



工程技术标准

# 深圳证券交易所STEP交易数据接口规范

(Ver1.00 α)



深圳证券交易所  
二〇一四年四月

## 文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2013-10	0.10	创建
2014-1	0.90	根据市场参与者反馈意见修订
2014-4	1.00 α	根据0.9版征求意见稿反馈修订

## 名词释义

词汇缩写	含义
TGW	Trade GateWay 交易网关 深圳证券交易所交易系统提供给市场参与者的接入点。
OMS	Order Management System 订单管理系统
STEP	Securities Trading Exchange Protocol 证券交易数据交换协议。
FIX	Financial Information Exchange 金融信息交换协议。
DMA	Direct Market Access, 指不通过会员而直接接入交易系统的机构投资者, 例如基金公司。

# 目 录

一、 前言 .....	1
二、 会话机制 .....	1
2.1 连接 .....	1
2.1.1 会话 .....	1
2.1.2 IP 地址和 Port .....	1
2.1.3 安全 .....	1
2.2 会话管理 .....	1
2.2.1 建立会话 .....	1
2.2.2 容错 .....	1
2.2.3 恢复 .....	2
三、 服务说明 .....	2
3.1 平台说明 .....	2
3.2 委托申报方式说明 .....	3
3.3 委托消息处理流程 .....	5
3.4 新订单处理消息流程图 .....	6
3.4.1 新订单消息流程图 .....	6
3.4.2 撤单请求消息流程图 .....	7
3.5 报价处理消息流程图 .....	7
3.6 意向申报处理消息流程图 .....	9
3.7 成交申报处理消息流程图 .....	10
3.7.1 协议配对申报模式 (one party report for matching) .....	10
3.7.1.1 新成交申报处理 .....	10
3.7.1.2 撤销尚未完成配对的成交申报 .....	12
3.7.2 成交报告申报模式 (two party report) .....	13
3.8 转托管处理消息流程图 .....	14
3.9 网络投票处理消息流程图 .....	15
3.9.1 投票 .....	15
3.9.2 密码服务处理消息流程图 .....	16
3.10 应用层消息恢复 .....	16
四、 消息定义 .....	17
4.1 业务消息-新订单处理 .....	17
4.1.1 新订单 (New Order) .....	17
4.1.2 撤单请求 (Order Cancel Request) .....	23
4.1.3 撤单失败响应 (Cancel Reject) .....	23
4.1.4 执行报告 (Execution Report) .....	24
4.2 业务消息-报价处理 .....	26
4.2.1 报价 (Quote) .....	26
4.2.2 报价状态回报 (Quote Status Report) .....	28
4.3 业务消息-意向申报处理 .....	29
4.3.1 意向申报 (Indication of Interest) .....	29
4.3.2 意向申报响应 (Quote Response) .....	30

4.4	业务消息-成交申报处理.....	32
4.4.1	成交申报 (Trade Capture Report) .....	32
4.4.2	成交申报响应 (Trade Capture Report Ack) .....	37
4.4.3	成交确认 (Trade Capture Report) .....	39
4.5	业务消息-注册处理 .....	41
4.5.1	注册 (Designation) .....	41
4.5.2	注册执行报告 .....	42
4.6	业务消息-网络投票处理消息.....	43
4.6.1	投票 .....	43
4.6.2	投票执行报告 .....	44
4.6.3	密码服务 .....	45
4.6.4	密码服务执行报告 .....	46
<b>五、</b>	<b>其它消息 .....</b>	<b>47</b>
5.1	业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT) .....	47
5.2	回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) .....	48
5.3	平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) .....	48
5.4	回报结束消息 (REPORT FINISHED) .....	49
<b>六、</b>	<b>数据字典 .....</b>	<b>49</b>
6.1	数据类型 .....	49
6.2	会话层域定义 .....	50
6.3	业务层域定义 .....	51
6.4	参与者编码 .....	57

# 深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范

## 一、前言

本接口规范提供给会员和以 DMA 方式接入的机构投资者，用以指导开发以 STEP 协议接入深圳证券交易所(以下简称深交所)第五版交易系统提交订单并获取执行报告。本接口规范描述内容包括可开展的业务、必要的运行指导以及详细的数据交换格式。

文档所采用的术语、消息格式、以及消息流描述均遵照 STEP 1.2 及 FIX 5.0 SP2 协议规范，同时深交所亦有特定的扩展。

本接口规范采用 UTF-8 编码。

## 二、会话机制

接入用户订单管理系统与交易网关间的会话机制遵循《轻量级 STEP 会话协议接口规范》，本节仅对交易系统特有的机制进行描述。

### 2.1 连接

#### 2.1.1 会话

接入用户通过会话将自身的系统连接到交易网关。该连接为标准的 TCP/IP 点对点连接。

#### 2.1.2 IP 地址和 Port

交易网关按每个平台（平台描述见“服务说明”章节）提供了一个交易服务端口供 OMS 接入。每个交易网关每个平台只能建立一个 TCP/IP 连接，每一个连接只能对应一个会话。

#### 2.1.3 安全

交易网关和接入用户订单管理系统必须位于同一个安全网络之中，交易网关和接入用户订单管理系统之间传输的数据是非加密的，数据传输安全由接入用户网络保证。

### 2.2 会话管理

#### 2.2.1 建立会话

会话建立过程参见《轻量级 STEP 会话层接口规范》

#### 2.2.2 容错

接入用户订单管理系统或交易网关事故后，接入用户订单管理系统可重新建立与交易网关之间的会话。重建会话后，接入用户订单管理系统应通过应用层规则恢复缺失的数据。

### 2.2.3 恢复

交易网关使用的会话协议参照《轻量级 STEP 会话层接口规范》实现，会话层恢复机制仅仅是为了与标准 Fix 会话协议兼容，不能作为真正的消息恢复机制使用，订单管理系统应通过应用层的消息恢复机制来获得缺失的数据。

## 三、 服务说明

### 3.1 平台说明

第五版交易系统按业务划分为多个平台，每个平台可以有各自独立的开闭市时间设置，市场参与者需要根据交易网关下发的各个平台的当前状态信息来控制各平台委托申报的开始和停止。

各平台处理的业务划分如下表所示：

平台	业务种类	委托申报时间
现货集中竞价交易平台	现货集中竞价交易	9:15-9:25
	质押式回购交易	9:30-11:30
	债券分销	13:00-15:00
综合金融服务平台 (原综合协议交易平台)	协议交易	9:15-11:30 13:00-15:30
	盘后定价大宗交易	
	转融通证券出借	
	资产管理计划份额转让	
	股票质押式回购	
	约定购回	
	质押式报价回购	
非交易处理平台	ETF 实时申购赎回	9:15-11:30 13:00-15:00
	网上发行认购 (包括 IPO, 增发, LOF 发行, 可转债申购发行)	
	配股认购	
	债券转股回售	
	权证行权	
	开放式基金申购赎回	

	要约收购	
	质押式回购质押解押	
	转托管	
	网络投票（含密码服务）	
	黄金 ETF 实物申购赎回	
衍生品集中竞价交易平台	期权集中竞价交易	9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:00

### 3.2 委托申报方式说明

用于申报委托的消息有多种类型，接口规范根据每类业务的特性，规定了相应的委托申报的消息类型。

由于存在多类业务使用同一种消息类型进行委托申报的情形，为了区分不同业务的委托，在所有委托申报消息中都存在一个 ApplID 字段，市场参与者在申报委托时，需要按接口规范的要求在委托中填写委托对应的 ApplID。

接口规范中的委托申报消息类型有：

消息类型	说明
New Order (D)	新订单
Order Cancel Request (F)	新订单撤销请求
Quote (S)	报价
IOI (6)	意向申报
Trade Capture Report (AE)	成交申报
Designation (U001)	注册（转托管）
NetVote (U004)	网络投票
Netvote Password Service (U006)	密码服务

各类业务的委托申报消息类型及 ApplID 如下表所示：

委托申报类型	申报消息类型 MsgType	应用标识 ApplID	所属平台
现货（股票，基金，债券等） 集中竞价交易订单申报	D	010	现货集中竞价交易平台



质押式回购交易订单申报	D	020	现货集中竞价交易平台
债券分销订单申报	D	030	现货集中竞价交易平台
期权集中竞价交易订单申报	D	040	衍生品集中竞价交易平台
期权集中竞价交易报价申报	S	041	
协议交易意向申报	6	050	综合金融服务平台
协议交易定价申报	D	051	
协议交易点击成交申报	D	052	
协议交易双方配对成交申报	AE	053	
以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	D	060	综合金融服务平台
以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报	D	061	
转融通证券出借非约定申报	D	070	综合金融服务平台
转融通证券出借约定申报	AE	071	
资产管理计划份额转让	AE	080	综合金融服务平台
股票质押式回购	AE	090	综合金融服务平台
约定购回	AE	100	综合金融服务平台
质押式报价回购	AE	110	综合金融服务平台
ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回)	D	120	非交易处理平台
网上发行认购申报	D	130	非交易处理平台
配股认购申报	D	140	非交易处理平台
债券转股申报	D	150	非交易处理平台
债券回售申报	D	151	
行权申报	D	160	非交易处理平台
开放式基金申购赎回申报	D	170	非交易处理平台

要约收购预受要约申报	D	180	非交易处理平台 非交易处理平台
要约收购解除预受要约申报	D	181	
质押式回购质押申报	D	190	非交易处理平台
质押式回购解押申报	D	191	
转托管申报	U001	200	非交易处理平台
网络投票申报	U004	210	非交易处理平台
密码服务激活申报	U006	211	
密码服务挂失申报	U006	212	
黄金 ETF 实物申购赎回申报 (该委托只能由上海黄金交易所申报)	D	220	非交易处理平台

注：ApplID 的前两位表示业务代码，第三位表示该业务下的委托申报代码。

### 3.3 委托消息处理流程

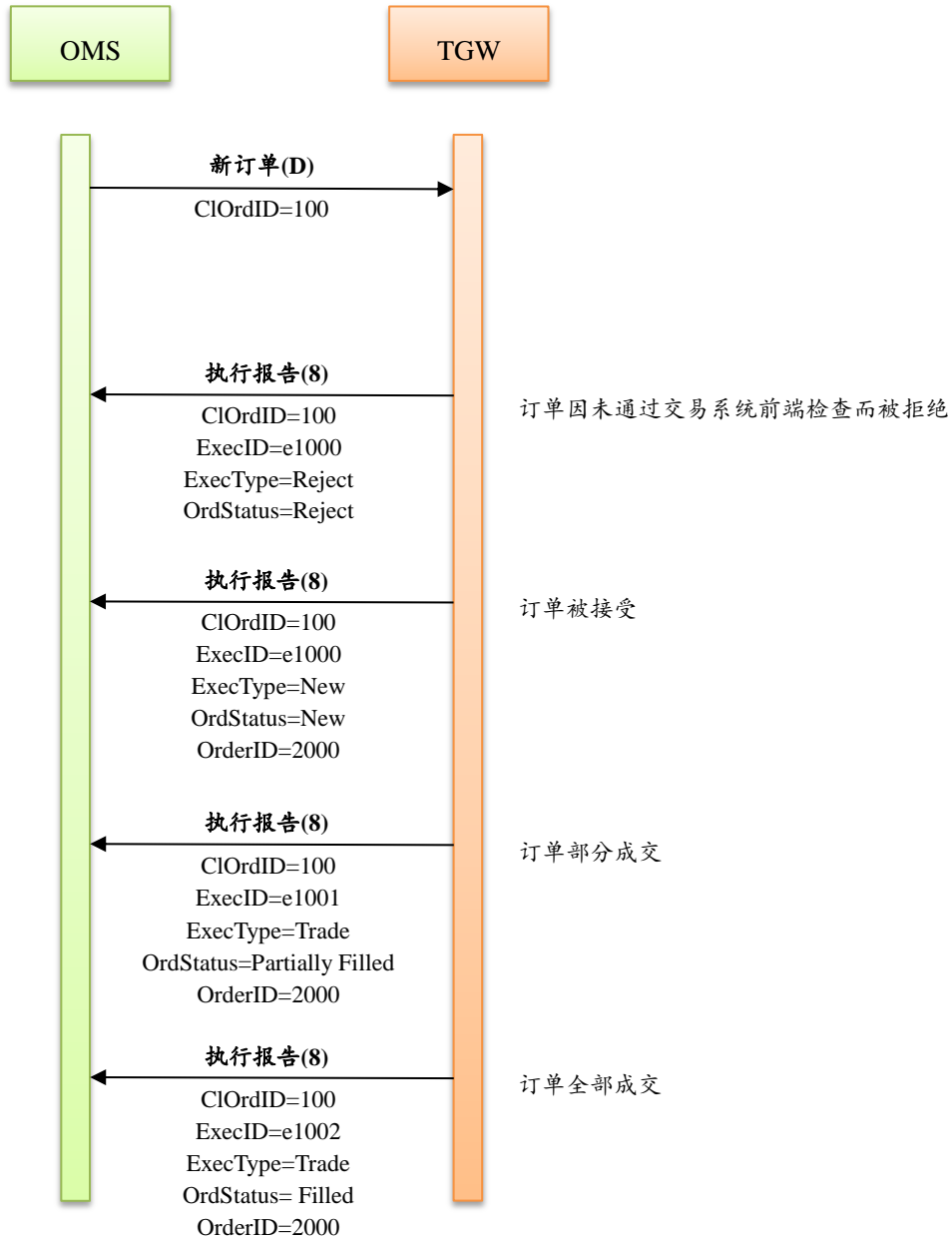
对于 OMS 申报的委托，交易系统会首先作基本合法性检查，比如委托中的证券代码是否存在、是否到达委托申报时间等等。

如果检查未通过，交易系统会通过 Business Reject (MsgType=j) 消息通知 OMS 委托被拒绝。

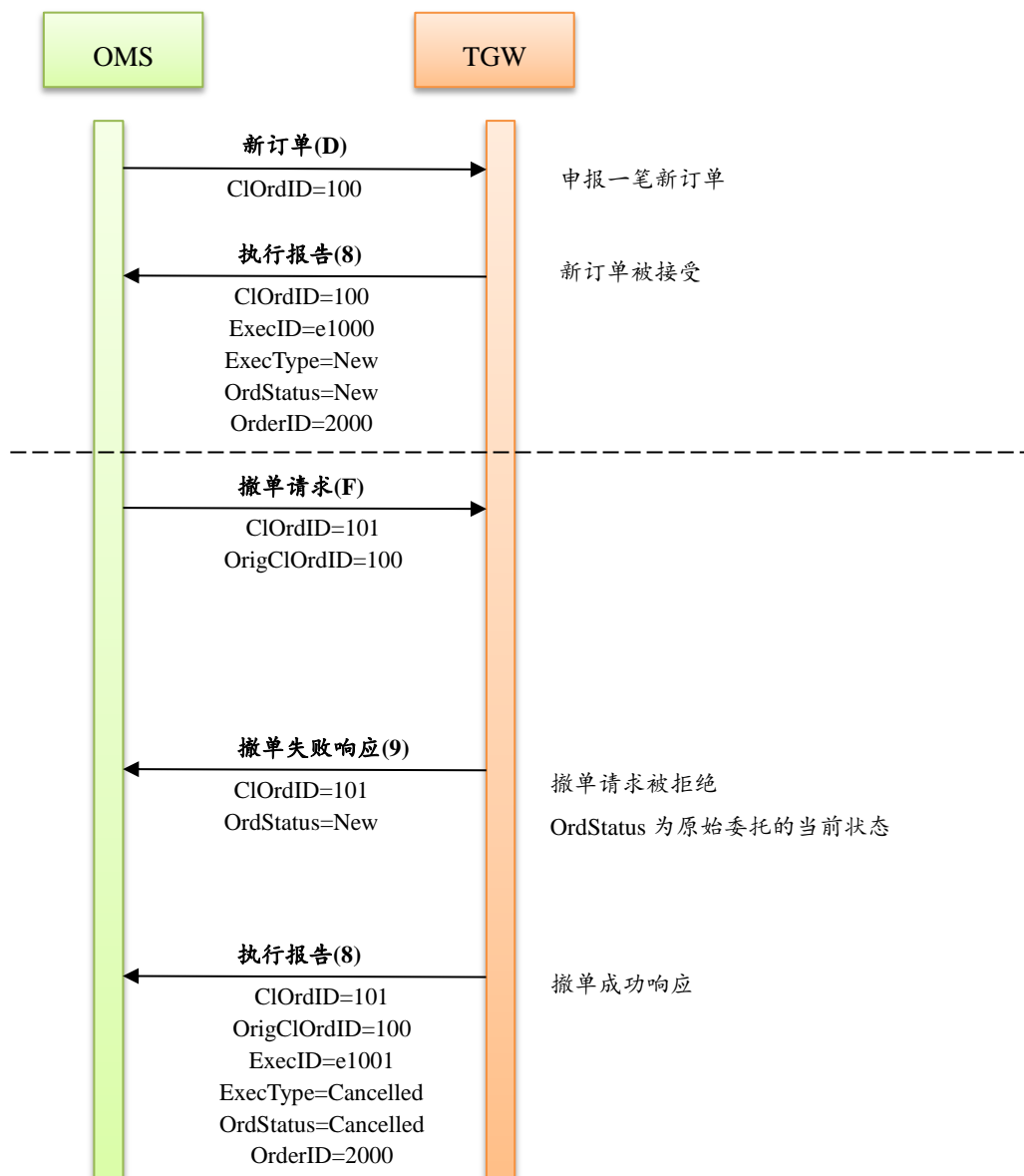
如果通过基本合法性检查，交易系统会根据委托消息类型的不同向 OMS 发出相应的回报消息，具体参见 3.4-3.9 节。

### 3.4 新订单处理消息流图

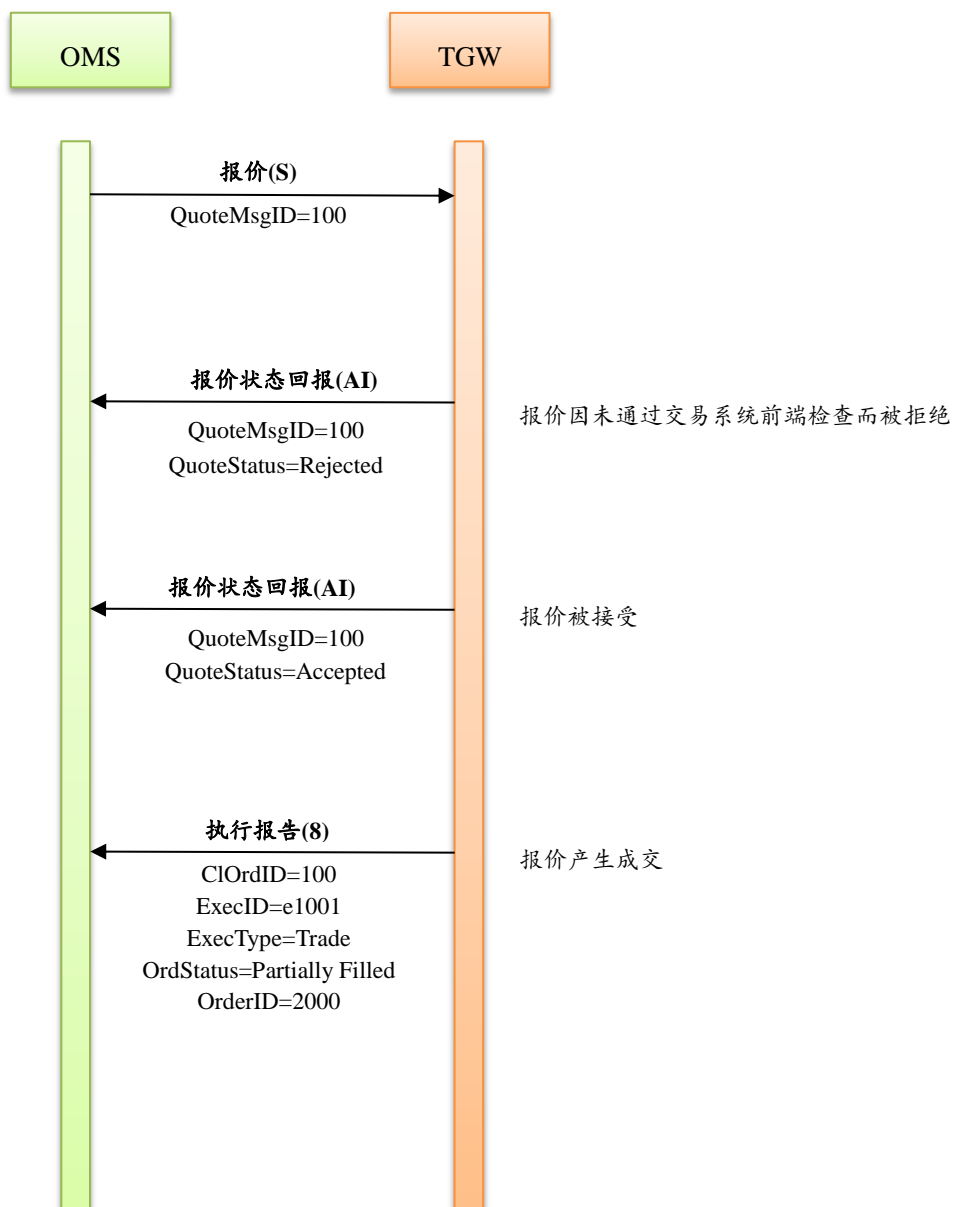
#### 3.4.1 新订单消息流图



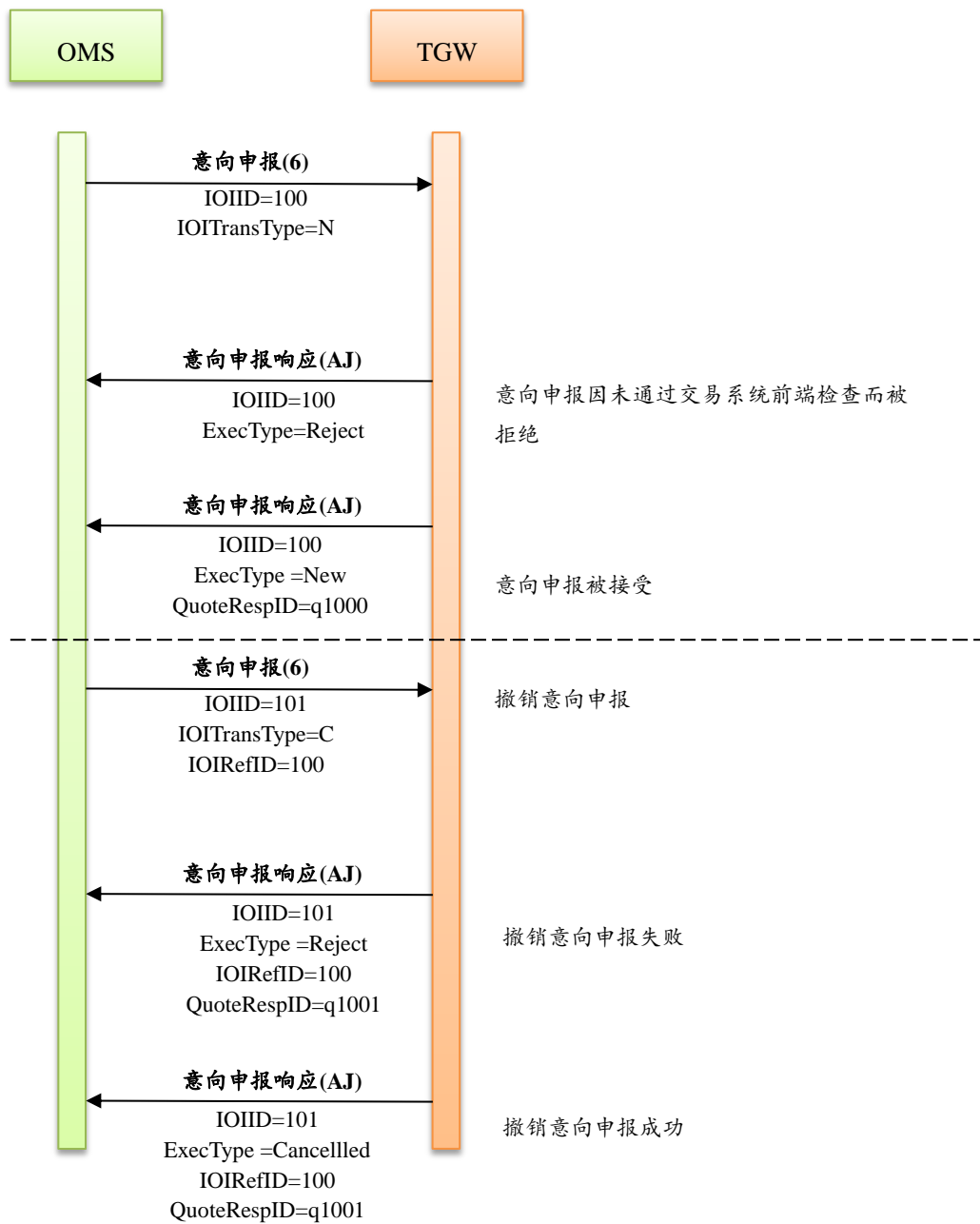
## 3.4.2 撤单请求消息流图



## 3.5 报价处理消息流图



## 3.6 意向申报处理消息流图

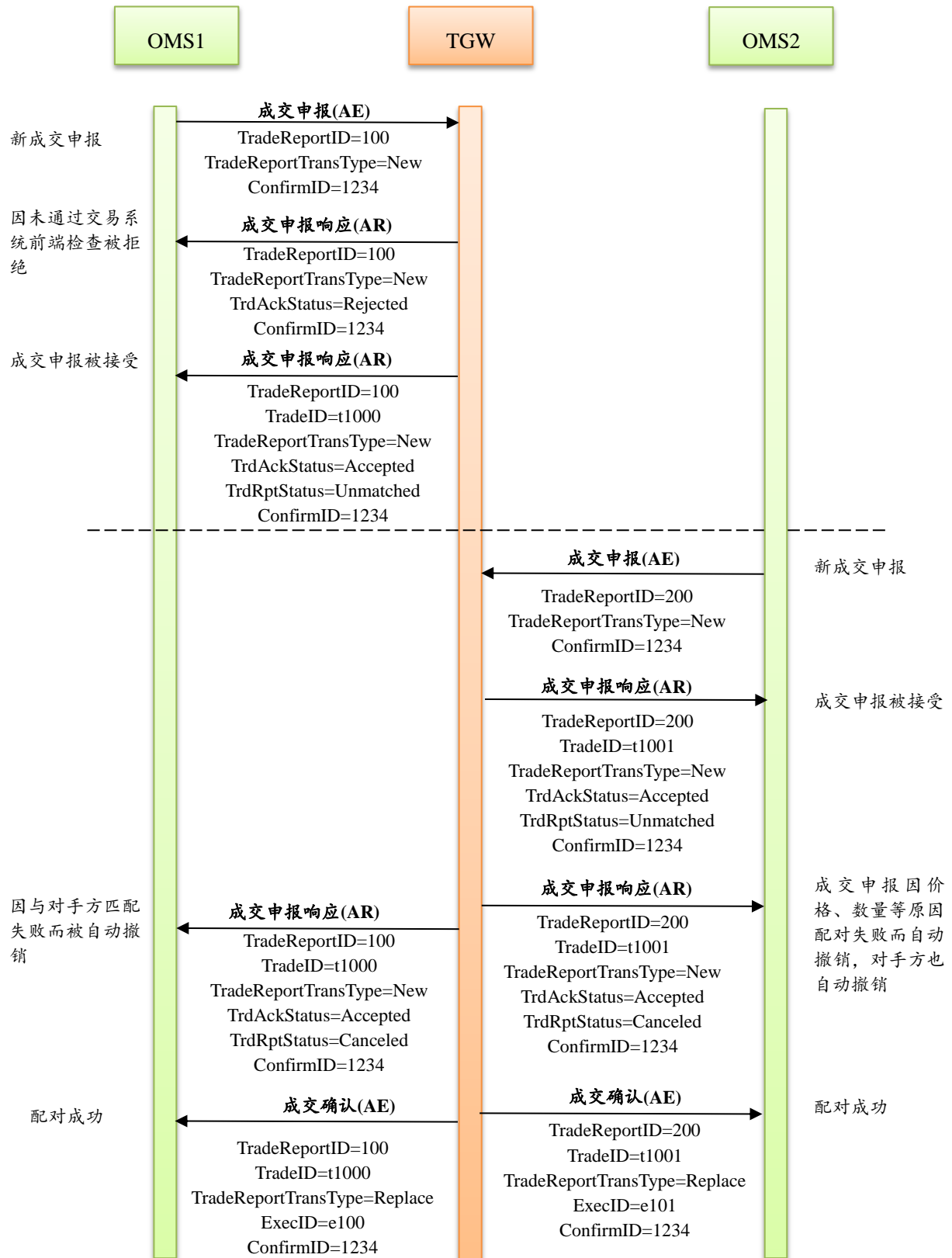


### 3.7 成交申报处理消息流图

#### 3.7.1 协议配对申报模式 (one party report for matching)

##### 新成交申报处理

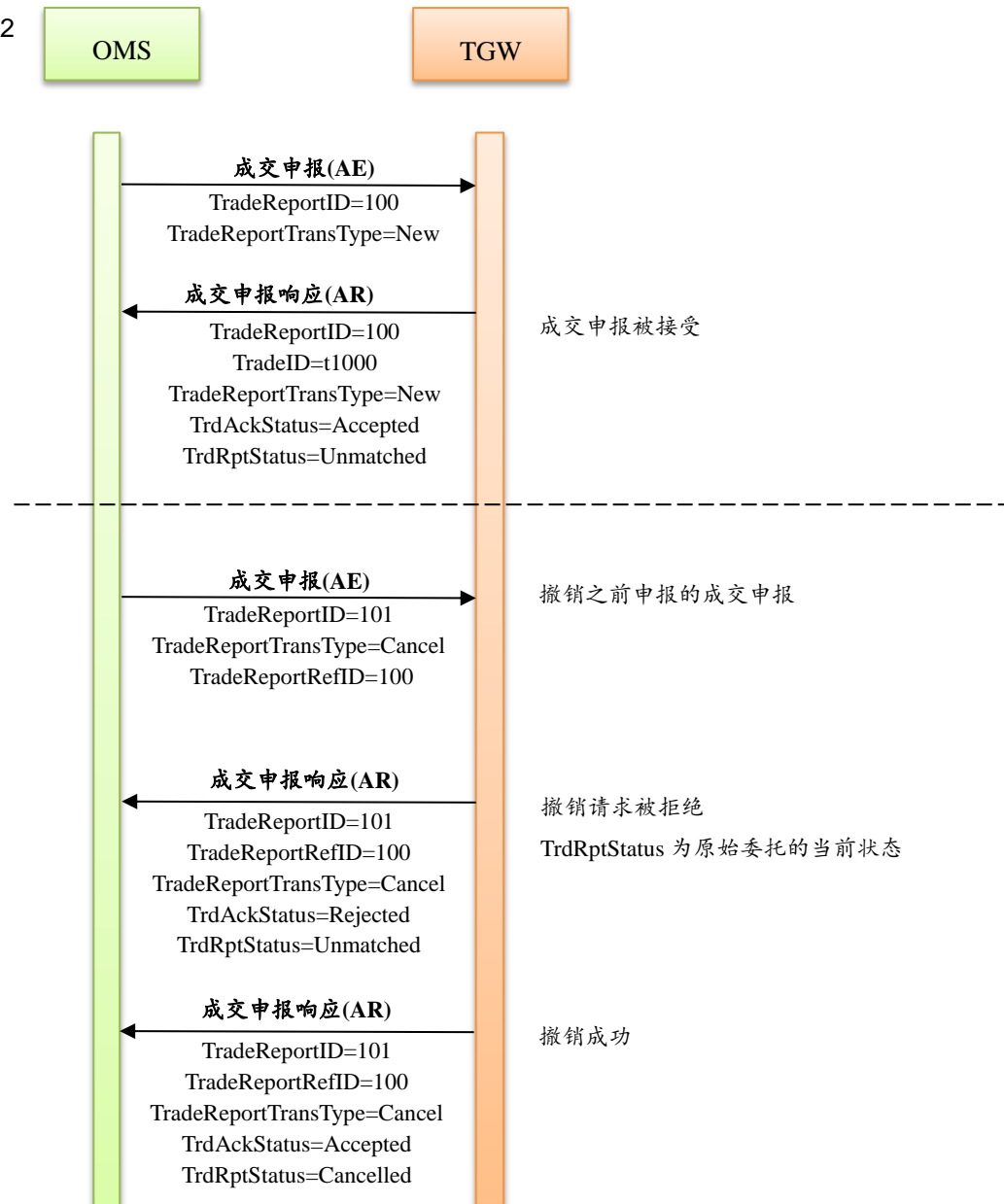
##### 3.7.1.1



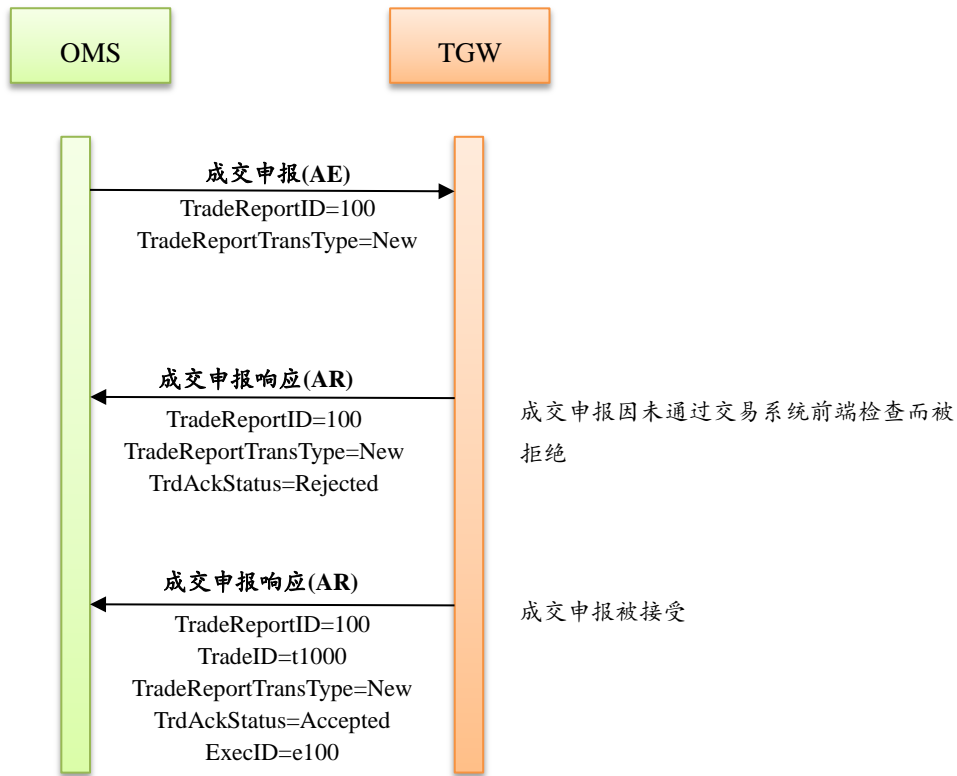


### 撤销尚未完成配对的成交申报

3.7.1.2

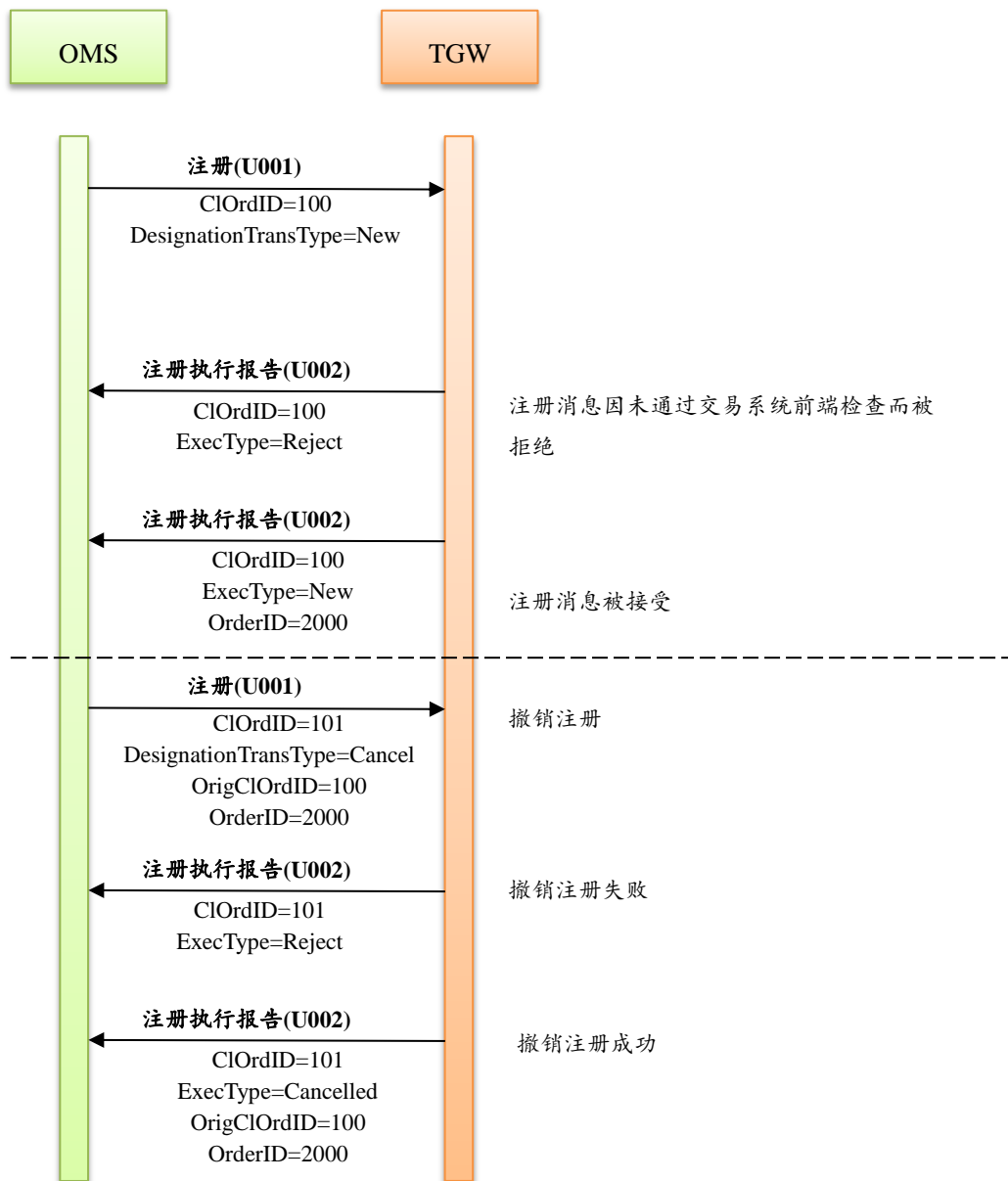


### 3.7.2 成交报告申报模式 (two party report)



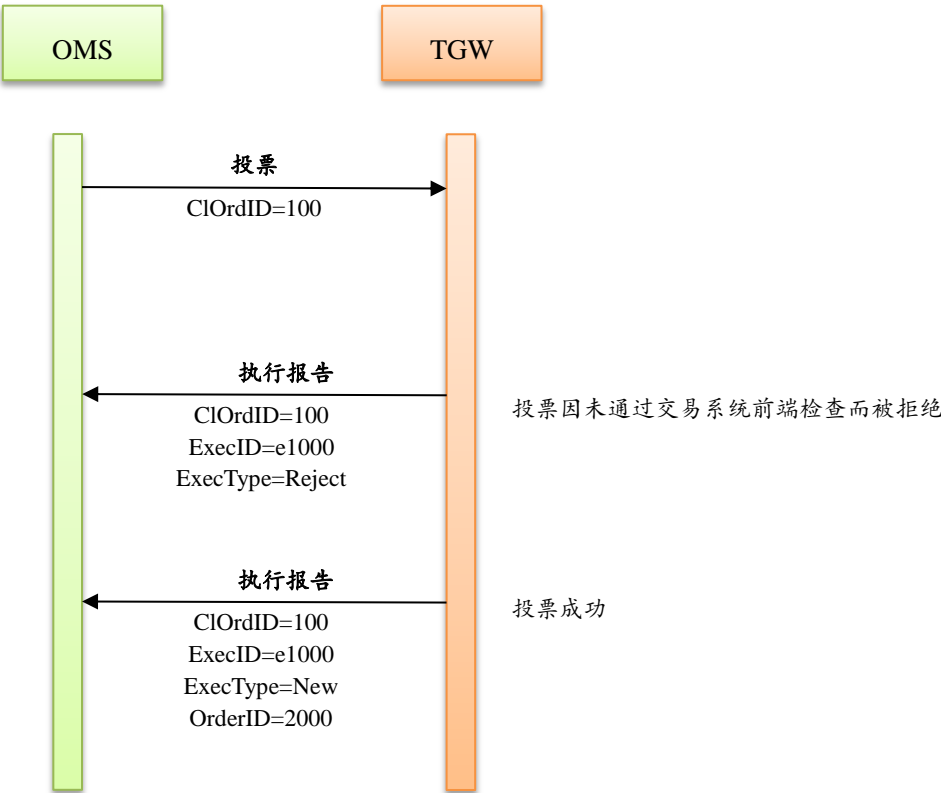
成交报告申报模式暂不支持撤销。

## 3.8 转托管处理消息流程图

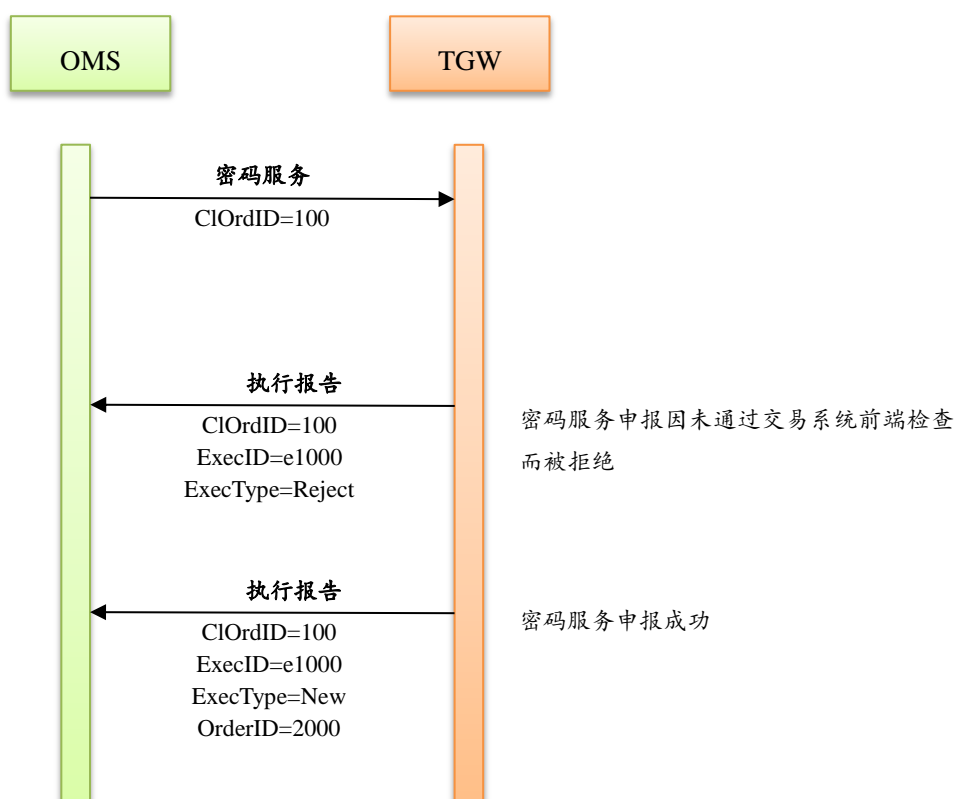


3.9 网络投票处理消息流图

3.9.1 投票处理消息流图

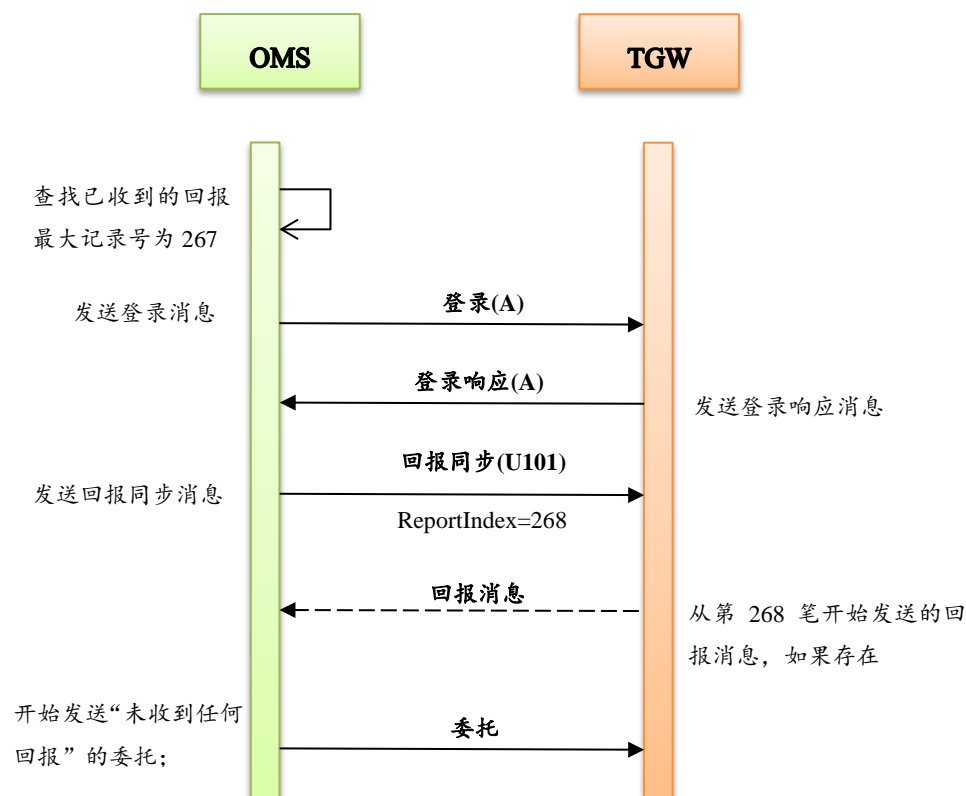


### 3.9.2 密码服务处理消息流程图



### 3.10 应用层消息恢复

TGW 发送给 OMS 的每笔回报消息（业务拒绝消息 Business Reject 除外）都有一个回报记录号 ReportIndex 字段，字段值从 1 开始连续编号，表示该笔回报是第几笔回报，在 OMS 与 TGW 异常断开连接后，OMS 应该首先查找到已收到回报的最大记录号并按照下图所示流程与 TGW 重新建立连接（首次建立连接也必须按照该流程进行，相当于最大记录号为 0）。



OMS 在发送回报同步消息后，并不需要等待到有回报消息返回才开始发送委托，但建议等待 3 秒钟以接收尽可能多的回报消息，从而减少委托的重复发送。

在闭市以后，OMS 不能继续申报委托，但是仍然可以登录 TGW 并通过该机制重新接收当天的回报数据，比如将同步消息中的 ReportIndex 设置为 1 即可以重新接收当天的所有回报数据。

如果 OMS 发送的回报同步消息中的 ReportIndex 值大于实际存在的回报记录数目，则 TGW 不会发送回报消息，直至回报记录数达到 ReportIndex 值才开始继续回报。比如发送的回报同步消息中的 ReportIndex 为 1001，而 TGW 端实际存在的回报数只有 300，则 TGW 会等到实际的回报数达到 1001 时才开始发送回报，回报记录号为 1-1000 的回报不会发送给 OMS。

#### 四、 消息定义

##### 4.1 业务消息-新订单处理

###### 4.1.1 新订单 (New Order)

Tag	域名	必须	字段描述
-----	----	----	------

	MessageHeader	Y	MsgType=D
1180	ApplID	Y	应用标识
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
40	OrdType	Y	订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优
54	Side	Y	买卖方向
522	OwnerType	Y	订单所有者类型
60	TransacTime	N	订单发起时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>		Y	
152	CashOrderQty	N	订单金额
38	OrderQty	Y	订单数量
组件结束			
44	Price	N	价格 OrdType 为 2 时填写
99	StopPx	N	止损价，预留
59	TimeInForce	N	有效时期类型 0=当日有效 3=即时成交或取消 缺省值为 0
1090	MaxPriceLevels	N	最多成交价位数

			0 表示不限制成交价位数 缺省值为 0
110	MinQty	N	最低成交数量 缺省值为 0
544	CashMargin	N	融资融券信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓 缺省值为 1
77	PositionEffect	N	开平仓标识, 衍生品交易填写 O=开仓 C=平仓 缺省值为 O
203	CoveredOrUncovered	N	备兑标签, 衍生品交易填写 0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑 缺省值为 1
664	ConfirmID	N	约定号 协议交易点击成交填写
8911	ExpirationDays	N	期限, 单位为天数
8906	ExpirationType	N	期限类型 1=固定期限
58	Text	N	Free Text

注:

## 1) 各业务申报新订单时的 Side 取值

应用标识 ApplID	说明	Side (54)
010	现货 (股票, 基金, 债券等) 集中竞价交易申报	1=买 2=卖
020	质押式回购交易申报	1=买 (融资) 2=卖 (出资)
030	债券分销申报	1=买 (认购) 2=卖 (分销)
040	期权集中竞价交易申报	1=买 2=卖



051	协议交易定价申报	1=买 2=卖
052	协议交易点击成交申报	1=买 2=卖
060	以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	1=买 2=卖
061	以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报	1=买 2=卖
070	转融通证券出借非约定申报	G=借入 F=出借
120	ETF 实时申购赎回申报	D=申购 E=赎回
130	网上发行认购申报	固定填 1
140	配股认购申报	固定填 1
150	债券转股申报	固定填 1
151	债券回售申报	固定填 1
160	行权申报	固定填 1
170	开放式基金申购赎回申报	D=申购 E=赎回
180	要约收购预受要约申报	固定填 1
181	要约收购解除预受要约申报	固定填 1
190	质押式回购质押申报	固定填 1
191	质押式回购解押申报	固定填 1

2) 现货集中竞价交易、质押式回购交易、期权集中竞价交易三类业务申报的 OrdType 可取值 1/2/U, 其他业务申报的 OrdType 固定填 2。

3) 除必填字段外, 各业务需选填字段说明如下:

应用标识 ApplID	业务说明	可选字段填写说明
010	现货(股票, 基金, 债券等) 集中竞价交易申报	在 OrdType 为 2 时必须填写 Price; TimeInForce, MinQty, MaxPriceLevels 为可选 字段, 不填则取缺省值, 不管是否填写, 三个字 段的取值组合必须在下面列举的“限价委托及五 种市价委托申报方式”之内;

		CashMargin 为可选字段，不填则取缺省值
020	质押式回购交易申报	在 OrdType 为 2 时必须填写 Price; TimeInForce, MinQty, MaxPriceLevels 为可选 字段，不填则取缺省值，不管是否填写，三个字 段的取值组合必须在下面列举的“限价委托及五 种市价委托申报方式”之内；
030	债券分销申报	必须填写 Price
040	期权集中竞价交易申报	在 OrdType 为 2 时必须填写 Price; TimeInForce, MinQty, MaxPriceLevels 为可选 字段，不填则取缺省值，不管是否填写，三个字 段的取值组合必须在下面列举的“限价委托及五 种市价委托申报方式”之内； 必须填写 PositionEffect 和 CoveredOrUncovered
051	协议交易定价申报	必须填写 Price
052	协议交易点击成交申报	必须填写 Price; 必须填写 ConfirmID
060	以收盘价交易的盘后定价大宗 交易申报	必须填写 Price
061	以成交量加权平均价交易的盘 后定价大宗交易申报	必须填写 Price
070	转融通证券出借非约定申报	必须填写 Price，值为费率； 必须填写 ExpirationDays 和 ExpirationType
120	ETF 实时申购赎回申报	只需填写必须字段
130	网上发行认购申报	必须填写 Price，值为认购价
140	配股认购申报	必须填写 Price，值为配股价
150	债券转股申报	只需填写必须字段
151	债券回售申报	只需填写必须字段
160	行权申报	必须填写 Price，值为行权价
170	开放式基金申购赎回申报	申购时必须填写 CashOrderQty 值为申购金额， 金额必须为 1 元的整数倍，OrderQty 填 0； 赎回时使用 OrderQty 填写赎回份额
180	要约收购预受要约申报	只需填写必须字段
181	要约收购解除预受要约申报	只需填写必须字段
190	质押式回购质押申报	只需填写必须字段

191	质押式回购解押申报	只需填写必须字段
-----	-----------	----------

## 4) 限价委托及五种市价委托申报方式:

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
限价委托	0	2	0	0
本方最优	0	U	0	0
对手方最优	0	1	1	0
立即成交剩余撤销	3	1	0	0
全额成交或撤销	3	1	0	=OrderQty
最优五档成交剩余撤销	3	1	5	0

## 5) 参与人代码说明

申报新订单必须包括以下三个参与人代码:

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码

要约收购业务还需要申报收购人编码:

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
收购人编码	D=自定义代码	4003= 要约收购收购人编码

期权集中竞价交易业务还需要填写结算账号:

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
合约账户标识码	C=通用市场参与者标识	38=合约账户标识码

- 6) 现货集中竞价交易申报, 如果 CashMargin 取值为“融资融券平仓 (3)”, 同时订单所有者类型为“会员发起 (102)”, 则表示该笔订单为会员强制平仓。

## 4.1.2 撤单请求 (Order Cancel Request)

Tag	域名		必须	字段描述
	MessageHeader		Y	MsgType=F
1180	ApplID		Y	原始订单应用标识
11	ClOrdID		Y	客户订单编号
522	OwnerType		Y	订单所有者类型
54	Side		Y	原始订单买卖方向
60	TransacTime		Y	订单发起时间
组件<Instrument>			Y	
48	SecurityID		Y	证券代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与方代码个数=1
→	448	PartyID	Y	申报交易单元
	447	PartyIDSource	Y	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	Y	1=当前 PartyID 为申报交易单元
组件结束				
组件<OrderQtyData>			Y	
38	OrderQty		Y	原始订单数量 交易所对该字段的值不作检查
组件结束				
41	OrigClOrdID		Y	原始订单的客户订单编号
37	OrderID		N	原始订单交易所订单编号 该字段为选填字段，交易所不作检查
58	Text		N	Free Text

## 4.1.3 撤单失败响应 (Cancel Reject)

Tag	域名		必须	字段描述
	MessageHeader		Y	MsgType=9
10179	ReportIndex		Y	回报记录号
1180	ApplID		Y	原始订单应用标识
522	OwnerType		Y	订单所有者类型

37	OrderID	N	原始订单的交易所订单编号
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
60	TransacTime	Y	撤单失败响应时间
41	OrigClOrdID	Y	原始订单的客户订单编号
39	OrdStatus	Y	原始订单当前状态 如果未找到原始订单，则填 8=Rejected
102	CxlRejReason	Y	拒绝原因代码
1328	RejectText	N	拒绝原因说明
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数=1
→	448	PartyID	申报交易单元
	447	PartyIDSource	取 C，表示通用市场参与者标识
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 为申报交易单元
组件结束			

#### 4.1.4 执行报告（Execution Report）

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=8
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识
522	OwnerType	Y	订单所有者类型
17	ExecID	Y	执行编号
37	OrderID	Y	交易所订单编号
150	ExecType	Y	执行类型
39	OrdStatus	Y	订单状态
31	LastPx	N	成交价
32	LastQty	N	成交数量
151	LeavesQty	Y	剩余量
14	CumQty	Y	累计成交数量
103	OrdRejReason	N	撤单/拒绝原因代码，执行类型为 8 或 4 时填写
1328	RejectText	N	撤单/拒绝原因说明，执行类型为 8 或 4 时填写

			写
54	Side	Y	买卖方向
60	TransacTime	Y	执行报告时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
41	OrigClOrdID	N	原始订单客户订单编号, 撤单请求成功响应填写
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数 同原始订单一致
→	448	PartyID	Y 参与人代码
	447	PartyIDSource	Y 参与人代码源
	452	PartyRole	Y 参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>		Y	
152	CashOrderQty	N	订单金额
38	OrderQty	Y	订单数量
组件结束			
44	Price	N	价格
99	StopPx	N	止损价
59	TimeInForce	N	有效时期类型
40	OrdType	Y	订单类型
1090	MaxPriceLevels	N	最多成交价位数
110	MinQty	N	最低成交数量
544	CashMargin	N	融资融券信用标识
77	PositionEffect	N	开平仓标识
203	CoveredOrUncovered	N	备兑标签
664	ConfirmID	N	约定号
8911	ExpirationDays	N	期限, 单位为天数

8906	ExpirationType		N	期限类型
541	MaturityDate		N	到期日
组件<CompDeliverData> 用于回报 ETF 实时申购赎回的股份和资金交付明细			N	
8902	NoSecurity		Y	成份股记录数
→	309	UnderlyingSecurityID	Y	成份股证券代码
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	Y	证券代码源
→	8903	DeliveryQty	N	股份交付数量
→	8904	SubstCash	N	现金替代金额
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

- 1) 股票 ETF、债券 ETF 申购时如果投资者持有成份股不足，RejectText 填写第一只不足额的成份股代码；赎回时如果基金管理人成份股不足，RejectText 填写第一只不足额的成份股代码；
- 2) 对于期权集中竞价交易业务的平仓（PositionEffect=C）执行报告，如果 OwnerType=101（交易所发起），则表示该笔执行报告是交易所发起的强平委托的回报，如果 OwnerType=106（结算机构发起），则表示该笔执行报告是结算机构发起的强平委托的回报。

## 4.2 业务消息-报价处理

### 4.2.1 报价（Quote）

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=S
1180	ApplID	Y	应用标识 041=期权集中竞价交易报价
1166	QuoteMsgID	Y	客户报价消息编号
522	OwnerType	Y	报价所有者类型
60	TransacTime	N	报价发起时间
131	QuoteReqID	N	预留字段 当报价是对报价请求的响应时,填写报价请求 的 ID
537	QuoteType	N	报价类型 1= Tradeable, 表示可交易的报价

组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
132	BidPx	N	买报价 BidSize>0 时必须填写
133	OfferPx	N	卖报价 OfferSize>0 时必须填写
134	BidSize	N	买数量
135	OfferSize	N	卖数量
8909	BidPositionEffect	N	买开平仓标志, 衍生品报价填写 O=开仓 C=平仓
8910	OfferPositionEffect	N	卖开平仓标志, 衍生品报价填写 O=开仓 C=平仓
58	Text	N	Free Text

注:

## 1) 参与人代码说明

报价申报必须包括以下两个参与人代码:

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者 标识	1=申报交易单元

期权集中竞价交易报价还需要填写结算账号:



PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
合约账户标识码	C=通用市场参与者 标识	38=合约账户标识 码

2) 报价消息支持以下报价方式（不支持撤销单边报价）

报价方式	BidSize (134)	OfferSize (135)
双边报价	>0	>0
买报价	>0	=0
卖报价	=0	>0
撤销报价	=0	=0

3) 对于期权集中竞价交易报价，如果 BidSize>0，则必须填写 BidPositionEffect，如果 OfferSize>0，则必须填写 OfferPositionEffect。

#### 4.2.2 报价状态回报（Quote Status Report）

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AI
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
1166	QuoteMsgID	Y	客户报价消息编号
522	OwnerType	Y	报价所有者类型
131	QuoteReqID	N	预留字段 当报价是对报价请求的响应时，填写报价请求 的 ID
537	QuoteType	N	报价类型 1=Tradeable，表示可交易的报价
297	QuoteStatus	N	报价状态 0=Accepted，接受 5=Rejected，拒绝
300	QuoteRejectReason	N	报价拒绝原因代码
1328	RejectText	N	报价拒绝原因说明
60	TransacTime	N	报价接收时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码

22	SecurityIDSource		Y	证券代码源
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
132	BidPx		N	买报价
133	OfferPx		N	卖报价
134	BidSize		N	买数量
135	OfferSize		N	卖数量
8909	BidPositionEffect		N	买开平仓标志 O=开仓 C=平仓
8910	OfferPositionEffect		N	卖开平仓标志 O=开仓 C=平仓
58	Text		N	Free Text

### 4.3 业务消息-意向申报处理

#### 4.3.1 意向申报 (Indication of Interest)

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=6
1180	ApplID	Y	应用标识 050=协议交易意向申报
23	IOIID	Y	客户意向申报编号 同一交易单元一个交易日内申报的所有意向申报 IOIID 不能重复
28	IOITransType	Y	意向申报类型 N=意向申报 C=意向申报撤单
26	IOIRefID	N	原意向申报 IOIID, 对于意向申报该字段取值为空,

				若为撤单则为被撤原意向申报 IOIID
54	Side		Y	买卖方向  1=买  2=卖
522	OwnerType		Y	意向申报所有者类型
60	TransacTime		N	意向申报发起时间
组件<Instrument>			Y	
48	SecurityID		Y	证券代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源  102=深圳证券交易所
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
27	IOIQty		N	数量
44	Price		N	价格
58	Text		N	对于协议交易业务用于填写联系人及联系方式，最多 50 个字符

注：

## 1) 参与人代码说明

意向申报必须包括以下三个参与人代码：

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码

## 4.3.2 意向申报响应 (Quote Response)

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AJ

10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
693	QuoteRespID	Y	交易所意向申报响应编号
694	QuoteRespType	Y	响应类型 2=意向申报响应
150	ExecType	Y	执行类型 0=New, 意向申报成功 4=Canceled, 意向申报撤单成功 8=Reject, 意向申报拒绝
300	QuoteRejectReason	N	拒绝原因代码, 响应类型为 8 时填写
1328	RejectText	N	拒绝原因说明, 响应类型为 8 时填写
23	IOIID	Y	客户意向申报编号
28	IOITransType	Y	意向申报类型
26	IOIRefID	N	原意向申报 IOIID, 对于意向申报该字段取值为空, 若为撤单则为被撤原意向申报 IOIID
54	Side	Y	买卖方向
522	OwnerType	Y	意向申报所有者类型
60	TransacTime	N	意向申报接收时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
448	PartyID	Y	参与人代码
447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束			
27	IOIQty	Y	订单数量
44	Price	N	价格
58	Text	N	

## 4.4 业务消息-成交申报处理

## 4.4.1 成交申报 (Trade Capture Report)

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AE
1180	ApplID	Y	应用标识
571	TradeReportID	Y	客户成交申报编号, 同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的客户成交申报编号不得重复
522	OwnerType	Y	成交申报所有者类型
828	TrdType	N	成交申报业务类别 1001=股票质押式回购初始交易 1002=股票质押式回购提前购回 1003=股票质押式回购到期购回 1004=股票质押式回购延期购回 1005=股票质押式回购终止购回 1006=股票质押式回购补充质押 1007=股票质押式回购部分解除质押 1008=股票质押式回购违约处置 1011=约定购回初始交易 1012=约定购回提前购回 1013=约定购回到期购回 1014=约定购回延期购回 1021=质押式报价回购初始交易 1022=质押式报价回购提前购回
829	TrdSubType	N	成交申报子业务类别, 预留
856	TradeReportType	Y	成交申报类型 0= Submit, 提交成交申报
487	TradeReportTransType	Y	成交申报事务类别 0=New, 新申报 1=Cancel, 撤销申报
1123	TradeHandlingInstr	N	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party report for matching, 协议配对
572	TradeReportRefID	N	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用

60	TransacTime		N	成交申报发起时间		
组件<Instrument>			Y			
48	SecurityID		Y	证券代码		
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源 102=深圳证券交易所		
组件结束						
组件<RootParties>			Y			
1116	NoRootPartyIDs		Y	参与人代码个数		
→	1117	RootPartyID	Y	参与人代码		
	1118	RootPartyIDSource	Y	参与人代码源		
	1119	RootPartyRole	Y	参与人代码角色		
组件结束						
组件<TrdCapRptSideGrp>			Y			
552	NoSides		Y	side 个数		
→	54	Side	Y	买卖方向		
	组件<Parties>		Y			
	453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数		
	→	448	PartyID	Y	参与人代码	
		447	PartyIDSource	Y	参与人代码源	
		452	PartyRole	Y	参与人代码角色	
	组件结束					
组件结束						
31	LastPx		Y	成交价格		
32	LastQty		Y	成交数量		
152	CashOrderQty		N	金额		
664	ConfirmID		N	约定号		
8911	ExpirationDays		N	期限，单位为天数		
8906	ExpirationType		N	期限类型，转融通证券出借填写 1=固定期限		
8908	ShareType		N	股份性质		
541	MaturityDate		N	购回交易日		
8907	ExpirationExecInst		Y	到期续做方式，质押式报价回购填写 1=到期自动续做		

			2=到期手动续做
423	PriceType	N	价格类型 1=Percentage, 表示收益率 3=Fixed amount, 表示绝对价格, 对于资产管理计划份额转让业务指按“人民币现金”报价
1126	OrigTradeID	N	初始交易交易所成交申报编号
10182	OrigTradeReportID	N	初始交易客户成交申报编号
1125	OrigTradeDate	N	初始交易成交申报申报日期
58	Text	N	Free Text

注：

1) 各业务成交申报模式为

应用标识 ApplID	说明	成交申报模式 TradeHandlingInstr
053	协议交易双方协议成交申报	协议配对
071	转融通证券出借约定申报	协议配对
080	资产管理计划份额转让	成交报告
090	股票质押式回购	成交报告
100	约定购回	成交报告
110	质押式报价回购	成交报告

2) RootParties 填写说明

a) 必须填写以下参与人代码：

PartyID (1117)	PartyIDSource (1118)	PartyRole (1119)
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元

b) 对于以下成交申报业务类别，还必须填写初始交易申报交易单元

- 1002=股票质押式回购提前购回
- 1003=股票质押式回购到期购回
- 1004=股票质押式回购延期购回
- 1005=股票质押式回购终止购回
- 1006=股票质押式回购补充质押
- 1007=股票质押式回购部分解除质押

- 1008=股票质押式回购违约处置
- 1010=约定购回提前购回
- 1011=约定购回到期购回
- 1012=约定购回延期购回
- 1014=质押式报价回购提前购回

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者 标识	13=初始交易申报 交易单元

c) 对于以下业务类别，还必须填写结算机构代码

- 资产管理计划份额转让 (080)
- 股票质押式回购 (090)
- 质押式报价回购 (110)

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
结算机构代码	F=交割机构	4=结算机构代码

### 3) TrdCapRptSideGrp 填写说明

业务	NoSides (552)	Side (54)	PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
协议交易双方协议成交申报 (053)	1	申报方 Side 1=买 2=卖	申报方交易单元	C=通用市场参与者 标识	1=申报交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			对手方交易单元	C=通用市场参与者 标识	17=对手方交易单元
转融通证券出借约定申报 (071)	1	申报方 Side G=借入 F=出借	申报方交易单元	C=通用市场参与者 标识	1=申报交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			对手方交易单元	C=通用市场参与者 标识	17=对手方交易单元
资产管理计划份额转让 (080)	2	1=转入方	交易单元	C=通用市场参与者 标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户



			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
		2=转出方	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
股票质押式回购 (090)	2	2=(资金)融入方	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
		1=(资金)融出方	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
约定购回 (100)	2	2=客户方(券融出)	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
		1=证券公司方	证券公司专用账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
质押式报价回购 (110)	2	1=客户方(资金融出)	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
		2=证券公司方	证券公司自营账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户

4) 除必填字段外, 各业务需选填字段说明如下:

应用标识 ApplID	可选字段填写说明
协议交易双方协议成交申报 (053)	必须填写 LastPx, LastQty, ConfirmID
转融通证券出借约定申报 (071)	必须填写 LastPx, LastQty, ConfirmID, ExpirationDays, ExpirationType
资产管理计划份额转让 (080)	必须填写 LastPx, LastQty, PriceType
股票质押式回购 (090)	必须填写 LastPx, 值为利率; 必须填写 TrdType;

	CashOrderQty 为选填字段，成交申报类别为初始交易时填写初始交易金额；成交申报类别为提前购回，到期购回，延期购回，终止购回时填写购回交易金额；成交申报类型为补充质押时不填；成交申报类型为部分解除质押时填写解除红利金额；成交申报类型为违约处置时不填； 必须填写 ShareType, MaturityDate; 成交申报类不为初始交易时，必须填写 OrigTradeID, TradeReportRefID, OrigTradeDate
约定购回（100）	必须填写 LastQty, 值为标的证券数量； 必须填写 CashOrderQty, 值为交易金额； 必须填写 MaturityDate; 必须填写 TrdType ; 成交申报类不为初始交易时，必须填写 OrigTradeID, TradeReportRefID, OrigTradeDate
质押式报价回购（110）	必须填写 LastQty, PriceType, ExpirationExecInst, ExpirationDays, MaturityDate; 必须填写 TrdType ; 成交申报类不为初始交易时，必须填写 OrigTradeID, TradeReportRefID, OrigTradeDate

#### 4.4.2 成交申报响应（Trade Capture Report Ack）

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AR
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
1003	TradeID	Y	交易所为成交申报分配的唯一 ID
571	TradeReportID	Y	客户成交申报编号，同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的客户成交申报编号不得重复
522	OwnerType	Y	成交申报所有者类型
828	TrdType	N	成交申报业务类别
829	TrdSubType	N	成交申报子业务类别
856	TradeReportType	Y	成交申报类型

487	TradeReportTransType		Y	成交申报事务类别	
1123	TradeHandlingInstr		N	成交申报模式	
572	TradeReportRefID		N	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用	
8912	TrdAckStatus		Y	成交申报响应状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	
939	TrdRptStatus		N	成交申报状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝 2=Cancelled, 已撤销 100=Unmatched, 尚未匹配 101=Matched, 已匹配	
751	TradeReportRejectReason		N	成交申报被拒绝原因代码	
1328	RejectText		N	成交申报被拒绝原因说明	
60	TransacTime		N	成交申报接收时间	
组件<Instrument>			Y		
48	SecurityID		Y	证券代码	
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源	
组件结束					
组件<RootParties>			Y		
1116	NoRootPartyIDs		Y	参与人代码个数	
→	1117	RootPartyID	Y	参与人代码	
	1118	RootPartyIDSource	Y	参与人代码源	
	1119	RootPartyRole	Y	参与人代码角色	
组件结束					
组件<TrdCapRptSideGrp>			Y		
552	NoSides		Y	side 个数	
→	54	Side	Y	买卖方向	
	组件<Parties>		Y		
	453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数	
	→	448	PartyID	Y	参与人代码
		447	PartyIDSource	Y	参与人代码源

		452	PartyRole	Y	参与人代码角色
	组件结束				
组件结束					
17	ExecID			Y	执行编号
31	LastPx			Y	成交价格
32	LastQty			Y	成交数量
152	CashOrderQty			N	金额
664	ConfirmID			N	约定号
8911	ExpirationDays			N	期限，单位为天数，转融通证券出借填写
8906	ExpirationType			N	期限类型，转融通证券出借填写
8908	ShareType			N	股份性质
541	MaturityDate			N	购回交易日
8907	ExpirationExecInst			Y	到期续做方式，质押式报价回购填写
423	PriceType			N	价格类型
1126	OrigTradeID			N	初始交易交易所成交申报编号
10182	OrigTradeReportID			N	初始交易客户成交申报编号
1125	OrigTradeDate			N	初始交易成交申报申报日期
58	Text			N	Free Text

#### 4.4.3 成交确认 (Trade Capture Report)

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AE
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
1003	TradeID	Y	交易所为成交申报分配的唯一 ID
571	TradeReportID	Y	客户成交申报编号，同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的客户成交申报编号不得重复
522	OwnerType	Y	成交申报所有者类型
828	TrdType	Y	成交申报业务类别
829	TrdSubType	N	成交申报子业务类别
856	TradeReportType	Y	成交申报类型
487	TradeReportTransType	Y	成交申报事务类别

				2=Replace，成交申报成功	
1123	TradeHandlingInstr		N	成交申报模式	
60	TransacTime		N	成交确认时间	
组件<Instrument>			Y		
48	SecurityID		Y	证券代码	
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源	
组件结束					
组件<RootParties>			Y		
1116	NoRootPartyIDs		Y	参与人代码个数	
→	1117	RootPartyID	Y	参与人代码	
	1118	RootPartyIDSource	Y	参与人代码源	
	1119	RootPartyRole	Y	参与人代码角色	
组件结束					
组件<TrdCapRptSideGrp>			Y		
552	NoSides		Y	side 个数	
→	54	Side	Y	买卖方向	
	组件<Parties>		Y		
	453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数	
	→	448	PartyID	Y	参与人代码
		447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
		452	PartyRole	Y	参与人代码角色
	组件结束				
组件结束					
17	ExecID		Y	执行编号	
31	LastPx		Y	成交价格	
32	LastQty		Y	成交数量	
152	CashOrderQty		N	金额	
664	ConfirmID		N	约定号	
8911	ExpirationDays		N	期限	
8906	ExpirationType		N	期限类型	
8908	ShareType		N	股份性质	
541	MaturityDate		N	购回交易日	
8907	ExpirationExecInst		Y	到期续做方式	

423	PriceType	N	价格类型
58	Text	N	Free Text

## 4.5 业务消息-注册处理

### 4.5.1 注册 (Designation)

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U001
1180	ApplID	Y	应用标识 200=转托管
522	OwnerType	Y	注册所有者类型
60	TransacTime	Y	注册发起时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
41	OrigClOrdID	N	原始交易的客户订单编号, 指示被主动撤单的委托
8502	DesignationInstruction	Y	注册指令 3=转托管
8527	DesignationTransType	Y	注册类型 1=New 表示新注册请求 3=Cancel 表示注册撤单
组件<Instrument>		N	
48	SecurityID	Y	证券代码 如果是系统内转托管, 证券代码可填空表示转托管所有证券
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>		N	
38	OrderQty	Y	转托管数量

			如果是系统内转托管，数量可填 0 表示转托管全部持有量
组件结束			

注：

1) 参与者代码说明

转托管申报必须包括以下四个参与者代码：

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
转入交易单元代码	C=通用市场参与者标识	40=转入交易单元代码

#### 4.5.2 注册执行报告

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U002
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
522	OwnerType	Y	注册所有者类型
60	TransacTime	Y	注册接收时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
41	OrigClOrdID	N	原始交易的客户订单编号，指示被主动撤单的委托
37	OrderID	Y	交易所订单编号
17	ExecID	Y	执行编号
150	ExecType	Y	执行类型 0=New 订单被接受 4=Cancelled 订单被主动撤单 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
103	OrdRejReason	N	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
1328	RejectText	N	拒绝原因说明，执行类型为 8 时填写
8502	DesignationInstruction	Y	注册指令

组件<Instrument>		N	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>		N	
38	OrderQty	Y	转托管数量
组件结束			

## 4.6 业务消息-网络投票处理消息

### 4.6.1 投票

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U004
1180	ApplID	Y	应用标识 210=投票
522	OwnerType	Y	投票所有者类型
60	TransacTime	Y	投票发起时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	投票代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源



	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
8529		VotingProposal	Y	投票议案号 1-99 表示具体议案号 100 表示总议案
8530		VotingSubProposal	N	投票子议案号或选举候选人 0 表示所有子议案 >0 其他表示具体子议案
8531		VotingPreference	Y	投票意向 1 代表同意, 2 代表反对, 3 代表弃权
组件<OrderQtyData>			N	
38		OrderQty	Y	投票数量 (累计投票制选举候选人时必须填)
组件结束				

注:

1) 参与人代码说明

投票申报必须包括以下三个参与人代码:

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者 标识	1=申报交易单元
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码

#### 4.6.2 投票执行报告

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U005
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
522	OwnerType	Y	投票所有者类型
60	TransacTime	Y	投票接收时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
37	OrderID	Y	交易所订单编号

17	ExecID	Y	执行编号
150	ExecType	Y	执行类型 0=New 表示投票成功 8=Reject 表示投票失败
103	OrdRejReason	N	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
1328	RejectText	N	拒绝原因说明，执行类型为 8 时填写
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	投票代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
8529	VotingProposal	Y	投票议案号
8530	VotingSubProposal	N	投票子议案号或选举候选人
8531	VotingPreference	Y	投票意向
组件<OrderQtyData>		N	
38	OrderQty	Y	投票数量
组件结束			

#### 4.6.3 密码服务

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U006
1180	ApplID	Y	应用标识 211=密码服务激活 212=密码服务挂失
522	OwnerType	Y	所有者类型
60	TransacTime	Y	发起时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号

组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
8539	ValidationCode	Y	密码激活校验号

注：

1) 参与人代码说明

网络投票密码服务申报必须包括以下三个参与人代码：

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者 标识	1=申报交易单元
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码

#### 4.6.4 密码服务执行报告

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U007
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
522	OwnerType	Y	所有者类型
60	TransacTime	Y	接收时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
37	OrderID	Y	交易所订单编号
17	ExecID	Y	执行编号
150	ExecType	Y	执行类型 0=New 表示请求接受 8=Reject 表示请求失败
103	OrdRejReason	N	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
1328	RejectText	N	拒绝原因说明，执行类型为 8 时填写

组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
8539	ValidationCode	Y	密码激活校验号

## 五、 其它消息

### 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject)

Tag	域名	必须	字段描述
	Standard Header	Y	MsgType=j
45	RefSeqNum	N	被拒绝消息的消息序号
327	RefMsgType	Y	被拒绝的消息类型
组件<Parties>		N	
453	NoPartyIDs	N	参与方代码个数=1, 为申报交易单元
→	448	PartyID	申报交易单元
	447	PartyIDSource	取 C, 表示通用市场参与者标识
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 为申报交易单元
379	BusinessRejectRefID	N	被拒绝消息对应的业务层 ID, 需要填写业务层 ID 的消息参见下面的列表。
380	BusinessRejectReason	Y	拒绝原因
58	Text	N	详细描述, 最多 50 个字符

消息及业务层 ID 对应表:

消息类型	被拒绝消息对应的业务层 ID
新订单 (New Order)	ClOrdID
错误!未找到引用源。撤单请求 (Order Cancel Request)	ClOrdID
报价 (Quote)	QuoteMsgID
意向申报 (IOI)	IOIID
成交申报 (TCR)	TradeReportID

注册	ClOrdID
投票	ClOrdID
投资者网络投票密码服务	ClOrdID

## 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization)

本消息用于 OMS 在成功登录 TGW 后,告知 TGW 期望接收的下一条回报的记录号。

Tag	域名	必须	字段描述
	Standard Header	Y	MsgType=U101
10179	ReportIndex	Y	OMS 期望接收的下一条回报的记录号。 收到本消息后, TGW 会从该记录号开始向 OMS 发送回报消息; 如果没有收到该消息, TGW 不会向 OMS 发送回报。

## 5.3 平台状态消息 (Platform State Info)

本消息用于第五版交易系统向 OMS 提供各平台的当前状态,便于 OMS 控制是否发送委托。

OMS 成功登录到 TGW 后,会收到一条平台状态消息,消息中描述相应平台的当前状态。当每个平台的状态发生变化时, OMS 都会收到一条平台状态消息,描述该平台的最新状态。

Tag	域名	必须	字段描述
	Standard Header	Y	MsgType=U102
10180	PlatformID	Y	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台
10181	PlatformStatus	Y	平台状态 0=PreOpen, 未开放 1=OpenUpcoming, 即将开放 2=Open, 开放 3=Halt, 暂停开放 4=Close, 关闭

## 5.4 回报结束消息 (Report Finished)

TGW 使用该消息通知 OMS 本交易日所有回报发送完毕。

Tag	域名	必须	字段描述
	Standard Header	Y	MsgType=U103
10179	ReportIndex	Y	回报记录号 该回报记录号与各类回报消息中的回报记录号连续编号
10180	PlatformID	Y	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台

## 六、 数据字典

### 6.1 数据类型

数据类型	类型定义	说明
Price	N13(4)	价格
Qty	N15(2)	数量
Amt	N18(4)	金额
SeqNum	N18	消息序号 正数
Boolean	C1	'Y'=True/Yes, 'N'=False/No
Length	N9	长度 表示字节为单位的数据长度, 正数
UTCTimeStamp	C21	国际标准时间戳 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss (毫秒), YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60 (秒), sss=000-999 (毫秒)。
LocalTimeStamp	C21	本地时间戳 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss (毫秒), YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60 (秒), sss=000-999 (毫秒)。

NumInGroup	N9	重复数 表示重复组的项数，正数
LocalMktDate	C8	本地市场日期 格式 YYYYMMDD, YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31

注：

1) 数据类型说明：

- ✓ Cx 表示字符串, x 表示字符串最大长度, 除非特别声明, 字符串均可包含数字, 大写字母以及小写字母;
- ✓ Nx 表示十进制整数, x 表示整数最大位数 (不包括正负号), 除非特别声明, 整数类型均有正负;
- ✓ Nx(y) 表示浮点数, x 表示整数与小数总计位数, 不包括小数点, y 表示小数位数, 小数位数不足时必须在后面补 0, 比如 N5(3) 类型的值 18.460 是合法的, 18.46 以及 18.4600 都是不合法的; 除非特别声明, 浮点数类型均有正负。

## 6.2 会话层域定义

Tag	域名	类型	说明
7	BeginSeqNo	SeqNum	起始消息序号
8	BeginString	C9	起始串 固定为 STEP.1.20
9	BodyLength	Length	消息体长度
10	Checksum	C3	校验和 不加密, 必须是最后一个域 校验算法参见 STEP 协议
16	EndSeqNo	SeqNum	结束消息序号
34	MsgSeqNum	SeqNum	消息序号, 由 1 开始
35	MsgType	C8	消息类型
36	NewSeqNo	SeqNum	新消息序号
43	PossDupFlag	Boolean	指示该消息序号的消息可能重复发送, 取值: =Y: 可能重复 =N: 首次发送
49	SenderCompID	C20	接收方代码
52	SendingTime	UTCTimestamp	消息发送时间
56	TargetCompID	C20	发送方代码
58	Text	C200	文本 长度不超过 200。
97	PossResend	Boolean	可能重发标志 指示该消息可能发送过 (使用不同的消息序号), 取值:

			=Y: 可能重发 =N: 首次发送
98	EncryptMethod	Int	加密方法 =0: 即不加密
108	HeartBtInt	Int	心跳监测的时间间隔 为系统设定值,以秒为单位
112	TestReqID	C32	用于测试请求消息,将包含在回应的心跳消息中。
123	GapFillFlag	Boolean	缺口填补标志 用于序号重设消息,指示是否填补缺口,取值: =Y: 序号重设-缺口填补消息,消息序号域有效 =N 或不存在序号重设-重设消息,消息序号域无效
347	MessageEncoding	C16	消息中编码域的字符编码类型 =GBK
383	MaxMessageSize	Length	最大消息长度,单条消息的最大字节数。 <b>该字段暂未启用</b>
789	NextExpectedMsgSeqNum	SeqNum	接收方期望得到的下一条消息序号
1137	DefaultApplVerID	C8	本次会话中使用的 FIX 消息的缺省版本。
1407	DefaultApplExtID	Int	本次会话中使用的 FIX 消息[在 Tag1137 基础上] 的缺省扩展包。
1408	DefaultCstmApplVerID	C8	本次会话中, FIX 消息的缺省自定义应用版本。本 标签是对 tag 1137 + tag 1407 的进一步约束。 <b>本字段填写交易所发布的数据协议版本</b>

### 6.3 业务层域定义

Tag	域名	类型	说明
11	ClOrdID	C10	客户订单编号 同一交易单元每个交易日申报的委托 的 ClOrdID 不得重复
14	CumQty	Qty	累计执行数量
17	ExecID	C16	交易所赋予的执行编号,单个交易日内 不重复
22	SecurityIDSource	C4	证券代码源 102=深圳证券交易所
23	IOIID	C10	客户意向申报编号 同一交易单元每个交易日申报的意向 申报的 IOIID 不得重复
26	IOIRefID	C10	原意向申报 IOIID 撤销意向申报时使用



27	IOIQty	Qty	意向申报数量
28	IOITransType	C1	意向申报类型 N=意向申报 C=意向申报撤单
31	LastPx	Price	成交价格
32	LastQty	Qty	成交数量
37	OrderID	C16	交易所订单编号 交易所赋予的订单编号，跨交易日不重复
38	OrderQty	Qty	订单数量
39	OrdStatus	C1	订单状态 0=New，表示新订单 1=Partially filled，表示部分成交 2=Filled，表示全部成交 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝
40	OrdType	C1	订单类型 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优
41	OrigClOrdID	C10	原订单 ClOrdID
44	Price	Price	价格
45	RefSeqNum	SeqNum	引用的消息序号
48	SecurityID	C8	证券代码
54	Side	C1	买卖方向 1=买 2=卖 G=借入 F=出借 D=申购 E=赎回
58	Text	C8	自由格式文本串，如无特别说明最多 8 个字符，超过部分将被自动截掉
59	TimeInForce	C1	订单有效时期类型

			0 表示当日有效 3 表示即时成交或取消 (IOC)
60	TransacTime	LocalTimestamp	订单或执行的创建时间
77	PositionEffect	C1	开平仓标识 O 表示开仓 C 表示平仓
99	StopPx	Price	止损价格
102	CxlRejReason	N5	撤单拒绝原因代码, 正数
103	OrdRejReason	N5	订单拒绝原因代码, 正数
110	MinQty	Qty	最低成交数量
150	ExecType	C1	执行报告类型 0=New, 表示新订单 4=Cancelled, 表示已撤销 8=Reject, 表示已拒绝 F=Trade, 表示已成交
151	LeavesQty	Qty	订单剩余数量
152	CashOrderQty	Amt	订单现金金额
203	CoveredOrUncovered	N1	备兑标签, 衍生品交易填写 0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑
297	QuoteStatus	N2	报价状态 0=Accepted, 接受 5=Rejected, 拒绝
300	QuoteRejectReason	N5	意向申报拒绝原因代码, 正数
305	UnderlyingSecurityIDSource	C4	基础证券代码源
309	UnderlyingSecurityID	C8	基础证券代码
327	RefMsgType	C8	被拒绝的消息类型
379	BusinessRejectRefID	C10	被拒绝消息对应的业务层 ID
380	BusinessRejectReason	N5	拒绝原因
423	PriceType	N2	1=百分比 3=固定数量
453	NoPartyIDs	NumInGroup	参与方个数
487	TradeReportTransType	N1	成交申报事务类别 0=New, 新申报

			1=Cancel, 撤销申报 2=Replace, 成交申报成功
522	OwnerType	N4	所有者类型, 正数 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起 106=结算结构发起
541	MaturityDate	LocalMktDate	到期日
544	CashMargin	C1	融资融券信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融券融券平仓
571	TradeReportID	C10	客户成交申报编号 同一交易单元每个交易日申报的成交申报的 TradeReportID 不得重复
572	TradeReportRefID	C10	原客户成交申报编号, 最多 8 个字符
664	ConfirmID	C8	约定号 8 位数字字符串, 不足 8 位前补 0
693	QuoteRespID	C16	交易所意向申报编号 交易所赋予的意向申报编号, 跨交易日不重复
694	QuoteRespType	N2	意向申报响应类型 2=意向申报响应
751	TradeReportRejectReason	N5	成交申报拒绝原因代码
828	TrdType	N5	成交申报类型, 正数 1001=股票质押式回购初始交易 1002=股票质押式回购提前购回 1003=股票质押式回购到期购回 1004=股票质押式回购延期购回 1005=股票质押式回购终止购回 1006=股票质押式回购补充质押

			1007=股票质押式回购部分解除质押 1008=股票质押式回购违约处置 1011=约定购回初始交易 1012=约定购回提前购回 1013=约定购回到期购回 1014=约定购回延期购回 1021=质押式报价回购初始交易 1022=质押式报价回购提前购回
829	TrdSubType	N4	成交申报子业务类别，正数
856	TradeReportType	N1	成交申报消息类型 0=Submit，提交成交申报
939	TrdRptStatus	N	成交申报状态 0=Accepted，接受 1=Rejected，拒绝 2=Cancelled，已撤销 100=Unmatched，尚未匹配 101=Matched，已匹配
1003	TradeID	C16	交易所成交申报编号 交易所赋予的成交申报编号，跨交易日不重复
1090	MaxPriceLevels	N4	最多成交价位数，正数 0 表示不限制成交价位数
1116	NoRootPartyIDs	NumInGroup	参与人代码个数
1123	TradeHandlingInstr	C1	成交申报模式 1=Two-Party Report，成交报告 2=One-Party report for matching，协议配对
1125	OrigTradeDate	LocalMktDate	初始成交申报申报日期
1126	OrigTradeID	C16	初始成交申报的 TradeID
1166	QuoteMsgID	C10	客户报价消息编号
1180	ApplID	C3	应用标识
1328	RejectText	C16	拒绝原因说明
8502	DesignationInstruction	C1	注册指令 3 表示转托管

8527	DesignationTransType	N1	注册指令类型 1=New, 表示新注册请求 3=Cancel, 表示注册撤单
8529	VotingProposal	N4	投票议案号, 正数 1-99 表示具体议案号 100 表示总议案
8530	VotingSubProposal	N4	投票子议案号或选举候选人, 正数 0 表示所有子议案 >0 其他表示具体子议案
8531	VotingPreference	C1	投票意向 1 代表同意, 2 代表反对, 3 代表弃权
8539	VelidationCode	N9	密码激活校验号, 正数
8902	NoSecurity	NumInGroup	证券只数
8903	DeliverQty	Qty	证券交付数量
8904	SubstCash	Amt	现金替代金额
8906	ExpirationType	N2	期限类型 1 表示固定期限
8907	ExpirationExecInst	N2	到期续做方式 1 表示到期自动续做 2 表示到期手动续做
8908	ShareType	C4	股份性质
8909	BidPositionEffect	C1	买开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
8910	OfferPositionEffect	C1	卖开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
8911	ExpirationDays	N4	期限, 单位为天数
8912	TrdAckStatus	C1	成交申报响应状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
10179	ReportIndex	SeqNum	回报记录号, 从 1 开始编号
10180	PlatformID	N4	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台

			3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台
10181	PlatformStatus	N4	平台状态 0=PreOpen, 未开放 1=OpenUpComing, 即将开放 2=Open, 开放 3=Halt, 暂停开放 4=Close, 关闭
10182	OrigTradeReportID	C10	初始交易客户成交申报编号

#### 6.4 参与人编码

参与人代码 PartyID	参与人代码源 PartyIDSource	参与人代码角色 PartyRole
证券账户 (最多 12 个字符, 不足 12 个字符后补空格)	5 表示中国投资者编号	5 表示投资者证券账户 39 表示对手方投资者证券账户
交易单元 (PBU) (6 个字符)	C 表示通用市场参与者标识	1 表示交易单元 13 表示初始交易申报交易单元 17 表示对手方交易单元
营业部代码 (最多 4 个字符, 不足 4 个字符后补空格)	D 表示自定义代码	4001 表示营业部代码 4002 表示对手方营业部代码
结算机构代码 (2 个字符)	F 表示交割机构	4 表示结算机构代码
收购人编码 (6 个字符)	D 表示自定义代码	4003 表示要约收购收购人编码
合约账户标识码 (6 个字符)	C 表示通用市场参与者标识	38 表示合约账户标识码