关于开展沪深300ETF期权业务

全网测试的通知

各会员单位及市场参与者：

上海证券交易所定于2019年12月14日（周六）联合中国证券登记结算有限责任公司上海分公司，组织开展沪深300ETF期权业务全网测试（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16日（周一）12:00前在会员专区[提交测试情况反馈表](mailto:提交第一轮测试情况反馈表至test_support@sse.com.cn；请于4月19日15)。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期权业务全网测试方案

上海证券交易所

二〇一九年十二月十一日

附件：

沪深300ETF期权业务全网测试方案

**一、方案概要**

上海证券交易所（以下简称本所）定于2019年12月14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，验证相关业务功能。测试使用竞价撮合平台88环境、期权业务平台83环境，行情文件为mktdt88.txt、mktdt91.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1个交易日的交易，测试交易日同真实日期（20191214），测试用期权标的为510300。主要测试内容如下：

（一）510300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）会员申请转处置证券账户申报：划入处置证券账户验证、划出处置证券账户验证。

（四）保证金查询指令：开仓、平仓、组合、拆分后保证金查询。

（五）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。

（六）行情与盘后报表接收与处理：期权行情mktdt91.txt接收与处理、期权过户OGH接收与处理。

（七）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。

（八）510300ETF申赎与交易：510300ETF申赎订单申报、510300ETF交易订单申报。

**四、测试数据**

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、保证金等均以2019年12月13日（周五）闭市后生产环境数据为基准。

测试使用的ETF产品PCF文件与2019年12月13日（周五）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12月、1月、3月、6月合约 |

**五、测试交易时间表**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **竞价撮合平台** | | | **期权业务平台** | |
| 1 | | 13:15-13:25 | 开市集合竞价 | 13:15-13:25 | 开市集合竞价 |
| 2 | | 13:30-14:30 | 连续竞价 | 13:30-14:30 | 连续竞价 |
| 3 | | 14:35-14:57 | 连续竞价 | 14:35-14:57 | 连续竞价 |
| 4 | | 14:57-15:00 | 收盘集合竞价 | 14:57-15:00 | 收盘集合竞价 |
| 5 | | 15:00-15:30 | 债券质押式回购延长 | 15:00-15:30 | 行权指令合并申报 |
| 6 | | 15:30-18:00 | 闭市处理 | 15:30-18:00 | 闭市处理 |

**六、数据接收与发送**

参测单位通过EzSR、MDGW等软件接收行情文件mktdt88.txt、mktdt91.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。

**七、测试注意事项**

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16日（周一）12:00前在会员专区提交测试情况反馈表（详见附件），并在测试结束后做好系统与数据恢复，务必不能影响正常生产。测试期间联系电话：4009003600。

附件： 沪深300ETF期权业务全网测试情况反馈表

附件：

沪深300ETF期权业务全网测试情况反馈表

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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□ | | |
| 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□ | | |
| 会员申请划入处置证券账户申报 | | | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ | | |
| 会员申请划出处置证券账户申报 | | | 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□ | | |
| 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□ | | |
| 备注 | | | 测试发现的异常及其它反馈信息 | | |