股转系统办发〔2022〕18号附件1

工程技术文档

可转换公司债券转让与回售业务

第三次全网测试方案

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

二〇二二年三月

 **关于本文档**

|  |  |
| --- | --- |
| 文档名称 | 可转换公司债券转让与回售业务第三次全网测试方案 |
| 说明 |  |
| 修订历史 |
| 版本号 | 修改日期 | 修改说明 |
| V1.0 | 2022.1.4 | 创建本文档 |
| V1.1 | 2022.1.14 | 调整部分测试参数 |
| V1.2 | 2022.3.9 | 增加压力测试内容 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

**目 录**

[一、测试目的和背景 - 1 -](#_Toc97796984)

[二、参测机构 - 1 -](#_Toc97796985)

[三、参考技术规范 - 1 -](#_Toc97796986)

[四、参测技术系统 - 2 -](#_Toc97796987)

[五、测试时间安排 - 2 -](#_Toc97796988)

[六、测试内容 - 3 -](#_Toc97796989)

[七、测试场景 - 5 -](#_Toc97796990)

[（一）测试场景 - 5 -](#_Toc97796991)

[（二） 证券信息 - 7 -](#_Toc97796992)

[（三） 除息信息 - 8 -](#_Toc97796993)

[八、测试数据准备 - 9 -](#_Toc97796994)

[（一）挂牌情况、证券行情和证券信息 - 9 -](#_Toc97796995)

[（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 - 9 -](#_Toc97796996)

[（三）交易网关、行情网关和结算网关 - 9 -](#_Toc97796997)

[九、测试系统接入方式 - 9 -](#_Toc97796998)

[（一）参测机构接入深证通 - 9 -](#_Toc97796999)

[（二）参测机构接入中国结算 - 9 -](#_Toc97797000)

[十、测试要求及注意事项 - 10 -](#_Toc97797001)

[十一、联系方式 - 11 -](#_Toc97797002)

一、测试目的和背景

为验证各市场参与者技术系统对于可转换公司债券（以下简称“可转债”）转让与回售业务技术准备情况，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”）共同搭建测试环境供市场进行全网测试。

请各参测机构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. 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. 交易支持平台全网测试环境
2. 中国结算北京市场登记结算系统全网测试环境
3. 深证通通信系统全网测试环境
4. 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

本次全网测试时间为2022年4月9日，模拟一个交易日和两个结算日：8:30至12:00模拟T日的交易，12:00至16:00模拟T日的日终过程，18:00至20:00模拟T+1日的日终过程。

**本次全网测试增加压力测试场景，压力测试时间段为：10:20至10:30、11:20至11:30。**

具体时间见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 | 发送初始证券行情库，当日证券信息库等。 | 接收初始证券行情库、证券信息库等。 |
| 9:15-9:30 | 禁止可转债转让、回售申报；发送证券信息库和证券行情库，不发送与当天可转债交易相关的任何行情。 | 可转债转让、回售申报废单；接收并正确揭示证券信息库和证券行情库。 |
| 9:30-10:30 | 处理可转债转让、回售申报；发送证券信息库和证券行情库，不发送与当天可转债交易相关的任何行情。**10:20-10:30，接收压力测试申报。** | 发送可转债转让、回售申报，处理确认回报；接收并正确揭示证券信息库和证券行情库。**10:20-10:30，交易网关以最大流速发送压力测试申报（申报类别不限，以覆盖全部类型为宜）。** |
| 10:30-10:35 | 中午休市，不接收申报处理。 |
| 10:35-11:30 | 处理可转债转让、回售申报；发送证券信息库和证券行情库，不发送与当天可转债交易相关的任何行情。**11:20-11:30，接收压力测试申报。**  | 发送可转债转让、回售申报，处理确认回报；接收并正确揭示证券信息库和证券行情库。**11:20-11:30，交易网关以最大流速发送压力测试申报（申报类别不限，以覆盖全部类型为宜）。** |
| 11:30-12:00 | 禁止可转债转让、回售申报；发送证券信息库和证券行情库，实时发送可转债收盘行情。 | 可转债转让、回售申报废单；接收并正确揭示可转债收盘行情。 |
| 12:00 | T日闭市 |
| 12:00-14:00 | 接收中国结算发送的T日清算交收数据。 | 接收中国结算发送的T日清算交收数据。 |
| 14:00-16:00 | 根据中国结算数据进行T日日终处理，下发适当性数据等文件。 | 完成T日日终处理。 |
| 16:00-18:00 |  | 接收中国结算发送的T+1日清算交收数据。 |
| 18:00-20:00 |  | 完成T+1日日终处理。  |

六、测试内容

验证各参测机构技术系统已按照《交易支持平台数据接口规范（V2.0）》《[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)》等技术规范的要求对可转债转让与回售业务进行改造，达到上线要求。

1.验证交易支持平台能够正确发布北交所上市公司和全国股转系统挂牌公司的可转债信息，正确对可转债转让、回售等各类申报进行处理，正确发布证券行情。

2.验证中国结算北京市场登记结算系统能够正确进行日终处理，生成日终数据并发布，各参测机构能够正常完成日终清算。

3.验证深证通通信系统能够正确转发证券公司、基金公司的申报数据和交易支持平台的回报、行情数据。

4.验证证券公司、基金公司技术系统能够支持可转债转让与回售业务，能够根据适当性控制要求进行可转债转让、回售申报，处理确认回报，正确揭示行情。证券公司周边系统能够满足相关技术文档要求。

5.验证信息商能够根据交易支持平台下发的证券信息和证券行情正确揭示可转债初始化证券信息和收盘行情。

七、测试场景

（一）测试场景

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **可转债代码** | **可转债简称** | **基础证券代码** | **T日（4月9日）交易参数** |
| **挂牌/上市日** | **除息** | **允许回售** | **暂停转让** |
| 810010 | 贝特定转 | 835185 | 是 | 否 | 是 | 否 |
| 810011 | 泽生定转 | 871392 | 是 | 否 | 是 | 是（停牌一天） |
| 810012 | 原子定转 | 430005 | 是 | 否 | 是 | 是（紧急停牌） |
| 810013 | 森萱定转 | 830946 | 否 | 否 | 否 | 否 |
| 810014 | 华韩定转 | 430335 | 是 | 否 | 是 | 是（长期停牌） |
| 810015 | 凌志定转 | 831068 | 是 | 是 | 否 | 否 |
| 810016 | 同辉定转 | 430090 | 是 | 是 | 否 | 否 |

|  |  |
| --- | --- |
| **可转债代码** | **可转债信息** |
| 810010 | 可转债简称：贝特定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.8 起息日：2022年4月9日回售价格（元）：103.333 上市日期：2022年4月9日债券到期日：2027年4月9日 |
| 810011 | 可转债简称：泽生定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.9 起息日：2022年4月9日回售价格（元）：103.000 挂牌日期：2022年4月9日债券到期日：2027年4月9日 |
| 810012 | 可转债简称：原子定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：1.0 起息日：2022年4月9日回售价格（元）：103.555 挂牌日期：2022年4月9日债券到期日：2027年4月9日 |
| 810013 | 可转债简称：森萱定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.8 起息日：2022年4月10日回售价格（元）：103.555 上市日期：2022年4月10日债券到期日：2027年4月10日 |
| 810014 | 可转债简称：华韩定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：0.6 起息日：2022年4月9日回售价格（元）：103.000 挂牌日期：2022年4月9日债券到期日：2027年4月9日 |
| 810015 | 可转债简称：凌志定转 每张面值（元）：100票面利率（%）：1.0 起息日：2022年4月9日回售价格（元）：103.000 挂牌日期：2022年4月9日债券到期日：2027年4月9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：2022年4月9日回售价格（元）：103.555 上市日期：2022年4月9日债券到期日：2027年4月9日 |

（二）证券信息

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **可转债代码** | **可转债简称** | **基础证券代码** | **基础证券简称** | **基础证券级别** | **基础证券****市场层级** | **基础证券****交易类型** |
| 810010 | 贝特定转 | 835185 | 贝特瑞 | 上市公司股票 | —— | 集合竞价+连续竞价 |
| 810011 | 泽生定转 | 871392 | 泽生科技 | 挂牌公司股票 | 基础层 | 集合竞价 |
| 810012 | 原子定转 | 430005 | 原子高科 | 挂牌公司股票 | 创新层 | 集合竞价 |
| 810013 | 森萱定转 | 830946 | 森萱医药 | 上市公司股票 | —— | 集合竞价+连续竞价 |
| 810014 | 华韩定转 | 430335 | 华韩整形 | 挂牌公司股票 | 创新层 | 做市交易 |
| 810015 | 凌志定转 | 831068 | 凌志环保 | 挂牌公司股票 | 基础层 | 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 |

（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）** |
| 810015 | 凌志定转 | 4月9日 | 1 |
| 810016 | 同辉定转 | 4月9日 | 0.8 |

八、测试数据准备

（一）挂牌情况、证券行情和证券信息

初始证券行情和初始证券信息以2022年4月8日（周五）交易支持平台生产环境收盘证券行情（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

证券账户、交易单元、托管单元及持仓的初始信息以2022年4月8日（周五）中国结算生产环境日终数据为准。

本次测试新增可转债持仓，持仓账户由证券公司、基金公司在测试前通过邮件报送，每个账户分配可转债持仓100000张，账户报送要求详见QQ群。

（三）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2022年4月8日（周五）深证通生产环境闭市时数据为准。

九、测试系统接入方式

（一）参测机构接入深证通

参测机构通过生产环境线路接入深证通提供的全网测试环境，如有问题，及时联系深证通。

（二）参测机构接入中国结算

参见中国结算测试方案。

十、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）》《[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)》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全网测试工作。

2.各证券公司经纪系统应确保至少有两种交易终端（其中至少一种为非现场方式）和两种行情终端（其中至少一种为非现场方式）满足业务要求。

3.各参测基金公司应同时通知为其开展托管结算业务的托管机构参加全网测试。

4.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。

5.测试过程中，各参测机构应实时关注QQ群信息，及时获悉各项报单要求。参测机构在测试过程中如发现异常现象，请及时通过电话或QQ群上报。

6.测试结束后，各参测证券公司应收集各自技术系统的测试情况，于2022年4月9日20:00之前通过BPM提交测试报告（无需盖章）。各参测基金公司、信息商应按上述时间要求通过电子邮件提交测试报告（无需盖章），邮件主题和附件名称均为：机构名称+可转换公司债券转让与回售业务第三次全网测试反馈报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。

7.全网测试的数据仅为模拟测试使用，不能作为生产环境任何交易、非交易及开户等业务的依据。

8.各参测机构应在测试完毕后，做好环境恢复和验证工作，确保下一交易日生产系统正常。

十一、联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **测试联系单位** | **联系电话** |
| 全国股转公司/北京证券交易所运行控制中心 | 010-63889800 |
| 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○二二年三月