



平安证券 PB 投资管理系统

机构客户端

用户手册

(恒生版)

PB 业务事业部

2017 年 4 月

目 录

| | |
|--------------------|----|
| 目 录 | 2 |
| 欢迎使用 PB 机构客户端..... | 6 |
| 文档大纲..... | 6 |
| 系统环境要求..... | 6 |
| 第一章 系统入门..... | 7 |
| 1.1 系统简介..... | 7 |
| 1.2 账户结构..... | 8 |
| 1.3 系统界面介绍..... | 9 |
| 1.3.1 系统登录..... | 9 |
| 1.3.2 系统界面..... | 11 |
| 1.3.3 其它常用功能..... | 15 |
| 1.4 布局设置..... | 29 |
| 第二章 基础设置..... | 31 |
| 2.1 账户维护..... | 31 |
| 2.2 角色维护..... | 33 |
| 2.3 人员维护..... | 36 |
| 2.4 业务提醒设置..... | 42 |
| 第三章 财务管理..... | 46 |
| 3.1 资金管理..... | 46 |
| 3.2 证券管理..... | 53 |

| | |
|-------------------------|----|
| 3.3 费用设置 | 55 |
| 第四章 风险控制 | 57 |
| 4.1 投资风险设置 | 57 |
| 4.2 参数设置 | 66 |
| 4.3 风险类型介绍 | 67 |
| ● A 证券持仓数量控制 | 67 |
| ● B 证券持仓成本控制 | 69 |
| ● C 证券持仓市值控制 | 71 |
| ● D 证券市值按行业控制（社保） | 73 |
| ● E 资产类别市值控制 | 75 |
| ● F 交易额控制 | 77 |
| ● G 当日交易量/市场成交量控制 | 80 |
| ● H 执行价格控制 | 83 |
| ● I 证券买卖控制 | 85 |
| ● J 同向反向控制 | 86 |
| ● K 剩余天数控制 | 89 |
| ● L 到期回购资产控制 | 90 |
| ● R 期货保证金控制 | 92 |
| 4.4 风控预警查询 | 94 |
| 4.5 静态风控查询 | 95 |
| 4.6 证券池管理 | 96 |
| 4.6.1 证券池界面 | 96 |

| | |
|------------------------|-----|
| 4.6.2 证券池设置..... | 97 |
| 4.7 风险监控设置..... | 98 |
| 4.7.1 监控设置..... | 99 |
| 4.7.2 执行计划设置..... | 100 |
| 4.7.3 监控启/停用..... | 101 |
| 4.8 风险监控与处置..... | 102 |
| 第五章 信息查询..... | 103 |
| 5.1 委托成交查询..... | 103 |
| 5.2 流水查询..... | 106 |
| 5.3 资产分析..... | 108 |
| 5.3.1 产品资产查询..... | 108 |
| 5.3.2 单元资产查询..... | 112 |
| 5.3.3 现货持仓查询..... | 113 |
| 5.3.4 汇总证券查询..... | 115 |
| 5.3.5 交易所回购..... | 117 |
| 5.3.6 期货资产分析..... | 118 |
| 5.3.7 标准券查询..... | 121 |
| 5.3.8 可质押债券..... | 122 |
| 5.3.9 期货持仓查询..... | 123 |
| 5.3.10 非期货类资金数据..... | 125 |
| 5.3.11 非期货类资金数据明细..... | 125 |
| 5.3.12 维持担保比例监控..... | 126 |

| | |
|------------------------|-----|
| 5.3.13 ETF 投资端查询..... | 127 |
| 5.4 基础数据查询..... | 127 |
| 5.5 操作日志查询..... | 128 |
| 5.6 指令查询..... | 129 |
| 5.7 期权报表..... | 129 |
| 5.7.1 个股期权保证金..... | 130 |
| 5.7.2 期权盈亏统计..... | 133 |
| 5.7.3 期权持仓查询..... | 134 |
| 5.7.4 个股期权被行权指派表..... | 136 |
| 5.7.5 个股期权到期义务方监控..... | 137 |
| 5.7.6 期权交割日行权查询表..... | 138 |
| 5.8 新股申购信息查询..... | 139 |
| 5.9 投资建议查询..... | 141 |
| 5.10 可用资金明细查询..... | 142 |
| 5.11 方案查询..... | 142 |

欢迎使用 PB 机构客户端

文档大纲

平安 PB 投资管理系统（简称：PB）机构管理端手册包括以下部分：

第一章 系统入门

系统基础介绍、账户结构及主界面介绍。

第二章 基础设置

介绍账户维护、角色维护、人员维护等基础信息的设置。

第三章 财务管理

介绍资金管理、证券管理等相关操作和费用设置。

第四章 风险控制

介绍机构端风险控制相关操作。

第五章 信息查询

介绍系统各项数据报表。

系统环境要求

| 机构客户端推荐配置 | | | | | | |
|-----------|---|---------------------------|--------|--------|----|----------------------------|
| 名称 | 操作系统 | 系统配置：cpu 数量\ 核数\线程数\主频 | 内存 (G) | 硬盘 (G) | 网卡 | 带宽 |
| RC(客户端) | windows7 64 位 (推荐) windows10 64 位 | 1\4\-\- | >=4 | >=80 | 1 | 单客户端独 占 2M 以上， 推荐 4M |

第一章 系统入门

1.1 系统简介

平安 PB 投资管理系统采用三层架构设计模型，底层数据访问层采用大型的 Oracle 数据库，支持 oracle10g，oracle11g，数据本身可以保存在存储上，安全稳定；中间服务层业务逻辑计算采用恒生自主研发的 ASAR 中间件，支持 LINUX 或者 AIX 操作系统；数据展示和操作层只需要在使用者电脑上安装客户端连接服务器即可，既可以通过机构客户端程序进行投资交易操作，也可以使用对接的三方系统开展投资业务；整体系统架构安全、稳定，应用广泛。

平安 PB 投资管理系统主要包括券商管理端、机构客户端、统一接入平台、交易报盘通道等。其功能结构，如下图所示：

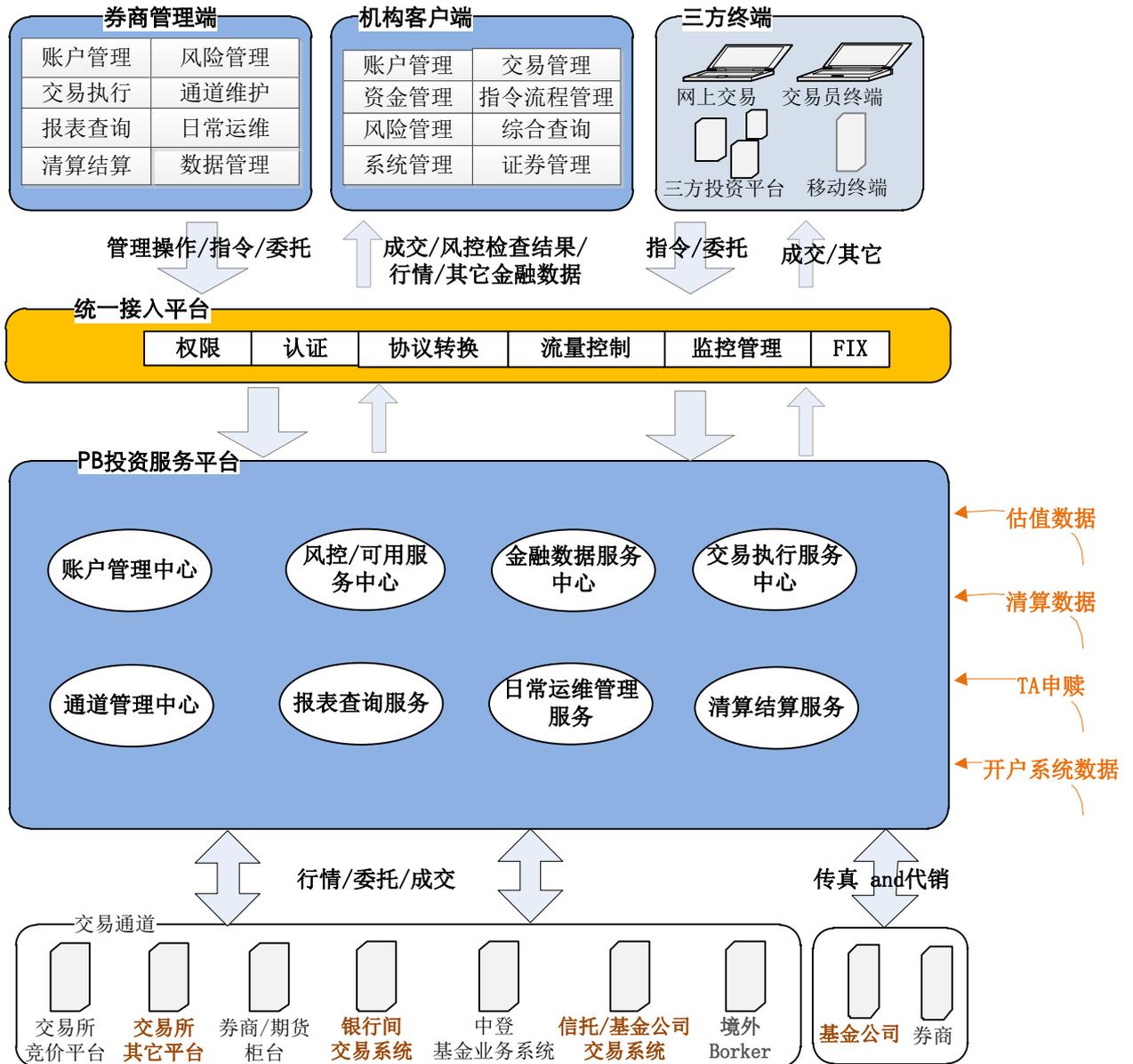
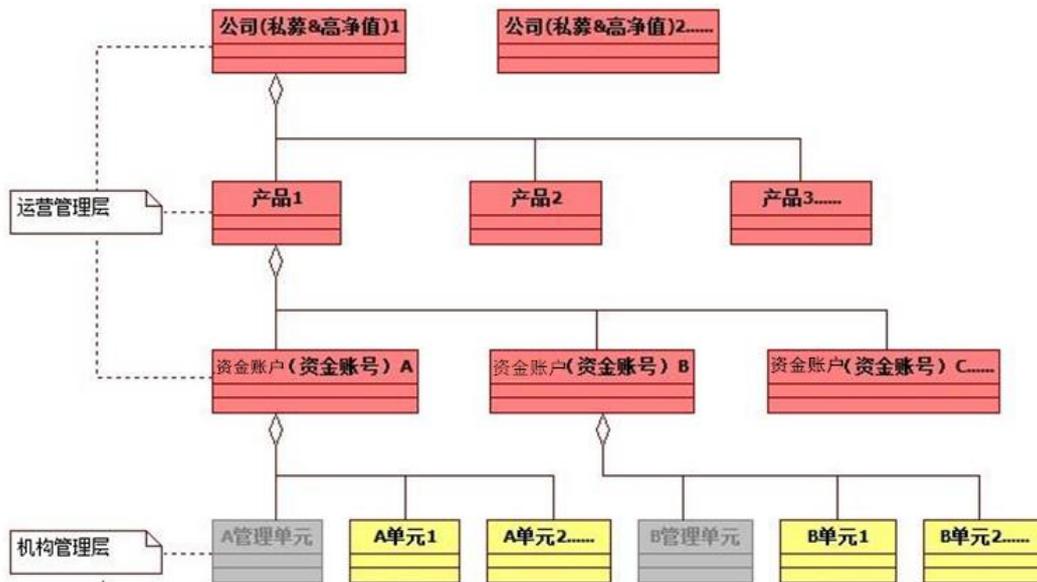


图 1.1

1.2 账户结构

平安 PB 投资管理系统 (简称：PB) 的账户结构分为公司层、产品层、资金账户层和单元层，如下图所示。券商端进行账户管理只进行到资金账户层，而单元层的账户管理是由机构端进行。



1.3 系统界面介绍

1.3.1 系统登录

双击 pbrc.exe 运行程序，弹出机构客户端的登录界面（如下图）：



点击登录界面中的“网络设置”按钮，根据实际网络选择接入的站点，建议使用连接速度快的线路。



如需要设置代理才能上网，请在“代理设置”处设置，当前系统支持 HTTP 代理、SOCKS4 代理、SOCKS5 代理三种代理方式。代理设置需要设置代理 IP、端口等信息，最后点击确认即可。回到登录界面，输入操作员编号、操作员密码、验证码，点击“登录”按钮，登录系统。



如果有多个行情站点，可以在行情站点列表选择站点状态较好、响应速度快、

负载低的站点进行连接，其中现货、期货、期权、港股等可分别选择不同站点，如下图所示：



1.3.2 系统界面

系统主窗口可划分为三个区域，上方为系统功能菜单和系统设置菜单，中间部分为系统的主界面，下方主要为系统信息查询栏（包含软件版本、单位信息等信息），如下图所示：



1.3.2.1 功能菜单

用户在日常业务办理时,首先通过鼠标光标移动到功能菜单来展开功能子菜单,再通过单击子菜单来打开系统界面,如下图所示:



1.3.2.2 常用功能

菜单栏  模块。用户可以将平常使用频率较高的菜单集合放在同一菜单下,方便使用和管理。

用户打开功能菜单下的功能子菜单之后,点击对应功能子菜单右边的  图标,就可将该功能增加到常用功能。这里以指令分发为例,将指令分发设置为常用功能,如下图(1)、图(2)所示:



图 (1)



图 (2)

1.3.2.3 联机帮助

用户如果想进一步了解系统详细功能介绍,可以查询系统网上功能说明书,在功能说明书里面对系统功能有进一步的描述。用户可以通过点击系统主窗口

联机帮助来打开恒生公司网站上的系统功能说明书,功能说明书如下图所示:



1.3.2.4 用户锁定

用户可以通过点击系统主窗口来进行用户锁定，锁定后返回系统登录界面，返回系统须重新输入登录密码，如下图所示：



1.3.2.5 消息查看

用户可在 PB 系统左下角打开消息窗口（如下图（1）），双击标志打开消息界面，其中红色数字部分显示当前消息数量。



图（1）

消息界面可查看当前接收到的消息提示和业务提醒（如下图（2）图（3）），该功能必须要连接消息服务器才可以使用。



图 (2)

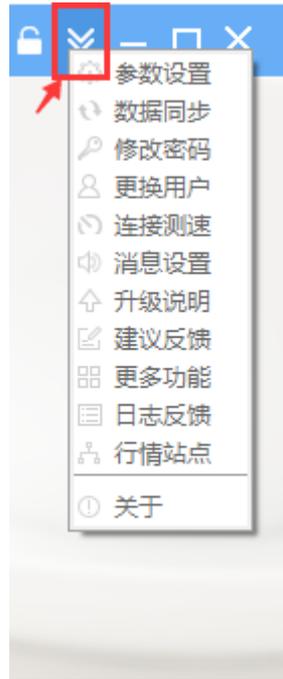


图 (3)

1.3.3 其它常用功能

系统其它常用功能主要用于设置个人参数和系统常用功能。包括：刷新缓存、修改密码、切换用户、参数设置等。

系统其它功能位于 PB 主界面的右上角，点击  按钮，可以打开系统其它功能列表。



1.3.3.1 参数设置

用户可以在功能栏“参数设置”菜单，设置当前机构端账户的系统安全、声音提示等功能项。

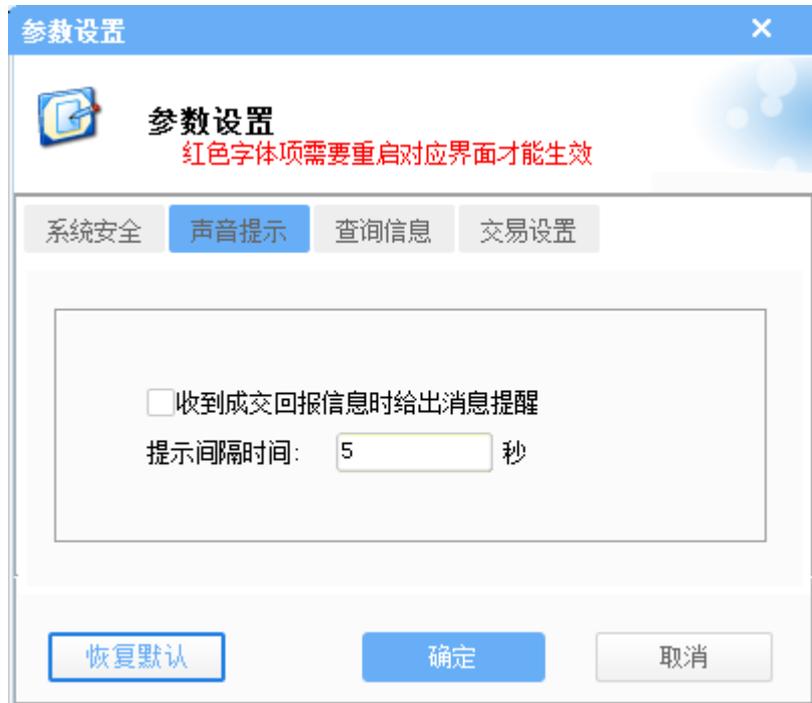
- **系统安全**：该界面主要用于机构端系统锁屏设置和日志设置。



启用系统锁屏：启用该项，锁屏后用户需要输入密码后方可重新进入机构端主界面。如果在该界面勾选“启用系统锁屏”按钮，需要设置“锁屏间隔时间”，在该时间内如系统无操作，将自动锁定机构端。如不勾选“启用系统锁屏”按钮，则不启用锁屏。

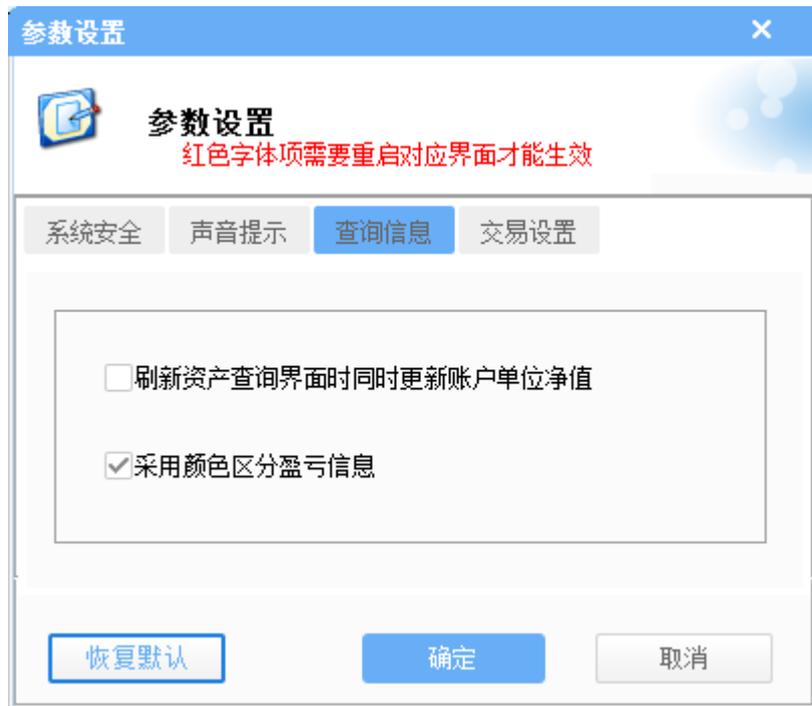
启用详细日志：启用该项后，重新登录系统会在机构端 logs 目录下生成格式为 Tentrusts_日期.log 和 Trealdeal_日期.log 的文件，用于存放委托流水和成交流水。如果 logs 目录下存在其它日期的委托和成交日志文件，系统会自动删除。

- **声音提示**：该界面用于设置成交回报消息提醒。如果在该界面勾选“收到成交回报信息时给出消息提醒”，则还需要设置“提示间隔时间”，系统收到委托成交回报信息后，根据提示间隔时间，向委托人发送一条消息提醒。



- **查询信息**：在“查询信息”界面，可以对各交易、查询界面的查询栏显示内

容进行通用设置。



采用颜色区分盈亏信息：勾选后，各交易、查询菜单界面，期货盈亏、浮动盈亏相关字段用颜色区分，亏损显示绿色，盈利显示红色。

- **交易设置**：该界面用于设置各交易菜单的通用设置。



启用双击委托撤单功能：勾选后，各交易模块“挂单”标签页，支持未报、已报、部成的委托，双击委托行后直接撤单。

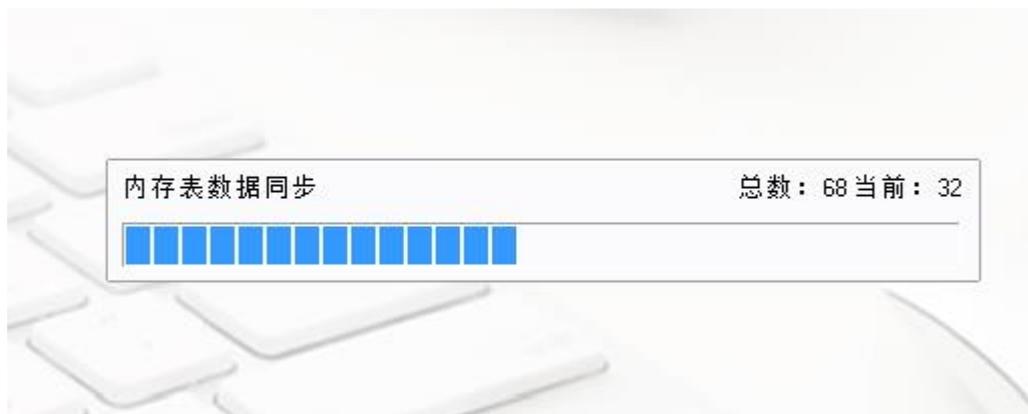
是否启用交易界面试算风控功能：勾选后，各交易模块委托面板，显示“试算风控”按钮，交易下单前可以进行风控试算。

显示期货五档行情面板：用于维护在“期货交易”和“期货组合单”模块委托面板是否显示期货五档行情。

启用风控交互的模块：在此处设置启用风险控制的菜单，如果设置好风控但未在该项勾选相应菜单，则未勾选菜单内的风控不启用。

1.3.3.2 数据同步

该界面主要用于手工同步机构端后台缓存，当系统设置修改报内存错误时，可暂时使用手工刷新内存功能，解决该问题。选择数据同步之后系统会对内存表数据同步（如下图），等待同步结束即可。



1.3.3.3 修改密码

用户在该界面修改本账户登录密码，界面会显示新密码强度判定。如下图所示

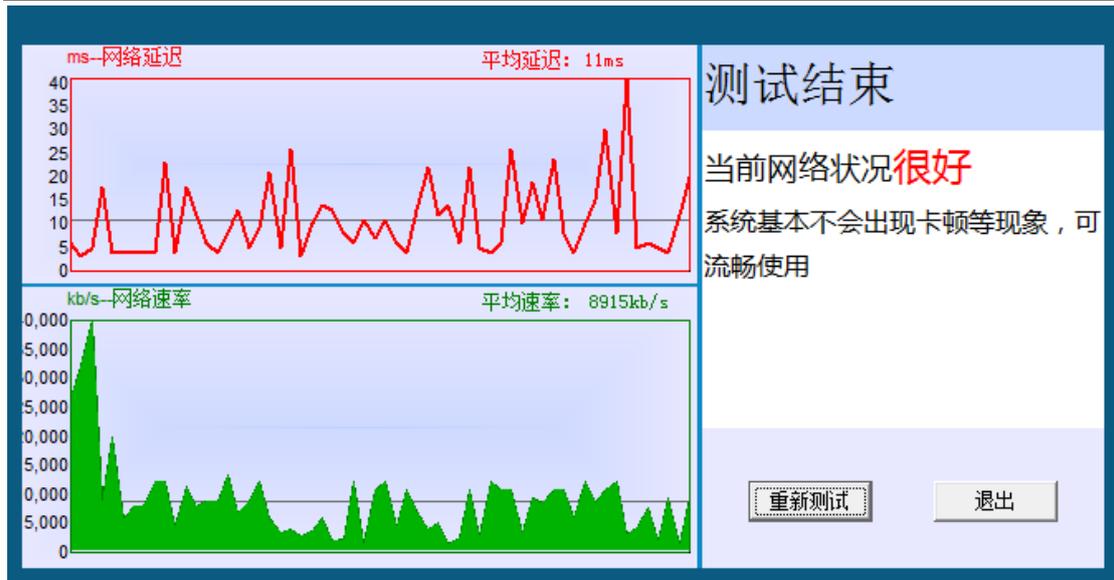
示：

1.3.3.4 更换用户

点击“更换用户”按钮后，系统弹出提示（如下图所示），如果确定更换用户，则退出当前用户登录状态，并重新打开登录框使用其他用户进行登录。如下图所示：

1.3.3.5 连接测速

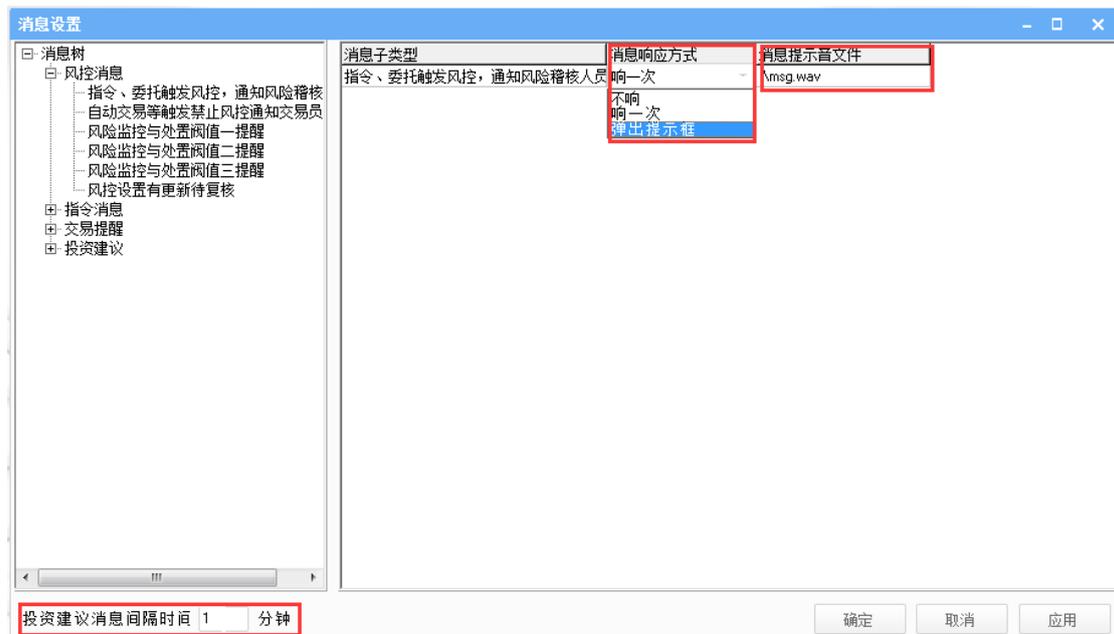
如果出现卡顿情况，用户可以在选择进行“连接测速”来测试机构端与后台 AR 的连接速度，以此来验证是否是 AR 连接造成卡顿问题。



1.3.3.6 消息设置

在消息设置界面，可以设置消息类型的提醒方式。

打开消息设置界面之后，在对应窗口可以设置消息提醒的响应方式、提示音文件等。



消息响应方式：设置当触发风险监控时，消息提示音、消息响应方式。

消息提示音文件：用户可以上传声音文件，作为触发风险监控时消息提示音。该

设置仅在“消息响应方式”是“响一次”或“响一次并且弹出提示框”时有效。

注意：

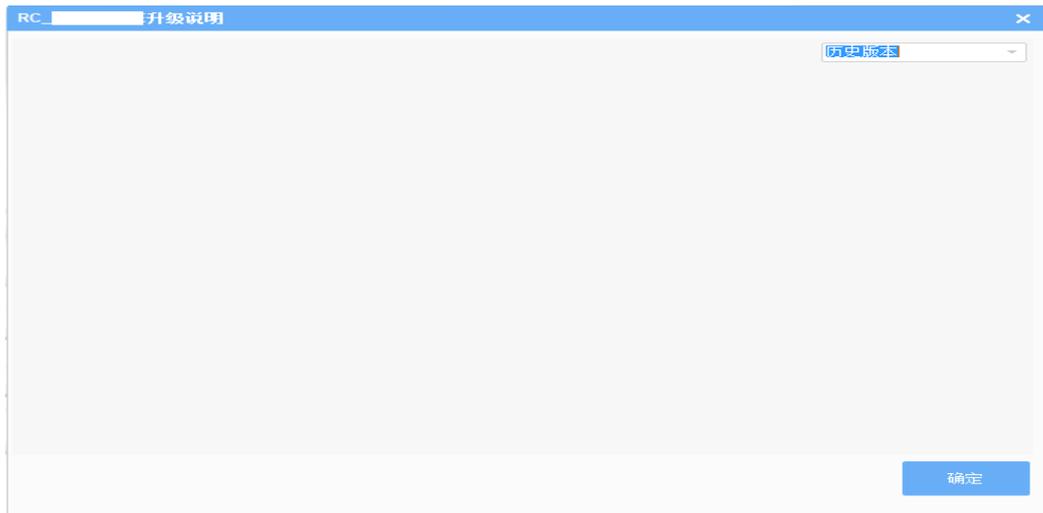
使用该功能前，用户必须拥有用户消息权限，该权限在菜单“系统管理” →

“人员维护” → “消息权限” 菜单中设置（如下图）。



1.3.3.7 升级说明

可以查询升级后修正及更新后的内容。



1.3.3.8 建议反馈

用户在使用过程中如果有产品建议或者遇到功能异常，可以打开“建议反馈”界面（如下图（1）和图（2））进行登记并提交给恒生公司，同一时间只能提交一个产品建议反馈单或者功能异常反馈单，如果有同时有产品建议和功能异常反馈请分别进行提交。



图 (1)

图 (2)

1.3.3.9 更多功能

用户可以通过更多功能来了解更多的其它恒生系统功能模块, 可以查看相关说明, 也可以通过超链接来进一步了解相关信息, 如下图所示:

| 更多功能 | | |
|------|-------------------------------|---|
| 序号 | 功能名称 | 说明 |
| 1 | 证券投资建议（单账户交易） | 1.标准算法交易 |
| 2 | | 2.自定义算法交易，恒生提供轻单策略，支持埋单策略、本地套利策略 |
| 3 | 证券投资建议（多账户交易） | 支持多个账户同时买入或卖出某只股票或者基金； |
| 4 | 新股申购投资建议 | 支持新股、新债单个账户和多账户的统一申购及分配； |
| 5 | 期货投资建议（单账户交易） | 支持期货普通委托、埋单委托、批量委托、止盈止损、智能追单、快速平仓/撤单等功能。 |
| 6 | 期货投资建议（多账户交易） | 支持股指期货、国债期货、各种大宗商品期货多个账户同时开仓某个合约 |
| 7 | 融资融券投资建议 | 支持融资融券买入、融券卖出、卖券还款、买券还券、直接还款、直接还券、担保券交存、担保券提取、担保券交易等。 |
| 8 | ETF投资建议 | 上海单市场ETF申赎（股票、债券） |
| 9 | | 深圳单市场ETF申赎（股票、债券） |
| 10 | | 上海跨市场ETF申赎（股票、债券） |
| 11 | | 深圳跨市场ETF申赎（股票、债券） |
| 12 | | 跨境ETF申赎 |
| 13 | 开基投资建议 | 支持场内沪深LOF申赎以及交易型货币基金等的申赎； |
| 14 | | 支持上证LOF申赎； |
| 15 | | 货币ETF申赎； |
| 16 | 期现投资建议 | 支持套利组的期现套利交易，实现套利过程监控、支持展期、调仓等功能； |
| 17 | 组合投资建议（篮子交易） | 股票篮子交易，也称之为组合交易；支持普通交易、算法交易（自带和三方算法平台接入）； |
| 18 | 期货组合投资建议 | 支持期货两腿合约的套利和互换，包括自定义套利单和标准套利单。 |
| 19 | 期权投资建议 | 支持个股期权基础交易（eT期权）； |
| 20 | 期权投资建议 | 支持新三板市场的期权交易； |

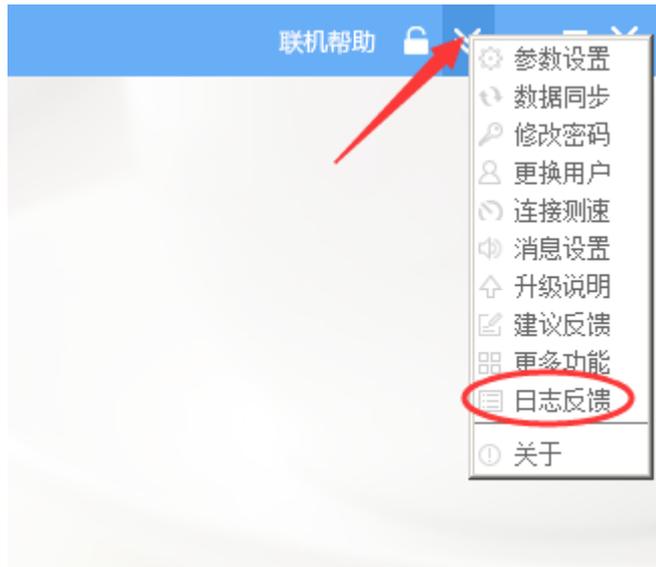
1.3.3.10 日志反馈

鉴于很多机构端问题排查需要取得机构端日志,为了更方便快捷地取得机构端日志,机构端支持日志反馈功能。券商端维护好日志反馈邮箱,机构客户点击发送日志按钮,即可将日志发送到券商反馈邮箱,解决机构日志提取困难问题。

注：

机构端日志反馈功能需要先进行券商端的参数维护,维护路径为“日常运维管理”-“系统参数维护”-“机构端设置”-“安全设置”,日志反馈接收邮箱,日志反馈发送邮箱(有格式串要求,具体见说明)和日志发送邮箱密码。券商端修改发送邮箱后,需要重新登录机构端才可以生效。

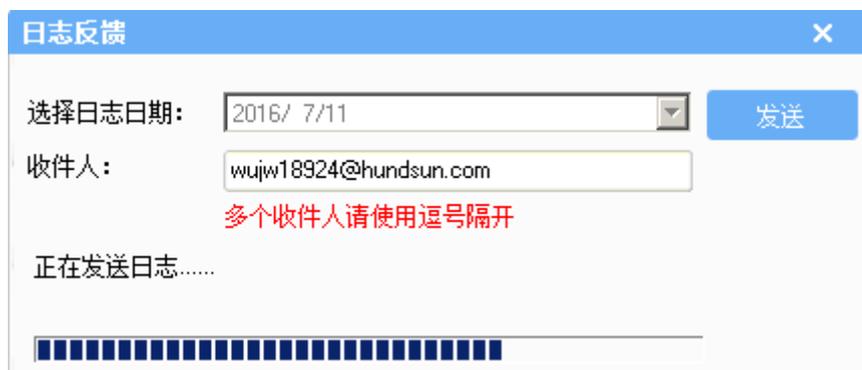
1、登陆机构端之后,在右上角的系统参数控制界面选择日志反馈功能,如下图所示：



2、日期按需选择，历史或者当日日志都可以，点击发送即可（收件人信息是券商端维护好的，不需要机构人员维护，机构人员只需要选择日志日期，再点击发送即可）。



点击发送后正常状态如下截图：





3、获取日志，机构端发送日志后，会在收件人的邮箱中看到如下标题的内容，邮件内包含日志压缩包。主要包括当天 logs 文件夹底下的日志以及缓存信息。

PB客户日志反馈_公司[恒生电子股份有限公司]_操作员[1]_日期[2016-07-11]

elecwish@163.com

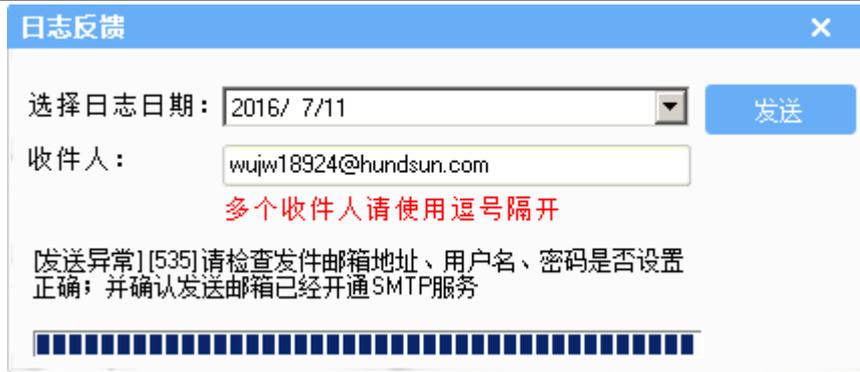
发送时间: 2016/7/11 (周一) 10:09

收件人:

附件: Logs_2016-07-11[1].7z (421 KB) MemData_2016-07-11[1].7z (615 KB)

```
ClientID:      HS
CompanyName:   恒生电子股份有限公司
OperatorNo:    1
Client DateTime: 2016-07-11 10:08:44
RcVersion:    RC_20160429A
SysVersion:   TRADE_20160429A
Server DateTime: 2016-07-11 10:08:43
```

4、常见问题，根据系统参数上面提示的之后，客户这边设置邮箱之后，客户这边的日志仍然没拿到。



原因：系统所维护的收件人邮箱没有开通 SMTP 服务导致。通常情况下出现发送异常不是程序的问题，是邮箱方面的问题，通过将错误代码进行百度，获得解决方案。

1.3.3.11 行情站点

用户可在行情站点里面进行站点切换，选择连接响应时间较短的站点进行连接，如下图所示：



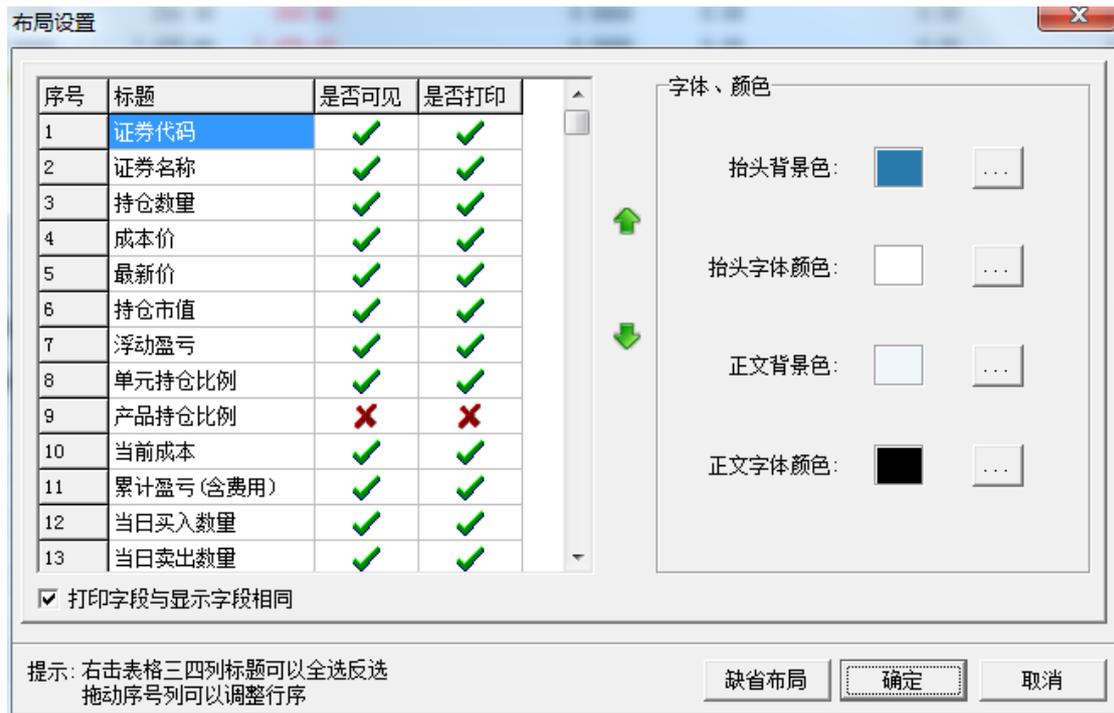
1.3.3.12 关于

在该界面用于查看 PB 版本和版权的信息，如下图所示：



1.4 布局设置

布局设置一般通过系统界面的布局设置按钮进行设置,部分系统界面通过右键—> “ 布局设置 ” 来进行设置,在布局设置界面,可以对当前页面的字体、颜色,可见,打印和显示顺序进行设置。



- 显示顺序：左侧显示顺序为持仓区的默认显示顺序，使用上下按钮调整字段顺序。也可以点列表表头字段，对列表内容进行升序降序排列。
- 可见、打印：“是否可见”列为“√”表示该列显示可见，“×”为显示不可见。“是否打印”列为“√”表示打印可见，“×”为打印不可见。例如“浮动盈亏”字段，是否显示为“√”，是否打印是“×”，说明“浮动盈亏”字段在界面中可见，但是不可以打印。

“打印字段与显示字段相同”选项默认勾选，在修改“是否可见”时，“是否打印”会同时修改方向，如果需要分开设置，取消勾选。

- 颜色：在界面右侧可以设置对抬头字体、颜色，正文字体颜色。
- 缺省布局：点击“缺省布局”按钮可以恢复系统默认显示设置。

第二章 基础设置

基础设置包括角色维护、人员维护、账户维护、业务提醒设置等设置，私募公司系统管理员通过这些基础设置对私募公司的账户、人员进行维护。

2.1 账户维护

平安 PB 投资管理系统（简称：PB）的账户结构分为公司层、产品层、资金账户层和单元层。“账户维护”主要用于私募公司管理人员维护资金账户的资金账号的密码，及维护单元层。

“账户维护”位于机构端菜单“系统管理”→“账户维护”菜单中，如下图所示，界面左侧为产品-资金账户的树形列表，右侧为单元的基本信息列表。



详细说明

- 定位：在产品和资金账户较多的情况下，可在“产品定位”按钮左侧输入框输入产品名称，点击“产品定位”按钮查找产品，可在“账户定位”按钮左侧输入框输入资金账户名称，点击“定位”按钮查找资金账户。
- 资金账户密码校验：选中资金账户后，点击左下角密码校验按钮，在弹出对

对话框(如下图),输入交易密码,点击“确定”,会提示校验密码成功。密码校验完成后,通知券商总公司维护人员进行账户初始柜台同步。

- 新增:选中资金账户后,点击界面“新增”按钮,输入单元名称和选择单元属性。其中单元属性包含 0 无和 4 港股通资产单元。

- 修改:选中资金账户后,点击界面“修改”按钮,可维护单元名称、单元状态。其中单元状态包括:“1 正常”、“2 冻结”。

修改 [X]

修改单元
修改单元信息

产品编号: 1 安泽一号

单元编号: 2

名 称: 安泽账户缺省

单元状态: 1 正常

极速交易: 0 非极速交易

单元属性: 0 无

备 注:

[确定] [取消]

2.2 角色维护

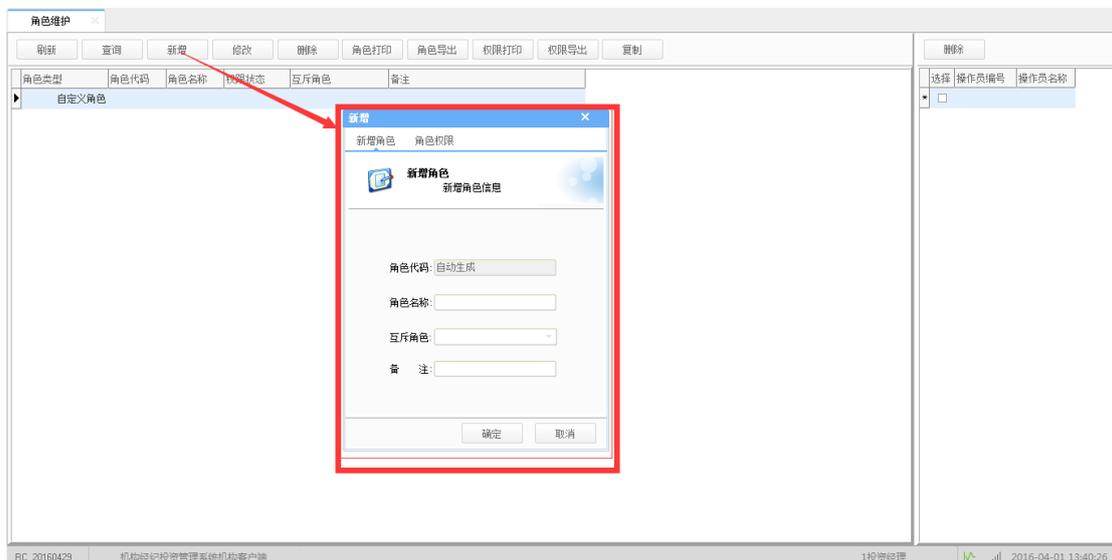
角色维护是对私募公司操作员权限进行打包管理,每个角色提供一个人员管理权限模板,并给予相同职位操作员赋予角色,方便系统管理员根据人员职位统一管理。

“角色维护”位于机构端菜单“系统管理”→“角色维护”菜单中,界面如下图所示。界面左侧为角色维护策略列表,右侧为角色维护策略赋权的操作员。



详细说明

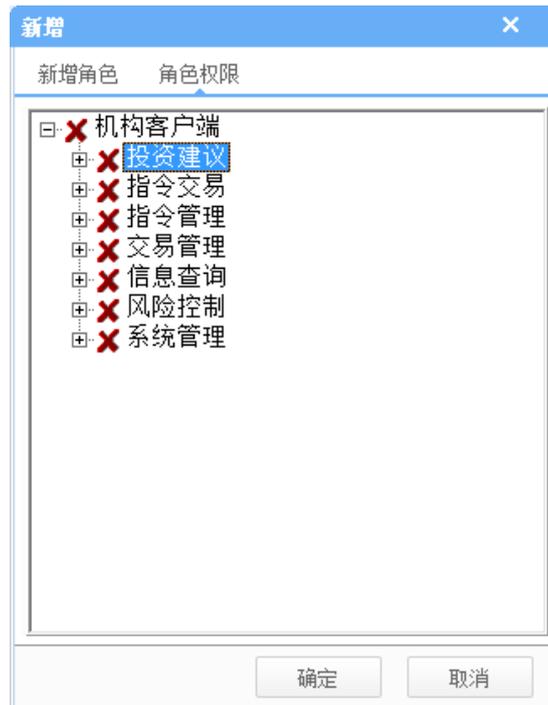
- 新增：点击“新增”按钮，在弹出窗口“新增角色”tab 页维护操作员角色信息，在“角色权限”tab 页赋权操作员机构端菜单权限。同时还可以使用修改、删除、权限复制等功能，对角色进行调整。



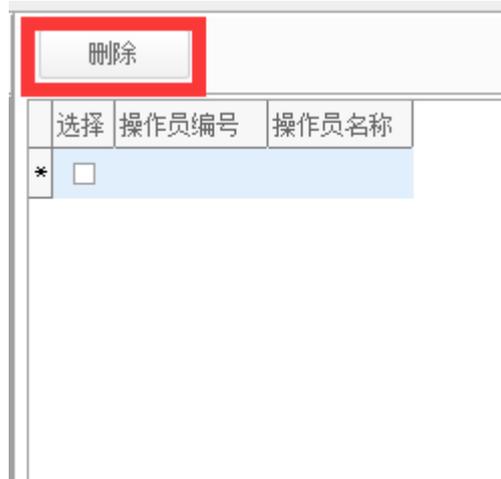
互斥角色：此处可以设置互斥角色，一个操作员如拥有了该角色权限，则不允许再赋予互斥角色。



角色权限：完成角色信息新增后，需要对角色赋予权限。✔代表赋予权限，✘代表未赋予权限，并且可以通过右键“全部选中”、“全部取消”、“全部展开”、“全部收缩”进行菜单全选、取消、展开、收缩操作。

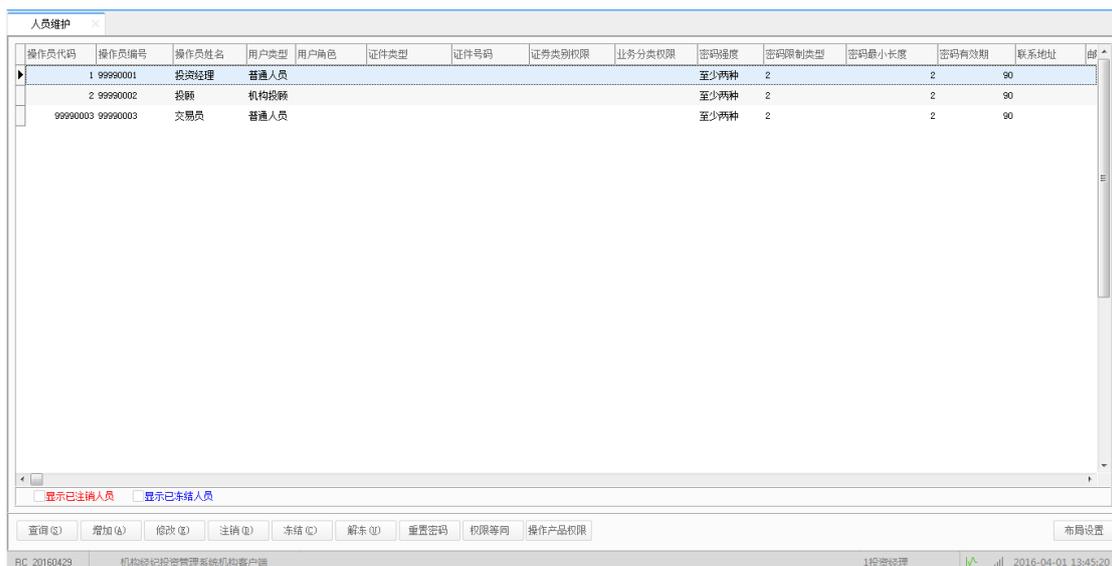


- 删除：在该界面还可以对角色赋予操作员进行批量删除设置。勾选操作员，点击“删除”按钮，可以对操作员赋予的角色进行删除。



2.3 人员维护

“人员维护”用于对私募公司操作员的资料进行增加、修改、删除操作，例如：基本信息、操作菜单权限、操作产品和消息权限，维护人员有操作权限的产品、单元等等。系统菜单目录为系统管理→人员维护，打开界面如下：



点击“增加”、“修改”按钮，弹出“人员维护”窗口，在该窗口增加或修改

操作员资料：

| 人员维护 | | | | | | |
|---|--|-----------------|-------------------------------|-------|------|--------|
| 用户资料 | 功能菜单 | 登录站点 | 操作产品 | 证券池权限 | 消息权限 | 业务提醒权限 |
| 所属公司 | 恒生信托 | 联系电话 | 13099999999 | | | |
| 操作员代码 | 10001 | 联系地址 | 恒生大厦 | | | |
| 操作员编号 | 00010001 | 邮件地址 | 67556@hundsun.com | | | |
| 操作员姓名 | thp投顾 | 传真 | 0571-88888888 | | | |
| 投资顾问 | <input checked="" type="radio"/> 是 <input type="radio"/> 否 | 所属部门 | 1 恒生信托超管部门 | | | |
| 密码限制类型 | 2 至少两种 | 业务分类权限 | 1, 2, 4, A, B, C, K, L, R, T, | | | |
| 密码最小长度 | 2 | 证券类别权限 | !, (,), 1, 2, 3, 4, 5, 6, 8, | | | |
| 密码有效期 | 90 天 | 新增产品默认赋值权限: | | | | |
| 证件类型 | 1 身份证 | 新增单元时权限按产品权限赋值: | 0 否 | | | |
| 证件号码 | 23999999999999999999 | 新增股票池默认权限: | | | | |
| 用户角色 | 12 投资顾问 | 默认赋权的股票池类型: | | | | |
| <input type="button" value="确定"/> <input type="button" value="取消"/> | | | | | | |

● 用户资料

操作员编号：登录时使用的编号，不能重复。

业务分类权限：选择操作员可以操作的业务类别。缺省不选为全部业务都可以操作。

证券类别权限：选择操作员可以操作的证券类别。缺省不选为全部证券类别都可以操作。

新增产品默认赋值权限：选择“查询权限”时，该操作员默认拥有新增产品的查询权限，选择“操作权限”时，该操作员默认拥有新增产品的操作权限（包含增加、修改、删除、查询等权限），缺省不选默认无权限。

新增股票池权限：选择“增删改”时，该操作员默认拥有对新增股票池的增加、修改、删除等操作权限，选择“查询”时，该操作员默认拥有新增股票池的查询权限，缺省不选默认无权限。该设置要生效还须在“默认赋权的股票池类型”进行配套设置。

默认赋权的股票池类型：在设置了“新增股票池权限”权限之后，还需要通过“默认赋权的股票池类型”设置“新增股票池权限”对哪几个股票池类型生效，此处选择相应的证券池类型即可，缺省不选择默认新增股票池权限默认权限不生效。

● 功能菜单

显示各菜单下的附加权限，通过左键单击附加权限，来选择是否选中。✔

代表选中状态，✘代表未选中状态，如在“用户资料”界面配置了“用户角色”，

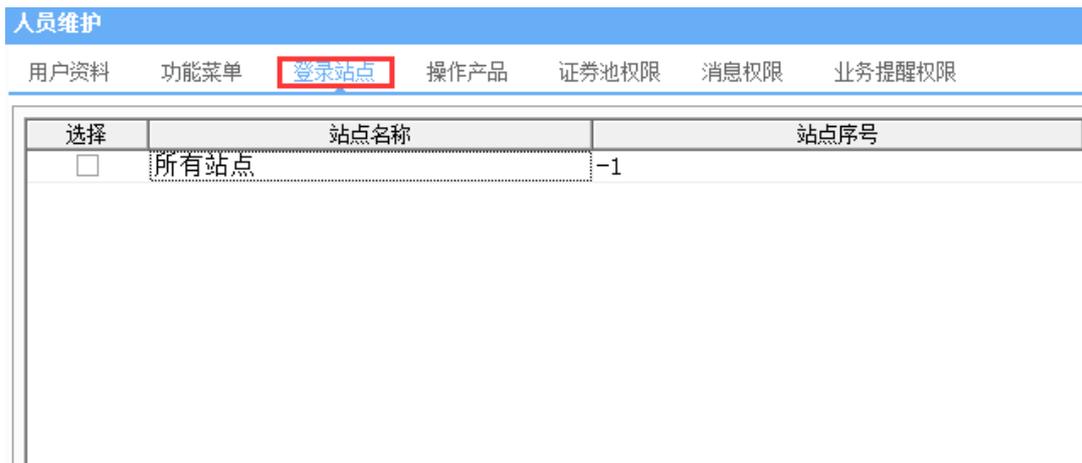
✔代表所选择的角色权限赋予的菜单权限。并且可以通过右键功能“全部选中”、“全部取消”进行全选操作，通过“全部展开”、“全部收缩”进行展开收缩操作。



● 登陆站点

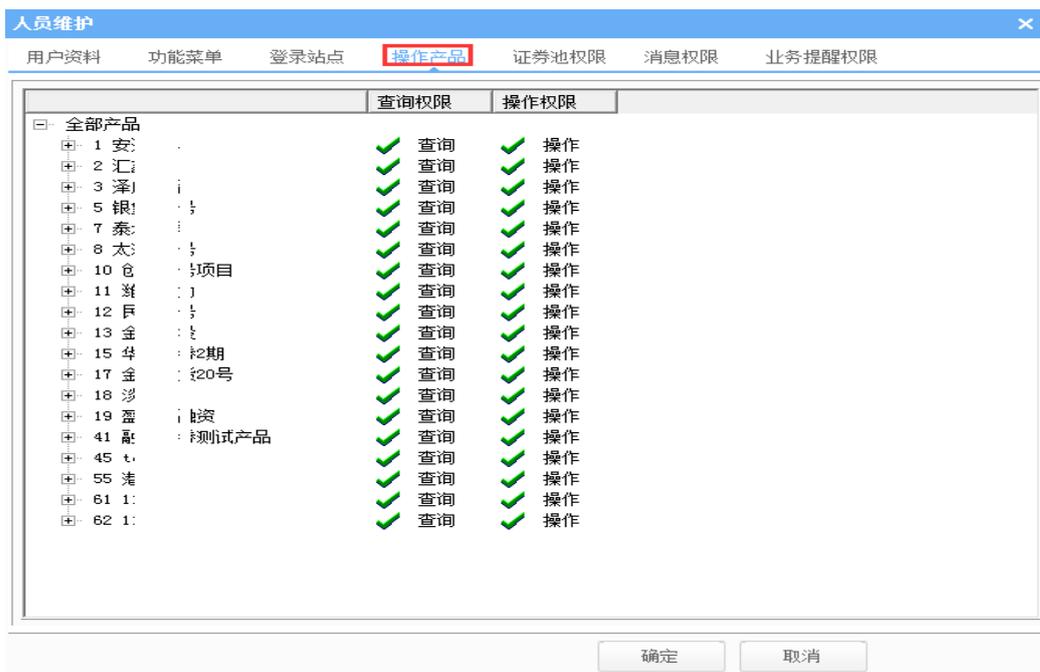
机构端用户可以在登录站点界面查询该操作员被允许登录的站点（电脑），如果需要进行新增或调整，请联系券商进行调整。

券商端启用登陆站点之后，机构端用户可在机构端系统管理→人员维护“登陆站点”界面进行查看当前被允许登录的站点信息，如下图：



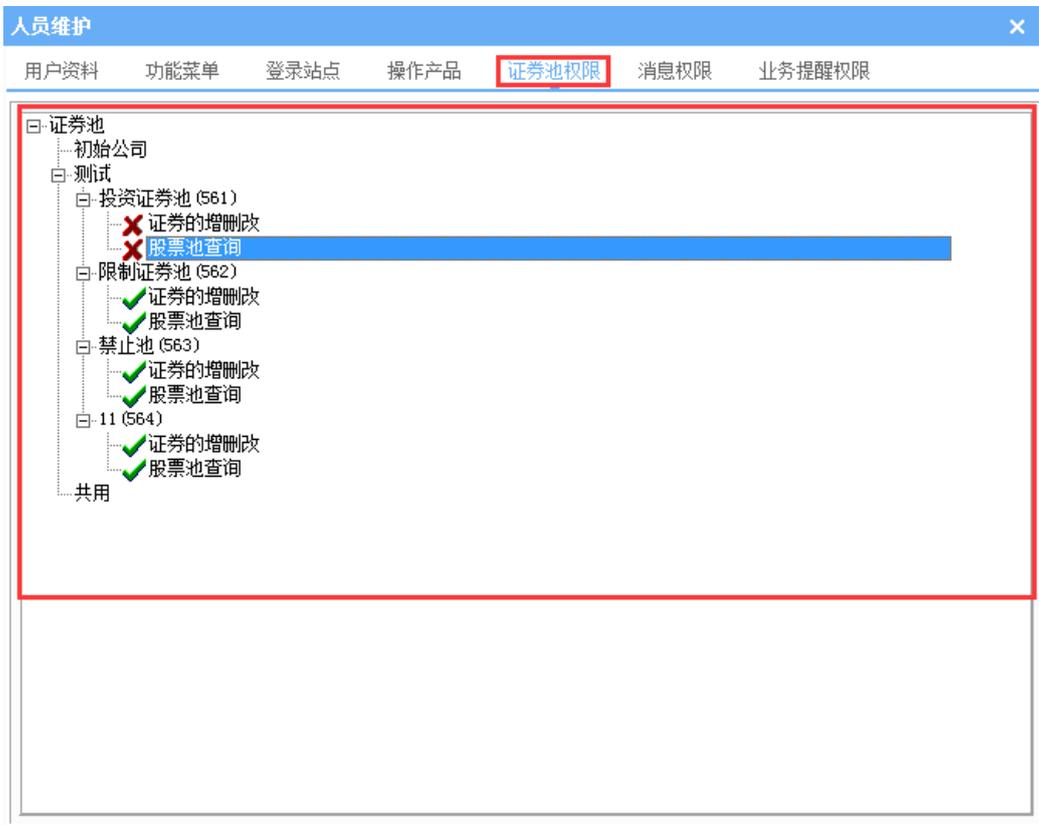
● 操作产品

在此界面，设置操作员可以操作的产品和单元的权限。



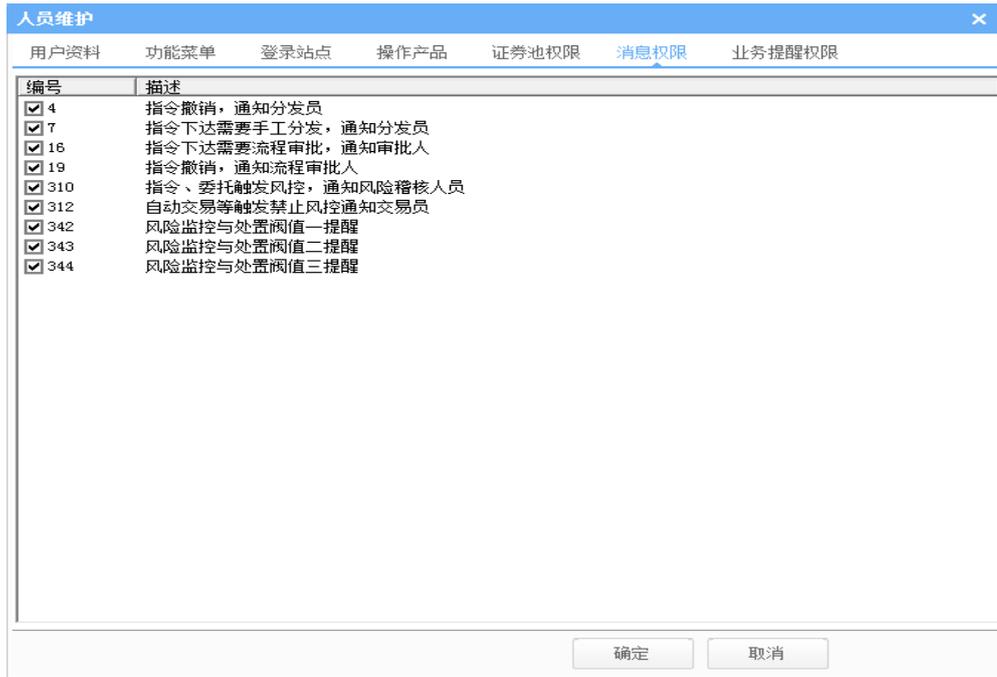
● 证券池权限

在此界面，设置操作员可以操作的证券池的权限。



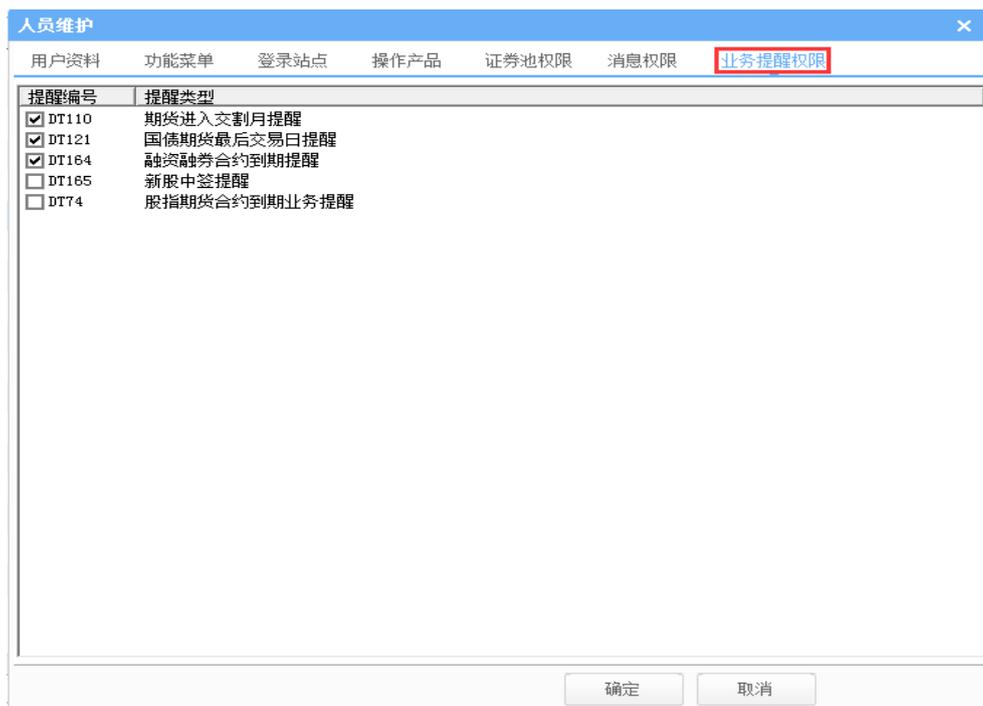
● 消息权限

用户在消息权限界面可以按消息类型设置该操作员对可以接收的消息权限（如下图），且操作员有消息类型的权限，并且有相应菜单权限，才能收到相应的消息提醒。



● 业务提醒权限

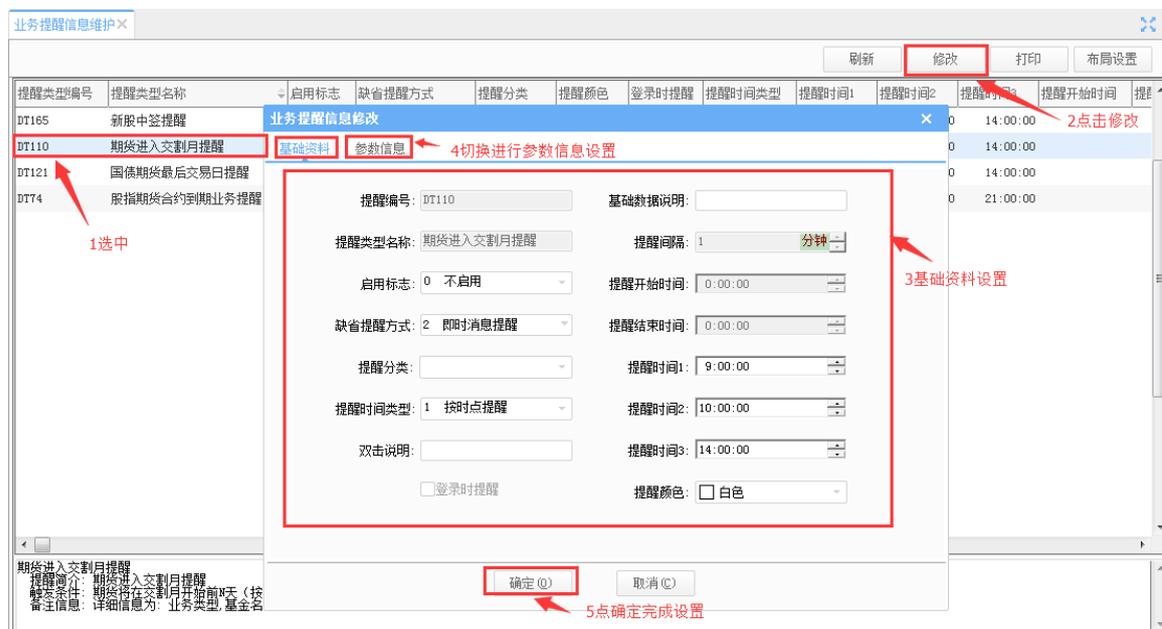
在业务提醒权限界面可以按提醒类型设置该操作员的业务提醒接收权限(如下图), 操作员须同时具有相应类型业务提醒接收权限和相应菜单权限, 才能接收到对应的业务提醒。



2.4 业务提醒设置

业务提醒设置包含业务提醒信息维护和业务提醒参数维护,机构端用户可通过业务提醒信息维护来设置业务提醒是否启用、提醒方式、提醒分类、提醒时间类型等信息,业务提醒参数维护主要用于开放权限给操作员(相关业务人员)自行修改业务提醒方式和提前提醒天数信息。

“业务提醒信息维护”位于机构端菜单“系统管理”→“业务提醒信息维护”菜单中,系统界面如下图所示:



详细说明

- 详细设置步骤: 选择提醒信息点击右上方“修改”按钮,在弹出窗口“业务提醒信息修改”界面“基础资料”tab页进行设置,设置启用标志、缺省提醒方式、提醒分类、提醒时间类型、双击说明、基础数据说明、提醒时间(如选择按提醒间隔提醒,须设置提醒间隔、提醒开始时间和提醒结束时间;如

选择按时点提醒须设置提醒时间，可最多设置 3 个提醒时间分别为提醒时间

1、提醒时间 2、提醒时间 3）、提醒颜色，如下图所示：

业务提醒信息修改

基础资料 参数信息

提醒编号: DT110

提醒类型名称: 期货进入交割月提醒

启用标志: 0 不启用

缺省提醒方式: 2 即时消息提醒

提醒分类: 1 股票

提醒时间类型: 1 按时点提醒

双击说明: 登录时提醒

基础数据说明:

提醒间隔: 1 分钟

提醒开始时间: 0:00:00

提醒结束时间: 0:00:00

提醒时间1: 9:00:00

提醒时间2: 10:00:00

提醒时间3: 14:00:00

提醒颜色: 白色

确定 (O) 取消 (C)

“基础资料” tab 页设置完毕之后切换到“参数设置” tab 页，设置提醒信息的提前提醒参数以及是否允许操作员修改，如下图所示：

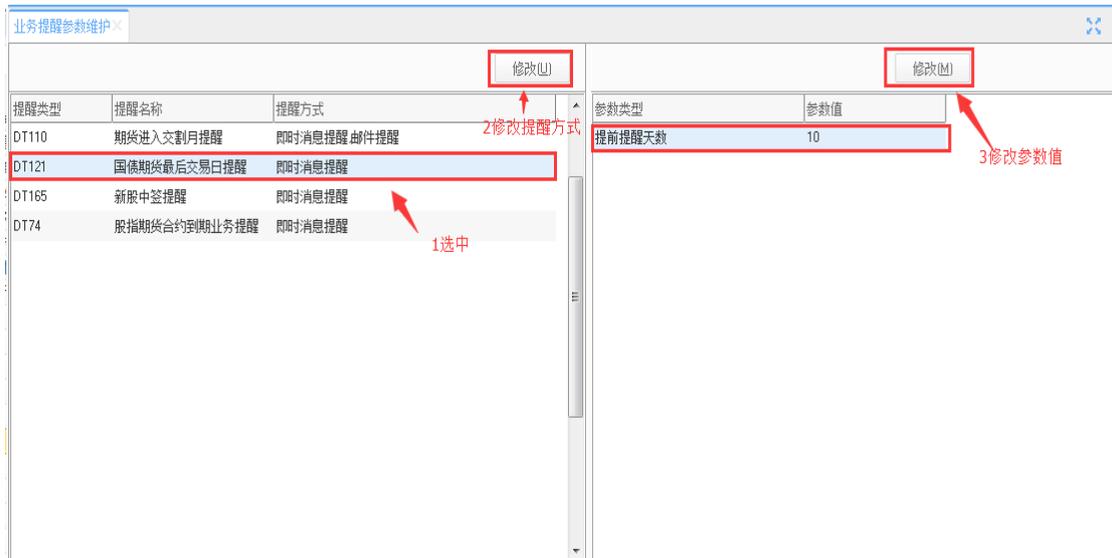
业务提醒信息修改

基础资料 参数信息

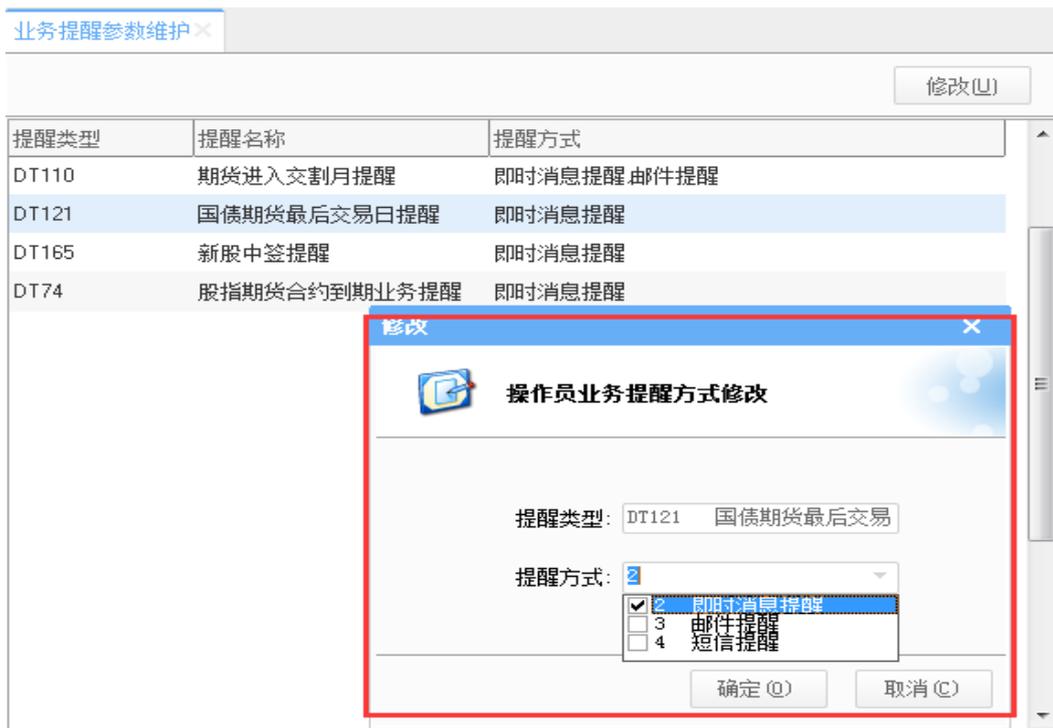
提前提醒天数: 2 允许操作员修改

确定 (O) 取消 (C)

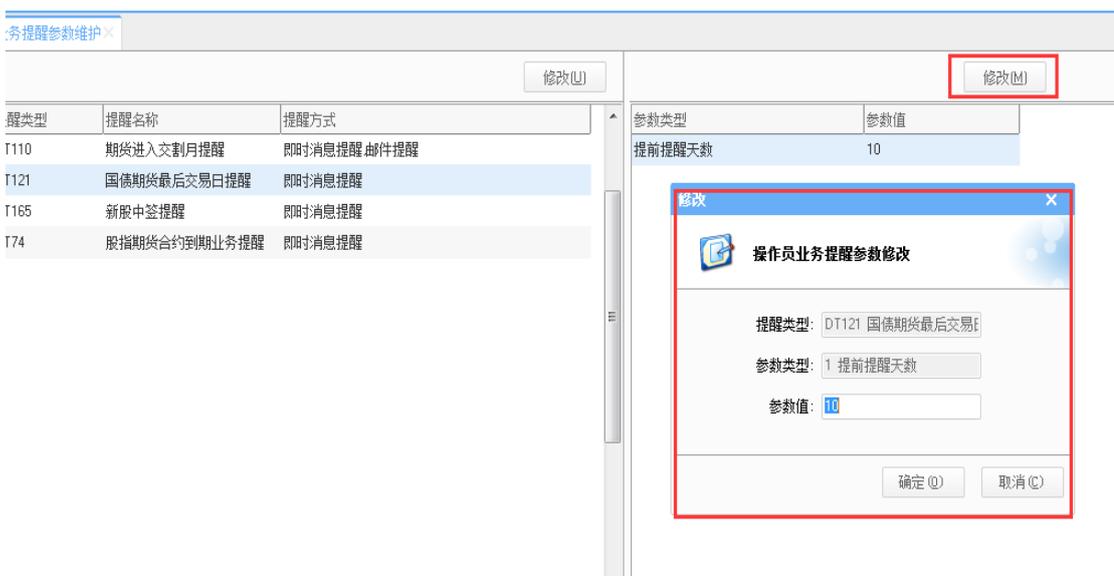
“业务提醒参数维护”位于机构端菜单“系统管理”→“业务提醒参数维护”菜单中，左边可以查看相关业务提醒信息，右边可以查看业务提醒信息的相关可以设置参数信息，系统界面如下图所示：



- 详细设置步骤：选择提醒信息点击上方“修改”按钮，在弹出窗口“操作员业务提醒方式修改”界面进行设置，设置提醒方式，有即时消息提醒、邮件提醒、短信提醒三种方式，三种方式可同时选择，如下图所示：



业务提醒方式设置完毕之后，在参数界面右上角点击“修改”按钮，在弹出窗口“操作员业务提醒参数修改”界面，设置参数值（提醒提前天数），如下图所示：



第三章 财务管理

3.1 资金管理

在券商端完成对资金账户添加资金后,和完成同步柜台数据到资金账户及单元新建后,需要从资金账户划转资金到相应单元,用于其投资交易。资金管理主要用于查询账户(包括资金账户和单元)的可用和融资负债信息,及对单元的各类资金的增减操作。

调整资金：调整产品下资产单元的资金或期货保证金的增加和减少。

冻结资金：冻结产品下单元的资金,可用减少。

解冻资金：解冻产品下单元的资金,可用增加。

划转资金：同一产品同一资金账户下的单元与单元之间的资金相互划转。

资金管理:如下图所示,界面列表中显示各产品对应下账户(包括资金账户和单元)的资金明细数据。

| 日期 | 产品编号 | 产品代码 | 产品名称 | 单元编号 | 单元名称 | 期初现金余额 | 交易保证金 | 当前现金余额 | 沪深T+0交易可用 | 沪深T+1交易可用 |
|----|------|------|------|------|------|--------|-------|--------|-----------|-----------|
| | | | | | | | | | | |

调整资金：点击“调整资金”按钮，弹出如图下图所示界面，选择调整类型可选择期货保证金增加/减少后，再选择产品编号、操作生效日期（默认当天）、单元、可在调增金额内输入需要增加/减少的期货保证金的资金数量，也可点击调整到金额后输入目标期货保证金的金额，点击确定按钮后完成操作。

冻结/解冻资金：冻结/解冻资金不会对系统内的现金资产做调整，只会改变单元的可用头寸数量（冻结减少可用，解冻增加可用）。点击“资金冻结”按钮，弹出如下图所示。输入产品编号、单元编号和失效日期，与资金调整类似，冻结也可以设置冻结金额和冻结到金额。同时设置到期影响可用标志，“到期影响可用”表示在冻结到期日计算 T+1 可用时会预先加上之前的冻结金额，反之“到期不影响可用”则不增加。冻结和解冻系统界面如下图（1）、图（2）所示：

资金冻结
✕

产品资金的冻结

产品: 21 自营产品

单元: 3 期货资金账户缺省

操作失效日期: 2016-04-01

冻结到金额:

冻结金额: 0.00

零

备注:

资金信息

当前现金余额:

沪深T+0交易可用:

沪深T+1交易可用:

图 (1)

资金解冻
✕

产品资金的解冻

产品:

单元:

操作失效日期: 2016-05-27

解冻到金额:

解冻金额: 0.00

零

备注:

资金信息

当前现金余额:

沪深T+0交易可用:

沪深T+1交易可用:

图 (2)

划转资金：同一产品同一资金账户下的单元与单元资金资金划转，从其中某个

单元划转到另一个单元，账户资金总额不变，系统界面如下图所示：

资金划转
✕

资产单元间的资金划转

产品编号:

资金账户:

划出单元编号:

划转金额:

产品编号:

资金账户:

划入单元编号:

备注:

源单元资金信息

当前现金余额:

沪深T+0交易可用:

沪深T+1交易可用:

预计调整后
当前现金余额:

目标单元资金信息

当前现金余额:

沪深T+0交易可用:

沪深T+1交易可用:

预计调整后
当前现金余额:

- 融资负债：用于查询融资负债的信息，如下图所示。

资金管理
✕

资金管理
融资负债
资金冻结解冻查询
批量业务处理
资金类操作查询

融资划转
刷新
查询
打印
导出
布局设置

| 日期 | 交易日期 | 产品名称 | 单元名称 | 市场 | 股东 | 未偿还总金额 | 未偿还总利息 | 期初金额负债 | 期初利息负债 | 当日新增金额负债 | 当日新增利息负债 | 期初已 |
|----|------|------|------|----|----|--------|--------|--------|--------|----------|----------|-----|
| | | | | | | | | | | | | |

每页显示行数: 50 100 500
上页
下页
到第 1 页
确定
共有 0 条记录。

融资划转：同一产品下单元与单元资金的融资负债划转。如下图

- 资金冻结解冻查询：用于查询冻结/解冻的记录，并可点击“取消冻结解冻”按钮，取消相应的冻结解冻记录，如下图（1）所示。此外，通过点击“查询”按钮弹出查询设置界面，可以按产品编号、单元编号、操作类型、状态、发生开始-结束日期，到期开始-结束日期等条件来对查询的结果进行筛选，如下图（2）所示。

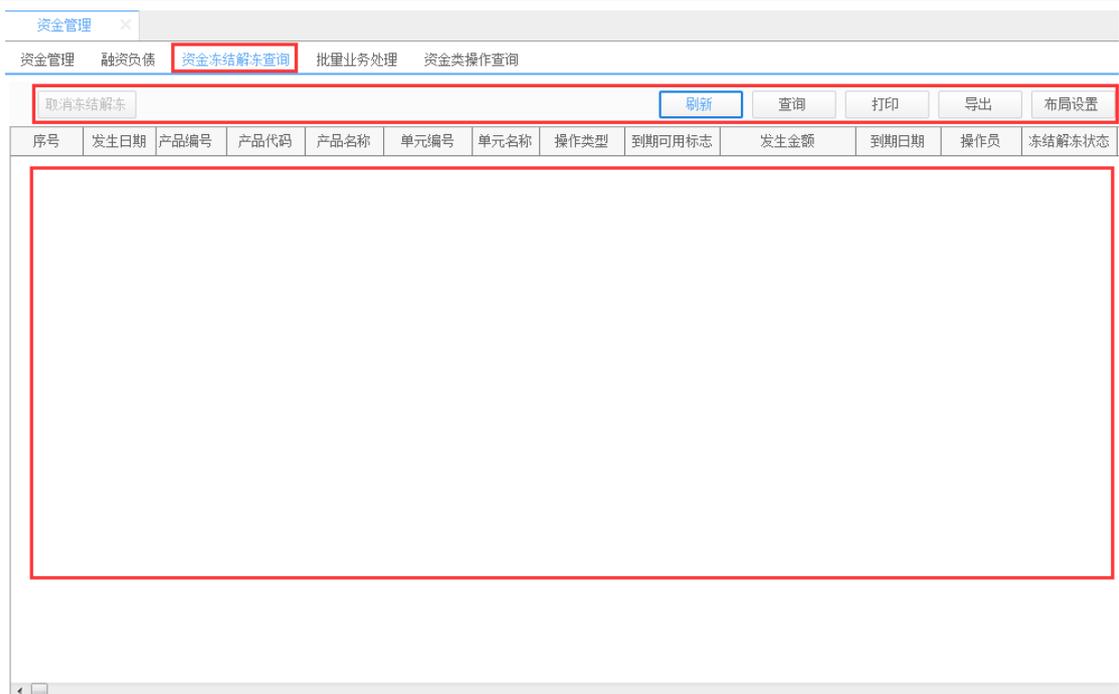


图 (1)

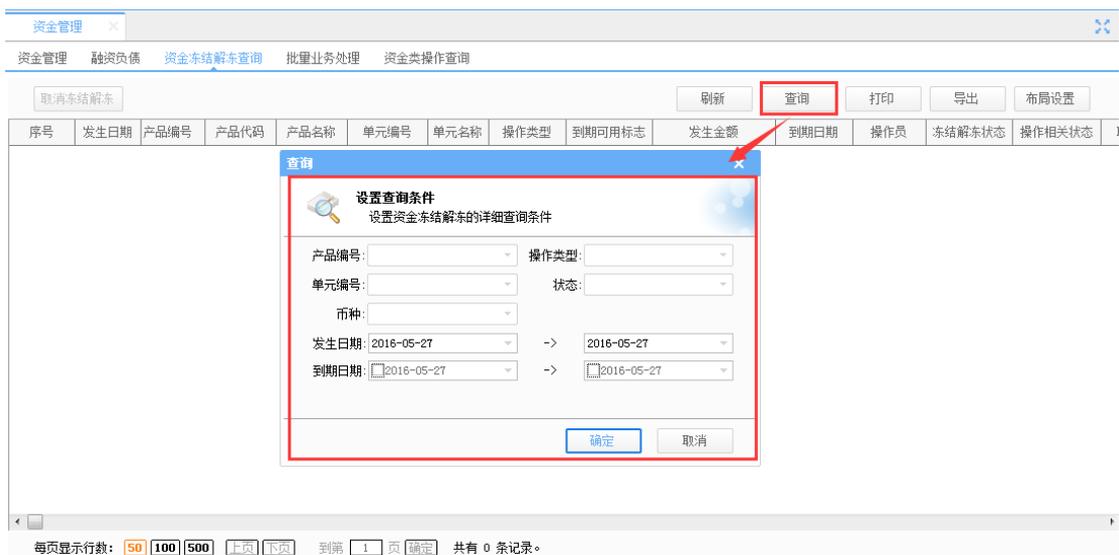
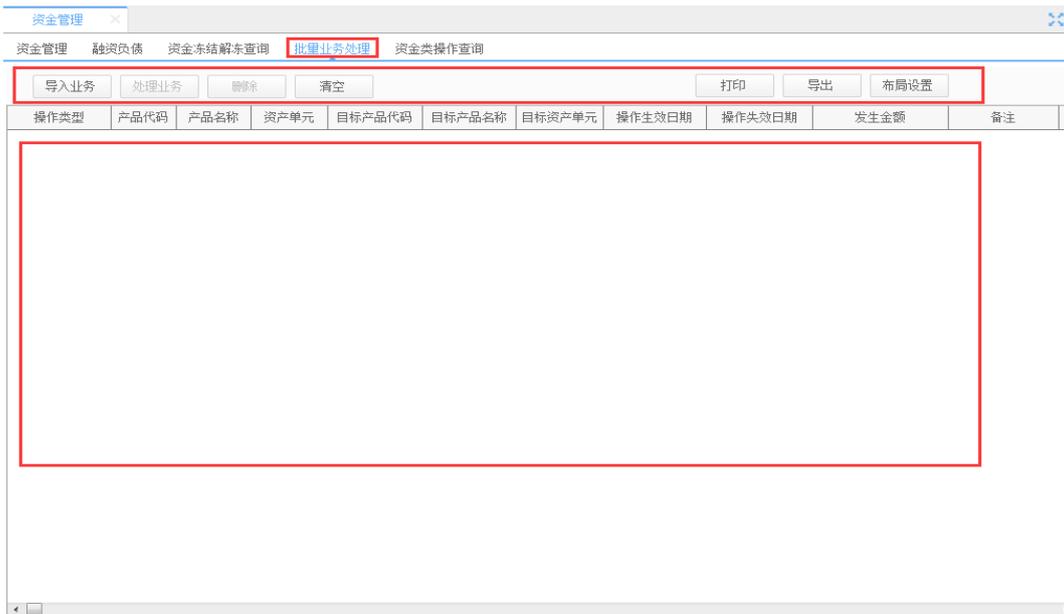


图 (2)

- **批量业务处理** :用于对资金业务中资金增加、资金减少、期货保证金增加(影响现金)、期货保证金减少(影响现金)、资金冻结、资金解冻、资金划转等业务的批量处理。



- **资金管理复核：**资金管理复核功能的启用和设置在券商端，资金管理复核包含对资金调整、资金划转、资金批量划转、资金冻结解冻等业务操作进行复核，机构端用户如果需要启用和设置可以咨询券商相关人员。
- **资金类操作查询：**用于查询“资金管理”菜单下的所有操作，该页签显示了相应产品以及产品单元的发生金额和份额等数据。



3.2 证券管理

如果券商端有无委托清算，或是进行期初同步柜台数据到资金账户等后，则有持仓信息，那么需要从资金账户划转资金到相应单元。

证券管理主要用于查询账户(包括资金账户和单元)的持仓和融券负债信息，及对单元的各类证券的增减操作。

如下图所示，界面列表中显示各产品对应下账户(包括资金账户和单元)的证券明细数据。



调整成本、冻结/解冻、证券划转、证券冻结解冻查询、证券复核设置、证券类操作查询等功能与上述资金管理中的类似，此处不再赘述。

- **融券负债**：该页签展示了融券业务中，期初的利息负债和数量负债，当日新增的利息负债和数量负债，期初已偿还的负债，当日已偿还的负债，以及负债总量等信息。

| 日期 | 交易日期 | 产品名称 | 单元名称 | 投资类型 | 市场 | 股东 | 证券编码 | 证券名称 | 未偿还总数量 | 未偿还总利息 | 期初数量负债 | 期初利息负债 | 当日新增数量负债 | 当日新增利息负债 | 期初已偿还数量负债 | 期初已偿还利息负债 |
|----|------|------|------|------|----|----|------|------|--------|--------|--------|--------|----------|----------|-----------|-----------|
| | | | | | | | | | | | | | | | | |

融券负债划转：支持同一产品不同单元间的证券互转。

融券负债划转
✕

单元之间互转

| | |
|---|--|
| <p>产品编号: 23 恒生基金</p> <p>源单元: 1 股票资金账户缺省</p> <p>目标单元: 1 股票资金账户缺省</p> <p>证券代码: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>股东代码: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>投资类型: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>负债类型: 已偿还</p> <p>已偿还证券: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>已偿还利息: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> | <p>源单元</p> <p>已偿还证券: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>已偿还利息: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>未偿还证券: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>未偿还利息: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>目标单元</p> <p>已偿还证券: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>已偿还利息: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>未偿还证券: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> <p>未偿还利息: <input style="width: 100%;" type="text"/></p> |
|---|--|

- **期货调整**：对期货进行调整，支持手工持仓划转的操作，如图所示。



- **证券管理复核**：证券管理复核用于对证券调整成本、冻结解冻、证券划转、证券批量划转等业务操作进行复核，如下图所示。

注：复核启用须由券商进行开通，如有需要和疑问请咨询券商。



3.3 费用设置

券商总公司在券商端完成对私募公司的费用设置后,如果私募公司有自己的

客户通过机构端进行投资交易，那么私募公司可按照实际的佣金进行费用维护，以收取客户的佣金，否则无需维护费用。

在菜单“系统管理”→“费用维护”界面中，设置收取的佣金（前提条件是只有佣金差模式才可设置），如下图。

| 产品名称 | 单元名称 | 交易市场 | 业务分类 | 证券类别 | 证券代码 | 证券名称 | 佣金 | | | |
|--|------|------|------|------|------|------|------|----|------|------|
| | | | | | | | 计费方式 | 费率 | 费用区间 | 合笔方式 |
| <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="width: 20%;"> <p>产品名称: <input type="text"/></p> <p>单元名称: <input type="text"/></p> <p>交易市场: <input type="text"/></p> <p>业务分类: <input type="text"/></p> <p>证券类别: <input type="text"/></p> <p>证券代码: <input type="text"/></p> </div> <div style="width: 40%;"> <p>佣金</p> <p>计费方式: <input type="text"/></p> <p>最低费用: 0 <input type="text"/> 元</p> <p>合笔方式: <input type="text"/></p> </div> <div style="width: 40%;"> <p>券商佣金</p> <p>计费方式: <input type="text"/></p> <p>最低费用: 0 <input type="text"/> 元</p> <p>合笔方式: <input type="text"/></p> </div> </div> | | | | | | | | | | |

最高费用：计算的费用如果超过此值，按此值计算。

最低费用：计算的费用如果低于此值，按此值计算。

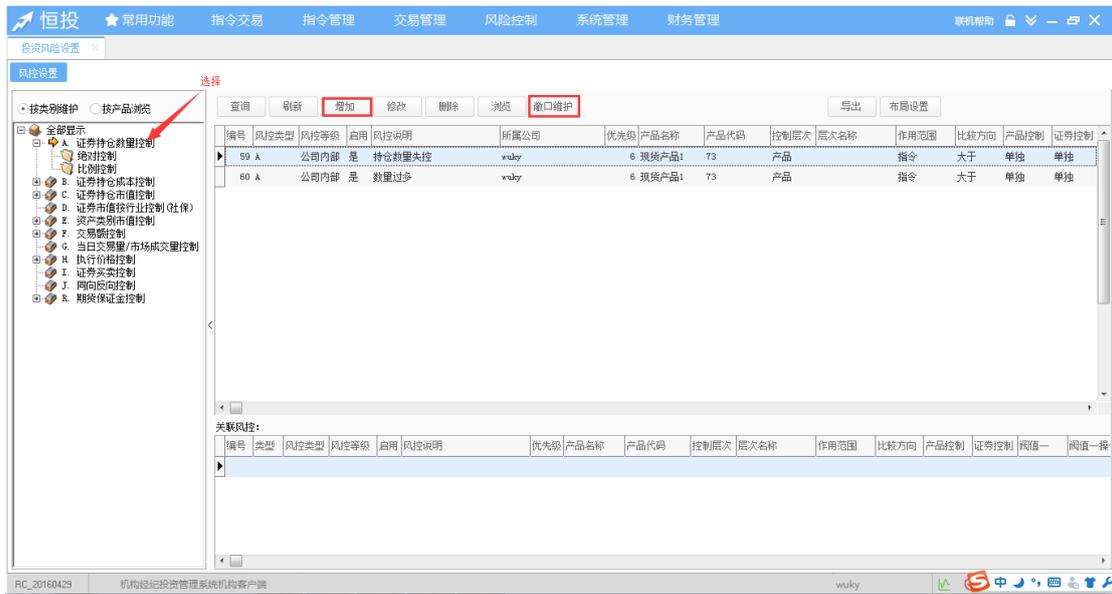
分合标志：1-分笔（分笔成交分笔计算）；2-合笔（分笔成交合笔计算）。

第四章 风险控制

风险控制主要的作用是实时的监控指令、委托以及整个产品当前的状况是否违反了在风控系统中设置的规则，并根据风控设置的具体情况进行相应的处理。

4.1 投资风险设置

在菜单“风险控制” → “投资风险设置”进入风控设置主界面。左面为树状结构，可以按照风控类别或产品来浏览；右半部分为上下结构，其中上部为具体的风控设置信息，下部为某条风控的关联风控（互斥风控）。当在左侧树状结构选中某个节点时，右侧对应的会查询出对应类别的风控设置项目。



证券持仓数量控制（绝对控制）

风控设置

设置证券持仓数量风险的控制参数，阈值为数量型。
对于股指期货，一股就是一手

风控编号： 比较方向：

优先级：低 高 作用范围： 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

启用风控： 汇总控制： 风控等级：

风控说明： 触发后进行消息提醒

有效开始日期： 有效截止日期：

| | | |
|---------------------------|----|---|
| 阈值一： <input type="text"/> | 万股 | 触警操作： <input type="text" value="1 预警"/> |
| 阈值二： <input type="text"/> | 万股 | 触警操作： <input type="text"/> |
| 阈值三： <input type="text"/> | 万股 | 触警操作： <input type="text"/> |

[控制条件](#) [高级设置](#) [互斥设置](#) [联合设置](#) [备注](#)

控制方式：

控制层次：

产品编号：

排除产品：

产品控制：

持仓类型：

- (认购期权
-) 认沽期权
- 1 股票
- 2 封闭式基金
- 3 国债
- 4 企债
- 5 可转债
- 6 政策性金融债
- D 央行票据
- F 开放式基金
- G 非政策性金融债
- K 次级债
- M 认股权证

● 详细说明（红框部分）

风控编号：由系统自动生成。

比较方向：表示风控是控制大于还是小于某个阈值。比较原则：对于增加方向的变化，与委托方向为“大于”或“大于等于”的风控相关，与委托方向为“小于”或“小于等于”的风控无关，减少方向相反。例如，买入股票，持仓增加，那么与比较方向设置为“大于”或“大于等于”的风控相关，与“小于”或“小于等于”的风控无关。

优先级：每条设置的风控都有一个优先级，优先级实际上是 1 - 10 中的一个数字，代表一种等级，主要是设置互斥时用来进行判别使用。所以，如果想要设置一条风控能够互斥其它风控，应该把该条风控的优先级设置成比待互斥的风控的优先级别高。（互斥设置：详见下文解释）

作用范围：表示何时进行风控判断，目前有：委托下达时（普通交易）、静态风控查询时（静态查询）、特殊交易（系统参数“60171-风控设置中特殊交易定义”中设置的交易类型）、指令。

启用风控：风控开关，可单独对该条风控开启或关闭。

汇总控制：用来设置是否对所属的证券进行加和控制，以 B 类证券成本控制为例，若不勾选汇总控制，表示控制单只证券的成本。若勾选则表示控制证券所属类别中所有券的成本。

风控等级：标识风控的类型。目前有，政策性、契约性和公司内部三种。

风控说明：对该条风控的简单描述。

有效日期：表示该条风控的生效日期，不填则始终有效。

阈值：用于风控比较的触发数值，可设置三档阈值。其中 A、B、C、E、F、H、R 类风控的阈值有绝对值控制和比例控制两种。根据实际情况的不同，阈值代表的含义也不同，共分为四种：

1 - 百分比（%）；

2 - 金额（万元）；

3 - 数量（万股）；

4 - 天数（天）。其中天数必须录入整数，其余三种情况允许录入 2 位小数。

触警操作：目前有，1.预警、2.禁止、3.不提示。预警表示系统给予警示，但不

做限制，可以继续下委托；禁止表示指令到此终止，不能进行后续委托。

● 详细说明（绿框部分）

1. 控制条件

在该界面设置风控的控制范围。

控制方式：设置用来进行风控检查的方式，分为五类：

0 - 按计算公式：B 类风控特有，可支持按证券类别或按动态维护来控制；

1 - 按证券控制：可以对录入的特定的证券进行监控，可以录入多只证券；

2 - 按证券类别控制：对于选中的证券类别进行风险监控，可以多选；

3 - 按维度控制：可根据“动态维度”、“行业”、“股票池”分别选择对应的维度进行控制，如若维度列表中未包含所需项，可咨询券商端维护人员新增相应的维度。

5 - 按多维度控制：功能同“按维度控制”，另外可同时选择多项维度进行控制。

6 - 按期货品种控制：对选中的多个期货品种进行风险监控。

控制层次：设置控制到哪个层次，分为三类：

- 1 - 产品：可通过产品编号来选择受控制的产品；
- 2 - 资产单元：可按资产单元进行控制；
- 7—产品类型：可按产品类型进行控制；
- f—资金账户：可按资金账户进行控制；
- B - 公司：可按公司进行控制。

产品编号：用来设置受控制的产品，可以多选及“Ctrl+A”快捷键全选。

产品控制：用来设置产品与产品间的控制方式，分为两种控制方式：

- 1 - 单产品控制：各产品间单独进行控制；
- 2 - 多产品联合控制：对于所选产品进行联合控制；

分母类型：对于比例控制，选择用来作为比较的项目，下面罗列了一些比较常见的分母类型：

1 - 净值：现金资产 + 股票资产 + 基金资产 + 债券资产 + 回购资产 + 未回资产 + 应收资产 - 应付资产；

2 - 总资产：产品净资产 + 应付资产；

4 - 敞口：用户设置的一个指定的数值。例如保险公司在设置资产类风控时习惯于“上季度末的总资产”进行比较，“上季度末总资产”是一个特定的值，即可设置为敞口。

6 - 上一交易日净值：直接从基金资产信息历史表取基金净资产；

40—权益类多头头寸价值：买入持有的股票市值 + 多头股指期货的合约价值 + 多头期权的合约价值

B - 证券流通股本：交易所公布的证券的流通股本；

C - 证券总股本：交易所公布的证券的总股本；

D - 所在证券类别总成本：该证券所在的证券类别的所有证券的成本之和；

E - 所在证券类别持仓总市值：该证券所在证券类别的所有证券的市值之和；

F - 该证券流通市值：交易所公布的证券的流通市值；

I - 前 N 日市场平均成交量：从历史证券信息表中取最近非停牌的 N 个交易日的市场成交量平均值；

J - 所有证券总市值：取所有持仓的股票、债券、基金、权证类证券总市值；

M - 债券资产：持仓表中的 当前市值 + 买入市值 - 卖出市值 + 预买市值(大于控制时)-预卖市值(小于控制时)；

V—发行人净资产：根据风控设置的控制范围，直接取发行人信息表中净资产字段总和。

W—权益类资产：权益类资产=股票资产+权证资产+(股票基金+ETF 基金+LOF 基金+混合基金)

2. 高级设置

在该界面设置启用市场、投资类型等高级触发条件。

| 控制条件 | 高级设置 | 互斥设置 | 联合设置 | 备注 |
|-------|--------|---|-------|----|
| 控制条件 | | 启用条件 | | |
| 市场代码: | 0 所有市场 | 净值控制: | 0 不控制 | |
| 投资类型: | 0 不区分 | 净值: | 0 | 万元 |
| | | <input type="button" value="确定"/> <input type="button" value="取消"/> | | |

市场代码：选择相应的市场来进行控制是否启用风控。

投资类型：此项可选择不区分、可交易、持有到期、可供出售、贷款和应收款项、

投机、套保和套利等投资类型进行控制。

净值控制：设置净值控制的比较方向，可选择不控制、大于、小于和范围控制。

单位净值控制：设置单位净值控制的比较方向，可选择不控制、大于、小于和范围控制。

3. 互斥设置

互斥设置是用来对相互之间有判断交集的风控进行比较控制。

| 控制条件 | 高级设置 | 互斥设置 | 联合设置 | 备注 | | | | |
|---|------|------|------|----|----|----|--|--|
| <table border="1"> <thead> <tr> <th>编号</th> <th>说明</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td> </td> <td> </td> </tr> </tbody> </table> | | | | | 编号 | 说明 | | |
| 编号 | 说明 | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| <p>增加 删除</p> <p style="text-align: right;">确定 取消</p> | | | | | | | | |

假设风控 A 为恒生产品持有投资池①中的股票市值不得超过产品净值的 10%。风控 B 为恒生产品持有投资池①对应核心池股票市值不得超过产品净值的 15%。那么当恒生产品持有核心池股票市值超过 10%即被拦截。为解决此问题，可以通过设置互斥风控来实现。设置风控 A 和 B 为互斥风控，且 B 优先级高于 A。那么在投资核心池股票时，只判断风控 B，就不会被风控 A 拦截，同时保证投资池中股票也能正常被控制。

4. 联合设置

设置风控 A 和 B 为联合风控，则需 A 风控和 B 风控同时触犯时，才触犯风控。

控制条件 高级设置 互斥设置 **联合设置** 备注

| 编号 | 说明 |
|----|----|
| | |

增加 删除

确定 取消

5. 敞口维护

敞口维护主要是设置一些个性化的数据作为分母进行比较,例如某些用户在设置资产类风控时习惯于“上季度末的总资产”进行比较,“上季度末总资产”是一个特定的值,即可设置为敞口。

新增敞口时,点击右侧界面上方的“敞口维护”按钮,弹出如下图所示界面:

敞口类型维护

| 敞口序号 | 层次 | 敞口名称 | 最后修改人 | 最后修改日期 | 最后修改时间 | 日期 | 状态 |
|------|----|------|-------|--------|--------|----|----|
| | | | | | | | |

查询(S) **新增** 修改 删除 打印 字段选择

| 敞口序号 | 层次 | 敞口值 | 业务数据日期 | 最后修改人 | 最后修改日期 | 最后修改时间 | 操作类型 |
|------|----|-----|--------|-------|--------|--------|------|
| | | | | | | | |

新增(A) 修改(M) 删除(D) 打印(P) 字段选择(F) 导入(I) 关闭(X)

敞口维护界面分上下两部分，上方为敞口名称，点击“新增”按钮（红色方框），输入敞口所属层次和敞口名称新增敞口。

在“层次”下拉框中，可选择“全体有效”、“账户层”、“资产单元层”、“账户组层”。

以选择选择账户层为例。选中敞口名称，点击界面下方的“新增”按钮（绿色方框）。

针对该敞口维护相应敞口数值。可针对不同的产品分别维护敞口值。

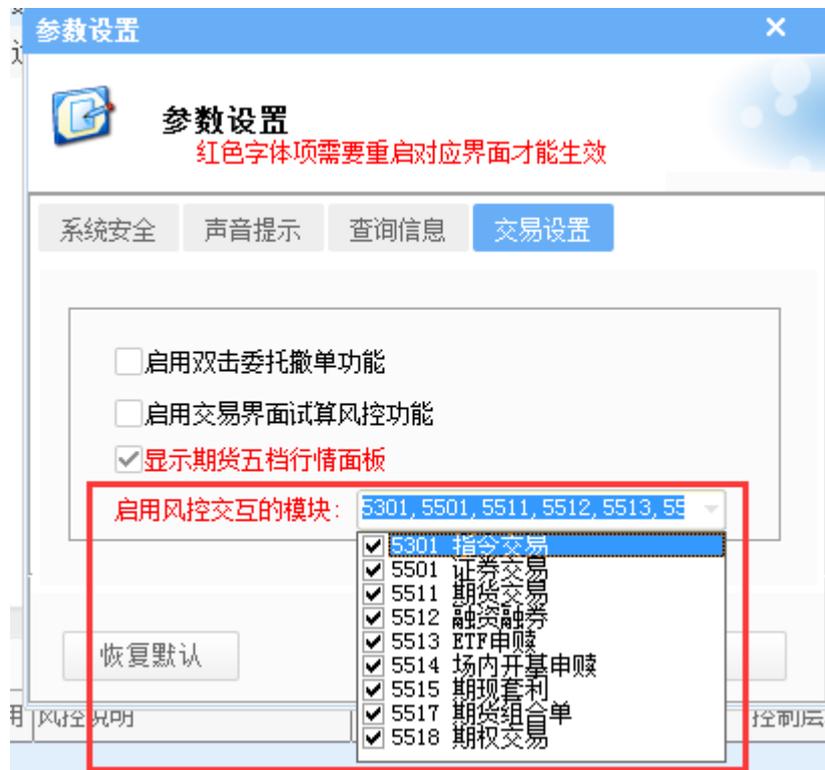
4.2 参数设置

参数设置主要是用来控制风控需要在哪些模块中开启使用。具体设置方法如下所示：

点击主界面右上角的下拉箭头，点击“参数设置”。



在“交易设置”标签页，“启用风控交互的模块”点击下拉箭头，即可选择需要启用风控的交易模块。



4.3 风险类型介绍

● A 证券持仓数量控制

该类风控主要对证券的持仓数量进行监控。既可以控制所选类型的证券的持仓数量（绝对控制），也可以通过设置所选类型的持仓数量与所选分母类型的相关数量的比例关系（比例控制）来进行控制。

图 3.1

用户如果想要控制产品的证券数量或是控制持仓数量占流通股本或总股本的

比例就可以通过该类风控进行控制。

注意：

“持仓类型”一般选择“多仓”。“空仓”在开通期货业务时才会用到。

风控举例

同一产品管理人管理的全部产品持有单只证券，不能超过该证券总股本的10%。设置如下图所示，

证券持仓数量控制（比例控制）
✕

风控设置

设置证券持仓数量风险的控制参数，阈值为比例型

风控编号：

优先级：低 高

启用风控： 汇总控制：

有效开始日期：

比较方向：

作用范围： 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

风控等级：

有效截止日期：

风控说明： 触发后进行消息提醒

阈值一： %

阈值二： %

阈值三： %

触警操作：

触警操作：

触警操作：

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

控制方式：

控制层次：

产品编号：

排除产品：

产品控制：

持仓类型：

分子类型：

分母类型：

- (认购期权
-) 认沽期权
- 1 股票
- 2 封闭式基金
- 3 国债
- 4 企债
- 5 可转债
- 6 政策性金融债
- D 央行票据
- F 开放式基金
- G 非政策性金融债
- K 次级债
- M 认股权证
- N 认沽权证
- R 股指期货
- S 公司债
- T 地方债

● B 证券持仓成本控制

该类风控主要对证券的持仓成本（购买金额）进行控制，与 A 类风控相似，B 类风控也可以通过绝对控制与比例控制来进行证券的购买成本的控制,如果用户想要对各个产品的证券的持仓成本进行绝对成本或想让绝对成本占指定类型的某一比例范围内,就可以通过该类风控进行设置。

证券持仓成本控制（比例控制）
×

风控设置

设置证券持仓成本风险的控制参数，阈值为比例型

| | |
|--|---|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: <input type="text" value="大于"/> |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: 3 公司内部 |
| 风控说明: <input type="text"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> |

| | |
|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 阈值一: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: 1 预警 |
| 阈值二: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: <input type="text" value=""/> |
| 阈值三: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: <input type="text" value=""/> |

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|----------------------------|---|
| 控制方式: 2 按证券类别控制 | <input type="checkbox"/> 1 股票 <input type="checkbox"/> 2 封闭式基金 <input type="checkbox"/> 3 国债 <input type="checkbox"/> 4 企业债 <input type="checkbox"/> 5 可转债 <input type="checkbox"/> 6 政策性金融债 <input type="checkbox"/> D 央行票据 <input type="checkbox"/> F 开放式基金 <input type="checkbox"/> G 非政策性金融债 <input type="checkbox"/> K 次级债 <input type="checkbox"/> M 认股权证 <input type="checkbox"/> N 认沽权证 <input type="checkbox"/> R 股指期货 <input type="checkbox"/> S 公司债 <input type="checkbox"/> T 地方债 |
| 控制层次: 1 产品 | |
| 产品编号: <input type="text"/> | |
| 排除产品: <input type="text"/> | |
| 产品控制: 0 单产品控制 | |
| 统计范围: 1 全部持仓 | |
| 分母类型: <input type="text"/> | |

注意：

“统计范围”可选择 1.全部持仓，2.流通持仓，3.非流通持仓（主要是一些待上市的股票、债券等）。

风控举例

每个产品持有国债的总成本不超过 10 万元，如下图所示。

证券持仓成本控制（绝对控制）
✕

风控设置

设置证券持仓成本风险的控制参数，阈值为金额型

风控编号：

优先级：低 高

启用风控： 汇总控制：

有效开始日期：

比较方向：

作用范围： 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

风控等级：

有效截止日期：

风控说明： 触发后进行消息提醒

阈值一： 万元

阈值二： 万元

阈值三： 万元

触警操作：

触警操作：

触警操作：

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

控制方式：

控制层次：

产品编号：

排除产品：

产品控制：

统计范围：

- 1 股票
- 2 封闭式基金
- 3 国债
- 4 企业债
- 5 可转债
- 6 政策性金融债
- D 央行票据
- F 开放式基金
- G 非政策性金融债
- K 次级债
- M 认股权证
- N 认沽权证
- P 权证

● C 证券持仓市值控制

该类风控主要对所持有的证券的市值进行控制，与 A 类风控相似，C 类风控也可以通过绝对控制与比例控制。进行所持有证券的当前市值的控制,如果用户想要对各个证券持仓的市值进行绝对市值或想让绝对市值占指定类型的某一比例范围内,就可以通过该类风控进行设置。

证券持仓市值控制（比例控制）
✕

风控设置

设置证券持仓市值风险的控制参数，阈值为比例型

| | |
|--|---|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: <input type="text" value="大于"/> |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 <input type="text" value=""/> | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: <input type="text" value="3 公司内部"/> |
| 风控说明: <input type="text"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> |

| | |
|-----------------------------|---|
| 阈值一: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text" value="1 预警"/> |
| 阈值二: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|--|--|
| 控制方式: <input type="text" value="2 按证券类别控制"/> | <input type="checkbox"/> (认购期权 <input type="checkbox"/>) 认沽期权 <input checked="" type="checkbox"/> 1 股票 <input checked="" type="checkbox"/> 2 封闭式基金 <input checked="" type="checkbox"/> 3 国债 <input checked="" type="checkbox"/> 4 企业债 <input checked="" type="checkbox"/> 5 可转债 <input checked="" type="checkbox"/> 6 政策性金融债 <input checked="" type="checkbox"/> D 央行票据 <input checked="" type="checkbox"/> F 开放式基金 <input checked="" type="checkbox"/> G 非政策性金融债 <input checked="" type="checkbox"/> K 次级债 <input checked="" type="checkbox"/> M 认股权证 <input checked="" type="checkbox"/> N 认沽权证 <input checked="" type="checkbox"/> R 股指期货 <input checked="" type="checkbox"/> S 公司债 <input checked="" type="checkbox"/> T 地方债 |
| 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> | |
| 产品编号: <input type="text"/> | |
| 排除产品: <input type="text"/> | |
| 产品控制: <input type="text" value="0 单产品控制"/> | |
| 持仓类型: <input type="text" value="1, 2, 3, 4, b"/> | |
| 统计范围: <input type="text" value="1 全部持仓"/> | |
| 分母类型: <input type="text"/> | |

风控举例

一个产品持有单只股票的市值不能超过基金资产净值的 10%。设置如图 3.6 所示。

证券持仓市值控制（比例控制）
✕

风控设置

设置证券持仓市值风险的控制参数，阈值为比例型

| | | |
|--|---|---|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: <input type="text" value="1 大于"/> | |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 <input type="text" value=""/> | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input checked="" type="checkbox"/> 静态查询 | <input checked="" type="checkbox"/> 指令 <input checked="" type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: <input type="text" value="3 公司内部"/> | |
| 风控说明: <input type="text" value="股票的市值不能超过基金资产净值的10%"/> | | <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | |

| | | |
|--|---|--|
| 阈值一: <input type="text" value="10"/> % | 触警操作: <input type="text" value="1 预警"/> | |
| 阈值二: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: <input type="text" value=""/> | |
| 阈值三: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: <input type="text" value=""/> | |

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|--|---|
| 控制方式: <input type="text" value="2 按证券类别控制"/> 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> 产品编号: <input type="text" value="73, 74, 75, 194"/> 排除产品: <input type="text" value=""/> 产品控制: <input type="text" value="0 单产品控制"/> 持仓类型: <input type="text" value="1, 2, 3, 4, b"/> 统计范围: <input type="text" value="1 全部持仓"/> 分母类型: <input type="text" value="1 净值"/> | <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> (认购期权 <input type="checkbox"/>) 认沽期权 <input checked="" type="checkbox"/> 1 股票 <input type="checkbox"/> 2 封闭式基金 <input type="checkbox"/> 3 国债 <input type="checkbox"/> 4 企债 <input type="checkbox"/> 5 可转债 <input type="checkbox"/> 6 政策性金融债 <input type="checkbox"/> D 央行票据 <input type="checkbox"/> F 开放式基金 <input type="checkbox"/> G 非政策性金融债 <input type="checkbox"/> K 次级债 <input type="checkbox"/> M 认购权证 <input type="checkbox"/> N 认沽权证 <input type="checkbox"/> R 股指期货 <input type="checkbox"/> S 公司债 <input type="checkbox"/> T 地方债 |
|--|---|

● D 证券市值按行业控制（社保）

该类风控用来对每个股票行业进行汇总的市值控制，该项只能设置比例控制。

证券市值按行业控制（比例控制）
✕

控制所设置的维度的比重的上下浮动的百分比, 通过控制目标
可以设置浮动的绝对值 (百分点差的绝对值) 或百分比 (百分点比例)

| | | | |
|---------|---|---------|---|
| 风控编号: | <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: | <input type="text" value="1 大于"/> |
| 优先级: | <input type="text" value="低"/> <input type="text" value="高"/> | 作用范围: | <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: | <input checked="" type="checkbox"/> | 汇总控制: | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 风控等级: | <input type="text" value="3 公司内部"/> | | |
| 风控说明: | <input type="text"/> | | |
| 有效开始日期: | <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: | <input type="text" value="2013-02-11"/> |

| | | |
|---------------------------|---|---|
| 阈值一: <input type="text"/> | % | 触警操作: <input type="text" value="1 预警"/> |
| 阈值二: <input type="text"/> | % | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> | % | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件 互斥设置 联合设置 备注

| | |
|---|--|
| 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> | 维度大类: <input type="text"/> |
| 产品编号: <input type="text"/> | 控制维度: <input type="text"/> |
| 排除产品: <input type="text"/> | |
| 产品控制: <input type="text" value="0 单产品控制"/> | 维度标准权重比例范围 |
| 价格类型: <input type="text" value="1 产品设置市值价格"/> | 比例上限: <input type="text" value="0"/> % |
| 分母类型: <input type="text" value="1 净值"/> | 比例下限: <input type="text" value="0"/> % |
| 控制目标: <input type="text" value="1 百分点差的绝对值"/> | |

注意：

当“控制目标”选择“1.百分比差的绝对值”，买入时控制的维度市值/分母-维度权重，然后和设置值对比；非买入时，标准权重-实际权重；静态时，先检

查实际权重-标准权重，未触发检查标准权重-实际权重。

当“控制目标”选择“2.百分点比例”，(控制的维度市值/分母)/维度权重，然后和设置值对比。

当“控制目标”选择“3.实际权重-标准权重”，只控制大于方向。

风控举例

一个产品持有建筑业的证券，其市值不能超过基金资产净值的 10%。

证券市值按行业控制 (比例控制)
✕

 控制所设置的维度的比重的上下浮动的百分比, 通过控制目标
可以设置浮动的绝对值 (百分点差的绝对值) 或百分比 (百分点比例)

风控编号: 比较方向:

优先级: 低 高 作用范围: 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

启用风控: 汇总控制: 风控等级:

风控说明: 触发后进行消息提醒

有效开始日期: 有效截止日期:

| | |
|--|---|
| 阈值一: <input type="text" value="10"/> % | 触警操作: <input type="text" value="1 预警"/> |
| 阈值二: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: <input type="text" value=""/> |
| 阈值三: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: <input type="text" value=""/> |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|--|--|
| 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> 产品编号: <input type="text" value="73, 74, 75, 194"/> 排除产品: <input type="text" value=""/> 产品控制: <input type="text" value="0 单产品控制"/> 价格类型: <input type="text" value="1 产品设置市值价格?"/> 分母类型: <input type="text" value="1 净值"/> 控制目标: <input type="text" value="1 百分点差的绝对值"/> | 维度大类: <input type="text" value="1 行业"/> 控制维度: <input type="text" value="251 建筑业(全公司)"/>  维度标准权重比例范围 比例上限: <input type="text" value="0"/> % 比例下限: <input type="text" value="0"/> % |
|--|--|

● E 资产类别市值控制

该类风控用来对各产品的资产类别进行控制，既可以设置绝对控制，也可以设置比例控制。用户可以通过对某些资产类别进行操作选择来控制所选资产类别使得所选资产类别的绝对值与指定分母的比值在一定范围内。

资产类别市值控制（比例控制）
✕

风控设置

设置资产类别风险的控制参数，阈值为比例型

提示：E类风控效率较低，C类风控效率较高

对于能用C类风控实现的，推荐用C类风控实现

风控编号：

比较方向：

优先级：

作用范围： 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

启用风控： 汇总控制：

风控等级：

风控说明： 触发后进行消息提醒

有效开始日期：

有效截止日期：

阈值一： %
 阈值二： %
 阈值三： %

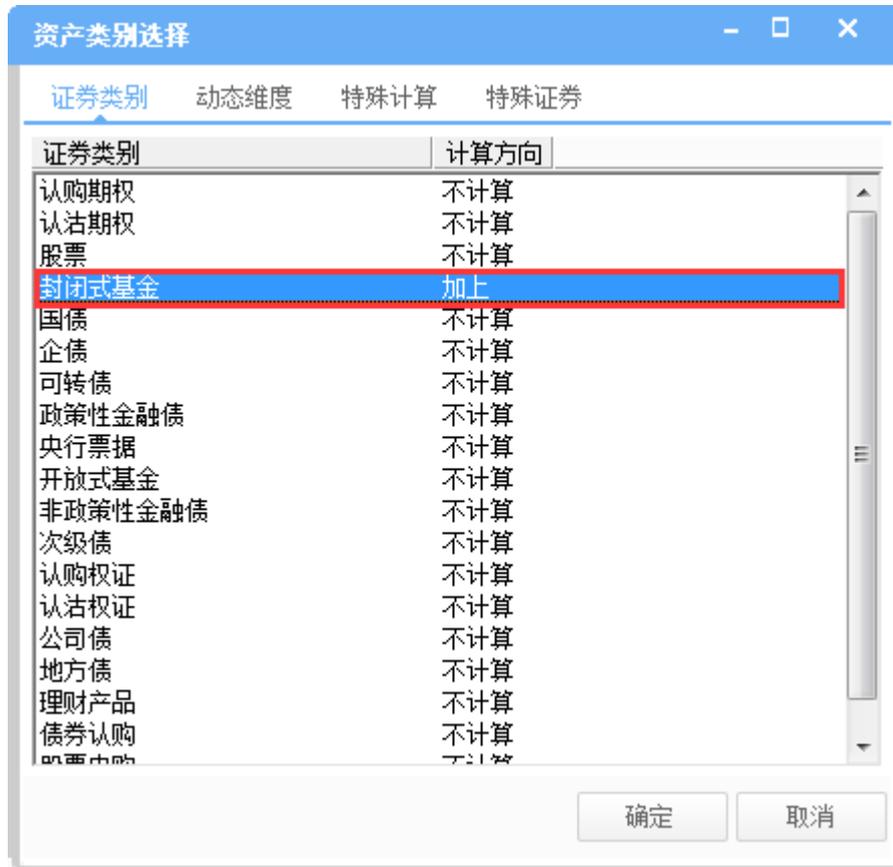
触警操作：
 触警操作：
 触警操作：

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

| 控制条件 | 资产类别 | | | | |
|---|--|------|------|--|--|
| 控制层次： <input type="text" value="1 产品"/> 产品编号： <input type="text"/> 排除产品： <input type="text"/> 产品控制： <input type="text" value="0 单产品控制"/> 分母类型： <input type="text"/> 适用时段： <input type="text"/> | <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">计算方向</th> <th style="width: 70%;">资产大类</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="height: 100px;"></td> <td></td> </tr> </tbody> </table> | 计算方向 | 资产大类 | | |
| 计算方向 | 资产大类 | | | | |
| | | | | | |

点击“**选择**”按钮弹出资产类别选择列表，双击资产类别列表内项目，计算方向会发生改变，计算方向包括：不计算 - 相当于该类别不进行统计；加上 - 表

示该类别对应的计算的值需要加上；减去 - 表示该类别对应的计算的值需要减去。



注意：

“适用时段”用六位数字表示，例 ‘091500,093000’ - 代表上午 9 : 15 - 9 : 30。

‘091500,093000|145000,150000’ - 代表上午 9 : 15 - 9 : 30 以及下午 14 : 50 - 15 : 00 都进行控制。

风控举例

封闭式基金和股票持有市值不得超过上季末总资产的 15%，适用时段在上午 9 : 15 - 9 : 30 以及下午 14 : 50 - 15 : 00。设置如下图 3.11，

资产类别市值控制 (比例控制)
✕

风控设置

设置资产类别风险的控制参数，阈值为比例型

提示：E类风控效率较低，C类风控效率较高

对于能用C类风控实现的，推荐用C类风控实现

风控编号:

优先级: 低 高

启用风控: 汇总控制:

风控说明:

有效开始日期: 有效截止日期:

比较方向:

作用范围: 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

风控等级:

触发后进行消息提醒

阈值一: %

阈值二: %

阈值三: %

触警操作:

触警操作:

触警操作:

控制条件 高级设置 互斥设置 联合设置 备注

控制层次:

产品编号:

排除产品:

产品控制:

分母类型:

适用时段: 00, 093000 | 145000, 150000

| 资产类别 | 计算方向 | 资产大类 |
|-------|------|------|
| 股票 | 加上 | 证券类别 |
| 封闭式基金 | 加上 | 证券类别 |

● F 交易额控制

该类风控用来进行指定人员的每日的交易的控制，可以设置绝对控制也可以设置相对控制。

交易额控制（比例控制）
✕

风控设置

设置当日交易额风险的控制参数，阈值为比例型

风控编号:

优先级: 低 高

启用风控: 汇总控制:

有效开始日期: 有效截止日期:

比较方向: 1 大于

作用范围: 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

风控等级: 3 公司内部

风控说明: 触发后进行消息提醒

阈值一: %

阈值二: %

阈值三: %

触警操作: 1 预警

触警操作:

触警操作:

控制条件

高级设置

互斥设置

联合设置

备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号:

排除产品:

产品控制: 0 单产品控制

额度方式: 1 当日合计

委托方向: 2 卖(融券、平仓)

计算方式: 1 按金额计算

分母类型: 1 净值

债券业务: 1 一二级业务均控制

上市首日进行控制

银行间债券按全价计算

- (认购期权)
-) 认沽期权
- 1 股票
- 2 封闭式基金
- 3 国债
- 4 企业债
- 5 可转债
- 6 政策性金融债
- 8 债券回购
- D 央行票据
- F 开放式基金
- G 非政策性金融债
- K 次级债
- M 认股权证
- N 认沽权证
- R 股指期货
- S 公司债
- T 地方债
- U 理财产品
- W 国债期货
- Z 债券申购
- a 股票增发
- d 增发
- l 债券申购

确定

注意：

“额度方式”可选择 1.当日合计：表示计算时将当日所有该证券的指令相加计算总和；2.单笔：表示计算单笔委托；3.单笔指令：表示计算单个指令；4.前 N 日合计：表示将前 N 天（选择该项时，可输入具体天数）所有的该证券指令相加

计算总和；5.本周合计：表示将本周所有该证券指令相加计算总和；6.前 N 交易日合计：表示将前 N 个交易日（选择该项时，可输入具体天数）所有该证券指令相加算总和；7.基准日起合计：表示从基准日（选择该项时，可输入基准日）开始计算所有该证券指令相加计算总和。

“**委托方向**”可选择买、卖、买+卖、买-卖、卖-买、买入开仓、卖出开仓、买入开仓+卖出平仓、卖出开仓+买入平仓。（此处的买卖包括普通的证券买卖，也包括融资、融券，“买”相当于融资，“卖”相当于融券）

“**计算方式**”可选择“按金额计算”、“按面值计算”，“按数量”，“按金额计算（卖出按成本价）”和“按金额控制（银行间债券按面额）”计算。

“**上市首日进行控制**”的意思是证券的上市首日做交易量控制。若不勾选，则上市首日不做控制。

“**债券业务**”通过选择一级业务不控制、一二级业务均控制、仅控制一级业务等选项，控制债券一二级市场的交易量。

风控举例

股票净买金额不能大于上一交易日净值的 10%。

交易额控制（比例控制）
✕

风控设置

设置当日交易额风险的控制参数，阈值为比例型

| | |
|--|---|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: <input type="text" value="1 大于"/> |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 <input type="text" value=""/> | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: <input type="text" value="3 公司内部"/> |
| 风控说明: <input type="text" value="股票净买金额不能大于10%"/> | |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> |

| | |
|--|---|
| 阈值一: <input type="text" value="10"/> % | 触警操作: <input type="text" value="2 禁止"/> |
| 阈值二: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: <input type="text" value=""/> |
| 阈值三: <input type="text" value=""/> % | 触警操作: <input type="text" value=""/> |

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|---|---|
| 控制方式: <input type="text" value="2 按证券类别控制"/> | <div style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px;"> <input type="checkbox"/> (认购期权 <input type="checkbox"/>) 认沽期权 <input checked="" type="checkbox"/> 1 股票 <input type="checkbox"/> 2 封闭式基金 <input type="checkbox"/> 3 国债 <input type="checkbox"/> 4 企业债 <input type="checkbox"/> 5 可转债 <input type="checkbox"/> 6 政策性金融债 <input type="checkbox"/> 8 债券回购 <input type="checkbox"/> D 央行票据 <input type="checkbox"/> F 开放式基金 <input type="checkbox"/> G 非政策性金融债 <input type="checkbox"/> K 次级债 <input type="checkbox"/> M 认股权证 <input type="checkbox"/> N 认沽权证 <input type="checkbox"/> R 股指期货 <input type="checkbox"/> S 公司债 <input type="checkbox"/> T 地方债 <input type="checkbox"/> U 理财产品 <input type="checkbox"/> W 国债期货 <input type="checkbox"/> Z 债券申购 <input type="checkbox"/> a 股票申购 <input type="checkbox"/> d 增发 <input type="checkbox"/> v 债券申购 </div> |
| 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> | |
| 产品编号: <input type="text" value="73 现货产品1"/> | |
| 排除产品: <input type="text" value=""/> | |
| 产品控制: <input type="text" value="0 单产品控制"/> | |
| 额度方式: <input type="text" value="1 当日合计"/> | |
| 委托方向: <input type="text" value="4 买 - 卖"/> | |
| 计算方式: <input type="text" value="1 按金额计算"/> | |
| 分母类型: <input type="text" value="6 上一交易日净值"/> | |
| 债券业务: <input type="text" value="1 一二级业务均控制"/> | |
| <input checked="" type="checkbox"/> 上市首日进行控制 <input type="checkbox"/> 银行间债券按全价计算 | |

● G 当日交易量/市场成交量控制

该类风控主要是控制指定证券类别的证券，其当日的交易量不能超过该证券当日市场成交量的一个设置好的百分比。如下图，在该类风控中，既可以控制证

券的单笔交易，也可以对该证券当日的交易数量进行控制。值得注意的是，该类风控可以设定进行风控判断的时间，既可以是一段连续的时间，也可以是多段不连续的时间，当设置多段不连续时间时，各个时间段不能有重叠的时间。

当日交易里/市场成交量控制（比例控制）
✕

风控设置

设置当日交易量风险的控制参数，阈值为比例型

| | |
|--|---|
| 风控编号: 自动生成 | 比较方向: 大于 |
| 优先级: 低 <input type="text"/> 高 | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: 3 公司内部 |
| 风控说明: <input type="text"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: 2013-02-11 | 有效截止日期: 2013-02-11 |

| | |
|-----------------------------|----------------------------|
| 阈值一: <input type="text"/> % | 触警操作: 1 预警 |
| 阈值二: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

| | | | | | | | | | | | | | |
|---|-----------------|------------|----------------------------|----------------------------|---------------|--------------------|-------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|--|---------------------------------------|---|
| <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>控制方式: 2 按证券类别控制</td></tr> <tr><td>控制层次: 1 产品</td></tr> <tr><td>产品编号: <input type="text"/></td></tr> <tr><td>排除产品: <input type="text"/></td></tr> <tr><td>产品控制: 0 单产品控制</td></tr> <tr style="border: 2px solid red;"><td>分母类型: 38 前N日市场成交量的</td></tr> <tr><td>比较天数: 1 天之内</td></tr> <tr><td>委托方向: <input type="text"/></td></tr> <tr><td>控制模式: <input type="text"/></td></tr> <tr><td>适用时段: <input type="text"/></td></tr> <tr><td><input checked="" type="checkbox"/> 上市首日进行控制</td></tr> <tr><td><input type="checkbox"/> 适用时段做为分子计算条件</td></tr> </table> | 控制方式: 2 按证券类别控制 | 控制层次: 1 产品 | 产品编号: <input type="text"/> | 排除产品: <input type="text"/> | 产品控制: 0 单产品控制 | 分母类型: 38 前N日市场成交量的 | 比较天数: 1 天之内 | 委托方向: <input type="text"/> | 控制模式: <input type="text"/> | 适用时段: <input type="text"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 上市首日进行控制 | <input type="checkbox"/> 适用时段做为分子计算条件 | <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> (认购期权 <input type="checkbox"/>) 认沽期权 <input type="checkbox"/> 1 股票 <input type="checkbox"/> 2 封闭式基金 <input type="checkbox"/> 3 国债 <input type="checkbox"/> 4 企业债 <input type="checkbox"/> 5 可转债 <input type="checkbox"/> F 开放式基金 <input type="checkbox"/> R 股指期货 <input type="checkbox"/> S 公司债 <input type="checkbox"/> T 地方债 <input type="checkbox"/> W 国债期货 <input type="checkbox"/> v 商品期货 |
| 控制方式: 2 按证券类别控制 | | | | | | | | | | | | | |
| 控制层次: 1 产品 | | | | | | | | | | | | | |
| 产品编号: <input type="text"/> | | | | | | | | | | | | | |
| 排除产品: <input type="text"/> | | | | | | | | | | | | | |
| 产品控制: 0 单产品控制 | | | | | | | | | | | | | |
| 分母类型: 38 前N日市场成交量的 | | | | | | | | | | | | | |
| 比较天数: 1 天之内 | | | | | | | | | | | | | |
| 委托方向: <input type="text"/> | | | | | | | | | | | | | |
| 控制模式: <input type="text"/> | | | | | | | | | | | | | |
| 适用时段: <input type="text"/> | | | | | | | | | | | | | |
| <input checked="" type="checkbox"/> 上市首日进行控制 | | | | | | | | | | | | | |
| <input type="checkbox"/> 适用时段做为分子计算条件 | | | | | | | | | | | | | |

注意：

“分母类型”可选择“当日市场成交量”、“前 N 日市场平均成交量”、“max(当

日市场成交量，前 N 日市场平均成交量)”，其中 $\max(\text{当日市场成交量}, \text{前 N 日市场平均成交量})$ 表示在当日市场成交量和前 N 日市场平均成交量两者中取大的作为分母。

“适用时段做分子计算条件”当勾选该条件时在计算分子“当日交易量”时，只会计算适用时间段内的交易量。

风控举例

单笔股票买入的数量不得大于当日市场成交量的 10%。

当日交易量/市场成交量控制 (比例控制)
✕

风控设置

设置当日交易量风险的控制参数，阈值为比例型

风控编号:

优先级: 低 高

启用风控: 汇总控制:

有效开始日期: 有效截止日期:

比较方向:

作用范围: 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

风控等级:

风控说明: 触发后进行消息提醒

阈值一: %

阈值二: %

阈值三: %

触警操作:

触警操作:

触警操作:

控制条件

互斥设置

联合设置

备注

控制方式:

控制层次:

产品编号:

排除产品:

产品控制:

分母类型:

委托方向:

控制模式:

适用时段:

上市首日进行控制

适用时段做为分子计算条件

- (认购期权
-) 认沽期权
- 1 股票
- 2 封闭式基金
- 3 国债
- 4 可转债
- 5 可转换债
- F 开放式基金
- R 股指期货
- S 公司债
- T 地方债
- W 国债期货
- v 商品期货

● H 执行价格控制

该类风控主要控制当日证券交易的指令价格与指定的价格的比值不能超过设定的范围。可以用作比较的价格有：昨收盘、市均价、最新价、参考价格等。

执行价格控制 (比例控制)
✕

风控设置
 买入时控制的是涨幅，卖出时控制的是跌幅

| | |
|--|---|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: <input type="text" value="大于"/> |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: <input type="text" value="3 公司内部"/> |
| 风控说明: <input type="text"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> |

| | |
|-----------------------------|---|
| 阈值一: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text" value="1 预警"/> |
| 阈值二: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

| 控制方式: <input type="text" value="1 按证券控制"/> | <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <th style="width: 50%;">证券代码</th> <th style="width: 50%;">证券名称</th> </tr> <tr> <td> </td> <td> </td> </tr> </table> | 证券代码 | 证券名称 | | |
|--|---|------|------|--|--|
| 证券代码 | 证券名称 | | | | |
| | | | | | |
| 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> | | | | | |
| 产品编号: <input type="text"/> | | | | | |
| 排除产品: <input type="text"/> | | | | | |
| 市场代码: <input type="text" value="0 所有市场"/> | 证券代码: <input type="text"/> <input type="button" value="增加"/> | | | | |
| 控制价格: <input type="text" value="1 指令、委托价格"/> | 证券名称: <input type="text"/> <input type="button" value="删除"/> | | | | |
| 价格类型: <input type="text" value="2 限价指令生效"/> | | | | | |
| 委托方向: <input type="text"/> | 日期类型: <input type="text" value="1 自然日"/> | | | | |
| 比较价格: <input type="text"/> | 比较天数: <input type="text" value="0"/> 天之前 | | | | |
| 适用时段: <input type="text"/> | 计算模式: <input type="text" value="0 除法"/> | | | | |
| <input checked="" type="checkbox"/> 上市首日进行控制 | 业务分类: <input type="text" value="0 不区分"/> | | | | |

注意：

“控制价格”可选择 1.指令、委托价格；2.复权价格；；3.最新价（当选择最新价时，“价格类型”可选择市价指令生效或限价指令生效。）；4.银行间债券收益率；5.沪深股票涨跌幅；6.最新价（债券按净价）。

“比较价格”可选择昨收盘、市均价、涨跌停价等价格。

“日期类型”与比较天数结合使用，可设置于 N 天之前的价格做比较，比较天数默认为 0 表示与当天的价格做比较。

风控举例

买卖证券代码为“600000”的股票价格不能超过 55 元。设置如下图 3.17，

执行价格控制（绝对控制）

风控设置
设置执行价格风险的控制参数，阈值为金额型

风控编号：自动生成 比较方向：1 大于

优先级：低 [] 高 作用范围： 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

启用风控： 汇总控制： 风控等级：3 公司内部

风控说明：买卖600000的价格不能超过55 触发后进行消息提醒

有效开始日期：2013-02-11 有效截止日期：2013-02-11

| | |
|-------------|-----------|
| 阈值一：0 元 | 触警操作：1 预警 |
| 阈值二：55 元 | 触警操作：2 禁止 |
| 阈值三： 元 | 触警操作： |

控制条件 互斥设置 联合设置 备注

| | | |
|----------------|-------------|------|
| 控制方式：1 按证券控制 | 证券代码 | 证券名称 |
| 控制层次：1 产品 | ▶ 600000 | 浦发银行 |
| 产品编号： | | |
| 排除产品： | | |
| 市场代码：1,2 | 证券代码：600000 | 增加 |
| 控制价格：1 指令、委托价格 | 证券名称：浦发银行 | 删除 |
| 价格类型：2 限价指令生效 | | |
| 委托方向：3 买卖都控制 | 业务分类：0 不区分 | |
| 适用时段： | | |

上市首日进行控制

确定 取消

● I 证券买卖控制

该类风控主要控制选定可以进行的证券是否允许买卖的控制。

证券买卖控制
✕

风控设置

设置证券买卖风险的控制参数
控制方式为按股票池类别时
选择的股票池类型不包含维度层次

| | |
|--|---|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 触警操作: <input type="text" value="1 预警"/> |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: <input type="text" value="3 公司内部"/> |
| 风控说明: <input type="text"/> | <input type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> |

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|--|--|
| 控制方式: <input type="text" value="2 按证券类别控制"/> | <div style="border: 1px solid #ccc; padding: 5px;"> <input type="checkbox"/> (认购期权 <input type="checkbox"/>) 认沽期权 <input type="checkbox"/> 1 股票 <input type="checkbox"/> 2 封闭式基金 <input type="checkbox"/> 3 国债 <input type="checkbox"/> 4 企债 <input type="checkbox"/> 5 可转债 <input type="checkbox"/> 6 政策性金融债 <input type="checkbox"/> 8 债券回购 <input type="checkbox"/> D 央行票据 <input type="checkbox"/> F 开放式基金 <input type="checkbox"/> G 非政策性金融债 <input type="checkbox"/> K 次级债 <input type="checkbox"/> M 认股权证 <input type="checkbox"/> N 认沽权证 <input type="checkbox"/> R 股指期货 <input type="checkbox"/> S 公司债 <input type="checkbox"/> T 地方债 <input type="checkbox"/> U 理财产品 <input type="checkbox"/> W 国债期货 <input type="checkbox"/> a 股票申购 <input type="checkbox"/> d 增发 <input type="checkbox"/> k 债券申购 <input type="checkbox"/> .. 债券 </div> |
| 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> | |
| 产品编号: <input type="text"/> | |
| 排除产品: <input type="text"/> | |
| 操作类型: <input type="text"/> | |

债转股时判断该条风控
 买断式回购现券不控制

风控举例

交易时禁止股票买入。

证券买卖控制
✕

风控设置

设置证券买卖风险的控制参数
控制方式为按股票池类别时
选择的股票池类型不包含维度层次

风控编号: 自动生成

优先级: 低 高

启用风控: 汇总控制:

风控说明: 禁止股票买入

有效开始日期: 2013-02-11 有效截止日期: 2013-02-11

触警操作: 2 禁止

作用范围: 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

风控等级: 3 公司内部

触发后进行消息提醒

控制条件
高级设置
互斥设置
联合设置
备注

控制方式: 2 按证券类别控制

控制层次: 1 产品

产品编号: 73 现货产品1

排除产品:

操作类型: 2 控制买入

债转股时判断该条风控

买断式回购现券不控制

- (认购期权
-) 认沽期权
- 1 股票
- 2 封闭式基金
- 3 国债
- 4 企业债
- 5 可转债
- 6 政策性金融债
- 8 债券回购
- D 央行票据
- F 开放式基金
- G 非政策性金融债
- K 次级债
- M 认股权证
- N 认沽权证
- R 股指期货
- S 公司债
- T 地方债
- U 理财产品
- W 国债期货
- a 股票申购
- d 增发
- k 债券申购
- .. 可转债

确定
取消

● J 同向反向控制

该类风控主要用来避免产品内或产品间进行反向交易。可以通过选择反向模式来区分不同的反向交易的概念与范围。

同向反向控制
✕

风控设置

设置同向反向风险的控制参数

| | |
|--|---|
| 风控编号: 自动生成 | 触警操作: 预警 |
| 优先级: 低 <input type="text"/> 高 | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: 3 公司内部 |
| 风控说明: <input type="text"/> | <input type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: 2013-02-11 | 有效截止日期: 2013-02-11 |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|--|---|
| <p>控制方式: 2 按证券类别控制</p> <p>控制层次: 1 产品</p> <p>产品编号: <input type="text"/></p> <p>排除产品: <input type="text"/></p> <p>产品控制: 0 单产品控制</p> <p>投资类型: <input type="text"/></p> <p>控制模式: 0 不做控制</p> <p>比较天数: 1</p> <p>市场代码: 0 所有市场</p> <p>反向信息: <input type="text"/></p> <p>人员控制: 2 单人员、多人员联合</p> <p>业务分类: <input type="text"/></p> | <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> (认购期权 <input type="checkbox"/>) 认沽期权 <input type="checkbox"/> 1 股票 <input type="checkbox"/> 2 封闭式基金 <input type="checkbox"/> 3 国债 <input type="checkbox"/> 4 企业债 <input type="checkbox"/> 5 可转债 <input type="checkbox"/> 6 政策性金融债 <input type="checkbox"/> 8 债券回购 <input type="checkbox"/> D 央行票据 <input type="checkbox"/> F 开放式基金 <input type="checkbox"/> G 非政策性金融债 <input type="checkbox"/> K 次级债 <input type="checkbox"/> M 认购权证 <input type="checkbox"/> N 认沽权证 <input type="checkbox"/> R 股指期货 <input type="checkbox"/> S 公司债 <input type="checkbox"/> T 地方债 <input type="checkbox"/> U 理财产品 <input type="checkbox"/> W 国债期货 <input type="checkbox"/> v 商品期货 |
|--|---|

注意：

“控制模式”可选择 0.不做控制；1.不能有买有卖；2.不允许买价”=卖价；3.已成的指令\委托不形成反向交易：表示若指令或委托已完成，则允许做反向交易；4.未成部分不允许买价”=卖价；5.同向控制；6.ETF 一二级市场不允许反向。

“比较天数”表示与交易日当天及前 N 个交易日数据进行比较,天数不能小于 1，

填 1 的时候表示控制当天数据进行同向反向的比较。

“反向信息”选择触犯反向时提示的信息。0.不显示；1.显示层次信息(表示显示哪个组合发生了反向交易)；2.显示价格；3.显示数量。

“人员控制”可选择 1.单人员控制，对各个人员进行单独控制 2.多人员联合控制，对所有人员进行联合控制 3.单人员、多人员联合控制，对于各人员、人员间的反向交易都进行控制。

风控举例

不允许买价大于等于卖价。

同向反向控制
✕

风控设置

设置同向反向风险的控制参数

| | |
|--|--|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 触警操作: <input type="text" value="预警"/> |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 <input type="text" value=""/> | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input checked="" type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: 3 公司内部 |
| 风控说明: <input type="text" value="不允许买价大于卖价"/> | <input type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|--|---|
| <p>控制方式: 2 按证券类别控制</p> <p>控制层次: 1 产品</p> <p>产品编号: 73, 74, 75, 194</p> <p>排除产品: <input type="text"/></p> <p>产品控制: 2 单产品、多产品联合</p> <p>投资类型: 0 不区分</p> <p>控制模式: 2 不允许买价>=卖价</p> <p>比较天数: 1</p> <p>市场代码: 0 所有市场</p> <p>反向信息: 1, 2, 3</p> <p>人员控制: 2 单人员、多人员联合</p> <p>业务分类: <input type="text"/></p> | <ul style="list-style-type: none"> <input checked="" type="checkbox"/> (认购期权) <input checked="" type="checkbox"/>) 认沽期权 <input checked="" type="checkbox"/> 1 股票 <input checked="" type="checkbox"/> 2 封闭式基金 <input checked="" type="checkbox"/> 3 国债 <input checked="" type="checkbox"/> 4 企业债 <input checked="" type="checkbox"/> 5 可转债 <input checked="" type="checkbox"/> 6 政策性金融债 <input checked="" type="checkbox"/> 8 债券回购 <input checked="" type="checkbox"/> D 央行票据 <input checked="" type="checkbox"/> F 开放式基金 <input checked="" type="checkbox"/> G 非政策性金融债 <input checked="" type="checkbox"/> K 次级债 <input checked="" type="checkbox"/> M 认股权证 <input checked="" type="checkbox"/> N 认沽权证 <input checked="" type="checkbox"/> R 股指期货 <input checked="" type="checkbox"/> S 公司债 <input checked="" type="checkbox"/> T 地方债 <input checked="" type="checkbox"/> U 理财产品 <input checked="" type="checkbox"/> W 国债期货 <input type="checkbox"/> 商品期货 |
|--|---|

● K 剩余天数控制

该类风控主要用来对债券的久期或剩余天数进行控制。

剩余天数控制（绝对控制）
✕

风控设置

设置（货币市场产品）剩余天数风险的控制参数

风控编号:

优先级: 低 高

启用风控: 汇总控制:

风控说明:

有效开始日期: 有效截止日期:

比较方向:

作用范围: 普通交易 指令 静态查询 特殊交易

风控等级:

触发后进行消息提醒

| | | |
|---------------------------|---|---|
| 阈值一: <input type="text"/> | 天 | 触警操作: <input type="text" value="1 预警"/> |
| 阈值二: <input type="text"/> | 天 | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> | 天 | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

控制层次:

产品编号:

排除产品:

控制方式:

期限类型:

付息债期限:

含权债期限:

产品控制:

分子计算扣除基金剩余存续期

当日冲现申赎款计入现金

注意：控制方式可支持“按维度控制”，选择“按维度控制”后计算类型支持按“剩余天数”和按“修正久期”计算。

风控举例

单个债券的修正久期不得超过 1 年。

剩余天数控制（绝对控制）
✕

风控设置

设置（货币市场产品）剩余天数风险的控制参数

风控编号:

优先级: 低 高

启用风控: 汇总控制:

有效开始日期: 有效截止日期:

比较方向: 1 大于

作用范围: 普通交易 静态查询
 指令 特殊交易

风控等级: 3 公司内部

风控说明: 触发后进行消息提醒

| | |
|---------------------------------------|----------------------------|
| 阈值一: <input type="text" value="1"/> 年 | 触警操作: 2 禁止 |
| 阈值二: <input type="text"/> 年 | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> 年 | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

控制层次: 1 产品

产品编号: 2 恒生增长1号

排除产品:

控制方式: 2 单个债券

计算类型: 2 修正久期

产品控制: 0 单产品控制

分子计算扣除基金剩余存续期

- **L 到期回购资产控制**

该类风控主要对在途回购的资产进行控制，支持绝对控制和比例控制。

到期回购资产控制（绝对控制）
✕

风控设置

设置在途回购资产风险的控制参数

| | |
|---|---|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: <input type="text" value="大于"/> |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input checked="" type="checkbox"/> | 风控等级: <input type="text" value="3 公司内部"/> |
| 风控说明: <input type="text"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2016-12-05"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2016-12-05"/> |

| | |
|------------------------------|---|
| 阈值一: <input type="text"/> 万元 | 触警操作: <input type="text" value="1 预警"/> |
| 阈值二: <input type="text"/> 万元 | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> 万元 | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

| |
|--|
| 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> |
| 产品编号: <input type="text"/> |
| 排除产品: <input type="text"/> |
| 产品控制: <input type="text" value="0 单产品控制"/> |
| 市场代码: <input type="text" value="0 所有市场"/> |
| 回购用途: <input type="text" value="-1 所有"/> |
| 法定到期日: <input type="text"/> 天 |
| 控制方向: <input type="text"/> |

风控举例

到期天数为 10 天内的融券回购资产不得超过资产净值的 10%。设置如下图，

到期回购资产控制（比例控制）
✕

风控设置

设置在途回购资产风险的控制参数

| | |
|---|--|
| 风控编号: 1 | 比较方向: 1 大于 |
| 优先级: 低 <input type="text"/> 高 | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input checked="" type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input checked="" type="checkbox"/> | 风控等级: 3 公司内部 |
| 风控说明: 融券回购资产不得超过资产净值的10% <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 | |
| 有效开始日期: 2016-12-07 | 有效截止日期: 2016-12-07 |

| | |
|-----------------------------|----------------------------|
| 阈值一: 10 % | 触警操作: 2 禁止 |
| 阈值二: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件
互斥设置
联合设置
备注

| | |
|----------------------------|--|
| 控制层次: 1 产品 | |
| 产品编号: 2 | |
| 排除产品: <input type="text"/> | |
| 产品控制: 0 单产品控制 | |
| 市场代码: 0 所有市场 | |
| 回购用途: -1 所有 | |
| 法定到期日: 4 小于等 10 天 | |
| 控制方向: 2 融券(含拆借) | |
| 分母类型: 1 净值 | |

● R 期货保证金控制

该类风控主要对期货保证金进行控制，支持绝对控制和比例控制。

期货保证金控制（比例控制）
✕

风控设置

设置期货保证金风险的控制参数

| | |
|--|---|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: <input type="text" value="大于"/> |
| 优先级: 低 <input type="text" value=""/> 高 | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 <input type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> 汇总控制: <input type="checkbox"/> | 风控等级: 3 公司内部 |
| 风控说明: <input type="text"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2013-02-11"/> |

| | |
|-----------------------------|----------------------------|
| 阈值一: <input type="text"/> % | 触警操作: 1 预警 |
| 阈值二: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |
| 阈值三: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> |

控制条件
高级设置
备注

| | |
|---|--|
| 控制方式: 2 按证券类别控制 控制层次: 1 产品 产品编号: <input type="text"/> 排除产品: <input type="text"/> 产品控制: 0 单产品控制 开仓方向: 0 不区分 分母类型: <input type="text"/> 适用时段: <input type="text"/> 价格类型: 1 最新价 <input type="checkbox"/> 同合约内多空轧差取绝对值 | <input type="checkbox"/> R 股指期货 <input type="checkbox"/> W 国债期货 <input checked="" type="checkbox"/> V 商品期货 |
|---|--|

风控举例

期货保证金占用不得超过所控范围期货保证金的 10%。设置如下，

期货保证金控制（比例控制）
✕

风控设置

设置期货保证金风险的控制参数

| | | |
|--|--|--|
| 风控编号: <input type="text" value="自动生成"/> | 比较方向: <input type="text" value="1 大于"/> | |
| 优先级: <input type="text" value="低"/> <input type="text" value="高"/> | 作用范围: <input checked="" type="checkbox"/> 普通交易 <input type="checkbox"/> 静态查询 | <input checked="" type="checkbox"/> 指令 <input type="checkbox"/> 特殊交易 |
| 启用风控: <input checked="" type="checkbox"/> | 汇总控制: <input checked="" type="checkbox"/> | 风控等级: <input type="text" value="3 公司内部"/> |
| 风控说明: <input type="text" value="期货保证金占用不得超过所控范围期货"/> | | <input checked="" type="checkbox"/> 触发后进行消息提醒 |
| 有效开始日期: <input type="text" value="2016-01-07"/> | 有效截止日期: <input type="text" value="2016-01-07"/> | |

| | | |
|--|---|--|
| 阈值一: <input type="text" value="10"/> % | 触警操作: <input type="text" value="2 禁止"/> | |
| 阈值二: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> | |
| 阈值三: <input type="text"/> % | 触警操作: <input type="text"/> | |

控制条件
高级设置
备注

| | |
|--|--|
| 控制方式: <input type="text" value="2 按证券类别控制"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 股指期货 |
| 控制层次: <input type="text" value="1 产品"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 国债期货 |
| 产品编号: <input type="text" value="1,2"/> | <input checked="" type="checkbox"/> 商品期货 |
| 排除产品: <input type="text"/> | |
| 产品控制: <input type="text" value="0 单产品控制"/> | |
| 开仓方向: <input type="text" value="0 不区分"/> | |
| 分母类型: <input type="text" value="25 所控范围期货保证"/> | |
| 适用时段: <input type="text"/> | |
| 价格类型: <input type="text" value="1 最新价"/> | |
| <input type="checkbox"/> 同合约内多空轧差取绝对值 | |

4.4 风控预警查询

“风控预警查询”位于菜单“风险控制”→“风控预警查询”界面，是用来查询已经记录下来的触发了的风控以及审批记录的情况。通过查询日期、操作员、

产品、触警操作、风控类型等查询条件，就能正确的缩小查询范围，快速定位到待查询的记录。

在风控预警查询界面中，还可以进行自动刷新，设置好正确的刷新时间后，界面每隔一定时间便会执行自动查询，方便用户及时掌握风控状况。

在界面输入查询时间、操作员、风控类型等查询条件后点击“查询”按钮即可。



4.5 静态风控查询

静态风控是用来对当前各产品的风险状况进行风控计算，并显示计算结果，供用户查询。通过静态风险监控，用户可以随时掌握当前各只基金是否有违反风控设置的情况。特别是一些被动触发的风控，如市值的控制，由于价格的升高，有可能会被动触发的触发风控，用户需要时常关注，以便及时作出调整。

在菜单“风险控制”→“静态风控查询”菜单界面，界面上方区域一显示具体触发的风控，下方区域二为风控阈值、风控检查实际值和两者的差值。



4.6 证券池管理

用户可以在证券池管理按不同维度针对各项产品设置投资方案,包括设置建议投资、限制投资(数量限制)及禁止投资三种类型的证券池。维度的分类用户可自行选择相关标准,通常可按证监会标准行业、指数、板块等等划分,维度划分之后可以以此作为数据分析的依据。系统菜单路径:“风险控制”→“证券池管理”。

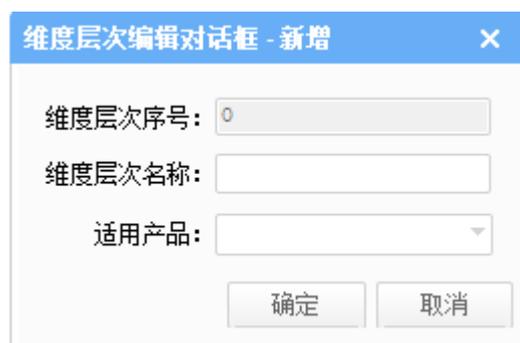
4.6.1 证券池界面

系统界面分为三个区域,左侧区域一是对维度信息和证券池进行操作,包含增加、修改和删除;右侧区域二可对相关证券池的证券信息进行新增、修改、删除和查询等操作,且查询时可以通过维度、证券池条件来筛选列表证券信息;右侧区域三显示证券信息。



4.6.2 证券池设置

维度：在维度层次点击增加，输入维度代码和维度名称，以及适用于那些产品，之后点‘确定’保存即可。维度的删除、修改和增加下级操作类似，不再赘述。



证券池：在证券池点击增加，选择证券池类型，输入证券池代码和名称，以及证券数量限制（可不设置），之后点‘确定’保存即可。证券池的删除、修改和增加下级操作类似，不再赘述。

证券信息：在系统界面区域二点击增加，输入证券代码来选择证券，之后点‘确定’保存即可。证券信息的删除、修改和增加下级操作类似，不再赘述。

4.7 风险监控设置

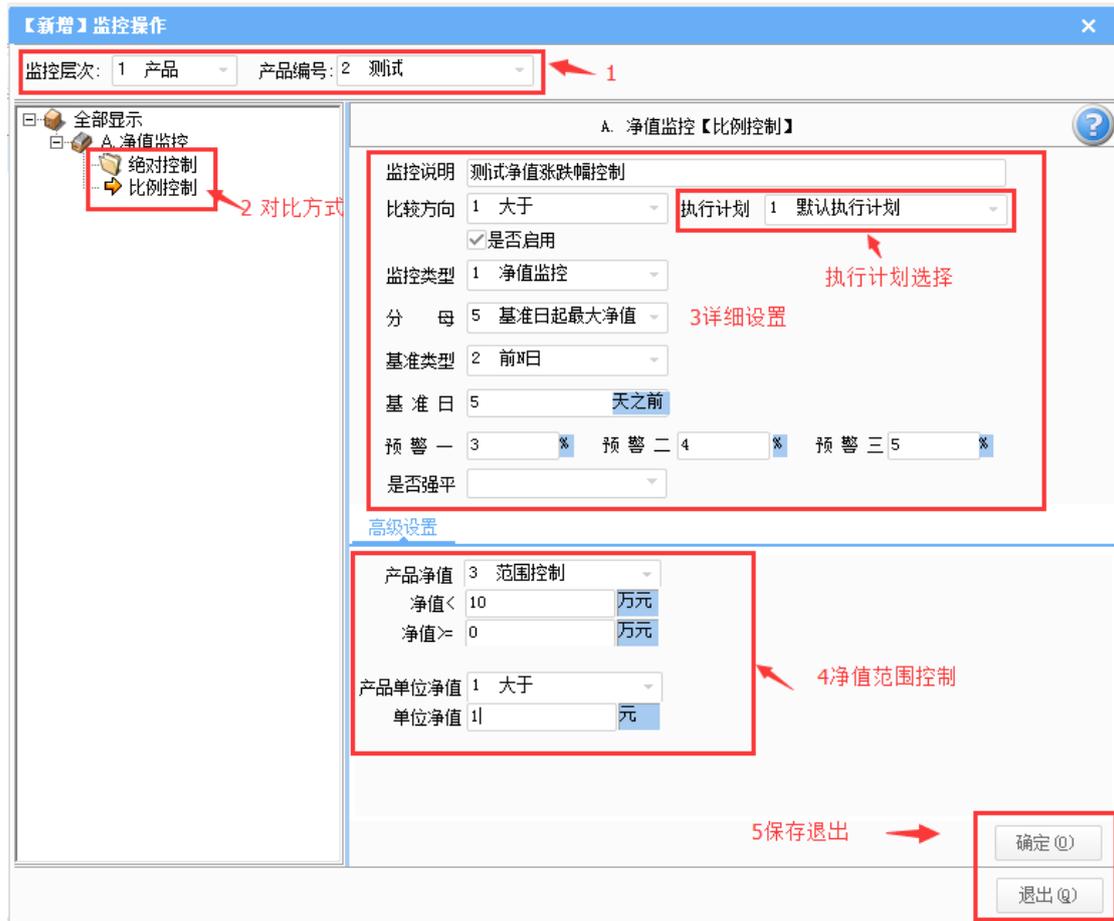
用户可以通过风险监控设置来对净值和单位净值的变化进行监控，可以针对产品或者单元层面进行设置。设置完毕可以通过进行‘执行计划设置’来设置监控提醒的间隔，以及对监控提醒进行启用和停用。系统菜单路径：“风险控制”

→ “风险监控设置”。



4.7.1 监控设置

在系统界面点新增，进入监控设置界面，1 选择监控层次、对应产品或和单元信息；2 监控方式选择，可选择按绝对控制（以具体金额作比较）或比例控制（以比例作比较）；3 对监控提醒参数进行详细设置，如要使用自定义执行计划可进行选择，执行计划设置见 4.7.2；4 高级设置，可针对净值和产品单位净值设置区间进行监控提醒控制；5 保存退出，设置完毕点确定即可，取消保存点退出。



4.7.2 执行计划设置

用户可以在“执行计划设置”里自定义新的执行计划，设置相关提醒的间隔，以及是否启用计划，设置完毕之后，已启用的执行计划就可以在进行监控提醒设置的时候进行选择。

4.7.3 监控启/停用

监控提醒设置完毕之后可以返回列表页面进行启用或者停用设置,选择监控信息之后点击启用/停用按钮(已启用的监控按钮显示为停用)即可生效,如果需要对所有监控进行批量设置,可点击启用按钮右边的按钮,之后选择启用/停用所有监控。



4.8 风险监控与处置

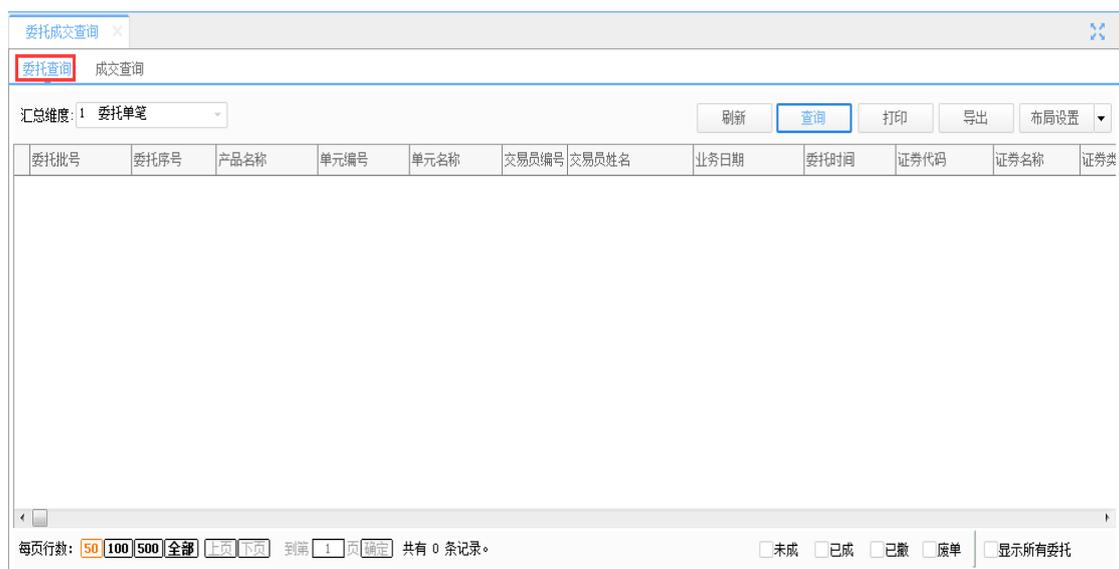
用户可以通过风险监控与处置查询监控信息，对持仓证券进行强平处理、对融资融券进行负债调整和平仓处理、对强平委托进行撤单和修改处理等业务操作，进行禁买权限控制、历史监控信息查询等业务处置。详细介绍见《平安 PB 投资管理系统用户手册-风险监控与处置》。系统菜单路径：“风险控制” → “风险监控与处置”。

第五章 信息查询

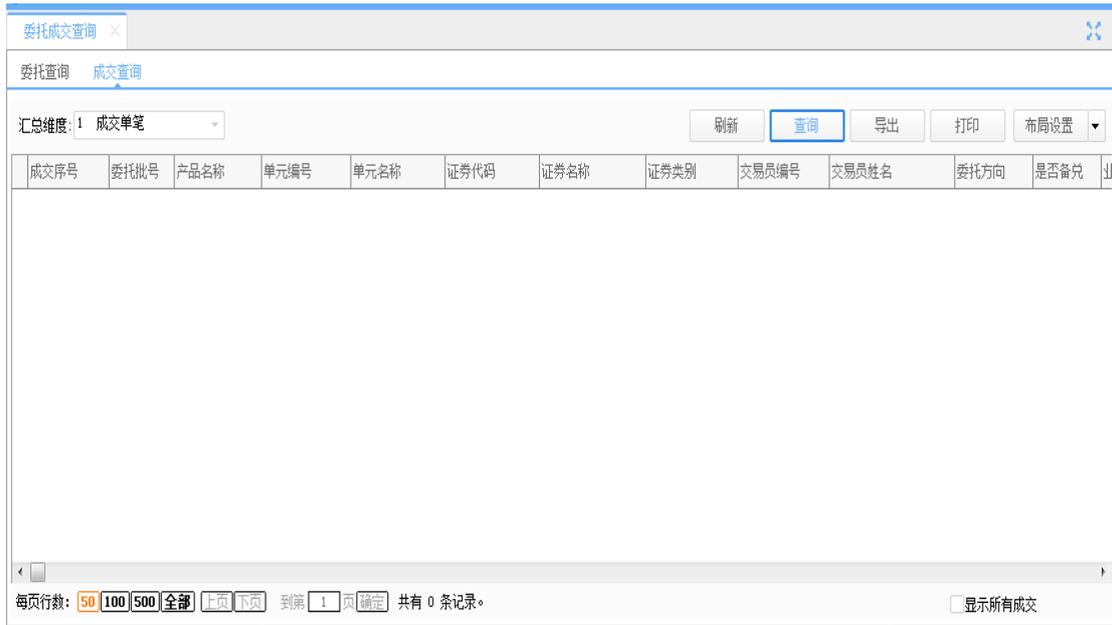
5.1 委托成交查询

“委托成交查询”分为“委托查询”和“成交查询”两个子页面。“委托查询”中用户可以查询当天委托和历史委托数据，能根据条件过滤查询的数据，并能指定数据汇总的维度；“成交查询”中用户可以查询当天和历史的成交数据，能根据条件过滤查询的数据，也能指定数据汇总的维度。委托和成交数据还支持打印和导出功能。

在“信息查询”→“委托成交查询”主界面。委托查询界面如下图（1）所示，成交查询界面如下图（2）所示：



图（1）



图（2）

“委托查询”界面中，通过单击“刷新”按钮，可以加载或刷新委托数据；在汇总维度中可以选择按“委托单笔”、“委托合笔”、“证券代码+委托方向”、“产品+证券代码+委托方向”和“产品+证券代码+委托方向+业务日期”进行委托数据的树形结点的汇总。

通过委托数据列表下方的“未成”、“已成”、“已撤”和“废单”和“显示所有委托”五个勾选框，可以按委托状态来过滤数据。

单击“查询”按钮可以通过更多的条件来过滤所查数据，其中委托数据在满足设置的所有条件时才会显示。

“成交查询”界面中，通过单击“刷新”按钮，可以加载或刷新成交数据；在汇总维度中可以选择按“成交单笔”、“委托序号”、“证券代码”、“证券代码+委托方向”、“产品+证券代码+委托方向”和“产品+证券代码+委托方向+业务日期”进行成交数据的树形结点的汇总。

单击“查询”按钮可以通过更多的条件来过滤所查数据，查询条件设置界面。

委托查询调整设置如下图（1）所示，成交查询条件设置如下图（2）所示：

图（1）

图（2）

5.2 流水查询

“流水查询”主要是对资金流水的一个记录功能，可以查询当前操作员有权限制的产品的当日或历史的委托流水记录。

在菜单“信息查询”→“流水查询”界面，就能根据刷新以及查询来查找出相应的历史记录。

| 业务日期 | 流水序号 | 发生业务 | 证券代码 | 证券名称 | 产品名称 | 单元编号 | 单元名称 | 交易市场 | 业务分类 | 发生金额 | 发生后余额 | 委托方向 | 委托价格 | 发生数量 | 交易 |
|------------|------|--------|--------|--------|-------|------|----------|------|-------|----------------|----------------|------|--------|------------|----|
| 2016-04-01 | 1499 | 增加证券成非 | 522997 | 长信YLTZ | 自营产品 | 1 | 自营股票资金账户 | 上交所A | | 2,000.00 | 2,000.00 | | 2.0000 | 0.00 | |
| 2016-04-01 | 1498 | 增加证券成非 | 522997 | 长信YLTZ | 自营产品 | 1 | 自营股票资金账户 | 深交所A | | 0.00 | 0.00 | | 2.0000 | 1,000.00 | |
| 2016-04-01 | 1497 | 增加证券成非 | 182003 | 长城货币 | 自营产品 | 1 | 自营股票资金账户 | 深交所A | | 1,200.00 | 1,200.00 | | 1.2000 | 0.00 | |
| 2016-04-01 | 1496 | 增加证券成非 | 182003 | 长城货币 | 自营产品 | 1 | 自营股票资金账户 | 深交所A | | 0.00 | 0.00 | | 1.2000 | 1,000.00 | |
| 2016-04-01 | 1495 | 融资购回 | 8010 | 8014 | 银行间产品 | 1 | 缺省资金账户 | 银行间 | 银行间业务 | -10,002,739.73 | 9,289,160.27 | 融资购回 | 1.0000 | 100,000.00 | |
| 2016-04-01 | 1491 | 银行间费用 | 8010 | 8014 | 银行间产品 | 1 | 缺省资金账户 | 银行间 | 银行间业务 | 0.00 | 19,291,900.00 | 融资购回 | 1.0000 | 100,000.00 | |
| 2016-04-01 | 1484 | 资金解冻 | | | 自营产品 | 1 | 自营股票资金账户 | 交易所 | 交易所业务 | 100.00 | 0.00 | | 0.0000 | 0.00 | |
| 2016-04-01 | 1483 | 资金冻结 | | | 自营产品 | 1 | 自营股票资金账户 | 交易所 | 交易所业务 | 1,000.00 | 100,000,000.00 | | 0.0000 | 0.00 | |
| 2016-04-01 | 1482 | 资金冻结 | | | 自营产品 | 1 | 自营股票资金账户 | 交易所 | 交易所业务 | 1,000.00 | 100,001,000.00 | | 0.0000 | 0.00 | |
| 2016-04-01 | 1478 | 计提应付 | | | 银行间产品 | | | | 交易所业务 | 0.00 | 0.00 | | 0.0000 | 0.00 | |
| 合计: 10条 | | | | | | | | | | -9,997,439.73 | 228,585,260.27 | | | 202,000.00 | |

每页行数: 50 (100) (500) 到第 1 页 (确定) 共有 10 条记录。 PS刷新当前数据

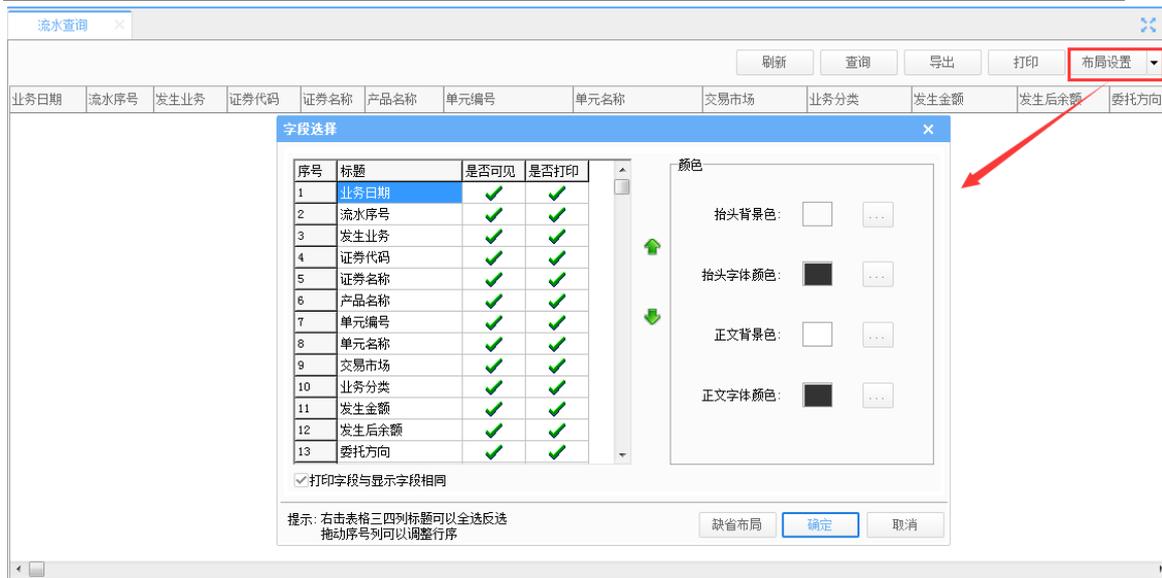
点击“查询”按钮我们可以根据起始、终止日期来选择我们所要查询的时间段，具体的产品和单元来过滤所要查询的结果。如下图

流水查询条件设置
✕

流水查询条件设置

流水查询条件明细设置

| | |
|----------------------------|---|
| 产品编号: <input type="text"/> | 委托方向: <input type="text"/> |
| 单元编号: <input type="text"/> | 业务分类: <input type="text"/> |
| 交易市场: <input type="text"/> | 发生业务: <input type="text"/> |
| 证券代码: <input type="text"/> | 起始日期: <input type="text" value="2016-04-01"/> |
| | 终止日期: <input type="text" value="2016-04-01"/> |



5.3 资产分析

“资产分析”分为“产品资产查询”、“单元资产查询”、“现货持仓查询”、“汇总证券查询”、“交易所回购”、“期货资产分析”、“标准券查询”、“可质押债券”、“期货持仓查询”、“非期货类资金数据”、“非期货类资金数据明细”、“维持担保比例监控”、“ETF 投资端查询”子页面。

5.3.1 产品资产查询

“产品资产查询”界面主要反映产品层的资金可用等情况，可以查询日期、产品名称、产品净值、单位净值、持仓市值(轧差)/产品净值(%)、现金余额、产品份额、总资产、股票资产、债券资产、期权资产、期货盈亏、回购资产、基金资产、其他资产、累计应付、累计应收、沪深 T+0 交易可用、沪深 T+1 交易可用、沪港通可用、深港通可用、期货可用保证金、期货占用保证金($\sum(\text{合约乘数} * \text{当前数量} * \text{市价} * \text{保证金比例})$)、股票成本、债券成本、基金成本、场外基金成本、期货当日实现盈亏、股票浮动盈亏、债券浮动盈亏、基金浮动盈亏、

昨日单位净值、单位净值增长率、累计实现收益（含费用）、股票+基金资产、股票资产/产品净值（%）、债券资产/产品净值（%）、基金资产/产品净值（%）、回购资产/产品净值（%）、期权资产/产品净值（%）、其他资产/产品净值（%）、融资负债、融券负债等信息。

在“信息查询”→“资产分析”→“产品资产查询”界面，输入产品编号、查询起始日期后，可以查看产品当前资产详情。同时，该界面还支持刷新、打印、导出、布局设置等功能。



详细说明

总资产=现金余额+应收+股票资产+债券资产+基金资产+回购资产+权证资产+其它资产+期货盈亏+期权资产+融资回购金额绝对值。

产品净值：产品净值=现金余额-应付+应收+股票资产+债券资产+基金资产+回购资产+权证资产+其它资产+期货盈亏+期权资产。

单位净值：产品净值/份额。

现金余额：就是当前现金资产，包括当天所有增加和减少部分。=期初现金余额+当天业务处理资金变化部分+手工调整部分。

股票资产：即该产品下所有股票的市值加和。

债券资产：该产品上资产类别为债券的所有证券的市值

期权资产：该产品期权资产类别的所有证券市值。

期货盈亏：一种资产类别，期货以盈亏记录资产，期货是保证金交易，合约价值不作为基金资产，合约当天的浮动盈亏要记入基金资产（在日终结算时，浮动盈亏要结转成资金）。

回购资产：该产品上所有回购的市值

基金资产：基金资产(除货币产品) = 基金资产 - 货币产品（主要是因为货币产品一般算作流动性资产,因此很多时候都不希望统计在基金资产中）

其他资产：其他资产是指不能包括在流动资产、长期投资、固定资产、无形资产等以外的资产，主要包括长期待摊费用和其他长期资产。其他长期资产包括特准储备物资，银行冻结存款、冻结物资、诉讼中财产等。

累计应付：合计应付金额。

累计应收：合计应收金额。

T+0 可用：当日可用金额。

T+1 可用：T+1 日的可用金额。

期货可用保证金：可用保证金金额 = 当前期货保证金产品余额 - 当前持仓占用保证金(开关) - 未成交的开仓委托需要的保证金 - 未成交委托所需要的手续费 - 最低准备金+期货浮动盈亏(开关)。

开仓时，增加持仓占用的保证金。

平仓时，按照先进先出的顺序进行处理。将浮动盈亏资产转化为保证金产品余额和当日实现盈亏，并减少保证金占用。

可用金额是否考虑保证金增加开关。当合约上涨时候，增加保证金占用，计算可用是否需要考虑这部分增加部分。

期货浮动盈利是否计入可用开关。亏损部分减少可用，盈利部分按照不同期货公司要求进行设置。

期货占用保证金：期货持仓所占用的保证金，是按照最新价来计算的保证金。

= (\sum 所有合约 (持仓手数*该合约的最新价*合约乘数*保证金比例))。

股票成本：当前数量*成本价。其中，成本价=(结转过包含费用的期初成本 + 当日买入金额 + 当日买入费用)/(当前持仓数量 + 当日卖出数量)，是包含费用的单价。股票成本只计算资产类别为“股票资产”的证券的持仓成本

债券成本：和股票成本计算类似，只是取资产类别为“债券资产”。

基金成本：和股票成本计算类似，只是取资产类别为“基金资产”。

股票浮动盈亏：股票资产-股票成本。

债券浮动盈亏：债券资产-债券成本。

基金浮动盈亏：持仓产品总市值-持仓产品总成本。

累计实现收益：期初累计实现收益+当日实现收益。

1.如果是回购类证券的持仓，证券资产类别为“回购资产”或者证券类别为“股票回购”或“债券回购”，当日实现收益为0；

2.如果是资产类别是“期货盈亏”标的的持仓，当日实现收益为期货当日实现收益；

3.对于其他情况，当日实现收益=卖出金额-卖出费用-卖出成本，卖出成本=当日卖出数量*(结转过含费用的期初成本+买入金额+买入费用)/(当前数量+当日卖出数量)。

昨日单位净值：上个交易日的单位净值。

单位净值增长率(%)：如果基金类型为开放式基金，并且投资方向为 ETF 基金，则单位净值增长率(%)=(单位净值-昨日单位净值)/昨日单位净值*100。否则，单位净值增长率(%)=单位净值/(昨单位净值-单位分红金额)-1。

累计实现收益(含费用)：如果投资类型是可交易、套保、套利或投机，累计实现收益=卖出金额 - 买入金额 - 买入费用 - 卖出费用，否则为 0。

股票+基金资产：显示股票与基金资产的和。

5.3.2 单元资产查询

“单元资产查询”界面主要反映各交易单元层次的资金可用等情况，具体可以查询日期、产品名称、单元名称、单元净值、单元净值(全价)、持仓资产/单元净值(%)、期初现金余额、当前现金余额、沪深 T+0 交易可用、沪深 T+1 交易可用、期货可用保证金、期货占用保证金($\sum(\text{合约乘数} * \text{当前数量} * \text{市价} * \text{保证金比例})$)、银行间 T+0 交易可用，银行间 T+1 交易可用、回购资产、期货当日实现盈亏、期权资产、期货盈亏、股票资产、股票成本、股票浮动盈亏、债券资产、债券成本、债券浮动盈亏、基金资产、基金成本、基金浮动盈亏、累计收益率(%)、合计应收、合计应付、累计实现收益(含费用)、单元净值增长、单元净值增长率、股票+基金资产、股票资产/单元资产净值(%)、债券资产/单元资产净值(%)、基金资产/单元资产净值(%)、回购资产/单元资产净值(%)、期权资产/单元资产净值(%)、现货总资产、融资负债、融券负债等信息。

在“信息查询”→“资产分析”→“单元资产查询”界面，用户可以通过产品编号、单元编号、起始和截止日期等信息进行筛选和查询。

详细说明

累计收益率：期初收益率+本期收益率。本期收益率：(资产单元净资产-日均本金) /日均本金。

持仓资产/总资产：(总资产-当前现金余额-合计应收+合计应付) /总资产。

(其他字段参考产品资产查询字段的解释。)

5.3.3 现货持仓查询

“现货持仓查询”支持当前和历史现货持仓数据的查询。

在“信息查询”→“资产分析”→“现货持仓查询”界面,点击“查询”按钮后我们可以通过选择相应的起始、终止时间、产品、单元、市场、证券代码等信息来筛选列表内容。

| 日期 | 证券名称 | 证券代码 | 证券类别 | 停牌标志 | 最新价 | 成本价 | 产品名称 | 单元编号 | 单元名称 | 分层信息 | 持仓数量 | 可用数量 | 当前成本 | 持仓市值(净价) | 持仓市值(全价) |
|--|------|------|------|------|-----|-----|------|------|------|------|------|------|------|----------|----------|
| 证券代码: <input type="text"/> 定位 刷新 查询 打印 导出 布局设置 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 每页行数: 50 100 500 全部 翻页 下一页 到第 1 页 共有 0 条记录 刷新当前数据 | | | | | | | | | | | | | | | |

成本价：如果 当前数量+卖出数量=0，成本价=0；如果 当前数量+卖出数量” “0，成本价=成本/（当前数量+卖出数量）。成本 = 结转过含费用的期初成本+买入金额+实际当日买入费用（远程客户端的成本是包含费用的）

持仓数量：就是当前持仓数量(资产数量)，包括新红配，以及当天所有增加和减少部分。当前期初数量+当天业务处理资产变化部分 + 手工调整部分

当前成本：如果当前数量+卖出数量=0，当前成本为 0；如果当前数量+卖出数量” “0，当前成本=成本*（当前数量/（当前数量+卖出数量））。成本 = 结转过含费用的期初成本+买入金额+实际当日买入费用（远程客户端的成本是包含费用的）

持仓市值（净价）：当前数量*净价市价，计算后的价格四舍五入，同时取两位小数。

持仓市值（全价）：当前数量*全价市价，计算后的价格四舍五入，同时取两位小数。

持仓市值（净价）/单元净值（%）：（净价市值/净资产）*100，计算后的价格四舍五入，同时取四位小数。

持仓市值(全价)/单元净值(%):(全价市值/净资产)*100, 计算后的价格四舍五入, 同时取四位小数。

累计现实盈亏: 如果证券类别是股票回购、债券回购或资产类别是回购资产, 则累计盈亏为 0; 累计实现盈亏 = 期初累计实现盈亏 + 当日实现盈亏, 对于当日实现盈亏:

- (1) 如果卖出数量为 0, 则当日实现盈亏为 0;
- (2) 如果卖出金额+当前数量=0, 则当日实现盈亏为 0;
- (3) 否则当日实现盈亏=卖出金额-实际卖出费用-卖出数量 * 成本价

浮动盈亏: 市值-当前成本。

浮盈率(%): 持仓市值(净价)=0, 浮盈率为 0; 否则浮盈率=浮动盈亏*100/持仓市值(净价)

盈亏率(%): 当前成本为 0, 盈亏率为 0; 否则, 盈亏率=浮动盈亏*100/当前成本

投资类型: 值域有: 可交易、持有到期、可供出售、贷款和应收款项。

当日买入数量: 当日买入现货合计数量。

当日卖出数量: 当日卖出现货合计数量。

保本价:(当前成本-(累计盈亏-结转后可交易资产总费用+卖出金额-卖出费用-卖出成本-(当日实际买入费用+当日实际卖出费用)))/当前数量。

5.3.4 汇总证券查询

“汇总证券查询”可以汇总查询证券相关信息。

在“信息查询”→“资产分析”→“汇总证券查询”界面, 点击“查询”按

钮在弹出查询界面选择按起始、终止时间、产品、单元、证券代码等信息筛选列表内容。

| 证券代码 | 证券名称 | 证券类别 | 交易市场 | 停牌标志 | 分层信息 | 最新价 | 成本价 | 持仓数量 | 当日买入数量 | 当日买入金额 | 当日卖出数量 | 当日卖出金额 | 当前成本 | 持仓市值(净价) | 持仓市 |
|--|------|------|------|------|------|-----|-----|------|--------|--------|--------|--------|------|----------|-----|
| 每页行数: 50 100 500 全部 刷新 打印 共有 0 条记录 | | | | | | | | | | | | | | | |

持仓数量：就是当前持仓数量(资产数量)，包括新红配，以及当天所有增加和减少部分。当前期初数量+当天业务处理资产变化部分+手工调整部分

当前成本：如果当前数量+卖出数量=0，当前成本为 0；如果当前数量+卖出数量” “0，当前成本=成本*(当前数量/(当前数量+卖出数量))。成本 = 结转过含费用的期初成本+买入金额+实际当日买入费用（远程客户端的成本是包含费用的）

持仓市值（净价）：当前数量*净价市价，计算后的价格四舍五入，同时取两位小数。

持仓市值（全价）：当前数量*全价市价，计算后的价格四舍五入，同时取两位小数。

当日实现盈亏：(当日结算价-上一交易日结算价)×持仓量

股票涨跌幅：(当前价格-昨日收盘价格) / 昨日收盘价格

浮动盈亏：市值-当前成本。

浮盈率(%)：持仓市值(净价)=0，浮盈率为 0；否则浮盈率=浮动盈亏*100/

持仓市值(净价)

盈亏率(%)：当前成本为 0，盈亏率为 0；否则，盈亏率=浮动盈亏*100/当前成本。

保本价：(当前成本- (累计盈亏-结转后可交易资产总费用+卖出金额-卖出费用-卖出成本- (当日实际买入费用+当日实际卖出费用))) /当前数量。

5.3.5 交易所回购

“交易所回购”可以查询交易所回购相关信息。

在“信息查询”→“资产分析”→“交易所回购”界面，点击“查询”按钮在弹出查询界面选择起始、终止时间、产品、单元、证券代码等信息筛选列表内容。

| 回购日期 | 产品名称 | 单元编号 | 单元名称 | 回购代码 | 证券名称 | 委托方向 | 数量 | 净资金额 | 退回金额 | 利润 | 额外利润 | 清算速度 | 购回处理日期 | 购回交割日期 |
|--|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|--------|--------|
| 每页行数: 50 100 500 全部 上页 下页 到第 1 页 确定 共有 0 条记录 | | | | | | | | | | | | | | |
| 回购日期 | 产品名称 | 单元编号 | 单元名称 | 回购代码 | 执行人 | 清算速度 | 股票代码 | 数量 | 成交价格 | 净资金额 | 计提利息 | 退回金额 | | |

回购日期：回购的交易日期。

净资金额：如果是融资回购，则净资金额 = 成交金额 - 费用,否则净资金

额 = -成交金额 - 费用。

返回金额：如果是融资回购，则返回金额 = 成交金额 + 回购利息,否则返回金额 = -成交金额 + 回购利息。

利润：如果是融资回购，则利润 = 回购利息 - 回购费用,否则利润 = -回购利息 - 回购费用。

额外利润：回购利息-回购费用-(成交金额+成交费用) * (年利率/年利率天数) *回购天数。

购回处理日期：在购回处理时的日期。

购回交割日期：实际购回日期 + 清算速度。

实际购回日期：由于工作日关系，实际购回日期和法定购回日期可能不同。

法定购回日期：即回购到期自然日。

计提利息：如果是融资回购，则利润 = -当前已计利息,否则利润 = 当前已计利息。

5.3.6 期货资产分析

“期货资产分析”可以查询日期、产品、单元、可用保证金、期初权益、动态权益、静态权益、期初占用保证金、占用保证金、占用保证金(含挂单)、风险度(%)、风险度(含挂单%)、保证金余额、盯市盈亏、当日总平仓盈亏、浮动盈亏、总盈亏、产品出入金等信息。

在“信息查询”→“资产分析”→“期货资产分析”界面，可以选择按产品、单元、开始和截止日期信息筛选列表内容。该界面支持刷新、查询、打印、导出、布局设置等操作。



可用保证金：该单元的可用保证金。可用保证金 = 当前期货保证金产品余额 - 当前持仓占用保证金(开关) - 未成交的开仓委托需要的保证金 - 未成交委托所需要的手续费 - 最低准备金 + 期货浮动盈亏(开关)；

开仓时，增加持仓占用的保证金。

平仓时，按照先进先出的顺序进行处理。将浮动盈亏资产转化为保证金产品余额和当日实现盈亏，并减少保证金占用。

可用金额是否考虑保证金增加开关。当合约上涨时候，增加保证金占用，计算可用是否需要考虑这部分增加部分。

期货浮动盈利是否计入可用开关。亏损部分减少可用，盈利部分按照不同期货公司要求进行设置。

期初权益：昨日清算结算后的产品权益。

产品权益：产品权益 = 期货保证金账户余额 + 盯市盈亏。

期初占用保证金：T 日开市前，该单元占用持仓按照昨日结算价来计算所占用的保证金。(\sum 所有合约(日初占用持仓手数 * 该合约的昨日结算价 * 合约乘数 * 保证金比例))。

占用保证金：持仓所占用的保证金，是按照最新价来计算的保证金。（ \sum 所有合约（持仓手数*该合约的最新价*合约乘数*保证金比例））。

占用保证金(含挂单)：占用保证金+挂单金额，在占用保证金的基础上加上委托占用部分。挂单金额=（委托数量-当天成交数量-撤单数量）*最新价*合约乘数*保证金比例

风险度(%)：占用保证金 / 产品权益 * 100。

风险度(含挂单%)：占用保证金（含挂单）/ 产品权益* 100

保证金余额：期货产品的保证金金额。出入金、开仓（减费用）、平仓（加上盈亏）都会影响此金额。

盯市盈亏：当天现有持仓的盯市盈亏的情况。对于不是当天建仓的持仓，盯市盈亏=当天最新价与昨日结算价之间的盈亏情况。对于当天建仓的持仓，盯市盈亏=当天最新价与开仓价格之间的盈亏情况。

盯市盈亏= \sum （当前持仓数量*多空标志*合约乘数*（最新价 - X））。其中 X：今仓取开仓价，昨仓取前结算价。

当日总平仓盈亏：当日做平仓操作的盈亏总和。如果平的是昨日的持仓，成本价是昨日结算价。如果平的是今日新开的持仓，成本价为开仓价。日初始化后清零。

浮动盈亏：又称持仓盈亏，持仓盈亏是从开仓到当前为止的盈亏总额，是没有按日结转的盈亏。 \sum （明细持仓数量 * 多空标志*（最新价-开仓价格）*合约乘数）。

产品出入金：只针对业务操作类型是期货保证金增加、期货保证金减少、期货保证金调增、期货保证金调减的数据进行统计。

预计日终占用：预计日终持仓所占用的保证金，与占用保证金计算类似，不同的是按照结算价来计算的保证金占用。（ \sum 所有合约（持仓手数*该合约的结算价*合约乘数*保证金比例））

累计盈亏（含浮动盈亏）：累计盈亏 + 浮动盈亏。

累计盈亏：未结转收益+当日实现收益。

5.3.7 标准券查询

“标准券查询”用于查询交易所标准券库存、融券、可用数量等信息。

在“信息查询”→“资产分析”→“标准券查询”界面，点击“查询”按钮在弹出查询界面选择按产品、单元、证交易市场等信息来筛选列表内容。该界面支持刷新、查询、打印、导出、布局设置等操作。

| 产品名称 | 单元编号 | 单元名称 | 标准券名称 | 交易市场 | 库存数量 | 融券数量 | 可用数量 | 深交所当日转标准券数量 |
|------|------|----------|--------|------|--------------|------|--------------|-------------|
| 号 | 1 | 融券资金账户融券 | 新标准券 | 上交所A | 1,200.00 | 0.00 | 1,200.00 | 0.00 |
| 创投 | 1 | 现货资金账户融券 | 新标准券 | 上交所A | 1,000,000.00 | 0.00 | 1,000,000.00 | 0.00 |
| 号 | 1 | 融券资金账户融券 | 131990 | 深交所A | 2,001,200.00 | 0.00 | 2,001,200.00 | 0.00 |
| 创投 | 1 | 现货资金账户融券 | 131990 | 深交所A | 1,000,000.00 | 0.00 | 1,000,000.00 | 0.00 |
| | | | | | 4,002,400.00 | | 4,002,400.00 | 0.00 |

每页行数: 50 | 100 | 500 | 全部 | 上页 | 下页 | 1 到第 1 页 | 确定 | 共有 4 条记录。

| 债券代码 | 债券名称 | 库存数量 | 可用数量 | 抵押比率 (%) | 可转标准券数量 |
|------|------|------|------|----------|---------|
| | | 0.00 | 0.00 | | 0.00 |

库存数量（汇总页面）：融券数量 - 融资数量。

可用数量（汇总页面）：债券兑换成标准券的数量 - 融资的数量。

融券数量：取持仓表的冻结数量。

深交所当日转标准券数量：当日质押数量 * 质押比率 取新标准券代码为深

交所代码'131990SZ', '131991SZ'的数据。

库存数量 (明细页面): 即持仓数量。

可用数量 (明细页面): 对于老的标准券该字段含义为可抵押数量 = 当前数量 - 冻结数量 + 解冻数量 ; 对于新的标准券该字段含义为已质押的数量 = 期初质押数量 + 当日质押数量 - 当日转回数量。

抵押比率 (%): 对于老的标准券该字段表示抵押比率 ; 对于新的标准券该字段表示质押比率。

可转标准券数量 : 对于老的标准券为 可抵押数量 * 抵押比率 = (当前数量 - 冻结数量 + 解冻数量) * 抵押比率 ; 对于新的标准券为 质押数量 * 质押比率 = (期初质押数量 + 当日质押数量 - 当日转回数量) * 质押比率。

5.3.8 可质押债券

“可质押债券”用于查询交易所回购业务的可质押债券信息。

在“信息查询”→“资产分析”→“可质押债券”界面，点击“查询”按钮在弹出查询界面选择产品、单元、证券代码等信息来筛选列表内容。该界面支持刷新、查询、导出、打印、布局设置等操作。

抵押比率(%)：表示债券折算老标准券的比例。

库存数量：取持仓表(tunitstock)的当前数量字段(l_current_amount)。

已质押数量：期初质押数量 + 当日质押数量 - 当日转回数量。

可质押数量：持仓当前数量 + 解冻数量 - 冻结数量。

已转标准券数量：对于上交所，已转标准券数量=已质押数量*当前面值*抵押比例/100；对于深交所，已转标准券数量=已质押数量*质押比例。

可转标准券数量：对于上交所，可转标准券数量=可质押数量*当前面值*抵押比例/100；对于深交所，可转标准券数量=可质押数量*质押比例。

5.3.9 期货持仓查询

“期货持仓查询”支持当前和历史期货持仓数据的查询。

在“信息查询”→“资产分析”→“期货持仓查询”界面查询，点击“查询”按钮后可以通过选择起始、终止时间、产品、单元、以及特定的市场、证券代码来进行筛选。

总持仓：就是当前持仓数量(资产数量)，包括新红配，包括当日所有增加和减少部分。总持仓 = 期初数量 + 当天业务处理资产变化部分 + 手工调整部分。

昨仓：昨仓剩余数量，日初始化后同期初数量，期货实时成交平昨仓之后减少。

今仓：总持仓-昨仓。

持仓均价：当前持仓*开仓价格/总持仓。

前结算价：昨日的结算价。

最新价：最新成交价。

浮动盈亏：SUM(多空仓标志)*合约乘数*当前持仓*(最新价-开盘价)。

投资类型：值域有：可交易、持有到期、可供出售、贷款和应收款项。

多空标志：分为多仓和空仓，用于期货。

盯市盈亏：当天现有持仓的盯市盈亏的情况。对于不是当天建仓的持仓，盯市盈亏=当天最新价与昨日结算价之间的盈亏情况。对于当天建仓的持仓，盯市盈亏=当天最新价与开仓价格之间的盈亏情况。盯市盈亏= \sum (当前多头持仓数量*(市价-X)*合约乘数-当前空头持仓数量*(市价-X)*合约乘数)
其中：X对于当天开仓的，则为开仓价格，否则为前结算价。

当日平仓盈亏：显示该合约当日平仓盈亏情况。

平仓结算收益：该合约从开仓以来到目前平仓后所产生的收益。包括未平仓的持仓每日结算产生的盈亏和已平仓产生的平仓收益。

总费用：显示当前合约的费用和。

总盈亏：盯市盈亏+平仓结算收益-总费用

占用保证金：占用保证金=当前持仓*合约乘数*decode(开仓日期，发生日期，开盘价，前结算价)*保证金比例。

当日成交次数：当日合约成交总次数。

当日成交手数：当日合约成交总手数。

当日买入数量：当日合约买入数量。

当日卖出数量：当日合约卖出数量。

合约市值：持仓数量*价格*合约乘数，其中价格取结算价，如果结算价为 0 时，则取最新价。

5.3.10 非期货类资金数据

非期货类资金数据：该页签展示了相应日期下，相应客户资金账号下非期货类资金的当日盈亏和净值总额数据。

| 日期 | 客户内部资金账号 | 当日盈亏 | 净值总额 | 币种 | 备注 |
|----|----------|------|------|----|----|
| | | | | | |

每页行数: 50 | 100 | 500 | 全部 | 上页 | 下页 | 到第 1 页 确定 | 共有 0 条记录 | F5刷新当前数据

5.3.11 非期货类资金数据明细

非期货类资金数据明细：该页签展示了相应日期下，客户资金账户下相应的投资标的的上日盈亏和上日净值数据。



5.3.12 维持担保比例监控

维持担保比例监控：展示了相应产品单元下资金账号的维持担保比例。



5.3.13 ETF 投资端查询

“ETF 投资端查询”可查询 ETF 基金的买卖、申购、赎回等相关信息。
在“信息查询”→“资产分析”→“ETF 投资端查询”界面查询,点击“查询”按钮后可以通过选择产品编号、单元编号、ETF 代码、汇总类型、开始日期及结束日期来进行筛选列表内容。



5.4 基础数据查询

通过打开“基础数据查询”,我们可以查询到券商总公司在券商端已维护的证券的基础信息,如证券资料、债券属性、期货品种、证券发行信息等。

单击“信息查询”→“基础数据查询”主界面,进行查询。如下图所示:



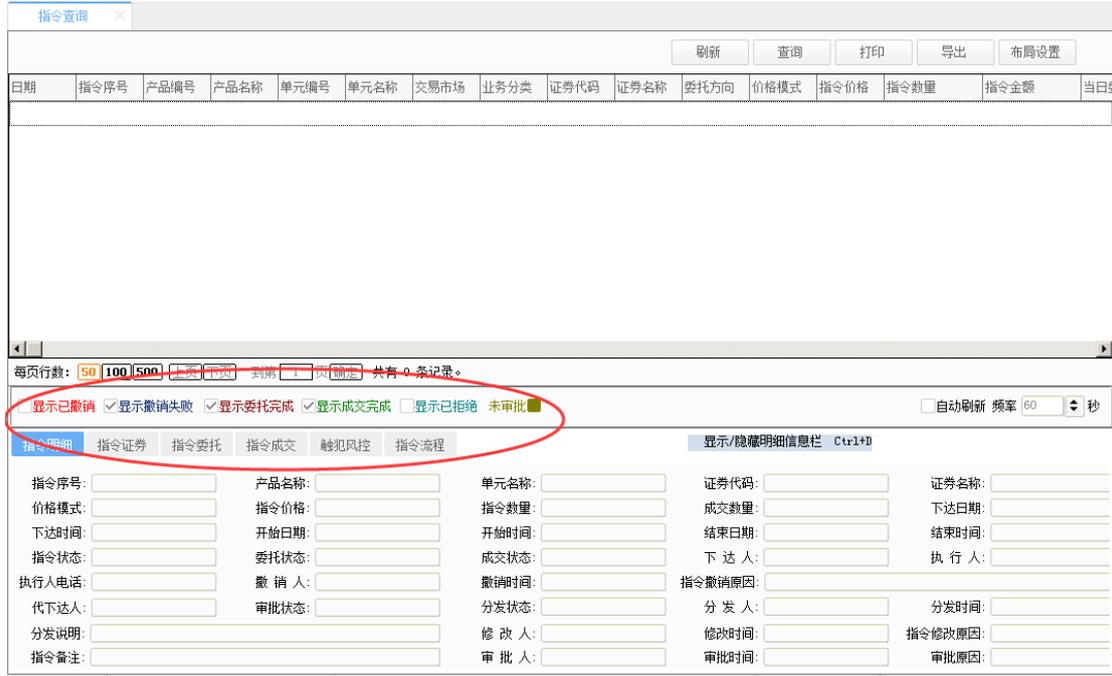
5.5 操作日志查询

操作日志查询：该界面显示了本机构操作员操作的发生时间，操作菜单，操作内容，以及操作员 IP、网卡和硬盘序列号等硬件信息。



5.6 指令查询

指令查询：指令查询上半部分显示了指令的发生时间，指令的数量、金额信息，指令委托信息，成交信息，以及指令的最新状态等信息；指令查询下半部分分页签展示了指令的详细情况。



- 指令明细：显示了相应指令的产品单元，指令价格、数量，委托状态，分发状态，成交状态等详细信息。
- 指令证券：显示了指令的当日委托与累计委托的数量、价格和金额，当日成交与累计成交的数量、价格和金额信息，以及委托与成交完成比例信息。
- 触犯风控：显示了指令触发的风控信息，包括触发时间、触发操作、触发对象信息，触发的风控类型和等级说明，风控审批信息。

5.7 期权报表

期权报表：包含个股期权保证金、期权盈亏统计、期权持仓查询、个股期权

被行权指派表、个股期权到期义务方监控和期权交割日行权查询表。

5.7.1 个股期权保证金

进入机构端菜单“信息查询” - “报表查询” - “个股期权保证金”，该界面用于实时统计每日期权保证金变化。“汇总栏”显示的是产品下各单元的期权保证金信息，“明细栏”显示的是选中的产品下具体各单元的保证金信息明细。支持对期权保证金信息的查询、打印、导出。

| 产品编号 | 产品名称 | 单元编号 | 单元名称 | 日期 | 市场编号 | 市场名称 | 期初保证金余额 | 买入额度 | 可用买入额度 | 权利金实时流出 | 权利金实时流入 | 出金 | 入金 | 保证金变动 | 保证金余额 |
|------|----------|------|------------------------|----|------|------|---------------|------|--------|---------|---------|------|------|-------|---------------|
| 15 | 1xt极速投资 | 3 | 1xt极速投资-一期2016-12-22 1 | | | 上交所A | 49,978,374.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 49,978,374.00 |
| 10 | 1xt非极速投资 | 3 | 1xt非极速投资-2016-12-22 1 | | | 上交所A | 49,989,813.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 49,989,813.00 |
| 合计: | | | | | | | 99,968,187.00 | | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 99,968,187.00 |

| 单元编号 | 单元名称 | 合约编码 | 合约简称 | 期初占用保证金 | 日间 | | 期初 | | | 日间 | | | 权利持仓 | 义务 | |
|------|---------|----------|-----------|---------|--------|---------|-------|-------|-------|------|------|-------|------|------|-------|
| | | | | | 权利实时流出 | 权利金实时流入 | 保证金占用 | 保证金占用 | 权利持仓 | 义务持仓 | 备兑持仓 | 权利持仓 | | | 义务持仓 |
| 3 | 1xt极速投资 | 10000625 | 50ETF购12F | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 23.00 | 0.00 | 0.00 | 23.00 | 0.00 | 0.00 | 23.00 |
| 3 | 1xt极速投资 | 10000691 | 50ETF购12F | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 1.00 | 0.00 | 0.00 | 1.00 | 0.00 | 0.00 | 1.00 |

汇总栏显示主要字段介绍：

期初保证金余额：T-1 日日终的保证金余额。

日间_出金：买入开仓、买入平仓、备兑平仓减少的权利金金额。

日间_入金：卖出平仓、卖出开仓、备兑开仓获得的权利金金额。

日间_保证金变动：等于入金-出金。

日间_保证金余额：等于期初保证金余额+保证金变动。

日间_保证金占用：保证金义务方持仓占用保证金部分。

日间_保证金可用：等于保证金余额-保证金占用。

日终_保证金占用: 根据实时持仓计算出单边义务方持仓的保证金占用。

日终_保证金可用: 日间保证金余额-日终保证金占用。

保证金占用比例: 保证金占用占保证金总额的比例, 等于保证金占用/(保证金占用+保证金可用)。

明细栏显示主要字段介绍:

期初占用保证金: T-1 日终合约义务持仓占用的保证金。

日间_权利金实时流出: 买入开仓、买入平仓、备兑平仓减少的权利金金额。

日间_权利金实时流入: 卖出平仓、卖出开仓、备兑开仓获得的权利金金额。

日间_保证金占用: 保证金义务方持仓占用保证金部分。

日终_保证金占用: 根据实时持仓计算出单边义务方持仓的保证金占用。

期初_权利持仓: T-1 日终的持仓数量, 持仓多空标志为多头。

期初_义务持仓: T-1 日终的持仓数量, 持仓多空标志为空头。

期初_备兑持仓: T-1 日终的持仓数量, 持仓多空标志为备兑空仓。

日间_权利持仓: 持仓数量, 持仓多空标志为多头。

日间_义务持仓: 持仓数量, 持仓多空标志为空头。

日间_备兑持仓: 持仓数量, 持仓多空标志为备兑空仓。

日终_权利持仓: 日终的持仓数量, 持仓多空标志为多头。

日终_义务持仓: 日终的持仓数量, 持仓多空标志为空头。

日终_备兑持仓: 日终的持仓数量, 持仓多空标志为备兑空仓。



备兑锁券查询，展示了相应产品单元下备兑仓持仓数量，相对应需要锁定的标的券数量，已经锁定的标的券数量和前两者的差值。

注意：失效（冻结、注销）产品、单元，在查询下拉框中可以选择并查询。如果不选择产品、单元的查询条件直接查询时，则系统过滤失效产品记录。



5.7.2 期权盈亏统计

“期权盈亏统计”显示各单元的盈亏信息。支持对期权盈亏统计信息的查询、打印、导出。

| 单元编号 | 单元名称 | 合约编码 | 合约简称 | 合约类别 | 市场编号 | 市场名称 | 行权价 | 最新价 | 标的最新价 | 持仓类别 | 持仓数量 | 成本价 | 浮动盈亏 | 实现盈亏 | 总盈亏 |
|------|----------------------|---------------|------|------|------|-------|--------|-------|-------|------|--------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 3 | 1st标准投资-期权-10000691 | 50ETF购12月2400 | 认购 | 1 | 上交所A | 2.400 | 0.0000 | 2.262 | 权利仓 | 1.00 | 0.2000 | -2,000.00 | 0.00 | -2,000.00 | |
| 3 | 1st非标准投资-期权-10000661 | 50ETF购12月2300 | 认购 | 1 | 上交所A | 2.300 | 0.0000 | 2.262 | 权利仓 | 1.00 | 0.1363 | -1,353.00 | 0.00 | -1,353.00 | |
| 3 | 1st非标准投资-期权-10000691 | 50ETF购12月2400 | 认购 | 1 | 上交所A | 2.400 | 0.0000 | 2.262 | 权利仓 | 6.00 | 0.0469 | -2,811.00 | 0.00 | -2,811.00 | |
| 3 | 1st非标准投资-期权-10000691 | 50ETF购12月2400 | 认购 | 1 | 上交所A | 2.400 | 0.0000 | 2.262 | 备兑仓 | 1.00 | 0.0359 | 359.00 | 0.00 | 359.00 | |
| 3 | 1st非标准投资-期权-10000695 | 50ETF购3月2400C | 认购 | 1 | 上交所A | 2.400 | 0.0000 | 2.262 | 权利仓 | 5.00 | 0.0725 | -3,625.00 | -776.00 | -4,401.00 | |
| 3 | 1st非标准投资-期权-10000695 | 50ETF购3月2400C | 认购 | 1 | 上交所A | 2.400 | 0.0000 | 2.262 | 义务仓 | 4.00 | 0.0733 | 2,931.43 | 133.57 | 3,065.00 | |
| 3 | 1st非标准投资-期权-10000695 | 50ETF购3月2400C | 认购 | 1 | 上交所A | 2.400 | 0.0000 | 2.262 | 备兑仓 | 1.00 | 0.0825 | 825.00 | 0.00 | 825.00 | |
| 3 | 1st非标准投资-期权-10000696 | 50ETF购3月2450 | 认购 | 1 | 上交所A | 2.300 | 0.0000 | 2.262 | 义务仓 | 2.00 | 0.0634 | 1,068.00 | 0.00 | 1,068.00 | |
| | | | | | | | | | | | | 21.00 | -4,606.57 | -942.43 | -5,548.90 |

主要字段介绍：

浮动盈亏：根据权利金价格的实时行情计算期权合约的浮动损益。

浮动盈亏_权利方: (最新价-成本价)*权利方数量*合约单位。

浮动盈亏_义务方: (成本价格-最新价)*义务方数量*合约单位。

浮动盈亏_备兑: (成本价格-最新价)*备兑数量*合约单位。

总浮动盈亏: \sum 浮动盈亏。

实现盈亏_权利方: 平仓实现的盈亏。

实现盈亏_义务方: 平仓实现的盈亏。

实现盈亏_备兑: 平仓实现的盈亏。

总盈亏: 总浮动盈亏+总实现盈亏。

注意：失效（冻结、注销）产品、单元，在查询下拉框中可以选择并查询。如果



主要字段介绍：

认购权利仓数量：认购期权多仓合约的数量

认沽权利仓数量：认沽期权多仓合约的数量

总权利仓数量：等于认购权利仓数量+认沽权利仓数量

认沽义务仓数量：认沽期权空仓合约的数量

认购义务仓数量：认购期权空仓合约的数量

备兑义务仓数量：期权备兑仓的持仓数量

总义务仓数量：等于认沽义务仓数量+认购义务仓数量

总持仓数量：所有期权持仓数量

Delta：衡量标的券价格变动时，期权价格的变化幅度

Gamma：衡量标的券价格变动时，期权 delta 值的变化幅度

Vega：衡量标的券价格波动率变动时，期权价格的变化幅度

Theta：衡量时间消逝，期权价格变化幅度

Rho：衡量利率变动时，期权价格的变化幅度

5.7.4 个股期权被行权指派表

个股期权被行权指派表，作为期权义务方可以通过该表查询被指派的认购期权和认沽期权的行权被指派信息、需准备的标的券以及资金信息和合约信息，如下图所示。（注：该表查询信息以上一次日终清算完成的数据为准）



认购：

- 1) 行权指派所需标的券总数量：认购期权义务方在多合约被行权指派时需要准备的相应标的券的总量；
- 2) 行权指派所需标的券总数量（轧差）：行权指派所需标的券总数量-认沽交收数量；
- 3) 扣除行权指派剩余数量：扣除行权指派所需数量后剩余的标的券数量；
- 4) 扣除行权指派剩余数量（轧差）：扣除行权指派剩余数量 + 认沽交收数量。
- 5) 明细表-行权指派数量：单一认购期权合约义务方，行权被指派的合约数量；
- 6) 明细表-所需标的数量：单一认购期权合约义务方，行权被指派所需准备的标的券数量。

认沽：

- 1) 行权指派所需总金额：认沽期权义务方在多合约被行权指派时需要准备的相应资金总量；
- 2) 行权指派所需总金额（轧差）：行权指派所需总金额 - 认购收取金额；
- 3) 扣除行权指派剩余金额：可用金额 - 行权指派所需总金额；
- 4) 扣除行权指派剩余金额（轧差）：扣除行权指派剩余金额 + 认购收取金额。
- 5) 明细表-行权指派数量：单一认沽期权合约义务方，行权被指派的合约数量；
- 6) 明细表-所需资金金额：单一认沽期权合约义务方，行权被指派所需准备的资金量。

5.7.5 个股期权到期义务方监控

个股期权到期义务方监控：作为期权义务方可以查询临近到期（一个月内）的个股期权在当前情况下如果被行权还存在的股票缺口和资金缺口等信息，系统查询界面如下图（1）、图（2）所示。



图 (1)



图 (2)

5.7.6 期权交割日行权查询表

期权交割日行权查询表 :行权方可以通过该表查询期权行权信息和资金或股票缺口信息。

按时间段查询分别有三种情况 :该期权在行权日之前及行权日日间查询的对比结果是以在系统进行行权委托登记的信息为准 ;在行权日日终清算后查询的对比结果以从中国结算公司传递过来的数据为准 ;在 E+1 日 (行权日下一交易日) 查询的对比结果以上一日的清算结果为准。系统查询界面如下图(1)、图(2)所示:



图(1)



图(2)

5.8 新股申购信息查询

- 配号查询：对 T 日各产品单元相应申购代码、申购价格、起始配号和配号数量进行查询。

指令查询 新股申购信息查询 × 投资建议查询 期权保证金查询

配号查询 中签查询

刷新 查询 布局设置

| 申购日期 | 产品名称 | 单元名称 | 市场 | 股东代码 | 证券代码 | 证券名称 | 申购代码 | 申购价格 | 起始配号 | 配号数量 |
|------|------|------|----|------|------|------|------|------|------|------|
| | | | | | | | | | | |

0 (笔)

- 中签查询：对 T+1 日各产品单元相应申购的中签进行查询。

指令查询 新股申购信息查询 × 投资建议查询 期权保证金查询

配号查询 中签查询

刷新 查询

| 申购日期 | 产品名称 | 单元名称 | 当前可用 | 应缴款金额 | 资金缺口 | 缴款截止日期 | 中签数量 |
|------|------|------|------|-------|------|--------|------|
| | | | | | | | |

0 (笔)

| 申购日期 | 产品名称 | 单元名称 | 市场 | 证券代码 | 证券名称 | 申购代码 | 中签数量 | 申购价格 (元) | 中签日期 | 申购数量 |
|------|------|------|----|------|------|------|------|----------|------|------|
| | | | | | | | | | | |

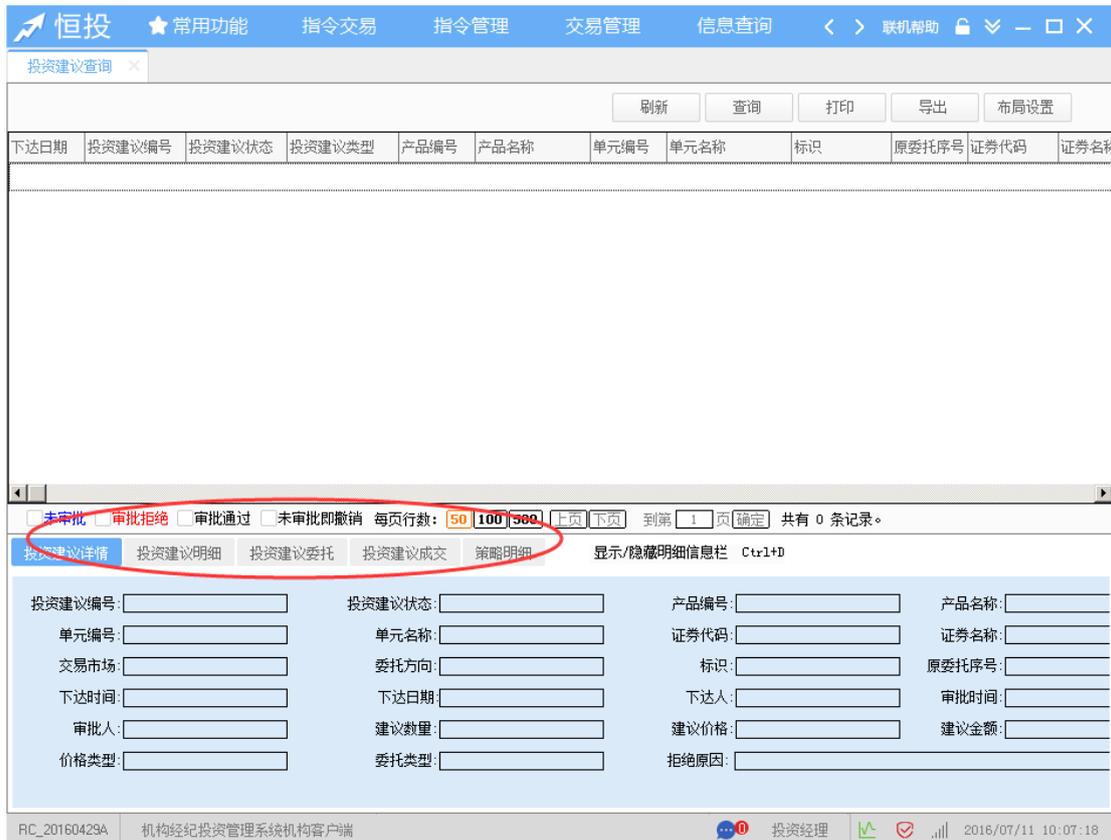
0 (笔)

应缴款金额：等于申购价格*中签数量。

资金缺口：应交款金额-当前可用。如果应缴款金额小于当前可用，那么表示资金足够，资金缺口显示为零。

5.9 投资建议查询

投资建议查询：界面上半部分显示了投资建议编号、产品单元、证券买卖交易等流水信息，下半部分各页签显示了各条投资建议的详情，明细和委托、成交等信息。



- 投资建议详情：显示了投资建议的证券信息，委托（方向、类型和序号）信息，建议的数量、价格和金额信息等；
- 投资建议委托：显示了投资建议委托的委托数量、价格，成交数量、金额，成交数量、金额，撤单数量信息，以及交易对手方的信息；

- 投资建议成交：显示了产品单元成交的投资建议价格、数量和金额，以及成交时间。

5.10 可用资金明细查询

可用资金明细查询：用户可以通过该表查询各产品下各资金账户资金的使用与占用情况，可以选择按日期进行筛选，系统查询界面如下图。

| | 2016-07-14 | 2016-07-15 |
|-------------|--------------|------------|
| 当前资金余额 | 6,110,450.00 | 0.00 |
| 冻结解冻金额 | 0.00 | 0.00 |
| 冻结解冻到期 | 0.00 | 0.00 |
| 远期资金操作 | 0.00 | 0.00 |
| 指令占用 | 0.00 | 0.00 |
| 股票权证买卖 | 0.00 | 0.00 |
| 债券买卖 | 0.00 | 0.00 |
| 融资回购 | 0.00 | 0.00 |
| 融券回购 | 0.00 | 0.00 |
| 融资回购 | 0.00 | 0.00 |
| 融券回购 | 0.00 | 0.00 |
| 新股申购 | 0.00 | 0.00 |
| 开放式基金 | 0.00 | 0.00 |
| 存款类业务 | 0.00 | 0.00 |
| 债券一级市场 | 0.00 | 0.00 |
| 债券招投标 | 0.00 | 0.00 |
| TA申购赎回 | 0.00 | 0.00 |
| 结算类业务 | 0.00 | 0.00 |
| 国债预发行保证金变动 | 0.00 | 0.00 |
| 买入未成交 | 0.00 | 0.00 |
| 港股通股票买卖 | 0.00 | 0.00 |
| 港股通指令占用 | 0.00 | 0.00 |
| 港股通买入未成交 | 0.00 | 0.00 |
| 港股通影响T日可用部分 | 0.00 | 0.00 |

注：[1]双击数据单元格可显示明细数据 [2](*)表示该项不计入会计可用

5.11 方案查询

方案查询：用户可通过“方案查询”来查询交易过程中设置的自动交易和算法交易的方案以及执行情况，可以选择按产品、起始时间、截至时间、交易市场等信息来筛选列表内容，系统查询界面如下图（1）、图（2）：

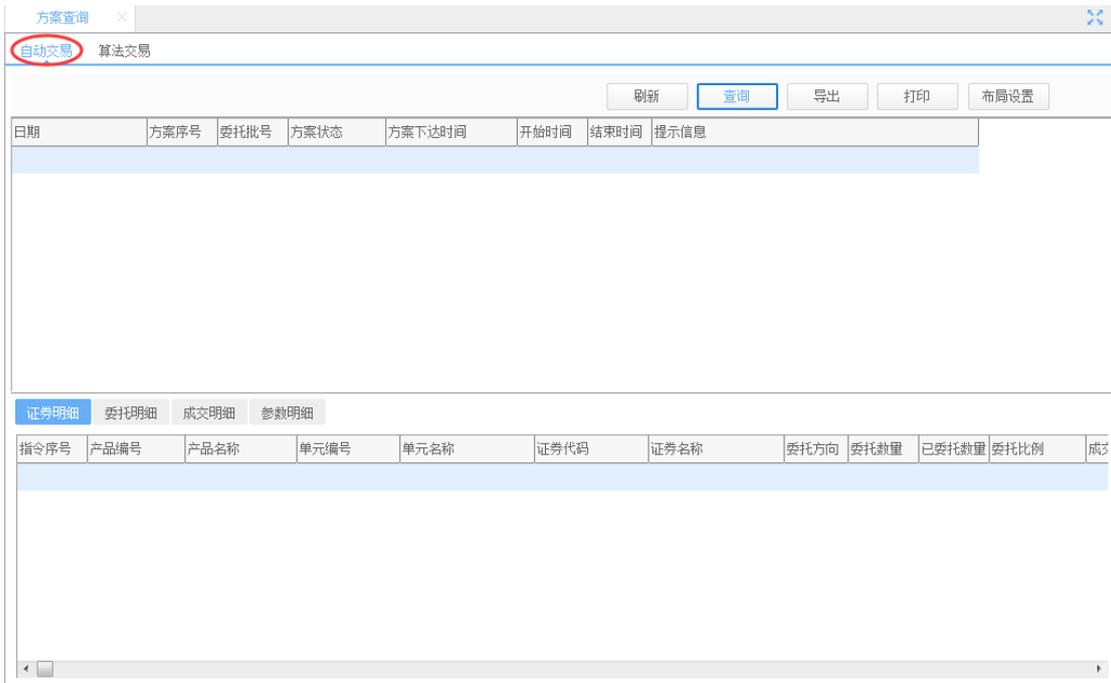


图 (1)

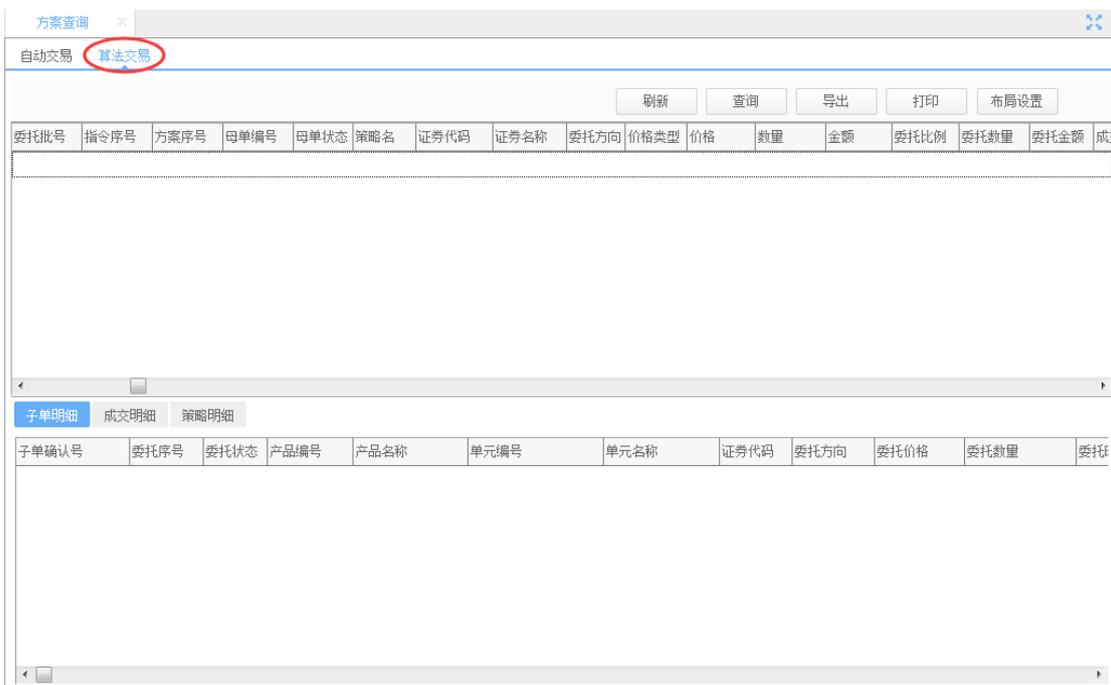


图 (2)