

关于开展深市港股通按金优化项目

2022年5月28日全网测试的通知

各结算参与机构：

为进一步完善结算风险防范措施，提高按金的精细化管理水平，香港结算拟对港股按金计算模型进行调整。根据主场原则，内地港股通业务按金计算模型需要相应调整。对此，中国证券登记结算有限责任公司于2022年4月8日发布了关于《内地与香港股票市场交易互联互通机制登记、存管、结算业务实施细则(2022年4月征求意见稿)》征求意见的通知。为确保相关业务的顺利开展，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称中国结算深圳分公司）定于2022年5月28日组织全网测试，检验市场参与各方技术系统的正确性。

现将测试相关事项通知如下：

一、参测单位

1. 深圳证券交易所
2. 中国结算深圳分公司
3. 香港联交所
4. 香港中央结算公司
5. 深圳证券通信有限公司
6. 证券公司
7. 基金公司
8. 托管银行

9. 其他相关单位

二、测试内容

本次测试内容主要为中国结算深圳分公司对参与者使用新按金模型，根据香港结算 T 日提供的 T-1 日按金风险参数档案，结合参与者未交收头寸（包括公司行为头寸）、证券担保品情况，计算参与者应缴纳按金金额。各参测机构应根据自身需求申报港股通证券买入或卖出，形成用于计算按金的未交收头寸，并确保日终可以正常接收及处理按金清算数据。

港股通系统模拟半日市交易和 1 个结算日的结算（即模拟 T 日 2022 年 5 月 28 日）。

三、测试时间

港股通交易结算业务测试的具体安排请见下表：

步骤	时间段	测试内容	
深交所港股通 T 日测试安排（模拟 T 日 2022 年 5 月 28 日的交易）			
1	9:00-10:00	持续交易时段	模拟港股通交易业务的委托申报，并接收成交回报；实时行情的接收与展示。
2	10:00-10:45	发布港股收盘价格文件	接收港股收盘价格文件
中国结算深圳分公司 T 日测试安排（模拟 T 日 2022 年 5 月 28 日的结算）			
1	8:30-12:00	D-COM 业务申报（港股通公司行为及非交易业务等）	
2	12:00-17:00	港股通结算日终处理	
3	17:00 后	中国结算深圳分公司发送 T 日的港股通结算数据	

四、测试数据准备

本次测试以 2021 年 5 月 27 日（星期五）港股通系统所有证券收盘行情、收市后的股份数据作为交易、结算的起始数据。

五、注意事项

1. 本次测试包括交易系统、结算系统、D-COM 系统。

2. D-COM 系统在 2022 年 5 月 28 日期间属于测试环境，2022 年 5 月 28 日（星期六）23:45 以后将恢复回生产环境。

3. 测试期间通过交易终端进行的密码修改、用户添加等用户管理相关操作，仅在测试期间有效，仅适用于 2022 年 5 月 28 日全网测试。

4. 请各参测单位根据自身技术系统情况，制定详尽的测试计划和操作流程。测试前先做好线上系统和数据环境的保护工作，再准备 2022 年 5 月 28 日测试相关数据。测试完成后做好线上系统和数据环境的恢复工作，确保下一交易日（2022 年 5 月 30 日）生产系统的正确运行。

5. 本次测试的数据仅为模拟测试数据，与实际业务无任何关系，不能作为生产环境任何交易、非交易、账户等业务的依据。

六、测试要求

1. 在测试过程中，请各参测单位详细记载测试现象与结果，检查其正确性。如发现异常现象，请及时报告。

2. 各参测单位应在 2022 年 5 月 28 日 19:00 前提交全网测试反馈表（见附件 1）。请参测单位将全网测试反馈表通过邮件发送至 szjsb@chinaclear.com.cn 邮箱，邮件主题为：“深市港股通按金优化项目 2022 年 5 月 28 日全网测试反馈”。

七、测试联系电话：

业务咨询电话：0755-21899208

技术咨询电话：0755-25946080

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

2022年5月25日

附件 1

深市港股通按金优化项目全网测试反馈表

结算参与人代码		公司名称	
联系人		联系电话 (包括手机)	
Email 地址			
本业务涉及系统的软件开发商名称			
测试结论	测试完成情况： <input type="checkbox"/> 通过 <input type="checkbox"/> 失败 (注：无相关业务或评估不影响业务开展的视为测试通过) 测试完成情况为失败时的情况说明：		
请填写以下各功能点测试结果			
功能点		测试结果	
1、	按金清算数据接收及处理	<input type="checkbox"/> 通过 <input type="checkbox"/> 失败 (注：无相关业务或评估不影响业务开展的视为测试通过)	