**附件2**

1月1日指数熔断通关测试方案

**一、方案概要**

本次测试由上海证券交易所（以下简称“本所”）联合深圳证券交易所（以下简称“深交所”）、中国金融期货交易所（以下简称“中金所”）、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）上海分公司、全体会员及期货公司共同参与进行。测试旨在检验各会员单位指数熔断相关技术系统的改造就绪情况。

主要测试内容包括模拟沪深300指数触发+5%可恢复交易熔断、+7%不可恢复交易熔断2个场景；同时，验证在设计场景下的订单申报、成交接收、行情接收处理和闭市数据处理等方面是否正常。

此次测试本所使用竞价交易平台00环境、综合业务平台01环境、衍生品平台03环境；中国结算上海分公司使用生产环境。测试模拟1个完整交易日的交易和结算。

**二、参测单位**

（一）本所。

（二）中国结算上海分公司。

（三）深交所。

（四）中金所。

（五）中国证券金融股份有限公司。

（六）全体会员。

（七）期货公司。

**三、测试内容**

**（一）测试安排**

1月1日上午8:30开始，各参测会员可进行系统接入，当日交易时间表及场景安排如下：

**竞价交易平台时间表**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **交易时间表** | **测试内容**  |
| 本所 | 9:15-9:25 集合竞价 | 模拟集合竞价 |
| 9:30-10:30 连续竞价 | * 9:30-9:40 在此时段内，各会员申报买入订单的价格不得高于前收价的+5%，申报卖出订单的价格不得低于前收价的-5%。会员此时每笔申报订单中的产品数量不宜过大，从而避免给后续模拟触发熔断带来较大阻力。
* 9:40 模拟触发+5%可恢复交易熔断。
* 9:40开始直至熔断触发前，各会员申报买入订单的价格需高于产品前收价的+5%、低于产品前收价的+7%，同时申报卖出订单的价格不得低于前收价的+5%。
* 熔断触发后，各会员申报买入订单的价格不得高于前收价的+7%，申报卖出订单的价格不得低于前收价的-5%。
 |
| 10:30-10:35 盘中休市 |  |
| 10:35-11:30 连续竞价 | * 10:35-11:10 各会员申报买入订单的价格不得高于前收价的+7%，申报卖出订单的价格不得低于前收价的-5%。会员此时每笔申报订单中的产品数量不宜过大，从而避免给后续模拟触发不可恢复熔断带来较大阻力。
* 11:10 模拟触发+7%不可恢复交易熔断。
* 11:10开始直至熔断触发前，各会员申报买入订单的价格范围需高于产品前收价的+8%，申报卖出订单的价格不得低于前收价的+7%。不可恢复熔断发生后，会员可以自由申报订单。
 |
| 中国结算 | 11:30 - 12:00 | 接收交易数据 |
| 12:00 - 15:00 | 登记结算处理 |
| 14:00 - 16:00 | 登记结算数据发送 |

**综合业务平台交易时间表**

|  |  |
| --- | --- |
| **交易时间表** | **测试内容**  |
| 9:15-9:25 集合竞价 |   |
| 9:30-10:30 连续竞价 | 9:40 竞价触发+5%可恢复交易熔断 |
| 10:30-10:35 盘中休市 |  |
| 10:35-11:30 连续竞价 | 11:10 竞价触发+7%不可恢复交易熔断 |
| 11:30-11:40 | 转融通成交 |
| 11:30-11:45 | 大宗成交申报、盘后固定价格申报 |

**衍生品平台交易时间表**

|  |  |
| --- | --- |
| **交易时间表** | **测试内容**  |
| 9:15-9:25 集合竞价 |  |
| 9:30-10:30 连续竞价 | 9:40 竞价触发+5%可恢复交易熔断 |
| 10:30-10:35 盘中休市 |  |
| 10:35-11:30 连续竞价 | 11:10 竞价触发+7%不可恢复交易熔断 |

市场具体进入熔断期的时间点，以测试实际情况为准。参测会员应按照测试方案要求准备订单数据，若会员未按要求申报订单，对测试构成影响的，本所将视情况采取相关监管措施。

**（二）测试场景**

1.9:40触发+5%可恢复交易熔断。

受影响：A股成交、期权成交，预期会员单位在熔断期间不能接收到成交回报。

不受影响：A股交易订单申报及撤单、A股非交易、大宗意向申报、转融通非约定/约定申报、期权非交易(锁定/解锁)。

2.11:10触发+7%不可恢复交易熔断。

受影响：A股交易、期权交易、大宗意向申报、转融通非约定/约定申报。

不受影响：A股交易订单撤单、期权非交易(锁定/解锁)。

3.连续交易时段。A股交易、大宗意向申报、转融通非约定/约定申报、期权交易、期权非交易(锁定/解锁)均可正常申报。预期会员单位相关业务订单申报处理不受影响。

4.盘后申报时段。由于测试触发了+7%不可恢复熔断，大宗盘后固定价格申报、大宗成交申报均不能正常进行。转融通申报也不能正常进行，但对于盘中已经申报成功的订单仍可正常进行撮合成交。

**四、测试数据准备**

此次测试基础数据以2015年12月31日（周四）00、01、03环境闭市后生产数据为准，包括股票证券账户及持仓、交易单元、指定交易、清算路径等。

**五、数据发送与接收**

**（一）开市前通过单向卫星获得以下信息文件**

1.产品基础信息文件接口（CPXX）。

2.产品非交易基础信息接口（FJY）。

3.ETF公告文件（50ETF、180ETF）。

4.期权基础信息文件（reff03）。

5.转融通标的证券清单（zrtbd）。

**（二）订单申报**

参演会员使用EzOES接入竞价交易平台00环境，使用EzSTEP接入综合业务平台01环境，使用EzSTEP接入衍生品交易平台03环境进行订单申报，接入IP同生产环境配置。

**（三）行情接收**

参测会员可使用EzSR接收竞价行情mktdt00.txt、Show2003.dbf，期权行情mktdt03.txt。

**（四）盘后数据发送**

参测会员通过EzTrans取得过户数据。

**六、注意事项**

（一）参测会员应按照测试方案要求准备订单数据，若会员未按要求申报订单，对测试构成影响的，本所将视情况采取相关监管措施。

（二）测试完成后，请参测会员于1月1日17:00前至本所官方网站会员专区提交测试反馈表（详见附件）。期货公司请将反馈表发至本所，Email：tech\_support@sse.com.cn。

（三）测试期间，如发现异常请及时反馈至本所或中国结算上海分公司，并留下单位名称、联系人和电话。

测试日现场联系：本所：4009003600，传真：021-68810883，Email：tech\_support@sse.com.cn。

中国结算上海分公司：021-58887750，传真：021-58888760，PROP技术支持热线：021-62321666。

附件：1月1日指数熔断通关测试反馈表

**附件**

1月1日指数熔断通关测试反馈表

|  |  |
| --- | --- |
| 会员名称： | 会员编码： |
| **测试情况**1. 可恢复交易熔断期间各类业务订单申报、撤单、成交接收是否符合预期 是□ 否 □

若不符合预期，请具体说明： 1. 不可恢复交易熔断期间各类业务订单申报、撤单、成交接收是否符合预期 是□ 否□

若不符合预期，请具体说明： 1. 正常交易时段各类业务订单申报、撤单、成交接收是否符合预期 是□ 否□

若不符合预期，请具体说明： 1. 行情揭示是否符合预期 是□ 否□

若不符合预期，请具体说明： 1. 技术系统是否已就绪 是□ 否□
 |
| **其他异常情况：** |
| 备注： |
| **联系人： 联系电话：****联系邮箱：** |