

关于上市红枣期货交易交易系统测试的通知

郑商函〔2019〕137号

各会员单位、行情转发单位：

郑州商品交易所（以下简称郑商所）定于4月20日、4月27日进行红枣期货上市前交易系统测试，同时组织期货做市商使用双边报价指令为TA907、ZC907合约提供报价测试。现将有关事项通知如下：

一、4月20日、4月27日8:30至12:00，郑商所组织会员单位、行情转发单位进行交易、行情接收、结算、报表发布等全流程集中测试。本次测试合约参数详见《红枣期货合约测试参数》（附件1），具体测试要求见《红枣期货测试指引》（附件2）。

二、4月20日、4月27日8:30至12:00，郑商所组织期货做市商进行测试，参加测试的期货做市商需按照《期货做市商测试指引》（附件3）进行测试。

三、测试结束后，请各单位在测试当日16:00前通过邮件提交《交易系统测试反馈表》（附件4）。

特此通知。

附件：1. 红枣期货合约测试参数
2. 红枣期货测试指引

3. 期货做市商测试指引
4. 交易系统测试反馈表

郑州商品交易所

2019年4月15日

附件 1

红枣期货合约测试参数

一、红枣期货合约（测试用）

交易品种	干制红枣（简称“红枣”）
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价±5%及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 7%
合约交割月份	1、3、5、7、9、12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9：00-11：30，下午 1：30-3：00 及交易所规定的其他交易时间 最后交易日上午 9：00-11：30
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 12 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所期货交割细则》
交割地点	交易所指定交割仓库
交割方式	实物交割
交易代码	CJ
上市交易所	郑州商品交易所

二、挂牌合约月份

首日挂牌的红枣期货合约为：CJ1912、CJ2001、CJ2003、CJ2005。

三、合约相关参数

(一) 交易保证金标准

交易时间段	交易保证金标准
自挂牌至交割月前二个月最后一个日历日期间的交易日	7%
交割月前一个月第一个日历日至交割月前一个月第 15 个日历日期间的交易日	10%
交割月前一个月第 16 个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期间的交易日	15%
交割月份	20%

(二) 限仓标准

品 种	非期货公司会员及客户最大单边持仓（手）			
红枣	自挂牌至交割月前二个月最后一个日历日期间的交易日	交割月前一个月第一个日历日至交割月前一个月第 15 个日历日期间的交易日	交割月前一个月第 16 个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期间的交易日	交割月份（自然人客户限仓为 0）
	300	60	20	6

(三) 交易手续费

交易手续费为 4 元/手，当日开平仓减半收取；套保开仓手续费免收。

附件 2

红枣期货测试指引

一、测试目的

测试红枣期货上市后会员单位、行情转发单位等接入交易系统进行委托、成交、行情接收、结算及其它业务处理的能力。

二、测试人员

会员单位、行情转发单位相关人员等。

三、测试数据和时间

4月20日和4月27日进行两次全市场测试。

4月20日测试使用4月19日结算后数据，红枣期货合约代码为：CJ1912、CJ2001、CJ2003、CJ2005。模拟4月22日交易，时间安排如下：

模拟交易日	时间	内容
4月22日	08:45—08:55	交易系统就绪
	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	闭市
	11:00—12:00	测试后结算数据放在会员服务系统的“结算报表查询”栏目中，在“结算数据包下载”选择模拟测试日期。

4月27日测试使用4月26日结算后数据，红枣期货合约代码为：CJ1912、CJ2001、CJ2003、CJ2005。模拟4月29

日交易，时间安排如下：

模拟交易日	时间	内容
4月29日	08:45—08:55	交易系统就绪
	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	闭市
	11:00—12:00	测试后结算数据放在会员服务系统的“结算报表查询”栏目中，在“结算数据包下载”选择模拟测试日期。

四、测试环境

本次测试使用技术中心生产交易系统。序列号、授权码、初始密钥、交易密码与生产环境保持一致。技术中心交易前置机地址为 129.20.1.21\22\23\24\25\26。

五、结算数据

会员单位使用数字证书登录期货大厦生产会员服务系统 <http://member.czce.com.cn> 获取结算数据包进行结算，选择下载日期应为测试日期。请尽早下载结算数据包。

六、测试要求

1. 请各单位测试前做好测试准备和数据备份，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。
2. 测试中发现问题请及时与郑商所联系，反馈情况。
3. 红枣期货委托不少于 200 笔，期货套利委托不少于 10 笔。

4. 各单位应从郑商所网站的“会员服务>>技术专栏>>系统测试”栏目下载、填写并通过邮件提交《交易系统测试反馈表》，反馈时请将会员号附缀至文件名尾。

七、技术支持

在测试过程中，远程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郑商所。

网络支持：0371—65610732、65610682

远程交易：0371—65610536、65610671

会服系统：0371—65610226、65610261

结算业务：0371—65613170

技术中心值班：0371—65610688、60908532

期货大厦值班：0371—65610300、65612922

联系邮箱：ItDepartment@czce.com.cn

附件 3

期货做市商测试指引

一、测试目的

测试期货做市商使用双边报价指令进行做市，验证会员端系统委托、成交、行情接收、结算及其它业务处理的能力。

二、测试时间

4月20日和4月27日进行两次全市场测试。

4月20日测试使用4月19日结算后数据，做市期货合约代码为：TA907、ZC907。模拟4月22日交易，时间安排如下：

模拟交易日	时间	内容
4月22日	08:45—08:55	交易系统就绪
	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	闭市
	11:00—12:00	测试后结算数据放在会员服务系统的“结算报表查询”栏目中，在“结算数据包下载”选择模拟测试日期。

4月27日测试使用4月26日结算后数据，做市期货合约代码为：TA907、ZC907。模拟4月29日交易，时间安排如下：

模拟交易日	时间	内容
4月29日	08:45—08:55	交易系统就绪
	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	闭市
	11:00—12:00	测试后结算数据放在会员服务系统的“结算报表查询”栏目中，在“结算数据包下载”选择模拟测试日期。

三、报价要求

使用双边报价指令为TA907、ZC907合约提供报价，双边报价最大买卖价差不得超过该合约最小变动价位的5倍（PTA为10元/吨，动力煤为1元/吨），最小挂单量不得低于10手。其中，有效报价持续时间计算方法为：

1. 有效持续报价未成交或成交后双边挂单量仍不低于10手的，其持续报价时间为撤单时间（未撤单时按闭市时间）与报单时间的差；

2. 有效持续报价成交后至少有一边挂单量小于10手的，其持续时间为成交后单边最早小于10手的成交时间与报单时间的差。

3. 有效持续报价时间比例不得低于60%。有效持续报价时间比例是指做市商在指定合约上的有效持续报价累计时间除以指定合约的全部交易时间。

4. 测试时要求报入委托不少于200笔，TA907和ZC907合约相关组合委托不少于100笔。

附件 3.1

期货做市商业业务测试反馈表

一、期货做市商基本信息表				
公司名称			交易编码	
所在期货公司名称			会员号	
做市业务联系人		联系电话		联系手机
二、期货做市商业业务测试情况				
测试时间				
测试项	测试情况		备注	
双边报价指令报价	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
会员端委托及撤单	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
会员端成交回报	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
会员端行情接收	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
其他业务处理	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
特殊情况说明				

附件 4

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		
系统恢复情况	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
特殊情况说明				
三、会员服务系统及结算测试情况				
测试项	测试情况		备注	
会员服务系统登录情况	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
会员服务系统业务办理情况	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
结算情况	<input type="checkbox"/> 正常	<input type="checkbox"/> 异常		
恢复情况	<input type="checkbox"/> 完成	<input type="checkbox"/> 未完成		
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。