上海证券交易所技术文档



**沪深300ETF期权市场参与者技术实施指引**

**1.0版**



上海证券交易所

**二零一九年十二月**

**版本历史**

|  |  |
| --- | --- |
| **版本号** | **调整内容** |
| V1.0 20191211 | 根据新增沪深300ETF期权标的情况编写 |
|  |  |

**文档摘要**

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）新增沪深300ETF期权标的相关交易业务的技术实施指引。

**特别申明：**

* 本指引为技术实施指引，所涉相关业务规定以本所业务规则为准。
* 本指引根据本所相关规则、业务方案制定，**后续若业务规则或方案发生调整，本指引亦会进行相应调整**。
* 本所保留对本指引的解释与修改权。

**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 (回复00进入人工服务)  **3e4dc5951bf0a4ce7754c754c3ef8087** |

# 简介

本文档为上海证券交易所新增沪深300ETF期权标的技术实施指引，并对券商端相关技术系统提出建议。本次新增期权标的相关业务在期权平台实施。

# 新增标的市场接口关注点

本次新增期权标的涉及业务规则部分，以发布的业务实施细则为准。新增期权标的未涉及市场接口结构变化，但需关注相关接口内容变动，关注节点如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **日期** | **接口文件** | **变动内容** |
| 1 | 2019年12月20日（新增标的） | 期权基础信息reff03 | 下一交易日期权基础信息文件包含新标的合约72个，分为1月、2月、3月及6月到期 |
| 2 | 2019年12月21日（通关测试） | 期权行情文件mktdt03；  期权收盘价格文件clpr03；  过户数据（trns03、hold03、qtyw03） | 期权行情文件、期权收盘价格文件包含新标的合约72条；  当日新标的合约达成成交的，则过户数据包含新标的合约 |
| 3 | 2019年12月23日（上线首日） | 期权行情文件mktdt03；  期权收盘价格文件clpr03；  过户数据（trns03、hold03、qtyw03） | 期权行情文件、期权收盘价格文件包含新标的合约；  当日新标的合约达成成交的，则过户数据包含新标的合约 |
| 4 | 2020年1月20日（新标的首个垂直价差策略自动拆分日） | 期权基础信息reff03 | 期权基础信息文件1月份到期合约构建的组合策略，盘后进行自动解除组合策略；  当日新标的合约达成成交的，则过户数据包含新标的合约 |
| 4 | 2020年1月21日（新标的首个禁止垂直价差策略） | 期权基础信息reff03 | 当日期权基础信息文件包含新标的合约，且1月份到期合约“期权合约状态信息标签”第6位为‘1’，盘中1月份到期合约无法构建垂直价差组合策略 |
| 5 | 2020年1月22日（行权日） | 期权基础信息reff03 | 当日新标的可进行行权、行权指令合并申报；  当日1月份到期合约跨式、宽跨式组合策略盘后自动拆分；  下一交易日期权基础信息文件，50ETF标的及新标的挂牌9月份到期合约 |

# 市场端软件说明

本次期权新增期权标的相关业务涉及市场端软件相关信息如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **软件功能** | **软件名称** | **版本** | **备注** |
| 报盘软件 | 易神系统通用报盘软件（EzSTEP） | 2019版（推荐）  2016版 | http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/download/c/SSE\_EzSTEP\_2019.zip  http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/download/c/SSE\_EzSTEP\_2016.zip |
| 行情接收软件 | 易神系统行情接收客户端（EzSR） | 2014版+已有配置（包括期权接口扩容配置、综业FAST行情配置等） | http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/download/c/SSE\_EzSR\_2014.rar  http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/download/c/SSE\_EzSR\_Upgrade.zip  http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/download/c/SSE\_EzSR\_FAST\_Upgrade\_20190604.zip |
| 行情网关软件（MDGW） | 0.4.1版（推荐）  0.3.8版 | http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/download/c/SSE\_MDGW\_0.4.1.rar  http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/download/c/SSE\_MDGW\_0.3.8.rar |

# 会员技术系统改造建议

会员技术系统应在保持现有上交所股票、债券、基金、期权等各类业务正常运行的基础上，提供期权多标的交易管理、风险管理等功能。

1. 投资者适当性管理

* 会员技术系统应具备灵活的多标的期权产品交易权限、交易限制等参数设置功能。根据本所规定的适当性管理要求做好对投资者交易资格的准入控制。

1. 技术系统就绪

* 会员应当充分评估新增期权标的产品对技术系统的影响，评估技术系统容量和性能是否满足需求，切实做好技术系统就绪工作。

1. 交易管理

* 会员技术系统应对多标的期权产品业务的交易类、非交易类的各申报要素进行有效验证，做好前端控制。
* 会员技术系统应对多标的期权产品提供行情揭示等功能。

1. 风险管理

* 会员技术系统应具备支持多标的期权产品业务的风险管理与风险处置功能，设定相应的监控指标和预警参数，并对投资者的交易行为进行监督和管理。

1. 其他

* 会员技术系统改造不得改变或影响现有业务及技术接口规范的要求。

# 相关技术文档

本次新增期权标的相关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：

IS113 上海证券交易所股票期权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