附件

原油期权仿真交易指南

1. 参与交易

帐号、密码、交易编码等使用上期能源仿真测试环境已设立的数据。

1. 挂牌标的合约

SC2106、SC2107

1. 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 -次日02:30（与标的期货合约一致）。

1. 仿真参数

**（一）期权合约**

|  |  |
| --- | --- |
| 合约标的物 | 原油期货合约（1000桶） |
| 合约类型 | 看涨期权，看跌期权 |
| 交易单位 | 1手原油期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/桶 |
| 最小变动价位 | 0.05元/桶 |
| 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盘。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13个交易日，上海国际能源交易中心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≤250元/桶，行权价格间距为2元/桶；250元/桶＜行权价格≤500元/桶，行权价格间距为5元/桶；行权价格＞500元/桶，行权价格间距为10元/桶 |
| 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：SC-合约月份-C-行权价格看跌期权：SC-合约月份-P-行权价格 |
| 上市交易所 | 上海国际能源交易中心 |

**（二）相关仿真交易参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 原油期权仿真交易参数值 |
| 交易手续费 | 1.5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 | 1.5元/手 |
| 行权前期权自对冲手续费 | 1.5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 |

**（三）持仓限额**

|  |  |
| --- | --- |
| **参数名称** | **参数值** |
| 非期货公司会员持仓限额（手，单边） | 标的期货合约挂牌至交割月前第三月（期权合约挂牌至到期月前二月） | 3000 |
| 标的期货合约交割月份前第二月（期权到期月前第一月） | 1500 |
| 标的期货合约交割月前第一月（期权到期月） | 500 |
| 客户持仓限额（手，单边） | 标的期货合约挂牌至交割月前第三月（期权合约挂牌至到期月前二月） | 3000 |
| 标的期货合约交割月份前第二月（期权到期月前第一月） | 1500 |
| 标的期货合约交割月前第一月（期权到期月） | 500 |
| 做市商持仓限额（手，单边） | 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） | 25000 |
| 标的期货合约交割月前第一月（期权到期月） | 25000 |

五、套保、套利额度申请
　　会员通过仿真会员服务系统，境外中介机构通过仿真境外中介服务系统，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。

上期能源的一档行情主题号为5001，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 |
| 上期能源一档单边行情 | 5001 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.145 | 25001 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.146 | 25001 |
| 上期能源五档单边行情 | 5000 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.145 | 25000 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.146 | 25000 |

**（三）仿真会员服务系统（通过证联网测试网接入）**

<http://42.24.1.245>

**（四）仿真境外中介服务系统（通过互联网接入）**

<https://124.74.244.145>或<https://220.248.39.145>

**（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

数据报送测试的用户名及密码同生产环境。

业务联系人：张 琎  010-66555063

技术联系人：孙思迪 010-66552172

**（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，请联系上期能源另外申请。

**（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**

会员单位应填写《原油期权仿真交易反馈表（会员）》（附表1），以电子邮件方式发送到运行部tech@shfe.com.cn。

七、联系方式

产品咨询：021-20616726

技术咨询：021-68400802

电子邮箱：tech@shfe.com.cn

传 真：021-68400385

特此通知。

附表：原油期权仿真交易反馈表（会员）

附表1

原油期权仿真交易反馈表（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□　　自开发□ |
| 其他：（开发商名称）： |
| 报盘机IP地址 |  | 登录用户名 |  |
| **测试内容及结果反馈** |
| **业务场景** | **验证内容** | **验证结果** | **问题反馈** |
| 普通交易日（非原油期权到期日）的盘中业务 | 席位可正常登录 |  |  |
| 原油期权、原油期货、原油TAS合约行情能正常接收 |  |  |
| 原油期权、原油期货、原油TAS合约可正常报单、撤单、开/平仓、成交回报均正常（包括期货公司会员、境外特参、境外中介的客户） |  |  |
| 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 |  |  |
| 在sc2106原油期权系列、sc2106原油期货合约上可正常下套保单，开/平仓、成交回报均正常 |  |  |
| 在sc2107及之后的原油期权系列、sc2107及之后的原油期货合约上可正常下套保单，开/平仓、成交回报均正常 |  |  |
| 通过交易指令提交原油期权 | 行权申请 |  |  |
| 自对冲申请 |  |  |
| 期货自对冲申请 |  |  |
| 通过会服系统提交原油期权 | 行权申请 |  |  |
| 自对冲申请 |  |  |
| 期货自对冲申请 |  |  |
| 通过境外中介服务系统提交原油期权 | 行权申请 |  |  |
| 自对冲申请 |  |  |
| 期货自对冲申请 |  |  |
| 普通交易日（非原油期权到期日）的收盘后 | 结算是否正常 |  |  |
| 数据正常报送监控中心 |  |  |
| 检查可换汇款项已包含了权利金收支和行权、履约手续费 |  |  |
| sc2106期权系列到期日的盘中业务 | 通过交易指令提交原油期权 | 行权申请 |  |  |
| 放弃行权申请 |  |  |
| 自对冲申请 |  |  |
| 期货自对冲申请 |  |  |
| 通过会服系统提交原油期权 | 行权申请 |  |  |
| 放弃行权申请 |  |  |
| 自对冲申请 |  |  |
| 期货自对冲申请 |  |  |
| 通过境外中介服务系统提交原油期权 | 行权申请 |  |  |
| 放弃行权申请 |  |  |
| 自对冲申请 |  |  |
| 期货自对冲申请 |  |  |
| sc2106期权系列到期日的收盘后 | 结算是否正常 |  |  |
| 数据正常报送监控中心 |  |  |

**注：验证结果填写“通过”，“未通过”，“未完成”，其中“未通过”，“未完成”需要填写问题反馈。请会员按每个席位填写此表，并在仿真交易结束（2021年5月21日）前通过电子邮件方式，递交到运行部，邮箱：****tech@shfe.com.cn****。谢谢配合。**

填表日期： 填表人：