

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所 债券借贷电子化及回购优化 市场参与者技术实施指南



上海证券交易所

二零二六年九月

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）债券借贷及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

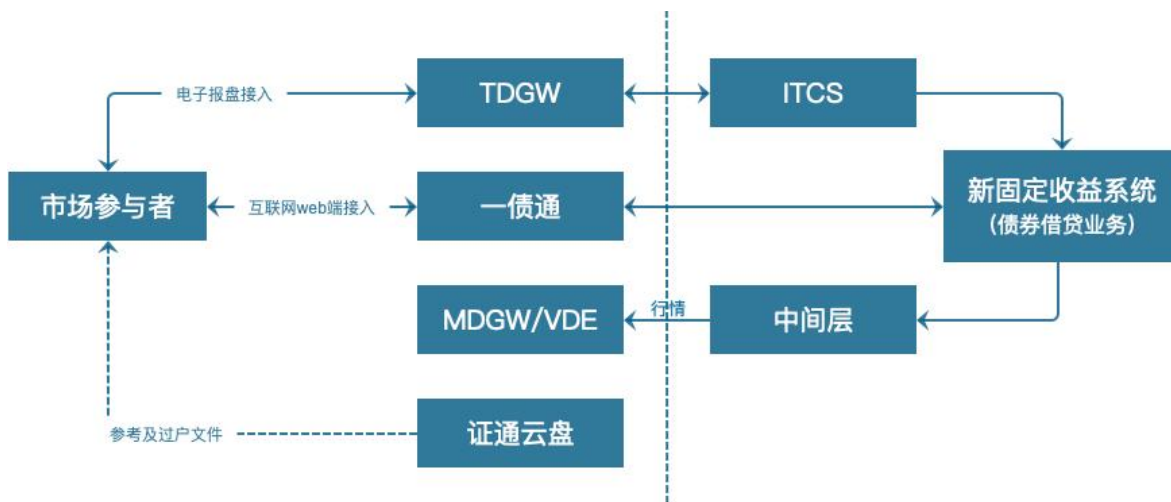
通讯地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号 上交所技术公司交易研发总部

为更好地满足市场需求，提高业务运行效率，本所拟对市场提供债券借贷电子报盘服务。为确保系统平稳切换上线，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。

债券借贷电子报盘服务与债券回购优化拟分批上线，具体安排请关注本所后续通知。

业务规则方面无调整。

本次债券借贷电子化将参照新固定收益系统接入模式进行建设：



具体变更内容如下:

1 网页端（一债通）

原债券借贷模块将迁移至一债通模块内，迁移后原互联网交易平台会员交易员账户将不再支持申报债券借贷业务，原会员交易员账户内债券借贷业务相关数据将迁

移至一债通账户。用户需使用 10 位一债通账户登录一债通模块网页端（登录时账户类型选择“一债通账户”），在一债通内申报债券借贷业务。

详细账户数据迁移方案请关注本所后续通知。

2 报盘端（TDGW）

债券借贷：

1) 债券借贷报盘入口与新固定收益系统一致，须通过互联网交易平台交易网关（TDGW）进行申报。

2) TDGW 通过交易单元（技术 PBU）登录；申报时，须填写订单对应的 10 位一债通账户及业务 PBU。

3) 交易员如需通过 TDGW 申报订单，均须事先在一债通网页端绑定 PBU，多个交易员可绑定同一 PBU。

4) 一债通与 TDGW 两端订单及成交信息互通。交易员可在网页端查询其通过 TDGW 申报的订单，亦可在 TDGW 端接收网页端申报的订单或成交确认。

5) 申报字符串须统一采用 UTF-8 编码，不得包含系统保留字符，包括但不限于：\r、\t、\n、\f、'、&。具体接口协议规范详见附件一。

更多报盘端接入注意事项可参考《上海证券交易所新固定收益系统市场参与人技术实施指南_20260612》。

债券回购：

协议回购首期和续作逆回购方确认时，需要填写“质权人名称”字段。本调整拟设置上线过渡期：过渡期内，如改造完成，可进行报送；如未改造完成，可暂不报送。过渡期结束后，此字段将设置为必填，必须报送。提请相关机构在过渡期结束前完成技术改造，初步安排过渡期为 2027 年初至 2027 年上半年，具体时间另行通知。

3 行情接收（MDGW/VDE）

债券借贷将通过 MDGW 和 VDE 对外提供流式快照行情，详细接口协议参见附件二和附件三。

4 文件接收（证通云盘/RPA）

本次债券借贷新增债券借贷参考信息文件（bondlendparams_yyyymmdd.xml），证券产品基础信息文件（products_yyyymmdd.xml）、债券非匹配成交汇总文件（zghXXXXXX.txt）、债券非匹配成交参考价文件（bondnegorefp_x_yyyymmdd）增加债券借贷相关数据，其他参考文件参见下表，详细文件接口参见附件四。

文件内容	文件名	格式调整
债券交易参与人信息文件	bondmbrs_yyyymmdd.xml	无
债券交易员信息文件	bondtrdrs_yyyymmdd.xml	无
证券产品基础信息文件	products_yyyymmdd.xml	增加债券借贷产品数据
债券借贷业务参考信息	bondlendparams_yyyymmdd.xml	新增
债券非匹配成交汇总文件	zghXXXXXX.txt	增加债券借贷相关数据
债券非匹配成交参考价文件	bondnegorefp_x_yyyymmdd.xml	增加债券借贷相关数据

请各市场机构充分评估系统改造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，保证业务顺利开展，同时保障现有交易系统各类业务的正常运行。如对各接口开发稿有任何意见和建议，请通过技术服务热线反馈。

四、附件

附件 1：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）2.01 版_20261023（债券借贷电子化及回购优化技术开发稿）

附件 2：IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范 0.64 版_20261023（债券借贷电子化技术开发稿）

附件 3：IS120_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范 0.64 版_20261023

（债券借贷电子化技术开发稿）

附件 4：IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 3.80 版

_20261023（债券借贷电子化技术开发稿）