金融期货协商交易平台申报端软件 国债期货期转现相关功能操作手册

版本 V1.00

第1章 概述

本文面向第一次使用本系统的用户,概要介绍系统为国债期货期转现交易提供的功能, 提供快速上手指南。

第二章介绍系统最基本的操作,包括如何登录、退出系统,如何使用界面通用功能等。 第三章则对国债期货期转现相关功能进行详细描述。

第四章则对个人信息、修改密码相关操作进行了详细描述。

注意: 文中相关截图中数据为示例数据, 仅做参考。

第2章 系统基本操作

2.1 登录

1、将数字证书插入USB 接口。

2、在浏览器中 https://obt.cffex.com.cn,浏览器会弹出证书选择窗口(下图仅作参考)。

		×
m.cn:443 上对您本人进行身份	分验证	
颁发者	序列号	
SHECA G2		
	确定	取消
	m.cn:443 上对您本人进行身份 颁发者 SHECA G2	m.cn:443 上对您本人进行身份验证 颁发者 序列号 SHECA G2

3、用户选择对应的用来做中金所期转现的数字证书,点击"确认"按钮。输入数字证书的密码:

USBKey存储区1用户密码 >>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>>						
请输入用户密码 (8-	16个字符)					
密码:						
й	1 定	取 消	ä			

4、数字证书验证通过后,可打开协商交易平台首页,如下图:

中金所协商交易平台 @willedus@shiftaha. Filledus.eta.au.au.au.au.au.au.au.au.au.au.au.au.au	
△ 用户名 A, 登录条件	

5、输入用户名、密码,点击登录按钮,系统校验用户名、密码是否正确,正确则提示



2.2 退出

提示				\times	
0	确定要退出吗?				
		确;	ئ ة ال	湖	

用户点击"确认"则退出当前登录,点击"取消"则取消退出,回到系统中。

第3章 国债期货期转现

本部分主要描述国债期货期转现申报的创建、确认及相关操作。

3.1 创建申报

功能描述:

交易双方完成期转现交易要素协商后,由期货交易卖方通过本功能创建申报,并提交期 货交易买方确认。

操作说明:

 1、点击菜单,进入"创建申报"功能界面。期转现交易的申报有期货交易卖方创建, 期货交易买方确认。标记为*号的必须填写。

易时间及交易双方信	息(期货合约卖方录入)									
*协商一致日期:	20180823	1 * 物·	第一致时间:	请选择时间	<u>ن</u>	(币经纪公司(若有):	请输入货币经约	记公司名称		
* 会员:	请选择会员	•	*客户:	请选择客户	*	*对手方交易员:	请选择对手方交	杨云		
期现货匹配方法: 🔹	风脸匹配 🔵 面值匹配									
货合约交易信息										
* 合约代码:	请输入合约代码	•	价格(元):	请输入价格		* 买卖方向:	奕	•		
•数量(手):	请输入数量		• 开平标志:	请选择开平标志	-					
价证券或相关合约交	易信息									
现货类型:	● 债券 ○ 债券远期									
*交易场所:	中国外汇交易中心 🔍	* 成交编号	请输入成交	编号 * 债务	券简称:	请输入债券简称	* 债券代码:	请输入债券代码		
•买卖方向:	买 🔻	*券面总额(万)	请输入券面:	总额 *净价	(元):	请输入成交净价	*成交日期:	请选择成交日期		
										+

- 2、交易时间及交易双方信息(期货合约卖方录入)填写:
 - a) 协商一致日期:默认为当前日期,为交易双方协商本期转现交易的日期,除
 了交易所交易时间,也可以在非交易所交易时间内协商,但是根据规则,该
 日期不能小于上一交易日,不能大于当前交易日,选择方式如下:

20180	823					
~~ •	<	2018	3年	8月)	> >>
日	_	_	Ξ	四	五	六
		31	1	2	3	4
5	6	7	8	9	10	11
12	13	14	15	16	17	18
19	20	21	22	今天	24	25
26	27	28	29	30	31	1
2		4				

b) 协商一致时间:为交易双方协商本期转现交易的时间,除了交易所交易时间, 也可以在非交易所交易时间内协商,但是根据规则,协商一致日期小于当前 交易日时,该时间必须大于 9:15 并且小于 10:15 (具体以业务规则中的时间 为准),如果协商一致日期等于当前交易日时,该时间必须大于 9:15。协商时 间不可填写未来的时间。选择方式如下:

金融期货协商交易平台申报端软件(版本: V1.00)



- c) 货币经纪公司(若有):如果本期转现交易的协商是经由货币经纪公司撮合的, 此处填写其公司名称,否则不用填写。
- d) 会员:下拉列表,列表中可以选择的会员为备案过当前登录用户所在机构的 会员。



e) 客户:下拉列表,列表中可以选择的客户为所选会员对的客户中,符合期转现准入客户类型要求的,并且证件号码与当前登录用户所在机构证件号码相同的客户。如果客户为资管客户,则以会员的组织机构代码进行识别。



f) 对手方交易员,可编辑的下拉列表,系统根据用户输入进行筛选,筛选结果 列表最多显示 10条。筛选结果列表中可以选择的交易员为本系统中除去当前 登录用户的所有交易员用户。如果下拉列表中没有看到预期的对手方,可增 加输入内容让系统进行更准确的推荐。

* 对手方交易员:	zx
	zxqh02-管理员02
	zxqh9-杨飞

3、期现货匹配方法,只能选择一种,选择风险匹配,表示期现货匹配将根据其基点价 值来判断,交易所会做事后的检查;选择面值匹配,则会校验期货交易的面值与现 货交易的券面总额(如果有多笔现货交易,则为多笔现货交易的券面总额的和)相 等,若不相等,不能提交申报。



- 4、期货合约交易信息填写:
 - a) 合约代码:文本输入,系统自动将输入转换成大写。输入完成后,系统会校
 验该合约是否合法,主要判断其是当前可以进行期转现交易的期货合约,同
 时在价格(元)下方显示合约当日的涨跌停板价格。

	* 合约代码: TF1809
b)	价格 (元): 文本输入,价格必须在涨跌停板范围内。
	* 价格(元): 100
	涨停:103.01 跌停:98.19
c)	买卖方向,默认为卖方,无需用户编辑。
	* 买卖方向: 卖 🔹
d)	数量 (手): 文本输入,必须输入正整数。
	*数量(手): 1
e)	开平标识: 下拉列表, 列表中可以选择开或者平。
	*开平标志: 请选择开平标志 🔺
	Ŧ

5、有价证券或相关合约(简称现货)交易信息填写,根据期转现规则,一笔期转现交 易中的现货交易可以是1笔或多笔,可以通过"添加"、"删除"按钮进行管理。

₽

有价证券或相关合约交	易信息									
现货类型:	🔵 债券 💿 债券远期									
· * P.47	also and the later of the state	· ethologie m	07700400004000004	• =		• • TANJAR MA (2)	101701		00100011	H
- xx+80+80441 :	中国外汇交易中心	- 1060CMM-55 ;	CB120180621000001	初山使列间初;	国債1701	杨山康9月5	101701	11月11月1日日 :	20180911	
• 买卖方向:	 ₹ ▼	*券面总额(万):	100	*净价(元):	99.98	*成交日期:	20180621			
									+ 汤加	0.899
* 交易场所:	中国外汇交易中心	*成交编号:	CBT20180621000002	*标的债券简称:	国债1702	*标的债券代码:	国债1702	*结算日期:	20180925	
						1 - H - T - T - H - T				
• 天实方问:	矢 ▼	"芬國思設(万):	100	"净价(元):	98	* 成交日期:	20180621			
									+ iābu	0 898

a) 现货类型,可以选择债券或者债券远期,目前国债期货期转现的现货交易的 债券范围是利率债,债券远期则是以利率债为标的的远期合约,债券远期交 易相比债券交易多一个结算日期。一笔期转现交易中的现货类型只能有一种。

现货类型: 💿 债券 🔵 债券远期

b) 交易场所,下拉列表,列表中可选择的有中国外汇交易中心、上海证券交易 所、深圳证券交易所。

* 交易场所:	中国外汇交易中心 🔺
* 买卖方向:	中国外汇交易中心
	上海证券交易所
	深圳证券交易所

c) 成交编号,文本输入,现货交易在现货交易场所的成交编号。一笔现货交易 只能参与一笔期转现交易,系统会根据成交编号、成交日期、交易场所联合 进行防重复性检查。

* 成交编号:

CBT20180621000001

d) 债券代码(如果债券类型选择"债券远期",则为标的债券代码):如果期现 货匹配方法选择的是"面值匹配",则此处只能输入期货交易合约代码的可交 割券的代码。系统提供债券代码模糊匹配的功能,供用户快速选择。

*债券代码:	180016
*净价(元):	180016-18附息

如果用户输入的债券代码经系统检查不是符合规则要求的债券,则系统会显

示"解释说明与承诺"的输入框让用户填写说明:

* 债券代码:	18009	* 债券简称:	请输入债券简称
解释说明与承诺:	债券【18009】未通过检查 转现交易规则要求。	,请解释说明并	<mark>清輸入债券简称</mark> 承诺此债券符合中金所期
	转现交易规则要求。		

如果用户发现是自己债券代码输入错误,更正后,解释框就会消失,如果用户确认债券代码正确,怀疑系统检查有误,填写说明后不影响申报创建。

e) 选中债券代码后,系统自动将债券的简称填充在此处。

	* 债券代码:	1800	16	* 债券	简称:	18附息国债16	
f)	买卖方向,无需	填写,	默认为买。				
	* 买卖方向:	买		•			
g)	券面总额 (万),	文本	俞入。				
	*券面总额(万) :	100				

h) 净价 (元): 文本输入,现货交易的成交价。

*净价(元):

99.98	

i) 成交日期,现货交易的成交日期,必须与协商一致日期相同。如果有多笔现 货交易,成交日期全部相同。

	~~ •	<	2018	3年	6月)	> >>
	日	_	=	Ξ	四	五	六
	27				31	1	2
	3	4	5	6	7	8	9
	10	11	12	13	14	15	16
	17	18	19	20	21	22	23
	24	25	26	27	28	29	30
*债券代码:	1	2		4			7
* 成交日期:	20180)621					

j) 结算日期,现货类型选中"债券远期"时,需要填写本字段,该日期不能小 于期货交易合约代码的最后交易日。



3.2 查询申报

可以对当前用户创建的申报信息进行查询、查看详情、撤销、删除、重新申报操作。

3.2.1 查询

功能描述:

根据查询条件查看申报。

操作说明:

1、点击菜单,进入页面,根据默认条件查出当前用户提交的国债期货期转现申报。也

可以修改查询条件,点击

Q 按钮查询申报。

2、可以根据申报编号、申报时间进行排序调整。

💑 中金所 协商交易平	2台											92030
□ 與使用沒常给取 ^ 畫 位置:/ 關係用於物始說 / 查用中班												
■ 堕询申报												
+ 创建申报	申报开始日期:	请选择日期	□ 申报	結束日期: 请选择日	期	□ 产品号:	请选择	-	合约号:		申报状态:	
✓ 書以前盤 其器集 10 動质 => ○ (1 2 3)								23)前往1				
	申报编号 ≎	申报时间 ⇔	确认禁止时间	会员	客户	对手方交易员	合约号	价格	教室	申报状态	动期	編作
▲ 个人中心 ∨	68	20181024 10:12:46	20181024 11:12:46	2016-国联期线	00009203-T EST0000920 3	920401-920401	TF1812	100	1	申报		0.15週 中部州
	67	20181024 10:05:09	20181024 11:05:09	2016-国联期货	00009203-T EST0000920 3	920401-920401	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	0 详错

- 3、所有申报都可以点击"详情"查看详细信息。
- 4、申报状态为"申报"的申报,可以进行"撤销"操作。
- 5、申报状态为"交易失败"的申报,可以进行"重新申报"操作。
- 6、申报状态为"撤销"的申报,可以进行"删除"操作。

3.2.2 详情

功能描述:

查看期转现申报详细信息。

操作说明:

- 1、从申报查询结果中,点击对应
 ↓ 详情
 详情。
- 2、点击 返回 反回主界面。

3.2.3 撤销

功能描述:

"申报"状态的申报可以撤销,即一旦对手方确认后,就不可以撤销。

操作说明:

1、从申报查询结果中,点击对应 按钮,弹出撤销申报确认对话框。



操作说明:

删除成功! 取消 3、 按钮,取消删除操作,返回到主界面,并提示: 点击 取消删除! 4、如果撤销的同时,对手方进行了申报的确认操作,则会撤销失败,提示: × 申报无法被撤销! ×

重新申报 3.2.5

功能描述:

已经交易失败的申报,可以进行重新申报操作,主要是为了方便用户对于某些输入错误 导致交易失败时,可以高效地重新申报。

金融期货协商交易平台申报端软件(版本: V1.00)

操作说明:

1、从申报查询结果中,点击对应 发钮,进入重新申报页面:

位置: / 国债期货期转现	/ 创建申报					
交易时间及交易双方信	息(期货合约卖方录入)					
•协商一致日期:	20180621	·协商一致时间:	17:26:31 ③	货币经纪公司(若有):	请输入货币经纪公司名称	
* 会员:	2032 - 东海期货	▼ * 客户:	00009208 🐨	*对手方交易员:	dzqh6-张铁柱	
期现货匹配方法: 💿	风脸匹配 🔵 面值匹配					
期货合约交易信息						
* 合约代码:	TF1809	*价格(元):	99	* 买卖方向:	ĝ. ▼	
			<u>张</u> 傳:103.01 跌傳:98.19			
* 数量 (手) :	1	*开平标志:	₹ *			
有价证券或相关合约交	易信息					
现货类型:	● 债券 🦳 债券远期					
*交易场所:	上海证券交易所 🔍	* 成交编号: 1	* 债券简称	: 1	* 债券代码: 1	
* 买卖方向:	卖 🔻	* 券面总额 (万) : 1	*净价(元)	: 1	*成交日期: 20180621	Ċ.
						+165m

 2、页面中,根据之前交易失败的申报信息已经自动填写了申报要素,用户根据需要对 信息进行编辑,输入规则同创建申报,后续操作也同创建申报。

3.3 确认申报

期货买方交易员对卖方提交的申报信息进行确认,并填写本方信息,确认申报。

3.3.1 查询

功能描述:

根据查询条件查看申报。

操作说明:

1、点击菜单,进入页面,根据默认条件查出当前用户可以确认或者已经确认的期转现

申报。也可以修改查询条件,点击按钮查询申报。

2、可以根据申报编号、申报时间进行排序调整。

	2台												920301
国债期货期转现 ^	位置:/国债期	8 期转现 / 确认申报											
圖 查询中报													
+ 创建申报	申报开始日期:	通送择日期	□ 申扬	結束日期: 過逝	峰日期	2 产品	号: 通选择		• i	自约号:	申	假状态:	~ •
✔ 确认申报													
i 备案机构名单											共4条 10 象	质 👻 🤇 1 🔿	前往 1
	申报编号 ≎	कार्यव्यक्त 🗈	输入数止时间	会员	進力	対手方を易尽	合約是	4048	80.03		144.80		
A. (mo.)			P T T T T T T T T T T T				6095		ADX HE	H11998-477-62	6,62,88,9	38115	
个人中心 💙	59	20181016	20181016		-	920401-920401	TF1812	100	1	甲腺(K 6) 超时	NGRS	深和F 译版	
个人中心 ∨	59 50	20181016 10:12:24 20181008 09:30:26	20181016 11:12:24 20181008 10:20:26			920401-920401 920401-920401	TF1812	100	*0X.88.	申編状 (2) 超时 超时	sang	3841: 14 45 14 15	
个人中心 🗸	59 50 49	20181016 10:12:24 20181008 09:30:26 20180928 09:34:01	20181016 11:12:24 20181008 10:30:26 20180928 10:34:01	2016-国联朗 战	00009203-T EST0000920 3	920401-920401 920401-920401 920401-920401	TF1812 TF1812 TF1812	100 100 100	1 1 1	 申載状心 超时 超时 交易失敗 	交易检查失敗:合 約1F1812已収量	38115 1915 1915 1915	

3、申报状态为"申报"的申报,可以进行"查看详情并确认"操作。

4、其他申报状态的申报,可以进行查看"详情"操作。

3.3.2 查看详情并确认

功能描述:

期货买方交易员查看申报信息详情并进行确认。申报确认必须在申报确认截止时间之前, 否则就会被设置为"超时"。

操作说明:

☑ 查看详情并确认

1、从申报查询结果中,点击对应 2244 所知 按钮,进入确认申报页面:

2、页面中,可以查看到除了卖方的会员、客户、开平标志的其他所有信息。

3、输入本方的会员、客户、开平标志:

* 会员:	请说	选择会员 🔺				
	203	32 - 东海期货				
*客户:	00	0009210 - TEST0000921 🔺				
	00	0009210 - TEST00009210				
*开平标志	::	请选择开平标志				
		开				
		푸				



功能描述:

查看期转现申报详细信息。

操作说明:

 1、从申报查询结果中,点击对应
 ●详情 按钮,进入申报详情界面,查看申报信息
 详情。

	1000100-1000 FT0 0000			Laboration and an other states							+1910+1	
明经开划1日期:	请选择日期		甲胺结束日期:	请远译日期		产品号:	育适择	Ψ.	首约号:		甲报状态:	Ψ
											共1条 10条/页 🔻	〈 1 〉 前往
申报编号 令	申报时间 ≑	确认截止时 问	会员	客户	对手方交易 员	合约号	价楷	数量	申报状态	说明	操作	
85	20180621 15:28:17	20180622 10:15:00	2032-东海期 货	00009210-T EST0000921	zxqh8-陈明	TF1809	100	2	已确认		详慎	

2、点击 返回 反回主界面。

3.4 备案机构名单

3.4.1 查询

功能描述:

查看所有备案通过的机构名单。

操作说明:

1、打开菜单,显示名单信息,如下:

≡	位置:/目	期货期转现 / 备案机构名单
		国债期货期转现交易机构备案名单
	序号	机构名称
	1	TEST00009201机构
	2	TEST00009203机构
	3	TEST00009204机构
	4	TEST00009207机构
	5	TEST00009215机构
	6	TEST00009210机构

第4章 个人信息

本部分主要描述个人信息、修改密码相关操作。

4.1 个人信息

功能描述:

查看当前登录用户个人信息。

操作说明:

1、点击菜单,进入页面,查看个人信息。

位置: 个人中心 /	个人信息
🗴 请修改登录密码和交	易密码!(点击前往)
用户代码:	testzs
姓名:	张三
电子邮件:	zs@test.com.cn
电话号码:	021-8888999
身份证号:	310001199101010099
机构名称:	test证券

4.2 修改登录密码

功能描述:

2,

修改当前用户进行协商交易的协商交易平台登录密码。用户使用账户初始密码时不能创 建申报、确认申报,需要修改了初始密码之后才可以进行创建申报、确认申报的相关操作。 操作说明:

1、具有创建申报、确认申报菜单权限的用户使用初始密码登录系统时,系统会提示:

	🛛 诸修改登	绿密码和交易密码!(点击前往)
点 面	开上面链接,进	入修改登录密码页面,或者直接点击修改登录密码菜单进入本页
	🔀 请修改登录密码	和交易密码!(点击前往)
	*旧登录密码:	请输入旧登录密码
	*新登录密码:	至少8位,需同时包含大写字母、小写字母、数字与特殊字符
	*确认登录密码:	请再次输入新登录密码
		确认修改重置

- 3、用户输入旧登录密码,新登录密码并确认新登录密码,登录密码的设置规则为:
 至少8位,需同时包含大写字母、小写字母、数字与特殊字符。
- 4、点击 ,系统弹出如下的密码修改确认对话框,用户点击"确认"后

提交登录密码修改。

提示			×
0	确定要修改登录密码吗?		- 1
		确定	取消

5、密码修改成功后,将跳转到登录界面,用户重新登录系统。

6、初始登录密码被修改后,该提示
★ 请修改登录密码 消失。

4.3 修改交易密码

功能描述:

修改或者设置当前用户进行协商交易的交易密码。账户初始状态时是没有设置交易密码 的,系统在有协商交易权限的用户登录系统时,会提醒其修改交易密码。如果没有设置交易 密码,则不能创建申报、确认申报等。

用户也可以根据自己的需要对交易密码进行修改。

操作说明:

1、点开菜单,进入修改交易密码页面,如果没有设置交易密码则会看到如下界面:

🗴 请修改交易密码!	(点击前往)
* 新交易密码:	请输入新交易密码
* 确认交易密码:	请确认新交易密码
	确认修改 重置

2、用户输入交易密码,并进行二次数据以确认密码输入正确,交易密码设置为6位数

字。点击 确认修改 提交交易密码修改。

如果用户之前设置过交易密码,进行修改时除了新的交易密码,还需要输入旧的交易密码。

	Ξ	位置: / 个人中心	心 / 修改登录密码		
		*旧登录密码:	请输入旧登录密码		
		*新登录密码:	至少8位,需同时包含大写字母、小写字母、数字与特殊字符		
		* 确认登录密码:	请再次输入新登录密码		
			确认修改 重置		
4,	交	易密码设置后,	중 法修改交易密码 ! (点击前往) 该提示 消失。		