

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所  
特定参与者接口规格说明书  
(基金公司卷)

2.6 版



上海证券交易所  
二〇二六年七月

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》2.6 版 发布说明

2026 年 7 月修订内容：

配合 IOPV 外部源机构接入，调整如下：

1、ETF 定义文件接口，IOPV 发布标记字段新增字段取值 C，代表由第三方机构（非中证指数公司）计算 IOPV，经互联网交易平台转发，通过交易所行情发布；调整取值 B 含义为：由中证指数公司计算 IOPV，通过交易所行情发布。

2、ETF 公告文件接口，对应 ETF 定义文件，调整 Publish（PublishIOPVFlag）字段描述。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》2.5 版 发布说明

2026 年 3 月修订内容：

- 1、下线 ETF 定义文件 2.1 版、ETF 确认文件 2.1 版、ETF 公告文件 2.1 版，删除相关描述。
- 2、基金公司盘后数据文件 ZZZZZ.sse 新增新竞价过户数据文件（gh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt）、新竞价发行过户数据文件（ipogh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt）、指定过户数据文件（zdgh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt）。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》2.4 版 发布说明

2026 年 2 月修订内容：

根据 IOPV 行情计算源调整规划，交易所不再支持计算 IOPV，调整 ETF 定义文件接口中 Publish IOPV Flag 字段（xml 版为 PublishIOPVFlag 字段），取消“Y-由交易系统计算 IOPV 且通过行情发布”取值。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》2.3 版 发布说明

2025 年 11 月修订内容：

- 1、基于《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》文档正式废止，相关内容迁移至《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》，更新相关引用描述。
- 2、调整 ETF 定义文件 xml 版、ETF 公告文件 xml 版接口描述，明确部分字段填写规则（无本质规则调整）。
- 3、卫星发送盘后数据功能下线，调整相关描述。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》2.2 版 发布说明

2025 年 10 月修订内容：

调整文件结构约定章节，新增加载要求：数据接收方在加载时（包括读取、稽核、比较等场景）应按照 xml 标签进行读取，不应受 xml 标签顺序（字段顺序）影响。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》2.1 版 发布说明

2025 年 10 月修订内容：

调整 ETF 定义文件 xml 版接口，将 InvestorAccountID、PBUID 字段调整为必填，删除填空相关描述。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》2.0 版 发布说明

2025 年 10 月修订内容：

根据 ETF 定义文件整体规划，调整如下：

一、新增 ETF 定义文件 xml 版、ETF 确认文件 xml 版、ETF 公告文件 xml 版相关描述。

（一）ETF 定义文件 xml 版和 ETF 确认文件 xml 版相对于 2.1 版，除格式变更外：

1. 启用“市场 ID”字段；
2. 调整“替代标志”字段描述；
3. 启用“当日净申购基金份额上限”、“当日净赎回基金份额上限”字段；
4. 新增“单个账户净申购总额限制”、“单个账户净赎回总额限制”字段；
5. 新增“单个账户累计申购总额限制”、“单个账户累计赎回总额限制”字段；
6. 增加部分字段长度；
7. 新增“申赎模式”字段。

（二）ETF 公告文件 xml 版相对于 2.1 版，除格式变更外：

1. 启用“市场 ID”字段；
2. 调整“替代标志”字段描述；
3. 新增“当日净申购基金份额上限”、“当日净赎回基金份额上限”字段；
4. 新增“单个账户净申购总额限制”、“单个账户净赎回总额限制”字段；
5. 新增“单个账户累计申购总额限制”、“单个账户累计赎回总额限制”字段；
6. 新增“当日申购限额”、“当日赎回限额”；
7. 增加部分字段长度；
8. 新增“申赎模式”字段。

（三）调整 ETF 定义文件部分字段填写说明：

1. NAVperCU、NAV、PreCashComponent、CashDividend、EstimatedCashComponent 字段不再要求小数位补零。
2. CreationLimit、RedemptionLimit 必须大于等于每个篮子对应的 ETF 份数（CreationRedemptionUnit），不再要求必须是最小申购、赎回单位（CreationRedemptionUnit）的正整数倍。

（四）在 2.3.2 交互文件通用约定章节中，增加 xml 版相关约定。

二、根据新“替代标志”及新增“申赎模式”字段取值，调整附录一为“ETF 产品与申赎模式、替代标志、市场 ID 对应关系表”（含跨市场债券（银行间）ETF）。

三、新增附录二 xml 版本文件结构、附录三 ETF 定义文件标志文件举例、附录四 现金替代比例计算说明、附录五 现金替代标志说明。

此处仅保留近一年的修订记录，历史修订记录详见文末历史修订记录部分。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

服务电话：4008888400-2

通信地址：上海市浦东南路 528 号上交所技术公司技术开发总部

网站地址：<http://www.sse.com.cn/> — 服务 — 交易技术支持专区

# 目 录

|          |                                       |           |
|----------|---------------------------------------|-----------|
| <b>1</b> | <b>简介.....</b>                        | <b>1</b>  |
| 1.1      | 本文的目的.....                            | 1         |
| <b>2</b> | <b>交易所基金（ETF）文件接口规范.....</b>          | <b>2</b>  |
| 2.1      | 概要.....                               | 2         |
| 2.2      | 接口信息流.....                            | 2         |
| 2.2.1    | 文件接口说明.....                           | 2         |
| 2.3      | 基于文件的接口.....                          | 3         |
| 2.3.1    | 交易系统和基金管理公司之间的文件接口清单.....             | 3         |
| 2.3.2    | 交互文件通用约定.....                         | 3         |
| 2.3.2.1  | 文件交互通道.....                           | 3         |
| 2.3.2.2  | 文件上传约定.....                           | 3         |
| 2.3.2.3  | 文件命名约定.....                           | 3         |
| 2.3.2.4  | 文件结构约定.....                           | 4         |
| 2.3.2.5  | 文件规格约定.....                           | 5         |
| 2.3.2.6  | 文件应急约定.....                           | 6         |
| 2.3.3    | 由基金管理公司发送至交易系统的文件.....                | 7         |
| 2.3.3.1  | ETF 定义文件 xml 版.....                   | 7         |
| 2.3.4    | 由交易系统发送至基金管理公司的文件.....                | 12        |
| 2.3.4.1  | ETF 确认文件 xml 版.....                   | 12        |
| 2.3.4.2  | ETF 公告文件 xml 版.....                   | 14        |
| 2.3.4.3  | 过户数据文件(包含 ETF 申购赎回成交数据).....          | 17        |
| 2.4      | ETF 实时申赎.....                         | 17        |
| <b>3</b> | <b>盘后文件接口规范.....</b>                  | <b>18</b> |
| 3.1      | 基金公司盘后数据文件.....                       | 18        |
| 3.2      | 基金公司数据文件解密工具.....                     | 19        |
| 3.2.1    | 数据文件解密工具功能.....                       | 19        |
| 3.2.2    | 解密使用示例.....                           | 19        |
| 3.2.3    | 重要提示（FAQ）.....                        | 20        |
| <b>4</b> | <b>后记.....</b>                        | <b>21</b> |
|          | 附录一 ETF 产品与申赎模式、替代标志、市场 ID 对应关系表..... | 22        |
|          | 附录二 XML 版本文件结构.....                   | 24        |
|          | 附录三 ETF 定义文件标志文件举例.....               | 26        |
|          | 附录四 现金替代比例计算说明.....                   | 27        |
|          | 附录五 XML 版现金替代标志说明.....                | 28        |
|          | 历史修订记录.....                           | 29        |

# 图表目录

|                                             |    |
|---------------------------------------------|----|
| 图 1: ETF 定义文件/确认文件/公告文件文件命名规范 (xml 版) ..... | 4  |
| 图 2: 基金公司接口数据流图 .....                       | 18 |
|                                             |    |
| 表 1: 交易系统和基金管理公司之间的接口文件.....                | 3  |
| 表 2: 标志文件格式 .....                           | 7  |
| 表 3: ETF 定义文件 xml 版.....                    | 11 |
| 表 4: ETF 确认文件 xml 版.....                    | 14 |
| 表 5: ETF 公告文件 xml 版.....                    | 16 |
| 表 6: ETF 产品与申赎模式、替代标志、市场 ID 对应关系表 .....     | 23 |
| 表 7: 现金替代标志说明 .....                         | 28 |

## 1 简介

上海证券交易所特定参与者接口规格说明书含多卷：基金公司卷、托管银行卷、网下 IPO 卷。

本文为上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）。

### 1.1 本文的目的

本文是交易系统和基金管理公司之间的接口的功能和技术规格文档，包括两部分内容：

1. 交易系统和基金管理公司的关于交易所基金（ETF）业务的接口；
2. 交易系统通过证通云盘在盘后发送基金管理公司的数据文件接口。

## 2 交易所基金（ETF）文件接口规范

本章节是交易系统和基金管理公司之间的接口的功能和技术规格文档。本文详细定义了：

- 1、交易系统和基金管理公司之间存在的接口
- 2、交易系统和基金管理公司之间接口所采用的技术和标准
- 3、通过接口交换的数据
- 4、接口交换数据的格式
- 5、数据如何在接口处进行交换

### 2.1 概要

本文用于描述交易系统与基金管理公司的关于交易所基金（ETF）业务的接口。对于基金管理公司的封闭式基金业务，基金管理公司所需要的交易功能与普通券商一致，采用与普通券商一致的接入方式。关于券商的接入方式，请参考市场参与者接口技术规格说明文档；对于开放式基金业务，基金管理公司通过中国登记结算公司开展开放式基金业务，不与交易所发生直接联系。

关于 ETF 基金业务，交易系统与基金管理公司之间是基于文件的接口。

基于文件的接口用来在交易系统和基金管理公司之间批量地交换数据，其中主要是 ETF 定义文件和过户数据文件。

### 2.2 接口信息流

#### 2.2.1 文件接口说明

基金公司交易系统关于现货交易的申报及数据传输方式，请参考市场参与者接口规格说明文档描述。本文档侧重描述 ETF 定义文件和申购赎回的数据接口，ETF 定义文件上传与确认的方式。

为有效地与基金管理公司交换和确认 ETF 定义文件，交易系统将提供给基金管理公司如下组件：

文件传输及确认客户端（证通云盘）

在基金管理公司的 PC 上，将部署一个 ETF 定义文件上传程序。该程序提供如下功能：

- 选择需要发送的文件，程序进行格式检查后将文件发送至交易系统。
- 通知上传人员从交易系统返回的响应结果

## 2.3 基于文件的接口

### 2.3.1 交易系统和基金管理公司之间的文件接口清单

交易系统和基金管理公司间交换的数据包括如下内容：

| 次要类型    | 信息                           | 基金公司上传交易系统 | 交易系统发送基金公司 |
|---------|------------------------------|------------|------------|
| 交易所交易基金 | ETF 定义文件                     | ●          |            |
|         | ETF 确认文件                     |            | ●          |
|         | ETF 公告文件                     |            | ●          |
| 接口      | 过户数据文件<br>(包含 ETF 申购赎回日成交数据) |            | ●          |

表 1：交易系统和基金管理公司之间的接口文件

### 2.3.2 交互文件通用约定

#### 2.3.2.1 文件交互通道

基金公司可以通过证通云盘上传 ETF 定义文件、获取 ETF 确认文件、ETF 公告文件，通过证通云盘接收盘后过户数据。

市场机构可以通过证通云盘获取 ETF 公告文件及盘后过户数据。

#### 2.3.2.2 文件上传约定

- ETF 定义文件上传时间

基金公司上传下一交易日使用的 ETF 定义文件，上传时间为 18:00-24:00 及下一交易日的 0:00-6:00，周五的情况也适用。（考虑到交易所周末测试等因素，建议基金公司节假日后第一个交易日的定义文件在当天早上上传）

定义文件可以多次上传，但交易系统以最后收到且校验成功的文件为准。

若交易系统在开市后发现系统中无某 ETF 的定义文件，则自动暂停该 ETF 的申购赎回业务，但 ETF 交易业务可以进行。

- ETF 定义文件上传格式版本

交易系统支持基金公司上传 xml 格式版本的 ETF 定义文件。

#### 2.3.2.3 文件命名约定

交易系统和基金管理公司及市场机构之间交换的文件遵循以下命名规范：

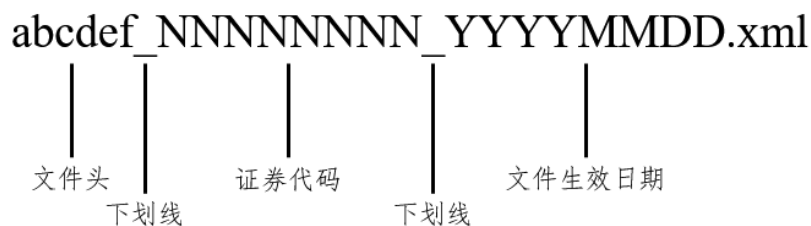


图 1：ETF 定义文件/确认文件/公告文件文件命名规范（xml 版）

- 文件头
  - ETF 定义文件固定为 etfd。
  - ETF 确认文件固定为 etfc。
  - ETF 公告文件固定为 ssepcf。
- 证券代码
  - 为该 ETF 二级市场交易代码。

#### 2.3.2.4 文件结构约定

- 字段
  - 如果字段必选项为“否”，则该字段允许为空。
  - 如果某一字段为空或未启用，则该字段 xml 标签不应出现。
- 文件编码
  - 均为 UTF-8 编码无 BOM 格式。
- 文件模板

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<root>
  <child1>.....</child1>
  <child2>
    <subchild1>.....</subchild1>
    <subchild2>.....</subchild2>
    .....
  </child2>
  .....
</root>
```

具体可参见附录二。

- 根元素（root）
  - ETF 定义文件为 ETFDefinition。
  - ETF 确认文件为 ETFConfirmation。
  - ETF 公告文件为 SSEPortfolioCompositionFile。

- 扩展性要求

未来新增字段时，如接收方不使用新增字段，应能够自动忽略新增字段，无需改造。

未来调整字段长度时，如接收方不使用对应字段，应能够自动忽略对应字段，无需改造。

- 加载要求

数据接收方在加载时（包括读取、稽核、比较等场景）应按照 **xml** 标签进行读取，不应受标签顺序（字段顺序）影响。

### 2.3.2.5 文件规格约定

交易系统和基金管理公司之间交换的接口文件功能规格说明的条目如下：

- 文件名

该文件的名称。

- 处理类型

目标系统对该文件的处理类型，交易型或对帐型。

- 功能描述

对该文件功能的简要描述。

- 时间和频率

该文件何时以及以何等的频率由交易系统或外部系统生成，并且作为流出（入）的文件上传（下载）到交易系统或外部系统。

- 产品类型

该功能适用的产品类型。

- 关联文件

该文件的生成和处理与其它文件的关联关系。

- 数据格式

文件中数据的格式和对各字段的描述。

所有在交易系统与基金管理公司之间交换的 **xml** 格式文件，字段类型分为以下三类：

#### 一、字符串型

“CX”代表该字段为字符串型字段，X 为该字段的最大字节长度，例如“C5”代表最大长度为 5 字节的字段。

#### 二、十进制整数型

“NX”代表该字段为十进制整数型字段，可表示正负（由负数表示字符“-”，“0”至“9”组成），X 为该整数的最大长度（包括符号位），例如“N5”代表最大长度为 5 的整数字段。

### 三、十进制浮点数字型

“NX(Y)”代表该字段为十进制浮点数字型字段，可表示正负（由负数表示字符“-”，“0”至“9”和“.”组成），X 代表该字段的最大长度（包括小数点和符号位），Y 代表该字段最大小数位长度，对于无符号字段其整数位数最大长度为 X-Y-1，对于有符号字段其整数位数最大长度为 X-Y-2，例如“N8(4)”代表字段最大长度为 8，最大小数位长度为 4，最大整数位长度为 3（正数）或 2（负数）。

xml 格式字段均为变长字段，字段不足最大长度左右两端不可补空或补零。

- 处理

简要说明交易系统应如何处理该文件。

对于交易系统发往外部系统的文件，外部系统如何处理文件不在本文档的描述范围内，该部分应为空。

- 例外事件

指文件或行条目处理过程中可能发生的例外事件。对于交易系统发往外部系统的文件，外部系统如何实施相关的例外处理不在本文档的描述范围内，该部分应为空。

#### 2.3.2.6 文件应急约定

- 应急流程

基金公司使用应急通道上传定义文件后，交易系统不会返回确认文件及公告文件，但在定义文件通过校验后会生成并向市场发布 ETF 公告文件及其标志文件。

- 标志文件

基金管理公司应急发送到交易所的 ETF 定义文件，需要同时发送一个标志文件。通过主用通道上传定义文件至交易系统时无需上传其标志文件。

该标志文件命名规则为：

主文件名.flg

其中主文件名为其所标志的文件的名字。

文件格式：

1、每行为一个数据单元，由多个字段组成，各字段间以分隔符“|”进行分隔，行开头和结束不包括分隔符。各行以“New Line”字符（0xA）结尾。

2、字段内容不足字段长度的左对齐，右补空格。

文件内容如下：

| 编号 | 字段名            | 字段类型 | 描述                   | 必选项 |
|----|----------------|------|----------------------|-----|
| 1  | File Name      | C 60 | 被标志的文件名              | 是   |
| 2  | File Size      | C 16 | 文件大小，以字节为单位          | 是   |
| 3  | Creation Date  | C 8  | 该文件的生成日期，YYYYMMDD 格式 | 是   |
| 4  | Creation Time  | C 6  | 文件生成时间，HHMMSS 格式     | 是   |
| 5  | Record Number  | C 12 | 文件记录数（xml 版为文件行数）    | 是   |
| 6  | Check Sum      | C 64 | MD5 校验码              | 是   |
| 7  | Reserved Field | C 64 | 预留字段                 |     |

表 2：标志文件格式

### 2.3.3 由基金管理公司发送至交易系统的文件

#### 2.3.3.1 ETF 定义文件 xml 版

- 文件名

etfd\_NNNNNNNN\_YYYYMMDD.xml，其中 NNNNNNNN 为该 ETF 二级市场交易代码，按照实际长度填写。

- 功能描述

该文件用于描述 ETF

- 产品类型

交易型开放式基金

- 时间和频率

按照“处理”一节描述的流程发送，直至双方确认。

- 关联文件

无

- 数据格式

| 字段名               | 字段类型 | 描述                                       | 必选项 |
|-------------------|------|------------------------------------------|-----|
| Version           | C8   | ETF 每日传递的版本号<br>从 1 开始，供比较用，必须递增（可以不连续）。 | 是   |
| ISINCode          | C12  | ETF 产品国际代码                               | 否   |
| FundInstrumentID  | C12  | 基金二级市场交易代码<br>最大支持 6 位。                  | 是   |
| InvestorAccountID | C13  | 基金公司在 ETF 申购/赎回中使用的沪市账户<br>最大支持 10 位。    | 是   |
| PBUID             | C8   | 基金公司在 ETF 申购/赎回中使用的沪市 PBU                | 是   |

|                         |        |                                                                                                                                                                                                                 |   |
|-------------------------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|
|                         |        | 须为沪市账户指定的PBU或其同一联通圈PBU。<br>最大支持5位。                                                                                                                                                                              |   |
| FundName                | C40    | 基金名称                                                                                                                                                                                                            | 否 |
| FundCompanyName         | C50    | 基金公司名称                                                                                                                                                                                                          | 否 |
| UnderlyingIndex         | C20    | 标的指数代码                                                                                                                                                                                                          | 否 |
| UnderlyingIndexISINCode | C12    | 标的指数国际代码                                                                                                                                                                                                        | 否 |
| CreationRedemptionUnit  | N12    | 每个篮子（最小申购、赎回单位）对应的ETF份数<br>必须大于0，最大支持8位数字。                                                                                                                                                                      | 是 |
| TradingDay              | C8     | 当前交易日                                                                                                                                                                                                           | 否 |
| PreTradingDay           | C8     | 前一交易日，具体由业务含义约定                                                                                                                                                                                                 | 否 |
| NAVperCU                | N19(5) | 前一日最小申赎单位净值<br>暂最大支持N12(2)。                                                                                                                                                                                     | 否 |
| NAV                     | N19(5) | 前一日基金份额净值<br>暂最大支持N8(4)。                                                                                                                                                                                        | 是 |
| PreCashComponent        | N19(5) | 前一日现金差额<br>暂最大支持N11(2)。                                                                                                                                                                                         | 否 |
| CashDividend            | N19(5) | 最小基金单位现金分红<br>暂最大支持N8(4)。                                                                                                                                                                                       | 是 |
| EstimatedCashComponent  | N19(5) | T日每个篮子的预估现金差额<br>暂最大支持N11(2)。                                                                                                                                                                                   | 是 |
| MaxCashRatio            | N7(5)  | 总的现金替代比例<br>填写比例数值（非百分比），例如：5.551%在此字段中<br>填写0.05551，2.1%填写0.021。<br>必须大于等于0。<br>其控制方式详见附录四。                                                                                                                    | 是 |
| CreationLimit           | N18    | 当日申购限额<br>必须大于等于每个篮子对应的ETF份数<br>（CreationRedemptionUnit）。<br>不做控制时此字段xml标签不应出现。<br>最大支持12位数字。                                                                                                                   | 否 |
| RedemptionLimit         | N18    | 当日赎回限额<br>必须大于等于每个篮子对应的ETF份数<br>（CreationRedemptionUnit）。<br>不做控制时此字段xml标签不应出现。<br>最大支持12位数字。                                                                                                                   | 否 |
| PublishIOPVFlag         | C1     | 用以表示单位净参考值是否需要公布的标志位<br>B – 由中证指数公司 <del>第三方机构（非交易所）</del> 计算<br>IOPV，通过交易所行情发布<br><u>C – 由第三方机构（非中证指数公司）计算IOPV，经互<br/>联网交易平台转发，通过交易所行情发布</u><br>N – 交易系统不计算IOPV，也无需通过交易所行情发<br>布<br>跨境ETF，此字段取值应为B，但交易系统不进行校验。 | 是 |

|                              |     |                                                                                                 |   |
|------------------------------|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------|---|
| CreationRedemptionSwitch     | C1  | 申购/赎回切换<br>0 - 不允许申购/赎回<br>1 - 申购和赎回皆允许<br>2 - 仅允许申购<br>3 - 仅允许赎回                               | 是 |
| CreationRedemptionMechanism  | C1  | 申赎模式<br>0 - 现金申赎<br>1 - 沪市成分证券实物对价<br>2 - 沪市、深市成分证券实物对价（预留，暂不启用）<br>3 - 银行间市场债券实物对价             | 是 |
| RecordNumber                 | N5  | 成分证券的数目<br>取值1-9999，且与后续成分证券数量相同。                                                               | 是 |
| LastTenMinuteRedemptionLimit | N12 | 最后10分钟赎回的基金份额上限<br>为0表示没有限制，目前只能为整数。<br>暂时未启用，此字段xml标签不应出现。。                                    | - |
| NetCreationLimit             | N18 | 当日净申购基金份额上限<br>必须大于等于每个篮子对应的ETF份数（CreationRedemptionUnit）。<br>不做控制时此字段xml标签不应出现。<br>最大支持12位数字。  | 否 |
| NetRedemptionLimit           | N18 | 当日净赎回基金份额上限<br>必须大于等于每个篮子对应的ETF份数（CreationRedemptionUnit）。<br>不做控制时此字段xml标签不应出现。<br>最大支持12位数字。  | 否 |
| NetCreationLimitPerAcct      | N18 | 单个账户净申购总额限制<br>必须大于等于每个篮子对应的ETF份数（CreationRedemptionUnit）。<br>不做控制时此字段xml标签不应出现。<br>最大支持12位数字。  | 否 |
| NetRedemptionLimitPerAcct    | N18 | 单个账户净赎回总额限制<br>必须大于等于每个篮子对应的ETF份数（CreationRedemptionUnit）。<br>不做控制时此字段xml标签不应出现。<br>最大支持12位数字。  | 否 |
| CreationLimitPerAcct         | N18 | 单个账户累计申购总额限制<br>必须大于等于每个篮子对应的ETF份数（CreationRedemptionUnit）。<br>不做控制时此字段xml标签不应出现。<br>最大支持12位数字。 | 否 |
| RedemptionLimitPerAcct       | N18 | 单个账户累计赎回总额限制<br>必须大于等于每个篮子对应的ETF份数（CreationRedemptionUnit）。<br>不做控制时此字段xml标签不应出现。               | 否 |

|                     |           |                |                                                                                                                                                                    |                                                                                                                             |   |
|---------------------|-----------|----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|
|                     |           |                | 最大支持12位数字。                                                                                                                                                         |                                                                                                                             |   |
| AllCashFlag         | C1        |                | 表示该基金申赎过程中是否支持全现金替代模式<br>0 – 仅支持全现金申赎模式<br>1 – 同时支持全现金申赎模式和实物申赎模式<br>2 – 仅支持实物申赎模式<br>暂时未启用，此字段xml标签不应出现。                                                          | -                                                                                                                           |   |
| AllCashAmount       | N12(3)    |                | 表示全现金替代时所需总金额<br>是否支持全现金申赎标志为0、1时此字段必填，且必须大于等于0。<br>是否支持全现金申赎标志为2时，非必填项。<br>暂时未启用，此字段xml标签不应出现。                                                                    | -                                                                                                                           |   |
| AllCashPremiumRate  | N7(5)     |                | 全现金替代时，计算申购价格时增加的比例（不含100%）<br>填写比例数值（非百分比），例如：2.551%在此字段中填写0.02551，2.1%填写0.021。<br>是否支持全现金申赎标志为0、1时此字段必填，且必须大于等于0。<br>是否支持全现金申赎标志为2时，非必填项。<br>暂时未启用，此字段xml标签不应出现。 | -                                                                                                                           |   |
| AllCashDiscountRate | N7(5)     |                | 全现金替代时，计算赎回价格时减少的比例（不含100%）<br>填写比例数值（非百分比），例如：2.551%在此字段中填写0.02551，2.1%填写0.021。<br>是否支持全现金申赎标志为0、1时此字段必填，且必须大于等于0。<br>是否支持全现金申赎标志为2时，非必填项。<br>暂时未启用，此字段xml标签不应出现。 | -                                                                                                                           |   |
| RTGSFlag            | C1        |                | 表示该基金申赎过程中是否支持RTGS<br>0 – 支持RTGS<br>1 – 不支持RTGS<br>暂时未启用，此字段xml标签不应出现。                                                                                             | -                                                                                                                           |   |
| ComponentList       |           |                | 成分证券列表                                                                                                                                                             |                                                                                                                             |   |
| →                   | Component |                | 成分证券                                                                                                                                                               |                                                                                                                             |   |
| →                   | →         | ISINCode       | C12                                                                                                                                                                | 国际产品代码                                                                                                                      | 否 |
| →                   | →         | InstrumentID   | C20                                                                                                                                                                | 证券代码                                                                                                                        | 是 |
| →                   | →         | InstrumentName | C40                                                                                                                                                                | 证券简称                                                                                                                        | 否 |
| →                   | →         | Quantity       | N10                                                                                                                                                                | 证券数量<br>必须大于等于0且小于1亿。<br>对于沪市证券：<br>1. 成分证券为债券的，单位为千元面额（1000元发行面值）；<br>2. 成分证券为股票的，单位为股；<br>3. 成分证券为其他类型的，单位为本所交易规则规定的交易单位。 | 是 |

|   |   |                        |        |                                                                                                                                                          |   |
|---|---|------------------------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|
|   |   |                        |        | 非沪市证券的，单位参照以上标准。                                                                                                                                         |   |
| → | → | SubstitutionFlag       | C1     | 替代标志<br>表示该成分证券是否可被现金替代(含义详见附录五):<br>0 – 禁止现金替代<br>1 – 允许现金替代<br>2 – 必须现金替代                                                                              | 是 |
| → | → | CreationPremiumRate    | N7(5)  | 申购溢价比例<br>证券用现金进行替代的时候，计算价格时增加的比例（不含100%）。<br>填写比例数值（非百分比），例如：2.551%在此字段中填写0.02551，2.1%填写0.021。<br>替代标志为1时，此字段必填，且取值范围为[0,1)。<br>替代标志为0,2时，此字段xml标签不应出现。 | 否 |
| → | → | RedemptionDiscountRate | N7(5)  | 赎回折价比例<br>证券用现金进行替代的时候，计算价格时减少的比例（不含100%）。<br>填写比例数值（非百分比），例如：2.551%在此字段中填写0.02551，2.1%填写0.021。<br>替代标志为1时，此字段必填，且取值范围为[0,1)。<br>替代标志为0,2时，此字段xml标签不应出现。 | 否 |
| → | → | SubstitutionCashAmount | N12(3) | 替代金额<br>该证券所需总金额。<br>必须大于等于0。<br>除以下情况，此字段必填：<br>1、替代标志为0时，此字段xml标签不应出现。<br>2、ETF实物申赎模式的ETF产品，替代标志为1且市场ID为101的成分券，此字段xml标签不应出现。                          | 否 |
| → | → | UnderlyingSecurityID   | C4     | 市场ID<br>101 = 上海证券交易所<br>102 = 深圳证券交易所<br>103 = 香港联合交易所<br>105 = 外汇交易中心<br>106 = 北京证券交易所<br>9999 = 其他                                                    | 是 |
| → | → | BuyorSelltoOpen        | C1     | 表示当成分券中含有期权期货合约时，期权期货合约是买入开仓还是卖出开仓<br>0 – 买入开仓<br>1 – 卖出开仓<br>暂时未启用，此字段xml标签不应出现。                                                                        | - |

表 3：ETF 定义文件 xml 版

• 说明

1. 通过主用通道和应急通道上传的定义文件，校验规则一致。
2. 对于深市或京市成分证券，按照收到的前一日信息文件进行校验。

3. 以上信息，由基金公司保证上传数据的准确性。
4. 交易系统以最后一次上传版本为准。
5. 对于特定类型 ETF，其所有成分股替代标志中只能出现某些取值（见附录一），对于不满足该校验的定义文件将无法上传。

- 处理

交易系统在每次收到该文件后，会对该文件进行有效性检查。

对于通过检查的 ETF 定义文件，生成如下文件及其标志文件（生成规则参见 2.3.2.6）：

- ETF 确认文件 xml 版（见第 2.3.4.1 ETF 确认文件 xml 版）
- ETF 公告文件 xml 版（见第 2.3.4.2 ETF 公告文件 xml 版）

交易系统会将 ETF 确认文件 xml 版（无标志文件）、ETF 公告文件 xml 版（无标志文件）发送给基金管理公司。

交易系统会将 ETF 公告文件 xml 版（包含标志文件）发送市场机构。市场机构可通过证通云盘获取。

- 例外事件

N/A

## 2.3.4 由交易系统发送至基金管理公司的文件

### 2.3.4.1 ETF 确认文件 xml 版

- 文件名

etfc\_NNNNNNNN\_YYYYMMDD.xml

NNNNNNNN 为该 ETF 二级市场交易代码，对应 xml 版 ETF 定义文件的文件名 NNNNNNNN 部分；

YYYYMMDD 对应 xml 格式定义文件名中的日期 YYYYMMDD。

- 处理类型

交易型

- 功能描述

交易系统使用该文件向基金管理公司发送对收到的 ETF 定义文件 xml 版的验证和确认结果。

- 产品类型

交易型开放式基金

- 时间和频率

每次收到 ETF 定义文件 xml 版后 15 秒之内，在规定的目录下生成本文件。

- 关联文件

ETF 定义文件 xml 版

- 数据格式

对于 ETF 定义文件 xml 版，返回文件如下：

| 字段名                          | 字段类型   | 描述                            |
|------------------------------|--------|-------------------------------|
| ValidationResult             | C1     | 验证结果<br>Y:代表通过验证<br>N:代表未通过验证 |
| Version                      | C8     | ETF每日传递的版本号                   |
| ISINCode                     | C12    | ETF产品国际代码                     |
| FundInstrumentID             | C12    | 基金二级市场交易代码                    |
| InvestorAccountID            | C13    | 基金公司在ETF申购/赎回中使用的沪市账户         |
| PBUID                        | C8     | 基金公司在ETF申购/赎回中使用的沪市PBU        |
| FundName                     | C40    | 基金名称                          |
| FundCompanyName              | C50    | 基金公司名称                        |
| UnderlyingIndex              | C20    | 标的指数代码                        |
| UnderlyingIndexISINCode      | C12    | 标的指数国际代码                      |
| CreationRedemptionUnit       | N12    | 每个篮子（最小申购、赎回单位）对应的ETF份数       |
| TradingDay                   | C8     | 当前交易日                         |
| PreTradingDay                | C8     | 前一交易日                         |
| NAVperCU                     | N19(5) | 前一日最小申赎单位净值                   |
| NAV                          | N19(5) | 前一日基金份额净值                     |
| PreCashComponent             | N19(5) | 前一日现金差额                       |
| CashDividend                 | N19(5) | 最小基金单位现金分红                    |
| EstimatedCashComponent       | N19(5) | T日每个篮子的预估现金差额                 |
| MaxCashRatio                 | N7(5)  | 总的现金替代比例                      |
| CreationLimit                | N18    | 当日申购限额                        |
| RedemptionLimit              | N18    | 当日赎回限额                        |
| PublishIOPVFlag              | C1     | 用以表示单位净参考值是否需要公布的标志位          |
| CreationRedemptionSwitch     | C1     | 申购/赎回切换                       |
| CreationRedemptionMechanism  | C1     | 申赎模式                          |
| RecordNumber                 | N5     | 成分证券的数目                       |
| LastTenMinuteRedemptionLimit | N12    | 最后10分钟赎回的基金份额上限               |
| NetCreationLimit             | N18    | 当日净申购基金份额上限                   |
| NetRedemptionLimit           | N18    | 当日净赎回基金份额上限                   |
| NetCreationLimitPerAcct      | N18    | 单个账户净申购总额限制                   |
| NetRedemptionLimitPerAcct    | N18    | 单个账户净赎回总额限制                   |

|                        |           |                             |
|------------------------|-----------|-----------------------------|
| CreationLimitPerAcct   | N18       | 单个账户累计申购总额限制                |
| RedemptionLimitPerAcct | N18       | 单个账户累计赎回总额限制                |
| AllCashFlag            | C1        | 表示该基金申赎过程中是否支持全现金替代模式       |
| AllCashAmount          | N12(3)    | 表示全现金替代时所需总金额               |
| AllCashPremiumRate     | N7(5)     | 全现金替代时，计算申购价格时增加的比例（不含100%） |
| AllCashDiscountRate    | N7(5)     | 全现金替代时，计算赎回价格时减少的比例（不含100%） |
| RTGSFlag               | C1        | 表示该基金申赎过程中是否支持RTGS          |
| ComponentList          |           | 成分证券列表                      |
| →                      | Component | 成分证券                        |
| →                      | →         | ISINCode                    |
| →                      | →         | InstrumentID                |
| →                      | →         | InstrumentName              |
| →                      | →         | Quantity                    |
| →                      | →         | SubstitutionFlag            |
| →                      | →         | CreationPremiumRate         |
| →                      | →         | RedemptionDiscountRate      |
| →                      | →         | SubstitutionCashAmount      |
| →                      | →         | UnderlyingSecurityID        |
| →                      | →         | BuyorSelltoOpen             |

表 4：ETF 确认文件 xml 版

- 处理

基金管理公司需要将该文件的内容与原 ETF 定义文件的内容进行比较，如果发现有错误，则需要生成一个新的 xml 版 ETF 定义文件，并重新上传。

- 例外事件

N/A

#### 2.3.4.2 ETF 公告文件 xml 版

- 文件名

ssepcf\_NNNNNNNN\_YYYYMMDD.xml

NNNNNNNN 为该 ETF 二级市场交易代码，对应 xml 版 ETF 定义文件的文件名 NNNNNNNN 部分；

YYYYMMDD 对应 xml 格式定义文件名中的日期 YYYYMMDD。

- 功能描述

交易系统根据 xml 格式的 ETF 定义文件生成 xml 格式的 ETF 公告文件，并发送给基金管理公司

进行验证和确认。

- 产品类型

交易型开放式基金

- 时间和频率

每次收到 ETF 定义文件 xml 版后 15 秒之内，在规定的目录下生成成本文件。

- 关联文件

ETF 定义文件 xml 版。

- 数据格式

文件为 UNIX 格式。

| 字段名                         | 字段类型   | 描述                                                | 对应 xml 版定义文件字段              |
|-----------------------------|--------|---------------------------------------------------|-----------------------------|
| FundInstrumentID            | C12    | 该字段填二级市场交易代码                                      | FundInstrumentID            |
| CreationRedemptionUnit      | N12    | 每个篮子对应的ETF份数                                      | CreationRedemptionUnit      |
| TradingDay                  | C8     | 当前交易日                                             | TradingDay                  |
| PreTradingDay               | C8     | 前一交易日，具体由业务含义约定                                   | PreTradingDay               |
| NAVperCU                    | N19(5) | 前一日最小申赎单位净值                                       | NAVperCU                    |
| NAV                         | N19(5) | 前一日基金份额净值                                         | NAV                         |
| PreCashComponent            | N19(5) | 前一日现金差额                                           | PreCashComponent            |
| EstimatedCashComponent      | N19(5) | T日每个篮子的预估现金差额                                     | EstimatedCashComponent      |
| MaxCashRatio                | N7(5)  | 最大现金替代比例                                          | MaxCashRatio                |
| CreationLimit               | N18    | 当日申购限额                                            | CreationLimit               |
| RedemptionLimit             | N18    | 当日赎回限额                                            | RedemptionLimit             |
| NetCreationLimit            | N18    | 当日净申购基金份额上限                                       | NetCreationLimit            |
| NetRedemptionLimit          | N18    | 当日净赎回基金份额上限                                       | NetRedemptionLimit          |
| NetCreationLimitPerAcct     | N18    | 单个账户净申购总额限制                                       | NetCreationLimitPerAcct     |
| NetRedemptionLimitPerAcct   | N18    | 单个账户净赎回总额限制                                       | NetRedemptionLimitPerAcct   |
| CreationLimitPerAcct        | N18    | 单个账户累计申购总额限制                                      | CreationLimitPerAcct        |
| RedemptionLimitPerAcct      | N18    | 单个账户累计赎回总额限制                                      | RedemptionLimitPerAcct      |
| PublishIOPVFlag             | C1     | 是否需要发布IOPV<br>当定义文件取值B、C时，此处为1<br>当定义文件取值为N时，此处为0 | PublishIOPVFlag             |
| CreationRedemptionSwitch    | C1     | 申购赎回切换                                            | CreationRedemptionSwitch    |
| CreationRedemptionMechanism | C1     | 申赎模式                                              | CreationRedemptionMechanism |
| RecordNumber                | N5     | 成分证券数量                                            | RecordNumber                |

|                     |           |                        |        |                                                          |                        |
|---------------------|-----------|------------------------|--------|----------------------------------------------------------|------------------------|
| AllCashFlag         |           |                        | C1     | 是否支持全现金申赎<br>暂时未启用，此字段xml标签不出现。                          | AllCashFlag            |
| AllCashAmount       |           |                        | N12(3) | 全现金替代的总金额<br>暂时未启用，此字段xml标签不出现。                          | AllCashAmount          |
| AllCashPremiumRate  |           |                        | N7(5)  | 全现金替代的申购溢价比例<br>暂时未启用，此字段xml标签不出现。                       | AllCashPremiumRate     |
| AllCashDiscountRate |           |                        | N7(5)  | 全现金替代的赎回折价比例<br>暂时未启用，此字段xml标签不出现。                       | AllCashDiscountRate    |
| RTGSFlag            |           |                        | C1     | 是否支持RTGS<br>暂时未启用，此字段xml标签不出现。                           | RTGSFlag               |
| ComponentList       |           |                        |        | 成分证券列表                                                   |                        |
| →                   | Component |                        |        | 成分证券                                                     |                        |
| →                   | →         | InstrumentID           | C20    | 证券代码                                                     | InstrumentID           |
| →                   | →         | InstrumentName         | C40    | 证券简称                                                     | InstrumentName         |
| →                   | →         | Quantity               | N10    | 证券数量                                                     | Quantity               |
| →                   | →         | SubstitutionFlag       | C1     | 替代标志                                                     | SubstitutionFlag       |
| →                   | →         | CreationPremiumRate    | N7(5)  | 申购溢价比例                                                   | CreationPremiumRate    |
| →                   | →         | RedemptionDiscountRate | N7(5)  | 赎回折价比例                                                   | RedemptionDiscountRate |
| →                   | →         | SubstitutionCashAmount | N12(3) | 替代金额                                                     | SubstitutionCashAmount |
| →                   | →         | UnderlyingSecurityID   | C4     | 市场ID                                                     | UnderlyingSecurityID   |
| →                   | →         | BuyorSelltoOpen        | C1     | 表示当成分券中含有期权期货合约时，期权期货合约是买入开仓还是卖出开仓<br>暂时未启用，此字段xml标签不出现。 | BuyorSelltoOpen        |

表 5: ETF 公告文件 xml 版

- 标志文件

交易所返回给基金公司的公告文件无标志文件。

- 处理

基金管理公司需要将本文件的内容与原 ETF 定义文件的内容进行比较，如果发现有错误，则需要生成一个新的 ETF 定义文件，并通过 ETF 定义文件上传工具重新上传。

- 例外事件

N/A

#### 2.3.4.3 过户数据文件(包含 ETF 申购赎回成交数据)

本报表即交易系统发往券商的过户数据文件，包含发往基金管理公司的 ETF 申购赎回成交数据。详细说明及格式定义请参考上海证券交易所向市场发布的市场参与者接口文档。

## 2.4 ETF 实时申赎

通过综合业务平台进行的 ETF 实时申赎相关接口请参照《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》。

### 3 盘后文件接口规范

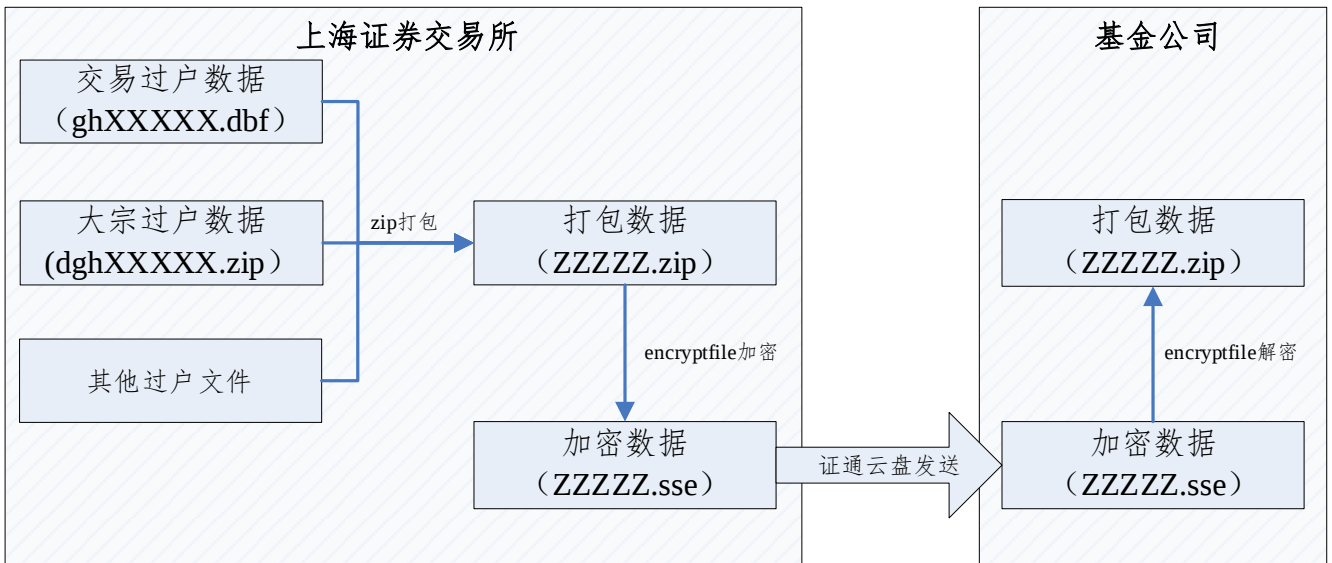


图 2：基金公司接口数据流图

#### 3.1 基金公司盘后数据文件

**文件名：**ZZZZZ.sse。其中 ZZZZZ 为基金公司英文简称，长度为 2-16 位不等；

**功能描述：**新交易将需要发给基金公司 PBU 过户数据、固定收益平台成交数据文件、大宗交易过户数据、综合业务过户数据、ZQY 数据、IPOGH 数据、ZQGH 数据、JJGH 数据、新竞价过户数据文件、新竞价发行过户数据文件、指定过户数据文件，按照要发往的基金公司分别压缩打包并加密，再按需要根据基金公司配置文件向市场发送。

**时间和频率：**每个交易日 15:00 之后。

**数据格式：**

1) 新一代交易系统根据配置文件，将基金公司对应的席位成交(ghXXXXX.dbf)文件、大宗交易过户数据文件(dghXXXXX.dbf)、综合业务过户数据(bghXXXXX.dbf)、固定收益平台成交文件(bjYYYY.dbf)、ZQY 数据(zqyXXXXX.dbf)、IPOGH 数据(IPOGHXXXXX.txt)、ZQGH 数据(ZQGHXXXXX.txt)、JJGH 数据(JJGHXXXXX.txt)、新竞价过户数据文件(gh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt)、新竞价发行过户数据文件(ipogh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt)、指定过户数据文件(zdgh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt)一起使用 zip 压缩，形成 ZZZZZ.gz 文件。这里 XXXXX 为 PBU 号，ZZZZZ 为基金公司简称。基金公司简称 2-16 位长度不等；

2) 新一代交易系统调用 encryptfile 工具，对前面生成的 ZZZZZ.gz 文件加密为 ZZZZZZ.sse。此文件发送基金公司；

3) 席位成交(ghXXXXX.dbf)文件、大宗交易过户数据文件(dghXXXXX.dbf)、综合业务过户数据(bghXXXXX.dbf)、固定收益平台成交文件、ZQY 数据(zqyXXXXX.dbf)、IPOGH 数据(IPOGHXXXXX.txt)、

ZQGH 数据（ZQGHXXXXX.txt）、JJGH 数据（JJGHXXXXX.txt）、新竞价过户数据文件（gh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt）、新竞价发行过户数据文件（ipogh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt）、指定过户数据文件（zdgh00PXXXXX\_YYYYMMDD.txt）相关格式参见各相关系统接口文件。

处理：

基金公司收到盘后数据文件 ZZZZZ.sse 后，首先运行 encryptfile 工具解密成.zip 文件：

```
encryptfile -d -p 12345678 -i ZZZZZ.sse -o ZZZZZ.zip
```

然后运行 unzip 解压缩软件解压缩。

## 3.2 基金公司数据文件解密工具

### 3.2.1 数据文件解密工具功能

|        |                                                                                                                                    |                                                        |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|
| 操作系统   | 客户端解密工具：兼容 Windows95/98/2000/xp 操作系统                                                                                               |                                                        |
| 界面形式   | 命令行界面                                                                                                                              |                                                        |
| 参数输入形式 | 所有参数作为开关与主命令共同一次输入                                                                                                                 |                                                        |
| 信息输出形式 | 屏幕输出，错误能够反馈给批处理调用。                                                                                                                 |                                                        |
| 功能开关设置 | 命令格式：<br>encryptfile [SW] [INFO] [SW] [INFO] ... -i srcFileName -o destFileName<br>SW:开关 INFO:信息 srcFileName:源文件 destFileName:目的文件 |                                                        |
|        | 开关                                                                                                                                 | 描述 举例                                                  |
|        | -p                                                                                                                                 | 指定加/解密的密码                                              |
|        | -e                                                                                                                                 | 指定为加密 encryptfile -e -p password -i 123.txt -o 123.sec |
|        | -d                                                                                                                                 | 指定为解密 encryptfile -d -p password -i 123.sec -o 123.txt |
|        | -i                                                                                                                                 | 指定源文件                                                  |
|        | -o                                                                                                                                 | 指定目标文件                                                 |
|        | -t                                                                                                                                 | 加密文本文件                                                 |
|        | -r                                                                                                                                 | 加密/解密后删除源文件 如果不加此开关，默认保留源文件                            |
| 安装要求   | 工具为绿色软件，复制成功就能使用。包含文件：<br>encryptfile.exe, libeay32.dll                                                                            |                                                        |
| 下载     | 可通过上海证券交易所市场技术服务平台下载：<br><a href="https://idc.ztcloud.ssetech.com.cn/">https://idc.ztcloud.ssetech.com.cn/</a>                     |                                                        |
| 其他要求   | 文件加密保证文件本身没有任何改变。应该能保证对于批处理生成的文件（dbf, zip, Steam LF 格式的 txt 文本），加密后在 Windows 环境下解密后仍保持不变。                                          |                                                        |

### 3.2.2 解密使用示例

```
encryptfile -d -p password -i 123.sse -o 123.zip
```

输入需要解密的文件：123.sse

输出解密完成的文件：123.zip

密钥：password (此密码各基金公司与托管银行自行设定)

```
encryptfile -d -r -p password -i 123.sse -o 123.zip
```

输入需要解密的文件：123.sse

输出解密完成的文件：123.zip

密钥：password (此密码各基金公司与托管银行自行设定)

解密完成后并删除 123.sse

### 3.2.3 重要提示 (FAQ)

1. 为何解密生成的.zip 文件无法解压缩？

请检查所输入的密码是否正确。当解密密码错误时，命令行窗口会提示“cannot decrypt file XXXX.sse”，但会生成目标.zip 文件，只是此文件无法解压缩。

请用正确的密码解密，即可获得正确的.zip 文件。

2. 席位成交(ghXXXXXX.dbf)具体含义在哪份文档可以查询？

可通过上海证券交易所市场技术服务平台下载：

<https://idc.ztcloud.ssetech.com.cn/> - 产品服务 - 其他 - 交易支持软件专区 - 技术接口 - 《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》。

## 4 后记

上海证券交易所对本文档享有知识产权，未经上海证券交易所书面许可，任何单位和个人不得将本文档用于其他商业目的。

对本文档有任何批评指正意见，请发电子邮件到 [tech\\_support@sse.com.cn](mailto:tech_support@sse.com.cn)。

附录一 ETF 产品与申赎模式、替代标志、市场 ID 对应关系表

| ETF 产品细分类别          | 申赎模式 | 成分券来源  |  | xml 版可出现替代标志 | xml 版市场 ID      |
|---------------------|------|--------|--|--------------|-----------------|
| F111 单市场股票（沪）ETF    | 1    | 沪市     |  | 0、1、2        | 101             |
| F112 跨市场股票（沪深京）ETF  | 1    | 沪市     |  | 0、1、2        | 101             |
|                     |      | 深市     |  | 1、2          | 102             |
|                     |      | 京市     |  | 1、2          | 106             |
| F113 跨市场股票（沪港深京）ETF | 1    | 沪市     |  | 0、1、2        | 101             |
|                     |      | 深市     |  | 1、2          | 102             |
|                     |      | 京市     |  | 1、2          | 106             |
|                     |      | 港市     |  | 1、2          | 103             |
| F114 单市场股票（科创板）ETF  | 1    | 沪市     |  | 0、1、2        | 101             |
| F115 跨市场股票（含科创板）ETF | 1    | 沪市     |  | 0、1、2        | 101             |
|                     |      | 深市     |  | 1、2          | 102             |
| F121 单市场债券（沪）ETF    | 1    | 沪市     |  | 0、1、2        | 101             |
| F122 跨市场债券（沪深）ETF   | 1    | 沪市     |  | 0、1、2        | 101             |
|                     |      | 深市     |  | 1、2          | 102             |
| F123 现金申赎类债券 ETF    | 0    | -      |  | 1、2          | 不限 <sup>1</sup> |
| F124 跨市场债券（银行间）ETF  | 3    | 外汇交易中心 |  | 0            | 105             |
| F131 跨境 ETF         | 0    | -      |  | 1、2          | 不限 <sup>2</sup> |
| F141 黄金 ETF         | 0    | -      |  | 1、2          | 9999            |
| F142 商品期货 ETF       | 0    | -      |  | 1、2          | 9999            |

<sup>1</sup> 按照实际成分券所属市场进行填写，如所属市场不在 101、102、103、105、106 范围内，则填写 9999。

<sup>2</sup> 按照实际成分券所属市场进行填写，如所属市场不在 101、102、103、105、106 范围内，则填写 9999。

|              |   |   |  |     |      |
|--------------|---|---|--|-----|------|
| F150 交易型货币基金 | 0 | - |  | 1、2 | 9999 |
|--------------|---|---|--|-----|------|

表 6：ETF 产品与申赎模式、替代标志、市场 ID 对应关系表

## 附录二 xml 版本文件结构

ETF 定义文件:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<ETFDefinition>
  <Version>1</Version>
  ...
  <RecordNumber>12</RecordNumber>
  <ComponentList>
    <Component>
      <InstrumentID>11111111</InstrumentID>
      ...
    </Component>
    <Component>
      <InstrumentID>22222222</InstrumentID>
      ...
    </Component>
    ...
  </ComponentList>
</ETFDefinition>
```

ETF 确认文件:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<ETFConfirmation>
  <ValidationResult>Y</ValidationResult>
  ...
  <RecordNumber>12</RecordNumber>
  <ComponentList>
    <Component>
      <InstrumentID>11111111</InstrumentID>
      ...
    </Component>
    <Component>
```

```
        <InstrumentID>22222222</InstrumentID>
        ...
    </Component>
    ...
</ComponentList>
</ETFConfirmation>
```

ETF 公告文件:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<SSEPortfolioCompositionFile>
    <FundInstrumentID >123456</ FundInstrumentID >
    ...
    <RecordNumber>12</RecordNumber>
    <ComponentList>
        <Component>
            <ISINCode>11111111</ISINCode>
            <InstrumentID>11111111</InstrumentID>
            ...
        </Component>
        <Component>
            <ISINCode>22222222</ISINCode>
            <InstrumentID>22222222</InstrumentID>
            ...
        </Component>
        ...
    </ComponentList>
</SSEPortfolioCompositionFile>
```



附录四 现金替代比例计算说明

综合业务系统会根据 ETF 定义文件中总的现金替代比例 MaxCashRatio 字段做如下控制：

对于实物申赎模式 ETF：

$$\frac{\sum \left[ \left( \text{申购篮子数} \times \text{证券数量}_{\text{市场ID=101, 替代标志=1}} - \text{实际交付数量} \right) \times \text{证券昨收价} \right]}{\text{申购份额数量} \times \text{ETF 二级市场昨收价}} \leq \text{总的现金替代比例}$$

其中证券昨收价、ETF 二级市场昨收价均为除权除息后的昨收价。

附录五 xml 版现金替代标志说明

一、“禁止现金替代”，申购、赎回基金份额时该成份证券不接受现金替代，且投资者在申购环节必须拥有足额成份券。

二、“必须现金替代”，申购、赎回基金份额必须使用 PCF 清单明确的固定现金，不接受成份券。

三、“允许现金替代”，各产品类型下该替代标志的定义如下表所示：

| ETF 产品细分类别          | 允许现金替代的定义                                                                                                                                      |
|---------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| F111-单市场股票（沪）ETF    | 对于 ETF 实物申赎：<br>对于沪市（101）成分券，申购基金份额优先使用成分券，成分券不足时差额部分用现金替代，赎回基金份额时该成分券不允许使用现金作为替代；对于非沪市成分券，在申购赎回基金份额时，该成分券只能使用现金作为替代，根据基金管理人代买卖情况，与投资者进行退款或补款。 |
| F112-跨市场股票（沪深京）ETF  |                                                                                                                                                |
| F113-跨市场股票（沪港深京）ETF |                                                                                                                                                |
| F114-单市场股票（科创板）ETF  |                                                                                                                                                |
| F115-跨市场股票（含科创板）ETF |                                                                                                                                                |
| F121-单市场债券（沪）ETF    |                                                                                                                                                |
| F122-跨市场债券（沪深）ETF   |                                                                                                                                                |
| F123-现金申赎类债券 ETF    | 在申购赎回基金份额时，该成分券只能使用现金作为替代，根据基金管理人代买卖情况，与投资者进行退款或补款。                                                                                            |
| F131-跨境 ETF         |                                                                                                                                                |
| F141-黄金 ETF         |                                                                                                                                                |
| F142-商品期货 ETF（预留）   |                                                                                                                                                |
| F150-交易型货币基金        |                                                                                                                                                |

表 7：现金替代标志说明

# 历史修订记录

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.9 版 发布说明

2024 年 6 月修订内容：

配合北交所股票纳入 ETF 成分证券范围，调整定义文件相关字段描述。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.8 版 发布说明

2023 年 4 月修订内容：

下线 ETF 定义文件 2.0 版、ETF 确认文件 2.0 版、ETF 公告文件 1.0 版，删除相关描述。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.7 版 发布说明

2022 年 10 月修订内容：

1、调整附录一中 ETF 细分类别，变更 F131 含义为“跨境 ETF”，并取消 F132、F133 分类。

2022 年 7 月修订内容：

1、提高 IOPV 发布精度至小数点后 4 位。

2、修订 ETF 定义文件应急上传相关描述。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.6 版 发布说明

2022 年 2 月修订内容：

1、调整债券相关数量单位为千元面额；

2、调整“证券数量”字段描述，对于成分证券为股票的，删除关于 100 的整数倍的限制。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.5 版 发布说明

2022 年 2 月修订内容：

1、根据多码合一需求，调整定义文件、确认文件及公告文件的“基金以及市场申赎代码”字段填写说明。

2、删除传统接口变化中原竞价 ETF 申赎成交回报的内容。

## 《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 发布说明

2021 年 8 月修订内容：

1、调整下一交易日使用的 ETF 定义文件的上传时间为 18:00-24:00 及下一交易日的 0:00-6:00。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.3 版 发布说明

2021 年 6 月修订内容：

1、根据科创板相关 ETF 需求，调整定义文件有关说明。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.2 版 发布说明

2021 年 5 月修订内容：

1、调整债券 ETF 定义文件、确认文件及公告文件的“基金一级市场申赎代码”字段填写说明。

2、基金公司盘后数据文件补充基金过户（JJGH）、债券过户（ZQGH）、综合业务过户（BGH）数

据说明。

### 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.1 版 发布说明

2020 年 12 月修订内容：

- 1、修订 ETF 定义文件中“Publish IOPV Flag”字段，明确交易所仅支持计算单市场股票 ETF、科创板 ETF 的 IOPV。
- 2、调整 IOPV 计算说明。

### 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》1.0 版 发布说明

2020 年 4 月修订内容：

- 1、增加 2.1 版本 ETF 定义文件，2.1 版本 ETF 确认文件，2.1 版本 ETF 公告文件。
- 2、定义文件 2.1 版本中将溢价比例字段分列为申购溢价比例和赎回折价比例两个字段，因此修正替代金额计算公式。
- 3、定义文件 2.1 版本中现金替代标志字段新增港市资金替代值，因此修正 IOPV 计算公式。
- 4、申购赎回实时成交回报增加港市资金记录。

2017 年 8 月修订内容：

- 1、调整下一交易日使用的 ETF 定义文件的上传时间为 18:00-24:00 及下一交易日的 0:00-8:00。
- 2、文档名称由 IS103 ETF 基金公司接口规格说明书调整为 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）
- 3、增加 IS104 托管银行（含基金公司）接口规格的基金公司接口部分章节，原 IS104 文档废止
- 4、删除不符合本技术接口文档定位的纯业务描述内容。

2013 年 1 月修订内容：

- 1、明确证券数量的单位，成分证券为债券时，单位为手，其余为股/份。
- 2、根据债券相关内容修正替代金额计算公式、现金替代比例计算公式、IOPV 计算公式。
- 3、当定义文件 publish IOPV flag 字段取值为 N 时，公告文件的 Publish 字段应为 0

2012 年 12 月修订内容：

- 1、根据所内纪要，定义文件上传时增加对账户及 PBU 有效性、指定关系的检查，增加对深圳成分股的代码校验。
- 2、定义文件中 IOPV 发布类型增加“交易系统不计算 IOPV，也无需通过行情发布”。
- 3、补充说明对于各类型 ETF，IOPV 发布类型为 Y 时的计算公式。
- 4、根据债券 ETF，将所有成分股改为成分证券。

2012 年 6 月修改内容：

删除文档中关于 1.0 格式定义文件相关内容。

2012 年 5 月修改内容：

- 1、明确现金替代金额计算精度；
- 2、明确现金替代比例、现金替代额计算过程中，使用的替代价格取值。

## 《新一代交易系统 ETF 基金公司接口规格说明书》1.3 版发布说明

2011 年 11 月修改内容：

### 1、根据后台增强版及流程优化方案，对 2.0 ETF 定义文件优化：

- ✧ 开市后禁止通过 ETFPut 上传定义文件。
- ✧ 公告文件标志文件格式与内容同定义文件
- ✧ 2.0 格式定义文件上传时间修改为每个交易日的 0: 00-8: 00, 22: 00-24: 00
- ✧ 2.0 格式中，若成分股为非沪市股票，成分股数量不必须为 100 的整数倍
- ✧ 通过 ETFPut 上传时只校验账户和 PBU、深圳股票的格式，不校验指定关系及其正确性
- ✧ 修改公告文件中大小写字符、Fundid1 描述有误，应为一级市场代码，对应关系不变。
- ✧ Record Number 改为必须大于 0
- ✧ 返回给基金公司的公告文件名为小写
- ✧ 定义文件中账户和 PBU 可不同时为空，为空表示同前一交易日数据

### 2、根据跨境 ETF 业务需求，进行以下修订：

- ✧ 增加成分股替代类型 6，为非沪深市场成分股，必须现金替代
- ✧ 修订基金公司成交回报内容
- ✧ 对 NAV 和现金分红字段的取值进行了修订

## 《新一代交易系统 ETF 基金公司接口规格说明书》1.2 版发布说明

2011 年 4 月发布 1.2 版本。

主要变更内容为：

- 1、根据业务要求，由交易系统代为生成 1.0 格式的公告文件，新增 1.0 格式公告文件内容。
- 2、增加已发行 ETF 基金定义文件代码
- 3、用红色表示 2.0 格式定义文件中与 1.0 格式定义文件的差异部分
- 4、2.0 定义文件中 NAV 字段长度改为 N8(4)，成分股产品简称字段改为 C8

## 《新一代交易系统 ETF 基金公司接口规格说明书》1.1 版发布说明

2011 年 1 月发布 1.1 版本。

主要变更内容为：

- 1、根据业务需求修订 2.0 格式接口。
  - 将交易系统不用的字段改为非必填项
  - 在定义文件中增加 PBU ID 和账户
  - 删除 IOPV 发布字段中不通过交易所发布的两种方式
  - 删除定义文件中的资金代码
  - 对于替代标志为 4 的代码，溢价比例无意义
- 2、增加已发行 ETF 基金定义文件代码
- 3、根据实际情况简化定义文件的处理部分描述

## 《新一代交易系统 ETF 基金公司接口规格说明书》1.02 版发布说明

2010 年 7 月发布 1.02 版本。

主要变更内容为：

新增跨境 ETF 内容。

修订说明：

2010-5-27:

- (1) 明确交易系统收到 2.0 格式定义文件后转发的存储网关目录，并生成的文件名。
- (2) 将定义文件成分股中的产品简称字段由 10 位改为 15 位。
- (3) 增加已上市 ETF 的交易代码。

2010-6-4:

- (1) 在定义文件中增加前一日现金差额字段，确认现金分红字段的必选属性。

2010-6-21

- (1) 明确鹏华基金民企 ETF 代码为 fm011;
- (2) Cash Divided 现金分红字段的中文含义改为每一基金单位分红，字段长度及取值不变。

2010-6-29

修改 PreTradingDay 的中文注释。

### **《新一代交易系统 ETF 基金公司接口规格说明书》1.01 版发布说明**

2010 年 1 月发布 1.01 版本。

主要变更内容为：

新增跨市场 ETF 内容。

### **《新一代交易系统 ETF 基金公司接口规格说明书》1.00 版发布说明**

2009 年 11 月发布正式版本。