附件1

铜期货期权全市场演练指南

一、参加演练单位

参加演练的单位包括上期所会员及行情转发单位、中国期货市场监控中心。

二、演练安排

第一次演练（8月25日-26日）

本次演练假定铜期货期权上市日为2018年8月24日，标的为cu1809的系列期权合约到期日为2018年8月27日。8月25日模拟上市日的场景，8月26日模拟到期日的场景。

详细的演练安排参见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **演练时间** | **内容** | **备注** |
| 8月25日： 模拟铜期货期权上市日 | | |
| 08:55:00 | 集合竞价申报 | 开始交易铜期货、铜期货期权合约，会员验证开仓、平仓、委托回报、成交回报、实时行情、查询等功能。做市商验证报价、留仓申请等功能。 |
| 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 |  |
| 11:30-12:45 | 交易所结算 |  |
| 12:45 | 下载结算文件，核对结算结果 | 会员单位通过会员服务系统下载测试结算数据〔**新版结算文件，菜单：业务窗口->每日报表->最新业务数据文件（新版）**〕，并检查结算数据正确性。 |
| 14:00前 | 向监控中心报送盘后数据 |  |
|  | | |
| 8月26日：模拟标的为cu1809系列期权到期日 | | |
| 08:55:00 | 集合竞价申报 | 开始交易铜期货、铜期货期权合约，会员验证开仓、平仓、委托回报、成交回报、实时行情、查询等功能。做市商验证报价功能。验证由交易指令/会员服务系统提交行权申请、放弃行权申请、期权自对冲申请、做市商留仓申请、期货自对冲申请等功能。 |
| 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 | 期货收盘 | 所有期货合约收盘，发布期货合约当日结算价。 |
| 11:30-12:00 | 期权行权交易 | 交易指令/会员服务系统提交行权申请、放弃行权申请、期权自对冲申请、做市商留仓申请、期货自对冲申请等功能。 |
| 12:00:00 | 收市 |  |
| 12:00-13:30 | 交易所结算 |  |
| 13:30 | 下载结算文件，核对结算结果 | 会员单位通过会员服务系统下载测试结算数据〔**新版结算文件，菜单：业务窗口->每日报表->最新业务数据文件（新版）**〕，并检查结算数据正确性。 |
| 14:30前 | 向监控中心报送盘后数据 |  |

第二次演练（9月1日-2日）

本次演练假定铜期货期权上市日为2018年8月31日，标的为cu1810的系列期权合约到期日为2018年9月3日。9月1日模拟上市日的场景，9月2日模拟到期日的场景。

详细的演练安排参见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **演练时间** | **内容** | **备注** |
| 9月1日： 模拟铜期货期权上市日 | | |
| 08:55:00 | 集合竞价申报 | 开始交易铜期货、铜期货期权合约，会员验证开仓、平仓、委托回报、成交回报、实时行情、查询等功能。做市商验证报价、留仓申请等功能。 |
| 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 |  |
| 11:30-12:45 | 交易所结算 |  |
| 12:45 | 下载结算文件，核对结算结果 | 会员单位通过会员服务系统下载测试结算数据[**新版结算文件，菜单：业务窗口->每日报表->最新业务数据文件（新版）**]，并检查结算数据正确性。 |
| 14:00前 | 向监控中心报送盘后数据 |  |
|  | | |
| 9月2日：模拟标的为cu1810系列期权到期日 | | |
| 08:55:00 | 集合竞价申报 | 开始交易铜期货、铜期货期权合约，会员验证开仓、平仓、委托回报、成交回报、实时行情、查询等功能。做市商验证报价功能。验证由交易指令/会员服务系统提交行权申请、放弃行权申请、期权自对冲申请、做市商留仓申请、期货自对冲申请等功能。 |
| 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 | 期货收盘 | 所有期货合约收盘，发布期货合约当日结算价。 |
| 11:30-12:00 | 期权行权处理 | 交易指令/会员服务系统提交行权申请、放弃行权申请、期权自对冲申请、做市商留仓申请、期货自对冲申请等功能。 |
| 12:00:00 | 收市 |  |
| 12:00-13:30 | 交易所结算 |  |
| 13:30 | 下载结算文件，核对结算结果 | 会员单位通过会员服务系统下载测试结算数据[**新版结算文件，菜单：业务窗口->每日报表->最新业务数据文件（新版）**]，并检查结算数据正确性。 |
| 14:30前 | 向监控中心报送盘后数据 |  |

三、业务演练说明

1. 第一次演练，系统使用2018年8月22日的会员、客户、持仓、资金等数据，在此基础上，系统为每个会员的资金账户再增加1亿资金。如需要更多资金，请联系交易所另外申请。

2. 第二次演练，系统使用2018年8月29日的会员、客户、持仓、资金等数据，在此基础上，系统为每个会员的资金账户再增加1亿资金。如需要更多资金，请联系交易所另外申请。

3. 要求会员分别通过交易系统及会员服务系统提交行权指令，覆盖所有行权场景。

4. 为了充分演练铜期权套保额度使用场景，会员可在会员服务系统申请套保、套利额度，交易部会及时审批将额度上场。

四、演练要求

8月25日-26日的演练采用8月22日（周三）结算后的会员、客户、持仓、资金等数据。9月1日-2日的演练采用8月29日（周三）结算后的会员、客户、持仓、资金等数据。请提前作好技术系统的演练准备，并制定具体的演练方案，确保在演练期间，能按照演练时间安排进行操作。

演练结束后，请认真检查演练结果并及时反馈给上期所，邮箱：[FdTecSys@sfit.shfe.com.cn](mailto:FdTecSys@sfit.shfe.com.cn)

五、注意事项

本次演练不涉及客户统一开户、交割、仓单业务、银行转账等相关业务。请勿将测试数据发送至处于生产状态的系统。

六、技术指引

**1. 交易、行情接入**

（1） 本次演练上期所接入的FENS地址为：

192.168.11.131、192.168.11.132

（2） 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；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；FRONT前置机服务器对外开放端口号为32005，MDKERNEL行情服务器对外开放端口号为32011。

防火墙安全策略中需开放192.168.11.\* 段的4901，4903，32005，32011四个端口。

第一次演练使用交易编码、席位帐号和密码同20180822生产一致。第二次演练使用交易编码、席位帐号和密码同20180829生产一致。

**2. 上期所会员服务**

http://192.168.9.215

防火墙安全策略中需开放192.168.9.\* 段的80，443，7002三个端口。

第一次演练，会员服务使用的登录账号和密码同20180822生产一致。第二次演练，会员服务使用的登录账号和密码同20180829生产一致。

**3. 监控中心报送**

15.9.11.45 （三所环网地址），报送服务器端口：9002

42.0.2.4（证联网地址），报送服务器端口：9002

数据报送测试的用户名及密码同生产一致。

**注意：监控中心铜期货期权数据报送测试系统同时提供三所环网和证联网地址，请各数据报送方自主选择其中一个地址进行报送，选择证联网报送的，请将报送服务器的证联网地址提供给监控中心（发邮件给石晶晶或葛明阳，具体联系方式参见第七节），监控中心需要开通相应网络权限。**

七、联系方式

技术问题：021-68400802、021-68401178

交易业务：021-68400639

结算业务：021-68400587

监查业务：021-68400723

监控中心：

石晶晶 电话：010-66553029  邮箱：[shijj@cfmmc.com](mailto:shijj@cfmmc.com)

葛明阳 电话：010-66553037 邮箱：[gemy@cfmmc.com](mailto:gemy@cfmmc.com)