

附件一：

深市债券质押式三方回购及债券质押式协议回购到期续做 业务仿真测试方案

一、 测试目的

深圳证券交易所（以下简称“深交所”）联合中国证券登记结算有限责任公司于 2018 年 5 月 17 日发布了《关于就〈深圳证券交易所中国证券登记结算有限责任公司债券质押式三方回购交易及结算暂行办法（征求意见稿）〉公开征求意见的通知》，并于 2018 年 5 月 23 日发布了《关于做好支持债券质押式三方回购及债券质押式协议回购到期续做业务的技术准备通知》。为确保深市债券质押式三方回购及债券质押式协议回购到期续做业务的顺利开展，现定于 2018 年 6 月 11 日至 2018 年 6 月 29 日在深市交易结算独立测试环境组织仿真测试，主要通过模拟债券质押式三方回购及债券质押式协议回购到期续做申报、交易、结算等业务的处理过程，检验市场参与各方技术系统的正确性。

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. 证券公司
5. 基金公司

6. 托管银行

7. 其他相关单位

三、 测试内容

本次测试包括但不限于以下内容：

- 1、债券质押式三方回购正回购、逆回购交易权限开通、撤销申请的处理和取消权限处理。
- 2、债券质押式三方回购初始交易、补券、换券、提前购回、到期购回、到期续做、解除质押委托的申报处理和相应的清算交收处理。
- 3、债券质押式三方回购出库（提取）、入库（存放）委托的申报处理和相应的清算交收处理。
- 4、债券质押式三方回购 D-COM 终端选券结果查询。
- 5、债券质押式三方回购质押的债券发生付息、全部兑付、分批兑付、强制赎回的清算交收处理。
- 6、债券质押式协议回购到期续做委托的申报处理和相应的清算交收处理。
- 7、债券质押式三方回购正回购、逆回购交易权限开通、撤销、取消的申请通过固定收益品种业务专区测试系统进行。债券质押式三方回购及债券质押式协议回购到期续做业务均可通过电子接口或交易终端参与。

8、本次测试除债券质押式三方回购及债券质押式协议回购到期续做业务外，新增 RTGS 清算交收数据抄送管理人功能，相关管理人可对此进行验证。

四、 测试时间安排

仿真测试日期为 2018 年 6 月 11 日至 2018 年 6 月 29 日，测试时间为每个工作日 8:30 至 17:00。

五、 测试数据准备

本次测试用交易单元、托管单元等以 2018 年 6 月 8 日收市后的生产系统已开通单元为准（含测试专用交易单元）。

结算数据以 2018 年 6 月 8 日（星期五）交易结算独立测试环境发送的 SJSDZmmdd.DBF 及 SJSJGmmdd.DBF 作为初始股份持仓数据。

债券挂牌

测试标的及 内容	公司债券： 112998 债券简称：18 一篮 01	付息式国 债：105998 债券简称： 国债 1899	私募债券： 114998 债券简称：18 二篮 01	企业资产支持证 券：116998 证券简称：企业 支 01
测试日期	2018-06-14	上市日	上市日	转让服务起始 日
	上市日	上市日	转让服务起始 日	转让起始日

债券付息、全部兑付参数：

测试 标的及 内容	公司债券： 17 天神 01 (112496) 债券付息 每 10 张利息 50 元(个人、 机构、基金)	公司债券： 17 欧菲 01 (112499) 债券全部兑付 每 10 张利息 50 元 (个人、 机构、基金)	付息式国 债：105998 债券简称： 国债 1899 全部兑付 每 10 张利 息 50 元(个 人、机构、 基金)	私募债券： 114998 债券简称： 18 二篮 01 全部兑付 每 10 张利 息 50 元(个 人、机构、 基金)	企业资产 支持证券： 116998 证券简称： 企业支 01 全部兑付 到期摘牌 每 10 张利 息 50 元(个 人、机构、 基金)
测试日期	每 10 张利息 45 元(QFII)	每 10 张利息 45 元 (QFII)	每 10 张利 息 45 元 (QFII)	每 10 张利 息 45 元 (QFII)	每 10 张利 息 45 元 (QFII)
2018-06- 15	股权登记日		股权登记 日	股权登记 日	股权登记 日
2018-06- 19	利息资金到 账日	股权登记日	兑付资金 到账日	兑付资金 到账日	兑付资金 到账日
2018-06- 20		兑付资金到账 日			

债券分批兑付参数：

测试标的及内容	资产证券化债券： 17 财先 B (116741) 债券分批兑付(面值 调整)	私募债： 17 大庆 01(114277) 债券分批兑付（数量 调整按兑付比例付 息)	私募债： 17 绵科发 (114281) 债券分批兑付（数量 调整全额付息)
测试日期	每 10 张利息 50 元(个 人、机构、基金) 每 10 张利息 45 元 (QFII) 兑付后面值：50 元	每 10 张利息 50 元(个 人、机构、基金) 每 10 张利息 45 元 (QFII) 兑付比例：20%	每 10 张利息 50 元(个 人、机构、基金) 每 10 张利息 45 元 (QFII) 兑付比例：20%
2018-06-20	股权登记日		
2018-06-21	兑付资金到账日	股权登记日	
2018-06-22		兑付资金到账日	股权登记日
2018-06-25			兑付资金到账日

债券赎回

测试标的及 内容	公司债券： 18 青信 Y1(112687) 全部赎回 每 10 张利 息 50 元(个	私募债券： 16 泛海 03 (118749) 全部赎回 每 10 张利息 50 元(个人、	企业资产支持 证券：17 云龙 02 (116730) 全部赎回 每 10 张利息 50 元(个人、	公司债券： 17 创投 S1 (112627) 债券赎回 每 10 张利息 50 元(个人、
-------------	---	---	---	---

测试日期	人、机构、基金) 每 10 张利息 45 元 (QFII)	机构、基金) 每 10 张利息 45 元 (QFII)	机构、基金) 每 10 张利息 45 元 (QFII)	机构、基金) 每 10 张利息 45 元 (QFII) 赎回比例: 20%
2018-06-19	股权登记日	股权登记日	股权登记日	
2018-06-20	赎回资金到账日	赎回资金到账日	赎回资金到账日	
2018-06-25				股权登记日
2018-06-26				赎回资金到账日

暂停上市

测试标的及内容	公司债券: 18 中材 Y1 (112668)	附息式国债: 国债 1802 (101802)	私募债券: 17 晨控 02 (114148)	企业资产支持证券: 15 安信 A (119296)
测试日期	2018-06-19	2018-06-19	2018-06-19	2018-06-19
	暂停上市日	暂停上市日	暂停上市日	暂停上市日

证券评级调整

测试标的及内容	公司债券: 17 千方 01 (112622)	私募债券: 16 津租 01 (118759)	企业资产支持证券: 绿源优 04 (116533)
测试日期	2018-06-21	2018-06-21	2018-06-21
	证券评级调整日	证券评级调整日	证券评级调整日

对于上述发生付息、全部兑付、分批兑付、强制赎回的债券，中国结算深圳分公司为每个测试投资者账户在每个托管单元登记测试证券 100,000 张（份）。

测试投资者账户：0809900000—0809900001（法人）。

六、 交易独立测试系统接入方式

- 1、测试参与人可使用测试专线或者互联网 VPN 接入深交所交易独立测试系统。具体可参考《深交所新一代交易独立测试系统指南》（请参见深交所网站=>技术专栏=>交易独立测试系统栏目（<http://www.szse.cn/main/rule/jysywzn/dlcsxt/xgwd/>））。
- 2、测试请使用生产系统已开通交易单元或者测试系统测试交易单元，并使用生产系统已开通的业务权限进行相应的业务仿真测试。债券质押式三方回购及债券质押式协议回购到期续做业务均可通过电子接口或交易终端参与。（交易终端用户手册请见附件三）。使用交易终端参与测试前，管理员需要为交易员分配三方回购业务权限。具体操作步骤为：一级管理员登录后进入“用户管理”页面，点击用户列表中权限列的设置链接，可以为二级管理员和由一级管理员创建的交易员添加三方回购权限，由二级管理员创建的交易员的权限需要二级管理员来设置。使用电子接口参与测试前，应确认需要测试的交易单元已申请配置在测试交易网关。新增测试网关或者变更已有测试网关请按照《深交所交易系统独立测试系统指南》中申请流程申请。

3、测试期间，中国结算深圳分公司的 D-COM 使用与生产系统一致的接入账号。D-COM 网关及终端软件从 QQ 群的群文件中下载或在线升级（群号见下文联系方式中），本次测试使用 D-COM 网关的版本为 20180315 或更新，D-COM 终端的版本为 20180530 或更新。本次测试报文接口规范版本为《深市登记结算 XML 实时报文接口规范（Ver 1.11）》（见附件四）。

4、固定收益品种业务专区测试系统接入方式：

1) 插入会员业务专区证书的 EKey；（债券质押式三方回购交易权限申请通过会员证书登录办理）

2) 在 IE 浏览器中打开测试系统：<https://biztest.szse.cn/fic>

3) 菜单栏目为：固定收益品种专区=>质押式三方回购=>交易权限申请；通过“质押式三方回购业务申办=》交易权限申请”办理。

七、 测试要求及注意事项

1、各参测单位应以独立于生产系统的测试环境开展仿真测试，应做好详尽的系统测试计划，指定专人负责本次仿真测试工作，并于开始测试前做好测试环境的准备。

2、各参测单位应于测试过程中详细记录测试现象与结果，检查其正确性，如果测试过程中发现跟预期不一致的现象，请及时报告。

3、测试期间，请登录深交所“会员网上业务专区”首页“快速导航—在线调查表”栏目填写并提交测试反馈表（详见附件 2），测试结果支持更新。各会员单位应在**测试期间每周五 14:00**之前提交测

试反馈表,非会员用户请将填报好的反馈表发送至 sseyxb@szse.cn 和 szjsb@chinaclear.com.cn。登录深交所“会员网上业务专区”需使用专用电子认证证书(Ekey),具体方法可询问各自单位负责每月技术月报的填报人员或负责会籍席位业务的人员。

4、测试过程中,各参测单位如发现任何问题,可通过相关 QQ 群、电话或邮箱联系(联系方式见后文)。

八、 联系电话

深圳证券交易所技术: 0755-88668679 (电子接口)

0755-25918713 (交易终端)

0755-22388812 (固收专区)

深圳证券交易所业务: 0755-88668150

中国结算深圳分公司: 0755-21899261 (业务)、0755-21899265
(业务)、0755-25946080 (技术)

深圳证券通信公司: 0755-83182222

QQ 群:

288321593 (深交所交易开发测试 1 群,面向证券公司、系统
开发商等)

530909929 (深交所交易开发测试 2 群,面向基金公司、资产
管理公司、保险公司、托管银行等)

91355646 (深市结算技术券商群,适用于证券公司)

345221331 (深市结算基金银行群,适用于基金公司、托管银

行、结算银行)

137835879 (深圳结算业务开发商, 适用于软件开发商)

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

2018年6月5日