



多账户联合风控系统介绍

新湖期货资产管理部

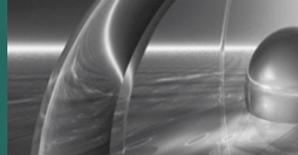
董军伟

2013年8月23日

XINHU
FUTURES

目录

- ❖ 1: 软件介绍
- ❖ 2: 软件安装
- ❖ 3: 软件设置
- ❖ 4: 软件登陆
- ❖ 5: 软件主界面
- ❖ 6: 监控阈值配置
- ❖ 7: 风控软件在企业套保中的应用

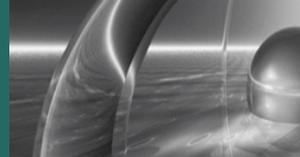


联合风控软件是资管部根据市场和业务需要开发的一款风控预警软件，它支持：

1. 对于多个CTP账户的实时在线监控
2. 针对预设阈值的实时报警
3. 可以同时监控多个期货公司的CTP账户

优点：

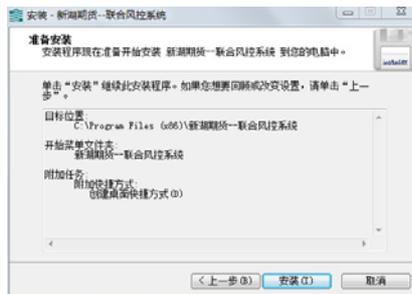
1. 易于安装使用，不依赖于复杂的第三方交易平台和软件
2. 软件界面简单清晰，监控指标详细专业
3. 易于扩展，向不同客户提供定制版本



1. 双击应用图标



2. 安装程序提示进行一步步安装

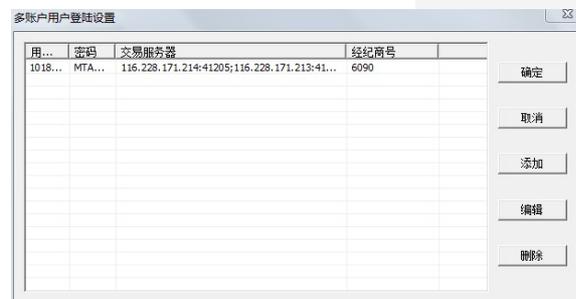
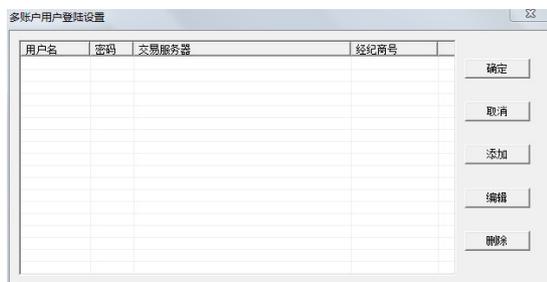


软件设置—经纪商和账户设置

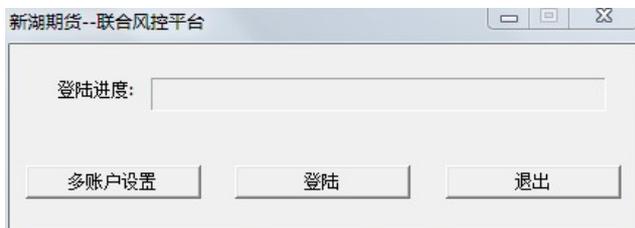
1: 启动软件，弹出登陆界面



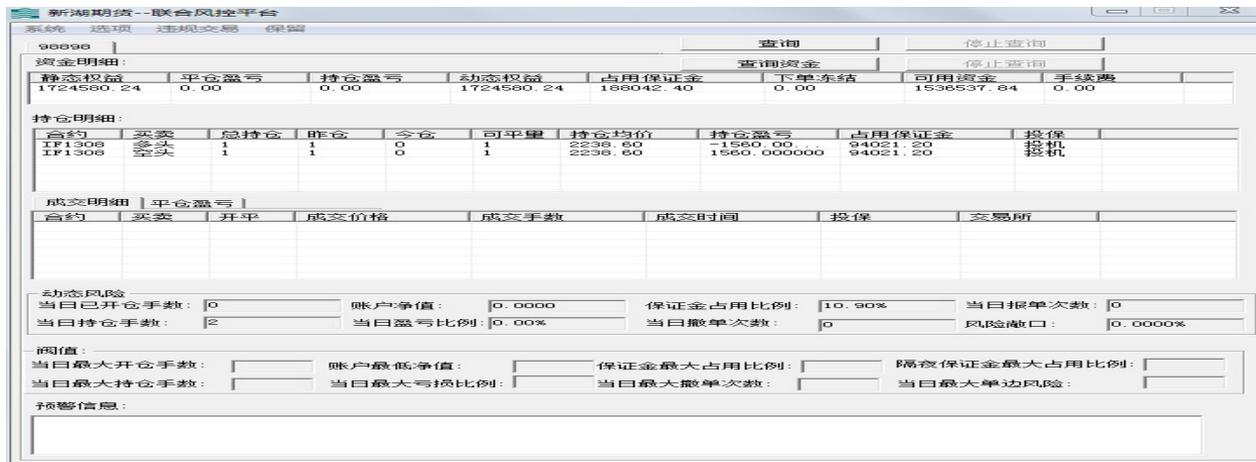
2: 进入多账号设置，添加用户



1: 设置完毕, 重启启动软件, 弹出登陆界面



2: 点击登陆, 开始软件登陆, 登陆过程中会提示各个账户登陆的进度, 如果其中一个账号登陆失败, 软件登陆失败。登陆成功后, 弹出如下界面



软件主界面说明

新湖期货--联合风控平台

系统 选项 违规交易 保留

98898

资金明细: **账户名**

静态权益	平仓盈亏	持仓盈亏	动态权益	占用保证金	下单冻结	可用资金	手续费
1724580.24	0.00	0.00	1724580.24	188042.40	0.00	1538537.84	0.00

持仓明细:

合约	买卖	总持仓	昨仓	今仓	可平量	持仓均价	持仓盈亏	占用保证金	投保
IF1308	多头	1	1	0	1	2238.60	-1560.00...	94021.20	投机
IF1308	空头	1	1	0	1	2238.60	1560.000000	94021.20	投机

成交明细 | 平仓盈亏

合约	买卖	开平	成交价格	成交手数	成交时间	投保	交易所

动态风险

当日已开仓手数: 账户净值: 保证金占用比例: 当日报单次数:

当日持仓手数: 当日盈亏比例: 当日撤单次数: 风险敞口:

阈值:

当日最大开仓手数: 账户最低净值: 保证金最大占用比例: 隔夜保证金最大占用比例:

当日最大持仓手数: 当日最大亏损比例: 当日最大撤单次数: 当日最大单边风险:

预警信息:

资金情况

持仓情况

成交历史

动态风险

阈值设置

报警情况

软件设置—监控阈值设置

98898

持仓及开仓配置

每日开仓最大限制(股指) 手

每日持仓最大限制 手

撤单配置

每日最大撤单 次

权益及保证金配置

期初资金: 元

总资金亏损幅度达到 %时, 报警

净值列表:

当日资金亏损幅度达到 %时, 报警

当保证金占用幅度超过 %时, 报警

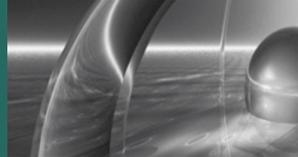
隔夜保证金占用幅度超过 %时, 报警

当单边风险超过 %时, 报警

监控阈值:

- 1.每日最大开仓手数
- 2.每日最大持仓手数
- 3.每日最大撤单次数
- 4.总资金亏损幅度（按照净值水平）
- 5.当日亏损幅度
- 6.保证金占用幅度
- 7.隔夜保证金占用幅度
- 8.单边风险
- 9.可以根据净值设置多级风控预警

风控软件在企业套保中的应用



1: 套保比例的设定

A:根据企业的现货价值和可以允许的风险敞口，可以通过软件计算出合适的套保比例，并对应到相应的期货合约上。

B:软件可以根据已经计算好的期货合约数量，实时提醒企业已经套保的数量和未套保的数量。

2: 保证金的调整

A:交割，由于期货合约在临近交割月时，保证金上调的比例比较高，所以，如果企业套保账户上的保证金不足的话，可能会面临被强制平仓的风险。风控软件可以根据保证金的比例及时预警，提醒企业补充保证金。

B:展期，如果企业希望套保合约不交割，而是展期，那么软件会提醒展期到流动性比较好的合约上去，如果结合展期策略的话，还可以帮企业自动展期。

3: 期货和现货的联动

企业在做套期保值时，往往要参考现货的价格，如果软件能自动抓取现货价格，并且和现有期货价格做比较，那么企业可以根据基差等指标，制定更好的套保策略。



谢谢各位！