
深交所与中国结算基金盘后业务 第一次全网测试方案



中国证券登记结算有限责任公司

二〇一〇年三月

目 录

1	测试目的.....	1
2	参测单位.....	1
3	定义和术语.....	1
4	涉及技术系统.....	1
5	测试内容.....	1
5.1	测试业务功能.....	2
5.2	测试数据接口.....	2
6	测试时间安排和数据传送时点.....	2
6.1	测试时间安排.....	2
6.2	测试数据传送时点.....	3
7	测试基础数据.....	6
8	测试步骤.....	8
9	测试要求.....	8

1 测试目的

深圳证券交易所与中国证券登记结算有限责任公司基金盘后业务技术系统开发完成，并且已经与部分券商进行了内部测试。为了保证基金盘后业务系统顺利上线并投入使用，现特安排本次全网测试(时间 2010 年 3 月 20 日周六)，以验证各参与方技术系统的正确性。

2 参测单位

- (1) 中国证券登记结算有限责任公司总部(简称中国结算总部)
- (2) 中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司(简称中国结算深圳分公司)
- (3) 深圳证券交易所(简称深交所)
- (4) 深圳证券通信有限公司(简称深证通)
- (5) 具有基金代销资格的券商
- (6) 国投瑞银基金公司及直销

3 定义和术语

(1) FDEP: 即深证通金融数据交换平台, 它包括 FDEP 消息传输系统和 FDEP 文件传输系统两个组成部分, 其中 FDEP 文件传输系统旧称“深证通文件交换平台”。

4 涉及技术系统

- (1) 中国结算基金盘后业务系统;
- (2) 深证通金融数据交换平台(FDEP): 包括消息传输系统和文件传输系统;
- (3) 深证通双向通信系统。

注: 本次测试, 深证通综合结算通信系统、开放式基金通信系统暂不参测。

5 测试内容

本次测试完成一个交易日的完整测试。对于所有周边接口, 参考先前发布的基金盘后业务系统相关接口规范。

由于测试时间点前后连接比较紧密, 请参与人在相关规定时点内, 完成相关数据的接收和发送。

本次测试, 券商日间将业务报送给中国结算总部(通过深证通 FDEP 消息传输系统), 总部返回预确认结果。日终统一由深圳分公司作份额变更登记, 并发送股份结算数据给参测券商(通过深证通双向通信系统)。

本次测试中使用的 FDEP 环境, 是位于深圳证券通信专网内的 FDEP 测试环境,

不是生产环境。在该环境中，中国结算总部的消息传输 UserID 为 R_BEIJING01，AppID 为 jjph01，文件传输小站号为 R_BEIJING01。需要参加测试的单位，请于测试日之前与深圳证券通信有限公司联系，事先做好网络连通性配置和其他准备工作。

交易系统不参与本次测试，测试期间不发送行情数据。

5.1 测试业务功能

a. 基金分拆 (085)，合并 (086)

基金代码：父基金： 161207，子基金： 150008，150009

b. 交易查询；

c. 交易撤单 (099)；

5.2 测试数据接口

下面是基金盘后业务系统文件数据接口：

A. 盘后业务系统文件数据接口：

数据文件	发送方	接收方	文件名	说明
基金信息	管理人	TA	SCD-GG-98-yyyymmdd-GJ.DBF	通过 FDEP 文件传输系统接收
基金行情	TA	代理人	SCD-98-XXX-yyyymmdd-DJ.DBF	
交易回报	TA	代理人	SCD-98-XXX-yyyymmdd-HB.DBF	

B. 深圳分公司结算数据接口

通过SJS GF.DBF中‘4A’业务表示基金盘后业务份额变更，具体请参见之前发布的《关于基金盘后业务券商股份调账接口的通知》。

6 测试时间安排和数据传送时点

6.1 测试时间安排

本次测试用一天的时间（实际测试日期为 3 月 20 日，周六）完成一个交易日（模拟交易日期为 3 月 22 日周一）的测试。

注意：本次测试，不涉及场外及场内基金申赎交易申报和二级市场买卖，不涉及模拟资金交收。测试过程中交易系统不启动，不接受委托，不产生成交，不发送行情数据。

6.2 测试数据传送时点

下表包含了券商、基金管理人和本公司在整个测试过程中的数据交换内容和时点。

操作时点	模拟时点	代理人（券商）	中国结算总部	中国结算深圳分公司	基金管理人
3月20日之前		3月20日之前，请提前与深圳证券通信有限公司联系，事先做好网络连通性配置和 FDEP 的配置工作。			3月20日之前，请提前与深圳证券通信有限公司联系，事先做好网络连通性配置和 FDEP 的配置工作。
3月20日 8:30~9:00	3月22日 8:00之前				通过 FDEP 文件传输系统发送基金信息给中国结算总部实时系统。
9:30	8:30	通过 FDEP 文件传输系统接收基金行情。	通过 FDEP 文件传输系统发送基金行情。		
9:30~14:00	9:30~15:00	通过 FDEP 消息传输系统发送拆分和合并等消息指令。	通过 FDEP 消息传输系统返回预确认结果。		
14:00~ 14:30	15:00~ 16:00		生成当日交易申请汇总文件，发送给中国结算深圳分公司。	接收总部文件，进行处理，并返回处理结果。	
16:00	18:00		接收中国结算深圳分公司返回的过户处理结果并进行处理。		

		<p>通过 FDEP 文件传输系统接收实时系统的当日回报文件。</p> <p>通过双向通信系统接收中国结算深圳分公司结算数据。</p>	<p>将回报文件通过 FDEP 文件传输系统发送给代理人（券商）。</p>	<p>通过双向通信系统向代理人（券商）发送 SJSGF.DBF、SJSDZ.DBF 等结算数据。</p>	
--	--	---	---------------------------------------	--	--

7 测试基础数据

考虑到本次测试业务的特殊性及要求,本次测试根据券商场外基金销售人代码,模拟生成相应的股东账户及初始份额持有数据。请各参测方在各自系统中按以下规则自行生成相关数据。

A. 券商代码及名称

序号	券商编码	券商名称
	601	国泰君安证券股份有限公司
	602	中信建投
	603	国信证券有限责任公司
	604	招商证券
	605	广发证券
	606	中信证券
	607	银河证券公司
	608	海通证券公司
	609	华泰联合证券
	610	申银万国证券公司
	613	兴业证券公司
	614	长江证券公司
	615	安信证券
	616	西南证券
	617	金通证券
	618	湘财证券
	619	万联证券
	620	民生证券
	621	国元证券
	622	渤海证券
	624	华泰证券
	625	山西证券
	626	万通证券
	627	东兴证券
	628	东吴证券
	629	信达证券
	631	东方证券
	633	方正证券
	634	长城证券
	635	光大证券
	636	广州证券公司
	638	东北证券
	640	南京证券
	641	上海证券

	642	新时代证券
	643	大同证券
	644	国联证券
	645	浙商证券
	646	平安证券
	647	华安证券
	648	国海证券
	649	财富证券
	650	东莞证券
	651	中原证券
	652	国都证券
	653	东海证券
	654	中银证券
	655	恒泰证券
	656	国盛证券
	658	华西证券
	659	宏源证券
	660	齐鲁证券
	661	世纪证券
	663	第一创业
	664	金元证券
	665	江南证券
	667	华林证券
	668	德邦证券
	669	西部证券
	671	广发华福证券
	672	华龙证券
	673	中金公司
	674	财通证券
	677	华鑫证券
	678	瑞银证券
	679	中国建银投资证券
	680	中山证券
	681	红塔证券
	682	西藏证券
	684	日信证券
	685	联讯证券
	686	江海证券
	688	银泰证券
	689	国金证券
	690	民族证券
	691	华宝证券

	692	厦门证券
	693	爱建证券
	694	英大证券
	695	华融证券
	699	大通证券

B. 托管单元（席位代码）

使用上述券商在中国结算深圳分公司的各自的托管单元（席位代码），是真实数据。

C. 股东账户及名称

序号	股东代码	股东名称
1	XXX000000N	券商 XXX 投资人 N

N: 取值为 1 或 2 或 3 或 4 或 5，XXX 为对应券商代码（见上表 A），每家券商只能使用自身代码，所以，每家券商只分配 5 个可用的测试股东代码，分别托管券商（见上表 A）全部的托管单元上。

D. 初始份额持有

基金代码	托管单元	股东代码	持有份额
161207	TTTTTT	XXX000000N	100000
150008			50000
150009			80000

注意：XXX 为对应券商代码，每家券商只能使用自身代码；TTTTTT, 为券商的各自使用的托管单元。

举例说明：以 XXX 为 601，N 为 4 说明：

基金代码	托管单元	股东代码	持有份额
161207	002800	6010000004	100000
150008			50000
150009			80000

8 测试步骤

- 在测试日，各参与方将数据在规定时间点内上传到中国结算深圳总部；
- 各个参与人在规定的各个时间点，检查应接收的数据是否收到以及是否正确；
- 份额对帐；
- 系统和数据恢复。

9 测试要求

- 本次测试涉及到的数据都是测试数据，不是生产数据。测试前，请各参测单位

- 做好生产环境的保护工作；测试结束后，请各参测单位做好环境恢复和检查工作，以确保下一交易日（3月22日）的正常运作。
- b. 参与测试的各方，请于测试日之前与深圳证券通信有限公司联系，事先做好网络连通性配置和其他准备工作。
 - c. 敬请各参测单位认真组织，做好相关准备和测试记录，落实专人负责测试工作。
 - d. 敬请各参测单位在测试后汇总内部情况，填报《基金盘后业务第一次全网测试反馈表》（附件2），并于测试后的第一个工作日（3月22日）内反馈至中国证券登记结算有限责任公司。

中国证券登记结算有限责任公司

二〇一〇年三月

附件 1: 基金盘后业务系统返回代码表

返回代码	代码含义
0000	成功
0105	代理人非法
0200	无效的基金代码
4001	品种余额数量不足
4002	品种代码无效
4003	交易时间无效
4004	申请单编号无效或重复
4005	销售商代码无效
4006	席位代码/托管单元无效或非法
4007	申请金额或数量无效
4008	分拆合并比例错误
4009	基金暂停该业务
4010	业务类型无效
4011	证券账户无效
4012	具有相同非空配对号码的记录的证券账户不同
4013	交易日期非法
4014	流水号无效
4015	数据发送日期无效
4016	沪深标志非法
4017	内部稽核失败
4018	冻结序号非法或不存在
4099	销售人已撤单

4128	基金盘后业务系统故障
4129	基金盘后业务系统未启动
4130	报文转换内部错误
4132	报文转换错误: 没有任何交易数据
4133	报文转换错误: 字符位数超长
4134	报文转换错误: 数字字段小数位超长
4135	报文转换错误: 数字字段整数位溢出
4136	报文转换错误: 数据转换其他格式错误
4137	报文转换错误: 无效的数字字符
4138	销售商代码与发送方代码不一致
4139	系统序号表确认序号不存在
4140	交易处理内部错误
4141	交易时间未到或已过
4142	无效的发送方代码
4143	报文校验和不匹配
4144	无效的报文校验和
4145	报文体长度与实际长度不匹配
4146	无效的报文类型
4147	无效的报文体长度
4148	无效的起始串
4149	非法接入者
4150	重发的交易
4151	基金净值未到达
4152	基金禁止拆分
4153	基金未成立
4154	基金禁止合并
4155	取扩展参数失败
4156	获取标志文件传入参数无效
4157	无相关通讯机信息
4159	交易流水号已满/不可用
4160	撤单对应的申请数据不存在
4161	失败的申请不能撤单
4162	申请尚未受理, 不允许撤单
4163	申请已处理完成, 不允许撤单
4164	申请二次处理中, 不允许撤单
4165	只能对非撤单业务进行撤单处理
4166	接收接口文件出错
4167	导入接口文件出错
4168	结算结果与结算业务不一致
4169	确认份额/金额大于申请份额/金额
4170	传入的申请流水号不存在
4171	无确认结果数据
4172	无申请数据

附件 2: 《基金盘后业务第一次全网测试反馈表》

填表日期:

参与人名称:	参与人编码:	
<p>一、测试情况说明</p> <p>1、选择参测角色: (可多选)</p> <p><input type="checkbox"/> 管理人 <input type="checkbox"/> 直销 <input type="checkbox"/> 券商</p> <p>二、测试问题详细记录</p> <p>1、</p> <p>2、</p> <p>3、</p> <p>三、外购软件说明 (软件名: 版本号: 开发商名称)</p> <p>1、 _____ : _____ : _____</p> <p>2、 _____ : _____ : _____</p>		
测试联系人	联系电话	E-MAIL
(业务)		
(技术)		

注: 此表由参测人填写, 在所选项目的“□”打“√”。

注: 填好后请传真到 010 - 58598907, 或者发送邮件至 kfj@chinaclear.com.cn。