

# 深市结算系统数据接口调整 2022 年 5 月 28 日全网测试方案

## 一、测试目的

深圳证券交易所（以下简称深交所）和中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称中国结算深圳分公司）已于 2022 年 1 月 21 日发布《关于做好深市银行间债券市场与交易所债券市场互联互通业务的技术准备通知》、于 2022 年 4 月 21 日发布《关于做好深市银行间债券市场与交易所债券市场互联互通业务技术准备的补充通知》，其中涉及《深市登记结算 XML 实时报文接口规范》中非交易过户、冻结、新型冻结、冻结解冻、轮候冻结、续冻、RTGS 等业务相关接口的调整，详见附件 2《深市结算系统 XML 实时报文接口调整》，本次全网测试将对该部分 XML 实时报文接口调整进行测试（债券市场互联互通业务全网测试另行安排）。通过模拟 XML 非交易类报文的委托申报、RTGS 结算等业务处理，检验市场参与各方技术系统的正确性。特别提醒，本次测试的 XML 实时报文接口调整内容，其启用日期不与债券市场互联互通业务绑定，请各结算参与机构合理安排本次测试及将来上线的软件版本。

## 二、参测单位

1. 深圳证券交易所
2. 中国结算深圳分公司
3. 深圳证券通信公司
4. 会员单位

- 5. 结算参与机构
- 6. 其他相关单位

### 三、测试内容

深市证券交易系统、结算系统模拟 1 个业务日的交易、结算（即模拟 T 日 2022 年 5 月 28 日），港股通证券模拟 1 个小时的交易和 1 个结算日的结算（即模拟 T 日 2022 年 5 月 28 日）。

本次测试重点包括以下内容：

1、D-COM 非交易类业务的委托申报及结算处理，包括 QFII 及 RQFII 同名划转、冻结、新型冻结、冻结解冻、轮候冻结、续冻等业务；

2、采用 RTGS 结算模式进行交收业务的清算交收等业务处理过程。

#### （一）T 日（模拟 2022 年 5 月 28 日）测试内容

**市场参与人技术系统：**模拟深市证券日常交易、非交易等业务的委托申报（重点测试债券现券交易、D-COM 非交易等业务），接收成交回报与实时行情。通过交易终端进行委托申报、行情查询、成交查询及数据下载。

模拟港股通证券日常交易、非交易业务的委托申报，接收成交回报与实时行情。

模拟深市证券、港股通证券的股份及资金清算交收等业务处理。

#### （二）恢复验证测试内容（模拟 2022 年 5 月 28 日）

**市场参与人技术系统：**交易网关、行情网关、文件网关使用与 2022

年 5 月 30 日生产系统相同配置连接交易及相关系统。模拟深市证券日常交易、非交易等业务的委托申报，接收成交回报与实时行情，验证自身系统的正确性。

#### 四、测试时间安排

测试时间为 2022 年 5 月 28 日（星期六）8:30 至 20:30（含恢复验证测试）。

深交所交易系统 T 日接收交易委托的时间为 9:00 至 15:30，协议交易时段为 9:15 至 15:30；其中 11:30-13:00 模拟中午休市。

深市证券交易、结算业务的具体安排请见下表：

实际时间 (5月28日)	主要测试事项	参测单位 重点测试内容	模拟日期
9:00 前	早间下发 T 日静态交易参考信息文件、PCF 文件、信息公告、股东大会信息文件	接收并加载静态交易参考信息文件、PCF 文件、信息公告、股东大会信息文件	T 日：2022 年 5 月 28 日
9:00-15:30	设置福田中心为主中心、南方中心为备中心运行，接收日常交易、非交易等委托，11:30-13:00 中午休市。 其中： <b>现货集中竞价交易平台</b> 9:15-15:00（9:25 开盘，9:30 开始连续竞价，15:00 平台闭市） <b>综合金融服务平台</b> 9:15-15:30 <b>衍生品集中竞价交易平台</b> 与现货集中竞价交易平台相同（期权组合策略保证金、普通仓与备兑仓互转业务申报截止时间为 15:15） <b>非交易处理平台</b> 与现货集中竞价交易平台相同（期权相关业务申报截止时间为 15:30） <b>固定收益交易平台</b> 9:00-15:30（其中匹配成交的开盘集合匹配时间 9:15-9:25，连续匹配开始时间 9:30；竞买成交的竞买发起	模拟债券相关业务的委托申报、成交回报、行情接收与展示。 <b>D-COM</b> 非交易类业务的委托申报。	

	申报时间 9:00-10:00, 应价申报时间 10:00-11:30) <b>场外业务平台 (本次不参测)</b>		
15:30-16:30	发送网络投票回报文件	接收网络投票回报文件	
15:30-17:00	中国结算深圳分公司模拟 T 日股份资金清算交收		
17:00 后	T 日结算数据发送	接收结算数据, 进行核对及交收处理	
<b>实际时间 (5月28日)</b>	<b>主要测试事项</b>	<b>参测单位 重点测试内容</b>	<b>模拟日期</b>
18:55 前	恢复生产系统环境, 并准备恢复验证测试数据。		
18:55 前	通过文件网关发布恢复验证测试的交易参考信息文件。	接收并加载交易参考信息文件。	
18:55-20:00	设置福田中心为主中心、南方中心为备中心运行, 恢复验证测试, 接收日常交易、非交易等委托, 其中 19:30-19:35 中午休市。其中: <b>现货集中竞价交易平台</b> 19:00-19:50 (19:10 开盘, 19:15 开始连续竞价, 19:50 平台闭市) <b>综合金融服务平台</b> 19:00-20:00 <b>衍生品集中竞价交易平台</b> 与现货集中竞价交易平台相同 (期权组合策略保证金、普通仓与备兑仓互转业务申报截止时间为 19:55) <b>非交易处理平台</b> 与现货集中竞价交易平台相同 (期权相关业务申报截止时间为 20:00) <b>固定收益交易平台</b> 18:55-20:00 (其中匹配成交的开盘集合匹配时间 19:00-19:10, 连续匹配开始时间 19:15; 竞买成交的竞买发起申报时间 18:55-19:20, 应价申报时间 19:20-19:30) <b>场外业务平台 (本次不参测)</b>	交易网关、行情网关、文件网关使用与 2022 年 5 月 30 日生产系统相同配置进行恢复验证测试。	2022 年 5 月 28 日

港股通交易结算业务测试的具体安排请见下表:

步骤	时间段	测试内容	
<b>深交所港股通 T 日测试安排 (模拟 T 日 2022 年 5 月 28 日的交易)</b>			
2	9:00-10:00	持续交易时段	模拟港股通交易业务的委托申报, 并接收成交回报; 实时行情的接收与展示。
5	10:00-10:45	发布港股收盘价格文件	接收港股收盘价格文件
<b>中国结算深圳分公司 T 日测试安排 (模拟 T 日 2022 年 5 月 28 日的结算)</b>			
1	9:00-12:00	D-COM 业务申报 (港股通公司行为)	

		及非交易业务等)。	
2	12:00-17:00	港股通结算日终处理。	
3	17:00 后	中国结算深圳分公司发送 T 日的港股通结算数据。	

## 五、测试数据准备

1. T 日和恢复验证测试均以 2022 年 5 月 27 日（星期五）深市所有证券的收盘行情、收市后的股份数据作为交易的起始数据。

2. 测试使用的交易网关、交易单元、交易单元与交易网关绑定关系、衍生品结算账号、衍生品合约账户、做市商相关信息、ETF 的 PD 券商名单均与 2022 年 5 月 30 日（星期一）生产系统保持一致。

### 3. ETF 的 PCF/IOPV 文件

所有 ETF 测试使用的 PCF/IOPV 文件与 2022 年 5 月 27 日（星期五）交易生产系统保持一致，所有基金管理人均无需上传全网测试使用的 PCF/IOPV 文件。

### 4. 资金账户余额设置：

中国结算深圳分公司统一将所有结算参与人 2022 年 5 月 28 日的现货结算备付金账户余额修改为 100 亿元。如果需要调整，可致电中国结算深圳分公司进行账户余额的调整，联系电话：0755-88666429。

## 六、注意事项

1. 本次测试包括交易系统、结算系统、D-COM 系统（不包括资金划拨业务）。

2. D-COM 系统在 2022 年 5 月 28 日期间属于测试环境，2022 年 5 月 28 日（星期六）23:45 以后将恢复回生产环境。

3. 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 2022 年 5 月 28 日全网测试。

4. 恢复验证测试前，交易参与者应当重置其柜台系统的回报记录号（具体方法可详询各自的软件供应商），使得回报同步消息（Report Synchronization）中的回报记录号从 1 开始，否则将无法收到委托确认与成交回报消息。

5. 请各参测单位根据自身技术系统情况，制定详尽的测试计划和操作流程。测试前先做好线上系统和数据环境的保护工作，再准备 2022 年 5 月 28 日测试相关数据。测试完成后做好线上系统和数据环境的恢复工作，确保下一交易日（**2022 年 5 月 30 日**）生产系统的正确运行。

6. 本次测试的数据仅为模拟测试数据，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、账户等业务的依据。

7. 测试冻结业务、QFII 及 RQFII 同名划转业务及 RTGS 业务的参测单位需升级 D-COM 业务终端到 20220330 或更新版本，终端软件可从 QQ 群（技术券商群：91355646、基金银行群：345221331）下载。

## 七、测试要求

1. 在测试过程中，请各参测单位详细记载测试现象与结果，检查其正确性。如发现异常现象，请及时报告。

2. 测试完成后,各参测单位应在 2022 年 5 月 28 日的 20:30 前提交测试反馈表(见附件 1),请会员单位、基金管理公司、债券交易参与者、期货公司等交易参与者,登录深交所“会员业务专区”首页底部“友情链接—在线调查表”栏目填写并提交反馈表(填报内容支持更新);请行情服务商、结算参与机构、托管行等无法登录会员业务专区的参测单位,通过互联网地址 <https://survey.szse.cn/v/tech> 填写反馈表(填报内容不支持更新,多次提交以最后一次为准)。

## 八、联系方式

技术咨询电话:

深圳证券交易所: 0755-82083510

中国结算深圳分公司: 0755-88666429

深圳证券通信有限公司: 0755-83182222

深圳证券交易所

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

2022 年 5 月 23 日

## 附件 1

### 深市结算系统数据接口调整 2022 年 5 月 28 日全网测试反馈表

会员代码 (仅会员填写)		公司名称	
联系人		联系电话 (包括手机)	
Email 地址			
本业务涉及系统的软件开发商名称			
是否参加本次测试	<input type="radio"/> 已参测 <input type="radio"/> 未参测, 未参测原因: _____		
结算系统数据接口调整相关技术系统是否就绪	<input type="radio"/> 无需改造, 已评估对现有系统无影响 <input type="radio"/> 需要改造且技术系统已就绪 <input type="radio"/> 需要改造但技术系统暂未就绪, 预计就绪时间: _____. 深交所、结算公司技术系统上线后, 已评估现有业务均可正常开展。 <input type="radio"/> 需要改造但技术系统暂未就绪, 预计就绪时间: _____. 深交所、结算公司技术系统上线后, 已评估现有业务 <b>无法</b> 正常开展。业务影响_____, 应对措施: _____.		
请填写以下各功能点测试结果 (未参测单位可不填写以下内容)			
<b>结算系统测试反馈项</b>			
1.	QFII 及 RQFII 同名划转的委托申报及处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
2.	冻结的委托申报及处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
3.	新型冻结的委托申报及处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
4.	冻结解冻的委托申报及处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
5.	轮候冻结的委托申报及处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
6.	续冻的委托申报及处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
7.	采用 RTGS 结算模式进行交收业务的清算与交收	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
<b>其他反馈</b>			
8.	早间下发的静态交易参考信息文件的接收和处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
9.	LEVEL1 行情接收与展示	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
10.	LEVEL2-1 行情接收与展示	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
11.	LEVEL2-2 行情接收与展示	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
12.	现货集中竞价交易平台相关业务的委托申报与成交回报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
13.	综合金融服务平台相关业务的委托申报与成交回报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
14.	非交易平台相关业务的委托申报与成交回报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
15.	衍生品平台相关业务的委托申报与成交回报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
16.	国际市场互联平台相关业务的委托申报与成交回报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
17.	固定收益交易平台相关业务的委托申报与成交回报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	
18.	交易终端固收专区各业务的委托申报、主动撤单、行情查询、当日委托/当日成交查询及导出、固收专区权限管理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务	

19.	交易终端股基专区各业务的委托申报、主动撤单、行情查询、当日委托/当日成交查询及导出、股基专区权限管理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务
20.	接收并处理现货集中竞价交易平台成交汇总文件	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务
21.	接收并处理综合金融服务平台成交汇总文件	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务
22.	接收并处理非交易处理平台成交汇总文件	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务
23.	接收并处理衍生品集中竞价交易平台成交汇总文件	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务
24.	接收并处理国际市场互联平台成交汇总文件	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务
25.	接收并处理固定收益交易平台成交汇总文件	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测 <input type="radio"/> 无此业务
以上反馈项有“异常”的，务必说明具体情况：（不超过 500 汉字，需详细说明涉及哪些业务系统及各系统的具体现象）		

## 附件 2

### 深市结算系统 XML 实时报文接口调整



深市结算系统XML  
L实时报文接口调整