



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

国债期货期转现交易 业务操作

CONTENTS

目录

01

会员备案及交易管理

柜台升级、会员备案、交易过程管理

02

客户数字证书申请与账户管理

数字证书申请、管理员账户、交易员账户、权限管理

03

客户创建与确认交易申报

创建申报、确认申报、查询申报

04

重点注意事项提示

会员注意事项、客户注意事项、仿真测试

01

会员备案及交易管理

柜台升级、备案、交易过程管理

协商交易API，是中金所提供给会员柜台系统的一个应用程序接口，开发商会基于本接口开发功能，以支持期转现交易申报的风控检查及相关功能。

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

柜台所在机器的IP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。

(一) 会员服务系统介绍

- 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。
- 期转现生产业务正式推出后，我所会将“期转现”模块的权限分配给会员的会服管理员账户，管理员账户再行分配给业务操作账户后，业务人员方可进行相应备案操作。



(二) 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

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 注册

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

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
-----	------	-----	------	------	------	------	----	--------	--------

共0页/第1页 跳转

系统管理
投资者适当性
国债交割管理

版权所有：中国金融期货交易所

(二) 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。
- 会员可下载模板，进行相关材料准备。
 - 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：*业务类型：*

上传材料

 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

(三) 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

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
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			

共1页/第1页 1 跳转

版权所有：中国金融期货交易所

(三) 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。
- 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：*业务类型：*

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

(四) 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交易编码，均可在当前会员下进行国债期货期转现交易业务。

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会员操作登录 登录 注册

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

机构备案管理

产品组: 1-国债期货 组织机构代码:
业务类型: 1-期转现 机构名称: 查询

备案

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
共0页/第1页 <input type="text"/> 跳转											

(四) 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。
- 会员可下载模板，协同客户准备相应材料。

新增机构备案

基本信息

产品组：*

业务类型：*

组织机构代码：

机构名称：

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。

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

暂存草稿

提交

取消

(五) 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: MSPront_V1.186 会员: 2032 简称: 华泰期货 欢迎 2032会员操作账号 登录 注册

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

机构备案管理

产品组: 1-国债期货 组织机构代码:

业务类型: 1-期转现 机构名称: 查询

备案

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	

共1页|第1页 1 跳转

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: 1-国债期货 组织机构代码:

业务类型: 1-期转现 机构名称: 查询

备案

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

共1页|第1页 1 跳转

(六) 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柜台系统进行风控检查。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

版本: MSFront_V1.186 会员: 2032 简称: 永安期货 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

客户期转现席位报备

客户号: 查询

添加 修改 删除

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:

客户名称:

证件号码:

席位号:

保存 取消

(六) 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:	<input type="text" value="203201"/>

- 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。



交易过程管理

- 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柜台系统发生故障，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。
 - 会员如果有多套柜台系统、多个席位，不能将一个席位配置在不同的柜台系统上登录交易所系统（协商交易平台、交易系统），做期转现的柜台系统，必须在协商交易平台、交易系统都登录。
-

02

客户数字证书申请 与账户管理

数字证书申请、机构管理员账户、
用户组管理、用户管理、角色管理

申请指南

数字证书申请指南
(中金所).docx

受理表

SHECA单位证书受理表
(中金所).doc

组织机构代码，应与在中金所进行客户开户时用的组织机构代码一致。

- 文档下载地址：中金所官网首页--服务--投资者服务--创新业务专栏--期转现交易--业务操作--上海CA数字证书申请。
- **提醒**：客户收到数字证书后，当保管好证书序列号，万一证书有遗失需向上海CA申请证书吊销时，上海CA要求提供证书序列号，再进行吊销操作。
吊销流程参考：中金所官网首页--服务—投资者服务--创新业务专栏--期转现交易--业务操作—上海CA数字证书吊销
- **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。



上海CA机构数字证书（具体以收到实物为准）

数字证书协卡助手安装

- 使用浏览器访问<https://www.sheca.com/resources/tools>，进入上海市数字证书认证中心的“下载中心”
- 在下载并安装“协卡助手”软件，详见中金所官网首页--服务--投资者服务--创新业务专栏--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。

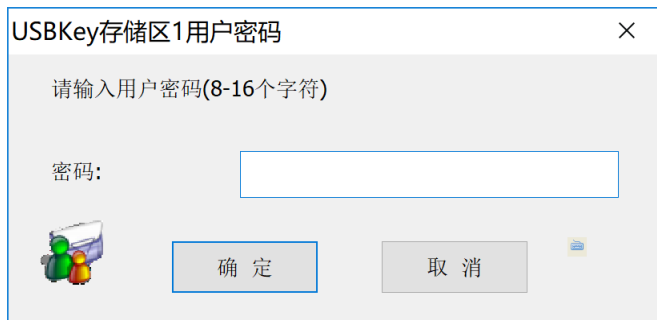
使用数字证书登录协商交易平台

- 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“确定”。

如果终端上安装了多个证书，客户当选择用来做期转现的证书



- 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。



- 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。

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。



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。

中金所 协商交易平台 测试公司管理员

用户管理 位置： / 用户组管理 / 用户组信息 / 用户组信息列表

用户组管理
用户管理
角色管理

用户组代码： 用户组名称：

共 1 条 10 条/页 < 1 > 前往 1 页

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	<input type="button" value="操作"/>

中金所 协商交易平台

用户管理 位置： / 用户组管理 / 用户组信息 / 用户组信息新增

用户组管理
用户管理
角色管理

* 用户组代码：

* 用户组名称：

* 上级用户组：

分配角色

分配权限

查看权限

修改信息

删除

调整用户

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

用户组代码： 用户代码： 用户姓名：

用户代码	用户姓名	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
cxiaojin	小金	xiaojin@testsec.com.cn	021-88888888	310000199001010101	正常	证书	cxadmin	20181026	15:24:16	<input type="button" value="操作"/>

共 1 条 10 条/页 < 1 > 前往 1 页

位置： / 用户管理 / 用户信息 / 用户新增

用户信息

* 用户代码：

* 用户姓名：

* 用户组：

* 用户类型：

* 密码：

email：

电话：

身份证号：

位置： / 用户管理 / 用户权限 / 用户权限分配

用户信息

用户代码： cxiaojin 用户姓名： 小金 用户组： 菜单类型：

未分配权限 已分配权限

协商交易平台

- 国债期货转现
 - 查询申报
 - 创建申报
 - 确认申报
- 备案机构名单
- 个人中心
 - 交易员信息
 - 修改登录密码
 - 修改交易密码

已选 13/17 项 共 0 项

- 分配角色
- 分配权限
- 查看权限
- 禁止权限
- 修改信息
- 修改密码
- 注销
- 激活
- 删除

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

用户管理 位置： / 角色管理 / 角色信息 / 角色信息列表

用户组管理

用户管理

角色管理 + 创建

用户组代码： 角色代码：

共 1 条 10 条/页 < 1 > 前往 1 页

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	国债期货转现	固定收益部	cxadmin	20181026	15:41:15	<input type="button" value="操作"/>

位置： / 角色管理 / 角色信息 / 角色信息新增

*角色代码：

*角色名称：

*用户组：

位置： / 角色管理 / 角色权限 / 角色权限分配

角色信息

角色代码： cxgsefp 角色名称： 国债期货转现 菜单类型： 可筛选菜单

未分配权限

- 协商交易平台
 - 国债期货转现
 - 查询申报
 - 创建申报
 - 确认申报
 - 备案机构名单
 - 个人中心
 - 交易员信息
 - 修改登录密码
 - 修改交易密码
 - 统一用户管理系统
 - 用户组管理

已选 17/24 项

已分配权限

暂无数据

共 0 项

操作

分配权限

查看权限

修改信息

删除

第一步：在默认用户组下创建用户

位置： / 用户管理 / 用户信息 / 用户新增

用户信息

* 用户代码：

* 用户姓名：

* 用户组：

* 用户类型：

* 密码：

email：

电话：

身份证号：

第二步：为用户分配默认用户组下的操作权限

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 用户姓名： 交易员A 用户组： 菜单类型：

未分配权限

- 协商交易平台
- 国债期货期转现
 - 查询申报
 - 创建申报
 - 确认申报
 - 备案机构名单
- 个人中心
 - 交易员信息
 - 修改登录密码
 - 修改交易密码

已选 17/17 项

已分配权限

暂无数据

共 0 项

请修改登录密码和交易密码！(点击前往)

如果首次登录没有出现此红色提示框，表示账户可能被人使用过需与管理员确认是否安全

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易细则》

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

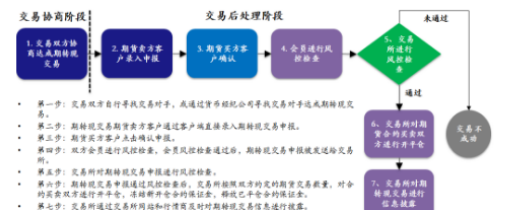
中国结算

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



请修改登录密码和交易密码！(点击前往)

修改登录密码

修改交易密码

*旧登录密码：

*新登录密码：

*确认登录密码：

确认修改

重置

请修改交易密码！(点击前往)

修改登录密码

修改交易密码

*新交易密码：

*确认交易密码：

确认修改

重置

完成初始密码修改和交易密码
设置后，红色提示框消失

中金所 协商交易平台

位置： / 首页

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易细则》

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



03

交易

创建申报 确认申报 查看交易结果



交易要素



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

在规则规定的时间点内提交申报信息

- 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。

中金所 协商交易平台 920301

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： 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

选择会员后才可以选择

* 对手方交易员： 请选择对手方交易员

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： 风险匹配 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

合约代码必须是可上市合约的上市合约

* 价格（元）： 请输入价格

价格必须在当日合约涨跌停板内

* 买卖方向： 卖

期货卖方申报，故系统已自动选好买卖方向，用户无需选择

* 数量（手）： 请输入数量

* 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

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】进行防重复性检查。

* 交易场所： 中国外汇交易中心

* 成交编号： 请输入成交编号

* 债券代码： 请输入债券代码

* 债券简称： 请输入债券简称

* 买卖方向： 买

用户无需选择

* 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

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，代码和简称可能有所不同，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。

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。

在规则规定的时间点内提交申报信息

- 填写完成申报信息后，点击 **提交** 按钮
- 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。

提示 ✕

* 请输入交易密码：

确定
取消

- 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

位置： / 国债期货转现 / 查询申报

申报开始日期： 申报结束日期： 产品号： 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	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	交易成功	详情

确认申报：期货买方

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。

中金所 协商交易平台 920401

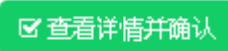

位置： / 国债期货转现 / 确认申报

申报开始日期： 申报结束日期： 产品号： 合约号： 申报状态：

共 26 条 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 type="button" value="查看详情并确认"/>
67	20181024 10:05:09	20181024 11:05:09	2032-东海期货	00009204-T EST0000920 4	920301-920301	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>
66	20181024 09:56:38	20181024 10:56:38	2032-东海期货	00009204-T EST0000920 4	920301-920301	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>
65	20181023 09:33:55	20181023 10:33:55	2032-东海期货	00009204-T EST0000920 4	920301-920301	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>
64	20181019 14:28:57	20181022 09:28:57	2032-东海期货	00009204-T EST0000920 4	920301-920301	TF1812	100	2	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>
63	20181019 13:59:34	20181019 14:59:34	2032-东海期货	00009204-T EST0000920 4	920301-920301	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>
62	20181017 12:37:00	20181017 14:00:00	2032-东海期货	00009204-T EST0000920 4	920301-920301	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>
61	20181017 12:21:53	20181017 14:00:00	2032-东海期货	00009204-T EST0000920 4	920301-920301	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>
60	20181017 09:36:52	20181017 10:36:52	2032-东海期货	00009204-T EST0000920 4	920301-920301	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>

确定交易编码和开平标志

- 点击  按钮，进入确认申报界面。
- 查看申报信息，确认无误后，选择“会员”、“客户”、“开平标志”，点击  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： / 国债期货期转现 / 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： * 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：

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

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

位置： / 国债期货期转现 / 确认申报

申报开始日期： 申报结束日期： 产品号： 合约号： 申报状态：

共 4 条 前往 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
59	20181016 10:12:24	20181016 11:12:24			920401-920401	TF1812	100	1	超时		<input type="button" value="详情"/>
50	20181008 09:30:26	20181008 10:30:26			920401-920401	TF1812	100	1	超时		<input type="button" value="详情"/>
49	20180928 09:34:01	20180928 10:34:01	2016-国联期货	00009203-T EST00009203	920401-920401	TF1812	100	1	交易失败	交易检查失败：合约TF1812已收盘	<input type="button" value="详情"/>
44	20180925 09:32:11	20180925 10:32:11	2016-国联期货	00009203-T EST00009203	920401-920401	TF1812	100	1	交易成功	交易成功	<input type="button" value="详情"/>

- 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的任一环节。

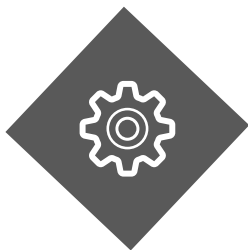
交易所端合法性检查

- 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

- 客户所在柜台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、柜台系统未启动等）
- 客户的申报没有通过会员柜台系统的风控检查（客户资金不足、仓位检查失败、没有开户等）.....



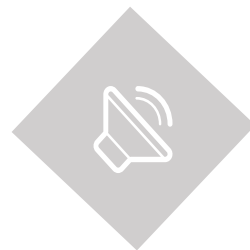
交易所端交易检查

- 会员资金不足、平仓时持仓不足或超仓等
- 合约已收盘.....



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）.....

- 名单中机构，为截止上一交易日备案成功的机构名称。
- 名单中期货公司，一般为资管客户的会员单位。

☐ 国债期货转现 ^

☰ 位置： / 国债期货转现 / 备案机构名单

☰ 查询申报

+ 创建申报

✓ 确认申报

i 备案机构名单

👤 个人中心 v

国债期货转现交易机构备案名单

序号	机构名称
1	YY资产管理（北京）有限公司公司
2	XX资产管理有限公司公司
3	AA期货股份有限公司
4	SS投资管理有限公司公司
5	RR管理有限公司公司
6	PP对冲投资企业（有限合伙）公司
7	XX证券证券股份有限公司公司
8	BB期货股份有限公司

04

重点注意事项提示

会员注意事项、客户注意事项、仿真

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，当及时处理，如有需要及时与交易所沟通，评估影响。

国债期货 期转现

及时检查机构管理员账户信息

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



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。



- 协商交易平台申报端仿真测试环境中的访问地址为：<https://sim-obt.cffex.com.cn>。
 - 仿真测试环境中，客户登录协商交易平台申报端的数字证书，由中金所技术部提供，客户无需向上海CA申请。在机构备案完成后，与机构管理员账户一同提供。
-



THANKS

技术支持 : tech_support@cffex.com.cn