附件1

新型组合保证金第二次全市场生产系统

演练指南

一、测试时间安排

2024年9月21日（周六）测试采用9月19日（周四）结算后的数据，模拟9月20日（周五）、9月23日（周一）两个交易日的交易和结算。

1. 2024年9月21日（周六）上午测试内容

周六上午模拟交易日9月20日（周五），测试重点包括：配置/导入组保参数，配置组保客户，结算时启用组保算法，验证结算时不同客户的组保与单向大边是否正常，以及当日报送结算结果是否正确。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 9月20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 |
| 09:30:00 | 收市 |
| 9月20日结算和数据报送 | 9:30-10:30 | 交易所结算 |
| 10:30-11:30 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 12:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

（二）2024年9月21日（周六）下午测试内容

周六下午模拟交易日9月23日（周一），组保测试重点包括：盘中客户组保开始生效，验证交易与结算时组保与单向大边是否正常，当日报送结算结果是否正确。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 9月23日交易 | 13:00:00 | 集合竞价申报 |
| 13:04:00 | 集合竞价撮合 |
| 13:05:00 | 连续交易 |
| 15:00:00 | 收市 |
| 9月23日结算和数据报送 | 15:00-16:00 | 交易所结算 |
| 16:00-17:00 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 17:30前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

二、组保**保证金**参数

**（一）客户保证金算法**

如果会员单位系统已升级至支持新型组合保证金业务的版本，请在9月19日17:00前向结算部提交开启新组保的客户名单，格式如下：

**上期所新组保全市场演练客户开通申请表**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **交易所** | **会员简称** | **会员号** | **客户号** | **组保客户优惠分类** |
| 上期所 | XX期货 | 0001 | 87000000 | 组保做市商 |
| 00000001 | 组保普通客户 |
| 00000002 | 组保普通客户 |

每个会员可申请名下所有做市商客户以及最多不超过2个非做市商客户参与演练，请发送邮件至qian.lele@shfe.com.cn、li.jiaqi@shfe.com.cn, 联系电话: 021-68401487、68402172。系统未升级至组保版本的会员仍然使用单向大边计算保证金。

**（二）商品组、商品群、组保优惠参数**

见附件2《上期新型组合保证金业务参数》，周六上午（模拟9月20日）结算后的结算文件中也包含该参数，会员可根据系统支持方式选择手工录入或导入文件。

三、套保额度申请

会员可在测试当日通过上期所会员服务测试系统为客户申请套期保值额度，请使用套保用户申请，密码同生产。建议各会员提前检查套保账号，确保测试当日可以及时进行套保额度的申请。测试当日交易时段，交易所会实时审批套期保值申请。

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；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。

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、4903、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/201908/t20190822\_794941.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）会服API接口测试系统**

会服API接口测试地址为192.168.9.219，端口号为443。用户名、密码以及证书信息同生产系统。

**（五）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：

42.0.10.27（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）请升级系统以支持监控中心数据报送接口4.6版本。**

（二）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。

（三）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。

（四）应重点关注新型组合保证金的测试。

（五）测试完成后请各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“20240921生产系统演练反馈”的记录进行操作。

（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

信科一部：

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：上期所新型组合保证金第二次生产系统演练反馈表

**附表**

上期所新型组合保证金第二次生产系统演练反馈表

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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** | |
| 系统备份 | | | 系统和数据是否备份 | | |  | |
| 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 | | |  | |
| 投资者期货报单、撤单 | | | 在期货合约报单、撤单、开/平仓、成交回报、组合保证金、单向大边保证金是否正常 | | |  | |
| 投资者期权报单、撤单、询价 | | | 在期权合约报单、撤单、询价、开/平仓、成交回报、组合保证金、单向大边保证金是否正常 | | |  | |
| 投资者下套保单 | | | 选择任意合约进行套保报单，形成套保持仓，确认套保头寸组合保证金是否正常。 | | |  | |
| 投资者跨品种组合持仓 | | | 客户有跨品种商品群的各品种交易权限的，可选取一个跨品种商品群形成组合头寸，确认组合保证金计算是否正常 | | |  | |
| 合约临近交割退出组合优惠 | | | 新组保业务中，合约在最后交易日前5日退出组合优惠。请选择符合条件的合约进行报单，成交并形成组合持仓，确认组合保证金计算是否正确 | | |  | |
| 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 | | |  | |
| 结算文件导入 | | | 新组保业务新增了4个结算文件，确认是否成功导入。结算文件可以从会服系统下载也可以通过API接口自动获取 | | |  | |
| 保证金算法 | | | 申请开通组保业务的客户使用组合保证金计算，其中做市商享受组保做市商优惠，非做市商客户享受组保普通客户优惠；未申请的客户使用单向大边计算保证金。 | | |  | |
| 系统结算 | | | 结算流程是否正常 | | |  | |
| 结算结果核对 | | | 结算结果核对正确；组合保证金和单向大边的客户按照不同算法计算保证金正确 | | |  | |
| 未升级会员交易是否正常 | | | 如会员生产系统未升级至支持组合保证金版本，则确认交易所组保业务试点开启后交易是否正常 | | |  | |
| 未升级会员结算是否正常 | | | 如会员生产系统未升级至支持组合保证金版本，则确认交易所组保业务试点开启后结算是否正常 | | |  | |
| 盘后数据报送 | | | 盘后数据报送文件是否正确 | | |  | |
| 其它故障 | | | 测试过程中未发生其它故障 | | |  | |
| 系统恢复 | | | 系统恢复是否正常 | | |  | |

填表日期： 填表人：

**注：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“20240921生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**