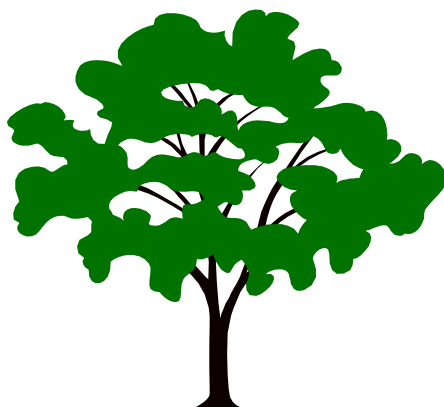




工程技术标准

深圳证券交易所 Binary 交易 数据接口规范

(Ver1. 11)



深圳证券交易所
二〇一八年十二月

文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2013-10	0.10	创建
2014-1	0.90	根据市场参与者反馈意见修订
2014-4	1.00 α	根据0.9版征求意见反馈修订
2014-6	1.00β	增加期权集中竞价交易询价申报 增加借券/还券申报 新订单增加订单限定 OrderRestrictions 字段 增加对于质押式回购交易到期成交执行报告的说明 协议交易意向申报增加联系人 Contactor 字段 股份性质 ShareType 字段更名为 ShareProperty 股票质押式回购业务成交申报增加质权人类型 PledgeeType 字段 修改网络投票密码服务申报及其执行报告的报文号 报价申报中删除单边报价方式 补充消息校验和计算范围的说明 订正部分文字错误
2014-9	1.00 γ	非交易处理平台的关闭时间由 15:00 改为 15:30; 业务拒绝消息增加回报时间、证券代码字段; 原行权业务的委托和回报消息改为期权行权业务的委托和回报消息; 新增权证行权业务的委托和回报定义; 新增备兑锁定、解锁业务的委托和回报定义; 密码服务业务从网络投票业务中拆分出来, 作为一个独立业务, 委托和回报消息格式不变, 使用新的 ApplID; 增加保证金查询业务的委托和回报消息定义; 增加协议交易报价委托及回报消息定义; 增加对回报消息中“回报交易单元”字段的说明; 增加委托拒绝原因代码表;

		<p>增加限价全额成交或撤销（限价 FOK）委托申报说明；</p> <p>增加各种市价、限价委托申报方式适用的业务范围说明；</p> <p>报价委托增加单边报价方式；</p> <p>协议交易业务和盘后定价交易业务支持融资融券交易，委托和回报增加信用标识字段；</p> <p>股票质押式回购成交申报业务类别增加“1009=股票质押式回购部分购回”类别；</p> <p>约定号域 ConfirmID（tag=664）的取值由 8 位数字字符串改为普通字符串；</p> <p>股份性质域 ShareProperty（tag=8908）的类型由 4 位字符改为 2 位字符；</p> <p>“盘后定价大宗交易业务”更名为“盘后定价交易业务”</p> <p>订正部分文字错误</p>
2015-1	1.00 δ	<p>增加转处置、垫券还券、待清偿扣划业务委托申报定义。</p> <p>增加各业务新订单是否可以撤销的说明。</p> <p>完善委托拒绝原因代码说明。</p>
2015-8	1.00	<p>增加消息体的可扩展说明。</p> <p>保证金条目类别 MarginItem 增加“2=保证金总金额”。</p> <p>增加字符串的说明。</p> <p>增加报价更新、报价撤销处理消息流程图。</p> <p>修改委托申报拒绝原因代码 20003 的含义，删除 20004。</p> <p>修改平台说明和委托申报方式说明两节中关于质押式回购业务所属平台的描述。</p> <p>增加密码服务证券代码 369991 的说明。</p> <p>增加债券质押式协议回购业务的委托和回报消息定义；</p> <p>增加分级基金实时分拆合并业务的委托和回报消息定义</p>
2016-6	1.01	<p>增加国际市场互联平台定义。</p> <p>增加港股通业务的委托和回报消息定义。</p> <p>删除备兑锁定解锁业务的委托和回报消息定义。</p>

2017-2	1.02	<p>股票质押式回购成交申报业务类别增加“1010=股票质押式回购违约处置撤销”类别；</p> <p>股票质押式回购业务成交申报增加字段：资金用途类型 InvestmentType 、</p> <p>预警线 AlertRatio 、平仓线 SettlementRatio；</p> <p>资产管理计划份额转让业务成交申报增加字段：本方交易账户 ExecutingTrader、</p> <p>对手方交易账户 CounterpartyExecutingTrader。</p>
2017-7	1.03	<p>增加“通信版本号”定义；</p> <p>协议交易业务成交申报、成交确认报文启用“成交申报业务子类别（TrdSubType）”字段，用于表示是否为受限股份转让</p> <p>增加拒绝原因“20079减持额度不足”</p>
2018-5	1.04	<p>增加成交请求申报模式；</p> <p>修改成交报告申报模式；</p> <p>增加债券质押式三方回购交易、出入库业务，修改成交申报、成交申报响应、成交确认消息报文；</p> <p>增加债券质押式协议回购到期续做指令；</p> <p>增加委托申报拒绝原因代码；</p> <p>附件增加新订单及成交申报的处理回报说明</p>
2018-7	1.10	<p>除业务拒绝外的其他回报消息增加分区字段；</p> <p>回报同步消息、回报结束消息增加分区字段；</p> <p>增加平台信息消息；</p> <p>修改应用层消息恢复流程；</p>
2018-12	1.11	<p>（本文档中橙色修订部分）</p> <p>修改债券质押式回购业务交易时间；</p> <p>修改非交易处理平台及债券质押式回购质押解押申报业务交易时间</p>

名词释义

词汇缩写	含义
TGW	Trade GateWay 交易网关 深圳证券交易所交易系统提供给市场参与者的接入点。
OMS	Order Management System 订单管理系统
STEP	Securities Trading Exchange Protocol 证券交易数据交换协议。
FIX	Financial Information Exchange 金融信息交换协议。

目 录

一、 前言	1
二、 会话机制	1
2.1 连接	1
2.1.1 通信版本号	1
2.1.2 会话	1
2.1.3 IP 地址和 Port	1
2.1.4 安全	1
2.2 会话管理	1
2.2.1 建立会话	1
2.2.2 心跳包和测试请求	2
2.2.3 终止会话	2
2.2.4 重建会话	2
三、 服务说明	2
3.1 平台说明	2
3.2 委托申报方式说明	4
3.3 委托消息处理流程	7
3.4 新订单处理消息流图	7
3.4.1 新订单消息流图	8
3.4.2 撤单请求消息流图	10
3.5 报价处理消息流图	11
3.5.1 新报价处理消息流图	11
3.5.2 报价更新处理消息流图	11
3.5.3 报价撤销处理消息流图	15
3.6 询价处理消息流图	16
3.6.1 投资者申报处理	16
3.6.2 做市商接收询价处理	17
3.7 意向申报处理消息流图	18
3.8 成交申报处理消息流图	18
3.8.1 协议配对申报模式 (one party report for matching)	19
3.8.1.1 新成交申报处理	20
3.8.1.2 撤销成交申报	21
3.8.2 成交报告申报模式 (two party report)	22
3.8.2.1 新成交申报处理	22
3.8.2.2 撤销成交申报	24
3.8.3 成交请求申报模式 (one party report for pass through)	26
3.8.3.1 新成交申报处理	27
3.8.3.2 撤销成交申报	28
3.9 转托管处理消息流图	29
3.10 网络投票处理消息流图	30
3.11 密码服务处理消息流图	31
3.12 保证金查询处理消息流图	32

3.13 应用层消息恢复.....	32
3.14 回报交易单元.....	34
四、 消息定义.....	34
4.1 消息结构.....	34
4.1.1 消息头.....	34
4.1.2 消息尾.....	34
4.2 管理消息.....	35
4.2.1 登录消息 (Logon)	35
4.2.2 注销消息 (Logout)	35
4.2.3 心跳消息 (Heartbeat)	36
4.3 业务消息-新订单处理	36
4.3.1 新订单 (New Order)	36
4.3.1.1 现货集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100101)	38
4.3.1.2 质押式回购交易业务新订单扩展字段 (100201)	39
4.3.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100401)	40
4.3.1.4 协议交易业务新订单扩展字段 (100501)	40
4.3.1.5 盘后定价交易业务新订单扩展字段 (100601)	41
4.3.1.6 转融通证券出借业务新订单扩展字段 (100701)	41
4.3.1.7 期权行权业务新订单扩展字段 (101601)	41
4.3.1.8 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段 (101701)	41
4.3.1.9 要约收购业务新订单扩展字段 (101801)	41
4.3.1.10 转处置业务新订单扩展字段 (102701)	42
4.3.1.11 垫券还券业务新订单扩展字段 (102801)	42
4.3.1.12 待清偿扣划业务新订单扩展字段 (102901)	42
4.3.1.13 港股通业务新订单扩展字段 (106301)	42
4.3.2 撤单请求 (Order Cancel Request)	43
4.3.3 撤单失败响应 (Cancel Reject)	43
4.3.4 订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)	44
4.3.4.1 现货集中竞价交易业务执行报告扩展字段 (200102)	47
4.3.4.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200202)	47
4.3.4.3 期权集中竞价交易业务执行报告扩展字段 (200402)	47
4.3.4.4 协议交易业务执行报告扩展字段 (200502)	48
4.3.4.5 盘后定价交易业务执行报告扩展字段 (200602)	48
4.3.4.6 转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200702)	48
4.3.4.7 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段 (201202)	48
4.3.4.8 期权行权业务执行报告扩展字段 (201602)	49
4.3.4.9 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段 (201702)	49
4.3.4.10 要约收购业务执行报告扩展字段 (201802)	49
4.3.4.11 转处置券业务执行报告扩展字段 (202702)	49
4.3.4.12 垫券还券业务执行报告扩展字段 (202802)	49
4.3.4.13 待清偿扣划业务执行报告扩展字段 (202902)	50
4.3.4.14 分级基金实时分拆合并业务执行报告扩展字段 (203102)	50
4.3.4.15 港股通业务执行报告扩展字段 (206302)	50

4.3.5	订单成交执行报告 (Execution Report)	51
4.3.5.1	现货集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段 (200115)	52
4.3.5.2	质押式回购交易业务成交执行报告扩展字段 (200215)	53
4.3.5.3	期权集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段 (200415)	53
4.3.5.4	协议交易业务执行报告扩展字段 (200515)	53
4.3.5.5	盘后定价交易业务执行报告扩展字段 (200615)	53
4.3.5.6	转融通证券出借业务成交执行报告扩展字段 (200715)	53
4.4	业务消息-报价处理	54
4.4.1	报价 (Quote)	54
4.4.1.1	期权集中竞价交易业务报价扩展字段 (100405)	55
4.4.2	报价状态回报 (Quote Status Report)	55
4.4.2.1	期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段 (200406)	56
4.5	业务消息-询价申报处理	57
4.5.1	询价申报 (Quote Request)	57
4.5.1.1	期权集中竞价交易业务询价扩展字段 (100417)	58
4.5.2	询价申报接受响应 (Quote Request Ack)	58
4.5.2.1	期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段 (200417)	58
4.5.3	询价申报拒绝响应 (Quote Request Reject)	59
4.5.3.1	期权集中竞价交易业务询价申报拒绝响应扩展字段 (200418)	59
4.6	业务消息-意向申报处理	60
4.6.1	意向申报 (Indication of Interest)	60
4.6.1.1	协议交易意向申报扩展字段 (100509)	61
4.6.2	意向申报响应 (Quote Response)	61
4.6.2.1	协议交易意向申报响应扩展字段 (200510)	62
4.7	业务消息-成交申报处理	62
4.7.1	成交申报 (Trade Capture Report)	62
4.7.1.1	协议交易业务成交申报扩展字段 (100503)	66
4.7.1.2	转融通证券出借业务成交申报扩展字段 (100703)	66
4.7.1.3	资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段 (100803)	67
4.7.1.4	股票质押式回购业务成交申报扩展字段 (100903)	67
4.7.1.5	约定购回业务成交申报扩展字段 (101003)	68
4.7.1.6	质押式报价回购业务成交申报扩展字段 (101103)	69
4.7.1.7	债券质押式协议回购业务成交申报扩展字段 (103003)	69
4.7.1.8	债券质押式三方回购交易业务成交申报扩展字段 (103203)	69
4.7.2	成交申报响应 (Trade Capture Report Ack)	71
4.7.3	转发成交申报 (Trade Capture Report)	73
4.7.3.1	债券质押式三方回购交易业务转发成交申报扩展字段 (203220)	74
4.7.4	成交确认 (Trade Capture Report)	75
4.7.4.1	协议交易业务成交确认扩展字段 (200503)	76
4.7.4.2	转融通证券出借业务成交确认扩展字段 (200703)	77
4.7.4.3	债券质押式协议回购业务成交确认扩展字段 (203003)	77
4.7.4.4	债券质押式三方回购交易业务成交确认扩展字段 (203203)	77
4.8	业务消息-转托管处理	78

4.8.1	注册 (Designation)	78
4.8.2	注册执行报告 (Designation Report)	79
4.9	业务消息-网络投票处理	80
4.9.1	投票 (Evote)	80
4.9.2	投票执行报告 (Evote Report)	81
4.10	业务消息-密码服务处理	82
4.10.1	密码服务 (Password Service)	82
4.10.2	密码服务执行报告 (Password Service Report)	83
4.11	业务消息-保证金查询处理	83
4.11.1	保证金查询 (Margin Query)	83
4.11.2	保证金查询结果 (Margin Query Result)	84
五、	其它消息	85
5.1	业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT)	85
5.2	回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION)	86
5.3	平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO)	86
5.4	回报结束消息 (REPORT FINISHED)	87
5.5	平台信息消息 (PLATFORM INFO)	88
六、	数据字典	88
6.1	数据类型	88
6.2	会话层域定义	89
6.3	业务层域定义	90
6.4	委托申报拒绝原因代码	101
6.5	联交所拒绝原因代码	107
七、	附件	108
7.1	新订单 (NEW ORDER) 处理流程说明	108
7.1.1	申报新订单并产生成交	108
7.1.2	撤销尚未产生成交的新订单	109
7.1.3	撤销已部分成交的新订单	109
7.1.4	撤销已全部成交的新订单	110
7.1.5	撤销不存在的新订单	110
7.2	成交申报 (TCR) 处理流程说明	110
7.2.1	协议配对模式	110
7.2.1.1	申报新成交申报	110
7.2.1.2	撤销尚未配对成功的成交申报	111
7.2.1.3	撤销已配对成功的成交申报	112
7.2.1.4	撤销已被拒绝的成交申报	112
7.2.1.5	撤销不存在的成交申报	113
7.2.2	成交报告申报模式	113
7.2.2.1	申报新成交申报	113
7.2.2.2	撤销已接受的成交申报	114
7.2.2.3	撤销已被拒绝的成交申报	114
7.2.2.4	撤销不存在的成交申报	115
7.2.3	成交请求申报模式	115

7.2.3.1	申报新成交申报.....	115
7.2.3.2	撤销尚未配对成功的成交申报.....	117
7.2.3.3	撤销已配对成功的成交申报.....	117
7.2.3.4	撤销已被拒绝的成交申报.....	119
7.2.3.5	撤销不存在的的成交申报.....	119

深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范

一、前言

本接口规范提供给会员和以 DMA 方式接入的机构投资者，用以指导开发以 Binary 协议接入深圳证券交易所（以下简称深交所）新一代交易系统（即第五版交易系统）提交订单并获取执行报告。本接口规范描述内容包括可开展的业务、必要的运行指导以及详细的数据交换格式。

文档所采用的术语、消息内容、以及消息流描述与 STEP 交易数据接口规范基本一致，可以互为参考。

二、会话机制

2.1 连接

2.1.1 通信版本号

本版接口规范对应的通信版本号为：1.10，在登录消息（Logon）的 DefaultAppVerID 字段应填写该通信版本号，具体填写方式见“会话层域定义”一节。

2.1.2 会话

接入用户通过会话将自身的订单管理系统（简称“OMS”）连接到交易网关（简称“TGW”）。该连接为标准的 TCP/IP 点对点连接。

2.1.3 IP 地址和 Port

交易网关（TGW）按每个平台（平台描述见“服务说明”章节）提供了一个交易服务端口供订单管理系统（OMS）接入。每个交易网关每个平台只能建立一个 TCP/IP 连接，每一个连接只能对应一个会话。

2.1.4 安全

交易网关和订单管理系统必须位于同一个安全网络之中，交易网关和订单管理系统之间传输的数据是非加密的，数据传输安全由接入用户网络保证。

2.2 会话管理

2.2.1 建立会话

会话建立过程：

1. 订单管理系统首先建立一个到交易网关的 TCP/IP 连接，然后发送一个 Logon 消息给交易网关。
2. 如果交易网关验证订单管理系统有权登录，那么交易网关会返回 Logon 消息给订单管理系统，作为一个登录消息的确认，表示本次会话登录成功。

3. 如果订单管理系统登录验证失败,那么交易网关会返回 Logout 消息给订单管理系统,表示本次会话登录失败。
4. 订单管理系统发送 Logon 消息后,如果交易网关没有在适当的时间间隔里作回应,则可以关闭连接,并在等待一段时间后再次尝试连接。
5. 如果订单管理系统断线或收到交易网关的 Logout 消息,也应该等待一段时间后再次尝试连接。

2.2.2 心跳包和测试请求

为了交易网关和订单管理系统通信的双方能够实时监测通信链路状态,要求通信双方在数据空闲时互相发送心跳包,当一方没有接收到数据包的时间超过两倍的心跳间隔时,则可认为是数据链路发生故障,接收方可以断开此异常链接。

当订单管理系统登录到交易网关时,订单管理系统应在登录消息中指定心跳间隔参数(单位为秒)。

在一个心跳间隔时间内,如果交易网关没有需要向订单管理系统发送的数据,那么交易网关会向订单管理系统发送一个心跳消息,以保证两条消息之间的时间间隔不会超过设定的心跳间隔;同样,订单管理系统必要时也应该发送心跳消息来保证交易网关收到的连续两条消息之间的时间间隔不超过心跳间隔时间。

订单管理系统也可以采用类似的检测机制对交易网关和订单管理系统之间的连接情况进行检测。

2.2.3 终止会话

订单管理系统和交易网关都能通过发送 Logout 消息要求终止会话。对方接收到 Logout 消息请求后,会发送一条 Logout 消息回应,发起方收到 Logout 消息回应后,终止连接;如果对方没有在适当的时间间隔里作回应,则可终止连接。

2.2.4 重建会话

如果会话被终止,订单管理系统可以通过登录消息重建会话。

重建会话后,订单管理系统应通过应用层规则进行下行数据同步。

三、 服务说明

3.1 平台说明

新一代交易系统按业务划分为多个平台,每个平台可以有各自独立的开闭市时间设置,市场参与者需要根据交易网关下发的各个平台的当前状态信息来控制各平台委托申

报的开始和停止。

各平台处理的业务划分如下表所示：

表 0-1 各类业务所属业务平台划分

平台	业务种类	委托申报时间
现货集中竞价交易平台	现货集中竞价交易	9:15-9:25
	债券分销	9:30-11:30
		13:00-15:00
综合金融服务平台 (原综合协议交易平台)	协议交易	9:15-11:30 13:00-15:30 特别地，对于质押式回购交易： 9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:30
	盘后定价交易	
	转融通证券出借	
	资产管理计划份额转让	
	股票质押式回购	
	约定购回	
	质押式报价回购	
	质押式回购交易	
	债券质押式协议回购	
	债券质押式三方回购交易	
	债券质押式三方回购出入库	
非交易处理平台	ETF 实时申购赎回	9:15-11:30 13:00-15:00 特别地，对于债券质押式回购质押解押申报业务： 9:15-11:30 13:00-15:30
	网上发行认购 (包括 IPO, 增发, LOF 发行, 可转债申购发行)	
	配股认购	
	债券转股回售	
	期权行权	
	开放式基金申购赎回	
	要约收购	
	质押式回购质押解押	

	转托管	
	网络投票（含密码服务）	
	权证行权	
	保证金查询	
	转处置	
	垫券还券	
	待清偿扣划	
	分级基金实时分拆合并（暂未启用）	
衍生品集中竞价交易平台	期权集中竞价交易	9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:00
国际市场互联平台	港股通	8:55-16:20

3.2 委托申报方式说明

用于申报委托的消息有多种类型，接口规范根据每类业务的特性，规定了相应的委托申报的消息类型。

委托申报消息类型有：

表 0-2 委托申报消息类型

消息类型	报文号	说明
New Order	10xx01	新订单
Quote	10xx05	报价
Quote Request	10xx17	询价
IOI	10xx09	意向申报
Trade Capture Report	10xx03	成交申报
Designation	102099	注册（转托管）
EVote	102197	网络投票
Password Service	102489	密码服务
Margin Query	102587	保证金查询

不同业务可能使用同一种消息类型进行委托申报，但是申报的要素可能有差别，因此同一种消息类型按照业务类型又分为多种报文，以报文号加以区别。

同一业务可能有多种委托申报类型，因此在所有委托申报消息中都存在一个 ApplID

字段，市场参与者在申报委托时，需要按接口规范的要求在委托中填写委托对应的 ApplID。

各类业务的委托申报的报文号及 ApplID 如下表所示：

表 0-3 委托申报消息类型与应用标识列表

委托申报类型	申报消息类型 MsgType	应用标识 ApplID	所属平台
现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易订单申报	100101	010	现货集中竞价交易平台
质押式回购交易订单申报	100201	020	综合金融服务平台
债券分销订单申报	100301	030	现货集中竞价交易平台
期权集中竞价交易订单申报	100401	040	衍生品集中竞价交易平台
期权集中竞价交易报价申报	100405	041	
期权集中竞价交易询价申报	100417	042	
协议交易意向申报	100509	050	综合金融服务平台
协议交易定价申报	100501	051	
协议交易点击成交申报	100501	052	
协议交易双方配对成交申报	100503	053	
协议交易报价申报	100505	054	
以收盘价交易的盘后定价交易申报	100601	060	综合金融服务平台
以成交量加权平均价交易的盘后定价交易申报	100601	061	
转融通证券出借非约定申报	100701	070	综合金融服务平台
转融通证券出借约定申报	100703	071	
资产管理计划份额转让	100803	080	综合金融服务平台
股票质押式回购	100903	090	综合金融服务平台
约定购回	101003	100	综合金融

			服务平台
质押式报价回购	101103	110	综合金融服务平台
ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回)	101201	120	非交易处理平台
网上发行认购申报	101301	130	非交易处理平台
配股认购申报	101401	140	非交易处理平台
债券转股申报	101501	150	非交易处理平台
债券回售申报	101501	151	
期权行权申报	101601	160	非交易处理平台
开放式基金申购赎回申报	101701	170	非交易处理平台
要约收购预受要约申报	101801	180	非交易处理平台
要约收购解除预受要约申报	101801	181	非交易处理平台
质押式回购质押申报	101901	190	非交易处理平台
质押式回购解押申报	101901	191	
转托管	102099	200	非交易处理平台
投票	102197	210	非交易处理平台
黄金 ETF 实物申购赎回申报 (该委托只能由上海黄金交易所申报)	102201	220	非交易处理平台
权证行权申报	102301	230	非交易处理平台
密码服务激活	102489	240	非交易处理平台
密码服务挂失	102489	241	
保证金查询	102587	250	非交易处理平台

转处置扣券申报	102701	270	非交易处 理平台
转处置还券申报	102701	271	
垫券申报	102801	280	非交易处 理平台
还券申报	102801	281	
待清偿扣划客户申报	102901	290	非交易处 理平台
待清偿扣划自营申报	102901	291	
债券质押式协议回购申报	103003	300	综合金融 服务平台
分级基金实时分拆申报	103101	310	非交易处 理平台
分级基金实时合并申报	103101	311	
港股通申报	106301	630	国际市 场互联 平台
债券质押式三方回购交易申报	103203	320	综合金融 服务平台
债券质押式三方回购入库申报	103301	330	
债券质押式三方回购出库申报	103301	331	

注：ApplID 包含大写字母 A-Z 和数字 0-9，ApplID 的前两位表示业务代码，第三位表示该业务下的委托申报代码。

3.3 委托消息处理流程

对于 OMS 申报的委托，交易系统会首先作一些基本合法性检查，比如委托中的证券代码是否存在、是否到达委托申报时间等等。

如果检查未通过，交易系统会通过 Business Reject (MsgType=4) 消息通知 OMS 委托被拒绝。

如果通过基本合法性检查，交易系统会根据委托消息类型的不同给 OMS 发出相应的回报消息，具体参见 3.4-3.9 节。

3.4 新订单处理消息流程图

对于 OMS 提交的新订单，交易系统以执行报告消息作为响应。执行报告消息分为两类报文，一类报文用于新订单的确认响应、撤单成功时的响应以及委托被交易系统自动撤销时（比如市价委托剩余自动撤销）的响应 (MsgType=20xx02)，一类报文用于新订单达成成交时的响应 (MsgType=20xx15)。

对于 ETF 实时申购赎回、行权等非交易订单，只会回报上述第一类执行报告。

下面列出新订单相关各类消息的处理流程，其中相关各类消息中具体字段取值参见附件 7.1 新订单 (New Order) 处理回报说明。

3.4.1 新订单消息流图

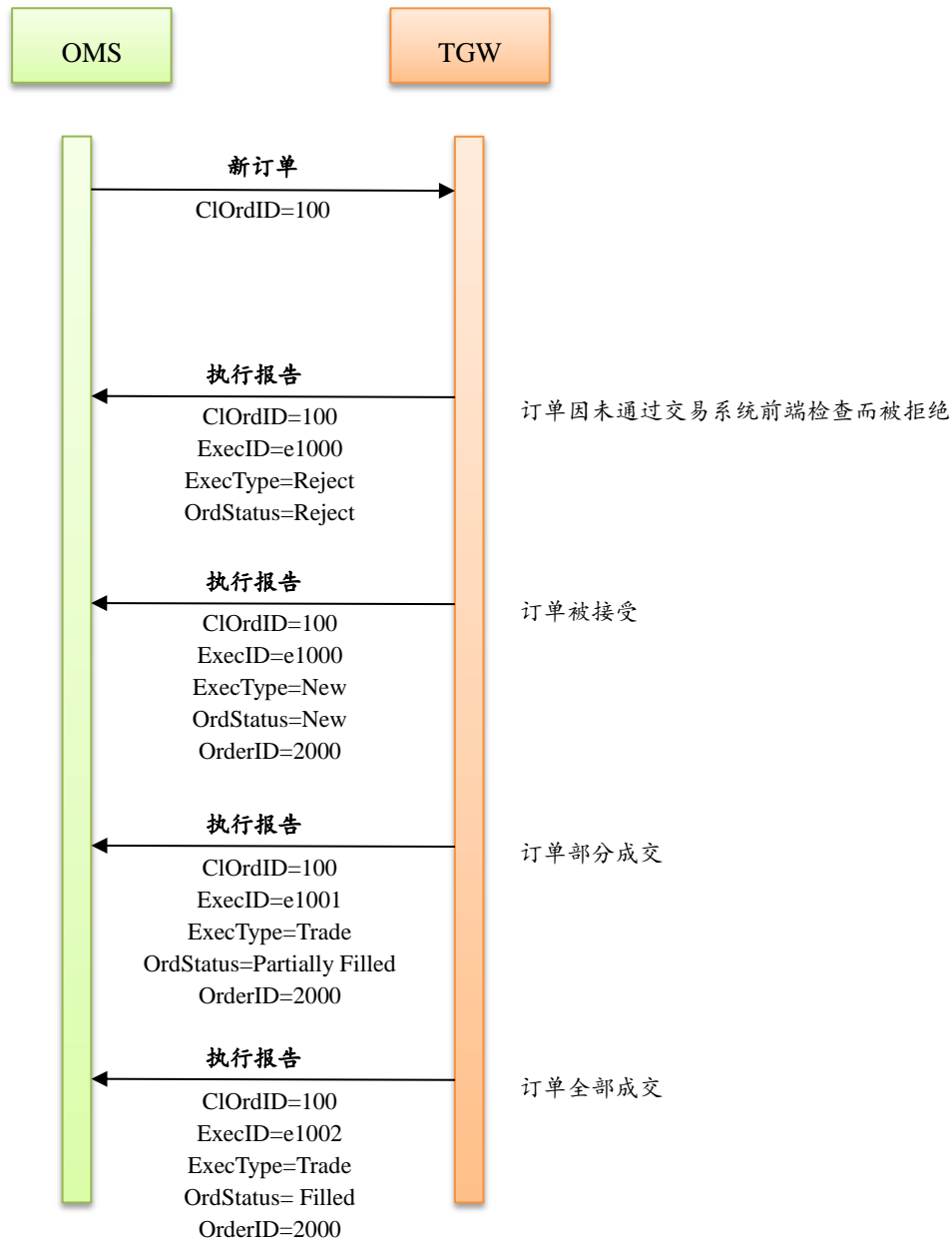


图 0-1 新订单消息流示意图

交易系统对于收到的每一笔新订单，都会立即给出订单被接受（ExecType=New）或拒绝（ExecType=Reject）的确认执行报告(MsgType=20xx02)；对于交易类业务，订单后续达成成交的还会继续给出成交（ExecType=Trade）执行报告(MsgType=20xx15)；对于非交易类业务，一般在订单确认时即完成处理，不会有后续的成交执行报告。OMS 申报各业务新订单收到的执行报告类型如下：

表 0-4 订单执行报告类型列表

应用标识 ApplID	说明	确认执行报告	成交执行报告
010	现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易申报	●	●
020	质押式回购交易申报	●	●
030	债券分销申报	●	●
040	期权集中竞价交易申报	●	●
051	协议交易定价申报	●	●
052	协议交易点击成交申报	●	●
060	以收盘价交易的盘后定价交易申报	●	●
061	以成交量加权平均价交易的盘后定价交易申报	●	●
070	转融通证券出借非约定申报	●	●
120	ETF 实时申购赎回申报	●	
130	网上发行认购申报	●	
140	配股认购申报	●	
150	债券转股申报	●	
151	债券回售申报	●	
160	期权行权申报	●	
170	开放式基金申购赎回申报	●	
180	要约收购预受要约申报	●	
181	要约收购解除预受要约申报	●	
190	质押式回购质押申报	●	
191	质押式回购解押申报	●	
230	权证行权申报	●	
270	转处置扣券申报	●	
271	转处置还券申报	●	
280	垫券申报	●	
281	还券申报	●	
290	待清偿扣划客户申报	●	
291	待清偿扣划自营申报	●	
310	分级基金实时分拆	●	
310	分级基金实时合并	●	

630	港股通新订单申报	●	●
330	债券质押式三方回购入库申报	●	
331	债券质押式三方回购出库申报	●	

3.4.2 撤单请求消息流图

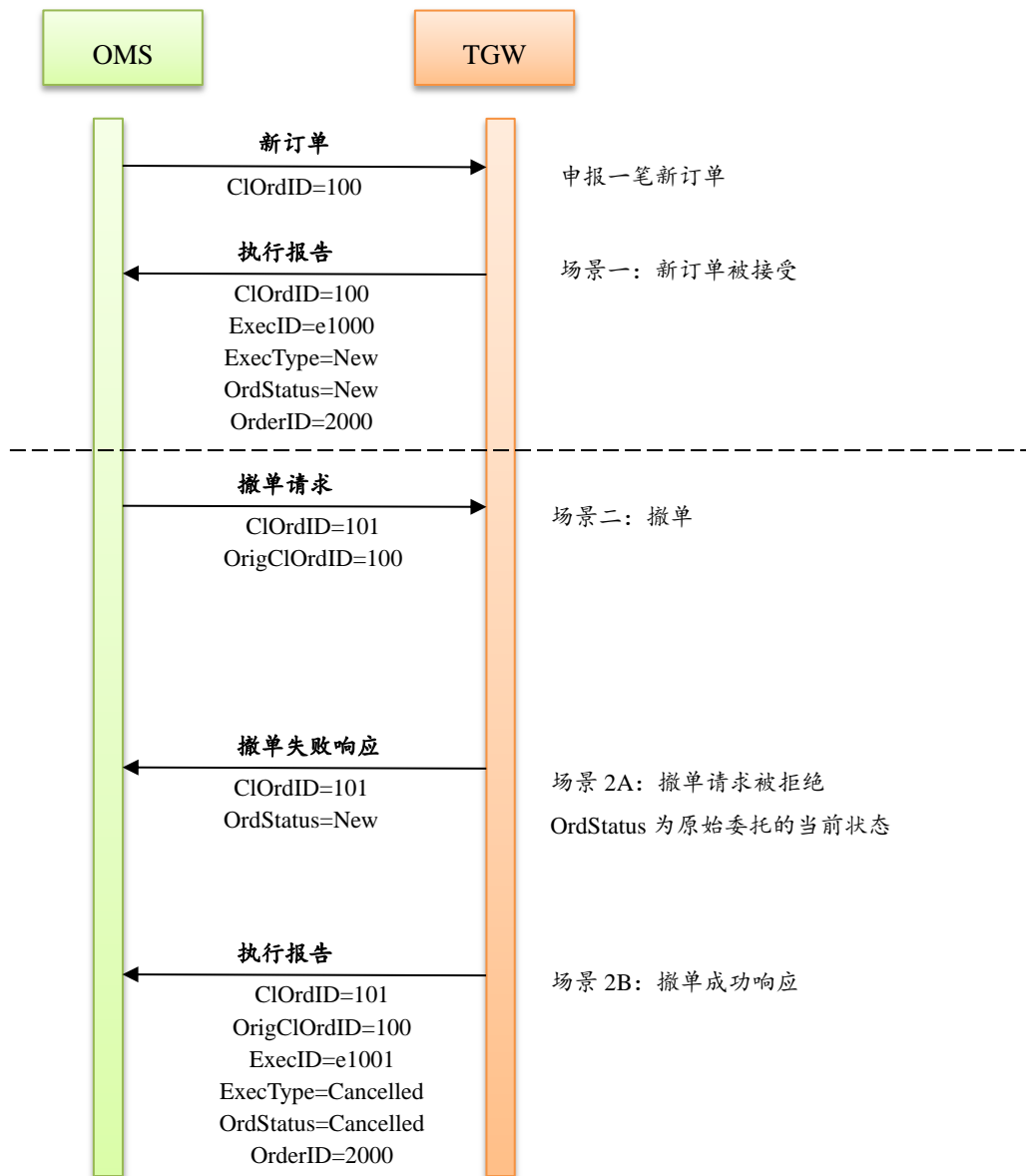


图 0-2 撤单请求消息流示意图

3.5 报价处理消息流图

3.5.1 新报价处理消息流图

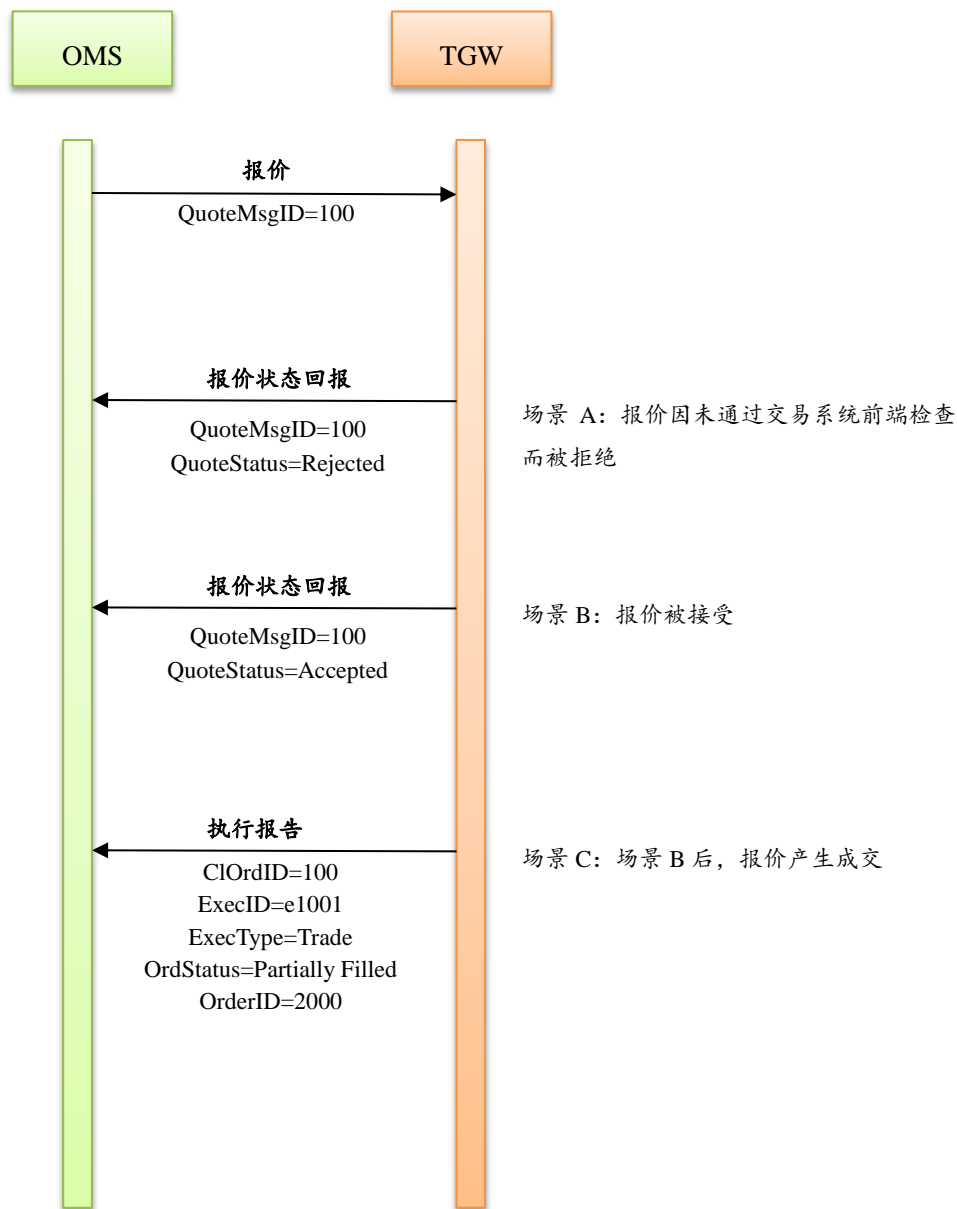


图 0-3 新报价处理消息流示意图

3.5.2 报价更新处理消息流图

- 情形一：更新双边报价，如图 3-4 所示
- 情形二：更新单边报价，价格没有锁价或倒挂，如图 3-5 所示
- 情形三：更新单边报价，价格出现锁价或倒挂，如图 3-6 所示

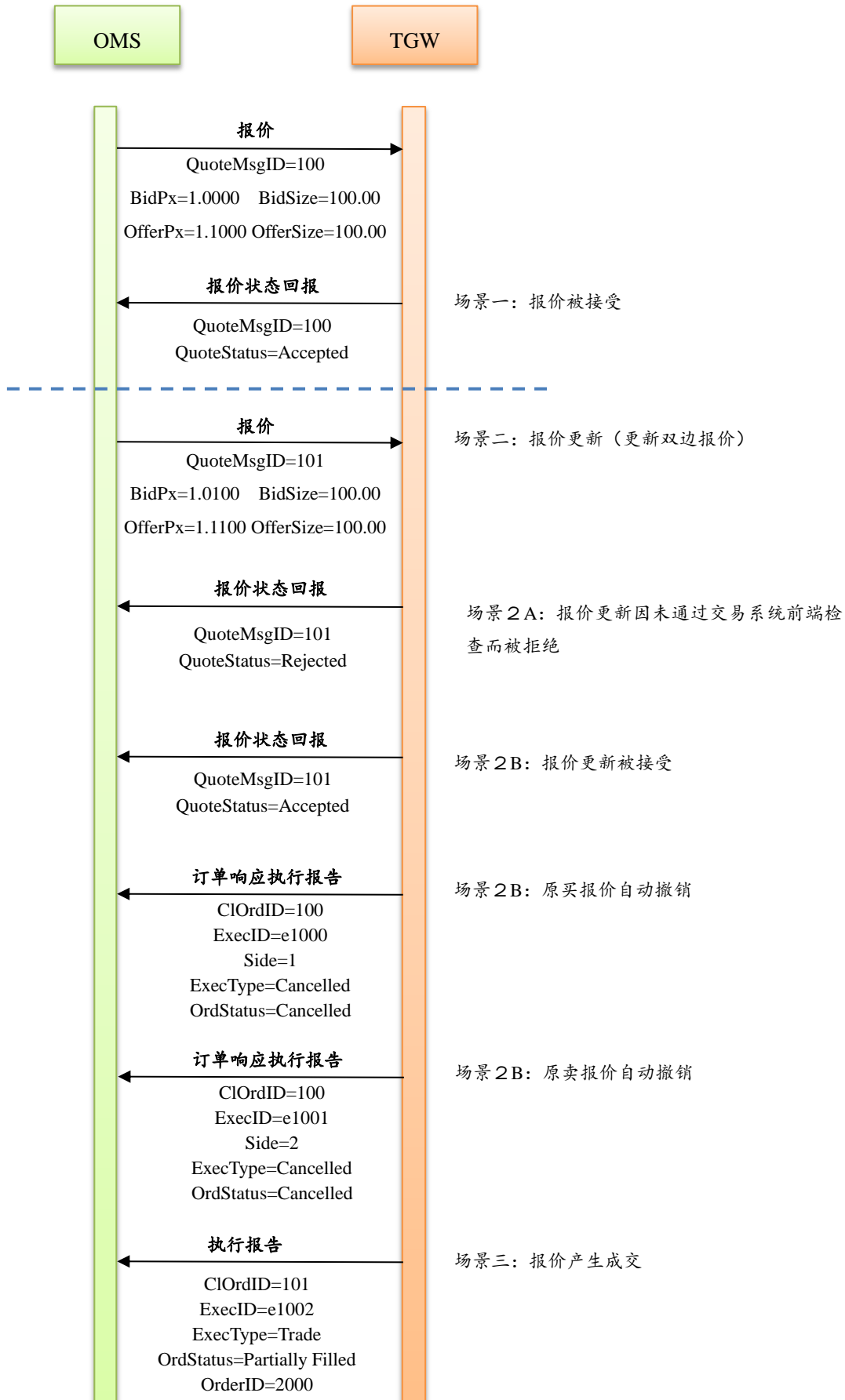


图 0-4 更新双边报价处理消息流示意图

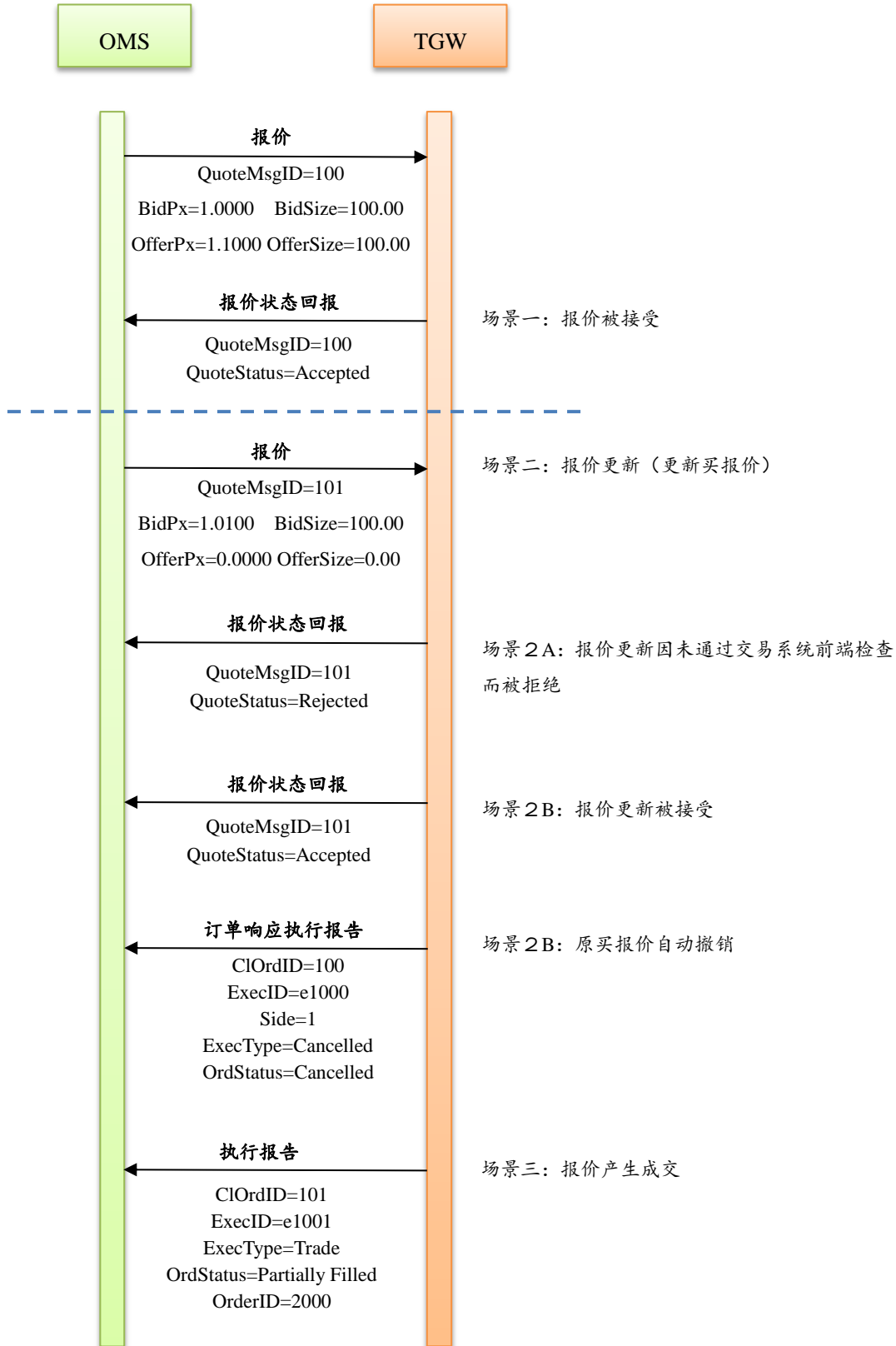


图 0-5 更新单边报价（情形二）处理消息流示意图

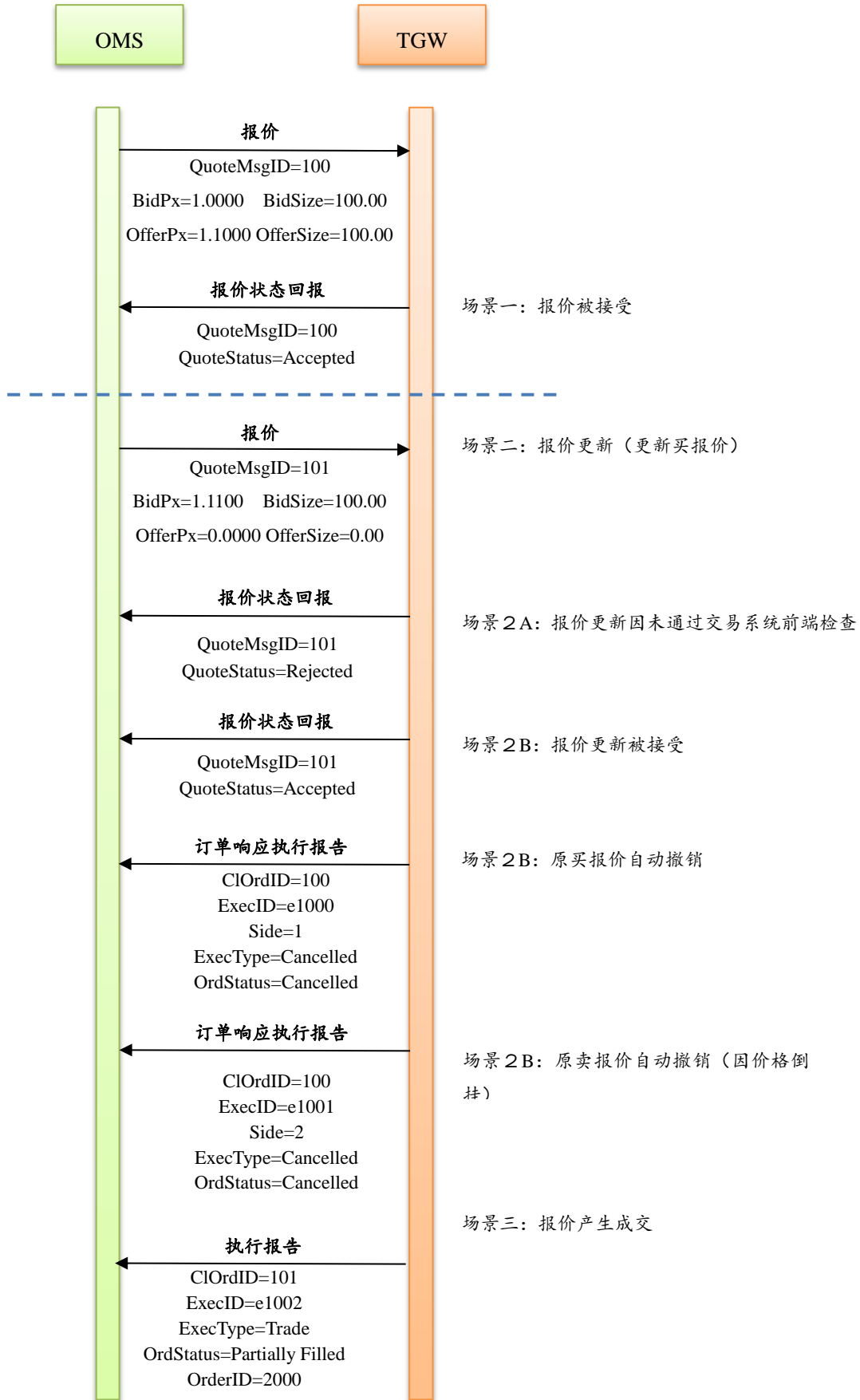


图 0-6 更新单边报价（情形三）处理消息流示意图

3.5.3 报价撤销处理消息流图

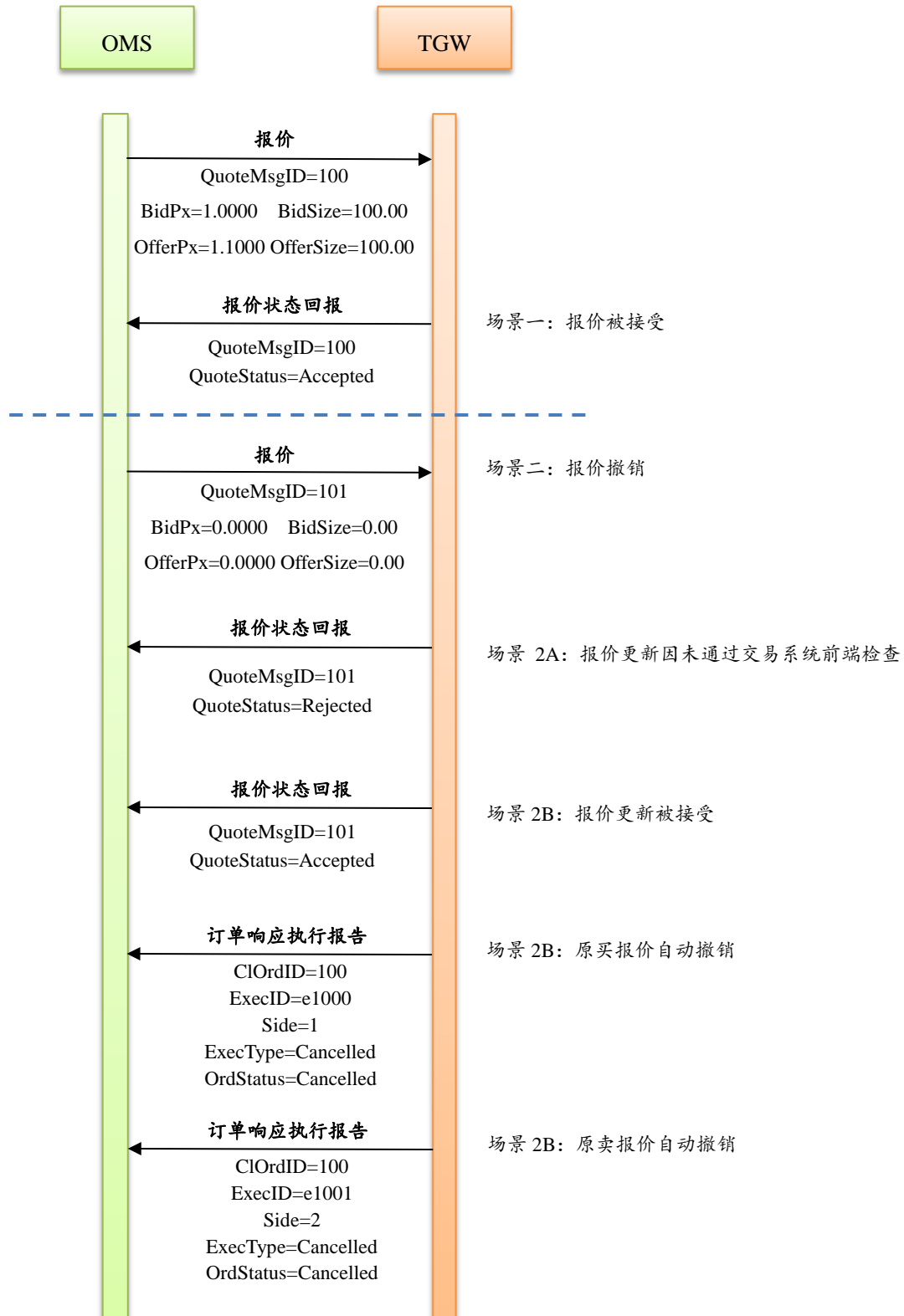


图 0-7 报价撤销处理消息流示意图

3.6 询价处理消息流图

3.6.1 投资者申报处理

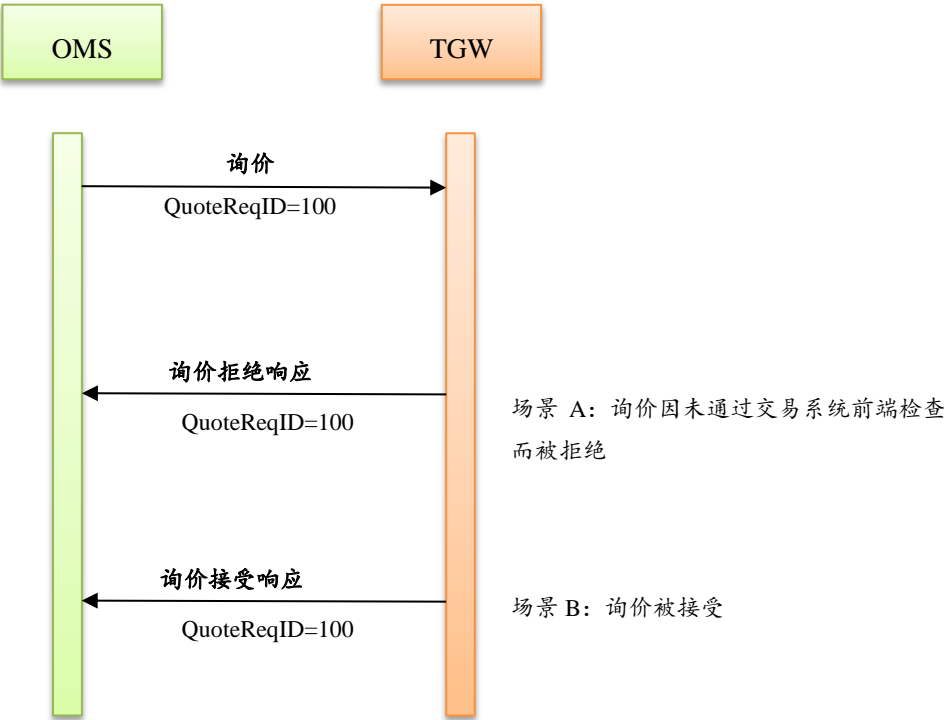


图 0-8 投资者申报询价处理消息流示意图

3.6.2 做市商接收询价处理

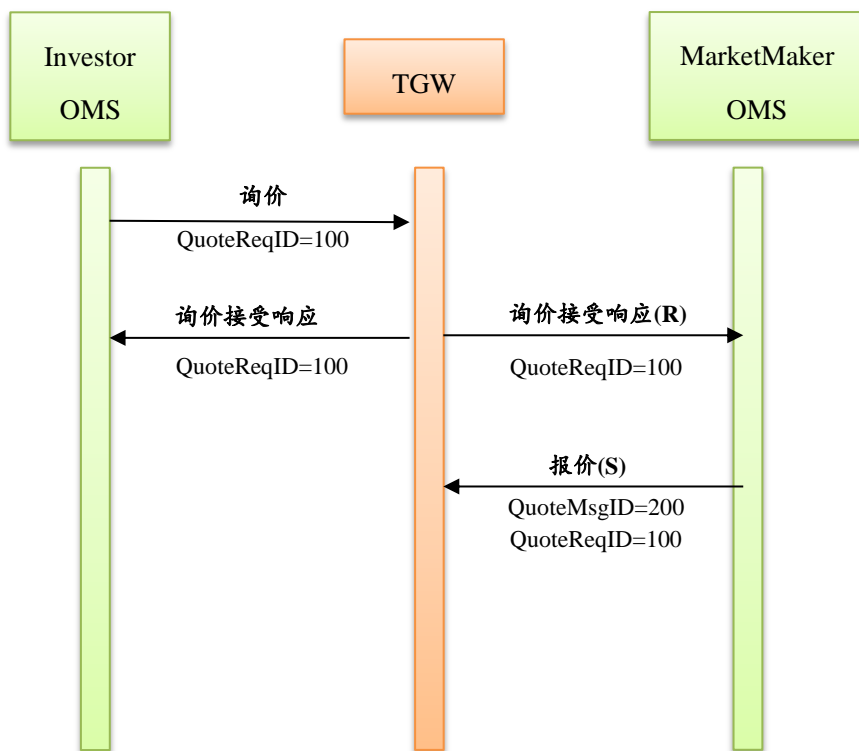


图 0-9 做市商接收询价处理消息流示意图

3.7 意向申报处理消息流图

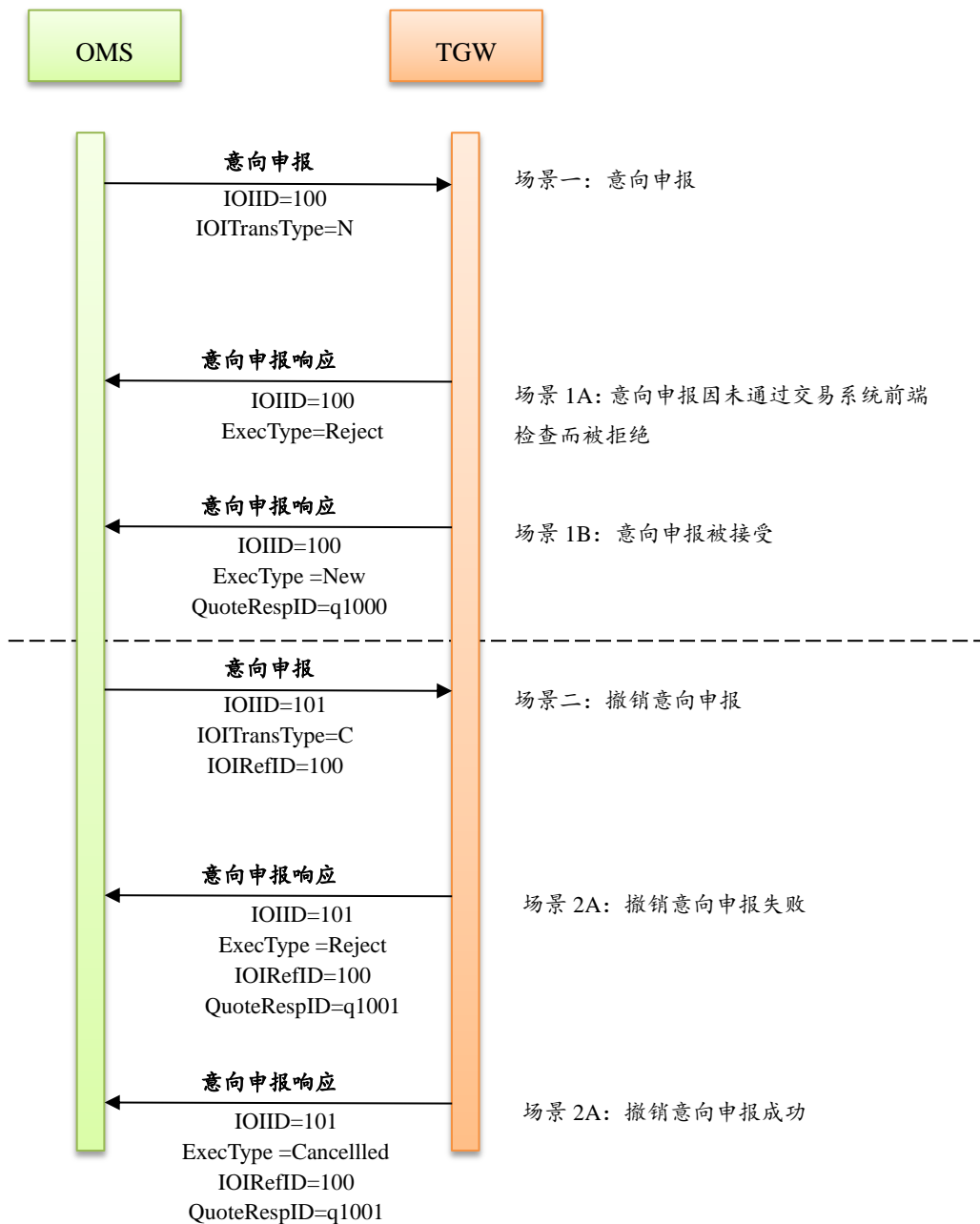


图 0-10 意向申报处理消息流示意图

3.8 成交申报处理消息流图

下面列出成交申报相关各类消息的处理流程，其中相关各类消息中具体字段取值参见附件 7.2 节成交申报（TCR）处理回报说明。

3.8.1 协议配对申报模式 (one party report for matching)

大宗交易等多种协议交易业务的成交申报采用 “协议配对申报模式 (one party report for matching)”，即买卖双方各报一笔，深交所交易系统配对。

3.8.1.1 新成交申报处理

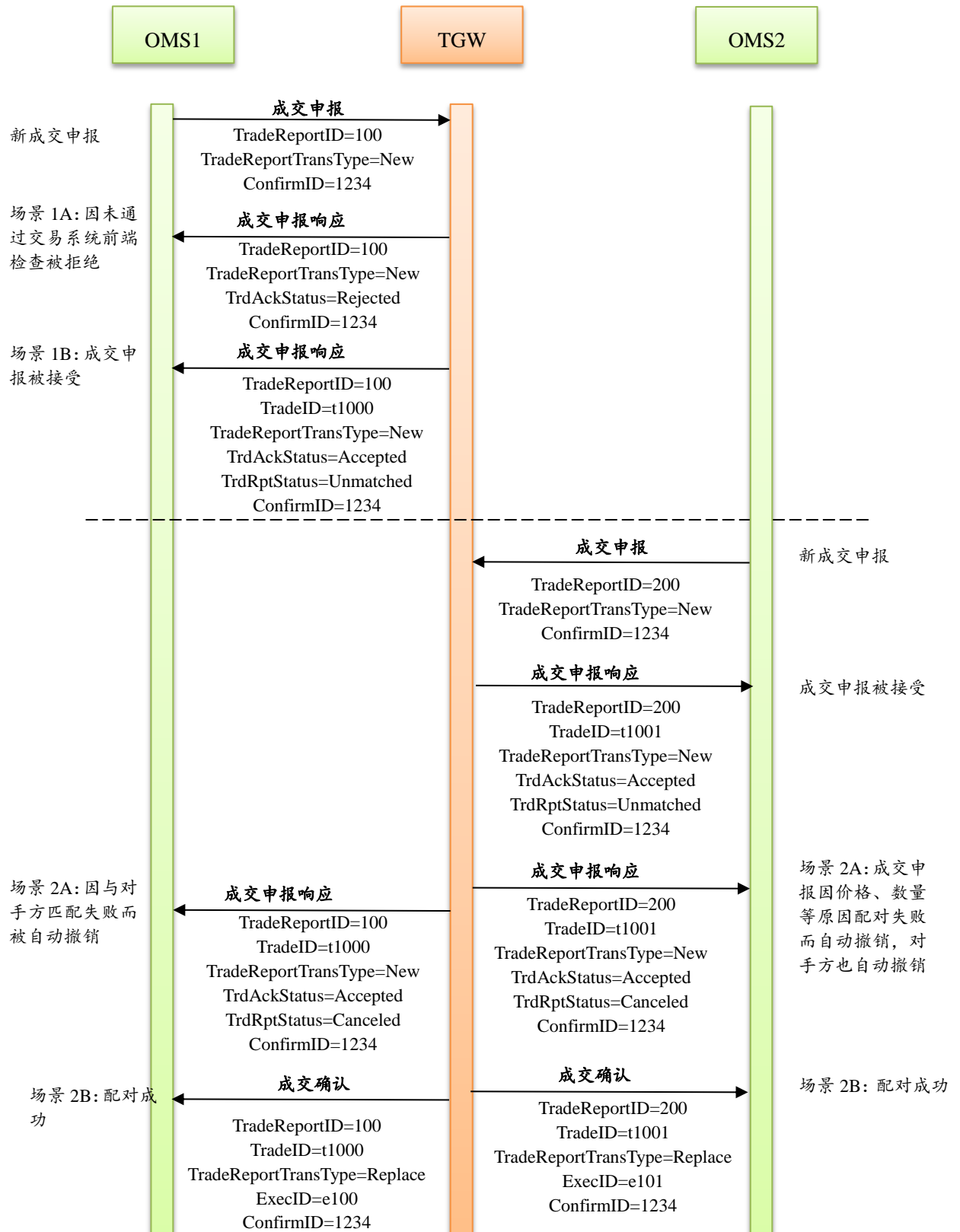


图 0-11 新成交申报处理消息流示意图

3.8.1.2 撤销成交申报

尚未完成配对的成交申报可以撤销，撤销流程如图 3-12 所示。

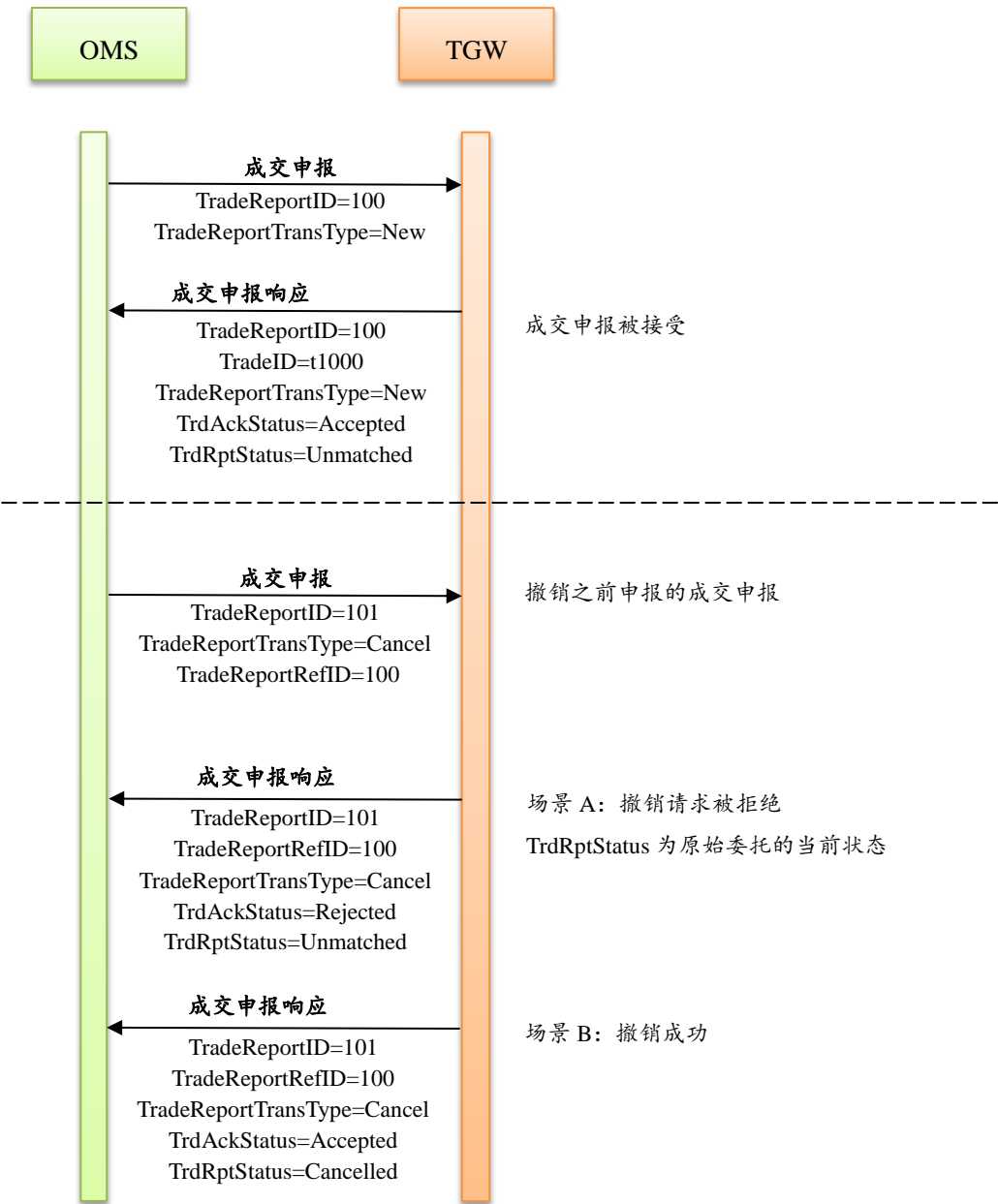


图 0-12 撤销成交申报处理消息流示意图

3.8.2 成交报告申报模式 (two party report)

成交报告申报模式 (two party report) 是指由交易一方或第三方中介机构申报一笔包含双方完整信息的委托, 深交所交易系统进行即时确认。

3.8.2.1 新成交申报处理

对于以成交报告申报模式的委托, 目前有两种处理方式, 方式一如图 3-13 的场景 1A 或 1B 所示, 交易系统仅返回委托确认 (成交申报响应消息); 方式二如图 3-13 的场景 2 所示, 交易系统除返回委托确认外, 对于被接受的委托, 还返回成交确认 (成交确认消息), 如委托是由交易一方发起的, 可能还会根据业务需要将成交确认转发给对方 (转发成交申报消息)。

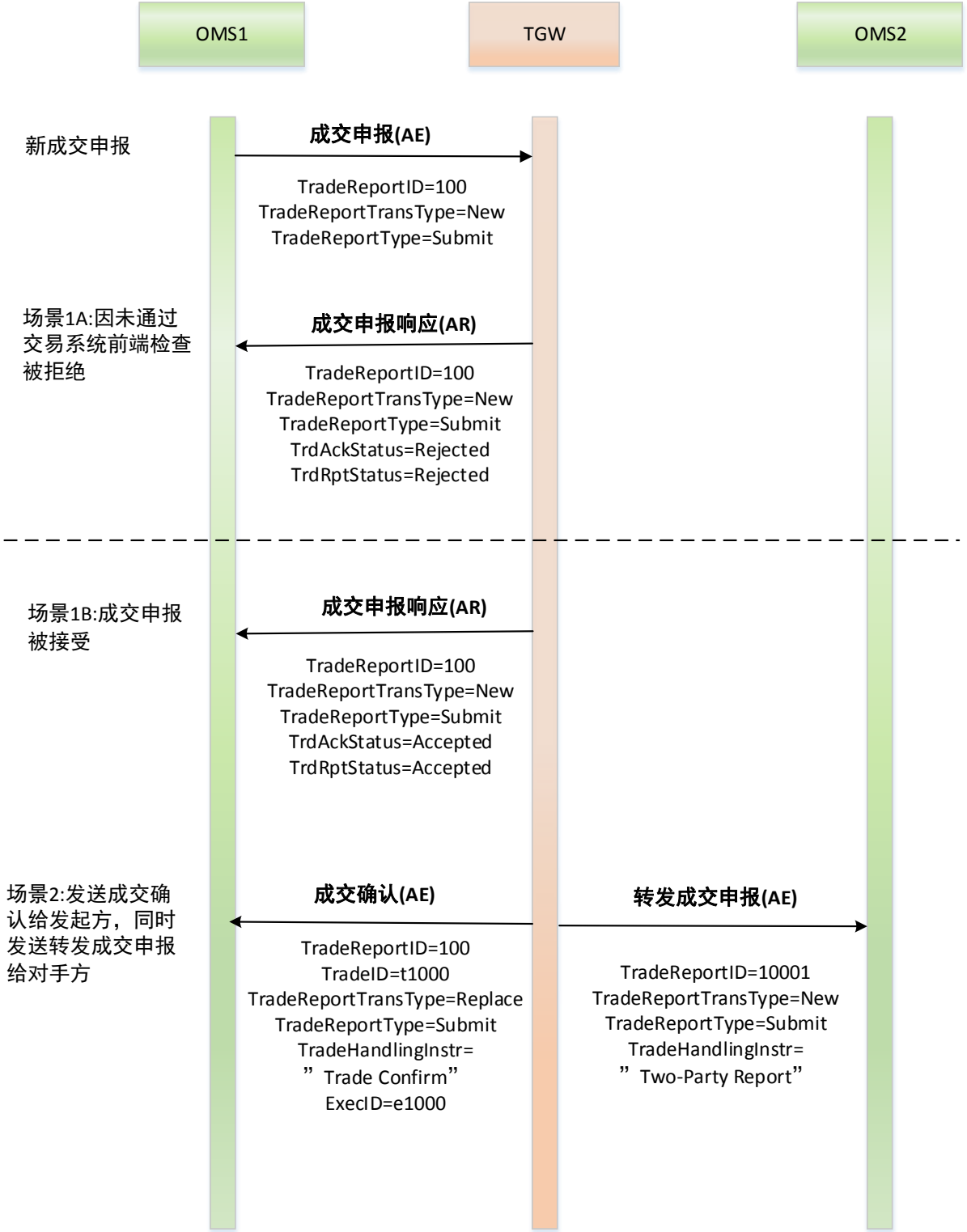


图 0-13 成交报告申报处理消息流示意图

表 0-5 成交报告模式业务列表

应用标识	说明	成交申报	成交确认	转发成交	是否支持
AppIID		响应		申报	撤销

080	资产管理计划份额转让	●			
090	股票质押式回购	●			
100	约定购回	●			
110	质押式报价回购	●			
320	债券质押式三方回购交易 (到期购回、补券)	●	●	●	● (到期购回不支持)

3.8.2.2 撤销成交申报

成交报告申报模式的撤销流程如图 3-14 所示，其中按上述方式一处理的委托，对于其撤销请求交易系统同样仅返回撤销委托确认。

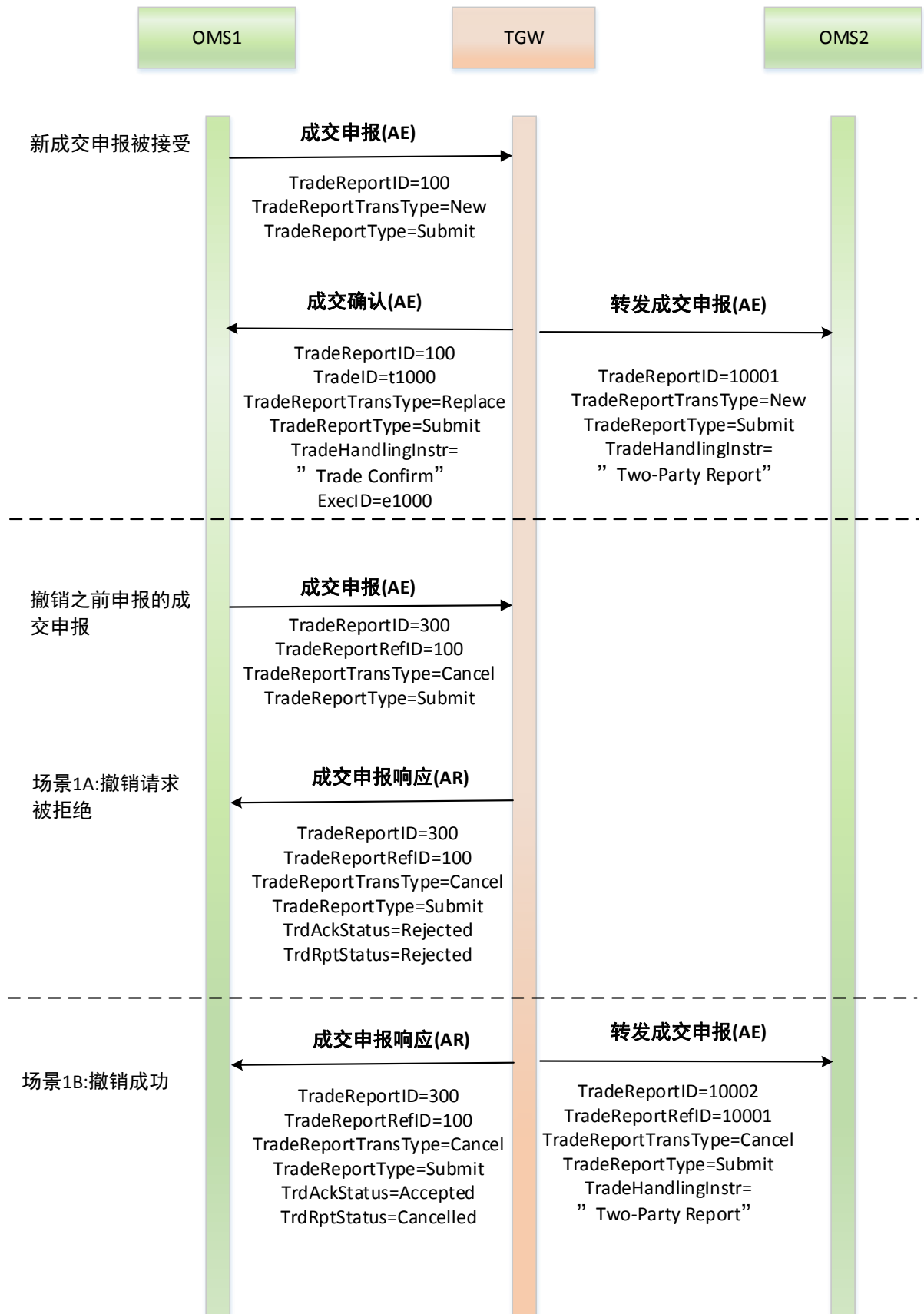


图 0-14 成交报告撤销成交申报处理消息流示意图

3.8.3 成交请求申报模式 (one party report for pass through)

债券质押式三方回购等业务的成交申报采用“成交请求申报模式 (one party report for pass through)”，即由一方发起一笔指定对手方的成交申报，经交易系统转发给指定对手方，对手方在接收到转发的成交申报后，通过申报接受或拒绝的成交申报进行确认。

3.8.3.1 新成交申报处理

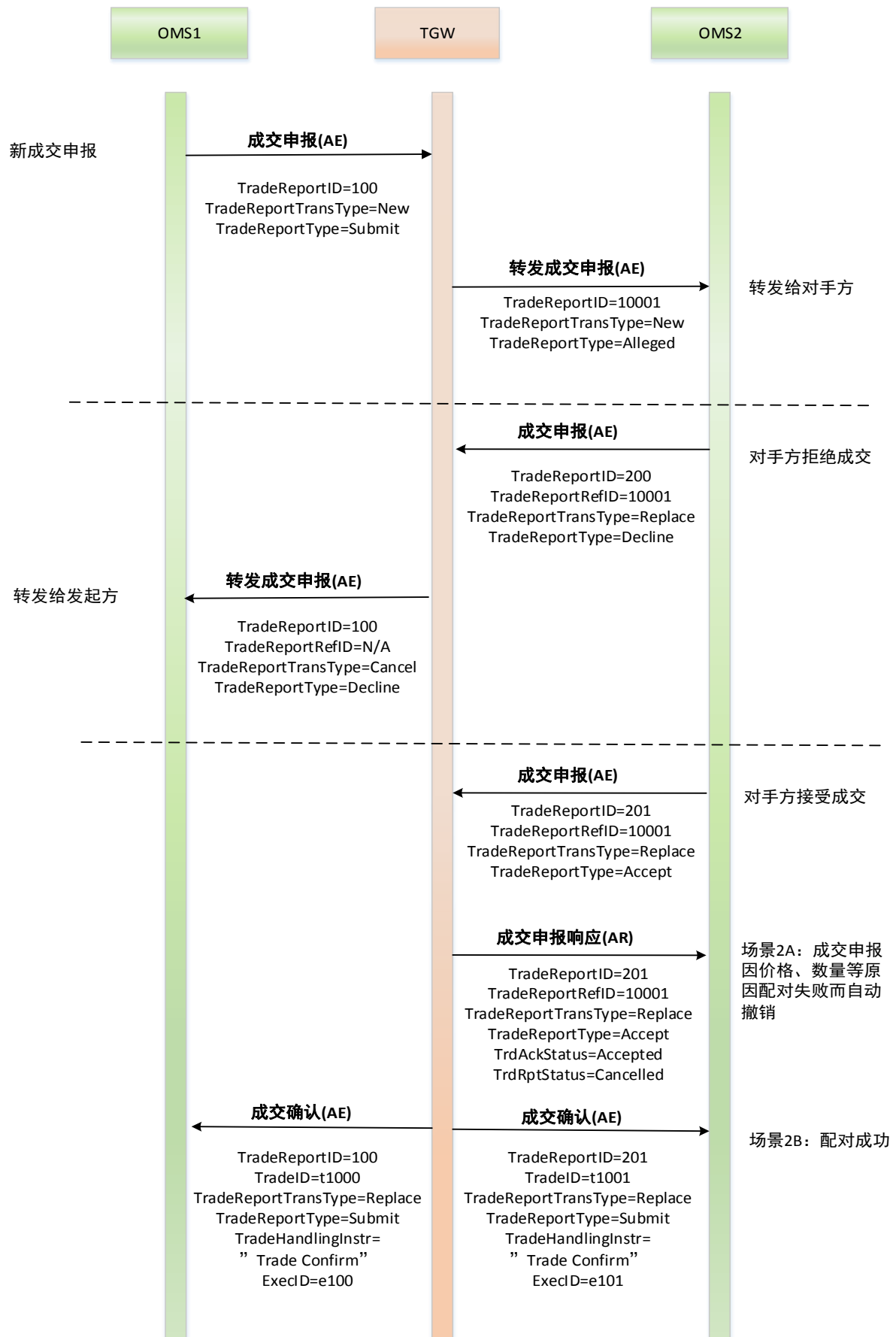


图 0-15 新成交申报处理消息流示意图

深交所交易系统对于每一笔投资者申报的成交申报都会发成交申报响应(ACK)，由于篇幅原因，上图中省略了交易系统对于每一笔申报返回的 ACK。

3.8.3.2 撤销成交申报

成交请求的发起方可在对方完成确认前撤销成交请求，撤销流程如图 3-16 所示。

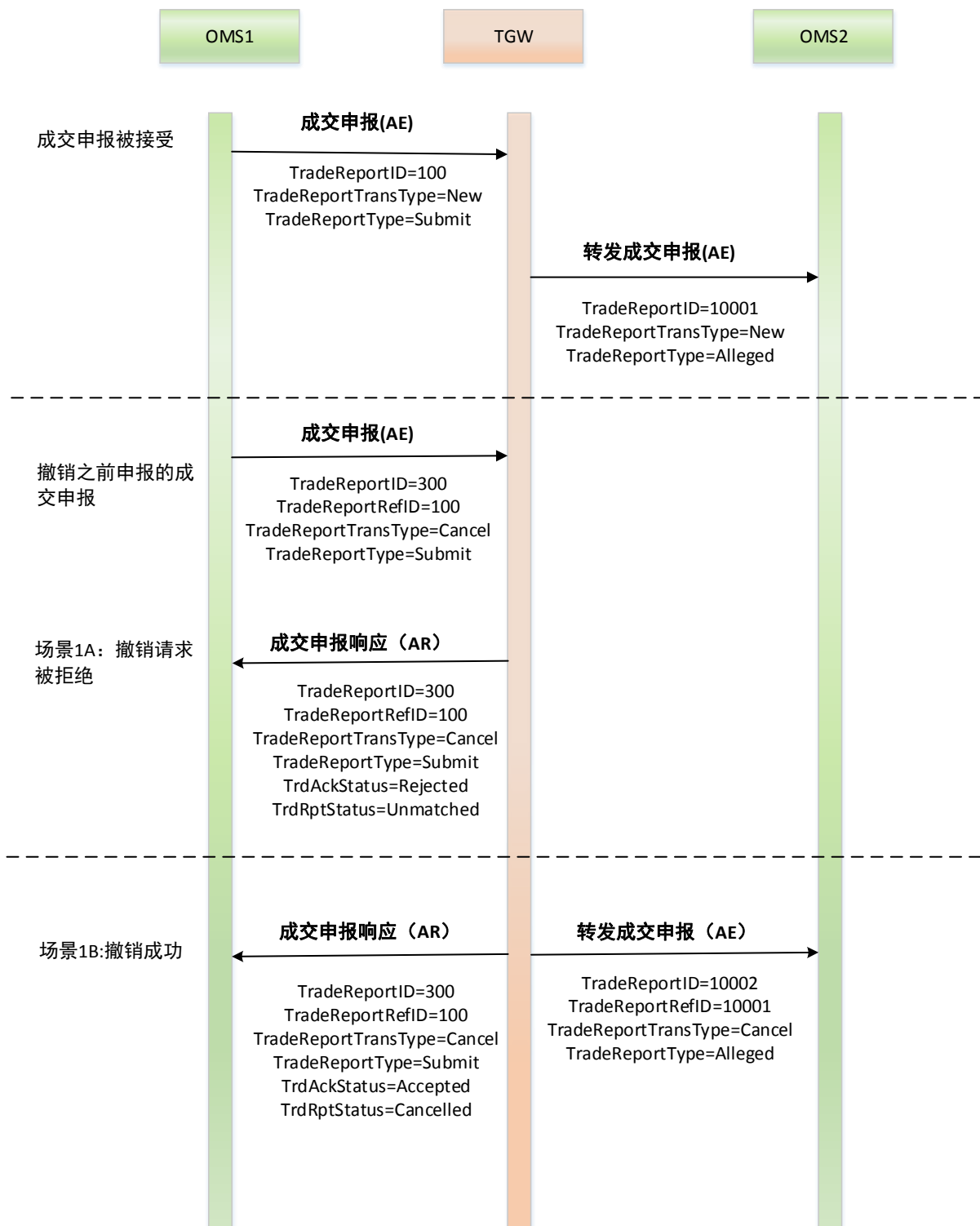


图 0-16 撤销成交申报处理消息流示意图

3.9 转托管处理消息流图

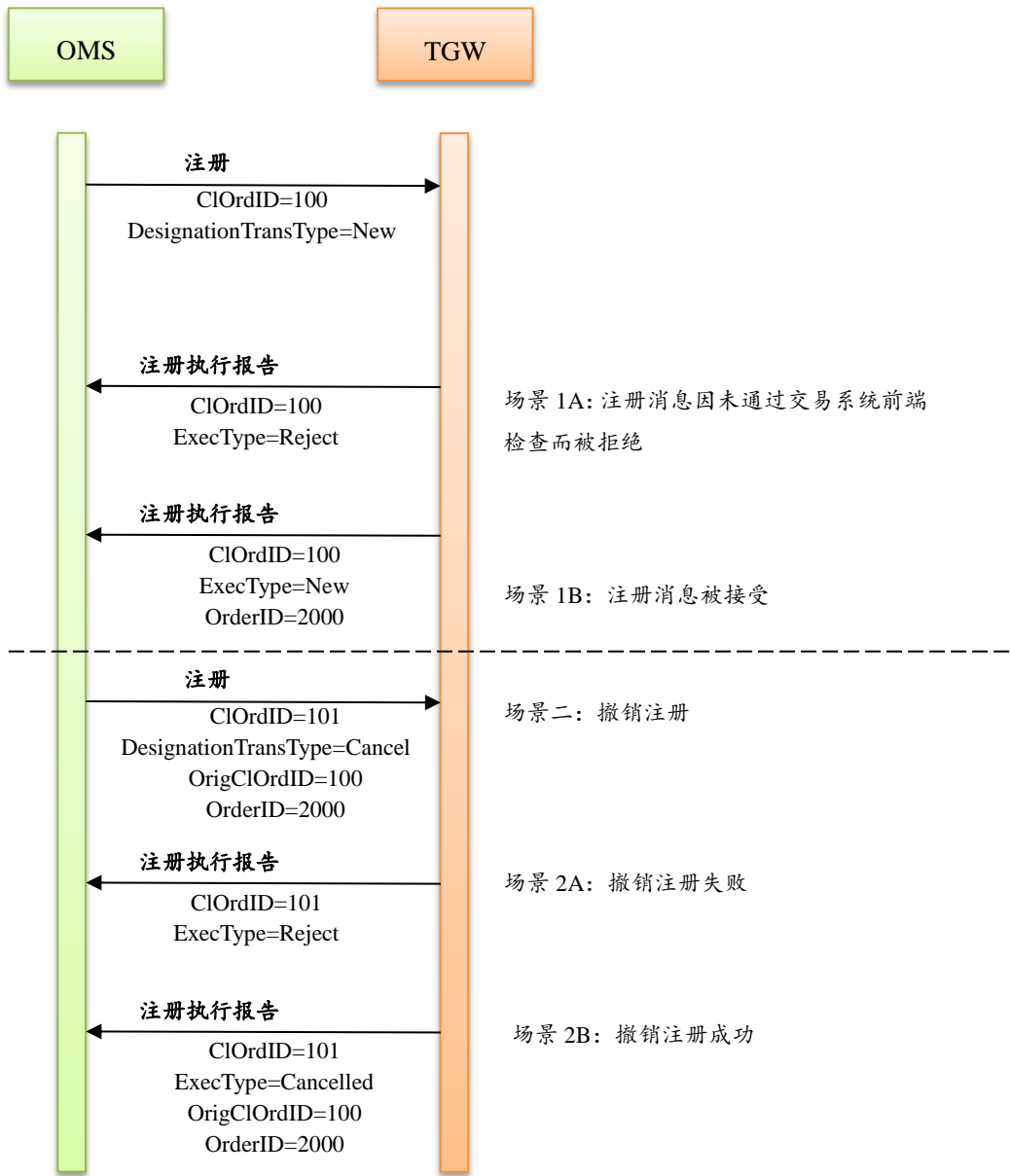


图 0-17 转托管处理消息流示意图

3.10 网络投票处理消息流图

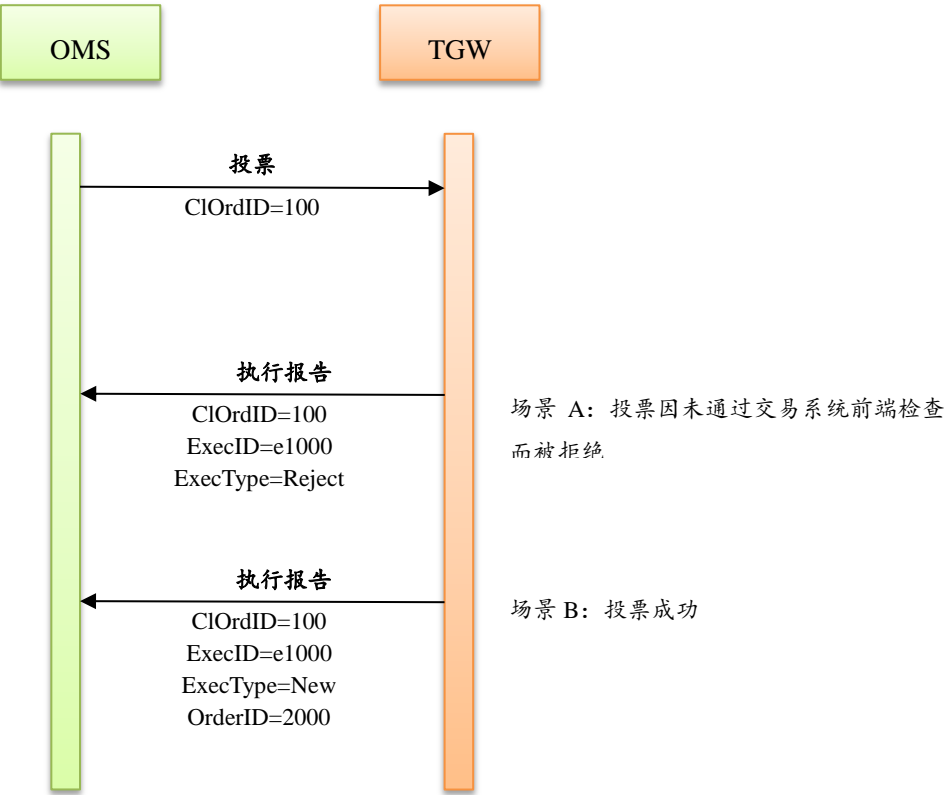


图 0-18 网络投票处理消息流示意图

3.11 密码服务处理消息流图

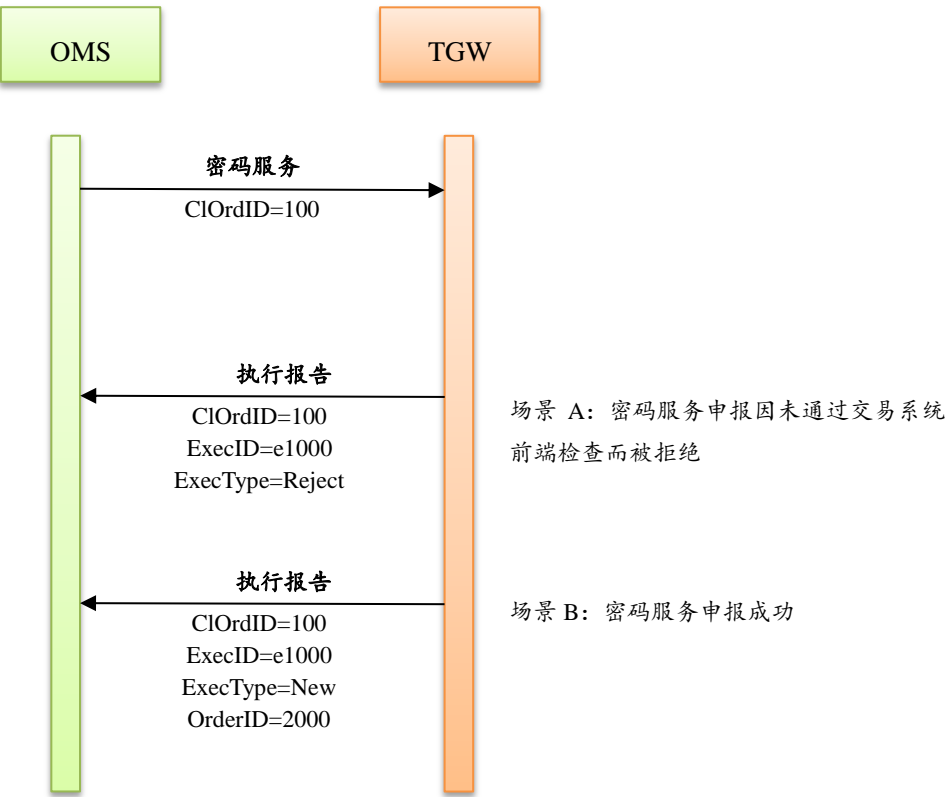


图 0-19 密码服务处理消息流示意图

3.12 保证金查询处理消息流图

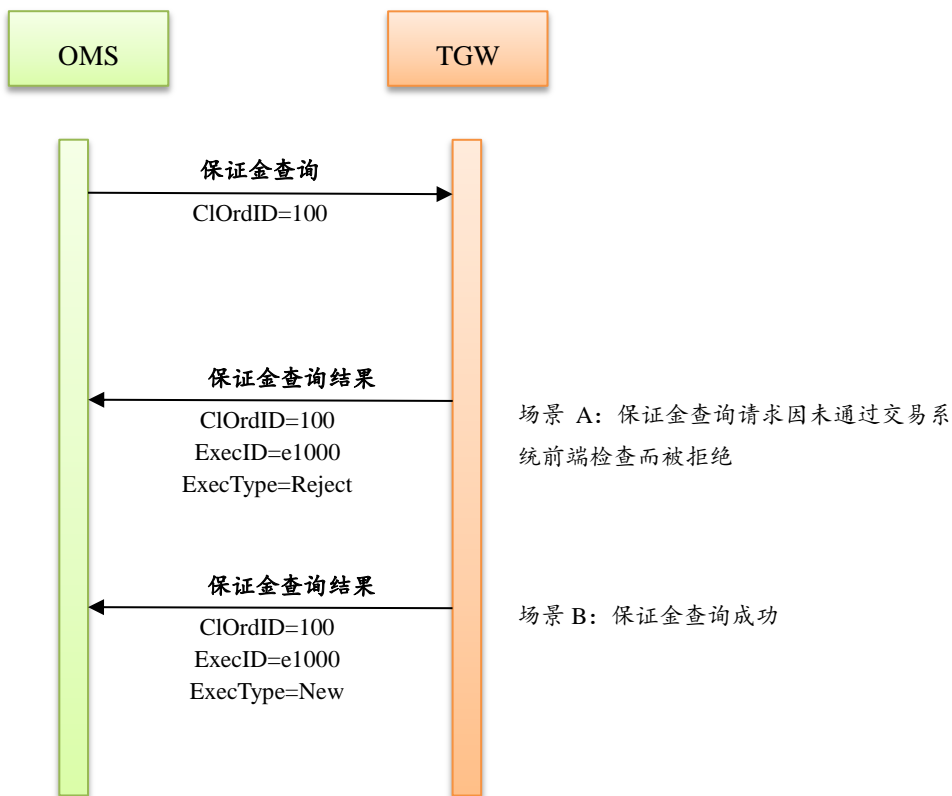


图 0-20 保证金查询处理消息流示意图

3.13 应用层消息恢复

TGW 发送给 OMS 的每笔回报消息（业务拒绝消息 Business Reject 除外）都含平台分区号 PartitionNo 和回报记录号 ReportIndex 两个字段，对于每一个分区其回报记录号字段值都从 1 开始连续编号，该编号表示该笔回报是该分区的第几笔回报。在 OMS 与 TGW 异常断开连接后，OMS 应该根据本次连接收到的平台信息消息确定各个分区已收到回报的最大记录号并按照下图所示流程与 TGW 重新建立连接（首次建立连接也必须按照该流程进行，相当于最大记录号为 0）：

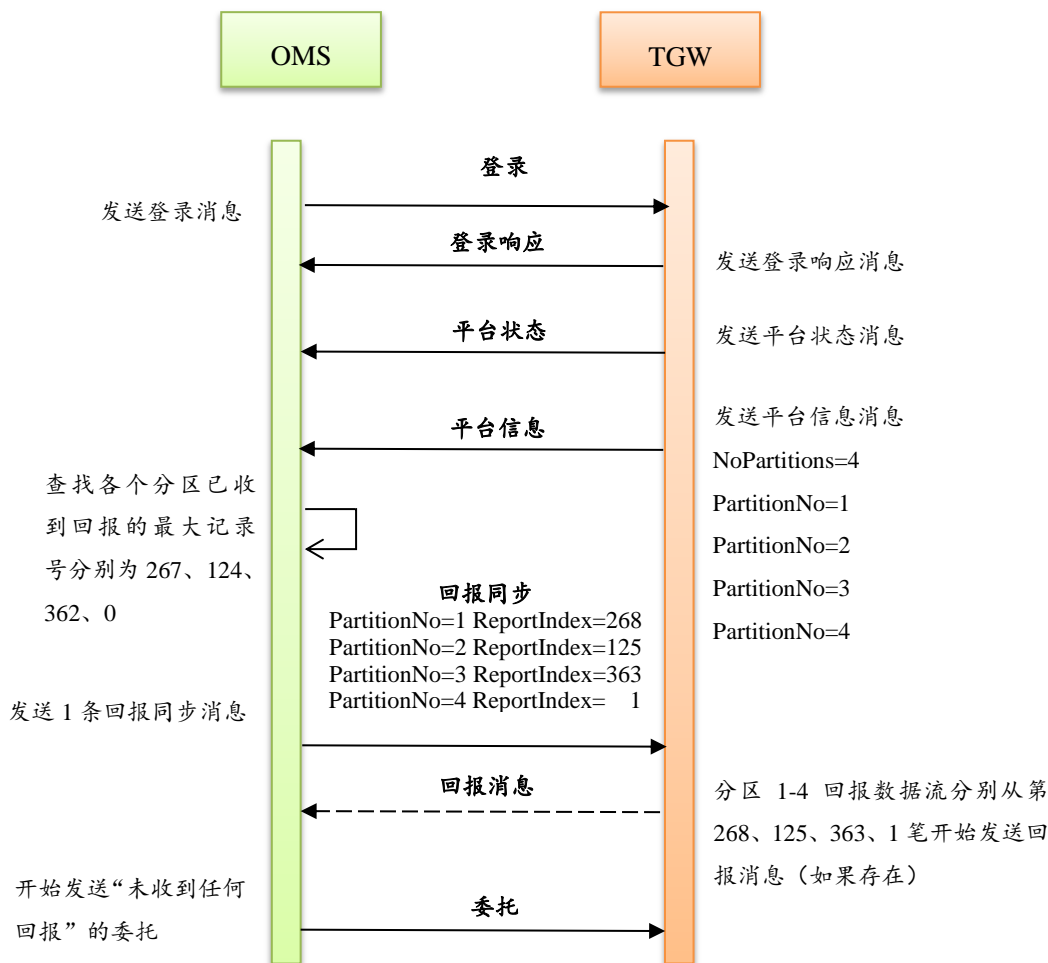


图 0-21 OMS 恢复与 TGW 通信消息流示意图

建议 OMS 收到 TGW 返回的平台信息消息后，再发送回报同步消息。如果 OMS 发送的回报同步消息中含有非法的分区号，该笔回报同步消息会被丢弃，OMS 会收到拒绝原因为 20106 的业务拒绝消息（Business Reject），此时，OMS 必须重新发送回报同步消息否则 OMS 将无法收到回报数据。OMS 在发送回报同步消息后，并不需要等待到有回报消息返回才开始发送委托，但建议等待 3 秒钟以接收尽可能多的回报消息，从而减少委托的重复发送。

在闭市以后，OMS 不能继续申报委托，但是仍然可以登录 TGW 并通过该机制重新接收当天的回报数据，比如将回报同步消息中本平台所有分区的 ReportIndex 都设置为 1 即可以重新接收当天的所有回报数据，也可在回报同步消息中指定重新接收某一个分区的回报数据。

如果 OMS 发送的回报同步消息中的 ReportIndex 值大于实际存在的回报记录数目，则 TGW 不会发送回报消息，直至回报记录数达到 ReportIndex 值才开始继续回报。比

如发送的回报同步消息中的 ReportIndex 为 1001, 而 TGW 端实际存在的回报数只有 300, 则 TGW 会等到实际的回报数达到 1001 时才开始发送回报, 回报记录号为 1-1000 的回报不会发送给 OMS。

3.14 回报交易单元

TGW 发送给 OMS 的每笔回报消息(业务拒绝消息 Business Reject 除外)中除了“申报交易单元”外还会多一个“回报交易单元”, “回报交易单元”一般情况下与“申报交易单元”一致, 只有在需要将某个交易单元申报委托的回报抄送给另外一个交易单元时, 两者才会不一致。

四、 消息定义

4.1 消息结构

每一条消息都由消息头、消息体和消息尾组成。

对于 TGW 发送给 OMS 的消息, OMS 应能支持消息体尾部扩展新的字段, 并且 OMS 如果不关心新扩展的字段, 应该能够不作改造而自动忽略新字段。

4.1.1 消息头

消息头定义了应用消息的类型、长度数据域, 均不加密传输。

域名	字段描述
MsgType	消息类型
BodyLength	消息体长度

4.1.2 消息尾

消息尾定义了消息的校验和, 不加密传输。校验和的计算范围从消息头开始(包括消息头)一直到消息体结束。

域名	字段描述
Checksum	校验和

以下为计算校验和的代码段:

```
uint32 GenerateChecksum( char *buf, uint32 bufLen )
{
    long idx;
    uint32 cks;
    for( idx = 0L, cks = 0; idx < bufLen; cks += (uint32)buf[ idx++ ] );
    return ( cks % 256 );
}
```

4.2 管理消息

4.2.1 登录消息 (Logon)

Logon 消息应该是订单管理系统开始工作时向交易网关发出的第一条消息。订单管理系统使用 **Logon** 消息来与交易网关建立连接，交易网关使用 **Logon** 消息确认订单管理系统登录成功。

表 0-1 OMS 向 TGW 发送申请登录消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 1
SenderCompID	发送方代码
TargetCompID	接收方代码
HeartBtInt	心跳间隔，单位为秒。订单管理系统登陆时提供给交易网关。
Password	密码
DefaultApplVerID	二进制协议版本，即通信版本号。

4.2.2 注销消息 (Logout)

当订单管理系统发起的连接请求不被交易网关接受时，交易网关会向订单管理系统发送 **Logout** 消息来拒绝登录请求。在必要时订单管理系统也可以主动发送 **Logout** 消息来中断当前和交易网关的连接。

表 0-2 OMS 与 TGW 间注销消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 2
SessionStatus	退出时的会话状态 0 = 会话活跃 1 = 会话口令已更改 2 = 将过期的会话口令 3 = 新会话口令不符合规范 4 = 会话退登完成 5 = 不合法的用户名或口令 6 = 账户锁定 7 = 当前时间不允许登录 8 = 口令过期 9 = 收到的 MsgSeqNum(34)太小 10 = 收到的 NextExpectedMsgSeqNum(789)太大。 101 = 其他 102 = 无效消息

Text	文本 注销原因的进一步补充说明
------	--------------------

4.2.3 心跳消息 (Heartbeat)

交易网关和订单管理系统之间用 **Heartbeat** 消息来检测 TCP 连接的状态，因此当一方处于数据发送空闲期时，需要定时发送 **Heartbeat** 消息以供检测连接的健康度。

表 0-3 OMS 与 TGW 间心跳消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 3, BodyLength=0

4.3 业务消息-新订单处理

4.3.1 新订单 (New Order)

表 0-4 OMS 向 TGW 报送新订单消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx01
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定
Side	买卖方向
OrdType	订单类别 1 表示市价 2 表示限价

	U 本方最优
OrderQty	订单数量
Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务新订单的申报

表 0-5 新订单申报类型关键要素取值

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	Side (54)	有无扩展 字段	是否允 许撤销
现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易申报	010	100101	1=买 2=卖	Y	Y
质押式回购交易申报	020	100201	1=买（融资） 2=卖（出资）	Y	Y
债券分销申报	030	100301	1=买（认购） 2=卖（分销）	N	Y
期权集中竞价交易申报	040	100401	1=买 2=卖	Y	Y
协议交易定价申报	051	100501	1=买 2=卖	Y	Y
协议交易点击成交申报	052		1=买 2=卖		N
以收盘价交易的盘后定价交易申报	060	100601	1=买 2=卖	Y	Y
以成交量加权平均价交易的盘后定价交易申报	061		1=买 2=卖		Y
转融通证券出借非约定申报	070	100701	G=借入 F=出借	Y	Y
ETF 实时申购赎回申报	120	101201	D=申购 E=赎回	N	N
网上发行认购申报	130	101301	固定填 1	N	Y
配股认购申报	140	101401	固定填 1	N	Y
债券转股申报	150	101501	固定填 1	N	Y
债券回售申报	151		固定填 1		Y

期权行权申报	160	101601	固定填 1	Y	Y
开放式基金申购赎回申报	170	101701	D=申购 E=赎回	Y	Y
要约收购预受要约申报	180	101801	固定填 1	Y	Y
要约收购解除预受要约申报	181		固定填 1		Y
质押式回购质押申报	190	101901	固定填 1	N	N
质押式回购解押申报	191		固定填 1		N
权证行权申报	230	102301	固定填 1	N	Y
转处置扣券申报	270	102701	固定填 1	Y	Y
转处置还券申报	271	102701	固定填 1		Y
垫券申报	280	102801	固定填 1	Y	Y
还券申报	281	102801	固定填 1		Y
待清偿扣划客户申报	290	102901	固定填 1	Y	Y
待清偿扣划自营申报	291	102901	固定填 1		Y
分级基金实时分拆申报	310	103101	固定填 1	N	N
分级基金实时合并申报	311	103101	固定填 1		N
港股通新订单申报	630	106301	1=买 2=卖	Y	Y
债券质押式三方回购入库申报	330	103301	固定填 1	N	Y
债券质押式三方回购出库申报	331		固定填 1		Y

- 2) 现货集中竞价交易、质押式回购交易、期权集中竞价交易三类业务申报的 OrdType 可取值 1/2/U, 其他业务申报的 OrdType 固定填 2。

4.3.1.1 现货集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100101)

表 0-6 现货集中竞价交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数

TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

注：

- 1) 限价委托及五种市价委托申报方式：

表 0-7 现货集中竞价业务新订单申报委托类型定义

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
限价委托	0	2	0	0
本方最优	0	U	0	0
对手方最优剩余 转限价	0	1	1	0
市价立即成交剩 余撤销	3	1	0	0
市价全额成交或 撤销	3	1	0	=OrderQty
市价最优五档全 额成交剩余撤销	3	1	5	0

- 2) 如果 CashMargin 取值为“融资融券平仓(3)”，同时订单所有者类型为“会员发起(102)”，则表示该笔订单为会员强制平仓。

4.3.1.2 质押式回购交易业务新订单扩展字段(100201)

表 0-8 质押式回购交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型

注：

- 1) 质押式回购交易业务目前只可以申报限价委托：

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
------	-------------	---------	----------------	--------

限价委托	0	2	0	0
------	---	---	---	---

4.3.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段（100401）

表 0-9 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
PositionEffect	平仓标识 (‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓)
CoveredOrUncovered	备兑标签 (0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑)
ContractAccountCode	合约账户标识码

注:

- 1) 现货集中竞价业务新订单的限价委托及五种市价委托申报方式也适用于期权集中竞价交易业务, 此外期权集中竞价还增加“限价全额成交或撤销”委托类型:

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
限价全额成交或撤销	3	2	0	=OrderQty

4.3.1.4 协议交易业务新订单扩展字段（100501）

表 0-10 协议交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
ConfirmID	约定号 点击成交申报填写
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.3.1.5 盘后定价交易业务新订单扩展字段（100601）

表 0-11 盘后定价交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.3.1.6 转融通证券出借业务新订单扩展字段（100701）

表 0-12 转融通证券出借业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限

4.3.1.7 期权行权业务新订单扩展字段（101601）

表 0-13 期权行权业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.3.1.8 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段（101701）

表 0-14 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	申购金额

注:

- 1) LOF 是现金申购, 份额赎回, 申购时使用 CashOrderQty 填写申购金额, 金额必须为 1 元的整数倍, OrderQty 填 0; 赎回时使用 OrderQty 填写赎回份额。

4.3.1.9 要约收购业务新订单扩展字段（101801）

表 0-15 要约收购业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
Tenderer	收购人编码

4.3.1.10 转处置业务新订单扩展字段（102701）

表 0-16 转处置业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
DisposalPBU	划入待处置券的交易单元
DisposalAccountID	划入待处置券的证券账户

4.3.1.11 垫券还券业务新订单扩展字段（102801）

表 0-17 垫券还券业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
LenderPBU	出借券交易单元
LenderAccountID	出借券证券账户

4.3.1.12 待清偿扣划业务新订单扩展字段（102901）

表 0-18 待清偿扣划业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
DeductionPBU	用于扣划证券的交易单元
DeductionAccountID	用于扣划证券的证券账户

4.3.1.13 港股通业务新订单扩展字段（106301）

表 0-19 港股通业务新订单扩展字段

域名	字段描述
StopPx	止损价，预留，固定填 0
MinQty	最低成交数量，预留，固定填 0
MaxPriceLevels	最多成交价位数，预留，固定填 0
TimeInForce	订单有效时间类型 0=增强限价盘，Day 9=竞价限价盘，At Crossing
LotType	订单数量类型 1=零股订单，Odd Lot 2=整手订单，Round Lot

4.3.2 撤单请求（Order Cancel Request）

表 0-20 OMS 向 TGW 报送撤单请求消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=190007
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
Side	原始订单买卖方向
OrderID	原始订单交易所订单编号 交易所对该字段的值不作检查
OrderQty	原始订单数量 交易所对该字段的值不作检查

4.3.3 撤单失败响应（Cancel Reject）

表 0-21 TGW 向 OMS 传送撤单失败响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=290008
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源

OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
Side	原始订单买卖方向
OrdStatus	原始订单当前状态 如果未找到原始订单，则填 8=Rejected
CxlRejReason	拒绝原因代码
RejectText	拒绝原因说明
OrderID	原始订单交易所订单编号

注：

- 1) 港股通撤单请求被联交所拒绝时，拒绝原因代码 CxlRejReason 为 29997 或 29995，具体联交所的拒绝原因代码填写在 RejectText 中。联交所的拒绝原因代码参见数据字典。

4.3.4 订单响应及撤单成功执行报告（Execution Report）

表 0-22 TGW 向 OMS 传送订单响应及撤单成功执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx02
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间

UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型
OrdStatus	订单状态
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
OrdType	订单类别
OrderQty	订单数量
Price	价格
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务的订单响应及撤单成功响应

表 0-23 各类业务订单响应及撤单成功关键要素说明

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	有无扩展 字段
现货（股票，基金，债券等） 集中竞价交易执行报告	010	200102	Y
质押式回购交易执行报告	020	200202	Y
债券分销执行报告	030	200302	N
期权集中竞价交易执行报告	040	200402	Y
协议交易定价执行报告	051	200502	Y
协议交易点击成交执行报告	052		

以收盘价交易的盘后定价交易执行报告	060	200602	Y
以成交量加权平均价交易的盘后定价交易执行报告	061		
转融通证券出借非约定执行报告	070	200702	Y
股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回执行报告 黄金 ETF 现金申购赎回执行报告	120	201202	Y
网上发行认购执行报告	130	201302	N
配股认购执行报告	140	201402	N
债券转股执行报告	150	201502	N
债券回售执行报告	151		
期权行权执行报告	160	201602	Y
开放式基金申购赎回执行报告	170	201702	Y
要约收购预受要约执行报告	180	201802	Y
要约收购解除预受要约执行报告	181		
质押式回购质押执行报告	190	201902	N
质押式回购解押执行报告	191		
黄金 ETF 实物申购赎回执行报告	220	202202	N
权证行权执行报告	230	202302	N
转处置扣券执行报告	270	202702	Y
转处置还券执行报告	271	202702	
垫券执行报告	280	202802	Y
还券执行报告	281	202802	
待清偿扣划客户申报执行报告	290	202902	Y
待清偿扣划自营申报执行报告	291	202902	
分级基金实时分拆申报	310	203102	Y

分级基金实时合并申报	311	203102	
港股通订单执行报告	630	206302	Y
债券质押式三方回购入库执行报告	330	203302	N
债券质押式三方回购出库执行报告	331	203302	

4.3.4.1 现货集中竞价交易业务执行报告扩展字段（200102）

表 0-24 现货集中竞价交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识

4.3.4.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段（200202）

表 0-25 质押式回购交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型

4.3.4.3 期权集中竞价交易业务执行报告扩展字段（200402）

表 0-26 期权集中竞价交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数

TimeInForce	订单有效时间类型
PositionEffect	平仓标识 (‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓)
CoveredOrUncovered	备兑标签 (0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑) 目前仅适用于期权集中竞价业务
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.3.4.4 协议交易业务执行报告扩展字段 (200502)

表 0-27 协议交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ConfirmID	约定号
CashMargin	信用标识

4.3.4.5 盘后定价交易业务执行报告扩展字段 (200602)

表 0-28 盘后定价交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.3.4.6 转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200702)

表 0-29 转融通证券出借业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型

4.3.4.7 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段 (201202)

表 0-30 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
InsufficientSecurityID	申赎不足成份股证券代码 申购时如果投资者持有成份股不足, 填写第一只不足额的成份股代码

		赎回时如果基金管理人成份股不足，填写第一只不足额的成份股代码
	NoSecurity	成份股记录数
→	UnderlyingSecurityID	成份股证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→	DeliveryQty	股份交付数量
→	SubstCash	现金替代金额

4.3.4.8 期权行权业务执行报告扩展字段（201602）

表 0-31 期权行权业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.3.4.9 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段（201702）

表 0-32 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	申购金额

4.3.4.10 要约收购业务执行报告扩展字段（201802）

表 0-33 要约收购业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
Tenderer	收购人编码

4.3.4.11 转处置券业务执行报告扩展字段（202702）

表 0-34 转处置券业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
DisposalPBU	划入待处置券的交易单元
DisposalAccountID	划入待处置券的证券账户

4.3.4.12 垫券还券业务执行报告扩展字段（202802）

表 0-35 垫券还券业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
LenderPBU	出借券交易单元
LenderAccountID	出借券证券账户

4.3.4.13 待清偿扣划业务执行报告扩展字段（202902）

表 0-36 待清偿扣划业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
DeductionPBU	用于扣划证券的交易单元
DeductionAccountID	用于扣划证券的证券账户

4.3.4.14 分级基金实时分拆合并业务执行报告扩展字段（203102）

表 0-37 分级基金实时分拆合并业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
InsufficientSecurityID	合并不足子基金代码 合并时如果投资者持有子基金不足，填写第一只不足额的子基金代码
NoSecurity	子基金记录数
→ UnderlyingSecurityID	子基金证券代码
→ UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→ DeliveryQty	子基金交付数量

4.3.4.15 港股通业务执行报告扩展字段（206302）

表 0-38 港股通业务执行报告扩展字段

域名	字段描述
RejectText	拒绝原因说明（填写联交所拒绝原因代码）
StopPx	止损价，预留，固定填 0
MinQty	最低成交数量，预留，固定填 0
MaxPriceLevels	最多成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
LotType	订单数量类型
IMCRejectTextLen	联交所拒绝原因说明长度

IMCRejectText	联交所拒绝原因说明
---------------	-----------

注：

- 1) 港股通新订单被联交所拒绝 (ExecType 为 8) 时, 拒绝原因代码 OrdRejReason 为 29998 或 29997; 港股通新订单被联交所自动撤销 (ExecType 为 4) 时, 撤销原因代码 OrdRejReason 为 29996; 具体的联交所的拒绝/自动撤销原因代码填写在 RejectText 中, 拒绝/自动撤销原因说明填写在 IMCRejectText 中, 最长 150 字节。联交所的拒绝原因代码参见数据字典。

4.3.5 订单成交执行报告 (Execution Report)

表 0-39 TGW 向 OMS 传送订单成交执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx15
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型
OrdStatus	订单状态
LastPx	成交价
LastQty	成交数量

LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务订单成交回报

表 0-40 各类业务订单成交回报关键要素说明

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	有无扩展 字段
现货（股票，基金，债券等） 集中竞价交易执行报告	010	200115	Y
质押式回购交易执行报告	020	200215	Y
债券分销执行报告	030	200315	N
期权集中竞价交易执行报告	040	200415	Y
协议交易定价执行报告	051	200515	Y
协议交易点击成交执行报告	052		
以收盘价交易的盘后定价交易 执行报告	060	200615	Y
以成交量加权平均价交易的 盘后定价交易执行报告	061		
转融通证券出借非约定执行 报告	070	200715	Y
港股通订单执行报告	630	206315	N

4.3.5.1 现货集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段（200115）

表 0-41 现货集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.3.5.2 质押式回购交易业务成交执行报告扩展字段（200215）

表 0-42 质押式回购交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
MaturityDate	到期日

注：在回购到期日，交易系统会主动下发一笔回购到期成交执行报告，其中应用标识 ApplID 为 029，回报时间 TransactTime 为当前时间，其他字段与初始交易成交执行报告一致。

4.3.5.3 期权集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段（200415）

表 0-43 期权集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
PositionEffect	平仓标识 (‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓)
CoveredOrUncovered	备兑标签 (0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑) 目前仅适用于期权集中竞价业务
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.3.5.4 协议交易业务执行报告扩展字段（200515）

表 0-44 协议交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ConfirmID	约定号
CashMargin	信用标识

4.3.5.5 盘后定价交易业务执行报告扩展字段（200615）

表 0-45 盘后定价交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.3.5.6 转融通证券出借业务成交执行报告扩展字段（200715）

表 0-46 转融通证券出借业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限，单位为天数

ExpirationType	期限类型
MaturityDate	到期日

4.4 业务消息-报价处理

4.4.1 报价 (Quote)

表 0-47 OMS 向 TGW 报送报价消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx05
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 取 102, 表示代码源为深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号
AccountID	证券账户
QuoteReqID	报价请求 ID 预留字段 当报价是对报价请求的响应时, 填写报价请求 的 ID
QuoteType	报价类型 1=可交易的报价 (Tradeable)
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务报价申报

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
041	期权集中竞价交易报价申报	100405	Y
054	协议交易报价申报	100505	N

2) 报价消息支持以下报价方式（不支持撤销单边报价）

报价方式	BidSize	OfferSize
双边报价	>0	>0
买报价	>0	=0
卖报价	=0	>0
撤销报价	=0	=0

4.4.1.1 期权集中竞价交易业务报价扩展字段（100405）

表 0-48 期权集中竞价交易业务报价扩展字段定义

域名	字段描述
BidPositionEffect	买平仓标识 (‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓) BidSize=0 时该字段无意义, 填写空格
OfferPositionEffect	卖平仓标识 (‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓) OfferSize=0 时该字段无意义, 填写空格
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.4.2 报价状态回报（Quote Status Report）

表 0-49 TGW 向 OMS 传送报价状态回报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx06
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号

ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号
AccountID	证券账户
QuoteReqID	报价请求 ID
QuoteStatus	报价状态 0=Accepted, 接受 5=Rejected, 拒绝
QuoteRejectReason	拒绝原因代码
QuoteType	报价类型
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务报价状态的回报

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
041	期权集中竞价交易报价状态 回报	200406	Y
054	协议交易报价状态回报	200506	N

4.4.2.1 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段（200406）

表 0-50 期权集中竞价交易业务报价状态回报扩展字段定义

域名	字段描述
BidPositionEffect	买平仓标识 (‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓)
OfferPositionEffect	卖平仓标识 (‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓)
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5 业务消息-询价申报处理

4.5.1 询价申报 (Quote Request)

表 0-51 OMS 向 TGW 报送询价申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx17
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteReqID	报价请求 ID
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务询价申报

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
042	期权集中竞价交易询价申报	100417	Y

4.5.1.1 期权集中竞价交易业务询价扩展字段（100417）

表 0-52 期权集中竞价交易业务询价申报扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5.2 询价申报接受响应（Quote Request Ack）

表 0-53 TGW 向 OMS 传送询价申报接受响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx17
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteReqID	报价请求 ID
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务询价申报接受响应

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
042	期权集中竞价交易询价申报	200417	Y

4.5.2.1 期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段（200417）

表 0-54 期权集中竞价交易业务询价申报接受响应扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5.3 询价申报拒绝响应 (Quote Request Reject)

表 0-55 TGW 向 OMS 传送询价申报拒绝响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx18
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteReqID	报价请求 ID
QuoteRequestRejectReason	拒绝原因代码
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务询价申报拒绝响应

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
042	期权集中竞价交易询价申报	200418	Y

4.5.3.1 期权集中竞价交易业务询价申报拒绝响应扩展字段 (200418)

表 0-56 期权集中竞价交易业务询价申报拒绝响应扩展字段定义

域名	字段描述
----	------

ContractAccountCode	合约账户标识码
---------------------	---------

4.6 业务消息-意向申报处理

4.6.1 意向申报 (Indication of Interest)

表 0-57 OMS 向 TGW 报送意向申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx09
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码 固定填全空格
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
IOIID	客户意向申报编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
IOITransType	意向申报类型 取值为：N=意向申报, C=意向申报撤单
Side	买卖方向 1 表示买 2 表示卖
IOIRefID	原意向申报 IOIID
IOIQty	数量
Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务的意向申报

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
050	协议交易意向申报	100509	Y

4.6.1.1 协议交易意向申报扩展字段（100509）

表 0-58 协议交易意向申报扩展字段定义

域名	字段描述
Contactore	联系人
ContactInfo	联系方式

4.6.2 意向申报响应（Quote Response）

表 0-59 TGW 向 OMS 传送意向申报响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx10
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteRespID	交易所意向申报响应编号
QuoteRespType	响应类型 2=意向申报响应
ExecType	执行类型 0=New, 意向申报成功 4=Canceled, 意向申报撤单成功

	8=Reject, 意向申报拒绝
QuoteRejectReason	拒绝原因代码
IOIID	客户意向申报编号
IOIRefID	原意向申报 IOIID, 对于意向申报该字段取值为空, 若为撤单则为被撤原意向申报 IOIID
IOITransType	意向申报类型
Side	买卖方向
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
IOIQty	数量
Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务的意向申报响应

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
050	协议交易意向申报响应	200510	Y

4.6.2.1 协议交易意向申报响应扩展字段 (200510)

表 0-60 协议交易意向申报响应扩展字段定义

域名	字段描述
Contactactor	联系人
ContactInfo	联系方式

4.7 业务消息-成交申报处理

4.7.1 成交申报 (Trade Capture Report)

表 0-61 OMS 向 TGW 报送成交申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx03
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元

SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=Accept, 接受成交申报 3=Decline, 拒绝成交申报
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3=One-Party Report for Pass Through, 成交请求
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别 1001=股票质押式回购初始交易 1002=股票质押式回购提前购回 1003=股票质押式回购到期购回 1004=股票质押式回购延期购回 1005=股票质押式回购终止购回 1006=股票质押式回购补充质押 1007=股票质押式回购部分解除

	<p>质押</p> <p>1008=股票质押式回购违约处置</p> <p>1009=股票质押式回购部分购回</p> <p>1010=股票质押式回购违约处置撤销</p> <p>1011=约定购回初始交易</p> <p>1012=约定购回提前购回</p> <p>1013=约定购回到期购回</p> <p>1014=约定购回延期购回</p> <p>1021=质押式报价回购初始交易</p> <p>1022=质押式报价回购提前购回</p> <p>1031=债券质押式协议回购初始交易</p> <p>1032=债券质押式协议回购购回交易</p> <p>1033=债券质押式协议回购到期续做</p> <p>1041=债券质押式三方回购初始交易</p> <p>1042=债券质押式三方回购到期购回</p> <p>1043=债券质押式三方回购到期续做</p> <p>1044=债券质押式三方回购提前购回</p> <p>1045=债券质押式三方回购补券</p> <p>1046=债券质押式三方回购换券</p> <p>1047=债券质押式三方回购解除质押</p>
TrdSubType	<p>成交申报子业务类别</p> <p>对于协议交易业务取值如下：</p> <p>0=非受限股份转让</p> <p>1=受限股份转让</p> <p>其他业务固定填 0</p>

ConfirmID	约定号
Side	本方参与人买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务的成交申报

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	成交申报模式 TradeHandlingInstr	有无扩展 字段
协议交易双方协议成交申报	053	100503	协议配对	Y
转融通证券出借约定申报	071	100703	协议配对	Y
资产管理计划份额转让	080	100803	成交报告	Y
股票质押式回购	090	100903	成交报告	Y
约定购回	100	101003	成交报告	Y
质押式报价回购	110	101103	成交报告	Y
债券质押式协议回购	300	103003	协议配对	Y
债券质押式三方回购交易 (到期购回、补券)	320	103203	成交报告	Y
债券质押式三方回购交易 (初始交易、到期续做、提前购回、换券、解除质押)	320		成交请求	Y

2) 各业务成交申报的市场参与人代码填写方式

业务	Side	PBUID	AccountID	BranchID	Counterparty PBUID	Counterparty AccountID	Counterparty BranchID
协议交易双方协议成交申报 (053)	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
转融通证券出借约定申报 (071)	G=借入 F=出借	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
资产管理计划份额转	固定为1	转入方	转入方	转入方	转出方	转出方	转出方

让 (080)							
股票质押式回购 (090)	固定为 2	(资金) 融入方	(资金) 融入方	(资金) 融入方	(资金) 融出方	(资金) 融出方	不填
约定购回 (100)	固定为 2	客户方 (券融出)	客户方 (券融出)	客户方 (券融出)	不填	证券公司专用账户	不填
质押式报价回购 (110)	固定为 1	客户方 (资金融出)	客户方 (资金融出)	客户方 (资金融出)	不填	证券公司自营账户	不填
债券质押式协议回购 (300)	1=买 (资金融出) 2=卖 (资金融入)	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
债券质押式三方回购交易 (320)	1=逆回购 2=正回购	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填

4.7.1.1 协议交易业务成交申报扩展字段 (100503)

表 0-62 协议交易业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.7.1.2 转融通证券出借业务成交申报扩展字段 (100703)

表 0-63 转融通证券出借业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限

4.7.1.3 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段（100803）

表 0-64 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
PriceType	价格类型 3=Fixed amount, 表示绝对价格, 对于资产管理计划份额转让业务指按“人民币现金”报价
ExecutingTrader	本方交易账户
CounterpartyExecutingTrader	对手方交易账户

4.7.1.4 股票质押式回购业务成交申报扩展字段（100903）

表 0-65 股票质押式回购业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	现金金额 成交申报类别为初始交易时填写初始交易金额; 成交申报类别为提前购回、到期购回、延期购回、部分购回时填写购回交易金额; 成交申报类型为部分解除质押时填写解除红利金额; 其他类别填 0
ShareProperty	股份性质 成交类别为违约处置、违约处置撤销时填空, 其他类别必须填写正确的股份性质
MaturityDate	购回交易日 成交类别为初始交易、提前购回、到期购回、延期购回、部分购回、终止购回时必须填写, 其他类别填 0
PledgeeType	质权人类型 成交申报类别为初始交易时, 必须填写, 其他类别填 0

OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期
InvestmentType	资金用途类型 01=生产经营 02=补充流动资金 03=股权类投资 04=债权类投资 05=不动产投资 06=偿还债务 07=个人消费 99=其他 成交申报业务类别为初始交易时必须填写，其它类别填空格
AlertRatio	预警线，单位为百分比 成交申报业务类别为初始交易时必须填写，其它填 0
SettlementRatio	平仓线，单位为百分比 成交申报业务类别为初始交易时必须填写，其它填 0

注：

- 1) 若成交申报业务类别为初始交易（TrdType=1001），必须填写 LastPx 字段，表示年化利率，单位为百分比，有两位小数，取值范围为[-99.99,99.99]。

4.7.1.5 约定购回业务成交申报扩展字段（101003）

表 0-66 约定购回业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	现金金额
MaturityDate	购回交易日
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号

OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期
---------------	--------------

4.7.1.6 质押式报价回购业务成交申报扩展字段（101103）

表 0-67 质押式报价回购业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
PriceType	价格类型 1=Percentage, 表示收益率
ExpirationExecInst	到期续做方式, 质押式报价回购填写 1=到期自动续做 2=到期手动续做
ExpirationDays	期限, 单位为天数
MaturityDate	购回交易日
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期

4.7.1.7 债券质押式协议回购业务成交申报扩展字段（103003）

表 0-68 债券质押式协议回购业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	现金金额
ExpirationDays	期限, 单位为天数
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期
TrdMatchID	交易编号, 跨交易日唯一

4.7.1.8 债券质押式三方回购交易业务成交申报扩展字段（103203）

表 0-69 债券质押式三方回购交易业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
TrdMatchID	交易编号 成交申报类别为到期购

	回、到期续做、提前购回、补券、换券、解除质押时填写初始交易达成时交易系统生成的交易编号
ExpirationDays	<p>期限</p> <p>成交申报类别为初始交易时填写初始交易购回期限</p> <p>成交申报类别为到期续做时填写续做购回期限</p> <p>成交申报类别为到期购回、提前购回、补券、换券、解除质押时填 0</p>
CashOrderQty	<p>现金金额</p> <p>成交申报类别为初始交易时填写初始交易金额</p> <p>成交申报类别为到期续做时填写续做金额</p> <p>成交申报类别为提前购回时填写提前购回金额</p> <p>成交申报类别为解除质押时填写解除质押结算金额；</p> <p>成交申报类别为到期购回、补券填 0</p> <p>成交申报类别为换券时，若为换出金额，则填换出金额，否则填 0</p>
NoBaskets	<p>质押篮子个数</p> <p>成交申报类别为初始交易时填写指定质押券篮子个数</p> <p>成交申报类别为到期购回、到期续做、提前购回、</p>

		补券、换券、解除质押填 0
→	BasketID	篮子编号
	NoSecurity	质押券个数 成交申报类别为初始交易时填写指定质押券个数 成交申报类别为补券、换券时填写补券、换券个数 成交申报类别为到期购回、到期续做、提前购回、解除质押填 0
→	UnderlyingSecurityID	证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源 固定填 102
→	DeliveryQty	数量
→	DeliverySide	方向 1 表示质押 2 表示解押

4.7.2 成交申报响应（Trade Capture Report Ack）

表 0-70 TGW 向 OMS 传送成交申报响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx04
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型

ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型
TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
TradeReportRefID	原客户成交申报编号
TrdAckStatus	成交申报响应状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
TrdRptStatus	成交申报状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝 2=Cancelled, 已撤销 100=Unmatched, 尚未匹配 101=Matched, 已匹配
TradeReportRejectReason	成交申报被拒绝原因代码
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与人买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

同成交申报各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务成交申报的响应

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	有无扩展 字段
协议交易双方协议成交申报响应	053	200504	Y
转融通证券出借约定申报响应	071	200704	Y
资产管理计划份额转让成交申报响应	080	200804	Y
股票质押式回购成交申报响应	090	200904	Y
约定购回成交申报响应	100	201004	Y
质押式报价回购成交申报响应	110	201104	Y
债券质押式协议回购成交申报响应	300	203004	Y
债券质押式三方回购交易成交申报响应	320	203204	Y

2) 各业务扩展字段定义同成交申报一致，请参考成交申报消息定义。

4.7.3 转发成交申报（Trade Capture Report）

表 0-71 TGW 向 OMS 传送转发成交申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx20
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元

SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型
TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
TradeReportRefID	原客户成交申报编号
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与者买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务的转发成交申报

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	有无扩展 字段
债券质押式三方回购交易	320	203220	Y

4.7.3.1 债券质押式三方回购交易业务转发成交申报扩展字段（203220）

表 0-72 债券质押式三方回购交易业务转发成交申报扩展字段定义

域名		字段描述
TrdMatchID		交易编号
ExpirationDays		期限
CashOrderQty		现金金额
SettlCurrAmt		结算金额
NoBaskets		质押篮子个数
→	BasketID	篮子编号
NoSecurity		质押券个数
→	UnderlyingSecurityID	证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→	DeliveryQty	数量
→	DeliverySide	方向

4.7.4 成交确认 (Trade Capture Report)

表 0-73 TGW 向 OMS 传送成交确认消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx03
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型

TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与者买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务成交申报的确认

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	有无扩展 字段
协议交易双方协议成交申报确认	053	200503	Y
转融通证券出借约定申报确认	071	200703	Y
债券质押式协议回购成交申报确认	300	203003	Y
债券质押式三方回购交易	320	203203	Y

4.7.4.1 协议交易业务成交确认扩展字段（200503）

表 0-74 协议交易业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.7.4.2 转融通证券出借业务成交确认扩展字段（200703）

表 0-75 转融通证券出借业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限，单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
MaturityDate	到期日

4.7.4.3 债券质押式协议回购业务成交确认扩展字段（203003）

表 0-76 债券质押式协议回购业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	现金金额
ExpirationDays	期限，单位为天数
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期
TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一

4.7.4.4 债券质押式三方回购交易业务成交确认扩展字段（203203）

表 0-77 债券质押式三方回购交易业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
TrdMatchID	交易编号
OrigTradeDate	初始交易日
MaturityDate	回购到期日
ExpirationDays	期限
CashOrderQty	现金金额
SettlCurrAmt	结算金额
NoBaskets	质押篮子个数
→ BasketID	篮子编号
NoSecurity	质押券个数
→ UnderlyingSecurityID	证券代码
→ UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→ DeliveryQty	数量
→ DeliverySide	方向

4.8 业务消息-转托管处理

4.8.1 注册 (Designation)

表 0-78 OMS 向 TGW 报送注册消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102099
ApplID	应用标识 200=转托管
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码 如果是系统内转托管, 证券代码可 填空表示转托管所有证券
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始交易的客户订单编号, 指示被 主动撤单的委托
DesignationInstruction	注册指令 3=转托管
DesignationTransType	注册类型 1=New 表示新注册请求 3=Cancel 表示注册撤单
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderQty	如果是系统内转托管, 数量可填 0 表示转托管全部持有量
TransfereePBUID	转入交易单元代码

4.8.2 注册执行报告 (Designation Report)

表 0-79 TGW 向 OMS 传送注册执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202098
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识 200=转托管
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始交易的客户订单编号, 指示被主动撤单的委托
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型 0=New 订单被接受 4=Cancelled 订单被主动撤单 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason	拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写
DesignationInstruction	注册指令 3 表示转托管
DesignationTransType	注册类型 1=New 表示新注册请求 3=Cancel 表示注册撤单

AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderQty	如果是系统内转托管，数量可填 0 表示转托管全部持有量
TransfereePBUID	转入交易单元代码

4.9 业务消息-网络投票处理

4.9.1 投票 (Evote)

表 0-80 OMS 向 TGW 报送投票指令消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102197
ApplID	应用标识 210=投票
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	投票代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码 固定填全空格
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
VotingProposal	投票议案号 1-99 表示具体议案号 100 表示总议案
VotingSubProposal	投票子议案号或选举候选人 0 表示所有子议案 >0 其他表示具体子议案
VotingPreference	投票意向 (非累积投票议案填写)

	1=同意 2=反对 3=弃权
OrderQty	投票数量（累积投票议案填写）

4.9.2 投票执行报告（Evote Report）

表 0-81 TGW 向 OMS 传送投票执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202196
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识 210=投票
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	投票代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型 0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
VotingProposal	投票议案号

VotingSubProposal	投票子议案号或选举候选人
VotingPreference	投票意向
OrderQty	投票数量

4.10 业务消息-密码服务处理

4.10.1 密码服务 (Password Service)

表 0-82 OMS 向 TGW 报送密码服务请求消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102489
ApplID	应用标识 240=密码服务激活 241=密码服务挂失或重置
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码 固定填全空格
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
ValidationCode	密码激活或重置校验号

注：

- 1) 各类密码服务证券代码填写如下：

服务类型	证券代码	证券代码源
中国结算总部网站注册	369991	102
网络投票	369999	102

4.10.2 密码服务执行报告 (Password Service Report)

表 0-83 TGW 向 OMS 传送密码服务执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202488
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型 0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason	拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
ValidationCode	密码激活或重置校验号

4.11 业务消息-保证金查询处理

4.11.1 保证金查询 (Margin Query)

表 0-84 OMS 向 TGW 报送保证金查询请求消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头

	MsgType=102587
ApplID	应用标识 250=保证金查询
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码 固定填全空格
SecurityIDSource	证券代码源 固定填全空格
OwnerType	订单所有者类型 固定填 0
ClearingFirm	结算机构代码 固定填全空格
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户查询编号
FundPBUID	结算账号

4.11.2 保证金查询结果（Margin Query Result）

表 0-85 TGW 向 OMS 传送保证金查询结果消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202586
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息

ClOrdID		客户查询编号
ExecID		执行编号
ExecType		执行类型 0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason		拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
FundPBUID		结算账号
NoMarginItems		保证金条目个数
→	MarginItem	保证金条目类别 1=保证金可用余额 2=保证金总金额
→	MarginAmount	保证金金额

注：

- 1) 保证金查询失败，则保证金条目个数为 0；查询成功则保证金条目个数为 2，返回保证金可用余额和保证金总金额。

五、 其它消息

5.1 业务拒绝消息 (Business Reject)

表 0-1 TGW 向 OMS 传送业务拒绝消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=4
ApplID	应用标识
TransactTime	回报时间
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
RefSeqNum	被拒绝消息的消息序号
RefMsgType	被拒绝的消息类型
BusinessRejectRefID	被拒绝消息对应的业务层 ID，需要填写业务层 ID 的消息参见下面的列表。
BusinessRejectReason	拒绝原因

BusinessRejectText	拒绝原因说明
--------------------	--------

注：

- 1) 消息及业务层 ID 对应表：

表 0-2 业务消息类型与业务拒绝消息业务层 ID 对应表

消息类型	被拒绝消息对应的业务层 ID
新订单 (New Order)	ClOrdID
撤单请求 (Order Cancel Request)	ClOrdID
报价 (Quote)	QuoteMsgID
意向申报 (IOI)	IOIID
成交申报 (TCR)	TradeReportID
注册	ClOrdID
投票	ClOrdID
投资者网络投票密码服务	ClOrdID

5.2 回报同步消息 (Report Synchronization)

本消息用于 OMS 在成功登录 TGW 后,告知 TGW 对应分区期望接收的下一条回报的记录号。

表 0-3 OMS 向 TGW 传回报同步消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=5
NoPartitions	平台分区数量
→ PartitionNo	OMS 期望接收的平台分区号
→ ReportIndex	对应分区下, OMS 期望接收的下一条回报的记录号(回报记录号从 1 开始连续编号)。收到本消息后, TGW 会从该记录号开始向 OMS 发送该平台分区的回报;如果没有收到某一分区的记录号,则 TGW 不会向 OMS 发送该分区的回报。

5.3 平台状态消息 (Platform State Info)

本消息用于新一代交易系统向 OMS 提供各平台的当前状态,便于 OMS 控制是否发送委托。

OMS 成功登录到 TGW 后,会收到一条平台状态消息,消息中描述相应平台的当前

状态。当每个平台的状态发生变化时，OMS 都会收到一条平台状态消息，描述该平台的最新状态。

表 0-4 TGW 向 OMS 传送平台状态消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=6
PlatformID	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台
PlatformState	平台状态 0=PreOpen，未开放 1=OpenUpComing，即将开放 2=Open，开放 3=Halt，暂停开放 4=Close，关闭

5.4 回报结束消息 (Report Finished)

TGW 使用该消息通知 OMS 本交易日当前平台对应分区回报发送完毕。

表 0-5 TGW 向 OMS 传送回报结束消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType=7
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号 该回报记录号与本分区各类回报消息中的回报记录号连续编号
PlatformID	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台

注：

- 1) OMS 收到本平台所有分区对应的回报结束消息后,才说明本交易日对应平台所有回报接收完毕。
- 2) 平台对应的分区信息,参见“平台信息消息 (Platform Info)”。

5.5 平台信息消息 (Platform Info)

本消息用于 TGW 向 OMS 提供各平台的基本信息,便于 OMS 控制回报同步。

OMS 成功登录到 TGW 后,除了会收到一条平台状态消息外,还会收到一条平台信息消息,消息中描述了相应平台的分区数量及分区号等信息。建议 OMS 收到平台信息消息后,才开始发送回报同步消息。

表 0-6 TGW 向 OMS 传送平台信息消息定义

域名		字段描述
Standard Header		MsgType = 9
PlatformID		平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台
NoPartitions		平台分区数量
→	PartitionNo	平台分区号,分区号不一定连续

六、数据字典

本接口规范中的所有整数类型字段都采用高字节序 (BIG-ENDIAN) 编码方式。

6.1 数据类型

表 0-1 数据类型定义

数据类型	二进制类型	说明
Price	Int64	价格, N13(4)
Qty	Int64	数量, N15(2)
Amt	Int64	金额, N18(4)
SeqNum	Int64	消息序号
Boolean	uInt16	1=True/Yes,0=False/No
Length	uInt32	长度 表示字节为单位的数据长度,正数
LocalTimeStamp	Int64	本地时间戳 YYYYMMDDHHMMSSsss (毫秒),

		YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60 (秒), sss=000-999 (毫秒)。
NumInGroup	uInt32	重复数 表示重复组的个数, 正数
LocalMktDate	uInt32	本地市场日期 格式 YYYYMMDD, YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31
SecurityID	char[8]	证券代码
PBUID	char[6]	交易单元代码
AccountID	char[12]	证券账户
BranchID	char[4]	营业部代码

注:

- 1) 表中的 Nx(y)表示相应的类型实际为浮点数类型, 其中 x 表示整数与小数总计位数, 不包括小数点, y 表示小数位数, 比如对于 Price 类型, Int64 值 186400 表示的价格为 18.6400。
- 2) 在某些应用场景下, 一个消息中可能有部分字段不需要填写, 如果是字符串型字段则填写全空格, 如果是数值型字段则填写 0。
- 3) char[x]表示字符串, x 表示字符串最大字节数, 除非特别声明, 字符串只可包含数字、大写字母、小写字母以及空格; 字符串实际长度小于字段类型最大长度的都后补空格; 字符串统一使用 UTF-8 编码。特别地, char[]表示变长字符串。其字节数由前导字段指定。

6.2 会话层域定义

表 0-2 会话层域定义

域名	类型	说明
BodyLength	uInt32	消息体长度
MsgType	uInt32	消息类型
SenderCompID	char[20]	发送方代码
TargetCompID	char[20]	接收方代码
Password	char[16]	密码
Text	char[200]	文本信息 可能包含中文字符, 表示最多 200 个

		字节
HeartBtInt	Int32	心跳监测的时间间隔 为系统设定值,以秒为单位
DefaultApplVerID	char[32]	通信版本号 填写为 n.xy 如通信版本号为 1.01 时,则字段应设置为 1.01。
SessionStatus	Int32	会话状态

6.3 业务层域定义

表 0-3 业务层域定义

域名	类型	说明
AccountID	AccountID	证券账户
ApplID	char[3]	应用标识
BidPositionEffect	char	买开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
BidPx	Price	买报价
BidSize	Qty	买数量
BranchID	BranchID	营业部代码
BusinessRejectReason	uInt16	拒绝原因:
BusinessRejectRefID	char[10]	被拒绝消息对应的业务层 ID
BusinessRejectText	char[50]	拒绝原因说明 可能包含中文字符,表示最多 50 个字节
CashMargin	char	融资融券信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融券融券平仓
CashOrderQty	Amt	订单现金金额

ClearingFirm	char[2]	结算机构代码 00=中国证券登记结算总公司 01=中国证券登记结算公司深圳分公司 09=自建 TA
ClOrdID	char[10]	客户订单编号
ConfirmID	char[8]	约定号
ContactInfo	char[30]	联系方式 可能包含中文字符，表示最多 30 个字节
ContactOr	char[12]	联系人 可能包含中文字符，表示最多 12 个字节
ContractAccountCode	char[6]	合约账户标识码
CounterpartyAccountID	AccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	BranchID	对手方营业部代码
CounterpartyExecID	char[16]	交易所赋予的执行编号，单个交易日内不重复
CounterpartyPBUID	PBUID	对手方交易单元
CoveredOrUncovered	uInt8	备兑标签，衍生品交易填写 0=Covered，表示备兑仓 1=UnCovered，表示普通仓
CumQty	Qty	累计执行数量
CxlRejReason	uInt16	撤单拒绝原因代码，正数
DeductionAccountID	AccountID	用于扣划证券的证券账户
DeductionPBU	PBUID	用于扣划证券的交易单元
DeliverQty	Qty	证券交付数量

DesignationInstruction	char	注册指令 3 表示转托管
DesignationTransType	uInt8	注册指令类型 1=New, 表示新注册请求 3=Cancel, 表示注册撤单
DisposalAccountID	AccoutID	待处置券存放账户
DisposalPBU	PBUID	待处置券存放交易单元
ExecID	char[16]	交易所赋予的执行编号, 单个交易日内不重复
ExecType	char	执行报告类型 0=New, 表示新订单 4=Cancelled, 表示已撤销 8=Reject, 表示已拒绝 F=Trade, 表示已成交
ExpirationDays	uInt16	期限, 单位为天数
ExpirationExecInst	uInt8	到期续做方式 1=到期自动续做 2=到期手动续做
ExpirationType	uInt8	期限类型 1=固定期限
FundPBUID	char[6]	结算账号
IMCRejectText	char[]	国际市场互联对方市场拒绝原因说明 变长字符串, 长度由 IMCRejectTextLen 字段指示
IMCRejectTextLen	NumInGroup	指示 IMCRejectText 字段 长度
InsufficientSecurityID	char[8]	申购赎回不足成份股证券 代码

IOIID	char[10]	客户意向申报编号
IOIQty	Qty	意向申报数量
IOIRefID	char[10]	原意向申报 IOIID 撤销意向申报时使用
IOITransType	char	意向申报类型 N=意向申报 C=意向申报撤单
LastPx	Price	成交价格
LastQty	Qty	成交数量
LeavesQty	Qty	订单剩余数量
LenderAccountID	AccountID	出借券证券账户
LenderPBU	PBU	出借券交易单元
LotType	char	订单数量类型 1=零股订单, Odd Lot 2=整手订单, Round Lot
MarginAmount	Amt	保证金金额
MarginItem	uInt8	保证金条目类别 1=保证金可用余额 2=保证金总金额
MaturityDate	LocalMktDate	到期日
MaxPriceLevels	uInt16	最多成交价位数, 正数 0 表示不限制成交价位数
MinQty	Qty	最低成交数量
NoMarginItems	NumInGroup	保证金条目个数
NoPartitions	NumInGroup	分区个数
NoPartyIDs	NumInGroup	参与方个数
NoSecurity	NumInGroup	证券只数
OfferAccountID	AccoutID	卖方证券账户
OfferBranchID	BranchID	卖方营业部代码

OfferPBUID	PBUID	卖方交易单元
OfferPositionEffect	char	卖开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
OfferPx	Price	卖报价
OfferSize	Qty	卖数量
OrderID	char[16]	交易所订单编号 交易所赋予的订单编号， 跨交易日不重复
OrderQty	Qty	订单数量
OrderRestrictions	C4	订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如没有限定类型则填空
OrdRejReason	uInt16	订单拒绝原因代码，正数
OrdStatus	char	订单状态 0=New，表示新订单 1=Partially filled，表示部分成交 2=Filled，表示全部成交 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝
OrdType	char	订单类型 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优
OrigClOrdID	char[10]	原订单 ClOrdID
OrigSubmittingPBUID	PBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeDate	LocalMktDate	初始成交申报申报日期

OrigTradeID	char[16]	初始成交申报的 TradeID
OrigTradeReportID	char[10]	初始交易客户成交申报编号
OwnerType	uInt16	所有者类型，正数 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起 106=结算结构发起
PartitionNo	Int32	平台分区号
PlatformID	uInt16	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台
PlatformState	uInt16	平台状态 0=PreOpen，未开放 1=OpenUpComing，即将开放 2=Open，开放 3=Halt，暂停开放 4=Close，关闭
PledgeeType	uInt16	质权人类型
PositionEffect	char	开平仓标识 O 表示开仓 C 表示平仓

Price	Price	价格
PriceType	uInt8	价格类型 1=百分比 3=固定数量
QuoteMsgID	char[10]	客户报价消息编号
QuoteRejectReason	uInt16	意向申报拒绝原因代码， 正数
QuoteReqID	char[10]	报价请求 ID
QuoteRequestRejectReason	uInt16	询价请求拒绝原因代码
QuoteRespID	char[16]	交易所意向申报编号 交易所赋予的意向申报编号，跨交易日不重复
QuoteRespType	uInt8	意向申报响应类型 2=意向申报响应
QuoteStatus	uInt8	报价状态 0=Accepted，接受 5=Rejected，拒绝
QuoteType	uInt8	报价类型 1=Tradeable，表示可交易的报价
RefMsgType	uInt32	被拒绝的消息类型
RefSeqNum	SeqNum	引用的消息序号
RejectText	char[16]	拒绝原因说明 可能包含中文字符，表示最多 16 个字节
ReportIndex	SeqNum	回报记录号，从 1 开始编号
ReportingPBUID	PUBID	回报交易单元
RptExecID	char[16]	成交申报执行编号
SecurityID	char[8]	证券代码

SecurityIDSource	char[4]	证券代码源 102=深圳证券交易所
ShareProperty	char[2]	股份性质
Side	char	买卖方向 1=买 2=卖 G=借入 F=出借 D=申购 E=赎回
StopPx	Price	止损价格
SubmittingPBUID	PBUID	申报交易单元
SubstCash	Amt	现金替代金额
Tenderer	char[6]	要约收购参与者编码
TimeInForce	char	订单有效时期类型 0=当日有效, Day (港股通增强限价盘) 3=即时成交或取消 (IOC) 9=At Crossing (港股通竞价限价盘)
TimeToExpiration	uInt16	期限, 单位为天数, 正数
TradeHandlingInstr	char	成交申报模式 0=Trade Confirm, 成交确认 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3=One-Party Report for Pass Through, 成交请求
TradeID	char[16]	交易所成交申报编号 交易所赋予的成交申报编号, 跨交易日不重复

TradeReportID	char[10]	客户成交申报编号
TradeReportRefID	char[10]	原客户成交申报编号，最多 8 个字符
TradeReportRejectReason	uInt16	成交申报拒绝原因代码
TradeReportTransType	uInt8	成交申报事务类别 0=New，新申报 1=Cancel，撤销申报 2=Replace，响应
TradeReportType	uInt8	成交申报消息类型 0=Submit，提交成交申报 1=Alleged，转发成交申报 2=Accept，接受成交申报 3=Decline，拒绝成交申报
TransactTime	LocalTimestamp	订单或执行的创建时间
TransfereePBUID	PBUID	转入交易单元代码
TrdAckStatus	uInt8	成交申报响应状态 0=Accepted，接受 1=Rejected，拒绝
TrdMatchID	char[16]	交易编号，跨交易日唯一
TrdRptStatus	uInt8	成交申报状态 0=Accepted，接受 1=Rejected，拒绝 2=Cancelled，已撤销 100=Unmatched，尚未匹配 101=Matched，已匹配
TrdSubType	uInt16	成交申报子业务类别 对于协议交易业务取值如下： 0=非受限股份转让 1=受限股份转让

		其他业务固定填 0
TrdType	uInt16	成交申报类型，正数 1001=股票质押式回购初始交易 1002=股票质押式回购提前购回 1003=股票质押式回购到期购回 1004=股票质押式回购延期购回 1005=股票质押式回购终止购回 1006=股票质押式回购补充质押 1007=股票质押式回购部分解除质押 1008=股票质押式回购违约处置 1009=股票质押式回购部分购回 1010=股票质押式回购违约处置撤销 1011=约定购回初始交易 1012=约定购回提前购回 1013=约定购回到期购回 1014=约定购回延期购回 1021=质押式报价回购初始交易 1022=质押式报价回购提前购回 1031=债券质押式协议回购初始交易 1032=债券质押式协议回购购回交易

		1033=债券质押式协议回购到期续做 1041=债券质押式三方回购初始交易 1042=债券质押式三方回购到期购回 1043=债券质押式三方回购到期续做 1044=债券质押式三方回购提前购回 1045=债券质押式三方回购补券 1046=债券质押式三方回购换券 1047=债券质押式三方回购解除质押
UnderlyingSecurityID	char[8]	基础证券代码
UnderlyingSecurityIDSource	char[4]	基础证券代码源 102=深圳证券交易所
UserInfo	char[8]	用户私有信息，仅可包含ASCII可显示字符
ValidationCode	uInt32	密码激活校验号，正数
VotingPreference	char	投票意向 1 代表同意，2 代表反对，3 代表弃权
VotingProposal	uInt16	投票议案号，正数 1-99 表示具体议案号 100 表示总议案
VotingSubProposal	uInt16	投票子议案号或选举候选人，正数 0 表示所有子议案 >0 其他表示具体子议案
InvestmentType	char[2]	资金用途类型 01=生产经营

		02=补充流动资金 03=股权类投资 04=债权类投资 05=不动产投资 06=偿还债务 07=个人消费 99=其他
AlertRatio	Int32	预警线，单位为百分比， 定义为 N6(2)
SettlementRatio	Int32	平仓线，单位为百分比， 定义为 N6(2)
ExecutingTrader	char[17]	本方交易账户
CounterpartyExecutingTrader	char[17]	对手方交易账户
SettlCurrAmt	Amt	结算金额
NoBaskets	NumInGroup	质押篮子个数
BasketID	Int16	篮子编号，从 1 开始编号， 最大不超过 99
DeliverySide	char	方向 1=质押 2=解押

6.4 委托申报拒绝原因代码

表 0-4 委托申报拒绝原因代码表

原因代码	原因简称	原因说明
20001	无效账户	账户为未开户账户
20002	无效账户	账户是一个无效账户（已注销、挂失等等）
20003	无效账户	账户无对应业务产品的交易权限
20005	业务禁止	证券的业务开关关闭

20006	业务禁止	当前阶段不允许申报该类委托
20007	证券停牌	证券停牌, 不允许该类申报委托
20008	价格错误	委托价格不是价格档位的整数倍;网上发行认购价格不等于发行价;配股认购价格不等于配股价
20009	价格错误	委托价格超过涨跌幅限制;盘后定价大宗交易委托价格不为指定价格;转融通证券出借委托的费率与公布的不一致
20010	数量非法	委托数量不是数量单位的整数倍;分级基金分拆合并委托数量非配比的整数倍
20011	量额非法	委托数量和金额都未满足最低交易门槛要求;委托数量或金额超过上限;开放式基金申购未满足最低申购金额要求
20012	业务禁止	对折算率为 0 的证券不允许申报质押式回购质押申报; 对非 A 股证券, 成交申报业务子类别必须为非受限股份转让
20013	业务禁止	融资融券标的的不存在或业务被禁止;申报转融通证券出借委托, 证券代码和期限不在当天发布的标的范围内;证券代码不在当天发布的港股通标的范围内;证券代码不在股票质押式回购业务标的范围内
20014	业务禁止	证券当天集中竞价没有成交, 不能申报以成交量加权平均价交易的委托
20015	业务禁止	融券卖出禁止申报市价委托
20016	价格错误	融券卖出委托价格不满足提价检查要求
20017	无效账户	信用账户只能买入担保品证券
20018	无效账户	非信用账户申报融资融券委托
20019	无效单元	债券分销业务中, 卖委托的交易单元非承销商交易单元
20020	无效账户	债券分销业务中, 卖委托的证券账户非承销商证券账户或者买委托的证券账户为承销商证券账户
20021	数量超限	债券分销业务中, 自行挂牌量超出自行挂牌总

		量
20022	股份卖空	持有股份不足;质押式报价回购初始交易数量大于可用标准券数量
20023	无效单元	委托的交易单元不存在;黄金 ETF 投资者交易单元找不到托管单元
20024	无效单元	委托的交易单元无对应产品的交易权限
20025	无效单元	委托的交易单元无对应业务的交易权限
20026	无效单元	信用账户必须通过信用交易单元申报;非信用账户必须通过非信用交易单元申报
20027	无效单元	QFII 账户未从指定交易单元申报
20028	无效单元	交易单元无对应产品的业务权限
20029	业务禁止	市场参与者业务资格被限制
20030	约定号重	协议交易成交申报约定号重复
20031	配对失败	交易双方申报要素不匹配
20032	配对失败	B 股协议交易境内账户和境外账户不能成交
20033	无对手方	协议交易点击成交申报约定号错误,未找到对应的定价申报
20034	金额非法	委托中的金额必须为金额单位的整数倍
20035	申购不足	申购 ETF 时投资者成份股不足
20036	赎回不足	赎回 ETF 时基金公司成份股不足
20037	现金超限	现金替代部分超过上限
20038	无效账户	合约账户标识码与申报交易单元对应的结算账号不一致;保证金查询指令中的结算账号与交易单元不匹配或交易单元无对应结算账号
20039	重复认购	网上发行重复认购
20040	无效单元	非证券金融公司专用交易单元申报借入委托;证券金融公司专用交易单元申报出借委托;非金交所专用交易单元申报委托;
20041	股份卖空	解押业务中对应的已质押股份不足
20042	股份卖空	解押业务中对应的标准券不足
20046	无法成交	市价委托不满足成交条件撤单
20047	规模超限	基金累计申购或赎回总规模超限;质押式报价回购总规模超限;国际市场互联额度不可用

20048	规模超限	单个账户基金累计申购或赎回规模超限
20049	规模超限	基金净申购或净赎回总规模超限
20050	规模超限	单个账户基金净申购或净赎回规模超限
20051	购回期限错误	回购天数超过业务限制
20055	无效会员	会员无对应业务的交易权限
20056	无效账户	非业务指定交易的证券账户
20059	金额超限	当日净买入金额超出设定限额
20060	仓位不足	期权平仓检查时, 可平数量不足; 质押式报价回购提前购回时, 申报数量大于未到期合约数量
20061	交易量超限	超过投资者交易量限额
20062	持仓超限	超过结算参与人持仓限额
20063	持仓超限	超过投资者持仓限额
20064	资金不足	结算参与人可用资金不足
20065	平台已关闭	平台已关闭
20067	备兑标签错	备兑标签错误, 只有卖开认购合约或买平认购合约时备兑标签可以为备兑
20068	结算机构错	结算机构代码错误
20069	无效账户	委托中的账户为结算受限账户
20070	无效账户	委托中的账户为不合格账户
20071	OwnerType 错误	强平主动撤单的 OwnerType 必须与原委托的一致
20073	报价错误	双边报价申报的买价必须低于卖价
20074	无效业务	强平委托必须是限价委托
20075	报价撤销	报价被更新或撤销
20076	申报方式错误	竞价委托申报方式错误, TimeInForce、OrdType、MaxPriceLevels、MinQty 字段的组合不合法
20077	无报价权限	无做市报价权限
20078	交易量超限	超过结算参与人交易量限额
20079	减持额度不足	受限股份减持, 可用额度不足
20095	撤单请求错误	主动撤单请求的 applid 或证券 id 与原委托的不一致
20096	无法撤销	主动撤单请求目标委托不能被撤销

20097	委托不存在	主动撤单未找到原始委托或者没有可以被撤销的报价
20099	重单	重单
20101	应用标识错	应用标识错误
20102	证券非法	证券不支持所申报的业务
20103	解包失败	解包失败
20104	平台未开放	平台未开放
20105	交易单元错	网关对交易单元无权限
20106	字段错误	字段取值错误
20107	消息类型非法	不支持的消息类型
20108	平台非法	委托申报的平台错误, 例如向现货集中竞价平台申报发行认购业务的委托
20110	价格类型错	价格类型错误
20111	无效单元	成交申报中的多方交易单元不属于同一会员
20112	无权限	网关无申报委托权限
20113	服务暂停	资金查询服务暂停
20114	临时停市拒绝	临时停市拒绝
20115	申报方式错误	成交申报报文 TradeHandlingInstr、TradeReportTransType、TradeReportType 字段组合不合法
20116	申报方式错误	成交请求发起方错误
20117	无效账户	证券账户无三方回购业务的正/逆回购权限
20118	篮子非法	三方回购申报的篮子个数超限; 三方回购交易业务申报的篮子编号不在质押券篮子清单范围内
20119	质押券非法	三方回购申报质押券个数不符合业务要求
20120	质押券非法	三方回购初始交易申报的指定质押券不在申报的质押券篮子内; 三方回购补券申报的证券及换券申报的换入证券不在其对应的在途合约指定质押券篮子内
20121	质押券非法	三方回购初始交易、补券、换券(仅换入)申报的指定质押券全天停牌
20122	质押券非法	三方回购换券申报的换出证券不在其对应的在途合约质押券列表中

20123	无效单元	成交申报中的对手方交易单元不存在
20124	回购期限错误	三方回购初始交易指定质押券的到期日小于合约到期日；三方回购到期续做对在途合约质押券到期日小于续做合约到期日
20125	合约不存在	三方回购到期购回、到期续做、提前购回、补券、换券未找到对应的在途合约
20126	业务禁止	三方回购到期购回、到期续做委托对应的在途合约不是当日到期合约；三方回购提前购回、换券、补券对应的在途合约不是未到期合约
20127	业务禁止	三方回购到期购回、到期续做、提前购回、补券、换券委托中交易单元、证券账户与对在途合约中交易单元、证券账户不一致
20128	金额非法	三方回购到期续做金额超过原合约金额；三方回购提前购回金额小于原合约金额；三方回购解除质押金额（场内结算）小于原合约金额
20129	证券非法	三方回购入库证券不在质押券篮子清单范围内
20130	无对手方	成交请求模式下确认方发起的委托未找到提交方申报的委托
20131	业务禁止	三方回购在途合约当前状态不允许申报该类别委托，比如已提前购回的合约不能再申报换券、补券委托，已对合约申报了到期购回，则不能再次申报到期购回或到期续做
29995	市场互联拒绝	港股通撤单请求被联交所拒绝，具体拒绝原因代码见 RejectText
29996	市场互联拒绝	港股通委托被联交所自动撤销，具体撤销原因代码见 RejectText，撤销原因说明见 IMCRejectText
29997	市场互联拒绝	港股通委托被联交所拒绝，具体拒绝原因代码见 RejectText，拒绝原因说明见 IMCRejectText
29998	市场互联拒绝	港股通委托被联交所拒绝，具体拒绝原因代码见 RejectText，拒绝原因说明见 IMCRejectText
29999	其他错误	

注：OMS 申报一笔委托后，如果收到拒绝原因为 20104（平台未开放）的业务拒绝消息（Business

Reject), 则必须在平台恢复开放后尝试重新申报该委托。

6.5 联交所拒绝原因代码

以下为联交所的拒绝原因代码说明, 摘自联交所数据接口规范《HKEx_OCG_FIX_Trading_Interface_Specifications_v1_2.pdf》, 后续联交所接口规范中的拒绝原因代码发生变化时, 本接口规范不保证及时同步更新。

表 0-5 联交所拒绝原因代码

深交所拒绝原因代码	联交所拒绝原因代码
29998 港股通新订单被联交所拒绝 (ExecType=8)	3 = Order exceeds Limit 6 = Duplicate order (e.g., dupe ClOrdID) 13 = Incorrect quantity 16 = Price exceeds current price band 19 = Reference price is not available 20 = Notional value exceeds threshold 99 = Other 101 = Price exceeds current price band (override not allowed) 102 = Price exceeds current price band
29997 港股通新订单被联交所拒绝 (ExecType=8)	0 = Other 1 = Unknown ID 2 = Unknown Security 3 = Unspecified Message Type 4 = Application not available 5 = Conditionally required field missing 8 = Throttle limit exceeded
29996 港股通新订单被联交所自动撤销 (ExecType=4)	6 = Cancel on Trading Halt 8 = Market Operation 100 = Unsolicited Cancel for original order (for cancel/replace operation which fails market validation) 103 = Mass cancelled by Broker 104 = Cancel On Disconnect 105 = Cancel due to Broker suspension

	106 = Cancel due to Exchange Participant suspension 107 = System Cancel
29995 港股通撤单请求被联交所拒绝	0 = Too late to cancel 1 = Unknown order 3 = Order already in Pending Cancel or Pending Replace status 6 = Duplicate ClOrdID (11) received 8 = Price exceeds current price band 99 = Other (default) 100 = Reference price is not available 101 = Price exceeds current price band (override not allowed) 102 = Price exceeds current price band 103 = Notional value exceeds threshold

七、 附件

7.1 新订单 (New Order) 处理流程说明

下面表中的 Time 列表示时间顺序，值相同的行数表示可能发生的多种情形，但任何时候有且只有一种情形会发生；Received 列和 Sent 列是以交易系统的视角来描述。

7.1.1 申报新订单并产生成交

表 0-1 申报新订单的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单 MsgType=10xx01
2		Execution	Rejected	Rejected	10000	0	0	0	订单被拒绝 MsgType=20xx02
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=20xx02
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=20xx02
4		Execution	Trade	Partially Filled	10000	4000	6000	1000	订单成交 1000 MsgType=20xx15

5		Execution	Trade	Filled	10000	10000	0	6000	订单成交 6000 MsgType=20xx15
---	--	-----------	-------	--------	-------	-------	---	------	-----------------------------

7.1.2 撤销尚未产生成交的新订单

表 0-2 新订单被成功撤销的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单 MsgType=10xx01
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=20xx02
3	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=20xx15
4		Execution	Canceled	Cancelled	10000	0	0	0	撤单成功 MsgType=20xx02

7.1.3 撤销已部分成交的新订单

表 0-3 申请撤销已部分成交订单的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单 MsgType=10xx01
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=20xx02
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=20xx02
4	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=190007
5		Cancel Reject		Partially Filled					撤单被拒绝， OrdStatus 填写目标 委托当前状态 MsgType=290008
5		Execution	Canceled	Cancelled	10000	3000	0	0	撤单成功

			d						MsgType=20xx02
--	--	--	---	--	--	--	--	--	----------------

7.1.4 撤销已全部成交的新订单

表 0-4 申请撤销已全部成交订单的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单 MsgType=10xx01
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=20xx02
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=20xx15
4		Execution	Trade	Filled	10000	10000	0	7000	订单成交 7000 MsgType=20xx15
5	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=190007
6		Cancel Reject		Filled					撤单被拒绝 MsgType=290008

7.1.5 撤销不存在的新订单

表 0-5 申报撤销不存在订单或已被拒绝订单的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=190007
2		Cancel Reject		Rejected					撤单被拒绝 MsgType=290008

7.2 成交申报（TCR）处理流程说明

下面表中的 Time 列表示时间顺序，值相同的行数表示可能发生的多种情形，但任何时候有且只有一种情形会发生；Received 列和 Sent 列是以交易系统的视角来描述。

7.2.1 协议配对模式

7.2.1.1 申报新成交申报

表 0-6 申报新成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
3		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Cancelled	与对手方成交申报配对失败 MsgType=20xx04
3		TCR	Replace	Submit	OnePartyReport for matching			与对手方配对成功 MsgType=20xx03

7.2.1.2 撤销尚未配对成功的成交申报

表 0-7 申请撤销尚未配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack		Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
4		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Unmatched	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写目标委托当前状态 MsgType=20xx04

4		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Cancelled	撤单成功 MsgType=20xx04
---	--	---------	--------	--------	-----------------------------	----------	-----------	------------------------

7.2.1.3 撤销已配对成功的成交申报

表 0-8 申请撤销已配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	Replace	Submit	OnePartyReport for matching			与对手方配对成功 MsgType=20xx03
4	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写目标委托当前状态 MsgType=20xx04

7.2.1.4 撤销已被拒绝的成交申报

表 0-9 申请撤销已被拒绝成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport			提交一笔成交申报

					t for matching			报撤销请求 MsgType=10xx03
4		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写 目标委托当前状态 MsgType=20xx04

7.2.1.5 撤销不存在的成交申报

表 0-10 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

7.2.2 成交报告申报模式

7.2.2.1 申报新成交申报

表 0-11 申报新成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Accepted	Accepted	成交申报被接受 MsgType=10xx03
3		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			成交确认 MsgType=20xx03
3		TCR	New	Submit	Two-Party			发给对手方的转发成交申报

								MsgType=20xx20
--	--	--	--	--	--	--	--	----------------

7.2.2.2 撤销已接受的成交申报

表 0-12 申请撤销尚未配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Accepted	Accepted	成交申报被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			成交确认 MsgType=20xx03
3		TCR	New	Submit	Two-Party			发给对手方的转发成交申报 MsgType=20xx20
4	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Accepted	Cancelled	撤销成功 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Submit	Two-Party			转发撤销请求给对手方 MsgType=20xx20

7.2.2.3 撤销已被拒绝的成交申报

表 0-13 申请撤销已被拒绝成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝

								MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 撤销请求 MsgType=10xx03
4		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

7.2.2.4 撤销不存在的成交申报

表 0-14 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 撤销请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

7.2.3 成交请求申报模式

7.2.3.1 申报新成交申报

表 0-15 申报新成交申报且对手方拒绝成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=20xx20

4	TCR		Replace	Decline	One-Party for pass-thru			对手方拒绝接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Decline	One-Party for pass-thru			转发给发起方 MsgType=20xx20

表 0-16 申报新成交申报且对手方接受成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给 对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Accept	One-Party for pass-thru			对手方接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
6		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			与对手方配对成功， 发给发起方的成交确 认 MsgType=20xx03

6		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			与对手方配对成功， 发给对手方的成交确 认 MsgType=20xx03
---	--	-----	---------	--------	------------------	--	--	---

7.2.3.2 撤销尚未配对成功的成交申报

表 0-17 申请撤销尚未配对成功成交申报的回报场景

Time	Receiv ed	Sent	TradeRep ortTransT ype	TradeRep ortType	TradeHandlin gInstr	TrdAckSt atus	TrdRptStatu s	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请 求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给 对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤 销请求 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Cancelled	撤销成功 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Alleged	One-Party for pass-thru			转发撤销请求给对手 方 MsgType=20xx20

7.2.3.3 撤销已配对成功的成交申报

表 0-18 申请撤销已被对手方拒绝成交的回报场景

Time	Receive d	Sent	TradeRep ortTransT ype	TradeRep ortType	TradeHandlin gInstr	TrdAckSt atus	TrdRptStatu s	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for			提交一笔成交申报请

					pass-thru			求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给 对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Decline	One-Party for pass-thru			对手方拒绝接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Decline	One-Party for pass-thru			转发给发起方 MsgType=20xx20
7	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤 销请求 MsgType=10xx03
8		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

表 0-19 申请撤销已被对手方接受成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给 对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Accept	One-Party for pass-thru			对手方接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party	Accepted	Unmatched	成交申报被接受

					for pass-thru			MsgType=20xx04
6		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			与对手方配对成功，发给发起方的成交确认 MsgType=20xx03
6		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			与对手方配对成功，发给对手方的成交确认 MsgType=20xx03
7	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
8		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

7.2.3.4 撤销已被拒绝的成交申报

表 0-20 申请撤销已被拒绝成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
4		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

7.2.3.5 撤销不存在的成交申报

表 0-21 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04