**中期统一风控平台报表需求**

# 1报表结构

**根据风控平台的分级结构，能够分级统计个级别绩效；**

第一级 资管中心统计报表

第二级 产品统计报表

第三级 账户统计报表

**每级别报表内容**

账户权益绩效统计、交易绩效统计、持仓统计

# 2报表内容

## 2.1账户权益绩效统计

**可导出历史账户的逐日权益列表**

|  |  |
| --- | --- |
| 账户 |  |
| 上次质押金额 |  |
| 上次信用额度 |  |
| 上次存款额 |  |
| 上次结算准备金 |  |
| 上次占用保证金 |  |
| 利息基数 |  |
| 利息收入 |  |
| 入金金额 |  |
| 出金金额 |  |
| 冻结的保证金 |  |
| 冻结的资金 |  |
| 冻结的手续费 |  |
| 当前保证金总额 |  |
| 资金差额 |  |
| 手续费 |  |
| 平仓盈亏 |  |
| 持仓盈亏 |  |
| 期货结算准备金 |  |
| 可用资金 |  |
| 基本准备金 |  |
| 交易日 |  |
| 信用额度 |  |
| 质押金额 |  |
| 交易所保证金 |  |

**权益曲线**

**曲线1 逐日权益曲线 x 日期 y 权益 (线图)**

**曲线 2 每日权益变化量曲线 x 日期 y 每日权益增加量（柱状图）**

**2条曲线合并展示**

## 2.2交易绩效统计

交易报表总分为多头盈亏和空头盈亏2种

**导出逐日交易盈亏表**

|  |  |
| --- | --- |
| 账户 |  |
| 合约 |  |
| 买卖方向 |  |
| 开平标志 |  |
| 投机套保标志 |  |
| 价格 |  |
| 成交量 |  |
| 成交时间 |  |
| 成交类型 |  |
| 成交价来源 |  |
| 平仓盈亏 |  |

**交易曲线**

**曲线1 逐日多头和空头合计盈亏（曲线）x 日期 y 盈亏**

**曲线2 每日多头盈亏（柱状图）x 日期 y每日盈亏变化**

**曲线3 每日空头盈亏（柱状图）x 日期 y每日盈亏变化**

**3条曲线合并展示**

## 2.3持仓统计

**提供整体所有交易品种合并的持仓统计**

**提供分品种的持仓统计**

|  |  |
| --- | --- |
| 账户 |  |
| 合约 |  |
| 投机套保标志 |  |
| 买卖方向 |  |
| 开仓时间 |  |
| 数量 |  |
| 开仓价 |  |
| 投资者保证金 |  |
| 交易所保证金 |  |
| 保证金率 |  |
| 保证金率（按手数） |  |
| 昨日结算价 |  |
| 结算价 |  |
| 平仓价 |  |
| 平仓金额 |  |
| 成交类型 |  |
| 组合合约代码 |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |

**持仓统计曲线**

**曲线1 逐日持仓曲线 x 日期 y 持仓量（金额）线图**

**曲线2 日内增减量曲线 x 日期 y增减量(金额) 柱状图**

**2曲线合并显示，显示分品种曲线时x 轴 显示为 持仓量/手数**