关于开展港股通南向投资者识别码通关测试的通知

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总部及上海分公司定于2020年1月11日（周六）组织开展港股通南向投资者识别码通关测试（方案详见附件）,要求全体有港股通资质的市场参与者参加，验证相关业务功能。

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1月11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：港股通南向投资者识别码通关测试方案

上海证券交易所

二〇二〇年一月八日

附件：

港股通南向投资者识别码通关测试方案

**一、方案概要**

上海证券交易所（以下简称本所）定于2020年1月11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）总部及上海分公司、香港交易所，组织开展港股通南向投资者识别码通关测试，模拟港股通相关业务的委托申报、成交回报、行情接收等业务处理过程，检验市场参与各方技术系统正确性。测试使用港股通系统04环境，本所行情文件为trdses04.txt，港交所行情文件为mktdt04.txt。

**二、参测单位**

（一）本所技术公司、信息公司。

（二）中国结算总部及上海分公司。

（三）香港交易所。

（四）参测市场参与者。

（五）参测信息商。

**三、测试内容**

测试模拟一个交易日的交易（T日为20200111），主要验证对于境内港股通投资者实时交易订单，本所技术系统在向港交所转发时附加该投资者相应的南向投资者识别码（本所市场端软件无需升级改造）。具体如下：

（一）港股通交易业务的委托申报、成交回报；

（二）港股通实时行情的接收与展示。

**四、测试时间安排**

测试时间为2020年1月11日（周六）8:30至12:30，港股通接收交易委托时间为9:00至12:10。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** |
| 9:00前 | 开市前公告文件（含zxjc、reff04等） | 接收并处理公告文件 |
| 9:00-12:10 | 接收港股通的交易等委托，交易时间表详见下文 | 模拟港股通的交易委托申报，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HGH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10日（周五）闭市后生产环境数据为基准。

**六、测试交易时间表**

|  |  |
| --- | --- |
|  | **港股交易时间表** |
| 1 | 09:00-09:30 | 开市前时段 |
| 2 | 09:30-12:00 | 持续交易时段 |
| 3 | 12:00-12:10 | 收市竞价交易时段 |

**七、数据接收与发送**

参测单位通过MDGW、UT、BT等软件获取zxjc、reff04、trdses04、mktdt04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2020年1月11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11日通关测试。

**九、测试要求**

（一）请有港股通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2020年1月13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13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11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： 港股通南向投资者识别码通关测试情况反馈表

附件：

港股通南向投资者识别码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 |
| 测试完成情况（必填） | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 港股通盘前公告接收与处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 港股通整股交易委托 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 港股通零股交易委托 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 港股通行情接收与展示 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 港股通盘后数据接收与处理 | 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 |