关于开展ETF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2020年4月11日（周六）组织开展ETF全网测试（测试方案详见附件），邀请已就绪的基金公司参加，要求参与ETF业务的市场参与者参加，验证相关各方技术系统的ETF定义文件上传、ETF交易、ETF申赎、行情展示及盘后报表处理等功能。

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2020年4月13日（周一）12:00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：ETF全网测试方案

上海证券交易所

二○二○年四月七日

附件

ETF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2020年4月11日（周六）会同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ETF全网测试，模拟参测ETF产品（见附件1）的定义文件上传、交易委托（含大宗交易）、申赎委托、成交回报、行情接收、报表处理等业务过程，检验市场各方技术系统正确性。测试使用竞价撮合平台88环境、综合业务平台89环境，行情文件为mktdt88.txt、mktdt89.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20200411），主要验证相关各方可正常开展参测ETF产品的定义文件上传、交易委托申报成交、申赎委托申报、行情接收与展示、盘后报表接收与处理等业务。具体内容如下：

（一）ETF定义文件上传：在规定时间内参测基金公司通过证通云盘或EzTrans上传参测ETF产品的定义文件（附件1中斜体灰化的产品为2.0版本，其余产品为2.1版本），同时通过本所信息公司网站上传相应定义文件。

（二）盘前公告（CPXX、ETF公告等）：正常接收、加载。

（三）ETF交易订单：柜台系统在竞价撮合平台、综合业务平台正常申报、接收成交回报（含大宗交易）。

（四）ETF申赎订单：柜台系统在竞价撮合平台、综合业务平台正常申报、接收订单响应。

（五）行情：正常接收、展示。

（六）盘后报表（GH、DGH等）：正常接收、处理。

（七）清算交收：正常接收、处理中国结算盘后测试文件。

**四、测试时间安排**

测试时间为2020年4月11日（周六）6:00-15:00，接收交易委托时间为9:15-12:00。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** |
| 6:00-8:00 | ETF定义文件2.1版本 | 上传2.1版本ETF定义文件（部分产品上传2.0版本） |
| 8:15-9:15 | 开市前公告文件（含cpxx、fjy、ETF公告等） | 接收并处理公告文件 |
| 9:15-12:00 | 竞价、综业的ETF交易委托、申赎委托，交易时间表详见下文 | 模拟ETF交易委托申报，接收成交回报，ETF申赎委托申报，接收并展示实时行情 |
| 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GH、DGH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、减持控制信息等均以2020年4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**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **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 | 开市集合竞价 |
| 2 | 09:30-10:30 | 连续竞价 | 09:30-10:30 | 连续交易 |
| 3 | 10:35-11:27 | 连续竞价 | 10:35-11:30 | 连续交易 |
| 4 | 11:27-11:30 | 收盘集合竞价 | 11:30-12:00 | 盘后交易/大宗交易 |
| 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EzSR、MDGW等软件接收行情文件mktdt88.txt、mktdt89.txt，接入地址同生产；通过UT、BT等软件获取cpxx系列、ETF公告等文件。

**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4月11日测试相关数据。

（二）测试相关文件仅为模拟测试数据，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4月11日测试。

**九、测试要求**

（一）要求有业务需求的市场参与者必须参加测试。因故不能参加的，请务必填写反馈表（见附件2）说明原因。

（二）各参测单位应使用与2020年4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保护工作；测试完成后做好技术系统和数据环境恢复工作，确保下一交易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，并于2020年4月13日（周一）12:00前在会员专区提交测试情况反馈表（见附件2）。

测试期间联系电话：4009003600。

附件 1：ETF全网测试参测产品清单

2：ETF全网测试情况反馈表

附件1：

ETF全网测试参测产品清单

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **基金公司名称** | **参测基金代码1** | **参测基金代码2** | **参测基金代码3** | **参测基金代码4** | **参测基金代码5** | **参测基金代码6** |
| 博时基金 | 512960 | *510710* | 513500 | 511860 |  |  |
| 大成基金 | 515520 | 511690 | *510440* |  |  |  |
| 方正富邦基金 | 510550 |  |  |  |  |  |
| 富国基金 | 515950 | 515650 | 515750 | 510210 | 511900 | 511310 |
| 工银瑞信基金 | 510060 | 510350 |  |  |  |  |
| 广发基金 | 510510 |  | 511290 | 511950 |  |  |
| 国联安基金 | 512480 |  |  |  |  |  |
| 国寿安保基金 | 510380 |  |  |  |  |  |
| 国泰基金 | 512290 |  |  |  |  |  |
| 华安基金 | 510180 | 512120 | 513030 | *518880* | 511600 |  |
| 华宝基金 | 510030 | 511990 | 515000 |  |  |  |
| 华富基金 | 515980 |  |  |  |  |  |
| 华泰柏瑞基金 | 510300 | 510880 | 515580 |  |  |  |
| 华夏基金 | 510330 | 511650 | 513660 | 510050 | 511280 |  |
| 汇安基金 | 512150 |  |  |  |  |  |
| 汇添富基金 | 512820 | 512650 | *510810* | 519888 | 511980 |  |
| 嘉实基金 | 515860 | 512550 | 512750 |  |  |  |
| 嘉实基金 | 511960 |  |  |  |  |  |
| 建信基金 | 511660 | 512530 | 513680 | 512180 | 510800 |  |
| 交银施罗德基金 | 510010 |  |  |  |  |  |
| 金鹰基金 | 511770 |  |  |  |  |  |
| 景顺长城基金 | 512280 | 512220 |  |  |  |  |
| 民生加银基金 | 515350 |  |  |  |  |  |
| 南方基金 | 510500 | 512100 | 510290 | 513600 | 513800 | 511810 |
| 鹏华基金 | 510070 | 512690 | 511820 |  |  |  |
| 平安基金 | 510590 | 511020 | *511700* |  |  |  |
| 前海开源基金 | 515590 |  |  |  |  |  |
| 融通基金 | 511911 |  |  |  |  |  |
| 山西证券 | 515570 |  |  |  |  |  |
| 申万菱信基金 | 515200 |  |  |  |  |  |
| 泰康资产 | 515380 |  |  |  |  |  |
| 天弘基金 | 515330 |  |  |  |  |  |
| 万家基金 | 510680 |  |  |  |  |  |
| 万家基金 | 510680 |  |  |  |  |  |
| 新华基金 | 512920 |  |  |  |  |  |
| 兴业基金 | 510890 |  |  |  |  |  |
| 易方达基金 | 510100 | 510310 | *510900* | 513090 | 513050 |  |
| 易方达基金 | 511800 |  |  |  |  |  |
| 银华基金 | 512380 | 511880 | 510430 |  |  |  |
| 招商基金 | 515080 | 510150 | 511850 |  |  |  |
| 浙商证券资管 | 512190 |  |  |  |  |  |
| 中融基金 | 515550 | 511930 |  |  |  |  |
| 中信建投基金 | 512850 |  |  |  |  |  |
| 南华基金 | 512870 |  |  |  |  |  |

附件2：

ETF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□ |
| ETF定义文件上传 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| ETF交易委托申报成交（含大宗交易） | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| ETF申赎委托申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| ETf成交回报接收 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 盘前公告接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 行情接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 盘后报表接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 清算交收 | 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 |