

上海证券交易所技术文档



**上海证券交易所
指定交易迁移
市场参与者技术实施指南
1.4 版**



上海证券交易所
二〇二二年十月

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）指定交易迁移的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
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指定交易迁移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

《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（指定交易迁移正式稿）-20221020》:

- 1) 新增指定交易申报接口。
- 2) 调整指定关系生效说明。

《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 1.61 版（指定交易迁移正式稿）-20221020》:

- 1) 根据指定交易迁移计划，指定登记和指定撤销业务迁移至综合业务平台进行申报（对应业务的盘后过户数据仍记录在 ghXXXXX.dbf 中）：删除申报接口 ordwth 中相关描述；删除 f jyYYYYMMDD.txt 中指定登记和指定撤销的非交易记录；cpxx0201.txt 中增加指定登记和指定撤销（子类型为 CMD）的产品记录。

《IS111-上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.25 版（指定交易迁移正式稿）-20220822》

- 1) 调整综合业务平台的错误代码及说明。

3 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，拟将指定交易申报功能从竞价撮合平台迁移至综合业务平台。同时，在本所互联网交易平台上的核心系统备用通道模块将提供指定登记、指定撤销业务申报功能。通过核心系统备用通道模块申报指定登记、指定撤销业务生效时间与综业平台申报一致，市场参与者可以根据自身业务需要，选择使用。

4 市场参与者技术实施建议及注意事项

- 1) 综业平台指定交易功能开通后，安排一周左右的切换过渡期。过渡期内，竞价撮合平台仍提供指定交易（包括指定登记和指定撤销）申报

- 功能，且 f jyYYYYMMDD 文件包含相关非交易代码。过渡期间，市场参与者应从竞价、综业、核心交易系统备用通道中，选择惟一的通道作为指定交易主用申报通道，不可同时通过三个通道申报。
- 2) 对于指定交易通道已迁移至综业或核心交易系统备用通道的市场参与者，若上交所综业平台或核心系统备用通道异常、市场参与者技术系统异常，市场参与者可自主回退至竞价撮合平台申报，对于回退前已生效的订单，请勿重复申报。同一交易日内，仅允许应急情况下盘中从综业平台及核心系统备用通道切回竞价撮合平台申报，不可盘中将申报通道从竞价撮合平台切往综业平台或核心系统备用通道。
 - 3) 过渡期结束后，竞价撮合平台将不再支持指定交易（包括指定登记和指定撤销）申报，f jyYYYYMMDD 文件不再包含相关非交易代码。市场参与者在过渡期内，尽快将指定交易申报通道迁移至综业平台或核心系统备用通道。
 - 4) 综业平台指定交易功能开通后，通过综业平台或核心系统备用通道申报指定交易的，新债券交易平台指定关系调整为实时生效，综业平台所有业务指定关系均也将统一调整为实时生效，即所有在新债券交易平台和综业平台申报的订单均校验实时指定关系。其他平台指定关系生效时间不变。过渡期内，通过竞价平台申报指定交易的，各平台生效时间不变。
 - 5) 柜台系统应该做好指定交易前端检查，不向交易系统申报不满足账户指定关系的业务订单。对于当天发生过订单申报、成交的账户，不申报撤销指定交易订单。若账户当天发生指定关系调整（指定登记或指定撤销），不向指定关系次日生效的系统申报业务订单。
 - 6) 指定交易盘后过户数据仍维持现有接口 ghXXXXX.dbf 格式不变。
 - 7) 指定交易迁移前，竞价 EzOES 软件支持指定交易委托的同步控制，即同一账户下的后续委托需等待收到指定交易委托响应才能继续申报。

- 指定交易迁移到综业平台后，不再支持同账号阻塞申报机制，市场参与者应确保指定交易确认完成后再申报相同账户的其他后续委托，否则可能产生废单。
- 8) 综业平台指定登记业务支持多账户申报模式，即一笔指定登记申报可支持 20 个账户指定到同一 PBU 下。为提高指定登记申报效率，避免开市时影响会员报盘通道其他业务申报，建议市场参与者采用多账户申报。
 - 9) 对于综业平台指定登记申报，如部分账户指定失败，响应中将返回“13566 存在指定交易失败的账户”的错误码；如全部账户指定失败，响应中将返回“13568 所有账户指定交易失败”的错误码。每个账户具体的指定登记处理结果参见响应 STEP 中的账户重复组。详细 STEP 格式请参考上交所官网《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》。市场参与者请注意指定登记业务与其他业务区别，并做好相应技术准备。
 - 10) 市场参与者 EzSTEP 申报端异常时，可登录互联网交易平台，通过核心系统备用通道进行申报。
 - 11) 账户通过指定交易申报变更所属机构的，该账户当日不能使用互联网交易平台核心系统备用通道申报综业平台其他业务（同一机构内更换指定 PBU 不受此限制）。
 - 12) 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。
 - 13) 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

《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（指定交易迁移正式稿）-20221020》

《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 1.61 版（指定交易迁移正式稿）-20221020》

《IS111-上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.25 版（指定交易迁移正式稿）-20220822》

6 各系统指定关系生效说明

序号	系统	指定交易迁移后指定关系生效说明
1	竞价撮合系统	对于所有业务：指定关系盘中调整即刻生效（与指定交易迁移前一致）
2	综合业务系统	对于所有业务：指定关系盘中调整即刻生效（与指定交易迁移前相比，部分业务指定关系盘中调整时由次日生效改为即刻生效，详见接口规格说明书附录）
3	新债券交易系统	对于所有业务：指定关系盘中调整即刻生效（与指定交易迁移前相比，对于债券及债券回购交易业务，指定关系盘中调整时由次日生效改为实时生效）
4	期权交易系统	根据业务规则，合约账户未完成销户的，不允许对应证券账户转指定（撤指定）（与指定交易迁移前一致）
5	港股通系统	对于所有业务：指定关系盘中调整次日生效（与指定交易迁移前一致）
6	固收收益系统	对于所有业务：指定关系盘中调整次日生效（与指定交易迁移前一致）
7	互联网交易平台	一、指定关系盘中调整即刻生效的业务（与指定交易迁移前

		一致): 基金通转入转出 二、指定关系盘中调整次日生效的业务 (与指定交易迁移前 一致): 科创板询价转让锁定、司法执行平台竞买申报
--	--	--

注: B 股及 B 转 H 业务涉及的指定关系由中国结算维护, 本所系统不支持盘中调整。