上海证券交易所技术文档



 **上海证券交易所股票期权做市商双边报价订单市场参与者技术实施指南**

**1.0版**



上海证券交易所

**二〇二〇年三月**

**版本历史**

|  |  |
| --- | --- |
| **版本号** | **调整内容** |
| V1.0 20200325 | 创建说明 |
|  |  |
|  |  |
|  |  |

**文档摘要**

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）股票期权做市商双边报价的技术实施指南。

**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:  　 　4009003600(8:00-20:00) |
| 电子邮件：  　　 tech\_support@sse.com.cn |
| 技术服务微信公众号：SSE-TechService **3e4dc5951bf0a4ce7754c754c3ef8087** |

# 简介

本文档为上海证券交易所股票期权交易技术接口及相关变更的技术实施指南，对市场参与者技术实施提出建议。

# 本所市场接口调整说明

1. 期权交易平台新增双边报价订单（以下简称Quote订单）申报指令接口，业务类型编号取值OQO，仅限做市商申报，订单类型默认为限价订单当日有效，限一档报价；允许买入开仓/平仓，卖出开仓/平仓，不支持备兑开仓/平仓。

支持业务功能:双边报价、双边报价更新、更新单边报价或单边报价（不推荐用来报单边价格）、撤销双边报价。不支持撤销单边报价，仅剩单边报价时，可使用双边撤单撤销该单边报价。

Quote订单校验同一做市商账户同一合约买报价需低于卖报价①。

注：①价格校验仅支持避免Quote订单买价格与卖价格交叉，不支持Quote与普通申报价格交叉校验。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **业务功能** | **买方向** | **卖方向** |
| **买数量** | **买价格** | **卖数量** | **卖价格** |
| 双边报价 | >0 | >0 | >0 | >0 |
| 双边报价更新 | >0 | >0 | >0 | >0 |
| 单边（更新）买报价 | >0 | >0 | =0 | =0 |
| 单边（更新）卖报价 | =0 | =0 | >0 | >0 |
| 撤销双边报价 | =0 | =0 | =0 | =0 |

1. 新增Quote订单申报响应接口，具体场景响应说明如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **业务** | **场景** | **返回状态（部分字段）** | **说明** |
| 双边报价 | 申报成功 | ExceType=0OrdStatus=0LeavesQty=0Side=1LeavesQty=0Side=2 |  |
| 申报失败 | ExecType=8OrdStatus=8LeavesQty=0Side=1LeavesQty=0Side=2 |  |
| 双边报价更新 | 更新双边成功 | ExceType=0OrdStatus=0OrigClOrdID=原买单会员内部订单编号LeavesQty=原买单撤单数量Side=1OrigClOrdID=原卖单会员内部订单编号LeavesQty=原卖单撤单数量Side=2 | 响应中返回新交易所订单编号（OrderId），成交后执行报告中买卖双边均使用新交易所订单编号（OrderId） |
| 更新双边失败 | ExceType=8OrdStatus=8OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=1OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=2 | 双边检查均无错误时更新双边报价，任何一边存在错误时双边均不作更新。 |
| 更新双边时买报价已被成交，卖报价更新成功 | ExceType=0OrdStatus=0OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=1OrigClOrdID=原卖单会员内部订单编号LeavesQty=原卖单撤单数量Side=2 | 撤销未完全成交的一边，新挂买卖双边报价，响应返回新交易所订单编号（OrderId）与客户端会员内部订单编号（QuoteMsgID） |
| 单边报价更新 | 更新买单边报价成功 | ExceType=0OrdStatus=0OrigClOrdID=原买单会员内部订单编号LeavesQty=原买单撤单数量Side=1OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=2 | 更新买单边的交易所订单编号（OrderId）与会员内部订单编号  |
| 更新卖单边报价成功 | ExceType=0OrdStatus=0OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=1OrigClOrdID=原卖单会员内部订单编号LeavesQty=原卖单撤单数量Side=2 | 更新卖单边的交易所订单编号（OrderId）与会员内部订单编号 |
| 更新单边报价失败 | ExceType=8OrdStatus=8OrigClOrdID=LeavesQty=0Side=1OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=2 |  |
| 更新单边报价时该单边已被完全成交 | ExceType=0OrdStatus=0OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=1OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=2 | 新挂该单边订单，响应中撤销数量为0，撤销订单会员内部订单编号为空 |
| 双边撤单 | 双边撤单成功 | ExceType=6OrdStatus=6OrigClOrdID=原买单会员内部订单编号LeavesQty=原买单撤单数量Side=1OrigClOrdID=原卖单会员内部订单编号LeavesQty=原卖单撤单数量Side=2 | 响应中返回撤单会员内部编号与原订单会员内部订单编号，交易所订单编号（OrderId）为空 |
| 双边撤单失败 | ExceType=8OrdStatus=8LeavesQty=0Side=1LeavesQty=0Side=2 |  |
| 双边撤单买单边已被成交 | ExceType=6OrdStatus=6OrigClOrdID= LeavesQty=0 Side=1OrigClOrdID=原卖单会员内部订单编号LeavesQty=原卖单撤单数量Side=2 | 响应中返回撤单会员内部编号与原卖单会员内部订单编号，交易所订单编号（OrderId）为空 |
| 双边撤单卖单边已被成交 | ExceType=6OrdStatus=6OrigClOrdID=原买单会员内部订单编号LeavesQty=原买单撤单数量Side=1OrigClOrdID= LeavesQty=0Side=2 | 响应中返回撤单会员内部编号与原买订单会员内部订单编号，交易所订单编号（OrderId）为空 |

1. 执行报告新增OQO业务类型，一笔Quote订单业务中买卖两笔成交分别发送执行报告，字段内容与原有普通申报内容一致。
2. 原普通报价接口仍可用来申报做市报价单。

# 申报消息示意图

1. 新报价消息示意图



1. 更新双边报价消息示意图



1. 更新买报价消息示意图



1. 更新卖报价消息示意图



1. 撤销双边报价消息示意图



# 会员技术系统改造建议

会员技术系统应在保持现有期权交易申报基础上，增加申报Quote订单与处理返回响应功能。

1. Quote订单仅校验申报Quote订单中的买价格与卖价格是否交叉，但不校验Quote订单与普通订单价格是否交叉，因此会员在申报订单时应注意申报价格，避免自成交；
2. 申报更新单边价格时，另一边数量与价格应该为0；
3. 更新双边报价时，除依据订单执行类型（150）与当前申报状态（39）字段判断外，需依据买卖方向中原会员内部订单编号与撤单数量判断原买卖方向订单是否被成功撤销；
4. 由于不支持单边撤单，在一边已成交另一边未成交时如需撤销未成交的单边报价可通过申报撤销双边订单撤销该单边。

# 相关技术文档

本所技术文档详见上交所网站交易技术支持专区，本次涉及相关技术文档如下：

IS113\_上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书1.3版本（做市商双边报价订单技术开发稿）\_20200325