

港股通业务第三次 专项碰头会

2016年11月9日

深圳证券交易所
SHENZHEN
STOCK EXCHANGE



议程

目录

- 深港通技术准备总体进展
- 相关技术系统上线总体安排
- 所司技术上线后生产安排
- 市场参与者注意事项



深港通技术准备总体进展



SZ-HK CONNECT

技术准备总体进展

● 所司技术准备就绪

- 组织开展业务仿真测试、全网测试与开通演练
- 深交所与结算深圳分公司系统按计划准备就绪，决定技术先行上线，11月11日收市后实施
- 已制定上线实施方案

● 港股通业务参与者技术准备进展顺利

- 参加业务仿真测试、全网测试
- 完成现场检查（抽查15家证券公司）
- 92家证券公司，17家基金/保险公司已获批开通港股通交易权限



业务仿真测试与全网测试完成情况

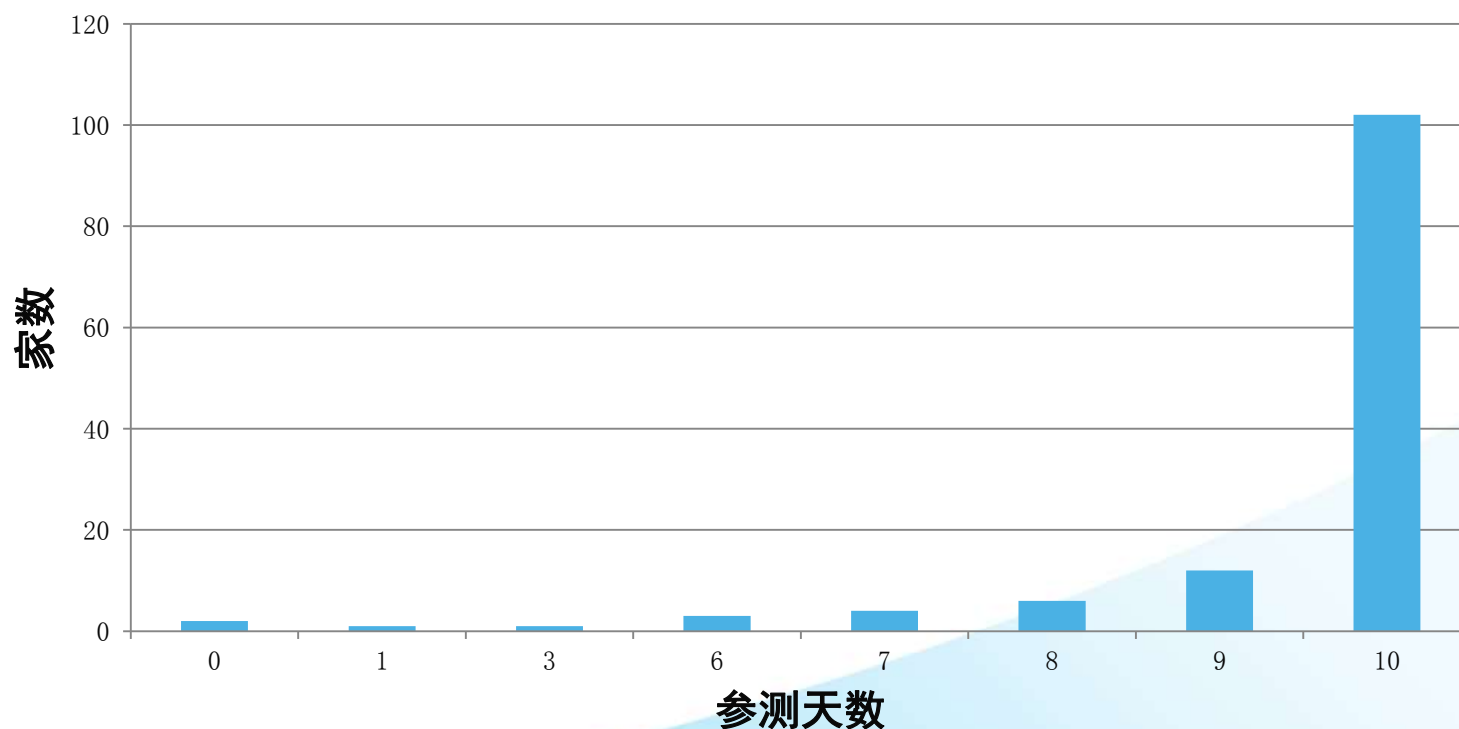
时间	测试安排
10月17日-11月9日 (工作日)	全市场业务仿真测试
10月22-23日	第一次全网测试
10月29-30日	第二次全网测试
11月5日-6日	第三次全网测试
11月12日	第四次全网测试 (所司及部分交易参与者技术上线验证)
至通关测试前一周六、周日	全网测试 (可选)
业务启动日前一周六	*通关测试



业务仿真测试情况

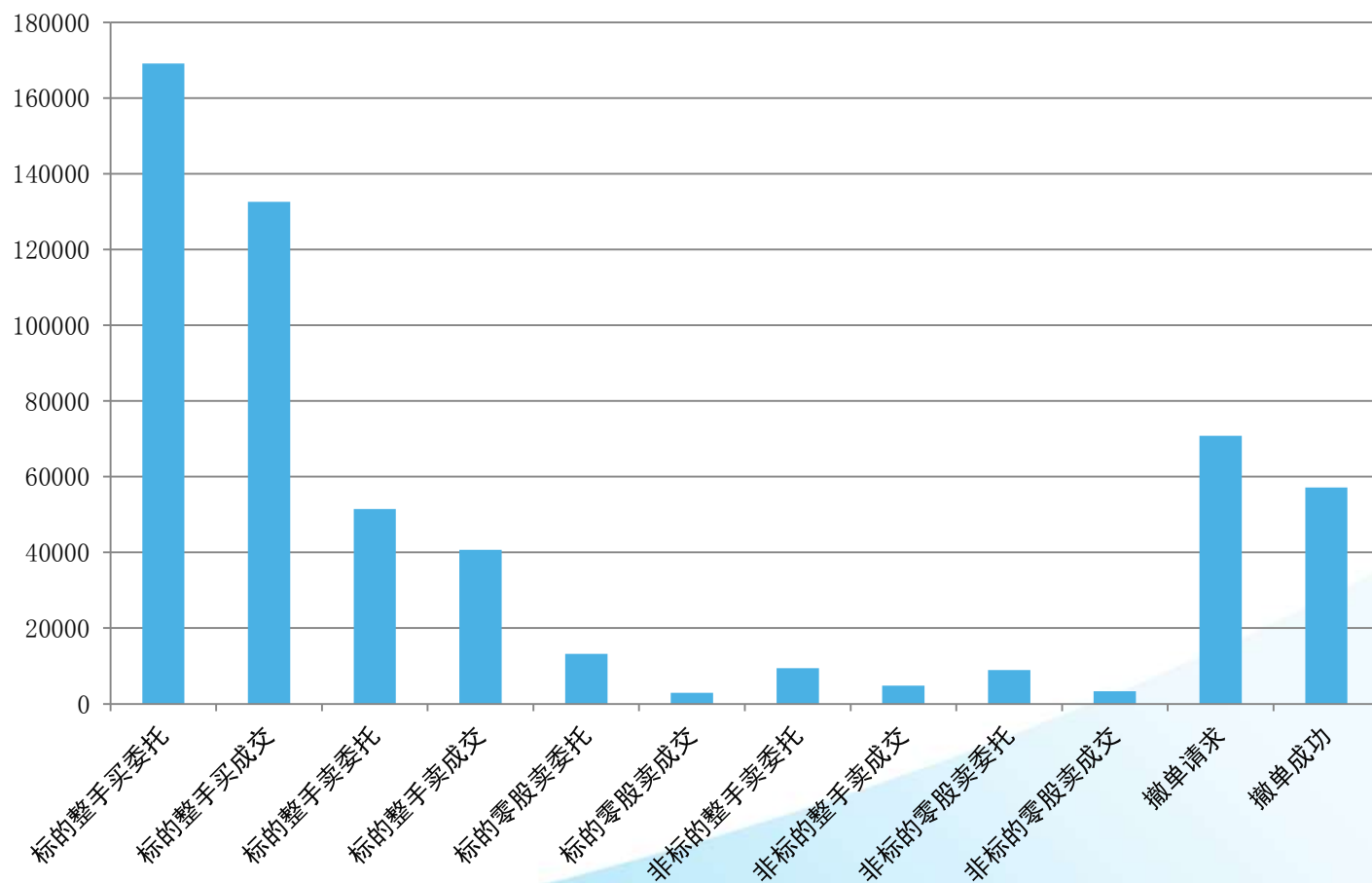
- 128家市场参与者（包括97家证券公司、25家基金公司）参加了南向测试

内地市场参与者参测情况



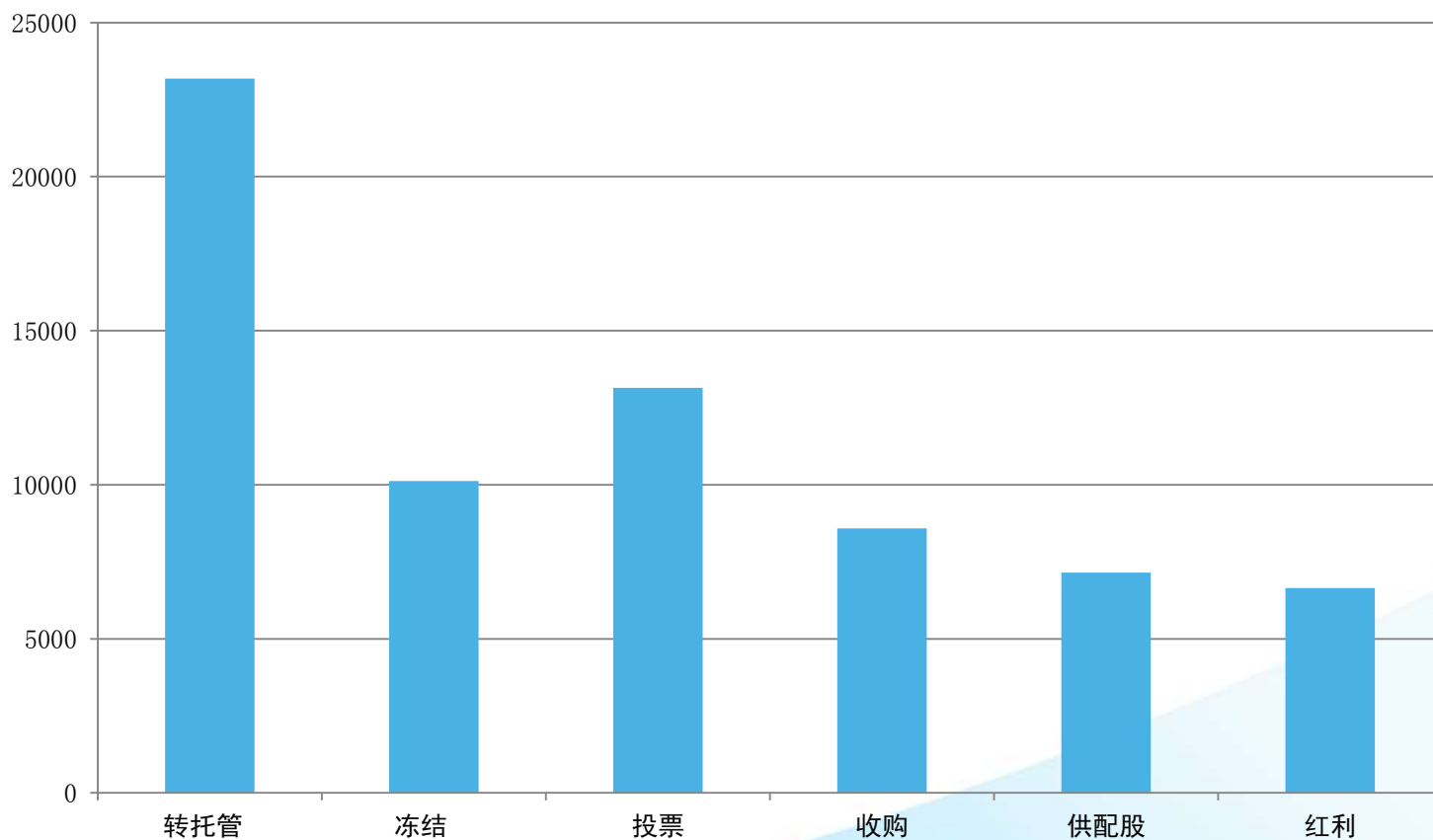
业务仿真测试情况

▶ 港股通业务覆盖情况（交易）



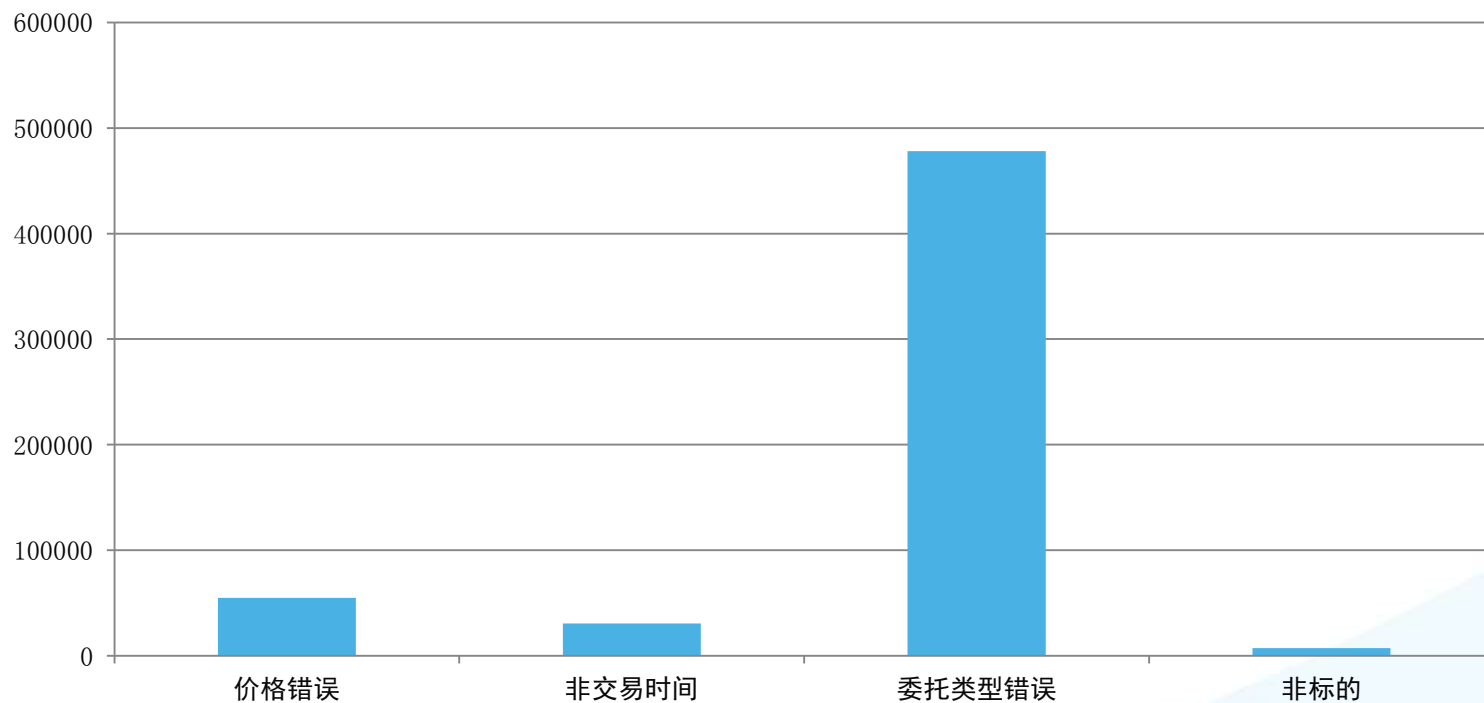
业务仿真测试情况

▶ 港股通业务覆盖情况（结算）



业务仿真测试测试情况

错单统计



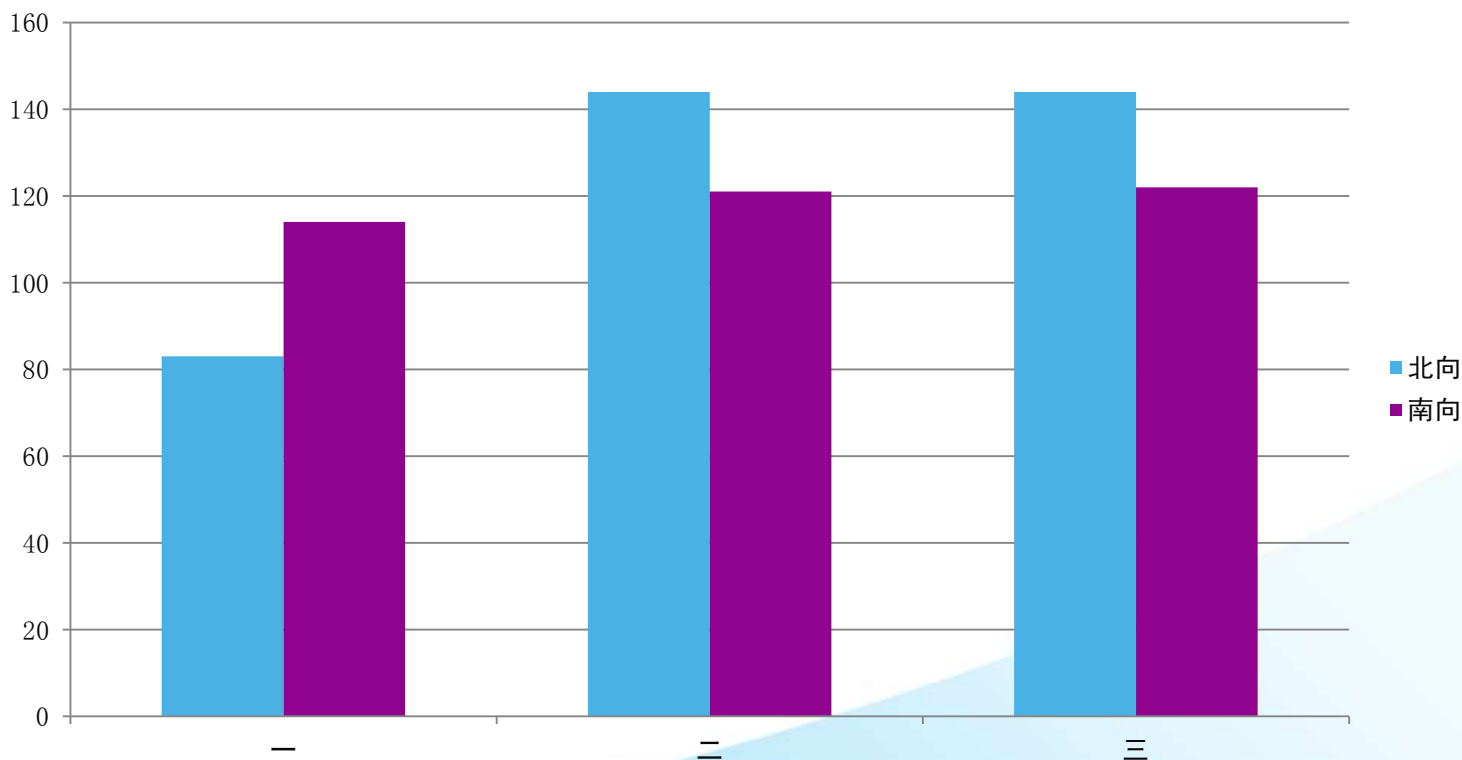
QQ群：《港交所常见拒绝原因代码》



全网测试情况

- 125家市场参与者（包括95家证券公司、24家基金公司）参加了南向测试

三次全网测试参测家数



相关技术系统上线 总体安排



SZ-HK CONNECT

相关技术系统上线总体安排

- 11月7日发布《关于深港通相关技术系统上线安排的通知》
- 交易所与结算公司相关系统
 - 11月11日收市后实施技术上线，港股通相关数据接口启用，深交所启用20161018版行情网关和监控程序
 - 11月14日技术投产就绪，**港股通交易业务未启动**
- 拟首批开通港股通业务参与者相关系统

技术上线 实施时间	证券公司	基金公司	其他 参与者
11月11日收市后	37	3	0
11月18日收市后	56	12	3

- 参加11月12日、19日全网测试



相关技术系统上线总体安排

- **不开展港股通业务、或开通港股通业务前的其他单位**
 - 自身技术系统不需软件变更
 - 建议更新行情网关软件
 - **需参加11月12日全网测试、通关测试（业务启动前一周六），验证自身系统运行正常**
- **业务启动后拟申请开通港股通业务的交易参与人**
 - 在业务技术准备就绪后自行选择时间技术上线、申请业务开通。我所视需要提供通关测试服务



所司技术上线后生产安排



SZ-HK CONNECT

深交所技术上线后生产安排

- 11月14日至业务启动日前的交易日

- 设置为港股通非交易日
- 已获批开通交易单元港股通交易权限的业务参数，已在深交所新一代交易系统中配置
- 基于港股通相关交易接口规范向市场参与者发送基础数据（或空文件）



深交所技术上线后生产安排—业务启动通知发布前

● 11月14日至业务启动通知发布日

➤ 盘前（早间）

- 新增国际市场互联状态信息（imcparams，**港股通不开放**）
- 新增国际市场互联标的的信息（imcsecurityparams，**空文件**）
- 新增国际市场互联汇率信息（imcexchangerate，**一条无效记录**）
- 证券业务开关信息（securityswitch）中**无港股通相关业务开关**
- 无港股产品信息（hkexreff04）
- 无最小价差文件（hkexzxc）

➤ 盘中

- 新增市场实时状态（Step:h,Binary:390019,**港股通未开市、额度不可用**）
- 港股实时行情5001频道统计（Step:UA004,Binary:390090,**证券只数0**）
- 证券实时状态消息（Step:f,Binary:390013）中**无港股通相应业务状态**
- 无5001频道港股快照行情报文（Step:w, Binary:306311）
- 无港股收盘价格文件hkexclpr04

➤ 盘后（晚间）

- 证券业务开关信息（pre_securityswitch）中**无港股通相关业务开关**
- 无港股通成交单据文件hkexecution_tax



深交所技术上线后生产安排—业务启动通知发布后

● 业务启动通知发布次日交易日至业务启动前的交易日

➤ 盘前（早间）

- 新增国际市场互联状态信息（imcparams，**港股通不开放**）
- 新增国际市场互联标的信息（imcsecurityparams，**有港股通标的清单**）
- 新增国际市场互联汇率信息（imcexchangerate，**一条无效记录**）
- 证券业务开关信息（securityswitch）中**有港股通相关业务开关**
- 无港股产品信息（hkexreff04）
- 无最小价差文件（hkexzxjc）

➤ 盘中

- 新增市场实时状态（Step:h,Binary:390019,**港股通未开市、额度不可用**）
- 港股实时行情5001频道统计（Step:UA004,Binary:390090,**证券只数0**）
- 证券实时状态消息（Step:f,Binary:390013）中**有港股通相应业务状态**
- 无5001频道港股快照行情报文（Step:w, Binary:306311）
- 无港股收盘价格文件hkexclpr04

➤ 盘后（晚间）

- 证券业务开关信息（pre_securityswitch）中**有港股通相关业务开关**
11日晚间发布的pre_securityswitch_20161114中无港股通相关业务开关
- 无港股通成交单据文件hkexecution_tax



结算公司技术上线后生产安排

- 11月14日至业务启动日前的交易日

- 设置为港股通非交收日
- 基于港股通相关结算接口规范向市场参与者发送基础数据
- 全体深市结算参与人将收到两个港股通广播类型文件，分别是SZHK_SJSGB（广播类信息文件）和SZHK_TZXX（通知信息文件），以及结束标志文件END_SZHK.OK



结算公司技术上线后生产安排

● 11月14日至业务启动日前的交易日

- 成功开通了深港通下港股通交易权限的结算参与人将在权限开通下一工作日收到全部12个港股通结算文件以及结束标志文件END_SZHK.OK
- 联合公告前，SZHK_TZXX（通知信息文件）为空，联合公告后及交易开通前，公司行为信息为实际生产参数
- 获批开通港股通交易权限的券商、基金及其托管银行需要在业务启动前将D-COM网关和终端版本升级至20161015版本，要先卸载旧版本后重新安排
- 非港股通结算参与人可以选择升级，也可以不升级



全市场技术上线后生产安排—业务启动

- **业务启动前一周五收市后实施业务启动操作**
 - 业务启动前一周五收市后，全市场实施深港通交易业务开通的操作（主要是业务参数等基础数据准备）
- **业务启动前一周六，组织通关测试**
- **业务启动日，深港通交易等日常业务运作**
 - 业务启动日及之后的三个月，为技术运行特别保障期。发现异常及时向深交所或结算公司报告
 - 业务启动的头一周，港股通交易参与人每日向深交所报告交易相关技术系统运行情况，之后的三周报周报



市场参与者注意事项



SZ-HK CONNECT

11月12日全网测试注意事项

● 11月12日全网测试注意事项

- 全市场模拟所司技术上线、业务未启动时深市首交易日（即11月14日，港股通非交易日、非结算日）的运行
- 所有交易参与者、结算参与者及行情信息商都须参加
- 应使用11月14日生产环境参测
- 选择同步技术上线的交易参与者，全网测试中验证通过后正式上线，否则可选择回退
- 晚6点前及时填报测试反馈及自身系统上线实施情况
- 如发生极端情况，深交所可决定技术回退，将通知所有市场参与者并于13日组织恢复测试



行情网关软件升级注意事项

● 交易参与人与行情用户单位

- 建议11月12日全网测试前完成行情网关及网关监控程序的升级（20161018版）
 - ✓ 解决了不接收港股通行情维持使用STEP1.00协议用户行情网关持续告警的问题
 - ✓ 解决了部分缺陷
 - ✓ 新版本软件下载：www.sccc.com -> 下载专区->新一代交易系统

	20160315版	20161018版
STEP1.00	持续告警（需升级或改接收频道配置）	无问题
STEP1.01	无问题	无问题
Binary1.00	无问题	无问题
Binary1.01	无问题	无问题



11月19日全网测试注意事项

● 11月19日

- 全市场模拟深港通业务开通（交易业务启动）日的运行，拟首批开通港股通业务的参与者须参测
- 如为业务启动前一周六，则为**通关测试**，**所有交易参与者、结算参与者及行情信息商**都须参加，应使用**11月21日生产环境参测**
- 选择18日收市后实施技术上线的参与者，全网测试中验证通过后正式上线，否则可选择回退
- 晚6点前及时填报测试反馈及自身系统上线实施情况



11月14日至业务启动前技术运行注意事项

- 关注前述业务启动通知发布日前及之后交易所下发业务数据的差异，确保技术安全运行
- 11月14日收市后运行情况报告
 - 交易过程中发现异常及时向深交所报告
 - 下午5时前，所有交易参与者向深交所报告技术运行情况
 - 晚8时前，所有结算参与者向结算公司报告技术运行情况



技术上线及运行注意事项

- **建议市场参与者完善技术应急方案**
 - 港股通业务功能出现异常时，能够采取措施优先保障深市本地市场交易的正常进行
 - 对深港通和沪港通下共同的港股通标的，在单一通道出现技术异常时能尽量透明的继续向投资者提供港股通标的的买入服务、达到交易通道互备效果



讨论&答疑



SZ-HK CONNECT

携手共创未来

