

金仕达系统结算账单解读

本结算单为金仕达交易系统生成的逐笔对冲型结算单，共由资金状况、成交记录、平仓明细、持仓汇总四部分组成。其中，手续费收取标准为 100 元/手，保证金收取标准暂定为 10%。

资金状况 币种：人民币														
上日结存：	198680.00	当日结存：	199180.00	可用资金：	-10532.00									
出入金：	0.00	浮动盈亏：	-5520	风险度：	105.44%									
手续费：	400.00	客户权益：	193660.00	追加保证金：	10532.00									
平仓盈亏：	900.00	保证金占用：	204192.00	交割保证金：										
成交记录														
成交日期	交易所	品种	交割期	序号	买卖	成交价	手数	开平	成交额	手续费	投保	平仓盈亏		
20061128	中金所	股指	0612	0	买	1664.30	1	开	499290.00	100.00	投	0.00		
20061128	中金所	股指	0612	0	买	1665.00	1	开	499500.00	100.00	投	0.00		
20061128	中金所	股指	0612	0	买	1668.10	1	开	500430.00	100.00	投	0.00		
20061128	中金所	股指	0612	0	卖	1668.00	1	平	500400.00	100.00	投	0.00		
共 4 条							4		1999620.00	400.00				
平仓明细														
成交日期	交易所	品种	交割期	序号	买卖	成交价	开仓日期	开仓价	手数	昨结算	平仓盈亏			
20061128	中金所	股指	0612	0	卖	1668.00	20061128	1665.00	1	1666.30	900.00			
共 1 条									1		900.00			
持仓汇总														
交易所	品种	交割期	买持	买均价	卖持	卖均价	昨结算	今结算	浮动盈亏	持仓盯市盈亏	保证金占用	投保		
中金所	股指	0612	2	1666.20	0	0.00	0.00	1663.10	-1860.00	0.00	99786.00	投		
中金所	股指	0701	2	1746.20	0	0.00	0.00	1740.10	-3660.00	0.00	104406.00	投		
共 1 条			4		0				-5520.00	0.00	204192.00			

一、成交记录

“成交记录”记录当天所有成交明细。

二、平仓明细

“平仓明细”是对当日所有平仓单的结算。

本账单中，IF0612 的平仓盈亏： $(1668-1665) * 300 * 1 = 900$ （元）

三、持仓盈亏

由于本账单类型采取“逐笔对冲”计算方式，故在“持仓盈亏”中关于“昨结算价”、“持仓盯市盈亏”字段为空。

1、浮动盈亏

本账单中“浮动盈亏”为按照逐笔对冲盈亏计算方法计算出的盈亏。逐笔对冲盈亏计算方法如下：

浮动盈亏 = 当日结算价与开仓价之差 * 合约乘数 * 手数

本账单中，IF0701 历史持仓的“浮动盈亏”： $(1740.1-1746.2) * 300 * 2 = -3660$ （元）

本账单中，IF0612 当日持仓的“浮动盈亏”： $(1663.1-1666.2) * 300 * 2 = -1860$ （元）

3、持仓保证金（按照期货公司保证金比例计算）

持仓保证金 = 当日结算价 * 合约乘数 * 手数 * 保证金比例

本账单中，IF0701 合约 2 手历史持仓的持仓保证金为： $1740.1 * 300 * 2 * 0.1 = 104406$ （元）

四、资金状况

1、当日结存（逐笔对冲）

当日结存 = 上日结存（逐笔对冲） + / - 平仓盈亏 - 当日手续费

本账单中，当日结存 = $198680 - 400 + 900 = 199180$ （元）

2、客户权益

客户权益 = 当日结存（逐笔对冲） + / - 浮动盈亏

本账单中，客户权益 = $199180 - 5520 = 193660$ （元）

4、可用资金

可用资金 = 客户权益 - 保证金占用

本账单中，可用资金 = $193660 - 204192 = -10532$ （元）

本账单中客户需追加保证金等于今日可用资金，为 10532。

4、风险度

风险度 = 根据期货公司保证金比例计算的持仓保证金 / 客户权益 × 100%

$= 204192 / 193660 \times 100\%$

$= 105.44\%$

当客户的风险率一大于等于 100% 时，公司将于当日交易结算报告中向客户发出追加保

证金通知,客户应当在下一交易日开市前及时追加保证金或者在开市后立即自行平仓。否则,公司有权按照盘中即时价重新测算风险率, 据此对客户的部分或全部未平仓合约强行平仓, 直至客户的盘中风险率小于 100%。