

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所综合业务平台  
市场参与者接口规格说明书  
(业务汇总)  
(1.10 版)



上海证券交易所

二〇一二年八月

## 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.10 版发布说明

本文档新增定义了上交所跨境 ETF 申赎市场参与者 EzSTEP 接口，即合并了《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者 接口规格说明书 1.00 版(跨境 ETF 申赎，技术开发稿)\_20120528》技术开发文档，跨境 ETF 二级市场买卖与其他单市场 ETF 买卖接口一样，继续采用 EzOES 接入上交所竞价撮合平台实现。

本文档基于原发布的《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.00 版（大宗交易）\_20120215》新增跨境 ETF 内容。

## 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.00 版发布说明

本文档为市场参与者通过 EzSTEP 接入上交所综合业务平台的接口规格。

本文档定义了上交所大宗交易市场参与者 EzSTEP 接口，上交所大宗交易系统采用远程数据交互模式，以电子交易方式受理大宗交易意向报价发布和成交申报发布，并向市场发布意向和成交信息。交易用户通过大宗交易系统买卖行为应当符合《上海证券交易所交易规则》的有关规定。

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

通信地址：上海市浦东南路 528 号上海证券交易所技术规划与服务部

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

# 目录

1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范 .....	4
2 大宗交易业务消息规范 .....	7
2.1 .....大宗交易 STEP 消息流程图 .....	7
2.2 .....公共数据消息 .....	8
2.3 .....意向申报消息/意向申报撤单消息 .....	9
2.4 .....意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息 .....	10
2.5 .....成交申报消息 .....	11
2.6 .....申报撤单消息 .....	12
2.7 .....申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....	13
2.8 .....申报撤单失败响应消息 .....	14
2.9 .....执行报告消息 .....	15
2.10 .....过户数据接口 dghXXXXXYYYYMMDD.dbf .....	16
3 跨境 ETF 申赎业务消息规范 .....	18
3.1 .....跨境 ETF 申赎 STEP 消息流程图 .....	18
3.2 .....申报消息 .....	18
3.3 .....申报响应消息 .....	19
3.4 .....执行报告消息 .....	19
4 过户数据接口 bghXXXXX.dbf .....	22
5 后记 .....	24

## 1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范

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

STEP 消息约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》文档。

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

请求业务类型编号（reqid），交易所据此处理不同的业务请求，取值为：

BII	大宗意向	Block trade Intention of Interest
BPT	大宗交易	Block trade appoint Trade
QBD	报价入库	Quote Bond Deposit
QBW	报价出库	Quote Bond Withdraw
QNE	报价回购	Quote bond New Entry
QCA	报价回购提前购回	Quote bond repo
RNE	初始交易	Repurchase New Entry
RNR	购回交易	Repurchase Return
EEC	跨境 ETF 申购	External ETF Creation
EER	跨境 ETF 赎回	External ETF Redemption
ZII	转融通非指定对手方申报	Lending and Borrowing Indication of Interest
ZPT	转融通指定对手方申报	Lending and Borrowing appoint Trade

数据广播类型（bcasttype），取值为：

- 01: 跨境 ETF 申赎业务（execreport）
- 02: 大宗交易执行报告（execreport）
- 03: 大宗交易意向申报行情（pubdata）
- 04 转融通出借人实时申报及成交汇总行情广播（pubdata）
- 05 指定对手方转融通执行报告（execreport）
- 06 非指定对手方转融通执行报告（execreport）
- 07 转发的转融通指定对手方出借申报（execreport）

08 转发的转融通非指定对手方出借申报 (execreport)

09 转发的转融通指定对手方出借申报撤单 (execreport)

10 转发的转融通非指定对手方出借申报撤单 (execreport)

业务类型与执行报告数据广播类型及产品集关系表:

业务名称	业务类型 (reqid)	执行报告 广播类型 (bcasttype)	公共数据 广播类型 (bcasttype)	产品集编号 (setid)
跨境 ETF 申 赎	EEC 跨境 ETF 申购 EER 跨境 ETF 赎回	01	N/A	102
大宗业务	BII 大宗意向 BPT 大宗交易	02	03	101
报价回购	QBD 报价入库 QBW 报价出库 QNE 报价回购 QCA 报价回购提前购回	N/A	N/A	
约定购回	RNE 初始交易 RNR 购回交易	N/A	N/A	
转融通	ZII 转融通非指定对手方 ZPT 转融通指定对手方	05,07,09 06,08,10	04	

消息类型 (MsgType), 取值为:

6 = 意向申报或意向申报撤单 (IOI)

8 = 申报响应或执行报告 (Execution Report)

9 = 申报撤消失败 (OrderCancelReject)

D = 申报 (NewOrder Single)

F = 申报撤单 (OrderCancel Request)

AJ = 意向申报响应或意向申报撤单响应 (QuoteResponse)

**说明及约定:**

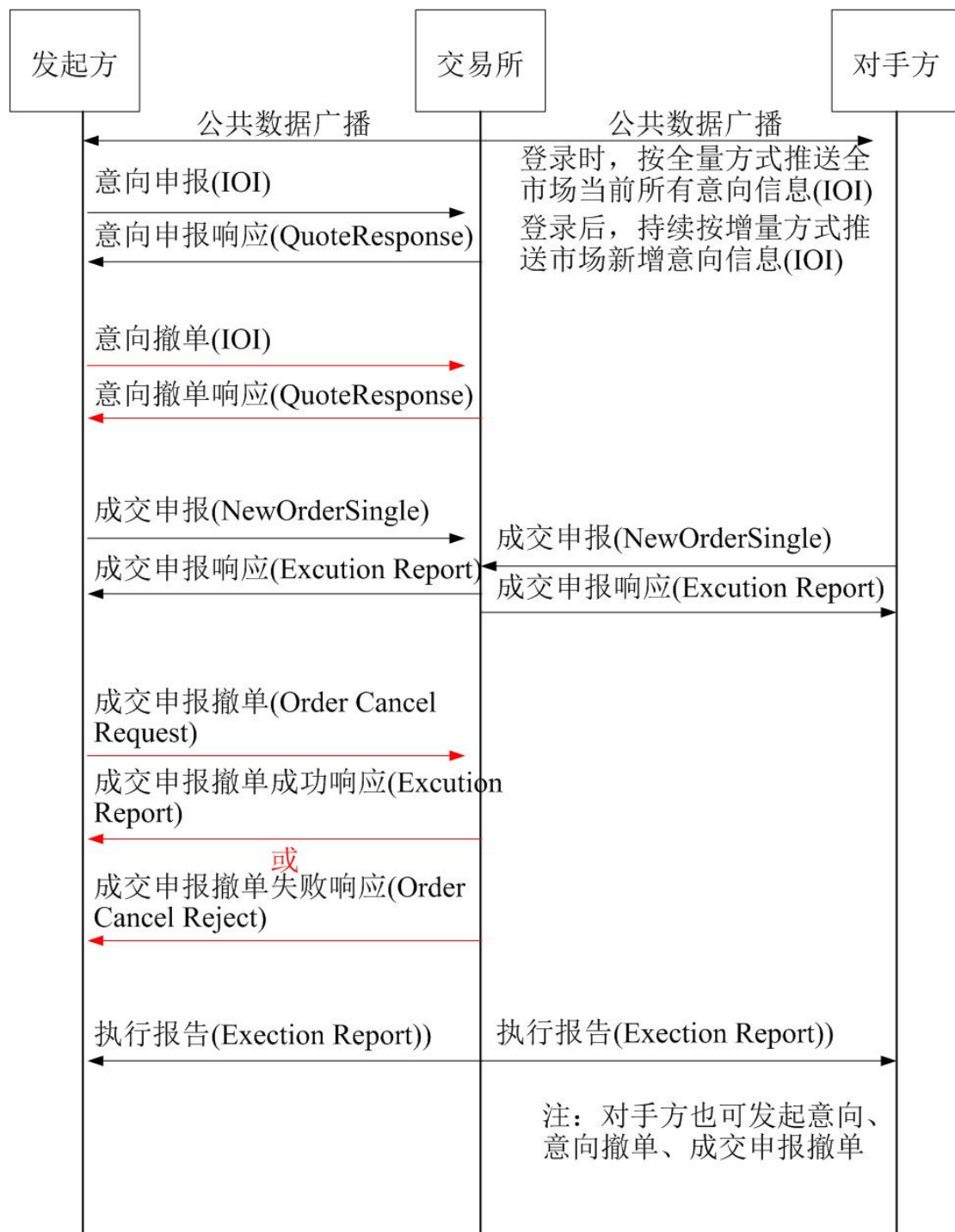
注意大宗交易证书(Ekey)取消后,大宗交易用户直接使用 PBU 进行大宗交易,该 PBU 对产品的交易权限及连通指定关系同竞价交易系统。

对于跨境 ETF 申赎,reqresp 表 securityid 字段为跨境 ETF 二级市场交易代码。

## 2 大宗交易业务消息规范

### 2.1 大宗交易 STEP 消息流程图

在发起方登录时，客户端将收到全市场的意向申报信息（即公共数据），之后只发新增的公共数据。根据大宗交易的操作流程，发起方可以进行意向报价发布，成交申报发布，以及相应的撤单等操作，下图描述了大宗交易的 STEP 消息通信流程。



## 2.2 公共数据消息

IOI (mdtext)	公共数据消息
<b>描述:</b> 公共数据表中的 mdtext 字段数据。 本消息用来发送市场有效时段内的所有的意向申报（包括已成交和撤单的，具体由申报单状态确定），向市场参与者发送。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: 6=意向申报	
23	IOIID	会员内部编号。	C10
28	IOITransType	意向报单类型，取值为: N=意向申报, C=意向申报撤单	C1
26	IOIRefID	撤单编号，对于意向申报该字段取值为空，若为撤单则为被撤原订单的会员内部编号。	C10
48	SecurityID	证券代码	C6
44	Price	价格	N11(3)
38	OrderQty	数量	N10
54	Side	买卖方向，取值有： 1 表示买 2 表示卖	C1
453	NoPartyIDs	后接重复组，包含发起方的申报交易单元号，取 1	N2
发起方交易单元	448	Party ID	C5
	452	Party Role	N4
58	Text	备注，通常填写联系方式	C50



### 2.3 意向申报消息/意向申报撤单消息

IOI (reqtext)	意向申报消息/意向申报撤单消息
<p><b>描述:</b></p> <p>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。</p> <p>市场参与者使用 IOI 消息进行意向申报或撤单。</p> <p>需要注意的是，综合业务平台采用原始意向申报的会员内部编号和业务交易单元号作为撤单索引字段。</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: 6=意向申报或意向申报撤单	
23	IOIID	会员内部编号, 指意向申报或意向申报撤单会员内部编号。	C10
28	IOITransType	意向报单类型, 取值为: N=意向申报, C=意向申报撤单	C1
26	IOIRefID	撤单编号, 对于意向申报该字段取值为空, 若为撤单则为被撤原订单的会员内部编号。	C10
48	SecurityID	证券代码	C6
44	Price	价格	N11(3)
38	OrderQty	数量	N10
54	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买, 2 表示卖。	C1
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码、结算代码, 取值为具体包含的字段数量。取值 4	N2
发起方投	448 PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452 PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方申报	448 PartyID	发起方业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号, 对于意向申报撤单, 应为原始意向申报的业务 PBU 代码。	C5
	452 PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为发起方交易单元号。	N4
发起方营	448 PartyID	发起方营业部代码	C5
	452 PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

发起方结算代码	448	PartyID	发起方结算代码，用于 B 股，若无填空。	C5
	452	PartyRole	取 4，表示当前 PartyID 的取值为发起方结算代码。	N4
58	Text		备注，通常填写联系方式	C50

## 2.4 意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息

QuoteResponse (resptext)	意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息
<b>描述：</b>  请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。  每一个意向申报记录或意向申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。	

序号	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为：AJ=意向申报响应或意向申报撤单响应。	
693	QuoteRespID	交易所意向申报响应记录标识，上交所内部使用。	C16
694	QuoteRespType	取值： 2=意向申报响应或意向申报撤单响应，用于未来扩展。	N1
48	SecurityID	证券代码	C6
23	IOIID	会员内部编号，该字段对应意向申报消息/意向撤单消息中的 IOIID。	C10
60	TransactTime	接受请求时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=意向申报成功响应，8=拒绝响应，6=意向申报撤单成功响应。	C1
102	CxlRejReason	意向申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。	C5

		撤消成功时，该字段取值为空。  撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同 Remark 字段。	
103	OrdRejReason	意向申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。  意向申报成功时，该字段取值为空  意向申报失败时，表示拒绝的理由，取值同 Remark 字段。	C5

## 2.5 成交申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	成交申报消息
<b>描述:</b>  请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。  市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行成交申报。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: D=成交申报	
11	ClOrdID	会员内部编号，指成交申报会员内部编号。	C10
48	SecurityID	证券代码	C6
44	Price	价格	N11(3)
38	OrderQty	订单数量	N10
54	Side	买卖方向，取值有：  1 表示买  2 表示卖	C1
664	ConfirmID	约定号	C6
453	NoPartyIDs	参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码、结算代码，以及对手方 PBU，取值为 5。	N2
发起方投	448 PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452 PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
已发	448 PartyID	发起方业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号，对于成交申报	C5

			撤单，应为原始成交申报的业务 PBU 代码。	
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为 PBU	N4
发起方营	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码	N4
发起方结	448	PartyID	发起方结算代码	C5
	452	PartyRole	取 4，表示当前 PartyID 的取值为发起方结算代码	N4
对手方申报交易	448	PartyID	对手方业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为对手方交易单元号	N4
58	Text		备注，通常填写联系方式	C50

## 2.6 申报撤单消息

OrderCancel Request (reqtext)	申报撤单消息
<b>描述：</b>  请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。  市场参与者使用 OrderCancel Request 消息进行申报撤单  需要注意的是，为简化会员公司备份切换动作，综合业务平台采用原始申报的会员内部编号和业务交易单元号作为撤单索引字段。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为： F=申报撤单	
11	ClOrdID	会员内部编号，指申报会员内部编号。	C10
41	OrigClOrdID	原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的 ClOrdID	C10
48	SecurityID	证券代码	C6
38	OrderQty	订单数量	N10

54	Side	买卖方向，取值有：  1 表示买  2 表示卖		C1
453	NoPartyIDs	参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号，取值为 2。		N2
发起方投	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方申报	448	PartyID	发起方业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号，对于成交申报撤单，应为原始成交申报的业务 PBU 代码。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为 PBU	N4
58	Text	备注		C50

## 2.7 申报响应消息/申报撤单成功响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
<p><b>描述：</b></p> <p>请求及响应接口表中的 <b>resptext</b> 字段数据。</p> <p>每一个申报记录或申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。</p> <p><b>150 和 39 组合取值含义：</b></p> <p>申报成功响应：150=0, 39=0</p> <p>申报拒绝响应：150=8, 39=8</p> <p>申报撤单成功响应：150=6,39=6</p> <p>申报撤单失败响应：参见 OrderCancelReject</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为：8=申报响应	
37	OrderID	交易所订单编号	C16
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有：	C1

		0=成功响应  8=拒绝响应  6=撤单成功	
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应  6=撤单成功	C1
48	SecurityID	证券代码	C6
11	CIOrdID	会员内部编号。	C10
60	TransactTime	接受请求时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
41	OrigCIOrdID	对于申报撤单成功响应，为原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的 CIOrdID，对于申报响应，取值为空。	C10
103	OrdRejReason	对于申报响应，为申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。申报成功时，该字段取值为空。申报失败时，表示拒绝的理由，取值同 Remark 字段。  对于申报撤单成功响应，该字段取值为空。	C5

## 2.8 申报撤单失败响应消息

OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
<b>描述：</b>  请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。	

标签	字段名	字段描述	类型
	标准消息头	MsgType 取值为： 9=申报撤单失败响应。	
37	OrderID	交易所订单编号	C16
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有：  8=拒绝响应	C1

11	CIOrdID	会员内部编号。	C10
41	OrigCIOrdID	原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的 CIOrdID	C10
60	TransactTime	接受请求时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
102	CxlRejReason	撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同 Remark 字段。	C5
434	CxlRejResponseTo	撤单响应类型，取值： 1=撤单响应	C1

## 2.9 执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
<b>描述：</b>  执行报告表中的 ExecReport 字段数据。  每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息，该消息文本由成交回报表中的 ExecReportText 字段包含。	

序号	字段名	字段描述	类型
	标准消息头	MsgType 取值为：8=成交回报	
11	CIOrdID	会员内部编号	C10
37	OrderID	交易所订单编号	C16
17	ExecID	成交编号	C16
48	SecurityID	证券代码	C6
31	LastPx	价格	N11(3)
32	LastQty	该笔成交数量	N12
8504	TotalValueTraded	成交金额	N16(3)
151	LeavesQty	本次剩余余额	N12
54	Side	买卖方向，取值有：	C1

		1 表示买  2 表示卖		
60	TransactTime		订单执行时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
42	OrigTime		原 有 订 单 请 求 接 收 的 时 间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
150	ExecType		当前订单执行状态，取值：  F=成交	C1
39	OrdStatus		当前订单状态，取值：1=部分成交，2=已成交	C1
453	NoPartyIDs		参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的 <b>投资者账户、申报交易单元号，对手方的投资者账户、交易单元号</b> ，取值为 4。	N2
发起方投	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方申报	448	PartyID	发起方业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号	N4
对手方投	448	PartyID	对手方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 39，表示当前 PartyID 的取值为对手方投资者帐户	N4
对手方申	448	PartyID	对手方业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为对手方申报交易单元号	N4

## 2.10 过户数据接口 dghXXXXXYYYYMMDD.dbf

dghXXXXXYYYYMMDD.dbf	过户数据接口
<b>描述：</b>  文件名中 <b>XXXXXX</b> 表示业务交易单元号。闭市后发送。  未申明特别填写方式的字段，均填写对应订单输入时的原始信息。  过户数据接口 dghXXXXXYYYYMMDD.dbf 压缩到 dghXXXXX.zip 文件中供券商用 RptGet 下	



dghXXXXXXXXXXMMDD.dbf	过户数据接口
载，YYYYMMDD 为日期格式。	

序号	字段名	说明	备注	类型
1	GDDM	股东代码	字符串	C10
2	GDXM	股东姓名	不用，该字段置为空格	C8
3	BCRQ	本次日期	成交日期，格式为 YYYYMMDD	C8
4	CJBH	成交编号	整数（目前本业务有效位用到 8 位，后期将逐步扩展位数，注意做好相关技术准备工作）	N16
5	GSDM	公司代码	业务 PBU	C5
6	CJSL	成交数量	不以正负标识买卖	N10
7	BCYE	本次余额	过户后的持股余额	N10
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	CJJG	成交价格		N8(3)
12	CJJE	成交金额		N15(2)
13	SQBH	申请编号	会员内部订单号，同申报接口中的 reff	C10
14	BS	买卖标志	B=买入，S=卖出	C1
15	MJBH	操作员代码		C5

### 3 跨境 ETF 申赎业务消息规范

#### 3.1 跨境 ETF 申赎 STEP 消息流程图

根据跨境 ETF 申赎流程，市场投资者可以通过 EzSTEP 进行跨境 ETF 申赎申报，交易所实时反馈申报确认，并实时反馈各类成交回报（即执行报告），下图描述了跨境 ETF 申赎的 STEP 消息通信流程。



#### 3.2 申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
<b>描述:</b> 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行跨境 ETF 申赎申报。	

标签	字段名	字段描述	类型
----	-----	------	----

	消息头	MsgType 取值为: D=申报	
11	ClOrdID	会员内部编号, 指成交申报会员内部编号。	C10
48	SecurityID	证券代码, 跨境 ETF <b>二级市场交易证券代码</b>	C6
44	Price	价格, 填写 1.000, 单位元	N11(3)
38	OrderQty	申赎数量	N10
54	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买, 对应申购 2 表示卖, 对应赎回	C1
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码, 取值为 3。	N2
投资者账户	448 PartyID	投资者帐户	C10
	452 PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	N4
申报交易单元	448 PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5
	452 PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为 PBU	N4
营业部代码	448 PartyID	营业部代码	C5
	452 PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	N4
58	Text	备注	C50

### 3.3 申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

### 3.4 执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
描述:	

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
<p>执行报告表中的 ExecReport 字段数据。</p> <p>每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息，该消息文本由成交回报表中的 ExecReportText 字段包含。</p> <p>每笔跨境 ETF 申赎执行报告（即成交回报）有三笔消息记录：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 一条 ETF 二级市场交易代码成交记录，证券代码为二级市场交易代码，价格和数量均为 0，成交金额为 0。</li> <li>● 一条非沪市资金代码成交记录，证券代码为非沪市资金代码，价格和数量均为 0，成交金额为现金替代总额。现金替代总额计算方法为：先将每个成份股的替代金额加减对应溢价后四舍五入到小数点后三位，然后将各个股票的现金替代额相加，结果四舍五入到小数点后两位。得到每个篮子对应的现金替代额。对于每笔申购或赎回，则根据篮子数×每个篮子对应的现金替代额，得到该笔订单对应的现金替代总额。</li> <li>● 一条 ETF 一级市场申赎代码成交记录，证券代码为一级市场申赎代码，价格为 0，数量为申购/赎回数量，成交金额为 0。</li> </ul>	

序号	字段名	字段描述	类型
	标准消息头	MsgType 取值为：8=成交回报	
11	ClOrdID	会员内部编号，对于基金公司填写 ETFJ1JIN	C10
37	OrderID	交易所订单编号	C16
17	ExecID	成交编号，目前本业务有效位用到 10 位，后期将逐步扩展位数，注意做好相关技术准备工作	C16
48	SecurityID	证券代码	C6
31	LastPx	价格	N11(3)
32	LastQty	该笔成交数量	N12
8504	TotalValueTraded	成交金额	N16(3)
151	LeavesQty	本次剩余余额，暂为 0	N12
54	Side	买卖方向，取值有： 1 表示买，对应申购	C1

		2 表示卖，对应赎回  基金公司作为对手方买卖方向与投资者相反。		
60	TransactTime		订单执行时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
42	OrigTime		原有订单请求接收的时间，式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
150	ExecType		当前订单执行状态，取值：  F=成交	C1
39	OrdStatus		当前订单状态，取值：1=部分成交，2=已成交	C1
453	NoPartyIDs		参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号，取值为 2。	N2
投资者帐	448	PartyID	投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	N4
申报交易单	448	PartyID	业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4

#### 4 过户数据接口 bghXXXXX.dbf

bghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p><b>描述:</b></p> <p>综合业务平台盘后文件接口，文件名中 XXXXXX 表示业务交易单元号，闭市后发送。</p> <p>未申明特别填写方式的字段，均填写对应订单输入时的原始信息。</p> <p>过户数据接口 bghXXXXX.dbf 和相同 PBU 的 dghXXXXXYYYYMMDD.dbf（如有）压缩到现有的 dghXXXXX.zip 文件中供券商用 RptGet 下载。</p> <p>对于跨境 ETF 申赎业务，过户数据同实时成交回报，每笔跨境 ETF 申赎有三笔成交明细记录，相关证券代码、价格、数量、成交金额字段数据同实时执行报告。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gddm	证券账户	C10
2	bcrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD	C8
3	cjbh	成交编号，目前本业务有效位用到 10 位，后期将逐步扩展位数，注意做好相关技术准备工作	C16
4	gsdm	业务 PBU	C5
5	cjsl	成交数量	N12
6	zqdm	证券代码	C6
7	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS	C6
8	cjsj	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
9	cjg	成交价格	N11(3)
10	cjje	成交金额	N16(2)
11	sqbh	会员内部订单号，同申报接口中的 reff（会员内部订单号） 跨境 ETF 申赎业务，对于基金公司填写“ETFJIJIN”（左补空格）。	C10
12	cjbz	成交业务类型标志  BPT 大宗交易  QBD 报价入库	C3

		<p>QBW 报价出库</p> <p>QNE 报价回购</p> <p>QCA 报价回购提前购回</p> <p>RNE 初始交易</p> <p>RNR 购回交易</p> <p>EEC 跨境 ETF 申购</p> <p>EER 跨境 ETF 赎回</p>	
13	bs	<p>买卖方</p> <p>B: 跨境 ETF 申购时为买</p> <p>S: 跨境 ETF 赎回时为卖</p> <p>对于跨境 ETF 申赎, 基金公司作为对手方买卖方向与投资者相反。</p>	C1
14	text	备注, 保留字段, 暂不填	C30

## 5 后记

上海证券交易所对本文档享有知识产权，未经上海证券交易所书面许可，任何单位和个人不得将本文档用于其他商业目的。

对本文档有任何批评指正意见，请发电子邮件到 [spwu@sse.com.cn](mailto:spwu@sse.com.cn) 或者致电 021-68827268。