

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
可转债交易机制优化
相关业务
市场参与者技术实施指南
(正式稿)
1.0版



上海证券交易所

二〇二二年七月

版本历史

版本号	调整内容
V1.0 20220718	创建说明

文档摘要

本文档是上海证券交易所（以下简称“本所”）可转债交易机制优化相关业务技术实施指南。

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



1 简介

本文档为上海证券交易所可转债交易机制优化相关业务技术实施指南，对市场参与者技术实施提出建议。

2 本所市场接口调整说明

此次市场接口调整主要是为配合可转债交易机制优化相关业务需求，在竞价撮合系统市场参与者接口规格说明书的产品基础信息文件接口cpxx0201MMDD.txt和cpxx0202MMDD.txt中调整可转换公司债券（以下简称“可转债”）的涨跌幅说明。调整后，可转债的涨跌幅限制类型为N-有涨跌幅限制类型，“涨幅上限价格”和“跌幅下限价格”字段当日不会变更，基于前收盘价（上市首日为发行价）计算。可转债和定向可转债产品的“价格档位”调整为0.001。固定收益平台外部数据接口成交行情中修订关于公募可转债“昨日加权均价”的说明。

3 业务说明

可转债交易机制优化业务中，将可转债和定向可转债的申报价格的最小变动单位由0.01元调整为人民币0.001元。可转债的涨跌幅限制类型调整为有涨跌幅限制类型，并且通过匹配成交方式交易的（即通过新债券交易系统申报）上市首日的涨幅比例为57.3%、跌幅比例为43.3%，上市次日起的涨幅比例为20%、跌幅比例为20%；通过协商成交方式交易的（即通过固定收益平台申报）上市首日申报价在发行价上下30%内确定，上市次日起申报价格在前收盘价上下20%内确定。

4 市场参与者技术实施建议及注意事项

- 1) 本所提供市场参与者的产品基础信息接口，通过“涨幅上限价格”和“跌幅下限价格”字段揭示可转债的涨跌幅上下限，对于超过价格涨跌幅限制的申报视为无效申报，予以拒单处理。通过匹配成交方式交易的可转债，上市首日仍保留动态价格笼子控制和盘中临时停牌机制，具体价格范围参见交易规则，上市次日起取消

可转债的动态价格笼子控制和盘中临时停牌机制。可转债和定向可转债的最小变动单位调整为0.001元后，接口格式不变，应注意债券行情文件（mktDt02.txt及行情网关实时行情）中价格相关字段精确到0.001元，交易网关实时成交回报“成交价格”字段精确到0.001元，综合业务平台定向可转债转让业务的执行报告消息的“价格”字段精确到0.001元。具体接口格式参见《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》《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》《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》《IS122 上海证券交易所交易网关BINARY接口规格说明书》《IS122 上海证券交易所交易网关STEP接口规格说明书》《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书》。

- 2) 市场参与者应充分评估该业务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，确保可转债交易机制优化相关业务的顺利开展，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。
- 3) 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。

5 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，本次业务涉及相关技术文档如下：

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1.59版
_20220718（可转债交易机制优化正式稿）

IS109-上海证券交易所固定收益平台外部数据接口规范3.26版(正式
稿)_20220712