

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
开放式基金等四类非交易业务迁移
市场参与者技术实施指南
1.2 版



上海证券交易所

二〇二四年三月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20230712	创建说明
V1.1 20230926	1、新增第三项第3、6、7条内容。 2、更新发布IS101等四项技术开发稿，更新文档编号。
V1.2 20240312	1、调整第三项结构，补充与原业务平台差异及其他内容。

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）互联网交易平台非交易业务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：4008888400-2（8:00-20:00）

电子邮件：tech_support@sse.com.cn

技术服务微信公众号：SSE-TechService



一、简介

本文档为上海证券交易所针对开放式基金、融资融券、要约/现金选择权、网络密码服务非交易迁移业务迁移，为指导市场参与者尽快完成技术准备工作，特制定本指南。

二、业务调整说明

为更好的服务市场参与者，根据上交所技术系统规划，拟将开放式基金（申赎、分红选择、份额转出）、融资融券（余券划转、还券划转、担保品划入、担保品划出、券源划入、券源划出）、要约/现金选择权（要约预受/现金选择权登记、要约撤销/现金选择权撤销）、网络密码服务（密码激活/注销）四类非交易业务从竞价撮合平台迁移至互联网交易平台。

三、市场参与者技术实施建议及注意事项

市场参与者可使用 TDGW 交易网关申报端（互联网平台），或登录互联网交易平台统一门户网站（含专网及互联网），通过交易业务互联网申报通道进行申报。其他注意事项如下：

（一）、与原竞价撮合系统主要差异

1、部分字段存在差异，请以互联网交易平台市场接口相关要求

为准。

2、对于要约收购（含现金选择权）非交易业务，依据业务规则，新增要约收购结束日前3交易日内不允许撤销申报。

3、融资融券非交易业务新增校验申报正股产品有效性，新增校验账户类型、PBU所属市场与正股产品所属市场的对应关系。

4、如申报表单中有目标业务不使用的字段（详情见互联网交易平台市场参与者接口文档），返回的执行报告中将不包含该字段的标签与值，详情参见互联网交易平台市场参与者接口。

5、互联网交易平台将进行订单全字段长度校验，如字段超长则断开连接，并在注销消息中告知原因。此前使用竞价平台 EzOES 申报的机构需按照 STEP 协议标准进行调整，如字段长度等校验项。

6、互联网交易平台在处理本次迁移的四类非交易业务订单申报、撤单申报时不保证严格按照请求顺序处理。

（二）、非交易基础信息下发

1、市场参与者仍可通过产品非交易基础信息接口（fjyYYYYMMDD.txt）获取非交易基础信息，格式不变。其中融资融券非交易业务、网络密码服务业务信息将不再通过 fjyYYYYMMDD.txt 文件下发，相关交易要素可通过《IS122_上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书（互联网交易平台）1.15 版（技术开发稿）》获取；要约收购（现金选择权）申报编号通过备注字段下发。

2、本次迁移的开放式基金产品（不含开放式货币市场基金）不再通过产品基础信息第二版第一批次文件接口 cpxx0201MMDD.txt 发

布。

（三）时间安排及其他要求

1、互联网交易平台相关测试安排、生产业务切换等时间节点请关注后续官网通知。业务正式切换后竞价撮合平台将不再支持上述四类非交易业务的申报。市场参与者应在此前完成技术就绪及相关准备工作。

2、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，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。

3、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。

四、 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。

1、《IS122_上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书（互联网交易平台）1.15 版（竞价非交易迁移互联网_技术开发稿）20240312》。

2、《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 1.66 版（竞价非交易迁移互联网_技术开发稿）20240312》。

3、《IS122_上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书（竞价平台）0.57 版（竞价非交易迁移互联网_技术开发稿）20230926》。

4、《IS122_上海证券交易所交易网关 Binary 接口规格说明书(竞价平台) 0.57 版(竞价非交易迁移互联网_技术开发稿) 20230926》。