

大资管时代优质的信息技术提供商

THE SUPERIOR INFORMATION TECHNOLOGY
PROVIDER IN ASSET MANAGEMENT

绩效分析系统

V3.7.6.0

上海融航信息技术股份有限公司

公司地址:上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦7楼D座

网址:<http://www.rohon.net/>

客服热线:400-083-4361

目录

系统运维篇.....	8
1、 系统架构.....	8
1.1 绩效分析系统架构.....	8
1.2 组件模块.....	8
2、 特别注意事项.....	8
3、 系统部署.....	9
3.1 环境搭建要求.....	9
3.2 软硬件配置.....	9
3.3 安装部署.....	10
3.3.1 数据库创建与维护.....	10
3.3.2 Windows 版本部署.....	10
4、 系统灾备.....	15
基础业务篇.....	17
绩效分析系统-后台管理系统.....	17
5、 后台管理系统登录/退出.....	17
5.1 功能点简介.....	17
5.2 入口路径.....	17
5.3 使用说明.....	18
6、 人员管理.....	19
6.1 功能点简介.....	19
6.2 入口路径.....	19
6.3 使用说明.....	19
6.3.1 新增人员.....	20
6.3.2 编辑人员.....	21
7、 数据源管理.....	22
7.1 操作账户.....	22

7.1.1 功能点简介	22
7.1.2 入口路径	23
7.1.3 使用说明	23
7.2 资金账户	26
7.2.1 功能点简介	26
7.2.2 入口路径	26
7.2.3 使用说明	26
7.3 估值文件	30
7.3.1 功能点简介	30
7.3.2 入口路径	30
7.3.3 使用说明	30
8、投顾产品	33
8.1 功能点简介	33
8.2 入口路径	33
8.3 使用说明	33
8.3.1 绑定数据源	35
8.3.2 新增/编辑投顾产品	36
9、产品	36
9.1 功能点简介	37
9.2 入口路径	37
9.3 使用说明	37
9.3.1 绑定数据源	39
9.3.2 新增产品	40
9.3.3 编辑产品	45
10、出入金归属	47
10.1 功能点简介	47
10.2 入口路径	47
10.3 使用说明	47

10.3.1 编辑归属出入金	48
11、经纪公司管理.....	49
11.1 功能点简介.....	49
11.2 入口路径	49
11.3 使用说明	49
11.3.1 新增经纪公司管理.....	50
11.3.2 编辑经纪公司管理.....	50
绩效分析系统-前端	51
12、前端登录/退出.....	51
12.1 功能点简介.....	51
12.2 入口路径	51
12.3 使用说明	51
13、首页-页头基础数据	52
13.1 功能点简介.....	52
13.2 入口路径	52
13.3 使用说明	52
14、产品业绩.....	55
14.1 功能点简介.....	55
14.2 入口路径	55
14.3 使用说明	55
14.3.1 净值走势图	55
14.3.2 收益走势图	57
14.3.3 业绩表	57
14.3.4 月度回报图	58
14.3.5 回撤走势图	60
14.3.6 风险评估指标.....	61
15、交易分析.....	63
15.1 功能点简介.....	63

15.2 入口路径	63
15.3 使用说明	63
15.3.1 持仓分析	63
15.3.2 交易风格	63
15.3.3 权益走势	64
15.3.4 累计盈亏走势	65
15.3.5 收益明细	66
15.3.6 盈亏排行	67
15.3.7 投资偏好	67
16、 期货分析	69
16.1 功能点简介	69
16.2 入口路径	69
16.3 使用说明	69
16.3.1 市值比例	69
16.3.2 多空持仓市值	70
16.3.3 风险度	72
16.3.4 品种累计盈亏	73
16.3.5 品种盈亏走势	76
16.3.6 品种成交	77
16.3.7 品种盈利占比	79
16.3.8 品种亏损占比	80
16.3.9 行业成交统计	82
16.3.10 行业盈亏统计	83
17、 投资顾问	85
17.1 功能点简介	85
17.2 入口路径	85
17.3 使用说明	85
18、 产品—产品业绩	86

18.1 功能点简介.....	86
18.2 入口路径	86
18.3 使用说明	86
19、 产品分析.....	86
19.1 功能点简介.....	86
19.2 入口路径	87
19.3 使用说明	87
20、 产品信息.....	87
20.1 功能点简介.....	87
20.2 入口路径	87
20.3 使用说明	87
20.3.1 组合成分	87
20.3.2 组合成分收益率	88
21、 对比拟合.....	89
21.1 功能点简介.....	89
21.2 入口路径	89
21.3 使用说明	89
21.3.1 对比拟合列表.....	89
21.3.2 单位净值拟合分析.....	92
21.3.3 收益走势图对比	93
21.3.4 收益率走势图对比.....	93
21.3.5 动态回撤对比.....	94
21.3.6 月度收益率对比	95
21.3.7 指标对比.....	95
22、 我的对比.....	96
22.1 功能点简介.....	96
22.2 入口路径	96
22.3 使用说明	97

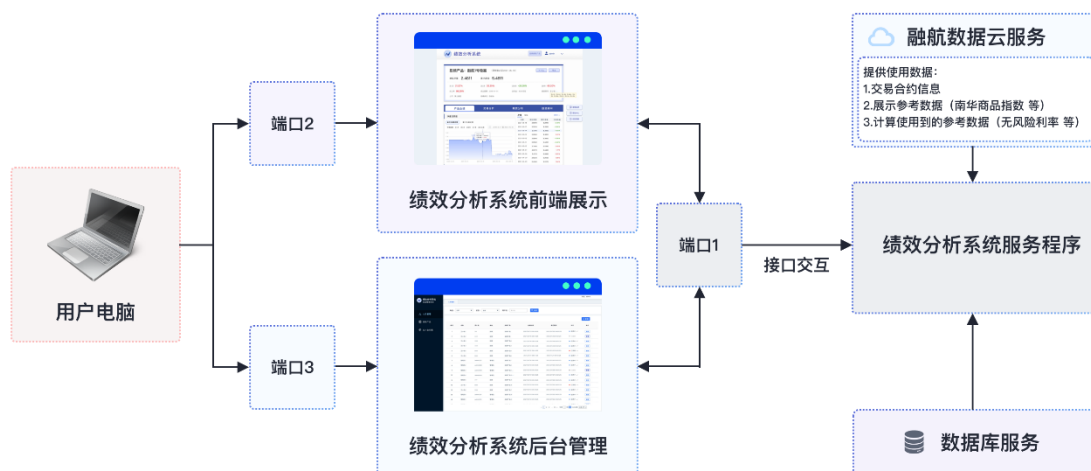
23、报告发送.....	97
23.1 功能点简介.....	97
23.2 入口路径	98
23.3 使用说明	98
23.3.1 报告发送-待发送	98
23.3.2 报告发送-发送记录	99
23.3.3 新建报告发送.....	99
24、说明书下载	102
25、修订记录.....	102

系统运维篇

本篇为系统运维篇，针对于绩效分析系统 IT 运维人员进行编写。通过系统架构、特别注意事项、系统部署、系统灾备四个章节进行重点介绍。

1、系统架构

1.1 绩效分析系统架构



1.2 组件模块

完整的一套绩效分析系统组件模块组成如下。

程序名称	功能简述
绩效系统前台展示	连接服务端的可视化图形界面。主要功能用于实现绩效结算后的数据展示、PDF 报告导出、定时发送结算单等功能。
绩效系统后台管理	连接服务端的可视化图形界面。主要功能用于实现绩效系统的数据管理、结算任务管理等功能。
绩效系统 Server（服务）	是整个系统的数据库操作的中转站。整个绩效分析系统对数据库的读写操作都是通过服务完成的。

2、特别注意事项

1、互联网权限

在本系统中，由于核心模块的结算功能需要获取外部数据，请务必确保以下网站或内网地址能访问通畅：

融航数据云平台(用于获取计算及界面展示使用的第三方数据)：

http://210.22.96.58:11005

可选择开通项：

对应管理平台(用于获取结算单数据)：

例如:http://127.0.0.1:10005

保证金监控中心(如需导入保证金监控中心结算单须开通)：

https://investorservice.cfmmc.com/

保证金监控中心解析验证码使用(超级鹰)：

http://upload.chaojiying.net/Upload/Processing.php

3、系统部署

3.1环境搭建要求

系统操作系统版本	配置要求
Windows 版本	1、Tomcat: 8.5.61 2、Java 版本: 1.8 3、Chrome 浏览器: 901902 (已包含在升级包中)

3.2软硬件配置

绩效分析系统支持 Windows 操作系统平台。

注：绩效分析系统可独立部署，亦可将绩效分析系统的应用服务部署在融航平台系统交易服务器，数据库同级部署在融航平台系统数据库服务器上。

硬件用途	应用程序	推荐配置	系统及支撑软件
应用服务器	绩效系统前台展示	硬盘: 1T 内存: 8G CPU: 4 核以上	1、支持 Windows 操作系统平台: windows server

	绩效系统后台管理 绩效系统 Server（服务）	带宽：非内网，上行带宽，建议：4M	2016/2019 64 位 数据中心版本。 2、Tomcat： 8.5.61 3、Java 版本： 1.8 4、Chrome 浏览器：901902（已包含在升级包中）
数据库服务器	绩效分析系统数据库	硬盘： 1T 内存： 8G CPU： 4 核以上	1、支持 Windows 操作系统平台： windows server 2016/2019 64 位 数据中心版本。 2、数据库版本： Oracle 11g

3.3 安装部署

绩效分析系统部署是支持 Windows 版本。

3.3.1数据库创建与维护






绩效分析系统建库脚本：

.\ServerApi\file\sql\部署脚本(无需执行升级脚本).txt

3.3.2Windows 版本部署

3.3.2.1后台服务程序说明

① 绩效分析系统程序文件说明

 JXfile	2022/3/3 10:40	文件夹	
 ServerApi11008	2022/3/3 10:40	文件夹	
 ShowWeb11006	2022/3/3 10:40	文件夹	
 SysWeb11007	2022/3/3 10:40	文件夹	
 VersionDetails.txt	2022/2/25 10:59	文本文档	1 KB

主要文件项说明：

JXfile	程序缓存目录
--------	--------

ServerApi	绩效系统 Server（服务）目录
ShowWeb	绩效系统前台展示目录
SysWeb	绩效系统后台管理目录
ServerApi\WEB-INF\classes\db.properties	绩效系统数据库配置文件
ServerApi\WEB-INF\classes\setting.properties	绩效系统其他参数配置文件
ShowWeb\config.js	绩效系统前台展示配置文件
SysWeb\config.js	绩效系统后台管理配置文件

3.3.2.2 具体部署流程

（一）文件准备：

前往发布路径，获取最新版本升级包文件发送至部署环境。

（二）文件解压（注：建议所有涉及到的文件目录都统一放到 D:/SMJX 下，方便归档管理）后如下：

JXfile	2022/3/3 10:40	文件夹	
ServerApi11008	2022/3/3 10:40	文件夹	
ShowWeb11006	2022/3/3 10:40	文件夹	
SysWeb11007	2022/3/3 10:40	文件夹	
VersionDetails.txt	2022/2/25 10:59	文本文档	1 KB

（三）操作步骤

1、数据库创建

新建 Oracle 数据库，复制数据库脚本 文件中的内容到 sql 执行界面，确保没有乱码后直接执行到 相应库即可（旧版升级新版部署在准备部署时已标注并提前处理，此处可以省略）

2、配置文件配置

需要配置的文件主要有：Tomcat 的 server.xml，前端展示界面和后台管理界面项目中的 config.js 以及后台服务的 setting.properties 和 db.properties（均位于 WEB-INF 的 classes 目录下）

① 首先配置 Tomcat 的 server.xml（具体配置依照实际情况决定）：

在</Server>标签前添加以下配置（非图片，可复制），其中端口号和项目路径仅供参考，具体环境部署请酌情修改。

方案 A:

```
<!-- 私募绩效 前端展示 -->

    <Service name="PerformanceAnalysis_FrontDesk">
        <Connector port="8881" protocol="HTTP/1.1"
            connectionTimeout="20000"
            redirectPort="8444" />
        <Engine name="Catalina" defaultHost="192.168.1.180">
            <Realm
className="org.apache.catalina.realm.LockOutRealm">
                <Realm
className="org.apache.catalina.realm.UserDatabaseRealm"
                    resourceName="UserDatabase"/>
            </Realm>
            <Host name="192.168.1.180" unpackWARs="true"
autoDeploy="true">
                <Context
path="/" docBase="D:\SMJX\projects\PerformanceAnalysis_FrontDesk"
" sessionCookieName="NEWSMJX"/>
                <Valve
className="org.apache.catalina.valves.AccessLogValve"
directory="logs"
                    prefix="localhost_access_log" suffix=".txt"
                    pattern="%h %l %u %t &quot;%r&quot; %s %b" />
            </Host>
        </Engine>
    </Service>

<!-- 私募绩效 后台管理-->

    <Service name="PerformanceAnalysis_Admin">
        <Connector port="8882" protocol="HTTP/1.1"
            connectionTimeout="20000"
            redirectPort="8412" />
        <Engine name="Catalina" defaultHost="192.168.1.180">
            <Realm
className="org.apache.catalina.realm.LockOutRealm">
                <Realm
className="org.apache.catalina.realm.UserDatabaseRealm"
                    resourceName="UserDatabase"/>
            </Realm>
```

```

        <Host name="192.168.1.180" unpackWARs="true"
autoDeploy="true">
        <Context
path="/" docBase="D:\SMJX\projects\PerformanceAnalysis_Admin"
sessionCookieName="NEWSMJX"/>
        <Valve
className="org.apache.catalina.valves.AccessLogValve"
directory="logs"
        prefix="localhost_access_log" suffix=".txt"
        pattern="%h %l %u %t &quot;%r&quot; %s %b" />
        </Host>
    </Engine>
</Service>

```

```

<!-- 私募绩效 后台服务-->
    <Service name="PerformanceAnalysis_Admin">
        <Connector port="8080" protocol="HTTP/1.1"
            connectionTimeout="20000"
            redirectPort="8413" />
        <Engine name="Catalina" defaultHost="192.168.1.180">
            <Realm
className="org.apache.catalina.realm.LockOutRealm">
                <Realm
className="org.apache.catalina.realm.UserDatabaseRealm"
                    resourceName="UserDatabase"/>
            </Realm>
            <Host name="192.168.1.180" unpackWARs="true"
autoDeploy="true">
                <Context
path="/" docBase="D:\SMJX\projects\PerformanceAnalysis_Api"
sessionCookieName="NEWSMJX"/>
                <Valve
className="org.apache.catalina.valves.AccessLogValve"
directory="logs"
                prefix="localhost_access_log" suffix=".txt"
                pattern="%h %l %u %t &quot;%r&quot; %s %b" />
            </Host>
        </Engine>
    </Service>

```

方案 B:

```

<!-- 私募绩效 一个端口配置 -->

    <Service name="OnePortNewBenefit">
        <Connector port="11007" protocol="HTTP/1.1"

```

```

        connectionTimeout="20000"
        redirectPort="84445" />
    <Engine name="OnePortNewBenefit" defaultHost="localhost">
        <Realm
className="org.apache.catalina.realm.LockOutRealm">
            <Realm
className="org.apache.catalina.realm.UserDatabaseRealm"
                resourceName="UserDatabase"/>
            </Realm>
        <Host name="localhost" appBase="webapps"
unpackWARs="true" autoDeploy="true">
            <Context
path="/" docBase="D:\SMJX\NewBenefit\ServerApi"
sessionCookiePath="/" sessionCookieName="NewBenefit"/>
            <Context
path="/11006" docBase="D:\SMJX\NewBenefit\ShowWeb" debug="0"
reloadable="true" crossContext="true"/>
            <Context
path="/11007" docBase="D:\SMJX\NewBenefit\SysWeb" debug="0"
reloadable="true" crossContext="true"/>

            <Valve
className="org.apache.catalina.valves.AccessLogValve"
directory="logs"
                prefix="localhost_access_log" suffix=".txt"
                pattern="%h %l %u %t &quot;%r&quot; %s %b" />
            </Host>
        </Engine>
    </Service>

```

② 配置前端和管理端的 config.js:

前台:

```

var Glod = {
  BaseUrl: "", //默认不配置
  BasePort: "11008" // 配置绩效后台端口
}

```

后台:

```

const VUE_APP_URL = {
  baseUrl: '', //默认不配置
  BasePort: '11008' //配置绩效后台端口
}

```

③ 配置后端服务的 db.properties:

主要配置项如下所示：

```
#Server端
jdbc.driver=oracle.jdbc.OracleDriver
jdbc.url=jdbc:oracle:thin:@192.168.1.183:1521:orcl
jdbc.username=rh_ServerTest01
jdbc.password=rh_ServerTest01
#定义初始连接数
jdbc.initialSize=0
#定义最大连接数
jdbc.maxActive=60
#定义最小空闲
jdbc.minIdle=1
#定义最长等待时间
jdbc.maxWait=60000

#主库
jdbc2.driver=oracle.jdbc.OracleDriver
jdbc2.url=jdbc:oracle:thin:@192.168.1.183:1521:orcl
jdbc2.username=rhserver_smjx3Test05
jdbc2.password=rhserver_smjx3Test05
#定义初始连接数
jdbc2.initialSize=5
#定义最大连接数
jdbc2.maxActive=60
#定义最小空闲
jdbc2.minIdle=5
#定义最长等待时间
jdbc2.maxWait=60000
```

这一块暂时没有用到，不用动

oracle数据库地址
用户名
密码

除上面三项外其他项维持默认即可

注：为便于理解 用户名 与 密码 使用明文，实际为加密字符串。

④ 配置后端服务的 setting.properties：

略，详见部署文档-其它配置说明。

⑤ 启动 tomcat，进入页面查看版本号是否正确，点击按钮是否能正常登录检查管理平台对应白名单是否配置，检查管理平台功能参数对应绩效授权开关及 ip 白名单是否配置正确。

4、系统灾备

为保障服务器在宕机情况下，绩效分析系统能够继续平稳运行，在部署时采用主备模式，应用服务器一主一备，主备应用服务器都配置主数据库，数据库一主一备。

正常情况下，运行主机上绩效分析系统，若出现主机宕机或者网络异常情况，便需要按照如下步骤进行切换。

➤ 应用服务器切换

主应用服务器发生故障，则关闭主应用服务器上程序，启用备机应用服务。

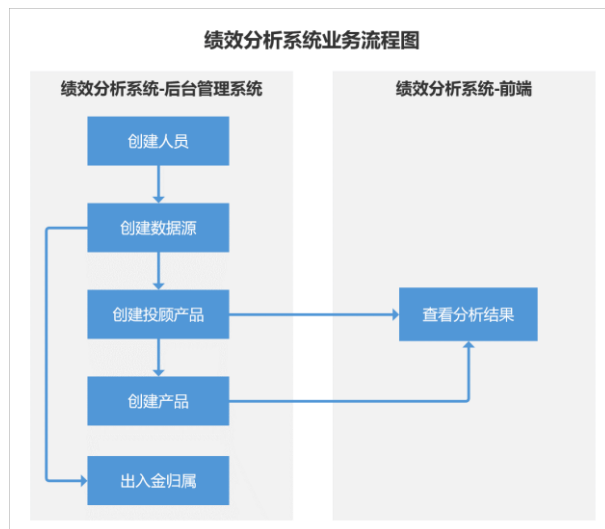
由于应用服务器的 IP 地址发生变更,则需要修改对应程序中的配置（数据库连接,前端项目对于服务指向地址）。

➤ 数据库服务器切换

主数据库服务器发生故障，则将启用的应用服务器上应用服务关闭，配置备机数据库，重启应用服务。

基础业务篇

基础业务篇包含绩效分析系统-后台管理系统、绩效分析系统前端的产品说明书，以图文结合的方式描述了绩效分析系统-后台管理系统、绩效分析系统前端的核心功能点，旨在帮助用户更好的使用绩效分析系统。业务流程图如下：



以下 5~11 章节主要包含了绩效分析系统-后台管理系统的登录、退出、人员管理、数据源管理、投顾产品、产品、出入金归属、经纪公司管理的说明，正文部分将详细展开描述。12~24 章节主要包含了绩效分析系统的前端登录/退出、首页-页头基础数据、产品业绩、交易分析、期货分析、投资顾问、产品-产品业绩、产品分析、产品信息、对比拟合、我的对比、报告发送、说明书下载的说，正文部分将详细展开描述。

绩效分析系统-后台管理系统

5、后台管理系统登录/退出

5.1功能点简介

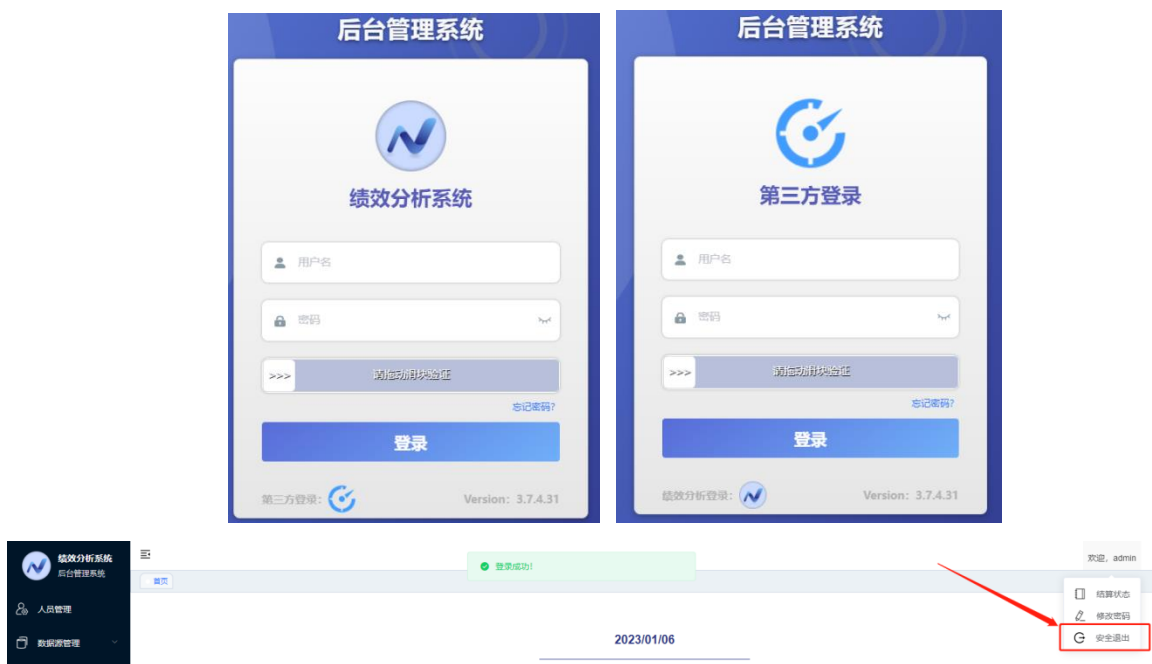
登录是用户进入和使用绩效分析系统-后台管理系统的途径。退出是用户退出绩效分析系统-后台管理系统的途径。

5.2入口路径

登录：在浏览器中输入绩效分析系统-后台管理系统的网址可直接打开本系统的登录界面。

退出：登录之后，点击首页右上角的账户名称，或者直接关闭网页，即可退出登录。

5.3使用说明



登录：用户输入账号、密码，拖动滑块验证后即可登录进入绩效分析系统web。账号密码的来源：使用绩效分析系统-后台管理系统，可进行账号及密码的创建。目前以下人员可登录绩效分析系统后台管理系统：

- ①绩效系统 admin；
- ②绩效系统“管理员”角色；

使用融航 AMS 资管系统的用户，在管理平台启用“向绩效分析系统开放数据接口”，填入对应的 IP 地址（只能填入 1 个对应的 IP 地址）之后；管理平台：处于“启用”和“禁用”状态的，角色为“账户管理员”的账户也可以登录绩效分析系统的后台管理系统。可通过切换至第三方登录的入口，用户输入账号、密码，拖动滑块验证后即可登录进入绩效分析系统。

退出：登录之后，有两种退出途径：①点击首页右上角的账户名称，然后点击“安全退出”即可退出登录。②直接关闭网页，即可退出登录。

6、人员管理

6.1功能点简介

可进行绩效分析系统的人员管理，包括绩效分析系统前端和后台管理系统人员的新增、编辑和删除。

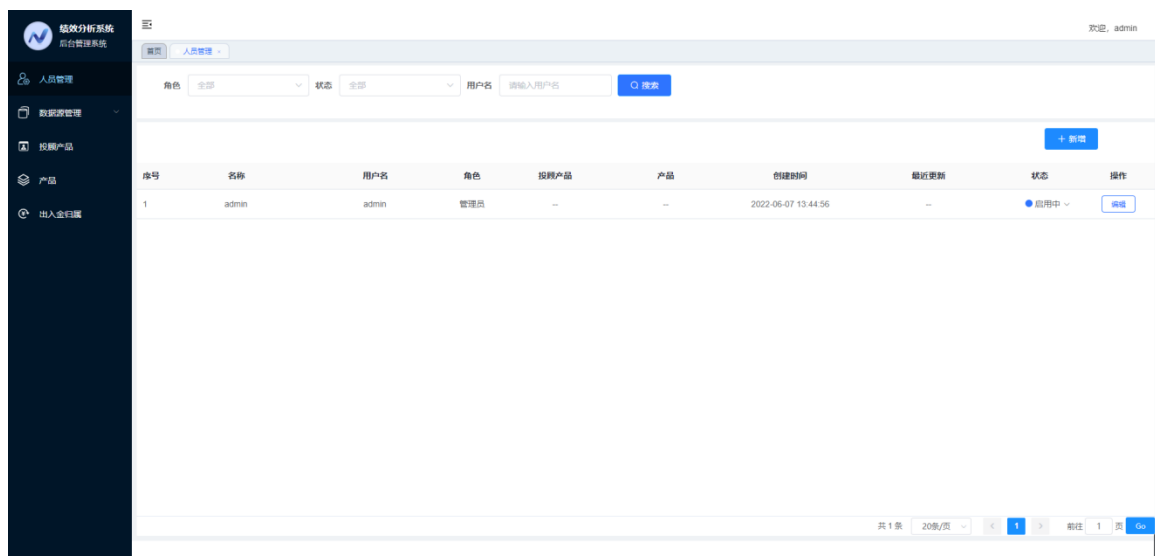
能够查看人员管理信息的人员及权限如下：

- ①admin：能够看到全部的人员信息。
- ②管理员：只能看到当前登录的管理员账户创建的人员信息。

6.2入口路径

点击左侧导航栏的人员管理即可进入。

6.3使用说明



搜索：可进行“角色”、“状态”、“用户名”的搜索。

01、角色可进行下拉，下拉项：全部、管理员、投顾。默认显示：全部。

02、状态可进行下拉多选，下拉项：启用中、已禁用、已删除。默认显示：全部。

03、用户名支持搜索联想，模糊匹配。

新增：可进行“新增”操作，点击“新增”进入新增人员界面详见 6.3.1。

列表页：按照创建时间来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。展示字段：序号、名称、用户名、角色、投顾产品、产品、创建时间、最近更新、状态、操作（编辑/查看）。当整体模块无数据时，展示“暂无数据”。

操作： 点击“编辑”，进入“编辑人员”界面，详见 6.3.2。

6.3.1新增人员

The screenshot shows the '新增人员' (Add Person) interface. On the left is a dark sidebar with a logo and navigation menu. The main area contains a form with the following fields and labels:

- 名称:** 15字以内
- *用户名:** 15字以内, 只支持数字、英文字母
- *密码:** 8-16个数字、大小写字母、特殊字符的组合
- *重复密码:** 8-16个数字、大小写字母、特殊字符的组合
- *角色:** ☒ 投顾 ☐ 管理员
- *邮箱:** 请输入邮箱
- *手机号:** 请输入手机号
- 投顾简介:** 500字以内
- 投顾产品:** 选择投顾产品
- 产品:** 选择产品

1、点击人员管理页面上的“新增”按钮，即可跳转到新增人员界面。字段：名称、用户名、密码、重复密码、角色、邮箱、手机号、投顾简介、投顾产品、产品。

2、名称：用户自主填入。名称不能超过15个字限制，超过15个字不可输入。

3、用户名：用户自主填入，需要去重。用户名若有重复，提醒：用户名重复。用户名只支持输入数字或英文字母，不能超过15个字限制，超过15个字不可输入。默认措辞：15字以内，只支持数字，英文字母。

4、密码/重复密码：用户自主填入，默认措辞：请输入8-16个数字、大小写字母、特殊字符的组合。可输入的特殊字符有：~、!、@、#、¥、\$、%、^、&、*。密码和重复密码必须完全一致。

5、角色：只能做单选，有2种角色可供选择：投顾，管理员。默认选中：投顾。切换至管理员时，“投顾简介”字段隐藏。

6、邮箱：用户自主填入。

7、手机号：用户自主填入。

8、投顾简介：用户自主填入。名称不能超过 500 个字限制，超过 500 个字不可输入。默认措辞：500 字以内。当角色是管理员时，“投顾简介”字段隐藏。

9、投顾产品/产品：点击“选择投顾产品”/“选择产品”出现“选择投顾产品”/“选择产品”弹窗。

①admin：能够给当前创建的人员，绑定任意投顾产品、产品。

②管理员：只能够给当前创建的人员，绑定当前登录账户能够看到的投顾产品、产品。

10、点击“保存”，若必填项不为空，即保存该数据，回到人员管理列表。点击“取消”，不进行任何操作，回到人员管理列表。

6.3.2编辑人员

点击人员管理列表的“编辑”按钮，进入“编辑人员”界面。字段：名称、用户名、角色、邮箱、手机号、投顾简介（当“角色”是“投顾”时，才有此字段）、投顾产品、产品、修改密码。

其中“用户名”，“角色”不可更改。

修改密码：点击修改密码，出现修改密码弹窗。字段：用户名，原密码，新密码，确认新密码。

- 1、用户名：为当前的用户名。
- 2、新密码、确认新密码：用户自主填入。新密码、确认新密码必须完全一致。
- 3、点击“确定”按钮时，进行条件判定。若输入信息有误，则出现对应文字提示。

若输入信息无误，即关闭弹窗，密码修改成功，回到编辑人员界面。点击“取消”或“X”，即关闭弹窗，不做改动，回到编辑人员界面。

7、数据源管理

用户管理原始的数据源。主要分为：操作账户、资金账户。

能够查看数据源管理信息的人员及权限如下：

- ①admin：能够看到全部的数据源信息。
- ②管理员：能看到当前登录账户创建的数据源信息，以及绑定的投顾产品穿透的数据源信息。

7.1操作账户

7.1.1功能点简介

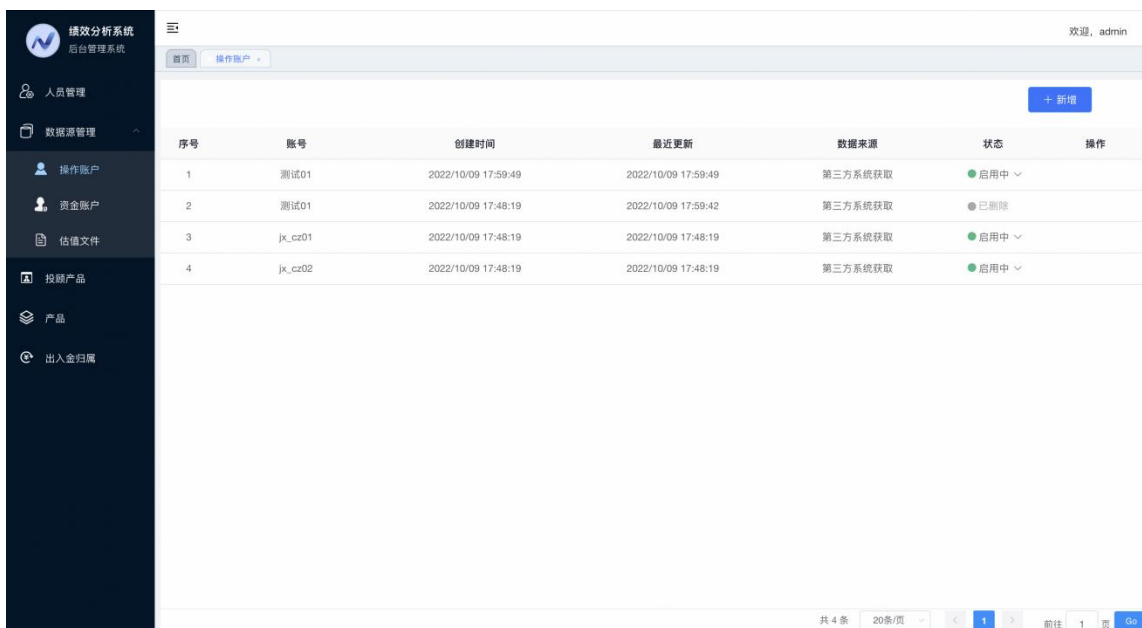
操作账户的数据来源于：融航 AMS 资管系统“管理平台-操作账户配置-操作账户管理”或者融航 RAMS 资管系统“管理平台-操作账户配置-操作账户管理”。一个管理平台的操作账户，只能在绩效分析系统形成唯一的操作账户数据源。

一般由管理平台启用“向绩效分析系统开放数据接口”，填入对应的 IP 地址（只能填入 1 个对应的 IP 地址）之后，自动同步而来。

7.1.2入口路径

点击左侧导航栏的数据源管理——操作账户即可进入。

7.1.3使用说明

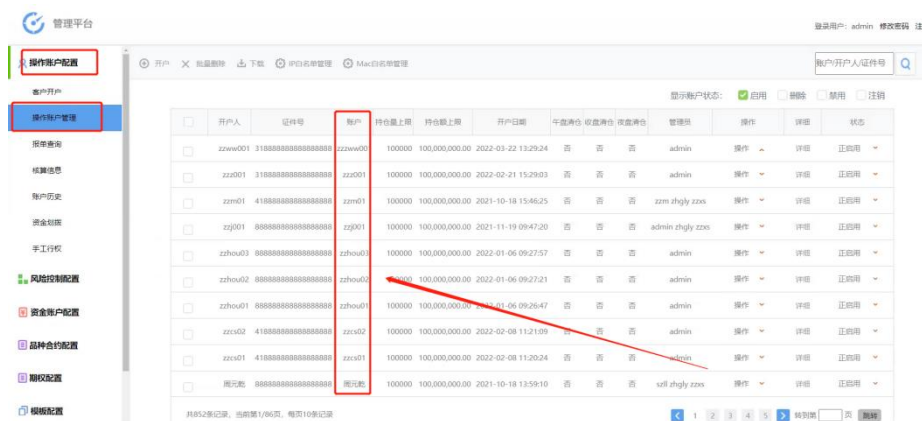


序号	账号	创建时间	最近更新	数据来源	状态	操作
1	测试01	2022/10/09 17:59:49	2022/10/09 17:59:49	第三方系统获取	● 启用中	
2	测试01	2022/10/09 17:48:19	2022/10/09 17:59:42	第三方系统获取	● 已删除	
3	jk_cz01	2022/10/09 17:48:19	2022/10/09 17:48:19	第三方系统获取	● 启用中	
4	jk_cz02	2022/10/09 17:48:19	2022/10/09 17:48:19	第三方系统获取	● 启用中	

1、操作账户列表显示顺序：按照最近更新来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。

2、展示字段：序号、账号、创建时间、最近更新、数据来源、状态、操作（编辑）。

01、账号：取“管理平台-操作账户配置-操作账户管理-账户”。



开单人	证件号	账户	持仓量上限	持仓额上限	开户日期	平仓持仓	收盘持仓	夜盘持仓	管理组	操作	详细	状态
zzww001	31888888888888888888	zzww00	100000	100,000,000.00	2022-03-22 13:29:24	否	否	否	admin	操作	详细	正常
zzw001	31888888888888888888	zzw001	100000	100,000,000.00	2022-02-21 15:29:03	否	否	否	admin	操作	详细	正常
zzm01	41888888888888888888	zzm01	100000	100,000,000.00	2021-10-18 15:46:25	否	否	否	zzm zhgly zze	操作	详细	正常
zzj001	88888888888888888888	zzj001	100000	100,000,000.00	2021-11-19 09:47:20	否	否	否	admin zhgly zze	操作	详细	正常
zzhou03	88888888888888888888	zzhou03	100000	100,000,000.00	2022-01-06 09:27:57	否	否	否	admin	操作	详细	正常
zzhou02	88888888888888888888	zzhou02	100000	100,000,000.00	2022-01-06 09:27:21	否	否	否	admin	操作	详细	正常
zzhou01	88888888888888888888	zzhou01	100000	100,000,000.00	2021-11-19 09:26:47	否	否	否	admin	操作	详细	正常
zzc02	41888888888888888888	zzc02	100000	100,000,000.00	2022-02-08 11:21:09	否	否	否	admin	操作	详细	正常
zzc01	41888888888888888888	zzc01	100000	100,000,000.00	2022-02-08 11:20:24	否	否	否	admin	操作	详细	正常
周元彪	88888888888888888888	周元彪	100000	100,000,000.00	2021-10-18 13:59:10	否	否	否	zzf zhgly zze	操作	详细	正常

02、数据来源：有 3 种来源，分别是：第三方系统获取、第三方系统获取+数据自主上传、数据自主上传。管理平台同步过来的数据默认为：第三方系统获取。

03、状态：有 3 种状态：启用中，已删除，已禁用。管理平台同步过来的数据默认为：启用中。

启用中：可以正常的进行数据绑定。

已禁用：禁用后不再支持绑定，不再进行数据的读取同步，允许重新启用。

已删除：不再支持绑定，不会进行后续的数据更新。不允许恢复启用中状态。

数据源：删除后不能够恢复正常状态。删除之后，能够新增一条同样的数据源名称记录。删除后不可编辑，其余状态均可编辑。

04、操作：

当状态为：“启用中”或“已禁用”，且数据来源是：“第三方系统获取+数据自主上传”或“数据自主上传”时，操作展示：编辑，点击“编辑”，进入“编辑操作账户”界面，详见 7.1.3.1。

当状态为：“已删除”时，操作部分展示为空。

7.1.3.1新增操作账户

当管理平台的数据同步不及时，可以手动的进行操作账户的新增。

1、“数据来源”下拉：第三方系统获取、第三方系统获取+数据自主上传、数据自主上传。默认：第三方系统获取。

1) 当数据来源为“第三方系统获取”时，展示字段：第三方系统、账号。

第三方系统为：融航 AMS 资管系统，账号为必填项。

绩效分析系统
后台管理系统

欢迎, admin

首页 操作账户 新增操作账户

* 数据来源: 第三方系统获取+数据自主上传

第三方系统: 融航AMS资管系统

* 账号: 请输入账号

* 数据自主上传 + 添加文件 (单个文件不超过50M) * 数据自主上传规则

传:

取消 保存

2) 当数据来源为“第三方系统获取+数据自主上传”时，展示字段：第三方系统、账号、数据自主上传（附件）。

01、第三方系统为：融航 AMS 资管系统，账号、数据自主上传为必填项。

02、点击“数据自主上传”出现弹窗，弹窗内容如下：

数据自主上传规则

- 1、上传的格式必须是zip格式。
- 2、zip文件下的目录是excel文件。
- 3、excel文件的数据必须是标准格式的结(核)算单，如：
[保证金监控中心结算单](#)
[融航AMS资管系统核算单](#)
- 4、当第三方系统为“保证金监控中心”时，zip文件中应该均为：保证金监控中心结算单；
当第三方系统为“融航AMS资管系统”时，zip文件中应该均为：融航AMS资管系统核算单；
- 5、当“第三方系统获取”与“数据自主上传”存在时间周期的重合时，以“第三方系统获取”的数据为准。
- 6、当“数据自主上传”中的文件存在时间周期的重合时，以最新上传的数据为准。

确定

03、数据自主上传允许用户上传 ZIP 文件或者 excel 文件，可以同时上传多个文件。上传的文件显示在“附件列表”。

3) 当数据来源为“数据自主上传”时，展示字段：账号、数据自主上传（附件），均为必填项。

——这种情况一般比较少见，建议用户直接以对接第三方系统的形式进行数据互通，便于数据的自主获取，可避免手动进行数据更新。

2、保存/取消：保存时，会对账号进行判重。若出现相同的账号，提示：账号已存在，不能重复创建。

点击“取消”，不进行任何操作，回到列表界面。

7.1.3.2 编辑操作账户

同新增操作账户界面。

7.2 资金账户

7.2.1 功能点简介

资金账户的数据来源于：保证金监控中心。一个保证金监控中心的资金账户，只能在绩效分析系统形成唯一的资金账户数据源。

7.2.2 入口路径

点击左侧导航栏的数据源管理——资金账户即可进入。

7.2.3 使用说明

绩效分析系统
后台管理系统

人员管理

数据源管理

操作账户

资金账户

估值文件

投资产品

产品

出入金归集

经纪公司管理

资金账户

序号	名称	创建时间	最近更新	状态	操作
1	xgff1	2023/02/10 10:40:59	2023/02/10 10:40:59	● 启用中	编辑
2	ctp2	2023/02/10 10:02:23	2023/02/10 10:02:23	● 启用中	编辑
3	t1	2023/02/10 09:48:01	2023/02/10 09:48:01	● 已删除	
4	ctf	2023/02/09 18:53:07	2023/02/09 18:53:07	● 启用中	编辑
5	01970300028	2023/02/09 18:51:49	2023/02/09 18:51:49	● 启用中	编辑

共 5 条 | 20条/页 | 1 | 前往 1 页

1、资金账户列表显示顺序：按照最近更新来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。

2、展示字段：序号，名称，创建时间，最近更新，状态，操作（编辑、文件上传）。

01、名称：创建资金账户数据源时填写的数据源名称。

02、状态：有 3 种状态：启用中，已删除，已禁用。默认为：启用中。

启用中：可以正常的进行数据绑定。

已禁用：禁用后不再支持绑定，不再进行数据的读取同步，允许重新启用。

已删除：不再支持绑定，不会进行后续的数据更新。不允许恢复启用中状态。

03、操作：

当状态为：“启用中”或 “已禁用”，操作展示：编辑、文件上传，点击“编辑”，进入“编辑资金账户”界面，详见 7.2.3.1。点击“上传文件”，进入“上传文件”界面，详见 7.2.3.3。

当状态为：“已删除”时，操作部分展示为空。

7.2.3.1新增资金账户

资金账户的数据来源可以是：保证金监控中心或者 CTP 交易柜台。

当第三方系统为保证金监控中心时，提供保证金监控中心账号、保证金监控中心密码，即可自动获取到保证金监控中心结算单进行数据解析。

当第三方系统为 CTP 时，提供开户经纪公司、资金账户、资金账户密码、经纪公司穿透式认证码，即可自动获取到 CTP 结算单进行数据解析。

The image shows two screenshots of the '新增资金账户' (Add Fund Account) form in the '绩效分析系统' (Performance Analysis System). The top screenshot shows the '第三方系统' (Third Party System) set to '保证金监控中心' (Guarantee Fund Monitoring Center). The bottom screenshot shows it set to 'CTP'. The form includes fields for name, third-party system, CTP account, CTP password, and CTP authentication code.

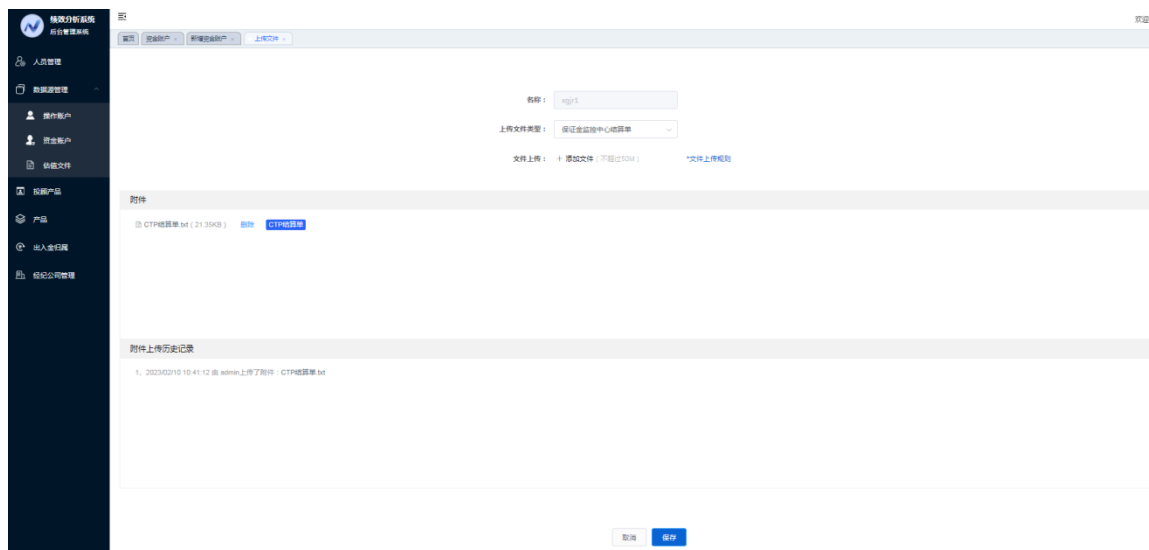
点击新增经纪公司可以进行经纪公司的创建，提供经纪公司名称、经纪公司代码（Broker ID）、交易服务器地址、行情服务器地址，即可进行经纪公司添加。

The image shows the '新增经纪公司' (Add Broker Company) form. It includes fields for broker name, Broker ID, trading server address, and market data server address. There are also buttons for '测试' (Test) and a '柜台类型' (Counter Type) dropdown set to 'CTP穿透式柜台' (CTP Penetration Counter).

7.2.3.2编辑资金账户

同新增操作账户界面。

7.2.3.3文件上传



01、点击“文件上传规则”出现弹窗：



02、文件上传允许用户上传 ZIP 文件或者 excel、txt 文件，可以同时上传多个文件。上传的文件显示在“附件列表”。

2、保存/取消：保存时，需要对上传文件类型进行判断。若出现上传文件类型与实际不一致，提示：文件上传失败。

点击“取消”，不进行任何操作，回到列表界面。

7.3 估值文件

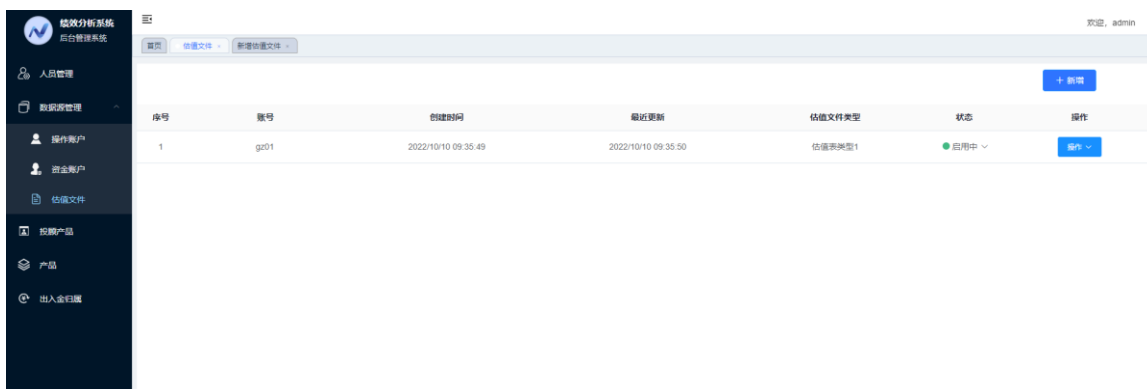
7.3.1 功能点简介

估值文件的数据来源于用户自主上传。启用中的估值文件的账号在数据源管理中需要保持唯一。

7.3.2 入口路径

点击左侧导航栏的数据源管理——估值文件即可进入。

7.3.3 使用说明



序号	账号	创建时间	最近更新	估值文件类型	状态	操作
1	gz01	2022/10/10 09:35:49	2022/10/10 09:35:50	估值类型1	启用中	操作

1、估值文件列表显示顺序：按照新增的估值文件来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。

2、展示字段：账号、创建时间、最近更新、估值文件类型、状态、操作。

01、账号：用户自主输入。

02、估值文件类型：上传时选择的估值文件类型。

03、状态：存在 2 种状态：启用中、已删除。

启用中：可以正常的进行数据绑定。

已删除：不再支持绑定，不会进行后续的数据更新。不允许恢复启用中状态。

删除之后，能够新增一条同样的估值文件账号。

04、操作：

当状态为：“启用中”，点击操作展示：查看净值、调仓记录、编辑，点击进入对应操作界面，详见 7.3.3.1、7.3.3.2、7.3.3.4。

当状态为：“已删除”时，操作部分展示为空。

7.3.3.1查看净值

净值列表(以最后一次更新的数据为准)

gz01

批量删除 上传净值

<input type="checkbox"/>	日期	单位净值	累计净值	操作
<input type="checkbox"/>	2022/03/18	1.008	1.008	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/>	2022/03/17	1.003	1.003	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/>	2022/03/16	0.999	0.999	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/>	2022/03/15	1.001	1.001	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/>	2022/03/14	1.014	1.014	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>
<input type="checkbox"/>	2022/03/11	1.034	1.034	<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/>

共 6 条 20条/页 < 1 > 前往 1 页 Go

可查看选中的估值表文件的净值记录，支持编辑、删除、批量删除、上传净值操作。

编辑：

编辑净值

净值日期: 2022-03-18

* 单位净值: 1.008

* 累计净值: 1.008

份额 7724373.7797

取消 确定

可对单位净值、累积净值、份额进行编辑。

上传净值：

点击可上传估值表文件。

7.3.3.2调仓记录

调仓记录							
GZ_03							批量清空
<input type="checkbox"/>	日期	申购	赎回	增强	退增强	分红	操作
<input type="checkbox"/>	2022/03/18	--	--	--	--	--	✕ ○
<input type="checkbox"/>	2022/03/17	--	--	--	--	--	✕ ○
<input type="checkbox"/>	2022/03/16	--	--	--	--	--	✕ ○
<input type="checkbox"/>	2022/03/15	--	--	--	--	--	✕ ○
<input type="checkbox"/>	2022/03/14	--	--	--	--	--	✕ ○
<input type="checkbox"/>	2022/03/11	--	--	--	--	--	✕ ○

支持查看、编辑、清空、批量清空调仓记录。

编辑：

编辑

净值日期：

2022-03-18

出入金类型：申购

添加

请选择类型

添加 删除

取消

确定

可添加多条出入金记录。

7.3.3.3新增估值文件

绩效分析系统

后台管理系统

人员管理

数据管理

操作账户

资金账户

估值文件

投资组合

产品

出入金归属

首页

估值文件

新增估值文件

* 账号：

请输入账号

☐ 自动形成投资组合

估值文件类型：

估值表类型1

上传：

+ 添加文件（只能上传Excel文件或zip文件，且单文件不超过50M）

下载估值表类型1

取消

保存

1、用户可自主输入账号，账号名称需要在估值文件的范围内去重，可以与操作账户、资金账户的账号名重复。

2、可勾选开启“自动形成投顾产品”。即在创建估值文件的同时，新增一个投顾产品，投顾产品默认数据源为该估值文件，投顾产品名称、账号均为估值文件的账号。

3、估值文件类型：支持两种估值表类型:估值表类型 1、估值表类型 2。支持上传 Excel 文件或 zip 文件，可以同时上传多个文件，单文件不超过 50M。

7.3.3.4编辑估值文件

同新增估值文件，但无自动形成投顾产品的选择项。

8、投顾产品

8.1功能点简介

可进行绩效分析系统的投顾产品管理，包括投顾产品的新增、编辑和删除。

当前有两种创建投顾产品的方式：

①管理平台同步：管理平台—其他配置—功能参数—“绩效分析系统配置”—启用“向绩效分析系统开放数据接口”—输入 IP 白名单—自动同步管理平台的操作账户，形成“投顾产品”。（购买了“融航 AMS 资管系统”的客户，可以通过这种方式进行“投顾产品”创建）

②自主创建：绩效分析系统-后台管理系统—投顾产品—点击“新增”。

能够查看投顾产品信息的人员及权限如下：

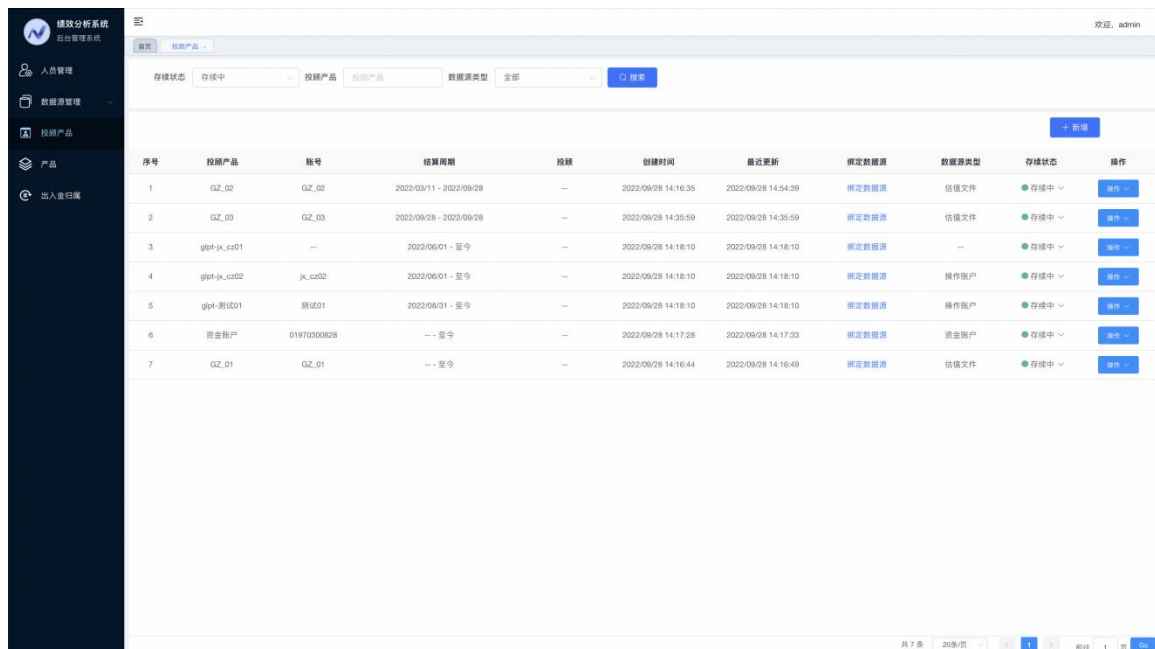
①admin：能够看到全部的投顾产品信息。

②管理员：只能看到与当前登录账户存在绑定关系的投顾产品信息，这些投顾产品来源：可能为管理员自己创建；admin 给管理员绑定对应的投顾产品。

8.2入口路径

点击左侧导航栏的投顾产品即可进入。

8.3使用说明



The screenshot displays the 'Performance Analysis System' (绩效分析系统) interface. On the left is a dark sidebar with navigation options: 人员管理, 数据源管理, 投顾产品, 产品, and 出入金归属. The main area shows a table of investment products with search filters at the top: 存续状态 (dropdown), 投顾产品 (dropdown), 数据源类型 (dropdown), and a 搜索 button. The table has columns: 序号, 投顾产品, 账号, 结算周期, 投顾, 创建时间, 最近更新, 绑定数据源, 数据源类型, 存续状态, and 操作. There are 7 rows of data. At the bottom right, there is a pagination bar showing '共 7 条', '20条/页', and page numbers 1, 2, 3.

序号	投顾产品	账号	结算周期	投顾	创建时间	最近更新	绑定数据源	数据源类型	存续状态	操作
1	GZ_02	GZ_02	2022/03/11 - 2022/09/28	---	2022/09/28 14:16:35	2022/09/28 14:54:39	绑定数据源	估值文件	● 存续中	操作
2	GZ_03	GZ_03	2022/09/28 - 2022/09/28	---	2022/09/28 14:35:59	2022/09/28 14:35:59	绑定数据源	估值文件	● 存续中	操作
3	glpk-ku01	---	2022/06/01 - 至今	---	2022/09/28 14:18:10	2022/09/28 14:18:10	绑定数据源	---	● 存续中	操作
4	glpk-ku02	ku-02	2022/06/01 - 至今	---	2022/09/28 14:18:10	2022/09/28 14:18:10	绑定数据源	操作账户	● 存续中	操作
5	glpk-测试01	测试01	2022/06/01 - 至今	---	2022/09/28 14:18:10	2022/09/28 14:18:10	绑定数据源	操作账户	● 存续中	操作
6	资金账户	01970300828	--- 至今	---	2022/09/28 14:17:28	2022/09/28 14:17:33	绑定数据源	资金账户	● 存续中	操作
7	GZ_01	GZ_01	--- 至今	---	2022/09/28 14:16:44	2022/09/28 14:16:49	绑定数据源	估值文件	● 存续中	操作

1、可进行“存续状态”“投顾产品”“数据源类型”的搜索。

2、列表页：按照创建时间来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。展示字段：序号、投顾产品、账号、结算周期、投顾、创建时间、最近更新、绑定数据源、数据源类型、存续状态、操作（编辑）。产品列表显示顺序：按照最近更新来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。

3、存续状态：有 3 种状态：存续中，已清算，已删除。

存续中：可正常显示，净值正常更新。

已清算：继续显示（显示时有已清算的特殊标识），不再进行净值的更新。

已删除：不继续显示（后续的选择项中剔除该选项），净值不再更新，历史信息继续保留。删除后不能够恢复正常状态，删除之后，能够新增一条同样的投顾产品名称记录。删除后不可编辑，其余状态均可编辑。

3、点击“绑定数据源”出现绑定数据源弹窗，详见：8.3.1。

4、**新增**：可进行“新增”操作，点击“新增”进入新增投顾产品界面详见 8.3.2。

5、**操作**：点击可展开“编辑”、“风控设置”。

编辑：点击进入“编辑投顾产品”界面，详见 8.3.2。

风控设置：可针对投顾产品进行单位净值、累计净值的风控线设置。当用户设置了单位净值、累计净值风控线之后，会在绩效分析系统前端单位净值、累计净值的走势图展示风控线。



风控设置

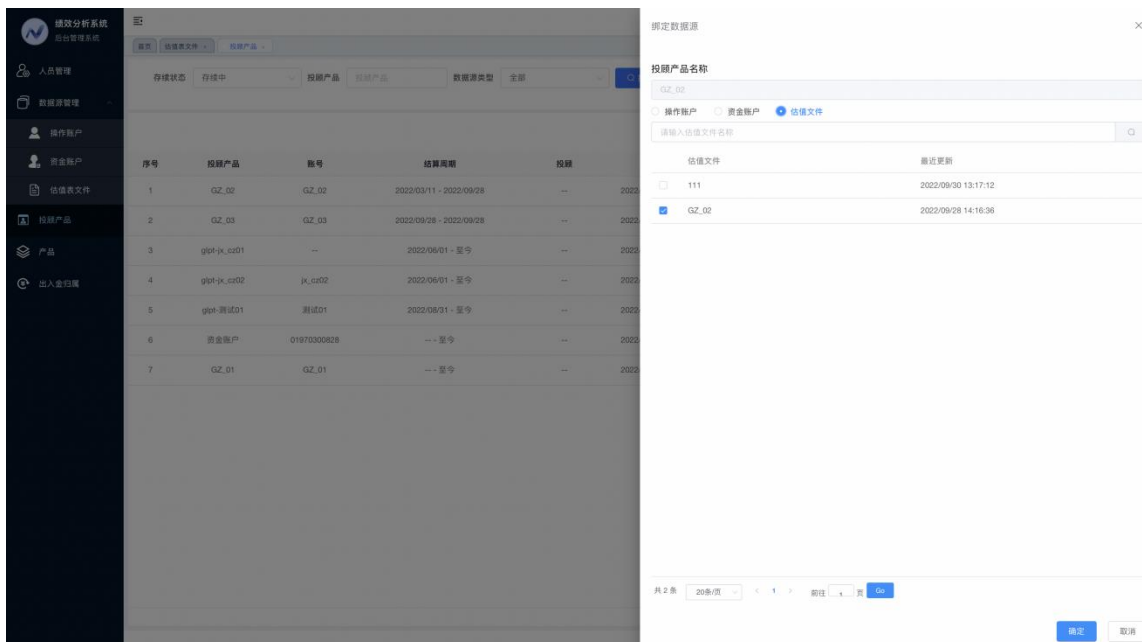
单位净值:

累计净值:

*当用户设置了单位净值、累计净值风控线之后，会在单位净值、累计净值的走势图展示风控线。

8.3.1 绑定数据源

1 个投顾产品只能绑定 1 个数据源。列表中的操作账户、资金账户或估值文件是未形成投顾产品的账户。



绑定数据源

投顾产品名称: GZ_02

☐ 操作账户 ☐ 资金账户 ☒ 估值文件

请输入估值文件名称:

估值文件	最近更新
<input type="checkbox"/> 111	2022/09/30 13:17:12
<input checked="" type="checkbox"/> GZ_02	2022/09/28 14:16:36

共 2 条 20条/页

1、可以进行操作账户、资金账户、估值文件的单选。选择哪种类型即在列表展示哪种类型的数据。默认选中：操作账户。

2、列表字段：单选框、资金账户/操作账户/估值文件、最近更新。按照最近更新的时间进行倒序排列。最新时间显示在最上边。

3、确定/取消：选择对应的账号，点击“确定”，即绑定了对应的数据源

8.3.2新增/编辑投顾产品

1、字段：投顾产品、结算周期、投顾。

2、投顾产品：限制条件：25 字以内。必填项。需要在投顾产品命名范围内去重。

3、结算周期：用户自主选择。

01、若未选择开始时间和结束时间，视为获取所有日期的结算单信息，包括未来每天更新的数据。

02、若未选择开始时间，视为获取结束时间之前所有日期的结算单信息。

03、若未选择结束时间，视为获取开始时间之后所有日期的结算单信息，包括未来每天更新的数据。

04、举例：资金账号对应的结算数据是：2018/01/01-至今。

结算单选择周期：开始时间：未选择；结束时间：2019/01/01。

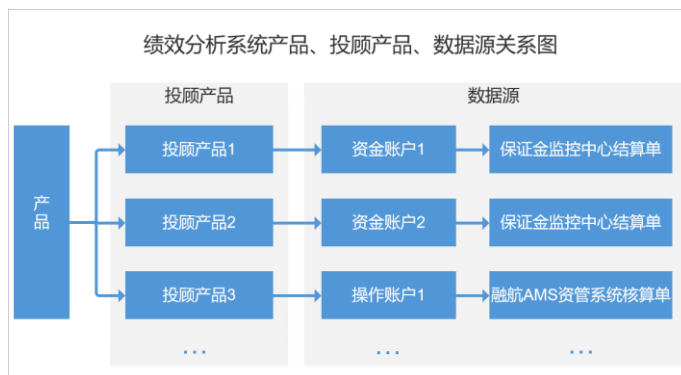
那么实际获取的结算数据区间是：2018/01/01—— 2019/01/01。

4、投顾：点击“选择投顾”出现投顾选择弹窗，可进行投顾人员的勾选。

5、保存/取消：点击保存，若投顾产品名称与已有投顾产品名称重复，提示：投顾产品名称重复。若无异常，保存该数据，回到列表界面。点击取消不做任何操作。

9、产品

1 个产品可以绑定多个投顾产品，1 个投顾产品可以被多个产品绑定。产品和投顾产品的关系如下图：



9.1功能点简介

可进行绩效分析系统的产品管理，包括产品的新增、编辑和删除。

能够查看产品信息的人员及权限如下：

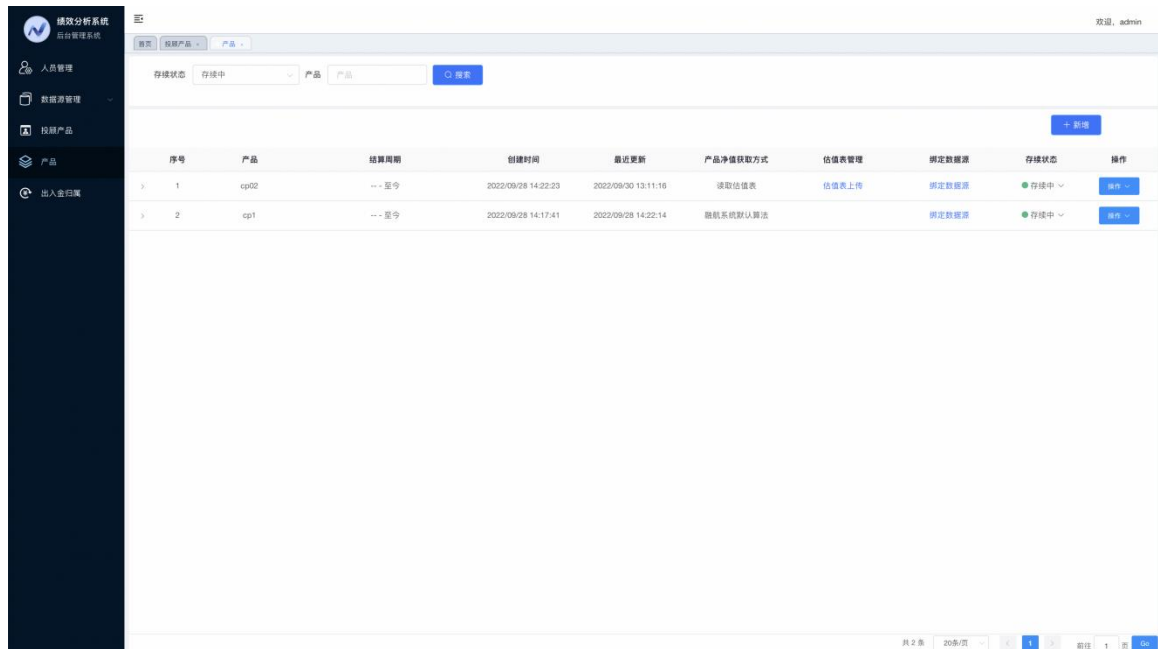
①admin：能够看到全部的产品信息。

②管理员：只能看到与当前登录账户存在绑定关系的产品信息，这些产品来源：可能为管理员自己创建；admin 给管理员绑定对应的产品。

9.2入口路径

点击左侧导航栏的产品即可进入。

9.3使用说明



1、可进行“存续状态”“产品”的搜索。

存续状态：可进行下拉单选，下拉项：全部、存续中，已清算，已删除。默认显示：存续中。

2、展示字段：序号、产品、结算周期、创建时间、最近更新、产品净值获取方式、估值表管理、绑定数据源、存续状态、操作（编辑）。产品列表显示顺序：按照最近更新来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。

01、产品净值获取方式：有 2 种方式：融航系统默认算法、读取估值表。

02、估值表管理：产品净值获取方式为：读取估值表，才会出现“估值表上传”，否则为空。点击“估值表上传”，跳转上传界面。

03、绑定数据源：点击“绑定数据源”跳出绑定数据源的弹窗。详见：9.3.1 说明。

04、存续状态：有 3 种状态：存续中，已清算，已删除。

存续中：可正常显示，净值正常更新。

已清算：继续显示（显示时有已清算的特殊标识），不再进行净值的更新。

已删除：不继续显示（后续的选择项中剔除该选项），净值不再更新，历史信息继续保留。删除后不能够恢复正常状态。删除之后，能够新增一条同样的产品名称记录。删除后不可编辑，其余状态均可编辑。

05、操作：当状态为：存续中或者已清算时，操作展示：编辑、风控设置。

编辑：点击进入“编辑产品”界面，详见 9.3.3。

风控设置：可针对产品进行单位净值、累计净值的风控线设置。当用户设置了单位净值、累计净值风控线之后，会在绩效分析系统前端展示单位净值、累计净值的走势图展示风控线。



风控设置

单位净值:

累计净值:

*当用户设置了单位净值、累计净值风控线之后，会在单位净值、累计净值的走势图展示风控线。

当状态为：已删除时，操作部分展示为空。

3、列表左侧：可以展开、收起绑定的数据源明细，可进行数据源的删除。

一次只能展开 1 条数据，展开下一条时，上一条展开的项自动收起。

9.3.1 绑定数据源



绑定数据源

产品名称:

选择投顾产品

请输入内容

<input type="checkbox"/>	产品名称	账号	账号类型	最近更新
<input type="checkbox"/>	gz01	gz01	估值文件	2022/10/10 09:36:06
<input type="checkbox"/>	zj	01970300828	资金账户	2022/10/09 18:00:52
<input checked="" type="checkbox"/>	glpk_k_cz01	jk_cz01	操作账户	2022/10/09 17:48:19
<input checked="" type="checkbox"/>	glpk_k_cz02	jk_cz02	操作账户	2022/10/09 17:48:19

1、绑定数据源即选择绑定的投顾产品，选择项为所有“存续状态”为“存续中”的投顾产品。

2、列表字段：多选框、产品名称、账号、账号类型。按照最近更新的时间进行倒序排列。

3、确定/取消：选择对应的账号，点击“确定”，即展示在对应的产品展开项及内部展示中。

9.3.2新增产品

产品新增分为 4 步：基本信息——产品净值——绑定数据源——数据回测。每个“下一步”均视同于“保存”操作。

9.3.2.1基本信息

- 1、基本信息：产品名称、产品备案函编码、成立日期。
- 2、产品名称：限制条件：25 字以内。必填项。
- 3、产品备案函编码：一般备案过的产品才会有备案函编码，选填。
- 4、结算周期：用户自主选择。

01、若未选择开始时间和结束时间，视为获取所有日期的信息，包括未来每天更新的数据。

02、若未选择开始时间，视为获取结束时间之前所有日期的信息。

03、若未选择结束时间，视为获取开始时间之后所有日期的信息，包括未来每天更新的数据。

5、产品前端的净值显示区间由 2 个因素确定：

- 01、后台管理系统的产品的结算周期。
- 02、当净值获取方式为：融航系统默认算法时，取绑定的数据源的并集时间。
- 当净值获取方式为：估值表上传时，取估值表的时间周期。

取 01 和 02 的交集来决定最后的净值显示周期，若无交集则无数据展示。详见以下案例：

举例 1：

产品结算周期未选择，当净值获取方式为：融航系统默认算法时，数据源有 3 个，分别为投顾产品 1、投顾产品 2、投顾产品 3，这三个投顾产品分别的前端净值显示周期为：2022.1.1~2022.1.5；2022.1.6~2022.1.15；2022.1.10~2022.1.31，最后数据源的并集为：2022.1.1~2022.1.31，最后最后产品前端显示的净值区间，取数据源和产品的结算周期交集：2022.1.1~2022.1.31。

举例 2:

产品结算周期选择为：2022.12.1-2022.1.15，当净值获取方式为：融航系统默认算法时，数据源有 3 个，分别为投顾产品 1、投顾产品 2、投顾产品 3，这三个投顾产品分别的前端净值显示周期为：2022.1.1~2022.1.5；2022.1.6~2022.1.15；2022.1.10~2022.1.31，最后数据源的并集为：2022.1.1~2022.1.31，最后产品前端显示的净值区间，取数据源和产品的结算周期交集：2022.1.1~2022.1.15。

举例 3:

结算周期未选择，当净值获取方式为：估值表上传，估值表上传的周期为：2022.1.1~2022.1.5，最后产品前端显示的净值区间，取估值表周期和产品的结算周期交集：2022.1.1~2022.1.5。

举例 4:

产品结算周期选择为：2022.12.1-2022.1.15，当净值获取方式为：估值表上传，估值表上传的周期为：2022.1.1~2022.1.5，最后产品前端显示的净值区间，取估值表周期和产品的结算周期交集：2022.1.1~2022.1.5。

6、点击“下一步”进入产品净值界面。

01、若必填项数据为空，提示：xxx 不能为空。停留在当前界面。

02、若产品名称与已有产品名称重复，提示：产品名称重复。

9.3.2.2 产品净值

绩效分析系统

后台管理系统

人员管理

数据源管理

投资组合

产品

出入金归属

首页

投资组合

新增投资组合

产品

新增产品

欢迎, admin

1 基本信息

2 产品净值

3 数据源绑定

4 数据回调

说明：若是自定义组合、未登记备案过的产品，建议选择：融航系统默认算法，详见：[融航产品净值算法说明](#)；若是登记备案过的产品，建议选择：读取估值表。

* 产品净值获取方式：融航系统默认算法

式：

上一步 下一步

1 基本信息

2 产品净值

3 数据源绑定

4 数据回调

说明：若是自定义组合、未登记备案过的产品，建议选择：融航系统默认算法，详见：[融航产品净值算法说明](#)；若是登记备案过的产品，建议选择：读取估值表。

* 产品净值获取方式：读取估值表

式：

* 估值表类型：估值表类型1

* 估值表上传：添加文件（不超过50M） 估值表上传规则

上一步 下一步

融航产品净值算法说明

单位净值=总权益/总份额

总权益=sum(数据源总权益)

总份额=昨日份额+（今申购-今赎回）/今日单位净值

产品的申购、赎回计算如下：

当sum[数据源（申购-赎回）]>0时，判定为：申购=sum[数据源（申购-赎回）]

当sum[数据源（申购-赎回）]<0时，判定为：赎回=-sum[数据源（申购-赎回）]

注意：第1日初始单位净值为1.0000，取所有数据源成立日期的交集，作为产品的初始净值开始的日期。

确定

1、产品净值获取方式：默认“融航系统默认算法”，展开可选择：融航系统默认算法、读取估值表。若是自定义组合、未在在登记备案过的产品，建议选择：融航系统默认算法，详见以上弹窗：[融航产品净值算法说明](#)；若是登记备案过的产品，建议选择：读取估值表。

若用户选择“读取估值表”，展示：估值表类型选择、估值表上传（附件、附件上传历史记录）。

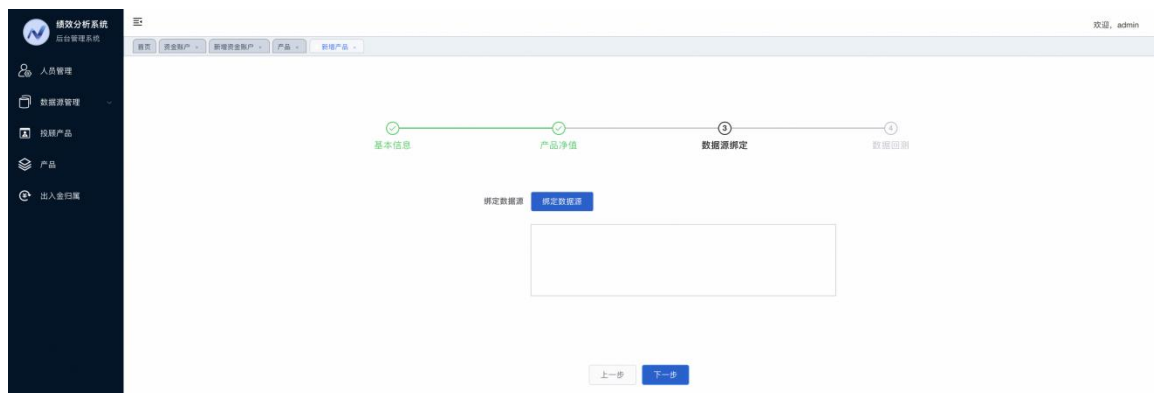
2、估值表类型：展开可选：估值表类型 1、估值表类型 2。

3、估值表上传：点击“估值表上传规则”，出现估值表上传规则弹窗。按照用户选择的估值表的类型做解析，选择的是估值表类型 1，那么只解析上传的估值表类型 1；选择的是估值表类型 2，那么只解析上传的估值表类型 2。

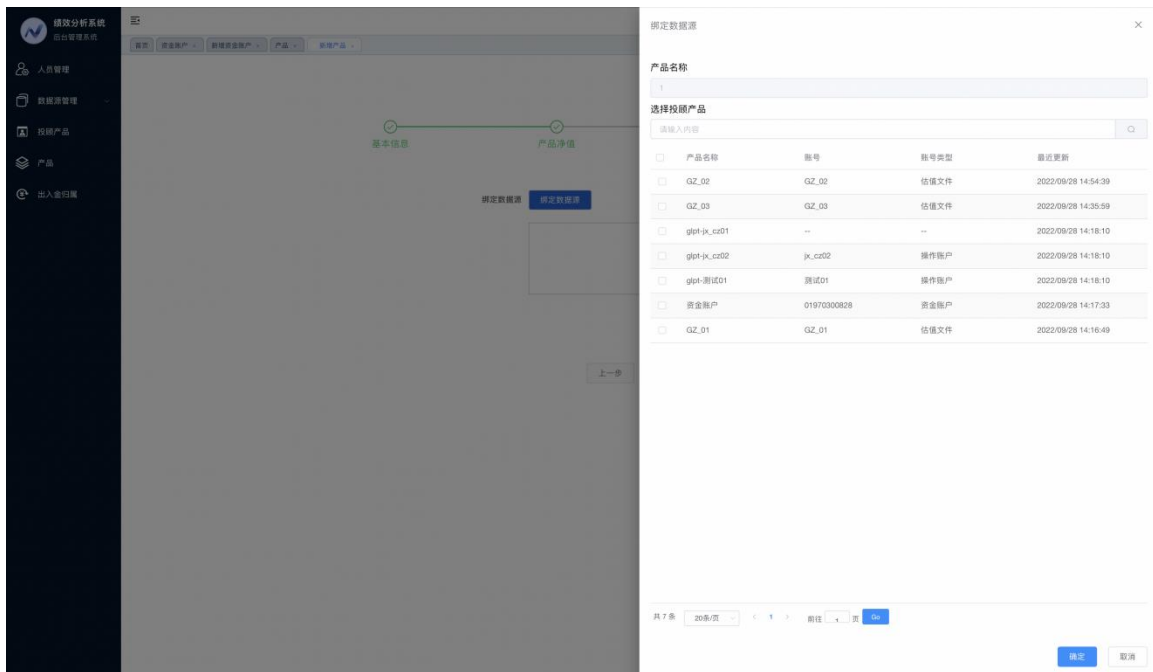


4、点击“上一步”回到上一个界面，点击“下一步”进入数据源绑定界面。

9.3.2.3绑定数据源



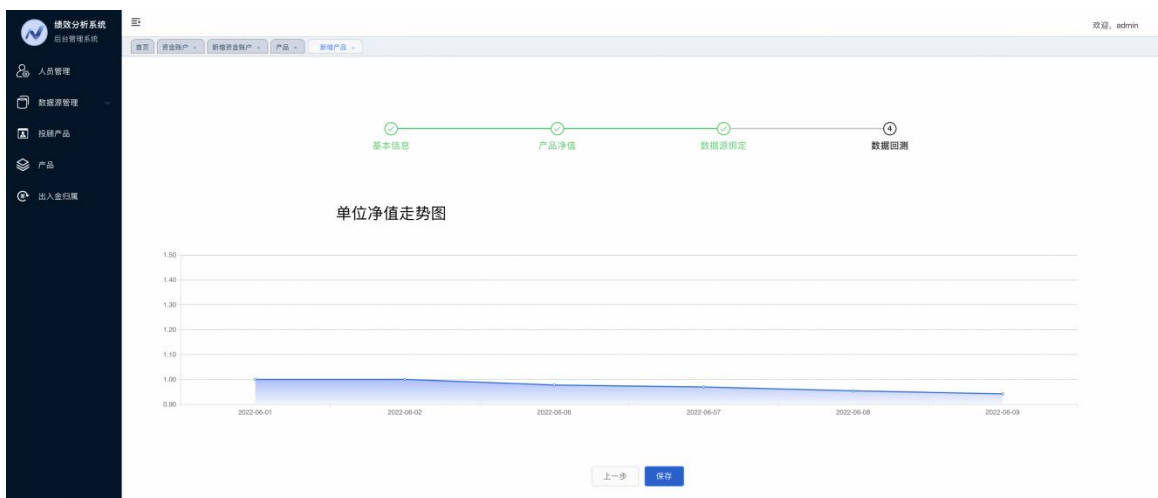
1、点击“绑定数据源”出现绑定数据源弹窗：



2、选择数据源后，展示在数据源绑定的框内，可在框内进行数据的删除，删除后的数据与弹窗内数据互通。

3、点击“上一步”回到上一个界面，点击“下一步”进入数据源绑定界面。

9.3.2.4数据回测



1、基于数据源、产品净值进行数据回测，展示基础的单位净值走势。

2、单位净值走势图：横轴显示日期，纵轴显示净值。

01、若用户产品净值选择：融航系统默认算法，那么根据用户绑定的数据源来决定。

02、若用户产品净值选择：读取估值表，提供什么时间段的估值表就显示什么时间段的单位净值。

5、点击“上一步”回到上一个界面，点击“保存”回到产品列表页。

9.3.3编辑产品

产品编辑分为 4 步：基本信息——产品净值——绑定数据源——数据回测。

9.3.3.1基本信息

产品名称、备案函编码、结算周期均可编辑。

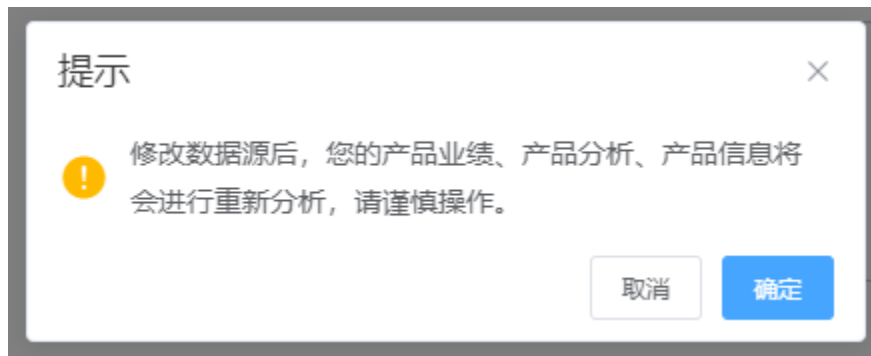
9.3.3.2产品净值

1、当产品净值获取方式为：融航系统默认算法时，不可编辑。当产品净值获取方式为：读取估值表时，估值表上传可编辑。

2、附件上传历史记录：显示估值表附件的新增、删除等记录，显示：日期、时间、操作者、操作（上传/删除）、附件名称。

9.3.3.3数据源绑定

数据源绑定可编辑。点击删除某数据源，或者点击“绑定数据源”时，需要对用户进行弹窗提示：



用户点击“确定”，进行数据源的删除；或者进入相应的绑定数据源的弹窗。
点击“取消”，关闭弹窗不做任何操作。

9.3.3.4数据回测

同新增产品界面中的数据回测。

10、出入金归属

10.1功能点简介

可进行绩效分析系统的出入金归属，出入金的归属会影响到投顾产品的单位净值、累计净值等数据计算。系统默认出入金类型为申购、赎回。

能够查看出入金归属的人员及权限如下：

①admin：能够看到全部的出入金归属信息。

②管理员：能看到当前登录账户创建的数据源的出入金信息，以及绑定的投顾产品穿透的数据源的出入金信息。

③第三方账户（若是购买了融航 AMS 资管系统的用户，可使用第三方登录的方式，一般是管理平台：处于“启用”和“禁用”状态的，角色为“账户管理员”的账户）：只能看见自己可见的数据源（操作账户）出入金信息。

10.2入口路径

点击左侧导航栏的出入金归属即可进入。

10.3使用说明

列表默认显示的出入金归属的记录为该账号可见的所有处于启用中、已禁用的操作账户、资金账户的出入金记录。

序号	账号	账号类型	金额	转入/转出	发起时间	最近更新	数据来源	出入金类型	归属出入金
1	662007	操作账户	10,000,000.00	转入	2019/08/02	2022/12/09 14:40:10	第三方系统获取	申购	编辑
2	662001	操作账户	10,000,000.00	转入	2019/08/02	2022/12/08 15:43:53	第三方系统获取	申购	编辑
3	662002	操作账户	10,000,000.00	转入	2019/08/02	2022/12/06 11:41:11	第三方系统获取	申购	编辑
4	jx_cz01	操作账户	10,000,000.00	转入	2022/06/01	2022/12/06 11:24:12	数据自主上传	申购	编辑
5	888001	操作账户	3,000.00	转出	2021/01/05	2022/12/05 14:06:00	第三方系统获取	退增强	编辑
6	662003	操作账户	10,000,000.00	转入	2019/08/02	2022/12/01 16:48:04	第三方系统获取	增强	编辑
7	9309229	操作账户	52.70	转入	2022/04/12	2022/12/01 16:05:22	数据自主上传	增强	编辑
8	982016	操作账户	10,000,000.00	转入	2020/08/24	2022/11/30 15:25:58	第三方系统获取	赎回	编辑

搜索：可进行“账号类型”、“数据来源”的搜索。

01、账号类型：默认“全部”，下拉项：全部、操作账户、资金账户。

02、数据来源：默认“全部”，下拉项：全部、第三方系统获取、第三方系统获取+数据自主上传、数据自主上传。

待归属出入金列表：展示字段：序号、账号、账号类型、金额、转入/转出、发起时间、最近更新、数据来源、出入金类型、归属出入金（编辑）。

归属出入金：点击“编辑”进入“编辑归属出入金”界面，详见 10.3.1。

10.3.1编辑归属出入金

账号: 662007

金额: 10,000,000.00

转入/转出: 转入

发起时间: 2019/08/02

出入金类型: 申购

[取消](#) [保存](#)

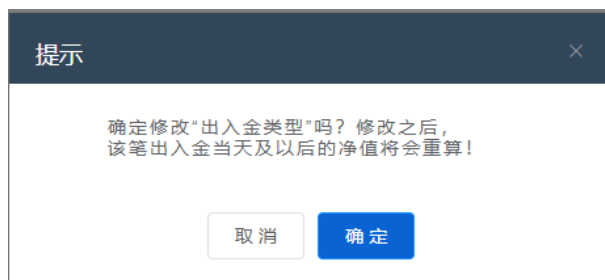
“增强”和“申购”差别：增强不影响份额，申购会导致份额增加。
 单位净值=总权益/总份额
 总权益=市值权益+ 上日结转 - 信用额度 - 上次质押 - 质押 - 出金+入金+平盈 + 持盈-手续费+权利金收支+期权市值
 总份额=昨日份额+（今申购-今赎回）/昨日单位净值
 单位净值=总权益/总份额

若显示：转入，出入金类型可选项为：申购，增强。

若显示：转出，出入金类型可选项为：赎回，分红，退增强。

点击“保存”，判断用户是否做了“出入金类型”的改动。

若改动了，出现弹窗提示：



点击“确定”即进行出入金类型的修改；点击“取消”，不进行任何操作。

11、经纪公司管理

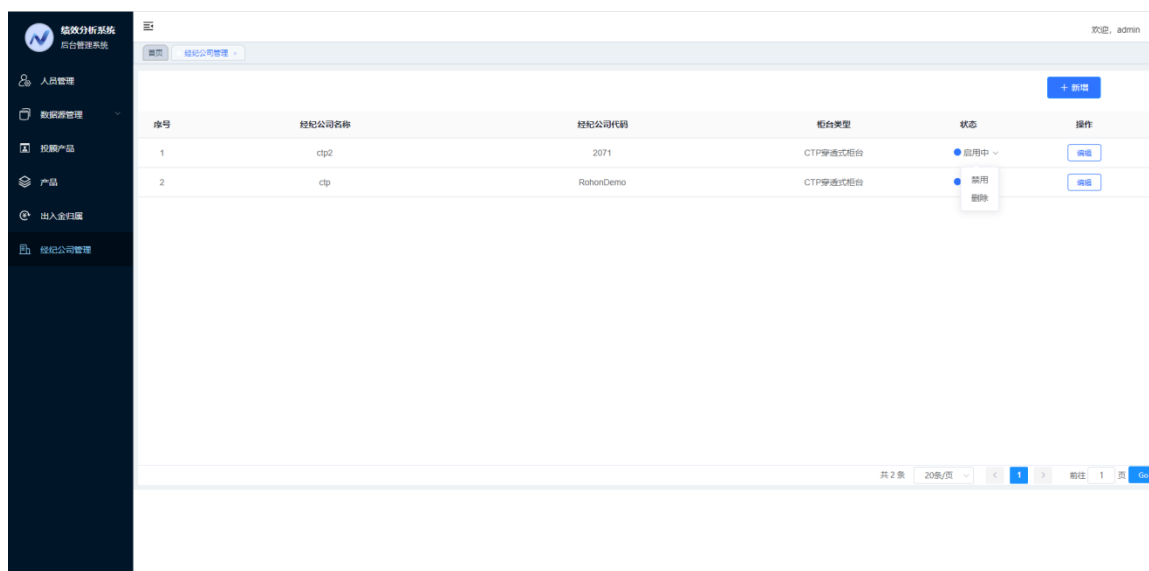
11.1功能点简介

可对经纪公司进行统一的管理。

11.2入口路径

点击左侧导航栏的经纪公司管理即可进入。

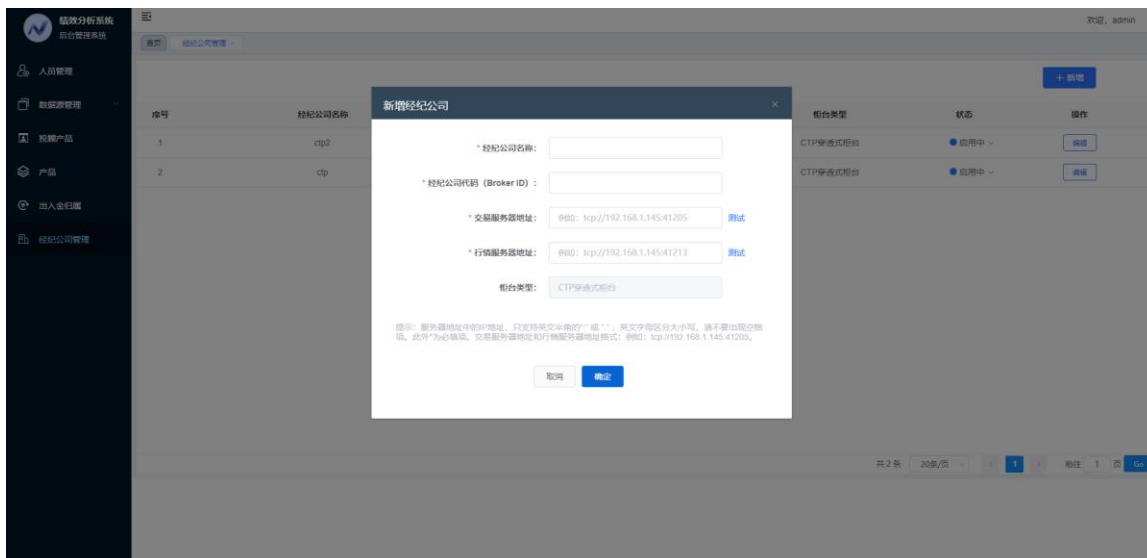
11.3使用说明



经纪公司管理列表：展示字段：序号、经纪公司名称、经纪公司代码、柜台类型、状态、操作。

状态：已禁用、已删除的经纪公司在新增资金账户数据源时不做展示。已禁用的经纪公司对应的资金账户数据源不再更新，可重新启用；已删除的经纪公司不可重新启用，可再次创建同名称、代码的数据。

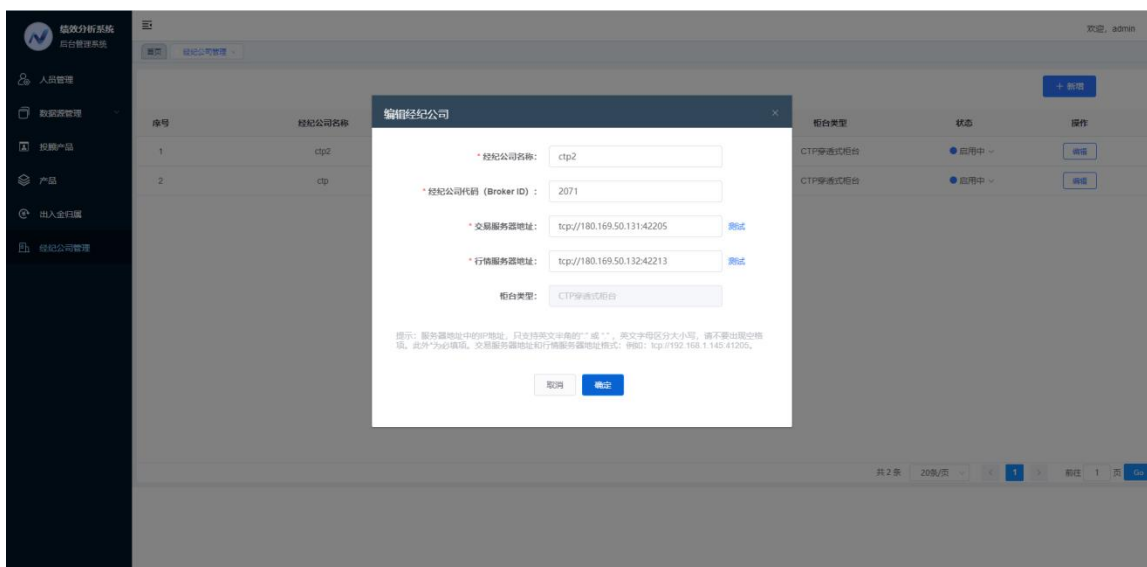
11.3.1新增经纪公司管理



点击新增，可以进行经纪公司的创建，提供经纪公司名称、经纪公司代码（Broker ID）、交易服务器地址、行情服务器地址，即可进行添加。

11.3.2编辑经纪公司管理

操作：可编辑启用中、已禁用的经纪公司。编辑同新增。



绩效分析系统-前端

12、前端登录/退出

12.1功能点简介

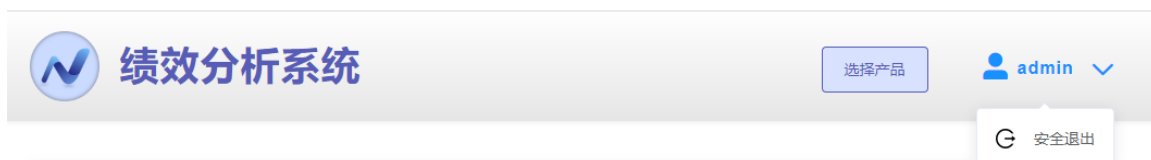
登录是用户进入和使用绩效分析系统前端的途径。退出是用户退出绩效分析系统前端的途径。

12.2入口路径

登录：在浏览器中输入绩效分析系统的网址可直接打开本系统的登录界面。

退出：登录之后，点击首页右上角的账户名称，或者直接关闭网页，即可退出登录。

12.3使用说明



登录：当账号密码的来源是：使用绩效分析系统-后台管理系统创建的账号及密码时；用户输入账号、密码，拖动滑块验证后即可登录进入绩效分析系统。

当账号密码的来源是：第三方系统（目前主要是指管理平台的用户）时，可切换至第三方登录的入口，用户输入账号、密码，拖动滑块验证后即可登录进入绩效分析系统。

目前以下人员可登录绩效分析系统前端：

1、第一类用户：在绩效分析系统后台创建的用户，分为 3 种：

- ①admin：可以看到所有的投顾产品。
- ②管理员：可以看到的投顾产品、产品由后台的绑定关系决定的。
- ③投顾：前端可以看到的投顾产品、产品由后台的绑定关系决定的。

2、第二类用户：第三方系统的用户（目前主要是指管理平台的用户）。分为 2 种：

①管理平台：处于“启用”和“禁用”状态的“操作账户”。可以看到的投顾产品由管理平台本身的操作账户绑定关系决定的，沿用管理平台的权限逻辑。

②管理平台：处于“启用”和“禁用”状态的，角色为“账户管理员”的登录账户。可以看到的投顾产品由管理平台本身的操作账户绑定关系决定的，沿用管理平台的权限逻辑。

退出：登录之后，有两种退出途径：①点击首页右上角的账户名称，然后点击“安全退出”即可退出登录。②直接关闭网页，即可退出登录。

13、首页-页头基础数据

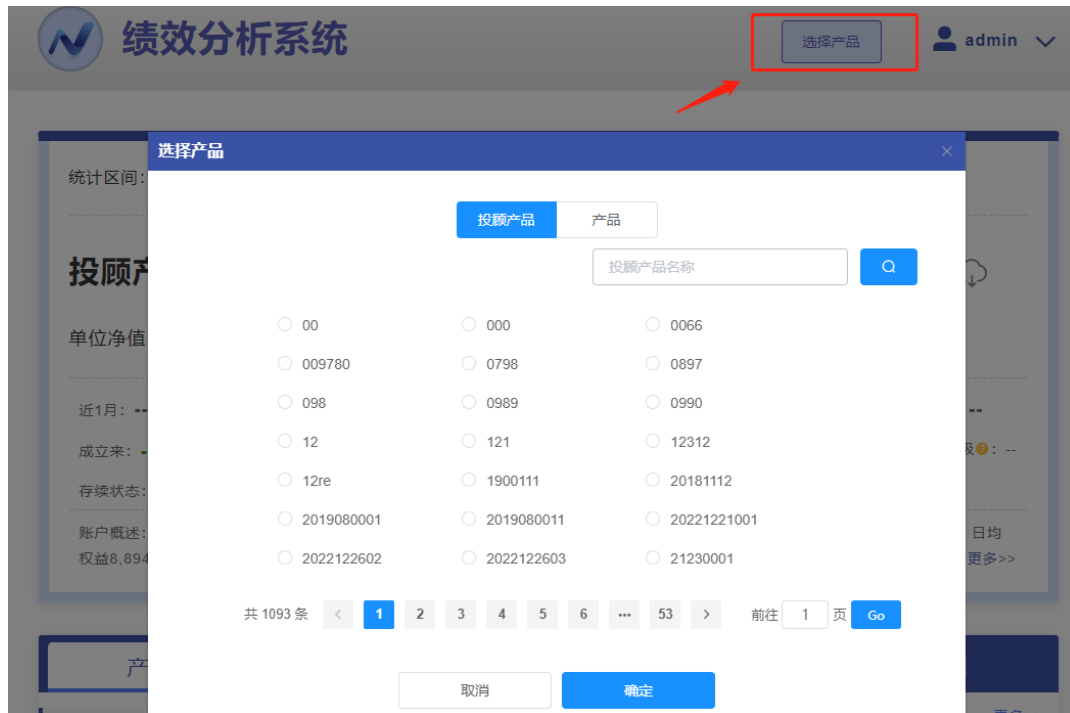
13.1 功能点简介

首页展示了该产品的基础信息字段，以及包含了产品的快速切换入口，对比拟合的入口。

13.2 入口路径

登录绩效分析系统即可进入首页。

13.3 使用说明



可在右上角“选择产品”，进行投顾产品和产品的切换。



投顾产品会从产品业绩、交易分析、期货分析、投资顾问 4 个层面进行分析。
详见如下：13、产品业绩，14、交易分析，15、期货分析，16、投资顾问说明。



产品会从产品业绩、产品分析、产品信息 3 个层面进行分析。详见如下：18、产品—产品业绩，19、产品分析，20、产品信息说明。

统计区间：

近1年

2022-01-11 至 2023-01-11

查询

投顾产品： jx_cz01

(更新截止至2022-06-09)

PK

单位净值： 0.9392

累计净值： 0.9392

近1月： --

近3月： --

近6月： --

近1年： --

成立来： -6.08%

成立日期： 2022-06-01

总权益： 945.65万元

数据等级： --

存续状态： 存续中

投资顾问： 小航,q,tg01

账户概述：尊敬的客户，您的账户在2022-01-11 ~ 2023-01-11期间，期初总权益10,000,000.00元，期末总权益9,456,516.40元，日均权益8,894,929.95元，手续费权益比（日均手续费/日均权益）0.88%；总计出金2,000,000.00元，总计入金12,000,000.00... [展开更多>>](#)

统计区间：

近1年

2022-01-06 至 2023-01-06

查询

产品： 产品1

(更新截止至2022-06-09)

PK

单位净值： 0.9406

累计净值： 0.9406

近1月： --

近3月： --

近6月： --

近1年： --

成立来： -5.94%

成立日期： 2022-06-01

总权益： 1,892.11万元

数据等级： --

存续状态： 存续中

账户概述：尊敬的客户，您的账户在2022-01-06 ~ 2023-01-06期间，期初总权益20,000,000.00元，期末总权益18,921,150.80元，日均权益17,824,299.71元，手续费权益比（日均手续费/日均权益）0.89%；总计出金4,000,000.00元，总计入金24,000,000.00... [展开更多>>](#)

投顾产品基础信息字段：投顾产品名称（更新截止至 YYYY-MM-DD）、单位净值、累计净值、近 1 月、近 3 月、近 6 月、近 1 年、成立来、成立日期、总权益、数据等级、存续状态、投资顾问。

产品基础信息字段：产品名称（更新截止至 YYYY-MM-DD）、单位净值、累计净值、近 1 月、近 3 月、近 6 月、近 1 年、成立来、成立日期、总权益、数据等级、存续状态。

对比：点击“对比”图标，进入对比拟合的界面，详见 21、对比拟合说明。

导出：点击“导出”图标，可进行该产品的绩效分析报告的导出。可在顶部进行时间区间的自定义导出对应的绩效分析报告。

账户概述：对产品的期货收益能力、期货风险控制、期货品种偏好进行了分析。可展开查看详细的账户概述内容。

14、产品业绩

14.1功能点简介

产品业绩展示了该产品的净值走势图，收益走势图，业绩表，月度回报图，回撤走势图，风险评估指标。

14.2入口路径

登录绩效分析系统后即可进入绩效分析系统的产品业绩界面。

14.3使用说明

14.3.1净值走势图



1、可进行“单位净值走势”和“累计净值走势”的 Tab 切换。

2、投顾产品关于单位净值、累计净值的算法：

单位净值=总权益/总份额

总权益=市值权益 = 上日结存 - 信用额度- 上次质押 - 质押- 出金
+入金+平盈 + 持盈-手续费+权利金收支+期权市值

总份额=昨结算后确定的总份额，同以上份额的计算。

累计净值=单位净值+sum(每份的分红资金)

特别说明：第 1 日初始累计净值=单位净值

每份的分红资金=分红总计/总份额

3、产品关于单位净值、累计净值的算法：

取决于绩效分析系统后台管理系统进行设置，若是选择融航默认算法，算法如下：

单位净值=总权益/总份额

总权益=sum(数据源总权益)= sum(数据源市值权益)

总份额=昨日份额+（今申购-今赎回）/昨日单位净值

产品的申购、赎回计算如下：

当 $\text{sum}[\text{数据源}(\text{申购}-\text{赎回})] > 0$ 时，判定为：申购= $\text{sum}[\text{数据源}(\text{申购}-\text{赎回})]$

当 $\text{sum}[\text{数据源}(\text{申购}-\text{赎回})] < 0$ 时，判定为：赎回= - $\text{sum}[\text{数据源}(\text{申购}-\text{赎回})]$

注意：第 1 日初始单位净值为 1.0000，取所有数据源成立日期的交集，作为产品的初始净值开始的日期。

若是选择读取估值表，即直接读取估值表的方式获取。

3、可进行“净值”和“分红”的 tab 切换。

4、点击“更多”，出现相应的弹窗。

日期	单位净值	分红	累计净值	日涨幅
2021-07-15	54.3000	--	55.3000	+10.00%
2021-07-14	14.3000	--	25.3000	0.00%
2021-07-13	24.3000	--	35.3000	-12.00%
2021-07-12	25.3000	--	35.3000	+30.00%
2021-07-11	22.1000	--	35.3000	-25.00%
2021-07-10	23.3000	--	35.3000	+10.00%
2021-07-09	21.3000	--	38.3000	+10.00%
2021-07-08	30.3000	--	35.3000	-18.00%
2021-07-07	23.3000	9.0000	38.3000	+10.00%
2021-07-06	23.3000	10.0000	39.3000	+10.00%

共 27 条 10条/页 < 1 2 3 > 前往 1 页 56

确定

分红明细

日期	分红明细
2021-07-07	9.0000
2021-07-06	10.0000
2021-07-05	2.0000

共 3 条 10 条/页 < 1 页 >

确定

- 01、若当前界面展示“净值”，点击“更多”展示历史净值明细弹窗。
- 02、若当前界面展示“分红”，点击“更多”展示分红明细弹窗。

14.3.2收益走势图



- 1、收益走势图：横轴显示日期，纵轴显示收益率。
- 2、可选的 PK 项：南华商品指数、上证 50、沪深 300、中证 500、中证 1000。
- 3、算法，以今年以来的涨跌幅为例：

横轴时间：从去年最后一个交易日开始至今的所有交易日。

纵轴涨跌幅：（最新累计净值-去年最后一个交易日的累计净值）/去年最后一个交易日的单位净值*100%

14.3.3业绩表

历史业绩表	月度业绩表	季度业绩表	年度业绩表						
	近1周	近1月	近3月	近6月	今年来	近1年	近2年	近3年	成立以来
收益率	4.38%	-15.00%	8.65%	--	--	--	--	--	11.58%
南华商品	0.22%	-0.51%	-0.32%	--	--	--	--	--	8.13%

1、可进行“历史业绩表”“月度业绩表”“季度业绩表”“年度业绩表”的切换。

2、“历史业绩表”的展示维度：近1周、近1月、近3月、近6月、今年来、近1年、近2年、近3年、成立以来。若无数据，“--”显示。

3、“月度业绩表”的展示维度：近8个月。例如：当前的日期是2021年5月18日，即展示：2021年05月、2021年04月、2021年03月、2021年2月、2021年1月、2020年12月、2020年11月、2020年10月。若无数据，“--”显示。

4、“季度业绩表”的展示维度：近8个季度。例如：当前的日期是2021年5月18日，即展示：2021年2季度、2021年1季度、2020年4季度、2020年3季度、2020年2季度、2020年1季度、2019年4季度、2019年3季度。若无数据，“--”显示。

5、“年度业绩表”的展示维度：近8年。例如：当前的日期是2021年5月18日，即展示：2021年度、2020年度、2019年度、2018年度、2017年度、2016年度、2015年度、2014年度。若无数据，“--”显示。

6、算法，以下述为例：

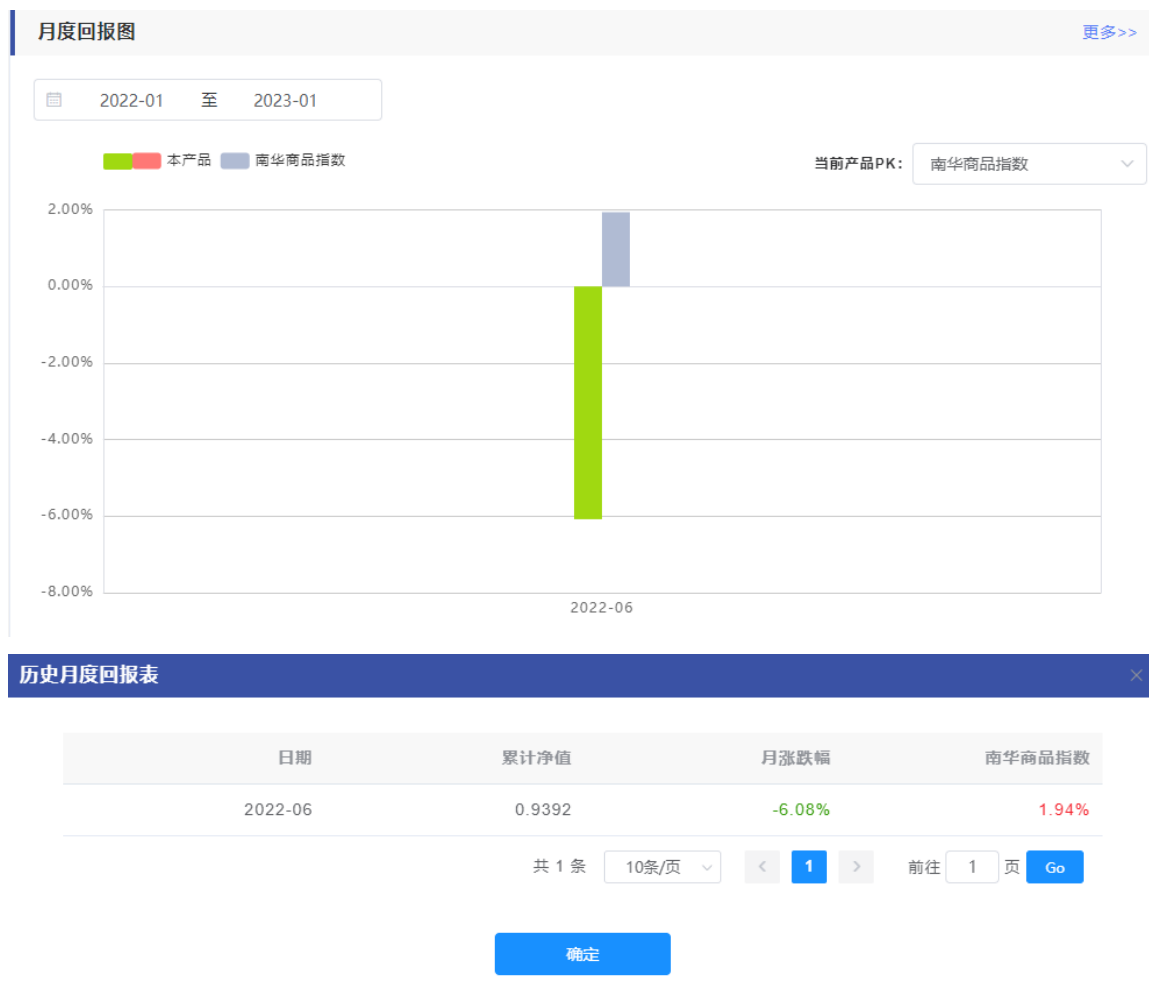
近1周涨幅=（最新累计净值-1周前的累计净值）/1周前的单位净值*100%

月度涨幅=（月底累计净值-月初累计净值）/月初单位净值*100%

季度涨幅=（季度底累计净值-季度初累计净值）/季度初单位净值*100%

年度涨幅=（年度底累计净值-年度初累计净值）/年度初单位净值*100%

14.3.4 月度回报图



1、展示本产品和对应的比较基准的回报图。

2、月度回报图：横轴显示日期，纵轴显示于月度回报收益率。

01、可选的 PK 项：南华商品指数、上证 50、沪深 300、中证 500、中证 1000。

3、点击“更多”，出现“历史月度回报表”弹窗。

01、包含字段：日期、累计净值、月涨跌幅、南华商品指数/上证 50/沪深 300/中证 500/中证 1000(根据用户选择的 PK 项进行相应的展示)。

02、日期按照月份进行倒序展示，最新的展示在最上边。日期样式：YYYY-MM。

03、累计净值：展示对应月份最后一个交易日的累计净值。

4、算法：

本基金月度涨幅=（月底累计净值-月初累计净值）/月初单位净值*100%

14.3.5回撤走势图



1、展示本产品和对应的比较基准的回撤走势图。

2、回撤走势图：横轴显示日期，纵轴显示回撤。

01、可选的PK项：南华商品指数、上证50、沪深300、中证500、中证1000。

3、点击“更多”，出现历史回撤表。

01、包含字段：日期、单位净值、累计净值、回撤（注意该回撤为本产品的回撤）。

02、日期倒序展示，最新的展示在最上边。日期样式：YYYY-MM-DD。

4、算法：

回撤比率 $d = (\text{回撤结束累计净值} - \text{前高的累计净值}) / \text{前高的累计净值} * 100\%$

当回撤比率 $d \geq 0$ 时，取 0.00%。

14.3.6 风险评估指标

风险评估指标					名词解释：
	近1年	近2年	近3年	成立以来	
年化收益率	256.25%	-256.25%	--	0.00%	1. 夏普比率：反映每单位风险的超额收益，该比率越大越好。
年化波动率	132.12%	132.12%	--	132.12%	2. 卡玛比率：描述年化收益率和历史最大回撤之间的关系，该比率越大越好。
最大回撤	-36.65%	-36.65%	--	-36.65%	3. 信息比率：描述投资组合的超额收益与非系统性风险之间的关系，该比率越大越好。
夏普比率	2.27	2.27	--	2.27	4. Alpha：用来衡量投资组合的超额回报，其值越大，表明投资组合的绩效越好。
卡玛比率	35.23	35.23	--	35.23	5. 贝塔：衡量基金收益相对于基准收益的总体波动性，是一个相对指标。β越高，意味着基金相对于业绩评价基准的波动性越大。β大于1，则基金的波动性大于业绩评价基准的波动性。反之亦然。
信息比率	15.25	15.25	--	15.25	
Alpha	45.36%	-4.36%	--	0.00%	
贝塔	0.17	0.17	--	0.17	

1、年化收益率、年化波动率、最大回撤、夏普比率、卡玛比率、信息比率、Alpha、贝塔。

2、展示的区间维度：近1年、近2年、近3年、成立以来。

3、固定措辞：

名词解释：

1、夏普比率：反映每单位风险的超额收益，该比率越大越好。

2、卡玛比率：描述年化收益率和历史最大回撤之间的关系，该比率越大越好。

3、信息比率：描述投资组合的超额收益与非系统性风险之间的关系，该比率越大越好。

4、Alpha：用来衡量投资组合的超额回报，其值越大，表明投资组合的绩效越好。

5、贝塔：衡量基金收益相对于基准收益的总体波动性，是一个相对指标。 β 越高，意味着基金相对于业绩评价基准的波动性越大。 β 大于 1，则基金的波动性大于业绩评价基准的波动性。反之亦然。

4、算法：

年化收益率：

成立以来：{【(当前累计净值 - 1)/1】 / 截止到当前的天数} * 365 * 100%

截止到当前的天数：这里的天数指自然日天数

年化波动率：年化收益率的标准差。

成立以来：成立以来的每一天的年化收益率，计算标准差。

最大回撤：同回撤走势图 16.3.5 中的回撤计算。

最大净值回补期（天）：

净值回补到最大累计净值的时间周期，按照天来计算。

夏普比率：（年化收益率 - 无风险利率） / 年化波动率

无风险利率参照：上海银行间拆放利率 (shibor.org)

卡玛比率：年化收益率 / 最大回撤

信息比率：信息比率 = $\frac{\alpha}{\omega}$

α ：超额收益率；

ω ：超额收益率 α 的标准差。

Alpha: $\alpha_i = r_i - [r_f + \beta_{im} * (r_m - r_f)]$

r_i ：资产 i 的收益率，取本基金的收益率；

r_m ：基准的收益率，一般选取指数收益率，这里取沪深 300 指数收益率；

r_f ：无风险收益率，同夏普比率中的无风险收益率。

贝塔： $\beta_{im} = \frac{\text{cov}(r_i, r_m)}{\sigma_m^2}$

r_i ：资产 i 的收益率，取本基金的收益率；

r_m ：基准的收益率，一般选取指数收益率，这里取沪深 300 指数收益率；

σ_m ：基准收益率的标准差。

15、交易分析

15.1功能点简介

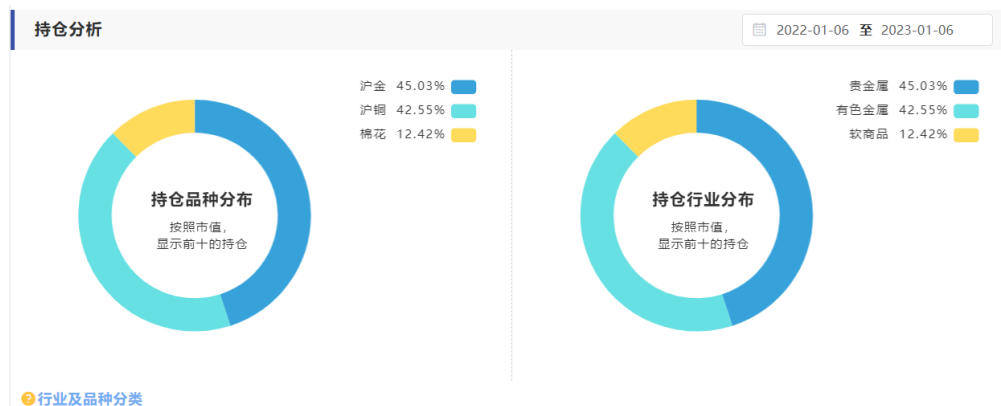
交易分析展示了该产品的持仓分析，交易风格，收益明细，盈亏排行，投资偏好。

15.2入口路径

登录绩效分析系统后，点击“交易分析”即可进入绩效分析系统的交易分析界面。

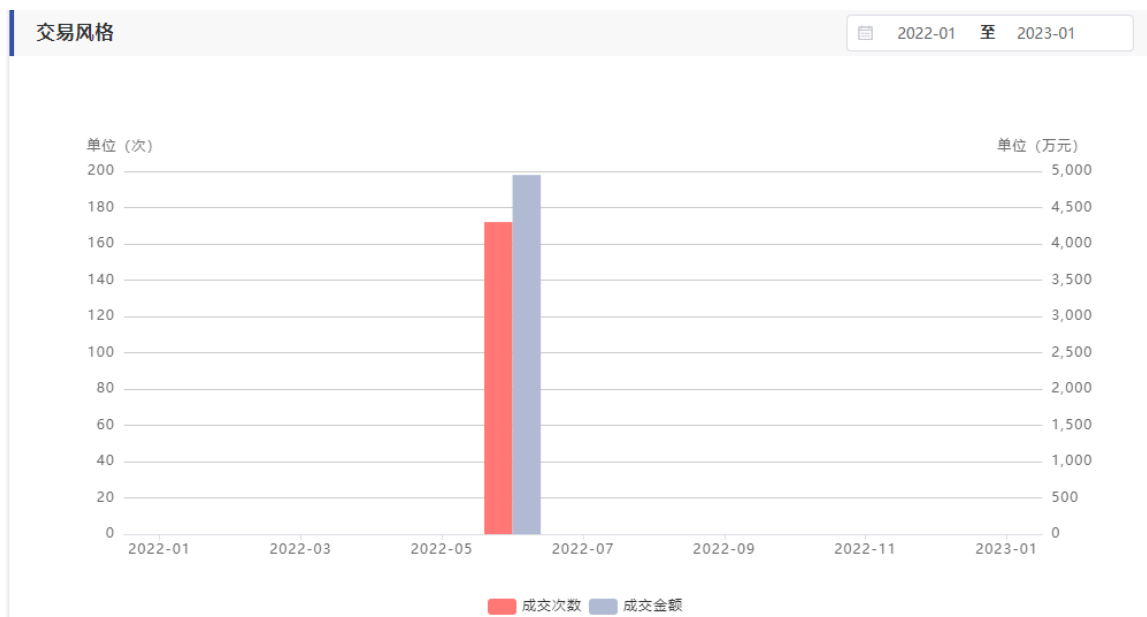
15.3使用说明

15.3.1持仓分析



- 1、可自定义时间周期，进行持仓品种、持仓行业的市值统计。
- 2、持仓品种分布（按照持仓市值，展示前十的持仓），不足 10 个有多少展示多少。
- 3、持仓行业分布（按照持仓市值，展示前十的持仓），不足 10 个有多少展示多少。

15.3.2交易风格



1、横轴显示日期，纵轴左边显示成交次数，右边显示成交金额。

01、光标移动到走势图日期范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、成交次数，成交金额。

02、光标移出到走势图日期范围外，悬浮窗消失。

2、点击右上角可进行月度周期选择。

15.3.3 权益走势

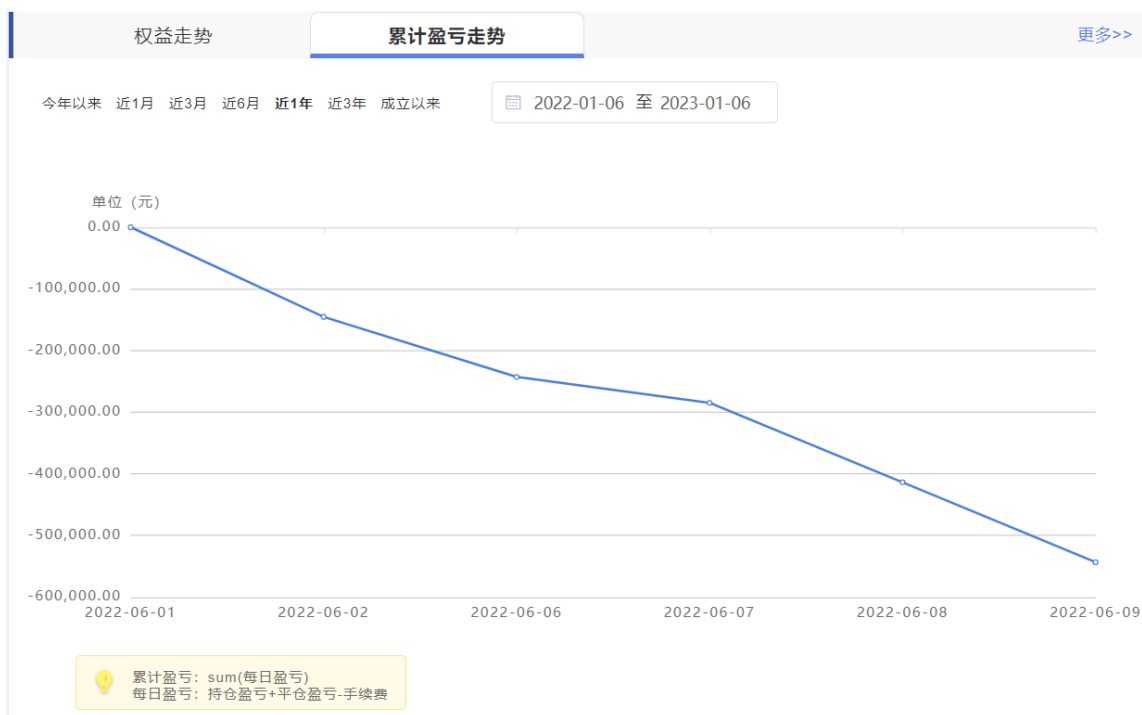


- 1、横轴显示日期，纵轴显示动态权益、市值权益。
- 2、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、动态权益、市值权益。
- 3、点击更多，展示权益走势弹窗：



- 01、默认展示字段：日期、动态权益（元）、市值权益（元）。
- 02、日期：按照日期进行倒序展示，最新的展示在最上边。日期样式：YYYY-MM-DD。

15.3.4 累计盈亏走势



- 1、横轴显示日期，纵轴显示累计盈亏。

2、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、累计盈亏。

3、点击更多展示累计盈亏明细弹窗。



01、默认展示字段：日期、累计盈亏（元）。

02、日期：按照日期进行倒序展示，最新的展示在最上边。日期样式：YYYY-MM-DD。

15.3.5 收益明细



1、可进行周期切换。控制：收益明细，盈亏排行，投资偏好的展示维度。

2、展示对应时间区间的总盈亏（元），收益率，成交次数，胜率。

3、收益明细图：横轴展示对应的日期，纵轴展示收益。

01、光标移动到走势图日期范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、赚/亏金额。

4、算法：

每日盈亏：持仓盈亏+平仓盈亏-手续费

盈亏：sum(每日盈亏)

收益率：收益率=（期末-期初-入金+出金）/（期初+入金-出金）

成交次数：统计对应时间区间的成交记录的条数

胜率：逐笔平盈次数/平仓总次数

15.3.6 盈亏排行

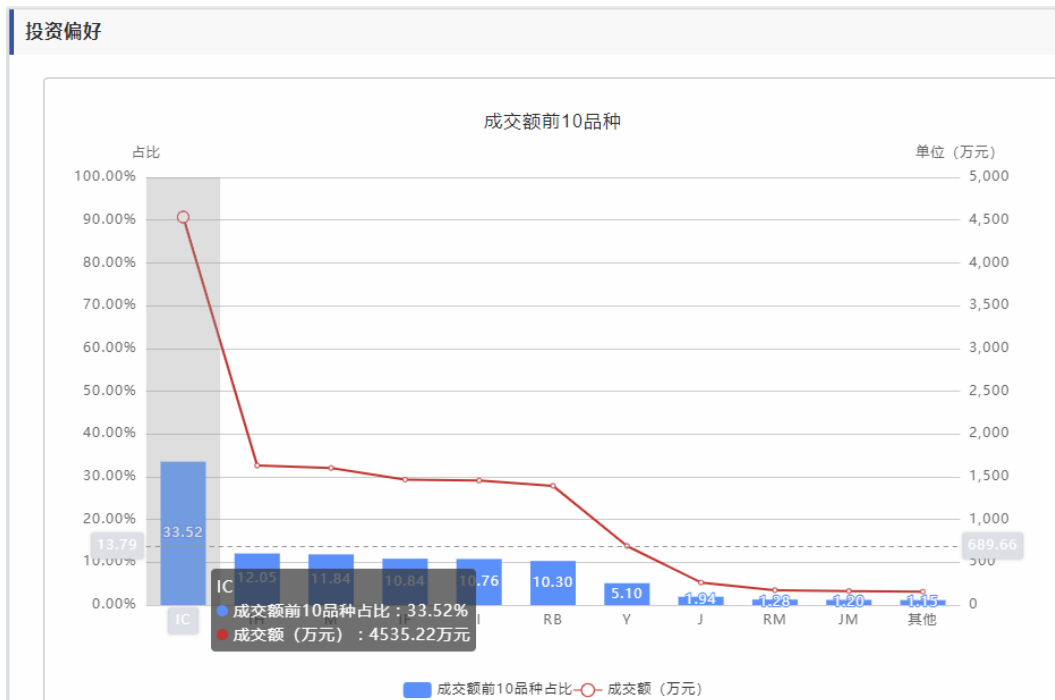
盈亏排行			
盈利排行			
序号	名称	盈利（元）	平均买卖价差
1	CU	3200.00	63.67
2	AU	740.00	0.13
3	CF	0.00	0.00
亏损排行			
序号	名称	亏损（元）	平均买卖价差
1	CF	-12650.00	-240.00
2	AU	-460.00	-0.10
3	CU	-400.00	-40.00

1、展示对应时间区间的盈利和亏损。

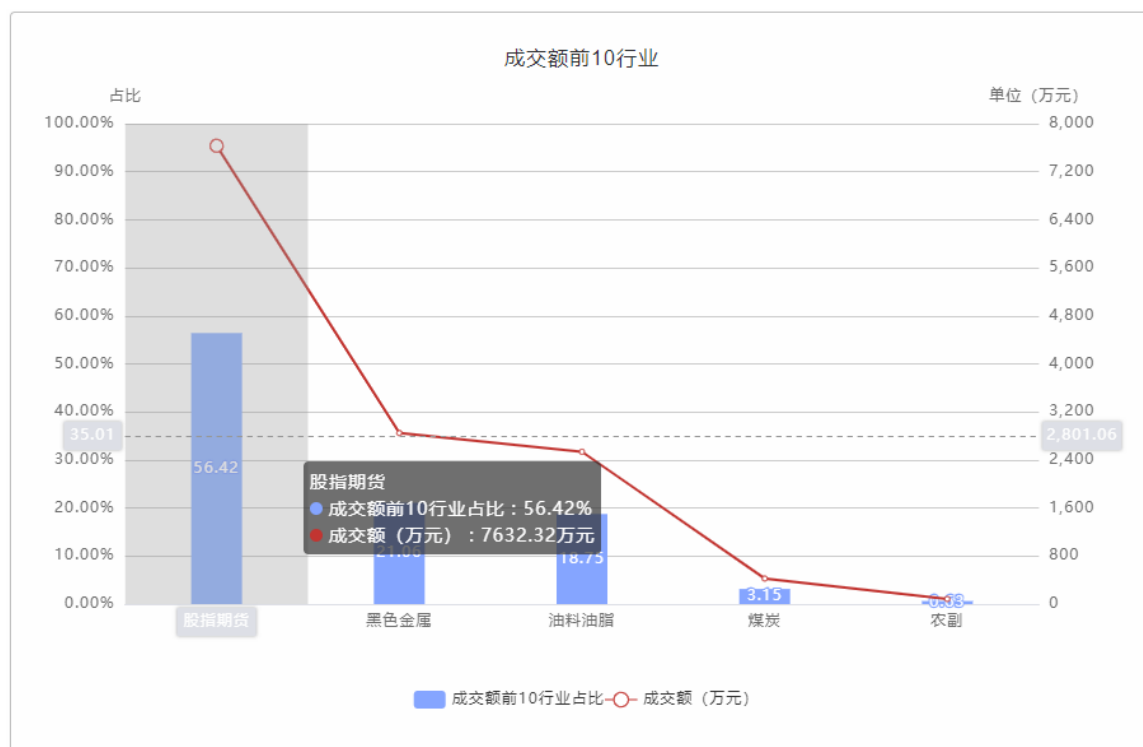
2、盈利对应的字段：序号，名称，盈利，平均买卖价差。按照盈利金额从大到小展示。

3、亏损对应的字段：序号，名称，亏损，平均买卖价差。按照亏损金额从大到小展示。

15.3.7 投资偏好



1、上图展示成交额前10的品种：横轴展示对应的品种，纵轴左边展示成交额前10品种占比，右侧展示成交额（万元）。



2、上图展示成交额前10的行业：横轴展示对应的行业，纵轴左边展示成交额前10行业占比，右侧展示成交额（万元）。

3、算法：

合约成交金额=SUM(手数*合约成交价*合约乘数)。

成交额（品种）：对当天持仓的合约进行品种的分类，进行成交额的统计。

成交额（行业）：对当天持仓的合约进行行业的分类，进行成交额的统计。

16、期货分析

16.1功能点简介

期货分析展示了该产品的市值比例，多空持仓市值，风险度，品种累计盈亏，品种盈亏走势，品种成交，品种盈亏占比，品种亏损占比，行业月交易手数，行业月盈亏手数。

16.2入口路径

登录绩效分析系统后，点击“期货分析”即可进入绩效分析系统的期货分析界面。

16.3使用说明

16.3.1市值比例



市值比例

日期	轧差市值	非轧差市值	市值权益	市值比例(轧差)	市值比例(非轧差)
2021-05-18	3,500.80	3,500.80	13,500.80	-0.48%	0.48%
2021-05-17	3,502.50	3,502.50	13,502.50	-2.60%	2.60%
2021-05-14	3,500.80	3,500.80	13,500.80	-1.92%	1.92%
2021-05-13	3,502.50	3,502.50	13,502.50	2.60%	2.60%
2021-05-12	3,500.80	3,500.80	13,500.80	-1.92%	1.92%
2021-05-11	3,502.50	3,502.50	13,502.50	-2.60%	2.60%
2021-05-10	3,500.80	3,500.80	13,500.80	-1.92%	1.92%
2021-05-07	3,502.50	3,502.50	13,502.50	2.60%	2.60%
2021-05-06	3,500.80	3,500.80	13,500.80	-1.92%	1.92%
2021-04-30	3,502.50	3,502.50	13,502.50	2.60%	2.60%

< 1 2 3 ... 20 >

到第 1 页 GO 共199条 10条/页

确定

1、走势图：横轴显示日期，纵轴显示百分比。

2、可切换的区间：今年以来，近 1 月，近 3 月，近 6 月，近 1 年，近 3 年，成立以来，自定义时间区间。

3、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、市值比例（轧差）、市值比例（非轧差）。

4、固定解释措辞：

*市值比例(轧差)=轧差市值 / 市值权益；

* 市值比例(非轧差)=非轧差市值 / 市值权益。

*轧差市值=多仓市值-空仓市值；

*非轧差市值=多仓市值+空仓市值。

5、点击“更多”，出现相应的弹窗。

01、弹窗标题：市值比例。

02、按照日期倒序展示，最新的日期展示在最上边。

03、字段：日期、轧差市值、非轧差市值、市值权益、市值比例（轧差）、市值比例（非轧差）。

16.3.2多空持仓市值



1、走势图：横轴显示日期，纵轴显示市值。

2、可切换的区间：今年以来，近1月，近3月，近6月，近1年，近3年，成立以来，自定义时间区间。

3、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、多仓持仓市值、空仓持仓市值。

4、固定解释措辞：

*多仓持仓市值=多仓持仓合约结算价*手数*合约乘数

*空仓持仓市值=空仓持仓合约结算价*手数*合约乘数

5、点击“更多”，出现相应的弹窗。

01、弹窗标题：多空持仓市值。

02、按照日期倒序展示，最新的日期展示在最上边。

03、字段：日期、多仓持仓市值、空仓持仓市值。

16.3.3 风险度



风险度			
日期	占用保证金	市值权益	风险度
2021-05-18	3,500.80	13,500.80	2.60%
2021-05-17	3,502.50	13,502.50	2.60%
2021-05-14	3,500.80	13,500.80	1.92%
2021-05-13	3,502.50	13,502.50	2.81%
2021-05-12	3,500.80	13,500.80	1.89%
2021-05-11	3,502.50	13,502.50	2.40%
2021-05-10	3,500.80	13,500.80	2.49%
2021-05-07	3,502.50	13,502.50	1.11%
2021-05-06	3,500.80	13,500.80	3.25%
2021-04-30	3,502.50	13,502.50	1.95%

< 1 2 3 ... 20 > 到第 1 页 GO 共199条 10条/页

确定

1、走势图：横轴显示日期，纵轴显示风险度。

2、可切换的区间：今年以来，近 1 月，近 3 月，近 6 月，近 1 年，近 3 年，成立以来，自定义时间区间。

3、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、风险度。

4、固定解释措辞：

*风险度=占用保证金/市值权益

5、点击“更多”，出现相应的弹窗。

01、弹窗标题：风险度。

02、按照日期倒序展示，最新的日期展示在最上边。

03、字段：日期、占用保证金、市值权益、风险度。

16.3.4品种累计盈亏



品种累计盈亏 (2022-10-15 至 2022-11-15)

日期	产品	品种	平盈	持盈	手续费
2022/10/31	SDZD05	AL	0.00	17,675.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	SA	0.00	16,380.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	TA	0.00	16,100.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	J	0.00	15,200.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	BU	0.00	14,240.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	RB	0.00	12,920.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	JM	0.00	11,700.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	FG	0.00	11,000.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	OI	0.00	10,500.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	HC	0.00	10,200.00	0.00

共 277 条

10条/页

<123456...28>

前往1页Go

导出

确定

- 1、周期切换：点击右上角日历表，可进行时间周期的切换。控制：品种累计盈亏，品种盈亏走势，品种成交，品种盈利占比，品种亏损占比。
- 2、展示所选时间周期内累计盈亏排行前 7，后 7 的品种，中间 可 “.....”展示，点击 “更多”，以弹窗的形式，展示全部的品种的每日盈亏情况。不足 14 个有多少展示多少。
- 3、点击 “更多”，出现相应的弹窗。
- 01、弹窗标题：品种累计盈亏（yyyy-mm-dd 至 yyyy-mm-dd）。
- 02、按照日期倒序展示，最近的日期展示在最上面；相同日期按照盈亏金额倒序展示，最大的金额展示在最上边。
- 03、字段：日期、产品、品种、平盈、持盈、手续费、盈亏（元）。
- 04、点击 “导出” 按钮可导出品种盈亏明细表.Excel。如下图：

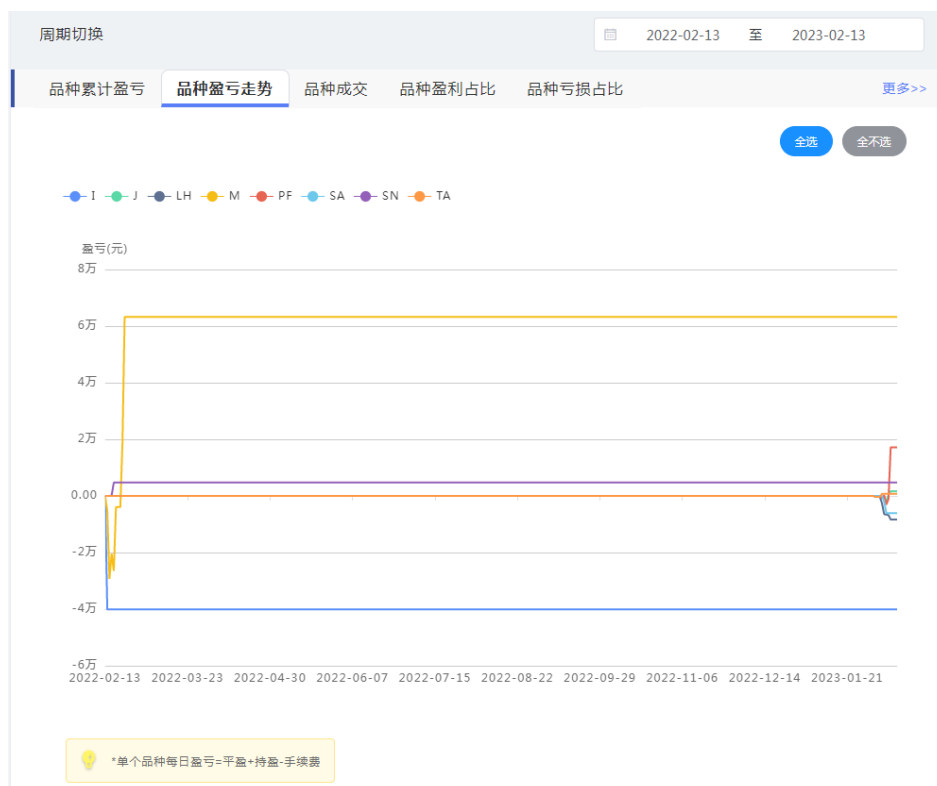
	A	B	C	D	E	F	G
1	日期	产品	品种	平盈	持盈	手续费	盈亏
2	2022/10/17	SDZD05	UR	0.00	24600.00	0.00	24600.00
3	2022/10/17	SDZD05	JM	4650.00	14280.00	141.99	18788.01
4	2022/10/17	SDZD05	PK	0.00	15260.00	0.00	15260.00
5	2022/10/17	SDZD05	LH	9120.00	960.00	498.32	9581.68
6	2022/10/17	SDZD05	RM	-1000.00	8250.00	82.54	7167.46
7	2022/10/17	SDZD05	EB	0.00	1520.00	0.00	1520.00
8	2022/10/17	SDZD05	CU	1900.00	-700.00	69.52	1130.48
9	2022/10/17	SDZD05	FG	-2640.00	3080.00	290.47	149.53
10	2022/10/17	SDZD05	RB	-4080.00	3570.00	139.03	-649.03
11	2022/10/17	SDZD05	AP	0.00	-840.00	44.07	-884.07
12	2022/10/17	SDZD05	P	0.00	-1600.00	22.05	-1622.05
13	2022/10/17	SDZD05	SC	0.00	-2500.00	22.04	-2522.04
14	2022/10/17	SDZD05	J	-8200.00	5550.00	120.75	-2770.75
15	2022/10/17	SDZD05	AL	-2800.00	-700.00	46.29	-3546.29
16	2022/10/17	SDZD05	NI	-3360.00	-1030.00	26.49	-4416.49

4、算法：

某品种累计盈亏：统计选定时间区间的 $\text{sum}(\text{品种每日盈亏})$

品种每日盈亏：平盈+持盈-手续费。

16.3.5品种盈亏走势



品种盈亏走势 (2022-10-15 至 2022-11-15)					
日期	产品	品种	平盈	持盈	手续费
2022/10/31	SDZD05	AL	0.00	17,675.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	SA	0.00	16,380.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	TA	0.00	16,100.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	J	0.00	15,200.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	BU	0.00	14,240.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	RB	0.00	12,920.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	JM	0.00	11,700.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	FG	0.00	11,000.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	OI	0.00	10,500.00	0.00
2022/10/31	SDZD05	HC	0.00	10,200.00	0.00

共 277 条 10条/页 < 1 2 3 4 5 6 ... 28 > 前往 1 页 Go

导出 确定

1、品种盈亏走势图：横轴显示日期，纵轴显示品种盈亏。

2、点击“更多”，出现相应的弹窗。

01、弹窗标题：品种盈亏走势（yyyy-mm-dd 至 yyyy-mm-dd）。

02、按照日期倒序展示，最近的日期展示在最上面；相同日期按照盈亏金额倒序展示，最大的金额展示在最上边。

03、字段：日期、产品、品种、平盈、持盈、手续费、盈亏（元）。

04、点击“导出”按钮可导出品种盈亏明细表.Excel。

3、算法：品种每日盈亏：平盈+持盈-手续费。

16.3.6品种成交



品种成交 (2022-10-15 至 2022-11-15)

品种名称	交易手数(手)	交易手数占比
TA	368	10.69%
RM	275	7.99%
MA	270	7.84%
M	238	6.91%
BU	224	6.51%
HC	204	5.93%
RB	204	5.93%
SA	182	5.29%
EB	160	4.65%
EG	144	4.18%

共 26 条

10条/页

< 1 2 3 >

前往 1 页

Go

确定

1、按照所选时间周期内品种的交易手数进行占比统计：某品种成交：统计选定时间区间的 $\text{sum}(\text{品种每日交易手数})$ 。展示前 10 的品种的交易手数，并进行占比计算。不足 10 个有多少展示多少，10 个以上的均显示“其他”。

2、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：品种、手数（占比）。光标移出到走势图范围外，悬浮窗消失。

3、点击“更多”，出现相应的弹窗。

01、弹窗标题：品种成交（yyyy-mm-dd 至 yyyy-mm-dd）。

02、按照交易手数占比倒序展示，最大的展示在最上边。

03、字段：品种名称、交易手数（手）、交易手数占比。

16.3.7 品种盈利占比



品种盈利占比 (2022-10-15 至 2022-11-15)		
品种名称	盈利(元)	盈利占比
FG	59,549.53	26.65%
J	22,277.51	9.97%
RM	21,775.81	9.74%
AL	20,897.29	9.35%
CU	20,847.64	9.33%
UR	19,917.24	8.91%
AP	18,363.47	8.22%
JM	15,566.05	6.97%
PK	12,926.95	5.78%
RB	6,327.70	2.83%

共 11 条 10条/页 < 1 2 > 前往 1 页 Go

确定

1、按照所选时间周期内品种的盈利进行占比统计，展示前 10 的品种的盈利，并进行占比计算。不足 10 个有多少展示多少，10 个以上的均显示“其他”。

2、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：品种、盈利（占比）。光标移出到走势图范围外，悬浮窗消失。

3、点击“更多”，出现相应的弹窗。

01、弹窗标题：品种盈利占比（yyyy-mm-dd 至 yyyy-mm-dd）。

02、按照盈利占比倒序展示，最大的展示在最上边。

03、字段：品种名称、盈利（元）、盈利占比。

4、算法：

某品种盈利：统计选定时间区间的 $\text{sum}(\text{品种每日盈亏}) > 0$ 。

品种每日盈亏：平盈+持盈-手续费。

16.3.8 品种亏损占比



品种亏损占比 (2022-10-15 至 2022-11-15)

品种名称	亏损(元)	亏损占比
SC	-27,074.69	16.20%
NI	-24,176.78	14.47%
OI	-18,592.04	11.12%
EB	-17,728.38	10.61%
BU	-14,398.40	8.62%
SP	-13,069.47	7.82%
SA	-12,461.04	7.46%
TA	-10,263.12	6.14%
LH	-6,774.95	4.05%
M	-6,583.28	3.94%

共 15 条

10条/页

<12>

前往1页Go

确定

1、按照所选时间周期内品种的亏损进行占比统计，展示前 10 的品种的亏损，并进行占比计算。不足 10 个有多少展示多少，10 个以上的均显示“其他”。

2、点击“更多”，出现相应的弹窗。

01、弹窗标题：品种亏损占比（yyyy-mm-dd 至 yyyy-mm-dd）。

02、按照亏损占比倒序展示，最大的展示在最上边。

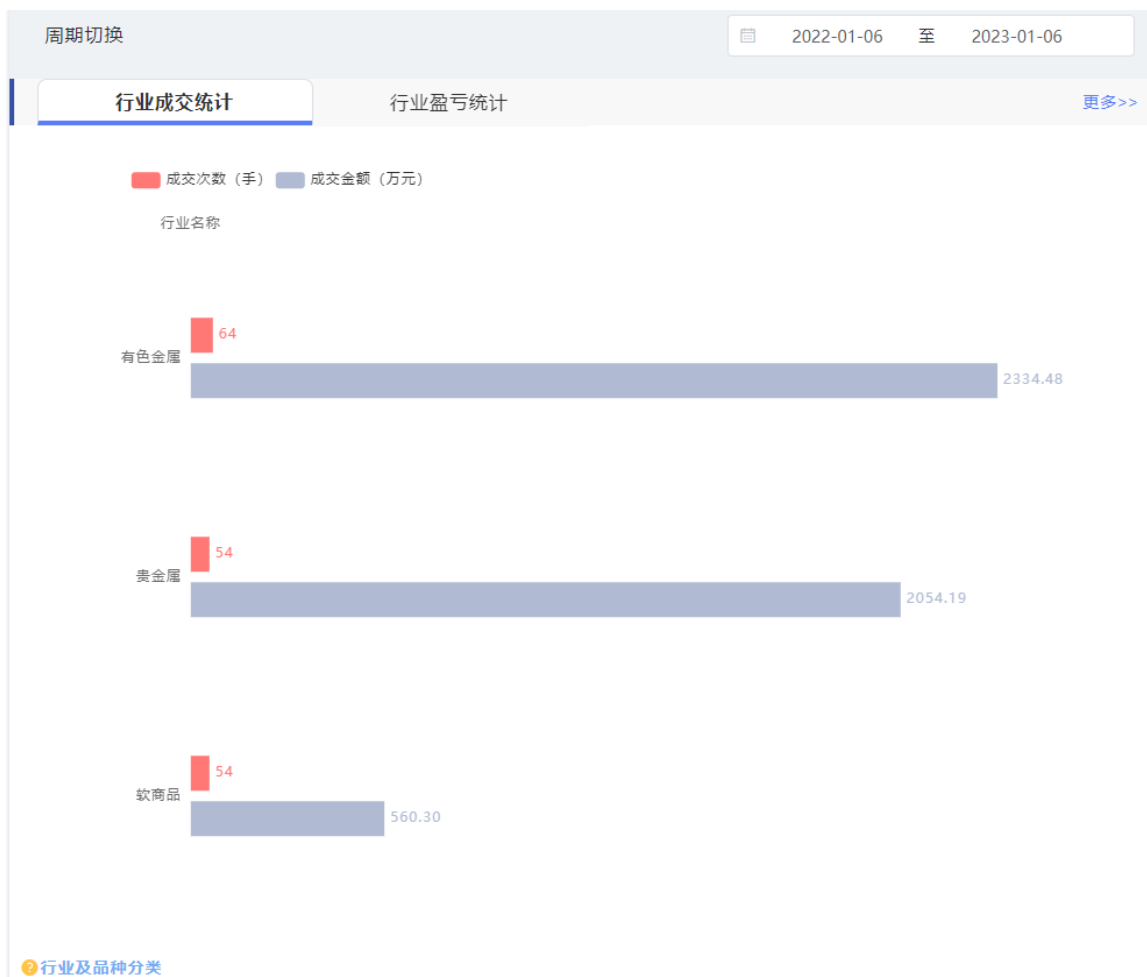
03、字段：品种名称、亏损（元）、亏损占比。

3、算法：

某品种亏损：统计选定时间区间的 $\text{sum}(\text{品种每日盈亏}) < 0$

品种每日盈亏：平盈+持盈-手续费。

16.3.9 行业成交统计



行业成交统计 (2022-01-06 至 2023-01-06) ×

行业名称	行业交易手数(手)	成交金额(万元)
有色金属	64	2,334.48
软商品	54	560.30
贵金属	54	2,054.19

共 3 条 10条/页 < 1 > 前往 1 页 Go

确定

- 1、周期切换：点击右上角，可进行周期切换。控制：行业成交统计、行业盈亏统计。
- 2、展示排行前 14 的品种，不足 14 个有多少展示多少。
- 3、点击“更多”，出现相应的弹窗。
 - 01、按照行业交易手数倒序展示，最大的展示在最上边。
 - 03、字段：品种名称、行业交易手数（手）、成交金额（万元）。

16.3.10行业盈亏统计



- 1、展示排行前 7，后 7 的行业，中间可“.....”展示，点击“更多”，以弹窗的形式，展示全部的行业的盈亏情况。不足 14 个有多少展示多少。
- 2、点击“更多”，出现相应的弹窗。

01、按照行业盈亏进行倒序展示，最大的展示在最上边。

03、字段：品种名称、行业盈亏（元）。

17、投资顾问

17.1功能点简介

投资顾问展示了该产品的对应的投资顾问一系列的详细信息。

17.2入口路径

登录绩效分析系统后，点击“投资顾问”即可进入绩效分析系统的投资顾问界面。

17.3使用说明

产品业绩 交易分析 期货分析 投资顾问				
历任投资顾问				
起始日期	截止日期	投资顾问	任职期限	任职回报
2020-06-30	至今	王小毛1, 王小毛2	330天	20.21%
2020-01-01	2020-06-20	投顾2	180天	13.15%
2019-01-01	2019-12-31	投顾3	1年	-25.12%
2018-01-01	2018-06-20	投顾4	180天	13.15%
2017-01-01	2018-12-31	投顾5	1年又30天	0.00%

< 1 > 到第 1 页 GO 共5条

1、历任投资顾问对应字段：起始日期，截止日期，投资顾问，任职期限，任职回报。

现任投资顾问简介					
小航 现任管理人投资经理兼策略总监，致力于期现套利、ETF 套利、高频阿尔法对冲、股指量化对冲等策略研究、近6年的投资实践，积累了丰富的对冲策略经验。					
序号	产品名称	管理时间	任职期限	任职回报	最新净值
1	jx_cz01	2023/01/10 - 至今	1天	0.00%	0.9392 (2022-06-09)

1、展示所有现任投顾的信息。

2、展示对应投顾历任产品一览表，字段：序号，产品名称，管理时间，任职期限，任职回报，最新净值。

18、产品—产品业绩

18.1功能点简介

产品业绩展示了该产品的净值走势图，收益走势图，业绩表，月度回报图，回撤走势图，风险评估指标。

18.2入口路径

登录绩效分析系统后，切换产品，即可进入绩效分析系统的产品业绩界面。

18.3使用说明

产品关于单位净值、累计净值的算法，取决于绩效分析系统后台管理系统进行设置。

1、若是选择融航默认算法，算法如下：

单位净值=总权益/总份额

总权益=sum(数据源总权益)= sum(数据源市值权益)

总份额=昨日份额+（今申购-今赎回）/昨日单位净值

产品的申购、赎回计算如下：

当 $\text{sum}[\text{数据源}(\text{申购}-\text{赎回})] > 0$ 时，判定为：申购= $\text{sum}[\text{数据源}(\text{申购}-\text{赎回})]$

当 $\text{sum}[\text{数据源}(\text{申购}-\text{赎回})] < 0$ 时，判定为：赎回= - $\text{sum}[\text{数据源}(\text{申购}-\text{赎回})]$

注意：第 1 日初始单位净值为 1.0000，取所有数据源成立日期的交集，作为产品的初始净值开始的日期。

2、若是选择读取估值表，即直接读取估值表的方式获取。

19、产品分析

19.1功能点简介

产品分析展示了该产品的市值比例，多空持仓市值，风险度，品种累计盈亏，品种盈亏走势，品种成交，品种盈亏占比，品种亏损占比，行业月交易手数，行业月盈亏手数。

19.2入口路径

登录绩效分析系统后，切换产品，点击“产品分析”即可进入绩效分析系统的产品分析界面。

19.3使用说明

数据均取数据源汇总的数据。若用户绑定了数据源即进行相应的数据展示，未绑定数据源，均显示暂无数据。

算法均可参照：16、期货分析。

20、产品信息

20.1功能点简介

产品分析展示了该产品的组合成分、组合成分收益率。

20.2入口路径

登录绩效分析系统后，切换产品，点击“产品信息”即可进入绩效分析系统的产品信息界面。

20.3使用说明

20.3.1组合成分

组合成分

序号	组合成分	成分类型	投顾	单位净值	累计净值
1	glpt-jx_cz01	投顾产品	投顾01,投顾02	0.9521	0.9521
2	glpt-jx_cz02	投顾产品	投顾01,投顾02	0.9542	0.9542

共 2 条

10条/页

< 1 >

前往 1 页

Go

1、组合成分显示字段：序号、组合成分、成分类型、投顾、单位净值、累计净值。按照绑定的先后顺序进行展示。

01、组合成分：产品下的投顾产品名称。

02、成分类型：投顾产品。

03、投顾：显示对应投顾产品对应的投顾人员，无投顾人员，“--”展示。

04、单位净值：显示对应单位净值，无数据，“--”展示。

05、累计净值：显示对应累计净值，无数据，“--”展示。

20.3.2 组合成分收益率

组合成分收益率								
序号	组合成分	成分类型	成立日期	近1月	近3月	近6月	近1年	成立以来
1	glpt-jx_cz...	投顾产品	2022-06-01	--	--	--	--	-4.79%
2	glpt-jx_cz...	投顾产品	2022-06-01	--	--	--	--	-4.58%

1、组合成分收益率显示字段：序号，组合成分，成分类型，成立日期，近 1 月，近 3 月，近 6 月，近 1 年，成立以来。

01、组合成分、成分类型：同上。

02、成立日期：取投顾产品成立日期。

03、近 1 月、近 3 月、近 6 月、近 1 年、成立以来：显示投顾产品对应收益率数据，无数据，“--”展示。

21、对比拟合

21.1 功能点简介

可以对投顾产品、产品进行对比拟合。

21.2 入口路径



点击首页-页头-“PK”，进入对比拟合的界面。

21.3 使用说明

21.3.1 对比拟合列表

对比拟合							
序号	名称	类型	投顾	成立日期	单位净值	累计净值	操作
1	GZ_01	投顾产品	--	2022-09-28	1.008 2022-03-18	1.008	🗑️
2	GZ_02	投顾产品	--	2022-03-11	1.0071 2022-03-18	1.0071	🗑️
3	GZ_03	投顾产品	--	--	-- --	--	🗑️
4	cp02	产品	--	2022-03-11	1.008 2022-03-18	1.008	🗑️
5	cp1	产品	--	2022-06-01	0.9406 2022-06-09	0.9406	🗑️

点击右上角的图标可进行截图📷、添加对比➕、清空对比👉、保存对比💾等操作。

添加对比：

添加对比

全部

请输入产品名称

Q

	名称	类型	投顾	单位净值
<input checked="" type="checkbox"/>	GZ_01	投顾产品	--	1.008 2022-03-18
<input checked="" type="checkbox"/>	GZ_02	投顾产品	--	1.0071 2022-03-18
<input checked="" type="checkbox"/>	GZ_03	投顾产品	--	-- --
<input checked="" type="checkbox"/>	cp02	产品	--	1.008 2022-03-18
<input checked="" type="checkbox"/>	cp1	产品	--	0.9406 2022-06-09

共 9 条20条/页< 1 > 前往 1 页Go

已选对比 (6)

清空

GZ_01

X

GZ_02

X

GZ_03

X

cp02

X

cp1

X

glpt-jx_cz01

X

取消

确认

1、可进行产品名称的输入，支持模糊搜索，选中后点击确认即展示对应的产品拟合结果。

2、可进行对应的产品的删除，点击“清空”一键全部删除。

清空对比：

提示

确定删除该对比的产品吗？

取消

确定

点击即清空对比拟合列表所有对比的产品。

保存对比：

保存对比

对比组名称

对比组1

取消

确定

- 1、可进行对比组的保存，用户自主设置对比组名称。
- 2、点击右侧“我的对比”按钮可查看、编辑所保存的对比组。详见 22、我的对比。

截图：

截图:



点击可将当前对比拟合结果存储为长图片。

21.3.2单位净值拟合分析



1、走势图：横轴显示日期，纵轴显示单位净值。

2、可切换的区间：同区间，今年以来，近 1 月，近 3 月，近 6 月，近 1 年，近 3 年，成立以来，自定义时间区间。

3、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、拟合产品分别的单位净值，拟合的单位净值。

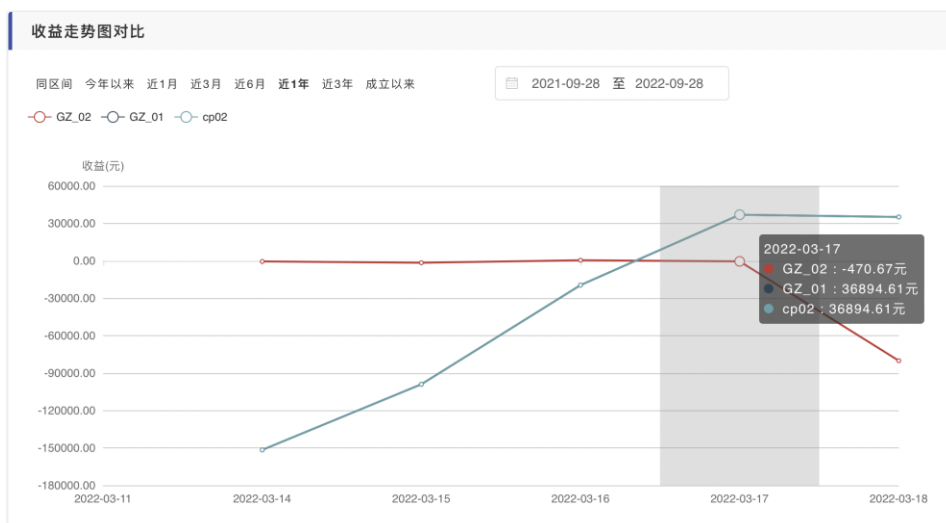
4、自定义拟合比例

01、默认展示对应时间区间的最优拟合比，可手动输入对应拟合比例。最优拟合比为在对应时间区间下，使得拟合曲线的卡玛比率是最大的比例。

02、可手动输入对应的拟合比例。只能输入 0 到 999 的整数。

03、点击“恢复默认”，即可恢复至默认的拟合比例。

21.3.3收益走势图对比

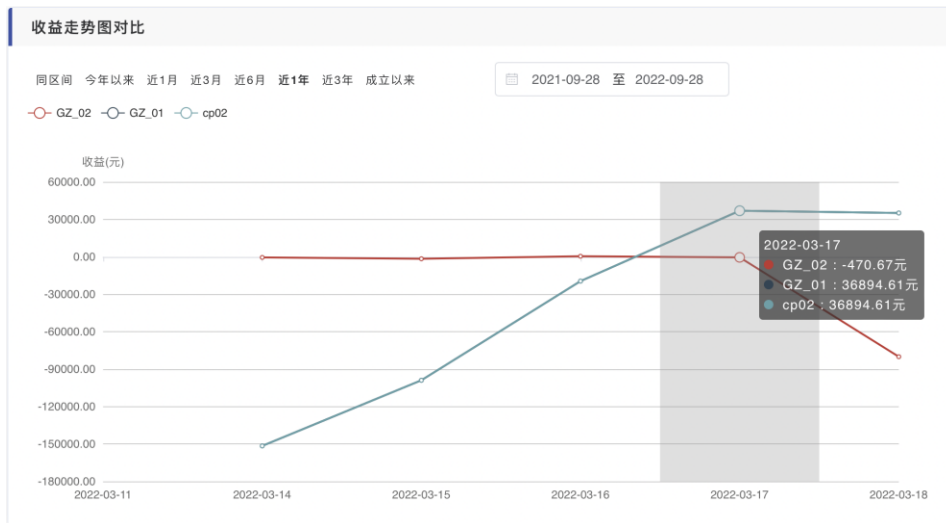


1、收益走势图：横轴显示日期，纵轴显示产品的收益。

2、收益走势图可切换的区间：同区间，今年以来，近1月，近3月，近6月，近1年，近3年，成立以来，自定义时间区间。

3、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、对比产品。

21.3.4收益率走势图对比



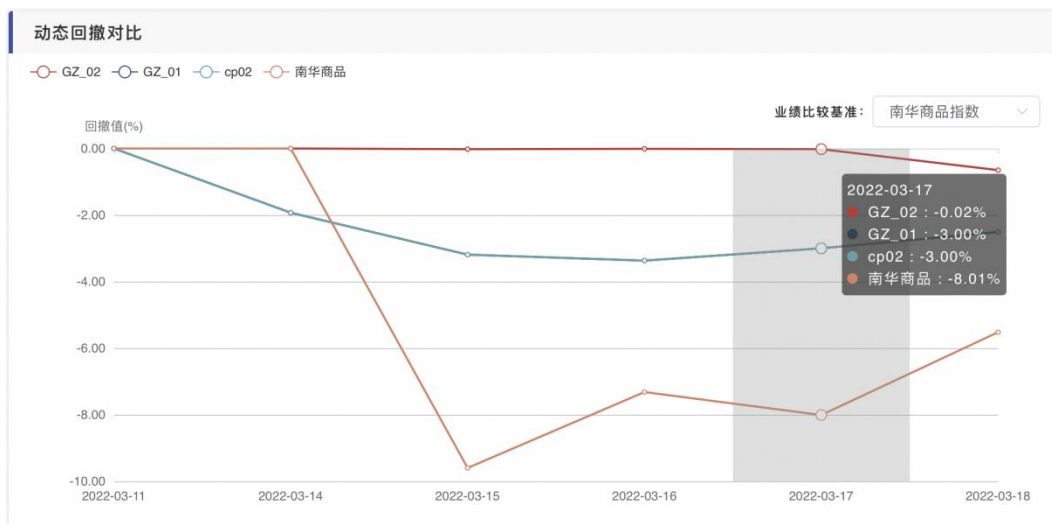
1、收益率走势图：横轴显示日期，纵轴显示收益率。

2、收益走势图可切换的区间：同区间，今年以来，近1月，近3月，近6月，近1年，近3年，成立以来，自定义时间区间。

3、光标移动到走势图范围，展示悬浮窗，悬浮窗显示字段：日期、对比产品、选定的PK项（默认选中：南华商品指数）。

4、业绩比较基准：南华商品指数、上证 50、沪深 300、中证 500、中证 1000。

21.3.5动态回撤对比



1、可以进行动态回撤的对比，周期默认显示所有投顾产品、产品的有累计净值的日期的并集。

2、业绩比较基准：南华商品指数。

21.3.6月度收益率对比

月度收益率对比										
										导出
										2022
名称	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月
GZ_01	--	--	-2.51%	--	--	--	--	--	--	--
GZ_02	--	--	-0.65%	--	--	--	--	--	--	--
GZ_03	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
cp02	--	--	-2.51%	--	--	--	--	--	--	--
cp1	--	--	--	--	--	-5.94%	--	--	--	--
glpt-jx_cz01	--	--	--	--	--	-6.08%	--	--	--	--
glpt-jx_cz02	--	--	--	--	--	-5.81%	--	--	--	--
glpt-测试01	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
资金账户	--	--	0.03%	-6.32%	-13.16%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	--

展示所有的对比产品的月度收益率，可以进行数据导出，年份切换，可切换近5年的时间周期。导出 excel 详情如下：

名称	2022年1月	2022年2月	2022年3月	2022年4月	2022年5月	2022年6月	2022年7月	2022年8月	2022年9月	2022年10月	2022年11月	2022年12月
GZ_01	-	-	-2.51%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GZ_02	-	-	-0.65%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GZ_03	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
cp02	-	-	-2.51%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
cp1	-	-	-	-	-	-5.94%	-	-	-	-	-	-
glpt-jx_cz01	-	-	-	-	-	-6.08%	-	-	-	-	-	-
glpt-jx_cz02	-	-	-	-	-	-5.81%	-	-	-	-	-	-
glpt-测试01	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资金账户	-	-	0.03%	-6.32%	-13.16%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	-	-	-

21.3.7指标对比

指标对比						
						导出
						添加指标
名称	近1年年化收益率	近1年年化波动率	近1年最大回撤	近1年夏普比率	近1年卡玛比率	近1年信息比率
GZ_02	0.00%	--	--	-10.43	-1	-13.77
glpt-jx_cz01	-6.00%	--	6.00%	-12.95	-1	-13.52
GZ_01	-2.00%	--	3.00%	-21.22	-0.74	-6.84
cp02	-2.00%	--	3.00%	-21.22	-0.74	-6.84
cp1	-5.00%	--	5.00%	-13.14	-1	-15.88
GZ_03	--	--	--	--	--	--

可以进行数据导出、指标编辑。

添加指标：

添加指标

周期性指标

☐ 近1周

☐ 近1月

☐ 近3月

☐ 近6月

☒ 近1年

☐ 近2年

☐ 近3年

☐ 近5年

☐ 今年以来

☐ 成立以来

☐ 收益率

☒ 年化收益率

☒ 年化波动率

☒ 最大回撤

☒ 夏普比率

☒ 卡玛比率

☒ 信息比率

☐ Alpha

☐ 贝塔

☐ 最大净值回补期(天)

其他指标

☐ 成立日期

☐ 截止日期

☐ 交易天数

已选对比 (6) [恢复默认](#) [清空](#)

近1年年化收益率

×

近1年年化波动率

×

近1年最大回撤

×

近1年夏普比率

×

近1年卡玛比率

×

近1年信息比率

×

取消

确认

可进行指标编辑，选中的指标变化之后，可恢复默认选中的指标。

导出：

名称	近1年年化收益率	近1年年化波动率	近1年最大回撤	近1年夏普比率	近1年卡玛比率	近1年信息比率
GZ_02	-0.0065%	0.0031	0.0065%	-10.436	-1	-13.777
glpt-jx_cz	-0.0608%	0.0065	0.0608%	-12.9546	-1	-13.5246
GZ_01	-0.0251%	0.0024	0.0338%	-21.2299	-0.7426	-6.84
cp02	-0.0251%	0.0024	0.0338%	-21.2299	-0.7426	-6.84
cp1	-0.0594%	0.0063	0.0594%	-13.1437	-1	-15.8873
GZ_03	--	--	--	--	--	--

可以进行数据导出。

22、我的对比

22.1功能点简介

可将对比拟合的对比组进行保存。

22.2入口路径

点击右侧导航栏的“我的对比”即可进入。



22.3 使用说明



可新建对比、编辑/删除对比组，点击对比组的名称即可查看该对比组的对比拟合结果。

23、报告发送

23.1 功能点简介

报告发送功能：可进行对应产品近一年的净值数据及绩效分析报告的邮件发送。

能够使用“报告发送”的人员及权限如下：

1、第一类用户：即在绩效分析系统后台创建的用户均可使用报告发送。

①admin：可以看到所有的投顾产品。

②管理员：可以看到的投顾产品、产品由后台的绑定关系决定的。

③投顾：前端可以看到的投顾产品、产品由后台的绑定关系决定的。

注意：第二类用户，即第三方系统的用户（目前主要是指管理平台的用户）。不能使用报告导出。

23.2入口路径

点击右侧导航栏的“报告发送”即可进入。



23.3使用说明

23.3.1报告发送-待发送



1、**新建报告发送：** 点击进行报告的新建发送。点击进入“新建报告发送”界面，详见 23.3.3。

2、**批量删除：** 点击可进行待发送报告的“批量删除”操作。

3、**待发送列表页：**

01、**显示顺序：** 默认按照创建时间来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。

02、**展示字段：** 选择框，序号，发件人，收件人，创建时间，发送方式，定时时间，发送状态，操作（复制，编辑，删除，开启）。

（1）复制：点击复制，进入此模板的详情页界面，等同于新建了同样内容的邮件，可点击“立即发送”“定时发送”进行相同邮件的再发送操作。

（2）编辑：点击跳转到收益报告发送的编辑页面，可对此条定时发送可进行再编辑。

（3）删除：可删除此条定时发送。点击删除出现确认弹窗。



（4）开启/关闭：用户新建定时发送后，默认是开启状态，点击关闭后，则暂停定时发送，可重新打开。

23.3.2 报告发送-发送记录



1、**搜索：**支持“发件人”、“收件人”的搜索。

2、**发送记录列表页：**

01、**显示顺序：**按照发送时间来进行倒序展示，最新时间的展示在最上边。

02、**展示字段：**序号，发件人，收件人，创建时间，发送时间，发送方式，附件，发送状态。

3、**发送状态：**已发送或发送失败。任何原因导致的未成功发送都记为发送失败。

23.3.3 新建报告发送

 **绩效分析系统**

admin

新建报告发送 (发送所选产品成立以来净值数据及绩效分析报告)

返回

发件人邮箱: message@rohon.net

产品名称:

选择产品

请选择产品

发送内容: ☐ 净值报告 ☐ 绩效分析报告

收件人邮箱:

最多只能输入10个邮箱, 例如112233@qq.com,123456@qq.com

发送方式:

立即发送

定时发送

- 1、展示字段：发件人邮箱，产品名称，收件人邮箱，发送方式。
- 2、发件人邮箱：默认邮箱 **message@rohon.net**。
- 3、产品名称：产品名称为必填项。点击“选择产品”出现选择产品弹窗，详见 23.3.3.1。输入框内支持删除操作。
- 4、发送内容：可选净值报告、绩效分析报告。
- 4、收件人邮箱：收件人为必填项。用户可输入对应的收件人邮箱，输入上限 10 个邮箱。输入框内支持删除操作。
- 5、发送方式：分为“立即发送”、“定时发送”。
 - (1) 立即发送：必填项不为空，点击“立即发送”即立即发送至对应邮箱。
 - (2) 定时发送：点击“定时发送”按钮。若无异常情况，出现定时发送弹窗。



选择定时发送的时间

重复: 每天

时间: 08:00

* 本邮件将在 每天08:00 投递到对方邮箱

取消 确定

23.3.3.1 选择产品弹窗



选择产品

产品名称

序号	产品名称	产品类型	最近更新
1	cp03	产品	2022/08/23 13:37:10
2	glpt-jk_cz01	投顾产品	2022/08/23 11:19:08
3	toug008	投顾产品	2022/08/23 11:18:59
4	cp05	产品	2022/08/23 10:49:59
5	产品0822	产品	2022/08/22 17:09:57
6	cp01	产品	2022/08/16 14:13:54
7	cp02	产品	2022/08/16 14:13:13
8	glpt-jk_cz02	投顾产品	2022/08/16 14:08:56
9	基金账号	投顾产品	2022/08/16 14:08:28

共 9 条 10条/页 1 页 6条

确认选中

1、点击“选择产品”出现弹窗，展示：产品名称、产品类型、最近更新。按照“最近更新”倒序排列，最新时间的排在最上面。

01、可选项由登录前端的账户的绑定关系决定的，该账户后台绑定了哪些产品、投顾产品，此列表即可见哪些产品、投顾产品。

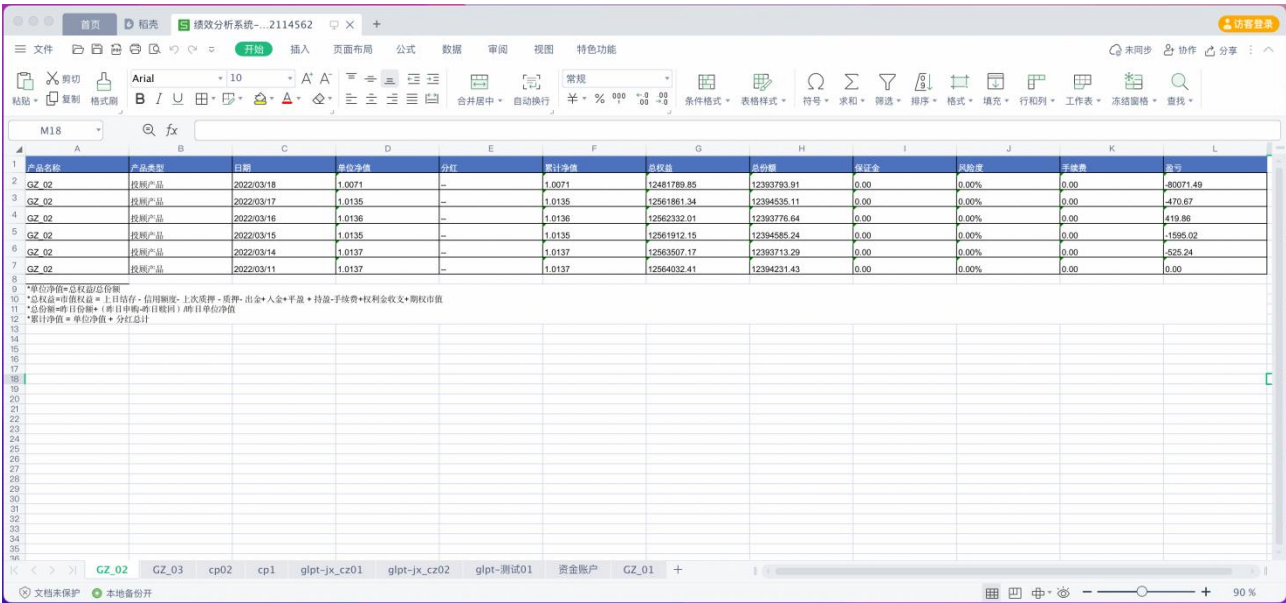
2、搜索框：可在右上角进行产品名称的搜索。

3、导出的绩效净值报告（excel 文件）有更新：

01、字段： 产品名称、产品类型、日期、单位净值、分红、累计净值、总权益、总份额、风险度、手续费、盈亏。

02、展示时间区间：展示近 1 年的数据，不足一年有多久展示多久。

03、如下图所示：



产品名称	产品类型	日期	单位净值	分红	累计净值	总权益	总份额	保证金	风险度	手续费	盈亏
GZ_02	投顾产品	2022/03/18	1.0071	--	1.0071	12481789.85	12393793.91	0.00	0.00%	0.00	-80071.49
GZ_02	投顾产品	2022/03/17	1.0135	--	1.0135	12561861.34	12394536.11	0.00	0.00%	0.00	-470.67
GZ_02	投顾产品	2022/03/16	1.0136	--	1.0136	12562332.01	12393776.64	0.00	0.00%	0.00	-419.86
GZ_02	投顾产品	2022/03/15	1.0135	--	1.0135	12561912.15	12394586.24	0.00	0.00%	0.00	-1595.02
GZ_02	投顾产品	2022/03/14	1.0137	--	1.0137	12563567.17	12393713.29	0.00	0.00%	0.00	-625.24
GZ_02	投顾产品	2022/03/11	1.0137	--	1.0137	12564032.41	12394231.43	0.00	0.00%	0.00	0.00

24、说明书下载

统计区间：

近1年

2022-01-11 至 2023-01-11

查询

投顾产品：jx_cz01

(更新截止至2022-06-09)

PK

单位净值：0.9392

累计净值：0.9392

近1月：--

近3月：--

近6月：--

近1年：--

成立来：-6.08%

成立日期：2022-06-01

总权益：945.65万元

数据等级：--

存续状态：存续中

投资顾问：小航,q.tg01

账户概述：尊敬的客户，您的账户在2022-01-11 ~ 2023-01-11期间，期初总权益10,000,000.00元，期末总权益9,456,516.40元，日均权益8,894,929.95元，手续费权益比（日均手续费/日均权益）0.88%；总计出金2,000,000.00元，总计入金12,000,000.00... 展开更多>>

我的对比

报告发送

帮助中心

说明书下载

回到顶部

点击可下载绩效分析系统的操作手册。

25、修订记录

序号	版本号	修订日期	修订描述
1	V3.1.0.0	2021/11/23	建立初稿
2	V3.2.0.0	2022/01/12	增加产品业务流程图、对投顾产品的创建方式进行梳理、其他界面优化。

102

3	V3.4.0.0	2022/08/18	<p>1、增加系统运维篇；</p> <p>2、整合绩效分析系统后台管理系统、前端内容；</p> <p>3、更新业务流程图、人员管理、投顾产品、出入金归属；</p> <p>4、后台管理系统新增数据源、产品模块；</p> <p>5、前端新增产品绩效分析；</p> <p>6、前端新增第三方登录入口、新增风险评估指标、更新交易分析-收益明细部分算法、新增行业品种分类；</p> <p>7、其他界面优化、页面跳转优化。</p>
4	V3.5.0.0	2022/10/12	<p>1、后台管理系统-新增数据源类型：估值表文件。</p> <p>2、后台管理系统-投顾产品、产品新增风控设置。</p> <p>3、前端扩展了对比拟合的数量。</p> <p>4、前端丰富了净值表的字段。</p>
5	V3.5.3.0	2022/11/15	<p>1、新增品种盈亏走势图。</p> <p>2、品种累计盈亏/品种盈亏走势/品种成交/品种盈利占比/品种亏损占比增加时间周期自定义。</p> <p>3、增加品种盈亏明细表导出。</p>
6	V3.5.4.0	2022/11/15	<p>1、对比拟合数量上限增加后台配置。</p> <p>2、行业月盈亏统计公式优化。</p>
7	V3.7.4.0	2022/12/20	<p>1、可自定义时间周期导出对应的绩效分析报告。</p> <p>2、增加产品的账户概述。</p>

			<p>3、增加产品业绩-月度回报图的时间周期选择。</p> <p>4、增加交易分析一系列的时间周期选择。</p> <p>5、优化期货分析-行业成交统计、行业盈亏统计。</p>
8	V3.7.5.0	2023/01/09	<p>1、增加说明书下载入口。</p> <p>2、增加首页的帮助提示项。</p> <p>3、增加权益走势图、累计盈亏走势图。</p> <p>4、支持多个基准指标同时对比。</p> <p>5、报告发送优化。</p> <p>6、出入金归属优化。</p>
9	V3.7.6.0	2023/02/10	<p>1、更新资金账户的数据源。</p> <p>2、增加经纪公司管理。</p> <p>3、其他界面优化。</p>

此文档含有具体的技术和业务相关的专有信息，文中涉及的所有资料必须严格保密。除因需要而得到授权的客户和本公司有关人员外，不得向他人泄露。