关于开展沪深300ETF期权业务通关

测试的通知

各会员单位及市场参与者：

上海证券交易所联合中国证券登记结算有限责任公司上海分公司定于2019年12月21日（周六）组织开展沪深300ETF期权业务通关测试（方案详见附件）,请有相关资质的市场参与者参加，验证沪深300ETF期权业务功能。

请各参测单位务必高度重视，组织专人负责。测试结束后，请于12月21日（周六）15:00前在会员专区提交测试情况反馈表。如有疑问，请及时联系技术服务热线：4009003600。

特此通知。

附件：沪深300ETF期权业务通关测试方案

 上海证券交易所

 二○一九年十二月十八日

附件：

沪深300ETF期权业务通关测试方案

**一、方案概要**

上海证券交易所（以下简称本所）定于2019年12月21日（周六）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，组织开展沪深300ETF期权业务全网测试，模拟现货证券（含华泰柏瑞沪深300ETF）及其期权品种的交易、非交易等业务的委托申报、成交回报、行情接收、清算交收等业务处理过程，检验市场参与各方技术系统正确性。测试使用竞价撮合平台00环境、期权业务平台03环境，行情文件为mktdt00.txt、mktdt03.txt。

**二、参测单位**

（一）本所技术公司、信息公司。

（二）中国结算上海分公司。

（三）参测市场参与者。

（四）参测信息商。

**三、测试内容**

测试模拟一个交易日的交易和清算（T日为20191221），测试用期权标的为510300，主要验证相关各方可正确处理现货证券及其期权品种的交易与非交易、行情接收与展示、清算交收等业务。具体内容如下：

（一）510300ETF期权合约订单申报：买入/卖出开仓、买入/卖出平仓、备兑开仓、备兑平仓。

（二）证券锁定解锁指令申报：证券锁定指令申报、证券解锁指令申报。

（三）保证金查询指令：开仓、平仓、组合、拆分后保证金查询。

（四）组合与拆分：认沽牛市价差组合策略构建与拆分、认沽熊市价差组合策略构建与拆分、认购牛市价差组合策略构建与拆分、认购熊市价差组合策略构建与拆分、跨式空头组合策略构建与拆分、宽跨式组合策略构建与拆分。

（五）行情与盘后报表接收与处理：期权行情mktdt03.txt接收与处理、期权过户OGH接收与处理。

（六）结算处理：日终交易结算、备兑锁券及维持保证金收取、结算文件接受与处理。

（七）510300ETF申赎与交易：510300ETF申赎订单申报、510300ETF交易订单申报。

**四、测试时间安排**

测试时间为2019年12月21日（周六）8:30至16:00，接收交易委托时间为9:15至11:30。其中，10:30-10:35模拟中午休市。具体安排如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **实际时间** | **主要测试事项** | **参测单位****重点测试内容** |
| 9:15前 | 开市前公告文件（含cpxx、reff03、zhcl等） | 接收并处理公告文件 |
| 9:15-12:00 | 接收竞价、期权的交易及非交易等委托，交易时间表详见下文 | 模拟现货（含ETF）、期权等品种交易、非交易业务的委托申报，接收成交回报，接收并展示实时行情 |
| 12:00-14:00 | 中国结算上海分公司模拟T日股份资金清算交收。 |  |
| 14:00后 | T日盘后数据发送。 | 接收盘后数据,进行核对及交收处理（含OGH等） |

**五、测试数据准备**

测试所使用的证券账户、交易单元、指定交易、清算路径、产品持有、权益数据、做市商信息、保证金等均以2019年12月20日（周五）闭市后生产环境数据为基准。

测试使用的华泰柏瑞沪深300ETF产品PCF文件与2019年12月23日（周一）生产环境使用的PCF文件一致，基金管理人无需上传测试用PCF文件。测试新增ETF期权标的参数如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **期权类型** | **标的证券代码** | **主要参数** |
| ETF期权 | 510300 | 初始挂牌1月、2月、3月、6月合约 |

**六、测试交易时间表**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **竞价撮合平台** | **期权业务平台** |
| 1 | 09:15-09:25 | 开市集合竞价 | 09:15-09:25 | 开市集合竞价 |
| 2 | 09:30-10:30 | 连续竞价 | 09:30-10:30 | 连续竞价 |
| 3 | 10:35-11:27 | 连续竞价 | 10:35-11:27 | 连续竞价 |
| 4 | 11:27-11:30 | 收盘集合竞价 | 11:27-11:30 | 收盘集合竞价 |
| 5 | 11:30-12:00 | 债券质押式回购延长 |  |  |
| 6 | 12:00-14:00 | 闭市处理 | 12:00-14:00 | 闭市处理 |

**七、数据接收与发送**

参测单位通过EzSR、MDGW等软件接收行情文件mktdt00.txt、mktdt03.txt，接入地址同生产；通过UT、BT等软件获取cpxx系列、reff03、zhcl等文件。

**八、测试注意事项**

（一）请参测单位先完成交易生产数据接收及备份，再准备2019年12月21日测试相关数据。

（二）测试数据仅为模拟测试数据，与实际业务无任何关系，不能作为生产环境任何交易、非交易、账户等业务依据。

（三）测试期间通过交易终端进行的密码修改、用户添加等用户管理相关操作仅在测试期间有效，仅适用于2019年12月21日通关测试。

（四）期权行情不纳入Level-2行情、仅在Level-1行情发布。请相关参测单位检查自身技术系统期权行情正确性。

**九、测试要求**

（一）请有资质的市场参与者务必参加测试。因故不能参加测试者，请务必填写反馈表（详见附件）说明原因。

（二）各参测单位应使用与2019年12月23日生产系统相同的数据及软硬件环境参加测试。

（三）请各参测单位务必在测试前做好线上系统和数据环境的保护工作，测试完成后做好线上系统变更稽核和线上数据环境恢复工作，确保下一交易日（2019年12月23日）生产系统正常运行。

（四）测试过程中，请各参测单位详细记载测试现象与结果，检查业务正确性。如发现异常现象，请及时报告。

（五）请各参测单位务必高度重视，组织专人负责测试工作。请于12月21日（周六）15:00前在会员专区提交测试情况反馈表（详见附件）。

（六）测试期间联系电话：4009003600。

附件： 沪深300ETF期权业务通关测试情况反馈表

附件：

沪深300ETF期权业务通关测试情况反馈表

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 机构基本情况 | 机构名称 |  |
| 参与机构所属类别 | □证券公司 □基金公司 □期货公司□保险公司 □托管银行 □其他 |
| 联系人 | 姓名 |  | 电话 |  |
| 手机 |  | 电子邮件 |  |
| 反馈项目 | 答案 |
| 柜台系统是否必须升级（必填） | 必须□ 非必须□ 无此业务□ |
| 技术系统改造就绪情况 （必填） | 完成□ 未完成□ 无需改造□ |
| 若未就绪，改造完成时间（必填） | 一周□ 一月□ 更长时间□ 不适用□ |
| 测试完成情况（必填） | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 510300ETF申赎订单申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 510300ETF交易订单申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 510300期权合约买入开仓订单申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 510300期权合约卖出开仓订单申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 510300期权合约买入平仓订单申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 510300期权合约卖出平仓订单申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 510300期权合约备兑开仓订单申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 510300期权合约备兑平仓订单申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 证券锁定指令申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 证券解锁指令申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 开仓保证金查询指令 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 平仓保证金查询指令 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 组合构建后保证金查询指令 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 组合拆分后保证金查询指令 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 认沽牛市价差组合策略构建与拆分 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 认沽熊市价差组合策略构建与拆分 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 认购牛市价差组合策略构建与拆分 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 认购熊市价差组合策略构建与拆分 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 跨式空头组合策略构建与拆分 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 宽跨式空头组合策略构建与拆分 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 期权行情接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 期权过户接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 结算处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 备注 | 测试发现的异常及其它反馈信息 |