大连商品交易所基差交易业务 操作手册

第一章	章 交易系统功能介绍	3
1	登录系统	3
2	出入金管理	4
	2.1 入金申请	4
	2.2 出金申请	4
	2.3 入金明细查询	4
	2.4 出金明细查询	5
3	信用管理	5
	3.1 授信额度申请	5
	3.2 授信额度申请历史查询	5
	3.3 授信额度查询	6
4	基差子账户管理	6
	4.1 基差子账户管理	6
	4.2 交易编码查询	6
	4.3 基差子账户交易圈管理	7
5	交易商给子账户转入/转出资金	7
6	资金查询	8
	6.1 可用资金查询	8
	6.2 其他资金明细	8
7	'产品信息	9
	7.1 基差合约自定义管理	9
	7.2 我的合约	11
	7.3 买方线下结算发票上传	13
8	;交易管理	13
	8.1 挂牌	13
	8.2 协商	16
9	交易查询	17
	9.1 持仓查询	17
	9.2 成交查询	17
	9.3 交易确认书查询	18
1	0 日报表查询	20
	10.1 日成交单查询	20
	10.2 日资金结算表	21
	10.3 日持仓报表	21

		22
_主 月		
		23
		24
		25
		26
		27
算		27
算		
		29
,完成交收,使	可用信用	
,转让并完成交	5收	
,完成交收		
	清 算 算 , 完成交收, 使 , 转让并完成交 , 完成交收	 清 算 算 算 , 完成交收,使用信用 ,转让并完成交收 , 完成交收

第一章 交易系统功能介绍

1 登录系统

交易商/子账户/客户通过 http://otc.dce.com.cn 中的"场外平台交易入口"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。

					大商所官网
つ 大连商品交易所 1	汤外平台	首页 业务	/服务 规则/指引	通知公告 综合	服务 关于我们
		丰富场外工 服务大宗 	具体系 '商品交易中	心建设	
🛄 场外平台交易入口 💿	搜索品种/业务/关键字				搜索
25 全部		诸交易 基差交易	商品互换 场外期	X	
👗 化工振块	成交 行情 标准仓	全单		非标仓单	
聚乙烯 聚丙烯 聚氨乙烯 苯乙烯 乙二醇 	价格(元/吨)/品种 3,953.00 ▲	成交日期 2021-09-23 成交时间 10:17:01	价格(元/吨)/品种 870.00	成交日期 成交时间	2021-08-10 14:53:39
	大生商品交易所 第二日、日本ののの日の日本を見たれるの 第二日、日本ののの日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本	小交易平台 RET登录 ◎密码登录 3010 u88 a9c 送成功,38秒后可重新 着 Copyright © 2015 /	登录 文法絵证码 支法絵证码 対大法絵证码		

2 出入金管理

2.1入金申请

交易商或客户进入: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 XX 万(风险保障金具 体金额根据交易商开通的品种权限具体确认),风险保障金入金足够后方可交易。

會产品信息 <	您现在的位置:资金管理>>出入:	会營理>>入会中请								
自在户管理 <	没有找到记录. 🔯									
	选择 申请日期 申请序	号 清算会员号 清算会员前用	清算账户 账户类型	交易会员号 交易会员简称	805 8080	> 入金银行 申请入金金额	 (元) 申请状态 入金处理状态 	失致原因 银行处理状态	銀行错误信息 录入人	景入时间
自信用管理 <										
自出入金管理 🗸										
入金申請										
出金中讀										
入金明細查询	交易商	请输入或者选择	▼							
出金明細查询	清算账户	清法绎	v			入金银行	Ŧ			
	入金金額(元)	10,000,000.00				餐注				
可用證金產简										
其它资金明细				+	- 新聞 - 10	紀秋 乞服的				

2.2 出金申请

交易商或客户进入: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。

自 产品信息	<	忽现在的	位置:安全省	·理>>出入金·	管理>>出金中译	ĩ																	
自 客户管理	<	没有找到	12. . .	l																			
音 资金管理	~	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	中请状态	出金处理状态	银行处理状态	银行错误体息	录入人	录入日
自 信用管理	<																						
自 出入金管理	~																						
入金申請																							
出金申請		4	_	_			_	_			_	_	_					_				-	,
入金明細查词		30	K户		820200082	12	Y DE	现户:测试公						出金银行	建设银行		٣						
出金明细查询		出金	金額(元)		333,333.00			大可出金额:	1,029,805.99开					是否允许差额出金	● 是 ○ 否								
		俯注			甚至																		
可用资金查询																							
其它资金明细											+	新聞	- PL - S	1 K 🕤 1	R 99								

2.3入金明细查询

交易商或客户进入:资金管理-出入金管理-入金明细查询,查看入金明细。

	- maale.w.	<	APPACLE FLEE	(A.M. 19 18:	Call Brade 7 Cally	and the second													
E.	自 客户管理	<	起始日期		20160615						ŝ	1來日期	20160615						
	a 200.000		清算会员号	3							3	5局会员号							
1	英圭昌理		畜户号								5	积	交通银行	T					
	自信用管理	<	10001 011070	B.C. 1 101 1	// / X XX														湖
	曲 出入全管理		机制工采证示	10077 1 99 1	~ ~ 7 77	10 •													
			申请日期	申请序号	清算会员号	清算会员简称	清韓账户	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	申请入金金額(元)	申请状态	入金处理状态	失败原因	银行处理状态	银行
	入金申请		20160615	0000000007	DCE		80050008005	自有账户	8005	DD资本	0008005	DD股份集团有限公司	交通银行	600,000.00	未复核				
	出金申请		< l																÷
	入金明细查询																		

自产品信息 <	您现在的位置:	资金管理>>出)	、金管理>>出金剛	细查询													
自客户管理 <	起始日期		20160615						\$	吉東日期	20160615						
白 资全管理	清算会员号								ā	に見会員号							
	客户号								ę	見行	交通银行	٣					
■ 信用管理 <	北田1 초记录	展示 1 項 1	// / N N	10 🔻												(Q #	询
自 出入金管理 ↓	1004- 10044	32/11 = 3-1 =															Ξ.
	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	申请出金金額(元)	是否允许差额出金	实际出金金额	备注	申请状态	出;
入金申请	20160615	000000008	DCE		80050008005	目有账户	8005	DD资本	0008005	DD股份集团有限公司	り 交通銀行	65,000.00	2	0.00		未复核	
出金申请	4																×
入金明细查询																	
出金明细查询																	

交易商或客户进入:资金管理-出入金管理-出金明细查询,查看出金明细。

3 信用管理

3.1 授信额度申请

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。

自 产品信息	<	您现在的位置	:资金管理>>信用	· 普理>>按信额度申请									
自 客户管理	<	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	授信額度	申请状态	备注	操作人	操作日期	操作时间
	~		7	8003	CC公司	基整交易市场	基型	500,000.00	新建		DDzb	20190903	09:32:54
自 信用管理	~												
授信额度查询													
授信额度申请													
授信申请历史查询	0												
自 出入金管理	<	授信交易	町					市场 超	差交易市场	Ψ.			
可用资金查询		产品类型		基差	¥			申请授信額度 50	00000				
其它资金明细						+新增	2 修改	□ 复核 ×	删除				

3.2 授信额度申请历史查询

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。

自产品信息。	¢	您现在的位置:资金	able まませま - All Reger - All All Reger All All All Reger All All All Reger All All All All All All All All All Al									
	¢	授信交易商号										
自 资金管理 、	/	找到1 条记录, 显;	〒1到1 ≪ < > ≫	10 🔹 🚺								Q查询
自信用管理、	-	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
授信额度查询	_	4	8007	FF企业	基差交易市场	표환	2,000.00	审批通过	通过	jc	20190902	09:43:22
授信额度申请												

3.3 授信额度查询

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。

首 产品信息	<	您现在的(2置:资金管理>>信用	用管理>>授信徽)	登查询									
自 客户管理	<	交易日	明		2016	50613								
自资金管理	~	挑到3 条ì	录,显示1到3	« < > >	> 10 🔻 🚺	1								Q.查询】
自 信用管理	~	序号	交易日期	交易商号	交易商简称	授信來源交易商号	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	要托冻结保证金	详细
		1	20160613	8005	DD资本	8006	EE企业	基差交易市场	포문	1,000.00	1,000.00	0.00	0.00	- 6月 4日
授信额度查询		2	20160613	8005	DD资本	8007	FF企业	基差交易市场	基型	1,000.00	1,000.00	0.00	0.00	明细
授信额度申请		3	20160613	8007	FF企业	8005	DD资本	基整交易市场	표원	2,000.00	2,000.00	0.00	0.00	E81 E93

4 客户管理

4.1交易编码注册

交易商进入:客户管理-交易编码注册,录入客户信息并选择基差业务后进行开户, 然后进行复核。复核后客户开通清算账号。

产品信息		^	您现在的位	过置:客户管理>>3	交易编码注册								
自客户管理			客户号							状态		全部	V
交易编码注册	10		找到1 条记	已录,显示 1 到 1									
一一日四四本	~		选择	申请编号	申请类型	交易商号	交易商简称	客户号	客户名称	业务类型	状态	可选市场("\$"表示全部)	可选品种('\$'表示全部)
父幼期的巨1	unj			110	交易编码注册	8888	高測试交易商简称	0010079	zyk1001	基差	审批通过	\$	\$
基差子账户	管理												
基差交易品種	种管理												
📋 资金管理													
自信用管理													
自 出入金管理			客户号							客户名称			
可用资金查试	询		业务类	型	商品互换	V							
其它资金明线	细		说明:基差)	业务需要在基差3	交易品种管理页面设置者	17户交易品种		[+ л	e (也复枝			
自 其它资金管理	理 ィ												

4.2交易编码查询

交易商或客户进入:客户管理-交易编码查询,查看交易商、子账户、客户的清算 账号

自 产品信息 く	您现在的位置	f:客户管理>>交易编码查询						
	找到2 条记录	1,显示1到2 《〈〉》	10 🔻 过渡 清除					
交易编码查询	序号	清鐘账号	交易商号	交易商简称	客户号	客户名称	状态	资金账户明细
基差客户管理	1	80050010003	8005	DD资本	0010003	123	开户	明細
	2	80050008005	8005	DD资本	0008005	DD股份集团有限公司	开户	明細
自资金管理 <								

4.3 基差子账户管理

交易商进入:客户管理-基差子账户管理,新增或修改子账户信息。子账户可以使 用交易商的信用。**子账户必须选择【交易商间交易】还是【交易商客户间交易】。**

自 产品信息	< ^	您现在的位置	皆:客户管理>>基差	子账户管理							
自 客户管理	~	找到8 条记3	录, 显示 1 到 8								Q查询
交易编码注册		选择	交易商号	子账户客户号	子账户客户名称	登录用户名	中文用户名	手机号码	用户描述	市场层次	
			8888	0010091	zzy123	aaaaa	aaaaa	13190197172	111	交易简间交易	
交易编码查询			8888	0010092	zzy123	bbbb	bbbb	13190197172	111	交易商问交易	
基差子账户管理			8888	0010093	cccc	0000	CCCC	13190197172	1	交易商间交易	
			8888	0010094	123aa	ddd	ddd	13190197172	11	交易商间交易	
基型父初品种管理			8888	0010095	eee	eee	eee	13190197172	1	交易商间交易	
自 资金管理	~		8888	0010096	mm	m	m	13190197172	afd	交易商间交易	
			8888	0010097	999	999	999	13190197172	1	交易商间交易	
	<u>`</u>		8888	0010098	中信金履01	0000	0000	13190197172	111	交易简间交易	~
自 出入会管理	<	登录用户	16 (•		中文用户名		•		
可用资金查询		密码			•		确认密码		•		
其它资金明细		手机号码			•		客户名称		•		
	-	用户描述					市场层次	交易向间交易	V		
其它资金管理	<					+ #i #i	☑ 惨改				

4.4 基差交易品种管理

交易商进入:客户管理-基差子账户交易圈管理,为子账户和客户分配品种交易权限。新建的子账户和客户必须分配品种交易权限才能正常参与交易,子账户和客户只能响应品种交易权限分配后发布的合约。

自 产品信息	<	您现在的位置:	客户管理>>基差子	账户交易网管理								
自 客户管理		找到2条记录,	显示 1 到 2 🚺	1								
交易编码查询		选择	品种		子账户客户号	子账户客户名称		最后更新人	最后更新日	UI .	最后更新时间	
			聚乙烯		0010020	测试公司—PE		测试	20200625		08:39:09	
基粒子账户管理			聚氯乙烯		0010029	制试公司一PVC		测试	20200625		08.38:56	
基差子账户交易圈管理	2											
自 资金管理	<											
■ 交易管理	<											
自 交易查询	<	品种		聚乙烯	T			客户号	0010019 - 明日按設PP公司	Ŧ		
自 日报来查询	<						Q ###	0. #99				
自 交收管理	<											
■ 公共管理	<											

5 交易商给子账户转入/转出资金

交易商进入:资金管理-其他资金管理-账户资金划转,给子账户转入/转出资金。录 入转入/转出资金后,进行复核。(子账户的清算账号可以通过客户管理-交易编码查询 功能获取)。**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。主子账户的市场层次必须一致。

自 产品信息 く	感現在的位置	:资金管理>>非	耳它资金管理>>账)	户资金划制												
自 客户管理	找到4 条记录	, 显示 1 到 4														
交易编码推阅	选择 交	易商号	交易商号简称	交易商白有清望账户	子账户清算账户	子账户清望账户类型	子账户简称		想转方向	划转资金(元)	秘密	操作人	操作日期	操作时间	资金类型	备注
	. 82	202	象就公司一	82020008202	82020010020	子账户	激励公司——	РЕ	从子账户到主账户	3,938,192.0	3 复核	8202	20200103	15:40:03	会员客户账号资金划转	
基础子账户管理	. 83	202	测试公司—	82020008202	82020010019	子账户	潮減公司——	PP2	从子账户到主账户	1,000,000.0	9 親族	8202	20190930	14:25:31	会员客户账号资金划转	
基差子账户交易圈管理	8	202	测试公司一	82020006202	82020010020	子账户	創成公司—	PE	从主账户到子账户	1,000,000.0	9 親校	8202	20190924	14:57:09	会员赛户账号资金划转	
	. 83	202	奥试公司一	82020008202	82020010019	子账户	潮波公司——	PP公司	从主账户到子账户	1,000,000.0	2 复核	8202	20190924	14:55:43	会员客户账号资金划转	
■ 資金管理																
自 信用管理 <																
自出入金管理 <	交易商号		8202					交易商简称		Rit)同—					
可用资金表明	交易商自有	i清算账户	8202000	18202				子账户满卸	0KA							
-3/034163649	子账户清算	印度內與型						子账户简称								
其它资金明细	划转方向		从主账户	到子账户	•			划转资金(元)							
自 其它资金管理	资金类型		会员客户	乐号资金划转	-			僧注								
账户资金划转																
自交易管理(+ * ×	_0 %	(tt)	in 🛛						

6 资金查询

6.1可用资金查询

交易商/子账户/客户进入:资金管理-可用资金查询,查看交易商、子账户、客户的可用资金、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足额的风险保障金,交易商必须在入金足额风险保障 金的基础上再入金,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。可出金额按照清算账户进行预测。

自 产品信息	<	您现在的位置]:资金管理>>¬	目用资金查询											
自 客户管理	<	交易日期		20190204						春户号					
自 资金管理	~	找到1 条记录	し, 显示 1 到 1	\ll \langle \rangle \gg	10 🗸 🚺										Q 查询)
■ 信用管理	<	序号	交易日期	清算账户	清鐘账户类型	交易商号	交易商简称	客户号	客户名称	可用资金 (元)	保证金 (元)	現金 (元)	风险保障金 (元)	预测可出资金 (元)	其它资金 (元)
出入金管理	<	1	20190204	80230008023	自有账户	8023	C集团 (聚烯烃)	0008023	C集团 (酸烯烃)	97,995,265.00	4,735.00	98,000,000.00	2,000,000.00	97,995,165.00	0.00
可用资金查询															
其它资金明细															
🗎 其它资金管理	<														
自交易管理	<														
自 交易查询	~														
持合查询															
成交查询															

6.2 其他资金明细

交易商/子账户/客户进入:资金管理-其他资金明细,查看交易商、子账户、客户在 交收过程中产生的其他资金明细。

■ 产品信息	<	您现在的位置:	资金管理>>其它资金明细	1											
自 客户管理	<	开始日期		20200317	₿			续束日期		20200317					
會 资金管理	~	客户号													
自 信用管理	<	找到2 祭记录,	显示 1 到 2 🔍 <	> >> 10 🔻 🌉											Q ± 9
自 出入金管理	<	序号	結算日期	清算账户	交易商号	交易商简称	客户号	客户名称	资金类型		应收金额		实收金额		备注
		1	20200317	82070008207	8207	测试公司二	0008207	测试公司二有限公司	付費方贷款	(80%)		1,008,000.00		1,008,000.00	
可用资金查询		2	20200317	82070008207	8207	测试公司二	0008207	测试公司二有限公司	付卖方贷款	(80%)		967,200.00		967,200.00	
其它资金明细															
自 北京资金管理															
	<u> </u>														
會 交易管理	<														
自交易查询	<														
mi □::::::::::::::::::::::::::::::::::::															
自 交收管理	<														
自 公共管理	<														
密码修改															

7 产品信息

7.1 基差合约自定义管理

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。

自 产品信息 ~	您历	i在的位置:产品信息>>基差合约B	自定义管理									
交易日历查询	+6.55		N N 10 T	2+1 342 (3#1 8≩)						L	+ #	建
基差合约信息查询	93	11 300 38, 3207 1 39 1 1 1 1	() » 10 · 🌉									
基差合约自定义管理	19	号 市场	品种	合约号	秋恋	录入日期	开始交易日	最后点价日	最后交收日	修改	发布	删除
	1	基差交易市场	铁矿石	bt-20160608-i-000001	已录入,待审批	20190903	20160608	20160615	20160622	Ì	2	×

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. 通过单选按钮选择合约是【交易商间交易】还是【交易商客户间交易】
- 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。
- 3. 品级和交货地可以下拉选择也可以自定义输入。
- 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
- 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。基差合约最后点价日前2个交易日起(包含最后点价日共三个交易日)仍未点 价的,期间系统每日发送短信提醒交易双方。
- 6. 最后交收日闭市结算后,若双方依然未完成交收申请确认,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申请确认环节。基差合约最后交收日前2个交 易日起(包含最后交收日共三个交易日)仍未进行交收申请的,期间系统每日发送 短信提醒交易双方。
- 7. 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。

- 8. 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。只有部分 品种支持合约转让。
- 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。
- **10.** 追保方: 追保方在首次点价确认后, 直至交收申请确认前, 可以多次向对方发起追保。
- 11. 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。
- 每个自定义合约会生成一个唯一的合约号,如果想复用之前已生成的合约要素再生成一张新合约,可以将想复制的合约号复制粘贴在"复制合约"文本框,点击"复制",对合约要素进行复制。

复制合约		11 : 输入完整合约号进行复	制,复制内容不包含合约附件		市场层次	● 交易商间交易 ○ 交易商客户间多	8易
品种	铁矿石 🔻	基准期货合约	铁矿石2008test	Ŧ	交易数量		单位:吨
晶級	请输入或者选择 ▼	交货地(仓库)	请输入或者选择				
开始交易日	20200706	最后点价日			最后交收日		
是否期转现业务	香・マ	报价买卖标志	卖	T			
是否利用平台结算	是	买方交易保证金率	0	%	卖方交易保证金率	0	%
点价方	买方 ▼	是否可转让	是	T	追保方	无 ▼	
合约附件		文件格式仅支持pdf、doc、docx、r	rar, zip)				
说明							~
台约专用条款	1.盐加制证金的情形内证: 如:你们后期的公式情况很少公规证金;而约 2.空放方式及相关最新的应; 3.觉发得移动意; 3.觉发得移动意; 4.检查方式方式。 4.检查方式方式。 4.处量方式方式。 4.处量方式方式。 4.以上公式间间都根据目、除汗、质产地证明, 5.可以用动物能相目、除汗、质产地证明,	高基准期货合约价格上涨/下跌XX时 调XX;目提,倍权转移以交付XX结 出厂证明等材料为依据。 不成的应当根据业务规则进行调解	,追加XX保证金。 资权转移凭证为推尊。 ,调解不能达成一致的,应当采用	(仲裁/诉讼的方式)	屠夫,仲裁地:, 仲裁机构):;方所在地有管建	风的法院。

录入日期

20190903

开始交易日

20160608

最后点价日

20160615

最后交收日

20160622

修改 发布 删除

🖉 🗉 🗙

2) 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"。

状态

bt-20160608-i-000001 已录入,待审批

合约号

序号 市场

基差交易市场

品种

铁矿石

自 产品信息 💦 🗸 🔷	您现在的位置:产品信息>>基差合	的自定义管理							
基差合约自定义管理	市场层次	○交易商间交易 ⑧ 交易	商客户间交易						
我的合约	品种	铁矿石	Ŧ	基准期货合约	铁矿石2008test	· •	交易数量	10	单位:吨
	間級	PB盼	T	交货地(仓库)	A级	Y			
买方线下结算发票上传	开始交易日	20200706		最后点价日	20200707		最后交收日	20200708	
自 客户管理 🗸 🗸	是否期转现业务	否	T.	是否利用平台结算	是	Ŧ			
交易编码注册	报价买卖标志	卖	T	买方交易保证金率	0.0000	%	卖方交易保证全率	0.0000	%
交易编码查询	点价方	买方	T	是否可转让	否	Ŧ	追保方	无	Y
	合约附件		浏览 (上传)	文件格式仅支持pdf、doc、docx、	rar, zip)				
基本子账户管理		FE: %, AL2O3: %,	SIO2: %, P: %	6,S: %,H2D: %					^
基差交易品种管理									
自 资金管理 🗸 🗸	说明								
■ 信用管理 <									~
自 出入金管理 <		 追加保证金的情形约定 如:点价后按照XX价格收 2 交货方式及相关费用的 	; (取XX保证金;点价); ~:	后基准期货合约价格上涨/下跌XXB	t,追加XX保证金。				^
可用资金查询	合约专用条款	如:如送货上门,每公里 3.齿权转移标志: 如:货权转移以XX为准。 4.检验方式约定:	moxx元、送货地范	IIIIXX;目提,货权转移以交付XX	货权转移凭证为准等。				
其它资金明细		如:以XX时间装播报告、 5.仲裁及诉讼条款: 交易双方发生纠纷应当先	磅杆、原产地证明、 自行协商解决,协商	出厂证明等材料为依据。 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	当采取仲裁》积公的方式第	缺,仲裁地:,仲裁机构	:;方所在地有	*管辖权 的法院。
自 其它资金管理 /									

3)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。如果要发布昨天或更早生成的基差合约,需要进入修改页面, 点击"完成",系统会将合约的开始交易日更新为当前交易日,再回到发布页面,就可 以正常发布基差合约了。

	市场层次	○ 交易商间交易 ⑧ 交易章	8客户间交易						
	品种	秋矿石	Y	基准期货合约	秋府~石2008test	T	台约号	i-200706-000001	
基差合约自定义管理	交易数量	10	单位:吨	品級	PB\$	Y	交货地 (仓库)	Aig	Y
我的合约	开始交易日	20200706		最后点价日	20200707		最后交收日	20200708	
买方线下结算发票上传	是否期转现业务	否	¥	是否利用平台结算	屋	T			
自名户管理 🗸	报价买卖标志	卖	Y	买方交易保证金率	0.0000	%	卖方交易保证金率	0.0000	%
在目 前 四注册	点价方	买方	Y	是否可转让	香	Y	追保方	无	Y
5C 889 WHD (0.12) //	合约附件								
交易编码查询		FE: %,AL203: %,S	NO2: %, P: %, S: 9	6,H20: %					^
基差子账户管理	1405								
基差交易品种管理	2009								
自资金管理 🗸 🗸									~
自信用管理 <		1.追加保证金的情形约定: 如:点价后按照XX价格收购 2.交货方式及相关费用约定 如:如送货上门,每公里加	DXX保证金;点价后基准期的 ; 收XX元、送货地范围XX;自	给约价格上涨/下跌XX时,追加X 提,货权转移以交付XX货权转移	X保证金。 凭证为准等。				^
自出入金管理 <	合约专用条款	 3.货权转移标志: 如:货权转移以XX为准。 4.检验方式约定: 如:以XX时间预准报告、被 	9年、1954地证明、出厂证明	唇材料为依据。					
可用资金查询		5.仲裁及诉讼惩款: 交易双方发生纠纷应当先自	行协调解决,协称不成的应当	当根据业务规则进行调解,调解不	截达成一致的,应当采取仲裁/诉	2的方式解决,仲	脱始:,仲貌机构:	;方所在地有管辖权的	法院. 🗸
其它资金明细								目 发布	5 ⊻0

7.2 我的合约

发布合约所属品种圈内的交易商/子账户/客户进入:产品信息-我的合约,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。

对于成交、交收过程的合约,可以点击"详细"按钮查看资金详情,了解合约的保证金、货款情况和对手方对于当前合约的资金状况。

对于客户来说合约在成交后才在我的合约里可见。

您现在I	的位置:产品信息>>我的合	th .															
品料		全部		¥					合约状态		全部	v					
合约	i⊕																
1	静仓中	交收中	Ē	2完结/已回购													Q.查询]
找到(36	条记录,显示 1 到 10	« < <mark>></mark> »	10	•													
序号	合约号	品种	数量	基准合约	初始成交价	交货地	品级	买卖方向	最后点价日	最后交收日	对手方交易商	对手方清算账号	是否平台结算	合约状态	资金详情	是否上传发票	完成交收日
1	<u>v-200630-000001</u>	聚氧乙烯	100	聚氯乙烯2007test	+10.00	111	PVC糊	₹	20200702	20200703	最悦物产	82070008207	是	待收货	评估		
2	bt-20200525-pp-0000	2 夏丙烯	1000	駅丙烯2009 for test	+20.00	常州宾牛	均駅PP粒	픗	20200820	20200821	永安资本(合成树脂)	82080008208	是	已回购		-	
3	bt-20200525-pp-0000	過 聚丙烯	550	駅丙烯2009 for test	+450.00	宁波八三七国储库	均数PP粒	픗	20200528	20200529	永安资本(合成树脂)	82080008208	是	已回购			
4	b1-20200423-1-000004	聚乙烯	560	聚乙烯2009 for test	+90.00	浙江国际贸易物流有限公司	LLDPE	픗	20200521	20200529	永安资本(合成树脂)	82080008208	是	已回购			
5	bt-20200423-1-000005	聚乙烯	500	聚乙烯2009 for test	+100.00	常州、宁波、上海	LLDPE	买	20200529	20200601	华泰国贸	82110008211	否	已完结	洋蘭	否	
6	bt-20200423-pp-0000	2 聚丙烯	500	聚丙烯2009 for test	+30.00	常州奔牛港务库	均聚PP粒	买	20200514	20200521	永安资本(合成树脂)	82080008208	是	已回购			
7	bt-20200423-pp-0000	8 聚丙烯	480	聚丙烯2009 for test	+250.00	常州、金华、宁波	均聚PP粒	买	20200529	20200602	华泰国贸	82110008211	否	已完结	详情	否	
8	bl-20200316-v-000004	聚氯乙烯	400	聚氯乙烯2005 for test	0.00	奔牛库	PVC粉	索	20200327	20200331	物产化工	82060010013	是	已完结	详情		
9	bl-20200316-v-000006	聚氯乙烯	400	聚氯乙烯2005 for test	0.00	尖峰库	PVC粉	买	20200327	20200331	物产化工	82060010013	是	已完结	详情		
10	b1-20200226-pp-0000	13 聚丙烯	800	聚丙烯2005 for test	-100.00	常州奔牛港务库	均聚PP粒	买	20200310	20200416	永安资本(合成树脂)	82080008208	是	已回购			
4																	Þ

找到1条记录,显示 1 到 1 🛛 🧾

合约号	交易日	买方交易保证金	其中:现金	其中:信用抵扣	卖方交易保证金	其中:现金	其中:信用抵扣	买方履约保证金/货款	卖方履约保证金	对手方违约标识
<u>v-200630-000001</u>	20200706	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	692,500.00	0.00	否

Q 关闭

Q 关闭

找到1 条记录, 显示 1	到1 其									
合约号	当前交易日	买方交易保证金	其中:现金	其中:信用抵扣	卖方交易保证金	其中:现金	其中:信用抵扣	买方履约保证金/货款	卖方履约保证金	对手方违约标识
<u>1-200630-000003</u>	20200709	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	<u>400.00</u>	0.00	否

找到2 条记录, 显示 1 到 2 🛛 📃

合约号	结算日期	交易商号	交易商简称	清算账号	资金类型	金额
<u>1-200630-000003</u>	20200702	8207	嘉悦物产	82070008207	买方转货款	-62,750.00
<u>I-200630-000003</u>	20200703	8207	嘉悦物产	82070008207	买方交割余款	62,350.00
	20200100	0201		02010000201		02,00

合约							
市场层次		○交易商间交易 ◎ 交易商客户间交易	8				
品种		铁矿石	基准期货合约	铁劢*石2008test	台约号	i-200703-000008	
交易数量(吨)		5	結算价计算使用类型	结算价	品级	P889	
交货地(仓库)		888	买方	8888-高剧试交易向简称	签发方	8888-海测试交易南简称	
			买方联系方式	13566669999	签发方联系方式	13566669999	
开始交易日		20200706	最后点价日	20200706	最后交收日	20200707	
是否期转现业务		否	是否利用平台结算	是	基差合约状态	得感价	
报价买卖标志		奕	买方交易保证金率	0%	卖方交易保证金率	0%	
初始成交价(元)	+1.00	买方交易保证金	0	卖方交易保证金	0	
点价方		买方	是否可转让	푬	追保方	无	
合约附件							
交收数量			实际货款		完成交收日		
結算单价			发票凭证				
说明		FE: %, ALZO3: %, SHO2: %,	P: %,S: %,H2D: %				^
							~
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 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,追 3.货权转移标志: 如:货权转移标志:	;点价后基准期综合约价格上涨, š货地范围XX;自提,货权转移0	下原2019,追加2018年金。 122月2018月19時85年3月前後。			^

7.3 买方线下结算发票上传

若交易双方采用线下结算(即定义合约时选择不利用平台结算)成交基差合约,买 方可以在该功能中上传发票信息,包括交收数量、实际货款、完成交收日、结算单价、 发票凭证的照片或 PDF 五项信息。完成发票上传流程的线下结算基差合约才会被交易所 记为有效合约。

自 产品信息 🗸 🗸	您现在的	9位置:产品创	1.11>>>买方线下	结鹅发票上	-19															
基着合约自定义管理	iQ4883	962 0 .																		
我的合约	發择	合约号	基准合约	品级	交货地	初始地区沿	最后点价日	最后交收日	对手方交易商	对手方清整账号	是否平台结算	是否上传发票	完成交收日	括整单价	交收設量	家际货数	状态	操作人	操作日期	操作时间
买方线下站算发票上传																				
自 客户管理 〈																				
資金管理 <																				
會交易管理 <																				
自 交易查询 <	交政	think (实际货款									
自日报表查询 🗸	完成	交收日									结算单价									
	没票	96E			+ 未选择任	E何文件	上传文件格式仅多	tiepdf, rar, zip,	bmp, png, jpg, j	ieg),最大上传文件5M										
日成交单查询	注:1、 2、交收	只有买方能」 数量:鸡蛋-	上传结算发票 500千克、纤维	板-立方米。	胶合板-张.	其它-吨。														
日資全結算表									+	新聞	(#18)	2 2 4								

8 交易管理

对于【交易商间交易】合约,交易商与子账户都可以交易。对于【交易商客户间交易】 的合约则交易的一方为交易商或子账号,另一方为客户。

客户仅允许做【交易商客户间交易】合约的交易。

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,系统会动态试算交易保证金,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。

<u>商 产品信息</u>	挂牌成交															
	◎ 协商成交 ⑧ 挂牌成5	5										我要报价		我要下单	我要转让	我要回购
交易日历查询	合约		品种	基准期货	初始成交价	挂牌方	方向	点价方	最后点价日	最后交收日	签发方	交货地	<u>救量</u> (吧)	品级	品级说明	联系方式
基差合约信息查询	1 Dt-20160617-	p-000002	聚丙烯	p1705		DD资本	픗	灭	20160712	20160718		昔口港	200	均聚PP粒	厂家:测试.	
基差合约白定义管理																
自客户管理 <																
曾 资金管理																
自交易管理 🗸 🗸																
交易下单	10 ▼ 14 4 第1	共1页	н о													显示1到1,共1记录
自 交易查询 <	合约 bt-20160617-pp-000000	2	30.00	切帽	DD	課』 资本:1564117	6人信息 18251			~				客户号印	08005 清算账户:800	50008005 账户设置
目报表查询 <		当日成交				124.1004111	0201							□ 委托查询	S 42250	(1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1)
自交收管理 <	操作 美托号	状态		合约号	订单类	型 买卖方	问	客户号) 7	仲名称	清算账户	数量(吨)	价档	已成交(吨)	录入日期	录入时间
自产品信息 v	注決成交											0704	_			
交易日历查询	 Implat> ● Implat> 自约 		品种	基准期货	初始成交价	挂牌方	方向	点价方	最后点价日	最后交收日	签发方	交货地	双量(吗)	30天下平 品级	品级说明	我爱兰纳
基差合约信息查询	1 <u>bt-20160617-p</u>	p-000002	聚丙烯	pp1705		DD资本	푯	天	20160712	20160718		営口港	200	均聚PP粒	厂家:测试	
基差合约白定义管理																
自有户管理 <																
自交易管理 🗸						5	碗认报)	A18?								
交易下单		共1页)	но				?	合约: b 价格: 3	0.00	-000002						显示1到1,共1记录
自交易查询 <	合约		20.00	价格		E)		款量: 2	200	取消				505.00		CONSOLS RECTOR
自日服表查询 <	当日委托	当日成交							t	and N				三 委托查询	S acces 1	持合直闭 羊 资金直闭
■ 交收管理 <	操作 責托号	状态		合约号	订单类	2 买卖方	间	客户号	10	户名称	清算账户	鼓量 (吨)	价幅	巳成交(吨)	景入日期	最入时间
	挂牌成交															
自信用管理 <	◎ 协商成交 ◎ 挂牌成交											我要报价		我要下单	我要转让	我要回购
自出入金管理 🗸	 		品种	基准期货	初始成交价	挂牌方	方向	点价方	最后点价日	最后交收日	签发方	交货地	数量(吨)	品级	品级说明	联系方式
入金申请	1 <u>bi-20160617-c</u>	p-000002	聚丙烯	pp1705	30	DD资本	픗	픗	20160712	20160718		营口港	200	均数PP粒	厂家: 測试	
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	10 V H 4 篇1 下单	共1页	• н о													显示1到1,共1记录
自 其它资金管理 🗸 🗸	合约			价档	DD	联系 资本:1564117	《人信息 8251		- H	~					客户号:未设置 清算》	沪:未设置 账户设置
账户资金划转	当日委托	当日成交												🗄 委托查询	() () () () () () () () () ()	持合查询 羊 资金查询
自交易管理 ∨	操作 委托号 1 数档 4	状态 已报入	<u>bt-20</u>	合约号 160617-pp-000	订单类 102 报入	型 买卖方 买	向	客户号 000800	- 曹 5 DD股份	户名称 集团有限公司	清算账户 80050008005	数量(吨) 200	价格 30	日成交(吨)	录入日期 20160617	景入时间 10:54:28
交易下单	2 3 3 1	完全成交 槽单	bt-20	160617-pp-000	103 哨应 102 提入	픗		000800	5 DD股份 5 DD股份	集团有限公司 集团有限公司	80050008005 80050008005	100 200	-10 30	100	20160617 20160617	10:24:24 10:19:57 302061:

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,系 统会动态试算交易保证金,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。

自产品信白 /	挂牌成交															
7 Hellesta	◎ 协商成交 ⑧ 挂牌成交										我要报价		我要下单	我要转	£ (我要回购
自客户管理 <	✓ 合约	品种	基准期货	初始成交价	基整报价	的时一口价	挂牌方	方向点价方	5 最后点价日	最后交收日	签发方	交货地	数量(吨)	品级	品级说明	联系方式
自资金管理 <	1 Jt-20160624-pp	-000002 聚丙烯	pp1705	10	10		CC公司	买 买	20160630	20160708	CC公司	杭州	1000	均聚PP粒	厂家:绍州	<= CC公司集团:1
自交易管理																
交易下单																
自交易査询く																
自日报表查询 <																
fa volution .	10 1 14 4 第1	#1页 ▶ N C)													显示1到1.共1记
	TΦ															
	合约 bt-20160624-pp-000002		价格		联展	人信息		#G X					太白岳 の	108005 浅質詳	⇒:8005000800;	5 8 608
	自日安托 指作 西托曼	自日成交	会约要	订成进	刑 平赤方	a 203		室白盆物	海道所有	- 27番	(151)	价格	:= 会化应问 日成本(順)	○ HLXE 査询	 (目) 101日前日 (日) 101日 (日) 101日	1 7 2000 00
	2010			N+4.					444444	-	(***)	01164	Callest (***)	407100		
自产品信息<	挂牌成交															
178	◎ 协商成交 ⑧ 挂牌成交										我要报价	R	要下单	我要转让		我要回购
	✓ 合约	品种	基准期货	初始成交价	基整报价	8085—四63	挂牌方	方向点价方	最后点价日	最后交收日	医发方	交货地	<u>数量(吨)</u>	品级	品级说明	联系方式
■ 資金管理 <	1 🗷 <u>bt-20160624-pp</u>	-000002 聚丙烯	pp1705	10	10		00公司	픗 픗	20160630	20160708	00公司	杭州	1000	均限PP粒	厂家 : 绍兴日	E CC公司集团:15
自交易管理 🗸 🗸																
交易下单																
■ 交易查询 <																
自日报表查询 <					9	确认报入吗?										
自交收管理 <	10 • 14 4 第1	共1页 ▶ ▶ ෮				2 合约: bi 价格: 11	-20160624-	pp-000002							1	显示1到1,共1记录
	下单		10.47			数量: 10	000									
	pt-20160624-pp-000002		DITE		日本:156411 日本:156411		确定	取消					客户号:000	18005 清算账户	80050008005	账户设置
	当日委托	当日成交											Ξ 委托查询	(\$) 成交重调	合 持合查询	羊 資金查询
	操作 委托号	状态	合约号	订单类	型 买卖方	向 客户号	1	客户名称	清算账户	設量 (0E)	价格	巳成交 (吨)	录入日期	景入时间	Ð
	_															
自 产品信息 <											60.TE 17/A		TT A	(1)T(***)		
自客户管理 <	 Statistic Statistic Statistic Statistic 	₩.	整准期代	初始成本价	基業振行	10时一口价 :	接牌方	方向点价东	最后点价日	最后交收日	3.安城67 签发方	交活地	数最(時)	大安特让	品級領部	X3世国内 既系方式
in access	0.00	BATT.		0,1000000					Jone of the second seco						an Arger	
交易下单																
■ 交易查询																
■ 日报表查询 〈																
自交收管理 <	10 V H 4 18 0	共0页 ▶ ▶ 0													1	显示0到0,共0记录
	台约		价格		联系	人信息										
				DD3	覺本:15641178;	251	Į.	ελ					ş	第户号法设置 涌	算账户未设置	账户设置
	当日委托	当日成交											Ξ 委托查询	(*) 成交重词	合持合查询	羊 资金查询
	操作 委托号	状态 来全成交 [ht.2)	合约号 0160624-nn-000	订单类3 002 喧中	2	日本 10008005	00824	客户名称 計集团者限公司	清算账户 800500080	数量(FE)	价格 10	已成交(吨) 1000	录入日期 20160624	最入时间 10:14:34	0
				**/W	~	0000005	JURI	- Andrew (1922/P)	5555000801	100	-	10		20100024	10.14.3	· _

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。【交易商客户间交 易】的合约不允许进行转让。

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"。【交易商客户间交易】的合约不允许进 行回购。 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"。点击当日成交,可以看到成交记录。 "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。

8.2 协商

a) 下单、响应

1)交易商[DD资本]使用交易下单功能,选择协商交易,我要报价,选择合约, 填写价格,系统会动态试算交易保证金,修改联系人信息,设置要协商的对手方账 户信息,点击"报入"。

全部	产品信	ue.	客户管理	资金管理	交易	管理	交易查询		日报表到	監御	交收管理						0 0
		协商成交															
自信用管理		◎ 协商成	交 🔍 挂牌成交										我要报价		我要下单	我要转让	我要回购
自 出入金管理			合约	品种	基准期货	初始成交价	挂牌方	方向	点价方	最后点价日	最后交收日	签发方	交货地	数量(吨)	品級	品级识	明 联系方式
入今由法		1 🗹	bt-20160617-pp-00	0002 聚丙烯	pp1705		DD资本	买	Ŧ	20160712	20160718		昔日港	200	均聚PP粒	厂家: 澎	đ
八五年間																	
出金申请																	
入金明细查询																	
山玉明如雪周																	
可用资金查询																	
其它资金明细		10 🔻	K (1;	共1页 ▶ ▶	0												显示1到1,共1记
		下单	0/5		10.49		Pro	5 L (4) (11)									
		bt-2016	1617-pp-000002	28	0/98	Þ	^{政協} D资本:1564117	8251		H	K			对手方套户号:	未设置 春户号:0	008005 清算账户:	80050008005 账户设置
账户资金划转		HE HE	委托	当日成交											:Ξ 委托查询	◎ 成交重询	合 持合查询 羊 资金查询
■ 交易管理		操	作 委托号 订	单状态	合约号	操作类型	下单时间	对于	F方交易商	1号 对手2	交易商简称	香户号	香户名称	清算账户	买卖方向	数量(吨)	价格 是否已匹配
☆黒玉 魚																	
全部	产品信以	a	客户管理	资金管理	交易	會理	交易查询		日报表查	饷	交收管理						0 0
全部	产品信以	a 协商成交	客户管理	資金管理	交易	≑ 理	交易查询		日报表查	ii A	交收管理						0 0
全部 自信用管理	<u>产品信</u> (協商成交 ③ 协商成3 	客户管理 5 ○ 挂牌成交	資金管理	交易	空班	交易查询		日报表查	nia)	交收管理		我要报价		我要下单	我要转让	 3. (1) 3. (1) 3. (1) 3. (1) 3. (1) 4. (1) 4. (1) 5. (1)
全部 自 信用管理 自 出入企管理	产品信』 く 、	訪商成交 ● 訪商成3 ■	 客户管理 ○ 挂桿成交 合约 	資金管理	交易的	會理 初始成交价	交易查询 挂稿方	方向	日根表音	御 最后点价日	交收管理 最后交收日	签发方	我要报价 交货地	数量(吨)	我要下单品级	我要转让 品级说明	 ・
 全部 自 信用管理 自 出入金管理 入金由请 	<u>产品信</u> に く 〜	 (1) (1) (2) (2) (3) (4) (4) (5) (5)<th>客户管理 E ● 挂牌成交 合约 bt-20160617-pp-000</th><th>資金管理 品件 002 緊丙烯</th><th>交易\$ 基准期质 pp1705</th><th>意理 初始成交价</th><th><u>交易宣词</u> 挂牌方 DD资本</th><th>方向买</th><th>■ 报表音 点价方 买</th><th>(词) 最后点价日 20160712</th><th>交收管理 最后交收日 20160718</th><th>签发方</th><th>我要报价 交货地 营口港</th><th>数量(吨) 200</th><th>线要下单 品级 均聚PP粒</th><th>我要转让 品级说明 厂家: 测定</th><th>代要回時 秋要回時 戦振方式</th>	客户管理 E ● 挂牌成交 合约 bt-20160617-pp-000	資金管理 品件 002 緊丙烯	交易\$ 基准期质 pp1705	意理 初始成交价	<u>交易宣词</u> 挂牌方 DD资本	方向买	■ 报表音 点价方 买	(词) 最后点价日 20160712	交收管理 最后交收日 20160718	签发方	我要报价 交货地 营口港	数量(吨) 200	线要下单 品级 均聚PP粒	我要转让 品级说明 厂家: 测定	代要回時 秋要回時 戦振方式
全部 首 信用管理 首 出入金管理 入会申請	<u>产品信</u> く 、	 協商成交 ③ 协商成3 ④ ① 1 	客户管理 5 ② 挂牌成交 合约 bt:20160617-pp-000	资金管理 员件 002 服丙烯	交易\$ 藝度期後 pp1705	≹理 初始成交价	交易查询 挂碑方 DD资本	方向	目报表音 高价方 要	100 最后点价日 20160712	交收管理 最后交收日 20160718	签发方	我要报价 交货地 营口港	数量(時) 200	我要下单 品级 均聚PP粒	我要转让 品级说明 厂家: 激品	1 秋景回向 秋景回向 秋景四向 秋景四向 秋泉方式
全部 自 信用管理 自 出入会管理 入会申請 出会申請	<u>产品信</u> く 、	 動商成交 動商成交 動商成支 1 	各户管理 E ◎ 接梯成交 合约 bl:20180617-cp-000	资金管理 品种 002 服門房	交易 整准期货 pp1705	言理 初始成交价	交易宣询 挂续方 DD资本	方向买	■振表音 点价方 栗	(词) 最后点价日 20160712	交收管理 最后交收日 20160718	签发方	我要报价 交货地 奮口港	数量(院) 200	线要下单 品级 <mark>均聚PP拉</mark>	我要转让 品级说明 厂家: 测 记	大景国時 秋景国時 秋泉方式
全部 自 信用管理 自 出入金管理 人金申請 出金申请 人金申请 人金申请	<u>产品信</u> く 、	3 防商成交 ● 协商成3 ■ 2 1 ■	客户管理 E ● 挂梯成交 合约 b1:20180517-sp-000	资金管理	交易(基准期货 pp1705	會理 初始成交价 難中i	交易音询 挂牌方 DD资本	方向	日报表声 点价方 买	前 最后点价日 20160712	交收管理 最后交收日 20160718	签发方	我要服价 交货地 奮口道	数量(院) 200	我要下单 品级 均聚PP粒	我要转让 品级说明 厂家: 例沿	大要回時 秋寒の方式
全部 値 信用管理 値 信用管理 道 出入全管理 入全申请 出会申请 人会明细密询 出今初細歌句	产品信 に く 、 、 、	 動商成交 ・ 协商成3 ・ 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一 一	客户管理 5 ● 接接成交 合約 bt20160817-cp-000	资金管理 品件 002 服門場	交易(基盘期质 pp1705		<u>交易音调</u>	方向 买 一	III 探表音 点价方 平	論 最短点价日 20160712	交收管理 最后交次日 20160718 C	签发方	我要报价 交货地 當口港	欺量(吗) 欺量(吗) 200	找要下单 品级 均聚PP粒	我要转让 显级说明 厂家: 激短	秋毎回時 秋毎回時 秋季回時 秋季回時 秋季回時 秋季回時 秋季の方 秋季の方の 秋季の方の 秋季の方の 秋季の方の 秋季の方の 秋季の 秋季の方の 秋季の 秋季の 秋季の方の 秋季の 秋季の方の 秋季の 秋季の方の 秋季の 秋季の 秋季の方の 秋季の 秋季の 秋季の方の 秋季の 秋季の 秋季の方の 秋季の方の 秋季の 秋季のか 秋季のの
全部 ・ に用用電 ・ 出入企業電 ・ 出会申請 ・ 出会申請 ・ 人会明画面前 ・ 出会明画面前 ・ 出会明画面前	产品信 ル く マ	 訪商成交 ⑦ 訪商成五 ⑦ 訪商成五 1 	 客户管理 全 単接成交 会約 	资金管理 品件 002 配門地	交易 基础均衡 pp1705		交易言词 挂牌方 DD该本	方向 天 天	 一根表白 点价方 平 008003 008005 	简 最后点价日 20160712	<u> </u>	筆放方 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二	<u>我要保你</u> 交貨地 奮口港	欺量(時) 200	式要下単 品級 均聚PP粒	究要特让 品级说明 「家: 満招	1. 新規制度 1. 新規 1. 新 1. 新規 1. 新 1. 新規 1. 新 1
全部 企用電量 通 出入企業理 入会申請 出会申請 人会申請 出会申請 人会申請 日 小会申請 日	产品信 () く 、	 · 助商成交 · ● 协商成交 · □ · □ · □	客户管理 E ● 接線成交 会约 bt:20150517-cp-000	資金管理 品件 002 服務場	交局 藝樂期後 pp1785	19月1日 19月1日 1月日 1月日 1月日 1月日 1月日 1月日 1月日 1月日 1月日	<u>交易</u> 合領	方向 天天 (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1)	 一根太白 点价方 要 009003 008005 00500080 	協 最后点价日 20160712 205-自有张户:	交收管理 最后交收日 20160718 0 0 0 0 0 000股份/mg	奎波芳 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二	我要报价 交換地 室口港	武士 武士 200	式要下单 品収 均服PP粒		1. 数単規模 1. 数 1. 1
全部 企用電量 山太金管理 人会申請 山会申請 人会明細意詞 山会明細意詞 可用用金書詞 其公清金明細		3. 物商成交 ● 协商成3 1 √	 新戸信辺 ご 登録成次 会约 助た201606174xxx-000 助た201606174xx-000 	資金管理 昼仲 002 駅門時 11页 ▶ ▶	交局 基准畸质 pp1705		 交易音询 挂续方 DD炭本 分離 台離 一日 <	方向 天 計号: 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	日版大音 点价方 要 008003 008003	協会 最后点价日 20160712 005-目有张户:)	交收管理 最后交收日 20160718	至波方 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二 二	我请我价 交流地 第二届	200 200	此要下单 品级 均聚PP粒	25要钟让 最级说明 厂家: 開始	 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2
全部 ・ 使用電源 ・ 出入企管源 ・ 出入企管源 ・ 出会申請 ・ 出会申請 ・ 出会申請 ・ 出会申請 ・ 日前 ・ 日前 <t< th=""><th></th><th>○ 物商成交 ● 物商成交 ● 物商成立 1 < ● 1 < ● 1 < ● 下单</th><th>各户款提 を ● 接続式文 会けう bi20150817xp-000</th><th>资金管理 002</th><th>交易 基単期済 pp1785</th><th></th><th>交易音调</th><th>方向 天 () () () () () () () () () (</th><th>日 股 太 市 点 价 方 栗 の08003 008003 008008(0</th><th>1回 最后点价日 20160712 20160712</th><th><u> 交換管理</u> 最后交換目 20160718 C D D D D D D D D</th><th>筆双方 工公司集团 D 股份集团有限公</th><th>現在我が 交流地 東口市</th><th>型量(円) 200</th><th>抗要下単 品級 均駅PP粒</th><th>究要特让 原成讲述 「茶: 影約</th><th> ・ ・ ・</th></t<>		○ 物商成交 ● 物商成交 ● 物商成立 1 < ● 1 < ● 1 < ● 下单	各户款提 を ● 接続式文 会けう bi20150817xp-000	资金管理 002	交易 基単期済 pp1785		交易音调	方向 天 () () () () () () () () () (日 股 太 市 点 价 方 栗 の08003 008003 008008(0	1回 最后点价日 20160712 20160712	<u> 交換管理</u> 最后交換目 20160718 C D D D D D D D D	筆双方 工公司集团 D 股份集团有限公	現在我が 交流地 東口市	型量(円) 200	抗要下単 品級 均駅PP粒	究要特让 原成讲述 「茶: 影約	 ・ ・ ・
全部 ・ の用電準 ・ 山へ企管理 ・ 山へ企管理 ・ 山会申請 ・ 山会申請 ・ 山会明館意询 ・ 山会明館意向 ・ 山会明館表向 ・ 山会明館表向 ・ 山会明館表向 ・ 山会明館表向 ・ 山会明館表向 ・ 山会明館表向 ・ 山会明館 ・ 山会の館 ・ 山会の館 ・ 山谷会館 ・ 山谷の館 ・ 山谷の館 <tr< th=""><th>が品信 く ・ ・ ・</th><th>は 動商成交 ● 协商成立 1 ● 1 ● 一 1 ● 一 1 ● 一 1 ● 一 日 日 一 日 一 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 日 日 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 日 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日</th><th>各户世記 E ● 接続式文 合け H 《 第1 第4 合け H 《 第1 第4</th><th>日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日</th><th>交易性 基準期済 pp1785 40倍</th><th></th><th> 交易音询 注综方 DD炭本 Q費 対単方音 客片号: 清貫際片 </th><th>方向 天 天 二 : 8</th><th>日根本 点 が 方 要 308003 008005 0050008(</th><th>1個 最后点价日 20160712 2005-母有张户:</th><th> 交收管理 最后交次日 20160718 C C D DORE0.987 D DORE0.987 </th><th>至波方 二 二 二 公司集団 の 原 の 集団の 展公</th><th>実務部の 交流地 東口市</th><th>数量(円) 200</th><th>牧夢下単 品級 均数PP粒</th><th></th><th>・ ・ ・</th></tr<>	が品信 く ・ ・ ・	は 動商成交 ● 协商成立 1 ● 1 ● 一 1 ● 一 1 ● 一 1 ● 一 日 日 一 日 一 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 日 日 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 日 日 日 一 日 日 一 日 日 一 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日	各户世記 E ● 接続式文 合け H 《 第1 第4 合け H 《 第1 第4	日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日	交易性 基準期済 pp1785 40倍		 交易音询 注综方 DD炭本 Q費 対単方音 客片号: 清貫際片 	方向 天 天 二 : 8	日根本 点 が 方 要 308003 008005 0050008(1個 最后点价日 20160712 2005-母有张户:	 交收管理 最后交次日 20160718 C C D DORE0.987 D DORE0.987 	至波方 二 二 二 公司集団 の 原 の 集団の 展公	実務部の 交流地 東口市	数量(円) 200	牧夢下単 品級 均数PP粒		・ ・ ・
	か品価は 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、	は 動商成交 ● 均高成立 1 ✓ 1 ✓ 下生 P-20160	 各户款港 日 注意成文 会り お(20100817200-000 お(20100817200-000 お(3010817200-000 ふ(3010817200-000 ふ(3010817200-0000 ふ(3010817200-000	日成交	◆局 基単規度 pp1705 6/16		 交易査询 注線方 DD資本 Q置 対率方面 客中号: 清算原件 	方向 天 子: 8	日根本 点价方 要 008003 008003 0080080	協 最短点价日 20160712	交收管理 最高效农日 20160718 C DD設分研究	至城方 二 二 公司集団 の限的集団の開公	1985年 第日日 第日日 19 19 19 19 19 19 19 19 19 19	欺量(兩) 200	技帯下単 品級 均関PP粒 10間PP粒 10間 第4000 10日 第4000 11日 第4000 11日 第4000	2 要 特上 西 成功 初 の	 ・
	 * 品信 、 	3 助商成2 ● 助商成2 ● 1 ● 1 ● 1 ● 1 ● 1 ● 1 ● 1 ● 1 ● 1 ● 1	 各户世禄 ● 注意成交 会り と(2015061720+000 と(2015061720+000 と(2015061720+000 (11) をからののの2 (11) をからののの2 (11) をからのの2 (11) をからのの2 (11) をからのの2 (11) をからのの2 (11) をからのの2 	日本式交		103年成文(f) 第1月 第1月	<u>交易</u> 合領	方向 天 天 :: 8	日报表点 点价方 天 008803 008005 00500080	最短点が日 20160712 205-豊有张产1	交收管理 最后交攻日 20160718 00股份 (MC)	並双方 二公司集団 の動の生活有限公 優好	11年500 又読む 軍口書 10 7) <p< th=""><th>数量(丙) 200 201 201 201 201 201 201 201 201 201</th><th>北東下単 品級 均数PP检 12至 東小号00 1三 創作品(3) 天空方向</th><th>牧養特上 岳政規模 「京: 教授 「京: 教授 ションのの5 満用時小8 「真白虎」 武直(氏)</th><th>・ ・</th></p<>	数量(丙) 200 201 201 201 201 201 201 201 201 201	北東下単 品級 均数PP检 12至 東小号00 1三 創作品(3) 天空方向	牧養特上 岳政規模 「京: 教授 「京: 教授 ションのの5 満用時小8 「真白虎」 武直(氏)	・ ・
全部 自信用指導 日本会報報 人会申请 出会申请 出会申请 出会申请 出会明細志向 田太明細志向 可用語金書明 其心清金期報 其心清金期報 其心清金期報 東心清金期報 東心清金期報 東心清金期報 東心清金期報 東の音金期報	 * 品信 、 、 、 、 、 、 	は め時成文 ● 10頁 1 ● 10 1 ● 10 1 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 1 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 ● 10 1 1 ● 10 1 ● 10 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	新戸校研 z 単純年の 自分 比201001700-000 H 4 第1 月 自分 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日	 新会会課 高特 の02< 取行時 28.00 日成交 出版交 			<u>交易</u> 奇词 注律方	方向 天 元	日报表育 点价方 夹 2008003 00500080	協会	今秋世課 最高支改日 20160718	至双方 C公司集团 回题的生得的概公 在	11年日の 2月1日日 第二日日 7月1日 7月1	設量(同) 200 200 200 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3	北東下集 品級 均駅PP粒 10日 宮か与のの 「三 創た高向 天堂方向		

2) 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,系 统会动态试算交易保证金,点击"报入"。点击当日成交,可以看到成交记录。

b) 转让、响应

交易商[CC 资本] 使用交易下单功能,选择协商交易,我要转让,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"。**协商成交的合同也可公开** 挂牌转让。【交易商客户间交易】的合约不允许进行转让。 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"。【交易商客户间交易】的 合约不允许进行回购。

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/客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

9.现在的位晋:交易查询>>持仓查询

交易商/子账户/客户进入:交易查询-持仓查询,查看交易商、子账户、客户的持仓 状况。

通过持仓查询可以查到该笔交易的对手方,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。

开始	日期	20200713						结	東日期	20200713		2				
交易	商号	8102							沪号	全部		T				
品种		全部		T				合	约号							
清算	账户															
找到3 刍	R记录, 显示 1	到3 《〈〉〉	10 💌 🌉													Q查询
序号	交易日期	合约号	基准合约	清韓账户	账户类型	交易商简称	客户名称	对手方交易向	号 对手方交易商简称	合约状态	昨日持仓(吨)	今日持仓(吨)	保证金(元)	信用額度抵扣(元)	盈亏(元)	手续费 (元)
1	20200713	i-20200708-000001	铁矿石2008test	81020008102	主账户	河綱国際	河锅集团北东国际贸易有限公司	8105	中继管理	待交收申请	0	-10	0.00	0.00	0.00	0.00
2	20200713	i-20200708-000002	铁矿石2008test	81020008102	主账户	河綱国際	河锅集团北东国际贸易有限公司	8105	中继管理	待交收申请	0	10	0.00	0.00	0.00	0.00
3	20200713	i-20200708-000003	铁矿石2008test	81020008102	主账户	河纲国际	河锅集团北京国际贸易有限公司	8105	中继管理	待交收申请	0	-10	0.00	0.00	0.00	0.00
<																>

9.2 成交查询

交易商/子账户/客户进入:交易查询-成交查询,查看交易商、子账户、客户的成交 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。

自 产品信息	<	您现在的	位置:交易查询>	>成交查询														
自 客户管理	<	开始日	3#8	20160613						结束日期	2016062	0						
自 资全管理		交易商	1 9	8005		DD资本				客户号								
	<u> </u>	版交方) z C	全部	٣				市场	基整交易	市场		•					
自 交易管理	<	合约		全部	Ψ.													
查 交易查询	~	抗到1 茶i	记录, 显示 1 争	1 « < > » 10	•												l	Q查询
持合查询		序号	交易日期	合约号	基准合约	买交易商简称	买清箩账户	买报入流水号	卖交易商简利	\$P\$ 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
成交查询		1	20160617	bt-20160617-pp-000003	胶内塢1705	DD资本	80050008005	3	CC公司	80030008003	2	报入	13	100	-10.00	0.00	10:24:24	挂牌成交
交易确认单查询																		
目 日报表查询	<																	
自 交收管理	<																	

9.3交易确认书查询

交易商/子账户/客户入:交易查询-交易确认单查询,查询并打印每笔合约的交易确 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。

自 产品信息	<	您现在的位置:交易查询>>	交易确认单查询									
自 客户管理	<	开始日期	20160613				结束日期	20160620				
1 VI.0.4617		交易商号	8005	DD资本			清算账户					
■ 貴道當姓	<	香户号					市场	基整交易市场	T			
自 交易管理	<	合约	全部	T								
自 交易查询	~	找到1 茶记录, 显示 1 到	1 « < > » 1	0 🔹 🏹								Q查询
持合查询		交易确认书	成交编号 交易商	号 交易商简称	合约号	基准合约	肉 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
成交查询		\$7£0	13 8005	DD资本	bt-20160617-pp-000003	服丙烯:	705 20	160617 买	100	-10.00	元吨	80050008005
交易确认单查询												
自 日报表查询	<											
自 交收管理	<											



确认书编号: b+20160617-pp-000003_20160617_13

基差交易确认书(基差贸易合同)

本次基差交易适另相 纷 新基差交易达另相 纷 新基定 易 小海认书与构成主协 本确认书与商品 定义 文 文 文 易 双 方 同 意 ,本确 礼 书 方 本 市 水 方 木 市 大 市 大 市 木 市 木 市 木 市 木 市 木 市 木 市 木 市 木 市 木 市 木 市 木 市 木 市 市 本 市 本 市 本 市 木 市 木 市 本 市 本 市 本 市 本 信 本 市 本 市 本 市 本 信 本 作 本 作 本 本 信 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 作 本 本 作 本 本 で 本 で 本 で の 本 作 本 で の で の で の で の で で の で の で の で の で で の で	连解"下券件书, 一条件书, 一条件书,	交易所基差交易业务管理办法》、 规处理办法》(以下简称"业务规 一方",合称"交易双方"。交让 项"交易有效约定",除非本确ti 市场衍生品交易商品类衍生品定; 约定不一致,本确认书的相关约5 条款构成了交易双方之间就本确 条款、专用条款三部分构成,若引	《大连商品交易所基差交 规则")及大连商品交易所基差交 易双方已经签署了《中国证 人书中另有约定,主协议及 义文件(2015年版)》及其 f 定具有优先法律效力。 人书项下交易的完整条款。 与用条款与基本信息和通用:	易业务交易商管理办法》、《大连商品交易 其他相关业务规定。 券期货市场衍生品交易主协议(2018年版)》 其补充协议适用于本确认书。 修改或补充(以下称"商品定义文件"),才 且对交易双方具有法律约束力。 条款约定不一致,以基本信息和通用条款为							
基本信息											
成交日期:	20164	年06月17日	合同编号:	bt-20160617-pp-000003							
卖方:	CC 公	司集团	买方:	D D 股份集团有限公司							
实方清算账号: 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:	80030	0008003	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									
基准期货合约		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									

【交易商客户间交易】的合约标题为"基差贸易合同(交易商与客户间)"



基差贸易合同(交易商与客户间)

本次基差交易适用《大; 卖方和买方以下单独称	车商品 "交易	,交易所基差交易业务管理办法》及大; ,一方",合称"交易双方"。	生商品交易所其他相关业	2务规定。
基本信息				
成交日期:	2020年	607月06日	合同编号:	i-200703-000008
卖方:	高测试	式交易商全称	买方:	高测试交易商全称
卖方清算账号:	888881	008888	买方清算账号:	88880010079
卖方开户银行:	交通银	银行	买方开户银行:	交通银行
卖方银行资金账号:	888881	0088888888881008888	买方银行资金账号:	888880010079888880010079
卖方联系人信息:	高测量	£13588887777	买方联系人信息:	zyk1001:13190197172
品种		铁矿石		
基准期货合约		铁矿石2008test		
品级		PB粉		
交货地(仓库)		888		
开始交易日		2020年07月06日		
最后点价日		2020年07月06日		

10 日报表查询

日终结算后,交易商/子账户/客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/客户进入:日报表查询-日成交单查询,查看交易商、子账户、客户 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。

首 产品信息	<	您现在的	9位置:日报表查询:	>>日成交单查询											
自 客户管理	<	开始	日期	20160601					结束日期	20160620					
白 湖今等面		交易	商号	8005	DD资本				客户号						
	<u> </u>	清算	账户						市场	基壁交易市场	i	Ŧ			
自 交易管理	<	合约		全部	Ŧ										
自 交易査询	<	找到2 疗	(记录, 显示 1 到:	2 ≪ < > ≫ 10 ▼											Q查询
自 日报表查询	~	序号	清算日期	合约号	基准合约	成交号	买交易商简称	买清算账户	卖交易商简称	奏清鐘账户	成交量	成交价 (元)	盈亏(元)	成交时间	成交方式
日成交单查询		1	20160617	bt-20160617-pp-000003	駅丙烯1705	13	DD资本	80050008005	CC公司	80030008003	100	-10.00	0.00	10:24:24.128	挂牌成交
日资全结管索		2	20160602	bt-20160530-i-000001	铁矿石1705	8	FF <u>企业</u>	80070008007	DD资本	80050010003	2000	10.00	-20,000.00	10:17:57.357	挂牌成交
HATHER															
日持合报表															
追保通知查询															
自 交收管理	<														

10.2 日资金结算表

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

自产品信息	<	您现在的	的位置:日报表望	6询>>日资金结算	ŧ										
自有户管理	<	开始	日期	201606	20					结束日期	20160620				
自 资金管理	<	客户	- 5							清算账户					
-		交易	商号	8005			DD资本								
	<	找到2 纾	张记录, 显示 1	푀2 《 <	> >> 10	•									Q查询
自 交易查询	<	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)	应追加资金额 (元) 今日初始可用額度(元) 出金(元)	入金(元)	現金(元)	抵押品(元)	昨日现金保证金 (元)
自 日报表查询	~	1	20160620	80050008005	DD资本	0008005	DD股份集团有限公司	30,059,550.00	0.0	30,059,55	0.00 0.00	0.00	30,059,550.00	0.00	0.00
日成交单查询		2	20160620	80050010003	DD资本	0010003	123	380,000.00	0.0	380,00	0.00 0.00	0.00	380,000.00	0.00	0.00
日资金结算表		4													•
日持合报表															
追保通知查询															
自 交收管理	<														

10.3 日持仓报表

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

首 产品信息	<	您现在	的位置:日报表到	版词>>日持仓报表												
自 有户管理	<	开始	日期	20160615						结束日期	21	160620				
自 资金管理	~	交易	商号	8005		DD资本				客户号						
		清算	职账户							市场	3	差交易市场	Ŧ			
自 交易管理	<	合约	5	全部	Ŧ											
查 交易查询	<	扰到1 j	条记录, 显示 1	到1 《 < > 》 1	10 🔹 🏹											Q.查询
自 日报表查询	~	序号	清楚日期	合约号	基准合约	清豐账户	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)	信用譲度抵扣 (元)	盈亏(元)	手续费(元) 1
日成交单查询		1	20160617	bt-20160617-pp-000003	顧丙烯1705	80050008005	主账户	DD资本	0008005	DD股份集团有限公司		0 0	0.00	0.00	0.00	0.00
日资金结算表		4														•
日持仓报表																
追保通知查询																
自 交收管理	<															

10.4 追保通知查询

交易商/子账户/客户进入:日报表查询-追保通知查询,查看交易商/子账户/客户是 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。

10.5 结算单打印

交易商/子账户进入:日报表查询-结算单打印,可以查看并打印指定时间段内的账 户结算单,结算单内容包括:资金状况、出入金明细、其他资金明细、成交记录、持仓 明细、交收明细。交易商可以生成包括主账户、子账户的所有账户明细,或指定单一账 户生成结算单;子账户只能生成自己账户的结算单。

11 交收管理

交易商、子账户、客户均可进行交收,实例中以交易商为例。

11.1 首次点价/追保申请

1) 首次点价

交易商登录交易平台,选择要操作的合约,点击首次点价确认。

勾选记录并确认无误后,点击"复核"。

首次点价后,合约进入交收状态,合约不可转让、回购。

基差合约最后点价日前 2 个交易日起(包含最后点价日共三个交易日)仍未点价的, 期间系统每日发送短信提醒交易双方。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。

自产	品信息	<	息现在的6	2图:交收管理>	首次点价追保申请												
自命	沪管理	<	没有找到后	3 . .													
自资	金管理	<	选择	合约号	对手方交易商	最后点价日	最后交收日	首次点价状态	被追保方交易商	被追保方清整张户	已收保证金	造保金额	申请状态	操作人	操作日期	操作时间	备注
自交	易管理	<															
自交	易查询	<															
B B	报表查询	<															
自交	收管理	~															
	交收查询		這保会	\$?													
	首次点价编保申请		衛注														
	追保中请查询		说明		买震双方均可确。	1.信价,首次信价后载;	需要执行确认点价流程	,确认点价后合约不可转;	E.							li	
-	交收申请					Gh the		10 2 3 3 1			+ #60015	Xas	1 17	\$7.40			
	线上转线下交收																
	网络农长管理																

2) 追保申请

<u>ё</u> дняш (

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。

自 产品信息	<	感现在的位	置:交收管理>>	首次点价追保申请												
自 客户管理	<	没有找到记	禄.													
自 资金管理	<	选择	合约号	对手方交易商	最后点价日	最后交收日	首次点价状态	被追保方交易商	被追保方清整账户	已收保证金	追保金额	申请状态	操作人	操作日期	操作时间	备注
會 交易管理	<															
自 交易查询	<															
■ 日授表查询	<															
會 交收管理	~															
交收查询		進保金!	đ													
首次版价追保申请		發注														
追保申請查询		说明		买卖双方均可确认	人感价,算次感价质就	國要执行論认成价流程	,确认点价后合约不可转让	£.							h	
交政申請						an × 1	:en 🖸 25 te	2		+ 20000	×	• Ø:	SZ NE			
线上转线下交收																
现货交收管理																

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) 进入: 交收管理-追保申请查询, 查看追保记录和被追保记录。

Ŭ,	产品信息	<	您现在的包	位置:交收管理>>追保中	请查询									
Ú I	客户管理	<	市场		基整交易用	5135 V			合约		全部	T		
自日	资金管理	<	方向		◎ 追保记录	: ○ 被追保记录			状态		全部	▼		
Ú :	交易管理	<	找到1 条i	記录, 显示 1 到 1 🔍	$\langle \rangle \gg$	10 • 🕅								Q查询
- -	交易查询		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	
•	又吻里向	<u> </u>	2	基差交易市	5	bt-20160524-i-000001		3,331,000.00	已复核	CCgs	20190830	09:14:01	這完這算后B就欠200	
Ü	日报表查询	<	合计					3,331,000.00						
Ľ۵.	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													

11.2 交收申请

1) 卖方在交易平台的交收申请管理中,选择需要交收的合约,填写交收货款,点击"交收申请",买方无权发起交收。

會 产品信息 <	\$B	R在的位置:交收管理:	>交收中请																	
自有户管理 <		市场		基整交易		٣					台约		全部			٣				
■ 資金管理 〈	121	就到记录. 《 〈	> >>	10 🔻 🚺																() 2 Ø
自 交易管理 く	18	睜 首次点价日	合约号	买交易商前非	买清赞账户	卖交易商简称	卖清费账户	交收数量	交收货款	买方屋约金额	卖方屋约金额	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
自交易查询 〈																				
自日服表查询 <																				
■ 交換管理 🗸																				
交收查询																				
首次点价值保申请		交政策数																		
遺保申請查询		普注																		
交收申请																			ti.	
线上转线下交收								+ #3	1xx	⇒最新	🔍 Résa	X	Elixa							
现货交收管理	iRA	月:1、交收数量:跨	脂-500千克、	、纤维板·立方米、服	Q合板-张、其它-1	ą.														

2) 买方在交易平台的交收申请管理中,选择要确认的合约,点击"同意交收"。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。

自 产品信息	<	您现在的位置:交收管理>	>交收中请																	
自 客户管理	¢	市场		基整交易		Y					會約		全部			Y				
自 资金管理	<	没有找到记录. 《 〈	> >>	10 🔹 🚺																入査部
自 交易管理	<	选择 首次点价日	合约号	哭交易商简称	买清算账户	类交易商简称	卖清望账户	交收数量	交收贷款	买方服约金额	卖方服约金额	中请号 中	時状态	操作人 措	象作日期	操作时间	审批操作人	审批操作日期	审批操作时间	备注
查 交易查询	<																			
日報表查询	<																			
自 交收管理	v																			
交收查询																				
首次点价虚保申请		交收贷款																		
油保申請查询		發注																		
交收申请												_								
线上转线下交收								+ #3	ixa	5 # 9	T REAL	X®	esa -							
现货交收管理		1088 · 4 2080/0083 · 46	RE SOOJER	454836 (Tribula - M	1457 NO1															

3)交收申请最早可在首次点价日后的下一个交易日发起,基差合约最后交收日前 2个交易日起(包含最后交收日共三个交易日)仍未进行交收通知的,期间系统每日发 送短信提醒交易双方,若双方始终未达成交收申请/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。

交收申请达成当日即可完成确认收货流程,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	<	感现在	E的位置:交收T	管理>>规茨交收	管理														
自客户管理	<	市	5		基整交易市场	Ŧ				合约		全部		Ψ.					
資金管理	<	找到1	条记录,显示	1到1 《	< > > 10 •													Q	查询
自 交易管理	<	选择	现货状态	首次点价日	合约号	买交易商简称	买清鹽账户	卖交易商简称	卖清鐘账户	交收数量	交收贷款 (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
查 交易查询	<	V	未收货	20160608	bt-20160608-i-000003	FF企业	80070008007	CC公司	80030008003	10000	10.00		20160615						
自 日报表查询	<																		
自 交收管理	~																		
交收查询		4																	ŀ
首次点价/追保申请		实	际货款(元)			8	元整												
追保申请查询		备	Ξ																
交收通知管理																	l.		
现份交收管理								十发票。	88 X (5	撤销	 ① 市設通过 	│ ★ 審徴	1548.						

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出发票发给买方。 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"开 具发票"。

自 产品信息	<	您现在	E的位置:交收管	普醒>>現货交收	管理														
自有户管理	<	th	场		基差交易市场	Ŧ				合约		全部		٣					
自 资金管理	<	找到1	条记录,显示	1월1 《	< > > 10 •													Q =	ធា
自 交易管理	<	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
自 交易查询	<	۲	已收货	20160608	bt-20160608-i-000003	FF企业	80070008007	CC公司	80030008003	10000	10.00		20160615	FF	20190904	03:31:37			
自日报表查询	<																		
自 交收管理	~																		
交收查询																			
首次点价/追保申请		 <	际货款(元)		20000		万元整												•
追保申请查询		-	ŧ		实收货款														
交收通知管理																	li li		
现货交收管理						1	🖹 确认收货	十发票的		設約	D interest		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"确认 发票",**买方可用资金不够差额尾款不能进行发票确认**。

自 产品信息	<	您现在的	的位置:交收管	·珊>>现货交收	管理														
自有户管理	<	市场			基卷交易市场	Ŧ				台约		全部		٣					
自 资金管理	<	批到1 ;	条记录, 显示	1到1 《	< > > 10 •													Q #	王词
自 交易管理	<	选择	现货状态	首次点价日	合约号	买交易商简称	买清鹽账户	卖交易商简称	卖清豐账户	交收数量	交收货款 (元)	实际贷款 (元)	交收日	收货人	收货日期	收货时间	申请号	申请状态	操作
自 交易查询	<	2	已收货	20160608	bt-20160608-I-000003	FF企业	80070008007	CC公司	80030008003	10000	10.00	20,000.00	20160615	FF	20190904	03:31:37	18	申请	CC
自 日报表查询	<																		
自 交收管理	~																		
交收查询		4																	•
首次点价/追保申请		实际	(詩歌 (元)		20000	, i	万元整												
追保申请查询		普注			实收货款两万元														
交收通知管理												_					- 11		
现货交收管理							目 确认收货	十次票据		撤销	C) ARCAR	× #批	6æ						

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	<	2512012189121	1.X00512//X	00.00109														
自 客户管理	<	市场		#	差交易市场		T			合约	1		全部		v			
自 资金管理	e l	开始日期		20	160613					结束	日期		20160620					
		买货信息																Q查询
	<	找到1 条记的	t,显示1到1	« < >	>> 10	•												
查 交易查询	<	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	欸(元) J	最约保证金 (元)	交收手续费 (元)	交收日	現货状态
目报表查询	<	1	20160617	bt-201606	17-pp-0000	03 聚丙烯	DD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		
■ 交收管理	ř	ata (1), 140 ata																
交收查询		安货信息 没有找到记录	ŧ. « < >	>> 10	•													
首次点价/追保申请		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) \$	际货款(元)	履约保证	金(元) 交	波手续费 (元)	交收日	现货状态
追保申请查询		合计								0		0.00	0.00		0.00	0.00		
交收通知管理																		
现货交收管理																		

履约保证金项目为累计缴纳的保证金金额。

11.6 线上转线下交收

定义合约时,选择利用平台结算,即线上交收。若首次点价确认后,买卖双方不想 继续利用交易所平台计算,可申请转为线下结算。

进入交收管理-线上转线下交收,买卖双方中一方勾选基差合约交收记录,点击"新 增",发起线上转线下交收申请,另一方进入页面点击"确认线下",即完成合约线上 转线下交收流程。

合约首次点价确认后次日到交收确认前可发起线上转线下交收流程,确认转线下 交收后当日闭市结算时系统会清退买卖双方的交收保证金。

转线下交收的基差合约需要在"卖方线下结算发票上传"功能中完成发票上传, 交易所才会将该笔合约视为有效交易,具体功能详见 7.3。

自 产品信息 く	8	現在的位置:	これ曾彊>>线」	转线下交收														
自有户管理 <	Ľ	市场			基整交易	T				台约			全部		٣			
自然会管理 <	57	有找到记录。	« < >	≫ 10 ♥														Q 2 10
自交易管理 <		曲择 首	次点价日	合约号	买交易商简称	买清整账户	卖交易商简称	卖清楚张户	交收数量	申请号	申请状态	提作人	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
自交易查询 <																		
自日报表查询 <																		
自 交教管理 🗸 🗸																		
交收查询																		
首次点价值保申请																		
追保中请查询		筆注																
交收申请								+ # #	(5 ₿ 9	1) muser		LTF .					
线上转线下交收		81-1 公赦	96日・18日、50	计字句 纤细胞	0.5* 0.66.35	18-C: 10												
现货交收管理	0.	AUT 1. 300.	actine i petite ofo	o i su, fridak	active actives in													

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 i-160520-000005,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 i-160520-000005, 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
 i-160520-000005,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:(基准期货合约昨结价格+基差 价格)*数量*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 i-160521-000001,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i-160521-000001,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:(基准期货合约昨结价格+基差价格)*数量*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
 i-160521-000001,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 i-160521-000001 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 i-160521-000001,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 i-160521-000001 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 i-160521-000001 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 i-160521-000001 的新一条

行情状态变为成交。

9)回购完成后,合约i-160521-000001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 i-160521-000001,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 i-160521-000001,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:(基准期货合约昨结价格+基差价格)*数量*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
 i-160521-000001,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 i-160521-000001 合约上。
- **15**) 成交后,查看门户和 APP 的全市场行情页面,合约 i-160521-000001 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 i-160521-000001, 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,追保方可以向另一方发起追保。
- 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申请,交 收申请只能卖方发起,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申请确认,则系统自动为双方达 成交收申请,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-交收申请管理,点击查询,在列表页勾选指定 合约 i-160521-000001,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,完成交收申请
- 27) 子账户[BB 交易员] 进入交收管理-交收申请管理,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 成交收申请确认流程。

- 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 i-160521-000001,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出 发票发给买方。
- 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
 i-160521-000001,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 i-160521-000001,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 i-160521-000001 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 i-160521-000001,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 i-160521-000001,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 i-160521-000001 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 i-160521-000001 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) 后续的交收环节与案例 4 类似,不再赘述。

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 i-160520-000005,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 i-160520-000005,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 i-160520-000005,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,后续的交收环节参考案例 4