

交易行情网关软件升级等业务 2017年12月2日全网测试方案

一、测试目的

为进一步稳定交易网关、行情网关的网络传输时延，深圳证券交易所（简称“深交所”）优化了交易网关、行情网关及网关监控程序的相关功能，优化后交易网关的软件版本日期更新为 20171108、行情网关的软件版本日期更新为 20170828、网关监控程序的软件版本日期更新为 20170828。为此，深交所定于 2017 年 12 月 2 日组织全网测试，请各会员、基金公司等交易参与人（简称“交易参与人”）通过模拟深市证券交易、非交易等业务的委托申报、成交回报、行情接收及深市证券结算等业务处理，检验市场参与各方技术系统的正确性。

本次测试，深交所将验证 Level2 快照行情进一步增大发送速率后，市场参与各方技术系统的适应性；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”）将进行 D-COM 文件分发服务器迁移。

二、参测单位

1. 深圳证券交易所
2. 中国结算深圳分公司
3. 深圳证券通信有限公司
4. 会员单位
5. 基金管理公司

6. 行情服务商
7. 托管人（托管银行或者具有托管资格的券商及相关单位）
8. 其他相关单位

三、测试内容

深市证券模拟 1 个完整交易日的交易、1 个完整结算日的结算（T 日 2017 年 12 月 2 日），验证市场参与各方可正确处理深市证券交易、非交易、行情接收与清算交收等业务。

T 日为港股通非交易日非结算日，不发送港股产品信息 hkexreff04、最小价差文件 hkexzxjc、5001 频道港股快照行情报文（Step: w, Binary: 306311）、港股收盘价格文件 hkexclpr04。

（一）深交所交易系统

1. 早间发布当日测试使用的静态交易参考信息。
2. 模拟深市证券日常交易、非交易等业务的委托处理与成交回报。
3. 模拟深市证券实时行情及收盘行情的发布。

（二）中国结算深圳分公司结算系统

模拟深市证券日常交易、非交易等业务的清算交收处理；
进行 D-COM 文件分发服务器迁移。

（三）市场参与者技术系统

1. 进行深市证券交易、非交易等业务的委托申报、成交回报。实施部分或全部交易网关软件升级至 20171108 版本的市场参与者，重点

观察网络传输时延是否符合预期。

2. 接收深市证券的实时行情。Level2 行情服务商，以及实施部分或全部行情网关软件升级至 20170828 版本的市场参与者，重点检查行情接收是否正常。

3. 接收静态交易参考信息及收盘行情等文件。

4. 使用交易终端进行深市证券的委托申报、成交查询、行情查询及数据下载。

5. 深市证券交易、非交易业务的清算交收处理。

四、测试时间安排

测试时间为 2017 年 12 月 2 日（星期六）9:00 至 16:00，模拟深市交易日、深市结算日、港股通非交易日、港股通非结算日。

深市证券交易及结算业务的具体安排请见下表：

实际时间 (12月2日)	主要测试内容	交易参与者 重点测试内容	模拟日期
9:00 前	发布静态交易参考信息文件。	接收静态交易参考信息文件。	T日：2017 年12月2 日
9:00 前	发布 PCF 文件。	接收及处理 PCF 文件。	
9:00 前	发布信息公告。	接收信息公告。	
9:15-12:00	接收日常交易、非交易等委托， 10:30-10:35 中午休市。其中： 现货集中竞价交易平台 9:15-11:30（9:25 开盘，9:30 开始连续竞价，11:30 平台闭市） 综合金融服务平台 9:15-12:00 非交易处理平台 9:15-11:30	模拟深市证券交易、非交易业务的委托申报，并接收成交回报； 接收深市证券实时行情并展示。	
12:00-14:00	中国结算深圳分公司模拟 T 日 股份资金清算交收。		

14:00 后	T 日结算数据发送。	接收以下结算数据, 进行核对及交收处理: SJSMX1mmdd.DBF SJSMX2mmdd.DBF SJSJGmmdd.DBF SJSQSmdd.DBF SJSYEmdd.DBF SJSZJmmdd.DBF SJSZmmdd.DBF SJSTJmmdd.DBF SJSFWmmdd.DBF SJSGBmmdd.DBF SZSDSmdd.DBF LOFJSmmdd.DBF BHDZmmdd.DBF BHJGmmdd.DBF SJSFXmmdd.DBF	
15:00 后		系统环境及数据恢复。	

五、测试数据准备

本次测试以 2017 年 12 月 1 日（星期五）深市所有证券的收盘行情、收市后的股份数据作为交易结算的起始数据。

六、测试前准备工作

请参测单位务必于测试前做好以下准备工作：

- 1、根据自身技术系统情况，制定详尽的内部测试计划和操作流程。
- 2、测试前做好现有系统和数据环境的备份工作。
- 3、依据本方案，完成测试数据的准备，认真准备测试环境。

七、注意事项

- 1、请市场参与人先完成生产数据的接收及备份，再准备 12 月 2 日测试相关数据。

2、本次测试包括交易系统、结算系统、D-COM 系统（但不包括资金划拨部分）。

3、D-COM 系统在测试当天属于测试环境,12月2日(周六)16:00以后将恢复回生产环境。

4、本次测试的数据仅为模拟测试数据,不能作为生产环境任何交易、非交易等业务的依据。

5、交易网关、行情网关及网关监控程序的版本说明

计划在 2017 年 12 月 1 日收市后升级交易网关、行情网关的参测单位应对程序所在目录进行完整备份,备份后再将交易网关升级至 20171108 版本、将行情网关升级至 20170828 版本、将网关监控程序升级至 20170828 版本。交易网关和行情网关只需替换可执行程序 tgw 和 mdgw,不需要修改协议版本号;网关监控程序需替换可执行程序 gwmon 和 webroot.zip。

交易网关、行情网关及网关监控程序的软件安装包下载地址为 www.sccc.com ->下载专区->新一代交易系统。

20171108 版本 Linux/Windows 交易网关可通过 knock_offset_time 参数配置敲门偏移时间,20171108 版本 Linux 交易网关、20170828 版本 Linux 行情网关支持 Ekey 设备。具体使用及操作说明详见相应网关的用户手册(包含在软件安装包中)。

6、全网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 12 月 2 日测试。

7、中国结算深圳分公司 D-COM 文件分发服务器迁移，需验证日终结算文件的接收。

八、测试要求

1、请各会员单位、Level2 行情服务商，以及计划在 2017 年 12 月 1 日收市后升级部分或全部交易网关、行情网关的市场参与人务必参加本次测试。因故不能参加测试者，务必电话或传真通知深交所。

2、应使用与 2017 年 12 月 4 日生产系统相同的软硬件环境开展测试。请各参测单位认真组织，落实专人负责本次测试工作。

3、各参测单位测试前务必做好线上系统和数据环境的备份工作。测试完成后，做好线上系统和数据环境的恢复与变更稽核工作，确保下一交易日（12 月 4 日）生产系统的正确运行。

4、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，及时报告。

5、所有参测单位务必在 2017 年 12 月 2 日 16:00 之前登录深交所“会员业务专区”首页“快速导航—在线调查表”栏目填写并提交《政交易行情网关软件升级等业务 2017 年 12 月 2 日全网测试反馈表》（详见附件），非会员用户请将填报好的反馈表发送至 sseyxb@szse.cn，邮件名为“参测单位名称+交易行情网关软件升级等业务 2017 年 12 月 2 日全网测试反馈表”。

登录深交所“会员业务专区”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。

九、联系电话

深圳证券交易所： 0755-82083510

中国结算深圳分公司： 0755-88666429

深圳证券通信公司： 0755-83182222

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

2017年11月28日

附件：

交易行情网关软件升级等业务 2017 年 12 月 2 日全网测试反馈表

会员代码 (其他单位不填)		会员名称或单位名称	
联系人		联系电话(包括手机)	
Email 地址			
系统的软件开发商名称 (软件开发商不填)			
功能点	反馈结果		
20171108 版本交易网关的上线情况	<input type="radio"/> 全部上线 <input type="radio"/> 部分上线 <input type="radio"/> 上线后回退 <input type="radio"/> 未计划上线 <input type="radio"/> 未使用交易网关 若未全部上线,则后续的上线计划为: _____		
20170828 版本行情网关的上线情况	<input type="radio"/> 全部上线 <input type="radio"/> 部分上线 <input type="radio"/> 上线后回退 <input type="radio"/> 未计划上线 <input type="radio"/> 未使用行情网关 若未全部上线,则后续的上线计划为: _____		
20171108 版本成交汇总服务网关 (tgw) 的使用与监控	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测		
20171108 版本交易网关的使用与监控	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测		
20171108 版本 Linux 交易网关支持 Ekey 设备	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测		
平台状态切换为“即将开放”后申报委托	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测		
20171108 版本交易网关使用 knock_offset_time 参数配置敲门偏移时间	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测		
20170828 版本行情网关的使用与监控	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测		
20170828 版本 Linux 行情网关支持 Ekey 设备	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测		
20170828 本网关监控程序的使用	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测		

深市现货集中竞价交易平台各类业务申报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
深市综合金融服务平台各类业务申报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
深市非交易处理业务平台各类业务申报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
深市证券成交回报接收	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
深市 LEVEL I 行情接收与显示	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
深市 LEVEL II 行情接收与显示	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
交易参考信息接收与加载	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
信息公告接收与加载	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
PCF 文件接收及处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
ETF 申赎业务处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
融资融券业务处理	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
交易终端的委托申报	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
交易终端的成交查询	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
交易终端的行情查询	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
交易终端的各类数据下载	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
D-COM 日终结算文件接收	<input type="radio"/> 正常 <input type="radio"/> 异常 <input type="radio"/> 未测
异常说明：(不超过 500 汉字)	

注：非会员用户填写后发送至 sseyxb@szse.cn。