

## 系统简介

新潮期货投资者账户分析系统是根据投资者的日常交易数据来全方位地分析投资者的投资行为,以供投资者了解自己的投资方向、完善投资策略的一个系统。

该系统从八个方面来分析投资者的账户情况:投资者运营情况、投资者日运营情况、投资者日权益变化情况、投资者交易盈亏情况、投资者日交易情况、投资者类型变动情况、投资者盈利率变动情况、投资者进出点位与行情比较情况。

# 使用说明

## 目 录

一、投资者运营情况	1
1、投资者日运营情况表	1
2、投资者月成交笔数盈利图	2
3、投资者月胜率表（图）	3
4、投资者月运营情况表（图）	4
二、投资者日运营情况	5
1、投资者日运营情况图	5
（1）盈利图	5
（2）交易回合图	7
2、投资者日运营情况-品种交易图	9
（1）分品种成交金额图	9
（2）分品种净盈利图	10
（3）分品种交易回合图	11
三、投资者日权益变化情况	12

四、投资者交易盈亏情况	13
五、投资者日交易情况	14
六、投资者类型变动情况	16
1、投资者类型变动表	16
2、投资者类型变动图	17
七、投资者盈利率变动情况	19
1、投资者盈利率变动情况图	19
2、投资者盈利率变动情况表	20
八、投资者进出点位与行情比较情况	21

## 一、 投资者运营情况

投资者的运营情况描述和分析了投资者当前的运营情况，首先从当月累计成交、期末持仓、期末权益、当月累计盈利（盯市）及投资者类型五个方面对投资者的现状进行描述。再从以下几个图表来分析运营情况。

### 1, 投资者日运营情况表

表 1-1, 投资者日运营情况表

日期	平仓亏损	平仓盈利	盈亏比
20100901	1000	2000	200%
20100902	2600	1800	69.23%
20100903	300	300	100%

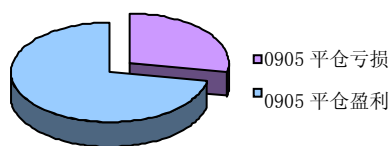
表格来源：新潮期货客户账户分析系统。

该表描述了投资者当月每天的浮动平仓盈利和亏损，盈亏比即平仓盈利与平仓亏损的比值，用来比较投资者每天平仓盈利与亏损的大小，综合反映投资者当天的平仓盈亏情况，如盈亏比大于 100%，则说明当天平仓的盈利大于亏损，当天是盈利的，如盈亏比小于 100%，则表示亏损大于盈利，若等于 100%，则表示盈亏相等。

通过浮动的平仓盈利和亏损，投资者可以看到相对于开仓价而言的平仓所带来的盈亏，更为明确地了解自己的盈亏状况。

## 2, 投资者月成交笔数盈利图

图 1-1, 投资者月成交笔数盈利图



月成交笔数盈利图反映了当月的成交中亏损金额和盈利金额各占了当月亏损和盈利总金额的比例。

图 1-2, 品种平仓盈利图

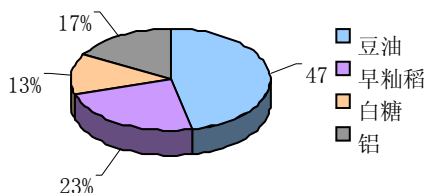
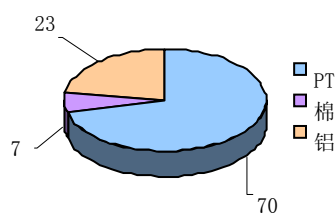


图 1-3, 品种平仓亏损图



图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

点击月成交笔数盈利图可以看到品种平仓盈利图和品种平仓亏损图两张成交品种明细图。通过这两张图投资者可以看到自己当月在哪些品种上做单盈利或亏损了及该品种盈利或亏损占全部盈利或亏损的比重，由此可以分析自己更善于做什么品种，在什么品种上亏损比较大。

### 3, 投资者月胜率表与月胜率图

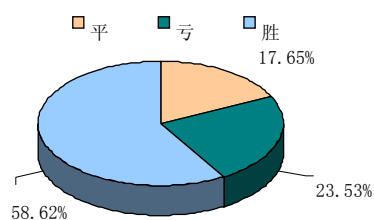
表 1-2, 投资者月胜率表

客户名称	日期	客户分组
XX 客户	20100901	胜
	20100902	亏
	20100903	平

表格来源：新湖期货客户账户分析系统。

通过月胜率表投资者可以看出自己当月有成交的每天总体是盈利还是亏损，这与投资者日运营情况表相对应，如果是平仓盈利大于亏损，说明该投资者是盈利的，即当天为胜；如果盈利小于亏损，则当天是亏损的，即为亏；如果盈亏相等，则为平。

图 1-4, 投资者月胜率图



月胜率图则用图来描述投资者当月胜、亏、平的天数各占交易总天数的比重，能让投资者更直观地了解自己当月有多少天是盈利的。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

#### 4, 投资者月运营情况表与月运营情况图

表 1-3, 投资者月运营情况表

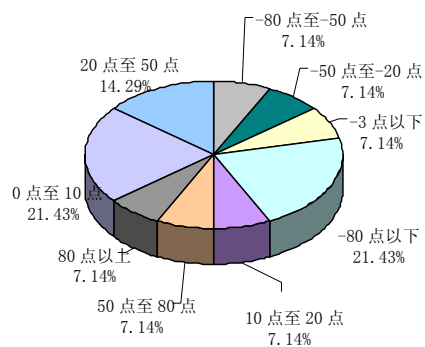
日期	交易流水号	客户盈亏点分组
20100901	00049846	-80 点至-50 点
	00056932	0 点至 10 点
	00037483	10 点至 20 点

表格来源：新湖期货客户账户分析系统。

投资者月运营情况表根据盈亏点对客户每天的每一笔平仓交易进行分组。从月运营情况表中投资者可以看出自己的每一笔平仓交易相对于开仓价是盈利还是亏损（正为盈利，负为亏损）及盈利或亏损了多少点。

\*盈亏点的计算方法为：如果是卖出平仓，则盈亏点=平仓价-开仓价；如果是买入平仓，盈亏点=开仓价-平仓价。

图 1-5, 投资者月运营情况图



从月运营情况图中可以了解各盈亏点分组在所有分组中的比重。

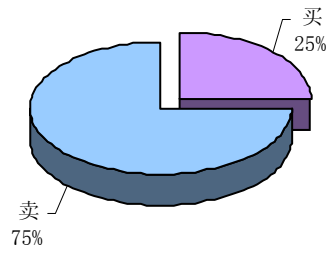
图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

## 二、 投资者日运营情况

### 1、 投资者日运营情况图

#### (1) 盈利图

图 2-1, 投资者月盈利图

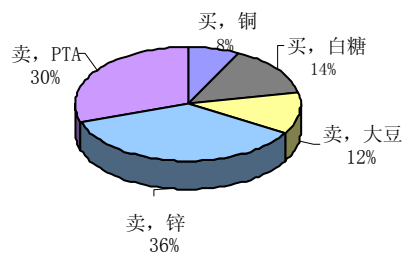


投资者月盈利图从行为角度来分析投资者盈利的构成,反映了当月买入盈利(包括买开持仓盈利和买平平仓盈利)及卖出盈利(包括卖开持仓盈利和卖平平仓盈利)占当月累积盯市总盈利的比重。

图形来源: 新湖期货客户账户分析系统。



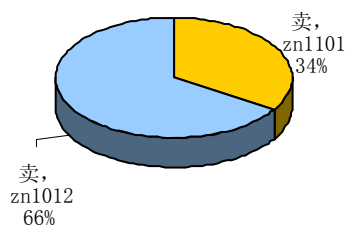
图 2-2，品种交易利润图 1



点投资者月盈利图可以查看品种交易利润图，通过该图可以查看买入或卖出盈利中各品种的盈利所占比重。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

图 2-3，品种交易利润图 2

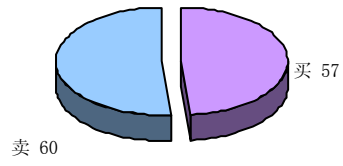


再点投资者日运营情况-品种交易利润图的某个品种，就可以看到该品种的各个成交合约的买卖盈利比重。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

## (2) 交易回合图

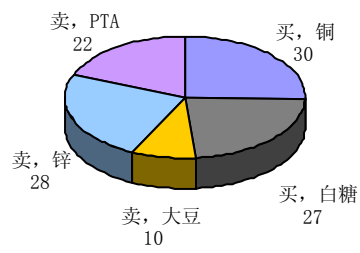
图 2-4, 投资者月交易回合图



投资者月交易回合图是以当月的交易次数为基础, 描述交易次数中有多少次是买入交易, 多少次是卖出交易。

图形来源: 新潮期货客户账户分析系统。

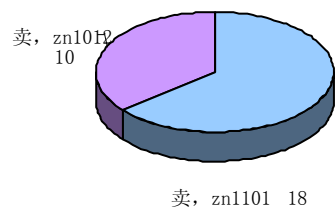
图 2-5，品种交易回合图 1



点击投资者月交易回合图可以查看该投资者当月买入和卖出交易回合中各个品种的交易回合次数（即买卖次数）。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

图 2-6，品种交易回合图 2



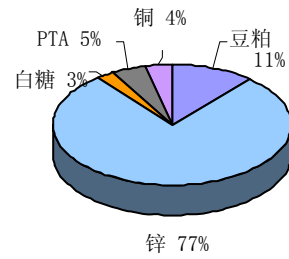
点品种交易回合图中的某个品种可以看到该品种的每个交易合约的买卖次数。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

## 2、投资者日运营情况-品种交易图

### (1) 分品种成交金额图

图 2-7，投资者月分品种成交金额图 1



投资者月分品种成交金额图是指投资者当月各成交品种的成交金额分别占自己当月全部成交金额的比重。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

图 2-8，投资者月分品种成交金额图 2

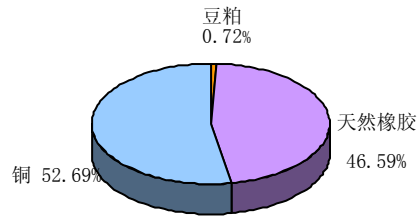


点击成交金额图中的每个品种可以查看此品种的各个成交合约成交金额各占该品种成交金额的比重。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

## (2) 分品种净盈利图

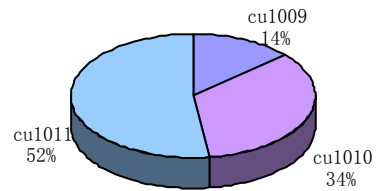
图 2-9，投资者月分品种净盈利图 1



投资者月分品种净盈利图反映了当月成交的各个品种的净盈利和（盯市盈利-手续费）分别占全部品种净盈利和的比重。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

图 2-10，投资者月分品种净盈利图 2

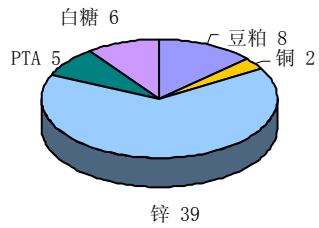


点击投资者月分品种净盈利图的每个品种也可以查看该品种的净盈利中各个合约的盈利分别占了多少比例。通过净盈利图可以查看投资者各品种盈利交易所带来的净利润大小和在总利润中的占比。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

### (3) 分品种交易回合图

图 2-11，投资者月分品种交易回合图 1



投资者月分品种交易回合图描述当月成交的各品种的交易次数（交易回合包括买和卖）。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

图 2-12，投资者月分品种交易回合图 2



点击投资者月分品种交易回合图的某个品种可查看该品种的各个合约的交易次数。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

### 三、 投资者日权益变化情况

图 3-1， 投资者日权益变化图

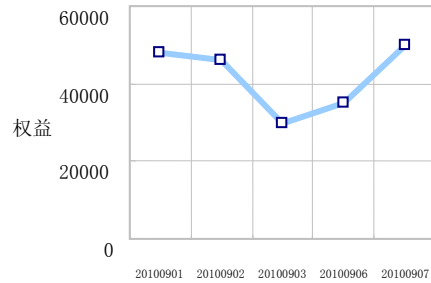


表 3-1， 投资者日权益变化表

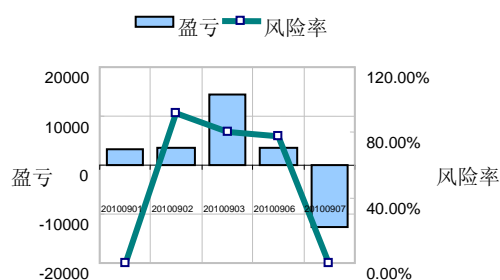
客户名称	月	日期	权益
XX 客户	201009	20100901	48000
		20100902	46000
		20100903	30000
		20100906	35000
		20100907	50000

图表来源：新湖期货客户账户分析系统。

投资者每日的权益变化情况是通过日权益变化表 and 变化图来反映的，可以选择查看某月到某月之间每天的权益数据及其变化图。

#### 四、 投资者交易盈亏情况

图 4-1， 投资者日盈亏风险情况图



图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

表 4-1， 投资者日盈亏风险情况表

客户名称	月	日期	盈亏	风险率
XX 客户	201009	20100901	3200	0.00%
		20100902	3400	92.00%
		20100903	14500	80.00%
		20100906	3400	78.00%
		20100907	-12600	0.00%

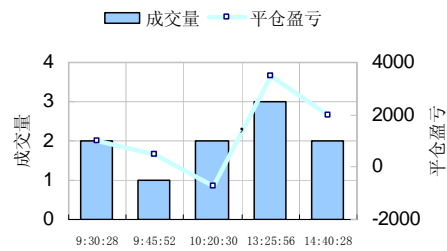
表格来源：新湖期货客户账户分析系统。

投资者日盈亏风险情况包括投资者每天的盈亏情况和风险率情况。盈亏指的是投资者每日的盯市总盈亏，风险率是指保证金与权益的比重，如果风险率大于 90%，说明投资者已经超过风险警示标准，应该注意市场和交易风险，及时关注自己的保证金变化，保证自己的风险率不超过 100% 的风险标准。



## 五、 投资者日交易情况

图5-1, 投资者成交盈亏情况图

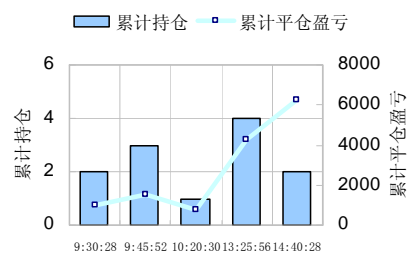


投资者成交盈亏情况图描绘了成交量与平仓盈亏之间的对比和联系。

图形来源：新湖期货

客户账户分析系统。

图5-2, 投资者累计持仓盈亏图



通过投资者累计持仓盈亏图可以看出当天每个交易时点的累计持仓和累计平仓盈亏及其变化趋势图。使投资者可以清晰的了解每一次成交时累计的当天的总体交易情况。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

表 5-1，投资者日成交盈亏情况表

日期	时间	成交量	平仓盈亏	累计持仓	累计平仓盈亏
20100901	9:30:28	2	0	2	0
	9:45:52	1	0	3	0
	10:20:30	2	-750	1	-750
	13:25:56	3	0	4	-750
	14:40:28	2	2000	2	1250

表格来源：新湖期货客户账户分析系统。

投资者日成交盈亏情况表反映了投资者每天的交易情况数据，包括投资者当天每一笔交易的时间、成交量、当天每个时间点的累计持仓及每笔平仓盈亏和当天的累计平仓盈亏。平仓表示持仓减少，开仓表示增加，最后一个交易时点的累计持仓就表示的是当天新开仓量减去平仓量。

## 六、 投资者类型变动情况

### 1、 投资者类型变动情况表

表 6-1, 投资者类型变动情况表

月	客户分组	净盈利	平均权益
201001	稳健投资型客户	3800	50000
201002	保守投资型客户	-1700	68000
201003	稳健投资型客户	-1600	54500
201004	保守投资型客户	2500	44000
201005	稳健投资型客户	1000	30000
201006	积极进取型客户	-800	31000

表格来源：新湖期货客户账户分析系统。

通过类型变动情况表投资者可以看出自己每个月总体上是风险偏好型还是风险厌恶型及相对于此类型每个月的净盈利和平均权益是多少。

\*投资者类型分类方法：把投资者按风险率进行分类，每日将客户按风险率以以下方式分组：

0%≤风险率<30%：无风险客户；

30%≤风险率<70%：保守型客户；

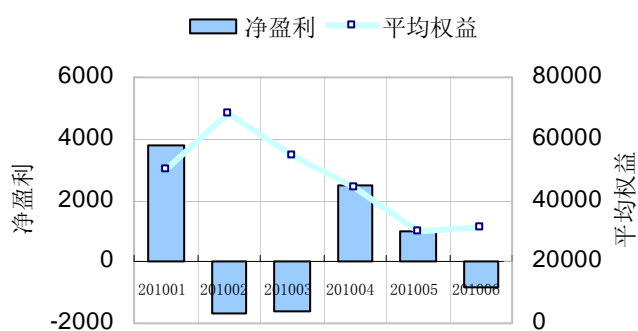
70%≤风险率<90%：稳健型客户；

90%≤风险率：积极进取型客户。

以每个月中哪种类型出现的频率高，则客户这个月就是此投资类型，若有出现频率一样的情况，则取高值。

## 2、投资者类型变动情况图

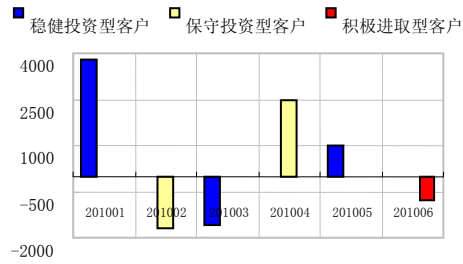
图6-1，投资者月平均权益与净盈利变动情况图



图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

此图是投资者月平均权益与净盈利之间的对比情况，（其中净盈利=逐日盯市总盈亏-手续费，平均权益=月累计权益/月交易日）。

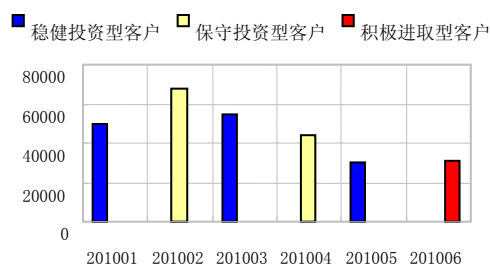
图 6-2，投资者月净盈利与投资类型变动情况图



净盈利与投资类型变动图反映了投资者每个月净盈利与投资类型之间的对比。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

图 6-3，投资者月平均权益与投资类型变动情况图



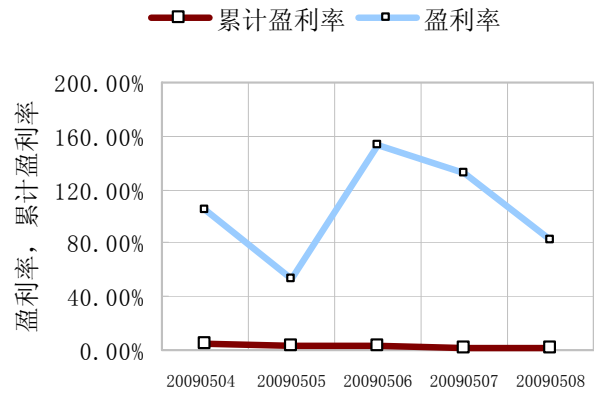
此图是投资者每个月的月平均权益与投资类型之间的对比情况。

图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

## 七、投资者盈利率变动情况

### 1、投资者盈利率变动情况图

图7-1，投资者盈利率变动情况图



图形来源：新湖期货客户账户分析系统。

通过盈利率变动情况图投资者不仅可以知道自己每一天的盈利率，还可以了解从开户以来随着自己资金的投入和交易的总盈亏所带来的累计盈利率变化，分析累计盈利率的变化趋势，从而调整投资策略。

## 2、投资者盈利率变动情况表

表 7-1, 投资者盈利率变动情况表

客户名称	月	日期	盈利率	累计盈利率	累计盈亏
XX 客户	201009	20100901	100.00%	5.00%	100630
		20100902	50.00%	4.00%	101000
		20100903	150.00%	4.00%	100020
		20100906	130.00%	2.00%	112360
		20100907	80.00%	1.80%	102380

表格来源：新湖期货客户账户分析系统。

投资者盈利率变动情况表用具体的数据反映投资者每天的盈利率、累计盈利率、累计盈亏。

其中各指标的计算方法为：

(1) 盈利率：当日逐日盯市总盈亏 / (上一天权益 + 当天入金)；

(2) 累计盈利率：累计逐日盯市总盈亏 / (期初权益 + 累计资金存入)

\*累计逐日盯市总盈亏：从开户日或系统初始日开始累加的逐日盯市总盈亏

\*期初权益：从开户日或系统初始日开始的第一笔权益

\*累计资金存入：从开户日或系统初始日开始累加的资金存入

(3) 累计盈亏：从开户日或系统初始日开始累加的逐日盯市总盈亏。

## 八、投资者进出点位与行情比较情况

表 8-1，投资者进出点位与行情比较情况表

客户名称	品种	前结算价	今开盘价	今收盘价	今结算价	客户开仓价	客户平仓价
XX 客户	锌	12740	12650	12865	12835	12730	12780
	天胶	14750	14780	14780	14760	14710	14670
	铜	38400	36240	36240	36234	36600	33880

表格来源：新湖期货客户账户分析系统。

通过该表可以看出投资者每天每笔交易的进出点位（开仓价、平仓价）及该品种合约前一天的结算价、当天的开盘价、收盘价和结算价。

客服热线：400-8888-398

公司网站：<http://xinhu.cn>