关于开展科创板交易性能容量全网测试

的通知

各会员单位及市场参与者：

为确保科创板业务平稳有序开展，上海证券交易所（以下简称本所）联合中国证券金融股份有限公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司定于2019年7月6日（周六）组织开展科创板交易性能容量、科创板产品增加扩位证券简称全网测试（测试方案详见附件），请全体市场参与者参加。

参测单位务必高度重视，组织专人负责，使用生产环境参与测试。测试结束后，请于7月6日（周六）20:00前在会员专区提交测试情况反馈表，并做好系统和数据恢复工作，保障下一交易日的正常生产。

如有疑问，请及时联系本所技术服务热线：4009003600。

特此通知。

附件：科创板交易性能容量全网测试方案

上海证券交易所

二〇一九年七月二日

附件：

科创板交易性能容量全网测试方案

**一、方案概要**

为确保科创板相关工作平稳有序开展，上海证券交易所（以下简称本所）联合中国证券金融股份有限公司（以下简称中证金融）、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）上海分公司定于2019年7月6日（周六）组织开展全网测试。本次测试主要目的为验证本所交易系统、会员柜台系统等的性能与容量，以及科创板产品增加扩位证券简称业务功能。

请各参测单位按各自生产环境历史数据建立模拟生产的测试数据模型，合理设置查询、委托等各类型订单配比。测试使用竞价撮合平台00环境、综合业务平台01环境，测试行情文件为mktdt00.txt和mktdt01.txt。

**二、参测单位**

（一）本所技术公司、信息公司。

（二）中证金融。

（三）中国结算上海分公司。

（四）相关信息商。

（五）其他市场参与者。

**三、测试内容**

测试模拟1个完整交易日的交易和结算，测试用交易日同真实日期（20190706）。主要测试内容如下：

**（一）科创板股票订单申报性能测试**

安排20只科创板股票供合格投资者进行订单申报及撤单申报（10只为上市后前5日无涨跌幅控制、10只为上市后第6日起有涨跌幅控制）。请参测单位在测试日10:00-10:10和11:00-11:10以最大速率连续输入订单各10分钟。其他时间使用尽可能多的合格投资者账户持续进行科创板股票订单申报。

为便于准备测试数据和达成成交，要求参测单位对20只科创板股票订单作如下控制：一是每笔价格不超过开盘参考价的2%；二是每笔买入订单的数量不超过1000股。

**（二）主板各类产品订单申报测试**

全部投资者可进行主板股票、债券等产品的订单申报，主板产品订单量与科创板产品订单量配比建议为5:1。

**（三）股东大会网络投票测试**

安排2只科创板股票（688989、688999）模拟股东大会网络投票，参测单位可根据议题进行网络投票测试。

**（四）异常账户权限控制测试**

根据有关参测单位提供的测试账户，验证盘前和盘中对异常账户进行权限控制的相关业务流程。

**（五）单边站点故障切换测试**

测试日下午将安排交易系统单边站点故障切换测试。在此期间，参测单位若发现交易异常，请及时联系本所。

**四、测试数据**

测试所使用的证券账户、交易单元、指定交易、清算路径、权益数据等均以2019年7月5日（周五）闭市后生产环境数据为基准。

为确保测试顺利开展，请各参测单位于2019年7月4日（周四）12:00前自行向本所报备最多5个机构投资者账户（B类账户）。本所和中国结算上海分公司在测试开始前为中证金融提供的融券专户初始化688980-688999等20只科创板股票“PT/0”类型持有各1亿股；同时，为已报备的机构投资者账户初始化688980-688999等20只科创板股票“PT/0”和“XL/H”类型的持有各1亿股。生产环境中所有账户均可参测，请自行交易获得持仓。测试新增产品基本信息如下：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 名称 | 无涨跌999 | 无涨跌998 | 无涨跌997 | 无涨跌996 | 无涨跌995 |
| 代码 | 688999 | 688998 | 688997 | 688996 | 688995 |
| 简称 | wzd999 | wzd998 | wzd997 | wzd996 | wzd995 |
| 中文简称（长） | wzd999 wzd999 | wzd998 wzd998 | wzd997 wzd997 | wzd996 wzd996 | wzd995wzd995 |
| 开盘参考价 | 10元 | 10元 | 10元 | 10元 | 10元 |
| 名称 | 无涨跌994 | 无涨跌993 | 无涨跌992 | 无涨跌991 | 无涨跌990 |
| 代码 | 688994 | 688993 | 688992 | 688991 | 688990 |
| 简称 | wzd994 | wzd993 | wzd992 | wzd991 | wzd990 |
| 中文简称（长） | wzd994 wzd994 | wzd993 wzd993 | wzd992 wzd992 | wzd991 wzd991 | wzd990 wzd990 |
| 开盘参考价 | 10元 | 10元 | 10元 | 10元 | 10元 |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 名称 | 有涨跌989 | 有涨跌988 | 有涨跌987 | 有涨跌986 | 有涨跌985 |
| 代码 | 688989 | 688988 | 688987 | 688986 | 688985 |
| 简称 | yzd989 | yzd988 | yzd987 | yzd986 | yzd985 |
| 中文简称（长） | yzd989 yzd989 | yzd988 yzd988 | yzd987 yzd987 | yzd986 yzd986 | yzd985 yzd985 |
| 开盘参考价 | 10元 | 10元 | 10元 | 10元 | 10元 |
| 名称 | 有涨跌984 | 有涨跌983 | 有涨跌982 | 有涨跌981 | 有涨跌980 |
| 代码 | 688984 | 688983 | 688982 | 688981 | 688980 |
| 简称 | yzd984 | yzd983 | yzd982 | yzd981 | yzd980 |
| 中文简称（长） | yzd984 yzd984 | yzd983 yzd983 | yzd982 yzd982 | yzd981 yzd981 | yzd980 yzd980 |
| 开盘参考价 | 10元 | 10元 | 10元 | 10元 | 10元 |

**五、测试交易时间表**

|  |
| --- |
| **竞价撮合平台** |
| 1 | 9:15-9:25 | 开市集合竞价 |
| 2 | 9:30-11:30 | 连续竞价 |
| 3 | 13:00-14:57 | 连续竞价 |
| 4 | 14:57-15:00 | 收盘集合竞价 |
| 5 | 15:00-15:30 | 债券质押式回购延长 |
| 6 | 15:30-18:00 | 闭市处理 |
| **综合业务平台** |
| 1 | 9:30-15:30 | 大宗交易意向申报 |
| 2 | 9:30-15:30 | 科创板股票盘后固定价格申报 |
| 3 | 9:30-15:30 | 科创板股票大宗交易成交申报 |
| 4 | 15:00-15:30 | 普通股票大宗交易成交申报 |
| 5 | 15:00-15:30 | 普通股票大宗交易固定价格申报 |
| 6 | 15:30-18:00 | 闭市处理 |

**六、数据接收与发送**

请各参测单位通过EzSR、MDGW等软件接收行情文件mktdt00.txt和mktdt01.txt，接入地址同生产；通过UT、BT等软件接收cpxx系列、fjy、vtls等文件。

**七、测试注意事项**

请各参测单位使用生产环境进行测试，认真进行以下测试数据准备，模拟生产压力，验证各系统在性能与容量压力下的运行情况：一是进行合格投资者账户预估，以全部潜在合格投资者账户开展科创板股票交易；二是同时进行主板现有交易业务测试，建议主板产品订单量与科创板产品订单量之比为5:1；三是按生产环境实际情况设置测试数据中的订单申报与查询比例。

请各参测单位高度重视，组织专人负责测试工作，并于7月6日（周六）20:00前在会员专区提交测试情况反馈表（详见附件）。测试结束后，请务必做好系统与数据恢复，保障下一交易日的正常生产。

测试期间联系电话：4009003600。

附件： 科创板交易性能容量全网测试情况反馈表

附件：

科创板交易性能容量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 □保险公司 □其他 |
| 测试PBU |  |
| 联系人 | 姓名 |  | 电话 |  |
| 手机 |  | 电子邮件 |  |
| 反馈项目/测试项 | 测试结果 |
| 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□ |
| 若未完成改造，需要时间（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□ |
| 科创板无涨跌幅股票竞价交易 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 科创板有涨跌幅股票竞价交易 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 科创板盘后固定价格交易 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 科创板大宗交易 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 行情接收和处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 公告文件接收和处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 结算数据接收处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 科创板融资融券及转融通 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 科创板网络投票 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 科创板股票增加扩位证券简称的处理 | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ |
| 会员内部系统 | 集中交易系统 | 主板订单笔数（）速率峰值（）本次速率峰值/历史速率峰值（） |
| 科创板订单笔数（）速率峰值（）容量占比（） |
| 融资融券交易系统 | 主板订单笔数（）速率峰值（）本次速率峰值/历史速率峰值（） |
| 科创板订单笔数（）速率峰值（）容量占比（） |
| 账户数量 | 参与测试的主板投资者数量（） |
| 参与测试的科创板合格投资者数量（） |
| 行情系统 | 正常□ 不正常□ 未测□ |
| 风控系统 | 正常□ 不正常□ 未测□ |
| 备注 | 测试发现的异常及其它反馈信息 |