

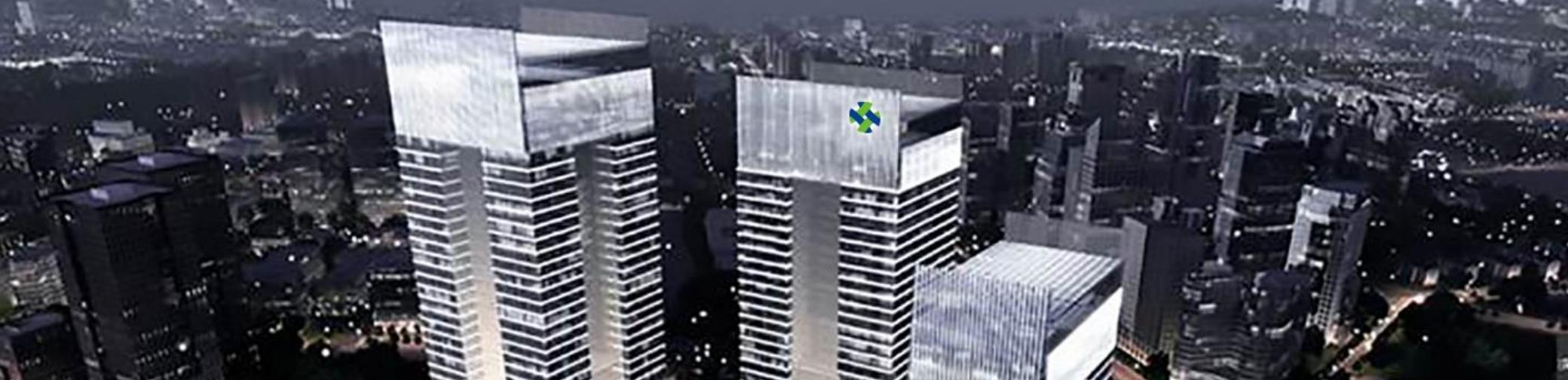


中国金融期货交易所
China Financial Futures Exchange

国债期货期转现货交易

业务操作

2019.01



◆ 交易前准备 ◆

数字证书、柜台升级、备案、用户管理

◆ 交 易 ◆

卖方申报、买方确认、交易结果查看

◆ 注意事项 ◆

会员、客户重点提示、仿真交易



中国金融期货交易所
China Financial Futures Exchange

01

交易前准备

柜台升级、备案
数字证书、用户管理

(客户)

申请流程

申请表

中金所期转现

1. 申请材料:

- ① 填写申请表，填完打印出来后在表格上方空白处手工写上“中金所期转现”字样，
- ② 经办人身份证复印件
- ③ 营业执照复印件，
- ④ 以上材料均需盖章。

2. 缴费

3. 快递给上海CA

4. 收取数字证书



上海CA机构数字证书（具体以收到实物为准）

- 下载地址：中金所官网首页--服务—投资者服务--创新专栏--期转现交易--业务操作—上海CA数字证书申请
- 提醒：收到数字证书后，妥善保管证书序列号及密码信封序列号。
如有疑问，请联系上海CA客服进行咨询
- 建议：为了防止因为证书损毁或者遗失而影响交易，交易各家机构在证书数量上当尽量考量余量。

SHECA 单位数字证书受理表

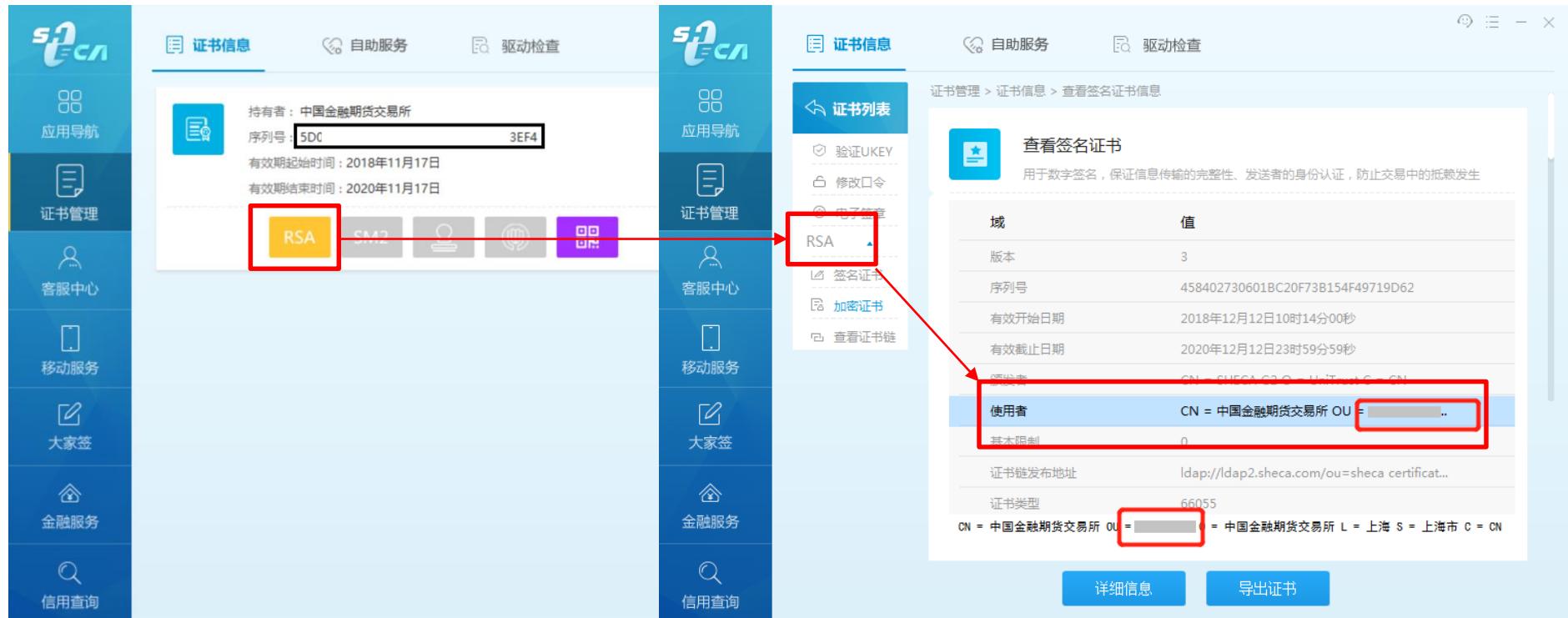
第一联 受理机构保存联

No (D)

| 请选择服务类型，并在对应的栏目中打“√”： | | 请选择证书种类，并在对应的栏目中打“√”： | |
|--|-------------------------------|---|-----------------------------------|
| <input type="checkbox"/> 证书申请 | <input type="checkbox"/> 证书更新 | <input type="checkbox"/> 单位身份证证书 | <input type="checkbox"/> 单位代码签名证书 |
| <input type="checkbox"/> 证书吊销 | <input type="checkbox"/> 其他 | <input type="checkbox"/> 其他 | |
| 单位基本信息： | | | |
| 申请单位名称：----- | | 单位性质： <input type="checkbox"/> 企业 <input type="checkbox"/> 事业 | |
| 单位邮政地址：----- | | 邮政编码：□□□□□□ | |
| 统一社会信用代码号：□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□ | | | |
| 组织机构代码证号：□□□□□□□□□□ | | | |
| 办理人信息： | | | |
| 姓名：----- 身份证号码：----- | | | |
| 联系电话：----- 传真：----- 电子邮箱地址：----- | | | |
| 用户须知： | | | |
| ● 用户在申请时，需携带以下证件的原件及复印件（复印件需加盖申请单位公章）。 | | | |

数字证书支持软件安装

- 根据上海CA要求，使用数字证书前，需安装支持软件：协卡助手、根证书，具体操作详见中金所官网首页>服务>投资者服务>创新专栏>期转现交易>业务操作--上海CA数字证书相关支持软件安装指南。
- 安装完成后，将数字证书插入电脑，可以查看证书信息，检查证书的各项信息是否正确，尤其是组织机构代码。



The screenshot shows two pages from the Shanghai CA digital certificate management system:

- Left Page (证书信息 - Certificate Information):** Displays basic certificate details: Holder: China Financial Futures Exchange, Serial Number: 5DC 3EF4, Valid From: November 17, 2018, Valid To: November 17, 2020. A yellow box highlights the "RSA" button.
- Right Page (证书列表 - Certificate List):** Shows a list of certificates. The "RSA" certificate is selected and highlighted with a red box. A red arrow points from the "RSA" button on the left to the selected certificate in the list.
- Bottom Right Page (查看签名证书 - View Signature Certificate):** Provides detailed certificate information. The "使用者" (User) section is highlighted with a red box and contains the text: CN = 中国金融期货交易所 OU = [REDACTED] L = 上海 S = 上海市 C = CN.

使用数字证书登录协商交易平台

- 推荐用户使用chrome、搜狗、360等浏览器访问协商交易平台。
- 打开浏览器，在地址栏输入<https://obt.cffex.com.cn>，浏览器会弹出如下的证书选择窗口，选中正确的证书并点击“确认”
- 输入数字证书设备密码，验证通过后即可打开协商交易平台登录页面。

USBKey存储区1用户密码

请输入用户密码(8-16个字符)

密码:

 确定 取消 



- 输入用户名、密码，点击登录进入系统。
- 登录成功后，数字证书可拔下，安全会话时间持续4小时。如果关闭浏览器、重启电脑后，需要重新插入数字证书进行登录。



协商交易API是中金所提供的会员交易系统的一个应用程序接口，开发商会基于本接口开发功能，以支持国债期货期转现交易申报的风控检查确认及相关功能。

该接口目前为我所唯一接受的、可以对客户期转现申报进行风控检查的数据交互接口。

会员交易系统使用的协商交易API版本得是**1.0**版本。

会员系统版本信息需要在会员备案材料中填写准确，我所将为其开通连接协商交易平台的网络策略。

① 会员服务系统——期转现

- 会员服务系统的期转现模块为国债期货期转现交易提供备案功能。目前模块权限分配给结算会员。
- 会员会服管理员将权限分配给业务操作用户。

The screenshot shows the login interface for the CFFEX Member Service System. On the left, the 'User Login' (USER LOGON) form is displayed, featuring fields for 'Login Method' (选择登陆方式), 'Username' (用户名), and a 'Login' (LOGIN) button. Above the form, there are links for 'Latest Transaction Data File' (最新成交数据文件) and 'Latest Settlement Data File' (最新结算数据文件). On the right, a sidebar menu titled 'Periodic Transfer' (期转现) lists three options: 'Member Record Filing' (会员备案), 'Institution Record Filing' (机构备案), and 'Client Periodic Transfer Seat Allocation Filing' (客户期转现席位报备).

② 会员备案——备案

- 会员备案成功后，才可以向客户提供期转现服务。

中国金融期货交易所
China Financial Futures Exchange

期权执行申请管理
套利管理
套期保值
个人服务
国债期货交割管理
用户管理
程序化交易报备管理
信息上报
交易控制服务
会员大户报告
客户相关
每日报表
套保套利交易监管
期转现
会员备案
机构备案
客户期转现席位报备

系统管理
投资者适当性
国债交割管理

会员备案管理
备案 取消备案 刷新

| 申请号 | 申请日期 | 产品组 | 业务类型 | 申请类型 | 上传材料 | 申请状态 | 备注 | 备案成功日期 | 取消备案日期 |
|-----|------|-----|------|------|------|------|----|--------|--------|
| | | | | | | | | | |

版本: MSFront_V1.186 会员: 2032 简称: 东海期货 欢迎 2032会员操作账号 登录 注销

共0页|第1页 跳转

版权所有:中国金融期货交易所

③ 会员备案——备案

- 根据实际情况，提交备案材料。只能上传pdf、doc、docx格式的文档，每个文档不能超过2M。如果添加补充材料，最多不能超过10个文件。
- 会员可下载模板文件进行参考。
 - 若会员有多套系统做期转现，可复制模板中相应内容逐一填写。

新增会员备案

| | | | |
|--|----|------------------------|----------------------|
| 基本信息 | | | |
| 产品组： <select>1-国债期货</select> 业务类型： <select>1-期转现</select> | | | |
| 上传材料 | | | |
| <input type="checkbox"/> 添加补充材料 | | | |
| 文件类型名称 | 文件 | 操作 | 备注 |
| 期转现会员备案申请书* | | +上传 删除 | 下载模板 |
| 期转现业务准备情况说明书* | | +上传 删除 | 下载模板 |
| 提交 取消 | | | |

- 备案成功的会员信息，将于下一交易日在中金所官网展示：首页--服务--会员服务--期转现会员信息。

④ 会员备案——取消备案

- 会员提交取消备案申请后，即不可向客户提供期转现服务。若其代理客户继续创建或确认申报，将交易失败。

The screenshot shows the CFFEX member service system interface. On the left, a vertical navigation bar lists various modules: Option Execution Application Management, Settlement Management, Margin Management, Individual Services, Bond Futures Settlement Management, User Management, Programmatic Transaction Reporting Management, Information Reporting, Transaction Control Services, Member Large Account Reports, Client Related, Daily Report, Margin Settlement Monitoring, Margin Transfer, Member Margin, Institution Margin, and Client Margin Transfer Seat Reporting. The 'Margin Transfer' module is highlighted in blue, and the 'Member Margin' sub-module is selected, indicated by a red box.

The main content area displays a table titled 'Margin Application Management'. The table has columns: Application Number (申请号), Application Date (申请日期), Product Group (产品组), Business Type (业务类型), Application Type (申请类型), Upload Materials (上传材料), Application Status (申请状态), Remarks (备注), Success Date (备案成功日期), and Cancellation Date (取消备案日期). A single row is shown:

| 申请号 | 申请日期 | 产品组 | 业务类型 | 申请类型 | 上传材料 | 申请状态 | 备注 | 备案成功日期 | 取消备案日期 |
|-----|----------|------|------|------|--|------|----|--------|--------|
| 24 | 20181023 | 国债期货 | 期转现 | 会员备案 | XX公司国债期货期转现会员备案申请书.docx XX公司国债期货期转现业务准备情况说明书.docx | 成功 | | | |

At the top right of the main area, there are status messages: Version: MSFront_V1.186, Member: 2032, Short Name: Donghai Futures, Welcome 2032 Member Operation Center, Log In, and Logout. Below the table, there are buttons for 'Page 1/1' and 'Jump'.

At the bottom center, the copyright notice is: 版权所有：中国金融期货交易所 (Copyright © China Financial Futures Exchange).

⑤ 会员备案——取消备案

- 根据实际情况，提交取消备案材料。只能上传pdf、doc、docx格式的文档，每个文档不能超过2M。如果添加补充材料，最多不能超过10个文件。
- 交易所不提供会员取消备案情况说明书模板，会员根据实际情况填写。

取消会员备案

基本信息

产品组： 1-国债期货 *
业务类型： 1-期转现 *

上传材料

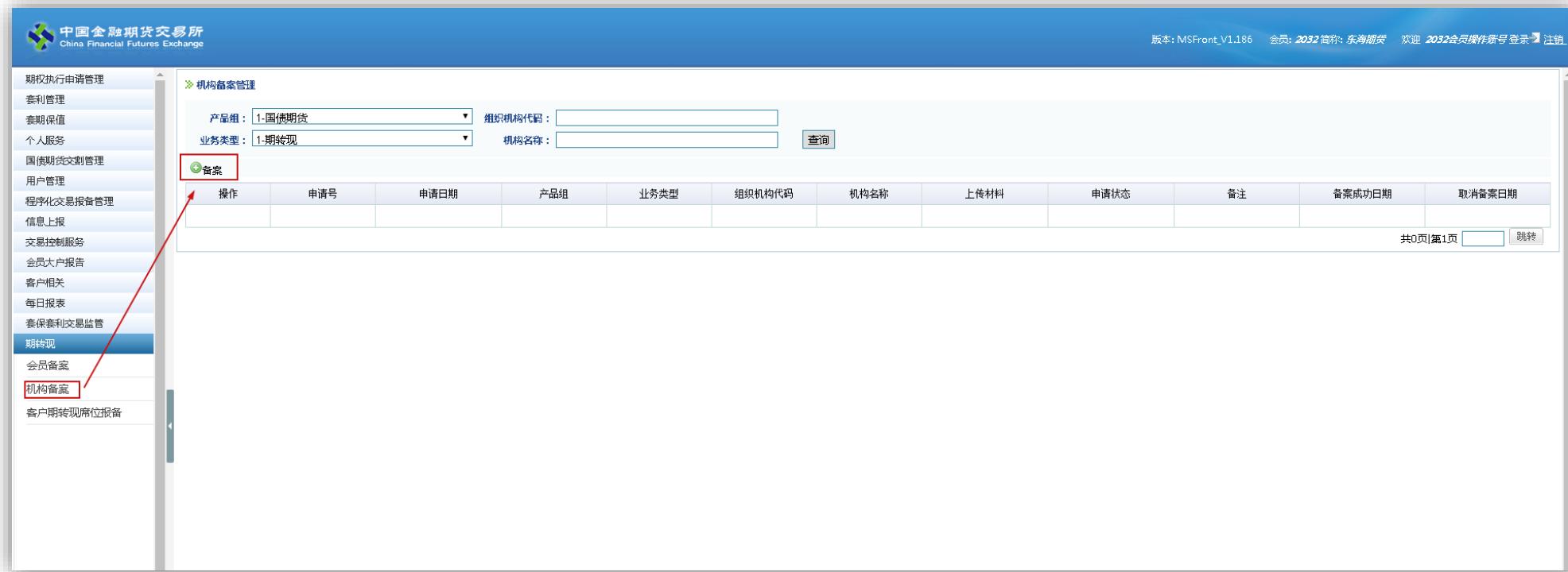
添加补充材料

| 文件类型名称 | 文件 | 操作 | 备注 |
|---------------|----|---------|----|
| 取消期转现备案情况说明书* | | +上传 -删除 | |

提交 取消

① 机构备案——备案

- 参与国债期货期转现交易的客户，以机构为单位，通过会员向交易所提交备案材料。
- 一个机构备案成功后，其下以备案的组织机构代码在中金所开户的、符合国债期货期转现交易规则要求客户类型的客户编码，均可在当前会员下进行国债期货期转现交易业务。



The screenshot shows the CFFEX institutional filing management system. The left sidebar has a blue header '期转现' (Institutional Filing) with several sub-options: '会员备案' (Member Filing), '机构备案' (Institutional Filing), and '客户期转现席位报备' (Customer Institutional Filing Seat Reporting). The '机构备案' option is highlighted with a red box and has a red arrow pointing to it from the bottom-left. The main area is titled '机构备案管理' (Institutional Filing Management) and contains a search form with dropdowns for '产品组' (Product Group) set to '1-国债期货' (Government Bond Futures), '组织机构代码' (Organization Code), '业务类型' (Business Type) set to '1-期转现' (Institutional Filing), and '机构名称' (Institution Name). Below the search form is a table with columns: 操作 (Operation), 申请号 (Application Number), 申请日期 (Application Date), 产品组 (Product Group), 业务类型 (Business Type), 组织机构代码 (Organization Code), 机构名称 (Institution Name), 上传材料 (Upload Material), 申请状态 (Application Status), 备注 (Remarks), 备案成功日期 (Filing Success Date), and 取消备案日期 (Cancel Filing Date). The table currently displays one row of data. At the bottom right of the table, there are buttons for '共0页|第1页' (Page 1 of 0) and '跳转' (Jump).

- 备案成功的机构信息，将于下一交易日在协商交易平台--国债期货期转现--备案机构名单展示。

② 机构备案——备案

- 组织机构代码：
 - 特殊单位客户为合格境外机构投资者或者人民币合格境外机构投资者的，填写特殊机构代码。
 - 如为资管客户进行机构备案，此处填写会员的组织机构代码。并且会员一旦备案自己的组织机构代码，该会员下所有资管客户均可进行国债期货期转现交易。
- 根据实际情况，提交机构备案材料。只能上传pdf、doc、docx格式的文档，每个文档不能超过2M。如果添加补充材料，最多不能超过10个文件。
- 会员可下载模板文件，对客户提交的材料进行检查。
- 机构备案成功后，发送邮件到tech_support@cffex.com.cn获取机构管理账户。

新增机构备案

基本信息

| | | |
|----------|--|---|
| 产品组 : | 1-国债期货 | * |
| 业务类型 : | 1-期转现 | * |
| 组织机构代码 : | <input type="text"/> <div style="border: 1px solid red; padding: 2px;">注意: 1、特殊单位客户为合格境外机构投资者或者人民币合格境外机构投资者的，填写特殊机构代码。 2、如为资管客户进行机构备案，此处填写会员的组织机构代码。</div> | |
| 机构名称 : | | |

上传材料

 [添加补充材料](#)

| 文件类型名称 | 文件 | 操作 | 备注 |
|---|----|---------|----------------------|
| 会员提供期转现交易服务承诺书 (或期转现交易服务承诺的经纪服务合同) * | | +上传 -删除 | 下载模板 |
| 机构备案申请书* | | +上传 -删除 | 下载模板 |

③ 机构备案——取消备案

- 会员提交机构的取消备案申请后，该机构在当前会员下的客户即刻不能进行期转现交易。
- 会员取消机构备案无需上传文件，点击机构备案记录对应的“取消备案”链接即可进行操作。

中国金融期货交易所
China Financial Futures Exchange

版本：MSFront_V1.186 会员：2032 简称：东海期货 欢迎 2032会员操作账号 登录 [注销](#)

| 期权执行申请管理 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-----|----------|------|------|----------|----------------|--|------|----|----------|--------|----|-----|------|-----|------|--------|------|------|------|----|--------|--------|----------------------|----|----------|------|-----|----------|----------------|--|------|--|----------|--|
| 套利管理 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 套保保值 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 个人服务 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 国债期货交割管理 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 用户管理 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 程序化交易报备管理 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 信息上报 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 交易控制服务 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 会员大户报告 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 客户相关 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 每日报表 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 套保套利交易监管 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 期转现 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 会员备案 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 机构备案 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 客户期转现席位报备 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 机构备案管理 <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="flex: 1;"> 产品组：<select>1-国债期货</select> 组织机构代码：<input type="text"/> 业务类型：<select>1-期转现</select> 机构名称：<input type="text"/> <button>查询</button> </div> <div style="flex: 1;"></div> </div> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 备案 <table border="1"> <thead> <tr> <th>操作</th> <th>申请号</th> <th>申请日期</th> <th>产品组</th> <th>业务类型</th> <th>组织机构代码</th> <th>机构名称</th> <th>上传材料</th> <th>申请状态</th> <th>备注</th> <th>备案成功日期</th> <th>取消备案日期</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取消备案</td> <td>25</td> <td>20181112</td> <td>国债期货</td> <td>期转现</td> <td>00009201</td> <td>TEST00009201机构</td> <td> XX公司会员提供期转现交易服务承诺书.docx XX公司国债期货期转现机构备案申请书.docx </td> <td>备案成功</td> <td></td> <td>20181113</td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>共1页 第1页 <input type="checkbox"/> 跳转</p> | | | | | | | | | | | | 操作 | 申请号 | 申请日期 | 产品组 | 业务类型 | 组织机构代码 | 机构名称 | 上传材料 | 申请状态 | 备注 | 备案成功日期 | 取消备案日期 | 取消备案 | 25 | 20181112 | 国债期货 | 期转现 | 00009201 | TEST00009201机构 | XX公司会员提供期转现交易服务承诺书.docx XX公司国债期货期转现机构备案申请书.docx | 备案成功 | | 20181113 | |
| 操作 | 申请号 | 申请日期 | 产品组 | 业务类型 | 组织机构代码 | 机构名称 | 上传材料 | 申请状态 | 备注 | 备案成功日期 | 取消备案日期 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 取消备案 | 25 | 20181112 | 国债期货 | 期转现 | 00009201 | TEST00009201机构 | XX公司会员提供期转现交易服务承诺书.docx XX公司国债期货期转现机构备案申请书.docx | 备案成功 | | 20181113 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

来自网页的消息

是否确认执行取消备案？

确定 取消

| 机构备案管理 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-----|----------|------|------|----------|----------------|--|----------------------|----|--------|----------|----|-----|------|-----|------|--------|------|------|------|----|--------|--------|--|----|----------|------|-----|----------|----------------|--|----------------------|--|--|----------|
| 产品组： <select>1-国债期货</select> 组织机构代码： <input type="text"/> 业务类型： <select>1-期转现</select> 机构名称： <input type="text"/> <button>查询</button> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 备案 <table border="1"> <thead> <tr> <th>操作</th> <th>申请号</th> <th>申请日期</th> <th>产品组</th> <th>业务类型</th> <th>组织机构代码</th> <th>机构名称</th> <th>上传材料</th> <th>申请状态</th> <th>备注</th> <th>备案成功日期</th> <th>取消备案日期</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>25</td> <td>20181112</td> <td>国债期货</td> <td>期转现</td> <td>00009201</td> <td>TEST00009201机构</td> <td> XX公司会员提供期转现交易服务承诺书.docx XX公司国债期货期转现机构备案申请书.docx </td> <td>取消备案</td> <td></td> <td></td> <td>20181024</td> </tr> </tbody> </table> <p>共1页 第1页 <input type="checkbox"/> 跳转</p> | | | | | | | | | | | | 操作 | 申请号 | 申请日期 | 产品组 | 业务类型 | 组织机构代码 | 机构名称 | 上传材料 | 申请状态 | 备注 | 备案成功日期 | 取消备案日期 | | 25 | 20181112 | 国债期货 | 期转现 | 00009201 | TEST00009201机构 | XX公司会员提供期转现交易服务承诺书.docx XX公司国债期货期转现机构备案申请书.docx | 取消备案 | | | 20181024 |
| 操作 | 申请号 | 申请日期 | 产品组 | 业务类型 | 组织机构代码 | 机构名称 | 上传材料 | 申请状态 | 备注 | 备案成功日期 | 取消备案日期 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 25 | 20181112 | 国债期货 | 期转现 | 00009201 | TEST00009201机构 | XX公司会员提供期转现交易服务承诺书.docx XX公司国债期货期转现机构备案申请书.docx | 取消备案 | | | 20181024 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

① 客户期转现席位报备

- 当前会员下的一个客户只能备案一个席位。即会员的一个客户的期转现申报，只会让通过该席位登录协商交易平台的会员交易系统进行风控检查。会员业务人员当与技术人员共同确定。
- 会员输入客户号后，系统自动载入客户名称以及客户的证件号码，以便会员进行信息核对。

中国金融期货交易所
China Financial Futures Exchange

期权执行申请管理
套利管理
套期保值
个人服务
国债期货交割管理
用户管理
程序化交易报备管理
信息上报
交易控制服务
会员大户报告
客户相关
每日报表
套保套利交易监管
期转现
会员备案
机构备案
客户期转现席位报备

版本：MSFront_V1.186 会员：2032 简称：东财期货 欢迎 2032会员操作账号 登录 | 注销

客户期转现席位报备

| 客户号 | 客户名称 | 席位号 | 操作员 | 操作日期 | 操作时间 |
|----------|--------------|--------|---------|----------|----------|
| 00009204 | TEST00009204 | 203201 | 2032Mid | 20181010 | 13:51:05 |

共1页 第1页 1 跳转

客户期转现席位报备-新增

新增客户期转现席位

| | |
|-------|--------------|
| 客户号: | 00009201 |
| 客户名称: | TEST00009201 |
| 证件号码: | 00009201 |
| 席位号: | |

保存 取消

② 客户期转现席位报备

- 如有需要，会员可以修改备案席位，交易所端实时生效，会员需保证修改后的席位正常登录协商交易平台。

客户期转现席位报备-修改

| 修改客户期转现席位 | |
|---|----------|
| 客户号: | 00009204 |
| 席位号: | 203201 |
| <input type="button" value="保存"/> <input type="button" value="关闭"/> | |

- 如果客户不再做国债期货期转现交易，也可以删除对应的客户席位报备。



机构管理员账户：交易所分配、机构内部账户管理

(客户)

获取账户

会员替机构备案成功后

- 交易所会为机构创建管理员账户，
- 并将机构管理员账户信息发给会员，
- 会员将机构管理员账户转交给机构指定机构管理员。

验证账户

机构管理员获取账户后

- 使用用户名、密码及数字证书登录协商交易平台；
- 如右图分别检查用户组、用户、角色的数据情况，如有异样应及时通过会员向交易所反馈，以排查账户安全情况；
- 修改初始登录密码，并妥善保管好密码；**
- 如果机构管理员密码忘记或者被恶意篡改，需通过会员向交易所提交密码修改申请。
- 如果是机构自行创建的用户密码忘记，可由创建账户或相应管理员账户修改即可。

The screenshot shows the 'User Group Management' section of the platform. A red box highlights the 'User Group Management' tab in the sidebar. A red arrow points from the 'User Group Management' tab to the 'User Group List' table. The table has columns: User Group Code, User Group Name, Operator, Operation Date, Operation Time, and Operation. One row is visible: User Group Code 'CX', User Group Name '测试公司', Operator 'ADMIN', Operation Date '20181026', Operation Time '14:48:59'. A red speech bubble on the right says: '只有一个用户组 并且操作人为 ADMIN'.

The screenshot shows the 'User Management' section of the platform. A red box highlights the 'User Management' tab in the sidebar. A red speech bubble on the right says: '没有用户'. The table below has columns: User Code, User Name, Email, Phone Number, ID Card Number, User Status, Authentication Method, Operator, Operation Date, Operation Time, and Operation. It displays '暂无数据'.

The screenshot shows the 'Role Management' section of the platform. A red box highlights the 'Role Management' tab in the sidebar. A red speech bubble on the right says: '没有角色'. The table below has columns: Role Code, Role Name, User Group Name, Operator, Operation Date, Operation Time, and Operation. It displays '暂无数据'.

用户组管理： 实现机构内部的分层用户管理：创建、分配权限、修改、删除等

- 机构管理员可以根据公司的实际需要，创建用户组，比如以部门为单位创建用户组，每个部门可以安排自己的管理员、管理自己的交易员账户。

The screenshot shows the 'User Management' section of the CME Trading Platform. On the left sidebar, 'User Group Management' is selected and highlighted with a red box. A red arrow points from this box to a green 'Create' button ('+ 创建') located below the search bar. The main content area displays a table of existing user groups, with one row highlighted:

| 用户组代码 | 用户组名称 | 上级用户组名称 | 操作人 | 操作日期 | 操作时间 | 操作 |
|-------|-------|---------|-------|----------|----------|---------------------|
| CX | 测试公司 | | ADMIN | 20181026 | 14:48:59 | <button>操作</button> |

Below this, there are two smaller pop-up windows. The left window is titled 'User Group Information Addition' and shows fields for 'User Group Code' (gs), 'User Group Name' (Fixed Income Department), and 'Upper User Group' (cx - Test Company). The right window is titled 'Operation' and lists several options: 'Assign Role' (highlighted in grey), 'Assign Permission', 'View Permission', 'Edit Information', 'Delete', and 'Adjust User'.

用户管理: 创建并管理自己创建的用户信息：创建、分配权限、修改、删除等

- 创建用户、输入用户信息→根据实际需要为用户分配权限（或分配角色）；
- 管理用户信息。

中金所 协商交易平台 测试公司管理员

位置：/ 用户管理 / 用户信息 / 用户信息列表

用户管理

用户组管理

用户管理 (当前)

角色管理

+ 创建

| 用户代码 | 用户名 | email | 电话号码 | 身份证号码 | 用户状态 | 认证方式 | 操作人 | 操作日期 | 操作时间 | 操作 |
|-----------|-----|------------------------|--------------|--------------------|------|------|---------|----------|----------|-----------|
| cxxiaojin | 小金 | xiaojin@testsec.com.cn | 021-88888888 | 310000199001010101 | 正常 | 证书 | cxadmin | 20181026 | 15:24:16 | 操作 |

位置：/ 用户管理 / 用户信息 / 用户新增

用户信息

* 用户代码：xiaojin

* 用户姓名：小金

* 用户组：cxgs - 固定收益部

* 用户类型：操作用户

* 密码：123456

email：xiaojin@testsec.com.cn

电话：021-88888888

身份证号：310000199001010101

保存 返回

位置：/ 用户管理 / 用户权限 / 用户权限分配

用户信息

用户代码：cxxiaojin 用户姓名：小金

用户组：固定收益部 菜单类型：操作菜单

未分配权限 已分配权限

| | |
|---------|-------------------------------------|
| 协商交易平台 | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 国债期货期转现 | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 查询申报 | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 创建申报 | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 确认申报 | <input type="checkbox"/> |
| 备案机构名单 | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 个人中心 | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 交易员信息 | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 修改登录密码 | <input checked="" type="checkbox"/> |
| 修改交易密码 | <input checked="" type="checkbox"/> |

已选 13/17 项

暂无数据

已选 0 项

保存 返回

操作

分配角色

分配权限 (当前)

查看权限

禁止权限

修改信息

修改密码

注销

激活

删除

角色管理： 角色是权限的逻辑组织，是分配权限的快速操作

- 根据需要创建角色，为角色分配权限。为用户、用户组分配权限时，可以直接分配具有相应权限的角色；以简便赋权操作。
- 一个用户、用户组可以被分配多个角色，角色间权限有交叉时，享有多个角色的所有权限。

中金所 协商交易平台 测试公司管理员

位置：/ 角色管理 / 角色信息 / 角色信息列表

| 用户组代码 | 角色代码 | 角色名称 | 用户组名称 | 操作人 | 操作日期 | 操作时间 | 操作 |
|-------|---------|---------|-------|---------|----------|----------|---------------------|
| | cxgsefp | 国债期货期转现 | 固定收益部 | cxadmin | 20181026 | 15:41:15 | <button>操作</button> |

+ 创建

位置：/ 角色管理 / 角色信息 / 角色信息新增

* 角色代码： efp
* 角色名称： 国债期货期转现
* 用户组： cxgs - 固定收益部

保存 返回

位置：/ 角色管理 / 角色权限 / 角色权限分配

操作

操作

分配权限
查看权限
修改信息
删除

2步 创建好期转现下单交易员账户**第一步：创建用户**

位置 : / 用户管理 / 用户信息 / 用户新增

用户信息

| | |
|----------|--------------------|
| * 用户代码 : | A |
| * 用户姓名 : | 交易员A |
| * 用户组 : | CX - 测试公司 |
| * 用户类型 : | 操作用户 |
| * 密码 : | 111111 |
| email : | A@testsec.com.cn |
| 电话 : | 021-88888888 |
| 身份证号 : | 310000198910101010 |

保存 **返回**

第二步：分配操作权限

位置 : / 用户管理 / 用户权限 / 用户权限分配

用户信息

| | | | |
|------------|------------|------------|-------------|
| 用户代码 : CXA | 用户名 : 交易员A | 用户组 : 测试公司 | 菜单类型 : 操作菜单 |
|------------|------------|------------|-------------|

未分配权限

| |
|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> 协商交易平台 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 国债期货期转现 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 查询申报 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 创建申报 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 确认申报 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 备案机构名单 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 个人中心 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 交易员信息 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 修改登录密码 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 修改交易密码 |

已分配权限

| |
|------|
| 暂无数据 |
|------|

保存 **返回**

02

交易

创建申报 确认申报 查看交易结果



交易要素

- 期货交易信息
- 有价证券及相关合约交易信息



时间信息

- 协商一致日期、时间
- 预计申报时间
- 确认截止时间



双方交易员信息

- 谁录入、谁确认？
- 双方交易员账户、交易员姓名



国债期货期现

位置：/ 首页

个人中心

请修改登录密码和交易密码！(点击前往)

操作手册

全部下载



用户管理

可以对本系统中的用户进行分层管理，功能主要包括创建用户组，创建用户，分配权限等。

立即下载



机构备案

机构参与中金所期现业务需要通过会员向中金所提交备案信息

立即下载



期转现申报

期转现交易协商达成，先到现货市场提交成交，再到本平台创建、确认申报信息。

立即下载



期转现百问百答

如果对期转现业务有疑惑，不如先看看这里

立即下载



期转现规则

- 《中国金融期货交易所交易细则》
- 《中国金融期货交易所国债期货期转现交

立即下载



技术支持

联系邮箱：tech_support@cffex.com.cn



培训材料

国债期货期转现培训材料

立即下载

友情链接

中金所官网

中国货币网

中央结算

中国结算

上交所

深交所

上海数字证书中心

国债期货期转现交易流程



国债期货期现

位置：/ 个人中心 / 修改登录密码

请修改登录密码和交易密码！(点击前往)

个人信息

修改登录密码

修改交易密码

*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：

确认修改

重置



国债期货期现

位置：/ 个人中心 / 修改交易密码

请修改交易密码！(点击前往)

个人信息

修改登录密码

修改交易密码

*新交易密码：*确认交易密码：请再次输入新交易密码

确认修改

重置



小金

完成初始密码修改和交易
密码设置后，红色提示框
消失

国债期货转现

位置：/ 首页

个人中心

个人信息

修改登录密码

修改交易密码

操作手册

全部下载

用户管理

可以对本系统中的用户进行分层管理，功能主要包括创建用户组，创建用户，分配权限等。

立即下载

机构备案

机构参与中金所期转现业务需要通过会员向中金所提交备案信息。

立即下载

期转现申报

期转现交易协商达成，先到现货市场提交成交，再到本平台创建、确认申报信息。

立即下载

期转现百问百答

如果对期转现业务有疑惑，不如先看看这里

立即下载

期转现规则

- 《中国金融期货交易所交易细则》
- 《中国金融期货交易所国债期货期转现交

立即下载

技术支持

联系邮箱：tech_support@cffex.com.cn

培训材料

国债期货期转现培训材料

立即下载

友情链接

中金所官网

中国货币网

中央结算

中国结算

上交所

深交所

上海数字证书中心

国债期货期转现交易流程

交易协商阶段

- 交易双方协商达成期转现交易。
- 期转现买卖客户录入申报。
- 期转现买卖客户确认。
- 交易所进行风险控制。
- 交易所进行风险控制。

未通过

通过

失败

交易后处理阶段

- 交易所对期转现买卖客户进行平仓。
- 交易所对期转现买卖客户进行平仓。

- 9:15:00~15:15:00之间可以申报。如果期转现交易为上日协商，申报时间不能晚于当前交易日10:15:00。
- 可选的会员、客户为截止上一交易日收盘成功备案的会员、机构下符合要求的客户。
- 填写完成申报信息后，点击 **提交** 按钮

 中金所 协商交易平台

920301

国债期货期转现 ^

查询申报

+ 创建申报

✓ 确认申报

i 备案机构名单

个人中心 ^

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 : 20181115 | * 协商一致时间 : 请选择时间 | 货币经纪公司 (若有) : 请输入货币经纪公司名称 |
| * 会员 : 请选择会员 | * 客户 : 请选择客户 | * 对手方交易员 : 请选择对手方交易员 |
| 选择会员后才可以选择 需要双方约定准确, 如果 选错, 申报可能不能被正 确确认 | | |
| 期现货匹配方法 : <input checked="" type="radio"/> 风险匹配 <input type="radio"/> 面值匹配 当选择面值匹配时, 系统会检查期货交易的面值与所有 有价证券或相关合约交易的券面总额之和需要相等 | | |

期货合约交易信息

| | | |
|--|---|----------------------------------|
| * 合约代码 : 请输入合约代码 <small>合约代码必须是可以进行期转现交易的产品 的上市合约</small> | * 价格 (元) : 请输入价格 <small>价格必须在当日合约涨跌停板内</small> | * 买卖方向 : 卖 |
| * 数量 (手) : 请输入数量 | * 开平标志 : 请选择开平标志 | 期货卖方申报, 故系统已自动 选好买卖方向, 用户无需选择 |

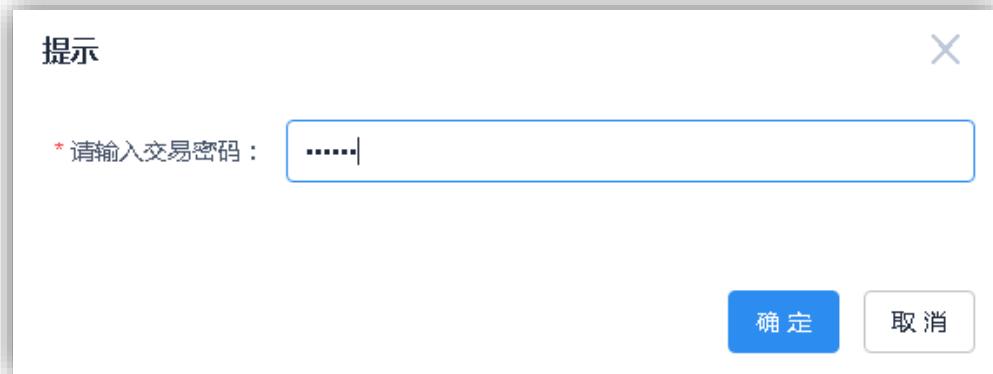
有价证券或相关合约交易信息

| | | | |
|---|---|--|------------------|
| 现货类型 : <input checked="" type="radio"/> 债券 <input type="radio"/> 债券远期 | 一笔有价证券或相关合约的交易只能参与一 笔期转现交易, 系统会根据【交易场所+成 交编号+成交日期】进行防重複性检查。 | | |
| * 交易场所 : 中国外汇交易中心 | * 成交编号 : 请输入成交编号 | 债券简称和债券代码需要匹配。同一只债券如果在不同交易场所流通, 代码和简称可能不 同, 用户当输入同一市场的代码和简称。此外系统会检查债券是否符合国债期货期转现要求。 | |
| * 买卖方向 : 买 | * 券面总额 (万) : 请输入券面总额 | * 债券代码 : 请输入债券代码 | * 债券简称 : 请输入债券简称 |
| 用户无需选择 | | * 净价 (元) : 请输入成交净价 | * 成交日期 : 请选择成交日期 |

用户必须勾选才能提交

本人承诺: 本期转现交易的申报内容真实有效, 若交易所对期货合约交易申报不予以确认, 将妥善处理相关有价证券及其他相关合约的交易。

- 在弹出的对话框中，输入交易密码，系统校验通过则申报创建成功。



- 创建成功的申报可以在“查询申报”处查看，如发现申报信息有误，在对手方交易员未确认前，可以撤销申报。

中金所 协商交易平台 920301

国债期货期转现 位置：/ 国债期货期转现 / 查询申报

查询申报

| 申报开始日期 : | 请选择日期 | 申报结束日期 : | 请选择日期 | 产品号 : | 请选择 | 合约号 : | 请选择 | 申报状态 : | 请选择 | 共 26 条 10 条/页 | < 1 2 3 > 前往 1 页 |
|----------|----------------------|----------------------|-----------|-------------------------------|---------------|--------|-----|--------|------|---------------------|------------------|
| 68 | 20181024 10:12:46 | 20181024 11:12:46 | 2016-国联期货 | 00009203-T EST0000920 3 | 920401-920401 | TF1812 | 100 | 1 | 申报 | 详情 撤销 | |
| 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 | 详情 | |

卖方申报后60分钟（连续竞价时间）内进行确认

- 9:15:00~15:15:00之间可以确认申报。期货卖方申报后，期货买方需于60分钟（连续竞价时间）内确认申报，午间休市期间亦可操作。午间休市时间、盘后、盘前时间不纳入60分钟限制的计算。临近收盘创建的申报可于下一交易日确认。
- 期货买方确认后，申报即被会员、交易所进行处理。如临近合约收盘进行确认，交易可能会失败。
- 点击 查看详情并确认 按钮，进入确认申报界面。

 中金所 协商交易平台 920401

位置：/ 国债期货期转现 / 确认申报

查询申报

创建申报

确认申报

备案机构名单

个人中心

申报开始日期：请选择日期 申报结束日期：请选择日期 产品号：请选择 合约号： 申报状态： 共 26 条 10 条/页 < 1 2 3 > 前往 1 页

| 申报编号 | 申报时间 | 确认截止时间 | 会员 | 客户 | 对手方交易员 | 合约号 | 价格 | 数量 | 申报状态 | 说明 | 操作 |
|------|----------------------|----------------------|-----------|---------------------------|---------------|--------|-----|----|------|------|---|
| 68 | 20181024 10:12:46 | 20181024 11:12:46 | | | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 1 | 申报 | | <input checked="" type="checkbox"/> 查看详情并确认 |
| 67 | 20181024 10:05:09 | 20181024 11:05:09 | 2032-东海期货 | 00009204-T EST00009204 | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 1 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |
| 66 | 20181024 09:56:38 | 20181024 10:56:38 | 2032-东海期货 | 00009204-T EST00009204 | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 1 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |
| 65 | 20181023 09:33:55 | 20181023 10:33:55 | 2032-东海期货 | 00009204-T EST00009204 | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 1 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |
| 64 | 20181019 14:28:57 | 20181022 09:28:57 | 2032-东海期货 | 00009204-T EST00009204 | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 2 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |
| 63 | 20181019 13:59:34 | 20181019 14:59:34 | 2032-东海期货 | 00009204-T EST00009204 | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 1 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |
| 62 | 20181017 12:37:00 | 20181017 14:00:00 | 2032-东海期货 | 00009204-T EST00009204 | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 1 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |
| 61 | 20181017 12:21:53 | 20181017 14:00:00 | 2032-东海期货 | 00009204-T EST00009204 | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 1 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |
| 60 | 20181017 09:36:52 | 20181017 10:36:52 | 2032-东海期货 | 00009204-T EST00009204 | 920301-920301 | TF1812 | 100 | 1 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |

确定交易编码和开平标志

- 查看申报信息，确认无误后，选择“会员”、“客户”、“开平标志”，点击 **确认** 按钮，输入交易密码即完成申报确认操作。
- 可选的会员、客户为截止上一交易日收盘成功备案的会员、机构下符合要求的客户。

中金所 协商交易平台 9201操作员

位置：/国债期货期现/确认申报

确认申报

申报信息

申报编号：2 申报状态：申报 确认截止时间：20181217 10:15:00

交易时间及交易双方信息（期货合约买方确认）

协商一致日期：20181214 协商一致时间：11:20:40 货币经纪公司：

*会员：请选择会员 *客户：请选择客户 对手方交易员：203201-东海期货操作员

期现货匹配方法： 风险匹配 面值匹配

期货合约交易信息

合约代码：TS1903 价格（元）：100 买卖方向：买

数量（手）：1 *开平标志：请选择开平标志

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：中国外汇交易中心 成交编号：S1234567890123456789 债券代码：12345678 债券简称：test123

买卖方向：卖 券面总额（万）：100 净价（元）：100 成交日期：20181214

确认 **返回**

卖方申报后60分钟（连续竞价时间）内进行确认

- 如果过了确认截止时间，期货买方仍没有进行申报确认，则申报状态会变更为“超时”，期货买方不可再确认，申报也不会被会员、交易所处理。如交易申报还要提交，则期货卖方需要重新创建申报。

中金所 协商交易平台 920301

国债期货期转现 ^ 位置： / 国债期货期转现 / 确认申报

查询申报 创建申报 ✓ 确认申报 备案机构名单

个人中心

| 申报编号 | 申报时间 | 确认截止时间 | 会员 | 客户 | 对手方交易员 | 合约号 | 价格 | 数量 | 申报状态 | 说明 | 操作 |
|------|----------------------|----------------------|-----------|-------------------------------|---------------|--------|-----|----|------|--------------------|---------------------|
| 59 | 20181016 10:12:24 | 20181016 11:12:24 | | | 920401-920401 | TF1812 | 100 | 1 | 超时 | | <button>详情</button> |
| 50 | 20181008 09:30:26 | 20181008 10:30:26 | | | 920401-920401 | TF1812 | 100 | 1 | 超时 | | <button>详情</button> |
| 49 | 20180928 09:34:01 | 20180928 10:34:01 | 2016-国联期货 | 00009203-T EST0000920 3 | 920401-920401 | TF1812 | 100 | 1 | 交易失败 | 交易检查失败：合约TF1812已收盘 | <button>详情</button> |
| 44 | 20180925 09:32:11 | 20180925 10:32:11 | 2016-国联期货 | 00009203-T EST0000920 3 | 920401-920401 | TF1812 | 100 | 1 | 交易成功 | 交易成功 | <button>详情</button> |

共 4 条 10 条/页 < 1 > 前往 1 页

了解识别交易失败的结果说明

- 期货卖方在“查询申报”菜单查看已创建申报的交易结果；期货买方在“确认申报”菜单查看已确认申报的交易结果。
- 如果交易失败，交易员可以看到本方的详细原因，可以看到对手方的大概原因。若交易失败，当与对手方就失败原因进行沟通，以确认是否重新申报以及是否需要调整申报要素。
- 交易失败的原因可能发生在申报处理环节的任一节点。

交易所端合法性检查

- 非法人投资者之间不能以期转现交易方式达成交易
- 现货...不可参与期转现交易
- 会员、客户不可参与期转现
- 交易所审核不通过
-

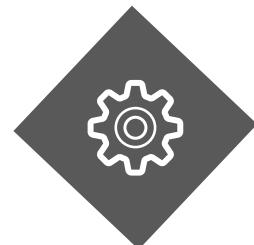


会员端风控检查

- 客户所在会员交易系统的席位没有正常登录协商交易平台（系统故障、席位未备案、会员交易系统未启动等）
- 客户的申报没有通过会员交易系统的风控检查（客户资金不足、仓位检查失败、没有交易权限等）
-

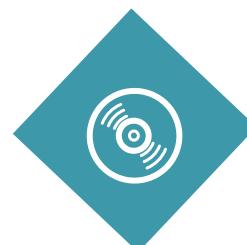
交易所端交易检查

- 会员资金不足、客户持仓不足或超仓等
- 合约已收盘、无交易权限
-



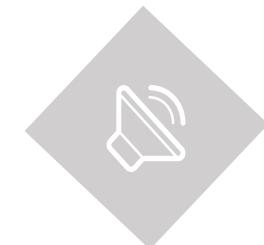
申报数据格式非法

- 申报数据格式非法或会员端风控检查反馈结果格式非法
-



异常情况

- 处理失败，请联系系统管理（网络故障、不可抗力）
-



- 通过中金所行情接口实时披露的行情信息中：
- 期货合约行情记录中的总成交量、总成交额、总持仓量包含期转现成交；
- 同时单独披露期转现成交的当日总成交量、当日总持仓变化量。



- 协商交易平台——备案机构名单，名单中的机构，为截止上一交易日备案成功的机构名称。
- 名单中若是期货公司，一般为资管客户的会员单位。

The screenshot shows the 'CME Futures Trading Platform' interface. The top navigation bar includes the logo, platform name, and a user ID (920401). The left sidebar has several menu items: 'Bond Futures Spot Delivery' (selected), 'Query Submission', 'Create Submission', 'Confirm Submission', and 'Registered Institutions' (highlighted with a red box). The main content area displays a table titled 'Bond Futures Spot Delivery Registered Institutions List'. The table has two columns: '序号' (Number) and '机构名称' (Institution Name). The listed institutions are:

| 序号 | 机构名称 |
|----|---|
| 1 | YY Asset Management (Beijing) Co., Ltd. |
| 2 | XX Asset Management Co., Ltd. |
| 3 | AA Futures Co., Ltd. |
| 4 | SS Investment Management Co., Ltd. |
| 5 | RR Management Co., Ltd. |
| 6 | PP Counterparty Investment Enterprise (General Partnership) Co., Ltd. |
| 7 | XX Securities Co., Ltd. |
| 8 | BB Futures Co., Ltd. |

更多交易前功能，敬请期待

04

重点注意事项提示

会员注意事项、客户注意事项、仿真

- 会员对于需要登录协商交易平台做国债期货期转现交易的柜台、席位，应该进行实时监控，确保交易期间系统状态正常、稳定。
- 一旦会员端有客户在进行期转现交易的会员交易系统发生故障，应尽快联系交易所汇报问题，排查是否有受影响的期转现申报，处理方案应该充分知晓交易所。
- 会员如果有多套会员交易系统、多个席位，不能将一个席位配置在不同的会员交易系统上登录交易所系统（协商交易平台、交易系统），做期转现的会员交易系统，必须在协商交易平台、交易系统都登录。

及时跟踪备案状态

如备案失败，需根据提示更新材料
重新提交备案。

及时检查机构管理员账户信息

当收到邮件或交易所通知，应及时将账户准确、安全地告知机构指定机构管理员，不得私自篡改账户信息。



及时处理客户反馈的异常信息

客户反馈账户异常、申报异常等情况时，
应及时处理，如有需要及时与交易所沟通，
评估影响。

完善监控

对系统、客户的申报处理情况建立
完善的监控机制，以及时发现问题、
解决问题。



- 客户数字证书由中金所技术部提供，随机构管理员账户信息一起发布。
- 仿真协商交易平台网址为：<https://sim-obt.cffex.com.cn>

THANKS

投资者咨询: zixun@cffex.com.cn

技术支持: tech_support@cffex.com.cn