



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：	
[] 草稿	当前版本：	V6.0
[√] 正式发布	作 者：	黄玉玲、常雅琼
[] 正在修改	完成日期：	2013-04-16

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
001	A	22页，新增备注：手工强平（备注3）	王卫新			2012-05-16
002	A	97页，新增错单预警特殊说明	王卫新			2012-05-16
003	A	132页，新增备注：报单查询	王卫新			2012-05-16
004	A	134页，新增菜单：持仓查询—〉风 险通知（触发手工）	王卫新			2012-05-16
005	A	81、87、93页，预警参数中新增[投 保]标志	王卫新			2013-04-16
006	A	2.3章节修改查询功能的快捷键	王卫新			2013-04-16

目 录

用户操作手册	6
1 系统使用说明.....	6
1.1 系统概述	6
1.2 基本功能说明	6
1.2.1 使用须知	6
1.2.2 登陆系统	6
1.2.3 主界面说明	7
1.2.4 用户退出	8
1.2.5 导出数据	9
1.2.6 打印、打印预览	10
1.2.7 复制单元格/记录	10
1.2.8 自动设置列宽	11
1.2.9 设置最佳列宽	11
1.2.10 排序、按组排序、多重排序	12
1.2.11 视图快速模式	13
1.2.12 移动视图	14
1.2.13 前端显示	15
1.2.14 布局保存及应用	16
1.2.15 密码修改	18
1.2.16 锁定终端	19
1.2.17 查看系统版本	19
1.2.18 关闭系统	20
1.3 风控功能说明	21
1.3.1 手动生成强平单	21
1.3.2 辅助生成强平单	22
1.3.2.1 强平设置	23
1.3.2.2 单客户强平	29
1.3.2.3 批量强平	35
1.3.3 预埋强平单	36
1.3.4 撤单	38
1.3.5 权益反向计算	39
1.3.6 批量权益反向计算	44
1.3.7 净持仓指标设置及超标强平	48
1.3.7.1 净持仓指标设置	48
1.3.7.2 超标强平	50
1.3.8 风险预算	52
1.3.9 压力测试	56

1.3.10	发送风险通知.....	59
1.3.10.1	自动发送	59
1.3.10.2	手动发送	64
1.3.11	发送业务通知.....	67
1.3.11.1	自动发送业务通知.....	67
1.3.11.2	手动发送业务通知.....	68
1.3.12	标记电话人工通知状态.....	70
1.4	预警功能说明	71
1.4.1	行情预警	71
1.4.2	权益预警	73
1.4.3	报单预警	78
1.4.4	成交预警	84
1.4.5	持仓预警	90
1.4.6	错单预警	96
2	各菜单视图说明.....	102
2.1	选项.....	102
2.2	信息.....	106
2.2.1	投资者资金信息.....	106
2.2.2	特别关注投资者信息.....	112
2.2.3	已选投资者列表.....	113
2.2.4	投资者信息.....	115
2.2.5	投资者报单信息.....	116
2.2.6	投资者成交信息.....	117
2.2.7	投资者持仓信息.....	118
2.2.8	投资者报单排行.....	119
2.2.9	投资者成交排行.....	121
2.2.10	投资者持仓排行.....	124
2.2.11	实时风控行情.....	126
2.2.12	市场持仓量分布显示.....	128
2.2.13	风险通知信息.....	130
2.3	查询.....	131
2.3.1	报单查询.....	131
2.3.2	成交查询.....	133
2.3.3	持仓查询.....	134
2.3.4	资金查询.....	136
2.3.5	出入金查询.....	136
2.3.6	投资者信息查询.....	137
2.3.7	交易编码查询.....	138
2.3.8	电话通知查询.....	139
2.3.9	业务通知查询.....	140

2.3.10	席位资金查询.....	141
2.3.11	用户事件查询.....	142
3	风控权限说明.....	143

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) 使用对象：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 x86/x64, Windows 7 x86/x64

b) 安装步骤：略

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（以下简称风控）授权才能查看和使用某些功能，该权限可以向综合交易平台的管理员进行申请。

具体的风控权限对应的风控系统功能，请参见风控权限说明。

1.2.2 登陆系统

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



图 1.2.2-1

- ◆ 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；
- ◆ 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；
- ◆ 风险前置：风控服务器配置，详见选项配置。
- ◆ 清除缓存：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，重新登录再查看。

连接一个风险前置时，同一个用户，同时只能在一处登录，不能重复登录。

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，按功能分为三个部分：

1. 菜单栏/工具栏：显示所有的菜单项及快捷工具图标；
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，从左往右依次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选中激活的视图中的记录数量；最右边将在登录成功后显示登陆用户的用户名。

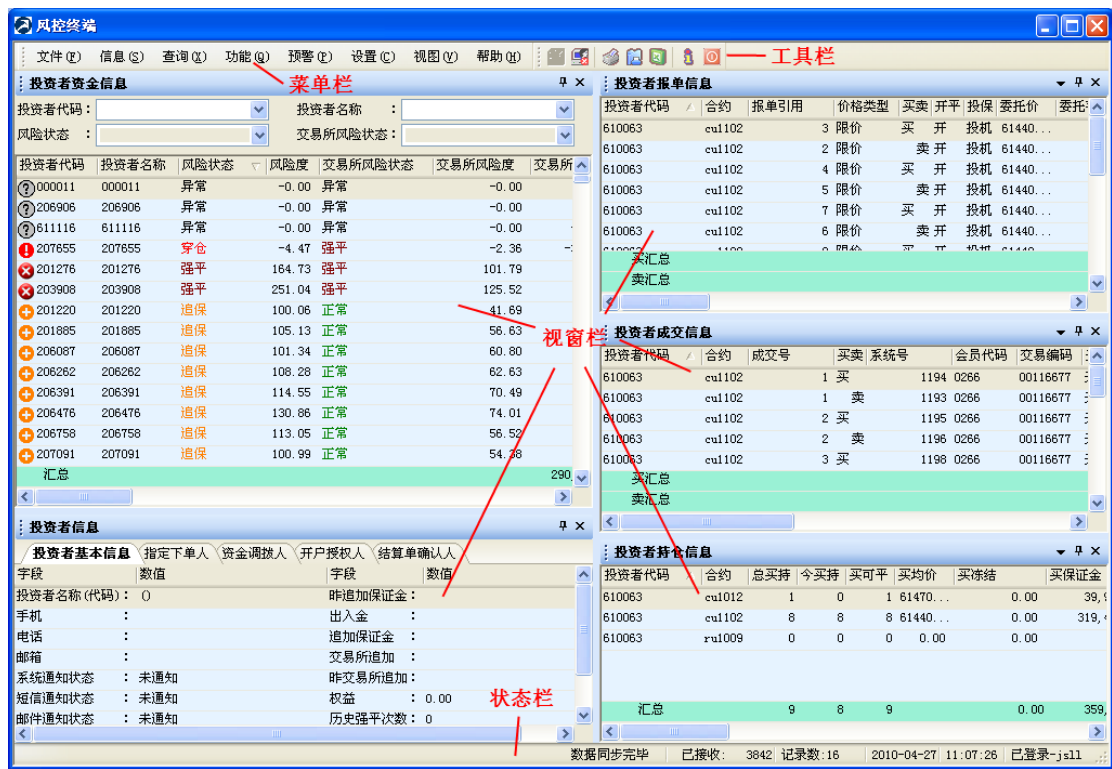


图 1.2.3-1

系统提供用户操作手册快捷方式，用户可以通过鼠标点击来选中一个视图，当前被选中视图的标题栏为橙色，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. 投资者资金信息视图--投资者代码；
2. 投资者成交、报单以及持仓信息视图--品种/合约；
3. 所有查询视图--品种/合约、投资者代码、下单用户。

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】，或者工具栏的【用户退出】按钮，实现该用户退出风险监控系统的，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】，或者工具栏的【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

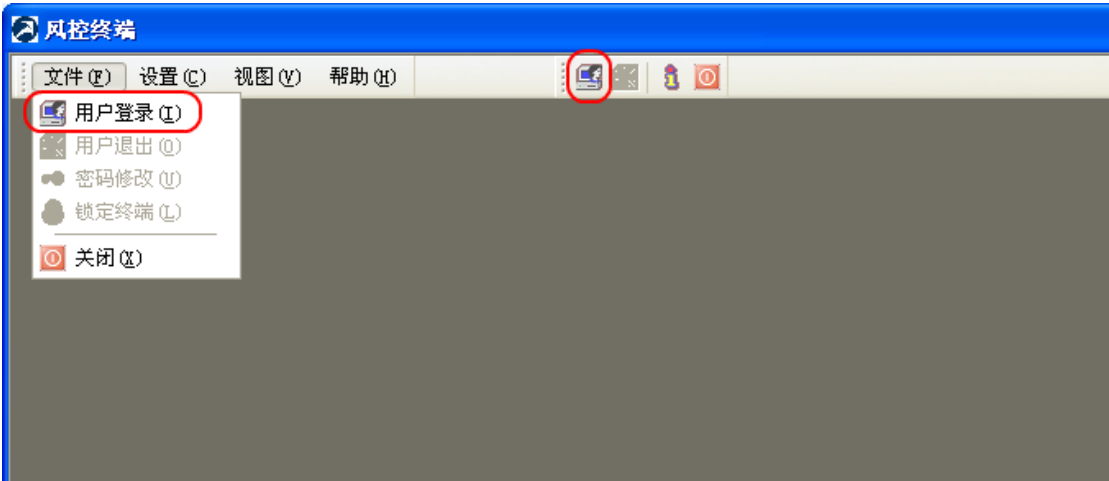


图 1.2.4-2

1.2.5 导出数据

导出数据功能，需要用户拥有对应的风控权限。

用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【导出Excel...】，或者工具栏的【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。导出数据时，文件名默认为【视图名】+【系统当前日期】.xls。

导出数据文件的历史记录，可以在综合交易平台【信息查询】->【事件查询】->【风控导出记录】查看。



图 1.2.5-1

1.2.6 打印、打印预览

打印、打印预览功能，需要用户拥有对应的风控权限。

用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【打印】、【打印预览】，或者工具栏的【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 复制单元格/记录

系统提供复制单元格/记录的功能。

用户鼠标单击选中一个视图中的一个单元格时，按【Ctrl+C】键即可复制当前选中单元格的内容至剪贴板。该功能只针对单一单元格，选中多个单元格时无效。

用户鼠标单击选中一个视图中的一条记录时，按【Shift+C】键即可复制当前选中记录的整行内容至剪贴板。选中多条记录时，该功能仍然有效，将复制所有选中记录的内容。

1.2.8 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，在弹出的下拉框中勾选【自动设置列宽】，如图 1.2.8-1。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】取消勾选即可。

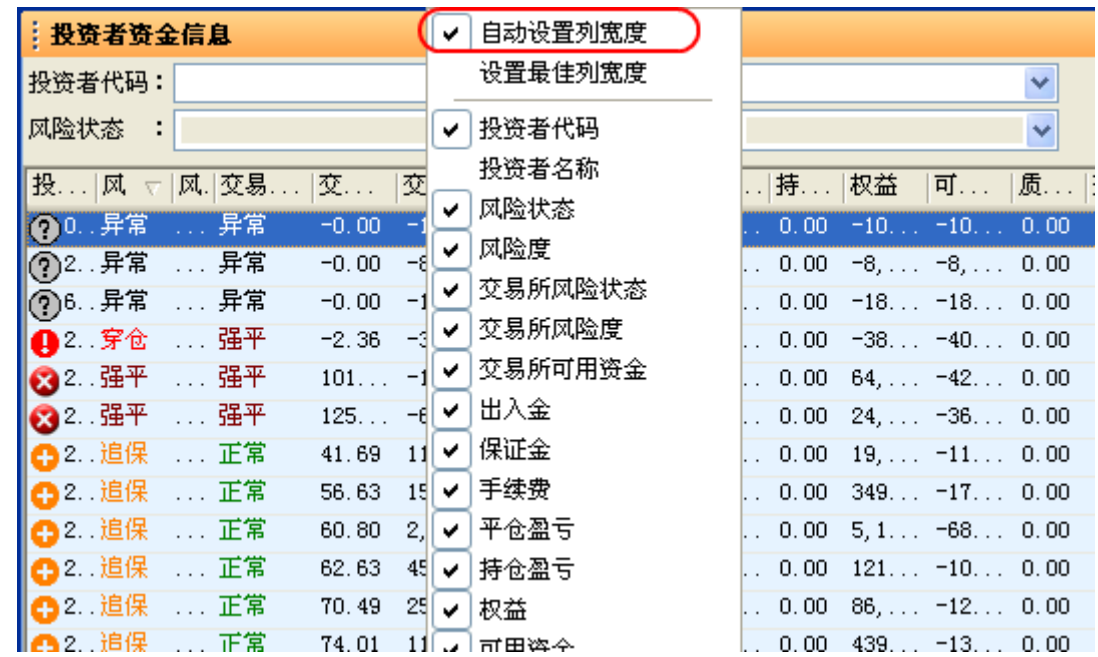


图 1.2.8-1

1.2.9 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 1.2.9-1。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取消勾选。

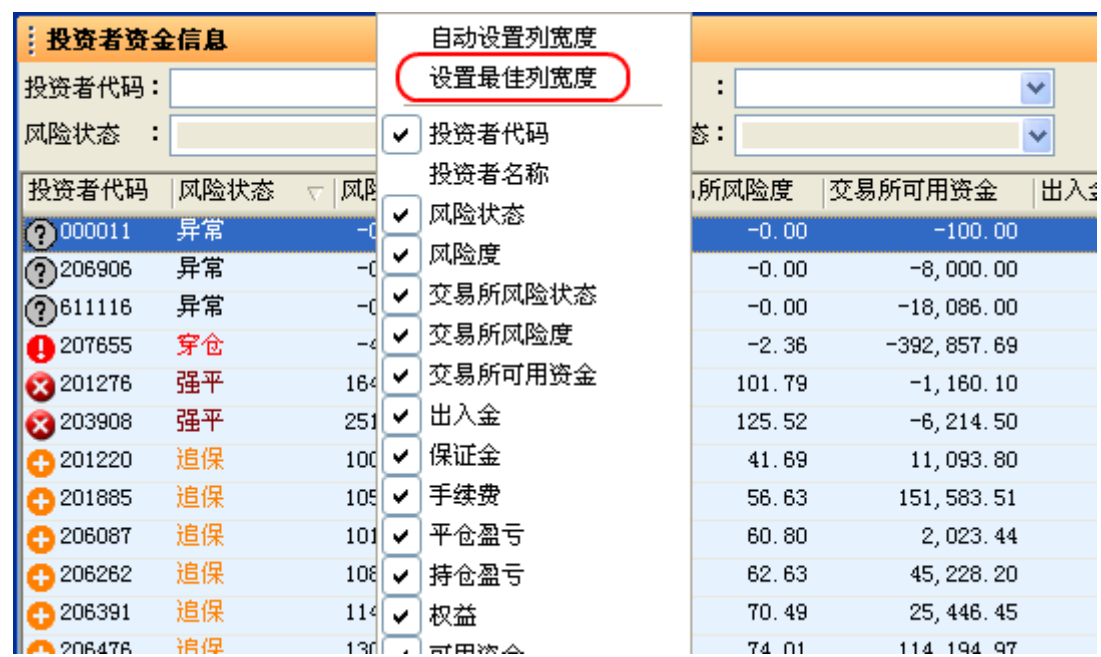


图 1.2.9-1

1.2.10 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 1.2.10-1。

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 1.2.10-2。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】取消勾选即可。注意，当【设置】->【选项】->【视图设置】中，勾选了【视图快速模式】时，系统将不支持按组排序，详见视图快速模式。

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 1.2.10-1



图 1.2.10-2

1.2.11 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 1.2.11-1，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，视图不再支持数据的按组排序。



图 1.2.11-1

1.2.12 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 1.2.12-1。

移动视图时会出现九个方向图标，将鼠标放到图标上可以：

- 将视图移至整个视图框的最上方；
- 将视图移至整个视图框的最右方；
- 将视图移至整个视图框的最下方；
- 将视图移至整个视图框的最左方；
- 将视图移至当前图标所在的分视图框的最上方；
- 将视图移至当前图标所在的分视图框的最右方；
- 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。

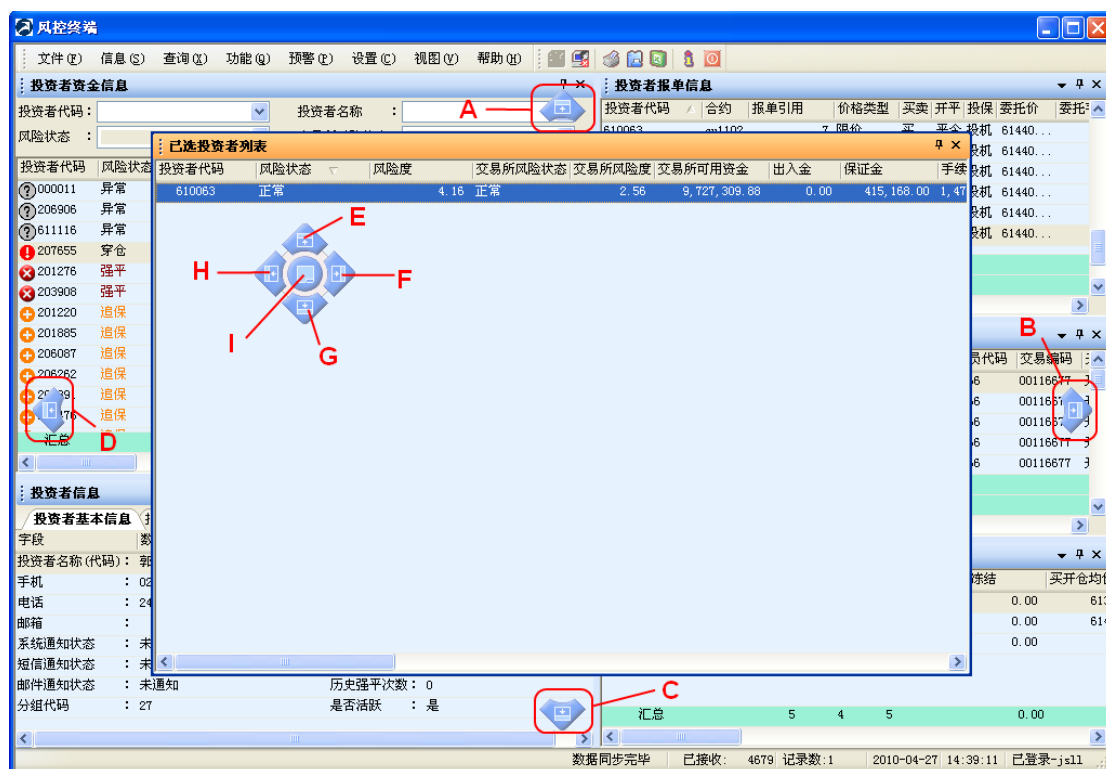


图 1.2.12-1

1.2.13 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；取消勾选则关闭该功能；设置实时生效。如图 1.2.13-1。



图 1.2.13-1

1.2.14 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【视图】->【布局】，如图 1.2.14-1，进入布局设置界面，如图 1.2.14-2。



图 1.2.14-1

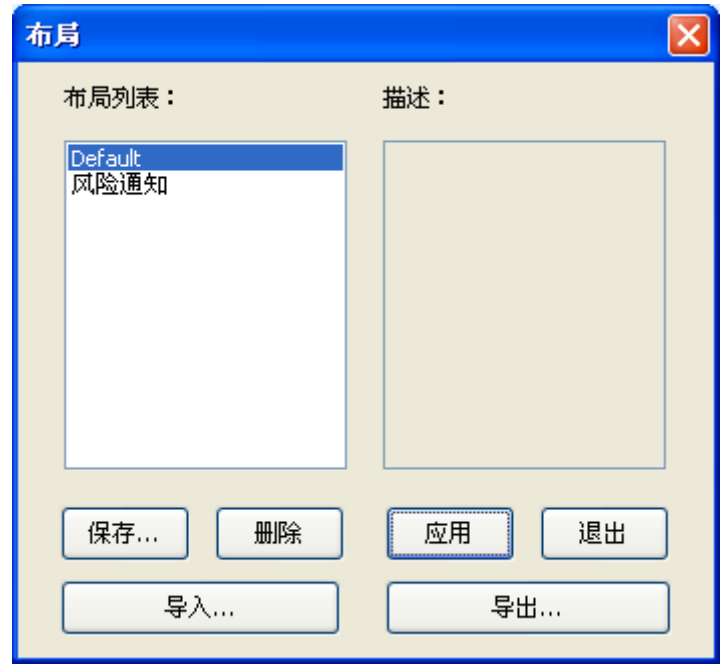


图 1.2.14-2

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 1.2.14-3。



图 1.2.14-3

布局影响的配置范围包括：【设置】->【选项】中，除“服务器配置”页、“投资者资金信息”页中的【风险度自定义强平】以外的其他所有配置内容。

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。

点击【导出...】按钮可以把当前已保存的布局导出到指定文件夹。点击【导入...】按钮

可以从指定文件夹导入布局文件。

系统提供默认布局，用户可以通过点击【视图】->【使用默认布局】，在确认后使用默认的视图布局。

1.2.15 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 1.2.15-1，进入密码修改界面，如图 1.2.15-2，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：

- 1. 输入的新密码和确认新密码必须一致；
- 2. 新密码不能为空，不能包含空格。



图 1.2.15-1

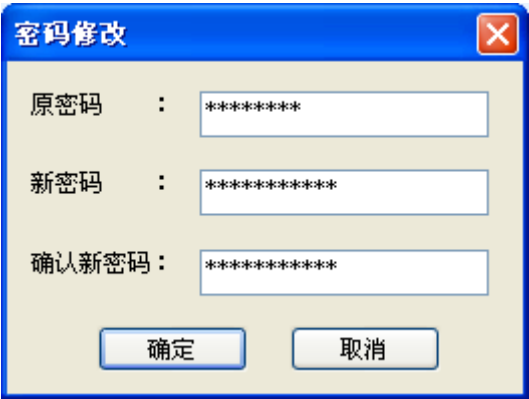


图 1.2.15-2

1.2.16 锁定终端

系统提供风险监控客户端锁定功能。用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【锁定终端】，如图 1.2.16-1，进入终端锁定界面，客户端将不可操作，如图 1.2.16-2。输入当前风控操作员的登陆密码，点击【解锁】按钮，解除锁定；点击【退出程序】按钮，退出风险监控系统。



图 1.2.16-1

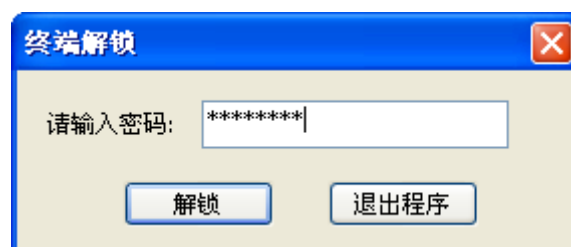


图 1.2.16-2

1.2.17 查看系统版本

用户可以通过点击菜单栏的【帮助】->【关于RCWin】，或者工具栏的【关于】按钮，查看当前系统的版本。如图 1.2.17-1。版本界面如图 1.2.17-2（后台版本为V6.0）。



图 1.2.17-1

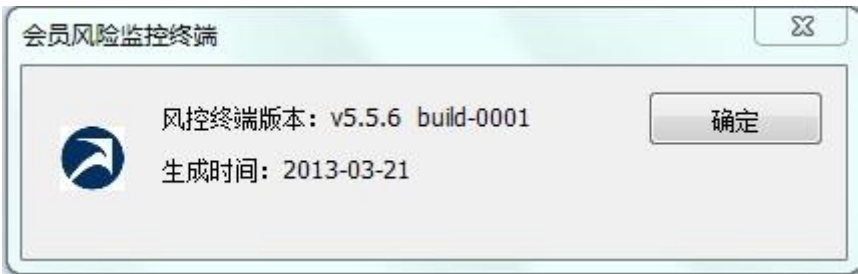


图 1.2.17-2

1.2.18 关闭系统


用户可以通过点击菜单栏的【文件】->【关闭】，或者工具栏的按钮，或者客户端的【关闭】按钮，关闭风险监控终端，如图 1.2.18-1。



图 1.2.18-1

1.3 风控功能说明

1.3.1 手动生成强平单

强平功能需要用户拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

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 1.3.1-1。

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，弹出强平回应对话框（可在下单界面最下方的【显示强平回应】勾选框中配置是否显示该对话框）；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 1.3.1-2。

投资者持仓信息															
投资者代码	合约	总买持	今买持	买可平	买均价	买冻结	买开仓均价	总卖持	今卖持	卖可平	卖均价	卖冻结	卖开仓均价	平仓盈亏	手续费
610063	cu1012	1	0	1	61470.00	0.00	61370.00	1	0	1	614.00	0.00	61370.00	0.00	0.00
610063	cu1102	4	4	4	61440.00	0.00	61440.00	4	4	4	614.00	0.00	61440.00	0.00	1,474.56
610063	ru1009	0	0	0	0.00	0.00	0.00	1	0	1	242.00	0.00	24770.00	0.00	0.00
610063	zn1012	1	1	1	19825.00	0.00	19825.00	1	1	1	198.00	0.00	19825.00	0.00	35.82
610063	zn1102	1	1	1	20175.00	0.00	20175.00	1	1	1	201.00	0.00	20175.00	0.00	36.18
610063	zn1103	1	1	1	20300.00	0.00	20300.00	1	1	1	203.00	0.00	20300.00	0.00	36.30
610063	zn1104	1	1	1	20285.00	0.00	20285.00	1	1	1	202.00	0.00	20285.00	0.00	36.28
汇总		9	8	9	0.00			10	8	10	0.00			0.00	1,619.1

强平多头持仓

强平空头持仓

图 1.3.1-1

报单录入

请求编号：0

投资者：610063

姓名：

合约：ru1009

投机套保：投机

买卖：卖

平仓类型：平仓 ☒ 强平

委托手数：1

委托价：23045.00

涨跌：25470.00/23045.00

可平：0

可平今：0

可用资金：9462724.79

☒ 显示强平回应

确定 预埋

图 1.3.1-2

强平单成交后，如果【设置】-【业务通知模板】中，【强平成交】的自动系统通知设置为【是】，则系统将自动发送强平成交业务通知。同笔报单分笔成交，则分别在首次成交及全部成交时发送两次系统通知。具体参考自动发送业务通知章节。

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。
3. 对于郑商所的ME合约，投机仓与套保仓在手动强平时，投保标志均为投机，可平数为投机和套保的总可平数。

1.3.2 辅助生成强平单

强平功能需要用户拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

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。

1.3.2.1 强平设置

用户可以通过点击菜单栏的【功能】->【强平设置】进入强平设置界面，如图 1.3.2-1。
强平设置界面如图 1.3.2-2。

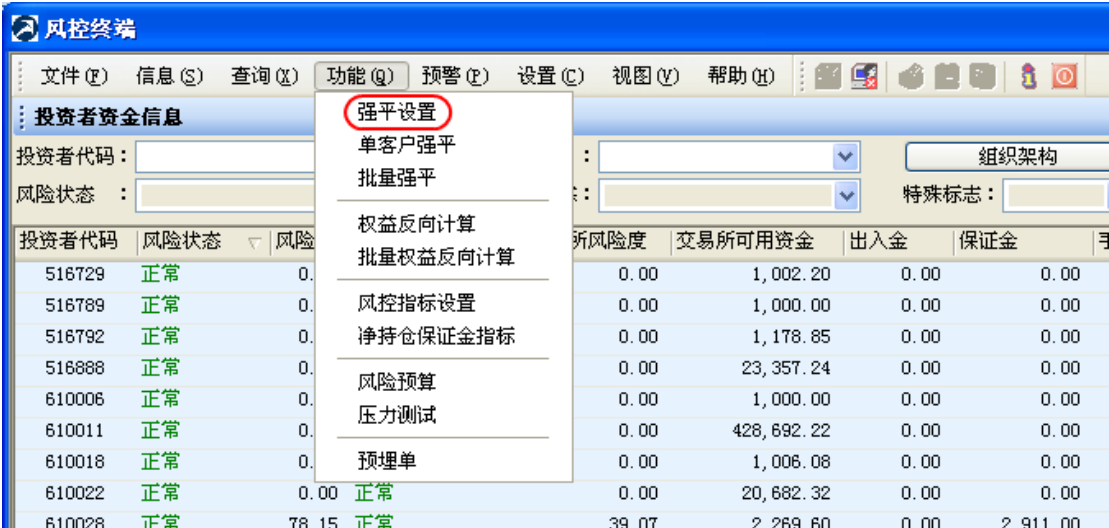


图 1.3.2-1

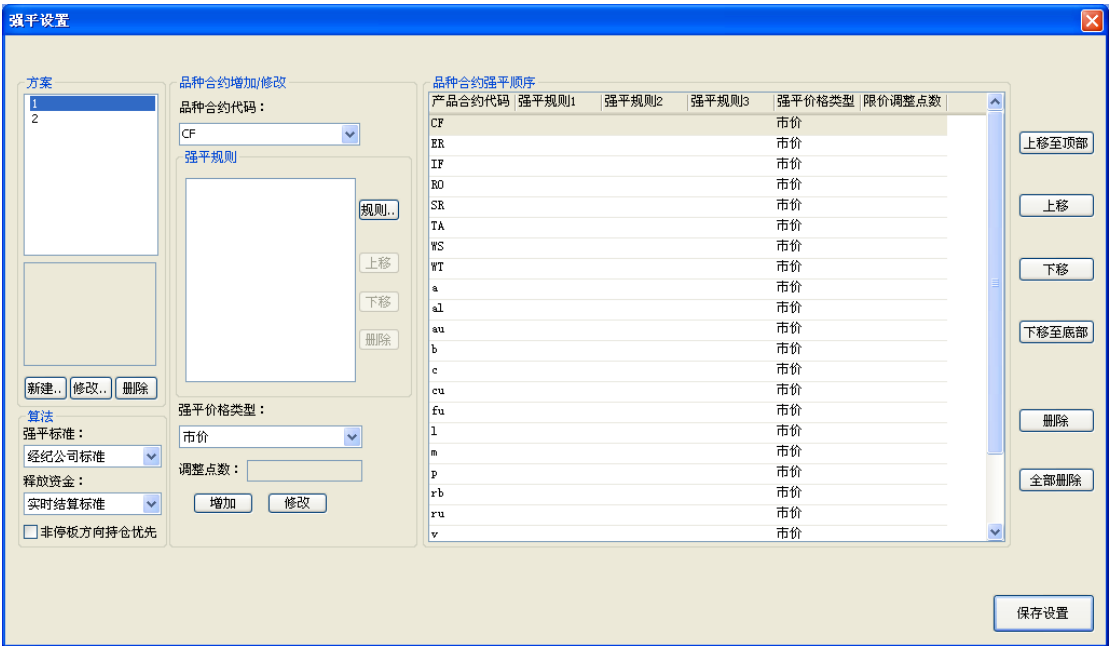


图 1.3.2-2

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 1.3.2-3。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。

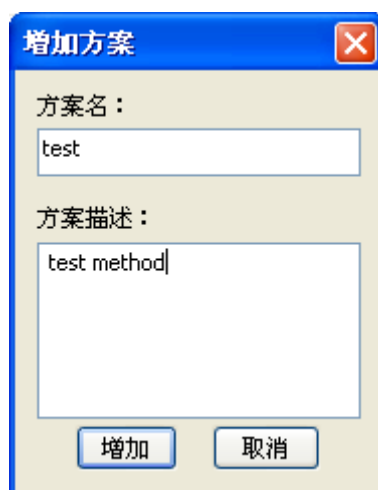


图 1.3.2-3

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 1.3.2-4。输入新的方案名和方案描述,点击【修改】按钮即可。

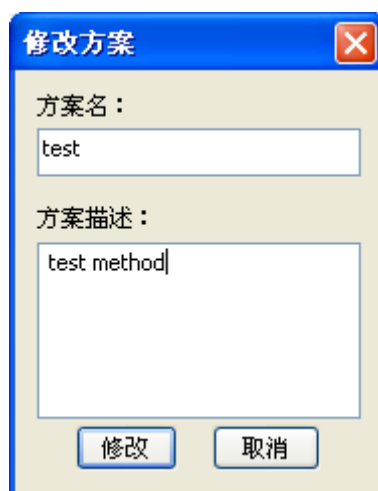


图 1.3.2-4

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 1.3.2-5。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。

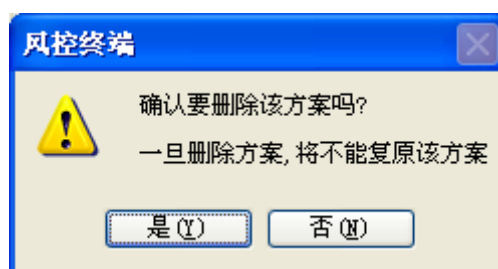


图 1.3.2-5

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

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。

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 1.3.2-6。

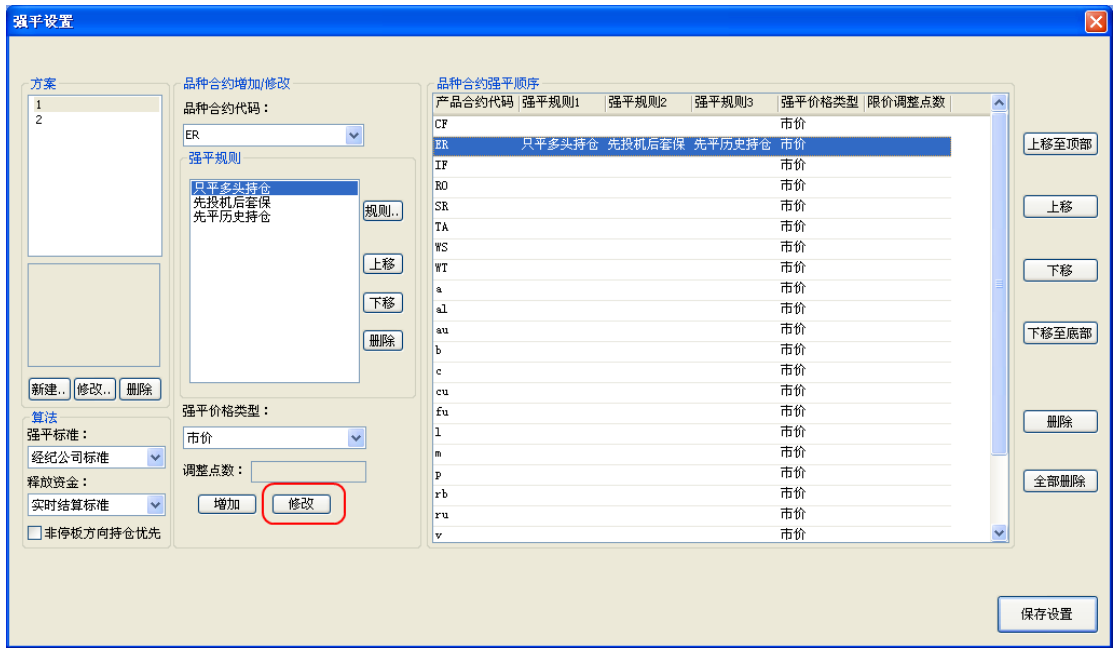


图 1.3.2-6

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 1.3.2-7。

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。

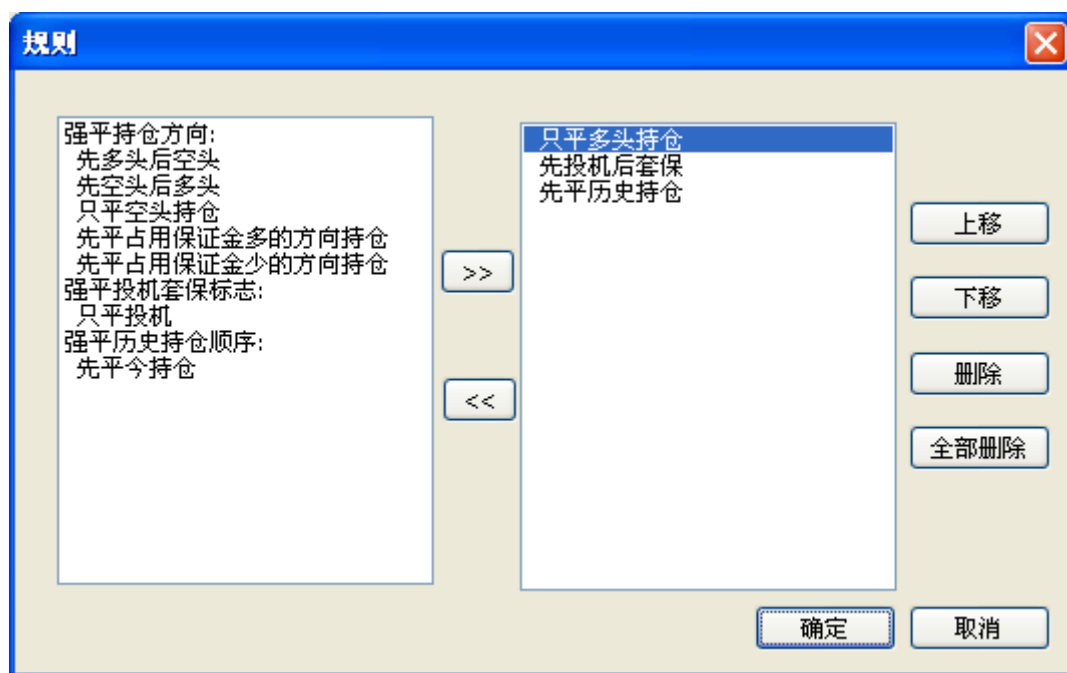




图 1.3.2-7

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。

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1.2.17强平规则设置对话框中的【上移】、【下移】、【删除】按钮功能相同。

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 1.3.2-8。

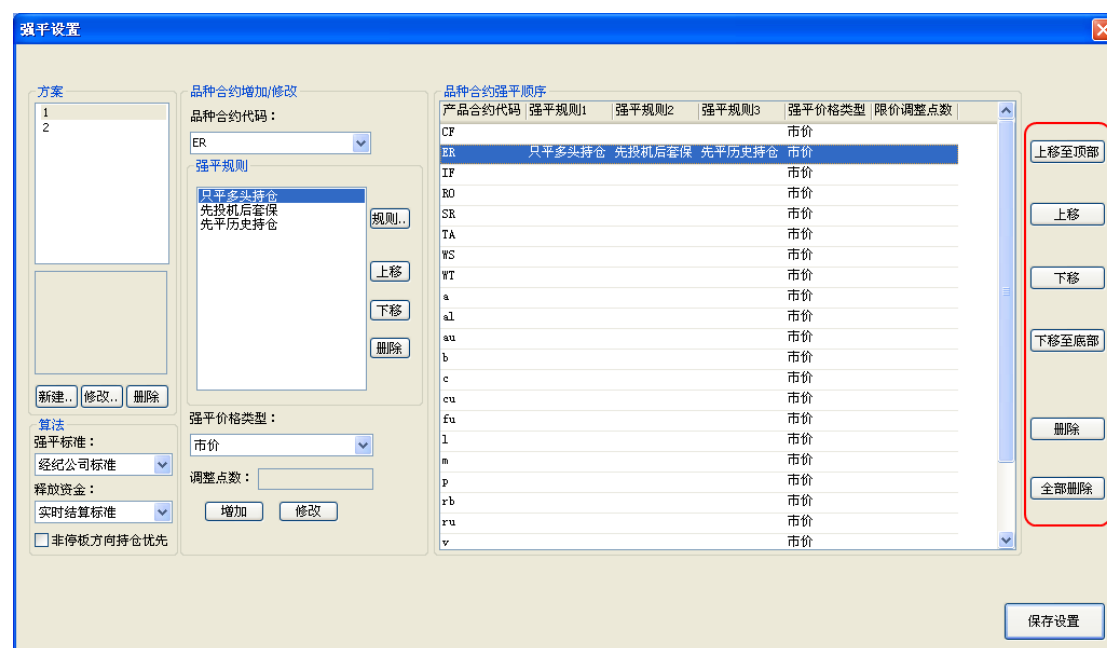


图 1.3.2-8

Step5. 保存设置

全部设置完毕后，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（按规则优先顺序）：
 - 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。
3. 上期所不支持市价的强平价格类型。

1.3.2.2 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投资者资金信息视图，或者特别关注投资者信息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【功能】->【单客户强平】，进入单客户强平界面。如图 1.3.2-9、图 1.3.2-10。

投资者资金信息								
投资者代码：		投资者名称：		组织架构				
风险状态：		交易所风险状态：		特殊标志：				
投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费
207655	穿仓	-4.47	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	17,141.50	0.
201276	强平	164.73	强平	101.79	-1,160.10	0.00	106,953.80	0.
203908	强平	251.04	强平	125.52	-6,214.50	0.00	61,131.00	0.
201220	追保	100.06	正常	1.69	11,093.80	0.00	19,036.80	0.
201885	追保	105.13	正常	6.63	151,583.51	0.00	367,424.20	0.
206087	追保	101.34	正常	0.80	2,023.44	0.00	5,231.00	0.
206262	追保	108.28	正常	2.63	45,228.20	0.00	131,065.10	0.
206391	追保	114.55	正常	0.49	25,446.45	0.00	98,779.20	0.
206476	追保	130.86	正常	4.01	114,194.97	0.00	575,053.00	0.
206758	追保	113.05	正常	6.52	1,119.50	0.00	2,911.00	0.
207091	追保	100.99	正常	4.38	77,823.68	0.00	172,263.00	0.
207619	追保	101.19	正常	0.71	1,980.47	0.00	5,101.00	0.
516371	追保	101.13	正常	54.46	182,857.78	0.00	406,048.50	0.

图 1.3.2-9

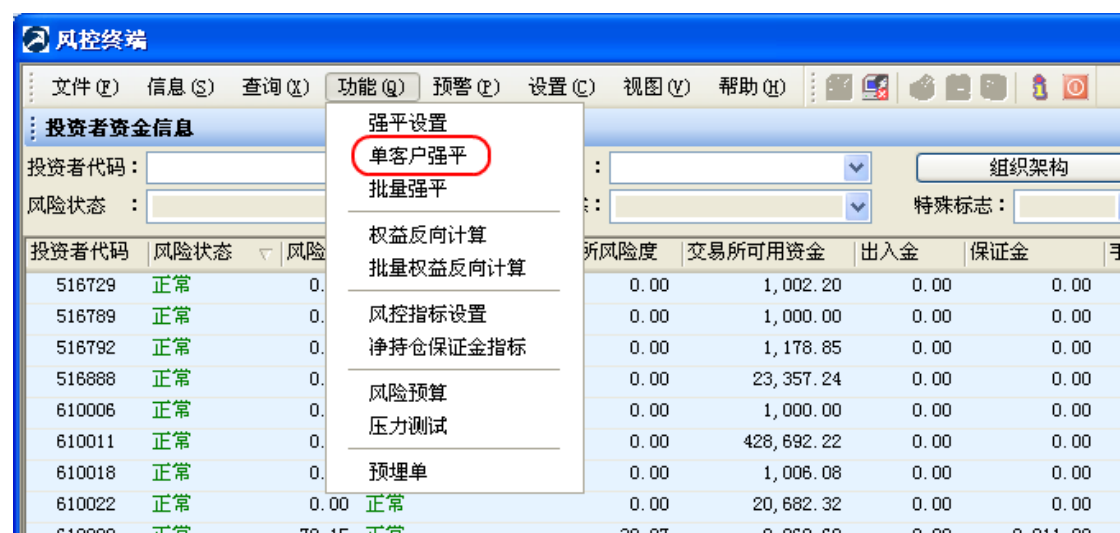


图 1.3.2-10

Step1. 查看资金持仓情况

单客户强平界面如图 1.3.2-11。

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。

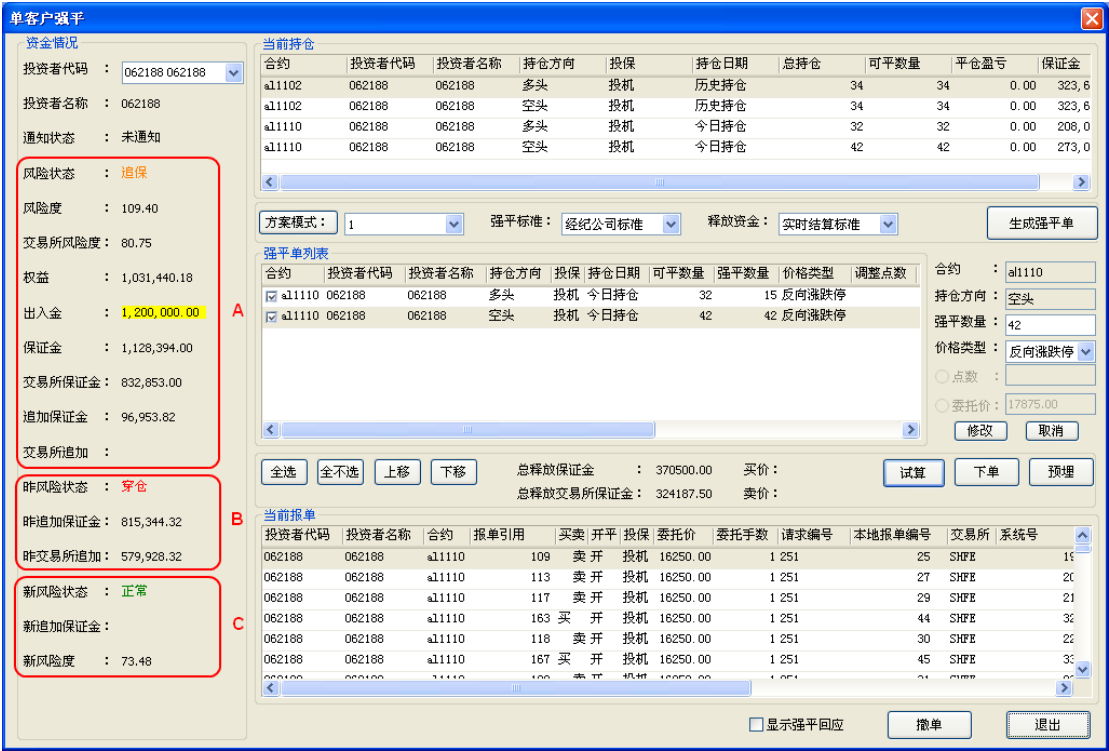


图 1.3.2-11

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【品种/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 1.3.2-12；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 1.3.2-12

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. 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 1.3.2-13。

图 1.3.2-13

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，弹出强平回应对话框（可在单客户强平界面右下方的【显示强平回应】勾选框配置是否显示该对话框），显示下单情况。如图 1.3.2-14。

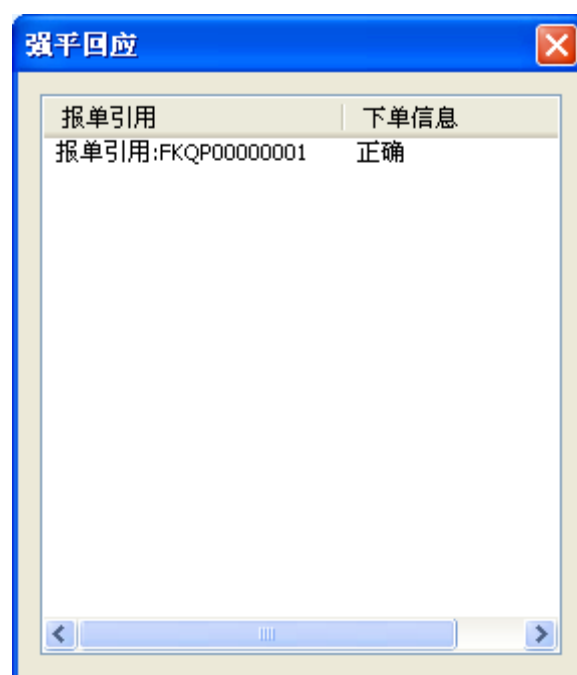


图 1.3.2-14

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。

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。

1.3.2.3 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【功能】->【批量强平】，进入批量强平界面，如图 1.3.2-15。

在[查询条件]中选择 [风险状态]、[昨风险状态]、[通知状态]、[特殊标志]（当在投资者资金信息配置中选择【支持特殊投资者过滤】时生效），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。

批量强平

查询条件

风险状态
☒ 穿仓
☐ 强平
☒ 追保

昨风险状态
☐ 穿仓
☐ 强平
☒ 追保

通知状态
☐ 未生成
☐ 已生成未发送
☐ 已发送未接收
☐ 已接收未确认
☐ 发送失败
☐ 已确认

特殊标志
☐ 0
☐ 1

强平方案：1 强平标准：经纪公司标准 释放资金：实时结算标准

投资者代码	投资者名称	风险状态	风险度	通知状态	昨风险状态	追加保证金	风险持仓	特殊标志
<input checked="" type="checkbox"/> 201220	201220	追保	100.06	已发送未接收	追保	11.00	0 0	
<input checked="" type="checkbox"/> 201885	201885	追保	105.13	已发送未接收	追保	17,913.69	0 0	
<input checked="" type="checkbox"/> 206087	206087	追保	101.34	已发送未接收	追保	68.96	0 0	
<input checked="" type="checkbox"/> 206262	206262	追保	108.28	已发送未接收	追保	10,027.30	0 0	
<input checked="" type="checkbox"/> 206391	206391	追保	114.55	已发送未接收	追保	12,545.55	0 0	
<input checked="" type="checkbox"/> 206476	206476	追保	130.86	已发送未接收	追保	135,622.23	0 0	
<input checked="" type="checkbox"/> 206758	206758	追保	113.05	已发送未接收	追保	336.00	0 0	
<input checked="" type="checkbox"/> 207091	207091	追保	100.99	已发送未接收	追保	1,682.32	0 0	
<input checked="" type="checkbox"/> 207619	207619	追保	101.19	已发送未接收	追保	59.93	0 0	

全选 全不选 查询 批量强平 退出

图 1.3.2-15

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 1.3.2-16。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。



图 1.3.2-16

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【显示强平回应】、【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；

1.3.3 预埋强平单

预埋单功能是强平功能的一部分，需要用户拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

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【功能】->【预埋单】，如图 1.3.3-1，进入预埋单界面，如图 1.3.3-2。



图 1.3.3-1

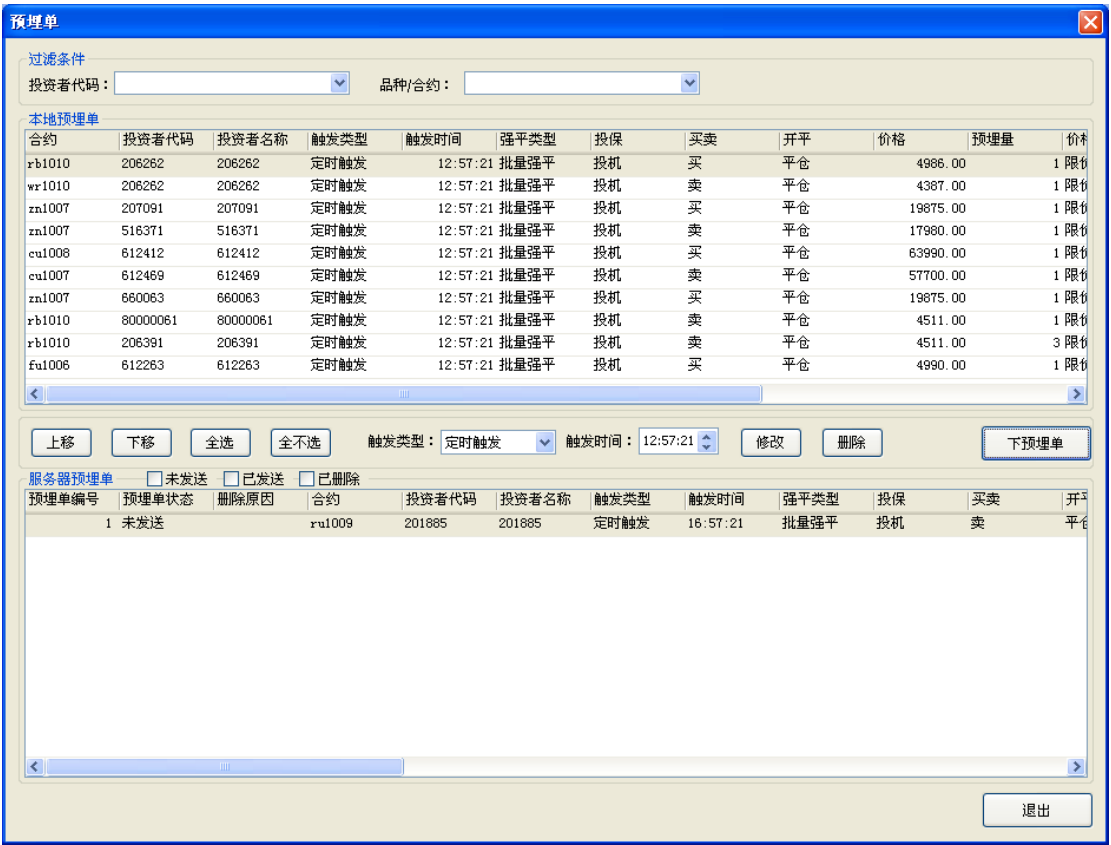


图 1.3.3-2

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。

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。

1.3.4 撤单

撤单功能需要用户拥有对应的风控权限，权限要求与强平相同，具体授权在综合交易平台上配置。

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 1.3.4-1。

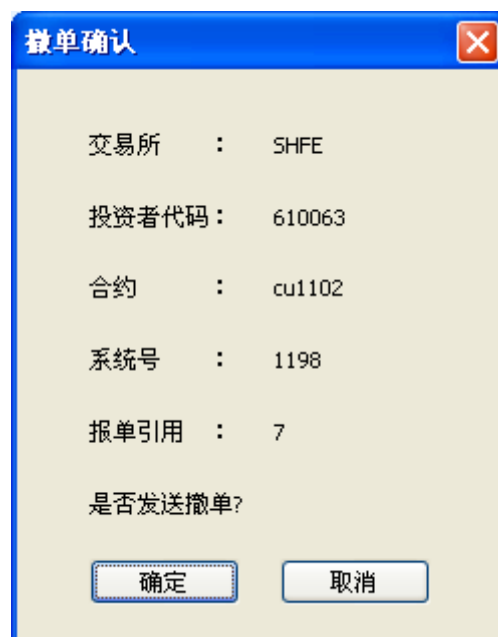


图 1.3.4-1

1.3.5 权益反向计算

权益反向计算功能需要用户拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

系统提供权益反向计算功能，主要针对那些尚未达到追保、强平、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，计算结果可以用作为后几天风险控制的参考。

用户可以通过在投资者资金信息视图中，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 1.3.5-1，或者通过点击菜单栏中的【功能】->【权益反向计算】，如图 1.3.5-2，进入权益反向计算界面。

投资者资金信息

投资者代码：

投资者名称：

组织架构

风险状态：

交易所风险状态：

特殊标志：

投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费
207855	穿仓	-4.47	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	17,141.50	0.
201276	强平	164.73	强平	101.79	-1,160.10	0.00	106,953.80	0.
203908	强平	251.04	强平	125.52	-6,214.50	0.00	61,131.00	0.
201220	追保	100.06	正常	1.69	11,093.80	0.00	19,036.80	0.
201885	追保	105.13	正常	6.63	151,583.51	0.00	367,424.20	0.
206087	追保	101.34	正常	0.80	2,023.44	0.00	5,231.00	0.
206262	追保	108.28	正常	2.63	45,228.20	0.00	131,065.10	0.
206391	追保	114.55	正常	0.49	25,446.45	0.00	98,779.20	0.
206476	追保	130.86	正常	4.01	114,194.97	0.00	575,053.00	0.
206758	追保	113.05	正常	6.52	1,119.50	0.00	2,911.00	0.
207091	追保	100.99	正常	4.38	77,823.68	0.00	172,263.00	0.
207619	追保	101.19	正常	0.71	1,980.47	0.00	5,101.00	0.
516371	追保	101.13	正常	54.46	182,857.78	0.00	406,048.50	0.

发送已选择

发送全部

添加关注

风险通知

电话通知

单客户强平

权益反向计算

图 1.3.5-1

风控终端

文件(F) 信息(S) 查询(Q) 功能(Q) 预警(E) 设置(C) 视图(V) 帮助(H)

投资者资金信息

投资者代码：

风险状态：

组织架构

特殊标志：

强平设置

单客户强平

批量强平

权益反向计算

批量权益反向计算

风控指标设置

净持仓保证金指标

风险预算

压力测试

预埋单

投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费
516729	正常	0.	0.00	1,002.20	0.00	0.00	0.00
516789	正常	0.	0.00	1,000.00	0.00	0.00	0.00
516792	正常	0.	0.00	1,178.85	0.00	0.00	0.00
516888	正常	0.	0.00	23,357.24	0.00	0.00	0.00
610006	正常	0.	0.00	1,000.00	0.00	0.00	0.00
610011	正常	0.	0.00	428,692.22	0.00	0.00	0.00
610018	正常	0.	0.00	1,006.08	0.00	0.00	0.00
610022	正常	0.00	0.00	20,682.32	0.00	0.00	0.00
610028	正常	78.15	39.07	2,269.60	0.00	2,911.00	0.00

图 1.3.5-2

权益反向计算界面如图 1.3.5-3。

权益反向计算

投资者代码：

001879 001879

风险类型：

强平

生成合约设置

资金情况

风险状态：

正常

风险度：

15.30

保证金：

437,450.00

权益：

2,859,588.65

持仓盈亏：

26,500.00

新风险状态：

强平

新风险度：

186.29

新保证金：

468,227.50

新权益：

251,338.65

新持仓盈亏：

-2,581,750.00

合约设置

合约	波动方向	波动幅度(%)	基准价类型	自定义价格
<input checked="" type="checkbox"/> al1104	上涨		昨结算价	
<input checked="" type="checkbox"/> al1105	上涨		昨结算价	
<input checked="" type="checkbox"/> al1106	下跌		昨结算价	
<input checked="" type="checkbox"/> al1111	下跌		昨结算价	

波动方法：

相同幅度波动

提交

反算结果 ☒ 过滤无效记录

投资者代码	投资者名称	合约	基准价格	波动价格	波动幅度	停板数
001879	001879	al1104	16000.00	30215.00	88.84%	
001879	001879	al1105	15870.00	29970.00	88.85%	
001879	001879	al1106	14500.00	7430.00	-48.76%	
001879	001879	al1111	16800.00	8610.00	-48.75%	

退出

图 1.3.5-3

各操作步骤说明如下：

Step1. 生成合约设置

在【投资者代码：】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、强平和追保三种风险级别，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. 风险类型指定强平时，在【设置】-【选项】-【投资者资金信息】中，没有勾选【使用自定义强平】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 - 交易所保证金）减少；如果合约的价格无论上涨还是下跌都不影响（权益 - 交易所保证金），则波动方向为无涨跌；在【设置】-【选项】

-【投资者资金信息】中，勾选【使用自定义强平】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，将导致该投资者的风险度增加，具体风险度算法参照设置的值；如果合约的价格无论上涨还是下跌都不影响风险度，则波动方向为无涨跌；

4. 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；

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。基准价可在综合交易平台->交易管理->基本参数设置中设定。

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. 设定合约的价格波动方向、波动幅度、基准价类型（、自定义价格）

在【合约设置】中点击需要修改的设置，即可进行修改。可设置的字段为：波动方向、波动幅度、基准价类型、自定义价格。

备注：

1. 波动方向为无涨跌时，不能进行修改；
2. 波动方向可以指定为上涨或者下跌，不能手工修改为无涨跌；
3. 波动幅度要求为非负数；如果指定的方向为下跌，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】。
5. 基准价是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、自定义价格。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。选择自定义价格时,需要在自定义价格列输入基准价数值。

Step3. 选择算法, 提交计算

算法配置波动方法(、停板数)。

- 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。

- 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。停板数的计算上限为256。

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。

1.3.6 批量权益反向计算

权益反向计算功能需要用户拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

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 1.3.6-1。

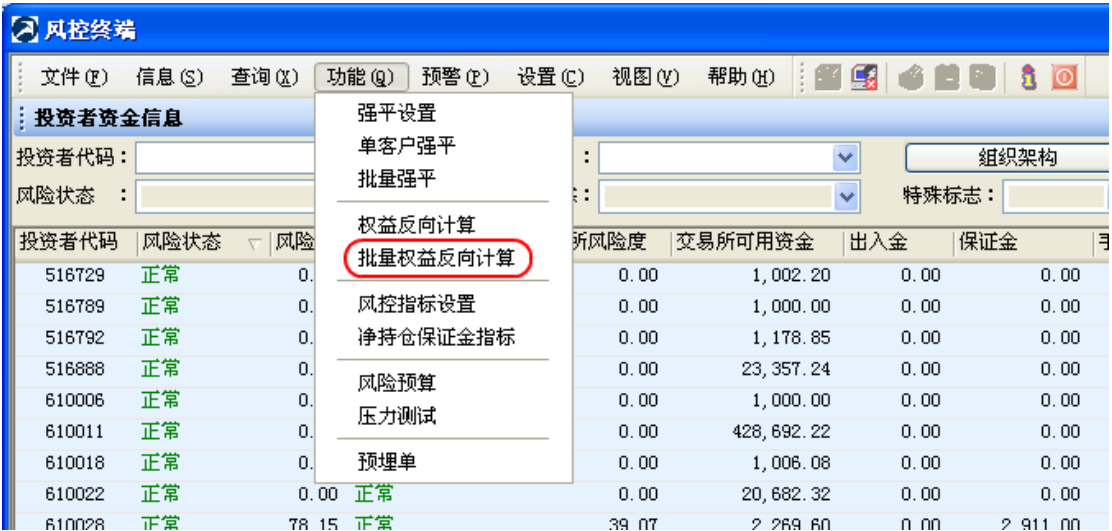


图 1.3.6-1

批量权益反算界面如图 1.3.6-2。



图 1.3.6-2

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 1.3.6-3。



图 1.3.6-3

Step2. 设定合约/品种的波动方向、波动幅度、基准价类型（、自定义价格）

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波动范围和基准价类型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、波动范围或基准价类型，必须在设置好品种之后，再对该合约进行单独设置。

如果需要选中全部合约/品种，点击【全选】按钮；如果需要取消所有合约/品种的选中情况，点击【全不选】按钮。

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 1.3.6-4。



图 1.3.6-4

Step3. 选择算法，提交计算

选择【风险类型】、【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. 模板管理

系统支持将本次反向计算设置的投资者、合约/品种以及算法选择情况保存至某一模板，以供下次计算时使用。点击右上方【模板】按钮，弹出模板管理界面，如图 1.3.6-5。

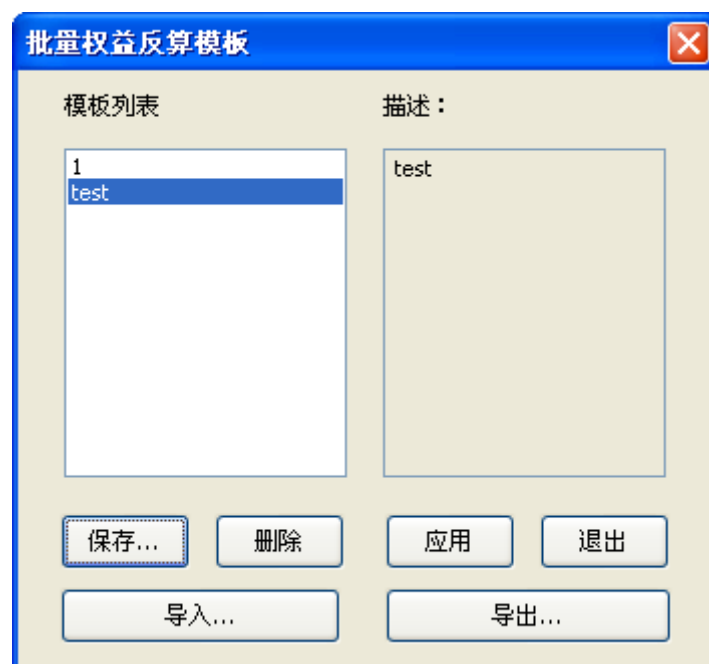


图 1.3.6-5

如果需要将本次计算的设置保存为某模板，点击【保存】按钮，在弹出的新建模板对话框中，输入新建的模板名以及模板描述，点击【增加】按钮即可，【取消】按钮用于取消本次新建模板的操作。如图 1.3.6-6。



图 1.3.6-6

如果需要删除某模板，在模板列表中选中某模板后点击【删除】按钮；如果需要使用某模板的设置，在模板列表中选中某模板后点击【应用】按钮；如果需要退出模板管理界面，点击【退出】按钮。

如果需要将模板列表中的模板保存到指定目录，点击【导出】按钮，在弹出的对话框中选择欲将模板存放的文件夹，点击【确认】按钮即。

如果需要将指定目录的模板导入到系统中，点击【导入】按钮，在弹出的对话框中选择模板存放的文件夹，点击【确认】按钮即。

Step5. 导出计算结果、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。

1.3.7 净持仓指标设置及超标强平

1.3.7.1 净持仓指标设置

风控指标设置功能需要用户拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

用户可以通过点击菜单栏中的【功能】->【风控指标设置】，如图 1.3.7-1，进入风控

指标设置界面，如 图 1.3.7-2。

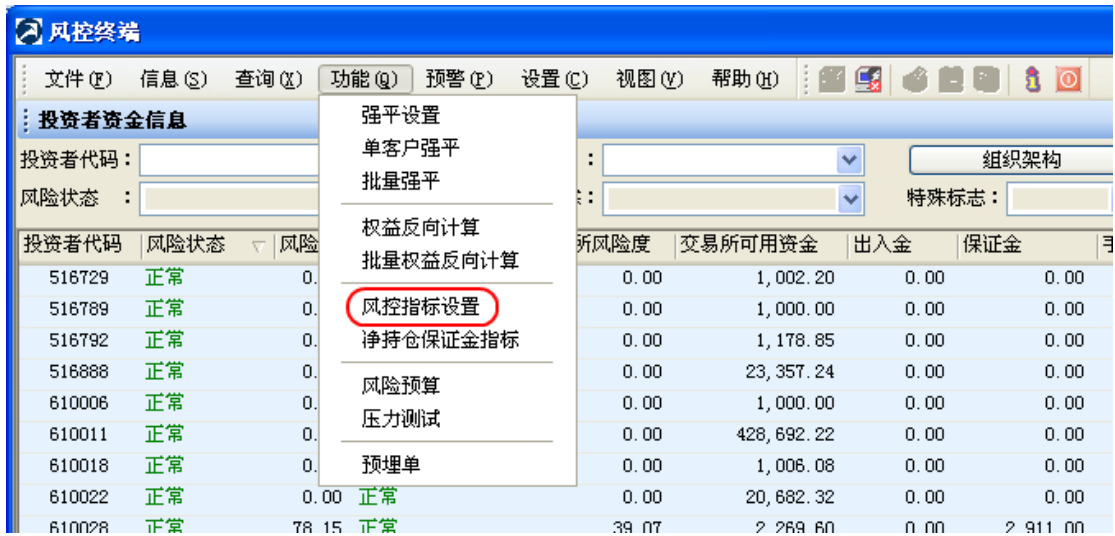


图 1.3.7-1

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

净持仓保证金指标 = |多头保证金-空头保证金| / 权益

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[品种组合]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。

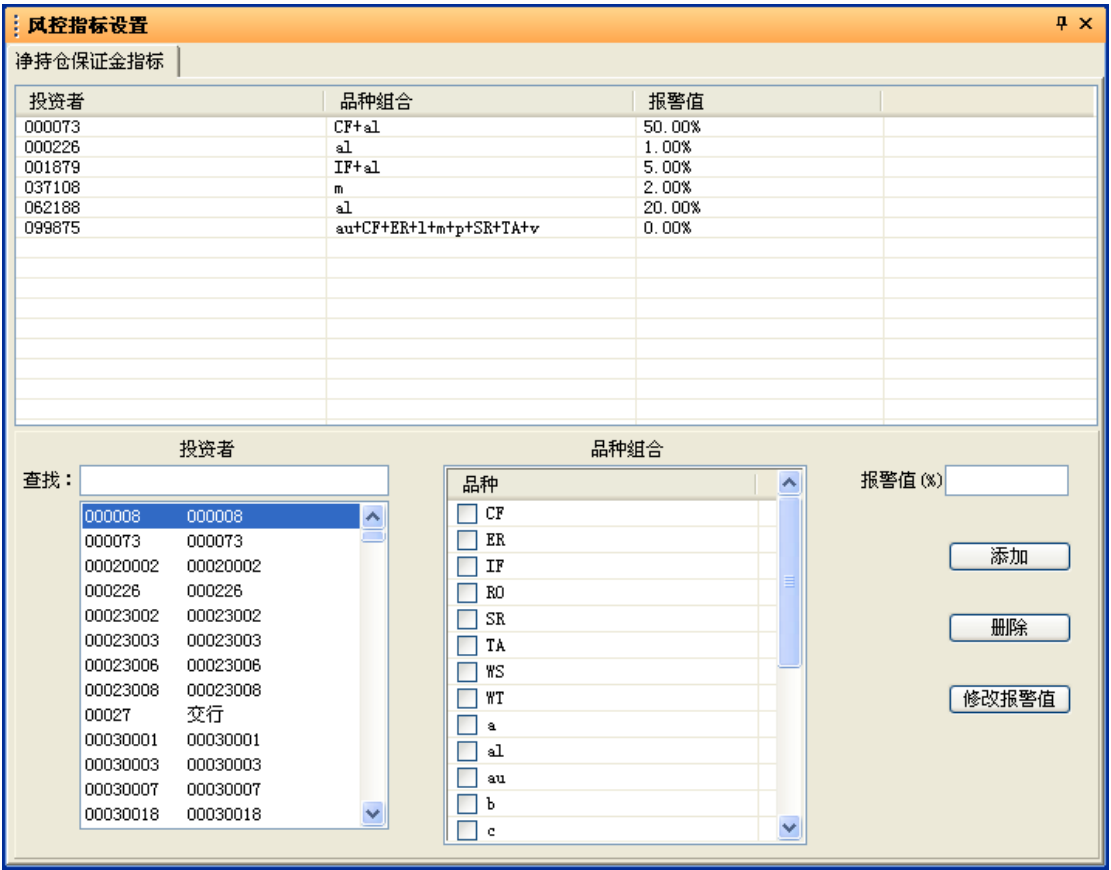


图 1.3.7-2

1.3.7.2 超标强平

净持仓保证金指标超标强平功能需要用户拥有对应的风控权限。

用户可以通过点击菜单栏中的【功能】->【净持仓保证金指标】，进入净持仓保证金指标查询界面如图 1.3.7-3。



图 1.3.7-3

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,如果净持仓保证金指标大于等于报警值则以粗体红色背景色提示。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 1.3.7-4。

净持仓保证金指标				
经纪公司代码	投资者代码	品种组合	净持仓保证金指标	报警值
8000	000073	CF+a1	0.00%	50.00%
8000	000226	a1	0.01%	1.00%
8000	001879	IF+a1	3.66%	3.00%
8000	001888	a1	0.10%	0.01%
8000	037108	m	单客户强平	
8000	037831	ru	0.00%	3.00%
8000	062188	a1	0.00%	20.00%
8000	099875	au+CF+ER+l+m+p+SR+TA+v	0.00%	10.00%

图 1.3.7-4

弹出超标单客户强平界面,如图 1.3.7-5。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。

资金情况

投资者代码 : 062188 062188

投资者名称 : 062188

通知状态 : 未通知

风险状态 : 追保

风险度 : 109.40

交易所风险度 : 80.75

权益 : 1,031,440.18

出入金 : 1,200,000.00

保证金 : 1,128,394.00

交易所保证金 : 832,853.00

追加保证金 : 96,953.82

交易所追加 :

昨风险状态 : 穿仓

昨追加保证金 : 815,344.32

昨交易所追加 : 579,928.32

新风险状态 : 追保

新追加保证金 : 77,453.82

新风险度 : 107.51

指标情况

指标值 : 6.30%

警示值 : 5.00%

新指标值 : 4.41%

当前持仓

合约	投资者代码	投资者名称	持仓方向	投保	持仓日期	总持仓	可平数量	平仓盈亏	保证金
a11102	062188	062188	多头	投机	历史持仓	34	34	0.00	323,6
a11102	062188	062188	空头	投机	历史持仓	34	34	0.00	323,6
a11110	062188	062188	多头	投机	今日持仓	32	32	0.00	208,0
a11110	062188	062188	空头	投机	今日持仓	42	42	0.00	273,0

强平目标 : 指标正常

强平标准 : 经纪公司标准

释放资金 : 实时结算标准

生成强平单

强平单列表

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
a11110	062188	062188	空头	投机	今日持仓	42	3	反向涨跌停	0

合约 : a11110

持仓方向 : 空头

强平数量 : 3

价格类型 : 反向涨跌停

点数 :

委托价 : 17875.00

修改

取消

全选

全不选

上移

下移

总释放保证金 : 19500.00

总释放交易所保证金 : 17062.50

买价 :

卖价 :

试算

下单

预埋

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	系统号
062188	062188	a11110	109	卖	开	投机	16250.00	1	251	25	SHFE	15
062188	062188	a11110	113	卖	开	投机	16250.00	1	251	27	SHFE	20
062188	062188	a11110	117	卖	开	投机	16250.00	1	251	29	SHFE	21
062188	062188	a11110	163	买	开	投机	16250.00	1	251	44	SHFE	30
062188	062188	a11110	118	卖	开	投机	16250.00	1	251	30	SHFE	20
062188	062188	a11110	167	买	开	投机	16250.00	1	251	45	SHFE	30

显示强平回应

撤单

退出

图 1.3.7-5

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，品种强平顺序按照净持仓保证金占用从大到小。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。

1.3.8 风险预算

风险预算功能需要用户拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

系统提供风险预算功能，用于当出现极限行情时，结合交易所关于出现3个连续停板的风险管理规定，预算经纪公司应该如何调整保证金比率以控制客户风险。

用户可以通过点击菜单栏的【功能】->【风险预算】，如图 1.3.8-1，进入风险预算界面，如图 1.3.8-2。



图 1.3.8-1

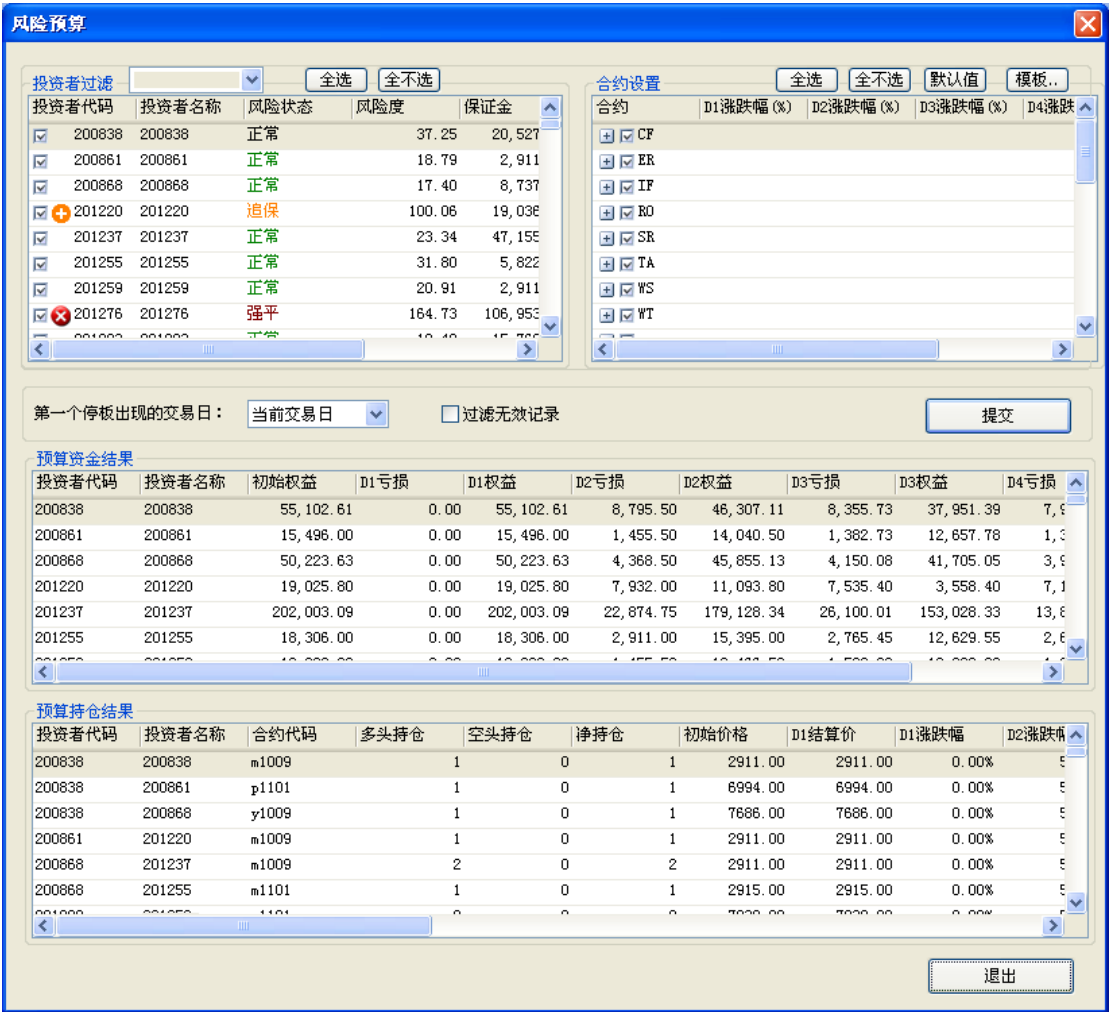


图 1.3.8-2

选择参与预算的投资者和品种/合约，设置第一个停板出现的交易日，点击【提交】按钮，预算结果将显示在【预埋资金结果】以及【预算持仓结果】列表框中。

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。

Step2. 选择停板出现的交易日

在投资者设置下面的【第一个停板出现的交易日】选择框中选择第一个停板出现的交易日，用来决定风险预算算法中的D1是当前交易日还是下一交易日。

Step3. 设定合约/品种的涨跌幅度和价格

合约/品种的极限行情可以在【合约设置】中修改，D1涨跌幅不能修改，其他涨跌幅可

以修改。直接鼠标左击欲修改的涨跌幅值，出现输入框，输入新的涨跌幅回车即可完成修改。

用户可以通过点击合约/品种前面的勾选框，来选定参与风险预算的品种。

如果需要选中全部合约/品种，点击【全选】按钮；如果需要取消所有合约/品种的选中情况，点击【全不选】按钮。【默认值】按钮用来恢复所有合约/品种的默认涨跌幅。

计算时取的合约初始价格，可以在【合约设置】中通过输入指定的价格来设定；如果没有输入指定价格，则在盘中取合约的最新价，在盘后取合约的当日结算价，如果没有当日结算价时取合约的当日收盘价。

Step4. 模板管理

系统支持将本次风险预算设置的投资者、品种设置以及选择情况保存至某一模板，以供下次计算时使用。点击【模板】按钮，弹出模板管理界面，如图 1.3.8-3；

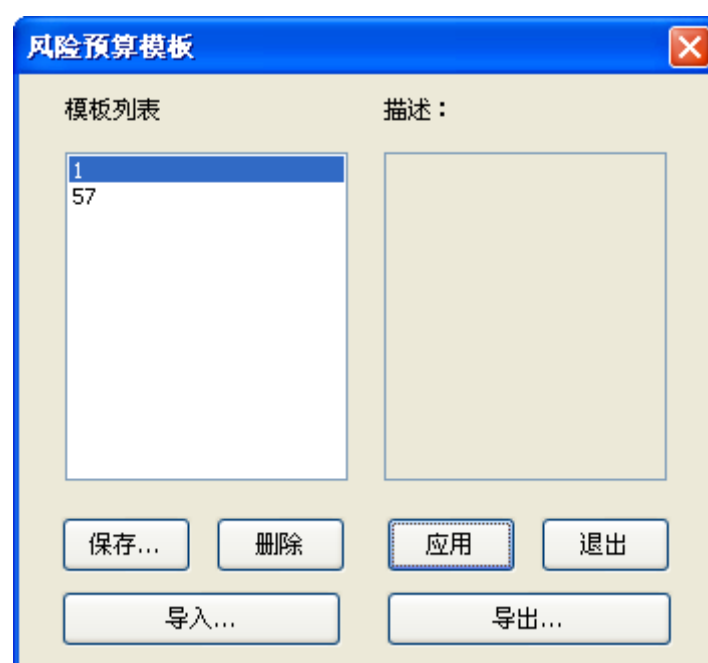


图 1.3.8-3

如果需要将本次计算的设置保存为某模板，点击【保存】按钮，在弹出的新建模板对话框中，输入新建的模板名以及模板描述，点击【增加】按钮即可，【取消】按钮用于取消本次新建模板的操作。如图 1.3.8-4。

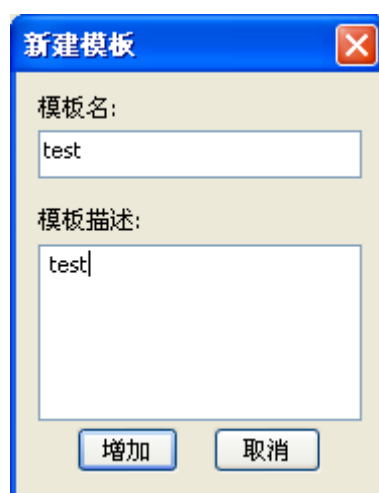


图 1.3.8-4

如果需要删除某模板，在模板列表中选中某模板后点击【删除】按钮；如果需要使用某模板的设置，在模板列表中选中某模板后点击【应用】按钮；如果需要退出模板管理界面，点击【退出】按钮。

如果需要将模板列表中的模板保存到指定目录，点击【导出】按钮，在弹出的对话框中选择欲将模板存放的文件夹，点击【确认】按钮即。

如果需要将指定目录的模板导入到系统中，点击【导入】按钮，在弹出的对话框中选择模板存放的文件夹，点击【确认】按钮即。

Step5. 导出计算结果

鼠标左击选中【预埋资金结果】或者【预算持仓结果】列表框，点击菜单栏中的【导出】按钮，将导出本次预算的所有信息，包括：初始资金、初始持仓、品种设置、算法（第一个停板出现的交易日）、预算后资金结果、预算后持仓结果。

备注：

1. 极限行情说明：

D1出现涨跌停板，例如5%；

D2根据交易所规则扩版，例如涨跌停板为7%，并且当日继续出现涨跌停板；

D3根据交易所规则继续扩版，例如涨跌停板为9%，并且当日继续出现涨跌停板；

D4根据交易所规则交易所进行强减，涨跌停板恢复为5%。

2. 勾选【过滤无效记录】，可以过滤预算持仓结果中，不影响风险值的记录。

1.3.9 压力测试

压力测试功能需要用户拥有对应的风控权限。

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。

Step1. 设置模板

点击菜单栏的【功能】->【压力测试】，点击【参数设置】，打开设置界面，如图 1.3.9-1。



图 1.3.9-1

1. 添加投资者：点击【添加】，在弹出的投资者代码选择框中，手工输入或者通过下拉框选择单一投资者，点击【确定】添加成功。注意下拉框只会显示有持仓的投资者，“所有投资者”表示所有有持仓的投资者。新添加的投资者所持有的品种合约即会显示在“合约设置”列表中。点击【删除】可以从列表中删除选中的投资者，点击【全部删除】可以清空投资者列表。



图 1.3.9-2

2. 结算价设置：单击合约设置列表中的【结算价类型】，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 1.3.9-3。



图 1.3.9-3

3. 保证金率设置：添加新的投资者列表后，该投资者的保证金率会显示在合约设置列表中。点击投资者多头保证金率、投资者空头保证金率、套保多头保证金率或套保空头保证金率，可以自行设定保证金率。点击【增加交易日】，可以按序增加交易日并针对交易日做不同保证金率的设定。点击【减少交易日】可以从最后一天开始减少交易日。注意交易日最多只能增加到第30天。点击【同步合约】可以更新投资者当前的合约持仓至最新。
4. 模板：点击【模板】按钮，弹出压力测试模板界面，可保存当前设置至模板；点击【导出】按钮可以将模板导出到指定的目录中；点击【导入】按钮，可将指定目录中的模板导入到系统中。

Step2. 压力测试

点击菜单栏的【功能】->【压力测试】，如图 1.3.9-4，打开压力测试界面。



图 1.3.9-4

在视图左上方的【投资者列表】中勾选/取消勾选投资者，在右上方的【已设置合约】中勾选/取消勾选合约，在【选择交易日】中选择天数，点击【提交】后在下方的【测试结果】中显示结果。如图 1.3.9-5。

勾选“所有投资者”时，测试结果显示所有有持仓的投资者的风险、资金状况；当同时有“所有投资者”和投资者单独设置时，测试以投资者单独设置为准。选择交易日后，如该交易日有对应的保证金率设置，则以该日的设置为准；如无该交易日设置，则往前查找最近的有设置的交易日，以该设置为准。

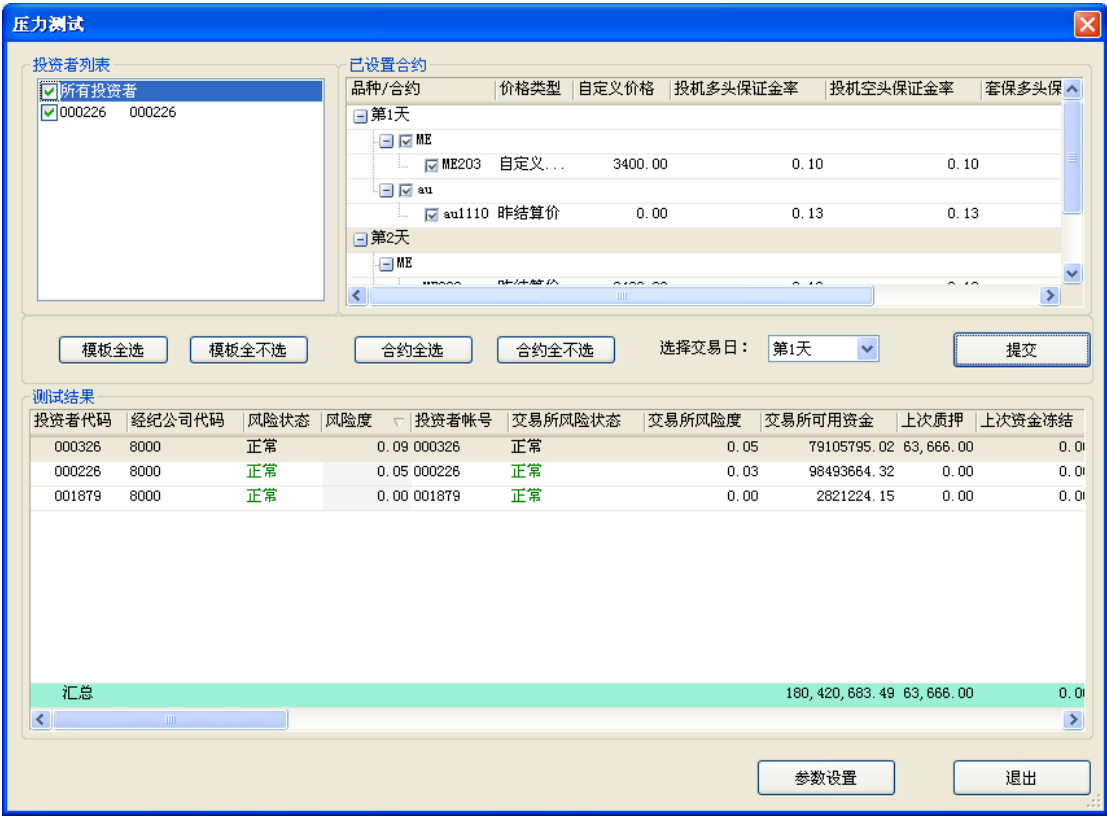


图 1.3.9-5

1.3.10 发送风险通知

手动、自动发送风险通知功能，需要用户分别拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

系统提供两种风险通知的发送方式：自动和手动；提供三种风险通知的发送途径：系统通知、短信通知、邮件通知。已发送的风险通知可以在风险通知信息视图中查询。

1.3.10.1 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：

点击菜单栏【设置】->【风险通知模板设置】，进入设置界面，如图 1.3.10-1。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。

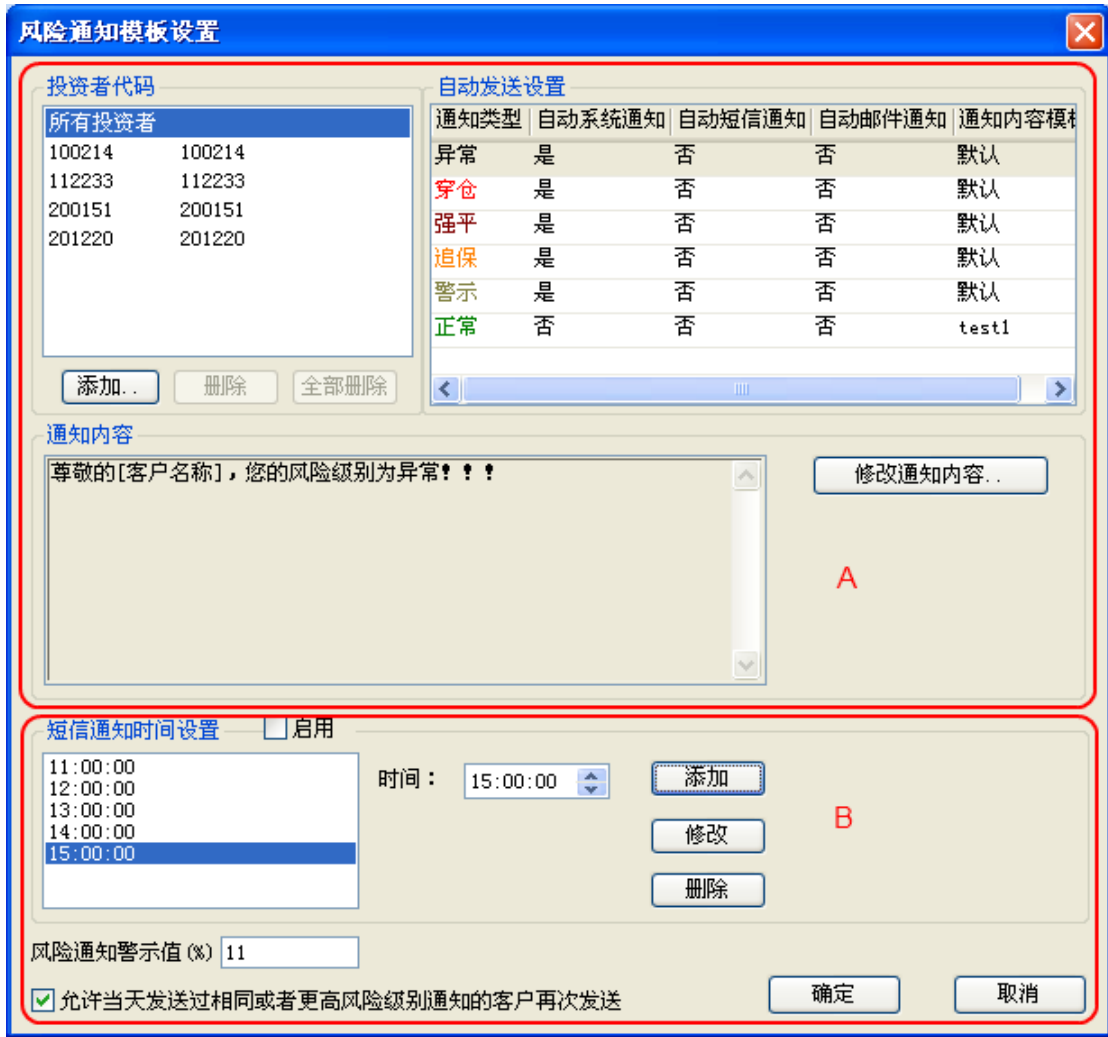


图 1.3.10-1

A区的设置包括【自动发送设置】、【通知内容】，可以根据投资者进行单独设置。

B区的设置包括【短信通知时间设置】、【风险通知警示值】、【允许当天发送过相同或者更高级别通知的客户再次发送】，对所有投资者生效，不能对投资者进行单独的设置。

修改完设置后，点击【确定】按钮，保存后全局生效。注意：由于该设置面向经纪公司，所以建议把权限配给级别比较高的管理员。

针对每个投资者，可以单独设置风险通知模板，并能进行添加、修改、删除的操作。注意，在【投资者代码】列表中，风控操作员只能看到并操作自己对其有数据权限的投资者。

1. 添加投资者风险通知设置

点击【添加】按钮，打开添加投资者界面，如图 1.3.10-2。

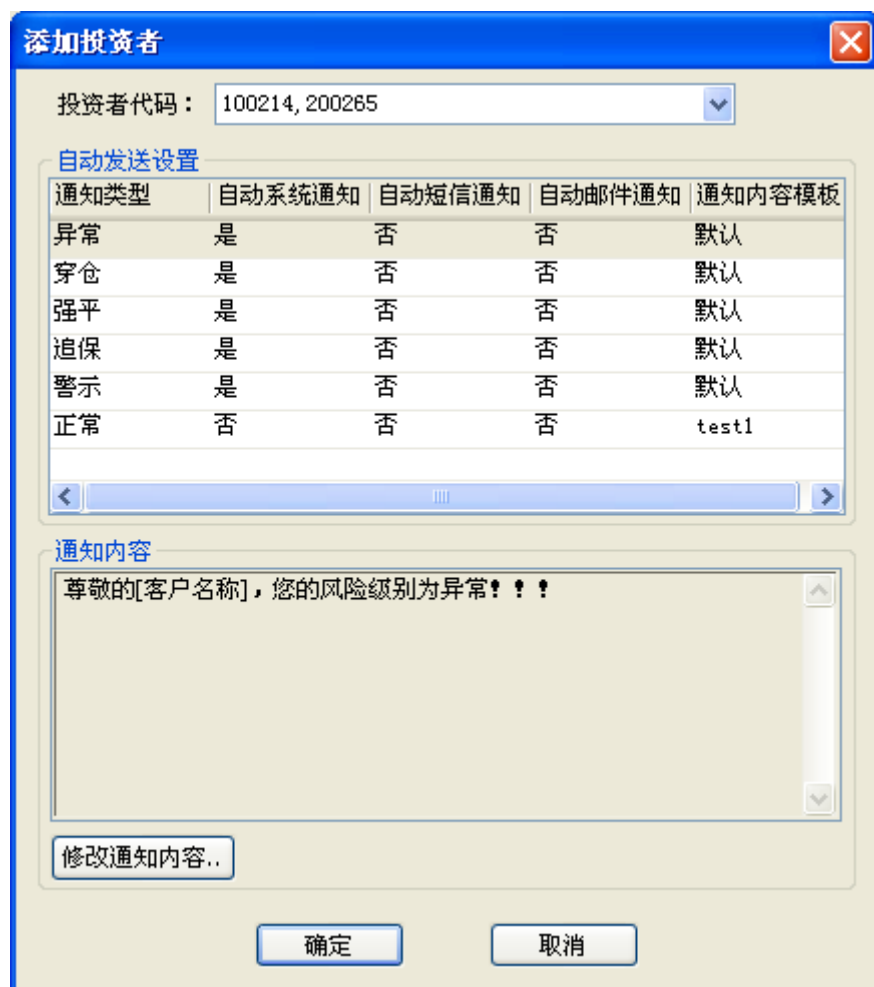


图 1.3.10-2

在【投资者代码】输入框中，手动输入一个或多个投资者代码，并用半角逗号“,”分隔，或通过下拉框勾选来确定投资者。风控操作员只能选择自己对其有数据权限的投资者进行单独设置。

对已选投资者的每种风险类型，都可以进行单独的自动发送设置。如果需要设置自动系统/短信/邮件通知，选中【是/否】字段，在弹出的下拉框中选择【是】或者【否】即可。

如果需要修改风险通知内容，选中一项风险类型，点击通知内容模板列的模板名，如图中的【默认】，在弹出的下拉框中选择需要修改为的模板名，或选择【修改通知内容】打开通知模板内容设置界面，对通知内容进行设置，如图 1.3.10-3。

修改完毕后，点击【确定】按钮保存并返回到风险通知模板设置界面。

2. 修改投资者风险通知设置

在风险通知模板设置界面，选中【投资者代码】列表中的所有投资者或某单一投资者，【自动发送设置】中的内容会更新为当前选中投资者的设定值。

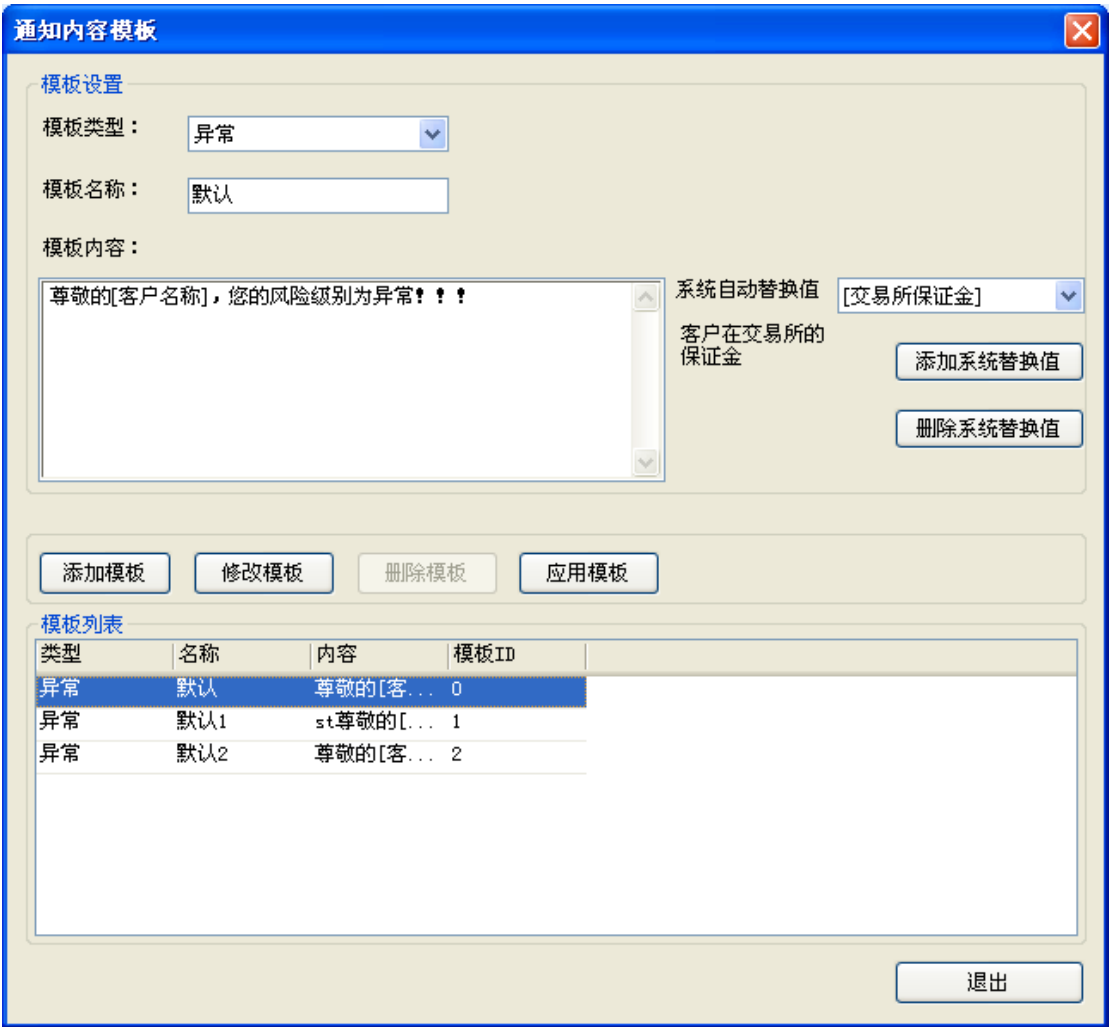
如果需要修改自动系统/短信/邮件通知,选中【是/否】字段,在弹出的下拉框中选择【是】或者【否】即可。如果需要修改风险通知内容,选中一项风险类型,点击通知内容模板列的模板名,如图中的【默认】,在弹出的下拉框中选择需要修改为的模板名,或选择【修改通知内容】打开通知模板内容设置界面,如图 1.3.10-3。直接点击界面右方的【修改通知内容】按钮也可以打开通知内容设置界面。

3. 删除投资者风险通知设置

在风险通知模板设置界面,选中【投资者代码】列表中的某单一投资者,点击【删除】按钮,可以删除该投资者的单独设置。点击【全部删除】按钮,可以删除所有的单独设置。注意,默认存在的“所有投资者”不能【删除】或【全部删除】。

4. 修改通知内容模板

通知内容模板可以通过风险通知模板设置界面或添加投资者界面打开,界面如图 1.3.10-3。



通知内容模板

模板设置

模板类型: 异常

模板名称: 默认

模板内容:

尊敬的[客户名称],您的风险级别为异常!!!

系统自动替换值: [交易所保证金]

客户在交易所的保证金

添加系统替换值

删除系统替换值

添加模板 修改模板 删除模板 应用模板

模板列表

类型	名称	内容	模板ID
异常	默认	尊敬的[客...	0
异常	默认1	st尊敬的[...	1
异常	默认2	尊敬的[客...	2

退出

图 1.3.10-3

选择模板类型，输入模板名称，并输入模板内容，然后点击【添加模板】按钮，可以添加新的模板。

选择模板类型，选中模板列表中的一个模板，该模板的设置即会显示在上方的模板设置中，对其通知内容进行修改后，点击【修改模板】按钮可以修改该模板。

选择模板类型，选中模板列表中的一个模板，点击【删除模板】按钮可以删除该模板。正被使用的模板不能删除。

选择模板类型，选中模板列表中的一个模板，点击【应用模板】，可以把选中的模板应用为当前设置。即如果通过模板设置总界面打开通知内容设置界面，则应用到模板设置界面中已选投资者的当前设置；如果通过添加投资者界面打开通知内容设置界面，则应用到添加投资者界面的当前设置。已经是当前设置的模板，不能再【应用模板】。

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资金数据值替换。用户在【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。

通知内容的设置实时生效，修改完毕后点击【退出】按钮，即可保存并关闭界面。

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。
- d. 勾选【允许当天发送过相同或者更高风险级别通知的客户再次发送】时，在持仓不变的情况下，当发送过更高级别的风险类型通知后，风险类型降到更低级别，只要这一级别没有发送过通知，系统即会对其发送通知；取消勾选该项时，在持仓不变的情况下，当发送过更高级别的风险类型通知后，风险类型降到更低级别，系统不会再次发送通知。

5. 其他设置

风险通知模板设置界面下方的【短信通知时间设置】、【风险通知警示值】及【允许当

天发送过相同或者更高级别通知的客户再次发送】，如图 1.3.10-4。

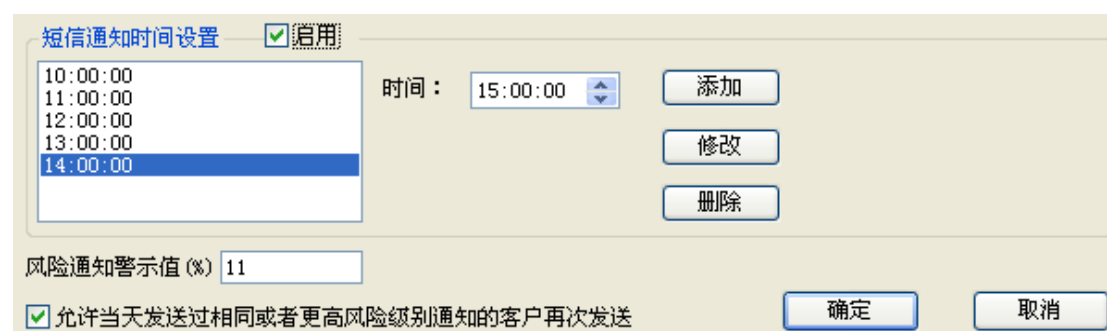


图 1.3.10-4

【短信通知时间设置】用来为自动短信通知设定触发时间。

在【时间：】输入需要触发自动短信通知的时间，点击【添加】按钮可新增时间点。选中一个已存在的时间点，在【时间：】输入修改后的时间，点击【修改】可修改该时间点。选中一个时间点，点击【删除】可删除该时间点。

勾选【启用】时，风控系统将只在设定的时间对打开自动发送的风险类型进行发送。不勾选【启用】时，短信通知的发送与上述自动发送规则相同，在持仓/风险类型发生变化时立即发送。通知时间最多可以设置5个时间点，同时生效。

短信通知时间设置只影响自动短信发送功能，系统、邮件通知仍是按照自动发送规则。

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无关。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。

1.3.10.2 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。

在投资者资金信息视图，或持仓查询视图中，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】，如图 1.3.10-5，弹出风险通知确认框，如图 1.3.10-6。

投资者资金信息

投资者代码：

投资者名称：

组织架构

风险状态：

交易所风险状态：

特殊标志：

投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费
207855	穿仓	-4.47	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	17,141.50	0.
201276	强平	164.73	强平	101.79	-1,160.10	0.00	106,953.80	0.
203908	强平	251.04	强平	125.52	-8,214.50	0.00	61,131.00	0.
201220	追保	100.06	正常	1.69	11,093.80	0.00	19,036.80	0.
201885	追保	105.13	正常	6.63	151,583.51	0.00	367,424.20	0.
206087	追保	101.34	正常	0.80	2,023.44	0.00	5,231.00	0.
206262	追保	108.28	正常	2.63	45,228.20	0.00	131,065.10	0.
206391	追保	114.55	正常	0.49	25,446.45	0.00	98,779.20	0.
206476	追保	130.86	正常	4.01	114,194.97	0.00	575,053.00	0.
206758	追保	113.05	正常	6.52	1,119.50	0.00	2,911.00	0.
207091	追保	100.99	正常	4.38	77,823.68	0.00	172,263.00	0.
207619	追保	101.19	正常	0.71	1,980.47	0.00	5,101.00	0.
516371	追保	101.13	正常	54.46	182,857.78	0.00	406,048.50	0.

发送已选择

发送全部

添加关注

风险通知

电话通知

单客户强平

权益反向计算

图 1.3.10-5

风险通知确认

☒系统通知

☐短信通知

☐邮件通知

☒自定义系统通知内容：

系统通知

☒允许发送风险状态为警示的风险通知

☒允许发送风险状态为正常的风险通知

☒允许当天发送过相同或者更高风险级别通知的客户再次发送

确定

取消

图 1.3.10-6

系统支持手动发送风险通知的内容采用模板和自定义两种方式。勾选中【自定义】则表示该通知方式发送的风险通知，采用自定义的通知内容，三种通知方式均可以自行设置通知内容。如果不选中【自定义】则表示该通知方式发送的风险通知，采用风险通知模板中设定的通知内容。风险通知模板中设定的通知内容，请参考自动发送风险通知。鼠标放在通知途径字段上，下方对话框就会显示相应通知途径的自定义内容，系统默认保存上次发送时编辑的自定义内容，用户可再自行编辑。

系统默认不支持向风险状态是【警示】或【正常】的投资者手动发送风险通知。勾选【允许发送风险状态为警示的风险通知】或【允许发送风险状态为正常的风险通知】后，手动发送系统/短信/邮件风险通知时，才能对【警示】/【正常】的投资者生效。

【允许当天发送过相同或者更高风险级别通知的客户再次发送】选项的用处同自动发送，参考自动发送章节。

通过勾选发送途径：系统通知、短信通知、邮件通知，以及是否自定义、是否向警示/正常的投资者发送、是否重复发送，确认后即可发送该投资者当前风险状态的风险通知。发送完毕后，系统将回复风险通知回应，显示发送结果，如图 1.3.10-7。发送成功的风险通知信息，可以在菜单【信息】-【风险通知信息】视图中查询。

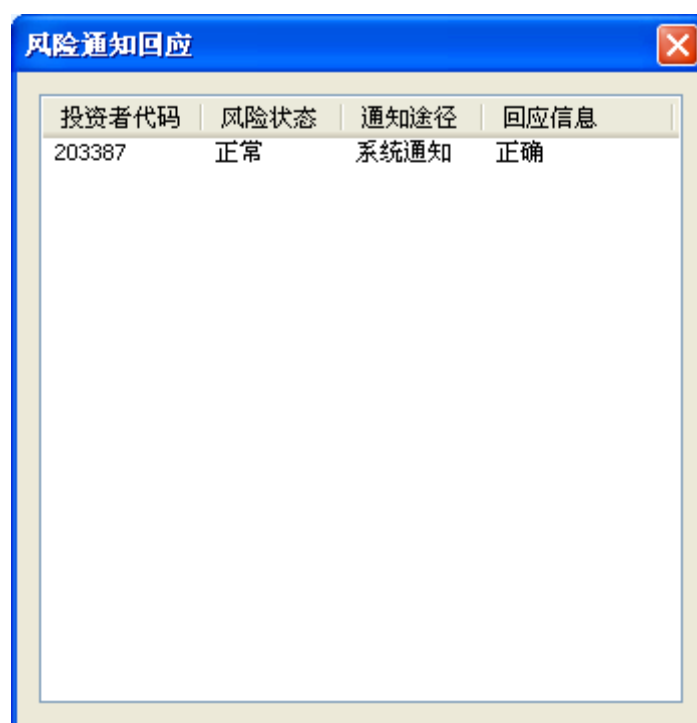


图 1.3.10-7

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，选中投资者资金信息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】，勾选设置确认后即可批量发送风险通知。

1.3.11 发送业务通知

业务通知功能需要用户拥有对应的风控权限，具体授权在综合交易平台上配置。

系统提供针对特殊业务发送短信通知的功能，支持自动和手动两种方式。目前只支持部分业务的短信通知和系统通知途径，不支持邮件通知途径。已发送的业务通知可以在业务通知查询界面中查询。

支持的特殊业务说明如下：

1. 投资者新开户（投资者销户暂不支持）；
2. 新增交易编码（交易编码注销暂不支持）；
3. 强平成交
4. 手工投资者入金、手工投资者入金冲销（手工出金以及出金冲销暂不支持）；
5. 投资者银期转账出入金（银期转账出入金冲销暂不支持）；

1.3.11.1 自动发送业务通知

自动发送业务通知是指系统根据业务发生情况自动发送业务通知。具体说明如下：

点击菜单栏【设置】->【业务通知模板设置】，进入设置界面，如图 1.3.11-1。该设置需要给操作员赋予配置业务通知模板设置权限，具体授权在综合交易平台上配置。

修改完设置后，点击【确定】按钮，保存后全局生效，即将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，所以建议把权限配给级别比较高的管理员。

针对每种业务通知类型可以单独设置是否自动短信通知、自动系统通知，以及各通知内容模板。如果需要修改自动发送设置，选中待修改项的【是/否】字段，在弹出的下拉框中选择【是】或者【否】即可；其中背景为灰色的设置不可修改。如果需要修改通知内容模板，选中待修改的通知类型，在下方的【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。

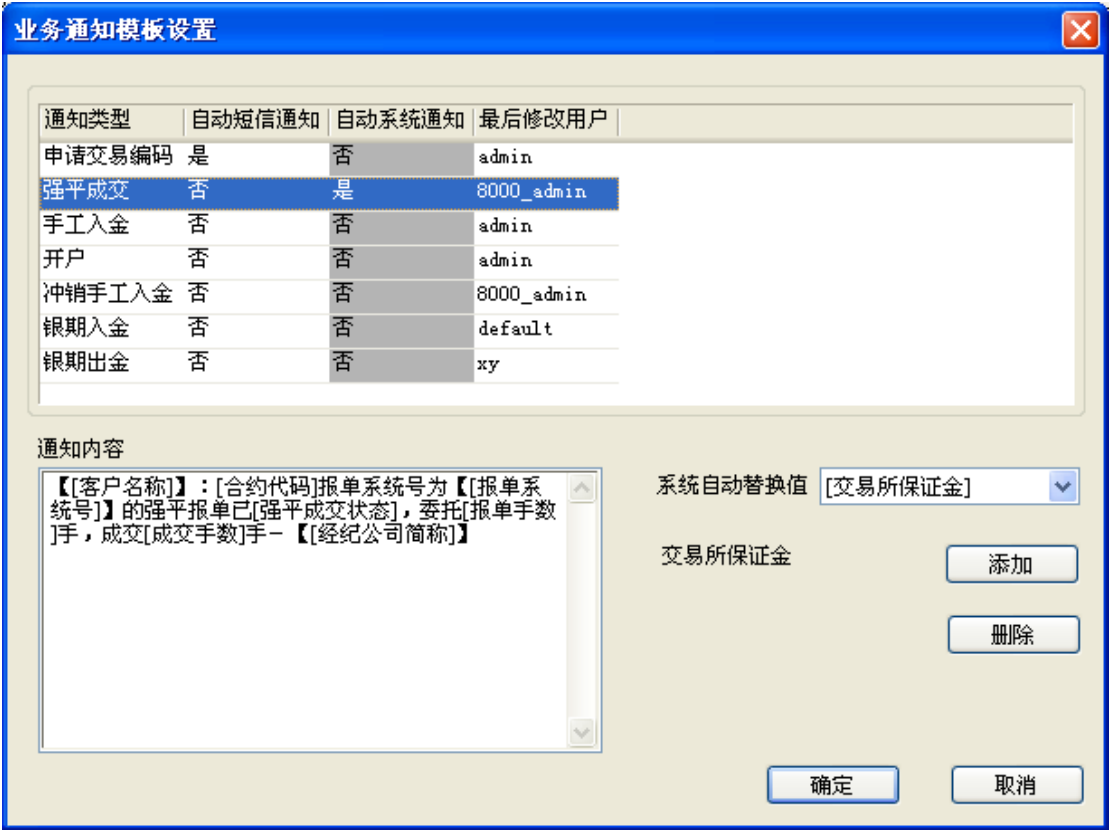


图 1.3.11-1

自动通知设置为【是】的类型，在进行相关操作时，将自动发送对应的短信或者系统通知。其中强平成交的系统通知只在报单成交时发送；同笔报单分笔成交，则分别在首次成交及全部成交时发送两次系统通知。

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资金数据值替换。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。

1.3.11.2 手动发送业务通知

系统支持手动发送业务短信通知。该功能需要给操作员赋予发送业务通知权限，具体授权在综合交易平台上配置。

在业务查询视图（出入金查询界面、交易编码查询界面、投资者信息查询界面）中，鼠标右击需要发送业务通知的业务记录，在弹出的下列框中选择【业务通知】，如图 1.3.11-2，弹出业务通知确认框，如图 1.3.11-3。

选择通知类型，输入通知内容，点击【确定】按钮，即可发送指定业务通知类型的业务

短信通知。手动发送业务短信通知，必须输入通知内容，内容不能为空且不能大于250个中文字符。系统默认保存上次发送时编辑的自定义内容，用户可再自行编辑。



图 1.3.11-2

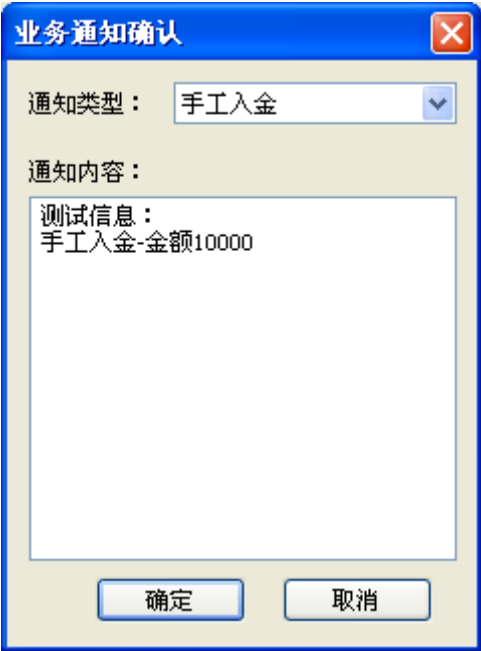


图 1.3.11-3

1.3.12 标记电话人工通知状态

系统支持由用户在风控客户端对某投资者自行设置【电话通知】的状态位，用此状态位标示该投资者是否已经由风控人员人工电话通知成功过；投资者资金信息界面中的【电话通知标志】列显示该标志位，详细的记录可以在电话通知查询界面查询。

如果需要设置【电话通知标示】，可在投资者资金信息界面选中单一投资者（本功能不支持多选），鼠标右击，在弹出的下拉框中点击【电话通知】，如图 1.3.12-1，弹出电话通知设置界面，如图 1.3.12-2。

投资者资金信息

投资者代码：

投资者名称：

组织架构

风险状态：

交易所风险状态：

特殊标志：

投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费
207655	穿仓	-4.47	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	17,141.50	0.
201276	强平	164.73	强平	101.79	-1,160.10	0.00	106,953.80	0.
203908	强平	251.04	强平	125.52	-6,214.50	0.00	61,131.00	0.
201220	追保	100.06	正常	1.69	11,093.80	0.00	19,036.80	0.
201885	追保	105.13	正常	6.63	151,583.51	0.00	367,424.20	0.
206087	追保	101.34	正常	0.80	2,023.44	0.00	5,231.00	0.
206262	追保	106.28	正常	2.63	45,228.20	0.00	131,065.10	0.
206391	追保	114.55	正常	0.49	25,446.45	0.00	98,779.20	0.
206476	追保	130.86	正常	4.01	114,194.97	0.00	575,053.00	0.
206758	追保	113.05	正常	6.52	1,119.50	0.00	2,911.00	0.
207091	追保	100.99	正常	4.38	77,823.68	0.00	172,263.00	0.
207619	追保	101.19	正常	0.71	1,980.47	0.00	5,101.00	0.
516371	追保	101.13	正常	54.46	182,857.78	0.00	406,048.50	0.

发送已选择

发送全部

添加关注

风险通知

电话通知

单客户强平

权益反向计算

图 1.3.12-1

图 1.3.12-2

默认的投资者代码为选中的投资者，可以输入或者通过下拉菜单进行修改；时间为当前本机时间；当时风险状态为选中的投资者的风险状态，手动更改投资者后应同时手动更新风险状态；通知状态分为通知成功及通知失败两种；通知操作员为当前登录风控系统的操作员代码，可以手动输入进行修改；备注信息最大长度为250个汉字。

输入对应的信息，点击【确定】按钮完成电话通知设置操作。该记录可以在电话通知查询中查询，标志位也可以在投资者资金信息窗口查看到。

1.4 预警功能说明

1.4.1 行情预警

行情预警功能需要用户拥有对应的风控权限。

行情预警是指当某合约行情最新价达到涨跌停板附近某区域时，列出含有该合约持仓，并且风险状态为追保、强平或穿仓的投资者。用户可以通过点击菜单栏的【预警】->【行情预警】，进入行情预警界面，界面如图 1.4.1-1。



图 1.4.1-1

合约设置列表中列出场所有有效合约，合约最新价在【下跌价格】到【上涨价格】之间为安全范围，最新价超出安全范围则为预警范围。合约最新价 > 【上涨价格】时，预警列出持有该合约空头仓位的有风险的投资者；合约最新价 < 【下跌价格】时，预警列出持有该合约多头仓位的有风险的投资者。

设置合约预警阈值方法：

1. 在合约设置列表中修改【下跌价格】、【上涨价格】；
2. 在合约设置列表中修改【相对下跌幅度（%）】、【相对上涨幅度（%）】，相对下跌幅度：下跌到跌停板价格时，相对下跌幅度为100%，如果相对下跌幅度为80%，表示的价格 = 昨结算价 - （（昨结算价 - 跌停价）*0.8）；相对上涨幅度：上涨到涨停板价格时，相对上涨幅度为100%，如果相对上涨幅度为80%，表示的价格 = 昨结算价 + （（涨停价 - 昨结算价）*0.8）；
3. 使用【全部设为】按钮，在弹出的输入对话框中输入相对幅度，如图 1.4.1-2，点击【确定】按钮后，所有合约的相对下跌幅度以及相对上涨幅度均设置为输入的数值；

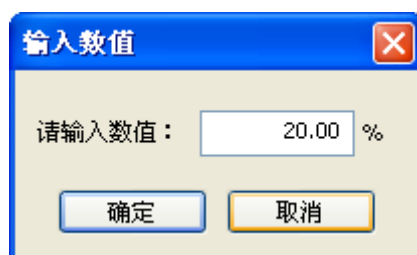


图 1.4.1-2

4. 使用【模板】按钮，在弹出的模板设置界面中，可以将当前合约设置保存为一个模板，也可以将之前保存过的某个模板应用到当前设置中；
5. 【全选】按钮用于选中所有合约，【全不选】按钮用于取消所有合约的选中状态，点击合约/品种前面的勾选框也可以改变该合约/品种的选中状态。

合约设置完毕后，点击【提交】按钮（必须点击此按钮，当前的设置才会生效），系统会根据合约的勾选情况以及价格阈值设置情况，在风险投资者列表中将显示有风险的投资者，默认按照风险度（保证金*100/权益）由大到小排序，右击投资者可以进入单客户强平界面。

如果需要在有风险的投资者列表发生变化时，自动弹出该行情预警界面，则选中左下方的【风险投资者或其合约变化时自动弹出窗口】勾选框。

1.4.2 权益预警

权益预警功能需要用户拥有对应的风控权限。

权益预警功能用来提醒操作员，某些投资者的权益低于设定的预警值，便于风控人员监控异常交易行为。

可以通过点击菜单栏的【预警】->【权益预警】，如图 1.4.2-1，打开报单预警界面，界面如图 1.4.2-2。



图 1.4.2-1



图 1.4.2-2

预警列表中列出所有超标（即权益不足）的预警记录。预警共分为3个级别，由低级别到高级别依次为：提示/警告/异常。当预警字段超标时，根据预警字段数值所在的预警级别以不同颜色表示；当预警字段正常时，则不显示在预警列表中。

- 提示级别：提示值 \geq 权益 $>$ 警告值，以灰色粗体表示；
- 警告级别：警告值 \geq 权益 $>$ 异常值，以橙色粗体表示；

- 异常级别：异常值 \geq 权益，以**红色**粗体表示。

“超标字段更新标志”用来标记该条记录的超标字段在上次查阅后是否有更新，帮助操作员更好的关注有变动的预警记录。更新标志共有两种状态，【有更新】即提示🔔黄色警示图标，【无更新】即空白无图标。

以下情况更新标志会变为【有更新】：

- 每次登录风控客户端时，超标预警记录的初始状态为【有更新】；
- 添加新的预警记录时，该记录的预警字段已经超标，则默认状态为【有更新】；
- 当预警字段超标后，每次该字段数值发生变化（变化后的数值仍在预警范围），状态都变为【有更新】。

选中一条【有更新】的记录，点击【已看过选中记录】按钮，可以把该条记录设置为【无更新】状态。点击【已看过全部记录】按钮，可以把所有【有更新】的记录设置为【无更新】。

勾选【超标字段更新时自动弹出窗口】，关闭该预警窗口，当超标字段更新标志出现【有更新】时，则会自动弹出该预警窗口，并有声音提示；取消勾选，则不会自动弹出。

点击【参数设置】按钮，弹出参数设置界面，如图 1.4.2-3。设置好参数后点击【退出】按钮退出参数设置界面。



图 1.4.2-3

参数设置步骤说明：

1. 选择投资者

可以通过投资者代码的下拉菜单选择一个或多个投资者，或在输入框中手动输入需添加的投资者代码，并用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔；投资者代码为空表示对所有投资者设置参数。当对所有投资者设置参数时，在预警列表窗口，会为每个超标的投资者显示一条超标记录；当单个投资者和所有投资者参数同时存在时，该投资者的预警以单独设置的参数为准。

2. 输入权益预警值

权益预警值可以用斜杠【/】分隔，分别输入3个预警级别，即提示/警告/异常的预警值。预警值不能全为空，可以输入正数、负数、小数；超过2位的小数，将被自动四舍五入到小数点后2位。

3个预警级别可以同时存在，也可以只输入其中的部分级别，跳过的级别直接留空。如输入【10000//1000】表示只有提示/异常级别。

输入多个预警级别时，高级别的权益预警值应比低级别的更低，以使预警级别有意义。

当高级别的权益预警值比低级别的更高时，低级别的预警将被忽略。

3. 全部设置完毕后，点击【添加】按钮添加预警参数记录

4. 修改已存在的预警参数记录

选中一条已存在的记录时，其设置值会显示到上方的参数设置中。修改权益预警值，点击【添加】按钮，即可修改该条记录。

添加完预警参数记录后，记录会显示在【已设参数】列表中。勾选记录前的方框可以启用该条记录进行预警；取消勾选，则禁用该条预警。

根据已启用的预警参数，当投资者的权益超标时，会在预警界面的【预警列表】中显示一条对应的超标预警记录，其中超标字段根据预警级别以不同颜色显示。禁用的预警参数不参与预警判断。

5. 删除已设预警参数记录

鼠标选中一条或多条记录，点击【删除选中】按钮可以删除所选记录；点击【删除所有】可以删除全部记录。

6. 模板设置

点击【模板】按钮，打开模板设置界面，如图 1.4.2-4。

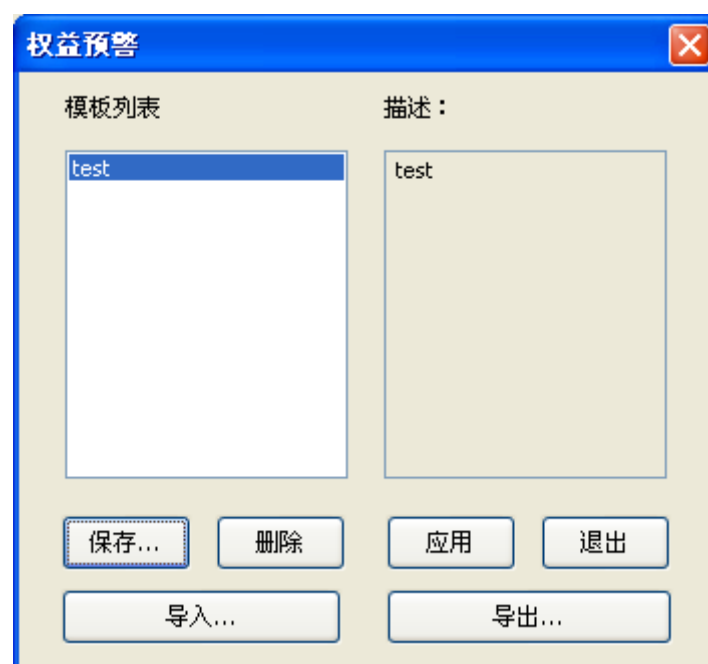


图 1.4.2-4

点击【保存】按钮把当前的【已设参数】保存为模板。点击【应用】按钮把已保存的模板设置应用到当前设置，注意将会覆盖已有设置。点击【删除】按钮删除模板。点击【导出】

按钮并选择目标文件夹，可以把已保存的所有模板以文件形式导出到指定文件夹。点击【导入】按钮并选择目标文件的，可以把该文件夹中的模板文件导入到客户端中。

1.4.3 报单预警

报单预警功能需要用户拥有对应的风控权限。

报单预警功能用来提醒操作员，某些投资者的成交报单笔数、撤单笔数、总报单笔数、开仓报单笔数、平仓报单笔数、大额撤单笔数，超过设定的预警值，便于风控人员监控异常交易行为。

可以通过点击菜单栏的【预警】->【报单预警】，如图 1.4.3-1，打开报单预警界面，界面如图 1.4.3-2。



图 1.4.3-1




超	投资者代码	交易所/品种合约	成交报单笔数	撤单笔数	总报单笔数	开仓报单笔数	平仓报单笔数	成交比例	大额撤单笔数	撤单量含部成部撤
▲	000073		30	383	417	407	10	7.19%	7	是
▲	000073		30	382	417	407	10	7.19%	6	否
▲	000326		2	1	3	3	0	66.67%	0	否
▲	001888		22	162	200	194	6	11.00%	0	是
▲	001888		22	157	200	194	6	11.00%	0	否
▲	00410009		3	0	4	4	0	75.00%	0	否
▲	00410010		1	0	1	1	0	100.00%	0	否
▲	062188		92	46	136	85	51	67.65%	0	是
▲	062188		92	44	136	85	51	67.65%	0	否
▲	000073+0...		122	429	553	492	61	22.06%	7	是

图 1.4.3-2

预警列表中列出所有超标的预警记录。预警共分为3个级别，由低级别到高级别依次为：提示/警告/异常。当预警字段超标时，根据预警字段数值所在的预警级别以不同颜色表示；当预警字段正常时，则不显示在预警列表中。

- 提示级别：提示值 \leq 报单笔数 $<$ 警告值，以灰色粗体表示；
- 警告级别：警告值 \leq 报单笔数 $<$ 异常值，以橙色粗体表示；
- 异常级别：异常值 \leq 报单笔数，以红色粗体表示。

“超标字段更新标志”用来标记该条记录的超标字段在上次查阅后是否有更新，帮助操作员更好的关注有变动的预警记录。更新标志共有两种状态，【有更新】即提示  黄色警示图标，【无更新】即空白无图标。

以下情况更新标志会变为【有更新】：

- 每次登录风控客户端时，超标预警记录的初始状态为【有更新】；
- 添加新的预警记录时，该记录的预警字段已经超标，则默认状态为【有更新】；
- 当预警字段超标后，每次该字段数值发生变化（变化后的数值仍在预警范围），状态都变为【有更新】。

选中一条【有更新】的记录，点击【已看过选中记录】按钮，可以把该条记录设置为【无更新】状态。点击【已看过全部记录】按钮，可以把所有【有更新】的记录设置为【无更新】。

勾选【超标字段更新时自动弹出窗口】，关闭该预警窗口，当超标字段更新标志出现【有更新】时，则会自动弹出该预警窗口；取消勾选，则不会自动弹出。

点击【参数设置】按钮，弹出参数设置界面，如图 1.4.3-3。设置好参数后点击【退出】按

钮退出参数设置界面。

报单预警参数设置

参数设置

投资者代码: 000000001640 交易所/品种合约: SHFE

成交报单笔数: 10/20/30 撤单笔数: 10/20/30 总报单笔数: 10/20/30 开仓报单笔数: 10/20/30 平仓报单笔数:

大额撤单笔数: 50/100/400 投保: 投机+套保+套利 撤单含部成部撤

拆分添加 合并添加 清空输入框

已设参数

投资者代码	投资者姓名	交易所/品种...	投保	成交报单笔数	撤单笔数	总报单笔数	开仓报单笔数	平
<input checked="" type="checkbox"/> 0000000...	张	SHFE	投机+套保+...	10/20/30	10/20/30	10/20/30	10/20/30	
<input checked="" type="checkbox"/> 0000000...	李淼	SHFE	投机+套保+...	10/20/30	10/20/30	10/20/30	10/20/30	
<input checked="" type="checkbox"/> 0000000...	陈东海	SHFE	投机+套保+...	10/20/30	10/20/30	10/20/30	10/20/30	
<input checked="" type="checkbox"/> 0000000...	钟锦才	SHFE	投机+套保+...	10/20/30	10/20/30	10/20/30	10/20/30	
<input checked="" type="checkbox"/> 0000000...	罗保添	SHFE	投机+套保+...	10/20/30	10/20/30	10/20/30	10/20/30	
<input checked="" type="checkbox"/> 0000000...	杭州世群国	SHFE	投机+套保+...	10/20/30	10/20/30	10/20/30	10/20/30	

删除选中 删除所有 全勾选 全不勾选 模板... 定义大额撤单...

退出

图 1.4.3-3

参数设置步骤说明:

1. 选择投资者

可以通过投资者代码的下拉菜单选择一个或多个投资者,或在输入框中手动输入需添加的投资者代码,并用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔;投资者代码为空表示对所有投资者设置参数。当对所有投资者设置参数时,在预警列表窗口,会为每个超标的投资者显示一条超标记录;当单个投资者和所有投资者参数同时存在时,该投资者的预警以单独设置的参数为准。

2. 选择交易所/品种合约

在交易所/品种合约中,通过下拉菜单选择需要进行预警的交易所或品种合约,或在输入框手动输入交易所代码或合约代码,区分大小写,用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔。手动输入时,系统将自动把低级项并入上一级,如同时输入SHFE+al时,由于SHFE中已包含al,系统将自动把al省略。注意同时选择多个合约产品时,预警值为所有选择的品种、合约各项报单数之和。

3. 输入报单预警值

报单预警值可以用斜杠【/】分隔,分别输入3个预警级别,即提示/警告/异常的预警值。预警值不能全为空,只能输入正整数。

3个预警级别可以同时存在，也可以只输入其中的部分级别，跳过的级别直接留空。如输入【10/100】表示只有提示/异常级别。

输入多个预警级别时，高级别的报单预警值应比低级别的更高，以使预警级别有意义。当高级别的预警值比低级别的更低时，低级别的预警将被忽略。

【撤单量含部成部撤】选项默认为勾选，即【撤单笔数】、【大额撤单笔数】中包含部分成交部分撤单的报单笔数。不勾选该选项时，【撤单笔数】、【大额撤单笔数】中不包含部分成交部分撤单的报单笔数。

【投保】选项包括投机、套保、套利三类，选项默认为全勾选，即【成交报单笔数】、【撤单笔数】、【总报单笔数】、【开仓报单笔数】、【平仓报单笔数】中所有类型的报单手数。对所需类型标志进行勾选，实现不同的报单类型预警设置，如图 1.4.3-4。

图 1.4.3-4

4. 全部设置完毕后，添加预警参数记录

点击【拆分添加】按钮，按投资者、交易所/品种合约全部拆分，分别增加预警参数记录。选择单个投资者，单个交易所/品种合约时，添加一条记录；选择多个投资者，单个交易所/品种合约时，为每个投资者添加一条记录；选择单个投资者，多个交易所/品种合约时，为该投资者在每个交易所/品种合约上分别添加一条记录；选择多个投资者，多个交易所/品种合约时，按投资者及交易所/品种合约交叉组合，为每种组合添加一条记录。

点击【合并添加】按钮，合并投资者、交易所/品种合约，添加一条合并预警参数记录。系统将对设定的所有投资者，在交易所/品种合约上的各项报单数汇总值进行合并预警。

特殊处理说明：

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角加号【+】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【合并添加】，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【+SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【合并添加】执行；

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角逗号【,】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【拆分添加】，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【,SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【拆分添加】执行。
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角分号【;】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为拆分至合约，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【;SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都向下拆分至合约，即拆分至al1011、al1012、al101...cu1011、cu1012、cu1101.....。

详细交易所/品种合约输入方式配合不同添加按钮的说明见表格 1.4.3-1。

表格 1.4.3-1

	是否按投资者拆分	是否按交易所/品种合约拆分
普通输入+【拆分添加】	拆分	拆分
普通输入+【合并添加】	合并	合并
加号输入交易所/品种合约+【拆分添加】	拆分	合并
加号输入交易所/品种合约+【合并添加】	合并	合并
逗号输入交易所/品种合约+【拆分添加】	拆分	拆分
逗号输入交易所/品种合约+【合并添加】	合并	拆分
分号输入交易所/品种合约+【拆分添加】	拆分	拆分至合约
分号输入交易所/品种合约+【合并添加】	合并	拆分至合约

5. 修改已存在的预警参数记录

投资者代码、交易所/品种合约、【撤单量含部成部撤】，3个选项确定一个唯一值，在

这唯一值上，只能存在一条记录。再次添加相同记录时即为修改。

选中一条已存在的记录时，其设置值会显示到上方的参数设置中。修改报单预警值，并根据该记录是否按投资者、按交易所/品种合约拆分，点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，即可修改该条记录。具体对应关系见表格 1.4.3-1。如果不按表格中对应关系进行修改，则为添加新的记录。

添加完预警参数记录后，记录会显示在【已设参数】列表中。勾选记录前的方框可以启用该条记录进行预警；取消勾选，则禁用该条预警。

根据已启用的预警参数，当投资者的相关报单数大于或等于预警值时，会在预警界面的【预警列表】中显示一条对应的超标记录，其中超标的相关报单数根据预警级别以不同颜色显示。禁用的预警参数不参与预警判断。

6. 删除已设预警参数记录

鼠标选中一条或多条记录，点击【删除选中】按钮可以删除所选记录；点击【删除所有】可以删除全部记录。

7. 模板设置

点击【模板】按钮，打开模板设置界面，如图 1.4.3-。

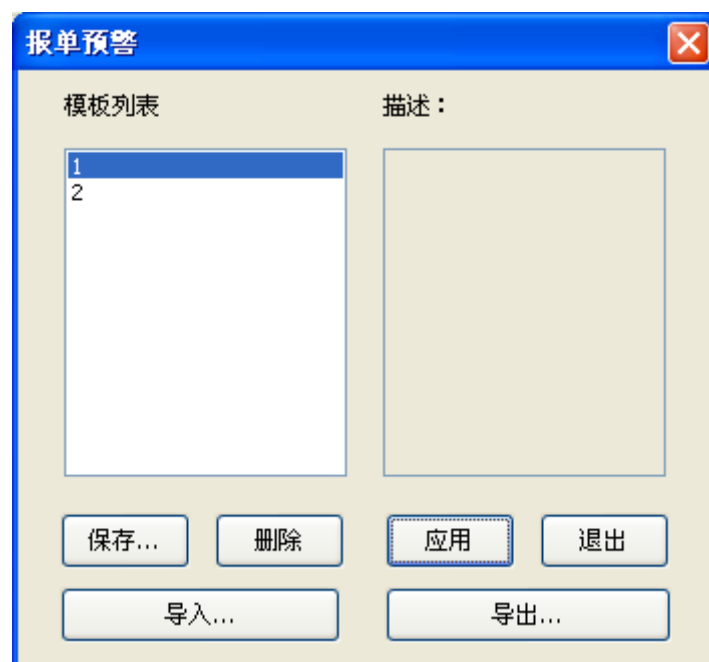


图 1.4.3-5

点击【保存】按钮把当前的【已设参数】保存为模板。点击【应用】按钮把已保存的模板设置应用到当前设置，注意将会覆盖已有设置。点击【删除】按钮删除模板。点击【导出】

按钮并选择目标文件夹，可以把已保存的所有模板以文件形式导出到指定文件夹。点击【导入】按钮并选择目标文件的，可以把该文件夹中的模板文件导入到客户端中。

备注：

1. 成交报单笔数= 全部成交的报单笔数 + 部分成交的报单笔数；
2. 撤单笔数 = 全部撤单的报单笔数 + 部成部撤的报单笔数（*根据【撤单量含部成部撤】选项来决定是否参与计算）；
3. 成交比例 = （成交报单笔数 / 总报单笔数）*100%
4. 大额撤单笔数：对于上期所合约表示撤单量为300手以上（含300手）的撤单笔数；对于郑商所合约表示撤单量为500手以上（含500手）的撤单笔数；对于大商所合约表示撤单量超过合约最大下单手数80%的撤单笔数；对于中金所合约表示撤单量为80手以上（含300手）的撤单笔数。根据【撤单量含部成部撤】选项来决定部成部撤是否参与计算。



图 1.4.3-6

1.4.4 成交预警

成交预警功能需要用户拥有对应的风控权限。

成交预警功能用来提醒操作员，某些投资者的开仓成交手数、平仓成交手数、总成交手数、自成交笔数、开仓挂单手数，超过设定的预警值，便于风控人员监控异常交易行为。

可以通过点击菜单栏的【预警】->【成交预警】，如图 1.4.4-1，打开成交预警界面，界面如图 1.4.4-2。



图 1.4.4-1



图 1.4.4-2

预警列表中列出所有超标的预警记录。预警共分为3个级别，由低级别到高级别依次为：提示/警告/异常。当预警字段超标时，根据预警字段数值所在的预警级别以不同颜色表示；当预警字段正常时，则不显示在预警列表中。

- 提示级别：提示值 \leq 成交手数 $<$ 警告值，以灰色粗体表示；
- 警告级别：警告值 \leq 成交手数 $<$ 异常值，以橙色粗体表示；

- 异常级别：异常值 \leq 成交手数，以**红色**粗体表示。

“超标字段更新标志”用来标记该条记录的超标字段在上次查阅后是否有更新，帮助操作员更好的关注有变动的预警记录。更新标志共有两种状态，【有更新】即提示🚨黄色警示图标，【无更新】即空白无图标。

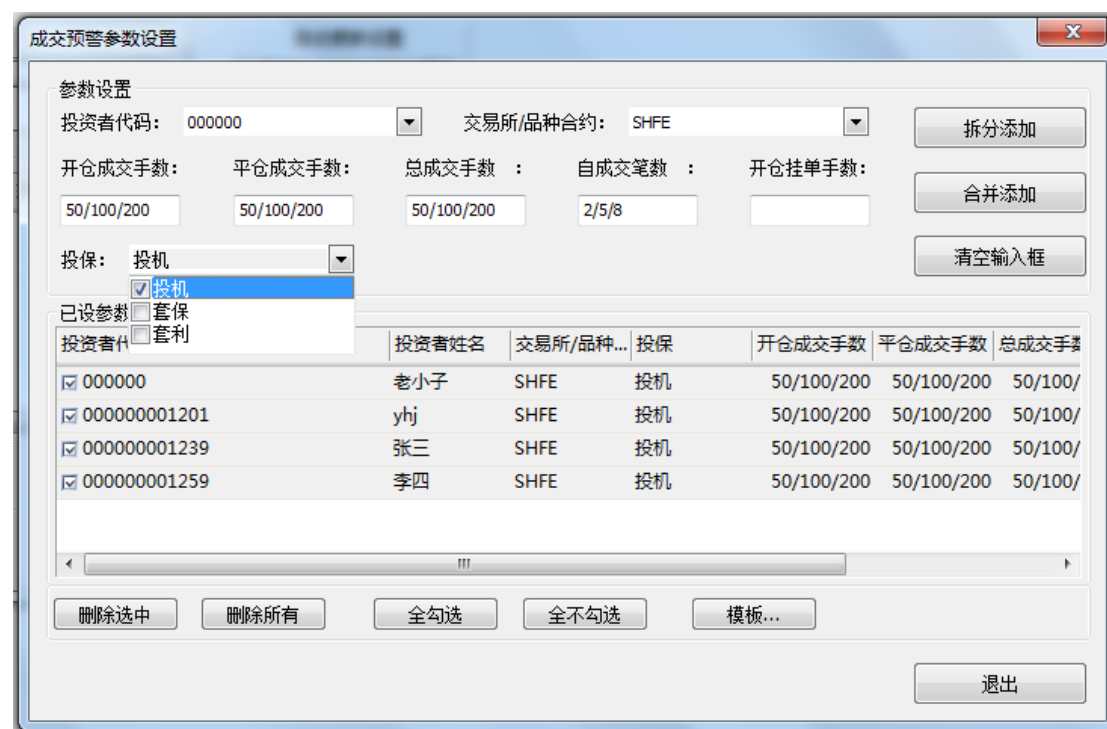
以下情况更新标志会变为【有更新】：

- 每次登录风控客户端时，超标预警记录的初始状态皆为【有更新】；
- 添加新的预警记录时，该记录的预警字段已经超标，则默认状态为【有更新】；
- 当预警字段超标后，每次该字段数值发生变化（变化后的数值仍在预警范围），状态都变为【有更新】。

选中一条【有更新】的记录，点击【已看过选中记录】按钮，可以把该条记录设置为【无更新】状态。点击【已看过全部记录】按钮，可以把所有【有更新】的记录设置为【无更新】。

勾选【超标字段更新时自动弹出窗口】，关闭该预警窗口，当超标字段更新标志出现【有更新】时，则会自动弹出该预警窗口；取消勾选，则不会自动弹出。

点击【参数设置】按钮，弹出参数设置界面，如图 1.4.4-3。设置好参数后点击【退出】按钮退出参数设置界面。



成交预警参数设置

参数设置

投资者代码： 000000 交易所/品种合约： SHFE

开仓成交手数： 50/100/200 平仓成交手数： 50/100/200 总成交手数： 50/100/200 自成交笔数： 2/5/8 开仓挂单手数：

投保： 投机

已设参数 ☒ 投机 ☐ 套保 ☐ 套利

投资者代码	投资者姓名	交易所/品种...	投保	开仓成交手数	平仓成交手数	总成交手数
<input checked="" type="checkbox"/> 000000	老小子	SHFE	投机	50/100/200	50/100/200	50/100/200
<input checked="" type="checkbox"/> 000000001201	yhj	SHFE	投机	50/100/200	50/100/200	50/100/200
<input checked="" type="checkbox"/> 000000001239	张三	SHFE	投机	50/100/200	50/100/200	50/100/200
<input checked="" type="checkbox"/> 000000001259	李四	SHFE	投机	50/100/200	50/100/200	50/100/200

删除选中 删除所有 全勾选 全不勾选 模板...

退出

图 1.4.4-3

参数设置步骤说明：

1. 选择投资者

可以通过投资者代码的下拉菜单选择一个或多个投资者,或在输入框中手动输入需添加的投资者代码,并用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔;投资者代码为空表示对所有投资者设置参数。当对所有投资者设置参数时,在预警列表窗口,会为每个超标的投资者显示一条超标记录;当单个投资者和所有投资者参数同时存在时,该投资者的预警以单独设置的参数为准。

2. 选择交易所/品种合约

在交易所/品种合约中,通过下拉菜单选择需要进行预警的交易所或品种合约,或在输入框手动输入交易所代码或合约代码,区分大小写,用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔。手动输入时,系统将自动把低级项并入上一级,如同时输入SHFE+al时,由于SHFE中已包含al,系统将自动把al省略。注意同时选择多个合约产品时,预警的值为所有选择的品种、合约各项成交手数之和。

3. 输入成交预警值

成交预警值可以用斜杠【/】分隔,分别输入3个预警级别,即提示/警告/异常的预警值。预警值不能全为空,只能输入正整数。

3个预警级别可以同时存在,也可以只输入其中的部分级别,跳过的级别直接留空。如输入【10/100】表示只有提示/异常级别。

输入多个预警级别时,高级别的成交预警值应比低级别的更高,以使预警级别有意义。当高级别的预警值比低级别的更低时,低级别的预警将被忽略。

【投保】选项包括投机、套保、套利三类,选项默认为全勾选,即【开仓成交手数】、【平仓成交手数】、【总成交手数】中所有类型的成交手数。对所需类型标志进行勾选,实现不同的类型成交预警设置。如图 1.4.4-4。

图 1.4.4-4

4. 全部设置完毕后，添加预警参数记录

点击【拆分添加】按钮，按投资者、交易所/品种合约全部拆分，分别增加预警参数记录。选择单个投资者，单个交易所/品种合约时，添加一条记录；选择多个投资者，单个交易所/品种合约时，为每个投资者添加一条记录；选择单个投资者，多个交易所/品种合约时，为该投资者在每个交易所/品种合约上分别添加一条记录；选择多个投资者，多个交易所/品种合约时，按投资者及交易所/品种合约交叉组合，为每种组合添加一条记录。

点击【合并添加】按钮，合并投资者、交易所/品种合约，添加一条合并预警参数记录。系统将对设定的所有投资者，在交易所/品种合约上的各项成交手数汇总值进行合并预警。

特殊处理说明：

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角加号【+】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【合并添加】，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【+SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【合并添加】执行；
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角逗号【,】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【拆分添加】，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【,SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【拆分添加】执行。
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角分号【;】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为拆分至合约，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【;SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都向下拆分至合约，即拆分至al1011、al1012、al1101...cu1011、cu1012、cu1101.....。

详细交易所/品种合约输入方式配合不同添加按钮的说明见表格 1.4.4-1。

表格 1.4.4-1

	是否按投资者拆分	是否按交易所/品种合约拆分
普通输入+【拆分添加】	拆分	拆分
普通输入+【合并添加】	合并	合并
加号输入交易所/品种合约+ 【拆分添加】	拆分	合并

加号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	合并
逗号输入交易所/品种合约+ 【拆分添加】	拆分	拆分
逗号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	拆分
分号输入交易所/品种合约+ 【拆分添加】	拆分	拆分至合约
分号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	拆分至合约

5. 修改已存在的预警参数记录

投资者代码、交易所/品种合约，2个选项确定一个唯一值，在这唯一值上，只能存在一条记录。再次添加相同记录时即为修改。

选中一条已存在的记录时，其设置值会显示到上方的参数设置中。修改成交预警值或【含套保成交量】选项，并根据该记录是否按投资者、按交易所/品种合约拆分，点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，即可修改该条记录。具体对应关系见表格 1.4.4-1。如果不按表格中对应关系进行修改，则为添加新的记录。

添加完预警参数记录后，记录会显示在【已设参数】列表中。勾选记录前的方框可以启用该条记录进行预警；取消勾选，则禁用该条预警。

根据已启用的参数，当投资者的相关成交手数大于或等于预警值时，会在预警界面的【预警列表】中显示一条对应的超标记录，其中超标的相关报单数用红色粗体表示。禁用的预警参数不参与预警判断。

6. 删除已设预警参数记录

鼠标选中一条或多条记录，点击【删除选中】按钮可以删除所选记录；点击【删除所有】可以删除全部记录。

7. 模板设置

点击【模板】按钮，打开模板设置界面，如图 1.4.4-5。



图 1.4.4-5

点击【保存】按钮把当前的【已设参数】保存为模板。点击【应用】按钮把已保存的模板设置应用到当前设置，注意将会覆盖已有设置。点击【删除】按钮删除模板。点击【导出】按钮并选择目标文件夹，可以把已保存的所有模板以文件形式导出到指定文件夹。点击【导入】按钮并选择目标文件的，可以把该文件夹中的模板文件导入到客户端中。

备注：

1. 郑商所CZCE自成交判断原则：

- 成交编号相邻；
- 经纪公司代码、投资者代码、合约代码、成交价格、成交时间、成交手数一致；
- 买卖方向相反。

2. 上期所SHFE、中金所CFFEX、大商所DCE自成交判断原则：

- 经纪公司代码、投资者代码、合约代码、成交编号、成交价格、成交时间、成交手数一致；
- 买卖方向相反。

1.4.5 持仓预警

持仓预警功能需要用户拥有对应的风控权限。

持仓预警功能用来提醒操作员，某些投资者的多头持仓量、空头持仓量、总持仓量，超

过设定的预警值，便于风控人员监控异常交易行为。

可以通过点击菜单栏的【预警】->【持仓预警】，如图 1.4.5-1，打开持仓预警界面，界面如图 1.4.5-2。



图 1.4.5-1



图 1.4.5-2

预警列表中列出所有超标的预警记录。预警共分为3个级别，由低级别到高级别依次为：提示/警告/异常。当预警字段超标时，根据预警字段数值所在的预警级别以不同颜色表示；当预警字段正常时，则不显示在预警列表中。

- 提示级别：提示值 \leq 持仓量 $<$ 警告值，以灰色粗体表示；
- 警告级别：警告值 \leq 持仓量 $<$ 异常值，以**橙色**粗体表示；
- 异常级别：异常值 \leq 持仓量，以**红色**粗体表示。

“超标字段更新标志”用来标记该条记录的超标字段在上次查阅后是否有更新，帮助操作员更好的关注有变动的预警记录。更新标志共有两种状态，【有更新】即提示🚨黄色警示图标，【无更新】即空白无图标。

以下情况更新标志会变为【有更新】：

- 每次登录风控客户端时，超标预警记录的初始状态皆为【有更新】；
- 添加新的预警记录时，该记录的预警字段已经超标，则默认状态为【有更新】；
- 当预警字段超标后，每次该字段数值发生变化（变化后的数值仍在预警范围），状态都变为【有更新】。

选中一条【有更新】的记录，点击【已看过选中记录】按钮，可以把该条记录设置为【无更新】状态。点击【已看过全部记录】按钮，可以把所有【有更新】的记录设置为【无更新】。

勾选【超标字段更新时自动弹出窗口】，关闭该预警窗口，当超标字段更新标志出现【有更新】时，则会自动弹出该预警窗口；取消勾选，则不会自动弹出。

点击【参数设置】按钮，弹出参数设置界面，如图 1.4.5-3。设置好参数后点击【退出】按钮退出参数设置界面。

图 1.4.5-3

参数设置步骤:

1. 选择投资者

可以通过投资者代码的下拉菜单选择一个或多个投资者,或在输入框中手动输入需添加的投资者代码,并用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔;投资者代码为空表示对所有投资者设置参数。当对所有投资者设置参数时,在预警列表窗口,会为每个超标的投资者显示一条超标记录;当单个投资者和所有投资者参数同时存在时,该投资者的预警以单独设置的参数为准。

2. 选择交易所/品种合约

在交易所/品种合约中,通过下拉菜单选择需要进行预警的交易所或品种合约,或在输入框手动输入交易所代码或合约代码,区分大小写,用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔。手动输入时,系统将自动把低级项并入上一级,如同时输入SHFE+al时,由于SHFE中已包含al,系统将自动把al省略。注意同时选择多个合约产品时,预警的值为所有选择的品种、合约各项持仓量之和。

3. 输入持仓预警值

持仓预警值可以用斜杠【/】分隔,分别输入3个预警级别,即提示/警告/异常的预警值。预警值不能全为空,只能输入正整数。

3个预警级别可以同时存在,也可以只输入其中的部分级别,跳过的级别直接留空。如输入【10/100】表示只有提示/异常级别。

输入多个预警级别时,高级别的持仓预警值应比低级别的更高,以使预警级别有意义。当高级别的预警值比低级别的更低时,低级别的预警将被忽略。

【投保】选项包括投机、套保、套利三类,选项默认为全勾选,即【多头持仓量】、【空头持仓量】、【总持仓量】中所有持仓手数。对所需类型标志进行勾选,实现不同的类型持仓预警设置。如图 1.4.4-4。

投资者代码	投资者姓名	交易所/品种...	投保	多头持仓量	空头持仓量	总持仓量
000000001201	yhj	SHFE	投机	10/30/50	10/30/50	20/50/100

图 1.4.5-4

4. 全部设置完毕后，添加预警参数记录

点击【拆分添加】按钮，按投资者、交易所/品种合约全部拆分，分别增加预警参数记录。选择单个投资者，单个交易所/品种合约时，添加一条记录；选择多个投资者，单个交易所/品种合约时，为每个投资者添加一条记录；选择单个投资者，多个交易所/品种合约时，为该投资者在每个交易所/品种合约上分别添加一条记录；选择多个投资者，多个交易所/品种合约时，按投资者及交易所/品种合约交叉组合，为每种组合添加一条记录。

点击【合并添加】按钮，合并投资者、交易所/品种合约，添加一条合并预警参数记录。系统将对设定的所有投资者，在交易所/品种合约上的各项持仓量汇总值进行合并预警。

特殊处理说明：

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角加号【+】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【合并添加】，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【+SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【合并添加】执行；
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角逗号【,】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【拆分添加】，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【,SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【拆分添加】执行。
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角分号【;】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为拆分至合约，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【;SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都向下拆分至合约，即拆分至al1011、al1012、al1101...cu1011、cu1012、cu1101.....。

详细交易所/品种合约输入方式配合不同添加按钮的说明见表格 1.4.5-1。

表格 1.4.5-1

	是否按投资者拆分	是否按交易所/品种合约拆分
普通输入+【拆分添加】	拆分	拆分
普通输入+【合并添加】	合并	合并
加号输入交易所/品种合约+【拆分添加】	拆分	合并

加号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	合并
逗号输入交易所/品种合约+ 【拆分添加】	拆分	拆分
逗号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	拆分
分号输入交易所/品种合约+ 【拆分添加】	拆分	拆分至合约
分号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	拆分至合约

5. 修改已存在的预警记录

投资者代码、交易所/品种合约，2个选项确定一个唯一值，在这唯一值上，只能存在一条记录。再次添加相同记录时即为修改。

选中一条已存在的记录时，其设置值会显示到上方的参数设置中。修改持仓预警值，并根据该记录是否按投资者、按交易所/品种合约拆分，点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，即可修改该条记录。具体对应关系见表格 1.4.5-1。如果不按表格中对应关系进行修改，则为添加新的记录。

添加完预警参数记录后，记录会显示在【已设参数】列表中。勾选记录前的方框可以启用该条记录进行预警；取消勾选，则禁用该条预警。

根据已启用的参数，当投资者的相关持仓量大于或等于预警值时，会在预警界面的【预警列表】中显示一条对应的超标记录，其中超标的相关报单数用红色粗体表示。禁用的预警参数不参与预警判断。

6. 删除已设预警参数记录

鼠标选中一条或多条记录，点击【删除选中】按钮可以删除所选记录；点击【删除所有】可以删除全部记录。

7. 模板设置

点击【模板】按钮，打开模板设置，如图 1.4.5-。

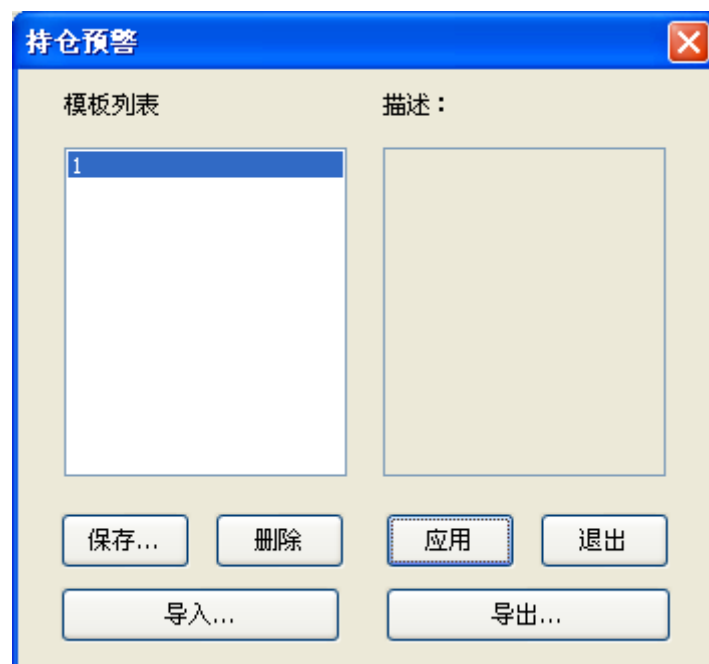


图 1.4.5-5

点击【保存】按钮把当前的【已设参数】保存为模板。点击【应用】按钮把已保存的模板设置应用到当前设置，注意将会覆盖已有设置。点击【删除】按钮删除模板。点击【导出】按钮并选择目标文件夹，可以把已保存的所有模板以文件形式导出到指定文件夹。点击【导入】按钮并选择目标文件的，可以把该文件夹中的模板文件导入到客户端中。

1.4.6 错单预警

错单预警功能需要用户拥有对应的风控权限。

错单预警功能用来提醒操作员,某些投资者的错单笔数、错单频率(1秒内的错单笔数),超过设定的预警值,便于风控人员监控异常交易行为。

可以通过点击菜单栏的【预警】->【错单预警】，如图 1.4.6-1，打开错单预警界面，界面如图 1.4.6-2。



图 1.4.6-1

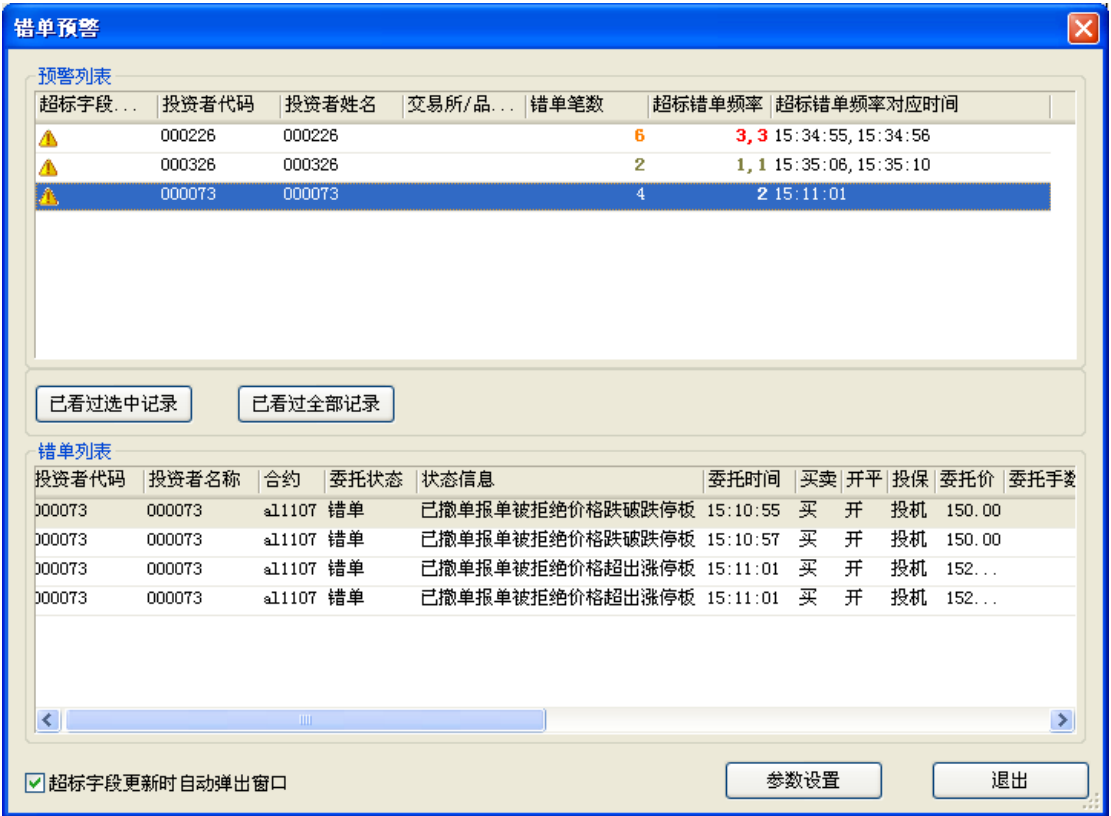


图 1.4.6-2


预警列表中列出所有超标的预警记录。在预警列表中选中一条记录后，错单详情显示在下方的错单列表中。

【错单预警】特殊说明：该预警功能仅对被交易所拒绝的错单进行预警，不对被本平台交易后台拒绝的错单、以及撤单失败的错单操作进行预警。

预警共分为3个级别，由低级别到高级别依次为：提示/警告/异常。当预警字段超标时，根据预警字段数值所在的预警级别以不同颜色表示；当预警字段正常时，则不显示在预警列表中。

- 提示级别：提示值 \leq 错单笔数/错单频率 $<$ 警告值，以灰色粗体表示；
- 警告级别：警告值 \leq 错单笔数/错单频率 $<$ 异常值，以橙色粗体表示；
- 异常级别：异常值 \leq 错单笔数/错单频率，以红色粗体表示。

其中，“错单频率”只显示超标的最高级别的预警，即有异常级别的错单频率发生时，不再显示警告或提示级别的预警。当有多次错单频率超标时，显示所有的超标错单频率，并且显示超标错单频率对应的错单时间。

“超标字段更新标志”用来标记该条记录的超标字段在上次查阅后是否有更新，帮助操作员更好的关注有变动的预警记录。更新标志共有两种状态，【有更新】即提示  黄色警示图标，【无更新】即空白无图标。

以下情况更新标志会变为【有更新】：

- 每次登录风控客户端时，超标预警记录的初始状态皆为【有更新】；
- 添加新的预警记录时，该记录的预警字段已经超标，则默认状态为【有更新】；
- 当预警字段超标后，每次该字段数值发生变化（变化后的数值仍在预警范围），状态都变为【有更新】。

选中一条【有更新】的记录，点击【已看过选中记录】按钮，可以把该条记录设置为【无更新】状态。点击【已看过全部记录】按钮，可以把所有【有更新】的记录设置为【无更新】。

勾选【超标字段更新时自动弹出窗口】，关闭该预警窗口，当超标字段更新标志出现【有更新】时，则会自动弹出该预警窗口；取消勾选，则不会自动弹出。

点击【参数设置】按钮，弹出参数设置界面，如图 1.4.6-3。设置好参数后点击【退出】按钮退出参数设置界面。

错单预警参数设置

参数设置

投资者代码: 000226+000326 交易所/品种合约: SHFE

错单笔数: 1/5/10 错单频率: 1/2/3 (即1秒内的错单笔数)

拆分添加 合并添加 清空输入框

已设参数

投资者代码	投资者姓名	交易所/品种	错单笔数	错单频率
<input checked="" type="checkbox"/>			1/5/10	1/2/3
<input checked="" type="checkbox"/> 000073	000073		1/5/10	1/2/3
<input type="checkbox"/> 000226	000226		1/5/10	1/2/3
<input checked="" type="checkbox"/> 000226	000226	SHFE	1/5/10	1/2/3
<input checked="" type="checkbox"/> 000226+...	000226+00...	SHFE	1/5/10	1/2/3

删除选中 删除所有 全勾选 全不勾选 模板...

退出

图 1.4.6-3

参数设置步骤:

1. 选择投资者

可以通过投资者代码的下拉菜单选择一个或多个投资者,或在输入框中手动输入需添加的投资者代码,并用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔;投资者代码为空表示对所有投资者设置参数。当对所有投资者设置参数时,在预警列表窗口,会为每个超标的投资者显示一条超标记录;当单个投资者和所有投资者参数同时存在时,该投资者的预警以单独设置的参数为准。

2. 选择交易所/品种合约

在交易所/品种合约中,通过下拉菜单选择需要进行预警的交易所或品种合约,或在输入框手动输入交易所代码或合约代码,区分大小写,用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔。手动输入时,系统将自动把低级项并入上一级,如同时输入SHFE+al时,由于SHFE中已包含al,系统将自动把al省略。注意同时选择多个合约产品时,预警的值为所有选择的品种、合约各项错单笔数/错单频率之和。

3. 输入错单笔数/错单频率预警值

错单预警值可以用斜杠【/】分隔,分别输入3个预警级别,即提示/警告/异常的预警值。预警值不能全为空,只能输入正整数。

3个预警级别可以同时存在,也可以只输入其中的部分级别,跳过的级别直接留空。如

输入【10/100】表示只有提示/异常级别。

输入多个预警级别时，高级别的持仓预警值应比低级别的更高，以使预警级别有意义。当高级别的预警值比低级别的更低时，低级别的预警将被忽略。

4. 全部设置完毕后，添加预警参数记录

点击【拆分添加】按钮，按投资者、交易所/品种合约全部拆分，分别增加预警参数记录。选择单个投资者，单个交易所/品种合约时，添加一条记录；选择多个投资者，单个交易所/品种合约时，为每个投资者添加一条记录；选择单个投资者，多个交易所/品种合约时，为该投资者在每个交易所/品种合约上分别添加一条记录；选择多个投资者，多个交易所/品种合约时，按投资者及交易所/品种合约交叉组合，为每种组合添加一条记录。

点击【合并添加】按钮，合并投资者、交易所/品种合约，添加一条合并预警参数记录。系统将对设定的所有投资者，在交易所/品种合约上的错单笔数/错单频率总和进行合并预警。

特殊处理说明：

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角加号【+】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【合并添加】，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【+SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【合并添加】执行；
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角逗号【,】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【拆分添加】，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【,SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【拆分添加】执行。
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角分号【;】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为拆分至合约，此时投资者的添加，仍根据点击【拆分添加】、【合并添加】按钮执行。如输入【;SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都向下拆分至合约，即拆分至al1011、al1012、al1101...cu1011、cu1012、cu1101.....。

详细交易所/品种合约输入方式配合不同添加按钮的说明见表格 1.4.5-1。

表格 1.4.6-1

	是否按投资者拆分	是否按交易所/品种合约拆分
普通输入+【拆分添加】	拆分	拆分

普通输入+【合并添加】	合并	合并
加号输入交易所/品种合约+ 【拆分添加】	拆分	合并
加号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	合并
逗号输入交易所/品种合约+ 【拆分添加】	拆分	拆分
逗号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	拆分
分号输入交易所/品种合约+ 【拆分添加】	拆分	拆分至合约
分号输入交易所/品种合约+ 【合并添加】	合并	拆分至合约

5. 修改已存在的预警记录

投资者代码、交易所/品种合约，2个选项确定一个唯一值，在这唯一值上，只能存在一条记录。再次添加相同记录时即为修改。

选中一条已存在的记录时，其设置值会显示到上方的参数设置中。修改错单预警值，并根据该记录是否按投资者、按交易所/品种合约拆分，点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，即可修改该条记录。具体对应关系见表格 1.4.6-1。如果不按表格中对应关系进行修改，则为添加新的记录。

添加完预警参数记录后，记录会显示在【已设参数】列表中。勾选记录前的方框可以启用该条记录进行预警；取消勾选，则禁用该条预警。

根据已启用的参数，当投资者的相关错单笔数/错单频率大于或等于预警值时，会在预警界面的【预警列表】中显示一条对应的超标记录，其中超标的相关值用红色粗体表示。禁用的预警参数不参与预警判断。

6. 删除已设预警参数记录

鼠标选中一条或多条记录，点击【删除选中】按钮可以删除所选记录；点击【删除所有】可以删除全部记录。

7. 模板设置

点击【模板】按钮，打开模板设置，如图 1.4.6-4。

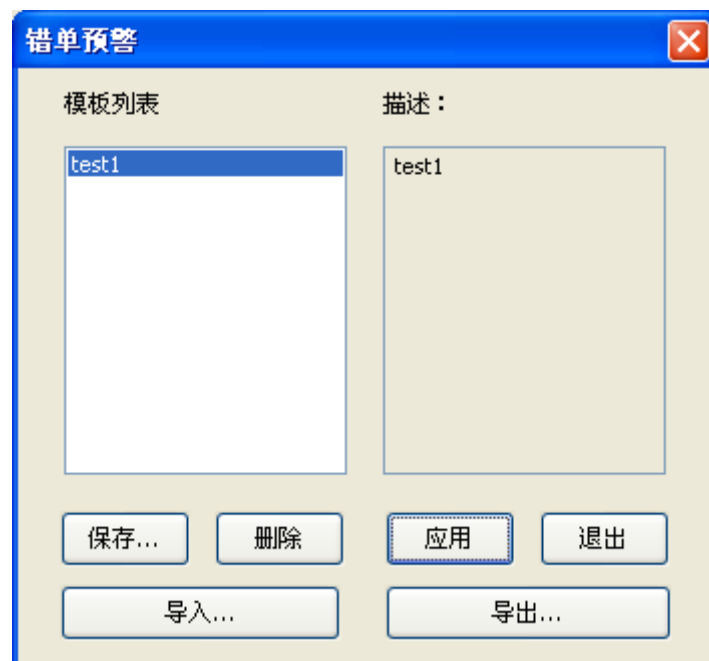


图 1.4.6-4

点击【保存】按钮把当前的【已设参数】保存为模板。点击【应用】按钮把已保存的模板设置应用到当前设置，注意将会覆盖已有设置。点击【删除】按钮删除模板。点击【导出】按钮并选择目标文件夹，可以把已保存的所有模板以文件形式导出到指定文件夹。点击【导入】按钮并选择目标文件的，可以把该文件夹中的模板文件导入到客户端中。

2 各菜单视图说明

2.1 选项

◆ 打开方式

用户可以通过点击菜单栏的【设置】->【选项】，如图 2.1-1，或按键盘【Ctrl】+【s】键，打开选项界面。



图 2.1-1

◆ 界面说明

选项窗口用于管理系统各项配置，所有配置修改后，点击【保存设置】按钮，确认保存后实时生效。

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。

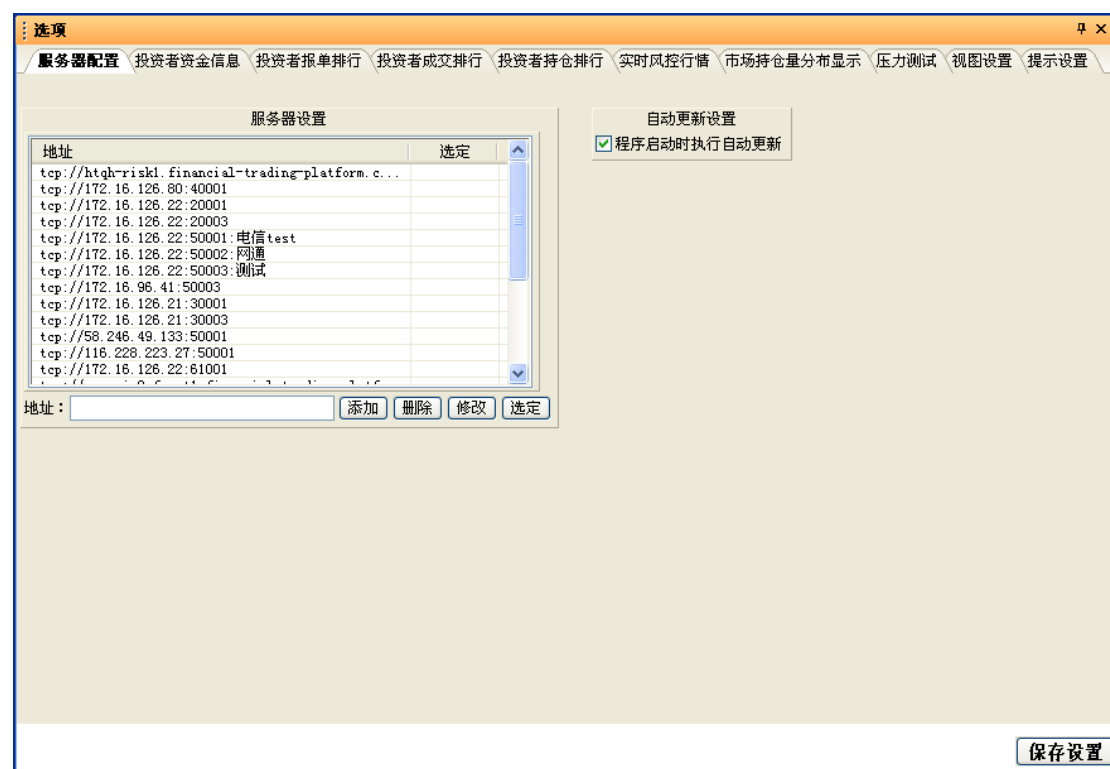


图 2.1-2









输入服务器地址时，在地址的最后加上【@经纪公司代码】即可自定义登录该地址时的经纪公司代码。如输入【tcp://172.16.126.22:610001:测试服务器@8000】，就是登录测试服务器时，不论默认配置的经济公司代码是多少，都使用自定义的8000经纪公司代码登录。

2. 投资者资金信息：具体说明见投资者资金信息的选项配置；
3. 投资者报单排行：具体说明见投资者报单排行的选项配置；
4. 投资者成交排行：具体说明见投资者成交排行的选项配置；
5. 投资者持仓排行：具体说明见投资者持仓排行的选项配置；
6. 实时风控行情：具体说明见实时风控行情的选项配置；
7. 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；
8. 压力测试：具体说明见压力测试的选项配置；
9. 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。



图2.1-3

具体说明如下：

- 1) 在视图选择中选中某一视图，待选字段出现该视图下未选择显示的表头字段，已选字段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，将该字段排在最上面；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。

10. 提示设置：管理客户端各提示设置，如图2.1-4。

【声音提示】用于设置报单状态发生变化或有成交时，是否有提示音；【状态栏提示】用于设置报单状态发生变化或有成交时，在状态栏中是否显示相应的提示信息；所有提示仅针对本次登录的操作员报入的报单以及成交变化。



图2.1.4

2.2 信息

各信息视窗的查看需要用户拥有对应的风险权限。

2.2.1 投资者资金信息

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。

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【信息】->【投资者资金信息】，打开投资者资金信息界面。
如图 2.2.1-1。

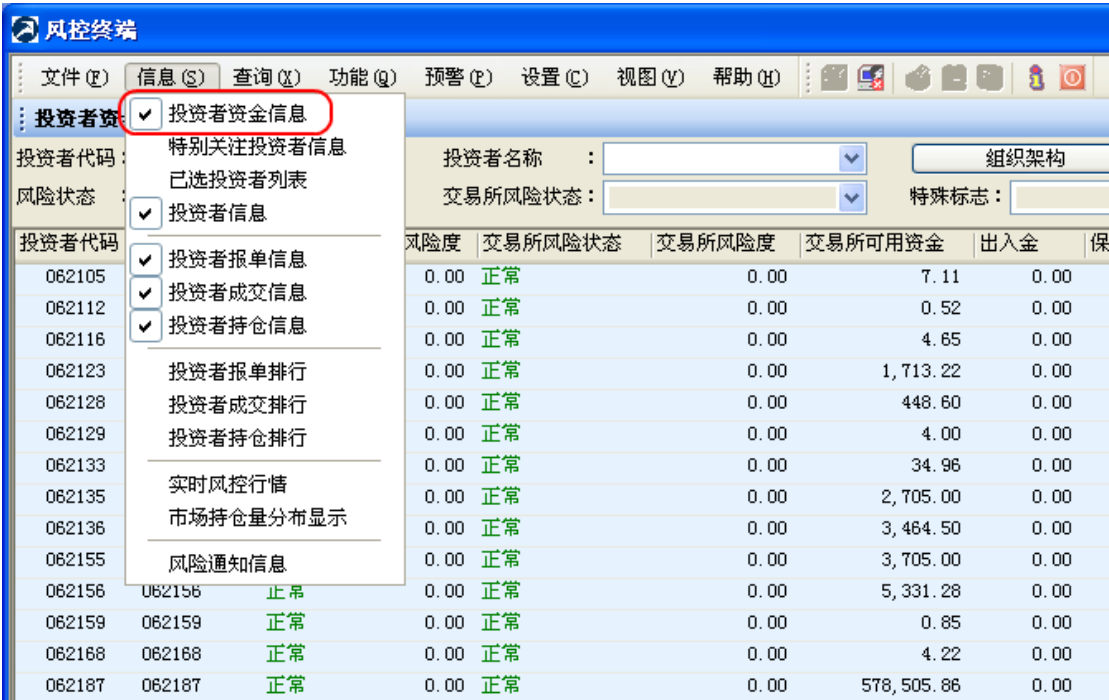


图 2.2.1-1

◆ 界面说明

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、投资者名称、特殊标志（当在配置中选择【支持特殊投资者过滤】时生效）。最下方总计了所有资金项，如图 2.2.1-2。

投资者资金信息									
投资者代码：		投资者名称：		组织架构					
风险状态：		交易所风险状态：		特殊标志：					
投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费	平仓盈亏
000011	异常	-0.00	异常	-0.00	-100.00	0.00	0.00	0.00	0.
206906	异常	-0.00	异常	-0.00	-8,000.00	0.00	0.00	0.00	0.
611116	异常	-0.00	异常	-0.00	-18,086.00	0.00	0.00	0.00	0.
207655	穿仓	-4.47	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	17,141.50	0.00	0.
201276	强平	164.73	强平	101.79	-1,160.10	0.00	106,953.80	0.00	0.
203908	强平	251.04	强平	125.52	-6,214.50	0.00	61,131.00	0.00	0.
201220	追保	100.06	正常	41.69	11,093.80	0.00	19,036.80	0.00	0.
201885	追保	105.13	正常	56.63	151,583.51	0.00	367,424.20	0.00	0.
206087	追保	101.34	正常	60.80	2,023.44	0.00	5,231.00	0.00	0.
206262	追保	108.28	正常	62.63	45,228.20	0.00	131,065.10	0.00	0.
206391	追保	114.55	正常	70.49	25,446.45	0.00	98,779.20	0.00	0.
206476	追保	130.86	正常	74.01	114,194.97	0.00	575,053.00	0.00	0.
206758	追保	113.05	正常	56.52	1,119.50	0.00	2,911.00	0.00	0.
207091	追保	100.99	正常	54.38	77,823.68	0.00	172,263.00	0.00	0.
207619	追保	101.19	正常	60.71	1,980.47	0.00	5,101.00	0.00	0.
516371	追保	101.13	正常	54.46	182,857.78	0.00	406,048.50	0.00	0.
611295	追保	114.11	正常	95.09	247.50	0.00	5,751.00	0.00	0.
612093	追保	101.04	正常	50.52	1,427.50	0.00	2,915.00	0.00	0.
612263	追保	100.04	正常	62.97	8,157.50	0.00	22,037.40	0.00	0.
612412	追保	100.64	正常	60.25	658,988.53	0.00	1,668,175.00	0.00	0.
612469	追保	105.44	正常	64.88	39,447.24	0.00	118,443.00	0.00	0.
630170	追保	101.57	正常	50.78	1,410.57	0.00	2,911.00	0.00	0.
660063	追保	100.22	正常	54.42	44,995.40	0.00	98,934.25	0.00	0.
80000061	追保	100.66	正常	61.94	9,336.98	0.00	24,694.80	0.00	0.
汇总					290,531,403.03	1,000,0...	170,566,34...	0.00	0

图 2.2.1-2

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 2.2.1-3。

用户在【投资者】、【投资者名称】输入框中输入投资者代码或者名称，回车后可以选出指定的投资者资金纪录；或者用鼠标选中该视图，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】、【特殊标志】筛选条件中复选多个条件，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。

如果需要查看某投资者的持仓、成交、报单数据，鼠标双击该投资者资金记录，该投资者将被选中到【已选投资者列表】中，该投资者的持仓、成交、报单数据将显示在相应的信息界面中。如果需要查看多个投资者的持仓、成交、报单数据，选中多个投资者（目前系统

支持【Ctrl】、【Ctrl】+【a】、【Shift】键来选中多个投资者），鼠标右击，在弹出的下拉框中选择【发送已选择】按钮即可。



图 2.2.1-3

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。

◆ 选项配置

用户可以通过视图选项中的投资者资金信息设置以下配置：

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投资者资金信息视图中,无论下面的过滤设置怎么配置;该配置只有在【过滤设置】中配置了过滤条件对投资者资金信息进行过滤,才会生效。

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投资者资金信息中;

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。

勾选【支持特殊投资者过滤】,系统将标识特殊投资者,在投资者资金信息、资金查询、持仓查询、批量强平界面加上【特殊标志】查询过滤条件。

3. 风险警示设置

警示阈值和强平阈值可以由用户自定义。警示阈值可在【警示 >】输入框中自定义修改;如果需要自定义强平阈值,则勾选【使用风险度定义强平】,在后面的输入框中自定义强平的风险度阈值;取消该勾选时仍然使用默认算法。

对于不同的风险度计算方法,自定义阈值有对应的范围限制;当设定的值超出范围,按【保存设置】时系统将会提示。注意强平阈值的修改需要对应的风控权限才能进行,无权限时无法勾选或修改该项。

4. 风险度计算方法

系统提供四种算法;在综合交易平台-交易管理-经济公司参数设置界面可以设置风险度计算方法,以及是否全局有效,该平台设置下一交易日生效;如果该平台设置中的【风险度算法全局有效】为是,那么【风险度计算方法】不能修改,使用平台设置中指定的【风险算

法】；如果该平台设置中的【风险度算法全局有效】为否，那么【风险度计算方法】可以修改，日初第一次登陆时使用平台设置中指定的【风险算法】，之后沿用上一次修改后的算法；

5. 数据刷新频率设置：刷新闻隔必须为大于0的整数；

6. 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；

7. 数据格式设置

勾选【表示资金的数字使用千位分隔符】，保存设置后，所有视图中的资金相关项显示都带千分位分割符；

8. 组织架构显示级别

勾选【自定义组织架构名称显示】，选择要显示的组织架构级别，保存设置后，投资者资金信息视图中的组织架构名称列即可显示多个级别。其中1级为最底层架构，5级为最高层架构；如无该级别组织架构，则显示为空。

所有设置在确认【保存设置】后实时生效。如图 2.2.1-4。

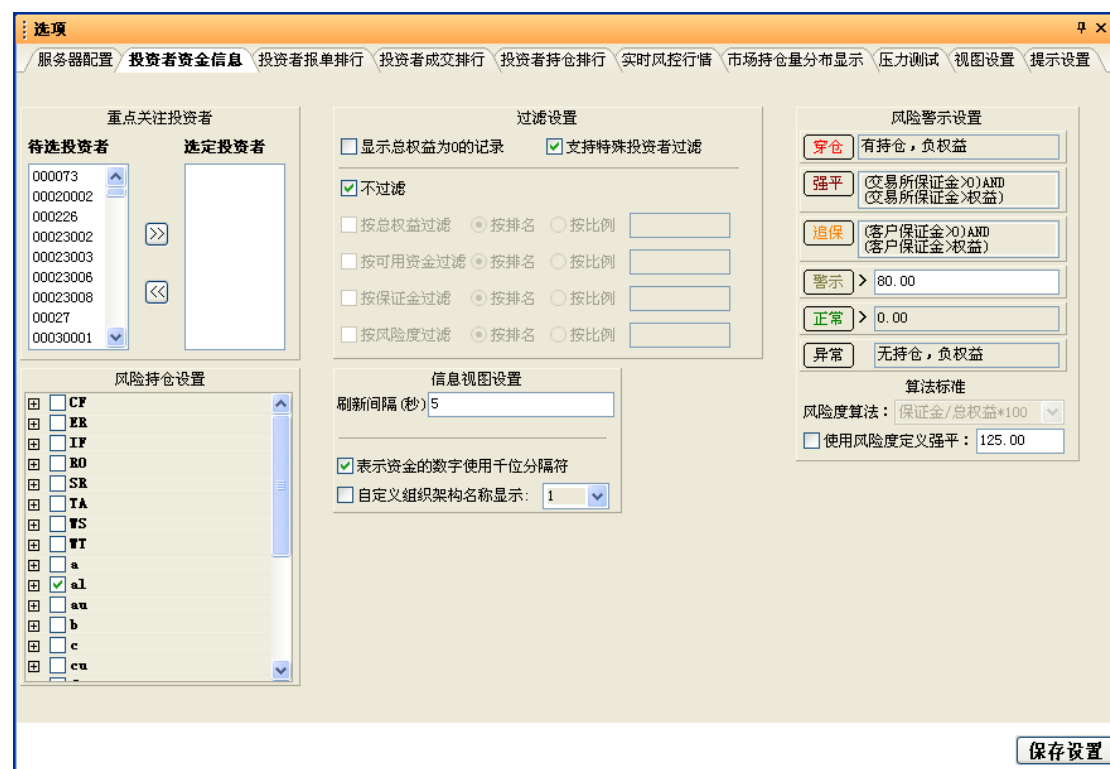


图 2.2.1-4

2.2.2 特别关注投资者信息

给用户提供一个界面来监控用户认为需要特别关注的某些投资者，功能以及使用方式同投资者资金信息界面。

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【信息】->【特别关注投资者信息】，打开特别关注投资者信息界面。如图 2.2.2-1。

◆ 界面说明

1. 新增特别关注投资者

用户可以通过在投资者资金信息视图中，选中某条投资者资金记录，或者按住【Ctrl】键多选几条投资者，再右击鼠标，在弹出的下列框中选择【添加关注】，如图 2.2.2-2，该单个或者多个投资者就会添加到特别关注投资者信息视图。

用户还可以在特别关注投资者信息界面上方的【投资者代码：】框中输入投资者代码，多个投资者代码之前用英文字符逗号隔开，点击【添加】按钮，即可将指定投资者添加到特别关注投资者列表中。

2. 删除特别关注投资者

如果需要取消该投资者的特别关注，则鼠标右击该投资者资金记录，在弹出的下拉框中选择【删除投资者】即可；

也可以鼠标选中某投资者后，点击【删除选中的投资者】按钮；

【删除所有投资者】按钮用于删除列表中的所有投资者。

3. 查看投资者持仓报单等信息

如果需要查看某投资者的持仓、成交、报单、基本信息数据，鼠标双击该投资者资金记录，该投资者将被选中到【已选投资者列表】中，该投资者的持仓、成交、报单、基本信息数据将显示在相应的信息界面中。如果需要查看多个投资者的持仓、成交、报单、基本信息数据，选中多个投资者（目前系统支持【Ctrl】、【Ctrl】+【a】、【Shift】键来选中多个投资者），鼠标右击，在弹出的下拉框中选择【发送已选择】按钮即可。

特别关注投资者信息

投资者代码：

添加

删除所有投资者

删除选中的投资者

投资者代码	风险状态	风险度	投资者帐号	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	上次质押	上次资金冻结	上次可用	昨
611116	异常	-0.00	611116	异常	-0.00	-18,086.00	0.00	0.00	-18,086.00	-1
207655	穿仓	-4.47	207655	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	0.00	-400,987.69	-3
201276	强平	164.73	201276	强平	101.79	-1,160.10	0.00	0.00	-42,021.10	6
203908	强平	251.04	203908	强平	125.52	-6,214.50	0.00	0.00	-36,781.50	2
201220	追保	100.06	201220		41.69	11,093.80	0.00	0.00	-11.00	19
206758	追保	113.13	206758		56.52	1,119.50	0.00	0.00	-336.00	2
汇总						-406,104.99	0.00	0.00	-498,111.10	-2

图 2.2.2-1

投资者资金信息

投资者代码：投资者名称：

组织架构

风险状态：交易所风险状态：特殊标志：

投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费
207655	穿仓	-4.47	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	17,141.50	0.00
201276	强平	164.73	强平	101.79	-1,160.10	0.00	106,953.80	0.00
203908	强平	251.04	强平	125.52	-6,214.50	0.00	61,131.00	0.00
201220	追保	100.06	正常	41.69	11,093.80	0.00	19,038.80	0.00
201885	追保	105.13	正常	6.63	151,583.51	0.00	367,424.20	0.00
206087	追保	101.34	正常	0.80	2,023.44	0.00	5,231.00	0.00
206262	追保	108.28	正常	2.63	45,228.20	0.00	131,065.10	0.00
206391	追保	114.55	正常	0.49	25,446.45	0.00	98,779.20	0.00
206476	追保	130.86	正常	4.01	114,194.97	0.00	575,053.00	0.00
206758	追保	113.05	正常	6.52	1,119.50	0.00	2,911.00	0.00
207091	追保	100.99	正常	4.38	77,823.68	0.00	172,263.00	0.00
207619	追保	101.19	正常	0.71	1,980.47	0.00	5,101.00	0.00
516371	追保	101.13	正常	54.46	182,857.78	0.00	406,048.50	0.00

图 2.2.2-2

2.2.3 已选投资者列表

◆ 打开方式

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

◆ 界面说明

双击投资者资金信息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。

用户可以通过在投资者资金信息视图中，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。用户可以通过在投资者资金信息视图中鼠标右击，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 2.2.3-1。

投资者资金信息

投资者代码： 投资者名称： 组织架构：

风险状态： 交易所风险状态： 特殊标志：

投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费
207655	穿仓	-4.47	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	17,141.50	0.
201276	强平	164.73	强平	101.79	-1,160.10	0.00	106,953.80	0.
203908	强平	251.04	强平	125.52	-6,214.50	0.00	61,131.00	0.
201220	追保	100.06	正常	1.69	11,093.80	0.00	19,036.80	0.
201885	追保	105.13	正常	6.63	151,583.51	0.00	367,424.20	0.
206087	追保	101.34	正常	0.80	2,023.44	0.00	5,231.00	0.
206262	追保	108.28	正常	2.63	45,228.20	0.00	131,065.10	0.
206391	追保	114.55	正常	0.49	25,446.45	0.00	98,779.20	0.
206476	追保	130.86	正常	4.01	114,194.97	0.00	575,053.00	0.
206758	追保	113.05	正常	6.52	1,119.50	0.00	2,911.00	0.
207091	追保	100.99	正常	4.38	77,823.68	0.00	172,263.00	0.
207619	追保	101.19	正常	0.71	1,980.47	0.00	5,101.00	0.
516371	追保	101.13	正常	54.46	182,857.78	0.00	406,048.50	0.

发送已选择

发送全部

添加关注

风险通知

电话通知

单客户强平

权益反向计算

图 2.2.3-1

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 2.2.3-2。

已选投资者列表									
投资者代码	风险状态	风险度	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	出入金	保证金	手续费	
000011	异常	-0.00	异常	-0.00	-100.00	0.00	0.00	0.00	
206906	异常	-0.00	异常	-0.00	-8,000.00	0.00	0.00	0.00	
611116	异常	-0.00	异常	-0.00	-18,086.00	0.00	0.00	0.00	
207655	穿仓	-4.47	强平	-2.36	-392,857.69	0.00	17,141.50	0.00	
201276	强平	164.73	强平	101.79	-1,160.10	0.00	106,953.80	0.00	
203908	强平	251.04	强平	125.52	-6,214.50	0.00	61,131.00	0.00	
201220	追保	100.06	正常	41.69	11,093.80	0.00	19,036.80	0.00	
201885	追保	105.13	正常	56.63	151,583.51	0.00	367,424.20	0.00	
206087	追保	101.34	正常	60.80	2,023.44	0.00	5,231.00	0.00	
206262	追保	108.28	正常	62.63	45,228.20	0.00	131,065.10	0.00	
206391	追保	114.55	正常	70.49	25,446.45	0.00	96,779.20	0.00	
206476	追保	130.86	正常	74.01	114,194.97	0.00	575,053.00	0.00	
206758	追保	113.05	正常	56.52	1,119.50	0.00	2,911.00	0.00	
207091	追保	100.99	正常	54.38	77,823.68	0.00	172,263.00	0.00	
207619	追保	101.19	正常	60.71	1,980.47	0.00	5,101.00	0.00	
516371	追保	101.13	正常	54.46	182,857.78	0.00	406,048.50	0.00	
611295	追保	114.11	正常	95.09	247.50	0.00	5,751.00	0.00	
612093	追保	101.04	正常	50.52	1,427.50	0.00	2,915.00	0.00	
612263	追保	100.04	正常	62.97	8,157.50	0.00	22,037.40	0.00	
612412	追保	100.64	正常	60.25	658,988.53	0.00	1,668,175.00	0.00	
612469	追保	105.44	正常	64.88	39,447.24	0.00	118,443.00	0.00	
630170	追保	101.57	正常	50.78	1,410.57	0.00	2,911.00	0.00	
660063	追保	100.22	正常	54.42	44,995.40	0.00	98,934.25	0.00	

图 2.2.3-2

2.2.4 投资者信息

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【信息】->【投资者信息】，打开投资者信息界面。

◆ 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，或者双击投资者资金信息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四个信息分窗口：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。用户可以通过点击上面的标签栏进行各窗口的切换。如图 2.2.4-1。

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	
字段	数值	字段	数值
投资者名称(代码)：	200062 (200062)	昨追加保证金：	
手机：		出入金：	1,000,000.00
电话：	3715941732	追加保证金：	
邮箱：		交易所追加：	
系统通知状态：	未通知	昨交易所追加：	
短信通知状态：	未通知	权益：	1,001,029.16
邮件通知状态：	未通知	历史强平次数：	0
分组代码：	09	是否活跃：	是

图 2.2.4-1

2.2.5 投资者报单信息



◆ 打开方式

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

◆ 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 2.2.5-1。

提供查询筛选条件：品种/合约、交易所、买卖方向、开平标志，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。

如果需要隐藏筛选条件栏，点击界面右上方的，在弹出的下拉框，取消选中【显示过滤条件】勾选框即可；如果需要恢复筛选条件栏，点击界面右上方的，重新选中【显示过滤条件】勾选框即可。

投资者报单信息												
品种/合约:		交易所:		买卖:		开平:		委托状态:				
投资者代码	合约	报单引用	价格类型	买卖	开平	投保	委托价	委托手数	强平原因	请求编号	本地报单编号	交易所 会员代码
610063	cu1010	2	限价	买	开	投机	61000...	1	非强平	214748...	1	SHFE 0266
610063	cu1010	3	限价	卖	开	投机	61000...	1	非强平	214748...	2	SHFE 0266
610063	al1011	4	限价	买	开	投机	17100...	1	非强平	214748...	3	SHFE 0266
610063	al1011	5	限价	卖	开	投机	17100...	1	非强平	214748...	4	SHFE 0266
买汇总								2				
卖汇总								2				

图 2.2.5-1

2.2.6 投资者成交信息



◆ 打开方式

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

◆ 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 2.2.6-1。

提供查询筛选条件：品种/合约、交易所、买卖方向、开平标志，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。

如果需要隐藏筛选条件栏，点击界面右上方的，在弹出的下拉框，取消选中【显示过滤条件】勾选框即可；如果需要恢复筛选条件栏，点击界面右上方的，重新选中【显示过滤条件】勾选框即可。

投资者成交信息												
品种/合约:		交易所:		买卖:		开平:						
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	成交手数	成交时间	成交
610063	al1010	1	买	1	0266	00116677	开仓	投机	17000...	1	09:21:53	
610063	al1010	1	卖	2	0266	00116677	开仓	投机	17000...	1	09:21:53	
610063	al1011	2	买	3	0266	00116677	开仓	投机	17100...	1	09:27:50	
610063	al1011	2	卖	4	0266	00116677	开仓	投机	17100...	1	09:27:50	
买汇总										2		
卖汇总										2		

图 2.2.6-1

2.2.7 投资者持仓信息



◆ 打开方式

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

◆ 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 2.2.7-1。

提供查询筛选条件：品种/合约、交易所、特殊标志（当在配置中选择【支持特殊投资者过滤】时生效），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。

如果需要隐藏筛选条件栏，点击界面右上方的，在弹出的下拉框，取消选中【显示过滤条件】勾选框即可；如果需要恢复筛选条件栏，点击界面右上方的，重新选中【显示过滤条件】勾选框即可。

投资者代码	合约	总买持	今买持	买可平	买均价	买冻结	买开仓均价	总卖持	今卖持	卖可平	卖均价	卖冻结	卖开仓均价
610063	cu1012	1	0	1	61470.00	0.00	61370.00	1	0	1	61470.00	0.00	61370.00
610063	ru1009	0	0	0	0.00	0.00	0.00	1	0	1	24260.00	0.00	24770.00
汇总		1	0	1	0.00			2	0	2	0.00		

图 2.2.7-1

2.2.8 投资者报单排行

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【信息】->【投资者报单排行】，打开投资者报单排行界面。
只拥有部分投资者数据权限的操作员，只能对其有权限的投资者进行排行。

◆ 界面说明

在【交易所/品种合约】中，通过下拉菜单选择交易所或品种合约，或在输入框手动输入交易所代码或合约代码，区分大小写，用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔。

点击【拆分添加】按钮，按所选交易所/品种合约全部拆分，分别增加排行分类。拆分粒度至所输入交易所/品种合约。

点击【合并添加】按钮，合并所选交易所/品种合约，添加一条在交易所/品种合约上的各项报单数汇总值的排行记录。

特殊处理说明：

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角加号【+】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【合并添加】。如输入【+SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【合并添加】执行；

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角逗号【,】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【拆分添加】。如输入【,SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【拆分添加】执行。
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角分号【;】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为拆分至合约。如输入【;SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都向下拆分至合约，即拆分至al1011、al1012、al1101...cu1011、cu1012、cu1101.....。

添加完以后，系统会根据添加的交易所/品种合约，显示当前场上的报单排行情况，如图 2.2.8-1。【删除所有】按钮，用于删除当前界面中所有的交易所/品种合约排行数据；【删除选中】按钮，用于删除鼠标选中的某交易所/品种合约排行数据。

投资者报单排行

交易所/品种合约:

拆分添加

合并添加

删除所有

删除选中

交易所...	经纪公司代码	投资者代码	总报单量	买报单量	卖报单量	净买入报单量	成交报单数	总报单数	成交比例	投资者名称
交易所/品种合约: SHFE										
SHFE	8000	062188	311	149	162	-13	144	160	90.00%	062188
SHFE	8000	000073	8	8	0	8	0	8	0.00%	000073
SHFE	8000	001888	6	2	4	-2	4	6	66.67%	001888
SHFE	8000	001879	4	2	2	0	4	4	100.00%	001879
SHFE	8000	065599	2	1	1	0	2	2	100.00%	王光华
SHFE	8000	005600	2	2	0	2	0	2	0.00%	005600

图 2.2.8-1

该视图支持按不同的列排行显示，用户可以通过鼠标左击列表头字段，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位的报单信息，鼠标左击总报单量列表头字段，视图将显示总报单量排行在前5位的报单信息。数据根据下面选项配置中的刷新频率刷新。

◆ 选项配置

用户可以通过视图选项中的投资者报单排行设置以下配置：

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报单统计信息，排名为负数时表示显示的是排名倒数几位的投资者报单统计信息；

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%的投资者报单统计信息，比例为负数时表示显示的是排名倒数N%的投资者报单统计信息；

3. 合约/品种分组设置：用于设置各报单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 2.2.8-2。



图 2.2.8-2

2.2.9 投资者成交排行

◆ 打开方式

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

◆ 界面说明

在【交易所/品种合约】中，通过下拉菜单选择交易所或品种合约，或在输入框手动输入交易所代码或合约代码，区分大小写，用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔。

点击【拆分添加】按钮，按所选交易所/品种合约全部拆分，分别增加排行分类。拆分粒度至所输入交易所/品种合约。

点击【合并添加】按钮，合并所选交易所/品种合约，添加一条在交易所/品种合约上的各项成交数汇总值的排行记录。

特殊处理说明：

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角加号【+】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【合并添加】。如输入【+SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【合并添加】执行；
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角逗号【,】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【拆分添加】。如输入【,SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【拆分添加】执行。
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角分号【;】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为拆分至合约。如输入【;SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都向下拆分至合约，即拆分至al1011、al1012、al1101...cu1011、cu1012、cu1101.....。

添加完以后，系统会根据添加的交易所/品种合约，显示当前场上的成交排行情况，如图 2.2.9-1。【删除所有】按钮，用于删除当前界面中所有的交易所/品种合约排行数据；【删除选中】按钮，用于删除鼠标选中的某交易所/品种合约排行数据。

该视图支持按不同的列排行显示，用户可以通过鼠标左击列表头字段，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位的报单信息。数据根据下面选项配置中的刷新频率刷新。

交易所/...	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
SHFE	8000	062188	294	25,582,850.00	141	12,275,600.00	153	13,307,250.00	
SHFE	8000	001888	4	1,246,300.00	2	623,150.00	2	623,150.00	
SHFE	8000	001879	4	360,000.00	2	180,000.00	2	180,000.00	
SHFE	8000	065599	2	170,000.00	1	85,000.00	1	85,000.00	

图 2.2.9-1

◆ 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2.2.9-2。



图 2.2.9-2

2.2.10 投资者持仓排行

◆ 打开方式

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

◆ 界面说明

在【交易所/品种合约】中，通过下拉菜单选择交易所或品种合约，或在输入框手动输入交易所代码或合约代码，区分大小写，用半角加号【+】或空格、逗号【,】、分号【;】分隔。

点击【拆分添加】按钮，按所选交易所/品种合约全部拆分，分别增加排行分类。拆分粒度至所输入交易所/品种合约。

点击【合并添加】按钮，合并所选交易所/品种合约，添加一条在交易所/品种合约上的各项持仓数汇总值的排行记录。

特殊处理说明：

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角加号【+】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【合并添加】。如输入【+SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或

【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【合并添加】执行；

- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角逗号【,】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为【拆分添加】。如输入【,SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都按【拆分添加】执行。
- 输入交易所/品种合约时，在代码前加上半角分号【;】，则添加交易所/品种合约时总是被认定为拆分至合约。如输入【;SHFE+m】，无论点击【拆分添加】或【合并添加】按钮，交易所/品种合约都向下拆分至合约，即拆分至al1011、al1012、al1101...cu1011、cu1012、cu1101.....。

添加完以后，系统会根据添加的交易所/品种合约，显示当前场上的持仓排行情况，如图 2.2.10-1。【删除所有】按钮，用于删除当前界面中所有的交易所/品种合约排行数据；【删除选中】按钮，用于删除鼠标选中的某交易所/品种合约排行数据。

该视图支持按不同的列排行显示，用户可以通过鼠标左击列表头字段，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，鼠标左击总持仓量列表头字段，视图将显示总持仓量排行在前5位的报单信息。数据根据下面选项配置中的刷新频率刷新。



投资者持仓排行

交易所/品种合约: 拆分添加 合并添加 删除所有 删除选中

交易所...	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	保值多头持仓	保值空头持仓	今仓
交易所/品种合约: SHFE											
SHFE	83040100	270	270	0	270	-270	0	270	0	0	
SHFE	83040063	260	260	0	260	-260	0	260	0	0	
SHFE	83040043	220	220	0	220	-220	0	220	0	0	
SHFE	81100281	196	196	0	196	-196	0	196	0	0	
SHFE	088399	125	125	0	125	-125	0	125	0	0	
SHFE	81080272	96	96	0	96	-96	0	96	0	0	
SHFE	031066	288	288	228	60	168	228	60	0	0	
SHFE	098657	50	50	0	50	-50	0	50	0	0	
SHFE	062188	68	80	34	46	-12	34	46	0	0	
SHFE	095155	40	40	0	40	-40	0	40	0	0	

图 2.2.10-1

◆ 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 2.2.8-2。



图 2.2.10-2

2.2.11 实时风控行情

◆ 打开方式

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

◆ 界面说明

在【合约】输入框中输入需要关注的合约，多合约以英文逗号标点隔开，点击【添加】

按钮，系统会根据添加的合约，显示当前场上行情，如图 2.2.11-1。【删除所有合约】按钮，用于删除当前界面中所有的合约数据；【删除选中的合约】按钮，用于删除鼠标选中的某合约数据。数据根据下面选项配置中的刷新频率实时刷新。

合约	最新价	成...	成交额	持仓量	昨结算	昨收盘	昨持仓	今开盘	最高价	最低价	今收盘	今结算	涨停价
al1005	16320▲	0	0.00	39710	16285	16320	39710						1709
al1006	16460▲	0	0.00	67180	16455	16460	67180						1727
al1007	16620	0	0.00	134870	16620	16620	134870						1745
al1008	16770▼	0	0.00	35756	16780	16770	35756						1761
al1009	16900▼	0	0.00	13080	16920	16900	13080						1776
al1010	17000▼	2	170,000.00	5856	17015	17020	5854	17000	17000	17000			1786
al1011	17100▼	2	171,000.00	2034	17105	17100	2032	17100	17100	17100			1796
al1012	17230▲	0	0.00	1554	17220	17230	1554						1806
al1101	17310▼	0	0.00	278	17325	17310	278						1819
al1102	17350	0	0.00	224	17350	17350	224						1821
al1103	17470▲	0	0.00	86	17460	17470	86						1833
al1104	17600▲	0	0.00	8	17550	17600	8						1842
au1005	252.10▲	0	0.00	18	251.06	252.10	18						263.6
au1006	252.00▲	0	0.00	12750	251.70	252.00	12750						264.2
au1007	251.07	0	0.00	66	251.07	251.07	66						263.6
au1008	252.06	0	0.00	34	252.06	252.06	34						264.6
au1009	253.21▲	0	0.00	64	252.37	253.21	64						264.9
au1010	251.86▼	0	0.00	88	252.30	251.86	88						264.9
au1011	252.89	0	0.00	26	252.89	252.89	26						265.9
au1012	252.50▼	0	0.00	39580	252.74	252.50	39580						265.3
au1101	253.40	0	0.00	14	253.40	253.40	14						266.0
au1102	253.66	0	0.00	66	253.66	253.66	66						266.7

图 2.2.11-1

◆ 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 2.2.11-2。



图 2.2.11-2

2.2.12 市场持仓量分布显示

◆ 打开方式

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

◆ 界面说明

在【品种/合约】输入框中输入需要关注的品种/合约，多品种/合约以英文逗号标点隔开，点击【添加】按钮，系统会根据添加的品种/合约，显示当前市场上该品种、合约持仓量情况，如图 2.2.12-1。

如果需要删除某持仓量分布图，选中该标签后，点击标签栏最右边的✕按钮，或者点击【删除选中的品种/合约】按钮，或者鼠标右击标签，在弹出的下拉框中选择【关闭】按钮，均可以完成删除操作。【删除所有品种/合约】按钮，用于删除当前界面中所有的品种/合约数据。

如果需要改变显示的颜色，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。

如果需要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】。

如果需要改变散户、中户、大户的持仓份额，详见下选项配置。

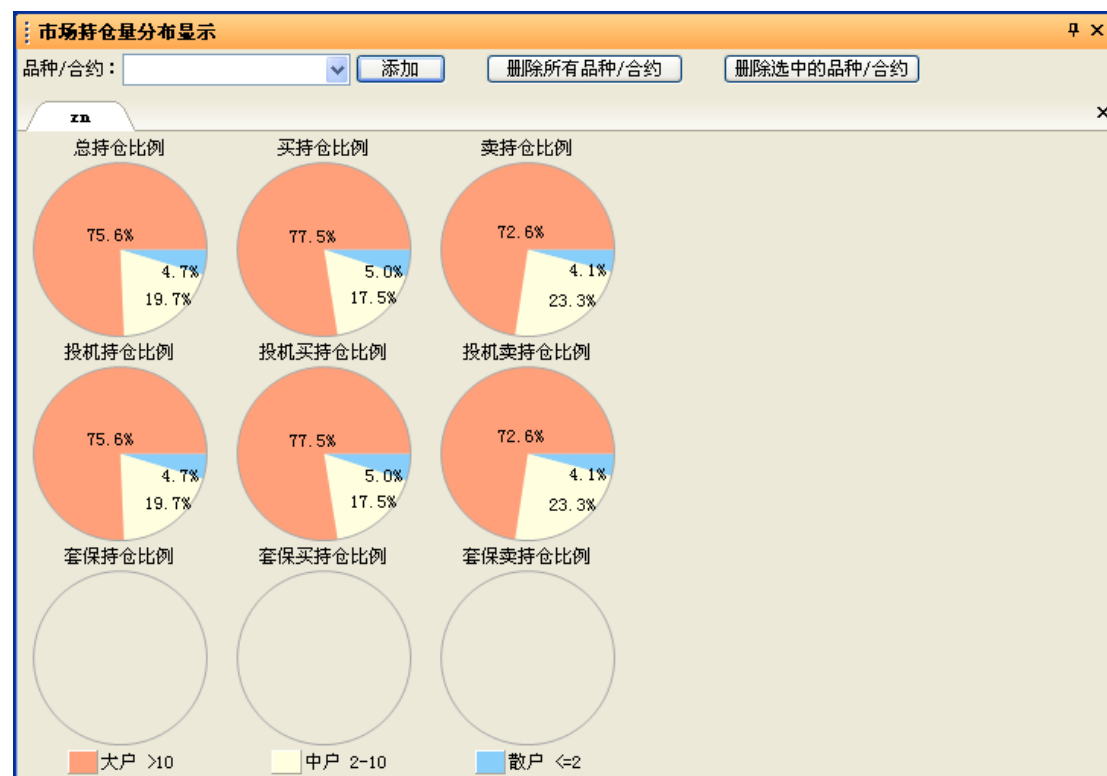


图 2.2.12-1

◆ 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 2.2.12-2。

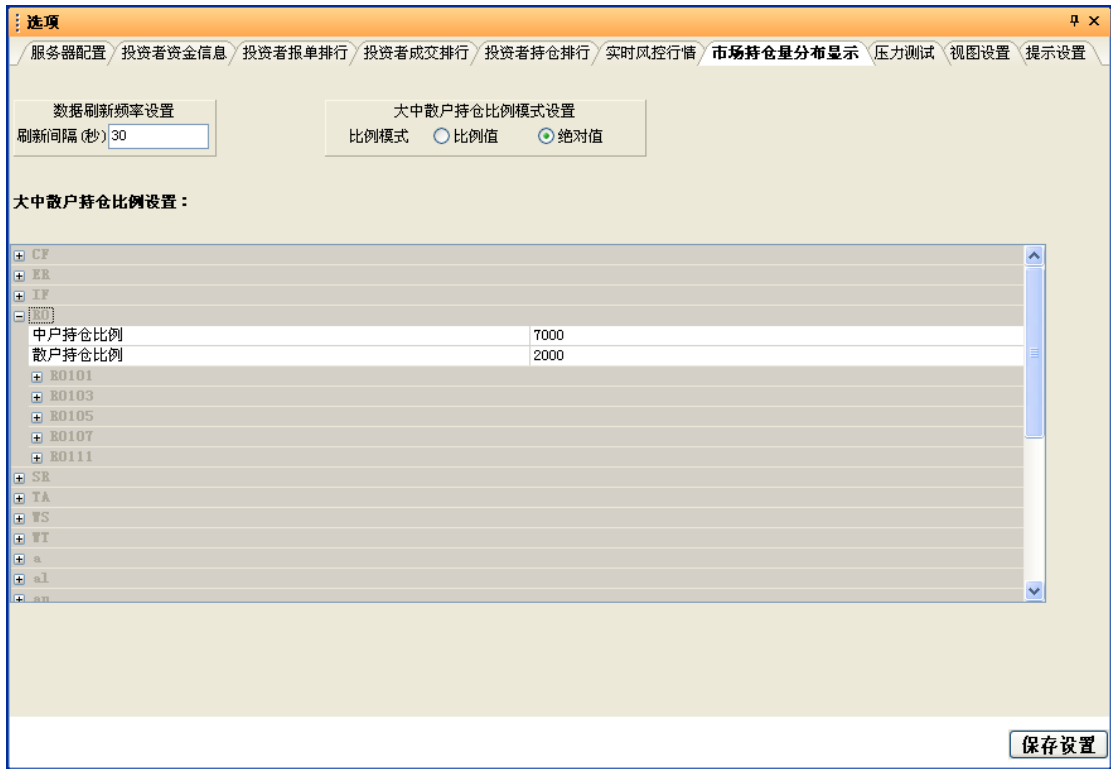


图 2.2.12-2

2.2.13 风险通知信息

◆ 打开方式

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

◆ 界面说明

该界面用于查询发送的风险通知信息，以及通知的状态跟踪，提供查询筛选条件：投资者代码、通知类型、通知途径、通知状态，如图 2.2.13-1。数据根据投资者资金信息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。

备注：

风险通知状态说明：

- 1. 未生成：没有在风控客户端手动/自动发送风险通知；
- 2. 已生成未发送：已经在风控客户端手动/自动发送了风险通知，但风控后台还没有发

送该风险通知；

- 3. 已发送未接收：在系统通知途径中该状态表示风控通知已经发送到客户端，但客户不在线；在短信/邮件通知途径中该状态表示已经将短信发送到短信运营商，但是还没有收到短信运营商的发送回执信息；
- 4. 已接收未确认：在系统通知途径中该状态表示客户在线；在短信通知途径中该状态表示收到短信运营商的发送成功回执信息；在邮件通知途径中表示收到邮件运营商的发送成功回执信息；
- 5. 发送失败：发送中出错；
- 6. 已确认：客户确认收到风险通知（目前系统不支持该状态）

风险通知信息										
投资者代码：		通知类型：		通知途径：		通知状态：				
经纪公司代码	用户代码	投资者代码	通知类型	通知途径	通知状态	事件序号	事件发生日期	事件发生时间	错误原因	风险
2080	system	860083	追保	系统通知	已发送未接收	16	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	611295	追保	系统通知	已发送未接收	17	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	630170	追保	系统通知	已发送未接收	18	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	516371	追保	系统通知	已发送未接收	19	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	207855	平仓	系统通知	已发送未接收	20	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	612469	追保	系统通知	已发送未接收	21	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	612412	追保	系统通知	已发送未接收	22	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	80000061	追保	系统通知	已发送未接收	23	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	612263	追保	系统通知	已发送未接收	24	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	612093	追保	系统通知	已发送未接收	25	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	201885	追保	系统通知	已发送未接收	26	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	206758	追保	系统通知	已发送未接收	27	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	201276	强平	系统通知	已发送未接收	28	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	201220	追保	系统通知	已发送未接收	29	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	206476	追保	系统通知	已发送未接收	30	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	206391	追保	系统通知	已发送未接收	31	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	206262	追保	系统通知	已发送未接收	32	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	206087	追保	系统通知	已发送未接收	33	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	207619	追保	系统通知	已发送未接收	34	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	203908	强平	系统通知	已发送未接收	35	20100427	11:23:04		尊敬
2080	system	207091	追保	系统通知	已发送未接收	36	20100427	11:23:04		尊敬

图 2.2.13-1

2.3 查询

各查询视窗的查看需要用户拥有对应的风控权限。

2.3.1 报单查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【报单查询】，如图 2.3.1-1，或者快捷键：【F4】键，打开报单查询界面。

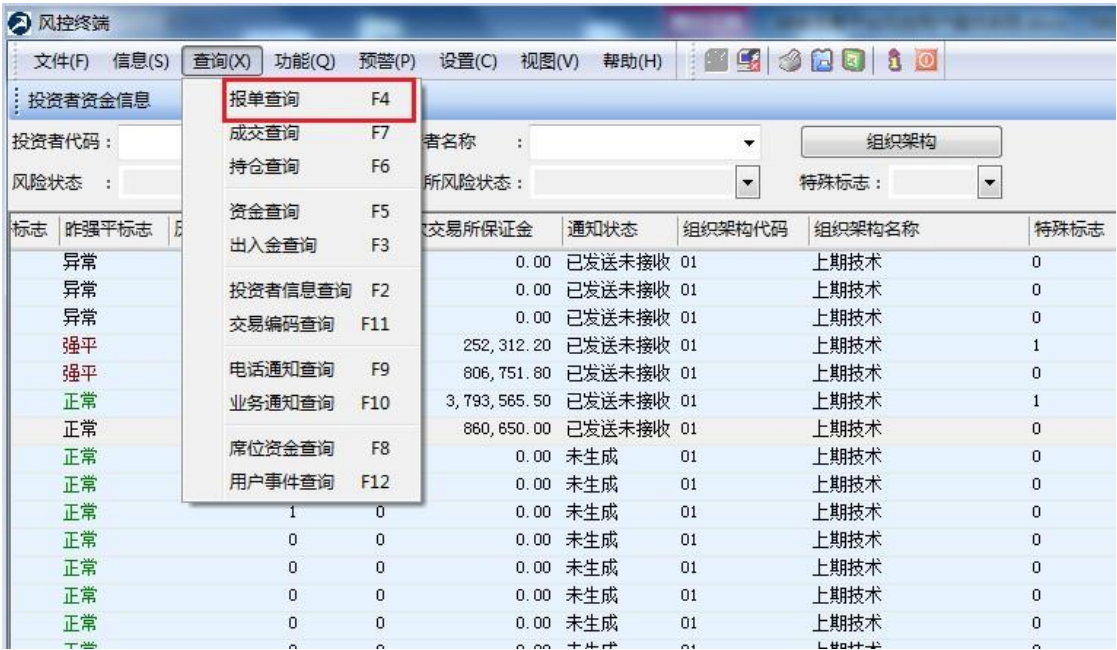


图 2.3.1-1

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、品种/合约、组织架构代码、状态、下单用户、席位，
【提交】按钮用于根据查询条件显示结果数据，【清除】按钮用于清空所有查询条件中的值，
如图 2.3.1-2。

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【;】为英文符号。

勾选【强平查询】，点击【提交】按钮，用户可查询公司强平报单情况。

报单查询

报单查询成交查询持仓查询资金查询出入金查询投资者信息查询交易编码查询电话通知查询业务通知查询席位资金查询用户事件查询

投资者代码 : 品种/合约 : 组织架构代码 : 状态 : 下单用户 : 席位 :

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	委托手数	强平原因	请求编号	本地报单编号	交易所	会员代码	交易编码
610006	rb1103	2	限价	买	开	投机	4860.00	1	非强平	194291...	2	SHFE	0266	00099676
610006	rb1103	1	限价	卖	开	投机	4860.00	1	非强平	194291...	1	SHFE	0266	00099676
610011	rb1103	3	限价	买	开	投机	4860.00	1	非强平	251	3	SHFE	0266	00111915
610011	rb1103	4	限价	卖	开	投机	4860.00	1	非强平	251	4	SHFE	0266	00111915
610011	rb1103	6	限价	买	开	投机	4860.00	10	非强平	251	6	SHFE	0266	00111915
610011	rb1103	5	限价	卖	开	投机	4860.00	10	非强平	251	5	SHFE	0266	00111915
610033	rb1103	7	限价	买	开	投机	4860.00	1	非强平	251	7	SHFE	0266	00116072
610063	rb1103	8	限价	卖	开	投机	4860.00	1	非强平	251	8	SHFE	0266	00116677
610063	rb1103	10	限价	买	开	投机	4860.00	1	非强平	251	10	SHFE	0266	00116677
610033	rb1103	9	限价	卖	平今	投机	4629.00	1	非强平	251	9	SHFE	0266	00116072
610006	rb1103	12	限价	买	平今	投机	4860.00	1	非强平	251	15	SHFE	0266	00099676
610006	rb1103	11	限价	卖	平今	投机	4629.00	1	非强平	251	11	SHFE	0266	00099676
610033	rb1103	13	限价	买	开	投机	4860.00	10	非强平	251	18	SHFE	0266	00116072
610033	rb1103	15	限价	买	开	投机	4860.00	5	非强平	251	21	SHFE	0266	00116072
买汇总								47						
卖汇总								37						

图 2.3.1-2

备注：自然人投资者，对于部分品种进入交割月交易所进行强平，系统显示强平原因：自然人临近交割。

2.3.2 成交查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【成交查询】，或者快捷键：【F7】键，打开成交查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、品种/合约、组织架构代码、下单用户、席位、投资者类型，具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.2-1。

勾选【强平查询】，点击【提交】按钮，用户可查询公司强平单的成交情况。

勾选【合并委托成交】，点击【提交】按钮，用户可查询属于同一委托单的成交的合并情况，【成交价】显示为同一委托单的成交均价。

勾选【自成交查询】，点击【提交】按钮，用户可查询投资者自买自卖情况。

成交查询

报单查询

成交查询

持仓查询

资金查询

出入金查询

投资者信息查询

交易编码查询

电话通知查询

业务通知查询

席位资金查询

用户事件查询

投资者代码 : 062188

品种/合约 :

组织架构代码 :

下单用户 :

席位 :

投资者类型 :

提交

清除

☐ 强平查询

☐ 合并同委托成交

☐ 自成交查询

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	成交手数	成交时间	成交类型	席位	本地报单编号
062188	al...	2	买	6	0081	00604073	开仓	投机	17310...	20	10:48:31		0081e4c	1
062188	al...	2	卖	7	0081	00604073	开仓	投机	17310...	20	10:48:31		0081e4c	2
062188	al...	3	买	10	0081	00604073	平今	投机	17310...	1	10:59:24		0081e4c	4
062188	al...	3	卖	9	0081	00604073	平今	投机	17310...	1	10:59:24		0081e4c	3
062188	al...	10	买	27	0081	00604073	开仓	投机	17310...	1	12:51:38		0081e4c	6
062188	al...	10	卖	26	0081	00604073	开仓	投机	17310...	1	12:51:38		0081e4c	5
062188	al...	11	买	29	0081	00604073	平今	投机	17310...	1	12:53:16		0081e4c	6
062188	al...	11	卖	28	0081	00604073	平今	投机	17310...	1	12:53:16		0081e4c	7
062188	al...	12	买	30	0081	00604073	开仓	投机	17310...	1	13:46:32		0081e4c	9
062188	al...	12	卖	31	0081	00604073	开仓	投机	17310...	1	13:46:32		0081e4c	10
062188	al...	13	买	33	0081	00604073	平今	投机	17310...	2	13:59:18		0081e4c	12
062188	al...	13	卖	32	0081	00604073	平今	投机	17310...	2	13:59:18		0081e4c	11
062188	al...	14	买	35	0081	00604073	平今	投机	17310...	1	06:50:55		0081e4c	14
买汇总										141				
卖汇总										153				
汇总										294				

图 2.3.2-1

2.3.3 持仓查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【持仓查询】，或者快捷键：【F6】键，打开持仓查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、品种/合约、组织架构代码、交易所、持仓方向、特殊标志（当在投资者资金信息配置中选择【支持特殊投资者过滤】时生效），具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.3-1。

持仓查询														
报单查询 成交查询 持仓查询 资金查询 出入金查询 投资者信息查询 交易编码查询 电话通知查询 业务通知查询 席位资金查询 用户事件查询														
投资者代码	:							品种/合约	:					
组织架构代码	:							交易所	:					
持仓方向	:							特殊标志	:					
提交		清除												
投资者代码	合约	总买持	今买持	买可平	买均价	买冻结	买开仓均价	总卖持	今卖持	卖可平	卖均价	卖冻结	卖...	平仓盈亏
205678	CF005	32	0	32	16550.00	0.00	16498.75	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
80000180	CF005	24	0	24	16550.00	0.00	16274.17	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
206821	CF007	40	0	40	16760.00	0.00	16757.50	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
80000180	CF007	20	0	20	16760.00	0.00	16635.00	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
205060	CF009	0	0	0	0.00	0.00	0.00	11	0	11	171...	0.00	169...	0.00
205396	CF009	0	0	0	0.00	0.00	0.00	60	0	60	171...	0.00	170...	0.00
205858	CF009	8	0	8	17115.00	0.00	16912.50	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
205715	CF009	2	0	2	17115.00	0.00	17180.00	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
205970	CF009	2	0	2	17115.00	0.00	17277.50	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
206106	CF009	1	0	1	17115.00	0.00	17100.00	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
207663	CF009	12	0	12	17115.00	0.00	17128.33	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
611349	CF009	0	0	0	0.00	0.00	0.00	1	0	1	171...	0.00	169...	0.00
612302	CF009	1	0	1	17115.00	0.00	16955.00	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
612369	CF009	0	0	0	0.00	0.00	0.00	2	0	2	171...	0.00	171...	0.00
612856	CF009	0	0	0	0.00	0.00	0.00	4	0	4	171...	0.00	171...	0.00
汇总		6569	24	6569		0.00		16473	24	16473		0.00		0.00

图 2.3.3-1

用户可以通过在持仓查询视图中，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，弹出【风险通知】图标，鼠标左击，则实现对投资者触发手工风险通知的快捷功能。如图 2.3.3-2。

持仓查询														
报单查询 成交查询 持仓查询 资金查询 出入金查询 投资者信息查询 交易编码查询 电话通知查询 业务通知查询														
投资者代码	:	354317						品种/合约	:					
组织架构代码	:							交易所	:					
持仓方向	:							特殊标志	:					
提交		清除												
投资者代码	合约	总买持	今买持	买可平	买均价	买冻结	买保证金	买开仓均价	总卖持	今卖持	卖可平	卖均价	卖冻结	卖...
354317	CF209	0	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00	30	0	0	0.00	0.00	0.00
354317	IF1206	1	0	1	2623.60	0.00	141,674.40	2620.20	0	0	0	0.00	0.00	0.00
354317	ME208	21	0	21	3083.00	0.00	485,572.50	3168.00	0	0	0	0.00	0.00	0.00
风险通知														
汇总		22	0	22		0.00	627,246.90		30	0				

图 2.3.3-2

2.3.4 资金查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【资金查询】，或者快捷键：【F5】键，打开资金查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、投资者名称、组织架构、特殊标志（当在投资者资金信息配置中选择【支持特殊投资者过滤】时生效），具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.4-1。

投资者代码	经纪公司代码	风险状态	风险度	投资者帐号	历史强...	交易所风险状态	交易所风险度	交易所可用资金	上次质押	上...
610063	2080	正常	3.17	610063		2 正常	1.95	9,788,878.64	0.00	
200062	2080	正常	25.13	200062		1 正常	15.46	85,241.16	0.00	
610006	2080	强平	3071...	610006		1 强平	1890.04	-14,768.56	0.00	
610011	2080	正常	54.76	610011		1 正常	33.70	283,196.96	0.00	
610033	2080	强平	3298...	610033		1 强平	2018.53	-38,568.56	0.00	
000011	2080	异常	-0.00	000011		0 异常	-0.00	-100.00	0.00	
100000	2080	正常	0.00	100000		0 正常	0.00	8.00	0.00	
100009	2080	正常	0.00	100009		0 正常	0.00	0.00	0.00	
1002	2080	正常	0.00	1002		0 正常	0.00	126,856.01	0.00	
100214	2080	正常	0.00	100214		0 正常	0.00	0.00	0.00	
112233	2080	正常	0.00	112233		0 正常	0.00	454,738.20	0.00	
200151	2080	正常	0.00	200151		0 正常	0.00	1,312.57	0.00	
200265	2080	正常	0.00	200265		0 正常	0.00	7.00	0.00	
200319	2080	正常	0.00	200319		0 正常	0.00	498.00	0.00	
200408	2080	正常	0.00	200408		0 正常	0.00	366.25	0.00	
200546	2080	正常	0.00	200546		0 正常	0.00	1,654.05	0.00	
汇总						6		289,091,840.85	1,249...	

图 2.3.4-1

2.3.5 出入金查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【出入金查询】，或者快捷键：【F6】键，打开出入金查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、出入金类型、组织架构代码、方向、有效标志，具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.5-1。

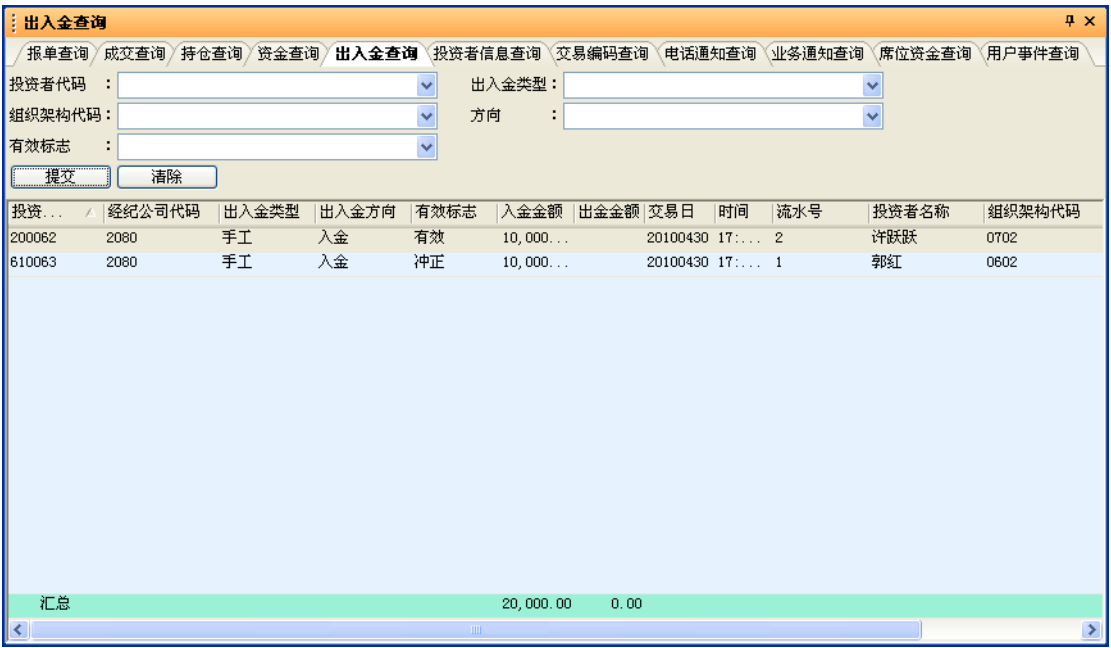


图 2.3.5-1

2.3.6 投资者信息查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【投资者信息查询】，或者快捷键：【F2】键，打开投资者信息查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、投资者名称、组织架构代码，具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.6-1。



图 2.3.6-1

2.3.7 交易编码查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【交易编码查询】，或者快捷键：【F11】键，打开交易编码查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、交易所代码、组织架构代码、交易编码类型，具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.7-1。



图 2.3.7-1

2.3.8 电话通知查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【电话通知查询】，或者快捷键：【F9】键，打开电话通知查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、组织架构代码、通知类型、通知状态，具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.8-1。



图 2.3.8-1

2.3.9 业务通知查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【业务通知查询】，或者快捷键：【F10】键，打开业务通知查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：投资者代码、组织架构代码、通知类型、通知状态，具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.9-1。



图 2.3.9-1

2.3.10 席位资金查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【席位资金查询】，或者快捷键：【F8】键，打开席位资金查询界面。

◆ 界面说明

提供查询筛选条件：交易所，具体使用方式和报单查询一样。如图 2.3.10-1。

交易所	经纪公...	会员代码	昨权益	保证金	平仓盈亏	权益	入金	出金	可用资金	保底资金	冻结保证金
SHFE	2080	0266	44,472,9...	31,083,4...	0.00	44,472,9...	0.00	0.00	13,389,5...	0.00	0.00
汇总			44,472,9...	31,083,4...	0.00	44,472,9...	0.00	0.00	13,389,5...	0.00	0.00

图 2.3.10-1

2.3.11 用户事件查询

◆ 打开方式

用户可以通过勾选菜单栏的【查询】->【用户事件查询】，或者快捷键：【F12】键，打开用户事件信息界面。

◆ 界面说明

用户可以根据【投资者代码】、【用户代码】、【组织架构代码】，选择【事件类型】，查询特定操作员或特定投资者的特定事件，如图 2.3.11-1。

勾选【自动刷新】，系统将根据【选项】-【投资者资金信息】中设定的信息视图刷新间隔，自动刷新该界面的记录。

用户事件查询								
报单查询 / 成交查询 / 持仓查询 / 资金查询 / 出入金查询 / 投资者信息查询 / 交易编码查询 / 电话通知查询 / 业务通知查询 / 席位资金查询 / 用户事件查询								
投资者代码 :		用户代码 :						
组织架构代码 :		事件类型 :						
提交		清除		<input checked="" type="checkbox"/> 自动刷新				
经纪公司代码	用户代码	用户事件类型	用户事件序号	事件发生日期	事件发生时间	用户事件信息	投资者代码	合约
2080	2080_admin	登录	1	20100430	15:55:22	用户登录: IP...	2080_admin	
2080	2080_admin	交易成功	2	20100430	15:55:44	报单: 卖 开...	610063	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	3	20100430	15:55:46	报单: 买 开...	610063	rb1103
2080	2080_admin	登出	4	20100430	17:40:38	用户登出: IP...	2080_admin	
2080	2080_admin	登录	5	20100430	09:03:51	用户登录: IP...	2080_admin	
2080	2080_admin	交易成功	6	20100430	10:54:12	报单: 买 开...	610063	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	7	20100430	10:54:16	报单: 卖 开...	610063	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	8	20100430	10:54:18	撤单: 交易所...	610063	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	9	20100430	13:51:29	报单: 卖 开...	610063	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	10	20100430	13:51:33	报单: 买 开...	610063	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	11	20100430	13:58:13	报单: 买 平...	610033	rb1103
2080	2080_admin	交易失败	12	20100430	13:58:18	报单失败: 综...	610033	rb1103
2080	2080_admin	交易失败	13	20100430	13:58:19	报单失败: 综...	610033	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	14	20100430	13:58:21	报单: 买 平...	610033	rb1103
2080	2080_admin	交易失败	15	20100430	13:58:39	报单失败: 综...	610011	rb1103
2080	2080_admin	交易失败	16	20100430	13:58:40	报单失败: 综...	610011	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	17	20100430	13:58:42	报单: 买 平...	610011	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	18	20100430	13:58:45	报单: 买 开...	610011	rb1103
2080	2080_admin	交易成功	19	20100430	13:58:57	报单: 卖 开...	610063	rb1103

图 2.3.11-1

3 风控权限说明

注：共三级权限

报单系统

|--交易所会员资金查询权限——控制【席位资金查询】界面的使用权限

风控系统

|--1 风控登录——控制风控客户端的登陆权限

|--2 风控信息——控制登录风控客户端后，【信息】、【查询】菜单下属界面的使用权限

|--2.1 资金查询——控制【投资者资金信息】、【资金查询】、【选项-投资者资金信息】、【已选投资者列表】、【特别关注投资者】、【权益预警】界面的使用权限

|--2.2 报单查询——控制【投资者报单信息】、【报单查询】、【报单预警】、【错单预警】、【投资者报单排行】、【选项-投资者报单排行】界面的使用权限

|--2.3 成交查询——控制【投资者成交信息】、【成交查询】、【成交预警】、【投资者成交排行】、【选项-投资者成交排行】界面的使用权限

|--2.4 持仓查询——控制【投资者持仓信息】、【持仓查询】、【持仓预警】、【投资者持仓排行】、【选项-投资者持仓排行】、【市场持仓量分布(仅适用对所有投资者有权限的用户)】、【选项-市场持仓量分布】界面的使用权限

|--2.5 行情查询——控制【实时风控行情】、【选项-实时风控行情】界面的使用权限

|--2.6 用户事件查询——控制【用户事件信息】界面的使用权限

|--2.7 风险通知查询——控制【风险通知信息】、【电话通知查询】界面的使用权限

|--2.8 出入金查询——控制【出入金查询】界面的使用权限

|--2.9 投资者信息查询——控制【投资者信息】、【投资者信息查询】界面的使用权限

|--2.10 交易编码查询——控制【交易编码查询】界面的使用权限

- |--2.11 业务通知查询——控制【业务通知查询】界面的使用权限
- |--3 风控功能——控制登陆风控客户端后，【功能】菜单栏下属的界面使用权限
 - |--3.1 强平——控制【强平设置】、【单客户强平】、【批量强平】、【预埋单】界面的使用权限，以及下强平单、预埋单、撤单的功能权限
 - |--3.2 压力测试——控制【压力测试】、【选项-压力测试】界面的使用权限
 - |--3.3 权益反算——控制【权益反算】、【批量权益反算】界面的使用权限
 - |--3.4 净持仓保证金指标——控制【净持仓保证金指标】界面的使用权限
 - |--3.5 风险预算——控制【风控预算】界面的使用权限
 - |--3.6 发送风险通知——控制手动发送风险通知、手动设置电话通知标志位的功能权限
 - |--3.7 数据导出——控制将界面数据导出至excel的功能权限，打印和打印预览的功能权限
 - |--3.8 行情预警——控制【行情预警】界面的使用权限
 - |--3.9 发送业务通知——控制手动发送业务通知的功能权限
- |--4 设置
 - |--4.1 风控指标设置——控制【风控指标设置】界面的使用权限
 - |--4.2 风险通知模板设置——控制【风险通知模板设置】界面的使用权限
 - |--4.3 业务通知模板设置——控制【业务通知模板设置】界面的使用权限
 - |--4.4 风控级别标准设置——控制【设置】->【选项】->【投资者资金信息】中【使用风险度定义强平】的功能及设置权限