

东软交易监察解决方案

咨询服务|软件系统|运行维护

东软交易监察系统 (Neusoft Trading Surveillance System , TSS) 是东软金融事业部在交易监察领域的咨询服务、解决方案项目实施、系统运维经验的积累与沉淀。东软通过十余年来与国内多家大型交易所在监察领域的长期合作，在业务发展与实践中形成一套符合中国证券市场监管要求的监察解决方案。该方案适用于中国证券监管机构及包括交易所和会员单位在内的一线监管者对市场交易违规行为的监控。东软将致力于为领域客户提供优质、高效、稳定的监察系统、咨询服务、项目实施、运维服务，打造具有业务及技术前瞻性的交易监察业务全流程解决方案。

专业化的咨询服务

东软金融事业部拥有通过项目实践逐步形成的金融行业咨询项目实施方法学，并在多个交易所咨询项目中成功应用，为客户在监察领域提供定制化的咨询服务，包括但不限于对监察领域业务发展战略、监察业务模型、IT 系统建设与运维支撑等方面，进行定位、评估与规划。东软通过国际合作把握监管业务发展动态，并结合国内专业的项目实施和本地化交付经验，为客户制定业务发展蓝图，构建符合国内监管领域发展趋势的交易监察业务模型，并遵循专业化的咨询方法学，将咨询成果向客户方进行有效的知识转移，为客户监察业务发展规划及信息系统建设带来价值。



领先的市场监察系统

系统功能

根据国内监管机构的职责和监管业务运转要求，东软交易监察解决方案包括预警管理、分析管理、案件管理、知识管理、报表/报告管理、查询统计、系统管理等子系统。

- 预警子系统用于监察业务人员进行预警规则的全生命周期管理包括预警规则的创建、测试、维护和执行，系统提供设置预警所需的基础指标、函数、算法模型，支持监控人员进行自定义规则的创建，提升预警规则的上线速度适应市场监管环境的快速变化；
- 分析管理子系统由市场回放、交易分析、行情分析、账户及 PBU 分析构成对市场违规行为的识别支撑；

- 案件管理子系统实现违规行为的全流程管理由案件分发、案件调查、案件档案等模块构成；
- 知识管理子系统是以交易监察业务为核心，沉淀监察领域业务分析经验和模型，建立起采集、整合、更新与复用的完善的知识管理体系，为监管机构业务运转提供增值价值；
- 查询统计子系统是支持监察分析人员可以根据成交、申报、持仓等数据要素，或按照产品、会员、PBU、账户/账户组、时间等维度，进行自定义查询并通过图形化进行展示；
- 报表/报告管理子系统能够让分析人员在以灵活自定义的交互方式进行业务数据的报表与报告的生成，系统支持格式化报告和非格式化报告两种模式；
- 系统管理子系统由用户管理、角色管理、参数设置、权限管理、安全认证，以及健康度监察等模块构成。

系统特性

可视化、多样化分析手段，有效降低市场各类风险

东软交易监察系统提供通用的预警引擎设计、丰富的规则指标、易用的分析工具。预警引擎提供实时、轮询、定时等多种预警触发方式，涵盖法律法规类、投资者交易行为类、市场行情类等多种预警规则，指标体系与预警引擎、分析模型、算法工具的有效结合，自动识别交易过程中发生的各类风险。

自主可控的一体化平台

东软交易监察系统集成了东软数据管理、平台服务、数据分析、数据计算、数据存储、数据整合、平台管理、安全管理等方面的开放式框架平台，提供基础架构接口，为上层应用提供透明、高效的基础架构服务，提升应用开发效率，降低应用系统与基础架构的耦合度。

极高系统性能和可靠性以确保业务正常运作

东软交易监察系统的性能指标极高，如订单接收 20 秒可达 400,000 笔。极高的可靠性，使交易所能够 24 小时不间断地为市场提供服务，同时提供全面的容灾技术保障，支持多级数据备份、容错机制以及多级别灾备策略，避免因系统性能低下和可靠性缺失而造成的业务中断、系统宕机以及数据丢失等情况的发生。

成功案例

- 上海证券交易所第三代监察系统
- 大连商品交易所监察系统
- 上海黄金交易所风险监控系統
- 中国金融期货交易所新一代监察系统业务咨询项目
- 上海证券交易所大数据平台暨新监察系统咨询项目
- 大连商品交易所新一代交易系统业务咨询项目
- 上海黄金交易所第三代业务系统建设咨询项目

更多产品信息请联络
 产品经理：任世伟 先生
 邮箱: renshiwei@neusoft.com