

深沪多资产 ETF 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）-深沪多资产 ETF 项目（改造）

拟采购的货物或服务的说明：

深沪多资产 ETF 项目（改造）

一、UF20 零售/机构柜台

1. 行情服务器改造：

- (1) ETF 组件转入公告文件支持深沪两市单市场/跨市场/现金多资产 ETF；
- (2) 上海文件竞价、上海流行情组件转产品信息、代码信息支持沪市单市场/跨市场/现金多资产 ETF；
- (3) 大 R 及深交所行情组件转产品信息、代码信息支持深市单市场/跨市场/现金多资产 ETF。

2. 证券参数调整：

- (1) ETF 代码设置菜单、ETF 转入菜单支持深沪两市单市场/跨市场/现金多资产 ETF。

3. 行情后台：

- (1) 产品信息更新、证券代码更新、ETF 代码信息更新、ETF 成份信息更新，支持深沪两市单市场/跨市场/现金多资产 ETF。

4. 证券交易：

- (1) 支持深沪两市单市场/跨市场/现金多资产 ETF 认购、申购、赎回，及申购权限校验；
- (2) 支持深沪两市单市场/跨市场/现金多资产 ETF 的普通委托买卖、大宗交易买卖。

5. 申报回报：

- (1) 支持深沪两市单市场/跨市场/现金多资产 ETF 认购、申购、赎回、买

卖的申报回报。

6. RTGS 回报：

- (1) 支持沪市全现金多资产 ETF 申购 RTGS 勾单回报处理；
- (2) 支持深市单市场/跨市场/现金多资产 ETF 代收代付 RTGS 勾单回报处理；
- (3) 支持深市全现金多资产 ETF 代收代付 RTGS 勾单回报处理

7. 代收代付回报：

- (1) 支持沪市单市场/跨市场/现金多资产 ETF 代收代付勾单回报处理。

8. 实时交收：

(1) 支持深沪两市单市场/跨市场/现金多资产 ETF 申赎现金差额实时交收处理；

(2) 支持深沪两市单市场/跨市场/现金多资产 ETF 申赎现金替代退补款实时交收处理；

(3) 支持深沪两市跨市场多资产 ETF 赎回所涉港股通组合证券的现金替代实时交收处理；

(4) 支持深沪两市全现金多资产 ETF 申购基金过户实时交收处理；

(5) 支持深沪两市全现金多资产 ETF 申购现金替代实时交收处理；

(6) 支持深沪两市全现金多资产 ETF 赎回现金替代实时交收处理

二、内存清算

1. 零售端+机构端

(1) 申购、赎回基金过户处理及交割记录，计算成本价。成分股过户及交割记录，计算成本价。预估现金冻结、补冻。

(2) 现金替代资金划拨及交割记录。

(3) 现金差额资金划拨及交割记录。

(4) 退补款资金处理及交割记录。

(5) 支持结算对账、一级清算对账。

三、LDP 系统

1. 初始化管理

初始化串处理：增加 3 个不同的串分别表示 3 个类型；

2. 交易管理

- (1) 多资产 ETF 申赎下单；
- (2) 多资产 ETF 申赎内部撤单；
- (3) 多资产 ETF 申赎申报；
- (4) 多资产 ETF 申赎回报(确认，废单，补单)；
- (5) 多资产 ETF 申赎主备同步和日间数据回库；
- (6) 多资产 ETF 申赎交易数据日终回库；

3. 接口改造

- (1) API 接口支持并验证多资产 ETF 申赎下单和撤单；
- (2) API 可买卖数量获取支持多资产 ETF 申赎；
- (3) 验证 333012-ETF 申购支持多资产 ETF 申购；
- (4) 验证 333013-ETF 赎回支持多资产 ETF 赎回；
- (5) 验证 332630-跨境 ETF 申购支持多资产 ETF 申购；
- (6) 验证 332631-跨境 ETF 赎回支持多资产 ETF 赎回；
- (7) 验证 332633-ETF 内部撤单支持内部撤单；
- (8) UFX 接口 333001-大约可买，333000-证券代码输入确认支持多资产 ETF 申赎可赎回数量获取；
- (9) UFX 接口 332704-综合委托查询，332705-综合成交查询支持多资产 ETF 申赎；
- (10) 333101/333100 支持多资产 ETF 委托查询；
- (11) 333102 支持多资产 ETF 成交查询。

4. 参数管理

- (1) 异常委托修改支持多资产 ETF 申赎；
- (2) ETF 代码查询和成份股查询支持多资产 ETF 申赎代码；
- (3) 委托查询支持多资产 ETF 委托查询；
- (4) 成交查询支持多资产 ETF 申赎成交查询；
- (5) 申赎明细查询支持多资产 ETF 申赎明细查询。

5. 行情模块

- (1)Win 版行情服务器升级
- (2)Linux 版行情服务器升级
- (3)支持多资产 ETF 申赎代码行情转入

四、机构经纪投资管理系统软件（包括 PB3.0）

1. 深沪多资产 ETF

- (1)ETF 基础信息新增字段，支持区分多资产 ETF
- (2)申赎清单导入支持多资产 ETF 的成分券导入
- (3)前台交易界面支持多资产 ETF 成分券的展示及替代金额的计算
- (4)后台服务支持多资产 ETF 的委托、成交的成分券持仓可用及资金可用的处理
- (5)风控支持多资产 ETF 的风控控制
- (6)报盘前置机支持多资产 ETF 的报单及成交回报
- (7)报表支持多资产 ETF 及成分券的数据展示
- (8)清算支持多资产 ETF 成分券的资产处理
- (9)篮子交易支持多资产 ETF 的一篮子成分券买卖
- (10)业务品种支持：单市场多资产 ETF、跨市场多资产 ETF、现金申赎类多资产 ETF

2. 深沪现金申赎 ETF 投资端 RTGS 交收

沪深现金申赎 ETF 投资端支持 RTGS 交收，申购成交后支持 RTGS 交收释放可用。

上交所：跨境 ETF、跨市场债券 ETF

深交所：跨境 ETF、跨市场债券 ETF、黄金 ETF

3. 沪深多资产 ETF 投资端 RTGS 交收

沪深多资产 ETF 投资端支持 RTGS 交收，申购成交后支持 RTGS 交收释放可用。

支持上交所：现金申赎类多资产 ETF

支持深交所：现金申赎类多资产 ETF

需配合沪深现金申赎 ETF 投资端 RTGS 交收模块使用。

五、托管估值

本次采购发行端 4 个 ETF 品种、联接端 4 个 ETF 品种、投资端 6 个 ETF 品种。

1. 发行端

(1) 增加支持从深沪交易所文件以及登记公司文件中读取深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 交易数据。包括：ETF 申购赎回份额数据、ETF 沪市成分券数据（股票和债券）、ETF 沪市现金替代数据；

(1) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 申购赎回清单的处理；

(2) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 发行端的清算处理；

(3) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 发行端的台账处理，本市场股票和本市场债券平均值法补券等；

(4) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 发行端的补票处理；

(5) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 发行端的退补数据处理；

(6) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 发行端相关会计科目；

(7) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 发行端生成相关业务凭证；

(8) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 发行端相关报表的处理；

(9) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 发行端划款指令的生成。

2. 联接基金

(1) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 联接申购赎回清单 xml 版本的导入和清算处理；

(2) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 联接申购赎回数据导入和清算处理；

(3) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 联接替代台账数据的处理；

(4) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 联接退补款数据的处理；

(5) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 联接申赎凭证、退补凭证处理；

(6) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 联接日终估值。

3. 投资端

(1) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 的 xml 版本 PCF 清单数据的导入和清算。

(2) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETFETF 申赎数据的处理，包含份额、组

合证券、沪市现金替代款。

(3) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 退补款台账的处理。

(4) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 申赎增值税的处理。

(5) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 套利处理。

(6) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 凭证及估值处理。

六、自营估值系统

1. 投资端

(1) 增加深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 的 xml 版本 PCF 清单数据的导入和清算；

(2) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETFETF 申赎数据的处理，包含份额、组合证券、沪市现金替代款；

(3) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 退补款台账的处理；

(4) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 申赎增值税的处理；

(5) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 套利处理；

(6) 深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 凭证及估值处理。

七、I2 收益互换

1. 深沪交易所多资产 etf

(1) ETF 基础信息新增字段，支持区分深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF；

(2) 申赎清单导入支持深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 的成分券导入；

(3) 前台交易界面支持深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 成分券的展示及替代金额的计算；

(4) 后台服务支持深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 的委托、成交的成分券持仓可用及资金可用的处理；

(5) 风控支持深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 的风控控制；

(6) 报盘前置机支持深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 的报单及成交回报；

(7) 报表支持深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 及成分券的数据展示；

(8) 清算支持深沪单市场/跨市场/现金多资产 ETF 成分券的资产处理；

- (9) 篮子交易上交所支持单市场多资产 ETF 的一篮子成分券买卖；
- (10) i2 支持回补 LDP 深沪单市场/跨市场多资产 ETF 委托成交流水；
- (11) i2 支持回补 LDP 深沪交易所全现金申赎类多资产 ETF 委托成交流水；

2. LDP 模块

2.1. 初始化管理

初始化串处理：增加 3 个不同的串分别表示 3 个类型；

2.2. 交易管理

- (1) 多资产 ETF 申赎下单；
- (2) 多资产 ETF 申赎内部撤单；
- (3) 多资产 ETF 申赎申报；
- (4) 多资产 ETF 申赎回报(确认，废单，补单)；
- (5) 多资产 ETF 申赎主备同步和日间数据回库；
- (6) 多资产 ETF 申赎交易数据日终回库；

2.3. 接口改造

- (1) API 接口支持并验证多资产 ETF 申赎下单和撤单；
- (2) API 可买卖数量获取支持多资产 ETF 申赎。

2.4. 参数管理

- (1) 异常委托修改支持多资产 ETF 申赎；
- (2) ETF 代码查询和成份股查询支持多资产 ETF 申赎代码；
- (3) 委托查询支持多资产 ETF 委托查询；
- (4) 成交查询支持多资产 ETF 申赎成交查询；
- (5) 申赎明细查询支持多资产 ETF 申赎明细查询。

2.5. 行情模块

- (1) Win 版行情服务器升级
- (2) Linux 版行情服务器升级
- (3) 支持多资产 ETF 申赎代码行情转入

3. LDP 交易子系统 RTGS 模块

- (1) 涉及 RTGS 交收品种，多资产 ETF 改造

八、自营 032

(1)支持上交所单市场多资产ETF（同时包含股债）ETF投资相关功能，支持一篮子股票和债券申赎指令、委托下达，日终清算；

(2)支持上交所跨市场多资产ETF（同时包含股债）ETF投资，支持本市场股票和债券实物申赎，对方市场成份券现金替代；支持一篮子股票和债券申赎指令、委托下达，日终清算；

(3)上交所跨市场多支持ETF支持新增北交所成分股改造，支持ETF一级市场申赎，日间资产和可用处理，日终清算交收；

(4)上交所跨市场ETF支持新增港股通成分券改造，支持ETF一级市场申赎，日间资产和可用处理，日终清算交收；

(5)支持上交所现金申赎类多资产ETF（同时包含股债）ETF发行，支持以全现金作为对价进行多资产ETF的申赎；支持一篮子股票和债券申赎指令、委托下达，日终清算；

(6)上交所ETF投资端支持ETF现金申购采用RTGS模式的业务系统改造；

(7)上交所多支持ETF支持新增北交所成分股改造，支持ETF一级市场申赎，日间资产和可用处理，日终清算交收；

(8)上交所多支持ETF支持新增港股通成分券改造，支持ETF一级市场申赎，日间资产和可用处理，日终清算交收；

(9)支持深交所单市场多资产ETF（同时包含股债）ETF投资相关功能，支持一篮子股票和债券申赎指令、委托下达，日终清算；

(10)支持深交所跨市场多资产ETF（同时包含股债）ETF投资，支持本市场股票和债券实物申赎，对方市场成份券现金替代；支持一篮子股票和债券申赎指令、委托下达，日终清算；

(11)支持深交所现金申赎类多资产ETF（同时包含股债）ETF发行，支持以全现金作为对价进行多资产ETF的申赎；支持一篮子股票和债券申赎指令、委托下达，日终清算；

(12)深交所ETF投资端支持ETF现金申购采用RTGS模式的业务系统改造；

(13)深交所多支持ETF支持新增北交所成分股改造，支持ETF一级市场申赎，日间资产和可用处理，日终清算交收；

(14) 深交所多支持ETF支持新增港股通成分券改造,支持ETF一级市场申赎,日间资产和可用处理,日终清算交收。

九、恒生投资赢家 PC

(1) 行情支持下发多资产ETF分类

(2) 客户端展示改造

十、托管投资监督

(1) 支持单市场股债多资产ETF(发行端)投资监督相关改造

(2) 支持跨市场股债多资产ETF(发行端)投资监督相关改造

(3) 支持单市场股债多资产现金申赎ETF(发行端)投资监督相关改造

(4) 支持跨市场股债多资产现金申赎ETF(发行端)投资监督相关改造

(5) 支持单市场股债多资产ETF(联接基金)投资监督相关改造

(6) 支持跨市场股债多资产ETF(联接基金)投资监督相关改造

(7) 支持单市场股债多资产ETF现金申赎(联接基金)投资监督相关改造

(8) 支持跨市场股债多资产ETF现金申赎(联接基金)投资监督相关改造

(9) 支持单市场股债多资产ETF(投资端)投资监督相关改造

(10) 支持跨市场股债多资产ETF(投资端)投资监督相关改造

(11) 支持单市场股债多资产ETF现金申赎(投资端)投资监督相关改造

(12) 支持跨市场股债多资产ETF现金申赎(投资端)投资监督相关改造。

十一、华锐联合风控

1. 证券基础信息上场

(1) 支持识别深交所41-多资产ETF证券上场,同时新增多资产ETF证券子类别。

2. ETF成份券上场

(1) 支持上交所ETF公告文件(ssepcf_NNNNNNNN_YYYYMMDD.xml)识别银行间、港股通、期货所等市场的标的成份券;

(2) 支持深交所ETF实时申购赎回业务参考信息文件(PCF.xml)识别银行间、

港股通、期货所等市场的标的成份券。

3. 名单初始化

(1) 支持多资产 ETF 纳入 ETF 证券组识别。

十二、新意法人

1. 清算管理

(1) 支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 交易(含大宗、融资、融券)、申购、赎回业务；

(2) 支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务对 SJSGB、SJSMX、SJSJG、DSFQS 等数据接口文件中多资产 ETF 业务的数据读取；

(3) 数据清分流程支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务；

(4) 清算预处理、股份清算、股份对账、资金清算等流程支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务。

2. 自有收支核算

支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务。

3. 资金总账

支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务。

4. 交收管理

支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务。

5. 综合查询

支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务。

6. 股份管理

支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务。

7. 财务接口

支持深交所单市场/跨市场/现金多资产 ETF 业务。

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：深福州市鼓楼区六一北路 558 号金三桥大厦 8 层

三、公示期限

2026 年 5 月 25 日 至 2026 年 5 月 27 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：邹圣洁

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：15067130032