**附件1**

**现金选择权行权扣税业务仿真测试方案**

1. **测试目的**

为落实2022年7月1日开始施行的《中华人民共和国印花税法》，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）将对现金选择权行权所涉的股份过户代扣代缴证券交易印花税，按成交金额的1‰向出让方（即行权方）收取。为确保相关业务的顺利开展，深圳证券交易所（以下简称深交所）联合中国结算深圳分公司定于2022年8月1日至2022年8月5日在深市交易结算独立测试环境组织仿真测试，通过模拟现金选择权行权业务（包括A股普通现金选择权行权、B股普通现金选择权行权和B股附条件现金选择权行权）的委托申报、成交回报、清算交收等业务处理过程，检验市场参与各方技术系统的正确性。

1. **参测单位**

1、深圳证券交易所

2、中国结算深圳分公司

3、会员单位

4、基金管理人

5、结算参与机构

6、其他相关单位

1. **仿真测试内容**

本次测试内容包括：

1、A股普通现金选择权行权的委托申报、成交回报、清算交收等业务处理；

2、B股普通现金选择权行权的委托申报、成交回报、清算交收等业务处理；

3、B股附条件现金选择权行权的委托申报、成交回报、清算交收等业务处理。

1. **仿真测试时间安排**

仿真测试时间为2022年8月1日至2022年8月5日，每日8:30至17:00。本次测试为滚动测试，每天模拟1个完整交易日的交易和结算。

1. **仿真测试数据**
2. 结算数据以2022年7月29日（星期五）交易结算独立测试环境发送的SJSDZmmdd.DBF及SJSJGmmdd.DBF作为初始股份持仓数据。
3. 交易单元以2022年7月29日收市后的生产系统已开通单元为准（含测试专用交易单元）。
4. 新增测试专用证券账户

新增测试专用A股证券账户0199900000—0199900001（A股个人）、0809900000—0809900001（A股法人）。

新增测试专用B股证券账户2089900000—2089900001（个人）、2879900000—2879900001（法人）。

上述测试专用证券账户无需向中国结算报送，可直接开通相关权限，但不适用于发行、增发、网络投票等业务测试。

1. 中国结算深圳分公司将为现金选择权测试用户增加现金选择权份额和标的证券股份，具体规则如下：

①A股现金选择权及其标的证券：

测试证券：现金选择权代码038995，标的证券代码000758。

测试专用投资者账户：0199900000—0199900001（个人）、0809900000—0809900001（法人）。

中国结算深圳分公司为每个测试专用投资者在每个A股有效托管单元登记测试标的证券和现金选择权各10,000股（份）。

|  |  |
| --- | --- |
| **现金选择权代码** | **主要参数** |
| 038995 | 行权方式：普通现金选择权，证券结算  行权日期：2022-08-01至2022-08-05  行权价格：24.04元，行权比例1:1  标的证券代码：000758（测试期间该证券停牌） |

②B股普通现金选择权及其标的证券：

测试证券：现金选择权行权代码238914，标的证券代码200725。

测试专用投资者账户：2089900000—2089900001（个人）、2879900000—2879900001（法人）。

中国结算深圳分公司为每个测试专用投资者在每个B股有效托管单元登记测试标的证券和现金选择权10,000股（份）。

|  |  |
| --- | --- |
| **现金选择权代码** | **主要参数** |
| 238914 | 行权方式：普通现金选择权，证券结算  行权日期：2022-08-01至2022-08-05  行权价格：16.80港元，行权比例1:1  标的证券代码：200725（测试期间该证券停牌） |

③B股附条件现金选择权及其标的证券：

测试证券：附条件现金选择权行权代码238913，标的证券代码200992。

测试专用投资者账户：2089900000—2089900001（个人）、2879900000—2879900001（法人）。

中国结算深圳分公司为每个测试专用投资者在每个B股有效托管单元登记测试标的证券和现金选择权10,000股（份）。

|  |  |
| --- | --- |
| **现金选择权代码** | **主要参数** |
| 238913 | 行权方式：附条件现金选择权，证券结算  行权日期：2022-08-01至2022-08-03  行权价格：12.39港元，行权比例1:1  标的证券代码：200992（测试期间该证券停牌）  行权清算日：2022-08-04  行权交收日：2022-08-05 |

1. 资金账户余额调整：

各市场参与人可以致电中国结算深圳分公司进行账户余额的调整，联系电话：0755-21899968。

1. **深市交易结算独立测试环境接入方式**

1、测试参与人可使用测试专线或者互联网VPN接入深市交易结算独立测试环境。具体可参考《深交所交易结算独立测试环境指南（含期权全真测试环境）》（请参见深交所网站->市场服务->技术服务->交易独立测试<http://www.szse.cn/marketServices/technicalservice/test/>，下同）。

2、测试前，须确认相关交易单元已申请配置在深市交易结算独立测试环境的测试交易网关（与期权全真环境交易网关不同）。深市交易结算独立测试环境测试交易网关的新增或变更流程请按照《深交所交易结算独立测试环境指南（含期权全真测试环境）》申请。

3、每日测试时间请参照《交易独立测试系统测试时间和服务变更通知》（请参见深交所网站->市场服务->技术服务->交易独立测试）。

1. **测试要求及注意事项**

1、各参测单位应以独立于生产系统的测试环境开展仿真测试，应做好详尽的系统测试计划，指定专人负责本次仿真测试工作，并于开始测试前做好测试环境的准备。

2、各参测单位应于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跟预期不一致的现象，请及时报告。

3、各参测单位应在2022年8月5日的17:00前提交测试反馈表（见附件2），请会员单位、基金管理人等交易参与者，登录深交所“会员业务专区”首页底部“友情链接—在线调查表”栏目填写并提交反馈表（填报内容支持更新）；请结算参与机构、托管行、软件开发商等无法登录会员业务专区的参测单位,通过互联网地址https://survey.szse.cn/v/tech填写反馈表（填报内容不支持更新，多次提交以最后一次为准）。

4、测试过程中，各参测单位如发现任何问题，可通过相关QQ群、电话或邮箱联系。

1. **联系电话**

业务咨询电话：

中国结算深圳分公司：0755-21899306

技术咨询电话：

深圳证券交易所：0755-88668223

中国结算深圳分公司：0755-25946080

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

2022年7月28日