

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所  
跨市场债券（银行间）ETF  
市场参与者技术实施指南  
1.0 版



上海证券交易所

二〇二二年九月

## 文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）跨市场债券（银行间）ETF 市场参与者技术实施指南。

## 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

本文档为上海证券交易所跨市场债券（银行间）ETF 市场参与者技术实施指南，对市场参与者相关的技术实施提出建议。

## 2 市场接口调整说明

《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 1.60 版\_20220808（跨市场债券（银行间）ETF 技术开发稿）》：

新增支持跨市场债券（银行间）ETF，增加 ETF 细分类别。

《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 1.51 版\_20220808（跨市场债券（银行间）ETF 技术开发稿）》

支持跨市场债券（银行间）ETF 业务开展，调整如下：

- 1 增加跨市场债券（银行间）ETF 实物申赎业务类型 BEC、BER；
- 2 ETF 申赎章节中，对于跨市场债券（银行间）ETF 实物申赎，申赎申报消息启用备注字段填写中央结算公司提供的业务标识号；增加申赎执行报告相关描述；
- 3 基金过户数据接口中，增加对于跨市场债券（银行间）ETF 实物申赎记录的描述；
- 4 基金非交易基础信息接口中，增加对于跨市场债券（银行间）ETF 产品的描述。

《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）1.8 版\_20220823（跨市场债券（银行间）ETF 技术开发稿）》

配合跨市场债券（银行间）ETF，新增 ETF 定义文件 xml 版、ETF 确认文件 xml 版相关描述。

### 3 业务调整说明

新增一类跨银行间市场债券交易型开放式指数基金（以下称跨市场债券（银行间）ETF），指以在银行间市场交易、由中央国债登记结算有限责任公司（以下简称中央结算）登记托管的债券为指数标的基础资产，基金份额在本所上市交易、由中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）办理登记结算的 ETF 产品。

申赎采用纯实物申赎，以其持有的银行间债券实物券或跨市场债券（银行间）ETF 向中央结算和本所申请完成跨市场债券 ETF 产品申赎。投资者应在本所交易日 9:15-11:30，13:00-15:00 提交申赎申报。申赎所使用的证券账户需已建立中国结算证券账户和中央结算债券托管账户关联关系备案。申赎订单不可撤单。申赎业务主要流程如下：

- （1）投资者向中央结算提交跨市场债券（银行间）ETF 申赎申报，中央结算对申报进行校验后生成业务标识号反馈投资者。
- （2）投资者通过代办券商向本所提交跨市场债券（银行间）ETF 申赎申报，并附带中央结算业务标识号，本所进行校验后向代办券商反馈校验结果。对于校验通过的赎回申报，本所冻结拟赎回的 ETF 份额。
- （3）日间，中央结算冻结申赎涉及的债券份额。
- （4）日终，中国结算上海分公司完成投资者 ETF 份额的记增、记减，中央结算完成对应债券的过户和解冻。

认购可采用网上现金认购、网下现金认购和实物认购三种方式。现金认购与现有 ETF 一致，实物认购由中国结算另行通知。

交易参见《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》及《上海证券交易所交易规则》。

持仓效率：当日实物申购的 ETF 份额，在当日日终交收完成后，次一交易日可以卖出或赎回；当日买入的 ETF 份额，当日可以卖出，次一交易日可

以实物赎回。

## 4 市场参与者技术实施建议及注意事项

### 1) 新增支持 xml 格式 ETF 定义文件

计划以跨市场债券（银行间）ETF 作为 ETF 定义文件 xml 版、ETF 确认文件 xml 版的试点，业务上线后，基金公司可通过证通云盘上传新增的 xml 格式定义文件，对于不同类别 ETF 支持情况如下：

ETF 产品细分类别	ETF 定义文件/ETF 确认文件		ETF 公告文件	
	xml 版	2.0/2.1 版	1.0 版	2.1 版
F111 单市场股票（沪）ETF	×	○	○	○
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	×	○	○	○
<b>F124 跨市场债券（银行间）ETF</b>	○	×	×	○
F131 单市场跨境 ETF	×	○	○	○
F132 多市场跨境 ETF（日内回转）	×	○	○	○
F133 多市场跨境 ETF（非日内回转）	×	○	○	○
F141 黄金 ETF	×	○	○	○
F142 商品期货 ETF	×	○	○	○
F150 交易型货币基金	×	○	○	○

后续根据业务发展情况，逐步推广 ETF 定义文件 xml 版至其他类别 ETF，并有序开展 txt 版 ETF 定义文件（包括 2.0 和 2.1 版）的下线工作。

### 2) 申赎

由于上午申报时间为 9:15-11:30，综合业务平台 EzSTEP 允许申报的时间也由 9:15-9:25、9:30-11:30 调整为 9:15-11:30。跨市场债券（银行间）ETF 业务上线后，其他业务在 9:25-9:30 期间向综合业务平台申报的订单，将被拒绝。市场参与者应注意此项变更对用户申报习惯的影响，在 9:25-9:30 期间建

议不要“预埋”订单至 EzSTEP 数据库，以免造成废单。

市场参与者通过 EzSTEP 软件向本所进行申赎报单，新增业务类型请求编号及对应如下：

业务名称	业务类型请求编号	业务类型说明
跨市场债券（银行间）	BEC	跨市场债券（银行间）ETF 实物申购
ETF 实物申赎	BER	跨市场债券（银行间）ETF 实物赎回

新增业务类型与执行报告数据广播类型及产品集关系表如下：

业务类型请求编号 (reqid)	执行报告广播类型 (bcasttype)	公共数据广播类型 (bcasttype)	产品集编号 (setid)
BEC、BER	23	N/A	102

申赎订单使用原有“ETF 实物申赎/ETF 现金申赎/黄金 ETF 实物申赎消息规范”，并统称为“ETF 申赎业务消息规范”，同时明确适用范围：ETF 实物申赎、ETF 现金申赎、黄金 ETF 实物申赎、跨市场债券（银行间）ETF 实物申赎。启用订单中 Text 备注字段 1-16 位，用于填写中央结算公司提供的业务标识号。对于跨市场债券（银行间）ETF 实物申购申报，投资者除申报响应外，会收到一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为 ETF 二级市场交易代码、成交数量为申购数量，买卖方向为 1 的成交记录。基金公司作为对手方收到的执行报告与投资者收到的执行报告买卖方向相反；对于赎回申报，投资者除申报响应外，会收到一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为 ETF 二级市场交易代码、成交数量为赎回数量，买卖方向为 2 的成交记录。基金公司作为对手方收到的执行报告与投资者收到的执行报告买卖方向相反。

交易系统对于申赎所使用的证券账户做账户关联关系备案校验，如校验不通过，则会拒单。

### 3) 持仓效率

持仓效率控制如下，建议市场参与制做好相应前端控制。

ETF 份额来源	卖出	实物赎回
T 日初持有的 ETF 份额	T	T
T 日买入的 ETF 份额	T	T+1
T 日实物申购的 ETF 份额	T+1	T+1

#### 4) 过户数据

基金公司、券商、托管银行盘后收取的基金过户数据接口 (jjghXXXXX.txt) 中增加对于跨市场债券 (银行间) ETF 实物申购 (BEC)、赎回 (BER) 的支持。

#### 5) 产品信息

产品基础信息第二版第一批次文件接口 (cpxx0201MMDD.txt) 及产品基础信息第二版第二批次文件接口 (cpxx0202MMDD.txt) 增加跨市场债券 (银行间) ETF 类别产品, 并在备注字段增加基金产品细分类别 F124 取值, 表示跨市场债券 (银行间) ETF。

基金非交易基础信息接口中增加跨市场债券 (银行间) ETF 类别产品。

#### 6) 其他

市场参与者应充分评估业务变更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, 保证跨市场债券 (银行间) ETF 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、股票期权等各类业务正常运行。

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

《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 1.60 版\_20220808 (跨市场债券 (银行间) ETF 技术开发稿)》

《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 1.51 版\_20220808 (跨市场债券 (银行间) ETF 技术开发稿)》

《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) 1.8 版\_20220823 (跨市场债券 (银行间) ETF 技术开发稿)》