附件

交易和行情API 2.0测试指南

一、参加单位

上期所会员和行情转发单位。

二、时间安排

2025年10月25日（周六）测试采用10月23日（周四）结算后的数据，模拟10月24日（周五）交易日的交易和结算。2025年11月8日（周六）测试采用11月7日（周五）结算后的数据，模拟11月10日（周一）交易日的交易。

（一）2025年10月25日（周六）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 时间 | 内容 |
| 10月24日交易 | 08:30:00 | 会员登录交易系统 |
| 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 |
| 09:15:00 | 模拟前置服务切换 |
| 09:50:00 | 暂停交易 |
| 09:55:00 | 会员重新登录交易系统 |
| 10:00:00 | 连续交易 |
| 10:05:00 | 模拟一台前置机故障和恢复 |
| 10:30:00 | 模拟网络故障和恢复 |
| 11:30:00 | 收市 |
| 10月24日结算 | 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 |

测试采用10月23日（周四）结算后的数据，模拟10月24日（周五）。

（二）2025年11月8日（周六）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 模拟阶段 | 时间 | 内容 |
| 11月10日 | 08:30:00 | 会员登录交易系统 |
| 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 |
| 09:15:00 | 模拟一台前置机故障和恢复 |
| 09:30:00 | 模拟网络故障和恢复 |
| 10:00:00 | 模拟大面积前置机故障 |
| 11:00:00 | 切换至同城数据中心 |
| 11:30:00 | 收市 |

测试采用11月7日（周五）结算后的数据，模拟11月10日（周一）。

三、通讯参数

交易系统（含二代行情）使用生产环境。

**（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链路端口号为4901；使用FENS服务器获取行情前置机地址参数的TCP链路端口号为4903。

各单位的网络安全控制策略应打开192.168.12.X、192.168.11.X、192.168.16.X网段上TCP端口为4901、4903、33005、33011的访问。请确保上述网段及协议端口的通讯正常。

二代行情参数请参照上期所网站链接：

https://www.shfe.com.cn/services/technology/technical\_download/201908/t20190822\_794941.html

**（二）会员服务测试系统**

专线地址：[http://192.168.9.215](http://192.168.9.215/)

证联网地址：[http://42.24.1.244](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。

**（三）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。

四、测试内容

请各会员单位对在用的每个柜台系统至少安排一个席位参加测试，确保在用的柜台系统登录、交易、行情、查询等功能正常。测试应覆盖API 2.0的业务功能和故障恢复功能，包括但不限于交易和行情API 2.0的登录、订阅、报单、报价、执行宣告、询价、期权自对冲、查询、行情接收等。每个席位测试内容不低于以下要求：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 期货报单 | 期权报单 | 报价 | 撤单 | 成交 | 行权 |
| 800笔 | 100笔 | 100笔 | 30笔 | 400笔 | 5笔 |

开展从API 2.0回退至API 1.0的应急操作。

有条件的会员参加报价测试。

五、测试要求

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，仔细核对数据。

（二）测试前做好系统和数据备份，测试后恢复备份，确保不影响下一交易日的正常业务。

（三）会员单位参与测试的每个席位均应**在上期所会服系统上填写系统测试情况（菜单路径：业务窗口 -> 系统测试 -> 系统测试反馈）**。

（四）各行情转发单位应填写《上期所交易系统测试反馈表（行情商）》（附表），以电子邮件方式发送到邮箱marketdata@shfe.com.cn。

（五）各单位做好测试数据的隔离工作，避免测试数据影响生产数据。

六、联系方式

值班电话：021-68400802

电子邮箱：tech@shfe.com.cn

传真：021-68400385

附表：上期所交易系统测试反馈表（行情商）

附表

上期所交易系统测试反馈表（行情商）

|  |
| --- |
| **行情商情况** |
| 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** |
| 系统登录是否正常 |  |  |
| 行情接收是否正常 |  |  |
| 测试过程中有无发生其它故障 |  |  |
| 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：marketdata@shfe.com.cn**

**谢谢配合。**