

关于交易系统测试的通知

郑商函〔2018〕420号

各会员单位、各境外客户保证金存管银行：

为保障 PTA 期货引入境外交易者业务顺利进行，郑州商品交易所（以下简称郑商所）定于 2018 年 11 月 17 日进行交易系统测试。现将有关事项通知如下：

一、进行交易系统的交易、行情接收、结算、报表发布等全流程测试。

二、进行 PTA 期货引入境外交易者相关业务测试，重点测试开户、美元出入金、交易、结算等业务。

三、本次测试使用郑商所技术中心作为交易主中心，期货大厦作为交易备中心，请各单位参照《交易系统测试指引》调整相关配置。

四、本次测试使用11月16日（日历日）夜盘交易后的数据，请各单位测试前做好测试准备和数据备份工作，测试完成后做好系统和数据的恢复，确保下一交易日的正常交易。

五、测试结束后，请各单位在当日 17:00 前通过邮件提交《交易系统测试反馈表》。

特此通知。

附件：1. 交易系统测试指引

2. 交易系统测试反馈表

郑州商品交易所

2018年11月13日

附件 1

交易系统测试指引

一、测试目的

测试并熟悉PTA期货引入境外交易者相关业务功能。测试会员端系统接入郑商所技术中心交易系统下单、撤单、成交回报、各种查询和行情显示等功能正确性。

二、测试人员

各会员单位、各境外客户保证金存管银行相关人员。

三、测试数据及测试时间

11月17日上午测试时使用11月16日（日历日）夜盘后的数据，模拟11月19日日盘的交易。下午测试时模拟11月30日的交易（测试时删除中间的交易日），数据使用上午测试结算后的数据。

测试时间安排如下：

模拟交易日	时间	系统状态	主要测试内容
11月19日	08:45—08:55	交易系统就绪	1、接入技术中心进行测试 2、通过会服系统提交境外经纪机构备案信息 3、通过统一开户系统为境外交易者开立交易编码 4、测试境外交易者没有郑商所品种的交易权限 5、已开通外汇保证金专用账户的会员进行美元出、入金各1笔，入金金额、出金额各为10美元
	08:55—08:59	集合竞价	
	08:59—09:00	竞价撮合	
	09:00—11:00	连续交易	
	11:00—11:30	闭市，结算	
	11:30—12:30	发布报表	

			6、向监控中心报送结算数据
11月 30日	13:15—13:25	交易系统就绪	1、接入技术中心进行测试 2、测试境外交易者只能交易PTA品种4月份之后的合约 3、模拟客户结售汇，生成结售汇记录，不用发送银行，检查结售汇记录是否正确 4、向监控中心报送结算数据
	13:25—13:29	集合竞价	
	13:29—13:30	竞价撮合	
	13:30—14:30	连续交易	
	14:30—14:50	闭市，结算	
	14:50—15:00	发布报表	
	15:00—17:00		系统恢复

四、测试环境

本次测试使用技术中心作为交易主中心，期货大厦作为交易备中心，相关配置如下：

(一) 网络接入配置

会员单位应优先使用接入技术中心的专线或者三所环网访问技术中心的交易前置机及会员服务系统。郑商所技术中心交易前置机IP网段为129.20.1.0/24，技术中心会员服务系统网段为129.21.1.0/24。请提前做好网络调测。

(二) 交易前置机接入参数

序列号、授权码、初始密钥、交易密码与生产系统保持一致。两中心前置机IP地址配置如下：

a) 两中心前置机地址对应表

期货大厦	技术中心
129.10.1.9	129.20.1.21
129.10.1.93	129.20.1.22
129.10.1.94	129.20.1.23
129.10.1.95	129.20.1.24

129.10.1.96	129.20.1.25
129.10.1.97	129.20.1.26
129.10.1.98	129.20.1.27

注：如生产配置主连前置地址为 129.10.1.93，本次测试时主连地址应配置为 129.20.1.22

b) 主用地址池

报盘机配置中的“主用前置机地址池”配置为技术中心前置机地址 129.20.1.21/22/23/24/25/26/27。

c) 备用地址池

报盘机配置中的“备用前置机地址池”配置为期货大厦前置机地址 129.10.1.9/93/94/95/96/97/98。

(三) 中国期货市场监控中心统一开户系统

WEB 方式：<https://15.9.11.24>

接口调用方式：<ssl://15.9.11.21:51002>

用户名密码同生产环境。

(四) 中国期货市场监控中心盘后数据报送

三所环网：15.9.11.45

端口号为 9000，用户名密码同生产环境。

五、结算数据

会员单位使用数字证书登录会员服务系统获取结算数据包进行结算，选择下载日期应为测试交易日日期。

请会员测试时登录技术中心生产会员服务系统 (<http://ms.czce.com.cn>)，或者登录期货大厦会员服务系统 (<http://member.czce.com.cn>)。请确保电脑

C:\Windows\System32\drivers\etc\hosts 文件中存在以下映射：

129.21.1.19 ms.czce.com.cn

129.11.1.19 member.czce.com.cn

六、注意事项

（一）各会员单位测试前务必做好测试准备和数据备份工作，测试完成后做好系统和数据恢复工作，确保下一交易日正常交易。

（二）各会员单位如需进行境外经纪机构备案测试，须于11月15日17:00前将期货公司名称、境外经纪机构名称、为境外经纪机构分配的内部资金账户等备案信息（每家会员限1家）发送到huiyuanbu@czce.com.cn，作为此次测试中境外经纪机构备案的依据，以备监控中心提前分配统一开户系统登录账号和密码。由于备案业务处理流程较长，如未提前提交备案信息，将无法保证测试当日通过会服系统成功备案。已提前提交备案信息的会员单位，如有系统测试需要，仍可将已提交的备案信息通过会服系统再次备案（备案提交即可，会服系统的处理结果将不作为备案成功与否的依据）。

（三）各会员为境外交易者开立交易编码的，应至少开立1个编码；如此次测试中，会员单位有备案成功的境外经纪机构的，还应通过转委托方式为境外交易者至少开立1个编码。

(四) 会员确保结算系统已升级支持我所外币业务的结算文件。

(五) 各会员委托笔数不少于200笔，成交笔数不少于150笔，其中模拟境外交易者PTA期货交易不少于10笔，同时测试境外交易者只能进行PTA期货交易。

(六) 各会员单位测试后,从郑商所网站的“会员服务>>技术专栏>>系统测试”栏目下载、填写并邮件提交《交易系统测试反馈表》。反馈时请将会员号附缀至文件名尾(例如“交易系统测试反馈表0001”)。

七、技术支持联系方式

在测试过程中，相关系统测试遇到问题和故障可与相应的软件开发商联系，也可以通过电话、电子邮件等方式及时反馈。

网络支持	0371—65610732、65610682
远程交易	0371—65610536、65610671
会员服务	0371—65610226、65610261
结算业务(含外汇业务)	0371—65611661、65610525
境外经纪机构备案相关	0371—65610392、65610165
技术中心值班电话	0371—60908531、60908532
期货大厦值班电话	0371—65610300、65610688
邮 箱	itdepartment@czce.com.cn

附件 2

交易系统测试反馈表

一、会员基本信息表				
会员名称			会员号	
技术联系人		联系电话		联系手机
技术联系人		联系电话		联系手机
交易席位总数			参与测试席位数	
二、远程交易席位测试情况				
交易席位号			席位交易软件及版本	
席位类别	<input type="checkbox"/> 主用席位 <input type="checkbox"/> 非主用席位		席位用途	<input type="checkbox"/> 交易 <input type="checkbox"/> 风控 <input type="checkbox"/> 行情 <input type="checkbox"/> 其它
测试时间				
测试项	测试情况		备注	
报盘登录	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
委托及撤单	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
成交回报	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
行情接收	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
结算情况	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
境外交易者开户业务	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
境外经纪机构备案业务	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
美元出入金业务	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
境外客户交易权限	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常	上午，所有品种都不能交易； 下午，只能交易 4 月之后的 PTA 合约。	
结售汇记录生成情况	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
数据报送情况	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
系统恢复情况	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
特殊情况说明				

说明：表中第二项需要每个参与测试的席位填写一份，可以根据参与测试的席位数量自行添加。