

上海证券交易所技术文档



新一代交易系统
市场参与者传统接口
(1.05 版)



上海证券交易所

二〇〇六年十二月二十五日

目录

1 实时数据接口规范	9
1.1. 行情接口 show2003.dbf	9
1.2. 申报接口 ordwth	15
1.3. 申报确认接口 ordwth2	19
1.4. 成交回报接口 cjhb	60
2 盘后数据接口规范	62
2.1. 过户数据接口 ghXXXXX.dbf	62
2.2. 证券帐户资料接口 zzhXXXXX.dbf	64
2.3. 席位联通接口 zxwXXXXX.dbf	65
2.4. 证券权益接口 zqyXXXXX.dbf	66
3 广播文件接口	67
3.1. 国债利息接口 gzlX.MDD	67
3.2. 买断式回购未到期余额接口 mdghljYYYYMMDD.txt	68
3.3. 账户式质押回购折算率接口 xzslMMDD.txt	69
3.4. 权证信息接口 qzxxMMDD.txt	70
3.5. 担保品及标的证券清单接口 dbpMMDD.txt	71
4 开放式基金数据接口规范	72
4.1. 开放式基金和净值数据接口	74
4.2. 开放式基金分红数据接口	76
4.3. 开放式基金帐户对帐数据接口	79
4.4. 开放式基金交易确认接口	80
4.5. 取值附表	87
4.5.1 基金业务代码与含义表	87
4.5.2 销售人代码表	90
4.5.3 返回代码表	91
5 申报与成交回报/盘后过户接口中字段转义说明	116
5.1. 其他交易类	116
5.1.1 深发行沪配售卖出	116
5.1.2 国债分销	118
5.2. 账户注册类	119

5.2.1 回购注销/回购登记	119
5.2.2 网络密码激活/网络密码注销.....	119
5.2.3 指定撤销/指定登记	119
5.3. 登记行权类	121
5.3.1 发行登记	121
5.3.2 配股/配转债.....	123
5.3.3 股票要约收购登记/股票要约收购撤销	124
5.3.4 网上投票	124
5.3.5 可转债转股.....	125
5.3.6 可转债回售.....	125
5.3.7 权证行权	125
5.3.8 开放式基金路由	126
5.4. 转换类	128
5.4.1 账户式质押回购入库/出库	128
5.4.2 ETF 申购/赎回.....	128
5.4.3 权证创设/注销	130
5.5. 融资融券非交易过户	131
5.5.1 余券划转	131
5.5.2 还券划转	131
5.5.3 担保品划转.....	132
5.5.4 券源划转	132
6 附录：营业部代码换码算法示例	134

《市场参与者传统接口》1.05 版发布说明

为了配合市场参与者接入新一代交易系统有关技术系统就绪工作，上证所向市场参与者发布本文档（文档编号 SSE-D0605）。本文档当前版本为 1.05，发布日期 2006 年 12 月 25 日。

各市场参与人务必根据本文档调整柜台系统和行情系统等有关系统，并进行充分测试。如果市场参与人使用本文档规定之外的接口特征，所造成一切后果由市场参与人自负。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

服务电话：021-68644780

电子邮件：ngts@sse.com.cn

通信地址：上海市浦东南路 528 号上海证券交易所技术中心

网站地址：<http://www.sse.com.cn/> → 新交易系统专区 → 技术资料

《市场参与者传统接口》1.04 版发布说明

为了配合市场参与者接入新一代交易系统有关技术系统就绪工作，上证所向市场参与者发布本文档（文档编号 SSE-D0605）。本文档当前版本为 1.05，发布日期 2006 年 11 月 30 日。

本次接口文档变更的主要内容如下：

1. 增加各种非交易业务在行情文件接口 Show2003.dbf 中的场景描述。
2. 增加部分非交易业务在过户文件接口 ghXXXXX.dbf 中的示例。
3. 说明新交易系统切换上线之后，申报确认接口中 Remark 字段增加的可能取值。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

《市场参与者传统接口》1.03 版发布说明

为了配合上海证券交易所交易规则中第 3.3.8 款融资融券有关业务的开展，以及支持市场参与者接入新一代交易系统有关技术系统就绪工作，上证所向市场参与者发布本文档（文档编号 SSE-D0605）。本文档当前版本为 1.03，发布日期 2006 年 7 月 15 日。

本次接口变更的主要内容如下：

1. 增加融资融券业务时的错误代码。
2. 增加融资融券交易业务对过户数据接口 ghXXXXX.dbf 中的 BS 字段取值调整的描述。
3. 增加融资融券担保品及标的证券清单接口 dbpMMDD.txt 的说明。
4. 增加融资融券非交易过户有关的转义说明。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

《市场参与者传统接口》1.02 版发布说明

为了配合上海证券交易所交易规则中第 3.3.8 款融资融券有关业务、第 3.4.4 款市价订单有关业务以及第 5.2.1 款开放式集合竞价有关业务的开展，上证所向市场参与者发布本文档（文档编号 SSE-D0605）。本文档当前版本为 1.02，发布日期 2006 年 6 月 15 日。

本次接口变更的主要内容如下：

1. 行情接口 `show2003.dbf` 支持在每个交易日 9:15 至 9:25 开盘集合竞价期间，披露虚拟开盘参考价格、虚拟匹配量和虚拟未匹配量。
2. 申报接口 `ordwth` 和申报确认接口 `ordwth2` 支持两种方式的市价订单申报，即最优五档即时成交剩余撤销和最优五档即时成交剩余转限价。
3. 申报接口 `ordwth` 和申报确认接口 `ordwth2` 支持融资融券业务订单的申报。
4. 增加市价订单时的错误代码。

上证所将同步发布升级后的 A 股场外报盘软件（版本号：Awx62(DLL 版本 1.14)）和 B 股场外报盘软件（版本号：Bwx62(DLL 版本 1.01)）。该版本的报盘软件可兼容以前的申报接口，但对开展本次新增业务的会员，必须按照本文档调整升级其柜台系统。

同时，上证所新交易系统有关测试即将开始，请会员务必于 2006 年 9 月 30 日之前，按照本文档中黄底红字描述的“新交易系统切换后”的有关说明，调整升级其柜台系统。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

《市场参与者传统接口》1.01 版发布说明

为了配合市场参与者接入上海证券交易所新一代交易系统的开发、测试工作，上海证券交易所向市场参与者发布本文档（文档编号 SSE-D0605）。本文档当前版本为 1.01，发布日期 2006 年 5 月 26 日。

本文档是上证所新交易系统**传统接口**的规格说明书。**传统接口**指上证所历年来对市场参与者发布的接口的总和。对于一些上证所已经不再使用或者停止提供技术支持的接口，比如 DBF 格式的报盘接口，三档行情 SHOW128.DBF 等不包括在本文定义的传统接口中。

新交易系统将在上线之初继续支持传统接口。但是由于新交易系统支持传统接口采用的是仿真模式，所以与系统升级以前的实现方式略有不同。**市场参与者必须使用本文档作为接口规格说明书用以调整和维护其柜台系统。**

传统接口的详细变化参见正文。主要变化可概括如下：

- 接收返回确认表 ordwth2 中，上证所主机订单编号字段（teordernum）只在同一个证券代码内唯一，不在整个市场内唯一。
- 成交回报数据表 cjhb 中，本次余额字段（bcye）在买卖成交中将被置为零；成交编号字段（cjbh）只在同一证券代码内唯一，不在全市场唯一；对于一个业务产生多条成交回报的情况，比如 ETF 申购/赎回、权证创设/注销以及新质押式国债入库/出库，成交编号字段（cjbh）不再连续递增，成交纪录不再连续发送。

对于上证所未来将推出的产品类型（比如金融衍生品）、订单类型（比如止损订单、冰山订单等）、业务功能（比如十档行情等），需要通过 SSE-D0603《市场参与者 STEP 接口》定义的实时接口和 SSE-D0604《市场参与者文件与报表接口》定义的文件接口来接入。传统接口不支持新交易系统切换上线之后上证所持续推出的创新产品和创新业务，并且将逐步停止技术支持，请市场参与者提前做好向 STEP 接口切换的安排。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

1 实时数据接口规范

本部分描述了市场参与者柜台系统同上证所交易系统之间的实时接口。

1.1 行情接口 show2003.dbf

show2003.dbf	行情接口
<p>描述:</p> <p>该文件存储上证所向全市场发布的实时行情信息。内容包括整体行情、指数行情与单一证券的行情。该文件按照 S1 字段递增排序。</p> <p>(1) 第 1 条记录为特殊记录，称之为整体行情。S1 为“000000”；S2 为当前时间，格式为“HHMMSS ”左对齐，其最后为两个空格；S3 为最新 A 股指数；S4 为最新 B 股指数；S6 为当前日期；S11 为闭市标志，交易期间该字段为空，闭市后该字段为“1111111111”，表示市场闭市，所有行情结束；S13 为最新上证指数；S15 为上海行情结束标志，“0”表示行情未结束，“1”表示行情结束；S17 为上海行情集合竞价结束标志，“0”表示集合竞价未结束，“1”表示集合竞价结束。S15 与 S17 的取值仅供深交所用来计算跨市场行情所用，会员柜台系统和行情系统请勿使用。该记录被标记为“删除”。</p> <p>(2) 对于指数代码（例如 000001），S1 为指数代码；S2 为指数名称；S3 为前收盘指数；S4 为今开盘指数；S5 为参与计算相应指数的成交金额；S6 为最高指数；S7 为最低指数；S8 为最新指数；S11 为参与计算相应指数的交易数量，S11 的单位和参与计算的证券类型相关，证券类型是股票的指数交易数量单位是 100 股，基金指数的交易数量单位是 100 份，债券指数的交易数量单位是手。B 股指数中成交金额 S5 字段单位为人民币元。指数类记录被标记为“删除”。</p> <p>(3) 对于证券交易行情，有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 对于暂停上市的股票（也称为 PT 类股票），行情文件中不包含该股票的记录。新交易系统切换后，行情文件中包含该股票的记录，但是标记为“删除”。 停牌证券被标记为“删除”。新交易系统切换后，例行的一小时（9:15 到 10:30）和半日（9:15 到 13:00）停牌，由于停牌期间可以接受订单输入，不再标记为“删除”。连续停牌的证券，不可以接受订单输入，仍然标记为“删除”。 对于 S3 前收盘价格、S4 今开盘价格、S5 今成交金额、S6 最高价、S7 最低价、S8 	

show2003.dbf	行情接口
<p>最新价、S9 当前买入价、S10 当前卖出价、S16 申买价二、S18 申买价三、S22 申卖价二、S24 申卖价三、S26 申买价四、S28 申买价五、S30 申卖价四、S32 申卖价五，它们的单位除 B 股为美元外，其他均为人民币元。</p> <ul style="list-style-type: none"> 对于 S15 申买量一、S17 申买量二、S19 申买量三、S21 申卖量一、S23 申卖量二、S25 申卖量三、S27 申买量四、S29 申买量五、S31 申卖量四、S33 申卖量五，它们的单位对股票为股，基金、权证为份，债券与回购为手。 S11 成交数量的单位对股票为股，基金为份，债券与回购为手，权证为 100 份。 对于 S3 前收盘价格，在开市之前即行发布。 在开盘集合竞价之后的短暂休市和中午休市期间同样揭示各档买卖价格数量等全部信息。 当 S1 为债券（国债、企债、可转债）时，由于债券交易的数量以手为单位，S5 为该债券每笔成交的价格*数量*10 的总和。 当 S1 为席位质押式国债回购代码 201***、席位质押式企业债回购代码 202***以及账户质押式国债回购代码 204***时，S5 为 100*S11*10。 当 S1 为买断式国债回购代码 203***时，S5 为 S11*100*10。新交易系统切换后，S5 为其基础产品昨日收盘价*S11*10。 在集合竞价时段（从 9:15 至 9:25 期间）内，S9 当前买入价和 S10 当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时 S15 申买量一和 S21 申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。S17 申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。S23 申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量。 <p>(4) 对于当日的其他交易类对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 深发行沪配售卖出，该业务已停止。 国债分销，同普通交易。 <p>(5) 对于当日的账户注册类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 回购注销/回购登记，当 S1 为回购注销代码 799996 时，S3 为 1.000，S2 为“回购注 	

show2003.dbf	行情接口
<p>销”。回购登记代码有关业务已经停止。</p> <ul style="list-style-type: none"> 网络密码激活/网络密码注销，当 S1 为密码服务代码 799988 或者 939988 时，S3 为 1.000，S2 为“密码服务”。 指定撤销/指定登记，当 S1 为指定撤销代码 799998 时，S3 为 1.000，S2 为“撤销指定”。当 S1 为指定登记代码 799999 时，S3 为 1.00，S2 为“登记指定”。 <p>(6) 对于当日的登记行权类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 发行登记， <ul style="list-style-type: none"> 当 S1 为发行代码 730***或者 780***等等时，S3 为发行价格。新交易系统切换后，S2 字段填对应基础代码后 4 位代码+“申购”。 根据发行业务，同时会在行情中增加对应的对应股票代码后 4 位代码+“配号”、“申购款”的记录，并置位为“删除”。 恒定设置一个置位为“删除”的记录，其 S1 为 799990，S2 为“市值股数”，S3 为 1.000。 配股/配转债， <ul style="list-style-type: none"> 当 S1 为配股代码 700***或者 760***等等时，S3 与 S4 为配股价格。新交易系统切换后，S2 字段填对应股票代码后 4 位代码+“配股”。 当 S1 为配转债代码 704***或者 764***时，S3 与 S4 为配债价格。新交易系统切换后，S2 字段填对应股票代码后 4 位代码+“配债”。 股票要约收购登记/股票要约收购撤销，当 S1 为股票要约收购代码 706***时，S3 为公布的要约收购价格。新交易系统切换后，S2 字段填对应股票代码后 4 位代码+“要约”。 网上投票，当 S1 为投票代码 738***、788***或者 938***时，新交易系统切换后，S2 字段填对应股票代码后 4 位代码+“投票”。 可转债转股，当 S1 为可转债转股代码 181***、190***或 191***时，S3 为 100.000。新交易系统切换后，S2 字段填对应债券代码后 4 位代码+“转股”。 可转债回售，当 S1 为可转债的回售代码 1009**时，S3 为公布的回售价格。新交易系统 	

show2003.dbf	行情接口
<p>统切换后，S2 字段填对应可转债代码后 4 位代码+“回售”。</p> <ul style="list-style-type: none"> • 权证行权，当 S1 为权证行权代码 582***时，S3 为行权价格；S15 为行权总量。新交易系统切换后，S2 字段填对应权证代码后 3 位代码+“行权”。 • 开放式基金路由， <ul style="list-style-type: none"> ○ 当 S1 为货币市场开放式基金申购赎回代码 519***时，S3 为 T-2 日每百万份基金收益；S8 存放 T-1 日每百万份基金收益（注：若基金百万份收益为负，将变为 0 以便处理）。 ○ 当 S1 为非货币市场开放式基金申购赎回代码 519***时，S3 为 T-2 日每百万份的基金净值；S8 存放 T-1 日每百万份的基金净值。 ○ 当 S1 为货币市场开放式基金认购代码 521***时，S3 为 1.000。新交易系统切换后，S2 字段填对应基金代码后 3 位代码+“认购”。 ○ 当 S1 为货币市场开放式基金份额转托管代码 522***时，S3 为 0.000。新交易系统切换后，S2 字段填对应基金代码后 3 位代码+ 转托”。 ○ 当 S1 为货币市场开放式基金分红设置代码 523***时，S3 为 0.000。新交易系统切换后，S2 字段填对应基金代码后 3 位代码+“分红”。 ○ 当 S1 为货币市场开放式基金转换代码 524***时，S3 为 0.000。新交易系统切换后，S2 字段填对应基金代码后 3 位代码+“转换”。 <p>(7) 对于当日的转换类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 账户式质押回购入库/出库，当 S1 为账户质押式回购入库/出库代码 09****时，S3 为 1.000。S2 字段填对应债券代码后 4 位代码+“质押”。 <ul style="list-style-type: none"> ○ 恒定设定一个置位为“删除”的记录，其 S1 为 888880，S2 为“新标准券”，S3 为 1.000。 • ETF 申购/赎回， <ul style="list-style-type: none"> ○ 当 S1 为 ETF 申购赎回代码时（例如 510051），S3 为 T-1 日该 ETF 的 IOPV，S8 为该 ETF 的 IOPV。新交易系统切换后，S2 字段填对应 ETF 代码后 3 位代码+“申赎”，S3 字段不再填写 T-1 日该 ETF 的 IOPV， 	

show2003.dbf	行情接口
<p>填空题。</p> <ul style="list-style-type: none"> 当 S1 为 ETF 申购赎回资金代码时（例如 510052），S8 为该 ETF 的 IOPV。该记录被标记为删除。新交易系统切换后，S2 字段填对应 ETF 代码后 3 位代码+“资金”。 权证创设/注销，当 S1 为权证创设/注销代码 581***时，S15 为当日累计创设总量/1000；S21 为当日累计注销总量/1000。新交易系统切换后，S2 字段填对应权证代码后 3 位代码+“创注”。 <p>(8) 对于当日的融资融券非交易过户类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 余券划转，S1 为 799981，S2 为“余券划转”； 还券划转，S1 为 799982，S2 为“还券划转”； 担保品划转，S1 为 799983，S2 为“担保划转”； 券源划转，S1 为 799984，S2 为“券源划转”。 	

序号	字段名称	描述	类型
1	S1	证券代码	C6
2	S2	证券名称	C8
3	S3	前收盘价格	N8(3)
4	S4	今开盘价格	N8(3)
5	S5	今成交金额	N12
6	S6	最高价	N8(3)
7	S7	最低价	N8(3)
8	S8	最新价	N8(3)
9	S9	当前买入价	N8(3)

10	S10	当前卖出价	N8(3)
11	S11	成交数量	N10
12	S13	市盈率	N8(3)
13	S15	申买量一	N10
14	S16	申买价二	N8(3)
15	S17	申买量二	N10
16	S18	申买价三	N8(3)
17	S19	申买量三	N10
18	S21	申卖量一	N10
19	S22	申卖价二	N8(3)
20	S23	申卖量二	N10
21	S24	申卖价三	N8(3)
22	S25	申卖量三	N10
23	S26	申买价四	N8(3)
24	S27	申买量四	N10
25	S28	申买价五	N8(3)
26	S29	申买量五	N10
27	S30	申卖价四	N8(3)
28	S31	申卖量四	N10
29	S32	申卖价五	N8(3)
30	S33	申卖量五	N10

1.2 申报接口 ordwth

ordwth	申报接口
描述: 柜台系统采取向该表追加记录的方式来向上证所发送申报。该接口除了支持标准的“交易买卖、撤单”业务以外，还采用转义的方式来支持一系列的“非交易业务”，转义规则参见第 5 章。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	rec_num	记录编号，从 1 开始，连续递增且唯一。	4 字节 Integer
2	date	记录写入日期，格式为 YYMMDD	C8
3	time	记录写入时间，格式为 HH:MM:SS	C8
4	reff	会员内部订单号，在整个申报的生命周期中，比如成交回报中，都会附带此数据作为标识字段，柜台系统可以利用此编号进行对应处理。 该字段第 1 和 2 字节填写营业部代码的转换码。营业部代码的转换码的生产方法可参见附录：营业部代码换码算法示例。 营业部代码由本所统一编制，以四字节数字字符型表示，代码使用区间为[1000, 4843]。各会员营业部代码可查阅本所网站 www.sse.com.cn ->会员专区->会员信息->基本信息。	C10
5	acc	证券账户	C10
6	stock	证券代码，可能是一个实际的可交易产品，也可能是一个非交易业务所用的辅助代码。转义发生在证券代码为辅助代码时。	C6
7	bs	买卖方向，当 stock（字段 6：证券代码）为一个实际的可交易产品时，‘B’代表买入，‘S’代表卖出。	C1
8	price	申报价格。债券交易申报价格为“每百元面值债券价格”，债券质押式回购交易申报价格为“每百元资金到期年收益”，债券买断式回购申报价格为“每百元面值债券到期购回价格”。其它为每股或者每份价格。	C8

		当订单类型为最优五档即时成交剩余撤销市价订单或者最优五档即时成交剩余转限价市价订单时，该字段取值为 1.000。	
9	qty	申报数量。债券交易、债券回购交易申报数量的单位为手（1000 元面值为一手）。其它为股或者份。	C8
10	status	发送状态，R 或 r 表示该记录还没有发送，P 表示已发往上证所。 该字段是本表中唯一会被上证所修改的字段。 柜台系统可以通过该字段来判断是否已经向上证所发送该申报。	C1
11	owflag	<p>订单类型标志</p> <p>“WTH”表示撤单。当取值为“WTH”时，bs（字段 8：买卖方向）、price（字段 9：申报价格）、qty（字段 10：申报数量）取值必需与原申报相同，ordrec（字段 12：撤单编号）取值为待撤单的 rec_num。</p> <p>对于限价订单、市价订单以及融资融券有关业务，该字段按下列规则取值：</p> <p>1. 该字段的第一位取值作为区分限价订单与市价订单的标志，取值方式如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> 为‘L’表示限价订单； 为‘M’表示最优五档即时成交剩余撤销的市价订单，含义为该申报在对手方实时最优五个价位内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分自动撤销； 为‘N’表示最优五档即时成交剩余转限价的市价订单，含义为该申报在对手方实时五个最优价位内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分按本申报最新成交价转为限价订单；如无对手方申报与该申报成交的，则按本方最优报价转为限价订单；如无本方申报的，该市价订单自动撤销； <p>2. 该字段的第二位和第三位作为支持融资融券业务所用，取值方式如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> 为“PT”表示普通的不参加融资融券的交易； 	C3

		<ul style="list-style-type: none"> 为“XY”表示担保品买卖，acc（字段 5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户；当 bs（字段 7：买卖方向）为‘B’表示买入担保品申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可作为担保品的证券；为‘S’表示卖出担保品申报，stock（字段 6：证券代码）为除回购外的股票、封闭式基金、ETF、国债、转债、权证； 为“RZ”表示融资交易，acc（字段 5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户；当 bs（字段 7：买卖方向）为‘B’表示融资买入申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可融资买入的证券；为‘S’表示在投资者信用证券账户中进行卖券还款申报，stock（字段 6：证券代码）为除回购外的股票、封闭式基金、ETF、国债、转债、权证； 为“RQ”表示融券交易，acc（字段 5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户；当 bs（字段 7：买卖方向）为‘B’表示买券还券申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可买券还券的证券；为‘S’，表示融券卖出申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可融券卖出的证券。注：融券交易时不允许以市价订单的方式卖出； 为“PC”表示平仓交易，acc（字段 5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户。当 bs（字段 7：买卖方向）为‘B’表示市场参与者进行平仓买入申报，stock（字段 6：证券代码）必须为融券卖出或被调出融券卖出范围但有合约未到期的证券；为‘S’，表示市场参与者进行平仓卖出申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可卖券还款的证券。 <p>为保持与以前接口的兼容，对于普通限价订单和第 5 章列举的非交易业务申报（比如指定登记、指定撤销等等），该字段取值即可为“LPT”，也可为“ORD”。</p>	
12	ordrec	撤单编号	C8

13	firmid	<p>B 股结算会员代码，对于 A 股投资者取值无意义。</p> <p>对于 B 股境外投资者 C9 类帐户此记录不能为空，填写 B 股结算会员代码。新交易系统切换之前，如果结算会员代码头两位为 00，须替换为两个空格。新交易系统切换后，可以直接填写中登公司公布的结算会员代码，即如果头两位为 00，无需变换。</p> <p>对于 B 股境内投资者 C1 类帐户可以不填。</p>	C5
14	checkord	校验码，上证所内部使用	Binary

1.3 申报确认接口 ordwth2

ordwth2	申报确认接口
<p>描述:</p> <p>每一个申报记录都会有一个对应的申报确认记录，包括第 5 章所列的所有非交易业务。柜台系统可以从该表读取上证所处理申报后返回的确认数据。</p> <p>rec_num（字段 1：记录编号）、date（字段 2：记录写入日期）、reff（字段 4：会员内部订单号）、acc（字段 5：证券账户）、stock（字段 6：证券代码）、bs（字段 7：买卖方向）、price（字段 8：申报价格）、qty（字段 9：申报数量）、owflag（字段 14：撤单标志）、ordrec（字段 15：撤单编号）、firmid（字段 16：席位编号）、checkord（字段 17：校验码）对应申报接口中同名字段。status1（字段 12：发送标志）对应申报接口的 status 字段。以上字段供上证所内部使用，柜台系统不得使用以上字段。</p> <p>新交易系统切换后，teordernum（字段 14：主机订单编号），只在同一个证券代码内唯一，不在整个市场内唯一。该字段供上证所内部使用，柜台系统不得使用。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	rec_num	记录编号，上证所内部使用	4 字节 Integer
2	date	记录写入日期，上证所内部使用	C8
3	time	接收确认时间，记录上证所收到申报的时间。格式为 HH:MM:SS	C8
4	reff	会员内部订单号，上证所内部使用	C10
5	acc	证券账户，上证所内部使用	C10
6	stock	证券代码，上证所内部使用	C6
7	bs	买卖方向，上证所内部使用	C1
8	price	申报价格，上证所内部使用	C8
9	qty	申报数量，上证所内部使用	C8
10	status	接收状态，‘F’表示交易所后台判断订单为废单；‘E’表示交易	C1

		<p>所前台判断订单出错；此时 remark（字段 12：错误信息）给出错误代码。</p> <p>‘?’ 表示通信故障。</p> <p>‘O’ 表示上证所成功接收该笔申报。对于卖出深发行沪配售卖出代码（609***），则表示该笔申报已经被上证所转发给深交所，有待于深交所校验处理；</p> <p>‘W’ 表示上证所成功接受该笔撤单；对于深发行沪配售卖出代码（609***），表示该笔撤单已经被上证所转发给深交所，有待于深交所校验处理。</p> <p>当订单类型为最优五档即时成交剩余自动撤销的市价订单时，且订单有效时，该字段取值为 ‘W’ 。</p>	
11	qty2	<p>撤单数量，</p> <p>对于限价订单申报记录，该字段为空；</p> <p>对于撤单记录，该字段为实际撤单返回数量；</p> <p>对于最优五档即时成交剩余自动撤销的市价订单，如果申报部分成交，该字段取值为自动撤单的数量；如果申报全部成交，则该字段取值为 0。</p> <p>对于深发行沪配售卖出代码（609***）的撤单，该字段取值为 0 。</p>	C8
12	remark	错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。	C30
13	status1	发送状态，上证所内部使用	C1
14	teordernum	主机订单编号，上证所内部使用。	C8
15	owflag	订单类型标志，上证所内部使用	C3
16	ordrec	撤单编号，上证所内部使用	C8
17	firmid	席位编号，上证所内部使用	C5
18	checkord	校验码，上证所内部使用	Binary

remark 字段取值说明

错误代码	含义
202	无效操作员代码
203	无效证券代码
204	申报时间为该证券的非交易时间
208	无效买卖标志，非‘B’或者‘S’
209	交易品种不对
211	此账号不能进行该证券交易
212	价格申报出错
213	证券已被挂起
214	该股票不参与集合竞价
215	无效帐号
216	该帐号未指定在你席位
217	帐号已被挂起
218	无效申报价格
219	申报价不能为零
220	申报价格不符合最小价格步长要求
222	申报价格超出范围
223	申报买入数量必须是 1000 的整数倍
224	无效的申报数量
225	申报数量必须大于 0
226	新股申报数量至少 1000
227	申报数量不符合最小步长要求
228	申报数量超过单笔最大允许申报的上限

错误代码	含义
231	账号可卖出的余额不足
234	股票持有量超出限量
236	不允许买入（债转股用）
237	没有卖出权限
243	基金帐号\机构帐号不能买卖此证券
244	'S'帐号不能买入
245	不能撤销指定（有卖空股票，请先补回卖空股票）
246	不能撤销指定（有申报）
247	不能撤销指定（公司卖空）
248	中央登记结算公司不允许撤销指定
250	托管席位（数据库中的 firmid）错，请用结算会员代码，可从中登公司上海分公司查询。
252	无效操作员代码
253	操作员权限不够
257	操作员申报的 rec_num 序号不连续
263	市价订单不参加集合竞价
264	最优五档即时成交剩余撤销市价订单对手方无未成交订单
265	最优五档即时成交剩余转限价市价订单对手方和本方均无未成交订单
266	该券种不允许做市价订单
267	帐户没有权限进行账户式质押回购的交易及出入库
268	场内报盘对于出入库申报的统一出错代码
269	申报类型错误
270	申报类型错误

错误代码	含义
271	该帐号已指定在你席位
272	未做指定不能交易
273	E 帐号不能通过场内申报进行交易
274	信用交易的申报帐户必须是 E 帐户
275	普通交易的申报帐户必须不是 E 帐户
276	信用买入权限不足
277	信用卖出权限不足
278	融资买入权限不足
279	卖券还款或融资平仓权限不足
280	买券还券或融券平仓权限不足
281	融券卖出权限不足
282	融券卖出申报价格低于最新成交价
283	买券还券、融券卖出、融券平仓申报的信用帐户必须配置证券公司融券专用帐户
401	无效操作员代码
403	无效申报序号
404	撤单对应申报序号检验失败
405	撤单对应的证券帐号检验失败
406	撤单对应的股票代码检验失败
407	撤单对应的买卖方向检验失败
408	对应的申报已经被撤单
409	只能通过买 799998 撤销指定
410	只能通过买 799999 重新指定
411	对应的申报已成交，不能撤单

错误代码	含义
412	不允许撤单
499	无申报可撤
731	基金公司未上传 ETF 申购赎回清单
732	ETF 状态不对
733	ETF 投资者持股不足
734	ETF 现金替代比例超过基金公司规定的比例
735	ETF 基金账号持股余额不足，投资者不能赎回
736	ETF 基金账户不能申购或赎回
740	权证无效操作员代码 (帐户初始化用)
741	权证无效数字 (帐户初始化用)
743	权证创设担保品帐户不存在。（创设与注销共用）
744	权证创设与注销对应的权证代码不存在。（创设与注销共用）
745	权证创设与注销对应的标的证券代码不存在。（创设与注销共用）
746	权证创设专用帐户中没有标的证券。（创设用）
747	权证创设专用帐户中标的证券余额不足。（创设用）
748	权证创设专用帐户中没有该权证。（注销用）
749	权证创设专用帐户中该权证余额不足。（注销用）
750	权证创设担保品帐户中没有标的证券。（注销用）
751	权证创设担保品帐户中标的证券余额不足。（注销用）
752	账户中没有现券
753	账户中现券余额不足
754	账户中没有标准券
755	账户中标准券余额不足

错误代码	含义
756	账户没有质押券
757	账户的质押券余额不足
758	标准券折算率未初始化
759	标准券代码不存在
1001	底层 UDP 通信环境没有成功建立
1011	底层 TCP 通信环境没有成功建立
1021	rec_num 必须连续递增
1022	股票代码错误
1023	账号错误
1024	买卖方向错误
1025	价格错误
1026	数量错误
1027	日期错误
1028	申报单或撤消单的标志错误
1029	结算会员代码错误
1030	撤消单的 ordrec 域错误
1031	撤消单的 ordrec 域大于等于撤消单的 rec_num 域
1032	被撤单记录在 ORDWITH 中无法找到
1033	撤消单的 TEORDERNUM 数据无效
1034	撤消的申报单是失败的数据单
1035	被撤单记录在 ORDWITH2 中找不到
1036	被撤单记录没有 TEOrderNumber!(是空白字符串), 合同号空
1038	本地撤单[a 撤 b]

错误代码	含义
1039	刚读入待处理的单子的 status 是'P'或'p'
1040	刚读入待处理的单子的 status 不是'R'，也不是'P'
1041	PC 本地撤单
1042	底层通讯接收时发生错
1043	接收到的数据包内容错误
1100	申报号太大
1101	记录不匹配
2000	与交易所的网络连接出错
2001	被撤单的日子不是今天
2004	被撤单的帐号不是本人
2006	撤单记录中被撤单的股票代码与被撤单不一致
2007	撤单记录中被撤单的股票价格不正确，与被撤单不一致
2008	只有申报才可被撤单
2100	笼统的“PC 端已处理”信息。只在崩溃恢复过程中产生，这时不再仔细区分各种 PC 端已处理、从而不再真正发往主机的情形，可能包括各种 PC 端检查发现错单以及本地撤单。
2101	撤单记录和被撤单记录的股票买卖方向不同
2102	撤单记录和被撤单记录的股票数量不同
4502	非交易所身份登录
4503	字段包含不可打印的字符
4504	无效的基本订单类型
4506	无效的报价数量
4508	无效的会员内部订单编号

错误代码	含义
4509	无效的失效日期
4513	无效的执行限制类型
4517	无效的交易限制类型
4518	无效的日期
4519	无效的时间
4525	卖出/买入数量不相等
4526	装载产品基础数据中发生错误
4527	无效的关键数据控制块
4528	无效的产品列表请求
4529	无效的交易 ID
4530	无该产品的交易许可证
4531	无效的对手方
4532	无效的会员 ID
4534	无效的价格货币代码
4535	无效的交易所会员
4536	无效的报价差价
4537	无效的请求数据
4538	帐户类型修改无效
4539	需要日期
4540	开始时间迟于结束时间
4541	无效的资源访问级别
4542	无效的经纪商标识
4543	无效的高级交易员标识

错误代码	含义
4544	无效的自营商标识
4545	无效的做市商标识
4546	表 01 读取过程中出现错误—未找到交易日期
4547	无效的价格合理性标识
4549	无效的响应数据
4550	无效的市场公告主题
4551	无效的市场公告消息
4553	无效的交易员姓名
4554	报表 ID 无效
4555	无效的报表名称
4556	无效的报表发布频率
4557	无效的报表主流程
4558	无效的报表组
4559	无效的报表清算会员类型
4560	无效的报表选择标识
4561	无效的备注
4562	无效的密码
4563	无效的交易类型
4564	无效的费用包类型
4565	无效的费用额
4566	无效的费用额格式
4567	无效的费用上限
4568	无效的费用下限

错误代码	含义
4569	无效的最高系统使用量
4570	无效的行为代码
4571	无效的订单限制组合
4572	该执行限制仅适用于 GFD 型订单
4575	无效的产品群代码
4576	无效的盘前处理启动时间
4577	无效的盘后处理结束时间
4578	波动性中断的持续时间无效
4579	市价订单中断的持续时间无效
4580	无效的盘后处理结束时间
4581	无效的整个市场 OBB 持续时间
4582	开盘集合竞价时段的持续时间无效
4583	盘中集合竞价时段的持续时间无效
4584	无效的闭市集合竞价 Call 持续时间
4585	无效的集合竞价启动时间
4586	无效的集合竞价列表
4588	无效的止损限价和执行限制组合
4589	随机终止的最长持续时间无效
4590	无效的集合竞价手数标识
4591	无效的多重 ISIN 计数
4592	无效的组代码
4593	无效的组类型
4594	无效的组名称

错误代码	含义
4595	无效的产品类型
4596	无效的转换交易时间表代码
4597	无效的子群组代码
4598	无效的交易模型类型代码
4599	无效的开市集合竞价
4600	无效的闭市集合竞价
4601	无效的结算帐户
4602	无效的结算期
4604	无效的成交价格
4605	无效的成交数量
4606	无效的快速市场标识
4607	装载权限数据时发生错误
4608	起始号码超出指定区间
4609	所需号码总数超出指定区间
4610	无效的比特调用
4612	无效的重传号码
4613	无效的限价变更
4614	无效的重复请求标识
4615	无效的成交取消筛选标识
4617	该通道不能处理报价
4619	无效的连续集合竞价起始时间
4620	无效的连续集合竞价结束时间
4621	无效的延长的集合竞价 Call 持续时间

错误代码	含义
4622	无效的发行人标识
4623	无效的做市商标识
4624	进行报价维护需要许可证
4626	报价只能转换为一笔公开报价
4627	报价请求输入不适用于这些交易模型中交易的产品
4628	报价请求查询不适用于连续集合竞价中交易的产品
4629	该交易时段不能输入（公开）报价
4631	无效的发行人会员 ID
4632	无效的权证类别
4633	无效的权证类型
4637	无效的订单类型和最高揭示数量组合
4640	无效的订单类型和交易限制组合
4641	无效的订单类型和执行限制组合
4643	无效的订单类型和有效期限制组合
4644	订单数量小于最高揭示数量
4645	最高揭示数量小于最小最高揭示数量的最低要求
4646	订单数量小于冰山数量的最低要求
4647	无效的 PTA 标识
4648	无效的订单类型标识
4649	无效的最低冰山数量要求
4650	无效的最高揭示数量最低要求
4651	无效的最高订单额
4652	无效的债券利率

错误代码	含义
4653	无效的交易所 ID
4654	无效的子类型代码
4655	无效的到期日
4656	无效的债券发行人
4657	无效的中点有效期持续时间
4658	无效的最大撮合范围有效期持续时间
4659	无效的交叉期启动
4660	发行人不允许输入报价请求
4661	该产品类型不支持 OTC 交易
4662	该产品类型不支持成交修改
4663	无效的结算地点
4664	无效的日终批处理集合竞价 Call 持续时间
4665	无效的集合竞价类型
4666	时间表上必须安排盘中闭市集合竞价
4667	无效的净额结算类型
4668	无效的净额结算后缀号码
4669	无效的执行代码
4670	无效的转手会员 ID
4671	无效的查询成交比率
4672	无效的应用 ID
4673	无效的转手标识
4674	无效的合约单位
4675	无效的回购类型

错误代码	含义
4676	无效的结算额
4677	无效的回购利率
4678	外部交易号码格式错误
4679	无效的外部交易地点
4680	无效的外部结算日期
4681	外部交易链接格式错误
4682	无效的用户类型标识
4683	无效的 BEST 买入/卖出价
4684	BEST 字段仅适用于 BEST 报价
4685	无效的 BEST 保留数量
4686	无效的 BEST 买入/卖出上下限价格
4687	不合理的上下限价格和 BEST 买入/卖出价格组合
4688	无效的 BEST 执行人 ID
4689	无效的许可证类型
4690	无效的流动性管理人标识
4691	无效的 BEST 执行人标识
4692	仅进行股票交易的 BEST 执行人
4693	无效的交易类型
4694	无效的债券收益率交易标识
4695	无效的参考价格
4696	筛选提供的限价中价格和收益率交易均支持的产品
4697	交易结束时段启动无效
4698	订单簿平衡前期的持续时间无效

错误代码	含义
4699	订单簿平衡时段的持续时间无效
4700	固定价格集合竞价时段的持续时间无效
4701	无效的时间格式
4703	时间不可为零
4704	无效的交易时段顺序
4705	未包含所有必选时段
4706	交易时段重叠
4707	无效的费用包名称
4708	无效的交易金额
4709	无效的费用百分比
4710	无效的费用代码
4711	无效的费用代码描述
4712	无效的频率代码
4713	无效的事务代码
4714	无效的费用
4715	无效的费用格式
4716	无效的费用调整数量
4717	无效的费用调整信息
4718	无效的费用包标志位
4719	无效的费用生效日期
4720	无效的累计费用符号
4721	无效的费用系数
4722	无效的计费基础标志符号

错误代码	含义
5000	无效的订单类型
5001	无效的信息类型标志
5002	无效的订单类型标志
5003	无效的结算币种
5004	无效的协商订单价格
5005	无效的冻结代码
5006	产品不在同一集合中
10000	未知错误
10002	找不到用户
10004	非法的密码
10006	请求已经被处理
10008	请确认它
10010	无效的价格类型
10012	债券可赎回/可收回标识无效
10014	债券可赎回/可收回日期无效
10016	未填写债券可赎回/可收回日期/价格
10020	未填写交易所交易基金（ETF）投资者帐户
10024	未填写基金公司代码
10026	未填写净资产值（NAV）
10028	无效的净资产值（NAV）日期
10030	无效的基础产品
10032	未填写基础产品
10034	未填写荷兰式分配处理日期

错误代码	含义
10036	无效的荷兰式分配处理日期
10040	未填写现金红利股权登记日期
10042	无效的现金红利股权登记日期
10044	未填写除息日期
10046	无效的除息日期
10048	未填写红利金额
10050	未填写股票红利股权登记日期
10052	无效的股票红利股权登记日期
10054	未填写除权日期
10056	无效的除权日期
10058	未填写分红率
10060	未填写配股股权登记日期
10062	无效的配股股权登记日期
10064	未填写除权日期
10066	无效的除权日期
10068	未填写配股率
10070	未填写配股价格
10072	未填写配股总数量
10074	未填写股东大会登记日期
10076	无效的股东大会登记日期
10078	未填写股东大会日期
10080	无效的股东大会日期
10082	无效的总流通股

错误代码	含义
10084	无效的股票总数量
10086	无效的每股收益（EPS）
10088	无效的期限：借贷天数
10090	国内标识
10092	每股收益（EPS）日期
10094	未填写到期日
10096	无效的权证类型
10098	未填写产品简称
10100	无效的产品子类型
10102	无效的赎回价值
10104	无效的产品群名称
10106	无效的产品类型
10108	该国际证券标识码（ISIN）已存在
10110	该产品缩写已存在
10112	无效的产品代码
10114	产品删除无效
10116	无效的缺省交易时间表
10118	未找到产品组
10120	产品和产品组不匹配
10122	产品组变更无效
10124	产品群变更无效
10126	无效的外部标识
10128	最后交易日期无效

错误代码	含义
10130	无效的利息计算方法
10132	产品数据不一致
10134	无效的息票支付日期
10136	无效的到期日
10138	无效的小数位
10140	无效的产品子类型
10142	错误的时间戳
10144	无效的结算货币
10146	无效的名义货币
10148	无效的结算期
10150	未找到记录
10152	未填写首次交易日期
10154	未填写订单手数类型
10156	无效的订单手数类型
10158	未填写收盘价计算方法
10160	未填写持续时间
10162	未填写启动时间
10164	未选择是否盘中可用
10166	盘中可用选择无效
10168	未填写结算期限
10170	未选择卖空标识
10172	卖空标识无效
10174	未填写冰山订单的最低数量

错误代码	含义
10176	未填写冰山订单的最低揭示数量
10178	最低揭示数量无效
10180	无效的订单价格范围
10182	无效的波动范围
10184	无效的扩展波动系数
10186	无效的范围计算方法？价格范围
10188	无效的最大剩余数量
10190	无效的订单类型
10192	无效的整手数
10194	无效的最大订单数量（A）
10196	无效的最大订单数量（P）
10198	无效的最大订单数量（M）
10200	无效的收盘价计算方法
10202	无效的参考价格
10204	未填写价格上下限
10206	未填写发行数量
10208	总数量无效
10210	借贷期限无效
10212	无效的交易所交易基金（ETF）帐户
10214	未填写配号日期
10216	无效的配号日期
10218	未填写抽签日期
10220	无效的抽签日期

错误代码	含义
10222	无效的价格上下限
10224	无效的转换率
10226	无效的处理代码
10228	无效的最低订单数量
10230	无效的产品组代码
10232	无效的产品组类型
10236	非法时间戳
10238	访问被拒绝
10240	超过最大订单有效期
10244	错误订单有效期
10246	错误产品类型
10248	无法读取该产品
10250	无效交易事务代码
10252	该交易时段内禁用该功能
10254	未分配该产品
10256	未获代理帐户授权
10258	未获做市商帐户授权
10260	未获自有帐户授权
10264	无效执行限制类型
10266	无效交易限制类型
10268	未获取做市商资格
10270	无效 PBU 的 PBU 代码
10272	当前用户不是交易所用户

错误代码	含义
10274	交易被拒绝: PBU 不能在该 MISS 上交易!
10276	无效报价价格或数量
10278	无效交易限制“SU”
10280	不合理数量
10282	最后修改时间已改变
10284	无效产品交易/非交易信息标识
10286	无效处理日期
10288	PBU 无分配子群组
10290	PBU 无分配产品
10292	无效的日期输入
10294	无效的日期参数
10296	合约 ISIN 前缀重复
10300	产品关联到当前子组
10302	产品不关联到当前子组
10304	资源信息找不到
10306	合约产品缩写前缀重复
10308	该产品已分配特许权限
10310	PBU 未分配特许权限
10312	无效收益率计算方法
10322	无效的最小报价数量
10324	无效首次交易日期
10326	无效最小可交易量
10328	无效交易所代码

错误代码	含义
10330	冰山订单最小数量非最小可交易量
10332	最小披露数量非最小可交易量
10336	无效下次计息日期
10338	无效首次计息日期
10340	无效最后计息日期
10342	无效回售/赎回开始日期
10344	无效回售/赎回结束日期
10346	无债券回售/赎回价格
10348	无效 IPO 发行方法
10350	无效是非标识
10354	无效持续时间
10356	无效开始时间
10358	无效交易量计算方法
10360	无效价格区间计算方法
10362	无效价格单位
10364	无效交易模型
10366	无法将 RAL 更新至数据库
10368	无效值间关系
10370	无效最小可成交量关系
10372	无效赎回日期/价格
10374	无效赎回
10376	无效的市场代号
10378	无效的交易所代号

错误代码	含义
10386	无效的最大订单数量(P)
10388	无效的最大订单数量(M)
10390	无效的成交金额的计算类型
10392	市场处于停盘状态
10394	无效的时段转换代码
10396	无法转换到目标状态
10398	产品无法使用
10400	当前状态无法转换到等待批处理
10402	未找到该市场
10404	状态转换请求已被触发
10406	交易时间表已经处于开启状态
10410	已超过交易结束时段的开始时间
10412	无效的产品状态
10414	无效的转换时间表
10416	PBU 已经被删除
10418	冻结时段内该事务无效
10420	无效帐户类型
10422	连续撮合时段内，该做市商无效
10424	订单数据已变更
10428	无效交易限制“OA”
10430	无效交易限制“AU”
10434	无效买卖标志
10438	订单类型无效更改

错误代码	含义
10440	市价转限价订单不可更改订单价格
10442	无效订单数量及最高揭示数量组合
10448	该交易员不是高级交易员
10450	订单价格超出范围
10452	空的报价
10454	PBU 已经存在
10456	参与者业务单元没有分配给下一级 PBU
10458	无效的 PBU 关系
10460	无效的 PBU 群组
10462	无效的参与者业务单元的下一级 PBU
10464	存在重复记录
10466	有超过限定记录的条数
10468	PBU 已经存在
10470	对于找到的交易所没有默认的记录
10472	不存在相关的 PBU 关系
10474	对于找到的交易所没有默认的产品组
10476	无效的 PBU 类型
10478	无效的时间标记
10480	不允许修改
10482	跨交易所会员字段为空
10484	参与者业务单元的下一级 PBU 没有买/卖标记
10486	无效 PBU 名称
10488	无效的 PBU ID

错误代码	含义
10492	参与者业务单元已分配了下一级 PBU
10494	PBU 没有被停止交易
10496	PBU 未被分配报表 MISS 节点
10500	HOSTSEC 初始化失败
10504	活动状态权限不足
10508	非活动状态权限不足
10510	不同 PBU 的交易要求被拒绝
10512	暂停状态权限不足
10514	非高级的交易员
10518	未授权状态
10520	该执行限制对接受剩余订单无效
10522	产品群已经存在
10524	PBU 不能输入买方订单
10526	无效的交易所已做标记的标识代码
10528	无效的市场代码
10530	无效的关闭订单簿指示
10532	无效的产品组代码
10534	无效的 PBU ID
10536	无效参与者业务单元群组
10540	参与者业务单元仍然处于激活状态
10542	无分配托管
10546	PBU 不能输入卖方订单
10548	无效产品组代码

错误代码	含义
10550	无效产品组类型
10552	产品组已经存在
10554	已经有产品分配给了将被删除的产品组
10558	产品组已经分配了产品
10566	交易时段未定义
10568	订单类型和交易模型不匹配
10570	TP_TICSIZ 数据错误
10572	产品未被配置至市场或产品群
10574	部分产品未得到处理
10576	无效的市场状态
10578	不允许进行产品群的状态转换
10580	无效的非交易订单类型
10582	覆盖旧的 IPO 订单
10584	无效的 IPO 订单
10588	无效的 OEF 订单
10590	订单的数量不是整手数
10592	超出 IPO 价格范围
10594	无效的交易时间表
10596	订单价格未遵循最小价格单位规则
10598	该产品非可转换债券
10604	未找到报价
10606	投资者帐户类型对报价无效
10608	错误的止损限价

错误代码	含义
10610	找不到指定的订单
10612	产品不在同一个市场
10614	无效的订单删除方法
10616	无效的交易模型代码
10618	无效的匹配优先级代码
10624	无效的预先交易日期
10626	错误的营业部号码
10628	错误的清算会员代码
10630	不允许改变过去的时段或把将来的时段改到过去
10632	当前改变与下次时段改变之间的时差太短
10634	不是所有的市场都处于批处理状态
10636	产品必须处于暂停状态
10638	调整的票面利率无效
10640	错误的查询日期
10642	错误的查询限价
10644	查询结束
10646	无查询结果
10648	集合竞价剩余量分配方式未知
10650	无效的最大订单数量 (D)
10652	订单数量超过投资者类型限额
10654	无效的最大订单数量 (F)
10656	无效的最大订单数量 (B)
10658	无效的最大订单数量 (C)

错误代码	含义
10660	PBU 无分配产品组
10662	用户群组，产品组写入错误
10664	币别不存在
10666	币别已经存在
10668	产品没有分配给子群组
10670	PBU 没有被分配特许权限
10672	子群组没有被分配任何做市商特许权限
10674	无效的用户 ID
10676	由于用户是 DEFMBR，系统拒绝访问
10678	用户不存在
10680	用户已经存在
10682	无效的 Agent 标记，只能是 Y 或 N
10684	无效的 Proprietary 标记，只能是 Y 或 N
10686	无效的 Senior 标记，只能是 Y 或 N
10688	无效的 Market Maker 标记，只能是 Y 或 N
10690	试图成为 Market Maker 类型，但是目前尚不是 Proprietary 类型
10692	试图成为 Agent 类型，但是 PBU 类型是 Broker
10694	试图删除 PBU 管理者被拒绝
10696	无效的交易员状态
10698	由于用户是 MBRSPV，系统拒绝访问
10700	订单数量小于最小协商订单交易数量
10702	投资者帐户与 PBU 无指定交易关系
10704	投资者帐户的指定交易关系未被激活

错误代码	含义
10706	投资者帐户已被暂停
10708	投资者帐户类型对该产品无效
10710	无效的“一揽子”订单代码
10712	无效投资者帐户
10714	无效的协商订单类型
10716	无效的协商订单信息类型
10718	无效的结算方式
10720	无效的结算币种
10722	无效的结算日期
10724	无效的协商订单删除
10726	无效的协商订单
10728	无效的场外交易删除
10730	无效的场外交易产品
10732	用户不存在或者已经被删除
10734	不能计算收盘价
10736	无效的收盘价计算方法
10738	收市时段已经开始
10740	固定价格竞价时段已经开始
10744	超出当日最高、最低成交价范围
10746	交易币种不匹配
10748	产品不匹配
10750	订单类型不匹配
10752	订单买卖方向不匹配

错误代码	含义
10754	系统状态编号不存在
10756	无目标地址
10758	订单数量不匹配
10760	订单价格不匹配
10762	该产品无做市商
10764	对手方 PBU 不匹配
10766	协商订单号不匹配
10768	结算代码不匹配
10770	结算日期不匹配
10772	结算币种不匹配
10774	产品被暂停场外交易
10776	产品被暂停协商交易
10778	无效工作日
10780	日期已存在
10782	日期不多于当前日期两天
10784	日期不早于四天前
10786	对指定的产品没有设置许可证信息
10788	消息长度不正确
10790	托管 PBU 不存在
10792	用户上下文内容太长
10794	投资者账户不存在
10796	不允许创建指定交易关系
10798	无效类型

错误代码	含义
10802	无效标志位
10804	投资者存在和其他参与者下 PBU 的指定交易关系
10806	不允许撤销指定交易关系
10808	无效状态
10810	不允许转移持仓
10812	不存在指定交易关系
10814	取消指定交易推迟到批量
10816	持仓转移给其他 PBU
10818	转移请求已经记录
10820	请求被拒绝:基础数据维护阻塞阶段
10822	无效的基本产品（非债券）
10824	无效的基本产品（不在同一市场）
10826	数据被非法修改
10828	无效更新持仓数量
10830	投资者帐户不能卖空
10832	产品不能卖空
10834	卖空价格不合理
10836	投资者持仓不足
10838	对手方不存在
10840	买方用户不存在
10842	卖方用户不存在
10844	该做市商未授权输入报价请求
10846	协议订单持仓修改错误

错误代码	含义
10848	首个交易日无法更改
10850	最后交易日大于基本产品的最后交易日
10852	无效的交易状态
10854	交易记录未找到
10856	无法再次取消已取消的交易
10858	无法取消交易所交易基金(ETF)交易
10860	无法取消跨交易所(CEX)交易
10862	交易取消请求已收到
10864	无效的费用类别
10866	最小金额不小于最大金额
10868	重复的记录
10870	超出最大费用包数量
10872	费用包已经被分配
10874	数据处于删除状态
10876	非法缴费包名
10878	PBU 没有缴费包
10880	非法缴费包类型
10882	投资者账户还和其他的 PBU 有指定交易关系
10884	存在已分配的被托管 PBU
10886	无效的托管 PBU
10888	无效的产品群（不在同一市场）
10890	跨交易所订单输入请求已接受
10892	跨交易所订单删除请求已接受

错误代码	含义
10894	订单未被冻结
10896	报价未被冻结
10898	默认的费用包不能被删除
10900	已存在冻结报价
10902	不支持的交易类型
10904	不能在月中改变 PBU 隶属关系
10906	无效的收费
10908	适用的费用参数不存在
10910	无效的货币汇率
10912	标准费用参数不能被删除
10914	系统当前无法接受订单
10916	无效的场外交易交易日期
10918	被代理者权限不足
10920	品种特许权限已被分配
10922	无效品种号
10924	品种未被分配给 PBU
10926	品种特许权限已被分配给 Subgroup
10928	品种特许权限未被分配给 Subgroup
10930	不正确的市场状态
10932	不正确的产品状态
10934	被代理者处于非活动状态
10936	无效品种删除
10938	无效品种代码

错误代码	含义
10940	品种已经存在
10942	品种下仍然存在合约
10944	无效的持仓检查
10946	无效的会员清算代码
10948	外部系统(EAI)使用的 PBUID 没有配置
10950	交易取消请求已收到，请等待
10952	指定的 ISIN 代码无效
10954	指定关系无效
10956	PBU 已经被暂停
10958	无效合约到期月份
10960	该月期货合约已经生成
10962	无效消息长度
10964	品种不存在
10966	无效最后合约自动生成日
10968	对同一议案重复投票
10970	更新持仓时所需保证金不足
10972	非法的默认缴费包类型
10974	存在投资者账户与该 PBU 有指定交易关系
10976	未找到该非交易订单
10978	交易所交易基金申购赎回请求已收到
10980	无效的非交易类型
10982	无效的分配日期
10984	无效的起始编号

错误代码	含义
10986	无效的配号规则表
10988	无效的比例配售比例
10990	无效的交割价格类型
10992	无效的承销商 PBU 代码
10994	无效的承销商投资者账户
10996	无效的非交易起始日
10998	无效的非交易结束日
11000	无效的最后交易日期（与基本产品冲突）
11002	无效的最后交易日期（与衍生产品冲突）
11004	无效的最后交易日期（与非交易信息冲突）
11006	无效的首次交易日期（与非交易信息冲突）
11008	未填写转换价格
11010	未填写行权价格
11012	缺少必填的信息
11014	开放式基金订单之前已被删除
11016	开放式基金的撤销订单不能再被删除
11018	删除承销商 PBU 被拒绝
11020	保证金撤销数目大于目前可用数目。
11022	投资者帐户只允许期货交易
11024	产品集代码不在列表中。产品集 = %s。
11026	无效的投资者类型。
11028	无效的产品代码。
11030	保证金更新的模式不是'U'或者'W'。

错误代码	含义
11032	该产品不适用
11034	请求超出有效的时期
11036	无效的交易员代码
11038	无效的分红选择
11040	无效的份额来源/份额目的
11042	非交易类型与产品不匹配
11044	无效的持仓解冻数量
11046	无效的非交易订单价格
11048	无效的非交易订单金额
11050	投资者持仓状态不存在
11052	无效的 ETF 订单数量
11054	不允许 ETF 申购
11056	不允许 ETF 赎回
11058	ETF 定义未找到
11060	PBU 对该产品没有买权限。
11062	产品买卖标志无效。
11064	PBU 对该产品没有卖权限。
11066	市场管理人员试图使用此项功能被拒绝
11068	该成员产品的买卖许可记录不存在
11070	品种代码或到期月份不能被修改
11072	指定交易类型无效。
11074	SD&C 持仓数量过大。
11076	合约简称前缀重复

错误代码	含义
11078	合约产品前缀重复
11080	投资者对该产品没有买权限。
11082	投资者对该产品没有卖权限。
11084	订单买/卖方向不能修改。
11086	重复输入国债回购登记或取消指令
11088	无效的国债回购登记指令类型
11090	无效的停牌状态更改
11092	无效的席位连通群组的主参与者单元。
11094	不能删除一个席位连通群组的主参与者单元。
11096	只提供给参与者 PBU
11098	无效的最大订单数量
11100	无效的输入开始日期
11102	无效的输入结束日期
11104	未定义发行价格
11106	无效的上市交易日
11108	无效的转换价格
11110	无效的非交易订单数量
11112	投票议案字段格式错误
11114	投票意愿字段格式错误
11116	非法更新已冻结的订单
11118	修改撮合优先权无效
11120	修改竞价数量分配方案无效
11122	撮合优先权和竞价数量分配方案组合无效

错误代码	含义
11124	该产品不允许输入单边报价
11126	PBU 无此非交易权限
11128	投资者无此非交易权限
11130	非交易服务不可用
11132	不适用于此子类型产品
11134	投资者账号没有被授权进行权证创设和注销
11136	产品不是认购权证类型
11138	投资者已经是冻结状态
11140	投资者已经是解冻状态
11142	不适用于非交易类型产品
11144	该交易无法被取消
11146	无效的权证行权模式
11148	无效的检验日期
11150	无效的转换基金
11152	指定交易取消请求已接收
11154	政府债券担保投资者持仓不足
11156	权证担保帐户不可以被激活
11158	PBU 有未提交的转指定交易请求
11160	当前 PBU 是转指定交易的目标方
11162	无效的转指定交易目标方
11164	权证担保帐户不可以创建指定交易
11166	投资者已与其他 PBU 存在指定交易关系
11168	取消指定交易仍在验证中

错误代码	含义
11170	无效的跨交易所代号
11172	无效的产品群代码
11174	指定的产品群中还有相关联的品种
11176	无效的系统状态码
11178	无效的最大差额
11180	无目标主机地址
11182	指定的产品组中还有相关联的品种
11184	MISS 广播授权失败
11186	广播流太多
11188	广播流授权失败
11190	没有广播流订阅
11192	广播未订阅
11194	可引起波动性中断的市价或市价转限价订单
11196	无效的审核标志
11198	内存持仓空间耗光
11200	内存订单簿耗光
11202	错误的请求 PBU
11204	正在计算闭市价格...
13300	繁忙：TXN 被拒绝。请再试一次

1.4 成交回报接口 cjhb

cjhb	实时成交回报接口
<p>描述:</p> <p>柜台系统可以从该表读取上证所处理申报后返回的成交确认数据。</p> <p>除了标准的“交易”导致的成交确认外，实时成交回报接口进行“转义”支持一些其他业务，具体可参见第 5 章描述。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gddm	证券账户	C10
2	gdxm	股东姓名，新交易系统切换后，上证所会将该字段置为空格。请以中国证券登记结算有限责任公司发布的数据为准。	C8
3	bcrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD	C8
4	cjbh	成交编号，新交易系统切换后，该字段在同一证券代码内唯一，但不在全市场唯一。柜台系统不得假设该编号在全市场内唯一，必须结合证券代码一起来辨识。 原来曾要求 cjbh 字段和 bs 字段为组合关键字，如果会员在该数据库表中设定了 cjbh 字段和 bs 字段组合的唯一约束条件或者唯一索引，要求必须取消该约束条件，或者修改为按照 cjbh 字段、zqdm 字段和 bs 字段设置组合关键字。 注：部分柜台系统根据对 cjbh 字段进行排序来定位下一个待处理成交回报纪录，这样的方式必须做出调整。柜台系统可考虑利用停用的 gdxm 字段来进行标志置位，以区分成交回报是否已处理过。	4 字节 Integer
5	gsdm	席位号	C5
6	cjsl	成交数量，单位为股(股票)或份(基金)或手(债券及回购)。	C10
7	bcye	本次余额，新交易系统切换后，对于买卖成交，上证所会将该字段置为零。请以中国证券登记结算有限责任公司发布的数据为准。	C10

8	zqdm	证券代码	C6
9	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS	C6
10	cjsj	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
11	cjgg	成交价格，单位为人民币元(A股、基金、债券)或美元(B股)或每百元资金的年收益率(国债回购)。精度为小数点后 3 位。	C8
12	cjje	<p>成交金额。精度为小数点后 2 位。</p> <p>对于证券代码为非交易业务代码的成交金额的取值，参见第 5 章。普通交易时，该字段的取值方式如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 对应股票、封闭式基金、ETF、权证产品，该字段为成交价格 $cjgg \times \text{成交数量 } cjsl$。 • 对应债券产品，该字段为成交价格 $cjgg \times \text{成交数量 } cjsl \times 10$。 • 对应席位质押式国债回购代码 201***、席位质押式企业债回购代码 202***以及账户质押式国债回购代码 204***时，该字段为成交价格 $cjgg \times \text{成交数量 } cjsl \times 10$。新交易系统切换后，将采用与行情一致的计算方式，即 $100 \times \text{成交数量 } cjsl \times 10$。 • 对应买断式国债回购代码 203***时，该字段为成交价格 $cjgg \times \text{成交数量 } cjsl \times 10$。新交易系统切换后，将采用与行情一致的计算方式，即基础产品昨日收盘价 $\times \text{成交数量 } cjsl \times 10$。 	C12
13	sqbh	会员内部订单号，同申报接口中的 reff（字段 4：会员内部订单号）。	C10
14	bs	买卖方向，同申报接口中的 bs（字段 7：买卖方向）。	C1
15	mjbh	操作员代码	C5

2 盘后数据接口规范

本部分描述了上证所交易系统发布给柜台系统的一些文件接口。

2.1 过户数据接口 ghXXXXX.dbf

ghXXXXX.dbf	盘后过户数据接口
描述: 文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。 该接口文件的组织形式同实时成交回报数据接口类似。由于数据库表与 DBF 文件表述的不同，成交编号、成交数量、本次余额、成交价格、成交金额的类型略有不同。 对于需要转义的非交易业务，一些没有包含在实时成交回报数据接口中的记录，通过盘后过户数据接口传送给参与者。具体的转义含义参见第 5 章。 新交易系统切换后，不再按照 cjbh 字段排序。 新交易系统切换后，对于 B 股 PBU 同样可产生该接口文件。	

序号	字段名	字段描述	类型
...			
4	cjbh	成交编号， 新交易系统切换后，该字段在同一证券代码内唯一，但不在全市场唯一。	N8
...			
6	cjsl	成交数量	N10
7	bcye	本次余额， 新交易系统切换后，该字段被置为 0。	N10
...			
9	sbsj	申报时间， 新交易系统切换后，该字段被置为空格。请以实时成交回报表中相应数据为准。	C6
...			
11	cjg	成交价格	N8(3)

12	cjje	成交金额	N12(2)
...			
14	bs	<p>B 普通订单, 买卖方向: 买入</p> <p>S 普通订单, 买卖方向: 卖出</p> <p>对于 E 类型帐户的融资融券业务, 对应关系如下:</p> <p>1 担保品买入订单, 券入投资者信用帐户, 申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“_XY”, “B”);</p> <p>2 担保品卖出订单, 券从投资者信用帐户出, 申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“_XY”, “S”);</p> <p>3 融资买入订单, 券入投资者信用帐户, 申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“_RZ”, “B”);</p> <p>4 融券还款订单, 券从投资者信用帐户出, 申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“_RZ”, “S”);</p> <p>5 买券还券订单, 券入证券公司融券专用帐户, 申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“_RQ”, “B”);</p> <p>6 融券卖出订单, 券从证券公司融券专用帐户出, 申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“_RQ”, “S”);</p> <p>7 平仓买入订单, 券入证券公司融券专用帐户, 申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“_PC”, “B”);</p> <p>8 平仓卖出订单, 券从投资者信用帐户出, 申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“_PC”, “S”);</p>	C1
...			

2.2 证券帐户资料接口 zzhXXXXX.dbf

zzhXXXXX.dbf	盘后证券账户资料接口
描述: 文件名中 XXXXXX 表示席位号。闭市后发送。 该文件接口提供指定交易关系数据给参与者，说明指定在席位（PBU）上的证券账户以及当前所处的状态。 该文件按照上证所的运行计划向市场发布，通常是每隔两周发布一次。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	GDDM	证券帐户	C10
2	GDXM	股东姓名，新交易系统切换后，该字段被置为空格。	C8
3	ZHZZ	证券帐户状态，‘N’为正常，‘S’为挂起，‘F’为冻结。	C1
4	GSDM	指定席位号	C5
5	QSDM	停用	C5
6	JZRQ	截止日期，发送数据生成日期。格式为 YYYYMMDD	C8
7	CLBZ	处理标志，柜台系统自由使用	C1

2.3 席位联通接口 zxwXXXXX.dbf

zxwXXXXX.DBF	盘后交易席位资料接口
描述: 文件名中 XXXXXX 表示席位号。闭市后发送。 该接口文件说明席位（PBU）联通圈。在进行指定交易有效性检查时，同一联通圈内的不同席位（PBU）可被视为同一个席位（PBU）。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	GSDM	席位号	C5
2	SXWH	联通首席位号	C5
3	QSDM	停用	C5
4	JZRQ	截止日期，格式为 YYYYMMDD	C8
5	CLBZ	处理标志，柜台系统自由使用	C1

2.4 证券权益接口 zqyXXXXX.dbf

zqyXXXXX.dbf	盘后证券权益
描述: 文件名中 XXXXXX 表示席位号。只在市值配售进行前一日闭市后发送。 该接口文件说明有关投资者所拥有股票的市值。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	GDDM	证券帐户	C10
2	ZQDM	证券代码, 为空	C6
3	ZQYE	登记日的证券余额, 为空	N12
4	QYDM	权益代码, 为 '799990', 表示市值	C6
5	QYMC	权益名称, 为空	C10
6	QYBL	权益比例, 为空	N12
7	QYSL	权益数量, 为投资者投资者的股票市值除以 1 万再乘以 1 千后的结果。	N12
8	QYJG	权益价格, 为空	N8
9	GSDM	指定席位号 (PBU)	C5
10	QSDM	停用	C5
11	DJRQ	权益登记日期, 为空	C8
12	CLBZ	处理标志, 柜台系统自由使用	C1

3 广播文件接口

广播文件指全市场均相同的文件，通常是公开信息。

3.1 国债利息接口 gzlx.MDD

gzlx.dbf	国债利息接口
描述: 转发自中登上海分公司。当 10 月份时，M 为 ‘A’ ； 11 月份时，M 为 ‘B’ ； 12 月份时，M 为 ‘C’ 。 该接口文件说明国债应计利息。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	GZDM	国债证券代码	C6
2	JXRQ	计息日期	C8
3	YJLX	每百元应计利息额	N15(8)
4	LXTS	利息天数	N6
5	PMLL	票面利率	N8(5)

3.2 买断式回购未到期余额接口 mdghljYYYYMMDD.txt

mdghljYYYYMMDD.txt	买断式回购未到期余额接口
描述: 文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。闭市后发送。 该接口文件说明截止到当日交易闭市后的国债买断式回购未到期余额数据，包括当日新成交的买断式回购数据，但不包括当日到期的买断式回购数据。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	回购代码	回购代码	C6
2	未到期数量	单位： 手	N15

3.3 账户式质押回购折算率接口 xzsIMMDD.txt

xzsIMMDD.txt	账户式质押回购折算率接口
<p>描述:</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。转发自中登上海分公司。开市前发送。</p> <p>该接口文件说明债券参加账户式质押回购业务时折算为标准券比例。</p> <p>字段间用分隔符‘ ’定位。</p> <p>新交易系统切换后，文件名切换为 ngzz1YYYYMMDD001.txt。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	国债证券代码	国债证券代码	C6
2	标准券比例	标准券比例	C15

3.4 权证信息接口 qzxxMMDD.txt

qzxxMMDD.txt	权证信息接口
描述: 文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。开市前发送。 该接口文件说明权证的相关信息。 字段间用分隔符 ‘ ’ 来定位。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	行权代码	权证行权时使用的证券代码	C6
2	权证代码	权证代码	C6
3	标的证券	权证对应的标的证券	C6
4	权证类型	若为认购权证，则本字段为“认购”；若为认沽权证，则本字段为“认沽”	C4
5	权证余额	当前权证的流通总余额	N17
6	结算方式	若为现金结算，则本字段为“现金”；若为实物结算，则本字段为“实物”	C4
7	行权方式	若为欧式行权，则本字段为“欧式”；若为美式行权，则本字段为“美式”	C4
8	行权结算价格	右对齐，单位：元	N20(9)
9	行权价格	右对齐	N8(3)
10	行权比例	右对齐	N6(3)
11	权证到期日期	格式为 YYYYMMDD	C8
12	结算价使用日期	格式为 YYYYMMDD	C8

3.5 担保品及标的证券清单接口 dbpMMDD.txt

dbpMMDD.txt	担保品及标的证券清单接口
描述： 文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。开市前发送。 该接口文件说明融资融券业务相关证券信息。 字段间用分隔符 ‘ ’ 来定位。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	证券代码		C6
2	对应类别	001：融资、002：融券、003：担保品	C3
3	余额	对应类别为 001 时，表示融资余额； 对应类别为 002 时，表示融券余量； 对应类别为 003 时，固定为 0；	C15

4 开放式基金数据接口规范

开放式基金接口规范《中国结算开放式基金数据接口规范_销售代理人》参见中国证券登记结算有限责任公司网站。其 URL 为：http://www.chinaclear.cn/main/05/0503/050301/050301_1.html

上证所把从中登 TA 系统返回的开放式基金业务回执和确认文件、开放式基金分红文件、开放式基金对帐文件按照不同的席位(PBU)分解并发送到市场参与者。新交易系统切换后，原来命名为 kxxMMDD.txt 的文件，重新命名为 OFD_99_101_YYYYMMDD_07；原来命名为 khXXXXXX.txt 的文件，重新命名为 OFD_99_101_YYYYMMDD_06；原来命名为 kyeXXXXXX.txt 的文件，重新命名为 OFD_99_101_YYYYMMDD_05；原来命名为 kghXXXXXX.txt 的文件，重新命名为 OFD_99_101_YYYYMMDD_04。

开放式基金数据接口中使用的数据类型定义如下：

类型	描述
C	字符型
A	数字字符型，限于 0—9（如不够，右补空格）
N	数值型，并可参与数值计算

数据表示与处理规则如下：

- (1) 以文本文件定长记录方式；
- (2) 每行一条完整记录；
- (3) 换行必须用换行（ODH）、回车（OAH）字符；
- (4) 数值型字段（N 类）左补零右对齐，字符型字段（C 类与 A 类）右补空格左对齐。
- (5) 字符不区分大小写。
- (6) 带有小数点的数值型数据（N 类），传输时不传小数点，小数点在数据字典中指定。数据字典中用 x(y)表示不包括小数点的全长为 x，小数点后位数为 y，而整数则省略掉 (0)。

文件组织方式如下：

名称	长度	值	描述
文件标识	8	“OFDCFDAT”	用以标明该文件的格式类型
文件版本号	4	10	1. 0 版本
文件创建人	4	空白	用于标明该文件的提交人
文件接收人	4	空白	用于标明该文件的接收人
日期	8	日期	当天日期
发送人	8	空白	
接收人	8	席位号 XXXXX+空格	
字段数	3	N	标明该数据文件的构成字段数
字段名 1			采用数据字典中的字段名
...			
字段名 N			
记录数	8	M	该数据文件包含的数据记录数，最多 99999999 条
记录 1			
...			
记录 M			
文件结束标识	8	“OFDCFEND”	文件结束

4.1 开放式基金和净值数据接口

OFD_99_101_YYYYMMDD_07	开放式基金和净值数据文件接口
描述: 文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。 转发自中登总公司 。开市前发送。	

ID	字段名	描述	类型
63	FundName	基金名称	C40
67	FundCode	基金代码	A6
68	FundStatus	基金状态 0-交易，1-发行 2-发行成功，3-发行失败 4-基金停止交易 5-停止申购，6-停止赎回 7-权益登记，8-红利发放 9-基金封闭，a-基金终止	C1
86	NAV	基金单位净值	N7(4)
37	CurrencyType	结算币种 156-人民币，840-美元 344-港元，954-欧元 392-日元，826-英镑 250-法郎，280-马克	A3
82	FundManagerCode	基金管理人	A3
114	RegistrarCode	注册登记人代码	A2

ID	字段名	描述	类型
149	UpdateDate	基金信息更改日期，格式为 YYYYMMDD。	A8
215	CollectFeeType	交易费收取方式 0-价内费 1-价外费	C1
216	NextTradeDate	下一交易日	A8
281	FundIncomeFlag	货币基金万份收益正负 0：正；1：负	C1
	FundIncome	货币基金万份收益率	N8(5)
283	YieldFlag	货币基金七日年收益正负 0：正；1：负	C1
	Yield	货币基金七日年收益	N8(5)
	GuaranteedNAV	保本净值	N7(4)

4.2 开放式基金分红数据接口

OFD_99_101_YYYYMMDD_06	开放式基金分红数据文件接口
<p>描述:</p> <p>文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。转发自中登总公司。闭市后发送。</p> <p>红利/红利再投资发放是指基金注册登记人把对投资人发放红利/红利再投资的数据发送给基金销售人。对于冻结份额分红时产生的再投资份额，若继续冻结，分红时发送一笔红利再投资记录 and 一笔份额冻结确认记录，解冻时发送一笔份额解冻记录，每笔份额解冻记录与原份额冻结记录一一对应。</p> <p>对于货币市场基金，基金分红不作取整处理。</p> <p>对于非货币市场基金的基金分红，如果采用红利转投方式，对于再投资的红利进行份额取整，取整后的小数份额部分将直接转换成现金退还投资者。</p> <p>对于现金分红方式：$\text{DividenAmount 项} = \text{ConfirmeAmount 项}$（分红的现金）</p> <p>对于红利转投方式：$\text{DividenAmount 项} = \text{VolOfDividendforReinvestment 项} \times \text{除权日的基金净值} + \text{手续费} + \text{ConfirmAmount 项}$（应退还投资者的现金）</p>	

ID	字段名	描述	类型	是否必需
67	FundCode	基金代码	A6	Y
136	TAAccountID	投资人基金账号	C12	Y
22	BasisforCalculatingDividend	红利/红利再投资基数，登记日基金持有人的基金份额	N16(2)	Y
32	TransactionCfmDate	交易确认日期，格式为：YYYYMMDD	A8	Y
41	VolOfDividendforReinvestment	基金账户红利再投资基金份数，取整处理	N16(2)	Y

42	DividentDate	分红日/发放日	A8	Y
43	DividendAmount	基金账户红利资金，红利总金额,含冻结红利及再投资的红利及份额取整后退还给投资者的部分	N16(2)	Y
46	XRDate	除权日	A8	Y
64	ConfirmedAmount	每笔交易确认金额，实发红利资金，不含冻结红利及再投资的红利。当采用红利再投分红方式时，该项是转投的份额小数部分换算成的现金金额，即份额取整后退还给投资者的部分	N16(2)	Y
113	RegistrationDate	权益登记日期，格式为：YYYYMMDD	A8	Y
119	ReturnCode	交易处理返回代码，取值见附表：TA 系统返回代码表	A4	Y
120	TransactionAccountID	投资人基金交易帐号 席位号(5 位，前补空格)+账号，席位号由于有一天的差别，未必是现在指定的席位号。	A17	Y
121	DistributorCode	销售人代码 101 代码,表示上海证券交易所市场	A3	Y
135	BusinessCode	业务代码：143	A3	Y
155	DividendPerUnit	单位基金分红金额（含税）	N16(2)	Y
24	DefDividendMethod	默认分红方式，现设置为空	A1	N
52	Charge	手续费	N10(2)	N
53	AgencyFee	代理费	N10(2)	N
59	TotalFrozenVol	基金冻结总份数	N16(2)	N
86	NAV	基金单位净值	N7(4)	N

94	OtherFee1	其他费用 1	N10(2)	N
95	OtherFee2	其他费用 2	N16(2)	N
98	IndividualOrInstitution	个人/机构标志, 0-机构, 1-个人	A1	N
123	DividendRatio	红利比例	N16(2)	N
137	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A20	N
138	StampDuty	印花税	N16(2)	N
187	FrozenBalance	冻结金额	N16(2)	N
255	TransferFee	过户费	N10(2)	N
260	ShareClass	收费方式 0-前收费, 1-后收费	A1	N
276	FeeCalculator	计费人 0-TA 计费 1-基金计费	A1	N
47	DownLoaddate	交易数据下传日期 格式为: YYYYMMDD	A8	N
37	CurrencyType	结算币种 156-人民币, 840-美元 344-港元, 954-欧元 392-日元, 826-英镑 250-法郎, 280-马克	A3	Y

4.3 开放式基金帐户对帐数据接口

OFD_99_101_YYYYMMDD_05	开放式基金帐户对帐数据文件接口
描述: 文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。 转发自中登总公司 。闭市后发送。 用于核对投资人持有份额数据。	

ID	字段名	描述	类型
67	FundCode	基金代码	A6
136	TAAccountID	投资人基金帐号 股票交易市场中的证券帐户，左对齐，后补空格	A12
13	AvailableVol	持有人可用基金份额	N16(2)
18	TotalVolOfDistributorInTA	基金总份数（含冻结）	N16(2)
59	TotalFrozenVol	基金冻结总份数	N16(2)
173	TotalBackendLoad	交易后端收费总额	N16(2)
268	AccountStatus	账户状态 0-正常，1-冻结，2-挂失	A1
	UndistributeMonetaryIncome	货币基金未分配收益	N16(2)
	GuaranteedAmount	剩余保本份额	N16(2)

4.4 开放式基金交易确认接口

OFD_99_101_YYYYMMDD_04	开放式基金交易确认文件接口
<p>描述:</p> <p>文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。该数据文件包含由上证所发送的 T 日业务申请回执和由中登总公司发送的业务申请确认记录及其他业务记录。闭市后发送。</p> <p>新交易系统切换后，由上证所发送的 T 日业务申请回执中的基金代码以及由中国结算发送的业务确认和主动发起的业务中基金代码均为 519xx 代码。</p>	

ID	字段名	描述	类型
8	AppSheetSerialNo	申请单编号，对于上证所发起的业务和 TA 对于上证所业务申请的确认记录，是交易流水号 (10 位) 左对齐，编号 < 100000000。 该类数据申请单编号和 T-1 日的业务申请申请单编号一致。 由 TA 发起的冻结、非交易过户等业务，编号为 TA 流水号	A24
67	FundCode	基金代码	A6
136	TAAccountID	投资人基金账号，10 位股东账号，左对齐	C12
32	TransactionCfmDate	交易确认日期，格式为：YYYYMMDD，TA 确认的日期	A8
62	ConfirmedVol	基金账户交易确认份数	N16(2)
64	ConfirmedAmount	每笔交易确认金额，为投资者实得金额	N16(2)
92	TransactionDate	交易发生日期，格式为：YYYYMMDD	A8
132	ApplicationVol	赎回的份数/转托管份数	N16(2)
134	ApplicationAmount	申请金额	N16(2)
135	BusinessCode	业务代码，取值与含义参见附表：业务代码与	A3

		含义表	
137	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A20
177	BusinessFinishFlag	业务过程完全结束标识, 0-中间过程 1-业务过程结束	C1
119	ReturnCode	交易处理返回代码 '0000'为成功, 其他出错原因见附表。	A4
16	BackendLoad	每笔交易后端收费	N16(2)
25	DiscountRateOfCommission	销售佣金折扣率 对投资人的总佣金折扣率, 取值为投资人实付佣金/投资人应付佣金	N5(2)
52	Charge	手续费, 总手续费	N10(2)
53	AgencyFee	代理费	N10(2)
138	StampDuty	印花税	N16(2)
193	RateFee	费率, 分段收费考虑	N5(4)
255	TransferFee	过户费	N10(2)
285	HandleCharge	经手费, 上证所收费	N10(2)
94	OtherFee1	其他费用 1	N10(2)
86	NAV	基金单位净值	N7(4)
260	ShareClass	收费方式 0-前收费, 1-后收费	A1
173	TotalBackendLoad	后端收费总额 收费方式为后端收费时使用	N16(2)
263	RedemptionReason	强行赎回原因	A1

		0-小于最低持有数，1-司法执行，2-政策原因	
256	FromTAFlag	是否注册登记人发起业务标志 0-由销售人发起， 1-由注册登记人发起，此时申请单编号为 TA 的流水号	A1
276	FeeCalculator	计费人 0-TA 计费 1-基金计费	A1
97	TargetDistributorCode	对方销售人代码 参见附表：销售人代码表	A3
176	TransferDirection	转入/转出标示 0-转入，1-转出	A1
58	FreezingDeadline	冻结截止日期 格式为：YYYYMMDD	A8
60	FrozenCause	冻结原因 0—司法冻结，1-柜台冻结 2-质押冻结，3-质押&司法冻结，4-柜台&司法冻结	A1
257	FrozenMethod	冻结方式 0-原份额冻结；1-原份额+红股/红利	A1
266	VolumeByInterest	利息产生的基金份额	N10(2)
24	DefDividendMethod	默认分红方式（只在分红申请和确认业务类型中有效） 0—红利转投，1-现金分红	A1
37	CurrencyType	结算币种 156-人民币，840-美元	A3

		344-港元, 954-欧元 392-日元, 826-英镑 250-法郎, 280-马克	
80	LargeRedemptionFlag	巨额赎回处理标志 0-取消, 1-顺延	A1
93	TransactionTime	交易发生时间 格式为: HHMMSS	A6
120	TransactionAccountID	投资人基金交易帐号 投资人在销售机构内开设的用于交易的帐号	A17
121	DistributorCode	销售人代码	A3
28	DepositAcct	投资人在销售人处用于交易的资金帐号	C19
29	RegionCode	交易所在地区编号 具体编码依 GB13497-92	A4
47	DownLoaddate	交易数据下传日期 格式为: YYYYMMDD	A8
90	OriginalAppSheetNo	原申请单编号	A24
91	OriginalSubsDate	原申购日期 格式为: YYYYMMDD	A8
98	IndividualOrInstitution	个人/机构标志 0-机构, 1-个人	A1
102	RedemptionDateInAdvance	预约赎回日期 格式为: YYYYMMDD	A8
150	ValidPeriod	交易申请有效天数	N2
89	OriginalSerialNo	TA 的原确认流水号	A20

		表示 TA 确认申购的流水号	
254	Specification	摘要说明 强行赎回原因	C30
40	DateOfPeriodicSubs	定期定额申购日期 格式为: YYYYMMDD	A8
141	TargetBranchCode	对方网点号 转销售人/机构、非交易过户时使用	A9
142	TargetTransactionAccountID	对方销售人处投资人基金交易帐号 在转销售人是一次完成时, 为必须项	A17
152	TargetRegionCode	对方所在地区编号 具体编码依 GB13497-92	A4
123	DividendRatio	红利比例	N16(2)
76	Interest	基金账户利息金额	N10(2)
133	TradingPrice	交易价格 单位基金净值+各种费用	N7(4)
147	TargetTAAccountID	对方 TA 帐号 转销售人、非交易过户时	A12
139	Tax	税金	N16(2)
162	TargetNAV	目标基金的单位净值	N7(4)
163	TargetFundPrice	目标基金的价格	N7(4)
161	CfmVolOfTargetFund	目标基金的确认份数	N16(2)
194	MinFee	最少收费	N10(2)
95	OtherFee2	其他费用 2	N16(2)
258	OriginalAppDate	原申请日期	A8

		用于撤单、解冻时键入原申请日期	
264	DetailFlag	数据明细标志 0-汇总；1-明细	C1
262	RedemptionInAdvanceFlag	预约赎回标志 0-非预约赎回 1-预约赎回	A1
261	OriginalCfmDate	TA 的原确认日期 表示 TA 确认申购的日期	A8
34	CodeOfTargetFund	转换时的目标基金代码	A6
55	TotalTransFee	交易确认费用合计	N10(2)
8000	Mark	纪录类型 1:上证所给出当日的申报回执 2:TA 返回的确认信息	N2
8001	BrokReff	券商自用字段 和申请的 reff 字段一致	C10

不同业务有效字段说明如下表：

字段号	订单 确认	认购 确认	申购 确认	赎回 确认	转托管 确认	认购 结果	分红 方式 确认	转换 确认	强增 强减	冻结 确认	解冻 确认	非交易 过户 确认
8	1	1	1	1	1	1	1	1		1	1	1
16				1								
24	1						1					
25		1	1	1		1		1				
32		1	1	1	1		1	1	1	1	1	1
34	1							1				

52		1	1	1	1	1		1	1			1
53		1	1	1	1	1		1				1
58										1		
60		1								1		
62			1	1	1	1		1	1	1	1	1
64		1	1	1		1			1			
67	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
86		1	1	1				1				
92	1	1	1	1	1	1	1	1		1	1	1
94			1	1	1	1			1			
97	1				1							1
119		1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
132	1	1		1	1	1		1		1	1	1
134	1	1	1			1						
135	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
136	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
137		1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
138		1	1	1	1	1			1			1
161								1				
162								1				
163								1				
173				1	1			1	1			1
176		1			1			1	1			1
177			1	1	1							1
193			1	1				1	1			

255		1	1		1			1	1	1	1	1
256		1	1		1		1	1	1			1
257										1		
260		1	1		1	1		1	1	1	1	1
263				1								
266						1						
276		1	1	1	1	1						1
285			1	1	1	1						
8000	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
8001	1	1	1	1	1	1	1	1	1			

4.5 取值附表

4.5.1 基金业务代码与含义表

BusinessCode(135)取值如下表:

类型	业务和其对应的业务代码
交易申请回执	认购申请 (020) 认购申请是投资人在开放式基金募集期间提出购买该开放式基金的申请。
	申购申请 (022) 申购申请是投资人在开放式基金成立之后，在基金存续期间，通过开放式基金的销售人购买基金单位的申请。
	赎回申请 (024) 赎回申请是投资人在开放式基金成立之后，基金存续期间，通过销售人将持有的基金单位按一定价格卖给基金管理人并收回现金的申请。
	转托管转出申请 (028) 转托管转出申请是投资人从证券市场转出的申请。

	设置分红方式申请（029） 设置分红方式是指投资人设置其基金账户下所持有某基金的分红处理方式。该业务需要在权益登记日之前提出申请。设置完成后，该基金除权时就以设定的分红处理方式进行处理。
	基金转换申请（036）
交易确认	认购确认(120) 认购确认是基金注册登记人对投资人认购申请的接收情况的处理结果。认购确认只有认购确认金额（和认购申请的金额一样）和费用，不含基金确认份数，投资人的实际认购份数，要在该基金募集期满后才能确认。
	申购确认(122) 申购确认是基金注册登记人对投资人申购申请的处理结果，包括交易确认份数、交易确认金额等信息。
	赎回确认(124) 赎回确认是基金注册登记人对投资人赎回申请的处理结果，包括交易确认份数、交易确认金额等信息。
	转托管转出确认(128) 对于转托管转出申报的确认信息。
	设置分红方式确认（129） 对于分红方式设置的确认。
	基金转换确认（137 和 138） 成功时返回两笔确认，业务代码分别为 137、138 代码, 失败时返回一笔确认，业务代码为 138 代码。
TA 发起的业务	认购结果(130) 认购结果是指开放式基金认购成功后，基金注册登记人根据投资人提出的有效认购申请和认购规则，计算出投资人的每一笔认购的确认金额、确认份数、认购费用等数据，该返回数据包含投资人的每一笔认购的确认金额、确认份数、认购费用等数据，其中由于份数记整，实际确认的金额=认购基金份数×发行价格+认购费用等，实际确认的金额<=原认购申请的金额。

	<p>基金份额冻结确认(131)</p> <p>基金份额冻结确认是基金注册登记人对基金份额冻结申请的处理结果。基金份额冻结后不接受除基金份额解冻以外的业务申请。</p>
	<p>基金份额解冻确认(132)</p> <p>基金份额解冻确认是基金注册登记人对基金份额解冻申请的处理结果。基金份额解冻后，对应的基金份额将恢复正常状态。解冻应根据原冻结申请具体情况，逐笔解冻及确认。</p>
	<p>非交易过户转入确认(134)，非交易过户转出确认(135)</p> <p>非交易过户转入确认、非交易过户转出确认是基金注册登记人对投资人非交易过户申请的处理结果。基金注册登记人将处理结果分别发送给该业务涉及的申请方和申请方的对方。</p>
	<p>转托管转入确认(127)</p> <p>从其他市场转入上证所市场的基金份额将通过本确认信息发送相应投资人指定的券商席位。</p>
	<p>认购拉单(190)</p> <p>因认购资金不足引起的拉单处理。</p>
	<p>强行调增(144)，强行调减(145)</p> <p>强行调增/调减是基金注册登记人在某种特定或契约预先规定的情况下，强制性地增加/减少投资人所持基金份额。</p>
	<p>强行赎回(142)</p> <p>强行赎回确认是强行赎回的处理结果。</p>

4.5.2 销售人代码表

DistributorCode(121)、TargetDistributorCode(97)的取值如下表：

销售人	编码
中国工商银行	002
中国农业银行	003
中国银行	004
中国建设银行	005
交通银行	006
上海证券交易所	101
深圳证券交易所	102
国泰基金管理公司	201
南方基金管理公司	202
华夏基金管理公司	203
华安基金管理公司	204
博时基金管理公司	205
鹏华基金管理公司	206
嘉实基金管理公司	207
长盛基金管理公司	208
大成基金管理公司	209
富国基金管理公司	210

4.5.3 返回代码表

ReturnCode(119)取值如下表:

返回代码	含 义
0000	成功
0001	份数余额不足
0002	账户已冻结
0003	账户已挂失
0004	发行期不受理
0005	封闭期不受理
0006	非开放日不受理
0007	收到预约数据确认
0008	巨额不受理
0009	无此账户
0010	其它原因失败
0100	证件号码错误（包括无证件号码）
0101	证件号码重复
0102	地区号无效
0103	业务种类非法
0104	销售人交易基金帐号非法
0105	销售代理人代码错误
0106	无户名
0107	个人/法人标志非法
0108	证件类型非法
0109	无经办人姓名

0110	经办人证件类型非法（包括无经办人证件号码）
0111	经办人证件号码错误
0112	无通讯地址
0113	邮政编码非法（包括无邮政编码）
0114	无电话
0115	无住址电话
0116	无单位电话
0117	开户网点非法
0118	冻结挂失截止日期无效
0119	无 E-MAIL 地址
0120	无法人代表姓名
0121	法人代表证件类型非法
0122	法人身份证件代码非法（包括无法人身份证件代码）
0123	TA 基金帐号非法（包括无 Ta 基金帐号）
0124	密函编号非法（包括无密函编号）
0125	职业代码非法
0126	学历代码无效
0127	年收入代码
0128	性别非法
0129	出生日期非法
0130	传真号码非法
0131	手机号码非法
0132	传呼机号码非法
0133	交收行代码非法

0134	交收行账户名非法
0135	交收行帐号非法
0136	上交所帐号非法
0137	深交所帐号非法
0138	开户日期非法
0139	申请单编号非法（包括无申请单编号）
0140	冻结标志非法
0141	默认分红方式非法
0200	基金代码非法
0201	交易日期非法
0202	交易时间非法
0203	销售人流水号非法
0204	币种代码非法
0205	资金帐号非法
0206	交易数量非法
0207	交易金额非法
0208	对方销售人基金帐号非法
0209	受理日期已变为下一个工作日
0210	对方 TA 帐号非法
0211	过户代理地点代码非法
0212	股东账户代码非法
0213	指定券商席位号非法
0214	预约赎回日期非法
0215	网点号非法

0216	折扣率非法
0217	有效天数非法
0218	原申请单编号非法
0219	巨额赎回处理标志非法
0220	冻结原因非法
0221	对方网点号非法
0222	再投资类型非法
0223	目标基金代码非法
0224	手续费率非法
0225	手续费非法
0226	对方销售人代码非法
0227	原申购日期非法
0228	账户未挂失
0229	账户未冻结
0301	帐户申请日期无效
0302	帐户申请不存在
0303	投资人已注册基金帐户
0304	帐户申请注册失败
0305	赎回份数过小
0306	因投资人未在转入方开户致使转托管失败
0307	持有份数超过持有上限
0308	基金账户已注销
0309	单笔申购低于申购下限
0310	赎回后剩余份数低于持有下限

0311	转出方余额不足
0312	确认异常
0313	投资人名或证件类型或证件代码与股东资料不符
0314	基金账户已挂帐
0315	证券账户不存在
0316	基金账户不存在
0317	基金非认购期
0318	基金非申购期
0319	基金非赎回期
0320	基金禁止转托管
0321	证券账户已注册为基金账户
0322	基金帐户有转托基金的冻结份数能单只基金全部转托管
0323	有在途份数，不能全转托管
0324	转出方余额为零
0325	原申请日期无效
0326	转入转出是同一代理人
0327	销售代理人不能代理此基金
0328	销售代理人无效
0329	性别代码无效
0330	申请日期无效
0331	投资人名无效
0332	投资人证件类型无效
0333	投资人证件号码无效
0334	通讯地址无效

0335	法人代表姓名无效
0336	经办人姓名无效
0337	单笔认购低于认购下限
0338	单笔认购高于认购上限
0339	基金处于权益分配期间，不允许更改分红方式
0340	单笔赎回高于预约下限
0341	单笔赎回低于赎回下限
0342	取基金信息错误
0343	写权益登记错误
0344	写基金明细表出错
0345	撤单申请无效
0346	转托管类型错
0347	转托管类型与申报数据不符
0348	旧基金帐号个人资料不存在
0349	旧基金帐号机构资料不存在
0350	无效分红方式
0351	该基金帐号有份数允许注销
0352	赎回金额不足以支付手续费
0353	证券账户类型非法
0354	同一网点申报相同数据
0355	管理人拒绝
0356	管理人配售确认撤销
0357	认购金额过少
0358	经办人识别方式非法

0359	CALLCENTER 交易标志非法
0360	INTERNET 交易标志非法
0361	账单寄送选择方式非法
0362	有基金份额，销户非法
0363	基金账号信息未作改动, 拒绝申请
0364	TA 基金账号凭证号非法
0365	有当日申请，销户非法
0366	基金净值非法
0367	转托管中转出与转入交易账户的基金账户不同
0368	基金不能转入
0369	基金不能转出
0370	持有份数小于最低持有份数, 应全部赎回或转换
0371	税率非法
0372	分红方案错误
0373	基金发行失败，退回认购
0374	该预约赎回单已失效
0375	手续费分成非法
0376	基金终止
0377	基金不在发行期或认购结束，认购不受理
0378	基金在正常交易期
0379	基金已发行或发行失败
0380	基金停止交易
0381	基金停止申购
0382	基金停止赎回

0383	基金正在权益登记
0384	红利发放，业务不受理
0385	无法识别的基金状态
0386	非交易过户对方账号未登记
0387	本日有冻结、挂失申请，交易无效
0388	一天仅接受一次重要资料修改
0389	分红期间有在途权益，不能处理
0390	基金帐号已登记
0391	基金帐号未登记
0392	该交易账号已开户
0393	有重复的冻结申请
0394	非交易过户必须逐笔确认
0395	交易后，入方余额低于最低限制
0396	交易后，出方余额低于最低限制
0397	基金转换对方基金停止交易
0398	基金无份数可冻结解冻
0399	无此冻结申请
0400	解冻份数与原冻结数不匹配
0401	超过最高赎回份数限制
0402	申购金额低于手续费
0403	总份额已超过募集金额，不能再认购
0404	按份数认购，金额计算错误
0405	不允许机构认购
0406	不允许个人认购

0407	逐笔人工处理为无效
0408	逐笔人工处理为成功
0409	已撤单
0410	巨额赎回延续部分
0411	重复开户
0412	不支持预约申请
0413	有份数冻结，不允许账户冻结
0414	没有指定赎回的基金份额
0415	小于初次投资金额限制
0416	小于追加投资限制
0417	转托管对方销售商或网点不存在
0418	不能修改客户类型
0419	重要资料修改当天不能赎回转托管
0420	申请日期大于最后认购日期
0421	巨额赎回，不能基金转换
0422	当天多次开户(交易帐号重)
0423	当天多次开户(基金帐号重)
0424	不存在要转出的份数
0425	经办人识别方式非法
0426	帐单寄送选择方式非法
0427	基金帐号信息未作改动, 拒绝申请
0428	持有份数小于最低持有份数, 应全部赎回或转换
0429	分红方案错误
0430	该预约赎回单已失效

0431	持有份数小于等于最低赎回份数, 应全部赎回或转换
0432	基金在个人认购期, 不接受机构认购
0433	基金在机构认购期, 不接受个人认购
0434	认购金额小于机构最低认购金额
0435	认购申请金额小于个人最低认购金额
0436	认购金额大于机构最高认购金额
0437	认购申请金额大于个人最高认购金额
0438	基金处于不允许申购状态
0439	申购申请金额小于机构最低追加投资金额
0440	申购申请金额小于个人最低追加投资金额
0441	申购申请金额小于机构最低首次投资金额
0442	申购申请金额小于个人最低首次投资金额
0443	定时定额申购申请金额小于最低定额
0444	定时定额申购申请金额超出最低定额部分不是级差的整数倍
0445	定时定额申购合约终止
0446	定时定额申购金额与原合约不符
0447	持有份数大于最低赎回份数, 申请赎回份数不小于最低赎回份数
0448	****柜员登录注销错误****
0449	柜员代码不能为空
0450	没有此柜员
0451	此柜员已被冻结
0452	此柜员已被删除
0453	柜员密码不符
0454	此柜员已经登录系统;或者此前非正常退出系统, 请与系统管理员联系

0455	登录柜员记录出现异常，请与系统管理员联系
0456	注销柜员状态出现异常，请与系统管理员联系
0457	操作员过期
0458	****柜员管理类错误****
0459	柜员代码长度必须为 3 位
0460	此柜员代码已经存在
0461	柜员姓名不能为空
0462	存在同名的有效柜员，系统不允许姓名重复
0463	柜员密码不能为空
0464	柜员所属部门不能为空
0465	有效天数必须是大于 0 的整数
0466	起始日期不能为空
0467	确认密码不能为空
0468	组代码不能为空
0469	组的成员已经存在
0470	权限代码不能为空
0471	组的权限已经存在
0472	柜员的权限已经存在
0473	组名称不能为空
0474	此组已经存在
0475	柜员角色不能为空
0476	组非空不能删除
0477	组的成员不存在
0478	组的权限不存在

0479	根用户不能删除
0480	操作员代码不能为空
0481	没有此组
0482	此柜员代码不存在
0483	确认密码不正确
0484	修改柜员资料时柜员状态不允许被设置为"删除"
0485	柜员已被删除，操作被禁止
0486	柜员处于活动状态，操作被禁止
0487	交易密码错误
0488	交易帐号凭证号错误
0489	交易帐户处于等待确认状态
0490	交易帐户已挂失
0491	确认密码不正确
0492	基金帐户处于等待确认状态
0493	当天有帐户申请
0494	当天有交易申请
0495	案号非法
0496	该交易申请已经提交
0497	定时定额申购日期非法
0498	定时定额申购类型错误
0499	定时定额申购状态非法
0500	该定时定额申购已完成
0501	该定时定额申购已撤单
0502	该定时定额申购已撤消

0503	定时定额申请不存在或其它数据库错误
0504	解冻份数大于已冻结份数
0505	在同一工作日同一投资者有相同的更改基金分红方式申请
0506	交易帐户已作废
0507	交易帐户凭证号状态错误
0508	交易帐户已销户
0509	交易帐户已冻结
0510	交易帐户已撤销
0511	交易帐户待确认
0512	交易帐户未开基金帐户
0513	基金帐户挂失
0514	基金帐户冻结
0515	基金帐户销户
0516	转托管对方机构代码与发起机构代码相同
0517	基金转换转出基金与目标基金相同
0518	交易帐户与基金帐户不匹配
0519	禁止此模式基金转换
0520	存在逆向基金转换
0521	无要复核的申请合同号
0522	要复核的合同号不属于本机构
0523	要复核的合同号不属于本网点
0524	要复核的合同号业务类型不一致
0525	复核人员与受理人员相同
0526	要复核的合同号已复核

0527	要复核的合同号已作废
0528	要复核的合同号已撤单
0529	复核流水的基金代码不对
0530	复核流水的申请金额不对
0531	复核流水的交易帐号不对
0532	写更改申请流水的复核标志失败
0533	复核流水的操作员代码不对
0534	复核流水的申请份数不对
0535	复核流水的巨额赎回处理方式不对
0536	复核流水的对方机构代码不对
0537	复核流水的转换目标基金代码不对
0538	复核流水的申请费用不对
0539	复核流水的分红方式不对
0540	复核流水的分红比例不对
0541	无此交易码
0542	该操作现不可用
0543	该申请已撤单
0544	该申请已作废
0545	该申请还未复核
0546	电话委托受理业务不能通过柜面撤单
0547	该申请已复核
0548	系统通用参数查询失败
0549	查询表单列值信息失败
0550	查询报表输出固定数据配置信息失败

0551	查询表单输入条件的配置信息失败
0552	未定义的表单查询
0553	查询表单数据集信息失败
0554	请选择输入查询表单号
0555	未定义的查询类别
0556	查询表单数据集信息失败
0557	取申请帐页失败
0558	发布日期不能为空
0559	利率生效时间非法
0560	利率非法
0561	利息税率非法
0562	实施时间不能为空
0563	最小手续费比率不能小于 0
0564	最大手续费比率不能大于 1
0565	最小手续费比率不能大于最大手续费比率
0566	TA 手续费分成比率不能为空
0567	此业务不能设置进入基金资产手续费比率
0568	手续费分成比率不能大于最小手续费比率
0569	手续费分成比率不能小于 0
0570	权益登记日非法
0571	除权日非法
0572	派息日非法
0573	利得比例不能为空
0574	利得比例必须在 0, 1 之间

0575	分红方案编码非法
0576	费率方案编号不能为空
0577	手续费计算方案起始时间非法
0578	基金名称不能为空
0579	基金状态非法
0580	基金转换状态非法
0581	基金认购价格非法
0582	费率方案不完整
0583	存在未确认记录,不能提交
0584	此操作员未输入费率方案, 不能输入费率
0585	金额非法
0586	持有天数非法
0587	手续费率段重叠
0588	此操作员未输入费率方案, 不能删除费率
0589	基金帐户受理方式不能为空
0590	不存在的基金帐户受理方式
0591	到帐情况不能为空
0592	证件唯一性不能为空
0593	系统状态不能为空
0594	强行签退时间不能为空
0595	强行签退持续时间不能为空
0596	强行签退持续时间不能小于 0
0597	基金净值路径不能为空
0598	销售点代码不能为空

0599	清算日期不能为空
0600	工作日期不能为空
0601	巨额赎回比例不能为空
0602	巨额赎回比例必须在 0-1 之间
0603	未知的系统参数
0604	定时定额申购日期不能为空
0605	按定时定额申购日期错
0606	印花税率非法
0607	审批日期不能为空
0608	审批人不能为空
0609	审批数量不能为空
0610	审批数量不能小于 0
0611	批准的基金转换份数应小于等于基金总份数
0612	待确认的记录超过一条
0613	确认审批内容与第一次输入内容不符
0614	不支持的基金发行方案
0615	待确认的基金发行记录超过一条
0616	到款日期不能为空
0617	预售规模不能为空
0618	预售规模不能小于 0
0619	认购价格不能小于 0
0620	****销售机构设置
0621	销售机构接收目录不能为空
0622	销售机构发送目录不存在

0623	销售机构接收目录不能为空
0624	销售机构接收目录不存在
0625	销售机构代码不能为空
0626	销售机构名称不能为空
0627	销售机构状态不能为空
0628	销售机构类型不能为空
0629	销售机构接受目录长度大于 120
0630	销售机构发送目录长度大于 120
0631	网点代码不能为空
0632	网点名称不能为空
0633	区域代码不能为空
0634	区域代码不存在
0635	银行名称不能为空
0636	银行状态不能为空
0637	公告状态不能为空
0638	公告已输入,未复核
0639	公告已复核成功
0640	未定义的公告状态
0641	此公告不存在
0642	公告标题不能为空
0643	公告日期不能为空
0644	公告日期不能比当前日期小
0645	公告内容不能为空
0646	公告类型不能为空

0647	取公告编号流水号失败
0648	操作员相同,不能复核公告
0649	操作员不同,不能修改公告
0650	公告已经发布
0651	公告复核错误
0652	不支持的传输状态
0653	未解上传包
0654	未打包上传包
0655	未解下传包
0656	未打包下传包
0657	包传输状态不存在
0658	第一次输入
0659	第一次删除
0660	第一次修改
0661	未生效
0662	已生效
0663	已实施
0664	未知状态
0665	记录只有一条
0666	记录不存在
0667	记录多于一条
0668	不是本操作员输入,不能修改, 请先清屏
0669	本操作员输入,不能再次输入
0670	不是本操作员输入,不能删除

0671	第二次输入内容与第一次输入内容不符
0672	第二次修改内容与第一次修改内容不符
0673	数据库错误
0674	写日志失败
0675	取交易帐户编号失败
0676	取基金帐户流水号失败
0677	取系统日期失败
0678	存在认购或未完成的赎回申请
0679	清算步骤错误
0680	取系统时间失败
0681	取参数 ACCPTMD(受理方式)的值失败
0682	取交易帐号凭证流水号失败
0683	取销售机构代码失败
0684	存在冻结的基金份额
0685	正在清算, 不能处理到帐操作
0686	存在未审批的巨额赎回
0687	取交易帐号凭证号失败
0688	取交易帐号失败
0689	取交易密码失败
0690	取基金余额失败
0691	更改余额失败
0692	写资金回款流水失败
0693	交易清算类型错误
0694	取清算日失败

0695	修改投资者基金分红信息失败
0696	取市场标志失败
0697	市场标志错误
0698	现为收市状态，还未日初，不能进行业务受理
0699	现为日终状态，还未日初，不能进行业务受理
0700	系统步骤错误
0701	取市场状态描述错误
0702	设置市场状态错误
0703	设置下一工作日错误
0704	生成工作日表错误
0705	系统日初错误
0706	系统日终错误
0707	设置上一工作日错误
0708	取收市处理状态失败
0709	收市处理步骤错误
0710	取收市处理状态描述失败
0711	设置收市处理状态失败
0712	收市初始化错误
0713	收市复核错误
0714	收市写帐页错误
0715	取系统状态失败
0716	取系统状态描述失败
0717	设置系统状态失败
0718	系统当前状态不允许操作

0719	取清算处理状态失败
0720	清算处理步骤错误
0721	取清算处理状态描述失败
0722	设置清算处理状态失败
0723	清算初始化错误
0724	清算数据备份错误
0725	清算数据恢复错误
0726	帐户清算错误
0727	交易清算错误
0728	清算复核错误
0729	清算结束错误
0730	预清算错误
0731	清算数据汇总错误
0732	审批赎回份数大于允许的最大审批份数
0733	审批申购份数大于允许的最大审批份数
0734	基金未发生巨额或超规模不用进行审批
0735	基金发生巨额或超规模请进行审批
0736	取募集期日处理状态失败
0737	募集期日处理步骤错误
0738	取募集期日处理状态描述失败
0739	设置募集期日处理状态失败
0740	募集期日处理初始化错误
0741	募集期日处理数据备份错误
0742	募集期日处理数据检查错误

0743	募集期日处理当日有效认购统计错误
0744	募集期日处理错误
0745	募集期日处理发行统计错误
0746	募集期日处理数据汇总错误
0747	募集期日处理复核开始错误
0748	募集期日处理复核结束错误
0749	募集期日处理数据恢复错误
0750	募集期日处理结束错误
0751	基金认购费率未设置或无有效费率
0752	基金交易费率未设置或无有效费率
0753	基金 NAV 值未设置或无有效 NAV 值
0754	没有基金可进行募集处理
0755	取发行处理状态失败
0756	发行处理步骤错误
0757	取发行处理状态描述失败
0758	设置发行处理状态失败
0759	发行处理初始化错误
0760	发行处理数据备份错误
0761	发行处理错误
0762	发行处理复核开始错误
0763	发行处理复核结束错误
0764	发行处理数据恢复错误
0765	发行处理结束错误
0766	发行预处理错误

0767	计算发行利息错误
0768	发行失败处理错误
0769	发行成功处理错误
0770	利率未设置或不存在
0771	没有基金可进行发行处理
0772	分红方案非法
0773	分红方案状态错误
0774	取投资者分红信息错误
0775	计算投资者分红权益错误
0776	权益登记错误
0777	红利发放错误
0778	红利统计错误
0779	统计认购清算确认数据错误
0780	统计认购数据(给核算)错误
0781	统计发行确认数据错误
0782	统计发行确认数据(给核算)错误
0783	汇总业务申请数据错误
0784	汇总业务确认数据错误
0785	汇总统计固定收费错误
0786	读数据库失败，请查看错误日志
0787	写数据库错误，请查看错误日志
0788	数据操作失败，请查看系统日志
0789	写交易申请流水失败
0790	写帐页失败

0791	数据历史备份与清除失败
0792	按申请编号检查申请数据错误
0793	按基金状态检查申请数据错误
0794	按申请数量检查申请数据错误
0795	写确认流水错误
0796	累计投资者认购金额错误
0797	写认购队列错误
0798	更改申请流水处理状态错误
0799	系统错误
0900~0999	自定义返回代码

5 申报与成交回报/盘后过户接口中字段转义说明

上证所传统接口采用增加辅助证券代码，然后对申报接口与成交回报接口中的某些字段进行转义的方式来支持除普通交易买卖以外的其它业务。

5.1 其他交易类

5.1.1 深发行沪配售卖出

注：深发行沪配售卖出业务于 2006 年 8 月停止。

卖出深发行沪配售卖出代码（609***）转义为对对应深圳市场股票（002***）卖出。通过实时成交回报记录表示申报是否成功进入深交所系统、撤单是否成功以及最终的成交结果。

当申报类型为卖出申报订单：

- **cjsl** 大于 0 表示在深交所已成功卖出。
- **cjsl** 小于 0 表示申报失败，其绝对值为对应的申报卖出数量；**sbsj** 转义为上证所错误代码，含义参见“沪深交易所市值配售错误代码对应表”。

当申报类型为撤单：

- **cjsl** 小于 0 表示在深交所已成功撤销，其绝对值代表撤单成功的数量。
- **cjsl** 等于 0 表示撤单失败，**sbsj** 转义为上证所错误代码，含义参见“沪深交易所市值配售错误代码对应表”。

沪深交易所市值配售错误代码对应表

上证所错误代码	简写	具体含义	对应深交所错误代码
0	深交所主机拒绝	该笔撤单被深交所主机拒绝	--
1	无效账户	证券账户无效	01
2	回购卖空	席位拥有的回购虚拟券数量小于卖出申报数量	02

3	席位卖空	席位拥有的该证券可用股数小于卖出申报数量	03
4	股东卖空	股东拥有的该证券可用股数小于卖出申报数量	04
5	总量超限	国债挂牌分销，账户买入量总和超过每账户的限制	05
6	价格过高	交易申报价格超出涨跌幅的上限	06
7	价格过低	交易申报价格超出涨跌幅的下限	07
8	价格错误	新股定价发行，申报价不等于发行价或 新股竞价发行，申报价超出限价范围或 国债挂牌分销，申报价不等于分销价或 配股认购的申报价不等于配股价	08
9	数量非法	新股申购量非 1000 的整数倍	09
10	数量超限	新股申购量超过最大可申购量或 国债挂牌分销买入量超过每笔委托申报数量限制或 国债挂牌分销卖方累计挂牌量超过注册量	10
11	重复申购	新股发行中同一证券账户重复申购	11
12	账户非法	国债分销商不能用托管账户自买	12
13	转股禁止	当天禁止该可转换债券的转股业务	13
14	回售禁止	当天禁止该可转换债券的回售业务	14
15	非质押物	该证券不能作为质押物	15
16	持股超限	单个或一类证券账户拥有某证券的股份数量超过限制	16
101		席位代码非法	A
102		申报日期非法	B
104		证券代码非法	D
105		证券停牌	E
106		买申报数量不是 SJSXX.XXBLDW 的整数倍；或 卖申报数量不是 SJSXX.XXSLDW 的整数倍；或 申报数量超出 SJSXX.XXMBXL 的限值；	F
107		申报价格不是 SJSXX.XXJGDW 的整数倍	G
108		证券账户含有非数字字符	H

109		非法的申报业务	I
110		测试环境正式用户不允许报单	J
111		WTCLBZ 没有填'z'	K
112		交易期间测试用户不允许报单	L
113		该席位无权经营该种证券	M
114		该证券账户无权交易该种证券	N
116		该证券在当前时间不可交易	P
117		席位被禁买或禁卖	Q
118		证券账户被禁买或禁卖	R
123		席位资金可用量不足	W
124		该申报记录标有 DELETE 标记	X

5.1.2 国债分销

买入国债分销代码（751***）转义为从对应分销商处买入特定国债。买入价格即分销价格。指令即时处理，不可撤单。

有实时成交回报记录。

有盘后过户记录。

5.2 账户注册类

5.2.1 回购注销/回购登记

买入回购注销代码（799996）转义为回购注销。买入价格为 1.000。买入数量为 1。指令即时处理，不可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

买入回购登记代码（799997）转义为回购登记。买入价格为 1.000。买入数量为 1。指令即时处理，不可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。（注：回购登记业务于 2006 年 5 月 8 日起停止。）

5.2.2 网络密码激活/网络密码注销

买入网络密码服务代码（A 股帐户：799988；B 股帐户：939988）转义为激活或者注销网络密码业务。激活密码时买入价格 1.000，买入数量为投资者在上交所网站注册时所获得的激活码。注销密码时买入价格 2.000，买入数量为 2。不可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

5.2.3 指定撤销/指定登记

买入指定撤销代码（799998）转义为指定撤销。买入价格为 1.000。买入数量为 1。指令即时处理，不可撤单。

无实时成交回报记录。

有盘后过户记录，数量为 0，价格为 0，成交时间为 150000。

买入指定登记代码（799999）转义为指定登记。买入价格为 1.000。买入数量为 1。指令即时处理，不可撤单。

无实时成交回报记录。

有盘后过户记录，数量为 0，价格为 0，成交时间为 150000。

示例如下：

Gddm	Gdxm	Berq	Cjbl	Gsdm	Cjst	Bcye	Zqdm	Sbsj	Cjsj	Cjtg	Cjte	Sqbh	Bs	Mjbl
D123456789		20061031	00123456	23160	0		799998	93612	150000	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A987654321		20061031	00123456	23160	0		799999	103612	150000	0.000	0.00	WU123456789	B	000001

新交易系统切换后，其中 Cjbl 字段填写指定登记/撤销订单号码的后 8 位。

5.3 登记行权类

5.3.1 发行登记

在一个发行周期中，会使用多个辅助证券代码。

股票发行时，辅助证券代码定义见下表，表格单元中第一行表示对应 600***股票的临时非交易代码，第二行表示对应 601***股票的临时非交易代码。

	（新股东）定 价首发 （新股东）询 价首发 新股东定价增 发	老股东询价增 发	新股东询价增 发	股票市值配售 首发	可转债资金发 行
发行申购/中签 代码	730*** 780***	700*** 760***	731*** 781***	737*** 787***	733*** 783***
发行配号代码	741*** 791***		741*** 791***	747*** 797***	744*** 794***
发行扣款/还款 代码	740*** 790***		740*** 790***		743*** 793***

封闭式基金 500***对应的发行申购/中签代码为 735***；发行配号代码为 746***；发行扣款/还款代码为 745***。（注：该产品已经停止发行。）

ETF 基金 510***对应的认购代码为其代码组第 4 个代码，比如 510053；认购扣款/还款代码为 ETF 代码组第 5 个代码例如 510054。

买入发行申购/中签代码（包括 ETF 认购代码）转义为对对应证券参与申购；询价模式时输入价格，其他模式下输入发行价格（ETF 网上现金认购买入价格为 1.000）。买入数量以 1000 为最小单位。股票申购不可撤单，ETF 认购可以撤单。**新交易系统切换后，各种申购/认购均支持撤单。**

当日无对应的买入发行申购/中签代码的实时成交回报记录。但会在过户库中包含下文描述的记录。

市值配售发行返回数据说明

日期	盘后过户文件接口说明
T	盘后过户文件中包含配号记录。zqdm 为发行配号代码（比如 747***）；cjbh 指配号的首个号码；cjsl 指配号成功的数量；当 cjsj 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况；bs 为买入。
T+1	盘后过户文件中包含中签记录。zqdm 为申购/中签代码（比如 737***）；cjbh 指中签号；cjsl 指中签数量；cjjg 指中签价格；cjje 等于分配数量乘以结算价格；bs 为买入。

资金申购发行返回数据说明

日期	盘后过户文件接口说明
T	盘后过户文件中包含发行扣款记录。zqdm 为发行扣款/还款代码（比如 740***）；bs 为买入的记录。
T+2	盘后过户文件中包含配号记录。zqdm 为发行配号代码（比如 741***）；cjbh 指配号的首个号码；cjsl 指配号成功的数量；当 cjsj 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况；bs 为买入。
T+3	<p>盘后过户文件中包含还款记录。zqdm 为发行扣款/还款代码（比如 740***）；cjsl 为 T 日申购数量；cjjg 为 T 日申购价格；cjje 还款金额等于申购数量乘以申购价格；bs 为卖出。</p> <p>盘后过户文件中包含中签记录。zqdm 为申购/中签代码（比如 730***）；cjbh 指中签号；cjsl 指中签数量；cjjg 指中签价格；cjje 等于分配数量乘以结算价格；bs 为买入。</p>

ETF 认购返回数据说明

日期	盘后过户文件接口中说明
----	-------------

T	盘后过户文件中包含认购扣款记录。zqdm 为 ETF 现金认购扣款/还款代码（ETF 代码组第 5 个代码例如 510054）；bs 为买入的记录。
T+2	<p>盘后过户文件中包含认购还款记录。zqdm 为 ETF 现金认购扣款/还款代码（ETF 代码组第 5 个代码，比如 510054）；bs 为卖出的记录。</p> <p>盘后过户文件中包含中签记录。zqdm 为 ETF 现金认购申请/中签代码（ETF 代码组第 4 个代码，比如 510053）；bs 为买进的记录。</p>

对于不允许重复申报的发行情况，一旦发生重复申报，在发行日的过户库中，会设定重复申报的记录 cjbh,cjsl 为 0，cije 为 0.00，sqbh 为“重复申报”。

一次 600000 新股东定价增发的示例如下：

Gddm	Gdxm	Bcrq	Cjbh	Gsdm	Cjsl	Bcye	Zqdm	Sbsj	Cjsj	Cjig	Cije	Sqbh	Bs	Mjbh
D123456789		20061116	00123456	23160	300000		740000	093016	150000	13.640	4092000.00	WU123456789	B	000001
A234567890		20061116	0	23160	0		740000	093016	150000	13.640	0.00	重复申报	B	000001
D123456789		20061120	10041136	23160	300000		741000	093016	150000	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
D123456789		20061121	10041312	23160	1000		730000	093016	150000	13.640	13640.00	WU123456789	B	000001
D123456789		20061121	00123456	23160	300000		740000	093016	150000	13.640	4092000.00	WU123456789	S	000001

新交易系统切换后，其中扣款还款记录中，Cjbh 字段填写发行认购订单编号的后 8 位。

5.3.2 配股/配转债

600***股票对应的配股代码为 700***；转配股代码为 701***（注：该业务已停止）；职工股配股代码为 702***；配转债代码为 704***。

601***股票对应的配股代码为 760***；职工股配股代码为 762***；配转债代码为 764***。

500***封闭式基金对应的扩募代码为 705***。（注：该业务已停止）。

卖出配股代码转义为对对应证券参与配股。卖出价格为配股价，该取值对全市场一致，新交易系统切换后，传统接口中该价格字段无意义，交易系统不检验卖出价格的输入取值。卖出数量为参加配股的数量。指令即时处理，不可撤单。

有实时成交回报记录。

有盘后过户记录。

一次 700000 增发的示例如下：

Gddm	Gdxm	Bcrq	Cjbh	Gsdm	Cjsl	Beve	Zqdm	Sbsj	Cjsj	Cjlg	Cije	Sgbh	Bs	Mjbh
D123456789		20061116	308007	23160	6724		700000	093016	093016	13.640	91715.36	WU123456789	S	00001

新交易系统切换后，其中 Cjbh 字段填写配股/配转债订单编号的后 8 位。

5.3.3 股票要约收购登记/股票要约收购撤销

股票的要约收购代码为 706***，与股票代码没有直接的对应关系，需要根据上证所在要约收购业务开始之前发布的公告决定。

卖出要约收购代码转义为对对应的股票进行要约收购登记。卖出价格为收购价，该取值对全市场一致，新交易系统切换后，传统接口中该价格字段无意义，交易系统不检验价格的输入取值。卖出数量以 1 股为最小单位。可撤单。

买入要约收购代码转义为对对应的股票进行要约收购撤销。买入价格为收购价，该取值对全市场一致，新交易系统切换后，传统接口中该价格字段无意义，交易系统不检验价格的输入取值。买入数量以 1 股为最小单位。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

5.3.4 网上投票

600***股票对应的网上投票代码为 738***。

601***股票对应的网上投票代码为 788***。

900***股票对应的网上投票代码为 938***。

买入网上投票代码转义为对对应证券投票。不可撤单。

买入价格代表股东大会议案，如有多个待表决的议案，则 1 元代表议案 1，2 元代表议案 2，依此类推。99 元代表所有议案。多个需逐项表决的议案可以组成一个议案组，用含两位小数的价格代表该议案组下的各个议案或者所有议案。如 2.01 元代表议案组 2 的第 1 个议案，2.02 元代表议案组 2 的第 2 个议案，2.00 元代表议案组 2 的全部议案。

不采用累积投票制的议案，买入数量中 1 代表同意，2 代表反对，3 代表弃权。采用累积投票制的议案，买入数量代表选举票数。

无实时成交回报记录。

有盘后过户记录。盘后过户记录示例如下：

Gddm	Gdxm	Bcrq	Cjbl	Gsdm	Cjst	Beve	Zqdm	Sbsj	Cjsj	Cjtg	Cje	Sqbh	Bs	Mjbl
D123456789		20061031	00123456	23160	1		738031	93612	150000	99.000		WU123456789	B	00001
A987654321		20061031	00123456	23160	2		738712	103612	150000	1.000		WU123456789	B	00001

新交易系统切换后，其中 Cjbl 字段填写网上投票订单号码的后 8 位。

5.3.5 可转债转股

100***或者 110***可转债对应的股票代码为 600***（有部分特殊代码没有遵循此对应关系，比如南化转债 100001），其对应的可转债转换代码为 181***或者 190***。

113***可转债产品对应的股票代码为 601***，其对应的可转债转换代码为 191***。

卖出可转债转换代码转义为对对应可转换债券进行转换登记。卖出价格填 100，该取值对全市场一致，新交易系统切换后，传统接口中该价格字段无意义，交易系统不检验卖出价格的输入取值。卖出数量以手为最小单位。不可撤单，新交易系统切换后，支持撤单。

无实时成交回报记录。

盘后过户有两条记录：卖出债券记录与买入转换后股票记录。示例如下：

Gddm	Gdxm	Bcrq	Cjbl	Gsdm	Cjst	Beve	Zqdm	Sbsj	Cjsj	Cjtg	Cje	Sqbh	Bs	Mjbl
A123456789		20061031	00123456	23160	1		110036	093612	150000	0.000	0.00	WU123456789	S	00001
A123456789		20061031	00123456	23160	174		600036	093612	150000	0.000	0.00	WU123456789	B	00001

新交易系统切换后，其中 Cjbl 字段填写转股订单号码的后 8 位。

5.3.6 可转债回售

可转债的回售代码为 1009**，与可转债没有直接的对应关系，需要根据上证所在回售业务开始之前发布的公告决定。

卖出可转债回售代码转义为对对应的可转债进行回售登记。卖出价格填公告的回售价格，该取值对全市场一致，新交易系统切换后，传统接口中该价格字段无意义，交易系统不检验卖出价格的输入取值。卖出数量以手为最小单位。不可撤单。新交易系统切换后，支持撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

5.3.7 权证行权

580***权证对应的行权代码为 582***。

买入权证行权代码转义为对对应权证进行行权。买入价格为行权价格，该取值对全市场一致，新交易系统切换后，传统接口中该价格字段无意义，交易系统不检验买入价格的输入取值。买入数量以份为最小单位。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

5.3.8 开放式基金路由

519***开放式基金的申购/赎回代码即其产品代码；对应的认购代码为 521***，对应的份额转托管代码为 522***；对应的分红设置代码为 523***；对应的转换代码为 524***。

买入开放式基金申购/赎回代码（519***）转义为对对应的开放式基金的申购，卖出该代码转义为对对应的开放式基金的赎回。买入/卖出价格为 1.000。买入时数量为申购金额；卖出时数量为赎回基金份额。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

买入开放式基金认购代码（521***）转义为对对应的开放式基金的认购。价格为 1.000。数量为认购金额。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

卖出开放式基金份额转托管代码（522***）转义为对对应的开放式基金的转托管转出。价格取整为对方对应的销售人代码（000-999）。数量为基金份额。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

买入开放式基金分红设置代码（523***）转义为对对应的开放式基金设置分红方式。价格为分红方式代码（100 元：红利转投，101 元：现金分红），数量为 100 无意义。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

卖出开放式基金转换代码（524***）转义为对对应的开放式基金转换为其他基金。价格字符串（519.***）移去小数点后转义为目标基金代码。数量为基金份额。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

5.4 转换类

5.4.1 账户式质押回购入库/出库

00****国债和 01****国债对应的账户式质押回购出入库代码为 09****。

卖出账户式质押回购出入库代码（09****）转义为对对应债券进行入库。买入该代码转义为对对应债券进行出库。价格为 1.000。数量以手为最小单位。不可撤单。

入库成功后，产生如下 3 条实时成交回报记录：

- cijg 与 cije 为 0，cjsl 为申请入库数量的卖出出入库代码的成交记录；
- cijg 与 cije 为 0，cjsl 为申请入库数量的卖出现券的成交记录；
- cijg 与 cije 为 0，cjsl 为折算后数量的买入标准券(888880)的成交记录。

出库成功后，产生与入库成功后买卖方向相反的实时成交回报记录。

盘后过户记录与实时成交回报记录组织方式相同。

新交易系统切换后，成交记录不再连续发送，成交编号 **cjbh** 不再连续递增，柜台系统须根据会员内部订单号 **sqbh** 字段将有关成交记录定位出来。示例如下：

Gddm	Gdxm	Bcrq	Cjbh	Gsdm	Cjsl	Bcve	Zqdm	Sbsj	Cjsj	Cjig	Cjie	Sqbh	Bs	Mjbh
D123456789		061031	00123456	23160	6525		090010	093612	093612	0.000	0.00	WU123456789	S	000001
D123456789		061031	01234567	23160	6525		010010	093612	093612	0.000	0.00	WU123456789	S	000001
D123456789		061031	02345678	23160	6394		888880	093612	093612	0.000	0.00	WU123456789	B	000001

5.4.2 ETF 申购/赎回

510*** ETF 对应的申购赎回代码为其 ETF 代码组第 2 个代码。

买入 ETF 申购赎回代码（示例代码：ETF 代码组第 2 个代码 510051）转义为对对应 ETF 的申购（成分证券置换为 ETF）。卖出该代码转义为对对应 ETF 的赎回（ETF 置换为成分证券）。价格为 1.000。数量的最小单位以基金管理公司公布的信息为准。（比如 510050 以 100 万份为最小单位）。不可撤单。

申购成功后，为申购者产生如下实时成交回报记录：

- cijg 与 cije 为 0，cjsl 为申购数量的买入基金（ETF 代码组第 1 个代码，比如 510050）的成交记录。

- **cjig** 与 **cjie** 为 0, **cjsl** 为过户数量的卖出成分证券成交记录; 对于 ETF 基金管理公司规定的当日必须用现金替代的成分证券, 没有该成分证券的成交记录。新交易系统切换后, 将产生所有的卖出成分证券成交记录, 全部用现金替代的成分证券, **cjsl** 被设定为 0。
- 0 到 2 条买入资金代码 (ETF 代码组第 3 个代码, 比如 510052) 成交记录。当现金替代值超过 1000 元, 会拆分为 2 条资金代码, 其中 **cjsl** 为资金比例因子, 填 1 或 1000000。 **cjig** 为现金值; **cjie** 为金额=**cjsl**×**cjig**。
- **cjig** 与 **cjie** 为 0, **cjsl** 为申购数量的买入 ETF 申购赎回代码 (ETF 代码组第 2 个代码, 比如 510051) 成交记录。(为 ETF 基金管理公司产生成交回报的方式参见 ETF 基金管理公司接口规格说明书。)

赎回成功后, 产生买卖方向与申购成功后相反的实时成交回报记录。

新交易系统切换后, 成交记录不再连续发送, 成交编号 **cjbh** 不再连续递增, 柜台系统须根据会员内部订单号 **sqbh** 字段将有关成交记录定位出来。同时请注意由于成交编号 **cjbh** 只在同一证券代码内唯一, 所以一次 ETF 申购/赎回业务中不同证券代码的成交编号有可能相同。

盘后过户记录与实时成交回报记录组织方式相同。一次 510050 赎回的示例如下:

GDDM	GDXM	BCRQ	CJBH	GSDM	CJSL	BCYE	ZQDM	SBSI	CJSJ	CJIG	CJJE	SQBH	BS	NJBH
A123456789		20061128	30518	23160	1000000		510050	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	S	000001
A123456789		20061128	30519	23160	2700		600000	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30520	23160	3800		600001	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30521	23160	1100		600004	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30522	23160	7100		600005	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30523	23160	2200		600009	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30524	23160	4600		600010	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30525	23160	1500		600011	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30526	23160	3800		600015	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30527	23160	16200		600016	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30528	23160	9500		600018	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30529	23160	11900		600019	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30530	23160	1400		600020	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30531	23160	1400		600026	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30532	23160	8100		600028	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30533	23160	2900		600029	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30534	23160	4100		600030	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30535	23160	11000		600036	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30536	23160	19300		600050	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30537	23160	800		600058	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30538	23160	500		600085	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30539	23160	900		600100	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30540	23160	3700		600104	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30541	23160	2400		600177	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30542	23160	1400		600188	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30543	23160	2300		600210	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30544	23160	1300		600269	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30545	23160	1100		600309	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30546	23160	2700		600320	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30547	23160	1700		600418	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30548	23160	700		600428	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30549	23160	1400		600500	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30550	23160	900		600519	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30551	23160	700		600583	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30552	23160	2200		600601	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30553	23160	3300		600642	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001

A123456789		20061128	30554	23160	1700		600649	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30555	23160	1100		600660	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30556	23160	2200		600688	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30557	23160	1600		600717	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30558	23160	2200		600795	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30559	23160	2200		600832	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30560	23160	3000		600839	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30561	23160	900		600879	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30562	23160	900		600887	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30563	23160	1400		600895	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30564	23160	7500		600900	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30565	23160	5900		601006	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30566	23160	15500		601398	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30567	23160	9800		601988	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	B	000001
A123456789		20061128	30568	23160	1		510052	093027	093027	325.000	325.00	WU123456789	S	000001
A123456789		20061128	30569	23160	1000000		510052	093027	093027	0.008	8000.00	WU123456789	S	000001
A123456789		20061128	30570	23160	1000000		510051	093027	093027	0.000	0.00	WU123456789	S	000001

5.4.3 权证创设/注销

本章节描述的权证实时创设与注销业务在本文档发布之时还未正式上线，仅供柜台系统开发参考。

580***权证对应的创设/注销代码为 581***。

具有创设资格的市场参与者，需要先到中登公司登记权证创设专用账户 A1，并开设权证创设抵押品账户 A2，A1 和 A2 必须指定在同一个席位上，并且不许转指定。其中，A2 账户为挂起状态，不允许进行任何交易。

买入认购权证创设/注销代码（581***）转义为对对应权证进行创设，卖出该代码转义为对对应权证进行注销。价格为 1.000。数量以 1,000 为最小单位。不可撤单。

创设成功后，为权证创设专用账户 A1 产生 3 条 cijg 与 cije 均为 0 的实时成交回报记录：

- 权证创设代码的买入成交记录（cjsl 为创设数量）；
- 权证交易代码的买入成交记录（cjsl 为创设数量）；
- 抵押标的证券的卖出成交记录（cjsl 为抵押的标的证券数量）。

为权证创设抵押品账户 A2 产生 3 条 cijg 与 cije 均为 0 的成交记录：

- 权证创设代码的卖出成交记录（cjsl 为创设数量）；
- 权证交易代码的卖出成交记录（cjsl 为创设数量）；

- 抵押标的证券的买入成交记录（**cjsl** 为抵押的标的证券数量）。

注销成功后产生与创设成功后的买卖方向相反的记录。

新交易系统切换后，成交记录不再连续发送，成交编号 **cjbh** 不再连续递增，柜台系统须根据会员内部订单号 **sqbh** 字段将有关成交记录定位出来。

盘后过户记录与实时成交回报记录组织方式相同。

5.5 融资融券非交易过户

投资者要进行融资融券信用交易，需向具备融资融券业务资格的证券公司申请，开设 E 字头的“**投资者信用证券账户**”。

开展融券业务的证券公司必须在中登公司开设“**证券公司融券专用账户**”，存放自有证券，供投资者进行融券交易。证券公司融券专用账户不得进行任何申报。

开展融券业务的证券公司还必须在中登公司开设“**证券公司信用交易担保证券账户**”，该帐户与投资者信用证券账户之间是总帐与二级明细帐的关系，用于记载投资者委托证券公司持有的担保证券的明细数据。证券公司信用交易担保证券账户不得进行任何申报。

5.5.1 余券划转

申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。

买入余券划转代码（**799981**）转义为从证券公司融券专用账户过户到证券公司信用交易担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由中登公司维护）。买入价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：**601.988**）。买入数量为申请划转数量，允许为零散股。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

5.5.2 还券划转

申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。

卖出还券划转代码（799982）转义为从证券公司信用交易担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由中登公司维护）过户到证券公司融券专用账户。卖出价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。卖出数量为申请划转数量，允许为零散股。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

5.5.3 担保品划转

申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。

买入担保品划转代码（799983）转义为从投资者普通证券账户过户到证券公司信用交易担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由中登公司维护）。

卖出担保品划转代码（799983）转义从证券公司信用交易担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由中登公司维护）过户到投资者普通证券账户。

申报价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。申报数量为申请划转数量，允许为零散股。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

5.5.4 券源划转

申报帐户必须为证券公司自营证券账户，订单类型必须为“LPT”。

买入券源划转代码（799984）转义为从证券公司融券专用账户过户到证券公司自营账户。

卖出券源划转代码（799984）转义为从证券公司自营账户过户到证券公司融券专用账户。

申报价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。申报数量为申请划转数量，允许为零散股。可撤单。

无实时成交回报记录。

无盘后过户记录。

6 附录：营业部代码换码算法示例

```
BOOL branchid2ReffPrefix(char *branchid, char *reff)
{
    int x,m,n,p,q;
    char temp[2];

    x = atoi(branchid);

    if ( x<1000 || x>4843 ) return FALSE;

    m = ( x - 1000 ) / 62;
    n = ( x - 1000 ) % 62;

    if ( m>=0 && m<=9 ) p = m+48;
    else if ( m >=10 && m<=35) p = m+55;
    else if ( m >=36 && m<=61) p = m+61;

    if ( n>=0 && n<=9 ) q = n+48;
    else if ( n >=10 && n<=35) q = n+55;
    else if ( n >=36 && n<=61) q = n+61;

    temp[0] = p;
    temp[1] = q;

    memcpy(reff,temp,2);

    return TRUE;
}

BOOL reffPrefix2Branchid(char *reff, char *branchid)
{
    int x=0,m=0,n=0,p=0,q=0;

    p = *reff;
    q = *(reff+1);

    if (p>=97 && p<=122) m = p-61;
    else if (p>=65 && p<=90) m = p-55;
```

```
else if (p>=48 && p<=57) m = p-48;

if (q>=97 && q<=122) n = q-61;
else if (q>=65 && q<=90) n = q-55;
else if (q>=48 && q<=57) n = q-48;

if (m==0 || n==0) return 2;
x = m*62 + n + 1000;

sprintf(branchid, "%d", x);
return TRUE;
}
```