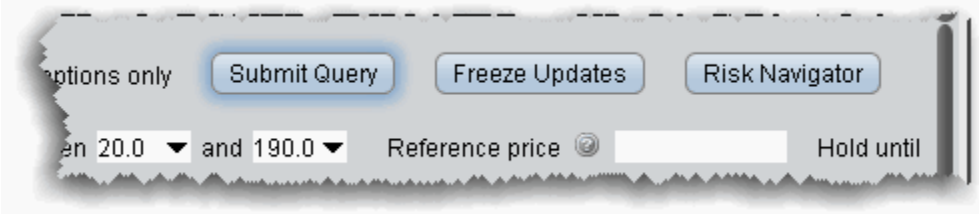
		限　制			
		Delta	Gamma	Vega	Theta
目标	Delta		> 0	> 0	
	Gamma	= 0			
	Vega	= 0			
	Theta	= 0			

例如，默认的 Delta 限制确保了查询结果解决方案的 Gamma 和 Vega 为正数。

要覆盖系统默认值，在一个或多个输入区域中输入值并点击*提交查询*。

评估解决方案

冻结对查询的更新来评估解决方案，并使用 IB 风险漫游 SM 来查看实施期权投资组合将如何影响您当前的风险状况。



停止算法更新结果

1 点击*冻结更新*，阻止算法重新评估和显示新的解决方案。

注意，数据将继续跳动，但查询列表将保持不变。

查看如果怎样风险

1 点击**风险漫游**按钮来打开包含了查询结果列表的如果怎样情形。

IB 算法

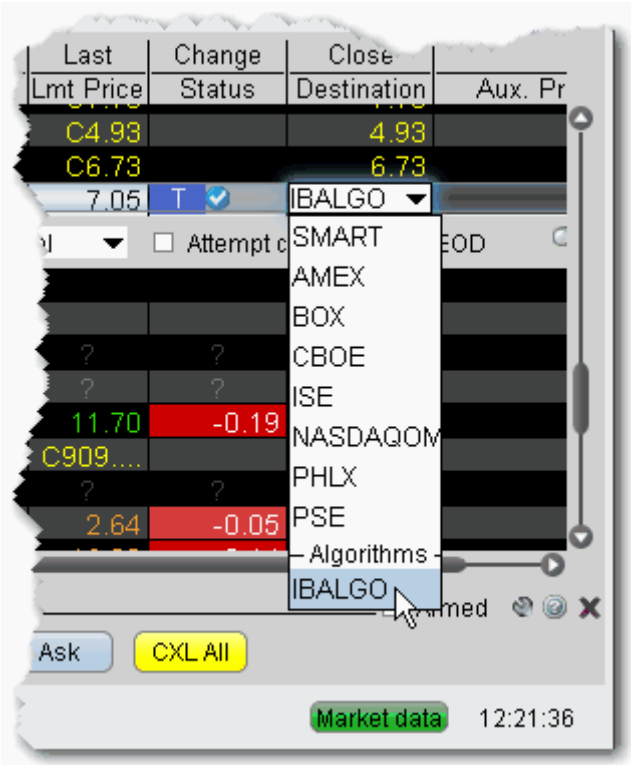
引言

使用 IB 算法来实施最优的交易策略，其帮助平衡市场影响和风险，从而实现对大定单的最佳执行。

- 创建 IB 算法定单
- 到达价格
- 交易量百分比策略
- 交易量加权平均价格
- 时间加权平均价格
- 最小化影响 （对期权）
- 平衡影响和风险 （对期权）

创建 IB 算法定单

使用 IB 算法来自动地对您的大额定单平衡市场影响和风险。算法可用于美国股票和美国股票期权。您能够从交易窗口或使用定单标签来创建算法定单。



设置 IB 算法定单

1. 在交易页面上，通过对买入定单点击要价或对卖出定单点击出价来创建一笔定单。
2. 在定单行上点击目的地区域，下拉到算法部分并选择 IBALGO。

   Note: 您必须使用定单**目的地**区域，而不是市场数据**交易所**区域。

3. 在算法区域中，定义算法。只有那些对工具类型有效的策略将出现在策略选择列表中。根据您选择的策略，必要的参数将会显示。

到达价格

该策略考虑到定义了执行速度的用户指定的市场风险水平，以及用户定义的交易量百分比，被设计用来实现或超过定单被提交时的出价 / 要价中点价格。

- 最大百分比 — 输入一个从 1%到 50%的日平均交易量的最大百分比。
- 紧迫 / 风险规避 — 从最积极的*完成*到最不积极的*被动*之间选择。该值决定了定单将被执行的速度。高紧迫水平可能导致较大的市场影响。
- 开始时间 / 结束时间 — 使用开始 / 结束时间区域来更改定单被提交和取消的默认时间。**注意，算法将在指定的结束时间停止，无论全部数量是否已经执行。**
- 允许在结束时间之后交易 — 如被选中，算法将尝试在指定的结束时间之前完成，但将继续在结束时间之后工作来执行任何未执行的部分。如果您指定了结束时间，那么该选项是可用的。
- 尝试在交易日结束之前完成 — 如被选中，您的定单将尽可能地在交易日结束之前被执行。请注意如果价格隔夜变动的风险低于今天执行整比定单的额外成本，无论 EOD 复选框是否被选中，您的定单的一部分可能会被留待执行。

要获取关于 IB 算法的更多信息，参见 IB 算法软件举要。

交易量百分比策略

允许您以用户定义比例的交易量参加。交易日中的定单数量和交易量分配，是使用您输入的交易量目标百分比以及从交易平台市场数据计算的连续更新的交易量预报一道决定的。

- 目标百分比 — 输入在日平均交易量中的参与百分比。
- 开始时间 / 结束时间 — 使用开始 / 结束时间区域来更改定单被提交和取消的默认时间。**注意，算法将在指定的结束时间停止，无论全部数量是否已经执行。**
- 尝试从不接受流动性 — 选中从而在可能的情况下确保算法定单将不会触及出价或抬高要价。这样可以帮助避免流动性接收费，并可能导致流动性添加回扣。然而，它同样可能导致与基准之间更大的偏差。

Note: IB 将尽最大努力来不接受流动性，然而，仍将存在无法避免的时候。

要获取关于 IB 算法的更多信息，参见 IB 算法软件举要。

交易量加权平均价格

被设计用来实现或超过从您提交定单时开始计算直到市场收盘时的 VWAP 价格。

- 最大百分比 — 输入一个从 1%到 50%的日平均交易量的最大百分比。
- 开始时间 / 结束时间 — 使用开始 / 结束时间区域来更改定单被提交和取消的默认时间。**注意，算法将在指定的结束时间停止，无论全部数量是否已经执行。**
- 允许在结束时间之后交易 — 如被选中，算法将尝试在指定的结束时间之前完成，但将继续在结束时间之后工作来执行任何未执行的部分。如果您指定了结束时间，那么该选项是可用的。

  Note: 如果您指定了开始和结束时间，那么交易平台会使用前一日的交易量来确认时间段的可接受性。如果您定义的时间段太短，您将收到带有推荐的时间调整的消息。

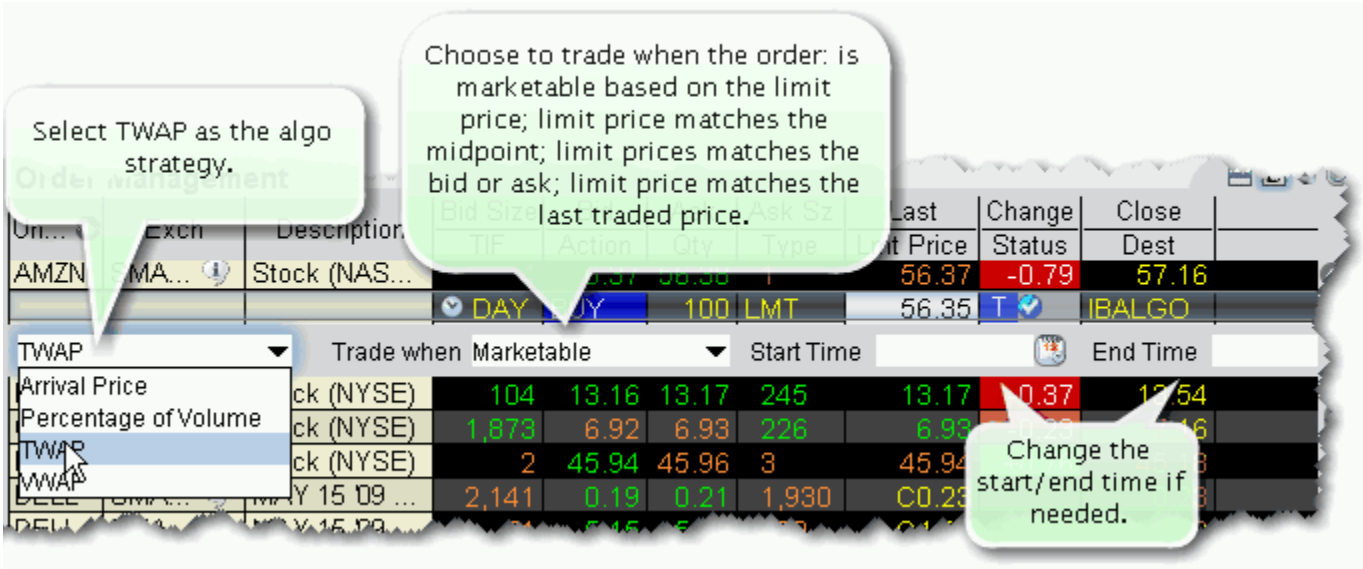
- 尝试从不接受流动性 — 选中从而在可能的情况下确保算法定单将不会触及出价或抬高要价。这样可以帮助避免流动性接收费，并可能导致流动性添加回扣。然而，它同样可能导致与基准之间更大的偏差。

  Note: IB 将尽最大努力来不接受流动性，然而，仍将存在无法避免的时候。

要获取关于 IB 算法的更多信息，参见 IB 算法软件举要。

时间加权平均价格

被设计用来实现从您提交定单时开始计算直到市场收盘时的时间加权平均价格。



何时交易 — 从以下当中选择：

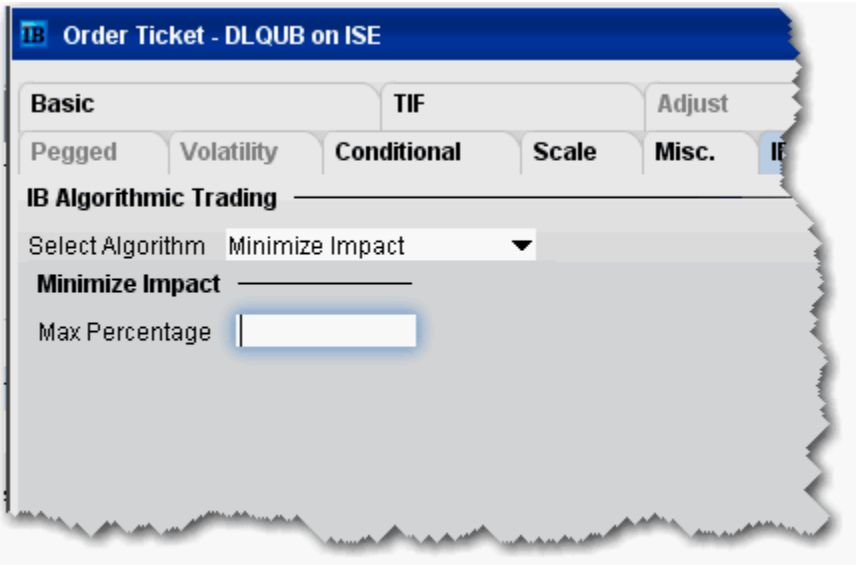
- 可交易 — 根据您的限价，定单在可交易的时候交易。
- 匹配中点 — 当限价＝中点时定单交易。
- 匹配相同边 — 当限价＝出价或要价时定单交易。
- 匹配最后 — 当限价＝最后价格时定单交易。

- 开始时间 / 结束时间 — 使用开始 / 结束时间区域来更改定单被提交和取消的默认时间。**注意，算法将在指定的结束时间停止，无论全部数量是否已经执行。**
- 允许在结束时间之后交易 — 如被选中，算法将尝试在指定的结束时间之前完成，但将继续在结束时间之后工作来执行任何未执行的部分。如果您指定了结束时间，那么该选项是可用的。

要获取关于 IB 算法的更多信息，参见 IB 算法软件举要。

最小化影响 （对期权）

被设计用来最小化市场影响，方法是根据最大百分比值的定义将定单沿时间切分。

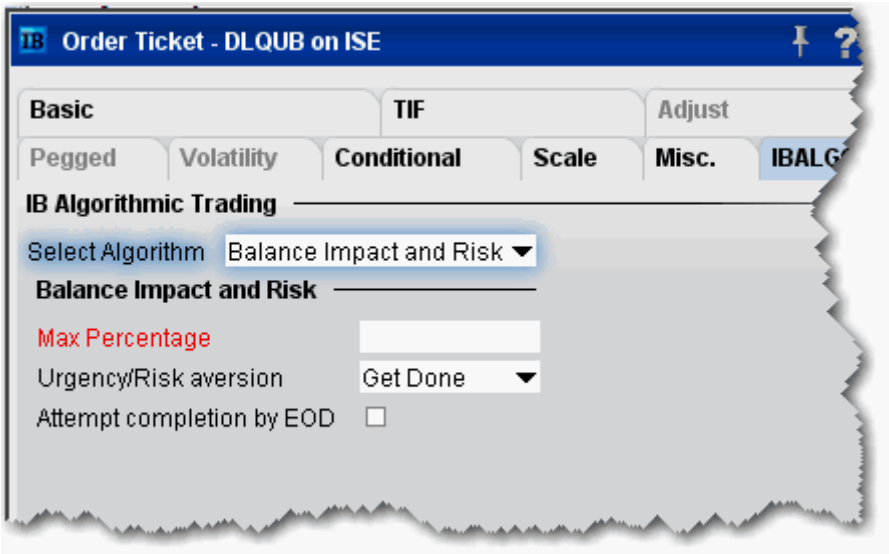


- 最大百分比 — 输入一个从 1%到 50%的日平均交易量的最大百分比。

要获取关于 IB 算法的更多信息，参见 IB 算法软件举要。

平衡影响和风险 （对期权）

通过考虑定义了执行速度的用户指定的市场风险水平，以及用户定义的交易量百分比，来平衡交易期权的市场影响与定单时间段内价格变动的风险。



- 最大百分比 — 输入一个从 1%到 50%的日平均交易量的最大百分比。
- 紧迫 / 风险规避 — 从最积极的*完成*到最不积极的*被动*之间选择。该值决定了定单将被执行的速度。高紧迫水平可能导致较大的市场影响。
- 强制在交易日结束之前完成 — 如被选中，您的定单将尽可能地在交易日结束之前被执行。如果不被选中，假如价格隔夜变动的风险低于今天执行整比定单的额外成本，那么您的定单的一部分可能会被留待执行。

要获取关于 IB 算法的更多信息，参见 IB 算法软件举要。

CSFB 算法

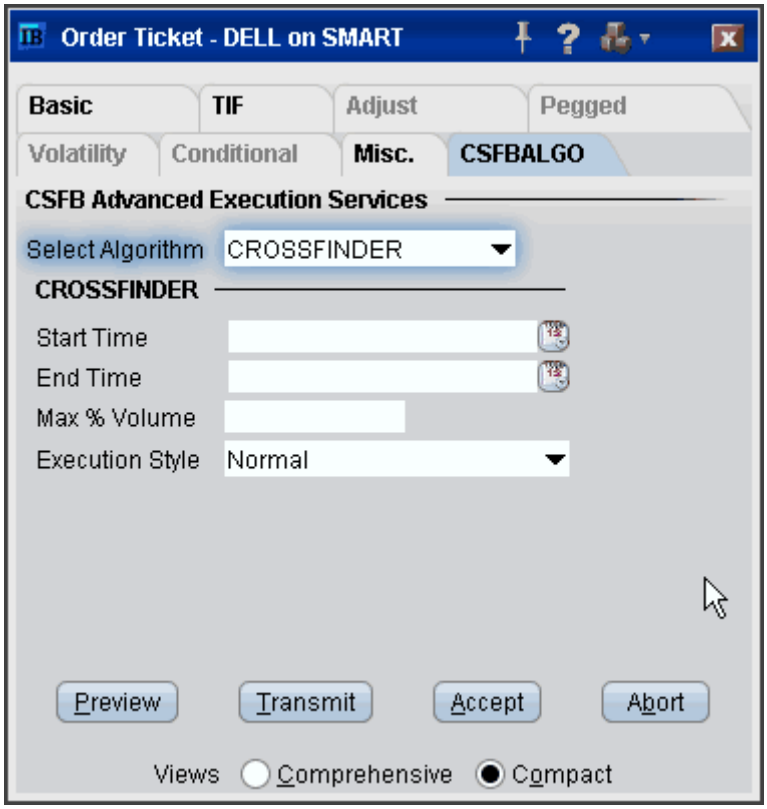
引言

要使用 CSFB 算法，选择 CSFB 算法作为传递目的地。

- Crossfinder
- Float
- Guerrilla
- Pathfinder
- Reserve
- Strike
- Tex
- 时间加权平均价格
- 交易量加权平均价格
- Work It
- Work It IW
- 10B 18

Crossfinder

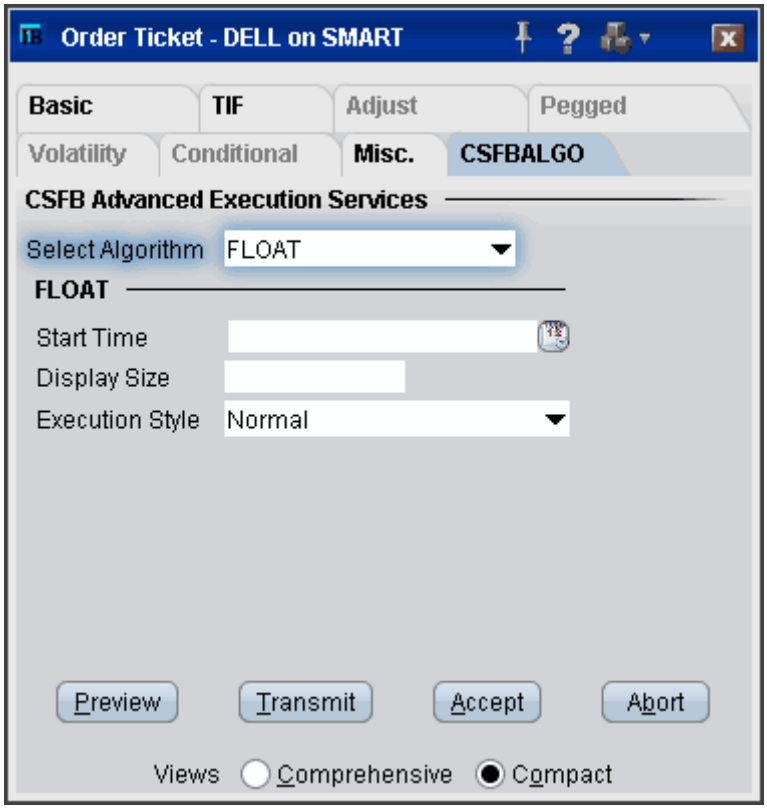
该策略以连续的交叉能力，在庞大的暗池列表之间找到流动性。CrossFinder 通过使用动态的智能传递逻辑，将会把您的定单传播到多个目的地。该算法将以中点或更优的价格执行，并有可能不执行。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Float

该策略仅显示您想要显示的尺寸，并漂浮在出价、中点或要价上直到完成。输入一个显示尺寸并选择耐心、正常或者积极执行。

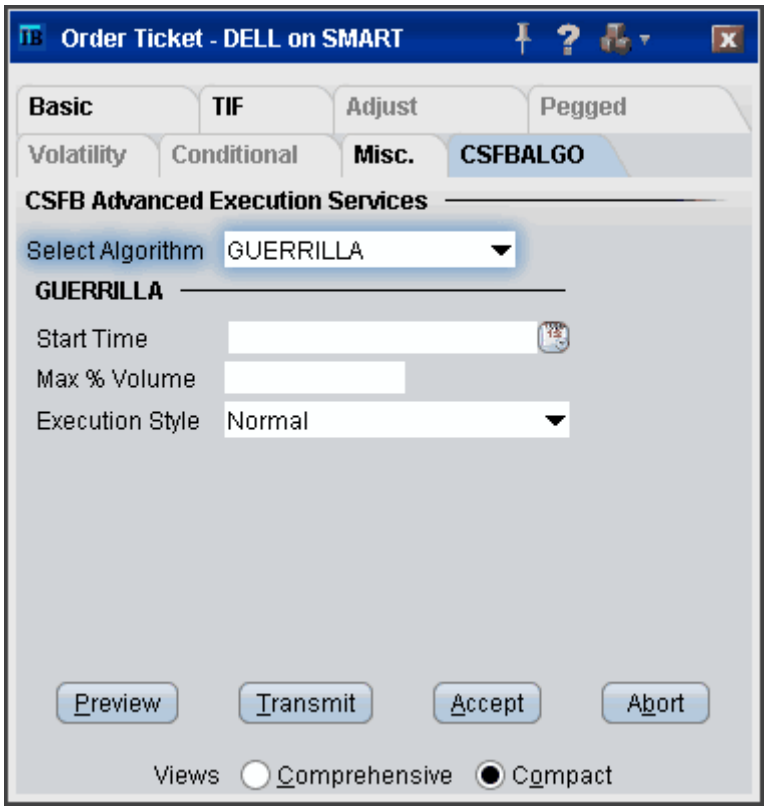


要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Guerrilla

GUERRILLA 算法根据您选择的执行风格，工作方式有所不同。

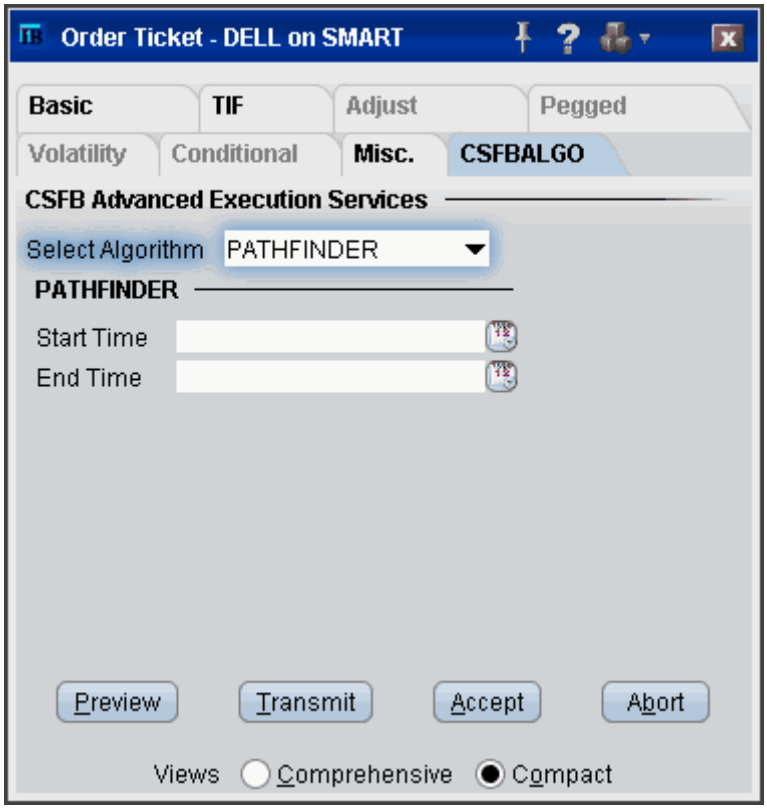
- 正常和被动模式：该策略在不显示出价或要价的情况下让定单工作。当流动性突然出现，其寻求积极地参与报价流。如果流动性较弱，定单可能不会完成。
- 积极模式：该方式将根据公平价格模型，以智能的方式来触及出价 / 接受要价。它从不发布出价或要价。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Pathfinder

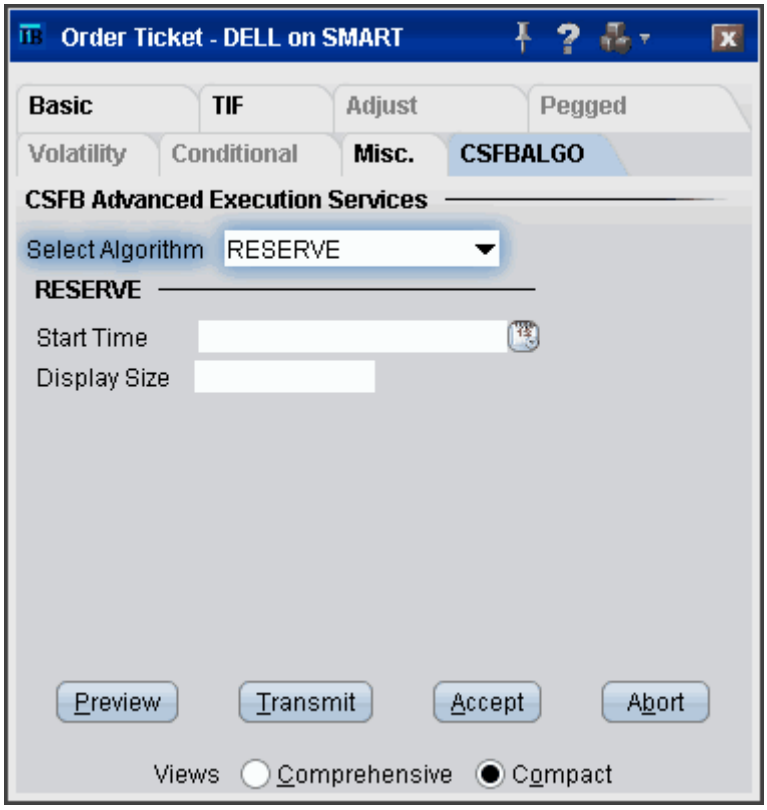
该策略通过瑞士信贷的智能定单传递设施，给了您直接的市场进入。通过 PathFinder 传递的定单被立刻以最佳价格和流动性传递至不同的目的地。瑞士信贷将同时扫光所有可用的流动性，并以您的限价发布剩余部分。PathFinder 将智能地和动态地在多个目的地发布。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Reserve

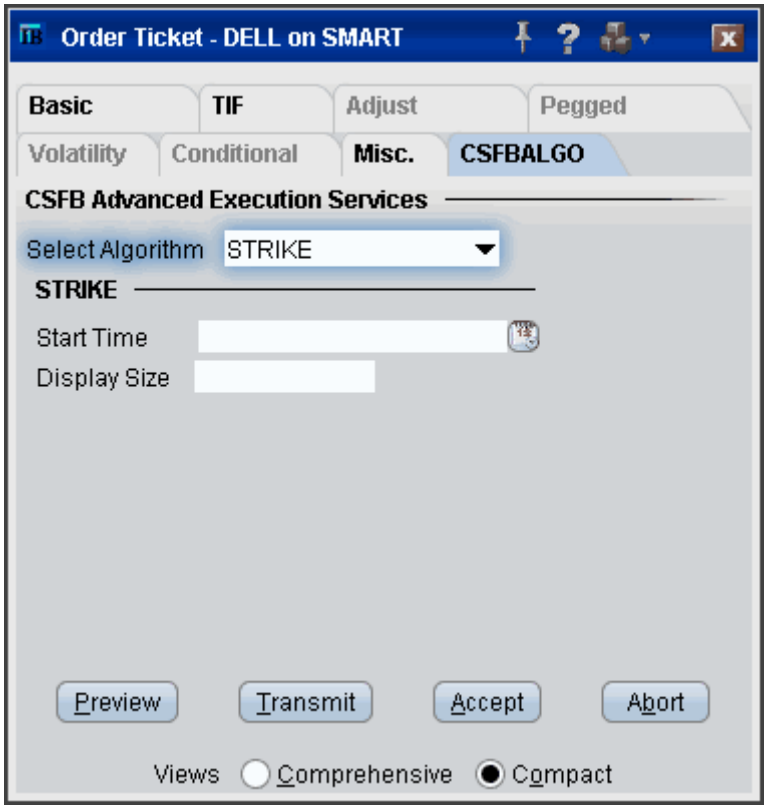
以您的价格指示 （市价或限价）显示您想要显示的尺寸。当获得执行时，其发送下一块直到完成。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Strike

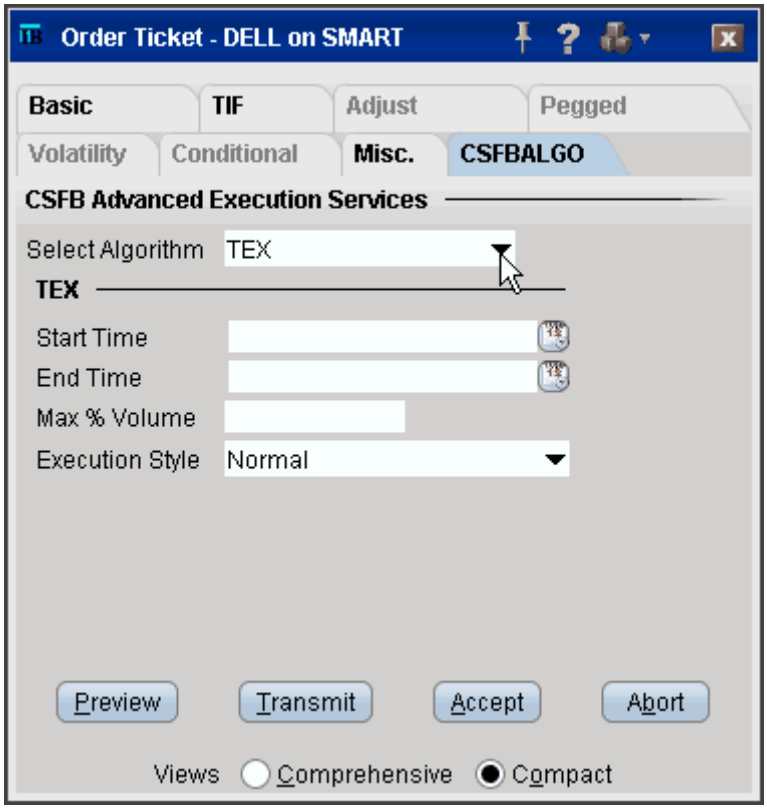
这是一种非常积极的策略，它将触及 / 接受优于您的限价的出价 / 要价，但将决不会发布出价或要价。它实现了高参与率。注意，它不是纯粹的扫光，并能够找出隐藏的流动性。因此，相比直接下达限价定单至市场，它通常是一个更好的选择。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Tex

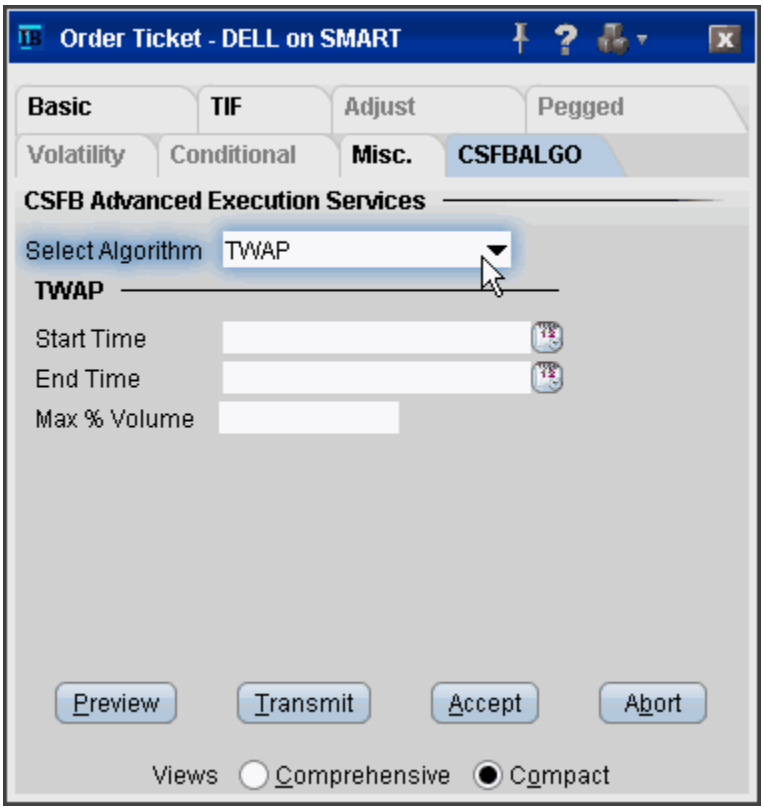
被设计用来最小化执行赤字。该策略在作出速度和价格决定时，考虑了总体市场和相关股票的变动。时机是基于价格和流动性的。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

时间加权平均价格

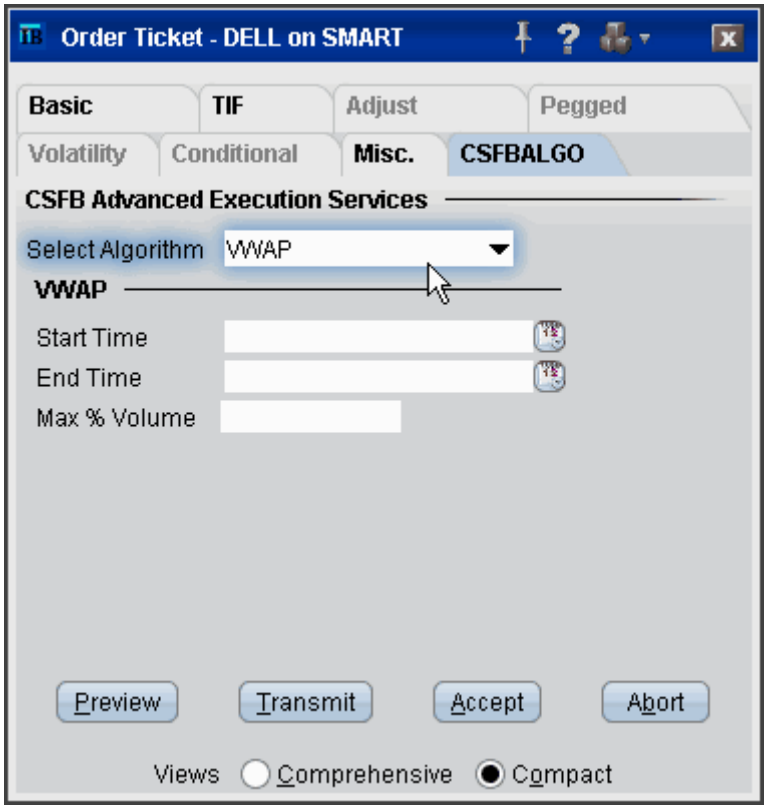
系统根据时钟交易，即，对一笔 2 小时的定单，30 分钟后系统完成了 25%，一小时后完成了 50%，等。不同于 VWAP，TWAP （时间加权平均价格）不会根据预计的交易量或价格变动来加速 / 减速。然而，它在整个定单中使用智能的限价定单下达策略。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

交易量加权平均价格

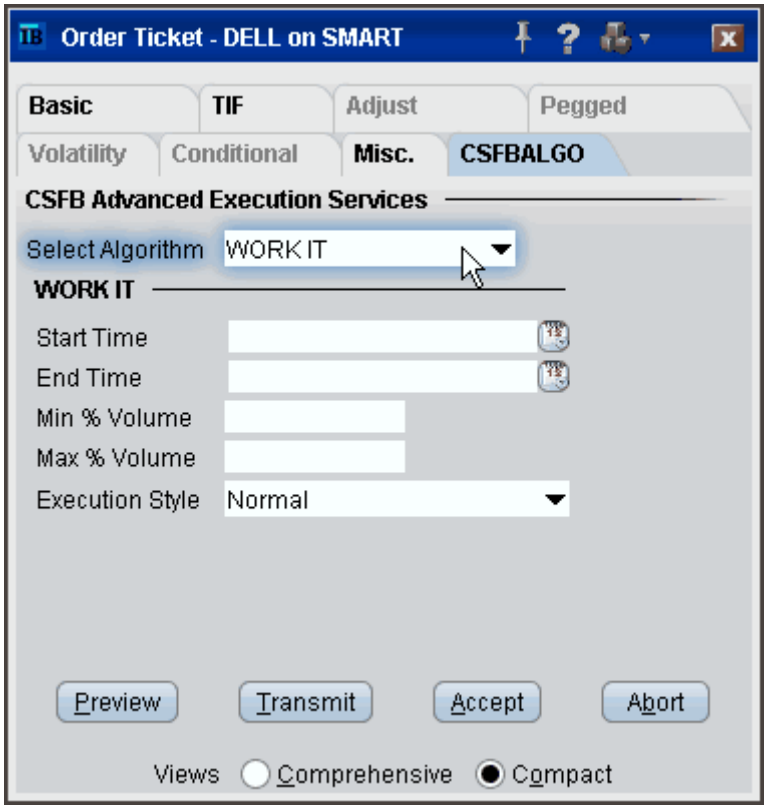
系统尝试从开始时间到结束时间匹配 VWAP （交易量加权平均价格）。独特而强大的功能是接受交易量最大百分比限制 （“不要超过交易量的 20%”）的能力。系统在您的时间段内交易，服从您的价格和交易量限制。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Work It

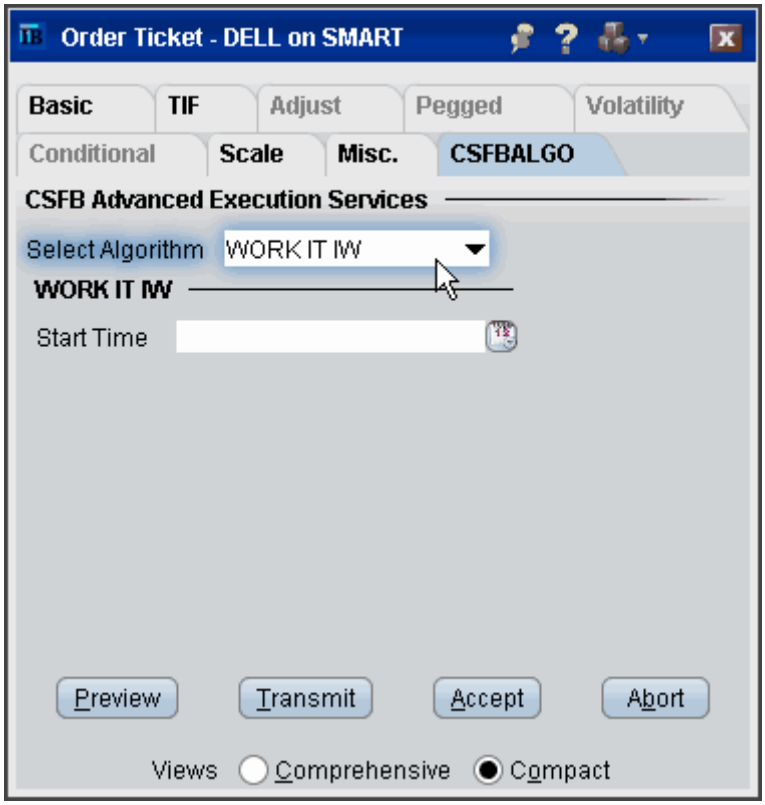
目标是以到达价格或更优的价格来让交易被执行，到达价格是定单被输入时的价格。参与率将根据价格和其他因素而有所不同。您能够通过使用最小和最大交易量百分比限制来控制参与率。如果有充足的流动性，定单可能会在您的结束时间之前完成。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Work It IW

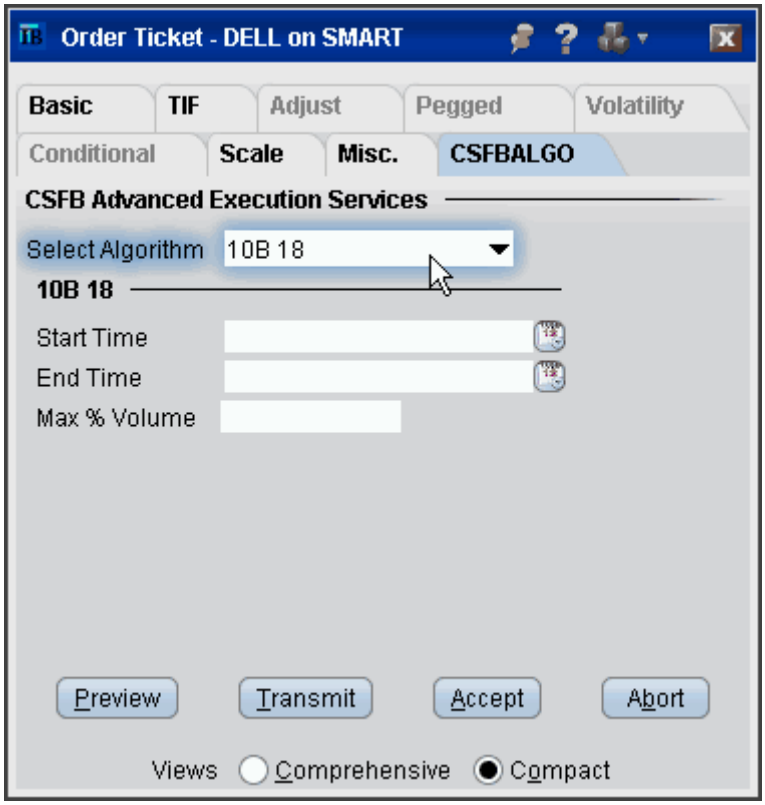
该策略在到达价格或更优的价格上是积极的，但如果股票价格移走，它就会让定单不那么积极地工作。然而，如果股票价格的移动对您有利，那么它将像 Strike 一样工作并快速地让您执行。该策略不接受最大或最小交易量百分比。如果您需要控制参与率，那么使用常规的 Work It。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

10B 18

公司买回策略将通过服从由 SEC 的 10b-18 法规设定的价格测试规则，来辅助交易者管理公司买回定单的执行。公司买回策略的交易基准是从交易开始到结束的交易量加权平均可用价格。由于价格测试的存在，公司买回策略不保证其将完成整笔定单。



要使用 CSFB 算法，在基本标签上选择 CSFBALGO 作为目的地。

Jefferies 算法

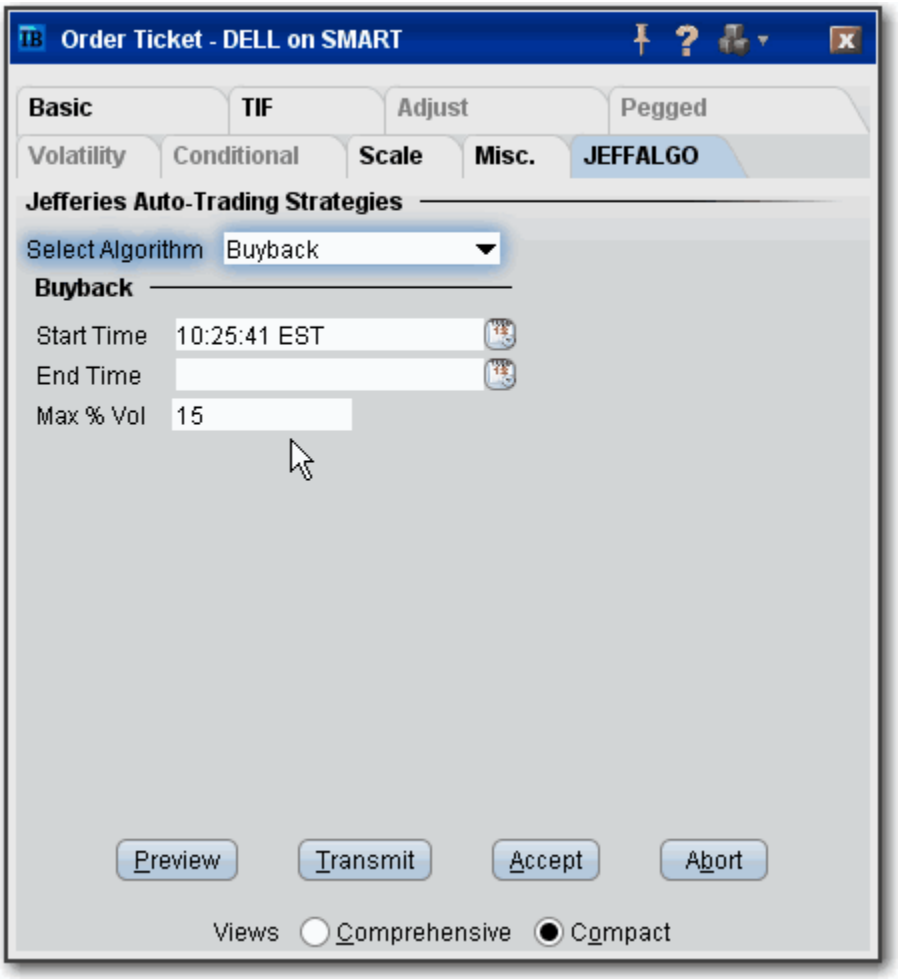
引言

要使用 Jefferies 算法，选择 JEFFALGO 作为传递目的地。

- 回购
- Post
- Seek
- Strike
- 时间加权平均价格
- 交易量参与
- 交易量加权平均价格

回购

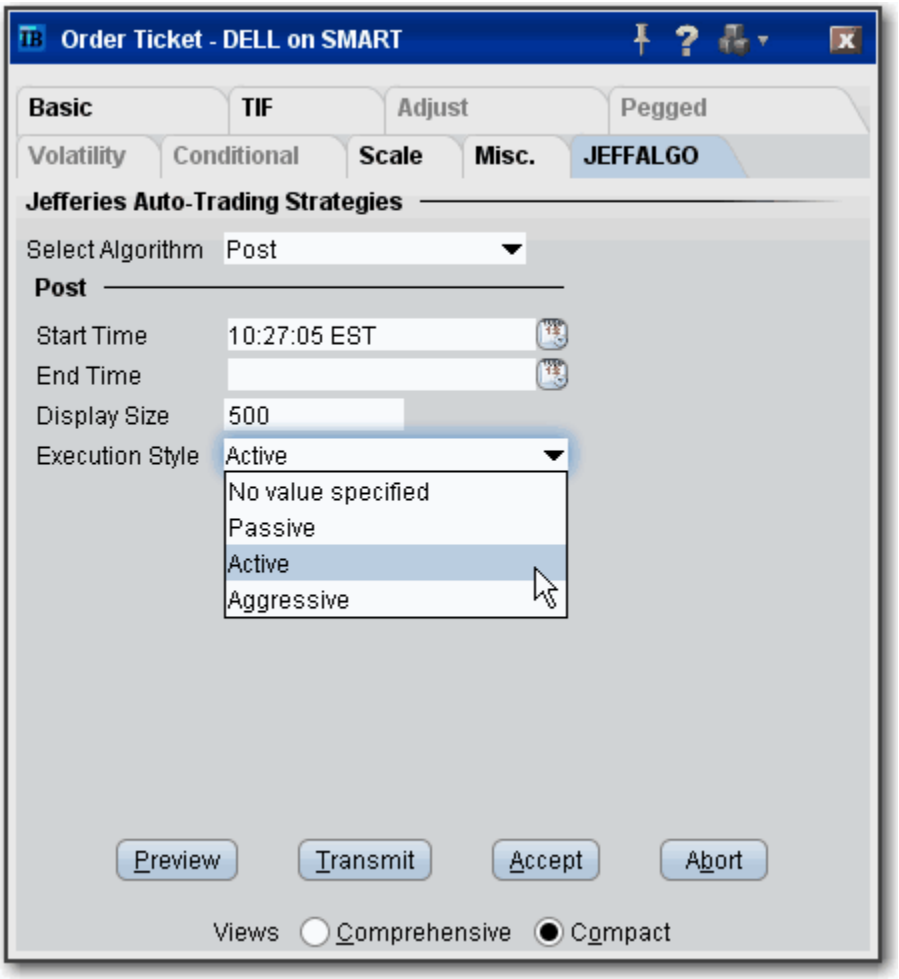
该策略提为寻求股票回购安全港 （SEC 法规 10b-18）的发行者供了交易量参与的交易。



要使用 Jefferies 算法，在定单标签上，从*基本*标签中选择 JEFFALGO 作为传递目的地。从 JEFFALGO 标签中设置算法参数。

Post

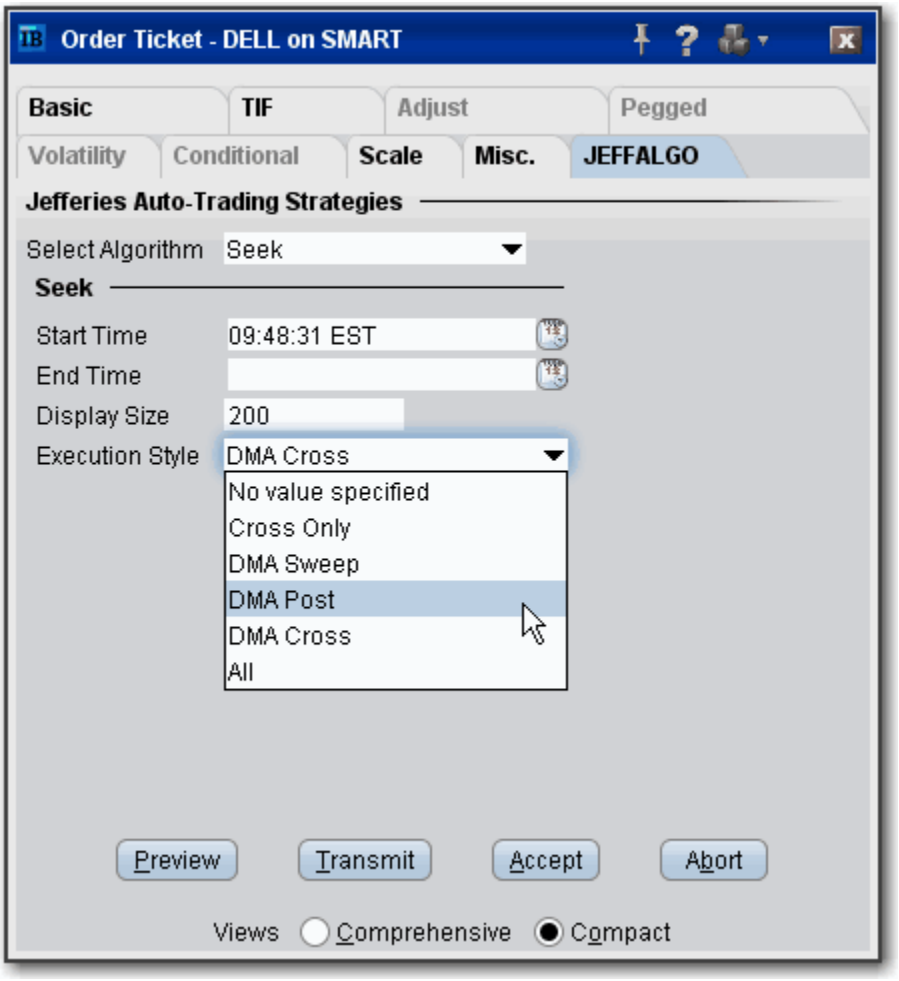
该策略通过使用*显示尺寸*，仅将定单的一小片显示给市场，从而能够限制大定单的影响。



要使用 Jefferies 算法，在定单标签上，从*基本*标签中选择 JEFFALGO 作为传递目的地。从 JEFFALGO 标签中设置算法参数。

Seek

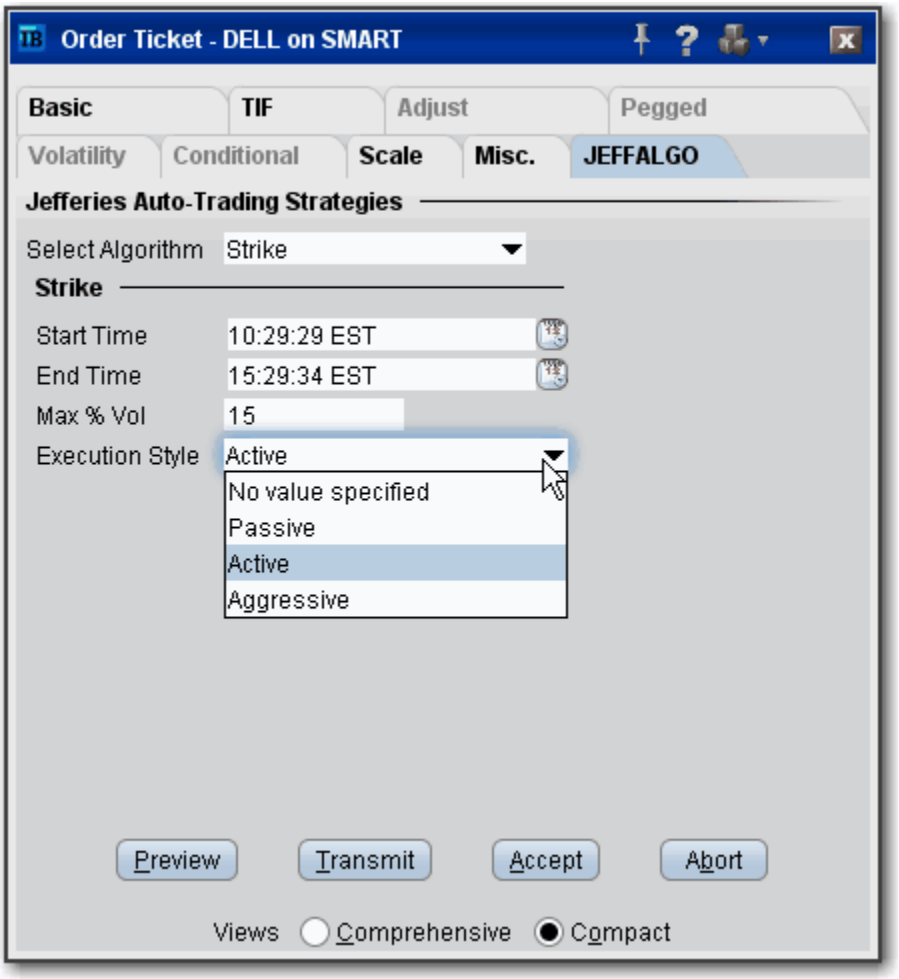
该策略通过从多种来源 （包括隐藏和显示的市场中心）寻找隐藏的流动性，追求对不易流动的证券的最佳执行。



要使用 Jefferies 算法，在定单标签上，从*基本*标签中选择 JEFFALGO 作为传递目的地。从 JEFFALGO 标签中设置算法参数。

Strike

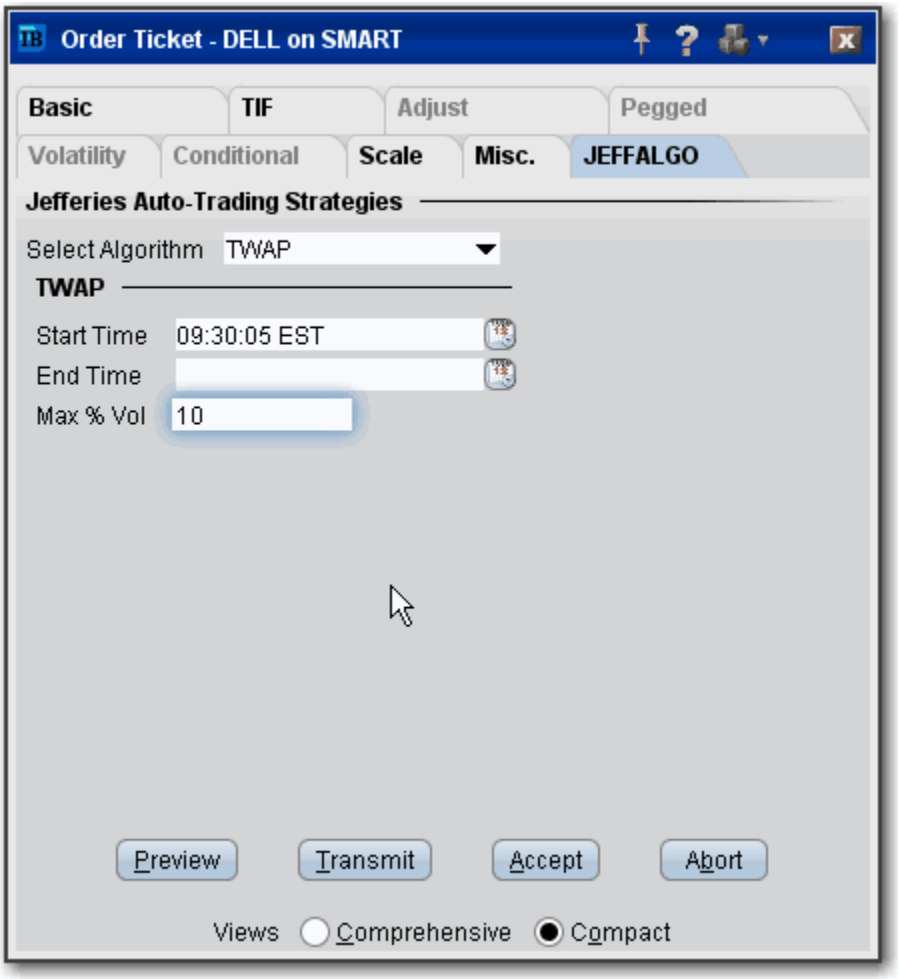
该策略在最小化市场影响和波动率成本并追踪到达价格的同时，在用户指定的时间段内寻求最佳执行。



要使用 Jefferies 算法，在定单标签上，从*基本*标签中选择 JEFFALGO 作为传递目的地。从 JEFFALGO 标签中设置算法参数。

时间加权平均价格

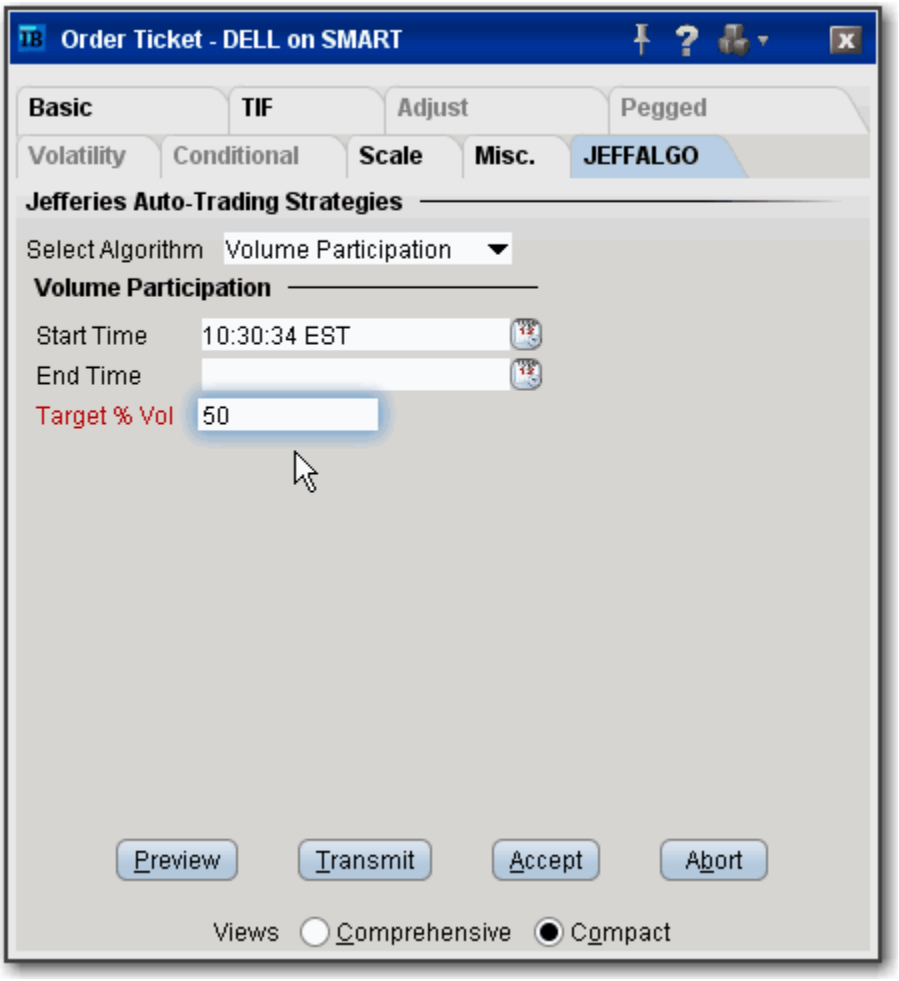
该策略通过将总定单数量切分为较小的定单，从而把交易均匀地分布在指定的时间段内。



要使用 Jefferies 算法，在定单标签上，从*基本*标签中选择 JEFFALGO 作为传递目的地。从 JEFFALGO 标签中设置算法参数。

交易量参与

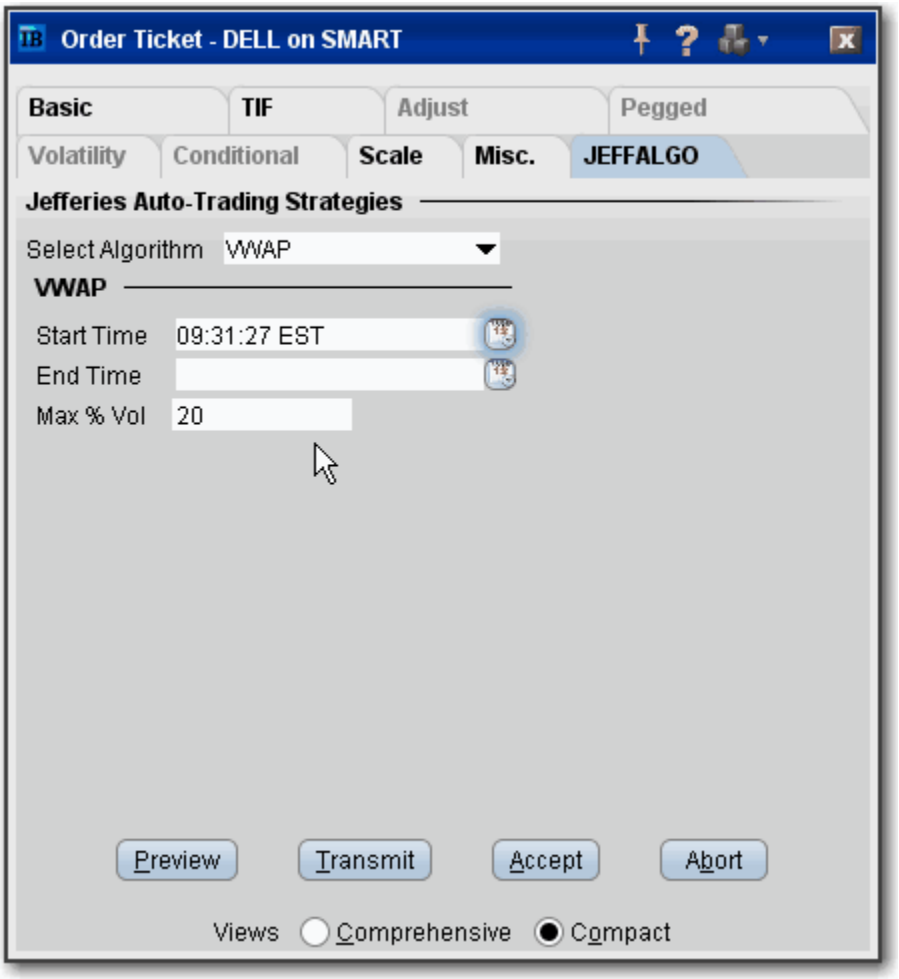
该策略允许用户规定在指定的时间段内被执行的股票百分比，从而与印刷的交易量保持一致。交易的影响被直接地链接到您指定的交易量目标。



要使用 Jefferies 算法，在定单标签上，从*基本*标签中选择 JEFFALGO 作为传递目的地。从 JEFFALGO 标签中设置算法参数。

交易量加权平均价格

该策略通过合适的算法，自动地管理交易从而实现全天或日内交易量加权平均价格。



要使用 Jefferies 算法，在定单标签上，从*基本*标签中选择 JEFFALGO 作为传递目的地。从 JEFFALGO 标签中设置算法参数。

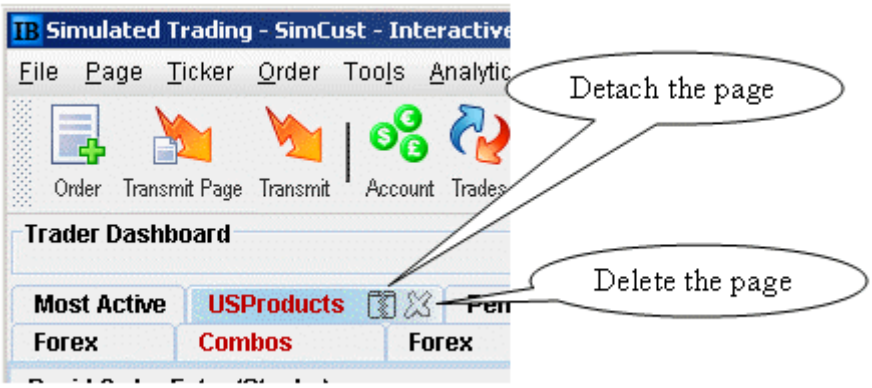
5

交易窗口

- 添加交易页面
- 编辑交易页面
- 恢复和保存页面设置
- 整理页面上的数据
- 使用功能搜索
- 创建交易平台窗口组
- 启用快速股票输入
- 编辑股息安排
- 价格和尺寸向导

添加交易页面

您能够创建多达 26 个交易页面。您能够输入您想要的数量的市场数据线，但在任何一次中您将只能看见 40 条活动的市场数据线。使用交易页面将您的资产根据工具类型、交易所或您自己的交易系统类别来分类。通过将 *Ctrl* 键与 *Page Up* 和 *Page Down* 键一道使用，您能够不用鼠标便可浏览标签页面。使用活动的页面上的图标，将其从交易平台中分离出来，或者删除该页面。



您同样能够使用一个叫做快速股票输入的页面水平的功能，它会使用您设定的定单目的地集合，自动地完成股票的市场数据线。

添加页面

1. 在**页面**菜单上，选择*新建*。
2. 输入一个页面名称。
3. 在**版式**下拉菜单中，选择一个页面版式。
4. 点击**确定**。

添加投资组合页面

- 在**页面**菜单上选择*创建投资组合页面*。

这会创建一个页面，对您持有的每个头寸有一条市场数据线。这些头寸被显示在账户窗口的投资组合部分中。每次您建立一个头寸，投资组合页面被自动地更新，以包括新头寸的市场数据线。当您将一个头寸清零，市场数据线仍会保留在您的投资组合页面中。您能够在页面上使用右键点击菜单并选择*清除零头寸*，将零头寸代码从该页面和其他页面中删除。

编辑交易页面

修改页面名称和其他设置，添加或删除市场数据和定单区域，以及使用右键点击菜单或**请求代码**对话框在您的交易页面中插入市场数据线或空白行。

编辑页面名称和其他设置

1. 在**页面**菜单上，选择*设置*。
2. 修改页面名称或分配的版式，并点击**确定**。

Note: 待处理页面是一个系统页面，其显示您所有工作中的页面。您不能删除或重命名待处理页面，但您能够编辑定单参数。

编辑页面版式

1. 在**页面**菜单上，选择*版式*。
2. 修改需要的特征，并点击**确定**。

Note: 在您修改页面版式之前，请知晓您不仅仅是在更改活动页面的外观，您修改的是可能也和其他页面相关联的应用版式。

在两条现有的线之间插入一条市场数据线

Note: 当您添加一条线，其被插入到选定的线上方。

1. 点击一条市场数据线。新的线将被插入到这条线的上方。
2. 使用以下方式之一来添加一条新的市场数据线：
   - 点击右键并选择插入代码或者，
   - 从代码菜单中选择添加代码。

在两条现有的市场数据线之间插入一条空白线

1. 点击一条市场数据线。空白行将被插入到这条线的上方。
2. 点击右键并选择插入行。

在页面中向上或向下移动、拖动和放下市场数据线

1. 通过点击您想要移动的市场数据线来将其选定。
2. 在选定的行上点击并握住鼠标。
3. 在页面上向上或向下拖动选定的行。
4. 松开鼠标，将行放到新位置。

在交易页面上删除行

您能够使用右键点击菜单，从您的交易页面上删除行。

Note: 删除命令不区分删除空白行和删除市场数据线，并且它在删除您的数据之前不会给您警告。请确保您只选定了您想要删除的行。被选定的行以深灰色被强调出现在交易屏幕中。

删除一行

- 右键点击您想要删除的行，并选择 “删除行”。

删除多行

1. 选定您想要删除的多个行：
2. 点击右键并选择 “删除行”。

选择相邻的行

- 点击要删除的第一行，按住 Shift 键，然后点击最后一行。

选择不相邻的行

- 握住 Ctrl 键盘并点击每个行。

从行中清除数据并将行留为空白

- 右键点击您想要删除的行并选择*清除行*。

添加一个空白行 （在选定的行上方）

- 右键点击一个行并选择*插入行*。

移动交易工具栏

- 点击并拖动工具栏左侧的有纹路的拖动手柄。

Note: 要将工具栏重新对接到页面顶部，使用拖动手柄将工具栏放置到菜单栏下，或者点击工具栏右上角的 “x”。

恢复和保存页面设置

要恢复您在前一天设置的交易页面和代码，您能够选择恢复整个设置文件，其包括所有的交易页面及其代码。

Note: 恢复页面文件将会使用来自前一日的交易页面完全地替换您当前所有的交易页面。

恢复设置

1. 在**文件**菜单上，选择*恢复设置*。
2. 在打开的对话框中，点击您想用来替换当前页面和标签集合的交易日文件。

   要查看文件被保存的实际日期，点击方框右上角的*细节*图标。
3. 点击*打开*。您当前的交易页面和代码将被那些来自您选定的文件的内容替换。

将设置保存到 IB 服务器

一旦您登录，您就能够从交易平台**文件**菜单中设定*在服务器上保存设置*功能。该设置为两个目的服务：当您登录时它从 IB 服务器获取被保存的设置，以及当您退出时它将任何会话更改保存至 IB 服务器。

如果您在没有选中该功能的情况下登录或退出交易平台，对您的交易平台环境的任何更改或添加将不会被全局地保存。

在 IB 服务器上保存您的设置

在您登录之后，转到**文件**菜单并选中*在服务器上保存设置*。请注意该功能必须被手动地激活，其在默认情况下不被选中。

使用被保存在 IB 服务器上的全局设置

在交易平台登录框中，选中*在服务器上保存设置*方框。它指示交易平台转到全球服务器，并使用您先前保存的任何设置。

整理页面上的数据

您能够根据底层证券交易代码，按字母顺序整理页面上的市场数据线。一旦您整理了行，您就不能返回到您最初的市场数据线定单。使用拖动和放下，在标签集内重新安排您的交易页面顺序。

按字母顺序整理页面标签

1 打开您想要根据代码整理的页面。

2 在**页面**菜单上点击*整理代码*。

在页面标签集内移动交易页面

1 点击页面标签来选择页面。

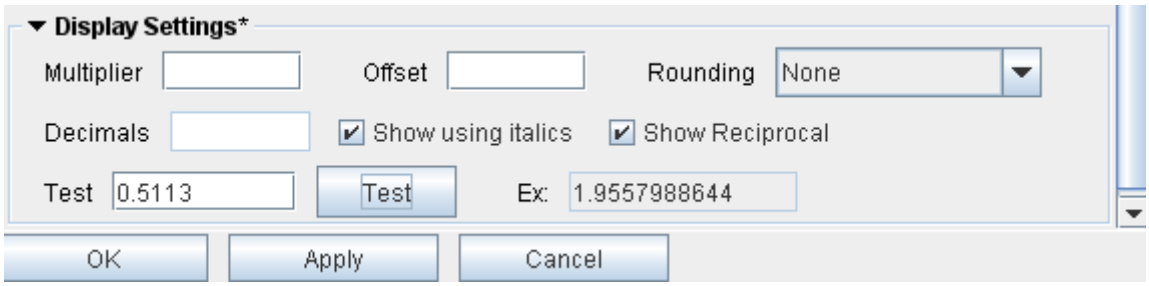
2 点击并握住鼠标，然后在标签集内向左或向右拖动页面。

3 松开鼠标，将页面放到新位置。

Note: 您不能移动**待处理**页面标签。

客户化数据显示

在**定单默认值**屏幕上使用*显示设置*区域来指定价格取整，更改显示的小数位数，以斜体字显示价格以及作出其他价格显示更改。



在交易窗口上修改价格显示

1 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。

2 在左侧窗格中，选择*定单*，然后选择*定单默认值*。

3 选择一个工具类型。

4 在右侧窗格底部的显示设置区域中，修改任意 / 全部以下项目：

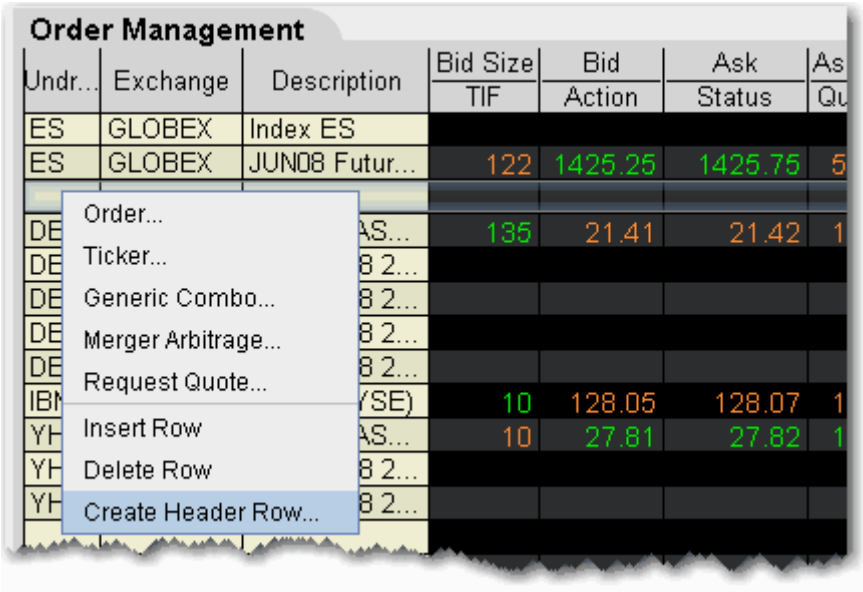
- **乘数** — 将价格乘以该数值。
- **抵消金额** — 您能够使用它来抵消显示的价格，以特定的期货合约为例。假设 ES 出价 / 要价是 1314.75/1315.00。首先，在中间的窗格中选择*期货*，然后在栏底部点击**添加**按钮，并输入 ES。输入抵消金额 1300。要查看这会如何显示，在*文本*框中输入 1314.75 并点击**文本**按钮。例子显示为 14.75。

- **取整** — 将默认值无更改为四舍五入、最近的有效价格或截断。使用测试输入区域来输入一个值，然后点击测试来查看结果。
- **小数** — 覆盖默认的 2 位小数价格显示。
- **使用斜体显示** — 显示斜体的价格数据。
- **显示倒数** — 选中该方框，将价格显示颠倒为等于 *1/ 价格*。对亚洲报价，该功能将把价格显示转换为更熟悉的本地价格显示。例如，值 0.0456683 的倒数为 21.90。对外汇产品，倒数仅适用于命名或结算货币。

在您修改了显示日期之后，在测试区域中输入一个价格，然后点击*测试*按钮来查看您的更改的显示结果。一个星号被显示在显示设置标题后，用来表明*显示倒数*被启用了。

在交易窗口中创建标题行

在您的交易页面中创建一个标题行，用行将代码分隔开。



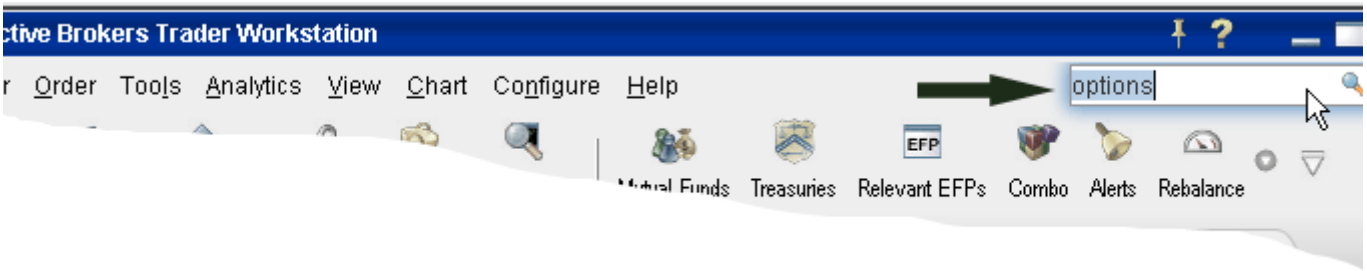
插入标题行

1. 右键点击一条空白的市场数据线并选择*创建标题行*。
2. 输入要出现在行中的文本描述行或标题，点击确定。

Note: 如果您想要在一串现有的代码之间插入标题行，右键点击您想要在其之上创建标题行的代码，并选择*插入行*。然后使用空白行来创建标题行。

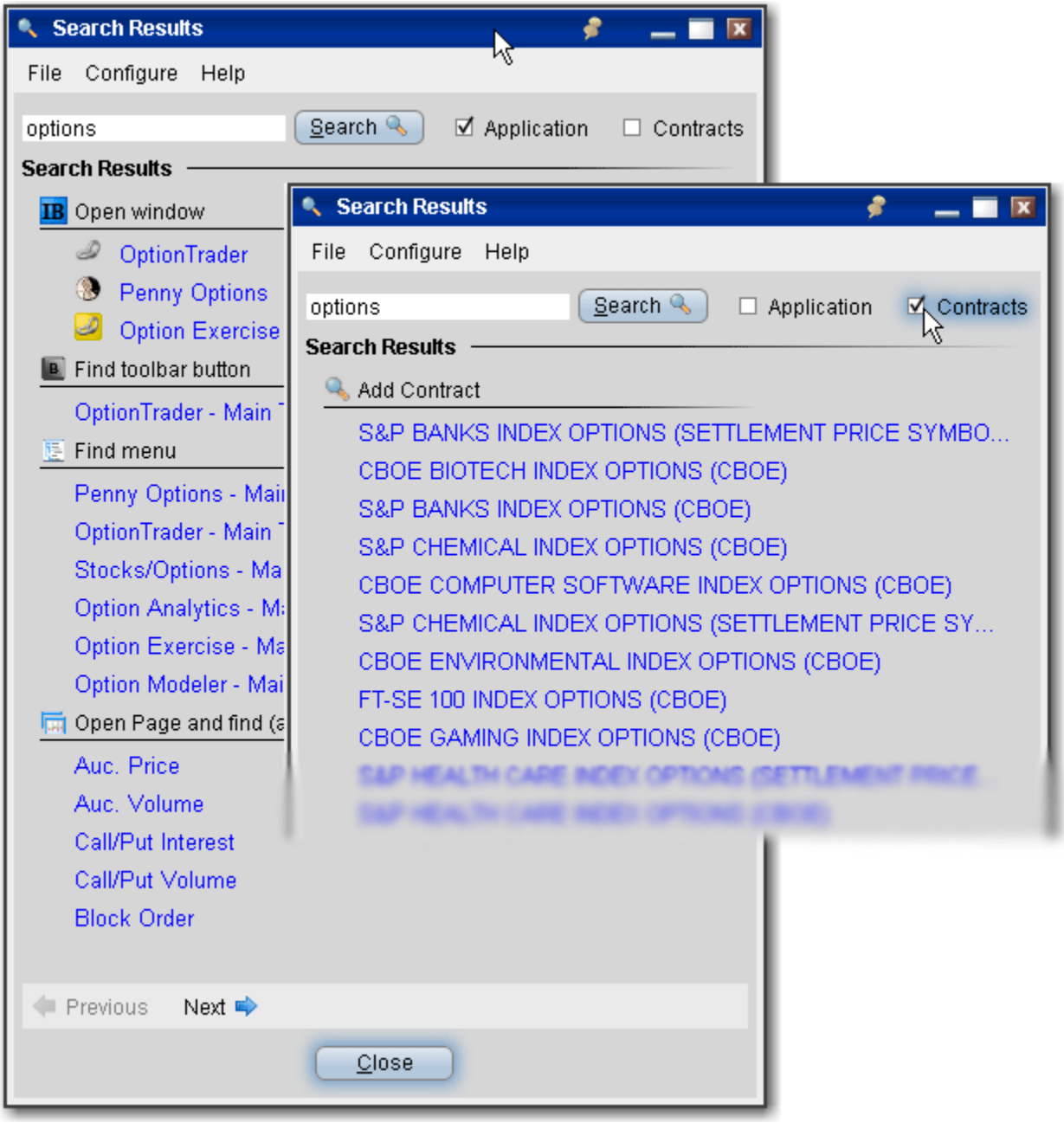
使用功能搜索

全面的**搜索**功能返回一个分类列表，里面是带有链接的与应用程序相关的结果，这些链接将打开窗口、添加栏或显示功能。它帮助您根据搜索标准将合约添加至您的交易页面。



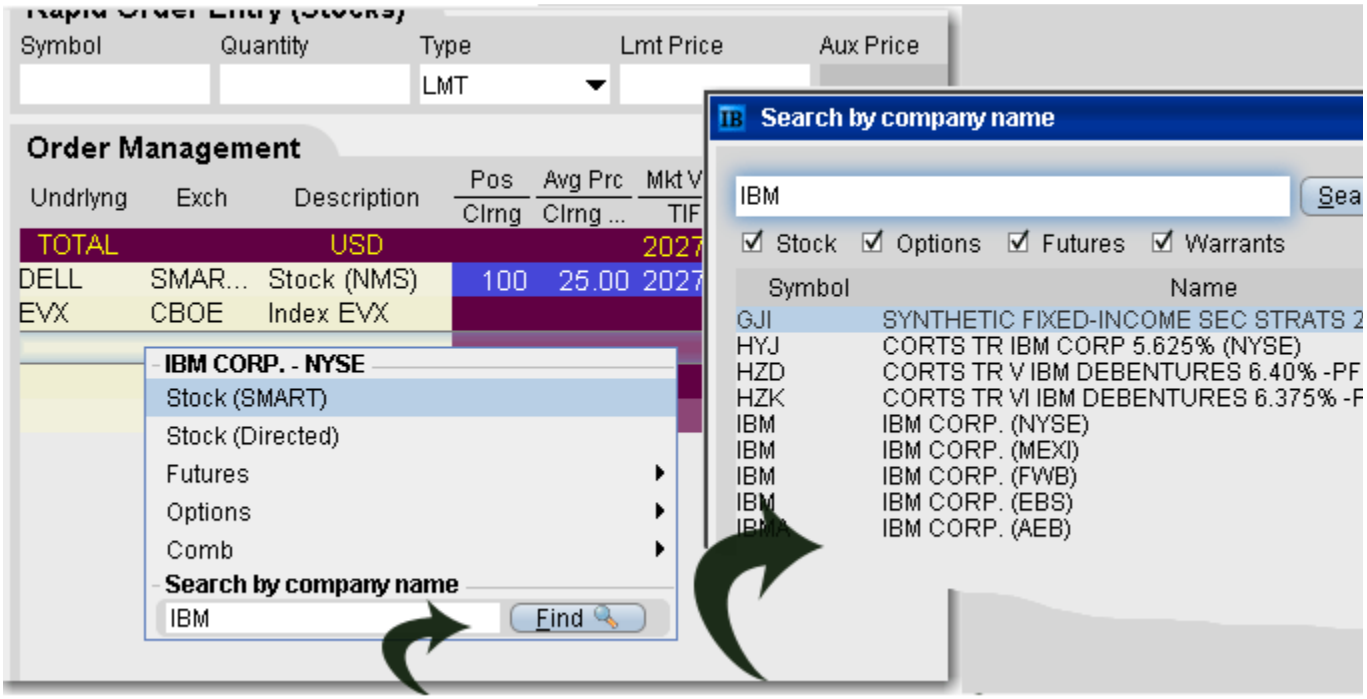
使用搜索区域

1. 在主交易窗口的右上角，在搜索区域中输入一个单词或短语并按下*回车*。
2. 在**搜索结果**页面上，选中*应用程序*来查看搜索的话题与交易平台相关的全部出现，并选中*合约*来查看在标题中带有搜索话题的全部合约。



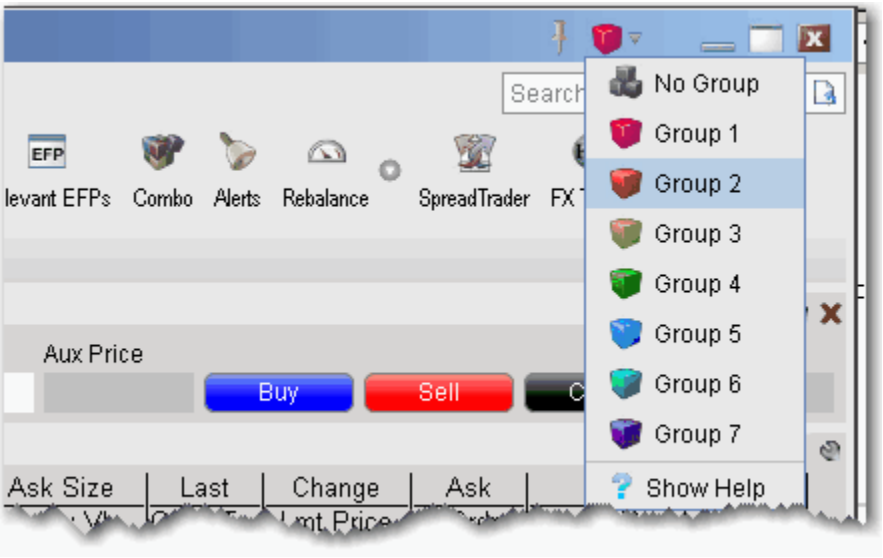
使用搜索结果

- 对与应用程序相关的结果，点击链接将会根据结果类别来执行与搜索相关的行动。例如，如果您从**打开窗口**类别点击*期权交易者*，那么交易平台将打开期权交易者窗口，或者如果该窗口已经打开则把您带到该窗口。
- 对*添加合约*结果，点击链接将在最后活动的交易页面上打开一个代码行，以搜索的项目作为聚焦的合约。 从这一点，您既能添加合约，也能点击*查找*按钮根据公司名称拓宽您的搜索。


Symbol
Quantity
Type
Lmt Price
Aux Price
LMT
Order Management
Undrlyng
Exch
Description
Pos
Clrng
Avg Prc
Clrng ...
Mkt V
TIF
TOTAL
USD
2027
DELL
SMAR...
Stock (NMS)
100
25.00
2027
EVX
CBOE
Index EVX
IBM CORP. - NYSE
Stock (SMART)
Stock (Directed)
Futures
Options
Comb
Search by company name
IBM
Find
Search by company name
IBM
Sea
Stock
Options
Futures
Warrants
Symbol
Name
GJI
SYNTHETIC FIXED-INCOME SEC STRATS 2
HYJ
CORTS TR IBM CORP 5.625% (NYSE)
HZD
CORTS TR V IBM DEBENTURES 6.40% -PF
HZK
CORTS TR VI IBM DEBENTURES 6.375% -F
IBM
IBM CORP. (NYSE)
IBM
IBM CORP. (MEXI)
IBM
IBM CORP. (FWB)
IBM
IBM CORP. (EBS)
IBM
IBM CORP. (AEB)

创建交易平台窗口组

将窗口分配给一个 “组”，以链接定单和代码行动。您使用标题栏右上角的有色方块来将窗口分配给一个组。所有颜色相同的窗口是相同的组的一部分。当您对组里的一个 “源” 窗口作出了更改，组里所有的目的地窗口将反映出该更改。



任何能够被作为组的一部分的窗口都将显示方块。一个窗口一次只能成为一个组的部分。当您关闭窗口时，它的组关系便被删除。

当您在组图标上停留时，窗口的标记被显示在鼠标悬停的工具提示中。标记可以应用于代码、定单，或同时应用于代码和定单。一个窗口可以是一个：

源 — 这是一个控制窗口，只能发送说明。源窗口包括：主交易窗口、期权交易者、外汇交易者、篮子交易者、再平衡、基本分析以及差价交易者。

目的地 — 这是一个接收窗口，只能从源窗口接收说明。目的地窗口包括：定单标签、合约信息 > 描述。

源 / 目的地 — 这是一个多任务窗口，其既能向组里的其他窗口发送说明，也能从这些窗口接收说明。同时起到源和目的地作用的窗口包括：在册交易者、实时图表、市场深度、TotalView 报价、NYSE Open Book 以及时间和销售。

创建窗口组

1. 从组方框的下拉列表中选择一个组号码。
2. 打开需要的其他窗口，并从组列表中选择相同的组号码 / 颜色。

举例

1. 创建一个组，其包括主交易窗口、显示了图表交易者的实时图表以及定单标签。
2. 在主交易窗口中，选择一个代码行，例如 *Dell*。

a 注意，在其他两个窗口中，合约描述改变为 *Dell*。

3 现在在主交易窗口中，点击**要价**，对不同的代码，例如 *IBM*，创建一笔买入定单。

a 注意，在图表中，数据将改变为 IBM，然而图表交易者中将不会有定单被创建。这是因为实时图表仅被指定为**代码**的目的地 / 源。

b 在定单标签 （其同时是代码和定单的目的地窗口）上，IBM 定单将被反映。

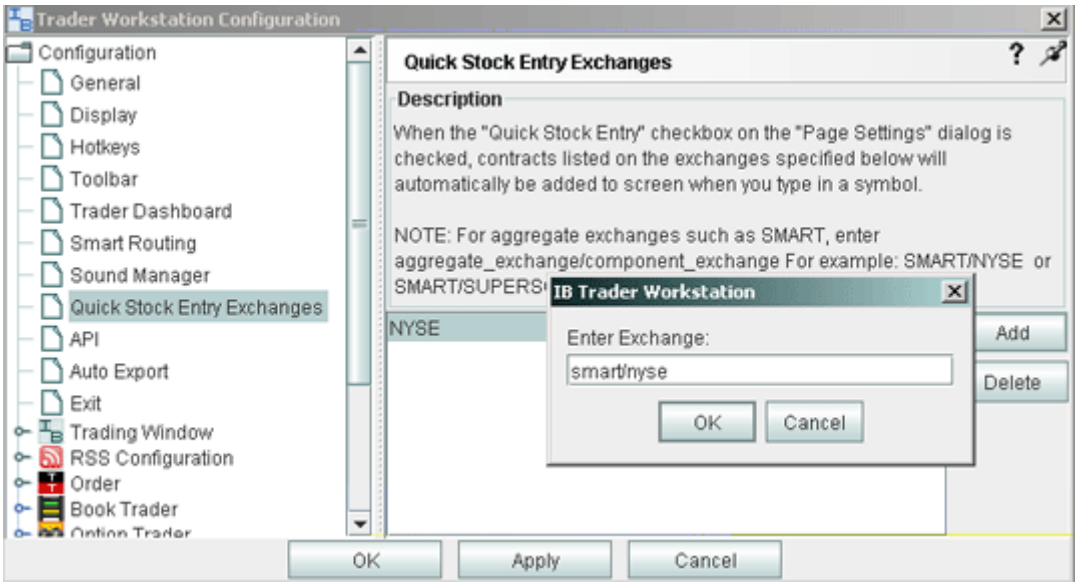
启用快速股票输入

快速股票输入是一项页面水平的功能，它根据您输入的底层证券代码，自动地完成股票的市场数据线。当被启用，您只须输入股票代码，交易平台就会自动地完成代码行。

如果您启用多个交易所，您将对代码进行交易的所有交易所获得一个代码行。例如，我激活了 NYSE、SMART/NYSE、ISLAND 和 TSE。当我输入代码 “MMM”，我获得四条代码行，当中 MMM 在前三家交易所代表 3M，而在 TSE 其代表 Minco Gold Corp。

在您能够使用快速股票输入功能之前，您必须：

- 对快速股票股票输入启用一个交易页面
- 创建一个快速股票定单目的地的列表



启用快速股票输入

当您对一个页面启用了快速股票输入，系统会假设您在该页面上只想输入股票代码，并会自动地以合适的定单目的地来完成市场数据线。

1 打开您想要对快速股票输入启用的页面。

Note: 我们推荐您通过恰当地命名页面，来识别其是否能用于快速股票输入。

2 在**页面**菜单上，选择*设置*。

3 在**页面设置**对话框中，选择*快速股票输入*。

4 点击快速股票输入交易所按钮，添加支持快速股票输入的受认可的交易所。

添加快速股票输入交易所

1 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。

2 在左侧窗格中，选择*快速股票输入交易所*。

3 点击**添加**。

4 输入一个目的地，例如 ISLAND，并点击确定。

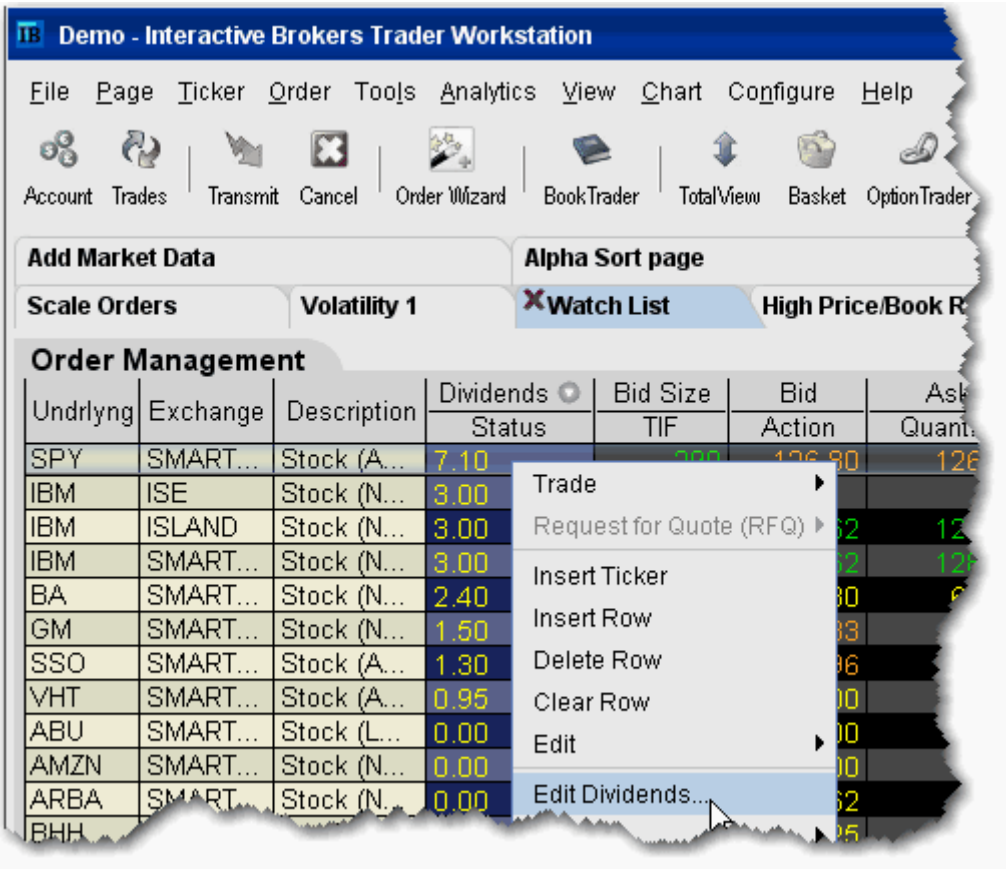
5 添加任何数量的您想要变为可用的定单目的地。您能够在任何时候添加更多的目的地。

Note: 要添加 SMART，您也必须定义首要交易所，例如 NYSE 或 ISLAND （对纳斯达克股票）。

您同样能够使用代码｜交易所来输入股票代码。

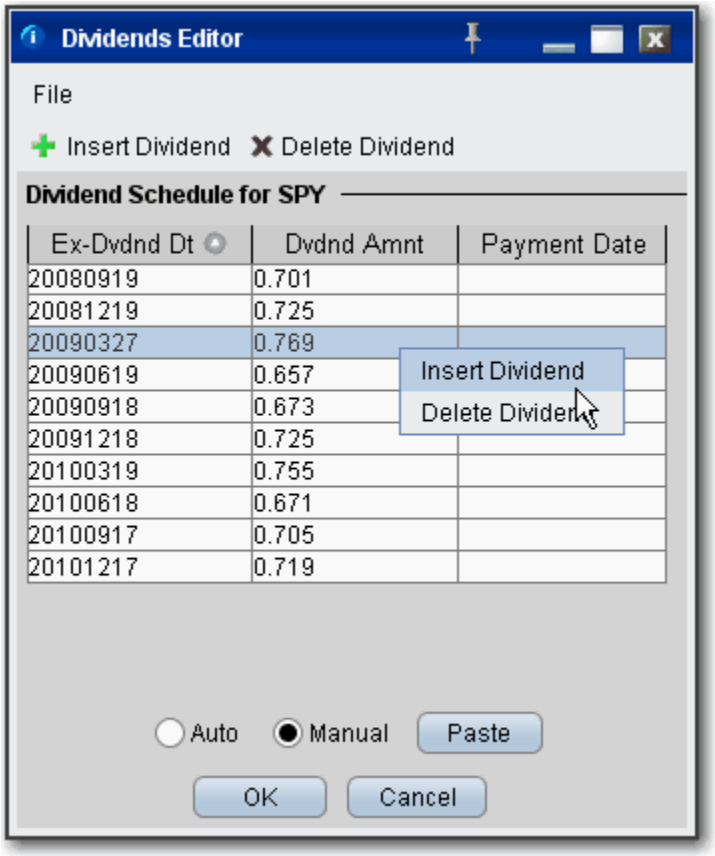
编辑股息安排

使用股息编辑器来自动地创建您自己的股息安排。IB 根据该资产的历史数据，提供自动的 “最优猜测” 股息支付安排。



打开股息编辑器

1. 右键点击您想要编辑股息安排的代码。
2. 选择*编辑股息*。



手动地创建股息安排

1 点击*手动*单选按钮。自动信息保留下来作为起始点，但您能够删除或更改任何信息。

2 要插入或删除一行，在行中点击右键并选择*插入股息*或*删除股息*。

3 在任何行上修改除息日期、股息发放日期或股息金额。

Note: 股息金额为现金价值。

4 点击**确定**将您的股息安排应用于选定的资产。

从 Word 或 Excel 表格中粘贴股息

1 在 MS Word 或 MS Excel 中创建一张两栏的表格。

2 以现有表格的格式输入数据，除息日期位于您的表格的第一栏，股息金额位于第二栏。

3 选择并复制表格。

4 在股息编辑器中，点击粘贴按钮。来自您的外部股息表格的数据将替换当前的股息数据。

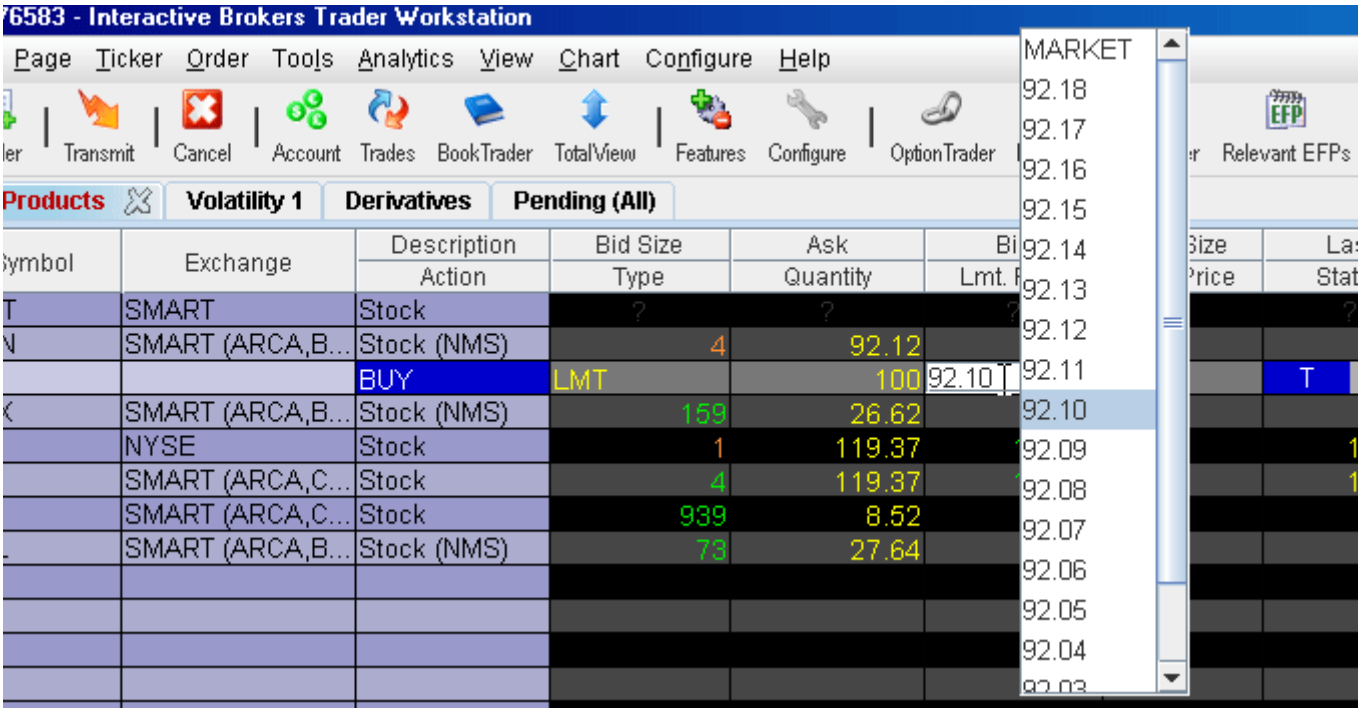
5 点击确定将您的数据保存到股息编辑器的手动显示中。

价格和尺寸向导

价格向导和尺寸向导帮助您只使用您的鼠标就能修改定单价格和定单数量。当您在定单行的**限价**或**数量**区域中点击并握住鼠标时，向导变为活动的。

使用价格向导

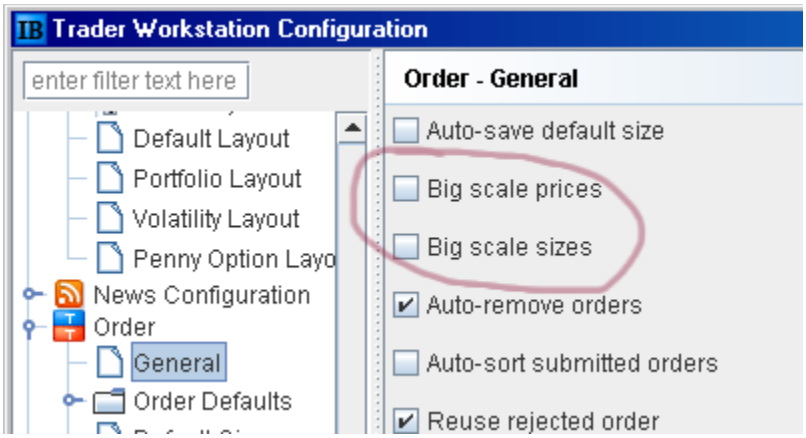
1. 创建限价定单。**限价**区域被填入最佳出价或要价。
2. 在限价区域中点击并握住您的鼠标来唤起价格向导。
3. 选择一个新的限价，然后松开鼠标。



Note: 向导阶梯的顶部包括 MARKET；底部为 VWAP。这些选项将您的定单类型更改为 MARKET 或 VWAP 定单，从而使用市价或 vwap 价格。

向导阶梯中的价格是使用市价加上 / 减去价格层级创建的。

在向导中修改层级

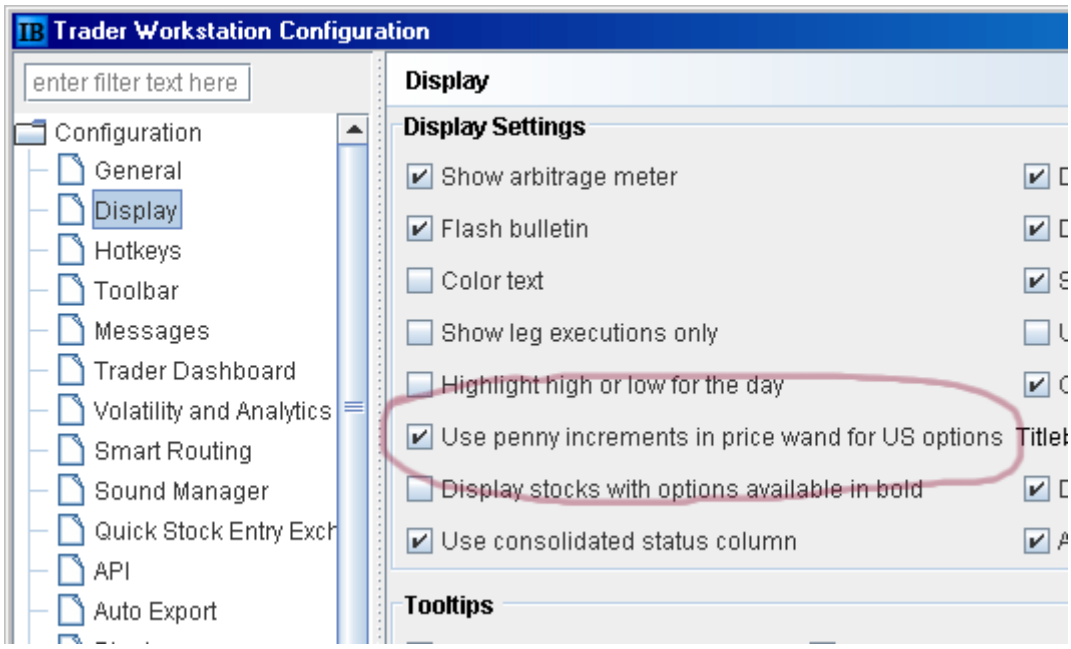


1 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。

2 扩展左侧窗格中的**定单**类别，并选择*一般*。

3 在右侧面板中，选中*大分段价格*或*大分段尺寸*来增加向导中使用的价格 / 尺寸。

在价格向导中对美国期权允许美分层级



1 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。

2 在左侧窗格的**配置**类别中，选择*显示*。

3 选中选项*在价格向导中对美国期权使用美分层级*。

6

实时活动监控

- 账户窗口
- 交易窗口
- 其他工具
- 理解系统颜色
- 警报和通知

账户窗口

账户窗口让您监控您的账户活动的每个方面。当您首次打开账户窗口时，我们展现了 “关键的”账户值作为默认值 （该默认视图被显示在下面的说明中）。账户窗口传递了这些实时数值：您可用于额外交易的资金以及在您的账户被清算之前可用的缓冲金额。

账户屏幕被分为以下部分：

- *余额*，它显示了您的证券、商品以及总共的账户余额。这些余额不包括保证金要求。
- *保证金要求*，它显示了基于您的当前投资组合的初始和维持保证金要求。
- *可用于交易*，其根据您的余额信息和保证金要求，告诉您您还有什么可用于进一步交易以及清算前的缓冲。
- *市场价值*，显示了全部头寸的总价值，按货币分类。
- *外汇投资组合*，其只显示货币对交易的活动。头寸区域中的值只反映了在外汇市场上执行的交易。请注意这些不反映实时外汇头寸，因为非基本货币换算不被包括。
- *投资组合*，其列举了按照底层证券分类的所有当前头寸，并对每个头寸显示了总的当前市场价值。

打开账户窗口

- 在主交易工具栏上，点击**账户**图标，或者从**视图**菜单上选择*账户*。

Demo - Account

File Portfolio Currencies Configure Help

Balances

Parameter	Total	Securities	Commodities
Net Liquidation Value	11,552,234.21 USD	11,525,649.22 USD	26,584.99 USD
Equity With Loan Value	11,607,163.65 USD	11,605,778.66 USD	1,384.99 USD
Cash	-7,531,165.96 USD	-7,557,750.96 USD	26,584.99 USD

Margin Requirements

Parameter	Total	Securities	Commodities
Current Initial Margin	5,583,016.36 USD	5,551,516.36 USD	31,500.00 USD
Current Maintenance Margin	5,570,889.66 USD	5,545,689.66 USD	25,200.00 USD

Available for Trading

Parameter	Total	Securities	Commodities
Current Available Funds	6,049,347.29 USD	6,054,262.30 USD	-4,915.01 USD
Current Excess Liquidity	6,061,473.99 USD	6,060,089.00 USD	1,384.99 USD
Buying Power	24,222,589.16 USD		

Market Value

Currency	Cash	Stock	Options	Futures	FOPs	Rlzd P&L	Unrealized P...	Nt Lqdtn
CAD	0.43	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0
USD	-7,531,1...	19,178,42...	-80,129.44	-2,372.51	0.00	0.00	1,309,840....	11,550,8
Total (in ...	-7,531,1...	19,180,03...	-80,129.44	-2,372.51	0.00	0.00	1,317,540....	11,552,2

FX Portfolio

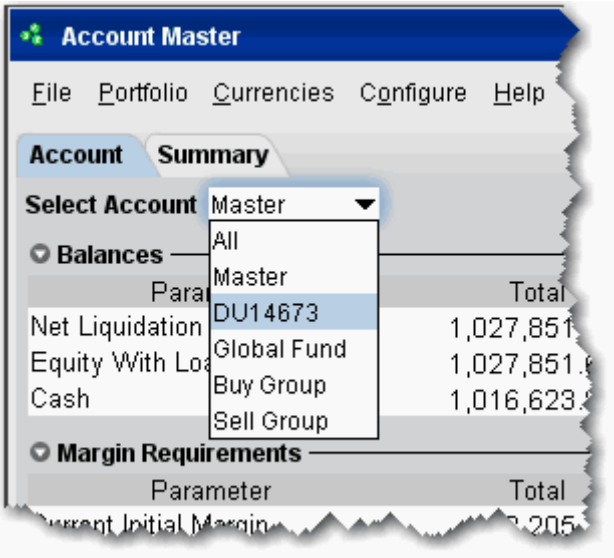
Cntrct Dscrptn	Pos	Crrncy	Mkt Val	Market Price	Average Pri...	Unrlzd P&L	Realized P&L	Liquidate L
USD.CHF	13	CHF	13.56	1.04285	1.0331	0.13	0.00	No
USD.EUR	-1,49...	EUR	-965,66...	0.64445	0.64799	5,304.42	0.00	No
USD.GBP	-4,200	GBP	-2,141.58	0.5099	0.50359	-26.50	0.00	No
JPY.USD	100,6...	USD	948.72	0.00943	0.00967	-25.10	0.00	No
GBP.USD	-15,3...	USD	-30,170...	1.96105	1.97497	214.17	0.00	No
EUR.GBP	-18,0...	GBP	-14,243...	0.7913	0.7846	-120.60	0.00	No
EUR.USD	18,057	USD	28,019....	1.5517	1.57251	-375.73	0.00	No
CAD.USD	1,340	USD	1,346.37	1.00475	0.9884	21.91	0.00	No

Portfolio

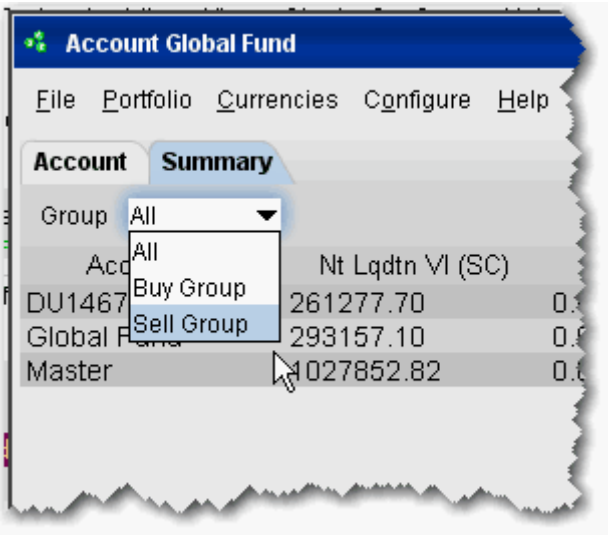
Show zero position rows

Cntrct Dscrptn	Pos	Crrncy	Mkt Val	Market Price	Avrg Prc	Unrlzd P&L	Realized P&L	Liquidate
BBY	2,500	USD	116,75...	46.70	43.27	8,575.00	0.00	No
BC	4,900	USD	67,130...	13.70	17.92	-20,678.00	0.00	No
BCO	4,000	USD	289,92...	72.48	66.80	22,720.01	0.00	No
BHH	-100	USD	-60.00	0.60	0.37	-23.00	0.00	

顾问和其他多客户账户持有者将在*账户*和*总结*标签中看见下拉选项，以选择个人账户或是账户组。



在账户页面上，选择对以下账户显示账户信息：全部账户，任何包括了主账户的个人账户，或者包括了账户子集的用户定义的账户组（在上图中，**买入组**和**卖出组**是用户定单的账户组）。



在总结页面上，选择对所有账户，或对任何账户组查看账户总结。

顾问还能够通过从**文件**菜单中选择*打印总结*来打印总结页面。

查看账户余额

余额部分显示了您的证券、商品以及总共的账户余额。这些余额不包括保证金要求。

要查看所有的*余额*值，使用绿色的加（＋）号展开这些部分。要客户化视图从而只显示您想要看见的值，将一个勾号放在这些参数旁边，并点击绿色的减（－）号来收起这些部分。

Balances

Parameter	Total	Securities	Commodities	
Net Liquidation Value	10,089,200.77 USD	10,088,634.09 USD	566.68 USD	☑
Equity With Loan Value	10,088,554.09 USD	10,088,487.41 USD	66.68 USD	☑
Previous Day Equity with Loan Value	10,084,049.16 USD	10,084,049.16 USD		☐
Reg T Equity with Loan Value	10,088,487.41 USD	10,088,487.41 USD		☐
Special Memorandum Account	9,994,052.41 USD	9,994,052.41 USD		☐
Securities Gross Position Value	605,440.37 USD	207,752.32 USD		☐
Cash	9,922,148.99 USD	9,921,582.31 USD	566.68 USD	☑
Settled Cash				☐
Accrued Interest	17,391.10 USD	17,391.10 USD	0.00 USD	☐

以下表格定义了在余额部分中可用的区域。

参数	证券	商品
净清算价值	总现金价值＋股票价值＋证券期权价值＋债券价值＋基金价值。	总现金价值＋期货损益＋商品期权价值。
带有贷款价值的权益	**现金账户：**已结算的现金。 **保证金账户：**总现金价值＋股票价值＋债券价值＋基金价值＋欧式和亚式期权价值。	**现金账户：**总现金价值＋商品期权价值－期货维持保证金要求＋最小值（0，期货损益）。 **保证金账户：**总现金价值＋商品期权价值－期货维持保证金要求。
前一日含贷款价值的权益	截至前一日东部时间 16:00 的可设保证金的含贷款价值的权益。	不可用。
含贷款价值的Reg T 权益	**现金账户：**已结算的现金。 **保证金账户：**总现金价值＋股票价值＋债券价值＋基金价值＋非美国和加拿大证券期权价值。	**现金账户：**总现金价值＋商品期权价值－期货维持保证金要求＋最小值（0，期货损益）。 **保证金账户：**总现金价值－期货维持保证金要求。
特别备忘录账户	最大值（（含贷款价值的权益－美国初始保证金要求）*，（前一日 SMA ＋ / － 该日的现金变化＋ / －该日内所作交易的美国初始保证金要求 **））。 * 在美国股票规则下于日末计算，无论交易的国家。 ** 在交易时	不可用。
证券总头寸价值（GPV）	多头股票价值＋空头股票价值＋多头期权价值＋空头期权价值＋基金价值	
现金	已结算现金＋交易时销售额	已结算现金＋交易时销售额＋期货损益

参数	证券	商品
已结算现金	在结算时已确认的现金－交易时购买额－佣金－税项－费用。 股票结算：交易日期＋ 3 天 期权结算：交易日期＋ 1 天	同证券。 期货结算：交易日期＋ 1 天
应计利息	已经累积但还未被支付或收取的利息。	同证券。

实时保证金监控

使用实时保证金监控来一眼查看您的当前保证金要求，并在您传递定单之前理解任意交易的保证金含义。

查看实时保证金要求

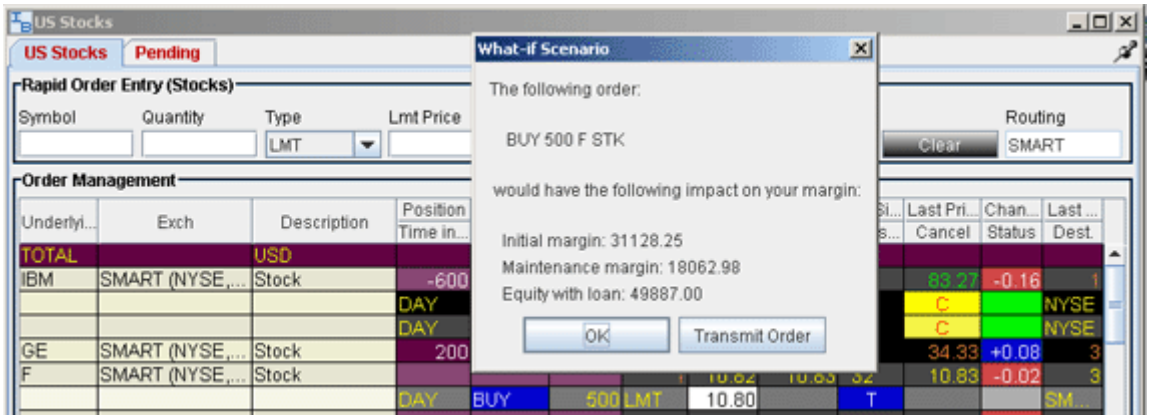
1. 在**视图**菜单上，选择*账户*。
2. 账户信息窗口显示了您的账户细节，包括当前市场价值和投资组合。
3. 使用*保证金要求和交易限制*部分来监控您的保证金。

Margin Requirements — Try PM

Parameter	Total	Securities	Commodities
RegT Margin	3,114.00 USD	3,114.00 USD	
Current Initial Margin	1,559.53 USD	1,559.53 USD	0.00 USD
Current Maintenance Margin	1,559.53 USD	1,559.53 USD	0.00 USD
Look Ahead Initial Margin	1,559.53 USD	1,559.53 USD	0.00 USD
Look Ahead Maintenance Margin	1,559.53 USD	1,559.53 USD	0.00 USD
Overnight Initial Margin	1,559.53 USD	1,559.53 USD	0.00 USD
Overnight Maintenance Margin	1,559.53 USD	1,559.53 USD	0.00 USD

查看 “如果怎样” 保证金情形

1. 在交易屏幕上通过点击资产的出价或要价来创建一笔定单。
2. 使用右键点击菜单来选择*检查保证金*。
3. 查看您的潜在保证金要求。



监控保证金要求

保证金在一天中的三个时段被计算：市场开盘时、市场收盘时和隔夜。*保证金要求*部分显示了您的当前保证金、对下一时段保证金计算的目标保证金 （前瞻）和隔夜计算 （仅对期货有效）。

- *当前*保证金是您现在的实时要求。如果恰巧在夜里 1:00 查看该屏幕，您的期货头寸的当前和隔夜保证金值将是相同的。如果您在交易时段中查看该屏幕，那么对您的期货的当前保证金要求将低于或等于隔夜要求。
- *前瞻*根据您现在的投资组合内容，估计了您的保证金要求在**下次**计算时将是多少。如果您在下午 2:00 查看该屏幕，**下次**计算将在收盘时。如果您在夜里 1:00 查看该屏幕，**下次**计算将在开盘时。
- *隔夜*是在常规市场时间之后的要求且仅适用于期货。

要查看所有*保证金要求*值，使用绿色的加 （＋）号来展开该部分。要客户化该视图来仅显示您想要看见的值，在这些参数旁的方框中打勾并点击绿色的减 （－）号来收起该部分。

Margin Requirements

Parameter	Total	Securities	Commodities	
RegT Margin	94,435.00 USD	94,435.00 USD		☐
Current Initial Margin	54,372.27 USD	53,697.27 USD	675.00 USD	☑
Current Maintenance Margin	54,005.47 USD	53,505.47 USD	500.00 USD	☑
Look Ahead Initial Margin	54,372.27 USD	53,697.27 USD	675.00 USD	☐
Look Ahead Maintenance Margin	54,005.47 USD	53,505.47 USD	500.00 USD	☐
Overnight Initial Margin	54,372.27 USD	53,697.27 USD	675.00 USD	☐
Overnight Maintenance Margin	54,005.47 USD	53,505.47 USD	500.00 USD	☐

尝试投资组合保证金

点击来看看如果您拥有投资组合保证金账户而不是 Reg T 保证金账户，那么您的保证金要求将会有什么不同。

软边缘保证金设定

为帮助您停留在保证金要求之上，我们现在提供了弹出消息和颜色加注的账户信息来通知您，您正在接近严重的保证金不足。对值处于危急状态的行，交易平台将作出强调。您的账户屏幕上的颜色告诉您以下信息：

黄色 — 您在保证金要求之上只剩下 5%的缓冲。

橙色 — 您的保证金缓冲已被耗尽，在 IB 开始清算您的头寸之前您还有一小段时间来进入保证金减少的交易。在此期间您应当能够进入将降低您的保证金要求的交易，但不能进入将增加保证金要求的交易。

红色 — 您的清算头寸不久将开始被清算，以便将您的账户带回到保证金限额之上。

以下表格定义了在保证金要求部分中可用的区域。

参数	证券账户	商品账户
Reg T 保证金	在美国 Regulation T 规则下**计算的初始保证金要求**。	在美国 Regulation T 规则下**计算的初始保证金要求**。
当前初始保证金	账户基本货币下的初始保证金要求。初始保证金要求是建立新头寸所需要的条件。	账户基本货币下的初始保证金要求。初始保证金要求是建立新头寸所需要的条件。

参数	证券账户	商品账户
当前维持保证金	账户基本货币下的维持保证金要求。这是维持您的当前头寸所需要的值。	账户基本货币下的维持保证金要求。这是维持您的当前头寸所需要的值。
前瞻初始保证金	账户基本货币下的截至下一时段保证金保证金变化时的初始保证金要求。	账户基本货币下的截至下一时段保证金保证金变化时的初始保证金要求。该数值依赖于您是什么时候查看您的保证金要求的。如果是东部时间下午 3:00，您向前看的下次计算是在收盘后，或者隔夜初始保证金 （100%）。如果是东部时间夜里 3:00，那么下次计算将是在市场开盘时 （50%）。
前瞻维持保证金	账户基本货币下的截至下一时段保证金保证金变化时的维持保证金要求。	账户基本货币下的截至下一时段保证金保证金变化时的维持保证金要求。该数值依赖于您是什么时候查看您的保证金要求的。如果是东部时间下午 3:00，您向前看的下次计算是在收盘后，或者隔夜初始保证金 （100%）。如果是东部时间夜里 3:00，那么下次计算将是在市场开盘时 （50%）。
隔夜初始保证金	对证券不适用。	账户基本货币下的隔夜初始保证金要求。对期货的隔夜计算是 100%。
隔夜维持保证金	对证券不适用。	账户基本货币下的隔夜维持保证金要求。对期货的隔夜计算是 100%。

请参见 IB 网站上的保证金总括页面来获取关于保证金计算的细节。

查看可用于交易的价值

如果您不看账户屏幕上的其他东西，可用于交易的值让您一眼知道您的账户状态。您的可用资金告诉您，您是否能够进行一笔交易。您的剩余流动性告诉您，您是否拥有充足的缓冲来维持您的当前头寸，而您的购买力告诉您，您在清算时包括权益和 IB 保证金在内拥有多少资产。

要查看所有*可用于交易*值，使用绿色的加（＋）号来展开该部分。要客户化该视图来仅显示您想要看见的值，在这些参数旁的方框中打勾并点击绿色的减（－）号来收起该部分。

Available for Trading

Parameter	Total	Securities	Commodities	
Current Available Funds	10,034,835.65 USD	10,035,004.42 USD	-168.77 USD	☑
Current Excess Liquidity	10,035,185.45 USD	10,035,179.22 USD	6.23 USD	☑
Look Ahead Available Funds	10,034,835.65 USD	10,035,004.42 USD	-168.77 USD	☐
Look Ahead Excess Liquidity	10,035,185.45 USD	10,035,179.22 USD	6.23 USD	☐
Overnight Available Funds	10,034,835.65 USD	10,035,004.42 USD	-168.77 USD	☐
Overnight Excess Liquidity	10,035,185.45 USD	10,035,179.22 USD	6.23 USD	☐
Buying Power	40,121,631.93 USD			☑
Leverage		0.02		☐
Look Ahead Next Change	@ 14:45:00			☐
Day Trades Left (T,...,T+4)	Unlimited			☐

以下表格定义了在*可用于交易*部分中可用的区域。

参数	证券账户	商品账户
当前可用资金	该数值告诉了您有什么可用于交易。 含贷款价值的权益－初始保证金。	相同。
当前剩余流动性	该数值显示了在清算之前您的保证金缓冲。 含贷款价值的权益－维持保证金。	相同。
前瞻可用资金	该数值反映了在下次保证金变化时您的可用资金。下次变化被显示在*前瞻下次变化*区域中。 含贷款价值的权益－前瞻初始保证金。	净清算价值－前瞻初始保证金。
前瞻剩余流动性	含贷款价值的权益－前瞻维持保证金。	净清算价值－前瞻维持保证金。
隔夜可用资金	与在常规交易时间中相同。	净清算价值－隔夜维持保证金。
隔夜剩余流动性	与在常规交易时间中相同。	净清算价值－隔夜维持保证金。
购买力	**现金账户：**（最小值（含贷款价值的权益，前一日含贷款价值的权益）－初始保证金） **标准保证金账户：**可用资金× 4	对期货不适用。

参数	证券账户	商品账户
杠杆率	总头寸价值 / 净清算价值。	相同
前瞻下次变化	向您显示下个保证金期间将在什么时候开始。	相同。
剩下的即日交易	还可用于 4 天典型即日交易期间的即日交易数量。	对期货不适用。

查看市场价值

市场价值部分向您显示了按币种分类的所有资产的总价值。有能力在经纪商之间转账的账户将同样拥有*转入*标签来监控 DVPs 和其他头寸转账。

IB | In Transit

Market Value

Currency	Cash	Stock	Options	Futures	FOPs	Net Liquidatio...	Unrealized P&L	Realized P&L
AUD	-19.92	0.00	0.00	0.00	0.00	-19.92	0.00	0.00
CAD	-41.45	0.00	0.00	0.00	0.00	-41.45	0.00	0.00
EUR	-11.16	0.00	0.00	0.00	0.00	-11.16	0.00	0.00
HKD	-249.97	0.00	0.00	0.00	0.00	-249.97	0.00	0.00
USD	25,021.17	6,228.00	0.00	0.00	0.00	31,311.42	94.9999	0.00
Total (in USD)	24,916.12	6,228.00	0.00	0.00	0.00	31,206.37	94.9999	0.00

以下表格定义了市场价值中部分中的区域。

参数	描述
币种	敞开头寸按照币种被分类。
现金	交易时已确认的现金＋期货损益。 该数值反映了实时的当前外汇头寸，包括： • 直接通过外汇市场执行的交易， • 作为 IB 自动换算的结果被执行的交易，其发生在您以非基本货币交易产品时， • 被故意地执行以关闭非基本货币头寸的交易。
应计利息	反映了本月截至今天的应计借方和贷方利息，每日更新。
股票	股票实时按市值计算的价值。
期权	证券期权实时按市值计算的价值。
期货	期货价值自从上次结算以来的实时变动。
期货期权	期货期权实时按市值计算的价值。
基金	当前资金余额。
汇率	币种相对于基本货币的汇率。
净清算价值	总现金价值＋股票价值＋期权价值＋债券价值。
未实现损益	您的敞开头寸的当前市场价值与平均成本之间的差额，或者**价值－平均成本**。
已实现损益	显示您在已平仓头寸上的利润，为您的进入执行成本与退出执行成本之间的差，或者 **（执行价格＋建立头寸的佣金）－（执行价格＋关闭头寸的佣金）**。

查看外汇投资组合价值

该部分只显示了货币对交易的活动。“头寸”价值只反映了在外汇市场中执行的交易总和，因此不反映实时的外汇头寸。检查市场价值部分的*现金*区域中的值来获取实时外汇头寸信息。

FX Portfolio

Cntrct Dscrptn	Position	Currency	Market Value	Market Price	Average Price	Unrlzd P&L	Realized P&L	Liquidate Last
JPY.USD	100,655	USD	948.77	0.00943	0.00967	-25.05	0.00	No
EUR.USD	18,057	USD	28,010.92	1.55125	1.57251	-383.86	0.00	No
CAD.USD	1,340	USD	1,345.29	1.00395	0.9884	20.84	0.00	No
USD.CHF	13	CHF	13.56	1.04315	1.0331	0.13	0.00	No
USD.GBP	-4,200	GBP	-2,141.79	0.50995	0.50359	-26.71	0.00	No
GBP.USD	-15,385	USD	-30,170.75	1.96105	1.97497	214.17	0.00	No
EUR.GBP	-18,000	GBP	-14,238.45	0.79102	0.7846	-115.65	0.00	No
USD.EUR	-1,498,427	EUR	-965,960.94	0.64465	0.64799	5,004.77	0.00	No

Portfolio

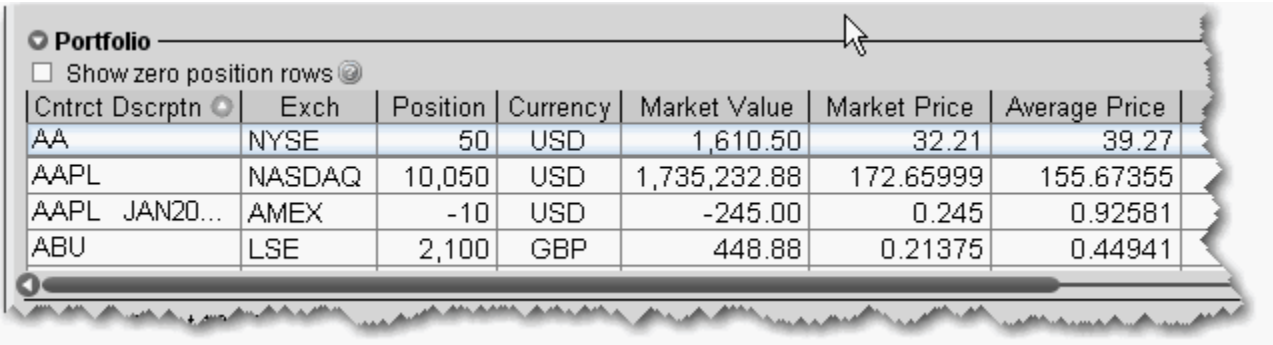
以下表格定义了在**外汇投资组合**部分中可用来显示的区域。

参数	描述
合约描述	代码和描述。
交易所	货币对交易的交易所。这可以不是交易的执行交易所。
头寸	选定的货币对在外汇市场中执行的交易总数。
未结算头寸	未结算的外汇交易。
币种	被用来买入 / 卖出外汇对的货币。
市场价值	（头寸）× （市场价格）。
市场价格	头寸的实时价格。
平均价格	每份合约平均价格。
未实现损益	交易价格和市场价格之间的差乘以头寸，包括佣金。 *例子*：以 1.54390 买入 20,000 EUR.USD 交易价格＝ 1.54390 市场价格 （当前价格）＝ 1.54385 1.54390 － 1.54385 ＝ .00005 .00005 × 20,000 ＝ 1 ＋ 2.5 佣金＝ -3.50 未实现损益
已实现损益	货币对的已实现损益。

参数	描述
最后清算	最后清算 “是”或 “否”标签。如被设为 “是”，该头寸将被放到队列的末尾，在保证金要求的情况下最后清算。要设置，在想要的头寸上使用右键点击菜单。 **Note:** 尽管 IB 为客户提供了在其账户保证金不足的情况下预请求清算顺序的机会，这些请求对 IB 不具有约束力。在客户的 IB 账户保证金不足的情况下，IB 保留其权利，来自行决定要被清算的资产、清算资产的数量，以及清算的顺序和方式。我们鼓励客户查询 IB 客户协议以及 IB 保证金交易风险披露来获取进一步的信息。

查看投资组合价值

投资组合部分显示了每个头寸的当前价值，并允许您将任何头寸标记为在追缴保证金的情况下被最后清算。有能力在经纪商之间转账的账户将同样拥有*转入*标签来监控 DVPs 和其他头寸转账。



Cntrct Dscrptn	Exch	Position	Currency	Market Value	Market Price	Average Price
AA	NYSE	50	USD	1,610.50	32.21	39.27
AAPL	NASDAQ	10,050	USD	1,735,232.88	172.65999	155.67355
AAPL JAN20...	AMEX	-10	USD	-245.00	0.245	0.92581
ABU	LSE	2,100	GBP	448.88	0.21375	0.44941

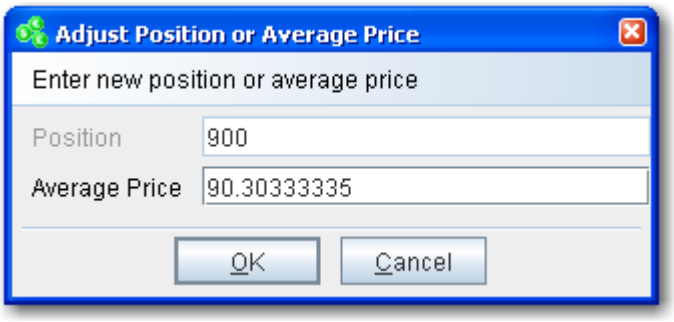
以下表格定义了投资组合部分中的区域。

参数	描述
显示零头寸行 — 对所有已交易的合约显示一行，即使头寸已被平仓。	
合约描述	代码和描述。
头寸	多头 / 空头股票或合约的数量。
币种	合约的币种。
市场价值	（头寸）× （市场价格）。
市场价格	头寸的实时价格。
平均价格	股票和证券期权敞开头寸的平均成本，包括佣金。 **Note:** 点击右键并选择*以基本货币显示全部值*，让交易平台换算所有非基本货币头寸，以您的基本货币来显示。被换算的数值以*斜体*被显示从而便于识别。
未实现损益	（头寸的市场价值）— （平均成本）。
已实现损益	（自从时段结束时的头寸市场价值 *）— （这些头寸的平均成本）。 * 决定交易的已实现损益的截止时间如下： • 对证券为东部时间 20:30 • 对期货有两个时段：东部时间 17:30 和东部时间 7:10
最后清算	最后清算 “是” 或 “否” 标签。如被设为 “是”，该头寸将被放到队列的末尾，在保证金要求的情况下最后清算。要设置，在想要的头寸上使用右键点击菜单。 **Note:** 尽管 IB 为客户提供了在其账户保证金不足的情况下预请求清算顺序的机会，这些请求对 IB 不具有约束力。在客户的 IB 账户保证金不足的情况下，IB 保留其权利，来自行决定要被清算的资产、清算资产的数量，以及清算的顺序和方式。我们鼓励客户查询 IB 客户协议以及 IB 保证金交易风险披露来获取进一步的信息。

右键点击投资组合菜单

如果您在投资组合部分中选定一个资产并点击您的鼠标右键，您将进入以下菜单项目。

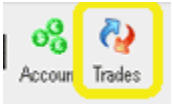
参数	描述
按证券类型分类	根据证券类型按字母顺序将头寸分类。
按当前页面顺序分类	根据头寸在交易页面上的位置将其分类。
交易	• 买入 — 在交易页面上对选定的合约创建一笔买入定单。 • 卖出 — 在交易页面上对选定的合约创建一笔卖出定单。 • 关闭头寸 — 传递一笔尺寸恰好的反向定单来关闭我们的头寸。 • 关闭所有头寸 — 传递多笔反向定单来关闭您的投资组合中的所有头寸。 • 关闭头寸的一部分 — 在弹出的文本输入框中，输入一个百分比，该百分比将被用于计算每个头寸要传递的反向定单的尺寸。
转账	对有能力转账的账户 — 发起 DVP/RVP、CMTA 或其他转账。
创建代码	为主交易屏幕上的合约创建一条市场数据线。
调整头寸或平均价格	只对外汇头寸是活动的。使用该功能来输入假设的 “新” 头寸和 “新” 平均成本。该功能不修改您的外汇头寸，但让您创建 “如果怎样” 情形来看看包括您可能在其他地方持有的头寸的总损益。

参数	描述
调整平均价格	对除去现金的所有产品被显示。选定一个头寸并选择调整平均价格。使用对话框来输入一个新头寸或者更改平均价格来包括转账和公司行动。 
设定最后清算	最后清算 “是” 或 “否” 标签。如被设为 “是”，该头寸将被放到队列的末尾，在保证金要求的情况下最后清算。要设置，在想要的头寸上使用右键点击菜单。 **Note:** 尽管 IB 为客户提供了在其账户保证金不足的情况下预请求清算顺序的机会，这些请求对 IB 不具有约束力。在客户的 IB 账户保证金不足的情况下，IB 保留其权利，来自行决定要被清算的资产、清算资产的数量，以及清算的顺序和方式。我们鼓励客户查询 IB 客户协议以及 IB 保证金交易风险披露来获取进一步的信息。
取消最后清算设定	删除对头寸的 “最后清算” 指定。
创建投资组合页面	创建一个叫做*投资组合*的交易页面，它包括了您的投资组合中所有代码的市场数据线。

交易窗口

引言

交易窗口对每日执行显示了报告，这些执行包括那些在常规时间之后的交易中完成的执行。要查看执行，点击交易工具栏上的**交易**图标。



菜单

菜单名称	描述
文件菜单	• 导出今天的报告 — 点击将您的执行报告保存到一个外部文件中，以便使用另一个应用程序例如 MS Excel 来打开它。 • 导出前一日的报告 — 点击将来自前一日的执行报告保存到一个外部文件中，以便使用另一个应用程序例如 MS Excel 来打开它。 • 打印 — 打印当前页面。 • 关闭 — 关闭交易窗口。
交易菜单	• 分类 — 打开分类对话框，您能够从中选择根据区域将报告分类。 • 显示平均价格 — 选择两份或更多的执行报告。对选定的报告计算平均价格和总股数。 • 展开 / 收起 — 如果适用，选定的行将被展开 / 收起。 • 显示边 — 这将展开任何差价和组合执行，并同时显示单条边。 • 展开全部 / 收起全部 — 展开或收起所有有效的行。
视图菜单	• 交易历史 — 把您带到账户管理中的报告管理部分的交易确认页面。

菜单名称	描述
设置菜单	• 版式 — 打开**表格栏设定**窗口，您能够从中选择显示或隐藏栏（通过选中 / 不选中栏标题），以及更改其相对于其他栏的位置。 • 平均价格精度 — 允许您通过输入小数点位置来决定平均价格计算的小数点位数精度。 • 字体大小 — 更改执行窗口数据的字体风格和字体大小。 • 强调交易 — 打开强调交易对话框。输入新的执行报告保持被强调的秒数（便于查看）。选中*在部分执行后自动展开*，让部分执行的定单的交易报告自动地展开来显示定单被执行时的其他部分。 • 仅显示边执行 — 如被选中，差价和组合执行将以单条边被显示。如果不被选中，整个组合将被显示，您能够点击展开行并显示单条边执行。 • 代码模式 — 以代码模式显示合约描述。 • 按照价格的组执行 — 如被选中，对定单的部分执行按照定单下的价格被分组。对一个价格水平的总执行，能够通过点击“＋”号被进一步地展开来查看单个执行。只有一个执行的价格水平是不能被展开的。 • 总是对新交易闪烁 — 如被选中，交易工具栏上的**交易**图标将闪烁来通知您一笔定单已经执行。 • 当交易窗口被关闭时闪烁 — 如被选中，只有当交易窗口被关闭时，交易工具栏上的**交易**图标才将闪烁来通知您一笔定单已经执行。 • 从不闪烁 — 如被选中，您将不会收到任何已执行定单的闪烁通知。
帮助菜单	• 点击*显示帮助*来打开交易平台用户指南。

交易标签

交易窗口有两个标签：*交易*和*小结*。顾问和其他多客户账户持有者有权选择查看*全部*账户、单个账户（包括主账户）或任何用户定义的*账户组*的交易活动。在上图中，账户组“全球基金”被选定。

在交易标签中添加或删除栏

1. 右键点击任何栏标题并选择*版式*。
2. 对您想要包括的栏打勾；对您想要隐藏的栏去掉打勾。

栏名称	描述
行动	行动，为买入或卖出。
数量	交易中的单位数量。
底层证券	底层证券代码。
组合	如被选中，将交易识别为组合交易。使用“＋”号来展开组合并查看单条边。
描述	合约描述。
价格	每单位的当前市场价格。
币种	头寸被持有的币种。
交易所	执行定单的交易所。
日期	执行日期。

栏名称	描述
时间	执行时间。
定单号	定单号。
定单参考	用户在定单标签上定义的定单参考号。对篮子定单，该区域包含了定单所属的篮子名称。
佣金	对交易收取的佣金。
VWAP 时间	对 VWAP 定单，定单执行的时间。
评论	显示与定单相关的评论。
账户	识别收益账户号。
确认	只对连锁客户有效。
提交人	识别定单提交人。
收益率	最低收益率。为到期收益率和所有赎回收益率中的较低者。收益率只有在交易所提供它时才被显示。
沿窗口底部的文本描述了**交易**标签上的区域的排序顺序。	

导出交易报告

您能够将今天的和前一日的执行报告导出到一个文件，然后您能够使用 MS Excel 或其他外部应用程序来查看该文件。

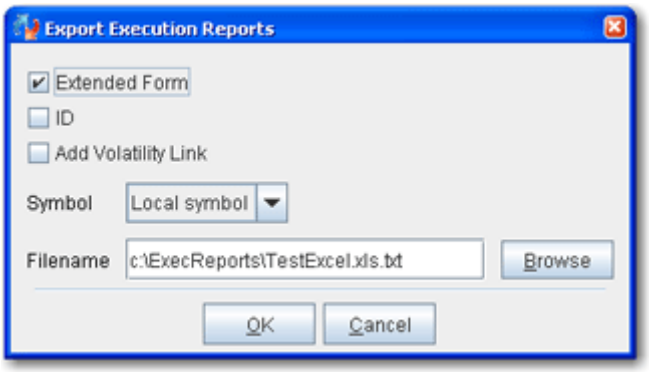
导出交易报告

1 点击交易工具栏上的交易图标来打开交易窗口。

2 在**文件**菜单上，选择*导出今天的* （或*前一日的*）*报告*。

3 如果可用，选择该天的报告并点击确定。

在**文件名**区域中，输入您想要分配给报告的位置和文件名。注意报告将被保存为文本 （.txt）文件。



- 选中*扩展形式*，在导出的报告上包括类型、到期日、行权价、权利和权利金币种区域。
- 选中 *ID*，在报告上包括 ID 区域。
- 选中*添加流动性链接*来包括波动率计算 （对波动率定单）。

4 在代码下拉选项中选择底层证券、本地代码或二者都选。

5 点击确定将报告保存至外部目录。

您能够通过执行若干简单的步骤，在例如 MS Excel 的工作表中打开您的导出报告。

在 Excel 中打开您的交易报告

1 打开 MS Excel 并点击**文件** > *打开*。

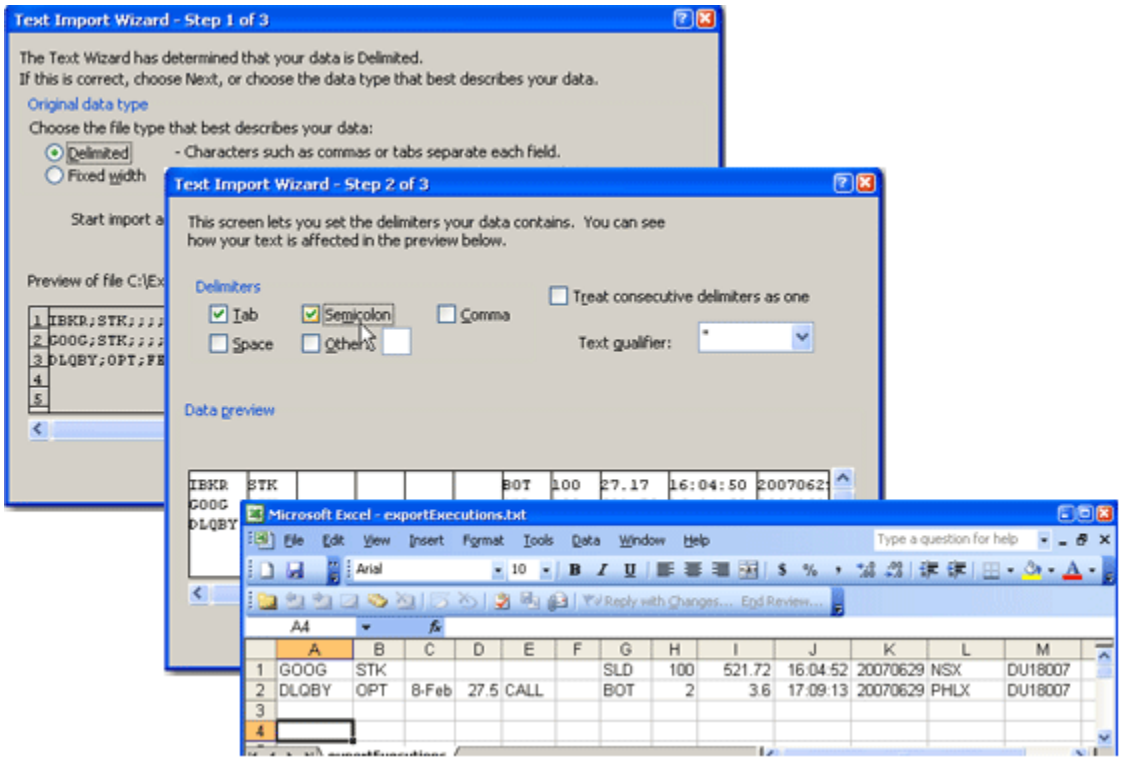
2 在**文件类型**下拉选项中，选择*全部文家（*.*）*。

3 找到您想要打开的 .txt 执行文件的位置。

4 在文本导出向导中，使用**分界**作为文件类型并点击*下一步*。

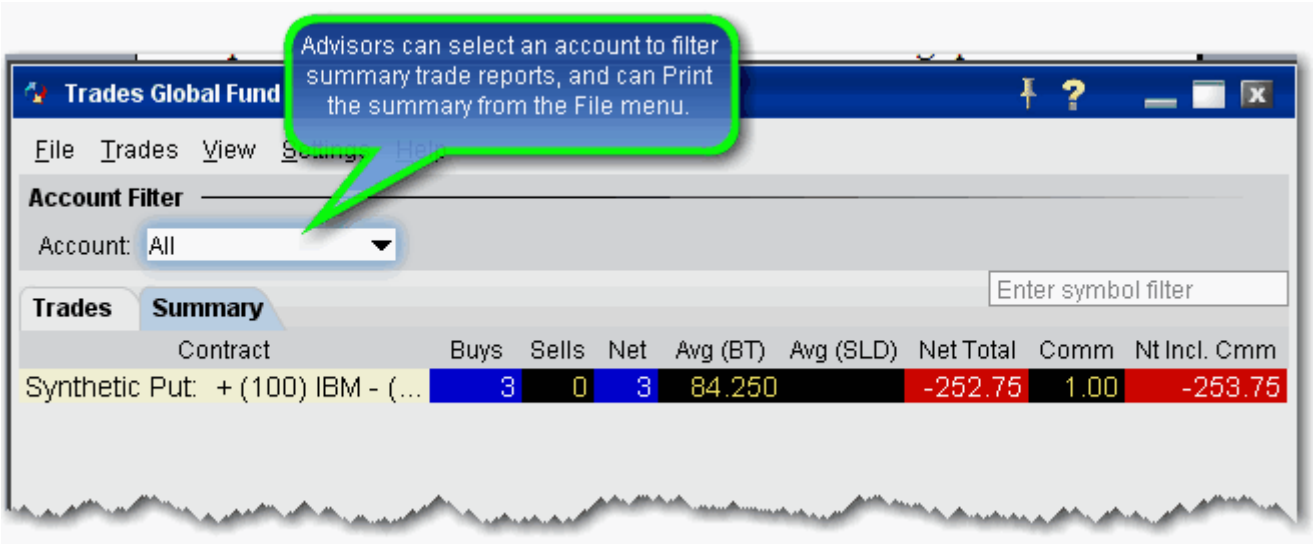
5 选择**半冒号**作为分界符并点击*下一步*。

6 将栏数据格式留为**一般**并点击*完成*。



交易小结

小结标签按合约显示了执行信息。要查看执行，点击交易工具栏上的**交易**图标。



添加 / 删除栏

1. 右键点击任何栏标题并选择*客户化版式*。
2. 在**可用的栏**列表中，选择一个栏并点击**添加**将其移动到**已显示的栏**列表中。

其他工具

引言

- 利润和损失
- 待处理的定单页面
- 再平衡窗口
- 交易者控制板
- 布告栏和系统状态
- 审计追踪
- 使用智能路径 SM的期权的最优价格

利润和损失

您能够在交易屏幕上和在账户窗口中看见损益。使用版式管理器来添加这些区域至您的交易屏幕。

- **头寸** — 显示您在工具中的头寸。
- **市场价值** — 等于头寸×市场价格。
- **平均价格** — 平均价格是通过将您的成本 （执行价格＋佣金）除以您的头寸数量来计算的。该价值随后被用于决定您的未实现损益。

  头寸和损益 — 显示当前日您的利润和损失。您能够选择显示新头寸损益，其只针对今天执行的交易，或者每日损益，其包括了所有未平仓头寸加上新头寸损益。

要设定损益计算，右键点击文件名并*选择配置头寸和损益栏*。

- 要显示新头寸损益，**不选中**方框*将今天的建仓头寸包括到损益计算中*。区域标题将显示**损益（净）**来表明其只是针对新头寸。

新头寸损益计算：
（当前价格－购买价格）× （今天购买的流通股数量）。

- 要显示每日损益，选中方框*将今天的建仓头寸包括到损益计算中*。区域标签将读作**头寸和损益**。

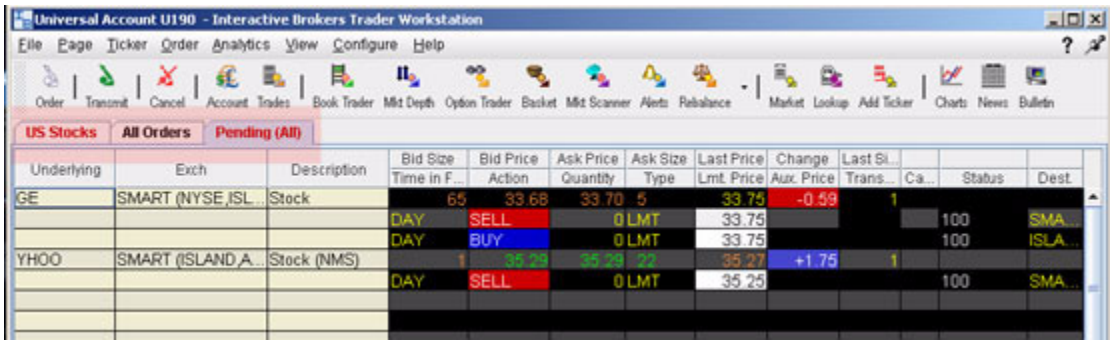
每日损益计算：（当前价格－前一日收盘价格）× （流通股总数量）＋ （对所有新头寸的新头寸计算）。

- **未实现损益** — 您的头寸的当前市场价值和平均价格之间的差。
- **已实现损益** — 显示您的已平仓头寸的利润或损失，其为您的进入执行成本 （执行价格＋建立头寸的佣金）与退出执行成本 （执行价格＋关闭头寸的佣金）之间的差。
- **成本基础** — （当前头寸×平均价格）。

待处理的定单页面

您能够在**待处理**页面上，以及任何显示该工具的交易页面上查看工作中的定单。一旦一笔定单已经被执行，它就从待处理页面中被删除，执行报告被显示在执行窗口中。如果您在登录时拥有待处理的定单，待处理页面被自动地显示给您查看。

您能够通过使用版式管理器显示头存栏，在待处理页面查看头寸。



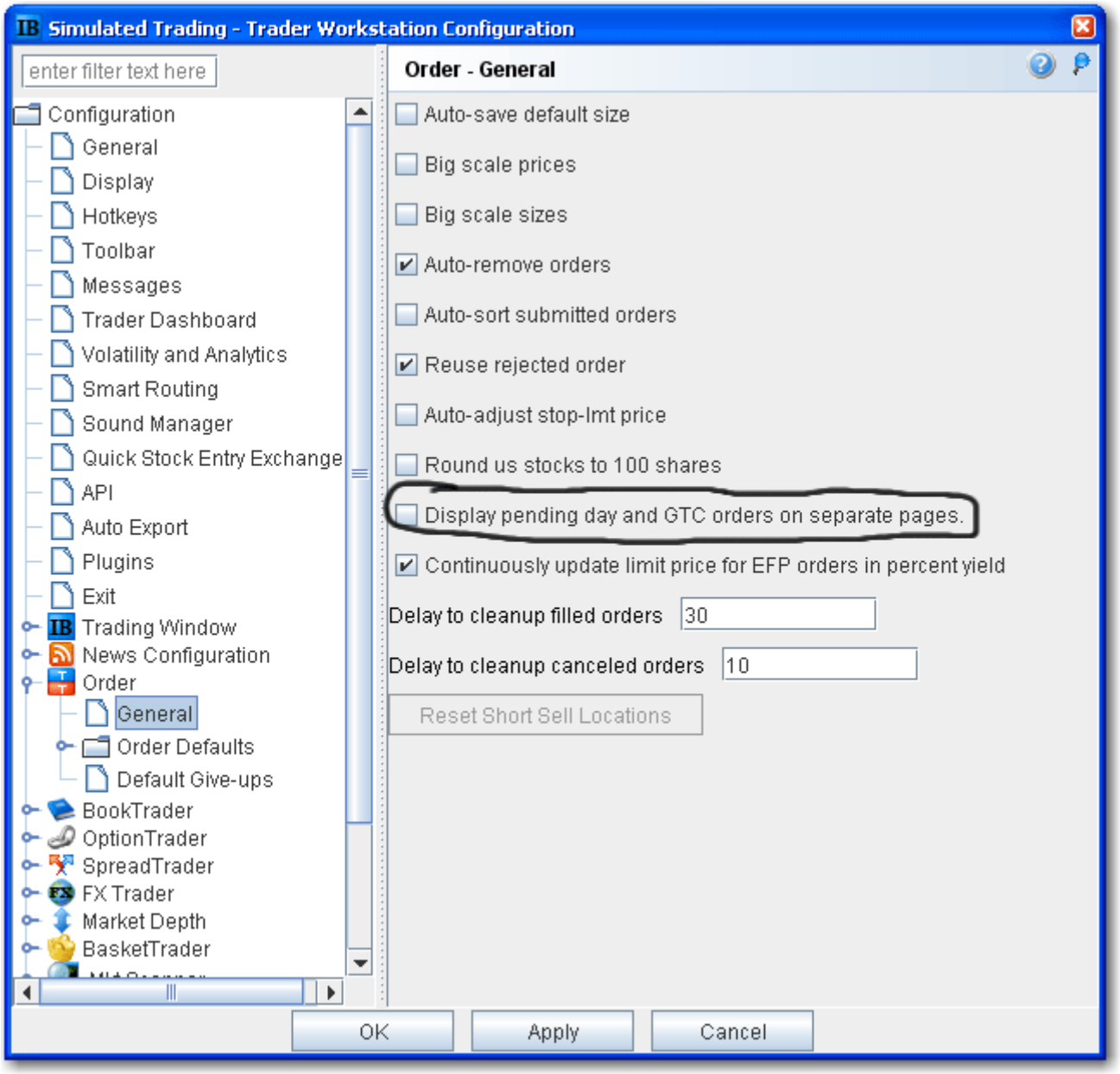
查看待处理的定单

- 在交易屏幕上，点击待处理标签。当定单在工作时，待处理标签的标题，以及资产被显示的页面的标题为红色。

您同样能够选择在与其他定单分别的待处理页面上显示取消前有效（GTC）定单。

对取消前有效定单使用单独的待处理定单页面

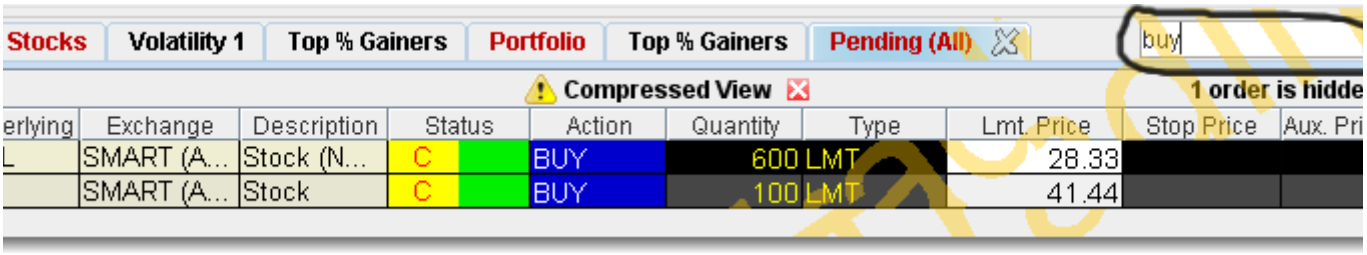
1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧窗格中，选择**定单**，然后选择*一般*。
3. 在右侧面板中，选中*在不同的页面上显示待处理的当日和取消前有效定单*。



Note: 您能够从待处理页面管理工作中的定单，但您不能够创建定单或添加新的市场数据线。您同样能够从**待处理**页面修改条件定单的条件。

待处理的定单 — 过滤和分类

您能够选择根据用户定义的搜索标准来查看待处理页面上的定单，以及根据*压缩*视图下的定单区域来将待处理的定单分类，该视图只显示定单行，无市场数据和空白行。



过滤待处理定单

1 在**待处理**页面上，*在输入搜索字符串*方框中输入搜索标准，该方框在您拥有工作中的定单时出现在页面标签右方。

Note: 所有满足您的标准的定单被显示在**压缩视图**中，这意味着只有定单行被显示，无空白行或市场数据行被包括。不满足您的标准的定单数目被注释在搜索字符串方框下方。

要返回到正常的**待处理**页面版式，点击 ☒ 来关闭压缩视图。

在压缩视图下按定单区域分类

1 从**全局配置**的显示页面中启用压缩视图下的定单分类。

2 在**待处理**页面上，点击您想要用来将定单分类的定单区域标题，例如限价。

Note: 所有待处理的定单根据您点击的定单区域被分类，并以**压缩视图**被显示，这意味着只有定单行被显示，无空白行或市场数据行被包括。

3 要返回到正常的**待处理**页面版式，点击“×”来关闭压缩视图。

再平衡窗口

使用**再平衡**窗口，在您的投资组合中重新分配组成了您的当前 （带符号的）净清算价值的头寸百分比。该应用程序根据您输入的新百分比，自动地建立和关闭头寸来再平衡您的投资组合。您能够像在主交易屏幕中一样来添加合约并创建定单。

再平衡您的投资组合

1 从**交易**菜单上，选择*再平衡投资组合*。

2 **再平衡投资组合**窗口显示了与您的交易屏幕上不同的三栏：

- *可交割价值* — 该数值为头寸的可交割价值。对股票，该数值为股票的价值，其与在**账户**窗口的*投资组合*部分中显示的头寸市场价值相同。对期权、期货和单一股票期货 （SSFs），该数值为底层股票或指数的价值。
- *当前百分比* — 该数值为当前头寸相对于在**账户**窗口中的*余额*部分中显示的您的净清算价值的带符号的百分比。该数值是通过将 DLV 除以 NLV （净清算价值）来计算的。
- *再平衡百分比* — 使用该区域来输入一个您想要头寸拥有的新的 NLV 百分比。

3 在一个或多个头寸的再平衡百分比区域中，输入您想要头寸拥有的净清算价值百分比。

4 点击**创建定单**按钮来指示应用程序自动地创建定单以实现百分比更改。

5 使用**传递全部**按钮来发送所有定单，或者在一个定单行上点击 “T” 来传递单个定单。

Note: 对期权，再平衡百分比是基于底层证券股票价格的值的。

从再平衡窗口建立头寸

1 从按钮面板中点击添加行，输入一个底层证券代码到空白行并按下*回车*。定义合约。

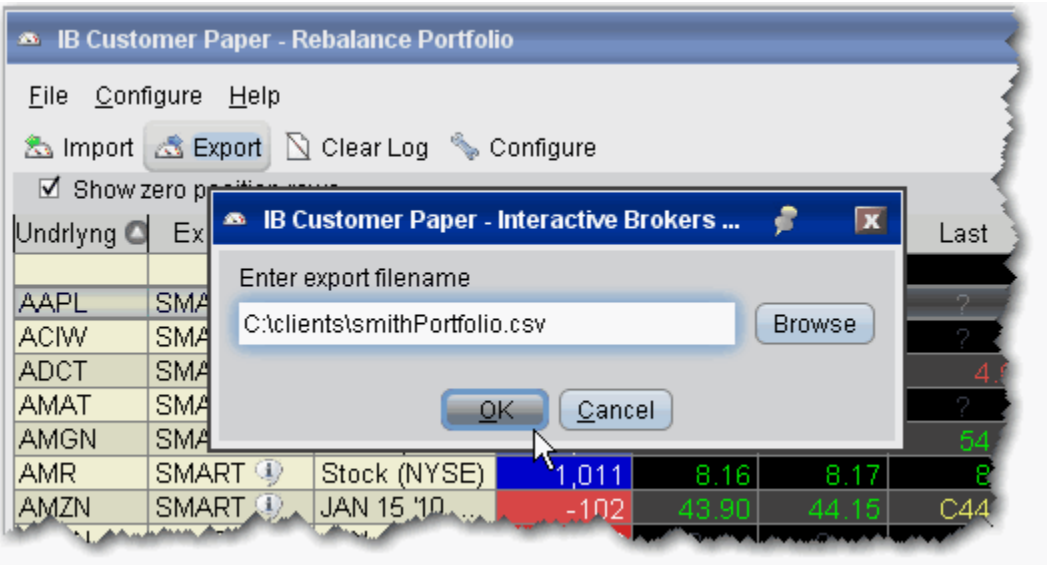
2 在*再平衡百分比*栏中输入一个值，点击**创建定单**按钮。

3 传递定单。

导入和导出头寸

偏好在 Excel 中工作的客户能够导出再平衡文件，并修改当前百分比来反映您想要让头寸拥有的净清算价值百分比，然后将被修改的文件导回到再平衡投资组合中。

顾问同样能够使用该功能将被修改的文件导入到新账户，从而容易地将该账户带到新的百分比。



导出投资组合

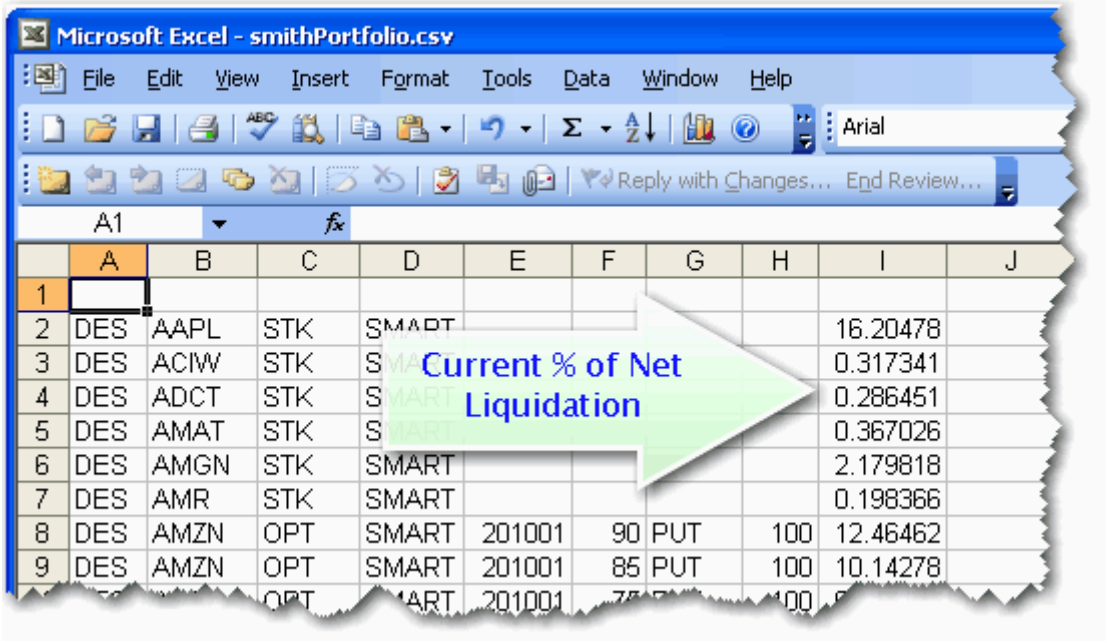
1 点击位于**再平衡投资组合**窗口顶部的*导出*图标。

2 如果需要，修改位置和文件名（保留 .csv 扩展名），并点击确定。您可能想要修改一般文件名来帮助识别它。

例如，您可以将默认的 C:\jts\rebalance.csv 更改为 C:\clients\smithPortfolio.csv。

3 在文件导出确认消息中点击确定。

Note: 目录路径必须存在，导出功能才能够工作。您不能在导出时创建新的文件夹。



	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J
1										
2	DES	AAPL	STK	SMART					16.20478	
3	DES	ACIW	STK	SMART					0.317341	
4	DES	ADCT	STK	SMART					0.286451	
5	DES	AMAT	STK	SMART					0.367026	
6	DES	AMGN	STK	SMART					2.179818	
7	DES	AMR	STK	SMART					0.198366	
8	DES	AMZN	OPT	SMART	201001	90	PUT	100	12.46462	
9	DES	AMZN	OPT	SMART	201001	85	PUT	100	10.14278	

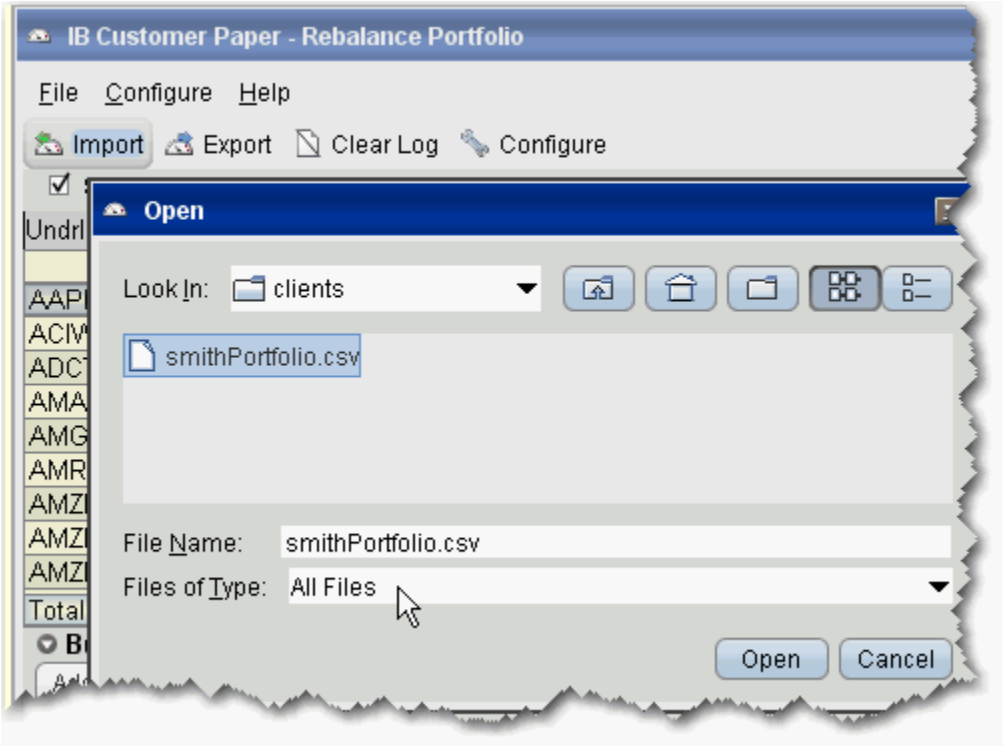
从 Excel 中再平衡头寸的 NLV 百分比

1 在 MS Excel 中打开导出的 .csv 文件。

Note: 注意，工作表的每一行都代表一个头寸。最后一栏代表了头寸在净清算价值中所占的当前百分比。这个被导出的值等于再平衡投资组合窗口中的**当前百分比**区域中的值。

2 将 NLV 的当前百分比更改为您想要的新百分比。对需要的行执行该行动并点击*保存*。

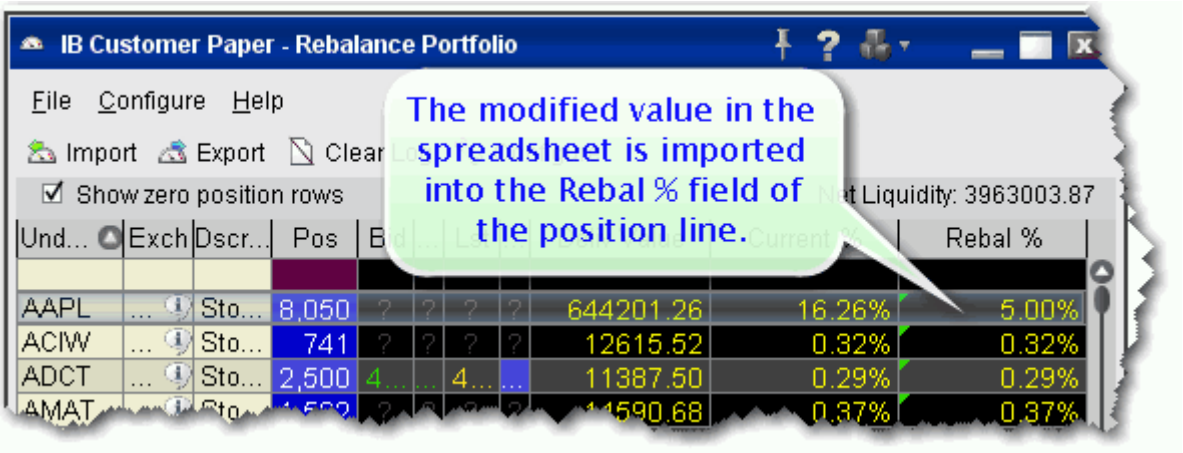
例如，如果您想要再平衡您的投资组合，让 AAPL STK 在净清算价值中所占的百分比为 5%，而不是上图第 3 行中显示的 16.20478，您应当将 16.20478 改为 5.0。这个被修改的值被导入到再平衡投资组合中作为新的再平衡百分比值。



导入再平衡投资组合

1 点击位于**再平衡投资组合**窗口顶部的导入图标。

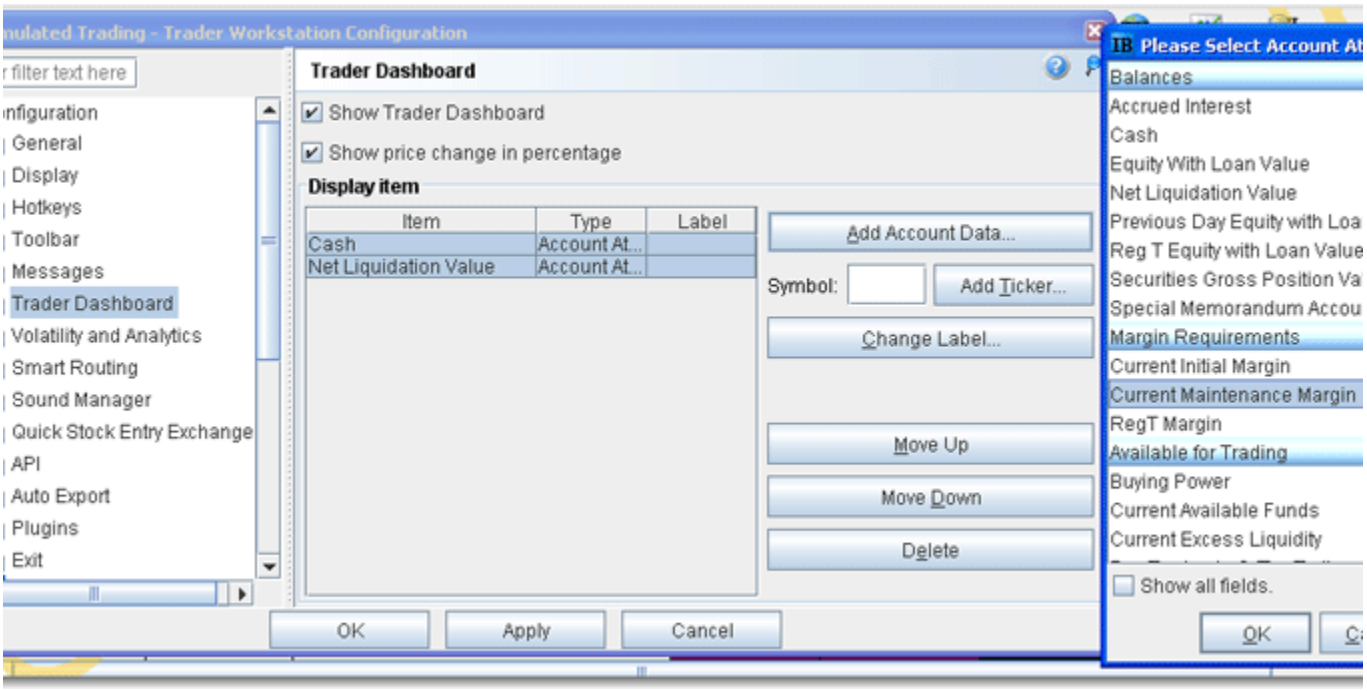
2 找到您想要导入的被修改的 .csv 文件并点击*打开*。您将在被修改的头寸行上看见新的再平衡百分比值。



Note: 要完成再平衡，创建并传递定单。

交易者控制板

实时的交易者控制板是一个可选的工具，其被显示在在页面标签集的顶部。这个可客户化的面板允许您从您的账户信息窗口中监控数据区域。您同样能够紧跟特定合约的最新活动。



配置交易者控制板

1. 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。
2. 在左侧窗格中，点击*交易者控制板*。
3. 使用右侧窗格中的复选框来设置以下：
   - **a** 选中*显示交易者控制板*，在您的交易窗口上显示控制板。
   - **b** 选中*以百分比显示价格变动*，以代码行的百分比来查看最后价格和价格变动值。如果留为不选中，价格变动以绝对数值被显示。
4. 点击**添加账户数据**按钮，并下拉至列表。双击您想要添加至控制板的每个账户区域。您双击的每个区域被添加至配置窗格中的*显示项目*列表。点击确定来关闭*添加*框。

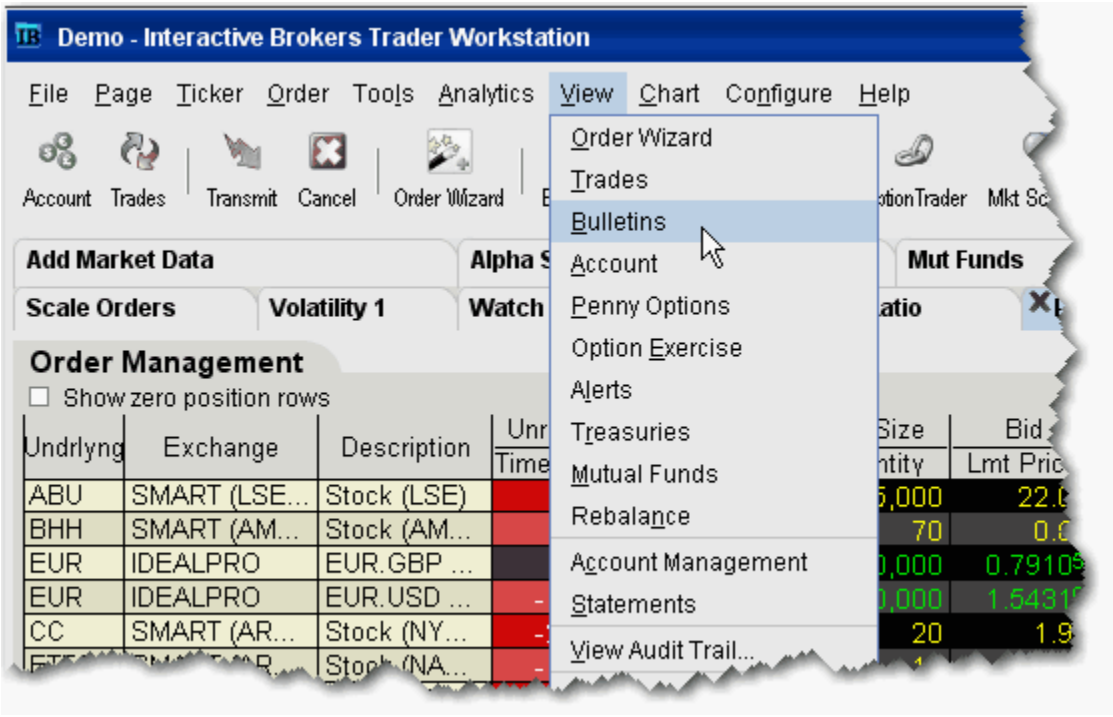
对账户信息区域的描述位于账户信息话题中。

5. 要对合约添加最后价格 / 价格变动区域，在*代码*区域中输入底层证券并点击**添加代码**，然后就像当您对交易页面添加市场数据一样来定义合约参数。最后价格 / 价格变动以红色显示来表明向下的移动，以蓝色显示来表明向上的移动。
6. 点击**确定**。**交易者控制板**被显示在您的交易窗口顶部，页面标签集的上方。

您能够使用更改标签功能，更改选定的控制板区域的显示名称。

布告栏和系统状态

涉及交易所发行、系统问题和其他交易信息的通知，通过布告栏和系统状态报告被宣布。布告栏通过沿菜单条顶部闪烁的红色 “布告栏” 通知被宣布。



阅读当前布告栏

- 点击闪烁的红色 “布告栏” 通知。

回顾布告栏

- 在工具栏上点击布告栏图标，或者
- 从**视图**菜单中选择*布告栏*。

Note: 您能够移动**布告栏**窗口 （它在您执行任何以上行动时打开）并改变其尺寸，这样它就不会盖住您的交易屏幕上的重要信息。系统保存您的设置，并将总是以您指定的尺寸和位置打开窗口。

从网站上查看今天所有的布告栏和系统状态

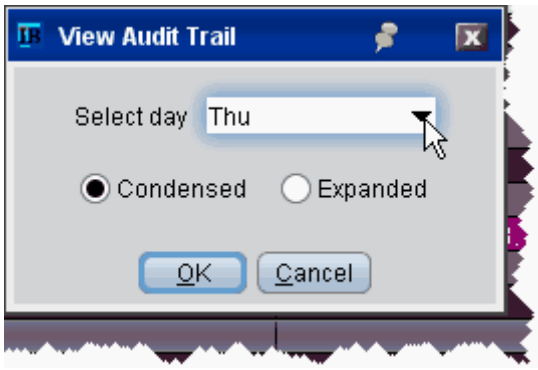
- 在帮助菜单上，选择系统状态。

审计追踪

该功能创建了一个每日交易活动的文件，您能够从您的浏览器中查看它。审计文件每天被创建，并使用一周中的星期几被命名。每周，现有的每日文件被使用相同名称的新文件覆盖。如果您想要保存这些每日文件，您能够对它们重命名。您必须首先启用审计追踪功能，然后才能查看审计追踪。

查看审计追踪

1. 在**视图**菜单上，选择*查看审计追踪*。
2. 选择一天，最多为 5 天前。
3. 选择*精简*或*展开*形式，并点击确定。



使用智能路径SM的期权的最优价格

使用智能路径的期权交易者能够看见哪些交易所提供最优的出价和要价。该信息被显示在市场数据线的出价交易所和要价交易所区域中。每个交易所以下表中定义的单个字母来表示。如果多个交易所显示了相同的“最优”价格提供，那么多个字母将被显示。例如，如果 “ACP”被显示在市场数据线的出价交易所栏中，这意味着 AMEX、CBOE 和 PSE 都对期权提供相同的最高出价 （被显示在出价栏中）。有效的交易所缩写如下：

缩写	交易所
A	AMEX
B	BOX
C	CBOE
I	ISE
P	PSE
X	PHLX

交易所所写总是以黄色被显示。**出价**和**要价**、**出价尺寸**和**要价尺寸**传达了以下信息：

颜色	描述
YELLOW	黄色表示价格或尺寸无变化。
GREEN	绿色表示价格或尺寸的向上变动。
ORANGE	橙色 （或红色）表示表示价格或尺寸的向下变动。
PURPLE	紫色表示最优价格不会自动地在任何显示的交易所执行。

智能路径不保证您的定单将在显示的最优价格执行。我们以紫色显示价格来表示一些交易所不在最优价格自动地执行，您的定单可能以不同的价格执行。然而，自动执行的可用性按每个最小报价跳动单位来更新。

Note: ISE 总是自动地执行，但可能并不总是提供最优价格，并且可能在快速市场中放慢其执行时间。

要获取关于定单传递和智能定单传递的更多细节，参见 IB 网站上的客户协议。

理解系统颜色

引言

应用程序使用彩色的文本和背景来传达关于市场变动、定单目的地和定单状态的信息。颜色被用在所有发送和接收数据的屏幕上，包括交易屏幕、市场深度窗口和套利表。文本颜色的意思在所有屏幕中都是一致的。有关系统颜色的信息被分类为以下几个部分：

- 文本颜色
- 市场数据线背景颜色
- 定单管理行背景颜色
- 定单状态颜色

文本颜色

屏幕黑色背景上的彩色文本被用来表示价格和数量的向上和向下变动，以及定单目的地信息。

颜色	描述
YELLOW	黄色表示尺寸或价格无变化。
GREEN	绿色表示尺寸或价格的向上变动。
ORANGE	橙色 （或红色）表示表示尺寸或价格的向下变动。
PURPLE	对期权，以紫色显示的价格表示最优价格在显示的一个或多个交易所不会自动地执行。
MAGENTA	品红色 — 对市场间差价定单，表示定单的内在价格。
BLUE	浅蓝色表示这是合约交易的最后价格。

页面标签文本颜色从黑色变为红色来表示页面显示地资产，已经有一笔定单被提交。

市场数据线背景颜色

颜色	描述
	贯穿整条市场数据线的深灰色表示该线被选定。

变动区域行使用背景颜色来表示向上和向下的市场变动。

颜色	描述
	变动栏识别了资产的当前价格相比前一个交易日的收盘价格的变动程度和方向。 变动区域中的红色背景表示当日的变动为负。
	变动区域中的蓝色背景表示当日的变动为正。

Note: 当日变动数据是基于前一日下午 4 点 （东部时间）的收盘价格的。

定单管理行背景颜色

颜色	描述
	行动区域中的蓝色背景表示买入行动。
	行动区域中的红色背景表示卖出行动。
	贯穿整条定单管理行的浅棕色表示您已经修改了一笔工作中的定单，但还没有重新提交该定单。

定单状态颜色

定单管理行的状态区域中的颜色表示了您的定单状态。

颜色	描述
	浅灰色表示您正处于创建定单的进程中且您还没有传递它。
	浅蓝色表示您已经传递了您的定单，但还没有收到其已经被定单目的地接受的确认。
	淡紫色表示定单已经被系统 （模拟定单）或交易所 （天然定单）接受，但由于系统、交易所或其他原因，当前定单是不工作的。当定单变为活动的，定单状态颜色将相应地变化。
	深蓝色表示定单已经被系统 （模拟定单）或交易所 （天然定单）接受，且该定单等待被选择。定单状态保持为深蓝色直到选择标准被满足。在那时定单被触发，定单状态颜色将相应地变化。
	绿色表示您的定单已经被接受且正在定单目的地工作。 当您显示 *可卖空*市场数据栏时，该颜色表示至少 1000 股可用于卖空。
	深绿色被用在 *可卖空*栏中，表示该合约能够被卖空，除非在无股数可用于卖空的时候，并且系统正在搜索股数。
	品红色表示您已经发送了请求来取消定单，但还没有从定单目的地收到取消确认。在该时点，您的定单不被确认为取消的。当您的取消请求等待处理时，您可能还会收到执行。
	焦橙色表示取消请求已经被系统接受，但由于系统、交易所或其他原因，当前请求没有被确认。在该时点，您的定单不被确认为取消的。当您的取消请求等待处理时，您可能还会收到执行。
	红色表示您的定单余额已经被系统确认为取消的。当目的地拒绝了您的定单时，这可能会意外地发生。 在 *可卖空*栏中，红色表示无股数可用于卖空。 一旦定单被确认为取消的定单管理行将于 30 秒之后从您的交易屏幕消失。请参见客户协议来获取关于定单确认和定单取消的进一步信息。
	褐红色表示附加的模拟定单类型已经被系统接受，并等待被选择。定单被持有在 IB 系统中 （状态保持为褐红色）直到选择标准被满足。在定单被传递至指定的定单目的地的时候，定单状态颜色将相应地变化。

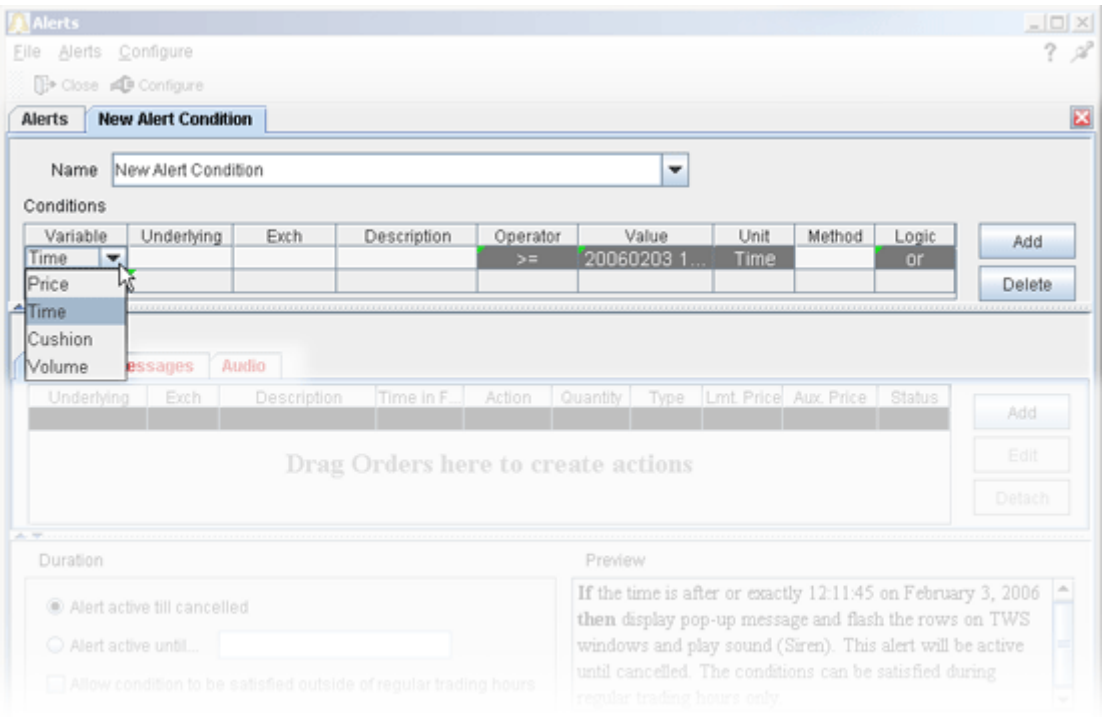
警报和通知

引言

- 设定时间警报
- 设定价格警报
- 设定保证金警报
- 设定交易量警报
- 设定基于执行的警报
- 将行动分配给警报
- 设定价格移动警钟
- 设定交易量变化激活警钟

设定时间警报

警报窗口由两个部分组成。第一个是*条件*区域，在这里您定义必须被满足用来激活警报的条件。第二个是*行动*区域，在这里您定义当条件被满足时将发生的行动。根据价格变动、时间和日期、交易量或者您的保证金缓冲状态来创建警报。警报行动包括在您的交易屏幕上发送一个诸如弹出消息的通告、电子邮件或文本消息，或者发起一笔定单，确切地说为买入或卖出定单。



设定时间警报

1. 在**视图**菜单上选择*警报*。
   - 如果您已经在警报框中，点击**警报**标签来进入*新建*按钮。根据以下第 2 步继续。
2. 点击*新建*按钮，并在*名称*方框中输入一个描述标题。< 未命名 > 标签将采用您输入的名称。
3. 通过点击*添加*按钮，在*条件*区域中定义一项资产。
4. 开始设定警报条件，方法是在**创建条件**框的*选择条件*部分中选择*时间*，然后点击*下一步*。
5. 在*配置时间条件*页面上使用操作符区域，从 “大于等于” 或 “小于等于” 中选择。
6. 在**时间**区域中，设定时间和日期。使用日历日期 / 时间选择器来容易地选择并确保格式是正确的。
7. 要定义多个条件，从逻辑下拉列表中选择*添加*或者*或*，然后遵照上面的第 3 — 6 步在下一行上添加另一份合约。

您的警报条件被描述在窗口右下角的**预览**框中。

现在，指定警报将触发的行动。您能够从电子邮件、短消息、弹出消息和听觉警报中选择，并选择让一笔定单被触发。

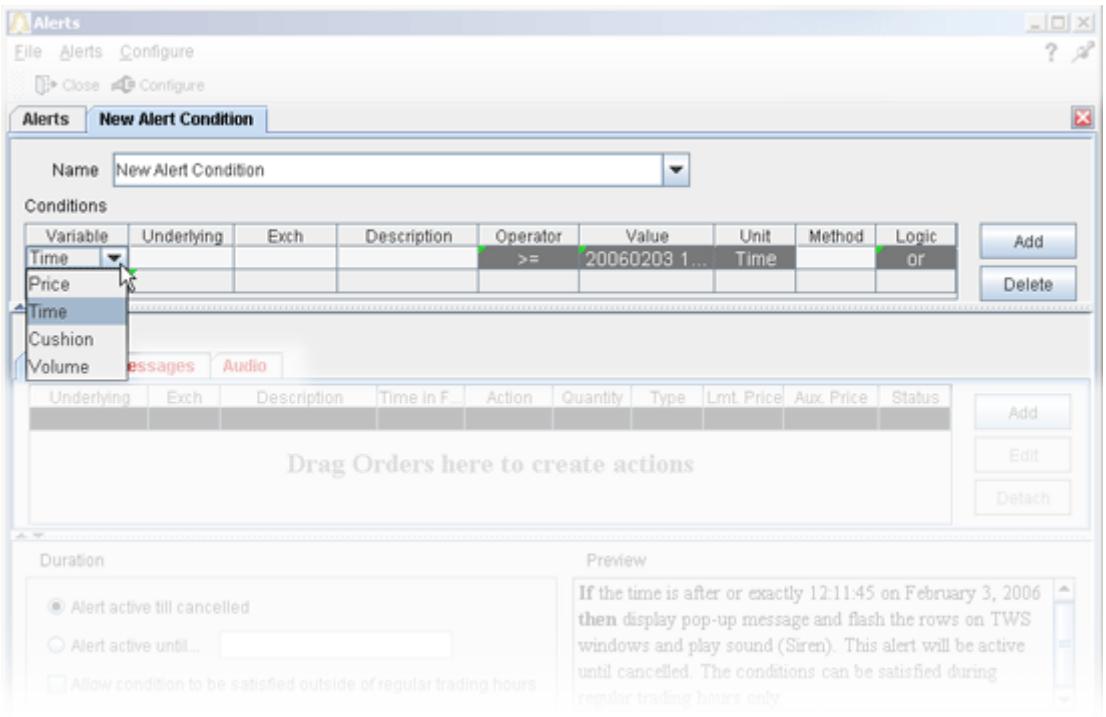
警报持续时间

默认情况下，警报将保持为活动的直到您取消它。您能够选择让警报在整个特定的日期和时间保持为活动的，方法是选定警报活动直到……并以格式 YYYYMMDD hh:mm:ss 设定一个日期。

如果您想要条件能够在常规交易时间之外触发，选中 “**允许条件被满足……**” 方框。

设定价格警报

警报窗口由两个部分组成。第一个是*条件*区域，在这里您定义必须被满足用来激活警报的条件。第二个是*行动*区域，在这里您定义当条件被满足时将发生的行动。根据价格变动、时间和日期、交易量或者您的保证金缓冲状态来创建警报。警报行动包括在您的交易屏幕上发送一个诸如弹出消息的通告、电子邮件或文本消息，或者发起一笔定单，确切地说为买入或卖出定单。



设定价格警报

1. 在**视图**菜单上选择*警报*。
   - 如果您已经在警报框中，点击**警报**标签来进入*新建*按钮。根据以下第 2 步继续。
2. 点击*新建*按钮，并在*名称*方框中输入一个描述标题。< 未命名 > 标签将采用您输入的名称。
3. 通过从您的交易屏幕中拖动和放下，或者点击*添加*按钮，在*条件*区域中定义一项资产。
4. 开始设定警报条件，方法是在**创建条件**框的*选择条件*部分中选择*价格*，然后点击*下一步*。
5. 在*配置价格条件*页面上，如果您有空白的区域，那么输入一个底层证券，并选择剩余的工具描述参数，包括工具类型和交易所。
6. 从**方式**下拉列表中选择一个触发方式。
7. 在**操作符**区域中，从 “大于等于” 或 “小于等于” 中选择。

8 在**价格**区域中，输入一个将被上面定义的操作符用作行动根据的价格，然后点击*完成*按钮。

9 要定义多个条件，从逻辑下拉列表中选择*添加*或者*或*，然后遵照上面的第3－8步在下一行上添加另一份合约。

您的警报条件被描述在窗口右下角的**预览**框中。

现在，指定警报将触发的行动。您能够从电子邮件、短消息、弹出消息和听觉警报中选择，并选择让一笔定单被触发。

警报持续时间

默认情况下，警报将保持为活动的直到您取消它。您能够选择让警报在整个特定的日期和时间保持为活动的，方法是选定警报活动直到……并以格式 YYYYMMDD hh:mm:ss 设定一个日期。

如果您想要条件能够在常规交易时间之外触发，选中“**允许条件被满足……**”方框。

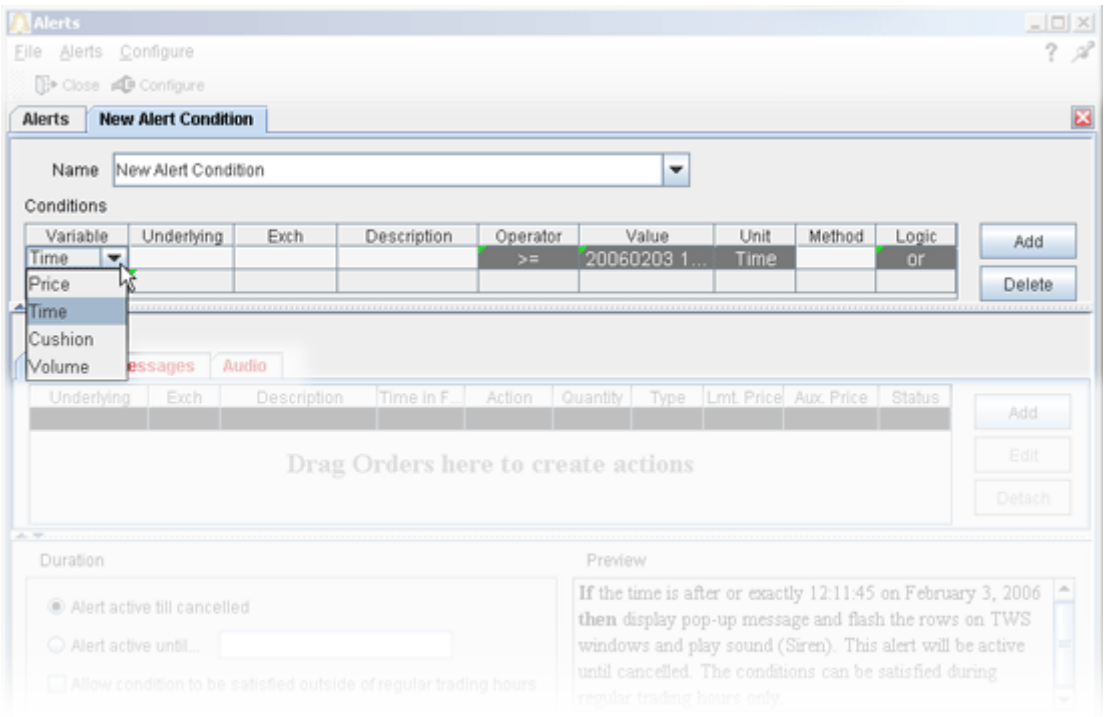
设定保证金警报

警报窗口由两个部分组成。第一个是*条件*区域，在这里您定义必须被满足用来激活警报的条件。第二个是*行动*区域，在这里您定义当条件被满足时将发生的行动。根据价格变动、时间和日期、交易量或者您的保证金缓冲状态来创建警报。警报行动包括在您的交易屏幕上发送一个诸如弹出消息的通告、电子邮件或文本消息，或者发起一笔定单，确切地说为买入或卖出定单。

保证金警报

保证金警报根据的是 IB 计算的 “保证金缓冲”，它是使用来自您账户的当前价值推导出来的。您能够在交易屏幕上找到这些值。保证金缓冲的计算如下：

（含贷款价值的权益－维持保证金）/ 净清算价值



创建保证金缓冲警报

1. 在**视图**菜单上选择*警报*。
   - 如果您已经在警报框中，点击**警报**标签来进入*新建*按钮。根据以下第 2 步继续。
2. 点击*新建*按钮，并在*名称*方框中输入一个描述标题。< 未命名 > 标签将采用您输入的名称。
3. 通过从您的交易屏幕中拖动和放下，或者点击*添加*按钮，在*条件*区域中定义一项资产。
4. 开始设定警报条件，方法是在**创建条件**框的*选择条件*部分中选择*缓冲*，然后点击*下一步*。

5 在**操作符**区域中，从“大于等于”或“小于等于”中选择。

6 在**缓冲**（%）区域中，输入一个将被上面定义的操作符用作行动根据的百分比值，然后点击*完成*按钮。

7 要定义多个条件，从逻辑下拉列表中选择*添加*或者*或*，然后遵照上面的第 3 － 6 步在下一行上添加另一份合约。

您现在能够以消息、定单行动或声音通告的形式，将行动分配给警报。

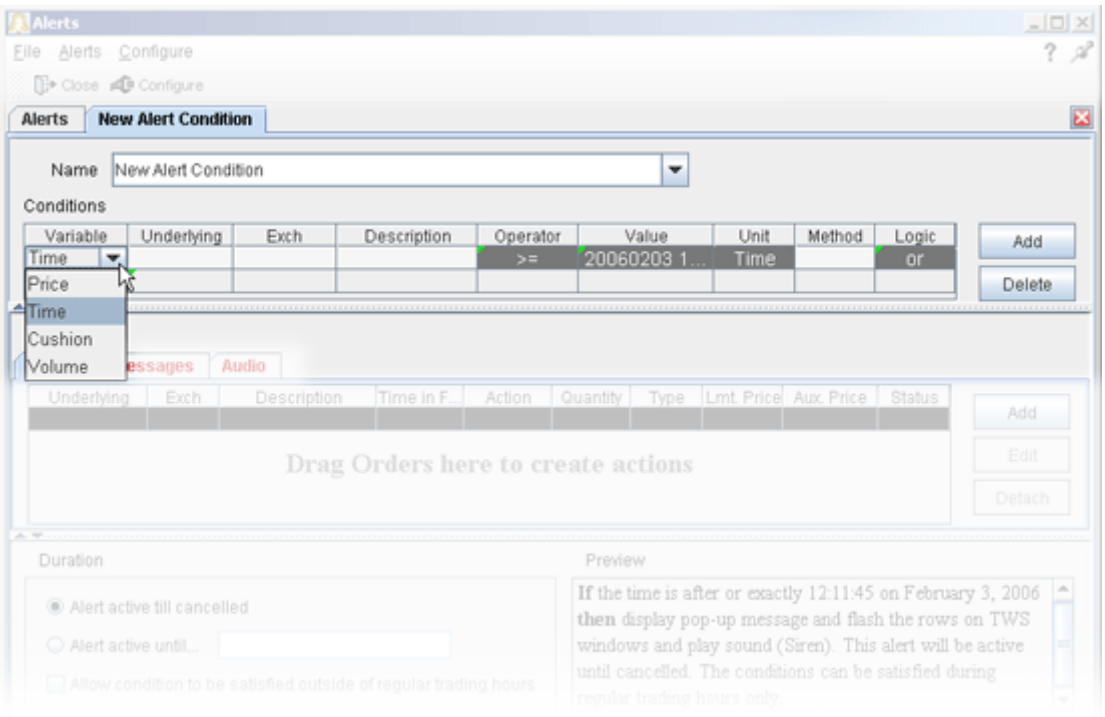
警报持续时间

默认情况下，警报将保持为活动的直到您取消它。您能够选择让警报在整个特定的日期和时间保持为活动的，方法是选定警报活动直到……并以格式 YYYYMMDD hh:mm:ss 设定一个日期。

如果您想要条件能够在常规交易时间之外触发，选中“**允许条件被满足……**”方框。

设定交易量警报

警报窗口由两个部分组成。第一个是*条件*区域，在这里您定义必须被满足用来激活警报的条件。第二个是*行动*区域，在这里您定义当条件被满足时将发生的行动。根据价格变动、时间和日期、交易量或者您的保证金缓冲状态来创建警报。警报行动包括在您的交易屏幕上发送一个诸如弹出消息的通告、电子邮件或文本消息，或者发起一笔定单，确切地说为买入或卖出定单。



设定交易量警报

1. 在**视图**菜单上选择*警报*。
   - 如果您已经在警报框中，点击**警报**标签来进入*新建*按钮。根据以下第 2 步继续。
2. 点击*新建*按钮，并在*名称*方框中输入一个描述标题。< 未命名 > 标签将采用您输入的名称。
3. 通过从您的交易屏幕中拖动和放下，或者点击*添加*按钮，在*条件*区域中定义一项资产。
4. 开始设定警报条件，方法是在**创建条件**框的*选择条件*部分中选择*交易量*，然后点击*下一步*。
5. 在*配置交易量条件*页面上，如果您有空白的区域，那么输入一个底层证券，并选择剩余的工具描述参数，包括工具类型和交易所。
6. 在**操作符**区域中，从“大于等于”或“小于等于”中选择。
7. 在**交易量**区域中，输入一个将被上面定义的操作符用作行动根据的交易量值，然后点击*完成*按钮。

8 要定义多个条件，从逻辑下拉列表中选择*添加*或者*或*，然后遵照上面的第 3 － 7 步在下一行上添加另一份合约。

您的警报条件被描述在窗口右下角的**预览**框中。

现在指定警报将触发的行动。

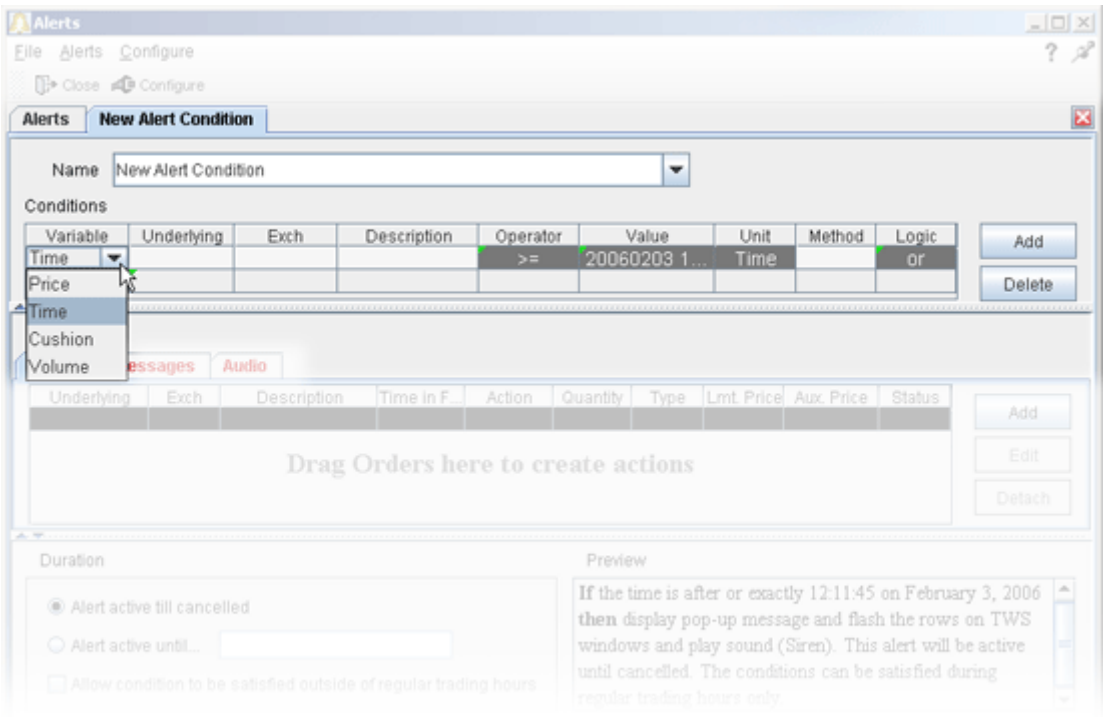
警报持续时间

默认情况下，警报将保持为活动的直到您取消它。您能够选择让警报在整个特定的日期和时间保持为活动的，方法是选定警报活动直到……并以格式 YYYYMMDD hh:mm:ss 设定一个日期。

如果您想要条件能够在常规交易时间之外触发，选中 “**允许条件被满足……**” 方框。

设定基于执行的警报

警报窗口由两个部分组成。第一个是*条件*区域，在这里您定义必须被满足用来激活警报的条件。第二个是*行动*区域，在这里您定义当条件被满足时将发生的行动。根据价格变动、时间和日期、交易量或者您的保证金缓冲状态来创建警报。警报行动包括在您的交易屏幕上发送一个诸如弹出消息的通告、电子邮件或文本消息，或者发起一笔定单，确切地说为买入或卖出定单。



设定基于执行的警报

1. 在**视图**菜单上选择*警报*。
   - 如果您已经在警报框中，点击**警报**标签来进入*新建*按钮。根据以下第 2 步继续。
2. 点击*新建*按钮，并在*名称*方框中输入一个描述标题。< 未命名 > 标签将采用您输入的名称。
3. 通过点击*添加*按钮开始定义警报。
4. 开始设定警报条件，方法是在**创建条件**框的*选择条件*部分中选择*交易*，然后点击*下一步*。
5. 在*配置交易量条件*页面上，输入一个底层证券，前提是您只想让警报在特定底层证券的执行上被触发。否则留为任意。
6. 在**交易所**区域中，从下拉列表中选择一个交易所，前提是您只想让警报在特定目的地的执行上被触发。否则，留为任意。

7 在**类型**区域中，选择一个工具类型，前提是您只想让警报在特定工具类型的执行上被触发。否则留为任意。点击*完成*按钮。

8 要定义多个条件，从逻辑下拉列表中选择*添加*或者*或*，然后遵照上面的第 3 － 7 步在下一行上添加另一份合约。

您的警报条件被描述在窗口右下角的**预览**框中。

现在指定警报将触发的行动。

警报持续时间

默认情况下，警报将保持为活动的直到您取消它。您能够选择让警报在整个特定的日期和时间保持为活动的，方法是选定警报活动直到……并以格式 YYYYMMDD hh:mm:ss 设定一个日期。

如果您想要条件能够在常规交易时间之外触发，选中 “**允许条件被满足……**” 方框。

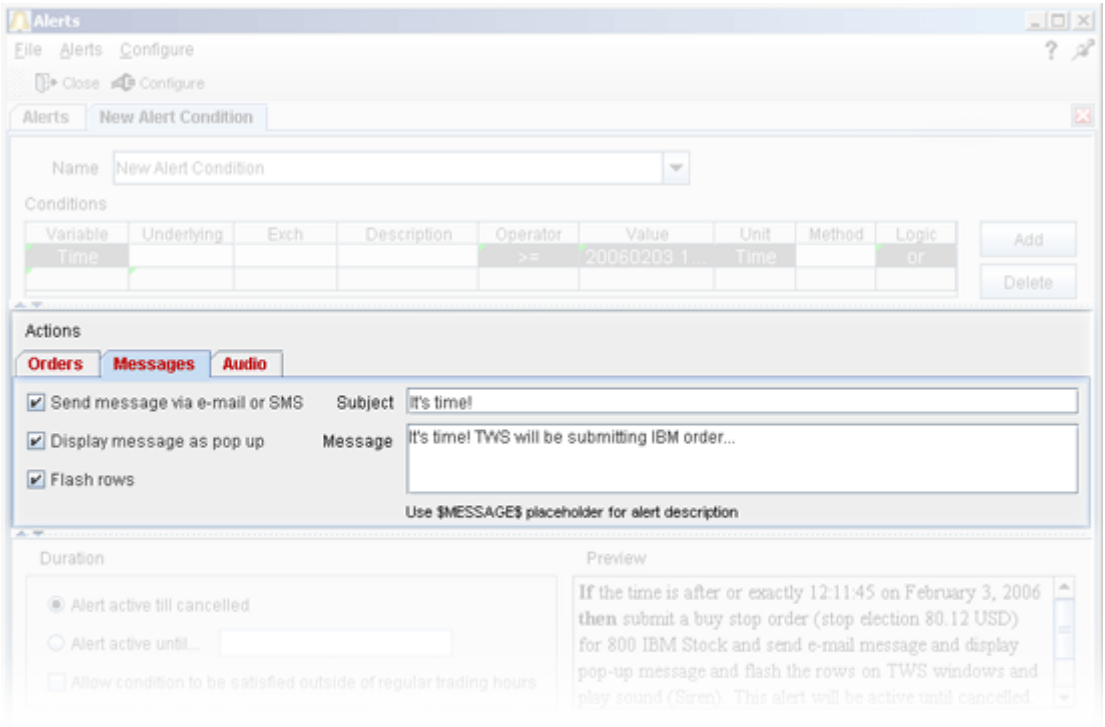
要让警报对相同底层证券的多个执行保持为活动的，选中*可重复*方框。

将行动分配给警报

- 将消息行动分配给警报
- 将定单行动分配给警报
- 将声音行动分配给警报
- 将声音分配给事件
- 更改事件的通知声音

将消息行动分配给警报

使用*行动*来定义当您的警报触发时应当发生什么。**消息**标签允许您创建电子邮件和短消息，在您的交易窗口上显示弹出消息（您创建的！），并指示市场数据行闪烁。



将电子邮件行动分配给警报

1. 在*行动*部分中点击**消息**标签并选中*将消息作为电子邮件发送*。在*主题*区域中输入您的注释标题，在*消息*框中输入您的电子邮件。
   - 当您创建您的账户时指定的电子邮件地址，是将要被使用的地址。
2. 在*预览*框中审查您的警报，然后点击**激活**来加载警报。

将短消息行动分配给警报

1. 在 IB 网站上通过账户管理注册您的短消息地址。

a 使用**登录**菜单来进入*账户管理*。

b 使用您的 IB 用户名和密码登录到账户管理。

c 在**交易使用**下，选择*警报通知*。

d 在*警报偏好*中，选择**短消息地址**来指示警报电子邮件功能，通过文本消息将您的警报发送至您的移动电话或 PDA。

2 在*行动*部分中点击**消息**标签，并选中*将消息作为电子邮件发送*。在*主题*和*消息*框中键入您的注释。

3 在*预览*框中审查您的警报，然后点击**激活**来加载警报。

将弹出消息行动分配给警报

1 在*行动*部分中，点击**消息**标签并选中*将消息作为弹出窗口显示*。

2 在*消息*框中键入您的注释。

3 在*预览*框中审查您的警报，然后点击**激活**来加载警报。

- 当警报触发，包含您的消息的弹出窗口将在交易窗口顶部打开。

闪烁行作为一种警报行动

1 在*行动*部分中，点击**消息**标签并选中*闪烁行*。

2 在*预览*框中审查您的警报，然后点击**激活**来加载警报。

- 当警报触发时，交易窗口上相关的市场数据行将闪烁来通知您。
- 您还能够指示您的警报来提交定单，或者播放声音。

将定单行动分配给警报

使用*行动*来定义当您的警报触发时应当发生什么。**定单**标签允许您从您的交易屏幕拖动定单，它们将在相关的警报触发时被提交。

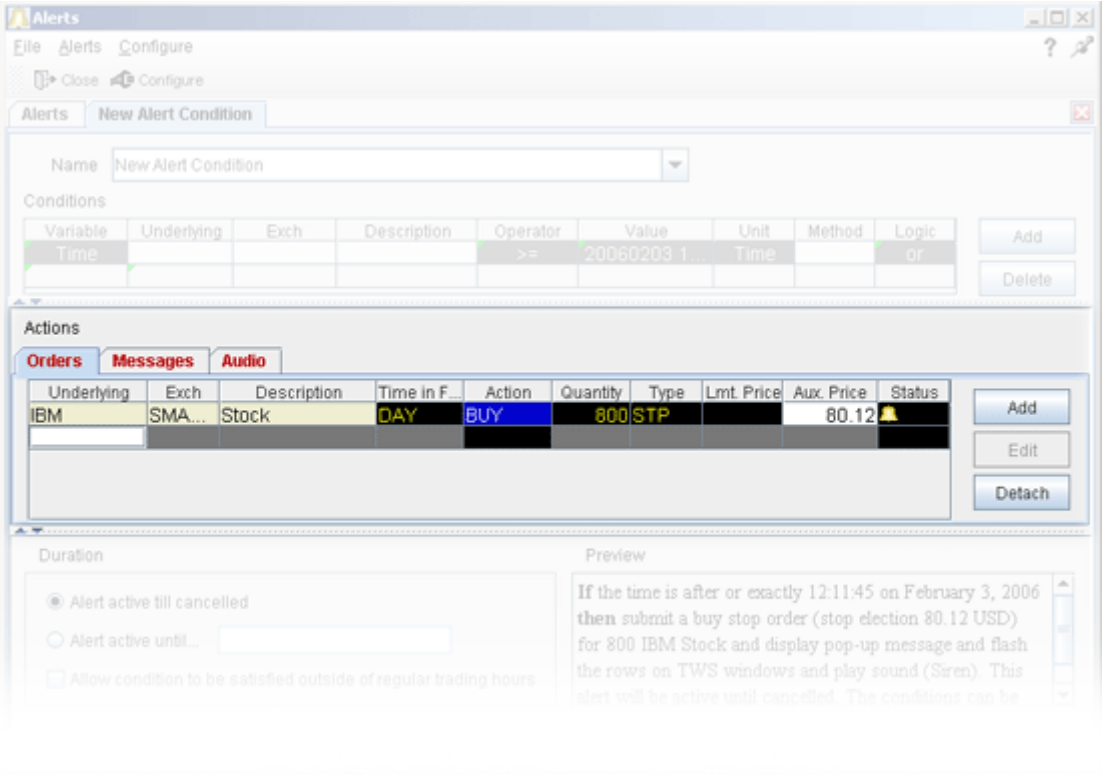
将定单行动分配给警报

1 在*行动*部分中，点击**定单**标签。

2 将定单从交易屏幕拖动到定单面板中。

- 您还能够通过如下方法创建定单：在底层证券区域中键入代码并使用合约选择框来确定合约。买入定单被自动地创建给合约。使用行动下拉选择区域来更改为卖出定单。

3 修改定单参数。当警报标准被满足时定单将被传递。



- 您还能够指示您的警报来发送消息，或者播放声音。

将声音行动分配给警报

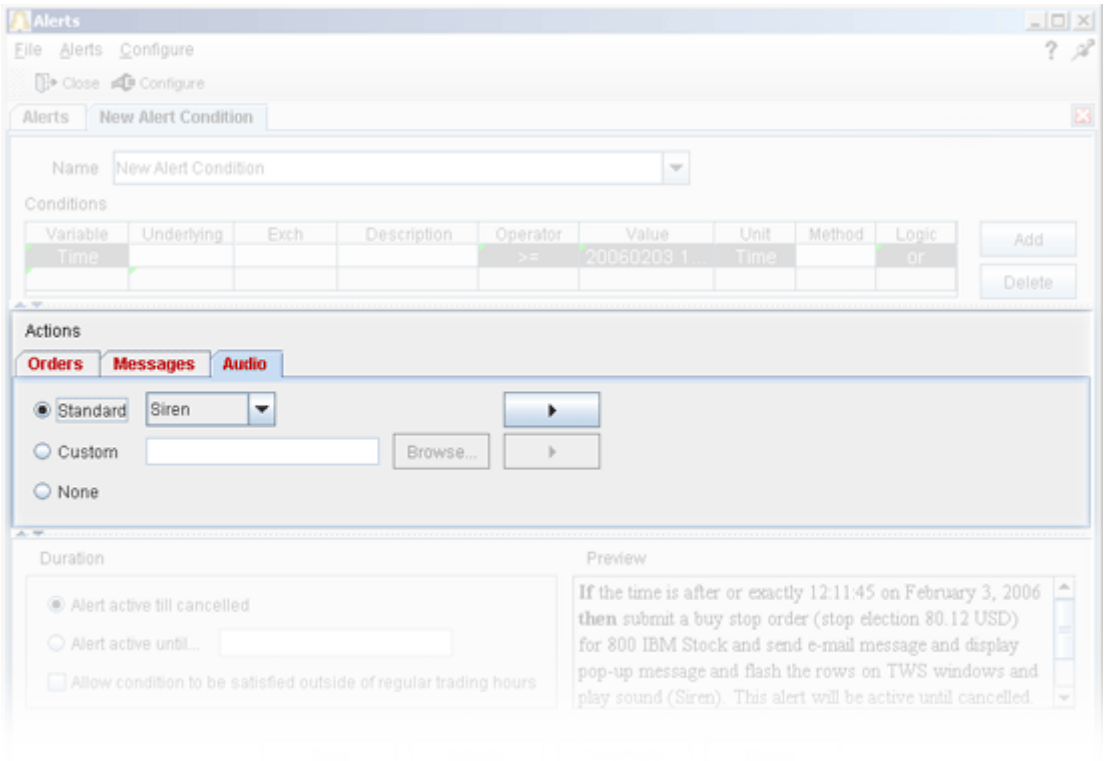
使用*行动*来定义当您的警报触发时应当发生什么。**声音**标签允许您将声音分配给警报。

将声音分配给警报

1 在*行动*部分中，点击声音标签。

2 选择一个单选按钮：

- **a** 选择**标准**来使用下拉列表分配系统声音。
- **b** 选择**客户化**来分配您自己的 .wav 文件声音。
- **c** 选择**无**来关闭任何听觉警报。



警报持续时间

默认情况下，警报将保持为活动的直到您取消它。您能够选择让警报在整个特定的日期和时间保持为活动的，方法是选定警报活动直到……并以格式 YYYYMMDD hh:mm:ss 设定一个日期。

如果您想要条件能够在常规交易时间之外触发，选中 “**允许条件被满足……**” 方框。

您还能够设定警报行动来提交定单，或者发送消息。

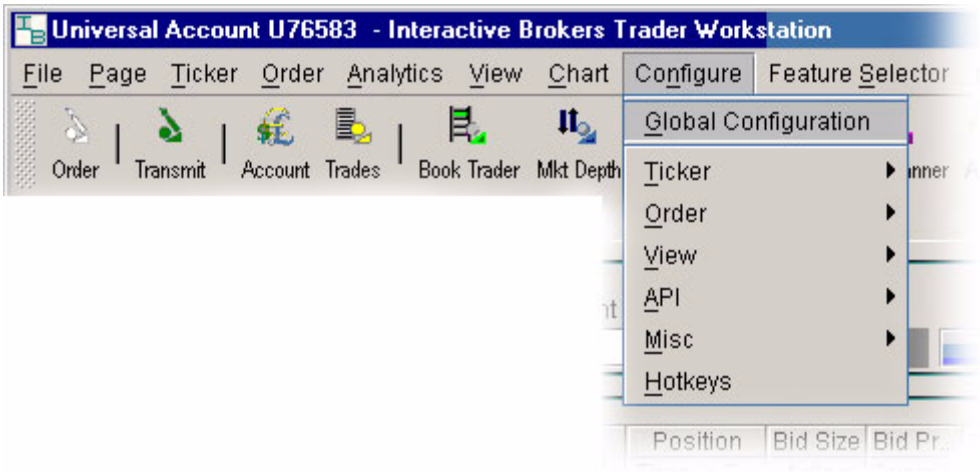
将声音分配给事件

使用**声音管理器**来修改被分配给交易事件的声音。

Note: 要在您的计算机上听见除蜂鸣音以外的声音，您必须安装声卡。

配置声音管理器

1 在**配置**菜单上选择*全局配置*。



2 在左侧窗格中点击*声音管理器*。

3 在**事件**下拉列表中，选择您想要更改声音的事件。

4 不要选择**使用默认声音**。

5 在**声音样本路径**区域中，输入一个到.wav 声音文件的路径，或者使用浏览器按钮来定义一个.wav 声音文件的路径。

选择您想要声音在被唤起时重复的次数。

更改事件的通知声音

您能够使用**声音管理器**来选择一个新的声音文件，并更改用于特定的定单事件的默认蜂鸣音，包括价格变动警报和“执行”通告。

更改事件的默认声音

1 在**配置**菜单中选择*全局配置*。

2 在左侧窗格中点击*声音管理器*。

3 在**事件**下拉列表中，选择您想要更改默认声音的事件。

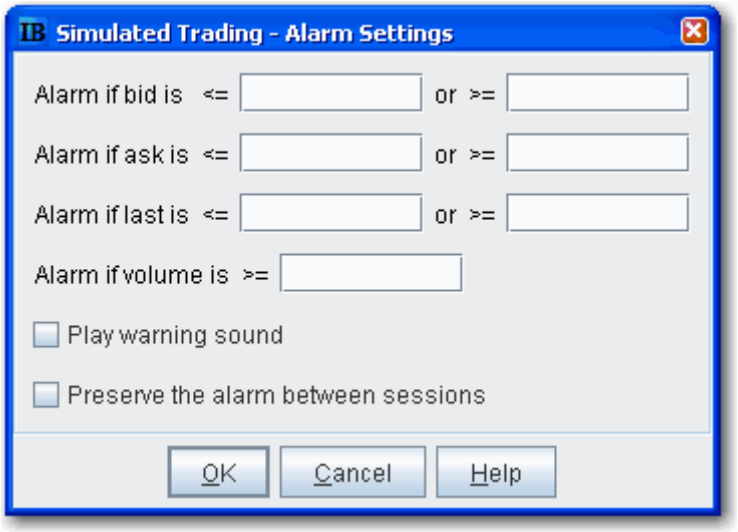
4 不要选择**使用默认声音**。

5 在**声音样本路径**区域中，输入一个到您想要使用的 .wav 声音文件的路径，或者点击浏览器按钮来定义到您想要使用的 .wav 声音文件的路径。

设定价格移动警钟

对任何资产，您能够设定一个价格触发的警钟，当被选定资产的价格触及触发值时，该警钟将响起。您能够使用**出价**、**要价**和 / 或**最后价格**区域中的值来作为触发价格。当您的价格被达到时，价格区域和页面标题变为红色并开始闪烁。您还能够设定声音警钟，以蜂鸣音通知您。

Note: 拥有附加的价格激活警钟的每条市场数据线，通常将占用一条实时市场数据线，无论页面是打开的 （活动的）还是关闭的。您只能够收到拥有有限数量的实时市场数据线 （通常为 40 条）的市场数据。



当您退出时，任何您已经设定的警钟将被关闭，除非您选择在会话之间保留它们。要这么做，当您设定警钟时，选择*在会话之间保留警钟*。

设定价格移动警钟

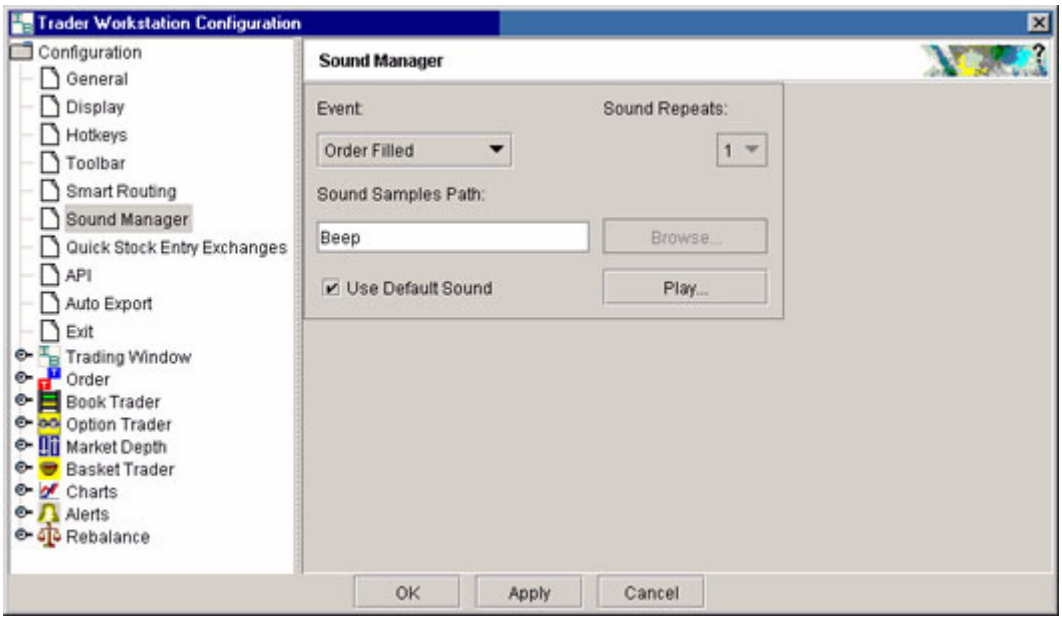
1. 选择您想要对其设定警钟的资产。
2. 点击右键并选择*工具*。然后选择*设定警钟*（或者使用**代码**菜单并选择*设定警钟*）。
3. 在**警钟设定**窗口中，在任意或所有出价、要价和最后价格输入区域中输入一个 “小于” 和 / 或 “大于” 价格。
4. 要设定交易量激活警钟，在**如果交易量大于则发出警钟**区域中，输入一个触发数量。
5. 要添加一个蜂鸣音至图像警钟，选中**播放警告声音**。

例子：如果您在顶行的第二个区域**如果出价大于则发出警钟**，输入一个价格 $40.15，那么当选定的资产的出价大于或等于 $40.15 时，您的警钟将触发。将价格 $40.00 放入第一个区域 （如果出价小于则发出警钟），如果出价等于该价格或跌至其以下时，警钟将触发。

对所有设定了警钟的区域，默认的背景颜色为墨绿色。您能够通过使用版式编辑器来修改背景颜色。

关闭已激活的价格变动警钟

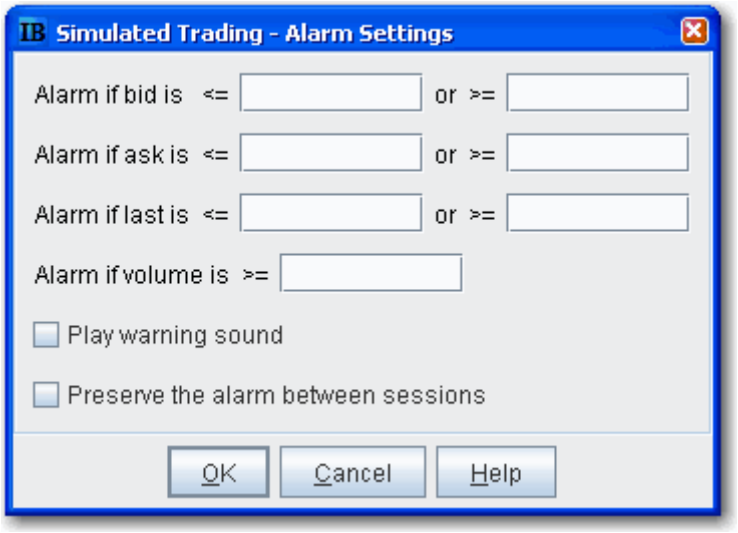
- 点击拥有警钟的资产的市场数据线。



设定交易量变化激活警钟

对任何资产，您能够设定一个交易量变化触发的警钟，当被选定资产的交易量增加了您定义的数额时，该警钟将响起。当交易量增加了您设定的数额时，**交易量**区域和页面标题变为红色并开始闪烁。您还能够设定声音警钟，以蜂鸣音通知您。

Note: 拥有附加的警钟的每条市场数据线，通常将占用一条实时市场数据线，无论页面是打开的 （活动的）还是关闭的。您只能够收到拥有有限数量的实时市场数据线 （通常为 40 条）的市场数据。



当您退出时，任何您已经设定的警钟将被关闭，除非您选择在会话之间保留它们。要这么做，当您设定警钟时，选择*在会话之间保留警钟*。

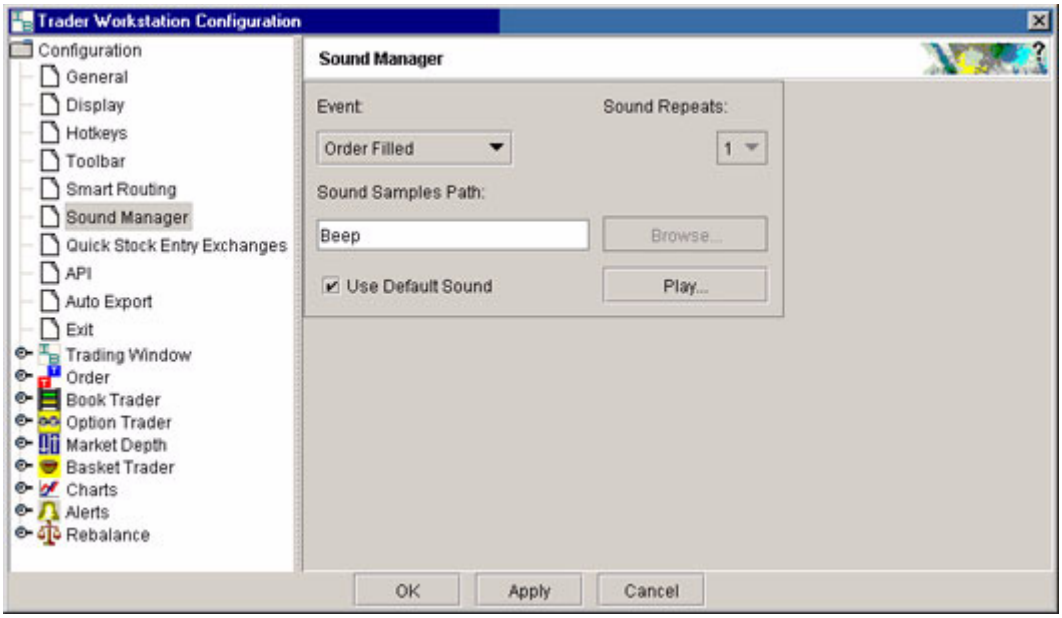
设定交易量变化警钟

1. 选择您想要对其设定警钟的资产。
2. 点击右键并选择*工具*。然后选择*设定警钟*（或者使用**代码**菜单并选择*设定警钟*）。
3. 在**警钟设定**窗口中，在**如果交易量大于则发出警钟**区域中，输入一个触发金额。
4. 要添加一个蜂鸣音至图像警钟，选中**播放警告声音**。

如果您在交易屏幕上显示了交易量区域，您将会看见拥有警钟设定的市场数据线上的默认背景颜色为墨绿色。您能够通过使用版式编辑器来修改背景颜色。

关闭已激活的交易量增加警钟

- 点击拥有警钟的资产的市场数据线。



Note: 要在您的计算机上听见除蜂鸣音以外的声音，您必须安装声卡。

7

价格 / 风险分析

- IB 风险漫游 SM
- IB 风险漫游报告
- 期权分析
- 模型导航
- 指数套利表

IB 风险漫游SM

引言

- 打开 IB 风险漫游
- 使用报告查看器
- 使用报告选择器
- 投资组合相对损益图表
- 创建如果怎样投资组合

打开 IB 风险漫游

IB 风险漫游℠ 显示了您在多种资产类别中的投资组合风险，并允许您查看和进入您的投资组合中的特定的风险部分，例如根据头寸的风险、根据底层证券的风险和根据行业的风险；查看每个报告的希腊字母头寸风险指标；查看风险价值和投资组合统计；根据价格变化 / 波动率变化来测量您的投资组合损益 （从收盘到收盘），以及根据底层证券 / 到期日来测量头寸暴露和希腊字母头寸指标。

IB 风险漫游报告数据每 10 秒钟自动地刷新，并且无论何时定单执行时立刻刷新，对所有定单如此除了*按价格变化和波动率变化测量*报告。该报告使用来自前一个工作日的收盘时的价格，并通过将时间参数提前到下一个工作日收盘时来来计算市场结果风险。

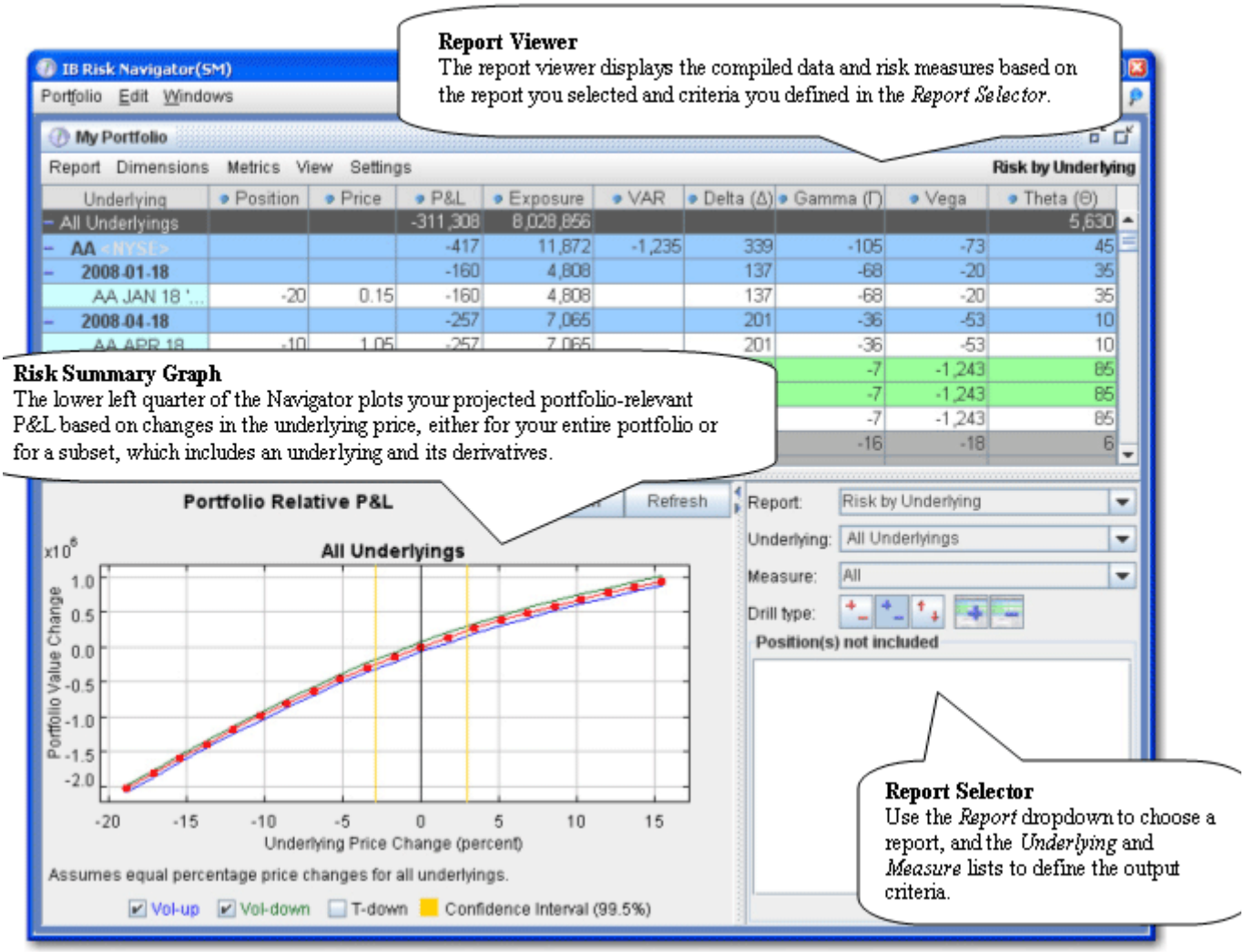
打开 IB 风险漫游

1 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游℠*。

您同样能够从期权交易者进入 IB 风险漫游。

要获取关于使用 IB 风险漫游的特定部分的细节，点击下面的链接：

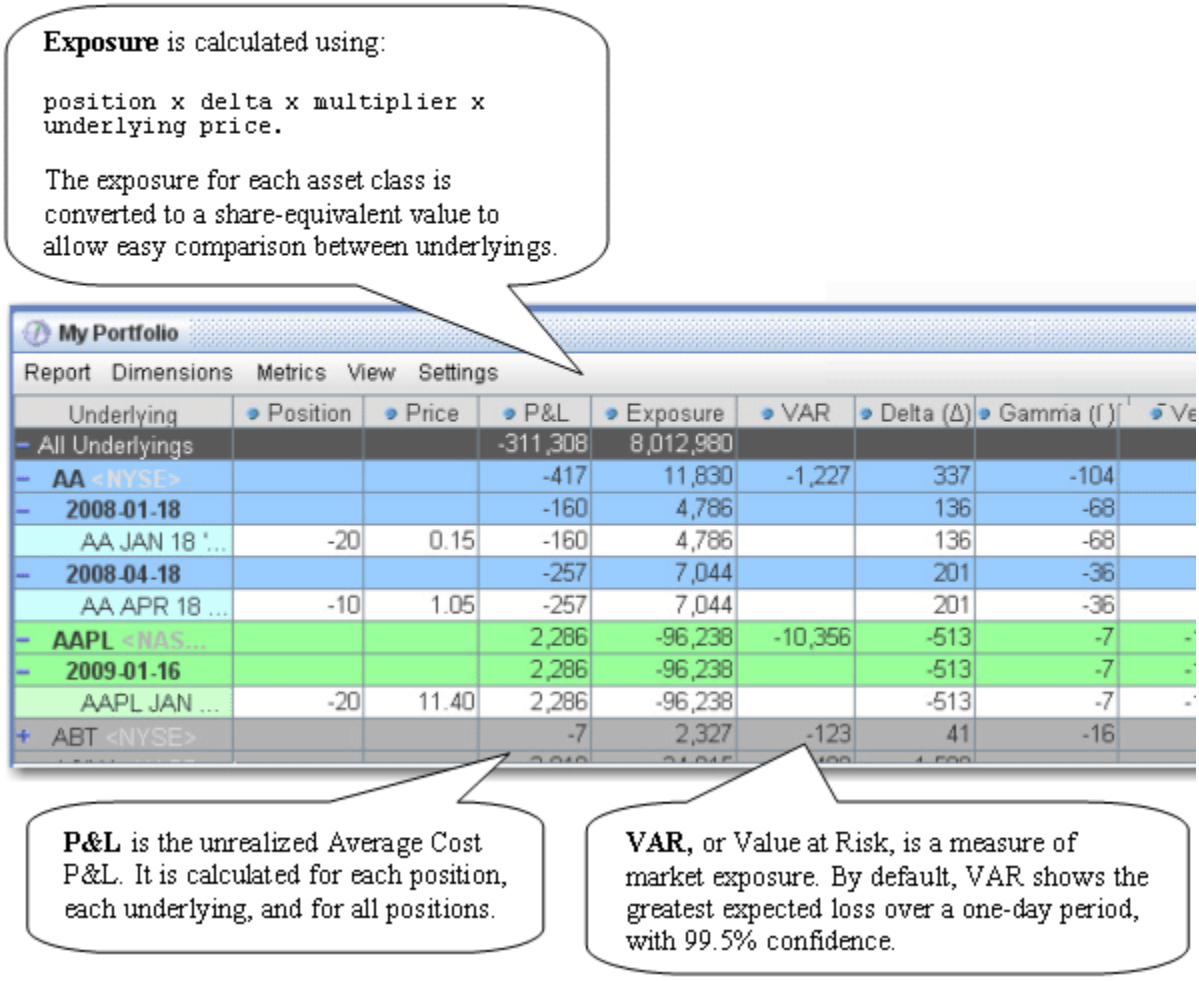
- 报告查看器
- 报告选择器
- 风险总结图表

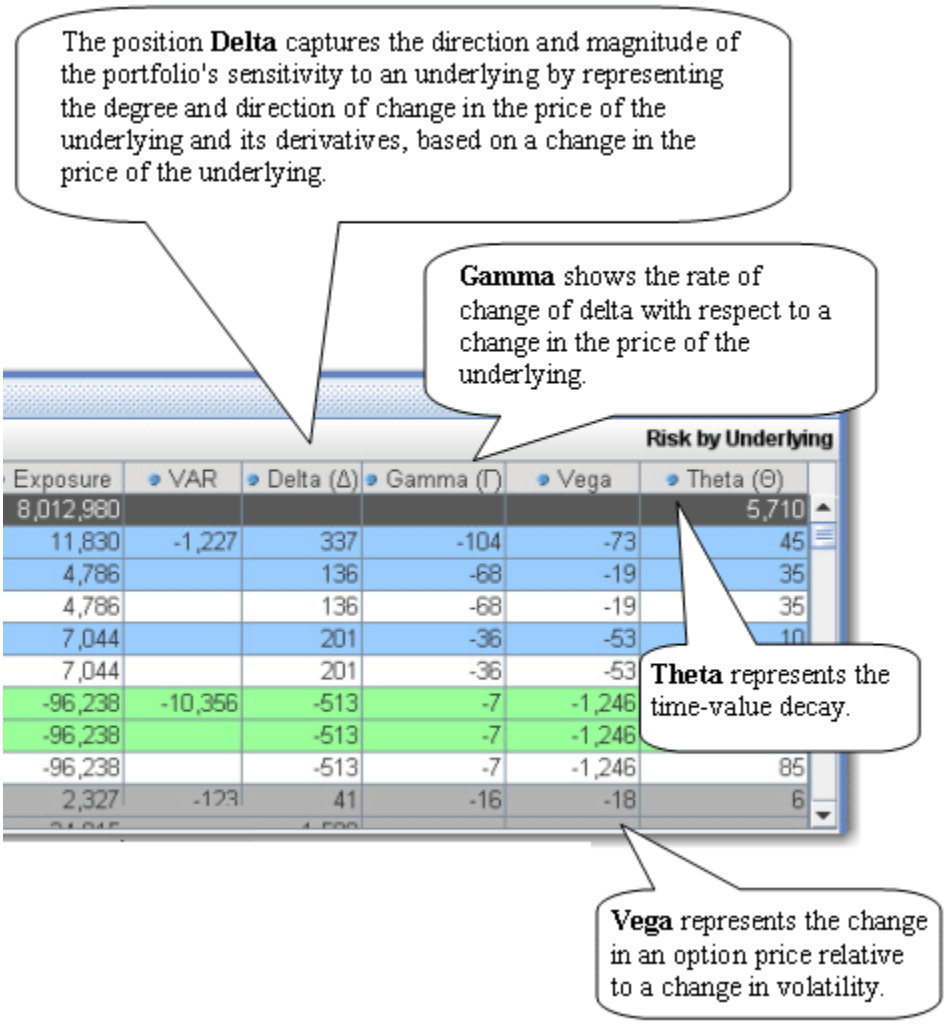

Report Viewer
The report viewer displays the compiled data and risk measures based on the report you selected and criteria you defined in the *Report Selector*.
IB Risk Navigator(SM)
Portfolio Edit Windows
My Portfolio
Report Dimensions Metrics View Settings
Risk by Underlying
Underlying Position Price P&L Exposure VAR Delta (Δ) Gamma (Γ) Vega Theta (Θ)
All Underlyings -311,308 8,028,856 5,630
AA <NYSE> -417 11,872 -1,235 339 -105 -73 45
2008-01-18 -160 4,808 137 -68 -20 35
AA JAN 18 '... -20 0.15 -160 4,808 137 -68 -20 35
2008-04-18 -257 7,065 201 -36 -53 10
AA APR 18 -10 1.05 -257 7,065 201 -36 -53 10
-7 -1,243 85
-7 -1,243 85
-7 -1,243 85
-16 -18 6
Risk Summary Graph
The lower left quarter of the Navigator plots your projected portfolio-relevant P&L based on changes in the underlying price, either for your entire portfolio or for a subset, which includes an underlying and its derivatives.
Portfolio Relative P&L
Refresh
All Underlyings
x10^6
Portfolio Value Change
1.0 0.5 0.0 -0.5 -1.0 -1.5 -2.0
-20 -15 -10 -5 0 5 10 15
Underlying Price Change (percent)
Assumes equal percentage price changes for all underlyings.
Vol-up Vol-down T-down Confidence Interval (99.5%)
Report: Risk by Underlying
Underlying: All Underlyings
Measure: All
Drill type:
Position(s) not included
Report Selector
Use the *Report* dropdown to choose a report, and the *Underlying* and *Measure* lists to define the output criteria.

使用报告查看器

报告查看器显示了您在报告选择器中定义的报告。报告查看器：

- 让您在单个屏幕上查看多种资产类别的投资组合风险指标。指标包括损益、头寸暴露、风险价值和希腊字母。
- 拥有向下钻取进入，让您控制对每种底层证券能够看见细节深度。
- 允许您通过添加、删除和配置栏来客户化视图。
- 让您通过点击栏标题，以升序或降序来按栏排序。首要分类栏显示了一个红色的箭头，向下指的表示降序，向上指的表示升序。





您能够使用指标菜单选项来添加或删除报告中的指标栏。

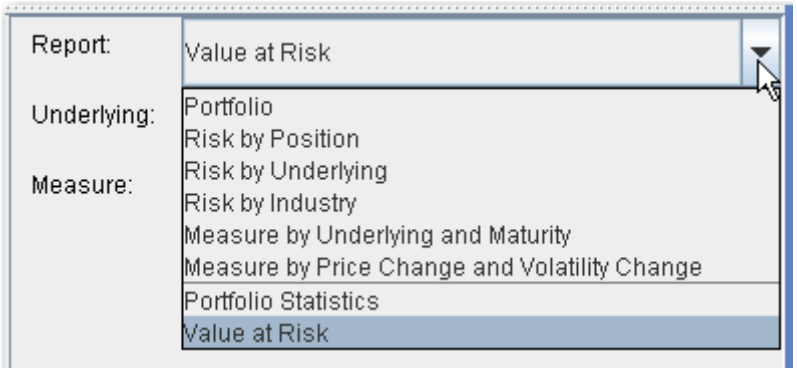
使用报告选择器

报告选择器是您浏览您的风险总结的起始点。从**报告**、**底层证券**和**指标**下拉菜单中选择来构建客户化的报告，对您的整个投资组合或者对包括了底层证券及其衍生品的投资组合子集，报告切分和显示了您的头寸暴露和其他风险指标的不同角度。

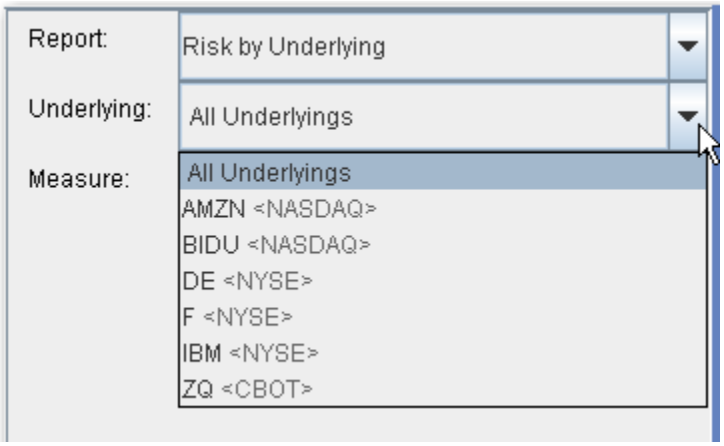
Note: IB 风险漫游在其打开时解析了您的当前头寸，然后它将数据使用在损益图表和报告计算中。任何不能被解析 （出于任何原因 ）的头寸被显示在报告选择器区域的*未被包括的头寸*列表中。如果头寸以黄色被强调，其数据不被包括在损益图表的计算中；如果头寸以桃色被被强调，其数据不被包括在报告计算中；如果其为粉色，那么其数据被同时排除在图表和报告计算之外。如果所有头寸都解析了，该方框将不会出现，除非您选择使用**视图**菜单上的复选框来手动地显示它。

定义您的报告

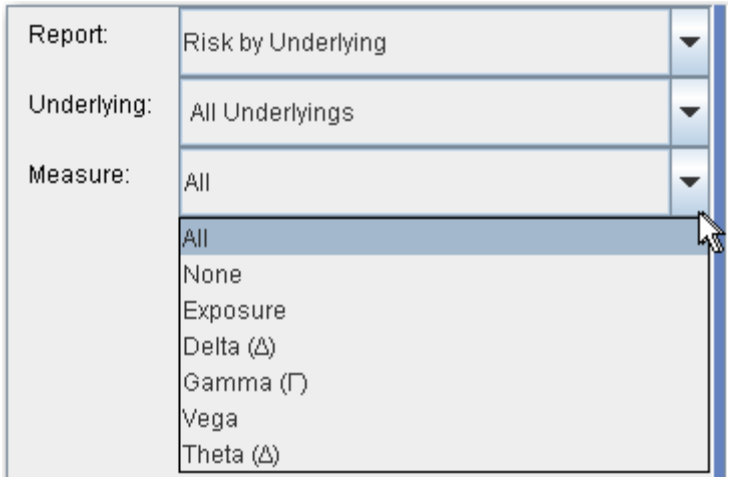
1 使用**报告**下拉列表来选择看待您的风险的视角。每种报告被简要地描述在以下表格中。



2 在**底层证券**列表中，选择是对所有底层证券显示报告数据，还是仅对特定的底层证券及其衍生品显示报告数据。



3 在**指标**下拉列表中，选择*全部*来查看对您的报告可用的所有风险测量计算，选择*无*来只查看那些刻意出现在报告中的指标而不包含额外的指标，或者选择有名称的值来显示单个指标。



要显示多个（但不是全部）指标，例如仅*头寸暴露*和 *Delta*，使用指标菜单上的**希腊字母栏**子菜单。

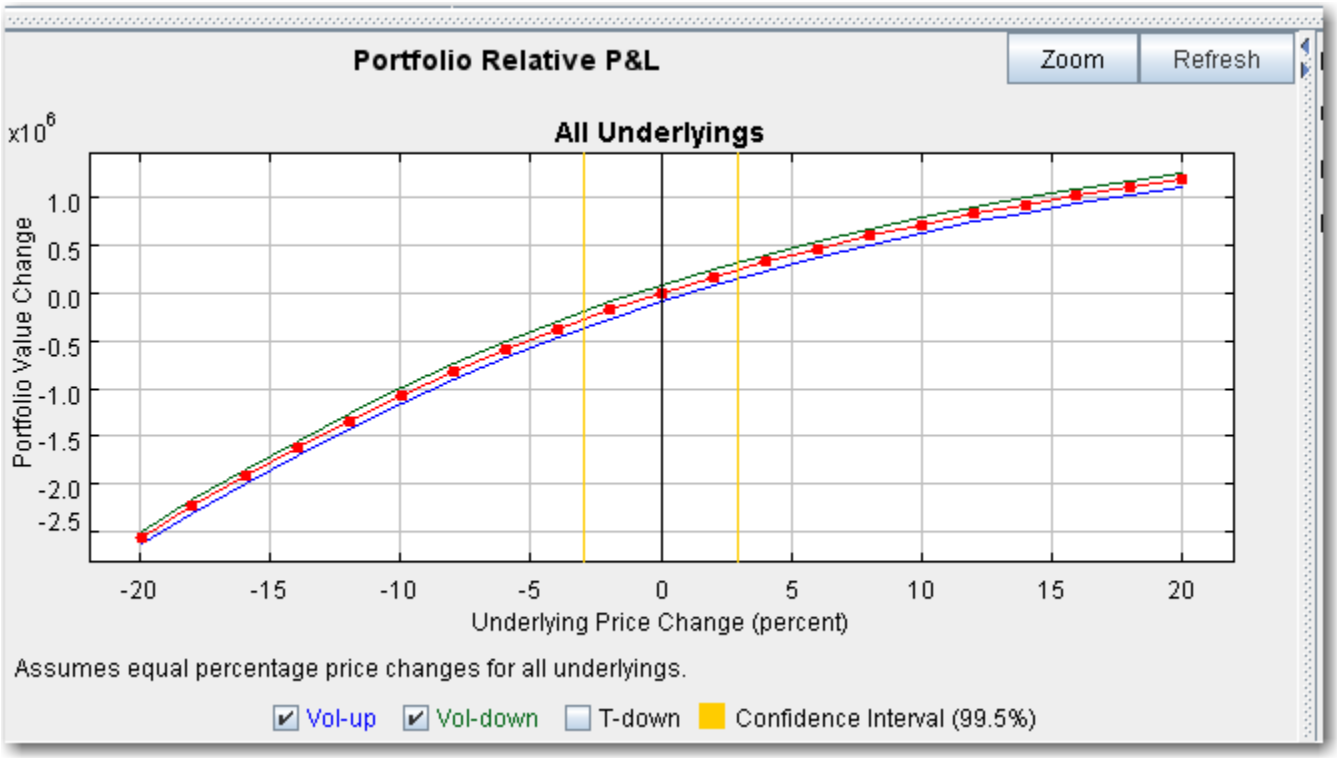
点击一个报告名称来查看报告话题。

报告	
投资组合 — 该报告展示了您的整个投资组合在多种资产类别中的风险和头寸暴露。投资组合视图不显示任何总数，不同于根据底层证券的风险报告。	根据底层证券和到期日的测量 — 该报告显示了在所有资产类别中对所有底层证券的风险测量，按到期日分组。
根据头寸的风险 — 该报告显示了所有资产类别中的风险指标，对每个头寸。	根据底层证券的风险 — 默认的报告。该报告显示了所有资产类别中的投资组合指标，并为每种底层证券提供了向下钻取的深度控制。
根据行业的风险 — 该报告显示了您的投资组合在多种资产类别中的风险和头寸暴露，按行业部门分类。向下钻取细节让您深入两级，对每个行业类别钻取到行业子类别，对每个子类别钻取到底层证券及其衍生品。	根据价格变化和波动率变化的测量 — 该报告在底层证券价格、波动率和利率的多种正、负和零百分比变动的情况下 — 使用任何一个工作日收盘时的底层证券和衍生品价格 — 测量了合约价格、delta、gamma、vega 和 theta 的市场结果。
风险价值 — 该报告显示了投资组合在一天时间当中将遭受的最大损失，置信区间为 99.5%。风险价值使用三种不同的方法被计算，每种对投资组合中的底层证券资产之间的相关系数有不同的假设。	投资组合统计 — 投资组合统计报告显示了两个总结表格：一个是对所有股票和期货头寸的，一个是对所有期权头寸的。

投资组合相对损益图表

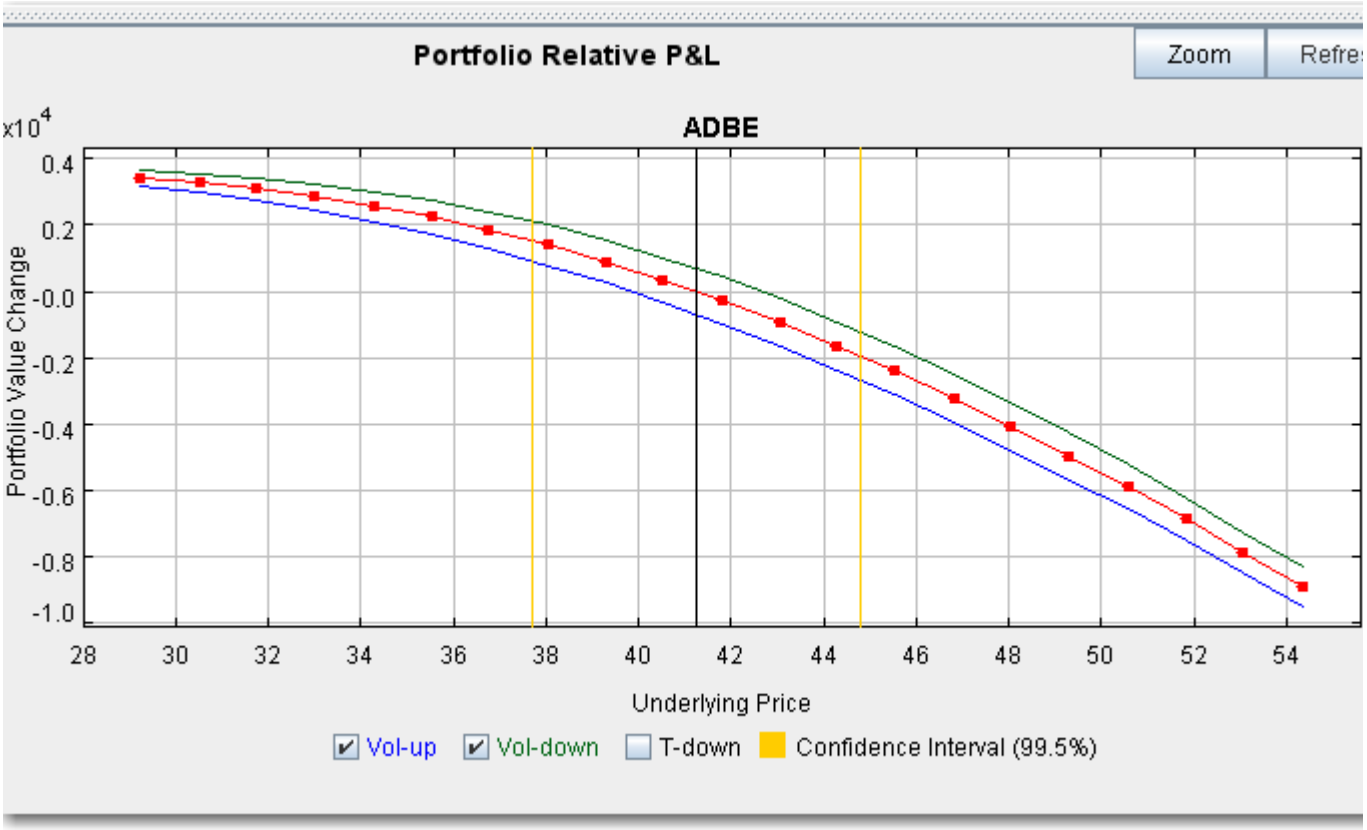
投资组合相对损益图表说明了您的投资组合 （或您的投资组合子集）的总价值将如何根据底层证券的价格百分比变化而变化。

图表 A



图表 A 对您的整个投资组合显示了投资组合相关损益，根据的是从**报告选择器**的*底层证券*列表中选择的值**所有底层证券**。

图表 B



图表 B 对您的投资组合子集显示了投资组合相关损益，包括您在底层证券及其衍生品中的所有头寸，根据的是从**报告选择器**的*底层证券*列表中选择的底层证券。

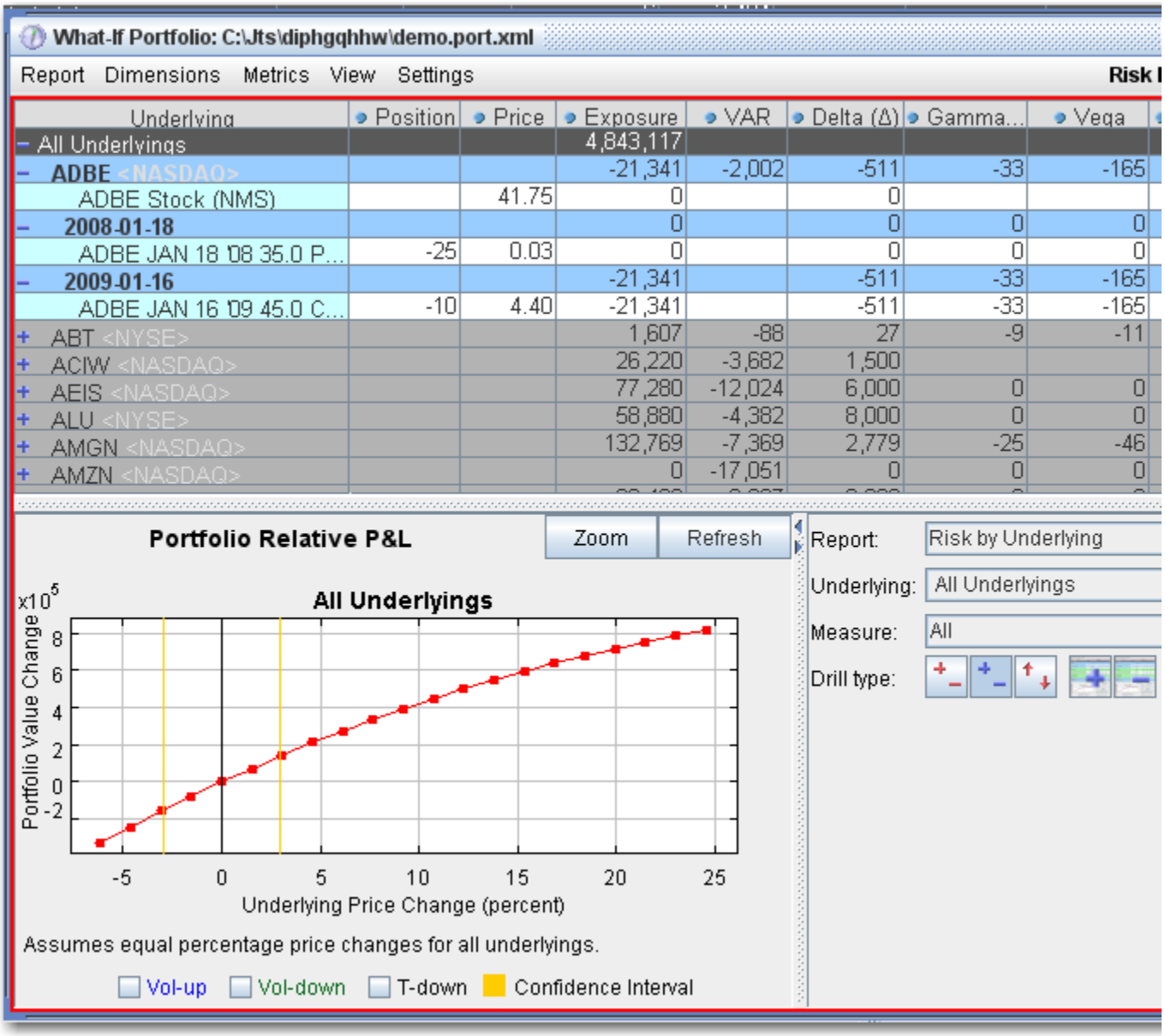
显示在黄色垂直线之间的**置信区间**，以默认的 99.5％的置信水平说明了一天时间内最坏情况下的损失。使用**设置**菜单上的*置信*子命令，在 95％、99％和 99.5％的置信水平之间切换。

使用图表下方的*波动率增加*、*波动率减少*和*时间减少*复选框来查看不同情形下的绘图，从而帮助您观察您的期权头寸中的波动率和时间风险。*波动率增加*将内在波动率以相对变化＊提高 15％；*波动率减少*将内在波动率以相对变化＊降低 15％；而*时间减少*将距离到期日的时间减少了一个日历日。

＊相对百分比变化是通过将当前内在波动率乘以 15％，再将该值添加到当前内在波动率或从当前内在波动率中扣除来计算的。例如，如果期权的当前内在波动率是 10％，15％的相对增加将导致内在波动率变为 11.5％，计算如下：10 ＋ （10 × 0.15）＝ 11.5％。如果期权的当前内在波动率是 42.45％，15％的相对减少将导致内在波动率变为 36.082％，计算如下：42.45 － （42.45 × 0.15）＝ 36.082％。

创建如果怎样投资组合

*如果怎样*投资组合功能让您根据您的真实的投资组合，创建一个可编辑的、假设的投资组合。这允许您查看您的风险状况将如何根据您对您的投资组合作出的更改而变化，包括、关闭、减少或增加头寸。或者建立一个新的假设的投资组合，逐个头寸地查看风险状况是如何随着头寸被添加和修改变化的。*如果怎样*功能让您将新的底层证券从您的交易窗口拖动到投资组合中来“采用”新头寸，并对现有头寸编辑头寸数量。您也能够选择为您的假设的投资组合中的一些或所有合约建立头寸。如果怎样投资组合以红色被标出以便于识别，并在窗口顶部显示**如果怎样**标题。



根据您当前的投资组合创建“如果怎样”情形

1 打开 IB 风险漫游窗口，并在**投资组合**菜单上，选择*新建*。一个新的、空白的如果怎样窗口将打开。

2 在**编辑**菜单上，选择*添加自*。您的当前投资组合是默认的列表值，名为*我的投资组合*。

3 点击**确定**将您的当前投资组合添加到如果怎样窗口。

Note: 这为您的投资组合创建了一个**复本**。您现在能够从您的交易屏幕拖入新的合约，并看到修改您的头寸的结果而无须实际地作出任何更改。

保存 “如果怎样” 投资组合

1 在**投资组合**菜单中选择*另存为*。

2 输入一个文件名并点击*保存*。

重新加载最后保存的版本

使用该命令，将活动的投资组合中的所有值重设为最后**保存的**版本。该命令仅对未保存的文件起作用。未保存的投资组合将在标题末尾显示一个星号 “*”。

1 在**编辑**菜单中选择*从文件加载*。

2 确认您想要通过点击*是*来重新加载文件，并丢失您所有未保存的更改。

从其他投资组合文件中加上 / 减去头寸

1 从活动的投资组合中，在**编辑**菜单中选择*添加*或*去除*。

2 选择一个要加上 / 减去的投资组合。加上 / 减去选项列表仅显示当前打开的投资组合名称。

3 点击**确定**从活动的投资组合中添加或去除投资组合。

- 加上 / 减去功能减去了两个投资组合共有的头寸，并对每个新合约创建一个合约行 （即使头寸为 “0”）。
- 您能够多次加上 / 减去相同的投资组合。当前头寸每次被减去。

从 “如果怎样” 情形中建立头寸

1 选择一个或多个头寸。

2 使用右键点击菜单，选择*添加头寸*来对选定的合约打开头寸，或者选择*添加投资组合*来对您的如果怎样投资组合中的全部合约打开头寸。

IB 风险漫游报告

引言

- 投资组合报告
- 根据头寸的风险报告
- 根据底层证券的风险报告
- 根据行业的风险报告
- 根据底层证券和到期日的测量
- 根据价格变化和波动率变化的测量
- 投资组合统计报告
- 风险价值报告
- 报告中的希腊字母集合
- 市场情形钻取
- 报告指标

投资组合报告

使用**投资组合**报告，对您的投资组合中的所有头寸查看风险和头寸暴露。您能够在根据底层证券的风险报告中，对特定的风险指标 （在可用之处）查看总数。

My Portfolio

Report Dimensions Metrics View Settings

Underlying	Description	Po...	Price	Value	P&L	Exp...	Delta...	Gamma...	Vega
ADBE...	ADBE JAN 16 '09 45.0 ...	-10	3.40	-3,400	743	-18,346	-456	-34	-162
AA	AA JAN 18 '08 30.0 PU...	-20	0.10	-200	-160	4,928	141	-73	-20
<NYSE>	AA APR 18 '08 30.0 PU...	-10	1.05	-1,050	-307	7,306	210	-37	-54
AAPL...	AAPL JAN 16 '09 300.0 ...	-20	11.80	-23,600	1,136	-99,978	-529	-7	-1,274
ABT ...	ABT FEB 15 '08 47.5 P...	-10	0.10	-100	-32	2,733	49	-17	-21
ACIW...	ACIW Stock (NMS)	1,500	16.62	24,930	-1,995	24,930	1,500		
ADCT	ADCT JAN 18 '08 15.0 ...	-25	0.85	-2,125	-1,080	20,925	1,437	-585	-28
<NASDAQ	ADCT JAN 18 '08 17.5 ...	-25	3.00	-7,500	-2,018	31,014	2,130	-250	-17
ADI <...	ADI JAN 18 '08 30.0 PU...	-15	0.95	-1,425	-648	27,219	925	-355	-34
AEIS	AEIS JAN 18 '08 17.5 P...		5.50		-2,029				
<NASDAQ	AEIS JAN 18 '08 20.0 P...		8.00		-2,028				
	AEIS Stock (NMS)		11.56		-1,243				
AIG	AIG JAN 18 '08 60.0 PU...	-10	4.50	-4,500	-1,007	46,137	825	-67	-29
<NYSE>	AIG JAN 18 '08 65.0 PU...	-5	9.10	-4,550	-679	27,206	487	-10	-4
ALL <...	ALL JAN 18 '08 55.0 PU...	-20	3.80	-7,600	-514	97,858	1,918	-117	-19

查看投资组合报告

1. 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游*。
2. 在**报告查看器**中，选择**报告**下拉列表中的*投资组合*。
3. 使用底层证券和测量下拉列表来定义您的报告标准。

下表描述了可用于**投资组合**报告的指标和测量。

指标	描述
头寸	合约中您的 （带符号的）头寸。 空头头寸以 “－”（减）号表示。
价格	一单位合约的当前市场价格。
价值	（价格）× （头寸）。
损益	“未实现的”平均成本损益以总数、每种底层证券和每个头寸被显示。
头寸暴露	头寸暴露使用该公式计算：头寸× delta ×乘数×底层证券价格。 **Note:** 对每种资产类别的头寸暴露被换算为股票等值的数值，从而使比较和加总有效。
风险价值	风险价值 （VAR）是对市场风险暴露的测量。它显示了在一天时间段内的最大预期损失，置信区间为 99.5%。 **Note:** 在风险价值不能被计算的情况下，注释 “不可用”将被显示在紫罗兰色的背景上。
Delta	Delta 同时捕捉投资组合对底层证券的敏感性的方向和程度，方法是根据底层证券价格的变化来表示期权价格变化的程度和方向。 我们使用大写字母 “D”，将被计算为 （delta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Delta”与希腊字母 delta 计算区分开来。
Gamma	Gamma 通过定义期权有方向的变动将发生的速度，即 delta 变动的速率，来帮助您评估有方向的风险。 我们使用大写字母 “G”，将被计算为 （gamma ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Gamma”与希腊字母 gamma 计算区分开来。
Vega	Vega 表示了投资组合对底层证券的内在波动率变化的敏感性，并反映了相对于底层证券内在波动率变化的期权价格变动。通常，多头期权头寸从上升的内在波动率中受益 （而从下降的内在波动率中受损），而空头期权头寸的经历相反 － 它们从下降的内在波动率中受益 （而从上升的波动率中受损）。 我们使用大写字母 “V”，将被计算为 （vega ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Vega”与希腊字母 vega 计算区分开来。
Theta	Theta 通过指出您的投资组合市值将随着时间变化的速率，表示了投资组合对时间段的敏感性。该指标计算根据的是如下假设：所有其他变量保持不变，包括底层证券价格、内在波动率和利率。 我们使用大写字母 “T”，将被计算为 （theta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Theta”与希腊字母 theta 计算区分开来。

根据头寸的风险报告

根据头寸的风险报告按底层证券显示了对每个头寸计算的风险测量。

My Portfolio

Report Dimensions Metrics View Settings

Underlying	Expiry	Strike	Right	Asset	Pos...	Price	P&L	Exposure	Delta...	Gamma...	Veg
KFT <...	20080118	30	P	OPT	-20	0.19	-34	9,003	338	-266	-2
FSS	20080215	37	P	OPT	-63	4.25	-2,879	50,569	6,144	-263	-
<NYSE>		15	P	OPT	-20	0.10	-14	8,132	257	-260	-2
WPP ...	20080118	12.5	P	OPT	-25	2.80	-1,455	32,156	2,185	-256	-1
VSH ...	20080118	15	P	OPT	-20	2.00	-564	11,763	1,033	-218	-9
STM	20080118	12.5	P	OPT	-15	0.79	-536	26,321	577	-212	-5
<NYSE>		17.5	P	OPT	-35	4.15	-2,125	35,745	3,369	-211	-1
BAC	20080118	22.5	P	OPT	-20	2.25	-1,064	39,069	1,921	-201	-
<NYSE>		45	P	OPT	-20	1.55	-1,264	40,976	966	-198	-6
	20080118	45	P	OPT	-45	0.20	-360	17,474	354	-198	-6
INFY	20080118	45	P	OPT	-10	0.40	-132	10,126	329	-194	-2
<NASDAQ	20080118	42.5	P	OPT	-15	0.50	-123	20,768	449	-189	-4
INTU	20080118	12.5	P	OPT	-25	0.20	-80	12,942	301	-180	-4
<NASDAQ	20080118	7.5	P	OPT	-24	3.90	-1,097	13,375	2,233	-178	-
	20080118	30	P	OPT	-10	1.67	-587	23,919	771	-174	-1
DOW	20080118	40	P	OPT	-10	0.20	-157	5,444	230	-172	-1
<NYSE>				OPT	-20	0.15	-214	10,683	284	-171	-3
	20080118	10	P	OPT	-46	5.60	-1,182	30,195	4,467	-171	-

查看根据头寸的风险报告

1. 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游*。
2. 在**报告查看器**中，选择报告下拉列表中的*根据头寸的风险*。
3. 使用底层证券和测量列表来定义您的报告标准。

   如果您选择了仅对单个底层证券显示指标，报告将不会显示如上所示的*底层证券*栏。

下表描述了可用于**根据头寸的风险**报告的指标和测量。

指标	描述
头寸	合约中您的 （带符号的）头寸。 空头头寸以 “－”（减）号表示。
价格	一单位合约的当前市场价格。

指标	描述
头寸暴露	头寸暴露使用该公式计算：头寸× delta ×乘数×底层证券价格。 **Note:** 对每种资产类别的头寸暴露被换算为股票等值的数值，以便于在类别之间比较。
Delta	Delta 同时捕捉投资组合对底层证券的敏感性的方向和程度，方法是根据底层证券价格的变化来表示期权价格变化的程度和方向。 我们使用大写字母 “D”，将被计算为 （delta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Delta”与希腊字母 delta 计算区分开来。
Gamma	Gamma 通过定义期权有方向的变动将发生的速度，即 delta 变动的速率，来帮助您评估有方向的风险。 我们使用大写字母 “G”，将被计算为 （gamma ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Gamma”与希腊字母 gamma 计算区分开来。
Vega	Vega 表示了投资组合对底层证券的内在波动率变化的敏感性，并反映了相对于底层证券内在波动率变化的期权价格变动。通常，多头期权头寸从上升的内在波动率中受益 （而从下降的内在波动率中受损），而空头期权头寸的经历相反 — 它们从下降的内在波动率中受益 （而从上升的波动率中受损）。 我们使用大写字母 “V”，将被计算为 （vega ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Vega”与希腊字母 vega 计算区分开来。
Theta	Theta 通过指出您的投资组合市值将随着时间变化的速率，表示了投资组合对时间段的敏感性。该指标计算根据的是如下假设：所有其他变量保持不变，包括底层证券价格、内在波动率和利率。 我们使用大写字母 “T”，将被计算为 （theta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Theta”与希腊字母 theta 计算区分开来。

根据底层证券的风险报告

根据底层证券的风险报告被设计为当您打开 IB 风险漫游℠ 时默认地打开。该报告显示了所有资产类别中的投资组合指标，并为每种底层证券提供向下钻取的深度控制。

My Portfolio

Report Dimensions Metrics View Settings Ri

Underlying	Position	Price	P&L	Exposure	VAR	Delta (Δ)	Gamma...	Ve
− All Underlyings			-269,079	8,343,217				
− ADBE <NASDAQ>			443	-19,646	-1,887	-480	-34	-1
− 2009-01-16			443	-19,646		-480	-34	-1
ADBE JAN 16 '09 45.0 C...	-10	3.90	443	-19,646		-480	-34	-1
− AA <NYSE>			-217	9,868	-1,113	278	-87	
− 2008-01-18			-60	3,282		93	-53	
AA JAN 18 '08 30.0 PUT...	-20	0.10	-60	3,282		93	-53	
− 2008-04-18			-157	6,586		186	-34	
AA APR 18 '08 30.0 PUT...	-10	0.85	-157	6,586		186	-34	
+ AAPL <NASDAQ>			1,286	-101,646	-11,322	-530	-7	-1,2
+ ABT <NYSE>			-32	2,942	-183	53	-21	
+ ACIW <NASDAQ>			-1,500	25,455	-3,574	1,500		
+ ADCT <NASDAQ>			-2,535	52,878	-7,998	3,607	-867	
+ ADI <NYSE>			-498	24,902	-3,674	840	-345	

查看根据底层证券的风险报告

1. 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游*。
2. 在**报告查看器**中，选择报告下拉列表中的*根据底层证券的风险*。
3. 使用底层证券和测量列表来定义您的报告标准。

下表显示了对**根据底层证券的风险**报告可用的所有指标和测量。

指标	描述
头寸	合约中您的 （带符号的）头寸。 空头头寸以 “－”（减）号表示。
价格	一单位合约的当前市场价格。
价值	（价格）× （头寸）。
损益	“未实现的”平均成本损益以总数、每种底层证券和每个头寸被显示。

指标	描述
头寸暴露	头寸暴露使用该公式计算：头寸× delta ×乘数×底层证券价格。 **Note:** 对每种资产类别的头寸暴露被换算为股票等值的数值，以便于在类别之间比较。
风险价值	风险价值 （VAR）是对市场风险暴露的测量。它显示了在一天时间段内的最大预期损失，置信区间为 99.5%。 **Note:** 在风险价值不能被计算的情况下，注释 “不可用”将被显示在紫罗兰色的背景上。
Delta	Delta 同时捕捉投资组合对底层证券的敏感性的方向和程度，方法是根据底层证券价格的变化来表示期权价格变化的程度和方向。 我们使用大写字母 “D”，将被计算为 （delta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Delta”与希腊字母 delta 计算区分开来。
Gamma	Gamma 通过定义期权有方向的变动将发生的速度，即 delta 变动的速率，来帮助您评估有方向的风险。 我们使用大写字母 “G”，将被计算为 （gamma ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Gamma”与希腊字母 gamma 计算区分开来。
Vega	Vega 表示了投资组合对底层证券的内在波动率变化的敏感性，并反映了相对于底层证券内在波动率变化的期权价格变动。通常，多头期权头寸从上升的内在波动率中受益 （而从下降的内在波动率中受损），而空头期权头寸的经历相反 — 它们从下降的内在波动率中受益 （而从上升的波动率中受损）。 我们使用大写字母 “V”，将被计算为 （vega ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Vega”与希腊字母 vega 计算区分开来。
Theta	Theta 通过指出您的投资组合市值将随着时间变化的速率，表示了投资组合对时间段的敏感性。该指标计算根据的是如下假设：所有其他变量保持不变，包括底层证券价格、内在波动率和利率。 我们使用大写字母 “T”，将被计算为 （theta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Theta”与希腊字母 theta 计算区分开来。

根据行业的风险报告

根据行业的风险报告按行业来整理您的投资组合。该报告显示了所有细节水平上的值，从单个头寸到每个行业部分的总数。

My Portfolio

Report Dimensions Metrics View Settings Risk

Industry	Underlying	Pos...	P&L	Expo...	VAR	Delta...	Gamma...	Vega
− All Industries	All Underlyings		-326,581	8,453,395				
+	+ All Underlyings		-1,403	29,914				
− Basic Materials	+ All Underlyings		-20,428	276,076				
− Chemicals	− All Underlyings		-11,848	102,180				
	− DOW <NYSE>		-1,542	56,460	-4,320	1,496	-339	-418
	− 2008-01-18		-214	10,401		276	-162	-34
	DOW JAN 18 '08 35....	-20	-214	10,401		276	-162	-34
	+ 2008-03-20		-514	20,443		542	-116	-114
	+ 2009-01-16		-814	25,616		679	-61	-270
	− GGC <NYSE>		-10,306	45,720	-6,495	9,000	0	0
	GGC Stock	8,000	-8,998	40,640		8,000		
	− 2008-01-18		-1,308	5,080		1,000	0	0
	GGC JAN 18 '08 15....	-10	-1,308	5,080		1,000	0	0
Chemicals-...	+ All Underlyings		-11,848	102,180				
+ Forest Produ...	+ All Underlyings		-8,064	161,284				

查看根据行业的风险

1. 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游*。
2. 在**报告查看器**中，从报告下拉列表中选择*根据行业的风险*。

您能够在行业**类别**内向下钻取几个水平，然后在该类别的*底层证券*区域中向下钻取来查看行业中的全部底层证券，以及底层证券的全部衍生品。要向下钻取到更深水平的细节，点击加号 “＋”。减号 “－”表示您已经向下钻取到了最深级别的细节。点击 “－”号转到上一级。

下表描述了可用于**根据行业的风险**报告的指标和测量。

指标	描述
头寸	合约中您的 （带符号的）头寸。 空头头寸以 “－”（减）号表示。
价格	一单位合约的当前市场价格。
价值	（价格）× （头寸）。

指标	描述
损益	“未实现的”平均成本损益以总数、每种底层证券和每个头寸被显示。
头寸暴露	头寸暴露使用该公式计算：头寸× delta ×乘数×底层证券价格。 **Note:** 对每种资产类别的头寸暴露被换算为股票等值的数值，从而使比较和加总有效。
风险价值	风险价值 （VAR）是对市场风险暴露的测量。它显示了在一天时间段内的最大预期损失，置信区间为 99.5%。 **Note:** 在风险价值不能被计算的情况下，注释 “不可用”将被显示在紫罗兰色的背景上。
Delta	Delta 同时捕捉投资组合对底层证券的敏感性的方向和程度，方法是根据底层证券价格的变化来表示期权价格变化的程度和方向。 我们使用大写字母 “D”，将被计算为 （delta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Delta”与希腊字母 delta 计算区分开来。
Gamma	Gamma 通过定义期权有方向的变动将发生的速度，即 delta 变动的速率，来帮助您评估有方向的风险。 我们使用大写字母 “G”，将被计算为 （gamma ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Gamma”与希腊字母 gamma 计算区分开来。
Vega	Vega 表示了投资组合对底层证券的内在波动率变化的敏感性，并反映了相对于底层证券内在波动率变化的期权价格变动。通常，多头期权头寸从上升的内在波动率中受益 （而从下降的内在波动率中受损），而空头期权头寸的经历相反 — 它们从下降的内在波动率中受益 （而从上升的波动率中受损）。 我们使用大写字母 “V”，将被计算为 （vega ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Vega”与希腊字母 vega 计算区分开来。
Theta	Theta 通过指出您的投资组合市值将随着时间变化的速率，表示了投资组合对时间段的敏感性。该指标计算根据的是如下假设：所有其他变量保持不变，包括底层证券价格、内在波动率和利率。 我们使用大写字母 “T”，将被计算为 （theta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Theta”与希腊字母 theta 计算区分开来。

根据底层证券和到期日的测量

根据底层证券和到期日的测量矩阵对所有底层证券显示了根据测量的风险，按到期日期排序。您在**报告选择器**的*测量*下拉菜单中选择的测量，被沿着矩阵顶部显示。到期日期区域显示了给定的底层证券 / 到期日期的所有头寸 （*测量*）的总和。

	All Expiry	Stock	20071220	20071221	20071231	20080118	20080215	20080320	20080418	200
AA <NYS...	636					401			235	
AAPL <N...	-494									
ABT <NY...	103					67	36			
ACIW <N...	1,500	1,500								
ADBE <N...	-483	0				43				
ADCT <N...	2,154					2,154				
ADI <NY...	602			159		443				
ADSK <N...	7					7				
AEIS <N...	5,636	2,000				3,636				
AIG <NY...	1,135					1,135				
ALL <NY...	1,871					1,871				
ALU <NY...	7,869	6,000				1,869				
AMAT <N...	2,485					1,815				
AMD <N...	6,652					6,652				
AMGN <...	2,761	2,000				467			294	
AMR <N...	1,639					1,639				
AMTD <N...	37					37				
AMZN <N...	457	2,000				-1,543				
ANN <NY...	1,905			1,905						
ARRS <N...	5,921	4,000				1,921				
ATML <N...	20,000	20,000								
ATVI <N...	40					40				
AVP <NY...	1,615	3,000				-1,385				
[illegible]	5,010					5,010				

查看根据底层证券和到期日的测量报告

1. 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游*。
2. 在**报告查看器**中，从报告下拉列表中选择*根据底层证券和到期日的测量*。
3. 使用底层证券和测量选项列表来指定报告标准。

指标	描述
头寸暴露	头寸暴露使用该公式计算：头寸× delta ×乘数×底层证券价格。 **Note:** 对每种资产类别的头寸暴露被换算为股票等值的数值，从而使比较和加总有效。
Delta	Delta 同时捕捉投资组合对底层证券的敏感性的方向和程度，方法是根据底层证券价格的变化来表示期权价格变化的程度和方向。 我们使用大写字母 “D”，将被计算为 （delta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Delta” 与希腊字母 delta 计算区分开来。

指标	描述
Gamma	Gamma 通过定义期权有方向的变动将发生的速度，即 delta 变动的速率，来帮助您评估有方向的风险。 我们使用大写字母 “G”，将被计算为 （gamma ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Gamma”与希腊字母 gamma 计算区分开来。
Vega	Vega 表示了投资组合对底层证券的内在波动率变化的敏感性，并反映了相对于底层证券内在波动率变化的期权价格变动。通常，多头期权头寸从上升的内在波动率中受益 （而从下降的内在波动率中受损），而空头期权头寸的经历相反 — 它们从下降的内在波动率中受益 （而从上升的波动率中受损）。 我们使用大写字母 “V”，将被计算为 （vega ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Vega”与希腊字母 vega 计算区分开来。
Theta	Theta 通过指出您的投资组合市值将随着时间变化的速率，表示了投资组合对时间段的敏感性。该指标计算根据的是如下假设：所有其他变量保持不变，包括底层证券价格、内在波动率和利率。 我们使用大写字母 “T”，将被计算为 （theta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Theta”与希腊字母 theta 计算区分开来。

根据价格变化和波动率变化的测量

该报告测量相关的投资组合 Delta、Gamma、Vega 和 Theta 的市场结果。风险漫游中的所有其他报告在其计算中使用了实时数据，但这些值是使用*前一个交易日收盘时*的底层证券和衍生品价格，在底层证券价格、波动率和利率的多种正、负和零百分比变化情形下被计算的。

每个值的情形为：

- 底层证券价格情形：-30%、-20%、-10%、不变、+10%、+20%、+30%
- 波动率情形：-30%、-15%、不变、+15%、+30%
- 利率情形：-100 bp、-50 bp、不变、+50 bp、+100 bp

情形将时间参数向前下一个交易日收盘时，表格中的数值反映了被应用于您在报告选择器中选择的测量的情形。尽管对每个合约都计算了 175 种市场结果情形 （7 × 5 × 5），由于我们的二维显示能力带来的限制，您一次只能够看见这些值的一个平片。

Underlying	Price Change	Volatility Change			
		-30 %	-15 %	0 %	15 %
+ All Underlyings	-30 %	-4,730,957	-4,773,076	-4,824,439	-4,884,713
	-20 %	-2,585,188	-2,659,792	-2,745,050	-2,839,113
	-10 %	-916,083	-1,008,120	-1,111,525	-1,224,808
	0 %	217,837	128,566	24,714	-91,065
	10 %	841,684	761,808	668,438	563,650
	20 %	1,121,760	1,054,148	975,035	885,565
	30 %	1,194,136	1,139,635	1,074,885	1,000,621

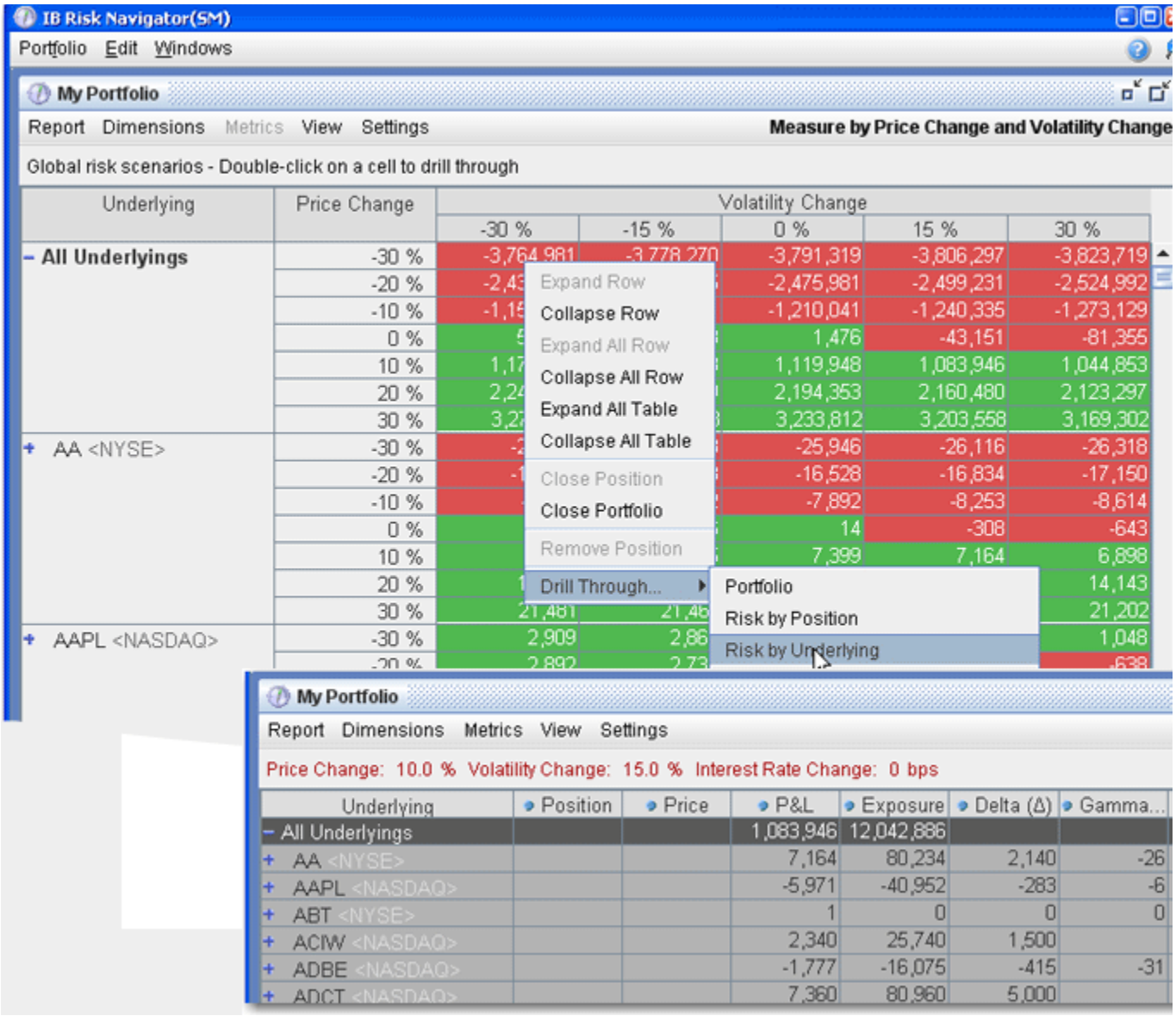
查看根据价格变化和波动率变化的测量报告

1. 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游*。
2. 在**报告查看器**中，在报告下拉菜单中选择*根据价格变化和波动率变化的测量*。
3. 使用**维度** > *情形风险矩阵*菜单来更改行和栏的值从而查看不同的情形。

您能够使用钻取功能，将市场情形应用于其他的 IB 风险漫游报告。

市场情形钻取

您能够使用右键点击菜单上的钻取命令，将市场结果情形 （被计算在根据价格变化和波动率变化的测量报告中）应用于任何其他的风险报告。



将市场结果情形应用于其他报告

1. 通过点击 x 轴和 y 轴情形交点处的一个单元格，来选择一个市场结果情形。
2. 使用右键点击菜单来选择**钻取**，然后选择一个报告。
3. 被选中的报告与您选择的适用的市场结果情形一起显示，该情形被描述在报告顶部。

Note: 当您通过钻取功能查看市场结果情形时，报告上的所有值反映了该假设的情形，因此不反映实际的实时风险。要将报告重设为实时，点击右上方的**重设情形**按钮。

投资组合统计报告

投资组合统计报告显示了两个总结表格：一个是对所有的股票和期货头寸，一个是对所有的期权头寸。

股票 / 期货总结显示了所有多头头寸、所有空头头寸、净单位和总单位以及它们相应的总价值。

期权总结显示了所有多头看涨期权、多头看跌期权、看涨和看跌期权总和以及总价值；所有空头看涨期权、空头看跌期权、看涨期权和看跌期权总和以及总价值；看涨和看跌期权的净单位、两者之和以及总净价值；看涨和看跌期权的总单位、两者之和以及相应的净价值。

Stock/Future

	Shares	Value
Long	244,500	4,805,719.00
Short	33,355	1,671,962.50
Net	211,145	-3,133,756.50
Gross	277,855	6,477,681.50

Options

	Calls	Puts	Both	Value
Long	25	60	85	11,500.00
Short	790	6,818	7,608	1,397,204.52
Net	-765	-6,758	-7,523	1,385,704.52
Gross	815	6,878	7,693	1,408,704.52

查看投资组合统计报告

1. 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游*。
2. 在**报告查看器**上，从报告下列菜单中选择*投资组合统计*。

风险价值报告

风险价值报告显示了在 99.5%的置信水平，投资组合在一天时间段内将遭受的岁大损失。风险价值 （VAR）使用三种方法被计算，每种方法对投资组合中的底层证券资产之间的相关系数都有不同的假设。

Method	Value at Risk	Scenario
Worst Case		See table below
Perfect Correlation	-300,520	All prices -2.9%
Index Correlated Price Estimate		SPX@CBOE

Worst Case Scenario

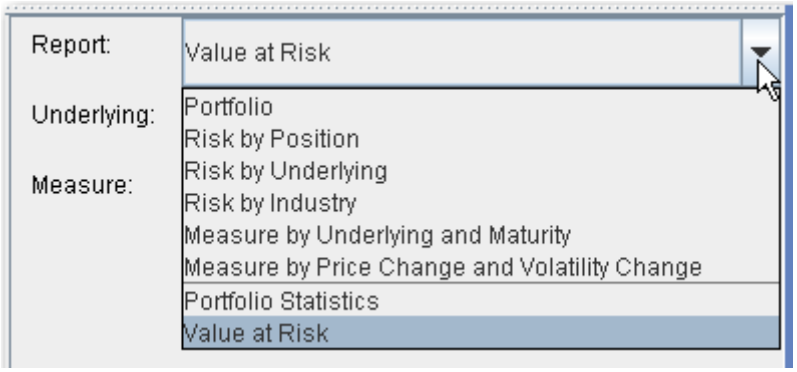
Underlying	Price	Price Change	Price Change (Percent)
AA	33.07	-0.74	-2.2%
AAPL	203.18	18.26	9.9%
ABT	54.58	-2.1	-3.7%
ACIW	21.62	2.18	11.2%
ADBE	44.44	3.51	8.6%
ADCT	16	-1.74	-9.8%
ADI	28.22	-3.17	-10.1%
ADSK	45.27	-3.42	-7.0%
AEIS	10.87	-2.13	-16.4%
AIG	52.04	-3.29	-5.9%
ALL	48.62	-2.86	-5.5%
ALU	6.78	-0.55	-7.4%
AMAT	16.48	-1.05	-6.0%
AMD	7.01	-1.01	-12.6%
AMGN	44.33	-2.59	-5.5%
AMR	14.72	-1.42	-8.8%
AMTD	17.49	-1.81	-9.4%
AMZN	66.62	-18.6	-21.8%

- **最坏情况** — 显示您的投资组合中每个底层证券的最大损失之和，假设每个产品独立地移动到位于每个底层证券 3 个标准差范围内的最大损失。
- **完全相关** — 假设每个产品与参考指数是完全相关的。其随后寻找位于参考指数的 4.5 个标准差范围内的最大损失。
- **指数相关价格估计** — 为您的投资组合中的每个底层证券分配一个和参考指数的相关系数 （Beta），然后寻找位于该指数的 4.5 个标准差范围内的最大损失。

查看风险价值报告

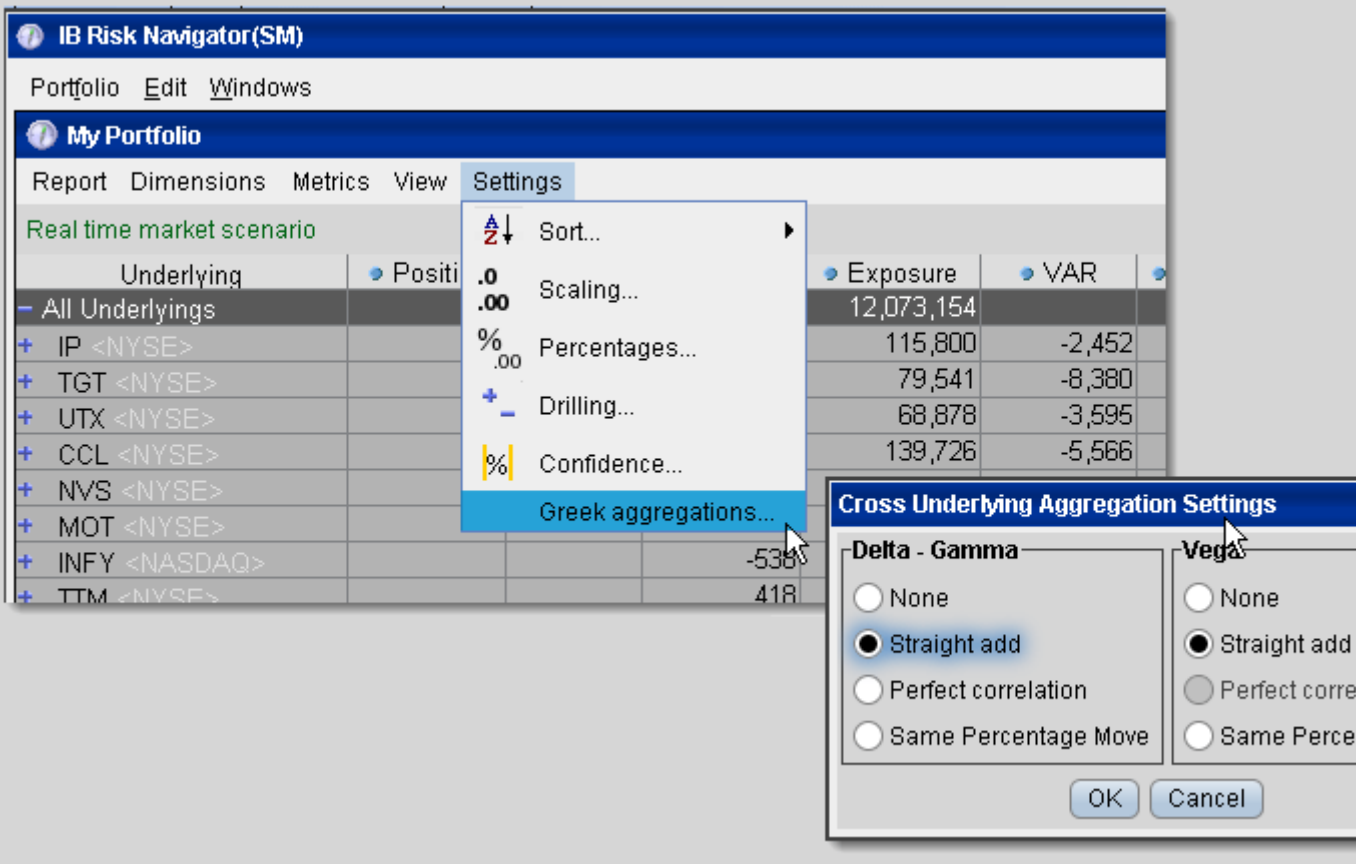
1 在**分析**菜单上，选择 *IB 风险漫游*。

2 在**报告选择器**中，从报告下拉列表中选择*风险价值*。



报告中的希腊字母集合

对 Delta、Gamma 和 Vega 头寸希腊字母的集中计算能够从**设置**菜单中通过选择*希腊字母集合*来被修改。



更改希腊字母集合计算

1. 从**设置**菜单上，选择*希腊字母集合*。
2. 使用单选按钮来选择一个计算。

计算使用以下变量：

S_i ＝底层证券价格。

sigma_i ＝底层证券的历史波动率。

Delta_i ＝以基本货币命名的总 delta。

Gamma_i ＝以基本货币命名的总 gamma。

Vega_i ＝以基本货币命名的总 vega。

直接相加：

总 Delta ＝对 i 求和 （Delta_i）
总 Gamma ＝对 i 求和 （Gamma_i）
总 Vega ＝对 i 求和 （Vega_i）

完全相关：

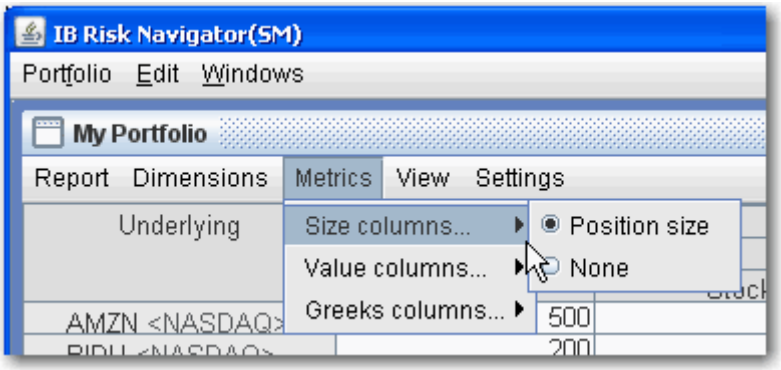
总 Delta ＝对 i 求和 （Delta_i × S_i × sigma_i）
总 Gamma ＝ 0.5 ×对 i 求和 （Gamma_i × （S_i × sigma_i）^2）

相同百分比变动：

总 Delta ＝对 i 求和 （Delta_i × S_i × 0.01）
总 Gamma ＝ 0.5 ×对 i 求和 （Gamma_i × （S_i × 0.01）^2）
总 Vega ＝对 i 求和 （Vega_i × S_i × 0.01）

报告指标

位于 IB 风险漫游顶部的**指标**菜单与上下文有关，并允许您为每种报告选择适用的指标。可用的指标包括：



指标	描述
尺寸栏……	
头寸尺寸	选择*头寸尺寸*来显示合约中您的 （带方向的）头寸。空头头寸以 “－”（减）号表示。 选择 “无”将头寸区域从您的报告中删除。
价值栏……	
风险价值	风险价值 （VAR）是对市场风险暴露的测量。它显示了在一天时间段内的最大预期损失，置信区间为 99.5%。 **Note:** 在风险价值不能被计算的情况下，注释 “不可用”将被显示在紫罗兰色的背景上。
损益	“未实现的”平均成本损益以总数、每种底层证券和每个头寸被显示。
价格	一单位合约的当前市场价格。
价值	（价格）× （头寸）。
换算率	显示被用来将非基本货币头寸转换为基本货币的汇率。
希腊字母栏……	
头寸暴露	头寸暴露使用该公式计算：头寸× delta ×乘数×底层证券价格。 **Note:** 对每种资产类别的头寸暴露被换算为股票等值的数值，以便于在类别之间比较。

指标	描述
Delta	Delta 同时捕捉投资组合对底层证券的敏感性的方向和程度，方法是根据底层证券价格的变化来表示期权价格变化的程度和方向。 我们使用大写字母 “D”，将被计算为 （delta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Delta”与希腊字母 delta 计算区分开来。
Gamma	Gamma 通过定义期权有方向的变动将发生的速度，即 delta 变动的速率，来帮助您评估有方向的风险。 我们使用大写字母 “G”，将被计算为 （gamma ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Gamma”与希腊字母 gamma 计算区分开来。
Vega	Vega 表示了投资组合对底层证券的内在波动率变化的敏感性，并反映了相对于底层证券内在波动率变化的期权价格变动。通常，多头期权头寸从上升的内在波动率中受益 （而从下降的内在波动率中受损），而空头期权头寸的经历相反 — 它们从下降的内在波动率中受益 （而从上升的波动率中受损）。 我们使用大写字母 “V”，将被计算为 （vega ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Vega”与希腊字母 vega 计算区分开来。
Theta	Theta 通过指出您的投资组合市值将随着时间变化的速率，表示了投资组合对时间段的敏感性。该指标计算根据的是如下假设：所有其他变量保持不变，包括底层证券价格、内在波动率和利率。 我们使用大写字母 “T”，将被计算为 （theta ×头寸）的 IB 风险漫游 “头寸 Theta”与希腊字母 theta 计算区分开来。

期权分析

引言

- 期权分析窗口
- 波动率交易

期权分析窗口

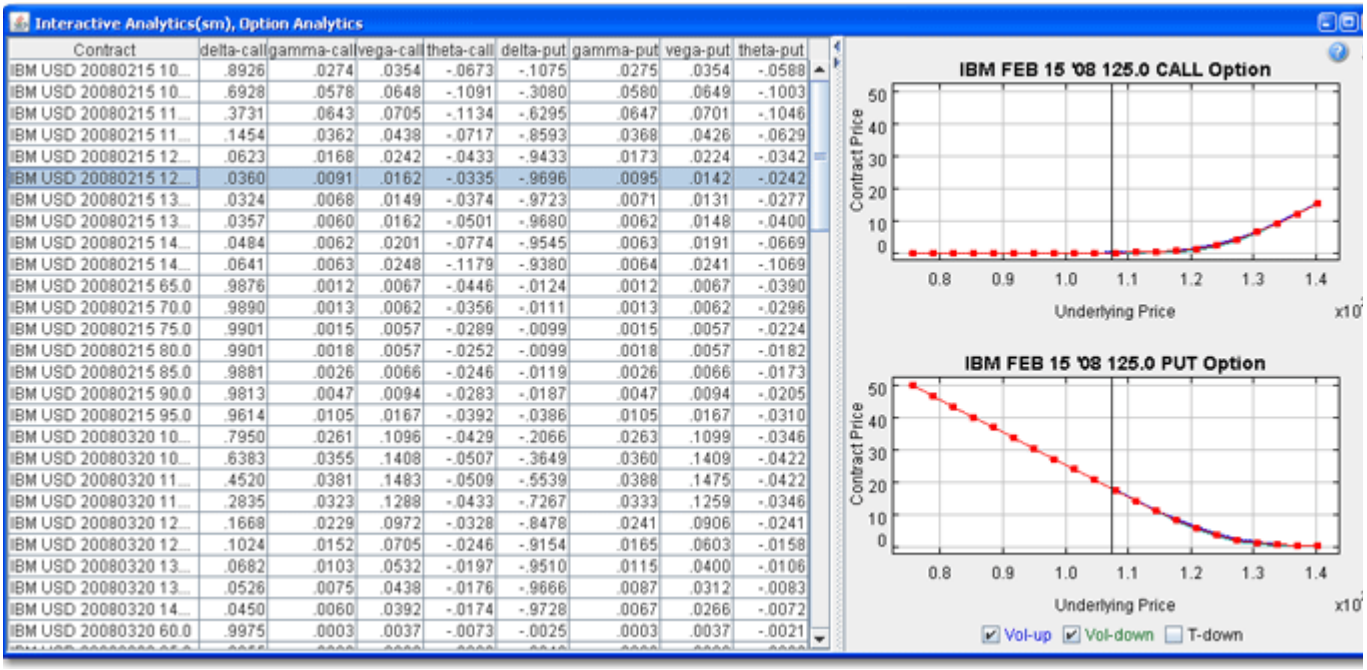
期权分析窗口显示的值反映了期权价格相对于若干风险指标当中的每个指标的一单位变化的变动率。

合约价格绘图显示了在价格扫描中决定的合约价格的静态集合。每一点将水平轴上的一个底层证券价格与垂直轴上的相应合约价格关联起来。注意，合约价格是以每底层证券单位的价格来表示的 （就像它被表示在定单行上或执行窗口中一样）。顶部绘图显示看涨期权，底部绘图显示看跌期权，对你在列表中强调的任何期权都如此。

使用*波动率增加*、*波动率减少*和*时间减少*复选框来查看不同情形下的绘图，从而帮助您观察您的期权头寸中的波动率和时间风险。*波动率增加*将内在波动率以相对变化 * 提高 15%；*波动率减少*将内在波动率以相对变化 * 降低 15%；而*时间减少*将距离到期日的时间减少了一个日历日。

查看期权分析窗口

- 从期权交易者中，选择一份合约并在期权交易者工具栏上点击点击**分析**，然后选择*期权分析*。
- 从交易窗口中，选择一份期权合约，然后使用**分析**菜单来选择*期权分析*。



Contract	delta-call	gamma-call	vega-call	theta-call	delta-put	gamma-put	vega-put	theta-put
IBM USD 20080215 10...	.8926	.0274	.0354	-.0673	-.1075	.0275	.0354	-.0588
IBM USD 20080215 10...	.6928	.0578	.0648	-.1091	-.3080	.0580	.0649	-.1003
IBM USD 20080215 11...	.3731	.0643	.0705	-.1134	-.6295	.0647	.0701	-.1046
IBM USD 20080215 11...	.1454	.0362	.0438	-.0717	-.8593	.0368	.0426	-.0629
IBM USD 20080215 12...	.0623	.0168	.0242	-.0433	-.9433	.0173	.0224	-.0342
IBM USD 20080215 12...	.0360	.0091	.0162	-.0335	-.9696	.0095	.0142	-.0242
IBM USD 20080215 13...	.0324	.0068	.0149	-.0374	-.9723	.0071	.0131	-.0277
IBM USD 20080215 13...	.0357	.0060	.0162	-.0501	-.9680	.0062	.0148	-.0400
IBM USD 20080215 14...	.0484	.0062	.0201	-.0774	-.9545	.0063	.0191	-.0669
IBM USD 20080215 14...	.0641	.0063	.0248	-.1179	-.9380	.0064	.0241	-.1069
IBM USD 20080215 65.0	.9876	.0012	.0067	-.0446	-.0124	.0012	.0067	-.0390
IBM USD 20080215 70.0	.9890	.0013	.0062	-.0356	-.0111	.0013	.0062	-.0296
IBM USD 20080215 75.0	.9901	.0015	.0057	-.0289	-.0099	.0015	.0057	-.0224
IBM USD 20080215 80.0	.9901	.0018	.0057	-.0252	-.0099	.0018	.0057	-.0182
IBM USD 20080215 85.0	.9881	.0026	.0066	-.0246	-.0119	.0026	.0066	-.0173
IBM USD 20080215 90.0	.9813	.0047	.0094	-.0283	-.0187	.0047	.0094	-.0205
IBM USD 20080215 95.0	.9614	.0105	.0167	-.0392	-.0386	.0105	.0167	-.0310
IBM USD 20080320 10...	.7950	.0261	.1096	-.0429	-.2066	.0263	.1099	-.0346
IBM USD 20080320 10...	.6383	.0355	.1408	-.0507	-.3649	.0360	.1409	-.0422
IBM USD 20080320 11...	.4520	.0381	.1483	-.0509	-.5539	.0388	.1475	-.0422
IBM USD 20080320 11...	.2835	.0323	.1288	-.0433	-.7267	.0333	.1259	-.0346
IBM USD 20080320 12...	.1668	.0229	.0972	-.0328	-.8478	.0241	.0906	-.0241
IBM USD 20080320 12...	.1024	.0152	.0705	-.0246	-.9154	.0165	.0603	-.0158
IBM USD 20080320 13...	.0682	.0103	.0532	-.0197	-.9510	.0115	.0400	-.0106
IBM USD 20080320 13...	.0526	.0075	.0438	-.0176	-.9666	.0087	.0312	-.0083
IBM USD 20080320 14...	.0450	.0060	.0392	-.0174	-.9728	.0067	.0266	-.0072
IBM USD 20080320 60.0	.9975	.0003	.0037	-.0073	-.0025	.0003	.0037	-.0021

期权分析区域	
合约	列出活动的交易页面上的期权，按底层证券、到期日期和行权价分类。
delta	看涨期权的价值相对于底层资产价格变化的变动率。由于看涨期权价值随着底层资产价格的上升而上升，看涨期权的 delta 通常为正数。delta 为 1.0 的看涨期权将以底层证券价格变动率的 100％变动，delta 为 0.50 的期权将以底层证券价格变动率的 50％变动，等等。
gamma	期权的 delta 相对于底层资产价格变化的变动率。
vega	期权的价值相对于波动率变化的变动率。
theta	期权的价值在一天时间段内将发生变化的数额。这不是衍生品，而是一个差额。Theta 也被称为时间价值衰减，或者权利金衰减。

Note: 数值与底层证券最后价格一起被更新，以及当您将更改应用于期权类别时被更新。这些风险指标值同样能够被显示在期权交易者屏幕上。

＊举一个相对百分比变化的例子，如果期权的当前内在波动率是 10％，15％的相对变化将导致 11.5％的内在波动率，计算如下：

10％×（1 ＋ 0.15）＝ 11.5％。

模型导航

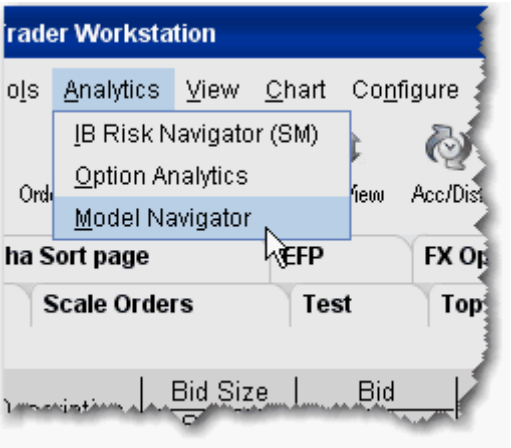
引言

使用**模型导航**来修改期权定价假设，包括波动率、利率和股息，并让模型导航在其期权模型价格计算中使用这些值。

- 使用模型导航
- 合约描述窗格
- 波动率模型窗格
- 波动率曲线表格
- 编辑利率
- 编辑股息
- 模型价格颜色键

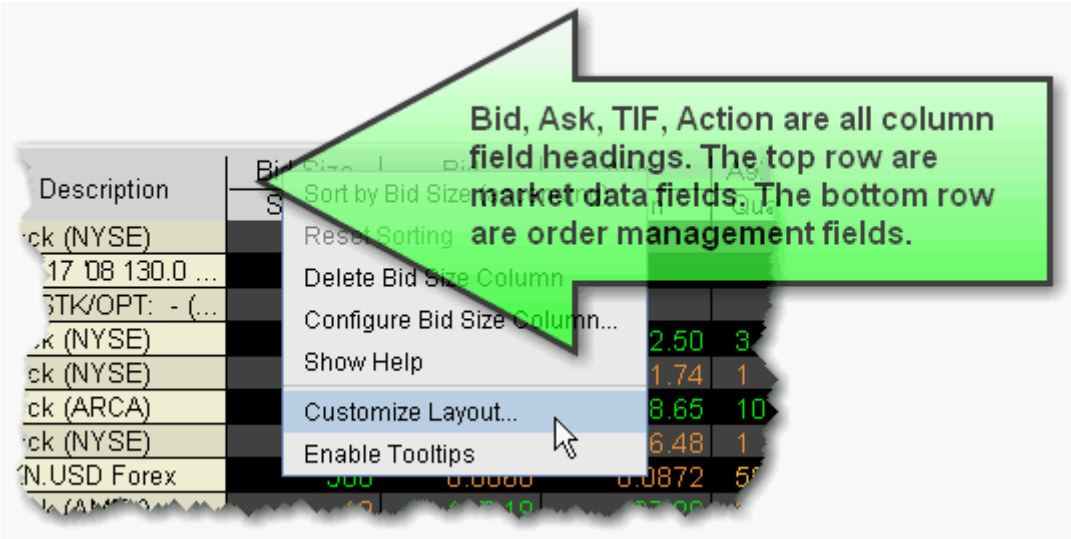
使用模型导航

IB 的价格 / 风险分析将当前市场数据与利息和股息值一起使用来计算内在波动率和期权模型价格。使用**模型导航**来修改定价假设并重新计算模型价格。



打开模型导航

1 在**分析**菜单上，选择*模型导航*。

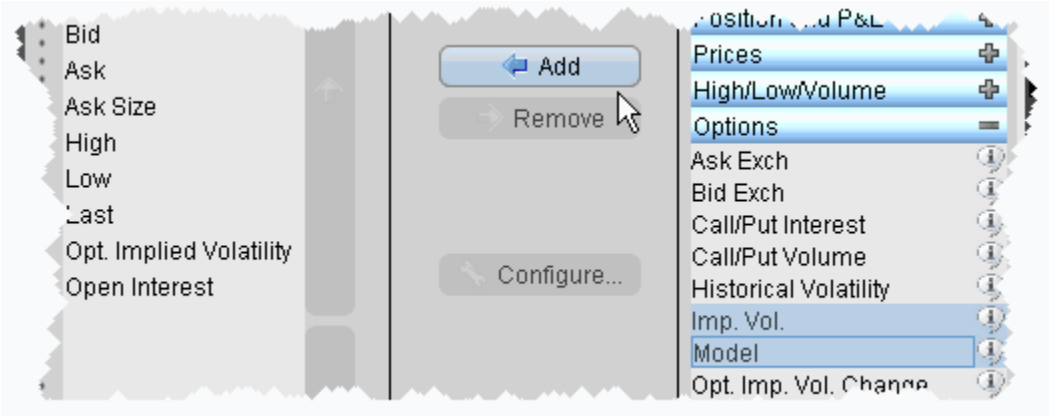


- 如果您从期权交易者打开**模型导航**，那么它会被自动地填入所有加载的期权链。
- 如果您从 IB 风险漫游 SM 打开**模型导航**，那么它会被填入所有期权。
- 如果您从交易页面打开**模型导航**，那么它将显示位于所有显示了*模型*或*内在波动率*区域的页面上的期权，这需要模型价格计算。

在交易页面上显示模型或内在波动率区域

1 右键点击交易页面的栏标题区域并选择*客户化版式*。

2 从版式管理器，在**可用的栏**列表中展开***期权***类别。



3 选择*内在波动率*和 / 或*模型*区域，并点击*添加*将它们移动到**已显示的栏**列表中。

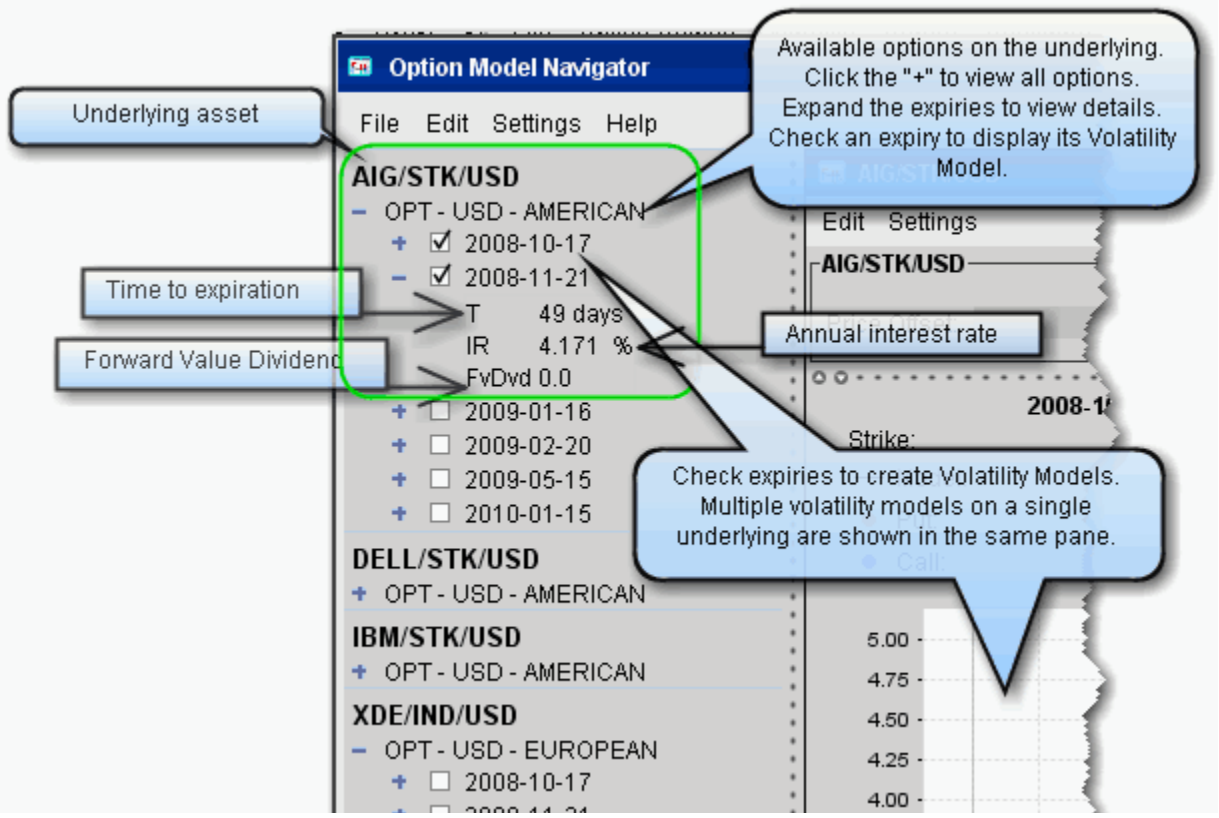
4 点击确定。

内在波动率和**模型**区域显示在交易页面上，并且页面上的所有期权合约现在要求模型计算并将出现在**模型导航**合约描述窗格中。内在波动率计算是非线性的，并可能对低 vega 期权不收敛。在这样的情况下，模型导航将不提供内在波动率估计。

模型导航窗口由三个主要部分组成：合约描述窗格以可扩展的树显示了所有可用的期权，波动率模型窗格显示了波动率曲线绘图，而波动率曲线表格列举了相关的行权价和内在波动率。

合约描述窗格

左侧窗格显示了按最终的底层证券分组的所有可用的期权，它们能够使用**设置**菜单上的*排序*命令，按照字母顺序或者根据期权数目顺序被排序。选择到期日期旁边的复选框来创建波动率模型。一个底层证券的所有波动率模型出现在相同的子窗格上。每个底层证券有唯一的波动率模型窗格。



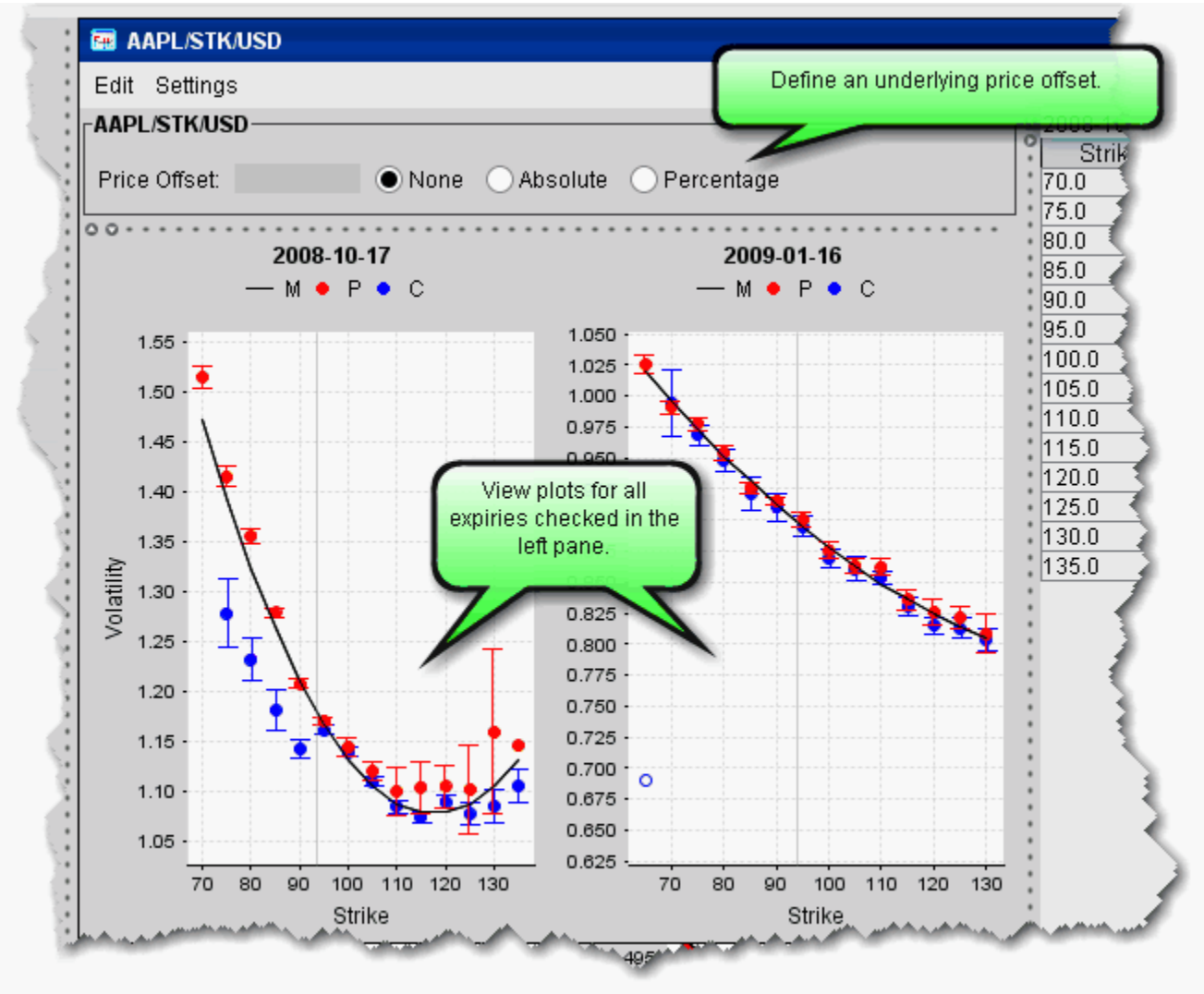
使用**设置**菜单来选择不要让期货子树与期权合并，并看见整个期货期权结构。

要将合约包括到**模型导航**中，您必须选择以下一种做法：使用期权交易者并下载一个期权链集合，打开 IB 风险漫游 SM，或者将合约添加到您的显示了内在波动率和 / 或模型区域的交易页面。

波动率模型窗格

波动率模型对所有被选中的合约被显示在模型导航的中间窗格中。波动率模型窗格包括：

- 价格抵消 — 可选的。对选定的期权，以绝对值或底层证券当前价格的百分比来抵消底层证券价格。
- 波动率曲线绘图 — 将波动率图像显示为行权价格的函数。您能够通过点击右键并选择*编辑*来手动地编辑绘图。



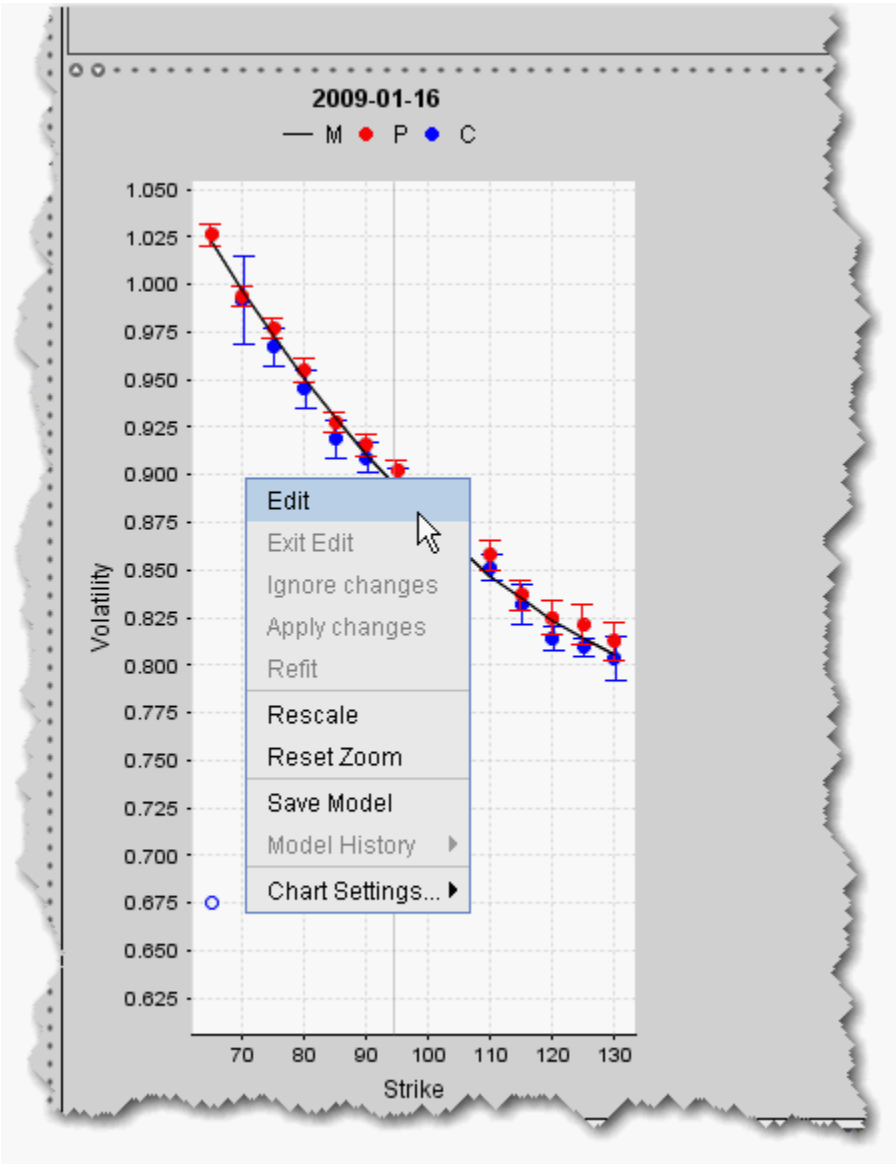
- 水平轴是行权价格，垂直轴是波动率。
- 蓝色和红色的点分别显示了从看涨期权和看跌期权的市场数据推导出来内在波动率。深蓝 / 深红表示半报价的看涨 / 看跌期权 （既可以是只有出价也可以是只有要价）。
- 从期权出价 / 要价计算的波动率结点包括具象的 “误差条” 来表示计算的误差范围。该范围被数字地指定在鼠标悬停帮助中，例如 “＋ / － 0.008”。如果波动率不是使用出价 / 要价计算的 （例如，半报价的看涨 / 看跌期权），那么误差范围不被显示。
- 开放的圆圈表示波动率是从收盘价格计算的。

- 要查看给定的内在波动率点的细节，在该点上握住您的鼠标。系统将显示期权权利、行权价格、内在波动率和错误范围。

编辑波动率图像

编辑模式允许你使用新的波动率点集，对到期日期创建一个新的波动率曲线绘图。您能够使用该编辑后的绘图，在交易平台中计算模型价格和内在波动率，并保存您的模型来与模型导航计算的绘图相比较。

默认情况下，模型导航复杂的期权模型计算引擎将绘图中的值与计算出的利率、股息、底层证券价格和其他参数一起使用，来计算*模型*价格。**如果您偏好使用反映在编辑后的绘图中的定价假设来计算模型价格，您必须将更改应用于您的绘图并将其留为*编辑*模式。**任何在编辑模式中拥有波动率曲线绘图的到期日期，将在模型价格和内在波动率的计算中使用该图像。



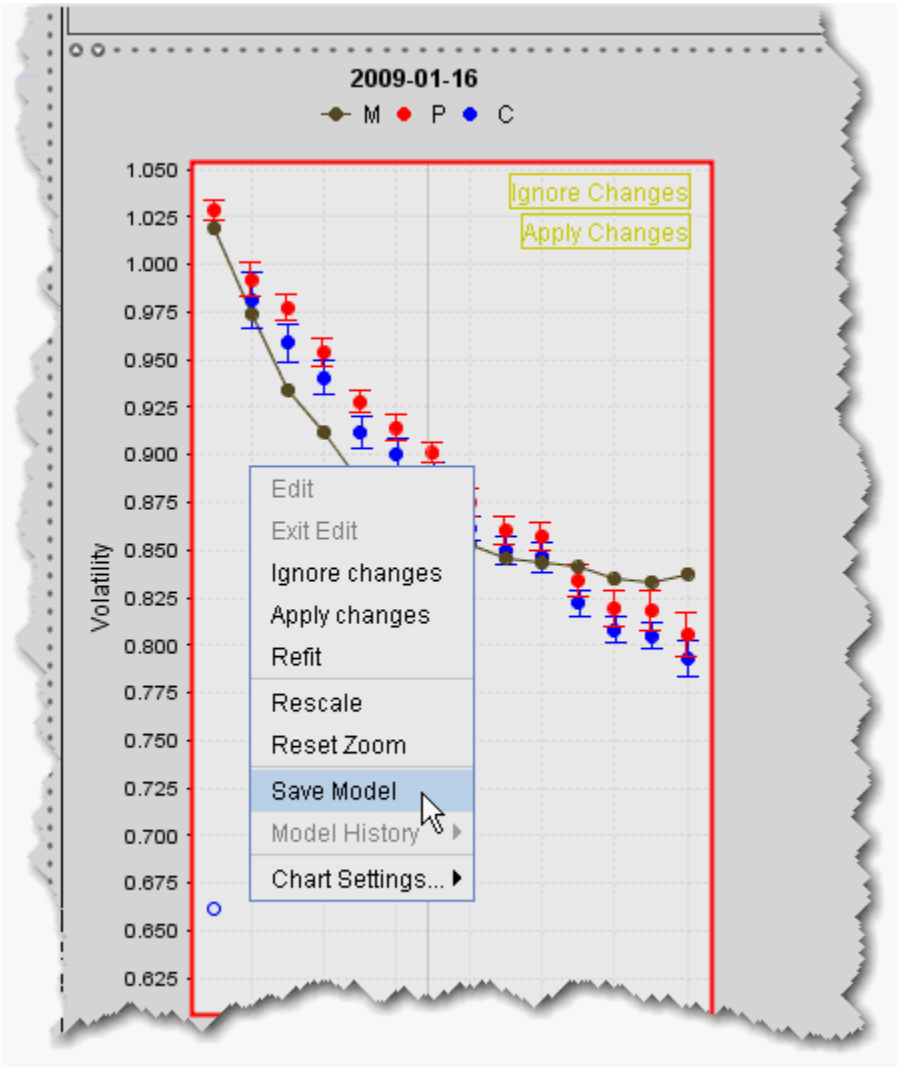
编辑波动率曲线绘图

1 右键点击波动率曲线绘图并选择*编辑*。

编辑模式沿着绘图的底部显示了一系列棕色的波动率结点。抓住并上下移动这些结点，来创建一个您认为更精确地表示内在波动率数据的波动率图像。对绘图应用的更改被反映在到期日的波动率曲线表格的*手动*栏中。

- 要查看被反映在波动率曲线表格中的手动波动率曲线的值，请确保您选中了到期日，您从位于表格顶部的到期日下拉列表中编辑其绘图。
- 表格和结点是双向工作的。您能够通过更改表格中相应的值来修改结点的内在波动率。
- 您能够在编辑模式中添加和删除棕色的波动率结点。要添加结点，指向您想要添加它的位置并双击。要删除结点，选择它并双击。
- 从右键点击菜单中点击*重新拟合*，将手动的波动率结点重新拟合到计算的波动率曲线。

通过从使用模型历史数据命令来保存和查看历史图像，从而比较波动率变化。

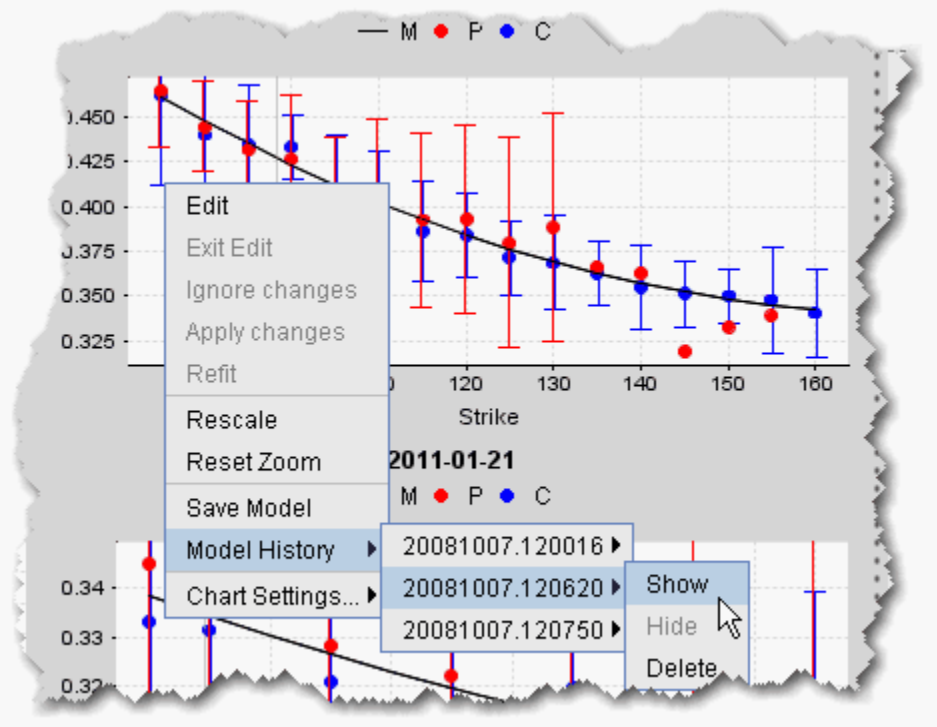


保存模型

1 从右键点击菜单中，选择*保存模型*。

2 点击图像右上角的*退出编辑*来关闭编辑模式。

模型使用当前日期和时间被保存。

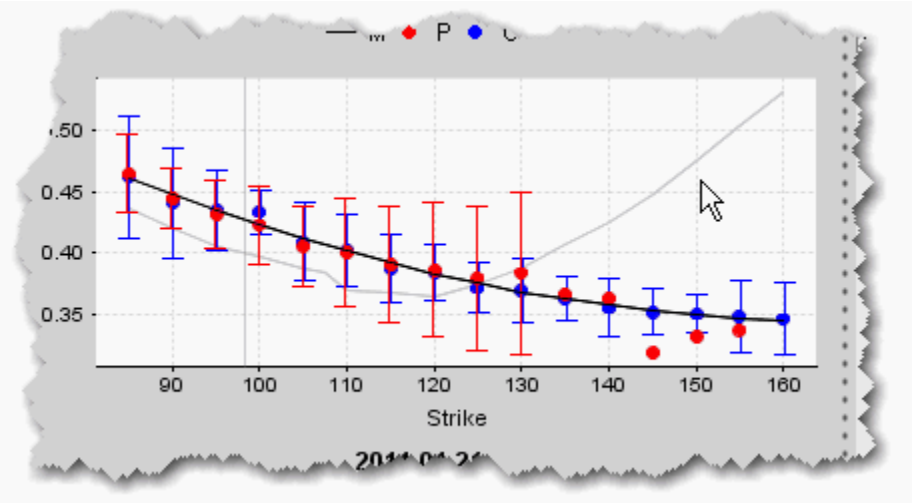


显示模型

1 从图像的右键点击菜单中，选择*模型历史*。

2 根据日期 / 时间名称来选择历史模型。

3 选择*显示*。



被保存的模型显示为实时彩色绘图内部的一条灰色的曲线。您同样能够在左侧合约描述窗格中的到期日下显示被保存的模型。

修改图表显示设置

您能够通过**频率控制**框来修改频率从而控制 CPU 的使用。同样，您能够使用图表设置框，对波动率曲线绘图的特定显示设置作出更改，包括对两个图表使用相同的水平 / 垂直轴，定义一行中图表的数量，等等。

如果您对波动率曲线显示选定了很多到期日，模型计算可能会用去 CPU 资源的一大部分。您能够使用频率控制框来降低值更新的速率 （并减少 CPU 资源负担）。您能够对模型计算 （全局），以及对波动率曲线和内在波动率数据修改频率。

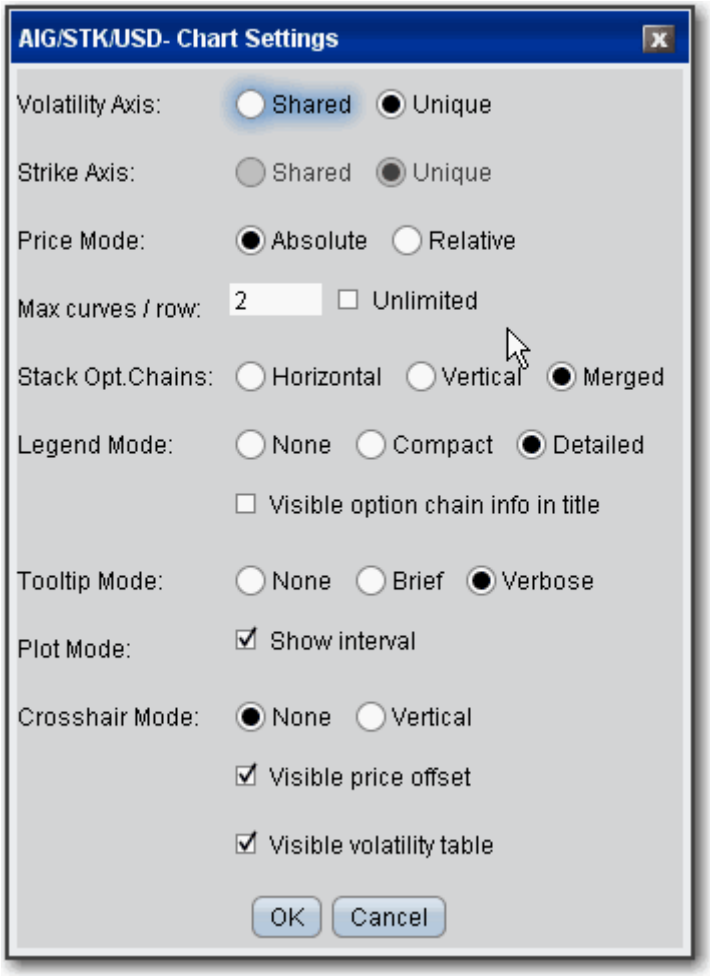
修改频率

1. 从**设置**菜单中，选择*频率*。
2. 修改默认值来提高 （较低的值）或降低 （较高的值）刷新速率。

修改图表设置

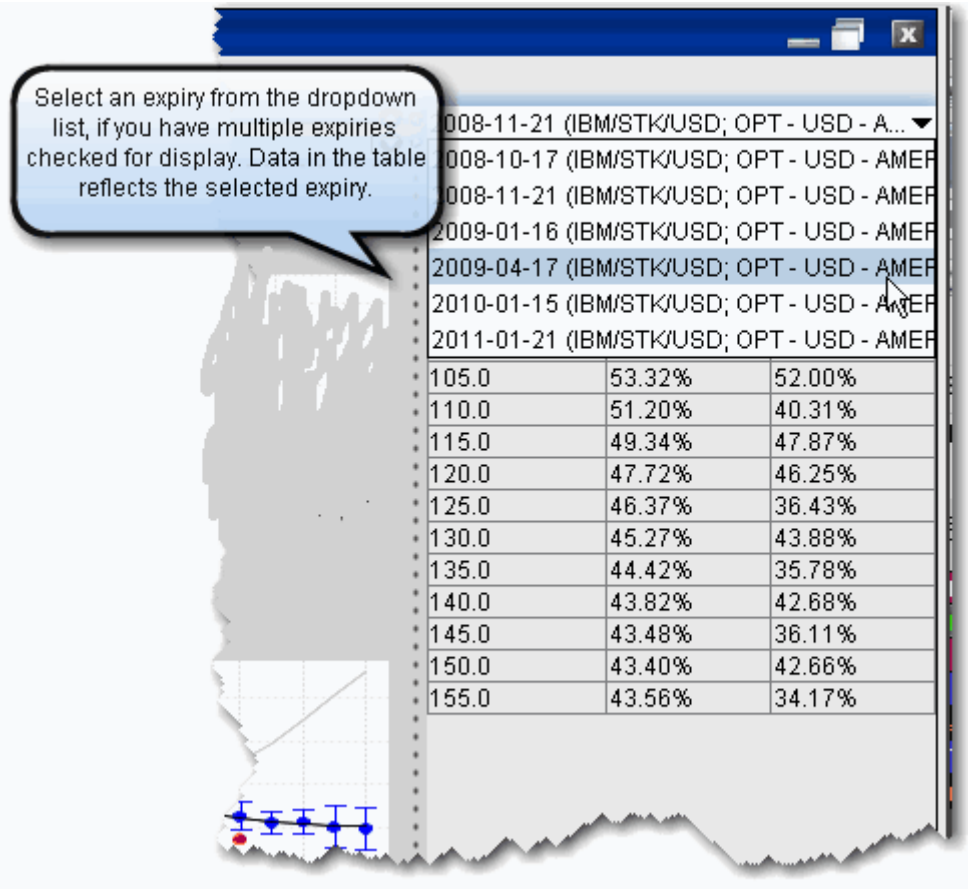
1. 从**设置**菜单中，选择*图表设置*。

NOTE: 如果您使用顶级设置菜单，那么设置将被全局地应用。如果您从波动率曲线窗格中使用设置菜单并选中**底层证券细节设置**，那么设置将只应用于底层证券的到期日。


AIG/STK/USD- Chart Settings
Volatility Axis:
Shared
Unique
Strike Axis:
Shared
Unique
Price Mode:
Absolute
Relative
Max curves / row:
2
Unlimited
Stack Opt.Chains:
Horizontal
Vertical
Merged
Legend Mode:
None
Compact
Detailed
Visible option chain info in title
Tooltip Mode:
None
Brief
Verbose
Plot Mode:
Show interval
Crosshair Mode:
None
Vertical
Visible price offset
Visible volatility table
OK
Cancel

波动率曲线表格

波动率曲线表格反映了绘图中的数据。要添加 IV （手动）输入，使用编辑菜单来选择要编辑的图像，或者右键点击一个绘图并选择*编辑*。波动率绘图和表格都变为可编辑的。在手动栏中，双击行权价上的内在波动率，并输入一个新的值。



默认情况下，模型导航复杂的期权模型计算引擎将绘图中的值与计算出的利率、股息、底层证券价格和其他参数一起使用，来计算*模型*价格。**如果您偏好使用反映在编辑后的绘图中的定价假设来计算模型价格，您必须将更改应用于您的绘图并将其留为*编辑*模式。**任何在编辑模式中拥有波动率曲线绘图的到期日期，将在模型价格和内在波动率的计算中使用该图像。

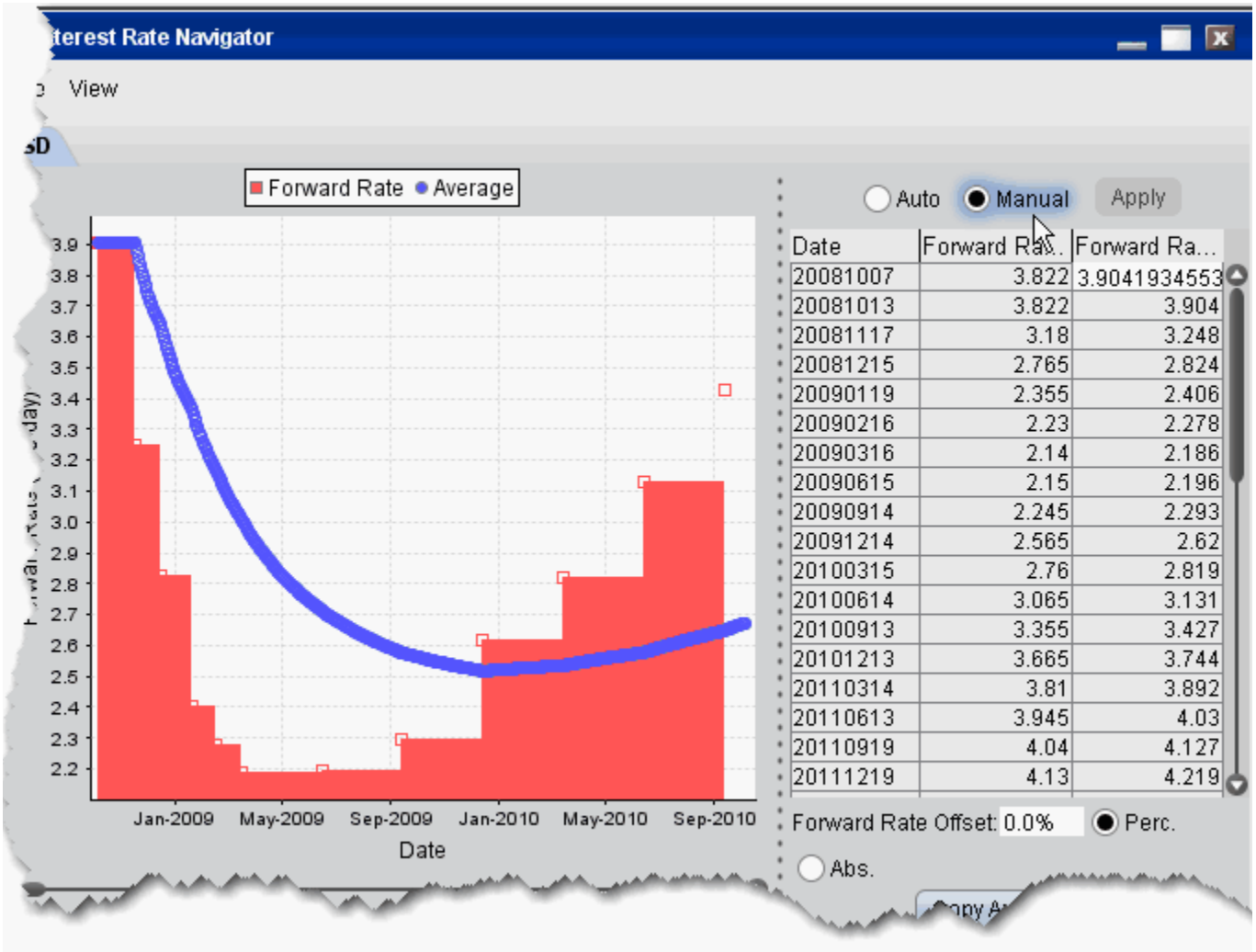
您同样能够修改利率和股息安排，并指定这些修改后的定价假设被用在模型价格计算中。

编辑利率

您能够通过在利率导航的手动栏中输入值来修改利率。

打开利率导航

1 从顶级**编辑**菜单中，选择*利率*。



有两个利率栏，*远期利率 （自动）*和*远期利率 （手动）*。自动栏显示了美国默认的利率。手动栏最初显示了美国利率 （而不是空白区域），但值是可编辑的。

编辑利率

1 选择手动单选按钮，来使手动利率栏可编辑。

2 在**手动**栏中双击一个利率并输入一个新利率。

3 点击应用来保存您的更改。

要让模型计算使用您的手动值，请确保手动单选按钮被选中。

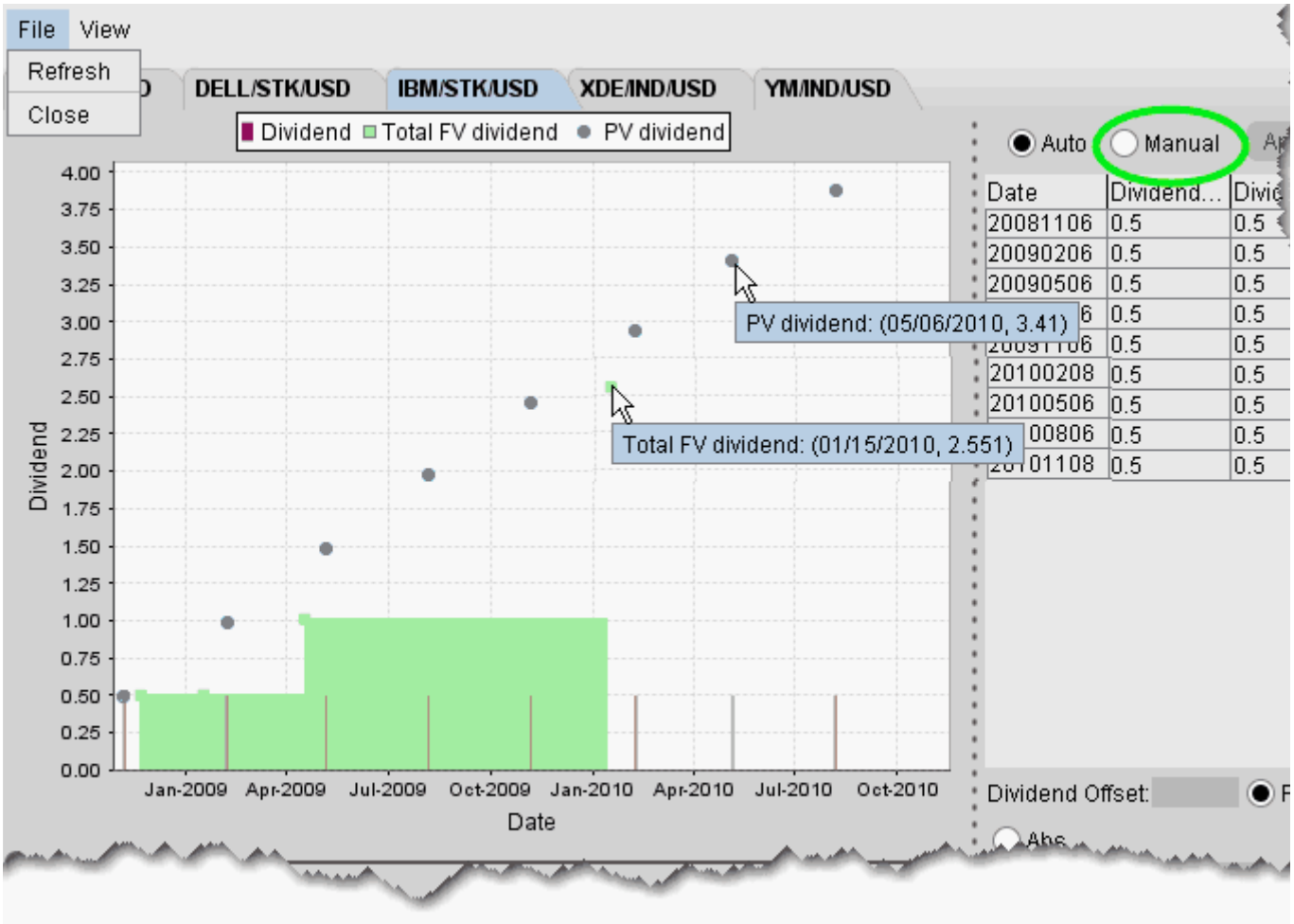
- 要更改显示的日期 / 利率数量，右键点击表格并选择*添加新的*，在表格顶部创建一个空白的可编辑的行，或者选择*删除已选中的*来删除已选中的行。
- 要将抵消值或百分比全局地应用于所有手动的输入，在利率抵消区域中输入一个抵消数额，并选择*百分比*或*绝对值*单选按钮。
- 期权模型是使用您通过选择**自动**或**手动**单选按钮而指定的利率来计算的。
- 年度百分比利率是使用银行年日历 （360 天 / 年）的单式定期存款利率。
- 系统将利率表格转换为指数利率的集合，其对类别中的每个到期日在即期基础上应用。当您展开一个到期日时，它作为 IR 值被显示在合约描述窗格中。
- 利率表格应用在所有期权类别中。当您在一个期权类别中更改利率时，更改将被应用于所有期权类别。

编辑股息

除了让您手动地设置股息安排，股息安排导航还根据资产的历史数据，提供自动的 “最佳猜想” 股息支付安排。

打开股息安排导航

1 从顶级**编辑**菜单中，选择*股息安排*。



有两种股息，*股息 （自动）*和*股息 （手动）*。自动栏根据历史数据，显示 “最佳猜想” 股息支付安排。手动栏显示相同的值 （而不是空白栏），但值是可编辑的。

编辑股息

1 选择**手动**单选按钮来让手动栏可编辑。

2 在**手动**栏中双击一个股息并输入一个新的值。

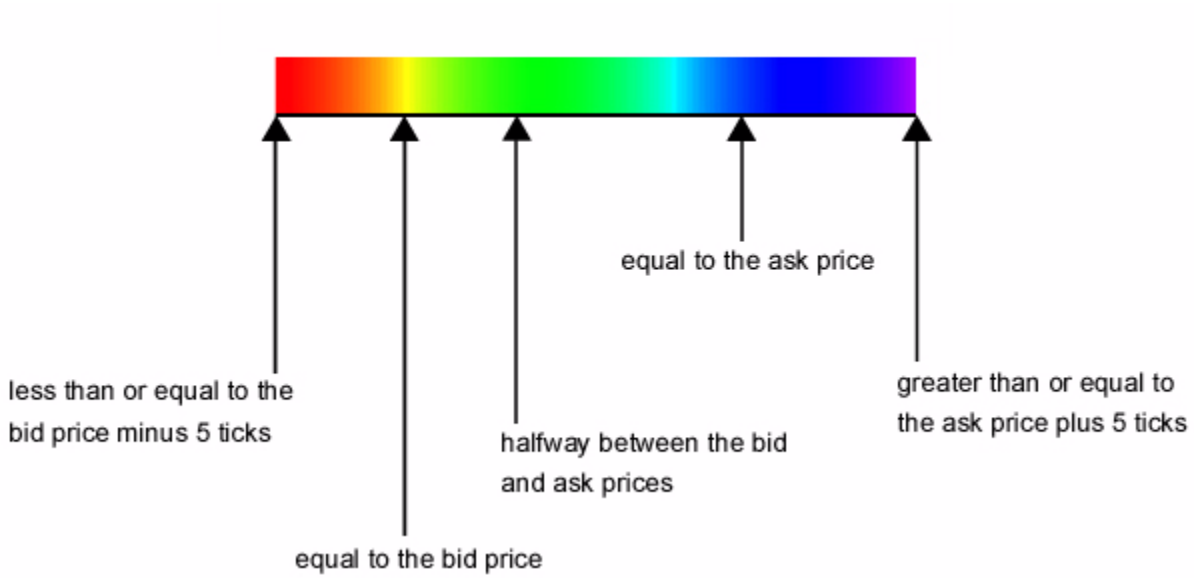
点击应用来保存您的更改。

- 要更改显示的股息数量，右键点击表格并选择*添加新的*，在表格顶部创建一个空白的可编辑的行，或者选择*删除已选中的*来删除已选中的行。
- 要将抵消值或百分比全局地应用于所有手动的输入，在股息抵消区域中输入一个抵消数额，并选择*百分比*或*绝对值*单选按钮。
- 期权模型是使用您通过选择**自动**或**手动**单选按钮而指定的股息安排来计算的。

模型价格颜色键

模型价格以彩色被显示在交易屏幕上，来帮助您一眼看出它们在什么位置与出价和要价相关。下面的颜色条显示了模型价格可能落在的范围。模型价格颜色与底层证券最后价格一起更新。

您必须在您的交易页面上显示模型区域，从而查看模型价格。

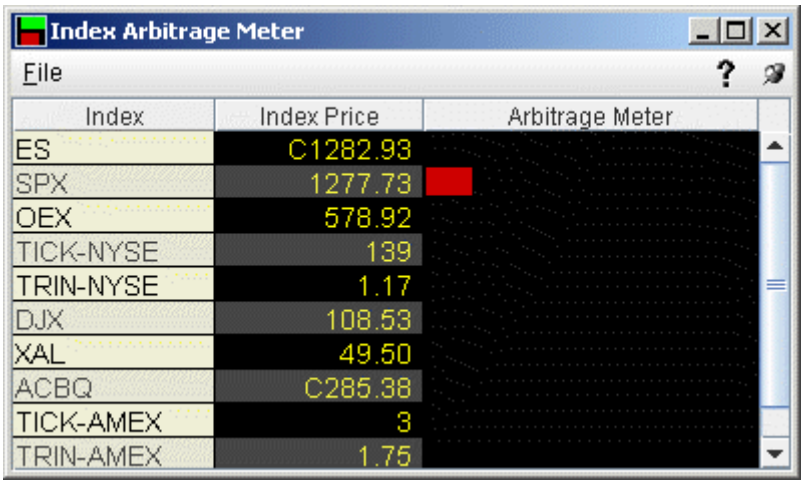


Note: 内在波动率 （在**内在波动率**栏中）通常以粉色或白色显示。如果**模型**或**内在波动率 （%）**值当中的一个以白色显示，那么这意味着模型没有计算任何价格或内在波动率。

指数套利表

引言

指数套利表说明了最近合约月期货价格高于 （或低于）其关于指数价格的公平未来价值的溢价 （或折价）程度。绿色的条表明最近合约月期货价格溢价于 （即大于）其公平未来价值。红色的条表明最近合约月期货价格折价于其公平未来价值。该工具可用于指数工具类型。



在登录时显示或隐藏套利表

当您登录时，对所有的指数工具，套利表被默认地显示。要在登录时隐藏指数套利表：

1. 在**配置**菜单上，选择*全局配置*，然后在左侧窗格中选择*显示*。
2. 选中或不选中*显示套利表*。

对指数显示套利表

1. 点击需要的市场数据线来选择指数。
2. 点击右键并选择**工具**，然后选择*套利表*。

8

基本分析

- 路透社基本分析
- MarketWatch 基本分析
- 新闻播报流

路透社基本分析

一旦您订阅了这项服务，您就能够在交易平台中的若干个地方查看路透社全球基本数据，包括：

- 在合约描述框中 （显示如下）
- 通过一系列特定合约的报告
- 通过将市场数据区域直接添加到您的交易窗口
- 通过基本市场扫描仪参数

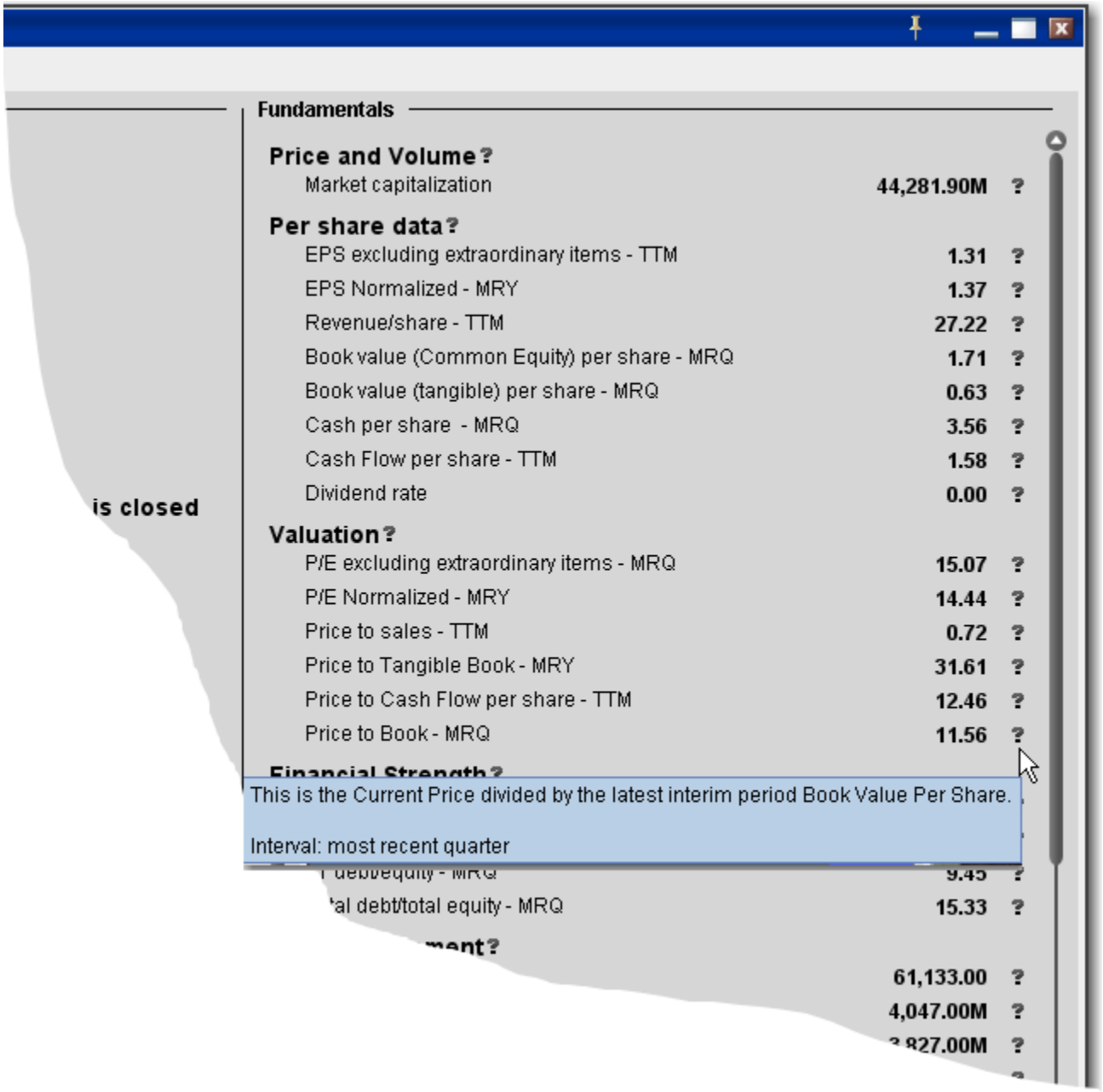
Note: 您必须在账户管理中，从**交易使用** > *市场数据订阅*页面来订阅路透社基本市场数据。在交易平台**视图**菜单上，使用账户管理选项直接进入账户管理。

合约描述中的路透社数据

在合约描述框中查看路透社基本

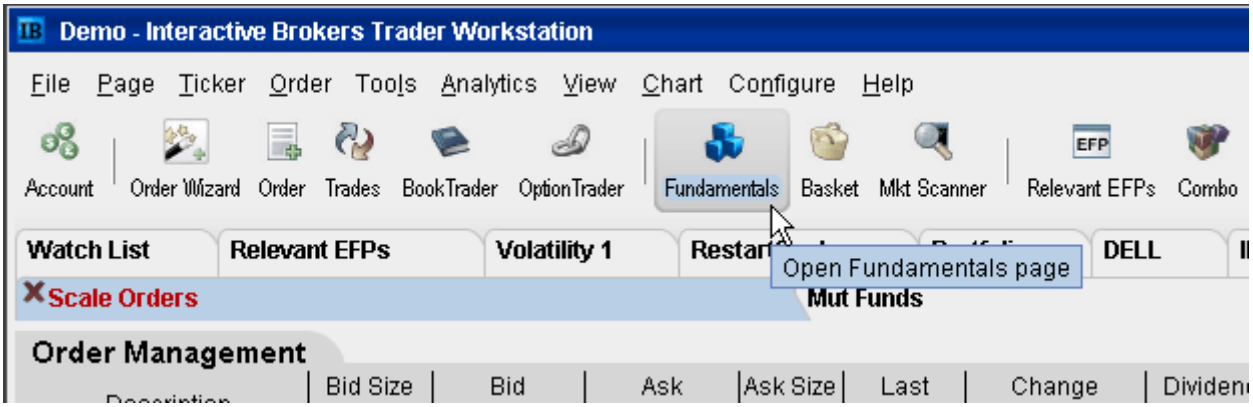
1. 在您的交易页面上右键点击一个代码行。
2. 从右键点击菜单中选择**合约信息**，然后选择*描述*。

基本数据被显示在描述框的右侧窗格中。在问号图标上握住您的鼠标来获取对其相关的值的定义。



路透社基本页面

通过一系列特定合约的报告来查看路透社全球基本数据。**基本**自包含的模块还通过报价、定单、日志、交易和投资组合面板提供完整的市场数据、定单管理和交易监控。

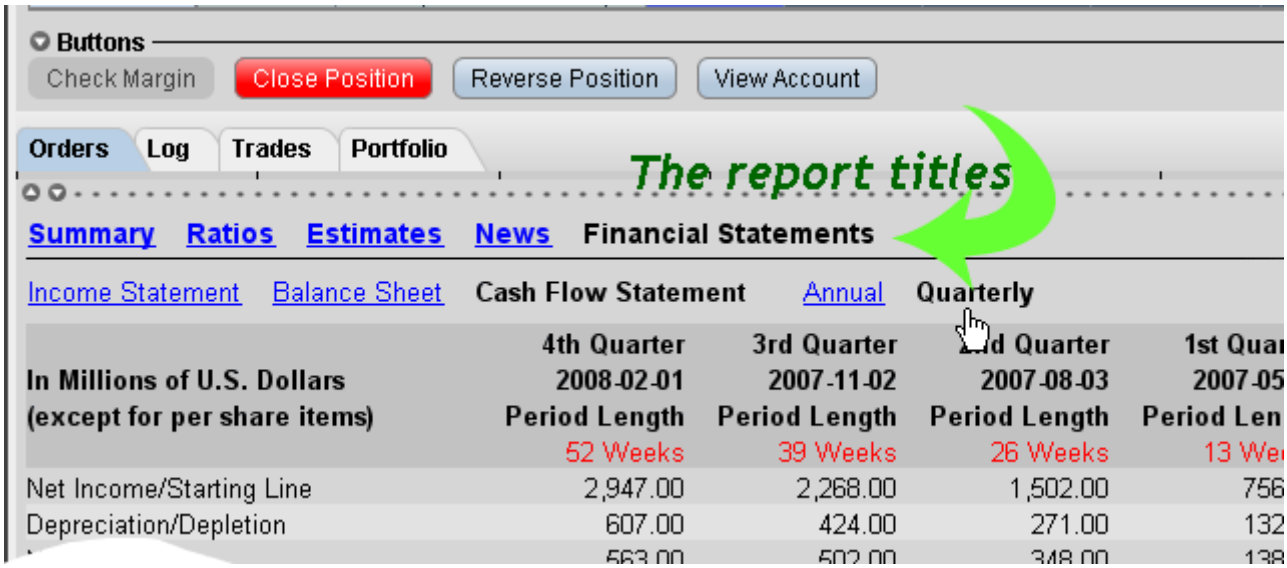


打开基本页面

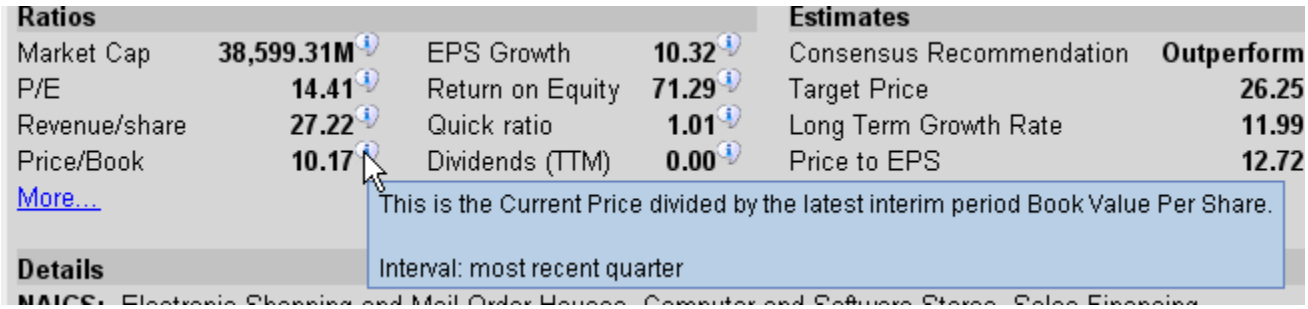
- 从交易工具栏中，点击**基本**图标。或者，从**代码**菜单中，选择*基本*。

基本报告

点击报告标题来打开报告。注意，若干个报告包含了被列举在报告页面顶部的子报告。



要查看一个区域的定义和计算，在计算旁边的“信息”图标上握住您的鼠标。


Ratios
Market Cap 38,599.31M
P/E 14.41
Revenue/share 27.22
Price/Book 10.17
More...
EPS Growth 10.32
Return on Equity 71.29
Quick ratio 1.01
Dividends (TTM) 0.00
Estimates
Consensus Recommendation Outperform
Target Price 26.25
Long Term Growth Rate 11.99
Price to EPS 12.72
This is the Current Price divided by the latest interim period Book Value Per Share.
Interval: most recent quarter
Details

将路透社区域添加到交易窗口

在页面上显示 / 删除市场数据栏

1 右键点击交易页面上的任何栏标题，然后选择客户化版式。

2 点击市场数据栏标签来查看栏。

已经显示在您的交易窗口中的栏出现在页面左侧的已显示的栏列表中。剩下的栏在右侧的可用的栏列表中根据类别被分组。

3 展开右侧窗格中的基本类别，并从交易窗口中添加或删除区域。

1

栏名称	描述
基本	
股息 （TTM）	该数值为在最近连续十二个月中支付给普通股股东的每股现金股息总数。
每股盈余 （EPS）增长	该增长率是过去 5 年中*每股盈余*的复合年度增长率，不包括*特殊项目*和*非持续经营*。 注：如果最近的年度或最远的年度的值为零或负数，那么增长率无法被计算，“NA”（不可用）将显示。
市值	市值的计算如下： 当前价格×当前在外流通股数
市盈率 （P/E）	该比率的计算方法是：将当前价格除以稀释的每股盈余总和，稀释的每股盈余总和来自特殊项目和会计方法更改之前的四个财务报表期间的连续经营。
市值与账面价值比	该数值为当前价格除以最近财务报表期间的每股账面价值。
速动比率	也被称作酸性测试比率，该数值被定义为：最近财务报表期间的现金加上短期投资再加上应收账款，除以该期间的流动负债总数。 注意：该项目不可用于 （NA）银行、保险公司以及其他不区分流动和长期资产与负债的公司。
股本回报率	该数值为在最近十二个月内可用于普通股股东的收入除以平均普通股权益，以百分比表示。平均普通股权益的计算是将最近 5 个季度的普通股权益相加再除以 5。

MarketWatch 基本分析

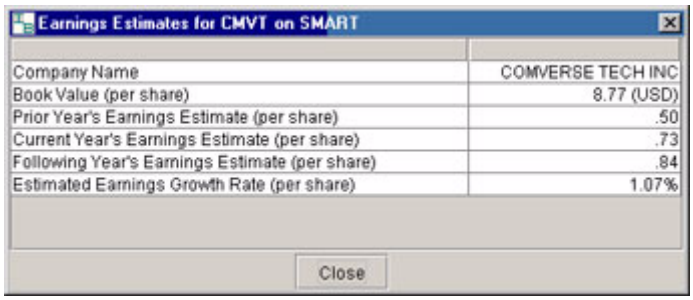
- 盈余估计
- 公司简介
- 新闻和评论
- 历史图表
- 公司财务报表
- 内部交易信息
- 分析师信息
- 证券交易委员会档案

盈余估计

查看特定公司的盈余估计

1 在主交易屏幕上选中一条市场数据线。

2 使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*盈余估计*。



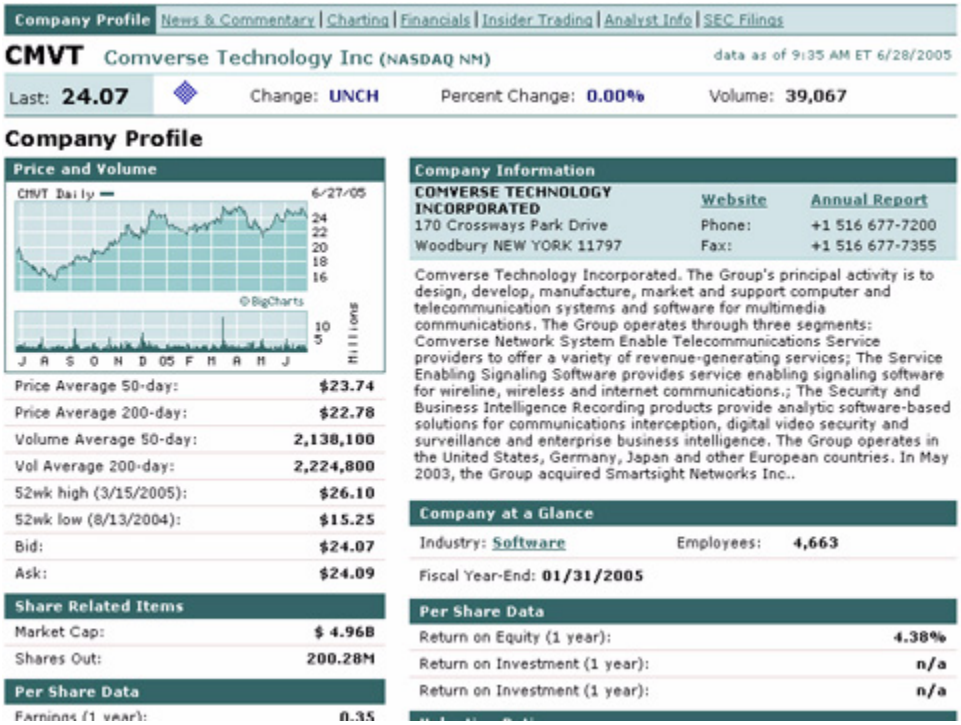
公司简介

公司简介显示了基本的数据，例如行业、联系信息、提供的产品 / 服务以及选定的资产的每股和盈利能力数据还有估值比率。

查看公司简介

1 在主交易屏幕上选中一条市场数据线。

2 使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*公司简介*。



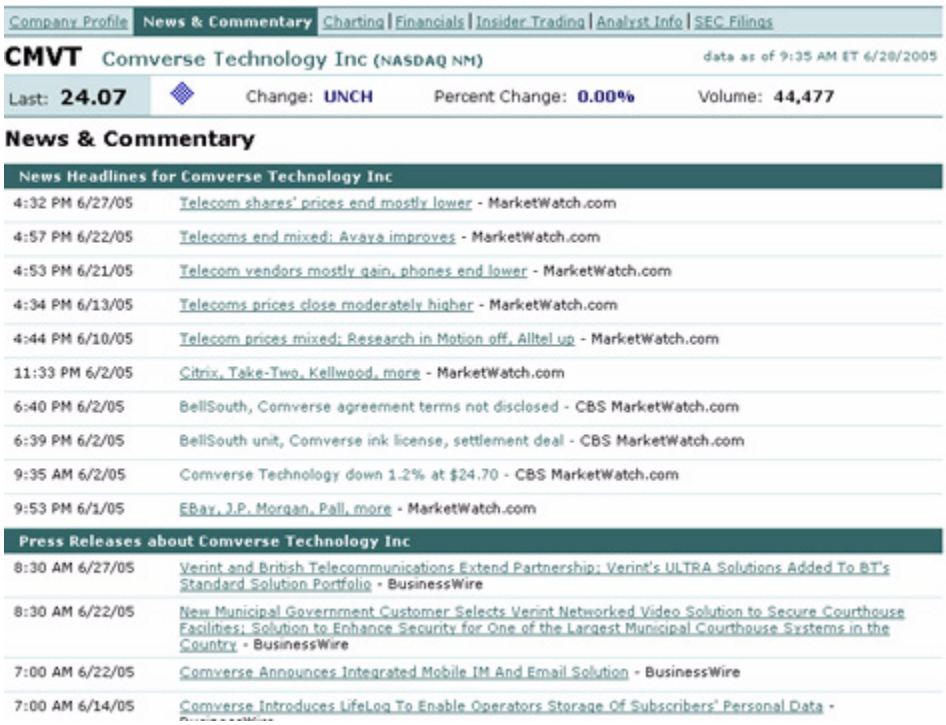
新闻和评论

新闻和评论显示了行业以及特定合约的标题和新闻发布。

查看新闻和评论

1 在主交易屏幕上选中一条市场数据线。

2 使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*新闻和研究*。



历史图表

绘图让您设定图表参数来创建时间范围从 1 天到十年的历史图表。

创建历史图表

1 在主交易屏幕上选中一条市场数据线。

2 使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*例如图表*。

公司财务报表

对选定的公司查看上一个财政年度的财务报表，包括资产负债表和现金流量表。

查看特定公司的财务报表

1 在主交易屏幕上选中一条市场数据线。

2 使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*财务*。

Company Profile | News & Commentary | Charting | **Financials** | Insider Trading | Analyst Info | SEC Filings

CMVT Comverse Technology Inc (NASDAQ NM) data as of 9:39 AM ET 6/28/2005

Last: **24.08** Change: **+0.01** Percent Change: **0.04%** Volume: **60,890**

Financials - Income Statement | Balance Sheet | Cash Flow Statement

Annual Financials for Comverse Technology Inc Quarterly Financials Fiscal Year-End: 01/31

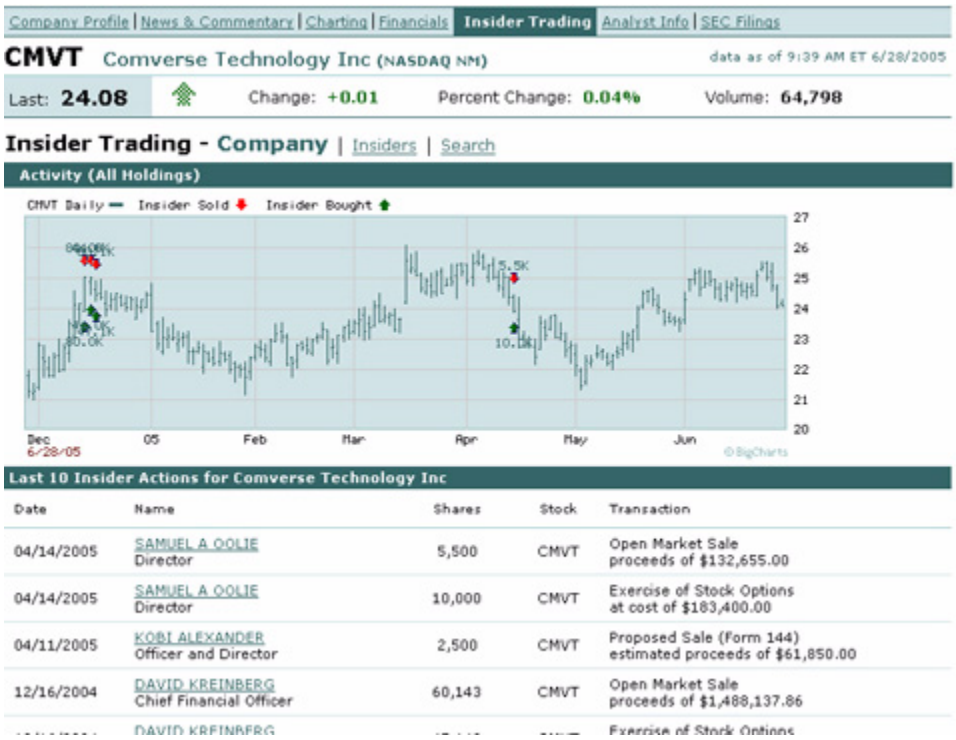
All dollar amounts in millions except per share amounts.	2004 01/31/2004	2003 01/31/2003	2002 01/31/2002	2001 01/31/2001
Net Sales	959.4	765.9	735.9	1,270.2
Cost Of Goods Sold	380.7	327.6	338.1	525.5
Gross Profit	**578.7**	**438.3**	**397.8**	**744.7**
SG and A Expenses	290.4	254.4	281.2	323.0
R and D Expenditures	241.3	216.5	232.6	293.3
Depreciation and Amortization	-	-	-	-
Income Before Depreciation and Amortization	47.0	-32.5	-116.0	128.4
Interest Expense	-	-	-	-
Investment Gains (Losses)	-	-	-	-
Total Operating Expenses	**531.7**	**470.8**	**513.8**	**616.3**
Non-Operating Income	36.2	41.1	-7.8	-70.1
Other Income	-	-	-	-
Income Before Tax	83.2	8.6	-123.8	58.3
Provision For Income Taxes	13.2	8.2	3.3	4.4

内部交易信息

对选定的公司查看主要的内部股东的交易活动。

查看内部交易信息

1. 在主交易屏幕上选中一条市场数据线。
2. 使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*内部交易*。



分析师信息

对选定的合约查看最近的分析师推荐。

查看分析师信息

1 在主交易屏幕上选中一条市场数据线。

2 使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*分析师信息*。

Company Profile | News & Commentary | Charting | Financials | Insider Trading | **Analyst Info** | SEC Filings

CMVT Comverse Technology Inc (NASDAQ NM) data as of 9:42 AM ET 6/28/2005

Last: **24.13** Change: **+0.06** Percent Change: **0.25%** Volume: **78,803**

Analyst Info - Snapshot | Ratings | Estimates

Avgerage Recommendation:	BUY	Average Target Price:	$28.57
Number of Ratings:	22	Current Qtrs. Estimate:	$0.13
FY Report Date:	1/2006	Current Year's Estimate:	$0.54
Last Qtr's Earnings:	$0.12	PE on CY Estimate:	77.84
Year-Ago Earnings:	$0.31	Next Fiscal Yr Estimate:	$0.54
		PE on Next FY:	44.93

Most Recent Analyst Recommendations

Date	Broker	New	Old	Comments
4/14/2005	Janney Montgomery Scott	Buy		Views fair value at $30
3/29/2005	Oppenheimer & Co.	Buy	Neutral	Cites increased confidence in revenue and long-term outlook
1/18/2005	J.P. Morgan	Neutral	Overweight	Cites valuation and its expectation that year on year growth will slow on tougher comparisons
7/8/2004	RBC Capital Markets	Sector Perform		Sets $21 price target
6/2/2004	WR Hambrecht & Co.	Buy	Hold	Ups price target to $22; believes co. is 'ideally' positioned to capitalize on accelerating growth of mobile data traffic

证券交易委员会档案

对选定的公司查看上一年的全部证券交易委员会档案。

查看证券交易委员会档案

1 在主交易屏幕上选中一条市场数据线。

2 使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*证券交易委员会档案*。

Company Profile | News & Commentary | Charting | Financials | Insider Trading | Analyst Info | **SEC Filings**

CMVT Comverse Technology Inc (NASDAQ NM) data as of 9:43 AM ET 6/28/2005

Last: **24.14** Change: **+0.07** Percent Change: **0.29%** Volume: **80,503**

SEC Filings - All Filings | 8-K | 10-K | 10-Q | Proxy | Registration | 13D | 13F | 13G

SEC Filings forComverse Technology Inc

Filing Date	Document Date	Type	Category	Amended
06/20/2005	06/16/2005	8-K	Special Events	*
06/01/2005	06/01/2005	8-K	Special Events	*
05/09/2005	06/16/2005	DEF 14A	22	*
04/20/2005	01/31/2005	10-K	Annual Reports	*
04/04/2005	01/31/2005	10-K	Annual Reports	*
03/14/2005	03/14/2005	8-K	Special Events	*
02/16/2005	02/11/2005	8-K	Special Events	*
12/08/2004	10/31/2004	10-Q	Quarterly Reports	*
12/07/2004	12/07/2004	8-K	Special Events	*
12/01/2004	12/01/2004	8-K	Special Events	*
09/09/2004	07/31/2004	10-Q	Quarterly Reports	*
09/08/2004	09/08/2004	8-K	Special Events	
06/08/2004	04/30/2004	10-Q	Quarterly Reports	
06/02/2004	06/02/2004	8-K	Special Events	*
05/03/2004	06/15/2004	DEF 14A	22	

新闻播报流

您现在能够使用新闻功能，来选择查看来自诸如 CNET News、Google News、MSNBC 和路透社等来源的实时新闻报道。

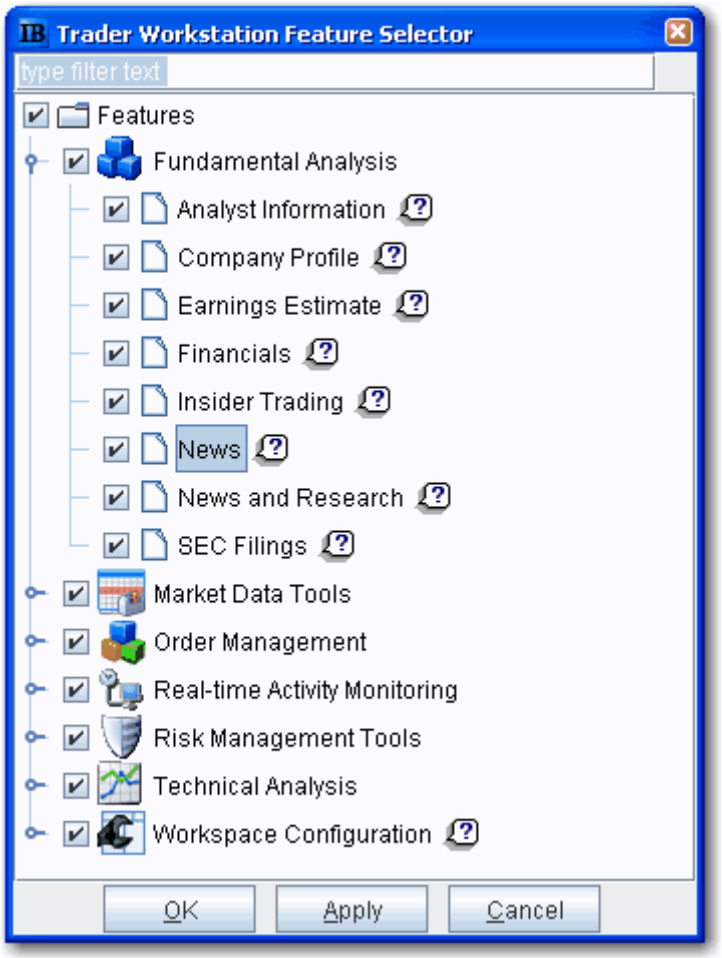
启用新闻播报

1 在**配置**菜单上，选择*功能选择器*。

2 通过点击水平键图标来展开**基本分析**类别。

3 选中*新闻*，然后点击**确定**。

显示新闻区域



1 在交易窗口顶部右键点击区域标题行，然后点击*客户化版式*。

2 在市场数据栏页面上的可用的栏列表中，拉动到新闻类别并选择新闻时间和新闻标题。点击添加按钮将它们移动到已显示的栏列表中。

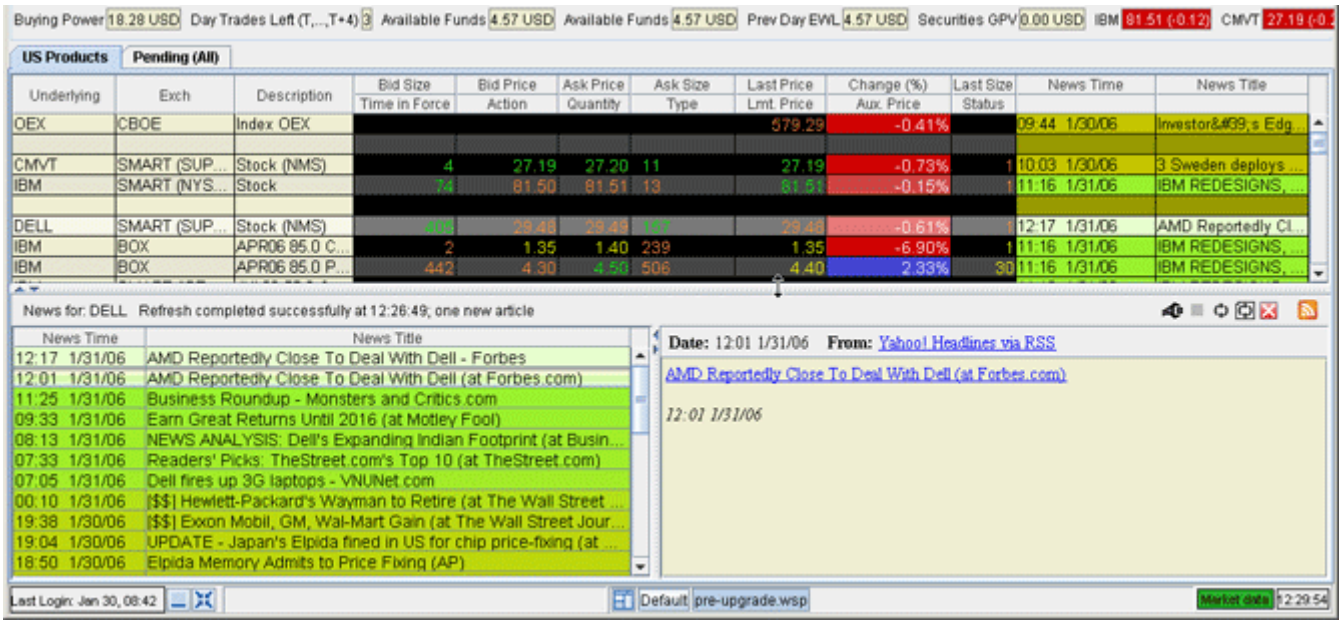
在您的交易页面上，栏*新闻时间*和*新闻标题*出现在区域列表中。注意，如果需要，您能够将它们拖动并放到另一个位置

另外，行以彩色被显示。颜色最浅的报道是最近的。

3 点击一个新闻标题，直接在交易窗口下方打开新闻浏览器。头条新闻显示在左侧窗格中，头条新闻和新闻标题显示在右侧窗格中。点击右侧窗格中的报道行，在另一个浏览器中查看整个报道。

Note: *您也能够在交易窗口中双击报道行，在另一个浏览器中打开报道。*

这些行也以分级的颜色显示。最浅的颜色表示最近的报道。



9

技术分析

- 图表
- 图表类型和工具
- 图表指标
- 市场扫描仪
- TICK 和 TRIN 市场指标

图表

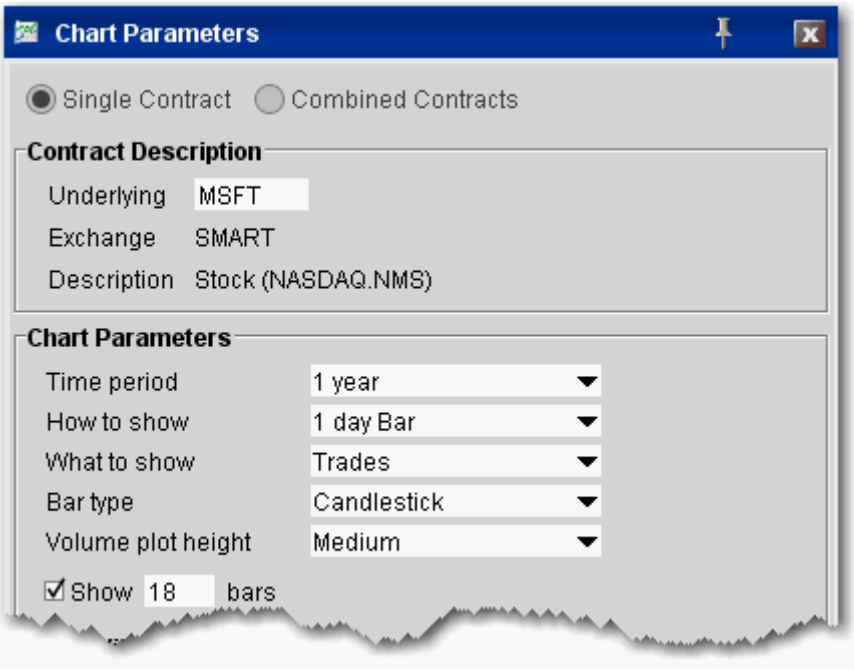
- 创建实时图表
- 为多个资产绘制图表
- 添加新图表至现有的图表窗口
- 将图表版式保存为模板
- 为到期的合约绘制图表
- 图表工具栏
- 编辑图表
- 图表显示

创建实时图表

您能够定义参数，对您的交易页面上的任何合约显示实时的线状或条状图，包括在 IDEAL 交易的货币。要获取关于如何从您的图表中直接交易的细节，参见用户指南的图表交易者话题。

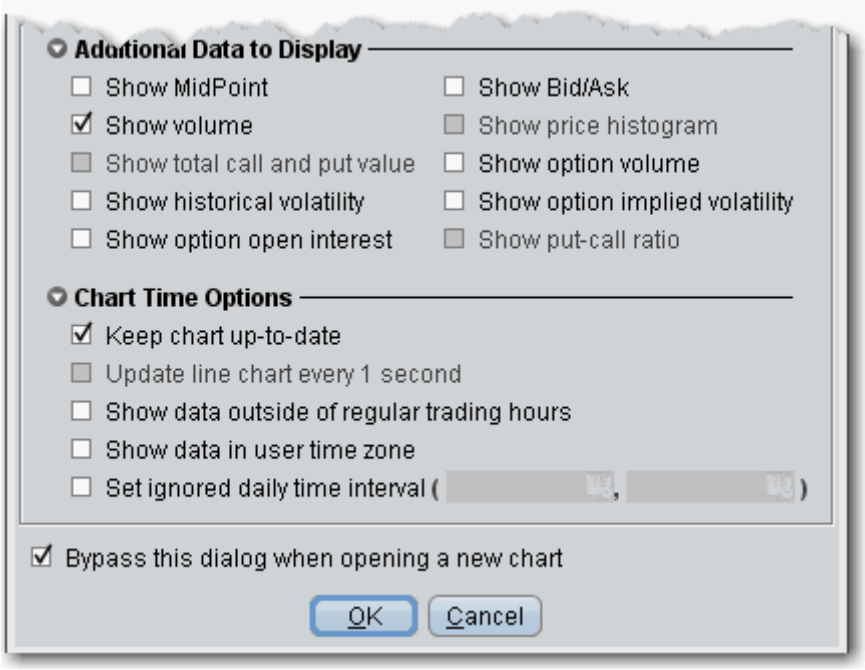
创建图表

1. 选择您想要创建图表的合约。
2. 从右键点击菜单中，选择**图表**，然后选择*新建图表*。
3. 设置图表参数来定义图表。



区域	描述
时间段	为图表选择一个时间段，范围从 1 分钟到 3 年。
如何显示	将底层证券绘制为线状图或 1 天棒状图。
显示什么	选择首要显示：交易、中点、出价 / 要价、期权交易量、历史波动率、期权内在波动率、期权未平仓合约数。
条类型	如果*如何显示*为 1 天棒状图，*显示什么*为**交易**或**中点**，那么您能够将条类型定义为*高低条*或烛台。
交易量绘图高度	如果您在**要显示的补充数据**部分中选择*显示交易量*，您能够将交易量绘图高度设定为小、中或大。

区域	描述
显示条数目	输入要在图表上显示的条数目，并选中来强制执行该属性。当被选中，条的数目将保持恒定，无论对时间段或其他变量作出什么更改。



要显示的补充数据

区域	描述	区域	描述
显示中点	绘制中点。	*显示出价 / 要价*	绘制出价 / 要价。
显示交易量	在子图表中绘制交易量。如有必要，设置上述的交易量绘图高度。	*显示价格直方图*	在图表中一个单独的区域中显示每个价格点上的每日交易量。
显示看涨和看跌期权的总价值	对期权设置，例如未平仓合约数和交易量，选中来显示看涨和看跌期权的总价值。	*显示期权交易量*	在期权交易量子图表中绘制看涨和看跌期权交易量。
显示历史波动率	为期权显示真实的历史波动率。	*显示期权内在波动率*	在波动率子图表中绘制内在波动率。
显示期权未平仓合约数	在未平仓合约数子图表上绘制看跌和看涨期权的未平仓合约数。	*显示看跌 / 看涨比率*	在子图表中显示看跌 / 看涨比率。注意您必须显示*期权交易量*或*期权未平仓合约数*来启用看跌 / 看涨比率。

图表时间选项

区域	描述
保持图表更新	选中来让图表实时地更新。
每 1 秒钟更新线状图	如被选中，线状图地最后部分将每 1 秒钟更新。
显示常规交易时间之外的数据	如被选中，显示在延长时段交易的交易所图表，例如 Globex。
以用户时区显示数据	如被选中，使用您的计算机的时区。否则，使用合约上市的市场的时区。
设定被忽略的每日时间间隔	定义一个时间段，当绘制底层证券时它将被忽略。
当打开新图表时绕开该对话框	如被选中，这些设置将在不显示该对话框的情况下被应用于您打开的下一个图表。您能够通过从**图表**菜单中选择*图表参数*来修改设置。

为多个资产绘制图表

您能够在相同的图表上绘制两种或以上资产来进行比较。

为多个资产绘图

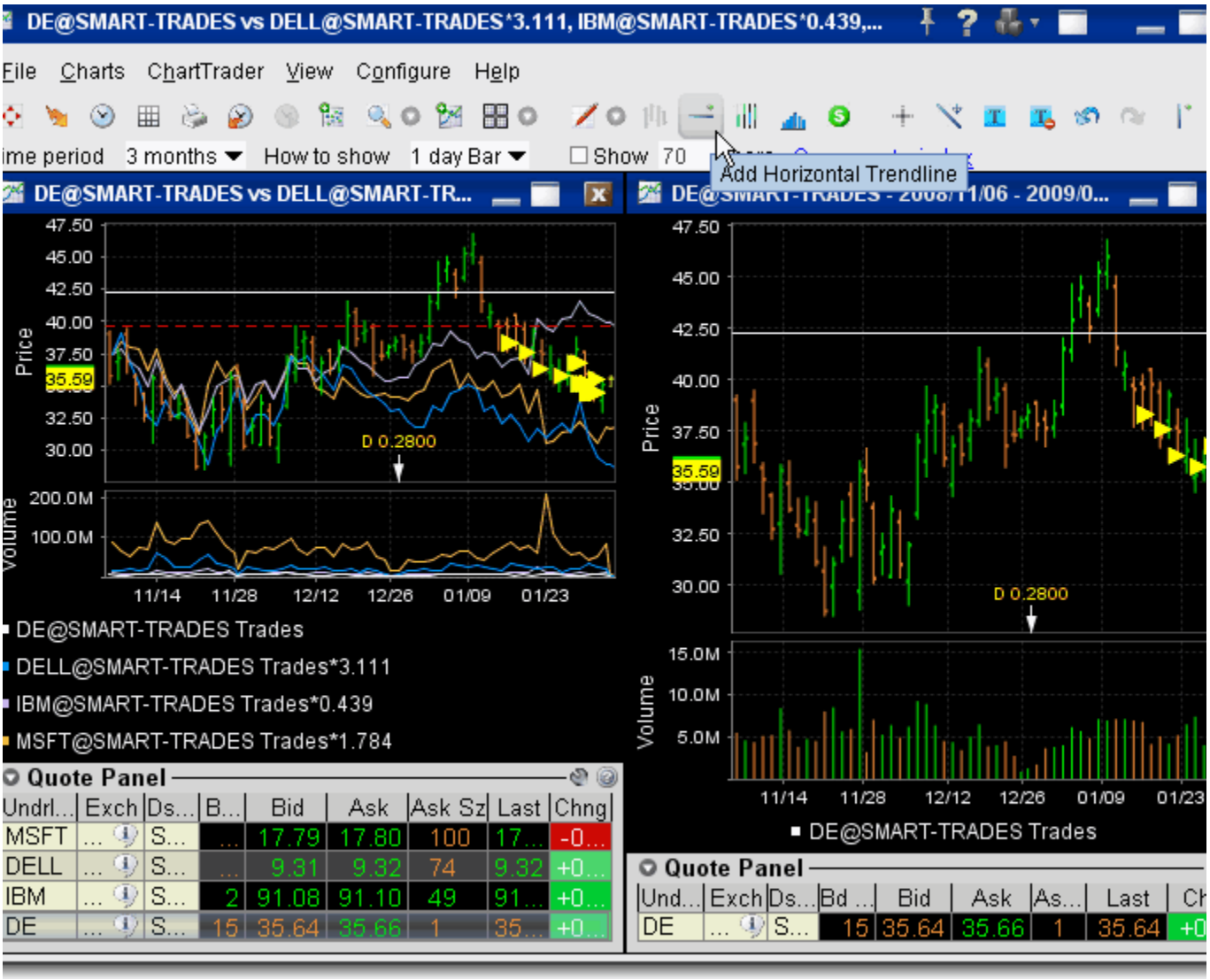
1. 在现有图表的**图表**菜单上，选择*添加合约*。
2. 输入底层证券代码并选择合约。
3. 选择**显示什么**：
   - **a** *交易*显示了定单执行的价格。
   - **b** *中点*画出了当前最佳出价 / 要价的中点。

c *出价／要价*显示了最佳出价和最佳要价。

4 点击确定。所有合约以不同的颜色被绘制，被沿着图表底部的键定义。

添加新图表至现有的图表窗口

您能够选择将多个图表包括到单个窗口中，使用自动显示功能来安排图表，并在相同底层证券的图表之间共享趋势线。



将新图表添加到现有的图表窗口中

1 从**图表**菜单中，选择*添加新图表*。

2 如果您想让图表使用与现有图表相同的底层证券，那么选中*子图表使用当前底层证券*。选中该功能就预先占据了**图表参数**框中的合约描述。如果您是为不同的底层证券添加图表，那么不要选中该选项。

Note: 如果您在相同的图表中绘制了多个合约，那么当前证券指的是被用来创建最初图表的代码。

3 在**图表参数**框中定义新图表并点击确定。两个图表都出现在图表框架中。

在一个窗口中安排多个图表

- 在图表的**视图**菜单中，点击平铺设计：平铺图表 （网格）、平铺图表 （垂直）或平铺图表 （水平）。窗口中的所有图表遵循选定的平铺设计。

在图表之间共享趋势线

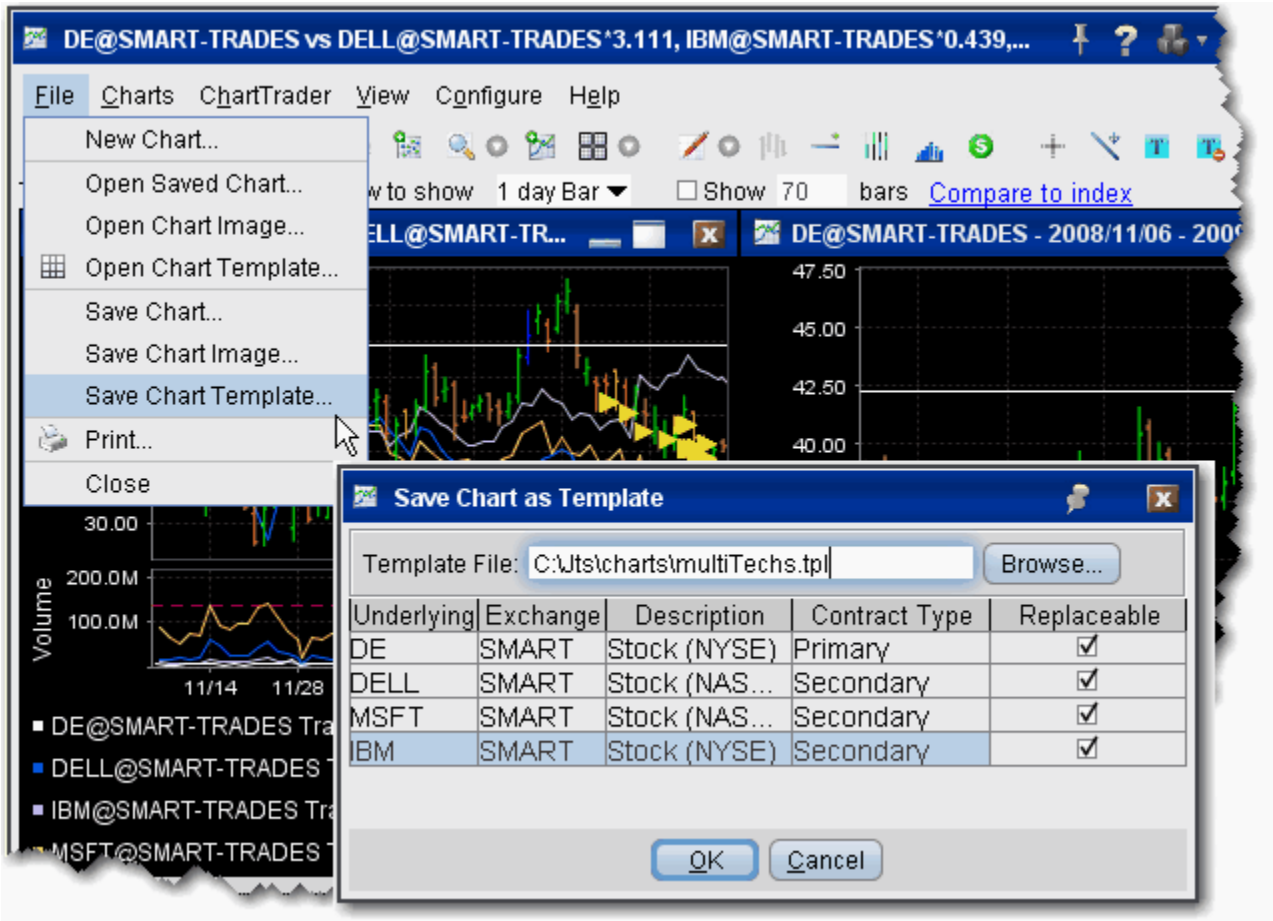
1 从图表窗口中点击配置扳手图标。

2 在**设置**页面中，选中*在图表之间共性趋势线*。

如果该功能被选中，当您在多图表的窗口中为单个图表添加或编辑趋势线时，趋势线行动将被应用于该窗口中相同合约的所有其他图表。

将图表版式保存为模板

您能够通过将图表保存为模板并随后对其他合约重新应用模板，从而重复使用喜好的图表版式，包括时间段、显示什么以及如何显示参数。



创建图表模板

1. 用所有定义的参数来创建实时图表或图表组。
2. 在图表的**文件**菜单上，选择*保存图表模板*。
3. 通过将**模板文件**区域中的 “未命名” 替换为图表名称来给模板一个描述性的名称。
4. 如果您想让任何次要的图表在您打开模板时可以被替换，那么选中可替换。您必须至少有一个图表被标记为 “可替换的”。
5. 点击**确定**来保存模板。

使用模板来创建新图表

1. 在图表的**文件**菜单上，选择*打开图表模板*。

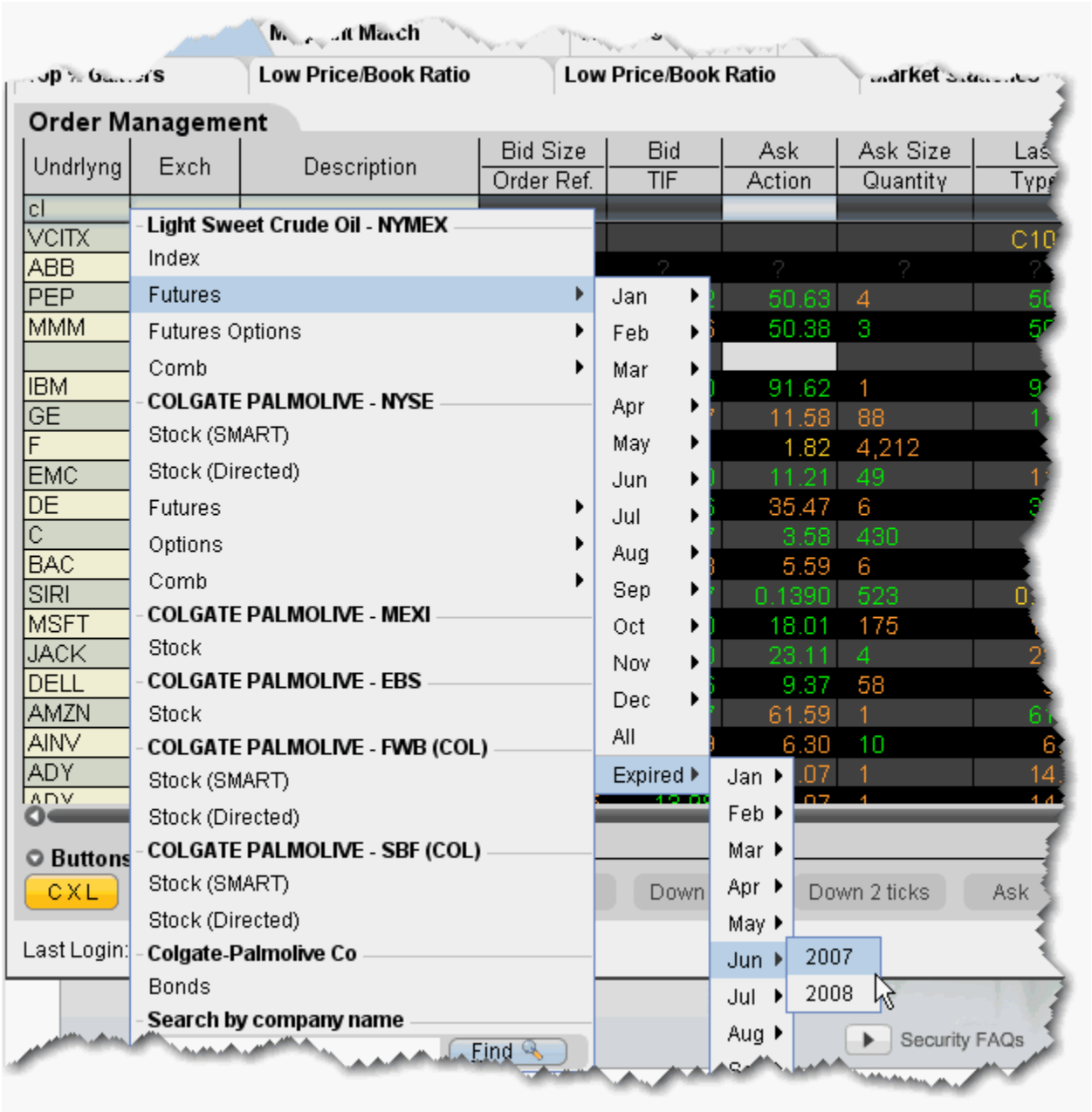
2 从模板文件列表中选择您想要打开的图表模板，或者使用浏览按钮来找到您想要使用的模板。

3 通过在底层证券区域中输入底层证券代码来输入新合约。

4 点击确定，根据您保存的模板来查看新图表。

为到期的合约绘制图表

您能够在实时的 IB 图表上为到期的期货合约绘制数据。另外，如果您想要绘制一个当前不在您的交易屏幕上的到期合约，您能够添加该合约。



将到期的期货合约添加至交易窗口

1 输入底层证券代码并敲下回车键，然后从工具类型列表中选择期货。

2 在到期日列表底部，选择到期的，然后通过选择到期月份和年份来选择您想要绘制的到期合约。

3 如果您也想要底层证券的市场数据，那么在询问您是否想要添加底层证券的消息上点击*是*。

为到期的合约绘制图表

1 选择到期的合约，然后从右键点击菜单中选择**图表**，然后选择*新建图表*。

2 为合约设定您的图表标准。

图表工具栏

使用工具栏上的图标来发起一个行动。关于如何从工具栏中添加或删除按钮的说明，使用图表配置话题。

图标	行动	描述
	图表参数	打开图表参数对话框，您在这里设定或修改图表显示的标准。
	显示 / 隐藏图表交易者	打开 （或隐藏）图表交易者工具，其让您直接从图表中提交交易。
	显示 / 隐藏时间参数面板	允许您对活动的图表更改时间段和间隔。
	打开图表模板	允许您打开从一个或多个图表创建的被保存的面板。
	打印	打印选中的图表。
	移动时间段……	为图表数据设定一个新的日期和时间。
	将时间段移动到目前	将时间段重设为当前日期 / 时间。 反映使用中的时间段类型的图标将变为灰色。
	添加合约	为被添加到当前图表的新资产定义图表参数。
	添加研究	点击图标旁边的下拉箭头来选择一个图表研究。

图标	行动	描述
	添加新图表	该按钮允许您快速地将另一个图表添加至打开的图表窗口。要以相同的合约信息开始，在弹出对话框中选中*子图表使用当前证券*。
	添加评论	打开**添加评论**对话框。输入将被显示在评论框中的图表上的文本。
	删除所有评论	从图表中删除所有评论框。
	平铺图表 （网格）	自动地改变多个图表的尺寸，并在图表窗口中将它们放置为网格式样。
	平铺图表 （水平）	自动地改变多个图表的尺寸，并在图表窗口中将它们并排放置。
	平铺图表 （垂直）	自动地改变多个图表的尺寸，并在图表窗口中将它们一个置于另一个的顶部。
	修改或删除	点击图标旁边的下拉箭头来从图表中修改或删除选定的资产或研究。该功能对带有多个资产和研究的单个图表起作用。它将不包括单个图表框中的多个图表。
	显示条	对烛状图，点击更改为条形图。
	显示烛	对条形图，点击更改为柱状显示。 反映当前图表类型的图标变为灰色。
	显示 / 隐藏交易量	在图表底部显示或隐藏交易量面板。
	时间和销售	点击将光标更改为时间和销售线。点击一个时间，然后时间和销售数据页面对该时间打开。要将光标便回原样，点击**切换到十字准线**图标。
	切换到十字准线模式	将光标更改为十字准线。注意如果您没有在全局配置中启用显示水平十字准线，那么在该模式下您将只能看见一条垂直线。

图标	行动	描述
	添加斐波纳契趋势线	将斐波纳契趋势线插入到图表。
	添加水平趋势线	将光标转换为水平趋势线。点击图表来设定趋势线。要将光标变回原样，点击**切换到十字准线**图标。
	添加垂直趋势线	将光标转换为垂直趋势线。点击图表来设置趋势线。要将光标变回原样，点击**切换到十字准线**图标。
	添加徒手画趋势线	让您添加徒手画趋势线。点击图表来设置趋势线。要将光标变回原样，点击**切换到十字准线**图标。
	创建选定的趋势线的平行线	添加一条与选定的线平行的趋势线。要将光标变回原样，点击**切换到十字准线**图标。
	编辑选定的趋势线	选定的趋势线现在将在任何一段显示一个白色的方块。当您点击并拉住一端，您能够将趋势线旋转 360 度，并缩短或延长趋势线。点击线区域允许您在维持相同的长度和与图表的角度时还能够移动趋势线。右键点击趋势线允许您更改线的颜色、线的厚度，或者删除线。
	删除选定的趋势线	删除选定的趋势线。要将光标变回原样，点击**切换到十字准线**图标。
	删除所有趋势线	从活动的图表中删除所有的趋势线。
	删除条	可从图表中被强调的条的右键点击菜单中进入。点击来从图表中完全地删除选定的条。
	替换条数据	可从图表中被强调的条的右键点击菜单中进入。点击来修改与图表中选定的条相关的当前数据。
	放大	放大到图表上的一个区域。您能够在放大框中移动到一个新区域。

图标	行动	描述
	缩小	缩小给了您图表区域的更大视图。
	添加水平空间	通过压缩当前视图并将更多的时间间隔添加到图表的右侧来创建 “缩小” 效果。
	删除水平空间	删除时间间隔来创建 “放大” 效果。
	添加垂直空间	通过压缩当前视图并将更多的价格间隔添加到价格轴的顶部来创建垂直的 “缩小” 效果。
	删除垂直空间	从图表顶部删除价格间隔来创建 “放大” 效果。
	配置图表颜色	打开全局配置窗口，选中图表颜色。更改被显示在不同的图表参数上的颜色。
	刷新	刷新图表数据。
	配置	打开全局配置窗口来进行图表配置。
	撤销	点击来撤销最后的行动。
	恢复	点击来执行最后被撤销的行动。

编辑图表

趋势线、指标、条和其他图表显示项目的右键点击编辑菜单让您隐藏、删除和更改项目的数据、颜色和厚度，从而客户化您的图表并使其更易读。

使用图表编辑功能

1. 通过在图表项目上握住您的鼠标来选择一个用来编辑的显示功能。当项目颜色变化时，其被 “选定”。

2. 点击右键，将需要的编辑应用于您的显示。

   右键点击菜单是与上下文有关的，只根据您选定的项目来显示可用的编辑选项。例如，如果您在条形图中选择了一个条，右键点击菜单选项包括*删除条*、*替换条数据*和*更改条颜色*。如果您从指标中选择规划线，那么右键点击菜单选项包括*隐藏指标*、*更改指标厚度*和*更改指标颜色*。

撤销编辑

- 使用图表工具栏上的*撤销*或*恢复*图标来删除或重新应用您执行的最后编辑功能。

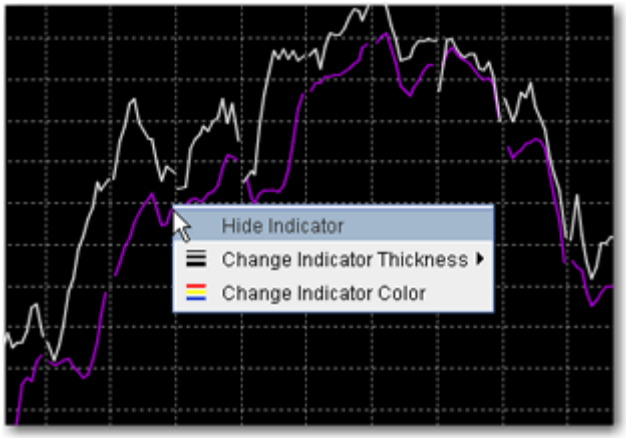
隐藏和显示指标行

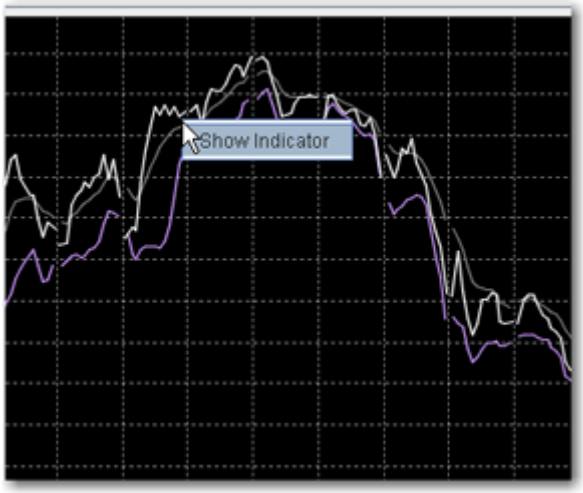
1. 通过在指标行上握住您的鼠标来选定该行。它改变颜色来表示其已被选定。

2. 点击右键并选择 “隐藏指标”。行消失，颜色键方块变为灰色。

3. 要显示隐藏的行，慢慢地将您的鼠标在图表上移动直到隐藏的行以灰色显示。

4 点击右键并选择 “显示指标”。行重新出现，且颜色键方块变回到其最初的颜色来与行匹配。





图表显示

交易平台直接在您的图表上显示即将到来的拆分和股息。当该功能被启用，在您打开它时事件在图表上将是可见的，拆分以品红色显示，股息以黄色显示。当您在事件上握住您的鼠标时，一个弹出对话框将显示细节。

启用对拆分和股息的查看

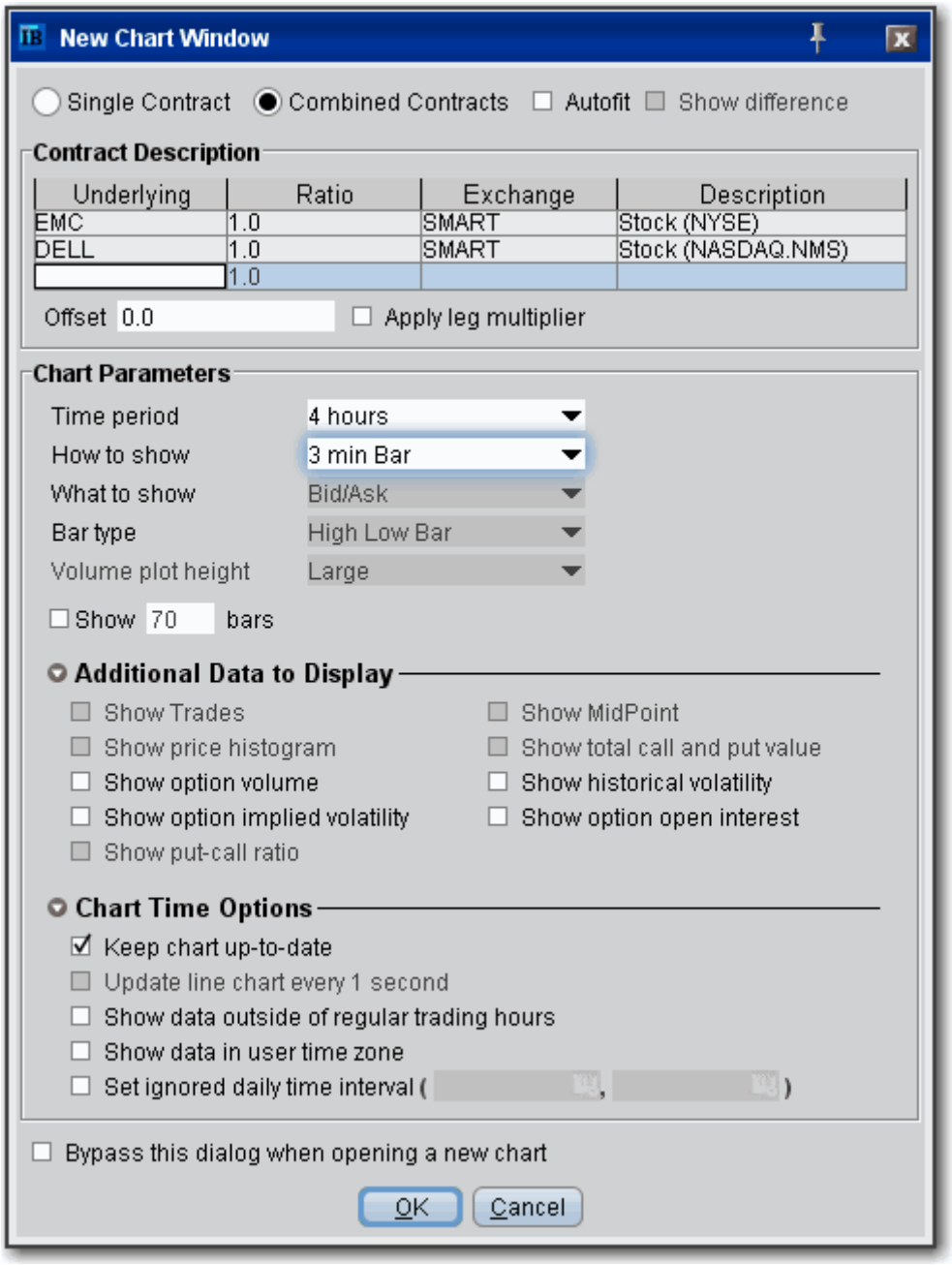
1. 在全局配置面板中，选择**图表**然后从左侧面板中选择*设置*。
2. 在右侧窗格中选中*显示拆分和股息*。

图表类型和工具

- 图表计算
- 图表交易者
- 创建条形图
- 创建线形图
- 创建烛形图
- 时间和销售数据
- 查看历史图表
- 应用斐波纳契趋势线

图表计算

您能够为两个或以上合约加上或减去出价 / 要价平均价格，并将和作为单个值来绘制图表。



为合并的合约绘制图表

1. 从交易窗口中点击**图表**图标。
2. 在新图表窗口的顶部选择*合并的合约*单选按钮。

3 在合约表格上，定义多个合约。

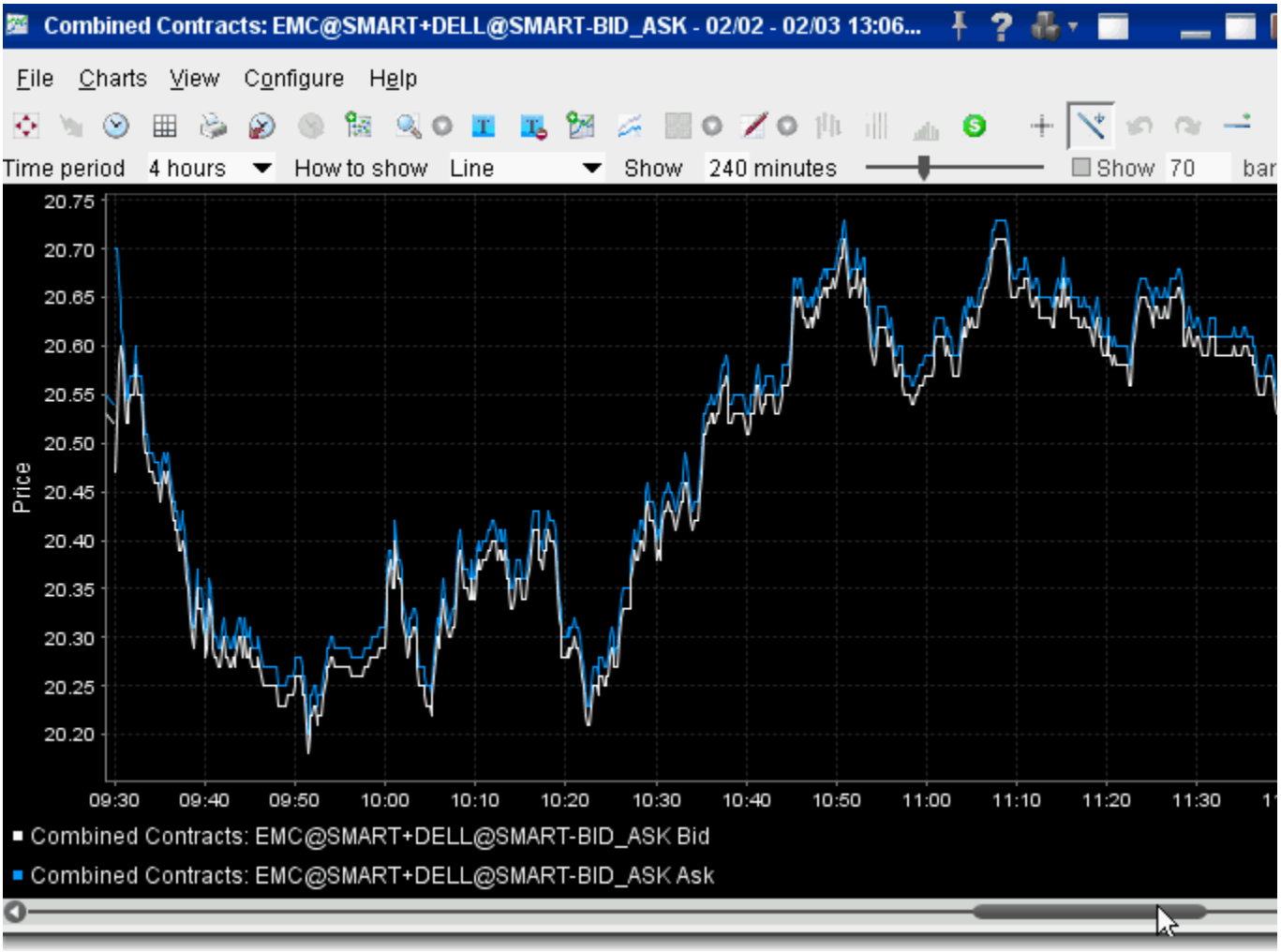
4 要减去一个值，使用比率区域在比率前输入一个减号，或者在窗口顶部选中*显示差额*。

5 如果需要，输入一个抵消金额。

6 选择时间段和如何显示的值。

7 点击确定。

合并的图表看上去如下：



自动拟合合并的图表

图表计算功能包括数学地计算一个或多个合约的比率从而尽可能地近似单个合约或指数的图表的能力。您能够选择同时显示首要和自动拟合图表，或者通过选中*显示差额*来查看它们的差。自动拟合的比率和抵消值的计算使用的是用来在非负限制下拟合最小二乘法回归问题的算法。细节被描述在 Lawson 和 Hanson 所著的《解决最小二乘法问题》（“Solving Least Squares Problems”）中。

使用自动拟合图表功能

1. 在窗口顶部选中*自动拟合*复选框。

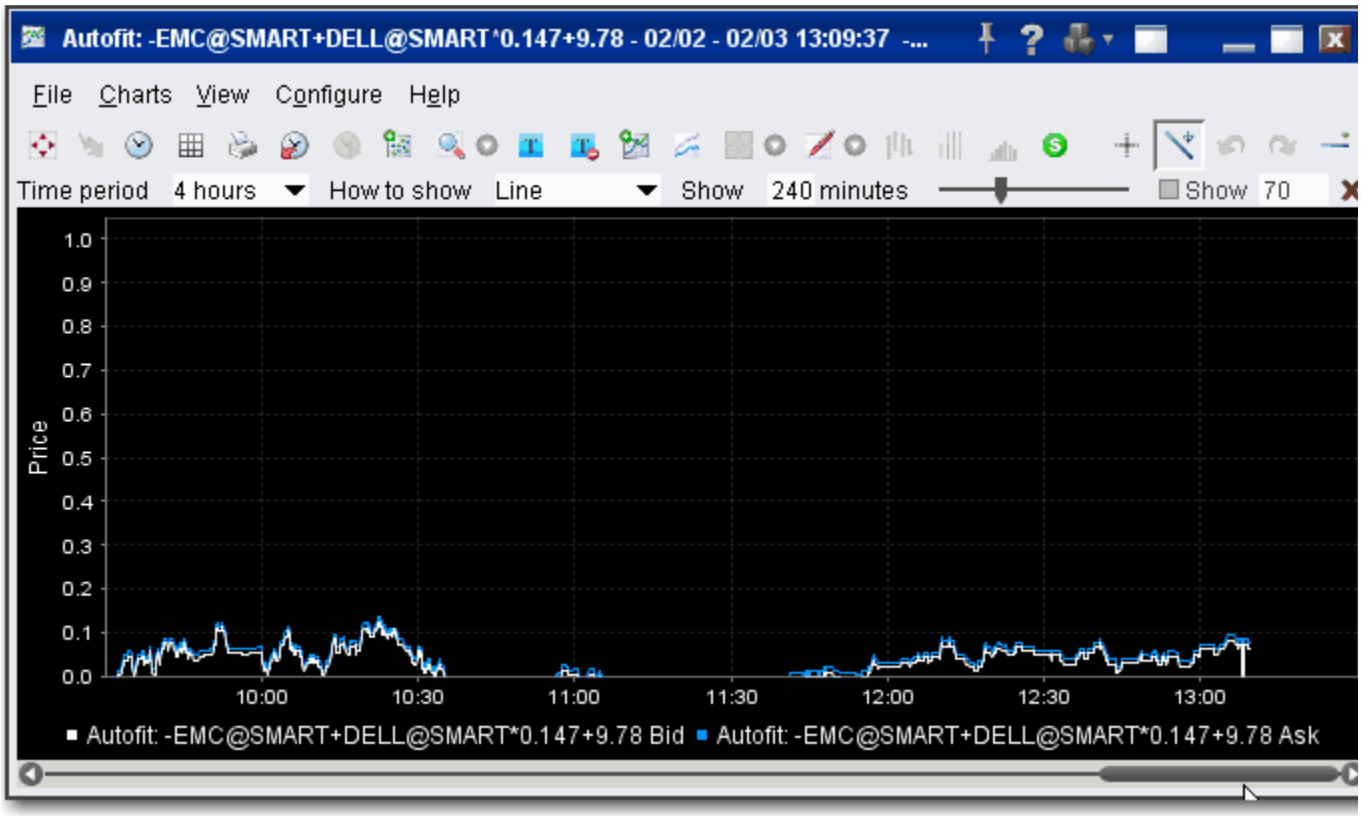
   使用*显示差额*复选框来看到单个自动拟合的图表等于首要图表和自动拟合图表之间的差值。

2. 在合约表格上，定义多个合约。您列出的第一个工具将为首要，而跟随其后的那些将被自动拟合到首要。

   您必须要么在列出您想要绘制图表的工具之前选中自动拟合框，要么在您选中该框之前选择您想要包括到自动拟合中的所有底层证券。

只使用自动拟合的图表看上去如下：

同时使用了自动拟合以及显示差额的图表看上去如下：

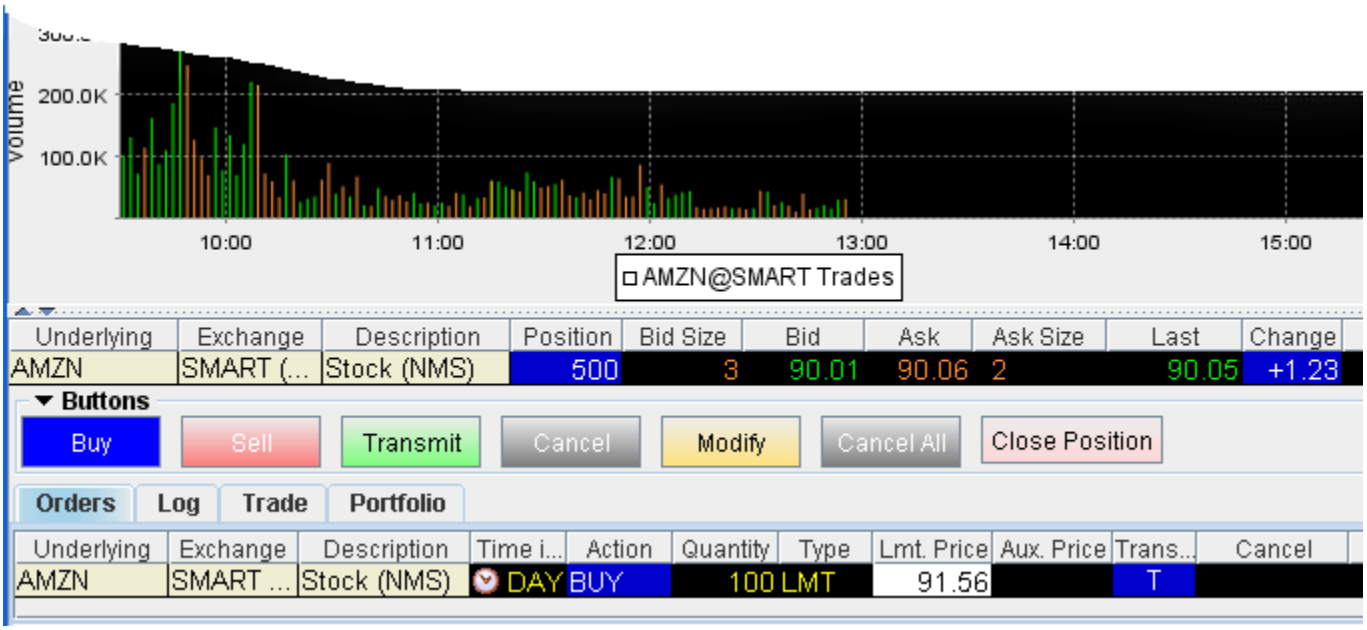


图表交易者

您能够使用图表交易者直接从实时图表中交易，图表交易者是您从图表菜单中显示的。一旦您创建了一笔定单，您能够直接在图表上或者使用**定单**标签上的定单管理行来传递它、取消它或修改它。

打开图表交易者

1. 通过在交易屏幕上选择一份合约，并在交易工具栏上点击图表图标来打开一个交互式图表。
2. 在图表菜单上，选择**图表交易者**，然后选择*显示／隐藏图表交易者*。
3. 图表交易者工具直接显示在图表报价行的下方。



在图表交易者中创建定单

1. 点击蓝色的**买入**按钮来创建一笔买入定单，或者红色的**卖出**按钮来创建一笔卖出定单。
2. 将您的光标移动到图表中，并将断开的蓝线放在您想要的定单价格上。注意，您的确切价格位置以蓝色沿着价格轴被显示在虚线的左边。
3. 点击来创建一笔定单。定单管理行出现在报价行下方，图表交易者的定单部分中，虚线变为实线。定单参数默认值与您使用定单默认窗口为您的交易窗口设定的默认值一样
4. 在传递区域中点击“T”来提交定单。您同样能够直接从图表中提交定单。

从图表中传递定单

1. 要直接从图表中传递，点击绿色的传递按钮，并将 IB 光标放在您想要发送的定单上。当实定单线变为虚线时，您就知道定单被正确地选中了。

2 点击要传递的定单。

Note: 在您从图表中传递定单之前，您能够在定单管理行中修改定单参数。

从图表中修改定单价格

1 您能够通过点击修改按钮，并将修改光标放到选定的定单上直到实定单线变为虚线来修改定单价格。

2 点击定单，并将其向上或向下拖动到需要的价格。

你使用图表交易者创建的定单同样显示在显示了合约数据的交易页面上。持有定单的交易页面以红色显示页面标题。

创建条形图

创建条形图

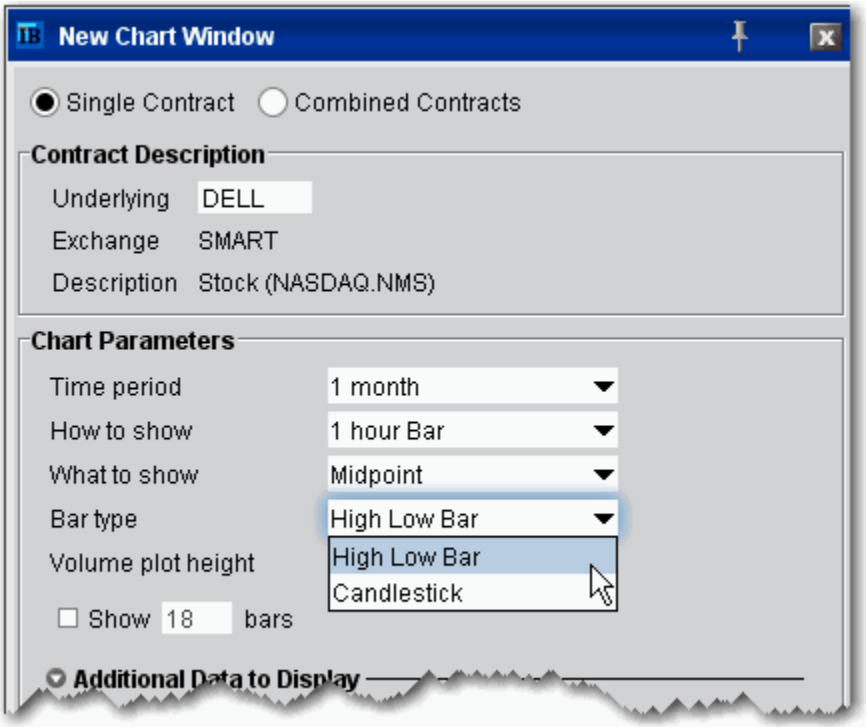
1 选择您想要创建条形图的合约。

2 从右键点击菜单中，选择**分析**，然后选择*实时图表*。

3 设置图表参数来定义图表，包括：

   a **如何显示**：选择带有指定间隔的条。

   b **条类型** — 选择*高低条*。



4 点击确定来显示您的图表。

创建线形图

创建线形图

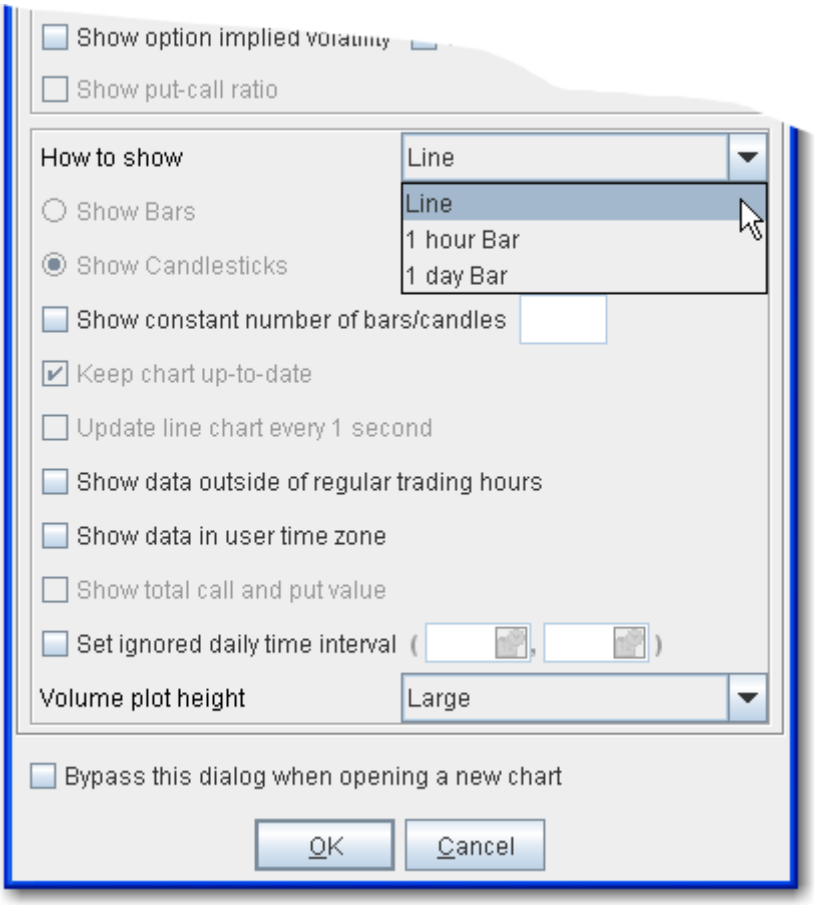
1 选择您想要创建图表的合约。

2 从右键点击菜单中，选择**分析**，然后选择*实时图表*。

3 设定图表参数来定义图表，包括：

- **如何显示：**选择*线*。

4 点击确定来查看视图。要获取关于您能够使用的全部设置的细节，参见图表总括话题。



创建烛形图

创建烛形图

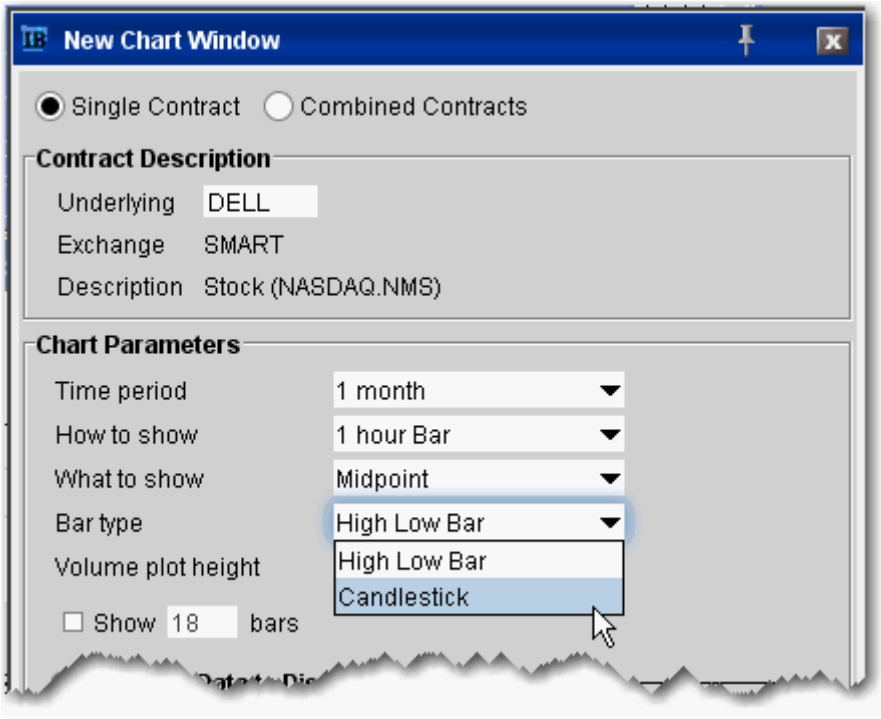
1 选择您想要创建图表的合约。

2 从右键点击菜单中，选择**分析**，然后选择*实时图表*。

3 设定图表参数来定义图表，包括：

   a **如何显示**：选择带有指定间隔的条。

   b **条类型** — 选择*烛台*。



时间和销售数据

您能够从交易屏幕中或从图表中选择对任何底层证券查看时间和销售。

从交易窗口中查看时间和销售

1. 选择代码，并在交易工具栏上点击*时间和销售*图标。
2. 时间和销售数据在一个单独的窗口中打开。条目根据时间以升序被列出。

   时间和销售数据以 60 秒层级被显示。每次当任何数据变化时，就会有一条新的线。
3. 要查看下一个或上一个 60 秒层级，点击**上一个**或**下一个**按钮。

在图表中查看时间和销售

1. 通过在交易窗口上选择一个底层证券代码并点击交易工具栏上的*图表*图标来创建一个图表。
2. 在图表上，使用**图表**工具栏来点击*时间和销售*图标。这会将光标更改为时间和销售光标，根据时钟的指标。
3. 将光标放在图表中您想要查看的时间上，并点击。
4. 时间和销售数据出现在一个单独的窗口中。其根据时间以升序被列出。

   时间和销售数据以 60 秒层级被显示。每次当任何数据变化时，就会有一条新的线。
5. 要查看下一个或上一个 60 秒层级，点击**上一个**或**下一个**按钮。

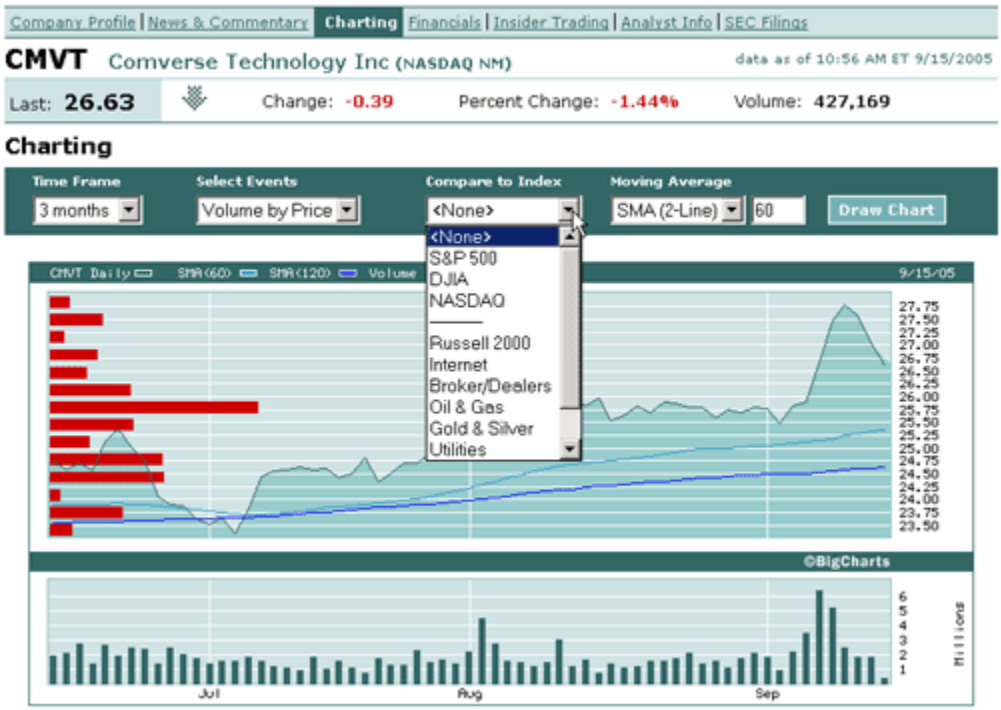
查看历史图表

使用从 1 天到十年的时间段来定义历史图表。您同样能够创建实时更新的交互式图表。

查看历史图表

1 在交易屏幕上，强调一个合约并使用右键点击菜单来选择*分析*，然后选择*历史图表*。

2 定义图表参数，例如时间范围、事件、指数比较和滑动平均，然后点击**画图**。



任何时候您修改图表参数，您必须点击**画图**来更新。

应用斐波纳契趋势线

斐波纳契趋势线可以被用来帮助决定在特定水平或附近的价格支持 / 阻力。交易平台斐波纳契线发生在 0.0%、23.6%、38.2%、50.0%、61.8%、76.4%和 100.0%。一个趋势内发生在这些点的回撤能够被用来帮助决定合约的进入和退出点。

将斐波纳契趋势线添加到图表

1. 创建实时交互式图表。
2. 在图表工具栏的趋势线部分中，点击*添加斐波纳契线*图标。

3. 在图表的峰点或低点点击您的鼠标，并在图表内向下 / 向上和向右拉动。
4. 交易平台在 0.0%、23.6%、38.2%、50.0%、61.8%、76.4%和 100.0%绘制一系列 7 种颜色的趋势线。

删除斐波纳契趋势线

- 点击*删除所有趋势线*图标，其位于*添加斐波纳契线*图标向右三个图标。

图表指标

将这些研究应用于您的图表：

- 应用 ADX/DMI 指标
- 应用积累 / 分配线
- 应用平均真实极差指标
- 应用蔡金资金流摆动指标
- 应用商品通道指标 （CCI）
- 应用肯特纳通道指标
- 应用动量指标
- 应用资金流指数研究
- 应用 MACD 指标
- 应用能量潮指标
- 应用变动率指标
- 应用相对强弱指标
- 应用随机摆动指标
- 应用终极摆动指标
- 应用威廉姆斯摆动指标
- 应用保力加通道指标
- 应用轨道线指标
- 应用指数滑动平均指标
- 应用抛物转向系统指标
- 支点
- 应用简单滑动平均指标
- 应用加权滑动平均指标

应用 ADX/DMI 指标

ADX/DMI 由三条线 +DM、-DM 和 ADX 代表。

有方向的移动

如果今日的最高价高于昨日的最高价，那么：

+DM ＝今日的最高价－昨日的最高价

如果今日的最低价低于昨日的最低价，那么：

-DM ＝昨日的最低价－今日的最低价

如果 +DM 大于 -DM，那么：-DM ＝ 0

如果 +DM 小于 -DM，那么：+DM ＝ 0

真实极差

真实极差是以下当中的最大值：

- ｜今日的最高价－今日的最低价｜
- ｜今日的最高价－昨日的收盘价｜
- ｜昨日的收盘价－今日的最低价｜

+DM、-DM 和真实极差的滑动平均

- +DMMA ＝ +DM 的指数滑动平均
- -DMMA ＝ -DM 的指数滑动平均
- TRMA ＝真实极差的的指数滑动平均

有方向的指标

- +DI ＝ +DMMA/TRMA
- -DI ＝ -DMMA/TRMA

有向指数

- DX ＝｜(+DI -(-DI))｜/(+DI + (-DI))

平均有向移动指数

- ADX ＝ DX 的指数滑动平均
- ADX ＝ SUM[(+DI-(-DI))/(+DI+(-DI)), N]/N

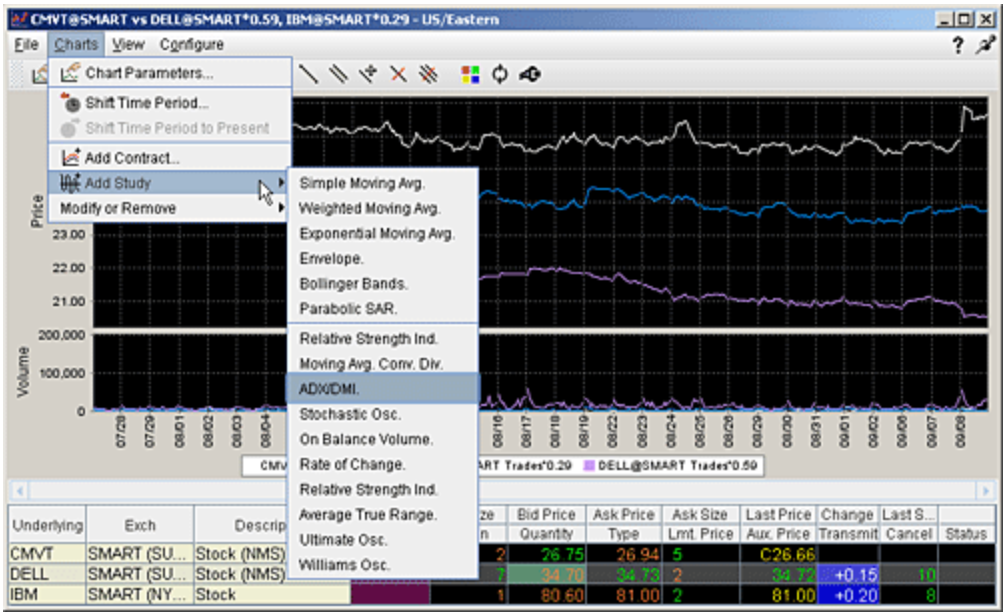
当中：

N ― 在计算中使用的时段数量。

应用 ADX/DMI 指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择 *ADX/DMI*。

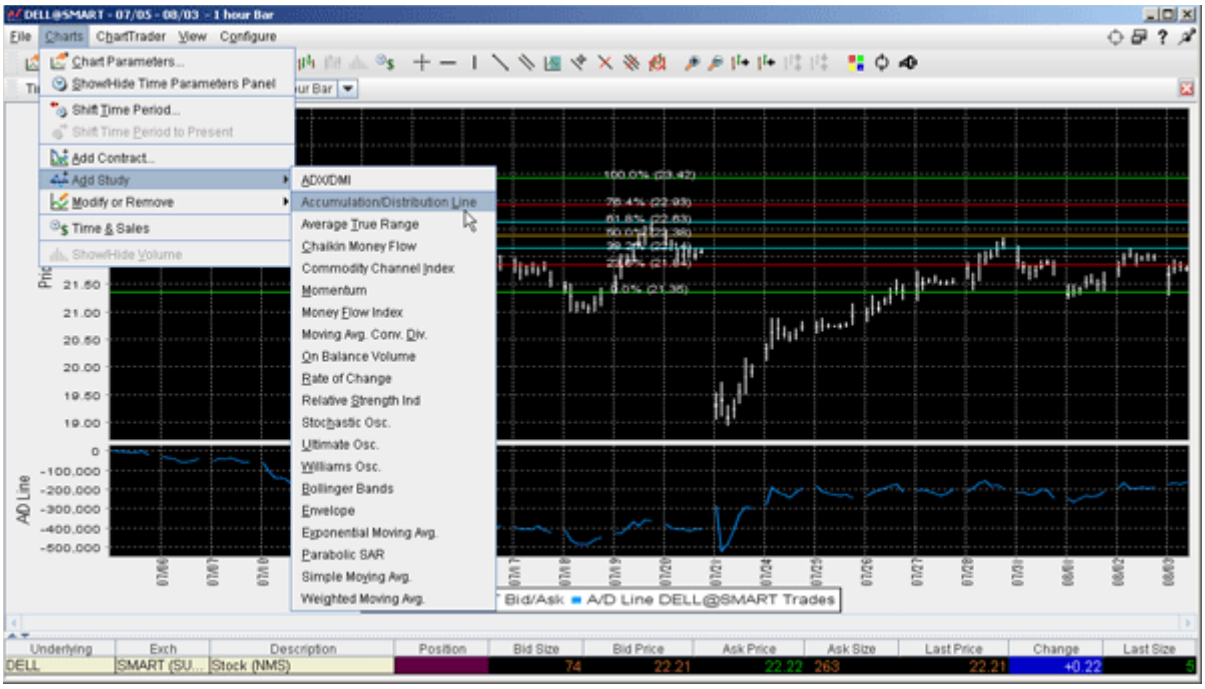


应用积累 / 分配线

该指标尝试量化流入和流出给定股票的资金流。理论上，知道该资金 / 交易量流可以帮助您认识到股票价格即将到来的变动。

应用积累 / 分配线

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*积累 / 分配线*。
3. 选择一个合约 （如果您的图表包括多个合约）并定义来源，然后点击确定。



应用平均真实极差指标

平均真实极差指标被用来决定市场的波动率。其思想是替换给定时段的高－低间隔，因为高－低间隔没有考虑到差距和限制的变动。您在创建研究时设定时段。

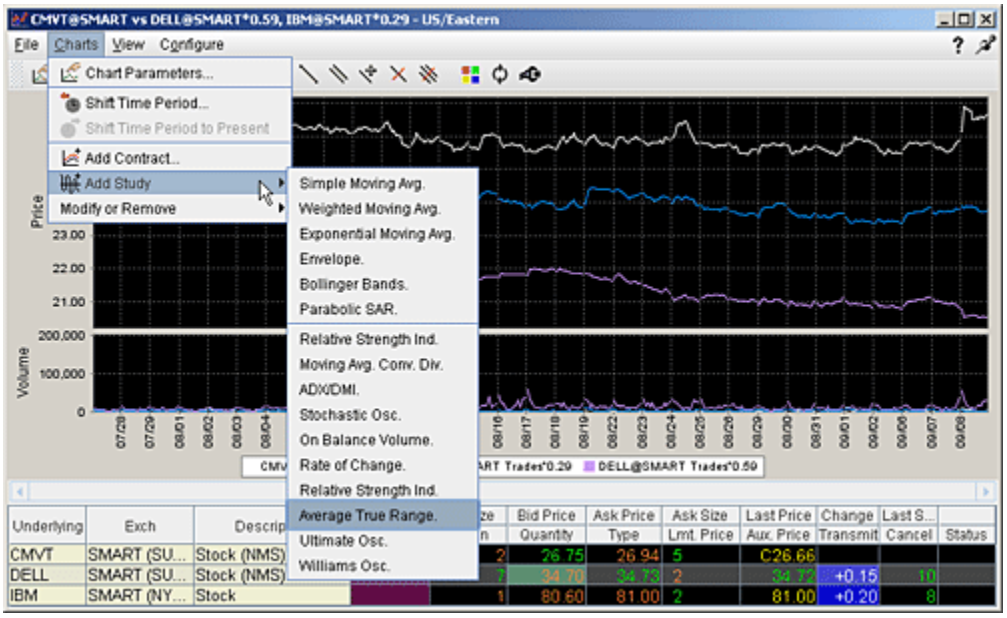
真实极差是以下当中的最大值：

- 当前最大值与最小值之间的差 （最高－最低）
- 前一日收盘价与当前最大值之间的差
- 前一日收盘价与当前最小值之间的差

平均真实极差是真实极差值的简单滑动平均。

应用平均真实极差

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*平均真实极差*。



应用蔡金资金流摆动指标

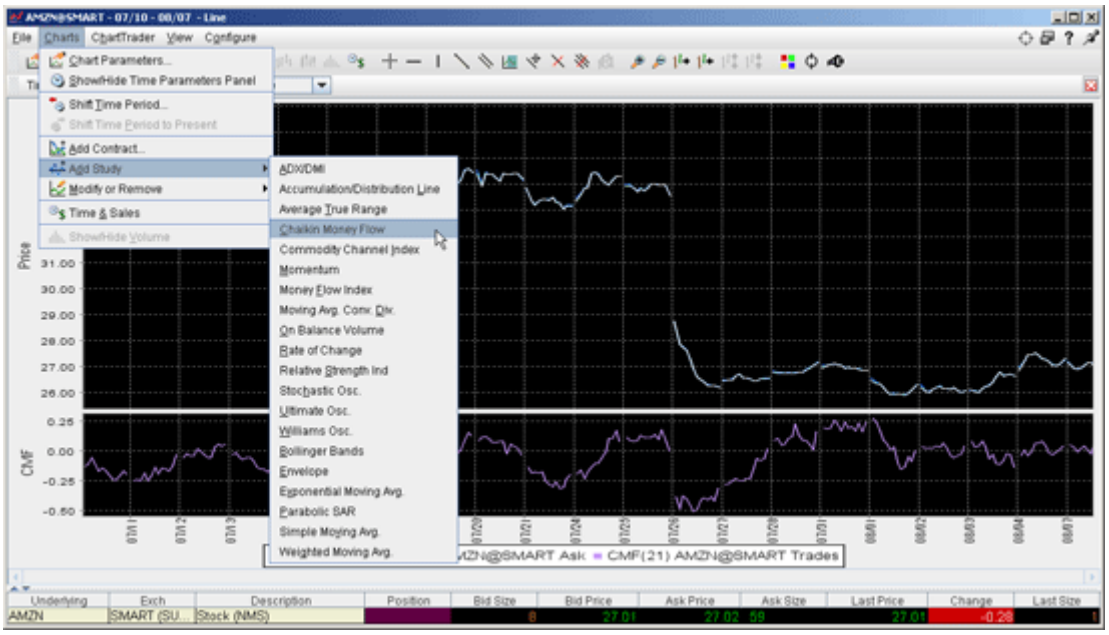
蔡金资金流摆动是使用积累 / 分配行计算的。它将 21 （或者 *X*个时段，如果您选择更改该值）个时段累积的积累 / 分配总价值除以 21 （或 X）个时段的累积总交易量。

应用蔡金资金流指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*蔡金资金流*。

3 选择一个合约 （如果您的图表包括多个合约），定义来源，如果需要则修改时间段，然后点击确定。



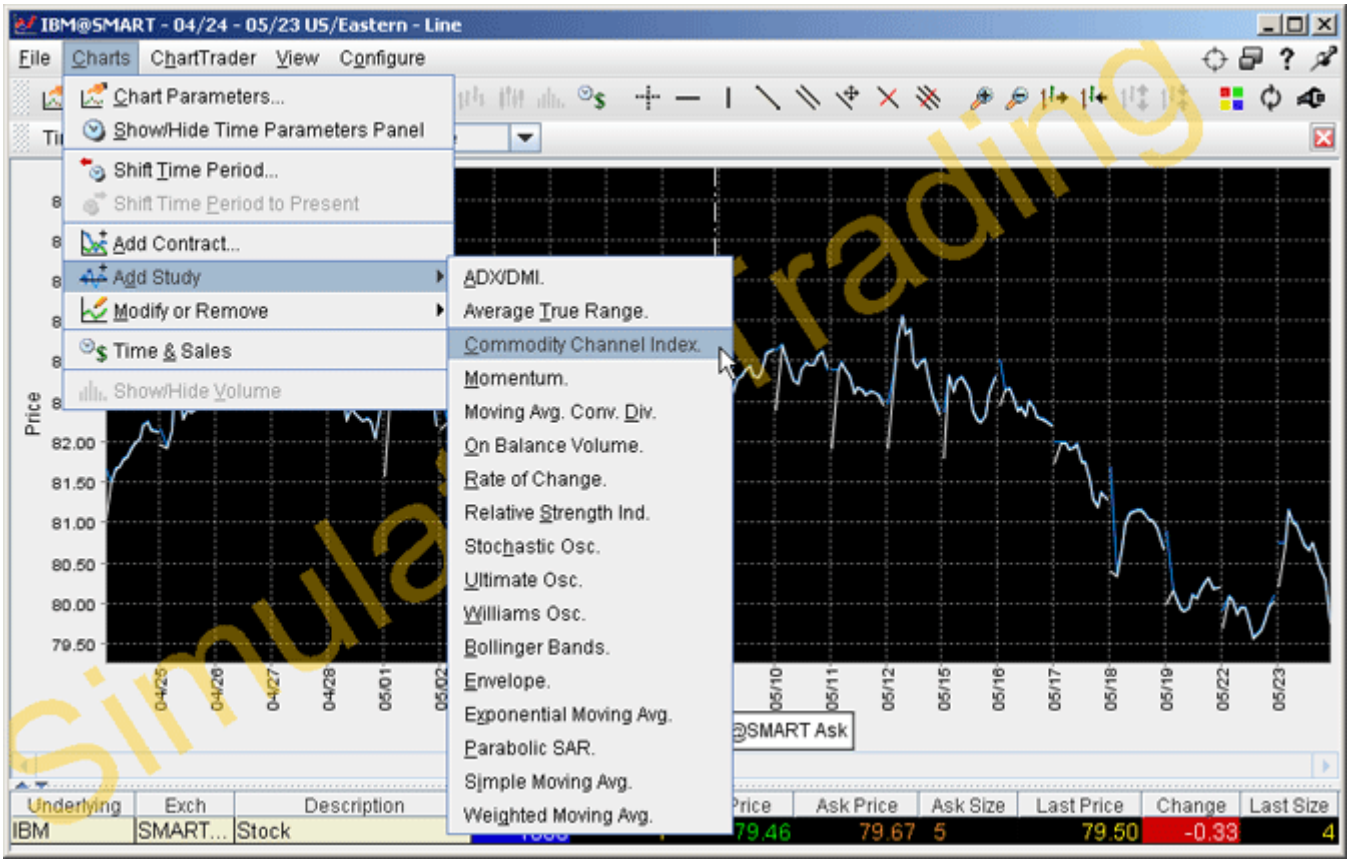
应用商品通道指标（CCI）

CCI 价格动量指标被设计用来识别商品定价的周期性的变化，并表示了当前价格相对于给定时间段的平均价格的位置。

应用 CCI

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择 *CCI*。



应用肯特纳通道指标

肯特纳通道指标对波动敏感，并画出了包含两条位于中线上方和下方的 “轨道线”，其代表了 20 个时段的指数滑动平均 （EMA）。上、下通道定义了区域，在该区域之内价格通常将下跌。与这些线交叉或向这些线浮动的价格可能表示了交易机会。

肯特纳通道带被计算如下：

中线＝ EMA(TP)

顶线＝ EMA(TP + Dev x TR)

底线＝ EMA(TP - Dev x TR)

当中：

EMA — 指数滑动平均

TP — 典型价格

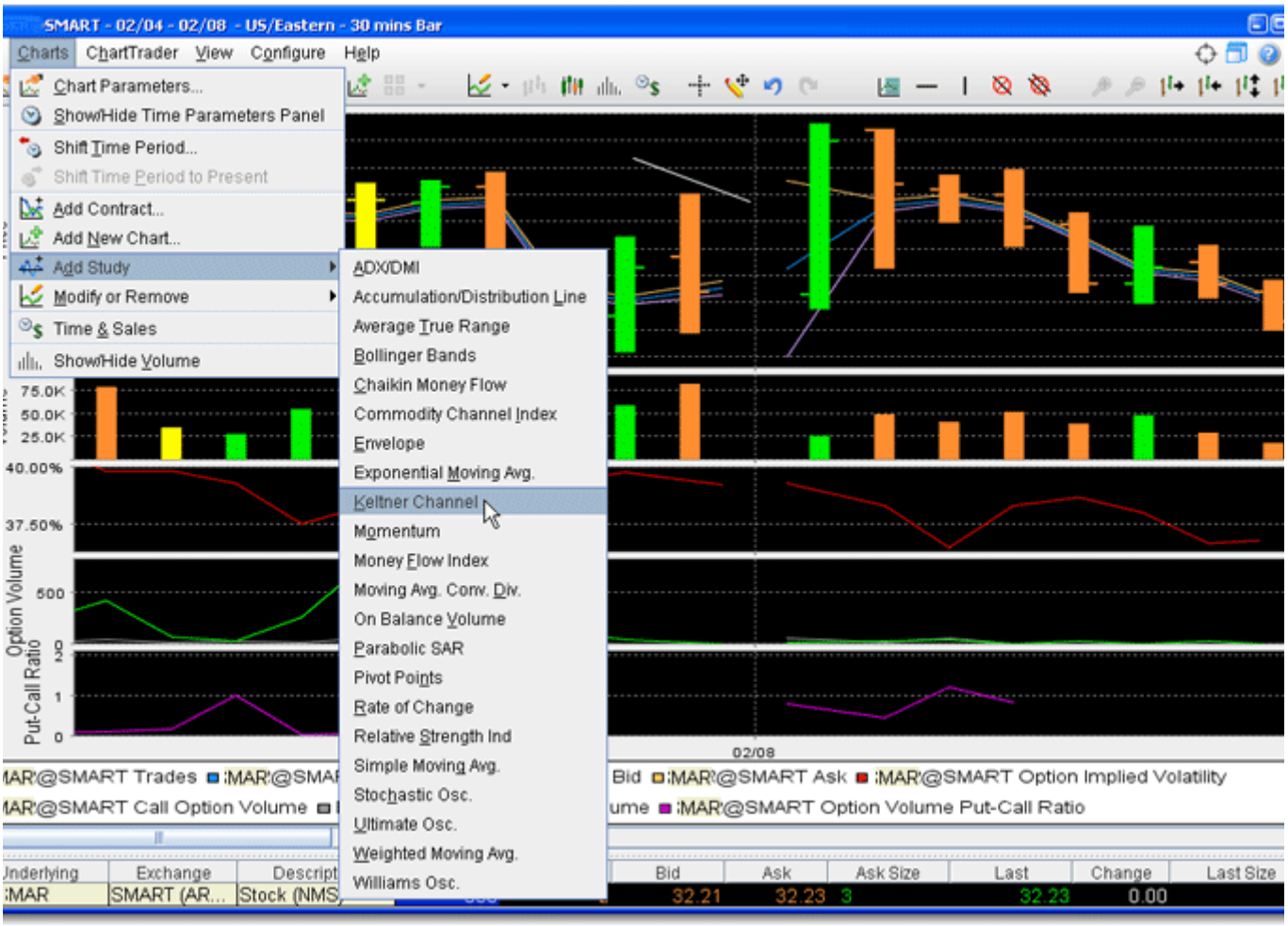
TR — 真实极差

Dev — 偏差因子

覆盖肯特纳通道指标

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择肯特纳通道。
3. 修改任何偏好，然后点击确定。

   注意您能够增加指标线的厚度并改变其颜色，方法是右键点击一条线并使用编辑菜单来选择*更改指标厚度*或*更改指标颜色*。厚度 “1” 是最薄的； “4” 是最厚的。


SMART - 02/04 - 02/08 - US/Eastern - 30 mins Bar
Charts
ChartTrader
View
Configure
Help
Chart Parameters...
Show/Hide Time Parameters Panel
Shift Time Period...
Shift Time Period to Present
Add Contract...
Add New Chart...
Add Study
Modify or Remove
Time & Sales
Show/Hide Volume
ADX/DMI
Accumulation/Distribution Line
Average True Range
Bollinger Bands
Chaikin Money Flow
Commodity Channel Index
Envelope
Exponential Moving Avg.
Keltner Channel
Momentum
Money Flow Index
Moving Avg. Conv. Div.
On Balance Volume
Parabolic SAR
Pivot Points
Rate of Change
Relative Strength Ind
Simple Moving Avg.
Stochastic Osc.
Ultimate Osc.
Weighted Moving Avg.
Williams Osc.
Option Volume
Put-Call Ratio
02/08
Underlying
Exchange
Bid
Ask
Ask Size
Last
Change
Last Size
32.21
32.23
32.23
0.00

应用动量指标

动量是当前点 （价格或别的量）与 N 个时段之前的点之间的差。动量被计算为今天的价格与若干 （N）个时段之前的价格之间的差。

动量＝ CLOSE(i)-CLOSE(i-N)

当中：

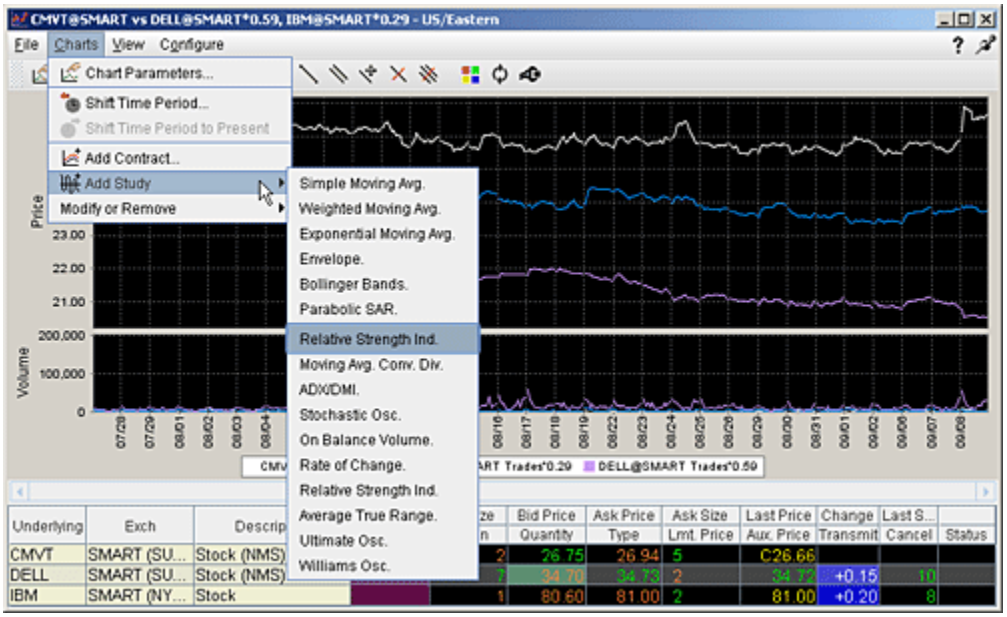
CLOSE(i) ― 当前条的收盘价格；

CLOSE(i-N) ― N 个时段以前的收盘价格。

应用动量指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*动量*。

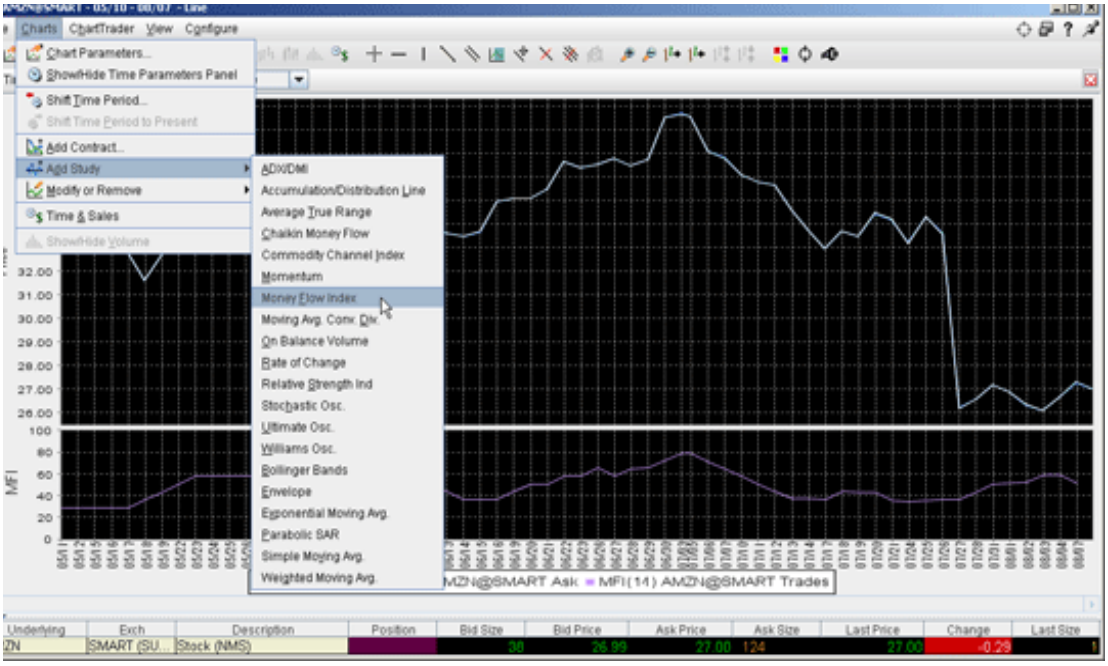


应用资金流指数研究

资金流指数 （MFI）指标与相对强弱指数 （RSI）指标相似，通常以 0 — 100 评分标准来测量 14 天的时段，除非它是交易量加权的。这使其成为一个对流入和留出证券的资金流强度的很好的测量指标，并被用来帮助识别一个趋势的强或弱。

应用资金流指数研究

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*资金流指数*。
3. 选择一个合约 （如果您的图表包括多个合约）并定义来源，如果需要则修改默认的 14 天的时间段，然后点击确定。



应用 MACD 指标

这是一个跟随趋势的动态指标，它显示了两组滑动平均之间的相关系数，通常是 26 个时段和 12 个时段的 SMA 或 WMA 或 EMA。您能够在创建研究时修改时段长度。为帮助说明机会，一条 9 个时段的 EMA “信号线”被绘制在 MACD 顶部。

MACD 和信号线使用以下计算被绘制：

MACD = MA(CLOSE, 12)-MA(CLOSE, 26)

SIGNAL = EMA(MACD, 9)

MACD Histogram/OSMA = MACD - SIGNAL

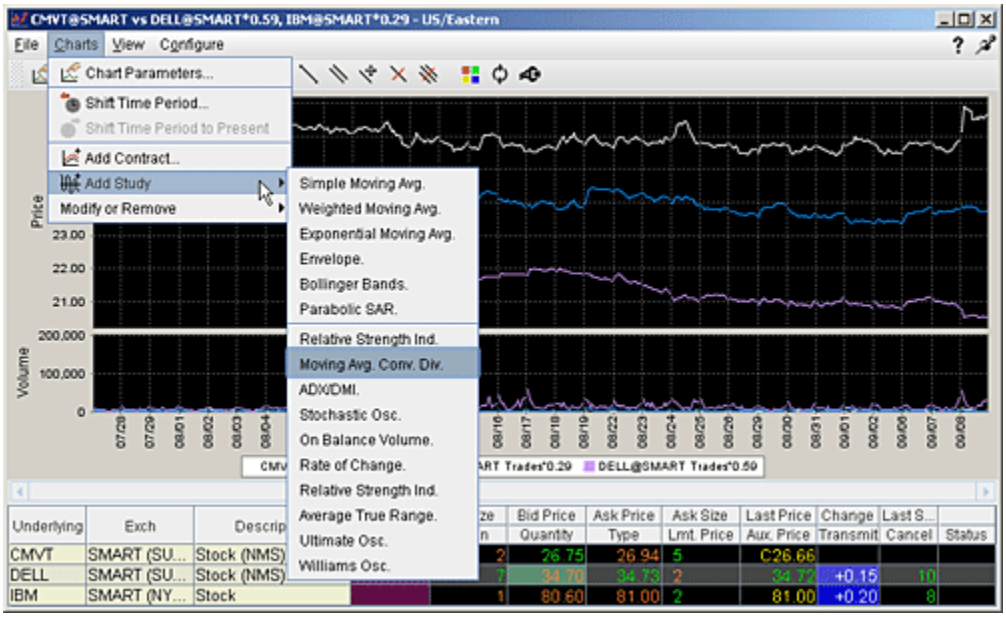
当中：

MA — 简单或加权或指数滑动平均；

SIGNAL — 指标的信号行。

应用滑动平均收敛 / 发散指标

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*滑动平均收敛发散*。



应用能量潮指标

能量潮 （OBV）指标背后的概念是：交易量先于价格。OBV 是一个简单的指标，当收盘价上涨时它加上该时段的交易量，当收盘价下跌时它减去该时段的交易量。累积的交易量添加和扣除总数形成了形成了 OBV 线。

如果今日的收盘价大于昨日的收盘价，那么：

OBV(i) = OBV(i-1)+VOLUME(i)

如果今日的收盘价小于昨日的收盘价，那么：

OBV(i) = OBV(i-1)-VOLUME(i)

如果今日的收盘价等于昨日的收盘价，那么：

OBV(i) = OBV(i-1)

当中：

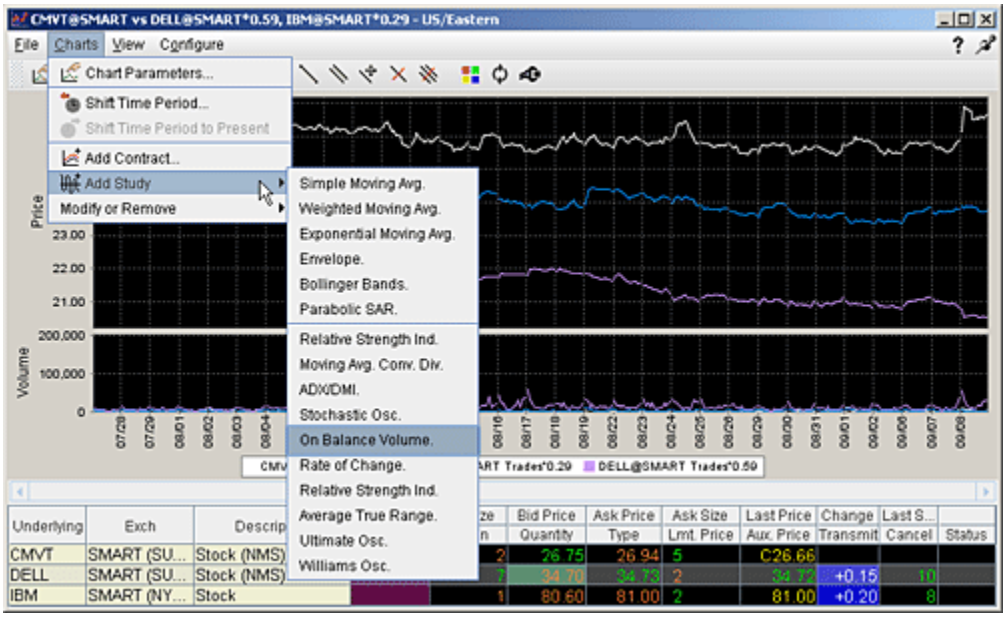
OBV(i) — 当前时段的指标值；

OBV(i-1) — 上一个时段的指标值；

VOLUME(i) — 当前条的交易量。

应用能量潮指标

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*能量潮*。



应用变动率指标

变动率 （ROC）是**动量**的改良版本。读数以零线周围的百分比波动。你在创建研究时设定数目。

变动率＝ 100(V/Vx)

当中：

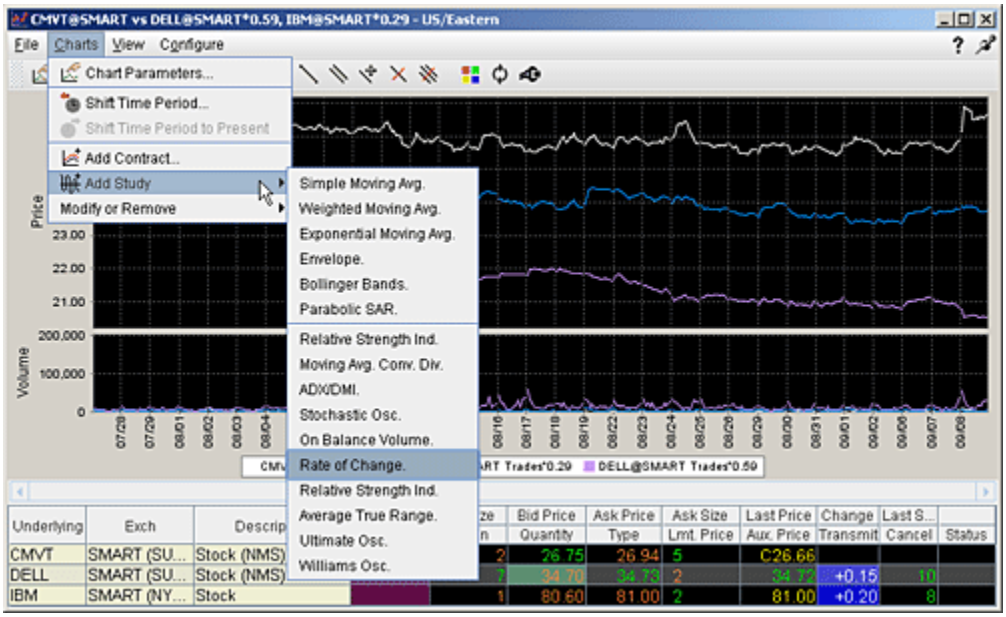
V — 最近的收盘价；

Vx — x 个条之前的收盘价。

应用变动率指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*变动率*。



应用相对强弱指标

相对强弱 （RSI）指标用于超买 / 超卖条件。当市场变强时它上升，当市场变弱时它下降，并在 0 — 100 摆动。RSI 的计算如下：

RSI = 100-(100/1+RS)

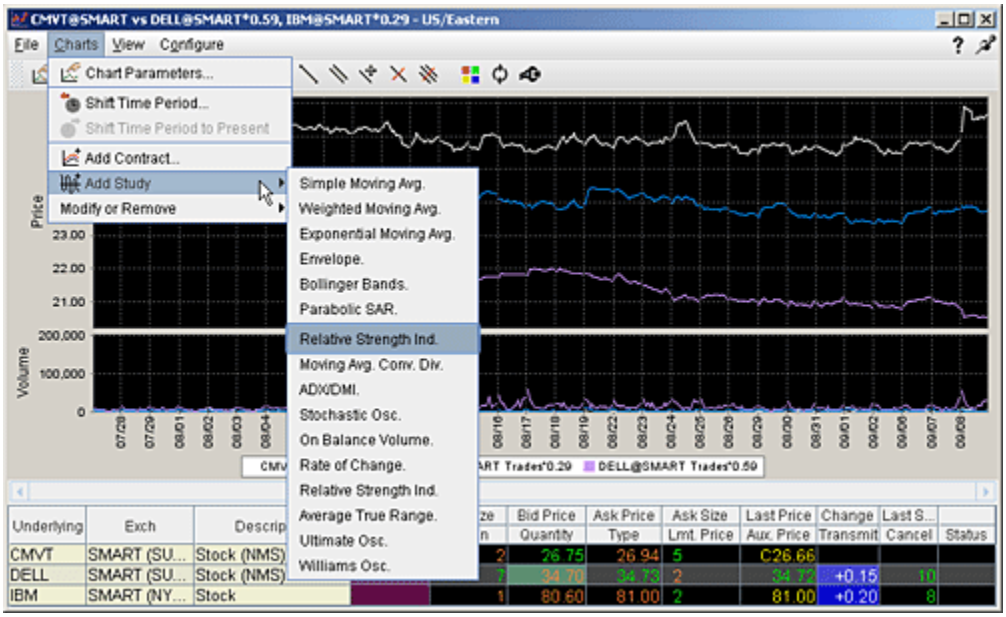
当中：

RS — X 个时段中收盘价上涨的平均值 /X 个时段中收盘价下跌的平均值 （X ＝用户设定的条数目）。

应用相对强弱指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*相对强弱指标*。



应用随机摆动指标

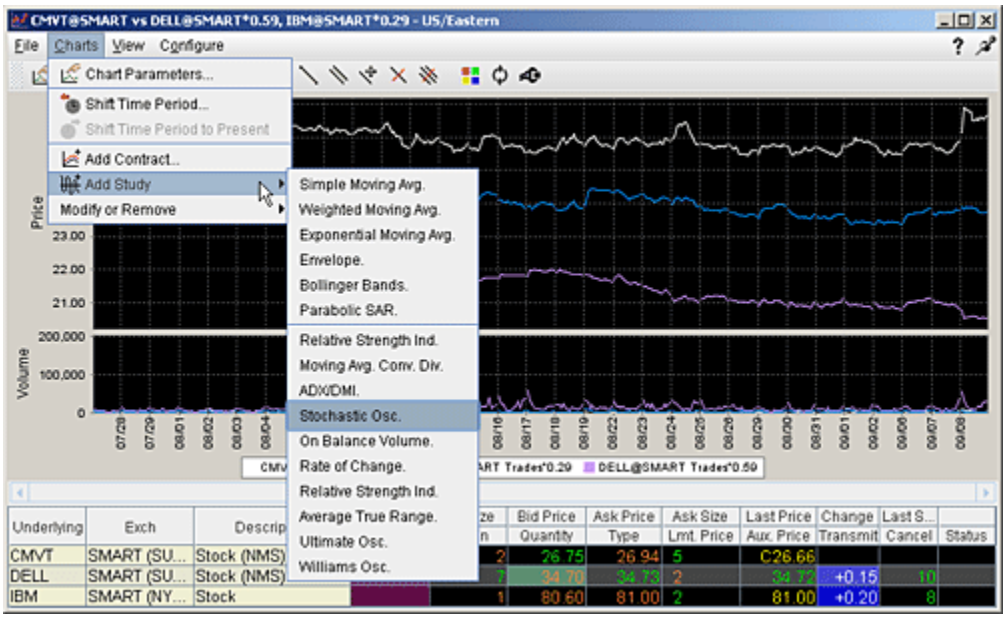
随机摆动指标提供了关于当前收盘价相对于该时段的最高价和最低价的位置的信息。其范围从 0%到 100%。读数 0%表示在证券交易的前 x 个时段中收盘价是最低价。读数 100%表示在证券交易的前 x 个时段中收盘价是最高价。

Note: 当您创建研究时，您能够指定方法 （SMA、WMA 或 EMA）、观察时段、慢速平均时段和快速平均时段。

应用随机摆动指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*随机摆动*。



应用终极摆动指标

终极摆动指标将三个不同时间范围的价格行动组合了起来。您在创建研究时设定观察时段 1、2 和 3。

时间范围：

- 真实最低＝最小值 （最低价或前一个收盘价）
- 买入压力＝收盘价－真实最低
- 真实范围＝最大值 （最高价－最低价，最高价－前一个收盘价，前一个收盘价－最低价）

买入压力总和 1、买入压力总和 2 和买入压力总和 3 是通过将 3 个不同时间范围的买入压力加起来计算出来的。

对真实范围总和 1、2 和 3 的计算同理。

原始终极摆动＝ 4 × （买入压力总和 1/ 真实范围总和 1）

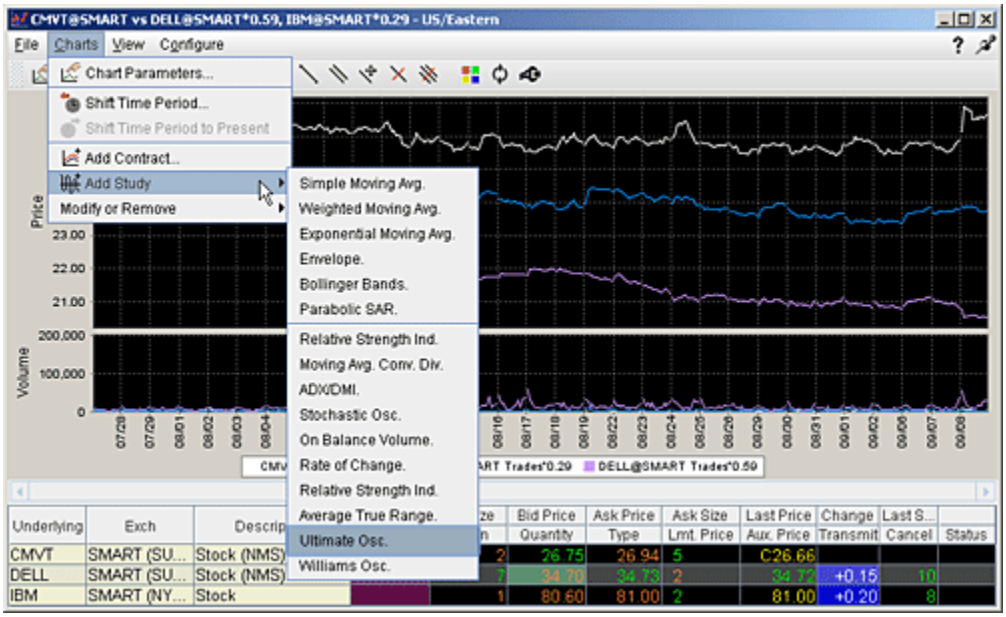
＋ 2 × （买入压力总和 2/ 真实范围总和 2）＋ （买入压力总和 3/ 真实范围总和 3）

终极摆动＝ （原始终极摆动 / （4 ＋ 2 ＋ 1））× 100

应用终极摆动指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*终极摆动*。



应用威廉姆斯摆动指标

威廉姆斯百分比范围（%R）指标识别了超买 / 超卖水平。标度从 0 延伸到 -100。

%R = (HIGH(i-n)-CLOSE)/(HIGH(i-n)-LOW(i-n))-100

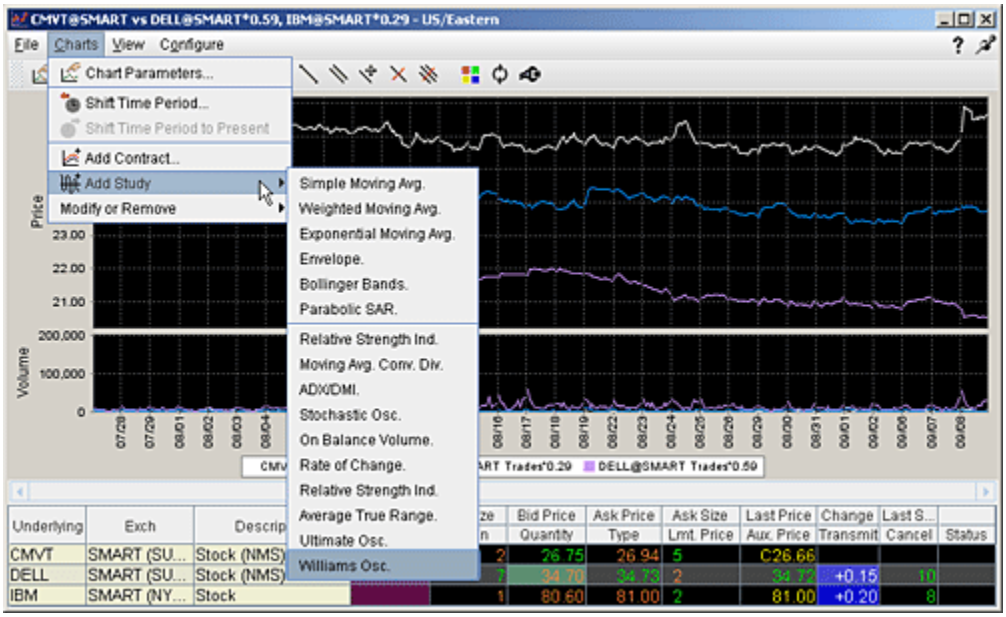
当中：

- CLOSE — 今日的收盘价；
- HIGH(i-n) — 前面若干（n）个时段的最高价的最高值；
- LOW(i-n) — 前面若干（n）个时段的最低价的最低值。

应用威廉姆斯摆动指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*威廉姆斯摆动*。



应用保力加通道指标

保力加通道通过画出一系列的三条通道来测量波动率。中通道代表滑动平均 （SMA 或 WMA 或 EMA）。上通道以标准差的某个倍数高于中通道 （通常为 2），而下通道则以标准差的某个倍数低于中通道 （通常为 2）。您在创建研究时设定标准差的距离。

保力加通道被计算如下：

ML = Avg. (N)

TL = ML + (D*StdDev)

BL = ML — (D*StdDev)

当中：

ML — 中线

Avg(N) — SMA 或 WMA 或 EMA

TL — 顶线

BL — 底线

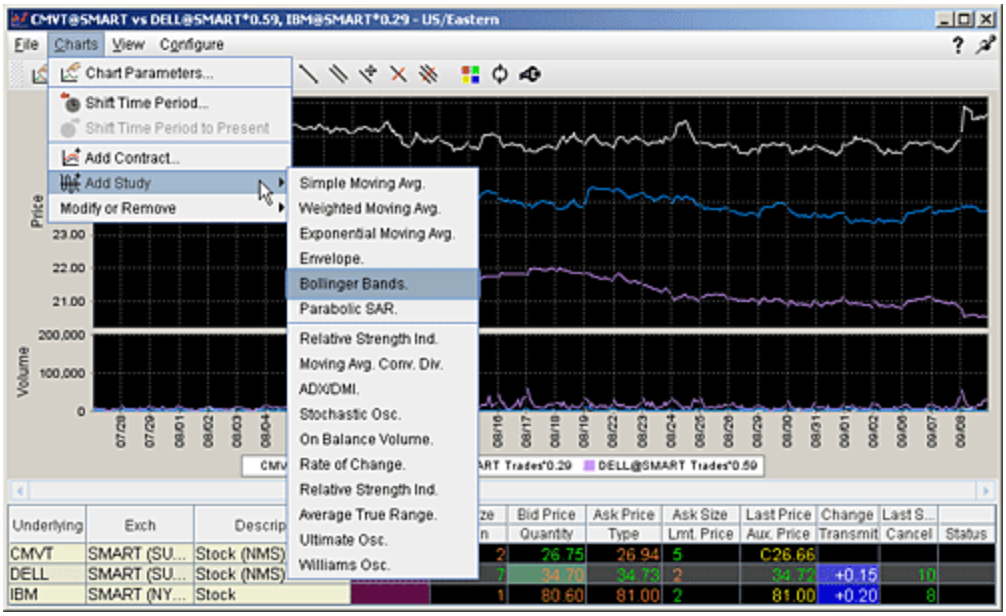
N — 计算中使用的时间段数目

StdDev — 标准差

StdDev = SQRT(SUM[(CLOSE-SMA(CLOSE, N))^2, N]/N)

应用保力加通道指标

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*保力加通道*。


CMVT@SMART vs DELL@SMART*0.59, IBM@SMART*0.29 - US/Eastern
File
Charts
View
Configure
Chart Parameters...
Shift Time Period...
Shift Time Period to Present
Add Contract...
Add Study
Modify or Remove
Simple Moving Avg.
Weighted Moving Avg.
Exponential Moving Avg.
Envelope.
Bollinger Bands.
Parabolic SAR.
Relative Strength Ind.
Moving Avg. Conv. Div.
ADX/DMI.
Stochastic Osc.
On Balance Volume.
Rate of Change.
Relative Strength Ind.
Average True Range.
Ultimate Osc.
Williams Osc.
Price
Volume
Underlying
Exch
Bid Price
Ask Price
Ask Size
Last Price
Change
Quantity
Type
Lmt. Price
Aux. Price
Transmit
Cancel
Status
CMVT
DELL
IBM

应用轨道线指标

SMA/WMA/EMA 轨道线画出了一条由两组滑动平均组成的通道，一组向上移动，另一组向下移动，来帮助定义股票的上下边界。轨道线的通道被计算如下：

上通道＝ MA(CLOSE, N)*[1+K/100]

下通道＝ MA(CLOSE, N)*[1-K/100]

当中：

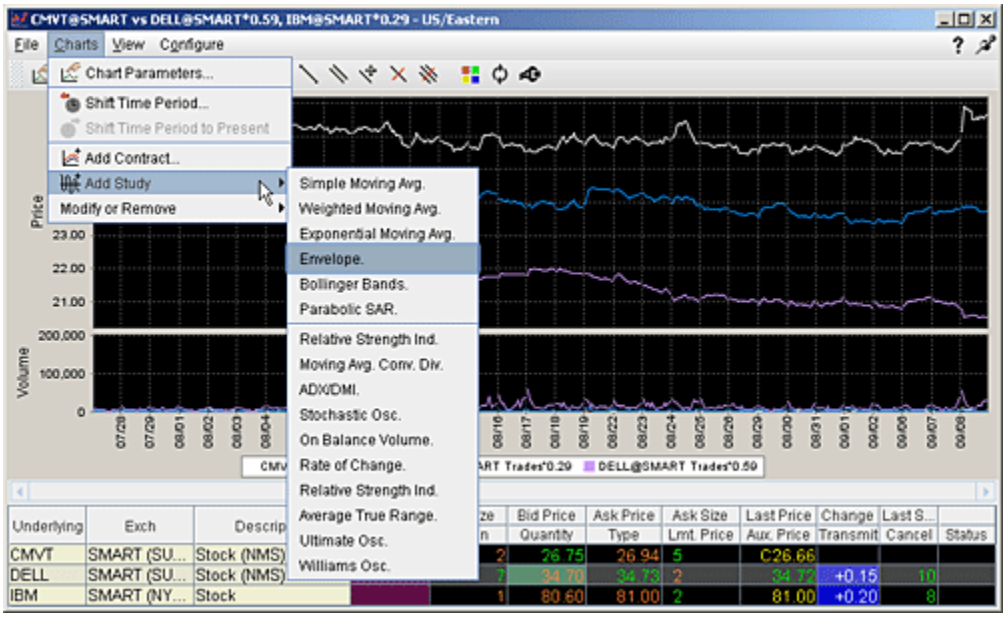
MA — 简单 （或加权或指数）滑动平均；

N — 平均时段；

K/100 — 偏离平均值的值 （以基点测量）。

应用轨道线指标

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*轨道线*。



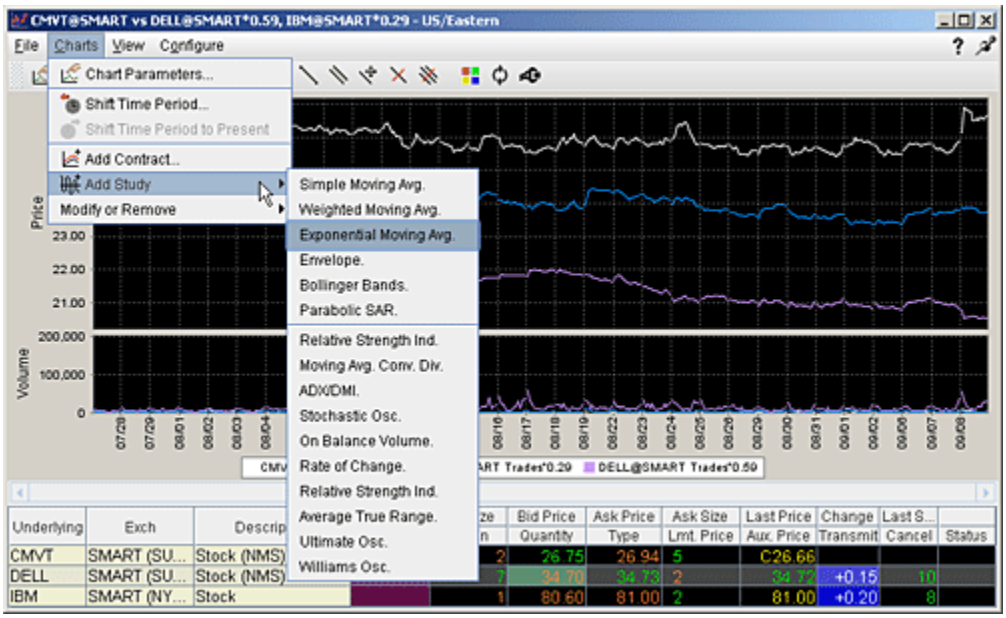
应用指数滑动平均指标

指数滑动平均给了最近的价格更多的权重，并包括了工具生命周期内的所有价格数据。它被定义为用：

（前一个时段的指数滑动平均）/（N ＋ 1）加上（当前价格）× 2/（N ＋ 1）。对第一个时段，我们使用简单滑动平均。

应用指数滑动平均

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*指数滑动平均*。



应用抛物转向系统指标

抛物转向系统被用于有趋势的市场，其使用追踪止损和反向的方法来帮助决定好的退出和进入点。抛物转向系统的计算如下：

$$SAR_{t+1} = SAR_t + AF \times (EP_{trade} \times SAR_t)$$

当中：

SAR_{t+1} — 下一个时段的 SAR；

SAR_t — 当前 SAR；

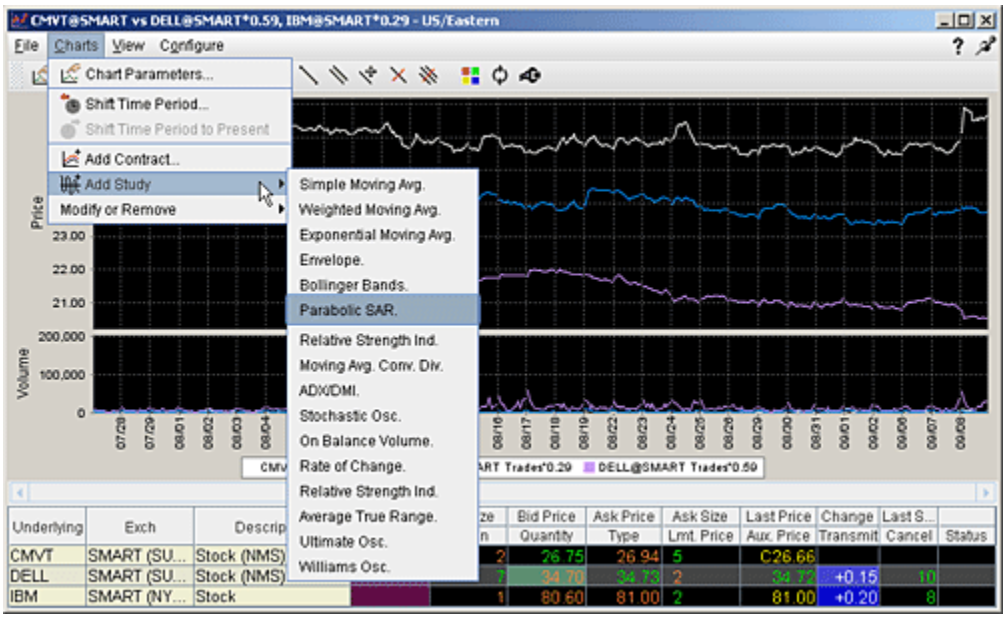
AF — 加速因子，以 .02 开始，并以 .02 增加到最大值 .20。

Note: 当您创建研究时，您能够重设加速因子的初始值、层级和最大值。

EP_{trade} — 极端价格（对多头头寸为最高价，对空头头寸为最低价）。

有用抛物转向系统指标

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*抛物转向系统*。



支点

支点指标计算了股票的最高价、最低价和收盘价的数学平均值，被用来帮助识别阻力和支持水平。我们使用五点系统来计算支点，该系统使用前一日的最高价、最低价和收盘价得出支点，然后计算两个阻力水平和两个支持水平，如下：

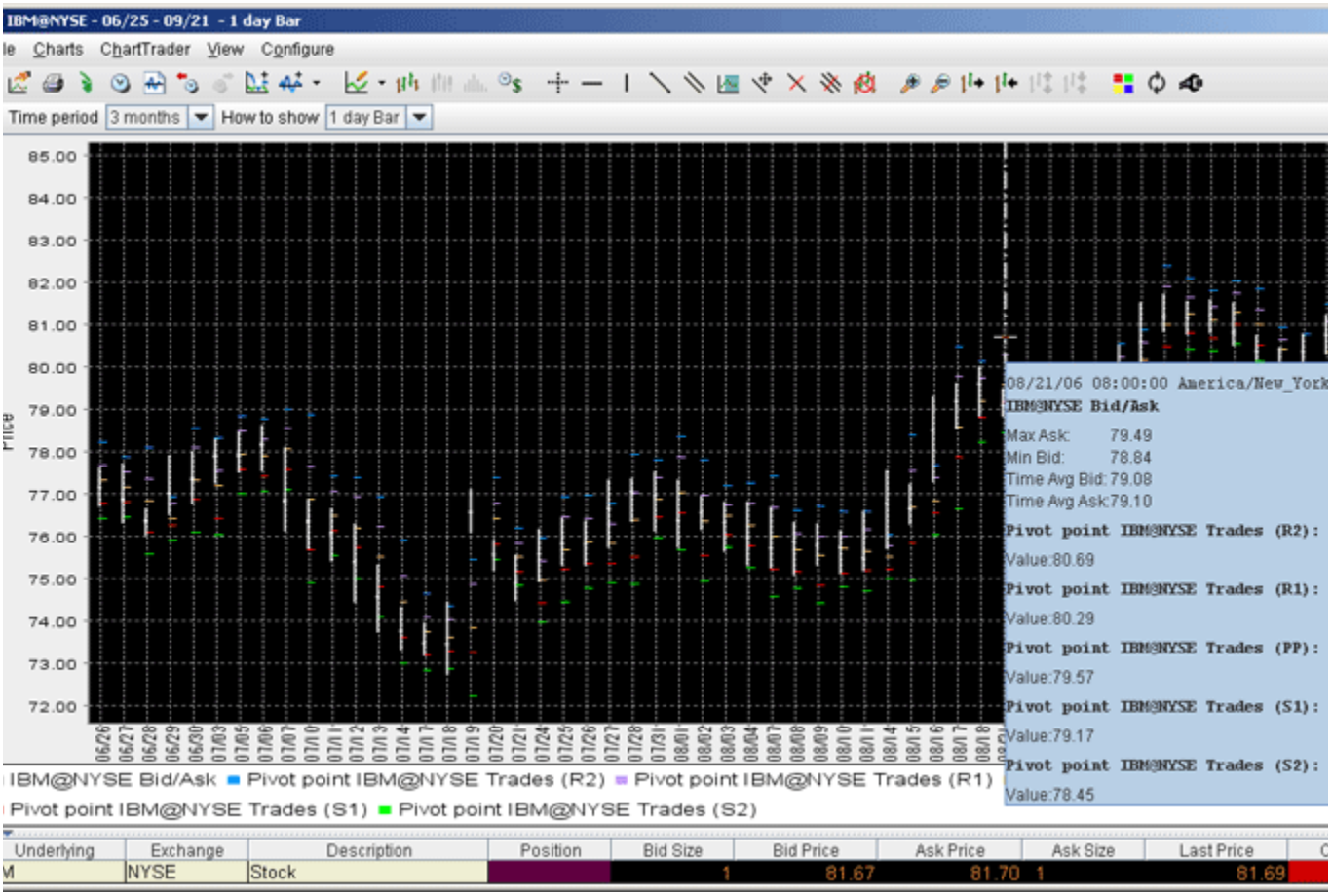
R2=P + (H-L) = P + (R1-S1)
R1 = (P x 2) - L
P = (H + L + C) /3
S1 = (P x 2) - H
S2 = P - (H - L) = P - (R1 - S1)

当中 “S” 是支持水平，“R” 是阻力水平，“P” 是支点，H、L、C 分别是最高价、最低价和收盘价。

添加支点指标

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*支点*。



应用简单滑动平均指标

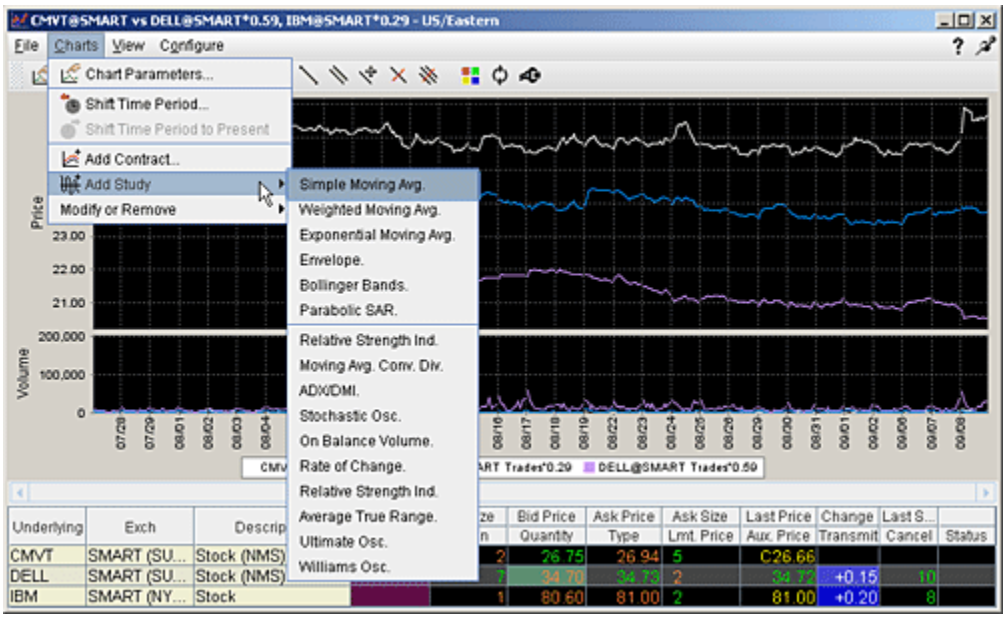
简单滑动平均将特定数目的数据点的价格 （您能够从收盘价格、交易量加权平均价格、时间加权平均价格或最高 / 最低 / 收盘平均价格中选择）加起来，再除以该数目。对 3 个时间周期的简单滑动平均计算如下：

（价格 1）＋ （价格 2）＋ （价格 3）再除以 3

应用简单滑动平均

1 在**图表**菜单上选择*添加研究*。

2 从研究指标列表中，选择*简单滑动平均*。



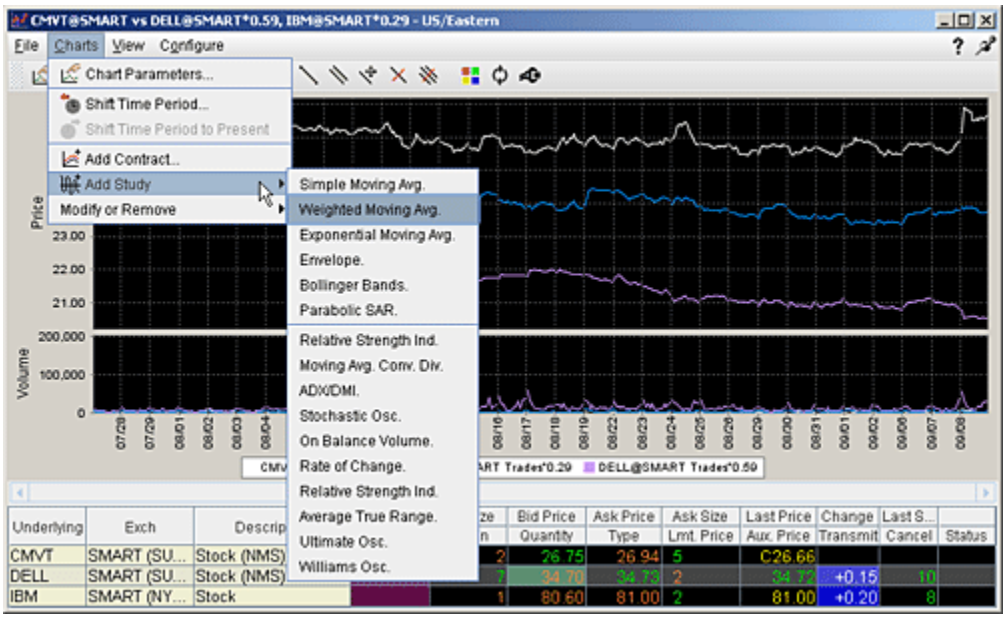
应用加权滑动平均指标

加权滑动平均给了每个数据点一个与其在序列中的顺序成比例的权重，然后再除以权重的总和。对 3 个时间周期的加权滑动平均的计算如下：

（1 ×价格 1）＋ （2 ×价格 2）＋ （3 ×价格 3）再除以 6，当中 6 是权重 （1 ＋ 2 ＋ 3）的总和。

应用加权滑动平均

1. 在**图表**菜单上选择*添加研究*。
2. 从研究指标列表中，选择*加权滑动平均*。

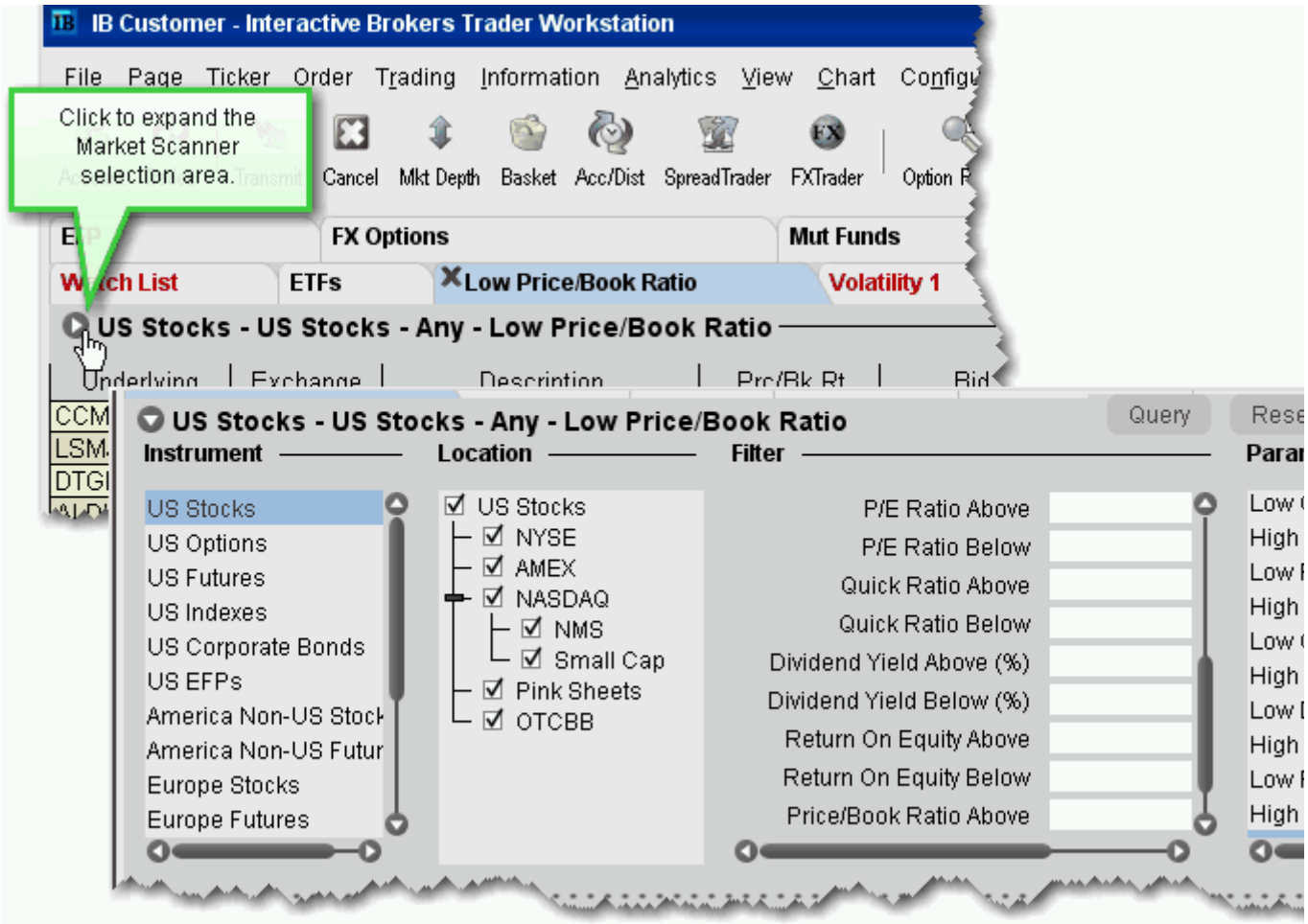


市场扫描仪

- 创建市场扫描仪
- 市场扫描仪类型

创建市场扫描仪

市场扫描仪页面根据您定义的工具、参数和过滤标准，自动地将排名前五十的合约填入预格式化的交易页面。



创建市场扫描仪页面

1 在**页面**菜单上选择*创建市场扫描仪*。

新的市场扫描仪页面被创建，默认扫描为美国股票，最低市值与账面价值比。

2 点击展开箭头来显示标准选择面板。

定义扫描标准

1 从**工具**列表中选择一个工具类型。扫描标题更改以反映您选择的标准。

Note: *工具按地区被定义。“全球”扫描仪能够扫描全球市场上的工具。*

2 选择数据将被包括在市场扫描中的地点/交易所。有效的地点根据您在第2步中选择的工具而相应地变化。

3 点击**过滤器**区域来缩小将被返回到您的查询中的合约范围。例如，您可能只想看见一定市盈率范围内、或市值在2,000,000以上的前%美国股票获利者。

4 在**参数**区域中选择一个扫描仪参数，例如*前%获利者*、*根据价格的热门合约*或者*最优的期权内在波动率*。

5 点击*查询*来返回满足您的搜索标准的前50份合约。数据每60秒被更新。

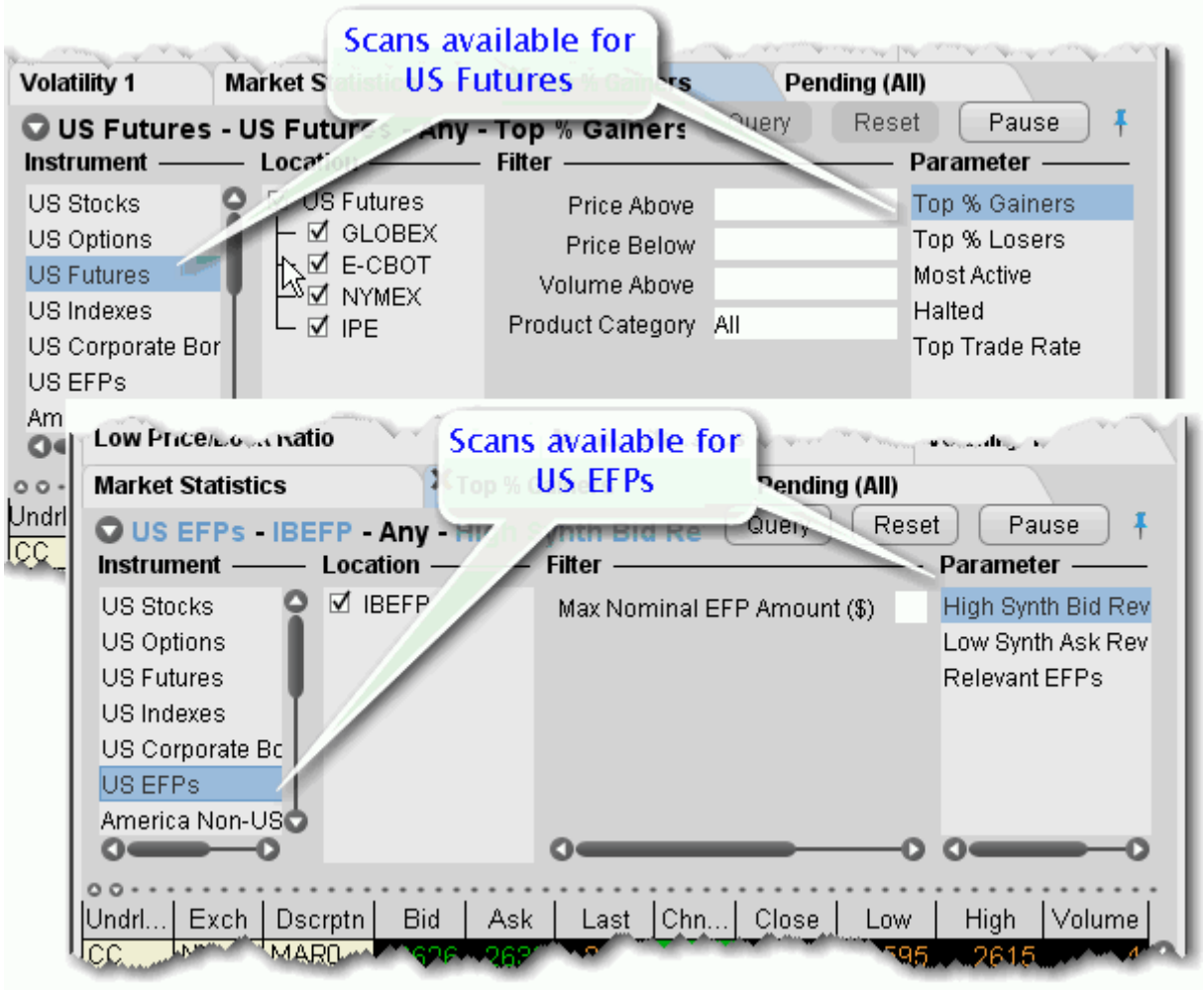
Note: *扫描区域中的时间显示了资产已被包括在扫描中多久。其在每分钟数据查询更新时刷新。*

Note: 您不能从*市场扫描仪*页面中修改页面版式或发起一笔定单，单您能够拖动一个代码并将其放到您的另一个交易页面上。您能够创建多个市场扫描仪页面并将市场扫描仪页面分开，但这些页面被算作交易页面，显示的市场数据被算作活动的市场数据。

IB的每日期权和期货智能报告使用了交易平台市场扫描仪数据作为其评论的基础。

市场扫描仪类型

可用的市场扫描根据您选择的工具 / 地点标准而变化。



市场扫描仪参数	
参数	**描述**
最高％获利者	最后交易价格相比前一晚的收盘价格显示出了最高百分比增长的合约。
最高％亏损者	最后交易价格相比前一晚的收盘价格显示出了最低百分比增长的合约。
最活跃的	根据使用的单位 （对美国股票为手；对衍生品和非美国股票为合约），今日交易量最高的合约。

市场扫描仪参数	
不开盘	今天没有交易的合约。
停盘	交易已被停止的合约。
根据价格的热门合约	这样的合约，当中： （最后交易价格－前一日收盘价）/ 平均每日变化有最高的绝对值（正或负）。 平均每日变化被定义为合约的 （每日收盘价－每日开盘价）的指数滑动平均。
根据交易量的热门合约	这样的合约，当中： 今日交易量 / 日平均交易量是最高的。 日平均交易量是合约每日交易量的 30 天指数滑动平均。
最高交易数目	一天当中最高的交易数目。
最高交易率	在过去 60 秒当中交易数目最高的合约 （无论那些交易的尺寸多大）。
最大价格极差	今日的最高价和最低价之间的最大差额，或者与昨日的收盘价的差额（如果在今天的极差范围之外）。
根据价格极差的热门合约	波动率的最大价格极差 （来自最大价格极差计算）。
最高交易量速率	每分钟最高交易量。
自开盘起最高％获利者	显示最后交易价格相比开盘价格上涨的百分比最高的合约。
自开盘起最高％亏损者	显示最后交易价格相比开盘价格下跌的百分比最高的合约。
最高收盘到开盘％获利者	显示今天的开盘价格相比前一日收盘价格上涨的百分比最高的合约。
最高收盘到开盘％亏损者	显示今天的开盘价格相比前一日收盘价格下跌的百分比最高的合约。
最高期权内在波动率 *	显示到期日在接下来两个月之内、有最高的 vega 加权内在波动率的最接近平价期权的底层证券合约 （股票或指数）。
最低期权内在波动率 *	显示到期日在接下来两个月之内、有最低的 vega 加权内在波动率的最接近平价期权的底层证券合约 （股票或指数）。
最高期权内在波动率％获利者 *	显示当前的内在波动率与昨日 15 分钟平均内在波动率的收盘值相比有最大百分比收益的底层证券合约 （股票或指数）。
最高期权内在波动率％亏损者 *	显示当前的内在波动率与昨日 15 分钟平均内在波动率的收盘值相比有最大百分比损失的底层证券合约 （股票或指数）。
期权内在波动率与历史波动率的最高偏差 *	显示内在波动率与历史波动率之间的偏离最大的底层证券合约 （股票或指数）。

市场扫描仪参数	
期权内在波动率与历史波动率的最低偏差 *	显示内在波动率与历史波动率之间的偏离最小的底层证券合约 （股票或指数）。
根据期权交易量最活跃的	显示根据期权交易量按降序排列的最活跃的合约。
根据期权未平仓合约数最活跃的	返回有最高的流通看涨期权合约数＋流通看跌期权合约数的前 50 个底层证券合约。
最高期权交易量看跌 / 看涨比率	看跌期权交易量被除以看涨期权交易量，有最高比率的底层证券代码将被显示。
最低期权交易量看跌 / 看涨比率	看跌期权交易量被除以看涨期权交易量，有最低比率的底层证券代码将被显示。
最高期权未平仓合约数看跌 / 看涨比率	返回流通期权合约的看跌 / 看涨比率**最高**的前 50 个合约。
最低期权未平仓合约数看跌 / 看涨比率	返回流通期权合约的看跌 / 看涨比率**最低**的前 50 个合约。
根据期权交易量的热门合约	显示 10 天平均期权交易量最高的底层证券合约。
13 周最高	过去 13 周的最高价格。
13 周最低	过去 13 周的最低价格。
26 周最高	过去 26 周的最高价格。
26 周最低	过去 26 周的最低价格。
52 周最高	过去 52 周的最高价格。
52 周最低	过去 52 周的最低价格。
最高增长率	返回每股盈余增长率*最高*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**增长率**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的每股盈余。
最低增长率	返回每股盈余增长率*最低*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**增长率**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的每股盈余。
最高市盈率	返回市盈率*最高*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**市盈率**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的市盈率。
最低市盈率	返回市盈率*最低*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**市盈率**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的市盈率。
最高速动比率	返回 “速动”比率*最高*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**速动比率**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的速动比率。
最低速动比率	返回 “速动”比率*最低*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**速动比率**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的速动比率。
最高股息收益率	返回每股股息收益率*最高*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**每股股息**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的每股股息收益率。
最低股息收益率	返回每股股息收益率*最低*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**每股股息**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的每股股息收益率。
最高股本回报率	返回股本回报率*最高*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**股本回报率**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的股本回报率。

市场扫描仪参数	
最低股本回报率	返回股本回报率*最低*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**股本回报率**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的股本回报率。
最高市值与账面价值比	返回市值与账面价值比*最高*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**市值与账面价值比**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的市值与账面价值比。
最低市值与账面价值比	返回市值与账面价值比*最低*的前 50 个合约。注意一个新的区域，**市值与账面价值比**，被插入到描述区域之后来显示每个合约的市值与账面价值比。
市场统计	来看看对以下指标的交易所特定的统计： • 增加、减少和不变的股票 • 上升、下降、不变和总的交易量 • TRIN 和 TICK 指标 要使用它，从**工具**列表中选择*市场统计*，然后从**地点**下拉菜单中选择一个交易所。
美分期权	打开美分期权页面。
最高合成出价收益率	强调可用的最高合成期货转现货利率。这些利率的计算方法是：得到单一股票期货与底层股票之间的价格差别，然后减去股息来算出单一股票期货期间按年度计算的合成内在利率。高利率可能表示投资机会。
最低合成出价收益率	强调可用的最低合成期货转现货利率。这些利率的计算方法是：得到单一股票期货与底层股票之间的价格差别，然后减去股息来算出单一股票期货期间按年度计算的合成内在利率。低利率可能表示借入机会。
相关期货转现货	该工具扫描美国市场，并根据您当前持有的股票和单一股票期货头寸返回与您的投资组合相关的所有期货转现货。要获取关于使用期货转现货来降低您的交易成本的更多信息，参见相关期货转现货用户指南话题。

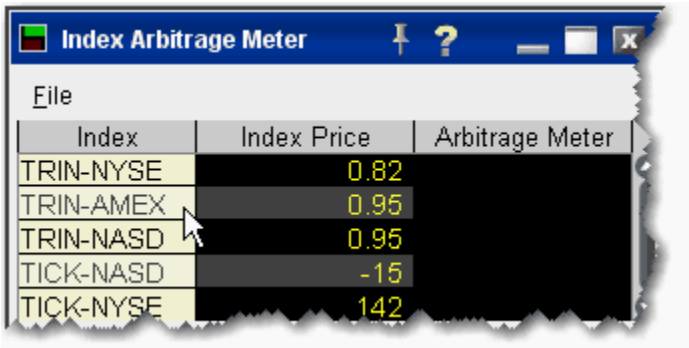
***30 天 （V30）内在波动率：**

内在波动率对美式期权使用 100 步二叉树计算，对欧式期权使用 Black-Scholes 模型计算。利率是使用来自交易日的欧洲美元期货合约的结算价格被计算的，股息根据的是历史支付率。

IB 的 30 天波动率是对当前交易日向前 30 个日历日的到期日估计的平价波动率。它根据的是来自两个连续到期月的期权价格。第一个到期月距离现在至少还有八个日历日。对每个到期日最接近市价的四个行权价的八只期权，内在波动率都被估计。内在波动率被拟合为每个到期日行权价的抛物线函数。一个到期日的平价内在波动率随后被作为拟合抛物线在到期日的预期未来价格上的值。根据平价波动率平方的 30 天方差的线性内插 （或外推，根据要求而定）被执行。V30 是估计的方差的平方根。如果第一个到期月不满足距离小于 60 个日历日，我们将不计算 V30。

TICK 和 TRIN 市场指标

使用市场指标来帮助确定趋势。Tick 指数指标显示了以向上跳动的报价交易的股票数减去以向下跳动的报价交易的股票数。TRIN （交易者指数）指标是一个技术分析指标，是通过将上升下降拐点的差价除以上升下降拐点的交易量来计算的 。



查看 tick 和 trin 指标

1 使用搜索功能来输入 “tick” 或 “trin” 并选择您想要查看的指数。

日期行出现在您的交易窗口上，带有指数价格的指数套利表打开。注意，您不能交易这些指数。

配置交易平台

10

交易平台是可以完全客户化的。全局配置设定让您能够对所有的交易平台窗口更改细节。页面版式功能提供了对您的交易平台的控制，功能选择器允许您根据您的需要来隐藏或显示功能。

- 全局配置
- 显示配置
- 交易工具
- 信息工具
- 页面版式
- 交易页面区域描述
- 功能选择器
- 配置定单预设
- 工作空间和面板

全局配置

引言

每个交易平台页面或工具都有允许您客户化的配置设定。全局配置是配置任何和所有交易平台组成部分的起始点。

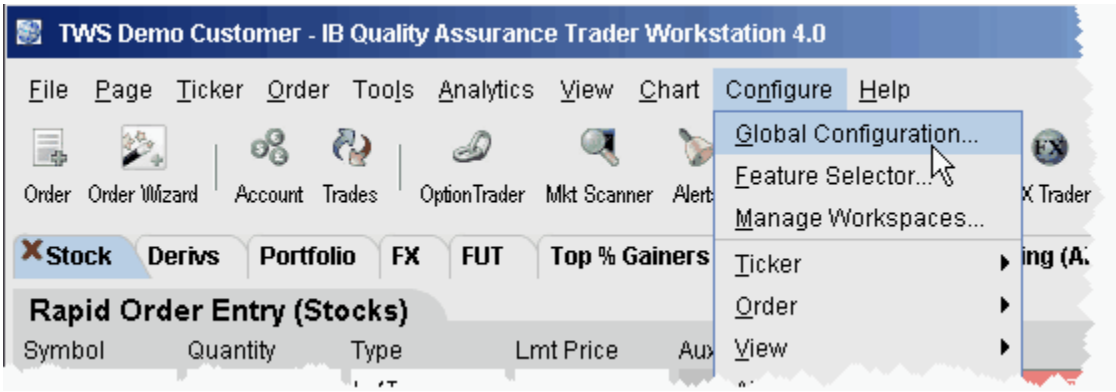
- 使用全局配置
- 一般配置
- 分配热键
- 显示交易平台消息
- 配置波动率和分析设定
- 配置智能传递指令
- 将声音分配给事件
- 快速股票输入交易所配置
- 启用 API 连接
- 配置自动导出
- eSignal 市场数据
- 配置锁定和退出参数

使用全局配置

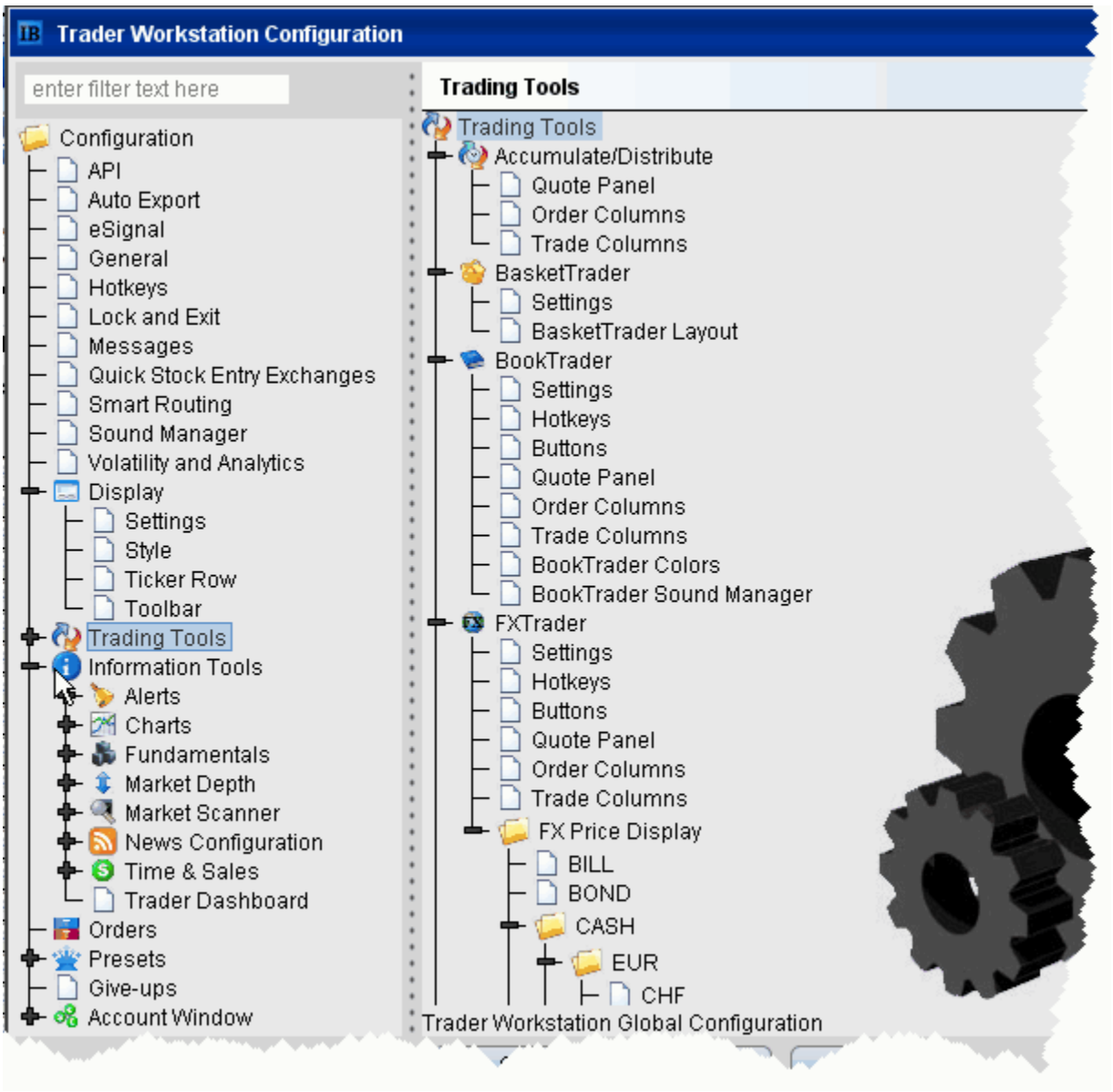
全局配置窗口是您定义整个系统范围内的默认配置设定的起始点。

进入全局配置

1 在**配置**菜单上，选择*全局配置*，或者从任何屏幕点击配置扳手图标。



2 向下滚动左侧目录来选择一个项目，并在右侧可选项中打开。



您同样能够使用窗口顶部的文本搜索框来找到您想要配置的页面。 列表被过滤，只显示那些在标题中包括了您输入的文本的页面。要再次查看所有类别，点击**搜索**框右边的页面图标。

一般配置

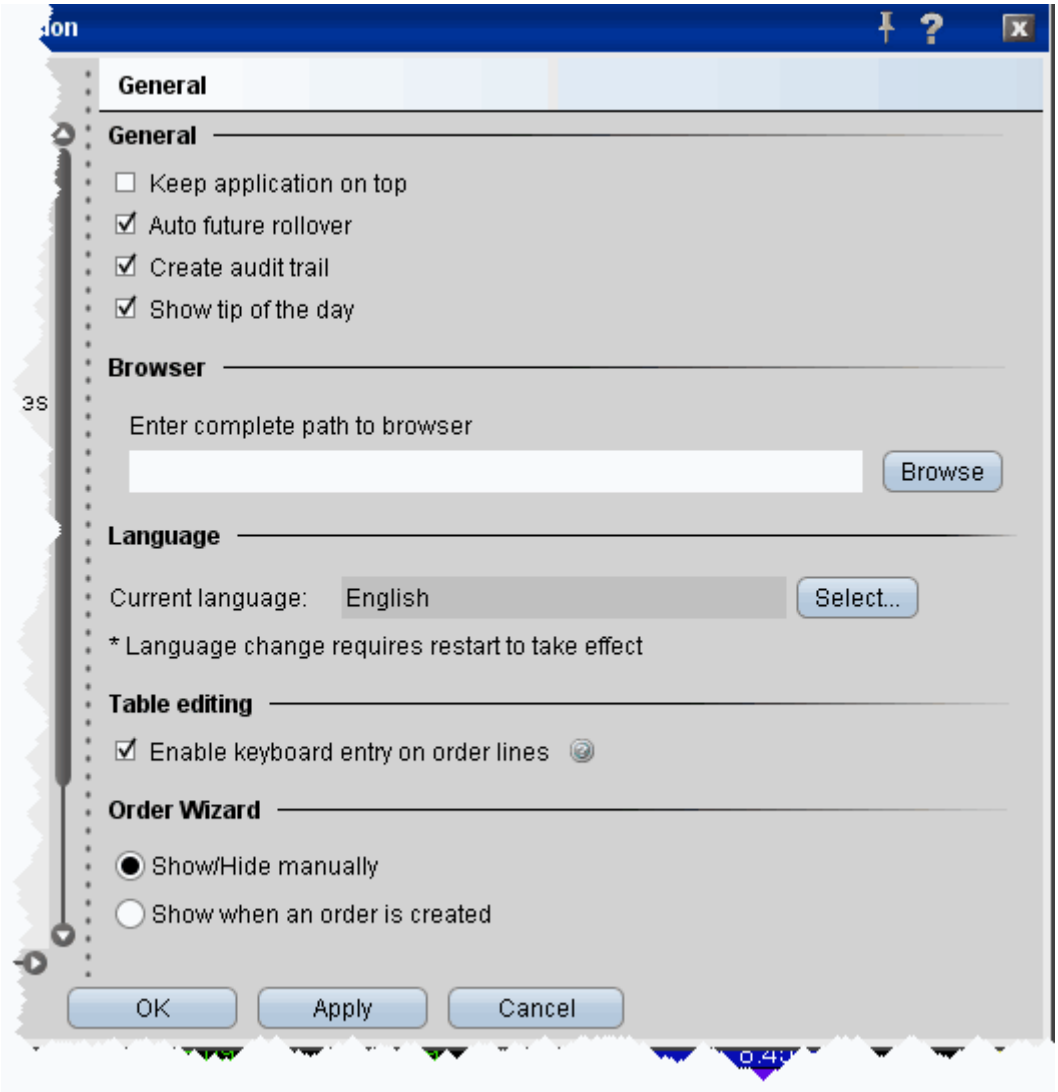
使用一般配置页面来设定各种默认值，例如自动期货再投资通知、审计追踪和语言设定。

定义一般配置设定

1 在**配置**菜单上选择*全局配置*。

2 在左侧目录中点击*一般*。

3 使用右侧可选项来设定这些参数。



一般

- **保持应用程序在顶部** — 打勾将主交易屏幕保持在其他所有活动的窗口之上。

- **自动期货再投资** — 当被选中，您将在到期之前被通过弹出消息通知，您有机会选择将期货再投资。
- **创建审计追踪** — 当被选中，您能够选择查看您的审计追踪的压缩或扩展版本，审计追踪包括了您账户的所有交易活动。
- **显示当日提示** — 当被选中，每日提示在启动时显示。

浏览器

- **将完整的路径输入到浏览器** — 对独立版本的用户，如有必要请修改浏览器位置。

语言

- **当前语言** — 显示当前的交易平台语言。点击选择来选择另一种语言。点击确定，然后退出交易平台以激活语言更改。

表格编辑

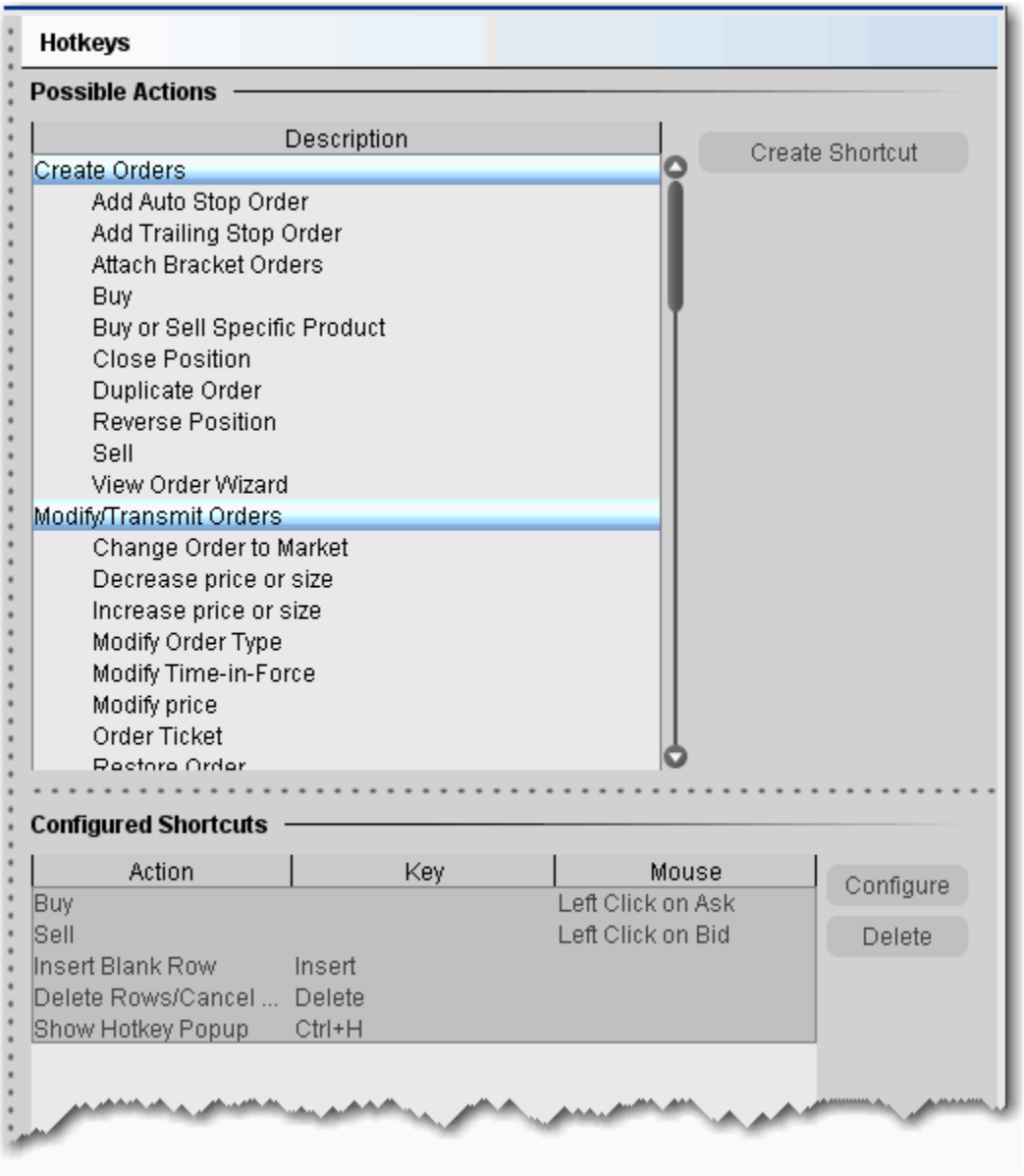
- **在定单行上启用键盘输入** — 当被选中，您能够选中一个定单行，并且在不使用鼠标的情况下修改区域值。每个区域在您到达它时变为可编辑的，回车键的作用相当于点击鼠标左键。

定单向导

- 使用单选按钮让交易平台自动打开向导，或者使用交易工具栏上的套环图标手动控制向导显示。

分配热键

将行为分配给特定的键和键的组合，会帮助您快速地创建定单并将其传递至市场。您能够用 26 个键盘字母当中的一个来分配任何按键或 “Ctrl” 和 “Shift” 键的组合，从而映射特定的定单创建和定单传递命令，例如买入、卖出、传递和取消。



记录热键

1. 在**配置**菜单上，选择*全局配置*，然后从左侧目录中选择*热键*。
2. 在*可能的行动*区域内，选择一个您想要对其分配热键的行动，并点击**创建快捷方式**。
3. 在键盘区域，点击**记录**。如果您已经对选定的行动记录了热键，它被显示在*当前快捷键*区域中。

4 按下您将用来完成该行动的真实按键或按键组合。系统记录下您的按键并将其显示在*当前快捷键*区域。

Note: 如果*客户化*页面可见，您能够客户化您的热键，使其更加具体。例如，在您记录下买入热键之后，将其客户化以便创建括号或追踪限价止损定单。

在您记录下需要的热键并点击**关闭**之后，映射的热键被显示在屏幕底部的状态行上。要重新记录热键分配，遵照以上的步骤 1 — 4。要从行动中删除热键分配，点击**清除**。

特定的热键过程和信息

- **对特定的定单类型创建买入 / 卖出热键** （例如，买入限价定单、卖出止损定单）
  - **a** 在**配置**菜单上点击*热键*。
  - **b** 选择*买入*或*卖出*作为行动并点击**创建快捷方式**。
  - **c** 点击*客户化*页面。
  - **d** 在**定单类型**下拉列表中选择您想要对其创建热键的定单类型。
  - **e** 填充任何必要的定单类型相关区域。
  - **f** 点击*快捷方式*标签。
  - **g** 点击**记录**并按下将代表定单类型热键的按键组合。
  - **h** 证实热键已被正确地记录在*快捷方式*部分中。
- **对特定的合约创建买入 / 卖出热键** （例如，对 XYZ 的买入限价定单）
  - **a** 在**配置**菜单上点击*热键*。
  - **b** 选择*买入*或*卖出特定产品*作为行动并点击**创建快捷方式**。
  - **c** 点击*客户化*页面。
  - **d** 在**底层证券**区域，输入一个底层证券代码。
  - **e** 填充**定单**相关区域。
  - **f** 点击*快捷方式*标签。
  - **g** 点击**记录**并按下将代表定单类型热键的按键组合。
  - **h** 证实热键已被正确地记录在*快捷方式*部分中。
- **即刻传递**

当您对任何定单类型创建买入或卖出热键时，您能够选择 “即刻传递定单”，方法是在*客户化*页面底部对该功能打勾。当您激活了即刻传递，使用热键组合将会在不给您时间审查和修改定单参数的情况下创建和传递定单。

不对该功能打勾，这样就可以让热键组合创建定单，然后将定单留在交易屏幕上给您手动传递。

- **附加括号定单**

a 在**配置**菜单上，选择*热键*。

b 选择*买入*或*卖出*作为行动并点击**创建快捷方式**。

c 点击*客户化*页面。

d 在**附加定单**范围内，对*添加简单括号*打勾。

e 在**括号定单**范围内：

- 在**限价（＋／－抵消额）**区域选择*出价*、*要价*、最后或*无*作为括号定单限价部分的基础，如果需要，还应输入抵消金额。
- 选择**止损类型**。
- 设定止损价格以及对止损触发价格的抵消额。
- 对**限价止损**定单，设定止损限价和抵消额。

f 在**快捷方式**页面记录下热键组合，然后点击确定。

- 创建增大（减小）定单尺寸热键

a 在**配置**菜单上选择*热键*。

b 选择*增加（减少）价格或尺寸*并点击**创建快捷方式**。

c 在**客户化**页面上，在**区域**下拉列表中选择*尺寸*。

d 设定**最小报价单位数**的数值，来代表增大（减小）默认定单尺寸所根据的增量。

e 在**快捷方式**页面上，点击**记录**并按下热键组合以代表*增大（减小）定单尺寸*。

f 关闭对话框。

- 创建提高（降低）限（辅助）价热键

a 在**配置**菜单上选择*热键*。

b 选择*提高（降低）价格或尺寸*并点击**创建快捷方式**。

c 在**客户化**页面上，在**区域**下拉列表中选择*限价（辅助价格）*。

d 输入*最小报价单位数*增量，您想要热键根据该增量增大（减小）价格数值。

e 在**快捷方式**页面上，点击**记录**并按下热键组合来代表*提高（降低）限（辅助）价*。

f 关闭对话框。

- 对买入／卖出定单使用全部可用的数量

a 在**配置**菜单上点击*热键*。

b 选择*买入*或*卖出*作为行动并点击**创建快捷方式**。

c 点击*客户化*页面。

d 在**尺寸**区域，选择*可用*，然后点击确定。

现在当您使用买入或卖出热键时，定单数量将由要价尺寸或出价尺寸区域内显示的可用合约数目决定。

- 更改定单类型 / 有效时间
  - **a** 在**配置**菜单上选择*热键*。
  - **b** 在**修改 / 传递定单**部分，选择*修改定单类型*或*修改有效时间*并点击**创建快捷方式**。
  - **c** 在**快捷方式**页面上，点击**记录**并按下热键组合。
  - **d** 关闭对话框。
- 打开警报框来查看 / 设定警报
  - **a** 在**配置**菜单上选择*热键*。
  - **b** 在**实时活动监控**部分，选择*查看警报*并点击**创建快捷方式**按钮。
  - **c** 在**快捷方式**页面，点击**记录**并按下热键组合，例如 Ctrl ＋ A。
  - **d** 关闭对话框。
  - **e** 点击**确定**。

当您从交易平台使用 Ctrl ＋ A 时，警报框打开显示您的当前警报。要创建警报，点击**新建**按钮。

- 设定自动止损
  - **a** 在**配置**菜单上选择*热键*。
  - **b** 在**实时活动监控**部分，选择*添加自动止损定单*。
  - **c** 点击**记录**并按下热键组合，例如 Ctrl ＋ A。
  - **d** 关闭对话框。
  - **e** 点击**确定**。

现在当您从交易平台使用 Ctrl ＋ A 时，您将附加一个止损定单到选定的定单。

- 设定自动追踪止损
  - **a** 在**配置**菜单上选择*热键*。
  - **b** 在**实时活动监控**部分，选择*添加自动追踪止损定单*。
  - **c** 点击**记录**并按下热键组合，例如 Ctrl ＋ T。
  - **d** 关闭对话框。
  - **e** 点击**确定**。

现在当您从交易平台使用 Ctrl ＋ T 时，您将附加一个追踪止损定单到选定的定单。使用的追踪金额是在定单默认值中定义的数值。

一些键盘按键不能被用作热键，包括：*Alt*、*Page Up*、*Page Down*、*Print Screen*、*Home*、*Backspace* 以及 *Windows* 键。我们保留在任何时间不通知的情况下激活这些键或者将热键功能从一个键删除的权利。对无效键的尝试使用将产生消息 “您选定的热键无效。请选择另外的热键组合。”

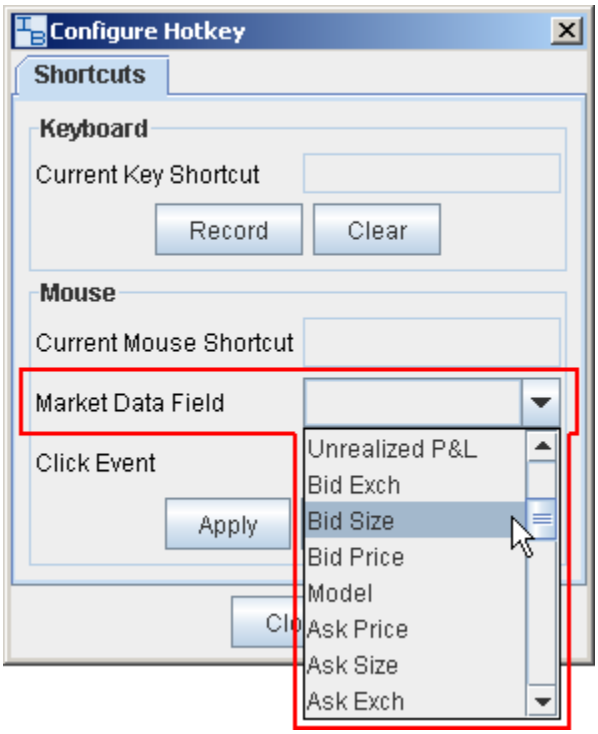
Note: 标准热键在快速定单输入面板中不起作用。当您对一个快速定单输入行动记录热键时，您必须使用 “Ctrl” 加上一个字母键，或者 Escape 键。

分配鼠标快捷方式

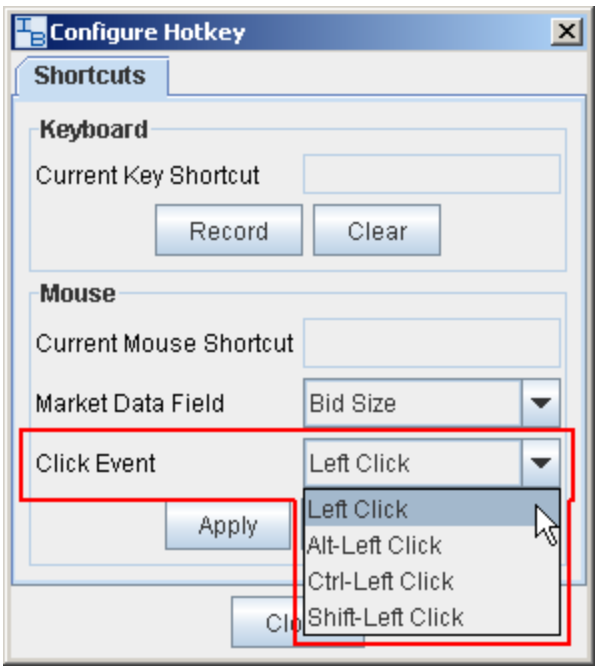
您能够对特定的定单创建和传递命令，如买入、卖出、传递和取消以及许多其他命令记录下鼠标点击快捷方式。

分配鼠标快捷方式

1. 在**配置**菜单上，选择全局配置，随后选择*热键*。
2. 在*可能的行动*列表上，选择一个您想要分配鼠标快捷方式的行动并点击**创建快捷方式**。
3. 在**鼠标**区域，使用*市场数据区域*下拉列表来选择您要点入的区域从而激活快捷方式。



4. 在*点击事件*下拉列表上，选择您将在选定的区域使用的点击方式来激活快捷方式。



5 点击**应用**，然后点击**关闭**。

例子：如果您在*可能的行动*中选择**取消定单**，在*市场数据区域*中选择**出价尺寸**，并选择**左键点击**作为点击事件，当您使用鼠标在**出价尺寸**栏中点击 （左键点击），您将会取消定单。注意，您必须显示恰当的区域来使用该鼠标快捷方式！要隐藏和显示区域，使用版面管理器。

Note: 鼠标快捷方式将覆盖默认的鼠标行动。要回到默认的鼠标行动，您必须在热键和鼠标快捷方式框中重新设定行动作为快捷方式。

客户化热键

在您映射热键之后，使用*客户化*页面上的选项来使您的热键行动更加具体。

客户化热键

1 在**配置**菜单上，点击*热键*。

2 在**快捷方式**区域，选择一个行动，您想要客户化该行动的热键，然后点击**配置**。

3 点击*客户化*页面然后设定参数来支持客户化的热键。

客户化的被映射的键被显示在位于应用程序底部的状态行上。

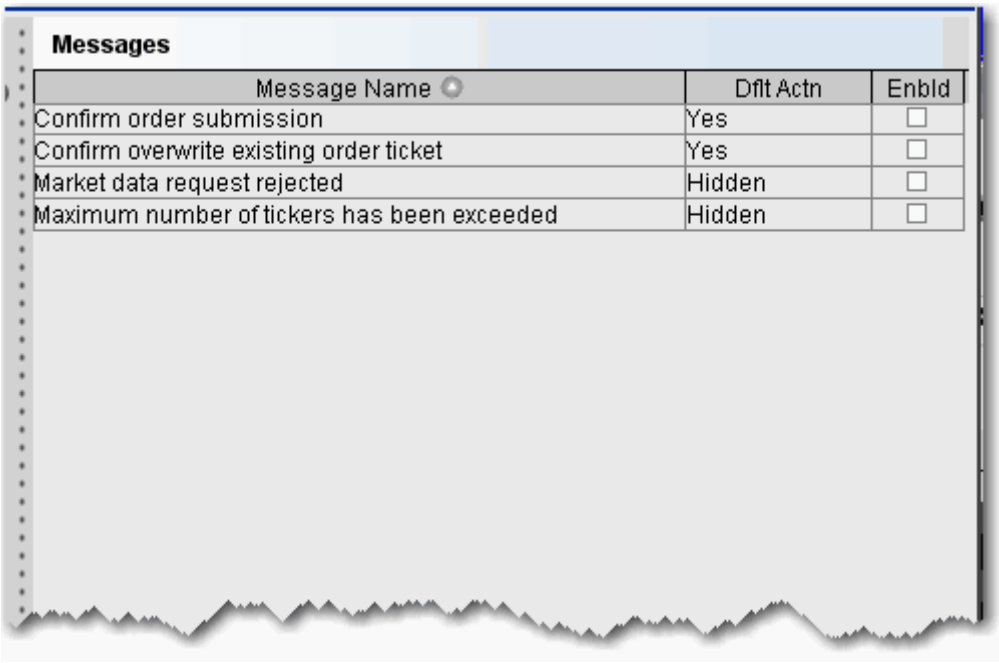
显示交易平台消息

每次您在交易平台中收到一条信息或确认消息时，我们都会在左下角包括一个复选框，上面写着 “不再显示该消息。”如果您选择隐藏消息，您能够在任何时候使用全局配置工具的**消息**部分将其重新启用。

启用交易平台消息

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击*消息*。
3. 使用右侧可选项对您想要启用的任何消息打勾。

Note: 该页面只能被用来启用您已经关闭的消息，而不是禁用消息。我们想确保您在选择禁用每条消息之前已经将其阅读了至少一遍。

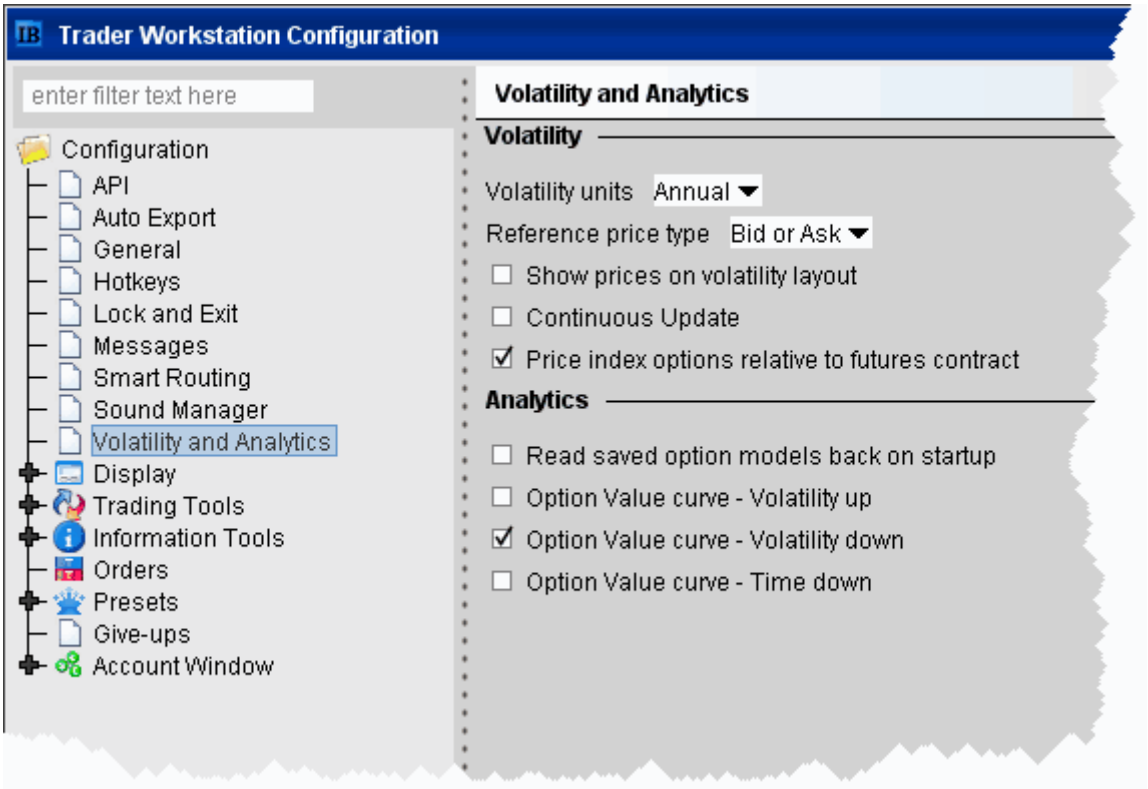


Messages

Message Name	Dflt Actn	Enbld
Confirm order submission	Yes	☐
Confirm overwrite existing order ticket	Yes	☐
Market data request rejected	Hidden	☐
Maximum number of tickers has been exceeded	Hidden	☐

配置波动率和分析设定

使用波动率和分析配置页面，同时对波动率定单和交互式分析定义默认设定。



定义默认波动率配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击*波动率和分析*。
3. 使用右侧可选项中的波动率部分来设定这些参数：
   - *波动率单位* — 选择每年或每日显示。
   - *参考价格类型* — 选择**出价**或**要价**，当买入看涨期权或卖出看跌期权时使用 NBB（出价），当卖出看涨期权或买入看跌期权时使用 NBO （要价）。选择**平均**来使用最优买卖报价的平均值。该价格还被用来计算发送至交易所的限价 （无论连续更新是否被选中），以及用于股票范围价格监控。
   - *在波动率版面上显示价格* — 当被选中，波动率页面显示与其他页面相同的价格，波动率被显示在括号中。如果不被打勾 （默认情况下）价格栏的值将为波动率。
   - *连续更新* — 当被选中，连续更新区域中的复选框被自动打勾并被启用。您能够在每份定单基础上取消连续更新。连续更新功能监控底层证券的价格，如果底层工具的价格有显著变化，它将更新定单的价格。**注意您一次只能对三个活动的定单使用连续更新。**

- *与期货合约相关的价格指数期权* — 当被选中，您能够从定单行上的**参考合约**区域，根据选定的期货价格，对智能传递的波动率指数期权定单定价。

定义默认分析配置设定

1 在**配置**菜单上选择*全局配置*。

2 在左侧目录中点击*波动率和分析*。

3 使用右侧可选项中的分析部分来设定这些参数：

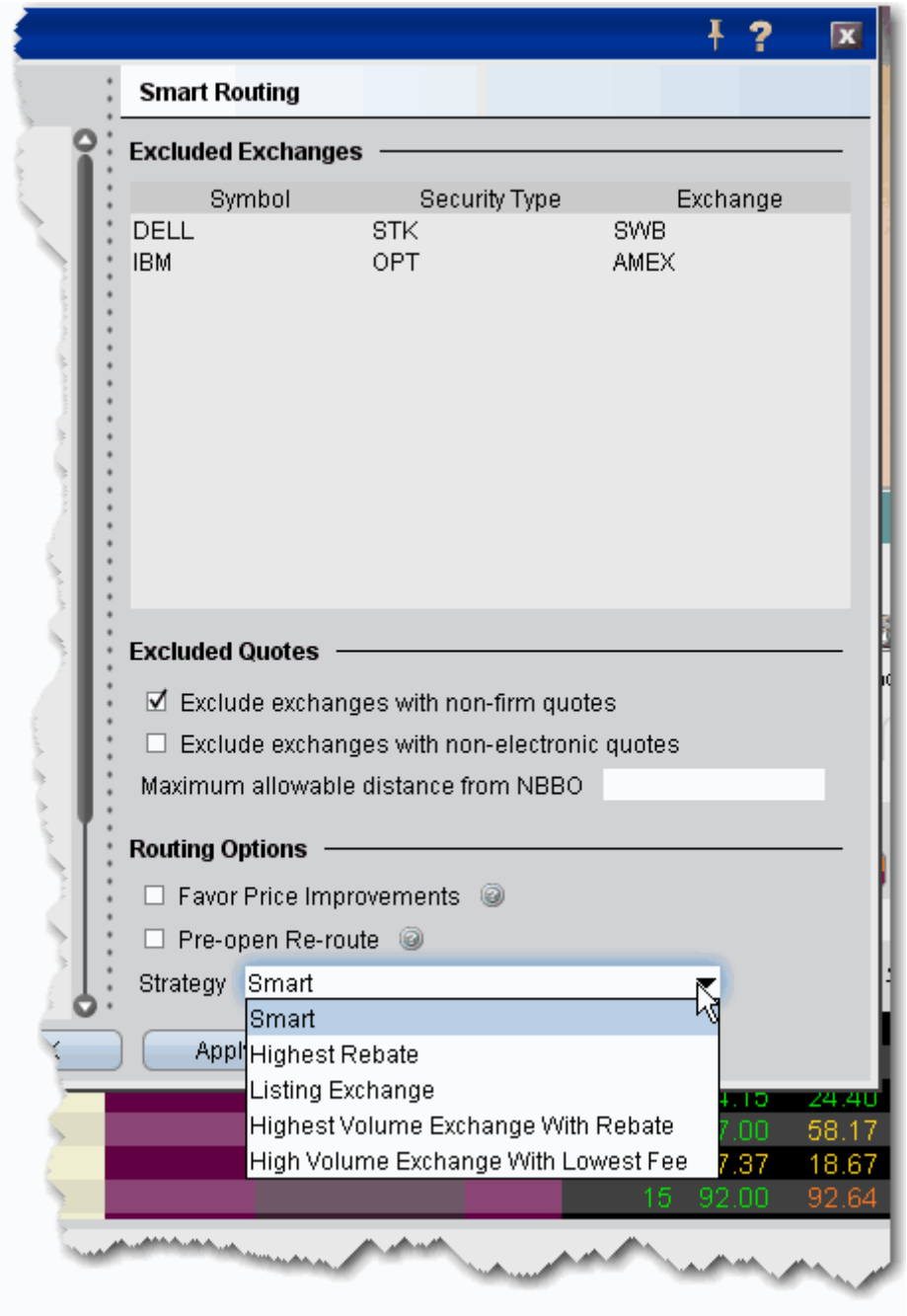
- *返回在启动时阅读保存的期权模型* —
- *期权价值曲线波动率上升* — 显示期权分析绘图的不同情形。使用蓝线来显示内在波动率达15%的相对上升*。
- *期权价值曲线波动率下降* — 显示期权分析绘图的不同情形。使用红线来显示内在波动率达15%的相对下降*。
- *期权价值曲线时间下降* — 以一个日历日来减少时间。

*举一个关于相对百分比变化的例子，如果期权的当前内在波动率为10%，15%的相对变化将导致内在波动率变为11.5%，计算如下：

10%×（1＋0.15）＝11.5%。

配置智能传递指令

您能够对通过 IB 智能路径传递的合约定义特定事件指令，尤其是排除交易所以及通过定义与 NBBO 可接受的距离来设定价格封顶。



修改智能传递功能

1 在**配置**菜单上选择*全局配置*。

2 在左侧目录中点击*智能传递*。

3 使用右侧可选项来设定这些参数：

被排除的交易所

使用该区域，对特定的合约实行智能传递，而不是传递至特定的交易所。输入底层证券并选择证券类型。可以被排除的有效交易所可在交易所下拉列表中获得。

被排除的报价

- 排除有非营利企业报价的交易所。
- 排除报价不可自动执行的交易所。如果选择了该选项，IB 将使用其最大努力来决定哪些交易所的报价是可立即自动执行的，以及哪些交易所的报价将会要求手动 （人工）处理，IB 将只把合约传递至那些提供自动执行的交易所。请注意尽管 IB 将使用其最大努力，但并不总是可以决定一个报价是否可自动执行。
- 通过输入 “与 NBBO 的最大可允许距离”来定义 NBBO 价格封顶。注意，NBBO 价格封顶弃用了对非营利企业报价的排除，即，您的定单将被传递至价格封顶之内的非营利企业报价，而不是价格封顶之外的盈利企业报价。

重要注意事项：如果您选择：1）排除来自特定交易所的报价； 2）排除非营利企业报价；或 3）排除报价不可自动执行的交易所，您的定单可能不会以全国最优的发布价格 （“NBBO”）执行。这是因为您选择排除的交易所当中的某一个可能有最优的发布价格，但该交易所将被 IB 智能路径系统根据您的指示绕开了。

另外，如果您从符合条件的智能路径目的地中排除了特定的交易所，并且您的定单被传递至另一个有较差的发布价格的交易所，您的定单可能不会被它发送到的交易所执行，因为该交易所或电子通讯网络可能不愿意以较差的价格执行，或者您的定单可能会无法在该交易所交易。在决定是否将特定的交易所从符合条件的 IB 智能路径目的地中排除之前，您应当仔细地评估所有这些因素。

传递选项

寻求价格改善

如果被打勾，智能路径将检查特定的交易所以便在更优的价格上获取隐藏流动性。这可能会导致执行变慢。

开市前再传递

该选项允许您在开市前三分钟将定单传递至主要交易所。对在开市前提交的定单，对该方框打勾确保了您的定单在开市前被传递。该指令仅适用于在主要交易所挂牌的股票，并且如果*忽略开盘竞价*定单属性被设定，则不能使用该指令。

策略

非捆绑式客户有能力对不可交易的股票定单从智能传递策略列表中选择策略来完成您的交易策略。从这里设定默认的策略，当有必要时您同样能够使用杂项页面，从定单卡片中对每笔定单修改策略。

可用的策略包括：

- 智能 — 允许智能路由器选择最佳目的地从而最大化回扣。如果没有选中定单，该策略为默认策略。
- 最高回扣 — 传递至有最高回扣的交易所。
- 挂牌交易所 — 这是当前的智能过程，将合约传递至挂牌交易所。
- 有回扣的最高交易量的交易所。

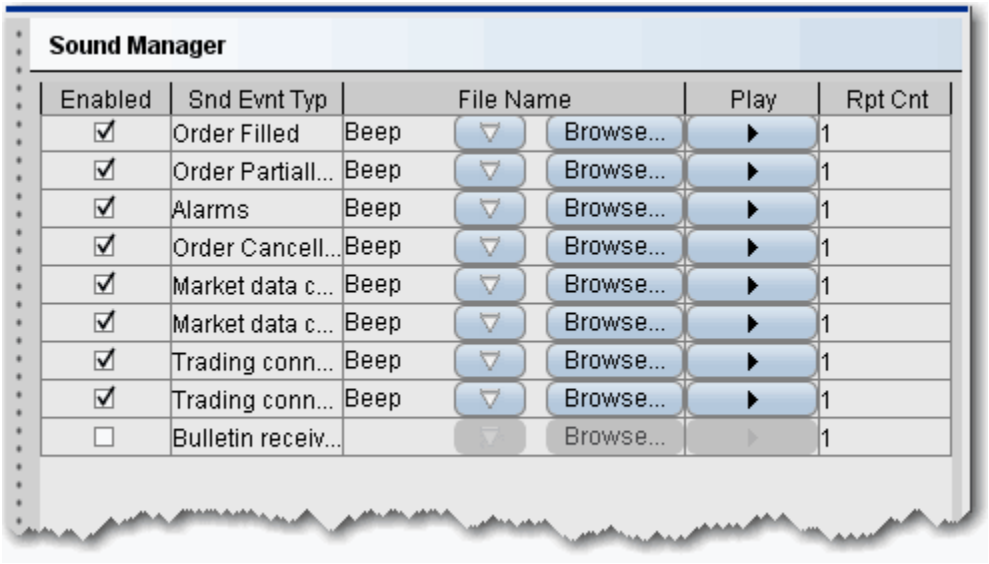
- 有最低流动性接受费的最高交易量的交易所。

要将您的定价结构从捆绑式改为非捆绑式并利用该功能，登录到账户管理，并选择**账户行政**，然后从左侧内容窗格中选择*定价结构*。

将声音分配给事件

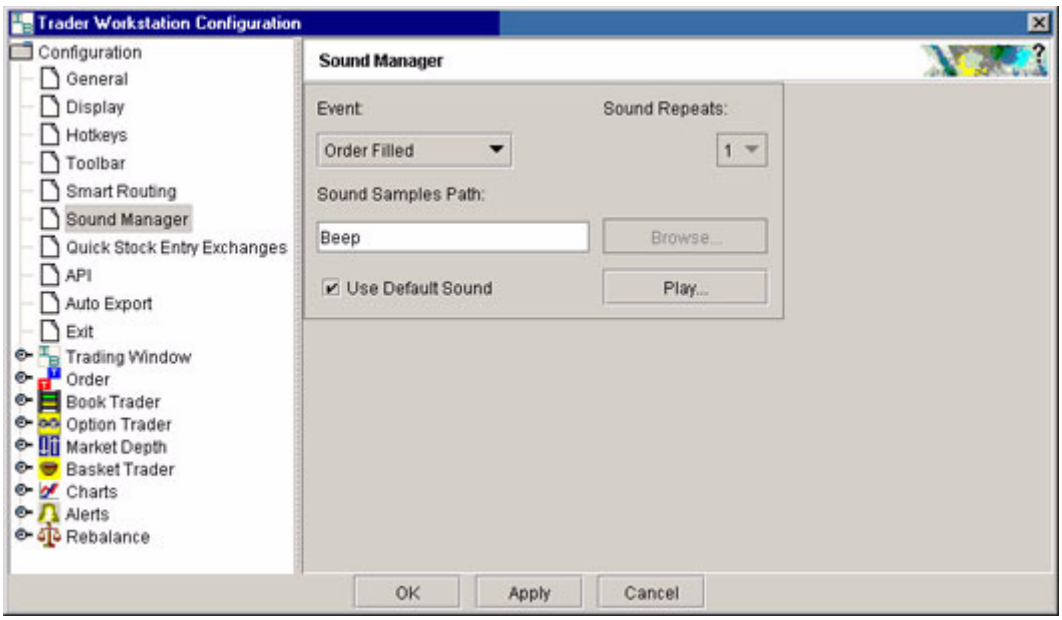
使用**声音管理器**来修改分配给交易事件的声音。

Note: 要在您的计算机上听见除蜂鸣音以外的声音，您必须安装声卡。



配置声音管理器

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击*声音管理器*。
3. 打勾以启用声音。不选中来禁用声音。
4. 要修改默认蜂鸣音，使用下拉箭头来选择一个蜂鸣类型。
5. 要使用新的声音文件，点击浏览器按钮找到 .wav 声音文件。使用播放箭头来收听您选择的声音。
6. 输入您想让声音在发出后重复的次数。


Trader Workstation Configuration
Configuration
General
Display
Hotkeys
Toolbar
Smart Routing
Sound Manager
Quick Stock Entry Exchanges
API
Auto Export
Exit
Trading Window
Order
Book Trader
Option Trader
Market Depth
Basket Trader
Charts
Alerts
Rebalance
Sound Manager
Event:
Sound Repeats:
Order Filled
1
Sound Samples Path:
Beep
Browse...
Use Default Sound
Play...
OK
Apply
Cancel

快速股票输入交易所配置

快速股票输入是一个页面水平的功能，其根据您输入的底层证券代码，自动地对股票完成市场数据线。要使用快速股票输入，您必须：

- 创建一个定单目的地列表。
- 对快速股票输入启用一个交易页面。

配置快速股票输入目的地

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击*快速股票输入交易所*。
3. 在右侧可选项中，点击**添加**，输入目的地并点击确定。
4. 添加您想要的所有可用的定单目的地。您能够在任何时候添加更多的目的地。

   Note: *将智能添加到列表，从而能够通过智能定单路径来传递快速股票。*

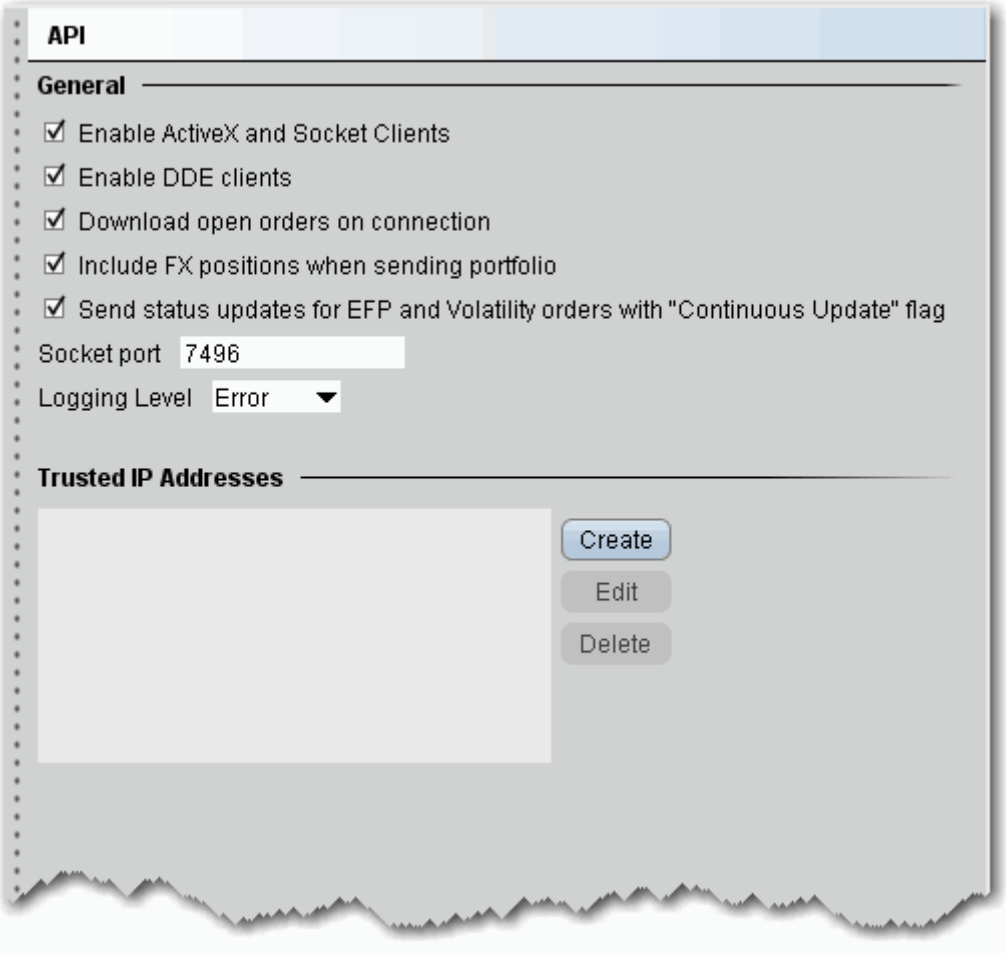
   阐明所选的交易所集合例如 Smart，同样要指明首选的交易所。例如，Smart/NYSE。

启用 API 连接

要使用任何 API 组成部分，您必须让您的系统运行。注意，不止一个 API 应用程序能够同时进入一个例子。除了对 DDE，API 应用程序不需要在程序运行的同一台电脑上运行。

定义 API 配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击 *API*。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：



一般

- **启用 Active X 和套接字客户端** — 打勾启用与交易平台的集成，使用 ActiveX 或套接字客户端包括 Java 和 C++。从 IB 网站上的软件页面下载样本程序。
- **启用 DDE 客户端** — 打勾启用通过 DDE 与交易平台的集成。从网站上的交易平台软件页面下载样本文件。

- **在连接时下载开仓定单** — 如果您不想在连接到您的 API 时下载所有开仓定单，那么不要选中。
- **当发送投资组合时包括外汇头寸** — 如果您激活了包括外汇头寸功能，当投资组合更新被发送至 API 客户时，所有外汇头寸将被包括。如果您不想在发送投资组合更新时将外汇头寸发送至 API 客户，那么不要选中。
- **使用 “连续更新”旗帜发送 EFP 和波动率定单的状态更新** — 如果您对 EFP 或波动率定单激活了连续更新，所有更新将被默认发送至 API 客户。如果您不想让这些更新从交易平台被发送至 API 客户，那么不要选中。
- **套接字端口** — 输入一个套接字端口号，其允许您在您的 ActiveX 工作表中将多个版本的交易平台同步。
- **日志水平** — 对 API 文本日志设定日志详细水平。*系统*给出了最笼统的日志记录水平；*细节*给出了最详细的水平。

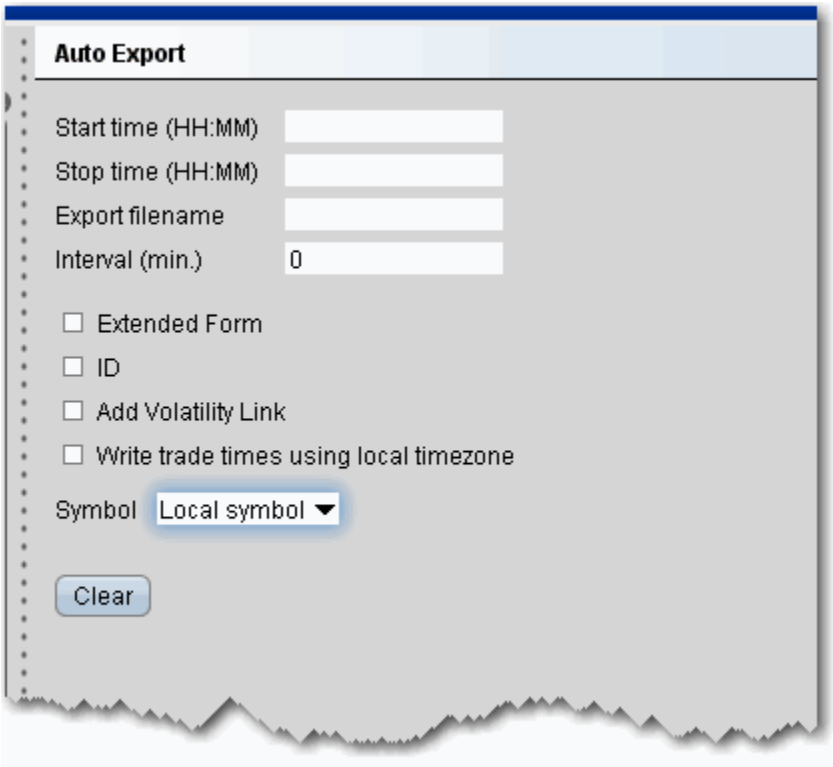
受信任的 IP 地址

如果您通过受信任的 IP 地址连接到 API，那么连接不会受到询问。否则，您将收到一条证实消息，询问您是否确定您想要实现连接。

- 点击**创建**将新的受信任的 IP 地址添加到列表。
- 点击**编辑**来修改选定的地址。
- 点击**删除**来去掉选定的地址。

配置自动导出

使用自动导出配置页面来定义对自动导出执行报告的设定。



定义自动导出配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击*自动导出*。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：
   - **开始时间** — 设定您想要开始导出报告的时间，使用格式 HH:MM。
   - **停止时间** — 设定您想要停止导出报告的时间，使用格式 HH:MM。
   - **导出文件名** — 输入您想要想要导出文件被保存的目录路径和文件名。
   - **间隔** — 设定用来导出报告的时间间隔（以分钟为单位）。
   - **扩展模式** — 与首要区域（代码、行动、股数、价格、时间、日期、交易所、账户号、定单参考 ID、执行 ID 和转让）一起，扩展模式还导出类型、到期日、行权价、权利和权利金货币区域。
   - **ID** — 对该方框打勾，将 ID 区域包括在导出的执行报告上。
   - **添加波动率链接** — 将 delta 对冲定单链接到波动率期权定单上。
   - **使用本地时区记录交易时间** — 如果被打勾，那么不管定单是在什么时区执行的，都对执行的交易显示本地时间。

- **代码** — 为代码选择显示类型。

eSignal 市场数据

使用 eSignal 页面来配置和使用 eSignal 市场数据。请注意为连接到 eSignal 数据，您必须订阅 eSignal，并下载和安装 eSignal 应用程序 www.esignal.com。

定义 eSignal 设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击 *eSignal*。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：

- **对市场数据使用 eSignal** — 打勾来使用您的 eSignal 订阅从而在交易平台中接收市场数据。如果被打勾，输入 eSignal 用户名、密码和主机地址。

连接性

- 为 eSignal 连接输入用户名、密码和主机地址。

Note: 为了使更改生效，您必须重启系统。

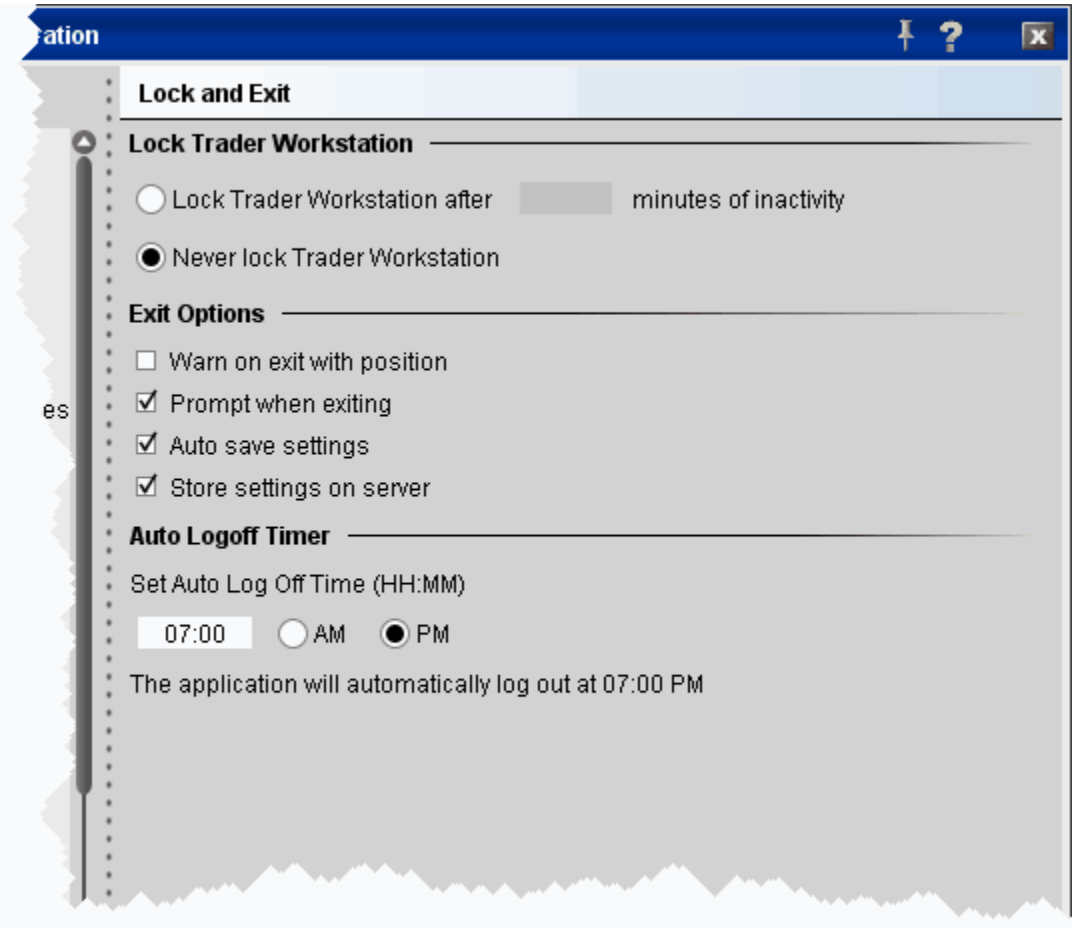
- 如果需要，更改更新频率。

市场数据

对可用的证券类型，将合适的方框打勾以便接收顶级和 / 或深层数据。

配置锁定和退出参数

使用退出配置页面来定义退出选项，例如您是否想在应用程序关闭之前看到警告消息。



定义退出配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击*锁定和退出*。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：

锁定交易平台

- **在 ___ 分钟不活动后锁定交易平台** — 如果在定义的分钟数内没有活动发生，您的交易平台将被锁定。一旦被锁定，您必须使用您的交易平台密码将程序解锁。
- **从不锁定交易平台** — 对该选项打勾，删除自动锁定机制。注意，您能够在任何时间手动地锁定交易平台，方法是从**文件**菜单中选择*锁定应用程序*。

退出选项

- **在带有头寸退出时发出警告** — 对该选项打勾，当您退出时会显示一条警告消息，让您知道您持有头寸，并证实您仍然想要退出。
- **显示服务器时间** — 打勾从而在状态栏的右下角显示当前时间。

显示配置

引言

使用显示配置页面来定义显示设定，例如隐藏或显示指数套利表、启用栏工具提示以及对基于价内状态的期权应用颜色。

- 显示设定
- 配置风格设定
- 代码行设定
- 工具栏配置

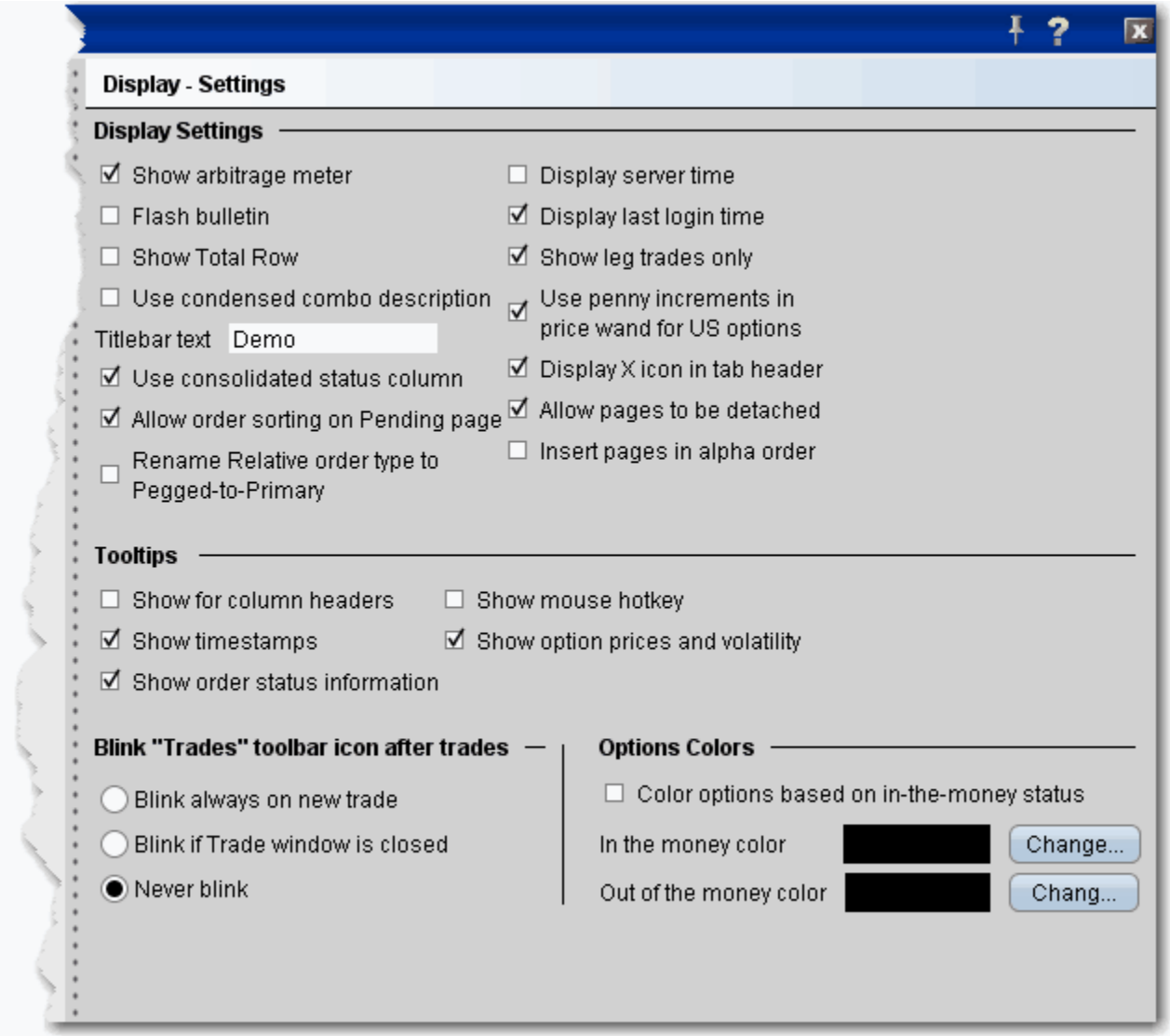
显示设定

定义显示配置设定

1 在**配置**菜单上选择*全局配置*。

2 在左侧目录中，点击**显示**，然后点击*设置*。

3 使用右侧可选项来设定这些参数：



显示设定

- **显示套利表** — 如果您有列举在市场数据中的指数工具，打勾来自动显示指数套利表。
- **动画布告栏** — 打勾让交易通知动画以红色出现在屏幕顶部。

- **显示总数行** — 当被选中，总数行被显示，并且对该页面显示利润 / 损失。
- **使用精简的组合描述** — 当被选中，只有本地代码被显示在对组合以及差价定单的描述区域中。
- **标题栏文本** — 输入在此处的文本将被用在交易平台标题栏中您的账户号码位置。
- **使用合并状态栏** — 当被选中，状态栏将拆分，并显示传递 / 取消按钮和状态颜色。您必须手动地删除传递区域来激活该功能。
- **允许在待处理页面上对定单分类** — 当被选中，在您点击定单区域题头将定单分类时，待处理页面将转为压缩视图。压缩视图只显示定单，没有市场数据线也没有空白行。
- **将相对定单类型重命名为挂钩首要** — 如果被打勾，无论标题在哪里出现，“相对”定单将作为“挂钩首要”定单显示。这只改变名称。相对功能保持不变。
- **显示服务器时间** — 打勾在状态行右下角显示当前时间。
- **显示上次登录时间** — 当被选中，您上次登录的时间将被显示在状态栏的左侧远端。
- **仅显示边交易** — 当被选中，差价和组合执行将被显示在单边中。如果打勾被去掉，整个组合将被显示，您能够点击来扩展行并显示单边执行。
- **在价格向导中对美国期权使用美分增量** — 当被选中，您在定单价格区域中点击和握住鼠标时激活的价格向导，在与美国期权一起使用时将显示 1 美分增量。
- **在页面题头显示×图标** — 当被选中，删除交易页面的×图标将出现在活动的页面上，位于交易页面标题的旁边。
- **允许将页面分离** — 当被选中，您能够将交易页面从主交易窗口中分离出来。
- **按字母顺序插入页面** — 当被选中，新添加的交易页面将被自动地按字母顺序插入到您已有页面名称标签集合中。

工具提示

- **对栏目题头显示** — 当被选中，当您在任何主交易屏幕栏名称上握住您的光标时，您将看见描述文本。
- **显示时间戳** — 如被选中，当您把鼠标放在最后交易上时，您将同样看见交易的时间。
- **显示定单状态信息** — 如被选中，当您把鼠标放在定单的状态区域上时，定单的状态，例如提交、待处理、执行将被显示。
- **显示鼠标热键** — 当被选中，在您把鼠标放在任何您创建了鼠标点击快捷方式的区域上时，您将看见热键描述。
- **显示期权价格和波动率** — 当被选中，将鼠标放在期权合约上将会显示内在波动率。

在执行后闪烁“交易”工具栏

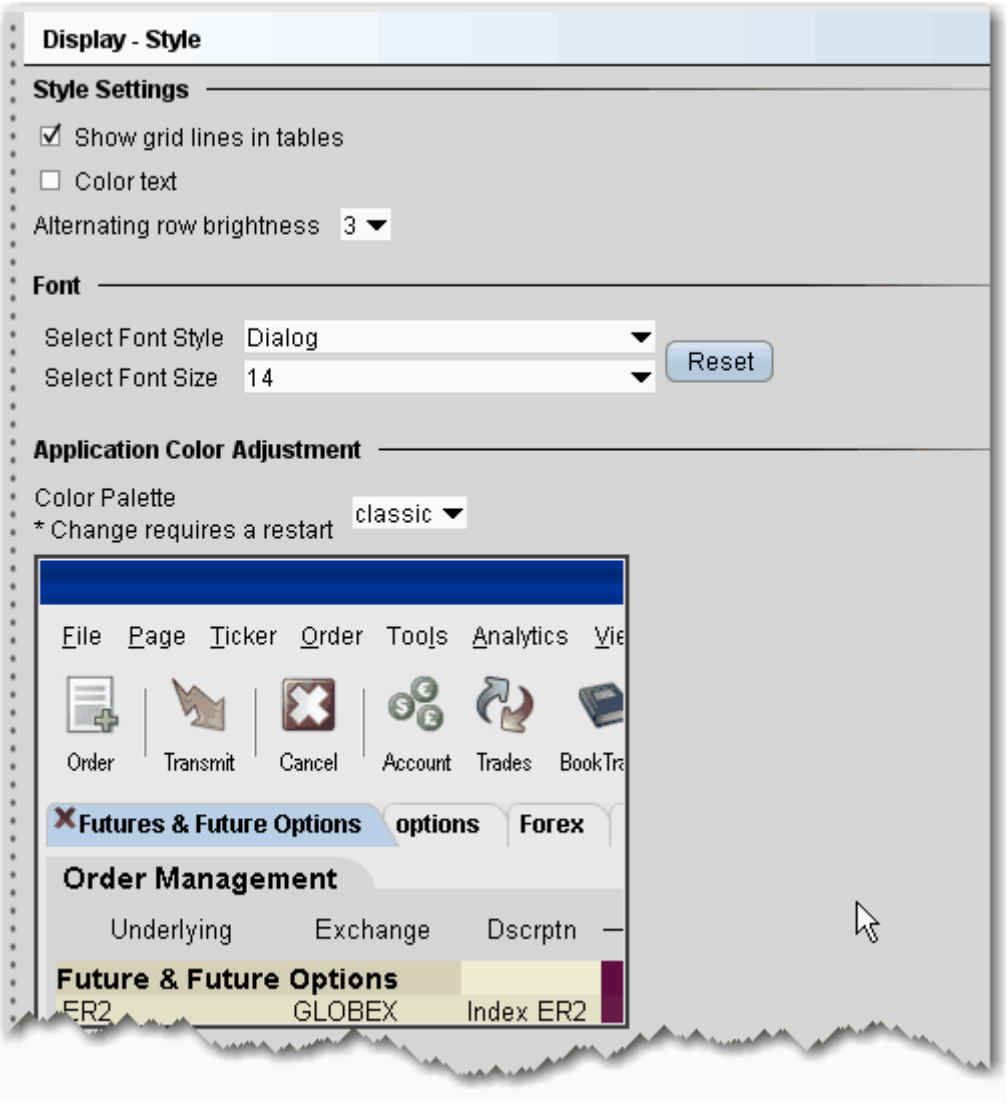
- 总是对新交易闪烁 — 如果被选定，交易工具栏上的交易图标在每次定单执行时都将闪烁。
- 在交易窗口被关闭时闪烁 — 如果被选定，交易工具栏上的交易图标将只在您关闭了执行窗口时才对新执行闪烁。
- 从不闪烁 — 如果被选定，交易工具栏上的交易图标将从不闪烁。

期权颜色

- **对基于价内状态的期权着色** — 对该方框使用颜色加注，从而在一瞥之间识别期权的颜色状态。
- 使用*更改*按钮来修改默认的价内或价外背景颜色。

配置风格设定

使用风格配置页面来定义风格设定，例如隐藏或显示网格线、更改字体以及修改调色板。



定义风格配置设定

1 在**配置**菜单上选择*全局配置*。

2 在左侧目录中，点击**显示**，然后点击*风格*。

3 使用右侧可选项来设定这些参数：

风格设定

- **在表格中显示网格线** — 在您的交易页面上打勾显示紧密的网格线。

- **对文本着色** — 打勾在着色的区域顶部显示对状态颜色的文本描述。例如，当您传递定单时，定单区域将变红。当对该功能打了勾，着色的区域将显示单词 “红色” 并同时显示颜色。
- **交替行亮度** — 该设定为了交易页面更好的逐行可读性提供了对照水平。设置 “4” 提供交替行之间最亮的对比，“0” 提供最少的对比。

字体

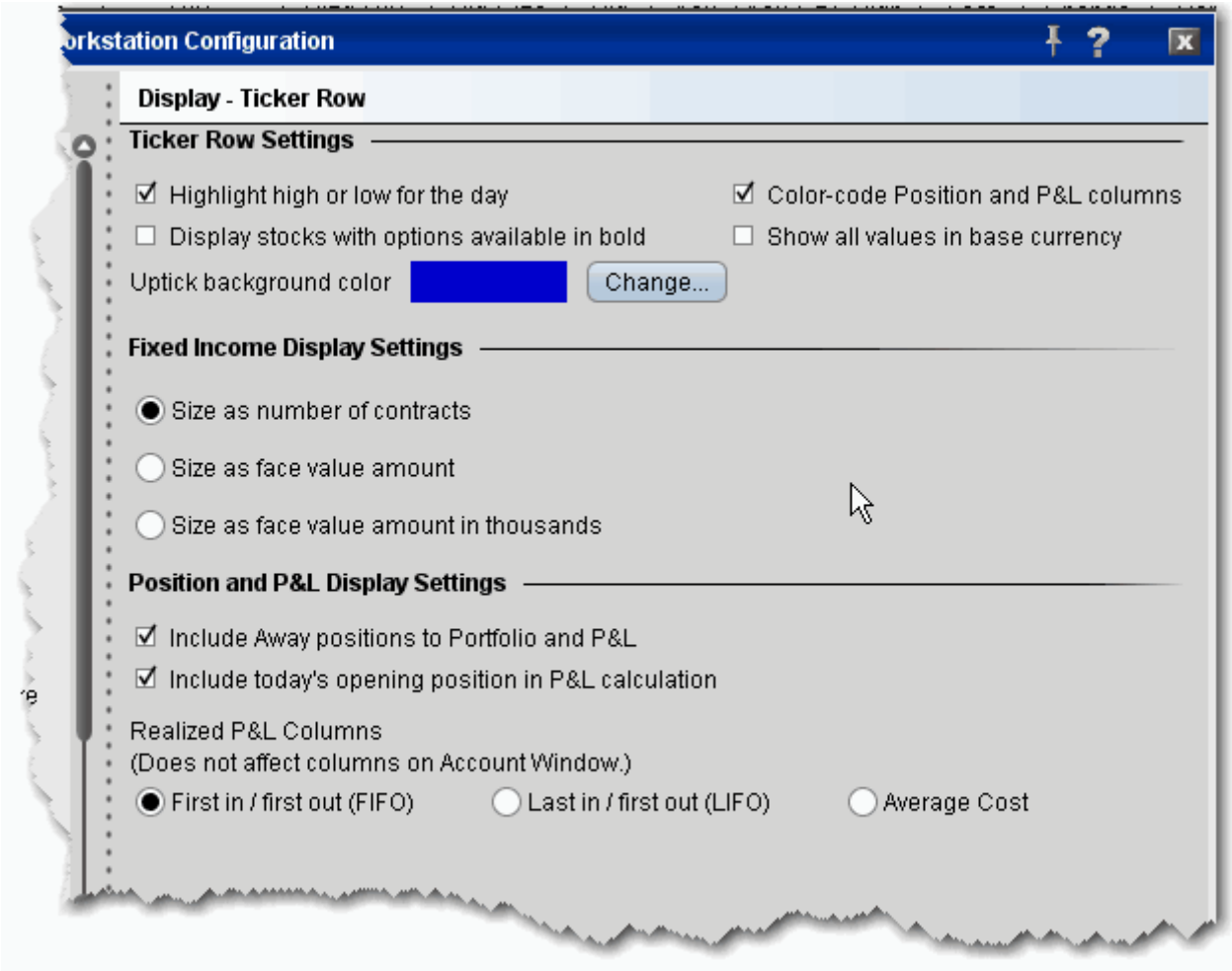
- **选择字体风格** — 选择一种新字体。
- **选择字体尺寸** — 选择新的字体尺寸。
- **重设** — 点击将字体风格和尺寸重设为默认值。

应用颜色调整

- 选择调色板将颜色方案应用于应用程序的各处。请注意，新设置将直到您下次登录时才会被应用。您的选择样图是使用交易平台图像显示的。

代码行设定

使用代码行配置设定来指定您的交易页面上的代码外观。



定义代码行配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中，点击**显示**，然后点击*代码行*。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：

代码行设定

- **强调当日最高或最低价格** — 当被选中，如果**最后**价格为当天的最低价，则会以红色显示，而当其为当天的最高价时则会以蓝色显示。
- **以粗体字显示有可用期权的股票** — 当被选中，拥有期权的股票将在交易屏幕上以粗体字显示。
- **颜色加注头寸和损益栏** — 当被选中，损益和头寸栏将使用颜色加注。

- **以基本货币显示所有价值** — 如被选中，所有头寸和损益价值将被重新计算，以您的基本货币显示，并以斜体字被显示，以便识别它们是从本地货币被转换为您的基本货币的。

固定收益显示设定

- 客户化对固定收益产品的数量显示。

头寸和损益显示设定

- **将偏离头寸包括到投资组合及损益中** — 打勾将偏离头寸显示在**账户**窗口中的头寸部分的新页面上，任何 TWS 交易页面上显示的头寸区域中，以及**投资组合**页面上。

Note: 出于显示目的，头寸被合计起来，对相同的合约同时包括了 IB 持有的头寸和 “偏离” 头寸。然而，出于交易目的，例如如果您选择 “关闭” 一个头寸，只有在 IB 持有的部分将被交易。

- **将今天的开盘头寸包括到损益计算中** — 打勾将已有的头寸只包括到损益栏的计算中。

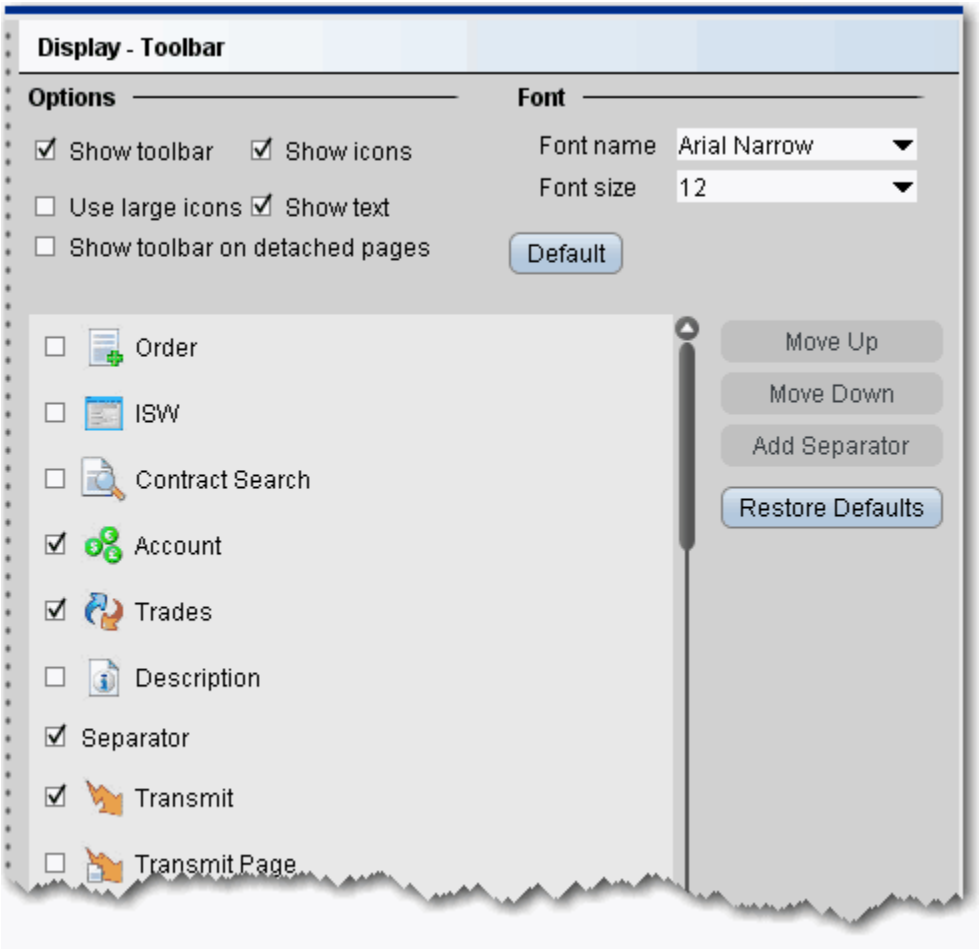
已实现的损益栏

默认情况下，已实现的损益使用平均成本计算。注意，如果您选择对已实现的损益使用 FIFO 或 LIFO 计算，计算只针对日内损益。跨日损益通常使用平均成本。

- FIFO — 当一笔平仓交易发生时，该交易增加的已实现损益是通过与第一笔开仓交易配对被计算的。
- LIFO — 当一笔平仓交易发生时， 该交易增加的已实现损益是通过与最后一笔开仓交易配对被计算的。
- 平均成本 — 当一笔平仓交易发生时，该交易增加的损益被匹配到所有建仓交易的平均值中。

工具栏配置

使用工具栏配置页面对主交易工具栏定义设置。



定义工具栏配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中，点击**显示**，然后点击*工具栏*。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：

选项

- **显示工具栏** — 打勾显示主交易工具栏。
- **显示图标** — 打勾在主交易工具栏上显示图标。
- **使用大图标** — 打勾在主交易工具栏上增大图标尺寸。
- **显示文本** — 打勾显示对工具栏上的按钮的文本描述。将该功能与显示图标选择一道使用，以同时查看工具栏按钮的图标和文本名称。

- **在分离的页面上显示工具栏** — 如果您选择分离一些交易页面，工具栏将保持可见。

字体

- **字体名称** — 选择一种新字体。
- **字体尺寸** — 选择一种新的字体尺寸。
- **默认** — 点击将字体风格和尺寸重设为默认值。

工具栏项目

屏幕中的项目能够被添加到交易工具栏，或从交易工具栏中被删除。使用右边的上移和下移按钮来更改按钮和分隔符的顺序。使用删除按钮从工具栏中删除功能。使用添加分隔符按钮在选定的工具栏功能上方添加分隔符线。点击重设将所有删除的功能和分隔符线放回。点击默认在默认版式基础上配置工具栏。

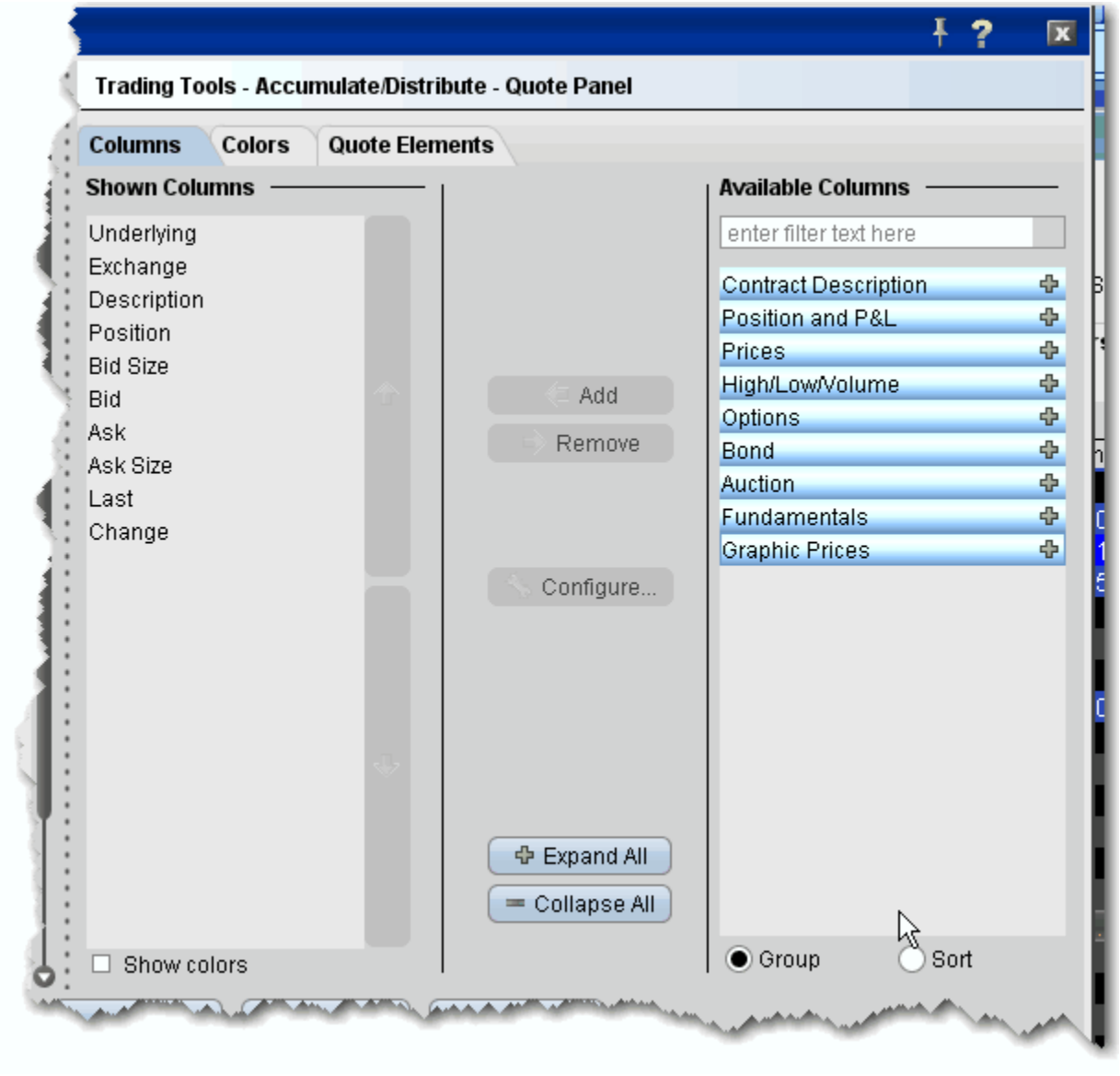
交易工具

引言

- 积累 / 分配
- 配置篮子交易者
- 配置在册交易者
- 配置外汇交易者
- 配置 ISW
- 配置期权投资组合
- 配置期权交易者
- 配置投资组合窗口
- 配置再平衡窗口
- 配置差价交易者
- 配置交易窗口

积累 / 分配

配置报价面板、定单页面和交易页面。



配置积累 / 分配

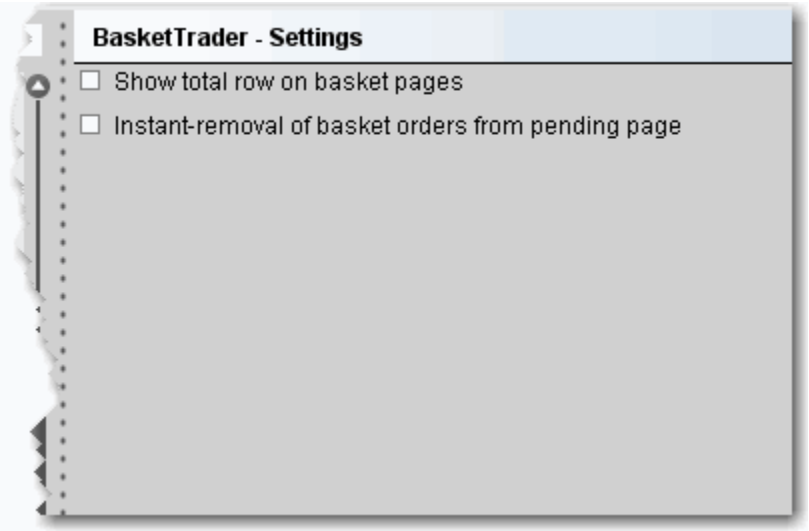
1. 从积累 / 分配中点击*配置*扳手图标，或者从配置菜单中选择全局配置。
2. 在交易工具下的左侧目录中，点击**积累 / 分配**，然后选择*报价面板*、*定单栏*或*交易栏*。
3. 使用右侧可选项来设定积累 / 分配参数。

配置篮子交易者

使用篮子交易者配置部分来修改现有页面的版式，或者在页面上应用新的版式。

定义篮子交易者配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*，或者从篮子交易者窗口中点击配置扳手图标。
2. 在左侧目录中点击*篮子交易者版式*。
3. 使用右侧可选项来配置以下区域：

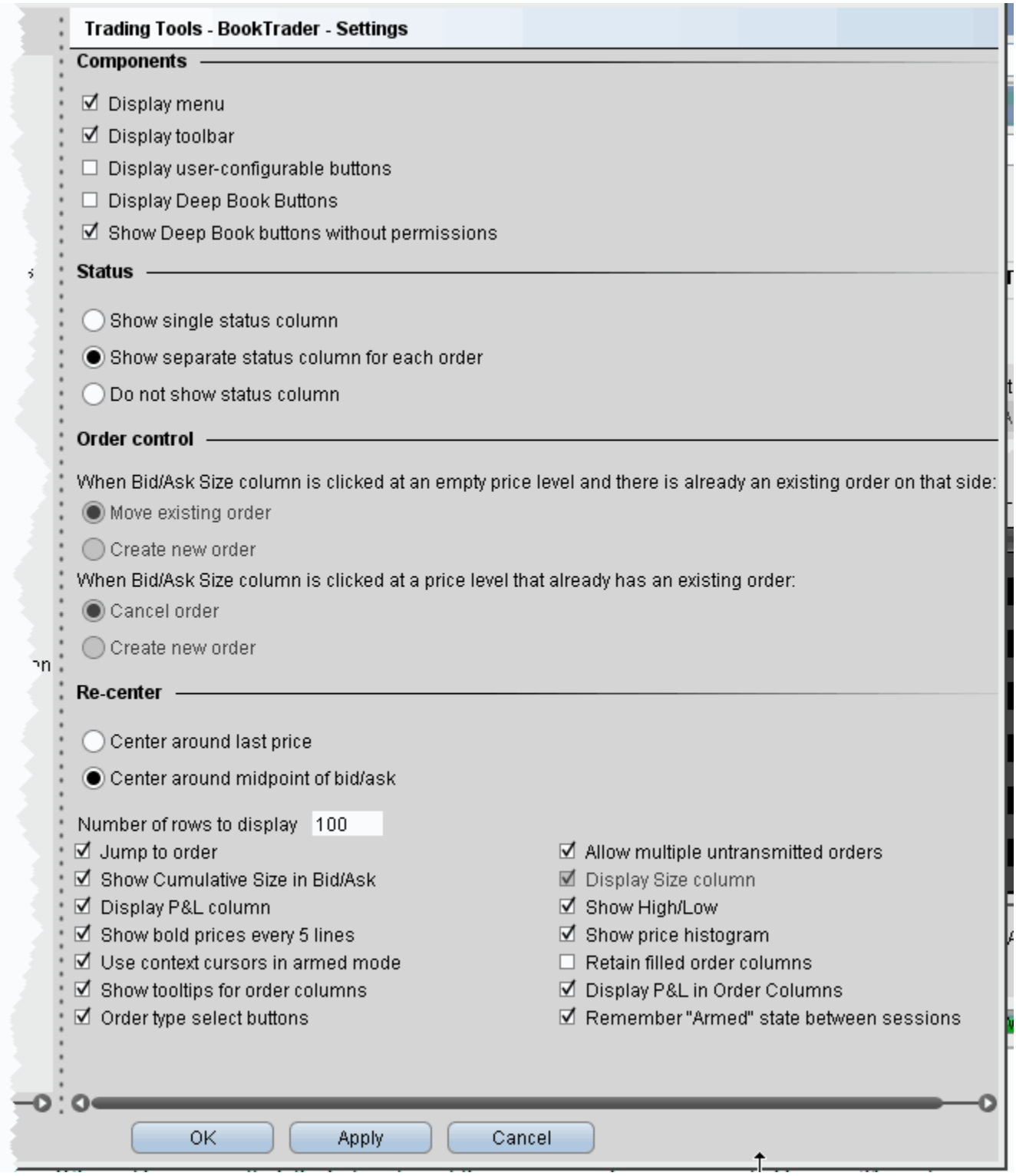


设定

- **在篮子页面上显示总数行** — 打勾在篮子交易者上显示*总数*行。总数行显示了所有您显示的损益区域的总损益价值。
- **将篮子定单从待处理页面中立刻删除** — 打勾将已执行的交易从待处理页面中立刻删除。

配置在册交易者

使用在册交易者配置页面来定义基本的设定、热键和按钮，并控制栏区域的可见性。



定义在册交易者配置设定

1. 在任何窗口中点击*配置*扳手图标。
2. 在左侧目录中点击**在册交易者**，然后点击*设定*。
3. 使用右侧可选项来设定以下：

组成部分

- **显示菜单** — 打勾查看在册交易者菜单。
- **显示工具栏** — 打勾查看在册交易者工具栏。
- **显示用户配置按钮** — 在在册交易者窗口中打开按钮面板。
- **显示深层在册按钮** — 打勾在在册交易者中显示深层在册按钮面板。在面板上按下一个按钮，将该数据包括到价格阶梯中。
- **显示没有许可的深层在册按钮** — 打勾对您当前没有订阅的任何可订阅的深层在册数据显示按钮。

状态

- **显示单个状态栏** — 打勾在出价方显示一个状态栏，在要价方显示一个状态栏。当该状态被选中，使用**定单控制**部分告诉交易平台如何处理同一方的多笔定单。
- **对每笔定单显示各自的状态栏** — 打勾对每笔定单创建一个新的状态栏。当该状态被选中，定单控制部分就不再有必要，将变为不活动的。
- **不显示状态栏** — 打勾从在册交易者中隐藏状态。当该状态被选中，使用定单控制部分告诉交易平台如何处理同一方的多笔定单。

定单控制

- **移动现有的定单** — 如果您想在同一方的空白价格水平被点击时移动现有的定单，选中该选项。该选择不允许同一方的多笔定单。
- **创建新定单** — 如果您想允许同一方位于不同价格水平的多笔定单，选中该选项。

- **取消定单** — 如果您想在特定的价格水平被点击时取消位于该相同价格水平的现有定单，选中该选项。该选择不允许同一方位于相同价格水平的多笔定单。
- **创建新定单** — 如果您想允许同一方位于相同价格水平的多笔定单，选中该选项。

重新确认中心

- **将中心置于最后交易价格附近** — 如被选中，当您点击重新确认中心按钮时，在册交易者阶梯会将中心焦点放回到最后交易价格附近。
- **将中心置于买 / 卖报价中点附近** — 如被选中，当您点击重新确认中心按钮时，在册交易者阶梯会将中心焦点放回到买 / 卖报价中点附近。

其他

- **要显示的行数** — 输入一个值，它定义了您将看见的行数或价格。
- **跳至定单** — 如被选中，您的光标在您传递之后将跳至定单面板中的定单。
- **允许多笔未传递的定单** — 如被选中，您能够在底层证券面板中创建多于一个的定单。否则，只允许一个未传递的定单。
- **显示出价 / 要价的累积尺寸** — 如被选中，累积尺寸被显示在出价栏和要价栏的顶部。
- **显示尺寸栏** — 打勾在出价方和要价方显示*尺寸*栏。注意，只有当在**定单控制**部分中选择了 “当买方尺寸 / 卖方尺寸栏在已经有现存定单的价格水平被点击时取消定单”时，该复选框才是活动的。
- **显示损益栏** — 点击，同时在在册交易者阶梯的出价方和要价方显示损益栏。
- **显示最高 / 最低** — 当被选中，通过显示不同颜色的背景来识别最高和最低价格。
  - **最高**价格以**亮蓝色**背景被强调。
  - **最低**价格以**红色**背景被强调。
- **每 5 行显示粗体字价格** — 使用该功能，通过让每第 5 行变为粗体使价格更容易追踪。
- **显示价格直方图** — 默认情况下被打勾。如果被打勾，一块有颜色的区域将显示在册交易者价格阶梯的每个价格水平上的每日交易量。颜色条与价格区域中的颜色相一致，例如最后交易价格为凫蓝色，当前最佳要价为绿色等。参见在册交易者颜色话题以获取细节。
- **在立刻传递模式下使用上下文光标** — 打勾将文本描述包括到您的光标下方。例如，如果您在黄色的出价尺寸栏握住光标，文字 “买入”将出现，让您知道在该区域点击一个价格水平将发起一笔买入定单。
- **保留执行的定单栏** — 只在高级模式下有效。当被选中，新定单栏在定单执行后将保持可见。
- **对定单栏显示工具提示** — 只在高级模式下有效。如被选中，当您在定单栏的区域上握住鼠标光标时显示与定单相关的工具提示。
- **在定单栏中显示损益** — 只在高级模式下有效。当被选中，损益将在定单执行时显示在新定单栏。
- **定单类型选择按钮** — 只有当在状态部分中选中*对每笔定单分别显示状态栏*时才有效。显示带有定单类型按钮的工具栏。点击按钮将鼠标光标放入该特定的定单类型模式。
- **在交易时段之间记住立刻传递状态** — 打勾使在册交易者保持立刻传递状态，这样下次您登录交易平台时它将为立刻传递模式。

热键

打开**热键和鼠标快捷方式**对话框。您能够通过选择行为并点击*配置*来修改对现有快捷方式的配置。要获取更多信息，参见在册交易者热键话题。

按钮

创建客户化的按钮添加到工具栏中，或者编辑现有的按钮。

报价面板

使用页面版式的*栏*页面在报价面板中隐藏或显示区域。使用*颜色*页面来修改文本和背景颜色。

定单栏

使用页面版式的栏页面，在定单区中隐藏或显示区域。

交易栏

在交易面板中隐藏或显示区域。

在册交易者颜色

允许您对在册交易者的许多区域更改文本 / 背景颜色。要更改颜色，在合适的行中点击文本或背景按钮，并从调色板中选择一种新颜色。

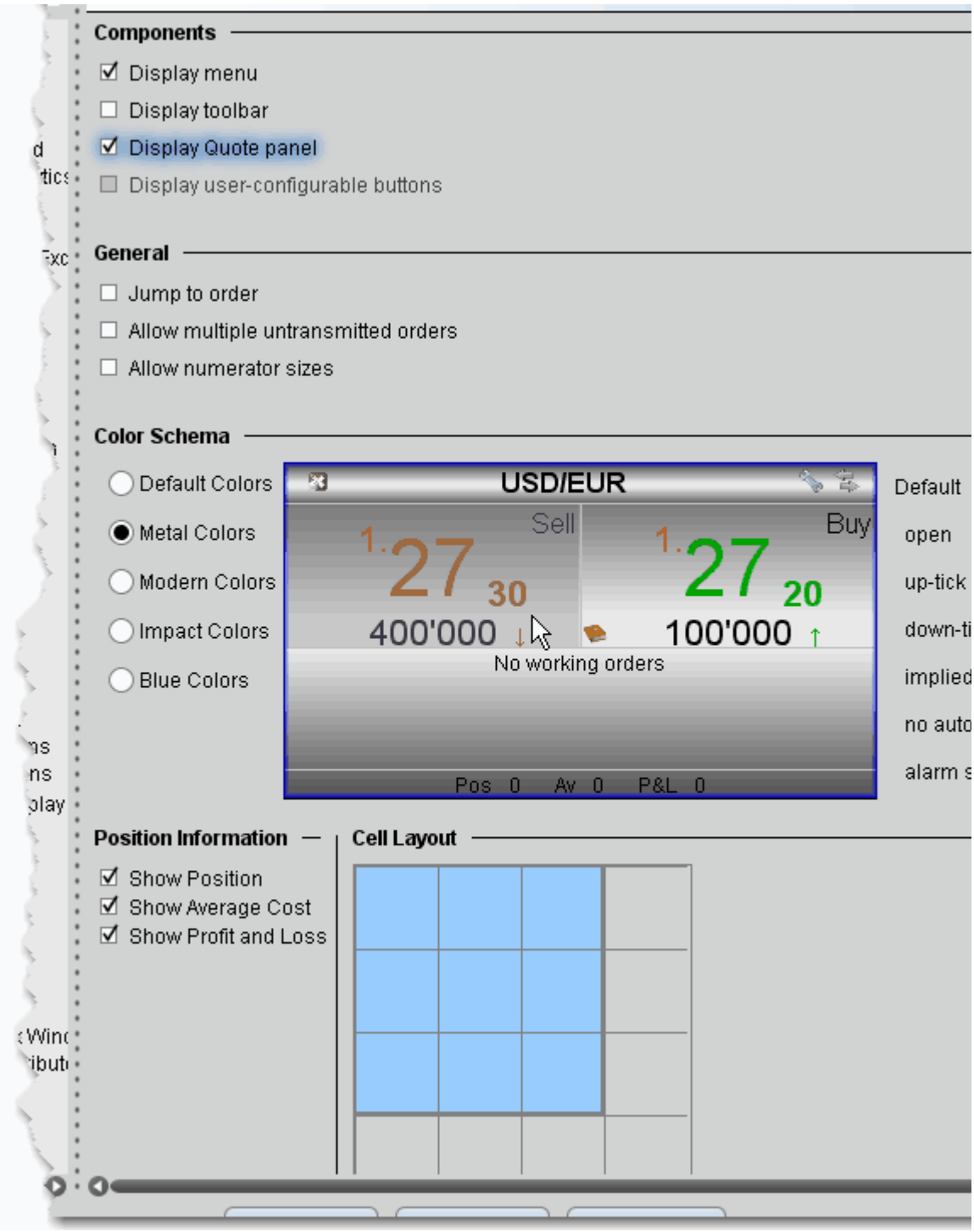
- 要价尺寸，非立刻传递和立刻传递
- 出价尺寸，非立刻传递和立刻传递
- 价格，例如要价、出价、最后、最高和最低
- 损益

在册交易者声音管理器

打开在册交易者的声音管理器，在这里您应用声音设置来下达限价定单 （点击出价或要价），取消定单，以及下达止损定单 （右键点击出价或要价）。您同样能够选择禁用事件声音，方法是将相应行中复选框的打勾去掉。

配置外汇交易者

外汇交易者在许多水平上都是可客户化的，从单元格颜色和数量到用来计算定单数量的方法。



定义外汇交易者配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*，或者点击从外汇交易者页面点击*配置*扳手。
2. 在左侧目录中点击*外汇交易者*。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：

设置页面

组成部分

- **显示菜单** — 打勾查看外汇交易者菜单。
- **显示工具栏** — 打勾查看外汇交易者工具栏。
- **显示报价面板** — 打勾显示报价面板，市场数据位于窗口顶部。
- **显示用户可配置的按钮** — 打勾显示可客户化的按钮。

一般

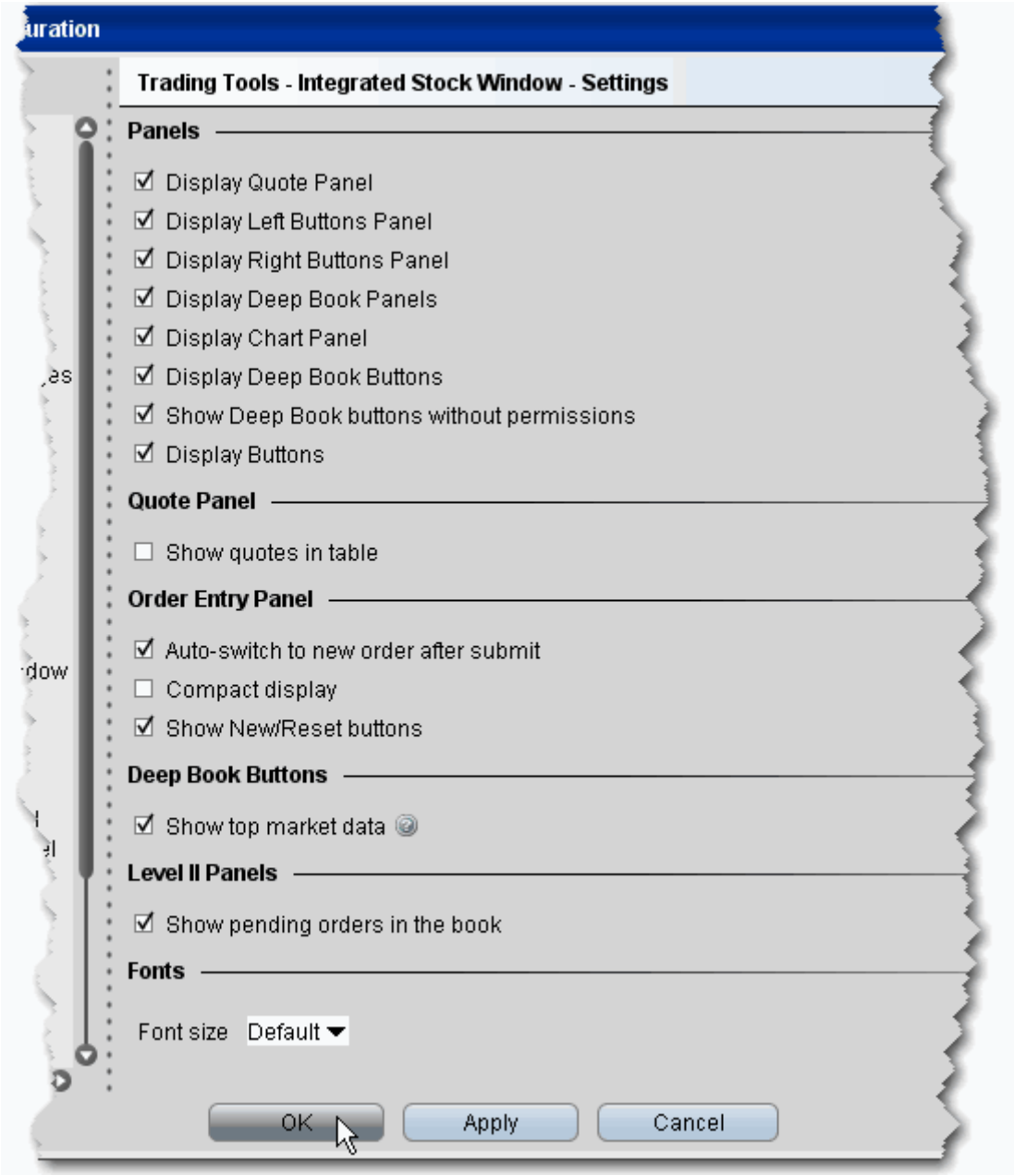
- **跳至定单** — 自动地将光标置于**定单**面板中新创建的定单上。
- **允许多个未传递的定单** — 如被选中，您能够在底层证券面板中创建多于一个的定单。否则，只有未传递的定单才被允许。
- **允许分子尺寸** — 调整显示以允许交易分子而不是分母。
- **颜色方案** — 使用这些设置，通过更改单元格和文本的颜色来改变您的外汇交易者界面外观。

头寸信息和单元格版式

- 显示头寸 — 当被选中，头寸被显示在交易单元格的底部。
- 显示平均成本 — 当被选中，头寸的平均成本被显示在交易单元格的底部。
- 显示利润和损失 — 当被选中，未实现的损益被显示在交易单元格的底部。
- 单元格版式方格 — 修改您的外汇交易者方格，可以小至一个单元格或者大至 4 × 4。蓝色单元格将显示在您的外汇交易者中。

配置 ISW

集成股票窗口 （ISW）将第一级和第二级市场数据、实时图表和完整的定单管理全都包括到了单个窗口中。使用配置窗口来客户化基本的设定、按钮和热键、图表参数以及第二级市场数据面板。



定义 ISW 配置

1 在**配置**菜单中选择*全局配置*，或者从集成股票窗口中点击*配置*扳手。

2 在左侧目录中点击*集成股票窗口*。

3 选择一个子类别，然后使用右侧可选项来设定这些参数：

设定

面板

- *显示报价面板* — 打勾在 ISW 中查看报价面板。
- *显示左侧按钮面板* — 打勾在 ISW 中查看左侧按钮面板。
- *显示右侧按钮面板* — 打勾在 ISW 中查看右侧按钮面板。
- *显示深层在册面板* — 打勾在图表面板的任何一方查看深层在册出价和要价面板。
- *显示图表面板* — 打勾在 ISW 中心查看实时图表。
- *显示深层在册按钮* — 打勾显示所有可用的深层在册按钮，其允许您从深层在册面板中显示 / 隐藏市场中心数据。
- *显示没有许可的深层在册按钮* — 打勾显示不活动的深层在册按钮，其暗示了如果您订阅可以被包括的订阅数据。
- *显示按钮* — 打勾在图表面板底部查看价格凸起按钮。

报价面板

- *在表格中显示报价* — 保留打勾，以基本的交易平台报价面板表格模式来显示报价面板。不选中，以标签视图显示报价面板。注意，您能够在报价面板本身上使用视图图标，将显示视图套接在一起。

定单输入面板

- *在提交后自动切换至新定单* — 如被选中，在您传递定单后，新定单的开始在定单输入面板的定单框中被设定。如果不被选中，在您传递定单后，您将在 OEP 定单框中看见已传递的定单。
- *紧凑显示* — 如被选中，标签从区域中被去掉，从而压缩显示尺寸。
- *显示新建 / 重设按钮* — 打勾在定单输入面板中显示新建和重设按钮。点击新建按钮切换到新定单。点击重设，清除定单区域。

深度在册按钮

- *显示顶级市场数据* — 如被选中，**定单**按钮将显示在深层在册面板中。如果**其他**被按下，第一级市场司数据将从这些地方被包括：不提供深层数据的交易所，您没有订阅的交易所，以及订阅了但数据按钮没有被选中的交易所。

第二级面板

- *在交易册中显示待处理的定单* — 打勾在深层定单册面板中查看以白色强调的您自己的定单。您有您能看见您的待处理定单。

字体

- *字体尺寸* — 为 ISW 显示选择一个新的字体尺寸。

热键

打开**热键和鼠标快捷方式**对话框。您能够通过选择行为并点击*配置*来修改对现有快捷方式的配置。要获取更多信息，参见在册交易者热键话题。

按钮

创建客户化的按钮添加到工具栏中，或者编辑现有的按钮。

报价面板

使用页面版式的*栏*页面在报价面板中隐藏或显示区域。使用*颜色*页面来修改文本和背景颜色。

左侧和右侧按钮面板

配置显示在 ISW 右侧远端和左侧远端的按钮。

图表设置

使用图表设定的子集来客户化图表显示，包括：

显示时间参数面板 — 如被选中，显示时间参数的工具栏在图表顶部是可见的。

显示拆分和股息 — 如被选中，拆分和股息（当可用时）在图表中会被直接注意到。

显示图表价值标签 — 如被选中，**价格**、**交易量**和其他轴标签将被显示。

强调最后交易价格 — 打勾强调最后交易的价格。

强调出价 — 打勾强调最后出价。

强调要价 — 打勾强调最后要价。

强调最高价格 — 打勾强调当天的最高价格。

强调最低价格 — 打勾强调当天的最低价格。

强调光标价格 — 如被选中，您光标下的价格将沿图表的价格轴被强调。

显示水平十字准线 — 当被选中，当您在十字准线模式下时，垂直和水平十字准线都将被显示在图表上。当不选中，只有垂直十字准线才会显示。

自动完成趋势线 — 如被选中，您能够指导交易平台来完成徒手画的趋势线。通过点击和握住鼠标开始您的趋势。要使用自动完成，释放鼠标键，然后再次点击。交易平台根据您的趋势线，在图表范围内完成趋势线。

显示 x 条 — 如被选中，所有图表将使用定义的条数目。

显示价格轴 — 使用下拉列表在右侧、左侧或者同时在右侧和左侧显示价格轴。

显示时间轴 — 使用下拉列表在顶部、底部或者同时在顶部和底部显示时间轴。

条状图表突变保护 （相对前一条的最大%变化） — 如果您想应用突变保护，输入一个百分比值。如果任何条超过了相对于前一条的该百分比值，它将自动从图表中被删除。

图表颜色

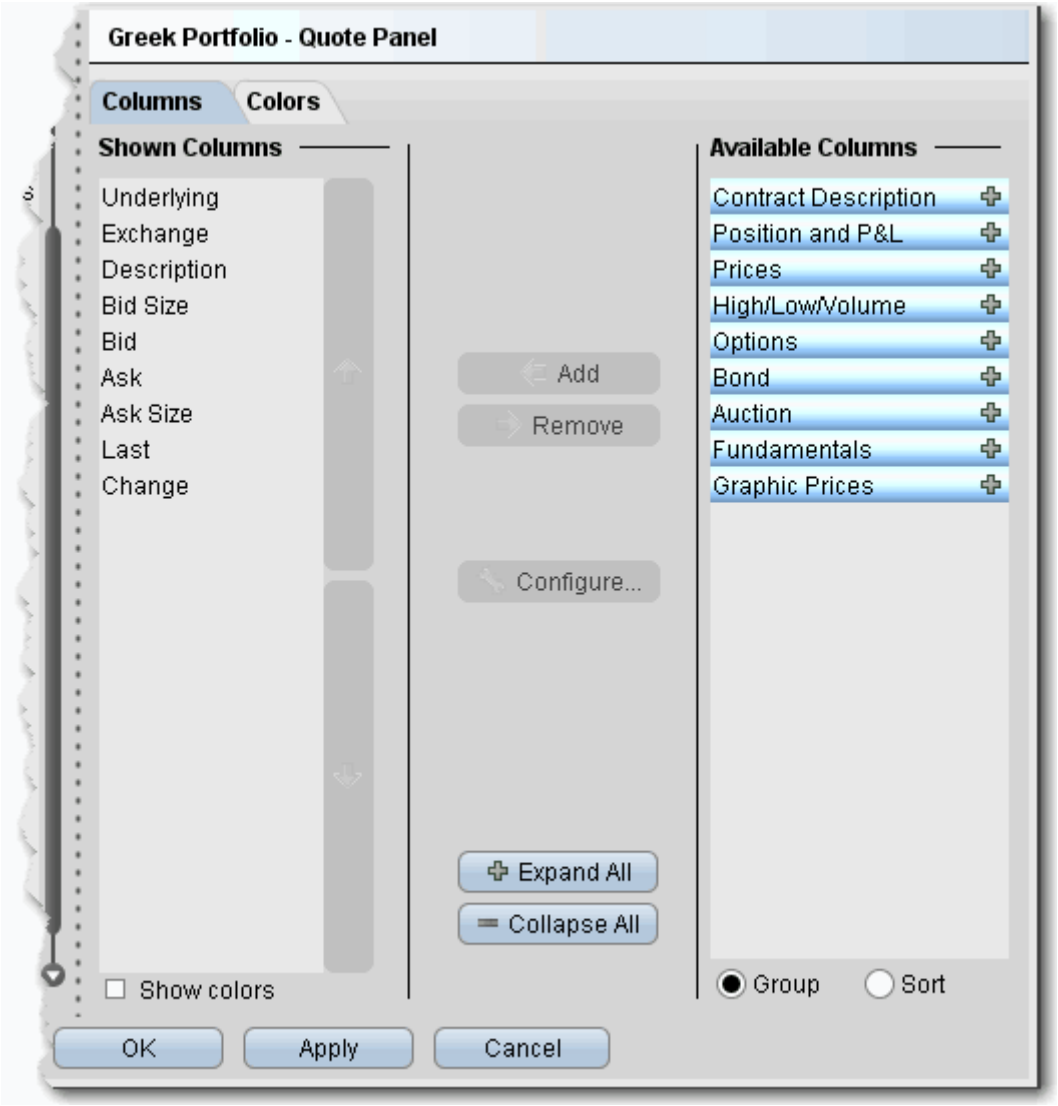
使用该部分来修改在 ISW 图表中使用的颜色。

第二级面板

从第二级面板中添加或删除栏。

配置期权投资组合

使用期权投资组合配置页面来定义在报价面板中可见的栏。



定义期权投资组合配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*，或者从期权投资组合页面点击*配置*扳手。
2. 在左侧目录中点击*期权投资组合*。
3. 使用右侧可选项，从报价面板中添加或删除栏。

配置期权交易者

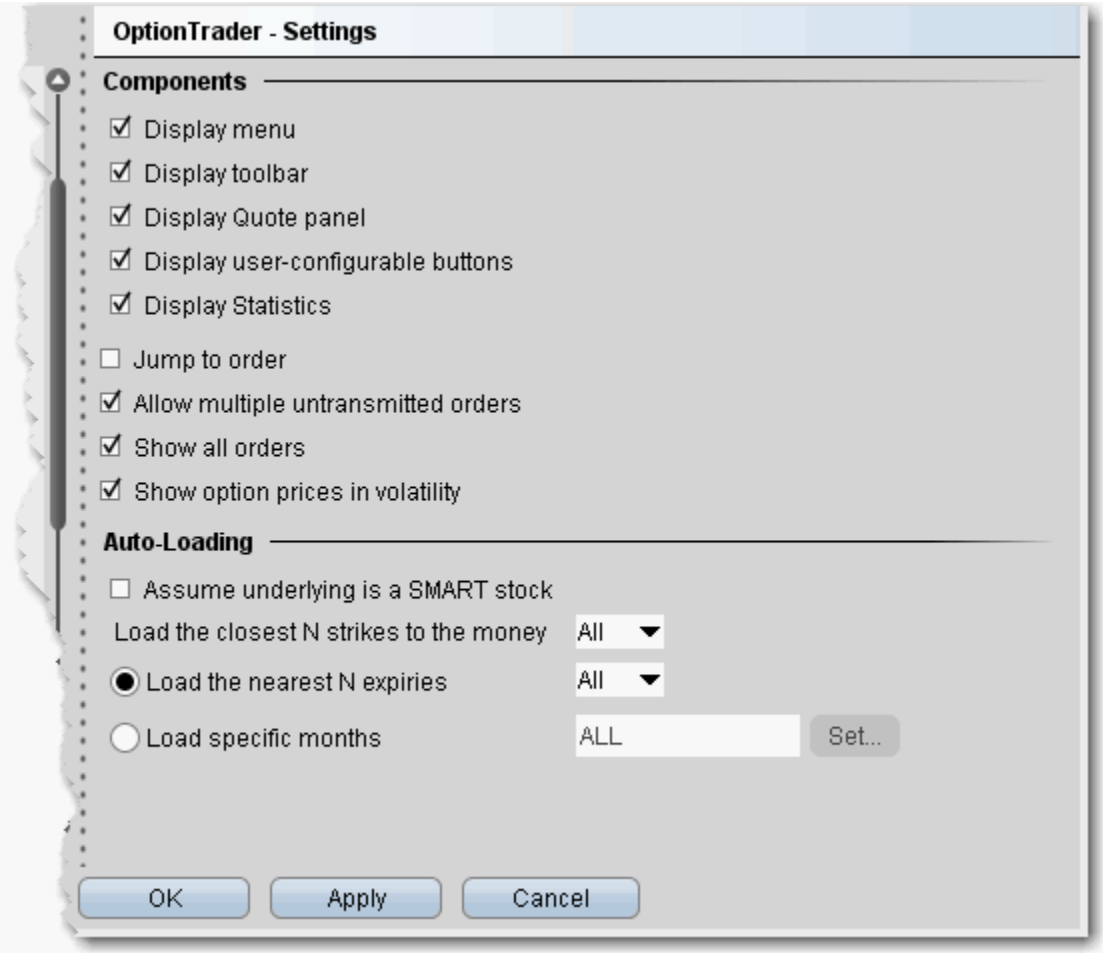
使用期权交易者配置页面来定义基本的设定、热键和按钮，并控制栏区域的可见性。

定义期权交易者配置设定

1 从任何窗口点击*配置*扳手。

2 在左侧目录中点击*期权交易者*，然后点击*设定*。

3 使用右侧可选项来设定这些参数：



设定

组成部分

- **显示菜单** — 打勾查看期权交易者菜单。
- **显示工具栏** — 打勾查看期权交易者工具栏。

- **显示报价面板** — 打勾显示报价面板，其显示了对资产的单条市场数据线。您能够从报价面板中通过点击买卖报价来创建定单。
- **显示用户可配置的按钮** — 使用按钮面板来隐藏或显示您创建的按钮。
- **显示统计数字** — 为一个可配置的可选面板，它显示了与期权相关的数据和统计数字。
- **跳至定单** — 自动地将光标置于**定单**面板中新创建的定单上。
- **允许多个未传递的定单** — 如被选中，您能够在底层证券面板中创建多于一个的定单。否则，只有未传递的定单才被允许。
- **显示所有定单** — 打勾查看底层证券的所有定单。
- **以波动率显示期权价格** — 打勾查看波动率而不是价格金额。

自动加载

期权交易者根据您在该区域设定的标准，自动地加载期权链。

- **假设底层证券是智能股票** — 使用智能而不是特定的交易所。
- **加载与平价最接近的 N 个行权价** — 选择一个数目来限制要加载多少期权到链中。
- **加载最近的 N 个到期** — 只向您显示到期日期最近的 N 个期权。
- **加载特定的月份** — 直接输入指明您想要看见期权的确切月份。

期权链

隐藏或显示期权链区域。

配置投资组合窗口

投资组合窗口是一个自动化的交易页面，您能够根据您的投资组合的当前内容来选择创建它。配置投资组合窗口来默认地隐藏或显示面板、市场数据和定单管理栏。您能够在任何时候直接从窗口中修改这些设定当中的任何一个。

配置投资组合窗口

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 点击***交易工具***，然后在左侧目录中点击*投资组合窗口*。
3. 配置设定、交易栏、定单管理栏或市场价值面板。
4. 使用右侧可选项来设定这些参数：

设定

- 显示市场价值面板 — 从账户信息窗口中打开带有数据的市场价值面板。
- 显示定单面板 — 在投资组合窗口中打开定单面板。新定单将被显示在这个单独的面板中，而不是被直接显示在代码下。
- 显示交易面板 — 打开交易面板来显示执行。
- 跳至定单 — 如被选中，自动地将光标置于**定单**面板中新创建的定单上。

交易栏

对您想要在交易面板中显示的栏打勾。

定单管理

通过从市场数据和定单栏中添加或删除栏来客户化主窗口的版式 。

市场价值

对您想要在市场数据面板中显示的栏打勾。

配置再平衡窗口

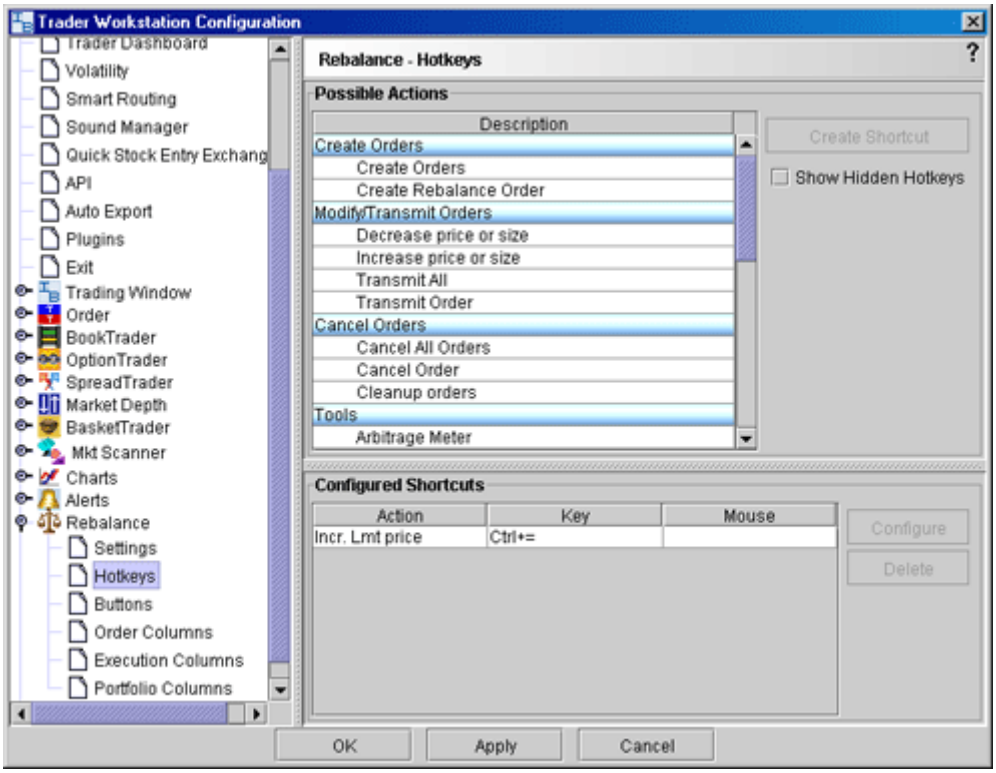
使用再平衡配置页面来定义基本的设定、热键和按钮，并控制栏区域的可见性。

定义再平衡配置设定

1 在**配置**菜单上选择*全局配置*，或者从再平衡菜单中点击*配置*。

2 在左侧目录中点击*再平衡*。您能够在左侧目录中或在右侧可选项中扩展选项。

3 使用右侧可选项来设定这些参数：



设定

- *显示菜单* —打勾查看再平衡菜单。
- *显示工具栏* — 打勾查看再平衡工具栏。
- *跳至定单* — 自动地将光标置于**定单**面板中新创建的定单上。
- *允许多个未传递的定单* — 如被选中，您能够在底层证券面板中创建多于一个的定单。否则，只有未传递的定单才被允许。

热键

打开**热键和鼠标快捷方式**对话框。您能够通过选择行为并点击*配置*来修改对现有快捷方式的配置。要获取更多信息，参见分配鼠标快捷方式话题。

按钮

创建客户化的按钮添加到工具栏中，或者编辑现有的按钮。

定单栏

使用页面版式的*栏*页面在定单区中隐藏或显示区域。

执行栏

使用执行栏在执行区中隐藏或显示区域。

投资组合栏

使用投资组合栏在投资组合区中隐藏或显示区域。

配置差价交易者

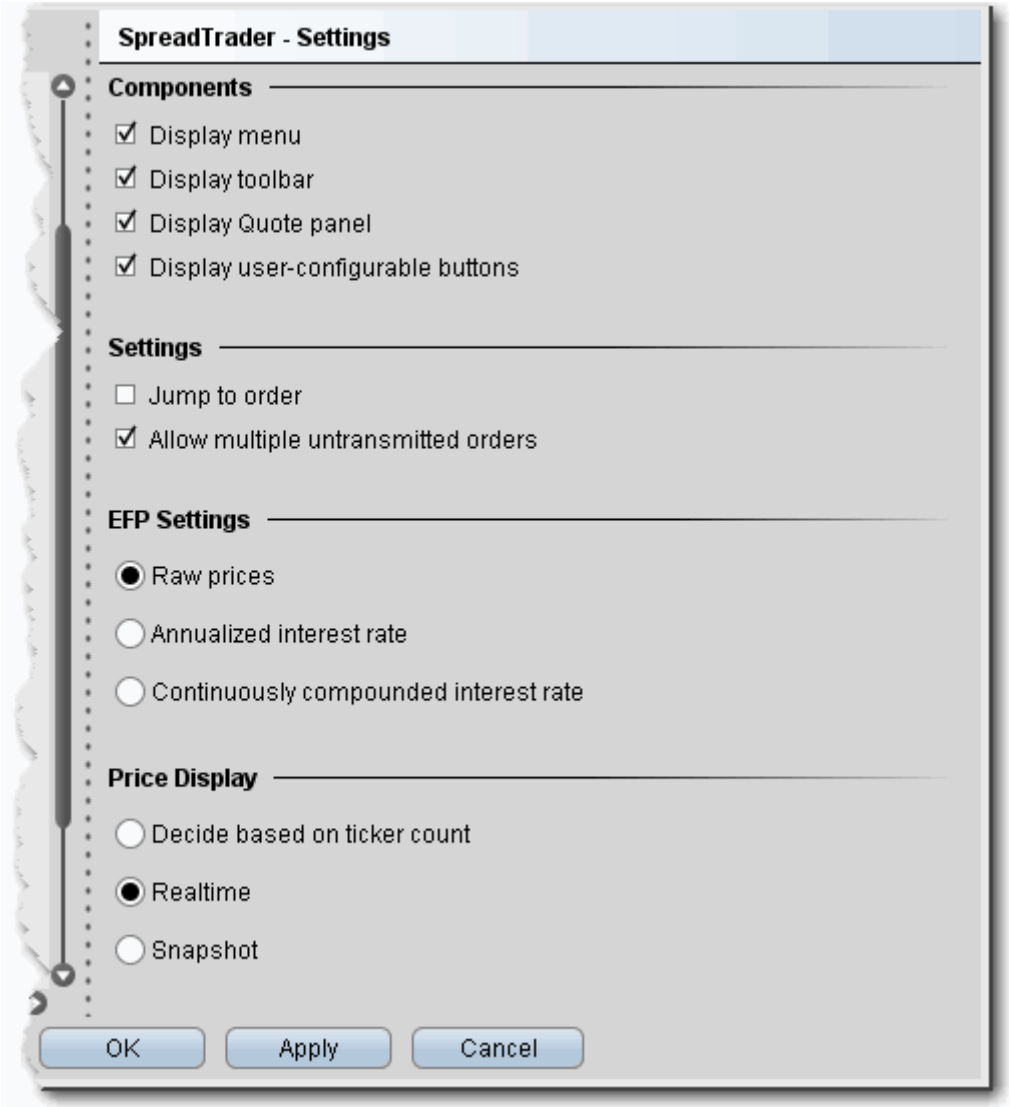
使用差价交易者配置页面来定义基本的设定、热键和按钮，并控制面板和区域的可见性。

定义差价交易者配置设定

1 在**配置**菜单上选择*全局配置*，或者从差价交易者菜单上点击*配置*。

2 在左侧目录中点击*差价交易者*。

3 使用右侧可选项来设定这些参数：



设定页面

组成部分

- **显示菜单** — 打勾查看差价交易者菜单。
- **显示工具栏** — 打勾查看差价交易者工具栏。
- **显示报价面板** — 打勾在窗口顶部显示带有市场数据的报价面板。
- **显示用户可配置的按钮** — 打勾显示可客户化的按钮。

设定

- **跳至定单** — 自动地将光标置于**定单**面板中新创建的定单上。
- **允许多个未传递的定单** — 如被选中，您能够在底层证券面板中创建多于一个的定单。否则，只有未传递的定单才被允许。

EFP 设定

- **原始价格** — 这是默认的出价或要价。
- **年利率** — 不计复利的内在年利率。
- **连续复利率** — 每天计算若干次复利的内在年利率。

价格显示

- **根据代码数量决定** — 交易平台根据矩阵中的代码数量，决定使用实时还是快照价格。如果代码的数量超过了您可用的市场数据限制，快照将被使用。要获取关于市场数据是如何分配给每个账户的信息，参见市场数据总括页面的注释部分。
- **实时** — 连续刷新的实时价格。
- **快照** — 请求提出时的价格静态快照。这些价格不刷新。

配置交易窗口

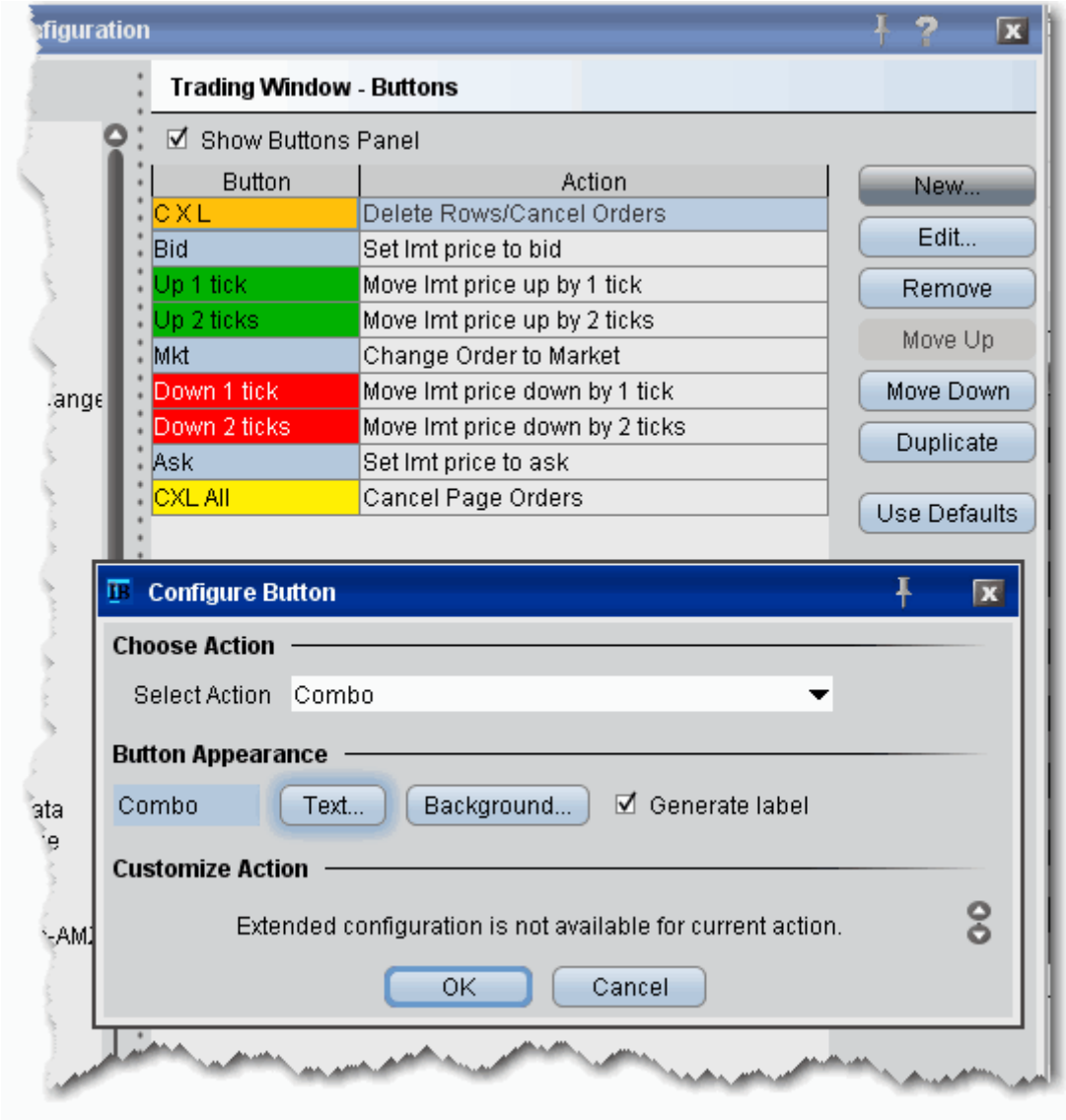
使用交易窗口配置部分来客户化您能够在页面中显示的按钮面板，修改现有页面的版式，或者对页面应用新版式。

定义显示配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击**交易工具**，然后选择*交易窗口*。
3. 在交易窗口标题下，您能够使用右侧可选项来设定以下参数：

配置按钮面板

创建和客户化按钮来执行普通的交易行动。使用配置页面默认地隐藏或显示按钮面板，并添加、编辑或删除按钮，以及重新安排面板上按钮的顺序。

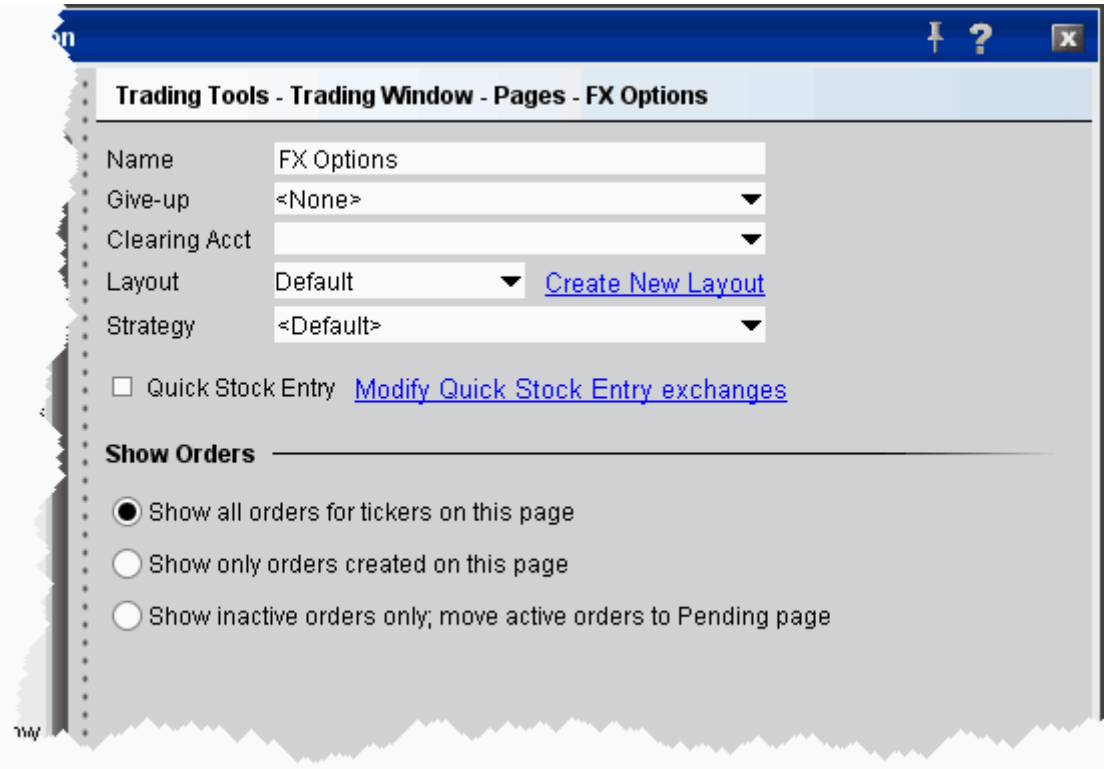


添加按钮

1. 点击*新建*。
2. 选择一个行动，将其分配给按钮。
3. 如有需要，修改文本和背景颜色。
4. 保留对*产生标签*的打勾，让按钮被相关的行动恰当地标记。
5. 如有需要且如被提供，客户化行动。
6. 点击确定。

添加按钮至任何交易页面。要编辑按钮，选择按钮并点击*编辑*。要创建一个新按钮，选择*新建*。从选择行动列表中选择一个行动。文本标题将被自动产生。如果客户化是可用的，则对按钮选择客户化的行动。

页面



页面选择展示了您在交易窗口中已经创建的所有当前页面标签列表。点击一个页面名称来修改以下页面水平的参数。

- **名称** — 通过删除和重新输入一个名称来更改当前页面的名称
- **转移** — 如果可用，选择一个目的地。
- **清算账户** — 如果可用，选择一个默认的清算账户。
- 版式 — 对选定的页面应用页面版式。
- **策略** — 选择一个预设定单默认策略。
- **快速股票输入** — 打勾指示选定的页面使用快速股票输入。
- **修改快速股票输入交易所** — 点击打开配置页面，它让您输入有效的快速股票交易所。

显示定单 — 关于如何处理定单显示的页面水平指示

- **显示该页面上代码的所有定单** — 定单将对任何代码出现，不管该代码的定单是不是在该页面上被创建的。
- **只显示在该页面上创建的定单** — 只有在该页面上被创建的定单才会显示，不管在该页面上显示的代码是否有活动的定单。
- **只显示不活动的定单，将活动的定单移到待处理页面** — 该页面将只显示失活的或非传递的定单。在该页面上被创建的定单将显示在待处理页面上。

页面版式

对选定的页面版式打开版式管理器。版式是一个页面模板，它允许您定义版式，查看和感受交易页面，并随后将该设置应用到任何页面。注意，当您对这里的版式修改和保存设定时，您的更改将被应用于所有使用了特定页面版式的交易窗口页面。使用页面版式在页面上添加和隐藏市场数据和定单管理区域，修改文本和背景颜色，并同时启用和配置快速定单输入面板。

信息工具

引言

配置设定账户信息和数据工具，包括警报、图表、市场深度、扫描仪和新闻。

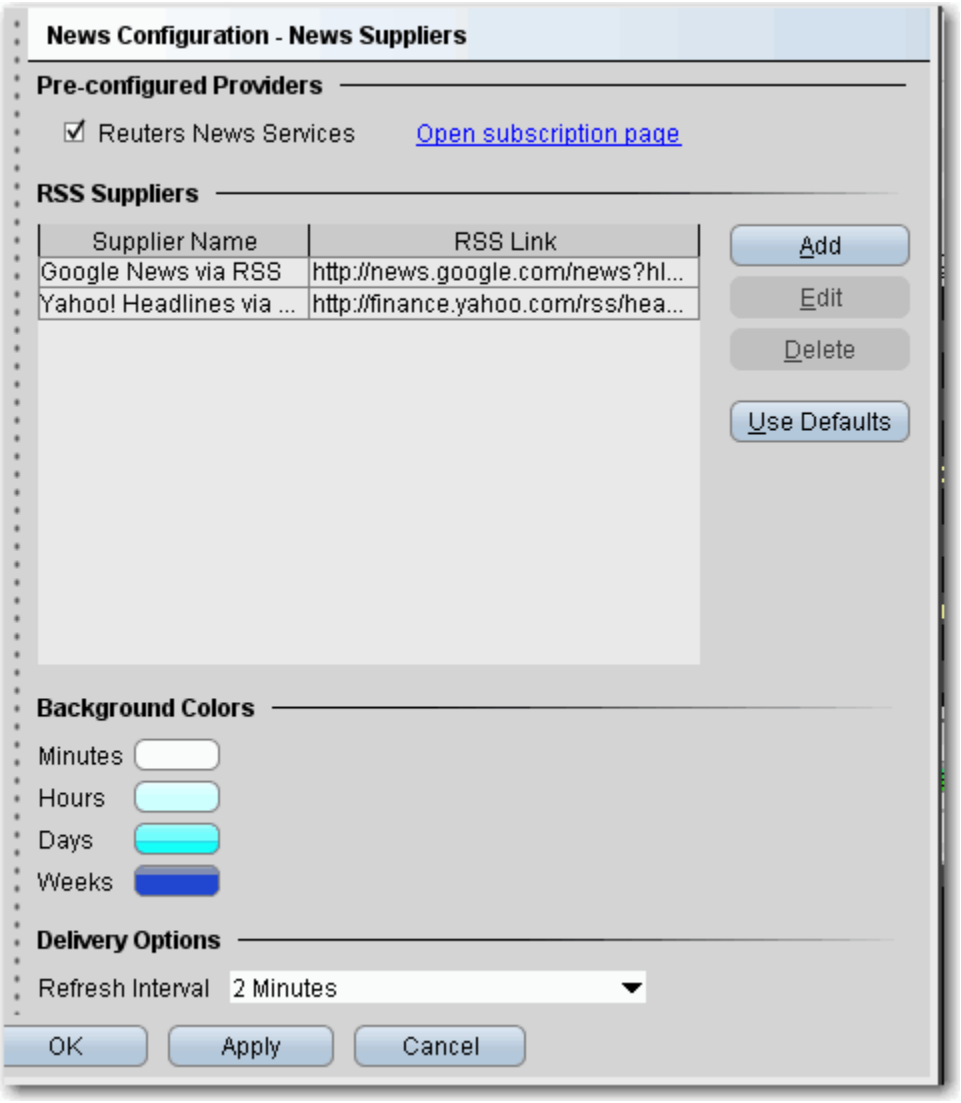
- 配置新闻播报
- 配置市场深度
- 配置图表
- 时间和销售
- 交易者控制板
- 配置警报

配置新闻播报

您能够选择将更多的预配置新闻播报添加至您的交易平台浏览器。您同样能够通过账户管理中的市场数据订阅页面来订阅路透社新闻服务。

查看路透社新闻

1. 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中，点击水平键来扩展**新闻配置**功能，然后选择*新提供者*。
3. 在右侧可选项顶部的**预配置提供者**部分，对*路透社新闻服务*打勾。



如果该选择变为灰色，这意味着您没有在账户管理中订阅该服务。

添加现有的新闻提供

1. 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中，点击水平键来扩展**新闻配置**功能，然后选择*新闻提供者*。
3. 右侧可选项显示了新闻提供者的当前列表，您能够进入它们的头条。点击**添加**按钮来配置新的提供者。
4. 从下拉列表中选择一个提供者名称。RSS 链接被自动加载。点击**确定**。
5. 新的提供者出现在可用新闻提供的列表中。

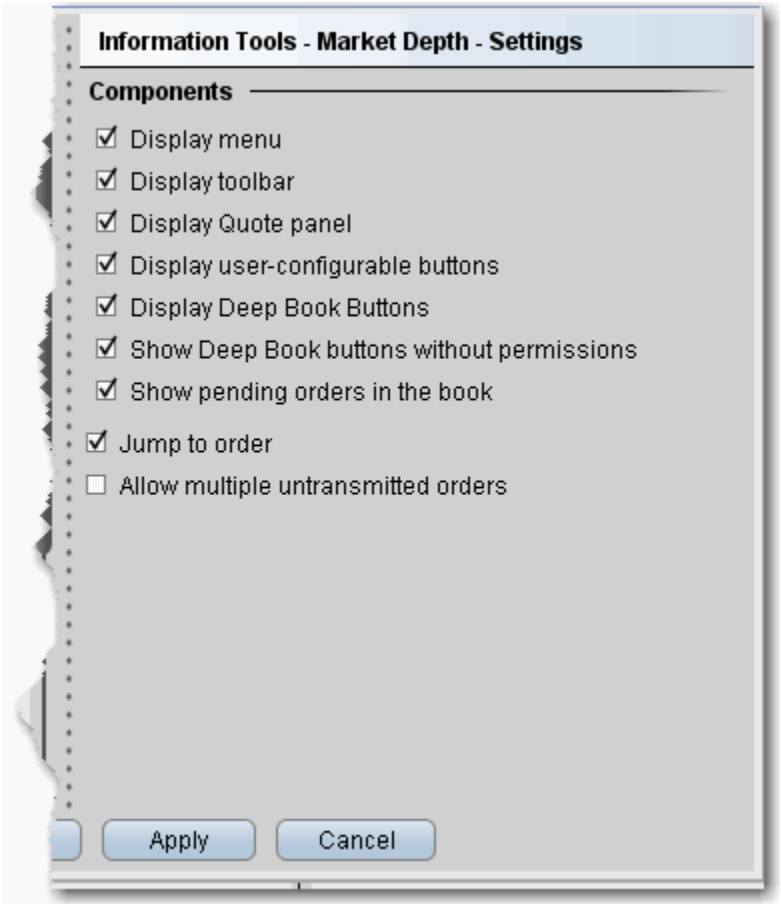
Note: 您能够选择 1、2、3、4、5、10 和 15 分钟作为刷新间隔。注意刷新新闻提供需要一些系统资源，较频繁的刷新间隔可能会对您的系统表现有少许影响，视您的连接类型而定。

配置市场深度

使用市场深度配置页面来定义基本的设定、热键和按钮，并控制栏区域的可见性。

定义市场深度配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*，或者从市场深度菜单中点击*配置*。
2. 在左侧目录中点击*市场深度*。您能够在左侧目录中或在右侧可选项中扩展选项。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：



设定

组成部分

- **显示菜单** — 打勾查看市场深度菜单。
- **显示工具栏** — 打勾查看市场深度工具栏。
- **显示报价面板** — 打勾显示报价面板，其显示了对资产的单条市场数据线。您能够从报价面板中通过点击买卖报价来创建定单。

- **显示用户可配置的按钮** — 如被选中，允许配置的按钮将被显示。
- **显示深层在册按钮** — 如被选中，深层在册按钮面板将会显示，对您拥有深层在册数据许可的每个市场中心都有一个按钮。
- **显示没有许可的深层在册按钮** — 如被选中，且如果深层在册按钮面板也被显示，那么即使您没有许可，深层数据的按钮也将显示。这些按钮将是可见的但不活动。
- **显示交易册中的待处理定单** — 如被选中，那么您从深层交易者窗口传递的任何定单，将显示在深层在册数据中，以白色被强调。
- **跳至定单** — 自动地将光标置于**定单**面板中新创建的定单上。
- **允许多个未传递的定单** — 如被选中，您能够在底层证券面板中创建多于一个的定单。否则，只有未传递的定单才被允许。

配置图表

使用图表配置页面来定义基本的设定、热键和按钮，并控制栏区域的可见性。

定义图表配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*，或者从图表菜单中点击*配置*。
2. 在左侧目录中点击*图表*。您能够在左侧目录中或在右侧可选项中扩展选项。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：

设定

组成部分

显示菜单 — 打勾显示**图表**菜单。

显示工具栏 — 打勾显示**图表**工具栏。

显示报价面板 — 如被选中，对合约显示市场数据的报价面板，将显示在图表窗口的底部。

显示用户可配置的按钮 — 适用于**图表交易者**。如被选中，您从图表交易者配置区中的*按钮*子部分配置的按钮将被显示。

显示时间参数面板 — 如被选中，显示时间参数的工具栏将在图表顶部可见。

显示拆分和股息 — 如被选中，拆分和股息（当可用时）将直接在图表中被注意到。

显示市场时钟 — 如被选中，则在顶部标题条中显示时间。

显示图表描述 — 如被选中，在图表底部显示对颜色、图表类型以及图表所指资产的描述。

显示图表价值标签 — 如被选中，**价格**、**交易量**和其他轴标签将被显示。

对齐报价线顶部 — 如被选中，报价面板将从图表底部移动到顶部。

强调最后交易价格 — 打勾强调最后交易的价格。

强调出价 — 打勾强调最后出价。

强调要价 — 打勾强调最后要价。

强调最高价格 — 打勾强调当天的最高价格。

强调最低价格 — 打勾强调当天的最低价格。

强调光标价格 — 如被选中，您光标下的价格将沿图表的价格轴被强调。

显示水平十字准线 — 当被选中，当您在十字准线模式下时，垂直和水平十字准线都将被显示在图表上。当不选中，只有垂直十字准线才会显示。

自动完成趋势线 — 如被选中，您能够指导交易平台来完成徒手画的趋势线。通过点击和握住鼠标开始您的趋势。要使用自动完成，释放鼠标键，然后再次点击。交易平台根据您的趋势线，在图表范围内完成趋势线。

显示子图表证券选择框 — 如被选中，当您选择添加新图表时，一个询问您是否想要子图表使用与选定图表相同的证券的方框将被显示。

禁用定单标签 — 如被选中，当您用图表交易者创建定单时，图表上的定单“线”被用行动、定单类型和其他状态标记。不选中将删除该定单线。

在图表之间共享趋势线 — 如被选中，在一个图表上绘制的趋势线将恰当地被反映在其他关于相同底层证券的活动图表上。

显示恒定的条数 — 如被选中，所有图表将使用与在恒定条数区域中定义的数目相同的条数。

显示价格轴 — 使用下拉列表在右侧、左侧或者同时在右侧和左侧显示价格轴。

显示时间轴 — 使用下拉列表在顶部、底部或者同时在顶部和底部显示时间轴。

条状图表突变保护 （相对前一条的最大%变化） — 如果您想应用突变保护，输入一个百分比值。如果任何条超过了相对于前一条的该百分比值，它将自动从图表中被删除。

报价面板

使用页面版式的*栏*页面在报价面板区中隐藏或显示区域。

工具栏

从图表工具栏中添加或删除按钮。

图表颜色

修改图表参数的颜色。

价格 / 价值信息

定义如何显示，以及是否显示价格 / 价值信息。

图表交易者

隐藏或显示区域，在图表交易者中创建按钮和热键。

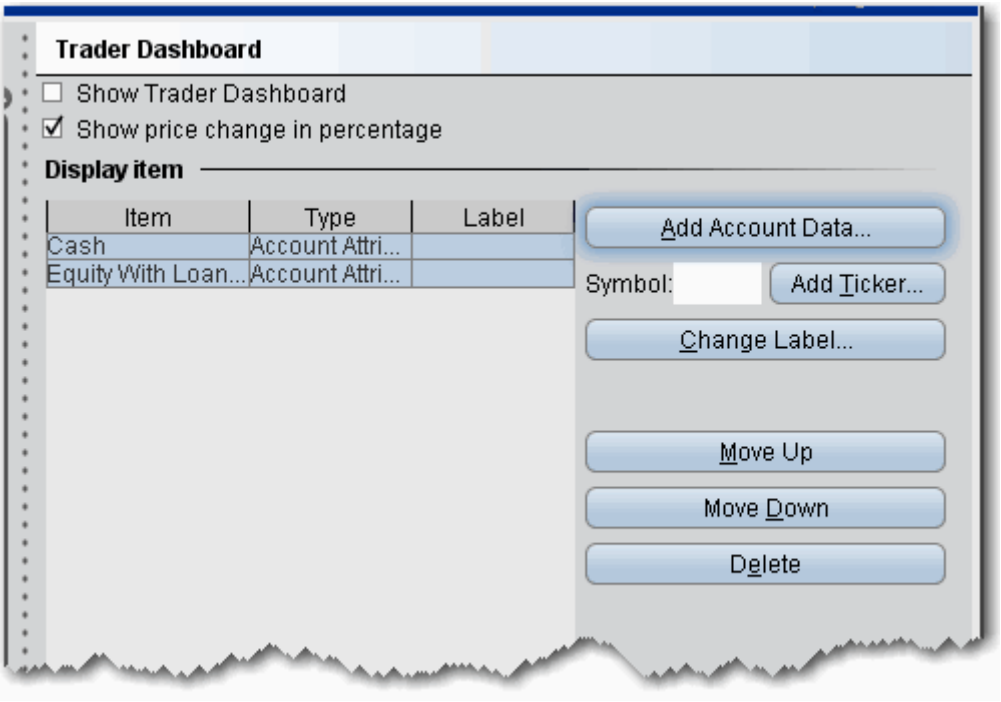
时间和销售

定义您能够为图表显示的时间和销售页面版式。

- *设定* — 选择显示报价行。
- *热键* — 定义时间和销售热键以及快捷方式。
- *报价面板* —在报价面板区中隐藏或显示区域。
- *颜色* — 修改颜色。
- *栏* — 不选中将栏从时间和销售主数据区中删除。

交易者控制板

实时交易者控制板是一个可选的工具，它被显示在页面标签集的顶部。这个可客户化的面板允许您从您的账户信息窗口中监控数据区域。您同样能够了解特定合约的最新活动。



配置交易者控制板

1 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。

2 在左侧目录中，点击*交易者控制板*。

3 在右侧可选项中使用复选框来设定以下：

- 选中*显示交易者控制板*，在您的交易窗口上显示控制板。
- 选中*以百分比显示价格变动*来查看最后价格和以代码行百分比表示的价格变动值。如果不选中，则价格变动以绝对值被显示。

4 点击**添加账户数据**按钮，并向下拉动列表。双击您想要添加到控制板的每个账户区域。您双击的每个区域被添加到配置窗格中的*显示项目*列表上。点击确定来关闭*添加*框。

对账户信息区域的描述，位于账户信息话题中。

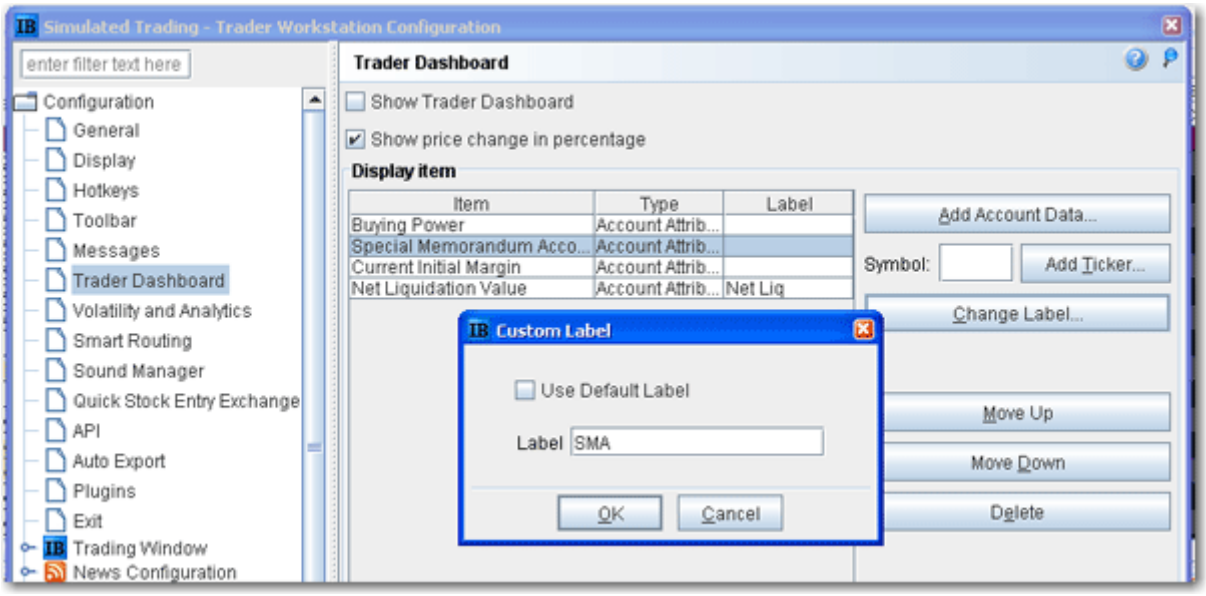
5 要对合约添加最后价格 / 价格变动区域，在*代码*区域中输入底层证券并点击**添加代码**，然后就像在为交易页面添加市场数据时一样来定义合约参数。最后价格 / 价格变动以红色显示来表明向下的运动，以蓝色显示来表明向上的运动。

6 点击**确定**。**交易者控制板**被显示在您的交易窗口顶部，刚好在页面标签集上方。

您能够使用更改标签功能，来对选定的控制板区域更改显示名称。

重命名控制板区域标签

您能够修改控制板上的区域名称，让它们变得更简短，或者包含更多的信息。例如，在英文版中，您可能想要将 Net Liquidation Value （净清算价值）缩短为 Net Liq，或者将 Special Memorandum Account （特殊备忘录账户）缩短为 SMA。



客户化属性标签

1. 从显示项目表格中强调您想要修改的标签。
2. 点击表格右方的更改标签按钮。
3. 在客户化方框中，去掉对 “使用默认标签” 选项的打勾。
4. 在标签区域中为您的属性输入一个新名称并点击确定。

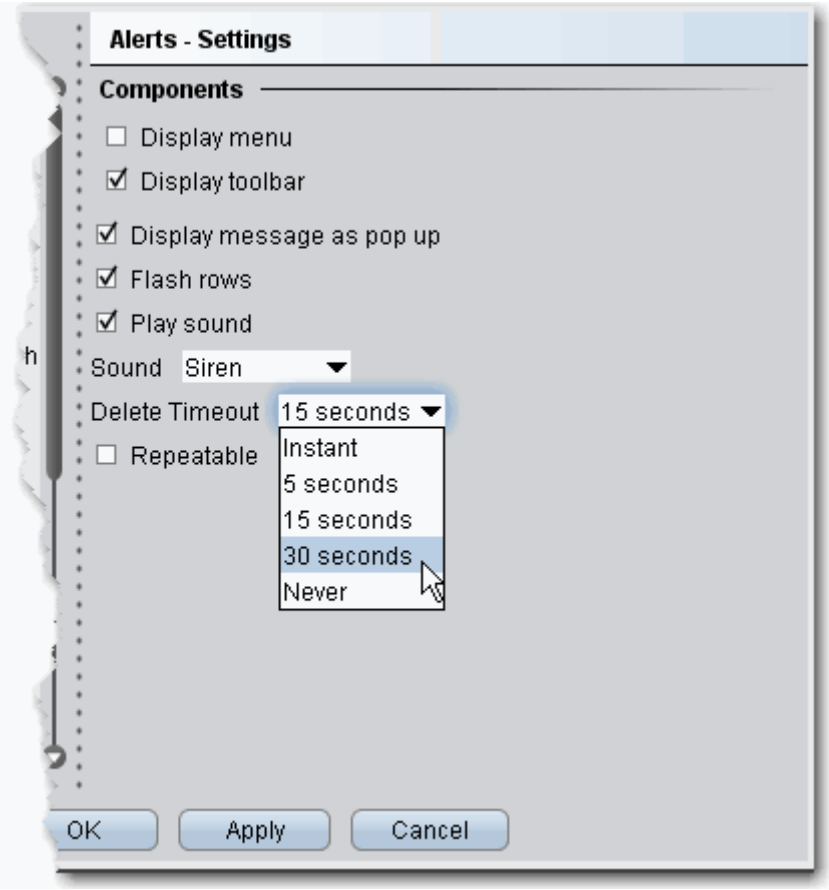
   新标签被列举在显示项目表格的标签栏中。

配置警报

使用警报配置页面来定义基本的设定、热键和按钮，并控制栏区域的可见性。

定义警报配置设定

1. 在**配置**菜单中选择*全局配置*，或者从警报菜单中点击*配置*。
2. 在左侧目录中点击*警报*。您能够在左侧目录中或在右侧可选项中扩展选项。
3. 使用右侧可选项来设定这些参数：



设定

组成部分

- *显示菜单* — 打勾查看警报菜单。
- *显示工具栏* — 打勾查看警报工具栏。
- *显示弹出消息* — 如被选中，警报默认为弹出消息。
- *动画行* — 如被选中，当警报被激活时，用于警报的市场数据行将闪烁。

- *播放声音* — 如被选中，在警报页面的**声音**子页面上，*无*被默认地选中。
- *声音* — 选择一个默认警报声音。
- *删除超时* — 设定一个时间，警报通知将在此时间之后停止。
- *可重复* — 如被选中，在警报页面的持训时间区中，该功能将被默认地选中。

热键

打开**热键和鼠标快捷方式**对话框。您能够通过选择行为并点击*配置*来修改对现有快捷方式的配置。要获取更多信息，参见分配鼠标快捷方式话题。

按钮

创建客户化按钮添加至工具栏，或者编辑现有的按钮。点击新建来创建新按钮。

定单工具栏

使用页面版式的*栏*页面，在定单区中隐藏或显示区域。

页面版式

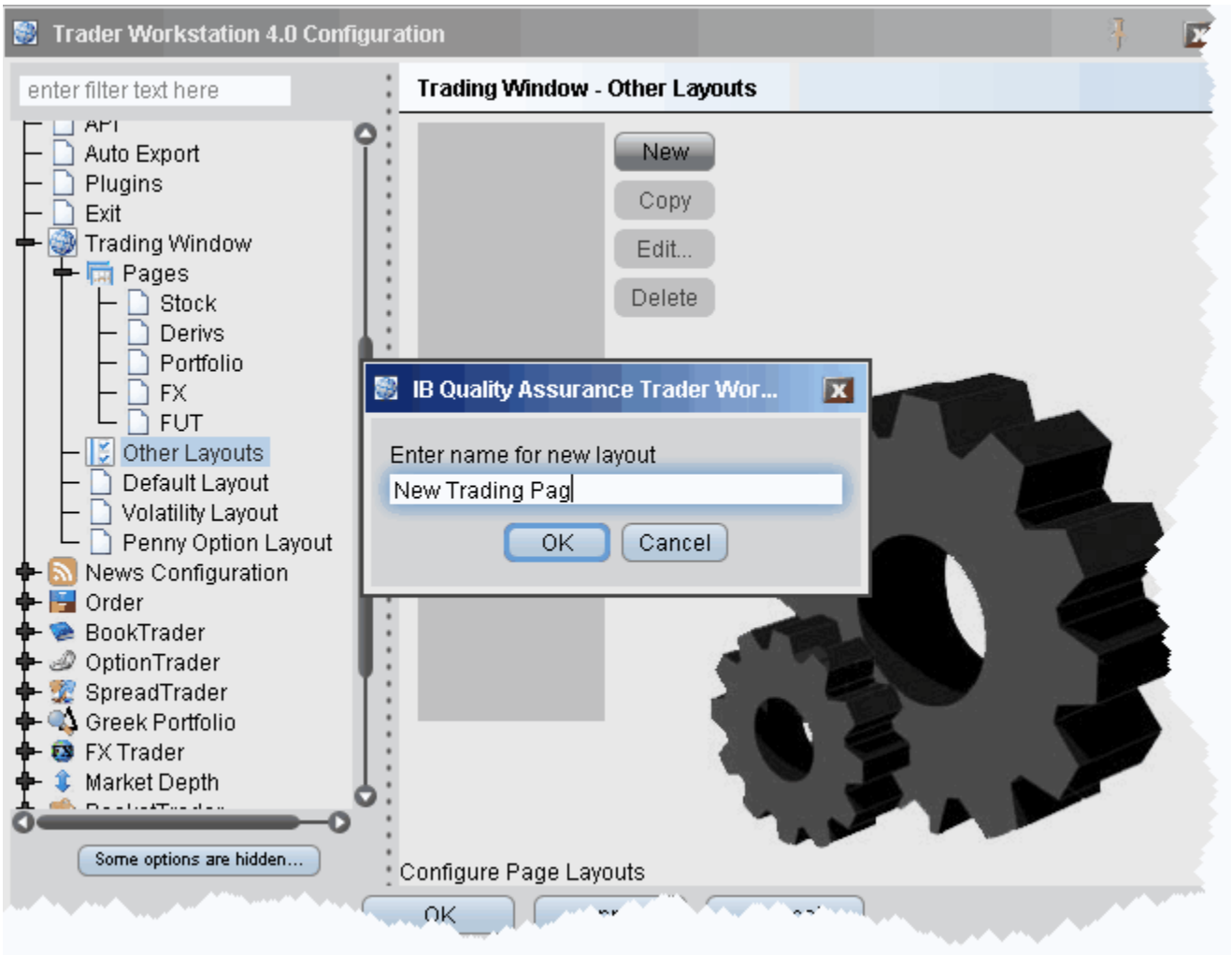
引言

- 创建页面版式
- 应用页面版式
- 编辑页面版式
- 显示市场数据栏
- 配置栏
- 显示定单管理栏
- 重新安排交易页面栏
- 更改背景和文本颜色
- 修改快速定单输入设定

创建页面版式

版式功能让您创建客户化的版式，您能够将其应用于您的交易页面。使用**版式**编辑器来指明您想要显示哪些栏，您想让这些栏在哪里彼此之间相关，以及用来对特定版式传递交易信息的文本和背景颜色。

如果您想更改您的页面显示的方式，但想让它们看上去都一样，您能够只简单地更改**默认**页面版式。如果您想对特定的页面应用不同的版式或者保存默认设置，那么创建一个新版式，方法是复制**默认**，将其重命名并编辑。



创建页面版式

要创建新的页面版式，您必须复制现有的版式，将其重命名，然后编辑它以符合您的标准。

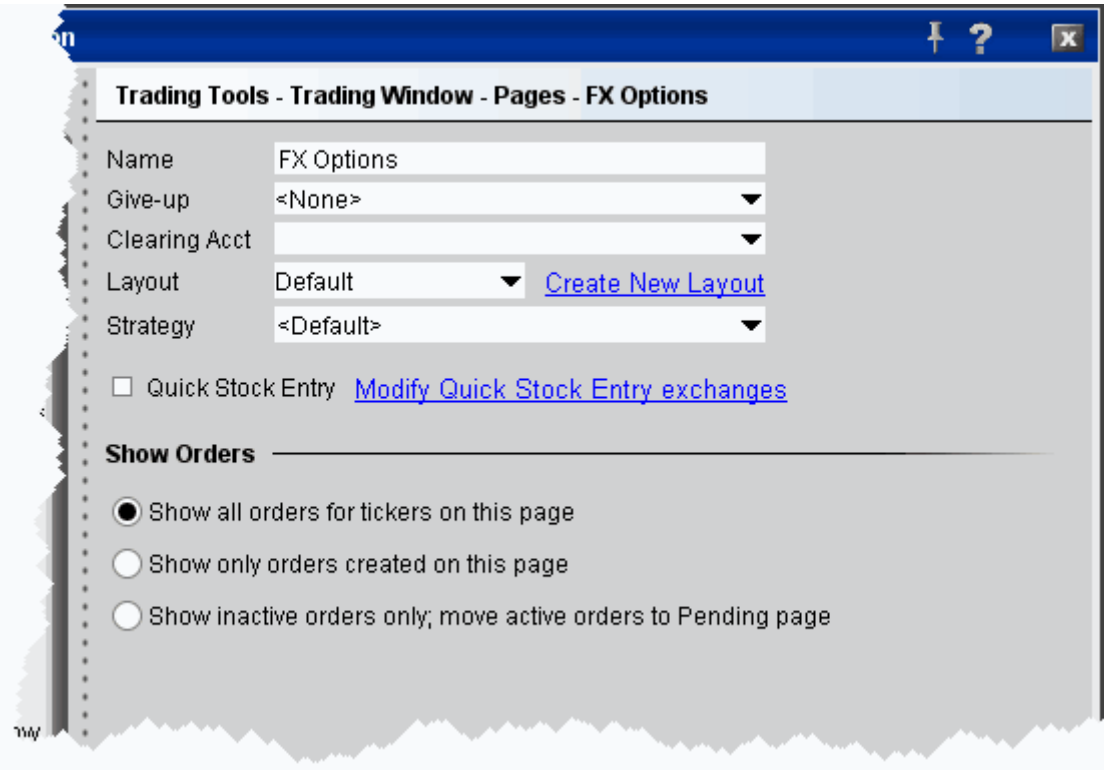
1. 在**配置**菜单上，点击*全局配置*，然后点击*交易窗口*。
2. 在左侧目录中选择*其他版式*，然后在右侧可选项中点**新建**按钮。
3. 对新的页面版式输入名称，并点击**确定**。

4 点击*编辑*来打开**页面版式**编辑器。

5 修改栏可见性、栏定单以及文本和背景颜色并点击确定。版式将保持闲置直到您将其应用于页面。

应用页面版式

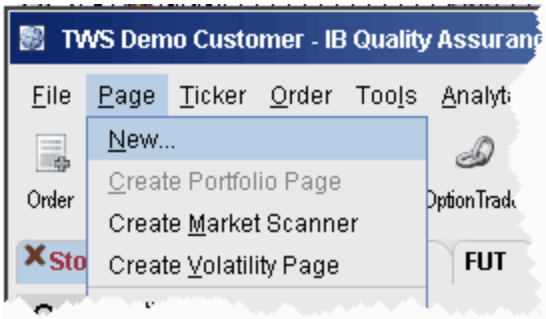
您能够每次一页地将版式应用于现有的交易页面，或者在您创建新页面时对新页面应用版式。

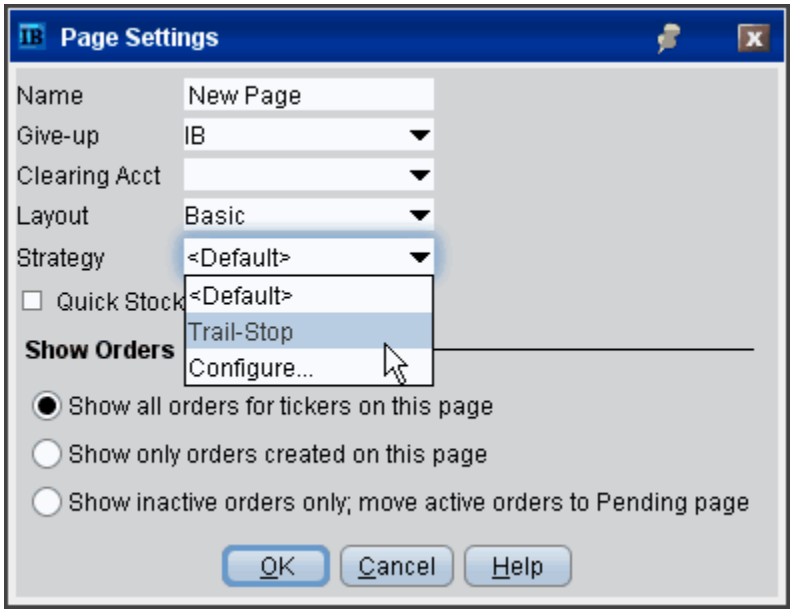


将版式应用于现有页面

1. 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中，选择*交易窗口*，然后选择*页面*。
3. 选择您想要应用版式的页面。
4. 在*版式*下拉列表中，选择您想要应用的版式。
5. 选择一个定单默认策略。
6. 点击**确定**。

Note: *所有页面使用**默认**版式和**默认**策略，除非您有别的指定。*





将版式应用于新页面

1. 在**页面**菜单上点击*新建*，然后输入一个页面名称。
2. 在**版式**下拉列表中，选择想要应用于新页面的版式。
3. 选择一个定单默认策略。
4. 指定您想让定单怎样显示在页面上。
5. 点击**确定**。

编辑页面版式

版式功能让您创建客户化的版式，您能够将其应用于您的交易页面。使用**版式**编辑器来指明您想要显示哪些栏，您想让这些栏在哪里彼此之间相关，以及用来对特定版式传递交易信息的文本和背景颜色。

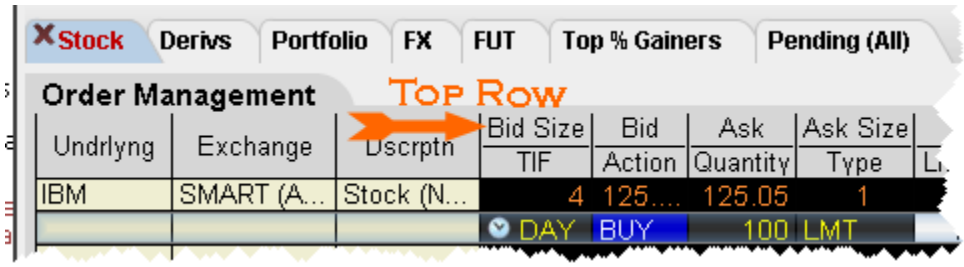
如果您想更改您的页面显示的方式，但想让它们看上去都一样，您能够只简单地更改**默认**页面版式。如果您想对特定的页面应用不同的版式或者保存默认设置，那么创建一个新版式，方法是复制**默认**，将其重命名并编辑。

编辑页面版式

1 在**配置**菜单上，点击*全局配置*，然后点击*交易窗口*。

2 在左侧目录中，选择您想要编辑的版式。

3 使用*市场数据栏*和*定单栏*标签来**添加**或**删除**区域。



市场数据栏页面中的区域在交易页面上沿着区域标题的首行显示。定单栏页面中的区域沿着区域标题的末行显示。如果您同时在市场数据和定单行页面上显示相同的区域，其将作为单个区域出现，如上图中的底层证券、交易所和描述区域。

4 如果需要，使用*颜色*标签更改文本和背景颜色并点击确定。

版式将保持闲置直到您将其应用于页面。

显示市场数据栏

您能够在全局配置中使用版式管理器，选择在交易页面上显示或隐藏多个栏。

在页面上显示 / 删除市场数据栏

1 在交易页面上右键点击栏标题，然后选择*客户化版式*。

2 点击**市场数据栏**标签来查看栏。

已经在您的交易窗口中显示的栏会出现在页面左边的*已显示的栏*列表中。剩下的栏在右边的*可用的栏*列表中按照类别被分组。

3 要显示栏，从*可用的栏*列表中选择一个栏，并点击**添加**按钮将栏移动到*已显示*列表中。

4 要删除栏，在*已显示的栏*列表中选择一个栏，点击**删除**按钮。

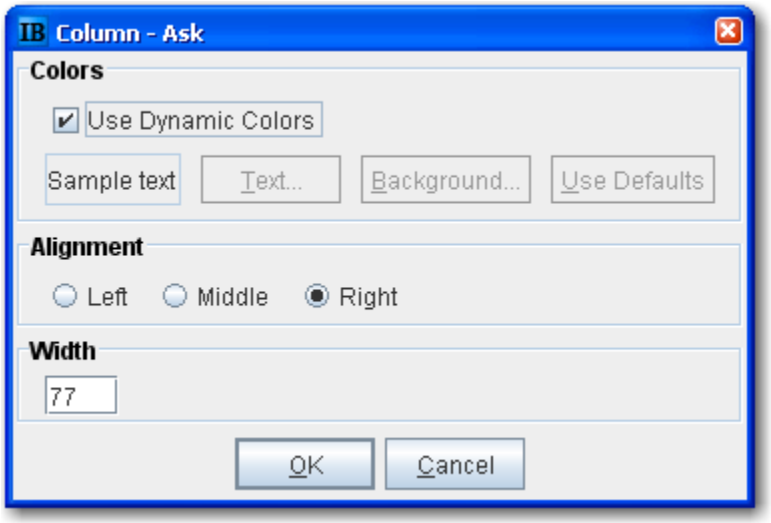
粗体的栏标题总是可见且不能被删除。使用过滤器区域来帮助找到您寻找的栏，或者点击分类单选按钮，按照字母顺序列出所有的栏。

要获取对显示在市场数据栏中的数据的描述，参见市场数据栏。

配置栏

您能够在交易窗口中配置单个栏的文本和背景。

对价格和尺寸栏，您能够通过不对*使用动态着色*框打勾，来关闭动态着色，动态着色指的是以绿色表示价格或尺寸的向上变动，以红色表示向下变动。

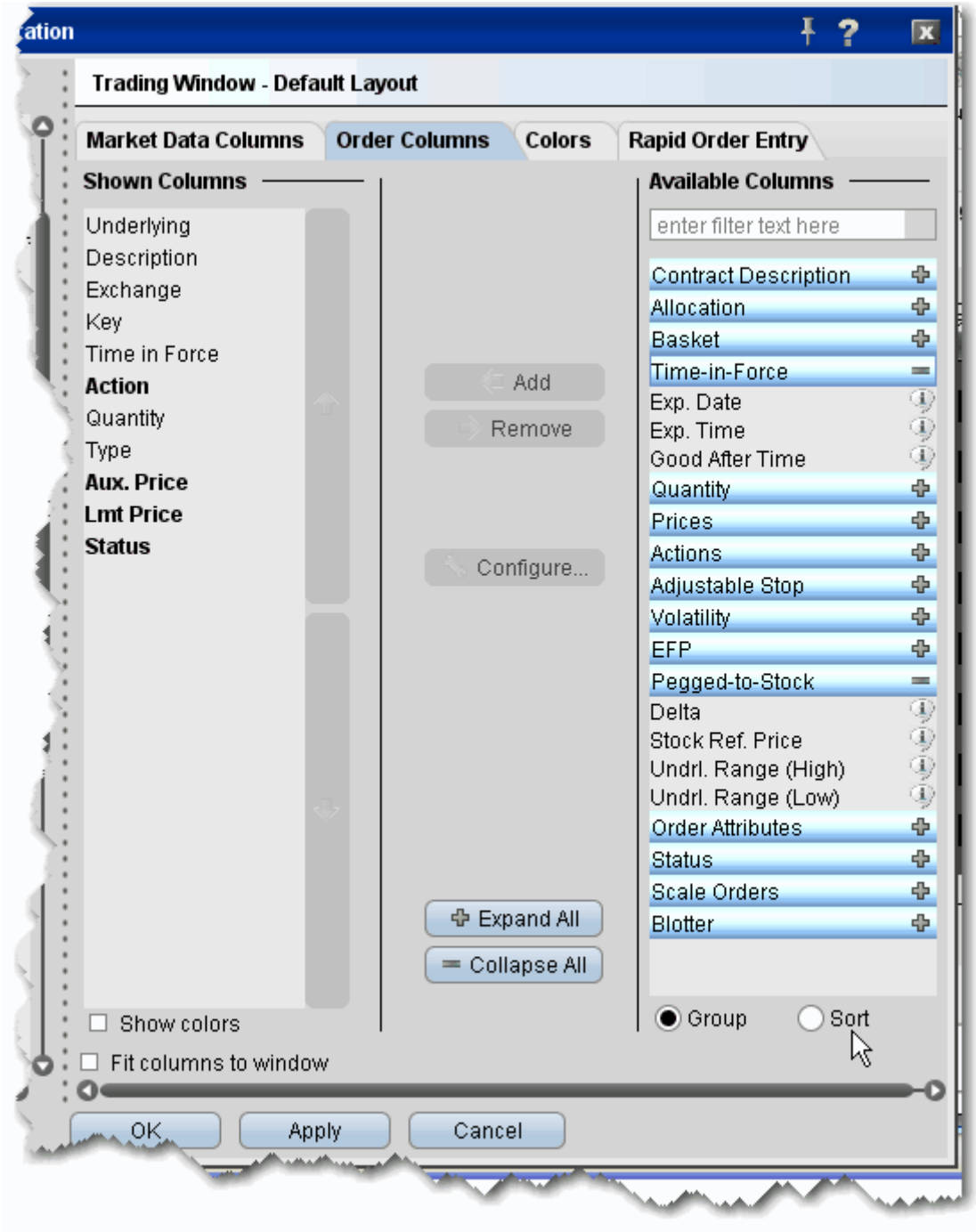


配置栏

1. 右键点击栏名称并选择*配置 xyz 栏*。
2. 如果动态着色可用，您能够根据需要去掉对该功能的打勾。
3. 使用*文本*和*背景*颜色选择器，修改栏的背景和文本颜色。点击用户默认值返回到最初的交易平台颜色。
4. 对齐方式将数据在栏内移动。
5. 宽度控制栏尺寸。

显示定单管理栏

您能够在全局配置中使用版式管理器，选择在交易页面上显示或隐藏多个栏。



在页面上显示 / 隐藏定单栏

1. 在交易页面上右键点击区域标签，并选择*客户化版式*。
2. 点击**定单栏**标签来查看栏。

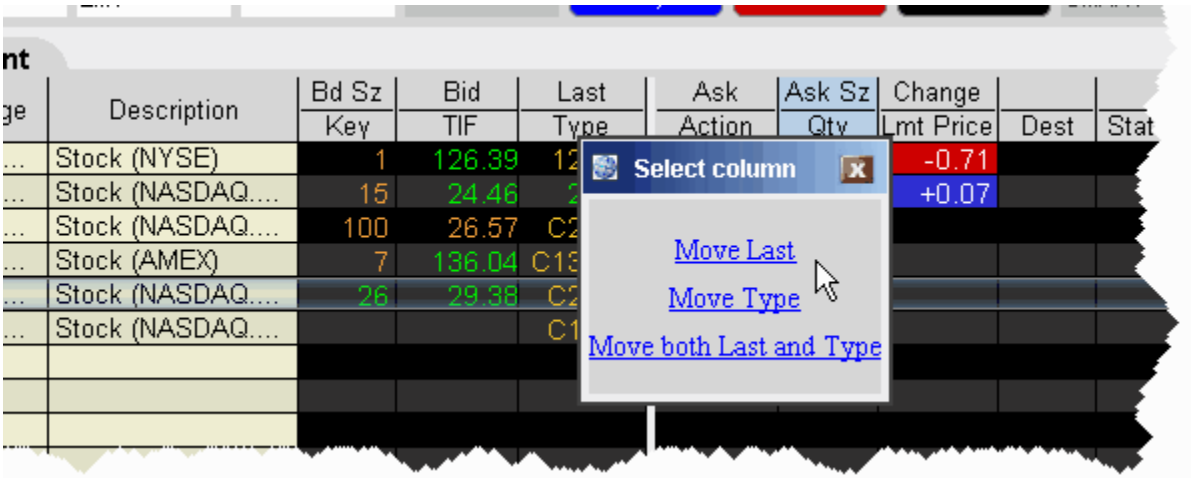
   已经在您的交易窗口中显示的栏会出现在页面左边的*已显示的栏*列表中。剩下的栏在右边的*可用的栏*列表中按照类别被分组。
3. 要显示栏，从*可用的栏*列表中选择一个栏，并点击**添加**按钮将栏移动到*已显示*列表中。
4. 要删除栏，在*已显示的栏*列表中选择一个栏，点击**删除**按钮。

粗体的栏标题总是可见且不能被删除。使用过滤器区域来帮助找到您寻找的栏，或者点击分类单选按钮，按照字母顺序列出所有的栏。

要获取对显示在定单栏中的数据的描述，参见定单管理栏。

重新安排交易页面栏

您能够通过拖动栏并将其放到新位置来改变交易页面上栏的位置。由于定单管理和市场数据栏是堆起来的，您将被询问您是想移动其中的一个栏，还是两个一起移动。

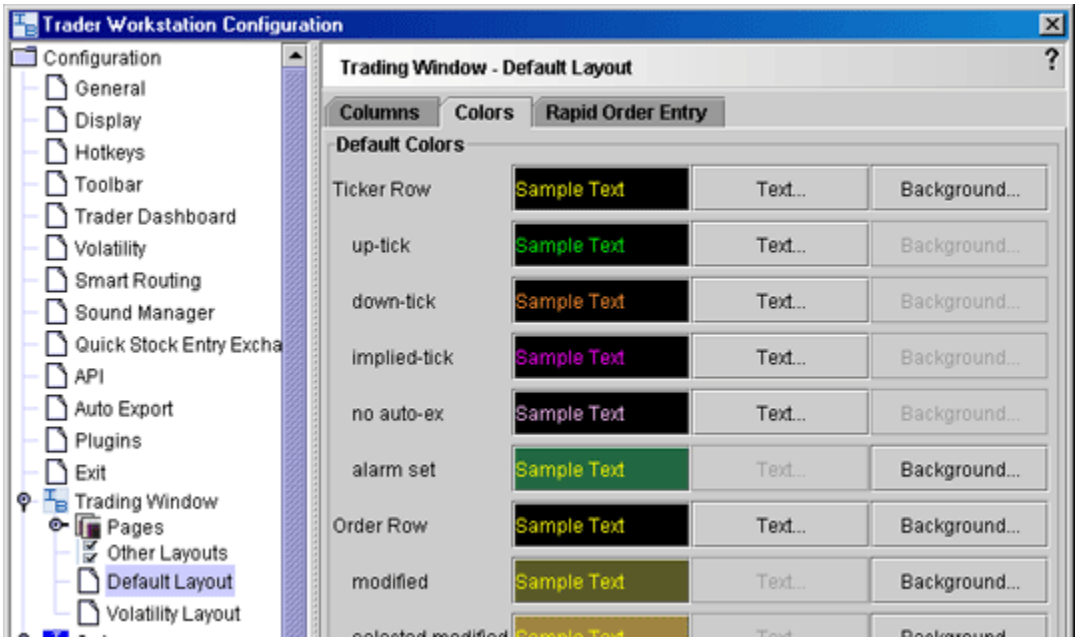


改变栏的位置

1. 在您想要移动的栏上点击鼠标。
2. 握住鼠标键，将栏向左或向右拖动到其新位置。
3. 放开鼠标按钮。
4. 在确认消息中，选择单个栏，或选择一起移动两个栏。

更改背景和文本颜色

您能够使用*版式编辑器*，对特定的栏和行修改背景和文本颜色。



更改页面版式中的颜色

1. 在**配置**菜单上，点击*全局配置*，然后在左侧目录中点击*交易窗口*。
2. 选择一个版式（使用**默认**来更改基本的版式，点击**其他版式**来找到您设计的客户化版式）。
3. 点击**颜色**标签，并选择修改文本或背景颜色。

您能够对以下项目修改文本和 / 或背景颜色：

- 代码行（*文本 & 背景*） — 包含了产品的市场数据的行。
- 向上跳动（*仅文本*） — 上升的最小报价单位。
- 向下跳动（*仅文本*） — 下降的最小报价单位。
- 内在报价跳动（*仅文本*） — 对组合定单的内在报价跳动，组合定单通过添加边的价值，而不是代表真实组合定单的市场数据被模拟。
- 无自动执行（*仅文本*） — 用于期权，告诉您对该市场下达的定单将不会电子化地执行。
- 警报设定（*背景*） — 告诉您对该行有一个警报设定。
- 定单行（*文本 & 背景*） — 当您对产品点击出价或要价时创建的定单行。
- 被修改过的（*背景*） — 被修改过的定单的背景。
- 选定的被修改过的（*背景*） — 您强调（传递或取消等）的被修改过的定单背景。
- 总数行（*文本 & 背景*） — 可选的总数行以不同的颜色显示，有助于让其突出。

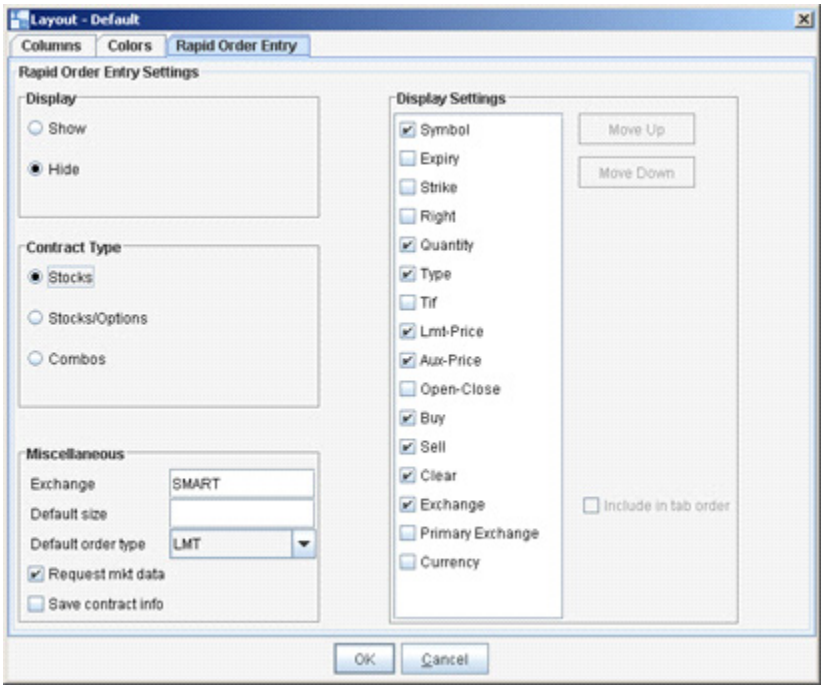
- 背景网格（*背景*）— 整个交易页面网格的背景。
- 背景竞价（*背景*）— 工具参与了竞价且不能被取消的定单行背景。

修改快速定单输入设定

快速定单输入面板是交易页面的一个组成部分，因此其设定是通过页面版式管理器来管理的。您对快速定单输入设定所作的任何更改，通过分配给该页面的页面版式被应用。如果您没有对特定的页面创建或应用页面版式，那么所有页面都将通过默认的页面版式被控制。下面的过程假设您对页面版式管理器有一定的属性程度。

修改快速定单输入设定

1. 在**页面**菜单上，点击*版式*。您编辑的版式名称出现在版式管理器的标题条中。
2. 点击**快速定单输入**标签来查看当前设置。
3. 使用下表中描述的复选框、可编辑区域和显示设定来启用 / 禁用功能，设定默认值以及选定默认定单类型。
4. 点击**确定**。



Note: 注意，您在对页面版式的组成部分，而不是对特定的页面作出更改。使用该版式，这些更改将同样被应用于所有其他页面。

快速定单输入设定

您能够对快速定单输入行动记录下热键分配。注意，您的标准热键 （买入、卖出等）在快速定单输入面板中是无效的。

显示

- 显示 — 在任何使用版式的页面顶部显示快速定单输入面板。
- 隐藏 — 在任何使用版式的页面顶部隐藏快速定单输入面板。

合约类型

- 股票 — 自动地配置快速定单输入面板以允许您交易股票。您将在右边看见显示设定列表，您能够从中选择您想要使用的区域。
- 股票 / 期权 — 自动地配置快速定单输入面板以允许您交易股票或期权。您将在右边看见显示设定列表，您能够从中选择您想要使用的区域。
- 组合 — 自动地配置快速定单输入面板以允许您创建和交易组合以及差价定单。显示设定列表与该版式不相关。

杂项

- 交易所 — 输入默认的传递交易所。我们推荐使用智能以获得最佳执行。
- 默认尺寸 — 设定默认的定单尺寸。您可以从面板中编辑该区域的值。
- 默认定单类型 — 设定默认的定单类型。您可以从面板中编辑该值。
- 要求市场数据 — 控制您是否将在定单管理行上方看见一行市场数据，定单管理行是在您创建定单时被创建的。
- 保存合约信息 — 当被选中，当前合约的信息在您传递定单之后将保留。当不被选中，在您传递定单之后所有区域将被清空。

显示设定

选中任何您想要出现在快速定单输入面板中的区域。

- 上升 / 下降 — 将被选中的区域按次序排放。它们在该列表中出现的次序，决定了它们将在快速定单输入面板中出现的次序，以及如果选中 “包括制表键次序”，您用制表键选择区域时光标将被插入的次序。
- 包括制表键次序 — 对列表中每个选定的区域，该方框必须被选中或不选中。对该方框打勾，会指示您的光标落在您用制表键选中的区域中。

交易页面区域描述

引言

- 市场数据栏
- 定单管理栏

市场数据栏

- 合约描述栏
- 新闻栏
- 头寸和损益栏
- 基于价格栏
- 高 / 低 / 交易量栏
- 期权栏
- 债券栏
- 竞价栏
- 路透基本栏
- 图表价格栏
- 定单预设

合约描述栏

栏名称	描述
合约描述	
公司名称	显示底层证券的公司名称。
描述	指明工具类型以及其他描述的合约信息。
交易所	市场数据交易所。如果没有对定单传递指定其他交易所，该交易所也将是合约被传递的地方。选择 SMART 定单传递，将定单直接传递至可用的最佳市场。
注释	一个可编辑的无限制文本区域，您能够在当中输入关于底层证券等的注释。当您将鼠标放在注释文字上时，它会显示在一个弹出方框中，这样您就能够阅读整个注释了。 **Note:** **注释**区域在系统生成的页面上是不可编辑的，因为这些页面 （包括待处理页面和投资组合页面）与用户维护的页面功能不同。它们被动态地创建，并在交易平台会话开始时被占据，没有能力保存用户输入地文本。
可卖空	使用颜色来识别是否有可被客户用于卖空的股票。颜色传达了以下的信息： 红色 — 没有股票可用。 深绿色 — 系统正尝试找到股票。 浅绿色 — 至少有 1000 股可用。
代码	对合约显示交易所代码。
底层证券	合约的底层证券代码。要在底层证券和代码模式之间切换，在**视图**菜单上选择需要的模式。

新闻栏

栏名称	描述
新闻	
新闻时间	显示最后与合约相关的新闻报道的时间和日期。行使用颜色坡度来帮助一瞥区分最新的和最旧的报道。要查看该区域，您必须通过功能选择器 > 基本分析类别来激活 RSS 新闻提供功能。
新闻标题	显示新闻报道的标题。要查看该区域，您必须通过功能选择器 > 基本分析类别来激活 RSS 新闻提供功能。要更深地了解报道，双击标题。

头寸和损益栏

栏名称	描述
头寸和损益	
平均价格	当前头寸的平均成本。
成本基础	成本基础是使用公式： 平均成本×头寸×乘数来计算的。
市场价值	等于 （头寸×市场价格）。
头寸	您在选定合约中的当前头寸。

栏名称	描述
头寸和损益	显示收益或损失。要修改使用的损益计算，右键点击区域，并选择*配置头寸和损益栏*。选中或不选中方框*将今日的建仓头寸包括到损益计算中*。
未实现损益	对股票、股票期权和期货期权计算未实现损益。未实现损益使用如下公式来计算： （当前市场价格－平均成本 / 股）×总股数 每股平均成本是实时更新的。当客户进入头寸时，该区域被自动地添加到交易窗口中。一旦被删除，它不能再被自动添加。
已实现损益	计算每个头寸的已实现损益。
未实现损益指标	对未实现盈利和亏损的实时图表表述，当中的箭头颜色表明您当前的未实现损益为正 （蓝色）或是负 （红色），方向表明最后价格的变动为负 （指向左）或是正 （指向右），箭头的长度代表买入 / 卖出价格与最后出价 / 要价之间的距离。

基于价格栏

栏名称	描述
价格	
要价	对合约的最佳要价。这是您当前可以买入的最佳价格。
要价尺寸	当前要价的大概深度。
出价	对合约的最佳出价。这是您当前可以卖出的最佳价格。
出价尺寸	当前出价的大概深度。
变动	当前价格与前一个交易日的收盘价格相比，上涨或下跌了多少。如果价格下跌了，背景为红色。如果价格上涨了，背景为蓝色。要在金额变动和百分比变动之间切换，点击栏标题。
变动 （%）	当前价格与前一个交易日的收盘价格相比，上涨或下跌的百分比。如果价格上涨了，背景为蓝色。要在百分比变动和金额变动之间切换，点击栏标题。
自开盘以来的变动	自交易日开盘以来的价格变动 （以金额或百分比表示）。如果价格下跌了，背景为红色。如果价格上涨了，背景为蓝色。要在百分比变动和金额变动之间切换，点击栏标题。
收盘	显示资产的最后可用收盘价格。对美国股权，我们使用公司行为处理来获取收盘价格。这意味着收盘价格被调整以反映向前和向后的拆分，以及现金和股票股息。
价差	显示前一晚收盘价格与今日开盘价格之间的差额。您能够在以货币单位显示价差或以百分比点 （100%×价差 / 今日开盘价）显示价差之间切换该显示。要切换显示，右键点击栏标题并选择*切换显示*。
最后	合约最后交易的价格。最后价格前面的 “C”表示这是前一个交易日的收盘价格。
最后尺寸	最后交易的合约尺寸。如果交易的最后合约尺寸大于前一个的尺寸，那么字体为绿色。如果小于，则字体为红色。
市场价格	市场价格等于最后价格，除非： 要价 < 最后价格 — 市场价格等于要价。 出价 > 最后价格 — 市场价格等于出价。
中点	当前出价和要价之间的中点。
开盘	交易日的开盘价格。
差价	当前要价和出价之间的差额。

高 / 低 / 交易量栏

栏名称	描述
高 / 低 / 交易量	
13 周最低	过去 13 周的最低价格。
13 周最高	过去 13 周的最高价格。
26 周最低	过去 26 周的最低价格。
26 周最高	过去 26 周的最高价格。
52 周最低	过去 52 周的最低价格。
52 周最高	过去 52 周的最高价格。
平均交易量	90 天的日平均交易量 （将该值乘以 100）。
最低	选定合约的当日最低价格。

栏名称	描述
最高	选定合约的当日最高价格。
交易量	选定合约的当日交易量。
交易量指标	对交易量活动的图表描述，当中代表 10,000 股的蓝色条从区域的左侧向右侧移动。条移动得越快，交易量越高。暂时的颜色改变表示最后出售大于 10,000 股。

期权栏

栏名称	描述
期权	
要价交易所	识别对期权合约发布最佳要价的期权交易所。
出价交易所	识别对期权合约发布最佳出价的期权交易所。
看涨 / 看跌未平仓合约数	交易日的看涨期权未平仓合约数 / 看跌期权未平仓合约数。
看涨 / 看跌交易量	交易日的看涨期权交易量 / 看跌期权交易量。
历史波动率	对期权显示实际的历史波动率。
内在波动率 （%）	内在波动率基于期权的最佳出价和要价平均值。该计算是非线性的，并且对低 vega 值的期权可能不收敛。在这种情况下，将不会显示内在波动率估计。
模型	期权模型价格是使用底层证券价格、利率、股息以及其他您使用期权模型编辑器输入的数据来计算的。
未平仓合约数	为未平仓的期权总数绘制图表。
期权内在波动率	对底层证券在未来将有多波动的预测。IB30 天波动率是对当前交易日向前三十个日历日到期估计的市场波动率，并且根据来自两个连续到期月的期权价格。
期权交易量	在指定的一段时间被交易的合约总数。
期权交易量变化	与前一个交易日收盘时相比的交易量变化。
看跌 / 看涨未平仓合约数	交易日的看跌期权未平仓合约数 / 看涨期权未平仓合约数。
看跌 / 看涨交易量	交易日的看跌期权交易量 / 看涨期权交易量。
波动率变化	与前一个交易日收盘时相比的波动率变化。

债券栏

栏名称	描述
债券	
出价收益	当债券以当前出价被购买时，其内在收益率。
要价收益	当债券以当前要价被购买时，其内在收益率。
最后收益	当债券以最后交易价格被购买时，其内在收益率。
债券属性	可能包括了非标准结算日期 （债券的正常结算为 T ＋ 3）的最后出售价格的债券属性，包括 C — 现金交易 ND — 下一日交易 S# — 卖方期权 其他属性 W — 加权平均交易 A — 收盘后时段交易

竞价栏

栏名称	描述
竞价	
竞价	竞价将发生的价格，前提是没有收到新定单且竞价现在举行。为竞价的预示价格。
竞价交易量	将交易的股数，前提是没有收到新定单且竞价现在举行。
不平衡	对下一次竞价不配对的股数；显示竞价的一方比另一方多了多少股。 蓝色表明买方的不平衡 （更多的买入定单），红色表明卖方的不平衡 （更多的卖出定单）。

路透基本栏

栏名称	描述
基本	
股息 （TTM）	该数值为在最近连续十二个月中支付给普通股股东的每股现金股息总数。
每股盈余增长	该增长率是过去 5 年中*每股盈余*的复合年度增长率，不包括*特殊项目*和*非持续经营*。 注：如果最近的年度或最远的年度的值为零或负数，那么增长率无法被计算，“NA”（不可用）将显示。
市值	市值的计算如下： 当前价格×当前在外流通股数
市盈率	该比率的计算方法是：将当前价格除以稀释的每股盈余总和，稀释的每股盈余总和来自特殊项目和会计方法更改之前的四个财务报表期间的连续经营。
市值与账面价值比	该数值为当前价格除以最近财务报表期间的每股账面价值。
速动比率	也被称作酸性测试比率，该数值被定义为：最近财务报表期间的现金加上短期投资再加上应收账款，除以该期间的流动负债总数。 注意：该项目不可用于 （NA）银行、保险公司以及其他不区分流动和长期资产与负债的公司。
股本回报率	该数值为在最近十二个月内可用于普通股股东的收入除以平均普通股权益，以百分比表示。平均普通股权益的计算是将最近 5 个季度的普通股权益相加再除以 5。

图表价格栏

栏名称	描述
图表价格	
要价指标	一个红色的条，其在区域中的放置代表了当前最佳要价中相对于一美元的美分。在区域中间的条表示要价的美分价值接近 $.50。靠近左侧的条表示美分价值接近零，靠近右侧的条表示其接近一美元。
出价指标	一个绿色的条，其在区域中的放置代表了当前最佳出价中相对于一美元的美分。在区域中间的条表示要价的美分价值接近 $.50。靠近左侧的条表示美分价值接近零，靠近右侧的条表示其接近一美元。

栏名称	描述
烛台	对价格变动的方向和大小的图表描述。箭头的宽端代表开盘价格，窄端代表最后价格。指向右边的箭头表示价格高于前一个收盘价格，指向左边的箭头表示价格与前一个收盘价格相比有所下跌。色调越亮，表明价格变动的量越大。
图像变动	对最后价格与前一个交易日收盘价格之间的差距的图表描述。箭头位于区域中央，如果最后价格高于收盘价，其为绿色，如果低于则其为红色。箭头越长，两个价格之间的差距越大。区域容纳了上至高于收盘价 $2.00 和下至低于收盘价 $2.00 的图像变动。
最后指标	一个品红色的条，其在区域中的位置代表了当前最后交易价格中相对于一美元的美分。在区域中间的条表示最后价格中的美分价值接近 $.50。靠近左侧的条表示美分价值接近零，靠近右侧的条表示其接近一美元。
范围	最后交易价格与当日最高和最低价格之间的图表比较。指标起始于区域中间，并随着最后价格接近当日最低价格而向左移动（红色），随着最后价格接近当日最高价格而向右移动 （绿色）。如果最后价格等于最低或最高，那么条将改变颜色。您能够选择以三种不同的视觉模式来查看范围：基本范围、范围 3D 以及范围 3D 警报。只有最后一种在价格等于最高或最低价格时显示颜色改变。
智能指标	对当前价格中相对于一美元的美分的图表描述。如果您持有空头头寸，条为红色并代表要价中的美分。如果您持有多头头寸，条为绿色并代表出价中的美分。对您不持有头寸的合约，条为灰色，并代表最后价格中的美分。在区域中间的条表示价格中的美分价值接近 $.50。靠近左侧的条表示美分价值接近零，靠近右侧的条表示其接近一美元。

定单预设

栏名称	描述
预设	显示对合约的当前默认策略，并包含可用于合约的所有定单策略的下拉选择列表。如果客户化的策略已经为合约准备好了，并且预设区域没有被显示，那么预设策略图标将被显示在合约描述区域中。

定单管理栏

- 强制栏 （不能从交易窗口中被删除）
- 合约描述栏
- 有效时间栏
- 数量栏
- 基于价格的栏
- 行动栏
- 可调整的止损栏
- 波动率栏
- 期货转现货栏
- 挂钩股票栏
- 定单属性栏
- 状态栏
- 分段定单栏

Note: 对页面版式作出的更改被自动地应用于任何已经使用了该版式的页面。

强制栏 （不能从交易窗口中被删除）

下面的栏总是被显示在交易窗口的定单行上。

栏名称	描述
已显示的栏 （不能被删除的强制栏）	
行动	定单行动。买入或卖出。
类型	定单类型。
数量	您定单中的单位数量。
限价	限价所适用的定单类型的限价，这些定单类型包括限价、限价止损和相对定单。
竞价	该区域反映了止损和止损限价定单的*选择*价格，相对和追踪止损定单的*抵消金额*。您能够在默认定单设定框中设定这些辅助数量。
基点	与期货 EFP 一起使用。基点值等于内在利率× 100。
状态	定单状态。参见系统颜色指南以获取细节。

合约描述栏

栏名称	描述
合约描述	
描述	识别工具类型和其他描述性的合约信息。
交易所	市场数据交易所。如果在目的地区域中没有其他交易所被指定，它将同样是合约被传递的交易所。选择 SMART 定单传递，将定单直接传递至可用的最佳市场。
代码	合约的交易所代码。
底层证券	显示底层证券代码。注意，如果您想要在交易窗口中有一个单个的底层证券区域，其下面没有定单区域，那么同时选中市场数据和定单管理的底层证券区域。

有效时间栏

栏名称	描述
有效时间	
到期日期	对 GTD （到期前有效）定单。保持定单为活动的，直到您输入的日期市场关闭时。日期格式为年年年年 / 月月 / 日日。
到期时间	对 GTD （到期前有效）定单。 保持定单为活动的，直到您在*到期*日期区域输入的日期的时间之前。
到时后有效	在指定的时间过去之后，激活定单。
有效时间	您的定单保持活动的时间跨度。默认情况下，有效时间为日，意味着截至市场关闭时您的定单任何没有执行的部分将被系统取消。

数量栏

区域名称	描述
数量	
显示尺寸	输入一个显示尺寸来创建冰山定单。
最低数量	输入最低可接受的数量，其必须可用于定单执行。
数量类型	与数量值区域一道使用 ，根据您的说明自动地计算定单数量。
数量值	与数量类型区域一道使用，根据您的说明自动地计算定单数量。
总数量	最初定单的总数量。

基于价格的栏

栏名称	描述
价格	
当前价格	定单在交易所的当前工作价格。
全权委托数量	与限价定单一起输入一个全权委托数量来创建全权委托定单。
限价抵消	用于追踪限价止损定单来决定合约的限价。

栏名称	描述
百分比抵消	根据偏离最佳出价或要价的百分比创建一个抵消价格。使用 0 — 1 之间的小数值。
止损价格	止损和限价止损定单的选择价格，以及追踪止损和追踪限价止损定单的初始止损价格。

行动栏

栏名称	描述
行动	
取消	点击取消定单。
传递	点击将定单发送至定单目的地。

可调整的止损栏

栏名称	描述
可调整的止损	
可调整的定单类型	当止损、限价止损、追踪止损或追踪限价止损定单的触发价格被触及时，提交的定单价格。
可调整的止损限价	可调整的限价止损或追踪限价止损定单的初始限价。
可调整的止损价格	可调整定单的新止损价格。
可调整的追踪金额	追踪止损或追踪限价止损定单的新追踪金额。
触发价格	触发对止损、限价止损、追踪止损或追踪限价止损定单的一次性调整的价格。

波动率栏

栏名称	描述
波动率	
连续更新	如被选中，期权限价将根据底层证券价格的显著移动被自动地更新。同样用于期货转现货。
对冲辅助价格	如果需要，为需要另一个价格区域的 delta 中性定单类型输入辅助价格。
对冲定单类型	为 delta 中性的交易定义一个定单类型。它将与您的波动率定单的动态管理一道被提交。
参考价格类型	对动态波动率定单。选择 NBBO 或买卖报价的平均值来被用作参考价格。
底层证券范围 （高）	波动率定单可选的股票价格范围高端。如果底层证券的价格涨至该数值以上，定单将被取消。
底层证券范围 （低）	波动率定单可选的股票价格范围低端。如果底层证券的价格跌至该数值以下，定单将被取消。
波动率	显示期权在特定行权的波动率。
波动率类型	对波动率定单显示年度或每日的内在波动率计算。

期货转现货栏

栏名称	描述
期货转现货	
连续更新	对期货转现货。如被选中，限价将根据基点的移动被自动地重新计算。
利率	对期货转现货。

挂钩股票栏

栏名称	描述
挂钩股票	
Delta	用于挂钩股票定单。该数值以百分比被使用，并被乘以底层证券价格的改变量。该数值被添加到起始价格以决定看涨期权的价格。
股票参考价格	用于挂钩股票期权定单的可选数值。如果留为空白，则使用 NBBO 中点。该数值从当前 NBBO 中点被扣除，以决定股票价格的变动。
底层证券范围 （高）	挂钩股票定单可选的股票价格范围高端。如果底层证券的价格涨至该数值以上，定单将被取消。
底层证券范围 （低）	挂钩股票定单可选的股票价格范围低端。如果底层证券的价格跌至该数值以下，定单将被取消。

定单属性栏

栏名称	描述
定单属性	
全或无	将定单标记为 AON，以确保定单将除非 / 直到全部数量可用时才会执行。
大额	将您的高交易量限价定单标记为大额定单。 您可能想对大交易量定单考虑使用分段交易者。
考虑成本	如被选中，智能路由器在决定将您的定单传递至哪里时，将考虑交易成本，包括佣金。
隐藏	打勾创建隐藏定单。
隐藏美分	对以美分报价的美国期权定单，将美分从市场中隐藏。
ISE 定单类型	对国际证券交易所 （ISE）的中点匹配定单，从两种定单类型中选择。*标准*定单被作为市价或限价定单输入，但不被显示给交易人群。标准定单支持立刻执行或全数取消 （IOC）定单属性。 *SOI （利息筹集）*定单将代码广播给 ISE 中点匹配用户。这些定单的最小定单数量为 2000。
无保障的	打勾，表明您将承担智能传递的差价定单被部分执行的所有风险。
OCA （一取消全）组	允许您在不打开定单卡片窗口的情况下，创建一取消全高级定单组。
建仓 / 平仓	指定定单是要开立 （或增加）头寸，还是要关闭 （减少）头寸。
来源	定单来自的客户类型。主要被用于机构账户。
保留时间优先	打勾将您的定单保留在队列中，不考虑发生的交易所费用。
股东	交易加拿大产品的大股东使用的标签。
一扫光	打勾以创建一扫光定单。
触发方式	显示带有所有可用的触发方式列表的下拉区域。这允许您对每个定单选择新方式。

状态栏

栏名称	描述
状态	
目的地	传递目的地。
键	系统创建的键，用来识别捆绑式限价、括号以及追踪止损定单。
交易价格	定单或定单的一部分执行的价格。

分段定单栏

栏名称	目的地
分段定单	
分段增量	该数额被用于计算分段阶梯中每个组成部分的每单位价格。注意价格增量不能为负数。
分段初始组成部分	对分段定单设定初始组成部分尺寸。
分段利润抵消	该区域中的数额指示交易平台提交获利回吐定单，并定义了您将接受以退出头寸的最低盈利金额。分段交易者将使用母组成部分的限价加上 / 减去利润抵消额，来提交一个与初始定单相对的对方获利定单。例如，如果您以 $65.00 提交了一笔 10,000 股的买入限价定单，组成部分尺寸为 1000，并输入 $15.00 作为**分段利润抵消**，一旦第一个组成部分执行，交易平台将以 $80.00 提交 1000 股卖出限价定单。使用定单卡片上的分段标签来设定高级获利定单说明。
分段后续组成部分	对分段定单设定后续组成部分尺寸。如果您将该区域留为空白，分段交易者将使用初始组成部分尺寸。

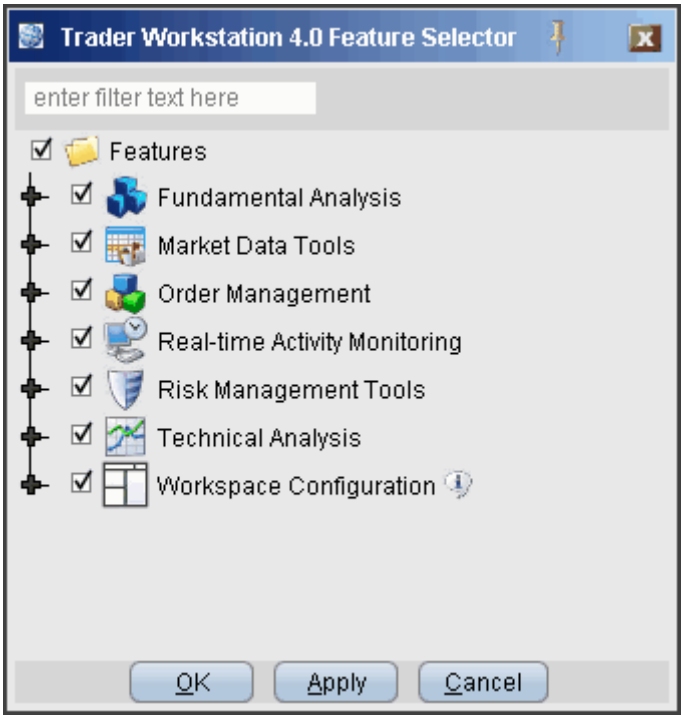
功能选择器

引言

- 打开功能选择器
- 通过菜单启用功能

打开功能选择器

功能选择器将功能按照类别和子类别分组。为了帮助您找到您要寻找的内容，使用窗口顶部的文本**搜索**框。列表被过滤，只显示那些包括了您在标题中输入的文本的功能。要清除搜索并再次显示所有类别，点击出现在**搜索**框右侧的*清除*图标。



打开功能选择器

- 在**配置**菜单上选择*功能选择器*。

您能够通过单击禁用整个类别的功能，或者使用展开 / 收起图标向下钻取到一组之内的特定功能。

使用功能选择器来禁用 / 启用功能

1. 点击删除功能或功能组旁边的选中标记。
2. 点击展开图标向下钻取到一个组中。

您同样能够从菜单中启用功能。

通过菜单启用功能

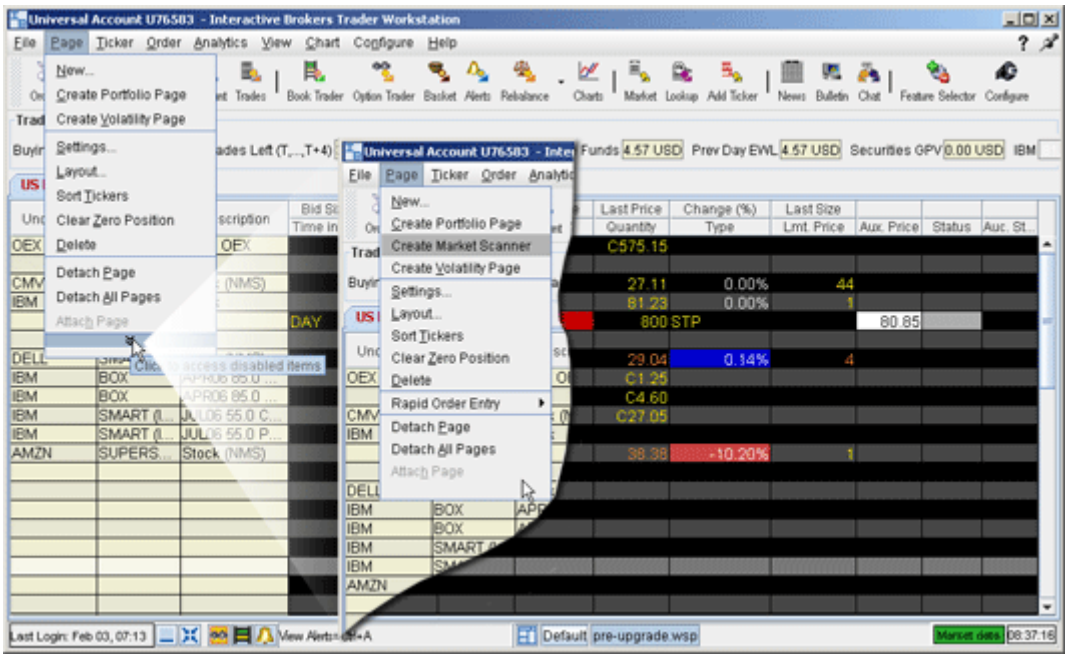
功能选择器可通过**配置**菜单或通过点击工具栏上的**配置**图标进入，它允许您禁用您不使用的功能。这些被禁用的功能从菜单和屏幕中被隐藏起来。您现在能够在任何时候启用这些功能，而不需要在功能选择器中通过展开菜单显示被禁用的功能来搜索它们。

从功能菜单中启用功能

包含了被禁用功能的菜单，在最后的菜单命令之后显示了一个双 “扩展” 箭头。

1. 在被选定的菜单底部点击双箭头。
2. 被禁用的功能现在出现在菜单中，以深灰色被强调。选择您想要使用的功能。
3. 对问题 “您想要现在启用该功能吗？” 点击**是**。

功能被启用，并将在适当的时候变为活动的。例如，如果您选定了一个底层证券，并选择启用市场深度，市场深度窗口将在您点击 “是” 之后对选定的底层证券打开。如果您没有选定底层证券，市场深度功能将被启用，但不会打开，因为其没有要显示的数据。



配置定单预设

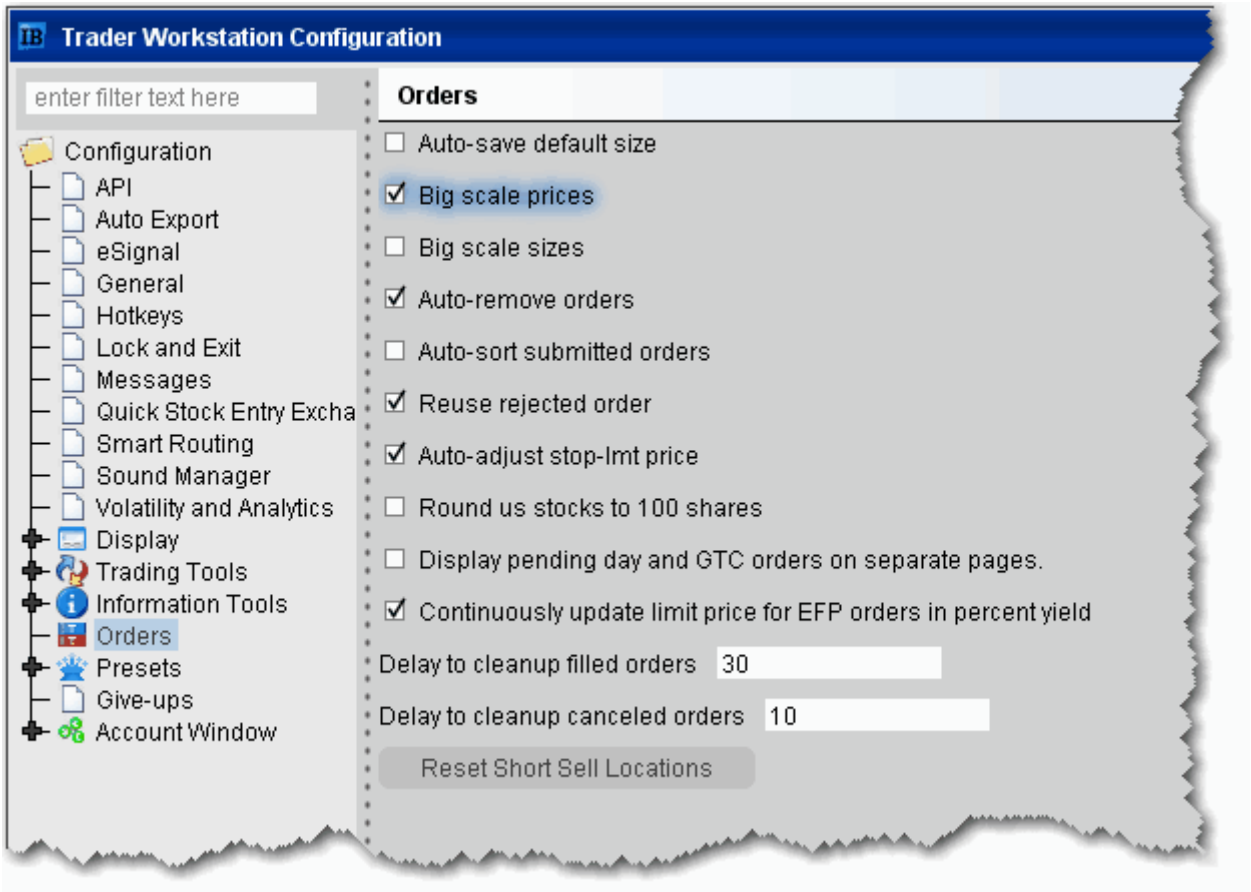
引言

使用定单配置页面来指定全局默认设定。使用定单预设功能来创建多个命名的定单默认策略。

- 定单 — 默认设定
- 定单预设策略
- 修改默认抵消金额
- 修改止损触发方式

定单 — 默认设定

使用定单页面来定义一般、全局默认设定。



定义一般定单配置设定

1. 在**配置**菜单上选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中点击*定单*。
3. 使用**定单**页面来设定以下参数：
   - **自动保存默认尺寸** — 当被选中，您对定单数量所作的任何更改，在定单传递后被保存为该工具类型的默认尺寸。
   - **大规模价格** — 当被选中，用在价格向导中的增量将被提高。价格向导展示了一系列高于或低于定单价格的价格，当您在定单行的*价格*区域中点击并握住光标时它将被触发。
   - **大规模尺寸** — 当被选中，用在尺寸向导中的增量将被提高。尺寸向导展示了一系列高于或低于定单尺寸的数量，当您在定单行的*数量*区域中点击并握住光标时它将被触发。
   - **自动删除定单** — 该功能默认被选中。当不选中，已执行的和已被取消的定单将同时保留在交易页面和待处理页面中。

- **自动将已提交的定单分类** — 该功能默认被选中。当不选中，对相同底层证券创建的定单不再根据限价被分类。
- **重新使用被拒绝的定单** — 如被选中，被拒绝的定单将保留在交易页面中。
- **自动调整限价止损价格** — 如被选中，当您修改止损价格时，限价止损定单中的限价将自动地被调整。限价根据您在创建定单时定义的抵消金额调整。
- **将美国股票取整到 100 股** — 如被选中，系统将会取整定单数量至最近的 100 股。
- **在不同的页面上显示待处理的当日定单和取消前有效定单** — 如被选中，待处理的定单将按照有效时间为“取消前有效”和“当日”被分开，显示在不同的页面上。
- **以收益率百分比连续地对 EFP 定单更新限价** — 如被选中，交易平台将连续地对 EFP 定单更新限价，价格以“百分比收益率”被输入。要以百分比收益率输入价格，右键点击价格栏头部，并选择*显示百分比*。
- **推迟清除被执行的定单** — 让您增加或减少已执行的定单从交易窗口中被删除之前的秒数。
- **推迟清除被取消的定单** — 让您增加或减少已取消的定单从交易窗口中被删除之前的秒数。

重设卖空地点按钮 — 只针对非清算的客户或能够清除的客户。默认情况下，交易平台记住您在下达卖空定单时分配了多少股。点击该按钮将清除该记忆。

定单预设策略

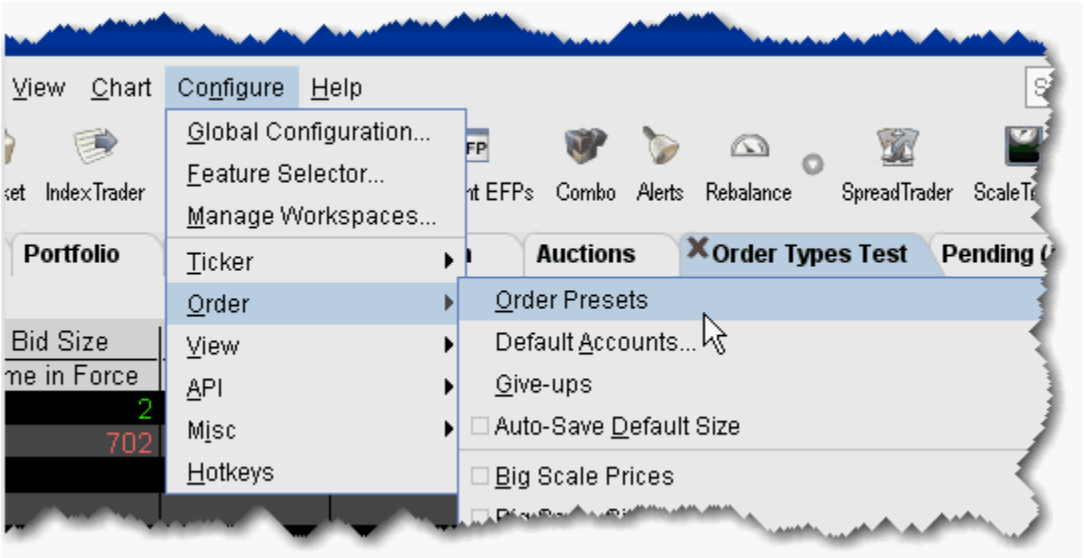
引言

定单预设功能允许您对每种工具类型和每个代码创建和保存多个命名的定单默认策略。活动的预设被用作每种工具类型的默认值。从代码行中使用预设下拉区域，将不同的定单策略应用于该代码的所有新定单。

- 创建定单预设
- 从交易窗口中使用预设

创建定单预设

预设通过允许您在工具水平或代码水平创建多个定单默认集合，并使用*预设*区域从交易页面应用它们，扩展了默认定单设定的有用性。



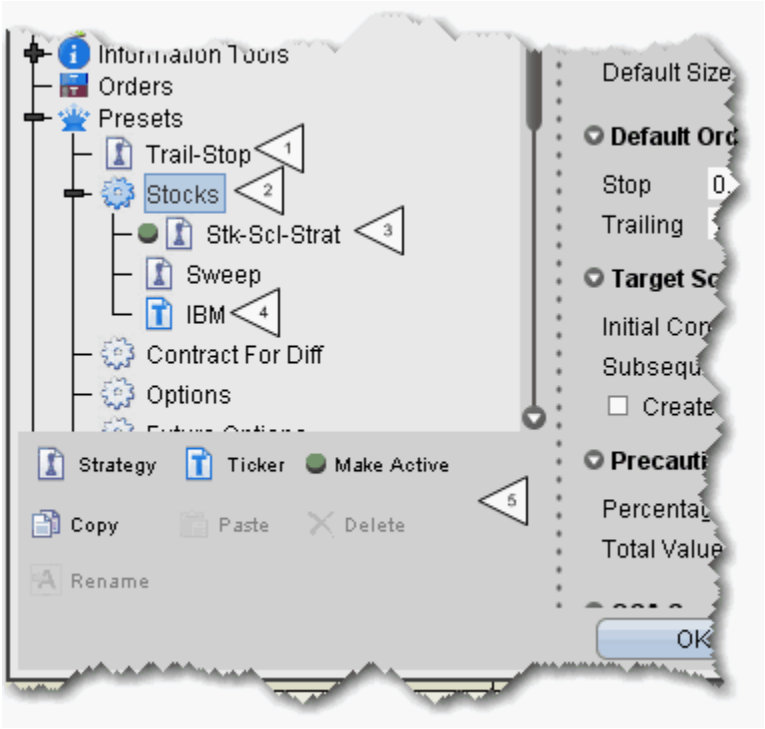
配置预设

1 从**配置**菜单中，选择*定单*，然后选择*定单预设*。

Note: *全局配置打开时，将注意力放在左侧目录中的**预设**类别。*

2 选择您想要定义预设的工具，并在左侧目录底部点击策略图标。

3 输入名称并点击确定。

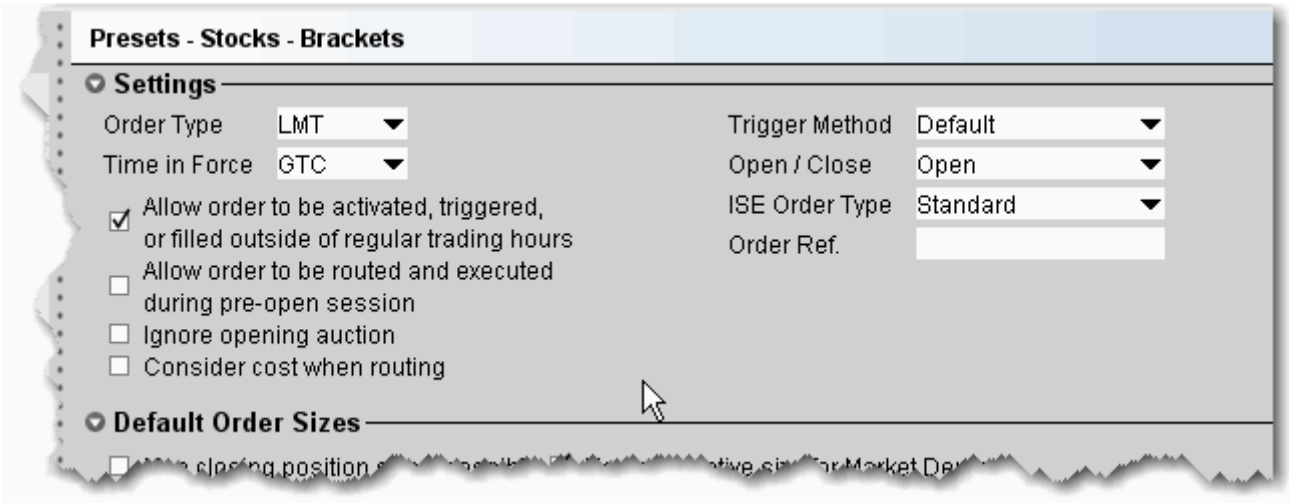


4 新策略在左侧目录中被强调，与其相关的定单默认页面在右侧。编辑您想要与定单策略关联的定单区域，并点击确定。下表中被编号的描述与上面的图片相对应：

1	在顶级预设水平定义的策略，例如本例中的追踪止损，能被应用于任何工具类型，但不能被指定为 “活动的”。
2	顶级工具类型是对该类型所有合约的默认定单预设，直到另一个被设为活动的。工具水平预设出现在顶级工具类型之下，并且只能从该工具类型的代码的预设下拉列表中获取。
3	对每个工具可以有一个活动的预设。活动的预设根据绿球来识别，并变为该类型所有合约的默认定单策略。在上面的例子中，当您创建定单时，所有页面上的所有股票合约将使用 Stk-Scl-Strat 定单默认值。在市场数据线上使用预设下拉列表，对任何合约选择一个不同的预设。
4	代码水平的预设变为该代码的默认值，且不可用于任何其他代码，即使工具相同。
5	预设图标功能如下： *策略* — 点击，对选定的水平创建一个新的预设策略，可以是顶级、工具水平或者代码水平。 *代码* — 当您选定一个工具类型时它变为可用的。点击创建代码水平的预设。 *使活动* — 点击使选定的预设对该工具类型的所有代码都变为活动的，除了那些有已定义的代码水平预设的代码。 *复制* — 从选定的预设中复制策略设定。 *粘贴* — 用复制的设定覆盖来自选定预设的设定。 *删除* — 无确认消息地删除选定地预设策略。 *重命名* — 更改选定预设的名称。

您能够对每个预设定义的默认值，根据您选择的工具 / 合约有微小变化。您能够设定的默认值被定义在下表中。

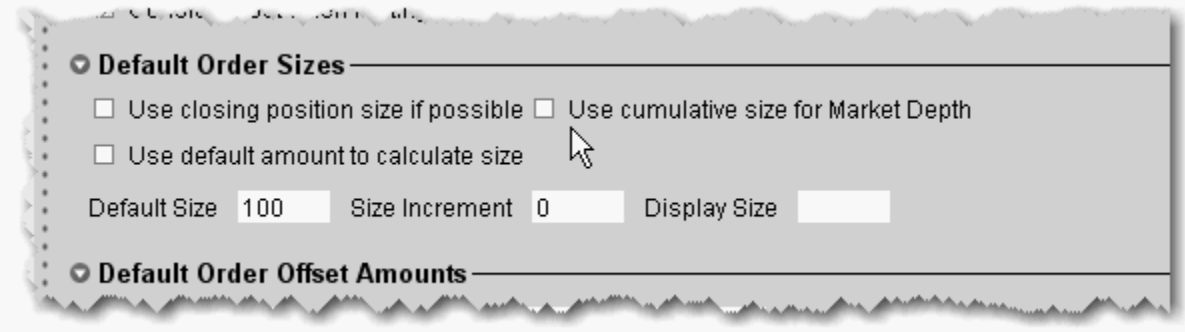
设置



区域名称	描述	注释
定单类型	设定将被默认使用的定单类型。	
触发方式	触发方式被用来触发止损、限价止损、追踪止损以及追踪限价止损定单。	
有效时间	有效时间决定了定单将在其目的地保持工作状态多久。	
建仓 / 平仓	设定开立新头寸或关闭头寸的默认值。	被用于 IB 执行服务客户。
ISE 定单类型	标准的定单是完全匿名的。SOI 定单将代码广播给其他 ISE 中点匹配成员，并可能获得执行优先权。	
定单参考	定义与市场相关的您的定单来源。	
允许定单在常规交易时段之外被激活、触发或执行	如果不选中，交易时段由定单目的地的开盘 / 收盘时间决定，止损定单将不会在常规交易时段之外触发。	对在主要交易所上市的美国股票有效。请注意，*仅常规交易时段*的期权不可以用于未在交易所列举的特定产品。IB 客户只有责任确保该参数适用于涉及的产品。 不可用于 IOC、开盘 （开盘市价和开盘限价）、全数执行或立刻取消、收盘市价或收盘限价定单。
允许定单在开市前时段被传递和执行	选中，允许定单参与 4:00 — 8:00 am 的开市前时段。	能够被应用于仅为常规交易时段设定的定单。
忽略开盘竞价	选中，忽略发生在开盘时的开盘竞价。	能够被应用于仅为常规交易时段设定的定单。 如果您配置了智能路径来参与开市前预传递，则该属性不能被使用。

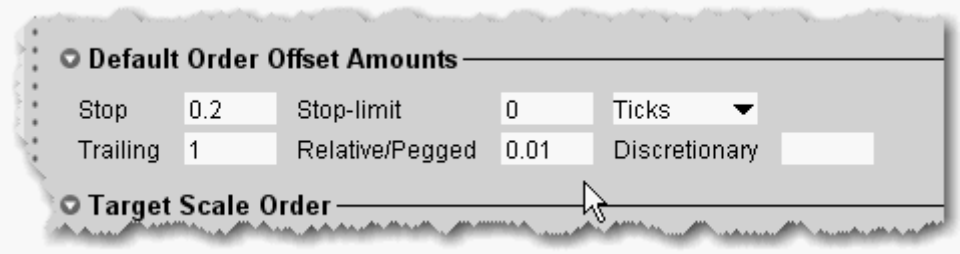
区域名称	描述	注释
当传递时考虑成本	如被选中，当决定将定单传递至何处时，智能路径将考虑执行定单的总成本，包括佣金和其他费用。如果不被选中，只有交易所价格会被考虑。	您的定单可能不会以最优的交易所价格执行，因为我们考虑了账户总价格，包括佣金。 只对传递至法兰克福证券交易所（FWB）的股票有效。
隐藏美分	对智能传递的期权：如被选中，将从市场中隐藏您定单上的美分。	注意，尽管您隐藏了您的美分价格，您的取整后的定单（对买入定单**向下**取整到五分或一角增量，对卖出定单则**向上**取整）仍然将被传递到一个期权交易所来显示。

默认定单尺寸



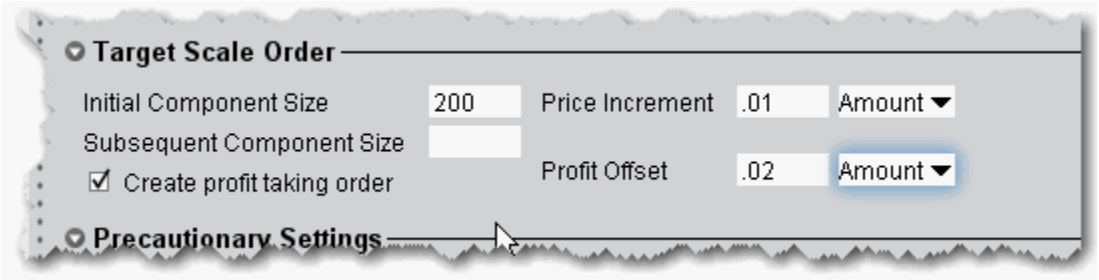
区域名称	描述	注释
如果可能，使用平仓头寸尺寸	**当被选中**，如果您持有资产的头寸，系统将创建等于您的建仓头寸数量的定单，基于的假设是您想要将您的头寸平仓。如果您不持有头寸，系统将使用默认的定单尺寸。	
对市场深度使用累积尺寸	**如被选中**，当您从总市场深度窗口的任何一行创建定单时，定单尺寸被设定为总累积尺寸×100。否则，定单尺寸将等于默认的定单数量。	
使用默认金额来计算尺寸	**如被选中**，默认定单尺寸将根据您在该页面的*默认金额*区域输入的货币金额进行计算。被计算的定单尺寸随后作为默认金额被显示在交易页面的*数量*区域中。	
默认尺寸 / 默认金额	默认定单尺寸。	如果您选中**使用默认金额来计算尺寸（如上）**，区域名称将更改为默认金额。
尺寸增量	当使用尺寸向导时，定单尺寸增大 / 减小的间隔将被显示出来，或者当使用热键时，数量增加 / 减少的数额将被显示出来。	
显示尺寸	将对冰山定单显示的默认金融。	

默认定单抵消金额



区域名称	描述	注释
止损	偏离当前市场价格的金额或最小报价单位数量，将被用于让自动止损定单设定止损选定价格。该数值被用于计算附加括号定单的止损价格和限价。	使用最小报价单位 / 金额下拉可选项来指定您想要使用哪种类型的抵消。
限价止损	偏离当前市场价格的金额，将被用于让限价止损定单设定止损选定价格。**只有当您首先将默认定单类型设为限价止损时，该区域才适用。**	
追踪	偏离当前市场价格的金额，您想要止损价格根据它来追踪。	输入数值，再使用金额 / 百分比下拉列表来指定该数值的单位。
相对 / 挂钩	将被添加到最佳出价 （对买入定单）和从最佳要价中被扣除 （对卖出定单）的金额，用来创建相对定单将被提交的限价。	
全权委托	被添加到限价或从限价中被扣除的一笔额外金额，用来帮助确保定单将执行。	

目标分段定单

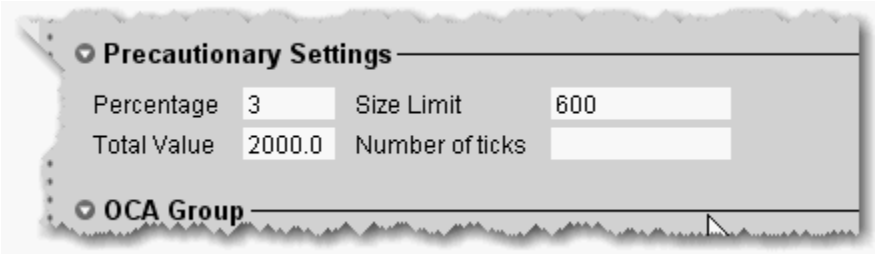


如果您从附加定单列表中选择添加目标分段定单，这些数值将被用作默认值。

区域名称	描述	注释
初始组成部分尺寸	对分段定单的初始组成部分设定一个默认尺寸。	
价格增量	增量金额，每个后续的组成部分的价格将根据该金额变动。	
后续组成部分尺寸	对分段定单的所有剩余定单组成部分设定组成部分尺寸。	留作空白，对所有组成部分使用*初始组成部分尺寸*。
创建获利回吐定单	选中，让交易平台自动创建对方获利定单。	
利润抵消	为对方获利定单定义将被添加到最后执行组成部分价格或从其中被扣除的金额。	

预防设置

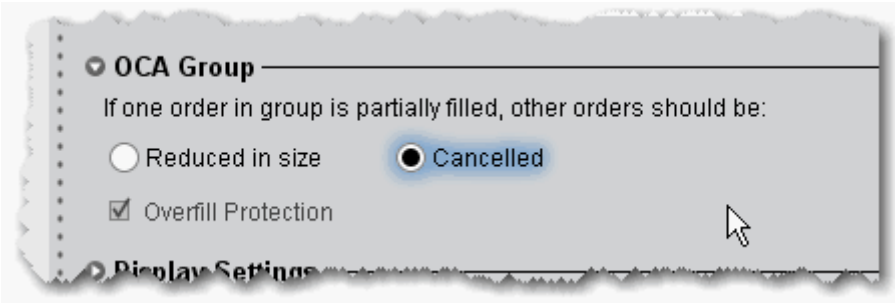
预防值被系统用作安全检查。如果您提交了违背任何这些客户化设置的定单，您将必须确认您在交易平台传递定单之前将其传递的意图。



区域名称	描述	注释
百分比	该选项被创建作为安全网，用来阻止您传递被错误键入限价的限价定单。如果您尝试传递价格位于计算的偏离市价百分比之外的限价定单，您将收到一条消息，要求您证实您确实打算在传递定单之前输入该偏离百分比的价格。使用的市场价格为当您传递定单时显示在出价 （卖）或要价 （买）区域中的价格。该选项能够被留作空白。	
尺寸限制	限制*数量*区域中的数值。如果您输入一个较高的值，您能够通过在警告框中点击是来覆盖默认尺寸限制。	
总价值	如果您传递一个定单，其价格超过了您指定的总货币金额，您将收到一条消息，告诉您总价值限制被违背了，且您必须确认无论如何您都想要提交定单。	

区域名称	描述	注释
最小报价单位数量	像上面的*百分比*选项一样，最小报价单位数量同样是一个安全网，阻止您传递被错误键入限价的限价定单。如果您尝试传递价格位于计算的偏离市价最小报价单位数量之外的限价定单，您将收到一条消息，要求您证实您确实打算在传递定单之前输入该偏离最小报价单位数量的价格。使用的市场价格为当您传递定单时显示在出价 （卖）或要价（买）区域中的价格。该选项能够被留作空白。	

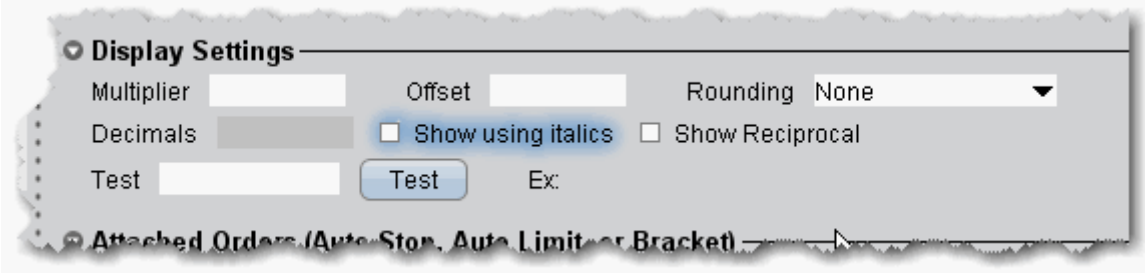
OCA （一取消全）组



使用一取消全定单属性，让相关的定单彼此之间联合工作。

区域名称	描述	注释
如果组里的一个定单被部分地执行，其他定单应当被……		
减小尺寸	默认设置为让 OCA 组里的其他定单根据执行部分的数量，按比例地被减小尺寸。	
取消	组里的所有其他定单被取消。	
过度执行保护	如被选中，则规定每一次组里只有 1 个定单将被传递至交易所。该策略完全去除了过度执行的可能性。	

显示设置



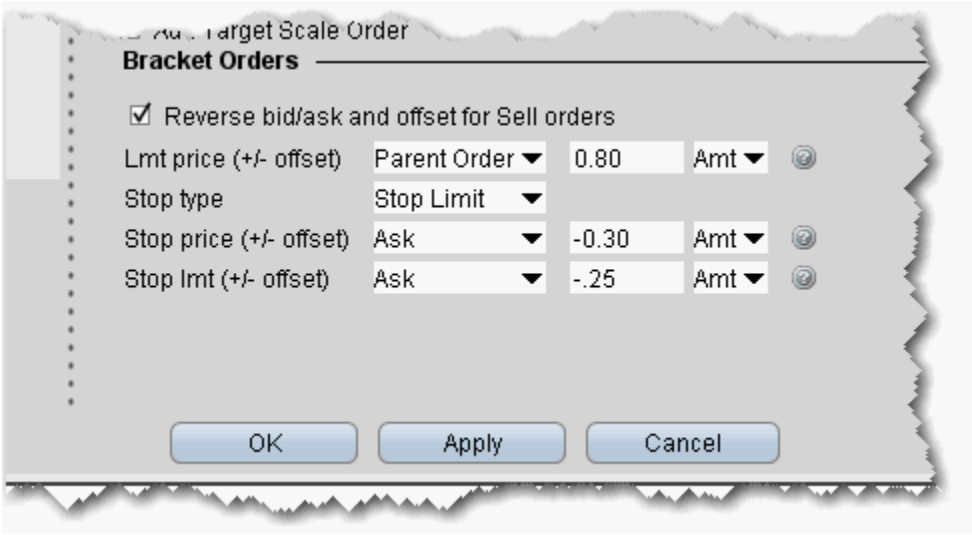
显示设置改变了数值被显示在交易窗口上的方式。

区域名称	描述	注释
乘数	将价格乘以该数值。	
抵消	您能够使用它来抵消显示的价格，例如对特定的期货合约。比如说，ES 出价 / 要价为 1314.75/1315.00。首先，在中间窗格中选择*期货*，然后在栏底部点击**添加**按钮并输入 ES。输入抵消金额 1300。要查看它将如何显示，在*测试*框中输入 1314.75 并点击**测试**按钮。例子显示为 14.75。	
取整	将默认设置无改为取整、最近有效价格或截断。使用测试输入区域来输入一个数值，能够点击测试来查看结果。	
小数	覆盖默认的 2 位小数价格显示。	
使用斜体字显示	将价格数据以斜体显示。	
显示倒数	重新将报价计算为 1/ 报价。该设置允许亚洲合约以熟悉的本地格式被查看。	您能够通过在左侧窗格列表下方使用添加按钮，将倒数显示应用于特定的合约。选择一个工具类型，点击添加，然后输入代码。强调该代码并点击显示显示倒数。
测试	被用来测试您所作的显示更改。输入一个假设价格值，然后点击*测试*按钮。所有的显示设置更改被应用，结果如例子所示。	

附加定单

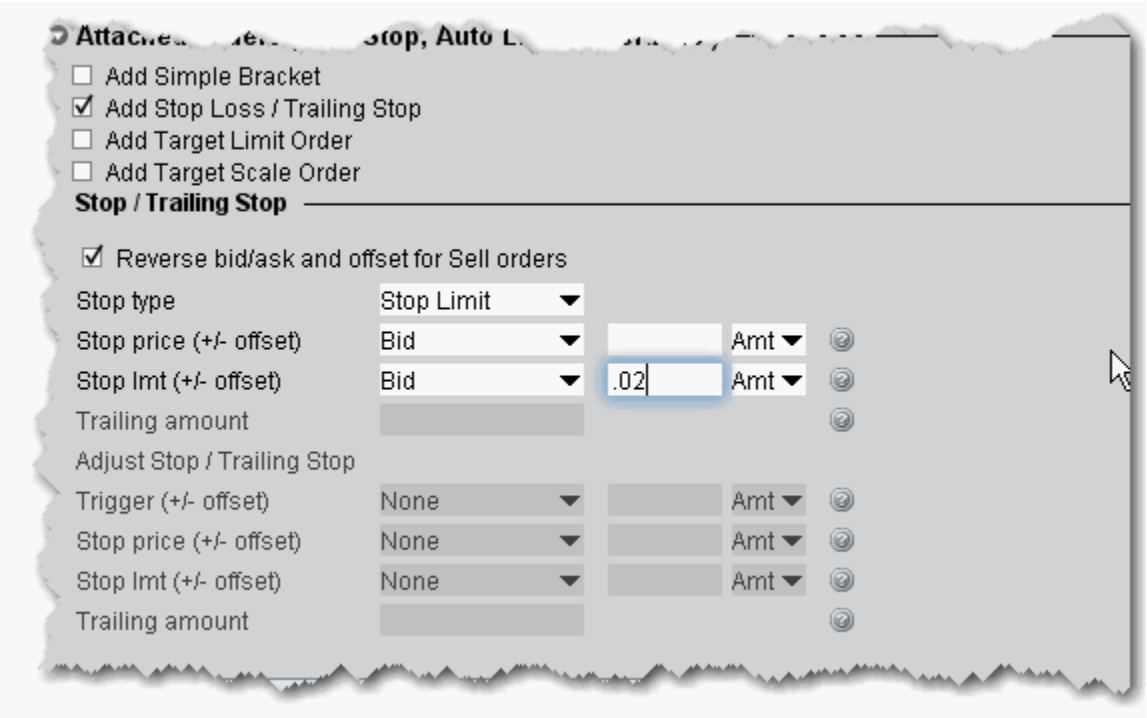
选择将简单的括号、止损、追踪止损、对方目标限价或目标分段定单附加到现有的定单。当您附加一个定单，最初的定单也被称为 “母” 定单，而被附加的定单则被称为 “子” 定单。

添加简单括号 — 打勾让一系列的定单为您最初的定单加括号。为括号定义默认值，其能够在每笔定单基础上被修改。要获取关于设置括号定单的细节，参见用户指南的定单类型部分。



区域名称	描述	注释
对卖出定单使用相反的出价 / 要价和抵消金额设置	打勾将设置应用于买入定单，并让交易平台对卖出定单应用相反的设置。	根据上面的数值，对买入定单，限价括号定单的限价将为最初的定单价格加上 80 美分。对卖出定单，为最初的母定单价格减去 80 美分。
限价 （＋ / －抵消金额）	选择用来对括号限价定单设定限价的标准。	定义一个可选的抵消金额，它将被添加到计算的限价中，或从限价中被扣除。
止损类型	定义止损定单类型，以用于止损括号。	
止损价格 （＋ / －抵消金额）	选择用来对括号止损定单设定止损选定价格的标准。	定义一个可选的抵消金额，它将被添加到计算的止损选定价格中，或从止损选定价格中被扣除。
限价止损 （＋ / －抵消金额）	如果您选择限价止损作为上面的止损类型，选择用来对括号止损定单设定止损限价的标准。	定义一个可选的抵消金额，它将被添加到计算的止损限价中，或从止损限价中被扣除。

添加止损 / 追踪止损 － 打勾将止损、限价止损、追踪止损或可调整定单附加到最初的定单。

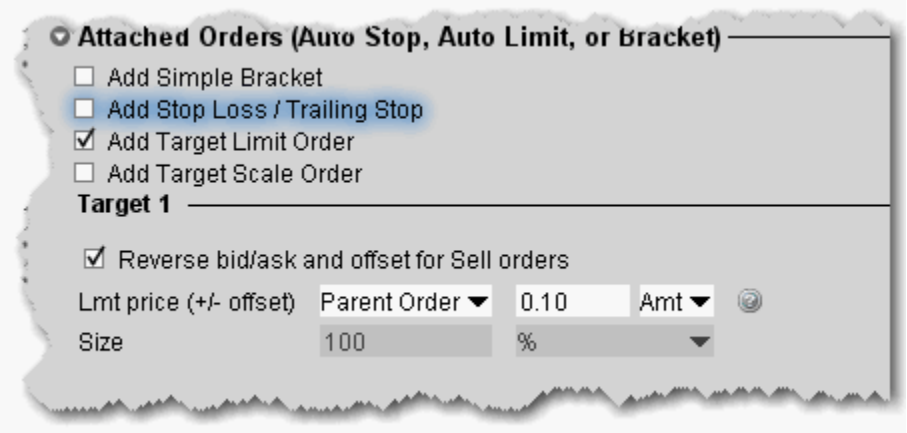


注意，区域对上下文敏感，如果它们不适用于您选定的止损类型，将变为灰色。

区域名称	描述	注释
对卖出定单使用相反的出价 / 要价和抵消金额设置	打勾将设置应用于买入定单，并让交易平台对卖出定单应用相反的设置。	如果您对买入定单指定了 10 美分的抵消金额标准，那么相同的抵消金额将被应用于卖出定单，为负 10 美分。
止损类型	定义要附加的止损定单类型。	
止损价格 （＋ / －抵消金额）	选择用来设定止损选定价格的标准。	定义一个可选的抵消金额，它将被添加到计算的止损选定价格中，或从止损选定价格中被扣除。
止损限价 （＋ / －抵消金额）	选择用来对括号止损定单设定止损限价的标准。	定义一个可选的抵消金额，它将被添加到计算的止损限价中，或从止损限价中被扣除。
追踪金额	定义一个追踪金额。	
触发 （＋ / －抵消金额）	选择用来触发可调整定单的标准。	定义一个可选的抵消金额，它将被添加到计算的触发价格中，或从触发价格中被扣除。

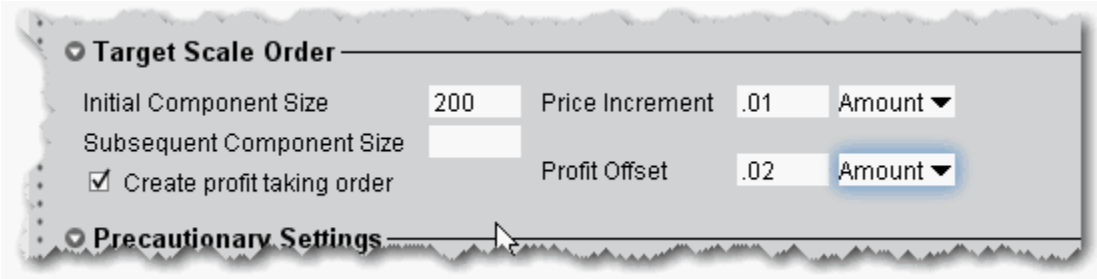
区域名称	描述	注释
止损价格 （＋ / －抵消金额）	选定用来设定新的止损价格的标准。	定义一个可选的抵消金额，它将被添加到计算的止损价格中，或从止损价格中被扣除。
止损限价 （＋ / －抵消金额）	选择用来设定新的止损限价的标准。	定义一个可选的抵消金额，它将被添加到计算的止损限价中，或从止损限价中被扣除。
追踪金额	定义一个追踪金额以使用追踪止损定单。	

添加目标限价定单 － 打勾，自动地将对方限价定单附加到最初的定单上。



区域名称	描述	注释
对卖出定单使用相反的出价 / 要价和抵消金额设置	打勾将设置应用于买入定单，并让交易平台对卖出定单应用相反的设置。	如果您对买入定单指定了 10 美分的抵消金额标准，那么相同的抵消金额将被应用于卖出定单，为负 10 美分。
限价 （＋ / －抵消金额）	选择用来设定限价的标准。	定义一个可选的金额或限价百分比标准，它将被添加到限价中，或从限价中被扣除。
尺寸	定单尺寸等于最初的限价定单的尺寸。	

添加目标分段定单 － 打勾将分段定单附加到最初的定单。要获取更多信息，参见交易平台用户指南的分段定单部分。



区域名称	描述	注释
初始组成部分尺寸	对分段定单的初始组成部分设定一个默认尺寸。	
价格增量	增量金额，每个后续的组成部分的价格将根据该金额变动。	
后续组成部分尺寸	对分段定单的所有剩余定单组成部分设定组成部分尺寸。	留作空白，对所有组成部分使用*初始组成部分尺寸*。
创建获利回吐定单	选中，让交易平台自动创建对方获利定单。	
利润抵消	为对方获利定单定义将被添加到最后执行组成部分价格或从其中被扣除的金额。	

从交易窗口中使用预设

要使用预设定单默认策略，只须在您的交易窗口上从代码行的预设区域中选择它即可。注意以下几点：

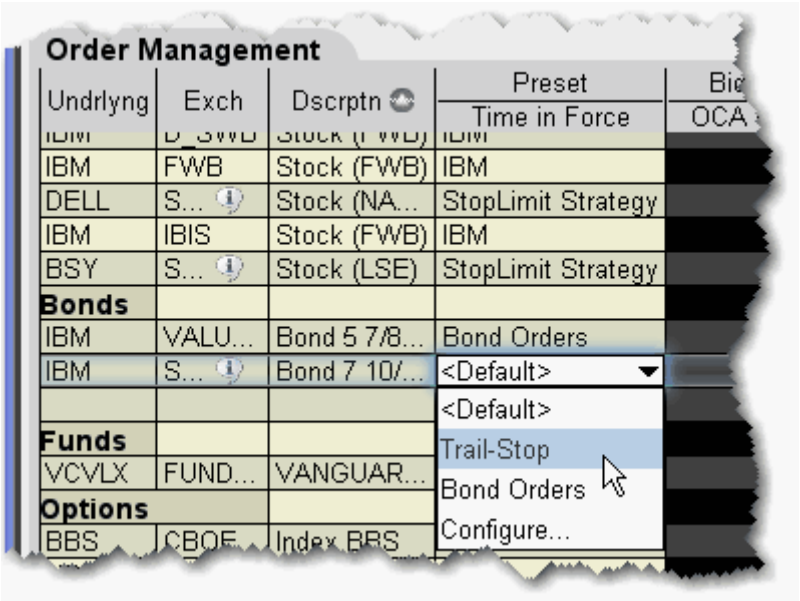
- 在顶级预设水平创建的预设可用于任何工具。
- 在工具水平创建的预设只可用于该工具。
- 代码水平 — 对特定的代码只能创建一个预设，且它只能被用于该代码。代码水平的预设被用作该代码的默认设置。

从交易窗口中使用预设区域

1 右键点击区域标题行并选择*客户化版式*。

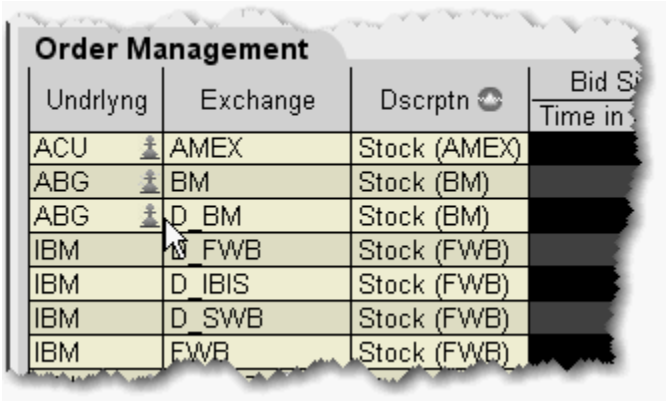
2 从定单预设类别中，选择*预设*并**添加**到已显示的栏列表中。

3 从市场数据线中点击预设下拉列表，来查看可用于被选定代码的预设策略。



Note: 现有客户：每个顶级水平的工具策略使用最初您定义的定单默认值，除非您选择复制和粘贴一个新的数值集合。

显示的数值为该工具类型或代码的默认策略；从下拉列表中选择一个新的策略。列表包括了所有全局预设和所有工具水平的预设。默认值为在全局预设中定义的当前活动的策略。新定单将使用显示的预设策略。如果您更改策略，更改将不会应用于现有的定单。



如果页面没有显示*预设*栏，那么一个策略图标会出现在任何应用了客户化策略的代码旁边。如果策略图标没有被显示，则代码使用默认的工具类型定单默认值集合。

修改默认抵消金额

1 在**配置**菜单上，点击*定单*，然后点击*定单默认值*。

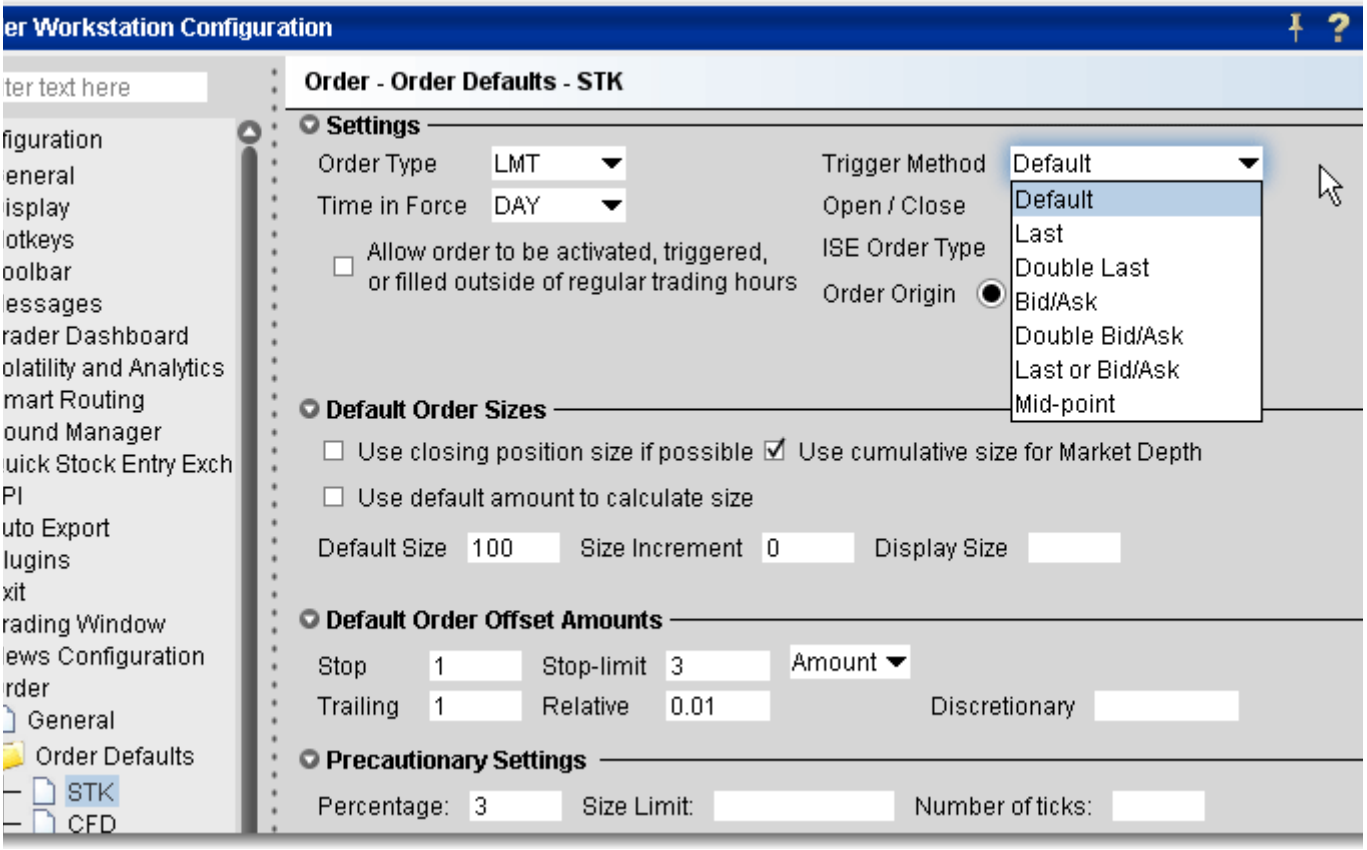
2 在中间的窗格中，选择您想要修改抵消金额的工具类型。

3 在右侧窗格的**默认定单尺寸和抵消**区域中，您能够修改止损抵消、追踪金额、相对金额和全权委托金额。

Note: *要对特定的合约而不是工具类型设定默认的抵消金额，选择工具类型，并在工具类型列表的底部点击**添加**按钮。输入底层证券代码并点击确定。*

修改止损触发方式

您能够使用定单卡片，对止损、限价止损、追踪止损和追踪限价止损定单在每笔定单基础上修改触发方式。您能够在**定单默认值**配置页面上使用*触发方式*下拉列表，对一个产品类型设定默认触发方式。



更改默认触发方式

1. 在**配置**菜单上，选择*全局配置*。
2. 在左侧目录中，选择*定单*，然后选择*定单默认值*。选择一个产品类型。
3. 在**触发方式**下拉列表中，选择一个将被用于所有产品类型定单的默认类型。

修改对当前定单的止损触发方式

1 在交易窗口上显示触发方式区域。

2 强调止损、止损限价、追踪止损或追踪限价止损定单，并从*触发方式*区域中选择一种方式。

触发方式	描述
默认	对纳斯达克股票 （NMS、小市值、OTC）和美国期权，默认的触发方式为双重出价 / 要价方式，当中两个连续的要价 （出价）值必须小于 （大于）或等于触发价格，并且如果第二个出价或要价与第一个出价或要价在相同的价格水平上，则前者必须有更大的尺寸。 对现货合约，默认的触发方式为出价 / 要价，当中要价 （出价）值必须小于 （大于）或等于触发价格。 对所有其他合约，默认的触发方式为*最后*方式，描述如下。
最后	对要被触发的买入 （卖出）定单： • 一个最后价格的值必须大于 （小于）或等于触发价格。 • 定单将被执行的交易所或其他市场中心必须也发布 （并且系统必须也接受）等于或高于触发价格的要价，以及等于或低于触发价格的出价。 • 最后价格必须在出价 / 要价范围内 （即 > ＝出价且 < ＝要价）或出价 / 要价之外的偏离百分比以内 （即 > ＝最后出价－ 0.5% of last 且 < ＝最后要价＋ 0.5 %）。 **Note:** 最后方式与触发价格有偏离，最多高于要价 0.5%，或最多低于出价 0.5%。该 0.5%的偏离度，有可能在任何时候没有通知的情况下被更改。
双重最后	对要被触发的买入 （卖出）定单： • 两个连续的最后价格的值必须大于 （小于）或等于触发价格，**或者** • 最后价格的值必须大于 （小于）或等于触发价格，且最后尺寸必须是增大的。
出价 / 要价	对要被触发的买入 （卖出）定单： • 单个出价 （要价）必须大于 （小于）或等于触发价格。
双重出价 / 要价	对要被触发的卖出定单： • 两个连续的要价必须小于或等于触发价格，**或者** • 一个要价的值必须小于或等于触发价格，且要价尺寸必须是增大的。 对要被触发的买入定单： • 两个连续的出价必须大于或等于触发价格，**或者** • 一个出价的值必须大于或等于触发价格，且出价尺寸必须是增大的。
最后或出价 / 要价	对要被触发的买入 （卖出）定单： • 单个出价 （要价）或单个最后价格必须大于 （小于）或等于触发价格。
中点	对要被触发的买入 （卖出）定单： • 出价 / 要价的中点必须大于 （小于）或等于触发价格。

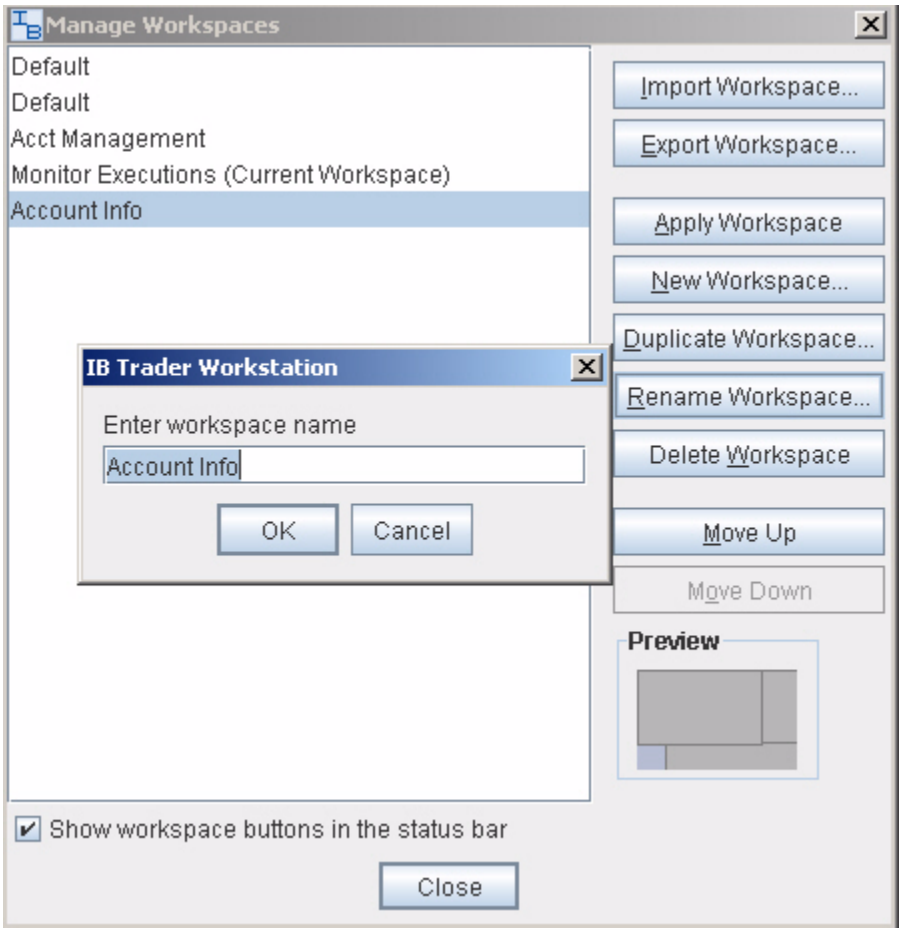
工作空间和面板

引言

- 管理工作空间
- 报价面板
- 定单面板
- 日志面板
- 交易面板
- 投资组合面板

管理工作空间

根据您的交易需要，在您的桌面上创建客户化的交易环境。当您登录时，从工具条的按钮集中选择一个工作空间。您能够创建包括了交易平台任何自包含窗口的工作空间。



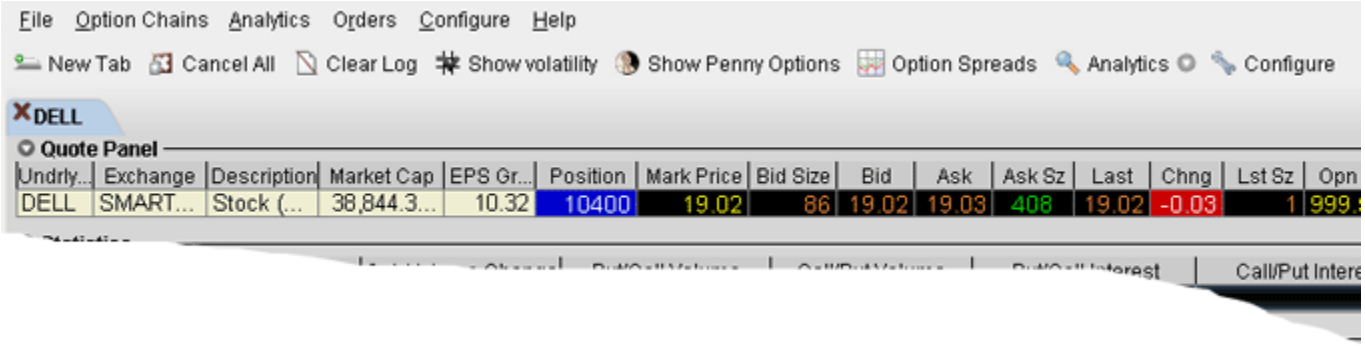
创建工作空间

1. 以任何组合和设计安排您桌面上的窗口。
2. 在**配置**菜单上选择*管理工作空间*（或者在工具栏的工作空间部分点击椭圆）。
3. 点击*新工作空间*，并输入工作空间名称。
4. 点击确定，新工作空间出现在列表中。当您登录时，最后使用的工作空间将被加载。

要删除工作空间，右键点击应用程序底部状态行上的相关工作空间图标，并选择*删除工作空间*。

报价面板

报价面板被显示在自包含的交易模块的顶部，并对页面指定的合约显示市场数据。该面板像交易屏幕上的市场数据线一样工作。点击出价来创建一个卖出定单，点击要价来创建一个买入定单。不同于交易窗口直接在代码行下创建定单，自包含的模块在定单面板上显示定单。



配置报价面板上的栏

1. 点击面板右上角的*配置*扳手图标。这样就为特定模块的面板打开了全局配置。
   - **a** 通过从**可用的栏**列表中选择区域并点击*添加*，来添加要显示的区域。
   - **b** 通过从**已显示的栏**列表中选择区域并点击*删除*，来删除区域。
2. 点击**确定**。

定单面板

使用定单面板来管理从自包含的交易模块的报价面板中创建的定单。就像从主交易屏幕中一样管理您的定单。您能够配置定单面板来隐藏或显示栏。

配置定单面板上的栏

1 点击面板右上角的*配置*扳手图标。这样就为特定模块的面板打开了全局配置。

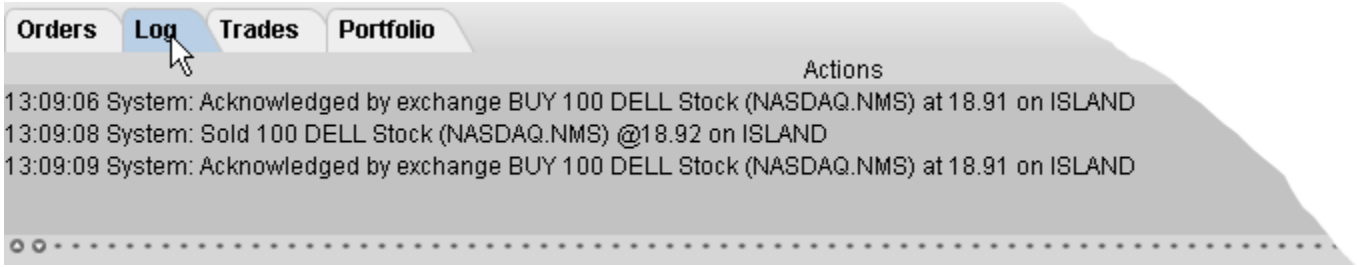
   a 通过从**可用的栏**列表中选择区域并点击*添加*，来添加要显示的区域。

   b 通过从**已显示的栏**列表中选择区域并点击*删除*，来删除区域。

2 点击**确定**。

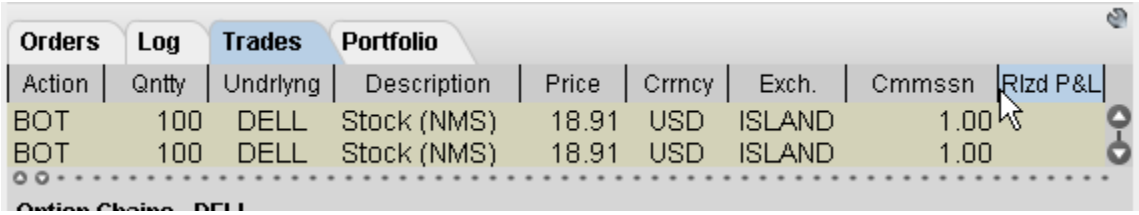
日志面板

日志面板对所有定单行动显示记录，这些行动包括来自某个自包含的交易模块的页面的传递、交易所承认、执行和取消。您能够通过点击窗口顶部的清除日志图标来删除日志内容。



交易面板

交易面板为从活动的页面传递的定单显示实时交易报告。



配置交易面板上的栏

1 点击面板右上角的*配置*扳手图标。这样就为特定模块的面板打开了全局配置。

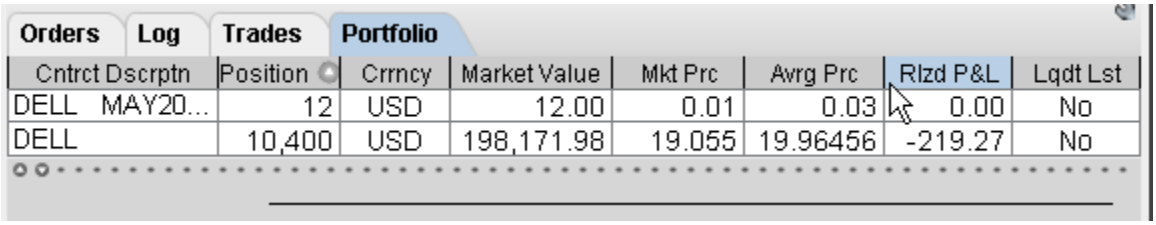
a 通过从**可用的栏**列表中选择区域并点击*添加*，来添加要显示的区域。

b 通过从**已显示的栏**列表中选择区域并点击*删除*，来删除区域。

2 点击**确定**。

投资组合面板

投资组合面板显示与头寸相关的信息，就像在账户窗口的投资组合部分看到的一样，但是只针对报价面板中的活动合约的头寸。



配置投资组合面板上的栏

1 点击面板右上角的*配置*扳手图标。这样就为特定模块的面板打开了全局配置。

   a 通过从**可用的栏**列表中选择区域并点击*添加*，来添加要显示的区域。

   b 通过从**已显示的栏**列表中选择区域并点击*删除*，来删除区域。

2 点击**确定**。

要获取有关投资组合面板中的区域的更多信息，参见账户信息话题。

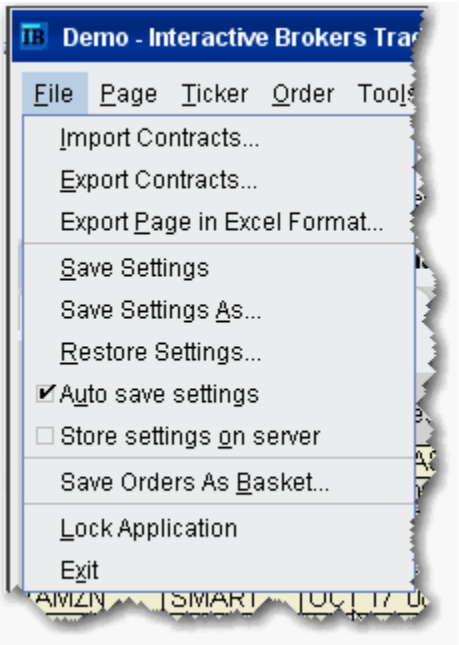
菜单

11

- 文件菜单
- 页面菜单
- 代码菜单
- 定单菜单
- 交易菜单
- 信息菜单
- 分析菜单
- 视图菜单
- 图表菜单
- 配置菜单
- 帮助菜单
- 在空白行上点击右键
- 在市场数据线上点击右键
- 在定单管理行上点击右键

文件菜单

使用**文件**菜单命令将报告导出到您的计算机，保存设置并创建篮子文件。**文件**菜单命令被描述在下表中。

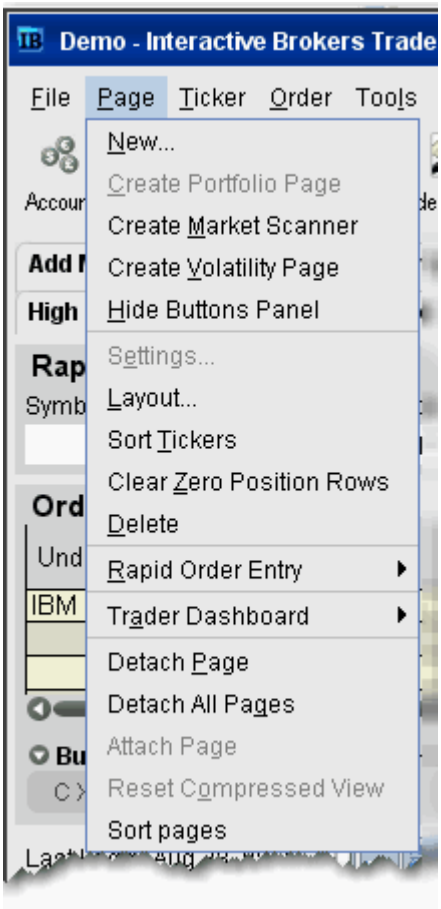


菜单命令	描述
导入合约	允许您将逗号分隔的文本文件导入到您的交易页面。
导出合约	允许您导出能够在 Excel 中被打开的 .csv 文件。
导出今日的报告	将今日的执行报告作为文本文件导出到您在计算机上设定的目录中。
导出前一个交易日的报告	将选定交易日的执行报告 （作为文本文件）导出到您在计算机上设定的目录中。
以 Excel 格式导出页面	将活动的交易页面作为文本文件导出到选定的文件目录。您能够在 Excel 中打开该文本文件并将数据复制到工作表。
保存设置	本地保存您对您的交易屏幕版式、默认值和菜单选项作出的任何更改。
恢复设置	打开恢复设置框，当中您能够选择从之前的会话恢复设置文件。
自动保存设置	如不被选中，您对交易平台所作的页面和设置更改在您退出时将不会被自动地保存。

菜单命令	描述
在服务器上存储设置	如被选中，当您退出时所有设置将被保存在 IB 服务器上 （而不是只被保存在您的本地计算机上），并且将在您下一次从浏览器登录时被使用，无论您使用的机器在什么地点。
将定单保存为篮子	将活动的交易页面上的所有定单保存为一个篮子文件。使用篮子以一个行动来交易被保存的定单集合。
退出	关闭交易平台并保存本地设置。

页面菜单

使用**页面**菜单来创建、编辑和删除交易页面，并修改页面版式。菜单命令被描述在下表中。

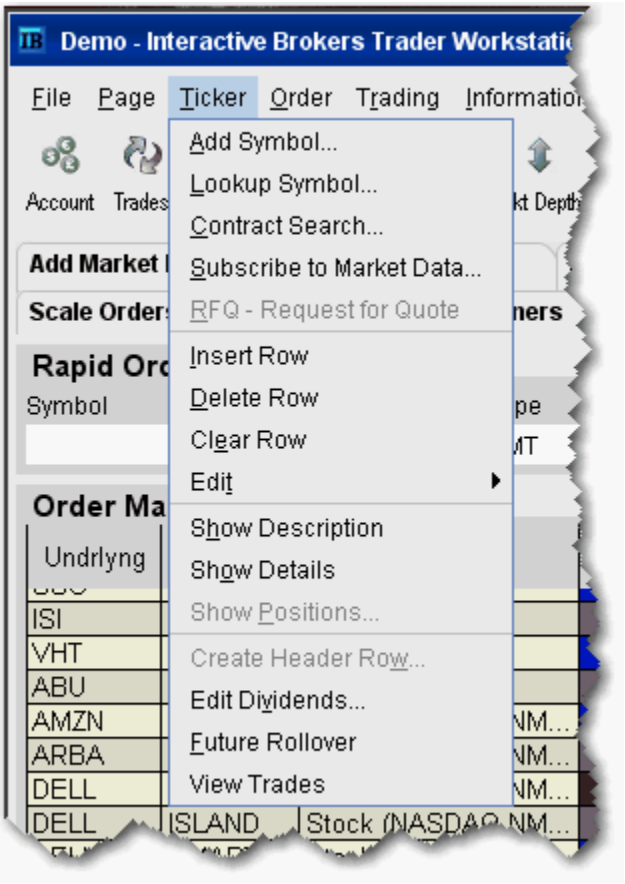


菜单命令	描述
新建	创建一个新的交易页面。
创建投资组合页面	创建一个叫做投资组合的新的交易页面，带有您持有头寸的所有资产的市场数据线。这些被显示在账户窗口中的投资组合部分中。
创建市场扫描仪	创建一个叫做扫描仪的新的交易页面，从中您能够根据许多不同的参数例如最活跃的、最大收益者、最大损失者等来查看前 20 个合约。
创建波动率页面	创建一个使用波动率页面版式的新的交易页面。
隐藏 / 显示按钮面板	显示或隐藏交易窗口底部的行动按钮面板。
设置	对活动的页面打开**设置**屏幕，其位于全局配置的**交易窗口** > *页面*下。让您重命名页面并更改页面设置，包括转移和清算账户、分配的版式以及页面水平的预设策略。同样，定义页面是否能够用于快速股票输入，以及对出现在多个页面上的代码如何显示活动的定单。

菜单命令	描述
版式	打开页面版式编辑器来查看默认的页面版式。使用该窗口来决定哪些栏在您的交易屏幕上是可见的，以及行和栏的文本、背景和其他特征。
整理代码	在打开的交易页面上按字母顺序整理市场数据线。
清除零头寸	对您不再持有头寸的合约，从投资组合页面中删除所有市场数据线。这确保了投资组合页面只包括您持有头寸的资产。
删除	让您删除选定的页面。在删除前给出一条警告消息。
快速定单输入	使用快速定单输入子菜单来显示或隐藏快速定单输入面板，以及定义可用的工具类型。使用配置子菜单，在全局配置框中打开快速定单输入配置页面。
交易者控制板	显示或隐藏交易者控制板。
分离页面	使活动的交易页面脱离，并在您的桌面上重新创建页面作为单独的窗口。要重新对接，在被分开的页面的**页面**菜单上选择*附加页面*。
分离所有页面	从工具栏将所有交易页面分离为单独的窗口。
附加页面	将交易页面重新附加到交易工具栏中。
重设压缩视图	仅待处理的页面 — 使用该命令，将待处理的页面重新设定为其正常的、未压缩的默认视图，显示所有待处理的定单。您能够使用待处理页面上的搜索过滤器区域，根据合约、行动、交易所等来过滤待处理的定单。
整理页面	按字母顺序从顶行的左边自动地重新整理您的标签集。

代码菜单

使用**代码**菜单来添加市场数据线，并引起与选定的市场数据线相关的行动。菜单命令被描述在下表中。

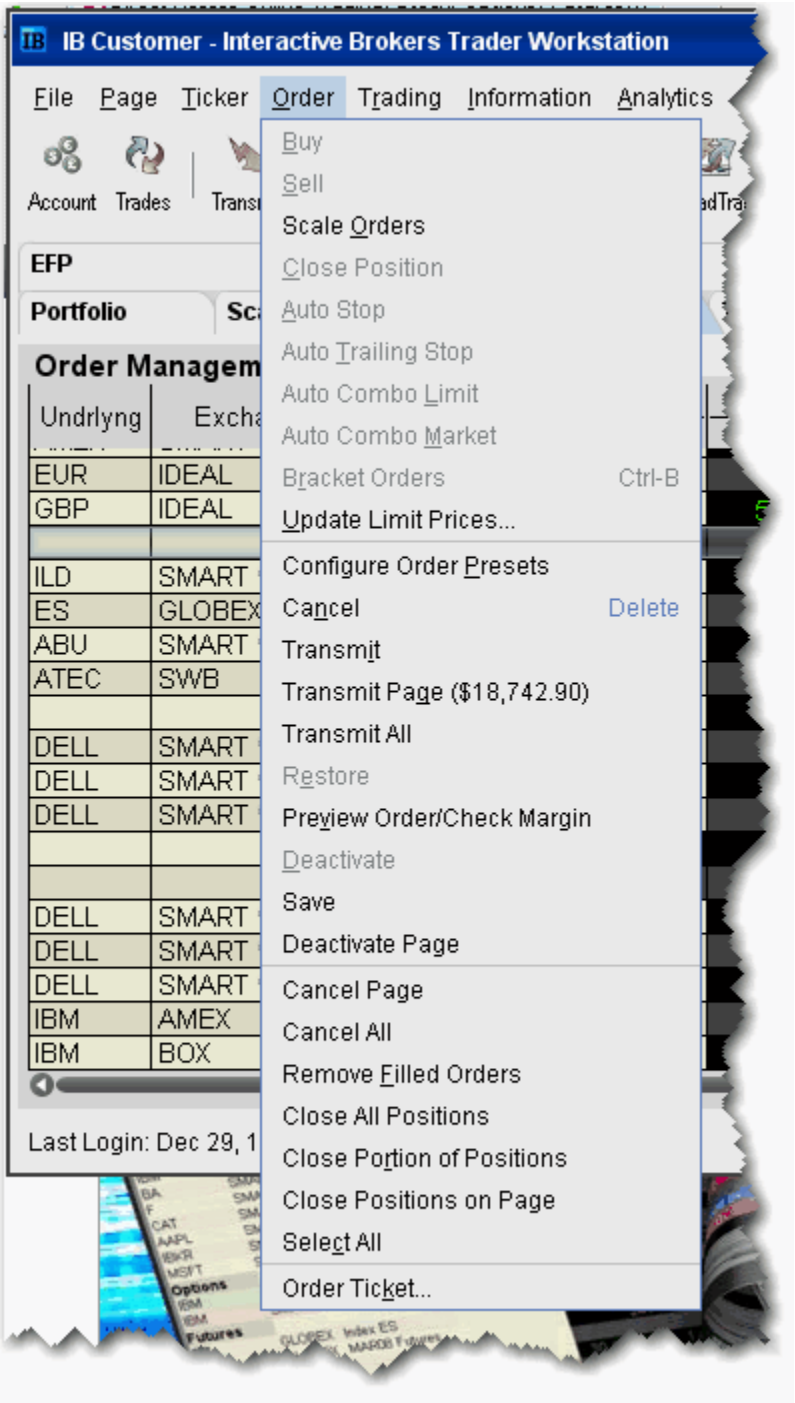


菜单命令	描述
添加代码	打开您输入合约信息的请求代码框。这会创建一条新的市场数据线。
查找代码	从 IB 网站上打开合约和证券搜索页面。
合约搜索	对您输入的公司名称返回所有代码。通过不选中特定的产品来过滤您的返回结果。
订阅市场数据	打开账户管理登录屏幕。从这里您能够执行您所有的账户管理任务，例如订阅市场数据服务、转移资金以及查看账户账单。 您必须订阅市场数据服务来接收市场数据以及查看第二级 NYSE 深层在册报价和市场深度。
RFQ — 请求报价	用来对不显示数据的工具请求市场数据。
插入行	再选定的市场数据线上方插入一个空白行。
删除行	删除选定的空白行和写有数据的行，无确认消息。
清除行	从选定的行中清除数据。

菜单命令	描述
编辑	让您在页面之间剪切、复制或粘贴市场数据线。如果您选定了线上的任何区域，那么整条线将被剪切 / 复制。如果您尝试在相同的页面上粘贴重复的市场数据线，粘贴命令将变为灰色。
显示描述	显示包含了关于选定的底层证券的信息的代码描述框。
显示细节	显示选定的底层证券的细节。
显示头寸	显示选定资产的当前头寸。
创建标题行	将一个非数据行插入到页面。输入一个标题或标签，将该行用作一组代码的分隔符或标签。
编辑股息	打开股息编辑窗口。
期货再投资	如果您持有将要到期的期货合约，使用该功能在到期前将它们再投资。
查看交易	打开交易窗口并显示选定的底层证券的所有交易。

定单菜单

使用**定单**菜单来创建、传递、取消和恢复定单。菜单命令被描述在下表中。

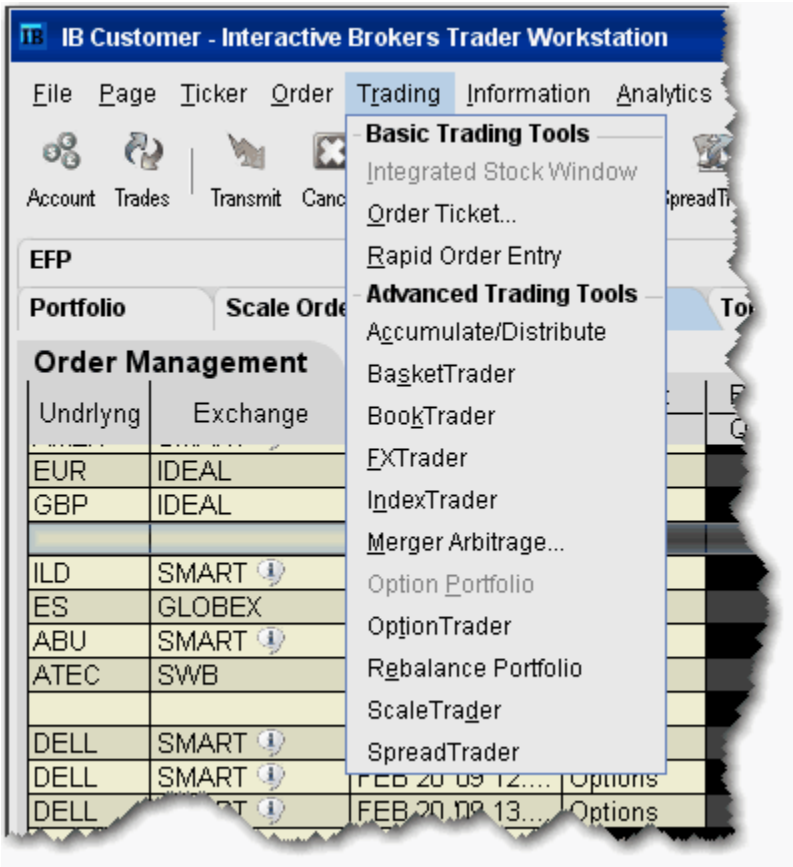


菜单命令	描述
买入	在选定的市场数据线上创建一笔买入定单，或者如果没有选定资产则打开定单标签窗口。
卖出	在选定的市场数据线上创建一笔卖出定单，或者如果没有选定资产则打开定单标签窗口。
分段定单	创建指定了以逐级递减 / 递增的价格区间被买入 / 卖出的总金额的定单。
关闭头寸	为您持有头寸的选定的资产创建一笔反向定单。您必须手动地传递定单。
自动止损	将一笔止损定单附加到限价定单。
自动追踪止损	将一笔追踪止损定单附加到限价定单。
自动组合限价	翻转母组合定单并提交一笔反向的限价定单。您必须输入一个限价。例如，如果您有一个买入日历差价，那么母定单看上去将如下： *买入 1 份 XYZ OPT NOV06 80.0 CALL* *卖出 1 份 XYZ OPT OCT06 80.0 CALL* 当您附加一笔自动组合限价定单，交易平台将翻转组合，并创建一笔卖出日历差价定单，如下所示： *卖出 1 份 XYZ OPT NOV06 80.0 CALL* *买入 1 份 XYZ OPT OCT06 80.0 CALL* 您必须对该定单输入一个限价。由于附加的定单依赖于母定单，它将直到母定单执行才会被传递。
自动组合市价	翻转母组合定单并提交一笔反向的市价定单。参见上面的*自动组合限价*。
括号定单	创建一对给您的初始定单加括号的定单。 括号定单被设计为用两笔反向的定单来给定单 “加括号”，从而限制您的损失并锁定利润。一笔买入定单被一笔高位卖出限价定单和一笔低位卖出止损定单加括号。一笔卖出定单被一笔高位买入止损定单和一笔低位买入限价定单加括号。
更新限价	打开更新限价对话框，当中您定义参数来对选定的定单或页面上的全部定单自动地更新限价。
配置定单预设	在全局配置中打开特定产品的定单预设页面。
取消	对不工作的定单，取消定单并将其从定单管理行中删除。 对工作中的定单，发送一个取消请求至定单目的地。直到**状态**区域变为红色，工作中的定单才被确认取消。
传递	将选定的定单传递至定单目的地。
传递页面	将活动的交易页面上的全部定单传递至其定单目的地。圆括号中的值显示了页面上所有定单的值。
传递全部	传递交易平台中所有页面上的全部定单。
恢复	被用来在您重新传递定单管理行上的工作中的定单之前，撤销对其所作的更改。
预览定单 / 检查保证金	对选定的未提交的定单，显示 “如果怎样”情形下的您的保证金要求。
使失效	在交易所取消已传递的定单，但将其保留在交易页面上以备之后的重新提交。
保存	通过将已失效的定单发送至特定的交易所来将其重新传递。
使页面失效	取消页面上所有已传递的定单，但将它们留在交易页面上以备之后的重新传递。

菜单命令	描述
取消页面	对活动的交易页面上的每个未传递的和工作中的定单发送一个取消请求。 直到**状态**区域变为红色，工作中的定单才被确认取消。
取消全部	对您所有的交易页面上的每个未传递的和工作中的定单发送一个取消请求。 直到**状态**区域变为红色，工作中的定单才被确认取消。
删除已执行的定单	如果您在**设置**菜单中没有选定*自动删除定单*，那么使用该命令，将所有已执行的和已取消的定单从您的交易页面和待处理页面中删除。
关闭全部头寸	对每个敞开头寸，以市价创建**并传递**一笔反向限价定单。如果无市场数据可用，那么创建一笔反向市价定单，您必须将其手动地传递。
关闭部分头寸	输入您想要平仓的敞开头寸的百分比。对该百分比的敞开头寸，以市价创建**并传递**一笔反向限价定单。如果无市场数据可用，那么创建一笔反向市价定单，您必须将其手动地传递。
关闭页面上的头寸	对活动的交易页面上的每个敞开头寸，以市价创建**并传递**一笔反向限价定单。如果无市场数据可用，那么创建一笔反向市价定单，您必须将其手动地传递。
选定所有	选定页面上的所有定单。
定单标签	打开定单标签窗口，您使用它来创建和传递定单。如果您选定了市场数据线，定单标签窗口将显示选定的资产和定单目的地。

交易菜单

使用**交易**菜单来打开任何定单管理工具。

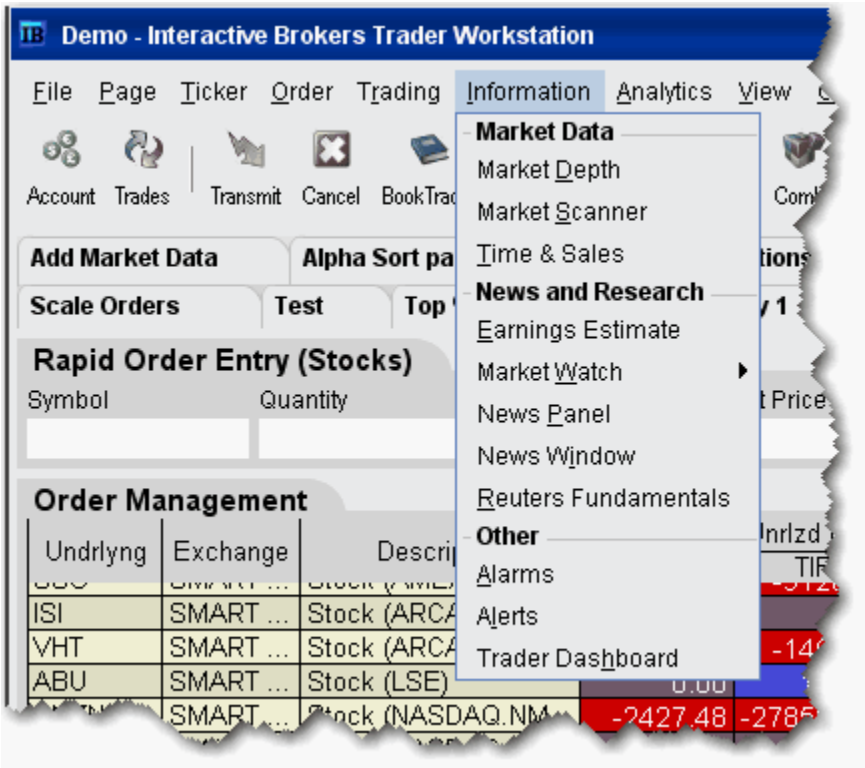


菜单命令	描述
集成股票窗口	集成股票窗口是一个对单只股票的综合的市场数据 / 定单管理工作空间。
定单标签	打开定单标签。标签将被填入选定的合约。
快速定单输入	使用快速定单输入子菜单来显示或隐藏快速定单输入面板，以及定义可用的工具类型。在全局配置框中使用配置子菜单来打开快速定单输入配置页面。
积累 / 分配	为大数量定单创建客户化的算法，在指定的价格间隔逐级提交分好尺寸的组成部分。使用随机化来避免在市场中被注意到。
篮子交易者	交易和管理多个产品的篮子定单。
记录簿	仅机构 — 接收和管理大数量电子定单。
在册交易者	通过单击将定单从在册数据阶梯中立刻传递。
外汇交易者	特别为外汇交易者设计的交易窗口。

菜单命令	描述
指数交易者	创建一笔以指数建模的客户化的篮子定单。
合并套利	为预期的合并创建一个组合定单。
期权投资组合	找到并交易最佳的期权组合，从而实现任何希腊字母的特定值。
期权交易者	完整的期权管理界面。
再平衡	打开再平衡窗口。
分段交易者	创建逐级分段、植入了获利回吐定单的大数量定单。
差价交易者	快速地创建期权、期货和期货转现货差价。

信息菜单

找到市场数据、新闻与研究以及其他与信息相关的工具。

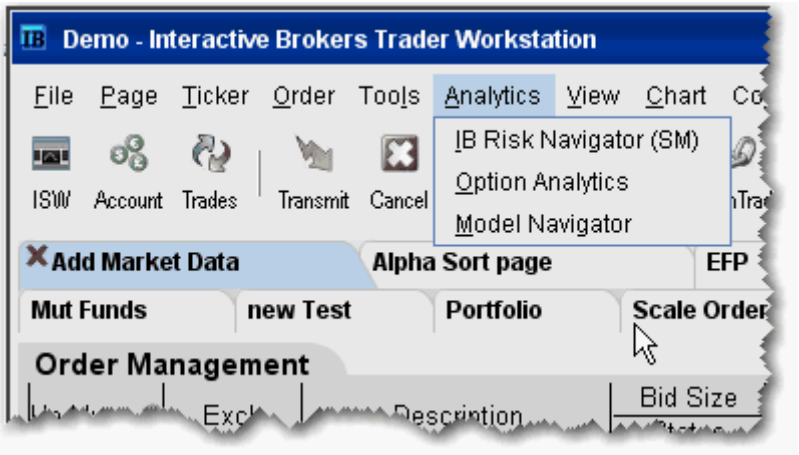


菜单命令	描述
市场深度	对选定的合约打开集成市场深度窗口。
市场扫描仪	打开市场扫描仪页面。
时间和销售	对选定的合约显示时间和销售。
盈余估计	对选定的底层证券查看盈余估计，包括每股账面价值、前一年的盈余估计和估计的盈余增长率。

菜单命令	描述
MarketWatch	• *分析师信息* — 对选定的合约显示分析师推荐。 • *图表* — 对选定的底层证券显示 MarketWatch 图表。 • *公司简介* — 简要描述选定的底层证券，包括每股数据、公司一览、评估比率和盈利能力。 • *财务报表* — 选定的底层证券的损益表和其他财务报表。 • *内部交易* — 对选定的底层证券显示最后十个内部交易行动。 • *新闻和研究* — 基于底层证券的行业相关新闻和评论。 • *证券交易所档案* — 与选定的底层证券关联的证券交易委员会档案。
新闻面板	显示基于底层证券的行业相关新闻和评论。
新闻窗口	打开带有选定底层证券的相关新闻的浏览器窗口。
路透社基本	如果您已订阅，打开路透社基本页面。
警钟	打开**警钟设置**框，当中您能够对选定的底层证券设置价格移动或交易量变化激活的警钟。为确保您在退出应用程序时不丢失警钟，当您设置警钟时，选择*在会话之间保留警钟*。
警报	打开警报窗口，当中您能够修改或创建根据时间、价格或保证金的警报。
交易者控制板	显示或隐藏可客户化的交易者控制板面板来显示快速一览账户或代码数据。

分析菜单

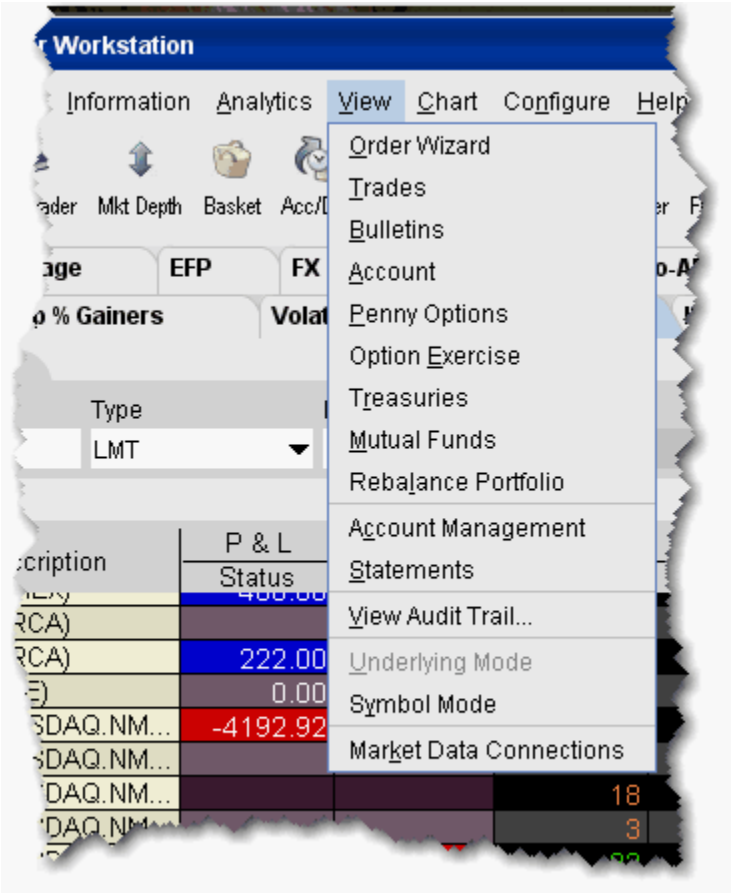
交互式分析是一个由投资组合分析、期权分析和期权建模者组成的风险评估套装。



菜单命令	描述
IB 风险漫游 SM	打开 IB 风险漫游 SM 实时风险工具。
期权分析	对选定的合约显示看跌 / 看涨期权的希腊字母。
模型导航	通过在模型导航中编辑定价假设来计算和再计算期权模型价格。

视图菜单

使用**视图**菜单来查看报告、待处理的定单、布告栏和状态。菜单命令被描述在下表中。

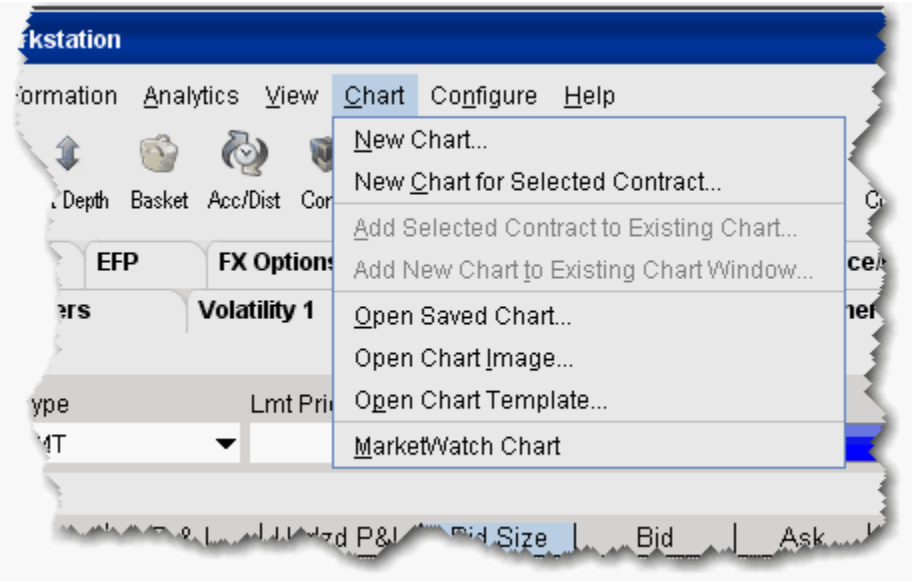


菜单命令	描述
定单向导	在您的交易窗口底部打开定单向导面板。
交易	查看当日的执行报告，通过账户管理查看交易确认，以及从您的交易工具栏配置闪烁交易通知。
布告栏	查看布告栏和系统状态。
账户	查看包括头寸和账户余额在内的账户信息。
美分期权	查看您最后的账户账单。
期权执行	使用期权执行窗口将期权在到期日期之前执行。

菜单命令	描述
国库券	打开合约选择矿，显示可用的长期、短期和中期国债。
共同基金	打开合约选择框，显示可用的免佣共同基金家族。
再平衡投资组合	打开再平衡窗口，当中您能够通过重新分配您的投资组合中的头寸百分比来交易，这些头寸组成了您当前的 （带符号的）净清算价值。
账户管理	将您登录到账户管理页面。使用左侧窗格中的菜单来查看和编辑账户信息。
账单	进入账户管理区域，页面显示为您的账单。
查看审计追踪	查看被保存为 html 文件的您的每日交易活动日志。每个星期的审计追踪报告将覆盖来自上一周的报告。
底层证券模式	如果为灰色，那么您已经在底层证券输入模式下，这意味着您输入一个代码标志并选择工具类型，然后以正常习惯交易。
代码模式	代码输入模式用于高级的期权交易者。该模式要求您根据由合约交易的交易所定义的类别或代码来输入合约定义。
市场数据连接	显示您的市场数据连接的目的和状态。

图表菜单

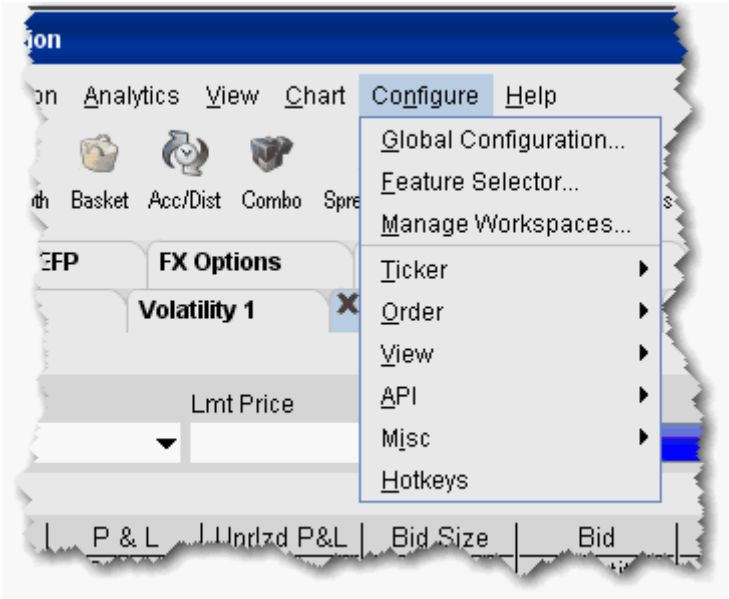
使用**图表**菜单命令来创建新的交互式图表，或者实时地打开现有的图表或将其作为图像打开。



菜单命令	描述
新建实时图表	打开一个空白的新图表窗口，让您输入底层证券并创建交互式图表。
对选定的合约新建实时图表	根据您在交易窗口中选定的合约，打开填入了合约描述的新的图表窗口。
将选定的合约添加到现有图表	允许您将选定的合约添加到打开的图表中，这样您就为多个合约绘制了图表，或者用选定的合约来替换主合约。
将新图表添加到现有的图表窗口	为选定的合约创建一个新的不同的图表，并将图表包括到与现有图表相同的窗口中。
打开已保存的图表	用来打开被保存为图表定义文件 （文件有 .def 文件扩展名）的图表。图表作为实时图表打开。
打开图表图像	用来打开您保存为图像文件 （文件有 .jpg 文件扩展名）的图表快照。图表作为图像文件打开，让您看到被保存的时刻的历史数据。
打开图表模板	打开加载图表模板对话框，您从中选择一个已保存的图表模板来打开。
MarketWatch 图表	对选定的底层证券查看 MarketWatch 图表。

配置菜单

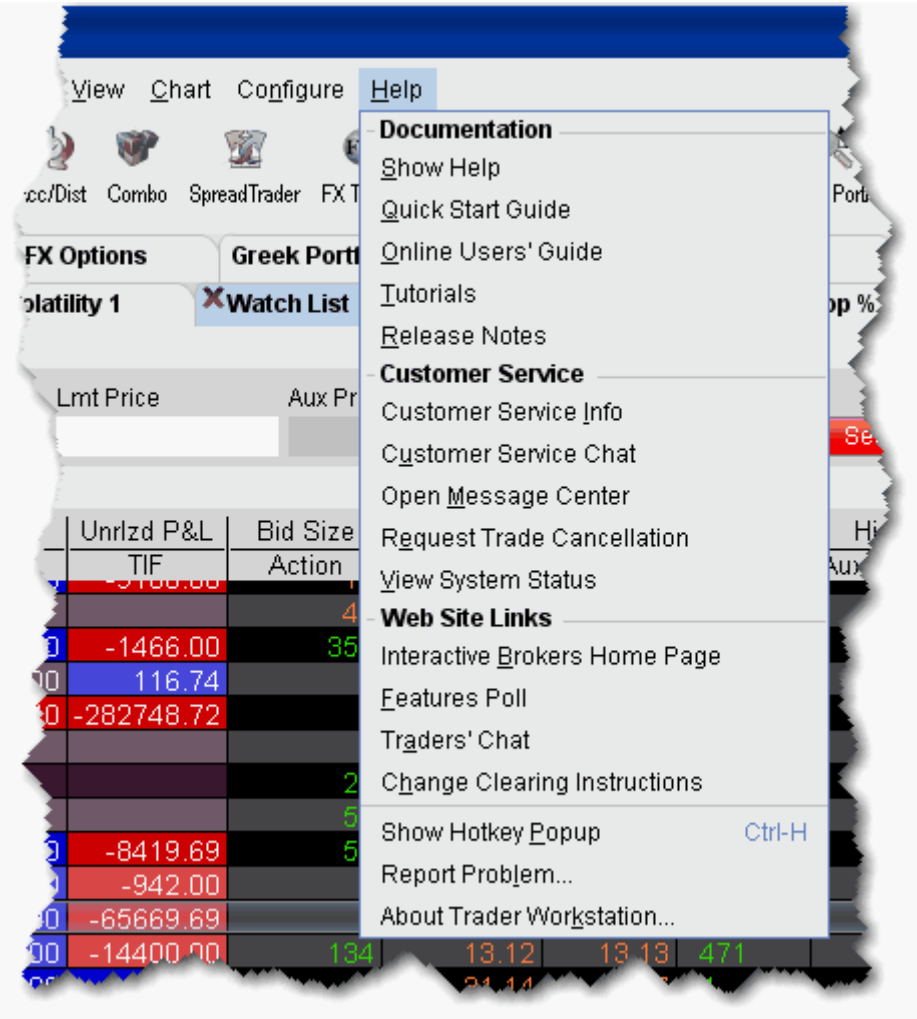
使用**配置**菜单来修改默认值，设置显示选项以及显示或隐藏功能。菜单命令被描述在下表中。



菜单命令	描述
全局配置	打开全局配置框，从中您对交易平台的所有方面定义配置设定。
功能选择器	打开功能选择器，其让您根据您的需要来隐藏或显示特定的功能。
管理工作空间	打开工作空间管理框，从中您能够创建、编辑和导入工作空间。
代码	快速进入配置代码显示设置。
定单	快速进入配置定单设置。
视图	快速进入配置杂项显示项目。
API	快速进入配置 API 功能。
杂项	快速进入配置杂项功能。
热键	快速进入配置热键。

帮助菜单

帮助菜单提供了到包括用户指南在内的在线客户服务信息的链接。菜单命令被描述在下表中。



菜单命令	描述
文献	
显示帮助	打开交易平台 java 帮助窗口。
快速入门指南	打开交易平台快速入门页面。
在线版用户指南	从您的网络浏览器打开交易平台用户指南。
向导	打开交互式向导网页，专注于交易平台基本向导。

菜单命令	描述
发行要点	打开交易平台发行要点索引。
客户服务	
客户服务信息	打开 IB 网站上的客户服务信息页面。
客户服务聊天	打开账户管理页面。打开聊天图标来与客户服务代表实况聊天。
打开消息中心	在账户管理中打开消息中心。使用该功能联系客户服务来提出任何问题或疑惑。
请求交易取消	在账户管理中打开*定单取消请求*框。
查看系统状态	显示 IB 系统的当前状态。
网站链接	
盈透证券主页	打开 IB 主页。
功能投票	打开 IB 功能投票页面，从中您能够提交对新的和改进的 IB 功能的建议并对其投票。
交易者聊天	打开 IB 交易者聊天页面，您能够登录并与其他交易者实况聊天。
更改清算说明	在账户管理中打开结算说明页面。
显示热键弹出	显示所有活动的热键行动以及与它们相关联的键的列表。
报告问题	打开便笺簿，当中您能够描述并提交您的问题。
关于交易平台	显示有关交易平台的信息，包括当前发行号和您运行的 Java 版本。

在空白行上点击右键

要查看右键点击菜单，选择一个行然后点击右侧的鼠标按钮。使用您的鼠标从右键点击菜单中选择一个项目。在空白行中打开的右键点击菜单包含以下菜单命令：

菜单命令	描述
定单	打开定单标签窗口，您能够使用它来创建和传递定单。
代码	代开请求代码框，当中您能够输入合约信息。这会创建一条新的市场数据线。
一般组合	打开组合成分框，转到底层证券区域。开始为差价定单定义边。
请求报价	输入合约信息来请求报价。
插入行	在选定的行上方插入空白行。
删除行	删除选定的一行或多行。该命令在没有警告的情况下既删除空白行也删除市场数据线。

在市场数据线上点击右键

要查看右键点击菜单，选择一个行然后点击右侧的鼠标按钮。使用您的鼠标从右键点击菜单中选择一个项目。在空白行中打开的右键点击菜单包含以下菜单命令：

菜单命令	描述
交易	• 买入 — 创建一笔买入定单。 • 卖出 — 创建一笔卖出定单。 • 定单标签 — 打开定单标签，您从中定义定单参数。
请求报价	• 提交 RFQ — 为不显示数据的工具请求市场数据。 • 修改 RFQ — 产生一个对话框，您能够在当中更改最后作出的报价请求的价格 / 数量。 • 取消 RFQ — 取消作出的最后报价请求。
插入代码	为您请求的底层证券代码添加一条新的市场数据线。
插入行	在选定的行上方插入空白行。
删除行	删除选定的行及其数据。
清除行	从行中删除数据，将行留为空白。
编辑	选择剪切或复制选定的市场数据线。
工具	• **在册交易者** — **打开**在册交易者窗口。 • **期权交易者** — 打开期权交易者窗口。 • **市场深度** — 对选定的证券显示集成的市场深度窗口。 • **设定警钟** — 打开**警钟设定**框，当中您能够为选定的资产设定价格变动激活的警钟。
合约信息	• 目的地 — 显示代码描述框，其包含了关于选定的底层证券的信息。 • 细节 — 对选定的底层证券显示细节。

在定单管理行上点击右键

要查看右键点击菜单，选择一个行然后点击右侧的鼠标按钮。使用您的鼠标从右键点击菜单中选择一个项目。在空白行中打开的右键点击菜单包含以下菜单命令：

菜单命令	描述
传递	将选定的定单传递至定单目的地。
取消	对不工作的定单，取消定单并将其从定单管理行中删除。 对工作中的定单，发送一个取消请求至定单目的地。直到状态区域变为红色，工作中的定单才被确认取消。
使失效	在交易所取消已传递的定单，但将其保留在交易页面上以备之后的重新提交。
检查保证金	打开*如果怎样情形*框，其描述了对您的定单的保证金要求。
恢复	让您在重新传递定单管理行上的工作中的定单之前，撤销对其所作的更改。
附加	• **自动止损** — 将一笔止损定单附加到限价定单。 • **自动追踪止损** — 将一笔追踪止损定单附加到限价定单。 • **括号定单** — 附加一对反向的定单，它们为当前定单 “加括号”，目的在于限制损失。 • **自动组合限价** — 翻转母组合定单并提交一笔反向的限价定单。您必须输入一个限价。例如，如果您有一个买入日历差价，那么母定单看上去将如下： *买入 1 份 XYZ OPT NOV06 80.0 CALL* *卖出 1 份 XYZ OPT OCT06 80.0 CALL* 当您附加一笔自动组合限价定单，交易平台将翻转组合，并创建一笔卖出日历差价定单，如下所示： *Sell 1 XYZ OPT NOV06 80.0 CALL* *Buy 1 XYZ OPT OCT06 80.0 CALL* 您必须对该定单输入一个限价。由于附加的定单依赖于母定单，它将直到母定单执行才会被传递。 • **自动组合市价** — 翻转母组合定单并提交一笔反向的市价定单。见上。
创建	• 复制 — 创建另一个定单管理行，相同的定单参数直接位于选定的行下方。 • 分段定单 — 创建一系列位于逐级递减 / 递增的价格区间的定单。

菜单命令	描述
修改	• **定单标签** — 打开**定单标签**窗口，当中您能够在传递定单之前修改参数。 • **触发方式** — 为模拟止损、模拟限价止损以及追踪止损定单类型选择一个止损触发方式。该选项让您为单个定单重新设定触发方式。要对所有定单更改触发方式，在**配置**菜单上选择*定单*，然后选择*止损触发方式*。 要允许限价止损和可用的模拟止损定单在交易时间之后触发，选择 “允许在常规交易时间之外触发”复选框。注意，现金合约的触发方式必须总是为默认的双重出价 / 要价方式。 • **条件** — 在定单标签上打开条件页面，您能够在当中创建或修改条件定单，这种定单只有当对一份或多份合约指定的标准被满足时才将自动地被提交或取消。
波动率	• 转换为基于价格 — 将市场数据显示从基于波动率的显示转换为基于价格。出价和要价区域中的值从波动率转变为价格。 • 转换为基于波动率 — 将市场数据显示从基于价格的显示转换为基于波动率。出价和要价区域中的值从价格转变为波动率。

12

执行和再投资

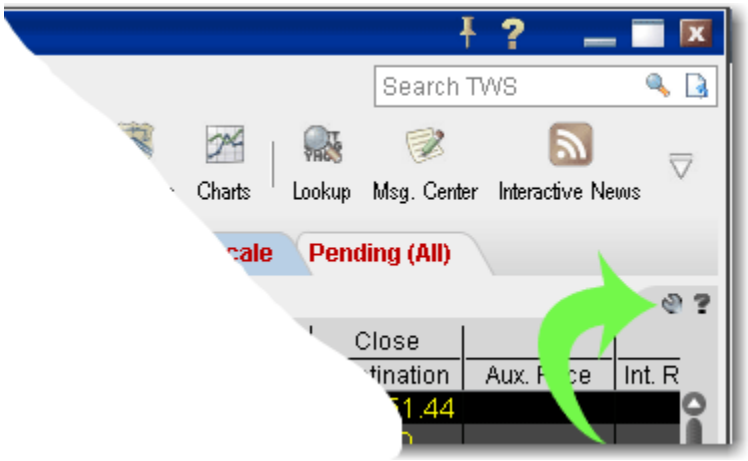
- 自动期货再投资
- 执行期权 — 手动文件
- 执行期权

自动期货再投资

当被激活，在到期前八天，系统会自动地在登录时显示一条消息，其允许您从将要到期的合约列表中选择来进行再投资。您也能够通过从**代码**菜单中选择*期货再投资*，在交易平台中查看该列表。

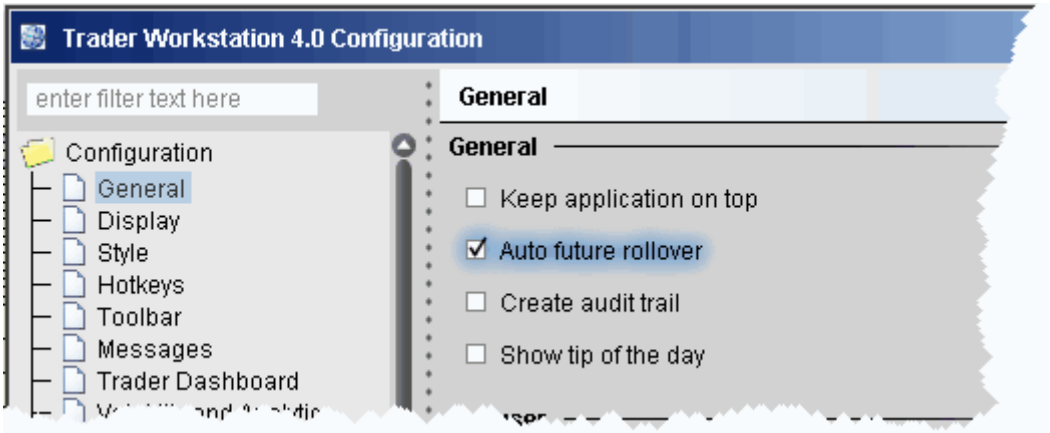
激活自动期货再投资

1 点击交易窗口上的配置扳手图标。



2 在**全局配置**的左侧面板中，选择*一般*。

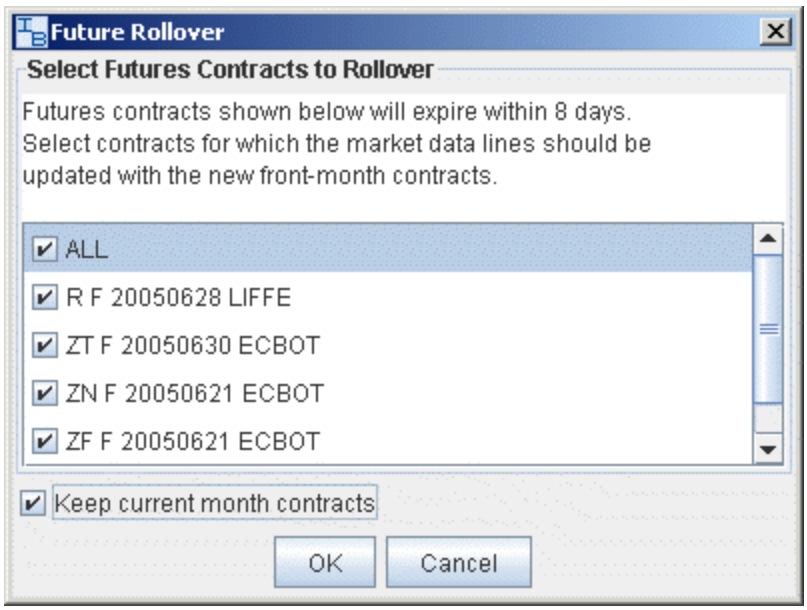
3 在右侧面板中，选中*自动期货再投资*。



从交易平台中查看可用的期货再投资

1 在**代码**菜单上，选择*期货再投资*。

2 选中您想要自动地更新到新的前月的所有合约。


Future Rollover
Select Futures Contracts to Rollover
Futures contracts shown below will expire within 8 days.
Select contracts for which the market data lines should be
updated with the new front-month contracts.
ALL
R F 20050628 LIFFE
ZT F 20050630 ECBOT
ZN F 20050621 ECBOT
ZF F 20050621 ECBOT
Keep current month contracts
OK
Cancel

执行期权 — 手动文件

期权执行窗口现在包括一个**从文件加载**按钮，它让您导入一个文件，该文件包含了执行特定的期权或使其期满的说明。您能够使用任何文字处理程序来创建文件，文件必须包括一个逗号分隔的值的列表，每个期权一行。您能够使用两种不同的格式当中的一种。表格 1 使用底层证券来说明，表格 2 显示了代码模式的区域。

对每个您想要包括到文件中的期权，创建一个文本行并遵守以下规则：

- 对描述在下表中的每个区域包括一个值。
- 以逗号分隔区域值。
- 将区域值按它们出现在下表中的顺序列举。

区域名称	可能的值		区域名称	可能的值
表格 1 — 底层证券模式			**表格 2 — 代码模式**	
行动	执行，期满		行动	执行，期满
账户号	IB 账号，例如 U44982		账户号	IB 账号，例如 U44982
底层证券	底层证券代码，例如 IBM		本地代码	IBMSE
行权价	例如 50		交易所	例如 AMEX （智能不被接受）
权利	p，c		数量	例如 3
到期日（yyyymm）	例如 200501		覆盖 *	是，否
乘数	例如 100			
交易所	例如 AMEX （智能不被接受）			
数量	例如 3			
覆盖 *	是，否			

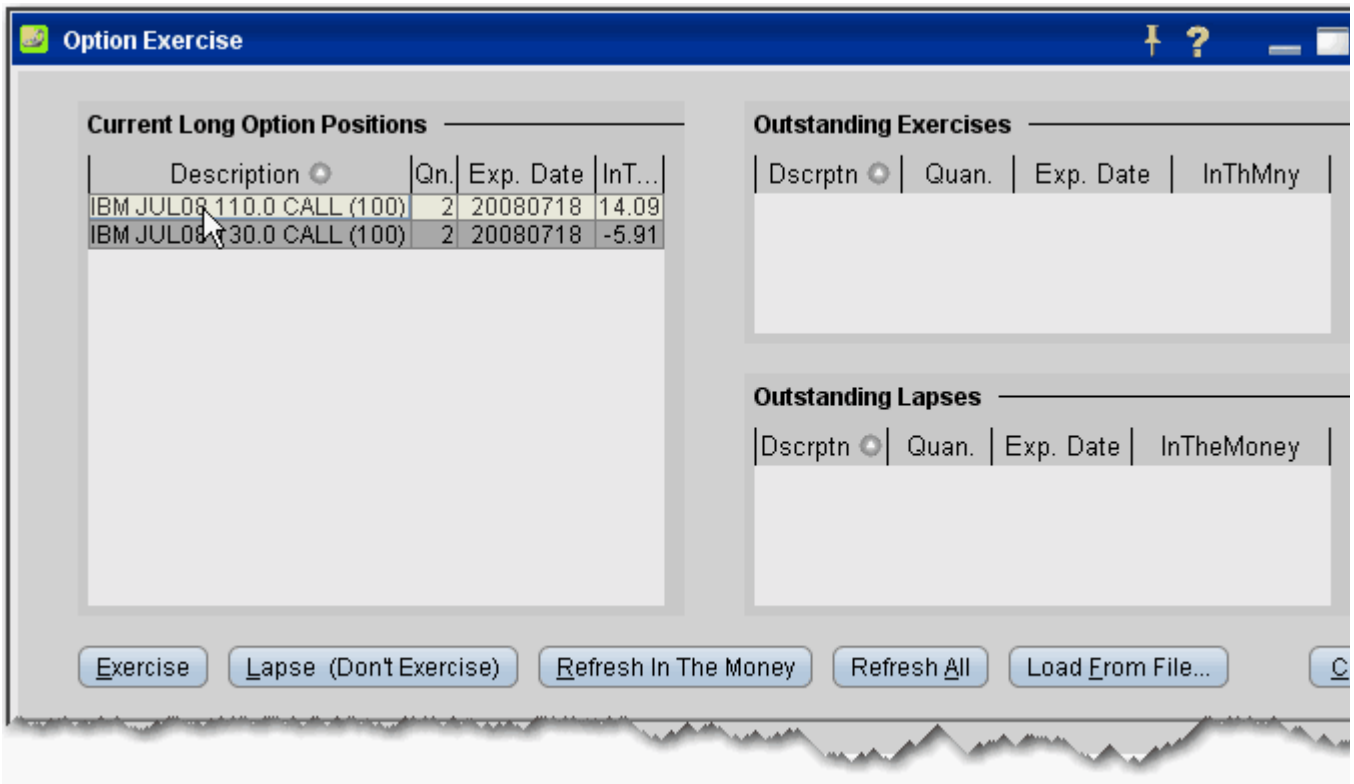
* 指定您的设置是否将覆盖系统的自然行动。例如，如果您将行动设定为执行期权且该合约不在价内，您将会收到一条消息说合约不在价内并将不执行期权。然而，如果您将覆盖设置为 “是”，那么该说明将覆盖系统，因而期权将执行。

您在区域中的行根据上表中的例子看上去将如下：

```
exercise, U44982, IBM, 50, C, 200501, 100, AMEX, 3, no
exercise, U44982, IBMSE, AMEX, 3, no
```

执行期权

使用**期权执行**窗口，在期权的到期日期之前将其执行，或者在到期星期五执行期权，根据期权清算公司（OCC）规则，到期星期五一般将被允许期满。您也能够使用**期权执行**窗口底部的*从文件加载*按钮，导入带有说明的文件。



执行期权

Note: 该过程是不可撤销的；一旦您承诺执行期权，您就不能撤销您的行动。

1. 从**视图**菜单上，选择*期权执行*。
2. 在**期权执行**窗口中，在窗口的*当前多头期权头寸*部分中强调您想要执行的期权。
3. 点击**执行**。
4. 检查 / 修改您想要执行的合约数目并点击**确定**。

   Note: *您不能输入大于当前多头期权头寸框中的数量的值。*

5. 检查您的选择，并在询问您是否确定想要执行选定的期权的消息中点击 “是”。

已执行的期权将出现在窗口的*未完成的执行*部分中，直到其被 OCC 清算。

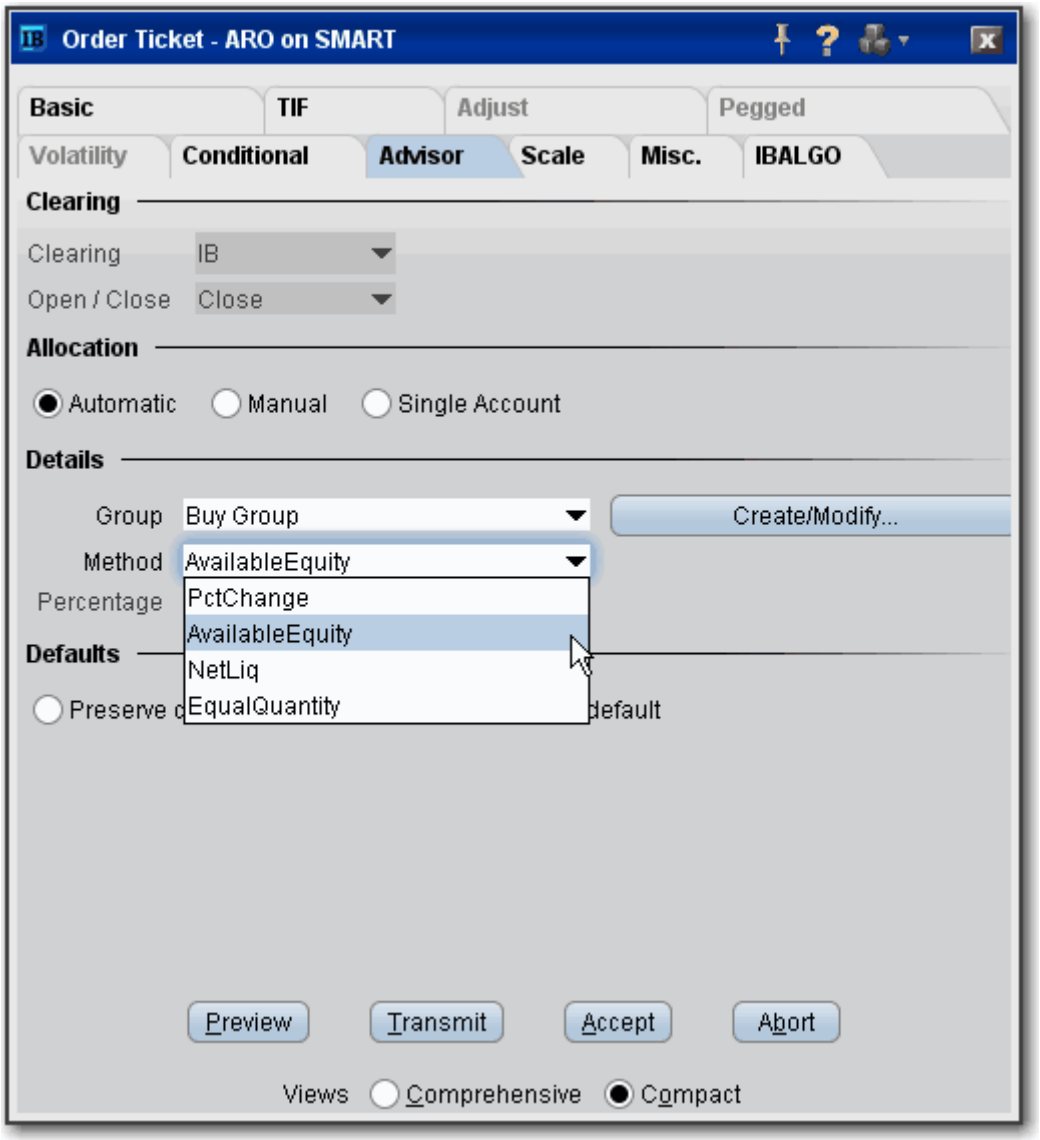
交易前分配

13

- 为多个客户创建定单
- 分配股票
- 顾问的再平衡
- 为股票分配创建账户组
- 创建股票分配方式
- 编辑股票分配方式
- 创建账户化名
- 设置默认分配

为多个客户创建定单

顾问也能够使用定单管理行上的**分配**栏，为分别管理的账户 （SMAs）创建定单并分配股票。



为多个客户创建定单

1 在市场数据线上点击 “要价” 或 “出价” 来创建一笔定单。

- 点击**要价**来创建一笔**买入**定单。
- 点击**出价**来创建一笔**卖出**定单。

2 使用分配区域下拉列表来选择账户组、账户方式、单个账户或*全部*账户。

或者

3 右键点击定单并选择**修改**，然后选择*股票分配*。

4 在**分配**对话框中，在自动分配区域中选择账户组，在手动分配区域中选择账户方式，或者选择单个账户。

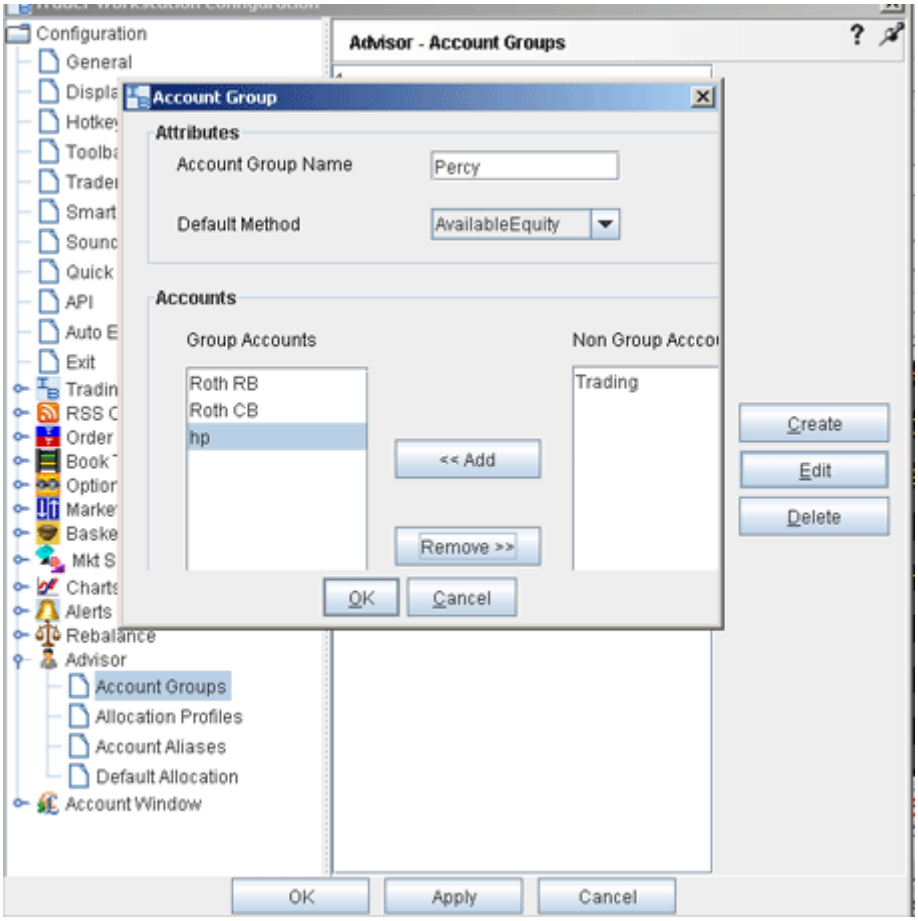
- **a** 对账户组，如有必要，修改分配方式。如果您选择百分比变动方式，那么在*百分比*区域中输入一个正的或负的值。所有其他自动分配方式使用定单尺寸被计算。
- **b** 如果您使用分配方式，那么选择一个组名称。
- **c** 要将所有股票分配到一个账户，选择单个账户。

5 点击**确定**来完成定单。

6 要传递，点击传递区域中红色的“T”。

分配股票

当您创建定单时，我们提供几种方式在账户之间分配股票。您能够选择一个**账户组**，其包含了预定义的账户子集以及相关联的分配方式。账户组根据由系统计算的比率，或者根据百分比来分配股票。被用来计算比率的数字衍生于您在创建组时选择的方式，或者根据您设定的百分比变化。

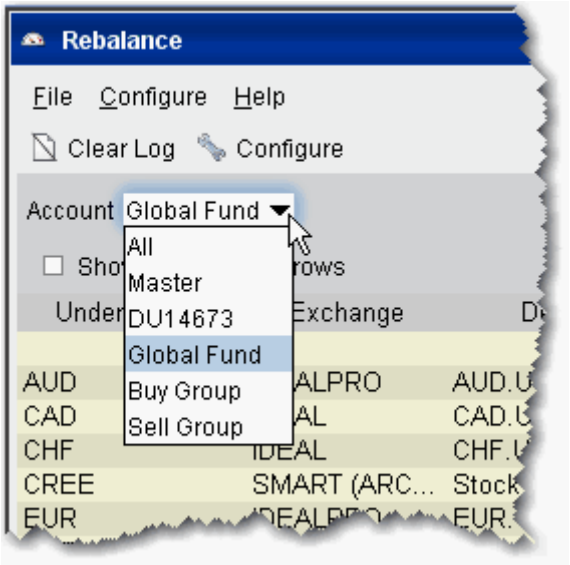


第二种分配股票的方式是通过**分配方式**，其根据您定义的百分比、比率或绝对数目将股票分配给方式中的每个账户。两种方式都要求您创建一个组，将账户分配给组，并定义组的分配方式。

您也能够通过从定单管理行上的**分配**区域选择单个账户的账号或化名来将定单分配到该账户，或者通过从**分配**区域中选择*全部*来将定单分配到所有账户。从全局配置中设定一个默认分配。

顾问的再平衡

顾问能够选择让交易平台自动地**再平衡**所有账户、单个子账户或者用户定义的包括账户子集的账户组，方法是重新分配其投资组合中的头寸百分比，这些头寸组成了当前（带符号的）净清算价值。交易平台根据您输入的新百分比来建立和关闭头寸，从而再平衡选定的账户的投资组合。您能够像从主交易屏幕中一样来添加合约以及创建定单。



再平衡子投资组合

1. 通过点击交易工具栏上的**再平衡**图标来打开再平衡窗口。
2. 在账户下拉列表中，选择：*全部*来再平衡所有账户；*主*来再平衡主账户；账户号来再平衡该账户；或者账户组来再平衡组中的所有账户。
3. **再平衡**窗口显示了与您的交易屏幕中的栏不同的三栏：
   - *可交割价值* — 这是头寸的可交割价值，与显示在**账户**窗口的*投资组合*部分中的头寸市场价值相同。
   - *当前百分比* — 这是头寸在您的净清算价值中所占的当前带符号的百分比，净清算价值被显示在**账户**窗口的*余额*部分中。该数字是用 DLV 除以 NLV（净清算价值）被计算出来的。
   - *再平衡百分比* — 使用该区域来输入一个您想让头寸拥有的 NLV 的新的百分比值。
4. 在**再平衡百分比**区域中，输入您想让头寸拥有的净清算价值的新百分比。

   Note: 如果您在账户下拉列表中选择了“全部”，工具的再平衡百分比将被应用于您的全部子账户的投资组合。

5. 点击**创建定单**按钮来指示应用程序自动地创建定单从而实现百分比变化。
6. 使用**传递全部**按钮来发送所有定单，或者点击定单行上的“T”来传递单个定单。

Note: 对期权，再平衡％根据的是底层证券股票价格的值。

从再平衡窗口中建立头寸

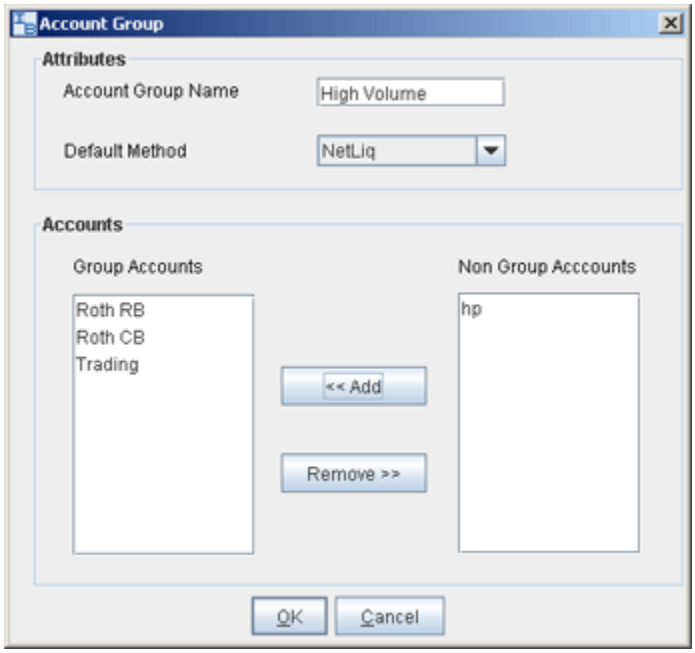
1. 首先，添加一个代码行到**再平衡**窗口，方法是在您的交易屏幕上选择市场数据线，然后在交易工具栏上选择附加到再平衡图标上的箭头。点击*添加到再平衡窗口*。或者，像在主交易窗口中一样，在**再平衡**屏幕上将底层证券代码输入到一个空白行中。

2. 在*再平衡%*栏中输入一个值并点击**创建定单**按钮。

3. 传递定单。

为股票分配创建账户组

您能够使用账户组来自动地计算比率，以及根据选定的分配方式将定单股票分配给预定义的账户组。当您创建了一笔定单并选择了一个组，定单使用默认的方式在组里的账户之间分配股票。



创建账户组

1 在**配置**菜单上，选择*顾问*，然后选择*账户组*，点击**创建**。

2 输入一个账户组名称。不要使用名称 “全部”，因为该名称已被系统预留。

Note: 当您创建一笔定单，显示在分配列表中的选项首先根据账户组被分组，然后是分配方式，在接下来是单个账户。然而，它们不以其他任何方式被识别。当您创建一个账户组时，您可能想要将一个例如 “AG”的前缀包括到名称中来将选项识别为账户组。

3 选择一个默认的分配方式。您能够对每个定单更改分配方式。

- **相等数量** — 要求您指定定单尺寸。该方式将股票在组里的全部账户之间相等地分配。

例：您传递了一笔 400 股的 ABC 股票定单。如果您的账户组包括四个账户，那么每个账户将收到 100 股。如果您的账户组包括六个账户，那么每个账户将收到 66 股，然后 1 股被分配到每个账户直到全部被分配。

- **净清算** — 要求您指定定单尺寸。该方式根据每个账户的净清算价值来分配股票。系统根据每个账户中的净清算价值来计算比率，然后根据这些比率来分配股票。

*例：您传递了一笔 700 股的 XYZ 股票定单。账户组包括三个账户， A、B 和 C，净清算价值分别为 $25,000、$50,000 和 $100,000。系统计算出比率 1:2:4，然后将 100 股分配给**客户 A**，200 股分配给**客户 B**，以及 400 股分配给**客户 C**。*

- **可用权益** — 要求您指定定单尺寸。该方式根据每个账户中当前可用的含贷款价值的权益金额来分配股票。系统根据每个账户中含贷款价值的权益来计算比率，然后根据这些比率来分配股票。

*例：您传递了一笔 700 股的 XYZ 股票定单。账户组包括三个账户， A、B 和 C，净清算价值分别为 $25,000、$50,000 和 $100,000。系统计算出比率 1:2:4，然后将 100 股分配给**客户 A**，200 股分配给**客户 B**，以及 400 股分配给**客户 C**。*

- **百分比变化** — 不指定定单尺寸。**由于数量是由系统计算的，定单尺寸在定单被承认后被显示在数量区域中。**该方式增加或减少已经存在的头寸。正百分比将增加头寸，负百分比将减少头寸。

买入定单	*正百分比*	*负百分比*
多头头寸	增加头寸	无效果
空头头寸	无效果	减少头寸

卖出定单	*正百分比*	*负百分比*
多头头寸	无效果	减少头寸
空头头寸	增加头寸	无效果

*例 1：假设组里六个账户中的三个持有 XYZ 股票的多头头寸。**客户 A** 拥有 100 股，**客户 B** 拥有 400 股，而**客户 C** 拥有 200 股。您想要将他们的持有增加 50%，因此您在百分比区域中输入 “50”。系统计算出您的定单尺寸需要等于 350 股。其随后将 50 股分配给客户 A，200 股分配给客户 B，100 股分配给客户 C。*

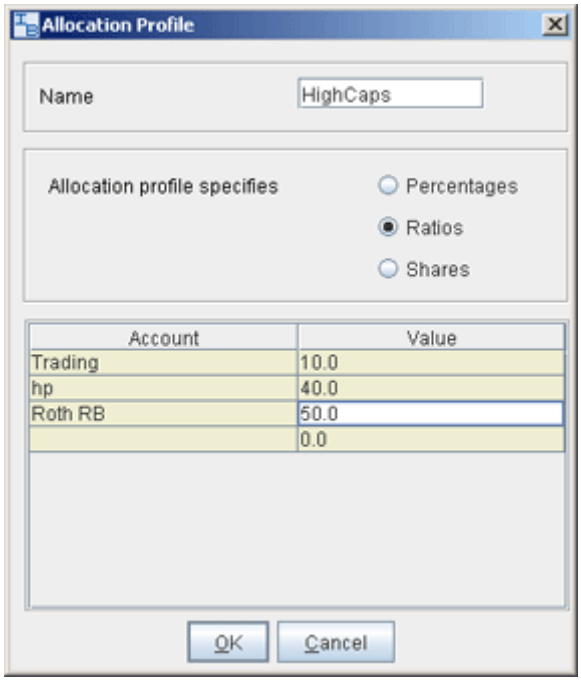
例 2：您想要平仓组里五个账户中的三个的全部多头头寸。您创建一笔卖出定单并在百分比区域中输入 “-100”。系统对组里持有头寸的每个账户计算出每个头寸的 100%，并卖出所有股票来关闭头寸。

4 *未分组账户*部分中的账户列表包括了对您可用的全部账户。要将账户添加到组，选择一个未分组账户并点击**添加**。

5 点击*确定*来保存组及其设置。

创建股票分配方式

您能够创建分配方式，其根据您设定的规则和输入的值，将每个定单的特定百分比或股数分配到单个账户。



创建股票分配方式

1 在**配置**菜单上，选择*顾问*，然后选择*分配方式*。

2 点击**创建**并输入一个方式名称，名称最好根据您计划用来在客户之间分配股票的方式。

Note: 当您创建一笔定单，显示在分配列表中的选项首先根据账户组被分组，然后是分配方式，在接下来是单个账户。然而，它们不以其他任何方式被识别。当您创建一个方式时，您可能想要将一个例如 “P”的前缀包括到名称中来将选项识别为方式。

3 在**分配方式指定**区域中，选择一个在账户之间分配股票的方式：

- **百分比** — 该方式将根据您指定的百分比，将定单中的股票总数目在列出的账户之间拆分。例如，使用该方式的一笔 1000 股定单，四个账户每个被设为 25%，将分配 250 股至方式中列出的每个账户。
- **比率** — 该方式根据您输入的比率来计算股数分配。例如，使用该方式的一笔 1000 股定单，四个账户的比率被设定为 4、2、1、1，将分别分配 500、250、125 和 125 股至列出的账户。
- **股数** — 该方式将您输入的股票绝对数目分配至每个列出的账户。如果您使用该方式，那么定单尺寸是通过将分配至该方式的每个账户的股数加起来被计算的。

4 点击*账户*区域来查看全部账户。选择一个账户并用 tab 键移动到*价值*区域。

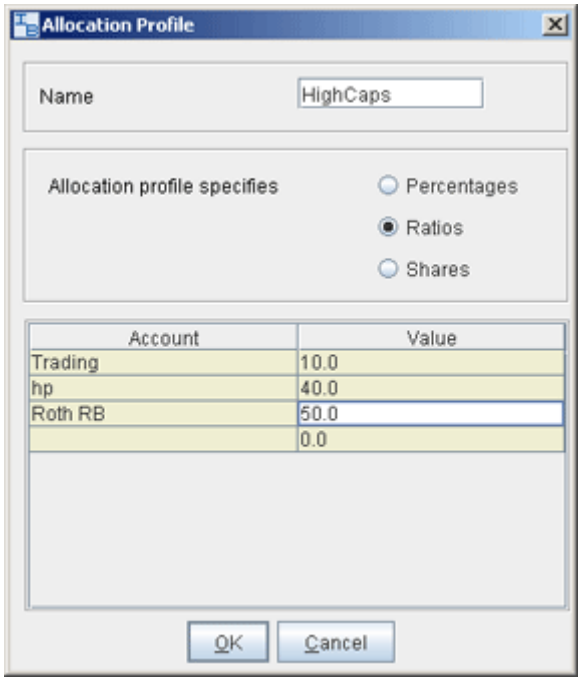
5 输入要被分配到选定的账户的百分比、比率或股数 （您可能需要删除当前值）。用 tab 键创建一个新的账户行。

Note: 如果您使用百分比来分配股票，被分配的百分比必须等于 100。如果您使用比率，那么系统会自动地计算这些百分比。

6 继续直到您列出了对当前方式需要的全部账户，然后点击**确定**。

编辑股票分配方式

在您创建了股票分配方式之后，当您创建定单时您能够选择一个方式。



编辑股票分配方式

1 从**配置**菜单中，选择顾问，然后选择*分配方式*。

2 选择分配方式并点击**编辑**。

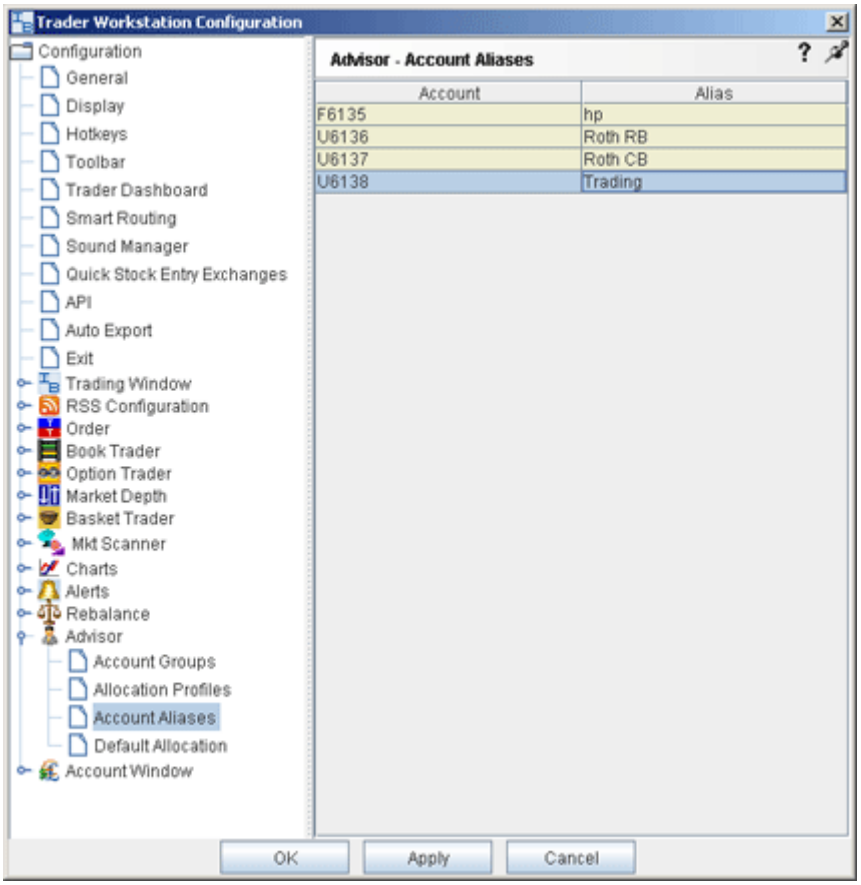
3 在**分配方式**窗口中，您能够添加或删除账户，选择一个不同的分配方式，或者对任何账户修改分配的百分比或比率。

4 点击**确定**来保存被编辑的方式。

Note: 被分配的百分比必须等于 100。如果您使用比率，系统将根据比率自动地计算股票百分比。

创建账户化名

您能够使用账户化名对话框，将可识别的名称分配给账户。当您创建一笔定单时，账户化名出现在分配列表中而不是单个账号中。



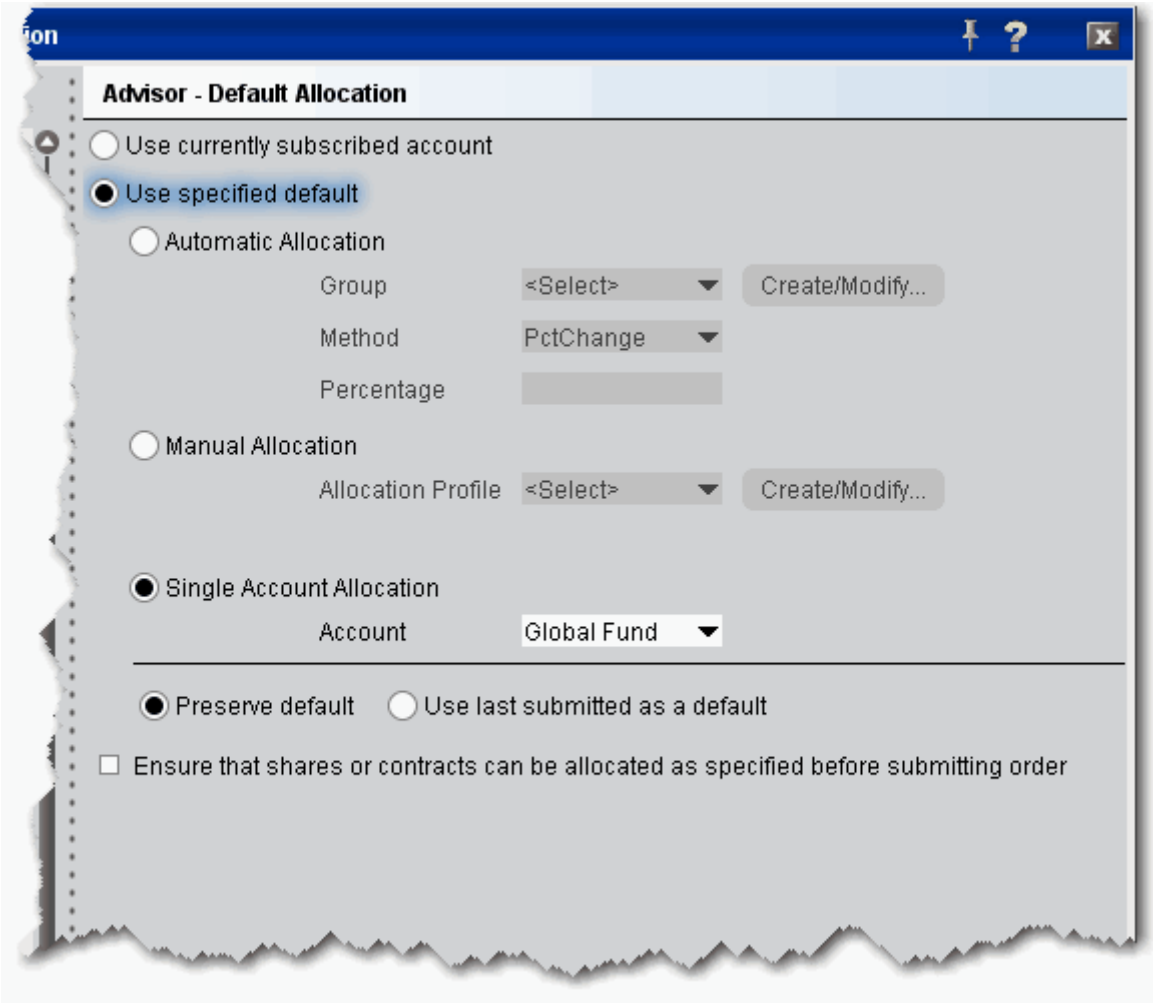
创建账户化名

1. 在**配置**菜单中选择*顾问*，然后选择*账户化名*。
2. 对选定的账户，在**化名**栏中输入可识别的名称。

Note: 当您创建一笔定单，显示在分配列表中的选项首先根据账户组被分组，然后是分配方式，在接下来是单个账户。然而，它们不以其他任何方式被识别。当您创建一个账户化名时，您可能想要将一个例如“IA”的前缀包括到名称中来将选项识别为单个账户。

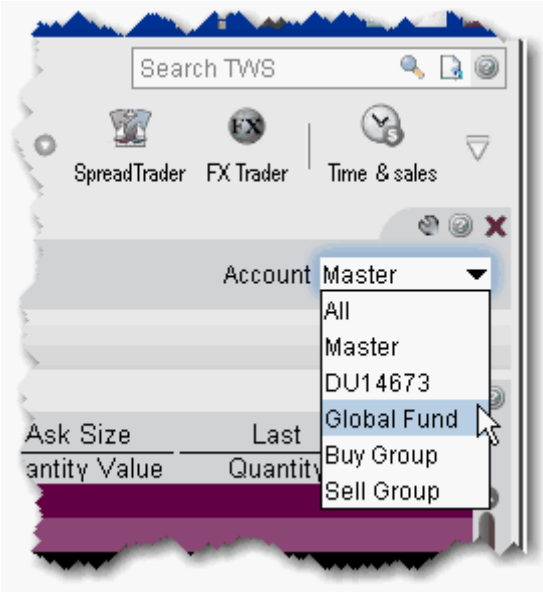
设置默认分配

默认的分配指的是当您创建定单时将被自动使用的分配方式。您能够对每笔交易修改分配方式，并在任何时候更改默认的分配。



设定默认分配

1 在**配置**菜单上选择*顾问*然后选择*默认分配*。



- **使用当前订阅的账户** — 选中该按钮，自动地将交易分配到在交易屏幕上的*账户*下拉列表中选定的账户或组，如上所示。
- **使用指定的默认值** — 选中该按钮来设置指定的绝对默认分配。
  - 自动分配 — 选择一个用户定义的账户组和方式来用于默认分配。
  - 手动分配 — 选择一个分配方式来用作默认分配。
  - 单个账户分配 — 选择单个账户来用作默认分配。注：要允许最后选定的单个账户被用于将发生的默认分配，在页面顶部选中*使用当前订阅的账户*单选按钮。
- **保持默认** — 选择总是在默认分配窗口中使用默认的设置，无论您在每笔定单基础上所作的更改。如果该选项被选中，您将需要使用该窗口来修改默认分配。
- **使用最后提交作为默认值** — 选择您是否想让默认的分配方式变为您在每笔定单基础上设定的分配方式。如果该选项被选中，当您更改定单的分配方式时，默认的分配方式将自动地改变。
- *确保股票或合约能够在提交定单之前按照指定被分配* — 如被选中，交易平台将确保股票能够在定单被提交之前根据分配说明被分配。如果分配不可能，您可以在提交定单之前修改分配方式。当不被选中，如果分配说明不能被遵循，那么定单被提交，您必须在执行之后重新分配股票。

14

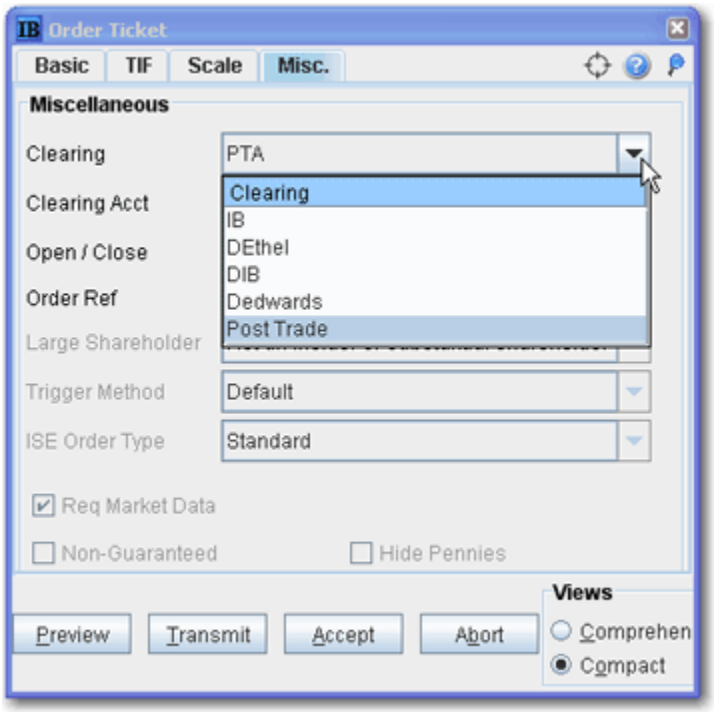
转移

- IB 执行服务
- 从定单行进入 IB 执行服务
- 创建 DVP/RVP 说明
- 卖空确认
- 使用 DVP/RVP 转移头寸

IB 执行服务

作为 IB 执行服务的客户，您能够在每笔定单基础上告诉交易平台您想在哪里清算您的交易。注意，在您能够使用 IB 执行服务之前，您必须通过账户管理首先申请，然后输入您的转移说明。您既可以从定单标签也可以在定单管理行上使用 IB 执行服务来定义交易前或交易后转移。

定单标签上的 IB 执行服务



1 右键点击一个代码并选择*交易*，然后选择*定单标签*。

2 在基本标签上设置您的定单，然后点击**杂项**标签来使用 IB 执行服务。

3 使用清算下拉列表来选择您的转移。从三 （3）种类型的清算选项中选择：

- **盈透证券** （IB）。这是之前默认的清算目的地。
- **交易前**。在交易时，从您通过账户管理定义的说明中选择一个第三方清算转移地点。如果您通过账户管理定义了多份 DTCID 或 CMTA 结算说明，那么您将看见多个交易前选项。如果您只有一个离开说明，那么上述账户将有一份名为 “IB” 的 DTCID 说明 （对股票）和一份名为 “Timber” 的 CMTA 说明 （对期权）。 交易前转移在说明标题前使用单个字母前缀以便易于识别：
    - “D” 是 DTCID （股票）转移的前缀。
    - “C” 是 CMTA （期权）转移的前缀。
- **交易后** （PTA）。该选项在执行后将您的交易放入 PTA 工具。使用账户管理的交易使用部分来分配交易后，该部分可以通过在**视图**菜单上选择*交易后分配*来直接进入。

Note: 您选择的清算选项，将在下一次您提交定单时被自动地用作默认的选择。

4 对美国期权定单使用**建仓 / 平仓**指标来指定您的定单是被设计用来平仓 / 减少头寸还是建仓 / 增加头寸。您能够在全局配置的定单默认值部分中为该指标设定一个默认值。

5 对使用 *PTA* 或*离开*清算的美国期货和期货期权定单，**清算账户**区域是必需的。您必须指定定单的真实受益人的账号或其他身份。该信息和定单一起被报告给交易所。对期权和股票定单，清算账号位于结算说明中，该区域是可选的。

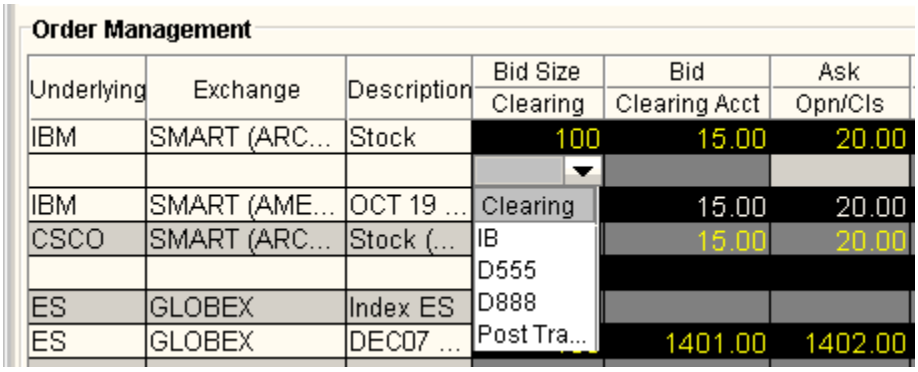
从定单行进入 IB 执行服务

作为 IB 执行服务的客户，您能够在每笔定单基础上告诉交易平台您想在哪里清算您的交易。注意，在您能够使用 IB 执行服务之前，您必须通过账户管理首先申请，然后输入您的转移说明。您既可以从定单标签也可以在定单管理行上使用 IB 执行服务来定义交易前或交易后转移。

从定单管理行进入 IB 执行服务

1 在市场数据线上点击要价或出价来分别创建一笔买入或卖出定单。

2 使用**清算**下拉列表来选择您的转移。从三 （3）种类型的清算选项中选择：



- **盈透证券** （IB）。这是之前默认的清算目的地。
- **交易前。**在交易时，从您通过账户管理定义的说明中选择一个第三方清算转移地点。如果您通过账户管理定义了多份 DTCID 或 CMTA 结算说明，那么您将看见多个交易前选项。上述账户有一份名为 “IB” 的 DTCID 说明 （对股票）和一份名为 “Timber” 的 CMTA 说明 （对期权）。交易前转移在说明标题前使用单个字母前缀以便易于识别：
    - “D” 意味着 DTCID 股票转移。
    - “C” 意味着 CMTA 期权转移。
- **交易后** （PTA）。该选项在执行后将您的交易放入 PTA 工具。使用账户管理的交易使用部分来分配交易后，该部分可以通过在**视图**菜单上选择*交易后分配*来直接进入。您选择的清算选项，将在下一次您提交定单时被自动地用作默认的选择。

3 对美国期权定单使用**建仓 / 平仓**指标来指定您的定单是被设计用来平仓 / 减少头寸还是建仓 / 增加头寸。您能够在全局配置的*定单默认值*部分中为该指标设定一个默认值。

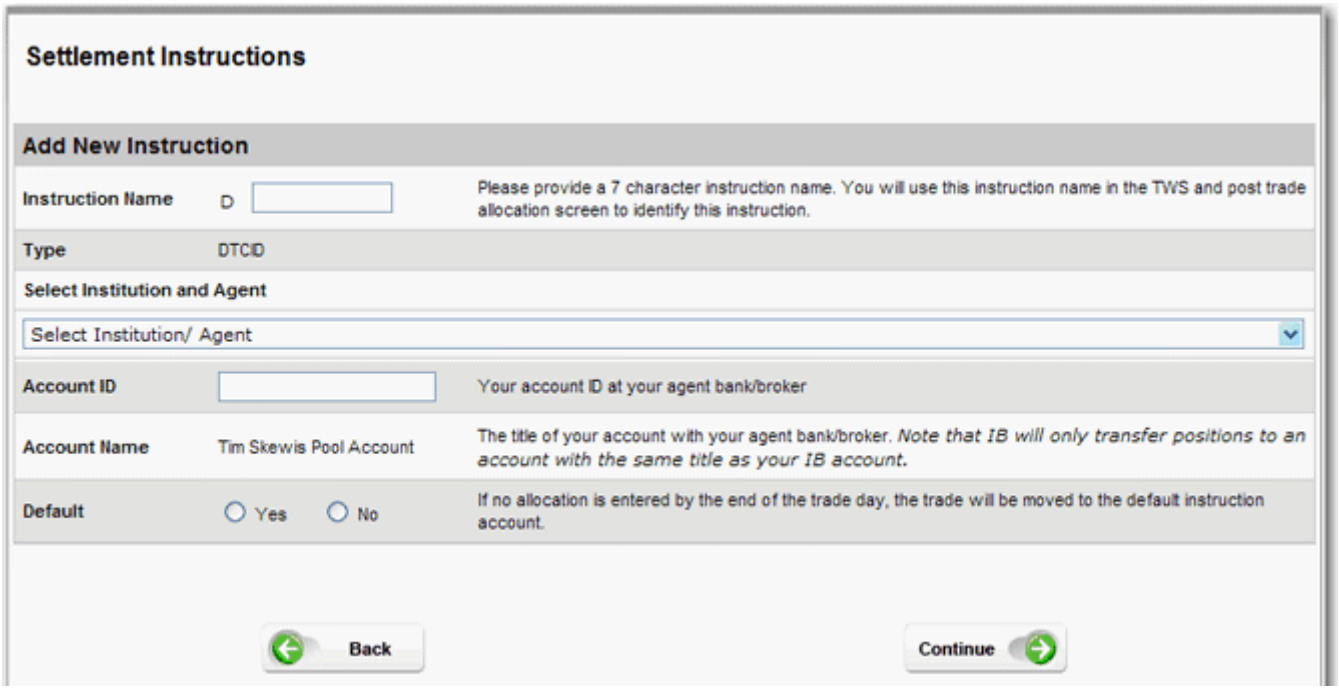
4 对使用 *PTA* 或*离开*清算的美国期货和期货期权定单，**清算账户**区域是必需的。您必须指定定单的真实受益人的账号或其他身份。该信息和定单一起被报告给交易所。对期权和股票定单，清算账号位于结算说明中，该区域是可选的。

创建 DVP/RVP 说明

在您能够使用 DVP 功能转移或接收头寸之前，您必须通过网站上的账户登录功能来指定 DVP 说明。

添加 DVP/RVP 说明

1. 从 IB 网站右上角的登录下拉列表中，选择*账户管理*。
2. 输入您的账户用户名和密码，然后点击*登录*。
3. 在**资金管理**部分下，点击*结算说明*。
4. 在恰当的部分下点击**添加**按钮，并完成说明区域。



有效的说明将在 24 小时之内被批准，在这之后您将看到它成为交易平台定单的清算下拉列表中的一个选项。

- 在东部时间下午 5:30 添加到默认的说明。

卖空确认

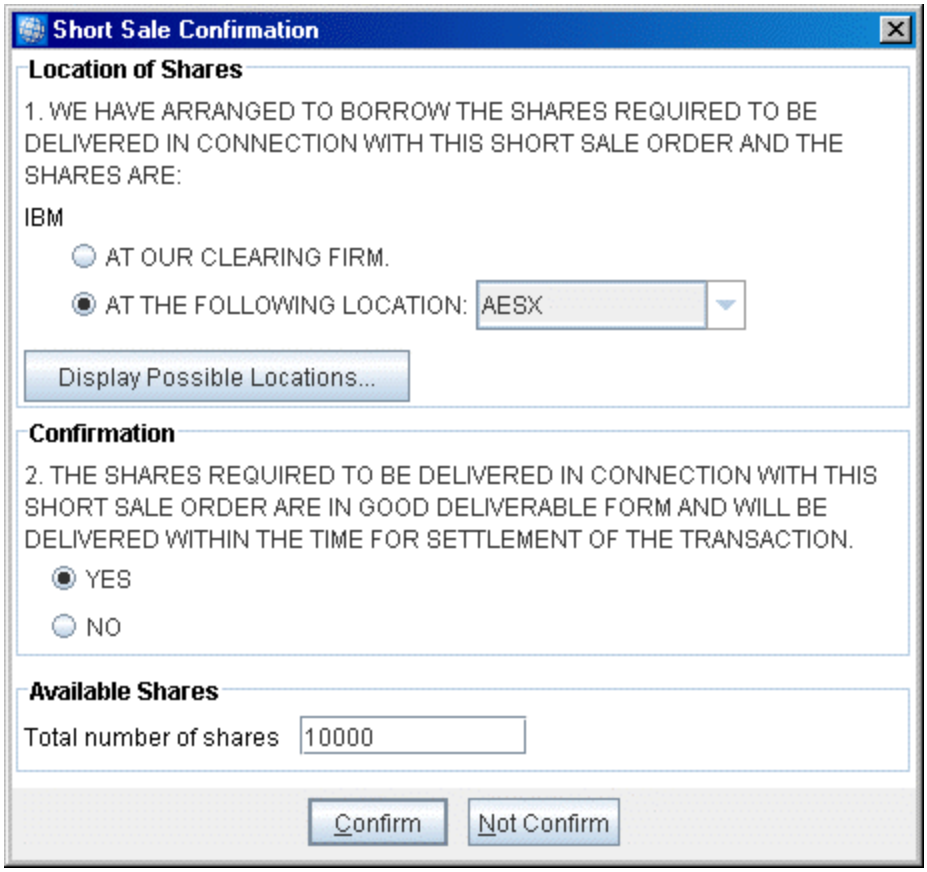
使用卖空确认框来确认您想要卖空的股票在清算公司是可用的。该确认框在您第一次选择卖空一个底层证券时弹出。如果您输入可用的股票数，它将只要求每个底层证券 / 每个交易平台会话 （一个会话持续到您退出交易平台）输入一次，只要您保持在可用的股数限制之内。

确认股票对卖空的可用性

1 在买入 / 卖出定单行上选择卖空作为行动。

2 在**卖空确认**框中输入确认信息。

Note: 输入可用的股票总数，从而避免每次您卖空该底层证券时都必须确认可用性。

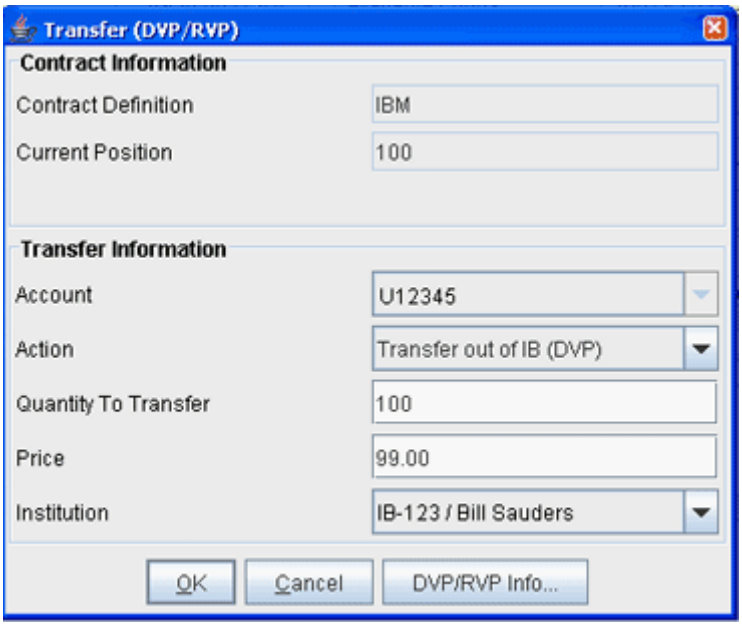


3 交易平台将根据您对底层证券提交的卖空定单来追踪可用的股票数。如果可用的股票数不能满足定单数量，您将被要求再次确认可用性。

使用 DVP/RVP 转移头寸

在您通过账户管理屏幕添加了说明之后，您能够选择一个首要或清算经纪商账户，您想要将您当前持有的任何头寸的全部或部分转移到该账户，或者您想要从该账户接收头寸到您的账户。

Note: 将只在类型相同并且与您的账户有相同标题的账户之间转移和接收头寸。



转移头寸

Note: 只有当您在设置您的转移说明时在**频率**区域中选择了*按需*时，您才将完成这些步骤。如果您选择了*常备*，那么说明将被自动地执行。

1. 打开账户窗口。
2. 在投资组合菜单上，选择转移 （DVP/RVP）并定义合约。
3. 在对话框的转移信息部分中，选择行动，*转出 IB （DVP）*或*转入 IB （RVP）*。
4. 输入要转移的数量。转移的数量必须等于或小于**可用的数量**。
5. 价格区域显示当前的市场价格。您能够在当前市价的任何方向，在 10%的幅度内修改价格。
6. 从您通过账户管理页面创建的说明列表中，使用**机构**下拉列表来选择目的地。
7. 点击确定。
8. 在**账户**窗口上点击*转移*标签来查看所有转移中的待处理头寸。该页面还将显示您提交的任何交易后分配的定单。

Note: DVP/RVP 在输入后的第三天结算。如果您的对方经纪商到结算日期前一天的东部时间 12:00:00 还没有接受 DVP/RVP 说明，那么将取消交易。请点击转移对话框上的 **DVP/RVP 信息**按钮以获取完整的细节。

同样注意，您有权利选择让您的常备说明以压缩模式被执行，该模式计算当日的交易净值，并使用加权平均价格。默认情况下，交易被非压缩地执行，这意味着它们不被计算净值，而是作为单笔交易被发送。要获取关于压缩和非压缩模式的更多细节，请联系您的 IB 销售代表。

A
Account 6-266
Account Alias 13-655
Account Group 13-649
Account Information 6-266
Account window for Advisors 6-267
Account Window summary for Advisors 6-268
Add a tab 4-205
Add columns 10-528
Add contracts to Model Navigator 7-366
Add total row 10-498
Advanced booktrader mode 2-40
Advisors 13-644
Advisors Account Window 6-268
Advisors rebalance 13-647
ADX/DMI 9-436
Aggregated Greeks 7-358
Alarm for change in volume 6-326
Alerts 10-543
Algo status 4-207
Algos 4-244
algos 4-243
Alias 13-655
Allocation 13-646, 13-649, 13-652
Allocation column 13-644
Allocation Profiles 13-652, 13-654
Analyst Info 8-396
Analytics configuration 10-482
API 10-490
Apply button 4-207
Arrival Price 14-666
Assign sounds to events 6-321
Auto Export 10-492
Auto future rollover configuration 10-473
Auto order 2-80
Auto order in ISW 2-80
Auto Rollover 12-638
Automatically allocate trades 13-657
Average Cost 6-301
Average price 4-208

B
Background 10-559
Background colors 6-302
Basket Order 2-25
Basket order format 2-29
Basket Trader 10-509
Bollinger Bands 9-453
Bond 1-18
Book Trader 2-36, 2-38
Book Trader colors 2-47
BookTrader 2-40
BookTrader Hotkeys 2-42
Box combo 2-53
but not higher than... price boundary 4-200
Butterfly combo 2-53
Buy algo 4-199
Buy Write 2-53
Buyback 4-238

C
Calendar spread 2-53
Cancel 1-14
Catch up in time 4-200
CCI 9-441
Change decimals 5-250
Chart Indicator - MFI 9-445
Charting 8-393
Charts 9-432, 10-537
Clearing 14-660
Clearing Account 14-662
Clearing instruction 14-662
Close position 11-618
color 10-501
color palette 10-501
Colors 6-302
Commentary 8-392
Commodity Channel Indicator 9-441
Company profile 8-391
Comparative moving average condition 4-204
Compare stock deltas 4-204
Component size 4-199
Confidence interval 7-337
Configure 10-471, 10-509, 10-521, 10-524, 10-535, 10-537, 10-543
Configure menu 11-629
Configure SpreadTrader 10-526
Confinuous update setting 10-482
Confirm short sell 14-664
Conversion spread 2-54
Create audit trail configuration 10-473
Cusip 1-18
Custom indicators 9-436
Customize trading data 5-250

D
Dashboard 10-482
Deactive 1-17
Define algo parameters 4-199
Delay in submitting order 4-200
Delete 5-248
Delivery vs. Payment 14-666
Delta neutral spread 2-54
Diagonal spread 2-54
Display 10-498, 10-552
Display model history in Model Navigator 7-372
Display Model Navigator fields on a trading page 7-367
Display settings 5-250
Dividend editor 5-259
Dividend Schedule Editor 7-378
DVP 14-663, 14-666
Dynamic colors 10-555

E
earnings 8-390
Earnings estimates 8-390
Edit dividend schedule 5-259
Edit Dividends in Model Navigator 7-378
Edit Interest Rates in Model Navigator 7-376

Edit the Volatility Profile 7-370
EFP combo 2-56
EFPs 2-123
EMA 9-456
Enable features 10-581
End time 4-200
Enter tickers 1-7
Envelope 9-455
Example of algo settings 4-202
Excel 2-33
Excel basket order 2-29
Exclude exchanges 10-484
Exercise 12-640
Exercise an Option 12-641
Exit 10-496
Exponential Moving Average 9-456
Export 10-492
Export Trade Reports 6-285

F
FA 13-644
Feature Selector 10-581
File menu 11-612
Fill outside of regular trading hours 4-201
Filter pending orders 6-291
Financials 8-394
Find 5-252
Fixed income 1-18
Font 10-498, 10-501
Friends and family 13-644
Fund families 1-21
Fundamentals 8-384, 8-391
Fundamentals page 8-386
Funds 1-21
Futures rollover 12-638

G
General configuration 10-473
Give up 14-662
Give up if conditions are false 4-204
Give-up 14-660
Global Configuration 10-471
Greek Portfolio 10-520
gridlines 10-501
Guaranteed Dollars 14-663

H
Header row 5-251
Help menu 11-630
Historical charts 9-432
Hot Keys 10-475
Hotkeys 2-42

I
IA configuration 10-482
IBAlgos 14-666
IBExecution 14-660, 14-662
IBExecution Account Screen 14-663
Import 1-8
Import indicators 9-436
Increment 4-199
Indicators, custom 9-436
Insert row 5-251
Insider Trading 8-395
Interest Rate Navigator 7-376
Inter-market or Smart Combo 2-56
Iron Condor 2-54
ISW Auto order 2-80

J
Java 1-2
Java plugins 9-436
Jefferies algo 4-239
Jefferies buyback 4-238
Jefferies Seek 4-240
Jefferies strike 4-241
Jefferies TWAP 4-242
Jefferies volume participation 4-243
Jefferies VWAP 4-244

K
Keep on top 10-473
Keltner Channel indicator 9-442

L
Last order status 4-208
Last price condition 4-203
Last Trade Price 4-208
Layout 10-546, 10-548
Limit price calculation 4-200
Local settings 1-2
Log in 1-2

M
MACD 9-446
Manual basket file 2-29
Margin monitor 6-271
Margining 6-271
Market Data 1-4, 1-8, 5-250, 10-482, 10-552
Market Depth 10-535
Market Scanner 9-462, 9-464
Menus 11-612, 11-614, 11-616, 11-618, 11-625, 11-626, 11-629, 11-630, 11-632, 11-633, 11-634
MFI 9-445
Missed orders 4-208
Model Navigator 7-365
    open 7-366
Model Navigator change pricing assumptions 7-370
Model Price Color Key 7-380
Modify 1-11
Momentum 9-444
Money Flow Index 9-445
Monitor 10-482
Mouse Shortcuts 10-506
Moving average condition 4-203
Moving Average Convergence/Divergence 9-446

Moving VWAP condition 4-203
Multiple algos 4-207
Multiple Clients 13-644
Mutual funds 1-21

N
News 8-392, 8-398
News condition 4-203
No load funds 1-21

O
OBV 9-447
Offset amount 10-600
On Balance Volume 9-447
Open the Model Navigator 7-366
Open trade reports in Excel 6-286
option chain fields 10-521
Option Exercise 12-641
Option model pricing 7-365
Option Portfolio - Open the Option Portfolio 4-210
Option Pricing 6-301
Optional conditions 4-203
Order defaults 10-582
Order increment 4-199
Order Management 10-556
Order Menu 11-618
Order price 4-199
Order quantity 4-199
Order status 6-302
Order types 1-16, 4-199
Order wizard 1-16
Orders 1-10
Oscillator 9-451, 9-452

P
P&L 6-301, 7-337
Page 5-249, 5-250
Page Layout 10-528, 10-546, 10-548, 10-550
Page menu 11-614
Palette 10-501
Parabolic SAR 9-457
Pending orders
    filter 6-291
Percent difference in price movement 4-204
Percent of Volume Strategy 14-666
Pivot points 9-458
Plugins 9-436
PNL 6-301
Portfolio EFPs 2-123
Position-related condition 4-203
Post algo 4-239
Post Trade Allocation 14-662
Pre-open re-route 10-484
Preserve default allocation 13-657
Pre-trade give up 14-662
Price colors 10-555
Price movement alarms 6-324
Price Offset in Model Navigator 7-369
Price range condition 4-203
Print account summary 6-268
Profit and Loss 6-301
Proxy 10-533
PTA 14-662

Q
Quick Stock 10-489
Quick Stock Entry 1-7, 5-257

R
Randomize size 4-201
Randomize time period 4-200
rapid order entry settings 10-561
Rate of Change 9-448
Reallocate all 13-647
Rebalance 10-524
Rebalance multiple accounts 13-647
Relative Strength Indicator 9-449
Relative to position 4-200
Relative to size traded 4-200
Relevant EFPs 2-123
Remove columns 10-528
reposition columns 10-558
Reset button 4-207
Restore 5-249
Restore button 4-207
Resume if conditions become true 4-204
Reuters 8-384
Reuters news 10-533
Reuters reports 8-386
Reversal spread 2-54
right-click menu 11-632, 11-633, 11-634
Risk Navigator
    Use drill through market scenario 7-353
Risk navigator 7-337
Risk Reversal spread 2-54
ROC 9-448
Rounding 5-250
RSI 9-449
RSS 8-398, 10-533
RSS Proxy 10-533
RVP 14-666

S
SAR 9-457
Save model history 7-372
Scanner 9-462, 9-464
Search 5-252
SEC 8-397
Seek algo 4-240
Sell algo 4-199
Separately Managed Accounts 13-644
Set conditions for the algo 4-203
Set default allocations 13-656
Set order price to 4-199
Set pacing for refresh rate in Model Navigator 7-373
Settlement instructions 14-663
Shade alternate rows on your trading screen 10-546
Share allocation 13-646, 13-649, 13-652

Shares bought 4-208
Shares deactivated 4-208
Shares remaining 4-208
Shares working 4-208
Short sell 14-664
Shortcut for entering tickers 1-7
Shortcuts 2-42, 10-506
Show italics 5-250
Show volatility prices 10-482
Shut off alarms 6-325
Simple moving average 9-459
SMA 9-459, 13-644
SmartRouting 10-484
Sort 5-250
Sound Manager 10-487
SSF/OPT spread 2-54
Start button 4-207
Start time 4-200
Status 4-207
Stochastic Oscillator 9-450
Stock/Option spread 2-54
Stop button 4-207
Stop trigger method 10-601
Straddle 2-54
Strangle 2-54
Streaming news 8-398
Streaming News Feeds 8-384
Strike 4-241
Styles 10-501
Supplier 10-533
Symbol Mode 1-6
Synthetic 2-54
Synthetic call 2-54
Synthetic put 2-54

T
Tabset 5-249
Take size if the bid/ask is... 4-201
T-Bills 1-18
T-Bonds 1-18
The Model Navigator window 7-367
Tick 9-468
Ticker menu 11-616
Time & Sales 9-430, 9-431, 12-638
Time interval 4-199
Time of last order 4-208
Time until next order 4-208
Title row 5-251
T-Notes 1-18
Toolbar 5-249, 10-505
Tooltips 10-498
Trading page 5-249, 5-250
Transfer via DVP 14-666
Transmit 1-12
Treasuries 1-18
Trigger method 10-601
Trin 9-468
TWAP 4-242

U
UG 14-663
Ultimate Oscillator 9-451
Underlying 1-4
Unrealized P&L 6-301
Use currently subscribed account 13-657
Use last submitted as a default allocation 13-657

V
Vanguard funds 1-21
Vertical spread 2-55
View menu 11-626
Volatility configuration 10-482
Volatility Curve Plot 7-369
Volatility Curve Table 7-375
Volatility Model 7-369
VWAP 4-244
VWAP algo 14-666

W
Wait for current order to fill 4-200
Weighted moving average 9-460
What if margin 6-271
Williams Oscillator 9-452
Wizard 1-16
wma 9-460
WMA Indicator 9-460
Workspace 10-604