关于开展ETF业务升级通关测试的通知

各会员单位及市场参与者：

上海证券交易所定于2020年4月18日（周六）组织开展ETF业务升级通关测试（测试方案详见附件），要求全体市场参与者参加，验证相关各方技术系统的ETF定义文件上传、ETF交易、ETF申赎、FJY文件处理、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：ETF业务升级通关测试方案

上海证券交易所

二○二○年四月十三日

附件

ETF业务升级通关测试方案

**一、方案概要**

上海证券交易所（以下简称本所）定于2020年4月18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业务升级通关测试，模拟参测ETF产品的定义文件上传、交易委托（含大宗交易）、申赎委托、成交回报、FJY文件处理、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00环境、综合业务平台01环境，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）全体市场参与者。

（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20200418），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、FJY文件处理、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：在规定时间内基金公司通过证通云盘或EzTrans上传定义文件，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、FJY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18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 | 上传ETF定义文件 |
| 8:15-9:15 | 开市前公告文件 | 接收并处理公告文件（含cpxx、fjy、ETF公告等） |
| 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 | 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mktdt00.txt、mktdt01.txt，接入地址同生产；通过UT、BT等软件获取cpxx系列、ETF公告、FJY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18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18日测试。

**九、测试要求**

（一）要求全体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）说明原因。

（二）各参测单位应使用与2020年4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18日（周六）15:00前在会员专区提交测试情况反馈表（见附件）。

测试期间联系电话：4009003600。

附件：ETF业务升级通关测试情况反馈表

附件：

ETF业务升级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 |  | 邮箱 |  |
| 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□ 无此业务□ |
| ETF定义文件上传 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| ETF1.0版公告文件接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| ETF2.1版公告文件接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| 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□ 无此业务□ |
| 基于ETF1.0版公告文件，ETF申赎委托申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| 基于ETF2.1版公告文件，ETF申赎委托申报 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| ETF成交回报接收 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| 盘前公告接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| 行情接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| 盘后报表接收及处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| 清算交收 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| FJY公告的深市资金代码接收与处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ |
| FJY公告的深市资金代码（EX）是否影响FJY文件导入和已有业务开展 | 有影响（请在备注说明原因）□ 无影响□ |
| 备注（反馈项如有“未测”、“失败”、“部分通过”请在备注中说明原因） | 测试发现的异常及其它反馈信息 |