北证办发〔2024〕240号附件1

交易支持平台优化

第四次全网测试方案

北京证券交易所

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

二〇二四年十一月

**关于本文档**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 文档名称 | 交易支持平台优化第四次全网测试方案 | |
| 说明 |  | |
| 修订历史 | | |
| 版本号 | 修改日期 | 修改说明 |
| V1.0 | 2024.11.10 | 创建本文档 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

**目录**

[一、测试目的和背景 - 1 -](#_Toc356548350)

[二、参测机构 - 1 -](#_Toc667606580)

[三、参测技术系统 - 1 -](#_Toc718343939)

[四、全网测试时间安排 - 2 -](#_Toc517576277)

[（一） 北交所交易时间 - 2 -](#_Toc1480757458)

[（二）新三板交易时间 - 3 -](#_Toc1705821423)

[（三）两网退市交易时间 - 3 -](#_Toc94919472)

[五、全网测试内容 - 4 -](#_Toc1032020046)

[六、 测试场景及相关说明 - 5 -](#_Toc976900580)

[（一） 北交所测试证券安排 - 5 -](#_Toc1849063695)

[（二）北交所公开发行测试证券安排 - 5 -](#_Toc1389907063)

[（三）新三板测试证券安排 - 6 -](#_Toc1867952431)

[（四）两网退市测试证券安排 - 7 -](#_Toc1105678058)

[七、全网测试数据准备 - 8 -](#_Toc615630436)

[（一）证券行情信息和证券信息 - 8 -](#_Toc620346059)

[（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 - 9 -](#_Toc564068514)

[（三）交易网关、行情网关和结算网关 - 9 -](#_Toc412184022)

[（四）FDEP小站 - 9 -](#_Toc1005221659)

[八、全网测试系统接入方式 - 9 -](#_Toc1856043060)

[（一）参测机构接入深证通 - 9 -](#_Toc1654111366)

[（二）参测机构接入中国结算 - 9 -](#_Toc1508853228)

[（三）测试相关软件下载 - 10 -](#_Toc1548146793)

[九、测试要求及注意事项 - 10 -](#_Toc1223848957)

[十、联系方式 - 11 -](#_Toc554960774)

一、测试目的和背景

为验证交易支持平台优化技术准备情况，北京证券交易所（简称北交所）、全国中小企业股份转让系统有限责任公司（简称全国股转公司）联合中国证券登记结算有限责任公司（简称中国结算）、深圳证券通信有限公司（简称深证通）共同搭建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. 北京证券交易所
2. 全国中小企业股份转让系统有限责任公司
3. 中国证券登记结算有限责任公司
4. 深圳证券通信有限公司
5. 开展全国股转公司、北交所业务的证券公司、基金公司
6. 提供全国股转公司、北交所行情服务的信息商

三、参测技术系统

1. 交易支持平台全网环境
2. 中国结算北京市场证券登记结算系统全网测试环境
3. 深证通通信系统和金融数据交换平台（FDEP）全网环境
4. 证券公司、基金公司、信息商等相关测试环境

四、全网测试时间安排

全网测试时间：2024年11月30日，模拟一个完整交易日。本次测试包含应急场景测试。

## 北交所交易时间

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **交易时段** | **北交所连续竞价（**含融资融券、北交所做市交易） | **公开发行** | | **要约** | **优先股** | **定向可转债** |
| **询价** | **申购** |
| 8:30 | 下发初始行情 | | | | | |
| 9:15 | 申报收单 | 询价申报 | 申购申报 | 要约申报 | 申报收单 | —— |
| 9:25 | 开盘集合竞价 |
| 9:30 | 连续竞价 | 成交确认申报、定价申报、互报成交确认申报 | 互报成交确认申报、转股、回售 |
| 10:30 |
| 11:30 |
| 11:30 | 中午休市 | | | | | |
| 13:00 | 下午开市 | | | | | |
| 13:00 | 连续竞价 | 询价申报 | 申购申报 | 要约申报 | 成交确认申报、定价申报、互报成交确认申报 | 互报成交确认申报、转股、回售 |
| 14:00 |
| 14:57 |
| 15:00 | 收盘集合竞价 |
| 15:00-15:30 | 大宗交易 | —— | | —— | —— | —— |
| 15:30 | 闭市 | | | | | |

## （二）新三板交易时间

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **交易时段** | **新三板股票** | **要约** | **优先股** | **定向可转债** |
|
| 08:30 | 下发初始行情 | | | |
| 09:15 | 申报收单 | 要约申报 | 申报收单 | —— |
| 09:25 |
| 09:30 | 做市交易/集合竞价 | 成交确认申报、定价申报、互报成交确认申报 | 互报成交确认申报、  转股、回售 |
| 10:30 |
| 11:30 |
| 11:30 | 上午闭市 | | | |
| 13:00 | 下午开市 | | | |
| 13:00 | 做市交易/集合竞价 | 要约申报 | 成交确认申报、定价申报、互报成交确认申报 | 互报成交确认申报、  转股、回售 |
| 14:00 |
| 14:57 |
| 15:00 |
| 15:00-15:30 | 大宗交易、做市商互报 | —— | —— | —— |
| 15:30 | 闭市 | | | |

## （三）两网退市交易时间

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **交易时段** | **两网退市股票** | **退市可转债** |
| 08:30 | 下发初始行情 | |
| 09:15 | —— | —— |
| 09:25 | —— |
| 09:30 | 集合竞价申报 | 互报成交确认申报、转股、回售 |
| 10:30 |
| 11:30 |
| 11:30 | 上午闭市 | |
| 13:00 | 下午开市 | |
| 13:00 | 集合竞价申报 | 互报成交确认申报、转股、回售 |
| 15:00 |
| 15:00 | 集合竞价成交 | —— |

五、全网测试内容

验证交易支持平台现有各项交易业务、发行业务等无异常。

1.验证交易支持平台能正确对各类申报进行检查并返回检查确认结果。能够正确对各类有效委托进行撮合处理，发送成交回报。能够正确生成北交所、新三板、两网退市业务各类行情。

2.验证中国结算北京市场证券结算系统能够正确进行日终处理，生成相关数据并下发市场。

3.验证深证通通信系统能够正确转发证券公司的委托数据、交易支持平台的回报和行情数据。

4.验证各证券公司、基金公司能够正确发送各类委托，接收交易支持平台返回的回报和行情数据并进行实时处理。

5.验证各提供全国股转系统、北交所行情服务的信息商能够正确接收、处理、揭示交易支持平台提供的各类行情信息。

1. 测试场景及相关说明
2. 北交所测试证券安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **品类** | **业务类型** | **证券代码** |
| 北交所股票 | 日常交易（连续竞价+集合竞价、大宗交易、融资融券、北交所做市等） | 835185（北交所做市）  430418（北交所做市）  833781  920002  920099 |
| 上市首日、放开涨跌幅 | 920099 |
| 盘中紧急停牌 | 833781 |
| 长期停牌 | 837006 |
| 盘中调整可融资、可融券状态 | 835185（暂停可融资）  430418（暂停可融券） |
| 要约 | 要约代码：841500  基础证券：920002  回购价格: 5.0元/股 |
| 行情发布：交易日8:30通过行情公告发布发行券、担保证券等各类行情信息 | 835185（北交所做市）  430418（北交所做市）  833781  920002  920099  837006 |

（二）北交所公开发行测试证券安排

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **证券代码** | **新三板基础券** | **方式** | **发行量** | **价格** | **申购上下限** | **测试业务** | **发行结果** |
| 920004 | 834072 | 定价 | 网上80万股  战略配售20万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 申购 | 申购失败 |
| 920014 | 834209 | 定价 | 网上80万股  战略配售20万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 申购 | 申购失败 |
| 920024 | 835881 | 询价 | 网上40万股  网下60万股  战略配售20万股 | 询价有效价格1-5元 | 100-10万 | 询价 | 询价失败 |
| 920034 | 835690 | 询价 | 网上40万股  网下60万股  战略配售20万股 | 询价有效价格1-5元 | 100-10万 | 询价 | 询价失败 |
| 920044 | 835775 | 竞价 | 网上80万股  战略配售16万股 | 申购价1-5元 | 100-4万 | 申购 | 申购失败 |

（三）新三板测试证券安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **品类** | **业务类型** | **证券代码** |
| 新三板股票 | 日常交易（集合竞价、做市、大宗交易、做市商互报等） | 430719、833044（基础层集合竞价股票）  870512、430659（创新层集合竞价股票）  832397、830806（基础层做市股票）  430335、834793（创新层做市股票） |
| 挂牌首日、放开涨跌幅 | 833044（基础层集合竞价股票）  834793（创新层做市股票） |
| 盘中紧急停牌 | 833044、430335 |
| 长期停牌 | 870520、834672 |
| 要约 | 基础层要约代码：841501  基础证券：430719  回购价格:1.6元/股  创新层要约代码：841502  基础证券：870512  回购价格:3.6元/股 |
| 行情发布：交易日8:30发布证券信息和证券行情 | 430719、833044、870512、430659、832397、830806、430335、834793、  870520、834672 |
| 新三板优先股 | 优先股交易（成交确认申报、定价申报） | 820039，基础券872916  820041，基础券837392 |
| 优先股停牌 | 820043 |
| 优先股紧急停牌 | 820039 |
| 优先股证券信息发布：XXQTYW其他业务字段回售、转股标志揭示 | 820039  820041  820043 |
| 新三板定向可转债 | 定向可转债交易 | 810004（基础券：873817）  810006（基础券：430616）  810008（基础券：430758） |
| 可转债紧急暂停转让 | 810008 |
| 定向可转债转股 | 810004（转股价格：10元/股）  810008（转股价格：10元/股） |
| 定向可转债回售 | 810004（回售价格：102元/张）  810006（回售价格：102元/张） |
| 盘中调整转股、回售状态为禁止 | 810008（禁止转股）  810006（禁止回售） |
| 盘中调整转股、回售状态为允许 | 810006（允许转股）  810008（允许回售） |
| 可转债行情发布及可转债证券信息发布：XXQTYW其他业务字段回售、转股标志揭示 | 810004  810006  810008 |

（四）两网退市测试证券安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **业务类型** | | **证券代码** |
| 两网股票 | 两网退市交易 | 400224（两网A，每周交易5次）  400077（两网A，每周交易1次）  400199（两网A，每周交易3次）  420016（两网B，每周交易5次）  420008（两网B，每周交易3次）  420011（两网B，每周交易1次） |
| 首日挂牌、放开涨跌幅 | 400224  420016 |
| 紧急停牌 | 400199 |
| 行情发布：交易日8:30发布证券信息和证券行情 | 400224、400077、400199、  420016、420008、420011 |
| 退市可转债 | 退市可转债交易 | 404002  404003 |
| 可转债紧急暂停转让 | 404002 |
| 可转债转股 | 404003（转股价格：10元/股） |
| 可转债回售 | 404002（回售价格：102元/张） |
| 盘中调整转股、回售状态为禁止 | 404003（禁止转股）  404002（禁止回售） |
| 盘中调整转股、回售状态为允许 | 404002（允许转股）  404003（允许回售） |
| 退市可转债行情发布及可转债证券信息发布：XXQTYW其他业务字段回售、转股标志揭示 | 404002  404003 |

七、全网测试数据准备

（一）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全网测试前一交易日（2024年11月29日）交易支持平台生产环境收盘行情（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

证券账户及持仓的初始信息以全网测试前一交易日（2024年11月29日）中国结算生产环境日终数据为准。

（三）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全网测试前一交易日（2024年11月29日）深证通生产环境闭市时数据为准。

（四）FDEP小站

证券公司用于接收交易支持平台下发文件的FDEP小站号以全网测试前一交易日（2024年11月29日）深证通生产环境闭市时数据为准。全国股转公司北交所FDEP小站号为k0903。

八、全网测试系统接入方式

（一）参测机构接入深证通

参测机构通过生产环境线路接入深证通提供的全网测试环境，如有问题，及时联系深证通。

（二）参测机构接入中国结算

参见中国结算测试方案。

（三）测试相关软件下载

本次测试所需的交易网关、行情网关均为现有生产版本，可通过深证通官网（http://biz.sscc.com/download.html）页面下载。

九、测试要求及注意事项

1.各参测机构应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，并指定专人负责全网测试工作。

2.本次测试包含应急场景测试。模拟故障发生后，当日公开发行（询价、申购等）全部暂缓，参测机构可依据结算下发的申购结果文件对申购冻结资金进行解冻。

3.开展全国股转系统、北交所业务的证券公司应参加测试并反馈报告，已开展融资融券或北交所做市交易业务的证券公司应安排参测相关业务场景。证券公司应通知租用其交易单元的基金公司参加测试。

4.开展全国股转系统、北交所业务的基金公司和提供全国股转系统、北交所行情服务的信息商建议参加测试。

5.在测试过程中，各参测机构应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群与全国股转公司北交所沟通联系。

6.测试结束后，各证券公司、基金公司和信息商应收集各自技术系统的测试情况，并于每次测试结束当日（2024年11月30日）18:00之前通过电子邮件向北交所提交测试报告（无需盖章），邮件主题和附件名称均为：机构名称+交易支持平台优化第四次全网测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。

十、联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **全网测试联系单位（人）** | **联系电话** |
| 北交所/全国股转公司  运行控制中心 | 010-63889855 |
| 深圳证券通信公司 | 0755-83182222（运行咨询）  0755-88666462（专线、VPN接入）  0755-88666464（交易、行情）  0755-88666470（CCNET、FDEP） |
| 测试QQ群 | 全国股转公司交易运行维护群：338167838  全国股转北交所技术通知群：536137764  全国股转北交所交易运行维护2群：362089063 |

北京证券交易所

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○二四年十一月