附件1

丁二烯橡胶期货及期权、投机转套保业务仿真交易指南

1. 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。

1. 丁二烯橡胶期货及期权交易时间

每周一至周五上午9:00 ~ 11:30，下午13:30 ~ 15:00，连续交易时间为每周一至周五21:00 ~ 23:00。

1. 丁二烯橡胶期货仿真参数

**（一）期货挂牌合约**

BR2308、BR2309、BR2310、BR2311、BR2312、BR2401、BR2402、BR2403、BR2404、BR2405、BR2406

**（二）期货相关仿真交易参数**

|  |  |
| --- | --- |
| **参数名称** | **仿真交易参数值** |
| 交易品种 | 丁二烯橡胶 |
| 产品代码 | BR |
| 交易单位 | 5吨/手 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 5元/吨 |
| 合约交割月份 | 1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12月 |
| 最后交易日 | 合约月份的15日（遇国家法定节假日顺延） |
| 交割日期 | 最后交易日后连续二个交易日 |
| 实际执行涨跌停板幅 | ±10% |
| 首日涨跌停板幅 | ±20% |
| 实际执行保证金率 | 12% |
| 交割方式 | 实物交割 |
| 交割单位 | 10吨 |
| 交易手续费 | 成交金额的万分之零点一 |
| 交易手续费平今优惠 | 平今仓免收交易手续费 |
| 限价单最大下单量 | 500手 |
| 限价单最小下单量(合约上市之日起) | 1手 |
| 限价单最小下单量(交割月第一个交易日起) | 2手 |

**（三）期货持仓限额**

|  |  |
| --- | --- |
| **参数名称** | **仿真交易参数值** |
| 持仓限制（合约挂牌至交割月份，期货公司会员） | （某一期货合约持仓量≥1万手）：25% |
| 持仓限制（非期货公司会员、客户） | 合约挂牌至交割月前第二月的最后一个交易日 | （某一期货合约持仓量≥1万手）：10%（某一期货合约持仓量＜1万手）：1000 |
| 交割月前第一月 | 300 |
| 交割月份 | 60 |

1. 丁二烯橡胶期权仿真参数

**（一）期权挂牌标的合约**

BR2308、BR2309

**（二）期权合约**

|  |  |
| --- | --- |
| **参数名称** | **仿真交易参数值** |
| 合约标的物 | 丁二烯橡胶期货合约（5吨） |
| 合约类型 | 看涨期权，看跌期权 |
| 交易单位 | 1手丁二烯橡胶期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 1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 |
| 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≤10000元/吨，行权价格间距为100元/吨；10000元/吨＜行权价格≤25000元/吨，行权价格间距为200元/吨；行权价格＞25000元/吨，行权价格间距为500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：BR -合约月份-C-行权价格看跌期权：BR -合约月份-P-行权价格 |

**（三）期权相关仿真交易参数**

|  |  |
| --- | --- |
| **参数名称** | **仿真交易参数值** |
| 交易手续费 | 0.5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 | 0.5元/手 |
| 行权前期权自对冲手续费 | 0.5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 |
| 挂牌标的合约持仓量阈值 | 10000手（单边） |

**（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） |
|
| 持仓限额(手，单边) | 持仓限额(手，单边) |
| 非期货公司会员 | 客户 | 非期货公司会员 | 客户 |
| 丁二烯橡胶期权 | 1000 | 300 | 1000 | 300 |

1. 投机转套保业务测试注意事项

（一）基本业务原则

1、投机转套保仅针对期货合约，仅持仓属性发生变化，开仓时间与开仓价格均不发生变化，先开的持仓先转换，暂不收取手续费。

2、客户可转换的投机持仓为该会员名下的，但客户可使用的套保额度为跨会员总额度。

3、如有多个会员为同一客户申请持仓转换的，则按照先申请先处理、后申请后处理的顺序完成转换。

4、如实际的投机持仓小于申请转换的投机持仓数额，则只转换实际的投机持仓（即为“可转换数额”）；如可转换数额超过下一交易日剩余套保额度的，只转换下一交易日剩余套保额度内的部分，超出部分仍保留原有的持仓属性。

5、如合约连续两日（D1,D2）同方向单边市，则D3交易日无法申请投机转套保，直到同方向单边市解除的交易日晚上21:00起恢复申请。

（二）业务流程

1、申请时间窗口为每日00:00-14:50，21:00-24:00。在交易日结算时统一处理。结算完成后，申请机构可通过系统查看转换结果。

2、对于提交的申请，可在14:50前自行撤销。对于中介提交的申请，为其代理的会员或特参如未在14:50前转发则该申请自动失效。

3、一般情况下，申请在15:00后根据预先设定的转换原则自动处理，交易所可在15:00前手动驳回申请。

4、处理结果主要分为三种情形：一是（额度足够）完全转换，二是（有额度但不足）部分转换，三是（无可用额度）未转换。

5、会员通过仿真会服系统套保模块为其客户提交转换的申请，菜单路径为套保套利 -> 投机转套保业务申请 -> 投机转套保申请，详细操作手册可在仿真会服系统20230630的通知中下载《投机转套保持仓操作指南（会员端）》。

1. 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。

1. 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 | 42.24.1.163 | 43022 |  |  |  |
| 行情B路 | 42.24.1.164 | 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 | 42.24.1.161 | 21001 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.162 | 21001 |
| 五档单边行情 | 1000 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.161 | 21000 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.162 | 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

**（六）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。

**（七）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。

**（八）要求**

会员完成丁二烯橡胶期货及期权、投机转套保业务仿真交易测试后，请在上期所仿真会员服务系统填写测试反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“丁二烯橡胶期货及期权仿真交易测试反馈”、“投机转套保业务仿真交易测试反馈”的记录分别进行操作。

八、联系方式

技术咨询：021-20616345

丁二烯橡胶期货业务咨询：021-68401828

丁二烯橡胶期权业务咨询：021-68400295

投机转套保业务咨询：021-68400477、68400116

电子邮箱：tech@shfe.com.cn

传真：021-68400385

特此通知。

附表1：丁二烯橡胶期货及期权仿真交易反馈表

附表2：投机转套保业务仿真交易测试反馈

**附表1：**

丁二烯橡胶期货及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□　　飞马□　　 飞创□ 顶点□ 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** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **测试项目** | **测试场景描述** | **备注** |
| 与交易所系统连接 | 1、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 |  |
| 查询合约、接收合约状态切换信息 | 查询丁二烯橡胶期货及期权合约正常接收,合约状态切换信息正常 |  |
| 投资者报撤单 | 丁二烯橡胶期货及期权合约报单、撤单、开/平仓、成交回报是否正常 |  |
| 普通客户询价 | 普通客户对丁二烯橡胶期权合约询价 |  |
| 做市商报价 | 做市商对丁二烯橡胶期权合约报价 |  |
| 通过交易指令对丁二烯橡胶期权 | 提交行权申请(可选行权后的期货自对冲)、提交自对冲申请(可选期权自对冲、做市商留仓、履约后的期货自动冲)、提交放弃期权行权申请 |  |
| 通过会员服务系统对丁二烯橡胶期权 | 提交行权申请(可选行权后的期货自对冲)、提交自对冲申请(可选期权自对冲、做市商留仓、履约后的期货自动冲)、提交放弃期权行权申请 |  |
| 投资者对丁二烯橡胶期货及期权合约下套保单 | 对丁二烯橡胶期货及期权合约下套保单 |  |
| 对投资者进行实时风险监控 | 对投资者进行实时风险监控，检查客户是否有异常交易情况，并提出预警 |  |
| 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。 |  |
| 系统结算 | 结算流程是否正常 |  |
| 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 |  |
| 盘后数据报送 | 盘后数据报送是否完成 |  |

**注：请会员在仿真交易测试结束（2023年7月21日）前按每个席位在上期所仿真会员服务系统填写丁二烯橡胶期货及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“丁二烯橡胶期货及期权仿真交易测试反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

**附表2：**

投机转套保业务仿真交易测试反馈

|  |
| --- |
| **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□　　飞马□　　 飞创□ 顶点□ 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** |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **测试日期** | **场景号** | **测试目的** | **测试场景** | **预期结果** |
| 任意交易日 | 1 | 基本流程测试：会员申请、撤销、结算文件核对 | 14:50/15:00之后提交申请 | 无法提交 |
| 2 | 14:50前提交申请，14:50后申请撤销 | 无法撤销 |
| 3 | 14:50前提交申请，14:50前申请撤销 | 撤销成功 |
| 4 | 批量导入申请 | 正常提交 |
| 5 | 结算文件核对 | 投机转套保的业务，在对会员的结算文件中分开列示 |
| 6 | 非特殊交易日转换原则 | 客户无持仓，申请转换（一般/临近） | 转换失败 |
| 7 | 客户无可用套保额度，申请转换（一般/临近） | 转换失败 |
| 8 | 可用套保额度≥申请转换量＞客户持仓（一般/临近） | 部分转换，转换量=客户持仓 |
| 9 | 申请转换量＞可用套保额度、客户持仓 | 部分转换，转换量=min（可用套保额度，客户持仓） |
| 10 | 客户持仓≥申请转换量＞可用套保额度（一般/临近） | 部分转换，转换量=可用套保额度 |
| 11 | 申请转换量≤可用套保额度、客户持仓（一般/临近） | 全部或部分转换，转换量=min（可用套保额度，客户持仓） |
| 12 | 不可申请投机转套保的特殊情况 | 合约连续2个交易日同方向单边市，提交申请 | 无法提交 |
| 13 | 合约连续2个交易日(D1,D2)同方向单边市后第3交易日(D3)解除同方向单边市，第4交易日(D4)提交申请 | 可提交 |
| 14 | 跨会员客户场景（如具备条件可测试） | 会员额度共享，不同会员先后申请等相关场景 | 　 |
| 合约最后三天 | 15 | 合约最后三日不可申请投机转套保 | 提交申请（能源类/非能源类） | 无法提交 |
| 月末2023/7/31 | 16 | 月末超仓：进入临近交割月限仓，申请投机转套保，投机持仓、套保持仓的计算和超仓提示是否正确*（测试场景中所涉的客户持仓指的是投机仓，超仓量为未申请投机转套保的超仓量）* | 客户仅有一般月份没有临近交割月份额度，客户持仓≤下月限仓值，申请转换量＞可用临近交割月额度（自动转化） | 部分转换，转换量=min(可用临近交割月额度，客户持仓） |
| 17 | 客户仅有一般月份没有临近交割月份额度，客户持仓＞下月限仓值，申请转换量≥超仓量＞可用临近交割月额度（自动转化） | 部分转换并收到超仓通知，转换量=可用临近交割月额度 |
| 18 | 客户仅有一般月份没有临近交割月份额度，客户持仓＞下月限仓值，可用临近交割月额度（自动转化）≥超仓量＞申请转换量 | 全部转换并提示超仓 |
| 19 | 客户持仓＞下月限仓值，申请转换量≥超仓量＞可用临近交割月额度 | 部分转换并提示超仓，转换量=可用临近交割月额度 |
| 20 | 客户持仓＞下月限仓值，申请转换量≥可用临近交割月额度≥超仓量 | 不提示超仓，转换量=可用临近交割月额度 |
| 21 | 客户持仓＞下月限仓值，可用临近交割月额度≥超仓量且申请转换量≥超仓量 | 不提示超仓，转换量=可用临近交割月额度 |
| 22 | 客户持仓＞下月限仓值，可用临近交割月额度≥超仓量＞申请转换量 | 全部转换并提示超仓 |

**注：请会员在仿真交易测试结束（2023年8月1日）前在上期所仿真会员服务系统填写投机转套保业务仿真交易测试反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“投机转套保业务仿真交易测试反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**