附件

氧化铝期货以及差异化收取保证金生产系统演练指南

一、氧化铝期货挂牌合约

AO2311、AO2312、AO2401、AO2402、AO2403、AO2404、AO2405、AO2406

二、测试时间安排

**（一）2023年6月10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（结算时起启用差异化保证率设置） | 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 |
| 11:00:00 | 收市 |
| 11:00-12:00 | 交易所结算 |
| 12:00-12:55 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 12:55前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |
| 模拟第二个交易日 | 12:55:00 | 集合竞价申报 |
| 12:59:00 | 集合竞价撮合 |
| 13:00:00 | 连续交易 |
| 14:00:00 | 收市 |
| 14:00-15:00 | 交易所结算 |
| 15:00-16:00 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 16:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

2023年6月10日（周六）上午测试采用6月8日（周四）结算后的数据，模拟6月9日（周五）的交易和结算，上午结算时起启用差异化保证率设置。6月10日（周六）下午测试模拟6月12日（周一）的交易和结算。

**（二）2023年6月17日（周六）测试安排**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 模拟日盘交易 | 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 |
| 10:15:00 | 连续交易暂停 |
| 10:30:00 | 连续交易 |
| 11:00:00 | 收市 |

6月17日（周六）测试采用6月16日（周五）连续交易的数据，模拟6月19日（周一）的日盘交易。

三、氧化铝期货测试用参数

**（一）氧化铝期货合约**

氧化铝期货合约请参见《上海期货交易所就氧化铝期货合约和相关业务规则公开征求意见的公告》，链接为：

https://www.shfe.com.cn/news/notice/911402870.html

**（二）相关测试用参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 参数值 |
| 交易代码 | AO |
| 交易品种 | 氧化铝 |
| 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 |
| 合约月份 | 1~12月 |
| 涨跌停板幅度 | 7％ |
| 交易保证金率 | 9％ |
| 交易手续费 | 成交金额的万分之零点一 |
| 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（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） | 15手 |
| 限价单最大下单量 | 500手 |

**（三）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 |

四、差异化保证金率参数

投机和套保头寸以不同的交易保证金率来收取保证金，如遇交易保证金水平与现行执行的不同时，则按保证金水平高的执行，即一旦出现涨跌停板、进入临近交割月或交割月等情况时，采用从高适用保证金原则。为测试需要，在如下四个品种上设置差异化保证金率，铅的投机保证金率设置为18%，其他品种保证金率按现行参数设置。

|  |  |
| --- | --- |
| 品种 | 保证金率 |
| 投机 | 套保 |
| % | % |
| 铜 | 9 | 8 |
| 热轧卷板 | 13 | 12 |
| 铅 | 18 | 8 |
| 天然橡胶 | 10 | 9 |

五、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。

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）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：

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）应重点注意氧化铝期货、保证金率设置、保证金计算以及相关资金报表的测试。

（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“20230610/20230617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《氧化铝期货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

**信科一部：**

值班电话：021-68400802

电子邮箱：tech@shfe.com.cn

传真：021-68400385

**结算部：**

值班电话：021-68400421、021-68400422

**交易部（6月10日套保审批）：**

电话：021-20616047、68400639

特此通知。

附表：1．氧化铝期货生产系统演练反馈表（会员）

2．氧化铝期货生产系统演练反馈表（信息商）

附表1

氧化铝期货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 | 查询氧化铝期货合约正常接收, 氧化铝期货合约状态切换信息正常 |  |
| 投资者报单、撤单 | 氧化铝期货合约报单、撤单、开/平仓、成交回报是否正常 |  |
| 差异化保证金设置 | 保证金率是否分投机、套保设置 |  |
| 盘中检查投机和保值保证金 | 6月10日模拟第二交易日时，盘中建立期货、期权投机和保值持仓，检查保证金是否正确；申请天胶期权保值持仓行权 |  |
| 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。请会员通过以下菜单进行新版结算文件下载：当日结算文件下载：“业务窗口-〉每日报表-〉最新业务数据文件（新版）”。历史交易日结算文件下载：“业务窗口-〉每日报表-〉历史业务数据文件（新版）”。 |  |
| 系统结算 | 结算流程是否正常 |  |
| 盘后结算检查投机和保值保证金 | 盘后结算检查期货、期权投机和保值保证金是否正确 |  |
| 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：

**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“20230610/20230617生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

附表2

氧化铝期货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氧化铝期货行情是否正常（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。**