
股转办发〔2025〕31号附件2

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
之退市公司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

修订历史		
版本号	修订日期	修订说明
V1.0	2023.6	定稿
V1.1	2025.9	1、增加转股价格、回售价格信息揭示公告文件 2、转股申报填写实际转股价格

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	6
(三) 申报	6
(四) 回报	9
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	11
(三) 委托库 NQWT.DBF	11
(四) 回报库 NQHB.DBF	12
(五) 信息公告文件 ZZyymmdd.nnn	12
六、周边技术系统改造要求	12

七、市场参与者技术系统注意事项	13
八、联系方式	13

一、说明

为便于各市场参与者和相应 IT 提供商更好地理解退市公司可转换公司债券（以下简称“退市可转债”）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”），未涉及内容请参考相关业务实施规则、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

参与全国股转系统退市可转债交易的投资者，应当是符合全国股转系统相关业务规则中关于退市可转债投资者适当性要求的投资者。

不符合上述要求的债券持有人，只能卖出其持有的退市可转债。

由于投资者适当性管理标准与退市公司股票一致，因此退市可转债业务的投资者适当性要求等同于退市公司股票的投资者适当性要求，退市可转债的合格投资者与退市公司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

退市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	所有证券	

(NQHQ.DBF)

行情揭示频率为 3 秒。

1. 证券信息

退市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	404XXX
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	退市可转债对应的标的证券
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	‘D’-退市公司 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

退市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, 不发送与当天退市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。

退市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

退市可转债无分层信息。

4. 公开信息

每个交易日全天交易时段结束后, 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”。

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

退市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。

退市可转债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。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 格	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		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	0

	一次性卖出。				张。	
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

退市可转债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。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）数据接口参见数据接口规范第一章。

（2）使用证券级别‘D’，通过 XXZQJB（字段 35：证券级别）识别，用于标识该证券是属于退市可转债。

（3）使用证券代码分段“404”，用于识别该证券是属于退市可转债。

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

表 5-1：其他业务状态含义表

XXQTYW	第一字节	第二字节	第三字节	第四字节
退市公司可转换公司债券	预留，默认为空格	预留，默认为空格	回售标志，该证券是否处于回售期：F-否，	转股标志，该证券是否允许转股：F-禁止，T-

XXQT YW	第一字节	第二字节	第三字节	第四字节
			T-是	允许

（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“404”，用于识别该证券是属于退市可转债。

（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。

（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。

(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. 行情软件应在退市板块中支持揭示退市可转债的行情，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、标的券代码、是否处于转股/回售状态、转股价格、回售价格等。

2. 行情软件应支持退市公司股票与其可转债代码关联揭示。

3. 退市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. 提供全国股转系统业务的周边行情系统应明确揭示退市可转债的交易方式、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。

5. 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和校验。

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

七、市场参与者技术系统注意事项

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）行情终端支持退市可转债业务。

2. 证券公司经纪系统对投资者进行退市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退市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，以支持退市可转债业务的交易。

八、联系方式

联系单位/部门	联系电话
全国股转公司	400-626-3333

深圳证券通信公司	0755-83182222
QQ 群	338167838、536137764 362089063、682283623