工程技术文档

可转换公司债券业务（转让与回售）

仿真测试方案

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

北京证券交易所

深圳证券通信有限公司

二〇二一年十二月

 **关于本文档**

|  |  |
| --- | --- |
| 文档名称 | 可转换公司债券业务（转让与回售）仿真测试方案 |
| 说明 |  |
| 修订历史 |
| 版本号 | 修改日期 | 修改说明 | 修订人 |
| V0.1 | 2021.12.1 | 创建本文档 | 孙岩、杨俊伟 |
| V1.0 | 2021.12.7 | 根据相关意见修改 | 孙岩、杨俊伟 |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

**目 录**

[一．测试目的和背景 1](#_Toc90301500)

[二．参测机构 1](#_Toc90301501)

[三．参考技术规范 1](#_Toc90301502)

[四．参测技术系统 2](#_Toc90301503)

[五．测试时间安排 2](#_Toc90301504)

[六．测试内容安排 1](#_Toc90301505)

[（一）测试场景 1](#_Toc90301506)

[（二）证券信息 1](#_Toc90301507)

[（三）除息信息 1](#_Toc90301508)

[（四）测试内容说明 1](#_Toc90301509)

[七．仿真测试数据准备 2](#_Toc90301510)

[（一）证券初始信息 2](#_Toc90301511)

[（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 3](#_Toc90301512)

[（三）分层信息 3](#_Toc90301513)

[（四）交易网关、行情网关和结算网关 3](#_Toc90301514)

[（五）FDEP小站 3](#_Toc90301515)

[八．仿真测试接入方式 3](#_Toc90301516)

[（一）参测市场机构接入深证通 3](#_Toc90301517)

[（二）参测市场机构接入中国结算 4](#_Toc90301518)

[（三）测试相关软件下载 4](#_Toc90301519)

[九．测试要求及注意事项 4](#_Toc90301520)

[十．联系方式 5](#_Toc90301521)

一．测试目的和背景

为验证各市场参与者技术系统改造情况，全国中小企业股份转让系统有限责任公司（以下简称“全国股转公司”）、北京证券交易所（以下简称“北交所”）联合中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）、深圳证券通信有限公司（以下简称“深证通”）共同搭建仿真测试环境供市场进行可转换公司债券（以下简称“可转债”）转让与回售业务仿真测试。

请各测试参与者认真阅读本测试方案，在测试过程中按照要求进行充分测试。

二．参测机构

1.全国中小企业股份转让系统有限责任公司

2.北京证券交易所

3.中国证券登记结算有限责任公司

4.深圳证券通信有限公司

5.各证券公司、信息商、基金公司及其托管机构

三．参考技术规范

1.《交易支持平台数据接口规范（V2.0）》

2.《[交易支持平台市场参与者技术系统变更指南之可转债业务](http://www.neeq.com.cn/uploads/1/file/public/202110/20211015172438_84wtnqsvmg.pdf)》

四．参测技术系统

1.全国股转公司、北交所交易支持平台仿真测试环境

2.中国结算新三板登记结算系统仿真测试环境

3.深证通通信系统仿真测试环境

4.各证券公司、信息商、基金公司及其托管机构相关测试环境

五．测试时间安排

本次仿真测试时间为2021年12月20日起至2021年12月31日止，周一到周五开放测试环境，每个测试日交易支持平台接收申报的时间为9:15至15:30。测试结束后仿真环境继续开放，供各参测机构进行自主测试。

具体时间安排如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **时间** | **全国股转公司、北交所测试内容** | **参测市场机构重点测试内容** |
| 8:30 | 发送初始行情库，当日证券信息库等。 | 接收初始行情库、证券信息库等。 |
| 9:15-9:30 | 禁止可转债转让、回售申报；发送可转债初始化行情信息及其他证券行情信息，不发送与当天可转债交易相关的任何行情信息。 | 可转债转让、回售申报废单；接收并正确揭示行情信息。 |
| 9:30-11:30 | 处理可转债转让、回售申报；发送可转债初始化行情信息及其他证券行情信息，不发送与当天可转债交易相关的任何行情信息。 | 发送可转债转让、回售申报，处理确认回报；接收并正确揭示行情信息。 |
| 11:30-13:00 | 中午休市，不接收申报处理。 |
| 13:00-15:00 | 处理可转债转让、回售申报；发送可转债初始化行情信息及其他证券行情信息，不发送与当天可转债交易相关的任何行情信息。 | 发送可转债转让、回售申报，处理确认回报；接收并正确揭示行情信息。 |
| 15:00-15:30 | 禁止可转债转让、回售申报；实时发送可转债收盘行情信息。 | 可转债转让、回售申报废单；接收并正确揭示收盘行情信息。 |
| 15:30 | 闭市 |
| 17:00 | 日终处理。 | 完成当日数据清算。 |

六．测试内容安排

（一）测试场景

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **可转债****代码** | **可转债****简称** | **基础代码** | **挂牌日期** | **除息日期** | **回售开始****日期** | **回售结束/终止****日期** | **暂停转让****日期** | **恢复转让****日期** | **终止挂牌****日期** |
| 810010 | 连续定转 | 439005 | 12月20日 | —— | 12月21日 | 12月23日 | 12月22日（停牌一天） | 12月23日 | 12月24日 |
| 810011 | 万事定转 | 839216 | 12月20日 | —— | 12月27日 | 12月29日 | 12月27日（长期停牌） | —— | 12月30日 |
| 810012 | 荣华定转 | 839217 | 12月20日 | 12月21日 | 12月22日 | 12月23日（回售终止）12月24日（回售结束） | —— | —— | —— |
| 810013 | 贝特定转 | 835185 | 12月20日 | —— | 12月21日 | 12月28日 | —— | —— | —— |
| 810014 | 长寿定转 | 839218 | 12月27日 | —— | 12月28日 | 12月30日（回售终止）12月29日（回售结束） | —— | —— | —— |
| 810015 | 花开定转 | 839219 | 12月27日 | 12月28日 | —— | —— | —— | —— | —— |
| 810016 | 同辉定转 | 430090 | 12月20日 | —— | 12月21日 | 12月28日 | —— | —— | —— |

（二）证券信息

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **可转债代码** | **可转债简称** | **基础代码** | **证券简称** | **证券级别** | **市场层级** | **交易类型** |
| 810010 | 连续定转 | 439005 | 连续9005 | 上市公司股票 | —— | 集合竞价+连续竞价 |
| 810011 | 万事定转 | 839216 | 万事顺意 | 挂牌公司股票 | 基础层 | 集合竞价 |
| 810012 | 荣华定转 | 839217 | 荣华富贵 | 挂牌公司股票 | 创新层 | 集合竞价 |
| 810013 | 贝特定转 | 835185 | 贝特瑞 | 上市公司股票 | —— | 集合竞价+连续竞价 |
| 810014 | 健康定转 | 839218 | 健康长寿 | 挂牌公司股票 | 创新层 | 做市交易 |
| 810015 | 花开定转 | 839219 | 花开富贵 | 挂牌公司股票 | 创新层 | 做市交易 |
| 810016 | 同辉定转 | 430090 | 同辉信息 | 上市公司股票 | —— | 集合竞价+连续竞价 |

|  |  |
| --- | --- |
| **可转债代码** | **可转债信息** |
| 810010 | 可转债简称：连续定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.8 起息日：2021年12月20日回售价格（元）：103 挂牌日期：2021年12月20日债券到日期：2026年12月20日 |
| 810011 | 可转债简称：万事定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.9 起息日：2021年12月20日回售价格（元）：103 挂牌日期：2021年12月20日债券到日期：2026年12月20日 |
| 810012 | 可转债简称：荣华定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：1.0 起息日：2021年12月20日回售价格（元）：103 挂牌日期：2021年12月20日债券到日期：2026年12月20日 |
| 810013 | 可转债简称：贝特定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.8 起息日：2021年12月20日回售价格（元）：103.55 挂牌日期：2021年12月20日债券到日期：2026年12月20日 |
| 810014 | 可转债简称：健康定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.6 起息日：2021年12月27日回售价格（元）：103 挂牌日期：2021年12月27日债券到日期：2026年12月27日 |
| 810015 | 可转债简称：花开定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：1.0 起息日：2021年12月27日回售价格（元）：103 挂牌日期：2021年12月27日债券到日期：2026年12月27日 |
| 810016 | 可转债简称：同辉定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.8 起息日：2021年12月20日回售价格（元）：103.55 挂牌日期：2021年12月20日债券到日期：2026年12月20日 |

（三）除息信息

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **可转债代码** | **可转债简称** | **除息日期** | **每张派息金额（元）** |
| 810012 | 荣华定转 | 12月21日 | 1 |
| 810015 | 花开定转 | 12月28日 | 1 |

（四）测试内容说明

各参测机构应重点验证如下内容：

1.验证各证券公司、基金公司技术系统支持可转债转让与回售业务，各类申报要素符合数据接口规范要求。

2.验证各证券公司技术系统能够依据可转债对应标的股票的投资者适当性信息进行相应的转让权限控制。

3.验证9:30前、11:30至13:00、15:00后交易支持平台不接收可转债转让与回售业务申报；验证9:30至11:30、13:00至15:00交易支持平台接收可转债转让与回售申报并予以处理（包括无效申报撤单返回以及撤单申报处理等）。

4.可转债转让申报数量为10张或其整数倍，且单笔转让数量不低于1000张或者转让金额不低于10万元；卖出时，余额不足1000张且转让金额低于10万元的，应当一次性申报卖出。验证交易支持平台能够对可转债的申报数量进行实时校验，若校验未能通过则该笔申报直接撤单。

5.验证在可转债转让期间，对于同一只可转债，当日买入当日可卖出。

6.验证在可转债回售期内，对于同一只可转债，当日买入当日可回售；当同一个交易日分别收到转让与回售申报时，处理顺序为：转让、回售。

7.验证在可转债回售期内，债券持有人进行回售申报时，回售申报当日可以撤单。

8.验证在可转债回售期内，如可转债处于暂停转让期间，交易支持平台仍可以按照约定的时间和方式接收可转债回售申报。

9.验证各证券公司、信息商、基金公司能够根据交易支持平台下发的证券信息和行情信息正确揭示可转债初始化信息和收盘行情信息。

10.验证各证券公司改造后的周边系统满足技术文档要求。

七．仿真测试数据准备

（一）证券初始信息

证券初始信息以2021年12月17日（周五）交易支持平台仿真环境收盘行情（NQHQ.DBF）和证券信息（NQXX.DBF）为准。

（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓

本次测试所涉及的证券账户、交易单元和托管单元以2021年12月17日（周五）交易支持平台仿真环境日终数据为准，各参测市场机构可转债初始持仓信息见测试QQ群。

（三）分层信息

除特殊处理证券外，其余挂牌公司和上市公司股票初始分层信息以2021年12月17日（周五）交易支持平台仿真环境日终数据为准。

（四）交易网关、行情网关和结算网关

交易网关、行情网关、结算网关的初始用户与密码以2021年12月17日（周五）仿真环境闭市时数据为准。

（五）FDEP小站

全国股转公司、北交所仿真环境FDEP小站号为k0903，请各证券公司在测试开始前确认FDEP小站传输配置。

八．仿真测试接入方式

（一）参测市场机构接入深证通

参测市场机构通过VPN或专线接入深证通提供的仿真测试环境，如有问题，及时联系深证通。测试连接相关参数：

|  |  |
| --- | --- |
| **名称** | **地址和端口** |
| 深证通SSL VPN接入 | <https://test.szse.cn> |
| 行情TCP | 172.200.1.97:7044 |
| 双向报盘 | 172.200.1.98:7043 |
| CCNET | 172.200.1.89:7013 |
| FDEP | 172.200.1.182:7015/7016 |

（二）参测市场机构接入中国结算

参见中国结算相关通知。

（三）测试相关软件下载

本次测试所需的交易网关（版本号：20201019）、行情网关（版本号：20200303）、结算网关（版本号：20200731）的安装程序可在深证通官网下载。

九．测试要求及注意事项

1.各参测机构应根据《交易支持平台数据接口规范(V2.0)》等技术规范和测试方案，认真做好技术准备和测试环境准备工作，制定详尽的测试计划，并指定专人负责本次仿真测试工作。

2.开展全国股转系统、北交所交易业务的各证券公司、基金公司均应参加本次测试；提供全国股转系统、北交所行情服务的信息商应参加本次测试。

3.测试过程中，各参测市场机构应按要求覆盖相应测试场景，详细记载测试现象与结果，检查其正确性。如发现异常，请及时通过电话或QQ群联系全国股转公司、北交所。

4.测试结束后，各参测市场机构应收集各自技术系统的测试情况，2021年12月31日18:00之前通过电子邮件向全国股转公司、北交所提交测试报告（无需盖章），邮件主题和附件名称均为：机构名称+可转债业务（转让与回售）仿真测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。

十．联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **测试联系单位** | **联系电话** |
| 全国股转公司、北交所运行控制中心 | 010-63889625 |
| 深圳证券通信公司 | 0755-83182222 |
| 测试QQ群 | 338167838 |

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

北京证券交易所

深圳证券通信有限公司

二○二一年十二月