



上海期货
信息技术有限公司

Shanghai Futures Information Technology Co.,Ltd.

风险监控系統

用戶操作手冊

文件状态：	文件标识：	
<input type="checkbox"/> 草稿	当前版本：	V4.1_4
<input type="checkbox"/> 正式发布	作 者：	
<input checked="" type="checkbox"/> 正在修改	完成日期：	

修订历史记录

修 改 记 录编号	修改 状态	修改页码及条款	修改人	审核人	批准人	修改日期

目 录

1、	系统使用说明	5
1.1	系统概述.....	5
1.2	基本功能说明	5
1.2.1	使用须知.....	5
1.2.2	登陆系统.....	5
1.2.3	主界面说明.....	6
1.2.4	用户退出.....	7
1.2.5	导出数据.....	8
1.2.6	打印、打印预览.....	9
1.2.7	自动设置列宽.....	9
1.2.8	设置最佳列宽.....	10
1.2.9	排序、按组排序、多重排序.....	10
1.2.10	手动生成强平单.....	11
1.2.11	辅助生成强平单.....	13
1.2.12	净持仓指标设置及超标强平.....	25
1.2.13	撤单.....	28
1.2.14	发送风险通知.....	29
1.2.15	权益反向计算.....	31
1.2.16	批量权益反向计算.....	34
1.2.17	预埋强平单.....	37
1.2.18	视图快速模式.....	38
1.2.19	移动视图.....	39
1.2.20	查看系统版本.....	40
1.2.21	前端显示.....	41
1.2.22	布局保存及应用.....	41
1.2.23	密码修改.....	42
1.2.24	关闭系统.....	43
2、	各分视图说明	44
2.1	选项	44
2.2	当日资金查询	46
2.3	已选投资者列表	50
2.4	投资者信息	52
2.5	投资者成交信息	53
2.6	投资者报单信息	54
2.7	投资者持仓信息	55
2.8	投资者持仓排行	56
2.9	投资者成交排行	58
2.10	实时风控行情	60

2.11	压力测试.....	61
2.12	市场持仓量分布显示.....	64
2.13	用户事件信息	66
2.14	风险通知信息	67
2.15	报单查询.....	68
2.16	成交查询.....	69
2.17	持仓查询.....	70

用户操作手册

1、 系统使用说明

1.1 系统概述

1) 软件名称：《新一代风险监控系统》

2) 对应对象：经纪公司

3) 安全特性：

a) 使用权限

b) 防范技术：

用户身份验证：只有具有合法用户名与密码的用户才能使用本系统。

用户功能权限：用户只能使用获得授权的功能。

4) 安装与设置：

a) 运行环境：Windows XP

b) 安装步骤：

1.2 基本功能说明

1.2.1 使用须知

只有具有合法的用户名和正确的密码才能进入本系统，且当用户获得对应的风险监控授权才能进入和使用某些功能，该权限可以向综合交易平台的管理员进行申请。

1.2.2 登陆系统

用户双击exe文件，输入用户编号、用户密码、风险前置，点击【登录】按钮，登录风险监控系統，如图1.2.2-1。

u 用户编号：为在综合交易平台->交易管理->操作员管理->设置操作员，获得的操作员代码；

u 用户密码：初始密码为在综合交易平台->交易管理->操作员管理->设置操作员，设定的密码；

u 风控前置：风控服务器配置；

【清除缓存】按钮用于清除本地缓存数据，当用户发现风控客户端中的数据有异常或者没有更新某些数据时，建议退出系统，清除缓存后，重新登陆再查看。

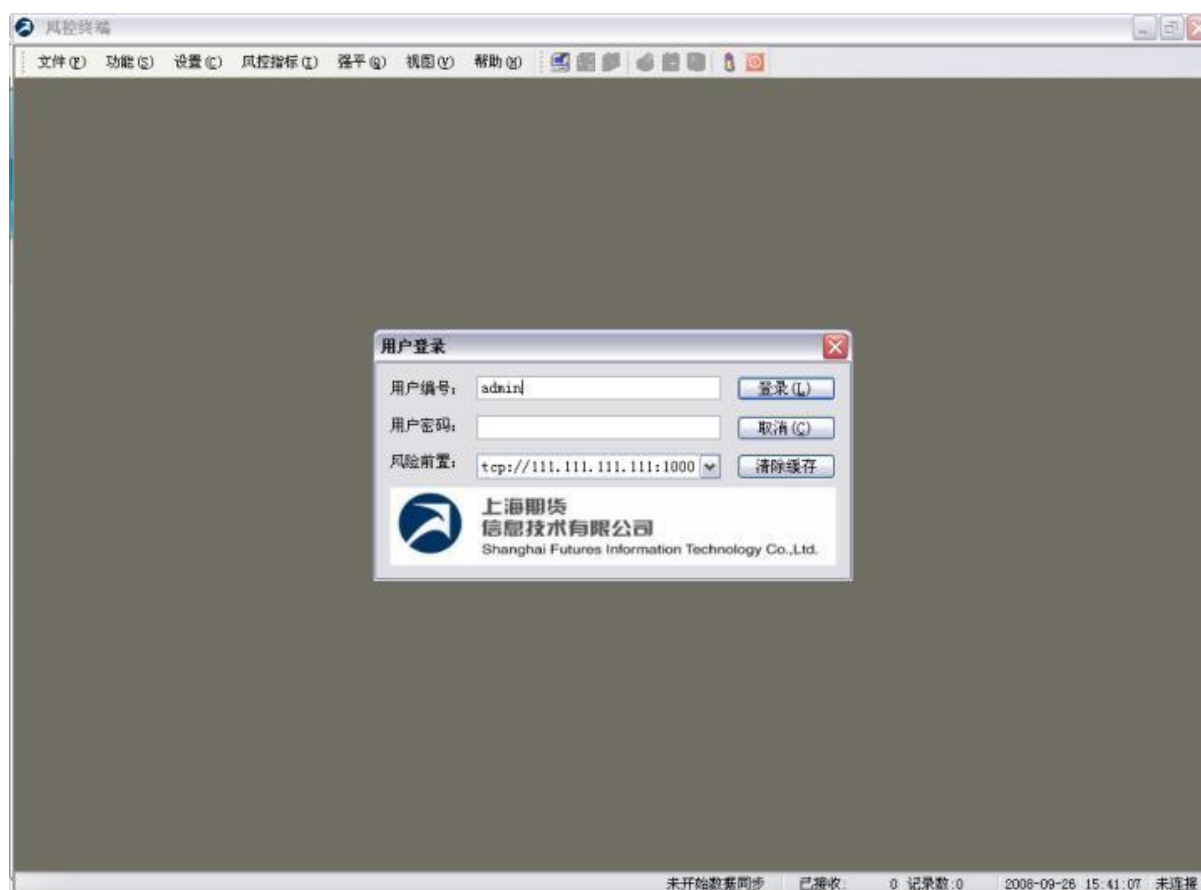


图 1.2.2-1

1.2.3 主界面说明

用户初次登陆后的主界面如图1.2.3-1，按功能分为下面三个部分：

1. 菜单栏：显示所有的菜单项；
2. 视图窗口：所有分视图均显示在该窗口中；
3. 状态栏：包含本地状态栏和主机状态栏，主要用于显示命令执行结果或返回信息、数据同步状态、已接收的记录数、记录数、系统时钟、与服务器连接状态等系统状态。其中记录数是指当前被激活的视图中的记录数量。

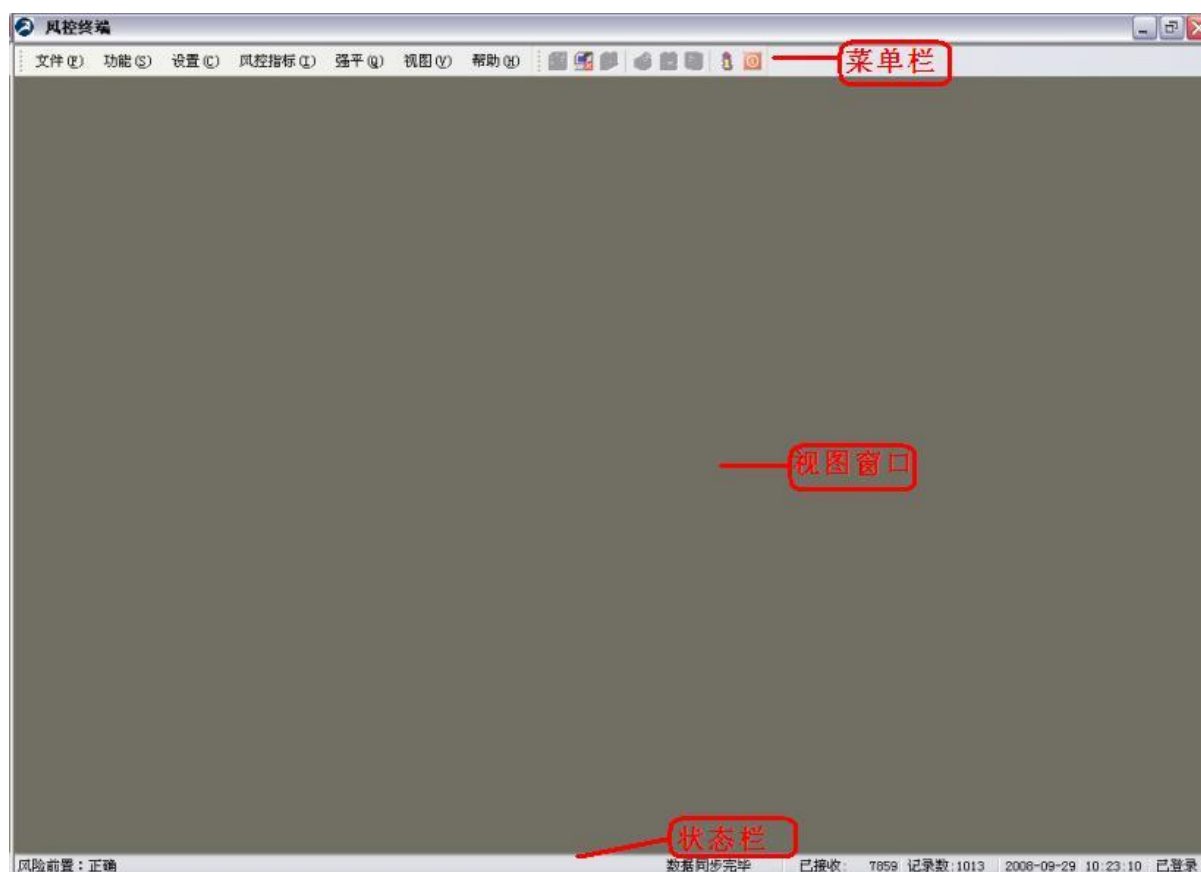


图1.2.3-1

系统提供用户操作手册快捷方式，用户可以通过点击某视图，然后按【F1】键，查看相应视图的操作说明。

系统中的某些查询界面的筛选条件输入框，支持通配符“*”和“？”，具体规则遵循dos操作习惯，即“*”代表一位或多位，“？”代表一位。

支持的输入框有：

1. 当日资金查询视图--查找投资者；
2. 投资者成交、报单以及持仓信息视图--合约/产品；
3. 报单、成交查询视图--下单用户、合约、投资者号；
4. 持仓查询视图--合约、投资者号。

1.2.4 用户退出

登陆成功后，用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【用户退出】，或者菜单栏的【用户退出】按钮，实现该用户退出风险监控系統，如图1.2.4-1。退出后，可以通过点击菜单栏的【文件】->【用户登录】，或者菜单栏的【用户登录】按钮，回到登录界面，重新登

录，如图1.2.4-2。



图 1.2.4-1



图 1.2.4-2

1.2.5 导出数据

用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【导出Excel...】，或者菜单栏的【导出Excel】按钮，导出选定的视图中的所有记录到指定的目录下，如图1.2.5-1。



图1.2.5-1

1.2.6 打印、打印预览

用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【打印】、【打印预览】，或者菜单栏的【打印】、【打印预览】按钮，打印、打印预览选定的视图中的所有记录，如图1.2.6-1。



图1.2.6-1

1.2.7 自动设置列宽

系统提供自动设置列宽功能，用户可以通过鼠标右击表头列字段，在弹出的下拉框中选择【自动设置列宽】，如图1.2.7-1。系统就会根据该视图窗口的大小，将所有表头列字段压缩，保证所有表头列字段都显示在窗口能见处。若需要取消设置，鼠标右击字段，在弹出的下拉框中将【自动设置列宽】勾去即可。



图1.2.7-1

1.2.8 设置最佳列宽

系统提供设置最佳列宽功能，用户可以通过鼠标右击表头列字段，在弹出的下拉框中选择【设置最佳列宽】，如图1.2.8-1。系统就会根据各表头列字段长度以及其数据字段的长度，将所有表头列字段展开，保证所有表头列字段及其数据都能完全显示。

设置最佳列宽和自动设置列宽功能是互斥的，所以在选择设置最佳列宽之前需要将自动设置列宽功能勾去取消。



图1.2.8-1

1.2.9 排序、按组排序、多重排序

系统提供按某表头字段升序或降序排列记录，用户可以通过鼠标左击需要进行排序的表头字段，实现排序。若需要取消排序，鼠标右击排序字段，在弹出的下拉框中选择【取消排序】即可。如图1.2.9-1。

系统提供按某表头字段分组显示数据，支持多个分组嵌套显示，支持分组和排序多层嵌套。用户可以通过鼠标右击需要进行分组的表头字段，在弹出的下拉框中勾选【按组排序】即可实现按组排序。如图1.2.9-2。若需要取消按组排序，鼠标右击排序字段，在弹出的下拉框中将【按组排序】勾去即可。

系统提供按多个表头字段多重排序，用户可以通过按住【Shift】按钮，鼠标左击多个表头字段，实现多重排序。先按照第一个点击的表头字段数据排序，然后在此基础上再按照第二个点击的表头字段排序，依次类推。若需要取消排序，鼠标右击排序字段，在弹出的下拉框中选择【取消排序】即可。



图1.2.9-1

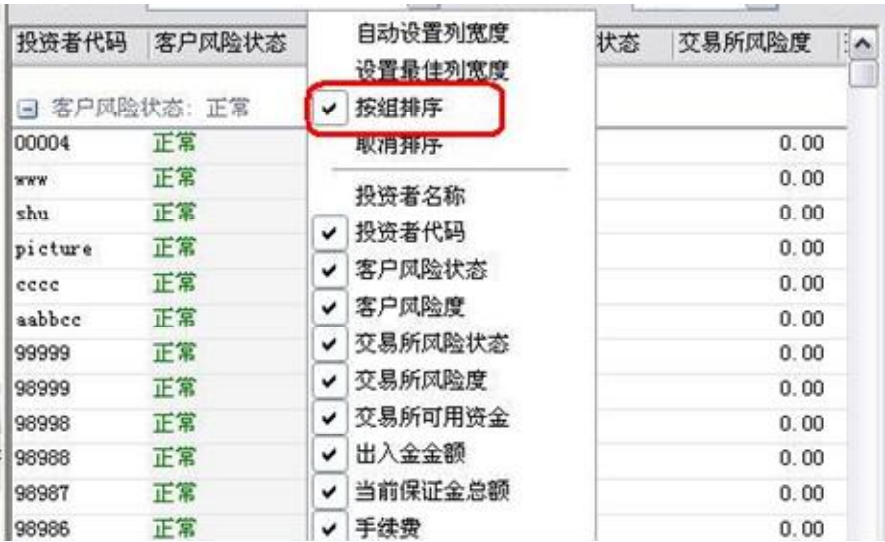


图1.2.9-2

1.2.10 手动生成强平单

系统提供手动生成强平单功能，用户可以通过双击“投资者持仓信息”视图中某条持仓记录的总买持、今买持、买可平、买均价或者买冻结字段，强平多头仓位；双击“投资者持仓信息”视图中某条持仓记录的总卖持、今卖持、卖可平、卖均价或者卖冻结字段，强平空头仓位。如图1.2.10-1。

在弹出的下单界面中输入平仓类型、委托手数、委托价，点击【确定】按钮，将该报单报入交易所，点击【预埋】按钮，将该笔报单报入本地预埋单列表；其中【可平】字段表示可平的总量，包括可平今量和可平昨量。如图1.2.10-2。

投资者持仓信息															✕
投资者代码	合约代码	总买持	今	买可平	买均价	买冻结	总卖持	今卖持	卖可平	卖均价	卖冻结	投资者保证金	交易所保证金	昨结算	
10885	al0810	0	0	0	0.00	0.00	2	2	2	19980.00	12907.10	25774.20	19980.00	19290	
10700	al0811	2	0	2	19680.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	9840.00	9840.00	19680	
10885	al0811	0	0	0	0.00	0.00	2	0	2	19680.00	0.00	27355.20	9840.00	19680	
10700	al0812	1	0	1	20360.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	5090.00	5090.00	20360	
10885	al0812	2	0	2	20360.00	0.00	3	0	3	20360.00	0.00	65661.00	25450.00	20360	
10885	au0812	1	0	1	178.33	0.00	1	0	1	178.33	0.00	32099.40	32099.40	178	
10700	cu0810	2	0	2	62710.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	94085.00	62710.00	62710	
10885	cu0810	0	0	0	0.00	0.00	2	0	2	62710.00	0.00	215722.40	62710.00	62710	
10700	fu0812	3	0	3	3622.00	0.00	1	0	1	3622.00	0.00	11590.40	11590.40	3622	
10885	fu0812	0	0	0	0.00	0.00	2	0	2	3622.00	0.00	5795.20	5795.20	3622	
11015	fu0812	0	0	0	0.00	0.00	1	1	1	3501.00	0.00	2800.80	2800.80	3622	
10885	ru0810	1	0	1	22455.00	0.00	1	0	1	22455.00	0.00	67365.00	67365.00	22455	
11015	al0810	1	1	1	19980.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	9990.00	9990.00	19290	
11022	al0810	1	1	1	19980.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	9990.00	9990.00	19290	
11022	fu0812	1	1	1	3501.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	2800.80	2800.80	3622	

强平多头持仓

强平空头持仓

强平多头持仓

强平空头持仓

图1.2.10-1

备注：

1.对于上期所的合约，平仓类型有平仓和平今，下强平单的时候平仓的数据不能大于（可平 - 可平今），平今的数量不能大于可平今；

2.对于其他交易所的合约，平仓类型只有平仓，下强平单的时候平仓的数据不能大于可平。

报单录入	
请求编号	0
投资者	98369
姓名	王
合约	cu1002
投机套保	投机
买卖	买
平仓类型	平仓 <input checked="" type="checkbox"/> 强平
委托手数	3
委托价	64530.00
涨跌	64530.00/59560.00
可平	12
可平今	12
可用资金	-2412837.38
<input type="button" value="确定"/> <input type="button" value="预埋"/>	

图1.2.10-2

1.2.11 辅助生成强平单

系统提供辅助生成强平单功能，支持单客户强平和批量强平两种方式。生成强平单之前需要先设置强平的规则。

1.2.11.1 强平设置

用户可以通过点击菜单栏的【强平】->【强平设置】进入强平设置界面，如图1.2.11-1。强平设置界面如图1.2.11-2。



图1.2.11-1

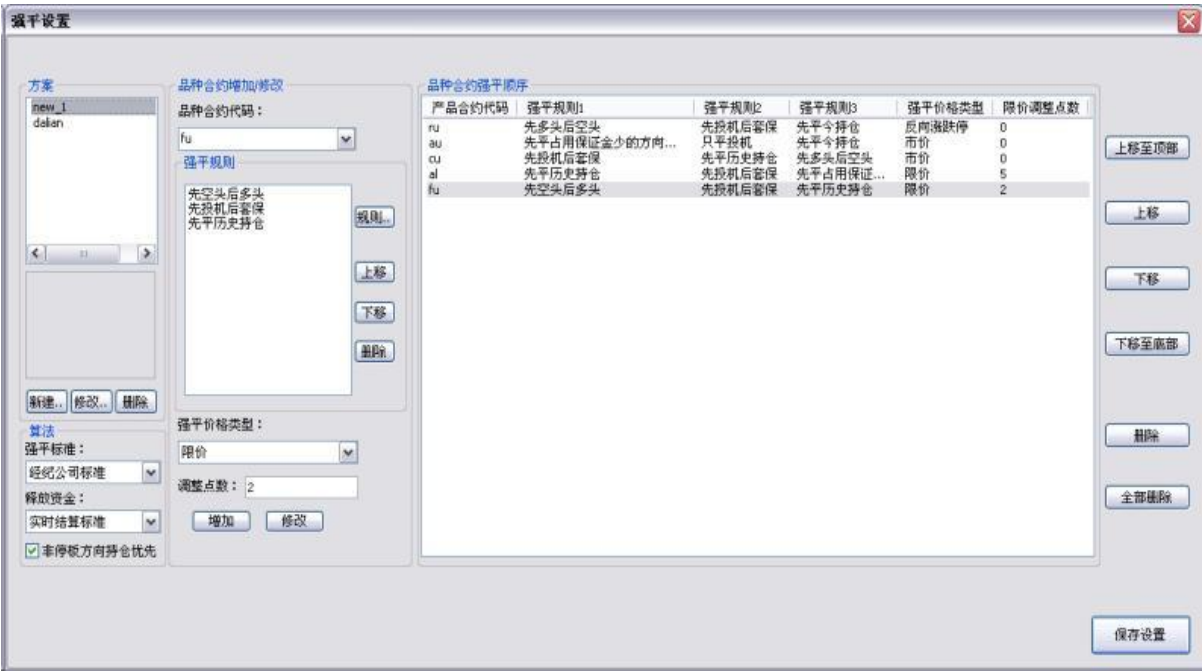


图1.2.11-2

强平设置步骤及说明：

Step1. 设置强平方案

强平方案是辅助强平单生成的强平规则依据单元，是一个或者多个合约或者品种的强平规则的集合。用户可以通过在[方案]列表框空白处鼠标右击，在下拉框中选择【新建

方案】，或者点击[方案]列表框下方的【新建..】按钮进入新建强平方案对话框，如图1.2.11-3。输入方案名和方案描述，点击【增加】按钮即可。方案描述显示在[方案]列表框下方的灰色显示框中。



图1.2.11-3

用户可以通过在[方案]列表框选中某个方案，再鼠标右击该方案，在下拉框中选择【修改方案】，或者点击[方案]列表框下方的【修改..】按钮进入修改强平方案名称和描述的对话框，如图1.2.11-4。输入新的方案名和方案描述，点击【修改】按钮即可。



图1.2.11-4

用户可以通过在[方案]列表框选中某个方案，再鼠标右击该方案，在下拉框中选择【删除方案】，或者点击[方案]列表框下方的【删除】按钮进入删除强平方案对话框，如图1.2.11-5。确认删除后，该方案中所有强平规则都将被删掉，而且不能复原。

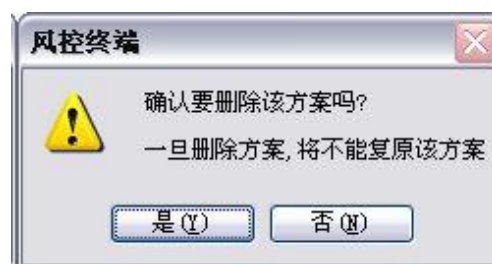


图1.2.11-5

Step2. 设置算法

每一个方案只能设置一套算法。每套算法包含三个方面：

- (1) 强平标准：经纪公司标准、交易所标准；
- (2) 释放资金：实时结算标准、以昨结算为标准；
- (3) 非停板方向持仓优先：合约停板时，对应方向的持仓放到最后强平；

Step3. 设置品种合约强平规则

3.1 强平规则增加

在【品种合约代码：】中选择需要添加的某品种或者合约，设置强平规则和强平价格类型，点击【增加】按钮，新增该品种或者合约的强平规则到右边的[品种合约强平顺序]列表框中。

如果需要导入所有合约，可以在【品种合约代码：】中选择“全部合约”。如果需要导入所有品种，可以在【品种合约代码：】中选择“全部品种”。

3.2 强平规则修改

如果需要对某品种或者合约的强平规则记录进行修改，可以选中右边的[品种合约强平顺序]列表框中某条规则记录，对应的数据会显示在[品种合约增加/修改]列表框中，在该框中设置新的强平规则和强平价格类型后，点击【修改】按钮，即可完成修改。如图1.2.11-6。

3.3 设置强平规则

点击[强平规则]列表框右边的【规则..】按钮，弹出强平规则设置对话框，如图1.2.11-7。强平规则决定着生成的强平单的排列顺序，共有三个方面：

- a. 强平持仓方向：决定先平多头持仓，还是先平空头持仓；
- b. 强平投机套保标志：决定先平投机持仓再平套保持仓，还是只平投机持仓；
- c. 强平历史持仓顺序：决定先平历史持仓，还是先平今日持仓；

每个方面上只能选择一项规则。强平规则最多可以设置三条，最少可以为空，为空

时采用系统默认规则。

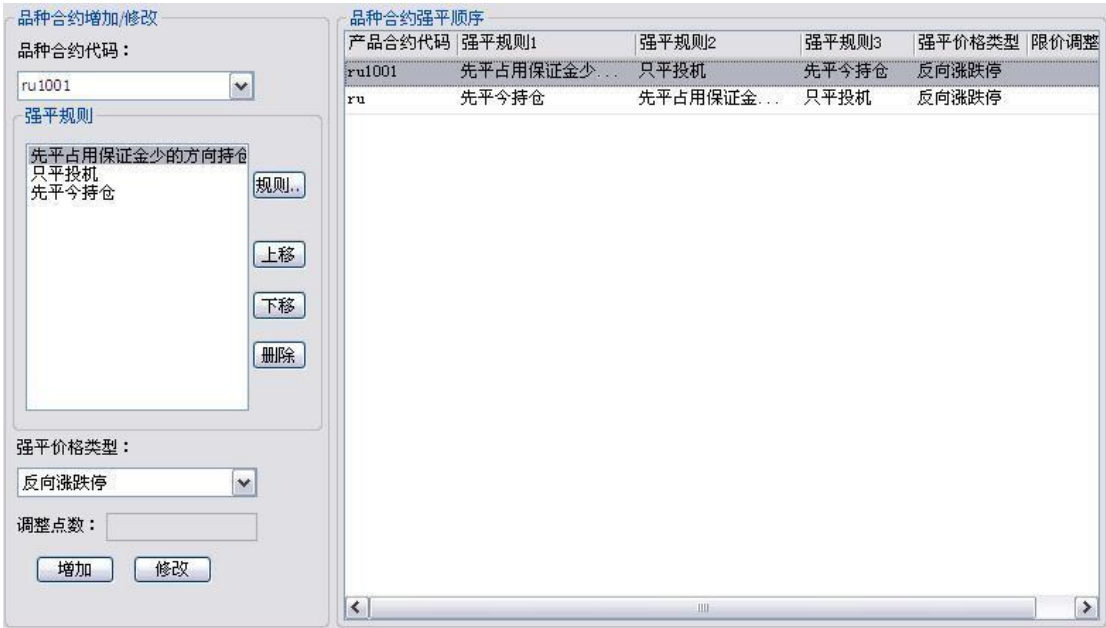


图1.2.11-6

对话框中的左边列表为待选规则，右边列表为已选规则。在左边列表框中选中某方面的一项规则，点击 **>>** 按钮，该规则被加入到已选规则中。右边列表中如果已经有该方面的某条规则，该条规则会被删除，新增的规则将被插入到列表的最后。在右边列表框中选中某项规则，点击 **<<** 按钮或者【删除】按钮，该规则会从已选规则中被删除。【全部删除】按钮用于清空已选规则列表。

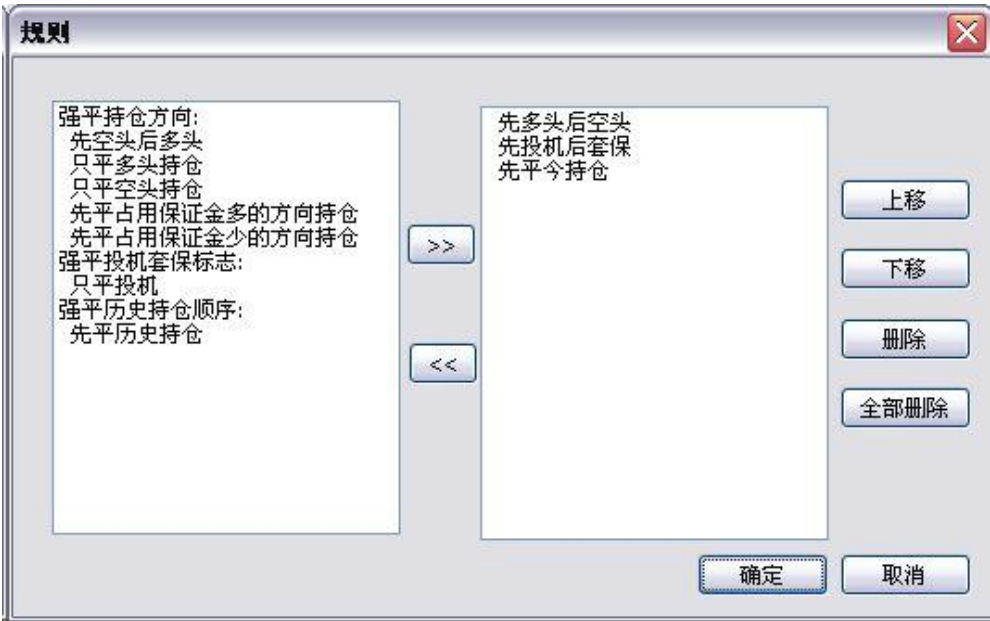


图1.2.11-7

在已选规则列表中，排列顺序代表强平规则执行的优先顺序。排列第一位的为强平规则1，具有最高优先级别；排列第二位的为强平规则2，在强平规则1的处理结果上执行，具有第二优先级别；排列第三位的为强平规则3，在强平规则2的处理结果上执行，具有第三优先级别。

如果需要变更已选规则列表中各规则的排列顺序，可以通过选中需要移动的规则，点击【上移】或者【下移】按钮将规则移动到期望的顺序上。

点击【确定】按钮完成本次强平规则设置，点击【取消】按钮取消本次强平规则设置。

[强平规则]列表框右边的【上移】、【下移】、【删除】按钮和图1.2.20强平规则设置对话框中的【上移】、【下移】、【删除】按钮功能相同。

3.4 设置强平价格类型

强平单价格有三种类型可供选择：

- a. 反向涨跌停；
- b. 限价：可以设置调整点数，计算公式为（平多头持仓）强平价格 = 最新价 - 调整点数*合约最小变动价格；（平空头持仓）强平价格 = 最新价 + 调整点数*合约最小变动价格，调整点数只能为零或者正整数；
- c. 市价：对于不支持市价报单的合约，系统将其自动转换为反向涨跌停类型；

Step4. 品种合约强平顺序

该列表框中显示某方案的所有强平规则，不支持按列自行排序。只有设置了强平规则的合约或者品种才参与强平单生成，没有设置规则的不参与强平。列表中的排列顺序代表强平顺序，排列第一位的合约或者品种的持仓最先被生成强平单，排列最后一位的合约或者品种的持仓最后被生成强平单。

当强平方案为空，没有设置任何合约或者品种的强平规则时，系统默认为所有合约按照默认强平规则生成强平单。

如果需要变更列表中各规则的排列顺序，可以通过选中需要移动的规则，点击【上移】或者【下移】按钮将规则移动到期望的顺序上。【上移至顶部】按钮用于将选中的规则移动到列表的第一位，其它规则向下顺移；【下移到底部】按钮用于将选中的规则移动到列表的最后一位，其它规则向上顺移。【删除】按钮用于将选中的规则从列表中删除；【全部删除】按钮用于清空列表中所有规则。如图1.2.11-8。

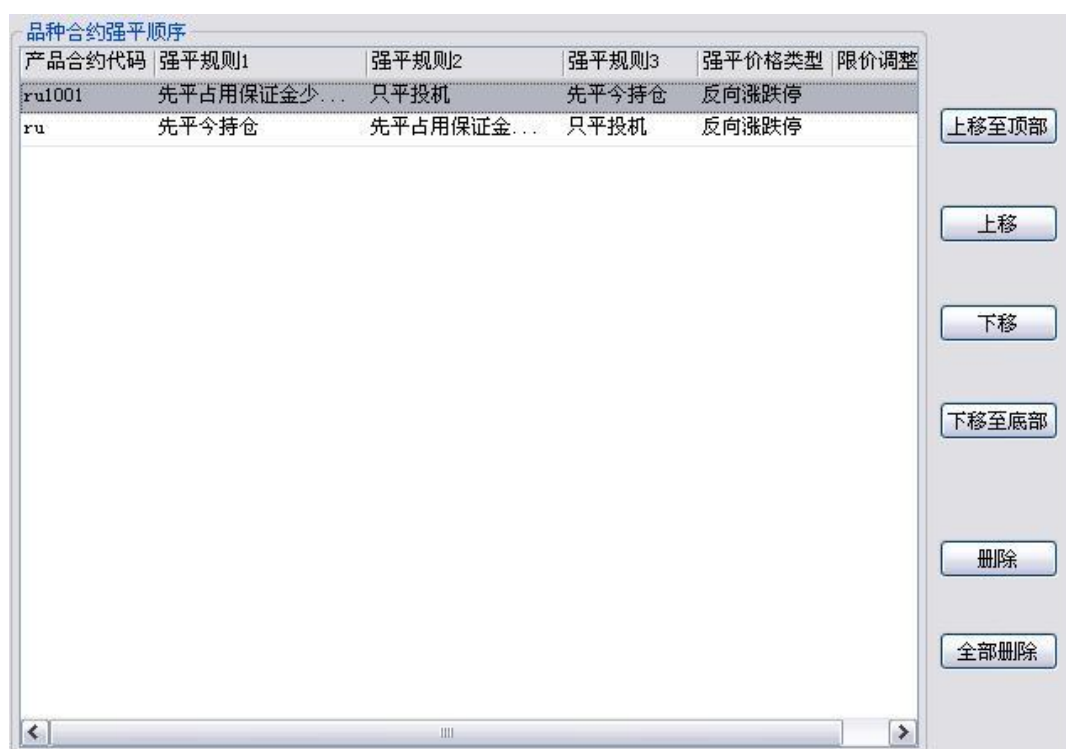


图1.2.11-8

Step5. 保存设置

点击【保存设置】按钮保存当前的所有设置，实时生效。

备注：

1. 系统默认的强平规则为1.先投机再套保；2.先昨仓再今仓；3.先多头再空头。
2. 如果不设置任何强平方案，不能进行批量强平操作。

1.2.11.2 单客户强平

单客户强平是指根据强平规则，对单个投资者进行强平单的辅助生成。用户可以通过鼠标右击“当日资金查询”视图中的某条投资者资金记录，在弹出的下拉框中选择【单客户强平】，或者通过点击菜单栏的【强平】->【单客户强平】，进入单客户强平界面。如图1.2.11-9、图1.2.11-10。



图1.2.11-9



图1.2.11-10

Step1. 查看资金持仓情况

单客户强平界面如图1.2.11-11。

界面最左边显示投资者的资金情况，用户可以在【投资者代码：】中输入投资者代码后回车，或者在下拉框中直接选择。

备注：

1. 【出入金】字段实时刷新，其他资金情况只有在点击【生成强平单】按钮后才会刷新；
2. A区资金项根据【释放资金】算法刷新；如果选择【实时结算标准】算法，点击【生成强平单】按钮后，A区资金刷新为投资者场上最新资金情况；如果选择【以昨结算为标准】算法，点击【生成强平单】按钮后，A区资金刷新为根据当日出入金以及平历史仓操作重新计算的投资者昨日资金情况；

3. B区资金项显示的是投资者昨日结算后的资金状况，不因当日有出入金或者平历史仓操作而变化；

4. C区资金项显示的根据强平单释放保证金情况，重新计算的新风险数据。



图1.2.11-11

右上方[当前持仓]列表框显示投资者的持仓明细信息，数据实时刷新。如果在强平单生成过程中有持仓的变化，系统将会弹出提示框，提醒用户该投资者的持仓发生了变化，是否根据新的持仓情况重新生成强平单，还是忽略持仓变化，依旧按照之前的持仓情况生成强平单。

Step2. 生成并发送强平单

系统提供两种生成模式：手动模式、方案模式；在手动模式下，点击【手动模式】按钮可切换到方案模式，在方案模式下点击【方案模式】按钮可切换到手动模式。

手动模式：不需要选择强平方案，强平单根据[当前持仓]列表的持仓顺序以及持仓选择情况生成。

用户可以通过点击【产品/合约选择...】按钮，在弹出的【品种/合约选择】界面，勾选需要生成强平单的品种/合约，点击【确定】按钮后完成持仓选择操作，如图1.2.11-12；也可以直接在[当前持仓]列表框中点击每条持仓记录最前面的勾选框来实现选择操作。

如果需要改变某条持仓记录的强平顺序，可以在[当前持仓]列表框中，鼠标左键选住不放某条持仓，然后移动到预期的位置后放开即可。调整好顺序和选择情况后，选择强平标准、释放资金方式，点击【生成强平单】按钮生成辅助强平单，显示在下方的[强平单列表]列表框中，强平单默认的强平数量为可平数量。

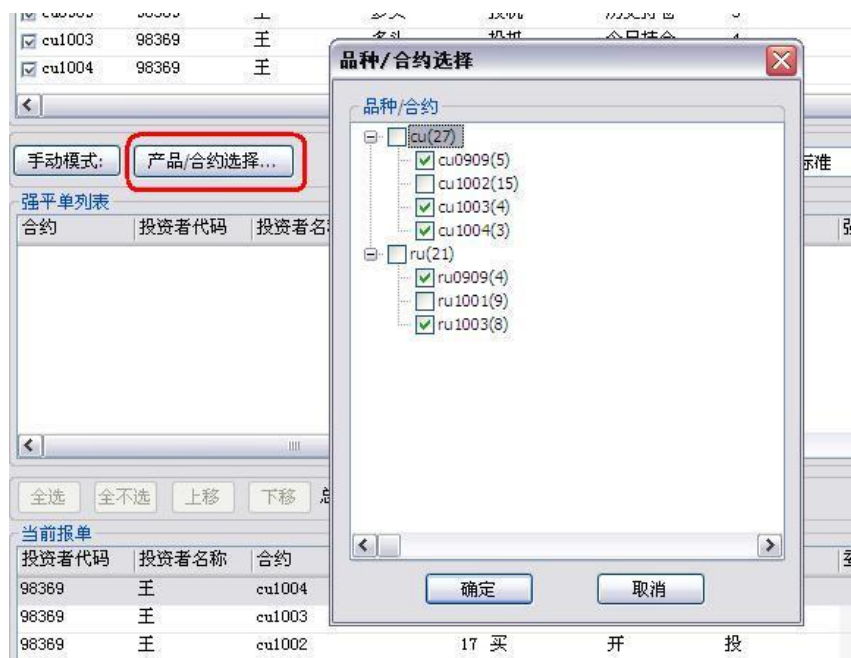


图1.2.11-12

方案模式：需要选择强平方案，强平单根据强平方案的强平规则生成。

用户选择之前设置的某强平方案，选择强平标准、释放资金方式，强平标准、释放资金方式默认显示选择的强平方案的参数值，点击【生成强平单】按钮生成辅助强平单，显示在下方的[强平单列表]列表框中。说明：这里对强平标准和释放资金方式的修改是临时性的，不会影响强平方案本来的算法设置。

备注：

1. 在强平方案中设置了规则的合约或者品种的所有持仓都会被生成强平单；
2. 从第一个强平单开始增加强平数量，直到满足总释放保证金 \geq 追加保证金（强平标准为“经纪公司标准”），或者总释放保证金 \geq 交易所追加保证金（强平标准为“交易所标准”）。

界面右中方的[强平单列表]列表框中显示辅助生成的强平单，不支持按列排序。如图1.2.11-13。



图1.2.11-13

强平单操作说明:

a. 修改强平单

选中某条强平单，在右边会同步显示相关数值，可以修改强平数量、价格类型，点击【修改】按钮，保存修改，点击【取消】按钮，取消修改，恢复到原来的数值。点击【试算】按钮，根据修改的数值重新生成强平价格、释放保证金、平仓盈亏、总释放保证金以及左边资金信息中的新风险度和新交易所风险度。

其中强平数量不能大于可平数量；限价支持调整点数和自定义委托价格两种形式，调整点数只能为零或者正整数。

b. 选择、移动强平单

用户可以通过点击强平单最前面的勾选框来选择强平单，[强平单列表]列表框下方的【全选】按钮用于勾选列表中所有强平单，【全不选】按钮用于取消勾选列表中的所有强平单。

[强平单列表]中的强平单排列顺序代表强平单的报单顺序，用户可以通过选中某条强平单记录，点击【上移】、【下移】按钮将强平单移动到期望的顺序上。

c. 发送强平单、发送预埋强平单

点击【下单】按钮，确认发送后，系统将选中的强平单按顺序发送，用户会收到强平回应提示框，显示下单情况。如图1.2.11-14。

点击【预埋】按钮，选择触发类型，确认后将选中的强平单按顺序发送到本地预埋单列表中。

备注:

1. 对辅助强平单的修改、选择操作，必须试算才能生效，所以对辅助强平单作了任何操作后，必须点击【试算】按钮重新计算；

2. 【生成强平单】按钮是用于根据选择的强平方案、强平标准、释放资金方式、当

前的持仓情况、资金情况生成强平单，而【试算】按钮是用于根据当前强平单的选择情况、强平数量、强平价格重新计算释放保证金、平仓盈亏、新风险状态/交易所风险状态、新追加保证金/交易所追保、新风险度/交易所风险度字段；

3. 在修改强平单时，当选择价格类型为限价，并且选择自行修改委托价，在左边的【买价/卖价：】将显示该合约的当前行情中的最高买方报价和最低卖方报价。



图1.2.11-14

Step3. 撤单、打印、导出

界面右下方的[当前报单]列表框中显示投资者所有报单信息，数据实时刷新。

用户可以通过选中列表中某条可撤的报单，点击列表框下方的【撤单】按钮，确认撤单后完成撤单功能；点击列表框下方的【预览/打印】按钮，预览/打印鼠标光标所在的列表框中的记录；使用导出功能，导出鼠标光标所在的列表框中的记录；点击列表框下方的【退出】按钮，退出单客户强平界面。

备注：[当前报单]列表框的列表头字段和视图中的一样，支持按列排序、按组排序、多重排序、设置最佳列宽和移动字段功能；其他列表框不支持上述排序功能。

1.2.11.3 批量强平

批量强平是指根据强平规则，对多个投资者进行强平单的辅助生成。用户可以通过点击菜单栏的【强平】->【批量强平】，进入批量强平界面，如图1.2.11-15。

在[查询条件]中选择 [风险状态]、[昨风险状态]、[通知状态]、，点击【查询】按钮，在下方的列表框中显示出符合条件的所有投资者。用户可以通过自行勾选投资者，来指定参与批量强平的投资者。最下方的【全选】按钮用于勾选列表中所有投资者，【全不

选】按钮用于取消勾选列表中的所有投资者。



图1.2.11-15

用户在选择强平方案、强平标准、释放资金方式后，点击【批量强平】按钮，系统根据选择的强平方案、强平标准和释放资金方式对选中的投资者生成辅助强平单，弹出批量强平确认界面，如图1.2.11-16。说明：这里对强平标准和释放资金方式的修改是临时性的，不会影响强平方案本来的算法设置。

用户可以通过勾选的方式，选择预发送的强平单。不同于单客户强平，批量强平不能对辅助生成的强平单的价格或者数量进行修改，只能选择。界面下方的【预览/打印】、【撤单】、【下单】、【预埋】、【退出】按钮、导出功能和单客户强平界面中的对应按钮功能相同。

[强平合约汇总]列表框和界面下方的【预强平客户数】、【预强平报单数】、【总释放保证金】字段会根据[强平客户列表]、[辅助强平单]列表框中的勾选情况自动刷新数据。

[当前报单]列表框显示选中参与批量强平的投资者的所有报单信息，数据实时刷新。

备注：除了[辅助强平单]列表框，其他列表框中的列表头字段和视图中的一样，支持按列排序、按组排序、多重排序、设置最佳列宽和移动字段功能；

强平客户确认											
强平客户列表											
投资者代码	投资者名称	风险状态	风险度	通知状态	释放保证金	追加保证金	追加交易...	昨追加保证金	昨追加交...		
60888	符	警告	-306.19	未通知	26701.50	113798.29	109220.89	113798.29	109220.89		
7007	邓	警告	-798.32	未通知	36450.00	327802.65	319702.65	347902.65	339802.65		
7055	张	警告	-2622.47	未通知	182520.00	4965060.51	4928490.51	4978425.51	5028990.51		
7077	闫	警告	-3234.90	未通知	36504.00	1217372.36	1209260.36	1237472.36	1229360.36		
强平强平单											
合约	投资者代码	投资者名称	持仓方向	投保	持仓日期	可平数量	强平数量	价格类型	调整点数	强平价格	释放前...
zz0910	60888	符	多头	投机	历史持仓	1	1	反向涨跌停	0	23395.00	21
sl001	7007	邓	多头	投机	今日持仓	10	10	反向涨跌停	0	3848.00	38
sl001	7055	张	多头	投机	今日持仓	50	50	反向涨跌停	0	3848.00	180
yl001	7055	张	多头	投机	今日持仓	30	30	反向涨跌停	0	0.00	
sl001	7077	闫	多头	投机	今日持仓	10	10	反向涨跌停	0	3848.00	38
强平合约汇总											
合约	买手数	卖手数									
sl001	0	2									
sl002	0	3									
sl001	1	95									
sl005	0	7									
当前报单											
投资者代码	投资者名称	合约	报单引用	买卖	开平	投保	委托价	委托手数	请求编号	本地报单编号	交易所...
98369	王	sl1002	75	买	平仓换		59560.00	3	0	210	51988
98369	王	sl1002	90	买	平仓换		59560.00	3	250	230	51988
98369	王	sl1002	94	买	平仓换		59560.00	5	250	236	51988
98369	王	sl1001	95	买	平仓换		21150.00	3	250	237	51988
强平客户数: 41 总释放保证金: 1992475.73											
强平报单数: 65											
[强平] [下单] [强平] [退出]											

图1.2.11-16

1.2.12 净持仓指标设置及超标强平

1.2.12.1 净持仓指标设置

用户可以通过点击菜单栏中的【风控指标】->【风控指标设置】，进入风控指标设置界面，如图1.2.12-1。

[净持仓保证金指标]列表框用于显示当前该经纪公司的各风险指标数值，该风险指标是全局的，一个经纪公司下只有一套风险指标。

1. 新增风控指标

用户可以在[投资者]列表框中选中某个投资者，或者在【查找：】输入框中输入某投资者代码，再在[产品组合]列表框中选择单个品种或者多个关联品种，然后在右边的【报警值（%）】输入框中输入风控报警值，点击【添加】按钮完成新增操作。

2. 修改风控指标

用户可以在[净持仓保证金指标]列表框中选择某条预修改的风控指标记录，然后在【报警值（%）】中输入新的风控报警值，点击【修改报警值】按钮完成修改操作。

3. 删除风险指标

用户可以在[净持仓保证金指标]列表框中选择某条预删除的风控指标记录，点击【删除】按钮完成删除操作。

4. 刷新风险指标

[净持仓保证金指标]列表框中的风险指标不会实时刷新，点击【刷新】按钮后才能显示出最新的全局风控指标。

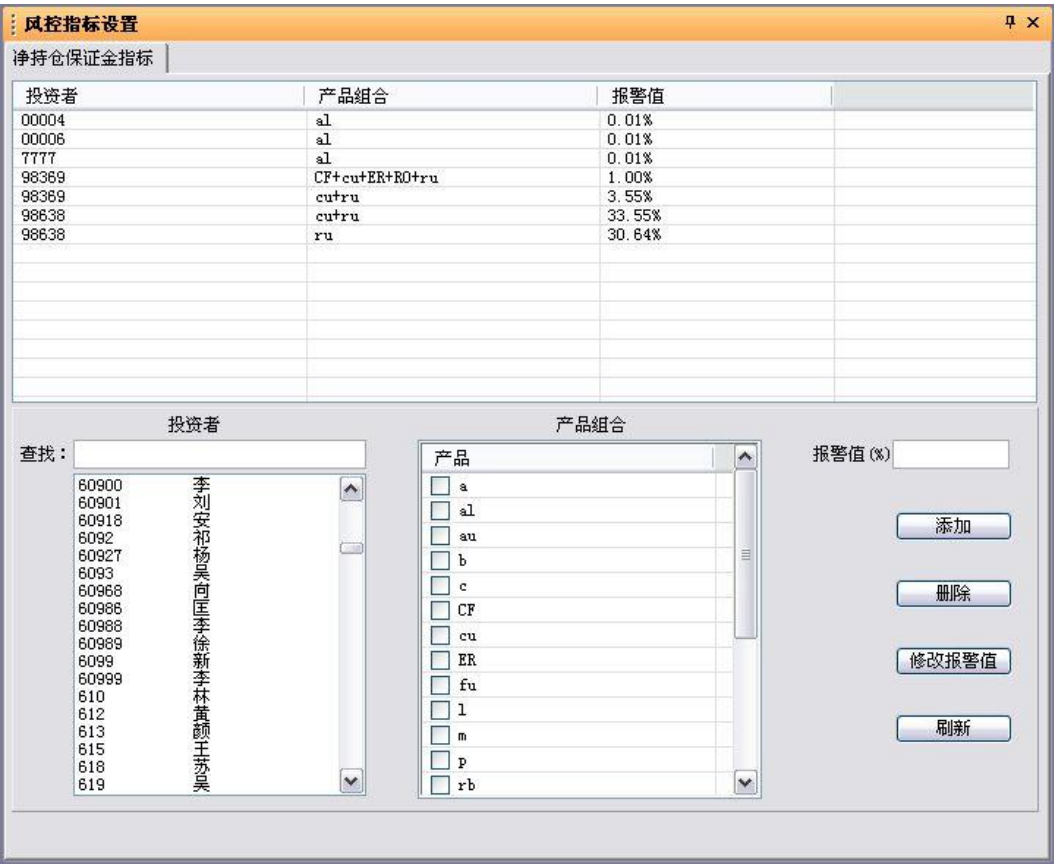


图1.2.12-1

1.2.12.2 超标强平

用户可以通过点击菜单栏中的【风控指标】->【净持仓保证金指标】，进入净持仓保证金指标查询界面。该界面根据之前设置的风控指标显示净持仓保证金指标值，如果指标值大于报警值则以红色背景色提示。鼠标右击指标值超过报警值的记录，在弹出的下拉框中选择【单客户强平】，进行超标强平，如图1.2.12-2。

净持仓保证金指标					
经纪公司代码	投资者代码	产品代码	指标值	报警值	投资者名称
2020	135	a	159.88%	1.00%	
2020	135	a+p	159.62%	1.00%	

单客户强平

图1.2.12-2

弹出超标单客户强平界面，如图1.2.12-3。该强平界面不能修改预强平的投资者，不能选择强平标准以及释放资金方式，在左边的资金情况中增加显示了指标情况，除了【强平目标】的其他功能和[单客户强平界面](#)相同。

系统支持两种【强平目标】：指标正常、资金正常。如果选择“指标正常”为目标，则只强平占有总保证金多的一方的持仓，以保证新的指标值低于警示值。如果选择“资金正常”为目标，则和采用默认强平规则的单客户强平单辅助生成功能相同。

【新指标值】字段显示的是根据强平单释放保证金的情况，重新计算的新净持仓保证金指标值；修改强平单后，需要进行试算才能刷新该值。

备注：

1. 净持仓保证金指标视图数据刷新频率为5秒；
2. 在风控指标设置视图中新增、修改、删除指标，如果净持仓保证金指标视图一直处于打开的状态，需要等待1分钟指标变动才会更新到该视图；如果重新打开净持仓保证金指标视图，指标变动会立即更新到该视图。



图1.2.12-3

1.2.13 撤单

系统提供撤单功能，用户可以通过双击“投资者报单信息”或者“报单查询”视图中某条可撤的报单，在弹出的撤单确认窗口中确认撤单后，实现撤单。如图1.2.13-1。



图1.2.13-1

1.2.14 发送风险通知

系统提供两种发送风险通知的方式：自动和手动。发送的风险通知可在“风险通知信息”视图中查询。

1.2.14.1 自动发送

自动发送是指系统根据投资者的风险状态以及持仓情况自动发送风险通知。具体说明如下：

1. 在【设置】->【风险通知模板设置】中设置了自动系统通知的才能自动发送风险通知；如图1.2.14-1。该设置需要给操作员赋予“配置风险通知”权限，具体授权在综合交易平台上配置。设置保存后对于该经纪公司下的所有投资者实时生效。注意：由于该设置面向经纪公司，所以建议配给级别比较高的管理员。

针对每种风险通知类型可以单独设置是否自动系统通知和通知内容模板。如果需要设置自动系统通知，选中某通知类型，将左下方的【自动系统通知】勾选上，确认保存即可。如果需要修改通知内容模板，选中某通知类型，在下方的【系统通知内容】输入框中会出现该风险通知的模板内容，用户可以自行修改，确认保存即可。

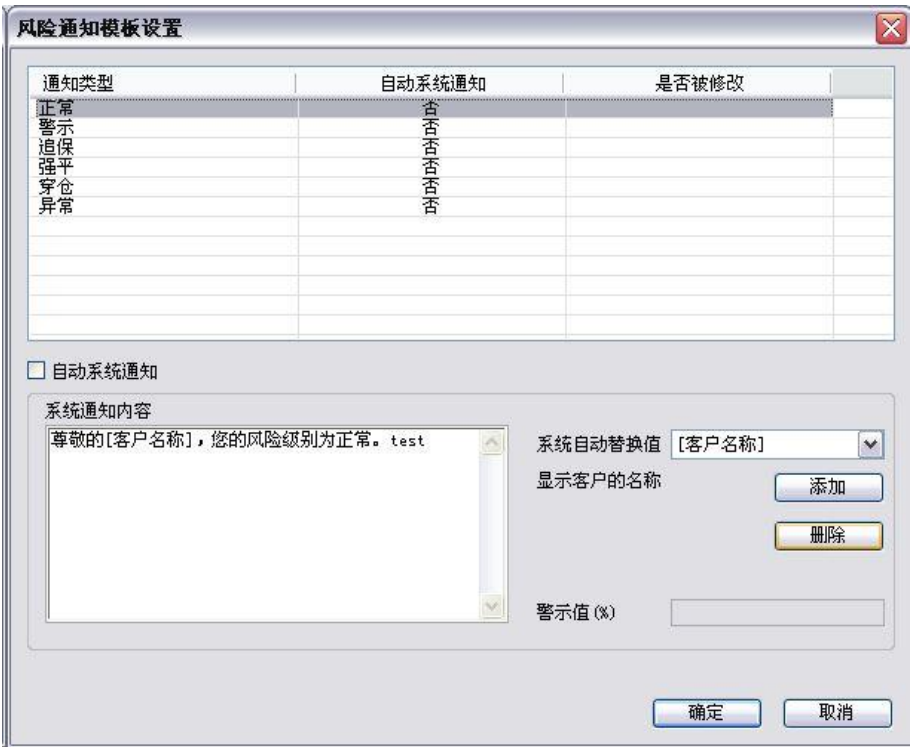


图1.2.14-1

在通知内容模板中，中括弧的内容为系统自动替换值，通知发送时，系统会将该部分的内容用相应的数据值替换。用户在右下方的【系统自动替换值】选择框中选择需要的替

换值，点击【添加】按钮，可将该替换值添加到通知内容模板中。用户在通知内容模板中将鼠标光标点在中括弧中，点击【删除】按钮，可将该替换值从通知内容模板中删除。

用户可以设定系统自动发送“警示”风险通知的风险度下限，当投资者风险度（（客户保证金/总权益）*100%）大于该风险度下限时，才可能发送“警示”风险通知。“警示”风险通知以该风险度下限为判断依据，和前台界面显示的风险状态不同。选中“警示”通知类型，在右下方的【警示值（%）】输入框中对风险度下限进行修改。

2. 设置了自动发送的风险类型，自动发送的规则如下：

- a. 在持仓不变的情况下，每种风险类型的风险通知只发一次。不会因为行情变化或者其他情况引起资金变化，导致风险状态波动而发送多次某风险状态的风险通知；
- b. 持仓发生变化后，风险通知会重新发送，各风险类型的通知次数重新计数；
- c. 如果在场上将自动发送功能去掉，从保存设置后开始不再自动发送通知，无论风险状态是否达到条件。直到重新打开自动发送功能。

1.2.14.2 手动发送

系统支持手动发送风险通知。该功能需要给操作员赋予“发送风险通知”权限，具体授权在综合交易平台上配置。在“当日资金查询”视图中，鼠标右击需要发送风险通知的投资者资金记录，在弹出的下列框中选择【风险通知】，确认发送后即可发送该投资者的当前风险状态的通知。

系统支持手动批量发送风险通知，用户可以通过按住【Ctrl】键，选中多个投资者资金记录，或者同时按下【Ctrl】键和字母【a】键，选中当日资金查询结果列表中的所有投资者，再鼠标右击，在弹出的下列框中选择【风险通知】，确认发送后即可批量发送风险通知。如图1.2.14-2。



图1.2.14-2

1.2.15 权益反向计算

系统提供权益反向计算功能，主要针对那些尚未达到追保、穿仓风险级别的，但是可用资金已经不多的投资者，看其资金能够抗所持合约价格多少的涨跌幅度，计算结果可以用作后几天风险控制的参考。

用户可以通过在“当日资金查询”视图中，鼠标右击需要权益反向计算的投资者资金记录，弹出下拉框，点击【权益反向计算】，如图1.2.15-1，或者通过点击菜单栏中的【功能】->【权益反向计算】，如图1.2.15-2。



图1.2.15-1



图1.2.15-2

权益反向计算界面如图1.2.15-3。各操作步骤说明如下：

Step1. 生成合约设置

在【客户代码：】下拉框中选择需要权益反向计算的投资者代码，或者输入投资者代码，以回车键结束；在【风险类型：】下拉框中选择反算希望达到的风险级别；点击【生成合约设置】按钮，在【资金情况：】显示框中显示该投资者当前的资金状况，在【合约设置】显示框中显示该投资者当前持有的合约信息，以及该合约的不利波动方向。

备注：

1. 风险类型包括穿仓和追保两种风险级别，用于指定权益反向计算最终要达到的风险级别上限；
2. 风险类型指定穿仓时，合约的不利波动方向表示该合约的价格按照此方向波动，将导致该投资者的权益减少；如果合约的价格无论上涨还是下跌都不影响权益，则波动方向为“无涨跌”；
3. 风险类型指定追保时，合约的不利波动方向表示该合约的价格按照此方向波动，将导致该投资者的（权益 - 保证金）减少；如果合约的价格无论上涨还是下跌都不影响（权益 - 保证金），则波动方向为“无涨跌”；



权益反向计算

客户代码：7777 李11

风险类型：穿仓

生成合约设置

资金情况

风险状态：追保

风险度：71.58

保证金：321646.24

权益：230236.00

持仓盈亏：92640.00

新风险状态：穿仓

新风险度：-0.04

新保证金：322348.00

新权益：-144.00

新持仓盈亏：-137740.00

合约设置

合约	波动方向	波动幅度
<input checked="" type="checkbox"/> a0905	下跌	
<input checked="" type="checkbox"/> a0909	下跌	
<input checked="" type="checkbox"/> a0911	上涨	
<input checked="" type="checkbox"/> a1001	上涨	
<input checked="" type="checkbox"/> a11002	下跌	
<input checked="" type="checkbox"/> a11003	下跌	
<input checked="" type="checkbox"/> b0903	无涨跌	

合约：a1001

价格方向：上涨

波动幅度：%

全选 全不选 上移 下移 修改 取消

基准价：昨结算价 波动方法：相同幅度波动 提交

反复结果 ☐ 过滤无效记录

投资者代码	合约	基准价格	波动价格	波动幅度	停板数	涨跌停
7777	a0905	4160.00	3960.00	-4.81 %	0	5
7777	a0909	4034.00	3840.00	-4.81 %	0	5
7777	a0911	4193.00	4394.00	4.79 %	0	5
7777	a1001	4050.00	4244.00	4.79 %	0	5
7777	a11002	19510.00	18005.00	-7.71 %	0	6
7777	a11003	19510.00	18005.00	-7.71 %	0	6
7777	b0903	4283.00				

退出

图1.2.15-3

Step2. 修改合约设置

用户可以修改生成的合约设置，包括：

1. 选择需要计算的合约

用户可以通过点击合约前面的勾选框完成选择操作。勾选框内打勾表示选中，勾选框内没有打勾表示未选中。如果需要选中全部合约，点击【全选】按钮即可；如果需要不选中全部合约，点击【全不选】按钮即可。未选中的合约提交计算后将按照基准价计算相关资金。

2. 调整合约计算的先后顺序

在【合约设置】显示框中点击需要移动顺序的记录，点击【上移】或者【下移】按钮，将合约移动到预期的顺序上即可。

只有当波动方法为“合约先后顺序”时有效。

3. 修改合约的价格波动方向、波动幅度

在【合约设置】显示框中点击需要修改设置的记录，相关数据同步显示在右边的三个输入框中：合约、价格方向、波动幅度。合约不能修改，输入新的价格方向和波动范围后，点击【修改】按钮，完成修改操作，点击【取消】按钮，则取消本次修改。

备注：

1. 波动方向为“无涨跌”时，不能进行修改；
2. 价格方向可以指定为上涨或者下跌；
3. 波动幅度要求为非负数；如果指定的价格为下跌，波动幅度上限为100%；如果指定的波动方向和不利方向相反，波动幅度必须设置；
4. 如果对所有选中合约都设置波动幅度，提交计算后，系统将弹出警示信息，如需继续按此次波动幅度计算，点击按钮【是】，否则点击按钮【否】。

Step3. 选择算法，提交计算

算法配置包括基准价、波动方法（、停板数）。

1 基准价：反向计算的基础价格，波动幅度以此价格为基准；可以设置为：昨结算价、成交均价、最新价、结算价。只有在收盘，并且系统收到当日结算价后，才支持结算价作为基准价；其他价格在盘中和盘后都支持。

1 波动方法：反向计算的算法，可以设置为：相同幅度波动、合约先后顺序；

其中算法一（相同幅度波动）表示所有已选合约涨跌幅度一致，即对于某一投资者，那些已经选择的合约在已经配置好的涨跌方向上，涨跌幅度完全一致；对于那些未选择的合

约，默认无涨跌，以基准价计算相关资金。

算法二（合约先后顺序）表示可以选择计算顺序，排在前的合约先计算，如果到了停板还有剩余资金，则计算下一顺序合约；对于那些未选择的合约，默认无涨跌，以基准价计算相关资金。

无论是算法一还是算法二，对于用户自行修改了波动幅度的选中合约，最先计算，并且直接按设置的波动幅度计算相关资金，不再进行估算；剩下的选中合约再按照算法一或者算法二进行计算。

I 停板数：当选择波动方法为“合约先后顺序”时，才需要设置停板数；用于限定单个合约波动的最大停板数目，但对最后一顺序合约无效；只有一个合约被选中参与计算时，停板数设置有效。

选择算法后，点击【提交】按钮，系统按照配置的算法反向计算，结算显示在【反算结果】显示框中。其中停板数表示从基准价开始，共经历了几个涨跌停板才达到波动价格；总波动点数表示波动价格相对于基准价，共涨跌了多少个tick，tick为合约最小波动价格。

Step4. 导出、过滤无效记录

鼠标左击选中【反算结果】列表框，使用导出功能，可以导出本次权益反算结果以及反算前资金、持仓等场景信息；如果鼠标选中其他列表框，使用导出功能，只能导出被选中列表框的数据。

【过滤无效记录】勾选框用于在反算结果中，过滤掉那些价格涨跌对投资者资金没有任何影响的合约结果记录，即波动方向为“无涨跌”的合约记录。

【退出】按钮用于关闭权益反向计算界面。

1.2.16 批量权益反向计算

系统支持对多个投资者批量权益反向计算功能。用户可以通过点击菜单栏中的【功能】->【批量权益反向计算】。进入批量权益反向计算界面，如图1.2.16-1。



图1.2.16-1

Step1. 选择参与计算的投资者

在【投资者过滤：】下拉框中选择需要参与计算的投资者的风险状态，符合条件的投资者将显示在下方的列表框中，点击投资者记录最前面的勾选框实现对投资者的选择操作，【全选】按钮用于勾选列表中的所有投资者，【全不选】用于取消勾选列表中所有投资者。如图1.2.16-2。



图1.2.16-2

Step2. 设定合约/品种的波动方向和波动幅度

该列表框中显示投资者列表中所选投资者持有的所有合约/品种。用户可以通过点击合约/品种前面的勾选框，来选定参与权益反向计算的合约/品种。由于针对品种的波动方向和波动范围设置会同步到该品种下所有合约的设置中，所以如果需要对某个合约设置特定的波动方向或者波动范围，必须在设置好品种之后，再对该合约进行设置。

如果需要移动某合约/品种的反向计算顺序，可以鼠标左击选中该合约/品种后，点击【上移】或者【下移】按钮，移动到预期位置。如图1.2.16-3。



图1.2.16-3

Step3. 选择算法，提交计算

选择【风险类型】、【基准价】、【波动方法】，点击【提交】按钮，提交计算；具体功能同[权益反向计算功能](#)。生成的反向计算结果显示在【反算结果】和【反算后资金情况】列表框中，如果合约/品种设定的波动方向对于某投资者的资金来说是有利方向，则不计算该合约/品种，【反算结果】中该合约/品种的波动幅度等字段为空。

Step4. 导出、过滤无效记录

鼠标左击选中【反算结果】列表框，使用导出功能，可以导出本次批量权益反算结果以及反算前资金、持仓等场景信息；如果鼠标选中其他列表框，使用导出功能，只能导出被选中列表框的数据。

【过滤无效记录】勾选框用于在反算结果中，过滤掉那些价格涨跌对投资者资金没有任何影响的合约结果记录，即波动方向为“无涨跌”的合约记录。

【退出】按钮用于关闭批量权益反向计算界面。

1.2.17 预埋强平单

系统支持强平单的预埋功能，但该功能暂不支持组合合约强平单预埋。用户可以通过点击菜单栏的【强平】->【预埋单】，进入预埋单界面，如图1.2.17-1。

通过手动强平、单客户强平、批量强平下单界面中的【预埋】按钮，将强平单报入本地预埋单列表。本地预埋单不能被触发，只有将预埋单从本地预埋单列表报入服务器预埋单列表，触发条件达到后，才能被触发。

本地预埋单列表只显示由本次登陆风控客户端的操作员报入的本地预埋单，不能查询到其他操作员报入的本地预埋单。可以对本地预埋单进行排序、修改、删除操作。【上移】、【下移】按钮用于移动某本地预埋单到指定位置；【全选】、【全不选】按钮用于选定本地预埋单；【删除】按钮用于删除某本地预埋单；对本地预埋单的触发类型和触发时间进行修改后，点击【修改】按钮确认当前修改，报单的其他参数不能修改。

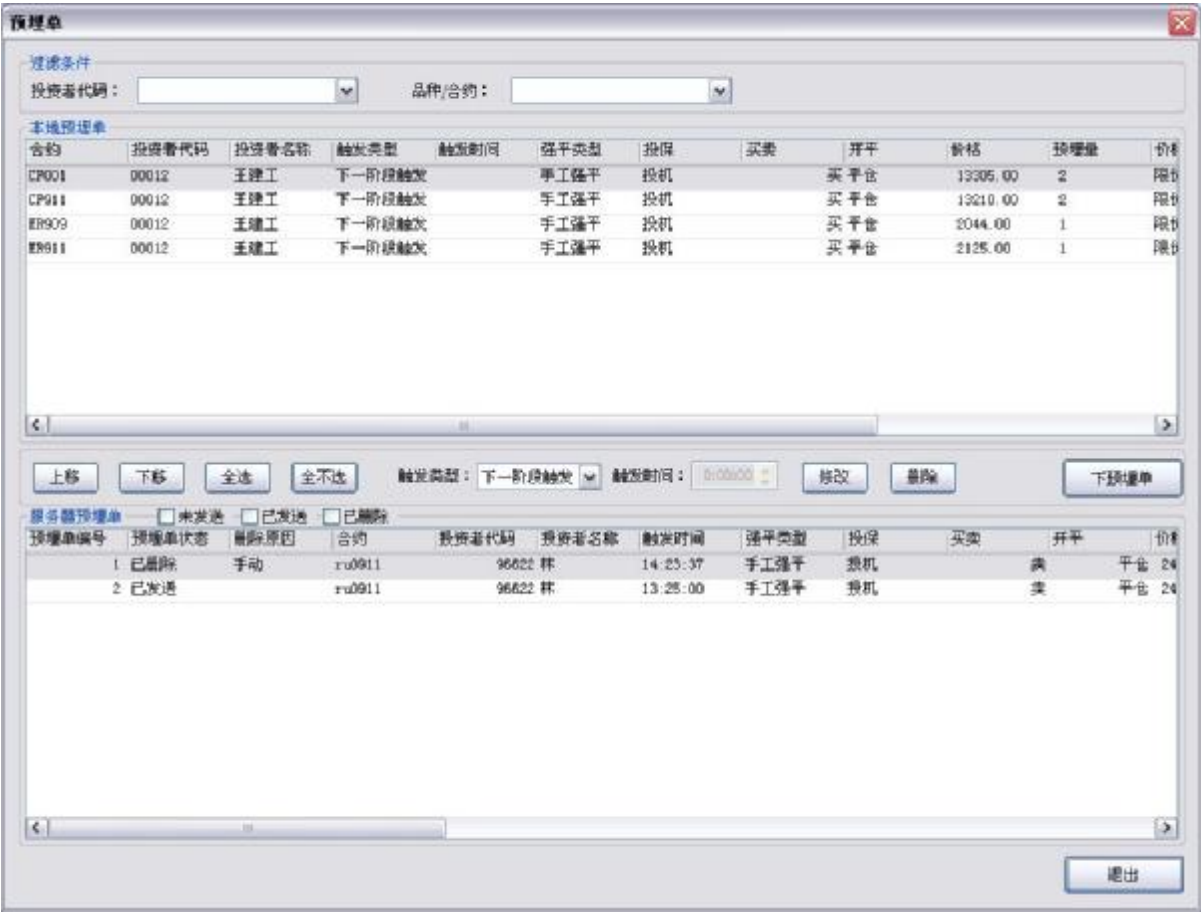


图1.2.17-1

触发类型有两种：

- 1. 下一阶段触发：下一个交易节开始时，将预埋单报入交易系统；

2. 定时触发：需要设定触发时间，服务器时间达到触发时间时，将预埋单报入交易系统。

选中某条本地预埋单，或者按住【Ctrl】键复选多条本地预埋单，点击【下预埋单】按钮，将选中的预埋单按顺序报入到服务器预埋单列表的最后。用户可以通过勾选复选框【未发送】、【已发送】、【已删除】对服务器预埋单进行筛选。服务器预埋单不支持修改、排序操作，只支持删除操作。鼠标右击某条需要删除的预埋单，弹出下拉框，点击【撤预埋单】按钮，将该预埋单删除，点击【撤预埋单并移至本地】按钮，将该预埋单删除，并且重新报入到本地预埋单列表的最后。

备注：

1. 预埋单被触发发送时，系统将检查该投资者的资金状况，如果该投资者资金情况处于不再需要追加保证金，则该预埋单将会被删除；
2. 预埋单被触发发送后，可以在服务器预埋单列表跟踪其报单状态。

1.2.18 视图快速模式

系统支持视图的快速模式功能，用于提高视图的性能，降低视图数据刷新的CPU占用率；当视图的记录数超过一万条时，建议使用该功能。

用户可以通过点击菜单栏的【设置】->【选项】，进入选项视图后选择【视图设置】分页，如图1.2.18-1，勾选需要使用快速模式的视图，或者勾去不需要使用快速模式的视图，点击【保存设置】按钮后实时生效。

快速模式相对于原来模式，视图的功能有所减少，减少的功能有：

1. 最后行的数据汇总；
2. 数据的按组排序、多重排序。



图1.2.18-1

1.2.19 移动视图

打开各分视图后，用鼠标左键点中不放视图顶部的标题栏，用户可随意拖动视图至视图窗口的任意位置。如图1.2.19-1。

移动视图时会出现九个方向图标，将鼠标放到图标上可以：

- A. 将视图移至整个视图框的最上方；
- B. 将视图移至整个视图框的最右方；
- C. 将视图移至整个视图框的最下方；
- D. 将视图移至整个视图框的最左方；
- E. 将视图移至当前图标所在的分视图框的最上方；
- F. 将视图移至当前图标所在的分视图框的最右方；
- G. 将视图移至当前图标所在的分视图框的最下方；

H. 将视图移至当前图标所在的分视图框的最左方；

I. 将视图并进当前图标所在的分视图框中。

退出系统后，视图布局会被自动记录下来，供再次登录后使用。

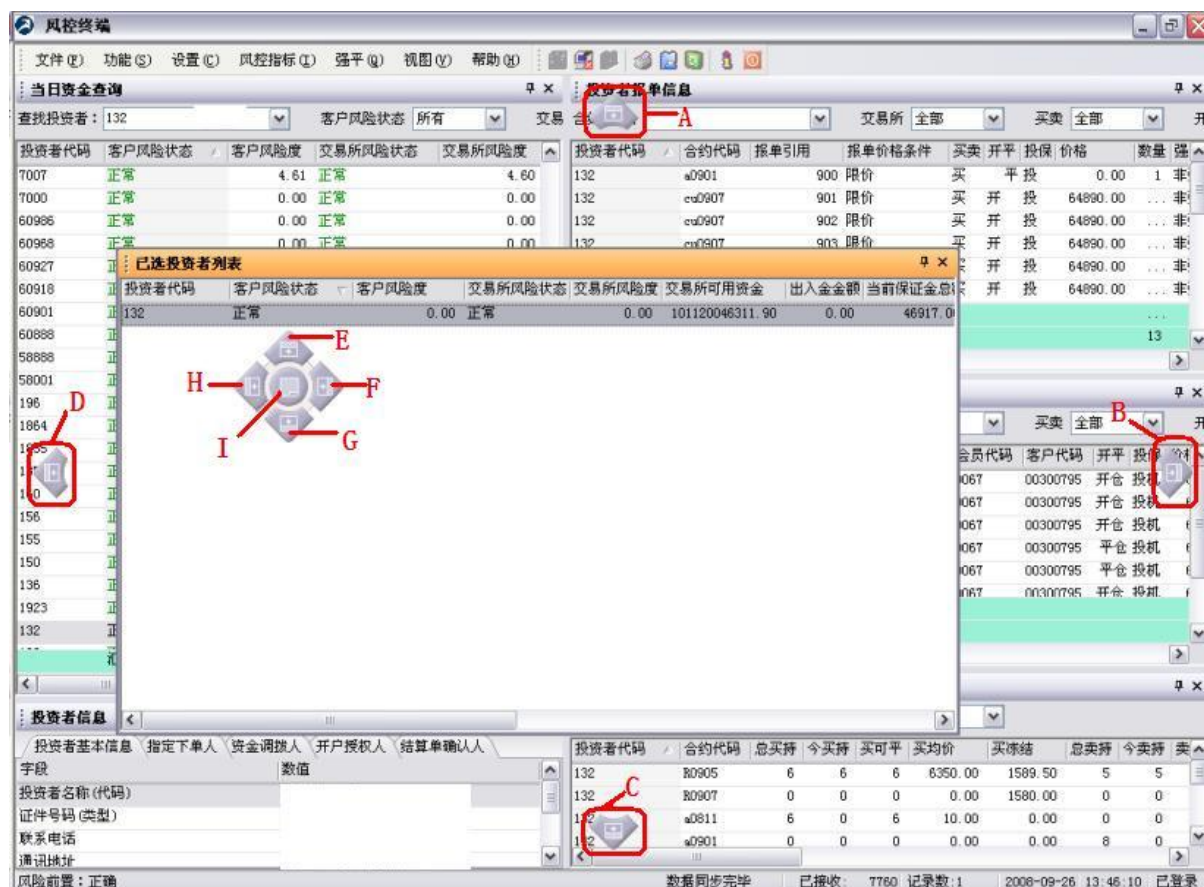


图1.2.19-1

1.2.20 查看系统版本

用户可以通过点击菜单栏的【帮助】->【关于RCWin】，或者菜单栏的【关于】按钮，查看当前系统的版本。如图1.2.20-1。



图1.2.20-1

1.2.21 前端显示

系统支持前端显示功能，用于将风控窗口置于桌面最前端显示，别的窗口不能覆盖风控窗口。用户可以通过勾选菜单栏的【视图】->【前端显示】，实现该功能；勾去则取消该功能；设置实时生效。如图1.2.21-1。

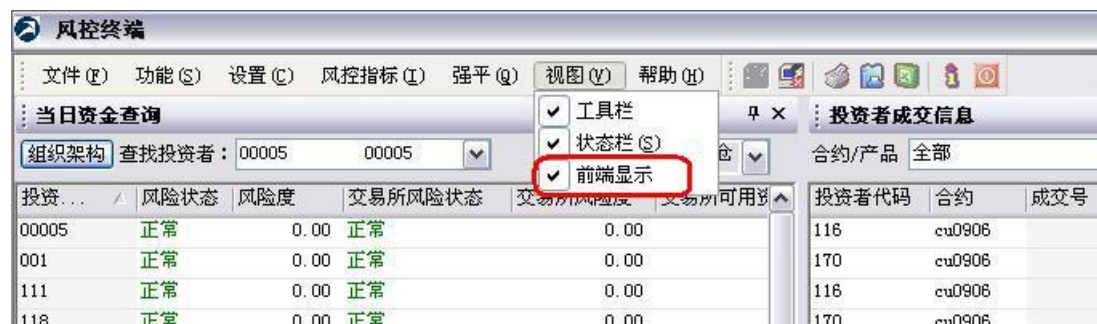


图1.2.21-1

1.2.22 布局保存及应用

系统支持布局保存以及应用。用户可以通过点击【设置】->【布局】，进入布局设置界面，如图1.2.22-1。



图1.2.22-1

点击【保存】按钮，弹出对话框，输入布局名、布局描述，确认后将保存当前布局以及各项配置，如图1.2.22-2。如果需要应用某布局，在布局列表中选中该布局，点击【应用】按钮即可将当前布局更换为指定的布局以及各项配置。【删除】按钮用于删除指定布局。【退出】按钮用于退出布局设置界面。



图1.2.22-2

系统提供默认布局，用户可以通过点击【设置】->【使用默认布局】，在确认后使用默认的视图布局。注意：使用默认布局后，之前的选项配置将会丢失。

1.2.23 密码修改

系统提供修改当前风控操作员的登陆密码功能。用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【密码修改】，如图1.2.23-1，进入密码修改界面，如图1.2.23-2，输入原密码、新密码、确认新密码，点击【确认】按钮，完成密码修改操作。

备注：输入的新密码和确认新密码必须一致。



图1.2.23-1



图1.2.23-2

1.2.24 关闭系统


用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【关闭】，或者菜单栏的【关闭】按钮，或者右上角的按钮，关闭风险监控系統，如图1.2.23-1。



图1.2.23-1

2、 各分视图说明

2.1 选项

选项窗口用于管理系统各项配置。

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【设置】->【选项】，或是键盘【Ctrl】+【s】键，打开选项界面，如图2.1.1。



图2.1.1

U 界面说明

所有配置修改后，点击【保存设置】按钮，确认保存后实时生效，只作用于当前风控客户终端。选项配置包括：

1. 服务器配置：管理登陆的服务器配置；选中某服务器地址，点击【删除】按钮可删除该服务器地址；选中某服务器地址，在【地址：】输入框中进行修改，再点击【修改】按钮可修改该服务器地址；在【地址：】输入框中输入新的服务器地址，点击【添加】按钮可新增服务器地址；【选定】按钮用于选定某服务器地址为登录时的默认服务器地址，如图2.1.2；









2. 当日资金查询：具体说明见[当日资金查询的选项配置](#)；
3. 投资者成交排行：具体说明见[投资者成交排行的选项配置](#)；
4. 投资者持仓排行：具体说明见[投资者持仓排行的选项配置](#)；
5. 实时风控行情：具体说明见[实时风控行情的选项配置](#)；
6. 市场持仓量分布显示：具体说明见[市场持仓量分布显示的选项配置](#)；
7. 压力测试：具体说明见[压力测试的选项配置](#)；



图2.1.2

8. 视图字段设置：管理各视图显示的表头字段和字体颜色，如图2.1.3。

具体说明如下：

- 1) 在“视图选择”中选中某一视图，待选字段一栏出现该视图下未选择显示的表头字段，已选字段一栏出现已经选择显示的表头字段；
- 2) 在待选字段一栏选中需要显示的表头字段，点击按钮，在已选字段一栏中新增该字段，可按住Ctrl键复选；若点击按钮，则把待选字段一栏中所有字段都增加到已选字段一栏；若不需要显示某字段，在已选字段一栏中选中该字段，点击按钮，该字段移至待选字段一栏中，可按住Ctrl键复选；若点击按钮，已选字段一栏中所有字段移至待选字段一栏中；
- 3) 在已选字段一栏中，选中某字段，若点击按钮，把该字段排在最上面；若点击按钮，为把该字段排在最下面；若点击按钮，该字段上移一个位置，若点击按钮，该字段下移一个位置。该栏中各字段的位置标示着在视图中的显示顺序；
- 4) 在【背景颜色】下拉框中选择颜色，点击【设置字体】按钮，在弹出的对话框中设置字体、大小、字段颜色等属性后确认，即可设置视图选择中指定视图的背景颜色和字体属性。

各视图的表头字段增减还能通过鼠标右击表头，在弹出的下拉框中勾选或者勾去某

表头字段实现。改变表头字段的显示顺序还能通过鼠标左键点中不放需要移动的字段，前后移动到期望的位置后，放开鼠标左键实现。



图2.1.3

u 选项配置

2.2 当日资金查询

根据登陆的操作员拥有的投资者对应关系，显示相应的投资者当日的资金信息。操作员投资者对应关系在综合交易平台->交易管理->操作员管理->操作员投资者对应关系中设置。

u 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【当日资金查询】，打开当日资金查询界面。如图2.2.1。



图2.2.1

U 界面说明

当日资金查询界面如图2.2.2。提供查询筛选条件：组织架构、投资者、风险状态、交易所风险状态。最下方总计了所有资金项。

用户可以通过点击【组织架构】按钮，在弹出的组织架构过滤界面中，勾选需要显示的投资者，或者勾去不需要显示的投资者，点击【确认】按钮，完成组织架构筛选操作，系统会根据用户的选择显示出资金记录。如图2.2.3。

用户在【查找投资者：】输入框中输入投资者代码，回车后可以选出指定的投资者资金纪录；或者将鼠标选中任意投资者记录，然后输入投资者代码，系统会自动找到指定的投资者资金纪录。

用户在【风险状态】、【交易所风险状态】筛选条件中可以同时选择多个风险状态，支持复选。直接选择需要的条件，不需要回车或者其他键盘操作，系统自动会根据条件显示出资金记录。

当【风险通知信息】视图处于打开状态，用户双击某投资者的【风险状态】字段，如果有对该投资者发送过该风险状态的风险通知，则会将光标定位到【风险通知信息】视图中的该投资者该风险状态的最新一条风险通知上。

当日资金查询										
组织架构		查找投资者： 000015 000015		风险状态： 异常 穿仓		交易所风险状态： 异常 强平				
投资者代码	风险状态	风险度	出入金	强平标志	昨强平标志	保证金	历史强平次数	风险持仓	昨风险状态	上
7077	穿仓	-3343.66	0.00	强平	强平	36504.00	0	0	穿仓	
98016	穿仓	-5.39	0.00	强平	强平	43982.25	4	1	穿仓	
96611	穿仓	-421.14	0.00	强平	强平	14660.75	4	1	穿仓	
98369	穿仓	-2497882.92	-11114931045.38	强平	正常	444793.25	6	3	警示	
96693	穿仓	-290100.00	0.00	强平	强平	9.00	0	0	穿仓	
60888	穿仓	-337.43	0.00	强平	强平	25811.45	4	0	穿仓	
98203	穿仓	-316011.11	0.00	强平	强平	9.00	0	0	穿仓	
90094	穿仓	-1715.83	0.00	强平	强平	11178.00	0	0	穿仓	
7708	穿仓	-3029.47	0.00	强平	强平	36495.00	0	0	穿仓	
96556	穿仓	-736.07	0.00	强平	强平	107582.40	5	0	穿仓	
96229	穿仓	-514511.11	0.00	强平	强平	18.00	0	0	穿仓	
98638	强平	34.99	0.00	强平	强平	633286.50	5	24	强平	
7777	追保	71.58	-3186031.58	强平	正常	321646.24	2	0	警示	
88362	警示	2204.88	0.00	正常	强平	109800.00	4	0	追保	
98065	警示	1780009.22	0.00	正常	正常	9.00	0	0	警示	
7780	警示	19594.44	0.00	正常	正常	18.00	0	0	警示	
90188	警示	611436.29	0.00	正常	正常	360.00	0	0	警示	
98096	警示	1351.75	0.00	正常	正常	117286.00	0	0	警示	
96898	警示	448355.56	0.00	正常	正常	9.00	0	0	警示	
96596	警示	615.78	0.00	正常	正常	29321.50	0	0	警示	
00012	警示	6477.06	0.00	正常	正常	186613.85	1	0	警示	
86168	警示	1393.78	0.00	正常	正常	293215.00	0	0	警示	
7856	警示	438907.89	0.00	正常	正常	18.00	0	0	警示	
96820	警示	211855.56	0.00	正常	正常	9.00	0	0	警示	
汇总			-11112217076.96			5503684.03	155	48		

图2.2.2



图2.2.3

其中列表数据字段【通知状态】显示的是投资者是否查看到风险通知的状态。“未通知”表示风险通知已发送，但是投资者还未登录客户下单终端，还未查看到其风险通知，或

者还未发送风险通知；“已通知”表示投资者已经登录客户下单终端，查看到其风险通知。

列表数据字段【昨强平标志】取值方式是当投资者昨风险状态出现赤字（即追保/强平/穿仓），该字段为“强平”；当昨风险状态为异常，该字段为“异常”；当昨风险状态为正常，该字段为“正常”。

列表数据字段【强平标志】取值方式是当投资者今日风险状态出现赤字，该字段为“强平”；当今日风险状态为异常，该字段为“异常”；当今日风险状态为正常，该字段为“正常”。

列表数据字段【历史强平次数】显示的是投资者历史上被强平的次数，一天强平多次，只算一次，并且只是计算历史强平次数，不包括今天已经进行的强平。

列表数据字段【风险持仓】显示的是投资者对于指定风险产品的总持仓量；风险产品的设置见下述[选项配置说明](#)。

U 选项配置

用户可以通过视图“选项”中的“当日资金查询”设置以下配置：

1. 重点关注投资者：从“待选投资者”选择重点关注的投资者到“选定投资者”，则该重点关注的投资者的资金情况会一直显示在当日资金查询视图中，无论排序设置怎么配置；
2. 过滤设置：勾选【显示总权益为0的记录】，将会显示出总权益为0的记录。勾去【显示总权益为0的记录】，将会显示出总权益不为0的，以及总权益为0，但是出入金不为0的记录；

勾去【不过滤】才能设置下方的四种按某资金字段的过滤；按资金字段的过滤有排名和比例两种方式，在后面的输入框中输入排名前几位或者占总排名多少百分比，针对资金字段，支持并列；

例如按总权益过滤，排名前十位，这表示需要显示出的是总权益从大到小排在前十位的，所有投资者的资金信息。如果有N个投资者的总权益都为P，并且P是排在所有总权益的前十位，那么这N个投资者的资金信息都应该显示在当日资金查询中；

例如按总权益过滤，占总排名的百分比为0.6，这表示需要显示出的是总排名的前60%的投资者资金信息。如果总共有100个投资者，按总权益从大到小排序，然后显示出前 $100 \times 60\% = 60$ 个投资者的资金信息。

3. 风险警示设置：只有警示值可以修改；风险度计算方法提供四种算法；
4. 数据刷新频率设置：刷新间隔必须为大于0的整数；

5. 风险持仓设置：用户可以通过点击合约/品种前面的勾选框，来选定参与风险持仓计算的合约/品种。由于针对品种的持仓方向会同步到该品种下所有合约的设置中，所以如果需要对某个合约设置特定的持仓方向，必须在设置好品种之后，再对该合约进行设置。

所有设置在确认【保存设置】后实时生效。如图2.2.4。



图2.2.4

2.3 已选投资者列表

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【已选投资者列表】，打开已选投资者列表界面。

U 界面说明

双击“当日资金查询”视图中的某条投资者资金记录，该投资者的资金信息就会自动存放到“已选投资者列表”中，其投资者信息、持仓信息、成交信息、报单信息也会同步显示在投资者信息、投资者持仓信息、投资者成交信息、投资者报单信息视图中。“已选投资者列表”只包含该投资者。

用户可以通过在“当日资金查询”视图中，鼠标右击选中某条投资者资金记录，或者按住【Ctrl】键多选几条投资者，在弹出的下列框中选择【发送已选择】，该单个或者多个投资者就会添加到“已选投资者列表”视图。用户可以通过在“当日资金查询”视图中鼠标右击，在弹出的下列框中选择【发送全部】，所有投资者就会添加到“已选投资者列表”视图。如图2.3.1。



图2.3.1

双击“已选投资者列表”视图中某条投资者资金记录，该投资者的资金信息就会从“已选投资者列表”视图中删除，其持仓信息、成交信息、报单信息也会同步从投资者持仓信息、投资者成交信息、投资者报单信息视图中被删除。

如果需要清空“已选投资者列表”所有资金数据，鼠标右击，在弹出的下拉框中选择【清空】即可。其持仓信息、成交信息、报单信息也会同步从投资者持仓信息、投资者成交信息、投资者报单信息视图中被删除。

“已选投资者列表”视图如图2.3.2。

U 选项配置

投资者代码	风险度	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	手续费	权益	保证金	可用资金
96683	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
96685	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
96686	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
96688	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
96689	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
98638	34.99	48.11	-1713721.60	0.00	0.00	221597.20	633286.50	-18864
7777	71.58	106.10	18339.49	-31860...	1821.00	230236.00	321646.24	-863
96916	405.32	557.29	377303.95	0.00	0.00	1062447.95	262123.00	3058
98960	476.87	574.72	2061717.98	0.00	0.00	2496022.98	523421.50	19726
88011	486.70	926.31	3874559.87	0.00	1050.00	4343795.44	892508.14	34509
98879	503.40	671.20	-378549.50	0.00	0.00	136250.00	27066.00	-3853
96596	615.78	800.51	158000.00	0.00	0.00	180555.00	29321.50	1512
96607	619.61	805.50	79562.50	0.00	0.00	90840.00	14660.75	761
96069	1278.84	1644.23	43270.73	0.00	0.00	46072.83	3602.70	424
98015	1290.94	1659.78	3838172.00	0.00	0.00	4084243.00	316377.00	37678
98285	1336.66	1737.66	270474.00	0.00	0.00	391929.00	29321.50	2637
98096	1351.75	1757.28	1297397.98	0.00	0.00	1585417.98	117286.00	12703
96578	1369.24	1760.45	371732.60	0.00	0.00	394120.00	28783.80	3653
86168	1393.78	1811.91	2872223.00	0.00	0.00	4086773.00	293215.00	28045
98080	1735.24	2429.34	24691.00	0.00	0.00	25751.00	1484.00	242
88362	2204.88	2645.86	-963988.59	0.00	0.00	2420961.41	109800.00	-9822
7015	3520.11	4525.86	110302.60	0.00	0.00	128308.00	3645.00	1094

图2.3.2

2.4 投资者信息

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【投资者信息】，打开投资者信息界面。

U 界面说明

单击“已选投资者列表”视图中某条投资者资金记录，该投资者的信息就会同步显示在“投资者信息”视图中。“投资者信息”视图包括五个信息分窗口：投资者基本信息、指定下单人、资金调拨人、开户授权人、结算单确认人、资金信息。用户可以通过点击上面的标签栏进行各窗口的切换。如图2.4.1。

资金信息窗口如图2.4.2，显示该投资者的追加保证金以及出入金等资金情况。

U 选项配置

投资者信息

投资者基本信息

指定下单人

资金调拨人

开户授权人

结算单确认人

资金信息

字段	数值
投资者名称(代码)	
证件号码(类型)	
电话号码	
手机号码	
邮箱地址	
通讯地址	
分组代码	

图2.4.1

投资者信息

投资者基本信息

指定下单人

资金调拨人

开户授权人

结算单确认人

资金信息

字段	数值
追加保证金	11110859400.99
昨追加保证金	
追加交易所保证金	11110738093.74
昨追加交易所保证金	
出入金	-11114931045.38
权益	-11110414607.74
历史强平次数	6
通知状态	已发送穿仓通知

图2.4.2

2.5 投资者成交信息

u 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【投资者成交信息】，打开投资者成交信息界面。

u 界面说明

显示在“已选投资者列表”视图中的所有投资者的成交信息，最下方统计买成交汇总量、卖成交汇总量。如图2.5.1。

提供查询筛选条件：合约/产品、交易所、买卖方向、开平标志。每个条件只能选定一个值，目前不支持复选。直接选择需要的条件，不需要回车或者其他键盘操作，系统会自动根据条件显示出结果数据。

U 选项配置

投资者成交信息

合约/产品 全部 交易所 全部 买卖 全部 开平 全部

投资者代码	合约代码	成交编号	买卖	系统报单编号	会员代码	客户代码	开平	投保	价格	数量	成交时间	成交
136	R0907	200901220...	卖	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6200.00	2	12:49:11	普通
136	R0907	200901220...	买	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6200.00	2	12:49:11	普通
136	R0905	200901220...	卖	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6100.00	1	12:43:33	普通
136	R0905	200901220...	卖	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6100.00	1	12:42:49	普通
136	R0905	200901220...	买	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6100.00	1	12:42:49	普通
136	R0907	200901220...	卖	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	5934.00	1	12:38:28	组合
136	R0907	200901220...	买	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	5934.00	1	12:38:28	组合
136	R0905	200901220...	卖	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6134.00	1	12:38:28	组合
136	R0905	200901220...	买	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6134.00	1	12:38:28	组合
136	R0905	200901220...	卖	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6200.00	1	12:36:52	普通
136	R0905	200901220...	买	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6200.00	1	12:36:52	普通
136	R0905	200901220...	卖	200901220...	0067	00300021	平仓	投机	6100.00	1	12:35:57	普通
136	R0905	200901220...	买	200901220...	0067	00300021	平仓	投机	6100.00	1	12:35:57	普通
136	R0905	200901220...	卖	200901220...	0067	00300021	开仓	投机	6000.00	1	12:35:22	普通
买汇总												
卖汇总												

图2.5.1

2.6 投资者报单信息

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【投资者报单信息】，打开投资者报单信息界面。

U 界面说明

显示在“已选投资者列表”视图中的所有投资者的报单信息，最下方统计买报单汇总量、买今已成交数量、买剩余数量、卖报单汇总量、卖今已成交数量、卖剩余数量。如图2.6.1。

提供查询筛选条件：合约/产品、交易所、买卖方向、开平标志。每个条件只能选定

一个值，目前不支持复选。直接选择需要的条件，不需要回车或者其他键盘操作，系统自动会根据条件显示出结果数据。

U 选项配置

当该视图的记录数很大（超过一万条）时，建议使用快速模式功能，提高视图查询性能。具体配置见[1.2.16 视图快速模式](#)。

投资者报单信息									
合约/产品		交易所		买卖		开平		全部	
投资者代码	合约代码	报单引用	报单价格条件	买卖	开平	投保	价格	数量	强平原因
136	R0905	225	限价	卖	开	投	6000.00	1	非强平
136	R0905	226	限价	买	开	投	6000.00	1	非强平
136	R0905	227	限价	买	开	投	6100.00	1	非强平
136	R0905	228	限价	买	平	投	6100.00	1	非强平
136	R0905	229	限价	卖	平	投	6100.00	1	非强平
136	R0905	230	限价	卖	开	投	6200.00	1	非强平
136	R0905	231	限价	买	开	投	6200.00	1	非强平
136	SPD R0905&R0907	232	限价	卖	开	投	200.00	1	非强平
136	SPD R0905&R0907	233	限价	买	开	投	200.00	1	非强平
136	R0905	236	限价	买	开	投	6100.00	1	非强平
136	R0905	239	限价	卖	开	投	6050.00	1	非强平
136	R0905	240	限价	卖	开	投	6100.00	1	非强平
136	R0905	242	限价	卖	开	投	6100.00	1	非强平
136	R0905	243	限价	买	开	投	6100.00	1	非强平
买汇总								537	
卖汇总								553	

图2.6.1

2.7 投资者持仓信息

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【投资者持仓信息】，打开投资者持仓信息界面。

U 界面说明

显示在“已选投资者列表”视图中的所有投资者的持仓信息，如图2.7.1。

提供查询筛选条件：合约/产品、交易所。每个条件只能选定一个值，目前不支持复选。直接选择需要的条件，不需要回车或者其他键盘操作，系统自动会根据条件显示出结果数据。

U 选项配置

投资者持仓信息												
合约/产品		全部		交易所		全部						
投资者代码	合约代码	总买持	今买持	买可平	买均价	买冻结	总卖持	今卖持	卖可平	卖均价	卖冻结	投资
109	a0811	0	0	0	0.00	0.00	3	0	3	10.00	0.00	
109	a0901	1557	0	1557	10.00	0.00	2162	0	2162	10.00	0.00	
109	a0903	1200	0	1200	4134.00	0.00	373	0	373	4134.00	0.00	9
109	a0905	1536	0	1536	10.00	0.00	390	0	390	10.00	0.00	
109	y0811	0	0	0	0.00	0.00	1	0	1	10.00	0.00	
121	a0811	3	0	3	10.00	0.00	52	0	52	10.00	0.00	
121	a0901	465	0	465	10.00	0.00	322	0	322	10.00	0.00	
121	a0903	200	0	200	4134.00	0.00	113	0	113	4134.00	0.00	1
121	a0905	1004	0	1004	10.00	0.00	256	0	256	10.00	0.00	
121	m0811	0	0	0	0.00	0.00	3	0	3	10.00	0.00	
121	y0811	2	0	2	10.00	0.00	1	0	1	10.00	0.00	
122	a0811	16	0	16	10.00	0.00	15	0	15	10.00	0.00	
122	a0901	11	0	11	10.00	0.00	18	0	18	10.00	0.00	
122	a0903	42	0	42	4134.00	0.00	51	0	51	4134.00	0.00	
122	a0905	27	0	27	10.00	0.00	25	0	25	10.00	0.00	
122	m0811	1	0	1	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	

图2.7.1

2.8 投资者持仓排行

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【投资者持仓排行】，打开投资者持仓排行界面。

U 界面说明

鼠标左击视图左上方的【品种：】，在弹出的下拉框中通过鼠标左击选中需要显示其持仓排行的品种或者合约。选中的品种或合约会显示在左上方【品种：】的后面，视图会根据选中的品种或合约，显示当前场上的持仓排行情况，如图2.8.1。品种和合约不能同时选中。

该视图支持按照总持仓、多头持仓、空头持仓或者净持仓排行显示，用户可以通过鼠标左击总持仓、多头持仓、空头持仓或者净持仓列表头字段，实现根据排行规则，针对该字段的排行显示。例如，排行规则设置为显示排行前5位的持仓信息，鼠标左击“总持仓”列表头字段，视图将显示总持仓排行在前5位的持仓信息；鼠标左击“多头持仓”列表头字段，视图将显示多头持仓排行在前5位的持仓信息，依次类推。数据根据下面选项配置中的刷新

频率刷新。

鼠标左击其他列表头字段，系统将先根据排行规则，针对“总持仓”数据排行显示出记录，再根据选择的列表头字段排行。数据根据下面选项配置中的刷新频率刷新。

U 选项配置

用户可以通过视图“选项”中的“投资者持仓排行”设置以下配置：

- 1. 数据刷新频率设置：间隔必须为大于等于10的整数；
- 2. 排行规则：有排名和比例两种方式；

排名不支持并列，排名数量不能为0，可以为正、负数；排名为正数时表示显示的是排名前几位的投资者持仓统计信息，排名为负数时表示显示的是排名倒数几位的投资者持仓统计信息；

比例数量的绝对值不能大于1，可以为正、负数，比例为正数时表示显示的是排名前N%的投资者持仓统计信息，比例为负数时表示显示的是排名倒数N%的投资者持仓统计信息；

- 3. 合约/品种分组设置：用于设置各持仓排行分组的背景颜色；

所有设置在确认【保存设置】后实时生效。如图2.8.2。

合约	品种	投资者代码	昨持仓	总持仓	多头持仓	空头持仓	净持仓	投机多头持仓	投机空头持仓	保值
a1	8	CF								
a1	8	RO								
a1	8	SR								
a1	8	TA								
a1	8	WS	7221	7221	4293	2928	1365	4293	2928	
a1	8	WT	2415	2415	1672	743	929	1672	743	
a1	8	a	250	250	0	250	-250	0	250	
a1	8	a1	205	205	96	109	-13	96	109	
a1	8	au	98	98	20	78	-58	20	78	
a1	8	b	3	34	10	24	-14	10	24	
a1	8	c	20	20	12	8	4	12	8	
a1	8	cu	13	13	7	6	1	7	6	
a1	8	fu	8	8	0	8	-8	0	8	
a1	8	l	6	6	0	6	-6	0	6	
a1	8	m	3	3	3	0	3	3	0	
a1	8	p	2	2	0	2	-2	0	2	
a1	8	rn								

图2.8.1



图2.8.2

2.9 投资者成交排行

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【投资者成交排行】，打开投资者成交排行界面。

U 界面说明

鼠标左击视图左上方的【品种：】，在弹出的下拉框中通过鼠标左击选中需要显示其成交排行的品种或者合约。选中的品种或合约会显示在左上方【品种：】的后面，视图会根据选中的品种或合约，显示当前场上的成交排行情况，如图2.9.1。数据根据下面选项配置中的刷新频率实时刷新。品种和合约不能同时选中。

该视图支持按照总成交量/额、买成交量/额、卖成交量/额或者净买入成交量/额排行显示，用户可以通过鼠标左击总成交量/额、买成交量/额、卖成交量/额或者净买入成交量/额列表头字段，实现根据排行规则，针对该字段的排行显示。例如，排行规则设置为显示排行前5位的成交信息，鼠标左击“总成交量”列表头字段，视图将显示总成交量排行在前5位的成交信息；鼠标左击“买成交量”列表头字段，视图将显示买成交量排行在前5位的成交信息，

依次类推。数据根据下面选项配置中的刷新频率刷新。

鼠标左击其他列表头字段，系统将先根据排行规则，针对“总成交量”数据排行显示出记录，再根据选择的列表头字段排行。数据根据下面选项配置中的刷新频率刷新。

The screenshot shows a software window titled "投资者成交排行" (Investor Transaction Ranking). It features a sidebar on the left with a tree view for selecting contracts (合约) and varieties (品种). The main area displays a table with columns: 合约 (Contract), 经纪公司代码 (Broker Code), 投资者代码 (Investor Code), 总成交量 (Total Volume), 总成交额 (Total Amount), 买成交量 (Buy Volume), 买成交额 (Buy Amount), 卖成交量 (Sell Volume), 卖成交额 (Sell Amount), 净买入成交量 (Net Buy Volume), and 净买入成交额 (Net Buy Amount). The table is grouped by contract and variety, with each group having a distinct background color (blue, yellow, and orange). The data is sorted by total volume within each group.

合约	经纪公司代码	投资者代码	总成交量	总成交额	买成交量	买成交额	卖成交量	卖成交额	净买入成交量	净买入成交额
a1	a1	10095	2	39960.00	0	0.00	2	39960.00	-2	-39960.00
		11022	1	19980.00	1	19980.00	0	0.00	1	19980.00
		11015	1	19980.00	1	19980.00	0	0.00	1	19980.00
cu	cu	10700	25	179400.00	15	102700.00	11	75700.00	4	27000.00
		11305	12	81800.00	8	55000.00	4	26800.00	-4	-26800.00
		10505	8	55200.00	0	0.00	8	55200.00	-8	-55200.00
fu	fu	11022	5	17510.00	3	10505.00	2	7005.00	-1	-3505.00
		11015	5	17510.00	2	7005.00	3	10505.00	-1	-3505.00

图2.9.1

U 选项配置

用户可以通过视图“选项”中的“投资者成交排行”设置以下配置：

- 1. 数据刷新频率设置：间隔必须为大于等于10的整数；
- 2. 排行规则：有排名和比例两种方式：

排名不支持并列，排名数量不能为0，可以为正、负数；排名为正数时表示显示的是排名前几位的投资者成交统计信息，排名为负数时表示显示的是排名倒数几位的投资者成交统计信息。

比例数量的绝对值不能大于1，可以为正、负数，比例为正数时表示显示的是排名前N%的投资者成交统计信息，比例为负数时表示显示的是排名倒数N%的投资者成交统计信息；

- 3. 合约/品种分组设置：用于设置各持仓排行分组的背景颜色；

所有设置在确认【保存设置】后实时生效。如图2.9.2。



图2.9.2

2.10 实时风控行情

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【实时风控行情】，打开实时风控行情界面。

U 界面说明

鼠标左击视图左上方的【合约：】，在弹出的下拉框中通过鼠标左击选中需要显示其行情的合约。选中的合约会显示在左上方【合约：】的后面，视图会根据选中的合约，显示实时行情，如图2.10.1。数据根据下面选项配置中的刷新频率实时刷新。

U 选项配置

用户可以通过视图“选项”中的“实时风控行情”设置以下配置：

1. 数据刷新频率设置：间隔必须为大于等于1的整数；
2. 合约列表视图颜色设置：用于设置实时行情背景以及各字段显示的颜色；

所有设置在确认【保存设置】后实时生效。如图2.10.2。



图2.10.1

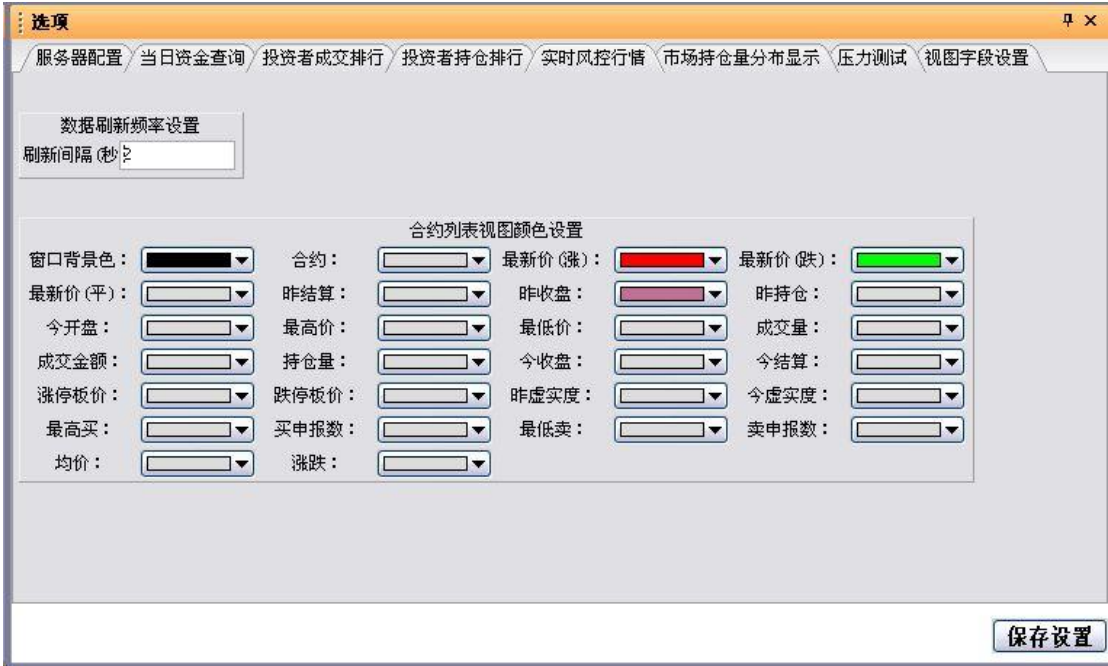


图2.10.2

2.11 压力测试

压力测试用于根据用户自己设定的结算价和保证金率，预测出N天后的资金以及风险状况。

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【压力测试】，打开压力测试界面。

U 界面说明

在视图左上方的【选择---天测试】的下列框中选择预测的日期，01表示当天，02表示当天+明天，03表示当天+明天+后天，依次类推。

下面共有四个显示框，左上角的显示框用来显示和选择模板，当选择01天测试时，该框中显示交易日数量为1的所有模板，当选择02天测试，该框显示交易日数量为2的所有模板，依次类推。单击勾选需要的模板，点击【提交】按钮，系统根据模板设置的结算价和保证金率预测出N天后的资金状况。每个模块只代表一个品种，可以多选。

左上居中的显示框在单击模板后，显示该模板的参数设置，只能查看，不能进行修改。如需修改，详见下“选项配置”。右上角的显示框在单击参数设置后，显示对应的保证金率设置，只能查看，不能进行修改。如需修改，详见下“选项配置”。

下方显示框用于显示提交后的预测结果。如图2.11.1。

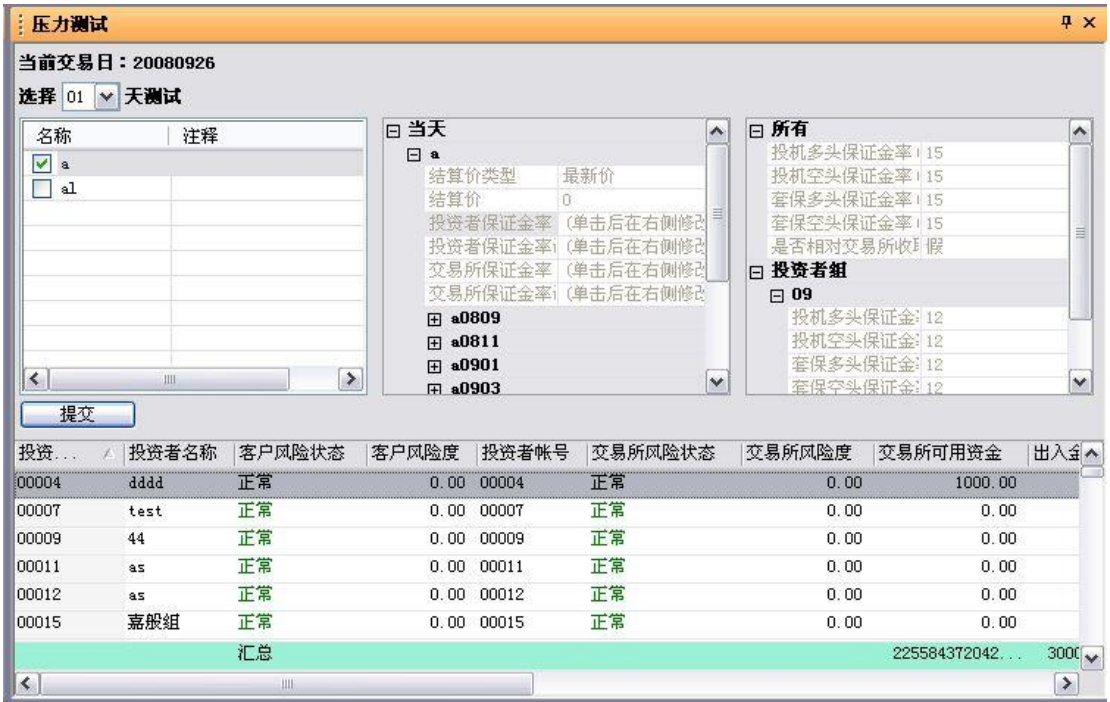


图2.11.1

U 选项配置

用户可以通过视图“选项”中的“压力测试”设置以下配置：

1. 模板列表：鼠标右击空白处，弹出【新建模板】，选择品种后，新建模版成功，默认新建的模板只含一个交易日，即当天；

鼠标右击已有模板，弹出菜单框实现包括：删除模板、重命名模板、增加交易日、减少交易日；其中当模板只含一个交易日时，不能再减少交易日；

2. 参数设置：单击“模板列表”中的模板，其相关参数就会显示在“参数设置”中。
在此用户可以自行设定结算价，单击【结算价类型】后，后面的输入框会出现▼按钮，点击该按钮，弹出下拉框，选择预设的结算价。若选择“自定义价格”，可在下方【结算价】的输入框中自行输入预设的结算价。如图2.11.2。
3. 保证金率设置：单击【参数设置】中的“投资者保证金率”、“投资者保证金率调整”、“交易所保证金率”或者“交易所保证金率调整”，其相应的场上交易保证金率就会显示在“保证金率设置”中。在此用户可以自行设定保证金率。如图2.11.3。

备注：“当天”以后的各天的结算价和保证金率都是在前一天的参数基础上进行比例调整的。只能输入【结算价调整】、【投资者保证金率调整】，输入的值为调整的比例。

所有设置在确认【保存设置】后实时生效。



图2.11.2




图2.11.3


2.12 市场持仓量分布显示

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【市场持仓量分布显示】，打开市场持仓量分布显示界面。

U 界面说明

用户可以通过单击视图右上方的  按钮，然后鼠标右击新增的标签栏【New】，在弹出的下列框中选择需要的合约或者品种，新增市场对于某一合约或者品种的持仓量分布扇形图示。选择合约或者品种后，标签栏【New】就会更新为所选的合约或者品种。如图2.12.1。数据根据下面选项配置中的刷新频率实时刷新。

如需删除某持仓量分布图，点击右上方的  按钮即可。

如需修改分布图的合约或者品种，鼠标右击标签栏，在弹出的下拉列表中选择需要的合约或者品种即可。

如需改变显示的颜色，单击视图下方的颜色块，在弹出的颜色选择框中，选择需要

的颜色，确定后颜色设置实时生效。

如需将某持仓量分布扇形图放大，点击该扇形图上方的名称字段即可，例如：【卖持仓比例】。

如需改变散户、中户、大户的持仓份额，详见下“选项配置”。



图2.12.1

U 选项配置

用户可以通过视图“选项”中的“市场持仓量分布显示”设置以下配置：

1. 数据刷新频率设置：间隔必须为大于等于10的整数；
2. 大中散户持仓比例模式设置：有比例值和绝对值两种方式；

例如：设置模式为绝对值，散户持仓比例为3，中户持仓比例为40，则持仓量 ≤ 3 的为散户， $40 \leq \text{持仓量} < 3$ 的为中户，持仓量 > 40 的为大户。扇形饼图显示比例的计算公式为：(散户的持仓总和 / 总的持仓量)；(中户的持仓总和 / 总的持仓量)；(大户的持仓总和 / 总的持仓量)；

3. 大中散户持仓比例设置：单击 + 按钮，展开设置，在此用户可以自行设置散户、中户、大户的持仓配额；其中要求设置的散户持仓比例必须小于中户持仓

比例；修改品种的设置，系统会自动对其衍生合约也做同样修改。

所有设置在确认【保存设置】后实时生效。如图2.12.2。



图2.12.2

2.13 用户事件信息

u 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【用户事件信息】，打开用户事件信息界面。

u 界面说明

用户可以通过输入视图左上角的【用户代码】，选择【事件类型】，点击【查询】按钮，或者按回车键查询特定操作员的特定事件。【用户代码】为空，【事件类型】为所有，表示查询所有用户事件。如图2.13.1。数据根据“当日资金查询”选项配置中设置的刷新频率实时刷新。

u 选项配置

当该视图的记录数很大（超过一万条）时，建议使用快速模式功能，提高视图查询性能。具体配置见[1.2.16 视图快速模式](#)。

用户事件信息							
用户代码		事件类型		所有			
经纪公司代码	用户代码	用户事件类型	用户事件序号	投资者代码	合约代码	事件发生日期	事件
2000	2000_admin	登录	1	2000_admin		20080926	13:5
2000	2000_admin	登录	2	2000_admin		20080926	13:5
2000	ye.h	登录	3	ye.h		20080926	13:5
2000	ye.h	交易成功	4	11026	cu0905	20080926	14:0
2000	ye.h	交易成功	5	11026	cu0905	20080926	14:0
2000	ye.h	交易成功	6	11026	cu0904	20080926	14:1
2000	ye.h	交易成功	7	11026	cu0904	20080926	14:1
2000	ye.h	交易成功	8	11026	cu0904	20080926	14:1
2000	ye.h	交易成功	9	11026	cu0904	20080926	14:1
2000	2000_admin	登录	10	2000_admin		20080926	14:1
2000	2000_admin	登出	11	2000_admin		20080926	14:1
2000	ye.h	交易成功	12	11026	cu0906	20080926	15:0
2000	ye.h	交易成功	13	11026	cu0906	20080926	15:0

图2.13.1

2.14 风险通知信息

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【风险通知信息】，打开风险通知信息界面。

U 界面说明

用户可以通过输入视图左上角的【投资者代码】，选择【通知类型】，系统自动根据输入的数据查询特定操作员的所有风险通知。【投资者代码】为空，【通知类型】为所有，表示查询当前所有操作员的所有风险通知。如图2.14.1。数据根据“当日资金查询”选项配置中设置的刷新频率实时刷新。

其中用户代码为“system”的通知为系统自动发送的通知，由用户手动发送的通知会在用户代码中记录执行发送操作的操作员代码。

U 选项配置

风险通知信息							
投资者代码		通知类型 穿仓					
经纪公司代码	用户代码	投资者代码	风险通知类型	事件序号	事件发生日期	事件发生时间	风险通知内容
2020	2020_admin	98065	穿仓	17	20080926	14:14:08	您的风险级别提升为穿仓
2020	wang.y	98221	穿仓	1016	20080926	15:09:50	您的风险级别提升为穿仓
2020	wang.y	98139	穿仓	1017	20080926	15:09:55	您的风险级别提升为穿仓
2020	wang.y	98096	穿仓	1018	20080926	15:09:55	您的风险级别提升为穿仓
2020	wang.y	98065	穿仓	1019	20080926	15:09:55	您的风险级别提升为穿仓
2020	wang.y	96666	穿仓	1020	20080926	15:10:01	您的风险级别提升为穿仓
2020	wang.y	96666	穿仓	1021	20080926	15:10:06	您的风险级别提升为穿仓
2020	wang.y	96658	穿仓	1022	20080926	15:10:06	您的风险级别提升为穿仓
2020	wang.y	96338	穿仓	1023	20080926	15:10:06	您的风险级别提升为穿仓

图2.14.1

2.15 报单查询




u 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【报单查询】，打开报单查询界面。

u 界面说明

用户可以通过输入查询筛选条件【席位：】、【下单用户：】、【合约：】、【投资者号：】，点击【提交】按钮，查询特定的报单记录。全部为空表示查询所有的报单记录。
【清除】按钮用于清空所有查询条件中的值。

每个输入框可以输入多个值，各值之间用逗号【，】或者分号【；】隔开即可。例如输入合约：al0809，al0901，cu0901；au0811；au0901。其中逗号【，】和分号【；】为英文输入法。如图2.15.1。数据根据“当日资金查询”选项配置中设置的刷新频率实时刷新。

每个输入框也可以通过点击按钮，在弹出的Dialog选择框中选择需要的值。Dialog选择框左边为待选数据，右边为已选数据，在待选数据框中双击或者单击选中后点击按钮，可以将值选中到已选数据框；在已选数据框中双击或者单击选中后点击按钮，可以将值从已选数据框删除。如图2.15.2。

勾选【强平查询】，点击【提交】按钮，用户可查询风控客户端发送的强平报单情

况。

U 选项配置

当该视图的记录数很大（超过一万条）时，建议使用快速模式功能，提高视图查询性能。具体配置见[1.2.16 视图快速模式](#)。

报单查询

席位:

下单用户:

合约:

投资者号:

提交

清除

☐ 强平查询

投资者代码	合约	报单引用	价格类型	买卖	开平	投保	委托价	委...	强平原因	请求编号	本地报单编号	交易所	会员代码
170	SP 109...	1	限价	卖	开	投	80.00	2	错误枚...	0	1	DCE	0003
170	10905	2	限价	买	开	投	13000.00	1	错误枚...	0	2	DCE	0003
170	10907	3	限价	卖	开	投	12920.00	1	错误枚...	0	3	DCE	0003
170	SP 109...	4	限价	买	平	投	80.00	1	错误枚...	0	4	DCE	0003
170	SP 109...	5	限价	买	平	投	60.00	1	错误枚...	0	5	DCE	0003
170	SP 109...	6	限价	卖	平	投	60.00	1	错误枚...	0	6	DCE	0003
170	c0905	28	限价	卖	开	投	1780.00	1	错误枚...	0	40	DCE	0003
170	c0905	30	限价	买	开	投	1750.00	1	错误枚...	0	43	DCE	0003
170	c0905	31	限价	卖	开	投	1750.00	1	错误枚...	0	44	DCE	0003
170	c0905	32	限价	买	开	投	1780.00	1	错误枚...	0	45	DCE	0003
170	c0905	33	限价	买	平	投	1740.00	1	错误枚...	0	46	DCE	0003
170	c0905	34	限价	卖	平	投	1740.00	1	错误枚...	0	47	DCE	0003
170	c0905	35	限价	卖	平	投	1800.00	1	错误枚...	0	48	DCE	0003
170	c0905	36	限价	买	平	投	1800.00	1	错误枚...	0	49	DCE	0003
170	a0909	40	限价	买	开	投	3833.00	1	错误枚...	0	53	DCE	0003
170	SP a09...	41	限价	卖	开	投	200.00	1	错误枚...	0	54	DCE	0003
170	SP a09...	42	限价	卖	开	投	200.00	1	错误枚...	0	55	DCE	0003
买汇总								305					
卖汇总								455					

图2.15.1

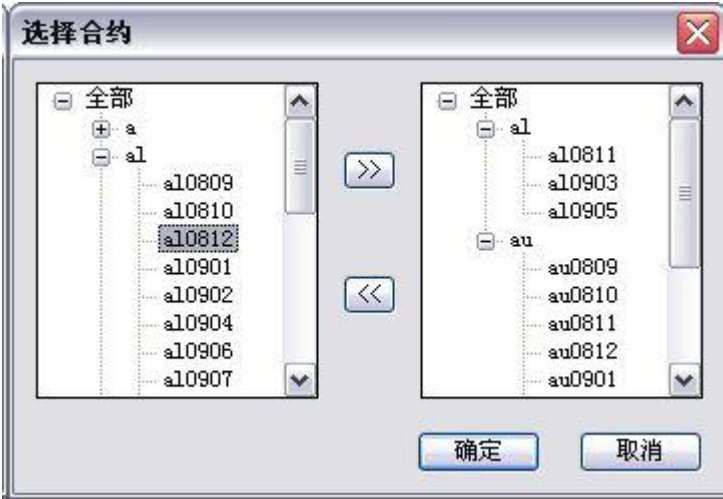


图2.15.2

2.16 成交查询

U 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【成交查询】，打开成交查询界面。

u 界面说明

提供查询筛选条件：席位、下单用户、合约、投资者号，具体使用方式和报单查询一样。如图2.16.1。数据根据“当日资金查询”选项配置中设置的刷新频率实时刷新。勾选【强平查询】，点击【提交】按钮，用户可查询风控客户端发送的强平单的成交情况。

u 选项配置

成交查询

席位：

下单用户：

合约：

投资者号：

提交

清除

☐ 强平查询

投资者代码	合约	成交号	买卖	系统号	会员代码	交易编码	开平	投保	成交价	成交...	成交时间	成交类型	席位	本
116	al0812	22	买	57	0068	00120414	开仓	投机	19955.00	1	10:02:51		0068cac	
170	al0812	22	卖	55	0068	00117032	开仓	投机	19955.00	1	10:02:51		0068cac	
116	al0812	23	买	58	0068	00120414	开仓	投机	19955.00	1	10:02:51		0068cac	
170	al0812	23	卖	56	0068	00117032	开仓	投机	19955.00	1	10:02:51		0068cac	
170	au0812	24	买	62	0068	00117032	开仓	投机	171.77	1	10:03:08		0068cac	
116	au0812	24	卖	59	0068	00120414	开仓	投机	171.77	1	10:03:08		0068cac	
170	au0812	25	买	63	0068	00117032	开仓	投机	171.77	1	10:03:08		0068cac	
116	au0812	25	卖	60	0068	00120414	开仓	投机	171.77	1	10:03:08		0068cac	
170	au0812	26	买	64	0068	00117032	开仓	投机	171.77	1	10:03:09		0068cac	
116	au0812	26	卖	61	0068	00120414	开仓	投机	171.77	1	10:03:09		0068cac	
116	cu0906	27	买	68	0068	00120414	开仓	投机	69900.00	1	10:03:37		0068cac	
170	cu0906	27	卖	65	0068	00117032	开仓	投机	69900.00	1	10:03:37		0068cac	
116	cu0906	28	买	69	0068	00120414	开仓	投机	69900.00	1	10:03:37		0068cac	
170	cu0906	28	卖	66	0068	00117032	开仓	投机	69900.00	1	10:03:37		0068cac	
170	cu0906	29	买	70	0068	00117032	开仓	投机	69900.00	1	10:03:39		0068cac	
170	cu0906	29	卖	67	0068	00117032	开仓	投机	69900.00	1	10:03:39		0068cac	
116	zn0812	30	买	73	0068	00120414	开仓	投机	26600.00	1	10:04:03		0068cac	
170	zn0812	30	卖	71	0068	00117032	开仓	投机	26600.00	1	10:04:03		0068cac	
买汇总										297				
卖汇总										297				

图2.16.1

2.17 持仓查询

u 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【功能】->【持仓查询】，打开持仓查询界面。

u 界面说明

提供查询筛选条件：合约、投资者号，具体使用方式和报单查询一样。如图2.17.1。数据根据“当日资金查询”选项配置中设置的刷新频率实时刷新。

u 选项配置

持仓查询														
合约：		投资者号：												
提交		清除												
投资者代码	合约代码	总买持	今买持	买可平	买均价	买冻结	总卖持	今卖持	卖可平	卖均价	卖冻结	投资者保证金	交易所保证金	昨
98732	CF901	1	0	1	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	2.50	2.50	
132	CF911	2	2	2	12260.00	0.00	2	2	2	12260.00	0.00	0.00	0.00	
132	R0907	19	19	12	6190.42	11763.50	18	18	12	6193.78	25...	3281.00	3281.00	
136	R0907	3	3	3	6306.67	2.50	4	4	3	6242.50	20...	3206.50	3206.50	
132	R0909	17	17	9	6094.00	9424.00	18	18	11	6078.00	24...	0.00	0.00	
136	R0909	4	4	4	5961.00	2.50	3	3	3	6418.00	15...	3016.00	3016.00	
132	SPD R0...	18	18	17	0.00	4686.00	17	17	17	0.00	0.00	53445.00	53445.00	
136	SPD R0...	2	2	2	0.00	0.00	3	3	3	0.00	0.00	7830.00	7830.00	
96193	SR811	1	0	1	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	7.00	6.00	
96566	SR811	20	0	20	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	140.00	120.00	
96568	SR811	2	0	2	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	14.00	12.00	
96568	SR811	3	0	3	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	21.00	18.00	
98398	SR811	4	0	4	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	28.00	24.00	
90168	SR901	1	0	1	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	7.00	6.00	
96202	SR901	1	0	1	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	7.00	6.00	
96218	SR901	6	0	6	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	42.00	36.00	
96338	SR901	1	0	1	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	7.00	6.00	
96558	SR901	2	0	2	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	14.00	12.00	
96568	SR901	2	0	2	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	14.00	12.00	
96626	SR901	4	0	4	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	28.00	24.00	
96633	SR901	100	0	100	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	700.00	600.00	
98013	SR901	1	0	1	10.00	0.00	0	0	0	0.00	0.00	7.00	6.00	

图2.17.1