

# 华泰期货看穿式监管操作指南

## 第一章 概述

根据《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》（证监会公告〔2013〕【30号】）、《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》（证监会发布【第27号公告】2018年9月7日），中国期货市场监控中心于2018年9月14日发布《关于发布〈期货公司客户交易终端信息采集及接入认证技术规范〉的通知》，要求期货公司于2019年6月14日前完成交易系统的升级改造工作，实现期货公司对客户交易终端接入认证管理、交易终端信息采集并上报的功能。

### 1.1 适用范围

需要通过CTP系统API接口连接我司的交易客户端和系统。

### 1.2 CTP终端认证原理

终端认证功能是CTP识别发起登录请求对象的重要手段，交易终端在登录CTP系统前必须携带其AppID和授权码，认证通过后，方可登录交易系统。

三个要素：AppID, AuthCode, AppType

#### 1、直连模式

(1) 终端信息由交易终端调用柜台商提供的 TraderAPI 直接采集，采集过程对终端软件透明，在登录柜台系统时上传

(2) 终端接入的公网地址、登录时间、资金账号、用户类型等信息由柜台系统在终端登录时补充采集

## 2、中继代理模式

(1) 终端信息由终端软件调用柜台商提供的专用采集 API 采集并在登录中继时上传

(2) 终端公网地址、登录时间、RelayAppID 等信息由中继代理系统补充采集

(3) 资金账号、用户类型、中继代理公网 IP、代终端登入时间(多对多)或代提交时间(一对多)等由柜台系统补充采集

## 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		

## 第二章 CTP 穿透式测试系统接入参数

### 2.1 CTP 穿透式测试系统接入参数（验证看穿式监管功能有效性）

#### 电信：

IP: 59.36.3.115

交易端口: 27206

行情端口: 27216

#### 联通：

IP: 120.86.122.82

交易端口: 27206

行情端口: 27216

brokerid: 8080

API 版本号: API\_6.3.13\_T4

API 下载地址: [http://www.sfit.com.cn/5\\_2\\_DocumentDown.htm](http://www.sfit.com.cn/5_2_DocumentDown.htm)

产品线	版本体系	最新版本	中文资料	英文资料	说明
期货 期权	生产版本	6.3.15_P2_mdapi	<ul style="list-style-type: none"> <li>6.3.15_API接口说明 (更新时间2019.04.11)</li> <li>其它参考资料</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>CTP Client Development Guidance</li> <li>CTP_API_Manual</li> </ul>	二代行情api新增ReqQryMulticastInstrument接口，支持组播合约查询。(注：该版本为非穿透式监管版本) 穿透式监管，需要搭配6.3.15 CTP front_se，不再兼容front_se，如需连接front的，请使用6.3.11版本（6.3.11版本已归档到历史版本中，目前线上版本为6.3.15）
		demo			
		服务器版			
		Android版			
		IOS版			
		历史版本			
	demo				
	穿透式监管评测版本	服务器版	CTP-API接口说明	---	采用监控中心测试密钥，需要搭配6.3.13_T4 CTP后台的新前置使用(front_se)
		Android版			
	个股现货	生产版本	个股API_20180914	----	---
历史版本					
CTP2 mini	生产版本	v1.2_20190222	----	---	CTP2mini_API
	历史版本				

## 2.2 CTP 仿真测试环境接入参数（验证是否能正常接入生产环境）

电信：

IP: 59.36.3.115

交易端口: 61206

行情端口: 41214

联通：

IP: 120.86.122.82

交易端口: 61206

行情端口: 41214

brokerid: 2318

API 版本号: API\_6.3.15

API 下载地址: [http://www.sfit.com.cn/5\\_2\\_DocumentDown.htm](http://www.sfit.com.cn/5_2_DocumentDown.htm)

产品线	版本体系	最新版本	中文资料	英文资料	说明
生产版本		demo			全场景案例
		6.3.15_P2_mdapi		--	二代行情api新增 ReqQryMulticastInstrument 接口, 支持组播合约查询。(注: 该版本为非穿透式监管版本)
		6.3.15_P2_mdapi_se	<ul style="list-style-type: none"> <li>6.3.15_API接口说明 (更新时间2019.05.06)</li> </ul>	--	二代行情api新增 ReqQryMulticastInstrument接口, 支持组播合约查询。(注: 该版本为穿透式监管版本)
	期货期权	<ul style="list-style-type: none"> <li>服务器版</li> <li>Android版</li> <li>IOS版</li> <li>历史版本</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>其它参考资料</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>CTP Client Development Guidance</li> <li>CTP_API_Manual</li> </ul>	穿透式监管, 需要搭配6.3.15 CTP front_se, 不再兼容 front。api如需连接front的, 请使用6.3.11版本(6.3.11版本已归档到历史版本中, 目前线上版本为6.3.15)
穿透式监管评测版本		服务器版	CTP-API接口说明	--	采用监控中心测试密钥, 需要搭配6.3.13_T4 CTP后台的新前置使用 (front_se)
		Android版			
FIX网关		--	CTP_FIX接口说明	CTP FIX Gateway User Manual	FIX4.2协议网关
个股现货	生产版本	个股API_20180914	-----	--	个股期权API
		历史版本			
CTP2 mini	生产版本	v1.2_20190222	-----	--	CTP2mini_API

## 第三章 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还是直连。

2、申请人通过我司网站上申请 CTP 期权仿真测试账号和 CTP 股指仿真测试账号, 申请地址:

<https://www.htfc.com/main/wsyty/wykh/jrfzkh/index.shtml?id=10012>。

账户中心

我要开户

- 网上开户
- 预约开户
- 仿真个人开户**
- 仿真机构开户
- 股票开户

软件下载

资金划转

应急措施

### 仿真个人开户

首页 > 网上营业厅 > 我要开户 > 仿真个人

姓名 \*

性别  男  女 \*

申请类型 仿真全选 \*

身份证号码 \*

手机号码 \*

邮箱 \*

联系地址 选择省 选择市 选择区 \*

邮编 \*

详细地址 地址详细到门牌号 \*

验证码 9374 \*

提交 重置

申请类型选择：仿真全选

3、账号申请成功后，填写《交易终端认证申请表》。

4、提交《交易终端认证申请表》给我司业务人员，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 期权仿真测试系统中设置 AppID /RelayAppID 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 穿透式测试系统。

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《交易终端认证测试反馈表》给我司业务人员，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 穿透式测试系统的登录、交易等记录，进行评估。

2、评估通过后，我公司会将 AppID /RelayAppID 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。

## 第四章 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：0755-82537410、021-50479235



附件 1:

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

## 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

# 穿透式监管实施常见问题

## 1、在什么时间点客户一定要更新成看穿式版本？

答：监控中心要求6月14日那天起，期货公司开始报送客户的信息。所以最晚**6月14日**（含）起所有客户的交易终端必须更新成看穿式版本，**否则将不能登录。**

## 2、启用看穿式采集以后，对客户有什么影响？

答：（1）只要客户登录终端软件，不管是否有进行交易，信息都会被采集；客户的信息采集非常全面，包括客户电脑基本信息（操作系统、硬盘序列号，cpu 信息等）、手机信息（手机型号、系统版本、地理位置）、网络信息等；

（2）一些自己开发程序的客户需要修改代码，增加工作量。

（3）从外面购买交易软件的客户需要联系第三方，进行软件修改升级

（4）我司托管及外部接入客户，必须重新进行我司托管、外部接入申请流程

## 3、客户自开发的程序来不及修改，在启用看穿式监管后将登陆失败，有何应急下单办法？

答：可以在公司网站下载对应系统的交易终端来下单。

## 4、客户自开发的程序只用来查询不下单，是否需要支持看穿式监管？

答：根据《期货公司客户交易终端信息采集及接入认证技术规范》要求只要进行登陆、交易、银期转账、密码修改都需要进行支持看穿式监管。

## 5、实施采集以后，监控中心是否会对不同客户采取不同的交易权限？

答：不会，现有的交易规则不受影响，监控中心负责收集数据供期货交易所进行查询分析。

## 6、实施采集的数据，期货公司可以查看么？

答：客户的所有终端信息在传输过程中都是加密的，中途不会泄露，只有监管机构通过密钥才能查看客户的终端信息。

## 7、授权码是否可以跟客户在其他公司的保持一致或者跟仿真测试时保持一致？

答：客户需要授权码与其他公司一致的或保持华泰仿真测试环境与生产环境一致的需要提前告知，并由客户经理在测试与生产流程中备注说明（如果在华泰环境中该客户提供的授权码未被使用可分配）。

## 8、后续需要客户做什么？

答：使用我司网站下载的交易终端客户，及时进行软件升级；

使用非我司提供的交易终端的客户，需要做以下几件事情：

（1）根据监控中心的命名规范，给自己的终端软件命名一个APPID 或者 RelayAPPID。

（2）将APPID 或者 RelayAPPID 提供给所在期货公司客户经理，用于申请系统授权码

（注：对接的后台都需要申请）

（3）使用授权码和开发接口文件改造系统，并对接我们仿真进行测试。

（4）测试通过后，联系期货公司进行生产系统对接。

### 9、APPID 的填写规则？

答：具体的填写规则可以参照以下监控中心的规范，特别说明如果该软件版权归属非个人的，请写公司名称。如果软件版权归属个人的请写 client。



中国期货市场监控中心  
China Futures Market Monitoring Center

AppID/RelayAppID  
格式规范

  

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	10	10	8
格式	终端/中继厂商名称_终端/中继软件名称_版本号		
示例	abcdef_ghijkl_1.6.0		
特殊说明	个人开发的终端软件，厂商名称为client		

  

AppID  
RelayAppID

1. AppID/RelayAppID在期货公司内部不能重复。
2. 同一终端软件/中继软件在不同期货公司，AppID/RelayAppID应该保持一致。
3. 个人开发的终端软件，厂商名称为client。

### 10、如何分是中继模式还是直连模式，中继模式时如何区分是一对多还是多对多模式？

答：

术语	术语说明
终端直连模式	终端和期货交易系统 <b>直接</b> 建立 TCP 连接，即终端—TCP 连接—期货交易系统。
中继服务器模式	终端和期货交易系统 <b>非直接</b> 建立 TCP 连接即终端—TCP 或 UDP 连接—客户系统（或第三方平台）—TCP 连接—期货交易系统方式连接（中间有平台进行中转）。包含了多对多类型中继服务器模式以及多对一类型中继服务器模式
多对多类型中继服务器模式	客户终端和中继建立连接时，在中继为每一个客户终端与期货交易系统都建立连接对象实例（例如文华、恒生 O32、恒生 PB）。
一对多类型中继服务器模式	客户终端和中继建立连接时，中继使用期货公司分配的操作员进行登陆到期货交易系统，所有客户共用建立连接对象实例（ <b>我司目前不提供该方式</b> ）