AMS用户使用说明

深圳米筐科技有限公司

RiceQuant

2019

**目录**

**目录1**

**1.简介2**

**2.系统功能2**

2.1登录2

2.2主窗口2

2.3菜单导航3

**3.概览3**

**4.组合分析4**

4.1组合分析4

*4.1.1实时监控*4

*4.1.2组合报告*6

*4.1.3资产配置*6

*4.1.4头寸报表*7

*4.1.5交易流水*7

4.2绩效分析9

*4.2.1绩效分析*9

*4.2.2风险分析*12

4.3组合统计14

*4.3.1产品全景*14

*4.3.2持仓全景*15

**5.组合管理16**

5.1交易流水导入16

5.2组合管理16

5.3资产单元管理17

5.4交易手动录入20

5.5自定义基准20

1. **简介**

AMS是由米筐科技开发的一套多资产量化分析和风险管理系统。AMS包含多种类型文件上传和管理、实时监控、组合报告、绩效分析、风险分析等多个系统功能模块，为投资经理、证券分析师、基金经理提供准确、及时、完整的量化分析支持。

1. **系统功能**
   1. **登录**

* 可从浏览器直接进入AMS，网址为：[https://rqams.ricequant.com/ams/](https://rqams.ricequant.com/ams/login)
* “AMS”采用统一用户身份认证和管理系统，该系统可以基于用户身份进行资源授权访问权限，保障了用户数据的安全性。用户系统提供用户在一定周期内可以在已授权的网络环境下进行系统访问。
* 登录窗口画面

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* 登录：输入用户账号与密码，点击「登录」按钮可进入AMS。
  1. **主窗口**

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* 账号登录后，账户名称会显示主窗口右上角位置。
* 点击「登出」，即退出当前登录的账号。
  1. **菜单导航**

1. **概览**

概览主要是用于展示用户创建的单个或多个投资组合的整体概况，用户可以直接点击进入该投资组合的详情（实时监控）。

* **入口**

菜单栏（概览）

* **主要页面**

图片包含 屏幕截图, 室内, 墙壁

描述已自动生成

1. **组合分析**
   1. **组合分析**
      1. ***实时监控***

“实时监控”主要是用于展示用户选择的资产单位的实时行情信息。从产品持仓、单位净值与收益率、业绩总览三个板块展现该资产单元的实时行情情况。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 组合分析 >> 实时监控

* **主要功能**

图片包含 屏幕截图, 室内, 计算机, 笔记本电脑

描述已自动生成

* + 产品持仓

按照用户选择的资产分类标准对该资产进行分类。从该资产的资产代码、资产名称、公允价格、涨跌幅、持仓方向、持仓数量、持仓市值等多个角度为用户带来全面、精准的分析。

资产分类标准如下图所示。业绩基准包括指数、收益率，以及用户自定义基准。如下图所示：

* + 单位净值与收益率

用于展示在一定时间区间内，该资产单位的净值和收益率分别与基准进行对比的变化趋势图。改变右上方的时间区间或拉动下方的时间条可以对不同时间段进行单独分析。

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* + 业绩总览

通过阿尔法、贝塔、夏普、最大回撤、信息比率等因子数值，为用户提供对该资产更好的量化分析。



* + 1. ***组合报告***

“组合报告”主要是用于生产用户选择的组合或资产单元的数据信息的报告与下载。从单位净值与收益率、业绩总览、超额收益、权益与总市值、行业配置、行业配置前十柱状图、持仓前十、持仓前十圆环图、个股收益、个股收益的收益贡献、行业收益、行业收益的收益贡献、资产仓位追踪共十三个板块展现该资产的详情情况。用户可以下载此报告。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 组合分析 >> 组合报告

* **主要功能**

按照用户选择的模板（包括权益和固收）生成报告。

**图片包含 屏幕截图, 室内, 计算机, 监视器

描述已自动生成**

* + 1. ***资产配置***

“资产配置”主要是用于生成用户选择的资产单元在历史上某一天的截面数据信息。按照用户选择的单个或多个资产分类标准对该资产单元进行分类。从资产分类分析、权重分布、权重趋势共三个板块展现该资产的截面详情情况。用户可以下载此报告。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 组合分析 >> 资产配置

* **主要页面**

*图片包含 屏幕截图

描述已自动生成*

* + 1. ***头寸报表***

“头寸报表”主要是用于生成用户选择的资产单元在历史上某一天截面的头寸报表。从头寸报表这一板块展现该资产的截面持仓信息。按照固收、股票、基金、期货四个种类，对该资产单元中的各资产进行分类。用户可以下载此报告。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 组合分析 >> 头寸报表

* **主要页面**

*图片包含 屏幕截图, 室内, 计算机

描述已自动生成*

* + 1. ***交易流水***

“交易流水“主要是用于展示用户选择的资产单元在一时间区间内的交易流水信息。从交易流水这一板块展现该资产单元的交易流水信息。用户可以下载此报告。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 组合分析 >> 交易流水

* **主要功能**

**图片包含 屏幕截图, 室内, 监视器, 计算机

描述已自动生成**

通过交易流水明细和对同一资产的交易流水进行汇总两种方式展现该资产单元的交易流水信息。

* + 交易流水明细

图片包含 室内, 计算机, 墙壁, 笔记本电脑

描述已自动生成

从每条交易流水的变动时间、资产代码、资产名称、所属组合、资产类型、变动名称类型、变动数量、变动价格、费用的角度提供给用户全面的信息。

* + 资产汇总

图片包含 天空, 计算机, 屏幕截图, 室内

描述已自动生成

对同一资产的交易流水进行汇总，从每一资产的资产代码、资产名称、变动数量、费用的角度提供给用户全面的信息。

* 1. **绩效分析**
     1. ***绩效分析***

“绩效分析”主要是用于展示用户选择的资产单元在一时间区间内的归因分析。从收益走势、收益分解、绩效归因等板块展现该资产的绩效分析。用户可以选择用于归因分析的模板类型和业绩基准。用户可以下载此Excel报告。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 绩效分析 >> 绩效分析

* **主要功能**

**图片包含 屏幕截图, 室内

描述已自动生成**

* + 收益走势

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

用于展示在一定时间区间内，该投资组合和用户选择的基准组合在一模板下的收益率变化趋势图以及仓位占比变化。改变下方的时间区间或拉动下方的时间条可以对不同时间段进行单独分析。

目前支持8种模板类型（其中一种为Campisi和因子归因混合模板），如下图所示。

* + 收益分解

图片包含 标牌

描述已自动生成

用于展示在所选时间区间内，对投资组合在一模板下的收益进行分解分析。选择的模板不同，收益的分解方式也不同。

* + 绩效归因

根据选择的模板，“绩效归因“板块展示的内容也不同。

1. 以下是固收模板下的板块内容。

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

*图片包含 屏幕截图

描述已自动生成*点击按键，可展示投资组合和基准组合各个归因项的具体数据。

1. 以下是权益模板下的板块内容。

图片包含 笔记本电脑, 室内, 计算机, 屏幕截图

描述已自动生成点击按键，可展示投资组合和基准组合各个因子的具体数据。

* + 风格分析（权益模板下）

在权益的模板下，风格分析板块对风格因子的暴露度展开整体分析。内容包括各个风格因子暴露度在时间区间内的变化趋势。

图片包含 文字, 地图

描述已自动生成

* + 净值分析（权益模板下）

在权益的模板下，净值分析板块展现了各个风格因子在个别时间截面的变化。

图片包含 文字, 地图

描述已自动生成

* + 1. ***风险分析***

“风险分析”主要是用于计算用户选择的资产单元在两个历史时间截面的数据分析对比。从风险预测和VaR分析两个板块展现该资产的风险对比信息。用户可以选择业绩基准、置信度水平和计算方法（包括历史法和参数法）。用户可以下载此Excel报告。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 绩效分析 >> 风险分析

* **主要功能**
  + 风格预测

“风险预测“板块包括风险分解概览和风险变动分析两部分内容。

图片包含 室内, 屏幕截图, 笔记本电脑, 计算机

描述已自动生成

图片包含 室内, 笔记本电脑, 计算机, 屏幕截图

描述已自动生成

在下拉列表中图片包含 屏幕截图

描述已自动生成可选择不同种类，展示风格因子和行业因子的详细数据。

* + VaR分析

“VaR分析“板块包括组合VaR概览、VaR行业分解、预期收益指标、预期收益分布四个部分的内容。

图片包含 文字

描述已自动生成

* 1. **组合统计**
     1. ***产品全景***

“产品全景”主要是用于计算用户选择的单个或多个产品在一定时间区间内的数据分析对比。从产品信息和回报趋势两个板块展现该资产的风险对比信息。用户可以选择业绩基准。用户可以下载此报告。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 组合统计 >> 产品全景

* **主要功能**

**图片包含 室内

描述已自动生成**

* + 在下拉列表中图片包含 屏幕截图

    描述已自动生成可选择单个或多个产品进行分析。
  + “回报趋势“板块展示所有选择的产品在时间区间内的日收益率变化趋势对比。
    1. ***持仓全景***

“持仓全景”主要是用于展示用户选择的单个或多个产品在某一历史时间截面的持仓数据信息。按照固收、股票、基金、期货四个种类，对各资产单元中的资产进行分类。每个资产的数据包括资产代码、资产名称、所属组合、所属资产单元、多头/空头、数量、公允价格、净价等内容。用户可以下载此报告。

* **入口**

菜单栏（组合分析）>> 组合统计 >> 持仓全景

* **主要页面**

**图片包含 室内, 屏幕截图, 墙壁, 计算机

描述已自动生成**

1. **组合管理**
   1. **交易流水导入**

“交易流水导入”主要是用于实现用户对组合导入交易流水数据的操作，从而用于组合分析。

* **入口**

菜单栏（组合管理）>> 交易流水导入

* **主要功能**

**图片包含 天空, 屏幕截图, 计算机, 室内

描述已自动生成**

根据组合名称选择相应的组合或通过右上方的搜索框查找相应组合。

* + 点击「导入」按键。选择相对应的资产类型，上传交易流水文件。文件具体格式可参考“下载范例“。

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* 1. **组合管理**

“组合管理”主要是支持用户实现新增组合、删除组合、对已有组合进行备注的操作。

* **入口**

菜单栏（组合管理）>> 组合管理

* **主要功能**

**图片包含 天空, 计算机, 室内, 笔记本电脑

描述已自动生成**

根据组合名称选择相应的组合或通过右上方的搜索框查找。

* + 点击「删除」按键。即可删除相应组合。
  + 点击「新增组合」按键，即可添加组合。填写相应内容，支持“创建并导入“与“仅创建”两种方式。在「高级」一栏中，PMS支持债券的四种估值方式：中债估值、中证估值、摊余成本法、成本法。

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* 1. **资产单元管理**

“资产单元管理”主要是支持用户实现新增、修改、删除、备注资产单元的操作。

* **入口**

菜单栏（组合管理）>> 资产单元管理

* **主要功能**

图片包含 计算机, 笔记本电脑, 屏幕截图, 室内

描述已自动生成

根据资产单元名称选择相应的资产单元或通过右上方的搜索框查找。

* + 点击「删除」按键。即可删除相应资产单元。
  + 点击「新增资产单元」按键，即可添加资产单元。支持“组合创建“与“持仓创建”两种方式。
    - 「组合创建」

填写相应内容，在「组合构成」一栏中可选择单个或多个组合。「起始日期」必须早于所有组合的交割单的日期。「出入金」文件具体格式可参考“下载出入金范例“。如需重新填写内容，可点击「重置」按键。

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* + - 「持仓创建」

填写相应内容，「起始日期」必须早于交割单的日期。「持仓文件」具体格式可参考“下载持仓范例“。「出入金」文件具体格式可参考“下载出入金范例“。若勾选「按资产拆分组合」，即自动对新增的资产单元中各资产按照资产种类进行分类合并为不同组合。如需重新填写内容，可点击「重置」按键。

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* + 点击「修改」按键，即可修改该资产单元。图片包含 屏幕截图

    描述已自动生成
  1. **交易手动录入**

“交易手动录入”主要是支持用户在单一组合中实现录入、修改、删除交易流水的操作。

* **入口**

菜单栏（组合管理）>> 交易手动录入

* **主要功能**

图片包含 室内

描述已自动生成

在下拉列表中选择相应组合。根据交易信息选择相应的交易或通过时间区间和关键字搜索进行查找。

* + 点击「录入」按键，即可新增交易流水。支持“权益类交易“、“固收类交易”、“期货交易“三种交易类型。填写相应内容。如需重新填写内容，可点击「重置」按键。

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* + 点击「修改」按键，即可修改交易流水。修改相应内容，资产代码不可改。如需重新修改内容，可点击「重置」按键。
  + 点击「删除」按键。即可删除相应交易流水。
  1. **自定义基准**

“自定义基准”主要是支持用户管理自定义基准，实现新增、修改、删除自定义基准的操作。

* **入口**

菜单栏（组合管理）>> 自定义基准

* **主要功能**

**图片包含 屏幕截图, 计算机, 监视器, 室内

描述已自动生成**

根据自定义基准名称选择相应的基准或通过右上方的搜索框查找。

* + 点击「删除」按键。即可删除相应自定义基准。
  + 点击「新增」按键，即可添加自定义基准。填写相应内容。点击「+」可新添指数，权重总和为100.00%。如需重新填写内容，可点击「重置」按键。

图片包含 屏幕截图

描述已自动生成

* + 点击「修改」按键，即可修改交易流水。修改相应内容。如需重新修改内容，可点击「重置」按键。