附件

铸造铝合金期货及期权业务全市场生产系统演练指南

一、铸造铝合金期货挂牌合约

AD2511、AD2512、AD2601、AD2602、AD2603、AD2604、AD2605

二、铸造铝合金期权挂牌标的合约

AD2511、AD2512

三、测试时间安排

**（一）2025年6月1日（周日）测试安排**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟交易日 | 演练时间 | 内容 |
| 模拟第一个交易日夜盘 | 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 |
| 09:10:00 | 连续交易暂停 |
| 模拟第一个交易日日盘（铸造铝合金期货上市） | 09:25:00 | 集合竞价申报 |
| 09:29:00 | 集合竞价撮合 |
| 09:30:00 | 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 |
| 11:30-12:30 | 交易所结算 |
| 12:30-13:25 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 13:25前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |
| 模拟第二个交易日（铸造铝合金期权上市） | 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 |
| 15:00-16:00 | 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 |
| 17:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

2025年6月1日（周日）上午测试采用5月29日（周四）结算后的数据，模拟5月30日（周五）的交易和结算。6月1日（周日）下午测试模拟6月3日（周二）的交易和结算。

**（二）2025年6月7日（周六）测试安排**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟交易日 | 演练时间 | 内容 |
| 模拟第一个交易日夜盘 | 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 |
| 09:10:00 | 连续交易暂停 |
| 模拟第一个交易日日盘（铸造铝合金期货上市） | 09:25:00 | 集合竞价申报 |
| 09:29:00 | 集合竞价撮合 |
| 09:30:00 | 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 |
| 11:30-12:30 | 交易所结算 |
| 12:30-13:25 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 13:25前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |
| 模拟第二个交易日（铸造铝合金期权上市） | 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 |
| 15:00-16:00 | 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 |
| 17:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

2025年6月7日（周六）上午测试采用6月5日（周四）结算后的数据，模拟6月6日（周五）的交易和结算。6月7日（周六）下午测试模拟6月9日（周一）的交易和结算。

四、铸造铝合金期货测试参数

**（一）期货相关测试参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 测试用参数值 |
| 上市交易所 | 上海期货交易所 |
| 交易代码 | AD |
| 交易品种 | 铸造铝合金 |
| 交易单位 | 10吨/手 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 5元/吨 |
| 合约月份 | 1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12月 |
| 最后交易日 | 合约月份的15日（遇国家法定节假日顺延） |
| 交割日期 | 最后交易日后连续二个交易日 |
| 实际执行涨跌停板幅 | ±7% |
| 首日涨跌停板幅 | ±14% |
| 实际执行保证金率 | 投机：9% 套保：8% |
| 交割方式 | 实物交割 |
| 交割单位 | 30吨 |
| 投机交易手续费 | 成交金额的万分之一 |
| 投机交易平今手续费 | 成交金额的万分之一 |
| 套保交易手续费 | 成交金额的万分之零点五 |
| 套保交易平今手续费 | 成交金额的万分之零点五 |
| 限价单最小下单量（合约上市之日起） | 1手 |
| 限价单最小下单量（交割月第一个交易日起） | 3手 |
| 限价单最大下单量 | 500手 |

**（二）持仓限额**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 参数名称 | 测试用参数值 | |
| 持仓限制  （合约挂牌至交割月份，期货公司会员） | （某一期货合约持仓量≥9000手）：25% | |
| 持仓限制  （非期货公司会员、客户） | 合约挂牌至交割月前第二月的最后一个交易日 | （某一期货合约持仓量≥9000手）：10%  （某一期货合约持仓量＜9000手）：900 |
| 交割月前第一月 | 300 |
| 交割月份 | 90 |

五、铸造铝合金期权测试参数

**（一）期权合约**

|  |  |
| --- | --- |
| **参数名称** | **目标值** |
| 合约标的物 | 铸造铝合金期货合约（10吨） |
| 合约类型 | 看涨期权，看跌期权 |
| 交易单位 | 1手铸造铝合金期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 1元/吨 |
| 涨跌停板幅度 | 与标的期货合约涨跌停板幅度相同 |
| 合约月份 | 最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌，具体数值交易所另行发布 |
| 交易时间 | 上午9:00-11:30下午13:30-15:00及交易所规定的其他时间 |
| 最后交易日 | 标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日 |
| 到期日 | 同最后交易日 |
| 行权价格 | 行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格≤10000元/吨，行权价格间距为50元/吨；10000元/吨＜行权价格≤20000元/吨，行权价格间距为100元/吨；行权价格＞20000元/吨，行权价格间距为200元/吨 |
| 行权方式 | 美式。买方可以在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可以在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请 |
| 交易代码 | 看涨期权：AD-合约月份-C-行权价格  看跌期权：AD-合约月份-P-行权价格 |
| 上市交易所 | 上海期货交易所 |

**（二）期权相关测试参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 参数名称 | 测试用参数值 |
| 投机交易手续费 | 10元/手 |
| 套保交易手续费 | 5元/手 |
| 投机交易手续费平今优惠 | 免收平今手续费 |
| 套保交易手续费平今优惠 | 免收平今手续费 |
| 行权（履约）手续费 | 10元/手 |
| 行权前期权自对冲手续费 | 10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 |
| 挂牌标的合约持仓量阈值 | 10000手（单边） |

**（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） | |
|
| 持仓限额(手，单边) | | 持仓限额(手，单边) | |
| 非期货公司会员 | 客户 | 非期货公司会员 | 客户 |
| 铸造铝合金期权 | 900 | 900 | 300 | 300 |

六、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，请使用套保用户（命名规则为H+会员号+‘.’+操作员，后期新申请的用户命名规则为会员号+TB01/02）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。

七、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、33011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。

八、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）应重点关注铸造铝合金期货及期权业务的测试。

（四）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“20250601/20250607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《铸造铝合金期货及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。

九、联系方式

联系电话：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.铸造铝合金期货及期权生产系统演练反馈表（会员）

2.铸造铝合金期货及期权生产系统演练反馈表（信息

商）

附表1

铸造铝合金期货及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□  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 | | |  | |
| 查询合约、接收合约状态切换信息 | | | 查询铸造铝合金期货及期权合约正常接收, 铸造铝合金期货及期权合约状态切换信息正常 | | |  | |
| 投资者报单、撤单 | | | 铸造铝合金期货及期权合约报单、撤单、开/平仓、成交回报是否正常 | | |  | |
| 普通客户询价 | | | 普通客户对铸造铝合金期权合约询价 | | |  | |
| 做市商报价 | | | 做市商对铸造铝合金期权合约报价 | | |  | |
| 通过交易指令对铸造铝合金期权 | | | 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 | | |  | |
| 通过会员服务系统对铸造铝合金期权 | | | 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 | | |  | |
| 投资者对铸造铝合金期货及期权合约下套保单 | | | 对铸造铝合金期货及期权合约下套保单 | | |  | |
| 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 | | |  | |
| 结算文件导入 | | | 结算文件导入成功。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 | | |  | |
| 系统结算 | | | 结算流程是否正常 | | |  | |
| 结算结果核对 | | | 核对结果正确：上期所成交、资金、投资者持仓、会员持仓等核对正确 | | |  | |
| 盘后数据报送 | | | 盘后数据报送是否完成 | | |  | |
| 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“20250601/20250607生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

附表2

铸造铝合金期货及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铸造铝合金期货及期权行情是否正常（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**](mailto:xxgl@shfe.com.cn) **谢谢配合。**