

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
部分ETF申购支持RTGS结算模式
市场参与者技术实施指南

1.0 版



上海证券交易所

二〇二一年七月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20210702	创建

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）部分ETF申购支持RTGS结算模式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(8:00-21:00)

电子邮件：tech_support@sse.com.cn

技术服务微信公众号：SSE-TechService



一、简介

本文档为上海证券交易所部分 ETF 申购支持 RTGS 结算模式相关业务技术实施指南，对市场参与者技术实施提出建议。

二、本所市场接口调整说明

此次市场接口调整主要是为配合部分 ETF 申购支持 RTGS 结算模式相关业务需求，调整综合业务平台市场参与者接口规格说明书中 ETF 现金申赎相关接口说明，并在基金非交易基础信息接口中增加 ETF 现金申赎类别产品，增加 RTGS 申购模式标志信息。

三、业务说明

投资者T日通过代办券商提交申购申请，代办券商实时发送申购申请至上交所，上交所将 ETF 申购指令实时发送中国结算上海分公司。

中国结算上海分公司进行 RTGS 清算，并将清算结果通知投资者对应的结算参与者。结算参与者根据投资者交收意愿和资金情况，T日日间在中国结算上海分公司 RTGS 平台上进行勾单确认。中国结算上海分公司在结算参与者非担保付金账户余额足额的情况下完成 ETF 申购现金替代金额的交收并进行基金份额登记，并告知上交所和投资者对应的结算参与者，由上交所通知基金管理人交收结果。基金管理人对应的托管机构将在日间收到投资者申购现金对价，基金管理人据此开展补券。上交所和投资者对应的结算参与人在收到中国结算上海分公司份额登记结果后可实时记增投资者基金份额，投资者当日即可卖出或赎回 ETF 份额。

对于日间未交收成功和日间未勾单的ETF申购指令，中国结算上海分公司将对日终前完成勾单ETF申购指令组织当日RTGS日终批次交收，并将交收结果发送给上交所、基金管理人和投资者对应的结算参与者，申购成功的基金份额在次日可用。

四、市场参与者技术实施建议及注意事项

1. 对于使用 RTGS 模式结算的 ETF 现金申购申报，除二级市场交易代码成交记录、非沪市资金代码成交记录和一级市场申赎代码成交记录以外，在盘中通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 RTGS 成功交收，会有以下执行报告（交收回报）消息记录：
 - 一条ETF二级市场交易代码交收记录，ExecType取值为K，证券代码为二级市场交易代码，价格为0，数量为交收数量，金额为清算金额（买方为负，卖方为正），成交编号为交收编号。
 - 对于使用RTGS模式结算的ETF现金交收回报，如遇需要冲正，则会收到对应一笔执行报告（交收冲正）消息记录：一条ETF二级市场交易代码交收冲正记录，ExecType取值为5，证券代码为二级市场交易代码，价格为0，数量为相对于原交收数量的变更数量（正数表示记增，负数表示记减），金额为相对于原清算金额的变更金额，成交编号同交收回报中交收编号。
2. 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，确保部分ETF支持RTGS结算模式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。
3. 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。

五、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：

《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1.48版_20210723》