关于开展跨市场股票ETF结算模式调整

通关测试的通知

各会员单位及市场参与者：

上海证券交易所配合中国证券登记结算有限责任公司上海分公司定于2020年1月18日（周六）组织开展跨市场股票ETF结算模式调整通关测试（方案详见附件）, 要求全体已有跨市场股票ETF产品上市交易的基金公司参加，邀请其他市场参与者参加，验证相关业务调整。

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1月18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：跨市场股票ETF结算模式调整通关测试方案

上海证券交易所

二〇二〇年一月十五日

附件：

跨市场股票ETF结算模式调整通关测试方案

**一、方案概要**

上海证券交易所（以下简称本所）定于2020年1月18日（周六）配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，组织开展跨市场股票ETF结算模式调整通关测试，模拟跨市场股票ETF业务的申购赎回、交易委托、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、综合业务平台01环境，本所行情文件为mktdt00.txt、mktdt01.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20200118），主要验证跨市场股票ETF结算模式调整后，市场各方技术系统在申赎、交易、清算等方面的正确性。具体如下：

（一）跨市场股票ETF的申赎委托申报、交易委托（含大宗交易）申报、成交回报（当日申购的份额，同日即可卖出，与单市场股票ETF保持一致）；

（二）跨市场股票ETF实时行情的接收与展示；

（三）跨市场股票ETF盘后报表的接收与处理；

（四）跨市场股票ETF清算数据的接收与处理。

**四、测试时间安排**

测试时间为2020年1月18日（周六）4:30至15:00，接收交易委托时间为9:15至12:00。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** |
| 8:00前 | 基金公司上传PCF文件 | 上传PCF文件并接收回执 |
| 9:00前 | 开市前公告文件（含cpxx、fjy等） | 接收并处理公告文件 |
| 9:15-12:00 | 跨市场股票ETF业务功能测试，交易时间表详见下文 | 跨市场股票ETF申购赎回（当日申购当日可卖）、交易委托（含大宗交易），接收成交回报，接收并展示实时行情 |
| 13:30后 | T日盘后数据发送 | 接收并处理盘后数据（含GH、DGH等），清算交收等 |

**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2020年1月17日（周五）闭市后生产环境数据为基准。

**六、测试交易时间表**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **竞价撮合平台** | **综合业务平台** |
| 1 | 09:15-09:25 | 开市集合竞价 | 09:15-09:25 | 集合竞价 |
| 2 | 09:30-10:30 | 连续交易 | 09:30-10:30 | 连续交易 |
| 3 | 10:35-11:27 | 连续交易 | 10:35-11:30 | 连续交易 |
| 4 | 11:27-11:30 | 收盘集合竞价 | 11:30-12:00 | 大宗交易/盘后交易 |
| 5 | 11:30-12:00 | 债券质押式回购延长 | 12:00-14:00 | 闭市处理 |
| 6 | 12:00-14:00 | 闭市处理 |  |  |

**七、数据接收与发送**

参测单位通过MDGW、UT、BT等软件获取cpxx、fjy等文件，通过EzSR、MDGW等软件接收mktdt00.txt、mktdt01.txt等行情。

**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2020年1月18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2020年1月18日通关测试。

**九、测试要求**

（一）请已有跨市场股票ETF产品上市交易的基金公司务必参加测试。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2020年1月20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（2020年1月20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1月18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： 跨市场股票ETF结算模式调整通关测试情况反馈表

附件：

跨市场股票ETF结算模式调整通关测试

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 □跨市场股票ETF基金管理人□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□ |
| 跨市场股票ETF申赎 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 跨市场股票ETF交易 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 跨市场股票ETF成交回报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 跨市场股票ETF行情接收与处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 盘后报表数据接收与处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 结算数据接收与处理 | 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 |