附件

螺纹钢、白银期权仿真交易指南

一、参与交易

帐号、密码、交易编码等使用上期所仿真测试环境已设立的数据。

二、挂牌标的合约

螺纹钢期权挂牌标的合约 RB2301、RB2302。

白银期权挂牌标的合约AG2301、AG2302。

三、交易时间

|  |  |
| --- | --- |
| **品种** | **交易时间** |
| 螺纹钢期权 | 每周一至周五上午9:00 - 11:30，普通交易日下午13:30 - 15:00，到期交易日下午13:30 - 15:30，连续交易时间为每周一至周五21:00 -23:00 |
| 白银期权 | 每周一至周五上午9:00 - 11:30，普通交易日下午13:30 - 15:00，到期交易日下午13:30 - 15:30，连续交易时间为每周一至周五21:00 -次日02:30 |

四、仿真参数

**（一）螺纹钢期权合约**

|  |  |
| --- | --- |
| 合约标的物 | 螺纹钢期货合约（10吨） |
| 合约类型 | 看涨期权，看跌期权 |
| 交易单位 | 1手螺纹钢期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 0.5元/吨 |
| 涨跌停板幅度 | 与标的期货合约涨跌停板幅度相同 |
| 合约月份 | 最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌，具体数值交易所另行发布 |
| 交易时间 | 上午9:00-11:30下午13:30-15:00及交易所规定的其他时间 |
| 最后交易日 | 标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日 |
| 到期日 | 同最后交易日 |
| 行权价格 | 行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格≤2500元/吨，行权价格间距为20元/吨；2500元/吨＜行权价格≤5000元/吨，行权价格间距为50元/吨；行权价格＞5000元/吨，行权价格间距为100元/吨 |
| 行权方式 | 美式。买方可以在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可以在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请 |
| 交易代码 | 看涨期权：RB-合约月份-C-行权价格看跌期权：RB-合约月份-P-行权价格 |
| 上市交易所 | 上海期货交易所 |

**（二）白银期权合约**

|  |  |
| --- | --- |
| 合约标的物 | 白银期货合约（15千克） |
| 合约类型 | 看涨期权，看跌期权 |
| 交易单位 | 1手白银期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/千克 |
| 最小变动价位 | 0.5元/千克 |
| 涨跌停板幅度 | 与标的期货合约涨跌停板幅度相同 |
| 合约月份 | 最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌，具体数值交易所另行发布 |
| 交易时间 | 上午9:00-11:30下午13:30-15:00及交易所规定的其他时间 |
| 最后交易日 | 标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日 |
| 到期日 | 同最后交易日 |
| 行权价格 | 行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格≤2500元/千克，行权价格间距为20元/千克；2500元/千克＜行权价格≤5000元/千克，行权价格间距为50元/千克；行权价格＞5000元/千克，行权价格间距为100元/千克 |
| 行权方式 | 美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请 |
| 交易代码 | 看涨期权：AG-合约月份-C-行权价格看跌期权：AG-合约月份-P-行权价格 |
| 上市交易所 | 上海期货交易所 |

**（三）相关仿真交易参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 螺纹钢、白银期权仿真交易参数值 |
| 交易手续费 | 2元/手 |
| 交易手续费平今优惠 | 免收平今手续费 |
| 行权（履约）手续费 | 2元/手 |
| 行权前期权自对冲手续费 | 2元/手 |
| 做市商期权自对冲手续费 | 免收手续费 |
| 行权后期货自对冲手续费 | 免收手续费 |
| 无风险利率 | 1.5% |
| 限价单最小下单量 | 1手 |
| 限价单最大下单量 | 100手 |

**（四）持仓限额**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 品种 | 标的期货合约挂牌至交割月前第二月（期权合约挂牌至到期月前一月） | 标的期货合约交割月前第一月（期权到期月） |
|
| 限仓数额（手，单边） | 限仓数额（手，单边） |
| 非期货公司会员 | 客户 | 非期货公司会员 | 客户 |
| 螺纹钢期权 | 90000 | 90000 | 4500 | 4500 |
| 白银期权 | 18000 | 9000 | 5400 | 2700 |

五、套保、套利额度申请

会员通过仿真会员服务系统，为客户申请套期保值、套利额度。

六、技术指引

**（一）仿真交易系统（通过证联网测试网接入）**

前端域名服务（以下简称FENS）地址为：

42.24.1.47、 42.24.1.48

使用FENS服务器获取交易前置机地址参数的TCP普通链路端口号为5901；使用FENS服务器获取行情前置机地址参数的TCP普通链路端口号为5903。

各会员单位和各行情转发单位的网络安全控制策略应开通对42.24.1.0/24网段上TCP端口为5901、5903、43005、43011的访问权限；及对42.24.1.0/24网段上TCP端口为80、443、7002的访问权限。确保上述网段及协议端口的通讯正常。

上期所的一档行情主题号为1001，发布频率为每秒2笔。

**（二）仿真二代行情平台（通过证联网测试网接入）**

行情查询服务相参数：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **网络通道** | **IP** | **TCP端口号** |
| 行情A路 | 42.24.1.147 | 43022 |
| 行情B路 | 42.24.1.148 | 43022 |

增量行情服务相关参数：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **产品** | **行情主题** | **网络通道** | **组地址** | **前置地址** | **端口** |
| 一档单边行情 | 1001 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.145 | 21001 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.146 | 21001 |
| 五档单边行情 | 1000 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.145 | 21000 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.146 | 21000 |

**（三）仿真会员服务系统（通过证联网测试网接入）**

<http://42.24.1.247>

**（四）仿真会员结算文件下载API接口（通过证联网测试网接入）**

IP: 42.24.1.149，端口：443

开放时间段：交易日 15:00 - 21:00

测试用户和证书信息在仿真会服系统20210223的通知中。

**（五）期货市场监控中心仿真统一开户系统（通过证联网接入）**

如需新开客户，请通过以下地址申请。

（1）web方式的地址:

https://42.0.2.2:7002/test

（2）接口调用方式的地址

ssl://42.0.2.3:51002

**（六）期货市场监控中心盘后报送测试系统**

15.9.11.45（专线地址），报送服务器端口：9000

42.0.2.4（证联网地址），报送服务器端口：9000

**（七）仿真交易数据准备**

请提前做好技术系统的仿真交易准备。如需要更多资金，请联系上期所另外申请。

**（八）注意事项**

本次仿真交易不涉及客户统一开户、交割、仓单业务、银行转账等相关业务。

**（九）要求**

请会员在上期所仿真会员服务系统填写螺纹钢、白银期权仿真交易测试反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“螺纹钢、白银期权仿真交易测试反馈”的记录进行操作。

七、联系方式

技术咨询：021-20616345

产品咨询：021-20616726

电子邮箱：tech@shfe.com.cn

传真：021-68400385

特此通知。

附表：螺纹钢、白银期权仿真交易反馈表

附表

螺纹钢、白银期权仿真交易反馈表

|  |
| --- |
| **会员情况** |
| 公司名称 |  | 会员号 |  |
| 技术系统联系人 | 姓名： | 电话： |
| Email： |  |
| **技术系统情况** |
| 使用系统 | 金仕达□　 恒生□　 易盛□　 上期技术□　 自开发□ |
| 其他：（开发商名称）： |
| 报盘机IP地址 |  | 登录用户名 |  |
| **测试场景反馈** |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 场景名称 | 参与角色 | 系统名称 | 功能点 | 测试场景 | 是否通过 |
| 日常交易 | 会员 | 会员系统、交易所交易系统 | 与交易所系统连接 | 1、确认会员是否连接到交易所正常交易2、一代行情是否正常3、二代行情是否正常 |  |
| 会员系统、交易所交易系统、终端厂商系统 | 查询合约、接收合约状态切换信息 | 查询螺纹钢、白银期权合约正常接收,合约状态切换信息正常 |  |
| 会员系统、终端厂商系统 | 报单、撤单、开/平仓 | 螺纹钢、白银期权合约报单、撤单、开/平仓、成交回报是否正常 |  |
| 会员系统、终端厂商系统 | 普通客户询价 | 普通客户对螺纹钢、白银期权合约询价 |  |
| 会员系统、做市商系统 | 做市商报价 | 做市商对螺纹钢、白银期权合约报价 |  |
| 会员系统、终端厂商系统 | 通过交易指令对螺纹钢、白银期权 | 提交行权申请(勾选买方期货自对冲)、提交期权自对冲申请、提交期货自对冲申请、提交做市商留仓申请 |  |
| 会员系统、交易所会服系统 | 通过会员服务系统对螺纹钢、白银期权 | 提交行权申请(勾选买方期货自对冲)、提交期权自对冲申请、提交期货自对冲申请、提交做市商留仓申请 |  |
| 会员系统、终端厂商系统 | 投资者对 螺纹钢、白银期权合约下套保单 | 对螺纹钢、白银期权合约下套保单 |  |
| 会员系统、交易所交易系统 | 对投资者进行实时风险监控 | 检查会员下客户是否有异常交易情况并提出预警。对投资者资金进行监控并进行追保、强平等操作。 |  |
| 到期行权（11月24日） | 会员 | 会员系统、终端厂商系统 | 通过交易指令对螺纹钢、白银期权 | 提交行权申请(勾选买方期货自对冲)、提交期权自对冲申请、提交期货自对冲申请、提交做市商留仓申请 |  |
| 会员系统、交易所会服系统 | 通过会员服务系统对螺纹钢、白银期权 | 提交行权申请(勾选买方期货自对冲)、提交期权自对冲申请、提交期货自对冲申请、提交做市商留仓申请 |  |
| 日常结算 | 会员 | 会员系统 | 上期所结算文件导入 | 结算文件导入成功。结算文件可以从会服系统下载也可以通过API接口自动获取，两种方式均需测试。 |  |
| 会员系统 | 系统结算 | 结算流程是否正常 |  |
| 会员系统 | 结算结果核对 | 核对结果正确：上期所成交、资金、投资者持仓、会员持仓等核对正确 |  |
| 会员系统 | 报表 | 生成报表结果正确性 |  |
| 数据报送 | 会员 | 会员系统 | 报送数据生成/报送结果查询 | 报送文件是否正确 |  |

注：请会员在仿真交易测试结束（2022年12月2日）前按每个席位在上期所仿真会员服务系统填写螺纹钢、白银期权仿真交易测试反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“螺纹钢、白银期权仿真交易测试反馈”的记录进行操作。谢谢配合。