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（测试环境1，可以交易所有交易所品种）

**电信：**

IP：59.36.3.115

交易端口：27226

行情端口：27236

brokerid：8080

公用测试账户1：10001437 密码：datong888

公用测试账户2：12430 密码：XIAOshao@123

公用测试账户3：21013 密码：zwy123321

公用测试账户4：21021 密码：Xiaofan@12

如果碰到用户上限，则说明同时登陆测试公共账户人多，可以另选时间登陆或者参考下文自己申请。

测试环境API 版本号：API\_6.3.15以上生产版本（非评测版）

API 下载地址：<http://www.sfit.com.cn/5_2_DocumentDown_2.htm>

**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 仿真测试账号，申请地

址：<https://www.htfc.com/main/wsyyt/wykh/jrfzkh/index.shtml?id=10012>;或使用我司提供的4个公共测试账户。

3、提交相关程序化或者外接申请材料给我司业务人员，业务人员走内部流程进行审批，表格内容必须填写完整。

4、我公司根据上述资料，在 CTP 仿真测试系统中和生产系统中设置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。

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、验资验仓等各类功能验证。

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《外部交易系统接入测试结果反馈表》至it@htfc.com。

4、收到评估回复后可以进行生产接入。

**3.3 审核评估**

1、我公司技术人员根据《外部交易系统接入测试结果反馈表》，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，我公司会将反馈结果给申请人并通知接入生产系统。

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**

技术支持电话：19124163291 张万焰

13631326969 徐日坚

附件一

外部交易系统接入测试结果反馈表

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 交易终端名称 | **client\_GAT\_1.0.0** | | | 版本号 | 1.0.0 | |
| AppID | client\_GAT\_1.0.0 | | | RELAYAPPID(中继客户需填） |  | |
| 联系方式 | **13222388605** | | | 测试时间 | **2025.4.1** | |
| 测试账号 | **21013** | | | 客户名称 | **葛曙** | |
| 终端本机IP | **140.238.35.11** | | | 终端本机MAC | **02:00:17:04:0b:37** | |
| 接入方式 | □ 直连模式  □ 中继代理模式 | | | | | |
| 测试环境 | □CTP □易盛 □飞马 □飞创 □恒生 □其他\_\_\_\_\_\_\_\_ | | | | | |
| 测试模块 | | 测试功能 | 测试结果 | | | 备注说明（未测试、测试异常时需说明原因） |
| 交易及行情 | | 通信链路是否正常 | □正常  □异常  □未测试 | | |  |
| 登录是否正常 | □正常  □异常  □未测试 | | |  |
| 登录截图: | | | | |
| 登出是否正常 | □正常  □异常  □未测试 | | |  |
| 报单 | □正常  □异常  □无此项 | | |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 报单截图： | | |
| 撤单 | □正常  □异常  □无此项 |  |
| 查询（委托查询、成交查询、持仓查询、资金查询、对账单查询） | □正常  □异常  □无此项 |  |
| 风控功能 | 单位时间内（查询、委托、撤单）次数的阈值设置 | □正常  □异常  □无此项 |  |
| 报单数量异常处理 | □正常  □异常  □无此项 |  |
| 报单速率异常处理 | □正常  □异常  □无此项 |  |
| 报单价格异常处理 | □正常  □异常  □无此项 |  |
| 验资验仓（平仓仓位不足或下单资金不足应有提示） | □正常  □异常  □无此项 |  |
| 验资验仓截图： | | |
| 穿透式管理 | 是否已集成符合监管要求的信息采集动态链接库 | □正常  □异常 |  |
| 是否能够准确采集终端信息（核对至测试设备MAC、IP信息） | □正常  □异常 |  |
| 其他 | 其他相关功能测试（如有，如日志记录、交易策略实现情况等） | □正常  □异常  □无此项 |  |
| 测试结论 | / | □通过测试  □不通过测试 |  |

接入方（公章）：葛曙

法定代表人（或授权人）签字：

2025 年 4 月 2 日