附件

新型组合保证金、集运指数（欧线）期货交割全市场生产系统演练指南

一、测试时间安排

2024年1月27日（周六）测试采用1月25日（周四）结算后的数据，模拟1月26日（周五）、1月29日（周一）两个交易日的交易和结算。

1. **2024年1月27日（周六）上午测试内容**

周六上午模拟交易日1月26日（周五），测试重点包括：配置/导入组保参数，配置组保客户，结算时启用组保算法，验证结算时不同客户的组保与单向大边是否正常，当日报送结算结果是否正确。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 1月26日交易 | 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 |
| 09:30:00 | 收市 |
| 1月26日结算和数据报送 | 9:30-10:30 | 交易所结算 |
| 10:30-11:30 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 12:00前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

**（二）2024年1月27日（周六）下午测试内容**

周六下午模拟交易日1月29日（周一），组保测试重点包括：盘中客户组保开始生效，验证交易与结算时组保与单向大边是否正常，当日报送结算结果是否正确。集运指数（欧线）期货现金交割测试重点包括：模拟EC2404合约现金交割，交割盈亏报送开关需要打开，现金交割结算处理是否正常，现金交割手续费是否与交易所计算一致，报送数据是否正确。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 演练时间 | 内容 |
| 1月29日交易 | 13:00:00 | 集合竞价申报 |
| 13:04:00 | 集合竞价撮合 |
| 13:05:00 | 连续交易 |
| 15:00:00 | 收市 |
| 1月29日结算和数据报送 | 15:00-16:00 | 交易所结算 |
| 16:00-17:00 | 会员结算，下载结算文件，核对结算结果 |
| 17:30前 | 会员向监控中心报送盘后数据 |

二、组保保证金参数

**（一）客户保证金算法**

在1月25日12:00前如果会员单位生产系统已经升级至支持上期组合保证金业务的版本，则在演练时对该会员下所有做市商启用组合保证金业务，配置为组保做市商分类。所有非做市商客户，以及生产系统未升级至组保版本的会员下的做市商，仍然使用单向大边计算保证金。

**（二）商品组、商品群、组保优惠参数**

见附件《上期新型组合保证金业务参数》，周六上午（模拟1月26日）结算后的结算文件中也包含该参数，会员可根据系统支持方式选择手工录入或导入文件。

三、集运指数（欧线）期货参数

为测试需要，**EC2404**合约到期日设置为**20240129**。

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。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。

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）请升级系统以支持监控中心数据报送接口4.6版本。**

（二）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。

（三）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。

（四）应重点关注新型组合保证金、集运指数（欧线）期货现金交割的测试。

（五）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“20240127生产系统演练反馈（INE）”的记录进行操作。

（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：1．上期能源新型组合保证金生产系统演练反馈表

2．上期新型组合保证金业务参数

附1

上期能源新型组合保证金生产系统演练反馈表

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | | |  | |
| 投资者期货报单、撤单 | | | 在期货合约报单、撤单、开/平仓、成交回报、组合保证金、单向大边保证金是否正常 | | |  | |
| 投资者期权报单、撤单、询价 | | | 在期权合约报单、撤单、询价、开/平仓、成交回报、组合保证金、单向大边保证金是否正常 | | |  | |
| 投资者下套保单 | | | 选择任意合约进行套保报单，形成套保持仓，确认套保头寸组合保证金正常。 | | |  | |
| 投资者跨品种组合持仓 | | | 上市初期拟设置贵金属商品群（黄金、白银），黑色金属商品群（螺纹钢、热轧卷板），能源商品群（原油、低硫燃料油），客户有相关品种交易权限的，可选取一个商品群形成跨品种组合头寸，确认组合保证金是否正常 | | |  | |
| 集运指数（欧线）合约报单、成交 | | | 在集运指数（欧线）上报单并形成持仓，组合保证金计算时不优惠 | | |  | |
| 集运指数（欧线）EC2404合约到期日现金交割结算 | | | 集运指数（欧线）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。现金交割的手续费，是否与交易所计算一致。 | | |  | |
| 合约临近交割退出组合优惠 | | | 组保业务中，合约在最后交易日前5日退出组合优惠。sc2402、lu2402合约在模拟交易日时退出组合保证金优惠。请进行报单，成交并形成组合持仓，确认组合保证金计算正确 | | |  | |
| 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 | | | 组合保证金新增了4个结算文件，确认能成功导入。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 | | | 申请开通组保业务的客户使用组合保证金计算，其中做市商享受组保做市商优惠，非做市商客户享受组保普通客户优惠；未申请的客户使用单向大边计算保证金。 | | |  | |
| 系统结算 | | | 结算流程是否正常 | | |  | |
| 结算结果核对 | | | 核对结果正确：结算结果核对正确；组合保证金和单向大边的客户按照不同算法计算保证金正确 | | |  | |
| 未升级会员交易是否正常 | | | 如会员生产系统未升级至支持组合保证金版本，则确认交易所组保业务试点开启后交易是否正常 | | |  | |
| 未升级会员结算是否正常 | | | 如会员生产系统未升级至支持组合保证金版本，则确认交易所组保业务试点开启后结算是否正常 | | |  | |
| 盘后数据报送 | | | 盘后数据报送文件是否正确。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 | | |  | |
| 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“20240127生产系统演练反馈(INE)”的记录进行操作。谢谢配合。**

附2

上期新型组合保证金业务参数

1. 组保商品组

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 商品组名称 | 商品组代码 | 产品代码 |
| 1 | 白银商品组 | agc | ag\_f |
| 2 | ag\_o |
| 3 | 铝商品组 | alc | al\_f |
| 4 | al\_o |
| 5 | 氧化铝商品组 | aoc | ao\_f |
| 6 | 黄金商品组 | auc | au\_f |
| 7 | au\_o |
| 8 | 铜(BC)商品组 | bcc | bc\_f |
| 9 | 丁二烯橡胶商品组 | brc | br\_f |
| 10 | br\_o |
| 11 | 石油沥青商品组 | buc | bu\_f |
| 12 | 铜商品组 | cuc | cu\_f |
| 13 | cu\_o |
| 14 | SCFIS欧线商品组 | ecc | ec\_f |
| 15 | 燃料油商品组 | fuc | fu\_f |
| 16 | 热轧卷板商品组 | hcc | hc\_f |
| 17 | 低硫燃料油商品组 | luc | lu\_f |
| 18 | 镍商品组 | nic | ni\_f |
| 19 | 20号胶商品组 | nrc | nr\_f |
| 20 | 铅商品组 | pbc | pb\_f |
| 21 | 螺纹钢商品组 | rbc | rb\_f |
| 22 | rb\_o |
| 23 | 天然橡胶商品组 | ruc | ru\_f |
| 24 | ru\_o |
| 25 | 原油商品组 | scc | sc\_f |
| 26 | sc\_o |
| 27 | 锡商品组 | snc | sn\_f |
| 28 | 纸浆商品组 | spc | sp\_f |
| 29 | 不锈钢商品组 | ssc | ss\_f |
| 30 | 线材商品组 | wrc | wr\_f |
| 31 | 锌商品组 | znc | zn\_f |
| 32 | zn\_o |

注1：ag\_f指白银期货，ag\_o指白银期权。其他品种名称规则与此一致。

注2：结算文件SpmmInstrumentParam中下发合约所属商品组信息。

1. 组保商品群

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 商品群代码 | 商品群名称 | 商品组代码 | 商品组  名称 |
| 1 | AlGroup | 铝商品群 | alc | 铝商品组 |
| 2 | AoGroup | 氧化铝商品群 | aoc | 氧化铝商品组 |
| 3 | BcGroup | 铜(BC)商品群[[1]](#footnote-1) | bcc | 铜(BC)商品组 |
| 4 | BrGroup | 丁二烯橡胶商品群 | brc | 丁二烯橡胶商品组 |
| 5 | BuGroup | 石油沥青商品群 | buc | 石油沥青商品组 |
| 6 | CuGroup | 铜商品群 | cuc | 铜商品组 |
| 7 | EcGroup | SCFIS欧线商品群 | ecc | SCFIS欧线商品组 |
| 8 | **EnergyGroup** | **能源商品群** | **luc** | **低硫燃料油商品组** |
| 9 | **scc** | **原油商品组** |
| **10** | **FerrousGroup** | **黑色金属商品群** | **hcc** | **热轧卷板商品组** |
| **11** | **rbc** | **螺纹钢商品组** |
| 12 | FuGroup | 燃料油商品群 | fuc | 燃料油商品组 |
| 13 | NiGroup | 镍商品群 | nic | 镍商品组 |
| **14** | **NobleGroup** | **贵金属商品群** | **agc** | **白银商品组** |
| **15** | **auc** | **黄金商品组** |
| **16** | NrGroup | 20号胶商品群 | nrc | 20号胶商品组 |
| 17 | PbGroup | 铅商品群 | pbc | 铅商品组 |
| 18 | RuGroup | 天然橡胶商品群 | ruc | 天然橡胶商品组 |
| 19 | SnGroup | 锡商品群 | snc | 锡商品组 |
| 20 | SpGroup | 纸浆商品群 | spc | 纸浆商品组 |
| 21 | SsGroup | 不锈钢商品群 | ssc | 不锈钢商品组 |
| 22 | WrGroup | 线材商品群 | wrc | 线材商品组 |
| 23 | ZnGroup | 锌商品群 | znc | 锌商品组 |

注1：结算文件SpmmInstrumentParam中下发合约所属商品群信息。

1. 组保业务参数

**客户类型枚举值：**

“1”: 组保普通客户

“2”: 组保做市商

**（一）组保做市商**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 组保优惠分类 | 商品群代码 | 商品群 | 期权纯粹价格风险比例 | 跨期优惠系数 | 跨品种优惠系数 | 最小保证金比例 |
| 1 | 组保做市商 | AlGroup | 铝商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 2 | 组保做市商 | AoGroup | 氧化铝商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 3 | 组保做市商 | BcGroup | 铜(BC)商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 4 | 组保做市商 | BrGroup | 丁二烯橡胶商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 5 | 组保做市商 | BuGroup | 石油沥青商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 6 | 组保做市商 | CuGroup | 铜商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 7 | 组保做市商 | EcGroup | SCFIS欧线商品群 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8 | 组保做市商 | EnergyGroup | 能源商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 9 | 组保做市商 | FerrousGroup | 黑色金属商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 10 | 组保做市商 | FuGroup | 燃料油商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 11 | 组保做市商 | NiGroup | 镍商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 12 | 组保做市商 | NobleGroup | 贵金属商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 13 | 组保做市商 | NrGroup | 20号胶商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 14 | 组保做市商 | PbGroup | 铅商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 15 | 组保做市商 | RuGroup | 天然橡胶商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 16 | 组保做市商 | SnGroup | 锡商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 17 | 组保做市商 | SpGroup | 纸浆商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 18 | 组保做市商 | SsGroup | 不锈钢商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 19 | 组保做市商 | WrGroup | 线材商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |
| 20 | 组保做市商 | ZnGroup | 锌商品群 | 0.9 | 1.6 | 1 | 0.1 |

**（二）组保普通客户**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 组保优惠分类 | 商品群代码 | 商品群 | 期权纯粹价格风险比例 | 跨期优惠系数 | 跨品种优惠系数 | 最小保证金比例 |
| 1 | 组保普通客户 | AlGroup | 铝商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 2 | 组保普通客户 | AoGroup | 氧化铝商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 3 | 组保普通客户 | BcGroup | 铜(BC)商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 4 | 组保普通客户 | BrGroup | 丁二烯橡胶商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 5 | 组保普通客户 | BuGroup | 石油沥青商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 6 | 组保普通客户 | CuGroup | 铜商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 7 | 组保普通客户 | EcGroup | SCFIS欧线商品群 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8 | 组保普通客户 | EnergyGroup | 能源商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 9 | 组保普通客户 | FerrousGroup | 黑色金属商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 10 | 组保普通客户 | FuGroup | 燃料油商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 11 | 组保普通客户 | NiGroup | 镍商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 12 | 组保普通客户 | NobleGroup | 贵金属商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 13 | 组保普通客户 | NrGroup | 20号胶商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 14 | 组保普通客户 | PbGroup | 铅商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 15 | 组保普通客户 | RuGroup | 天然橡胶商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 16 | 组保普通客户 | SnGroup | 锡商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 17 | 组保普通客户 | SpGroup | 纸浆商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 18 | 组保普通客户 | SsGroup | 不锈钢商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 19 | 组保普通客户 | WrGroup | 线材商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |
| 20 | 组保普通客户 | ZnGroup | 锌商品群 | 0.6 | 1 | 1 | 0.3 |

注：相关参数通过结算文件SpmmBusinessParam下发。

1. 合约不参与优惠

1．EC全系合约不参与优惠计算。

2．其他品种最后交易日前5日退出优惠。

注：合约是否参与优惠参数通过结算文件SpmmInstrumentParam下发。其中MarginCalc值等于1时为不参与优惠，值等于3时为参与优惠。

1. 客户组保分类

注1：客户是否启用组保手工设置，结算文件不下发此信息。

注2：客户所属组保分类通过SpmmClientCategory下发。数据含义为如果客户启用组保，则该客户所属的组保分类（在业务试点阶段，该文件中对于未启用组保的客户也进行了分类，是在组保与单向大边并行阶段正常现象）。

1. 铜(BC)的括号为英文输入法下的括号 [↑](#footnote-ref-1)