

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
ETF集合申购相关业务
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

二〇二一年五月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20210525	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集合申购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集合申购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集合申购相关业务需求，在综合业务平台市场参与者接口规格说明书增加了ETF集合申购业务申报消息、撤单消息、响应消息，基金过户文件中增加ETF集合申购业务成交数据。

3 业务说明

基金公司在做ETF集合申购业务时，在集合申购日（以下简称“E日”）前一交易日，基金公司需在业务管理系统平台上提交ETF集合申购相关数据及承诺函等信息给上海证券交易所进行审核。审核通过后，E日实时交易期间，基金公司在综合业务平台提交ETF集合申购业务相关订单，其中，申报消息中“交易编号”（1080 RefOrderID）需与业务管理系统平台上提交的申报数据中的“交易编号”相同，其他申报信息需与审核通过后的信息保持一致。当日申报成交结果，闭市后通过基金过户数据接口发送给基金公司投资者账户指定的券商。

强制赎回流程同集合申购流程。

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，通过业务类型区分集合申购与强制赎回业务，发给基金公司的“交易所订单编号”、“会员内部编号”与发给投资者账户指定的券商的“交易所订单编号”、“会员内部编号”相同。
- 2) 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集合申购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。
- 3) 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1.48版(ETF集合申购业务技术开发稿)20210525

IS111-上海证券交易所报盘软件错误代码表3.18版-(ETF集合申购业务技术开发稿)