附件

原油期货TAS升贴水生产系统演练指南

一、适用期货合约

sc2305、sc2306、sc2307、sc2308

二、测试时间安排

**（一）2023年4月1日（周六）测试安排**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 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 |
| 09:35:00 | 连续交易暂停 |
| 9:35-9:55 | 模拟日盘重启交易系统 |
| 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 | 连续交易暂停，TAS交易收盘 |
| 11:35:00 | 连续交易 |
| 11:40:00 | 收市 |
| 结算和数据报送 | 11:40-12:30 | 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3月30日（周四）结算后的数据, 模拟3月31日（周五）的交易和结算。

**（二）2023年4月8日（周六）测试安排**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 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 |
| 日盘交易 | 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 | 连续交易暂停，TAS交易收盘 |
| 11:35:00 | 连续交易 |
| 11:40:00 | 收市 |
| 结算和数据报送 | 11:40-12:30 | 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4月6日（周四）结算后的数据，模拟4月7日（周五）的交易和结算。

三、相关测试用参数

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 参数值 |
| 适用品种 | 原油期货 |
| 适用期货合约 | 上市原油期货合约的前四行 |
| TAS代码 | sc2305TAS、sc2306TAS、sc2307TAS、sc2308TAS |
| 报价升贴水范围 | ±2元/桶，对应±20个最小价格变动单位（tick） |
| 交易单位 | 同适用期货合约（1000桶/手） |
| 报价单位 | 同适用期货合约（元/桶） |
| 最后交易日 | 适用期货合约最后交易日前第八个交易日 |
| 交易保证金 | 同适用期货合约 |
| 交易手续费 | 20元/手，平今仓免收交易手续费 |
| 限价单最大下单量 | 500手 |
| 限价单最小下单量 | 1手 |

四、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。

上期能源的一档行情主题号为5001，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能源网站发布的二代行情平台上线通知，链接为：

http://www.ine.com.cn/news/notice/1455.html

**（三）会员服务测试系统**

专线地址：[http://192.168.9.214](http://192.168.9.215/)

证联网地址：[http://42.24.1.246](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。

五、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）应重点注意原油期货TAS合约的交易情况。

（四）测试完成后请会员单位在上期能源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“20230401/20230408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《原油期货TAS升贴水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。

六、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．原油期货TAS升贴水生产系统演练反馈表

（会员）

2．原油期货TAS升贴水生产系统演练反馈表

（信息商）

附表1

原油期货TAS升贴水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** | **测试场景描述** | **是否通过** |
| 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 |  |
| 日盘集合竞价撤销存量报单 | 日盘集合竞价阶段撤销夜盘存量报单是否正常（4月1日） |  |
| 日盘集合竞价撤销存量报价单 | 日盘集合竞价阶段撤销夜盘期权做市商报价单是否正常（4月1日） |  |
| 查询合约、接收合约状态切换信息 | 查询 TAS合约正常接收,TAS 合约状态切换信息正常 |  |
| 投资者对 TAS 合约报单、撤单 | 1、“价格”可以在涨跌停板范围内任意报价，可以为正，可以为0，可以为负；2、“报单价格条件”只支持“限价”；3、“有效期类型”仅支持“当日有效”，不支持“IOC”；4、对于超出报价范围或非最小报价单位整数倍的报单视为无效；5、适用期货合约盘中封板， TAS合约可以升贴水报价并成交；6、10:30到11:30间可对TAS进行报单；7、验证投资者的各项资金和持仓计算准确性。保证金占用、冻结计算、盈亏计算、持仓计算等。请联系开发商确定 TAS 合约保证金、盈亏计算公式。 |  |
| 投资者对 TAS 合约和适用期货合约进行平仓 | 1、TAS 报单能平适用期货合约的昨仓和今仓；2、TAS 报单能平 TAS 今仓；3、适用期货合约报单能平 TAS 今仓；平仓顺序：区分“平昨”、“平今”指令，区分昨仓和今仓，按成交编号先开先平，但不区分TAS持仓和适用期货合约持仓。 |  |
| 投资者对 TAS 合约下套保单 | 支持 TAS合约下套保单。TAS 报单与适用期货合约共用套保额度。 |  |
| 自动撤单 | TAS交易收盘后，对于尚未成交的TAS报单，系统会自动撤单，会员端是否收到撤单回报 |  |
| 对投资者进行实时风险监控 | 检查会员/境外特参下客户是否有异常交易情况；并提出预警。注：TAS 合约与适用期货合约在超仓、强平、异常交易监管等行为上合并进行风控，对投资者资金进行监控并进行追保、强平等操作。可进行对敲测试。 |  |
| 压力测试 | 进行程序化报单，验证会员/境外特参的交易、风控系统和交易所交易系统能正常工作。 |  |
| 结算文件导入 | 结算文件导入成功，结算文件中包含TAS成交调整文件。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，两种方式均需测试。（会服下载的结算文件增加成交调整文件，需重点测试） |  |
| 系统结算 | 结算是否正常1、TAS合约转换为适用期货合约参与结算；2、TAS合约手续费采用针对 TAS合约的设置；3、TAS合约保证金采用适用期货合约保证金率设置；4、TAS成交价为成交调整文件中的成交价。 |  |
| 结算结果核对 | 核对结果正确：上期能源成交、资金、投资者持仓、会员持仓等核对正确 |  |
| TAS盘后实际成交价不能突破涨跌停板价 | TAS升贴水成交超出涨跌停板情况下，成交价调整后的成交明细和相关结算文件中关于成交价的显示是否正确。 |  |
| 报表 | 生成报表是否正确 |  |
| 盘后数据报送 | 报送文件是否正确：1、成交明细（按 TAS 合约成交展示）；2、平仓明细（按 TAS 合约成交展示）；3、其他文件含有 TAS 的按适用期货合约显示；4、报送功能的回归测试（含其他期货/期权） |  |
| 其它故障 | 测试过程中有无发生其它故障 |  |
| 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能源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“20230401/20230408生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

附表2

原油期货TAS升贴水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** |
| 使用上期能源席位登录是否正常 |  |  |
| 通过上期能源席位接收原油期货TAS行情是否正常（含移动终端），TAS行情支持负价格 |  |  |
| 使用上期能源的席位应不能接收到上期能源以外的合约行情 |  |  |
| 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。**