关于1月20日配合开展债券质押式回购

相关结算业务通关测试的通知

各会员单位及相关市场参与者：

根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）《临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法》相关安排，为检验临时停市情况下债券质押式回购正常（延期）开展结算业务情况，上海证券交易所（以下简称本所）将配合中国结算于2018年1月20日（周六）组织开展相关结算业务通关测试。请全体市场参与者务必参加。

本次测试本所使用竞价撮合平台88环境，模拟2个交易日的实时交易和盘后处理，测试期间竞价行情文件为mktdt88.txt。请各参测单位及时做好充分准备，落实专人负责测试工作。测试完成后，及时反馈完成情况及技术就绪情况，并确保测试数据不对后续正常生产产生影响。

特此通知。

附件：1月20日配合开展债券质押式回购相关结算业务

通关测试方案

上海证券交易所

二○一八年一月十八日

附件

1月20日配合开展债券质押式回购相关结算

业务通关测试方案

**一、方案概要**

本次测试目的为检验临时停市情况下债券质押式回购业务正常（延期）开展结算业务情况及市场各方业务和技术系统就绪情况。本次测试本所使用竞价撮合平台88环境，测试期间竞价行情文件为mktdt88.txt。

**二、测试时间安排**

本次测试时间为2018年1月20日（周六），共模拟2个交易日（2018年1月20、21日）的实时交易和盘后处理。

**三、参测单位**

（一）本所。

（二）中国结算上海分公司。

（三）全体会员及市场参与者。

**四、测试内容及具体安排**

本次测试仅涉及债券质押式回购业务（204XXX）的暂停和恢复交易，测试期间其他业务可正常申报订单和结算。详细测试内容如下：

（一）2018年1月20日场景：盘中临时暂停债券质押式回购交易，当日未恢复交易；当日新达成及到期的债券质押式回购购回业务延至下一交易日清算。

（二）2018年1月21日场景：盘前临时暂停债券质押式回购交易，当日恢复交易；当日债券质押式回购清算交收正常处理，前一交易日延迟清算的债券质押式购回业务恢复清算。

| **步骤** | **时间段** | **测试内容** | **测试说明** |
| --- | --- | --- | --- |
| 2018年1月20日 | | | |
| 1 | 9：15-9：20 | 集合竞价  全部业务正常交易 | 盘中临时暂停，当日未恢复交易；当日新达成及到期的债券质押式回购业务延至下一交易日清算 |
| 2 | 9：25-10：25 | 连续竞价  全部业务正常交易 |
| 3 | 10：25-10：55 | 连续竞价  暂停债券质押式回购交易 |
| 4 | 10：55-16：00 | 本所盘后处理 |
| 5 | 10：55-16：00 | 中国结算日终结算处理 |
| 2018年1月21日 | | | |
| 1 | 16：50-16：55 | 集合竞价  暂停债券质押式回购交易 | 盘前临时暂停，当日恢复交易；被延迟清算的债券质押式回购购回业务恢复清算 |
| 2 | 17：00-17：20 | 连续竞价  暂停债券质押式回购交易 |
| 3 | 17：20-18：00 | 连续竞价  全部业务正常交易 |
| 4 | 18：00-22：00 | 本所盘后处理 |
| 5 | 18：00-22：00 | 中国结算日终结算处理 |

**五、测试数据准备**

本次测试基础数据以2018年1月 19日（周五）00环境闭市后生产数据为准，包括证券账户及持仓、交易单元、指定交易、清算路径等。

**六、数据接收与发送**

（一）开市前通过单向卫星获得产品基础信息文件接口（CPXX）和产品非交易基础信息接口（FJY）。

（二）订单申报：参测会员可使用EzOES在88环境进行订单申报，接入地址同生产配置。

（三）行情接收：参测会员可使用EzSR、UT等接收竞价行情mktdt88.txt。

（四）盘后数据发送与接收：无单向卫星盘后数据发送，参测会员可通过EzTrans等自行获取盘后数据。

（五）结算数据接收：结算参与人通过PROP系统接收日终登记结算数据并进行相应处理。

**七、测试注意事项**

（一）请全体市场参与者务必参加本次测试，按照测试通知和方案时间安排做好相关准备。

（二）请各参测单位以独立于生产系统的测试环境开展测试，指定专人负责，并于开始测试前做好测试环境准备。

（三）请各参测单位在测试过程中详细记录测试现象与结果，并检查其正确性。如发现与交易有关的问题请及时反馈至本所技术支持热线或技术服务QQ群（298643611）。

（四）测试完成后，请各参测单位好测试情况反馈表（详见附件）的填写工作并及时反馈。

（五）测试期间本所联系方式：技术支持热线：4009003600，传真：021-68810883，邮箱：tech\_support@sse.com.cn。

附件：债券质押式回购相关结算业务通关测试情况反馈表

附件：

债券质押式回购相关结算业务通关测试

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 □托管银行 □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** | | |
| 此次测试是否涉及技术系统升级（必填） | | | 必须□ 非必须□ 无此业务□ 不适用□ | | |
| 技术系统改造就绪情况 （必填） | | | 完成□ 未完成□ 无需改造□ 不适用□ | | |
| 若未完成改造，改造完成时间（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□ | | |
| ①盘中暂停当日未恢复，债券质押式回购订单申报及盘后数据交收 | | | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ | | |
| ①盘中暂停当日未恢复，其他订单申报及盘后数据交收 | | | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ | | |
| ②盘前暂停当日恢复，债券质押式回购订单申报及盘后数据交收 | | | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ | | |
| ②盘前暂停当日恢复，其他订单申报及盘后数据交收 | | | 测试完全通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ | | |
| 备注 | | | 测试发现的异常、及其它反馈信息 | | |