

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
ETF 产品纳入港股通标的
市场参与者技术实施指南
1.0 版



上海证券交易所
二〇二二年二月

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）ETF 产品纳入港股通标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

本档为上海证券交易所 ETF 产品纳入港股通标的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

为配合 ETF 纳入港股通标的，修订最小价差文件（zxjcMMDD.txt）描述。

3 业务调整说明

本次业务修改港股通系统市场接口，对 zxjc（最小价差）文件中价差代码的描述进行了说明，增加了“交易所买卖基金”（即 ETF）的价差表说明。本次修改市场接口的目的是提醒市场参与者注意 ETF 作为港股通标的时与股票的价差表不同，以便市场参与者进行改造。

4 市场参与者技术实施建议及注意事项

- 1) ETF 产品信息会在 reff04 文件中揭示，其“证券类别”为“TRST（信托）”。
- 2) ETF 的价位表与股票不同，市场参与者应根据 reff04 文件“备注”中的价差代码，从 zxjc 文件中获取相应的价位表，进行前端控制。
- 3) ETF 与股票的订单申报接口相同，支持竞价限价盘和增强限价盘订单申报。
- 4) 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，保证港股通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、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

验证。

5 相关技术文档

IS117 IS117-上海证券交易所港股通市场参与者接口规格说明书(港股交易)1.07版(ETF纳入港股通标的技术开发稿)-20220218