股转系统办发〔2021〕83号附件1

工程技术文档

全国中小企业股份转让系统交易支持平台

数据接口改造仿真测试方案

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

二〇二一年七月

**关于本文档**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 文档名称 | 全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口改造仿真测试方案 | | |
| 说明 |  | | |
| 修订历史 | | | |
| 版本号 | 修改日期 | 修改说明 | 修订人 |
| V1.0 | 2021.7.19 | 创建本文档 |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

**目 录**

[一．测试目的和背景 1](#_Toc77587339)

[二、参测机构 1](#_Toc77587340)

[三、参考技术规范 1](#_Toc77587341)

[四、参测技术系统 2](#_Toc77587342)

[五、测试内容 2](#_Toc77587343)

[六、测试时间安排 3](#_Toc77587344)

[七、测试场景及证券安排 4](#_Toc77587345)

[（一）测试场景安排 4](#_Toc77587346)

[（二）测试要求和说明 5](#_Toc77587347)

[八、仿真测试数据准备 5](#_Toc77587348)

[（一）挂牌情况、证券行情信息和证券信息 5](#_Toc77587349)

[（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 5](#_Toc77587350)

[（三）挂牌公司分层信息 6](#_Toc77587351)

[（四）交易网关、行情网关和结算网关 6](#_Toc77587352)

[（五）FDEP小站 6](#_Toc77587353)

[九、仿真测试系统接入方式 6](#_Toc77587354)

[（一）参测机构接入深证通 6](#_Toc77587355)

[（二）参测机构接入中国结算 7](#_Toc77587356)

[（三）测试相关软件下载 7](#_Toc77587357)

[十、测试要求及注意事项 7](#_Toc77587358)

[十一、联系方式 8](#_Toc77587359)

一．测试目的和背景

为验证各市场参与者技术系统改造情况，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”）联合深圳证券通信有限公司（以下简称“深证通”）、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）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. 深圳证券通信有限公司
3. 中国证券登记结算有限责任公司
4. 各主办券商、信息商、基金公司及其托管机构

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(V1.46)》
2. 《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）》
3. 《全国中小企业股份转让系统周边技术系统开发者指南（V1.6）》

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. 深证通通信系统仿真测试环境
3. 中国结算新三板登记结算系统仿真测试环境
4. 各主办券商、信息商、基金公司及其托管机构相关测试环境

五、测试内容

验证各参测机构技术系统已按照《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)》、《全国中小企业股份转让系统周边技术系统开发者指南（V1.6）》等技术规范的要求对数据接口进行改造，达到上线要求。

1．验证全国股转公司交易支持平台能通过证券信息库正确揭示发行方式和询价/申购（网上部分）的最小申报数量、最大申报数量。

2．验证全国股转公司交易支持平台能对询价申报和申购申报的申报数量进行实时校验，若校验未能通过则该笔申报直接撤单。

3．验证全国股转公司交易支持平台能对询价申报进行老股东申报剔除（业务类型为“7F”，错误原因为“A6”），调整确认库业务类别和撤单原因字段（取消撤单原因原数值 “07”，细化为因承销商剔除导致的“B1”-“B4”及数量不合法等原因导致的“A1”-“A5”）。

4．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、行情数据。

5．验证各主办券商、基金公司能够正常进行各类交易委托申报并接收成交回报。由于申报库NQWT.DBF中新增了WTRZRQ（融资融券标志）和WTPCBZ（平仓标志）两个字段，回报库NQHB.DBF中新增了HBRZRQ（融资融券标志）和HBPCBZ（平仓标志），各参测机构须确认能够正常进行各类委托申报并接收成交回报。

6．验证各主办券商、信息商、基金公司能够根据全国股转公司下发的证券信息库正确揭示发行方式和网上投资者询价/申购数量范围。

7．验证各主办券商对于采用询价发行方式的股票，能够根据确认库正确揭示投资者是否可以参与后续的申购（必须申购、可以申购、禁止申购）。

8．验证各参测机构技术系统本次数据接口改造过程中未涉及的其它业务功能正常。

六、测试时间安排

本次仿真测试时间为2021年7月26日至2021年8月13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** | **公开发行** |
| 08:30 | 下发初始行情 | | |
| 09:15 | 开市、大宗交易收单 | | 询价申报、申购申报 |
| 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 | 询价申报、申购申报 |
| 14:00 |
| 14:30 |
| 14:57 |
| 15:00 | 收盘集合竞价 |
| 15:00-15:30 | 大宗交易、做市商互报 | | —— |
| 15:30 | 闭市 | | —— |
| 15:40后 | 约19:00后下发投资者适当性和分层文件 | | 约19:00后下发确认库文件（NQQR.DBF） |

七、测试场景及证券安排

（一）测试场景安排

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **基础证券** | **询价代码** | **询价日期** | **询价确认结果下发** | **申购价格** | **申购日期** | **配售日期** |
| 839200 | 889300 | 7月27日 | 7月28日 | 5元 | 7月29日 | 8月2日 |
| 839201 | 889301 | 7月28日 | 7月29日 | 5元 | 7月30日 | 8月3日 |
| 839202 | 889302 | 7月29日 | 7月30日 | 5元 | 8月2日 | 8月4日 |
| 839203 | 889303 | 8月2日 | 8月3日 | 5元 | 8月4日 | 8月6日 |
| 839204 | 889304 | 8月3日 | 8月4日 | 5元 | 8月5日 | 8月9日 |
| 839205 | 889305 | 8月9日 | 8月10日 | 5元 | 8月11日 | 8月13日 |
| 839206 | 889306 | 8月10日 | 8月11日 | 5元 | 8月12日 | 8月16日 |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **基础证券** | **申购代码** | **发行方式** | **申购价格** | **申购日期** | **配售日期** | **发行结果** |
| 839211 | 889307 | 定价发行 | 5元 | 7月28日 | 7月30日 | 发行成功 |
| 839207 | 889308 | 竞价发行 | 5-10元 | 7月29日 | 8月2日 | 发行成功 |
| 839222 | 889309 | 定价发行 | 5元 | 8月3日 | 8月5日 | 发行成功 |
| 839208 | 889310 | 竞价发行 | 5-10元 | 8月4日 | 8月6日 | 发行成功 |
| 839223 | 889311 | 定价发行 | 5元 | 8月10日 | 8月12日 | 发行成功 |
| 839209 | 889312 | 竞价发行 | 5-10元 | 8月11日 | 8月13日 | 发行成功 |

（二）测试要求和说明

1．公开发行询价测试过程中，原则上保留询价范围在5-10元区间的询价申报，其余价格区间的询价申报将被剔除，实际询价确认结果以股转公司下发的NQQR文件为准。

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7月23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7月23日（周五）全国股转公司和中国结算仿真环境日终数据为准，各市场机构测试所用的网下投资者账户见测试QQ群（338167838）。

（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7月23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7月23日（周五）全国股转公司、中国结算和深证通仿真环境闭市时数据为准。

（五）FDEP小站

全国股转公司仿真环境FDEP小站号为k0903，请各主办券商在测试开始前确认FDEP小站传输配置，如需更改小站，请及时联系全国股转公司。

九、仿真测试接入方式

（一）参测机构接入深证通

参测机构通过VPN或专线接入深证通提供的仿真测试环境，如有问题，及时联系深证通负责仿真测试的工作人员。测试连接相关参数：

|  |  |
| --- | --- |
| **名称** | **地址和端口** |
| 深证通SSL VPN接入 | https://test.szse.cn |
| 行情TCP | 172.200.1.97:7044 |
| 双向报盘 | 172.200.1.98:7043 |
| CCNET | 172.200.1.89:7013 |
| FDEP | 172.200.1.182:7015/7016 |

（二）参测机构接入中国结算

参见中国结算相关通知。

（三）测试相关软件下载

本次测试所需的交易网关、行情网关均需升级，新版本网关安装包可在测试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(V1.46)》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仿真测试工作。

2.开展全国股转系统经纪业务、自营业务、做市业务、资管业务的各主办券商均须参加本次测试，测试过程中主办券商应确保各类交易委托可以正常申报，确保证券行情信息可以正确揭示。

3.参与全国股转系统交易业务、发行业务的基金公司应参加本次测试。

4.提供全国股转系统行情服务的信息商须参加本次测试。

5.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。

6.测试结束后，各参测机构应收集各自技术系统的测试情况，2021年8月13日17:00之前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+交易支持平台数据接口改造仿真测试报告，收件邮箱为：[techservice@neeq.com.cn](mailto:techservice@neeq.com.cn)。

十一、联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **测试联系单位** | **联系电话** |
| 全国股转公司 | 010-63889625 |
| 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○二一年七月