

深圳证券交易所创业板市场证券公司技术准备指南

(2009-8-8, 供参考)

特别提示: 为便于证券公司等市场参与者和相应 IT 提供商更好地理解创业板市场的各项业务, 并尽快做好证券公司系统的技术准备工作, 深圳证券交易所(以下简称“我所”或“本所”)编写了该指南, 供有关单位参考。创业板股票的发行、上市、交易、登记、结算等业务, 除发布的创业板相关规则和相关通知外, 参照主板 A 股的业务规则。

与本技术指南相适应的《深圳证券交易所数据接口规范》版本号为 Ver4.55 及以上。

一、创业板市场基本要素

1、 股票代码

创业板股票代码使用【300000, 309999】区间, 一般按发行顺序依次编码。

2、 交易单元

具有 A 股交易权限的深市所有交易单元均可参与创业板交易(含申购)。

3、 证券账户

只允许 A 股证券账户中的适当投资者参与创业板的各项业务。

A 股证券账户中的适当投资者指: A 股机构投资者, 可实时开户并在开户当天参与创业板的各项业务; 具有两年以上(含两年)股票交易经验的自然人投资者, 在书面签署《风险揭示书》两个交易日后证券公司可为其开通创业板的交易权限; 尚未具备两年交易经验的自然人投资者, 应当就自愿承担市场风险抄录“特别声明”, 并在书面签署《风险揭示书》五个交易日后证券公司可为其开通创业板的交易权限。

4、 股份监控

证券公司技术系统应根据中国证券登记结算公司深圳分公司在前一交易日收市后提供的结算数据, 对投资者卖出委托(含限价委托、市价委托、大宗交易)进行股份监控, 不允许股份卖空(经有权职能部门批准的融资融券等业务另有规定的除外)。T 日买

入的股票，T 日不得卖出，T+1 日可以卖出。

5、 资金监控

证券公司技术系统应对投资者买入委托（含限价委托、市价委托、大宗交易）、新股申购、增发申购等申报进行资金监控，不允许资金买空（经有权职能部门批准的融资融券等业务另有规定的除外）。

6、 税费标准

创业板的交易佣金、经手费率等，参照在我所上市交易的主板 A 股标准执行。

二、创业板股票发行

创业板股票的发行代码为 30xxxx。

创业板股票网下发行，同中小板股票网下发行，使用我所和结算深圳分公司的网下发行电子平台。

创业板股票网上发行，同中小板股票网上发行，采用资金申购定价发行模式，使用现有的交易、结算数据接口（《深圳证券交易所数据接口规范》Ver4.55 及以上版本）。

三、创业板股票交易

创业板股票的交易代码为 30xxxx。其交易以竞价交易方式进行，符合规定的，也可进行大宗交易。除特别规定外，参照执行《深圳证券交易所交易规则》关于主板 A 股的相关规定。

1、 证券基本信息

通过证券信息库 SJSXX.dbf/新证券信息库 SJSXXN.dbf 发布给证券公司等市场参与者，供其技术系统使用或向投资者发布用。创业板股票上市交易时，挂牌的证券代码为 30xxxx；上市首日，证券信息库 SJSXX.dbf 中的交易状态（字段名为 XXJYZT）为“Y”，新证券信息库 SJSXXN.dbf 中的证券状态（字段名为 XXZQZT）为“Y”。

2、 竞价交易

通过委托库 SJSWT.dbf 申报限价委托、市价委托及其撤单申请；通过回报库 SJSHB.dbf 返回成交结果。限价委托、市价委托及其撤单申请的具体定义参见《深圳证券交易所数据接口规范》。

(1) 通过竞价交易买入创业板股票的，申报数量应当为 100 股或其整数倍。卖出创业板股票时，申报数量应当为 100 股或其整数倍，余额不足 100 股的部分，应当一次性申报卖出。

(2) 创业板首次公开发行股票上市首日，实施盘中股价异常波动临时停牌制度。

3、 大宗交易

参照主板 A 股，由证券公司交易员在我所综合协议交易平台的交易终端上完成协议交易的委托申报，委托申报时间为 9:15—15:30；综合协议交易平台在 15:00—15:30 进行成交确认，交易员可在交易终端上查询确认结果，也可通过回报库 SJSHB.dbf 查询确认结果。

四、创业板增发

创业板增发时，将加挂专用证券代码 37xxxx，后四位与股票交易代码 30xxxx 的后四位相同。

相关数据接口同主板 A 股增发业务。其中，证券信息库 SJSXX.dbf 中 37xxxx 证券的交易状态（字段名为 XXJYZT）为“F”；新证券信息库 SJSXXN.dbf 中 37xxxx 证券的证券状态（字段名为 XXZQZT）为“F”，30xxxx 证券的证券简称前缀（字段名为 XXJCQZ）第三位为“J”。

五、创业板配股

创业板配股认购时，将加挂专用证券代码 38xxxx，后四位与股票交易代码 30xxxx 的后四位相同。

相关数据接口同主板 A 股配股业务。其中，新证券信息库 SJSXXN.dbf 中 30xxxx 证券的证券简称前缀（字段名为 XXJCQZ）第三位为“J”。

六、创业板上市公司交易系统网络投票

创业板上市公司通过交易系统开展股东大会网络投票时，将加挂专用证券代码 36xxxx，创业板网络投票的证券代码使用【365000，368999】区间，根据对应股票的交易代码顺序编码，即 300001 股票的网络投票代码为 365001、301001 的网络投票代码为 366001，依次类推。

相关数据接口同主板上市公司交易系统网络投票业务。其中，新证券信息库 SJSXXN.dbf 中 30xxxx 证券的网络投票标志（字段名 XXWLTP）为“T”、证券简称前缀（字段名为 XXJCQZ）第三位为“V”。

与现有 A 股的网络投票指令一样，通过委托库 SJSWT.dbf 申报网络投票指令。

通过投票库 SJSTP.dbf 返回从交易系统所下达网络投票指令的累计预处理结果，详见《交易系统投票结果回报数据接口》，网络投票的实际处理结果最终由上市公司按照《深圳证券交易所上市公司股东大会网络投票实施细则》确认。

七、创业板股票的非交易业务指令申报

与现有主板 A 股、中小板股票的非交易业务指令申报一样，创业板股票的转托管、质押、要约收购等非交易业务指令也是通过委托库 SJSWT.dbf 进行申报的，申报指令中的证券代码字段填对应创业板股票的交易代码 30xxxx，业务类别字段（WTYWLB）填相应的非交易业务类别值即可。

八、创业板交易信息披露

1、 实时行情信息

与主板等其它产品一样，我所通过行情系统实时发布创业板股票的行情，接口为行

情库 SJSHQ.dbf。

2、 创业板的成交量统计指标

在行情库中增加创业板股票的成交量指标，代码为“395004”，简称为“创业板”，统计口径为所有创业板股票的成交量。创业板股票的成交量纳入市场总成交量指标 395099 的计算范畴。

原成交量统计指标 395001 更名为“主板 A 股”，统计口径改为“不含中小板、创业板的所有 A 股的成交量”；原成交量统计指标 395002 更名为“主板 B 股”，统计口径不变；原成交量统计指标 395003 更名为“中小板”，统计口径不变。

3、 指数计算

深证指数系列、深证成指系列、行业分类指数系列均明确为全市场指数，即主板、中小板、创业板的股票均纳入这三个指数系列的计算样本范畴。

创业板指数的计算及发布将另行通知。

4、 创业板交易公开信息

同主板股票，以公告文件发布创业板交易公开信息，证券公司应当在营业场所及时公布交易公开信息。创业板指数发布前，收盘价格涨跌幅偏离值的计算拟以中小板综指为基准，即计算公式为：收盘价格涨跌幅偏离值 = 单只股票涨跌幅 - 中小板综指涨跌幅。

九、证券公司系统支持创业板的注意事项

1、 支持创业板投资者适当性管理

证券公司应进行技术系统调整，支持创业板投资者适当性管理：记录申请开通创业板的自然人投资者交易经验类型、签署《创业板市场投资风险揭示书》日期等信息；按规定时限为其开通创业板交易权限；按要求向结算公司报送创业板自然人投资者证券账户交易开通相关信息；在创业板发行、上市交易时，防止未经办理开通手续的客户参与创业板新股申购和交易活动。特别说明：机构投资者可实时开户并在开户当天参与创业板的各项业务。

涉及的主要技术修改点如下:

(1) 投资者创业板开通管理

改造投资者账户管理相关系统,使之能处理投资者开通创业板的申请,记录申请开通创业板的自然人投资者交易经验类型、签署《创业板市场投资风险揭示书》日期、开通创业板交易权限日期等信息,并能汇总生成创业板自然人投资者证券账户报送数据。

(2) 创业板自然人投资者证券账户交易开通相关信息报送

实现创业板账户数据报送功能:以法人为单位,通过 D-COM 系统,利用现有的账户规范数据接口(数据文件 ZHGFWT.dbf),每日集中一次在规定的时间内以文件方式报送创业板自然人投资者证券账户交易开通相关信息。收市后从结算公司接收 ZHGFHB.dbf 数据文件以获取反馈结果并进行处理。详细报送方案见附件《创业板自然人投资者证券账户信息报送方案》。

(3) 账户创业板权限的前端控制

证券公司技术系统应实现投资者账户的创业板业务权限的前端控制。对于未开通创业板交易权限的自然人投资者申报的买卖委托(含限价委托、市价委托、大宗交易)、新股申购、增发申购、配股认购等指令,证券公司技术系统应予以拒绝。

2、支持创业板的发行、交易、结算等业务

证券公司、基金公司等市场参与主体,应通过参数配置或系统调整,并参加本所组织的创业板业务全网测试,确保技术系统正确支持创业板的发行、交易、结算等业务。

3、关于行情揭示系统

行情分析系统,应能设置“创业板”板块,支持创业板股票行情的专板揭示,并在屏幕下方的指数栏预留创业板指数揭示位。

十、其它说明

1、参考文档

《深圳证券交易所创业板市场投资者适当性管理实施办法》

《深圳证券交易所创业板股票上市规则》

《关于认真做好创业板自然人投资者证券账户交易开通相关信息报送工作的通知》

《深圳证券交易所交易规则》（2006 年 7 月 1 日起施行）

《深圳证券交易所数据接口规范 (Ver4.56)》

《深圳证券交易所上市公司股东大会网络投票实施细则 (2006 年修订)》

《交易系统投票结果回报数据接口 (Ver1.02)》

2、本文未尽的创业板技术相关事宜请参照主板 A 股执行。

3、技术咨询电话

深交所：（0755）25918186 25918200

中国结算深圳：（0755）25946080

深圳证券交易所电脑工程部

中国结算深圳分公司电脑工程部

二〇〇九年八月八日

附件：

创业板自然人投资者证券账户信息报送方案

一、证券公司报送数据

自然人投资者在证券公司签署《创业板市场投资风险揭示书》（以下简称风险揭示书）、或申请开通创业板交易（已在其他证券公司签署了风险揭示书）时，证券公司应向深圳证券交易所和中国证券登记结算公司深圳分公司（以下简称结算公司）报送创业板自然人账户信息数据。

证券公司通过 D-COM 系统，利用现有的账户规范数据接口，以文件方式报送创业板自然人账户数据。

证券公司以法人为单位，每日集中报送一次数据，结算公司收市后做数据检查确认并反馈处理结果。证券公司报送的数据文件为 ZHGFWT.dbf，结算公司反馈的数据文件为 ZHGFHB.dbf。

数据报送时间为每个交易日 8：30 至 15：00。

二、证券公司查询数据

证券公司可以通过实时开户系统，查询投资者首次签署创业板风险揭示书的日期。查询时间为每个交易日 8：30 至 17：00。

三、日程安排

1. 2009 年 8 月 7 日—8 月 31 日，证券公司进行技术系统改造、业务准备。

2. 2009 年 9 月 1 日（周二），证券公司报送截至 2009 年 8 月 31 日已签署风险揭示书的创业板自然人账户存量数据，结算公司实时

开户系统的创业板风险揭示书签署日期查询功能上线。

3. 2009 年 9 月 2 日（周三）起，证券公司每个交易日报送截至上一自然日新增的已签署风险揭示书的创业板自然人账户数据。

4. 在创业板新股发行启动前，结算公司将向各证券公司发送其已经报送的全部创业板自然人账户数据，以便证券公司进行数据核对。数据发送时间和方式另行通知。

四、数据接口

证券公司需要报送的数据内容包括：证券公司资金结算主席位（ZHGFWT,WTZJJS 字段）、投资者证券账户号码（ZHGFWT,WTZQZH 字段）、投资者身份证号码（ZHGFWT,WTSFZH 字段）、所签署的创业板风险揭示书类别（ZHGFWT,WTBZNR 字段第 1 位）、营业部识别码（ZHGFWT,WTBZNR 字段第 2-3 位）、风险揭示书签署日期（ZHGFWT,WTTJRQ 字段）。

1. 数据报送接口（通过 D-COM 系统）

（1）账户规范委托库 ZHGFWT.DBF

字段名	字段描述	类型	长度	备注
WTZJJS	资金结算账号	C	6	即证券公司资金结算主席位编号
WTYWLB	业务类别	C	2	填写‘CY’，表示创业板自然人账户数据
WTZQZH	证券账户	C	10	开通创业板交易的深市股东代码
WTSFZH	身份证号	C	30	需要填写，用于数据校验

WTBZNR	备注内容	C	6	第 1 位填写所签署的风险揭示书
--------	------	---	---	------------------

				类别，第 2-3 位填写同一会员属下的证券营业部识别码，右补空格。详见下文的说明。
WTTJRQ	统计日期	D		风险揭示书签署日期。对于无需在本证券公司签署风险揭示书的投资者，填写其在本证券公司申请开通创业板交易的日期。 格式为 CCYYMMDD
WTWTRQ	委托日期	D		数据报送日期，格式为 CCYYMMDD

说明：

(1) 证券公司通过本接口库向结算公司报送创业板自然人账户数据。报送方式为通过 D-COM 系统上传文件。

(2) 数据格式为 FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式。证券公司应在数据申报日 15:00 前，通过 D-COM 系统进行文件上传。具体的文件上传和文件下载的操作步骤请参考《D-COM 用户手册》(http://www.chinaclear.cn/main/05/0502/050201/050201_1.html)。

(3) WTBZNR（备注内容）字段填写说明：

第 1 位填写所签署的风险揭示书类别：填写‘2’表示签署了 T+2 开通交易的风险揭示书（具有 2 年交易经验）；填写‘5’表示签署了 T+5 开通交易的风险揭示书（交易经验不足 2 年）；填写‘0’表示签署了提前开通创业板交易的风险揭示书（适用于因继承、离婚分割等情形被动成为创业板市场的投资者，在规定的特殊情形下提前开通创业板市场交易的情况）；填写‘A’表示无需在本证券公司签署风险揭示书（适用于投资者已经在其他证券公司签署了风险揭示书的情况）。

第 2-3 位填写同一会员属下的证券营业部识别码，即向深交所交易报盘时的营业部识别码（2 位长）。

第 4-6 位补空格。

(2) 账户规范回报库 ZHGFHB.DBF

字段名	字段描述	类型	长度	备注
HBZJJS	资金结算账号	C	6	
HBYWLB	业务类别	C	2	
HBZQZH	证券账户	C	10	
HBSFZH	身份证号	C	30	
HBBZNR	备注内容	C	6	
HBTJRQ	统计日期	D		
HBCLJG	处理结果	C	2	‘00’=数据报送成功; 其它内容表示数据有错, 详见下文的说明。
HBCLRQ	处理日期	D		接收数据的日期, 格式为 CCYYMMDD

说明:

(1) 本库是账户规范委托库 (ZHGFWT.DBF) 的检查反馈结果库, 在数据申报日收市后通过 D-COM 系统发送。本库各字段的定义与 ZHGFWT.dbf 的对应字段 (字段名右 4 位相同) 的定义相同。

(2) 结算公司已经成功接受的数据, 证券公司不应重复报送。

(3) “处理结果” (HBCLJG) 字段用于返回数据检查结果。若该字段为 ‘00’ 表示数据检查正常, 结算公司系统已经成功接受该条委托数据; 否则, 表示数据检查发现错误, 结算公司系统没有接受该条委托数据。

‘00’ =数据报送成功;

‘01’ =业务类别无效;

‘02’ =证券账户与身份证号不匹配;

‘03’ =账户无效;

- ‘04’ =重复报送;
- ‘05’ =本日不受理该类数据申报;
- ‘07’ =创业板风险揭示书签署日期错误;
- ‘08’ =创业板风险揭示书类别错误;
- ‘09’ =该账户不是自然人账户;
- ‘06’ =其它错误。

2. 风险揭示书签署日期查询接口（实时开户系统）

证券公司可以通过现有的账户使用信息实时查询接口（SJSKW.dbf, 业务代号为‘1C’）申报查询指令。返回数据（SJSKB.dbf, 业务代号为‘1C’）中，KBTXDZ字段的第17-24位填写自然人账户的《创业板市场投资风险揭示书》签署日期，例如20100101表示签署日期为2010年1月1日。对于机构账户，或没有签署风险揭示书的自然人账户，其签署日期信息为空格，需要注意处理。对于没有申报使用信息的自然人账户，返回数据中将提示相应的错误信息，并同时提供其风险揭示书签署日期信息。

注：经过本次接口内容扩充后，实时开户系统之“账户使用信息查询接口”的返回数据（SJSKB.dbf, 业务代号为‘1C’）含义为：KBTXDZ字段的第1-6位为交易单元代码，第7-8位为营业部编码，9-16位填写账户首次股票交易日期，17-24位填写自然人账户的《创业板市场投资风险揭示书》签署日期。

五、注意事项

1. 创业板自然人账户信息数据将作为深交所的重要监控数据使

用。各证券公司务必高度重视，确保数据报送及时、准确。

2. 同一证券公司在一日内报送多次数据的，结算公司只采用最后一次报送的数据。已报送成功的创业板自然人账户，不应重复报送。

3. 证券公司报送创业板自然人账户之后，该证券账户发生投资者身份证号码变更、补办新号码、合并账户等业务的，无需重新报送。

4. 机构账户无需签署创业板风险揭示书，无需报送创业板账户信息数据。

5. 若自然人投资者已经在某证券公司签署了风险揭示书，则其他证券公司在受理其开通创业板交易的申请时，仍应向结算公司报送创业板自然人账户信息数据。

6. 若多家证券公司对同一证券账户分别报送了不同的风险揭示书签署日期，则该证券账户的风险揭示书签署日期以最早报送的证券公司的数据为准。不同证券公司对同一证券账户重复报送签署日期数据的，结算公司在回报数据(ZHGFHB.dbf)中提示“数据报送成功”(HBCLJG字段为‘00’)，统计日期字段(HBTJRQ)反馈首家成功报送的签署风险揭示书日期。

7. 自然人投资者开通创业板交易的日期限制的解釋：

具备两年交易经验的自然人投资者，如果在 T 日签署风险揭示书，证券公司可在 T+2 日为其开通创业板市场交易。

尚未具备两年交易经验的自然人投资者，如果在 T 日签署风险揭示书，证券公司可在 T+5 日为其开通创业板市场交易。

其中，“T 日”表示投资者签署风险揭示书的自然日，“T+2”、“T+5”分别表示该自然日之后的第 2 个和第 5 个交易日。