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

二〇二一年八月

**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 | 修订人 |
| V1.0 | 2021.8.10 | 创建本文档 |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

**目 录**

[一．测试目的和背景 1](#_Toc79846847)

[二、参测机构 1](#_Toc79846848)

[三、参考技术规范 1](#_Toc79846849)

[四、参测技术系统 2](#_Toc79846850)

[五、测试内容 2](#_Toc79846851)

[六、测试时间安排 4](#_Toc79846852)

[七、测试场景及证券安排 6](#_Toc79846853)

[（一）测试场景安排 6](#_Toc79846854)

[（二）测试要求和说明 7](#_Toc79846855)

[八、仿真测试数据准备 7](#_Toc79846856)

[（一）挂牌情况、证券行情信息和证券信息 7](#_Toc79846857)

[（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 7](#_Toc79846858)

[（三）挂牌公司分层信息 7](#_Toc79846859)

[（四）交易网关、行情网关和结算网关 8](#_Toc79846860)

[（五）FDEP小站 8](#_Toc79846861)

[九、仿真测试接入方式 8](#_Toc79846862)

[（一）参测机构接入深证通 8](#_Toc79846863)

[（二）参测机构接入中国结算 8](#_Toc79846864)

[（三）测试相关软件下载 8](#_Toc79846865)

[十、测试要求及注意事项 8](#_Toc79846866)

[十一、联系方式 9](#_Toc79846867)

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”）共同搭建全网测试环境供市场进行全网测试。

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、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全网测试环境
2. 中国结算新三板登记结算系统全网测试环境
3. 深证通通信系统全网测试环境
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），各参测机构须确认经纪、做市、资管、自营等系统均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、可以申购或禁止申购）。

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

本次全网测试时间为2021年8月21日，模拟T日和T+1日两个交易日：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **测试日期** | **测试时间** | **模拟场景** |
| 8月21日 | 8:30-12:00 | T日交易  （8:30下发行情、9:15-10:30上午交易、10:35-11:30下午交易、11:30-12:00大宗交易） |
| 12:00-14:00 | T日结算 |
| 14:00-16:00 | T日日终 |
| 16:00-17:00 | T+1日交易  （16:00-16:20上午交易、16:25-16:40下午交易、16:40-17:00大宗交易） |
| 18:00-19:00 | 恢复性验证 |

注：“结算”指中国结算进行清算交收并向市场下发清算数据，“日终”指全市场参测机构根据结算数据完成各自日终清算。

T日测试各类交易业务申报并在日终处理过程中下发询价结果NQQR文件；T+1日测试除询价外各类交易业务申报和询价发行证券申购申报。因深证通不支持委托日期非当前自然日，参测机构须设置T日和T+1日交易日期均为8月21日。测试结束后，各参测机构须将交易网关回退为生产环境版本并完成恢复性验证。

具体安排如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **测试时间** | **全国股转公司测试内容** | **参测机构测试内容** |
| 8:30 | 发送T日初始行情库，当日证券信息库等，**重点测试发行方式揭示情况。** | 接收T日初始行情库、证券信息库等，**重点测试发行方式揭示情况。** |
| 9:15-10:30 | 测试能够正常接收各类交易委托申报并生成成交回报。能正确发送行情信息。 | 测试能够正常进行各类交易委托申报并接收处理成交回报。能正确接收行情信息。 |
| 10:30-10:35 | 中午休市，不接受申报处理。 | 模拟中午休市业务。 |
| 10:35-11:30 | 测试能够正常接收各类交易委托申报并生成成交回报。能正确发送行情信息。 | 测试能够正常接收处理进行各类交易委托申报并生成成交回报。能正确发送行情信息。 |
| 11:30-12:00 | 测试能够正常接收各类大宗交易委托申报和做市商盘后互报并生成成交回报。 | 测试能够正常进行各类大宗交易委托申报和做市商盘后互报并接收处理成交回报。 |
| 12:00-14:00 | 接收中国结算T日清算交收数据。 | 通过CCNET接收中国结算T日清算交收数据。 |
| 14:00-16:00 | 通过FDEP向市场下发NQQR文件，完成T日日终处理。 | 通过FDEP接收并处理NQQR文件，完成T日数据清算。 |
| 16:00-16:20 | 测试能够正确处理询价证券的申购申报，能够正常接收处理进行各类交易委托申报并生成成交回报。能正确发送行情信息。 | 测试能够根据询价确认结果进行询价证券申购申报，测试能够正常进行各类交易委托申报并接收处理成交回报。能正确接收行情信息。 |
| 16:20-16:25 | 中午休市，不接受申报处理。 | 模拟中午休市业务。 |
| 16:25-16:40 | 测试能够正确处理询价证券的申购申报，能够正常接收处理进行各类交易委托申报并生成成交回报。能正确发送行情信息。 | 测试能够根据询价确认结果进行询价证券申购申报，测试能够正常进行各类交易委托申报并接收处理成交回报。能正确接收行情信息。 |
| 16:40-17:00 | 测试能够正常接收各类大宗交易委托申报和做市商盘后互报并生成成交回报。 | 测试能够正常进行各类大宗交易委托申报和做市商盘后互报并接收处理成交回报。 |
| 18:00-19:00 | 为市场提供恢复性验证测试环境。 | 测试交易网关回退为生产版本后，可正常连接深证通通信系统。 |

七、测试场景及证券安排

（一）测试场景安排

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **基础证券** | **发行代码** | **发行方式** | **询价日期** | **申购数量** | **申购价格** | **申购日期** |
| 830899 | 889500 | 询价发行 | T日 | 100-100000 | 5元 | T+1日 |
| 430193 | 889501 | 询价发行 | T日 | 100-100000 | 5元 | T+1日 |
| 430335 | 889502 | 定价发行 | —— | 100-100000 | 5元 | T日 |
| 830809 | 889503 | 竞价发行 | —— | 100-100000 | 5-10元 | T日 |

（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全国股转公司下发的NQQR文件为准。

2. 测试过程中公开发行询价网下投资者账户以生产环境数据为准。

八、测试数据准备

（一）证券信息

本次测试的证券信息以2021年8月20日（周五）全国股转公司生产环境收盘行情（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8月20日（周五）全国股转公司和中国结算生产环境日终数据为准。

（三）挂牌公司分层信息

除特殊处理证券外，其余挂牌公司分层信息以2021年8月20日（周五）全国股转公司生产环境日终数据为准。

（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8月20日（周五）全国股转公司、中国结算和深证通生产环境闭市时数据为准。

（五）FDEP小站

测试所用FDEP小站以生产环境数据为准，请各主办券商在测试开始前确认FDEP小站传输配置，如有问题及时联系全国股转公司。

九、测试接入方式

（一）参测机构接入深证通

参测机构使用生产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需要升级，行情网关无需升级。新版本交易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全网测试工作。

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应参加全网测试，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应参加本次测试。

5.在测试过程中，各参测机构应按要求覆盖相应测试场景，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，各参测机构应回退交易网关版本并进行恢复性验证。各主办券商须收集各自技术系统的测试情况，2021年8月21日19:00之前通过BPM向全国股转公司提交测试报告（无需盖章）。各参测基金公司和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+交易支持平台数据接口改造第一次全网测试报告，收件邮箱为：[techservice@neeq.com.cn](mailto:techservice@neeq.com.cn)。

7.全网测试的数据仅为测试使用，不能作为生产环境任何交易、非交易及开户等业务的依据。

8.各参测机构须在测试完毕后，做好环境恢复和验证工作，确保下一交易日生产系统正常。

十一、联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **测试单位** | **联系电话** |
| 全国股转公司 | 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○二一年八月