上海证券交易所技术文档



**上海证券交易所**

**风险警示板股票退市后重新上市首日**

**市场参与者技术实施指南**

**1.0版**



上海证券交易所

**二〇二〇年五月**

**版本历史**

|  |  |
| --- | --- |
| **版本号** | **调整内容** |
| V1.0 20200525 | 根据上交所发布的《关于修订《上海证券交易所风险警示板股票交易管理办法》的通知》制定 |
|  |  |
|  |  |
|  |  |

**文档摘要**

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）风险警示板股票退市后重新上市首日市场参与者技术实施指南。

**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](mailto:tech_support@sse.com.cn) |
| 技术服务微信公众号：SSE-TechService  **3e4dc5951bf0a4ce7754c754c3ef8087** |

# 简介

根据本所发布的《关于修订《上海证券交易所风险警示板股票交易管理办法》的通知》，针对风险警示板股票退市后重新上市首日制定了《上海证券交易所风险警示板股票退市后重新上市首日市场参与者技术实施指南》，对市场参与者相关的技术实施提出建议。

# 市场接口调整说明

本次风险警示板股票退市后重新上市首日业务不涉及接口变化。

# 业务调整说明

根据《关于修订《上海证券交易所风险警示板股票交易管理办法》的通知》安排，对风险警示板股票退市后重新上市首日的盘中临时停牌及申报价格限制措施进行调整优化，优化后的措施与科创板上市首日相关安排基本相同，主要优化内容如下：

1. 盘中临时停牌，停牌条件调整为盘中交易价格较当日开盘价格首次涨跌幅度达30%和60%两档，且换手率达到30%不会触发停牌，单次停牌时间为10分钟；
2. 申报价格限制，集合竞价无申报价格限制，连续竞价阶段按照买入申报价格不得高于基准价格的102%，卖出申报价格不得低于基准价格的98%。基准价格含义如下：买入（卖出）基准价格，为即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格；无即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格的，为即时揭示的最高买入（最低卖出）申报价格；无即时揭示的最高买入（最低卖出）申报价格的，为最新成交价；当日无成交的，为前收盘价。

# 市场参与者技术实施建议及注意事项

1. 风险警示板股票退市后重新上市首日之后，从第二个交易日开始恢复风险警示板的交易模式。
2. 风险警示板股票退市后重新上市首日的交易中，价格控制、停复牌控制是新的规则（与科创板首日相同），但订单类型仍然是风险警示板的，即不允许市价订单等。
3. 市场接口不变，重新上市首日涨跌幅限制类型仍为“R”，市场参与者可通过产品基础信息（CPXX）文件产品状态标志第4位为“S”，涨跌幅限制类型为“R”来判定为风险警示板股票重新上市首日股票。产品基础信息（CPXX）文件中涨幅上（下）限价格对于R类型无涨跌幅限制的产品，无实际控制意义。
4. 市场参与者应充分评估业务变更对交易相关技术系统的影响，做好相关技术系统维护、改造工作，保证风险警示板股票退市后重新上市首日业务的顺利开展，同时保障现有上交所股票、债券、基金、融资融券、港股通、股票期权等各类业务正常运行。
5. 市场参与者应根据本所要求利用本所提供的测试环境进行充分测试验证。

# 相关技术文档

本次风险警示板股票退市后重新上市首日业务未涉及市场接口规格变化，相关技术文档无变更。

本所最新技术文档详见上交所网站交易技术支持专区：

IS101上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书

IS111 上海证券交易所报盘软件错误代码表

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