附件

模拟新品种生产系统演练指南

一、模拟期权挂牌合约月份

RB2303、RB2304以及后续持仓量超过10万手的标的期货合约

AG2303、AG2304以及后续持仓量超过2万手的标的期货合约

二、模拟期货挂牌合约

AO2304、AO2305、AO2306、AO2307、AO2308、AO2309、AO2310、AO2311

三、测试时间安排

**（一）2022年12月3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，测试场景为增挂2个期权品种 | 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 |
| 11:30-12:30 | 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，测试场景为增挂1个期货品种 | 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 |

2022年12月3日（周六）上午测试采用12月1日（周四）结算后的数据，模拟12月2日（周五）的交易和结算。12月3日（周六）下午测试模拟12月5日（周一）的交易和结算。

**（二）2022年12月10日（周六）测试安排**

测试场景为增挂2个期权品种 + 1个期货品种，以及模拟日盘增加一次集合竞价。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **模拟阶段** | **演练时间** | **内容** |
| 模拟夜盘交易 | 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 |
| 09:50:00 | 连续交易暂停 |
| 模拟日盘交易，增加一次集合竞价 | 09:55:00 | 集合竞价申报 |
| 09:59:00 | 集合竞价撮合 |
| 10:00:00 | 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 |
| 结算和数据报送 | 11:30-12:30 | 交易所结算 |
| 12:30-13:30 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 13:30前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

测试采用12月8日（周四）结算后的数据。请会员在周六演练前自行完成12月9日的结算（12月9日无交易数据）。周六上午模拟12月12日（周一）的交易和结算。

四、新期权测试用参数

**（一）RB期权合约测试用参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 合约类型 | 看涨期权，看跌期权 |
| 交易单位 | 1手期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 0.5元/吨 |
| 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≤2500元/吨，行权价格间距为20元/吨；2500元/吨＜行权价格≤5000元/吨，行权价格间距为50元/吨；行权价格＞5000元/吨，行权价格间距为100元/吨 |
| 交易代码 | 看涨期权：RB-合约月份-C-行权价格看跌期权：RB-合约月份-P-行权价格 |

**（二）AG期权合约测试用参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 合约类型 | 看涨期权，看跌期权 |
| 交易单位 | 1手期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/千克 |
| 最小变动价位 | 0.5元/千克 |
| 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≤2500元/千克，行权价格间距为20元/千克；2500元/千克＜行权价格≤5000元/千克，行权价格间距为50元/千克；行权价格＞5000元/千克，行权价格间距为100元/千克 |
| 交易代码 | 看涨期权：AG-合约月份-C-行权价格看跌期权：AG-合约月份-P-行权价格 |

**（三）相关测试用参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 参数值 |
| 交易手续费 | 2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 | 2元/手 |
| 行权前期权自对冲手续费 | 2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 |
| 涨跌停板幅度 | 与标的期货合约涨跌停板幅度相同 |
| 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 |

**（四）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 |
| RB期权 | 90000 | 90000 | 4500 | 4500 |
| AG期权 | 18000 | 9000 | 5400 | 2700 |

五、新期货测试用参数

**（一）相关测试用模拟参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 参数值 |
| 模拟代码 | AO |
| 交易单位 | 20吨/手 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 1元/吨 |
| 涨跌停板幅度 | 10％ |
| 交易保证金 | 合约价值的12％ |
| 交易手续费 | 1元/手 |
| 交易手续费平今优惠 | 平今仓免收交易手续费 |
| 限价单最小下单量 | 1手 |
| 限价单最大下单量 | 500手 |

**（二）持仓限额**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 合约挂牌至交割月份 | 合约挂牌至交割月前第二月的最后一个交易日 | 交割月前第一月 | 交割月份 |
| 某一期货合约持仓量 | 限仓比例（%） | 某一期货合约持仓量 | 限仓比例（%）和限仓数额（手） | 限仓数额（手） | 限仓数额（手） |
| 期货公司会员 | 非期货公司会员/客户 | 非期货公司会员/客户 | 非期货公司会员/客户 |
| ≥5万手 | 25 | ≥5万手 | 10 | 1800 | 600 |
| ＜5万手 | 5000 |

六、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。

七、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）应重点注意模拟新品种的交易情况。

（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“20221203/20221210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《模拟新品种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。

八、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．模拟新品种生产系统演练反馈表（会员）

2．模拟新品种生产系统演练反馈表（信息商）

附表1

模拟新品种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 |  |  |
| 日盘集合竞价阶段撤销夜盘报单是否正常（12月10日） |  |  |
| 新期权、新期货合约的一代行情是否正常 |  |  |
| 新期权、新期货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） |  |  |
| 新期权、新期货合约报单、撤单、开/平仓、成交回报是否正常 |  |  |
| 普通客户对新期权合约询价 |  |  |
| 做市商对新期权合约报价 |  |  |
| 通过交易指令对新期权 | 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新期权 | 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 |  |  |
| 结算是否正常 |  |  |
| 盘后数据报送是否完成 |  |  |
| 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“20221203/20221210生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

附表2

模拟新品种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新期权、新期货行情是否正常（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。**