

深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

深圳证券交易所
跨市场股票 ETF 全实物申赎之
券商技术系统变更指南
(Ver1.00)



深圳证券交易所
二〇二四年七月

关于本文档

文档名称		深圳证券交易所跨市场股票ETF全实物申赎之券商技术系统变更指南	
说明			
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2024-07	1.00	创建文档	

目 录

一、 说明	1
二、 跨市场股票 ETF 全实物申赎业务简介	1
2.1 深市跨市场股票 ETF 全实物申赎处理流程	1
2.2 其他说明	2
三、 深市跨市场股票 ETF 全实物申赎业务实现概况	2
3.1 PCF 文件	2
3.2 ETF 实时申购赎回业务新订单接口	3
3.2.1 Binary 接口委托申报	3
3.2.2 STEP 接口委托申报	4
3.2.3 跨市场股票 ETF 全实物申赎委托申报样例	7
3.2.3.1 跨市场股票 ETF 全实物申赎 Binary 消息示例	7
3.2.3.2 跨市场股票 ETF 全实物申赎 STEP 消息示例	8
3.2.4 其他 ETF 申赎委托申报样例	8
3.2.3.1 其他 ETF 申赎 Binary 消息示例	8
3.2.3.2 其他 ETF 申赎 STEP 消息示例	9
3.3 ETF 实时申赎业务订单响应执行报告	10
3.3.1 Binary 订单响应及撤单成功执行报告	10
3.3.2 STEP 订单响应及撤单成功执行报告	12
四、 券商系统注意事项	15
4.1 港股通非交易日	15
4.2 关于客户委托服务渠道	15
4.3 关于券商柜台系统	15
4.4 关于其他市场参与人系统	15
4.5 关于上线的安排	16
五、 参考文献	16

深圳证券交易所跨市场股票 ETF 全实物申赎 之券商技术系统变更指南

一、说明

为了指导市场参与者通过深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易系统开展深市跨市场股票 ETF 全实物申赎业务，以及配合上海证券交易所（以下简称“上交所”）开展沪市跨市场股票 ETF 全实物申赎业务，深交所联合上交所、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）专门编制和发布本指南，供相关市场参与者参考。

深交所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时，尽量减少系统改造对市场参与者带来的影响。

特别提示：如果业务规则或业务方案有所变更，本文档将做相应变更。

二、跨市场股票 ETF 全实物申赎业务简介

2.1 深市跨市场股票 ETF 全实物申赎处理流程

（1）T 日 9:15-11:30、13:00-15:00，投资者通过代办券商提交跨市场股票 ETF 全实物申购/赎回委托，代办券商实时进行如下检查：

- 1) 投资者深市 A 股账户及沪市账户是否具有相同的证件号、名称及资金账号；
- 2) 该投资者提交的深市交易单元及沪市指定交易的交易单元均为该代办券商所属；
- 3) 对于申购委托，检查投资者的深市成份证券、沪市成份证券、及现金替代金额等申赎对价是否足额；对于赎回委托，检查投资者的 ETF 份额是否足额；

如上述条件均满足，则冻结相关组合证券及相应资金；如上述任一条件不满足的，则作失败处理。

（2）T 日 9:15-11:30、13:00-15:00，代办券商向深交所交易系统报送跨市场股票 ETF 全实物申购/赎回委托，申报要素中应包含投资者的深市股东账户、沪市股东账户、深市交易单元及沪市指定交易单元、ETF 代码及申赎份额等。

（3）深交所交易系统接收到跨市场股票 ETF 全实物申赎委托后，将与上交所交易系统共同处理该申赎委托。

（4）若深、沪两所确认申赎委托成功后：

深交所交易系统将实时发送回报给代办券商、基金管理人。深市 ETF 申赎回报包含所有深市、沪市成份券的股份交付、现金替代的明细结果；港股、北交所等非深沪股票的现金替代金额填写在 159900 虚拟券记录。

注：若深交所或上交所确认申赎委托失败，深交所交易系统将实时发送撤单回报给代办券商（赎回不足、申赎超限等撤单回报也抄送给基金管理人）；代办券商收到深市撤单回报后，应确认该申赎委托处理失败，并解除相应的冻结股份或资金。

2.2 其他说明

(1) 通过沪市跨市场股票 ETF 全实物申赎引起的深市证券股份变动，适用深市 ETF 申赎的股份减持的相关规定。

三、 深市跨市场股票 ETF 全实物申赎业务实现概况

深市跨市场股票 ETF 全实物申赎,继续使用现有的 ETF 实时申购赎回业务的委托、回报接口。

深市跨市场股票 ETF 全实物申赎业务涉及的委托及回报对应的关系如下所示。

表 3- 1 委托及回报对应关系说明

业务	ApplID	委托申报		成交回报	
		MsgType (Binary)	MsgType (STEP)	MsgType (Binary)	MsgType (STEP)
ETF 实时 申购赎回 (含深市 跨市场股 票 ETF 全 实物申赎)	120	101201	D	201202	8

3.1 PCF 文件

对于实施全实物申赎的包含深市和沪市成份券的跨市场股票 ETF, 将使用深沪股票组合申赎 ETF，对于港股、北交所等非深沪股票仍然使用现金替代。该类跨市场股票

ETF 的 PCF 文件中沪市成份券将作为实物对价申赎成份券，即文件中的“是否实物对价申赎（PhysicalCreationRedemption）”字段必须存在，且取值为“Y”。具体格式参见《深圳证券交易所基金公司数据接口规范》。

跨市场股票 ETF 的场外申赎模式继续保留，基金管理人向中国结算总公司上传中国结算总公司约定格式的 PCF 文件的流程不变。

3.2 ETF 实时申购赎回业务新订单接口

3.2.1 Binary 接口委托申报

表 3-2 ETF 实时申购赎回业务 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=101201	
ApplID	应用标识	120: ETF 实时申购赎回 (含跨市场股票 ETF 全实物申赎)
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	ETF 证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102: 深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01: 中国结算深圳分公司
TransactTime	委托时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	深市证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	全空格
Side	买卖方向 D=申购 E=赎回	D 或 E

OrdType		订单类别 2 表示限价	2
OrderQty		订单数量	委托数量
Price		价格	委托价格
NoAccounts		其他市场账户信息	对于跨市场股票 ETF 全实物申赎，填 1； 其他 ETF 实时申赎，该字段为可选字段，可无该字段或填 0
→	MarketID	市场代码 XSHQ=上海证券交易所	
→	PBUID	交易单元	
→	AccountID	证券账户	

说明：

(1) 当静态交易参考信息的某只 ETF 的 pcf 文件中有某只或某几只非深市成份券（UnderlyingSecurityIDSource 不为 102）的“是否实物对价申赎 PhysicalCreationRedemption”取值为 Y 时，则表明该 ETF 适用跨市场股票 ETF 全实物申赎模式。本项目实施后，含沪市成份券的跨市场股票 ETF 适用全实物申赎模式。

(2) 对于跨市场股票 ETF 全实物申赎，NoAccounts 应填写为 1，重复组信息应填写为投资者的沪市证券账户和指定交易单元。而其他 ETF 的实时申赎，则 NoAccounts 为可选字段，可无该字段或填写为 0。

3.2.2 STEP 接口委托申报

表 3-3 ETF 实时申购赎回业务 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=D	
1180	ApplID	应用标识	120：ETF 实时申购赎回（含跨市场股票 ETF 全实物申赎）
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType	订单类型 2=限价	2
54	Side	买卖方向	D 或 E
522	OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型

		1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	
529	OrderRestrictions	订单限定	全空格
60	TransactTime	订单发起时间	委托时间
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	ETF 证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	3
→	448	PartyID	申报交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源 C: 通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色 1: 申报交易单元
	448	PartyID	深市证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源 5: 中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色 5: 投资者证券账户
	448	PartyID	投资者所在营业部识别码
	447	PartyIDSource	参与人代码源 D: 自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色 4001: 营业部代码
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
38	OrderQty	订单数量	委托数量
组件结束			
44	Price	价格	委托价格
组件<CounterInfos>			
10232	NoCounterInfos	账户所属市场个数	对于跨市场股票 ETF

				全实物申赎，该字段应填写为 1。 对于其他 ETF 实时申赎，则不出现该字段。
→	组件<NestedParties>			
	539	NoNestedPartyIDs	参与人代码个数	3
	→	524	NestedPartyID	参与人代码 市场代码 XSHG=上海证券交易所
		525	NestedPartyIDSource	C: 通用市场参与者标识
		538	NestedPartyRole	参与人代码角色 22: 交易所
		524	NestedPartyID	参与人代码 投资者沪市指定交易单元
		525	NestedPartyIDSource	参与人代码源 C: 通用市场参与者标识
		538	NestedPartyRole	参与人代码角色 17: 对手方交易单元
		524	NestedPartyID	参与人代码 投资者沪市证券账户
		525	NestedPartyIDSource	参与人代码源 5: 中国投资者编号

		538	NestedPartyRole	参与人代码角色	39: 对手方投资者证券账户
组件结束					
组件结束					

说明：

(1) 字段含义相关说明，请参见 Binary 接口委托申报章节。

3.2.3 跨市场股票 ETF 全实物申赎委托申报样例

某投资者通过券商提供的交易单元 000111 申购跨市场股票 ETF（ETF 证券代码 159001），ETF 份额为 20000 份，该投资者的深市证券账户为 0005555555，沪市交易单元为 66666，沪市证券账户为 0123456789。

该投资者在第一笔申购委托执行成功后，再次申报第二笔赎回委托，赎回份额为 10000 份。

3.2.3.1 跨市场股票 ETF 全实物申赎 Binary 消息示例

表 3-4 跨市场股票 ETF 全实物申赎申报 BINARY 消息示例

域名	第一笔申购委托	第二笔赎回委托
MsgType	101201	101201
ApplID	120	120
SubmittingPBUID	000111	000111
SecurityID	159001	159001
SecurityIDSource	102	102
OwnerType	1	1
ClearingFirm	01	01
TransactTime	20240520-14:00:13:555	20240520-14:20:13:555
UserInfo	用户自填	用户自填
ClOrdID	A0000001	A0000002
AccountID	0005555555	0005555555
BranchID	AB	AB
OrderRestrictions	全空格	全空格
Side	D	E
OrdType	2	2
OrderQty	20,000.00	10,000.00

Price	0	0
NoAccounts	1	1
MarketID	XSHG	XSHG
PBUID	66666	66666
AccountID	0123456789	0123456789

3.2.3.2 跨市场股票 ETF 全实物申赎 STEP 消息示例

第一笔跨市场股票 ETF 全实物申购委托：

1180=120<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=D<SOH>522=1<SOH>60=20240520-14:00:13:555<SOH>48=159001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000111<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AB<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=20000.00<SOH>44=0.0000<SOH>10232=1<SOH>539=3<SOH>524=XSHG<SOH>525=C<SOH>538=22<SOH>524=66666<SOH>525=C<SOH>538=17<SOH>524=0123456789<SOH>525=5<SOH>538=39<SOH>

第二笔跨市场股票 ETF 全实物赎回委托：

1180=120<SOH>11=A0000002<SOH>40=2<SOH>54=E<SOH>522=1<SOH>60=20240520-14:20:13:555<SOH>48=159001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000111<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AB<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=5000.00<SOH>44=0.0000<SOH>10232=1<SOH>539=3<SOH>524=XSHG<SOH>525=C<SOH>538=22<SOH>524=66666<SOH>525=C<SOH>538=17<SOH>524=0123456789<SOH>525=5<SOH>538=39<SOH>

3.2.4 其他 ETF 申赎委托申报样例

某投资者通过券商提供的交易单元 000111 申购本市场股票 ETF（ETF 证券代码 159150），ETF 份额为 20000 份，该投资者的深市证券账户为 0005555555。

该投资者在第一笔申购委托执行成功后，再次申报第二笔赎回委托，赎回份额为 10000 份。

3.2.4.1 其他 ETF 申赎 Binary 消息示例

表 3-5 跨市场股票 ETF 全实物申赎申报 BINARY 消息示例

域名	第一笔申购委托	第二笔赎回委托
MsgType	101201	101201

ApplID	120	120
SubmittingPBUID	000111	000111
SecurityID	159150	159150
SecurityIDSource	102	102
OwnerType	1	1
ClearingFirm	01	01
TransactTime	20240520-14:00:13:555	20240520-14:20:13:555
UserInfo	用户自填	用户自填
ClOrdID	A0000001	A0000002
AccountID	0005555555	0005555555
BranchID	AB	AB
OrderRestrictions	全空格	全空格
Side	D	E
OrdType	2	2
OrderQty	20,000.00	10,000.00
Price	0	0

说明：

(1) NoAccounts 字段为可选字段，无该字段或填 0 均可。

3.2.4.2 其他 ETF 申赎 STEP 消息示例

第一笔其他 ETF 申购委托：

1180=120<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=D<SOH>522=1<SOH>60=20240520-14:00:13:555<SOH>48=159150<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000111<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AB<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=20000.00<SOH>44=0.0000<SOH>

第二笔其他 ETF 赎回委托：

1180=120<SOH>11=A0000002<SOH>40=2<SOH>54=E<SOH>522=1<SOH>60=20240520-14:20:13:555<SOH>48=159150<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000111<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AB<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=5000.00<SOH>44=0.0000<SOH>

3.3 ETF 实时申赎业务订单响应执行报告

3.3.1 Binary 订单响应及撤单成功执行报告

表 3-6 ETF 实时申购赎回业务 Binary 订单响应执行报告消息定义

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx02	201202
PartitionNo	平台分区号	3
ReportIndex	回报记录号	
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	如发送给代办券商，则填写投资者申报交易单元； 如抄送给基金公司，则填写基金管理人交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	若为撤单成功执行报告则填写被撤销委托的 ClOrdID，否则为全空格
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0、4 或 8
OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0，则与原始委托数量一致，其它为 0
CumQty	累计执行数量	已成交数量
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向

OrdType		订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty		订单数量	原始委托的订单数量
Price		价格	原始委托的价格
AccountID		证券账户	原始委托的证券账户
BranchID		营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions		订单限定	原始委托的订单限定
InsufficientSecurityID		被拒单时不合法的成份股代码	被拒单时不合法的成份股代码
NoSecurity		成份股记录数	
→	UnderlyingSecurityID	成份股证券代码	
	UnderlyingSecurityIDSource	成份股证券代码源	证券代码源 101=上海证券交易所 102=深圳证券交易所
	DeliveryQty	股份交付数量	实际股份交付数量
	SubstCash	现金替代金额	实际现金替代金额
NoAccounts		其他市场账户信息	原始委托的其他市场账户信息
→	MarketID	市场代码 XSHQ= 上海证券交易所	原始委托的市场代码
	PBUID	交易单元	原始委托的交易单元
	AccountID	证券账户	原始委托的证券账户

说明：

(1) 对于跨市场股票 ETF 的全实物申赎，当申赎委托确认成功时（ExecType=0、OrdStatus=0、OrdRejReason=0），深市回报的成份股信息将包含所有深市、沪市成份券，即 UnderlyingSecurityIDSource=102、101 的成份股记录。

(2) 对于跨市场股票 ETF 的全实物申赎，当申赎委托确认失败时（ExecType=8、OrdStatus=8、OrdRejReason>0），深交所交易系统将实时发送撤单回报给代办券商（赎回不足、申赎超限等撤单回报也抄送给基金管理人）。

代办券商收到深市撤单回报后，应确认该申赎委托处理失败，并解除相应的冻结股份或资金。

(3) InsufficientSecurityID 被拒单时不合法的成份股代码，可能为沪市成份券代码。

3.3.2 STEP 订单响应及撤单成功执行报告

表 3-7 ETF 实时申购赎回业务 STEP 订单响应执行报告消息定义

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=8	8
10197	PartitionNo	平台分区号	
10179	ReportIndex	回报记录号	
1180	ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
37	OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType	执行类型	0、4 或 8
39	OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
31	LastPx	成交价	原始委托的价格
32	LastQty	成交数量	原始委托的订单数量
151	LeavesQty	剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty	累计成交数量	已成交数量
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	执行类型为 4 或 8 时填写拒绝原因代码
1328	RejectText	撤单/拒绝原因说明	执行类型为 4 或 8 时填写拒绝原因说明; 填写第一只因不足额等原因不合法的成份股代码
54	Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源

组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	4
→	448	PartyID	参与人代码	如发送给代办券商，则填写 投资者申报交易单元； 如抄送给基金公司，则填写 基金管理人交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C：通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	27：回报交易单元
	448	PartyID	参与人代码	原始委托的申报交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C：通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1：交易单元
	448	PartyID	参与人代码	原始委托的证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5：中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	5：投资者证券账户
	448	PartyID	参与人代码	原始委托的营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D：自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001：营业部代码
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
38	OrderQty		订单数量	原始委托的订单数量
组件结束				
44	Price		价格	原始委托的价格
组件<CompDeliverData> 用于回报 ETF 实时申购赎回的股 份和资金交付明细				
8902	NoSecurity		成份股记录数	PCF 文件中该 ETF 成份股 数量
→	309	UnderlyingSec urityID	成份股证券代码	PCF 文件中该 ETF 成份股 证券代码
	305	UnderlyingSec urityIDSource	证券代码源	证券代码源 101=上海证券交易所 102=深圳证券交易所

	8903	DeliveryQty	股份交付数量	交易系统股份交付数量
	8904	SubstCash	现金替代金额	交易系统现金替代金额
组件结束				
组件<CounterInfos> 其他相关市场参与人账户信息				
10232	NoCounterInfos			原始委托的账户所属市场个数
→	组件<NestedParties>			
	539	NoNestedPartyIDs	参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
	→	524	NestedPartyID	参与人代码 原始委托的市场代码 XSHG=上海证券交易所
		525	NestedPartyIDSource	参与人代码源 C: 通用市场参与者标识
		538	NestedPartyRole	参与人代码角色 22: 交易所
		524	NestedPartyID	参与人代码 原始委托的投资者沪市指定交易单元
		525	NestedPartyIDSource	参与人代码源 C: 通用市场参与者标识
		538	NestedPartyRole	参与人代码角色 17: 对手方交易单元
		524	NestedPartyID	参与人代码 原始委托的投资者沪市指定证券账户
		525	NestedPartyIDSource	参与人代码源 5: 中国投资者编号
		538	NestedPartyRole	参与人代码角色 39: 对手方投资者证券账户
	组件结束			

组件结束

说明：

(1) 字段含义相关说明，请参见 Binary 订单响应及撤单成功执行报告章节。

四、 券商系统注意事项

4.1 港股通非交易日

受相关变更影响，在港股通非交易日，深市将会发送平台 5（国际市场互联平台）的平台状态消息（MsgType=6，PlatformID=5）和回报结束消息（MsgType=7，PlatformID=5），市场参与人技术系统应能兼容该场景。

4.2 关于客户委托服务渠道

建议调整柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等投资者委托渠道（可选择一种或多种渠道）的相应前端系统，以支持跨市场股票 ETF 全实物申赎委托指令的录入。

4.3 关于券商柜台系统

(1) 前端风险控制

所有申报的数量等要素必须符合本所跨市场股票 ETF 全实物申赎相关业务规则。柜台系统应对投资者的账户、数量等字段做合法性检查，并进行资金、股份前端控制，对于不符合要求的委托应拒绝，不要申报至深交所交易系统。

对于跨市场股票 ETF 全实物申赎，柜台系统应该做好深沪两所股份及资金的前端控制。

(2) 回报处理

柜台系统应做好资金、股份的维护。

(3) 其他

非跨市场股票 ETF 的代办券商，应能保证其技术系统可适应 ETF 实时申赎业务的接口变动。

4.4 关于其他市场参与人系统

基金管理人需参照《深圳证券交易所基金公司数据接口规范》完成 PCF 文件、申赎委托等的改造。

托管行需正确处理深市 ETF 实时申赎业务的成交数据。

4.5 关于上线的安排

为确保跨市场股票 ETF 全实物申赎平稳落地，拟先在部分跨市场股票 ETF 进行试点，试点通过后再整体切换上线。因此：

1、券商技术系统

需要根据我所发布的跨市场股票 ETF 的 PCF 文件中非深市成份券“是否实物对价申赎（PhysicalCreationRedemption）”字段，来确定该跨市场股票 ETF 是否支持全实物申赎。对于非深市成份券，如该字段不存在，默认取值为“N”。

(1) 对于支持全实物申赎的跨市场股票 ETF，委托中需要填充“其他市场账户信息”（Binary 接口为 NoAccounts 重复组，STEP 接口为 CounterInfos 组件）；

(2) 对于不支持全实物申赎的 ETF，无需申报上述字段（该重复组为可选字段）；

(3) Binary 接口的 201202（ETF 实时申赎业务订单响应执行报告）报文尾部将新增 NoAccounts 重复组，技术系统应能兼容。

2、基金公司技术系统

试点全实物申赎的跨市场股票 ETF 的基金公司，需要按照我所基金管理部要求报备沪市交易单元和沪市证券账户；每日需要按照我所《深圳证券交易所基金公司数据接口规范》要求上传指定格式的 PCF 文件。未进行试点的，PCF 文件格式可保持不变。另外，Binary 接口的 201202（ETF 实时申赎业务订单响应执行报告）报文尾部将新增 NoAccounts 字段，技术系统应能兼容。

3、托管行技术系统

成交汇总文件中 201202 报文尾部将新增字段 NoAccounts，技术系统应能兼容。

五、参考文献

《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》

《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》

《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》

《深圳证券交易所基金公司数据接口规范》

《深圳证券交易所成交汇总文件接口市场参与者技术系统变更指南》

《深圳证券交易所委托申报拒绝原因代码表》