北京证券交易所公司债券（含企业债券）现券

交易业务第三次全网测试反馈报告

|  |
| --- |
| 一、参测机构名称： |
| 二、测试时间：第三次全网测试（2023年12月16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□ |
| 四、交易规则验证   |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | | **交易方式** | **匹配成交** | **协商成交** | **是否验证** | | **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） | 09:00-11:30  13:00-15:30 | 是□  否□ | | **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） | 是□  否□ | | **结算方式** | 多边净额结算  （担保） | 多边净额结算  （担保） | 是□  否□ | | **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 | 是□  否□ | | **价格最小变动单位** | 0.001元 | 0.0001元 | 是□  否□ | | **单笔最大申报数量** | 不超过100亿元面额 | 不超过100亿元面额 | 是□  否□ | | **申报类型** | 限价申报 | 协议配对（约定号） | 是□  否□ | | **显名/匿名申报** | 匿名 | 显名 | 是□  否□ | | **发送范围** | 全市场 | 指定对手方 | 是□  否□ | | **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。 | 是□  否□ | | **盘中临时停牌** | 1.信用债等其他债券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；  4.触发临时停牌时，行情网关发布临停公告信息。 | 匹配成交方式临时停牌期间，协商成交方式可正常交易 | 是□  否□ | | **停牌情形处理** | **全天停牌：**不接受交易申报；  盘中紧急停牌：不接受交易申报，可接受撤销申报；  **盘中临时停牌：**可以申报或撤销申报； | **全天停牌：**不接受交易申报 | 是□  否□ | | **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**：信用债等其他债券为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 | 是□  否□ | | **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。 | / | 是□  否□ | | **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。 | 是□  否□ | | **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。 | 是□  否□ | | **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。 | 是□  否□ | | **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。 | 是□  否□ | | **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。 | 是□  否□ | | **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。 | / | 是□  否□ | | **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。 | 是□  否□ | | **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。 | 是□  否□ | |
| **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，各参测机构应收集各自技术系统的测试情况，并于测试结束当日（2023年12月16日）18:00之前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）现券交易业务全网测试第三次测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。