

附件 2



标准债券远期集中清算

X-Swap

用户手册

一、首次使用指南

参与机构交易前必须在系统中完成以下设置：

1.1 系统设置

会员机构初次使用本系统需开通防火墙并对客户端进行设置：

请联系本机构技术人员确认本机构使用的网络是否经过网络地址转换（NAT）。如未经转换请忽略此节，因为安装包中默认服务器IP 地址中已经是正确的部分。会员机构内部网络使用NAT(Network Address Translation) 转换，对于使用NAT的客户端，需要重新指向内部映射过的地址：将安装路径中的配置文件的IP 地址更改为经过转换的IP 地址。更改方式如下：打开开始菜单，找到菜单项“X-Swap” -> “NAT-Switcher”，打开IP 地址修改工具“IP Manager”，输入以下内容即可：

| 交易中心服务器地址 | 服务端口 | 备注 | 环境 |
|---------------|-------------------|------------------|------|
| 200.31.73.60 | PING | 网络连接测试 | 生产环境 |
| | TCP 20001 至 20015 | 本币交易系统 | |
| | TCP 80 | 下载及自动更新服务 | |
| 200.31.52.161 | PING | 网络连接测试 | |
| | TCP 41000 | X-Swap 通讯服务器端口 | |
| 200.31.71.65 | TCP 9001 | 交易后处理服务平台应用服务器端口 | |
| 200.31.50.81 | UDP 53 | DNS 服务 | |
| 200.0.73.60 | PING | 网络连接测试 | 灾备环境 |
| | TCP 20001 至 20015 | 本币交易系统 | |
| | TCP 80 | 下载及自动更新服务 | |
| 200.0.71.65 | TCP 9001 | 交易后处理服务平台应用服务器端口 | |
| 200.0.50.81 | UDP 53 | DNS 服务 | |

注1：实际的映射IP 地址和端口请咨询各自机构的IT 部门技术人员。

注2：安装此客户端前请确保交易机已经安装了新一代本币交易系统的中后台客户端（MBO）或者前台客户端（DWS），且客户端可以正常登陆本币交易系统。如未安装，请参考《新一代本币交易系统中后台、前台安装手册》2.2 章节客户端网络要求和配置进行安装。

1.2 初始操作流程

会员机构初次使用本系统的建议操作流程为：

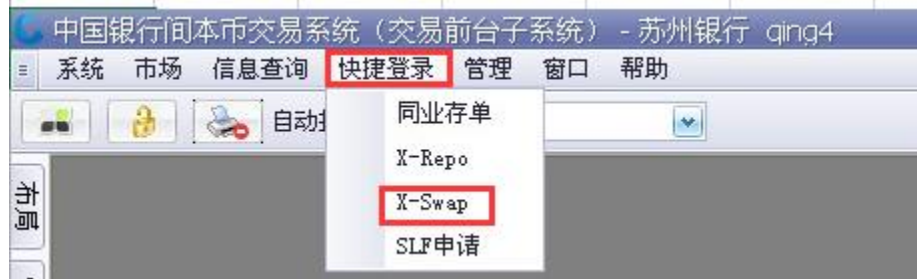
1. 机构系统管理员登录本币交易系统中后台（MBO）客户端，点击系统菜单“内部管理”->“用户管理”进入用户管理界面，界面默认展示本机构下的所有用户，管理员选择需要为其设置使用标准债券远期集中清算系统的权限的用户，“用户权限”设置后，隔日生效。用户设置 -> 点击“修改”按钮，在弹出的用户修改界面中 DWS/MBO 功能下勾选“交易执行”、“快捷登录”->“X-Swap”等功能权限，如图：



点击“确定”按钮，在系统提示修改成功后，该用户可具有标准债券远期集中清算市场前台 / 中后台的权限功能。

2. 具有标准债券远期集中清算市场权限的用户登录本币交易系统中后台（MBO）或前台

(DWS) 客户端，通过点击系统菜单“快捷登录->“X-Swap”登录本系统，如图：



3. 用户首次进入系统时，需要到中后台账户管理界面进行设置。账户管理功能供用户通过账户管理画面新建和维护资金账户信息。

点击“账户管理”->“账户管理”菜单，可进入本机构交易员账户管理界面，点击增加资金账户按钮，如图显示：



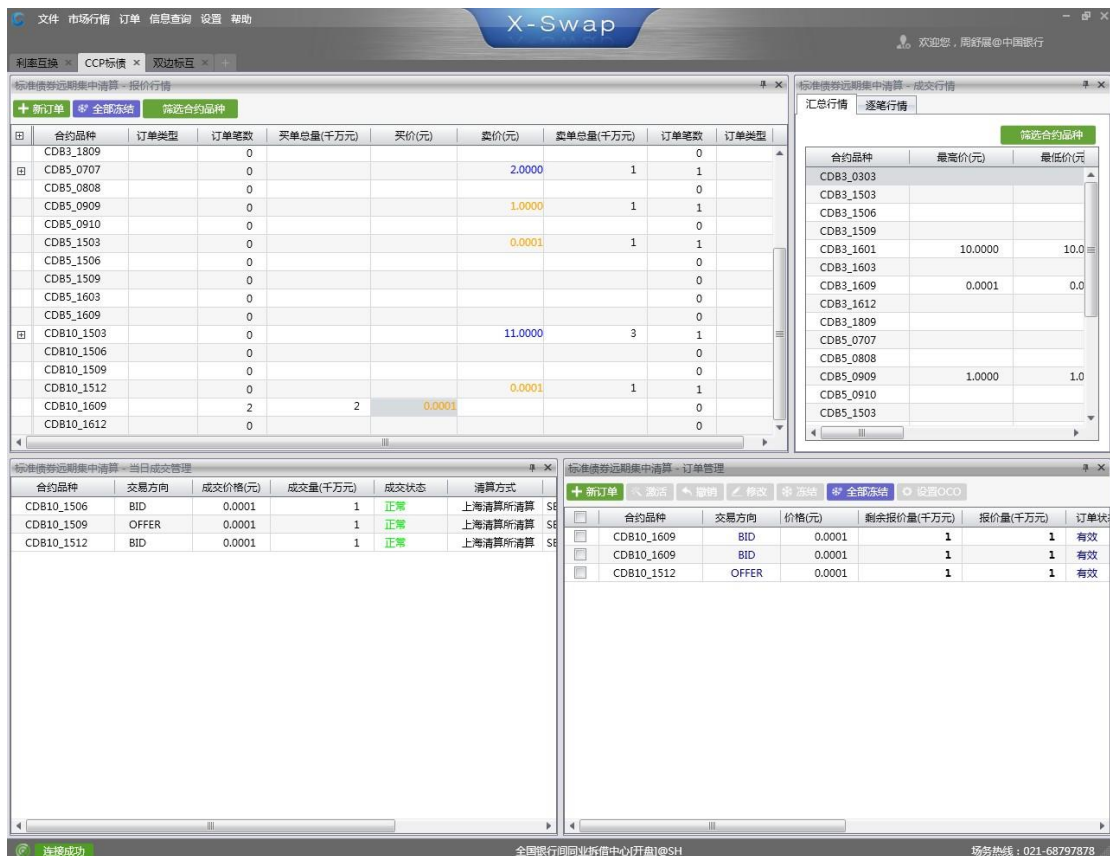
4. 用户输入资金账户信息，设置默认账户，如果不设置默认账户，首次交易时会提醒设置。点击增加按钮，资金账户添加成功，账户管理页面显示。如图：

| 操作 | 资金开户行 | 资金账户户名 | 资金账号 | 支付系统行号 | 是否默认账户 |
|--------------|-------|--------|------|--------|--------|
| 设为默认 修改 删除 | 123 | 123 | 123 | 123 | 是 |

5. 用户也可点击修改按钮进行修改当前资金账户信息。

二、系统主界面

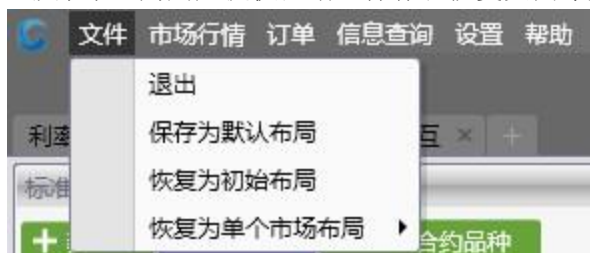
当用户成功登录本系统前台后，随即进入操作主界面。如下图所示：



2.1 系统菜单区

1. 系统菜单区位于系统主界面的左上方，根据用户勾选权限不同，以及登陆的是MBO/DWS 而展示不同的菜单内容。所有用户通用的菜单有：“文件”、“帮助”如下：

(1) “文件”菜单：包含“退出”、“保存为默认布局”、“恢复为初始布局”、“恢复为单个市场布局”二级菜单，为用户提供注销、保存和恢复页面布局等功能。如下图所示



(2) “帮助”菜单：包含“关于”二级菜单，为用户提供查看系统版本、版权信息等功能。

2、下面介绍用户勾选权限后，登陆 DWS/MBO 展示的不同菜单内容：

(1) 前台权限：菜单区由“市场行情”、“订单”、“信息查询”一级菜单组成。由“利率互换市场”、“标准利率互换市场”、“标准债券远期集中清算市场”二级菜单组成。其中，“标准债券远期集中清算市场”相关菜单如下图所示：

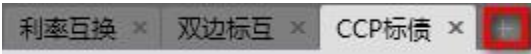
| 文件 市场行情 订单 信息查询 帮助 | | |
|--------------------|----------|------------|
| 市场行情 | 订单 | 信息查询 |
| • 报价行情 | • 新建订单 | • 成交查询 |
| • 成交行情 | • 订单管理 | • 当日订单查询 |
| | • 当日成交管理 | • 每日结算价展示 |
| | | • 持仓头寸查询 |
| | | • 持仓限额查询 |
| | | • 可交割债券查询 |
| | | • 合约基础信息查询 |

(2) 中后台权限：菜单区由“信息查询”、“账户管理”一级菜单组成。由“利率互换市场”、“标准利率互换市场”、“标准债券远期集中清算市场”二级菜单组成。其中，“标准债券远期集中清算市场”相关菜单如下图所示：

| 文件 授信 信息查询 账户管理 设置 帮助 | | | | |
|-----------------------|------------|--------|----------|--|
| 授信 | 信息查询 | 账户管理 | 设置 | |
| • 授信额度更新方式设置 | • 当日订单查询 | • 账户管理 | • 市场权限设置 | |
| • 授信设置 | • 可交割债券查询 | | | |
| • 风险系数设置 | • 合约基础信息查询 | | | |
| | • 成交查询 | | | |
| | • 持仓头寸查询 | | | |
| | • 持仓限额查询 | | | |

2.2 工作区

工作区位于系统主界面的中间区域，以 Tab 页的形式供用户定制个性化的工作区域，用户可以

点击增加按钮  增加工作区 Tab 页，也可以点击关

闭按钮  关闭工作区 Tab 页。通常业务操作区均存在


于工作区内，用户可以在工作区内用鼠标拖拽业务操作区窗口实现符合个人操作习惯的定制化界面。用户的默认工作区包含四个业务操作区：报价行情、成交行情、订单管理、当日成交管理，这四个业务操作区均实时更新数据。

三、行情发布与订单管理（前台）

行情发布功能供用户查看报价行情、市场深度行情、成交行情以及点击成交操作。

3.1 报价行情展示

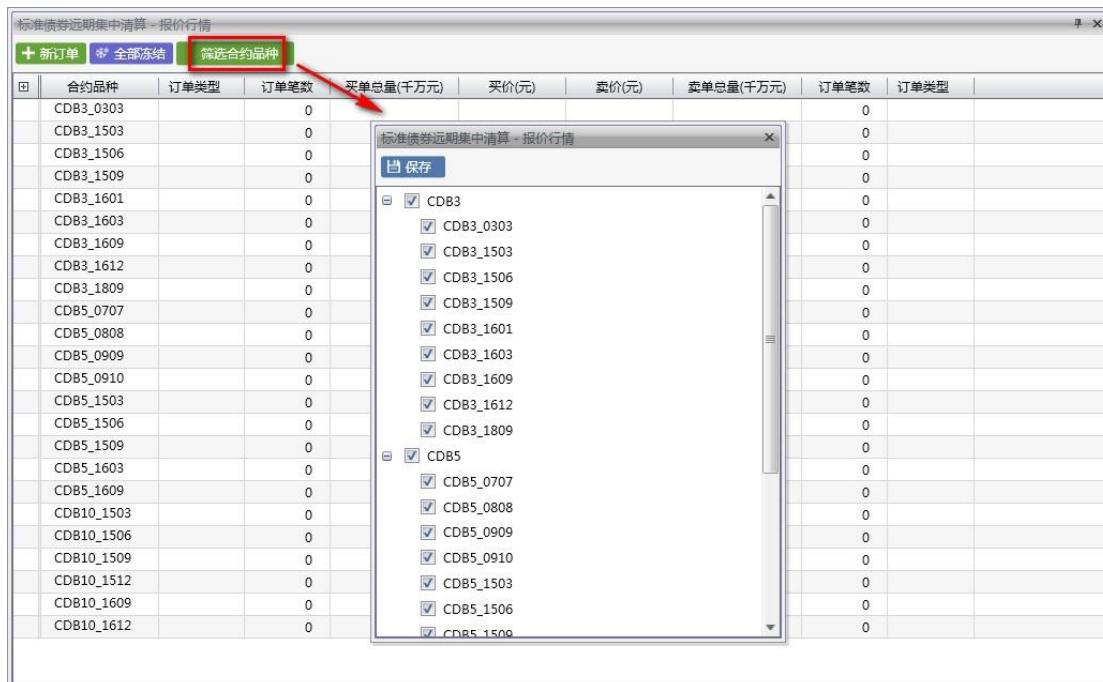
报价行情主要提供市场上所有合约品种的报价信息，展示的主要信息有：双向最优报价、最优报价订单笔数、最优报价订单量、最优报价订单类型等信息。用户登录后系统默认展示报价行情界面，用户也可以通过点击系统菜单“市场行情”->“标准债券远期集中清算市场”->“报价行情”进入该界面，如下图所示：



| 合约品种 | 订单类型 | 订单笔数 | 买单总量(千万元) | 买价(元) | 卖价(元) | 卖单总量(千万元) | 订单笔数 | 订单类型 |
|------------|------|------|-----------|--------|---------|-----------|------|------|
| CDB3_0303 | | 1 | 1 | 0.0001 | | | 0 | |
| CDB3_1503 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB3_1506 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB3_1509 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB3_1601 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB3_1603 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB3_1609 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB3_1612 | | 1 | 1 | 0.0001 | | | 0 | |
| CDB3_1809 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB5_0707 | | 0 | | | 2.0000 | 1 | 1 | |
| CDB5_0808 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB5_0909 | | 0 | | | 1.0000 | 1 | 1 | |
| CDB5_0910 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB5_1503 | | 0 | | | 0.0001 | 1 | 1 | |
| CDB5_1506 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB5_1509 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB5_1603 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB5_1609 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB10_1503 | | 0 | | | 11.0000 | 3 | 1 | |
| CDB10_1506 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB10_1509 | | 0 | | | | | 0 | |
| CDB10_1512 | | 0 | | | 0.0001 | 1 | 1 | |
| CDB10_1609 | | 2 | 2 | 0.0001 | | | 0 | |
| CDB10_1612 | | 0 | | | | | 0 | |

操作

1. 用户点击系统菜单“市场行情”->“标准债券远期集中清算市场”->“报价行情”，系统弹出报价行情窗口。
2. 用户可以点击各字段的列头进行排序，排序规则：界面默认按照合约品种首字母升序、同一字母按照月期限标准合约、年期限标准合约排序。
3. 用户可以根据合约品种的勾选框和“筛选合约品种”按钮对合约进行筛选，筛选完成后可通过“保存”按钮保存当前筛选的合约品种，如下图所示：



3.2 市场深度展示

市场深度展示主要提供市场上单个合约品种、所有合约品种的最优 N 档报价行情，展示的主要信息有：双向最优报价、最优报价订单量、最优报价订单类型等信息。

3.3 点击成交

点击成交功能在报价行情展示、市场深度展示的基础上为用户提供双击买价或卖价进行接受报买 (YOURS) 或接受报卖 (MINE) 功能。展示的主要信息有：合约品种、“MINE”、“YOURS”按钮；“BID RATE(元)”、“OFFER RATE(元)”、“BID AMOUNT(手)”、“OFFER AMOUNT(手)”文本框；“有效时间”时间框；“保存”、“提交”按钮。

1. 用户双击买价或卖价，进入点击成交报价功能。如果双击买价，界面如下图所示：

标准债券远期集中清算 - 订单

合约品种: CD85_1509 有效时间: 19:00 周舒展@中国银行

MINE **YOURS**

BID RATE(元): 0.0001 BID AMOUNT(手): 1 x 1千万 OFFER AMOUNT(手): 1 x 1千万 OFFER RATE(元): 0.0001

保存 提交

如果双击卖价，界面如下图所示：

标准债券远期集中清算 - 订单

合约品种: CD810_1503 有效时间: 19:00 周舒展@中国银行

MINE YOURS

BID RATE(元): 11.0000 BID AMOUNT(手): 3 x 1千万 OFFER AMOUNT(手): 3 x 1千万 OFFER RATE(元): 11.0000

保存 提交

3.4 成交行情展示

成交行情展示分为汇总行情和逐笔行情。用户登录后系统默认展示成交行情界面，用户也可以通过点击系统菜单“市场行情”->“标准债券远期集中清算市场”->“成交行情”进入成交行情展示界面。

1、汇总行情

为用户提供查看所有合约品种的最高价、最低价等市场最新成交行情的功能。展示的主要信息有：合约品种、最高价(元)、最低价(元)、开盘价(元)、最新成交价(元)、最新

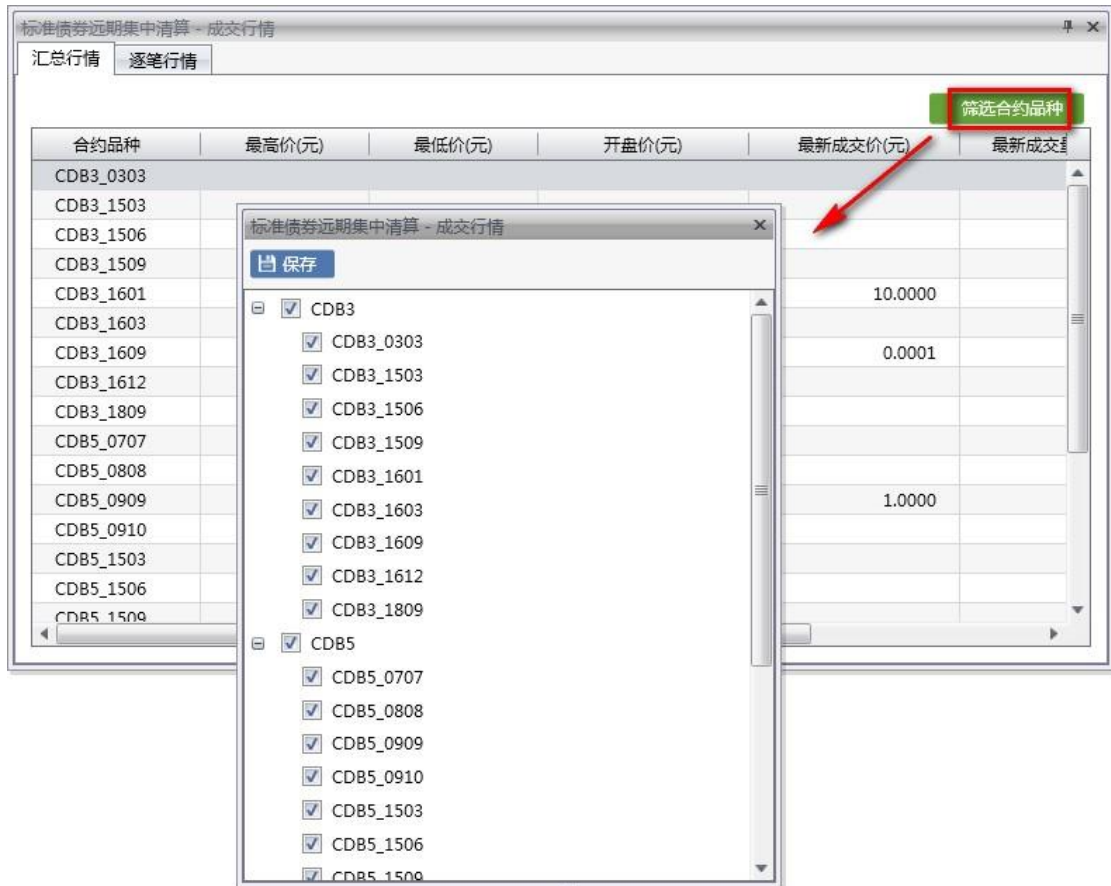
成交量（千万元）、更新时间。如图所示：

The screenshot shows a software interface for '标准债券远期集中清算 - 成交行情' (Standard Bond Forward Central Clearing - Transaction Market). It features a table with columns for contract type, highest price, lowest price, opening price, latest transaction price, transaction volume (in ten thousand yuan), and update time. A '筛选合约品种' (Filter Contract Types) button is visible in the top right. The '汇总行情' (Summary Market) tab is selected and highlighted with a red box.

| 合约品种 | 最高价(元) | 最低价(元) | 开盘价(元) | 最新成交价(元) | 最新成交量(千万元) | 更新时间 |
|------------|---------|---------|---------|----------|------------|----------|
| CDB3_0303 | | | | | | |
| CDB3_1503 | | | | | | |
| CDB3_1506 | | | | | | |
| CDB3_1509 | | | | | | |
| CDB3_1601 | 10.0000 | 10.0000 | 10.0000 | 10.0000 | 1 | 16:09:24 |
| CDB3_1603 | | | | | | |
| CDB3_1609 | 0.0001 | 0.0001 | 0.0001 | 0.0001 | 1 | 16:08:39 |
| CDB3_1612 | | | | | | |
| CDB3_1809 | | | | | | |
| CDB5_0707 | | | | | | |
| CDB5_0808 | | | | | | |
| CDB5_0909 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1 | 16:08:51 |
| CDB5_0910 | | | | | | |
| CDB5_1503 | | | | | | |
| CDB5_1506 | | | | | | |
| CDB5_1509 | | | | | | |
| CDB5_1603 | | | | | | |
| CDB5_1609 | | | | | | |
| CDB10_1503 | | | | | | |
| CDB10_1506 | 0.0001 | 0.0001 | 0.0001 | 0.0001 | 1 | 16:19:58 |
| CDB10_1509 | 0.0001 | 0.0001 | 0.0001 | 0.0001 | 1 | 16:19:52 |
| CDB10_1512 | 0.0001 | 0.0001 | 0.0001 | 0.0001 | 1 | 16:19:46 |
| CDB10_1609 | | | | | | |
| CDB10_1612 | | | | | | |

操作

1. 用户可以点击各字段的列头进行排序，排序规则：界面默认按照合约品种首字母升序、同一字母按照月期限标准合约、年期限标准合约依次排序。
2. 用户可以在合约品种列进行过滤操作，支持多选过滤，如图所示：



2、逐笔行情

为用户提供查看当天全市场逐笔成交记录的功能。展示的主要信息有：合约品种、成交时间、价格、成交量（百万元）、交易方向。如图所示：

标准债券远期集中清算 - 成交行情

汇总行情 **逐笔行情**

| 合约品种 | 成交时间 | 价格 | 成交量(千万元) | 交易方向 |
|------------|----------|---------|----------|------|
| CDB10_1506 | 16:19:58 | 0.0001 | 1 | tkn |
| CDB10_1509 | 16:19:52 | 0.0001 | 1 | gvn |
| CDB10_1512 | 16:19:46 | 0.0001 | 1 | tkn |
| CDB3_1601 | 16:09:24 | 10.0000 | 1 | gvn |
| CDB5_0909 | 16:08:51 | 1.0000 | 1 | tkn |
| CDB3_1609 | 16:08:39 | 0.0001 | 1 | tkn |

3.5 订单管理

订单管理功能供用户进行单笔或批量订单、OCO 订单的新建、撤销、修改、冻结、激活、全部冻结操作，同时支持用户通过订单管理列表对订单进行管理。如图所示：

标准债券远期集中清算 - 订单管理

+ 新订单 激活 撤销 修改 冻结 全部冻结 设置OCO

| | 合约品种 | 交易方向 | 价格(元) | 剩余报价量(千万元) | 报价量(千万元) | 订单状态 | 订单类型 | 订单编号 | 激活时间 | 有效时间 | OCO编号 |
|--------------------------|------------|-------|---------|------------|----------|------|------|------------------|----------|----------|-------|
| <input type="checkbox"/> | CDB10_1606 | OFFER | 11.8002 | 7 | 7 | 有效 | | 2015062900000241 | 10:37:19 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB3_1509 | BID | 37.4222 | 4 | 4 | 有效 | | 2015062900000236 | 10:35:26 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB3_1512 | BID | 11.9565 | 4 | 4 | 有效 | | 2015062900000237 | 10:35:26 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB3_1603 | BID | 11.8045 | 4 | 4 | 有效 | | 2015062900000238 | 10:35:26 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB10_1603 | BID | 14.0010 | 4 | 4 | 有效 | | 2015062900000239 | 10:35:26 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB10_1606 | BID | 11.8002 | 4 | 4 | 有效 | | 2015062900000240 | 10:35:26 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB10_1512 | OFFER | 12.9000 | 3 | 3 | 有效 | | 2015062900000225 | 10:31:58 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB3_1603 | OFFER | 11.8045 | 3 | 3 | 有效 | | 2015062900000226 | 10:31:58 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB3_1512 | OFFER | 11.9565 | 3 | 3 | 有效 | | 2015062900000227 | 10:31:58 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB3_1606 | OFFER | 10.8041 | 2 | 2 | 有效 | | 2015062900000224 | 10:30:33 | 19:00:00 | |
| <input type="checkbox"/> | CDB10_1603 | OFFER | 14.0010 | 1 | 1 | 有效 | | 2015062900000223 | 10:30:13 | 19:00:00 | |

四、信息查询（前台）

信息查询功能供用户查询机构的持仓限额、持仓头寸、可交割债券、合约信息、每日结算价、当日订单明细、当日以及历史的成交明细。

4.1 成交查询

用户可通过此功能查询当天以及历史的成交明细信息，点击“信息查询”->“标准债券远期集中清算市场”->“成交查询”菜单，可进入成交查询功能。如下图所示：

| 成交日期 | 成交编号 | 订单编号 | 成交状态 | 交易方向 | 对手方 | 交易品种 | 合约品种 |
|------------|-------------------|------------------|------|-------|-------|----------|-----------|
| 2015-06-30 | SEF20150630600152 | 2015063000000546 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 3年期标准... | CDB3_1509 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600151 | 2015063000000540 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 10年期标... | CDB10_160 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600150 | 2015063000000539 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 10年期标... | CDB10_160 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600149 | 2015063000000538 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 10年期标... | CDB10_151 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600148 | 2015063000000555 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 5年期标准... | CDB5_1509 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600147 | 2015063000000553 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 3年期标准... | CDB3_1603 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600146 | 2015063000000550 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 5年期标准... | CDB5_1509 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600145 | 2015063000000549 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 3年期标准... | CDB3_1606 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600144 | 2015063000000548 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 3年期标准... | CDB3_1603 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600125 | 2015063000000441 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 10年期标... | CDB10_151 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600110 | | 撤销 | | | 10年期标... | CDB10_160 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600106 | 2015063000000296 | 正常 | BID | 上海清算所 | 10年期标... | CDB10_150 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600096 | 2015063000000236 | 正常 | BID | 上海清算所 | 5年期标准... | CDB5_1603 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600095 | 2015063000000235 | 正常 | OFFER | 上海清算所 | 5年期标准... | CDB5_1606 |
| 2015-06-30 | SEF20150630600067 | 2015063000000136 | 正常 | BID | 上海清算所 | 3年期标准... | CDB3_1512 |

操作

1. 系统直接展示所有本方本交易员的当日成交信息；
2. 用户设置查询条件“开始日期”与“结束日期”；
3. 用户点击【查询】按钮；
4. 若查询条件有效，系统将返回指定成交的明细信息；
5. 用户可对成交日期、成交编号、订单编号、成交状态、交易方向、对手方、合约品种、成交类型等进行筛选或点击所有列头进行排序；
6. 系统将根据用户的筛选 / 排序要求展示相应的成交信息。

4.2 当日订单查询

用户可通过此功能查询当日订单明细信息，点击“信息查询”->“标准债券远期集中清算市场”->“当日订单查询”菜单，可进入当日订单查询功能。

| 订单编号 | 订单类型 | 订单状态 | 交易方向 | 合约品种 | 报价量(千万元) | 剩余报价量(千万元) | 价 |
|------------------|------|------|-------|------------|----------|------------|---|
| 2015063000000576 | | 撤销 | OFFER | CDB3_1606 | 1 | 1 | |
| 2015063000000575 | | 撤销 | OFFER | CDB3_1603 | 1 | 1 | |
| 2015063000000574 | | 撤销 | OFFER | CDB3_1512 | 1 | 1 | |
| 2015063000000559 | | 撤销 | OFFER | CDB3_1509 | 1 | 1 | |
| 2015063000000558 | | 撤销 | OFFER | CDB10_1606 | 7 | 7 | |
| 2015063000000557 | | 撤销 | OFFER | CDB10_1603 | 1 | 1 | |
| 2015063000000556 | | 撤销 | OFFER | CDB3_1603 | 1 | 1 | |
| 2015063000000555 | | 成交 | OFFER | CDB5_1509 | 1 | 0 | |
| 2015063000000554 | | 撤销 | OFFER | CDB3_1606 | 1 | 1 | |
| 2015063000000553 | | 成交 | OFFER | CDB3_1603 | 1 | 0 | |
| 2015063000000552 | | 撤销 | OFFER | CDB5_1603 | 1 | 1 | |
| 2015063000000551 | | 撤销 | OFFER | CDB5_1512 | 1 | 1 | |
| 2015063000000550 | | 成交 | OFFER | CDB5_1509 | 1 | 0 | |
| 2015063000000549 | | 成交 | OFFER | CDB3_1606 | 1 | 0 | |
| 2015063000000548 | | 成交 | OFFER | CDB3_1603 | 1 | 0 | |
| 2015063000000547 | | 撤销 | OFFER | CDB3_1512 | 1 | 1 | |
| 2015063000000546 | | 成交 | OFFER | CDB3_1509 | 1 | 0 | |

上一页 第 1 页 下一页 共 3 页 刷新

4.3 每日结算价展示

用户可通过此功能查询每日结算价，点击“信息查询”->“标准债券远期集中清算市场”->“每日结算价”菜单，可进入每日结算查询功能。

操作

1. 系统直接展示目前的每日结算价；
2. 用户可设置查询条件：交易品种、合约品种、开始日期、结束日期；

| 交易品种 | 合约品种 | 日期 | 每日结算价 |
|----------------|------------|------------|---------|
| 10年期标准化国开债远期合约 | CDB10_1509 | 2015-06-24 | 10.0000 |
| 10年期标准化国开债远期合约 | CDB10_1512 | 2015-06-24 | 0.0000 |
| 10年期标准化国开债远期合约 | CDB10_1603 | 2015-06-24 | 10.0004 |
| 10年期标准化国开债远期合约 | CDB10_1606 | 2015-06-24 | 0.0000 |
| 3年期标准化国开债远期合约 | CDB3_1509 | 2015-06-24 | 10.0008 |
| 3年期标准化国开债远期合约 | CDB3_1512 | 2015-06-24 | 0.0000 |
| 3年期标准化国开债远期合约 | CDB3_1603 | 2015-06-24 | 0.0000 |
| 3年期标准化国开债远期合约 | CDB3_1606 | 2015-06-24 | 0.0000 |
| 5年期标准化国开债远期合约 | CDB5_1509 | 2015-06-24 | 0.0000 |
| 5年期标准化国开债远期合约 | CDB5_1512 | 2015-06-24 | 0.0000 |
| 5年期标准化国开债远期合约 | CDB5_1603 | 2015-06-24 | 10.0006 |
| 5年期标准化国开债远期合约 | CDB5_1606 | 2015-06-24 | 9.9997 |
| 10年期标准化国开债远期合约 | CDB10_1509 | 2015-06-23 | 10.0000 |
| 10年期标准化国开债远期合约 | CDB10_1512 | 2015-06-23 | 0.0000 |
| 10年期标准化国开债远期合约 | CDB10_1603 | 2015-06-23 | 0.0000 |
| 10年期标准化国开债远期合约 | CDB10_1606 | 2015-06-23 | 0.0000 |

上一页 第 1 页 下一页 共 1 页

3. 用户点击【查询】按钮；
4. 若查询条件有效，系统将返回指定成交的明细信息；

5. 根据查询结果，用户可点击所有列头进行排序；

4.4 持仓限额查询

用户可通过此功能查询该机构的持仓额度信息，点击“信息查询”->“标准债券远期集中清算市场”->“持仓限额查询”菜单。如下图所示：

| 机构持仓总额度(亿) | 买方向剩余额度(亿) | 卖方向剩余额度(亿) | 买方向暂扣额度(亿) | 卖方向暂扣额度(亿) | 买方向已用额度(亿) | 卖方向已用额度(亿) |
|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| 12.7000 | 4.8910 | -5.0644 | 0.4156 | -0.9778 | 1.0435 | -0.3078 |

4.5 持仓头寸查询

用户可通过此功能查询当前机构的持仓头寸信息。

点击“信息查询”->“标准债券远期集中清算市场”->“持仓头寸查询”菜单。如下图所示：

| 合约种类 | 合约状态 | 合约品种 | 持仓头寸(亿) |
|-------|------|------------|---------|
| CDB10 | 交易中 | CDB10_1503 | 0.0000 |
| CDB10 | 交易中 | CDB10_1506 | 0.1000 |
| CDB10 | 交易中 | CDB10_1509 | -0.1000 |
| CDB10 | 交易中 | CDB10_1512 | 0.1000 |
| CDB10 | 已退市 | CDB10_1603 | 0.3000 |
| CDB10 | 交易中 | CDB10_1609 | 0.0000 |
| CDB10 | 交易中 | CDB10_1612 | 0.0000 |
| CDB10 | 已退市 | CDB10_1703 | 0.0000 |
| CDB10 | 已退市 | CDB10_1710 | 0.0000 |
| CDB3 | 交易中 | CDB3_0303 | 0.0000 |
| CDB3 | 交易中 | CDB3_1503 | 0.0000 |
| CDB3 | 交易中 | CDB3_1506 | 0.0000 |
| CDB3 | 交易中 | CDB3_1509 | 0.0000 |
| CDB3 | 已退市 | CDB3_1512 | 0.0000 |
| CDB3 | 交易中 | CDB3_1601 | -0.1000 |

持仓总头寸(亿): 0.9000

操作

1. 系统默认展示当前机构各合约品种的持仓头寸信息；
2. 用户设置查询条件“合约品种”与“合约种类”；
3. 用户点击【查询】按钮；
4. 若查询条件有效，系统将返回指定成交的明细信息；

5. 用户可点击所有列头进行排序；

4.6 可交割债券查询

用户可通过此功能查询标准债券远期合约相对应的一篮子可交割债券信息，点击“信息查询”->“标准债券远期集中清算市场”->“可交割债券远期查询”菜单。如下图所示：

| 债券名称 | 债券代码 | 转换因子 | | | | | | | | | | | |
|----------|----------|------------|------------|------------|------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | | CDB10_1509 | CDB10_1512 | CDB10_1603 | CDB10_1606 | CDB3_1509 | CDB3_1512 | CDB3_1603 | CDB3_1606 | CDB5_1509 | CDB5_1512 | CDB5_1603 | CDB5_1606 |
| CDB51509 | CDB51509 | - | - | - | - | - | - | - | - | 1.5000 | - | - | - |
| CDB31509 | CDB31509 | - | - | - | - | 1.5000 | - | - | - | - | - | - | - |

操作

1. 系统默认展示所有的标准债券远期集中清算市场的可交割债券信息；
2. 用户设置查询条件“合约品种”；
3. 用户点击【查询】按钮；
4. 若查询条件有效，系统将返回指定合约品种的可交割券信息；

4.7 合约基础信息查询

用户可通过此功能查询合约基础信息情况。

点击“信息查询”->“标准债券远期集中清算市场”->“合约基础信息查询”菜单。如下图所示：

| 合约基础信息 | | | | | | | |
|------------|----------------------|-----------------------------------|------------|------------|------|-----------|------|
| 合约品种 | <input type="text"/> | <input type="button" value="查询"/> | | | | | |
| 合约品种 | 交易品种 | 合约上架日期 | 合约下架... | 交割日 | 合约状态 | 最后交易日交... | 合约面值 |
| CDB10_1503 | 10年期标准国... | 2014-03-19 | 2015-03-17 | 2015-03-18 | 已退市 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB10_1506 | 10年期标准国... | 2014-06-18 | 2015-06-16 | 2015-06-17 | 已退市 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB10_1509 | 10年期标准国... | 2014-09-17 | 2015-09-15 | 2015-09-16 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB10_1512 | 10年期标准国... | 2014-12-17 | 2015-12-15 | 2015-12-16 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB10_1603 | 10年期标准国... | 2015-03-18 | 2016-03-15 | 2016-03-16 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB10_1606 | 10年期标准国... | 2015-06-17 | 2016-06-14 | 2016-06-15 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB3_1503 | 3年期标准国... | 2014-03-19 | 2015-03-17 | 2015-03-18 | 已退市 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB3_1506 | 3年期标准国... | 2014-06-18 | 2015-06-16 | 2015-06-17 | 已退市 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB3_1509 | 3年期标准国... | 2014-09-17 | 2015-09-15 | 2015-09-16 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB3_1512 | 3年期标准国... | 2014-12-17 | 2015-12-15 | 2015-12-16 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB3_1603 | 3年期标准国... | 2015-03-18 | 2016-03-15 | 2016-03-16 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB3_1606 | 3年期标准国... | 2015-06-17 | 2016-06-14 | 2016-06-15 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB5_1503 | 5年期标准国... | 2014-03-19 | 2015-03-17 | 2015-03-18 | 已退市 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB5_1506 | 5年期标准国... | 2014-06-18 | 2015-06-16 | 2015-06-17 | 已退市 | 12:00:00 | 1000 |
| CDB5_1509 | 5年期标准国... | 2014-09-17 | 2015-09-15 | 2015-09-16 | 交易中 | 12:00:00 | 1000 |

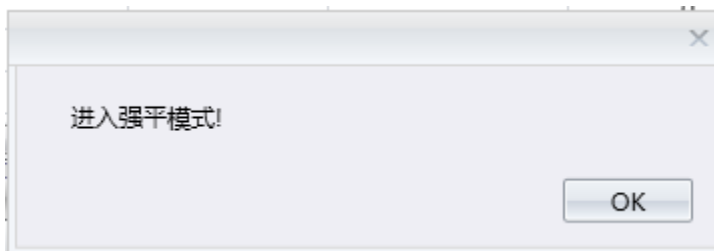
操作

1. 系统直接展示所有标准合约品种的基础信息；
2. 用户可对合约品种进行筛选或点击所有列头进行排序；
3. 系统将根据用户的筛选 / 排序要求展示相应的合约基础信息。

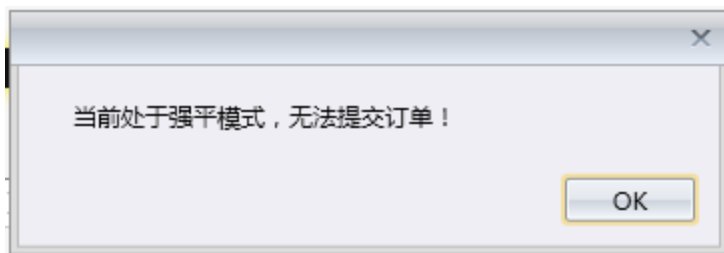
五、强行平仓（前台）

交易中心日间接上海清算所强制平仓指令，在收到该指令后冻结机构下所有已激活订单、暂停该机构交易功能，并按照指令要素为机构在系统中自动创建有效状态的订单。

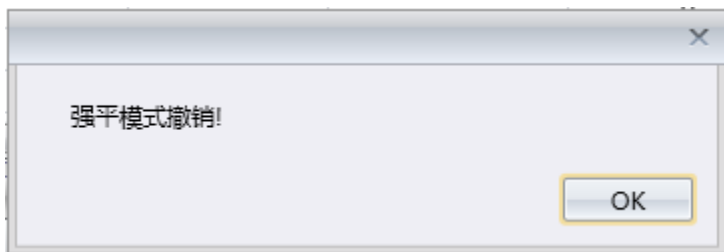
收到强平指令后系统提示如下图：



处于强平模式下，用户提单时系统提示如下：



收到上海清算所撤掉强制平仓指令后，恢复机构的交易功能，系统提示如下：



- 进入强制平仓模式后，冻结机构当前所有已激活订单，机构交易功能暂停（用户不可以激活、提交订单），直到收到强制平仓撤销指令为止。
- 根据强制平仓指令，为该机构在市场上挂出订单。强平订单达成交易后系统将成交结果实时反馈至上海清算所。
- 强制平仓的订单不受持仓额度控制影响，即强制平仓订单在挂单时不用满足持仓额度控制条件。
- 强平的订单不允许机构下的用户撤销、冻结或修改，至日终若仍未成交，则系统撤销该

笔订单，机构自动退出强平模式。

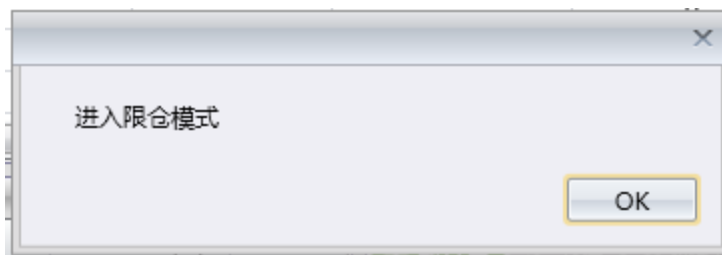
六、限仓功能（前台）

限仓功能指机构被限制交易，只能提交与当前合约头寸相反方向的订单，直至限仓解除。

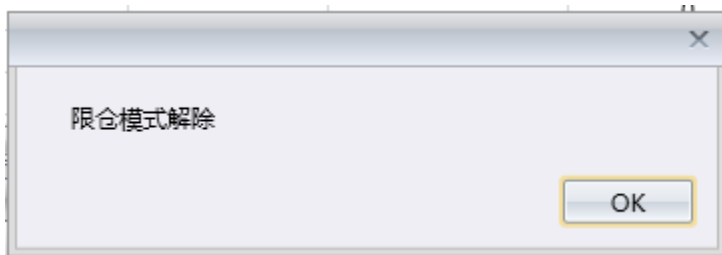
进入限仓模式需满足以下条件之一：

- 日间接上海清算所持仓限额调整指令、且最新的持仓限额小于当前买方向和卖方向已占用额度；
- 当前机构的买方向和卖方向额度同时达到最大额。

进入限仓模式时，系统提示如下图：



当不满足限仓模式的条件后，解除限仓，系统提示如下：



- 限仓模式下只能挂与当前合约头寸方向相反的订单，最大的提交量为合约的已占用额度。
- 进入限仓模式与退出限仓模式时系统冻结用户已提交的订单。

七、账户管理（中后台）

账户管理功能供用户通过账户管理画面维护资金账户信息。点击“账户管理”->“账户管理”菜单，可进入本机构交易员账户管理功能。如下图所示：

| + 新增资金账户 | | | | | | |
|----------------|--------|--------|-----------|--------------|--------|--|
| 操作 | 资金开户行 | 资金账户户名 | 资金账号 | 支付系统行号 | 是否默认账户 | |
| 设为默认 修改 删除 | 中国银行总行 | 中国银行总行 | 110400393 | 104100000004 | 是 | |

| + 新增托管账号 | | | | | | | | |
|----------|-------------|--------|--------|-----------|---------|-----------|--------------|--------|
| 操作 | 托管账号 | 托管账号户名 | 托管机构 | 关联资金账户... | 关联资金开户行 | 关联资金账号 | 关联支付系统... | 是否默认账户 |
| 修改 删除 | A0000063 | 中国银行 | 上海清算所 | 中国银行总行 | 中国银行总行 | 110400393 | 104100000004 | 是 |
| 修改 删除 | A0003000001 | 中国银行 | 国债登记结算 | | | | | 否 |

操作

1. 用户进入账户管理页面，默认显示现有信息；
2. 可新增、修改、删除账户信息；
3. 系统将根据用户的要求设置默认账户。

- 资金账户多个，设置唯一一个默认的资金账户；
- 如果已存在一个默认的资金账号，需要将另一资金账号设置为默认账号，此时，新默认资金账号的“是否默认账号”改为“是”，将原默认资金账号的“是否默认账号”改为否。
- 资金账号、托管账号不可重复；
- 默认的资金账户不允许删除；
- 与托管账户关联的资金账户不可修改；
- 托管账户时，如果设置为默认账户，必须关联资金账户；
- 在标准债券远期集中清算市场，资金帐号和相关联的托管账号都是默认账号才能进行提交（激活）订单。

八、权限设置（中后台）

权限设置功能供中后台用户维护本机构下前台用户的市场权限，点击“设置”->“市场权限设置”菜单，可进入本机构交易员权限管理功能。如下图所示：

| 权限 | 市场名 | 更新人 | 更新日期 |
|-------------------------------------|------------------|------|------------|
| <input checked="" type="checkbox"/> | 普通 IRS | 系统初始 | 2015-07-02 |
| <input checked="" type="checkbox"/> | 标准化 IRS (双边产品) | 系统初始 | 2015-07-02 |
| <input checked="" type="checkbox"/> | 标准化债券远期 (集中清算产品) | 系统初始 | 2015-07-02 |

操作

1. 用户进入集中清算产品权限设置页面，默认显示现有市场的权限；
2. 可选择机构下的用户名称、点击“修改”按钮，勾选集中清算产品权限；
3. 勾选完成后，点击“确认”按钮完成集中清算产品权限设置；

- 权限设置实时生效。
- 取消机构下用户某市场权限后，该用户在相应市场提交的订单自动被撤销。
- 未设置权限的市场，用户可以进入市场中可查看报价行情和成交行情等信息，但无法提交订单。