

附件 1

工程技术文档

全国中小企业股份转让系统指数优化
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
二〇一八年十二月

关于本文档

文档名称	全国中小企业股份转让系统指数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	2018.12.12	创建本文档
V1.1	2018.12.13	根据各方建议，调整全网测试方案
V1.2	2018.12.17	根据中国结算需求，调整全网测试方案

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	6
6.1	业务场景	6
7	全网测试数据准备	8
7.1	初始数据	8
7.2	测试数据	9
8	全网测试系统接入方式	9
8.1	参测单位接入深证通	9
8.2	测试相关软件下载	10
9	测试要求及注意事项	11
10	联系方式	12

1 测试目的和背景

为验证各方技术系统对指数优化的技术准备情况，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”）与中证指数有限公司（以下简称“中证指数”）、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. 中证指数有限公司
3. 深圳证券通信有限公司
4. 各主办券商、信息商

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. 中证指数有限公司指数通全网测试环境
3. 深圳证券通信系统全网测试环境
4. 各主办券商、信息商相关测试环境（包括行情系统、周边系统等
相关系统）

5 全网测试时间安排

本次全网测试时间为 2018 年 12 月 22 日。

具体时间见下表：

时间	全国股转公司重点测试内容	参测机构重点测试内容
8:30	发送初始行情库，当日证券信息库等。	接收初始行情库、证券信息库等。
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、行情揭示情况。
9:30-10:00	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，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、行情揭示情况。

10:00-10:30	中午休市，不接受申报处理。	模拟券商中午休市业务。
10:30-11:00	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，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、行情揭示情况。
11:00-11:30	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、行情揭示情况。

6 全网测试内容

1. 验证全国股转系统静态指数行情发布的及时性、准确性。
2. 验证主办券商、信息商技术系统能及时正确接收并展示静态指数行情。

6.1 业务场景

业务场景	验证内容	备注
【业务 1】静态指数 初始行情揭示 8:30-11:00	证券行情库和证券信息库存在静态指数记录，代码分别为 899001、899003、899004、899005、899006、899007。 证券行情库中上述静态指数记录的昨日收盘价为上一转让日数据，合约持仓量为转让日	

	期，其他字段值为 0，且 15:00 前保持不变。 行情转换程序能准确更新技术系统里的静态指数行情； 技术系统能准确、及时揭示静态指数行情。	
【业务 2】静态指数 收盘行情揭示 11:00-11:30 间更新一次	证券行情库和证券信息库存在静态指数记录，代码分别为 899001、899003、899004、899005、899006、899007。 证券行情库中上述静态指数记录的昨日收盘价、今日开盘价、最近成交价、最高成交价、最低成交价、成交数量、成交金额有值，合约持仓量为转让日期，其他字段值为 0。 行情转换程序能准确更新技术系统里的静态指数行情； 技术系统能准确、及时揭示静态指数行情。	
【业务 3】周边系统	验证周边系统是否能按要求揭示指数行情； 验证周边系统是否支持查询指数行情。	

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 12 月 21 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 12 月 21 日（周五）全国股转系统全网测试环境、中国结算生产环境日终数据为准。

3. 指数行情发布内容

本次全网测试模拟一个转让日指数行情发布。

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 12 月 21 日（周五）全国股转系统全网测试环境闭市时数据为准。

5. 投资者适当性

所有投资者初始的适当性状态以 2018 年 12 月 21 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 12 月 21 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 12 月 21 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

本次测试增加 5 个静态指数代码，分别为 899003、899004、899005、899006、899007。

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。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 测试相关软件下载

本次测试时无需升级全国股转系统通信程序。

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 首页右上角旧版网站-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://old.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，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、信息商必须参加测试，要求各主办券商行情系统、周边系统等能满足业务要求，要求信息商技术系统能满足业务要求。
3. 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，确保下一转让日（2018 年 12 月 24 日，周一）生产系统的正确运行。
4. 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。
5. 测试结束后，各参测单位应在 2018 年 12 月 22 日 20:00 前通过电子邮件向全国股转公司提交测试报告（附件 1-1，无需盖章），邮件主题和附件名称均为：机构名称+指数优化第一次全网测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn，并同时抄送 hangqing@neeq.com.cn。

10 联系方式

联系单位（人）	联系电话
全国中小企业股份转让系统有限责任公司	010-63889800
深圳证券通信有限公司	0755-83182222
测试 QQ 群	348545494（测试 1 群） 620651342（测试 2 群） 337926180（测试 3 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

二〇一八年十二月