附件

差异化收取保证金演练指南

一、差异化保证金率参数

|  |  |
| --- | --- |
| 品种 | 保证金率 |
| 投机 | 套保 |
| % | % |
| 白银 | 10 | 9 |
| 铝 | 10 | 9 |
| 黄金 | 8 | 7 |
| 石油沥青 | 10 | 9 |
| 铜 | 10 | 9 |
| 燃料油 | 12 | 11 |
| 热轧卷板 | 9 | 8 |
| 镍 | 10 | 9 |
| 铅 | 18 | 9 |
| 螺纹钢 | 9 | 8 |
| 天然橡胶 | 8 | 7 |
| 锡 | 10 | 9 |
| 纸浆 | 7 | 6 |
| 不锈钢 | 9 | 8 |
| 线材 | 9 | 8 |
| 锌 | 10 | 9 |

注：为测试需要，铅的投机保证金率设置为18%

二、测试时间安排

2020年7月25日（周六）测试安排

|  |  |
| --- | --- |
| 演练时间 | 内容 |
| 周六上午模拟的交易日为7月24日（周五） |
| 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 | 收市 |
| 10:15-11:30 | 交易所结算 |
| 11:30-13:00 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 周六下午模拟的交易日为7月27日（周一） |
| 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 |
| 15:00:00 | 收市 |
| 15:00-16:30 | 交易所结算 |
| 16:30-18:00 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |

2020年7月25（周六）上午交易测试采用7月23日（周四）结算后的数据，模拟7月24日（周五）的交易和结算，上午结算时起启用差异化保证率设置。周六下午模拟7月27日（周一）的交易和结算。

三、套保额度申请

会员可在测试当日通过会员服务测试系统为客户申请套期保值额度，交易所实时审批套期保值申请。

四、通讯参数

**（一）交易测试系统**

(1)通过专线接入

前端域名服务(以下简称FENS)地址为：

192.168.11.131、192.168.11.132

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，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，加密链路端口号为4913。

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192.168.11.0/24网段上TCP端口为4901、4911、4903、4913、32005、44305、32011、44311的访问权限。

（2）通过证联网接入

前端域名服务(以下简称FENS)地址为：

42.24.1.51、42.24.1.52

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。

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4901、4903、32005、32011的访问权限。

席位号及密码同生产环境。

**（二）会员服务测试系统**

专线地址：<http://192.168.9.215>

证联网地址：<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。

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）应重点关注保证金率设置、保证金计算以及相关资金报表的测试。

（四）会员单位应填写《上期所差异化收取保证金演练反馈表（会员）》（附表），以电子邮件方式发送到运行部tech@shfe.com.cn。

（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。

五、联系方式

运行部：

值班电话：021-68400802

电子邮箱：tech@shfe.com.cn

传真：021-68400385

结算部：

值班电话：021-68400421、021-68400422

交易部（测试日套保审批）：

电话：021-68400313

附表：上期所差异化收取保证金演练反馈表（会员）

**附表：**

上期所差异化收取保证金演练反馈表（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）： |
| **测试情况** |
| **测试项目** | **情况描述** | **备注** |
| 系统和数据是否备份 |  |  |
| 保证金率是否分投机、套保设置 |  |  |
| 7月27日盘中交易：建立期货、期权投机和保值持仓，检查保证金是否正确 |  |  |
| 7月27日盘中交易：申请天胶期权保值持仓行权 |  |  |
| 盘后结算：检查期货、期权投机和保值保证金是否正确 |  |  |
| 结算是否正常 |  |  |
| 盘后数据报送是否完成 |  |  |
| 测试过程中有无发生其它故障 |  |  |
| 系统恢复是否正常 |  |  |

填表日期： 填表人：

**请会员按每个席位填写此表，并在测试后的第一个工作日12:00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。**