**附件**

**铝、锌期权生产系统演练指南**

一、挂牌合约月份

（一）2020年8月1日（周六）测试

铝期权挂牌合约月份AL2010、AL2011、AL2012、AL2101。锌期权挂牌合约月份ZN2010、ZN2011、ZN2012。

（二）2020年8月9日（周日）测试

挂牌合约月份以当日生产系统挂出的为准。

二、测试时间安排

（一）2020年8月1日（周六）测试安排

|  |  |
| --- | --- |
| 演练时间 | 内容 |
| 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 |
| 11:30-13:00 | 交易所结算 |
| 13:00-14:30 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 14:30前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

2020年8月1日（周六）测试采用7月30日（周四）结算后的数据，模拟7月31日（周五）的日盘交易和结算。

（二）2020年8月9日（周日）测试安排

|  |  |
| --- | --- |
| 演练时间 | 内容 |
| 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 |

2020年8月9日（周日）测试采用8月7日（周五）连续交易的数据，模拟8月10日（周一）的日盘交易。

三 、测试用参数

**（一）期权合约**

铝、锌期权合约请参见《上海期货交易所就铝期权合约和锌期权合约公开征求意见的公告》，链接为：

<http://www.shfe.com.cn/news/notice/911337038.html>。

**（二）相关测试用参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 参数值 |
| 交易手续费 | 1.5元/手 |
| 交易手续费平今优惠 | 免收平今手续费 |
| 行权（履约）手续费 | 1.5元/手 |
| 行权前期权自对冲手续费 | 1.5元/手 |
| 做市商期权自对冲手续费 | 免收手续费 |
| 行权后期货自对冲手续费 | 免收手续费 |
| 无风险利率 | 1.5% |
| 限价单最小下单量 | 1手 |
| 限价单最大下单量 | 100手 |

**（三）持仓限额**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 品种 | 标的期货合约挂牌至交割月前第二月（期权合约挂牌至到期月前一月） | | | 标的期货合约交割月前第一月（期权到期月） | | |
|
| 限仓数额(手，单边) | | | 限仓数额(手，单边) | | |
| 非期货公司会员 | 客户 | 做市商 | 非期货公司会员 | 客户 | 做市商 |
| 铝期权 | 10000 | 10000 | 30000 | 3000 | 3000 | 30000 |
| 锌期权 | 6000 | 6000 | 25000 | 2400 | 2400 | 25000 |

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。

上期所的一档行情主题号为1001，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所网站发布的二代行情平台上线通知，链接为：

http://www.shfe.com.cn/news/notice/911333290.html

**（三）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。

**（四）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）应重点注意铝、锌期权合约的交易情况。

（四）会员单位参与测试的每个席位应各自填写《铝、锌期权生产系统演练反馈表（会员）》（附表1），以电子邮件方式发送到运行部[tech@shfe.com.cn](mailto:tech@shfe.com.cn)。

（五）各行情转发单位应填写《铝、锌期权生产系统演练反馈表（信息商）》（附表2），[以电子邮件方式发送到信息管理部xxgl@shfe.com.cn](mailto:以电子邮件方式发送到信息管理部xxgl@shfe.com.cn)。

（六）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

值班电话：021-68400802

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

传真：021-68400385

特此通知。

附表：

1．铝、锌期权生产系统演练反馈表（会员）

2．铝、锌期权生产系统演练反馈表（信息商）

上海期货交易所

2020年7月24日

**附表1：**

铝、锌期权生产系统演练反馈表（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）： | | | | | | | |
| 报盘机IP地址 | |  | | 登录用户名 | |  | | | |
| **测试情况** | | | | | | | | | |
| **测试项目** | | | | | **情况描述** | | **备注** | |
| 系统和数据是否备份 | | | | |  | |  | |
| 铝、锌期权合约的一代行情是否正常 | | | | |  | |  | |
| 铝、锌期权合约的二代行情是否正常（若尚未连接二代行情平台，则填写无） | | | | |  | |  | |
| 铝、锌期权合约报单、撤单、开/平仓、成交回报是否正常 | | | | |  | |  | |
| 普通客户对铝、锌期权合约询价 | | | | |  | |  | |
| 做市商对铝、锌期权合约报价 | | | | |  | |  | |
| 通过交易指令对铝、锌期权 | 提交行权申请(勾选买方期货自对冲) | | | |  | |  | |
| 提交期权自对冲申请 | | | |  | |  | |
| 提交期货自对冲申请 | | | |  | |  | |
| 提交做市商留仓申请 | | | |  | |  | |
| 通过会员服务系统对铝、锌期权（8月1号） | 提交行权申请(勾选买方期货自对冲) | | | |  | |  | |
| 提交期权自对冲申请 | | | |  | |  | |
| 提交期货自对冲申请 | | | |  | |  | |
| 提交做市商留仓申请 | | | |  | |  | |
| 结算是否正常（8月1号） | | | | |  | |  | |
| 盘后数据报送是否完成（8月1号） | | | | |  | |  | |
| 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**](mailto:tech@shfe.com.cn) **。谢谢配合。**

**附表2：**

铝、锌期权生产系统演练反馈表（信息商）

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **信息商情况** | | | | | | | |
| 公司名称 |  | | | | 登录用户名 | |  |
| 技术系统  联系人 | 姓名： | | | 电话： | | | |
| Email： |  | | | | | |
| **测试情况** | | | | | | | |
| **测试项目** | | | **情况描述** | | | **备注** | | |
| 使用上期所席位登录是否正常 | | |  | | |  | | |
| 通过上期所席位接收铝、锌期权行情是否正常（含移动终端） | | |  | | |  | | |
| 使用上期所的席位应不能接收到上期所以外的合约行情 | | |  | | |  | | |
| 系统恢复是否正常（备注完成时间） | | |  | | |  | | |

填表日期： 填表人：

**此表需在测试后的第一个工作日12:00前通过电子邮件方式，递交到信息管理部，邮箱：**[**xxgl@shfe.com.cn**](mailto:xxgl@shfe.com.cn)

**谢谢配合。**