附件

新一代交易系统测试指南

一、参加单位

上期所会员和行情转发单位。

二、时间安排

（一）2024年3月30日（周六）测试安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 时间 | 内容 |
| 3月29日夜盘交易 | 08:30:00 | 会员登录新一代交易系统 |
| 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 | 暂停交易 |
| 3月29日日盘交易 | 09:45:00 | 会员登录新一代交易系统 |
| 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 |
| 10:10:00 | 模拟前置机故障 |
| 10:30:00 | 收市 |
| 3月29日结算和数据报送 | 10:30-11:30 | 交易所结算 |
| 11:30-12:30 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 12:30前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |
| 4月1日交易 | 12:30:00 | 会员登录新一代交易系统 |
| 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 |
| 14:30:00 | 收市 |
| 4月1日结算和数据报送 | 14:30-15:30 | 交易所结算 |
| 15:30-16:30 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 16:30前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

测试采用3月28日（周四）结算后的数据，交易日为3月29日（周五）和4月1日（周一）。

（二）2024年4月13日（周六）测试安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 时间 | 内容 |
| 4月12日交易 | 08:30:00 | 会员登录新一代交易系统 |
| 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 |
| 10:30:00 | 切回当前生产交易系统 |
| 10:40:00 | 连续交易 |
| 11:30:00 | 收市 |
| 4月12日结算和数据报送 | 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 |
| 14:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

测试采用4月11日（周四）结算后的数据，交易日为4月12日（周五）。

4月13日（周六）安排部分品种差异化手续费测试，手续费参数如下：

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **品种代码** | **品种名称** | **品种类别** | **交易时间段** | **合约月份** | **投机手续费率** | **套保手续费率** | **投机手续费率单价** | **套保手续费率单价** |
| AU | 黄金 | 期货 | 合约挂牌之日起 | 默认 | 0 | 0 | 2 | 1 |
| 合约挂牌之日起 | 2月 | 0 | 0 | 2 | 1 |
| 交割月前第二月的第一个交易日起 | 2月 | 0 | 0 | 10 | 5 |
| 合约挂牌之日起 | 4月 | 0 | 0 | 2 | 1 |
| 交割月前第二月的第一个交易日起 | 4月 | 0 | 0 | 10 | 5 |
| 合约挂牌之日起 | 6月 | 0 | 0 | 10 | 5 |
| 合约挂牌之日起 | 8月 | 0 | 0 | 2 | 1 |
| 交割月前第二月的第一个交易日起 | 8月 | 0 | 0 | 10 | 5 |
| 合约挂牌之日起 | 10月 | 0 | 0 | 2 | 1 |
| 交割月前第二月的第一个交易日起 | 10月 | 0 | 0 | 10 | 5 |
| 合约挂牌之日起 | 12月 | 0 | 0 | 10 | 5 |
| AU | 黄金 | 期权 | 合约挂牌之日起 | 默认 | 0 | 0 | 2 | 1 |
| CU | 铜 | 期货 | 合约挂牌之日起 | 默认 | 0.00005 | 0.000025 | 0 | 0 |
| CU | 铜 | 期权 | 合约挂牌之日起 | 默认 | 0 | 0 | 5 | 2.5 |

三、通讯参数

交易系统和二代行情平台使用生产环境，会员服务系统和会员API接口系统使用会员测试环境。

**（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。

各单位的网络安全控制策略应打开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。请确保上述网段及协议端口的通讯正常。

**（二）二代行情平台**

二代行情平台参数请参照上期所网站链接：

http://www.shfe.com.cn/bourseService/technology/download/911334678.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>

用户名、密码同生产环境。

**（四）会服API接口测试系统**

专线地址：192.168.9.219，端口：443。

用户名、密码及证书同生产环境。

**（五）期货市场监控中心盘后数据报送**

证联网地址：42.0.10.27，端口：9000。

用户名、密码同生产环境。

四、测试内容

**（一）交易方面**

请各会员单位对在用的每个柜台系统至少安排一个席位参加测试，确保在用的柜台系统登录、交易、行情、查询等功能正常。每个席位测试内容不低于以下要求：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 期货报单 | 期权报单 | 报价 | 撤单 | 成交 | 行权 |
| 800笔 | 100笔 | 100笔 | 30笔 | 400笔 | 5笔 |

有条件的会员参加报价测试。

**（二）结算方面**

交易测试完成后，交易所将会发布结算文件，请各会员下载结算文件，核对结算结果，并向监控中心报送盘后数据。

五、测试要求

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，仔细核对数据。

（二）测试前做好系统和数据备份，测试后恢复备份，确保不影响下一交易日的正常业务。

（三）应重点关注交易和行情接收情况。

（四）会员单位参与测试的每个席位均应**在上期所会服系统上填写系统测试情况（菜单路径：业务窗口 -> 系统测试 -> 系统测试反馈）**。

（五）各行情转发单位应填写《上期所新一代交易系统测试反馈表（行情商）》（附表），以电子邮件方式发送到邮箱xxgl@shfe.com.cn。

（六）各单位做好测试数据的隔离工作，避免测试数据影响生产数据。

六、联系方式

值班电话：021-68400802

电子邮箱：tech@shfe.com.cn

传真：021-68400385

附表：上期所新一代交易系统测试反馈表（行情商）

附表

上期所新一代交易系统测试反馈表

（行情商）

|  |
| --- |
| **行情商情况** |
| 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** |
| 系统登录是否正常 |  |  |
| 行情接收是否正常 |  |  |
| 切回当前生产交易系统是否正常 |  |  |
| 测试过程中有无发生其它故障 |  |  |
| 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。**