

深市货银对付改革过渡期通关测试方案

一、测试目的

为确保深市货银对付改革业务的顺利开展，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）定于 2022 年 12 月 24 日（周六）组织开展通关测试。数据接口详见 2022 年 6 月 10 日发布的《深市货银对付改革技术实施指引（正式版）》。

二、参测单位

- 1.深圳证券交易所
- 2.中国结算深圳分公司
- 3.深圳证券通信有限公司
- 4.中国证券金融股份有限公司
- 5.证券公司
- 6.基金公司
- 7.托管银行
- 8.期货公司
- 9.其他相关单位

三、测试内容

深市结算系统模拟 1 个交易日（即 T 日 2022 年 12 月 24 日）、

1 个结算日（即 T 日 2022 年 12 月 24 日）的处理。

测试内容包括：

1.预清算数据的接收和处理，以及通过 D-COM 终端查询清算金额和资金核验净应付金额。

2.指令申报，包括优先标识指令、免除标识指令的申报和查询，可测试指令直接对接和 D-COM 终端申报两种模式。

3.债券质押式回购违约金额 D-COM 终端申报。

4.可售交收锁定数据的接收和处理。各参测机构应尽量申报各类业务以验证预清算数据和可售交收锁定数据的正确性，包括但不限于以下内容：交易业务（包括融资融券交易）、ETF 申赎、债券质押式回购交易及出入库等。

各参测机构可测试对 T 日买入证券日间申报用于 ETF 申赎、债券质押式回购出入库、期权备兑券锁定、非担保业务、非交易或冻结类业务（司法冻结、债券跨市场转托管、LOF 跨市场转托管以及普通转托管）等，以验证可售交收锁定数据的正确性。

5.T+1 多批次交收数据的接收和处理，以及通过 D-COM 终端查询。由于 2022 年 12 月 23 日不进行可售交收锁定处理，因此各参测机构在测试日当天接收或查询到的多批次交收结果为“日初无可售交收锁定”。

6.D-COM 终端其它调整，包括：“资金划拨-信息查询-资金余额查询”菜单和“资金划拨-信息查询-现货资金账户余额批量

查询”菜单增加“当日担保交收缺口”和“当日担保交收净额”两个字段。

7.差异化最低备付测试安排如下：2022年12月24日计算备付金；参与人在2022年12月1日至2022年12月23日期间生产系统的买入情况将作为最低备付计算的基数，比例固定为债券现券与债券回购类10%、非债券类16%；差异化备付金的生效日期为2022年12月30日。

8.三地资金划拨延长至17:00。

四、测试时间安排

测试时间为2022年12月24日（星期六）8:30至19:00。

测试当天各项业务时间安排与生产安排一致。

五、测试数据准备

1.T日测试以2022年12月23日（星期五）深市所有证券收市后的股份数据作为结算的起始数据。

2.测试当日不对结算参与人备付金余额进行调整。测试过程中，结算参与人如需进行结算备付金账户余额调整，可自行通过D-COM在客户/托管综合结算备付金账户和自营综合结算备付金账户之间进行资金划拨或进行三地资金划拨。

六、注意事项

1.本次测试包括交易系统、结算系统、D-COM系统。

2.D-COM 系统在 2022 年 12 月 24 日（星期六）期间属于测试环境，2022 年 12 月 24 日（星期六）23:45 以后将恢复回生产环境。

3. 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 12 月 24 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 12 月 26 日）生产系统的正确运行。

4. 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。

5. 参测单位需将 D-COM 网关升级至 20220820 版本，终端升级至 20221020 版本。该终端和网关软件可从本公司网站“首页>服务支持>业务资料>软件下载>深圳市场”下载。货银对付改革新增菜单位置位于清算交收栏目下新增的一级菜单“DVP”下。

七、测试要求

1. 请各结算参与机构及相关单位务必参加测试。

2. 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。

3. 测试完成后，各结算参与机构及相关单位应在 2022 年 12 月 24 日 20:00 之前提交测试反馈表（见附件 2）至 szjsb@chinaclear.com.cn。

八、测试联系电话

测试技术支持：0755-25946080、0755-88666429（仅测试当天使用）

业务咨询：0755-21899260

中国结算深圳分公司

2022年12月16日