

关于发布优化 ETF 申赎清单(含跨银行间市场债券 ETF) 市场接口及技术指南的通知

各市场参与人:

根据 ETF 申赎清单优化及跨银行间市场债券 ETF 相关工作安排, 现发布以下材料:

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) 2.0 版_20250324(优化 ETF 申赎清单 技术开发稿)》

二、《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 1.69 版_20250324(优化 ETF 申赎清单 技术开发稿)》

三、《IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范 0.58 版_20250324(优化 ETF 申赎清单 技术开发稿)》

四、《IS120_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范 0.58 版_20250324(优化 ETF 申赎清单 技术开发稿)》

五、《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_20250324(优化 ETF 申赎清单 技术开发稿)》

六、《上海证券交易所优化 ETF 申赎清单市场参与者技术实施指南_20250324》

七、《上海证券交易所跨市场债券(银行间)ETF 市场参与者技术实施指南_20250324》

市场参与人可通过市场技术服务平台“产品服务-交易支持软件专区”相关栏目获取上述材料。请提前做好技术就绪

准备。

本次主要变更内容：

一、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，启用“市场 ID”字段，调整“替代标志”字段描述，启用及新增部分申购、赎回控制字段，增加“申赎模式”字段；调整附录一中 ETF 产品与申赎模式、替代标志、市场 ID 对应关系表，新增附录二 xml 版本文件结构、附录三 ETF 定义文件标志文件举例、附录四 现金替代比例计算说明、附录五 现金替代标志说明。

二、在竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书中，支持 ETF 公告文件 xml 版，调整行情接口 mktddt00.txt 章节 IOPV 行情与 ETF 公告文件关联关系描述。

三、在行情网关 BINARY 及 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。

四、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。

另外提醒，本次发布的《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）》适用于跨银行间市场债券 ETF 业务，详见《跨市场债券（银行间）ETF 市场参与者技术实施指南》。

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

2025 年 3 月 28 日