



深圳证券交易所工程技术文档

报价转让系统交易模式改进之 券商技术系统变更指南 (V1.00)



深圳证券交易所 电脑工程部

二〇〇六年七月一日

关于本文档

文档名称	报价转让系统交易模式改进之券商技术系统变更指南		
说明	为报价转让系统主办券商等进行相关技术准备工作的指南		
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2006-07-1	V1.00	创建	原始版本

注：最新修订以橙色字体标示。

目 录

一、 报价转让系统交易模式改进的方案概述	1
1.1 在报价转让系统中增加定价委托方式	1
1.2 报价转让申报通过STBWT.DBF接口库申报	1
二、 总体技术方案	2
三、 定价委托的业务流程	2
四、 关于报价转让终端相应操作的说明	3
五、 报价转让业务其他说明	4
六、 报价转让指令申报	4
6.1 意向申报、意向申报撤销的申报	4
6.2 定价委托、定价委托撤销的申报	4
6.3 成交确认、成交确认撤销的申报	5
七、 报价转让回报	6
八、 意向申报行情	7
九、 券商系统支持报价转让系统交易模式改进的注意事项	8
9.1 关于投资者委托服务渠道	8
9.2 意向申报委托中的联系人信息	8
9.3 成交确认委托的约定号范围	8
9.4 关于券商柜台系统	9
十、 其它说明	10

报价转让系统交易模式改进的技术指南

(供参考)

特别提示：在报价转让系统试点运行的基础上，根据中国证券监督管理委员会、中国证券业协会的相关决定，深圳证券交易所（以下简称“我所”）对现有报价转让系统的交易模式进行了改进。为便于报价转让系统主办券商等市场参与者和相应 IT 提供商更好地明确本次业务变更，尽快做好券商系统的技术准备工作，我所编写了该指南，供有关单位参考。

一、 报价转让系统交易模式改进的方案概述

1.1 在报价转让系统中增加定价委托方式

定价委托的业务含义：该委托作为意向申报信息对外广播，同时也作为成交确认委托（系统自动为其生成约定号），只要其他投资者发现该定价委托合适就可要求与之成交，定价委托的发起人在委托撤单前负有成交义务且不需要再次申报成交确认委托，以定价委托的价格作为实际成交价，成交数量为双方委托数量的取小值。若定价委托的剩余数量大于等于 3 万股，则剩余部分仍然有效，以原自动约定号向整个市场广播；否则剩余部分无效，被系统自动撤销。

定价委托之间不得相互成交。其他投资者的与定价委托成交的申请（即指定定价委托约定号的成交确认委托）按时间优先原则与相应定价委托配对成交。

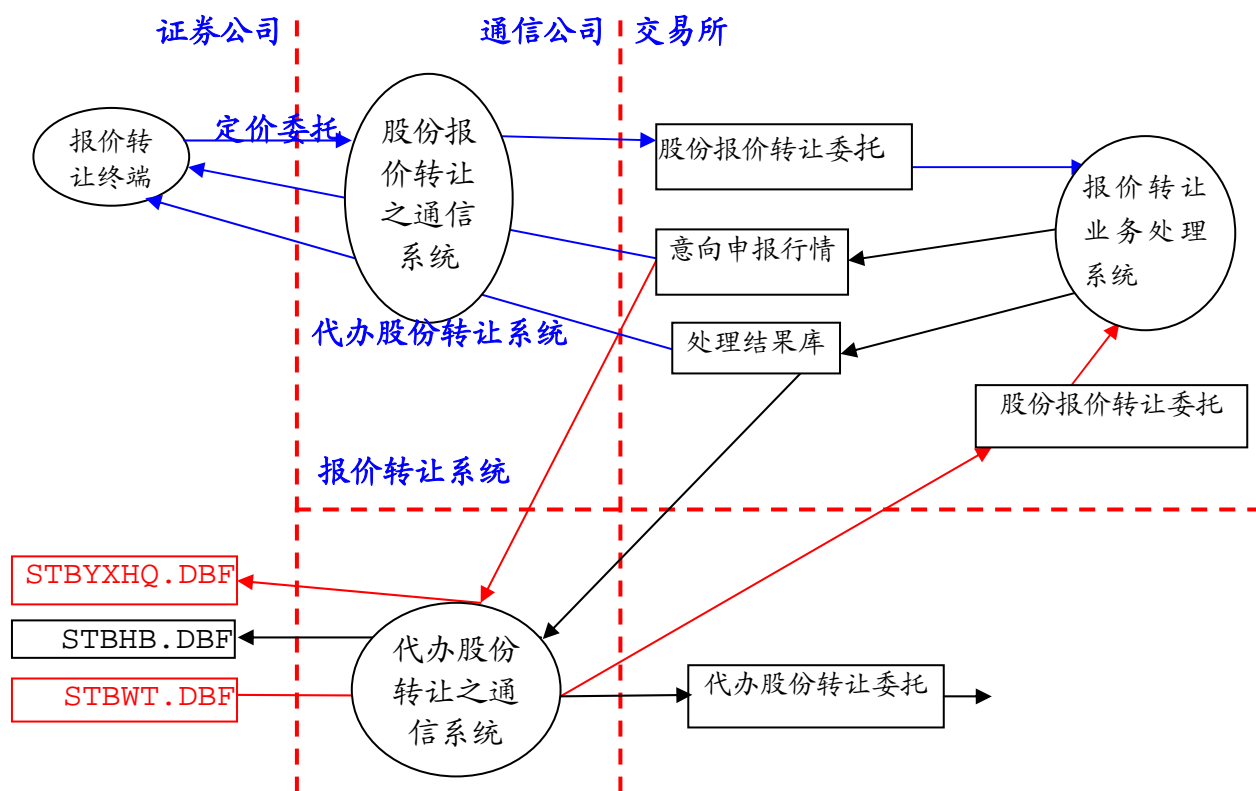
1.2 报价转让申报通过 STBWT.DBF 接口库申报

深圳证券交易所报价转让系统在保留现有报价转让终端的基础上，增加电子化接口（STBWT.DBF 接口库）申报途径。未来，电子化报盘将成为报价转让系统的主要交易方式，而报价转让终端将成为一种备份方式。

意向申报行情通过多媒体广播到各主办券商（新增）。

成交回报时，新增“HC”（意向申报撤单回报）、“OC”（定价委托撤单回报）两种业务类别的回报数据。

二、 总体技术方案



三、 定价委托的业务流程

- 1、投资者 A 委托主办券商 1 或自助方式申报定价委托。
- 2、主办券商 1 的交易员或技术系统对定价委托进行股份前端监控等合规性检查，合法委托才往报价转让系统申报。
- 3、报价转让系统收到主办券商 1 的定价委托，进行合法性检查；对于合法委托，报价转让系统为之自动产生约定号，并将自动约定号等信息通过意向申报行情向整个市场广播。
- 4、若主办券商 1 收到报价转让系统的定价委托撤单回报，且是卖出委托，应相应记加投资者 A 的当前可用股份数量。
- 5、其他投资者 B 在报价转让信息披露平台或主办券商 2 的营业部发现该定价委托适合自己。
- 6、其他投资者 B 委托主办券商 2 或自助方式下达成交易确认委托（必须填写对方席位、自动约定号、股份代码，不可修改股份价格，可修改委托数量），申请

与定价委托成交。

7、主办券商 2 的交易员或技术系统对成交确认委托进行股份前端监控等合规性检查，合法委托才往报价转让系统申报。

8、报价转让系统收到主办券商 2 的与定价委托成交之成交确认委托，进行合法性检查。对于合法委托，报价转让系统为投资者 A、投资者 B 进行成交确认，实际成交数量为双方委托数量的取小值；若投资者 B 申报的委托数量剩余或投资者 A 申报的委托数量未成交部分少于 3 万，则报价转让系统将剩余量自动撤单，并取消意向申报行情中相应的定价委托信息；若投资者 A 申报的委托数量未成交部分 ≥ 3 万，则定价委托的剩余部分仍然有效，以原自动约定号向整个市场广播。

9、主办券商 1、主办券商 2 收到报价转让系统的成交确认回报，进行相应业务处理。

若投资者 A 是卖出，主办券商 1 收到报价转让系统的定价委托撤单回报时，应相应记加投资者 A 的当前可用股份数量；若投资者 B 是卖出，主办券商 2 收到报价转让系统的成交确认撤单回报时，应相应记加投资者 B 的当前可用股份数量。

四、关于报价转让终端相应操作的说明

与原来的操作模式基本相同，增加功能的相关说明如下：

1、交易员接收到投资者的合法定价委托，可通过报价转让终端的相应页面进行申报及撤单。

2、报价转让终端的意向申报行情中显示了所有定价委托的相关信息。

3、投资者要求与定价委托成交时，交易员在意向申报行情中找到对应定价委托，点击并要求与之成交，输入必要信息后提交申请。

4、交易员查询相关委托的处理状态（相关的回报信息已通过 STBHB.DBF 下发到主办券商的技术系统，意向申报行情信息已通过 STBYXH.Q.DBF 下发）；交易员可下载自己申报的委托。

5、进入相应的 WEB 页面，可修改主办券商所属营业部的报价转让业务员姓名、联系电话。

五、 报价转让业务其他说明

1、 主办券商接受投资者委托的时间为每周一至周五。每个报价日报价转让系统接受申报的时间为上午 9:30 至 11:30，下午 13:00 至 15:00。遇法定节假日和其他特殊情况，暂停报价转让服务。

2、 报价证券代码区间为【430000，439999】；使用原代办股份转让系统的证券帐户；报价券商代码沿用代办股份转让系统的主办券商代码 72xxxx。

3、 委托的股份数量以股为单位。

4、 股份的报价单位为每股价格，报价的最小变动单位为 0.01 元。

5、 报价证券的转让价格目前未做涨跌停限制，可在系统允许的最大范围内协商，目前为[0.01, 99999.990]。

请直接使用我所发布的涨停价、跌停价、价格档位，即证券信息库（STBXX.dbf）的 XXZTJG（字段 24：涨停价格）和 XXDTJG（字段 25：跌停价格）、XXJGDW（字段 20：价格档位）。

六、 报价转让指令申报

6.1 意向申报、意向申报撤销的申报

意向申报、意向申报撤销指令通过委托库 STBWT.dbf 或通过深圳证券交易所开发的报价转让终端申报。意向申报委托当日有效，当日可以撤销。

通过委托库 STBWT.dbf 的申报内容如下表：

	WTHTXH	WTZQDM	WTGDDM	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTWTSJ
意向申报买	合同序号	证券代码	股份帐户	委托数量	委托价格	HB	委托时间
意向申报卖	合同序号	证券代码	股份帐户	委托数量	委托价格	HS	委托时间
意向申报的 撤单	合同序号	证券代码	股份帐户		=0	HC	撤单时间

6.2 定价委托、定价委托撤销的申报

定价委托、定价委托撤销指令通过委托库 STBWT.dbf 或通过深圳证券交易所开发的报价转让终端申报。定价委托当日有效，当日未被确认成交前可以撤销。

通过委托库 STBWT.dbf 的申报内容如下表：

	WTHTXH	WTZQDM	WTGDDM	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTWTSJ
定价委托买	合同序号	证券代码	股份帐户	委托数量	委托价格	0B	委托时间
定价委托卖	合同序号	证券代码	股份帐户	委托数量	委托价格	0S	委托时间
定价委托的 撤单	合同序号	证券代码	股份帐户		=0	0C	撤单时间

6.3 成交确认、成交确认撤销的申报

成交确认、成交确认撤销指令通过委托库 **STBWT.dbf** 或通过深圳证券交易所开发的报价转让终端申报。成交确认委托当日有效，当日未被确认成交前可以撤销。

通过委托库 **STBWT.dbf** 的申报内容如下表：

指令类型	WTHTXH	WTZQDM	WTGDDM	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTDFXW	WTWTSL2
买成交确认	合同序号	证券代码	股份帐户	委托数量	委托价格	1B	对方席位	约定号
卖成交确认	合同序号	证券代码	股份帐户	委托数量	委托价格	1S	对方席位	约定号
成交确认的 撤单	合同序号	证券代码	股份帐户		=0	1C		

说明：约定号 ≤ 99999999 。欲与定价委托成交的，券商系统应输入一笔成交确认委托，买卖方向与定价委托相反，约定号填写为 STBYXHQB.DBF 中的自动约定号 (>999999)；已达成协议交易，与对手的成交确认委托配对的，券商之间应商定约定号（必须 ≤ 999999 ）。

举例 1:

在 729999 席位下的投资者 A 与投资者 B 以 4.42 成交 439999 证券 27000 股（卖方一次性卖出），约定号为 1，则 729999 席位的券商系统应报送如下委托：

WTHTXH	WTZQDM	WTGDDM	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTDFXW	WTWTSL2
72999920060608DZ000001	439999	股份帐户 A	27000	00004.420	1B	729999	000000001
72999920060608DZ000002	439999	股份帐户 B	27000	00004.420	1S	729999	000000001

举例 2

728888 席位下的投资者 C 报了定价委托：卖出 436666 证券 50000 股，价格 7.89 元/股，报价转让系统为之生成的自动约定号为 99999999。729999 席位下的投资者 D 要求与该定价委托成交 30000 股，则 729999 席位的券商系统应报送如下委托：

WTHTXH	WTZQDM	WTGDDM	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTDFXW	WTWTSL2
72999920060608A9000001	436666	股份帐户 D	30000	00007.890	1B	728888	099999999

七、 报价转让回报

报价转让系统通过**回报库 STBHB.DBF** 发送成交回报记录、所有撤单回报记录。回报记录格式说明如下：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HBCJHM	成交号码	C	8	数字字符串
2	HBZQDM	证券代码	C	6	
3	HBHTXH	合同序号	C	22	
4	HBGDDM	股份帐户	C	10	数字字符串
5	HBCJSL	成交数量	N	9,0	
6	HBCJJG	转让价格	N	9,3	
7	HBDFXW	对方席位	C	6	数字字符串
8	HBDFGD	对方股东	C	10	数字字符串
9	HBCJSJ	成交时间	C	8	HHMMSSCC
10	HBCJRQ	成交日期	D	8	CCYYMMDD
11	HBYWLB	业务类别	C	2	HC: 意向申报撤销 1B: 买成交确认 1S: 卖成交确认 1C: 成交确认委托撤销 OC: 定价委托撤销
12	HBCDYY	撤单原因	C	2	
13	HBMARK	备用字段	C	2	保留
14	HBYYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 撤单回报记录包含主动撤单和系统自动撤单两类。前者是回应客户的撤单要求而返回的撤单回报记录，后者是对本所报价转让系统检查出的非法委托或无法配对成交确认委托返回的撤单回报记录，于 HBCDYY（字段 12：撤单原因）回报撤单原因代号。HBCJSL<0 表示成功撤单的回报（|HBCJSL|是被撤单的股数）；HBCJSL=0 则表示撤单不成功的回报；HBCJJG（成交价格）=0。

(2) 业务类别为“1B”或“1S”时，指经本所报价转让系统确认的成交确认申报与对方成交确认申报、或成交确认申报与对方定价委托之间成功配对的转让回报，其 HBCJSL>0，HBCJJG>0。

(3) 撤单原因代号说明等，详见接口规范。

八、意向申报行情

报价转让系统通过意向申报行情库 STBYXH.QDBF 发布即时意向申报行情，

券商系统只能通过多媒体广播接收程序接收 STBYXH.QDBF。发布内容如下：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	意向申报行情	定价委托行情
1	YXSBBX	意向申报序列号	N	9, 0	报价转让系统生成	报价转让系统生成
2	YXZQDM	证券代码	C	6	证券代码	证券代码
3	YXSBSL	意向申报数量	N	9,0	申报数量	申报数量
4	YXSBBJ	意向申报价格	N	9,3	申报价格	申报价格
5	YXMMLB	意向买卖类别	C	2	HB: 买意向申报 HS: 卖意向申报	OB: 买定价委托 OS: 卖定价委托
6	YXXWDM	意向席位代码	C	6	委托席位代码	委托席位代码
7	YXLSH	意向流水号	C	8	委托流水号	委托流水号
8	YXYHDM	用户代码	C	10	交易员代码(1)	空格
9	YXYHMC	用户名称	C	12	联系人姓名(2)	联系人姓名(2)
10	YXLXFS	联系方式	C	30	联系方式(3)	联系方式(3)
11	YXSBSJ	申报时间	C	8	申报时间	申报时间
12	YXZDYDH	自动约定号	N	8	0	自动约定号(4)
13	YXMARK	备用字段	C	4	保留，空格	保留，空格
14	YXJLZT	记录状态	C	1	通信系统填写	通信系统填写
15	YXBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用	券商系统自用

注：（1）“用户代码”为主办券商的交易员代码；

（2）若意向申报、定价委托申报的营业部识别码已登记到报价转让系统，则揭示营业部业务员的姓名，否则揭示主办券商交易员的姓名；

（3）若意向申报、定价委托申报的营业部识别码已登记到报价转让系统，则揭示为营业部业务员的联系电话，否则揭示为主办券商交易员的联系电话；

（4）对于定价委托的申报，自动约定号由报价转让系统生成，取值范围 [1000000, 99999999]，从 99999999 开始，每次递减 1。

（5）“记录状态”字段的值由通信系统填写，为“0”时，指该意向申报行情无效（对应的委托已被撤单或已成交），券商技术系统不应再揭示之；“记录状态”字段的值为“1”时，指该意向申报行情有效。

九、券商系统支持报价转让系统交易模式改进的注意事项

报价转让系统主办券商的技术系统应按照《证券公司代办股份转让系统中关村科技园区非上市股份有限公司股份报价转让试点办法》等相关业务规定和本指南，检查委托的合法性，实现资金和股份前端控制。

9.1 关于投资者委托服务渠道

应调整柜台委托或电话委托、自助委托、网上交易等投资者委托渠道（一个或多个）中的相应前端系统，以支持意向申报、意向申报撤销、成交确认、成交确认撤销、定价委托、定价委托撤销的指令录入，为投资者提供友好的操作界面。

9.2 意向申报委托中的联系人信息

通过 STBWT.DBF 送达报价转让系统的意向申报、定价委托申报，报价转让系统根据一定原则自动填写联系人姓名、联系电话，并通过意向行情信息 STBYXH.Q.DBF 对外广播。报价转让系统填写联系人姓名、联系电话的原则如下：

根据 STBWT.DBF 记录中合同序号的席位代码、营业部识别码，判断该委托来自哪个主办券商的哪个营业部。若主办券商的交易员已设置相关营业部报价转让业务员的姓名、联系电话，则报价转让系统将营业部报价转让业务员的姓名、联系电话对外广播；否则报价转让系统将主办券商的交易员姓名、联系电话对外广播。

席位交易员可通过深圳证券交易所开发的报价转让终端修改营业部报价转让业务员的姓名、联系电话。

9.3 成交确认委托的约定号范围

约定号取值范围[0~99999999]。[0, 999999]区段留给主办券商协商成交；[1000000, 99999999]区段留给报价转让系统自动分配，分配原则为：从 99999999 开始，每次递减 1。

成交确认委托中的约定号处于[0, 999999]区段时，表示本成交确认委托的对手方也是成交确认委托；成交确认委托中的约定号处于[1000000, 99999999]区段时，表示本成交确认委托的对手方为定价委托。

成交确认委托中的约定号处于[1000000, 99999999]区段时，若没有发现对手方定价委托或对手方定价委托的状态不为“等待成交”，则将本成交确认委托自动

撤单。主办券商协商达成的成交确认，必须保证约定号在[0, 999999]区段，否则委托将被自动撤单。

9.4 关于券商柜台系统

(1) 接收到投资者各种委托指令时的处理

对所有委托指令的数量应按下表检查委托合法性。

委托类型	买委托的判断逻辑	卖委托的判断逻辑
意向申报委托	≥ 3 万	≥ 3 万，小于 3 万时必须一次性卖出
定价委托	≥ 3 万	≥ 3 万，小于 3 万时必须一次性卖出
与定价委托成交的成交确认委托（约定号 >999999 ）	≥ 3 万，小于 3 万时必须 \geq 对方数量	≥ 3 万，小于 3 万时必须一次性卖出
与成交确认委托配对的成交确认委托（约定号 ≤ 999999 ）	与对方的委托数量相等（可不检查）	≥ 3 万，小于 3 万时必须一次性卖出

对所有买委托指令均不进行资金前端监控。

接收投资者卖出意向申报委托时，建议冻结投资者证券帐户下相应股份。在接收到投资者意向申报撤销指令的成功撤单回报时，根据原委托的买卖方向进行相反操作。

如系统在接收投资者卖出意向申报委托时进行了相应股份的冻结，在达成协议成交而申报成交确认前，应将之前下达的原意向申报委托撤销。

接收投资者卖出成交确认、卖出定价委托时，必须冻结投资者证券帐户下相应股份数量。在接收到投资者成交确认撤销、定价委托撤销指令时，要根据原委托的买卖方向进行相反操作（卖出委托的撤销指令应解冻相应股份数量）。

(2) 向报价转让系统申报委托

接受投资者意向申报、意向申报撤销、成交确认、成交确认撤销、定价委托、定价委托撤销指令后，按照接口规范所约定的内容向报价转让系统申报。合同序号的第 15、16 位（从左往右数）应填入营业部识别码。

每一次申报的委托合同序号不能重复，否则后送到报价转让系统的重单委托被视为非法。

(3) 意向行情信息 STBYXHQ.DBF 的展示

应在柜台系统、网上交易等交易终端上揭示即时意向申报行情信息（应过滤掉记录状态为“0”的意向行情记录）。对定价委托的意向行情，应增加“点击成交”功能键，即要求与被选中的定价委托成交；此时，自动填写对方席位、约定号、

股份代码，不可修改委托价格，可修改委托数量。

(4) 日结处理

委托数据可通过两种途径申报到报价转让系统：①深圳证券交易所开发的报价转让终端；②委托库 STBWT.DBF。在进行日结处理时，应将途径①申报的委托数据下载与 STBWT.DBF 合并归档并进行相应业务处理。

其他保持不变。

十、 其它说明

1、 非报价转让系统主办券商的股份转让代办券商，可暂不做任何技术系统变动，仍使用《非上市公司股份转让数据接口规范》（Ver2.1），但从长远来说，应择机根据《非上市公司股份转让数据接口规范》（Ver2.2）扩展的委托库（STBWT.dbf）结构进行技术系统的适应性调整。

2、 其它参考文档

《证券公司代办股份转让系统中关村科技园区非上市股份有限公司股份报价转让试点办法》

《非上市公司股份转让数据接口规范》（Ver2.2）

3、 业务咨询电话 （0755）25918155 ljzeng@szse.cn

技术咨询电话 （0755）25918186 ssegcb@szse.cn