

TF 联合风控软件说明

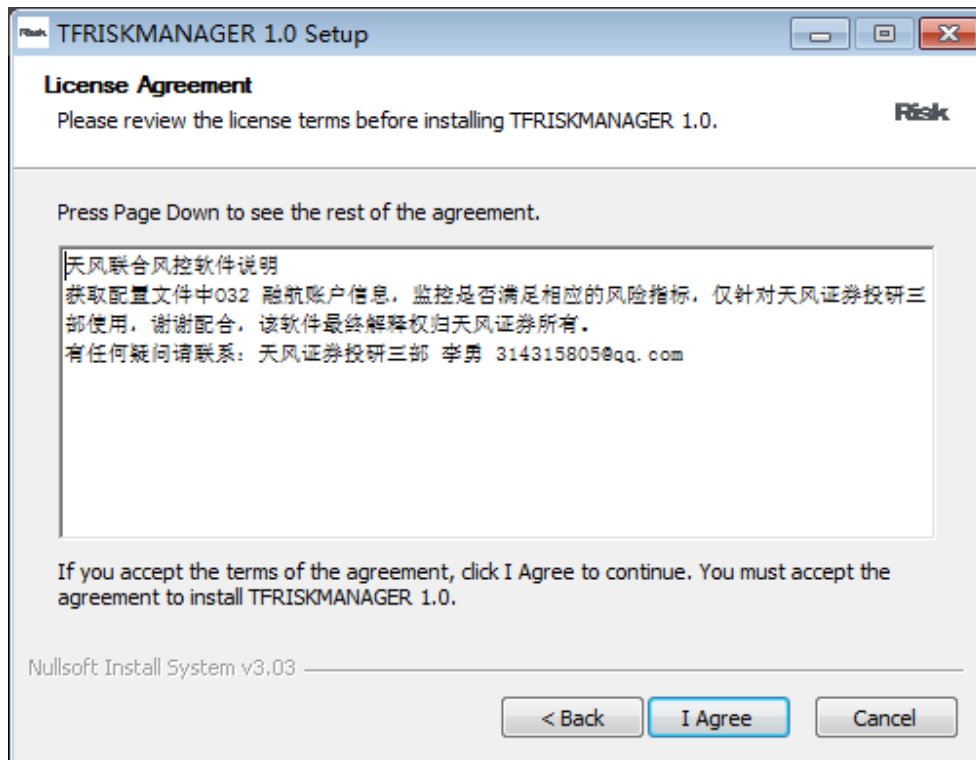
目录

- TF 联合风控软件说明.....1
 - 一、安装配置说明.....2
 - 安装.....2
 - 配置.....3
 - 二、运行以及内部算法说明.....5
 - 运行.....5
 - 算法解析.....6
 - 三、程序交互.....7

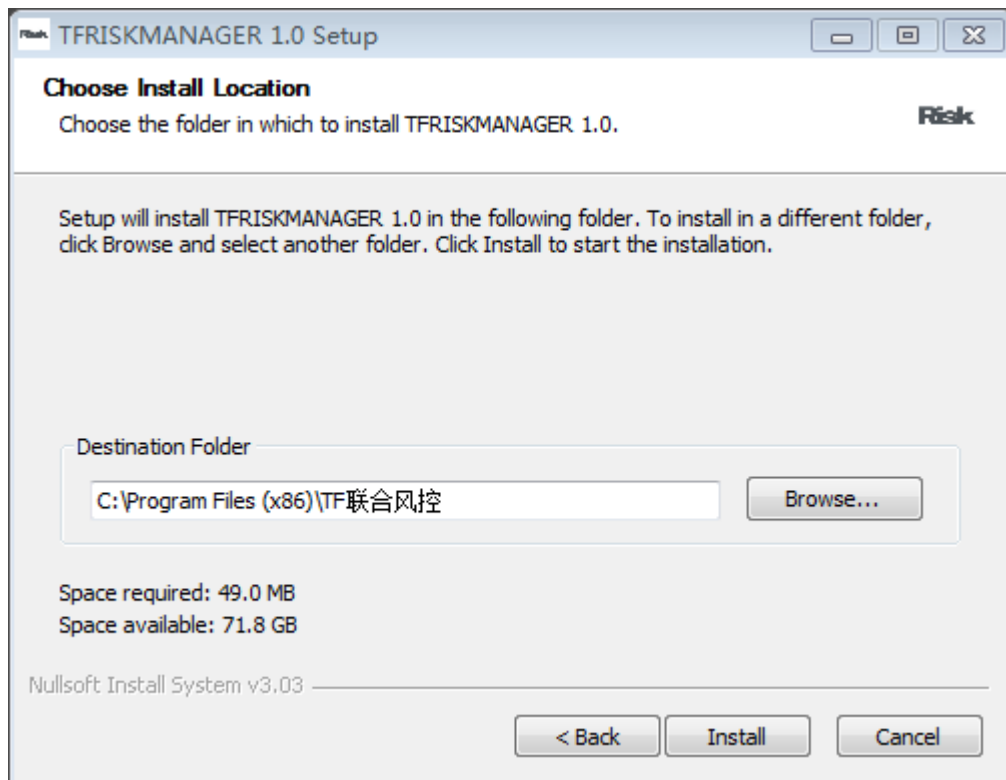
一、安装配置说明

安装

注：实盘应安装在服务器或者工作站。

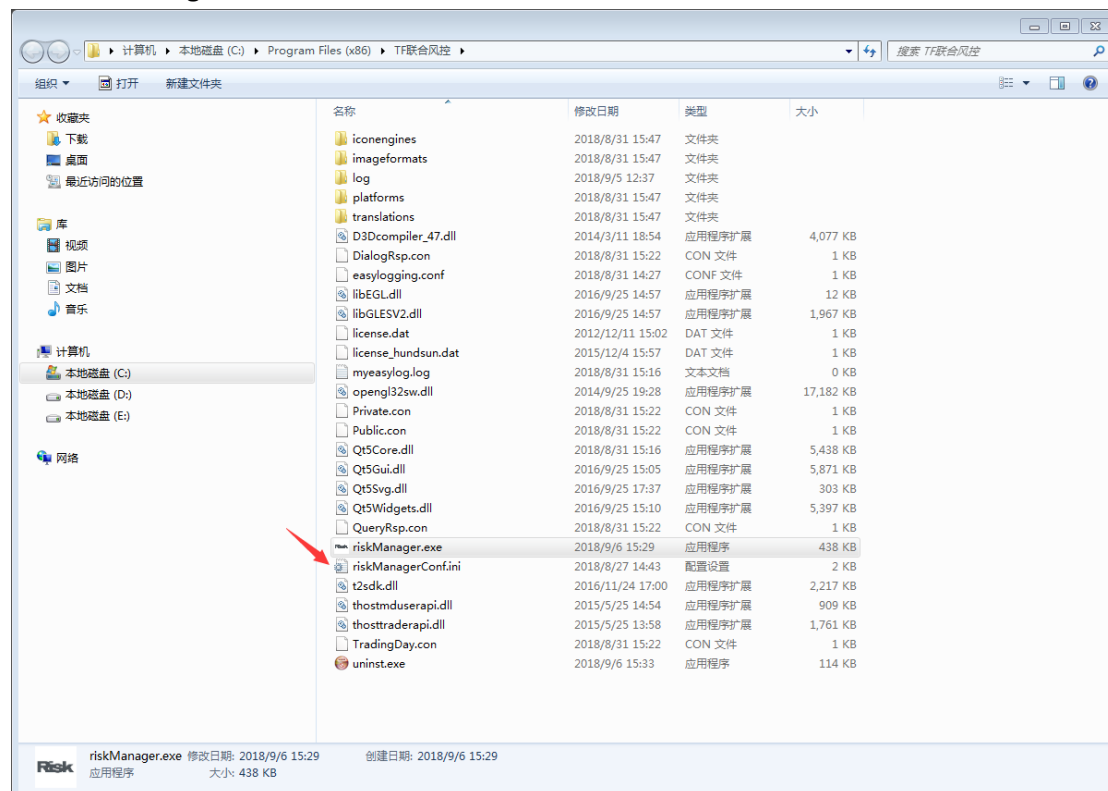


默认目录即可



配置

打开 riskManagerConf.ini



```
riskManagerConf.ini - 记事本
文件(F)  编辑(E)  格式(O)  查看(V)  帮助(H)

[t2sdk]
;如果要更换接入柜台请修改servers的IP和新柜台的许可证文件license_file, 如果许可证文件有密码请修改license_pwd;
servers=192.168.31.93:9003
servers_old=120.55.176.113:9359
license_file=license.dat
license_pwd=888888
;下面默认, 如需要修改或者增加请参照《T2SDK 外部开发者文档》修改或者增加;
;login_name可以设置客户端登录服务的名字, 实现有名连接;
login_name=asyn_send
lan=1033
send_queue_size=100
init_recv_buf_size=512
init_send_buf_size=512
send_queue_size=1000
;是否开启nagle算法; nagle算法专用TCP/IP网络减少拥塞控制;
;enable_nagle=1
errors=errors.ini
;是否配置自动重连, 配置自动重连之后网络断开, 不会触发onclose函数
;auto_reconnect=1
;下面三个为日志文件配置, 配置1说明开启日志功能, writedata1比较有用可以记录所有通过t2进行发收包情况, 生成的dat文件可以使用特有的工具进行解读; 工具: LogDecryTool.exe
;if_error_log=1
;if_sendRecv_log=1
;writedata=1
;客户端和服务端的心跳时间, 一般不用
;heartbeat_time = 15

[proxy]
;默认
proxy_type=
ip=127.0.0.1
port=
user_name=guest
password=888888

[safe]
;目前支持的安全连接模式有:
;1、none (明文); 只需要修改safe_ssl=none, 即可其他默认;
;2、ssl加密; 需要修改safe_level=ssl, 还需要配置cert_file和cert_pwd即为加密证书地址和密码
safe_level=none
client_id=123456
comm_pwd=888888
cert_file=c20150708.pfx
cert_pwd=111111

[ufx]
;如果开发者接入恒生的仿真环境, 需要先在网站上申请个人专属测试账号;
fund_account=2700
password=tf123456
authorization_id=1400FB61F167C31B7D12073F1F609A7E
asset_no=270000
[ctp_account]
brokerID=9999
tdAddress=tcp://180.168.146.187:10000
password=密码
mdAddress=tcp://180.168.146.187:10010
userID=036762
mdFlowPath = mdflow//
tdFlowPath = tdfLOW//
```

修改的参数有:

[ufx]

fund_account=操作员号

password=密码

authorization_id=1400FB61F167C31B7D12073F1F609A7E

asset_no=资产单元

[ctp_account]

brokerID=经纪公司代码

tdAddress=tcp://180.168.146.187:10000

password=密码

mdAddress=tcp://180.168.146.187:10010

userID=融航用户号

[t2sdk]

servers=UFx 服务地址

样例:

[ufx]

;如果开发者接入恒生的仿真环境, 需要先在网站上申请个人专属测试账号;

fund_account=2700

password=tf123456

authorization_id=1400FB61F167C31B7D12073F1F609A7E

asset_no=270000

[ctp_account]

brokerID=9999

tdAddress=tcp://180.168.146.187:10000
password=attention3
mdAddress=tcp://180.168.146.187:10010
userID=036762
servers=192.168.41.93:9003
！注意请不要在等号后加空格

二、运行以及内部算法说明

运行



双击桌面上图标-配置好各类预警线后点击启动监控,可 7*24 小时运行(内部自动断线重连),一般无需人工干预。到达预警线后,日志记录在安装目录中 log 文件夹内,如果到达平仓线则生成错误日志: error_log_date.log;如果到预警线则生成警告日志: warning_log_date.log, 风控人员只需查看某一天该类型文件大小即可知道是否触发了预警线和平仓线。

名称	修改日期	类型	大小
debug_log_20180831.log	2018/8/31 14:46	文本文档	0 KB
debug_log_20180906.log	2018/9/6 15:18	文本文档	0 KB
error_log_20180831.log	2018/8/31 15:08	文本文档	31 KB
error_log_20180906.log	2018/9/6 15:30	文本文档	1 KB
info_log_20180831.log	2018/8/31 15:08	文本文档	36 KB
info_log_20180906.log	2018/9/6 15:30	文本文档	4 KB
log_20180831.log	2018/8/31 14:46	文本文档	0 KB
log_20180906.log	2018/9/6 15:18	文本文档	0 KB
trace_log_20180831.log	2018/8/31 14:46	文本文档	0 KB
trace_log_20180906.log	2018/9/6 15:18	文本文档	0 KB
warning_log_20180831.log	2018/8/31 15:08	文本文档	30 KB
warning_log_20180906.log	2018/9/6 15:18	文本文档	0 KB

算法解析

由于软件针对资管产品层面开发，算法举例如下：

2、投资比例

固定收益类资产：占定向计划资产总值的比例为 80%-100%。

商品及金融衍生品类资产：合计占定向计划资产总值的比例为 0%-20%，其中商品期货
合约保证金占定向计划资产总值比例为 0%-5%。

权益类资产占定向计划资产总值的比例为 0%-20%。

注：融航账户：商品期货；032 账户：除商品期货外其他所有品种。

总资产 = 032 账户资产+融航账户资产

固定收益类资产比例= (债券资产+现金资产+回购资产)/ 总资产。

如果低于预警线，则触发报警，记录日志。

如果低于平仓线，则触发平仓，程序停止交易，并记录日志。

商品以及金融衍生品类资产比例 = (融航保证金+032 期货保证金+032 期权保证金) / 总资产

如果高于预警线，则触发报警，记录日志。

如果高于平仓线，则触发平仓，程序停止交易，并记录日志。

商品期货资产比例 = (融航保证金) / 总资产

如果高于预警线，则触发报警，记录日志。

如果高于平仓线，则触发平仓，程序停止交易，并记录日志。

权益类资产比例 = (032 股票资产) / 总资产

如果高于预警线，则触发报警，记录日志。

如果高于平仓线，则触发平仓，程序停止交易，并记录日志。

info_log_20180906.log - 记事本										
文件(F) 编辑(E) 格式(O) 查看(V) 帮助(H)										
[INFO]	2018-09-06	15:23:22, 812]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:0	0	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:23:25, 942]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:0	0	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:23:29, 055]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:0	0	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:23:32, 170]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:0	0	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:23:35, 290]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:0	0	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:23:38, 409]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:0	0	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:23:41, 513]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:0	0	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:23:44, 632]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:0	0	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:02, 506]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:05, 623]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:08, 754]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:11, 870]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:15, 009]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:18, 108]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:21, 228]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:24, 434]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:27, 556]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:30, 659]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:33, 771]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:36, 879]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:39, 994]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:43, 099]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:46, 230]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:49, 335]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:52, 457]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:55, 566]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:24:58, 689]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:01, 790]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:04, 910]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:08, 020]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:11, 144]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:14, 254]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:46, 698]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:49, 795]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:52, 908]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:56, 022]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:25:59, 156]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:26:02, 264]	Commodity:1	1	Derivative:1	1	FixedIncome:1	1	Equity:1	1
[INFO]	2018-09-06	15:26:05, 390]	Commodity:1	1	Derivative					