

工程技术文档

北京证券交易所
融资融券业务仿真测试方案

北京证券交易所
全国中小企业股份转让系统有限责任公司
深圳证券通信有限公司

二〇二二年九月

目 录

- 一、测试目的和背景 1
- 二、参测机构 1
- 三、参考技术规范 2
- 四、参测技术系统 2
- 五、仿真测试时间安排 2
- 六、仿真测试内容 3
- 七、测试场景及相关说明 4
 - （一）融资融券业务测试场景安排 4
 - （二）测试要求和说明 7
- 八、仿真测试数据准备 8
 - （一）挂牌情况、证券行情信息和证券信息 8
 - （二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 8
 - （三）挂牌公司分层信息 9
 - （四）交易网关、行情网关和结算网关 9
 - （五）FDEP 小站 9
- 九、仿真测试系统接入方式 9
 - （一）参测机构接入深证通 9
 - （二）参测机构接入中国结算 10
 - （三）测试相关软件下载 10
- 十、测试要求及注意事项 10
- 十一、联系方式 11

一、测试目的和背景

为验证拟开展北京证券交易所融资融券业务的会员等市场参与者技术系统的准备情况,北京证券交易所(以下简称“北交所”)、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”)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仿真测试。

仿真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. 拟开展北交所融资融券业务的会员、基金公司、QFII/RQFII等
6. 全国股转系统主办券商
7. 各提供北交所、全国股转系统行情服务的信息商

三、参考技术规范

1. 《交易支持平台数据接口规范(V2.1)》
2. 《北京证券交易所市场参与者技术系统变更指南之融资融券业务（V1.1）》

四、参测技术系统

1. 北交所和全国股转公司交易支持平台仿真环境
2. 中国结算北京市场证券登记结算系统仿真环境、统一账户平台（UAP）全真环境
3. 深证通通信系统和深证通金融数据交换平台（FDEP）仿真环境
4. 拟开展北交所融资融券业务会员相关测试环境
5. 全国股转系统主办券商相关测试环境
6. 各提供北交所、全国股转系统行情服务的信息商相关测试环境

五、仿真测试时间安排

第一轮仿真测试：2022 年 9 月 26 日至 2022 年 10 月 14 日

第二轮仿真测试：2022 年 10 月 17 日至 2022 年 10 月 28 日

第三轮仿真测试：2022 年 10 月 31 日至 2022 年 11 月 4 日

周一到周五全天开放测试环境。

交易时段	北交所连续竞价	新三板集合竞价		新三板做市交易	公开发行	
		基础层	创新层		询价	申购
08:30	下发初始行情					
09:15	开市、大宗交易收单				询价 申报	申购 申报
09:25	开盘集合竞价	——	——	——		
09:30	连续竞价	集合竞价	每 10 分钟	做市商双向报价		
10:30		集合竞价	一次集合竞价（含			
11:30		集合竞价	9:30）			
11:30	中午休市					
13:00	下午开市					
13:00	连续竞价	——	每 10 分钟 一次集合竞价（不含 13:00）	做市商双向报价	询价 申报	申购 申报
14:00		集合竞价				
14:57		——				
15:00	收盘集合竞价	集合竞价				
15:00-15:30	大宗交易			大宗交易、做市商互报实时确认	——	
15:30	闭市					

六、仿真测试内容

1. 验证北交所交易支持平台能正确对融资融券业务各类申报进行检查校验、返回确认结果，能够正确对融资融券业务各类申报进行撮合处理，并发送成交回报和行情信息；能够正确支持融资融券标的证券、担保物、风险控制等业务管理。

2. 验证中国结算北京市场证券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；验证中国结算 UAP 系统能够正确进行融资融券相关账户管理。
3. 验证深证通通信系统能够正确转发会员的委托数据和北交所的回报和行情数据。
4. 验证拟开展北交所融资融券业务的会员技术系统能够正确进行前端控制并发送各类委托，接收北交所返回的回报和行情数据并进行实时处理，确认融资融券行情揭示正常；能够正确对客户投资者适当性、交易权限进行管理；能够正确报送融资融券业务数据和违约数据；能够正确接收中国结算发布的日终数据并完成清算交收。
5. 验证各提供北交所、全国股转系统行情服务的信息商行情揭示正常。
6. 验证北交所、全国股转系统、中国结算、深证通、会员/主办券商等现有各项交易业务运行正常。

七、测试场景及相关说明

（一）融资融券业务测试场景安排

业务类型	证券代码	测试日期
------	------	------

融资融券业务场景	新增融资融券标的证券	430032, 430021	第一轮：10月13日 第二轮：10月26日 第三轮：无
	删除融资融券标的证券	839313, 839314	第一轮：10月10日 第二轮：10月20日 第三轮：11月3日
	融资融券标的证券和担保证券停牌（次日复牌）	标的券：839320, 839321 担保券：839100, 839102	第一轮：9月30日, 10月12日 第二轮：10月19日, 10月26日 第三轮：11月2日
	暂停融资融券业务（次日恢复）	839105 暂停可融资	第一轮：9月29日, 10月11日 第二轮：10月18日, 10月25日 第三轮：11月1日
		839106 暂停可融券	第一轮：9月29日, 10月11日 第二轮：10月18日, 10月25日 第三轮：11月1日
	担保券新增	839108, 839109	第一轮：10月10日 第二轮：10月20日 第三轮：11月3日
	担保券删除	839108, 839109	第一轮：9月29日 第二轮：10月18日 第三轮：11月1日
	股票除权除息	标的券：839105 每10股送1股 担保券：839100 每10股送1股	第一轮：10月10日 第二轮：10月20日 第三轮：11月3日
		标的券：839106 每10股送1股派1元 担保券：839102 每10	

		股送 1 股派 1 元	
其他业务场景	要约	要约代码：840004 基础证券：839320	9 月 26 日至 11 月 3 日
	优先股	820002	全周期
	可转债	810024	全周期
	公开发行(定价发行)	证券代码：430032 申购代码：889001 申购价格：2 元 发行量：100 万股 申购数量范围：10 万-20 万股	第一轮：9 月 30 日，上市日期为 10 月 13 日 第二轮：10 月 20 日，上市日期为 10 月 26 日 第三轮：11 月 3 日
	公开发行(询价发行)	证券代码：430021 询价代码：889002 询价价格：1 元-5 元 询价数量范围：不限	第一轮：9 月 29 日 第二轮：10 月 18 日 第三轮：11 月 1 日
		证券代码：430021 申购代码：889002 申购价格：2 元 战略配售：0 网下发行 20 万股，网上发行 80 万股 申购数量范围：10 万-20 万股	第一轮：9 月 30 日，上市日期为 10 月 13 日 第二轮：10 月 20 日，上市日期为 10 月 26 日 第三轮：11 月 3 日
行情发布	交易日 8:30 通过行情公告发布标的证券、担保证券		全周期
数据报送	通过 FDEP 报送融资融券业务数据、违约数据		全周期

与中国结算相关的测试场景参见中国结算测试方案。

(二) 测试要求和说明

测试场景	测试证券	测试要求和说明
非信用账户测试要求	430032, 430021, 839313, 839314, 839320, 839321, 839105, 839106	非信用账户不可通过融资融券专用交易单元申报
		客户信用担保证券账户和融券专用账户不允许进行任何申报
信用账户融资融券交易业务	融资融券标的证券： 430032, 430021, 839313, 839314, 839320, 839321, 839105, 839106 可冲抵保证金担保证券： 839108, 839109	通过信用账户进行 9 类申报：融资买入、卖券还款、融券卖出、买券还券、卖券还款强制平仓、买券还券强制平仓、担保品卖出强制平仓、担保品买入、担保品卖出，以及以上各申报类型的撤单申报。每轮每类申报数量不少于 5 笔
		信用账户不得申报要约业务，不得交易优先股、两网退市股票、可转债，不得通过非融资融券专用交易单元申报
		融券卖出不允许申报市价订单
		融券卖出最小申报数量不低于 100 股，不存在余股一次性卖出
		融券卖出卖出价不低于最近成交价（前收盘价）
信用账户融资融券大宗交易		信用账户的普通买入、卖出可申报大宗交易，每轮测试要求申报数量不少于 2 笔
		带有融资融券标识或带有强平标识的订单不可申报大宗交易
信用账户参与	889001, 889002	信用账户可以参与询价、申购，处理规则视同普通

公开发行业务		账户，每轮测试每类申报数量不少于 2 笔
数据报送、接收	_____	测试周期内每个交易日通过 FDEP 报送融资融券业务数据、违约数据，接收信用违约资料汇总数据

与中国结算相关的测试要求参见中国结算测试方案。

八、仿真测试数据准备

（一）挂牌情况、证券行情信息和证券信息

证券初始行情信息和初始信息以 2022 年 9 月 23 日（周五）全国股转系统、北交所仿真测试环境收盘行情（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

北交所为参测会员分配普通账户 2 个、信用账户 2 个、融券专用账户 1 个和客户信用交易担保证券账户 1 个，融资融券专用交易单元及对应托管单元 1 个，并为普通账户、融券专用账户分配测试用证券（430032, 430021, 839313, 839314, 839320, 839321, 839105, 839106, 839100, 839102, 839108, 839109）的初始持仓 666,666 股。其余证券账户及持仓的初始信息以 2022 年 9 月 23 日（周五）全国股转系统、北交所和中国结算仿真测试环境日终数据为准。

（三）挂牌公司分层信息

上市公司、挂牌公司股票初始分层信息以 2022 年 9 月 23 日（周五）全国股转系统、北交所仿真测试环境日终数据为准。

（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 2022 年 9 月 23 日（周五）全国股转系统、北交所、中国结算和深证通仿真测试环境闭市时数据为准。

（五）FDEP 小站

会员用于报送和接收融资融券业务数据的 FDEP 小站号另行通知。北交所 FDEP 小站号为 k0903，请各会员在测试开始前完成 FDEP 小站传输配置，如需更改小站，请联系北交所。

九、仿真测试系统接入方式

（一）参测机构接入深证通

参测机构通过 VPN 或专线接入深证通提供的仿真测试环境，如有问题，及时联系深证通负责仿真测试的工作人员。测试连接相关参数：

名称	地址和端口
深证通 SSL VPN 接入	https://test.sccc.com
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、行情网关为现有生产版本，请在深证通官网下载。

十、测试要求及注意事项

1.各参测机构应根据融资融券相关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.拟开展北交所融资融券业务的会员、全国股转系统主办券商应参加本次测试，各提供北交所、全国股转系统行情服务的信息商应参加本次测试。会员应通知有意开展北交所融资融券业务的基金公司、QFII/RQFII 参与测试。

3.在测试过程中，各参测机构应按要求达到测试用例数量，并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/全国股转公司沟通联系。

4. 每轮测试结束后，各会员/主办券商应收集各自技术系统的测试情况，并于每轮测试结束当日（2022 年 10 月 14 日，2022 年 10 月 28 日，2022 年 11 月 4 日）17:00 之前通过 BPM 向北交所/全国股转公司提交测试报告（无需盖章）。各参测信息商应按上述时间要求通过电子邮件向北交所/全国股转公司提交测试报告（无需盖章），邮件主题和附件名称均为：机构名称+融资融券第 X 轮仿真测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。

十一、联系方式

仿真测试联系单位（人）	联系电话
北交所/全国股转公司 运行控制中心	010-63889855
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	338167838

北京证券交易所

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

深圳证券通信有限公司

二〇二二年九月