

大连商品交易所基差交易平台 交易商操作手册

第一章 交易系统功能介绍

1 登录系统

交易商/子账户通过 <http://59.46.215.172:8080/portal/index> 中的平台入口进入平台登录页面。使用用户、密码及短信验证码登录交易平台。**为了达到最佳的用户体验，请尽量使用谷歌浏览器登录交易平台。**



2 出入金管理

1) 交易商进入：资金管理-出入金管理-入金申请，新增入金申请，然后进行复核，待银行处理。**出入金请备注“基差业务”，风险保障金入金 200 万，超过 200 万方可交易。**

产品信息

客户管理

资金管理

信用管理

出入金管理

入金申请

出金申请

入金明细查询

出金明细查询

可用资金查询

其它资金管理

您现在的位置:资金管理>>出入金管理>>入金申请
找到1条记录, 显示 1 到 1

选择	申请日期	申请序号	清算会员号	清算会员简称	清算账户	账户类型	交易会员号	交易会员简称	客户号	客户名称	入金银行	申请入金金额(元)	申请状态	入金处理状态	失败原因	银行处理状态
☒	20160615	0000000007	DCE		80050008005	自有资金	8005	DD资本	0008005	DC股份集团有限公司	交通银行	600,000.00	未复核			

清算账户

80050008005

自有资金-DD资本

入金银行

交通银行

入金金额(元)

600000

备注

入金六十万

新增

复核

撤销

2) 交易商进入：资金管理-出入金管理-出金申请，新增出金申请，然后进行复核，待交易所审批。交易所在每日闭市后进行出金审批。

产品信息

客户管理

资金管理

信用管理

出入金管理

入金申请

出金申请

入金明细查询

出金明细查询

可用资金查询

其它资金管理

您现在的位置:资金管理>>出入金管理>>出金申请
找到1条记录, 显示 1 到 1

选择	申请日期	申请序号	清算会员号	清算会员简称	清算账户	账户类型	交易会员号	交易会员简称	客户号	客户名称	出金银行	申请出金金额(元)	是否允许差额出金	实际出金金额	备注	申请状态
☒	20160615	0000000008	DCE		80050008005	自有资金	8005	DD资本	0008005	DC股份集团有限公司	交通银行	65,000.00	是	0.00		未复核

清算账户

80050008005

自有资金-DD资本

出金银行

交通银行

出金金额(元)

是否允许差额出金

☒ 是 ☐ 否

备注

新增

复核

撤销

3) 交易商进入：资金管理-出入金管理-入金明细查询，查看入金明细。

产品信息

客户管理

资金管理

信用管理

出入金管理

入金申请

出金申请

入金明细查询

出金明细查询

可用资金查询

其它资金管理

您现在的位置:资金管理>>出入金管理>>入金明细查询

起始日期

20160615

结束日期

20160615

清算会员号

交易会员号

客户号

银行

交通银行

找到1条记录, 显示 1 到 1

申请日期	申请序号	清算会员号	清算会员简称	清算账户	账户类型	交易会员号	交易会员简称	客户号	客户名称	入金银行	申请入金金额(元)	申请状态	入金处理状态	失败原因	银行处理状态
20160615	0000000007	DCE		80050008005	自有资金	8005	DD资本	0008005	DC股份集团有限公司	交通银行	600,000.00	未复核			

4) 交易商进入：资金管理-出入金管理-出金明细查询，查看出金明细。

产品信息

客户管理

资金管理

信用管理

出入金管理

入金申请

出金申请

入金明细查询

出金明细查询

可用资金查询

其它资金管理

您现在的位置:资金管理>>出入金管理>>出金明细查询

起始日期

20160615

结束日期

20160615

清算会员号

交易会员号

客户号

银行

交通银行

找到1条记录, 显示 1 到 1

申请日期	申请序号	清算会员号	清算会员简称	清算账户	账户类型	交易会员号	交易会员简称	客户号	客户名称	出金银行	申请出金金额(元)	是否允许差额出金	实际出金金额	备注	申请状态	出
20160615	0000000008	DCE		80050008005	自有资金	8005	DD资本	0008005	DC股份集团有限公司	交通银行	65,000.00	是	0.00		未复核	

3 信用管理

- 1) 交易商进入：资金管理-信用管理-授信额度申请，为指定交易商新增授信额度申请，然后进行复核，待交易所审核。**审核通过的双边授信额度需要在当日闭市结算后方可生效。**

产品信息

客户管理

资金管理

信用管理

授信额度查询

授信额度申请

授信申请历史查询

出入金管理

可用资金查询

其它资金管理

您现在的位置: 资金管理>>信用管理>>授信额度申请

找到1条记录, 显示 1 到 1

选择	申请号	授信交易商号	授信交易商简称	市场	产品类型	授信额度	申请状态	备注	操作人	操作日期	操作时间
☒	7	8003	CC公司	基差交易市场	基差	500,000.00	新建		DDab	20190903	09:32:54

授信交易商

8003-CC公司

市场

基差交易市场

产品类型

基差

申请授信额度

500000

新增

修改

复制

删除

- 2) 交易商进入：资金管理-信用管理-授信额度申请历史查询，可以查看授信申请的历史记录和审批状态。

产品信息

客户管理

资金管理

信用管理

授信额度查询

授信额度申请

您现在的位置: 资金管理>>信用管理>>授信申请历史查询

授信交易商号

找到1条记录, 显示 1 到 1

申请号	授信交易商号	授信交易商简称	市场	产品类型	授信额度	申请状态	备注	操作人	操作日期	操作时间
4	8007	FF企业	基差交易市场	基差	2,000.00	审批通过	通过	jc	20190902	09:43:22

- 3) 交易商进入：资金管理-信用管理-授信额度查询，可以查询其他交易商对自己、以及自己对其他交易商的授信额度、可用授信额度、用于交易保证金冻结的授信额度及明细。**只有审批通过且日终结算后的双边授信额度才能在授信额度查询中查到。**

产品信息

客户管理

资金管理

信用管理

授信额度查询

授信额度申请

您现在的位置: 资金管理>>信用管理>>授信额度查询

交易日期

20180613

找到3条记录, 显示 1 到 3

序号	交易日期	交易商号	交易商简称	授信来源交易商号	授信来源交易商简称	市场	产品类型	授信额度	可用授信额度	交易冻结保证金	委托冻结保证金	详细
1	20180613	8005	DD资本	8006	EE企业	基差交易市场	基差	1,000.00	1,000.00	0.00	0.00	新增
2	20180613	8005	DD资本	8007	FF企业	基差交易市场	基差	1,000.00	1,000.00	0.00	0.00	新增
3	20180613	8007	FF企业	8005	DD资本	基差交易市场	基差	2,000.00	2,000.00	0.00	0.00	新增

4 客户（子账户）管理

- 1) 交易商进入：客户管理-基差客户管理，新增或修改客户信息。**只有选择内部账户，新加的客户才可以使用交易商的信用，否则不能使用交易商的信用。**

产品信息

客户管理

交易编码查询

基础客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交易管理

您现在的位置: 客户管理>>基础客户管理

客户号

客户名称

找到1 条记录, 显示 1 到 1

选择	交易商号	客户号	客户名称	登录用户名	中文用户名	手机号码	用户描述	是否内部客户
☒	8005	0010003	123	DDbzzh	DD资本二号交易员	15641178251	DD资本 (期货子公司)	是

登录用户名

DDbzzh

密码

手机号码

15641178251

用户描述

DD资本 (期货子公司)

中文用户名

DD资本二号交易员

确认密码

客户名称

123

是否内部客户

是

新增

修改

2) 交易商进入: 客户管理-交易编码查询, 查看交易商和子账户的清算账号

产品信息

客户管理

交易编码查询

基础客户管理

资金管理

您现在的位置: 客户管理>>交易编码查询

找到2 条记录, 显示 1 到 2

序号	清算账号	交易商号	交易商名称	客户号	客户名称	状态	资金账户明细
1	80050010003	8005	DD资本	0010003	123	开户	明细
2	80050008005	8005	DD资本	0008005	DD股份集团有限公司	开户	明细

5 交易商给客户（子账户）转入/转出资金

交易商进入: 资金管理-其他资金管理-交易商客户资金划转, 给客户转入/转出资金。录入转入/转出资金后, 进行复核。(客户的清算账户可以通过客户管理-交易编码查询功能获取)。**内部子账户可以使用主账户的双边信用额度, 可分配给公司内部不同部门或不同交易员使用。**

产品信息

客户管理

资金管理

信用管理

出入金管理

入金申请

出金申请

入金明细查询

出金明细查询

可用资金查询

其它资金明细

其它资金管理

客户资金划转

您现在的位置: 资金管理>>其它资金管理>>客户资金划转

找到1 条记录, 显示 1 到 1

选择	交易商号	交易商号简称	交易商自有清算账户	客户清算账户	客户清算账户类型	客户简称	划转方向	划转金额 (元)	状态	操作人	操作日期	操作时间	资金类型	备注
☒	8005	DD资本	80050008005	80050010003	客户完全隔离	123	从交易商到客户	400,000.00	复核	DDzb	20190902	09:33:25	会员客户账号资金划转	DD资本给自己的二号交易员40万, 自

交易商号

8005

交易商简称

DD资本

交易商自有清算账户

80050008005

客户清算账户

80050010003

客户清算账户类型

客户完全隔离

客户简称

123

划转方向

从交易商到客户

划转金额 (元)

400000

资金类型

会员客户账号资金划转

备注

DD资本给自己的二号交易员40万,

新增

复核

删除

6 资金查询

交易商/子账户进入: 资金管理-可用资金查询, 查看交易商和子账户的可用资金、冻结交易保证金、风险保障金等资金状况。(交易商主账户可以看见主账户和所有子账户的资金状况, 子账户只能看到自己的资金状况)

系统默认每个交易商主账户必须有 **200 万** 的风险保障金，交易商必须在入金 **200 万** 的基础上再入金，才会被记入可用资金。预测可出金金额为可用资金扣除当天已经被追保但尚未在结算后扣除的金额。

序号	交易日期	清算账户	清算账户类型	交易商号	交易商名称	客户号	客户名称	可用资金 (元)	保证金 (元)	现金 (元)	风险保障金 (元)	预测可出资金 (元)	其它资金 (元)
1	20190204	80230008023	自有资金	8023	C集团 (集团)	000023	C集团 (集团)	97,995,265.00	4,735.00	98,000,000.00	2,000,000.00	97,995,165.00	0.00

7 基差合约管理

1) 交易商/子账户进入：产品信息-基差合约自定义管理，点击“新建”，进入合约定义页面。

序号	市场	品种	合约号	状态	录入日期	开始交易日期	最后点价日期	最后交收日期	修改	发布	删除
1	基差交易市场	铁矿石	b6-20160608-000001	已录入, 待审核	20190603	20160608	20160615	20160622			

填写合约相关信息，点击“新建”。

通过点击复制合约下拉框，可以复制历史合约内容，再修改部分合约要素，完成合约的快速创建。

关于几个合约要素重点说明如下：

1. 通过下拉选确定品种和品级后，品级说明模板会自动生成在输入框中，客户根据实际情况填写品级说明内容。
2. 品级和交货地可以下拉选择也可以自定义输入。
3. 开始交易日默认为当前交易日，合约只有在开始交易日开市后才可以报价。**开始交易日和最后点价日可以是一天，最后交收日必须大于最后点价日**
4. 最后点价日闭市结算后，若双方依然未完成首次点价确认，合约会自动进入交收环节。
5. 最后交收日闭市结算后，若双方依然未完成交收通知确认，平台会以最后点价日收盘价计算货款，自动为双方完成交收通知确认环节。
6. 是否利用平台结算：选择“是”，平台会按流程管理双方的交易、交收环节以及相应的保证金、货款、盈亏的划转，直至合约了结；选择“否”，合约不可转让和设置追保方，平台会在交易成交当日冻结双方的交易保证金，并在当日闭市结算后释放，合约在平台范围内了结，双方线下自行完成剩余的交收等环节。
7. 是否可转让：只有选择“是”的时候合约才可以在首次成交后转让报价。
8. 点价方可在定义合约时自定义，但是对应的为线下约定的有权点价方，**在系统内只**

要双方协商一致，买卖双方均可点击首次点价。

9. 追保方：追保方在首次点价确认后，直至交收通知确认前，可以多次向对方发起追保。
10. 报价买卖标志可选择：双边、买、卖，如果选择双边，则生成买卖两个合约。交易商可点击通用条款查看合约通用条款。合约专用条款为平台提供的模板，交易商可根据具体合同需求灵活修改，但通用条款效力优于专用条款。
11. 已新建的合同生成合约号，可以在“复制合约”选择，进行复制。

您现在的位置: 产品信息 >> 基金合约自定义管理

产品信息

交易日历查询

基金合约信息查询

基金合约自定义管理

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交收管理

复制合约	请输入或者选择有效合约	复制	注：复制内容不包含合约附件				
品种	铁矿石	基差期货合约	铁矿石1705	交易数量		单位：吨	
品级	请输入或者选择	交货地（仓库）	请输入或者选择				
开始交易日期	20160608	最后点价日期		最后交收日期			
是否期权衍生品	否	报价买卖标志	双边	双边合约会在创建时同时生成买卖两个方向的另外其他事看相同的合约			
是否利用平台结算	是	买方交易保证金	0	%	卖方交易保证金	0	%
点价方	买	是否可转让	是	追保方	无		
合约附件	选择文件 未选择任何文件 (上传文件格式仅支持pdf、doc、docx、rar、zip)						
品级说明							
合约专用条款	1. 追加保证金的触发约定： 如：点价后按照XX价格收取XX保证金；点价后基差期货合约的价格上涨/下跌XX时，追加XX保证金。 2. 交易方式及违约责任约定： 如：如违约方违约，每公里加收XX元。违约责任范围XX；自提，违约方以交付XX违约金作为违约金。 3. 检验方式约定： 如：以XX时间为准进行检验、验收、原产地证明、出厂证明等作为依据。 4. 仲裁及诉讼条款： 交易双方发生纠纷应首先自行协商解决，协商不成的应提请仲裁委员会进行调解，调解不能达成一致时，应当采取仲裁或诉讼的方式解决，仲裁地：____，仲裁机构：____。 5. 双方约定的其他条款（如有）：						

如果要修改合约，点击“修改”按钮，进入合约修改页面，修改后，点击“完成”。

您现在的位置: 产品信息 >> 基金合约自定义管理

产品信息

交易日历查询

基金合约信息查询

基金合约自定义管理

客户管理

共1条记录, 显示 1 到 1

序号	市场	品种	合约号	状态	录入日期	开始交易日期	最后点价日期	最后交收日期	修改	发布	删除
1	基金交易市场	铁矿石	hk-20160608-000001	已录入, 待审批	20160903	20160608	20160615	20160622			

您现在的位置: 产品信息 >> 基金合约自定义管理

产品信息

交易日历查询

基金合约信息查询

基金合约自定义管理

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交收管理

品种	铁矿石	基差期货合约	铁矿石1705	交易数量	2000	单位：吨	
品级	组群粉	交货地（仓库）	组群粉				
开始交易日期	20160608	最后点价日期	20160615	最后交收日期	20160622		
是否期权衍生品	否	是否利用平台结算	是				
报价买卖标志	买	买方交易保证金	5.0000	%	卖方交易保证金	0.0000	%
点价方	买	是否可转让	是	追保方	卖方		
合约附件	选择文件 未选择任何文件 (上传文件格式仅支持pdf、doc、docx、rar、zip)						
品级说明	FE：%，AL2O3：%，SiO2：%，P：%，S：%，%H2O：%						
合约专用条款	1. 追加保证金的触发约定： 如：点价后按照XX价格收取XX保证金；点价后基差期货合约的价格上涨/下跌XX时，追加XX保证金。 2. 交易方式及违约责任约定： 如：如违约方违约，每公里加收XX元。违约责任范围XX；自提，违约方以交付XX违约金作为违约金。 3. 检验方式约定： 如：以XX时间为准进行检验、验收、原产地证明、出厂证明等作为依据。 4. 仲裁及诉讼条款： 交易双方发生纠纷应首先自行协商解决，协商不成的应提请仲裁委员会进行调解，调解不能达成一致时，应当采取仲裁或诉讼的方式解决，仲裁地：____，仲裁机构：____。 5. 双方约定的其他条款（如有）：						

点击“发布”按钮，进入合约发布页面。点击“发布”按钮，对合约进行发布。发布后可进行报价与交易。

6

产品信息

交易日历查询

基差合约信息查询

基差合约自定义管理

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交易管理

您现在的位置: 产品信息>>基差合约自定义管理

品种	铁矿石	基差期货合约	铁矿石1705	合约号	bt-20160608+000001			
交易数量	2000	单位: 吨	品级	纽曼粉	交货地 (仓库)	张家港		
开始交易日	20160608		最后报价日	20160619	最后成交日	20160622		
是否期转现货	否		是否利用平台结算	是				
报价买卖标志	卖		买方交易保证金	5.0000	%	卖方交易保证金	0.0000	%
点价方	买		是否可转让	是		追保方	卖方	
合约附件								
品质说明	FE: %; AL2O3: %; SiO2: %; P: %; S: %; H2O: %							
合约专用条款	1. 追加保证金的情形约定: 如: 点价后按照XX价格收取XX保证金; 点价后基差期货合约价格上涨/下跌XX时, 追加XX保证金。 2. 交货方式及相关费用约定: 如: 如送货上门, 每公量加收XX元。送货地范围XX; 自提, 货权转移以交付XX货权转移凭证为准。 3. 检验方式约定: 如: 以XX时间装港报告、磅秤、原产地证明、出厂证明等材料为依据。 4. 仲裁及诉讼条款: 交易双方发生纠纷应当先自行协商解决, 协商不成的应当根据业务规则进行调解, 调解不能达成一致, 应当采取仲裁或诉讼的方式解决, 仲裁地: _____, 仲裁机构: _____。 5. 双方约定的其他条款 (如有):							

发布

撤回

2) 发布合约所属品种圈内的交易商/客户进入: 产品信息-基差合约信息查询, 查询到圈内所发布合约的信息。对于自己想再次修改或取消的合约, 可以点击合约后的摘牌按钮, 取消合约发布, 重新复制定义。

产品信息

交易日历查询

基差合约信息查询

基差合约自定义管理

客户管理

资金管理

您现在的位置: 产品信息>>基差合约信息查询

市场	基差交易市场	品种	铁矿石
----	--------	----	-----

共找到3条记录, 显示 1 到 3

序号	合约号	品种	买卖方向	数量	品级	交货地	初始成交价 (元)	开始交易日	最后点价日	最后成交日	摘牌
1	bt-20160530+000001	铁矿石	卖	2000	纽曼粉	张家港	20.00	20160530	20160602	20160606	摘牌
2	bt-20160602+000001	铁矿石	卖	2000	纽曼粉	张家港	50.00	20160602	20160602	20160607	摘牌
3	bt-20160608+000003	铁矿石	买	10000	普氏粉	张家港	700.00	20160608	20160629	20160630	

合约	交易时间				
品种	聚丙烯	基差期货合约	聚丙烯1705	合约号	bt-20160617-pp-000003
交易数量 (吨)	100	结算价计算使用类型	结算价	品级	均聚PP粒
交货地 (仓库)	苏州	买方交易商	8005	签发方交易商	8003
开始交易日	20160617	最后点价日	20160617	最后成交日	20160715
是否期转现业务	否	是否利用平台结算	是	基差合约状态	已点价
报价买卖标志	卖	买方交易保证金率	5%	卖方交易保证金率	0%
初始成交价 (元)	-10	买方交易保证金	40450	卖方交易保证金	0
点价方	买	是否可转让	是	追保方	卖方
合约附件					
品级说明	厂家：，牌号：				
合约专用条款	1.追加保证金的情形约定： 如：点价后按照XX价格收取XX保证金；点价后基差期货合约价格上涨/下跌XX时，追加XX保证金。 2.交货方式及相关费用约定： 如：如送货上门，每公量加收XX元。送货地范围XX；自提，货权转移以交付XX货权转移凭证为准。 3.检验方式约定： 如：以XX时间装港报告、磅秤、原产地证明、出厂证明等材料为依据。 4.仲裁及诉讼条款： 交易双方发生纠纷应当先自行协商解决，协商不成的应当根据业务规则进行调解，调解不能达成一致的，应当采取仲裁或诉讼的方式解决，仲裁地：____，仲裁机构：____。 5.双方约定的其他条款（如有）：				

8 交易管理

交易商、子账号均可进行交易，实例中以交易商为例。

8.1 挂牌

a) 报价、响应

1) 交易商[DD 资本]使用交易下单功能,选择挂牌交易,我要报价,选择合约,填写价格,修改联系人信息,点击“报入”,报入结果在状态列显示,如提示错单,可在最后一列查看原因。

产品信息

交易日历查询

基差合约信息查询

基差合约自定义管理

客户管理

资金管理

交易管理

交易下单

交易查询

日报单查询

交易管理

挂楼成交

交易成交

挂楼成交

我要报价

我要下单

我要转让

我要询价

	合同	品种	基差期限	初始成交价	挂牌方	方向	成交价	最新成交价	最新成交价	交易地	数量 (吨)	品级	基差说明	联系方式
1	sp20160617-sp-000002	顺元牌	201705		DD需求	买	买	20160712	20160719		营口港	200	均质PP粒	厂家: 测试

10

H

第1

共1页

H

O

显示1到1共12条

下单

合同

价格

联系电话

买入

sp20160617-sp-000002

30.00

DD需求:15641178251

客户号:0008005 清算账户:80050008000

客户设置

当日委托

当日成交

三 委托意向

成交意向

持仓意向

平仓意向

操作	委托号	状态	合约号	订单类型	买卖方向	客户号	客户名称	清算账户	数量 (吨)	价格	已成交 (吨)	录入日期	录入时间
----	-----	----	-----	------	------	-----	------	------	--------	----	---------	------	------

[illegible]

挂牌成交	挂牌成交	协商撮价	我要下单	我要转让	我要回购									
合约	品种	基准期限	初始成交价	挂牌方	方向	询价价	最低限价日	最新成交价	签发方	交割地	数量(吨)	品级	品级说明	联系方式
1	hs-20160617.sp-000002	夏商瑞	pp1705	30	DD需求	买	英	20160712	20160718	营口港	200	均聚PP粒	厂家：南玻。	

日期	合约	状态	合约号	订单类型	买卖方向	客户号	客户名称	清算账户	数量(吨)	价格	已成交(吨)	录入日期	录入时间
1	套期	4	已输入	hs-20160617.sp-000002	买入	英	00060005	DD股份集团有限公司	800500000005	200	30	0	20160617 10:54:28
2		3	完全成交	hs-20160617.sp-000003	响应	买	00060005	DD股份集团有限公司	800500000005	100	-10	100	20160617 10:24:24
3		1	挂单	hs-20160617.sp-000002	买入	英	00060005	DD股份集团有限公司	800500000005	200	30	0	20160617 10:19:57 30206

2) 交易商[CC 集团] 使用交易下单功能, 选择挂牌交易, 我要下单, 选择合约, 点击“报入”, 报入结果在状态列显示, 如提示错单, 可在最后一列查看原因。

The first screenshot shows the '下单' (Place Order) form with the '报入' (Submit) button highlighted. The second screenshot shows a confirmation dialog box asking '您确认报入吗?' (Are you sure you want to submit?). The third screenshot shows the order status in the '交易记录' (Transaction Record) table, with the status '报入成功' (Submitted Successfully) and the order number '2' highlighted.

b) 转让、响应

交易商[CC 资本] 使用交易下单功能, 选择挂牌交易, 我要转让, 选择合约, 填写价格, 修改联系人信息, 点击“报入”, 转让后合同编号不变。

交易商[DD 集团] 使用交易下单功能, 选择挂牌交易, 我要下单, 选择合约, 点击“报入”。点击当日成交, 可以看到成交记录。

c) 回购、响应

交易商[DD 资本] 使用交易下单功能, 选择挂牌交易, 我要回购, 选择合约, 填写价格, 修改联系人信息, 点击“报入”。

“我要报价”、“我要下单”、“我要转让”、“我要回购”中显示的“买卖方向”都是操作者视角的买卖方向，而行情展示的是从发布者视角的买卖方向。

a) 下单、响应

全部

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交易管理

信用管理

出入金管理

入金申请

出金申请

入金明细查询

出金明细查询

可用资金查询

其它资金管理

帐户资金划转

交易管理

交易下单

协助成交

合约成交

挂接成交

我要报价

我要下单

我要转让

我要回购

✓	合约	品种	基准期货	初始成交价	挂牌方	方向	点价方	最低点价日	最低成交价日	基地方	交割地	数量(吨)	品级	品级说明	联系方式
1	✓	hs20150817-pp-000002	聚丙烯	pp1705		DD需求	买	买	20160712	20160718		营口港	200	均聚PP粒	厂家：测试。

10

<

>

第1页

共1页

>>

<<

显示1到1共1条

下单

合约

价格

联系人信息

输入

对手方客户号:未设置 客户号:0008005 清算账户:80050008005 帐户设置

当日委托

当日成交

操作

委托号

订单状态

合约号

操作类型

下单时间

对手方交易账号

对手方交易简称

客户号

客户名称

清算账户

买卖方向

数量(吨)

价格

是否已匹配

全部

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交易管理

信用管理

出入金管理

入金申请

出金申请

入金明细查询

出金明细查询

可用资金查询

其它资金管理

帐户资金划转

交易管理

交易下单

协助成交

合约成交

挂接成交

我要报价

我要下单

我要转让

我要回购

✓	合约	品种	基准期货	初始成交价	挂牌方	方向	点价方	最低点价日	最低成交价日	基地方	交割地	数量(吨)	品级	品级说明	联系方式
1	✓	hs20150817-pp-000002	聚丙烯	pp1705		DD需求	买	买	20160712	20160718		营口港	200	均聚PP粒	厂家：测试。

10

<

>

第1页

共1页

>>

<<

显示1到1共1条

下单

合约

价格

联系人信息

输入

对手方客户号:未设置 客户号:0008005 清算账户:80050008005 帐户设置

当日委托

当日成交

操作

委托号

订单状态

合约号

操作

客户设置

对手方客户号: 0008005 C/C公司融资

客户号: 0008005 C/D融创华联的有限公司

清算账户: 80050008005-鲁信资产-DD股份有限

保存

关闭

b) 转让、响应

交易商[DD 集团] 使用交易下单功能，选择协商交易，我要下单，选择合约，点击

“报入”。点击当日成交，可以看到成交记录。

c) 回购、响应

交易商[DD 资本] 使用交易下单功能，选择协商交易，我要回购，选择合约，填写价格，修改联系人信息，设置账户信息，点击“报入”。

交易商[CC 集团] 使用交易下单功能，选择协商交易，我要下单，选择合约，点击“报入”。点击当日成交，可以看到成交记录。

9 交易查询

合约成交后，交易商/子账户可以在交易查询功能下对合约的交易记录进行查询。

9.1 持仓查询

交易商/子账户进入：交易查询-持仓查询，查看交易商、子账户的持仓状况。

通过持仓查询可以查到该笔交易自身所缴纳的总的保证金，以及用信用抵扣的额度。
持仓查询只能查到成交且未进入交收状态的合约，若合约完成首次点价流程（或自动过了最后点价日），则合约进入交收状态，持仓查询中不再显示该合约，在交收查询中能够查到交收状态的合约。

序号	交易日期	合约号	基础合约	清算账户	账户类型	交易商名称	客户号	客户名称	昨日持仓 (吨)	今日持仓 (吨)	保证金 (元)	信用额度抵扣 (元)	盈亏 (元)	手续费 (元)
1	20160617	h20160617-gc-000002	聚丙烯1705	80050008005	主账户	DD资本	0008005	DD股份有限公司	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
2	20160617	h20160617-gc-000003	聚丙烯1705	80050008005	主账户	DD资本	0008005	DD股份有限公司	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
3	20160602	h20160630+000001	铁矿石1705	80050010003	子账户	DD资本	0010003	123	2,000	0	0.00	0.00	0.00	0.00
4	20160601	h20160630+000001	铁矿石1705	80050010003	子账户	DD资本	0010003	123	2,000	2,000	62,000.00	1,000.00	0.00	0.00

9.2 成交查询

交易商/子账户进入：交易查询-成交查询，查看交易商、子账户的成交记录，包括每笔交易的合约信息、成交类型、成交方式、单笔盈亏等。

这里的盈亏单指交易盈亏，只显示转让和回购产生的盈亏。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

持仓查询

成交查询

交易确认单查询

日报表查询

交易管理

您现在的位置:交易查询>>成交查询

开始日期

20160613

结束日期

20160620

交易商号

8005

DD资本

客户号

成交方式

全部

市场

基金交易市场

合约

全部

1

1

1

1

10

1

1

1

1

1

1

1

序号	交易日期	合约号	基源合约	买交易商名称	买清算账户	买报入流水号	卖交易商名称	卖清算账户	卖报入流水号	订单类型	成交号	成交量	成交价 (元)	盈亏 (元)	成交时间	成交方式
1	20160617	bt-20160617-gp-000003	新万博1705	DD资本	80050008005	3	CC公司	80030008003	2	报入	13	100	-10.00	0.00	10:24:24	挂单成交

9.3 交易确认单查询

交易商/子账户进入: 交易查询-交易确认单查询, 查询并打印每笔合约的成交确认书 pdf。
交易确认书只有签发方和当前买方可以打印, 合约转让后原买方不能查看、打印交易确认书。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

持仓查询

成交查询

交易确认单查询

日报表查询

交易管理

您现在的位置:交易查询>>交易确认单查询

开始日期

20160613

结束日期

20160620

交易商号

8005

DD资本

清算账户

客户号

市场

基金交易市场

合约

全部

1

1

1

1

10

1

1

1

1

1

1

1

交易确认书	成交编号	交易商号	交易商名称	合约号	基源合约	成交日期	交易方向	交易数量	成交价	成交价单位	客户清算账户
打印	13	8005	DD资本	bt-20160617-gp-000003	新万博1705	20160617	买	100	-10.00	元吨	80050008005

基差交易确认书（基差贸易合同）

本次基差交易适用《大连商品交易所基差交易业务管理办法》、《大连商品交易所基差交易业务交易商管理办法》、《大连商品交易所基差交易业务纠纷调解及违规处理办法》（以下简称“业务规则”）及大连商品交易所其他相关业务规定。

卖方和买方以下单独称“交易一方”，合称“交易双方”。交易双方已经签署了《中国证券期货市场衍生品交易主协议（2018年版）》，本确认书构成主协议下的一项“交易有效约定”，除非本确认书中另有约定，主协议及其补充协议适用于本确认书。

本确认书适用《中国证券期货市场衍生品交易商品类衍生品定义文件（2015年版）》及其修改或补充（以下称“商品定义文件”），若本确认书与商品定义文件中的约定不一致，本确认书的相关约定具有优先法律效力。

交易双方同意，本确认书所述条款构成了交易双方之间就本确认书项下交易的完整条款，且对交易双方具有法律约束力。

本确认书分为基本信息、通用条款、专用条款三部分构成，若专用条款与基本信息和通用条款约定不一致，以基本信息和通用条款为准。

基本信息			
成交日期:	2016年06月17日	合同编号:	bt-20160617-pp-000003
卖方:	CC 公司集团	买方:	DD 股份有限公司
卖方清算账号:	80030008003	买方清算账号:	80050008005
卖方开户银行:	交通银行	买方开户银行:	交通银行
卖方银行资金账号:	80030008003	买方银行资金账号:	80050008005
卖方联系人信息:	CC 公司集团 15641178031	买方联系人信息:	DD 资本 15641178251
品种	聚丙烯		
基差期货合约	聚丙烯1705		
品级	均聚PP粒		
交货地（仓库）	苏州		
开始交易日	2016年06月17日		
最后点价日	2016年06月17日		
最后交收日	2016年07月15日		
交易数量	100吨		

10 日报表查询

日终结算后，交易商/子账户可以在日报表查询功能下对日终结算信息进行查询。

10.1 日成交单查询

交易商/子账户进入：日报表查询-日成交单查询，查看交易商、子账户指定交易日的成交记录，包括每笔交易的合约信息、成交类型、成交方式、盈亏等。

这里的盈亏单指交易盈亏，只显示转让和回购产生的盈亏。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

日成交单查询

日资金结算表

日持仓报表

追保通知查询

交收管理

您现在的位置: 日报表查询>>日成交单查询

开始日期

20160601

结束日期

20160620

交易商号

8005

DD资本

客户号

清算账户

市场

基金交易市场

合约

全部

共2条记录, 显示 1 到 2

1

2

查询

序号	清算日期	合约号	基准合约	成交号	买卖商简称	买清算账户	卖交易商简称	卖清算账户	成交量	成交价 (元)	盈亏 (元)	成交时间	成交方式
1	20160617	ht-20160617-gg-000003	聚芳隆1705	13	DD资本	80050008005	CC公司	80030008003	100	-10.00	0.00	10:24:24.128	挂单成交
2	20160602	ht-20160530-gg-000001	神矿石1705	8	FF企业	80070008007	DD资本	80050010003	2000	10.00	-20,000.00	10:17:57.357	挂单成交

10.2 日资金结算表

交易商/子账户进入：日报表查询-日资金结算表，查看交易商、子账户指定交易日的资金状况。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

日成交单查询

日资金结算表

日持仓报表

追保通知查询

交收管理

您现在的位置: 日报表查询>>日资金结算表

开始日期

20160620

结束日期

20160620

客户号

清算账户

交易商号

8005

DD资本

共2条记录, 显示 1 到 2

1

2

查询

序号	清算日期	清算账户	交易商简称	客户号	客户名称	今日结算可用额度 (元)	应追加保证金 (元)	今日初始可用额度 (元)	出金 (元)	入金 (元)	现金 (元)	质押品 (元)	昨日现金保证金 (元)
1	20160620	80050008005	DD资本	0008005	DC股份集团有限公司	30,059,550.00	0.00	30,059,550.00	0.00	0.00	30,059,550.00	0.00	0.00
2	20160620	80050010003	DD资本	0010003	123	380,000.00	0.00	380,000.00	0.00	0.00	380,000.00	0.00	0.00

10.3 日持仓报表

交易商/子账户进入：日报表查询-日持仓报表，查看交易商、子账户指定交易日的持仓状况。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

日成交单查询

日资金结算表

日持仓报表

追保通知查询

交收管理

您现在的位置: 日报表查询>>日持仓报表

开始日期

20160615

结束日期

20160620

交易商号

8005

DD资本

客户号

清算账户

市场

基金交易市场

合约

全部

共1条记录, 显示 1 到 1

1

查询

序号	清算日期	合约号	基准合约	清算账户	账户类型	交易商简称	客户号	客户名称	昨日持仓 (吨)	今日持仓 (吨)	保证金 (元)	信用额度抵扣 (元)	盈亏 (元)	手续费 (元)
1	20160617	ht-20160617-gg-000003	聚芳隆1705	80050008005	主账户	DD资本	0008005	DC股份集团有限公司	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00

10.4 追保通知查询

交易商/子账户进入：日报表查询-追保通知查询：查看交易商/子账户是否处于被追保状态。**此处为交易所结算后计算出的追保结果，而交收管理中的追保查询是基于买卖双方互相追保的查询。**

11 交收管理

交易商、子账户均可进行交收，实例中以交易商为例。

11.1 首次点价/追保申请

1) 首次点价

交易商[8012]登录交易平台，选择要操作的合约，点击首次点价确认。

首次点价后，合约进入交收状态，合约不可转让、回购。若买卖双方始终未进行首次点价，合约最后点价日日终结算后，合约自动完成首次点价流程。

首次点价后，当天结算后，双方冻结的交易保证金（含双边信用抵扣）全部释放，卖方转化为交割保证金、买方转化为买方转货款，划转到交易所账户。交易商可以在其他资金明细中看到交割保证金/买方转货款的资金明细。

合同成交后就可以进行首次点价确认。一方点价确认后，系统会以短信形式通知对手方。

2) 追保申请

首次点价后，追保方可多次发起追保申请，追保方在合约创建时定义。

交易商登录交易平台，在追保申请功能中选择合约，填写申请并复核。

您现在的位置: 交收管理 >> 首次追保申请

没有找到记录。

选择	申请号	市场	合约号	追保金额	申请状态	操作人	操作日期	操作时间	备注
市场 基金交易市场 合约 SH20160617-SP-000003 追保金额 50000 伍万元整 当前已收履约力保证金 40450 元, 追加履约力保证金 99450 元 备注 追保五万元 说明 买卖双方均可确认追保, 首次追保金额需等待行确认追保流程, 确认追保后合约不可转让。 提交 新增 删除 审核									

3) 追保申请复核后, 系统不会马上对被追保方进行追保, 当日日终结算后, 系统会按照追保申请对被追保方进行追保, 但是会在被追保方预测可出金金额中立即扣减。追保方发起追保申请后, 系统会以短信形式通知对手方。

4) 交易商/子账户可以进入: 交收管理-追保申请查询, 查看追保记录和被追保记录。

您现在的位置: 交收管理 >> 追保申请查询

市场	基金交易市场	合约	全部
方向	追保记录	被追保记录	状态

找到1条记录, 显示 1 到 10

申请号	市场	合约号	追保金额	申请状态	操作人	操作日期	操作时间	备注
2	基金交易市场	SH20160524-000001	3,331,000.00	已审核	CCgs	20190830	09:14:01	追保金额8元为200
合计			3,331,000.00					

11.2 交收通知

1) 卖方在交易平台的交收通知管理中, 选择需要交收的合约, 填写交收货款, 点击“新增”, 买方无权发起交收。

您现在的位置: 交收管理 >> 交收通知管理

市场	基金交易市场	合约	全部
找到1条记录, 显示 1 到 10			

选择	首次追保日	合约号	买交易商名称	买清算账户	卖交易商名称	卖清算账户	交收数量	交收货款	申请号	申请状态	操作人	操作日期	操作时间	审批操作人	审批操作日期	审批操作时间	备注
✓	20160617	SH20160617-SP-000003	DO资本	80050008005	CC公司	80030008003	100										

交收货款

290000

贰万玖仟元整

备注

新增

审核

确认交收

拒绝交收

2) 买方在交易平台的交收通知管理中, 选择要确认的合约, 点击“确认交收”。确认交收后, 平台即时收取买方货款。对于主动发起及确认交收的, 买方全额货款不足的不能确认交收。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交收管理

交收查询

首次点价/溢保申请

溢保申请查询

交收通知管理

溢保交收管理

您现在的位置: 交收管理>>交收通知管理

市场

基差交易市场

合约

全部

找到1条记录, 显示 1 到 1

10

查询

选择	首次点价日	合约号	买交易商简称	买清算账户	卖交易商简称	卖清算账户	交收数量	交收货款	申请号	申请状态	操作人	操作日期	审批日期	审批操作人	审批操作日期	备注
☒	20160617	h20160617-qc-000003	DD进本	80050008005	CC公司	80030008003	100									

交收货款

29000

贰万玖仟元整

备注

新增

删除

确认交收

审批拒绝

3) 交收通知申请最早可在首次点价日后的下一个交易日发起, 若双方始终未达成交收通知申请/确认流程, 则平台在最后交收日闭市结算后, 从买方账户上扣除保证金外的剩余全额货款, 暂存到平台上。默认交收货款计算公式(最后点价日收盘价+基差) * 货物数量

11.3 买方确认收货

买方线下收到货后, 登录交易平台, 在现货交收管理中, 选择合约后, 点击“确认收货”, 完成收货处理, 平台将 80%货款划转给卖方。如因在最后交收日系统自动扣除买方全额货款而导致买方可用资金为负的, 买方不能确认收货。

买方最早可在交收日后的下一个交易日完成确认收货流程, 80%交收货款以及卖方交割保证金均在确认收货后立即划转到卖方账户。卖方履约保证金在闭市结算后退还。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交收管理

交收查询

首次点价/溢保申请

溢保申请查询

交收通知管理

溢保交收管理

您现在的位置: 交收管理>>现货交收管理

市场

基差交易市场

合约

全部

找到1条记录, 显示 1 到 1

10

查询

选择	现货状态	首次点价日	合约号	买交易商简称	买清算账户	卖交易商简称	卖清算账户	交收数量	交收货款(元)	实际货款(元)	交收日	收货人	收货日期	收货时间	申请号	申请状态	操作人
☒	未收货	20160608	h20160608-qc-000003	FF企业	80070008007	CC公司	80030008003	10000	10.00		20160615						

实际货款(元)

零元整

备注

确认收货

发起通知

删除

审批通过

审批拒绝

11.4 发票/溢短确认

1) 买卖双方交收货物后, 确认最后的实际收货数量与金额并由卖方开发票发给买方。卖方登录交易平台, 在交收管理-现货交收管理中, 选择合约, 录入实际货款, 点击“发起发票划款”。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交收管理

交收查询

首次点价/追保申请

追保申请查询

交收通知管理

现货交收管理

您现在的位置: 交收管理 >> 现货交收管理

市场

基基交易市场

合约

全部

找到1条记录, 显示 1 到 10

选择	现货状态	首次点价日	合约号	买交易商简称	买清算账户	卖交易商简称	卖清算账户	交收数量	交收货款 (元)	实际货款 (元)	交收日	收货人	收货日期	收货时间	申请号	申请状态	操作
☒	已收清	20160608	16-20160608-000003	FF企业	80070008007	CC公司	80030008003	10000	10.00		20160615	FF	20190904	03:31:37			

实际货款 (元)

20000

或万元部

备注

实收货款

确认收货

追加货款

删除

审批通过

审批拒绝

2) 买方登录交易平台, 在现货交收管理中, 合约货款信息后, 选择合约, 点击“审批通过”, 买方可用资金不够差额尾款不能进行发票确认。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交收管理

交收查询

首次点价/追保申请

追保申请查询

交收通知管理

现货交收管理

您现在的位置: 交收管理 >> 现货交收管理

市场

基基交易市场

合约

全部

找到1条记录, 显示 1 到 10

选择	现货状态	首次点价日	合约号	买交易商简称	买清算账户	卖交易商简称	卖清算账户	交收数量	交收货款 (元)	实际货款 (元)	交收日	收货人	收货日期	收货时间	申请号	申请状态	操作
☒	已收清	20160608	16-20160608-000003	FF企业	80070008007	CC公司	80030008003	10000	10.00	20,000.00	20160615	FF	20190904	03:31:37	16	申请	CC

实际货款 (元)

20000

或万元部

备注

实收货款两万元

确认收货

追加货款

删除

审批通过

审批拒绝

3) 审批通过后, 平台计算尾款, 具体公式为: 全额货款 * 20% + (发票金额 - 全额货款)。若发票金额大于全额货款, 平台将全额货款的 20%划给卖方, 同时从买方账户划转差额部分给卖方; 若发票金额小于全额货款, 平台将全额货款的 20%扣除差额划给卖方, 剩余部分退给买方。

11.5 交收查询

整个交收过程中, 买卖双方均可进入页面: 交收管理-交收查询, 查看处于交收状态的合约信息: 首次点价日、交收日、交收保证金、交收货款、实际货款、现货状态等。

产品信息

客户管理

资金管理

交易管理

交易查询

日报表查询

交收管理

交收查询

首次点价/追保申请

追保申请查询

交收通知管理

现货交收管理

您现在的位置: 交收管理 >> 交收查询

市场

基基交易市场

合约

全部

开始日期

20160613

结束日期

20160620

买货信息

找到1条记录, 显示 1 到 10

序号	首次点价日	合约号	品种	买交易商简称	买清算账户	卖交易商简称	卖清算账户	交收数量	交收货款 (元)	实际货款 (元)	履约保证金 (元)	交收手续费 (元)	交收日	现货状态
1	20160617	16-20160617-sp-000003	聚丙烯	DO资本	80050008005	CC公司	80030008003	100	0.00	0.00	40,450.00	0.00		未收货
合计								100	0.00	0.00	40,450.00	0.00		

卖货信息

没有找到记录, 显示 1 到 10

序号	首次点价日	合约号	品种	买交易商简称	买清算账户	卖交易商简称	卖清算账户	交收数量	交收货款 (元)	实际货款 (元)	履约保证金 (元)	交收手续费 (元)	交收日	现货状态
合计								0	0.00	0.00	0.00	0.00		

履约保证金项目为累计缴纳的保证金金额。

18

第二章 模拟交易场景

看过第一章的功能介绍后，为了让用户进一步熟悉系统，特总结了如下几个模拟交易场景，在更接近真实的交易场景中直观地体现平台的各个功能，涵盖了协商成交、挂牌成交、是否利用平台结算、转让、回购、交收等平台主要功能。

1 协商成交、不利用平台结算

当交易商希望指定交易对手方时，可以使用平台的协商成交功能；当合约定义为不利用平台结算时，平台只管理合约的报价和成交结算，成交当日闭市结算后，合约在平台内了解，剩余的交收环节由买卖双方线下自行完成。

- 1) 交易商[AA 集团]登录系统
- 2) 交易商[AA 集团]进入资金管理-出入金管理-入金申请，完成 700 万元入金
- 3) 交易商[AA 集团]进入资金管理-可用资金查询，查看可用资金，其中 200 万元作为风险保障金不可交易，剩余 500 万为可用资金
- 4) 交易商[AA 集团]进入产品信息-基差合约自定义管理，点击“新建”，进入合约定义页面。
- 5) 定义新合约，具体合同细节如下：
品种：铁矿石
基准期货合约：铁矿石 1705
交易数量：1000 吨
品级：纽曼粉
交货地（仓库）：大连港
开始交易日：默认当前交易日，测试系统为 20160520
最后点价日：20160525
最后交收日：20160526
是否期转现业务：否
是否利用平台结算：否
报价买卖标志：卖
买方交易保证金率：10%
卖方保证金率：0%
点价方：买
是否可转让：否（不利用平台结算的合约均不可转让）
追保方：无（不利用平台结算的合约均不定义追保方）
品级说明、合约专用条款按模板内容填写。
填写合约后点击“新建”，完成合约创建。
- 6) 回到基差合约自定义管理页面，在列表页找到刚刚创建的合约，合约号为 bt-20160520-i-000005，点击发布按钮，核对信息无误后，点击“发布”，完成基差合约的发布。
- 7) 交易商[AA 集团]进入交易管理-交易下单，选择协商交易-我要报价，找到刚刚创建的合约 bt-20160520-i-000005，输入基差报价 10 元，如有需要可以修改默认联系方

式，点击“账户设置”，输入协商交易对手方[BB 资本]的客户号（线下联系对方获取），点击报入完成协商报价。（协商报价因为对手方确定，所以在委托报价时不会冻结委托保证金）

- 8) 报价成功后，交易商[AA 集团]可以在当日委托列表中看到成功的委托报价信息。（协商报价不会在门户和 APP 的全市场行情中展示）
- 9) 交易商[BB 资本]登录系统
- 10) 交易商[BB 资本] 进入资金管理-出入金管理-入金申请，完成 205 万元入金，其中 200 万为风险保障金，5 万为可用资金。
- 11) 交易商[BB 资本]使用交易下单功能，选择协商交易，我要下单，选择合约 bt-20160520-i-000005，点击“报入”。点击当日成交，可以看到成交记录。
- 12) 买卖双方分别进入交易查询-持仓查询页面，查看持仓合约状态，其中卖方由于合约卖方保证金为 0%，因此没有保证金冻结；而合约设置了 10%的买方保证金，因此买方持仓中有 49800 元的保证金，计算规则为： $(\text{基准期货合约昨结价格} + \text{基差价格}) \times \text{数量} \times \text{保证金率}$ 。
- 13) 买方交易商[BB 资本]进入资金管理-可用资金管理页面，可以看到保证金占用 49800 元，可用资金为 200 元。
- 14) 买卖双方分别进入交易查询-交易确认书查询页面，可以打印双方的成交确认书 PDF。
- 15) 买卖双方分别进入交易查询-成交查询页面，可以查看本次成交记录。
- 16) 当日日终结算后，买卖双方分别进入持仓查询页面，持仓归零，买方交易商[BB 资本]进入可用资金页面，交易保证金被释放，剩余的交收环节由买卖双方线下继续完成。

2 挂牌成交，不利用平台结算

当交易商希望指定交易对手方时，可以使用平台的协商成交功能；当合约定义为不利用平台结算时，平台只管理合约的报价和成交结算，成交当日闭市结算后，合约在平台内了解，剩余的交收环节由买卖双方线下自行完成。

- 1) 交易商[AA 集团]登录系统
- 2) 交易商[AA 集团]完成入金，保证清算账户有 500 万为可用资金
- 3) 交易商[AA 集团]进入产品信息-基差合约自定义管理，点击“新建”，进入合约定义页面。
- 4) 定义新合约，具体合同细节如下：
 - 品种：铁矿石
 - 基准期货合约：铁矿石 1705
 - 交易数量：1000 吨
 - 品级：纽曼粉
 - 交货地（仓库）：大连港
 - 开始交易日：默认当前交易日，测试系统为 20160520
 - 最后点价日：20160526
 - 最后交收日：20160526
 - 是否期转现业务：否
 - 是否利用平台结算：否
 - 报价买卖标志：卖

买方交易保证金率：10%

卖方保证金率：10%

点价方：买

是否可转让：否（不利用平台结算的合约均不可转让）

追保方：无（不利用平台结算的合约均不定义追保方）

品级说明、合约专用条款按模板内容填写。

填写合约后点击“新建”，完成合约创建。

- 5) 回到基差合约自定义管理页面，在列表页找到刚刚创建的合约，合约号为 **bt-20160521-i-000001**，点击发布按钮，核对信息无误后，点击“发布”，完成基差合约的发布。
- 6) 交易商[AA 集团]进入交易管理-交易下单，选择挂牌交易-我要报价，找到刚刚创建的合约 **bt-20160521-i-000001**，输入基差报价 10 元，如有需要可以修改默认联系方式，点击报入完成挂牌报价。
- 7) 报价成功后，交易商[AA 集团]可以在当日委托列表中看到成功的委托报价信息。挂牌报价会在门户和 APP 的全市场行情页面中展示，状态为报价
- 8) 报价成功后，交易商[AA 集团]进入交易查询-持仓查询页面，查看持仓合约状态，由于合约卖方保证金为 10%，因此挂牌报价有 49800 元的委托保证金冻结，由于挂牌报价时对手方不确定，因此不能用双边信用抵扣委托冻结保证金。保证金计算规则为： $(\text{基准期货合约昨结价格} + \text{基差价格}) \times \text{数量} \times \text{保证金率}$ 。
- 9) 交易商[BB 资本]登录系统
- 10) 交易商[BB 资本]使用交易下单功能，选择挂牌交易，我要下单，选择合约 **bt-20160521-i-000001**，点击“报入”。点击当日成交，可以看到成交记录。
- 11) 剩余流程参考案例 1 的 13)-16)

3 挂牌成交，回购

已成交且未进入交收环节的合约，签发方可以发起回购申请，买方响应后，双方结算回购盈亏，合约了解。卖方也可以响应买方的转让报价，等同于完成回购。

- 1) 参考案例 2 中的 1)-10)步骤，完成双方的挂牌成交。
- 2) 成交后双方可以到持仓查询、成交查询等菜单查看合约成交状态。
- 3) 成交后，查看门户和 APP 的全市场行情页面，合约 **bt-20160521-i-000001** 的状态变为成交。
- 4) 卖方交易商[AA 集团]进入交易管理-交易下单，选择挂牌交易-我要回购，选择合约 **bt-20160521-i-000001**，输入基差报价 5 元，点击报入完成回购挂牌报价。回购报价不会冻结委托保证金。
- 5) 回购报价完成后，看门户和 APP 的全市场行情页面，合约 **bt-20160521-i-000001** 又多了一条基差为 5 元的行情，状态为报价。
- 6) 买方交易商[BB 资本] 进入交易管理-交易下单，选择挂牌交易-我要下单，看到合约 **bt-20160521-i-000001** 的报价信息，交易类型为回购，点击报价响应回购。
- 7) 成交后，买卖双方到持仓查询、成交查询等菜单查看合约成交状态。可以看到双方持仓归零，其中卖方交易商[AA 集团]的交易盈亏为-5000 元，买方交易商[BB 资本]的交易盈亏为 5000 元。
- 8) 回购成交后，查看门户和 APP 的全市场行情页面，合约 **bt-20160521-i-000001** 的新一代行情状态变为成交。

9) 回购完成后, 合约 bt-20160521-i-000001 了结。

4 挂牌成交, 利用平台结算, 完成交收, 使用信用

利用平台的挂牌报价流程完成成交, 并利用平台结算, 线上完成整个合约的交收流程。本案例中卖方使用交易商主账户, 买方使用子账户。(交易商-交易商、子账户-子账户的成交流程类似)

- 1) 交易商[AA 集团]和交易商[BB 资本]先互相完成 200 万的双边授信
- 2) 交易商[AA 集团]登录系统
- 3) 交易商[AA 集团]完成入金, 保证清算账户有 500 万为可用资金
- 4) 交易商[AA 集团]进入产品信息-基差合约自定义管理, 点击“新建”, 进入合约定义页面。
 - 5) 定义新合约, 具体合同细节如下:
 - 品种: 铁矿石
 - 基准期货合约: 铁矿石 1705
 - 交易数量: 1000 吨
 - 品级: 纽曼粉
 - 交货地(仓库): 大连港
 - 开始交易日: 默认当前交易日, 测试系统为 20160520
 - 最后点价日: 20160526
 - 最后交收日: 20160526
 - 是否期转现业务: 否
 - 是否利用平台结算: 否
 - 报价买卖标志: 卖
 - 买方交易保证金率: 10%
 - 卖方保证金率: 10%
 - 点价方: 买
 - 是否可转让: 否(不利用平台结算的合约均不可转让)
 - 追保方: 无(不利用平台结算的合约均不定义追保方)
 - 品级说明、合约专用条款按模板内容填写。
 - 填写合约后点击“新建”, 完成合约创建。
- 6) 回到基差合约自定义管理页面, 在列表页找到刚刚创建的合约, 合约号为 bt-20160521-i-000001, 点击发布按钮, 核对信息无误后, 点击“发布”, 完成基差合约的发布。
- 7) 交易商[AA 集团]进入交易管理-交易下单, 选择挂牌交易-我要报价, 找到刚刚创建的合约 bt-20160521-i-000001, 输入基差报价 10 元, 如有需要可以修改默认联系方式, 点击报入完成挂牌报价。
- 8) 报价成功后, 交易商[AA 集团]可以在当日委托列表中看到成功的委托报价信息。挂牌报价会在门户和 APP 的全市场行情页面中展示, 状态为报价
- 9) 报价成功后, 交易商[AA 集团]进入交易查询-持仓查询页面, 查看持仓合约状态, 由于合约卖方保证金为 10%, 因此挂牌报价有 49800 元的委托保证金冻结, 由于挂牌报价时对手方不确定, 因此不能用双边信用抵扣委托冻结保证金。保证金计算规则

为： $(\text{基准期货合约昨结价格} + \text{基差价格}) \times \text{数量} \times \text{保证金率}$ 。

- 10) 交易商[BB 资本]登录系统
- 11) 交易商进入：客户管理-基差客户管理，新增子账户[BB 交易员]。是否内部账户选择“是”，子账户可以使用主账户的双边授信。
- 12) 子账户[BB 交易员]使用交易下单功能，选择挂牌交易，我要下单，选择合约 bt-20160521-i-000001，点击“报入”。点击当日成交，可以看到成交记录。
- 13) 成交后双方可以到持仓查询、成交查询等菜单查看合约成交状态。
- 14) 买卖双方进入可用资金查询页面，可以看到交易保证金抵扣 49800 元，全部为信用抵扣，双方进入资金管理-信用管理-授信额度查询页面，可以看到授信额度为 2,000,000 元，可用授信额度为 1,950,200 元，交易冻结保证金为 49,800 元，点击明细可以看到信用被抵扣到了 bt-20160521-i-000001 合约上。
- 15) 成交后，查看门户和 APP 的全市场行情页面，合约 bt-20160521-i-000001 的状态变为成交。
- 16) 成交当日闭市结算后，双方可以到日报表查询中查看各自的当日交易信息。
- 17) 次日开市后，直至最后点价日闭市前，买卖双方均可完成首次点价确认，本例中为卖方进入交收管理-首次点价/追保申请页面，选择指定合约 bt-20160521-i-000001，点击首次点价确认按钮，完成首次点价确认环节。
- 18) 任何一方完成首次点价确认后，合约进入点价状态，持仓归零，不可转让或回购，交收管理页面可以查到合约的交收状态，追保方向另一方发起追保。
- 19) 首次点价后，双方冻结的交易保证金（含双边信用抵扣）全部释放，卖方转化为交割保证金、买方转化为买方转货款，划转到交易所账户。交易商可以在其他资金明细中看到交割保证金/买方转货款的资金明细。本例中，转化的保证金为 49,800 元。双方进入可用资金查询，可以看到 49,800 元的交收保证金已经不在账户中，被划转到了交易商账户上。
- 20) 最后点价日结算前，双方均可执行首次点价确认流程，若双方一直不确认，到最后点价日闭市结算后，系统自动完成首次点价操作。
- 21) 本例中，合约追保方设定为买方，因此卖方交易商[AA 集团]在首次点价确认后无权向对手方追保，买方子账户[BB 交易员]进入交收管理-首次点价/追保申请页面，选定指定合约，输入追保金额 10,000 元，点击新增，增加一条追保记录。点击刚刚新增的追保记录，核对信息无误后，点击复核，完成追保申请。
- 22) 系统会在日终结算时对追保进行结算，日终结算后卖方交易商[AA 集团]查看可用资金，发现又减少了 10000 元，在其他资金明细页面中可以看到追保明细。
- 23) 追保方可以多次发起追保，若清算账户可用资金不足，系统会发出追保通知并限制其交易权限。交易商通过入金补足可用资金后，联系交易所基差管理人员核实后，人工恢复清算账户的交易权限。
- 24) 首次点价确认后，经过一次日终结算，最快次日就可以手动发起交收通知申请，交收通知申请只能卖方发起，买方确认
- 25) 若最后交收日闭市结算后双方依然未达成交收通知申请确认，则系统自动为双方达成交收通知申请，货款计算规则为最后点价日收盘价 * 货物数量
- 26) 交易商[AA 集团]进入交收管理-交收通知管理，点击查询，在列表页勾选指定合约 bt-20160521-i-000001，输入全额交收货款、备注，本例中输入交收货款为 100 万，点击新增，完成交收通知申请
- 27) 子账户[BB 交易员] 进入交收管理-交收通知管理，点击查询，在列表页勾选指定合约，可以看到卖方输入的全额货款和备注，确认货款无误后，点击确认交收完

成交收通知确认流程。

- 28) 确认交收后平台即时收取买方全额货款，不足则无法确认交收，本例中交收货款的 100 万元。由于之前买方已经有 49800 元的买方转货款，因此当日闭市时，买方需再交 950,200 元货款。
- 29) 买方线下确认货权转移后，子账户[BB 交易员]进入交收管理-现货交收管理页面，查询并勾选指定合约 **bt-20160521-i-000001**，点击确认收货
- 30) 确认收货后，买方交的全额货款的 80%货款 80 万立即划入卖方账户，卖方之前交的交割保证金 49800 元也重新划回卖方账户。
- 31) 买卖双方交收货物后，线下协商溢短，确认最后的实际收货金额并由卖方开发票发给买方。
- 32) 本例中，交易商[AA 集团]进入交收管理-现货交收管理页面，勾选指定合约 **bt-20160521-i-000001**，输入实际货款 110 万，点击发起发票划款，发起发票划款流程。
- 33) 买方子账户[BB 交易员] 进入交收管理-现货交收管理页面，勾选指定合约 **bt-20160521-i-000001**，核对实际货款后点击审批通过。
- 34) 审批通过后，平台将剩余的 20%货款即时划入卖方账户，同时为双方结算实收货款和预收货款的差额，本例卖方收到平台冻结的剩余 20%货款 20 万元，同时买方再划转 10 万元的差额给卖方。
- 35) 结算完成后，合约了结。

5 挂牌成交，使用平台结算，转让并完成交收

合约成交直至首次点价确认前，买方可以以一个新的基差价格对合约进行转让报价，若有其他交易商响应，则转让成交。原买方和新买方计算差价，完成交易盈亏划转，合约签发方和新买方以最初的基差价格继续完成合约交收。

- 1) 以案例 4 的 1 到 16 步为例，交易商[AA 集团]和交易商[AAAA 集团]的子账户[BB 交易员]达成 **bt-20160521-i-000001** 合约的挂牌成交，具体流程不再赘述。
- 2) 子账户[BB 交易员] 进入交易管理-交易下单，选择挂牌交易-我要转让，找到之前成交的合约 **bt-20160521-i-000001**，输入基差报价 15 元，如有需要可以修改默认联系方式，点击报入完成转让挂牌报价。
- 3) 报价成功后，子账户[BB 交易员]可以在当日委托列表中看到成功的委托报价信息。转让委托报价不会冻结委托交易保证金。
- 4) 挂牌报价会在门户和 APP 的全市场行情页面中展示一条新的行情，状态为报价
- 5) 交易商[CC 资本]登录系统并完成入金，保证清算账户中有 500 万的可用资金。
- 6) 交易商[CC 资本] 进入交易管理-交易下单，选择挂牌交易-我要下单，找到合约 **bt-20160521-i-000001**，显示了合约的初始价格为 10 元，报价为 15 元，报价类型为转让。勾选合约点击报入，完成转让成交。
- 7) 成交后，三方到持仓查询、成交查询等菜单查看合约成交状态。签发方交易商[AA 集团]可以看到持仓状态不变，从合约详情中可以看到买方已经变为[CC 资本]；原买方子账户[BB 交易员]可以看到持仓归零，交易盈亏为 5000 元；新买方交易商[CC 资本]可以看到有一条 **bt-20160521-i-000001** 的持仓信息，交易盈亏为-5000 元。
- 8) 转让成交后，查看门户和 APP 的全市场行情页面，合约 **bt-20160521-i-000001** 的新一条行情状态变为成交。
- 9) 成交当日闭市结算后，签发方交易商[AA 集团]进入授信额度查询，可以看到与原买

方[BB 资本]的可用授信额度恢复到了 200 万，由于签发方与新买方没有双边授信且合约的卖方保证金不为 0，签发方的可用资金被冻结了 49800 元的交易保证金。

10) 后续的交易环节与案例 3 类似，不在赘述。

6 协商成交，使用平台结算，完成交收

- 1) 交易商[AA 集团]登录系统并完成入金
- 2) 交易商[AA 集团]进入产品信息-基差合约自定义管理，点击“新建”，进入合约定义页面。
- 3) 定义新合约，具体合同细节如下：
品种：铁矿石
基准期货合约：铁矿石 1705
交易数量：1000 吨
品级：纽曼粉
交货地（仓库）：大连港
开始交易日：默认当前交易日，测试系统为 20160520
最后点价日：20160525
最后交收日：20160526
是否期转现业务：否
是否利用平台结算：是
报价买卖标志：卖
买方交易保证金率：10%
卖方保证金率：0%
点价方：买
是否可转让：否（不利用平台结算的合约均不可转让）
追保方：无（不利用平台结算的合约均不定义追保方）
品级说明、合约专用条款按模板内容填写。
填写合约后点击“新建”，完成合约创建。
- 4) 回到基差合约自定义管理页面，在列表页找到刚刚创建的合约，合约号为 bt-20160520-i-000005，点击发布按钮，核对信息无误后，点击“发布”，完成基差合约的发布。
- 5) 交易商[AA 集团]进入交易管理-交易下单，选择协商交易-我要报价，找到刚刚创建的合约 bt-20160520-i-000005，输入基差报价 10 元，如有需要可以修改默认联系方式，点击“账户设置”，输入协商交易对手方[BB 资本]的客户号（线下联系对方获取），点击报入完成协商报价。（协商报价因为对手方确定，所以在委托报价时不会冻结委托保证金）
- 6) 报价成功后，交易商[AA 集团]可以在当日委托列表中看到成功的委托报价信息。（协商报价不会在门户和 APP 的全市场行情中展示）
- 7) 交易商[BB 资本]登录系统并完成入金
- 8) 交易商[BB 资本]使用交易下单功能，选择协商交易，我要下单，选择合约 bt-20160520-i-000005，点击“报入”。点击当日成交，可以看到成交记录。
- 9) 协商成交完成后，后续的交易环节参考案例 4