**沪市货银对付改革过渡期通关测试方案**

1. **测试目的**

根据货银对付改革相关工作安排，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）现定于2022年12月24日（周六）开展沪市货银对付改革过渡期通关测试，检验市场参与各方技术和业务系统的正确性。数据接口详见《登记结算数据接口规范（结算参与人版V3.81）》。

1. **参测单位**
2. 上海证券交易所
3. 中国结算上海分公司
4. 中国证券金融股份有限公司
5. 证券公司
6. 基金公司及资管公司等托管产品管理人（以下简称“管理人”）
7. 托管银行
8. 期货公司
9. 香港结算
10. 其他相关单位
11. **测试内容**

本次测试时间为2022年12月24日（周六），模拟一个交易日（2022年12月24日）和一个结算日（2022年12月24日的处理。以下称2022年12月24日为T日。

测试内容及注意事项如下：

**功能1-预清算查询**：T日，可通过PROP服务“货银对付预清算结果查询”查询预清算结果，预清算结果的可查询时间分别为14:30、15:15、15:45、15:50左右。当日最终批次预清算的数据，与当日日终资金核验的相应数据一致。

**功能2-优先/免除标识指令申报及处理**：T日17:00前，可通过PROP服务“货银对付优先/免除标识指令申报及查询”申报优先标识指令或免除标识指令。上述两类指令同时申报的，结算系统只处理优先标识指令。申报要素包括：备付金账户（必填）+证券账户（必填）+证券代码（选填）+证券类别（选填，PT/GZ/JJ）+流通类型（选填，流通证券填0）+权益类别（选填，非送股权等权益类证券填空）+挂牌年份（选填，非送股权等权益类证券填0）+证券数量（选填）。

**功能3-可售交收锁定处理**：对于自营和托管业务，若担保交收备付金账户的资金核验（T日17:00左右）不足，则结算系统当日根据优先标识指令或免除标识指令进行证券可售交收锁定处理（以下简称“打标识”）。若优先标识指令申报不足，或免除标识指令申报过量，或结算参与人未进行申报的，结算系统对该备付金账户的当日全部净应收证券打标识。证券打标数据通过日终文件“qtsl(证券其他数量对账文件)”、“zqbd（证券变动文件）”、“zqye (证券余额对账文件)”等发送给结算参与人。

需要说明的是，根据《结算规则》，本公司对经纪业务和融资融券业务的相应净应收证券不打标识，打标识范围仅涉及自营业务和托管业务。

**功能4-T+1日多批次资金核验**：由于T日的前一工作日不进行可售交收锁定处理，因此各参测机构在T日当天查询到的多批次交收结果为“无可售交收锁定”。

**功能5-融资回购违约金额的申报及处理：**T日16:00前，可通过PROP服务“货银对付申报管理-融资回购违约金额申报”进行融资回购违约金额指令的申报和撤销。申报指令要素如下：申报类型、结算备付金账户、融资回购违约金额、日期，以上字段均必填。当日存在有效申报的情况下，不得再次申报。如需修改申报，应先撤销申报的内容，再进行相应申报。

**功能6-最低备付金比例调整**：以2022年12月1日至12月23日的生产环境数据为基础，于2022年12月24日进行最低备付月度调整。结算参与人可通过日终“tzxx（通知信息文件）”接收最低备付调整信息。管理人如需获取证券账户最低备付明细数据（管理人专用），可通过“tzxx（通知信息文件）”中通知类别为“050”的文件收取。最低备付比例调整的生效日期为2022年12月30日。

本次测试中，债券品种（包括现券交易和回购交易）以外的多边净额结算证券品种的最低备付金比例适用参数将统一设置为16%，债券品种的最低备付金比例为10%。

**功能7-资金变动查询：**使用PROP综合业务终端“资金存管2.0-信息查询-资金变动查询”菜单，查询备付金账户资金出入账（含三地资金划拨）新启用的“发生时间”字段。

**功能8-三地资金划拨时间延长至17点**：请各参测机构通过PROP综合业务终端“资金存管2.0-资金划拨”进行本机构京沪深三地备付金账户之间的资金划拨，请于日间（16：00之前）完成至少一笔，于16:00至17:00之间完成至少一笔。

1. **测试数据**

本次测试所使用的证券账户、交易单元、指定交易、清算路径、证券持仓、备付金账户及其指定收款账户数据以2022年12月23日（周五）闭市后生产环境数据为基准。

T日，结算参与人可通过担保、非担保备付金互划的方式，进行相应资金划转操作。

各参测单位务必保障测试环境与生产环境的隔离，以免测试数据影响生产。

1. **测试时间表**

|  |
| --- |
| 2022年12月24日（周六）测试时间安排 |
| 1 | T日（系统日期20221224）09:15-15:00 | 日间交易和相关业务申报（上交所15:00收盘） |
| 2 | T日（系统日期20221224）15:00-19:00 | 日终结算处理 |

1. **数据接收与发送**

PROP查询、申报和结算数据接收：各结算参与人使用生产环境相关网络地址连接PROP系统，进行预清算数据查询、PROP申报、接收日终登记结算数据并进行相应处理。请结算参与人在切换到测试环境后，首先为相应操作员配置货银对付业务PROP功能权限（JSXT 20/21/22/23/24）。

**七、测试注意事项及联系电话**

1. 请参测机构在开展交易时，保证同时进行买入交易和卖出交易报单。
2. 请各参测市场机构（尤其是期货公司）务必确保一笔交易成交，并进行相应预清算数据查询。
3. 请参测的管理人通过“tzxx（通知信息文件）”中通知类别为“050”的文件获取证券账户最低备付明细数据，检查其正确性，如果测试过程中发现与预期不一致的现象，请及时反馈至021-68606521。

（四）各参测单位应按照测试方案中的时间安排和要求进行操作，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与预期不一致的现象，请及时报告。

（五）测试完成后，各参测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。

（六）请各参测单位于12月24日20:00前提交测试反馈表（见附件2）至xczhang@chinaclear.com.cn。

（七）测试期间联系方式

中国结算上海分公司市场测试咨询电话：021-68606789

中国结算上海分公司数据接口咨询电话：021-68606788

QQ群：763373099或149247290（中国结算上海测试群）