

---

# 金盾御市场风险管理平台 V1.0

## 用户使用手册

2025 年 6 月

上海金轩数字科技有限公司 版权所有

# 目录

一、 引言	6
1. 编写目的	6
2. 读者群体	6
3. 内容范围	6
4. 名词解释	6
5. 参考文档	7
6. 编写规范	7
二、 使用指引	7
1. 产品概述	7
2. 功能概述	8
3. 登录系统	8
三、 功能模块	9
1. 首页	9
1.1 展示的内容	9
1.2 查询功能	10
2. 仓位信息中心	12
2.1 按证券代码的搜索	12
2.2 按其他要素的搜索	12
3. 限额管理中心	13
3.1 限额看板	13
3.2 限额报表	14
3.3 限额大类	15
3.4 限额指标	16
3.5 限额配置	18
4. 风险因子中心	21
4.1 风险因子池	21
4.2 风险因子映射	25
4.3 FRTB 风险因子	27
4.3.1 体系管理	27
4.3.2 因子管理	29
5. 参数管理	31
4.1 风险时序数据	31
4.1.1 债券	31
4.1.2 股票	31
4.1.3 外汇	32
4.1.4 货币市场	32

4.2 基础参数管理	33
4.2.1 风管部公司信评	33
4.2.2 产业类别控制	34
4.2.3 债券/证券发行信评	35
4.2.4 信评评级控制	37
4.2.5 路透社资料	38
4.2.6 彭博社资料	39
4.2.7 信用评级	41
4.3 金融日历	41
4.4 休市日维护	42
4. 数据中心	44
2.1 市场数据	44
2.1.1 市场数据采集配置	44
2.1.2 市场数据采集	44
5. 调度中心	45
3.1 ETL 调度	45
3.1.1 任务管理	45
3.1.2 批次管理	47
3.1.3 批次日志	49
3.2 数据质量检核	49
3.2.1 业务检核	49
3.2.2 技术检核	50
6. 分析报表	51
5.1 市场风险分析	51
5.1.1 一般利率风险	51
5.1.2 外汇风险	51
5.1.3 风险汇总	52
5.1.4 风险监管	52
5.1.5 利率特定风险	53
5.1.6 资产利率风险	53
7. 风险因子分析	54
6.1 股票价格走势	54
6.2 基金价格走势	54
6.3 债券价格走势	55
6.4 指数价格走势	55
8. 系统管理	56
7.1 用户管理	56
7.2 角色管理	59
7.3 菜单管理	61
7.4 部门管理	63
7.5 岗位管理	65
7.6 字典管理	68
	71

7.7 参数设置	71
7.8 通知公告	74
7.9 日志管理	76
7.9.1 操作日志	76
7.9.2 登录日志	78

# 一、引言

本章节简要地说明上海金轩数字科技有限公司自主研发的产品《金盾御市场风险管理平台 V1.0 用户使用手册》（以下简称本手册）的编写目的、读者群体、内容范围、名词解释、参考文档和编写规范。

## 1. 编写目的

为了帮助用户快速入门和使用金盾御市场风险管理平台 V1.0，熟悉产品功能，特编写本手册供使用者参考，在产品使用过程中如有任何疑问，欢迎您随时与金轩数科取得联系。

## 2. 读者群体

本手册主要面向金盾金融市场风险综合管理平台的使用者、业务人员、开发人员、管理人员以及其他相关人员。

## 3. 内容范围

本手册的内容主要是为使用者提供金盾御市场风险管理平台 V1.0 各项功能的介绍及其详细地操作步骤和说明，若您要了解平台的部署架构、软硬件部署需求以及系统运行维护等内容，请参考本平台的《金轩数科产品服务端部署手册》、《金轩数科产品部署环境需求文档》和《金轩数科产品服务端运维手册》等。

## 4. 名词解释

**市场风险：**指的是由于市场价格（如利率、汇率、股票价格、商品价格等）波动导致金融资产或负债价值发生变化的风险。

**风险因子：**指的是影响投资组合或金融资产收益波动的潜在变量或驱动力。这些变量通常是导致市场波动、资产价格变动或投资回报不确定性增加的关键因素。

**风险指标：**用来量化和衡量金融资产或投资组合所面临的风险的一系列数值。这些指标帮助投资者和金融机构评估潜在的损失和不确定性。常见的风险指标包括：

**风险限额：**为控制风险而设定的最大可接受损失限额。这些限额可以基于不同的风险指标来设定。风险限额的设定有助于防止因单一交易或市场事件导致的重大损失，确保金融机构的资本充足和运营稳定。

**风险价值：**在一定置信水平下，一定时间内资产或投资组合可能遭受的最大损失。

**压力测试**是一种评估金融资产或投资组合在极端市场条件下表现的风险管理工具。通过模拟历史上的极端市场事件或假设未来可能发生的极端情况，压力测试可以帮助金融机构评估在

极端不利情况下可能遭受的损失，并据此调整风险管理策略和资本储备。压力测试的结果通常用于设定风险限额和资本规划。

风险计量是指使用统计和数学模型来量化金融资产或投资组合的风险。这包括识别、评估和监控各种类型的风险。风险计量的目的是提供准确的风险评估，以便做出更好的投资决策和风险管理。风险计量的结果通常用于报告、合规和内部决策。

得尔塔风险因子是指金融工具的市场价值对基础资产价格变化的敏感度。它衡量的是基础资产价格每变化一个单位，金融工具价值的变化量。

维伽风险因子是指金融工具的市场价值对标的资产波动率变化的敏感度。它衡量的是标的资产波动率每变化 1%，金融工具价值的变化量。

曲度风险因子是指金融工具的市场价值对标的资产价格变化的二阶导数，即对得尔塔风险因子变化的敏感度。它衡量的是标的资产价格每变化一个单位，得尔塔值变化对金融工具价值的影响。

## 5. 参考文档

无

## 6. 编写规范

- ◇  该按钮图标位于主界面左上角公司 LOGO 的右侧，以下统称“导航栏按钮”，点击该按钮可隐藏或显示功能菜单；
  - ◇ **【】** 实心方头括号的内容表示功能菜单，例如【数据中心】、【调度中心】等；
  - ◇ “” 中文引号中的内容表示外来输入数据，例如“测试用户”、“DBA 管理员”等；
- 注意 仿宋加粗斜体“注意”，表示本手册中的特别注意的地方，需要使用者着重留意。

## 二、使用指引

### 1. 产品概述

金盾御市场风险管理平台是面向金融机构的市场风险管理平台，该平台集成风险因子处理、风险计量、压力测试及报表分析等功能，提供从咨询到售后全方位服务，助力银行、证券、保险、信托、基金、资管等金融机构提升监管合规性和风险控制能力，构建统一、专业、高效的市场风险管理体系。

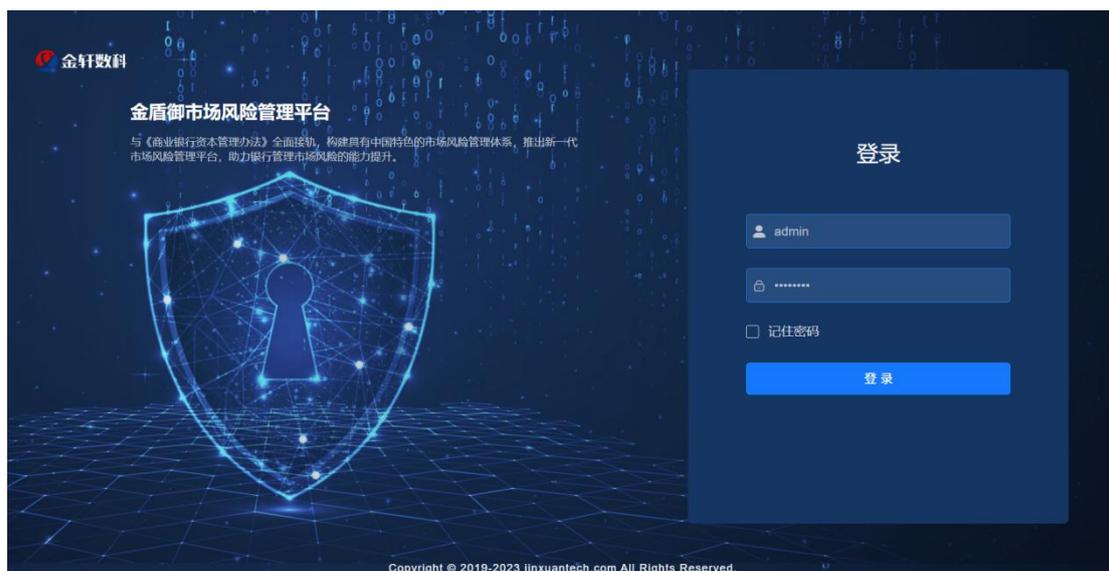
## 2. 功能概述

依据不同的用户权限，使用者能够在本系统中完成以下工作：

- ✧ 市场风险管理驾驶舱查看
- ✧ 市场风险外部数据以及内部数据采集
- ✧ 数据计量引擎输入数据准备
- ✧ 风险指标与限额的设定与监测
- ✧ 市场风险分析报表管理
- ✧ 市场风险风险因子管理
- ✧ 压力测试的创建与运行
- ✧ 管理平台的用户、角色和系统任务等

## 3. 登录系统

- ✧ 启动浏览器（推荐您使用 Chrome65 及以上版本），在浏览器地址栏中输入平台的 URL，例如 <http://http://100.10.1.104:8089>，即可进入平台的登录入口界面。
- ✧ **登录界面：**



在文本框中填写用户名和密码然后点击页面中的“登录”按钮，用户名和密码输入正确后，即可进入平台的主界面。

### 三、功能模块

#### 1. 首页

- ✧ **功能介绍：**提供报表查看功能。
- ✧ **功能入口：**菜单栏 --> 首页

##### 1.1 展示的内容



(1) 最上方的一栏显示关键风险指标概览，具体如下：

- ✓ **持仓金额：**显示当前持仓的总金额，以及与之前相比的环比和同比变化。
- ✓ **风险敞口：**展示当前的风险敞口总额，以及环比和同比变化。
- ✓ **盈亏金额：**显示当前的盈亏总额，以及环比和同比变化。
- ✓ **预期损失(ES)：**展示预期损失的金额，以及环比和同比变化。
- ✓ **风险价值：**显示风险价值的金额，以及同比变化。

(2) 中间一栏是展示持仓金额分布图：

- ✓ 以条形图的形式展示不同类别资产的持仓金额，包括股票、债券、基金、期货、期权、外汇、商品等不同资产。
- ✓ 以饼图的形式展示针对某一类别资产的分布占比情况。
- ✓ 以表格的形式展示不同类别资产的风险敞口、环比和同比。

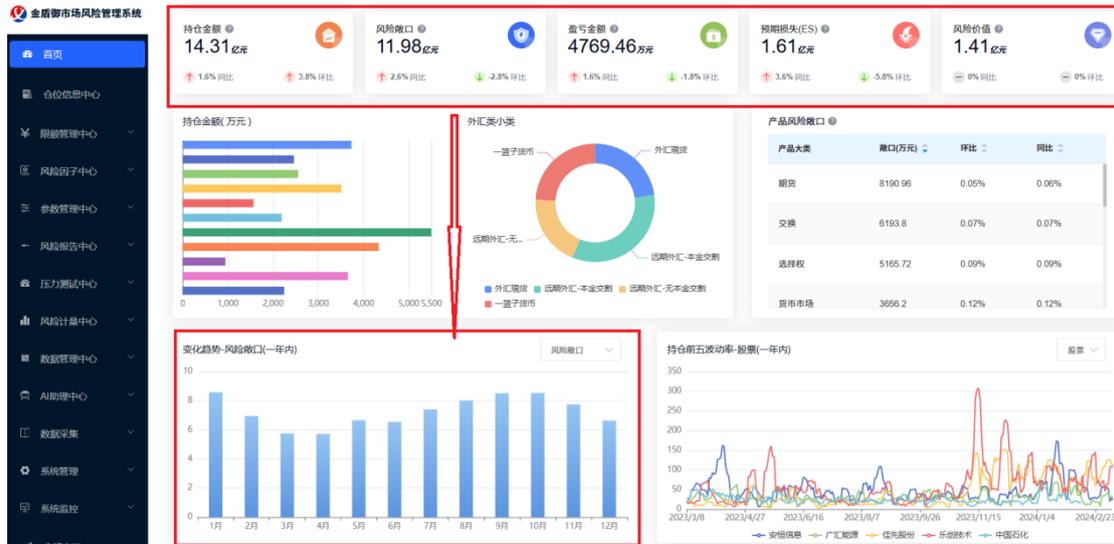
(3) 最下方的一栏展示了相关的趋势图：

- ✓ **变化趋势图：**展示持仓金额、风险敞口、盈亏金额、预期损失(ES)、风险价值等在过去一年内的变化趋势，以柱状图的形式呈现。

- ✓ 持仓前五波动率图：展示股票或者外汇持仓前五位在过去一年内的价格走势变化，以折线图的形式呈现。

## 1.2 查询功能

依次点击最上方的每一类指标，最下方左侧的柱状图会依次显示对应指标在最近 12 个月内的金额。

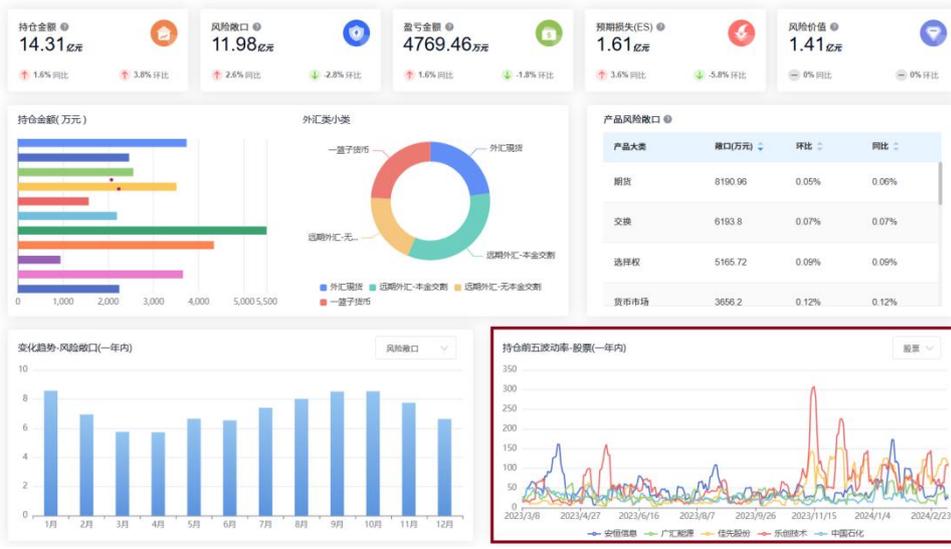


依次点击中间最左边的条形图，饼图就会显示出对应着不同资产的结构分布图。



在最下方右侧的持仓前五波动率图，通过下拉框可以得到不同资产类型中，持仓前五的资产在最近一年内的价格走势图。

- 首页
- 仓位信息中心
- 限额管理中心
- 风险因子中心
- 参数管理中心
- 风险报告中心
- 压力测试中心
- 风险计量中心
- 数据管理中心
- AI助理中心
- 数据采集
- 系统管理
- 系统监控



## 2. 仓位信息中心

- ◇ 功能介绍：提供整个仓位的查看功能。
- ◇ 功能入口：菜单栏 --> 仓位信息中心

### 2.1 按证券代码的搜索

在最上方的搜索框中，输入证券代码或着证券简称，就可以搜索得到相应的证券持仓信息数据。

部门名称	部	投资经理姓名	业务类型	资产类型	交易所	账户类型	日期选择						
投资一部	201	王二	自营交...	100000...	深圳证券交易所	权益类	主板股票	601857	中国石油	6661000	35000	16000	6680000
投资一部	201	王二	对客账户	100000...	深圳证券交易所	权益类	主板股票	601857	中国石油	6661000	35000	16000	6680000
投资一部	201	王二	资管账户	100000...	上海证券交易所	权益类	股票期权	10007148	50ETF...	8286	0	360	7926
投资一部	201	王二	自营交...	100000...	深圳证券交易所	权益类	主板股票	601857	中国石油	6661000	35000	16000	6680000
投资一部	201	王二	资管账户	100000...	上海证券交易所	权益类	股票期权	10007148	50ETF...	8286	0	360	7926
投资一部	201	王二	资管账户	100000...	中国开放式基	权益类	股票型...	000017	鹏博可...	43830000	0	80000	43850000
投资一部	201	王二	资管账户	100000...	大连商品交易所	商品类	商品期权	M2412...	豆粕24...	570	96	51	615

### 2.2 按其他要素的搜索

点击右上的“加号”按钮，会出现一个弹框，在弹框中可以按照“部门名称、投资经理姓名、业务类型、资产类型、交易所、账户类型、日期选择”等要素进行搜索。

以下内容省略，如有采购意向，在沟通后可提供完整用户手册