

附件 1

工程技术文档

全国中小企业股份转让系统 证券账户体系优化第一次全网测试方案

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

二〇一八年十一月

关于本文档

文档名称	全国中小企业股份转让系统证券账户体系优化第一次全网测试方案	
说明		
修订历史		
版本号	修改日期	修改说明
V1.0	2018.10.27	创建本文档

目 录

1	测试目的和背景	4
2	参测单位	4
3	参考技术规范	4
4	参测技术系统	5
5	全网测试时间安排	5
6	全网测试内容	8
6.1	业务场景	9
7	全网测试数据准备	10
7.1	初始数据	10
7.2	测试数据	12
8	全网测试系统接入方式	12
8.1	参测单位接入深证通	12
8.2	参测单位接入中国结算	13
8.3	测试相关软件下载	13
9	测试要求及注意事项	13
10	联系方式	15

1 测试目的和背景

为验证各方技术系统对证券账户体系优化改造的技术准备情况，全国中小企业股份转让系统（以下简称“全国股转系统”）与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”）共同搭建全网测试环境。

全网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，保证全网测试的有效性。

2 参测单位

1. 全国中小企业股份转让系统有限责任公司
2. 中国证券登记结算有限责任公司
3. 深圳证券通信有限公司
4. 各主办券商、做市商、基金公司、资管公司

3 参考技术规范

1. 《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范(V1.41)》

4 参测技术系统

1. 全国中小企业股份转让系统交易支持平台全网测试环境
2. 中国证券登记结算有限责任公司新三板登记结算全网测试环境
3. 中国证券登记结算有限责任公司统一账户平台全网测试环境
4. 深圳证券通信系统全网测试环境
5. 各主办券商、做市商、基金公司、资管公司相关测试环境

5 全网测试时间安排

本次全网测试时间为 2018 年 11 月 10 日、2018 年 11 月 17 日和 2018 年 11 月 18 日。

具体时间见下表：

日期	时间	全国股转系统重点测试内容	参测单位重点测试内容
----	----	--------------	------------

11 月 10 日	8:30-11:30	通过 FDEP 接收券商报送数据。	通过 FDEP 报送截至 2018 年 11 月 9 日已开通新三板交易权限的全量个人和机构账户数据。 注： 1. 报送数据时应严格按照 NQHGTZZ?????.DBF 接口规范的格式要求填报，特别注意“申请日期”字段统一填写为 20181109。本次报送数据仅作为全网测试数据。 2. 交易权限包括合格投资者、优先股投资者、两网退市投资者的交易权限。全体账户名单不会自动增加与其同一一码通账户下的其他证券账户。 3. 11 月 12 日-11 月 16 日，交易权限新增数据以生产环境 FDEP 每日报送的增量数据为准，无需单独报送。
11 月 10 日	13:00-15:30	通过 FDEP 返回账户资料异常报送数据以及截至发送时点的全量投资者适当性数据（不含新三板账户数据）。	通过 FDEP 接收账户资料异常报送数据和截至发送时点的全量投资者适当性数据（不含新三板账户数据）。
11 月 17 日	8:00-9:00	接收统一账户平台生成的存量账户并转发给券商。 注：存量账户是指券商报送的全体需要开展全国股转系统业务的证券账户、登记结算系统认为需要保留的受限、特殊及内部账户、统一账户平台认为需要保留的机构及产品账户，上述证券账户全部由统一账户平台默认增加股转标识。	券商通过 FDEP 接收全国股转系统转发的存量账户并转发给基金公司。
11 月 17 日	9:00-14:00	根据存量账户清理账户数据。	根据存量账户清理账户数据。 注：券商应自行制定清理方案，做到没有股转标识的证券账户不能报送股转交易权限，更不能开展股转业务。
11 月 17 日	15:00	发送初始行情库、证券信息库等。	通过股转行情网关接收初始行情库、证券信息库等。

11月17日	15:30-16:00	集合竞价转让限价申报处理，做市转让做市申报处理、限价申报处理。	查看各种申报处理状态，成交回报情况以及行情揭示情况；验证只有存量账户才能参与与其交易权限对应的各类申报，其他账户不能参与交易。
11月17日	16:00-16:30	集合竞价转让限价申报处理，做市转让做市申报处理、限价申报处理，两网及退市股票的限价申报处理、成交回报和行情信息发送。	查看各种申报处理状态，成交回报情况以及行情揭示情况；报送股转标识、账户使用信息；验证只有存量账户才能参与与其交易权限对应的各类申报，其他账户不能参与交易。
11月17日	16:30-16:40	中午休市，不接受申报处理。	模拟中午休市业务。
11月17日	16:40-17:20	集合竞价转让限价申报处理，做市转让做市申报处理、限价申报处理，两网及退市股票的限价申报处理、成交回报和行情信息发送。	查看各种申报处理状态，成交回报情况以及行情揭示情况；报送股转标识、账户使用信息；验证只有存量账户才能参与与其交易权限对应的各类申报，其他账户不能参与交易。
11月17日	17:20-18:00	协议转让成交确认申报、做市转让互报成交确认申报处理，成交回报和行情信息发送。	查看各种申报处理状态，成交回报情况以及行情揭示情况；验证只有存量账户才能参与各类申报，其他账户不能参与交易；报送新增的合格投资者、优先股投资者和两网退市投资者的交易权限。
11月17日	18:00-20:00		根据中国结算下发的清算交收数据进行日终准备。
11月17日	20:00-22:00	下发当日合格投资者、优先股投资者适当性数据报送的处理结果。	主办券商完成当日数据清算和对账。
11月18日	8:30	发送初始行情库，证券信息库等。	通过股转行情网关接收初始行情库、证券信息库等。
11月18日	9:15-9:30	集合竞价转让限价申报处理，做市转让做市申报处理、限价申报处理。	查看各种申报处理状态，成交回报情况以及行情揭示情况；验证上日报送成功的账户也能参与与其交易权限对应的各类申报。
11月18日	9:30-10:30	集合竞价转让限价申报处理，做市转让做市申报处理、限价申报处理，两网及退市股票的限价申报处理、成交回报和行情信息发送。	查看各种申报处理状态，成交回报情况以及行情揭示情况；报送股转标识、账户使用信息；验证上日成功报送成功的账户也能参与与其交易权限对应的各类申报。

6 全网测试内容

本次测试主要内容为：

1. 各主办券商、做市商、基金公司、资管公司的验证内容

(1) 能正确根据统一账户平台生成的存量账户完成账户数据清理，只有存量账户才能下挂到股转交易市场并保留交易权限。

(2) 能接收委托并申报，接收全国股转系统返回的成交并进行实时处理，接收全国股转系统发布的行情并正确揭示；验证只有存量账户才能参与与其交易权限对应的各类交易，其他账户不能参与交易；验证当日才报送成功股转标识的账户不能参与当日交易，次日才能参与与其交易权限对应的各类交易。

(3) 能接收中国结算发布的日终数据并完成清算交收。

(4) 能通过统一账户平台报送及查询股转标识和账户使用信息。

2. 全国股转系统的验证内容

(1) 能正确地对申报进行检查、撮合成交并发布行情。

(2) 能根据中国结算提供的账户数据和日终数据完成日终处理。

3. 深证通的验证内容

能对申报数据进行基本的前端校验，并正确地转发申报、回报和行情数据。

4. 中国结算的验证内容

(1) 能正确处理股转标识和账户使用信息的报送数据，生成账户数据并发送。

(2) 能根据成交数据进行日终处理，生成日终数据并发布。

6.1 业务场景

业务场景
【业务 1】挂牌公司集合竞价申报、查询、行情揭示业务 测试场景包括但不限于以下内容： 1. 使用经纪（覆盖机构和个人）、资管、自营、基金公司专用账户进行申报及成交 2. 使用做市、做市自营账户进行申报（不可交易非做市股票，系统自动废单）
【业务 2】挂牌公司做市申报、查询、行情揭示业务 测试场景包括但不限于以下内容： 1. 使用经纪（覆盖机构和个人）、资管、自营、做市、做市自营、基金公司专用账户进行申报及成交
【业务 3】挂牌公司协议转让申报、查询、行情揭示业务 测试场景包括但不限于以下内容： 1. 使用经纪（覆盖机构和个人）、资管、自营、做市、做市自营、基金公司专用账户进行申报及成交
【业务 4】两网及退市 A、B 股票申报、查询、行情揭示业务 测试场景包括但不限于以下内容： 1. 使用经纪（覆盖机构和个人）、资管、自营、基金公司专用账户进行申报及成交 2. 使用做市、做市自营账户进行申报（不可交易非做市股票，系统自动废单）
【业务 5】优先股申报、查询、行情揭示业务 1. 使用经纪（覆盖机构和个人）、资管、自营、基金公司专用账户进行申报及成交 2. 使用做市、做市自营账户进行申报（不可交易非做市股票，系统自动废单）

【业务 6】投资者适当性管理

1. 验证只有股转标识的合格投资者才能参与各类申报
2. 验证没有股转标识和使用信息的不能参与交易，在报送成为合格投资者后才能交易所有挂牌公司股票。
3. 验证无股转标识的存量深 A 账户不能开通全国股转系统业务权限，也不能报送全国股转系统适当性数据。
4. 验证当日报送股转标识的存量深 A 账户可以当日开通全国股转系统业务权限，开通后也可以当日报送全国股转系统适当性数据。
5. 验证当日新开的深 A 账户可以当日报送股转标识，报送成功后可以当日开通全国股转系统业务权限，开通后也可以当日报送全国股转系统适当性数据。

7 全网测试数据准备

7.1 初始数据

1. 初始挂牌情况、初始证券行情信息和初始证券信息

证券初始行情信息和初始信息以 2018 年 11 月 16 日（周五）

全国股转系统全网测试环境收盘行情（NQHQ.DBF）和证券信息（NQXX.DBF）为准。

2. 初始证券账户、交易单元、托管单元及持仓

证券账户、交易单元、托管单元及持仓的初始信息以 2018 年 11 月 16 日（周五）全国股转系统和中国结算全网测试环境日终数据为准。

3. 指数行情发布内容

本次全网测试不单独安排指数行情发布。

4. 挂牌公司分层信息

所有挂牌公司股票的分层情况以 2018 年 11 月 16 日（周五）全国股转系统生产环境日终数据为准。

5. 投资者适当性

所有投资者初始的适当性状态以 2018 年 11 月 16 日（周五）全国股转系统全网测试环境闭市时数据为准。

6. 定向行情发布

所有交易单元定向行情接收的权限以 2018 年 11 月 16 日（周五）全国股转系统全网测试环境闭市时数据为准。

7. 交易网关、行情网关和结算网关

交易网关、行情网关、结算网关的用户与密码以 2018 年 11 月 16 日（周五）全国股份转让系统全网测试环境闭市时数据为准。

7.2 测试数据

1. 投资者适当性管理

各主办券商应汇总本公司截至 2018 年 11 月 9 日已开通新三板交易权限的全量个人和机构账户数据，统一通过 FDEP 进行报送。

存量合格投资者、优先股投资者、受限投资者交易权限由全国股转系统统一生成，无需单独报送。

8 全网测试系统接入方式

8.1 参测单位接入深证通

参测单位通过生产环境线路接入深证通提供的全网测试环境，如有问题，及时联系深证通负责全网测试的工作人员。测试连接相关参数：

名称	地址和端口
行情（卫星） 组播地址	230.30.132.139 : 4003
行情（地面） 组播地址	230.30.232.139 : 4003

TCP 行情	172.50.101.60:7044 172.60.101.60:7044
双向报盘(数据汇总)	地面线路 172.50.101.30:7043 172.60.101.30:7043 卫星线路 172.50.102.30:7043

8.2 参测单位接入中国结算

参见中国结算股转证券账户体系优化第一次全网测试方案。

8.3 测试相关软件下载

本次测试无需升级股转通信程序。

如有需要，可至深证通官网下载最新的全国中小企业股份转让系统通信程序，下载路径为 www.sccc.com 首页-下载专区-全国中小企业股份转让系统--全国中小企业股份转让系统通信程序下载

(<http://www.sccc.com/main/xzzq/qgzxqygfzrxt/2014051430221.shtml>)。

程序详细配置参见用户手册。

9 测试要求及注意事项

1. 各参测单位应根据《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范(V1.41)》和本次测试方案，认真做好技术准备和测试

环境，做好详尽的测试计划，并指定专人负责本次全网测试工作。

2. 本次测试要求各主办券商已开展全国股转系统业务的的经纪系统、做市系统、自营系统、资管系统必须参加测试。
3. 本次测试要求已开展全国股转业务的各基金公司必须参加测试，请各主办券商做好通知工作——提醒租用本机构交易单元的基金公司参加测试。
4. 测试前，各参测机构务必做好生产系统数据备份，严格隔离生产和测试数据。测试完毕后，各参测机构应做好恢复验证工作，确保下一交易日（2018 年 11 月 12 日以及 2018 年 11 月 19 日，周一）生产系统的正确运行。
5. 各参测单位应仔细核对统一账户平台确认的存量账户，如果发现全国股转系统业务的交易权限的证券账户不在存量账户名单中，请及时通过电话或 QQ 群与全国股转公司沟通联系。
6. 在测试过程中，请各参测单位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 群与全国股转公司沟通联系。
7. 测试结束后，各参测单位应在 2018 年 11 月 18 日 20:00 前通过电子邮件向全国股转系统提交测试报告（附件 1，无需盖章），邮件

主题和附件名称均为：单位名称+股转证券账户体系优化第一次全网测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。

10 联系方式

全网测试联系单位（人）	联系电话
全国中小企业股份转让系统	业务支持：010-63889700 技术支持：010-63889800 010-63889721
深圳证券通信有限公司	0755-83182222
测试 QQ 群	337926180（测试 3 群） 620651342（测试 2 群） 348545494（测试 1 群）

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

二〇一八年十一月