

附件：

1月19日债券质押式回购延长交易时间业务通关测试方案

一、方案概要

本次测试目的是通过模拟在集合竞价、连续竞价、延长交易的不同时段，股票、基金、债券、债券质押式回购实时交易的交易与预清算数据处理过程，验证市场参与各方技术系统的正确性。

本次测试模拟一个交易日的交易和结算。参测单位请于1月20日 17:00 前提交测试反馈表（含相关联络人信息）至 shtest@chinaclear.com.cn。 技 术 咨 询 电 话：021-38874800-8331（李霖）

二、参测单位

- （一）上交所
- （二）中国结算上海分公司
- （三）各结算参与人
- （四）基金公司

三、测试环境

中国结算上海分公司使用生产环境。

四、测试安排

本次测试时间为 2019 年 1 月 19 日（周六）7:00-20:00。具体安排见下表：

步骤	时间段	测试内容
1	9:15-9:25 模拟开市集合竞价	股票、基金、债券、债券质押式回购实时交易的申报、撤单
2	9:30-11:30 模拟上午连续竞价	
3	13:00-14:57 模拟下午连续竞价	
4	14:57-15:00 模拟闭市集合竞价	
5	15:00-15:30 债券质押式回购延长闭市时间	
6	14:30-14:35 中国结算上海分公司第一批预清算结果数据生成	包含截止该批预清算处理的业务数据； 通过生产环境 PROP 发送
7	15:15-15:20 中国结算上海分公司第二批预清算结果数据生成	
8	交易闭市后，中国结算上海分公司第三批预清算结果数据生成	
9	15:45-18:30 中国结算上海分公司日终结算数据发送	通过生产环境 PROP 发送

注：预清算数据从现有的两批次调整为三批次发送，各批次数据包含的净额结算品种不变，查询时间如下：

1. 第一批次预清算结果的可查询时间为 14:30；
2. 第二批次预清算结果的可查询时间为 15:30 左右；
3. 第三批次预清算结果的可查询时间视当日闭市后上交所交易数据发送我公司时间而定，一般为 15:45 左右，包含交易截止到 15:30 的净额结算品种。

五、测试数据准备

此次测试基础数据以 2019 年 1 月 18 日（周五）生产环境闭市后生产数据为准，包括证券信息、证券账户、证券持有、交易单元、指定交易、清算路径等。

六、数据接收与发送

各结算参与人通过 PROP 系统接收日终登记结算数据并进行相应处理。

七、注意事项

（一）参测单位应按照测试方案中的时间安排和要求进行操作。若未按要求，对测试构成影响的，中国结算上海分公司将视情况采取相关措施。

（二）测试完成后，各参加测试单位应做好系统功能和数据恢复工作，保证下一交易日交易和结算业务的正常开展。

（三）测试过程中，各参测单位如发现与交易有关的问题应及时反馈至上交所，如发现与结算有关的问题应及时反馈至中国结算上海分公司。

中国结算上海分公司测试日现场联系方式：021-58887750，PROP技术支持热线：021-62321666，中国结算上海分公司测试服务QQ群：763373099或149247290。

八、债券质押式回购延长闭市时间业务通关测试反馈表

机构 基本	机构名称				
	参与机构	☐ 证券公司	☐ 托管银行	☐ 基金公司	☐ 其他

情况	所属类别			
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 ☐		
第一批次预清算结果接收与处理		测试完全通过 ☐ 部分通过 ☐ 失败 ☐ 未测 ☐		
第二批次预清算结果接收与处理		测试完全通过 ☐ 部分通过 ☐ 失败 ☐ 未测 ☐		
第三批次预清算结果接收与处理		测试完全通过 ☐ 部分通过 ☐ 失败 ☐ 未测 ☐		
日终结算数据接收与处理		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		