

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
互联网交易平台一债通业务
市场参与者技术实施指南
(固收迁移互联网交易平台开发稿)



上海证券交易所

二零二四年六八月

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）互联网交易平台一债通业务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，互联网交易平台一债通业务模块（以下简称“新系统”）将替换现有固定收益系统（以下简称“老系统”）切换上线（无并行期），以期为市场提供更优质的服务。

为保障固定收益业务的顺利开展，确保新系统平稳切换上线，特制订本技术实施指南，对市场参与人相关的技术实施提供指引。

新系统将分两个阶段替换逐步老系统，第一阶段迁移信用保护合约和组合型信用保护合约两个业务（提供网页端申报入口，不涉及接口变动），第二阶段迁移回购业务和现券交易非交易业务。各业务将逐步开放市场测试。第一阶段目前已基本技术准备就绪。第二阶段拟于**2024年年底**技术准备就绪，计划**2025年一季**度开放市场测试，并视市场就绪情况择机完成切换上线。

二、业务调整说明

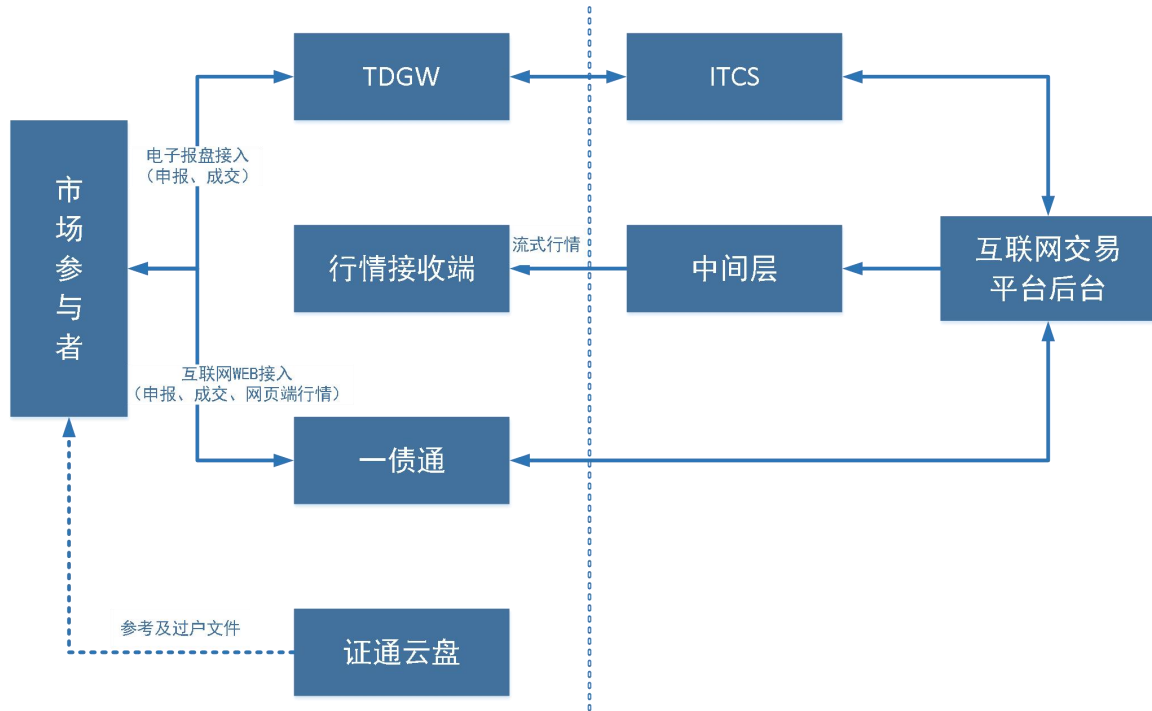
《上海证券交易所债券交易规则》第五十五条“采用其他交易方式的，债券交易的申报价格最小变动单位为0.0001元”原属暂缓实施条款，本次拟调整为正式实施。

三、技术调整说明

本次新系统上线后将参照现有本所其他核心交易系统接入经验进行优化调整：

- 1、原固定收益系统将迁移至互联网交易平台一债通业务模块；
- 2、原固收平台交易员终端（BOND）将迁移至互联网交易平台一债通模块网页端；
- 3、原固收平台STEP协议报盘软件（EzDA）将迁移至互联网交易平台交易网关（TDGW）；

- 4、原各类行情发送通道将通过行情网关（MDGW）和 Level2 对外发送；
- 5、原各类参考数据和成交数据文件接收通道将切换至证通云盘对外提供；
- 6、新系统对于现券仅保留当日数据，对于回购仅保留未了结合约数据，不再提供历史数据，请各市场参与者如有需要，做好相关交易信息的导出备份存储工作。



相应地，老系统《IS119 上海证券交易所固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》和《IS109 上海证券交易所固定收益平台外部数据接口规范》将废弃，原《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）1.35 版》将相应调整。

| 原文档名称 | 迁移安排 | 新文档情况 |
|--------------------------------------|------|--|
| IS119 上海证券交易所固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书 | 文档废弃 | 申报接口参考《IS122 上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书》； |
| IS109 上海证券交易所固定收益平台外部数据接口规范 | | 行情接口参考《IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范》和《IS120_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范》； 盘后接口参考《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》 |
| IS118_上海证券交易所特定 | 文档调整 | 盘后接口引用《IS124 上海证券交易所市场数据 |

| | | |
|-----------------------|--|--------------|
| 参与者接口规格说明书（托管 银行卷） | | 文件交换接口规格说明书》 |
|-----------------------|--|--------------|

具体变更内容如下：

1 网页入口

老系统登录用户名为 6 位，迁移到新系统后，原 6 位交易员代码将自动匹配 10 位一债通账户（三位用户类型识别码+五位机构识别码+两位数字），老用户可选择使用原 6 位交易员代码登录或 10 位一债通账户登录新系统网页端。在新系统新建的用户将仅有 10 位一债通账户，不匹配原 6 位交易员代码。后续如绑定安全手机或安全邮箱后，新系统网页端也支持使用手机或邮箱进行登录。

老系统的证书迁移后可在新系统继续应用，原证书如需更换则需要申请互联网交易平台一债通业务证书。

2 报盘入口（TDGW）

互联网交易平台 TDGW 将逐步支持 EzDA 相关申报业务（包含各类现券交易与非交易、协议回购、三方回购等）。主要变更包括：

1) 不同于 EzDA 使用交易员账号登录，与其他核心交易系统保持一致，TDGW 使用交易单元（技术 PBU）进行登录，申报时需要填写订单对应的 10 位一债通账户和业务 PBU（可以与技术 PBU 不同）。

2) 因固收各协商成交对手方均为交易员，为保证订单路由成功，交易员如使用 TDGW 申报订单，均需通过一债通网页端绑定一个 PBU，多个交易员可绑定同一个 PBU；系统将把指定给该交易员或该交易员所在交易参与人的订单发送至此交易员登录的一债通网页端或此交易员绑定的 PBU 登录的 TDGW；交易员绑定关系每日在交易时段内可通过一债通网页端进行绑定或解绑，隔日生效。如无变更，绑定一次后即可。

3) 订单和成交在一债通和 TDGW 端可以互通，交易员可在网页端查询其在 TDGW 端申报的订单，而此交易员在 TDGW 端也可以收到在网页端相关申报的订单或成交确认（将发送至申报交易员绑定的 PBU 登录的 TDGW，如有）。特别地，对于通过 TDGW 申报的订单用户需主动填写会员内部编号，而通过一债通网页端申报的订单，系统将自动生成会员内部编号（暂定以 UB 开头，为避免重复，**请 TDGW 端申报时避免以此前缀填写会员内部编号**）。

4) 接口中预留了竞买的接口，固收迁移切换上线后择机开放支持。

TDGW 的申报接口征求意见稿详见附件一，针对原固收支持的各类业务划分为四类申报类型：订单业务类（支持竞买、三方回购转入转出、转股、换股、回售、回售撤销和转托管等业务）、询价报价业务类（支持确定报价、待定报价和询价等业务）、意向申报类（支持现券和回购意向申报类业务）、成交申报类（支持各类指定对手方的申报包括协商成交、合并申报和回购业务首期、存续期各类申报等）。

3 行情接收（MDGW/Level2）

老系统客户端提供的行情文件，迁移后均不再提供，新系统将通过 MDGW 和 Level2 对外提供流式快照和逐笔行情服务。逐笔行情支持重传，重传端口同时仅支持一个 VSS 连接。

| 文件内容 | 文件名 | 原发送端 | 新系统规划 |
|---------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------------|
| 成交明细行情 | ZQ_CJMXyyyyymmdd.txt | BOND EzDA Level-2 MDGW | 逐笔行情发送 |
| 成交统计行情 | ZQ_CJHQyyyyymmdd.txt | | 快照行情发送 |
| 确定报价行情 | ZQ_QDBJyyyyymmdd.txt | | 逐笔行情发送 |
| 证券信息 | ZQ_ZQXXyyyyymmdd.txt | | 静态信息并入证券产品基础信息文件，证券状态并入快照行情 |
| 公开报价行情 | ZQ_GKBJyyyyymmdd.txt | EzDA | 逐笔行情发送 |
| 非公开报价行情 | ZQ_FGKBJyyyyymmdd.txt | | 通过订单转发方式实现 |
| 待定报价行情 | ZQ_DDBJyyyyymmdd.txt | | 逐笔行情发送 |

流式接口中各类行情配置如下。

| SecurityType | MDStreamID | 说明 |
|--------------|------------|----------------|
| 13 | MD210 | 债券非匹配成交统计快照行情 |
| | MD211 | 确定报价逐笔委托行情 |
| | MD212 | 待定报价逐笔委托行情 |
| | MD213 | 现券意向申报逐笔委托行情 |
| | MD214 | 协议回购意向申报逐笔委托行情 |
| | MD215 | 三方回购意向申报逐笔委托行情 |
| | MD216 | 竞买逐笔委托行情 |
| | MD217 | 债券非匹配成交逐笔成交行情 |

流式接口协议参见附件二和附件三。

4 文件接收（证通云盘）

- 针对所有市场参与者

老系统实时阶段提供的文件迁移后均不再提供，具体文件安排见下表。

| 文件内容 | 文件名 | 原发送端 | 新系统规划 |
|-------------|-------------------------------|------------|---|
| 过户/成交数据 | zghxxx.txt | EzDA | 下线，用户根据成交回报自主控制 |
| | zghxxx.dbf | BOND | 盘后提供，对应 zghXXXXX.txt |
| | bjYYYY.dbf | UT | 盘后提供，格式同 zgh |
| 订单状态 | ZQ_DDZTxxxxxx.txt | EzDA | 下线，用户根据成交回报自主控制 |
| 未结算合约 | ZQ_WJSxxx.txt | | 下线，使用中国结算发送数据 |
| 三方回购质押券所属篮子 | ZQ_SFHGLZXXYYYYMMDD D.txt | | 盘后提供，对应 trirepoparams_yyyymmdd.xml |
| 债券是否非担保 | ZQ_SFFDBXYYYYMMDD. txt | | 下线，并入产品信息 |
| 公告信息 | ZQ_GGXXYYYYMMDD.txt | BOND | 下线，功能下线 |
| 参与者清单 | se015jycyrYYYYMMDD00 1.txt | UT 证通云盘 | 盘后提供，对应 bondmbrs_yyyymmdd.xml |
| 交易员列表 | se015jyyYYYYMMDD001. txt | | 盘后提供，对应 bondtrdrs_yyyymmdd.xml |
| 收盘价 | bjspMMDD.txt | | 闭市盘 后提供，对应 bondnegorefpxunibondclspx_yyyymmdd.xml |
| 成交明细 | bjmxMMDD.txt | | 下线，通过行情接收端获取 |
| 确定报价 | bjqbMMDD.txt | | 下线，通过行情接收端获取 |
| | | | |

新系统盘后文件均通过证通云盘发送，相关变更情况参见下表，详细文件接口参见附件四。

| 文件内容 | 文件名 | 格式调整 |
|----------------------|--|---|
| 债券非匹配一债通成交汇总文件 | zghXXXXX.txt | <ul style="list-style-type: none"> ● 文件格式由 dbf 调整为 txt ● 汇总拆分粒度由交易商 (XXX) 调整为交易单元 (XXXXX, 业务 PBU) ● 交易员代码由 6 位扩为 10 位，证券代码由 6 位扩为 12 位，交易单元由 5 位扩为 8 位，投资者账户由 10 位扩为 13 位 ● 拆分证券信息字段为业务类型、业务子类型和会员内部编号三个字段 ● 买卖方向枚举值由 B (买) /S (卖) 改为 1 (买) /2 (卖)； ● 成交净价价格调整为成交价格，<u>实际表示净价还是全价根据证券产品基础信息文件计价方式字段确定</u> ● 移除交易产品、应计利息、成交全价价格、券面总额、成交净价金额、到期收益率、结算金额、是否做市报价字段 |
| 一债通收盘债券非匹配成交参考价文件 | bondnegorefp unibondclsp x _yyyymmdd.xml | <ul style="list-style-type: none"> ● 文件格式由 txt 调整为 xml |
| 债券交易参与者信息文件 | bondmbrs_yyyyymmdd.xml | <ul style="list-style-type: none"> ● 文件格式由 txt 调整为 xml ● 机构代码扩充为 12 位 |
| 债券交易员信息文件 | bondtrdrs_yyyyymmdd.xml | <ul style="list-style-type: none"> ● 文件格式由 txt 调整为 xml ● 交易员代码调整为一债通账户并扩为 10 位 |
| 证券产品基础信息文件 | products_yyyyymmdd.xml | <ul style="list-style-type: none"> ● 包含各类证券产品基础信息和债券特有信息 ● 仅包含已上市未摘牌产品，未上市或已摘牌的产品将不包含在此文件中 |
| 债券现券交易业务参考信息 (非匹配成交) | bondnegoparams_yyyyymmdd.xml | <ul style="list-style-type: none"> ● 新增 |
| 债券质押式协议回购业务参考信息 | bilateralrepoparams_yyyyymmdd.xml | <ul style="list-style-type: none"> ● 新增 |
| 债券质押式三方回购参考信息 | trirepoparams_yyyyymmdd.xml | <ul style="list-style-type: none"> ● 新增三方回购参考信息 ● 篮子信息主键调整为篮子编号 |

● 针对托管机构

针对各托管机构，原 bjYYYY.dbf 格式将与一债通成交汇总文件统一，并且每个 PBU 将生成一个文件，不再进行合并；原固收收盘价文件将调整为一债通收盘

价文件；原固收成交明细行情文件和确定报价行情文件接口不再发送。各文件中的价格为实际成交价格，对应的计价方式（全价/净价）可参考证券产品基础信息文件（products_yyyymmdd.xml）计价方式字段。请参见附件五和附件四。

请各市场机构谨慎评估相关变更影响，并根据迁移整体安排及时做好配套系统的变更研发工作。如对各接口开发稿有任何意见和建议，请在后续调查问卷或通过技术服务热线反馈。

四、附件

附件一：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）2.03 版_2024070422（固收迁移互联网交易平台开发稿）

附件二：IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范 0.59 版_20240624731（固收迁移互联网交易平台开发稿）

附件三：IS120_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范 0.59 版_20240624731（固收迁移互联网交易平台开发稿）

附件四：IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 2.4 版_202407050802（固收迁移互联网交易平台开发稿）

附件五：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）1.35 版（固收迁移互联网交易平台开发稿）