



中 华 人 民 共 和 国 金 融 行 业 标 准

JR/T 0151—2016

期货公司柜台系统数据接口规范

Business data interface standard for futures company counter system

2017 - 02 - 07发布

2017 - 02 - 07实施

中国证券监督管理委员会 发布

目 次

前言	III
1 范围	1
2 规范性引用文件	1
3 术语和定义	1
4 数据类型	2
4.1 整数	2
4.2 浮点数	2
4.3 定长字符串	2
4.4 变长字符串	2
4.5 日期	3
4.6 时间	3
4.7 日期时间	3
5 数据格式	3
5.1 数据格式说明	3
5.2 非实时文件格式	3
5.3 实时报文格式	5
6 业务主体	6
7 接口内容	8
7.1 交易模块文件	8
7.2 清算模块文件	11
7.3 账户资金模块文件	20
7.4 风控模块文件	35
7.5 实时消息接口	35
8 业务组件	40
8.1 客户信息组件	40
8.2 成交信息组件	41
8.3 委托信息组件	41
8.4 站点信息组件	42
8.5 合约信息组件	42
8.6 行情信息组件	43
8.7 权限信息组件	43
9 元素数据类型	44
9.1 账号变更状态	44
9.2 转账类型	44

附录 A（规范性附录） 数据字典 45

前 言

本标准按照GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本标准由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC68/SC4）提出。

本标准由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC68）归口。

本标准起草单位：中国期货业协会、中国金融期货交易所、上海金融期货信息技术有限公司、上海期货信息技术有限公司、大连飞创信息技术有限公司、郑州易盛信息技术有限公司、胜科金仕达数据系统（中国）有限公司、恒生电子股份有限公司、中信期货有限公司、国泰君安期货有限公司、鲁证期货股份有限公司、中信建投期货有限公司。

本标准的主要起草人：马文杰、王曦、史光伟、王康贵、王永峰、李翔、王磊、王涛、孟凡涛、张弛、吴豪权、徐慧康、滕飞飞、阎希岳、陈志刚。

期货公司柜台系统数据接口规范

1 范围

本标准规定了期货公司柜台系统数据接口数据类型、数据格式、业务主体、接口内容、业务组件以及元素数据类型。

本标准适用于期货公司柜台系统内部模块间的业务交互的设计与使用。

2 规范性引用文件

下列文件对于本文件的应用是必不可少的。凡是注日期的引用文件，仅注日期的版本适用于本文件。凡是不注明日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

GB/T 4880.2—2000 语种名称代码第2部分：3字母代码

GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码

GB 18030—2005 信息技术中文编码字符集

JR/T 0046—2009 证券期货业与银行间业务数据交换消息体结构和设计规则

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

数据格式 data format

数据保存在文件或记录中的编排方式，可为数字、字符或二进制数字等多种形式。

3.2

数据交换方式 data switching techniques

多数据终端设备，任意两个终端设备之间建立数据通信过程的方式。

3.3

业务组件 business components

消息中具有一定业务相关的数据域集合，主要用于更直观描述消息的业务含义。

3.4

业务要素 business element

业务要素是消息体的基本组成元素，对应于业务流程操作中的一个商业元素。

3.5

柜台系统 over the counter system

期货公司柜台系统包括主席系统和次席系统，提供交易、清算、账户与资金、风控等功能。

4 数据类型

4.1 整数

不含小数部分，可表示正负（ASCII码字符‘-’，‘0’至‘9’组成）。符号占据一个字符位置。允许前置字符零（例：“00023”=“23”）。整数数据类型见表1。

表1 整数数据类型

名称	描述	英文名称	格式	举例
整数	整数类型的数字	Number	最大长度为 32 位，小数位为 0 fractionDigital: 0 totalDigital: 32	123456789012345678

4.2 浮点数

含有可选小数部分，可表示正负（ASCII码字符‘-’，‘0’至‘9’和‘.’组成）。允许前置字符零（例如：“00023”=“23”），允许小数部分后置字符零（例：“23.0”=“23.0000”=“23”）。浮点数数据类型见表2。

表2 浮点数数据类型

名称	描述	英文名称	格式	举例
浮点数	浮点数类型的数字	DecimalNumber	最大长度为 64 位，小数位最大长度为 6 fractionDigital: 63 totalDigital: 64	123456789.123456789

4.3 定长字符串

长度固定的文本数据。其中Fix1Text为枚举类型，标准中涉及的枚举类型取值见附录A数据字典。定长字符串数据类型见表3。

表3 定长字符串数据类型

名称	描述	英文名称	格式	举例
定长字符串	固定长度的字符串	Fix*Text 其中*为正整数，如 Fix1Text，Fix3Text	固定长度为*个字符的字符串，其中*为正整数	A

4.4 变长字符串

变长文本指定字符串的最大长度，可以由不超过最大长度的任意字符组成。变长字符串数据类型见表4。

表4 变长字符串数据类型

名称	描述	英文名称	格式	举例
变长字符串	指定最大长度的字符串	Max*Text 其中*为正整数，如 Max5Text，Max20Text	最大长度*个字符，最小长度1字符	Aaaaa

4.5 日期

日期数据类型为表示某一日期的字符串，由8位数字组成。日期数据类型见表5。

表5 日期数据类型

名称	描述	英文名称	格式	举例
日期	日期	Date	YYYYMMDD	20060708

4.6 时间

时间数据类型为表示某一具体时间的字符串，由6位数字组成。时间数据类型见表6。

表6 时间数据类型

名称	描述	英文名称	格式	举例
时间	时间	Time	HHMMSS	130000

4.7 日期时间

日期时间数据类型为表示某一日期内某时间的字符串，由14位数字组成。日期数据类型见表7。

表7 日期时间数据类型

名称	描述	英文名称	格式	举例
日期时间	日期时间	DateTime	YYYYMMDDHHMMSS	20060708130000

5 数据格式

5.1 数据格式说明

期货公司柜台系统内部包括交易、清算、账户与资金、风控等关键子系统，各子系统之间数据交互方式包括非实时文件方式和实时报文方式，对应格式为非实时文件格式和实时报文格式。

本标准不涉及通信层协议，允许用户使用满足要求的通信层协议实现，同时在通信时考虑消息摘要算法第五版(MD5)校验和算法等来保证数据传输的准确性，通过压缩来保证数据传输的高效性。

5.2 非实时文件格式

5.2.1 文件命名

文件基本名命名规范对文件名称进行统一规划，以达到从文件名称上区分不同业务文件的目的。

文件名由“基本名”和“后缀名”两部分组成。基本名用于区分文件的业务属性，基本名中的英文字符均为大写，基本名的最大长度为52字节。后缀名紧跟基本名，用于区分文件的格式属性，后缀名包括“.”在内最大长度为4字节。

文件“基本名”可划分为6个子域，各部分之间以“_”分隔，大小写不明感。

示例：交易编码持仓明细文件可命名为：1002_1_20151010_JYBMCCMX_01_0.XML，其中基本名为1002_1_20151010_JYBMCCMX_01_0，后缀名为.XML。

文件基本名命名规范见表8。

表8 文件基本名命名规范

属性编号	属性名称	命名规范
1	期货公司统一编码	保证金监控中心为期货公司分配的统一编码，长度4位。
2	文件分类	如：TXT文件，XML文件，长度1位。见数据字典“文件分类”项。
3	文件日期	格式为YYYYMMDD。
4	业务分类	各个业务系统根据业务特征继续名称的划分，最大长度16位。
5	批次号/顺序号	01—99，支持一个文件日期下多批次的文件。
6	其他说明	可以自行定义内容，最大长度16位。

5.2.2 文件内容格式

5.2.2.1 文件内容格式说明

文件内容推荐使用TXT文件格式和XML文件格式。各柜台系统可选择提供一种或多种文件格式。本标准中的文件类型接口信息，如非特殊说明（备注中标示为“可选”等）均为必选信息。本标准中文件内容的完整性通过传输层协议保证。

5.2.2.2 TXT 文件格式

TXT文本文件格式的文件名以“.TXT”作为“后缀名”，其基本格式规定如下：

- 域与域之间通过半角|符（0x7C）分隔，转义字符采用半角\符（0x5C）。如域内容中包含半角|符，一律替换为其转义字符\\|；如域内容中包含半角\符，一律替换为其转义字符\\；
- 在每一行的最后一个域之后跟一个回车换行符（0x0D，0x0A），行中不得出现回车换行符，如果有，转义为[ent]；
- 第一行为域名，列举本文件所包含数据域的英文名称；
- 第二行开始为数据内容，数据内容的顺序必需与第一行数据域的顺序保持一致；
- 根据数据域“必需”属性，数据域分为“必需”（“必需”属性为“Y”）和“非必需”（“非必需”属性为“N”）两类。“必需”的数据域不能裁剪，必需包含在文件内容中；“非必需”的数据域可根据各期货交易所实际业务进行裁剪，部分包含在文件中；“必需”的数据域和选择包含的“非必需”的数据域的英文名称需要在第一行中列举；
- 对于整数和浮点数类型的数据域内容，统一转换成字符串类型；
- 连续两个回车换行符（0x0D，0x0A）表示文件内容结束。

5.2.2.3 XML 文件格式

数据包和消息体采用XML格式描述，数据包和消息体的语法规则应遵循可扩展标记语言（XML）语法规则。

注：XML语法规则见W3C XML 1.0标准。

5.2.3 文件接口字段命名规则

字段命名采用Pascal命名法。将标识符的首字母和每个单词的首字母都大写表示。单字之间不以空格断开或者连接号(-)、底线(_)连结,第一个单字首字母采用大写字母;后续单字的首写字母亦用大写字母。

示例: FirstName、LastName。

5.3 实时报文格式

5.3.1 基本结构

每一个消息体由一个消息头和多个业务要素构成。一个完整的消息见表9。

表9 消息体结构

起始标签	内容为<MsgText>
消息名称	消息体的标签名称
消息头	消息头内容
业务要素 1	业务要素 1 内容
业务要素 2	业务要素 2 内容
业务要素 3	业务要素 3 内容
...	...
消息名称	消息体的标签名称
结束标签	内容为</MsgText>

每一个会话或应用传输的消息应只有一个消息头。该消息头指明消息类型、发送起始点、发送目的地、发送时间、消息流水号以及其他一些通用信息。消息头格式见表10。

表10 消息头结构

要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
版本 ^a	Version	[1..1]	Max35Text	
应用系统类型 ^b	SystemType	[1..1]	SystemType	
业务功能码 ^c	InstructionCode	[1..1]	InstructionCode	
交易发起方 ^d	TradeSource	[1..1]	InstitutionType	
创建者 ^e	Creator	[0..1]	Institution	组件
发送机构 ^f	Sender	[1..1]	Institution	组件
接收机构 ^g	Recver	[1..1]	Institution	组件
发生日期 ^h	CreateDate	[0..1]	Date	
发生时间 ⁱ	CreateTime	[0..1]	Time	
消息流水号 ^j	Refrence	[0..1]	Reference	组件
相关消息流水号 ^k	RelatedReference	[0..1]	Reference	组件
最后分片标志 ^l	LastFragment	[0..1]	YesNoIndicator	

表 10 消息头结构（续）

^a	版本：消息体版本号，目前为 1.0.0.0。
^b	应用系统类型：现阶段包含期货柜台主席、期货柜台次席。
^c	业务功能码：比如成交信息、委托信息、行情信息等。
^d	交易发起方：F 表示期货公司发起。
^e	创建者：消息创建者标识，包含创建主次席 ID，模块 ID 等。
^f	发送机构：消息发送者标识，包含发送主次席 ID，模块 ID 等。
^g	接收机构：消息接收者标识，包含接收主次席 ID，模块 ID 等。
^h	发生日期：消息发送日期。
ⁱ	发生时间：消息发送时间。
^j	消息流水号：本消息的流水号。
^k	本消息链接的相关消息流水号。应答消息利用该元素指定对应的请求消息体流水号。
^l	最后分片标志：用于表述消息集合，说明是否为最后一个分片（Y：是，N：不是）。可选，如果不包含该元素，默认为 Y。

5.3.2 业务要素

业务要素是消息体的基本组成元素。它对应于业务流程操作中的一个商业元素。每一个业务要素都有其XML标签（XML Tag）、业务含义、数据类型和取值范围。在消息中，根据不同的XML Tag来确定不同业务要素。业务要素的数据类型决定了其取值范围。它的取值范围是一个集合，任何在此集合外的取值被认为是非法取值。数据字典部分详细定义了取值范围。业务要素可能是一个简单的元素，也可能是一个复杂的业务组件。

5.3.3 业务组件

应用消息中有很多业务相关的数据域集合。比如说，大多数应用消息都会用到一系列定义客户信息的数据域：客户名称、客户类型代码、客户证件类型代码、客户证件号码。为避免重复，本标准中定义了一些业务组件，在应用消息定义中利用这些组件描述业务流程中的业务要素。实际的消息定义和使用中，则应该将组件扩展开成为相应的数据域集合。一个业务组件可以包含其他的业务组件和元素。

6 业务主体

本接口标准涉及的业务主体包括期货公司柜台系统的交易、清算、账户与资金、风控等子系统。见图1所示。

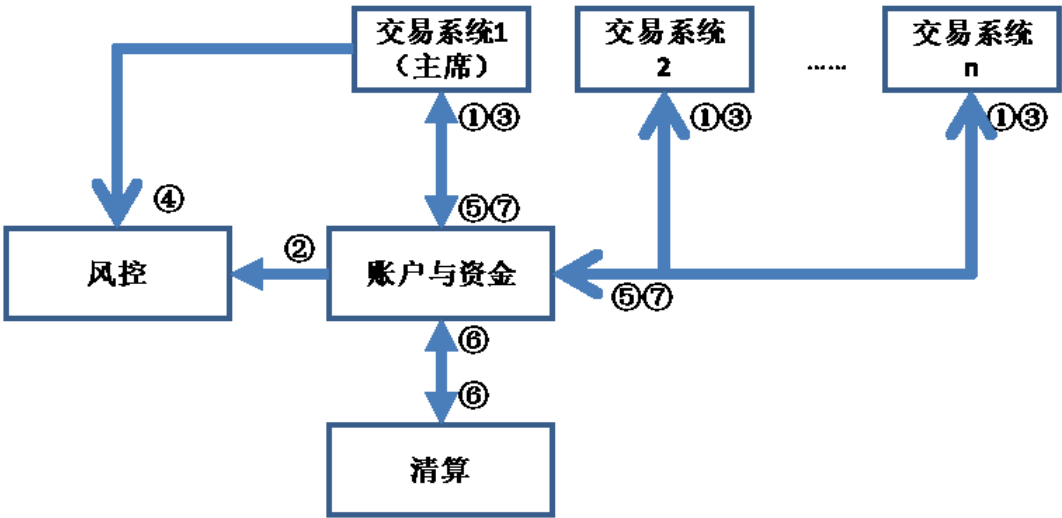


图1 期货公司柜台消息流示意图

消息流说明见表11。

表11 消息流说明表

消息流序号	消息流说明
1	交易初始化数据、交易结算单、盘中实时同步数据
2	交易系统参数、交易会员及客户账户信息、多交易中心编号
3	委托、成交、行情
4	委托、成交、行情（实时）
5	标的物、保证金、手续费率、昨持仓、资金、合约、成交、交割
6	持仓、资金变动
7	主次席同步

柜台系统分为交易、清算、账户与资金、风控四个子系统。开盘前准备交易系统和风控系统的上场数据；盘中的数据接口主要用于各系统间实时的数据交互；盘后会进行交易系统数据下场、账户资金系统向清算系统提供清算数据，清算系统向账户资金系统提供清算结果。期货公司柜台数据业务流程见图2。

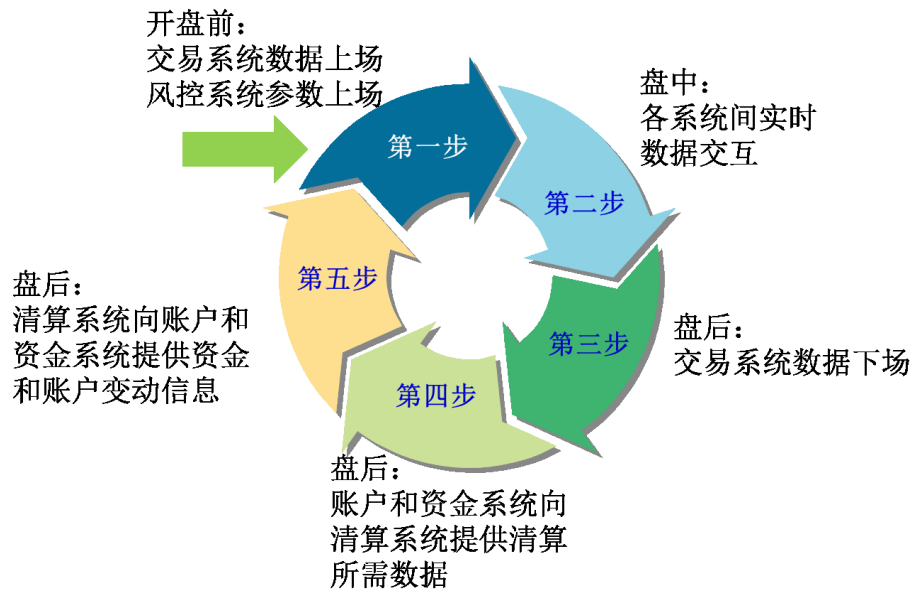


图2 期货公司柜台数据业务流程示意图

7 接口内容

7.1 交易模块文件

7.1.1 交易模块文件列表

交易模块文件列表见表12。

表12 交易模块文件类接口列表

接口名称	说明	方向（输入/输出）	备注
成交信息	交易系统下场	输出	见 7.1.2 同名接口说明，可选
委托信息	交易系统下场	输出	见 7.1.3 同名接口说明，可选
合约信息	交易系统下场	输出	见 7.1.4 同名接口说明，可选
会员基本信息	交易系统上场	输入	见 7.3.25 同名接口说明
客户基本信息	交易系统上场	输入	见 7.3.28 同名接口说明
客户交易编码及资金账户	交易系统上场	输入	见 7.3.33 同名接口说明
客户资金数据	交易系统上场	输入	见 7.3.29 同名接口说明
客户持仓数据	交易系统上场	输入	见 7.3.32 同名接口说明
客户交易保证金率	交易系统上场	输入	见 7.3.19 同名接口说明
客户交易手续费率	交易系统上场	输入	见 7.3.20 同名接口说明
客户合约组保证金类型	交易系统上场	输入	见 7.3.27 同名接口说明
标的物收盘价	交易系统上场	输入	见 7.3.3 同名接口说明
期权最低保障系数表	交易系统上场	输入	见 7.3.30 同名接口说明
客户套利保值额度	交易系统上场	输入	见 7.3.34 同名接口说明
会员期权最小保证金	交易系统上场	输入	见 7.3.31 同名接口说明

7.1.2 成交信息文件

成交信息文件见表13。

表13 成交信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	系统委托编号	SystemCommitCode	Max12Text	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
3	客户编码	CustNumber	Max15Text	
4	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
5	成交编号	TradeNo	Max12Text	
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	
7	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
8	开平标志	OpenLiquidationIndicator	Fix1Text	
9	成交价格	TradePrice	DecimalNumber	
10	成交数量	TradeVolume	Number	
11	交易类型	TradeType	Fix1Text	
12	操作员编号	OperatorNo	Max18Text	
13	强平原因代码	ForcedLiquidationReasonCode	Max50Text	
14	成交日期	TradingDate	Date	
15	成交时间	TradeTime	Time	
16	套利合约代码	ArbitrageContractNumber	Max30Text	
17	强平标志	ForceDropFlag	Fix1Text	
18	站点 IP	IP	Max64Text	
19	站点 MAC	MAC	Fix48Text	
20	下单来源	OrderSystem	Max50Text	描述下单来源， 识别第三方接入

7.1.3 委托信息文件

委托信息文件见表14。

表14 委托信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	本地委托编号	LocalOrderID	Max12Text	
2	系统委托编号	SysOrderID	Max12Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	席位代码	SeatID	Max30Text	
6	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
7	合约代码	ContractCode	Max30Text	
8	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	

表 14 委托信息文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
9	开平标志	OpenLiquidationIndicator	Fix1Text	
10	交易类型	TradeType	Fix1Text	
11	委托数量	CommitVolume	Number	
12	成交数量	TradeVolume	Number	
13	撤单数量	WithdrawVolume	Number	
14	委托价格	CommitPrice	DecimalNumber	
15	委托状态代码	OrderStatus	Fix1Text	
16	委托类型代码	CommitTypeCode	Fix1Text	
17	强平原因代码	ForceSropReason	Max50Text	
18	交易日期	TradingDate	Date	
19	委托日期	OrderDate	Date	
20	委托时间	CommitSubmitTime	Time	
21	定单有效时间类型代码	OrderProp	Max1Text	
22	套利合约代码	ArbitrageContractNumber	Max30Text	
23	提示信息	ErrorMessage	Max255Text	可选，备注信息
24	撤单时间	WithdrawTime	Time	
25	站点 IP	IP	Max64Text	
26	站点 MAC	MAC	Fix48Text	
27	下单来源	OrderSystem	Max50Text	描述下单来源，识别第三方接入

7.1.4 合约信息文件

合约信息文件见表15。

表15 合约信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如：IF（沪深 300 股指期货合约） TF（5 年期国债期货合约）
3	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
4	合约代码	ContractCode	Max30Text	
5	报价币种代码	QuoteCurrencyCode	Fix3Text	
6	结算币种代码	ClearCurrencyCode	Fix3Text	
7	合约乘数	InstrumentMultiple	Number	
8	合约面值	FaceValue	Number	
9	报价乘数	PriceUnit	Number	汇率期货使用

表 15 合约信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
10	月份	Month	Max12Text	
11	最后交易日期	LastTradeDate	Date	
12	合约标的	UnderlyingID	Max20Text	
13	标的乘数	UnderlyingUnit	Number	
14	执行价格	ExecutePrice	DecimalNumber	期权使用
15	期权类型	OptionType	Fix1Text	
16	开始行权日	ExecuteStartDate	Date	
17	最后行权日	ExecuteLastDate	Date	
18	行权方式代码	ExecuteType	Fix1Text	
19	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
20	结算价格	ClearPrice	DecimalNumber	
21	最低保证金比例	MinHoldBalance	DecimalNumber	可选
22	合约类别	InstrumentType	Max4Text	可选

7.2 清算模块文件

7.2.1 清算模块文件列表

清算模块文件列表见表16。

表16 清算模块文件列表

接口名称	说明	模块输入/输出	备注
交易编码持仓	清算结果输出	输出	见 7.2.2 同名接口说明
交易编码持仓明细	清算结果输出	输出	见 7.2.3 同名接口说明
交易编码合约资金	清算结果输出	输出	见 7.2.4 同名接口说明, 可选
交易编码交割持仓	清算结果输出	输出	见 7.2.5 同名接口说明
交易编码交割明细	清算结果输出	输出	见 7.2.6 同名接口说明, 可选
交易编码平仓明细	清算结果输出	输出	见 7.2.7 同名接口说明, 可选
交易编码期权执行明细	清算结果输出	输出	见 7.2.8 同名接口说明, 可选
交易会员资金变动	清算结果输出	输出	见 7.2.9 同名接口说明
结算会员资金变动	清算结果输出	输出	见 7.2.10 同名接口说明
客户资金变动	清算结果输出	输出	见 7.2.11 同名接口说明
成交明细	清算结果输出	输出	见 7.2.12 同名接口说明, 可选
策略组合保证金明细	清算结果输出	输出	见 7.2.13 同名接口说明, 可选
单向大边保证金明细	清算结果输出	输出	见 7.2.14 同名接口说明, 可选
本地委托	清算参数输入	输入	见 7.3.2 同名接口说明
标的物收盘价	清算参数输入	输入	见 7.3.3 同名接口说明
隔夜回购定盘利率	清算参数输入	输入	见 7.3.4 同名接口说明
合约信息	清算参数输入	输入	见 7.3.5 同名接口说明
汇率	清算参数输入	输入	见 7.3.6 同名接口说明

表 16 清算模块文件列表

接口名称	说明	模块输入/输出	备注
交易编码昨持仓	清算参数输入	输入	见 7.3.7 同名接口说明
交易编码昨持仓明细	清算参数输入	输入	见 7.3.8 同名接口说明
交易编码昨交割持仓	清算参数输入	输入	见 7.3.9 同名接口说明
交易会员或客户账户信息	清算参数输入	输入	见 7.3.10 同名接口说明
结算会员交割保证金率	清算参数输入	输入	见 7.3.11 同名接口说明
结算会员交割手续费	清算参数输入	输入	见 7.3.12 同名接口说明
结算会员交易保证金率	清算参数输入	输入	见 7.3.13 同名接口说明
结算会员交易手续费率	清算参数输入	输入	见 7.3.14 同名接口说明
结算会员期权执行手续费率	清算参数输入	输入	见 7.3.15 同名接口说明
结算会员移仓手续费率	清算参数输入	输入	见 7.3.16 同名接口说明
客户交割保证金率	清算参数输入	输入	见 7.3.17 同名接口说明
客户交割手续费率	清算参数输入	输入	见 7.3.18 同名接口说明
客户交易保证金率	清算参数输入	输入	见 7.3.19 同名接口说明
客户交易手续费率	清算参数输入	输入	见 7.3.20 同名接口说明
客户期权执行手续费率	清算参数输入	输入	见 7.3.21 同名接口说明
客户移仓手续费率	清算参数输入	输入	见 7.3.22 同名接口说明
期权保证金参数	清算参数输入	输入	见 7.3.23 同名接口说明
客户保障基金费率	清算参数输入	输入	见 7.3.24 同名接口说明

7.2.2 交易编码持仓文件

交易编码持仓文件见表17。

表17 交易编码持仓文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	MaxText	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	
7	结算价格	ClearPrice	DecimalNumber	
8	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
9	期初多头持仓数量	LongPositionBegin	Number	
10	期初空头持仓数量	ShortPositionBegin	Number	
11	买开仓量	BuyOpenVolume	Number	
12	买平仓量	BuyLiquidationVolume	Number	

表 17 交易编码持仓文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
13	买成交数量	BuyTradeVolume	Number	买成交数量=买开仓量+买平仓量
14	卖开仓量	SellOpenVolume	Number	
15	卖平仓量	SellLiquidationVolume	Number	
16	卖成交数量	SellTradeVolume	Number	卖成交数量=卖开仓量+卖平仓量
17	买成交金额	BuyTradeMoney	DecimalNumber	
18	卖成交金额	SellTradeMoney	DecimalNumber	
19	期末多头持仓数量	LongPositionEnd	Number	
20	期末空头持仓数量	ShortPositionEnd	Number	
21	多头组合持仓数量	LongCombPositoinVolume	Number	
22	多头大边持仓数量	LongPzdbPositionVolume	Number	
23	多头单腿持仓数量	LongSinglePositionVolume	Number	
24	空头组合持仓数量	ShortCombPositoinVolume	Number	
25	空头大边持仓数量	ShortPzdbPositionVolume	Number	
26	空头单腿持仓数量	ShortSinglePositionVolume	Number	
27	持仓盈亏（逐日盯市）	PositionProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
28	持仓盈亏（逐笔对冲）	PositionProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	
29	会员交易手续费	MemberFee	DecimalNumber	
30	客户交易手续费	ClientFee	DecimalNumber	
31	权利金收入	PremiumIn	DecimalNumber	
32	权利金支出	PremiumOut	DecimalNumber	
33	组合后会员保证金	AfterCombMemberMargin	DecimalNumber	
34	大边后会员保证金	AfterPzdbMemberMargin	DecimalNumber	
35	单腿会员保证金	SingleMemberMargin	DecimalNumber	
36	会员交易保证金	MemberMargin	DecimalNumber	
37	组合后客户保证金	AfterCombClientMargin	DecimalNumber	
38	大边后客户保证金	AfterPzdbClientMargin	DecimalNumber	
39	单腿客户保证金	SingleClientMargin	DecimalNumber	
40	客户交易保证金	ClientTradeMargin	DecimalNumber	

7.2.3 交易编码持仓明细文件

交易编码持仓明细文件见表18。

表18 交易编码持仓明细文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	
6	成交编号	TradeNo	Max12Text	
7	开仓日期	OpenDate	Date	
8	开仓时间	OpenTime	Time	
9	交易类型	TradeType	Fix1Text	
10	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
11	成交数量	TradeVolume	Number	
12	持仓数量	PositionVolume	Number	
13	开仓价格	OpenPrice	DecimalNumber	
14	结算价格	ClearPrice	DecimalNumber	
15	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
16	持仓盈亏（逐日盯市）	PositionProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
17	持仓盈亏（逐笔对冲）	PositionProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	
18	组合后会员保证金	AfterCombMemberMargin	DecimalNumber	
19	大边后会员保证金	AfterPzdbMemberMargin	DecimalNumber	
20	单腿会员保证金	SingleMemberMargin	DecimalNumber	
21	每手会员保证金	MemberMarginPerHand	DecimalNumber	可选
22	会员交易保证金	MemberMargin	DecimalNumber	
23	组合后客户保证金	AfterCombClientMargin	DecimalNumber	
24	大边后客户保证金	AfterPadbClientMargin	DecimalNumber	
25	单腿客户保证金	SingleClientMargin	DecimalNumber	
26	每手客户保证金	ClientMarginPerHand	DecimalNumber	可选
27	客户交易保证金	ClientTradeMargin	DecimalNumber	

7.2.4 交易编码合约资金文件

交易编码合约资金文件见表19。

表19 交易编码合约资金文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	

表 19 交易编码合约资金文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	
7	会员交易手续费	MemberTradeFee	DecimalNumber	
8	客户交易手续费	ClientTradeFee	DecimalNumber	
9	会员交易保证金	MemberTradeMargin	DecimalNumber	
10	客户交易保证金	ClientTradeMargin	DecimalNumber	
11	平仓盈亏（逐日盯市）	LiquidationProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
12	平仓盈亏（逐笔对冲）	LiquidationProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	
13	权利金收入	PremiumIn	DecimalNumber	
14	权利金支出	PremiumOut	DecimalNumber	
15	会员交割手续费	MemberDeliveryFee	DecimalNumber	
16	客户交割手续费	ClientDeliveryFee	DecimalNumber	
17	会员交割保证金	MemberDeliveryMargin	DecimalNumber	
18	客户交割保证金	ClientDeliveryMargin	DecimalNumber	
19	交割盈亏（逐日盯市）	DeliveryProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
20	交割盈亏（逐笔对冲）	DeliveryProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	
21	会员期权执行手续费	MemberExecuteFee	DecimalNumber	
22	客户期权执行手续费	ClientExecuteFee	DecimalNumber	
23	执行盈亏	ExecuteProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
24	持仓盈亏（逐日盯市）	PositionProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
25	持仓盈亏（逐笔对冲）	PositionProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	

7.2.5 交易编码交割持仓文件

交易编码交割持仓文件见表20。

表20 交易编码交割持仓文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	申请日期	ApplyDate	Date	
3	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
4	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
5	客户编码	CustNumber	Max15Text	
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	
7	交易类型	TradeType	Fix1Text	
8	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
9	结算价格	ClearPrice	DecimalNumber	
10	交割数量	DeliveryVolume	Number	

表 20 交易编码交割持仓文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
11	交割盈亏（逐日盯市）	DeliveryProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
12	交割盈亏（逐笔对冲）	DeliveryProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	
13	会员交割保证金	MemberDeliveryMargin	DecimalNumber	
14	客户交割保证金	ClientDeliveryMargin	DecimalNumber	
15	会员交割手续费	MemberDeliveryFee	DecimalNumber	
16	客户交割手续费	ClientDeliveryFee	DecimalNumber	

7.2.6 交易编码交割明细文件

交易编码交割明细文件见表21。

表21 交易编码交割明细文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	
7	开仓买卖标识	OpenTradeDirectionCode	Fix1Text	
8	开仓成交编号	OpenTradeNo	Max12Text	
9	开仓日期	OpenDate	Date	
10	开仓时间	OpenTime	Time	
11	开仓价格	OpenPrice	DecimalNumber	
12	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
13	交割数量	DeliveryVolume	Number	
14	交割结算价格	DeliveryClearPrice	DecimalNumber	
15	交割盈亏（逐日盯市）	DeliveryProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
16	交割盈亏（逐笔对冲）	DeliveryProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	

7.2.7 交易编码平仓明细文件

交易编码平仓明细文件见表22。

表22 交易编码平仓明细文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	

表 22 交易编码平仓明细文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	
7	开仓买卖标识	OpenTradeDirectionCode	Fix1Text	
8	开仓成交编号	OpenTradeNo	Max12Text	
9	平仓成交编号	LiquidationTradeNo	Max12Text	
10	开仓日期	OpenDate	Date	
11	开仓时间	OpenTime	Time	
12	开仓价格	OpenPrice	DecimalNumber	
13	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
14	平仓日期	LiquidationDate	Date	
15	平仓时间	LiquidationTime	Time	
16	平仓数量	LiquidationVolume	Number	
17	平仓价格	LiquidationPrice	DecimalNumber	
18	平仓盈亏（逐日盯市）	LiquidationProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
19	平仓盈亏（逐笔对冲）	LiquidationProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	

7.2.8 交易编码期权执行明细文件

交易编码期权执行明细文件见表23。

表23 交易编码期权执行明细文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	
7	开仓买卖标识	OpenTradeDirectionCode	Fix1Text	
8	开仓成交编号	OpenTradeNo	Max12Text	
9	开仓日期	OpenDate	Date	
10	开仓时间	OpenTime	Time	
11	开仓价格	OpenPrice	DecimalNumber	
12	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
13	执行数量	ExecuteVolume	Number	
14	执行价格	ExecutePrice	DecimalNumber	
15	执行盈亏	ExecuteProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	

7.2.9 交易会员资金变动文件

交易会员资金变动文件见表24。

表24 交易会员资金变动文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	资金账户编码	AccountID	Max30Text	
4	资金类型	FundType	Max12Text	
5	币种代码	CurrencyCode	Fix3Text	
6	资金金额	Amount	DecimalNumber	区分正负值

7.2.10 结算会员资金变动文件

结算会员资金变动文件接口见表25。

表25 结算会员资金变动文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	资金账户编码	AccountID	Max20Text	
4	资金类型	FundType	Max12Text	
5	币种代码	CurrencyCode	Fix3Text	
6	资金金额	Amount	DecimalNumber	区分正负值

7.2.11 客户资金变动文件

客户资金变动文件接口见表26。

表26 客户资金变动文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	资金账户编码	AccountID	Max30Text	
4	资金类型	FundType	Max12Text	
5	币种代码	CurrencyCode	Fix3Text	
6	资金金额	Amount	DecimalNumber	区分正负值

7.2.12 成交明细文件

成交明细文件接口见表27。

表27 成交明细文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	ClientID	Fix12Text	
5	合约代码	InstrumentID	Max30Text	
6	成交编号	TradeNo	Max30Text	
7	成交数量	TradeVolume	Number	
8	成交价格	TradePrice	DecimalNumber	
9	成交金额	TradeMoney	DecimalNumber	
10	成交时间	TradeTime	Time	
11	交易类型	TradeType	Fix1Text	
12	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
13	开平标志	OpenLiquidationIndicator	Fix1Text	
14	报单号	OrderID	Max12Text	
15	席位代码	SeatID	Max30Text	
16	短线量	TodayTradeVolume	Number	
17	短线前会员交易手续费	TodayClearMemberTradeFee	DecimalNumber	
18	短线前客户交易手续费	TodayMemberTradeFee	DecimalNumber	
20	会员交易手续费	MemberTradeFee	DecimalNumber	
21	客户交易手续费	ClientTradeFee	DecimalNumber	
23	会员结算手续费	MemberClearFee	DecimalNumber	
24	客户结算手续费	ClientClearFee	DecimalNumber	
25	平仓盈亏（逐日盯市）	OffsetProfitloss	DecimalNumber	
26	平仓盈亏（逐笔对冲）	LiquidationProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	
27	权利金收入	PremiumIn	DecimalNumber	
28	权利金支出	PremiumOut	DecimalNumber	

7.2.13 策略组合保证金明细文件

策略组合保证金明细文件接口见表28。

表28 策略组合保证金明细文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约组号	CombContractCode	Max30Text	
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	

表 28 策略组合保证金明细文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
7	交易类型	TradeType	Fix1Text	
8	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
9	持仓数量	PositionVolume	Number	
10	组合前会员保证金	BeforeCombMemberMargin	DecimalNumber	
11	组合后会员保证金	AfterCombMemberMargin	DecimalNumber	
12	组合前客户保证金	BeforeCombClientMargin	DecimalNumber	
13	组合后客户保证金	AfterCombClientMargin	DecimalNumber	

7.2.14 单向大边保证金明细文件

单向大边保证金明细文件接口见表29。

表29 单向大边保证金明细文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	
7	买持仓数量	BuyPositionVolume	Number	
8	卖持仓数量	SellPositionVolume	Number	
9	大边前会员保证金	BeforePzdbMemberMargin	DecimalNumber	
10	大边后会员保证金	AfterPzdbMemberMargin	DecimalNumber	
11	大边前客户保证金	BeforePzdbClientMargin	DecimalNumber	
12	大边后客户保证金	AfterPzdbClientMargin	DecimalNumber	

7.3 账户资金模块文件

7.3.1 账户资金模块文件列表

账户资金模块文件列表见表30。

表30 账户资金模块文件类接口列表

接口名称	说明	模块输入/输出	备注
本地委托	清算参数输入	输出	见 7.3.2 同名接口说明
标的物收盘价	清算参数输入	输出	见 7.3.3 同名接口说明
隔夜回购定盘利率	清算参数输入	输出	见 7.3.4 同名接口说明
合约信息	清算参数输入	输出	见 7.3.5 同名接口说明
汇率	清算参数输入	输出	见 7.3.6 同名接口说明
交易编码昨持仓	清算参数输入	输出	见 7.3.7 同名接口说明
交易编码昨持仓明细	清算参数输入	输出	见 7.3.8 同名接口说明

表 30 账户资金模块文件类接口列表（续）

接口名称	说明	模块输入/输出	备注
交易编码昨交割持仓	清算参数输入	输出	见 7.3.9 同名接口说明
交易会员或客户账户信息	清算参数输入	输出	见 7.3.10 同名接口说明
结算会员交割保证金率	清算参数输入	输出	见 7.3.11 同名接口说明
结算会员交割手续费	清算参数输入	输出	见 7.3.12 同名接口说明
结算会员交易保证金率	清算参数输入	输出	见 7.3.13 同名接口说明
结算会员交易手续费率	清算参数输入	输出	见 7.3.14 同名接口说明
结算会员期权执行手续费率	清算参数输入	输出	见 7.3.15 同名接口说明，期权使用
结算会员移仓手续费率	清算参数输入	输出	见 7.3.16 同名接口说明
客户交割保证金率	清算参数输入	输出	见 7.3.17 同名接口说明
客户交割手续费率	清算参数输入	输出	见 7.3.18 同名接口说明
客户交易保证金率	清算参数输入	输出	见 7.3.19 同名接口说明
客户交易手续费率	清算参数输入	输出	见 7.3.20 同名接口说明
客户期权执行手续费率	清算参数输入	输出	见 7.3.21 同名接口说明
客户移仓手续费率	清算参数输入	输出	见 7.3.22 同名接口说明
期权保证金参数	清算参数输入	输出	见 7.3.23 同名接口说明，期权使用
客户保障基金费率	清算参数输入	输出	见 7.3.24 同名接口说明
会员基本信息	交易系统数据上场	输出	见 7.3.25 同名接口说明，可选
合约组信息	交易系统数据上场	输出	见 7.3.26 同名接口说明
客户合约组保证金类型	交易系统数据上场	输出	见 7.3.27 同名接口说明
客户基本信息	交易系统数据上场	输出	见 7.3.28 同名接口说明，可选
客户交易手续费率	交易系统数据上场	输出	见 7.3.20 同名接口说明
客户资金数据	交易系统数据上场	输出	见 7.3.29 同名接口说明
期权最低保障系数表	交易系统数据上场	输出	见 7.3.30 同名接口说明
会员期权最小保证金	交易系统数据上场	输出	见 7.3.31 同名接口说明
客户持仓数据	交易系统数据上场	输出	见 7.3.32 同名接口说明
客户交易编码及资金账户	交易系统数据上场	输出	见 7.3.33 同名接口说明
客户套利保值额度	交易系统数据上场	输出	见 7.3.34 同名接口说明
标的物收盘价	交易系统数据上场	输出	见 7.3.3 同名接口说明
客户交易保证金率	交易系统数据上场	输出	见 7.3.19 同名接口说明
交易权限	交易系统数据上场	输出	见 7.3.35 同名接口说明
策略组合保证金明细	清算结果输出	输入	见 7.2.13 同名接口说明
成交明细	清算结果输出	输入	见 7.2.12 同名接口说明
单向大边保证金明细	清算结果输出	输入	见 7.2.14 同名接口说明
交易编码持仓	清算结果输出	输入	见 7.2.2 同名接口说明
交易编码持仓明细	清算结果输出	输入	见 7.2.3 同名接口说明
交易编码合约资金	清算结果输出	输入	见 7.2.4 同名接口说明
交易编码交割持仓	清算结果输出	输入	见 7.2.5 同名接口说明

表 30 账户资金模块文件类接口列表（续）

接口名称	说明	模块输入/输出	备注
交易编码交割明细	清算结果输出	输入	见 7.2.6 同名接口说明
交易编码平仓明细	清算结果输出	输入	见 7.2.7 同名接口说明
交易编码期权执行明细	清算结果输出	输入	见 7.2.8 同名接口说明
交易会员资金变动	清算结果输出	输入	见 7.2.9 同名接口说明
结算会员资金变动	清算结果输出	输入	见 7.2.10 同名接口说明
客户资金变动	清算结果输出	输入	见 7.2.11 同名接口说明

7.3.2 本地委托文件

本地委托文件接口见表31。

表31 本地委托文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
3	客户编码	CustNumber	Max15Text	
4	本地委托编号	LocalOrderID	Max12Text	
5	系统委托编号	SysOrderID	Max12Text	
6	委托方式	CommitTypeCode	Fix1Text	

7.3.3 标的物收盘价文件

标的物收盘价文件接口见表32。

表32 标的物收盘价文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	合约标的	UnderlyingID	Max20Text	
3	收盘价格	ClosePrice	DecimalNumber	
4	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
5	币种代码	CurrencyCode	Fix3Text	

7.3.4 隔夜回购定盘利率文件

隔夜回购定盘利率文件接口见表33。

表33 隔夜回购定盘利率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	计息日期	InterestDate	Date	
3	利率	InterestRate	DecimalNumber	
4	计息天数	Days	Number	

7.3.5 合约信息文件

合约信息文件接口见表34。

表34 合约信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
3	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
4	合约代码	ContractCode	Max30Text	
5	报价币种代码	QuoteCurrencyCode	Fix1Text	
6	结算币种代码	ClearCurrencyCode	Fix1Text	
7	合约乘数	InstrumentMultiple	Number	
8	合约面值	FaceValue	Number	
9	报价乘数	PriceUnit	Number	汇率期货使用
10	月份	Month	Max12Text	
11	最后交易日期	LastTradeDate	Date	
12	合约标的	UnderlyingID	Max20Text	
13	标的乘数	UnderlyingUnit	Number	
14	执行价格	ExecutePrice	DecimalNumber	期权使用
15	期权类型	OptionType	Fix1Text	
16	开始行权日	ExecuteStartDate	Date	
17	最后行权日	ExecuteLastDate	Date	
18	行权方式代码	ExecuteType	Fix1Text	
19	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
20	结算价格	ClearPrice	DecimalNumber	
21	最低保证金比例	MinHoldBalance	DecimalNumber	可选
22	合约类别	InstrumentType	Max4Text	可选

7.3.6 汇率文件

汇率文件接口见表35。

表35 汇率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
4	上一日汇率	LastExchangeRate	DecimalNumber	
5	汇率	ExchangeRate	DecimalNumber	

7.3.7 交易编码昨持仓文件

交易编码昨持仓文件接口见表36。

表36 交易编码昨持仓文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	
7	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
8	昨多头持仓数量	LongPositionEnd	Number	
9	昨空头持仓数量	ShortPositionEnd	Number	
10	昨会员保证金	MemberMargin	DecimalNumber	
11	昨客户保证金	ClientMargin	DecimalNumber	

7.3.8 交易编码昨持仓明细文件

交易编码昨持仓明细文件接口见表37。

表37 交易编码昨持仓明细文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
4	客户编码	CustNumber	Max15Text	
5	合约代码	ContractCode	Max30Text	
6	成交编号	TradeNo	Fix12Text	
7	开仓日期	OpenDate	Date	
8	开仓时间	OpenTime	Time	
9	交易类型	TradeType	Fix1Text	
10	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
11	成交数量	TradeVolume	Number	
12	持仓数量	PositionVolume	Number	
13	开仓价格	OpenPrice	DecimalNumber	
14	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
15	持仓盈亏（逐日盯市）	PositionProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
16	持仓盈亏（逐笔对冲）	PositionProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	
17	昨会员保证金	MemberMargin	DecimalNumber	
18	昨客户保证金	ClientMargin	DecimalNumber	

7.3.9 交易编码昨交割持仓文件

交易编码昨交割持仓文件接口见表38。

表38 交易编码昨交割持仓文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	申请日期	ApplyDate	Date	
3	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
4	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
5	客户编码	CustNumber	Max15Text	
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	
7	交易类型	TradeType	Fix1Text	
8	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
9	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
10	交割数量	DeliveryVolume	Number	
11	交割盈亏（逐日盯市）	deliveryProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	可选
12	交割盈亏（逐笔对冲）	DeliveryProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	可选
13	会员交割保证金	MemberDeliveryMargin	DecimalNumber	可选
14	客户交割保证金	ClientDeliveryMargin	DecimalNumber	可选
15	会员交割手续费	MemberDeliveryFee	DecimalNumber	可选
16	客户交割手续费	ClientDeliveryFee	DecimalNumber	可选

7.3.10 交易会员或客户账户信息文件

交易会员或客户账户信息文件接口见表39。

表39 交易会员或客户账户信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易会员或客户标识	BrokerInvestorFlag	Fix1Text	
3	交易会员或客户编码	Broker CustNumber	Max12Text	
4	结算会员资金账户	ClearMemberAccountNo	Max10Text	
5	交易会员或客户资金账户	BrokerInvestorAccount	Max12Text	
6	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
7	结算会员编码	ClearingMemberNumber	Fix4Text	
8	交易会员编码	TradingMemberNumber	Fix4Text	
9	客户编码	CustNumber	Max15Text	
10	交易类型	TradeType	Fix1Text	

7.3.11 结算会员交割保证金率文件

结算会员交割保证金率文件接口见表40。

表40 结算会员交割保证金率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	结算日期	ClearingDate	Date	
3	结算会员编码	ClearingMemberNumber	Max4Text	
4	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
5	交易类型	TradeType	Fix1Text	
6	多头保证金率	LmarginRate	DecimalNumber	按成交额
7	多头保证金单价	LMarginPrice	DecimalNumber	
8	空头保证金率	SmarginRate	DecimalNumber	
9	空头保证金单价	SMarginPrice	DecimalNumber	

7.3.12 结算会员交割手续费文件

结算会员交割手续费文件接口见表41。

表41 结算会员交割手续费文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	结算日期	ClearingDate	Date	
3	结算会员编码	ClearingMemberNumber	Max4Text	
4	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
5	交易类型	TradeType	Fix1Text	
6	交割方向	DeliveryDirection	Fix1Text	
7	交割手续费率	DeliveryFeeRate	DecimalNumber	
8	交割手续费单价	DeliveryFeePrice	DecimalNumber	

7.3.13 结算会员交易保证金率文件

结算会员交易保证金率文件接口见表42。

表42 结算会员交易保证金率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	结算日期	ClearingDate	Date	
3	结算会员编码	ClearingMemberNumber	Max4Text	
4	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
5	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	
7	交易类型	TradeType	Fix1Text	
8	多头保证金率	LmarginRate	DecimalNumber	
9	多头保证金单价	LMarginPrice	DecimalNumber	
10	空头保证金率	SMarginRate	DecimalNumber	

表 42 结算会员交易保证金率文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
11	空头保证金单价	SMarginPrice	DecimalNumber	

7.3.14 结算会员交易手续费率文件

结算会员交易手续费率文件接口见表43。

表43 结算会员交易手续费率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	结算日期	ClearingDate	Date	
3	结算会员编码	ClearingMemberNumber	Max4Text	
4	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
5	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	
7	交易类型	TradeType	Fix1Text	
8	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
9	开仓交易手续费率	OpenFeeRate	DecimalNumber	
10	开仓交易手续费单价	OpenFeePrice	DecimalNumber	
11	短线开仓交易手续费率	TodayOpenFeeRate	DecimalNumber	可选
12	短线开仓交易手续费单价	TodayOpenFeePrice	DecimalNumber	可选
13	平仓交易手续费率	LiquidationFeeRate	DecimalNumber	
14	平仓交易手续费单价	LiquidationFeePrice	DecimalNumber	
15	短线平仓交易手续费率	TodayLiquidationFeeRate	DecimalNumber	
16	短线平仓交易手续费单价	TodayLiquidationFeePrice	DecimalNumber	

7.3.15 结算会员期权执行手续费率文件

结算会员期权执行手续费率文件接口见表44。

表44 结算会员期权执行手续费率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	结算日期	ClearingDate	Date	
3	结算会员编码	ClearingMemberNumber	Max4Text	
4	期权品种代码	OptionVarietyCode	Max20Text	如 IO（沪深 300 股指期权合约） HO（上证 50 股指期权合约）
5	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	

表 44 结算会员期权执行手续费率文件(续)

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	
7	交易类型	TradeType	Fix1Text	
8	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
9	期权执行手续费率	ExecFeeRate	DecimalNumber	
10	期权执行手续费单价	ExecFeePrice	DecimalNumber	

7.3.16 结算会员移仓手续费率文件

结算会员移仓手续费率文件接口见表45。

表45 结算会员移仓手续费率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	结算日期	ClearingDate	Date	
3	结算会员编码	ClearingMemberNumber	Max4Text	
4	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
5	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	
7	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
8	移仓手续费率	PosTransferFeeRate	DecimalNumber	
9	移仓手续费单价	PosTransferFeePrice	DecimalNumber	

7.3.17 客户交割保证金率文件

客户交割保证金率文件接口见表46。

表46 客户交割保证金率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
3	客户编码	CustNumber	Max15Text	
4	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
5	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	
7	多头保证金率	LMarginRate	DecimalNumber	按成交额
8	多头保证金单价	LMarginPrice	DecimalNumber	
9	空头保证金率	SMarginRate	DecimalNumber	
10	空头保证金单价	SMarginPrice	DecimalNumber	

7.3.18 客户交割手续费率文件

客户交割手续费率文件接口见表47。

表47 客户交割手续费率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
3	客户编码	CustNumber	Max15Text	
4	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
5	交易类型	TradeType	Fix1Text	
6	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
7	交割手续费率	DeliveryFeeRate	DecimalNumber	
8	交割手续费单价	DeliveryFeePrice	DecimalNumber	

7.3.19 客户交易保证金率文件

客户交易保证金率文件接口见表48。

表48 客户交易保证金率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
3	客户编码	CustNumber	Max15Text	
4	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
5	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
6	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
7	合约代码	ContractCode	Max30Text	
8	交易类型	TradeType	Fix1Text	
9	多头保证金率	LMarginRate	DecimalNumber	
10	多头保证金单价	LMarginPrice	DecimalNumber	
11	空头保证金率	SMarginRate	DecimalNumber	
12	空头保证金单价	SMarginPrice	DecimalNumber	

7.3.20 客户交易手续费率文件

客户交易手续费率文件接口见表49。

表49 客户交易手续费率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
3	客户编码	CustNumber	Max15Text	
4	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
5	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
6	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
7	合约代码	ContractCode	Max30Text	

表 49 客户交易手续费率文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
8	交易类型	TradeType	Fix1Text	
9	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
10	委托方式	CommitTypeCode	Fix1Text	
11	开仓交易手续费率	OpenFeeRate	DecimalNumber	
12	开仓交易手续费单价	OpenFeePrice	DecimalNumber	
13	短线开仓交易手续费率	TodayOpenFeeRate	DecimalNumber	
14	短线开仓交易手续费单价	TodayOpenFeePrice	DecimalNumber	
15	平仓交易手续费率	LiquidationFeeRate	DecimalNumber	
16	平仓交易手续费单价	LiquidationFeePrice	DecimalNumber	
17	短线平仓交易手续费率	TodayLiquidationFeeRate	DecimalNumber	
18	短线平仓交易手续费单价	TodayLiquidationFeePrice	DecimalNumber	

7.3.21 客户期权执行手续费率文件

客户期权执行手续费率文件接口见表50。

表50 客户期权执行手续费率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
3	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
4	合约代码	ContractCode	Max30Text	
5	客户编码	CustNumber	Max15Text	
6	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
7	期权品种代码	OptionVarietyCode	Max20Text	如 IO/HO
8	交易类型	TradeType	Fix1Text	
9	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
10	期权执行手续费率	ExecFeeRate	DecimalNumber	
11	期权执行手续费单价	ExecFeePrice	DecimalNumber	

7.3.22 客户移仓手续费率文件

客户移仓手续费率文件接口见表51。

表51 客户移仓手续费率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
3	客户编码	CustNumber	Max15Text	
4	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
5	结算日期	ClearingDate	Date	

表 51 客户移仓手续费率文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
6	期权系列代码	OptionSetCode	Max20Text	
7	合约代码	ContractCode	Max30Text	
8	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
9	移仓手续费率	PosTransferFeeRate	DecimalNumber	
10	移仓手续费单价	PosTransferFeePrice	DecimalNumber	

7.3.23 期权保证金参数文件

期权保证金参数文件接口见表52。

表52 期权保证金参数文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	期权品种代码	OptionVarietyCode	Max20Text	如 IO/HO
3	最低保障系数	MinSecurityCoefficient	DecimalNumber	

7.3.24 客户保障基金费率文件

客户保障基金费率文件接口见表53。

表53 客户保障基金费率文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	手续费率	TransFeeRate	DecimalNumber	
4	手续费单价	TransFeePrice	DecimalNumber	

7.3.25 会员基本信息文件

会员基本信息文件接口见表54。

表54 会员基本信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
4	会员名称	MemberName	Max30Text	
5	席位代码	SeatID	Max30Text	
6	席位密码	SeatPwd	Max20Text	

7.3.26 合约组信息文件

合约组信息文件接口见表55。

表55 合约组信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	合约组代码	InstrumentComID	Fix30Text	
4	合约代码	ContractCode	Max30Text	

7.3.27 客户合约组保证金类型文件

客户合约组保证金类型文件接口见表56。

表56 客户合约组保证金类型文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	交易编码	TradeID	Max30Text	
4	合约组代码	InstrumentComID	Max18Text	
5	保证金收取类型	MarginChargeType	Fix1Text	

7.3.28 客户基本信息文件

客户基本信息文件接口见表57。

表57 客户基本信息文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易日期	TradingDate	Date	
2	客户编码	CustNumber	Max15Text	
3	客户类型代码	ClientType	Fix1Text	
4	客户名称	ClientName	Max30Text	
5	证件类型代码	IDType	Fix1Text	
6	证件号码	IDNumber	Max18Text	
7	出生日期	Birthday	Date	
8	联系地址	Address	Max50Text	
9	邮政编码	PostCode	Fix6Text	

7.3.29 客户资金数据文件

客户资金数据文件接口见表58。

表58 客户资金数据文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易日期	TradingDate	Date	
2	资金账户编码	AccountID	Max12Text	
3	客户编码	CustNumber	Fix12Text	客户编号

表 58 客户资金数据文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
4	上日质押金额	LastMortgage	DecimalNumber	可选
5	结算准备金	ReserveMoney	DecimalNumber	
6	冻结资金	FreezeAmount	DecimalNumber	可选
7	信用额度	CreditLine	DecimalNumber	可选
8	交易所保证金	LastTradeMargin	DecimalNumber	可选
9	币种代码	CurrencyCode	Fix3Text	
10	货币质押余额	PledgeBalance	DecimalNumber	可选
11	期初特殊品种代码占用保证金	OriginSpecialProductMargin	DecimalNumber	可选，计算货币质押（交易 交割）
12	期初特殊品种代码交易所保证金	OriginSpecialProductExMargin	DecimalNumber	可选
13	保证金总额	TotalMargin	DecimalNumber	保证金总额=交易保证金+交割保证金
14	交易保证金	TradeMargin	DecimalNumber	
15	交割保证金	DeliveryMargin	DecimalNumber	
16	保证金配比	MarginRate	DecimalNumber	
17	可用资金	AvailableFund	DecimalNumber	
18	可提资金	WithdrawFund	DecimalNumber	

7.3.30 期权最低保障系数文件

期权最低保障系数文件接口见表59。

表59 期权最低保障系数文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	期权品种代码	OptionVarietyCode	Max20Text	如 IO/HO
3	最低保障系数	MinSecurityCoefficient	DecimalNumber	

7.3.31 会员期权最小保证金文件

会员期权最小保证金文件接口见表60。

表60 会员期权最小保证金文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	客户编码	CustNumber	Max15Text	
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
4	期权品种代码	OptionVarietyCode	Max20Text	如 IO/HO

表 60 会员期权最小保证金文件（续）

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
5	期权系列代码	DeliveryDate	Date	
6	合约代码	ContractCode	Max30Text	
7	最低保证金比例	MinHoldBalance	DecimalNumber	

7.3.32 客户持仓数据文件

客户持仓数据文件接口见表61。

表61 客户持仓数据文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	结算日期	ClearingDate	Date	
2	资金账户编码	AccountID	Max30Text	
3	合约代码	ContractCode	Max30Text	
4	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
5	交易类型	TradeType	Fix1Text	
6	持仓数量	PositionVolume	Number	
7	交易保证金	TradeMargin	DecimalNumber	
8	持仓盈亏（逐日盯市）	PositionProfitLossMarketToMarket	DecimalNumber	
9	持仓盈亏（逐笔对冲）	PositionProfitLossIndividualHedge	DecimalNumber	
10	持仓均价	AveragePosition	DecimalNumber	
11	前结算价格	LastClearPrice	DecimalNumber	
12	结算价格	ClearPrice	DecimalNumber	
13	交易编码	TradeID	Max30Text	
14	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
15	交易会员编码	TradingMemberFlag	Fix1Text	
16	币种代码	CurrencyCode	Fix3Text	

7.3.33 客户交易编码及资金账户文件

客户交易编码及资金账户文件接口见表62。

表62 客户交易编码及资金账户文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易日期	TradingDate	Date	
2	客户编码	CustNumber	Max15Text	
3	资金账户编码	AccountID	Max30Text	
4	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
5	交易编码	TradeID	Max30Text	
6	交易类型	TradeType	Fix1Text	

7.3.34 客户套利保值额度文件

客户套利保值额度文件接口见表63。

表63 客户套利保值额度文件

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	客户编码	CustNumber	Max15Text	
2	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
3	品种代码	FutureVarietyCode	Max20Text	如 IF/TF
4	交割月份标志	DeliveryDateType	Fix1Text	
5	买卖方向代码	TradeDirectionCode	Fix1Text	
6	开始日期	StartDate	Date	
7	结束日期	EndDate	Date	
8	持仓额度	Volume	Number	
9	交易类型	TradeType	Fix1Text	

7.3.35 交易权限

交易权限接口见表64。

表64 交易权限

序号	字段名	字段英文名	数据类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	Max3Text	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	Max4Text	
3	客户编码	CustNumber	Max15Text	
4	合约或者品种	ProductInstrument	Fix1Text	
5	交易权限	Authority	Max30Text	

7.4 风控模块文件

7.4.1 风控模块文件列表

风控模块文件列表见表65。

表65 风控模块文件列表

接口名称	说明	模块输入/输出	备注
客户交易编码及资金账户	风控系统数据上场	输入	见 7.3.33 同名接口说明
客户资金数据	风控系统数据上场	输入	见 7.3.29 同名接口说明
客户持仓数据	风控系统数据上场	输入	见 7.3.32 同名接口说明
客户交易保证金率	风控系统数据上场	输入	见 7.3.19 同名接口说明
客户交易手续费率	风控系统数据上场	输入	见 7.3.20 同名接口说明
客户合约组保证金类型	风控系统数据上场	输入	见 7.3.27 同名接口说明
客户基本信息	风控系统数据上场	输入	见 7.3.28 同名接口说明

7.5 实时消息接口

7.5.1 实时消息接口列表

实时消息接口列表见表66。

表66 实时消息接口列表

接口名称	接口说明	接口方式	备注
成交	交易	推送	见 7.5.2 同名接口说明
委托	交易	推送	见 7.5.3 同名接口说明
行情（单腿/组合）	交易	推送	见 7.5.4 同名接口说明
交易权限	交易	推送	见 7.5.5 同名接口说明
账户申请	资金账户	请求/应答	见 7.5.6 同名接口说明
账户同步	资金账户	请求/应答	见 7.5.7 同名接口说明
资金同步	资金账户	请求/应答	见 7.5.8 同名接口说明

7.5.2 成交接口

成交接口见表67。

表67 成交接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件，见 JR/T 0046—2009
2	系统委托号	SysOrderID	[1..1]	Reference	组件，见 JR/T 0046—2009
3	客户信息	CustomerInfo	[1..1]	CustomerInfo	组件
4	成交信息	TradeInfo	[1..1]	TradeInfo	组件
5	站点信息	StationInfo	[0..1]	StationInfo	组件

7.5.3 委托接口

委托接口见表68。

表68 委托接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件，见 JR/T 0046—2009
2	本地委托编号	LocalOrderID	[1..1]	Reference	组件，见 JR/T 0046—2009
3	客户信息	CustomerInfo	[1..1]	CustomerInfo	组件
4	委托信息	OrderInfo	[1..1]	OrderInfo	组件
5	站点信息	StationInfo	[0..1]	StationInfo	组件

7.5.4 行情接口

行情接口见表69。

表69 行情（单腿/组合）接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件，见 JR/T 0046—2009
2	合约信息	ContractInfo	[1..1]	ContractInfo	组件
3	行情信息	PriceInfo	[1..1]	PriceInfo	组件

7.5.5 交易权限接口

交易权限接口见表70。

表70 交易权限接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件, 见 JR/T 0046—2009
2	客户信息	CustomerInfo	[1..1]	CustomerInfo	组件
3	交易权限信息	AuthorityInfo	[1..1]	AuthorityInfo	组件

7.5.6 账户申请接口

7.5.6.1 账户申请请求接口

在账户申请请求接口中,系统根据消息头中的业务功能码确定消息的具体业务功能。消息体中的银行方账户或证券方账户若包含密码,密码的加密传输方式由主次席双方约定。消息体中应包含转账金额,转账金额中包含币种信息,缺省为人民币。转账金额应大于0。如果业务过程中涉及转账费用,消息体中应包含费用标志,指明是费用支付方,同时包含发送方或接收方应支付的费用信息。接口见表71。

表71 账户申请请求接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件, 见 JR/T 0046—2009
2	转账类型	UETransferType	[1..1]	TransferType	
3	发卡银行	Bank	[1..1]	Institution	组件, 见 JR/T 0046—2009
4	预约流水号	BookReference	[0..1]	Reference	组件, 见 JR/T 0046—2009
5	重发标志	ResendFlag	[0..1]	YesNoIndicator	
6	客户信息	Customer	[1..1]	Customer	组件, 见 JR/T 0046—2009
7	银行方账户	BankAccount	[0..1]	Account	组件, 见 JR/T 0046—2009
8	证券方账户	SecuritiesAccount	[0..1]	Account	组件, 见 JR/T 0046—2009
9	币种代码	Currency	[1..1]	CurrencyCode	
10	转账金额	TransferAmount	[1..1]	Amount	
11	发送方的代理机构	SenderAgent	[0..1]	Institution	组件, 见 JR/T 0046—2009
12	接收方的代理机构	ReceiverAgent	[0..1]	Institution	组件, 见 JR/T 0046—2009
13	费用支付标志	FeePayFlag	[0..1]	FeeFlagCode	
14	发送方费用	SenderFee	[0..1]	Amount	
15	接收方费用	ReceiverFee	[0..1]	Amount	
16	发送方给接收方消息	Message	[0..1]	Max128Text	

表 71 账户申请请求接口（续）

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
17	费用	Fee	[0..1]	Amount	
18	摘要说明	Digest	[0..1]	Max35Text	
<p>注1：发卡银行参考JR/T 0046—2009标准协议中的机构标识。</p> <p>注2：如果是机构转账业务，消息体中流水号可能包含预约流水号。</p> <p>注3：重发标志。如果重发标志为‘Y’，表示本消息可能是重新发送的代理转账交易，其消息流水号应和以前发送的流水号一致。如果接收方已经处理该消息，业务上不需再次进行转账交易，但应返回被重复消息的处理结果。</p> <p>注4：摘要的填充内容是系统、柜台操作员提交的与本次操作相关的一些文字说明信息，摘要内容要求与本次操作的操作流水一起保存在相关日志中或者流水中。</p>					

7.5.6.2 账户申请应答接口

本消息用来回应对方发来的会话消息。消息头中的业务功能码应与回应消息中的业务功能码一致。消息头中的消息流水号必选，填写本消息的流水号。消息头中的相关流水号必选，填写与之对应的请求消息流水号。返回结果指示业务操作是否成功。账户申请应答接口见表72。

表72 账户申请应答接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件，见 JR/T 0046—2009
2	返回结果	ReturnResult	[1..1]	ReturnResult	组件，见 JR/T 0046—2009

7.5.7 账户同步接口

7.5.7.1 账户同步请求接口

系统根据消息头中的业务功能码确定消息的具体业务功能。客户信息、银行方账户、期货方账户、币种、汇钞标志、期货方账户余额均应为最新的信息。若账户变更类型代码为销户，则消息中应该包含银行方账户和证券方账户，指示被撤销的账户或解除签约关系的账户。每次只能向一个次席系统发起同步。账户同步请求接口见表73。

表73 账户同步请求接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件，见 JR/T 0046—2009
2	账户变更类型代码	AccountChgType	[1..1]	UEAccountChgType	
3	发卡银行	Bank	[1..1]	Institution	组件，见 JR/T 0046—2009
4	客户信息	Customer	[1..1]	Customer	组件，见 JR/T 0046—2009
5	代理人信息	Agent	[0..1]	Agent	组件，见 JR/T 0046—2009
6	银行方账户	BankAccount	[0..1]	Account	组件，见 JR/T 0046—2009

表 73 账户同步请求接口（续）

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
7	新银行方账户	NewBankAccount	[0..1]	Account	组件，见 JR/T 0046—2009
8	证券方账户	SecuritiesAccount	[0..1]	Account	组件，见 JR/T 0046—2009
9	币种代码	CurrencyCode	[0..1]	CurrencyCode	
10	汇钞标志	CashExCode	[0..1]	CashExCode	
11	期货方账户余额	SecuritiesBalance	[0..1]	Balance	
12	摘要说明	Digest	[0..1]	Max35Text	
13	原始交易发起方	OriginTradeSource	[1..1]	InstitutionType	

7.5.7.2 账户同步应答接口

本消息用来回应对方发来的会话消息。消息头中的业务功能码应与回应消息中的业务功能码一致。消息头中的消息流水号必选，填写本消息的流水号。消息头中的相关流水号必选，填写与之对应的请求消息流水号。返回结果指示业务操作是否成功。账户同步应答接口见表74。

表74 账户同步应答接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件，见 JR/T 0046—2009
2	返回结果	ReturnResult	[1..1]	ReturnResult	组件，见 JR/T 0046—2009

7.5.8 资金同步接口

7.5.8.1 资金同步请求接口

系统根据消息头中的业务功能码确定消息的具体业务功能。资金同步请求接口见表75。

表75 资金同步请求接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件，见 JR/T 0046—2009
2	转账类型	TransferType	[1..1]	UETransferType	
3	发卡银行	Bank	[1..1]	Institution	组件，见 JR/T 0046—2009
4	期货方流水号	FutureReference	[0..1]	Reference	组件，见 JR/T 0046—2009
5	银行方流水号	BankReference	[0..1]	Reference	组件，见 JR/T 0046—2009
6	次席申请流水号	SecondCounterRequestReference	[0..1]	Reference	组件，见 JR/T 0046—2009
7	客户信息	Customer	[1..1]	Customer	组件，见 JR/T 0046—2009

表 75 资金同步请求接口（续）

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
8	银行方账户	BankAccount	[0..1]	Account	组件，见 JR/T 0046—2009
9	证券方账户	SecuritiesAccount	[0..1]	Account	组件，见 JR/T 0046—2009
10	币种代码	CurrencyCode	[1..1]	CurrencyCode	
11	转账金额	TransferAmount	[1..1]	Amount	
12	证券方账户余额	SecuritiesBalance	[0..1]	Balance	组件，见 JR/T 0046—2009
13	银行方账户余额	BankAccountBalance	[0..1]	Balance	组件，见 JR/T 0046—2009
14	摘要说明	Digest	[0..1]	Max35Text	
15	原始交易发起方	OriginTradeSource	[1..1]	InstitutionType	
注1：发卡银行参考 JR/T 0046—2009 标准协议中的机构标识。 注2：若此笔转账涉及资金冻结，则消息头中的相关消息流水号需要填写资金冻结交易的消息流水号。 注3：主席代理次席转账的转账结果同步，消息头中的相关消息流水号为主席代理次席转账请求的消息流水号。 注4：期货方流水号为主席和银行之间转账业务，主席方的流水号。 注5：银行方流水号为主席和银行之间转账业务，银行方的流水号。 注6：主席代理次席转账的转账结果同步，次席申请流水号为次席业务申请的流水号。 注7：当转账类型是查询银行方账户余额时，要填写银行方账户余额。 注8：每次只能向一个次席系统发起同步。					

7.5.8.2 资金同步应答接口

本消息用来回应对方发来的会话消息。消息头中的业务功能码应与回应消息中的业务功能码一致。消息头中的消息流水号必选，填写本消息的流水号。消息头中的相关流水号必选，填写与之对应的请求消息流水号。返回结果指示业务操作是否成功。资金同步应答接口见表76。

表 76 资金同步应答接口

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	消息头	MessageHeader	[1..1]	MessageHeader	组件，见 JR/T 0046—2009
2	返回结果	ReturnResult	[1..1]	ReturnResult	组件，见 JR/T 0046—2009

8 业务组件

8.1 客户信息组件

客户信息组件的名称为：CustomerInfo。包含客户编码、交易会员编码、交易场所代码三个业务要素。见表77。

表 77 客户信息组件

索引	业务要素	英文名称	重复	元素类型	备注
1	客户编码	CustNumber	[1..1]	Max4Text	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	[1..1]	Max15Text	
3	交易场所代码	ExchangeCode	[0..1]	Max3Text	

8.2 成交信息组件

成交信息组件的名称为：TradeInfo。见表78。

表78 成交信息组件

索引	业务要素	英文名称	重复	元素类型	备注
1	系统委托编号	SystemCommitCode	[1..1]	Max12Text	
2	交易会员编码	TradingMemberNumber	[1..1]	Max4Text	
3	客户编码	CustNumber	[1..1]	Max15Text	
4	交易场所代码	ExchangeCode	[1..1]	Max3Text	
5	成交编号	TradeNo	[1..1]	Reference	组件，见 JR/T 0046—2009
6	合约代码	ContractCode	[1..1]	Max30Text	
7	买卖方向代码	TradeDirectionCode	[1..1]	Fix1Text	
8	开平标志	OpenLiquidationIndicator	[1..1]	Fix1Text	
9	成交价格	TradePrice	[1..1]	DecimalNumber	
10	成交数量	TradeVolume	[1..1]	Number	
11	交易类型	TradeType	[1..1]	Fix1Text	
12	操作员编号	OperatorNo	[1..1]	Max18Text	
13	强平原因代码	ForcedLiquidationReasonCode	[1..1]	Max50Text	
14	交易日期	TradingDate	[1..1]	Date	
15	成交时间	TradeTime	[1..1]	Time	
16	套利合约代码	ArbitrageContractNumber	[1..1]	Max30Text	
17	强平标志	ForceDropFlag	[1..1]	Fix1Text	
18	站点 IP	IP	[1..1]	Max64Text	
19	站点 MAC	MAC	[1..1]	Fix48Text	
20	下单来源	OrderSystem	[1..1]	Max50Text	识别第三方接入

8.3 委托信息组件

委托信息组件的名称为：OderInfo。见表79。

表79 委托信息组件

索引	业务要素	英文名称	重复	元素类型	备注
1	本地委托编号	LocalOrderID	[1..1]	Max12Text	
2	系统委托编号	SysOrderID	[1..1]	Reference	组件，见 JR/T 0046—2009
3	交易会员编码	TradingMemberNumber	[1..1]	Max4Text	
4	客户编码	CustNumber	[1..1]	Max15Text	
5	席位代码	SeatID	[1..1]	Max30Text	
6	交易场所代码	ExchangeCode	[1..1]	Max3Text	
7	合约代码	ContractCode	[1..1]	Max30Text	

表 79 委托信息组件（续）

索引	业务要素	英文名称	重复	元素类型	备注
8	买卖方向代码	TradeDirectionCode	[1..1]	Fix1Text	
9	开平标志	OpenLiquidationIndicator	[1..1]	Fix1Text	
10	交易类型	TradeType	[1..1]	Fix1Text	
11	委托数量	CommitVolume	[1..1]	Number	
12	总成交数量	TotalTradeVolume	[1..1]	Number	
13	撤单数量	WithdrawVolume	[1..1]	Number	
14	委托价格	CommitPrice	[1..1]	DecimalNumber	
15	委托状态代码	OrderStatus	[1..1]	Fix1Text	
16	委托类型代码	CommitTypeCode	[1..1]	Fix1Text	
17	强平原因代码	ForceSropReason	[1..1]	Max50Text	
18	交易日期	TradingDate	[1..1]	Date	
19	委托日期	OrderDate	[1..1]	Date	
20	委托时间	CommitSubmitTime	[1..1]	Time	
21	定单有效时间类型代码	CommitProp	[1..1]	Max1Text	
22	套利合约代码	ArbitrageContractNumber	[1..1]	Max30Text	
23	提示信息	ErrorMessage	[0..1]	Max255Text	
24	撤单时间	WithdrawTime	[1..1]	Time	
25	站点 IP	IP	[1..1]	Max64Text	
26	站点 MAC	MAC	[1..1]	Fix48Text	
27	下单来源	OrderSystem	[1..1]	Max50Text	识别第三方接入

8.4 站点信息组件

站点组件的类型名称为：StationInfo。包含站点IP、站点MAC两个业务要素。见表80。

表80 站点信息组件

索引	要素名称	英文名称	重复	元素类型	备注
1	站点 IP	IP	[1..1]	Max64Text	
2	站点 MAC	MAC	[1..1]	Fix48Text	

8.5 合约信息组件

合约信息组件的名称为：ContractInfo。包含交易场所代码、品种代码、合约代码三个业务要素。见表81。

表81 合约信息组件

索引	业务要素	英文名称	重复	元素类型	备注
1	交易场所代码	ExchangeCode	[1..1]	Max3Text	
2	品种代码	FutureVarietyCode	[1..1]	Max20Text	
3	合约代码	ContractCode	[1..1]	Max50Text	

8.6 行情信息组件

行情信息组件的名称为：PriceInfo。见表82。

表82 行情信息组件

索引	业务要素	英文名称	重复	元素类型	备注
1	前结算价格	LastClearPrice	[1..1]	DecimalNumber	
2	前收盘价格	LastClosePrice	[1..1]	DecimalNumber	
3	昨虚实度	PreDelta	[1..1]	DecimalNumber	
4	开盘价格	OpeningPrice	[1..1]	DecimalNumber	
5	最新价格	NewestPrice	[1..1]	DecimalNumber	
6	最高买价格	HighestSellPrice	[1..1]	DecimalNumber	
7	最高买数量	HighestBuyVolume	[1..1]	DecimalNumber	
8	最低卖价格	LowestSellPrice	[1..1]	DecimalNumber	
9	最低卖数量	LowestSellVolume	[1..1]	Number	
10	最高成交价格	HighPrice	[1..1]	DecimalNumber	
11	最低成交价格	LowPrice	[1..1]	DecimalNumber	
12	涨停板价位	UpLimitedPrice	[1..1]	DecimalNumber	
13	跌停板价位	DownLimitedPrice	[1..1]	DecimalNumber	
14	当日平均价格	IntradayAveragePrice	[1..1]	DecimalNumber	
15	成交数量	TradeVolume	[1..1]	Number	
16	持仓数量	PositionVolume	[1..1]	Number	
17	成交金额	TradeAmount	[1..1]	DecimalNumber	
18	收盘价格	ClosePrice	[1..1]	DecimalNumber	
19	结算价格	ClearPrice	[1..1]	DecimalNumber	
20	交易日期	CurrDate	[1..1]	Date	
21	今虚实度	CurrDelta	[1..1]	DecimalNumber	

8.7 权限信息组件

权限信息组件的名称为：AuthorityInfo。包含合约或者品种标识、交易权限两个业务要素。见表83。

表83 权限信息组件

索引	业务要素	英文名称	重复	元素类型	备注
1	合约或者品种标识	ProductInstrumentType	[1..1]	Fix1Text	
2	交易权限	Authority	[1..1]	Fix1Text	

9 元素数据类型

9.1 账号变更状态

账号变更状态见表84。

表84 账户变更状态

定义	名称	格式
账户变更状态	UEAccountChgType	{0~9} {1, 1}

账号变更状态取值描述见表85。

表85 账户变更状态取值描述

取值	描述	备注
1	开户	
2	销户	
3	账户信息修改	
4	账户变更	

9.2 转账类型

转账类型见表86。

表86 转账类型

定义	名称	格式
转账类型	UETransferType	{0~9} {1, 1}

转账类型取值描述见表87。

表87 转账类型取值描述

取值	描述	备注
1	银行方转期货方	
2	期货方转银行方	
3	银行方转期货方冲正	
4	期货方转银行方冲正	
5	查询期货方账户余额	
6	查询银行方账户余额	

附 录 A
(规范性附录)
数据字典

数据字典见表A. 1。

表A. 1 数据字典

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
保证金收取类型	0	策略组合大边
保证金收取类型	1	策略组合
保证金收取类型	2	大边
保证金收取类型	3	双边
币种代码	1	CNY-人民币元
币种代码	2	USD-美元
币种代码	3	EUR-欧元
币种代码	4	HKD-港元
费用支付标志	0	未支付
费用支付标志	1	已支付
行权方式代码	0	欧式行权
行权方式代码	1	美式行权
合约或者品种标识	0	合约
合约或者品种标识	1	品种
合约类别	CF	棉花一号
合约类别	ER	早籼稻
合约类别	FG	玻璃
合约类别	GN	绿豆
合约类别	JR	粳稻
合约类别	LR	晚籼稻
合约类别	MA	甲醇 N
合约类别	ME	甲醇
合约类别	OI	菜籽油 N
合约类别	PM	普麦
合约类别	QM	优麦
合约类别	RI	早籼稻 N
合约类别	RM	菜籽粕
合约类别	RO	菜籽油
合约类别	RS	油菜籽
合约类别	SF	硅铁
合约类别	SM	锰硅
合约类别	SR	白糖

表 A.1 数据字典（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
合约类别	SRO	白糖期权
合约类别	TC	动力煤
合约类别	WH	强麦 N
合约类别	WS	强麦
合约类别	WT	小麦
合约类别	ZC	新动力煤
合约类别	OA	黄大豆
合约类别	OA0	黄豆期权
合约类别	OB	豆二
合约类别	OC	玉米
合约类别	OI	铁矿石
合约类别	OJ	焦炭
合约类别	OL	聚乙烯
合约类别	OM	豆粕
合约类别	OMO	豆粕期权
合约类别	OP	棕榈油
合约类别	OS	大豆
合约类别	OV	聚氯乙烯
合约类别	OY	豆油
合约类别	BB	胶合板
合约类别	CS	玉米淀粉
合约类别	FB	纤维板
合约类别	JD	鸡蛋
合约类别	JM	焦煤
合约类别	PP	聚丙烯
合约类别	AG	白银
合约类别	AL	铝
合约类别	AU	黄金
合约类别	BU	沥青
合约类别	CU	铜
合约类别	CUO	铜期权
合约类别	FU	燃料油
合约类别	HC	热轧卷板
合约类别	NI	镍
合约类别	PB	铅
合约类别	RB	螺纹
合约类别	RU	橡胶
合约类别	SN	锡
合约类别	WR	线材

表 A.1 数据字典（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
合约类别	ZN	锌
合约类别	OT	国债 10 年期
合约类别	AF	澳元兑美元
合约类别	EF	欧元兑美元
合约类别	IC	中证 500
合约类别	IF	沪深 300
合约类别	IH	上证 50
合约类别	I00	股指期货
合约类别	TF	国债 5 年期
合约类别	TT	短期国债
合约类别	SC	原油
合约类别	NI	镍
合约类别	SN	锡
合约类别	TA	PTA
合约类别	TD	马铃薯
交易场所代码	1	场内市场
交易场所代码	101	上海证券交易所
交易场所代码	102	深圳证券交易所
交易场所代码	103	中国金融期货交易所
交易场所代码	104	大连商品交易所
交易场所代码	105	郑州商品交易所
交易场所代码	106	上海期货交易所
交易场所代码	107	上海国际能源交易中心
交易场所代码	2	场外市场
交易场所代码	201	全国中小企业股份转让系统
交易场所代码	202	中国结算开放式基金 TA 交易平台
交易场所代码	203	开放式基金场外其他交易平台
交易场所代码	204	券商间柜台市场
交易会员或客户标识	0	交易会员
交易会员或客户标识	1	客户标识
交易类型	1	投机
交易类型	2	套保
交易类型	3	套利
交易类型	4	做市商
交易权限	1	不可交易
交易权限	2	可以交易
交易权限	3	只可平仓

表 A.1 数据字典（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
开仓买卖标识	0	买
开仓买卖标识	1	卖
开平标志	0	开仓
开平标志	1	平仓
客户类型代码	0	自然人
客户类型代码	1	法人
买卖方向代码	0	买
买卖方向代码	1	卖
强平原因代码	1	资金不足
强平原因代码	2	客户超仓
强平原因代码	3	会员超仓
强平原因代码	4	违规
期权类型	0	看涨期权
期权类型	1	看跌期权
强平标志	0	否
强平标志	1	是
委托方式	1	自助委托
委托方式	2	电话委托
委托方式	3	驻留委托
委托方式	4	远程委托
委托方式	5	柜台委托
委托方式	6	漫游委托
委托方式	7	分支委托
委托方式	8	网上委托
委托方式	9	手机委托
委托方式	10	网页委托
委托方式	11	代理委托
委托方式	12	CATS 委托
委托方式	13	短信委托
委托方式	14	GPRS 委托
委托方式	15	其他场内
委托方式	16	其他场外
委托方式	17	银行 ATM
委托方式	18	银行 POS
委托方式	19	BREW 委托
委托方式	20	ETF 算法交易
委托方式	21	融资外围
委托方式	22	银行柜台
委托方式	23	第三方柜台

表 A.1 数据字典（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
委托方式	24	集中柜面
委托方式	25	自定义委托 A
委托方式	26	自定义委托 B
委托方式	27	自定义委托 C
委托方式	28	自定义委托 D
委托方式	29	自定义委托 E
委托类型代码	0	市价
委托类型代码	1	限价
定单有效时间类型代码	1	FAK
定单有效时间类型代码	2	FOK
定单有效时间类型代码	3	GFD
委托状态代码	0	未申报
委托状态代码	1	正在申报
委托状态代码	2	已报入
委托状态代码	3	已报待撤
委托状态代码	4	部成待撤（部分成交，未成交部分待撤销）
委托状态代码	5	部成部撤（部分成交，未成交部分已撤销）
委托状态代码	6	已撤销
委托状态代码	7	部分成交（部分成交，未成交部分继续挂单）
委托状态代码	8	全部成交
委托状态代码	9	废单
委托状态代码	10	未知
委托状态代码	11	尚未触发
文件分类	0	TXT 文件
文件分类	1	XML 文件
文件分类	2	DBF 文件
文件分类	3	HTML 文件
文件分类	4	其他文件
证件类型代码	101	身份证
证件类型代码	102	护照
证件类型代码	103	港澳居民来往内地通行证
证件类型代码	104	台湾居民来往大陆通行证
证件类型代码	105	军官证
证件类型代码	106	士兵证
证件类型代码	107	回乡证
证件类型代码	108	户口本

表 A.1 数据字典（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
证件类型代码	109	文职证
证件类型代码	110	警官证
证件类型代码	111	社会保障号
证件类型代码	112	外国人永久居留证
证件类型代码	199	其他人员证件
证件类型代码	201	组织机构代码（即技术监督局代码）
证件类型代码	202	工商营业执照
证件类型代码	203	社团法人注册登记证书
证件类型代码	204	机关事业法人成立批文
证件类型代码	205	批文
证件类型代码	206	军队凭证
证件类型代码	207	武警凭证
证件类型代码	208	基金会凭证
证件类型代码	209	特殊法人注册号
证件类型代码	299	其他机构证件号码
重发标志	0	不重发
重发标志	1	重发
资金类型	1	客户总盈亏
资金类型	2	交易手续费
资金类型	3	交割手续费
资金类型	4	非货币充抵手续费
资金类型	5	期转现手续费
资金类型	6	仓单转让手续费
资金类型	7	仓单抵押手续费
资金类型	8	结算手续费
资金类型	9	行权手续费
资金类型	10	交割货款
资金类型	11	非货币充抵变动额
资金类型	12	仓储费/仓租费
资金类型	13	交割差价/配对盈亏
资金类型	14	仓单升贴水
资金类型	15	交割预报定金
资金类型	16	交割预报定金罚没
资金类型	17	交割违约罚款
资金类型	18	强平盈利罚没
资金类型	19	冻结款
资金类型	20	仓单转让货款
资金类型	21	卖方交割保证金
资金类型	22	买方交割补偿金

表 A.1 数据字典（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
资金类型	23	卖方交割补偿金
资金类型	24	过户费
资金类型	25	转托管费
资金类型	26	权利金
资金类型	27	货币充抵变动额
资金类型	28	资产管理业绩报酬或管理费
资金类型	29	其他与客户有关资金
资金类型	30	年会费
资金类型	31	席位费
资金类型	32	利息
资金类型	33	手续费返还
资金类型	34	奖励
资金类型	35	补助
资金类型	36	交割货款
资金类型	37	经纪和自营账户结算准备金内转
资金类型	38	经纪和结算担保金账户内转
资金类型	39	其他与会员有关资金
交割月份标志	0	一般月份
交割月份标志	1	临近交割月份