

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 通关测试方案

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

二〇一九年一月

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通关测试方案	
说明		
修订历史		
版本号	修改日期	修改说明
V1.0	2019.1.2	创建本文档
V1.1	2019.1.4	修订文档通关测试内容、测试要求等章节
V1.2	2019.1.7	根据相关人员建议，调整测试要求等章节

目 录

1	测试目的和背景	4
2	参测单位	4
3	参考技术规范	5
4	参测技术系统	5
5	通关测试时间安排	5
6	通关测试内容	6
6.1	业务场景	7
7	通关测试数据准备	8
7.1	初始数据	8
8	通关测试系统接入方式	10
8.1	参测单位接入深证通	10
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

根据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”）《关于发布指数信息展示要求的通知》，为验证各方技术系统对指数优化的技术准备情况，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”）共同搭建通关测试环境。

通关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，保证通关测试的有效性。

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、做市商、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通关测试环境
2. 中证指数有限公司指数通通关测试环境
3. 深圳证券通信系统通关测试环境
4. 各主办券商、做市商、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 通关测试时间安排

本次通关测试时间为 2019 年 1 月 12 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 通关测试内容

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、做市商、信息商技术系统能及时正确接收并展示静态指数行情；支持指数所含所有样本股的行情展示。
3. 验证金融终端“新三板综合屏”的展示情况。

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。（静态指数清单详见全国股转公司官网通知） 证券行情库中上述静态指数记录中昨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 11:00 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。 支持指数所含所有样本股（指数样本股清单详见全国股转公司官网，首页>市场数据>NEEQ 指数）的行情展示。	
【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。 证券行情库中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，支持指数所含所有样本股的行情展示。	
【业务 3】周边系统	验证周边系统能按要求揭示指数行情，支持查询指数行情，支持指数所含所有样本股的行情展示。 验证金融终端“新三板综合屏”的展示情况。	

7 通关测试数据准备

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 2019 年 1 月 11 日（周五）
 全国股转系统生产环境收盘行情（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 2019 年 1 月 11 日（周五）全国股转系统和中国结算生产环境日终数据为准。

3. 指数行情发布内容

本次通关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 2019 年 1 月 11 日（周五）全国股转系统生产环境闭市数据为准。

5. 投资者适当性

所有投资者初始的适当性状态以 2019 年 1 月 11 日（周五）全国股转系统生产环境日终数据为准。

6. 定向行情发布

所有交易单元定向行情接收的权限以 2019 年 1 月 11 日（周五）全国股转系统生产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、行情网关的用户与密码以 2019 年 1 月 11 日（周五）全国股份转让系统生产环境闭市时数据为准。

8 通关测试系统接入方式

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通关测试环境，如有问题，及时联系深证通负责通关测试的工作人员。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 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，认真做好技术准备和测试环境，做好详尽的测试计划，并指定专人负责本次通关测试工作。
2. 本次测试要求各主办券商、做市商及开展股转业务的信息商必须参加测试，要求主办券商、做市商必须有有效申报及成交，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. 本次测试建议主办券商自营系统、资管系统、基金公司投资交易系统参与测试。
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，确保下一转让日（2019 年 1 月 14 日，周一）生产系统的正确运行。

5. 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。
6. 测试结束后，各主办券商应在 2019 年 1 月 12 日 15:00 前通过 BPM 回复通关测试主题向全国股转公司提交测试报告（附件 1-1，无需盖章），在 2019 年 1 月 15 日 17:00 之前通过 BPM 发起新主题方式向全国股转公司提交上述测试报告的盖章版扫描件（加盖公司章）。
7. 测试结束后，各信息商应在 2019 年 1 月 12 日 15:00 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+指数优化通关测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn，并同时抄送 hangqing@neeq.com.cn，在 2019 年 1 月 15 日 17:00 之前通过电子邮件向全国股转公司提交上述测试报告的盖章版扫描件（加盖公司章），邮件主题和附件名称均为：机构名称+指数优化通关测试报告（盖章件），收件邮箱同上。

10 联系方式

联系单位（人）	联系电话
全国股转公司	010-63889800

深证通	0755-83182222
测试 QQ 群	348545494（测试 1 群） 620651342（测试 2 群） 337926180（测试 3 群） 970024104（测试 4 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

二〇一九年一月