**附件1**

12月19日网上IPO性能全网测试方案

**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、基金公司共同参与进行。测试旨在检验各参测方在网上IPO大压力、大容量订单申报情况下的实时处理能力和盘后处理能力是否满足系统设计预期。

测试中，本所将配置10只处于T日的IPO产品，中国结算将在测试日当日同时配置5只处于T+1日、5只处于T+3日的IPO产品。主要测试内容包括T日实时阶段对网上IPO产品进行大压力大容量订单申报、T日盘后阶段对网上IPO订单大容量情况下的闭市数据处理、T+1日中签清算处理、T+3日新股放弃申购申报处理4项测试内容。

此次测试本所使用竞价交易平台00环境，中国结算上海分公司使用生产环境。测试将模拟1个完整交易日的交易和结算。

**二、参测单位**

（一）本所及本所信息公司。

（二）中国结算上海分公司。

（三）全体会员。

（四）基金公司。

**三、测试时间表**

12月19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：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **交易时间表** | **测试内容** |
| 本所 | 9:15-9:25 集合竞价 |  |
| 9:30-11:30 连续竞价 | 模拟IPO订单大压力申报 |
| 13:00-15:00 连续竞价 | 模拟IPO订单大压力申报 |
| 中国结算 | 13:00-15:00（PROP申报） | 模拟IPO放弃申购大压力申报 |
| 15:00-18:00 | 登记结算处理 |
| 18:30-20:00 | 登记结算数据发送 |

**四、测试内容**

**（一）T日盘中IPO订单申报**

为保证测试有效性，会员单位申报IPO订单要求如下：

1.测试中，各参测会员须使用本单位所有市值满足一个最小申购单位及以上的全部账户参与IPO订单的申报。

2.每个申购账户须按其所能够申报的最大数量进行订单申报，从而获得最多配号。

3.每个申购账户须对测试方案中设计的10只IPO产品进行申报，从而模拟出一定规模的订单量。

4.参测会员须在交易时段内以所能够申报的最快速度将所有设计的IPO订单申报完毕，从而模拟出较大的实时申报压力。

5.测试期间，若IPO订单申报数量达到本所技术系统容量上限，系统将返回废单，预期各参测单位应能正常处理。

**（二）T+1日新股中签清算**

中国结算上海分公司将安排5只证券进行中签清算处理。新股中签清算的安排如下：每只中签的产品采用相同的方式生成模拟测试数据。以2015年12月18日闭市后中国石化（600028）的持仓和指定交易关系为准，每个持有该股票且有指定交易关系的证券账户每只证券中签3000股。

在测试当日日终，中国结算上海分公司在日终登记结算数据中发送5只新股的中签清算数据，请各结算参与人据此进行中签清算处理。

**（三）T+3日新股放弃申购申报**

中国结算上海分公司将安排5只证券的中签数据供参与人进行放弃申购申报。放弃申购申报的安排如下：每只新股放弃申购申报的产品采用相同的方式生成模拟测试数据。以2015年12月18日闭市后中国石化（600028）的持仓和指定交易关系为准，每个持有该股票且有指定交易关系的证券账户每只证券中签5000股。

请各参测单位做好相关证券账户、专用中签股份的初始化工作，并通过以上安排做好放弃申购申报工作。为了验证测试性能，请参测单位在13：30-13:45、14：00-14：15、14：30-14：45时间段集中进行弃配申报。请各参测单位对中签的5只证券安排好一定规模的放弃申报量（建议至少有一半账户申报放弃），在规定的3个集中申报时段内以最快速度将所有设计的弃配报单申报完毕，从而模拟出较大的实时申报压力。

**（四）闭市数据处理**

参测会员应按照测试方案要求，完成测试当日完整的闭市处理流程验证，记录并反馈IPO过户及清算数据处理耗时。

**五、测试数据准备**

**（一）基础数据**

此次测试基础数据以2015年12月18日（周五）00环境闭市后生产数据为准，包括账户市值、证券账户及持仓、交易单元、指定交易、清算路径等。

**（二）T日产品设置**

测试共设置10只处于T日的新股产品，主承销席位是国泰君安 21022，主承销账户为D890338310。产品详细参数设置如下：

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **股票**  **代码** | **股票**  **简称** | **发行**  **代码** | **发行**  **价格** | **发行**  **数量** | **配号**  **代码** | **发行**  **简称** | **申购**  **配号日** | **中签日** |
| 1 | 600910 | 新股测一 | 730910 | 4.99元 | 9999亿 | 741910 | 申购测一 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 2 | 600911 | 新股测二 | 730911 | 5.00元 | 1000亿 | 741911 | 申购测二 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 3 | 600912 | 新股测三 | 730912 | 5.01元 | 100亿 | 741912 | 申购测三 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 4 | 600913 | 新股测四 | 730913 | 6.00元 | 10亿 | 741913 | 申购测四 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 5 | 601820 | 新股测五 | 780820 | 7.00元 | 1亿 | 791820 | 申购测五 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 6 | 601821 | 新股测六 | 780821 | 8.00元 | 1千万 | 791821 | 申购测六 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 7 | 601822 | 新股测七 | 780822 | 9.00元 | 1百万 | 791822 | 申购测七 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 8 | 603810 | 新股测八 | 732810 | 10.00元 | 10万 | 736810 | 申购测八 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 9 | 603811 | 新股测九 | 732811 | 20.00元 | 1万 | 736811 | 申购测九 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |
| 10 | 603812 | 新股测十 | 732812 | 99.99元 | 1千 | 736812 | 申购测十 | 2015-12-19 | 2015-12-20 |

**（三）T+1日产品设置**

测试共设置5只处于T+1日的新股中签清算的产品，主承销席位是国泰君安 21022，主承销账户为D890338310。产品详细参数设置如下：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **证券代码** | **证券简称** | **申购价格** | **发行代码** | **中签数量** |
| 1 | 601831 | 中签测一 | 2.10 | 780831 | 3000股 |
| 2 | 601832 | 中签测二 | 2.20 | 780832 | 3000股 |
| 3 | 601833 | 中签测三 | 2.30 | 780833 | 3000股 |
| 4 | 601834 | 中签测四 | 2.40 | 780834 | 3000股 |
| 5 | 601835 | 中签测五 | 2.50 | 780835 | 3000股 |

**（四）T+3日产品设置**

测试共设置5只处于T+3日的放弃申购的产品，主承销席位是国泰君安 21022，主承销账户为D890338310。产品详细参数设置如下：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **证券代码** | **证券简称** | **申购价格** | **发行代码** | **中签数量** |
| 1 | 601851 | 弃配测一 | 2.10 | 780851 | 5000股 |
| 2 | 601852 | 弃配测二 | 2.20 | 780852 | 5000股 |
| 3 | 601853 | 弃配测三 | 2.30 | 780853 | 5000股 |
| 4 | 601854 | 弃配测四 | 2.40 | 780854 | 5000股 |
| 5 | 601855 | 弃配测五 | 2.50 | 780855 | 5000股 |

**（五）ZQY文件获取**

参测会员在12月19日对新股申购订单进行校验时，应以2015年12月18日（周五）下午沪市00环境发送的ZQY.dbf文件为准。

**（六）资金账户余额设置**

中国结算上海分公司统一将所有结算参与人的备付金账户余额修改为100亿元。

**六、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）。

**（二）订单申报**

参演会员使用EzOES接入竞价交易平台00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。

**（四）盘后数据发送**

参测会员通过EzTrans取得过户数据。

**七、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，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12月21日12点前至本所官方网站会员专区提交测试反馈表（详见附件）。

请托管银行在填妥反馈表后打印盖章，以邮件形式于12月21日12点前发送至中国结算上海分公司，Email：shtest@chinaclear.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：12月19日网上IPO性能全网测试反馈表

**附件**

**12月19日网上IPO性能全网测试反馈表**

|  |  |
| --- | --- |
| 会员名称： | 会员编码： |
| **测试情况**  1.参测系统开发商  2.参测系统IPO订单设计峰值速度 ，当日IPO订单申报最大速度  3.参测系统IPO订单设计容量上限 ，当日实际申报IPO订单笔数  4.持仓市值满足IPO申报条件的账户数  5.参与申报IPO账户数  6.日终获得IPO配号总数量  7.日终从接收到IPO过户清算数据到全部完成IPO数据处理总耗时  8.参与申报弃配的笔数 笔  9.柜台系统IPO订单实时处理能力是否符合设计预期  10.柜台系统盘后数据处理能力（耗时）是否符合设计预期  11.登记结算处理是否符合设计预期  12.技术系统改造就绪情况  13.技术系统改造未就绪，请说明哪些部分尚未就绪，原因是什么  14.如技术系统改造未就绪，预计何时可以就绪  测试负责人  联系方式  其他测试情况说明 | |
| 备注： | |
| **联系人： 联系电话：**  **联系邮箱：** | |