股转系统办发〔2021〕109号附件3

工程技术文档

北京证券交易所开市第二次

全网测试方案

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

北京证券交易所

深圳证券通信有限公司

二〇二一年九月

**关于本文档**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 文档名称 | 北京证券交易所开市第二次全网测试方案 | |
| 说明 |  | |
| 修订历史 | | |
| 版本号 | 修改日期 | 修改说明 |
| V1.0 | 2021.9.19 | 创建本文档 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

**目 录**

[一．测试目的和背景 1](#_Toc83019719)

[二、参测机构 1](#_Toc83019720)

[三、参考技术规范 1](#_Toc83019721)

[四、参测技术系统 2](#_Toc83019722)

[五、测试时间安排 2](#_Toc83019723)

[六、测试内容 3](#_Toc83019724)

[七、测试场景 4](#_Toc83019725)

[（一）交易业务 4](#_Toc83019726)

[（二）发行业务 4](#_Toc83019727)

[八、测试数据准备 5](#_Toc83019728)

[（一）挂牌情况、证券行情信息和证券信息 5](#_Toc83019729)

[（二）证券账户、交易单元、托管单元及持仓 5](#_Toc83019730)

[（三）交易网关、行情网关和结算网关 5](#_Toc83019731)

[九、测试系统接入方式 5](#_Toc83019732)

[（一）参测机构接入深证通 5](#_Toc83019733)

[（二）参测机构接入中国结算 5](#_Toc83019734)

[十、测试要求及注意事项 5](#_Toc83019735)

[十一、联系方式 7](#_Toc83019736)

一．测试目的和背景

为验证各市场参与者技术系统对于北京证券交易所开市各类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”）、北京证券交易所（以下简称“北交所”）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”）、中证指数有限公司（以下简称“中证指数”）共同搭建测试环境供市场进行全网测试。

请各测试参与者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. 北京证券交易所
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. 中证指数有限公司
6. 证券公司、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. 《交易支持平台市场参与者技术系统开发指南V1.0》

四、参测技术系统

1. 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. 中证指数全网测试环境
5. 证券公司、信息商、基金公司及其托管机构相关测试环境

五、测试时间安排

本次全网测试时间为2021年10月9日，模拟一个完整交易日。

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **交易时段** | **北交所**  **上市股票** | **全国股转系统集合竞价股票** | | **全国股转系统做市股票** | **公开发行** | |
| **基础层** | **创新层** | **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 |
| 09:25 | 开盘集合竞价 | —— | —— | —— |
| 09:30 | 连续竞价 | 集合竞价 | 每10分钟一次集合竞价（含9:30） | 做市商双向报价 |
| 10:30 | 集合竞价 |
| 11:30 | 集合竞价 |
| 11:30 | 中午休市 | | | | | |
| 13:00 | 下午开市 | | | | | |
| 13:00 | 连续竞价 | —— | 每10分钟一次集合竞价(不含13:00) | 做市商双向报价 | 询价申报 | 申购申报 |
| 14:00 | 集合竞价 |
| 14:57 | —— |
| 15:00 | 收盘集合竞价 | 集合竞价 |
| 15:00-15:30 | 大宗交易 | | | 大宗交易、做市商互报实时确认 | —— | |
| 15:30 | 闭市 | | | | | |
| 17:00 | 日终清算 | | | | | |

六、测试内容

验证市场机构核心技术系统已按照《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)》《交易支持平台市场参与者技术系统开发指南V1.0》等技术规范的要求对北交所开市涉及的交易、行情等业务进行改造，达到上线要求。

1. 验证交易支持平台能够正确发布北交所上市公司和全国股转系统挂牌公司股票信息，正确对各类申报进行撮合处理。交易支持平台每3秒更新行情，各参测机构能够正确揭示行情和公告等信息。

2.验证中国结算新三板登记结算系统能够正确进行日终处理，生成日终数据并发布，各参测机构能够正常完成日终清算。

3.验证深证通通信系统能够正确转发证券公司、基金公司的委托数据和交易支持平台回报、行情数据，各参测机构能够正确处理。

4.验证各证券公司能够支持投资者开通/取消北交所合格投资者权限，并进行相应的权限控制。

5.验证各证券公司周边系统可提供便于投资者开展北交所交易的通用交易界面、快捷入口及专用入口，设立独立板块用于揭示北交所行情内容。验证信息商设立独立板块用于揭示北交所行情内容。以上须与沪深市场同级别，使用“BJ/北证/京市/北交所”等作为简称及市场标识。

七、测试场景

（一）交易业务

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **业务类型** | **证券代码** | **生效日期** |
| 上市首日 | 836800,836964 | 10月9日 |
| 长期停牌 | 833266,837242 | 10月9日 |
| 日间紧急停牌 | 835174,831768 | 10月9日 |
| 除权除息 | 838030（除权）,834765（除息）,836826（除权除息） | 10月9日 |
| 常规交易业务 | 全部证券 | —— |

（二）发行业务

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **发行方式** | **证券代码** | **发行代码** | **询价日期** |
| 询价发行 | 830899 | 889500 | 10月9日 |
| 询价发行 | 430193 | 889501 | 10月9日 |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **发行方式** | **证券代码** | **发行代码** | **申购日期** |
| 定价发行 | 430335 | 889502 | 10月9日 |
| 定价发行 | 830809 | 889503 | 10月9日 |
| 竞价发行 | 832800 | 889504 | 10月9日 |
| 竞价发行 | 832175 | 889505 | 10月9日 |

八、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10月8日（周五）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、交易单元、托管单元及持仓的初始信息以2021年10月8日（周五）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2021年10月8日（周五）深证通生产环境闭市时数据为准。

九、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。

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)》《交易支持平台市场参与者技术系统开发指南V1.0》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.各证券公司经纪系统须确保至少有两种交易终端（其中至少一种为非现场方式）和两种行情终端（其中至少一种为非现场方式）能满足业务要求。

3.基金公司参加本次测试的，应同时通知为其开展托管结算业务的托管机构参加测试。

4.提供北交所行情服务的信息商应参加本次测试。

5.参测机构在测试过程中如发现异常现象，请及时通过电话或QQ群上报。

6.测试结束后，参测证券公司应收集各自技术系统的测试情况，2021年10月9日18:00之前通过BPM提交测试报告（无需盖章）。各参测基金公司、信息商应按上述时间要求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+北京证券交易所开市第二次全网测试报告，收件邮箱为：[techservice@neeq.com.cn](mailto:techservice@neeq.com.cn)。

7.本次测试的数据仅为模拟测试使用，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.各参测单位须在测试完毕后，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

|  |  |
| --- | --- |
| **测试联系单位** | **联系电话** |
| 全国股转公司/北京证券交易所  运行控制中心 | 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

北京证券交易所

深圳证券通信有限公司

二○二一年九月