

跨市场股票 ETF 全实物申赎项目（改造）

单一来源采购方式公示

一、项目信息

采购人：财通证券股份有限公司

项目名称：其他项目（监管）-跨市场股票 ETF 全实物申赎项目（改造）

拟采购的货物或服务的说明：

项目一：跨市场股票 ETF 全实物申赎项目（改造）

1. 零售柜台、机构柜台系统支持：

- (1) 代码参数维护及行情转码，对于单只跨市场 ETF 仅支持一种模式即实物申赎或全实物申赎，新增 ETF 代码通道类型（channel_type=3）区分，适配新增通道类型的查询、校验业务处理；
- (2) 支持沪市、深市跨市场全实物申赎 ETF 申购委托申报、回报改造；
- (3) 支持沪市、深市跨市场全实物赎回 ETF 申购委托申报、回报改造；
- (4) ETF 全实物申赎（沪市 ETF）业务类型为 AEC（ETF 全实物申购 沪市 ETF），AER（ETF 全实物赎回 沪市 ETF）申报以及响应处理；
- (5) ETF 全实物申赎（沪市 ETF）广播类型为 22 的 AEC（ETF 全实物申购 沪市 ETF），AER（ETF 全实物赎回 沪市 ETF）执行报告消息处理；
- (6) ETF 全实物申赎（深市 ETF）广播类型为 23 的 SEC（ETF 全实物申购（深市 ETF），SER（ETF 全实物赎回（深市 ETF））执行报告消息处理；
- (7) 行情支持转入 jfjyyyyymmdd.xml 的业务类型，即 AEC=ETF 全实物申购（沪市 ETF），AER=ETF 全实物赎回（沪市 ETF）；
- (8) ETF 实时申购赎回（含深市跨市场股票 ETF 全实物申赎）申报回报

(申报消息：101201，回报消息：201202)；

- (9) 支持跨市场股份联动（配合上交所的沪市跨市场股票 ETF 全实物申赎）回报消息处理（消息类型：204815）。支持回报时无订单编号，支持深市成份股记录数据结果集处理；

2. 内存清算系统（零售、机构）：

- (1) 支持 jsmx 文件中 ywlb=530 的数据处理，申请编号解析需要按深圳市场解析，匹配深圳市场委托；
- (2) 支持 jsmx 文件中 ywlb=531 的数据处理，申请编号解析需要按深圳市场解析，匹配深圳市场委托；
- (3) 支持于深市跨市场股票 ETF 申购赎回涉及的沪市组合证券的过户费按结算文件收取；
- (4) 支持 sjsjg 文件中 jgyelx=SGKQ 的数据处理，按 JGDDBH2 解析前缀等，需要按上海市场解析，匹配上海市场委托；
- (5) 支持 sjsjg 文件中 jgyelx=SHKQ 的数据处理，按 JGDDBH2 解析前缀等，需要按上海市场解析，匹配上海市场委托；
- (6) 支持上海市场跨市是股票 ETF 申购赎回涉及的深市组合证券的过户费按结算文件收取；

3. UFT 极速交易系统支持：

- (1) 代码参数维护及行情转码，对于单只跨市场 ETF 仅支持一种模式即实物申赎或全实物申赎，新增 ETF 代码通道类型（channel_type=3）区分，适配新增通道类型的查询、校验业务处理；
- (2) 支持沪市跨市场全实物申赎 ETF 申购委托申报、回报改造；

- (3) 支持沪市跨市场全实物赎回 ETF 申购委托申报、回报改造；
- (4) 沪市报盘适配改造；
- (5) 代码参数维护及行情转码，对于单只跨市场 ETF 仅支持一种模式即实物申赎或全实物申赎，新增 ETF 代码通道类型 (channel_type=3) 区分，适配新增通道类型的查询、校验业务处理；
- (6) 支持深市跨市场全实物申赎 ETF 申购委托申报、回报改造；
- (7) 支持深市跨市场全实物赎回 ETF 申购委托申报、回报改造；
- (8) 深市报盘适配改造；

4. LDP 极速交易系统、I2 极速交易系统支持：

- (1) 新增配置开关、错误码等数据加载；
- (2) ETF 基金、成分股相关变动信息加载；
- (3) 提供配置开关、错误码、数据字典等脚本；
- (4) ETF 代码、成分股信息查询界面需要支持相关字典翻译沪深京港、沪深京、沪深港 ETF 申赎回报(主要是成交)；
- (5) 支持新增配置开关修改；
- (6) 支持全实物申赎另一市场账户信息检查；
- (7) 单中心模式支持全实物 ETF 申购下单另一市场成分股处理；
- (8) 单中心模式支持全实物申购回报另一市场成分股处理；
- (9) 单中心模式支持全实物 ETF 赎回回报另一市场成分股处理；
- (10) 主备切换，备机无委托回报处理时需要考虑全实物申赎场景；
- (11) 行情服务器、行情后台均需支持最新文件转入；
- (12) 深圳非交易报盘单网关、上海综合报盘单接口库需要支持全实物申

购委托申报；

(13) 深圳非交易报盘单网关、上海综合报盘单接口库需要支持全实物申购回报；

(14) 深圳非交易报盘单网关、上海综合报盘单接口库需要支持全实物赎回委托申报；

(15) 深圳非交易报盘单网关、上海综合报盘单接口库需要支持全实物赎回委托回报；

(16) 深圳非交易报盘多网关，上海综合报盘单接口库需要支持全实物申购委托申报；

(17) 深圳非交易报盘多网关、上海综合报盘单接口库需要支持全实物申购委托回报；

(18) 深圳非交易报盘多网关、上海综合报盘单接口库需要支持全实物赎回委托申报；

(19) 深圳非交易报盘多网关、上海综合报盘单接口库需要支持全实物赎回委托回报；

5. 032 系统支持：

支持对上交所跨市场股票 ETF 全实物申赎模式投资端的适应性改造。包括 ETF 投资端基础数据维护、PCF 文件导入、申赎指令及委托下达、日终清算、日间可用处理等支持全实物申赎模式的改造。该市场改造只支持深市成份股实物申赎改造。

6. 自营估值、托管估值系统：

(1) 增加上海、深圳 ETF 深市股票实物申赎 PCF 清单数据的导入和清算。

- (2) 上海、深圳 ETF 深市股票实物申赎 ETF 申赎数据的处理，深市成份券过户数据的处理。
- (3) 上海、深圳 ETF 深市股票实物申赎退补款台账的处理。
- (4) 上海、深圳 ETF 深市股票实时申赎增值税的处理。
- (5) 上海、深圳 ETF 深市股票实时申赎 ETF 套利处理。
- (6) 上海、深圳 ETF 深市股票实物申赎凭证的处理；

7. 托管清算系统：

- (1) 上海、深圳 ETF 深市股票实物申赎 ETF 申赎数据的处理，深市成份券过户费数据的处理。
- (2) 上海、深圳 ETF 深市股票实物申赎和估值系统的对账处理；

8. 华锐联合风控系统系统：

- (1) 新增将 reqid=AEC/AER 业务消息转换为 appl_id=120 业务内部协议；
包括：委托请求、订单响应、成交回报消息转换。；
- (2) ETF 实物申赎业务（appl_id=120）协议转换中，委托请求、订单响应、成交回报消息需将跨市场证券账户/市场转入内部协议中；
- (3) 引擎在收到 ETF 申赎委托消息时，拆分各成分券子单时对于跨市场的证券的子单需取对应市场（根据下发文件查找证券所属市场）的证券账户。
- (4) 规则计算适配 ETF 全实物申赎业务协议，，例如涉及因子：现货持仓数量、当日剩余有效委托数量、当日已成交数量、当日现货买入已成交成本；
- (5) 上交所 xml 版 ETF 公告文件上场成分券市场 ID 字段、调整替代标志

枚举值。

(6) 委托流水详情页面支持展示跨市场证券账户字段。

(7) ETF 实物申赎入库改造（支持跨市场证券账户字段入库）。

9. 新意法人系统：

(1) 日终清算环节分别支持深市跨市场股票 ETF 全实物申购沪市组合券过户业务，通过结算明细文件 JSMX 中的业务类型“530”体现沪市组合券过户业务的清算信息。

(2) 深市跨市场股票 ETF 全实物赎回沪市组合券过户业务，通过结算明细文件 JSMX 中的业务类型“531”体现沪市组合券过户业务的清算信息；

(3) 沪市跨市场股票 ETF 全实物申购深市组合券过户业务，通过清算明细库 SJS MX1 中的业务类别“SGKQ”体现深市组合券的清算信息，通过清算明细库 SJS MX2 中的业务类别“SGFY”体现深市组合券过户费的清算信息；

(4) 沪市跨市场股票 ETF 全实物赎回深市组合券过户业务，通过清算明细库 SJS MX1 中的业务类别“SHKQ”体现深市组合券的清算信息，通过清算明细库 SJS MX2 中的业务类别“SHFY”体现深市组合券过户费的清算信息；

(5) 支持沪市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务的数据清分，包括沪市 ETF 全实物申购深市组合券、沪市 ETF 全实物申购深市组合券过户费、沪市 ETF 全实物赎回深市组合券、沪市 ETF 全实物赎回深市组合券过户费，支持按独立席位清分、按合同序号进行

清分、按股东托管关系清分；支持深市跨市场股票 ETF 全实物申赎沪市组合券过户业务的数据清分，支持按独立席位清分、按合同序号进行清分、按股东托管关系清分；

(6) 支持沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物申购深市组合券过户业务的股份清算；

(7) 支持沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物赎回深市组合券过户业务的股份清算；

(8) 支持沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物申购深市组合券过户业务的股份对账，支持沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物赎回深市组合券过户业务的股份对账；

(9) 支持沪市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务的资金清算，支持的业务包括：沪市 ETF 全实物申购深市组合券过户费、沪市 ETF 全实物赎回深市组合券过户费，支持系统产生的资金流水与中登资金汇总数据进行对账；

(10) 支持深市跨市场股票 ETF 全实物申赎沪市组合券过户业务的资金清算，支持的业务包括深市跨市场股票 ETF 全实物申赎沪市组合券过户费，支持系统产生的资金流水与中登资金汇总数据进行对账；

(11) 支持沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务的资金交收；支持对沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务数据与柜台相关资金进行自有收支核对；支持对沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务数据进行资金总账簿记；支持沪市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业

务的交易数据查询，包括以下业务内容：清算明细库 SJSMX1：SGKQ-沪市 ETF 全实物申购深市组合券、SHKQ-沪市 ETF 全实物赎回深市组合券；清算明细库 SJSMX2：SGFY-ETF 申购组合券过户费、SHFY-ETF 赎回组合券过户费；资金清算汇总库 SJSQS：SGFY-ETF 申购组合券过户费、SHFY-ETF 赎回组合券过户费；资金变动库 SJSZJ：SGFY-ETF 申购组合券过户费、SHFY-ETF 赎回组合券过户费；

(12) 支持深市跨市场股票 ETF 全实物申赎沪市组合券过户业务的交易数据查询，包括以下业务内容：结算明细文件 JSMX：530-深市跨市场 ETF 申购的沪市成分券记录、531-深市跨市场 ETF 赎回的沪市成分券记录；

(13) 支持沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务的股份查询；

(14) 支持沪市、深市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务的无头账认领；

(15) 支持根据系统簿记的结算资金账务，沪市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务、深市跨市场股票 ETF 全实物申赎沪市组合券过户业务的资金凭证可以按总部的要求导出财务系统需要的接口数据；

(16) 支持根据系统簿记的结算资金账务，沪市跨市场股票 ETF 全实物申赎深市组合券过户业务、深市跨市场股票 ETF 全实物申赎沪市组合券过户业务的资金凭证可以按营业部的要求导出财务系统需要的接口数据。

二、拟定供应商信息

名称：恒生电子股份有限公司

地址：杭州市滨江区滨兴路 1888 号数智恒生中心

名称：深圳华锐分布式技术股份有限公司

地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园
5 栋 2301

名称：福建新意科技有限公司

地址：福州市鼓楼区六一北路 558 号金三桥大厦 8 层

三、公示期限

2024 年 12 月 03 日 至 2024 年 12 月 05 日

四、其他补充事宜：

无

五、凡对本次采购的采购方式存疑的，请按以下方式联系。。

1.采购人

联系人：王品

联系地址：杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦

联系电话：0571-85187063