股转系统办发〔2021〕68号附件1

全国中小企业股份转让系统

市场参与者技术系统变更指南

之发行优化业务

（V1.0）

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

二〇二一年五月

修订历史

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 修订历史 | | |
| 版本号 | 修订日期 | 修订说明 |
| V1.0 | 2021.5.20 | 定稿，说明发行优化业务变动内容及对市场的改造要求。 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

目录

[一、说明 1](#_Toc75189965)

[二、参考文档 1](#_Toc75189966)

[三、变动简述 1](#_Toc75189967)

[（一） 信息发布 1](#_Toc75189968)

[1. 揭示申报数量范围 1](#_Toc75189969)

[2. 揭示发行方式 2](#_Toc75189970)

[（二） 申报实时校验 2](#_Toc75189971)

[（三） 询价确认 2](#_Toc75189972)

[1. 新增询价剔除情形 2](#_Toc75189973)

[2. 完善询价确认结果下发功能 3](#_Toc75189974)

[四、数据接口规范修订说明 3](#_Toc75189975)

[（一） 证券信息库NQXX.DBF 3](#_Toc75189976)

[（二） 确认库NQQR??????.DBF 5](#_Toc75189977)

[五、市场参与者技术系统注意事项 6](#_Toc75189978)

[六、联系方式 7](#_Toc75189979)

# 一、说明

为便于各市场参与者和相应IT提供商更好地理解发行业务优化内容对相关技术系统的改造要求，做好技术系统的准备工作，全国股转公司专门编制和发布本指南。本指南包括行情发布、申报结果发送等方面的内容。

本次变更参考技术文档为《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.46）》（以下简称“数据接口规范”），未涉及内容请参考现有业务实施规则、细则和制度。

特别提示：如果业务规则、细则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。

# 二、参考文档

《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.46）》

# 三、变动简述

全国股转公司拟优化发行业务向市场揭示的相关信息，本次修改内容如下：

1. 信息发布
2. 揭示申报数量范围

通过证券信息库的最小申报数量和每笔限量单独揭示每只发行证券当前可以参与询价/申购（网上部分）的最小申报数量和最大申报数量。

1. 揭示发行方式

通过证券信息库的其他业务状态揭示该只发行证券采用的发行方式：第一字节为“T”表示采用的是询价发行方式，第二字节为“T”表示采用的是定价发行方式，第三字节为“T”表示采用的是竞价发行方式。三个字节的取值中只会有一个为“T”，其他两个字节全部为“F”。

| **XXQTYW** | **第一字节** | **第二字节** | **第三字节** | **第四字节** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 发行证券 | 为“T”表明采用的是询价发行方式，为“F”表示未采用询价发行方式 | 为“T”表明采用的是定价发行方式，为“F”表示未采用定价发行方式 | 为“T”表明采用的是竞价发行方式，为“F”表示未采用竞价发行方式 | 预留，默认为空格 |

1. 申报实时校验

对于处于询价阶段的发行证券，全国股转公司将实时校验每笔询价申报的申报数量是否在证券信息库指定的数量范围内，如果校验未通过则该笔申报直接撤单。

对于处于申购阶段的发行证券，全国股转公司将分别实时校验每笔申购申报：证券账户是否不在确认库“禁止申购”的名单中；如果证券账户在确认库“必须申购”的名单中，其申购申报的申报数量是否在确认库指定的数量范围内；如果证券账户在确认库“可以申购”的名单中或在确认库中找不到对应的证券账户，其申购申报的申报数量是否在证券信息库揭示的数量范围内，对于上述校验如果未能通过则该笔申报直接撤单。

1. 询价确认
2. 新增询价剔除情形

新增询价剔除场景：老股东禁止参与网下配售。

对于询价申报，检查证券账户是否为在登记日持有标的证券的老股东，如果为老股东，则询价申报无效，并通过确认库下发，对应业务类型为“7F”，对应错误原因为“A6”。

1. 完善询价确认结果下发功能

在确认库中增加闭市后剔除的无效询价申报，对应业务类型为“7F”，对应剔除原因为“A1”-“A5”。

取消原错误原因“07”，细化为“B1”-“B4”。

| **QRCDYY** | **QRDFZH** | **具体含义** |
| --- | --- | --- |
| A1 | 数量不合法 | 申报数量不满足上下限要求 |
| A2 | 交易笔数少 | 历史交易记录笔数不足的自然人投资者剔除 |
| A3 | 非协会注册 | 非协会注册的投资者剔除 |
| A4 | 重复报单 | 同一账户或同一投资者以最后一笔报单为准，此前申报无效 |
| A5 | 多配售对象 | 同一网下投资者的多个配售对象剔除 |
| A6 | 老股东剔除 | 老股东剔除 |
| B1 | 高报价剔除 | 承销商剔除，高价剔除申报 |
| B2 | 低价未入围 | 承销商剔除，低价未入围申报 |
| B3 | 关联方申报 | 承销商剔除，关联方申报 |
| B4 | 其他 | 承销商剔除，其他原因剔除申报 |

# 四、数据接口规范修订说明

1. 证券信息库NQXX.DBF

（1）通过最小申报数量（字段23：XXZXSBSL）和每笔限量（字段20：XXMBXL）单独揭示每只发行证券的申报数量范围。

（2）通过XXQTYW（字段41：其他业务状态）揭示该只发行证券当前采用的发行方式。

**表4-1：其他业务状态含义表**

| **XXQTYW** | **第一字节** | **第二字节** | **第三字节** | **第四字节** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 优先股 | 预留，默认为空格 | 预留，默认为空格 | 回售标志，该证券是否处于回售期：F-否，T-是 | 转股标志，该证券是否允许转股：F-禁止，T-允许 |
| 挂牌公司股票 | 为 “T”表明处于要约期，为“F”表明不处于要约期 | 为 “T”表明有差异化表决权安排，为“F”表明没有差异化表决权安排 | 预留，默认为空格 | 预留，默认为空格 |
| 要约收购/回购 | 为“T”表明处于要约收购/回购截止期间，禁止做撤回预受要约申报，为“F”表明处于要约收购/回购正常期间 | 预留，默认为空格 | 预留，默认为空格 | 预留，默认为空格 |
| 发行证券 | 为“T”表明采用的是询价发行方式，为“F”表示未采用询价发行方式 | 为“T”表明采用的是定价发行方式，为“F”表示未采用定价发行方式 | 为“T”表明采用的是竞价发行方式，为“F”表示未采用竞价发行方式 | 预留，默认为空格 |
| 其他 | 预留，默认为空格 | 预留，默认为空格 | 预留，默认为空格 | 预留，默认为空格 |

1. 确认库NQQR??????.DBF

（1）新增一类业务类别“7F”，用于表示为闭市后对询价申报进行合法性校验时剔除的无效单。

**表4-2：成交回报业务类别含义表**

| **QRYWLB** | **交易回报业务含义** | **QRCJSL** | **QRCJJG** | **QRCJSL2** | **对应申报业务类别** | **对应申购权限** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 7B | 询价申报确认回报 | >0 | 同申报价格 | >0 | 7B | 必须申购 |
| 7C | 询价申报撤单回报 | ≤0 | =0 | =0 | 7B | 禁止申购 |
| 7F | 询价申报被剔除 | =0 | =0 | =0 | 7B | 可以申购 |

（2）新增六类错误代码A1-A6，对应闭市后剔除的无效询价申报，说明被剔除的原因。取消原错误代码07，细化为B1-B4。

| **QRCDYY** | **QRDFZH** | **具体含义** |
| --- | --- | --- |
| A1 | 数量不合法 | 申报数量不满足上下限要求 |
| A2 | 交易笔数少 | 历史交易记录笔数不足的自然人投资者剔除 |
| A3 | 非协会注册 | 非协会注册的投资者剔除 |
| A4 | 重复报单 | 同一账户或同一投资者以最后一笔报单为准，此前申报无效 |
| A5 | 多配售对象 | 同一网下投资者的多个配售对象剔除 |
| A6 | 老股东剔除 | 老股东剔除 |
| B1 | 高报价剔除 | 承销商剔除，高价剔除申报 |
| B2 | 低价未入围 | 承销商剔除，低价未入围申报 |
| B3 | 关联方申报 | 承销商剔除，关联方申报 |
| B4 | 其他 | 承销商剔除，其他原因剔除申报 |

# 五、市场参与者技术系统注意事项

1. 提供全国股转系统业务的周边行情系统除现有已揭示的发行基本信息外，还应在发行信息列表和发行证券详情信息里揭示采用的发行方式、询价/申购（网上部分）数量范围。
2. 提供全国股转系统业务的交易系统，应能根据申报实时校验的结果，正确的向投资者及时揭示申报状态以及申报失败原因。
3. 提供全国股转系统业务的交易系统，在投资者查询或委托时，除原有的提示信息外，也应能向投资者提示该只发行证券采用的发行方式、询价/申购（网上部分）数量范围，投资者当前委托的数量是否在指定的数量范围内。
4. 提供全国股转系统业务的交易系统，还应能根据确认库正确的向投资者揭示询价失败的原因，以及是否能参与后续申购。

# 六、联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **联系单位/部门** | **联系电话** |
| 全国股转公司 | 400-626-3333 |
| 深圳证券通信公司 | 0755-83182222 |
| QQ群 | 338167838 |