附件

投机转套保业务全市场生产系统演练指南

一、测试时间安排

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 | 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 | 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、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）》。

6．投机转套保业务可在上期能源所有期货品种申请。为测试需要，将lu2309、nr2309的最后交易日调整为20230717。

三、套保额度申请

会员可在测试当日通过上期能源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。

四、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。

上期能源的一档行情主题号为5001，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能源网站发布的二代行情平台上线通知，链接为：

http://www.ine.com.cn/news/notice/1455.html

**（三）会员服务测试系统**

专线地址：[http://192.168.9.214](http://192.168.9.215/)

证联网地址：[http://42.24.1.246](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。

五、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）应重点注意投机转套保业务的测试。

（四）测试完成后请各单位在上期能源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（能源）”的记录进行操作。

（五）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。

六、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：投机转套保业务生产系统演练反馈表

附表

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**  **lu2309、nr2309）** | **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能源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（能源）”的记录进行操作。谢谢配合。**