**附件**

**暂停转融通借入证券实时可用**

**业务仿真测试方案**

一、**测试时间**

2月19日（周一）至3月1日（周五），为支持暂停转融通借入证券实时可用，中国证券金融公司（以下简称中证金融）组织具有转融券及做市借券业务资格的证券公司开展业务仿真测试。每日测试时间安排以上海证券交易所（以下简称“上交所”）全天候测试环境和深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易结算独立测试环境的测试时间为准。

**二、测试内容**

业务测试内容包括但不限于：沪深市场转融券和做市借券全部业务流程、沪深市场转融资全部业务流程，以及上述业务的清算等业务处理。

**三、测试环境**

1、上交所和中国结算上海分公司测试环境均为沪市全天候测试环境。

2、深交所和中国结算深圳分公司测试环境均为深市交易结算独立测试环境。

3、中证金融转融通系统和中国结算总部担保品系统测试连接方式同转融通业务仿真测试环境。

4、深证通FDEP平台：

MR消息服务器IP和端口：58.253.80.173:7001；

文件服务器IP和端口：58.253.80.173:7015和58.253.80.173:7016。

**四、相关约定事项**

1、本次测试，中证金融将清理仿真测试环境合约数据，且不预设初始合约数据。

**2、借入人融券专用证券账户初始持仓安排：本次测试中证金融为各出借人安排初始持仓（附件1）。沪市以全天候测试环境2月2日闭市后发送的证券余额数据为基准（ZQYE.DBF），深市以交易结算独立测试环境2月8日闭市后日终发送的对账数据（SJSDZ.DBF）为准。测试所需证券持仓，请通过转融券等方式取得。**

3、借入人转融通担保资金明细账户初始资金安排：中证金融为各参测借入人转融通担保资金明细账户设置初始资金各4亿元。资金余额以仿真测试环境2月8日闭市后中国结算担保品管理系统发送的资金余额数据为基准（DBPZJYE.DBF）。

4、本次测试，在现有固期固费转融资期限品种基础之上新增1天和2天期转融资业务品种，专供本次测试时使用。1天和2天期固期固费转融资合约到期后可再借。本次测试，每个交易日均为市场化转融资交易日，期限、费率及头寸详见每日下发参数文件。

5、各测试参与人应以独立于生产系统的测试环境开展仿真测试，并按照每日测试重点（附件2）做好详尽的系统测试计划，落实专人负责本次测试工作。具体测试安排详见沪深交易所测试通知。

6、各参与人完成本轮测试后，请填写测试反馈表（附件3），并于3月2日18:00前以邮件方式向我司反馈（邮箱：csftest@csf.com.cn）, 邮件主题名为“参测单位名称+暂停转融通借入证券实时可用仿真测试反馈表”。

**五、联系方式**

测试交流QQ群：260512248

中证金融公司测试技术联系电话： 010-63211719

中证金融公司测试转融券联系电话： 010-83325370

中证金融公司测试转融资联系电话： 010-83325365

中证金融公司测试结算联系电话： 010-63211717

中证金融公司测试授信调整联系电话： 010-63211653

中国证券金融股份有限公司

2024年2月2日

附件1 出借账户初始账户持仓

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **市场** | **证券代码** | **股份性质** | **调整数量** |
| 沪市 | 600000688018 | 无限售流通股 | 增加10万股 |
| 深市 | 000002300002 | 无限售流通股 | 增加10万股 |

附件2 每日测试重点

|  |  |
| --- | --- |
| **日期** | **测试内容** |
| 2月8日（周四） | 测试环境准备。 |
| 2月19日（周一） | 1. 沪深市场转融券交易
2. 沪深市场转融资交易
 |
| 2月20日（周二） | 1. 沪深市场转融券交易
2. 沪深市场转融资交易和再借
3. 沪深市场展期、提前了结
 |
| 2月21日（周三） | 1. 沪深市场转融券交易
2. 沪深市场转融资交易和再借
3. 沪深市场展期、提前了结
 |
| 2月22日（周四） | 1. 沪深市场转融券交易
2. 沪深市场转融资交易和再借
3. 沪深市场展期、提前了结
4. 权益测试：（688018、300002分红送股）
 |
| 2月23日（周五） | 1. 沪深市场保证金交易（具体以沪深交易所测试通知为准)
2. 保证金划转等
 |
| 2月26日（周一） | 1. 沪深市场保证金交易
2. 保证金划转等
 |
| 2月27日-3月1日 | 自行安排 |

**附件3 XXX公司暂停转融通借入证券实时可用业务仿真测试反馈表**

|  |  |
| --- | --- |
| **测试内容** | **测试结果** |
| T日转融通期限库文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 转融通资金头寸文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 转融通标的期限费率文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 转融通可充抵保证金证券文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 市场化转融券约定申报交易参数文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| T日转融通成交信息文件的接收和处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| T日新合约信息文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| T日合约偿还明细文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| T日合约对帐文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| T+1日交收通知文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 展期结果通知文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 提前了结结果通知文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 偿还划付差错文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 保证金追缴通知文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 转融通权益文件的接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 转融通成交信息01文件接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| T日转融通信息披露库接收与处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市市场化转融资申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市转融资申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市市场化转融资及转融资合约再借申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市主板转融券非约定申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市主板转融券市场化约定申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市主板转融券展期申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市主板转融券提前了结申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市双创板块转融券非约定申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市双创板块转融券市场化约定申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市双创板块转融券展期申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市双创板块转融券提前了结申报/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市保证金限价和市价交易/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市保证金资金交存提取替换/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 沪深两市保证金证券交存提取替换/撤单 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 转融资合约偿还 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 市场化转融资合约偿还 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 转融券合约偿还 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 转融通业务清算 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 中国结算上海结算数据处理 | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| 中国结算深圳结算数据处理注：明细结果库（SJSJG.DBF）中业务类别（JGYWLB）为转融通证券划转（RTR4）的数据，若为市场化转融通的转融券指令，且深交所未完成可交易余额实时调整的，客户订单编号（JGDDBH）填写申报指令中的委托序号，执行编号（JGZXBH）填写空，交收方式（JGJSFS）填写‘N’（非担保交收） | ◎正常◎异常◎未测◎无此业务 |
| (可自行添加) |  |
| 异常说明：（不超过500汉字） |

反馈人： 反馈日期：