北京证券交易所公司债券（含企业债券）

现券交易业务通关测试方案

北京证券交易所

深圳证券通信有限公司

二〇二四年一月

 **关于本文档**

|  |  |
| --- | --- |
| 文档名称 | 北京证券交易所公司债券（含企业债券）现券交易业务通关测试方案 |
| 说明 |  |
| 修订历史 |
| 版本号 | 修改日期 | 修改说明 |
| V0.1 | 2024.1.3 | 创建本文档 |
| V1.0 | 2024.1.8 | 修改定稿 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

**目 录**

[一、测试目的和背景 - 4 -](#_Toc155374376)

[二、参测机构 - 4 -](#_Toc155374377)

[三．参考技术规范 - 4 -](#_Toc155374378)

[四、参测技术系统 - 5 -](#_Toc155374379)

[五、通关测试时间安排 - 6 -](#_Toc155374380)

[六、通关测试内容 - 6 -](#_Toc155374381)

[七、测试场景及相关说明 - 8 -](#_Toc155374382)

[（一）测试证券安排 - 8 -](#_Toc155374383)

[（二）测试场景安排 - 12 -](#_Toc155374384)

[（三）测试说明 - 12 -](#_Toc155374385)

[八、通关测试数据准备 - 13 -](#_Toc155374386)

[（一）行情信息 - 13 -](#_Toc155374387)

[（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 - 13 -](#_Toc155374388)

[（三）交易网关、行情网关和结算网关 - 13 -](#_Toc155374389)

[（四）FDEP小站 - 13 -](#_Toc155374390)

[九、通关测试系统接入方式 - 14 -](#_Toc155374391)

[（一）参测机构接入深证通 - 14 -](#_Toc155374392)

[（二）参测机构接入中国结算 - 14 -](#_Toc155374393)

[（三）测试相关软件下载 - 14 -](#_Toc155374394)

[十、测试要求及注意事项 - 14 -](#_Toc155374395)

[十一、联系方式 - 16 -](#_Toc155374396)

一、测试目的和背景

为验证北京证券交易所公司债券（含企业债券）现券交易业务技术系统准备情况，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通关测试。

通关测试各参与者请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.北京证券交易所

2.全国中小企业股份转让系统有限责任公司

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.拟开展相关业务的各证券公司、信息商

6.拟开展相关业务的银行、基金公司、保险公司等机构

三．参考技术规范

1.《[北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统交易数据接口规范（二进制试行版）](https://www.bse.cn/uploads/6/file/public/202309/20230915170118_cyq3x19duw.pdf)》

2.《[北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统行情数据接口规范（二进制试行版）](https://www.bse.cn/uploads/6/file/public/202309/20230915170118_48mwltetto.pdf)》

3.《北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统数据文件接口规范（试行版）》

4.[《北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统组播行情数据分发协议（试行版）](https://www.bse.cn/uploads/6/file/public/202309/20230915170118_k62w7wk76g.pdf)》

5.《北京证券交易所债券现券交易市场参与者系统开发指南（试行版）》

四、参测技术系统

1.北京证券交易所固定收益平台通关测试环境

2.北京证券交易所交易支持平台通关测试环境

3.全国股转系统交易支持平台通关测试环境

4.中国结算北京市场登记结算系统通关测试环境

5.中国结算统一账户平台（UAP）通关测试环境

6.深证通通信系统、深证通金融数据交换平台（FDEP）通关测试环境

7.证券公司、信息商相关测试环境

8.银行、基金公司、保险公司等机构测试环境

五、通关测试时间安排

2024年1月13日，具体时间安排如下：

|  |  |
| --- | --- |
| **交易时段** | **北交所公司债券（含企业债券）现券交易测试内容** |
| **匹配成交方式** | **协商成交方式** | **数据文件** |
| 9:00-9:15 | 不收单 | 成交确认申报买入、卖出、撤单 | 1.参测机构报送投资者适当性管理信息库、债券市场交易员信息库（16:15前）2.北交所下发投资者适当性管理信息检查库、债券市场交易员信息检查库（16:15前）3.北交所下发日终静态行情信息（15:30） |
| 9:15-9:20 | 限价申报买入、卖出、撤单 |
| 9:20-9:25 | 限价申报买入、卖出（禁止撤单） |
| 9:25-9:30  | 收单自动废单 |
| 9:30-11:30 | 限价申报买入、卖出、撤单 |
| 11:30-13:00 | 不收单 | 不收单 |
| 13:00-15:30 | 限价申报买入、卖出、撤单 | 成交确认申报买入、卖出、撤单 |
| 15:30-17:00 | 不收单 | 不收单 |
| 17:00后 | 日终处理，北交所下发投资者适当性管理信息确认库、债券市场交易员信息确认库、静态交易参考信息。 |

六、通关测试内容

1.验证各参测机构技术系统已按照北交所技术规范及配套指南完成相关改造，达到上线要求。

2. 验证北交所固定收益平台能够接收证券的匹配成交、协商成交交易申报，完成申报检查和撮合处理，并返回处理结果，发送交易行情快照、逐笔行情、收盘行情等行情信息，揭示证券信息等静态交易参考信息，能够对证券进行停牌、复牌以及紧急维护等操作。

3.验证中国结算北京市场登记结算系统能够正确进行登记业务、处理交易成交数据、清算数据并下发市场机构。

4.验证深证通通信系统能够正确、及时转发申报、回报和行情数据，FDEP能够传输适当性管理信息、交易员信息、静态交易参考信息等文件。

5.验证各证券公司、基金公司、银行等能够正常进行交易申报、接收交易回报，进行资金冻结，完成清算交收；各证券公司、信息商、银行等能够正确、及时更新证券信息、停复牌状态、证券行情，证券公司能够据此控制投资者的相关业务权限；各证券公司能够做好投资者适当性管理、交易员报送、营业部报送等。

6.验证各参测系统债券交易规则相关业务实现，包括但不限于交易时间、现券申报数量、价格最小变动单位、显名/匿名申报、约定号重复检查、盘中临时停牌、有效申报价格范围、撤单、当日回转交易和持仓前端控制等，验证全部已开通交易单元可以正常使用，具体详见测试反馈报告。

7.验证各证券公司技术系统涉及公司债券（含企业债券）纳入两融担保物的相关功能正常。

8.验证北交所、全国股转公司、中国结算、深证通、证券公司、信息商、基金公司等现有证券品种交易业务运行正常。

七、测试场景及相关说明

（一）测试证券

|  |  |
| --- | --- |
| **证券代码** | **证券信息** |
| 821001 | 证券代码源：北京证券交易所 证券简称：24京资01 上市日期：2024-01-13 发行总量（亿元）：10证券简称（扩）：24京资01交易方式：匹配成交、协商成交 证券类别：公司债券（含企业债券）债券类型：小公募 跨市场标志：是 投资者适当性分类：专业机构投资者 发行面额（元）：100 面值（元）：100 发行价格（元）：100 起息日：2024-01-08 到期日：2027-01-08 债券期限：3年利息类型：固定利率 票面利率（%）：2.55 付息周期：1年 货币种类：人民币 发行人：北京市国有资产经营有限责任公司 行业种类：S91-综合 是否可作为融资融券可充抵保证金证券：是上市金额（亿元）：10 |
| 821002 | 证券代码源：北京证券交易所 证券简称：24京投01 上市日期：2024-01-13 发行总量（亿元）：10 证券简称（扩）：24京投01 交易方式：匹配成交、协商成交 证券类别：公司债券（含企业债券）债券类型：小公募 跨市场标志：是 投资者适当性分类：专业机构投资者 发行面额（元）：100 面值（元）：100 发行价格（元）：100 起息日：2024-01-10 到期日：2027-01-10 债券期限：3年利息类型：固定利率 票面利率（%）：2.52 付息周期：1年 货币种类：人民币 发行人：北京市基础设施投资有限公司 行业种类：G53-铁路运输业 是否可作为融资融券可充抵保证金证券：是上市金额（亿元）：10 |
| 821003 | 证券代码源：北京证券交易所 证券简称：24智都01 上市日期：2024-01-13 发行总量（亿元）：4.8 证券简称（扩）：24智都01交易方式：匹配成交、协商成交 证券类别：公司债券（含企业债券）债券类型：小公募 跨市场标志：是 投资者适当性分类：专业机构投资者 发行面额（元）：100 面值（元）：100 发行价格（元）：100 起息日：2024-01-10 到期日：2031-01-10 债券期限：7年利息类型：固定利率 票面利率（%）：3.3 付息周期：1年 货币种类：人民币 发行人：广州智都投资控股集团有限公司 行业种类：L72-商务服务业 是否可作为融资融券可充抵保证金证券：是上市金额（亿元）：4.8 |

（二）测试场景

|  |  |
| --- | --- |
|  | 1月13日 |
| 821001-821003 | 上市首日、协商成交、匹配成交 |

（三）测试说明

1.通关测试涉及的交易员和适当性管理信息需提前报送，范围为截至当日的全量**正式生产数据**，该数据除通关测试使用外，将同时在下一交易日（1月15日）生产环境生效。具体参见“通关测试数据准备”。

**2.参测机构应以测试证券前收盘价（上市首日为发行价格）作为参考，在合理价格范围内报价，避免触发盘中临停场景。**

3.测试证券发行总量有限，请参测机构测试匹配成交时控制买入申报数量，测试协商成交时提前确定对手方。

4测试期间严禁参测机构进行压力报单。

5.测试过程中的实时通知和要求将在QQ群中发布，请各参测机构关注。

八、通关测试数据准备

（一）行情信息

证券行情信息以通关测试期间固定收益平台行情发布为准。

（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、持仓等信息以通关测试前一交易日闭市数据为准。

（三）交易网关、行情网关和结算网关

交易网关、行情网关、结算网关等信息以通关测试前一交易日闭市数据为准。

（四）FDEP小站

北交所固定收益平台FDEP小站号为k8889，各参测机构应在通关测试前完成小站传输配置，并在**通关测试前一交易日（1月12日）**完成业务正式开展所用的适当性管理信息库和交易员信息库报送（如无相关信息需报送空库）。适当性管理信息库等参测机构私有文件的发送和接收应按照单个对端用户规则配置，证券信息等全市场公用文件的发送和接收应按照业务类型规则（规则名称为BSEBOND）模式配置。

九、通关测试系统接入方式

（一）参测机构接入深证通

参测机构通过生产线路接入深证通通关测试环境，如有问题及时联系深证通。交易网关、行情网关测试连接相关参数如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **名称** | **南方节点地址及端口** | **福田节点地址及端口** |
| 交易网关 | 172.50.101.110:7045（地面）172.50.102.110:7045（卫星） | 172.60.101.110:7045（地面） |
| 行情网关 | 230.30.107.3:7603（地面组播地址1）172.50.101.206（地面组播源地址1）230.30.107.4:7604（地面组播地址2）172.50.101.207（地面组播源地址2）172.50.101.120:7046（TCP重传地址） | 230.30.107.1:7601（地面组播地址1）172.60.101.206（地面组播源地址1）230.30.107.2:7602（地面组播地址2）172.60.101.207（地面组播源地址2）172.60.101.120:7046（TCP重传地址） |

（二）参测机构接入中国结算

参见中国结算测试方案。

（三）测试相关软件下载

本次测试所需的交易网关、行情网关等请在深证通网站（biz.sscc.com）-下载专区-北交所通信系统栏目下载。

十、测试要求及注意事项

1.各参测机构应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，并指定专人负责通关测试工作。

2.拟开展北交所公司债券（含企业债券）现券交易业务的证券公司、基金公司、银行等机构，以及拟开展北交所行情服务的信息商应参加通关测试。

3.在测试过程中，各参测机构应详细记载测试现象与结果，检查其正确性。如发现异常现象，请及时通过电话或QQ群与北交所沟通联系。

4.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，2024年1月13日18:00之前通过BPM提交测试报告，其它机构应按上述时间要求通过电子邮件提交测试报告，邮件主题和附件名称均为：机构名称+北交所公司债券（含企业债券）现券交易业务通关测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。

5.北交所履行上线决策后，请各参测机构根据北交所的通关测试结果做好技术系统数据恢复和验证工作，并于2024年1月14日10:00前反馈技术系统恢复情况报告。各证券公司通过BPM反馈，其它机构通过电子邮件反馈至techservice@neeq.com.cn。

6.通关测试期间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。

7.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

|  |  |
| --- | --- |
| **通关测试联系单位（人）** | **联系电话** |
| 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（运行咨询）0755-88666462（专线、VPN接入）0755-88666464（交易、行情）0755-88666470（CCNET、FDEP） |
| 测试QQ群 | 北交所固收平台交易运行维护群：392171220 |

北京证券交易所

深圳证券通信有限公司

二○二四年一月