附件2

上期新型组合保证金业务参数

一、组保商品组

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 商品组名称 | 商品组代码 | 产品代码 |
| 1 | 白银商品组 | agc | ag\_f |
| 2 | ag\_o |
| 3 | 铝商品组 | alc | al\_f |
| 4 | al\_o |
| 5 | 氧化铝商品组 | aoc | ao\_f |
| 6 | ao\_o |
| 7 | 黄金商品组 | auc | au\_f |
| 8 | au\_o |
| 9 | 铜(BC)商品组 | bcc | bc\_f |
| 10 | 丁二烯橡胶商品组 | brc | br\_f |
| 11 | br\_o |
| 12 | 石油沥青商品组 | buc | bu\_f |
| 13 | 铜商品组 | cuc | cu\_f |
| 14 | cu\_o |
| 15 | SCFIS欧线商品组 | ecc | ec\_f |
| 16 | 燃料油商品组 | fuc | fu\_f |
| 17 | 热轧卷板商品组 | hcc | hc\_f |
| 18 | 低硫燃料油商品组 | luc | lu\_f |
| 19 | 镍商品组 | nic | ni\_f |
| 20 | ni\_o |
| 21 | 20号胶商品组 | nrc | nr\_f |
| 22 | 铅商品组 | pbc | pb\_f |
| 23 | pb\_o |
| 24 | 螺纹钢商品组 | rbc | rb\_f |
| 25 | rb\_o |
| 26 | 天然橡胶商品组 | ruc | ru\_f |
| 27 | ru\_o |
| 28 | 原油商品组 | scc | sc\_f |
| 29 | sc\_o |
| 30 | 锡商品组 | snc | sn\_f |
| 31 | sn\_o |
| 32 | 纸浆商品组 | spc | sp\_f |
| 33 | 不锈钢商品组 | ssc | ss\_f |
| 34 | 线材商品组 | wrc | wr\_f |
| 35 | 锌商品组 | znc | zn\_f |
| 36 | zn\_o |

注1：ag\_f指白银期货，ag\_o指白银期权。其他品种名称规则与此一致。

注2：结算文件SpmmInstrumentParam中下发合约所属商品组信息。

二、组保商品群

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 商品群代码 | 商品群名称 | 商品组代码 | 商品组  名称 |
| 1 | AgGroup | 白银商品群 | agc | 白银商品组 |
| 2 | AlGroup | 铝商品群 | alc | 铝商品组 |
| 3 | AoGroup | 氧化铝商品群 | aoc | 氧化铝商品组 |
| 4 | AuGroup | 黄金商品群 | auc | 黄金商品组 |
| 5 | BcGroup | 铜(BC)商品群[[1]](#footnote-1) | bcc | 铜(BC)商品组 |
| 6 | BrGroup | 丁二烯橡胶商品群 | brc | 丁二烯橡胶商品组 |
| 7 | BuGroup | 石油沥青商品群 | buc | 石油沥青商品组 |
| 8 | CuGroup | 铜商品群 | cuc | 铜商品组 |
| 9 | EcGroup | SCFIS欧线商品群 | ecc | SCFIS欧线商品组 |
| **10** | **EnergyGroup** | **能源商品群** | **luc** | **低硫燃料油商品组** |
| **11** | **scc** | **原油商品组** |
| **12** | **FerrousGroup** | **黑色金属商品群** | **hcc** | **热轧卷板商品组** |
| **13** | **rbc** | **螺纹钢商品组** |
| 14 | FuGroup | 燃料油商品群 | fuc | 燃料油商品组 |
| 15 | NiGroup | 镍商品群 | nic | 镍商品组 |
| 16 | NrGroup | 20号胶商品群 | nrc | 20号胶商品组 |
| 17 | PbGroup | 铅商品群 | pbc | 铅商品组 |
| 18 | RuGroup | 天然橡胶商品群 | ruc | 天然橡胶商品组 |
| 19 | SnGroup | 锡商品群 | snc | 锡商品组 |
| 20 | SpGroup | 纸浆商品群 | spc | 纸浆商品组 |
| 21 | SsGroup | 不锈钢商品群 | ssc | 不锈钢商品组 |
| 22 | WrGroup | 线材商品群 | wrc | 线材商品组 |
| 23 | ZnGroup | 锌商品群 | znc | 锌商品组 |

注1：结算文件SpmmInstrumentParam中下发合约所属商品群信息。

三、组保业务参数

**客户类型枚举值：**

“1”: 组保普通客户

“2”: 组保做市商

**（一）组保做市商**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 组保优惠分类 | 商品群代码 | 商品群 | 期权纯粹价格风险比例 | 跨期优惠系数 | 跨品种优惠系数 | 最小保证金比例 |
| 1 | 组保做市商 | AgGroup | 白银商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 2 | 组保做市商 | AlGroup | 铝商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 3 | 组保做市商 | AoGroup | 氧化铝商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 4 | 组保做市商 | AuGroup | 黄金商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 5 | 组保做市商 | BcGroup | 铜(BC)商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 6 | 组保做市商 | BrGroup | 丁二烯橡胶商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 7 | 组保做市商 | BuGroup | 石油沥青商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 8 | 组保做市商 | CuGroup | 铜商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 9 | 组保做市商 | EcGroup | SCFIS欧线商品群 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 10 | 组保做市商 | EnergyGroup | 能源商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 11 | 组保做市商 | FerrousGroup | 黑色金属商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 12 | 组保做市商 | FuGroup | 燃料油商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 13 | 组保做市商 | NiGroup | 镍商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 14 | 组保做市商 | NrGroup | 20号胶商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 15 | 组保做市商 | PbGroup | 铅商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 16 | 组保做市商 | RuGroup | 天然橡胶商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 17 | 组保做市商 | SnGroup | 锡商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 18 | 组保做市商 | SpGroup | 纸浆商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 19 | 组保做市商 | SsGroup | 不锈钢商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 20 | 组保做市商 | WrGroup | 线材商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 21 | 组保做市商 | ZnGroup | 锌商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |

**（二）组保普通客户**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 组保优惠分类 | 商品群代码 | 商品群 | 期权纯粹价格风险比例 | 跨期优惠系数 | 跨品种优惠系数 | 最小保证金比例 |
| 1 | 组保普通客户 | AgGroup | 白银商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 2 | 组保普通客户 | AlGroup | 铝商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 3 | 组保普通客户 | AoGroup | 氧化铝商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 4 | 组保普通客户 | AuGroup | 黄金商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 5 | 组保普通客户 | BcGroup | 铜(BC)商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 6 | 组保普通客户 | BrGroup | 丁二烯橡胶商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 7 | 组保普通客户 | BuGroup | 石油沥青商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 8 | 组保普通客户 | CuGroup | 铜商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 9 | 组保普通客户 | EcGroup | SCFIS欧线商品群 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 10 | 组保普通客户 | EnergyGroup | 能源商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 11 | 组保普通客户 | FerrousGroup | 黑色金属商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 12 | 组保普通客户 | FuGroup | 燃料油商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 13 | 组保普通客户 | NiGroup | 镍商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 14 | 组保普通客户 | NrGroup | 20号胶商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 15 | 组保普通客户 | PbGroup | 铅商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 16 | 组保普通客户 | RuGroup | 天然橡胶商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 17 | 组保普通客户 | SnGroup | 锡商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 18 | 组保普通客户 | SpGroup | 纸浆商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 19 | 组保普通客户 | SsGroup | 不锈钢商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 20 | 组保普通客户 | WrGroup | 线材商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 21 | 组保普通客户 | ZnGroup | 锌商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |

注：相关参数通过结算文件SpmmBusinessParam下发。

**四、合约不参与优惠**

1. EC全系合约不参与优惠计算。
2. 其他品种最后交易日前5日退出优惠。

注：合约是否参与优惠参数通过结算文件SpmmInstrumentParam下发。其中MarginCalc值等于1时为不参与优惠，值等于3时为参与优惠。

**五、客户组保分类**

注1：客户是否启用组保手工设置，结算文件不下发此信息。

注2：客户所属组保分类通过SpmmClientCategory下发。数据含义为如果客户启用组保，则该客户所属的组保分类（在业务试点阶段，该文件中对于未启用组保的客户也进行了分类，是在组保与单向大边并行阶段正常现象）。

1. 铜(BC)的括号为英文输入法下的括号 [↑](#footnote-ref-1)