Data 2 上海证券交易所交易规则

信息抽取结果：

{

"id": "3.3.1.1",

"操作人": "交易参与人",

"操作": "竞价交易申报",

"时间": "9:15至9:25、9:30至11:30、13:00至15:00",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.5.1",

"操作": "处理",

"操作部分": "市价申报",

"key": "买入申报的成交价格和转为限价申报的价格",

"op": "不高于",

"key2": "买入保护限价",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.5.2",

"操作": "处理",

"操作部分": "市价申报",

"key": "卖出申报的成交价格和转为限价申报的价格",

"op": "不低于",

"key2": "卖出保护限价",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.6.1",

"value": "市价申报适用范围",

"时间": "连续竞价期间",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.8.1",

"操作": "买入",

"交易方式": "竞价交易",

"交易品种": "证券",

"key": "申报数量",

"数量": "100股（份）或其整数倍",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.8.2",

"操作": "卖出",

"交易方式": "竞价交易",

"交易品种": "证券",

"op": "不足",

"数量": "100股（份）",

"key": "一次性申报卖出",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.9.1",

"交易品种": "证券",

"key": "单笔申报最大数量",

"op": "不超过",

"数量": "100万股（份）",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.10.1",

"交易品种": "股票",

"key": "计价单位",

"value": "每股价格",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.10.2",

"交易品种": "基金",

"key": "计价单位",

"value": "每份基金价格",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.10.3",

"交易品种": "权证",

"key": "计价单位",

"value": "每份权证价格",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.10.4",

"交易品种": "存托凭证",

"key": "计价单位",

"value": "每份存托凭证价格",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.11.1",

"交易品种": "A股",

"key": "申报价格最小变动单位",

"价格": "0.01元人民币",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.11.2",

"交易品种": "基金",

"key": "申报价格最小变动单位",

"价格": "0.001元人民币",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.11.3",

"交易品种": "权证",

"key": "申报价格最小变动单位",

"价格": "0.001元人民币",

"结果": "成功"

},

{

"id": "3.3.11.4",

"交易品种": "B股",

"key": "申报价格最小变动单位",

"价格": "0.001美元",

"结果": "成功"

},

{

"id": "2.4.2.1",

"交易方式": "竞价交易方式",

"交易品种": "非基金",

"时间": "9:15至9:25",

"key": "开盘集合竞价时间",

"结果": "成功"

},

{

"id": "2.4.2.2",

"交易方式": "竞价交易方式",

"交易品种": "非基金",

"时间": "9:30至11:30、13:00至14:57",

"key": "连续竞价时间",

"结果": "成功"

},

{

"id": "2.4.2.3",

"交易方式": "竞价交易方式",

"交易品种": "非基金",

"时间": "14:57至15:00",

"key": "收盘集合竞价时间",

"结果": "成功"

},

{

"id": "2.4.2.4",

"交易品种": "基金",

"时间": "9:15至9:25",

"key": "开盘集合竞价时间",

"结果": "成功"

},

{

"id": "2.4.2.5",

"交易品种": "基金",

"时间": "9:30至11:30、13:00至15:00",

"key": "连续竞价时间",

"结果": "成功"

}

对应的规则原文：

3.3.1 本所接受交易参与人竞价交易申报的时间为每个交易日9:15至9:25、9:30至11:30、13:00至15:00。

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "证券"

and 交易操作 is "提交申报"

and 交易参与方 is "交易参与人（会员）"

and 时间 in ["9:15至9:25", "9:30至11:30", "13:00至15:00"]

then 申报接收结果 is "成功"

and 系统状态 is "正常处理"

3.3.5 市价申报内容应当包含投资者能够接受的最高买价（以下简称买入保护限价）或者最低卖价（以下简称卖出保护限价）。本所交易系统处理前款规定的市价申报时，买入申报的成交价格和转为限价申报的申报价格不高于买入保护限价，卖出申报的成交价格和转为限价申报的申报价格不低于卖出保护限价。

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "证券"

and 交易操作 is "处理市价申报"

and 交易参与方 is "交易所交易系统"

and 买卖方向 is "买入"

and 申报类型 is "市价申报"

and 成交价格 is ≤买入保护限价

then 交易有效性 is True

and 成交记录写入 is "匹配成功"

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "证券"

and 交易操作 is "处理市价申报"

and 交易参与方 is "交易所交易系统"

and 买卖方向 is "卖出"

and 申报类型 is "市价申报"

and 成交价格 is ≥卖出保护限价

then 交易有效性 is True

and 成交记录写入 is "匹配成功"

3.3.6 市价申报只适用于连续竞价期间的交易，本所另有规定的除外。

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "证券"

and 交易操作 is "提交市价申报"

and 交易参与方 is "投资者"

and 时间 not in ["连续竞价阶段"]

then 申报拦截结果 is True

and 错误信息 is "市价申报仅限连续竞价阶段"

3.3.8 通过竞价交易买入证券的，申报数量应当为100股（份）或其整数倍。卖出证券时，余额不足100股（份）的部分，应当一次性申报卖出。

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "证券"

and 交易操作 is "买入申报验证"

and 交易参与方 is "投资者"

and 申报数量 mod 100 ≠ 0

then 申报阻断结果 is True

and 提示信息 is "数量需为100整数倍"

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "证券"

and 交易操作 is "卖出申报验证"

and 交易参与方 is "投资者"

and 可卖出余额 < 100

and 申报数量 ≠ 可卖出余额

then 申报阻断结果 is True

and 提示信息 is "零碎股需一次性卖出"

3.3.9 证券交易单笔申报最大数量应当不超过100万股（份）。根据市场需要，本所可以调整证券的单笔申报最大数量。

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "证券"

and 交易操作 is "数量合规校验"

and 交易参与方 is "投资者"

and 申报数量 > 1,000,000

then 拦截信号 is True

and 错误码 is "E1003：单笔申报超限"

3.3.10 不同证券的交易采用不同的计价单位。股票为“每股价格”，基金为“每份基金价格”，权证为“每份权证价格”，存托凭证为“每份存托凭证价格”。

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 in ["股票", "基金", "权证", "存托凭证"]

and 交易操作 is "计价单位验证"

and 交易参与方 is "交易所清算系统"

and 计价单位 is {

"股票": "每股价格",

"基金": "每份基金价格",

"权证": "每份权证价格",

"存托凭证": "每份存托凭证价格"

}

then 交易结果 is "成功"

3.3.11 A股的申报价格最小变动单位为0.01元人民币，基金、权证交易的申报价格最小变动单位为0.001元人民币，B股交易的申报价格最小变动单位为0.001美元。本所可以依据股价高低，实施不同的申报价格最小变动单位。

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 in ["A股", "基金", "权证", "B股"]

and 交易操作 is "价格步长校验"

and 交易参与方 is "交易所撮合引擎"

and 申报价格最小变动单位 is {

"A股": 0.01元,

"基金": 0.001元,

"权证": 0.001元,

"B股": 0.001美元

}

then 交易结果 is "成功"

2.4.2 采用竞价交易方式的，除本规则另有规定外，每个交易日的9:15至9:25为开盘集合竞价时间，9:30至11:30、13:00至14:57为连续竞价时间，14:57至15:00为收盘集合竞价时间。基金交易，每个交易日的9:15至9:25为开盘集合竞价时间，9:30至11:30、13:00至15:00为连续竞价时间。

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "非基金"

and 交易操作 is "集合竞价时段验证"

and 交易参与方 is "交易所时间控制器"

and 集合竞价时间 is ["9:15至9:25"]

and 连续竞价时间 is ["9:30至11:30","13:00至14:57"]

and 收盘竞价时间 is ["14:57至15:00"]

then 交易结果 is "成功"

if 交易市场 is "上海证券交易所"

and 交易方式 is "竞价交易"

and 交易品种 is "基金"

and 交易操作 is "连续竞价时段验证"

and 交易参与方 is "交易所时间控制器"

and 集合竞价时间 is ["9:15至9:25"]

and 连续竞价时间 is ["9:30至11:30","13:00至15:00"]

then 交易结果 is "成功"

规则所在文档：已上传文件《2\_上海证券交易所交易规则.docx》