



附件

全国中小企业股份转让系统
市场参与者技术系统变更
指南之交易业务
(V1.3)

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

二〇一九年十一月



目录

一、说明.....	1
二、参考文档.....	1
三、变动简述.....	1
(一) 原有业务调整.....	1
1. 做市交易业务.....	1
2. 集合竞价交易业务.....	2
3. 大宗交易业务.....	3
(二) 新增连续竞价交易业务.....	3
1. 增加新的信息发布.....	5
2. 增加新的申报业务类型.....	9
3. 增加新的回报业务类型.....	15
4. 增加新的信息公告类型.....	18
5. 其他说明.....	18
四、数据接口规范修订说明.....	19
(一) 证券信息库 NQXX.DBF.....	19
(二) 证券行情库 NQHQ.DBF.....	20
(三) 申报库 NQWT.DBF.....	21
(四) 回报库 NQHB.DBF.....	22
(五) 分层信息公告文件 FCyymmdd.nnn.....	22
(六) 临时停牌信息公告文件 LTyymmdd.nnn.....	23

五、清算交收与税费标准.....	24
六、市场参与者技术系统注意事项.....	24
七、联系方式.....	26

一、说明

为便于各市场参与者和相应 IT 提供商更好地理解修订后的交易业务对相关技术系统的改造要求，做好技术系统的准备工作，全国股转系统专门编制和发布本指南。本指南包括业务申报、行情发送、信息发送等方面的内容，清算、交收方面的内容由中国证券登记结算有限责任公司另行发布。

本次变更参考技术文档为《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范 (V1.43)》(以下简称“数据接口规范”)，未涉及内容请参考现有业务实施规则、细则和制度。

特别提示：如果业务规则、细则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。

二、参考文档

《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范 (V1.43)》

三、变动简述

全国股转公司拟为进入精选层的挂牌公司股票提供连续竞价交易方式，同时修改涨跌幅限制、申报有效价格范围和最小交易单位，提高行情发布频率。本次修改内容如下：

(一) 原有业务调整

1. 做市交易业务

非做市商申报基本单位从 1000 股变更为 1 股，最小申

报数量从 1000 股变更为 100 股，不足 100 股必须一次性卖出。

做市商申报基本单位从 1000 股变更为 100 股，最小申报数量仍为 1000 股（余股一次性卖出例外），成交后不足 100 股的须需在 5 分钟内更新报价。报价价差不得超过 5% 或 2 个最小价格变动单位。

做市商盘后调库存的价格限制从不高于前收盘价的 200% 或当日已成交的最高价格中的较高者，且不低于前收盘价的 50% 或当日已成交的最低价格中的较低者，变更为不高于前收盘价的 130% 或当日已成交的最高价格中的较高者，且不低于前收盘价的 70% 或当日已成交的最低价格中的较低者。

行情揭示频率为 6 秒。

2. 集合竞价交易业务

申报基本单位从 1000 股变更为 1 股，最小申报数量从 1000 股变更为 100 股，不足 100 股必须一次性卖出。

基础层集合竞价股票的撮合频次从一天 1 次变更为一天 5 次。

创新层集合竞价股票的撮合频次从一天 5 次变更为一天 25 次。

基础层每次集中撮合前 3 分钟不准撤单。

创新层每次集中撮合前 3 分钟不准撤单。

最优一档买卖盘改为在买一卖一揭示。

支持终止挂牌决定作出后恢复交易期间的成交首日放开涨跌幅限制。

交易公开信息变更为每个交易日正常交易时段结束后，通过官方网站分别公布当日价格振幅达到 40% 的前 5 只股票、当日换手率达到 10% 的前 5 只股票的交易情况。

行情揭示频率为 6 秒。

3. 大宗交易业务

除做市股票和集合竞价股票外，采取连续竞价交易方式的股票也可以进行大宗交易。

大宗交易的成交价格从不高于一前收盘价的 200% 或当日已成交的最高价格中的较高者，且不低于前收盘价的 50% 或当日已成交的最低价格中的较低者，变更为不高于一前收盘价的 130% 或当日已成交的最高价格中的较高者，且不低于前一收盘价的 70% 或当日已成交的最低价格中的较低者。

大宗交易接收申报的时间变更为 9:15 至 11:30 ,13:00 至 15:30，确认时间不变。

(二) 新增连续竞价交易业务

全国股转系统对进入精选层的挂牌公司股票提供连续竞价交易业务。

连续竞价，是指对买卖申报逐笔连续撮合的竞价方式。

全国股转系统对采用连续竞价交易方式的股票提供开盘集合竞价和收盘集合竞价。

采用连续竞价交易方式的股票每个交易日的 9:15 至 9:25 为开盘集合竞价时间，9:30 至 11:30、13:00 至 14:57 为连续竞价时间，14:57 至 15:00 为收盘集合竞价时间。9:25 至 9:30 为静默期，不接受申报。

连续竞价交易的订单类型分为限价申报和市价申报两类，市价申报包括对手方最优申报、本方最优申报、最优五档即时成交剩余撤销和最优五档即时成交剩余转限价四种申报类型，市价申报仅允许在有价格涨跌幅限制的连续竞价时段可报，盘中临时停牌期间不接受市价申报。

连续竞价交易的价格涨跌幅限制为前收盘价的 $\pm 30\%$ ，股票进入精选层的成交首日除外。

连续竞价期间，限价申报的申报有效价格范围应当在涨跌幅限制以内，且买入申报价格不高于买入基准价格的 105%或不高于买入基准价格十个最小价格变动单位（以孰高为准），卖出申报价格不低于卖出基准价格的 95%或不低于卖出基准价格十个最小价格变动单位（以孰低为准）。

买入（卖出）基准价格，为即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格；无即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格的，为即时揭示的最高买入（最低卖出）价格；双方均无申报的，为最近成交价；当日无成交的，为前收盘价。

行情揭示频率为 6 秒。

1. 增加新的信息发布

连续竞价交易业务仍使用现有的证券信息库 NQXX.DBF 和证券行情库 NQH.Q.DBF 发布证券信息和实时行情，证券信息库和证券行情库的文件格式未作任何变更。

启用一类交易类型：B-集合竞价+连续竞价方式。

行情信息发布内容和范围如下：

证券行情文件	所含证券品种	发送对象
证券信息 (NQXX.DBF)	所有证券	全市场
证券行情(NQH.Q.DBF)	所有证券	

行情揭示频率为 6 秒。

(1) 证券信息

连续竞价交易业务需要揭示的证券信息内容见表 3-1。

表 3-1：证券信息

序号	证券信息内容	证券信息格式	填写说明
1	证券代码	6 位数字编码	
2	证券简称	8 位字符	
3	英文简称	20 位字符	
4	交易单位	4 位数字编码，整数	1
5	行业种类	5 位字符	
6	货币种类	2 位数字编码	
7	每股面值	7 位数字编码，小数点后 2 位	
8	总股本	12 位数字编码，整数	
9	非限售股本	12 位数字编码，整数	
10	上年每股收益	9 位数字编码，小数点后 4 位	
11	挂牌日期	8 位数字编码	CCYYMMDD

12	每笔限量	9 位数字编码，整数	1000000
13	买数量单位	6 位数字编码，整数	1
14	卖数量单位	6 位数字编码，整数	1
15	最小申报数量	9 位数字编码，整数	100
16	价格档位	5 位数字编码，小数点后 3 位	0.010
17	涨停价格	9 位数字编码，小数点后 3 位	
18	跌停价格	9 位数字编码，小数点后 3 位	
19	交易状态	1 位字母编码	
20	证券级别	1 位字母编码	‘T’-挂牌公司股票
21	交易类型	1 位字母编码	‘B’-集合竞价+连续竞价交易方式
22	停牌标志	1 位字母编码	
23	除权除息标志	1 位字母编码	
24	其他业务状态	4 位字母编码	

(2) 证券行情

连续竞价交易业务需要揭示的证券信息内容见表 3-2。

表 3-2：证券行情

序号	证券行情内容	证券行情格式	备注
1	证券代码	6 位数字编码	
2	证券简称	8 位字符	
3	昨日收盘价	9 位数字编码，小数点后 3 位	
4	今日开盘价	9 位数字编码，小数点后 3 位	
5	最近成交价	9 位数字编码，小数点后 3 位	
6	成交数量	12 位数字编码	
7	成交金额	17 位数字编码，小数点后 3 位	
8	最高成交价	9 位数字编码，小数点后 3 位	
9	最低成交价	9 位数字编码，小数点后 3 位	
10	价格升降 1	9 位数字编码，小数点后 3 位	
11	价格升降 2	9 位数字编码，小数点后 3 位	
12	买/卖价位一	9 位数字编码，小数点后 3 位	集合竞价期间参

			考成交价或最优一档买/卖价位； 连续竞价期间最优一档买/卖价位
13	买/卖数量一	12 位数字编码，整数	集合竞价期间匹配量或最优一档买/卖数量； 连续竞价期间最优一档买/卖数量
14	买/卖价位二	9 位数字编码，小数点后 3 位	集合竞价期间参考成交价； 连续竞价期间最优二档买/卖价位
15	买/卖数量二	12 位数字编码，整数	集合竞价期间未匹配量； 连续竞价期间最优二档买/卖数量
16	买/卖价位三	9 位数字编码，小数点后 3 位	连续竞价期间最优三档买/卖价位
17	买/卖数量三	12 位数字编码，整数	连续竞价期间最优三档买/卖数量
18	买/卖价位四	9 位数字编码，小数点后 3 位	连续竞价期间最优四档买/卖价位
19	买/卖数量四	12 位数字编码，整数	连续竞价期间最优四档买/卖数量
20	买/卖价位五	9 位数字编码，小数点后 3 位	连续竞价期间最优五档买/卖价位
21	买/卖数量五	12 位数字编码，整数	连续竞价期间最优五档买/卖数量

注：

a) 连续竞价期间，若买卖盘价格字段都不为空（都大

于零)时, 字段值有如下关系:

卖价位五 (HQSJW5) > 卖价位四 (HQSJW4) > 卖价位三 (HQSJW3) > 卖价位二 (HQSJW2) > 卖价位一 (HQSJW1);

买价位五 (HQBJW5) < 买价位四 (HQBJW4) < 买价位三 (HQBJW3) < 买价位二 (HQBJW2) < 买价位一 (HQBJW1)。

在集合竞价期间, 若当次能生成参考成交价则买卖盘一 (HQBJW1/HQBSL1 和 HQSJW1/HQSSL1) 显示集合竞价参考成交价、匹配量, 买卖数量二 (HQBSL2 和 HQSSL2) 显示对应未匹配量, 若当次不能生成参考成交价则买卖盘一 (HQBJW1/HQBSL1 和 HQSJW1/HQSSL1) 显示最优一档买卖盘, 若当次为撮合成交时点则揭示撮合结束后的最优五档买卖盘。

(3) 信息公告文件

分层公告文件新增一类市场层级: 精选层。

新增一类信息公告文件: LT-临时停牌公告, 用于揭示盘中临时停牌证券的相关公告信息。

(4) 公开信息

对于连续竞价交易业务, 每个交易日正常交易时段结束后, 全国股转系统通过官方网站分别公布当日收盘价涨跌幅

达到 20% 的前 5 只股票、当日价格振幅达到 30% 的前 5 只股票、当日换手率达到 20% 的前 5 只股票的交易情况。

对于大宗交易，每个交易日盘后交易结束后，全国股转系统通过官方网站逐笔公布成交信息，内容包括证券代码、证券简称、成交价格、成交数量、买卖双方主办券商证券营业部或交易单元的名称（若成交能找到对应的主办券商证券营业部，成交信息显示主办券商证券营业部名称，否则显示交易单元名称）。

交易公开信息涉及机构专用交易单元的，公布名称为“机构专用”。

2. 增加新的申报业务类型

连续竞价股票开展连续竞价交易业务和大宗交易业务仍使用现有的申报库 NQWT.DBF，申报库的文件格式未做任何变更。新增十一类申报业务类型：对手方最优申报买入、对手方最优申报卖出、对手方最优申报撤单、本方最优申报买入、本方最优申报卖出、本方最优申报撤单、最优五档即时成交剩余撤销买入、最优五档即时成交剩余撤销卖出、最优五档即时成交剩余转限价买入、最优五档即时成交剩余转限价卖出和最优五档即时成交剩余转限价撤单。连续竞价交易使用限价申报和市价申报，大宗交易使用成交确认申报。申报要素及填写格式见表 3-3。

表 3-3：申报要素

申报 内容	限价申报			成交确认申报		
	买入	卖出	撤单	买入	卖出	撤单
合同 序号	22 位编码：6 位交易单元代码（数字）、8 位申报日期（数字）、8 位申报流水号；申报流水号为 2 位证券营业部识别码（字母和数字）加上 6 位数字编码。					
证券 账户 号码	10 位数字编码，不足 10 位前补“0”					
证券 代码	6 位数字编码					
业务 类别	0B	0S	0C	3B	3S	3C
申报 价格	>0,价格最小变动单位 0.01 元		0	>0,价格最小变动单位 0.01 元		0
申报 数量	>0,整数，买卖最小申报数量为 100 股，买卖基本变动单位为 1 股，余股不足 100 股时必须一次性卖出。		0	>0,整数，买卖最小申报数量为 100 股，买卖基本变动单位为 1 股，余股不足 100 股时必须一次性卖出。买入申报数量必需与对手方申报数量一致。		0
拟成				6 位数字编码，必须填		

交对手方交易单元		写	
拟成交对手方证券账户号码		必须填写，填写要求同“证券账户号码”	
成交约定号		<1000000，数字编码，必须填写	
申报时间	6 位数字编码 (HHMMSS)		
处理标记	1 位编码		

申报内容	对手方最优申报			本方最优申报		
	买入	卖出	撤单	买入	卖出	撤单
合同序号	22 位编码：6 位交易单元代码 (数字)、8 位申报日期 (数字)、8 位申报流水号；申报流水号为 2 位证券营业部识别码 (字母和数字) 加上 6 位数字编码。					

证券 账户 号码	10 位数字编码，不足 10 位前补“0”					
证券 代码	6 位数字编码					
业务 类别	YB	YS	YC	XB	XS	XC
申报 价格	0					
申报 数量	>0,整数，买卖最小申报数量为 100 股，买卖基本变动单位为 1 股，余股不足 100 股时必须一次性卖出	0	>0,整数，买卖最小申报数量为 100 股，买卖基本变动单位为 1 股，余股不足 100 股时必须一次性卖出	0		
保护 限价	>0,价格最小变动单位 0.01 元	0	>0,价格最小变动单位 0.01 元	0		
申报 时间	6 位数字编码 (HHMMSS)					
处理 标记	1 位编码					

申报	最优五档即时成交剩余撤销	最优五档即时成交剩余转限价
----	--------------	---------------

内容	买入	卖出	买入	卖出	撤单
合同 序号	22 位编码：6 位交易单元代码（数字）、8 位申报日期（数字）、8 位申报流水号；申报流水号为 2 位证券营业部识别码（字母和数字）加上 6 位数字编码。				
证券 账户 号码	10 位数字编码，不足 10 位前补“0”				
证券 代码	6 位数字编码				
业务 类别	VB	VS	WB	WS	WC
申报 价格	0				
申报 数量	>0,整数,买卖最小申报数量为 100 股,买卖基本变动单位为 1 股,余股不足 100 股时必须一次性卖出				0
保护 限价	>0,价格最小变动单位以业务规则为准				0
申报 时间	6 位数字编码 (HHMMSS)				
处理 标记	1 位编码				

注：

(1) 限价申报内容包括合同序号、证券账户号码、证券代码、业务类别、申报价格、申报数量、申报时间、处理标记等。

(2) 成交确认申报成交内容包括合同序号、证券账户号码、证券代码、业务类别、申报价格、申报数量、拟成交对手方交易单元、拟成交对手方证券账户号码、成交约定号、申报时间、处理标记等。

(3) 市价申报内容包括合同序号、证券账户号码、证券代码、业务类别、申报价格、申报数量、保护限价、申报时间、处理标记等。

(4) 挂牌后未发生成交也无可参考前收盘价时，禁止做大宗交易业务。

(5) 当日买入的股票，当日不能做大宗交易业务。

(6) 申报价格不能超过价格涨跌幅范围的限制。价格范围以业务细则中公布的范围为准。申报价格下限不能小于 0。

(7) 对于成交确认申报，最大申报数量不作限制，但必须满足申报数量大于等于 10 万股或申报金额大于等于 100 万元的要求。

(8) 接收申报的时间安排如下：

时间	交易方式	接收申报类型
9:15-9:20	连续竞价（开盘集合竞价）	限价申报买入、卖出、撤单

9:20-9:25	连续竞价 (开盘集合竞价)	限价申报买入、卖出
9:25-9:30	连续竞价 (静默期)	不接受申报
9:30-11:30 13:00-14:57	连续竞价	限价申报买入、卖出、撤单 市价申报买入、卖出、撤单
14:57-15:00	连续竞价 (收盘集合竞价)	限价申报买入、卖出
9:15-11:30 13:00-15:30	大宗交易	成交确认申报买入、卖出、 撤单

3. 增加新的回报业务类型

连续竞价股票开展连续竞价交易业务和大宗交易业务仍使用现有的回报库 NQHB.DBF , 回报库的文件格式未做任何变更。新增四类回报业务类型：对手方最优申报撤单、本方最优申报撤单、最优五档即时成交剩余撤单、最优五档即时成交剩余转限价撤单。回报要素及填写格式见表 3-4。

表 3-4：回报要素

成交回报内 容	限价申报			成交确认申报		
	买入成 交回报	卖出成交 回报	撤单回 报	买入成 交回报	卖出成 交回报	撤单回 报
成交号码	8 位数字编码					
证券账户号 码	10 位字母和数字编码，同对应申报证券账户号码					
证券代码	6 位数字编码，同对应申报证券代码					
合同号码	22 位编码，同对应申报合同号码					
成交价格	撮合成交价格		0	同对应申报价格		0

成交数量	撮合成交数量		申报数 量的负 值	同对应申报数量		申报数 量的负 值
业务类别	0B	0S	0C	3B	3S	3C
撤单原因	详见数据接口规范描述					
成交时间	8 位数字编码，HHMMSSCC					
成交日期	8 位编码，YYYYMMDD					

成交回报内 容	对手方最优申报			本方最优申报		
	买入成 交回报	卖出成交 回报	撤单回 报	买入成 交回报	卖出成 交回报	撤单回 报
成交号码	8 位数字编码					
证券账户号 码	10 位字母和数字编码，同对应申报证券账户号码					
证券代码	6 位数字编码，同对应申报证券代码					
合同号码	22 位编码，同对应申报合同号码					
成交价格	撮合成交价格		0	同对应申报价格		0
成交数量	撮合成交数量		申报数 量的负 值	同对应申报数量		申报数 量的负 值
业务类别	0B	0S	YC	0B	0S	XC
撤单原因	详见数据接口规范描述					

成交时间	8 位数字编码，HHMMSSCC
成交日期	8 位编码，YYYYMMDD

成交回报内 容	最优五档即时成交剩余撤销			最优五档即时成交剩余转限价		
	买入成 交回报	卖出成交 回报	撤单回 报	买入成 交回报	卖出成 交回报	撤单回 报
成交号码	8 位数字编码					
证券账户号 码	10 位字母和数字编码，同对应申报证券账户号码					
证券代码	6 位数字编码，同对应申报证券代码					
合同号码	22 位编码，同对应申报合同号码					
成交价格	撮合成交价格		0	同对应申报价格		0
成交数量	撮合成交数量		申报数 量的负 值	同对应申报数量		申报数 量的负 值
业务类别	0B	0S	VC	0B	0S	WC
撤单原因	详见数据接口规范描述					
成交时间	8 位数字编码，HHMMSSCC					
成交日期	8 位编码，YYYYMMDD					

注：

(1) 连续竞价开盘集合竞价撮合时间为 9:25，收盘集合竞价撮合时间为 15:00；成交确认申报确认时间为 15:00 至

15:30。

(2) 市价申报的成交回报业务类别自动转换成限价申报的买卖成交回报。

4. 增加新的信息公告类型

增加新的信息公告文件类型：LT-临时停牌，表示精选层股票交易首日发生盘中临时停牌时向市场发送临时停牌公告文件，内容包括证券简称、证券代码、交易日期、停牌开始时间、停牌结束时间等信息，文件名为 LTyymmdd.nnn。

5. 其他说明

1、只对精选层的挂牌公司普通股票提供连续竞价交易方式，其他层级和类型的股票不提供连续竞价交易方式。

2、连续竞价股票正常交易时段的价格涨跌幅限制通过证券信息库的涨停价格和跌停价格字段对市场揭示，但申报有效价格范围不揭示。

3、对于连续竞价股票，在连续竞价业务上线后前收盘价即为可参考前收盘价。

4、对于连续竞价股票，至有成交首日，不设置价格涨跌幅限制，成交首日的次日起价格涨跌幅为前收盘价的 $\pm 30\%$ 。

5、对于连续竞价股票，连续竞价期间，限价申报的有效价格范围为买入申报价格不高于买入基准价格的 105%或

不高于买入基准价格十个最小价格变动单位（以孰高为准），卖出申报价格不低于卖出基准价格的 95% 或不低于卖出基准价格十个最小价格变动单位（以孰低为准）。

买入（卖出）基准价格，为即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格；无即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格的，为即时揭示的最高买入（最低卖出）价格；双方均无申报的，为最近成交价；当日无成交的，为前收盘价。

6、对于连续竞价股票，大宗交易的交易双方只能是投资者之间，做市商的做市账户不能对采用连续竞价交易方式的股票进行交易。

7、盘中临时停牌时不接受市价申报。

8、临时停牌复牌后对当前有效申报提供复牌集合竞价。

四、数据接口规范修订说明

（一）证券信息库 NQXX.DBF

（1）启用最小申报数量，通过 XXZXSBS（字段 23：最小申报数量）识别，用于存放除做市商外其他投资者在正常交易时段的每笔最小申报数量。

（2）启用交易类型‘B’，通过 XXZRLX（字段 36：交易类型）识别，用于标识该证券是属于提供开盘、收盘集合竞价的连续竞价股票。

（3）启用停牌标志‘H’，通过 XXTPBZ（字段 38：停牌

标志) 识别 , 用于标识该证券处于临时停牌状态 , 临时停牌期间继续接收申报。

(二) 证券行情库 NQH.QDBF

(1) 对于买卖盘的表述修订如下 :

b) 若是挂牌公司连续竞价股票 , 且买卖盘价格字段都不为空 (都大于零) 时 , 字段值有如下关系 (最优五档买卖盘)。

$HQSJW5 > HQSJW4 > HQSJW3 > HQSJW2 > HQSJW1 ;$

$HQBJW5 < HQBJW4 < HQBJW3 < HQBJW2 < HQBJW1。$

在集合竞价期间 , 买卖盘一 ($HQBJW1/HQBSL1$ 和 $HQSJW1/HQSSL1$) 显示集合竞价参考成交价、匹配量 , 买卖数量二 ($HQBSL2$ 和 $HQSSL2$) 显示对应未匹配量 , 买卖盘一 ($HQBJW1/HQBSL1$ 和 $HQSJW1/HQSSL1$) 揭示无参考成交价时的最优一档买卖盘 , 集合竞价撮合完毕时揭示最优五档买卖盘。

c) 若是挂牌公司集合竞价股票 , 买卖盘一 ($HQBJW1/HQBSL1$ 和 $HQSJW1/HQSSL1$) 显示集合竞价参考成交价、匹配量 , 买卖数量二 ($HQBSL2$ 和 $HQSSL2$) 显示对应未匹配量 , 买卖盘一 ($HQBJW1/HQBSL1$ 和 $HQSJW1/HQSSL1$) 显示无法生成参考成交价时的最优一档买卖盘。

(三) 申报库 NQWT.DBF

(1) 增加十一类申报业务类型：“YB”表示对手方最优申报买入、“YS”表示对手方最优申报卖出、“YC”表示对手方最优申报撤单、“XB”表示本方最优申报买入、“XS”表示本方最优申报卖出、“XC”表示本方最优申报撤单、“VB”表示最优五档即时成交剩余撤单买入、“VS”表示最优五档即时成交剩余撤单卖出、“WB”表示最优五档即时成交剩余转限价买入、“WS”表示最优五档即时成交剩余转限价卖出、“WC”表示最优五档即时成交剩余转限价撤单。

(2) 市价申报时申报价格 2 填写保护限价，保护限价指的是投资者买入时能接受的最高买价或卖出时能接受的最低卖价。

(3) 连续竞价申报的市价申报转为限价部分，在收盘集合竞价时可以直接参与收盘集合竞价。

(4) 大宗交易业务的申报时间改为 9:15 到 11:30 ,13:00 到 15:30，撮合时间不变。

(5) 大宗交易的申报价格区间为不高于前收盘价的 130%或当日已成交的最高价格中的较高者，且不低于前收盘价的 70%或当日已成交的最低价格中的较低者。

(6) 最小申报数量为 100 股，申报基本单位为 1 股，不足 100 股时必须一次性卖出。

(四) 回报库 NQHB.DBF

(1) 增加四类回报业务类型：“YC”表示对手方最优申报撤单、“XC”表示本方最优申报撤单、“VC”表示最优五档即时成交剩余撤单、“WC”表示最优五档即时成交剩余转限价撤单。

(2) 市价申报的成交回报业务类别自动转换成限价申报的买卖成交回报。

(五) 分层信息公告文件 FCyymmdd.nnn

(1) 增加新的市场层级后，分层信息公告文件的格式不变，数据分区及排序规则不变。

示例5：FC190101.001

发送日期: 20190101

发送时间: 08:30:00

信息类型: 分层信息

消息来源: 全国股转公司

主标题: 挂牌公司市场分层信息

副标题:

主题词: 公开信息，分层信息

TAG

3

839000|测试9000|创新层

839001|测试9001|基础层

839002|测试9002|精选层

END

(注：

分层信息公告文件的正文分为四段：

首行为数据区开始标签TAG；

次行为本次发布挂牌证券的总数；

第三行开始按行揭示所有已分层的挂牌证券的所属层级，每只证券用一行揭示，按证券代码从小到大的顺序排列，各字段之间用“|”分隔。

最末一行为数据区结束标签END。)

(六) 临时停牌信息公告文件 LTyymmdd.nnn

(1) 增加新的信息公告文件类型，用于告知市场证券被临时停牌，拟于何时恢复交易。

示例6：LT140801.001

发送日期: 20140801

发送时间: 10:06:30

信息类型: 紧急公告

消息来源: 全国股转公司

主标题: 关于测试代码 (831007) 盘中临时停牌的公告

副标题:

主题词: 临时停牌，831007

今日测试代码 (831007) 交易出现异常波动。根据《全

《全国中小企业股份转让系统股票交易规则》的有关规定，全国股转公司决定，自2014年08月01日10时06分00秒开始暂停测试代码（831007）交易，自2014年08月01日10时16分00秒起恢复交易。

本所提醒投资者注意交易风险，理性投资。

全国股转公司

2014年08月01日

五、清算交收与税费标准

中国结算对于交易业务的具体规定与要求以中国结算官网发布的文档为准。

六、市场参与者技术系统注意事项

1. 已开展全国股转技术系统经纪业务的主办券商至少应提供两种(其中至少一种为非现场的)交易终端和两种(其中至少一种为非现场的)行情终端支持连续竞价交易业务。

2. 主办券商经纪系统对投资者进行连续竞价交易业务的交易权限管理、适当性管理等应适用其对投资者对挂牌公司股票的各类权限管理。

3. 要求行情分析软件支持按不同交易方式分类揭示挂牌公司集合竞价股票、挂牌公司做市股票、挂牌公司连续竞价股票、两网公司及退市公司股票的行情。

4. 要求行情分析软件支持按不同市场层级分类揭示基础层、创新层、精选层挂牌公司股票的行情。

5. 连续竞价股票通过证券信息库和证券行情库揭示行情，可以向全市场发布，允许任何投资者查看。

6. 主办券商应根据该业务的目标投资者及业务风险属性，自行调整其柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等投资者委托渠道（可选择一种或多种渠道）中的相应前端系统，以支持连续竞价交易业务的交易。

7. 提供全国股转系统业务的周边系统应揭示证券采用的交易方式、所属层级及最近行情，对于连续竞价股票，应分时段明确揭示集合竞价时段的最近成交价、参考成交价、匹配量和未匹配量，无参考成交价时揭示最优一档行情，每次集合竞价成交后揭示最优五档行情，以及连续竞价时段的最优五档行情。

8. 主办券商应调整投资者委托时对于买卖基本单位的提示信息 and 校验。

9. 主办券商应调整投资者进行大宗交易委托时对于申报有效价格范围的提示信息 and 校验。

10. 主办券商应调整接收大宗交易委托的时间范围。

11. 做市商应根据业务规则自行控制最小申报数量（余股一次性卖出和大宗交易买入例外）。

12. 市价申报买入/卖出的成交回报为限价申报买入/卖出回报，主办券商应自行调整与原始申报的对应关系，正确

处理。

七、联系方式

联系单位/部门	联系电话
全国股转公司	400-626-3333
深圳证券通信公司	0755-83182222
QQ 群	338167838