

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
之定向发行可转换公司债券业务
(V1.1)

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

二〇二五年九月

修订历史

[illegible]

目 录

一、说明	1
二、参考技术文档	1
三、变动简述	1
(一) 对外揭示可转债转股价格、回售价格	1
(二) 转股申报填写实际转股价格	2
四、业务开发说明	2
(一) 投资者适当性	2
(二) 信息发布	2
1. 证券信息	3
2. 证券行情	4
3. 分层信息	5
4. 公开信息	5
5. 可转债转股回售信息	5
(三) 申报	6
(四) 回报	8
五、数据接口规范说明	10
(一) 证券信息库 NQXX.DBF	10
(二) 证券行情库 NQHQ.DBF	10
(三) 委托库 NQWT.DBF	10
(四) 回报库 NQHB.DBF	11
(五) 信息公告文件 ZZyymmdd.nnn	11
六、周边技术系统改造要求	12
七、市场参与者注意事项	12

八、联系方式 13

一、说明

为便于各市场参与者和相应 IT 提供商更好地理解全国中小企业股份转让系统（以下简称“全国股转系统”）定向发行可转换公司债券（以下简称“定向可转债”）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”）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。

本指南所参考的技术文档为《交易支持平台数据接口规范（V2.4）》（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。

本指南所参考的业务文档为在官网正式发布的最新的各类业务规则、业务细则、业务指南，如果相关业务文档有所变更，本文档将做相应变更。

二、参考技术文档

《交易支持平台数据接口规范（V2.4）》

三、变动简述

（一）对外揭示可转债转股价格、回售价格

新增信息公告文件 ZZyymmdd.nnn（所有可转债共用），揭示内容为证券代码、证券简称、转股价格、回售价格。公告结构详见数据接口规范。

(二) 转股申报填写实际转股价格

转股申报中申报价格改为填写实际转股价格。

四、业务开发说明

(一) 投资者适当性

参与全国股转系统定向可转债交易的投资者，应当是符合全国股转公司相关业务规则中关于定向可转债投资者适当性要求的合格投资者。

若是标的股票的受限投资者，可交易持有或曾经持有的标的股票对应的定向可转债。若不是标的股票的受限投资者，即使持有对应的定向可转债也只能卖出，禁止买入。

由于定向可转债投资者适当性管理标准与普通股一致，因此定向可转债业务的投资者适当性要求等同于其对应标的股票的投资者适当性要求，新三板定向可转债的合格投资者与新三板股票的合格投资者共用适当性类别，无需单独报送。

(二) 信息发布

定向可转债业务使用证券信息库 **NQXX.DBF** 和证券行情库 **NQHQ.DBF** 发布证券信息和实时行情。

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 3 秒。

1. 证券信息

定向可转债业务需要揭示的证券信息内容见表 4-1。

表 4-1：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	81XXXX
2	证券简称	8 位字符	
3	英文简称	20 位字符	
4	基础证券	6 位数字编码	定向可转债对应的标的股票
5	交易单位	4 位数字编码，整数	1
6	行业种类	5 位字符	
7	货币种类	2 位数字编码	
8	每股面值	7 位数字编码，小数点后 2 位	100
9	总股本	12 位数字编码，整数	
10	非限售股本	12 位数字编码，整数	
11	上年每股收益	9 位数字编码，小数点后 4 位	
12	挂牌/上市日期	8 位数字编码	CCYYMMDD
13	起息日	8 位数字编码	CCYYMMDD
14	到期日	8 位数字编码	CCYYMMDD
15	每笔限量	9 位数字编码，整数	999999999
16	买数量单位	6 位数字编码，整数	10
17	卖数量单位	6 位数字编码，整数	10
18	最小申报数量	9 位数字编码，整数	1000
19	价格档位	5 位数字编码，小数点后 3 位	0.001
20	涨停价格	9 位数字编码，小数点后 3 位	

21	跌停价格	9 位数字编码，小数点后 3 位	
22	折合比例	5 位数字编码，小数点后 2 位	票面利率
23	交易状态	1 位字母编码	
24	证券级别	1 位字母编码	‘C’-可转换公司债券
25	交易类型	1 位字母编码	‘T’-协议转让方式
26	停牌标志	1 位字母编码	
27	除权除息标志	1 位字母编码	
28	其他业务状态	4 位字母编码	第三位为“T”表明当前允许回售，为“F”表明当前禁止回售；第四位为“T”表明当前允许转股，为“F”表明当前禁止转股

2. 证券行情

定向可转债业务需要揭示的证券行情内容见表 4-2。

表 4-2：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	价格涨跌 1	9 位数字编码，小数点后 3 位	
11	价格涨跌 2	9 位数字编码，小数点后 3 位	

每个转让日 **8:30** 起发送初始化行情信息；**9:15-15:00** 期间仍只发送初始化行情信息，不发送与当天定向可转债交易相关的任何行情信息；**15:00** 后实时发送收盘行情信息。

初始化行情信息仅包括证券代码、证券简称、前收盘价，其他内容为空。

定向可转债证券收盘行情包括证券代码、证券简称、前收盘价、总成交数量、总成交金额、收盘价、较昨日收盘价涨跌等。

3. 分层信息

定向可转债无分层信息。

4. 公开信息

对于协议转让，每个交易日全天交易时段结束后（**15:30**），全国股转系统及北交所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、买卖双方证券公司证券营业部或交易单元的名称（若成交能找到对应的证券公司证券营业部，成交信息显示证券公司证券营业部名称，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”。

5. 可转债转股回售信息

可转债转股回售信息以信息公告文件形式向市场发布。

使用的信息公告文件类型为：**ZZ-可转债转股回售信息**，用于揭示所有可转债的转股价格和回售价格，内容包括证券代码、证券简称、转股价格、回售价格，文件名为**ZZyymmdd.nnn**，各字段结构定义见表 4-3。

表 4-3 可转债转股回售信息字段定义

序号	字段名称	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	转股价格	9 位数字编码，小数点后 3 位	
4	回售价格	9 位数字编码，小数点后 3 位	

可转债转股回售信息日间不更新。

（三）申报

定向可转债业务的订单类型分为成交确认申报、转股申报和回售申报三类。停牌期间仍接收转股申报和回售申报。

定向可转债业务通过申报库 **NQWT.DBF** 接收并处理投资者的订单。协议转让使用成交确认申报，转股业务使用转股申报，回售业务使用回售申报。申报要素及填写格式见表 4-4。

表 4-4：申报要素

申报 内容	成交确认申报			转股申报		回售申报	
	买入	卖出	撤单	卖出	撤单	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	3B	3S	3C	5S	5C	9S	9C
申报 价格	>0，价格最小变动单位 0.001 元		0	>0，必须等于转股价	0	>0，必须等于回售价格	0
申报 数量	>0，整数，买卖最小申报数量为 1000 张或金额 10 万元，买卖基本变动单位为 10 张，余股不足 1000 张时必须一次性卖出。		0	>0，整数，最小申报数量和基本变动单位都为 1 张。	0	>0，整数，最小申报数量和基本变动单位都为 1 张。	0
申报 数量 2				股份性质			

拟成交对手方交易单元	6 位数字编码， 必须填写					
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					

（四） 回报

定向可转债业务的回报类型分为成交确认回报、转股回报和回售回报三类。

定向可转债业务通过回报库 NQHB.DBF 返回回报。回报要素及填写格式见表 4-5。

表 4-5：回报要素

成交回报 内容	成交确认回报			转股回报		回售回报	
	买入成 交回报	卖出成 交回报	撤单回 报	转股确 认回报	撤单回 报	回售确 认回报	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	同对应申报价格		0	同对应 申报价 格	0	同对应 申报价 格	0
成交数量	同对应申报数量		申报数 量的负 值	同对应 申报数 量	申报数 量的负 值	同对应 申报数 量	申报数 量的负 值
成交数量 2				同对应 申报数 量 2			
业务类别	3B	3S	3C	5S	5C	9S	9C
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						

五、数据接口规范说明

（一）证券信息库 NQXX.DBF

（1）数据结构参见数据接口规范第一章。

（2）使用证券级别‘C’，通过 XXZQJB（字段 35：证券级别）识别，用于标识该证券是属于提供协议转让的可转换公司债券。

（3）使用证券代码分段“81”，用于识别该证券是属于提供协议转让的定向可转债。

（4）通过 XXQTYW（字段 41：其他业务状态）揭示该可转债当前是否允许转股或回售。

（二）证券行情库 NQH.Q.DBF

（1）数据结构参见数据接口规范第二章。

（2）使用证券代码分段“81”，用于识别该证券是属于提供协议转让的定向可转债。

（三）委托库 NQWT.DBF

（1）数据结构参见数据接口规范第三章。

（2）申报时间为 9:30 到 11:30，13:00 到 15:00。

（3）协议转让的申报价格无涨跌幅限制且精确到 0.001 元。转股申报的申报价格必须等于实际转股价格且精确到 0.01 元。回售申报的申报价格必须等于回售价格且精确到 0.001 元。

（4）协议转让时，卖出最小申报数量为 1000 张或金

额最小为 10 万元，申报基本单位为 10 张，不足 1000 张时必须一次性卖出，买入申报数量必须大于 0 且应当与对手方的卖出申报数量相等，约定号需要大于 0 且小于 100 万。

(5) 对于“5S”、“9S”的申报均只实时检查申报数量的格式是否合法，不检查数量是否有效。

(6) 使用 WTWTS2 (字段 10: 申报数量 2) 存放转股申报 (5S) 时股份性质。股份性质的定义以中国结算公布的为准。

(7) 对于回售申报，委托价格应等于其回售价格，委托数量应为大于 0 的整数。

(四) 回报库 NQHB.DBF

(1) 数据结构参见数据接口规范第四章。

(2) 回报时间为 9:30 到 11:30，13:00 到 15:00。

(3) 通过回报库返回的转股确认回报和回售确认回报仅表示该笔申报的填写格式及要素符合填写要求，不代表该笔申报是有效申报，最终的申报结果以中国结算确认的结果为准。

(五) 信息公告文件 ZZyymmdd.nnn

(1) 数据结构参见数据接口规范第十一章。

(2) 使用信息公告文件 ZZyymmdd.nnn。类型前缀“ZZ”表示“可转债转股回售信息”。

六、周边技术系统改造要求

1. 行情分析软件应分板块支持揭示定向可转债的行情，个股信息中揭示信息包括但不限于：可转债代码、可转债简称、标的股票代码、是否处于转股/回售状态、转股价格、回售价格等。

2. 行情分析软件应支持挂牌公司股票与其定向可转债代码关联揭示。

3. 定向可转债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。

4. 建议为新三板证券提供独立的综合行情列表，默认揭示顺序为挂牌公司股票、定向可转债、优先股。

5. 提供全国股转系统业务的周边行情系统应明确揭示定向可转债的交易方式、最近行情、前收盘价、成交数量、成交金额、可转股状态、可赎回状态、可回售状态。

6. 证券公司应调整投资者委托时对于买卖最小申报数量和基本单位的提示信息 and 校验。

7. 转股价格、回售价格等信息通过信息公告文件 **ZZyymdd.nnn** 揭示，应做好以上信息获取及展示工作。

七、市场参与者注意事项

1. 已开展全国股转系统经纪业务的证券公司至少应提供两种（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）行情终端支持定向可转债业务。

2. 证券公司经纪系统对投资者进行定向可转债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. 证券公司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，以支持定向可转债业务的交易。

八、联系方式

联系单位/部门	联系电话
全国股转公司/北交所	400-626-3333
深圳证券通信公司	0755-83182222
QQ 群	338167838、536137764 362089063、682283623