

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
ETF多码合一&ETF细分
类别相关业务
市场参与者技术实施指南
(正式稿)

1. 10 版



上海证券交易所

二〇二二年六三月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20220301	创建说明
<u>V1.1 20220614</u>	<u>补充市场接口调整说明和基金过户文件中替代价格相关说明</u>

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）ETF多码合一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(8:00-20:00)

电子邮件：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ETF多码合一相关业务技术实施指南，对市场参与者技术实施提出建议。

2 本所市场接口调整说明

此次市场接口调整主要是为配合ETF多码合一相关业务需求，在综合业务平台市场参与者接口规格说明书删除原ETF现金申赎/黄金ETF实物申赎申报消息、申报响应消息、执行报告消息，将ETF现金申赎/黄金ETF实物申赎合并到ETF实物申赎业务实时接口。删除过户数据接口bghXXXXX.dbf中关于ETF现金申赎和黄金ETF实物申赎的相关说明，并将申赎业务过户记录合并到基金过户数据接口，调整ETF实物申赎过户记录相关说明。调整基金非交易基础信息接口(jfjyYYYYMMDD.xml)，增加黄金ETF实物申赎业务。

在竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书调整申报接口、成交回报接口、过户数据接口、产品非交易基础信息接口等，删除ETF申赎相关说明。

在特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）调整ETF定义文件、ETF确认文件及ETF公告文件的“基金以及市场申赎代码”字段填写说明。删除传统接口变化中原竞价ETF申赎成交回报的内容。调整ETF定义文件的“证券数量”字段描述，对于成份证券为股票的，取消关于100的整数倍的限制。

配合ETF细分类别相关业务需求，在竞价撮合系统市场参与者接口规格说明书的产品基础信息文件接口cpxx0201MMDD.txt和cpxx0202MMDD.txt中增加ETF产品细分类别的相关描述。

3 业务说明

ETF多码合一业务中，将竞价撮合平台的ETF申赎业务（单市场/跨市场股票ETF、科创板ETF等申赎）迁移至综合业务平台，并和综合业务平台的ETF现金申赎

和黄金ETF实物申赎使用统一的申报消息、申报响应消息、执行报告消息，并取消ETF申赎代码和资金代码。盘后过户数据合并到基金过户文件。

ETF细分类别业务中，向市场揭示ETF产品的细分类别信息，便于市场了解“产品代码-产品细分类别-申赎模式”对应关系。

4 市场参与者技术实施建议及注意事项

- 1) 本所发给市场参与者的基金过户文件中，通过业务类型区分ETF实物申赎、ETF现金申赎、黄金ETF实物申赎和ETF集合申购业务。对于发送基金公司的ETF实物申赎业务数据，替代标志为“沪市可以被替代”的成分券成交记录（记录类型为“2=ETF成份券成交”）中不包含替代价格。市场参与者可以获取前收盘价格作为替代价格，具体途径为当日适用的产品基础信息第二版第一批次文件接口（cpxx0201MMDD.txt）中的“前收盘价格”或行情接口（mktDt00.txt、mktDt02.txt及行情网关实时行情）中的“昨日收盘价”（二者取值相同）。具体接口格式参见《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》《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》《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》。
- 2) 本所提供市场参与者的实时申报消息中，通过业务类型请求编号（reqid）区分ETF实物申赎、ETF现金申赎和黄金ETF实物申赎业务。
- 3) ETF多码合一业务上线后，取消ETF申赎代码和资金代码，竞价撮合平台不再支持ETF申赎业务。
- 4) 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ETF多码合一、ETF细分类别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、港股通、股票期权等各类业务正常运行。
- 5) 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

证。

5 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，本次业务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1.58版
_20220524（ETF多码合一&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1.50版
_20220426（ETF多码合一）

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）1.6版
_20220420（ETF多码合一）