北证办发〔2022〕40号附件

北京证券交易所

市场参与者技术系统变更指南

之做市交易业务

（V1.0）

北京证券交易所

二〇二二年十月

修订历史

|  |
| --- |
| 修订历史 |
| 版本号 | 修订日期 | 修订说明 |
| V1.0 | 2022.10 | 形成文档 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

目录

[一、说明 1](#_Toc1779433007)

[二、参考文档 1](#_Toc1826143267)

[三、变动简述 1](#_Toc2017981558)

[（一） 做市商可以参与公开发行业务 1](#_Toc1540518519)

[（二） 做市商可以参与连续竞价股票交易 2](#_Toc519948926)

[四、数据接口规范修订说明 4](#_Toc589617471)

[（一） 证券信息库NQXX.DBF 4](#_Toc1485779676)

[五、清算交收与税费标准 4](#_Toc294243230)

[六、市场参与者技术系统注意事项 4](#_Toc1177484097)

[七、联系方式 5](#_Toc1912463930)

# 一、说明

为便于各市场参与者更好地理解北京证券交易所（以下简称“本所”或“北交所”）股票做市交易业务对相关技术系统的改造要求，做好技术系统的准备工作，本所对北交所做市交易业务相关技术文档进行修订，形成本指南并发布。本指南包括业务申报、行情发送、信息发送等方面的内容，清算、交收方面的内容由中国证券登记结算有限责任公司另行发布。

本次变更参考技术文档为《交易支持平台数据接口规范（V2.1）》（以下简称“数据接口规范”），未涉及内容请参考现有业务实施规则、细则和制度。

特别提示：如果业务规则、细则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。

# 二、参考文档

《交易支持平台数据接口规范（V2.1）》

# 三、变动简述

做市商可以使用做市专用证券账户参与公开发行业务、参与北交所上市公司股票的交易。本次修改内容如下：

1. 做市商可以参与公开发行业务

做市商可以以网下投资者的身份参与询价，询价与申购的要求与其他网下投资者的要求一致。

做市商可以以网上投资者的身份直接参与申购，申购的要求与其他网上投资者的要求一致。

做市商不能参与战略配售。

1. 做市商可以参与连续竞价股票交易

做市商可以参与北交所上市公司股票交易，并履行做市报价义务。

做市商申报业务类别同样为限价申报、市价申报、大宗成交确认申报，不提供做市商间互报成交确认申报。做市商只能交易其已经申请加入做市的股票。

做市商的单笔申报数量最少为100股，以1股增减，且单边累计申报最低数量应不低于1000股。

连续竞价阶段，做市商的有效报价价差应不高于2%或2个最小价格变动单位（孰高为准）。开收盘集合竞价阶段，应不高于3%或2个最小价格变动单位（孰高为准）。买卖价差的计算公式为：

报价价差=（符合最低申报数量的卖出价格-符合最低申报数量的买入价格）/符合最低申报数量的卖出价格\*100%

符合最低申报数量的卖出价格，是指订单簿中做市商的卖出申报按价格由低到高进行排列，累计申报数量达到做市商最低申报数量所对应的卖出价格。

符合最低申报数量的买入价格，是指订单簿中做市商的买入申报按价格由高到低进行排列，累计申报数量达到做市商最低申报数量所对应的买入价格。

做市商参与开盘集合竞价，应当于9:20前发布有效报价。开盘集合竞价时段，做市商有效报价参与次数应当不少于该只股票每月可交易天数的50%；

做市商参与收盘集合竞价，应当于14:58前发布有效报价。收盘集合竞价时段，做市商有效报价参与次数应当不少于该只股票每月可交易天数的70%；

连续竞价阶段，做市报价时长应当不低于连续竞价交易时间的90%。做市商成交后报价不符合有效报价要求，但在2分钟内恢复有效报价的，补充报价时间计入有效报价时长。

做市商日内回转交易可按本所要求配置。开启盘中回转交易时，盘中（包括限价及市价申报）买入的股票当日可以卖出；开启盘后回转交易时，盘后（包括全天大宗申报）买入的股票当日可以卖出，交易系统不做回转额度及次数限制；关闭盘中回转交易时，盘中（包括限价及市价申报）买入的股票当日不可卖出；关闭盘后回转交易时，盘后（包括全天大宗申报）买入的股票当日不可卖出。

对于连续竞价股票，做市商接收到的行情和普通投资者完全相同，不提供其他额外行情。

做市商参与连续竞价业务的申报不提供替换撤单。

通过证券信息库的做市商数量字段揭示当前交易日为该只证券做市的做市商数量。

证券行情的发布方式和频率不变，做市商的报价及成交与其他投资者的报价及成交统一计算。

交易公开信息的发布方式不变，做市商的报价及成交与其他投资者的报价及成交统一计算。

# 四、数据接口规范修订说明

1. 证券信息库NQXX.DBF

对于连续竞价股票，启用做市商数量，通过**XXZSSSL** （字段37：做市商数量）识别，用于当前为该只股票做市的做市商数量，值为0时表示该只证券无做市商为其做市。

# 五、清算交收与税费标准

中国结算对于北交所做市交易业务的具体规定与要求以中国结算官网发布的文档为准。

# 六、市场参与者技术系统注意事项

1. 拟开展北交所做市交易业务的做市商技术系统应支持公开发行业务和连续竞价交易业务。
2. 对于连续竞价股票，行情分析软件也应支持揭示其存在的做市商数量。
3. 做市商应根据业务规则自行控制报价价差、有效报价时长。

# 七、联系方式

|  |  |
| --- | --- |
| **联系单位/部门** | **联系电话** |
| 北京证券交易所 | 400-626-3333 |
| 深圳证券通信公司 | 0755-83182222 |
| QQ群 | 338167838 |