附件

SCFIS欧线期货仿真交易指南

一、参与交易

帐号、密码、交易编码等使用上期能源仿真测试环境已设立的数据。

二、挂牌合约

EC2306、EC2308、EC2310、EC2312、EC2402、EC2404

三、交易时间

每周一至周五上午9:00 - 11:30，下午13:30 - 15:00。不进行夜盘交易。

四、相关仿真参数

|  |  |
| --- | --- |
| **参数名称** | **仿真交易参数值** |
| 交易品种 | SCFIS欧线 |
| 产品代码 | EC |
| 交易单位 | 50元/点 |
| 报价单位 | 指数点 |
| 最小变动价位 | 0.1点 |
| 合约交割月份 | 2月、4月、6月、8月、10月、12月 |
| 最后交易日 | 合约交割月份最后一个开展期货交易的周一 |
| 交割日期 | 同最后交易日 |
| 实际执行涨跌停板幅 | 10% |
| 首日涨跌停板幅 | 20%（实际执行涨跌板幅的2倍） |
| 最后交易日涨跌停板幅 | 20% |
| 实际执行保证金率 | 12% |
| 交易保证金算法 | 标准算法（无单向大边优惠） |
| 交割方式 | 现金交割 |
| 交割单位 | 1手 |
| 交易手续费 | 万分之零点一 |
| 交割手续费 | 万分之零点二 |
| 交易手续费平今优惠 | 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 |
| 交易限额 | 在某一合约上单日开仓量不超过1000手 |
| 自然人限制 | 交割月允许自然人开仓，不强平 |

五、时间梯度保证金率

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **参数名称** | **仿真交易参数值** | |
| 时间梯度保证金率 | 合约挂牌之日起 | 12% |
| 最后交易日前第七个交易日起 | 20% |
| 最后交易日前第二个交易日起 | 30% |

六、持仓限额

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **参数名称** | **仿真交易参数值** | |
| 持仓限制  （期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构） | （某一期货合约持仓量≥3万手）：25% | |
| 持仓限制  （非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户） | 合约挂牌至最后交易日前第八个交易日 | 1200 |
| 最后交易日前第七个交易日至最后交易日前第三个交易日 | 360 |
| 最后交易日前第二个交易日至最后交易日 | 120 |

七、套保、套利额度申请

会员通过仿真会员服务系统，境外中介机构通过仿真境外中介服务系统，为客户申请套期保值、套利额度。

八、技术指引

**（一）仿真交易系统（通过证联网测试网接入）**

前端域名服务（以下简称FENS）地址为：

42.24.1.47、42.24.1.48

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5901；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5903。

各会员单位和各行情转发单位的网络安全控制策略应开通对42.24.1.0/24网段上TCP端口为5901、5903、43005、43011的访问权限；及对42.24.1.0/24网段上TCP端口为80、443、7002的访问权限。确保上述网段及协议端口的通讯正常。

上期能源的一档行情主题号为5001，发布频率为每秒2笔。

**（二）仿真二代行情平台（通过证联网测试网接入）**

行情查询服务相参数：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 网络通道 | IP | TCP端口号 |
| 行情A路 | 42.24.1.163 | 43022 |
| 行情B路 | 42.24.1.164 | 43022 |

增量行情服务相关参数：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 产品 | 行情主题 | 网络通道 | 组地址 | 前置地址 | 端口 |
| 上期能源一档单边行情 | 5001 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.161 | 25001 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.162 | 25001 |
| 上期能源五档单边行情 | 5000 | 行情A路 | 232.1.1.1 | 42.24.1.161 | 25000 |
| 行情B路 | 232.1.1.11 | 42.24.1.162 | 25000 |

**（三）仿真会员服务系统（通过证联网测试网接入）**

<http://42.24.1.245>

**（四）仿真境外中介服务系统（通过互联网接入）**

<https://124.74.244.145> 或<https://220.248.39.145>

**（五）仿真会员结算文件下载API接口（通过证联网测试网接入）**

IP：42.24.1.149，端口：443

开放时间段：交易日 15:00 - 21:00

测试用户和证书信息在仿真会服系统20210223的通知中。

**（六）期货市场监控中心仿真统一开户系统（通过证联网接入）**

如需新开客户，请通过以下地址申请。

（1）web方式的地址:

https://42.0.2.2:7002/test

（2）接口调用方式的地址

ssl://42.0.2.3:51002

**（七）期货市场监控中心盘后报送测试系统**

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

**（八）注意事项**

请提前做好技术系统的仿真交易准备。如需要更多资金，请联系上期能源另外申请。本次仿真交易不涉及客户统一开户、仓单业务、银行转账等相关业务。

**（九）要求**

请会员在上期能源仿真会员服务系统填写SCFIS欧线期货仿真交易测试反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“SCFIS欧线期货仿真交易测试反馈”的记录进行操作。

九、联系方式

技术咨询：021-20616345

产品咨询：021-68400230、68400261

电子邮箱：[tech@shfe.com.cn](mailto:tech@shfe.com.cn)

传真：021-68400385

特此通知。

附表：SCFIS欧线期货仿真交易测试反馈

附表

SCFIS欧线期货仿真交易测试反馈

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |  | |
| **测试场景反馈** | | | | | |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **测试项目** | **测试场景描述** | **是否通过** |
| 与交易所系统连接 | 1．确认席位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SCFIS欧线期货合约正常接收,合约状态切换信息正常 |  |
| 投资者对SCFIS欧线期货合约报单、撤单 | 在SCFIS欧线期货合约上报单、撤单、开/平仓、成交回报是否正常（包括期货公司、境外特参和境外中介的客户） |  |
| 自然人交割月持仓 | 自然人可在SCFIS欧线期货交割月合约开仓 |  |
| 交易限额 | 在单个SCFIS欧线期货合约上单日开仓量不超过1000手 |  |
| 普通客户询价 | 普通客户对SCFIS欧线期货合约询价 |  |
| 做市商报价 | 做市商对SCFIS欧线期货合约报价 |  |
| 投资者对SCFIS欧线期货合约下套保单 | 在SCFIS欧线期货合约上可正常申请套保、套利额度，并正常申报投机、套保单、及后续成交回报均正常 |  |
| 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。 |  |
| 到期日现金交割结算（2023/5/29） | 合约现金交割结算正常处理，通过会服系统可查询现金交割结算单，客户分项资金文件中含交割盈亏数据，会员及客户持仓明细表含交割合约持仓（为测试需要，将ec2306合约到期日提前至2023/5/29） |  |
| 保证金算法 | 双向持仓均收取保证金，无单向大边优惠。会员系统保证金算法可否设置到品种级。 |  |
| 系统结算 | 结算流程是否正常 |  |
| 结算结果核对 | 核对结果正确：上期能源成交、资金、投资者持仓、会员持仓等核对正确 |  |
| 报送数据生成/报送结果查询 | 报送文件是否正确，特别是到期日交割盈亏正常报送给监控中心，客户分项资金报送A008交割盈亏数据，会员资金报送的出入金字段不含交割盈亏。交割盈亏报送开关打开后，适用于所有上市品种。 |  |

**注：请会员在仿真交易测试结束（2023年6月9日）前按每个席位在上期能源仿真会员服务系统填写SCFIS欧线期货仿真交易测试反馈，菜单路径为业务窗口-〉系统测试-〉系统测试反馈，请对标题为“SCFIS欧线期货仿真交易测试反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**