上海证券交易所技术文档



**资金前端控制**

**自设额度申报**

**市场参与者技术实施指引**

**1.0版**



上海证券交易所

**二零一八年四月**

**版本历史**

|  |  |
| --- | --- |
| **版本号** | **调整内容** |
| V0.1 20180402 | 根据业务方案完成初稿 |
|  |  |
|  |  |

**文档摘要**

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”)，资金前端控制自设额度申报业务的技术实施指引。

**特别申明：**

* 本指引为技术实施指引，所涉相关业务规定以本所业务规则为准。
* 本指引根据本所相关规则、业务方案制定，**后续若业务规则或方案发生调整，本指引亦会进行相应调整**。
* 本所保留对本指引的解释与修改权。

**联系方式**

如有问题，可与技术公司市场总部联系。

联系电话：021-58650101

传真：021-58661051

**目 录**

[1 业务描述](#_Toc12078)

[2 市场接口变化](#_Toc4825)

[3 交易时间](#_Toc25396)

[4 用户申报要素](#_Toc29374)

[5 其他相关技术文档](#_Toc10821)

# 业务描述

参照上海证券交易所官网规则栏目，本所业务指南与流程>交易管理业务指南与流程>交易管理业务指南中的《上海证券交易所证券交易资金前端风险控制交易参与人业务指南》；

自设额度申报分为常规申报和应急申报，其中常规申报的技术指南参见上海证券交易所会员/证券机构专区中的《会籍业务网上办理指引》；

本文以下章节描述的是自设额度应急申报的技术指引。

# 市场接口变化

资金前端控制自设额度应急申报业务在综合业务平台实现，通过EzSTEP报盘软件及该业务市场参与者接口申报、接收响应。

资金前端控制市场参与者接口规格说明参见：

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。

# 交易时间

资金前端控制自设额度应急申报交易时间为每个交易日9：15-9：25，9：30-11：30，13：00-15：00。

# 用户申报要素

**4.1 重要申报要素**

**1、申报代码**

资金前端控制自设额度应急申报业务填799970

**2、全天控制金额**

8位长度数字，单位为百万

**3、控制PBU代码**

即业务指南中所述的特定交易单元

**4、其他申报要素**

参见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

**4.2 错误码**

1、20168 ：用户订单全天控制金额字段格式错误

2、19006 ：用户订单全天控制金额字段填负数

3、11068：用户订单中的控制PBU无效

4、19058：申报PBU和登陆PBU不属于同一个会员

若订单通过校验，则返回订单确认。

**4.3 附加说明**

1、综合业务平台作为自设额度应急申报通道，仅对自设额度应急申报的格式校验。不进行申报要素（如全天控制金额）业务正确性的前端控制。市场参与者需做好前端控制和风险控制。

2、若市场参与者申报错误，可以通过重新申报进行错误纠正，申报失败时以最近一次申报成功为准。

# 其他相关技术文档

本所技术文档参见交易技术支持区，技术文档：

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

IS101 上海证券交易所 竞价撮合平台 市场参与者接口规格说明书