附件1

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能源仿真测试环境已设立的数据。

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. 上期能源系统：

(1) 如为会员直接代理的客户，则会员通过会服系统套保模块为其提交转换申请。

(2) 如为境外特参的客户，由境外特参通过会服系统为其提交转换申请。

(3) 如为由期货公司会员委托代理的境外中介客户，由中介机构通过境外中介服务系统提交转换申请，委托代理的会员进行审核。

(4) 如为由境外特参委托代理的境外中介客户，由中介机构通过境外中介服务系统提交转换申请，先由境外特参进行审核，再由该境外特参的代理结算期货公司会员转发申请。

(5) 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，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。

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 | 42.24.1.163 | 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 |
| 上期能源一档单边行情 | 5001 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.161 | 25001 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.162 | 25001 |
| 上期能源五档单边行情 | 5000 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.161 | 25000 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.162 | 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）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。

**（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）注意事项**

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。本次仿真交易不涉及客户统一开户、仓单业务、银行转账等相关业务。

**（八）要求**

会员完成投机转套保业务仿真交易测试后，请在上期能源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“投机转套保业务仿真交易测试反馈”的记录进行操作。

五、联系方式

技术咨询：021-20616345

投机转套保业务咨询：021-68400477、68400116

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

传真：021-68400385

特此通知。

附表：投机转套保业务仿真交易测试反馈

**附表：**

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 | 通过境外中介服务系统：中介提交、委托代理会员转发功能是否能正常提交 | 中介提交转换申请，代理的期货公司转发 | 转发成功 |
| 7 | 中介提交转换申请，14:50前申请撤销 | 撤销成功 |
| 8 | 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 |
| 9 | 客户无可用套保额度，申请转换（一般/临近） | 转换失败 |
| 10 | 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 |
| 11 | 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） |
| 12 | 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 |
| 13 | 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） |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 | 17 | 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 | 18 | 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） |
| 19 | 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 |
| 20 | 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 |
| 21 | 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 |
| 22 | 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 |
| 23 | 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 |
| 24 | 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）前在上期能源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。**