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**

**1.1版**



上海证券交易所

**二零一九年一月**

**版本历史**

|  |  |
| --- | --- |
| **版本号** | **调整内容** |
| V1.0 20180402 | 根据业务方案完成初稿 |
| V1.1 20190114 | 根据债券质押式回购交易时间延长业务规则调整资金前端控制自设额度申报时间 |
|  |  |

**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9：15-9：25，9：30-11：30，13：00-15：30。

# 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