

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所  
新竞价新综业若干技术调整  
市场参与人技术实施指南  
1.0 版



上海证券交易所  
二〇二六年一月

## 文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）对新一代竞价交易系统（以下简称“新竞价”）和新一代综合业务系统（以下简称“新综业”）相关技术调整的市场参与人技术实施指南。其中针对现生产运行的竞价交易系统和综合业务系统，以下简称“竞价”和“综业”。

## 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： 4008888400(按键 2)

电子邮件： [tech\\_support@sse.com.cn](mailto:tech_support@sse.com.cn)

技术服务微信公众号：SSE-TechService



## 1 简介

根据本所安排，将推进市场参与人配合新竞价和新综业的建设工作。为此本所制定该技术实施指南，对市场参与人相关的技术实施提出建议。

## 2 市场接口调整说明

- 《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 1.59 版（新竞价新综业技术开发稿）》

- 1) 过户数据接口 bghXXXXX.dbf、dghXXXXXYYYYMMDD.dbf：调整成交编号（cjbh）有效位数描述。
- 2) 行情文件 mktdt01.txt：“市场行情状态”，增加在无支持开盘集合竞价的产品、无发行期内国债预发行产品的情况下，字段无意义说明。
- 3) 根据现状，补充与修订过户数据接口 bghXXXXX.dbf 相关描述。

- 《IS111\_上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.29 版（新竞价新综业技术开发稿）》

- 1) 对新竞价新综业订单响应的部分错误码描述进行调整。

- 《IS118\_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）1.36 版（新竞价新综业技术开发稿）》

- 1) 托管银行私有数据接口 YYYY.sse 新增新竞价过户数据文件（gh00PXXXXX.txt）、新竞价发行过户数据文件（ipogh00PXXXXX.txt）、指定过户数据文件（zdgh00PXXXXX.txt），取消竞价过户数据文件

( ghXXXXX.dbf ) 。

- 《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 )2.4 版( 新竞价新综业技术开发稿 ) 》

1) 基金公司盘后数据文件 ZZZZZ.sse 新增新竞价过户数据文件

( gh00PXXXXX.txt )、新竞价发行过户数据文件( ipogh00PXXXXX.txt )、

指定过户数据文件 ( zdgh00PXXXXX.txt ) ，取消竞价过户数据文件

( ghXXXXX.dbf ) 。

- 《IS120\_上海证券交易所行情网关 BINARY/STEP 数据接口规范 0.60 版  
( 新竞价新综业技术开发稿 ) 》

1) 市场状态消息 ( MsgType=M101 ) ：增加在综合业务市场无支持开盘集合竞价的产品、无发行期内国债预发行产品的情况下，字段无意义说明。

- 《IS122\_上海证券交易所交易网关 Binary/STEP 接口规格说明书 ( 竞价平台 ) 0.58 版 ( 新竞价新综业技术开发稿 ) 》

1) 取消业务类型与执行报告分区的固定对应关系。

2) 取消申报数量字段取值小于 1000000000 的说明。

3) 取消成交金额字段超过 999999999.99999 元时返回-1 的说明。

- 《IS124\_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 3.10 版( 新竞价新综业技术开发稿 ) 》

1) 竞价撮合系统盘中停牌公告文件 tpxxxxhhmmss.txt: xxxx 不再从 0001 开

始递增编号。

- 2) 下线竞价过户数据文件 ghXXXXX.dbf，新增新竞价过户数据文件 gh00PXXXXX.txt、新竞价发行过户数据文件 ipogh00PXXXXX.txt、指定过户数据文件 zdgh00PXXXXX.txt。
- 3) 下线权证信息文件 qzxxMMDD.txt。

### 3 业务调整说明

本次不涉及业务调整。

### 4 市场交互变动说明（新竞价）

新竞价上线时，市场参与人技术系统与本所技术系统之间的交互将会有如下变化。

#### 4.1 停用/注销 PBU 不再支持登录交易网关

序号	竞价	新竞价
1	停用/注销 PBU，支持登录交易网关，但成功登录后不支持新订单申报和撤单申报，不支持订阅和被订阅。	停用/注销 PBU，不支持登录交易网关，不支持新订单申报和撤单申报，不支持订阅和被订阅。

市场参与人应提前确定登录 PBU 的状态，避免使用停用/注销 PBU 进行交易网关登录，以免影响当日的交易网关登录以及后续的业务开展。

#### 4.2 PBU 口令更新时效性调整

序号	竞价	新竞价
1	当日通过交易网关实时更新 PBU 口令后,通过竞价平台订阅 该 PBU 时的口令次日生效。	当日通过交易网关实时更新 PBU 口令后,通过竞价平台订阅该 PBU 时的口令实时同步生效。

#### 4.3 执行报告分区取消固定取值

序号	竞价	新竞价
1	业务类型与执行报告分区有固 定对应关系。	执行报告分区取消固定取值,业务 类型与执行报告分区取消固定对 应关系。

市场参与人应避免自行配置固定执行报告分区信息,影响系统的灵活性和兼容性。本所每个交易日通过 TDGW 执行报告信息 (ExecRptInfo) 向市场参与人揭示分区信息,市场参与人应支持每日通过本所 TDGW 获取该信息。详细说明参见本所《IS122\_上海证券交易所交易网关 Binary/STEP 接口规格说明书 (竞价平台) 0.58 版 (新竞价新综业技术开发稿)》。

#### 4.4 字符型枚举取值字段的填写调整

序号	竞价	新竞价
1	针对约定枚举值的字符型字段, 在该字段无意义场景下,若填报 枚举值以外的其它有效字符,响	针对约定枚举值的字符型字段,在 该字段无意义场景下,若填报枚举 值以外的其它有效字符,响应中该

	应中该字段（若有）返回原申报数据。	字段（若有）返回空格。
--	-------------------	-------------

针对约定枚举值的字符型字段，在该字段无意义场景下，建议市场参与人填写接口中的推荐值或空格，避免另做他用，以防影响业务开展。

示例：新订单申报接口中的信用标签（CreditTag），枚举值包括 XY、RZ、RQ、PC。针对非交易业务，该字段无意义。若非交易填报枚举值外的其他字符，如 NN，则在申报响应中，该字段返回为空格。

4.5 取消成交回报中成交金额字段溢出限制

序号	竞价	新竞价
1	交易网关成交金额字段，如果实际成交金额超过999,999,999.99999元，则该字段返回 OxFFFFFFFFFFFFFFFF(即对应数值-1)，请使用该字段的 市场参与人特殊处理，柜台系统应能识别并及时处理该字段溢出异常，可采取如自行计算或拆分调整，盘后采用登记结算数据或其他方式处理，做好该异常的	无此约束限制。

	识别和处理。	
--	--------	--

#### 4.6 取消新订单申报中申报数量的取值限制

序号	竞价	新竞价
1	申报数量 OrderQty 字段：取值 小于 10000000000.	无此约束限制。

#### 4.7 调整竞价撮合系统盘中停牌公告文件名的“公告序号”编号规则

序号	竞价	新竞价
1	tpxxxxhhmmss.txt 文件名中的 xxxx 为盘中停牌公告序号，从 0001 开始递增编号。	tpxxxxhhmmss.txt 文件名中的 xxxx 为盘中停牌公告序号，不再从 0001 开始递增编号。

市场参与人应避免依赖文件名中 xxxx 单调递增的规律来获取公告文件。

#### 4.8 启用新过户接口

序号	竞价	新竞价
1	竞价过户数据文件 ghXXXXX.dbf 文件	1) 启用三个新过户接口：新竞价过 户数据文件 gh00PXXXXX.txt、新竞 价发行过户数据文件 ipogh00PXXXXX.txt、指定过户数据



		文件 <code>zdgh00PXXXXX.txt</code>  2) 下线老过户接口：竞价过户数据  文件 <code>ghXXXXXX.dbf</code> 文件
--	--	--

新竞价将取消竞价过户数据文件 `ghXXXXXX.dbf`（如下简称“老过户”）的发送，新增发送三个新过户接口（以下简称“新过户”）：新竞价过户数据文件 `gh00PXXXXX.txt`、新竞价发行过户数据文件 `ipogh00PXXXXX.txt`、指定过户数据文件 `zdgh00PXXXXX.txt`。详细说明参见本所《IS124\_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 3.10 版（新竞价新综业技术开发稿）》。

托管银行私有数据接口/基金公司盘后数据文件取消老过户的发送，新增发送新过户。详细说明参见本所《IS118\_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）1.36 版（新竞价新综业技术开发稿）》、《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）2.4 版（新竞价新综业技术开发稿）》。

关于新过户接口，有如下注意事项。

1) 新过户接口采用“**字段变长+灵活结构**”的格式，具体格式及内容如下：

- a. 文件记录采用行格式，“|”分隔，UTF-8 编码规范；
- b. 字段长度不固定，取值以实际业务长度为准，左右不补空格；
- c. 不同业务类型，分别定义记录格式，市场参与者应根据业务类型字段取值解析不同的文件记录格式；
- d. 过户接口尾部可能随时增加扩展字段，市场参与者应能向下兼容过

户接口字段进行扩位；

e. 某 PBU 当天没有过户数据时，不会生成并下发空文件。

2) 为保障新过户接口平稳切换上线，拟于新竞价上线前，在现有竞价系统生产环境下提前推出新过户接口，具体时间计划安排如下：

新过户接口生产环境推出时间计划表			
阶段计划	市场接口输出范围	时间计划（拟）	备注
市场验证期	老过户+新过户	2026 年 3 月-6 月	该阶段新过户接口仅供市场参与人系统验证使用。 托管银行私有数据接口/基金公司盘后数据文件包含新过户+老过户。
市场切换期	老过户+新过户	2026 年 6 月-9 月	该阶段市场参与人可择机切换至新过户接口。 托管银行私有数据接口/基金公司盘后数据文件包含新过户+老过户。
启用生效期	新过户	2026 年 9 月后	老过户接口不再提供，市场参与人必须使用新过户接

			口。  托管银行私有数据接口/基金公司盘后数据文件包含新过户。
--	--	--	---------------------------------------

- a. 市场验证期，提前推出新过户接口，与现有老过户接口并行发送。

该阶段新过户接口仅供系统验证使用，不建议市场参与人直接切换到新接口。

- b. 市场切换期，老过户接口与新过户接口并行发送。市场参与人可逐步切换至新接口，用于相关业务处理。

- c. 启用生效期，老过户接口下线，仅提供新过户接口。此时，市场参与人应能支持处理新过户接口。

- d. 上表所列时间计划供参考，具体切换上线时间将另行通知。

#### 4.9 相关接口不包括场内分销代码记录（无业务开展时）

序号	竞价	新竞价
1	当无债券场内分销业务开展时， 竞价撮合系统行情文件 mkttdt00.txt、产品基础信息第二 版第一批次 cpxx0201mmdd.txt/ 产品基础信息第二版第二批次	当无债券场内分销业务开展时，竞 价撮合系统行情文件 mkttdt00.txt、 产品基础信息第二版第一批次 cpxx0201mmdd.txt/产品基础信息 第二版第二批次

	cpxx0202mmdd.txt、行情网关实时行情（MDStreamID=MD003）中不包括债券分销代码信息。	cpxx0202mmdd.txt、行情网关实时行情（MDStreamID=MD003）中不包括债券分销代码信息
--	--	---

债券场内分销代码为 751\*\*\*，当无债券场内分销业务开展时，新竞价相关接口中不包含债券分销代码记录。

#### 4.10 产品基础信息文件涨幅上限/下限价格字段更新（无实际控制场景下）

序号	竞价	新竞价
1	取值非 0	取值为 0

产品基础信息第二版第一批次、产品基础信息第二版第二批次，当涨跌幅限制类型为非 N 时，涨幅上限价格和涨幅下限价格，无实际控制意义。新竞价针对该场景下输出为 0。

#### 4.11 下线权证信息文件 qzxxMMDD.txt

新竞价不再发送权证信息文件 qzxxMMDD.txt。

#### 4.12 错误代码表变更

新竞价实时申报响应的错误信息，详细参见《IS111\_上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.29 版（新竞价新综业技术开发稿）》中的“新竞价交易系统错误代码表”工作表。

## 5 市场交互变动说明（新综业）

新综业上线时,市场参与人技术系统与本所技术系统之间的交互将会有如下变化。

### 5.1 停用/注销 PBU 不再支持登录 EzSTEP

序号	综业	新综业
1	停用/注销 PBU，支持登录 EzSTEP，但成功登录后不支持申报订单。仅有停用/注销 PBU 登录 EzSTEP 情况下，也可以获取 pubdata 数据。	停用/注销 PBU，不支持登录 EzSTEP。

市场参与人应提前确定登录 PBU 的状态，避免使用停用/注销 PBU 进行 EzSTEP 登录，以免影响当日的登录以及后续的业务开展。

### 5.2 成交编号有效长度扩位

删除过户数据接口 bghXXXXX.dbf、dghXXXXXYYYYMMDD.dbf 中成交编号（cjbh）有效位数描述，请市场参与人注意做好相关技术准备工作。

示例：过户数据接口 bghXXXXX.bdf 目前成交编号（cjbh）“有效位用到 10 位”描述已不适用，删除相关描述。

### 5.3 产品集编号取消固定取值

市场参与人应避免配置固定产品集编号（setid），影响系统的灵活性和兼

容性。市场参与人应支持通过数据广播类型（`bcasttype`）获取执行报告和 `pubdata`。详细说明参见本所《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 1.59 版（新竞价新综业技术开发稿）》。

#### 5.4 撤单申报要素一致性检查

序号	综业	新综业
1	各业务撤单一致性检查要素，不统一。	各业务撤单一致性检查要素，统一。要素包括：业务类型编号、证券代码、投资者账户、业务 PBU、买卖方向（若有意义）。

#### 5.5 失败响应中交易所订单编号取值

处理结果为失败的申报响应，交易所订单编号填写：

序号	综业	新综业
1	各业务不统一，取值包括 0，空，空格等	统一填充格

#### 5.6 国债预发行业务相关变化

在无发行期内国债预发行产品时，市场数据发送如下变化：

##### 1) 行情信息变化

行情文件 `mktdt01` 文件中“市场行情状态”、行情网关 `BINARY` 及 `STEP` 数据中综合业务（`SecurityType = 03`）的市场状态消息（`MsgType=M101`），填写原则进行优化，具体如下：

序号		综业	新综业
1	开盘集合竞价结束标志	根据已过期的国债预发行产品状态更新	当综合业务市场无支持开盘集合竞价的产品时，无意义
2	国债预发行市场行情闭市标志	根据已过期的国债预发行产品闭市更新	当无发行期内国债预发行产品时，无意义

## 2) 产品基础信息变化

产品基础信息第二版第一批次 `cpxx0201mmdd.txt`/产品基础信息第二版第二批 `cpxx0202mmdd.txt` 不再发送已过“最后交易日期”的国债预发行产品。

## 5.7 错误代码表变更

新综业实时申报响应的错误信息，详细参见《IS111\_上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.29 版（新竞价新综业技术开发稿）》中的“新综合业务系统错误代码表”工作表。

# 6 市场参与人技术实施建议

- 1) 上述市场交互变动内容，除新过户接口相关调整以外，本所现有竞价、综业不做变更，在新竞价、新综业上线时调整。请市场参与人在技术设计时应做好新老两代交易系统兼容,并在本所要求的时间前做好技术就绪。

- 2) 交易系统依据申报中的“业务 PBU+会员内部编号 (ClOrdID)”组合的取值,判断申报是否为重复订单。市场参与者应据此进行编号。
- 3) 不同业务的成交编号可能存在重复情况,建议市场参与人在使用成交编号时结合业务类型、证券账户等其他要素做识别处理。
- 4) 市场参与者应充分评估本次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,配合本所做好新一代交易系统项目的推出工作,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。

## 7 上线实施安排

各市场参与者按照相关规则要求和技术实施建议完成技术改造后,本所将择机组织开展测试和上线工作。

新竞价和新综业的相关变更**预期同步上线**,具体上线时间另行通知。

## 8 相关技术文档

- 《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 1.59 版(新竞价新综业技术开发稿)》
- 《IS111\_上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.29 版(新竞价新综业技术开发稿)》



- 《IS118\_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）1.36 版（新竞价新综业技术开发稿）》
- 《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)2.4 版(新竞价新综业技术开发稿)》
- 《IS120\_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范 0.60 版(新竞价新综业技术开发稿)》
- 《IS120\_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范 0.60 版（新竞价新综业技术开发稿）》
- 《IS122\_上海证券交易所交易网关 Binary 接口规格说明书(竞价平台)0.58 版（新竞价新综业技术开发稿）》
- 《IS122\_上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书(竞价平台)0.58 版（新竞价新综业技术开发稿）》
- 《IS124\_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 3.10 版（新竞价新综业技术开发稿）》