

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
ETF多码合一相关业务
市场参与者技术实施指南
(技术开发稿)

1.0 版



上海证券交易所

二〇二一年九月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20210908	创建说明

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）ETF多码合一相关业务技术实施指南。

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：4009003600(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

本文档为上海证券交易所ETF多码合一相关业务技术实施指南，对市场参与者技术实施提出建议。

2 本所市场接口调整说明

此次市场接口调整主要是为配合ETF多码合一相关业务需求，在综合业务平台市场参与者接口规格说明书删除原ETF现金申赎/黄金ETF实物申赎申报消息、申报响应消息、执行报告消息，将ETF现金申赎/黄金ETF实物申赎合并到ETF实物申赎业务实时接口。删除过户数据接口bghXXXXX.dbf中关于ETF现金申赎和黄金ETF实物申赎的相关说明，并将申赎业务过户记录合并到基金过户数据接口，调整ETF实物申赎过户记录相关说明。

在竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书调整申报接口、成交回报接口、过户数据接口、产品非交易基础信息接口等，删除ETF申赎相关说明。

在特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）调整ETF定义文件、ETF确认文件及ETF公告文件的“基金以及市场申赎代码”字段填写说明。删除传统接口变化中原竞价ETF申赎成交回报的内容。

3 业务说明

ETF多码合一业务中，将竞价撮合平台的ETF申赎业务（单市场/跨市场股票ETF、科创板ETF等申赎）迁移至综合业务平台，并和综合业务平台的ETF现金申赎和黄金ETF实物申赎使用统一的申报消息、申报响应消息、执行报告消息，并取消ETF申赎代码和资金代码。盘后过户数据合并到基金过户文件。

4 市场参与者技术实施建议及注意事项

- 1) 本所发给市场参与者的基金过户文件中，通过业务类型区分ETF实物申赎、ETF现金申赎、黄金ETF实物申赎和ETF集合申购业务。

- 2) 本所提供市场参与者的实时申报消息中，通过业务类型请求编号（reqid）区分ETF实物申赎、ETF现金申赎和黄金ETF实物申赎业务。
- 3) ETF多码合一业务上线后，取消ETF申赎代码和资金代码，竞价撮合平台不再支持ETF申赎业务。
- 4) 市场参与者应充分评估该业务对交易相关技术系统的影响，做好相关技术系统维护、改造工作，确保ETF多码合一相关业务的顺利开展，同时保障现有上交所股票、债券、基金、融资融券、港股通、股票期权等各类业务正常运行。
- 5) 市场参与者应根据本所要求，利用本所提供的测试环境进行充分测试验证。

5 相关技术文档

本所技术文档详见上交所网站交易技术支持专区，本次业务涉及相关技术文档如下：

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1.49版
_20210906（ETF多码合一技术开发稿）

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1.54版
_20210906（ETF多码合一技术开发稿）

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）1.4版
_20210906（ETF多码合一技术开发稿）