
中信期货非 CTP 次席系统看穿式监管认 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 5 月 21 日

目录

第 1 章	概述.....	3
第 2 章	交易终端验证测试流程.....	4
2.1	认证申请.....	4
2.2	认证测试.....	5
2.3	审核评估.....	5
第 3 章	飞马仿真系统验证系统接入参数.....	6
3.1	飞马多所仿真环境接入参数.....	6
第 4 章	易盛仿真系统验证系统接入参数.....	7
4.1	易盛仿真环境接入参数（验证是否能正常接入生产环境）.....	7
第 5 章	飞创仿真系统验证系统接入参数.....	7
第 6 章	盛立仿真系统验证系统接入参数.....	8
第 7 章	艾克朗科仿真系统验证系统接入参数.....	8
第 8 章	其他.....	8

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、中继软件名称和版

本号三部分构成。

AppID/RelayAppID 格式规范如下：

字段名称	终端/中继厂商名称	终端/中继软件名	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 交易终端验证测试流程

2.1 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直连模式还是中继代理模式。如果是直连模式，则按下一步操作。如果是中继代理模式，则直接联系我公司信息技术中心陈青山（021-60819953）。
- 2、 填写《交易终端认证申请及测试反馈表》的第一部分**认证终端基本信息**，提交给我公司业务人员。注：表格内容必须填写完整。
- 3、 我公司运营人员走内部 CRM 流程进行授权码的申请。
- 4、 我公司根据上述资料，在测试环境中设置 AppID 对应的授权码、测试账号等相关信息，我公司通过申请表中预留电子邮箱将授权码信息发送给申请人。

2.2 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。测试参数参加后续第三章至第七章的内容。
- 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。应确认达到如下要求：
 - 已按照新的 API 接口进行开发和对接
 - 可使用改造后的交易终端登录
 - 可使用改造后的交易终端交易（满足成交和撤单各 5 笔）
 - 终端具有提示用户开通相关信息采集权限的功能
- 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《交易终端认证申请及测试反馈表》第二部分内容，由终端厂商（个人）签字/盖章后提交给我公司业务人员。测试反馈中应当包括测试结果确认、测试截图等，其中登录截图应当为登录日志并截图，截图内容至少应包含账号、AppID、sessionid、登录时间等；交易委托记录满足成交和撤单各 5 笔或以上，应在上述同一 sessionid 下，委托记录应包含账号、日期、合约、开平标志、价格、数量等；
- 4、 我公司运营人员走内部测试结果评估流程。

2.3 审核评估

- 1、 我公司技术人员根据《交易终端认证申请及测试反馈表》，以及在仿真环境中的登录、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并通过申请表中预留电子邮箱以邮件方式通知给申请人。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，重新提交测试反馈。

第3章 飞马仿真系统验证系统接入参数

3.1 飞马多所仿真环境接入参数

IP 地址：211.95.84.4

交易：8002 行情：8005 brokerid: 0158

API 版本：FemasAllFutures_API_V3.02

API 相关资料：

<http://www.cffexit.com.cn/static/fmqhdjysb.html>

测试时间：周一至周五上午 8:00-18:00

测试账号：与 CTP 仿真系统里面测试账号一致

第4章 易盛仿真系统验证系统接入参数

4.1 易盛仿真环境接入参数（验证是否能正常接入生产环境）

IP 地址：IP:116.246.25.180 交易：6666 行情：9999

API 版本号：暂无，易盛公司还未公布正式版本号

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 8:00-20:00，周六至周日 09:00-20:00

（仅支持到 20190624）

测试账号：与 CTP 仿真系统里面测试账号一致

第5章 飞创仿真系统验证系统接入参数

交易：59.46.151.108 10910 175.170.135.66 10910

行情：59.46.151.108 10915 175.170.135.66 10915

API 版本号：暂无，飞创公司还未公布正式版本号

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

测试时间：周一至周五 8:00-18:00

测试账号：统一使用一个测试账号：

测试账号：000001

密码：123456

第6章 盛立仿真系统验证系统接入参数

IP 地址：参看下载包

API 版本号：参看下载包

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

测试时间：周一至周日 8:00-18:00

测试账号：下载包里已包含测试账号信息。

第7章 艾克朗科仿真系统验证系统接入参数

IP 地址：参看下载包

API 版本号：参看下载包

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

测试时间：周一至周日 8:00-18:00

测试账号：下载包里已包含测试账号信息。

第8章 其他

- 1、 由于易盛还没有正式发布 API 版本，因此使用易盛 API 的客户，多留意我司网站的相关栏目。我们会在易盛正式发布的第一时间更新网站上的 API 版本。
- 2、 完成接入认证并确保系统稳定可靠运行后，要求所有使用

客户开通信息采集授权并更新为最新的终端。

3、 技术支持电话：021-60819953 021-60812942

中信期货有限公司

附件：

交易终端申请及测试反馈表

第一部分 交易终端认证申请（由客户或终端厂商提供相关信息）			
交易终端名称		版本号	
终端厂商名称			
终端厂商联系人		终端厂商联系电话	
AppID		电子邮箱（用于接收授权码）	
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 VIP <input type="checkbox"/> 恒生 NST <input type="checkbox"/> 其他_____		
中继代理模式需加提供	RelayAppID: _____ 中继代理厂商名称: _____ 中继代理厂商联系人: _____ 中继代理厂商联系电话: _____		
特别强调： 1、AppID 和 RelayAppID 格式规则：终端/中继厂商名称_终端/中继软件名称_版本号； 2、以上信息将作为终端认证信息保存，应确保相关信息的准确性，应与实际参与测试和最终接入的终端信息保持一致； 3、如为客户自主开发，终端厂商名称、联系人、联系电话均填写客户本人/本单位信息。			
第二部分 交易终端认证测试反馈表			
测试账号		测试时间	
测试终端本机内网 IP 地址		测试终端本机 MAC 地址	
中继代理模式需加提供	中继代理公网 IP: _____		
测试环境	<input type="checkbox"/> CTP <input type="checkbox"/> 飞马 <input type="checkbox"/> 易盛 <input type="checkbox"/> 飞创 <input type="checkbox"/> 恒生 VIP <input type="checkbox"/> 恒生 NST <input type="checkbox"/> 其他_____		
测试结果	<input type="checkbox"/> 已按照新的 API 接口进行开发和对接 <input type="checkbox"/> 可使用改造后的交易终端登录 <input type="checkbox"/> 可使用改造后的交易终端交易（满足成交和撤单各 5 笔） <input type="checkbox"/> 终端具有提示用户开通相关信息采集权限的功能		
测试记录截图	截图 1-登录： 注：1、应当为登录日志并截图，截图内容至少应包含账号、AppID、sessionid、登录时间等。 2、若为中继代理模式，需单独增加中继代理登录截图，截图内容至少应包含账号、RelayAppID、登录时间等。 截图 2-委托和撤单：		

注：委托记录，应在同一 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。
截图 3-终端提示用户开通相关信息采集权限：

厂商（个人）签字/盖章：

签署日期： 年 月 日

中信期货有限公司

交易终端认证申请及测试反馈表（填写示例）

第一部分 交易终端认证申请（由客户或终端厂商提供相关信息）			
交易终端名称	超快交易系统	版本号	1.0.1
终端厂商名称	XXX 公司		
终端厂商联系人	张三	终端厂商联系电话	010-xxxxxxx
AppID	client_superfast_1.0.1	电子邮箱（用于接收授权码）	xxx@163.com
对接交易系统	<input type="checkbox"/> CTP <input type="checkbox"/> 飞马 <input checked="" type="checkbox"/> 易盛 <input type="checkbox"/> 飞创 <input type="checkbox"/> 恒生 VIP <input type="checkbox"/> 恒生 NST <input type="checkbox"/> 其他_____		
中继代理模式需加提供	RelayAppID: _____ 中继代理厂商名称: _____ 中继代理厂商联系人: _____ 中继代理厂商联系电话: _____		
特别强调： 1、AppID 和 RelayAppID 格式规则：终端/中继厂商名称_终端/中继软件名称_版本号； 2、以上信息将作为终端认证信息保存，应确保相关信息的准确性，应与实际参与测试和最终接入的终端信息保持一致； 3、如为客户自主开发，终端厂商名称、联系人、联系电话均填写客户本人/本单位信息。			
第二部分 交易终端认证测试反馈表			
测试账号	000001	测试时间	2019/05/20
测试终端本机内网 IP 地址	11.29.203.82	测试终端本机 MAC 地址	00-00-00-00-00-00
中继代理模式需加提供	中继代理公网 IP: _____		
测试环境	<input type="checkbox"/> CTP <input type="checkbox"/> 飞马 <input checked="" type="checkbox"/> 易盛 <input type="checkbox"/> 飞创 <input type="checkbox"/> 恒生 VIP <input type="checkbox"/> 恒生 NST <input type="checkbox"/> 其他_____		
测试结果	<input checked="" type="checkbox"/> 已按照新的 API 接口进行开发和对接 <input checked="" type="checkbox"/> 可使用改造后的交易终端登录 <input checked="" type="checkbox"/> 可使用改造后的交易终端交易（满足成交和撤单各 5 笔） <input checked="" type="checkbox"/> 终端具有提示用户开通相关信息采集权限的功能		
测试记录截图	截图 1-登录：		

```
<ReqAuthenticate>
  BrokerID [66666]
  UserID [8080808]
  UserProductInfo []
  AuthCode [2RG2264WNZXWQ8Y7]
  AppID [client_Thorp_1.0.0]
  nRequestID [1]
</ReqAuthenticate>
  客户端认证 = [0]
<OnRspAuthenticate>
  BrokerID [66666]
  UserID [8080808]
  UserProductInfo []
  AppID [client_Thorp_1.0.0]
  AppType [1]
  ErrorMsg [正确]
  ErrorID [0]
  nRequestID [1]
  bIsLast [1]
</OnRspAuthenticate>
<ReqUserLogin>
  TradingDay []
  BrokerID [66666]
  UserID [8080808]
  Password [1234334]
  UserProductInfo []
  InterfaceProductInfo []
  ProtocolInfo []
  MacAddress []
  OneTimePassword []
  ClientIPAddress []
  LoginRemark []
  nRequestID [0]
</ReqUserLogin>
<OnRspUserLogin>
  TradingDay [20190522]
  LoginTime [10:35:41]
  BrokerID [66666]
  UserID [8080808]
  SystemName [TradingHosting]
  MaxOrderRef [1]
  SHFETime [10:33:49]
  DCETime [10:33:46]
  CZCETime [10:33:56]
  FFEXTime [10:33:48]
  INETime [10:33:49]
  FrontID [7]
  SessionID [-1249852998]
  ErrorMsg [正确]
  ErrorID [0]
  nRequestID [0]
```

注：1、应当为登录日志并截图，截图内容至少应包含账号、AppID、sessionid、登录时间等。

2、若为中继代理模式，需单独增加中继代理登录截图，截图内容至少应包含账号、RelayAppID、登录时间等。

截图 2-委托和撤单：

未成交单(F2) 所有委托单(F5) 预埋单条件单(F7) 行权委托单							
报单编号	合约	买卖	开平	报单手数	未成交手数	报单价格	报单时间
344488	IF1907	买	开仓	1	1	3404.4	11:29:42
342824	IF1906	卖	开仓	1	1	3692.4	11:28:56
342467	IH1907	卖	开仓	1	1	2793.8	11:28:38
342032	IH1906	卖	开仓	1	1	2756.0	11:28:21

未成交单(F2) 所有委托单(F5) 预埋单条件单(F7) 行权委托单											
报单编号	合约	买卖	开平	挂单状态	报单价格	报单手数	未成交手数	成交手数	详细状态	报单时间	最后
SR907		卖	开仓	已撤单	5036	2	2	0	已撤单报单被拒绝CZCE...	11:31:58	
SR907		卖	开仓	已撤单	5036	1	1	0	已撤单报单被拒绝CZCE...	11:31:45	
344488	IF1907	买	开仓	已撤单	3404.4	1	1	0	已撤单	11:29:42	
cu1907		卖	开仓	错误	47750	3	3	0	下单失败: CTP 投资者未...		
342824	IF1906	卖	开仓	已撤单	3692.4	1	1	0	已撤单	11:28:56	
342467	IH1907	卖	开仓	已撤单	2793.8	1	1	0	已撤单	11:28:38	
342032	IH1906	卖	开仓	已撤单	2756.0	1	1	0	已撤单	11:28:21	

注：委托记录，应在同一 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。

截图 3-终端提示用户开通相关信息采集权限：

厂商（个人）签字/盖章：

签署日期： 年 月 日