

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所交易规则修订 市场参与者技术实施指南

1.0 版



上海证券交易所

二〇二六年四月

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）交易规则修订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： 4008888400-2

电子邮件： tech_support@sse.com.cn

技术服务微信公众号：SSE-TechService



1 简介

本文档为上海证券交易所交易规则修订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。

2 市场接口调整说明

无。

3 市场参与者技术实施建议及注意事项

根据本所发布的《上海证券交易所交易规则（2026年修订）》，本次交易规则修订内容以及相应技术实施建议如下。

1) 优化基金收盘交易机制

基金收盘阶段交易方式由连续竞价调整为收盘集合竞价，并通过集合竞价产生收盘价。

技术接口方面，基金在收盘集合竞价阶段的申报、响应、成交、行情接口均沿用现有接口不变。市场参与者应充分了解业务规则，关注收盘集合竞价阶段允许申报的订单类型、撤单限制、有效申报价格范围与连续竞价阶段的差异，做好相关技术评估和适配改造工作。

2) 扩展盘后固定价格交易方式适用品种

盘后固定价格交易方式适用证券范围由科创板股票扩展至全部 A 股和交易型开放式基金。

技术接口方面，主板 A 股和交易型开放式基金的盘后固定价格交易，均沿用现有现有盘后固定价格交易业务接口，包括实时申报、响应、成交、行情，以及参考数据文件（cpxx0202MMDD 备注字段的盘后固定价格交易标志）、过户文件（bgh）等。市场参与者应充分了解业务规则，关注主板 A 股和交易型开放式基金在最小价格变动单位、价格涨跌幅限制等方面与科创板股票的差异，做好相关技术评估和适配改造工作。

3) 调整主板风险警示股票涨跌幅比例限制

主板风险警示股票价格的涨跌幅限制比例由 5%调整为 10%。

技术接口方面，cpxx0201MMDD 文件中相关主板风险警示股票的“涨幅上限价格”“跌幅下限价格”的取值，将按照最新规则计算。市场参与者应按照最新的主板风险警示股票价格涨跌幅限制比例（10%）进行订单价格校验。对于使用 cpxx0201MMDD.txt 文件进行前端控制的，应确认系统已支持本次规则调整内容。对于自行计算“涨幅上限价格”“跌幅下限价格”进行前端控制的，应根据规则进行相应技术调整。

4) 其他调整

其他调整包括，一是增加科创板股票大宗交易固定价格交易类型，二是允许基金开

市期间的停牌时段接受申报，并于复牌时进行集合竞价，与股票保持一致。上述调整不涉及技术接口变化。

市场参与者应充分评估上述变更对申赎、交易、行情等相关技术系统的影响，做好相关技术系统维护、改造工作，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，同时保障现有上交所股票、债券、基金、融资融券、股票期权等各类业务正常运行。

4 相关技术文档

《IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书 3.20 版_20260327》