

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
支持 xml 版 ETF 定义文件
市场参与者技术实施指南
1.0 版



上海证券交易所
2024 年 3 月

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）支持 xml 版 ETF 定义文件市场参与者技术实施指南。

特别申明

- 本指南为技术实施指南，所涉相关业务规定以本所业务规则为准。
- 本指南根据本所相关规则、业务方案、公告通知制定。
- 本所保留对本指南的解释与修改权。

联系方式

技术服务 QQ 群：298643611

技术服务电话：4008888400 按键 2 (8:00-20:00)

电子邮件：tech_support@sse.com.cn

技术服务微信公众号：SSE-TechService



1 简介

本档为上海证券交易所支持 xml 版 ETF 定义文件市场参与者技术实施指南，对市场参与者相关的技术实施提出建议。

2 市场接口调整说明

《IS118_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）1.9 版_20240306（支持 ETF 定义文件 xml 版 技术开发稿）》：

- 1、新增 ETF 定义文件 xml 版、ETF 确认文件 xml 版、ETF 公告文件 xml 版相关描述。
- 2、下线 ETF 定义文件 2.1 版、ETF 确认文件 2.1 版、ETF 公告文件 2.1 版。

《IS105_上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.55 版_20240306（支持 ETF 定义文件 xml 版 技术开发稿）》：

- 1、新增 ETF 公告文件 xml 版相关描述。
- 2、下线 ETF 公告文件 2.1 版，删除相关描述。

3 技术调整说明及市场参与者实施建议

一、新增一整套 ETF 定义文件接口：

- a) xml 版 ETF 定义文件接口，支持至多 9999 成分券数量。
- b) xml 版 ETF 确认文件接口；
- c) xml 版 ETF 公告文件接口；

接口间对应关系如下：

	ETF 定义文件 (基金公司上传)	ETF 确认文件 (反馈基金公司)	ETF 公告文件 (反馈基金公司、发送市场)
调整前	txt 2.1 xml ¹ (未启用)	txt 2.1 xml ² (未启用)	txt 2.1
调整后	xml (新增)	xml (新增)	xml (新增)

对于尚未发生业务的跨市场债券（银行间）ETF，其 xml 版 ETF 定义文件及 ETF 确认文件根据业务推进情况，后续将合并至此次新增接口体系中，新接口及技术实施指南发布时间待定。前期发布的《IS118_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）1.8 版_20220823（跨市场债券（银行间）ETF 技术开发稿）》³作废，相关市场参与者实施指南《上海证券交易所跨市场债券（银行间）ETF 市场参与者技术实施指南_20220908》同步作废。

二、 对于基金公司：

需支持上传 xml 版本 ETF 定义文件，支持接收并读取 xml 版 ETF 确认文件、xml 版 ETF 公告文件并进行核对。

三、 对于所有市场参与者：

- 1、需能够接收并读取 xml 版 ETF 公告文件。
- 2、UT5 客户端由于已计划下线，不转发新增的 xml 版 ETF 公告文件，建议所有市场参与者迁移至证通云盘客户端获取。

市场参与者应充分评估上述变更对交易、行情等相关技术系统的影响，做好相关技术系统维护、改造工作，根据本所要求利用本所提供的测试环境进行充分测试验证；根据自身需求，对于不同渠道数据接收做出合理安排。

¹ 仅适用于跨市场债券（银行间）ETF 业务，未启用。

² 仅适用于跨市场债券（银行间）ETF 业务，未启用。

³ 2022 年 9 月 16 日通过上交所官网发布。

4 相关技术文档

《IS118_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）1.9 版
_20240306（支持 ETF 定义文件 xml 版 技术开发稿）》

《IS105_上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.55 版
_20240306（支持 ETF 定义文件 xml 版 技术开发稿）》