

# 关于发布跨市场股票 ETF 全实物申赎业务 市场接口技术开发稿的通知

各市场参与人：

上海证券交易所（以下简称本所）拟发布《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 1.56 版\_20240807（跨市场股票 ETF 全实物申赎业务 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）2.0 版\_20240807（跨市场股票 ETF 全实物申赎业务 技术开发稿）》、《IS111\_上海证券交易所报盘软件错误代码表\_V3.30\_20240807（跨市场股票 ETF 全实物申赎业务 技术开发稿）》、《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 1.68 版\_20240807（跨市场股票 ETF 全实物申赎 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(转发卷)1.4 版\_20240807（跨市场股票 ETF 全实物申赎 技术开发稿）》、《IS120\_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范 0.58 版\_20240807(跨市场股票 ETF 全实物申赎业务 技术开发稿)》、《IS120\_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范 0.58 版\_20240807（跨市场股票 ETF 全实物申赎业务 技术开发稿）》、《上海证券交易所跨市场股票 ETF 全实物申赎业务市场参与者技术实施指南》，请各市场参与人做好技术就绪相关工作。

本次主要变更内容有：在综合业务平台市场参与者接口规格说明书中，新增 ETF 公告文件 xml 版相关描述，下线 ETF 公告文件 2.1 版，删除相关描述；新增 ETF 全实物申赎消息规范描述，调整 ETF 实物申赎业务适用范围，新增 ETF 全实物申赎业务适用范围说明；调整基金过户数据接口 jjghXXXXX.txt、基金非交易基础信息接口 jfjyyyyymmdd.xml 相关描述。在特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）中，新增 ETF 定义文件 xml 版、ETF 确认文件 xml 版、ETF 公告文件 xml 版，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；启用当日净申购基金份额上限、当日净赎回基金份额上限、成份券市场 ID 字段；新增单个账户净申购总额限制、单个账户净赎回总额限制、单个账户累计申购总额限制、单个账户累计赎回总额限制、深市账户、深市交易单元字段；调整 ETF 产品与替代标志、市场 ID 对应关系表（附录一），新增 xml 版本文件结构（附录二）、ETF 定义文件标志文件举例（附录三）、现金替代比例计算说明（附录四）、现金替代标志说明（附录五）。在报盘软件错误代码表新增 ETF 全实物申赎相关错误码。在特定参与者接口规格说明书（转发卷）中，下线 ETF 公告文件 2.1 版，删除相关描述。在行情网关 BINARY/STEP 数据接口规范中，支持 ETF 公告文件 xml 版，调整集中竞价类行情快照扩展字段章节 IOPV 行情与 ETF 公告文件关联关系描述。

相关文件电子版本可通过本所官方网站“交易技术支持专区”相关栏目下载。

技术咨询电话：4008888400 转 2；技术支持邮箱：  
tech\_support@sse.com.cn；技术支持服务 QQ 群：298643611。  
特此通知。

上海证券交易所

2024 年 8 月 9 日