**附件1**

工程技术文档

全国中小企业股份转让系统

要约业务第二轮仿真测试方案

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

二〇一九年八月

**关于本文档**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 文档名称 | 全国中小企业股份转让系统要约业务第二轮仿真测试方案 | |
| 说明 |  | |
| 修订历史 | | |
| 版本号 | 修改日期 | 修改说明 |
| V0.1 | 2019.8.3 | 创建本文档 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

**目 录**

[1 测试目的和背景 1](#_Toc14515325)

[2 参测机构 1](#_Toc14515326)

[3 参考技术规范 1](#_Toc14515327)

[4 参测技术系统 2](#_Toc14515328)

[5 仿真测试时间安排 2](#_Toc14515329)

[6 仿真测试内容 3](#_Toc14515330)

[7 仿真测试数据准备 7](#_Toc14515331)

[7.1 挂牌情况、证券行情信息和证券信息 7](#_Toc14515332)

[7.2 证券账户、交易单元、托管单元及持仓 10](#_Toc14515333)

[7.3 指数行情发布内容 10](#_Toc14515334)

[7.4 挂牌公司分层信息 11](#_Toc14515335)

[7.5 投资者适当性 11](#_Toc14515336)

[7.6 定向行情发布 11](#_Toc14515337)

[7.7 交易网关、行情网关和结算网关 11](#_Toc14515338)

[7.8 分红派息信息 12](#_Toc14515339)

[8 仿真测试系统接入方式 12](#_Toc14515340)

[8.1 参测机构接入深证通 12](#_Toc14515341)

[8.2 参测机构接入中国结算 12](#_Toc14515342)

[8.3 测试相关软件下载 13](#_Toc14515343)

[9 测试要求及注意事项 13](#_Toc14515344)

[10 联系方式 14](#_Toc14515345)

1. 测试目的和背景

为验证各市场参与者技术系统对于要约收购业务和要约回购业务（以下简称“要约业务”）的技术准备情况，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”）共同搭建仿真测试环境。

仿真测试各参与者请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，保证仿真测试的有效性。

1. 参测机构
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. 各主办券商、做市商、信息商、基金公司、托管行
6. 参考技术规范
7. 《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要约收购业务（V1.0）》
8. 《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范(V1.42)》
9. 参测技术系统
10. 全国中小企业股份转让系统交易支持平台仿真测试环境
11. 中国证券登记结算有限责任公司新三板登记结算仿真测试环境
12. 深圳证券通信系统仿真测试环境
13. 各主办券商、做市商、信息商、基金公司、托管行相关测试环境
14. 仿真测试时间安排

本次仿真测试时间为2019年8月12日至2019年8月23日，周一到周五全天开放测试环境。

具体时间见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **时间** | **全国股转系统重点测试内容** | **参测机构重点测试内容** |
| 8:30 | 发送初始行情库，当日证券信息库等。 | 接收初始行情库、证券信息库等。 |
| 9:15-9:30 | **要约申报处理，确认回报处理；**集合竞价转让限价申报处理；做市转让做市申报、限价申报处理；优先股协议转让定价申报、成交确认申报、互报成交确认申报处理，成交回报和行情信息发送。 | **要约申报处理，确认回报处理；**集合竞价转让限价申报；做市转让限价申报；优先股协议转让定价申报、成交确认申报、互报成交确认申报。  查看各种申报处理状态，成交回报情况、行情揭示情况。 |
| 9:30-11:30 | **要约申报处理，确认回报处理；**集合竞价转让限价申报处理、成交回报和行情信息发送；做市转让做市申报处理、限价申报处理、成交回报和行情信息发送；优先股协议转让定价申报、成交确认申报、互报成交确认申报处理；两网及退市股票限价申报处理，成交回报和行情信息发送。 | **要约申报处理，确认回报处理；**集合竞价转让限价申报；做市转让限价申报；优先股协议转让定价申报、成交确认申报、互报成交确认申报；两网及退市股票限价申报。  查看各种申报处理状态，成交回报情况、行情揭示情况。 |
| 11:30-13:00 | 中午休市，不接受申报处理。 | 模拟中午休市业务。 |
| 13:00-15:00 | **要约申报处理，确认回报处理；**集合竞价转让限价申报处理、成交回报和行情信息发送；做市转让做市申报处理、限价申报处理、成交回报和行情信息发送；优先股协议转让定价申报、成交确认申报、互报成交确认申报处理；两网及退市股票限价申报处理，成交回报和行情信息发送。 | **要约申报处理，确认回报处理；**集合竞价转让限价申报；做市转让限价申报；优先股协议转让定价申报、成交确认申报、互报成交确认申报；两网及退市股票限价申报。  查看各种申报处理状态，成交回报情况、行情揭示情况。 |
| 15:00-15:30 | 协议转让成交确认申报处理，做市商间互报成交确认申报处理，成交回报和行情信息发送。  适当性数据接收处理。 | 查看各种申报处理状态，成交回报情况、行情揭示情况。  报送适当性数据。 |
| 15:30-18:30 | 中国结算进行当日的清算交收处理。 | 根据中国结算下发的清算交收数据进行日终准备。 |
| 18:30-20:30 | 按照中国结算数据接口进行系统处理。  下发投资者适当性管理汇总信息库和受限投资者可交易证券信息库。 | 主办券商完成当日数据清算和对账。  接收投资者适当性管理汇总信息库和受限投资者可交易证券信息库。 |

1. 仿真测试内容

本次仿真测试主要内容为：

1. 验证全国股转系统能正确对要约申报进行检查、返回确认结果；

2．验证中国结算新三板登记结算系统能够根据确认结果进行日终处理，生成日终数据并发布；

3．验证深证通通信系统能够正确转发主办券商的要约申报数据和全国股转系统的确认结果；

4. 验证各主办券商、做市商、信息商、基金公司能够正确接收要约委托并申报，接收全国股转系统返回的确认结果并进行实时处理，接收中国结算发布的日终数据并完成清算交收。

5. 验证各托管行能够正确接收中国结算发布的日终数据并完成清算交收。

相关测试场景安排如下（下述T日表示业务实际发生日期）：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **测试业务** | **测试场景** | **测试证券** |
| **【业务1】：要约申报业务** | 1. 测试各主办券商技术系统支持要约申报业务：只有要约代码才允许提交要约申报，非要约代码不能提交要约申报，要约代码不支持提交非要约申报。 2. 测试各做市商技术系统支持要约申报业务：只能申报正在做市证券的要约业务，只有要约代码才允许提交要约申报，非要约代码不能提交要约申报，要约代码不支持提交非要约申报。 3. 测试各基金公司技术系统支持要约申报业务：只有要约代码才允许提交要约申报，非要约代码不能提交要约申报，要约代码不支持提交非要约申报。 4. 测试各技术系统生成要约申报时合同序号、证券账户、证券代码、业务类别、申报价格、申报数量、股份性质等申报要素符合数据接口规范的填写要求。 5. 测试9:15前、11:30-13:00、15：30后全国股转系统不接受要约申报；测试9:15-11:30、13:00-15:00全国股转系统接受要约申报并予以处理（包括无效申报撤单返回以及撤单申报处理等）；测试15:00-15:30全国股转系统接收要约申报后直接撤单返回。 6. 测试要约申报价格等于要约收购/回购价格。 7. 测试要约申报数量必须是大于0的整数。 8. 测试预受要约申报按要求冻结股份，成功撤单后正确解冻冻结的股份。 9. 测试撤回预受要约申报不解冻股份，成功撤单后也不解冻股份。 10. 测试预受要约申报和撤回预受要约申报返回确认回报后可以提交撤单申报。 11. 测试符合申报限售条件股份情形的，可以申报限售股份（本次测试安排全面要约才接受任意股份性质的要约申报，部分要约只接受股份性质为非限售流通股的要约申报）。 12. 测试无相应股份性质的持仓时不能提交该类股份性质的要约申报。 13. 测试各主办券商周边技术系统在投资者输入要约代码时能自动关联显示标的券相关信息。 | 840000-840008、841000-841008 |
| **【业务2】要约回报业务** | 1. 测试只有9:15-11:30、13:00-15:00的要约申报才处理，15:00-15:30的要约申报直接废单，其他时段的要约申报不做处理。 2. 测试要约申报返回确认回报后股份处理正确。 | 840000-840008、841000-841008 |
| **【业务3】要约信息揭示** | 1. 测试行情揭示系统（包括但不限于网上交易、现场热自助、手机炒股等）能够以置顶或显著方式揭示要约信息。 2. 测试行情揭示系统能够揭示挂牌公司股票的要约状态及相应的要约信息。 3. 检查证券信息（NQXX.DBF）和证券行情（NQHQ.DBF）接收到的内容完整、准确，测试行情揭示系统能够及时、准确地揭示相关信息，包括收购/回购价格、要约业务状态、收购/回购期间等。 4. 检查要约期结束前两个转让日，其他业务状态为“要约截止期”。 5. 检查挂牌公司股票存在要约业务时，其他业务状态为“处于要约期”。 | 840000-840008、841000-841008 |
| **【业务4】常规停复牌业务** | 1. 测试T日挂牌公司股票停牌时，其要约代码状态不变，仍能正常接受要约申报。 | 430074（840000）  430002（841000） |
| **【业务5】盘中紧急停牌业务（含紧急公告，紧急停牌时间为10点左右）** | 1. 测试T日挂牌公司股票紧急停牌后，其要约代码状态不变，仍能正常接受要约申报。 2. 检查T日要约代码紧急停牌后，停牌标志为“停牌，不接收申报”。 3. 测试要约代码紧急停牌后不接受要约申报，返回的错误代码正确，错误原因清晰、明了。 | 430318（840001）  830772（841001）  840000  841000 |
| **【业务6】除权除息业务** | 1. 测试T日除权除息股票其要约代码的收购/回购价格同步除权除息，且除权除息价格不小于0。 2. 测试T日要约除权除息价格为0时，仍能正常接受要约申报。 | 430090（840002）  430032（841002） |
| **【业务7】 转让方式变更业务** | 1. 测试挂牌公司股票转让方式变更后要约业务不受影响。 | 430304（840003）  830830（841003） |
| **【业务8】 做市商加入/退出某只股票做市** | 1. 测试T日做市商加入或退出为挂牌公司股票做市后该挂牌公司股票的要约收购/回购业务不受影响。 | 430130（840004）  830821（841004） |
| **【业务9】交易控制业务** | 1. 测试进行挂牌公司股票要约申报时，各相关技术系统是否严格、自动执行预受要约申报冻结股份的指令。 2. 测试在要约业务截止期间，不能申报撤回预受要约。 3. 测试预受要约申报撤单成功后，撤单部分的股份可以卖出。 | 840000-840008、841000-841008 |
| **【业务10】经纪业务系统投资者适当性管理业务** | 1. 测试证券账户参与要约业务的交易权限是否参照技术系统目前适当性管理的交易权限控制执行。 | 840000-840008、841000-841008 |
| **【业务11】市场分层级别调整** | 1. 测试挂牌公司股票市场层级变更后要约业务不受影响。 | 830823（840005）  830824（841005） |
| **【业务12】要约终止** | 1. 测试要约终止后预受要约冻结部分正确解冻。 2. 检查要约终止或结束后，证券信息（NQXX.DBF）和证券行情（NQHQ.DBF）不再发布该要约相关信息。 | 840006  841006 |
| **【业务13】摘牌业务** | 1. 测试标的券摘牌后其对应的要约业务全部终止。 | 430093（840007）  430101（841007） |
| **【业务14】**  **要约中止** | 1. 测试中止要约恢复后，能正常接受要约申报。 2. 测试中止要约恢复后，要约结束日期按自然日顺延，截止期为最近两个交易日。 3. 检查要约中止时，停牌标志为“停牌，接收申报”，要约结束日期变更为99991231。 4. 测试要约中止期间，只接受撤回预受申报及相应的撤单申报，不接受预受申报。 | 840006  840008 |
| **【业务14】**  **其他业务** | 1. 测试其他业务仍能正常开展。 | 所有两网退市股票、优先股、集合竞价股票、做市股票的常规业务 |

1. 仿真测试数据准备
   1. 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2019年8月9日（周五）全国股转系统仿真测试环境收盘行情（NQHQ.DBF）和证券信息（NQXX.DBF）为准。

本次测试要约信息如下：

|  |  |
| --- | --- |
| **证券代码** | **证券信息** |
| 840000 | 股票简称：要约收1； 要约类型：部分要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430074 拟收购数量：500万股  收购价格：5.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190815 |
| 841000 | 股票简称：要约回1； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430002 拟收购数量：600万股  收购价格：5.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190815 |
| 840001 | 股票简称：要约收2； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430318 拟收购数量：700万股  收购价格：6.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190819 |
| 841001 | 股票简称：要约回2； 要约类型：部分要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：830772 拟收购数量：800万股  收购价格：6.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190819 |
| 840002 | 股票简称：要约收3； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430090 拟收购数量：500万股  收购价格：7.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 841002 | 股票简称：要约回3； 要约类型：部分要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430032 拟收购数量：600万股  收购价格：7.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 840003 | 股票简称：要约收4； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430304 拟收购数量：700万股  收购价格：8.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 841003 | 股票简称：要约回4； 要约类型：部分要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：830830 拟收购数量：800万股  收购价格：8.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 840004 | 股票简称：要约收5； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430130 拟收购数量：500万股  收购价格：9.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 841004 | 股票简称：要约回5； 要约类型：部分要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：830821 拟收购数量：600万股  收购价格：9.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 840005 | 股票简称：要约收6； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：830823 拟收购数量：700万股  收购价格：10.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 841005 | 股票简称：要约回6； 要约类型：部分要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：830824 拟收购数量：800万股  收购价格：10.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 840006 | 股票简称：要约收7； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430033 拟收购数量：500万股  收购价格：11.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 841006 | 股票简称：要约回7； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430033 拟收购数量：500万股  收购价格：11.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |
| 840007 | 股票简称：要约收8； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430093 拟收购数量：500万股  收购价格：12.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190816 |
| 841007 | 股票简称：要约回8； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430101 拟收购数量：500万股  收购价格：12.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190816 |
| 840008 | 股票简称：要约收9； 要约类型：部分要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：430033 拟收购数量：500万股  收购价格：11.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190817 |
| 841008 | 股票简称：要约回9； 要约类型：全面要约  证券级别：R-其他类型； 转让类型：O-其他类型；  基础证券：856001 拟收购数量：500万股  收购价格：11.00元  起始日期：20190812 结束日期：20190821 |

各测试业务场景时间安排如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **业务类型** | | **证券代码** | **备注** |
| 常规停牌股票 | | 430074（做市）  430002（集合竞价） | 停牌日期为2019年8月13日，长期停牌 |
| 紧急停牌股票 | | 430318（做市）  830772（集合竞价）  840000（要约收购）  841000（要约回购） | 停牌日期为2019年8月15日，停牌一天 |
| 常规复牌股票 | | 430074（做市）  430002（集合竞价） | 复牌日期为2019年8月15日 |
| 除权除息股票 | | 430090（做市）  430032（集合竞价） | 除权除息日为2019年8月16日 |
| 转让方式调整股票 | 集合竞价转做市 | 430304 | 调整日期为2019年8月19日 |
| 做市转集合竞价 | 830830 |
| 做市场加入/退出股票 | 做市商加入做市股票 | 430130 | 调整日期为2019年8月20日 |
| 做市商退出做市股票 | 830821 |
| 市场层级调整 | 基础层变为创新层 | 830823（集合竞价） | 调整日期为2019年8月21日 |
| 创新层变为基础层 | 830824（集合竞价） |
| 要约中止 | | 840006（要约收购） | 中止日期为2019年8月15日 |
| 840008（要约收购） | 中止日期为2019年8月13日 |
| 要约终止 | | 840006（要约收购）  841006（要约回购） | 终止日期为2019年8月16日 |
| 要约恢复 | | 840008（要约收购） | 恢复日期2019年8月14日 |
| 常规摘牌股票 | | 430093（做市）  430101（集合竞价） | 摘牌日期为2019年8月14日 |

* 1. 证券账户、交易单元、托管单元及持仓

证券账户、交易单元、托管单元及持仓的初始信息以2019年8月9日（周五）全国股转系统和中国结算仿真测试产环境日终数据为准。

本次测试使用的账户信息见附件2。每个参测机构的上述账户允许买卖业务场景所涉及的股票的非限售流通股的初始持仓为88，888股，高管锁定股的初始持仓为66，666股。

* 1. 指数行情发布内容

本次测试不模拟生成指数数据。

* 1. 挂牌公司分层信息

所有挂牌公司股票证券代码最末一位为“1、3、5、7、9”之一的，初始市场层级为基础层。

所有挂牌公司股票证券代码最末一位为“2、4、6、8、0”之一的，初始市场层级为创新层。

* 1. 投资者适当性

所有投资者的初始适当性状态以2019年8月9日（周五）全国股转系统仿真测试环境日终数据为准。

本次参测各主办券商所使用测试账户的适当性情况见附件2。

* 1. 定向行情发布

所有交易单元定向行情接收的初始权限以2019年8月9日（周五）全国股转系统仿真测试环境闭市时数据为准。

本次参测各机构所使用的经纪类交易单元均默认开通定向行情接收权限。

* 1. 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2019年8月9日（周五）全国股份转让系统、中国结算和深证通仿真测试环境闭市时数据为准。

* 1. 分红派息信息

|  |  |
| --- | --- |
| **证券类型** | **分派方案** |
| 挂牌公司做市转让股票 | 430090分派方案  红股：每10股送10股  派息：个人、机构投资者每10股派100元 |
| 挂牌公司集合竞价转让股票 | 430032分派方案  红股：每10股送10股 |

1. 仿真测试系统接入方式
   1. 参测机构接入深证通

参测机构通过仿真测试环境线路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 |
| FDEP | 172.200.1.182:7015/7016 |

* 1. 参测机构接入中国结算

参见中国结算要约业务相关测试方案。

* 1. 测试相关软件下载

本次测试需要升级股转通信程序。深证通将在QQ群上传测试用股转通信程序。

1. 测试要求及注意事项
2. 各参测机构应根据《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要约收购业务（V1.0）》、《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范(V1.42)》和本次测试方案（附件1），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。
3. 各主办券商的经纪系统必须参加本次测试，确保至少有两种交易终端（其中至少有一种为非现场方式）和两种行情终端能满足业务要求。
4. 建议各拟开展要约业务的主办券商的做市系统、自营系统和资管系统参加本次测试，若资管系统参加本次测试，应当同时通知为其开展托管结算业务的托管行参加测试。
5. 建议各拟开展要约业务的主办券商的做市系统、自营系统和资管系统参加本次测试，若资管系统参加本次测试，应当同时通知为其开展托管结算业务的托管行参加测试。
6. 各提供全国股转系统行情服务的信息商必须参加本次测试。
7. 在测试过程中，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。
8. 测试结束后，各主办券商应收集各自技术系统的测试情况，在2019年8月23日20：00之前通过BPM向全国股转系统提交测试报告（附件2，无需盖章）；各参测基金公司、信息商应在2019年8月23日20：00之前通过电子邮件向全国股转系统提交测试报告（无需盖章），邮件主题和附件名称均为：机构名称+要约业务第二轮仿真测试报告，收件邮箱为：[techservice@neeq.com.cn](mailto:techservice@neeq.com.cn)。
9. 联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **仿真测试联系单位（人）** | **联系电话** |
| 全国股份转让系统 | 010-63889721  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○一九年八月