上海证券交易所技术文档

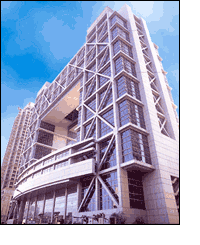
****

**上海证券交易所**

**新一代监察系统**

**常规查询**

**需求规格说明书**



**上海证券交易所**

**二○一七年十一月**

**修订记录**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **日期** | **版本** | **填写人** | **复核人** | **审核人** | **功能点** | **变更说明** |
| 201711 | V1.0 |  |  |  |  | 新一代监察系统常规查询需求规格说明书文档创建 |
| 20180910 | V1.0 |  |  |  |  | 删除如下章节内容：产品查询-订单簿查询、大小非减持监控、大宗交易查询、SET系统延迟查询、一码通账户查询、SET系统延迟查询、性能监控报告查询 |
| 20190319 | V1.0 |  |  |  |  | 修改需求与实现不一致的问题 |
| 20200902 | V1.0 | 刘瑶 | 鲁岳 | 王芳 | 产品查询-股票持有统计 | 细化期初期末相关指标的算法 |

**目 录**

[1 前言 5](#_Toc11736)

[1.1 背景 5](#_Toc32360)

[1.2 参考文档 6](#_Toc32062)

[1.3 名词定义 7](#_Toc21590)

[1.4 标识符定义 9](#_Toc9396)

[1.5 约定说明 10](#_Toc350)

[1.5.1 业务规则及法规等限制条件 10](#_Toc22017)

[1.5.2 其他约定 10](#_Toc23647)

[2 概述 10](#_Toc12259)

[2.1 系统目标 10](#_Toc26414)

[*2.2* 需求概述 11](#_Toc15033)

[*2.3* 系统相关方与交互 14](#_Toc26373)

[2.4 系统接口 15](#_Toc29638)

[3 用户及权限 15](#_Toc17736)

[3.1 用户 15](#_Toc9058)

[3.2 权限 15](#_Toc9064)

[4 功能需求 16](#_Toc24011)

[4.1 分析工具 17](#_Toc8945)

[4.1.1 常规查询 17](#_Toc19326)

[4.1.1.1 产品查询 17](#_Toc11020)

[4.1.1.2 参与者查询 210](#_Toc32052)

[4.1.1.3 市场统计查询 302](#_Toc32500)

[4.1.1.4 融资融券交易 358](#_Toc28926)

[4.1.1.5 股指期货查询 420](#_Toc21807)

[4.1.1.6 沪港通查询 430](#_Toc22810)

[4.1.1.7 多股同列 463](#_Toc23956)

[4.1.1.8 固定收益平台查询 471](#_Toc31334)

[4.1.1.9 优先股查询 502](#_Toc21594)

[4.1.1.10 减持监控查询 517](#_Toc26545)

[4.1.1.11 沪伦通查询 536](#_Toc29382)

[4.1.1.12 MSCI/分类投资者 555](#_Toc18477)

[4.1.1.13 国际指数标的监控 563](#_Toc21047)

[4.1.1.14 大宗交易查询 573](#_Toc2765)

[4.1.2 其他 583](#_Toc15517)

[4.1.2.1 重点监控查询 583](#_Toc13666)

[4.1.2.2 分类投资者查询 589](#_Toc32162)

[4.1.2.3 分类投资者申报查询 692](#_Toc13733)

[4.1.2.4 分类投资者持有查询 774](#_Toc8710)

[4.1.2.5 图表展示 839](#_Toc2966)

[4.1.2.6 融资融券定时任务 851](#_Toc16130)

[4.1.2.7 市场运行监控-账户 851](#_Toc8151)

[4.1.2.8 市场运行监控-机构 872](#_Toc27061)

[4.1.2.9 市场运行监控-证券 888](#_Toc28149)

[4.1.2.10 异常波动展示整合接入 900](#_Toc1754)

[4.1.2.11 异常波动展示系统-市场运行监测 903](#_Toc10669)

[4.1.2.12 门户整合 921](#_Toc7519)

[4.1.2.13 投资者画像链接展示 932](#_Toc32694)

[4.1.3 附录Ⅱ\_境外投资者持股比例盘前处理相关文件 932](#_Toc27291)

[4.2 批处理功能 935](#_Toc21919)

[4.2.1 分类1 935](#_Toc11562)

[4.2.1.1 总体流程 935](#_Toc18870)

[4.2.1.2 功能1 935](#_Toc957)

[4.2.1.3 功能2 935](#_Toc31513)

[5 非功能需求 936](#_Toc26466)

[5.1.1.1 性能和容量要求 936](#_Toc9055)

[5.1.1.2 可用性需求 936](#_Toc17677)

[5.1.1.3 安全性需求 936](#_Toc5758)

[5.1.1.4 可扩展需求 936](#_Toc6253)

# 前言

## 背景

证券市场是金融市场的重要组成部分，在金融市场体系中居重要地位。从20世纪90年代开始，中国证券市场经历了二十多年的发展历程，从不成熟逐步走向成熟，从监管缺位到监管逐渐完善，从初具规模到发展壮大，证券业已经成为中国国民经济中重要的行业。并逐步形成了以国务院证券监督管理机构、国务院证券监督管理机构的派出机构、证券交易所“三位一体”的监管体系和自律管理体系。按照“统一领导、共享资源、各司其职、各负其责、密切协作、合力监管”的原则开展工作，目的是形成一个分工明确、协调有序、运转顺畅、反应快速、监管有效的工作网络。各自的监管职责和范围明确，各方密切合作促进市场健康发展。

2015年，中国股市经历了有史以来最大波幅的震荡行情，从上半年的牛市冲天，到年中的大调整，再到下半年的反弹重建，充满了戏剧性。资本市场在各种利好消息的刺激下，在场内场外配资的杠杆效应的推动下，将一个本可以逐步健康增长，形成长期牛市的市场格局推动成一场资本狂欢。投资者经历了千股跌停、千股涨停、千股停牌，一年中见到了数十年难得一见的股市奇观。从“杠杆牛”“资金牛”，到“去杠杆”“挤泡沫”，危机不仅给了投资者一个深刻教训，更使证券市场监管面临前所未有的挑战。

以上交所为例，去年下半年以来，上交所按照“依法监管、从严监管、全面监管”的要求，充分发挥交易所一线监管优势，加大一线监管和自律监管措施的实施力度通过增强市场监察队伍力量、完善市场监察系统中实时监控模块、改造预警自动化系统，大幅提升了发现查处异常交易行为的力度，提升了自律监管的有效性。2016年上半年上交所共处理异常交易行为2275起，较去年全年增加92%；发出协查函、关注函等监管工作函件1201份，较去年全年增长24%；实施书面警示、盘中暂停账户交易等自律监管措施3205次，较去年全年增长76%。此外，还对4名严重违规的投资者采取了限制交易的纪律处分。交易所作为市场自律监管主体，凭借其一线监管优势，灵活、快速地响应市场变化，及时打击违法违规行为，全面保护投资者合法权益，有效保障市场公平、规范、稳定运行。

但是随着证券市场的发展，投资品种交易模式的增加和创新，为监管机构提出了更高的要求，尤其是处于监管一线的交易所。近两年来国内各大型交易所都开始根据新时期市场特点，在整合现有监管资源基础上，运用大数据技术，优化或进行新监察系统的规划和建设工作，通过的智能化监察工作平台，提升一线监管智能化水平。

上海证券交易所现在使用的监察系统是第三代监察系统，于2006年开始建设，2009年正式上线运行，目前已经运行了7年的时间，在证券市场监管中发挥着巨大的作用。但是，近年来市场交易量的巨幅增大，各类金融工具和交易模式创新呈现“井喷”态势，部分投资者利用自身技术优势，通过程序化交易进行频繁申报撤单等行为，导致证券市场异常交易形态较为复杂，异常交易行为呈现多发态势，给监管工作和监管系统带来了巨大的压力和挑战，导致原有3GSS系统在性能和功能上的不足之处逐渐体现，为监管工作带来了困难。现有市场监察业务及系统中面临的主要问题：

1. 根据市场异常交易及违规行为的发展态势，尚需对监管模式和预警指标体系进行完善和固化。
2. 数据的非集中管理、维度缺失、中间数据线下管理，导致监管分析维度缺失和复用困难。
3. 系统工作流程设计复杂，自动化程度低。
4. 系统的分散管理与功能缺失。
5. 系统易用性及可视化程度尚需完善。

上海证券交易所为了更好的以监察系统为依托，发挥一线监管的职责，启动了大数据平台暨新监察系统咨询项目，希望通过该咨询项目对现有市场监察业务现状和监管模型进行梳理，进一步构建更加合理、更加完善的交易所新监察业务模型，并在此基础对新一代监察系统进行规划，满足未来5-10年中国证券市场监察的需求。

## 参考文档

| **公开的** | |
| --- | --- |
| **序号** | **名称** |
| **规则** | |
| 1 | 《中华人民共和国证券法》 |
| 2 | 《上海证券交易所交易规则》 |

表 1‑1：参考资料“公开的”

| **非公开的** | |
| --- | --- |
| **序号** | **名称** |
| **规则** | |
| 1 | 《市场监察部管理制度和业务规则汇编》（2015年修订） |
| 2 | 《数据管理办法》（2009年修订） |
| 3 | 《监察系统接口规格说明书》（2016年修订） |
| 4 | 《监察部系统输出接口规格说明书》（2015年修订） |
| **访谈/调研** | |
| 5 | 《访谈纪要-专家组》 |
| 6 | 《访谈纪要-监察部》 |
| 7 | 《市场监察部调研纪要-实时组》 |
| 8 | 《市场监察部调研纪要-历史分析组》 |
| 9 | 《市场监察部调研纪要-稽核组》 |
| 10 | 《市场监察部调研纪要-创新组》 |
| **内部经验** | |
| 11 | 《市场监察业务平台改革方案》（2016年修订） |
| 12 | 《平台现有功能点梳理》 |
| 12 | 《实时主业务模块》 |
| 13 | 《历史分析组细节补充》 |
| 14 | 《新监察系统规划与设计》 |
| 15 | 《上海证券交易所数据仓库介绍》 |

表 1‑2：参考资料“非公开的”

## 名词定义

* 交易品种：在交易所交易的证券产品种类。目前包括股票，债券，基金，股票期权等，未来会有经证监会批准的其他交易品种。
* 股票：是一种有价证券。是股份有限公司发行的、用以证明投资者的股东身份和权益、并据以获取股息和红利的凭证。
* 衍生品：衍生品是一种其价值来源于基础金融工具的金融产品。基础金融工具包括股票、股票价格指数、固定利率债券、商品、货币等。权证和交易所交易的期权是典型的衍生品。
* 回购：公司将自己发行的股票或债券购回。回购的目的包括利用闲置现金，提高每股盈利，提高对公司的内部控制，获得股票以便用于员工股票期权计划或退休金计划。在这种情况下，也被称为公司回购。
* 质押式回购：指资金融入方（正回购方）在将债券出质给资金融出方(逆回购方）融入资金的同时，双方约定在将来某一日期由正回购方按约定回购利率计算的资金额向逆回购方返还资金，逆回购方向正向回购方返还原出质债券的融资行为。
* K线：是一条柱型的线条，由影线和实体组成。影线在实体上方的部分叫上影线，在实体下方的部分叫下影线。实体分阴线和阳线两种，又称红（阳）线和黑（阴）线。一条K线记录的是某一种股票一天的价格变动情况，将每天的K线按时间顺序排列在一起，就组成了这只股票上市以来的每天的价格变动情况，这就叫日K线图。
* 期货：期货是交易双方按约定价格在未来某一期间完成特定资产交易行为的一种方式，与远期合约相同。实质上是一种标准化的远期交易，一般在规范的交易所内进行。
* 股指期货：股指期货（Share Price Index Futures），全称是[股票价格指数](http://baike.baidu.com/view/157032.htm)期货，也可称为股价指数期货、期指，是指以[股价指数](http://baike.baidu.com/view/11036.htm)为[标的物](http://baike.baidu.com/view/609290.htm)的标准化期货合约，双方约定在未来的某个特定日期，可以按照事先确定的股价指数的大小，进行标的指数的买卖，到期后通过现金结算差价来进行交割。
* 期权：是一种选择权，期权的买方向卖方支付一定数额的权利金后，就获得这种权利，即拥有在一定时间内以一定的价格（执行价格）出售或购买一定数量的标的物（证券或期货合约）的权利。期权的买方行使权利时、卖方必须按期权合约规定的内容履行义务。相反，买方可以放弃行使权利。此时买方只是损失权利金，同时卖方则赚取权利金。
* 权证：是指标的证券发行人或其以外的第三人(以下简称发行人)发行的，约定持有人在规定期间内或特定到期日，有权按约定价格向发行人购买或出售标的证券，或以现金结算方式收取结算差价的有价证券，是一种股票期权。
* 债券：是一种确定债权债务关系的凭证，或者说是借款人向贷款人出具的对长期债务承担还本付息义务的凭证。
* 一码通：是指中国证券登记结算公司为所有的持有[证券账户](http://zhidao.baidu.com/question/1830477477582550660.html?gossl=http%3A%2F%2Fwww.baidu.com%2Fs%3Fwd%3D%25E8%25AF%2581%25E5%2588%25B8%25E8%25B4%25A6%25E6%2588%25B7%26tn%3D44039180_cpr%26fenlei%3Dmv6quAkxTZn0IZRqIHckPjm4nH00T1YknHK-P1K9mWFWnAw-PHKh0ZwV5Hcvrjm3rH6sPfKWUMw85HfYnjn4nH6sgvPsT6KdThsqpZwYTjCEQLGCpyw9Uz4Bmy-bIi4WUvYETgN-TLwGUv3EnH61njfLP1fLP1R3nWRdnjmvn0)（包括A股账户及[封闭式基金](http://zhidao.baidu.com/question/1830477477582550660.html?gossl=http%3A%2F%2Fwww.baidu.com%2Fs%3Fwd%3D%25E5%25B0%2581%25E9%2597%25AD%25E5%25BC%258F%25E5%259F%25BA%25E9%2587%2591%26tn%3D44039180_cpr%26fenlei%3Dmv6quAkxTZn0IZRqIHckPjm4nH00T1YknHK-P1K9mWFWnAw-PHKh0ZwV5Hcvrjm3rH6sPfKWUMw85HfYnjn4nH6sgvPsT6KdThsqpZwYTjCEQLGCpyw9Uz4Bmy-bIi4WUvYETgN-TLwGUv3EnH61njfLP1fLP1R3nWRdnjmvn0)账户）投资者配发[一码通账户](http://zhidao.baidu.com/question/1830477477582550660.html?gossl=http%3A%2F%2Fwww.baidu.com%2Fs%3Fwd%3D%25E4%25B8%2580%25E7%25A0%2581%25E9%2580%259A%25E8%25B4%25A6%25E6%2588%25B7%26tn%3D44039180_cpr%26fenlei%3Dmv6quAkxTZn0IZRqIHckPjm4nH00T1YknHK-P1K9mWFWnAw-PHKh0ZwV5Hcvrjm3rH6sPfKWUMw85HfYnjn4nH6sgvPsT6KdThsqpZwYTjCEQLGCpyw9Uz4Bmy-bIi4WUvYETgN-TLwGUv3EnH61njfLP1fLP1R3nWRdnjmvn0)，关联沪深A、B股等各类证券子账户。
* 沪港通：沪港通是指上海[证券交易所](http://baike.sogou.com/lemma/ShowInnerLink.htm?lemmaId=44118)和[香港联合交易所](http://baike.sogou.com/lemma/ShowInnerLink.htm?lemmaId=152408)允许两地投资者通过当地证券公司（或[经纪商](http://baike.sogou.com/lemma/ShowInnerLink.htm?lemmaId=69302641)）买卖规定范围内的对方交易所上市的股票，是沪港[股票](http://baike.sogou.com/lemma/ShowInnerLink.htm?lemmaId=49550)市场交易[互联互通](http://baike.sogou.com/lemma/ShowInnerLink.htm?lemmaId=10754608)机制。
* 功能权限：将单独的一个功能模块划分为一个功能权限。
* 板块：将具有相同属性的证券集合称之为一个板块。
* 重点监控：将某些对市场具有特殊影响力或用户感兴趣的产品和市场参与者划分出来特殊监控，对此类产品的监控称为重点监控。
* 半结构化数据(如公告数据、XBRL)：介于完全结构化数据（如关系型数据库、面向对象数据库中的数据）和完全无结构的数据（如声音、图像文件等）之间的数据。它一般是自描述的，数据的结构和内容混在一起，没有明显的区分。
* 非结构化：不方便用数据库二维逻辑表来表现的数据即称为非结构化数据，包括所有格式的办公文档、文本、图片、XML、HTML、各类报表、图像和音频/视频信息等。
* 结构化数据：即行数据，存储在数据库里，可以用二维表结构来逻辑表达实现的数据。
* 融资融券：融资融券交易(securities margin trading)又称“[证券信用交易](http://baike.baidu.com/view/1341833.htm)”或保证金交易，是指投资者向具有融资融券业务资格的证券公司提供担保物，借入资金买入证券（融资交易）或借入证券并卖出（融券交易）的行为。
* 订单簿：按照一定规则和顺序组织的订单的集合。
* 私募阳光化：就是给予私募证券投资基金合法地位，规范其运作方式，并对其进行有效的监管，使其成为我国资本市场一支重要的机构力量。
* 冷数据：大量的需要被长久、安全地保留或归档的数据。
* 列数据库：是以列相关存储架构进行数据存储的数据库，主要适合于批量数据处理和即时查询。
* 数据湖：是指一个大型的基于对象的存储库，以数据的原始格式保存数据，直到它需要被使用时。
* 指标阈值：主要采取统计分析方法，学习指标阈值设计，并根据市场变化提出阈值修改建议。
* 舆情分析：对互联网舆情进行跟踪和处理，提取舆情热点、情绪分析等辅助工具。
* 投资者画像：定时对系统中的投资者进行聚类分析，圈定值得加强监管的投资账户，挖掘账户关联关系。
* 行为分析：针对投资者的市场行为进行分析，对有可能存在违规的行为进行标记，持续跟踪。
* 自动化流程：根据用户操作历史数据和用户分类，自动推动流程处理，减少流程堵点，提高节点通过速度。

## 标识符定义

| 英文缩写 | 英文全称 | 中文全称 |
| --- | --- | --- |
| SSE | Shanghai Stock Exchange | 上海证券交易所 |
|  |  |  |

## 约定说明

### 业务规则及法规等限制条件

目前上交所明确定义的异常交易行为共14类，分别为：

1. 集合竞价虚假申报；

2. 盘中虚假申报；

3. 涨（跌）幅限制价格虚假申报；

4. 强化尾市涨跌停趋势的虚假申报；

5. 集合竞价异常申报；

6. 盘中异常申报；

7. 尾市异常申报；

8. 影响债券交易价格；

9. 影响交易所交易基金价格；

10. 大宗交易异常；

11. 自买自卖；

12. 约定交易；

13. 超限买入风险警示股票；

14. 其他规避监管意图明显，且多次实施，影响或可能证券交易秩序的以及交易所业务规则规定的其他证券异常交易行为。

### 其他约定

*无*

# 概述

## 系统目标

基于监察系统的现状和待解决的问题，以及新的监管要求，新监察系统的设计围绕以下目标，以期能够通过对监察系统的改造，解决监察系统的大部分问题，并落实新的监察要求，实现监察工作效能的全面改进和提升。主要达成以下五个目标：

**一是整合子系统和数据，消除系统割裂壁垒，建立全新的系统门户。**新监察系统采用统一监察平台的方式进行，消除因为系统切割而带来的流程互通和数据共享的壁垒，形成一套有机的整体。系统将采用统一门户、业务分类视图的组织方式，整合用户管理权限和业务审计，对系统功能进行重新组织规划，需支持灵活开发扩展。

**二是重构业务流程，优化操作模式，实现业务流程的标准化、自动化，沉淀监管经验。**新监察系统业务流程驱动分两大类：预警驱动类与事件驱动类。预警驱动类的业务流程通过新监察系统预警引擎触发，事件驱动类的业务流程则由外部门、外单位等触发，两类流程都将在新监察系统中转化为独立的任务。部门人员可在任务流转的同时调用分析工具和监管知识库功能辅助完成任务，相关的操作和结果将自动记入日志和监管知识库供后续审计、引用和分析。

**三是全新设计和扩展异常交易监测模型，完善对市场异常波动的识别能力。**首先，拓展监测维度。建立全新的市场运行监测与波动分析视图，从多个维度监测、展示市场整体运行状况，为盘中波动的快速分析与解读提供支持。其次，扩展预警监测范围。将预警从异常行为的实时预警扩展至线索分析的定时预警，对内幕交易、老鼠仓和跨期操纵等违法违规行为定期自动筛查和预警，主动开启核查。最后，优化预警实现和管理机制。通过建立预警实例的配置机制，将同样预警设置不同数据源、生效时间、监控对象、阈值等参数以激活不同的预警实例，灵活适应差异化监管的要求。

**四是集成数据源和分析工具集，增强违法违规线索的发现、分析和处理效率。**新监察系统将针对常规业务设计特定业务含义的分析工具，特定工具可根据业务规则和监管分析经验集成主要相关的数据、指标和分析工具，以提高分析的标准化和自动化，提升线索发现分析和上报的处理效率。新监察系统还将集成交易行为、历史监管的数据，并提供交易关联数据、历史监管数据的集成分析工具。此外，新监察系统将对舆情监测视图重新设计，最大程度地在数据库层面整合舆情数据、公告信息，和行情信息，形成舆情预警，减轻传统人工逐一核对的压力，提高系统的信息化和智能化水平。

**五是引入机器学习等人工智能新技术，提高一线监管工作水平。**新监察系统将结合市场监察部目前的联合研究计划成果，通过引机器学习、文本挖掘、知识图谱等新技术，拓宽市场监察思路，提升监管工作效能。同时，新监察系统也将依托本所未来的大数据平台，实现高性能、大容量、易扩展、易维护的要求，紧跟科技潮流，进一步提升科技监管的水平。

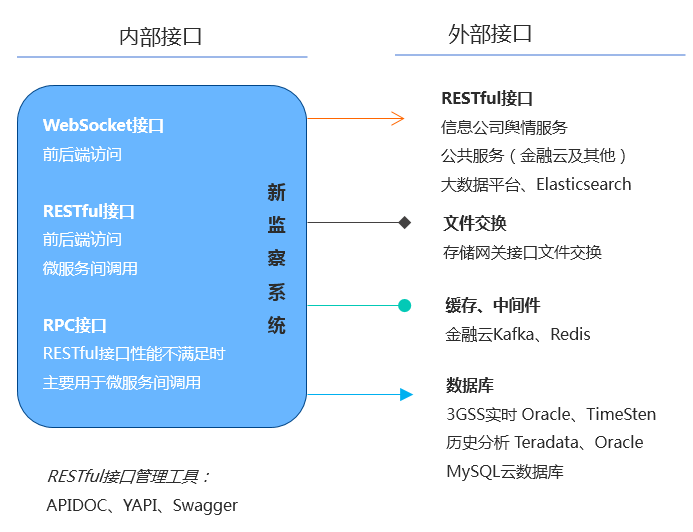
## 需求概述

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **视图** | **子视图** | **功能点** | **阶段** |
|
| 1 | 预警监控 | 预警列表 | 实时预警 | 1 |
| 2 | 历史预警（线索雷达） | 2 |
| 3 | 预警详情 | 预警信息展示 | 1 |
| 4 | 预警管理 | 预警模型 | 模型管理 | 2 |
| 5 | 模型上线 | 2 |
| 6 | 模型维护 | 2 |
| 7 | 模型下线 | 2 |
| 8 | 预警实例 | 实例管理 | 2 |
| 9 | 实例激活 | 2 |
| 10 | 实例参数配置 | 2 |
| 11 | 实例注销 | 2 |
| 12 | 预警评估 | 预警评估环境配置 | 2 |
| 13 | 预警模型评估 | 2 |
| 14 | 预警指标自动评估 | 2 |
| 15 | 舆情监控 | 舆情信息 | 舆情信息列表 | 2 |
| 16 | 舆情预警列表 | 2 |
| 17 | 舆情信息详情 | 2 |
| 18 | 市场运行监测 与波动分析 | 市场运行监测 | 市场行情 | 1 |
| 19 | 资金流向 | 1 |
| 20 | 异常交易统计 | 1 |
| 21 | 专项统计 | 分类投资者主动成交 | 1 |
| 22 | 市场流动性分析 | 1 |
| 23 | 大股东交易统计 | 1 |
| 24 | 程序化交易统计 | 1 |
| 25 | 市场波动预警 | 预警列表 | 1 |
| 26 | 预警详情 | 1 |
| 27 | 查询统计 | 穿透式查询 | 1 |
| 28 | 传统式查询 | 1 |
| 29 | 维稳监控 | 维稳监控模块 | 1 |
| 30 | 市场分析报告 | 市场分析报告模块 | 1 |
| 31 | 分析工具视图 | 查询工具 | 常规查询(3gss) |  |
| 32 | 数据综合查询（维度信息查询） | 1 |
| 33 | 数据综合查询（交易营业部变更查询） | 1 |
| 34 | 数据综合查询（成交明细及对倒明细查询） | 1 |
| 35 | 数据综合查询（港股通数据协查） | 1 |
| 36 | 数据综合查询（沪股通数据协查） | 1 |
| 37 | 数据综合查询（庄股协查） | 1 |
| 38 | 数据综合查询（基金反向交易查询） | 1 |
| 39 | 数据综合查询（账户行为追踪） | 1 |
| 40 | 数据综合查询（异常波动分析） | 1 |
| 41 | 数据综合查询（档位明细查询） | 1 |
| 42 | 自定义查询（集合竞价虚拟交易） | 1 |
| 43 | 自定义查询（私募季报） | 1 |
| 44 | 自定义查询（收益互换统计） | 1 |
| 45 | 自定义查询（回购越权交易） | 1 |
| 46 | 重点账户和股票监控(3gss) | 1 |
| 47 | 特定工具 | 趋同交易 | 1 |
| 48 | 内幕交易 | 1 |
| 49 | 操纵分析 | 1 |
| 50 | 账户组关联性分析 | 1 |
| 51 | 盈利计算 | 1 |
| 52 | 标准化数据协查模块 | 2 |
| 53 | 数据浏览器 | 1 |
| 54 | 网络黑嘴识别 | 2 |
| 55 | 报告生成 | 系统自动发送 | 2 |
| 56 | 下载邮件发送 | 2 |
| 57 | 工作日志 登记工具 | 工作日志登记 | 2 |
| 58 | 工作日志查询显示 | 2 |
| 59 | 知识库 | 知识库子视图 | 法律法规、交易规则 | 1 |
| 60 | 监察业务及技术文档 | 1 |
| 61 | 文档模板 | 1 |
| 62 | 会议纪要 | 1 |
| 63 | 监管历史库 | 预警历史信息 | 1 |
| 64 | 异常行为历史信息 | 1 |
| 65 | 自律监管历史信息 | 1 |
| 66 | 线索报告历史信息 | 1 |
| 67 | 全景搜索（代码/账户/一码通/关键字模糊搜索） | 1 |
| 68 | 投资者画像 | 2 |
| 69 | 公司画像 | 2 |
| 70 | 监察任务 | 预警处理 | 预警处理流程 | 1 |
| 71 | 联合监管 | 联合监管发函流程 | 1 |
| 72 | 联合监管复函流程 | 1 |
| 73 | 自律监管 | 标准化 | 1 |
| 74 | 差异化 | 1 |
| 75 | 纪律处分 | 1 |
| 76 | 调取资料流程 | 标准化 | 1 |
| 77 | 自定义 | 1 |
| 78 | 线索上报流程 | 线索上报流程 | 1 |
| 79 | 数据协查流程 | 数据协查流程 | 1 |
| 80 | 舆情分析流程 | 舆情分析流程 | 1 |
| 81 | 市场分析报告流程 | 市场分析报告流程 | 1 |
| 82 | 专项工作流程 | 专项工作流程 | 2 |
| 83 | 临时计算流程 | 临时计算流程 | 2 |
| 84 | 权限申请流程 | 权限申请流程 | 2 |
| 85 | 需求管理流程 | 需求管理流程 | 2 |
| 86 | 日志审计流程 | 日志审计流程 | 2 |
| 87 | 其它监察任务流程 | 其它监察任务流程 | 2 |
| 88 | 系统管理 | 工作流管理 | 工作流程配置维护 | 1 |
| 89 | 人员权限管理 | 用户及角色管理 | 1 |
| 90 | 角色及权限管理 | 1 |
| 91 | 系统参数管理 | 1 |
| 92 | 工作统计 | 预警数据统计 | 预警数据统计 | 1 |
| 93 | 异常行为统计 | 异常行为统计 | 1 |
| 94 | 自律监管统计 | 自律监管统计 | 1 |
| 95 | 线索报告统计 | 线索上报统计 | 1 |
| 96 | 联合监管发函统计 | 1 |
| 97 | 联合监管复函统计 | 1 |
| 98 | 舆情监测统计 | 2 |
| 99 | 数据协查统计 | 数据协查统计 | 1 |
| 100 | 工作量统计 | 工作量统计 | 1 |
| 101 | 工作统计数据浏览器 | 2 |
| 102 | 业务审计 | 操作日志审计 | 操作日志审计 | 2 |
| 103 | 业务内部审计 | 业务周期内部审计 | 2 |

## 系统相关方与交互



## 系统接口



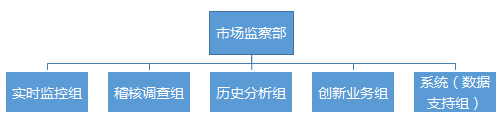
# 用户及权限

## 用户

根据部门工作职责内设5个业务小组：实时监控组、稽核调查组、历史分析组、创新业务组、系统（数据）支持组。

## 权限

根据部门工作职责内设5个业务小组：



图监察部业务小组

* 实时监控组：是日常交易一线监管者，借助实时监察系统和预警机制，对证券交易活动进行实时监控，发现异常交易行为并及时报告或转出调查，并负责日常市场移动情况报告。
* 稽核调查组：承担异常交易行为调查、分析职责，并根据行为严重程度采取递进式的自律监管措施。
* 历史分析组：主要工作职责是使用市场分析工具，对历史交易数据进行分析，将涉嫌违法违规的交易行为作为线索上报证监会调查，同时协助证监会等相关机构进行数据协查，案件调查工作。
* 创新业务组：负责舆情监控与筛查工作，及对市场新问题、新热点及新型违法违规交易行为的研究工作。
* 系统（数据）支持组：是监察系统的功能、性能优化及系统规划和需求的管理者，并对数据协查工作提供相应技术支持。