

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所  
定向可转债相关业务  
市场参与者技术实施指南  
1.0 版



上海证券交易所  
二〇二〇年十一月

## 版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20201113	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”）定向可转债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](mailto:tech_support@sse.com.cn)

技术服务微信公众号：SSE-TechService



## 1 简介

定向可转债，是指本所上市公司向特定对象发行，并在一定期间内依照约定条件可以转换成上市公司股票的公司债券。本文档为上海证券交易所定向可转债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

本次定向可转债相关业务主要是在综合业务平台增加了定向可转债转让业务、定向可转债转股业务和定向可转债回售业务，同时启用了债券非交易基础信息接口（zfjyyyyymmdd.xml），并在闭市后的过户数据接口（dghXXXXXXYYYYMMDD.dbf）中包含了定向可转债转让申报成交数据。为配合定向可转债业务需求，在竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书修订了产品基础信息文件（cpxxMMDD.txt），增加了相关证券子类别。

## 3 业务说明

定向可转债转让业务、定向可转债转股业务和定向可转债回售业务通过综合业务平台实现，定向可转债的转股、回售业务不分配辅助代码。

## 4 市场参与者技术实施建议及注意事项

- 1) 市场接口债券非交易信息文件（zfjyyyyymmdd.xml）中将揭示转股价格。
- 2) 转股申报需要填写转股价格，盘中会对转股价格进行校验，与系统设置的价格不一致时会被拒单。
- 3) 定向可转债相关业务有转股、转让、回售，只有当转让业务期间内，产品基础信息文件（cpxxMMDD.txt）中才会有定向可转债的记录存在，如果无转让业务市场投资者可参考债券非交易信息文件获取转股和回售相关信息。

- 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，确保定向可转债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 1.45a 版（定向可转债技术开发稿）-20201109

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 1.49 版（定向可转债技术开发稿）-20201109