

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所  
基金通业务做市商市场参与者  
技术实施指南  
1.2 版



上海证券交易所  
二〇二三年八月

## 版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20210907	创建说明
V1.1 20220822	新增询价消息转发PBU说明
<u>V1.2 20230808</u>	<u>增加行情网关作为基金通行情文件的接收渠道</u>

### 文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）基金通 2.0 做市商市场参与者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、概述

本文档为上海证券交易所基金通 2.0 项目相关业务技术实施指南，仅对做市商技术实施提出建议。

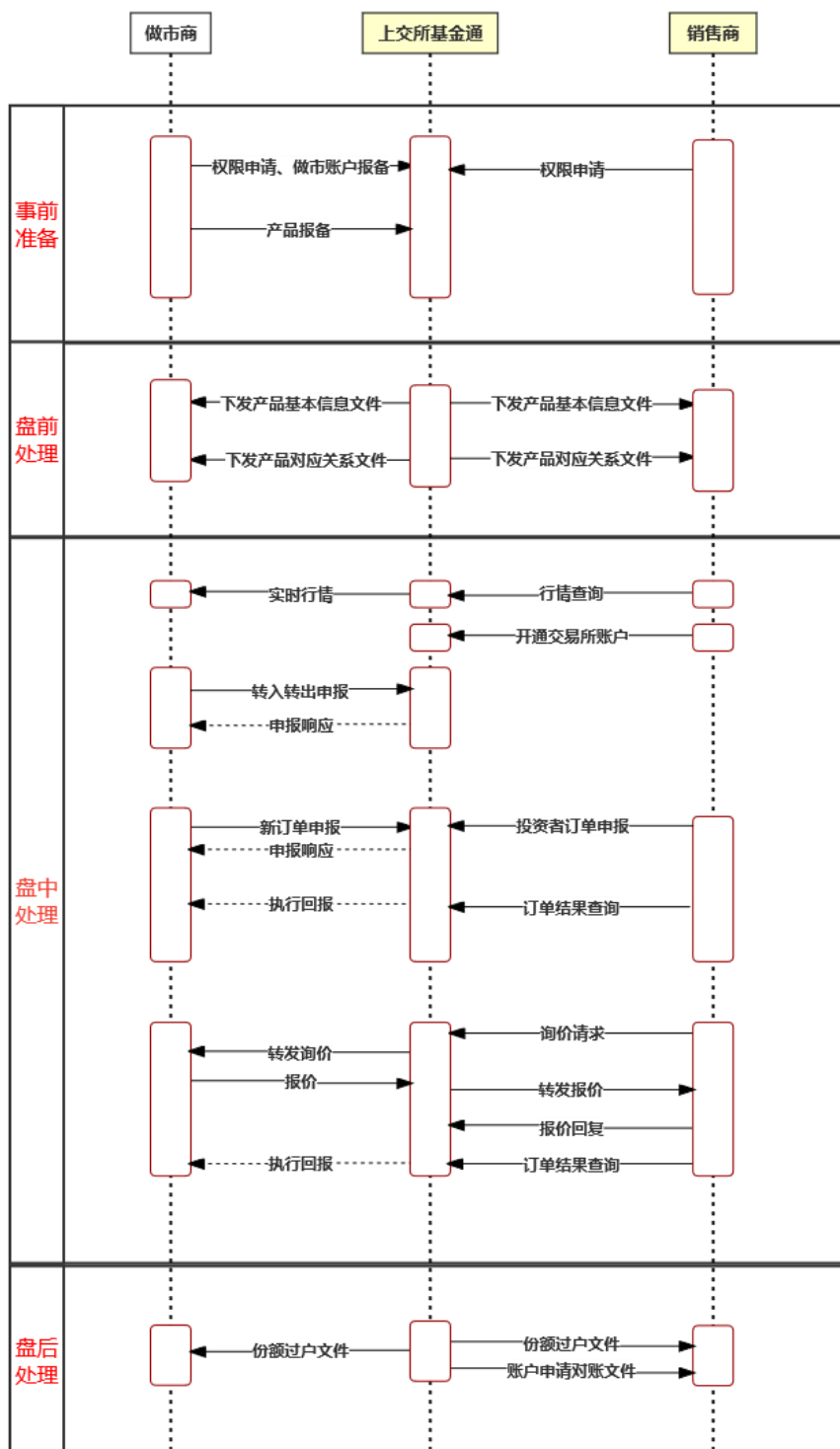
## 二、业务说明

本次文档主要针对上证基金通 2.0 项目做市商参与者。基金销售机构转发投资者申报委托，支持投资者使用开放式基金账户卖出公募 REITs 份额；针对特定数量的大单交易需求，投资者也可通过销售机构向做市商发出询价指令。做市商在基金通平台开展做市服务，向投资者提供持续报价，并对投资者询价提供回应报价。

做市商需做好前端资金控制，并保证交收顺利。

### 三、系统说明

#### 1. 整体业务流程



## 2. 交易窗口

平台	业务	订单申报时间
互联网交易平台	基金通业务	9:30-11:30
		13:00-15:00

## 3. 系统改造

- (1) 做市商通过互联网交易网关（TDGW）进行交易数据交互；
- (2) 通过证通云盘收发文件；
- (3) 通过 UT 客户端 MDGW 行情网关 接收基金通行情文件。

## 四、市场参与者技术实施建议及注意事项

### 1. 账户

(1) 基金通平台发起方开放式基金账户和发起方交易账户指做市商中国结算开放式基金账户和交易账户，通过直销或代销开通开放式基金账户时，中国结算会返回开放式基金账户和交易账户。

(2) 基金通平台发起方投资者账户指场内做市证券账户，发起方业务交易单元号指场内做市证券账户指定的 PBU 或与指定 PBU 属于同一联通圈的其它业务 PBU。

2. 销售机构对指定产品的询价消息将转发至该产品对应的做市证券账户指定 PBU。可使用该指定 PBU 登录 TDGW 收取询价消息，亦可登录其他 PBU 并订阅该指定 PBU 后收到询价消息。

3. 关于资金交收、代销备付金账户等，请详见中国结算相关文档。

4. 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，确保基金通 2.0 相关业务的顺利开展，同时保障现有各类业务正常运行。

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。

## 五、 相关文档列表

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：

《IS122\_上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书（互联网交易平台）》

《IS124\_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》

《IS111\_上海证券交易所报盘软件错误码表》

《IS120\_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范》

《IS120\_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范》