

逸顺风控软件 使用手册

苏州君桥信息科技有限公司

2013/9/5

目录

| | |
|-------------------|----|
| 一、软件概述..... | 3 |
| 1、说明..... | 3 |
| 2、产品介绍..... | 3 |
| 3、逸顺风控软件功能特点..... | 5 |
| 4、合作期货公司列表..... | 6 |
| 二、运行环境..... | 7 |
| 1、硬件环境..... | 7 |
| 2、软件环境..... | 7 |
| 三、软件运行..... | 7 |
| 四、软件使用和设置..... | 8 |
| 1、主界面和功能键说明：..... | 8 |
| 2、添加账号..... | 10 |
| 3、修改账户..... | 13 |
| 4、刷新账户..... | 14 |
| 5、持仓查询..... | 14 |
| 6、挂单查询..... | 14 |
| 7、日志查询..... | 15 |
| 8、删除账户..... | 15 |
| 9、合约限制..... | 16 |
| 五、常见问题 FAQ..... | 16 |

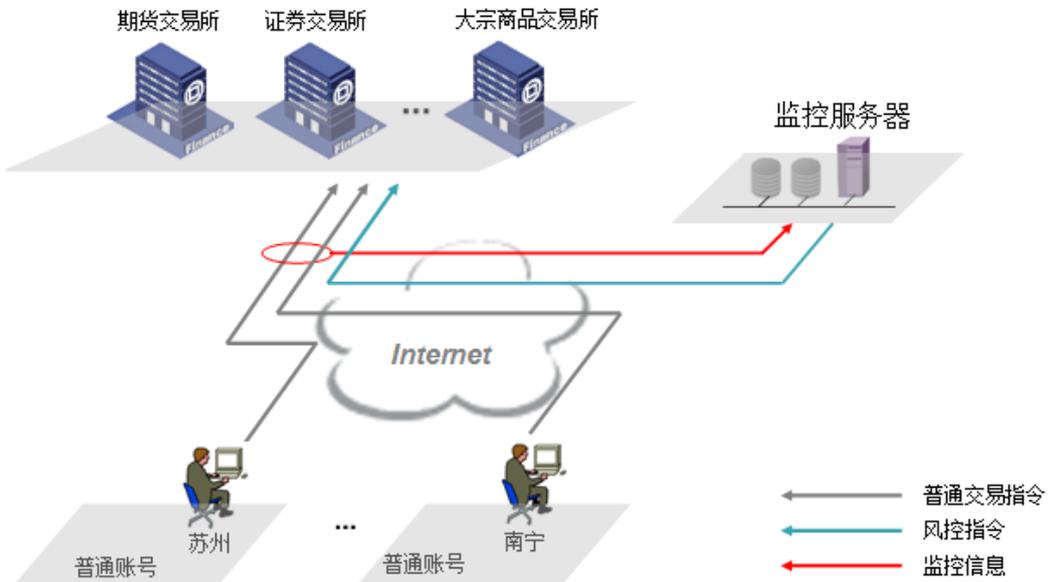
一、软件概述

1、说明

逸顺风控软件是由苏州君桥科技有限公司推出的一款账户监控管理软件，针对国内期货和股票市场，实时监控账户的动态权益，实现资金的风险控制。本软件可以广泛用于需要多账户管理的机构和个人。

2、产品介绍

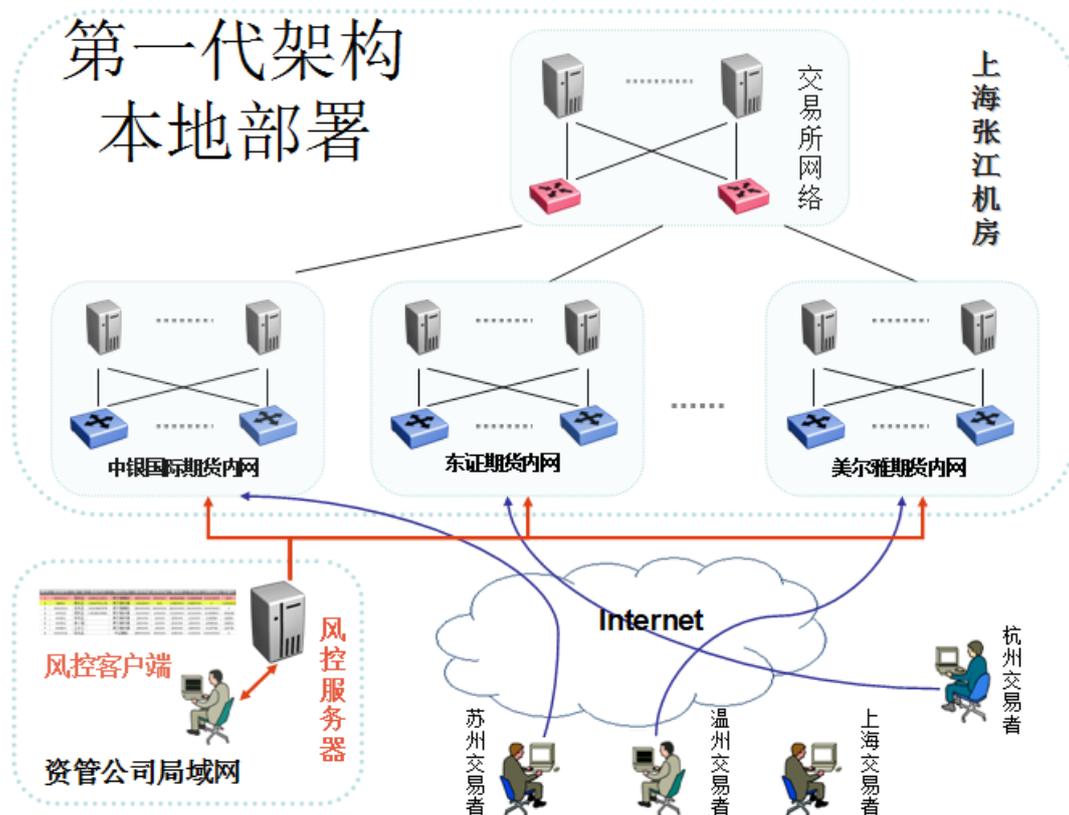
逸顺风控软件采用旁路风控模式，每秒在 CTP 交易接口采集一次账户的持仓信息，根据监控策略执行风控操作，风控策略包括持仓合约是否允许，持仓是否超出隔夜/午限制，是否需要减仓，是否触发报警线/平仓线等等。如果持仓符合风控策略，系统发送相应的指令到交易接口，从而实现资金账户的程序化风险控制。



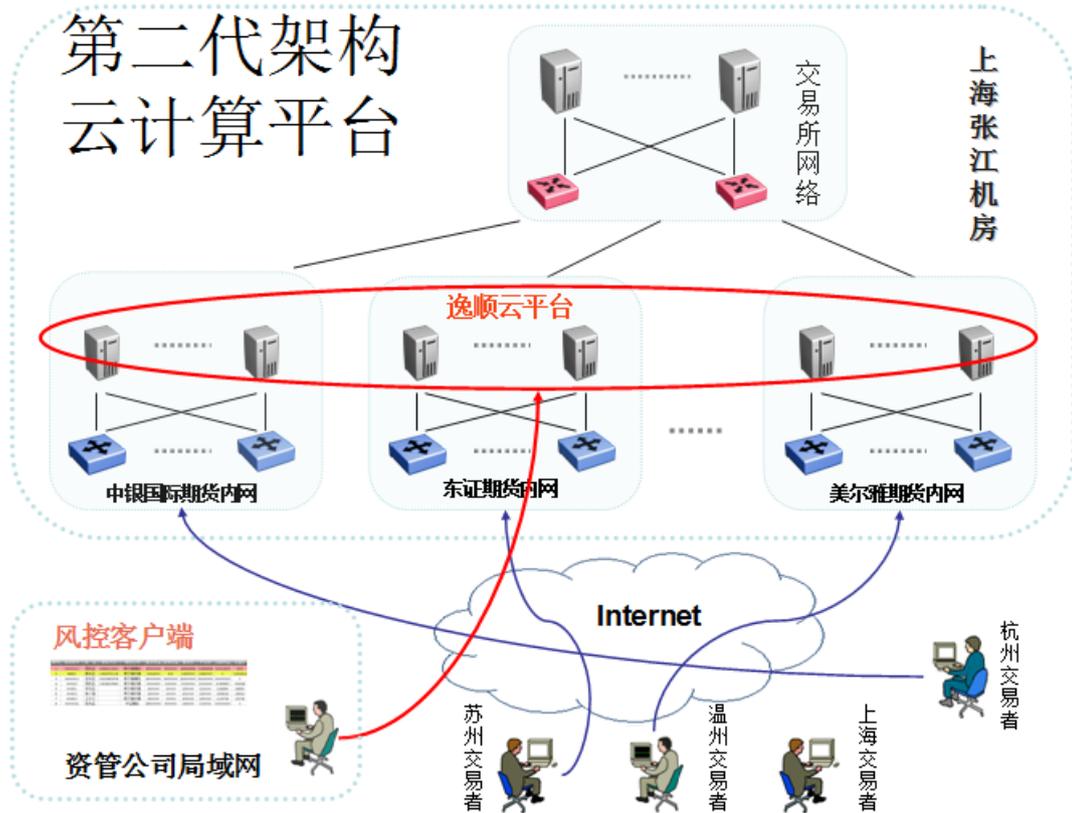
旁路风控模式中，被监控账户的交易指令不经过监控服务器，如上图所示，监控服务器通过单独的网络路径实现监督和控制两个过程。在这个模式中，每个被监控的账户的交易指令是直接发送到期货公司的柜台系统（交易接口），因此是效率最高的。

逸顺风控软件包括服务器和客户端两个部分，服务器的功能是搜集和保存来自客户端的

账户配置信息，实时风控。客户端的功能是实时展示被风控账户的状态，增加或修改账户风控信息。逸顺风控软件有两种部署方式：本地部署模式和云模式。



在本地部署方式中，服务器和客户端都安装在账户管理方的局域网内，风控服务器的交易指令要通过互联网发送到期货公司的柜台系统。



在云平台部署方式中，服务器分散在各个期货公司的机房里面，相比于第一代的部署架构，云平台在延迟、安全性、可靠性等各个方面都占用明显的优势。

| | 云平台 | 本地部署 |
|------|--------------------|------------------------------|
| 维护成本 | 软件提供商统一维护 | 自行维护 |
| 异常情况 | 容易排查 | 难于实时监控，很难排查异常 |
| 可靠性 | 无单点故障，服务器瘫痪不影响整体风控 | 没有备份方案，停电、断网、网络异常、主机异常等会影响风控 |
| 安全性 | 有专业的安全防护 | 无安全防护手段，易受病毒、黑客影响 |
| 平仓速度 | 3-5ms | 平均大于 30ms |

3、逸顺风控软件功能特点

逸顺风控产品在传统旁路风控技术上实现了突破，解决了最关键的几个技术瓶颈，从而把旁路风控的优点发挥到极致。

我们的优势：

- 1) 支持多期货公司、多柜台系统（CTP、恒生、金士达）；
- 2) 基于账户的合约限制；
- 3) 基于账户设定报警线、减仓线、平仓线；
- 4) 灵活的隔夜、隔午持仓比例；
- 5) 支持多个减仓时段；
- 6) 个性化隔夜、隔午减仓方案；
- 7) 夜盘控制；
- 8) 强平后锁定账户
- 9) 对单个合约涨跌价格的控制

4、合作期货公司列表

美尔雅仿真 美尔雅模拟 国金期货 东吴期货 光大期货 徽商期货 北京中期
华泰长城 方正期货 中证模拟 东证期货 中融汇信 申万期货 安信期货 渤海期货
华鑫期货 华鑫期货仿真 国际期货 华泰长城仿真 长江期货 大华期货 东方期货
东海期货 东兴期货 第一创业 弘业期货 光大期货仿 广发期货 广发期货仿真
国海良时期货 广州期货 格林期货 国泰君安 国投中谷期货 国都期货 国信期货
华安期货 海证期货 海通期货 海通期货模拟 华西期货 华西期货仿真 宏源期货
久恒期货 金石期货 经易期货 华龙期货 陇达期货仿真 良茂期货 鲁证期货
南华期货 平安期货 瑞达期货 瑞龙期货 瑞龙期货仿真 首创期货 东航期货
上海金源期货 上海金源仿真 上海中期期货 上海中期模拟 上海中期仿真 申万模拟
申万期货仿真 招商期货 天鸿期货 天鸿期货仿真 中投期货 五矿期货 国联期货
西部期货 西南期货 新世纪期货 兴业期货 永安期货 一德期货 中财期货
中大期货 中钢期货 中航期货 新湖期货 中融汇信 浙商期货 中信建投 中信新际
中银国际 中证期货 中证期货仿真 中衍期货 英大期货 东航期货

二、运行环境

1、硬件环境

CPU: PIII800 以上
内存: 1G 以上
硬盘: 80G 以上
显存: 128M 以上
分辨率: 800*600 以上

2、软件环境

Microsoft Windows 2000 Professional
Microsoft Windows 2000 server
Microsoft Windows XP Professional
Microsoft Windows 7

三、软件运行

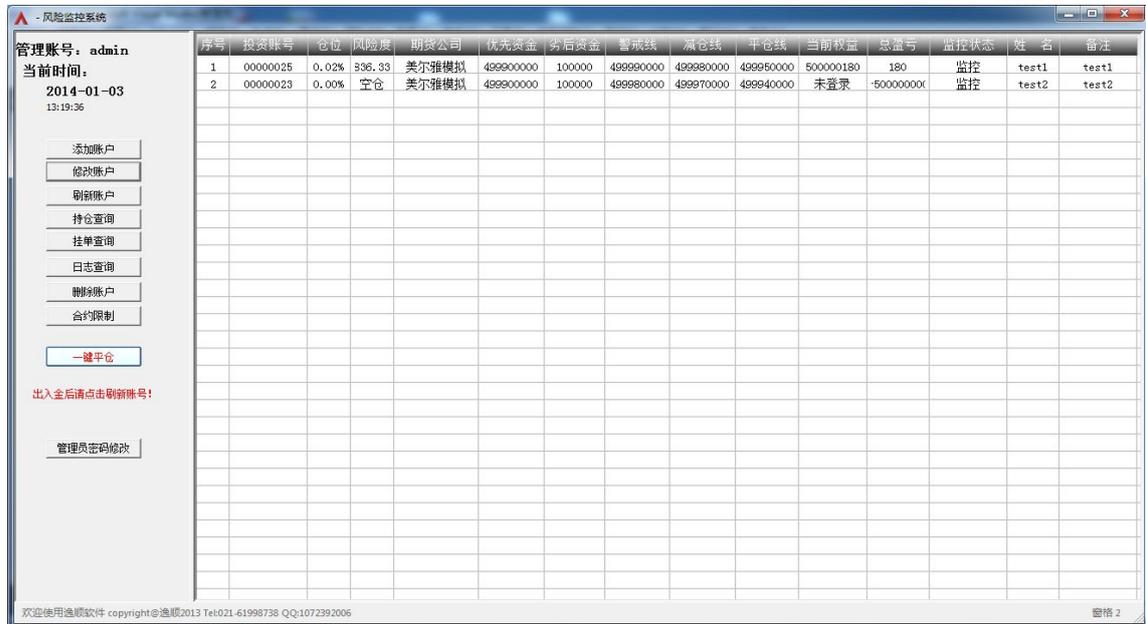
本软件充分考虑产品易用性，不需要安装。

- 1、把压缩包内所有文件解压到文件夹，运行 RiskCtrlClient.exe;
- 2、在下面的登录对话框中输入账号和密码，账号和密码需提前申请;



四、软件使用和设置

1、主界面和功能键说明：



1.1 功能键说明

- ✓ 添加账户： 增加受监控账户
- ✓ 修改账户： 修改受监控账户的配置信息
- ✓ 删除账户： 删除列表中的账户，操作前需在列表上点选账户
- ✓ 刷新账户： 手动刷新账户显示信息（注：客户出入金请点击刷新账号）
- ✓ 持仓查询： 显示某个账户的详细持仓信息
- ✓ 挂单查询： 显示某个账户的详细挂单信息
- ✓ 日志查询： 显示某个账户的配置修改信息和系统发出的交易信息
- ✓ 合约限制： 限制所有加载的账号的可以交易合约名称，合约数量不受限制。此处的合约限制会部署在每个受控账号上，如果某个账号不限制交易合约，那么需要关闭“开启合约限制”按钮。
- ✓ 一键平仓： 将该账户下的挂单撤销，平掉所持有的仓位
- ✓ 管理员密码修改： 修改登录密码

1.2 主界面关键字说明

- ✓ 序号： 账户编号
- ✓ 投资账号： 在期货公司开设的交易账号
- ✓ 仓位： 已占用保证金/账户总资金，百分比显示
- ✓ 风险度： 有三种显示方式：空仓、锁仓、数值，如果当前持仓为投机头寸，风险度显示信息是数值，含义是按照当前的持仓，行情反向多少跳会导致账户被强平，数值越大风险越小。空仓意味着账户没有持仓，锁仓含义是账户持有对锁的头寸。
- ✓ 期货公司： 账户所在期货公司
- ✓ 优先资金： 资方提供的资金总量
- ✓ 劣后资金： 盘方提供的资金总量
- ✓ 警戒线： 当账户权益下降到警戒线数值时，软件报警，**该账户信息黄色背景显示**
- ✓ 减仓线： 当账户权益下降到减仓线数值时，软件自动按照预设策略减少持仓
- ✓ 平仓线： 当账户权益下降到平仓线数值时，软件自动平掉所有持仓，撤销所有挂单，并禁止开立新的仓位，**该账户信息粉色背景显示**
- ✓ 当前权益： 当前账户总权益（**如果显示为未登陆可能是账号的密码或委托方式不对**）
- ✓ **总盈亏：** **当前权益 - 优先资金 - 劣后资金**
- ✓ 监控状态： 显示该账户是否在监控（监控/未监控 两种状态）
- ✓ 姓名： 开户人姓名（可选）
- ✓ 备注： 输入备注信息（可选）

2、添加账号

2.1 基本信息

- 1) 账户类型： 目前支持 CTP，恒生，金士达
- 2) 期货公司： 支持的期货公司
- 3) 账号： 受控账号的 id
- 4) 密码： 受控账号的密码

2.2 账户信息

- 1) 姓名: 开户人姓名, 可选;
- 2) 备注: 输入备注信息, 可选;
- 3) 优先资金: 资方提供的资金数量;
- 4) 劣后资金: 操盘手自己的保证金数量。

2.3 监控设置

- 1) 开启监控: 默认勾选, 如果未勾选, 则风控服务器不会对该账户进行风控
- 2) 开启合约限制: 开启此选项可以限制该账户只能交易“合约限制”栏内的合约; 勾选前请先在“合约限制”里添加可交易的合约
- 3) 允许夜盘: 默认勾选, 勾选此处开启夜盘交易, 否则夜盘时段会被限制交易
- 4) 警告线: 如果当前权益低于警告线, 则该账户以黄色背景显示

2.4 平仓策略

- 1) 强制平仓线: 当账户的动态权益低于此数值, 系统会发出平仓指令, 平掉所有持仓, 撤消所有挂单; 在监控页面该账户的显示信息背景颜色改为粉色
- 2) 强平后新开仓锁定账户: 默认非勾选, 如果勾选此项, 单账户达到强平线系统发出平仓指令后, 客户继续开仓, 这时系统会发出挂单指令, 占用保证金
- 3) 解锁: 默认不可用状态, 只有在“强平后新开仓锁定账户”勾选且客户有继续开仓的前提下该选项才可用。**如果该账户要继续交易请修改“强制平仓线”或勾选此项, 否则该账户将不可交易**

2.5 减仓策略

1) 亏损优先优先减仓:

在亏损优先减仓原则下, 系统会不断基于盈亏对持仓合约做排序, 优先减持亏损数量大的合约, 直到满足隔夜/午持仓上限。

2) 保证金优先减仓:

在保证金优先减仓原则下, 系统会不断基于保证金数额对持仓合约做排序, 优先减持保证金数额大的合约, 直到满足隔夜/午持仓上限。

3) 减仓线:

当账户的动态权益到达减仓线时, 系统会按照设置的条件自动减仓。

4) 减仓后可用的优先资金:

符合减仓线减仓时客户可以使用的优先资金。

5) 隔午减仓:

9: 00 - 11: 30 之间的时间段减仓策略; 隔午减仓功能打开后需要配置减仓时间、减仓比例两部分内容

6) 隔夜减仓:

13: 00 - 15: 15 以及 21: 30 - 次日 2: 30 之间的减仓策略; 隔夜减仓功能打开后需要配置减仓时间、减仓比例两部分内容

7) 减仓时间:

a) 商品减仓时间可以包括三个时间段, 之间用英文分号字符“;”分开, 每个时间段的起点时间和终点时间之间用中横连接, 示例: “10:13-10:15;11:28-11:30;14:58-15:00”, 在每个时间段内, 系统会在减仓之后持续监控账户持仓, 如果有新开仓位导致持仓比例超标, 系统会平掉新增持仓。早盘的时间段都用在隔午留仓策略中, 而午盘和夜盘的时段用在隔夜减仓策略中。

b) 股指减仓时间: 输入方法与商品减仓时间输入框相同, 但是股指减仓时间段只有两个;

8) 隔午减仓比例:

a) 商品隔午: 是指所有的商品合约所占用的保证金总量与自有资金的比值。如果在隔午减仓时段内没有股指持仓, 隔午持仓比例根据此数值确定;

b) 股指隔午(混合): 是指所有的合约(股指和商品)所占用的保证金总量与自有资金的比值。如果在隔午减仓时段内既有股指持仓, 也有商品持仓, 那么隔午持仓比例根据此数值确定;

c) 股指隔午: 是指所有的股指合约所占用的保证金总量与自有资金的比值。如果在隔午减仓时段内没有商品持仓, 隔午持仓比例根据此数值确定;

9) 隔夜减仓比例:

a) 商品隔夜: 是指所有的商品合约所占用的保证金总量与自有资金的比值。如果在隔夜减仓时段内没有股指持仓, 隔夜持仓比例根据此数值确定;

b) 股指隔夜(混合): 是指所有的合约(股指和商品)所占用的保证金总量与自有资金的比值。如果在隔夜减仓时段内既有股指持仓, 也有商品持仓, 那么隔夜持仓比例根据此数值确定;

c) 股指隔夜: 是指所有的股指合约所占用的保证金总量与自有资金的比值。如果在隔夜减仓时段内没有商品持仓, 隔夜持仓比例根据此数值确定;

注:

1) 在隔夜/午减仓时段内, 系统会根据持仓自动选择三种隔夜比例。确定留仓上限后, 系统会持续不断监控持仓数量, 如果有新增仓位导致持仓比例超标, 系统会立即减仓; 客户自有资金是变化的, 相对于最初的本金, 可能增加, 也可能减少, 因此每天客户能够持仓过夜的单量也是不一样的。

2) 本软件已经支持国债期货, 基于合约规则的设置, 国债期货被划分在商品一类。

- 10) 当前价格进入涨跌价格: 建议该数字小于 1%
- 11) 该合约保证金上限:
(具体的减仓算法请看 "FAQ" 中的第一点)

3、修改账户

账户信息

基本信息

账户类型: CTP账户 期货公司: 美尔雅模拟

账 号: 00000029 密 码: *****

账户信息

姓名: test 优先资金: 49900 万元

备注: test 劣后资金: 100 万元

监控设置

开启监控 开启合约限制 允许夜盘

警告线: 49999.85 万元

平仓策略

强制平仓线: 0 万元 强平后新开仓锁定账号 解锁

减仓策略

亏损优先减仓 保证金优先减仓

减仓线: 0 万元 减仓后可用优先资金: 10 万元

隔午减仓 隔夜减仓

商品减仓时间: 10:13-10:15;11:26-11:30;14:58-15:00

股指减仓时间: 11:28-11:30;15:10-15:15

商品隔午: 3 股指隔午(混合): 3.5 股指隔午: 4

商品隔夜: 2 股指隔夜(混合): 2.5 股指隔夜: 3

当前价格进入涨跌价格 0 %区间内,该合约保证金上限: 0 万元

更新 取消

(注: 修改账户部分和添加账户相似)

4、刷新账户

当客户出入金后，请点击刷新账号

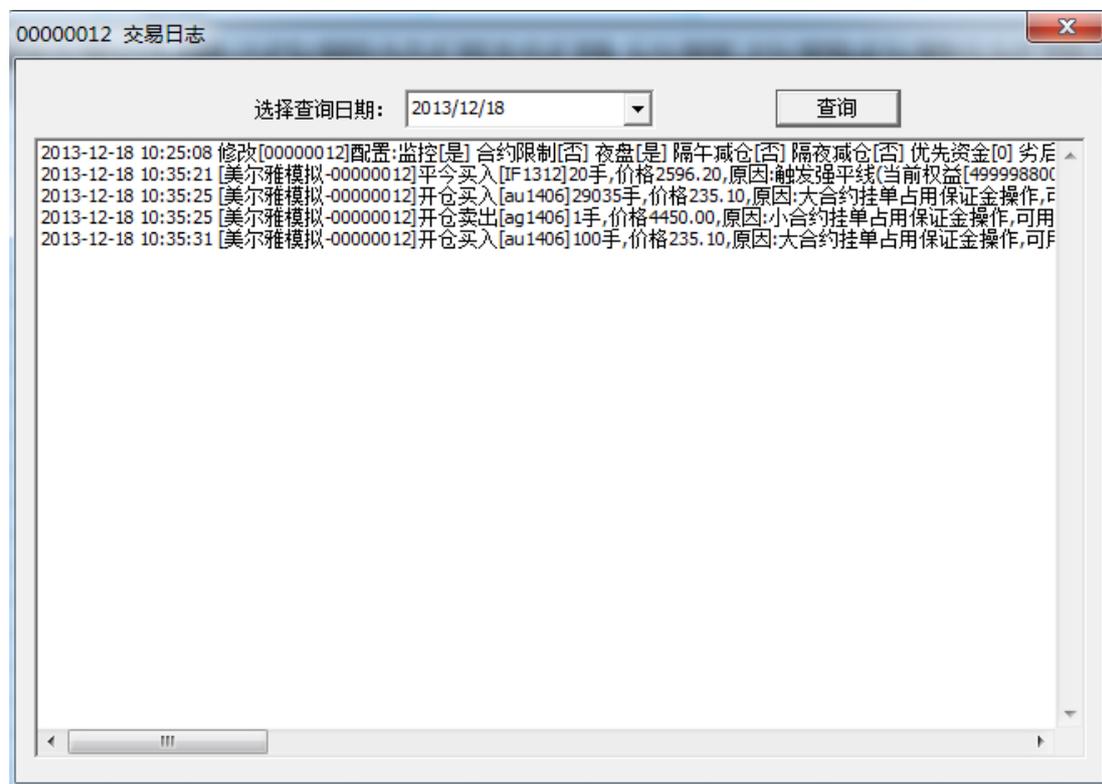
5、持仓查询

| 序号 | 商品 | 方向 | 总持仓 | 持仓均价 | 持仓保证金 | 当前价格 | 持仓盈亏 | |
|----|--------|----|-----|---------|--------|---------|---------|---------|
| 1 | IF1401 | 卖出 | 2 | 2337.40 | 168293 | 2331.60 | 3480.00 | |
| | | | | | | | 总持仓盈亏 | 3480.00 |

6、挂单查询

| 序号 | 报单编号 | 商品 | 方向 | 开平 | 数量 | 价格 |
|----|------------------|-------|----|----|----|---------|
| 1 | 2014010200477452 | RM405 | 买入 | 平 | 1 | 2621.00 |

7、日志查询

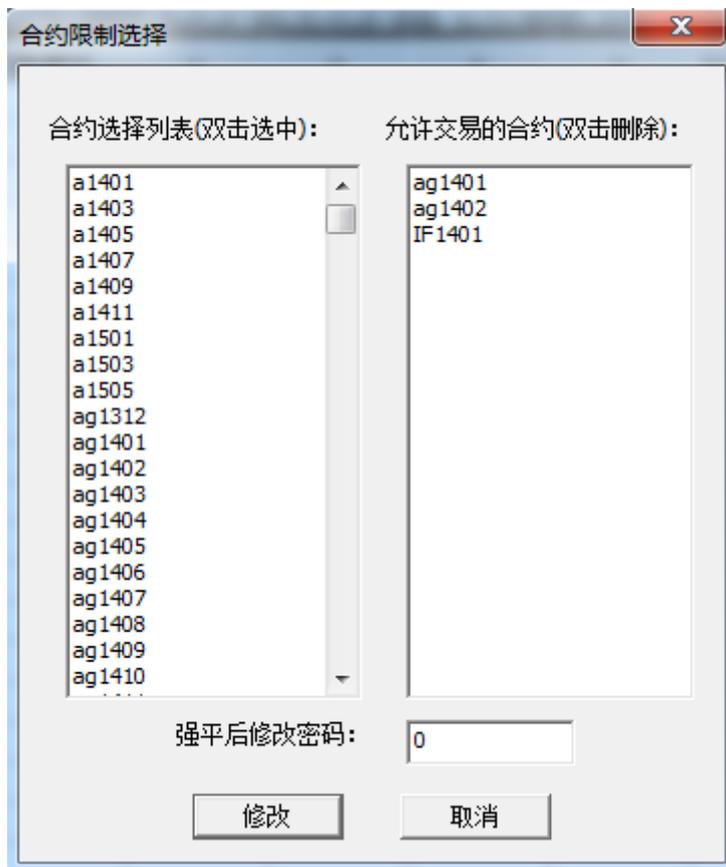


可以查询某个账户某天的配置信息修改情况，以及因触发风控参数而发生的交易记录

8、删除账户

当某个账户不再使用时，选中该账户在点击删除，就可以将该账户的相关信息删除。

9、合约限制



如果在账户配置信息中勾选了合约限制，则该账户只能交易允许交易合约列表中的合约，如果客户交易了允许交易合约列表外的合约，风控服务器会将不允许交易的合约持仓平仓。

注：强平后修改密码暂未开放

五、常见问题 FAQ

问题一：减仓的具体算法有哪些？

本软件具体提供三种减仓方式：减仓线减仓；隔午/隔夜减仓；涨跌停减仓
提供两种减仓原则：亏损优先减仓；保证金优先减仓

示例：

一个账号静态权益 11 万，优先资金 10 万，劣后资金 1 万，设置的减仓线为：10.5 万，减仓后可用的优先资金为 4 万，开启了隔夜减仓，隔夜商品减仓的倍数为：5，隔夜减仓的时间：14:58-15:00，当前价格进入涨跌停价格的 0.5% 区间内，该合约可用的保证上限为：0.5 万。勾选保证金优先减仓。

此时客户持仓 ru1405 多单 2 手，保证金约为 6 万。ag1406 多单 1 手，保证金约为 7500。

第一种：减仓线减仓

此时账户的当前权益为 10.1 万，低于设置的减仓线 10.5 万，系统会减仓，由于使用的减仓原则是保证金优先减仓，此时会优先减 ru1405，减仓的具体算法：

$$\text{减仓线减仓后的持仓保证金} \leq \text{当前权益} - \text{优先资金} + \text{减仓后可用的优先资金}$$

该账户可用的持仓保证金 $\leq 10.1 - 10 + 4 = 4.1$ 万，故此时将会减 1 手 ru1405

第二种：隔午/隔夜减仓

当前时间为 14:58，账户的当前权益为 10.8 万，隔夜减仓账户所持的保证金算法：

$$\text{隔午/隔夜减仓的持仓保证金} \leq (\text{当前权益} - \text{优先资金}) * \text{隔午/隔夜减仓倍数}$$

该账户可用的持仓保证金 $\leq (10.8 - 10) * 5 = 4$ 万，故此时将会减 1 手 ru1405

第三种：涨跌停减仓

ag1406 的昨结算价：4136 跌停价：3887，涨停价：4384，

a) 如果此时 ag1406 的最新价 $< (\text{跌停价 } 3887 + 4136 * 0.5\%)$ 时，ag1406 的多单持仓保证金将减至 设置的 0.5 万。

b) 如果此时 ag1406 的最新价 $> (\text{涨停价 } 4384 - 4136 * 0.5\%)$ 时，ag1406 的空单持仓保证金将减至 设置的 0.5 万。

问题二：“刷新账户”按钮的用处是什么？

客户出入金后会导导致权益变化，需要手动点击“刷新账户”保证权益同步。

问题三：如何做夜盘减仓控制？

- 1) 勾选“允许夜盘”；
- 2) 选择减仓策略，默认（亏损优先减仓）；
- 3) 设置减仓时间，金银的减仓时间建议设置为 2: 25-2: 30，铜、锌、铅、铝的时间建议设置为 0: 55-1: 00；
- 4) 设置商品隔夜倍数。

问题四：商品隔夜，混合隔夜和股指隔夜有什么差别？

隔夜包括了两个时间段，一个是 15: 00 和 15: 15 的下午收盘时间，另外一个 1: 00 和 2: 30 的凌晨收盘时间。

如果在风控配置中，激活了隔夜减仓功能，那么在下午盘和夜盘的对应时间段内，系统会在指定的减仓时间段内做相应的减仓操作。

商品隔夜，混合隔夜和股指隔夜是指三种持仓隔夜的方式：

- ✓ 商品隔夜是指持仓不包括股指
- ✓ 混合隔夜是指持仓包含商品和股指
- ✓ 股指隔夜是指持仓只有股指

问题五：总盈亏是什么含义？

总盈亏 = 当前权益 - (优先资金+劣后资金)

问题六：为什么有的账户显示“未登录”？

“未登录”是指风控客户端加载的账户没有登录到期货公司的柜台系统。出现这样的提示一般有几个原因：

- 1) 账号或者密码错误；
- 2) 账号对应的柜台系统不匹配，比如开户时账号对应的是恒生柜台系统，但是在风控客户端上加载账号时却指定了 CTP 柜台（很多期货公司同时有多个柜台系统）；

问题七：风险度是如何计算的？

风险度是指账户按照当前的持仓，从当前价格到达强平线权益价格的跳数。举个例子，如果账户持有一手 IF1401 合约，如果行情反向 5 个点账户会被强平，那么风险度就是 25（5 点*5 跳/点=25 跳）。风险度越大，账户的安全性越高。

问题八：为什么不用传统方式衡量风险度？

传统的风险度是用已用保证金除账户总资金，这样的结果只能衡量仓位，并且这样的算法无法区分账户盈利和亏损两种情况，两者的风险度是一样的，这显然不符合账户风控的需要。

问题九：如果账户管理方局域网瘫痪，是否会导致风控停止？

如果采用本地部署方式风控，局域网瘫痪会导致风控停止。如果采用云平台方式，本地网络瘫痪不会影响风控，因为在这种模式下，客户端只是起到实时显示账户状态和修改风控信息的作用，风控是在服务器上完成的。我们推荐使用云平台方式。