附件

丁二烯橡胶期货及期权、投机转套保业务

全市场生产系统演练指南

一、丁二烯橡胶期货挂牌合约

BR2401、BR2402、BR2403、BR2404、BR2405、BR2406、BR2407

二、丁二烯橡胶期权挂牌标的合约

BR2401、BR2402

三、测试时间安排

**（一）2023年7月15日（周六）测试安排**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **模拟交易日** | **演练时间** | **内容** |
| 模拟第一个交易日  （丁二烯橡胶期货上市） | 08:55:00 | 集合竞价申报 |
| 08:59:00 | 集合竞价撮合 |
| 09:00:00 | 连续交易 |
| 10:15:00 | 连续交易暂停 |
| 10:30:00 | 连续交易 |
| 11:30:00 | 收市 |
| 11:30-12:30 | 交易所结算 |
| 12:30-13:25 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 13:25前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |
| 模拟第二个交易日  （丁二烯橡胶期权上市） | 13:25:00 | 集合竞价申报 |
| 13:29:00 | 集合竞价撮合 |
| 13:30:00 | 连续交易 |
| 13:50:00 | 连续交易暂停 |
| 13:55:00 | 集合竞价申报 |
| 13:59:00 | 集合竞价撮合 |
| 14:00:00 | 连续交易 |
| 15:00:00 | 收市 |
| 15:00-16:00 | 交易所结算 |
| 16:00-17:00 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 17:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

2023年7月15日（周六）上午测试采用7月13日（周四）结算后的数据，模拟7月14日（周五）的交易和结算。7月15日（周六）下午测试模拟7月17日（周一）的交易和结算。

**（二）2023年7月22日（周六）测试安排**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **模拟交易日** | **演练时间** | **内容** |
| 模拟第一个交易日  （丁二烯橡胶期货上市） | 08:55:00 | 集合竞价申报 |
| 08:59:00 | 集合竞价撮合 |
| 09:00:00 | 连续交易 |
| 10:15:00 | 连续交易暂停 |
| 10:30:00 | 连续交易 |
| 11:30:00 | 收市 |
| 11:30-12:30 | 交易所结算 |
| 12:30-13:25 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 13:25前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |
| 模拟第二个交易日  （丁二烯橡胶期权上市） | 13:25:00 | 集合竞价申报 |
| 13:29:00 | 集合竞价撮合 |
| 13:30:00 | 连续交易 |
| 13:50:00 | 连续交易暂停 |
| 13:55:00 | 集合竞价申报 |
| 13:59:00 | 集合竞价撮合 |
| 14:00:00 | 连续交易 |
| 15:00:00 | 收市 |
| 15:00-16:00 | 交易所结算 |
| 16:00-17:00 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 17:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

2023年7月22日（周六）上午测试采用7月20日（周四）结算后的数据，模拟7月21日（周五）的交易和结算。7月22日（周六）下午测试模拟7月24日（周一）的交易和结算。

四、丁二烯橡胶期货测试用参数

**（一）丁二烯橡胶期货合约**

丁二烯橡胶期货合约请参见《上海期货交易所就合成橡胶期货及期权合约相关业务规则公开征求意见的公告》，链接为：

https://www.shfe.com.cn/news/notice/911403161.html

**（二）期货相关测试用参数**

|  |  |
| --- | --- |
| **项目** | **测试用参数值** |
| 交易代码 | BR |
| 交易品种 | 丁二烯橡胶 |
| 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 |
| 限价单最大下单量 | 500手 |

**（三）持仓限额**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **参数名称** | **测试用参数值** | |
| 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 |

五、丁二烯橡胶期权测试用参数

**（一）丁二烯橡胶期权合约**

丁二烯橡胶期权合约请参见《上海期货交易所就合成橡胶期货及期权合约相关业务规则公开征求意见的公告》，链接为：

https://www.shfe.com.cn/news/notice/911403161.html

**（二）期权相关测试用参数**

|  |  |
| --- | --- |
| **参数名称** | **测试用参数值** |
| 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） |

**（三）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 | 1000 | 300 | 300 |

六、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．会员通过会员服务测试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，详细操作手册可在测试当日从会服测试系统的通知中下载《投机转套保持仓操作指南（会员端）》。

**（三）注意事项**

1．投机转套保业务可在上期所所有期货品种申请。

2．为测试投机转套保场景需要，将sn2308、fu2310的最后交易日调整为20230717。

七、套保额度申请

会员可在测试当日通过会员服务测试系统为客户申请套期保值额度，请使用套保用户（命名规则为H+会员号+‘.’+操作员，后期新申请的用户命名规则为会员号+TB01/02）申请，密码同生产。建议各会员提前检查套保账号，确保测试当日可以及时进行套保额度的申请。测试当日交易时段，交易所会实时审批套期保值申请。

八、通讯参数

**（一）交易系统**

各单位的交易及行情系统应使用FENS配置方式来获取前置机IP地址，FENS服务器的IP地址为：192.168.12.41、192.168.12.42、192.168.11.31、192.168.11.32、192.168.16.31、192.168.16.32。

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4901，SSL加密链路端口号为4911；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4903，SSL加密链路端口号为4913。

上期所的一档行情主题号为1001，发布频率为每秒2笔。

各单位的网络安全控制策略应打开对192.168.12.X 192.168.11.X、192.168.16.X网段上TCP端口为4901、4911、4903、4913、33005、44305、33011、44311的访问；及对192.168.9.X、192.168.13.X、192.168.17.X网段上TCP端口为80、443、7002的访问。请确保上述网段及协议端口的通讯正常。

**（二）二代行情平台**

使用生产环境测试。二代行情平台参数请参照上期所网站发布的二代行情平台上线通知，链接为：

http://www.shfe.com.cn/news/notice/911333290.html

**（三）会员服务测试系统**

专线地址：<http://192.168.9.215>

证联网地址：<http://42.24.1.244>

会员服务测试系统的用户名及密码同生产环境。

**（四）会服API接口测试系统**

会服API接口测试地址为192.168.9.219，端口号为443。用户名、密码以及证书信息同生产系统。

**（五）期货市场监控中心盘后数据报送**

盘后数据报送接入技术参数如下：

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

数据报送测试的用户名及密码同生产环境。

九、要求

各单位应做好以下工作：

（一）测试前与各自软件供应商联系，制定周密测试计划，测试结束后，仔细核对结算数据。

（二）测试前做好系统和数据备份，测试后恢复备份，防止影响下一交易日的正常业务。

（三）应重点注意丁二烯橡胶期货及期权、投机转套保业务的测试。7月15日测试丁二烯橡胶期货及期权、投机转套保业务。7月22日测试丁二烯橡胶期货及期权业务，不测试投机转套保业务。

（四）测试完成后请各单位在上期所会员服务系统填写演练反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“20230715/20230722生产系统演练反馈”的记录进行操作。

（五）各行情转发单位应填写《丁二烯橡胶期货及期权生产系统演练反馈表（信息商）》（附表3），[以电子邮件方式发送到信息管理部xxgl@shfe.com.cn](mailto:以电子邮件方式发送到信息管理部xxgl@shfe.com.cn)。

（六）各单位做好测试数据的隔离工作，避免测试数据影响正式数据。

十、联系方式

**信科一部：**

值班电话：021-68400802

电子邮箱：[tech@shfe.com.cn](mailto:tech@shfe.com.cn)

传真：021-68400385

**交易部（7月15日套保审批）：**

电话：021-20616047、68400639

特此通知。

附表：1．丁二烯橡胶期货及期权生产系统演练反馈表

（会员）

2．投机转套保业务生产系统演练反馈表

3．丁二烯橡胶期货及期权生产系统演练反馈表

（信息商）

附表1

丁二烯橡胶期货及期权生产系统演练反馈表（会员）

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |  | | | |
| **测试情况** | | | | | | | | |
| **测试项目** | | | **测试场景描述** | | | **备注** | |
| 系统备份 | | | 系统和数据是否备份 | | |  | |
| 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, 丁二烯橡胶期货及期权合约状态切换信息正常 | | |  | |
| 投资者报单、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 | | |  | |
| 其它故障 | | | 测试过程中未发生其它故障 | | |  | |
| 系统恢复 | | | 系统恢复是否正常 | | |  | |

填表日期： 填表人：

**注：请会员在测试后的第一个工作日12:00前按每个席位在上期所会员服务系统填写演练反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“20230715/20230722生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

附表2

投机转套保业务生产系统演练反馈表

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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**  **日期** | **场景号** | **测试目的** | **测试场景（适用合约**  **sn2308、fu2310）** | **预期结果** |
| 7月15日上午模拟月末倒数第二个交易日 | 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 | 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 |
| 7月15日下午模拟月末最后交易日 | 13 | 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） |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 |
| 17 | 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 |
| 18 | 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 |
| 19 | 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：请会员在测试后的第一个工作日12:00前按每个席位在上期所会员服务系统填写演练反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“20230715生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

附表3

丁二烯橡胶期货及期权生产系统演练反馈表（信息商）

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **信息商情况** | | | | | | | |
| 公司名称 |  | | | | 登录用户名 | |  |
| 技术系统  联系人 | 姓名： | | | 电话： | | | |
| Email： |  | | | | | |
| **测试情况** | | | | | | | |
| **测试项目** | | | **情况描述** | | | **备注** | | |
| 使用上期所席位登录是否正常 | | |  | | |  | | |
| 通过上期所席位接收丁二烯橡胶期货及期权行情是否正常（含移动终端） | | |  | | |  | | |
| 使用上期所的席位应不能接收到上期所以外的合约行情 | | |  | | |  | | |
| 系统恢复是否正常（备注完成时间） | | |  | | |  | | |

填表日期： 填表人：

**此表需在测试后的第一个工作日12:00前通过电子邮件方式，递交到数据管理部，邮箱：**[**xxgl@shfe.com.cn**](mailto:xxgl@shfe.com.cn) **谢谢配合。**