北京证券交易所公司债券（含企业债券）现券

交易业务通关测试反馈报告

|  |
| --- |
| 一、参测机构名称： |
| 二、测试时间：2024年1月13日 |
| 三、测试整体内容1. 是否能够通过交易网关正常进行交易申报、接收成交回报。

是□ 否□ 不涉及□1. 是否能够通过成交汇总网关接收成交数据。

是□ 否□ 不涉及□1. 是否能够正常进行资金和持仓控制。

是□ 否□ 不涉及□1. 是否能够通过行情网关接收快照行情、逐笔行情和公告并正确、及时更新证券信息、停复牌状态等行情。

是□ 否□ 不涉及□1. 逐笔行情、公告、成交重传功能及行情数据组播协议接收是否正常。

是□ 否□ 不涉及□1. 是否能够正确报送投资者适当性管理、交易员信息，并接收交易所下发的静态交易参考、收盘行情等文件。

是□ 否□ 不涉及□1. 是否能够根据适当性信息控制投资者的相关业务。

是□ 否□ 不涉及□1. 是否能根据中国结算日终数据完成清算交收。

是□ 否□ 不涉及□1. 公司债券纳入融资融券担保物相关功能是否正常。

是□ 否□ 不涉及□1. 股票等现有证券品种交易业务是否正常。

是□ 否□ 不涉及□1. 全部已开通交易单元是否可以正常使用。

是□ 否□ 不涉及□ |
| 四、交易规则验证项参考

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **交易方式** | **匹配成交** | **协商成交** |
| **交易时间** | 09:15-09:25（开盘集合匹配）09:30-11:30（连续匹配）13:00-15:30（连续匹配） | 09:00-11:3013:00-15:30 |
| **交易品种** | 公开发行公司债券（含企业债券） | 公开发行公司债券（含企业债券） |
| **结算方式** | 多边净额结算（担保） | 多边净额结算（担保） |
| **现券申报数量** | 10万元面额或者其整数倍，卖出余额不足10万元面额的应一次性申报卖出 | 不低于1,000元面额，且为100元面额整数倍 |
| **价格最小变动单位** | 0.001元 | 0.0001元 |
| **单笔最大申报数量** | 不超过100亿元面额 | 不超过100亿元面额 |
| **申报类型** | 限价申报 | 协议配对（约定号） |
| **显名/匿名申报** | 匿名 | 显名 |
| **发送范围** | 全市场 | 指定对手方 |
| **约定号重复检查（约定号相同场景）** | / | 1.【重复申报】两笔申报，如果证券代码、本方交易商、本方交易员、对手方交易商、对手方交易员要素各自相同情况下，如果约定号重复，则只保留第一笔，后续委托按订单拒绝处理，报约定号重复错误；2.【匹配失败】两笔申报，如果证券代码相同，本方交易商、本方交易员与对手方交易商、对手方交易员可匹配，则会将两笔委托进行要素检查，如果要素不一致、匹配失败，两笔申报均被拒绝，报配对失败错误。 |
| **盘中临时停牌** | 1.盘中成交价格较前收盘价首次上涨或下跌达到或超过20%的，临时停牌持续时间为30分钟，临时停牌时间跨越15:27的，于当日15:27复牌；2.较前收盘价首次上涨或下跌达到或超过30%的，临时停牌时间持续至当日15:27；3.15:27之后不再触发临时停牌；1. 触发临时停牌时，行情网关发布临停公告信息。
2. 盘中临时停牌期间，可以申报或撤销申报。
 | 匹配成交方式临时停牌期间，协商成交方式可正常交易 |
| **有效申报价格范围** | **开盘集合匹配：**前收盘价上下30%；**连续匹配、盘中临时停牌复牌集合匹配**：匹配成交最近成交价上下20%；当日无交易的，以前收盘价作为最近成交价；超过有效申报价格范围的申报为无效申报。 | 不设置有效申报价格范围 |
| **有效申报价格范围的自动调整** | 债券在集合匹配阶段没有达成成交的，继续交易时，按照下列方式调整有效申报价格范围：最高买入申报价格高于前收盘价或者匹配成交最近成交价的，以最高买入申报价格为基准调整有效申报价格范围；最低卖出申报价格低于前收盘价或者匹配成交最近成交价的，以最低卖出申报价格为基准调整有效申报价格范围。 | / |
| **撤单** | 除09:20-09:25的开盘集合匹配阶段不接受撤销申报外，接受申报时间内未成交的申报可以撤销；部分成交的，未成交部分可以撤销；若原申报订单已经撤销成功，则撤销申报作废；若原订单也是撤销申报，则撤销申报作废。 | 接受申报时间内，未成交的申报可以撤销；若原申报订单已经撤销成功，则撤销申报作废；若原订单也是撤销申报，则撤销申报作废。 |
| **回转交易** | 当日回转交易，当日买入的债券可以在当日卖出。 | 当日回转交易，当日买入的债券可以在当日卖出。 |
| **持仓前端控制** | 持仓前端控制。债券申报卖出时，不得超过证券账户持仓，申报成功后，申报数量被预冻结（申报撤销后予以解冻）；交易达成后，卖出方证券账户实时扣减持仓，买入方所在证券账户实时增加持仓。 | 持仓前端控制。债券申报卖出时，不得超过证券账户持仓，申报成功后，申报数量被预冻结（申报撤销后予以解冻）。交易达成后，卖出方证券账户实时扣减持仓，买入方所在证券账户实时增加持仓。 |
| **计价方式** | 债券现券交易均采用净价价格进行申报。 | 债券现券交易均采用净价价格进行申报。 |
| **申报效力** | 当日提交的申报当日有效；集合匹配期间未成交的交易申报，自动进入连续匹配；债券交易申报不能一次全部成交时，未成交部分当日继续有效。 | 当日提交的申报当日有效。 |
| **交易申报信息披露** | **开盘集合匹配：**发布参考价格、匹配量、未匹配量等；若未产生集合匹配参考价的，则发布实时最优一档买卖申报价格、数量；**连续匹配：**最优五档买卖申报价格、数量等；申报数量100万元面额及以上的逐笔交易申报信息；债券临时停牌期间不揭示集合匹配参考价、匹配量和未匹配量。 | / |
| **成交信息披露** | 即时成交行情、单笔成交数量为100万元面额及以上的逐笔成交信息；已揭示大额申报如被撤单，将通过逐笔成交行情接口发布撤单信息。 | 即时成交行情、逐笔成交行情。 |
| **收盘价** | 债券上市首日以该债券的发行价格作为前收盘价；当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。 | 债券上市首日以该债券的发行价格作为前收盘价；当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。 |

 |
| **问题记录***注：如测试中发现技术系统问题或涉及交易规则业务验证的问题，请在本栏描述。* |
| **测试结论：**完全通过□ 部分通过□ 失败□ 特别说明： （如果测试结论是部分通过或失败，请说明原因、后续系统完善所需时间及应对策略。） |
| **测试负责人： 联系电话（固话和手机）：** |

说明：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（无需盖章），其它机构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+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。