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**

**2.0版**



上海证券交易所

**二〇二〇年九月**

**版本历史**

|  |  |
| --- | --- |
| **版本号** | **调整内容** |
| V1.0 20200325 | 创建说明 |
| V2.0 20200901 | 根据市场建议调整部分接口规范 |
|  |  |
|  |  |

**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；同一合约上已有双边报价时，可发送新的申报指令进行报价更新。

支持业务功能:双边报价、双边报价更新、买报价、买报价更新、卖报价、卖报价更新

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Quote订单报价自成交校验，不支持Quote与普通申报报价自成交校验。

Quote订单中，如果买方向的买数量和卖方向的卖数量都为0时，则该笔订单为废单。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 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 |
| 买报价 | >0 | >0 | =0 | =0 |
| 买报价更新 | >0 | >0 | =0 | =0 |
| 卖报价 | =0 | =0 | >0 | >0 |
| 卖报价更新 | =0 | =0 | >0 | >0 |

1. 期权交易平台新增双边报价撤单（以下简称Quote撤单）申报指令接口。

支持业务功能：撤销双边报价、撤销买报价、撤销卖报价。

Quote撤单中，如果买方向的买数量和卖方向的卖数量都不为0时，则该笔订单为废单。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 业务功能 | 买方向 | 卖方向 |
| 买数量 | 买价格 | 卖数量 | 卖价格 |
| 撤销双边报价 | =0 | =0 | =0 | =0 |
| 撤销买报价 | =0 | =0 | >0 | ≥0 |
| 撤销卖报价 | >0 | ≥0 | =0 | =0 |

1. 期权交易平台新增双边报价申报响应接口。

支持业务功能：双边报价申报响应。

1. 期权交易平台新增双边报价撤单响应接口。

支持业务功能：双边报价撤单响应。

1. 期权交易平台执行报告新增OQO类型。

# 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



1. 撤销单边报价消息示意图



# 市场参与者技术实施建议及注意事项

1. 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，保证期权做市商双边报价订单业务的顺利开展，同时保障现有股票期权业务的正常运行。
2. 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Quote撤单，并处理返回响应功能。
3. Quote订单仅校验申报Quote订单中报价是否出现自成交，但不校验Quote订单与普通订单报价是否出现自成交，因此会员在申报订单时应做好控制，避免自成交；
4. 更新报价与撤单时,需依据响应中的订单执行类型（150）、当前申报状态（39）、被撤报价原始会员内部订单编号(41)、撤单成功的数量(151)等字段共同判断原报价是否被成功撤销。
5. 在不接受撤单指令的时间范围内不能进行订单更新与Quote撤单。
6. 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1.4版本（做市商双边报价订单技术开发稿）\_20200901