

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
新一代期权交易系统若干技术调整
市场参与者技术实施指南
1.0 版



上海证券交易所

二〇二四年六月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0	创建文档

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）期权交易系统技术调整市场的技术实施指南。

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

技术服务 QQ 群： 298643611
技术服务电话： 4008888400-2 (8:00-20:00)
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，将推进市场参与者配合新一代期权交易系统建设工作。为此制定《上海证券交易所新一代期权交易系统若干技术调整市场参与者技术实

施指南（技术开发稿）》，对市场参与者相关的技术实施提出建议。

2 市场交互变动说明

上海证券交易所新一代期权交易系统上线时，市场参与者技术系统与本所技术系统之间的交互将会有如下变化：

1、实时交易订单格式检查变化：

字符型字段对当前业务不生效时，该字段填写的值：字段规定的枚举值或空格。

2、实时交易订单资金检查变化：

（1）市场参与者在申报市价类交易订单时，本所按照“涨停价”进行资金校验，为避免因资金不足导致订单申报失败，市场参与者应做好资金前端控制。

（2）做市商更新双边报价订单，本所进行资金检查时，原订单中未成交数量冻结的资金不计新订单的可用额度，通过本所各项检查后，释放原订单未成交部分所冻结的资金。市场参与者在进行做市商双边报价订单更新时，应注意做好资金控制。

3、实时交易订单持仓及限仓检查变化：

做市商更新双边报价订单，本所进行持仓与限仓额度检查时，原订单未成交数量冻结的持仓不计入新订单可用额度，通过本所各项检查后，释放原订单未成交部分所冻结的持仓。市场参与者在进行做市商双边报价订单更新时，应注意做好持仓与限仓控制。如需将冻结的持仓计入新订单可用额度，建议市场参与者撤销上一笔双边报价订单后，再申报新一笔双边报价订单。

4、执行报告分区变化：

业务类型与执行报告分区对应关系出现变化，对应关系非固定不变。市场参与者应避免自行配置固定分区信息，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) 向市场参与者揭示分区信息, 市场参与者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接口规格说明书》。

5、执行报告交易所订单编号 (OrderID) 变化:

交易所订单编号 (OrderID) 起始值进行调整, 字段格式和长度不变。订单编号不再从 1 开始递增, 改为增加偏移量后编号, 编号唯一, 相同交易主机内编号递增, 不同交易主机偏移量不同。例如: 主机一订单编号从 300000000001 开始递增, 主机二订单编号从 400000000001 开始递增 (示例, 以实际取值为准)。

6、执行报告成交编号 (ExecID) 变化:

成交编号 (ExecID) 起始值进行调整, 字段格式和长度不变。交易订单执行报告成交编号不再从 1 开始递增, 改为增加偏移量后编号, 编号唯一, 相同交易主机内编号递增, 不同交易主机偏移量不同。例如: 主机一订单编号从 300000000001 开始递增, 主机二订单编号从 400000000001 开始递增 (示例, 以实际取值为准)。

7、行情信息变化:

(1) 开市前、休市、闭市后, 行情文件接口 mkttdt03.txt 文件中“产品实时阶段及标志 (TradingPhaseCode)”第 4 位, 取值由“1”调整为“0”。

(2) 开市前、休市、闭市后, Binary/Step 行情快照中“证券类型 (SecurityType)”取值为“2”并且“行情类别 (MDStreamID)”取值为“MD301”时, “产品实时阶段及标志 (TradingPhaseCode)”第 4 位, 取值由“1”调整为“0”。

8、错误代码信息变化:

实时申报订单响应中错误代码信息变化, 错误代码含义详细参见《IS111-上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.27 版(新一代期权交易系

统技术开发稿)-20240621》

3 市场参与者技术实施建议

实时交易订单资金检查、执行报告分区、交易所订单编号、成交编号、错误代码等内容,本所现有期权交易系统不做变更,在新一代期权交易系统上线时调整。请市场参与者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。

4 相关技术文档

《IS120-上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范》

《IS120-上海证券交易所行情网关 STEP 数据接口规范》

《IS122-上海证券交易所交易网关接口规格说明书》

《IS124-上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》

《IS111-上海证券交易所报盘软件错误代码表 3.27 版(新一代期权交易系统技术开发稿)-20240621》