**国泰基金跨沪深港ETF全天候专项测试方案**

## 方案概要

为配合跨沪深港ETF产品推出，上海证券交易所（以下简称“本所”）联合中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（以下简称“中国结算上海分公司”）组织国泰基金及协测券商在本所全天候测试环境就跨沪深港ETF相关业务功能开展专项测试。

本次测试使用全天候测试90（竞价平台）环境、91（综业平台）环境、94（港股通平台）环境，参测机构可以通过上交所VPN或证联网访问。中国结算上海分公司的测试系统为全天候测试系统。

## 参测单位

1. 本所技术公司
2. 中国结算上海分公司
3. 国泰基金及其所邀请协测券商
4. 信息公司

## 测试时间表

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **步骤** | **时间段** | **测试内容** |
| **一、上交所测试日安排** | | |
| 1 | 18:00-8:10 | 模拟PCF文件上传时段 |
| 2 | 9:15-9:25 | 模拟集合竞价 |
| 3 | 9:30-10:30 | 模拟上午连续竞价 |
| 4 | 10:30-10:35 | 模拟盘中休市 |
| 5 | 10:35-11:42 | 模拟下午连续竞价 |
| 6 | 11:42-11:45 | 模拟收盘集合竞价 |
| 7 | 11:45-12:15 | 模拟生产15:00~15:30交易时间 |
| 8 | 12:15-18:00 | 模拟闭市处理 |
| 9 | 16:00-06:00 | 模拟过户文件发送 |
| **二、中国结算上海分公司测试日安排** | | |
| 1 | 13:30-16:00 | 模拟日终处理 |
| 2 | 16:00-18:00 | 模拟发送当日结算数据 |

## 测试内容

测试计划于2020年10月26日至2020年11月13日期间开展，持续15个工作日，测试用交易日同真实交易日期。本次测试模拟15个完整交易日和15个完整结算日，T日为2020年10月26日。测试内容安排如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **测试入口** | **测试日期** | **测试场景** | **测试描述** |
|  | T-1日前 | 各基金管理人、本所会员测试准备 | 基金管理人及协测会员需提前准备测试环境，  1.本次跨沪深港ETF认购期分为一天、三天  2.ETF定义文件中现金替代标志需全覆盖 |
| 本所-BT | T日 | 公告文件验证 | Fjy文件验证：  1.各机构能正常接收处理fjyyyyymmdd.txt文件；  2.预期fjyyyyymmdd.txt文件中包含认购数据。 |
| T+1~T+2日  （认购3天产品） |
| 本所-竞价平台（EzOES） | T日 | ETF认购验证 | 1.参测会员模拟投资者认购，预期认购成功；  2.认购期内每天都应有认购订单申报验证； |
| T+1~T+2日（限认购3天产品） |
|  | T+1日9:00前  （认购1天产品）  T+3日9:00前  （认购3天产品） | 比例配售验证 | 基金管理人提交全程比例配售确认比例 |
| 本所-证通云盘、EzTrans | T+5日  （认购1天产品）  T+7日  （认购3天产品） | 基金管理人PCF文件验证 | 1.PCF2.1版本文件上传验证；  2.se001fmxxxetfcyyyymmdd001.txt接收验证；（其中xxx为该ETF定义文件的指定基金编号） |
| 本所-BT | T+6~T+14日  （认购1天产品）  T+8~T+14日  （认购3天产品） | 公告文件验证 | 各参测机构能正常接收、处理下述文件：  1.cpxx系列文件验证  2.fjy文件验证：  (1)跨沪深港ETF 产品，fjyYYYYMMDD.txt中 “非交易业务类型” 字段取值为“EZ” ；  (2)跨沪深港ETF 产品非沪市资金代码，fjyYYYYMMDD.txt中“非交易业务类型”字段取值为“EX”，“备注”字段前两个字符取值为 “SZ”  (3)跨沪深港ETF 产品港市资金代码，fjyYYYYMMDD.txt中“非交易业务类型”字段取值为“EX”，“备注”取值为“HK”。  3.ETF公告文件xxxxxxmmdd2.etf(其中xxxxxx为基金二级市场交易代码)验证 |
| 本所-竞价平台（EzOES） | T+6~T+14日  （认购1天产品）  T+8~T+14日  （认购3天产品） | ETF申赎验证 | **申赎验证：**  1.沪市不可现金替代场景验证；  2.沪市可现金替代场景验证；  3.其他组合场景验证；  4.基金管理人接收、处理申购和赎回成交回报验证，预期正常；  5.成交回报记录应包含沪市资金记录、深市资金记录、港市资金记录，且对应的成交金额计算正确  6.申赎效率验证：  (1)T日申购的份额，预期T日可卖，T+1日可赎。  (2)T日买入的份额，预期T日可赎，T+1日可卖。  (3)T日买入的沪市证券，预期同日可以用于申购基金份额。  (4)T日赎回得到的沪市证券，预期同日可以卖出，但不得用于申购基金份额。 |
| 本所-竞价平台（EzOES） | T+6~T+14日  （认购1天产品）  T+8~T+14日  （认购3天产品） | ETF竞价交易验证 | **竞价平台交易验证：**  1.各时段交易验证，预期正常；  2.10%涨跌幅限制验证，预期正常；  3.交易单位验证，预期为100份及其整数倍；  4.最小变动单位验证，预期最小变动单位为0.001元。 |
| 综业平台（EzStep） | T+6~T+14日  （认购1天产品）  T+8~T+14日  （认购3天产品） | ETF大宗交易验证 | **1.大宗交易验证：** （1）大宗意向申报验证，预期规则同现有跨市场ETF；  （2）大宗成交申报验  1）申报时间验证，9:30-10:30,10:35-12:15期间申报，预期成功；  2）涨跌幅验证，预期涨跌幅为10%；  3）申报数量验证，申报数量预期不低于200万份或申报金额不低于200万元。  **2.大宗盘后固定价格验证：**  （1）申报时间验证：  1）9:30-10:30，10:35-12:15，大宗盘后固定价格申报，预期失败；  2）11:45-12:15，大宗盘后固定价格交易申报，预期正常；  （2）申报数量验证，预期同现有跨市场ETF交易规则。 |
| 本所-EzSR和行情网关 | T+6~T+14日  （认购1天产品）  T+8~T+14日  （认购3天产品） | FAST行情验证 | mktdt90.txt验证  1）预期ETF行情展示正确；  2）IOPV值验证，预期昨收IOPV值和实时IOPV值计算正确。 |
| 信息公司 | T+6~T+14日  （认购1天产品）  T+8~T+14日  （认购3天产品） | Level-2行情验证 | 各参测机构根据实际情况，从信息公司接收level-2行情，预期行情变动展示正常。 |
| 本所——证通云盘 | T~T+14日 | 盘后过户数据验证 | 1.ghxxxxx.zip接收处理验证；  2.dghxxxxx.zip接收处理验证。 |
| 中国结算上海分公司 | T~T+14日 | 清算交收 | 清算交收验证 |

## 测试数据

（一）基础数据

本次测试所使用证券账户、交易单元以2019年12月31日生产日终数据为准。本次测试中国结算上海分公司仅初始化沪市和港市产品持仓，本次测试所使用的证券持仓数据以全天候测试环境连续测试结果为基准，请参测机构于2020年10月23日下载中国结算上海分公司发送的ZQYE数据，作为初始持仓数据。

（二）产品代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **基金管理人** | 国泰基金 | |
| **代码** | 517040 | 517050 |
| **产品简称** | HSGETF40 | HSGETF50 |
| **认购代码** | 517043 | 517053 |
| **认购简称** | HSG认40 | HSG认50 |
| **认购资金代码** | 517044 | 517054 |
| **认购资金简称** | 认购款 | 认购款 |
| **发行方式** | 网上现金认购 | 网上现金认购 |
| **发行价格** | 1元 | 1元 |
| **发行开始日** | **T日** | **T日** |
| **发行结束日** | T日 | T+2日 |
| **资金确认日** | T+2日 | T+4日 |
| **认购确认日** | T+3日 | T+5日 |
| **申赎代码** | 517041 | 517051 |
| **申赎简称** | HSG申40 | HSG申50 |
| **申赎资金代码** | 517042 | 517052 |
| **申赎资金简称** | 申赎资金 | 申赎资金 |
| **跨市资金代码** | 517045 | 517055 |
| **跨市资金简称** | 跨市资金 | 跨市资金 |
| **港市资金代码** | 517046 | 517056 |
| **港市资金简称** | 港市资金 | 港市资金 |
| **上市日** | T+6日 | T+8日 |
| **申赎开始日** | T+6日 | T+8日 |
| **申赎单位** | 500000份 | 500000份 |
| **发行协调人** | 中信证券 | 中信证券 |
| **发行协调人席位** | 21748 | 21748 |
| **发行协调人账户** | D890132510 | D890132510 |

（三）PCF定义文件清单

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **产品代码** | **基金编码** | **上传PBU** |
| 517040 | FM286ETFDYYYYMMDD001.txt | 25241 |
| 517050 | FM287ETFDYYYYMMDD001.txt |

（四）ETF成分股清单

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **基金管理人** | **产品代码** | **成分股** | | | |
| **沪市** | **深市** | **沪港通** | **深港通** |
| 国泰基金 | 517040 | 600970、601857、601866、601898、601186、601766、601668、601618、601888 | 002415、002419、002080、002128 | 03311、03323、00390、01099、01313 | 02380、00836 |

（五）持仓添加

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 协测券商 | 账户 | 产品代码 | 持仓类型 | 持仓数量 |
| 中信证券 | D890353556 | **沪市：**  600970、601857、601866、601898、601186、601766、601668、601618、601888  **沪港通：**  03311、03323、00390、01099、01313 | PT/0 | 1000万股 |
| 中信证券 | A100266349 |
| 其他 | D890171551 |

## 数据接收与发送

1. 各参测机构通过证通云盘取得过户文件。
2. 行情接收

每个交易日用户可使用EZSR或行情网关获取mktdt90.txt文件

会员接入IP地址：198.2.248.1

会员接入环境号：90。

1. 结算数据接收：各结算参与人通过PROP仿真系统接收日终登记结算数据并进行相应处理。
2. 基金管理人通过证通云盘、工具EzTrans上传PCF文件，文件名PCF定义文件清单。

## 测试注意事项

1. 本次测试请各参测机构务必组织专人开展测试。
2. VPN环境准备工作技术支持电话：4009003600
3. 测试期间上交所全天候测试联系电话：021-68808594

测试期间中国结算上海分公司全天候技术支持电话：021-68873900

1. 请各参测机构于11月2日15点前通过邮件提交测试反馈表。
2. 因持仓有限，请基金管理人准备ETF定义文件时，每个篮子（最小申购、赎回单位）对应的ETF份数、证券数量不要过大。

## 附件《跨沪深港ETF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 □期货公司 □基金公司 □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□ | | |
| 柜台系统改造就绪情况（必填） | | 完成□ 未完成□ 无需改造□ | | |
| 若未完成改造，改造完成时间需要（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□ | | |
| 获取盘前公告文件 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| ETF定义文件上传验证（证通云盘、EzTrans） | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| ETF定义文件返回确认文件比对验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| ETF公告文件接收验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| ETF认购验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| ETF申购验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| ETF赎回验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| ETF竞价买入验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| ETF竞价卖出验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 大宗交易验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 大宗盘后固定价格验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 行情验证（FAST、Level2） | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 盘后报表验证（gh、dgh） | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 清算交收验证 | | 测试完全通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 备注（测试发现的异常、及其它反馈信息） | |  | | |