

200127

上海市浦东新区杨高南路288号19-21层  
上海金融期货信息技术有限公司  
李悦萌 女士

关于：申请号为**202210038761.0**的专利申请案  
申 请 人：上海金融期货信息技术有限公司  
发明名称：一种不间断连续交易系统  
我方编号：CNJRQH-0131. 219852

李悦萌 女士  
您好！

关于本案的第1次审查意见通知书，已按贵方指令于期限内答复国知局，附件是答复文本的副本，请查收。

如有问题请随时联系我们。谢谢！

顺颂 业祺



专利代理师 施浩  
2024年12月5日

hdc.doc

## 意见陈述书

① 专 利 或 申 请 利	申请号或专利号 2022100387610
	发明创造名称 一种不间断连续交易系统
	申请人或专利权人（第一署名人）上海金融期货信息技术有限公司
<p>② 陈述事项：关于费用的意见陈述请使用意见陈述书(关于费用)</p> <p>以下选项只能选择一项</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> 针对国家知识产权局于 <u>2024</u> 年 <u>08</u> 月 <u>21</u> 日发出的 <u>第 1 次审查意见通知书</u>（发文序号 <u>2024082101509760</u>）陈述意见。</p> <p><input type="checkbox"/> 针对国家知识产权局于__年__月__日发出的__（发文序号__）补充陈述意见。</p> <p><input type="checkbox"/> 针对国家知识产权局于__年__月__日发出的药品专利权期限补偿审查意见通知书（发文序号__）陈述意见。</p> <p><input type="checkbox"/> 主动提出修改（根据专利法实施细则第 57 条第 1 款、第 2 款的规定）</p> <p><input type="checkbox"/> 公布公告事项</p> <p><input type="checkbox"/> 其他事宜</p>	

## 意见陈述书

### ③ 陈述的意见：

尊敬的审查员，您好！

针对本案的审查意见，申请人的意见陈述如下。

#### 一、针对权利要求 1 中的“逻辑的交易日分界线”的解释或定义

申请人将原从属权利要求 4 中的附加技术特征，即“逻辑的交易日分界线”的具体说明，加入到独立权利要求 1 中，具体修改内容请见附件。

#### 二、将从属权利要求 3 中的“等”删除。

原独立权利要求 1 和从属权利要求 3 经上述修改后符合专利法及其实施细则的规定。

以上陈述，如有不妥，请指正并给与再次修改的机会，也可通过 021-34183200-2409 和代理人联系。申请人愿意积极配合以使本申请能够早日授权。谢谢！

### ④ 附件清单

【附件名称】权利要求书

【附件名称】修改对照页

已备案的证明文件备案编号：\_\_

### ⑤ 当事人或专利代理机构

上海专利商标事务所有限公司

# 权 利 要 求 书

---

1、一种不间断连续交易系统，其特征在于，系统包括基础数据模块、银期模块、清算模块、交易初始化模块、报送模块、交易模块，其中：

5       基础数据模块，用于维护交易结算所需的参数，支持不同交易所不同的交易日和状态；

银期模块，用于提供银期转账数据；

清算模块，在一交易所收盘后对其进行清算处理，实现分交易所清算，以逻辑的交易日分界线的时点所对应的各交易所清算结果合并为当日的最终清算结果，  
10       其中，逻辑的交易日分界线的设置是：各个交易所收盘结算后都具有单独启动下一交易日的交易的功能，所有交易所都完成收盘结算的时间点构成两个交易日之间的逻辑分界线；

交易初始化模块，支持分交易所的交易初始化，对完成结算后的交易所进行交易初始化，为其启动下一交易日的交易做好准备，以在连续交易状态下对各交易所依次进行交易初始化，动态加载增量数据，实现不间断连续交易；  
15

报送模块，待所有交易所当日结算都完成后，向外部的监控中心报送包含当日的最终清算结果在内的数据；

交易模块，基于多中心多活的模式进行交易处理，使多个交易中心同时工作，或者使一个交易中心工作的同时另一个交易中心进行系统升级。

20

2、根据权利要求1所述的不间断连续交易系统，其特征在于，银期模块中针对同一时刻各交易所的交易日不同的情况，设置将出入金归到各交易所中交易日最小的那个交易日。

25       3、根据权利要求1所述的不间断连续交易系统，其特征在于，清算模块的清算处理包括：

处理成交，判断是否平今，以T日手续费费率计算手续费，以该交易所投资者的T-1日持仓为基础，根据T日成交、交割、期权执行的盘后成交计算T日持

仓，生成超仓强平，计算 T 日盈亏，以 T 日保证金率计算保证金，然后汇总 T 日出入金，根据投资者在该交易所业务引起的资金变动、交易保证金变化更新投资者资金，其中 T 日为交易当日。

- 5           4、根据权利要求 1 所述的不间断连续交易系统，其特征在于，交易初始化模块配置为对持仓采用覆盖模式，对资金采用增量模式，不间断连续交易系统加载投资者在一交易所的持仓和资金变动数据，用该交易所的增量上场的持仓数据替换场上的持仓，根据各资金项的变化更新投资者资金，先计算投资者在该交易所的各资金项的变化，再根据各资金项的变化调整投资者和会员资金的可用资金、
- 10   权益、市值权益，重新计算可取资金。

- 5、根据权利要求 1 所述的不间断连续交易系统，其特征在于，报送模块向外部的监控中心所报送的数据包括：客户基本资料、客户编码信息、客户结算账户信息、客户期货期权账户基本资金数据、客户出入金记录、期货成交明细、期货
- 15   持仓数据、分项资金数据、需要说明的信息或数据、期货平仓明细，期货持仓明细，非货币充抵明细，期货交割明细、期货待交割结算合约、期权成交明细、期权持仓数据、期权行权明细、期权平仓明细、期权持仓明细。

# 权 利 要 求 书

1、一种不间断连续交易系统，其特征在于，系统包括基础数据模块、银期模块、清算模块、交易初始化模块、报送模块、交易模块，其中：

5 基础数据模块，用于维护交易结算所需的参数，支持不同交易所不同的交易日和状态；

银期模块，用于提供银期转账数据；

清算模块，在一交易所收盘后对其进行清算处理，实现分交易所清算，以逻辑的交易日分界线的时点所对应的各交易所清算结果合并为当日的最终清算结果，  
10 其中，逻辑的交易日分界线的设置是：各个交易所收盘结算后都具有单独启动下一交易日的交易的功能，所有交易所都完成收盘结算的时间点构成两个交易日之间的逻辑分界线；

交易初始化模块，支持分交易所的交易初始化，对完成结算后的交易所进行交易初始化，为其启动下一交易日的交易做好准备，以在连续交易状态下对各交易所依次进行交易初始化，动态加载增量数据，实现不间断连续交易；  
15

报送模块，待所有交易所当日结算都完成后，向外部的监控中心报送包含当日的最终清算结果在内的数据；

交易模块，基于多中心多活的模式进行交易处理，使多个交易中心同时工作，或者使一个交易中心工作的同时另一个交易中心进行系统升级。

20

2、根据权利要求1所述的不间断连续交易系统，其特征在于，银期模块中针对同一时刻各交易所的交易日不同的情况，设置将出入金归到各交易所中交易日最小的那个交易日。

25 3、根据权利要求1所述的不间断连续交易系统，其特征在于，清算模块的清算处理包括：

处理成交，判断是否平今，以T日手续费费率计算手续费，以该交易所投资者的T-1日持仓为基础，根据T日成交、交割、期权执行等的盘后成交计算T日

持仓，生成超仓强平，计算 T 日盈亏，以 T 日保证金率计算保证金~~等~~，然后汇总 T 日出入金，根据投资者在该交易所业务引起的资金变动、交易保证金变化更新投资者资金，其中 T 日为交易当日。

5 ~~4、根据权利要求 3 所述的不间断连续交易系统，其特征在于，逻辑的交易日分界线的设置是：各个交易所收盘结算后都具有单独启动下一交易日的交易的功能，所有交易所都完成收盘结算的时间点构成两个交易日之间的逻辑分界线。~~

10 ~~54、~~根据权利要求 1 所述的不间断连续交易系统，其特征在于，交易初始化模块配置为对持仓采用覆盖模式，对资金采用增量模式，不间断连续交易系统加载投资者在一交易所的持仓和资金变动数据，用该交易所的增量上场的持仓数据替换场上的持仓，根据各资金项的变化更新投资者资金，先计算投资者在该交易所的各资金项的变化，再根据各资金项的变化 调整投资者和会员资金的可用资金、权益、市值权益，重新计算可取资金。

15

~~65、~~根据权利要求 1 所述的不间断连续交易系统，其特征在于，报送模块向外部的监控中心所报送的数据包括：客户基本资料、客户编码信息、客户结算账户信息、客户期货期权账户基本资金数据、客户出入金记录、期货成交明细、期货持仓数据、分项资金数据、需要说明的信息或数据、期货平仓明细，期货持仓  
20 明细，非货币充抵明细，期货交割明细、期货待交割结算合约、期权成交明细、期权持仓数据、期权行权明细、期权平仓明细、期权持仓明细。