编号：SGE-ZB-JK-01

密级：内 部 资 料



GEMS-2会员二级系统

竞价交易接口规范

（征求意见稿）

上海黄金交易所

2015年9月

文档标识

|  |  |
| --- | --- |
| 文档名称 | 上海黄金交易所GEMS-2会员二级系统竞价交易接口规范 |
| 版本号 | V0.98 |
| 状况 |  |

文档修订历史

| **版本** | **日期** | **描述** | **文档所有者** |
| --- | --- | --- | --- |
| V0.1-V0.3 | 2014.10-2014.12 | 形成初稿及修订 | 余新泰 |
| V0.4 | 2014.12 | 根据组内评审意见修订 | 余新泰、李田 |
| V0.5 | 2014.12 | 新增对国际板法人客户开销户接口、上海金定价行情接口的支持 | 余新泰 |
| V0.6 | 2015.1 | 1. 与金仕达确认查询接口中会员代码是否必填问题；  2. 根据最新需求对国际板法人开销户接口进行修订  3. 附录补充2.5代应答码信息  4. 调整消息组件的相关表述 | 余新泰 |
| V0.7 | 2015.1 | 以会议形式组织通过评审，并根据评审反馈完成修订 | 余新泰 |
| V0.8 | 2015.2 | 根据GEMS1最新需求修订如下：  1. 应急报单应答/回报/复核中的报单类型为“1-普通报单”与2.5代保持一致，GEMS2再调整为“2-应急报单” |  |
| V0.81 | 2015.3 | 根据五一上线版本更新：  1）增加“32-国际板上海金买入”、“33-国际板上海卖出”。  2）会员类型增加“5-券商类“，“6-基金类“，“7-信托类“，“8-保险类“ | 余新泰 |
| V0.9 | 2015.3 | 1、补充消息类型标识符定义列表  2、根据国际会员二级系统API改造需求补充相关域定义 | 余新泰 |
| V0.91-0.92 | 2015.9 | 根据GEMS2需求修订， | 余新泰 |
| V0.93-V0.94 | 2015.9 | 根据评审意见形成对外发布初稿 | 余新泰、李田 |
| V0.95 | 2015.12 | 结合交易所内部讨论及外部征求意见反馈，完善相关章节内容，形成beta版，主要修订如下：  1、完善相关必填域和选填域  2、登录请求无需再上送交易日期  3、竞价交易接口不支持行情订阅  4、修改交易员登录报文字段要素  5、修改所有查询应答报文字段要素  6、增加通用报错报文  7、报单请求增加市场代码  8、新增GEMS2应答码 | 余新泰 |
| V0.96 | 2016.2 | 1、增加交易所状态发布接口  2、行情增加行情序号，分钟行情暂不支持推送  3、优化部分域定义  4、考虑到只有交割申报冻结库存时才会涉及替代交割品种问题，需要回报里面推送相应交割品种库存变动信息，其余回报信息均不推送库存变动信息  5、修改交易员登录“最大本地报单号”报文域为应答必填，“证件号码”报文域不填  6、交易核心设计中不会对会员代码做处理，删除接口中会员代码 | 余新泰 |
| V0.97 | 2016.5 | 1、根据内部开发实现，调整报单价格为必填，当为市价单时报单价格填0 | 余新泰 |
| V0.98 | 2016.7 | 1、对于客户持仓查询时，席位代码和客户代码要求必填，查询结果中新增返回客户当日开仓限额的冻结信息  2、细化递延费率查询条件的要求，只允许查当天  3、修订竞价交易和交割申报实时行情接口  4、因核心不支持，席位持仓查询条件删除持仓类型  5、本地报单号查询中，市场代码必填  6、调整查询接口，原查询条件中要求原值返回的字段下移放到应答数组中。  7、交割申报和中立仓申报回报中会返回库存冻结信息；交割撤销和中立仓撤销回报中暂无法返回库存释放信息。  8、交割申报和中立仓申报查询应答中无S95  9、成交回报和成交单查询中删除客户类别 | 余新泰 |
| V1.0 | 2016.9 | 形成外发稳定版本 | 余新泰 |
| V1.01 | 2017.2 | 完善报单状态取值范围描述 | 余新泰 |

目 录

[1 前言 6](#_Toc462670453)

[1.1 目标和范围 6](#_Toc462670454)

[1.2 读者对象 6](#_Toc462670455)

[1.3 参考文档 6](#_Toc462670456)

[2 数据类型 7](#_Toc462670457)

[2.1 数据类型表示 7](#_Toc462670458)

[2.2 基本数据类型 7](#_Toc462670459)

[2.3 复合数据类型 7](#_Toc462670460)

[2.3.1 数组类型 7](#_Toc462670461)

[2.3.2 哈希类型 8](#_Toc462670462)

[3 消息类型 8](#_Toc462670463)

[3.1 消息分类 8](#_Toc462670464)

[3.2 消息类型标识符 8](#_Toc462670465)

[3.2.1 生成规则 8](#_Toc462670466)

[3.2.2 标识符定义 9](#_Toc462670467)

[4 消息结构 12](#_Toc462670468)

[5 消息头定义 12](#_Toc462670469)

[6 消息体定义 13](#_Toc462670470)

[6.1 基本约定 13](#_Toc462670471)

[6.1.1 符号约定 13](#_Toc462670472)

[6.1.2 转义规则 14](#_Toc462670473)

[6.2 认证类交易 14](#_Toc462670474)

[6.2.1 交易员认证 14](#_Toc462670475)

[6.2.2 密码修改 15](#_Toc462670476)

[6.3 基础信息类交易 16](#_Toc462670477)

[6.3.1 市场信息 16](#_Toc462670478)

[6.3.2 合约信息 17](#_Toc462670479)

[6.3.3 交割品种代码信息 18](#_Toc462670480)

[6.3.4 递延费率信息 19](#_Toc462670481)

[6.3.5 交易所状态信息 20](#_Toc462670482)

[6.3.6 账户查询 20](#_Toc462670483)

[6.4 行情类交易 26](#_Toc462670484)

[6.4.1 竞价交易行情 26](#_Toc462670485)

[6.4.2 交割行情 29](#_Toc462670486)

[6.4.3 公告 29](#_Toc462670487)

[6.5 竞价类交易 30](#_Toc462670488)

[6.5.1 报单/撤单交易 30](#_Toc462670489)

[6.5.2 交割申报交易 36](#_Toc462670490)

[6.5.3 中立仓申报交易 40](#_Toc462670491)

[6.6 其他 43](#_Toc462670492)

[6.6.1 通用报错 43](#_Toc462670493)

[7 附录 43](#_Toc462670494)

[7.1 应答码信息 43](#_Toc462670495)

[7.2 标准域字典 48](#_Toc462670496)

# 前言

## 目标和范围

本文档对上海黄金交易所交易系统与二级系统之间进行竞价交易联机交易时使用的报文接口，包括：消息结构、消息类型、消息域以及各消息包含要素做了规定。

本文档所采用的术语、消息格式以及消息流描述等内容均遵照GTP协议标准。

## 读者对象

本文档既适用于按照协议规范文档方式接入到交易所系统的黄金交易市场参与者，也适用于交易所需求分析人员、技术管理人员、软件设计及开发人员、测试人员。

## 参考文档

《GEMS-1竞价交易系统需求分析说明书》

《上海黄金交易所GEMS-2竞价交易业务需求分析说明书》

《上海黄金交易所应用系统数据字典》

《上海黄金交易所GEMS-2系统编码规范》

《上海黄金交易所黄金交易数据交换协议(GTP)》

《上海黄金交易所交易系统接口说明书》（2.5代）

# 数据类型

## 数据类型表示

定义数据域时需先指定域对应的数据类型。数据类型标识约定如下：

1）Cx表示字符串，x表示字符串的最大长度，除非特殊声明，字符串均可包含大小写字母。

2）Nx表示十进制整数，x代表整数最大位数（不包括正负号）。

3）N(x,y)表示十进制浮点数，x表示小数点前后最大位数之和，y表示小数点后的最大位数。

## 基本数据类型

本接口规范中定义了如下基本数据类型：

| **扩展类型** | | **单位** | **精度** | **类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Amount | 金额 | 分 | 分 | N18 | 100表示1元 |
| Price | 价格 | 元/克  元/千克 | 0.000001元 | N(12,6) | 黄金/铂金/钯金：元/克  白银：元/千克 |
| Weight | 重量 | 千克 | 毫克 | N(12,6) | 0.000001表示1毫克 |
| Rate | 比率 | - | 百万分之一 | N(16,6) | 1表示100% |
| Quantity | 数量 | - | - | N12 |  |
| OKFlag | 是否标志 | - | - | C1 | 1-是，0-否 |
| Date | 日期 | - | - | C8 | YYYYMMDD |
| Time | 时间 | - | - | C8 | HH:MM:SS |

## 复合数据类型

### 数组类型

相同数据类型的元素按一定顺序排列的集合。元素的数据类型可以是基本数据类型，也可以是复合数据类型。示例如下：

[element1, element2,…, elementN]

### 哈希类型

一组无序元素的集合。元素的数据类型可以是基本数据类型，也可以是复合数据类型。示例如下：

{ element1, element2,…, elementN }

# 消息类型

## 消息分类

针对交易所对外应用消息接口，按照功能维度分类如下：

1）**认证类消息**：主要涵盖交易员登录、登出、修改密码等消息。

2）**基础信息类消息**：主要涵盖交易对象（市场、合约、递延费等）信息修改、发布以及交易对象、交易参与方、交易账户信息查询。

3）**行情类消息**：主要涵盖交易实时行情、分钟行情、延期交收行情、国际行情、上海金定价行情、公告及相应查询消息。

4）**竞价类交易**：主要涵盖竞价/集中撮合交易指令，如报单、撤单及相应的查询指令。

5）其他消息：主要包括通用错误信息。

## 消息类型标识符

### 生成规则

每个消息对应一个唯一的消息类型标识符。消息类型标识符由四个字符组成，生成规则如下：

1. 第1个字符标识消息类别，用法如下：

| **代码** | **说明** |
| --- | --- |
| A | 认证类消息 |
| B | 基础信息类交易 |
| Q | 行情类消息 |
| T | 竞价类交易 |
| M | 系统管理类 |

2）第2-3个字符为报文顺序编号，取值范围00-ZZ。

3）第4个字符标识报文功能，用法如下：

| **代码** | **说明** |
| --- | --- |
| 0 | 请求 |
| 1 | 请求应答 |
| 2 | 回报 |

### 标识符定义

| **消息大类** | **消息小类** | **消息报文** | **第1位** | **第2-3位** | **请求** | **应答** | **回报** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 认证类 | 交易员认证 | 交易员登录请求及应答 | A | 10 | A100 | A101 |  |
|  |  | 交易员登出请求及应答 | A | 11 | A110 | A111 |  |
|  | 密码修改 | 交易员修改密码请求及应答 | A | 13 | A130 | A131 |  |
|  |  | 应急密码修改请求及应答 | A | 32 | A320 | A321 |  |
| 基础信息类 | 市场信息 | 市场信息回报（现货/延期/即期） | B | 00 |  |  | B002 |
|  |  | 市场状态改变回报（现货/延期/即期） | B | 06 |  |  | B062 |
|  | 合约信息 | 合约信息回报（现货/延期/即期） | B | 10 |  |  | B102 |
|  |  | 合约交易状态改变回报（现货/延期/即期） | B | 18 |  |  | B182 |
|  | 交割品种代码 | 交割品种代码信息回报 | B | 20 |  |  | B202 |
|  | 递延费率信息 | 发布现货延期交收补偿费率通知 | B | 30 |  |  | B302 |
|  |  | 递延费率查询请求与应答 | B | 32 | B320 | B321 |  |
|  | 交易所状态 | 发布交易所状态通知 | B | 33 |  |  | B332 |
|  |  | 交易所状态查询请求及应答 | B | 34 | B340 | B341 |  |
|  | 账户查询 | 席位客户查询请求及应答 | T | 43 | T430 | T431 |  |
|  |  | 席位持仓查询请求及应答(延期/即期) | T | 44 | T440 | T441 |  |
|  |  | 席位资金查询请求及应答 | T | 45 | T450 | T451 |  |
|  |  | 客户持仓查询请求及应答(延期/即期) | T | 46 | T460 | T461 |  |
|  |  | 客户库存查询请求及应答 | T | 47 | T470 | T471 |  |
| 行情类 |  | 交易实时行情（现货/延期/即期） | Q | 07 |  |  | Q012 |
|  |  | 交易实时行情查询请求及应答（现货/延期/即期） | Q | 09 | Q090 | Q091 |  |
|  |  | 交易分钟行情查询请求及应答（现货/延期/即期） | Q | 10 | Q100 | Q101 |  |
|  | 交割行情 | 交割实时行情 | Q | 20 | Q200 | Q201 | Q202 |
|  | 公告 | 公告发布请求与应答及回报 | Q | 90 | Q900 | Q901 | Q902 |
|  |  | 交易所公告查询请求及应答 | Q | 91 | Q910 | Q911 |  |
| 竞价类交易 | 报单/撤单交易 | 报单请求及应答及回报（现货/延期/即期） | T | 20 | T200 | T201 | T202 |
|  |  | 撤单请求及应答及回报（现货/延期/即期） | T | 21 | T210 | T211 | T212 |
|  |  | 成交回报（现货/延期/即期） | T | 22 |  |  | T222 |
|  |  | 报单查询请求及应答（现货/延期/即期） | T | 23 | T230 | T231 |  |
|  |  | 本地报单号查询请求及应答（现货/延期/即期） | T | 24 | T240 | T241 |  |
|  |  | 成交单查询请求及应答（现货/延期/即期）（延期强平单） | T | 25 | T250 | T251 |  |
|  | 交割申报交易 | 交割申报请求及应答及回报 | T | 09 | T090 | T091 | T092 |
|  |  | 交割申报撤销请求及应答及回报 | T | 10 | T100 | T101 | T102 |
|  |  | 交割申报成交回报 | T | 11 |  |  | T112 |
|  | 中立仓申报交易 | 中立仓申报请求及应答及回报 | T | 12 | T120 | T121 | T122 |
|  |  | 中立仓申报撤销请求及应答及回报 | T | 13 | T130 | T131 | T132 |
|  |  | 交割申报报单查询请求及应答 | T | 40 | T400 | T401 |  |
|  |  | 交割申报成交查询请求及应答 | T | 41 | T410 | T411 |  |
|  |  | 中立仓申报报单查询请求及应答 | T | 42 | T420 | T421 |  |
| 其他 | 通用报错 | 通用报错应答 | M | 99 |  | M991 |  |

# 消息结构

遵循GTP协议定义，消息结构描述如下：

1. 应用消息由多个“域号=值”的基本结构组成。这些基本结构之间用可见的域界定符 ‘,’ 分割。



2）在消息中，除消息组件外，数据域不允许在消息中重复出现。

3）应用消息包括消息头和消息体两部分：



其中：

* 消息头标识了消息类型、消息序列号、消息序列类别号、报文连续标识等信息。
* 消息体定义了消息的主体结构，定义了消息交互时包含的信息要素。

# 消息头定义

消息头的定义遵循GTP协议标准，每个消息均带有一个消息头，消息头中包含的要素如下：

| **Tag** | **域名** | **必须** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
| X01 | beginString | Y | 标识协议版本号，固定取值为“GTP1.0” |
| X02 | ContentLength | N | 除消息头之外，各field长度和，以字节为单位 |
| X03 | MsgType | Y | 消息类型，不同类型消息的TID值不同 |
| X04 | SequenceSeriesNo | Y | 序列类别号，代表数据流的标号 |
| X05 | SequenceNo | Y | 消息序列号，基于数据流的编号 |
| X06 | ChainFlag | Y | 消息的连续标志，取值如下：  ‘C’-报文链的中间报文,有后续报文  ‘L’-报文链的最后一个报文，无后续报文 |
| X07 | RootID | N | 作为消息来源标志，交易所原值返回 |
| X08 | SenderID | N | 发送方标识符 |
| X09 | ReceiverID | N | 接收方标识符 |

其中：

1）**BeginString**：标识消息的协议版本号，不同版本号消息的消息头可能存在差异。

2）**ChainFlag**：当报文长度超过最大报文长度时，长报文需要分割成多个报文发送。通过Chain标识可以用来识别收到的报文是被分割成多块的长报文的哪一部分。一个长报文被分割成多个报文后，其序列号（SequeceNo）相同。

3）**SequenceSeriesNo** 和 **SequenceNo**: 用于保障通讯双方信息的完整性和有序性而定义的两个字段。

4）**MsgType**: 用于标识消息类型，具体定义参见“消息类型”章节。

5）**SenderID** 和 **ReceiverID**：用于标识发送方和接收方。当为交易所时，默认为为0000。

# 消息体定义

## 基本约定

### 符号约定

在定义消息体时，针对数据域的取值，引入如下符号：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **符号** | | **含义** |
| **数据域取值符号** | M | 必须填写的域 |
| C | 某条件成立时必须填写的域 |
| O | 可选，非必须填写的域 |
| ← | 必须与先前报文中对应域的值相同的域 |
| - | 必须去除的域 |
| **数据域属性符号** |  | 基本数据域 |
| [] | 标识为消息组件名称数据域 |
| {} | 标识为消息组件中重复的数据域 |
| → | 标识为消息组件中包含的基础数据域 |
| →[] | 标识为消息组件中的子消息组件 |
| →{} | 标识为子消息组件中重复的数据域块 |
| →→ | 标识为子消息组件中包含的基础数据域 |

### 转义规则

在部分报文中，若出现如下特殊字符，需进行转义处理。需要转义的字符及转规则如下表所示：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **转换前** | **转换后** | **备注** |
| [ | \[ |  |
| ] | \] |  |
| { | \{ |  |
| } | \} |  |
| = | \= |  |
| , | \, |  |
| \ | \\ |  |

## 认证类交易

### 交易员认证

#### 交易员登录请求及应答

**功能**：交易员登录指令用于：1）交易员身份验证；2）二级系统向交易所前置认证；3）通讯异常断开重新登录时传输断点进行消息恢复。

消息体格式如下：

| **符号** | **Tag** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
|  | M62 | loginPassword | 登录密码 | M | ← |  |
|  | T13 | tradeDate | 交易日期 | - | M | 交易日期由交易所下发 |
|  | O14 | maxLocalOrderID | 最大本地报单号 | - | M |  |
|  | X50 | ipAddress | IP地址 | M | ← |  |
|  | X55 | versionInfo | API版本信息 | M | ← |  |
| [] | X20 | [breakpointData] | 消息断点信息数据 | C | ← | 断点信息域，断点信息不为空时必填 |
| {} |  |  | 消息断点信息 |  |  |  |
| → | X04 | seqSrsNo | 消息序列类别号 | C | ← | 断点信息域，断点信息不为空时必填 |
| → | X05 | seqNo | 消息序号 | C | ← | 断点信息域，断点信息不为空时必填 |
|  | X80 | safeInfo | 安全信息域 | M | ← |  |
|  | X81 | safeInfoLen | 安全信息域长度 | M | ← |  |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 交易员登出请求及应答

**功能**：交易员登出指令用于交易员登出交易所系统。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

### 密码修改

#### 交易员修改密码请求及应答

**功能**：交易员修改密码指令用于修改交易员登录密码。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| T84 | oldPassword | 旧密码 | M | ← |  |
| T83 | newPassword | 新密码 | M | ← |  |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 会员应急密码修改请求及应答

**功能**：会员应急密码修改指令用于修改会员应急交易密码。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| T84 | oldPassword | 旧密码 | M | ← |  |
| T83 | newPassword | 新密码 | M | ← |  |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

## 基础信息类交易

### 市场信息

#### 市场信息回报（现货/延期/即期）

**功能**：市场信息回报指令用于交易所推送现货/延期/即期市场信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| I00 | marketID | 市场代码 | M |  |
| I01 | marketName | 市场全称 | M |  |
| I02 | marketType | 市场类型 | M | s-现货,d-递延, w-远期/即期,q-询价 |
| I03 | marketOpenFlag | 市场活跃标志 | M | ‘1’ – 是 ‘0’ – 否 |
| I04 | marketState | 市场交易状态 | M |  |

#### 市场状态改变回报（现货/延期/即期）

**功能**：市场状态改变回报指令用于交易所推送现货/延期/即期市场**交易状态**变更信息。

消息体格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| I00 | marketID | 市场代码 | M |  |
| I04 | marketState | 市场交易状态 | M | 0-初始化中;1-初始化完成;2-开市;3-交易;4-暂停;5-收市 |

### 合约信息

#### 合约信息回报（现货/延期/即期）

**功能**：合约信息回报指令用于交易所推送现货/延期/即期市场的合约信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| I10 | instID | 合约代码 | M |  |
| I11 | instName | 合约名称 | M |  |
| I00 | marketID | 市场代码 | M |  |
| V03 | varietyType | 品种类别 | M | 1-黄金，2-铂金，3-白银 |
| V00 | varietyID | 交割品种代码 | M |  |
| I12 | instUnit | 交易单位数量 | M |  |
| I13 | tick | 最小变动价位 | M |  |
| I14 | maxHand | 最大申报限量(单手) | M |  |
| I15 | minHand | 最小申报限量(单手) | M |  |
| I16 | upperLimit | 涨停板率 | M |  |
| I17 | lowerLimit | 跌停板率 | M |  |
| I18 | instOpenFlag | 合约活跃标志 | M | 1-活跃，2-不活跃，3-只平，4-只开 |
| I19 | instState | 合约交易状态 | M | 0-初始化中,1-初始化完成，2-开盘，3-竞价报单，4-竞价撮合，5-连续交易，6-暂停，7-交割申报，8-交割申报结束，9-中立仓申报，A-交割申报撮合,B-收盘 |
| I20 | refPrice | 参考价 | M |  |
| I21 | recvRate | 卖方收款比例 | C | 现货合约回报时必填 |
| I22 | dueDate | 到期日 | C | 即期合约回报时必填 |
| I23 | deliveryDay | 合约到期日,交割间隔天数 | C | 即期合约回报时必填 |

#### 合约状态改变回报（现货/延期/即期）

**功能**：合约状态信息回报指令用于交易所推送现货/延期/即期合约的交易状态变更信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| I10 | instID | 合约代码 | M |  |
| I19 | instState | 合约交易状态 | M |  |

### 交割品种代码信息

#### 交割品种代码信息回报

**功能**：交割品种代码信息回报指令用于交易所推送交割品种信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| V00 | varietyID | 交割品种代码 | M |  |
| V01 | varietyName | 交割品种全称 | M |  |
| V02 | varietyAbbr | 交割品种简称 | M |  |
| V03 | varietyType | 品种类别 | M |  |
| V04 | minPickup | 最小提货数量 | M |  |
| V07 | defaultStdWeight | 默认条块标重 | M |  |
| V05 | pickupBase | 提货步长 | M |  |
| V06 | weightUnit | 重量单位 | M | 01-克,02-千克,03-盎司 |
| B86 | destroyFlag | 注销标志 | M | 1-有效,2-注销,3-暂停 |

### 递延费率信息

#### 发布现货延期交收补偿费率通知

**功能**：递延交收补偿费率通知指令用于交易所发布延期费率信息。

消息体格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| T13 | tradeDate | 交易日期 | M |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M |  |
| I26 | payDirection | 支付方向 | M | 1-多付空，2-空付多，3-平 |
| I25 | deferFeeRate | 递延费率 | M |  |

#### 递延费率查询请求与应答

**功能**：递延费率查询指令用于会员二级系统查询指定时间区间的延期费率信息。只允许查询当天的递延费率信息，开始日期和截止日期只能填当天。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | T18 | beginDate | 开始日期 | M | - |  |
|  | T19 | endDate | 截止日期 | M | - |  |
| [] | I91 | [deferFeeRateInfoData] | 递延费率信息数据 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 递延费率信息 |  |  |  |
| → | T13 | tradeDate | 交易日期 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | I26 | payDirection | 支付方向 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | I25 | deferFeeRate | 递延费率 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

### 交易所状态信息

#### 发布交易所状态通知

**功能**：盘中向全市场发布交易所状态。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| G00 | exchageID | 交易所代码 | M |  |
| G01 | exchangeState | 交易所运行状态 | M | 0-初始化，1-初始化完成，2-开市，3-收市，4-正在结算，5-结算完成，6-T+0财务处理完成，7-日终登帐完成 |
| Q83 | announceTime | 发布时间 | M |  |

#### 交易所状态查询请求及应答

**功能**：用于查询交易所当前状态。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
| G00 | exchageID | 交易所代码 | - | M |  |
| G01 | exchangeState | 交易所运行状态 | - | M |  |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

### 账户查询

#### 席位客户查询请求及应答

**功能**：席位客户查询指令用于会员二级系统查询其代理的客户信息，支持查询会员下所有客户信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | O | - | 若为空默认查询该席位下所有客户信息 |
| [] | M93 | [clientInfoData] | 客户信息数据 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 客户信息 |  |  |  |
| → | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | I30 | tradeRight | 交易权限 | - | C | 查询结果不为空时必填  0-不可交易,1-可以交易 |
| → | M31 | clientSort | 客户类别 | - | C | 查询结果不为空时必填  1-法人/机构,2-自然人，3-特殊客户 |
| → | B86 | destroyFlag | 注销标志 | - | C | 查询结果不为空时必填  1-有效,2-注销,3-暂停 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

**注**：对于佣金划转类客户，客户类别为空。

#### 席位资金查询请求及应答

**功能**：席位资金查询指令用于开展冲抵业务的会员二级系统查询其保证金账户信息，支持同时查询自营和代理账户的资金信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| F40 | offsetOutLimit | 充抵出金限制金额 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F04 | lastAvailable | 上日可提资金 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F05 | todayAvailable | 当日可提资金 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F02 | lastCashBalance | 上日货币可报价余额 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F03 | todayCashBalance | 当日货币可报价余额 | - | C | 查询结果不为空时必填  可用于现货市场报价的余额 |
| F41 | lastQuotaBalance | 上日额度可报价余额 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F42 | todayQuotaBalance | 当日额度可报价余额 | - | C | 查询结果不为空时必填  可用于延期、即期市场报价的余额 |
| F43 | todayOffsetQuota | 当日实际充抵额度 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F44 | lastUsedOffsetQuota | 上日已用充抵额度 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F45 | todayUsedOffsetQuota | 当日已用充抵额度 | - | C | 查询结果不为空时必填  已经使用的充抵额度 |
| F46 | availOffsetQuota | 待用充抵额度/当日剩余充抵额度 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F06 | lastCashOccupied | 上日货币保证金占用 | - | C | 查询结果不为空时必填  *暂时不用，预留* |
| F07 | todayCashOccupied | 当日货币保证金占用 | - | C | 查询结果不为空时必填  *暂时不用，预留* |
| F47 | lastQuotaOccupied | 上日额度保证金占用 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F48 | todayQuotaOccupied | 当日额度保证金占用 | - | C | 查询结果不为空时必填  即延期市场的持仓占用保证金 |
| F08 | cashFrozen | 货币冻结保证金 | - | C | 查询结果不为空时必填  *暂时不用，预留* |
| F49 | quotaFrozen | 额度冻结保证金 | - | C | 查询结果不为空时必填  即延期市场的报单冻结保证金 |
| F61 | profit | 盈亏 | - | C | 查询结果不为空时必填  延期市场的盈亏，盘中为0 |
| F09 | todayIn | 当日入金 | - | C | 查询结果不为空时必填  入金合计 |
| F10 | todayOut | 当日出金 | - | C | 查询结果不为空时必填  出金合计 |
| F11 | Payment | 支付货款 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F12 | receivedCapital | 收到货款 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| F70 | miscFee | 费用 | - | C | 查询结果不为空时必填  盘中为0 |
| F13 | basefund | 基础保证金 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 客户库存查询请求及应答

**功能**：客户库存查询指令用于开展充抵业务的会员二级系统查询其代理客户的库存账户信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | M | - |  |
| [] | S91 | [clientStorageInfoData] | 客户库存信息数据 |  | C | 查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 客户库存信息 |  |  |  |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | V00 | varietyID | 交割品种代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | S01 | totalStorage | 库存总量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | S02 | availableStorage | 可用库存 | - | C | 查询结果不为空时必填  可用于交易/非交易业务的库存，当用到库存透支额度时，可用库存为负 |
| → | S03 | frozenStorage | 现货冻结库存 | - | C | 查询结果不为空时必填  现货申报/交收申报/中立仓申报时冻结的库存 |
| → | S04 | pendStorage | 待提库存 | - | C | 查询结果不为空时必填.  已申请提货但尚未出库的库存 |
| → | S13 | impawnStorage | 质押库存 | - | C | 查询结果不为空时必填.  质权方的质押库存，不能交易卖出、提货、租借质押等。只有质权方通过会服的质物库存转移功能将质押库存转成可用库存，才能够卖出、提货或用于办理其他业务 |
| → | S14 | lawFrozenStorage | 法律冻结库存 | - | C | 查询结果不为空时必填.  包括法律冻结及其他手工冻结业务冻结的库存，手工解冻操作会减少手工冻结库存，在多个交易日存在，收盘前不清零 |
| → | S19 | transferFrozenStorage | 过户业务冻结库存 | - | C | 查询结果不为空时必填.  质押、租借等非交易过户业务申报时冻结的库存。审批操作时会减少过户业务冻结库存，在多个交易日存在，收盘前不清零 |
| → | S15 | offsetStorage | 充抵冻结库存 | - | C | 查询结果不为空时必填.  上一日清算后的值，盘中不更新。交易过程中不能使用该库存 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 席位持仓查询请求及应答（延期/即期）

**功能**：席位持仓查询指令用于实时查询席位当前延期/即期市场的合约持仓信息，支持同时查询席位多个合约的持仓信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - |  |
|  | I10 | instID | 合约代码 | O | - | 不输入合约查询该市场下所有合约持仓 |
| [] | P80 | [posiInfoData] | 会员持仓信息数据 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 会员持仓信息 |  |  |  |
| → | M20 | seatID | 席位代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P01 | longPosi | 多头持仓量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P02 | shortPosi | 空头持仓量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P03 | lastLongPosi | 上日多头持仓 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P04 | lastShortPosi | 上日空头持仓 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P05 | todayLongPosi | 今日多头开仓 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P06 | todayShortPosi | 今日空头开仓 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P07 | todayOffsetLongPosi | 今日多头平仓量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P08 | todayOffsetShortPosi | 今日空头平仓量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P09 | longTurnOver | 多头持仓金额 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P10 | shortTurnOver | 空头持仓金额 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P11 | deliveryApplyLongFrozen | 交割申报多头冻结 | - | C | 查询结果不为空且为延期合约持仓必填 |
| → | P12 | deliveryApplyShortFrozen | 交割申报空头冻结 | - | C | 查询结果不为空且为延期合约持仓必填 |
| → | P13 | deliveryApplyLong | 交割申报使用多头持仓 | - | C | 查询结果不为空且为延期合约持仓必填 |
| → | P14 | deliveryApplyShort | 交割申报使用空头持仓 | - | C | 查询结果不为空且为延期合约持仓必填 |
| → | P15 | longLimitFrozen | 多头开仓冻结限额 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P16 | shortLimitFrozen | 空头开仓冻结限额 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P17 | offsetLongFrozen | 多头平仓冻结 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | P18 | offsetShortFrozen | 空头平仓冻结 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 客户持仓查询请求及应答（延期/即期）

**功能**：客户持仓查询指令用于实时查询指定客户当前延期/即期市场的合约持仓信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - | 有值查询该席位下的客户持仓 |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | M | - | 不填默认查询该席位所有客户 |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - |  |
|  | I10 | instID | 合约代码 | O | - | 不填查询该市场下所有合约持仓 |
| [] | P80 | [posiInfoData] | 客户持仓信息数据 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 客户持仓信息 |  |  |  |
| → | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P01 | longPosi | 多头持仓量 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P02 | shortPosi | 空头持仓量 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P03 | lastLongPosi | 上日多头持仓 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P04 | lastShortPosi | 上日空头持仓 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P05 | todayLongPosi | 今日多头开仓 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P06 | todayShortPosi | 今日空头开仓 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P07 | todayOffsetLongPosi | 今日多头平仓量 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P08 | todayOffsetShortPosi | 今日空头平仓量 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P09 | longTurnOver | 多头持仓金额 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P10 | shortTurnOver | 空头持仓金额 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P11 | deliveryApplyLongFrozen | 交割申报多头冻结 | - | C | 查询结果不为空且为延期合约持仓时必填 |
| → | P12 | deliveryApplyShortFrozen | 交割申报空头冻结 | - | C | 查询结果不为空且为延期合约持仓时必填 |
| → | P13 | deliveryApplyLong | 交割申报使用多头持仓 | - | C | 查询结果不为空且为延期合约持仓时必填 |
| → | P14 | deliveryApplyShort | 交割申报使用空头持仓 | - | C | 查询结果不为空且为延期合约持仓时必填 |
| → | P15 | longLimitFrozen | 多头开仓冻结限额 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P16 | shortLimitFrozen | 空头开仓冻结限额 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P17 | offsetLongFrozen | 多头平仓冻结 | - | C | 查询结果不为空必填 |
| → | P18 | offsetShortFrozen | 空头平仓冻结 | - | C | 查询结果不为空必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

## 行情类交易

### 竞价交易行情

#### 交易实时行情（现货/延期/即期）

**功能**：交易实时行情用于交易所按照一定频率推送现货/延期/即期市场的实时行情信息，支持多档行情信息发布。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M |  |
| [] | Q52 | [quotationInfoData] | 行情信息数据 | M |  |
| {} |  |  | 行情信息 |  |  |
| → | I10 | instID | 合约代码 | M |  |
| → | I11 | instName | 合约名称 | M |  |
| → | T80 | seqNo2 | 行情序号 | M | 行情序号按合约编号，每个合约单独一套编号 |
| → | Q13 | lastSettlePrice | 昨结算 | C | 延期、即期行情时必填 |
| → | Q14 | lastClosePrice | 昨收盘 | M |  |
| → | Q15 | openPrice | 开盘价 | M |  |
| → | Q16 | highPrice | 最高价 | M |  |
| → | Q17 | lowPrice | 最低价 | M |  |
| → | Q18 | lastPrice | 最新价 | M |  |
| → | Q19 | closePrice | 收盘价 | M |  |
| → | Q20 | settlePrice | 结算价 | C | 延期、即期行情时必填 |
| →[] | Q00 | [MDEntryData] | 行情条目信息数据 | M |  |
| →{} |  |  | 行情条目信息 |  |  |
| →→ | Q21 | bidPrice | 买价 | M |  |
| →→ | Q22 | bidLot | 买量 | M |  |
| →→ | Q23 | askPrice | 卖价 | M |  |
| →→ | Q24 | askLot | 卖量 | M |  |
| → | O64 | tradeVolume | 成交数量 | M |  |
| → | Q25 | tradeWeight | 成交（双边）重量 | M |  |
| → | Q26 | highLimitPrice | 涨停板 | M |  |
| → | Q36 | lowerLimitPrice | 跌停板 | M |  |
| → | Q28 | upDown | 涨跌 | M |  |
| → | Q29 | upDownRate | 涨跌幅度 | M |  |
| → | Q27 | Posi | 持仓量 | C | 延期、即期行情时必填 |
| → | Q30 | turnOver | 成交额 | M |  |
| → | Q31 | averagePrice | 均价 | M |  |
| → | Q11 | quoteDate | 行情日期 | M |  |
| → | Q12 | quoteTime | 行情时间 | M |  |

#### 交易实时行情查询请求及应答（现货/延期/即期）

**功能**：交易实时行情查询指令用于会员二级系统查询当前时间的交易实时行情信息，支持查询多合约的行情信息。交易所返回最新行情。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | I10 | instID | 合约代码 | O | - | 若为空则查询市场下所有合约的行情 |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - |  |
| [] | Q52 | [quotationInfoData] | 行情信息数据 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 行情信息 |  |  |  |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | I11 | instName | 合约名称 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | T80 | seqNo2 | 行情序号 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q13 | lastSettlePrice | 昨结算 | - | C | 查询结果不为空且为延期、即期行情时必填 |
| → | Q14 | lastClosePrice | 昨收盘 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q15 | openPrice | 开盘价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q16 | highPrice | 最高价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q17 | lowPrice | 最低价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q18 | lastPrice | 最新价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q19 | closePrice | 收盘价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q20 | settlePrice | 结算价 | - | C | 查询结果不为空且为延期、即期行情时必填 |
| →[] | Q00 | [MDEntryData] | 行情条目信息数据 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| →{} |  |  | 行情条目信息 |  |  |  |
| →→ | Q21 | bidPrice | 买价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| →→ | Q22 | bidLot | 买量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| →→ | Q23 | askPrice | 卖价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| →→ | Q24 | askLot | 卖量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | O64 | tradeVolume | 成交数量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q25 | tradeWeight | 成交（双边）重量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q26 | highLimitPrice | 涨停板 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q36 | lowerLimitPrice | 跌停板 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q28 | upDown | 涨跌 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q29 | upDownRate | 涨跌幅度 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q27 | Posi | 持仓量 | - | C | 查询结果不为空且为延期、即期行情时必填 |
| → | Q30 | turnOver | 成交额 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q31 | averagePrice | 均价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q11 | quoteDate | 行情日期 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q12 | quoteTime | 行情时间 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 交易分钟行情查询请求及应答（现货/延期/即期）

**功能**：交易分钟行情查询指令用于会员二级系统查询**截止当前时间为止**某一市场上某个合约的所有交易分钟行情信息。只能查询当前交易日行情。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | I10 | instID | 合约代码 | M | - |  |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - |  |
|  | T20 | lastTime | 上一次时间 | C | - | 上送最近一次分钟行情查询时间 |
| [] | Q90 | [minQuotationInfoData] | 分钟行情信息数据 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 分钟行情信息 |  |  |  |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q15 | openPrice | 开盘价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q16 | highPrice | 最高价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q17 | lowPrice | 最低价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q19 | closePrice | 收盘价 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | O64 | tradeVolume | 成交数量 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q27 | Posi | 持仓量 | - | C | 查询结果不为空且查询延期、即期行情时必填 |
| → | Q11 | quoteDate | 行情日期 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q12 | quoteTime | 行情时间 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

### 交割行情

#### 交割实时行情

**功能**：交割实时行情用于交易所按照一定频率（2.5代设置为2s）对外推送延期市场交收和中立仓申报的行情信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| [] | Q69 | [deferDeliveryQuotationInfoData] | 递延交收行情信息数据 | M |  |
| {} |  |  | 递延交收行情信息 |  |  |
| → | I10 | instID | 合约代码 | M |  |
| → | T80 | seqNo2 | 行情序号 | M | 行情序号按合约编号，每个合约单独一套编号 |
| → | Q22 | bidLot | 买量 | M |  |
| → | Q24 | askLot | 卖量 | M |  |
| → | Q33 | midBidLot | 中立仓买量 | M |  |
| → | Q32 | midAskLot | 中立仓卖量 | M |  |

### 公告

#### 公告回报

**功能**：公告回报指令用于交易所推送公告信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| M20 | seatID | 席位代码 | C | 发给特定会员时必填，若为空默认发给所有会员 |
| T80 | seqNo2 | 序号 | M |  |
| Q82 | announceDate | 发布日期 | M |  |
| Q83 | announceTime | 发布时间 | M |  |
| G10 | deptID | 部门代码 | M |  |
| Q84 | title | 标题 | M |  |
| Q85 | content | 内容 | M |  |
| G20 | userID | 操作员代码 | M |  |

#### 交易所公告查询请求及应答

**功能**：交易所公告查询指令用于会员二级系统查询指定日期的公告信息，可查询多条公告信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | O | - | 为空时查询全市场公告 |
|  | Q82 | announceDate | 发布日期 | **O** | - | 为空时查询近一个月 |
| [] | Q80 | [bulletinBoardInfoData] | 公告信息数据 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 公告信息 |  |  |  |
| → | T80 | seqNo2 | 序号 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q82 | announceDate | 发布日期 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q83 | announceTime | 发布时间 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | G10 | deptID | 部门代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q84 | title | 标题 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | Q85 | content | 内容 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | G20 | userID | 操作员代码 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

## 竞价类交易

### 报单/撤单交易

#### 报单请求及应答（现货/延期/即期）

**功能**：报单交易用于会员主动发起现货/延期/即期市场合约的报单，涵盖：普通手工报单、FOK报单指令和FAK报单指令。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| M30 | clientID | 客户代码 | M | ← |  |
| I00 | marketID | 市场代码 | M | ← |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M | ← |  |
| O00 | orderNo | 报单编号 | - | M | 一级系统生成 |
| O02 | buyOrSell | 买卖方向 | M | ← | b-买,s-卖 |
| O03 | offSetFlag | 开平标志 | C | ← | 延期/即期报单必填，取值：0-开仓，1-平仓，2-强行平仓 |
| T11 | applyDate | 申请日期 | - | M | 交易所日期 |
| T12 | applyTime | 申请时间 | - | M | 交易所时间 |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
| O06 | Price | 申报价格 | M | ← | 限价指令必填，市价指令固定填0 |
| O07 | quantity | 申报数量 | M | ← |  |
| O08 | remainQuantity | 剩余数量 | - | M |  |
| O09 | orderStatus | 报单状态 | - | M | o-未成交,p-部分成交,c-完全成交,d-用户删除,s-系统删除,u-应急撤单，a-自动撤单 |
| O65 | matchType | 成交类型 | M | ← | 1-普通，2-应急， 6-套保 |
| O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M | ← | 二级系统生成 |
| O15 | orderType | 报单指令类型 | M | ← | 0-普通指令,1-限价FOK指令,2-限价FAK指令，3-市价剩余转限价，4-市价FOK指令,5-市价FAK指令 |
| T82 | source | 交易渠道标识 | C | ← | APP和红马甲上送交易时必填：a-APP渠道、c-红马甲 |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 撤单请求及应答（现货/延期/即期）

**功能**：撤单指令用于会员主动撤销现货/延期/即期市场合约的报单。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| O00 | orderNo | 报单编号 | M | ← |  |
| I00 | marketID | 市场代码 | M | ← |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M | ← |  |
| M30 | clientID | 客户代码 | M | ← |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 报单/撤单回报（现货/延期/即期）

**功能**：报单/撤单回报指令用于交易所通知会员报单指令/报单撤销指令的处理信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| O00 | orderNo | 报单编号 | M | 一级系统生成 |
| I00 | marketID | 市场代码 | M |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M |  |
| M30 | clientID | 客户代码 | M |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M |  |  |
| O02 | buyOrSell | 买卖方向 | M |  |
| O03 | offSetFlag | 开平标志 | C | 延期/即期报单必填，取值：0-开仓，1-平仓 |
| T11 | applyDate | 申请日期 | M | 交易所日期 |
| T12 | applyTime | 申请时间 | M | 交易所时间 |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M |  |
| O06 | Price | 申报价格 | M | 限价指令必填，市价指令固定填0 |
| O07 | quantity | 申报数量 | M |  |
| O08 | remainQuantity | 剩余数量 | M |  |
| T22 | cancelTime | 撤销时间 | C | 撤单回报时必填 |
| T02 | cancelID | 撤销员代码 | C | 撤单回报时必填 |
| O09 | orderStatus | 报单状态 | M |  |
| O65 | matchType | 成交类型 | M | 1-普通，2-应急， 6-套保 |
| O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M | 二级系统生成 |
| O15 | orderType | 报单指令类型 | C | V2版报单接口需带该域 |

注：当为系统撤单时，撤销员代码为空。

#### 成交回报（现货/延期/即期）

**功能**：成交回报指令用于交易所通知会员报单成交信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| O60 | matchNo | 成交编号 | M |  |
| O02 | buyOrSell | 买卖方向 | M |  |
| O03 | offsetFlag | 开平标志 | C | 延期和即期成交单时必填 |
| M30 | clientID | 客户代码 | M |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M |  |
| I00 | marketID | 市场代码 | M |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M |  |
| O61 | matchDate | 成交日期 | M |  |
| O62 | matchTime | 成交时间 | M |  |
| O63 | matchPrice | 成交价格 | M |  |
| O64 | tradeVolume | 成交数量 | M |  |
| O00 | orderNo | 报单编号 | M |  |
| O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M |  |
| O65 | matchType | 成交类型 | M |  |

#### 报单查询请求及应答（现货/延期/即期）

**功能**：报单查询指令用于实时查询现货/延期/即期市场的报单信息，涵盖：普通手工报单、FOK报单、FAK报单，支持查询多笔报单信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | I10 | instID | 合约代码 | O | - | 不填查全部合约 |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - |  |
|  | O00 | orderNo | 报单编号 | O | - | 不填查全部报单 |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | O | - | 不填查全部客户 |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | O03 | offsetFlag | 开平标志 | O | - | 不填查开平仓报单 |
| [] | O40 | [orderInfoData] | 报单信息数据 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 报单信息 |  |  |  |
| → | O00 | orderNo | 报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M20 | seatID | 席位代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O02 | buyOrSell | 买卖方向 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O03 | offSetFlag | 开平标志 | - | C | 当查询结果不为空且为延期/即期报单必填 |
| → | T11 | applyDate | 申请日期 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T12 | applyTime | 申请时间 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M60 | traderID | 交易员代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O06 | Price | 申报价格 | - | C | 当查询结果不为空必填,市价报单价格为0 |
| → | O07 | quantity | 申报数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O08 | remainQuantity | 剩余数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T22 | cancelTime | 撤销时间 | - | C | 当查询结果不为空且有撤单时必填 |
| → | T02 | cancelID | 撤销员代码 | - | C | 当查询结果不为空且有撤单时必填 |
| → | O09 | orderStatus | 报单状态 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O65 | matchType | 成交类型 | - | C | 当查询结果不为空时必填  1-普通，2-应急， 6-套保 |
| → | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O15 | orderType | 报单指令类型 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 成交单查询请求及应答（现货/延期/即期）（延期强平单）

**功能**：成交单查询指令用于实时查询现货/即期/延期成交信息，也可查询强平成交单信息，支持查询多笔成交单信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | I10 | instID | 合约代码 | O | - | 不填查全部合约 |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - |  |
|  | O00 | orderNo | 报单编号 | O | - | 不填查全部成交单 |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | O | - | 不填查全部客户 |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | O60 | matchNo | 成交编号 | O | - |  |
| [] | O90 | [matchInfoData] | 成交信息数据 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 成交信息 |  |  |  |
| → | O60 | matchNo | 成交编号 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | O02 | buyOrSell | 买卖方向 | - | C | 查询结果不为空时必填 |
| → | O03 | offsetFlag | 开平标志 | - | C | 延期和即期成交单时必填 |
| → | M20 | seatID | 席位代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O61 | matchDate | 成交日期 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O62 | matchTime | 成交时间 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O63 | matchPrice | 成交价格 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O64 | tradeVolume | 成交数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O00 | orderNo | 报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O65 | matchType | 成交类型 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 本地报单号查询请求及应答（现货/延期/即期）

**功能**：本地报单号查询指令用于根据二级系统本地报单编号向交易所查询现货/延期/即期市场指定报单的处理信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | M | - |  |
|  | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M | - |  |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - |  |
| [] | O40 | [orderInfoData] | 报单信息数据 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 报单信息 |  |  |  |
| → | O00 | orderNo | 报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M20 | seatID | 席位代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O02 | buyOrSell | 买卖方向 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O03 | offSetFlag | 开平标志 | - | C | 当查询结果不为空且延期/即期报单必填 |
| → | T11 | applyDate | 申请日期 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T12 | applyTime | 申请时间 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M60 | traderID | 交易员代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O06 | Price | 申报价格 | - | C | 当查询结果不为空时必填，限价指令必填，市价指令固定填0 |
| → | O07 | quantity | 申报数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O08 | remainQuantity | 剩余数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T22 | cancelTime | 撤销时间 | - | C | 当查询结果不为空且有撤单时必填 |
| → | T02 | cancelID | 撤销员代码 | - | C | 当查询结果不为空且有撤单时必填 |
| → | O09 | orderStatus | 报单状态 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O65 | matchType | 成交类型 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O15 | orderType | 报单指令类型 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

### 交割申报交易

#### 交割申报请求及应答

**功能**：交割申报指令用于会员在多头/空头持仓交割前进行交割申报。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| O00 | orderNo | 报单编号 | - | M |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| M30 | clientID | 客户代码 | M | ← |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M | ← |  |
| O02 | buyOrSell | 买卖方向 | M | ← |  |
| T11 | applyDate | 申请日期 | - | M |  |
| T12 | applyTime | 申请时间 | - | M |  |
| O07 | quantity | 申报数量 | M | ← |  |
| O09 | orderStatus | 报单状态 | - | M |  |
| O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M | ← |  |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
| O08 | remainQuantity | 剩余数量 | - | M |  |
| T82 | source | 交易渠道标识 | C | ← | APP和红马甲上送交易时必填：a-APP渠道、c-红马甲 |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 交割申报撤销请求及应答

**功能**：交割申报撤销指令用于会员当日主动撤销原发起的交割申报指令。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| O00 | orderNo | 报单编号 | M | ← |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M | ← |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| M30 | clientID | 客户代码 | M | ← |  |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | - |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | - |  |

#### 交割申报/申报撤销回报

**功能**：交割申报/申报撤销回报指令用于交易所通知会员交割申报指令/交割申报撤销指令的处理信息。交割申报回报中会返回库存冻结信息；交割撤销回报中暂无法返回库存释放信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | O00 | orderNo | 报单编号 | M |  |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M |  |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | M |  |
|  | I10 | instID | 合约代码 | M |  |
|  | O02 | buyOrSell | 买卖方向 | M |  |
|  | T11 | applyDate | 申请日期 | M |  |
|  | T12 | applyTime | 申请时间 | M |  |
|  | O07 | quantity | 申报数量 | M |  |
|  | T22 | cancelTime | 撤销时间 | C | 申报撤销时必填 |
|  | T02 | cancelID | 撤销员代码 | C | 申报撤销时必填 |
|  | O09 | orderStatus | 报单状态 | M |  |
|  | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M |  |
|  | M60 | traderID | 交易员代码 | M |  |
|  | O08 | remainQuantity | 剩余数量 | M |  |
| [] | S95 | [clientStorageChangeInfoData] | 客户库存变动信息数据 | C | 当涉及客户库存冻结/解冻/增减时必填 |
| {} |  |  | 客户库存变动信息 |  |  |
| → | V00 | varietyID | 交割品种代码 | C | 当涉及客户库存冻结/解冻/增减时必填 |
| → | T52 | stdWeight | 发生标准重量 | C | 当涉及客户库存冻结/解冻/增减时必填 |

注：当为系统撤单时，撤销员代码为空。

#### 交割申报成交回报

**功能**：交割申报成交回报指令用于交易所通知会员交割申报报单的成交信息。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| O60 | matchNo | 成交编号 | M |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M |  |
| M30 | clientID | 客户代码 | M |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M |  |
| O02 | buyOrSell | 买卖方向 | M |  |
| O64 | tradeVolume | 成交数量 | M |  |
| O61 | matchDate | 成交日期 | M |  |
| O62 | matchTime | 成交时间 | M |  |
| O00 | orderNo | 报单编号 | M |  |
| O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M |  |
| O05 | middleFlag | 是否为中立仓 | M |  |

#### 交割申报报单查询请求及应答

**功能**：交割申报报单查询指令用于实时查询交割申报报单信息，支持查询多笔交割申报报单信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | I10 | instID | 合约代码 | O | - | 不填查全部合约 |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - |  |
|  | O00 | orderNo | 报单编号 | O | - | 不填查全部报单 |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | O | - | 不填查全部客户 |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | O03 | offsetFlag | 开平标志 | O | - | 不填查开平仓报单 |
| [] | O47 | [deliveryAppOrderInfoData] | 交割申报报单信息数据 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 交割申报报单信息 |  |  |  |
| → | O00 | orderNo | 报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M20 | seatID | 席位代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O02 | buyOrSell | 买卖方向 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T11 | applyDate | 申请日期 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T12 | applyTime | 申请时间 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O07 | quantity | 申报数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O09 | orderStatus | 报单状态 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M60 | traderID | 交易员代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T22 | cancelTime | 撤销时间 | - | C | 当查询结果不为空且有撤单时必填 |
| → | T02 | cancelID | 撤销员代码 | - | C | 当查询结果不为空且有撤单时必填 |
| → | O08 | remainQuantity | 剩余数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 交割申报成交查询请求及应答

**功能**：交割申报成交单查询指令用于实时查询交割申报成交信息，支持查询多笔交割申报成交单信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | I10 | instID | 合约代码 | O | - | 不填查全部合约 |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - | 02-递延市场 |
|  | O00 | orderNo | 报单编号 | O | - | 不填查全部报单 |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | O | - | 不填查全部客户 |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | O60 | matchNo | 成交编号 | O | - |  |
| [] | O97 | [deliveryAppMatchInfoData] | 交割申报成交信息数据 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 交割申报成交信息 |  |  |  |
| → | O60 | matchNo | 成交编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M20 | seatID | 席位代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O02 | buyOrSell | 买卖方向 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O64 | tradeVolume | 成交数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O61 | matchDate | 成交日期 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O62 | matchTime | 成交时间 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O00 | orderNo | 报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O05 | middleFlag | 是否为中立仓 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M | 当查询结果不为空时必填 |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M | 当查询结果不为空时必填 |

### 中立仓申报交易

#### 中立仓申报请求及应答

**功能**：中立仓申报指令用于交收申报不平时会员主动发起中立仓申报以获取延期补偿费收入。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| O00 | orderNo | 报单编号 | - | M |  |
| M30 | clientID | 客户代码 | M | ← |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M | ← |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| O02 | buyOrSell | 买卖方向 | M | ← |  |
| T11 | applyDate | 申请日期 | - | M |  |
| T12 | applyTime | 申请时间 | - | M |  |
| O07 | quantity | 申报数量 | M | ← |  |
| O09 | orderStatus | 报单状态 | - | M |  |
| O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M | ← |  |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
| O08 | remainQuantity | 剩余数量 | - | M |  |
| T82 | source | 交易渠道标识 | C | ← | APP和红马甲上送交易时必填：a-APP渠道、c-红马甲 |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 中立仓申报撤销请求及应答

**功能**：中立仓申报撤销指令用于会员当日主动撤销当日发起的中立仓申报指令。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| O00 | orderNo | 报单编号 | M | ← |  |
| I10 | instID | 合约代码 | M | ← |  |
| M30 | clientID | 客户代码 | M | ← |  |
| M20 | seatID | 席位代码 | M | ← |  |
| M60 | traderID | 交易员代码 | M | ← |  |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

#### 中立仓申报/申报撤销回报

**功能**：中立仓申报/申报撤销回报指令用于交易所通知会员中立仓申报指令和中立仓申报撤销指令的处理信息。中立仓申报回报中会返回库存冻结信息；中立仓撤销回报中暂无法返回库存释放信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **回报** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | O00 | orderNo | 报单编号 | M |  |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | M |  |
|  | I10 | instID | 合约代码 | M |  |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M |  |
|  | O02 | buyOrSell | 买卖方向 | M |  |
|  | T11 | applyDate | 申请日期 | M |  |
|  | T12 | applyTime | 申请时间 | M |  |
|  | O07 | quantity | 申报数量 | M |  |
|  | T22 | cancelTime | 撤销时间 | C | 撤单时必填 |
|  | T02 | cancelID | 撤销员代码 | C | 撤单时必填 |
|  | O09 | orderStatus | 报单状态 | M |  |
|  | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | M |  |
|  | M60 | traderID | 交易员代码 | M |  |
|  | O08 | remainQuantity | 剩余数量 | M |  |
| [] | S95 | [clientStorageChangeInfoData] | 客户库存变动信息数据 | C | 当涉及客户库存冻结/解冻/增减时必填 |
| {} |  |  | 客户库存变动信息 |  |  |
| → | V00 | varietyID | 交割品种代码 | C | 当涉及客户库存冻结/解冻/增减时必填 |
| → | T52 | stdWeight | 发生标准重量 | C | 当涉及客户库存冻结/解冻/增减时必填 |

注：当为系统撤单时，撤销员代码为空。

#### 中立仓申报报单查询请求及应答

**功能**：中立仓报单查询指令用于实时查询中立仓申报报单信息，支持查询多笔中立仓申报报单信息。

消息体格式如下：

| **符号** | **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | I10 | instID | 合约代码 | O | - | 不填查全部合约 |
|  | I00 | marketID | 市场代码 | M | - | 02-递延市场 |
|  | O00 | orderNo | 报单编号 | O | - | 不填查全部报单 |
|  | M30 | clientID | 客户代码 | O | - | 不填查全部客户 |
|  | M20 | seatID | 席位代码 | M | - |  |
|  | O03 | offsetFlag | 开平标志 | O | - | 不填查开平仓报单 |
| [] | O49 | [middleAppOrderInfoData] | 中立仓申报报单信息数据 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| {} |  |  | 中立仓申报报单信息 |  |  |  |
| → | O00 | orderNo | 报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M20 | seatID | 席位代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M30 | clientID | 客户代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | I10 | instID | 合约代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O02 | buyOrSell | 买卖方向 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T11 | applyDate | 申请日期 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T12 | applyTime | 申请时间 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O07 | quantity | 申报数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O09 | orderStatus | 报单状态 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | O01 | localOrderNo | 本地报单编号 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | M60 | traderID | 交易员代码 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
| → | T22 | cancelTime | 撤销时间 | - | C | 当查询结果不为空且有撤单时时必填 |
| → | T02 | cancelID | 撤销员代码 | - | C | 当查询结果不为空且有撤单时必填 |
| → | O08 | remainQuantity | 剩余数量 | - | C | 当查询结果不为空时必填 |
|  | X39 | rspCode | 响应代码 | - | M |  |
|  | X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M |  |

## 其他

### 通用报错

#### 通用报错应答

**功能**：当请求报文因格式错误、解密失败等原因导致报文解析失败，返回给二级系统失败应答及错误原因。

消息体格式如下：

| **域号** | **域名** | **业务字段名称** | **请求** | **应答** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| X39 | rspCode | 响应代码 | - | M | 错误码 |
| X40 | rspMsg | 响应消息 | - | M | 错误提示信息 |

# 附录

## 应答码信息

详见《上海黄金交易所GEMS-2核心交易系统应答码》文档。

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |

## （注：GEMS-2应答码信息后续根据系统设计还会进行调整。）标准域字典

详见《域字典》文档。