

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
基金通业务销售机构市场参与者
技术实施指南
1.01 版



上海证券交易所

二〇二二年三八月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20210907	创建说明
<u>V1.1 20220822</u>	<u>内容修订</u>

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）基金通 2.0 销售商市场参与者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 (8:00-21:00)

电子邮件：tech_support@sse.com.cn

技术服务微信公众号：SSE-TechService



一、概述

本文档为上海证券交易所基金通 2.0 项目相关业务技术实施指南，仅对销售机构技术实施提出建议。

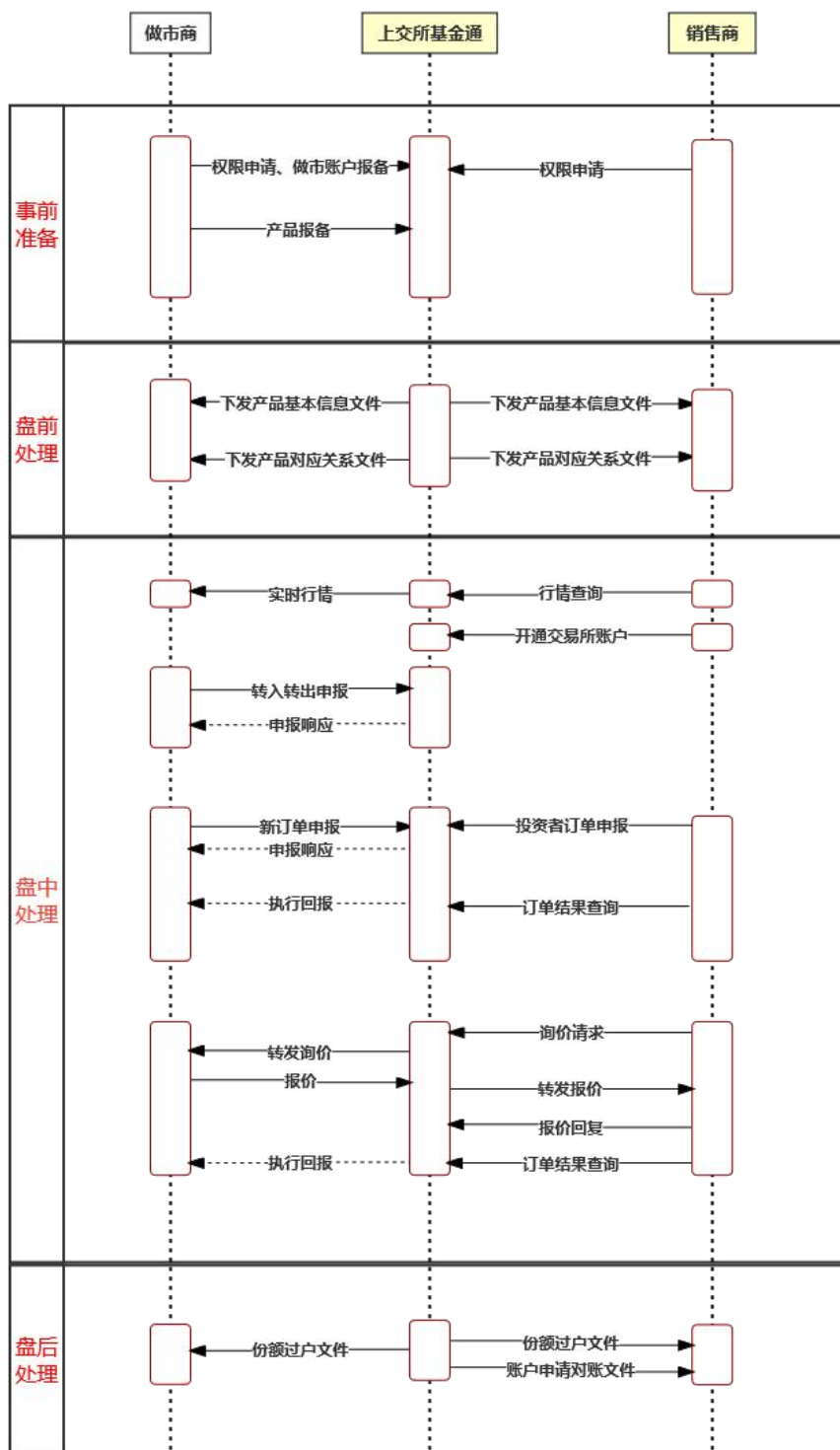
二、业务说明

本次文档主要针对上证基金通 2.0 项目销售机构参与者。基金销售机构转发投资者申报委托，支持投资者使用开放式基金账户卖出公募 REITs 份额；针对特定数量的大单交易需求，投资者也可通过销售机构向做市商发出询价指令。做市商在基金通平台开展做市服务，向投资者提供持续报价，并对投资者询价提供回应报价。

投资者需要有开放式基金账户才可以参与基金通份额转让，销售机构需做好前端资金控制，并保证交收顺利。

三、系统说明

1. 整体业务流程



2. 交易窗口

平台	业务	订单申报时间
互联网交易平台	基金通业务	9:30-11:30

		13:00-15:00
--	--	-------------

3. 关键技术问题简介

- (1) 销售机构通过交易行情网或 VSEP 网络与交易所进行网络对接。
- (2) 实时接口数据交互协议为 https, 文件交互采取证通云盘。
- (3) 实时接口信息防伪造签名采用 RSA 算法。报文中有关名字段, 双方各有一套公私钥, 采用私钥对明文加密作为签名, 由接收方使用公钥解密签名验证明文是否被伪造。
- (4) 文件接口信息防伪造签名方法: 一个 zip 文件, 一个 md5 文件。zip 文件是通过 txt 文件压缩后生成的; md5 文件中有一个密文。合作方收到这两个文件后, 对 zip 文件 md5 加密生成一个密文, 与 md5 文件中的密文校验数据完整性。

四、市场参与者技术实施建议及注意事项

1. 销售机构接入性能指标要求 (仅作参考):

- (1) 开户, 50tps, RT<500ms
- (2) 交易, 200tps, RT<500ms
- (3) 清算 500w 数据量, 2h 完成
- (4) 故障恢复时长 RT0 < 30min
- (5) 故障恢复点 RPO = 0, 无数据丢失

2. 关于资金交收, 请详见中国结算相关文档。

3. 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，确保基金通 2.0 相关业务的顺利开展，同时保障现有各类业务正常运行。

4. 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。

五、 相关文档列表

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：

《IS419-上海证券交易所互联网交易平台市场参与者接口规格说明书（销售机构卷）1.12 版-20220815IS419-~~上海证券交易所互联网交易平台市场参与者接口规格说明书（销售机构卷）1.00 版-20220228~~》