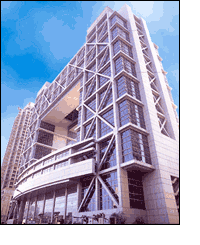
上海证券交易所技术文档



**IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书1.087版本**

**《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书1.087版本》发布说明**

2015-10-27对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 根据指数熔断，更新4.1期权行情接口文件产品实时阶段及标志。
* 根据指数熔断，更新3.1行情数据产品实时阶段及标志。

本次修订于2016年1月1日起正式生效。

2015-1-13 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 根据业务的反馈意见，更新4.6期权市场参与者数据报送文件中的描述部分。
* 文件接口处理原则中，增加标志文件格式描述。

2014-12-25 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 4.6期权市场参与者数据报送文件中，去除会员机构代码表。
* 金额描述由精确到0.1厘调整为精确到0.0001元
* 调整接口中相关字段名，与股票期权试点交易规则一致

2014-12-12 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 文档名称调整为股票期权市场参与者接口规格说明书。

2014-10-30 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 4.6期权行情文件接口中，明确了相关字段的时间有效性。
* OwnerType 102=会员发起,修改为102=期权经营机构（包括其风险管理部门）发起

2014-10-28 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 4.1期权行情文件接口中，对于字段“产品实时阶段及标志”，明确该字段第二位为预留，暂填空格。

2014-09-26 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt）中，修改RFStreamID字段说明为“A0302表示期权账户资料信息，此处为唯一值”。
* 期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt）中。补充BrokerNum字段说明，“采用全称，如\*\*\*证券股份有限公司”。
* 期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt）中，补充mainMargin字段说明，“各券商按照自己（券商）的方式进行计算即可”。
* 期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt）中，补充会员机构代码
* 期权行情新增收盘集合竞价状态

2014-08-26 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 期权基础信息文件中修改SecurityStatusFlag 字段，删除第5位关于D’表示当日摘牌的合约的描述。

2014-08-21 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 期权市场参与者数据报送文件中修改报送时间，从原有的“15:30-20:00”，调整为“15:30（T日）-7:00（T+1日）”
* 成交过户数据接口中修改人民币币种描述，由RMB调整为CNY

2014-08-07对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt）中修改衍生品可用保证金金额字段说明、可买入额度字段说明，及明确自营账户无需报备。

2014-07-09对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 期权会员数据报送文件变更为期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt）
* 期权行情数据及行情文件接口中，TradingPhaseCode新增限开仓标识

2014-07-01对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 在期权基础信息文件中，修改到期日提醒为5日提醒。

2014-06-25对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 增加4.6期权会员数据报送文件，描述会员报送期权数据文件的格式
* 增加4.5期权收盘价格文件，描述期权系统闭市后的收盘价和参考结算价。

2014-05-15对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 修改期权行情文件接口中校验和字段的校验逻辑

2014-04-14对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 申报指令、证券锁定与解锁指令、行权、会员申请转处置证券账户指令、撤单指令、执行报告中增加合约账户子编码及说明
* 修改期权基础信息中期权合约状态信息标签的第一位含义，改为‘1’表示限制卖出开仓（不包括备兑开仓）和买入开仓

2014-03-04对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 修改行情数据中行情条目价格字段，由N11(3)改为N11(4)
* 修改申报指令中申报价格字段，由N11(3)改为N11(4)
* 修改申报指令响应/撤单指令成功响应消息中市价转限价订单的价格，由N11(3)改为N11(4)
* 修改执行报告中成交价格，由N11(3)改为N11(4)
* 修改行情文件接口中昨日结算价、今日开盘价、动态参考价格、最高价、最低价、最新价、申买价一、申买价二、申买价三、申买价四、申买价五、申卖价一、申卖价二、申卖价三、申卖价四、申卖价五、今日结算价，由N11(3)改为N11(4)
* 修改期权基础信息中期权行权价、合约前收盘价、合约前结算价、标的证券前收盘、涨幅上限价格、跌幅下限价格，由N11(3)改为N11(4)
* 修改成交过户数据接口中成交价格，由N11(3)改为N11(4)
* 新增保证金查询指令与保证金查询响应消息
* 成交过户数据接口中，新增币种、交易经手费字段
* 期权基础信息接口中，新增最小报价单位字段
* T0306冲销数据（成交过户数据接口）中，删除营业部代码、会员内部订单编号、订单编号、申报时间、成交价格、成交金额、开平标志字段

2014-02-13对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 修改成交过户数据接口中成交编号字段，由N16改为C16
* 修改期权基础信息文件中保证金比例一、保证金比例二，由N3改为N6(2)
* 期权成交过户数据接口中执行类型字段，增加（E=-冲销）取值
* 增加期权持仓余额对账文件
* 修改8541域字段名，由TransacTime改为TransacTimeOnly

2013-12-06对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 修改数据格式约定中，请求业务类型编号描述
* 删除标的撤单指令，合并到撤单指令中
* 删除标的证券清单文件
* 行情接口中，增加收盘价的描述

2013-12-05对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 期权基础信息接口文件，新增行权交割日字段
* 期权行情接口，更新虚拟匹配数量与虚拟未匹配数量的字段描述

2013-12-04 期权组内评审，修改如下

* 修改第3.9章节标签453的说明，增加转处置指令的描述
* 修改第3.8章节标签[48](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag309.html)的说明，增加营业部代码的描述

2013-12-03 期权组内评审，修改如下

* 营业部代码统一命名为branchId
* 记录长度更新为实际长度
* 非交易指令添加营业部代码

2013-11-26对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 调整备兑标志，1表示备兑，空格表示非备兑。
* 新增非交易指令-会员申请转处置证券账户指令。
* 新增标的证券清单文件
* 成交过户中新增营业部代码字段
* 行情文件接口和行情数据中，更新为5档行情
* 版本改为1.05版

2013-11-13对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 期权合约的产品代码，中文名改为合约编码。
* 行情接口中增加新字段“未平仓合约数”。
* 期权行情文件接口，“产品实时阶段及标志”字段第1位增加“P表示临时停牌”；第2位修改为：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。
* 行情接口中，期权交易状态字段第1位，去掉 'A'表示日中集合竞价。
* 备兑标志由C3改为C1。
* 非交易申报指令响应，去掉市价转限价说明部分。
* 非交易申报指令响应，增加冻结/解冻现货的数量字段(预留字段)。
* 期权行情文件接口， 行情数据类型MD301改为M0301.
* 成交过户数据接口，交易事务类型 TD305改为T0305.
* 期权基础信息， 参考数据类型RF301改为R0301；
* 期权基础信息， ContractID 中文名称“期权合约代码”改为“合约交易代码”。
* 成交过户数据接口， 删除“此文件每天都发送，哪怕记录数为0”。
* 期权基础信息， “ref03”改为“reff03”。
* 期权行情文件接口， 删除“期权合约更新次数”。
* 文件接口规范中,文件头字段,文件体记录数字段由N5改为N12，数据长度字段由N10改为N12。
* 期权基础信息文件接口，去掉第一行特殊记录与最后一行特殊记录。
* 成交过户数据文件接口，去掉第一行特殊记录与最后一行特殊记录。

期权基础信息文件接口中，'昨日收盘价'字段，去掉'如遇除权除息则为调整后的结算价（合约上市首日填写参考价）'说明部分。

* 期权基础信息文件接口中，'昨日结算价'字段，新增'如遇除权除息则为调整后的结算价（合约上市首日填写参考价）'说明部分。
* 期权基础信息文件接口中，'涨跌幅限制类型'字段，去掉‘R表示交易规则3.4.15和3.4.16规定的无涨跌幅限制类型’
* 期权基础信息文件接口中，'期权合约状态信息标签'字段第2位，调整为‘0’表示未连续停牌或未暂停，‘1’表示连续停牌或暂停。

2013-09-30根据所内技术开发部评审意见，进行如下的修订 (技术开发部修订)

* 更新文档到1.03版本
* 删除“非交易指令-实物交割意向”
* 更新“证券冻结与解冻指令”为“证券锁定与解锁指令”
* 修改期权基础信息中的字段，删除“交易会员持仓限制”和“保证金比例”字段；补充新字段“保证金计算比例参数一”，“保证金计算比例参数二”
* 对于期权基础信息中的“期权合约状态信息标签”字段，第一位开仓控制字段，更新了描述“卖开禁止，买开不禁止”。
* 删除单边持仓逻辑下的头寸冲销数量，更新了申报指令响应、执行报告和成交过户数据接口。
* 删除申报指令中对于“备兑优先”功能的选项。

2013-09-15根据所内技术开发部评审意见，进行如下的修订 (技术开发部修订)

* 删除799888取值及含义说明
* 修改行文描述，“TD0302”改为“TD302”；“现行权”改为“行权”
* 修改非交易申报指令相应中，关于标签151的描述，改为“非交易申报的数量”
* 修改SenderCompID的取值，改为“XSHG03”
* 其他样式优化,删除封面中的多余字符“(”

2013-09-13根据所内技术规划部反馈意见，进行如下的修订（技术开发部修订）

* 期权合约的产品代码，英文名改为SecurityID，类型改为C8。原有标的证券名SecurityID，改为UnderlyingSecurityID，标签由48改为308
* 产品价格为由N10改为N11(3)，带3位小数，精确到厘
* 单笔合约、成交金额由N16改为N16(2)，带2位小数，精确到分
* Transactime域标签由60改为8541

2013-09-05根据所内及其他接口规格讨论意见，进行如下的修订（技术开发部修订）

* 新增独立的产品代码标识，N8
* 统一字段格式，价格为N10，不带小数点，单位：厘
* 保证金、成交金额为N16，不带小数点，单位：分
* 统一行情格式中关于“动态参考价格”的描述
* 期权行情文件中补充“今日结算价”
* 期权行情文件中补充了对于集合竞价状态下，产品虚拟成交价、虚拟匹配和买/卖方未匹配量的说明
* 新增非交易申报的响应结构

2013-08-29对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* STEP消息规范-行情数据中，开盘（上次）集合竞价价格修订为动态参考价格
* 去除T日（T+1日）相关的定义
* 去除期权合约代码的解释性文字
* 结算会员持仓限额修订为交易会员持仓限额
* 执行报告中去除备兑优先相关的描述
* 格式统一

2013-08-26对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

* 新增实物交割意向申报，OTP
* STEP消息处理原则章节，补充了格式约定
* 行情数据、行情文件接口中更新了状态字段，取值位的标识说明
* 申报指令，补充了交易时段与订单类型的说明、增加了申报来源的取值类型、增加了“最小成交数量”字段、移除了结算会员代码
* 行权指令、实物交割意向、执行报告、成交过户数据、四个接口中移除结算会员代码，更新申报来源取值
* 格式调整：字体和引用说明，拼写和语法修正

2013-08-16 根据个股期权业务方案更新稿，调整并修订市场参与者接口规格（技术开发部修订）

2013-07-15 根据个股期权业务方案对市场参与部分做更新（技术开发部修订）

2012-06-06 对市价转限价订单在没有任何对手盘可供成交之际的申报应答作出补充说明

本文档为市场参与者与本所通过STEP消息和文件交互等方式进行期权交易的接口规格。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

服务电话：4009003600

通信地址：上海市浦东南路528号上海证券交易所

**目录**

[1 数据格式约定 10](#_Toc408939659)

[2 期权交易系统接口规范 11](#_Toc408939660)

[2.1 STEP消息处理原则 11](#_Toc408939661)

[2.1.1 消息流程图 11](#_Toc408939662)

[2.1.2 格式约定 12](#_Toc408939663)

[2.2 文件接口处理原则 12](#_Toc408939664)

[2.2.1 格式约定 12](#_Toc408939665)

[2.2.2 结构描述 12](#_Toc408939666)

[2.2.3 标志文件 13](#_Toc408939667)

[3 STEP消息规范 15](#_Toc408939668)

[3.1 行情数据 15](#_Toc408939669)

[3.2 申报指令 18](#_Toc408939670)

[3.3 非交易指令-证券锁定与解锁指令 20](#_Toc408939671)

[3.4 非交易指令-行权指令 22](#_Toc408939672)

[3.5 非交易指令-会员申请转处置证券账户指令 23](#_Toc408939673)

[3.6 撤单指令 25](#_Toc408939674)

[3.7 申报指令响应/撤单指令成功响应消息 27](#_Toc408939675)

[3.8 非交易申报指令响应/非交易撤单指令成功响应消息 29](#_Toc408939676)

[3.9 撤单指令失败响应消息 31](#_Toc408939677)

[3.10 执行报告 32](#_Toc408939678)

[3.11 保证金查询指令 35](#_Toc408939679)

[3.12 保证金查询响应报告 36](#_Toc408939680)

[4 文件接口规范 38](#_Toc408939681)

[4.1 期权行情文件接口mktdt03.txt 38](#_Toc408939682)

[4.2 期权基础信息 reff03MMDD.txt 43](#_Toc408939683)

[4.3 成交过户数据接口trns03XXXXX.txt 46](#_Toc408939684)

[4.4 期权持仓余额对账文件（hold03xxxxx.txt） 50](#_Toc408939685)

[4.5 期权收盘价格文件（clpr03MMDD.txt） 51](#_Toc408939686)

[4.6 期权市场参与者数据报送文件（cybsXXXXXYYYYMMDD001.txt） 52](#_Toc408939687)

# 数据格式约定

**数据格式约定**参见《上海证券交易所市场参与者EzSTEP通用数据库接口规格说明书》文档。

其中，数据库接口中：

请求业务类型编号（reqid），本业务取值：

* OTO = 申报指令-期权订单（Option Trading Order Entry）
* OTU = 非交易指令-证券锁定与解锁（Option Trading UnderlyingFreeze）
* OTE = 非交易指令-行权指令/撤销行权（Option Trading Execution ）
* OTT = 非交易指令-会员申请转处置证券账户（Option Trading Transfer for Execution）
* OMR=保证金查询指令 (Option Margin Requirement）

数据广播类型（bcasttype），本业务取值：

7C期权交易执行报告

7H期权交易行情数据

消息类型（MsgType），本业务取值：

8 =申报响应或执行报告（Execution Report）

9 =申报撤消失败（OrderCancelReject）

D =申报（NewOrder Single）

F =申报撤单（OrderCancel Request）

W=行情数据（MarketData）

CH = 保证金查询指令（Margin Requirement Inquiry）

CJ = 保证金查询响应消息（MarginRequirementReport）

# 期权交易系统接口规范

## STEP消息处理原则

### 消息流程图

根据期权交易的操作流程，市场参与者通过STEP接口进行申报，交易平台通过集合竞价和连续竞价的模式进行撮合配对。发起方可以进行申报，以及相应的撤单等操作。下图描述了期权交易的STEP消息通信流程。



图表 1STEP消息交互逻辑图

### 格式约定

对于STEP消息，格式约定如下：

（一）所有的STEP消息必须包含接口中所定义的字段，且遵循接口规格中所定义的顺序；

（二）STEP消息中的字段对于字符型字段，空格表示空值；对于数值型字段，0表示空值；

（三）前后台对STEP消息的处理过程中，不对消息的长度做严格校验，从而支持在协议尾补充新字段的扩展。

## 文件接口处理原则

期权交易系统生成给市场参与者的文件接口为基于ASCII的TXT文本。

对于TXT文本格式，需要遵循以下的处理原则。

### 格式约定

文本txt文件，格式约定如下：

（一）竖线('|')为字段间分隔符，字段数据内容不应含有分隔符；

（二）竖线('|')不应用在每条记录的开头和结尾；

（三）各字段均为一个遵循格式定义的字符串，字段间有严格前后顺序；

（四）字段定长，字段格式定义约定了长度和精度；字符型字段以CX格式表示，其中X代表字符串长度，不足部分左对齐，右补空格；整数数字型字段以NX格式表示，其中X代表数字型字符串长度，不足部分右对齐，左补空格；浮点数字型字段以NX (Y)格式表示，其中X代表数字型字符串总长度，Y代表小数位数，X包括一位小数点，整数部分最多不超过X-Y-1位，小数部分最多不超过Y位，不足部分右对齐，左补空格；

（五）每行以二进制0x0A结束，最后一行也以0x0A结束。

（六）文档命名采取文档含义（英文缩写）和类型数字标签相结合的方式，格式为“ABCDEFxy”。第一部分“ABCDEF”为文档含义的英文缩写，“xy”为两位的阿拉伯数字，表示平台来源。例如“TRNSDT03”，TRNSDT代表事务类数据，03代表衍生品交易平台。

（七）文档中记录会采用记录标识类型，格式为“GHyzz”。“GH”取文档含义中的两个首字母，“y”从文档名称中继承，“zz”是同类文档中的细分。例如“TRNSDT03”表示非交易业务数据，记录中“TD301”表示成交数据、“TD302”表示行权数据。

### 结构描述

TXT格式的文件，将采用以下的组织结构。

（一）行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分；

（二）期权基础信息和成交过户数据接口文件仅包含文件体一个部分

（三）注意文件具有可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方应能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；

（四）文件体中，对于不同的记录数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应能根据行情数据类型识别处理；

以期权行情文件为例，其结构图如下：

图表 2文件结构示意图

文件结构描述参考：

**BeginString|Version|BodyLength|**[**TotNumTradeReports**](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag748.html)**|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|MDSesStatus**

**MDStreamID|SecurityID|Symbol|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|OpenPrice|HighPrice|LowPrice|TradePrice|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|TradingPhaseCode|Timestamp**

**……**

**……**

**……**

**EndString|CheckSum**

图表 3文件组织示例图

### 标志文件

标志文件命名规则为：主文件名.flg,其中主文件名为其所标志的文件的名字。

文件内容如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 编号 | 字段名 | 字段类型 | 描述 | 必选项 |
| 1 | File Name | C 60 | 被标志的文件名 | 是 |
| 2 | File Size | C 16 | 文件大小，以字节为单位 | 是 |
| 3 | Creation Date | C 8 | 该文件的生成日期，YYYYMMDD格式 | 是 |
| 4 | Creation Time | C 6 | 文件生成时间，  HHMMSS格式 | 是 |
| 5 | Record Number | C 12 | 文件记录数（含文件头和文件尾两行） | 是 |
| 6 | Check Sum | C 64 | MD5校验码 | 是 |
| 7 | Reserved Field | C 64 | 预留字段 |  |

表格 1：标志文件格式

文件发送方应在数据文件发送完毕后发送该标志文件，文件接收方要在发现和成功读取该标志文件后，读取数据文件。

标志文件行尾以换行符0x0A结束。

# STEP消息规范

本部分描述了市场参与者系统同上交所期权交易系统之间的接口消息文本格式，对应前面章节数据库接口表中的各消息文本字段，采用STEP格式封装。

## 行情数据

| **MktDataFull**（MDText） | **公共数据消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  本消息用来发送市场有效时段内的所有的报价行情信息，由后台向市场参与者单向发送。每条消息对应单个期权行情信息。  在STEP消息中，提供完整的交易相关信息和五档的行情数据。  **最大长度：**704字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***标签*** | ***域名*** | ***说明*** | | ***类型*** |
|  | **消息头** | **MsgType=W** | |  |
| [**963**](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag963.html) | [MDReportID](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag963.html) | 交易所行情信息编号(预留、暂不填) | | C16 |
| **1187** | RefreshIndicator | 用于标识消息中是否有新的行情数据，取值：有=1,无=0，推送已有行情信息为0，否则为1。（预留，暂填0） | | N5 |
| **48** | SecurityID | 合约编码 | | C8 |
| **8506** | TotalLongPosition | 总持仓量。单位是 （张） | | N12 |
| **8538** | TradingPhaseCode | 期权交易状态，取值范围如下：  该字段为4位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。   * 第1位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘B’表示休市时段，‘E’表示闭市时段，‘V’表示波动性中断，‘P’表示临时停牌、‘U’收盘集合竞价。‘M’表示可恢复交易的熔断（盘中集合竞价）,‘N’表示不可恢复交易的熔断（暂停交易至闭市） * 第2位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填空格） * 第3位：‘0’表示不限制开仓，‘1’表示限制备兑开仓，‘2’表示卖出开仓，‘3’表示限制卖出开仓、备兑开仓，‘4’表示限制买入开仓，‘5’表示限制买入开仓、备兑开仓，‘6’表示限制买入开仓、卖出开仓，‘7’表示限制买入开仓、卖出开仓、备兑开仓 * 第4位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’ 表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。 | | C4 |
| **8504** | TotalValueTraded | 当日累计成交金额，精确到分 | | N16(2) |
| [**387**](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag387.html) | [TotalVolumeTraded](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag387.html) | 当日累计成交数量 | | N12 |
| **268** | NoMDEntries | 行情条目个数，取值=16，本重复组依次包括今开盘价(269=4)、结算价(269=6)、最高价(269=7)、最低价(269=8)、动态参考价格(269=x)（该价格即为断路器参考价）、最新价(269=2)、以及五档买入价量信息(269=0，MDEntryPositionNo从1至5)、五档卖出价量信息(269=1，MDEntryPositionNo从1至5)，其中价格由MDEntryPx表示，数量由MDEntrySize表示。 | | N5 |
| **行情条目明细** | **269** | MDEntryType | 行情条目类别：  今开盘价=4  结算价=6  最高价=7  最低价=8  动态参考价格=x  最新价=2  买入=0  卖出=1 | C2 | |
| **270** | MDEntryPx | 行情条目价格，单位：元（精确到0.0001元） | N11(4) | |
| **271** | MDEntrySize | 行情条目数量, 如果数据组不含数量信息，则此字段不出现 | N12 | |
| **290** | MDEntryPositionNo | 行情条目买卖盘序号, 对应五档买入卖出价量的档位信息，否则此字段不出现 | N3 | |

说明：

* 在集合竞价时段内：

1. 当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第一档行情同时为动态参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格；
2. 同时，当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第一档行情数据中的申买量和申卖量分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟匹配量。
3. 同时，当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第二档行情数据中的申买量和申卖量分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟未匹配量。

* 在闭市时段内：

1. 最新价（269=2）中的价格为收盘价；
2. 今日结算价（SettlPrice）暂为0
3. 今日结算价通过期权收盘价格文件（clpr03MMDD.txt）揭示

* 产品实时阶段及标志中，第4位（是否接受新订单申报），仅在交易时段有效，在非交易时段无效。

## 申报指令

| **NewOrderSingle (ReqText)** | **申报指令消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求业务类型编号（reqid），本业务取值：OTO = 申报指令-期权订单  市场参与者使用NewOrderSingle消息进行申报指令申报，对应申报接口表中的ReqText。   1. 申报指令中的订单有效时间类型（59）取值与订单类型对应关系如下：    1. 限价申报 – GFD、FOK    2. 市价申报 – IOC、FOK    3. 市价剩余转限价申报 – GFD 2. 各交易时段允许输入的订单类型包括：    1. 集合竞价：限价申报（GFD）    2. 连续竞价：所有的订单类型与有效时间类型组合    3. 波动性中断：限价申报（GFD）    4. 收盘集合竞价：限价申报（GFD） 3. 申报指令中的备兑标签（203）适用于：    1. 买入平仓、卖出开仓：备兑、非备兑    2. 买入开仓、卖出平仓：非备兑   **最大长度：**88字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为： D=申报指令 | |  |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号，指成交申报会员内部编号。  在所有申报业务范围内，同一个交易单元的会员内部编号必须唯一，交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单，并以此编号重复作为订单重复依据。 | | C10 |
| **48** | SecurityID | 合约编码 | | C8 |
| **522** | OwnerType | 订单所有类型，取值包括：  1=个人投资者发起  101=交易所发起  102=期权经营机构（包括其风险管理部门）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 | | N 3 |
| **44** | Price | 申报价格，对于市价订单无意义，单位：元（精确到0.0001元） | | N11(4) |
| **38** | OrderQty | 申报数量（张） | | N10 |
| **54** | Side | 买卖方向，取值：1表示买，2表示卖 | | C1 |
| **77** | [PositionEffect](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag77.html) | 开仓/平仓,取值: C=平仓，O=开仓 | | C1 |
| **40** | OrdType | 订单类型，取值：  1 =市价（ Market）  2 =限价（ Limit）  K =市价剩余转限价 | | C1 |
| **59** | TimeInForce | 订单有效时间类型，取值范围：  0 ＝当日有效（GFD）  3 ＝即时成交剩余自动撤销(IOC)  4 ＝即时全部成交否则撤销(FOK)  默认情况下，限价为GFD，市价为IOC | | C1 |
| **203** | CoveredOrUncovered | 备兑标签，取值范围：  1- Covered备兑  空格 - Uncovered非备兑 | | C1 |
| **453** | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。 | | N2 |
| **发起方投资者账户** | **448** | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| **452** | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户。 | N4 |
| **发起方投资者账户子编码** | **448** | PartyID | 发起方投资者账户子编码，888 | C3 |
| **452** | PartyRole | 取500，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户子编码。  投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码（888）） | N4 |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | PartyID | 发起方申报交易单元代码，填写5位申报交易单元号，对于申报撤单，应为原始申报的申报交易单元代码。 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号。 | N4 |
| **发起方营业部代码** | **448** | PartyID | 发起方营业部代码 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为发起方的营业部代码。 | N4 |

## 非交易指令-证券锁定与解锁指令

| **NewOrderSingle (ReqText)** | **申报指令消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求业务类型编号（reqid），本业务取值：OTU = 非交易指令-证券锁定与解锁指令  市场参与者使用NewOrderSingle消息进行证券锁定与解锁指令申报，对应申报接口表中的ReqText。  **最大长度：**68字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为： D=申报指令 | |  |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号，指成交申报会员内部编号。  在所有申报业务范围内，同一个交易单元的会员内部编号必须唯一，交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单，并以此编号重复作为订单重复依据。 | | C10 |
| **308** | UnderlyingSecurityID | 证券代码，此处针对合约的标的证券 | | C6 |
| **38** | OrderQty | 现货的持仓数量（股票为股，ETF为份） | | N10 |
| **54** | Side | 锁定/解锁，取值：Z表示锁定，Y表示解锁 | | C1 |
| **453** | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。 | | N2 |
| **发起方投资者账户** | **448** | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| **452** | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户。 | N4 |
| **发起方投资者账户子编码** | **448** | PartyID | 发起方投资者账户子编码，888 | C3 |
| **452** | PartyRole | 取500，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户子编码。  投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码（888）） | N4 |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | PartyID | 发起方申报交易单元代码，填写5位申报交易单元号，对于申报撤单，应为原始申报的申报交易单元代码。 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号。 | N4 |
| **发起方营业部代码** | **448** | PartyID | 发起方营业部代码 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为发起方的营业部代码。 | N4 |

## 非交易指令-行权指令

| **NewOrderSingle (ReqText)** | **申报指令消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求业务类型编号（reqid），本业务取值：OTE = 非交易指令-行权指令  市场参与者使用NewOrderSingle消息进行行权指令申报，对应申报接口表中的ReqText。  **最大长度：**72字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为： D=申报指令 | |  |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号，指成交申报会员内部编号。  在所有申报业务范围内，同一个交易单元的会员内部编号必须唯一，交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单，并以此编号重复作为订单重复依据。 | | C10 |
| **48** | SecurityID | 合约编码，8位字符 | | C8 |
| **522** | OwnerType | 订单所有类型，取值包括：  1=个人投资者发起  101=交易所发起  102=期权经营机构（包括其风险管理部门）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 | | N 3 |
| **38** | OrderQty | 申报数量（张） | | N10 |
| **453** | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码。 | | N2 |
| **发起方投资者账户** | **448** | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| **452** | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户。 | N4 |
| **发起方投资者账户子编码** | **448** | PartyID | 发起方投资者账户子编码，888 | C3 |
| **452** | PartyRole | 取500，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户子编码。  投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码（888）） | N4 |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | PartyID | 发起方申报交易单元代码，填写5位申报交易单元号，对于申报撤单，应为原始申报的申报交易单元代码。 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号。 | N4 |
| **发起方营业部代码** | **448** | PartyID | 发起方营业部代码 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为发起方的营业部代码。 | N4 |

## 非交易指令-会员申请转处置证券账户指令

| **NewOrderSingle (ReqText)** | **申报指令消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求业务类型编号（reqid），本业务取值：OTT = 非交易指令-会员申请转处置证券账户指令  市场参与者使用NewOrderSingle消息进行会员申请转处置证券账户指令申报，对应申报接口表中的ReqText。  **最大长度：**71字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为： D=申报指令 | |  |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号，指成交申报会员内部编号。  在所有申报业务范围内，同一个交易单元的会员内部编号必须唯一，交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单，并以此编号重复作为订单重复依据。 | | C10 |
| **308** | UnderlyingSecurityID | 证券代码，此处针对合约的标的证券 | | C6 |
| **522** | OwnerType | 订单所有类型，取值包括：  1=个人投资者发起  101=交易所发起  102=期权经营机构（包括其风险管理部门）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 | | N 3 |
| **38** | OrderQty | 申报数量,个股单位为股，ETF单位为份 | | N10 |
| **747** | ExerciseMethod | 处理类别，取值包括：  Z=被指派行权违约处理  R=处置申报返还,现券由券商帐户返还投资者帐户 | | C1 |
| **453** | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。 | | N2 |
| **发起方投资者账户** | **448** | PartyID | 投资者账户 | C10 |
| **452** | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为被处置投资者帐户。 | N4 |
| **发起方投资者账户子编码** | **448** | PartyID | 发起方投资者账户子编码，888 | C3 |
| **452** | PartyRole | 取500，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户子编码。  投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码（888）） | N4 |
| **投资者申报交易单元号** | **448** | PartyID | 投资者申报交易单元代码，填写5位被处置帐户的申报交易单元号 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为被处置帐户的申报交易单元号。 | N4 |
| **投资者营业部代码** | **448** | PartyID | 投资者营业部代码，填写5位被处置帐户的营业部代码 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为被处置帐户的营业部代码。 | N4 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

## 撤单指令

| **OrderCancel Request (ReqText)** | **撤单指令消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用OrderCancel Request消息进行撤单指令，对应申报接口表中的ReqText  对于现有的请求业务类型编号（reqid）支持撤单指令的有且仅有：   * OTO = 申报指令-期权订单 * OTE = 非交易指令-行权指令 * OTT = 会员申请转处置证券账户指令   以下的请求业务类型，不支持撤单：   * OTU = 非交易指令-证券锁定与解锁指令 * OMR= 保证金查询指令   **最大长度：**72字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | | **类型** |
|  | **消息头** | MsgType取值为： F=撤单指令 | |  |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号，指成交申报会员内部编号。  在所有申报业务范围内，同一个交易单元的会员内部编号必须唯一，交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单，并以此编号重复作为订单重复依据。 | | C10 |
| **41** | OrigClOrdID | 原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤单订单的ClOrdID | | C10 |
| [**48**](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag309.html) | SecurityID | 如果是OTE/OTO指令此字段为合约编码  如果是OTT指令，此字段为6位证券代码，指针对合约的标的证券 | | C8 |
| **522** | OwnerType | 订单所有类型，取值包括：  1=个人投资者发起  101=交易所发起  102=期权经营机构（包括其风险管理部门）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 | | N 3 |
| **453** | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。 | | N2 |
| **发起方投资者账户** | **448** | PartyID | 发起方投资者帐户  如果是OTT指令，此字段为被转处置的投资者帐户 | C10 |
| **452** | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户。 | N4 |
| **发起方投资者账户子编码** | **448** | PartyID | 发起方投资者账户子编码，888 | C3 |
| **452** | PartyRole | 取500，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户子编码。  投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码（888）） | N4 |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | PartyID | 发起方申报交易单元代码，填写5位申报交易单元号，对于申报撤单，应为原始申报的申报交易单元代码。 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号。 | N4 |
| **发起方营业部代码** | **448** | PartyID | 发起方营业部代码 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为发起方的营业部代码。 | N4 |

## 申报指令响应/撤单指令成功响应消息

| **ExecutionReport (RespText)** | **申报响应/撤单指令成功响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个申报记录都分别有一个对应的申报响应。  每一个申报指令记录或撤单指令记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。  150和39组合取值含义：  成交申报成功响应：150=0, 39=0  拒绝响应：150=8, 39=8  撤单指令成功响应：150=6,39=6  市价转限价订单，在没有任何对手盘可供成交，从而自动全额撤单的情形作出如下补充说明：期权交易系统将返回一条拒绝响应信息，以造成类似于前端检查未通过时订单被拒的情形。  **最大长度：**86字节 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
|  | **消息头** | MsgType取值为：8=申报响应 |  |
| **37** | OrderID | 交易所订单编号, 取值为数字 | C16 |
| **150** | ExecType | 当前订单执行类型，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应  6=撤单成功 | C1 |
| **39** | OrdStatus | 当前申报的状态，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应  6=撤单成功 | C1 |
| [**48**](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag309.html) | SecurityID | 合约编码 | C8 |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号 | C10 |
| **41** | OrigClOrdID | 对于撤单成功响应，为原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的ClOrdID，对于申报响应，取值为空。 | C10 |
| 8541 | TransactTimeOnly | 接受请求时间，格式为HH:MM:SS.000 | C12 |
| [**845**](http://svn.tc.com/DevDTP/trunk/TSK%20任务/2013/接口协议/FIX/Fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag640.html) | DiscretionPrice | 对应申报市价转限价的订单，这里填写转为限价订单的价格，单位：元（精确到0.0001元） | N11(4) |
| **151** | LeavesQty | 对应申报是市价转撤单的时候，这里填写自动撤单的数量；对应申报是市价转限价的时候，这里填写转为限价订单的数量；当对应申报是限价订单时，填写撤单成功的数量；缺省填0 | N12 |
| **103** | OrdRejReason | 申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。  申报成功时，该字段取值为空。  申报失败时，表示拒绝的理由。 | C5 |

## 非交易申报指令响应/非交易撤单指令成功响应消息

| **ExecutionReport (RespText)** | **申报响应/撤单指令成功响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个申报记录都分别有一个对应的申报响应。  每一个申报指令记录或撤单指令记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。  150和39组合取值含义：  成交申报成功响应：150=0, 39=0  拒绝响应：150=8, 39=8  撤单指令成功响应：150=6,39=6  1362重复组（冻结/解冻数量）预留，暂不填。  **最大长度：**122字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | | **类型** |
|  | **消息头** | MsgType取值为：8=申报响应 | |  |
| **37** | OrderID | 交易所订单编号, 取值为数字 | | C16 |
| **150** | ExecType | 当前订单执行类型，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应  6=撤单成功 | | C1 |
| **39** | OrdStatus | 当前申报的状态，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应  6=撤单成功 | | C1 |
| [**48**](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag309.html) | SecurityID | 合约编码；  对于证券锁定与解锁指令及会员申请转处置证券账户指令，填写标的证券的产品代码，6位整数； | | C8 |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号 | | C10 |
| **41** | OrigClOrdID | 对于撤单成功响应，为原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的ClOrdID，对于申报响应，取值为空。 | | C10 |
| **8541** | TransactTimeOnly | 接受请求时间，格式为HH:MM:SS.000 | | C12 |
| **151** | LeavesQty | 非交易申报的数量；缺省填0 | | N12 |
| **103** | OrdRejReason | 申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。  申报成功时，该字段取值为空。  申报失败时，表示拒绝的理由。 | | C5 |
| **1362** | NoFills | 冻结/解冻数量个数，取值=3，本重复组依次包括当日可卖，可申赎(1443=101)的冻结/解冻数量，当日不可卖，可申赎（1443=102）的冻结/解冻数量，当日可卖，不可申赎（1443=103）的冻结/解冻数量。 | | N2 |
| **当日可卖、可申赎的冻结/解冻数量** | **1443** | FillLiquidityInd | 取101，表示当日可卖、可申赎。 | C3 |
| **1365** | FillQty | 冻结/解冻数量值。 | N12 |
| **当日不可卖，可申赎的冻结/解冻数量** | **1443** | FillLiquidityInd | 取102，表示当日不可卖，可申赎。 | C3 |
| **1365** | FillQty | 冻结/解冻数量值。 | N12 |
| **当日可卖，不可申赎的冻结/解冻数量** | **1443** | FillLiquidityInd | 取103，表示当日可卖，不可申赎。 | C3 |
| **1365** | FillQty | 冻结/解冻数量值。 | N12 |

## 撤单指令失败响应消息

| **OrderCancelReject (RespText)** | **撤单指令失败响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个撤单指令消息都有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理撤单申报后返回的确认信息。  **最大长度：**55字节 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为： 9=撤单指令失败响应。 |  |
| **37** | OrderID | 交易所订单编号 | C16 |
| **39** | OrdStatus | 当前订单状态，取值有：  8=拒绝响应 | C1 |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号 | C10 |
| **41** | OrigClOrdID | 原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤单订单的ClOrdID | C10 |
| **8541** | TransactTimeOnly | 接受请求时间，格式为HH:MM:SS.000 | C12 |
| **102** | CxlRejReason | 撤单失败时，撤单请求拒绝的代码。 | C5 |
| **434** | CxlRejResponseTo | 撤单响应类型，取值：  1=撤单响应 | C1 |

## 执行报告

| **ExecutionReport (ExecReportText)** | **执行报告消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息，该消息文本由成交回报表中的ExecReportText字段包含。  对于现有的请求业务类型编号（reqid）支持执行报告的指令的有且仅有：   * OTO = 申报指令-期权订单   以下的请求业务类型，不支持发送执行报告：   * OTE = 非交易指令-行权指令 * OTU = 非交易指令-证券锁定与解锁指令 * OTT= 非交易指令-会员申请转处置证券账户指令 * OMR= 保证金查询指令   **最大长度：**175字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为：8=成交回报 | |  |
| **11** | ClOrdID | 会员内部编号  以QP1开头，表示为交易所保证金强制平仓  以CV1开头，表示为交易所备兑强制平仓 | | C10 |
| **37** | OrderID | 交易所订单编号 | | C16 |
| **17** | ExecID | 成交编号 | | C16 |
| [**48**](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag309.html) | SecurityID | 合约编码 | | C8 |
| **31** | LastPx | 成交价格，单位：元（精确到0.0001元） | | N11(4) |
| **32** | LastQty | 成交数量 | | N12 |
| **151** | LeavesQty | 本次成交后申报余额数量 | | N12 |
| **54** | Side | 买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖 | | C1 |
| [**77**](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag77.html) | [PositionEffect](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag77.html) | 开仓/平仓,取值: C=平仓，O=开仓 | | C1 |
| **203** | CoveredOrUncovered | 备兑标签，取值范围：  1- Covered备兑  空格- Uncovered非备兑 | | C1 |
| **8541** | TransactTimeOnly | 订单执行时间，格式为HH:MM:SS.000 | | C12 |
| **42** | OrigTime | 原有订单请求接收的时间,式为HH:MM:SS.000 | | C12 |
| **150** | ExecType | 当前订单执行状态，取值：  F=成交 | | C1 |
| **522** | OwnerType | 订单所有类型，取值包括：  1=个人投资者发起  101=交易所发起  102=期权经营机构（包括其风险管理部门）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 | | N 3 |
| **39** | OrdStatus | 当前订单状态，取值：1=部分成交，2=已成交 | | C1 |
| **8504** | TotalValueTraded | 成交金额，精确到分 | | N17(2) |
| **453** | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。 | | N2 |
| **发起方投资者账户** | **448** | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| **452** | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户。 | N4 |
| **发起方投资者账户子编码** | **448** | PartyID | 发起方投资者账户子编码，888 | C3 |
| **452** | PartyRole | 取500，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户子编码。  投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码（888）） | N4 |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | PartyID | 发起方申报交易单元代码，填写5位申报交易单元号，对于申报撤单，应为原始申报的申报交易单元代码。 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号。 | N4 |
| **发起方营业部代码** | **448** | PartyID | 发起方营业部代码 | C5 |
| **452** | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为发起方的营业部代码。 | N4 |

## 保证金查询指令

| **MarginRequirementInquiry(ReqText)** | **保证金查询指令消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求业务类型编号（reqid），本业务取值：OMR(option margin requirement) = 保证金查询指令  市场参与者使用 MarginRequirementInquiry消息进行保证金查询查询请求，对应申报接口表中的ReqText  申报接口表中的securityid必须填写00000000（虚拟查询编码）  **最大长度：**50字节 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为CH | |  |
| **1635** | MarginReqmtInqID | 交易客户方（券商）查询申请内部编号 | | C10 |
| **453** | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=2，保证金账号、发起方的申报交易单元号。 | | N2 |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | PartyID | 保证金账号，长度为25位。 | C25 |
| **452** | PartyRole | 取100，表示当前PartyID的取值为保证金账号。 | N4 |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | **PartyID** | 发起方申报交易单元代码，填写5位申报交易单元号。 | C5 |
| **452** | **PartyRole** | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号。 | N4 |

## 保证金查询响应报告

| **MarginRequirementReport (RespText)** | **保证金查询响应报告** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个保证金查询请求都分别有一个对应的保证金查询report。  **最大长度：**105字节 | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | | **字段描述** | | | **类型** | |
|  | | **消息头** | | MsgType取值为CJ | | |  | |
| **1635** | | MarginReqmtInqID | | 交易客户方（券商）查询申请内部编号 | | | C10 | |
| 102 | | CxlRejReason | | 查询失败时，填写请求拒绝的理由，取值同Remark字段。查询成功时，填写空格。 | | | C5 | |
| 8541 | | TransactTimeOnly | | 查询时间，格式为HH:MM:SS.000 | | | C12 | |
| 1643 | | NoMarginAmt | | 查询结果总记录数，取值为2，填写符合查询条件的总记录数。 | | | N10 | |
| **总金额** | | **1645** | | MarginAmt | 总金额。单位：元，精确到分  查询失败，暂填0.00 | | N16(2) | |
| **1644** | | MarginAmtType | 取22，表示MarginAmt当前的取值为总金额。 | | N3 | |
| **可用金额** | | **1645** | | MarginAmt | 可用金额。单位：元，精确到分  查询失败，暂填0.00 | | N16（2） | |
| **1644** | | MarginAmtType | 取101，表示MarginAmt当前的取值为可用金额。 | | N3 | |
| **453** | NoPartyIDs | | 参与方个数，取值=2，保证金账号、发起方的申报交易单元号。此处填写-1，表示本域不启用。 | | | | | N2 | |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | | PartyID | | | 保证金账号，长度为25位。 | | C25 | |
| **452** | | PartyRole | | | 取100，表示当前PartyID的取值为保证金账号。 | | N4 | |
| **发起方申报交易单元号** | **448** | | PartyID | | | 发起方申报交易单元代码，填写5位申报交易单元号。 | | C5 | |
| **452** | | PartyRole | | | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号。 | | N4 | |

# 文件接口规范

本部分描述了市场参与者系统同上交所期权交易平台之间的文件接口。

## 期权行情文件接口mktdt03.txt

| **mktdt03.txt** | **行情文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  本文件为行情文件接口。对于期权交易系统生产环境，行情文件名为mktdt03.txt，当日开市前至交易结束期间实时发送。  行情文件为文本txt文件，文件描述：  （一）行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分；  （二）注意行情文件可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方应能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；  （三）文件体中，对于不同的行情数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应能根据行情数据类型识别处理；  （四）文件体记录按行情数据类型递增，同一行情数据类型按证券代码递增；  （五）对于摘牌后的产品，文件中不包含该产品的记录；  （六）如文件中数值字段取值超过约定格式最大值，取最大值，如N10取9999999999；  （七）前收盘价格，在开市之前即行发布；  （八）对于价格、金额数据，单位为人民币元。对于数量数据，合约单位为张；  （九）在集合竞价时段内，当前买入价和当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时申买量一和申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量；  （十）字段无意义或无该字段行情数据时，填空格；  （十一）交易所具体产品代码，参见相关发文通知，并参考以上处理。  **记录长度：**426字节/合约 | |

格式定义：文件头定义，第一行特殊记录：

| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | BeginString | 起始标识符 | C6 | HEADER |
| 2 | Version | 版本 | C8 | DTP1.00 |
| 3 | BodyLength | 数据长度 | N12 | 计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。  (暂不填写) |
| 4 | [TotNumTradeReports](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag748.html) | 文件体记录数 | N12 | 文件体记录数 |
| 5 | MDReportID | 行情序号 | N8 | 行情文件序号（预留，暂不填） |
| 6 | [SenderCompID](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag49.html) | 发送方 | C6 | 发送方标示符，取  XSHG03 |
| 7 | [MDTime](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag273.html) | 行情时间 | C21 | 行情时间，格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 |
| 8 | MDUpdateType | 发送方式 | N1 | 0 = 快照Full refresh  1 = 增量Incremental（暂不支持） |
| 9 | MDSesStatus | 市场行情状态 | C8 | 全市场行情状态：  该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第1位：‘S’表示全市场启动期间（开市前），‘T’表示全市场处于交易期间（含中间休市）， ‘E’表示全市场处于闭市期间。  第2位：‘1’表示开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。  第3位：‘1’表示市场行情闭市标志，未闭市取‘0’。 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

文件体定义，多条行情记录，行情数据类型取值标识字母M加类型编号。

当取值为M0301时，文件体记录格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | MDStreamID | 行情数据类型 | C5 | 行情数据类型标识符，取值  M0301表示行情数据格式类型，目前该类型包含期权交易行情 |
| 2 | SecurityID | 合约编码 | C8 | 期权合约的产品代码 |
| 3 | TotalLongPosition | 总持仓量 | N12 | 单位是 （张） |
| 4 | TradeVolume | 当日累计成交数量 | N16 |  |
| 5 | TotalValueTraded | 当日累计成交金额 | N16(2) | 精确到分 |
| 6 | PreSettlPrice | 昨日结算价 | N11(4) | 单位：元（精确到0.0001元） |
| 7 | OpenPrice | 今日开盘价 | N11(4) | 单位：元（精确到0.0001元） |
| 8 | AuctionPrice | 动态参考价格 | N11(4) | 波动性中断参考价，单位：元（精确到0.0001元） |
| 9 | AuctionQty | 虚拟匹配数量 | N12 |  |
| 10 | HighPrice | 当日最高成交价 | N11(4) | 单位：元（精确到0.0001元） |
| 11 | LowPrice | 当日最低成交价 | N11(4) | 单位：元（精确到0.0001元） |
| 12 | TradePrice | 最新成交价格 | N11(4) | 最新成交价，单位：元（精确到0.0001元） |
| 13 | BuyPrice1 | 申买价一 | N11(4) | 当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 14 | BuyVolume1 | 申买量一 | N12 |  |
| 15 | SellPrice1 | 申卖价一 | N11(4) | 当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 16 | SellVolume1 | 申卖量一 | N12 |  |
| 17 | BuyPrice2 | 申买价二 | N11(4) | 当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 18 | BuyVolume2 | 申买量二 | N12 |  |
| 19 | SellPrice2 | 申卖价二 | N11(4) | 当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 20 | SellVolume2 | 申卖量二 | N12 |  |
| 21 | BuyPrice3 | 申买价三 | N11(4) | 当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 22 | BuyVolume3 | 申买量三 | N12 |  |
| 23 | SellPrice3 | 申卖价三 | N11(4) | 当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 24 | SellVolume3 | 申卖量三 | N12 |  |
| 25 | BuyPrice4 | 申买价四 | N11(4) | 当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 26 | BuyVolume4 | 申买量四 | N12 |  |
| 27 | SellPrice4 | 申卖价四 | N11(4) | 当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 28 | SellVolume4 | 申卖量四 | N12 |  |
| 29 | BuyPrice5 | 申买价五 | N11(4) | 当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 30 | BuyVolume5 | 申买量五 | N12 |  |
| 31 | SellPrice5 | 申卖价五 | N11(4) | 当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到0.0001元） |
| 32 | SellVolume5 | 申卖量五 | N12 |  |
| 33 | SettlPrice | 今日结算价 | N11(4) | 单位：元（精确到0.0001元） |
| 34 | TradingPhaseCode | 产品实时阶段及标志 | C4 | 该字段为4位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第1位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘B’表示休市时段，‘E’表示闭市时段，‘V’表示波动性中断，‘P’表示临时停牌、‘U’表示收盘集合竞价。‘M’表示可恢复交易的熔断（盘中集合竞价）,‘N’表示不可恢复交易的熔断（暂停交易至闭市）  第2位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填空格）  第3位：‘0’表示不限制开仓，‘1’表示限制备兑开仓，‘2’表示卖出开仓，‘3’表示限制卖出开仓、备兑开仓，‘4’表示限制买入开仓，‘5’表示限制买入开仓、备兑开仓，‘6’表示限制买入开仓、卖出开仓，‘7’表示限制买入开仓、卖出开仓、备兑开仓  第4位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’ 表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。 |
| 35 | Timestamp | 时间戳 | C12 | HH:MM:SS.000 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

说明：

在集合竞价时段内：

1. 申买价一（BuyPrice1）和申卖价一（SellPrice1）中同时为虚拟动态参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格；
2. 同时，申买量一（BuyVolume1）和申卖量一（SellVolume1）分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟匹配量。
3. 同时，申买量二（BuyVolume2）和申卖量二（SellVolume2）分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟未匹配量。

在闭市时段内：

1. 最新价（TradePrice）为收盘价
2. 今日结算价（SettlPrice）暂为0
3. 今日结算价通过期权收盘价格文件（clpr03MMDD.txt）揭示

产品实时阶段及标志中，第4位（是否接受新订单申报），仅在交易时段有效，在非交易时段无效。

文件尾定义，最后一行特殊记录：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | EndString | 结束标识符 | C7 | TRAILER |
| 2 | CheckSum | 校验和 | C3 | 校验和，3位校验和  校验和是通过计算不包括校验和字段（不包括该字段后的换行符）数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模256得出，然后转化为3位ASCII码。例如，如果经计算校验和为274，则模256后的数为18，校验和域将取为ASCII字符串018 |

## 期权基础信息 reff03MMDD.txt

| **reff03MMDD.txt** | **期权公开信息接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中MMDD表示月日格式的日期。在交易日开市前发送，包含当前交易日可交易的期权合约的信息。  该接口文件说明期权的相关信息。  **处理类型：**N/A  **产品类型：**期权信息  **时间和频率：**每个交易日开市前发送  **关联文件：**无  **数据格式：**记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。  **记录长度：**342字节 | |

文件定义，多条行情记录，参考数据类型取值标识字母R加类型编号。

当取值为R0301时，文件体记录格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | RFStreamID | 参考数据类型 | C5 | 参考数据类型标识符，取值  R0301表示期权基础信息 |
| 2 | SecurityID | 合约编码 | C8 | 期权合约的合约编码 |
| 3 | ContractID | 合约交易代码 | C19 |  |
| 4 | ContractSymbol | 期权合约简称 | C20 |  |
| 5 | UnderlyingSecurityID | 标的证券代码 | C6 |  |
| 6 | UnderlyingSymbol | 基础证券证券名称 | C8 |  |
| 7 | UnderlyingType | 标的证券类型 | C3 | EBS – ETF， ASH – A股 |
| 8 | OptionType | 欧式美式 | C1 | 若为欧式期权，则本字段为“E”；若为美式期权，则本字段为“A” |
| 9 | CallOrPut | 认购认沽 | C1 | 认购，则本字段为“C”；若为认沽，则本字段为“P” |
| 10 | ContractMultiplierUnit | 合约单位 | N11 | 经过除权除息调整后的合约单位 |
| 11 | ExercisePrice | 期权行权价 | N11(4) | 经过除权除息调整后的期权行权价，精确到0.0001元 |
| 12 | StartDate | 首个交易日 | C8 | 期权首个交易日,YYYYMMDD |
| 13 | EndDate | 最后交易日 | C8 | 期权最后交易日/行权日，YYYYMMDD |
| 14 | ExerciseDate | 期权行权日 | C8 | 期权行权日，YYYYMMDD |
| 15 | DeliveryDate | 行权交割日 | C8 | 行权交割日，默认为行权日的下一个交易日，YYYYMMDD |
| 16 | ExpireDate | 期权到期日 | C8 | 期权到期日，YYYYMMDD |
| 17 | UpdateVersion | 合约版本号 | C1 | 期权合约的版本号 |
| 18 | TotalLongPosition | 当前合约未平仓数 | N12 | 单位是 （张） |
| 19 | SecurityClosePx | 合约前收盘价 | N11(4) | 昨日收盘价，右对齐，单位：元（精确到0.0001元） |
| 20 | SettlPrice | 合约前结算价 | N11(4) | 昨日结算价，如遇除权除息则为调整后的结算价（合约上市首日填写参考价），右对齐，单位：元（精确到0.0001元） |
| 21 | UnderlyingClosePx | 标的证券前收盘 | N11(4) | 期权标的证券除权除息调整后的前收盘价格，右对齐，单位：元（精确到0.0001元） |
| 22 | PriceLimitType | 涨跌幅限制类型 | C1 | ‘N’有涨跌幅限制类型 |
| 23 | DailyPriceUpLimit | 涨幅上限价格 | N11(4) | 当日期权涨停价格，单位：元（精确到0.0001元） |
| 24 | DailyPriceDownLimit | 跌幅下限价格 | N11(4) | 当日期权跌停价格，单位：元（精确到0.0001元） |
| 25 | MarginUnit | 单位保证金 | N16(2) | 当日持有一张合约所需要的保证金数量，精确到分 |
| 26 | MarginRatioParam1 | 保证金计算比例参数一 | N6(2) | 保证金计算参数，单位：% |
| 27 | MarginRatioParam2 | 保证金计算比例参数二 | N6(2) | 保证金计算参数，单位：% |
| 28 | RoundLot | 整手数 | N12 | 一手对应的合约数 |
| 29 | LmtOrdMinFloor | 单笔限价申报下限 | N12 | 单笔限价申报的申报张数下限。 |
| 30 | LmtOrdMaxFloor | 单笔限价申报上限 | N12 | 单笔限价申报的申报张数上限。 |
| 31 | MktOrdMinFloor | 单笔市价申报下限 | N12 | 单笔市价申报的申报张数下限。 |
| 32 | MktOrdMaxFloor | 单笔市价申报上限 | N12 | 单笔市价申报的申报张数上限。 |
| 33 | TickSize | 最小报价单位 | N11(4) | 单位：元，精确到0.0001元 |
| 34 | SecurityStatusFlag | 期权合约状态信息标签 | C8 | 该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第1位：‘0’表示可开仓，‘1’表示限制卖出开仓（不.包括备兑开仓）和买入开仓。  第2位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填0）  第3位：‘0’表示未临近到期日，‘1’表示距离到期日不足5个交易日。  第4位：‘0’表示近期未做调整，‘1’表示最近5个交易日内合约发生过调整。  第5位：‘A’表示当日新挂牌的合约，‘E’表示存续的合约 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

## 成交过户数据**接口**trns03XXXXX.txt

| **trns03XXXXX.txt** | **过户数据接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中XXXXX表示当前使用的交易单元（PBU）。闭市后发送，实际进行账户相关过户操作时，才会产生其中的记录。  该接口文件的组织形式同期权实时成交回报数据接口类似。  **处理类型：**事务型  **产品类型：**N/A  **时间和频率：**每个交易日闭市后发送  **关联文件：**期权系统成交日志  **数据格式：**记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。  **记录长度：**184字节 | |

文件定义，多条交易事务记录，交易事务类型取值标识字母T加类型编号。

当取值为T0305时，文件体记录格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | RFStreamID | 参考数据类型 | C5 | 参考数据类型标识符，取值  T0305表示期权成交过户数据 |
| 2 | Account | 期权的证券账户 | C10 |  |
| 3 | PartyID | 业务交易单元号 | C5 | 业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致 |
| 4 | branchId | 营业部代码 | C5 | 营业部代码 |
| 5 | OptionSubAccount | 证券账户的期权子账户编码 | C3 | 新增，证券账户的期权子账户编码。固定值”888” |
| 6 | ClOrdID | 会员内部订单号 | C10 | 会员内部订单号 |
| 7 | OrderID | 订单编号 | C16 | 交易所订单编号 |
| 8 | SecurityID | 合约编码 | C8 | 期权合约的产品代码 |
| 9 | OrigTime | 申报时间 | C6 | 申报时间，格式为HHMMSS |
| 10 | TransactTime | 成交时间 | C6 | 成交时间，格式为HHMMSS |
| 11 | TransactDate | 过户日期 | C8 | 过户日期，格式为YYYYMMDD |
| 12 | ExecID | 成交编号 | C16 | 交易所给出的成交编号 |
| 13 | LastQty | 成交数量 | N12 | 成交数量。单位是（张） |
| 14 | LastPx | 成交价格 | N11(4) | 成交价格，单位：元（精确到0.0001元）。 |
| 15 | TotalValueTraded | 成交金额 | N16(2) | 成交金额，精确到分 |
| 16 | Side | 买卖方向 | C1 | 买卖方向：B- 买入, S- 卖出 |
| 17 | PositionEffect | 开平标志 | C1 | 开平标志： O - 开仓; C - 平仓 |
| 18 | CoveredOrUncovered | 备兑期权标志 | C1 | 备兑标签，取值范围：  卖出开仓申报：  1 - Covered备兑  空格 - Uncovered非备兑 |
| 19 | ExecType | 执行类型 | C1 | 当前订单执行状态，取值：  F=成交 |
| 20 | OwnerType | 订单所有类型 | N 3 | 订单所有类型，取值包括：  1=投资者发起  101=交易所发起  102=期权经营机构（包括其风险管理部门）  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 |
| 21 | Currency | 币种 | C3 | CNY –人民币 |
| 22 | Amount | 交易经手费 | N16(2) | 单位：元，精确到分 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

当取值为T0306时，文件记录长度91字节，文件体记录格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | RFStreamID | 参考数据类型 | C5 | 参考数据类型标识符，取值  T0306表示期权冲销数据 |
| 2 | Account | 期权的证券账户 | C10 |  |
| 3 | PartyID | 业务交易单元号 | C5 | 业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致 |
| 4 | OptionSubAccount | 证券账户的期权子账户编码 | C3 | 新增，证券账户的期权子账户编码。固定值”888” |
| 5 | SecurityID | 合约编码 | C8 | 期权合约的产品代码 |
| 6 | TransactTime | 成交时间 | C6 | 成交时间，格式为HHMMSS |
| 7 | TransactDate | 过户日期 | C8 | 过户日期，格式为YYYYMMDD |
| 8 | ExecID | 成交编号 | C16 | 交易所给出的成交编号，以E开头的单独编号。如：E00000000000001 |
| 9 | LastQty | 成交数量 | N12 | 成交数量。单位是（张） |
| 10 | Side | 买卖方向 | C1 | 买卖方向：B- 买入, S- 卖出 |
| 11 | CoveredOrUncovered | 备兑期权标志 | C1 | 备兑标签，取值范围：  卖出开仓申报：  1 - Covered备兑  空格 - Uncovered非备兑 |
| 12 | ExecType | 执行类型 | C1 | 当前订单执行状态，取值：  E=冲销 |
| 13 | OwnerType | 订单所有类型 | N 3 | 订单所有类型，取值包括：  101=交易所发起 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

## 期权持仓余额对账文件（hold03xxxxx.txt）

| **hold03XXXXX.txt** | **持仓余额对账接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中XXXXX表示当前使用的交易单元（PBU）。闭市后发送，该交易单元存在持仓余额，才会产生其中的记录。  该接口文件的组织形式同期权过户接口类似。  **处理类型：**事务型  **产品类型：**N/A  **时间和频率：**每个交易日发送一次  **数据格式：**记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。  **记录长度：**52字节 | |

文件定义，多条持仓记录，持仓类型取值标识字母H加类型编号。

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | RFStreamID | 参考数据类型 | C5 | 参考数据类型标识符，取值  H0301表示持仓余额对账接口 |
| 2 | Account | 期权合约账户 | C10 |  |
| 3 | OptionSubAcctount | 期权合约子账户编号 | C3 | 固定值（暂定888） |
| 4 | PartyID | 交易单元号 | C5 | 业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致 |
| 5 | SecurityID | 合约编码 | C8 | 期权合约的编码，8位字符 |
| 6 | PositionType | 持仓方向 | C1 | L/S (权利方/义务方) |
| 7 | SellCoveredOrUncovered | 备兑期权标志 | C1 | 备兑标签，取值范围：  1 - Covered备兑  空格 - Uncovered非备兑 |
| 8 | PositionQty | 持仓余额 | N12 | 单位：张  持仓余额是扎差后持仓，扎差包括备兑持仓 |

## 期权收盘价格文件（clpr03MMDD.txt）

| clpr03MMDD.txt | 期权收盘价格文件 |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中MMDD表示月日格式的日期,在此表示当前交易日。  期权产品价格文件包含收盘价和参考结算价，闭市后由交易所向会员发送。  该接口文件的组织形式同期权基础信息接口类似。  **处理类型：**事务型  **产品类型：**N/A  **时间和频率：**每日盘后发送至市场  **数据格式：**记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。  **记录长度：**38字节  **标志文件:**无 | |

文件体定义，多条参考数据记录，参考数据类型取值标识字母R加类型编号。

取值为R0302时，文件体记录格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | RFStreamID | 参考数据类型 | C5 | 参考数据类型标识符，取值  R0302表示期权闭市价格信息 |
| 2 | SecurityID | 合约编码 | C8 | 期权合约的编码，8位字符 |
| 3 | SecurityClosePx | 期权收盘价 | N11(4) | 收盘价，单位为元，精确到0.0001元。 |
| 4 | SettlPrice | 期权参考结算价 | N11(4) | 参考结算价，单位为元，精确到0.0001元。 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

## 期权市场参与者数据报送文件（cybsXXXXXYYYYMMDD001.txt）

| cybsXXXXXYYYYMMDD001.txt | 期权市场参与者数据报送接口  市场参与者发往交易所 |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中XXXXX表示会员有效的业务交易单元（PBU），一个市场参与者使用向本所申报指定的PBU报备所有客户资料数据。  文件名中MMDD表示月日格式的日期,在此表示下一个交易日。闭市后由市场参与者向交易所报备，包括可买入额度、资金等相关信息。  该接口文件的组织形式同期权基础信息接口类似。  **处理类型：**事务型  **产品类型：**N/A  **时间和频率：**每个交易日市场参与者报送一次，15:30(T日)-16:30(T日)。  **数据格式：**记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。  **记录长度：**331字节  **标志文件:**有 | |

文件定义，多条持仓记录，帐户类型取值标识字母A加类型编号。

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | RFStreamID | 参考数据类型 | C5 | 参考数据类型标识符，取值  A0302表示期权账户资料信息，此处为唯一值 |
| 2 | BizDate | 当前交易日 | C8 | YYYYMMDD，为当前交易日 |
| 3 | BrokerCod | 市场参与者代码 | C12 | 第1第2位为国家代码，如中国为CH；第3位为地区代码，如华东区为4；第4第5位为省市代码，如上海为SH；第6位为市场参与者类别，如证券公司为S；第7位为固定值T，是保留字段，第8到第12位为该市场参与者公司的身份代码。 |
| 4 | BrokerNm | 市场参与者名称 | C48 | 市场参与者名称,可使用汉字  采用全称，如“\*\*\*证券股份有限公司” |
| 5 | PBU | 业务交易单元号 | C5 | 业务交易单元号 |
| 6 | PartyID | 营业部代码 | C5 | 营业部代码 |
| 7 | Account | 期权合约账户信息 | C10 | 账户信息 |
| 8 | OptionSubAcctount | 期权合约子账户编号 | C3 | 固定值（暂定888） |
| 9 | Underlying Account | 沪市证券账户 | C10 | 证券账户信息 |
| 10 | EAccount | 沪市E账户 | C10 | 沪市E账户信息 |
| 11 | totalMargin | 衍生品资金账户保证金总额 | N16（2） | 当前交易日数据，精确到分 |
| 12 | maintMargin | 沪市衍生品维持保证金金额 | N16（2） | 上一交易日结算后数据，按市场参与者保证金水平计算，精确到分。各券商按照自己（券商）的方式进行计算即可 |
| 13 | usableMargin | 衍生品可用保证金金额 | N16（2） | 上一交易日结算后数据，衍生品可用保证金，精确到分 |
| 14 | marginUpd | 当日资金划入划出净额 | N16(2) | 当前交易日数据，精确到分，日间转账数据  正代表资金划入，  负数代表资金划出 |
| 15 | optTotalVal | 衍生品合约市值权益 | N16(2) | 上一交易日结算后数据，含沪深，按照当日合约最新结算价计算，精确到分 |
| 16 | secTotalVal | 证券市值总额 | N16(2) | 上一交易日结算后数据，不含港股通、B股之外的所有证券市值，持有证券按照收盘价计算，精确到分 |
| 17 | secUsableFunds | 证券资金账户可用资金余额 | N16（2） | 上一交易日结算后数据，所有人民币资金，精确到分 |
| 18 | mrgTotalSecVal | 融资融券账户证券总市值 | N16(2) | 上一交易日结算后数据，含沪深,持有证券按当日收盘价计算，精确到分 |
| 19 | mrgTotalFunds | 融资融券账户资金总额 | N16(2) | 上一交易日结算后数据，精确到分 |
| 20 | mrgDbtFunds | 融资融券账户融入资金总额 | N16(2) | 上一交易日结算后数据，精确到分 |
| 21 | mrgDbtSecVal | 融资融券账户融券总市值 | N16(2) | 上一交易日结算后数据，含沪深,持有证券按收盘价计算，精确到分 |
| 22 | cltType | 分级级别 | C1 | 根据当前交易日数据情况填写，  自然人账户需填写  ‘1’表示一级，  ‘2’表示二级，  ‘3’表示三级。 |
| 23 | usableQty | 可买入额度 | N16(2) | 当前交易日数据，个人投资者限购总金额额度（买入额度，包括已使用和未使用），精确到分 |

**数据内容说明：**

1. 当日资金划入划出净额=当日总资金划入金额-当日总资金划出金额；多银行合并计算。

2、 衍生品合约市值权益=Σ（当日合约结算价\*合约单位\*权利仓张数）-Σ（当日合约结算价\*义务仓张数(含备兑) \*合约单位）。按所持有合约汇总。单位元，保留两位小数。

3、自营账户无需报备。