上海证券交易所技术文档



**科创板市场参与者技术实施指引**

**1.5版**



上海证券交易所

**二零一九年六月**

**版本历史**

|  |  |
| --- | --- |
| **版本号** | **调整内容** |
| V1.0 20190304 | 根据科创板技术开发稿3月修订情况编写 |
| V1.1 20190402 | 根据科创板技术开发稿4月第二次修订情况编写 |
| V1.2 20190410 | 根据科创板最新业务规则，增加市价单保护限价的相关说明 |
| V1.3 20190429 | 根据科创板转融通需求，调整转融通申报、执行报告、过户数据和公共数据消息的说明  根据科创板存托凭证需求，在产品信息中新增产品存托凭证标识 |
| V1.4 20190523 | 增加对竞价撮合平台柜台交易系统及EzOES升级策略的说明 |
| V1.5 20190604 | 增加市场端软件EzTrader说明 |

**文档摘要**

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）科创板相关交易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**

|  |
| --- |
| 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 (回复00进入人工服务)  **3e4dc5951bf0a4ce7754c754c3ef8087** |

# 简介

本文档为上海证券交易所科创板技术接口及相关变更的技术实施指引，并对券商端技术系统改造提出建议。科创板盘后固定价格交易在综合业务平台实施，其它相关业务在竞价撮合平台实施。

# 市场接口变化

（1）竞价撮合平台增加产品基础信息文件接口：第一版本第二批次cpxx0102MMDD.txt、第二版本第一批次cpxx0201MMDD.txt、第二版本第二批次cpxx0202MMDD.txt；即产品基础信息文件将有2个版本，每个版本分2批次对外发送。

（2）竞价撮合平台订单申报接口，新增两类订单类型；

（3）根据业务安排，拟规定科创板市价申报订单中包括保护限价。本所交易系统处理市价申报时，买入申报的成交价格和转限价的价格不高于保护限价，卖出申报的成交价格和转限价的价格不低于保护限价。因此调整竞价撮合平台市价申报接口价格字段的填写规则，支持填写保护限价信息；

（4）竞价撮合平台新增科创板交易公开信息接口；

（5）竞价撮合平台证券权益接口，调整相关字段；

（6）竞价撮合平台在产品信息第二版第一批次文件cpxx0201MMDD.txt增加存托凭证标识;

（7）综合业务平台增加盘后固定价格业务类型、新增STEP行情接口并调整行情文件接口；

（8）科创板转融通业务允许战略配售股份参与出借。科创板转融通约定申报支持实时对出借人、中证金融公司和借入人账户可卖余额的调整，即借入人可实时借入证券，办理相关业务。综合业务平台调整转融通申报、执行报告和过户数据的说明，在备注字段中增加战略配售股份标志，以支持战略配售股份参与出借；调整转融通公共数据消息的说明，增加科创板约定申报不揭示申报总量和成交总量的描述。

（9）错误代码表新增竞价撮合平台和综合业务平台相关错误代码；

（10）行情网关增加盘后固定价格交易的行情接口说明，调整国债预发行接口字段值。

上述接口变化，仅供技术开发时参考，涉及柜台系统的对接处理及改造，详细内容请参考最新发布的市场接口，涉及业务规则部分，以发布的业务实施细则为准。

# 市场端软件发布

为适应科创板相关技术需求与接口变更，本所将发布涉及改造的市场端软件，相关信息如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **软件名称** | **计划版本** | **主要变更** |
| 报盘子系统 EzOES | 2019版 | 支持科创板新增市价单类型的需求；  支持科创板市价订单申报指令中包括保护限价信息 |
| 行情接收客户端EzSR | 综业平台配置 | 支持综合业务平台盘后固定价格、国债预发行业务的行情接收 |
| 行情网关软件MDGW | 0.3.5 | 支持综合业务平台盘后固定价格的行情接收 |
| 通用交易端EzTrader | 2019版 | 支持盘后固定价格交易申报 |

注1：科创板业务上线时，上述软件若未同步升级将无法支持科创板相关业务功能。

1. EzOES软件若未同步升级，将无法正常支持科创板产品的市价订单申报（详细的申报接口填写规则，请参见最新的《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(科创板技术开发稿)》）；因上述接口调整涉及柜台交易系统与EzOES 2019版的升级，存在以下两种升级策略：

* 先升级EzOES 至2019版，后升级柜台交易系统；
* 柜台交易系统、EzOES 版本同步升级；

请各市场参与者认真评估自身实际情况，审慎选择升级策略，并在本所周二、周四88环境及周末科创板全网演练中进行充分测试验证，确保生产系统的安全运行。

1. EzSR软件本次提供通过FAST协议接收综合业务平台行情的支持，用户需随业务同步升级，以避免软件界面与日志报警；另外，现有通过SR协议发送的综业行情文件（mktdt01.txt）在并行期后将择机下线。

注2：实际软件版本与变更随业务需求可能有所调整，以实际发布为准。

# 会员技术系统改造建议

会员技术系统应在保持现有上交所股票、债券、基金、股票期权等各类业务正常运行的基础上，提供科创板相关的投资者适当性管理、交易管理、风险管理等功能。

1. 投资者适当性管理

* 会员应对投资者交易资格进行准入控制，参与科创板股票交易的投资者应当符合本所规定的适当性管理要求，通过相关校验的合格投资者方可开通科创板交易权限。
* 会员系统应根据投资者适当性管理业务规则对投资者进行管理，并根据投资者所属级别进行交易权限前端控制。

1. 交易管理

* 会员系统应根据科创板交易特别规定的要求，为合格投资者进行科创板股票交易提供竞价交易、盘后固定价格交易和大宗交易等方式。
* 会员系统应对科创板股票委托申报中委托类型、价格涨跌幅、申报数量、申报价格等各要素进行有效验证，做好前端控制。
* 会员系统应对科创板股票提供行情揭示等功能。

1. 风险管理

* 会员系统应设定科创板股票交易相应的监控指标和预警参数，对投资者的交易行为进行监督和管理。

1. 其他

* 会员系统改造不得改变或影响现有业务及技术接口规范的要求。

# 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，本次涉及相关技术文档如下：

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

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

IS111 上海证券交易所报盘软件错误代码表

IS120 上海证券交易所行情网关BINARY数据接口规范

IS120 上海证券交易所行情网关STEP数据接口规范