北交所股票启用新证券代码号段

仿真测试方案

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

二〇二四年二月

 **关于本文档**

|  |  |
| --- | --- |
| 文档名称 | 北交所股票启用新证券代码号段仿真测试方案 |
| 说明 |  |
| 修订历史 |
| 版本号 | 修改日期 | 修改说明 |
| V1.0 | 2024.2.1 | 创建本文档 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

**目 录**

[一、测试目的和背景 - 1 -](#_Toc157623417)

[二、参测机构 - 1 -](#_Toc157623418)

[三、参测技术系统 - 2 -](#_Toc157623419)

[四、仿真测试时间安排 - 2 -](#_Toc157623420)

[五、仿真测试内容 - 3 -](#_Toc157623421)

[六、测试场景及相关说明 - 4 -](#_Toc157623422)

[（一）公开发行测试证券及测试时间安排 - 4 -](#_Toc157623423)

[（二）日常交易测试证券及测试时间安排 - 7 -](#_Toc157623424)

[（三）测试要求和说明 - 8 -](#_Toc157623425)

[七、仿真测试数据准备 - 9 -](#_Toc157623426)

[（一）证券行情信息和证券信息 - 9 -](#_Toc157623427)

[（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 - 9 -](#_Toc157623428)

[（三）交易网关、行情网关和结算网关 - 10 -](#_Toc157623429)

[（四）FDEP小站 - 10 -](#_Toc157623430)

[八、仿真测试系统接入方式 - 10 -](#_Toc157623431)

[（一）参测机构接入深证通 - 10 -](#_Toc157623432)

[（二）参测机构接入中国结算 - 11 -](#_Toc157623433)

[（三）测试相关软件下载 - 11 -](#_Toc157623434)

[九、测试要求及注意事项 - 11 -](#_Toc157623435)

[十、联系方式 - 12 -](#_Toc157623436)

一、测试目的和背景

为验证北京证券交易所股票启用新证券代码号段技术系统准备情况，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. 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. 开展北交所业务的证券公司、基金公司
6. 提供北交所行情服务的信息商

三、参测技术系统

1. 北交所和全国股转公司交易支持平台仿真环境
2. 中国结算北京市场证券登记结算系统仿真测试环境
3. 深证通通信系统和金融数据交换平台（FDEP）仿真环境
4. 证券公司、基金公司、信息商相关测试环境

四、仿真测试时间安排

第一轮：2024年2月19日至2024年3月1日

第二轮：2024年3月4日至2024年3月15日

周一到周五全天开放测试环境。

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **交易时段** | **北交所连续竞价（融资融券、北交所做市交易）** | **公开发行** | **要约** | **优先股** | **可转债** |
| **询价** | **申购** |
| 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 | 要约申报 | 申报收单 | —— |
| 09:25 | 开盘集合竞价 |
| 09:30 | 连续竞价 |
| 实时撮合成交 |
| 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 | 实时撮合成交 |
| 14:00 |
| 14:57 |
| 15:00 | 收盘集合竞价 |
| 15:00-15:30 | 大宗交易 | —— | —— | —— | —— |
| 15:30 | 闭市 |

五、仿真测试内容

验证各参测机构技术系统已完成北交所股票启用新证券代码号段相关改造，达到上线要求。

1.验证北交所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、北交所的回报和行情数据。

4.验证各证券公司、基金公司能够正确发送各类委托，接收北交所返回的回报和行情数据并进行实时处理。

5.验证各提供北交所行情服务的信息商能够正确接收、处理、揭示北交所各类行情信息。

六、测试场景及相关说明

（一）公开发行测试证券及测试时间安排

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **证券代码** | **新三板基础券** | **方式** | **发行量** | **价格** | **申购上下限** | **发行日期** | **上市日期** |
| 920011 | 839001 | 定价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 2月23日申购2月26日配售 | 3月1日 |
| 920012 | 839002 | 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元申购价2元 | 100-10万 | 2月23日询价2月28日申购2月29日配售 | 3月6日 |
| 920013 | 839003 | 竞价 | 网上80万股战略配售16万股 | 申购价1-5元 | 100-4万 | 2月23日申购2月26日配售 | 3月1日 |
| 920014 | 839004 | 定价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 2月23日申购2月23日盘中紧急停牌2月27日恢复申购2月28日配售 | 3月5日 |
| 920015 | 839005 | 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元申购价2元 | 100-10万 | 2月23、26日询价2月29日申购3月1日配售 | 3月7日 |
| 920016 | 839006 | 定价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 2月23日申购2月26日配售 | 3月1日 |
| 920017 | 839007 | 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元申购价2元 | 100-10万 | 2月26日询价2月29日申购3月1日配售 | 3月7日 |
| 920018 | 839008 | 竞价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价1-5元 | 100-4万 | 2月26日申购2月27日配售 | 3月4日 |
| 920019 | 839009 | 定价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 2月27日申购2月28日配售 | 3月5日 |
| 920020 | 839010 | 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元申购价2元 | 100-10万 | 2月28、29日询价3月5日申购3月6日配售 | 3月12日 |
| 920021 | 839011 | 定价 | 网上80万股战略配售16万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 3月1日申购3月4日配售 | 3月8日 |
| 920022 | 839012 | 竞价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价1-5元 | 100-4万 | 3月5日申购3月6日配售 | 3月12日 |
| 920023 | 839013 | 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元申购价2元 | 100-10万 | 3月1日询价3月6日申购3月6日盘中紧急停牌3月8日恢复申购3月11日配售 | 3月15日 |
| 920024 | 839014 | 定价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 3月6日申购3月7日配售 | 3月13日 |
| 920025 | 839015 | 竞价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价1-5元 | 100-4万 | 3月7日申购3月8日配售 | 3月14日 |
| 920026 | 839016 | 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元申购价2元 | 100-10万 | 3月6日询价3月11日申购3月12日配售 | 3月15日 |
| 920027 | 839017 | 竞价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价1-5元 | 100-4万 | 3月8日申购3月11日配售 | 3月15日 |
| 920028 | 839018 | 定价 | 网上80万股战略配售20万股 | 申购价2元 | 100-4万 | 3月11日申购3月12日配售 | 3月15日 |
| 920029 | 839019 | 询价 | 网上400万股网下600万股 | 询价有效价格1-5元申购价2元 | 100-1000 | 3月11、12日询价3月15日申购失败 | —— |
| 920030 | 839020 | 定价 | 网上1000万股 | 申购价2元 | 100-1000 | 3月13日申购失败 | —— |

（二）日常交易测试证券及测试时间安排

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **业务类型** | **证券代码** | **测试日期** |
| 常规业务 | 北交所上市首日 | 920001-920010 | 2月20日 |
| 920011-920028 | 参考公开发行测试证券上市日期 |
| 盘中紧急停牌（次日复牌） | 920003 | 第一轮：2月21日第二轮：3月6日 |
| 920004 | 第一轮：2月28日第二轮：3月13日 |
| 长期停牌 | 920005 | 第一轮：2月22日第二轮：3月7日 |
| 复牌 | 920005 | 第一轮：2月27日第二轮：3月12日 |
| 暂停融资融券业务（次日恢复） | 920006暂停可融资 | 第一轮：2月22日第二轮：3月7日 |
| 920007暂停可融券 | 第一轮：2月28日第二轮：3月12日 |
| 股票除权除息 | 920008（每10股送一股） | 第一轮：2月22日第二轮：3月5日 |
| 920009（每10元派送1元） | 第一轮：2月22日第二轮：3月5日 |
| 920011（每10元送一股派送一元） | 第一轮：3月5日第二轮：3月12日 |
| 其他业务场景 | 要约 | 要约代码：840050基础证券：920001 | 2月20日预受要约3月8日要约截止回购价格:6元/股 |
| 优先股 | 820050新三板基础券：839001上市后基础券：920011 | 3月1日前停牌3月1日恢复交易 |
| 可转债 | 810050新三板基础券：839011上市后基础券：920021 | 2月19日至2月29日停牌、可转股2月29日至3月7日停牌、不可转股3月8日复牌、可转股3月29日转股截止转股价格:3元/股 |
| 行情发布 | 交易日8:30通过行情公告发布发行券、标的证券、担保证券等各类行情信息 |  | 全周期 |
| 数据报送 | 通过FDEP报送合格投资者、营业部信息、融资融券业务数据、违约数据 |  | 全周期 |

（三）测试要求和说明

北交所股票启用新证券代码号段，在公开发行期间和上市阶段均使用同一证券代码。各市场机构应验证上市前一日日终能够正确完成新三板数据切换为北交所数据的处理，包括但不限于持仓数据、曾持有数据、冻结数据等。

北交所股票上市首日起产生新的交易行情、信息披露等内容，新代码和原新三板代码不做关联，各市场机构进行行情揭示时应做好新老划断处理。

其它测试要求和说明如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **测试证券** | **测试场景** | **测试要求和说明** |
| 测试券发行途中 | 询价、申购申报 | 能够正常进行询价申报、申购申报，正常冻结资金，支持报单查询，申报上下限参照北交所下发的信息库。 |
| 配售 | 可根据结算返回的拉单数据、配售数据完成资金的解冻、扣款等动作 |
| 行情发布 | 能够正确接收并处理证券信息库，正常揭示三类发行信息。 |
| 数据接收 | 证券公司能正确接收和处理北交所通过FDEP下发的NQQR??????.DBF文件，根据文件内容控制网下投资者申购权限和申购数量。 |
| 测试券上市后 | 日间交易 | 能够正常进行市价、限价委托申报、大宗交易、融资融券等日间交易申报及各类非交易申报，能够正常接收北交所返回的回报和成交结果，正常冻结资金和清算交收。北交所做市商能正常履行报价义务。 |
| 行情发布 | 证券公司、信息商等能正确接收和处理各类行情文件。 |
| 数据接收 | 证券公司能正确接收和处理北交所通过FDEP下发的适当性、董监高、大股东、信用违约汇总等各类文件，。 |

七、仿真测试数据准备

（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2024年2月8日（周四）（第一轮）和2024年3月1日（周五）（第二轮）北交所仿真测试环境收盘行情（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2024年2月8日（周四）（第一轮）和2024年3月1日（周五）（第二轮）中国结算仿真测试环境日终数据为准。

（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2024年2月8日（周四）（第一轮）和2024年3月1日（周五）（第二轮）深证通仿真测试环境闭市时数据为准。

（四）FDEP小站

证券公司用于接收北交所下发文件的FDEP小站号以2024年2月8日（周四）（第一轮）和2024年3月1日（周五）（第二轮）深证通仿真测试环境闭市时数据为准。北交所FDEP小站号为k0903。

八、仿真测试系统接入方式

（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.sscc.com |
| 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，并指定专人负责本次仿真测试工作。

2.开展北交所业务的证券公司应参加测试，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。

3.开展北交所业务的基金公司和提供北交所行情服务的信息商应参加测试。

4.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群与北交所沟通联系。

5.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，并于测试结束当日（第一轮：2024年3月1日，第二轮：2024年3月15日）17:00之前通过电子邮件提交测试报告（无需盖章），邮件主题和附件名称均为：机构名称+北交所股票启用新证券代码号段第N轮仿真测试报告，收件邮箱为：techservice@neeq.com.cn。

十、联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **仿真测试联系单位（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○二四年二月