

附件一

## 深市可转债、可交换债发行方式改革

### 第三轮仿真测试方案

#### 一、测试目的

为了确保深市可转债、可交换债发行方式改革业务的顺利开展，深圳证券交易所（简称“深交所”）和中国证券登记结算有限公司深圳分公司（简称“中国结算深圳分公司”）定于2017年8月14日-8月25日在深市交易独立测试系统再次组织为期两周的仿真测试，主要通过模拟深市可转债、可交换债的发行流程，检验市场参与各方技术系统的正确性。

#### 二、参测单位

- 1、 深圳证券交易所
- 2、 中国结算深圳分公司
- 3、 深圳证券通信公司
- 4、 证券公司
- 5、 托管银行
- 6、 基金管理公司
- 7、 其他各相关单位

#### 三、仿真测试内容

通过模拟深市可转债、可交换债发行方式改革处理全过程，验证市场参与各方技术系统对可转债、可交换债发行改革业务的适应性。

本轮测试安排了多个申购日，每个申购日会提供多种发行方式的申购。申购日的安排如下：

日期	2017-08-14	2017-08-15	2017-08-16	2017-08-17	2017-08-18
<b>IPO</b>		300915 002915	002916	300917 002917	002918
<b>可转债</b>		072015	070016	370003	072004
<b>(配债)</b>				380003	082004
<b>可交换债</b>		120615		120617	
<b>LOF</b>		160015			
日期	2017-08-21	2017-08-22	2017-08-23	2017-08-24	2017-08-25
<b>IPO</b>	300921				
<b>可转债</b>	070001				
<b>(配债)</b>	080001				
<b>可交换债</b>	120621				
<b>LOF</b>	160015				

#### 四、仿真测试时间安排

仿真测试时间为 2017 年 8 月 14 日至 2017 年 8 月 25 日

测试日期	时间	主要测试内容	重点测试内容
T-1		结算公司发送发行参数数据	接收 SJSGB.DBF。
T	9:50-14:00	集中竞价	新股发行申购委托。

	14:00-15:30	结算公司进行内部系统处理	
	15:30-16:00	结算公司发送结算数据	接收以下回报数据,并进行核对: SJSFX.DBF 进行股份处理。
T+1	14:00-15:30	结算公司进行内部系统处理	
	15:30-16:00	结算公司发送结算数据	接收以下回报数据,并进行核对: SJSFX.DBF
T+2	14:00-15:30	结算公司进行内部系统处理	
	15:30-16:00	结算公司发送结算数据	接收以下回报数据,并进行核对: SJSQS.DBF
T+3	14:00-15:30	结算公司进行内部系统处理	
	15:30-16:00	结算公司发送结算数据	接收以下回报数据,并进行核对: SJSFX.DBF SJSZJ.DBF

## 五、仿真测试系统接入方式

测试参与人可使用测试专线或者互联网 VPN 接入深交所交易独立测试环境。具体可参考《深交所交易独立测试系统指南 Ver 1.1》

(请参见深交所网站->技术专栏->技术服务->全天候交易测试服务->相关文档栏目

(<http://www.szse.cn/main/rule/jysywzn/dlcsxt/xgwd/>) )

测试请使用生产系统已开通交易单元或者测试系统测试交易单元,并使用生产系统已开通业务权限进行相应的业务仿真测试。测试前,测试参与者应确认需要测试的交易单元已申请配置在测试交易网

关。新增测试网关或者变更已有测试网关请按照《深交所交易独立测试系统指南 Ver 1.1》中申请流程申请

## 六、仿真测试数据准备

本轮测试从 8 月 15 日起至 8 月 21 日，每日都会安排申购，具体的发行参数可以通过 SJSGB 中获取（业务类别为“FX”）。

1. LOF 发行的申购起始日为 8 月 15 日，申购截止日为 8 月 22 日，具体参数信息如下：

LOF 发行参数							
证券代码	证券简称	发行价格	发行总量	申购起始	申购截止	末日比例配售	末日比例配售日
160015	LOF 测 1	1.0	100 亿元	2017-08-15	2017-08-22	0.8	2017-08-24

2. IPO、可转债、可交换债每日都有申购，其具体参数信息根据申购日安排如下：

8月15日:

新股发行参数									
证券代码	证券简称	发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
002915	中小测 15	35.2	50000000	500	50000	2017-08-15	2017-08-16	2017-08-21	中签尾数: 1, 3, 5, 7, 9
300915	创业测 15	16.9	50000000	500	50000	2017-08-15	2017-08-16	2017-08-21	中签尾数: 2, 4, 6, 8,

可转债发行参数							
股票代码	股票简称	申购代码	申购简称	上市可转债代码	上市可转债简称	配售代码	配售简称
无	无	072015	中小发 15	128015	中小转 15	无	无
发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
100	20000000	10	2000	2017-08-15	2017-08-16	2017-08-21	尾数: 1, 3, 5, 7, 9

可交换债参数										
证券代码	证券简称	上市代码	发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
120615	交换债 15	120615	100	20000000	10	20000	2017-08-15	2017-08-16	2017-08-21	中签尾数: 2, 4, 6, 8

8月16日:

新股发行参数									
证券代码	证券简称	发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
002916	中小测16	15.6	50000000	500	50000	2017-08-16	2017-08-17	2017-08-22	中签尾数: 1, 3, 5, 7, 9

可转债发行参数							
股票代码	股票简称	申购代码	申购简称	上市可转债代码	上市可转债简称	配售代码	配售简称
无	无	070016	主板发16	127016	主板转16	无	无
发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
100	20000000	10	2000	2017-08-16	2017-08-17	2017-08-22	尾数: 1, 3, 5, 7, 9

8月17日:

新股发行参数									
证券代码	证券简称	发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
002917	中小测 17	8.9	50000000	500	50000	2017-08-17	2017-08-18	2017-08-23	中签尾数: 1, 3, 5, 7, 9
300917	创业测 17	25.8	50000000	500	50000	2017-08-17	2017-08-18	2017-08-23	中签尾数: 2, 4, 6, 8

可转债发行参数							
股票代码	股票简称	申购代码	申购简称	上市可转债代码	上市可转债简称	配售代码	配售简称
300003	乐普医疗	370003	乐普发债	123003	乐普转债	380003	乐普配债
发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
100	20000000	10	2000	2017-08-17	2017-08-18	2017-08-23	尾数: 1, 3, 5, 7, 9

可交换债参数										
证券代码	证券简称	上市代码	发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
120617	交换债 17	120617	100	20000000	10	2000	2017-08-17	2017-08-18	2017-08-23	中签尾数: 2, 4, 6, 8

8月18日:

新股发行参数									
证券代码	证券简称	发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
002918	中小测18	18.1	50000000	500	50000	2017-08-18	2017-08-21	2017-08-24	中签尾数: 1, 3, 5, 7, 9

可转债发行参数							
股票代码	股票简称	申购代码	申购简称	上市可转债代码	上市可转债简称	配售代码	配售简称
002004	华邦健康	072004	华邦发债	128004	华邦转债	082004	华邦配债
发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
100	20000000	10	2000	2017-08-18	2017-08-21	2017-08-24	尾数: 1, 3, 5, 7, 9



8月21日:

新股发行参数									
证券代码	证券简称	发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
300921	创业测 21	30.1	50000000	500	50000	2017-08-21	2017-08-22	2017-08-25	中签尾数: 2, 4, 6, 8

可转债发行参数							
股票代码	股票简称	申购代码	申购简称	上市可转债代码	上市可转债简称	配售代码	配售简称
000001	平安银行	070001	平安发债	127001	平安转债	080001	平安配债
发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
100	20000000	10	2000	2017-08-21	2017-08-22	2017-08-25	尾数: 1, 3, 5, 7, 9

可交换债参数										
证券代码	证券简称	上市代码	发行价格	网上发行总量	申购基数	申购上限	申购日	中签日	新股登记日	中签号码
120621	交换债 21	120621	100	20000000	10	2000	2017-08-21	2017-08-22	2017-08-25	中签尾数: 2, 4, 6, 8

3.为保证配债业务不受改革影响，为三只可转债发行提供了配债测试，具体的参数如下：

基础证券	乐普医疗 (300003)	华邦健康 (002004)	平安银行 (000001)
配债代码	380003	082004	080001
转换标的代码	123003	128004	127001
配债方案	每 10 股配 0.01 张	每 10 股配售 0.03 张	每 10 股配售 0.02 张
股权登记日	2017-08-16	2017-08-17	2017-08-18
配债价格	100	100	100
配债认购起止日期	2017-08-17~ 2017-08-17	2017-08-18~ 2017-08-18	2017-08-21~ 2017-08-21
登记日	2017-08-23	2017-08-24	2017-08-25

#### 4.资金账户余额设置

中国结算深圳分公司统一将所有结算参与人的人民币备付金账户余额修改为 20 亿元。如果需要调整，可致电中国结算深圳分公司进行账户余额的调整，联系电话：0755-25946080。

### 七、测试要求及注意事项

1、各参测单位应以独立于生产系统的测试环境开展仿真测试，做好详尽的系统测试计划，指定专人负责本次仿真测试工作，并于开始仿真测试前做好测试环境的准备。

2、交易独立测试系统中测试证券账户不能参加新股发行的申购。

3、有关文档，请参见 2017 年 05 月 26 日发布的《关于做好可转债、可交换债发行方式改革相关技术准备的通知》，可在中国结算网站（www.chinaclear.cn）和 D-COM 上查询。

4、各参测单位应于测试过程中详细记载测试现象与结果，检查其正确性。如发现异常现象，应及时报告。

5、测试工作完成后，参测单位请务必在 2017 年 08 月 25 日 16:00 之前填写反馈，交易所会员请在会员专区填写反馈，非会员单位请填写附件中反馈表并发送至 szjsb@chinaclear.com.cn，邮件主题为：“XX 公司-深市网上可转债、可交换债发行改革第三轮仿真测试反馈”。

## 八、联系电话

仿真测试系统联系方式如下：

深圳证券交易所：0755-88668480

中国结算深圳分公司：0755-25946080

深圳证券通信公司：0755-83182222

深圳证券交易所

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

二〇一七年八月九日