
中信期货

看穿式监管认证操作指南

中信期货有限公司

中信期货信息技术中心

2019年4月16日

目录

中信期货看穿式监管认证操作指南	1
第 1 章 概述.....	3
第 2 章 CTP 验证系统接入参数	4
2.1 CTP 评测系统接入参数（验证看穿式监管功能有效性）	4
2.2 CTP 仿真环境接入参数（验证是否能正常接入生产环境）	4
第 3 章 交易终端验证测试流程.....	5
3.1 认证申请	5
3.2 认证测试	6
3.3 审核评估	6
第 4 章 其他.....	7

中信期货有限公司

第1章 概述

根据中国证监会发布的《关于进一步加强期货经营机构客户交易终端信息采集有关事项的公告》，中国期货保证金监控中心发布《期货公司客户交易终端信息采集及接入认证技术规范》的要求，所有接入期货公司交易系统的交易终端都需要认证测试，通过审核后允许接入期货公司系统。因此，我公司制定本操作指南，指导软件开发商完成认证工作。

1.1 适用范围

需要通过系统 API 接口连接我公司的交易客户端和系统。

1.2 名词解释

1、直连模式

客户交易终端软件与期货公司交易系统 **直接**通讯，进行交易的模式。

2、中继代理模式

客户交易终端软件与期货公司交易系统 **间接**通讯，进行交易的模式。

3、AppID/RelayAppID

AppID 是客户交易终端软件的唯一标识码，由终端软件商按照要求编制，AppID 由终端厂商名称、终端软件名称和版本号三部分构成。RelayAppID 是中继代理软件的唯一标识码，由中继代理软件商按照要求编制，RelayAppID 由中继厂商名称、中级软件名称和版本

号三部分构成。

AppID/RelayAppID 格式规范如下：

字段名称	终端厂商名称	终端软件名	版本号
最大长度（字节）	10	10	8
示例	abcdef	ghijkl	1.6.0
最终示例效果	Abcdef_ghijkl_1.6.0		
特殊说明	个人开发的终端，厂商名称为 client		

第2章 CTP 验证系统接入参数

2.1 CTP 评测系统接入参数（验证看穿式监管功能有效性）

IP 地址：

ctpfz1-front1.citicsf.com 或 116.246.25.180

ctpfz1-front2.citicsf.com 或 116.246.25.180

brokerid :66666

交易端口：53205 行情端口：53213

API 版本号：API_6.3.13_T4

API 下载地址：<https://www.citicsf.com/e-futures/csc/app?type=9>

测试时间：周一至周五上午 8:30-11:30 下午 13:00-15:30

2.2 CTP 仿真环境接入参数（验证是否能正常接入生产环境）

IP 地址：

ctpfz1-front1.citicsf.com 或 116.246.25.180

ctpfz1-front2.citicsf.com 或 116.246.25.180

brokerid :66666

交易端口： 51305 行情端口： 51313

API 版本号： API_6.3.15

API 下载地址：<https://www.citicsf.com/e-futures/csc/app?type=9>

测试时间： 周一至周五上午 8:30-11:30 下午 13:00-15:30

第3章 交易终端验证测试流程

3.1 认证申请

- 1、 申请人根据 1.2 名词解释，判断将来用于生产交易的交易终端是否是中继接入方式。如果是中继代理接入方式，则直接联系我公司信息技术中心。如果是直连模式，则按下一步操作。
- 2、 申请人通过我公司网站上申请 CTP 仿真环境账号，申请地址：<https://www.citicsf.com/e-futures/mocktrading/>。
- 3、 账号申请成功后，填写《交易终端认证申请表》。
- 4、 提交 2 中的表格给我公司业务人员，业务人员走内部流程进行审批。表格内容必须填写完整。
- 5、 我公司根据上述资料，在 CTP 仿真环境中设置 AppID 对应的授权码等相关信息，通过预留邮箱发送给申请人。

3.2 认证测试

- 1、 申请人收到 AppID 对应的授权码后,进行 API 开发、验证、测试。请使用 2.1 中的 CTP 评测系统环境测试。
- 2、 测试要求: 应优先保障看穿式监管的登录认证过程无误,其次在此基础上进行委托、撤单、查询等各类功能验证。
- 3、 交易终端测试完成,且已满足看穿式监管要求后,申请人填写《交易终端认证测试反馈表》。
- 4、 申请人提交 3 中的表格给我公司业务人员,业务人员走内部流程进行审批。表格内容必须填写完整。

3.3 审核评估

- 1、 我公司技术人员根据《交易终端认证申请表》、《交易终端认证测试反馈表》,以及在 CTP 仿真环境中的登录、交易等记录,进行评估。
- 2、 评估通过后,我公司会将 AppID 以及对应的授权码信息同步到生产系统,同时发放生产系统的接入参数给申请人。
- 3、 如评估不通过,则通过邮件返回评估结果给申请人,并抄送客户经理。申请人应根据评估结果改造交易终端或中继代理,重新走 3.2 认证测试。

第4章 其他

- 1、 因为生产环境和评测环境 API 版本不同，为了保证交易安全，建议客户在完成 2.1 中 CTP 评测系统测试完成后，同时使用 2.2 中 CTP 仿真环境进行 API 测试。
- 2、 技术支持电话：021-60819953 021-60812942

中信期货有限公司

附件一：交易终端认证申请表

交易终端认证申请表 v1.0

认证申请编号：

交易终端名称		版本号	
联系人		联系电话	
AppID		测试账号	
电子邮箱（用于接收授权码）		预计测试时间	
交易终端功能介绍			
开发方式	<input type="checkbox"/> 自主开发 <input type="checkbox"/> 委托第三方厂商开发（若勾选此项，请填写表中第三方厂商信息）		
第三方厂商名称			
第三方厂商联系人		第三方厂商联系电话	
对接交易系统	<input type="checkbox"/> CTP <input type="checkbox"/> 飞马 <input type="checkbox"/> 易盛 <input type="checkbox"/> 飞创 <input type="checkbox"/> 恒生 <input type="checkbox"/> 其他_____		
接入方式	<input type="checkbox"/> 直连模式 <input type="checkbox"/> 中继代理模式（若勾选此项，请中继代理厂商填写《中继代理认证申请表》一并提交）		
其他事项			

终端厂商（个人）签字/盖章：

签署日期： 年 月 日

附件三：交易终端认证测试反馈表

交易终端认证测试反馈表 v1.0

认证测试反馈编号：

交易终端名称		版本号	
AppID			
联系方式		测试时间	
测试账号客户名称		测试账号	
终端本机 IP		终端本机 MAC	
接入方式	<input type="checkbox"/> 直连模式 <input type="checkbox"/> 中继代理模式（若勾选此项，请中继代理厂商填写《中继代理认证反馈表》一并提交）		
测试环境	<input type="checkbox"/> CTP <input type="checkbox"/> 易盛 <input type="checkbox"/> 飞马 <input type="checkbox"/> 飞创 <input type="checkbox"/> 恒生 <input type="checkbox"/> 其他_____		
测试情况			
登录截图			
委托记录截图			
终端是否具有提示用户开通相关信息采集权限的功能？			

备注：

- 1、终端登录应记录日志并截图，内容至少应包含账号、AppID、sessionid、登录时间等；如有多次登录，可提供多个截图；
- 2、终端必须能够采集硬件信息，当无权采集时，应提示相应内容。
- 3、委托记录，应在上述同一 sessionid 下进行，委托记录截图必须提供成交记录 5 笔以上、撤单记录 5 笔以上记录截图；记录应包含账号、日期、合约、开平标志、价格、数量等；
- 3、若为中继代理模式，需要中继代理厂商一并提交《中继代理认证测试反馈表》；

终端厂商（个人）签字/盖章：

签署日期： 年 月 日

附件五：交易终端认证评估报告

交易终端认证评估报告 v1.0

评估编号：

交易终端名称		版本号	
AppID			
测试账号		测试时间	
认证申请表编号		认证测试反馈表编号	
仿真系统测试情况截图 (信息技术中心在仿真系统中查询并截图)			
认证评估情况			
是否按照要求完成认证测试？	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
是否已集成符合监管要求的信息采集动态链接库？	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
是否能够准确采集客户终端信息？	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
是否具有提示用户开通相关信息采集权限的功能？	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
是否具有若用户不不开通权限可禁止用户登录的功能？	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
交易终端认证评估是否通过？	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
补充情况说明：			

信息技术中心评估人员签字：

评估日期： 年 月 日