附件

铅、镍、锡和氧化铝期权第二次生产系统

演练指南

一、期权挂牌标的合约

铅期权挂牌标的合约PB2412、PB2501。

镍期权挂牌标的合约NI2412、NI2501。

锡期权挂牌标的合约SN2412、SN2501。

氧化铝期权挂牌标的合约AO2412、AO2501。

二、测试时间安排

2024年8月31日（周六）测试安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 9月2日交易 | 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 |

2024年8月31日（周六）上午测试采用8月30日（周五）连续交易的数据，模拟9月2日（周一）的日盘交易。

三 、期权测试用参数

**（一）铅、镍、锡和氧化铝期权合约**

铅、镍、锡和氧化铝期权合约请参见《上海期货交易所就铅、镍、锡和氧化铝期货期权合约公开征求意见的公告》，链接为：

https://www.shfe.com.cn/publicnotice/notice/202407/t20240716\_801997.html

**（二）相关测试用参数**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 铅期权测试用参数值 | 镍、锡期权测试用参数值 | 氧化铝期权测试用参数值 |
| 投机交易手续费 | 2元/手 | 1.5元/手 | 3.5元/手 |
| 套保交易手续费 | 1元/手 | 0.75元/手 | 1.75元/手 |
| 投机/套保交易手续费平今优惠 | 免收平今手续费 | 免收平今手续费 | 免收平今手续费 |
| 行权（履约）手续费 | 2元/手 | 1.5元/手 | 3.5元/手 |
| 行权前期权自对冲手续费 | 2元/手 | 1.5元/手 | 3.5元/手 |
| 做市商期权自对冲手续费 | 免收手续费 | 免收手续费 | 免收手续费 |
| 行权后期货自对冲手续费 | 免收手续费 | 免收手续费 | 免收手续费 |
| 无风险利率 | 1.5% | 1.5% | 1.5% |
| 限价单最小下单量 | 1手 | 1手 | 1手 |
| 限价单最大下单量 | 100手 | 100手 | 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 | 非期货公司会员 | 客户 |
| 铅期权 | 5000 | 5000 | 1800 | 1800 |
| 镍期权 | 6000 | 6000 | 1800 | 1800 |
| 锡期权 | 1500 | 1500 | 600 | 600 |
| 氧化铝期权 | 5000 | 5000 | 1800 | 1800 |

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：

https://www.shfe.com.cn/services/technology/technical\_download/201906/t20190612\_794627.html

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。

（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）应重点关注铅、镍、锡和氧化铝期权的交易情况。

（四）测试完成后请会员单位在上期所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“20240831生产系统演练反馈”的记录进行操作。

（五）各行情转发单位应填写《铅、镍、锡和氧化铝期权第二次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。

（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

传真：021-68400385

特此通知。

附表：1．铅、镍、锡和氧化铝期权第二次生产系统演练

反馈表（会员）

2．铅、镍、锡和氧化铝期权第二次生产系统演练

反馈表（信息商）

附表1

铅、镍、锡和氧化铝期权第二次生产系统演练

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□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 |  |
| **测试情况** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **测试项目** | **测试场景描述** | **备注** |
| 与交易所系统连接 | 1、是否连接到交易所正常交易2、一代行情是否正常3、二代行情是否正常 |  |
| 查询合约、接收合约状态切换信息 | 查询铅、镍、锡和氧化铝期权合约正常接收,合约状态切换信息正常 |  |
| 投资者报撤单 | 铅、镍、锡和氧化铝期权合约报单、撤单、开/平仓、成交回报是否正常 |  |
| 普通客户询价 | 普通客户对铅、镍、锡和氧化铝期权合约询价 |  |
| 做市商报价 | 做市商对铅、镍、锡和氧化铝期权合约报价 |  |
| 通过交易指令对铅、镍、锡和氧化铝期权提交申请 | 提交行权申请(可选行权后的期货自对冲)、提交自对冲申请(可选期权自对冲、做市商留仓、履约后的期货自动冲)、提交放弃期权行权申请 |  |
| 投资者对铅、镍、锡和氧化铝期权合约下套保单 | 对铅、镍、锡和氧化铝期权合约下套保单 |  |
| 对投资者进行实时风险监控 | 对投资者进行实时风险监控，检查客户是否有异常交易情况，并提出预警 |  |

填表日期： 填表人：

**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所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“20240831生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

附表2

铅、镍、锡和氧化铝期权第二次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铅、镍、锡和氧化铝期权行情是否正常（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，递交到数据管理部，邮箱：xxgl@shfe.com.cn谢谢配合。**