附件

SCFIS欧线期货全市场生产系统演练指南

一、SCFIS欧线期货挂牌合约

EC2404、EC2406、EC2408、EC2410、EC2412

二、测试时间安排

（一）2023年8月6日（周日）测试安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 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 |
| 11:30:00 | 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 |

2023年8月6日（周日）上午测试采用8月3日（周四）结算后的数据，模拟8月4日（周五）的交易和结算。

（二）2023年8月12日（周六）测试安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 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 |
| 11:00:00 | 收市 |
| 结算和数据报送 | 11:00-12:00 | 交易所结算 |
| 12:00-13:00 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 13:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

2023年8月12日（周六）上午测试采用8月10日（周四）结算后的数据，模拟8月11日（周五）的交易和结算。

三、SCFIS欧线期货测试用参数

**（一）SCFIS欧线期货合约**

SCFIS欧线期货合约请参见《上海国际能源交易中心就集运指数（欧线）期货标准合约和相关业务规则公开征求意见的公告》，链接为：https://www.ine.com.cn/news/notice/130115.html

**（二）相关测试用参数**

|  |  |
| --- | --- |
| 参数名称 | 测试用参数值 |
| 交易代码 | EC |
| 交易品种 | SCFIS欧线 |
| 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%（实际执行涨跌停板幅的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 | 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 |
| 交割手续费 | 交割金额的万分之零点二 |
| 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 |

**（三）时间梯度保证金率**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 参数名称 | 测试用参数值 | |
| 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% |

**（四）持仓限额**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 参数名称 | 测试用参数值 | |
| 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 |

四、套保额度申请

会员可在测试当日通过上期能源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（命名规则为会员号+TB01/02）申请，密码同生产系统。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，上期能源会实时审批套期保值申请。

五、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）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：

42.0.10.27（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。

六、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SCFIS欧线期货的测试。

（四）测试完成后请各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“20230806/20230812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《SCFIS欧线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](mailto: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。

七、联系方式

信科一部：

值班电话：021-68400802

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

传真：021-68400385

特此通知。

附表：1．SCFIS欧线期货生产系统演练反馈表（会员）

2．SCFIS欧线期货生产系统演练反馈表（信息商）

附表1

SCFIS欧线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SCFIS欧线期货合约正常接收, SCFIS欧线期货合约状态切换信息正常 | | |  | |
| 投资者报单、撤单 | | | SCFIS欧线期货合约报单、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） | | |  | |
| 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 | | |  | |
| 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 | | |  | |
| 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 | | |  | |
| 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：

**注：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“20230806/20230812生产系统演练反馈”的记录进行操作。谢谢配合。**

附表2

SCFIS欧线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** | | |
| 使用上期能源席位登录是否正常 | | |  | | |  | | |
| 通过上期能源席位接收SCFIS欧线期货行情是否正常（含移动终端） | | |  | | |  | | |
| 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**](mailto:xxgl@shfe.com.cn) **谢谢配合。**