

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
1.5 版



上海证券交易所
二〇二六年八月

文档修订记录

版本号	日期	修订说明
V1.0	2026-01	创建并发布该文档
V1.1	2026-02	1. 更新“4.8 启用新过户接口”章节中的新过户接口文件名； 2. 新增“5.8 产品非交易基础信息文件”章节和“5.9EzSTEP 申报接口字段优化”章节；
V1.2	2026-04	新竞价： 1. 删除“4.4 字符型枚举取值字段的填写调整”章节。 2. 新增“4.12 下线竞价交易网关的“专用订阅通道””章节。 3. 更新“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）”章节的相关描述。 新综业： 4. 新增“5.10 大宗固定价格交易业务“本次剩余余额”字段取值”章节。 5. 更新“2 市场接口调整说明”、“5.2 成交编号有效长度扩位”、“5.8 产品非交易基础信息文件”、“5.9 EzSTEP 申报接口字段优化”章节的相关描述。
V1.3	2026-07	1. 新竞价新综业新增申报固定速率控制，新增章节“4.13

		新增申报固定速率控制”和章节“5.11 新增申报固定速率控制”。 2. 更新章节“6 市场参与人技术实施建议”的相关描述，新增带宽扩容、排查版本兼容性隐患、字符串类型字段填写说明等实施建议。 3. 更新“4.4 取消成交回报中成交金额字段的特殊溢出处理”、“4.5 取消新订单申报中申报数量的取值限制”和“4.8 相关接口不包括场内分销代码记录（当日无业务开展时）”章节的相关描述。
V1.4	2026-07	1. 新增“5.12 盘后固定价格交易行情相关变化”章节。 2. 更新“6 市场参与人技术实施建议”章节。 3. 更新“2 市场接口调整说明”章节。
<u>V1.5</u>	<u>2026-08</u>	<u>1. 更新“2 市场接口调整说明”章节，补充关于 CPXX 文件的相关调整说明。</u> <u>2. 更新“7 市场参与人技术实施建议”章节，补充关于 CPXX 文件生效日期的关注事项。</u> <u>3. 新增“5.13 EzTrader 下线”章节。</u> <u>4. 新增“5.14 易神系统 EzSTEP 应急工具下线”章节。</u> <u>5. 新增“6 市场接入说明”章节。</u>

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

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 1.60 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) 撮合业务及上证 LOF/公募 REITs 业务执行报告消息：调整成交编号（ExecID）有效位数描述。

- 《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_YYYYMMDD.txt）、新竞价发行过户数据文件

(ipogh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt) 、指定过户数据文件
(zdgh00PXXXXX_YYYYMMDD.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)2.5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_YYYYMMDD.txt) 、新竞价发行过户数据文件

(ipogh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt) 、指定过户数据文件

(zdgh00PXXXXX_YYYYMMDD.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 0.63 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。

2) 对于盘后固定价格交易业务, 明确行情快照字段取值。

- 《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 3.20 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_YYYYMMDD.txt、新竞价发行过户数据文件 ipogh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt、指定过户数据文件 zdgh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt。
- 3) 下线权证信息文件 qzxxMMDD.txt。
- 4) 修订产品非交易基础信息文件 fjyYYYYMMDD.txt 文件关于实时申赎货币基金 A 类产品“非交易价格”字段的描述。
- 5) 产品基础信息文件第二批次第一版本 cpxx0201mmdd.txt/产品基础信息文件第二批次第一版本 cpxx0202mmdd.txt(以下统称为“CPXX 文件”):
- (1) 当涨跌幅限制类型为非 N 时, 股票产品的涨幅上限价格和跌幅下限价格输出为 0; (2) 当日无场内分销业务时, 不再发送债券分销代码记录; (3) 产品集 SET 编号将切换为新竞价新综业的数据; (4) 不再发送已过“最后交易日期”的国债预发行产品。

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 取消成交回报中成交金额字段的特殊溢出处理

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)，请使用该字段的特殊处理，柜台系统应能识别并及时处理该字段溢出	成交金额字段无“超过 999,999,999.99999 元溢出”的特殊处理。成交金额字段若超过接口协议长度仍会进行溢出处理。

	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，做好该异常的识别和处理。	
--	--	--

4.5 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 1000000000.	申报数量字段无“取值小于 1000000000”的约束限制。申报数量范围仍需满足接口协议长度和业务规则范围。

4.6 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。

市场参与者应避免依赖文件名中 xxxx 单调递增的规律来获取公告文件。

4.7 启用新过户接口

序号	竞价	新竞价
----	----	-----

1	竞价过户数据文件 ghXXXXXX.dbf 文件	1) 启用三个新过户接口：新竞价过户数据文件 gh00PXXXXXX_YYYYMMDD.txt、新竞价发行过户数据文件 ipogh00PXXXXXX_YYYYMMDD.txt、指定过户数据文件 zdgh00PXXXXXX_YYYYMMDD.txt 2) 下线老过户接口：竞价过户数据文件 ghXXXXXX.dbf 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 gh00PXXXXXX_YYYYMMDD.txt、新竞价发行过户数据文件 ipogh00PXXXXXX_YYYYMMDD.txt、指定过户数据文件 zdgh00PXXXXXX_YYYYMMDD.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 3.20 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）2.5 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者系统验证使用。 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。

4.8 相关接口不包括场内分销代码记录（当日无业务开展时）

序号	竞价	新竞价
1	当日无债券场内分销业务开展时，竞价撮合系统行情文件 mkttdt00.txt、 <u>CPXX 文件</u> <u>产品基础信息第二版第一批次</u> epxx0201mmdd.txt/产品基础信息第二版第二批次 epxx0202mmdd.txt 、行情网关实时行情（MDStreamID=MD003）中包括债券分销代码信息。	当日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 epxx0201mmdd.txt/产品基础信息第二版第二批次 <u>epxx0202mmdd.txt</u> <u>CPXX 文件</u> 、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***，当日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。

4.9 产品基础信息文件涨幅上限/跌幅下限价格字段更新（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，针对股票产品，当涨跌幅限制类型为非 N 时，涨幅上限价格和跌幅下限价格，无实际控制

意义。新竞价针对该场景下的股票产品输出为 0。

4.10 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。

4.11 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。

4.12 下线竞价交易网关的“专用订阅通道”

新竞价不再支持“专用订阅通道”，若继续登录该通道，则会影响当日交易网关的正常登录。**请市场参与人在新竞价上线时，针对版本号为 1.8.25 及以上的交易网关版本，务必同步关闭交易网关的“专用订阅通道”开关。**

4.13 新增申报固定速率控制

新竞价新增订单申报的固定速率控制。1 个流速权对应 50 笔/秒（例：20 个流速权，则申报速率最大为 1000 笔/秒）。该速率控制由通信服务器实施，与交易网关现有机制叠加生效。

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），撮合业务执行报告消息、上证 LOF/公募 REITs 业务执行报告消息成交编号（ExecID）有效位数描述，请市场参与人注意做好相关技术准备工作。

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 1.60 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	说明	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次 cpxx0202mmdd.txt~~CPXX 文件不再发送已过“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。

5.8 产品非交易基础信息文件

产品非交易基础信息文件 fjyYYYYMMDD 文件，修正实时申赎货币基金 A 类产品（5198**）记录的“非交易订单整手数”、“非交易订单最小订单数量”、“非交易订单最大订单数量”“非交易价格”字段取值。新综业取值与货币市场基金实时申赎业务申报消息的“申赎数量最小变动单位”、“申赎数量下限”、“申赎数量上限”、“价格”一致。

5.9 EzSTEP 申报接口字段优化

1) 交易系统返回消息中字符型字段“去右空格”处理

序号	综业	新综业
1	对于字符类型字段： 市场申报的消息填写不足接口约定长度时，交易系统返回的消息中会右补空格至接口约定长度。 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）。	对于字符类型字段： 1) 市场申报的消息填写不足接口约定长度时，交易系统返回的消息中不再右补空格至接口约定长度； 2) 市场申报的消息填写无论是否满足接口约定长度，交易系统返回的消息中均会去掉所有右空格； 3) 市场申报的消息填写为全空格时，交易系统返回的消息中，保留一个空格。 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）。 市场申报时填写 ClOrdID 为“□□□□□”（5 位），响应及成交中的 ClOrdID 为“□”（1 位）。

2) 交易系统返回消息中“空”字符型字段“补空格”处理

序号	综业	新综业
----	----	-----

1	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。	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。
---	--	---------------------------------------

3) 交易系统返回消息无意义字段取值

建议市场参与者对于接口约定无意义的字段，可处理满足接口约定的任意取值或不使用该字段。因 STEP 消息字段默认值取值优化，交易系统返回的消息长度或发生变化。

序号	综业	新综业
1	不统一 【示例 1】 转融通业务，公共数据消息：接口约定为“行情结束记录消息中备注域（Text）取值“ZRT_MD_END”，消息体内其他域取值无意义。”，交易	对于接口约定“无意义”字段，除特殊约定，存在如下取值情况： 1) 填写默认值： a. 数字型字段，填写 0； b. 字符型字段，填写“□”（1 位）； c. 日期时间类型字段，填写实际时间 2) 填写市场参与者申报消息对应字段取值 【示例 1】 转融通业务，公共数据消息：接口约定为“行情结束记录消息中备注域（Text）取值“ZRT_MD_END”，消息体内其他域取值无意义。”，交易所发送消息为

	所发送消息为 【 9=60<SOH>35=W<SOH>1180=<SOH>48=<SOH>55=<SOH>44=0.000<SOH>271=0<SOH>387=0<SOH>580=0<SOH>58=ZRT_MD_END<SOH> 】	【 9=63<SOH>35=W<SOH>1180=□<SOH>48=□<SOH>55=□<SOH>44=0.000<SOH>271=0<SOH>387=0<SOH>580=0<SOH>58=ZRT_MD_END<SOH> 】 【 示例 2 】 股票质押式回购业务，申报响应消息/申报撤单成功响应消息： 接口约定为“证券代码，如无意义可取空格。”交易所返回消息与申报消息填写证券代码一致。
--	--	--

5.10 大宗固定价格交易业务“本次剩余余额”字段取值

大宗固定价格交易业务，执行报告消息中“本次剩余余额”字段及过户数据接口 dghXXXXXXYYYYMMDD.dbf 中“本次余额”取值。

序号	综业	新综业
1	固定填 0。	填写本次成交后发起方固定价格交易申报数量的剩余未成交数量。

5.11 新增申报固定速率控制

新综业新增订单申报的固定速率控制。1 个流速权对应 50 笔/秒（例：20 个流速权，则申报速率最大为 1000 笔/秒）。该速率控制由通信服务器实施，与 EzSTEP 现有机制叠加生效。

5.12 盘后固定价格交易行情相关变化

对于《IS120 上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范》及《IS120 上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范》中盘后固定价格业务的行情快照消息（MDStreamID= ‘MD102’ ），存在以下变化：

1）在启动（开市前）时段【09:30 前】或集中撮合时段【09:30-15:05】（含上述时段内停牌状态，TradingPhaseCode 第 1 位为‘I’、‘A’或‘F’），新综业揭示买、卖方向价格数量均为 0 的行情条目数据：

序号	综业	新综业
1	扩展字段 ExtendFields 中 不含 买入行情条目（MDEntryType 为‘0’） 和卖出行情条目（MDEntryType 为‘1’） 【示例】 []	扩展字段 ExtendFields 中 包含 买入行情条目（MDEntryType 为‘0’） 和卖出行情条目（MDEntryType 为‘1’） 上述条目的价格、数量均为 0 【示例】 [(‘0’,0,0,0),(‘1’,0,0,0)]
	说明：对于综业行情文件 mkttdt01.txt，盘后固定价格行情数据无上述新老差异，即买卖申报数量均为 0，无买卖价格字段）。	

2）在连续交易时段【15:05-15:30】或闭市时段【15:30 后】（TradingPhaseCode 第 1 位为‘H’或‘D’），新综业不揭示买方或卖方当前未成交的申报总股数为 0（即当前买方或卖方无挂单，不揭示该方向的价格信息）：

序号	综业	新综业
----	----	-----

1	扩展字段 ExtendFields 中包含买入行情条目（ MDEntryType 为‘0’）申报总股数为 0 或卖出行情条目（ MDEntryType 为‘1’）申报总股数为 0 的信息 上述条目的价格、数量均为 0 【示例 1：买方有挂单，卖方无挂单】 [(‘5’,闭市价,0,0),(‘0’,买入价格,买入数量,0),(‘1’,0,0,0)] 【示例 2：买方、卖方均无挂单】 [(‘5’,闭市价,0,0), (‘0’,0,0,0),(‘1’,0,0,0)]	扩展字段 ExtendFields 中不含买入行情条目（ MDEntryType 为‘0’）申报总股数为 0 或卖出行情条目（ MDEntryType 为‘1’）申报总股数为 0 的信息 【示例 1：买方有挂单，卖方无挂单】 [(‘5’,闭市价,0,0),(‘0’,买入价格,买入数量,0)] 【示例 2：买方、卖方均无挂单】 [(‘5’,闭市价,0,0)]
说明： 1)在连续交易时段【 15:05-15:30 】或闭市时段【 15:30 后 】产品停牌状态下（ TradingPhaseCode 第 1 位为‘F’），无上述差异，新老综业均发送[(‘5’,闭市价,0,0),(‘0’,0,0,0),(‘1’,0,0,0)]。 2) 对于综业行情文件 mkttdt01.txt，盘后固定价格行情数据无上述新老差异，即买或卖无挂单时，买卖申报数量均为 0，无买卖价格字段）。		

3）昨收盘 PreClosePx 字段（ T-1 日收盘价，非 T 日收盘价，T 日为当前交易日）：

序号	综业	新综业
----	----	-----

1	1) 在启动（开市前）时段【09:30 前】或集中撮合时间段【09:30-15:05】（含上述时段内停牌状态，TradingPhaseCode 第 1 位为‘I’、‘A’或‘F’），填 0； 2) 在连续交易时段【15:05-15:30】或闭市时段【15:30 后】（含上述时段内停牌状态，TradingPhaseCode 第 1 位为‘H’、‘D’或‘F’），填写昨收价	全天填写 0
说明：综业行情文件 mktdt01.txt 不涉及，无“昨收盘”字段。		

5.13 EzTrader 下线

新综业上线后，易神系统通用交易端软件（简称 EzTrader）正式下线，请市场参与者停止使用该软件。互联网交易平台交易业务互联网申报通道新增支持大宗（成交申报）、投票业务的订单申报，市场参与者可按需接入互联网交易平台进行相关业务申报。

5.14 易神系统 EzSTEP 应急工具下线

新综业上线后，易神系统 EzSTEP 应急工具（简称 STEPbcp）正式下线。上交所不再支持股票质押式回购交易、约定购回式证券交易、质押式报价回购等业务的应急申报通道。

6 市场接入说明

新竞价、新综业上线后，市场参与人应通过新的通信主机（以下简称 EzCS）地址接入，两系统分别为每家机构分配 4 个 EzCS 地址（金桥、外高桥站点各 2 个）及 1 个应急灾备地址。市场参与人可登录市场技术服务平台（<https://idc.ztcloud.ssetech.com.cn/>），依次进入“技术支持与信息管理”→“技术信息管理”→“通信主机接入信息”，分别查询获得新竞价与新综业 EzCS 地址及应急灾备地址信息。具体的接入说明如下。

6.1 新竞价交易网关接入

市场参与人务必将交易网关的竞价平台界面地址列表，更新为新竞价接入的 EzCS IP 地址。交易网关客户端软件配置地址时，除主用地址与备用地址外，需要在所有接入地址后配置一个应急灾备地址（外高桥站点，通过联通线路接入）。该应急灾备地址日常情况网络不连通，重大异常出现后，本所切换至异构灾备系统，相应网络将开通，交易网关将自动切换连接，继续后续业务申报。切换前已申报、处理的订单无须重新申报，切换后系统支持股票竞价交易等关键业务订单（具体参见切换通知）。交易网关地址配置示例如下：

<u>编号</u>	<u>主地址配置</u>	<u>备地址配置</u>	<u>应急地址配置</u>
<u>交易网关 1</u>	<u>地址 1</u>	<u>地址 2 (与地址 1 不同站点)</u>	<u>应急灾备地址</u>
<u>交易网关 2</u>	<u>地址 2</u>	<u>地址 3 (与地址 2 不同站点)</u>	<u>应急灾备地址</u>
<u>交易网关 3</u>	<u>地址 3</u>	<u>地址 4 (与地址 3 不同站点)</u>	<u>应急灾备地址</u>

6.2 新综业 EzSTEP 接入

市场参与人务必将综业平台 EzSTEP 交易员配置界面中的 CS IP 地址列表，更新为新综业接入的 EzCS IP 地址。EzSTEP 配置地址时，除主用地址与备用地址外，需在所有接入地址后配置一个应急灾备地址（外高桥站点，通过联通线路接入）。该应急灾备地址日常情况网络不连通，重大异常出现后，本所切换至异构灾备系统，相应网络将开通，EzSTEP 将自动切换连接，继续后续业务申报。切换前已申报、处理的订单无须重新申报，切换后支持综业 ETF 申赎（不含债券细分类别）等关键业务订单（具体参见切换通知）。EzSTEP 地址配置示例如下：

<u>编号</u>	<u>主地址配置</u>	<u>备地址配置</u>	<u>应急地址配置</u>
<u>EzSTEP 1</u>	<u>地址 1</u>	<u>地址 2 (与地址 1 不同站点)</u>	<u>应急灾备地址</u>
<u>EzSTEP 2</u>	<u>地址 2</u>	<u>地址 3 (与地址 2 不同站点)</u>	<u>应急灾备地址</u>
<u>EzSTEP 3</u>	<u>地址 3</u>	<u>地址 4 (与地址 3 不同站点)</u>	<u>应急灾备地址</u>

6.3 新竞价新综业接入要求

市场参与人日常仅允许登录已分配的 4 个主用 EzCS 地址，遇重大故障发生后后台系统切换时，将自动切换连接至应急灾备地址（需配置为客户端软件的一个地址）。

市场参与人登录新竞价、新综业，需满足均衡接入要求，即新竞价交易网关应均衡登录在 4 台 EzCS 上，单台 EzCS 上交易网关登录数偏离度¹小于 20%；新综业 EzSTEP 上的登录 PBU，应均衡登录在 4 台 EzCS 上，单台 EzCS 上 PBU 登录数偏离度²小于 20%。

¹ 机构在单台 EzCS 上交易网关登录数上限：MAX(基准值*120%，基准值+1)；下限：MIN(基准值*80%，基准值)；基准值：该机构当日新竞价交易网关登录总数 ÷ 4，向下取整

² 机构在单台 EzCS 上 PBU 登录数上限：MAX(基准值*120%，基准值+1)；下限：MIN(基准值*80%，基准值)；基准值：该机构当日新综业 PBU 登录总数 ÷ 4，向下取整

7 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。市场参与人应据此进行编号。另外，会员内部编号（ClOrdID）取值请避免仅包含空格字符的情况。建议新综业市场参与人参考新竞价交易网关 ClOrdID 字段要求，即长度等于 10 个字符，各字符仅填写数字 0-9、大小写字母 a-z A-Z，不建议包含其他字符。
- 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) 市场参与人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) 市场参与人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。
- 6) **新竞价相比现有生产竞价系统的系统性能有显著提升（例如在开盘等**

洪峰场景下，系统执行报告下发能力提升约 4~8 倍），建议市场参与人结合自身实际使用的流速权数量与业务规模、订阅交易网关数量等实际情况，按需进行带宽扩容（可按照生产实际带宽使用峰值的 4 倍进行扩容，允许申请的单条线路最大带宽为 100M）。若带宽资源不足可能导致下行拥堵，进而影响交易网关在途订单数量消减。（注：新竞价上线时，交易网关通信协议未作调整，订单交互所需带宽资源与《交易网关（竞价）市场参与者技术实施指南（第四版）》一致，即不同订单成交比场景下单个 TDGW 带宽使用情况参考下表。）

带宽	500 笔/s (10 个流速权)	1000 笔/s (20 个流速权)
上行 (Mbps)	0.7	1.3
下行 1:0 (Mbps)	1.4	2.8
下行 1:1 (Mbps)	2.3	4.6
下行 1:1.5 (Mbps)	2.8	5.6
下行 1:2 (Mbps)	3.3	6.5

- 7) 及时排查柜台及周边系统的兼容性隐患。近期测试中发现有集中柜台版本低于其数据库版本的版本兼容性问题，导致出现扫漏订单的执行报告无法实时处理，触发 60 秒一次的扫漏重发。建议市场参与人及时排查柜台及周边系统的相关版本，排除兼容性隐患。

- 8) 超量预埋单、集合竞价期间重启交易网关等极限压力场景下，近期测试中发现有柜台系统出现数据库行锁、中间件订单积压、订单回报延迟及个别订单委托丢失等异常现象。建议市场参与人关注此类异常场景，做好应急准备。
- 9) 对于市场申报接口中字符串类型字段，除特别声明，应只包含数字、大写字母、小写字母以及空格。严禁输入特殊字符，如 ‘\r’，‘\n’，‘\0’，‘|’，‘\t’，‘\f’ 等。
- 10) 上交所通用报盘软件 EzSTEP 发送的请求及响应接口表 reqresp，在部分失败场景下（如格式校验错误等），响应消息文本 resptext 为空。新老系统对于取值为空的错误码范围存在差异，请市场参与人做好技术准备，通过结合错误代码信息 remark 等字段获取错误信息。
- 11) 请关注 CPXX 文件相关变动的生效时间。假设新竞价新综业上线首日为 T 日，T 日的 CPXX 文件（对应文件名中的 “mmdd” 为 T 日）由老系统于 T-1 日生成，仍为老系统接口数据。因此本文档描述的 CPXX 文件相关变动于 T+1 日起（含）正式生效。请市场参与人关注该变动生效时间，做好系统兼容。（本文档提到的除 CPXX 文件外的其他相关变动，均于 T 日起（含）正式生效。）

8 上线实施安排

各市场参与人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。

9 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 1.60 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)2.5 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 0.63 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 0.63 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 3.20 版（新竞价新综业技术开发稿）》
- 《上海证券交易所新竞价新综业交易系统市场接入实施指南》