

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
新港股通交易系统市场参与者
技术实施指南



上海证券交易所

二零二三年九月

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）新港股通交易系统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

电子邮件：tech_support@sse.com.cn

服务电话：4008888400-2

网站地址：<https://www.sse.com.cn/> - 交易技术支持专区

通讯地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号 上交所技术公司技术开发总部

一、简介

根据本所新一代交易系统建设规划路线，新港股通交易系统（以下简称“新系统”）即将替换现有港股通交易系统（以下简称“老系统”）切换上线（无并行期），以为市场提供更优质的服务，本次切换上线基本原则是尽可能降低对市场参与者的影响。

为保障港股通业务的顺利开展，确保新系统平稳切换上线，特制订本技术实施指南，对市场参与者相关的技术实施提供指引。

二、业务调整说明

业务规则方面无调整。

三、技术调整说明

本次新系统上线不涉及市场接口调整，但涉及报盘机接入地址调整和一些新老系统差异。

1 报盘机接入地址调整

市场参与者需通过新 EzCS 地址接入新系统。新 EzCS 地址请见下表，为平均各 EzCS 节点压力，请参照以下规则，平均分配新 EzCS 地址。

1) PBU 应在双站点的单组 EzCS 上尽量平均登录，并且对站点间的 EzCS 分别配置为主用、备用。会员机构根据本机构下用于港股通业务的 PBU 总数除以 EzCS 组的数量，可得出本机构单组 EzCS 上报盘机最大登录数（向上取整）。

2) 会员以“组 1-组 4”的顺序循环配置，非会员以“组 4-组 1”的顺序循环配置。

新 EzCS 地址：

序号	金桥	证券大厦
----	----	------

组一	***.*.**	***.*.**
组二	***.*.**	***.*.**
组三	***.*.**	***.*.**
组四	***.*.**	***.*.**

(地址明细请见会员专区向港股通资格会员发布的新港股通技术指南)

例：会员 A 有港股通报盘机 10 个，非会员 B 有港股通报盘机 10 个，接入示例如下表：

	组 1	组 2	组 3	组 4
会员 A	3 个	3 个	2 个	2 个
非会员 B	2 个	2 个	3 个	3 个

2 新老系统差异

相比老系统，新系统市场接口规格未做变更，在满足市场接口规格不变的条件下，新系统在订单交互和字段处理上有少许优化和调整，预期不会影响市场参与者所属系统，以下列出所有市场相关的新老系统差异，提请市场参与者关注。

1) 申报消息多发错误场景，响应错误码字段存在差异

“申报消息”、“申报撤单消息”在申报元素出现多个错误时，因新系统校验顺序优化，校验失败时回复的错误码字段值可能与老系统不一致。具体字段为“申报响应消息/申报撤单成功响应消息”中“OrdRejReason”字段、“申报撤单失败响应消息”中“CxlRejReason”字段。

示例：申报消息出现两类申报要素错误，“投资者账户为 E 类型”和“该账户未指定在申报业务 PBU 上”。老系统返回错误码为 19180（不是此账户指定的 PBU），新系统返回错误码为 19072（无效的账户类型）。

2) EzSTEP 申报接口字段优化

a. 响应及执行报告消息中“ClOrdID”字段、“OrigClOrdID”字段

➤ 老系统:市场申报消息/申报撤单消息中填写的 ClOrdID 字段不足 C10 时,交易系统返回的响应及成交消息中,ClOrdID 字段会右补空格至 C10。OrigClOrdID 字段处理方式相同。

示例:市场申报时填写 ClOrdID 为“123□□”(5位。“□”代表一位空格,下同),响应及成交中的 ClOrdID 为“123□□□□□□□□”(10位)。

➤ 新系统:申报消息中填写的 ClOrdID 字段不足 C10 时,交易系统返回的响应及成交消息中,ClOrdID 字段不再补齐 10 位;市场申报消息中填写的 ClOrdID 字段无论是否满 C10,交易系统返回的响应及成交消息中,ClOrdID 字段均会去掉所有右空格;市场申报消息中填写的 ClOrdID 字段为全空格时,交易系统返回的响应及成交消息中,ClOrdID 字段为“□”(1位)。OrigClOrdID 字段处理方式相同。

示例:市场申报时填写 ClOrdID 为“123□□”(5位)或者“123□□□□□□□□”(10位),响应及成交中的 ClOrdID 均为“123”(3位)。

b. 返回消息空字段统一处理

➤ 老系统:对于交易系统返回的消息中,字符串类型的字段,若为空字段则填写一个空格或空值。

老系统空字段填空值场景:申报成功响应中,OrigClOrdID、Text 字段;申报拒绝响应中,OrderID、OrigClOrdID 字段,在 OrdRejReason 取值不为“30000/32000/32002/32004/32006”时的 Text 字段;申报撤单失败响应中,OrderID 字段,在 OrdRejReason 取值不为“30000/32000/32002/32004/32006”时的 Text 字段。执行报告消息中成交(ExecType=F),Text 字段。

➤ 新系统:对于交易系统返回的消息中,字符串类型的字段,若为空字段统一填写一个空格。

c. 申报消息中 NoPartyIDs 字段严格校验

➤ 老系统：对申报消息的 NoPartyIDs 字段取值为“4”（1 位）、“□4”（2 位，左补空格）、“4□”（2 位，右补空格）、“04”（2 位）均视为合法；对申报撤单消息的 NoPartyIDs 字段取值为“2”（1 位）、“□2”（2 位，左补空格）、“2□”（2 位，右补空格）、“02”（2 位）均视为合法。

➤ 新系统：对申报消息的 NoPartyIDs 字段取值仅为“4”（1 位）时视为合法，对于“□4”（2 位，左补空格）、“4□”（2 位，右补空格）、“04”（2 位）均视为非法；对申报撤单消息的 NoPartyIDs 字段取值仅为“2”（1 位）时视为合法，对于“□2”（2 位，左补空格）、“2□”（2 位，右补空格）、“02”（2 位）均视为非法。

四、市场参与者技术实施建议及注意事项

市场参与者应充分评估变更对交易相关技术系统的影响，做好相关技术系统维护、改造及变更工作，保证新老系统的顺利切换，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。

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。

市场参与者应提前准备好应急回退预案，做好相关应急事项安排。以备在应急场景发生时，下一交易日 EzSTEP 报盘机能平稳的回退接入至老系统 EzCS（请提前备份好老系统 EzCS 接入地址）。

五、相关技术文档

本所最新技术文档详见上交所网站交易技术支持专区，本次新系统上线涉及相关技术文档如下（本次无变更）：

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）

IS108 上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书