

## 附件 1

### 工程技术文档

# 全国股转公司摘牌证券服务专区等业务 第一轮仿真测试方案

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

二〇二一年五月



## 关于本文档

[illegible]

## 目 录

|                           |    |
|---------------------------|----|
| 一、测试目的和背景.....            | 1  |
| 二、参测机构.....               | 1  |
| 三、参考技术规范.....             | 1  |
| 四、参测技术系统.....             | 2  |
| 五、测试内容.....               | 2  |
| （一）摘牌证券服务专区业务.....        | 2  |
| （二）QFII/RQFII 经纪模式.....   | 3  |
| （三）信息发布优化.....            | 4  |
| （四）其他.....                | 5  |
| 六、测试时间安排.....             | 5  |
| 七、测试场景及证券安排.....          | 6  |
| （一）摘牌证券服务专区业务.....        | 6  |
| （二）QFII/RQFII 经纪模式.....   | 7  |
| （三）信息发布优化.....            | 9  |
| （四）其他.....                | 9  |
| （五）测试要求和说明.....           | 10 |
| 八、仿真测试数据准备.....           | 11 |
| （一）挂牌情况、证券行情信息和证券信息.....  | 11 |
| （二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓..... | 11 |
| （三）挂牌公司分层信息.....          | 11 |
| （四）交易网关、行情网关和结算网关.....    | 12 |
| 九、仿真测试系统接入方式.....         | 12 |
| （一）参测机构接入深证通.....         | 12 |
| （二）参测机构接入业务支持平台.....      | 12 |
| （三）参测机构接入中国结算.....        | 12 |
| （四）测试相关软件下载.....          | 12 |
| 十、测试要求及注意事项.....          | 12 |
| 十一、联系方式.....              | 14 |

## 一、测试目的和背景

为验证各市场参与者技术系统对于摘牌证券非公开电子化转让服务专区（以下简称“摘牌证券服务专区”）等业务的技术准备情况，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”）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”）共同搭建仿真测试环境供市场进行仿真测试。

请各参测机构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. 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、参测信息商

## 三、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(V1.45)》

2. 《全国中小企业股份转让系统摘牌证券服务专区技术开发指南（V1.0）》
3. 《全国中小企业股份转让系统周边技术系统开发者指南（V1.5）》

#### 四、参测技术系统

1. 全国股转公司交易支持平台仿真测试环境
2. 全国股转公司业务支持平台仿真测试环境
3. 中国结算新三板登记结算仿真测试环境
4. 深证通通信系统仿真测试环境
5. 各主办券商、参测信息商相关测试环境

#### 五、测试内容

验证各参测机构核心技术系统已按照《全国中小企业股份转让系统摘牌证券服务专区技术开发指南（V1.0）》等技术文档的要求对摘牌转让等业务进行改造，达到上线要求。

##### （一）摘牌证券服务专区业务

1. 验证全国股转公司能通过摘牌证券服务专区提供转让业务，能正确对市场上传的专区申报文件进行格式校验并生成专区回报文件，能正确下发专区终止挂牌股票转让信息文件。

2. 验证中国结算新三板登记结算系统能够根据成交回报数据正确对资金和股份进行日终处理，生成日终数据并发布。
3. 验证各主办券商能够正确将投资者的摘牌证券委托进行汇总，按照投资者委托的先后顺序生成专区申报文件，并向摘牌证券服务专区申报。券商在每个交易日的 15:40 后，可以通过摘牌证券服务专区下载专区回报文件。
4. 验证各主办券商能根据投资者适当性进行正确的交易权限控制，对提交的委托做必要的合法性校验并进行资金或股票的冻结。
5. 验证各主办券商和托管机构能够正确接收中国结算发布的日终数据并完成清算交收，并根据投资者成交情况做好反向交易控制。

## **(二) QFII/RQFII 经纪模式**

1. 验证全国股转公司能支持 QFII/RQFII 账户开展各类股转交易业务，并允许该类账户选择经纪模式开展业务。验证选择托管模式的 QFII/RQFII 账户只能通过指定的交易单元开展业务。
2. 验证中国结算新三板登记结算系统能够正确对交易进行日终处理，生成日终数据并发布。

3. 验证深证通通信系统能够正确转发主办券商的委托数据和全国股转公司的回报和行情数据。
4. 验证提供 QFII/RQFII 业务的主办券商能支持 QFII/RQFII 账户开展各类股转交易业务，并允许该类账户选择经纪模式开展业务。
5. 验证各主办券商能根据选择经纪模式开展业务的 QFII/RQFII 账户的投资者适当性进行正确的交易权限控制，对提交的委托做必要的合法性校验并进行资金或股票的冻结。
6. 验证各主办券商和托管机构能够正确接收中国结算发布的日终数据并完成清算交收。

### **(三) 信息发布优化**

1. 验证各主办券商技术系统能够正确接收 FDEP 下发的 NQFC.DBF 文件，并根据投资者的适当性控制其交易权限。
2. 验证各主办券商能够正确接收全国股转公司行情数据，并正确揭示证券是否存在差异化表决权。
3. 验证各参测信息商能够正确接收全国股转公司行情数据，并正确揭示证券是否存在差异化表决权。

#### (四) 其他

1. 验证各主办券商周边技术系统能够按照《全国中小企业股份转让系统周边技术系统开发者指南（V1.5）》优化改造要求处理限价申报、大宗申报和行情展示等业务。

#### 六、测试时间安排

本次仿真测试时间为 2021 年 5 月 24 日至 2021 年 5 月 28 日，周一到周五全天开放测试环境：

| 交易时段        | 精选层                 | 创新层、基础层   | 摘牌证券服务专区                      |
|-------------|---------------------|-----------|-------------------------------|
| 08:30       | 下发初始行情              |           | 业务支持平台于上一交易日约 20:00 后更新今日转让信息 |
| 09:15       | 开市、大宗交易收单           |           |                               |
| 09:25       | 开盘集合竞价              | ——        |                               |
| 09:30       | 连续竞价                | 做市交易、集合竞价 |                               |
| 10:30       |                     |           |                               |
| 11:30       |                     |           |                               |
| 11:30       | 中午休市                |           |                               |
| 13:00       | 下午开市                |           |                               |
| 13:00       | 连续竞价                | 做市交易、集合竞价 | ——                            |
| 14:00       |                     |           | 协议互报委托汇总文件上传                  |
| 14:30       |                     |           |                               |
| 14:57       |                     |           | 收盘集合竞价                        |
| 15:00       |                     |           |                               |
| 15:00-15:30 | 大宗交易、做市商互报          |           |                               |
| 15:30       | 闭市                  |           |                               |
| 15:40 后     | 约 19:00 后下发 NQFC 文件 |           | 协议互报成交结果文件下载                  |

## 七、测试场景及证券安排

### (一) 摘牌证券服务专区业务

| 业务类型   |                                               | 证券代码                                                             | 测试日期     |
|--------|-----------------------------------------------|------------------------------------------------------------------|----------|
| 进入专区   | 进入摘牌证券服务专区，专区信息文件包含该摘牌证券                      | 405000（基础券 830001），<br>405001（基础券 830002），<br>405002（基础券 830003） | 5 月 24 日 |
|        |                                               | 409998（基础券 830004），<br>409999（基础券 830005）                        | 5 月 25 日 |
| 紧急暂停转让 | 当日专区回报文件 HBCWM 字段返回证券已暂停转让错误，次日专区信息文件显示该券暂停转让 | 405000                                                           | 5 月 24 日 |
|        |                                               | 409999                                                           | 5 月 27 日 |
| 暂停转让   | 当日专区回报文件 HBCWM 字段返回证券已暂停转让错误，专区信息文件显示该券暂停转让   | 满足股东人数不超过 200 人时触发                                               | 全周期      |
|        |                                               | 405002                                                           | 5 月 25 日 |
| 恢复转让   | 当日专区回报文件返回结果正常，专区信息文件显示该券正常转让                 | 405000                                                           | 5 月 25 日 |
|        |                                               | 405002                                                           | 5 月 26 日 |
| 退出专区   | 退出摘牌证券服务专区，专区信息文件不包含退出证券                      | 满足股东人户不超过 200 人可退出专区                                             | 全周期      |
| 修改简称   | 专区信息文件中摘牌证券简称已修改                              | 405001,409999                                                    | 5 月 26 日 |

|        |                                      |                                    |     |
|--------|--------------------------------------|------------------------------------|-----|
| 反向交易   | 同一账户反向交易时间间隔不得少于 5 个交易日              | 405000,405001,405002,409998,409999 | 全周期 |
| 申报文件校验 | 14:00-14:30 可重复上传全量委托文件，即时返回格式初步校验结果 | 405000,405001,405002,409998,409999 | 全周期 |

## (二) QFII/RQFII 经纪模式

| 业务类型   |           | 证券代码         | 测试日期     |
|--------|-----------|--------------|----------|
| 新挂牌股票  | 做市股票      | 839400       | 5 月 24 日 |
|        | 集合竞价股票    | 839402（基础层）  |          |
|        |           | 839403（创新层）  | 5 月 25 日 |
| 定向增发股票 | 做市股票      | 430065       | 5 月 25 日 |
|        | 集合竞价股票    | 430031       | 5 月 26 日 |
| 常规停牌股票 | 做市股票      | 430021（停牌一天） | 5 月 26 日 |
|        |           | 430022（长期停牌） |          |
|        |           | 430065（长期停牌） |          |
|        | 集合竞价股票    | 430035（长期停牌） | 5 月 27 日 |
|        |           | 831100（停牌一天） |          |
|        | 连续竞价股票    | 839407（长期停牌） |          |
|        |           | 839408（停牌一天） |          |
|        | 两网及退市公司股票 | 400020（停牌一天） | 5 月 27 日 |
|        |           | 400017（长期停牌） |          |



|            |           |                                                                          |       |
|------------|-----------|--------------------------------------------------------------------------|-------|
|            |           | 400018（长期停牌）                                                             |       |
| 常规复<br>牌股票 | 做市股票      | 430022（正常转让）                                                             | 5月27日 |
|            | 集合竞价股票    | 831100（正常转让）                                                             |       |
|            | 连续竞价股票    | 839408（正常转让）                                                             |       |
|            | 两网及退市公司股票 | 400020（正常转让）                                                             |       |
|            | 做市股票      | 430065（正常转让）                                                             |       |
|            | 集合竞价股票    | 430035（正常转让）                                                             |       |
|            | 连续竞价股票    | 839407（正常转让）                                                             | 5月28日 |
|            | 两网及退市公司股票 | 400018（正常转让）                                                             |       |
| 紧急停<br>牌股票 | 做市股票      | 430070（长期停牌）                                                             | 5月27日 |
|            | 集合竞价股票    | 831094（停牌一天）                                                             |       |
|            | 连续竞价股票    | 839406（停牌一天）                                                             | 5月28日 |
|            | 两网及退市公司股票 | 400011（停牌一天）                                                             |       |
| 除权除<br>息股票 | 做市股票      | 839400（除权除息 10 送 1 股派 1 元）<br>839401（除息 10 送 1 元）                        | 5月27日 |
|            |           | 430005（除权 10 送 1 股）<br>430015（除息 10 派 1 元）<br>430010（除权除息 10 送 1 股派 1 元） |       |
|            | 连续竞价股票    | 839407（除权 10 送 1 股）<br>839408（除息 10 派 1 元）<br>839409（除权除息 10 送 1 股派 1 元） | 5月28日 |
|            |           |                                                                          |       |

|          |                   |                                                     |                   |
|----------|-------------------|-----------------------------------------------------|-------------------|
|          | 两网及退市公司股票         | 400012 (除权除息 10 送 1 股派 1 元)<br>400013 (除息 10 派 1 元) |                   |
| 交易方式调整股票 | 集合竞价转做市           | 830819                                              | 5 月 28 日          |
|          | 做市转集合竞价           | 430065                                              |                   |
| 要约业务     | 要约收购              | 840001                                              | 5 月 24 日-5 月 28 日 |
|          | 要约回购              | 841001                                              | 5 月 24 日-5 月 28 日 |
| 公开发行     | 询价 (价格范围 1-5 元)   | 889806 (基础券 839404)                                 | 5 月 24 日-5 月 25 日 |
|          | 询价发行申购 (申购价格 2 元) | 889806                                              | 5 月 27 日          |
|          | 定价发行 (申购价格 2 元)   | 889807 (基础券 839405)                                 | 5 月 24 日          |
|          | 竞价发行 (价格范围 1-5 元) | 889808 (基础券 839406)                                 | 5 月 24 日          |

### (三) 信息发布优化

| 业务场景     |                                                     | 证券代码                   |
|----------|-----------------------------------------------------|------------------------|
| 差异化表决权   | 证券信息库中 XXQTYW 字段第二字节“T”表明有差异化表决权安排, “F”表明没有差异化表决权安排 | 835084, 839483, 831445 |
| 分层信息文件下发 | 日终阶段通过 FDEP 下发 NQFC.DBF 文件                          | ——                     |

### (四) 其他

周边技术系统优化相关测试场景与 QFII/RQFII 经纪模式相同。

### (五) 测试要求和说明

1. 摘牌证券服务专区业务测试过程中，证券公司在每个测试日的 14:00-14:30 时间内，可以多次上传申报文件，每次上传的申报文件须为当天申报的全量数据，且以最后一次提交成功的申报文件为有效申报文件。14:30 以后，仍处于上传中的文件，系统将不作处理。如果申报文件较大，券商应合理安排上传时间，确保 14:30 之前传输完毕。券商须能下载并正确处理回报文件，能够正确识别文件中返回的错误信息并揭示给投资者。
2. 参与超 200 人摘牌公司股票转让的投资者，应该是正在持有该股票，或者是基础层的合格投资者，同一账户同一证券的反向交易时间间隔不得少于 5 个交易日，券商应做好交易权限控制。
3. QFII/RQFII 经纪模式测试过程中，公开发行询价保留询价范围在 1-5 元区间的询价申报，实际询价确认结果以 12 日发送的 NQQR 文件为准。竞价申购仅保留价格范围在 1-5 元区间的申购申报。QFII/RQFII 托管模式下只能通过开户时预留的账户交易单元和托管单元路径报单，否则该报单按废单处理。

4. 信息发布优化测试过程中，各主办券商应能正常接收 NQFC.DBF 文件并且根据 NQXX.DBF 文件正确揭示差异化表决权行情信息。
5. 各主办券商应按照《全国中小企业股份转让系统周边技术系统开发者指南（V1.5）》要求完成周边技术系统优化，包括权限控制、界面展示、委托处理以及行情揭示等内容。

## 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 2021 年 5 月 21 日（周五）全国股转公司仿真环境收盘行情（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

本次测试的账户、交易单元、托管单元及持仓的初始信息以 2021 年 5 月 21 日（周五）全国股转公司和中国结算仿真环境日终数据为准。

### （三）挂牌公司分层信息

除特殊处理证券外，其余挂牌公司股票初始分层信息以 2021 年 5 月 21 日（周五）全国股转公司仿真环境日终数据为准。

#### （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 2021 年 5 月 21 日（周五）全国股份转让系统、中国结算和深证通仿真环境闭市时数据为准。

### 九、仿真测试系统接入方式

#### （一）参测机构接入深证通

参测机构使用仿真环境线路接入深证通，如有问题，及时与深证通联系。

#### （二）参测机构接入业务支持平台

参测券商需要使用互联网访问业务支持平台仿真环境网址：  
<https://djbpm.neeq.com.cn:54011/portal/>，登录账户和密码可在测试 QQ 群（338167838）下载查看。

#### （三）参测机构接入中国结算

参见中国结算测试方案。

#### （四）测试相关软件下载

本次测试所需的交易网关、行情网关无须升级，可在测试 QQ 群（338167838）下载。

### 十、测试要求及注意事项

1.各参测机构应根据《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范(V1.45)》等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全网测试工作。

2.开展全国股转公司业务的各主办券商须确保至少提供一种摘牌专区股票收单渠道。拟开展 QFII/RQFII 业务的主办券商须参加 QFII/RQFII 业务经纪和托管模式的全业务测试部分。资管系统参加本次测试的，应当同时通知为其开展托管结算业务的托管机构参加测试。

3.摘牌证券服务专区的文件上传下载应以证券公司为单位统一处理，各主办券商应做好组织协调工作，确保能收齐所有参测技术系统的摘牌证券委托数据统一上传，对于下载的专区成交回报文件应做好拆分的工作。

4.在测试过程中，各参测机构应按要求覆盖相应测试场景。请各参测机构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，各主办券商应收集各自技术系统的测试情况，2021 年 5 月 28 日 17:00 之前通过 BPM 向全国股转公司提交测试报告。各参测信息商应按上述时间要求通过电子邮件向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+摘牌证券服务专区等业务仿真测试报告（第一轮），收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。

## 十一、联系方式

| 测试联系单位             | 联系电话          |
|--------------------|---------------|
| 全国股份转让系统<br>运行控制中心 | 010-63889800  |
| 深圳证券通信公司           | 0755-83182222 |
| 测试 QQ 群            | 338167838     |

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

二〇二一年五月