

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
股票期权组合策略单边平仓业务
市场参与者技术实施指南
1.0 版



上海证券交易所
二〇二六年六月

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

为进一步提升期权投资者资金使用效率，降低投资者交易成本，促进期权市场健康发展，本所拟完善股票期权组合策略业务，推出股票期权组合策略单边平仓功能。为此制定《上海证券交易所股票期权组合策略单边平仓业务市场参与人技术实施指南 1.0 版》，对市场参与人相关的技术实施提出建议。

2. 市场交互变动说明

期权订单申报消息(OTO)中增加选填字段“组合编码(SecondaryOrderID)”。
订单响应及撤单成功响应消息中,增加选填字段“组合编码(SecondaryOrderID)”。
开展单边平仓业务时,申报消息需填写“组合编码(SecondaryOrderID)”字段。

订单成交后,仅发送成交执行报告,不发送组合与拆分执行报告。其中,成交回报增加选填字段“组合编码(SecondaryOrderID)”。

组合策略单边平仓订单成交后,盘后发送的期权成交过户数据文件(trns03XXXXX.txt)中,T0305(期权成交过户数据)、T0307(期权当日组合拆分数据)各发一条数据。其中,T0307(期权当日组合拆分数据)“组合/拆分”字段新增“D”表示组合策略单边平仓成交拆分。

3. 市场参与者技术实施建议

市场参与者订单申报场景说明如下:

1. 未升级期权组合策略单边平仓软件版本的机构

普通交易订单与当前协议相比无变化。

2. 升级期权组合策略单边平仓软件版本的机构

支持做单边平仓业务的柜台系统,升级柜台版本后,申报组合策略单边平仓订单时“组合编码(SecondaryOrderID)”字段填写实际业务组合编码,其余情况填空格。

(1) 普通交易订单:

申报时,申报消息中需填写“组合编码”字段,取值为空格。

申报响应有“组合编码”字段,取值与申报消息一致,为空格。

订单成交后,成交回报中有“组合编码”字段,取值与申报消息一致,为空格。

撤单时,撤单申报无“组合编码”字段。

撤单成功响应有“组合编码”字段,取值为空格。撤单失败响应无“组合编码”字段。

注意事项:

撤单成功响应是否包含“组合编码”,取决于被撤订单是否包含该字段。

(2) “组合策略单边平仓”订单：

申报时，申报消息需填写“组合编码”字段，取值为业务实际的组合编码。

申报响应有“组合编码”字段，取值与申报消息一致。

订单成交后，成交回报有“组合编码”字段，取值与申报消息一致。

撤单时，申报接口无“组合编码”字段。

撤单成功响应有“组合编码”字段，取值为原申报消息中的“组合编码”。

撤单失败响应无“组合编码”字段。

各类消息中“组合编码”字段填写说明如下表：

		普通交易订单	组合策略单边平仓订单
组合编码 (SecondaryOrderID)	申报消息	空格	实际业务取值
	申报响应	空格	实际业务取值
	撤单消息	无该字段	无该字段
	撤单成功响应	空格	实际业务取值
	撤单失败响应	无该字段	无该字段
	成交回报	空格	实际业务取值

4. 相关技术文档

《IS122_上海证券交易所交易网关接口规格说明书（期权平台）1.1版_20260617》

《IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 3.50版_20260617》