

量化资产管理平台系统

【服务端】

V1.0.0 使用说明书



CONTENTS

目录

一、 引言	1
1. 系统介绍	1
2. 资管系统介绍	1
2.1. 优势	2
2.2. 说明	2
二、 安装与部署	2
1. 服务端安装与部署	3

三、 服务端功能介绍	5
1. 多主账户分拆子账户	5
2. 子账户实时监控	12
3. 新增子账户	13
4. 风控参数配置	13
5. 初始资金配置	13
6. 手续费模板比例配置	13
7. 保证金比例配置	13
9. 风控实时预警	14
10. 防自成交模块与流控阀	14
11. 子账户全局图	14
12. 手工风控干预	14
13. 架构可视化	14
14. 自动化运维	15
15. 连接监控	15
16. 日志持久化	16
17. 绩效报告与导出	18

一、引言

专门面向期货 FOF/MOM 基金/量化交易团队/交易员培训与孵化团队/机构团队或个人多策略/多账户混合交易而打造的以账户管理为核心，兼具风险管理，多账户独立结算，账户信息实时监控，是一个综合性的集主观交易，程序化交易分仓独立结算，独立分析的综合管理平台，支持不同期货公司 CTP 柜台，兼具内外盘市场，包括数字货币，内外盘期货，股票市场等。

1. 优势

1. 系统集成管理的方式能更方便管理多个交易员和多个市场的经纪商，实时查看交易员动态及各个经纪商包括内外盘的主账户和子账户的实时情况。

2. 传统方式需要保证每个账户有充足资金交易，但是实际整体资金使用率可能只有 50-80%，使用资管系统后，同样资金可以根据使用率适当放大，分配给更多的交易员。

3. 多个交易员或策略分开独立运行，但是收益拟合到一个总账户，交易曲线在总账户上可以更加平滑，各策略和交易员独立结算，方便进行归因分析，事后的策略回溯。

4. 提前给各个子账户按照各自风险偏好的不同设置开仓、强平规则，黑白名单交易合约，是否日内清仓等等风控规则，避免”死扛” ”贪婪” 等人性弱点导致的不按约定开平仓。降低交易思路的人为干扰因素。

2. 说明

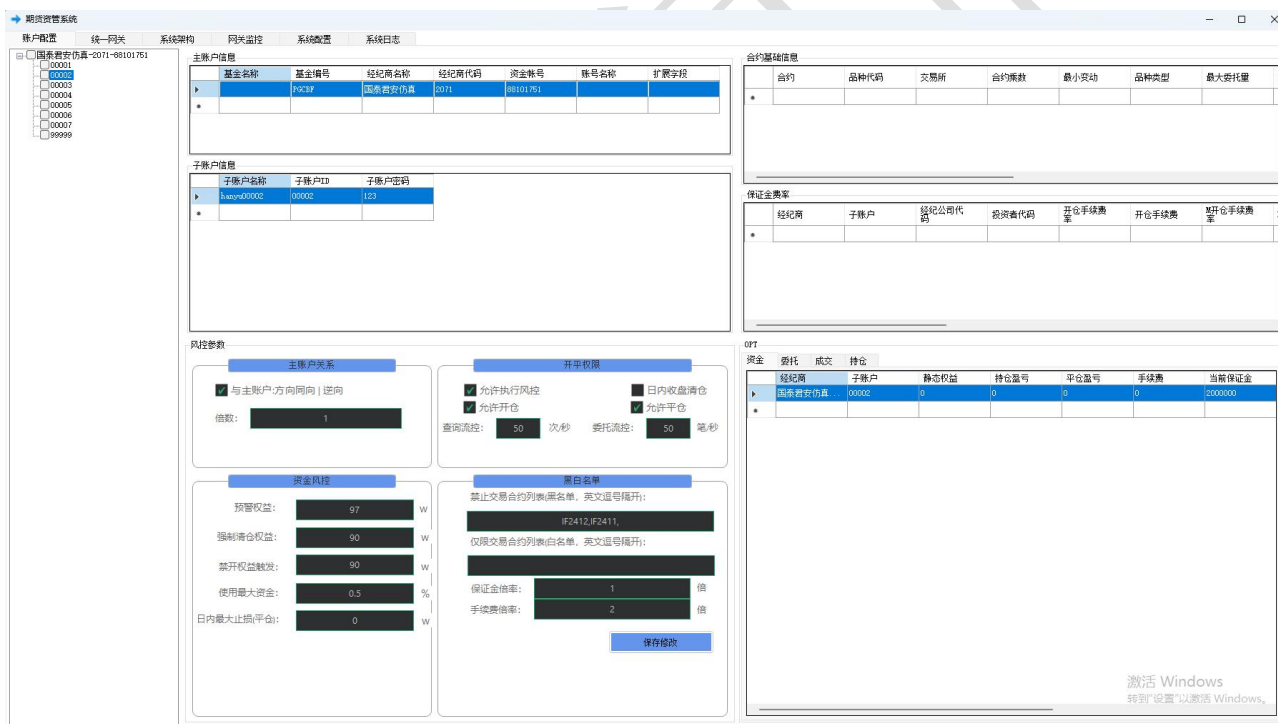
团队长期致力于量化交易系统，投研平台终端开发，自研 Global-Trader 全球量化交易-投研一体化终端的框架和前端建设，专注于私募/资产管理团队策略运维与运营自动化 IT 建设，打造更高效的策略投研与交易团队管理，交易实践一体化的平台整合方案。同时长期致力于自上而下的 CTA 投资组合的研究与实战，是一家兼具量化系统开发与量化资产管理的双赛道驱动的金融科技公司，秉承长期主义，欢迎交流。

1. 服务端安装与部署

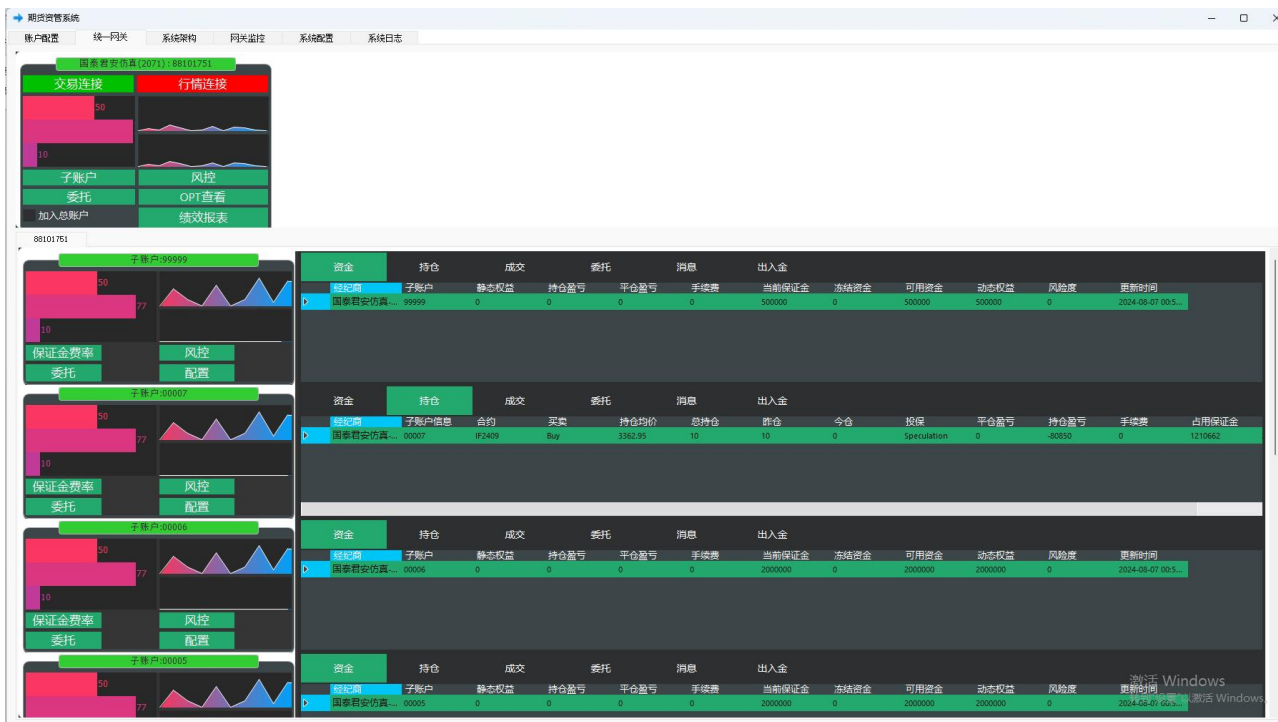
服务端采用全新的 Docker 堆栈部署模式，实现一键部署，包含内存 cache - redis，本地 sqlite 轻量化数据库，文件管理，消息中间件等，支持平台级别横向扩展，整个部署时间不超过 5 分钟，全自动化部署，真正保证开箱即用，点开 EXE 即可使用，无需其他组件的服务端部署。

• 2.1 多主账户分拆子账户

主账户支持横向扩展，即支持多市场的主账户对接，在抽象层面剥离出了网关层，消息层，子账户管理层，主账户管理层。在业务层面抽象出了主账户，子账户预备数据上下场，内存与文件 DB 实时同步等机制。

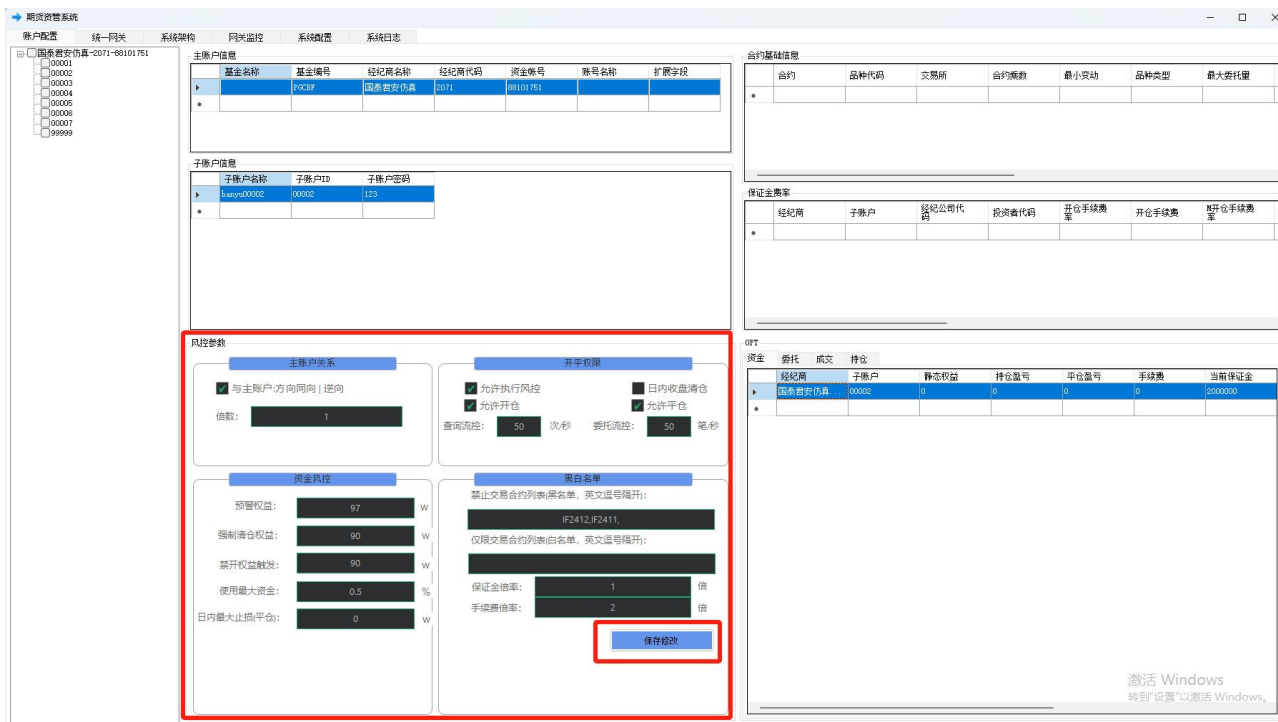


• 2.2 子账户实时监控



以极具可视化的形式实时展现主账户与子账户的当前状态，包含 OPT 委托成交持仓的数量，连接状态，等等信息，保证风控管理员可以实时观察各个交易员的交易情况。

• 2.4 风控参数配置



配置完成后，点击保存修改，实时生效。

• 2.5 初始资金配置



在新增子账户时，可根据需要配置给该交易员的资金情况，进行初始化的填写作为该交易员的起始资金状态。

• 2.6 手续费模板比例配置

合约基础信息

合约	品种代码	交易所	合约乘数	最小变动	品种类型	最大委托量
si2501	si	SHFE	5	5	Futures	1000
sc2509	sc	INE	1000	0.1	Futures	500
si2412	si	SHFE	5	5	Futures	1000
ag2501	ag	SHFE	15	1	Futures	500
v2412	v	DCE	5	1	Futures	1000

保证金费率

经纪商	子账户	经纪公司代码	投资者代码	开仓手续费率	平仓手续费	M开仓手续费率
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0.0004	0	0.0008
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	40	0
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	4	0
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	4	0
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	4	0
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	40	0

风控参数

主账户关系

与主账户:方向同向 | 逆向

倍数:

开平权限

允许执行风控 日内收盘平仓

允许开仓 允许平仓

查询流控: 次/秒 委托流控: 笔/秒

资金风控

预警权益: W

强制平仓权益: W

禁开权益触发: W

使用最大资金: %

日内最大止损(平仓): W

黑白名单

禁止交易合约列表(黑名单, 英文逗号隔开):

仅限交易合约列表(白名单, 英文逗号隔开):

保证金倍率: 倍

手续费倍率: 倍

[保存修改](#)

标准手续费由主账户在登陆后统一下发到各个子账户，子账户根据各自配置的保证金倍数和

手续费倍率进行重新调整，作为该子账户交易中的手续费和保证金标准。

• 2.7 保证金比例配置

合约基础信息

合约	品种代码	交易所	合约乘数	最小变动	品种类型	最大委托量
si2501	si	SHFE	5	5	Futures	1000
sc2509	sc	INE	1000	0.1	Futures	500
si2412	si	SHFE	5	5	Futures	1000
ag2501	ag	SHFE	15	1	Futures	500
v2412	v	DCE	5	1	Futures	1000

保证金费率

经纪商	子账户	经纪公司代码	投资者代码	开仓手续费率	开仓手续费	M开仓手续费率
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0.0004	0	0.0008
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	40	0
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	4	0
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	4	0
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	4	0
2071-2071-88...	00003	2071	00000000	0	40	0

风控参数

主账户关系

与主账户:方向同向 | 逆向

倍数:

开平权限

允许执行风控 日内收盘平仓

允许开仓 允许平仓

查询流控: 次/秒 委托流控: 笔/秒

资金风控

预警权益: W

强制平仓权益: W

禁开权益触发: W

使用最大资金: %

日内最大止损(平仓): W

黑白名单

禁止交易合约列表(黑名单, 英文逗号隔开):

仅限交易合约列表(白名单, 英文逗号隔开):

保证金倍率: 倍

手续费倍率: 倍

标准保证金由主账户在登陆后统一下发到各个子账户，子账户根据各自配置的保证金倍数和手续费倍率进行重新调整，作为该子账户交易中的手续费和保证金标准。

• 2.9 风控实时预警



服务端下发各个子账户的风险情况，当满足配置的风险配置时，会弹窗及声音提醒！

• 2.10 防自成交模块及流控阀



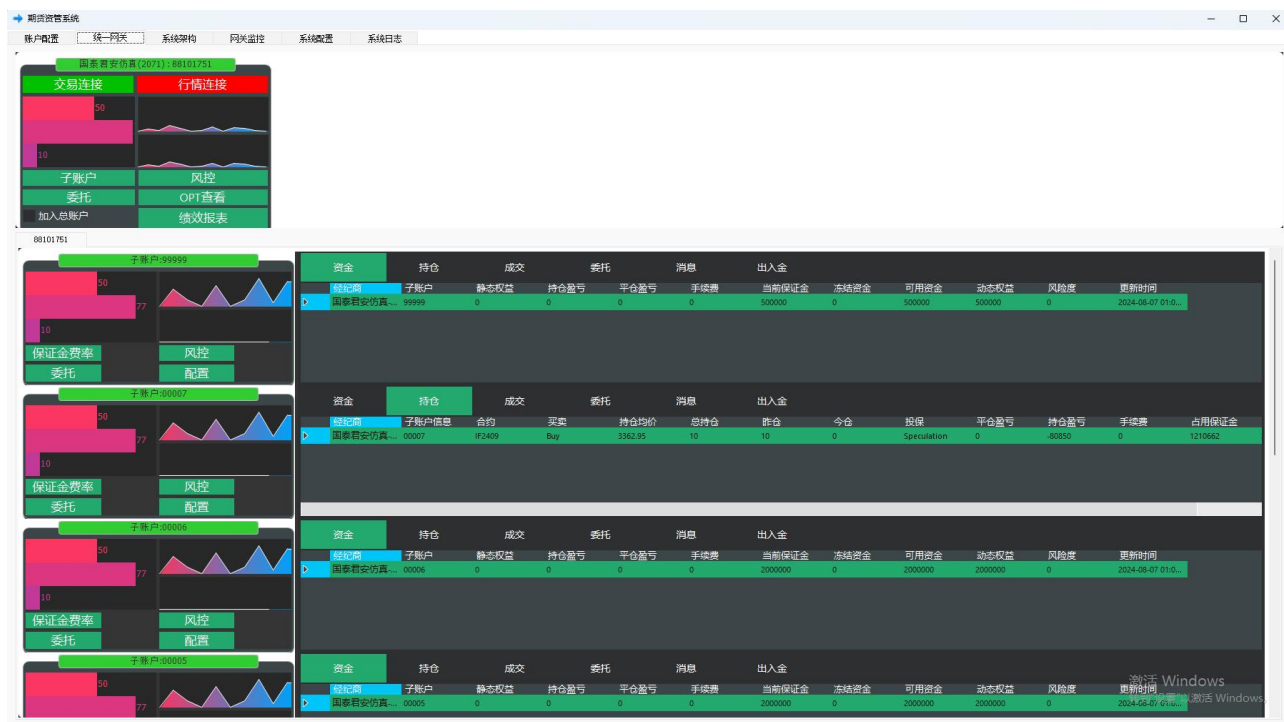
多个子账户虽然互相隔离，但是同时委托交易的委托单依旧统一进了主账户，将会有极大的可能在不做自成交防护的基础上发生自成交风险，这会对主账户构成虚假交易和被监管的极大的风险，尤其是部分交易所严格限制了当天发生自成交的次数，大于 5 次以上，就可能被下达警示与加强监管的信函，所以防自成交格外重要。

系统搭载了严格测试的防止自成交风险的模块，避免多个子账户的委托构成自成交风险，有效规避风险。



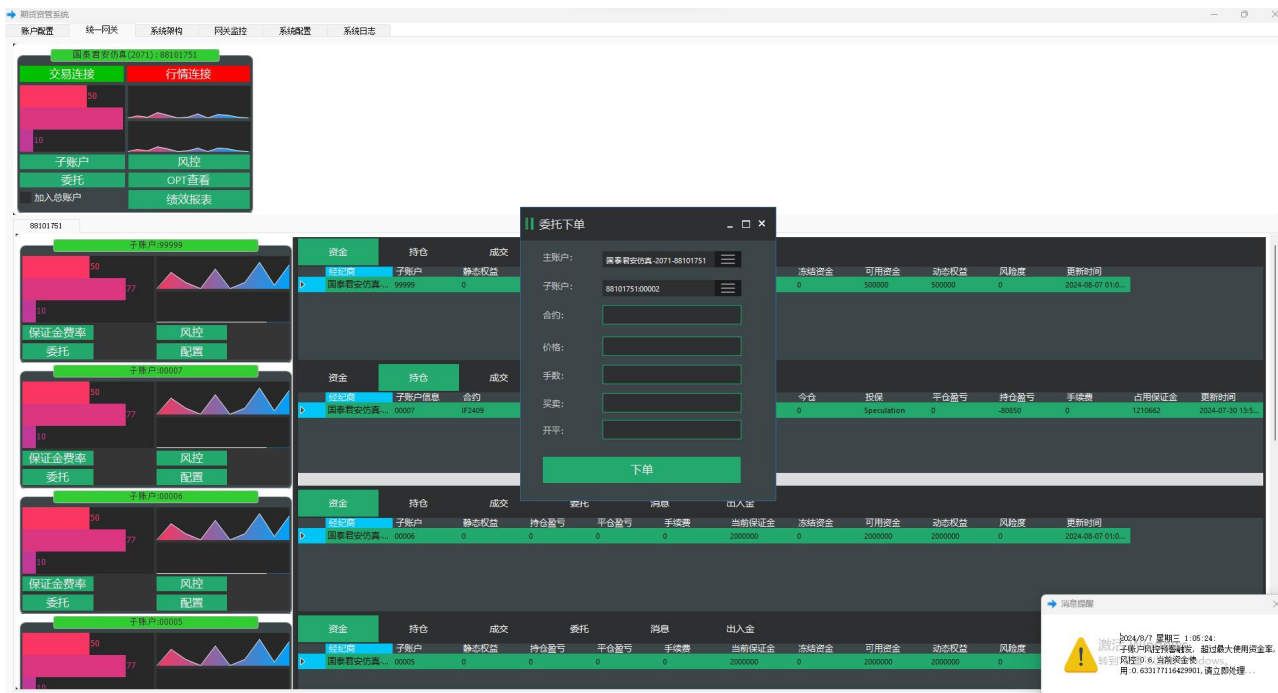
严控各个子账户的并发流控，防止多子账户并发委托，触发到主账户对接 CTP 及其他相关柜台的流控限制，导致委托和查询的拒单风险。同时系统内部也对委托流控进行了严格限制，保证符合主账户对接柜台的柜台流控管控。

• 2.11 子账户全局图



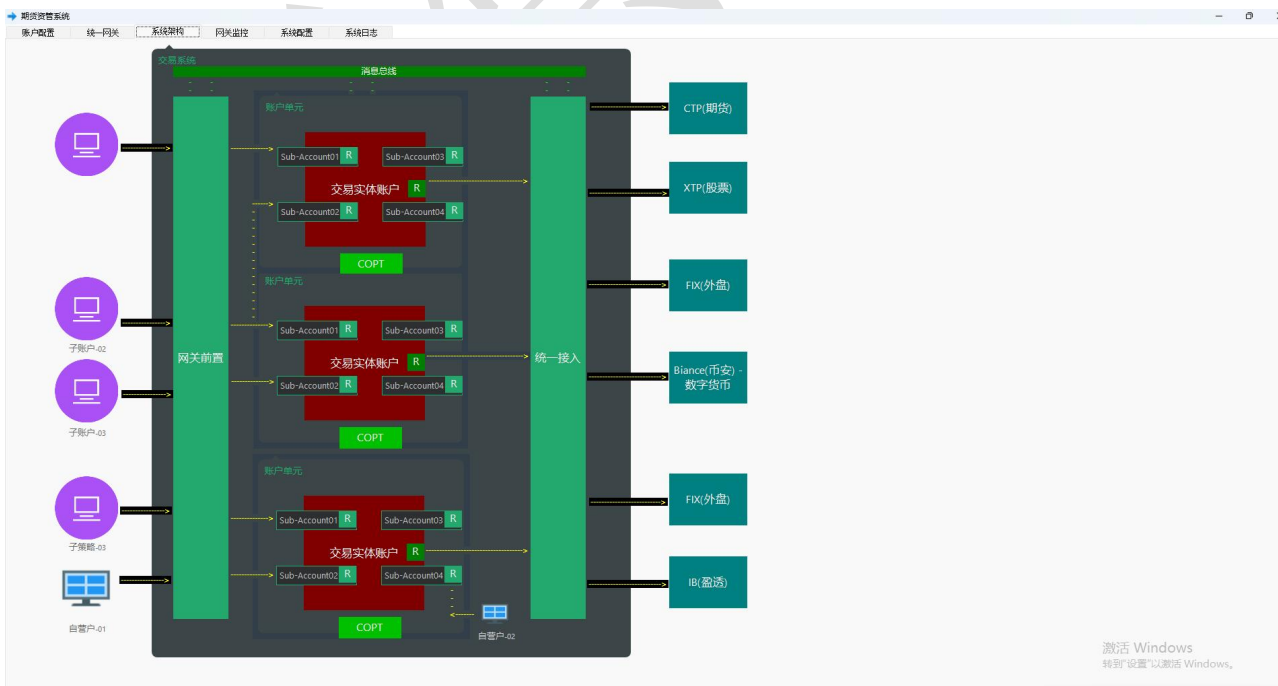
以极具可视化的形式实时展现主账户与子账户的当前状态，包含 OPT 委托成交持仓的数量，连接状态，等等信息，保证风控管理员可以实时观察各个交易员的交易情况。

• 2.12 手工风控干预



实时在服务端后台由风控人员介入进行人工干预式开平仓。可针对主账户，也可以直接针对某个子账户，风控措施开后，将会实时体现在客户端的子账户委托和成交里。

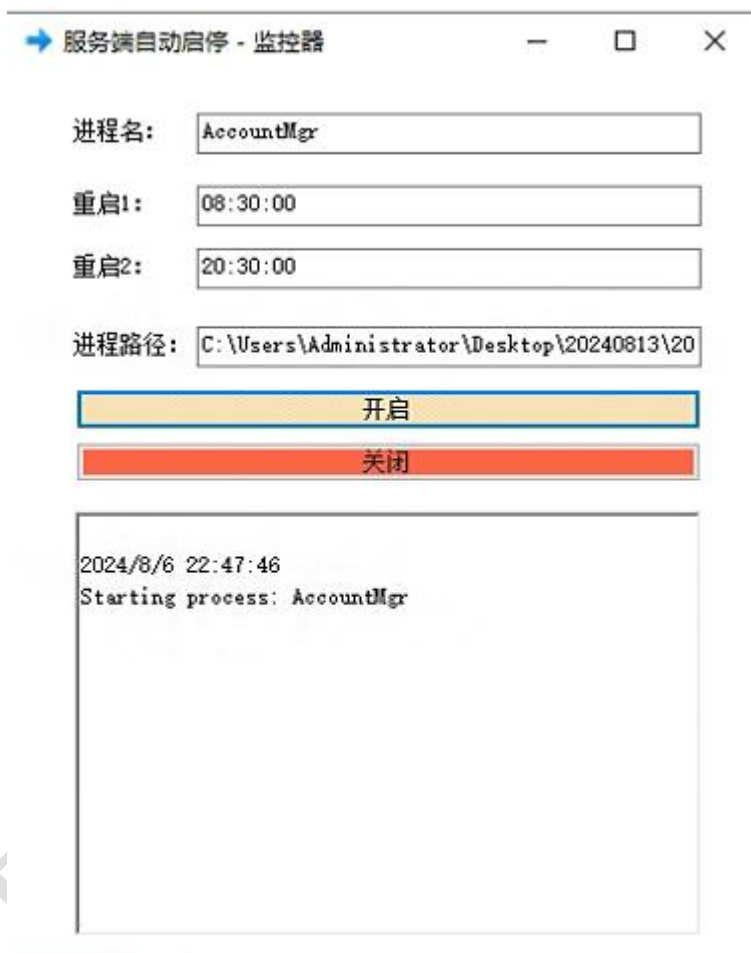
• 2.13 架构可视化



内部组件状态一览无余，实时查看系统内部各个组件的运行情况，针对有问题的组件进行介

入和干预，实时的掌握系统内部每个环节组件配合交易的情况，做到及时发现，及时处理，及时干预。

• 2.14 自动化运维



服务端搭配定时任务，由主任务对各个组件的子任务进行统一管理，每日定点关闭，重启服务端系统，保证无人值守 7*24 小时不间断自动化运维，运维出现的问题，由短信或三方(飞书)告知到运维人员或管理员进行人工干预。

• 2.15 连接监控

The screenshot displays the '连接监控' (Connection Monitoring) section of the system management software. On the left, there is a configuration panel for the monitoring server, including fields for IP (127.0.0.1), Port (2392), and connection parameters. Below this, there are options for automatic monitoring and manual monitoring. The right side features a table with columns for '账户名称' (Account Name), 'IP地址' (IP Address), '连接ID' (Connection ID), '连接状态' (Connection Status), '信息' (Info), and '连接时间' (Connection Time). The table lists several active connections with their respective details.

• 2.16 日志分类持久化

The screenshot shows the '日志分类持久化' (Log Classification Persistence) section. It contains a table with columns for '时间' (Time), '发布方' (Publisher), '信息类别' (Info Category), and '信息' (Info). The table lists various log entries, including connection status changes and account information updates. Below the table, there is a section for '持仓明细' (Position Details) with a similar table structure, showing detailed trade and position data for multiple accounts.

```

文件 编辑 查看
2024-08-04 17:08:44.952 [15] INFO PTS_Common.Logs [37] - 国泰君安仿真-2071-88101751-查询手续费率 12
2024-08-04 19:28:55.474 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - 服务窗口开始启动
2024-08-04 19:28:57.362 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : Start Init TradingSystem...
2024-08-04 19:28:57.368 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 开始登录交易通道:国泰君安仿真-2071-88101751
2024-08-04 19:29:03.482 [14] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 国泰君安仿真-2071-88101751:交易连接登录开始
2024-08-04 19:30:03.496 [14] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 国泰君安仿真-2071-88101751:连接通道应超期返回,请检查连接
2024-08-04 19:30:03.502 [14] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 行情报文暂未登录,该通道未加载,请及时关注Broker:国泰君安仿真-2071-88101751,CTP版本:v6.7.2_20230913 10:48:10.4926
2024-08-04 19:30:03.509 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 登录完毕,开始订阅主账户事件,下发子账户手续费保证金,以及行情订阅...
2024-08-04 19:30:03.514 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 登录完毕,订阅主账户事件进行处理订阅...
2024-08-04 19:30:03.527 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 交易未登录,无法查询到合约基础信息,基础信息无法下发给子账户,请注意...
2024-08-04 19:30:03.531 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 本地手续费文件列表条目当前总数720大于0,表示有相关信息,且当天2024-08-04 17:08:44已经更新过了,直接下发已有的手续费信息给子账户...
2024-08-04 19:30:03.542 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - Success Init TradingSystem...
2024-08-04 19:30:03.546 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - Start Init MsgQueue...
2024-08-04 19:30:03.549 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - Success Init MsgQueue...
2024-08-04 19:30:03.551 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - Start Init Real/Child AccountControl...
2024-08-04 19:30:03.709 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - Success Init Real/Child AccountControl...
2024-08-04 19:36:50.021 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - 服务窗口开始启动
2024-08-04 19:36:50.893 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : Start Init TradingSystem...
2024-08-04 19:36:50.896 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 开始登录交易通道:国泰君安仿真-2071-88101751
2024-08-04 19:36:55.864 [14] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 国泰君安仿真-2071-88101751:交易连接登录开始
2024-08-04 19:38:01.970 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - 服务窗口开始启动
2024-08-04 19:38:02.784 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : Start Init TradingSystem...
2024-08-04 19:38:02.788 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 开始登录交易通道:国泰君安仿真-2071-88101751
2024-08-04 19:39:08.804 [14] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 国泰君安仿真-2071-88101751:交易连接登录开始
2024-08-04 19:39:08.818 [14] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 行情报文暂未登录,该通道未加载,请及时关注Broker:国泰君安仿真-2071-88101751,CTP版本:v6.7.2_20230913 10:48:10.4926
2024-08-04 19:39:08.839 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 行情报文暂未登录,该通道未加载,请及时关注Broker:国泰君安仿真-2071-88101751,CTP版本:v6.7.2_20230913 10:48:10.4926
2024-08-04 19:39:08.848 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 登录完毕,开始订阅主账户事件,下发子账户手续费保证金,以及行情订阅...
2024-08-04 19:39:08.853 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 登录完毕,订阅主账户事件进行处理订阅...
2024-08-04 19:39:08.859 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 交易未登录,无法查询到合约基础信息,基础信息无法下发给子账户,请注意...
2024-08-04 19:39:08.887 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 本地手续费文件列表条目当前总数720大于0,表示有相关信息,且当天2024-08-04 17:08:44已经更新过了,直接下发已有的手续费信息给子账户...
2024-08-04 19:39:08.891 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统:等待连接登录,订阅事件下发完毕...
2024-08-04 19:39:09.243 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统:主账户整体初始化完毕,初始化主账户子账户界面UI配置成功...
2024-08-04 19:51:01.634 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统: [1]服务窗口开始启动
2024-08-04 19:51:01.844 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统: [2]SQLite初始化打开连接成功...
2024-08-04 19:51:02.421 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : Start Init TradingSystem...
2024-08-04 19:51:02.424 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 开始登录交易通道:国泰君安仿真-2071-88101751
2024-08-04 19:51:08.445 [14] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 国泰君安仿真-2071-88101751:交易连接登录开始
2024-08-04 20:01:18.452 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统: [1]服务窗口开始启动
2024-08-04 20:01:18.888 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统: [2]SQLite行情缓存文件初始化打开连接成功...
2024-08-04 20:01:19.465 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统: [3]Loader.Instance.Load(加载所有主子账户上墙配置初始化成功...
2024-08-04 20:01:19.479 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统: [4]根据子账户配置参数生成主子账户成功...
2024-08-04 20:01:19.487 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : Start Init TradingSystem...
2024-08-04 20:01:19.489 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 开始登录交易通道:国泰君安仿真-2071-88101751
2024-08-04 20:01:19.489 [1] INFO PTS_Common.Logs [37] - AccountMgr.Form2, Text: 期货资管系统: [5]根据子账户配置参数开始发起登录连接主账户...
2024-08-04 20:01:26.788 [14] INFO PTS_Common.Logs [37] - PTS_Common.RealAccountManager : 国泰君安仿真-2071-88101751:交易连接登录开始
    
```

激活 Windows
转到“设置”以激活 Windows。

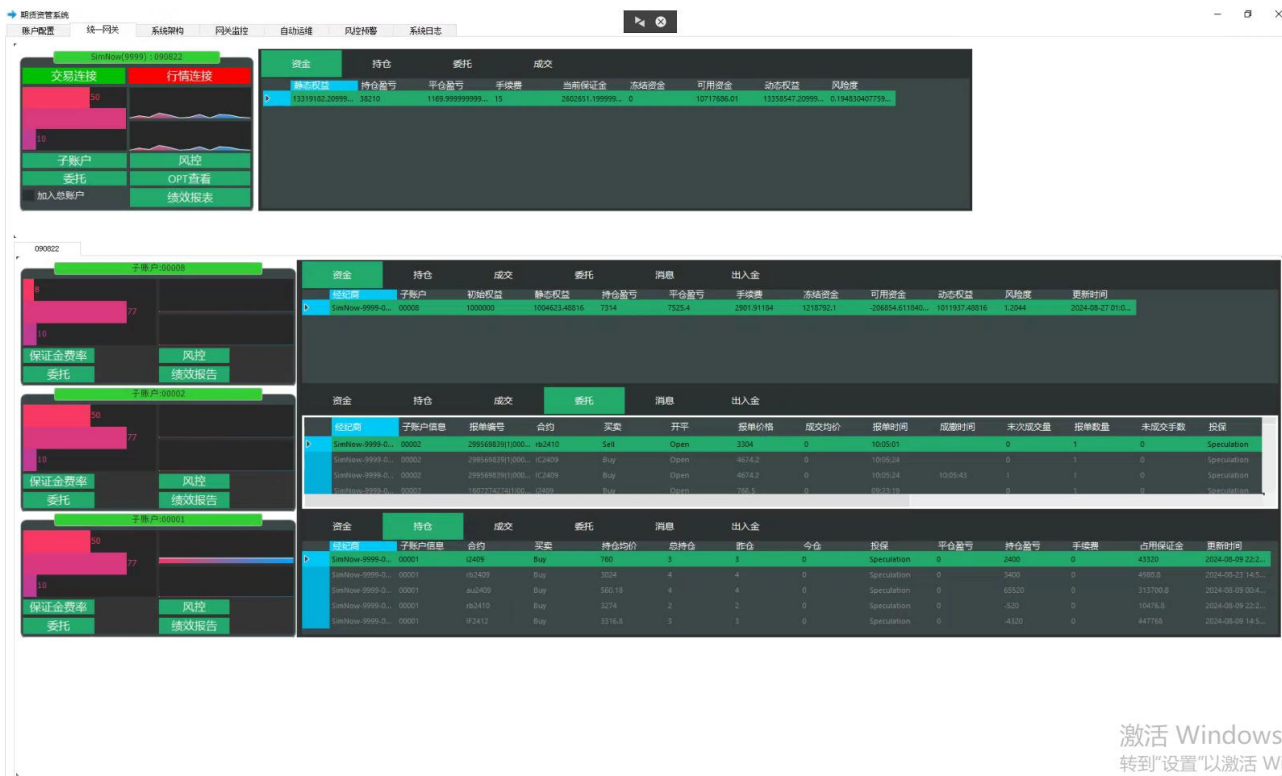
名称	修改日期	类型	大小
2024-06-09	2024/6/9 星期日 19:02	文本文档	4 KB
2024-06-10	2024/6/10 星期一 21:...	文本文档	125 KB
2024-06-11	2024/6/11 星期二 21:...	文本文档	124 KB
2024-06-14	2024/6/14 星期五 23:...	文本文档	528 KB
2024-06-15	2024/6/15 星期六 22:...	文本文档	77 KB
2024-06-17	2024/6/17 星期一 23:...	文本文档	206 KB
2024-06-28	2024/6/28 星期五 20:...	文本文档	4 KB
2024-07-20	2024/7/20 星期六 16:...	文本文档	13 KB
2024-07-26	2024/7/26 星期五 23:...	文本文档	1 KB
2024-08-01	2024/8/1 星期四 23:12	文本文档	14 KB
2024-08-03	2024/8/3 星期六 19:08	文本文档	298 KB
2024-08-04	2024/8/4 星期日 20:01	文本文档	81 KB
2024-08-05	2024/8/5 星期一 21:44	文本文档	59 KB
2024-08-06	2024/8/6 星期二 22:45	文本文档	96 KB
2024-08-07	2024/8/7 星期三 1:09	文本文档	127 KB

事前回溯历史每天日志情况，包括管理员，各子账户，系统内部所有操作的日志情况。

事中可以实时查看日志观察系统内部运行情况。

事后日志持久化为文件及 DBStore, 方便后期进行记录追踪。

• 2.17 绩效报告与导出



主账户以及各个子账户的交易报表可独立核算，独立导出，用于各个交易员独立清算，方便产品管理人员对各个交易员的交易业绩进行评估，回溯，归因分析等。