

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
3.0 版



上海证券交易所
二〇二五年九月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0	创建文档
V2.0	1、增加 PBU 被冻结后，禁止该 PBU 登录的说明。 2、增加撤单成功响应“订单所有者类型（OwnerType）”的取值说明。 3、增加行情发送变化说明。 4、增加组合与拆分执行报告说明。 5、增加保证金查询指令响应报告说明。
V3.0	1、修改成交编号（ExecID）变化说明。 2、增加业务闭市后，订单消息响应说明。 3、增加交易网关地址更新说明。

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 3.0 版》，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、PBU 被冻结后，该 PBU 被禁止登录交易网关，同时该 PBU 也不允许被订阅。

2、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。

示例：

双边报价订单（OQO 订单）对单边报价（比如买报价）进行更新时，另一边报价（比如卖报价）的开/平仓标志无效，此时该开/平仓标志可填写“0（开仓）/C（平仓）”或空格，此处推荐填空格，若填写规定值以外的其它有效字符，响应中该字段值为空格。

3、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买入开仓时，本所按照“涨停价”进行资金校验，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。

4、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。

5、主机分区变化

订单处理分区由单分区调整为多分区。涉及以下变化：

(1) 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》。

(2) 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）。

(3) 成交回报中成交编号 (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：主机一成交

编号从 300000000001 开始递增,主机二成交编号从 400000000001 开始递增(示例,以实际取值为准)。**组合与拆分执行报告中成交编号(ExecID)规则暂不调整。**

6、行情信息变化:

(1) 开市前、休市、闭市后,行情文件接口(mktdt03.txt)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”。

7、行情发送变化

行情发送由按照固定周期在同一时刻发送所有产品的增量行情及全量行情,调整为单个周期内所有产品分为多个组分批次发送行情。单个产品的增量行情与全量行情的发送周期保持不变。因每个交易日产品数量存在差异,分组数量及每个分组的产品数量可能不同。

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)-20250421》

9、订单重复性校验:

新一代期权交易系统加强订单重复性校验,市场参与者同一个交易单元的“会员内部编号(C10rdID)”与“报价编号(QuoteMsgID)”在申报的所有业务类型的订单中必须唯一(即PBU+会员内部订单编号需在期权交易系统内全局唯一)。

10、撤单成功响应变化:

本所发送的撤单成功响应中，“订单所有者类型（OwnerType）”字段的取值填写方式调整，该字段取值由被撤订单的“订单所有者类型（OwnerType）”调整为撤单申报消息的“订单所有者类型（OwnerType）”。

11、保证金查询指令响应报告

新一代期权交易系统为分布式系统，受分布式架构限制，保证金查询时，可能存在响应中资金信息未更新的情况，市场参与者遇到此情况时，可重新发起保证金查询指令，获取更新后的资金信息。

12、业务闭市后订单消息响应变化

市场参与者申报的订单时，若订单对应的业务已闭市，全局时间表尚未结束，针对业务时间表闭市校验错误（错误码 10740），新一代期权交易系统将通过申报拒绝（Order Request Reject）返回该类型错误，不再通过执行报告（Execution Report）返回该类型错误。全局时间表结束之后，新一代期权交易系统与现有期权交易系统保持一致，通过申报拒绝（Order Request Reject）返回该类型错误。

13、文件记录顺序变化

闭市后，本所向市场发送的各类接口文件中，明确标明数据记录排序规则的文件延续现有排序规则，未明确排序规则的文件，文件内的数据记录顺序可能存在变化，市场参与者不应依赖记录顺序进行相关业务处理。

14、交易网关远程地址更新

本所新一代期权交易系统上线时，市场机构需将交易网关的期权平台界面中的远程地址列表更新为本所通知的 IP 地址。

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)-20250421》