



工程技术标准

# 深圳证券交易所 Binary 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<br>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<br>证券交易数据交换协议。 |
| FIX  | Financial Information Exchange<br>金融信息交换协议。         |

# 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 心跳包和测试请求 .....                                 | 2  |
| 2.2.3 终止会话 .....                                     | 2  |
| 2.2.4 重建会话 .....                                     | 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 .....                                   | 6  |
| 3.4 新订单处理消息流图 .....                                  | 6  |
| 3.4.1 新订单消息流图 .....                                  | 7  |
| 3.4.2 撤单请求消息流图 .....                                 | 8  |
| 3.5 报价处理消息流图 .....                                   | 8  |
| 3.6 意向申报处理消息流图 .....                                 | 10 |
| 3.7 成交申报处理消息流图 .....                                 | 11 |
| 3.7.1 协议配对申报模式 (one party report for matching) ..... | 11 |
| 3.7.1.1 新成交申报处理 .....                                | 11 |
| 3.7.1.2 撤销尚未完成配对的成交申报 .....                          | 13 |
| 3.7.2 成交报告申报模式 (two party report) .....              | 14 |
| 3.8 转托管处理消息流图 .....                                  | 15 |
| 3.9 网络投票处理消息流图 .....                                 | 16 |
| 3.9.1 投票处理消息流图 .....                                 | 16 |
| 3.9.2 密码服务处理消息流图 .....                               | 17 |
| 3.10 应用层消息恢复 .....                                   | 17 |
| 四、 消息定义 .....  | 18 |
| 4.1 消息结构 .....                                       | 18 |
| 4.1.1 消息头 .....                                      | 18 |
| 4.1.2 消息尾 .....                                      | 19 |
| 4.2 管理消息 .....                                       | 19 |
| 4.2.1 登录消息 (Logon) .....                             | 19 |
| 4.2.2 注销消息 (Logout) .....                            | 19 |
| 4.2.3 心跳消息 (Heartbeat) .....                         | 20 |
| 4.3 业务消息-新订单处理 .....                                 | 20 |
| 4.3.1 新订单 (New Order) .....                          | 20 |
| 现货集中竞价业务新订单扩展字段 (100101) .....                       | 22 |

|                  |   |    |
|------------------|---|----|
|                  | 质押式回购交易业务新订单扩展字段 (100201) .....         | 23 |
|                  | 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100401) .....        | 23 |
|                  | 协议交易业务新订单扩展字段 (100501) .....            | 23 |
| 4.3.1.2          | 转融通证券出借业务新订单扩展字段 (100701) .....         | 24 |
| 4.3.1.3          | 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段 (101701) .....       | 24 |
| 4.3.1.4          | 要约收购业务新订单扩展字段 (101801) .....            | 24 |
| 4.3.2            | 撤单请求 (Order Cancel Request) .....       | 24 |
| 4.3.3            | 撤单失败响应 (Cancel Reject) .....            | 25 |
| 4.3.1.7<br>4.3.4 | 订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report) .....  | 25 |
|                  | 现货集中竞价业务执行报告扩展字段 (200102) .....         | 28 |
|                  | 质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200202) .....        | 28 |
| 4.3.4.1          | 期权集中竞价业务执行报告扩展字段 (200402) .....         | 28 |
| 4.3.4.2          | 协议交易业务执行报告扩展字段 (200502) .....           | 29 |
| 4.3.4.3          | 转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200702) .....        | 29 |
| 4.3.4.4          | ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段 (201202) .....     | 29 |
| 4.3.4.5          | 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段 (201702) .....      | 29 |
| 4.3.4.7          | 要约收购业务执行报告扩展字段 (201802) .....           | 29 |
| 4.3.5            | 订单成交执行报告 (Execution Report) .....       | 30 |
|                  | 现货集中竞价业务执行报告扩展字段 (200115) .....         | 31 |
| 4.3.5.1          | 质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200215) .....        | 31 |
| 4.3.5.2          | 期权集中竞价业务执行报告扩展字段 (200415) .....         | 31 |
| 4.3.5.3          | 协议交易业务执行报告扩展字段 (200515) .....           | 32 |
| 4.3.5.4          | 转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200715) .....        | 32 |
| 4.4              | 业务消息-报价处理 .....                         | 32 |
| 4.4.1            | 报价 (Quote) .....                        | 32 |
| 4.4.1.1          | 期权集中竞价业务报价扩展字段 (100405) .....           | 33 |
| 4.4.2            | 报价状态回报 (Quote Status Report) .....      | 33 |
|                  | 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段 (200406) .....       | 34 |
| 4.5              | 业务消息-意向申报处理 .....                       | 35 |
| 4.5.1            | 意向申报 (Indication of Interest) .....     | 35 |
| 4.5.2.1          | 协议交易意向申报扩展字段 (100509) .....             | 36 |
| 4.5.2            | 意向申报响应 (Quote Response) .....           | 36 |
|                  | 协议交易意向申报扩展字段 (200510) .....             | 37 |
| 4.6.1.1          | 业务消息-成交申报处理 .....                       | 37 |
| 4.6.1.2          | 成交申报 (Trade Capture Report) .....       | 37 |
| 4.6.1.3          | 转融通证券出借业务成交申报扩展字段 (100703) .....        | 40 |
| 4.6.1.4          | 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段 (100803) .....     | 40 |
| 4.6.1.5          | 股票质押式回购业务成交申报扩展字段 (100903) .....        | 40 |
|                  | 约定购回业务成交申报扩展字段 (101003) .....           | 41 |
|                  | 质押式报价回购业务成交申报扩展字段 (101103) .....        | 41 |
| 4.6.2            | 成交申报响应 (Trade Capture Report Ack) ..... | 41 |
| 4.6.3            | 成交确认 (Trade Capture Report) .....       | 43 |
| 4.7              | 业务消息-转托管处理消息 .....                      | 45 |

|           |                                     |           |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 4.7.1     | 注册 (Designation)                    | 45        |
| 4.7.2     | 注册执行报告 (Designation Report)         | 45        |
| 4.8       | 业务消息-网络投票处理消息                       | 47        |
| 4.8.1     | 投票 (Netvote)                        | 47        |
| 4.8.2     | 投票执行报告 (Netvote)                    | 48        |
| 4.8.3     | 密码服务 (Netvote Password Service)     | 48        |
| 4.8.4     | 密码服务执行报告 (Netvote Password Service) | 49        |
| <b>五、</b> | <b>其它消息</b>                         | <b>50</b> |
| 5.1       | 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT)            | 50        |
| 5.2       | 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION)     | 51        |
| 5.3       | 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO)        | 51        |
| 5.4       | 回报结束消息 (REPORT FINISHED)            | 52        |
| <b>六、</b> | <b>数据字典</b>                         | <b>52</b> |
| 6.1       | 数据类型                                | 52        |
| 6.2       | 会话层域定义                              | 53        |
| 6.3       | 业务层域定义                              | 53        |

# 深圳证券交易所 Binary 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 Binary 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、消息内容、以及消息流描述与 STEP 交易数据接口规范基本一致，可以互为参考。

本接口规范采用 UTF-8 编码。

## 二、会话机制

### 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订单管理系统接入。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

交易网关和订单管理系统必须位于同一个安全网络之中，交易网关和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：

1. 订单管理系统首先建立一个到交易网关的 TCP/IP 连接，然后发送一个 Logon 消息给交易网关。
2. 如果交易网关验证订单管理系统有权登录，那么交易网关会返回 Logon 消息给订单管理系统，作为一个登录消息的确认，表示本次会话登录成功。
3. 如果订单管理系统登录验证失败，那么交易网关会返回 Logout 消息给订单管理系统，表示本次会话登录失败。

4. 订单管理系统发送 Logon 消息后，如果交易网关没有在适当的时间间隔里作回应，则可以关闭连接，并在等待一段时间后再尝试连接。
5. 如果订单管理系统断线或收到交易网关的 Logout 消息，也应该等待一段时间后再次尝试连接。

### 2.2.2 心跳包和测试请求

为了交易网关和订单管理系统通信的双方能够实时监测通信链路状态，要求通信双方在数据空闲时互相发送心跳包，当一方没有接收到数据包的时间超过两倍的心跳间隔时，则可认为是数据链路发生故障，接收方可以断开此异常链接。

当订单管理系统登录到交易网关时，订单管理系统应在登录消息中指定心跳间隔参数（单位为秒）。

在一个心跳间隔时间内，如果交易网关没有需要向订单管理系统发送的数据，那么交易网关会向订单管理系统发送一个心跳消息，以保证两条消息之间的时间间隔不会超过设定的心跳间隔；同样，订单管理系统必要时也应该发送心跳消息来保证交易网关收到的连续两条消息之间的时间间隔不超过心跳间隔时间。

订单管理系统也可以采用类似的检测机制对交易网关和订单管理系统之间的连接情况进行检测。

### 2.2.3 终止会话

订单管理系统和交易网关都能通过发送 Logout 消息要求终止会话。对方接收到 Logout 消息请求后，会发送一条 Logout 消息回应，发起方收到 Logout 消息回应后，终止连接；如果对方没有在适当的时间间隔里作回应，则可终止连接。

### 2.2.4 重建会话

如果会话被终止，订单管理系统可以通过登录消息重建会话。

重建会话后，订单管理系统应通过应用层规则进行下行数据同步。

## 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<br>(原综合协议交易平台) | 协议交易                                       | 9:15-11:30<br>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<br>13:00-15:00 |
|                         | 网上发行认购<br>(包括 IPO, 增发, LOF 发行,<br>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)                               |                           |
| 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。

接口规范中的委托申报消息类型有：

| 消息类型                     | 报文号    | 说明      |
|--------------------------|--------|---------|
| New Order                | 10xx01 | 新订单     |
| Quote                    | 10xx05 | 报价      |
| IOI                      | 10xx09 | 意向申报    |
| Trade Capture Report     | 10xx03 | 成交申报    |
| Designation              | 102099 | 注册（转托管） |
| NetVote                  | 102097 | 网络投票    |
| Netvote Password Service | 102096 | 密码服务    |

不同业务可能使用同一种消息类型进行委托申报，但是申报的要素可能有差别，因此同一种消息类型按照业务类型又分为多种报文，以报文号加以区别。

同一业务可能有多种委托申报类型，因此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。

各类业务的委托申报的报文号及 ApplID 如下表所示：

| 委托申报类型                  | 申报消息类型<br>MsgType | 应用标识<br>ApplID | 所属平台        |
|-------------------------|-------------------|----------------|-------------|
| 现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易订单申报 | 100101            | 010            | 现货集中竞价交易平台  |
| 质押式回购交易订单申报             | 100201            | 020            | 现货集中竞价交易平台  |
| 债券分销订单申报                | 100301            | 030            | 现货集中竞价交易平台  |
| 期权集中竞价交易订单申报            | 100401            | 040            | 衍生品集中竞价交易平台 |
| 期权集中竞价交易报价申报            | 100405            | 041            |             |
| 协议交易意向申报                | 100509            | 050            | 综合金融服务平台    |
| 协议交易定价申报                | 100501            | 051            |             |

|  |        |     |          |
|--|--------|-----|----------|
| 协议交易点击成交申报   | 100501 | 052 |          |
| 协议交易双方配对成交申报   | 100503 | 053 |          |
| 以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报                                      | 100601 | 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                                 | 100601 | 061 |          |
| 转融通证券出借非约定申报   | 100701 | 070 | 综合金融服务平台 |
| 转融通证券出借约定申报  | 100703 | 071 |          |
| 资产管理计划份额转让   | 100803 | 080 | 综合金融服务平台 |
| 股票质押式回购  | 100903 | 090 | 综合金融服务平台 |
| 约定购回   | 101003 | 100 | 综合金融服务平台 |
| 质押式报价回购  | 101103 | 110 | 综合金融服务平台 |
| ETF 实时申购赎回申报<br>(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) | 101201 | 120 | 非交易处理平台  |
| 网上发行认购申报   | 101301 | 130 | 非交易处理平台  |
| 配股认购申报   | 101401 | 140 | 非交易处理平台  |
| 债券转股申报   | 101501 | 150 | 非交易处理平台  |
| 债券回售申报   | 101501 | 151 |          |
| 行权申报   | 101601 | 160 | 非交易处理平台  |
| 开放式基金申购赎回申报  | 101701 | 170 | 非交易处理平台  |
| 要约收购预受要约申报   | 101801 | 180 | 非交易处理平台  |
| 要约收购解除预受要约申报   | 101801 | 181 | 非交易处理平台  |
| 质押式回购质押申报  | 101901 | 190 | 非交易处     |

|                                      |        |     |             |
|--------------------------------------|--------|-----|-------------|
| 质押式回购解押申报                            | 101901 | 191 | 理平台         |
| 转托管                                  | 102099 | 200 | 非交易处<br>理平台 |
| 投票                                   | 102197 | 210 | 非交易处<br>理平台 |
| 密码服务激活                               | 102196 | 211 |             |
| 密码服务挂失                               | 102196 | 212 |             |
| 黄金 ETF 实物申购赎回申报<br>(该委托只能由上海黄金交易所申报) | 102201 | 220 | 非交易处<br>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，交易系统会首先作一些基本合法性检查，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=4) 消息通知 OMS 委托被拒绝。

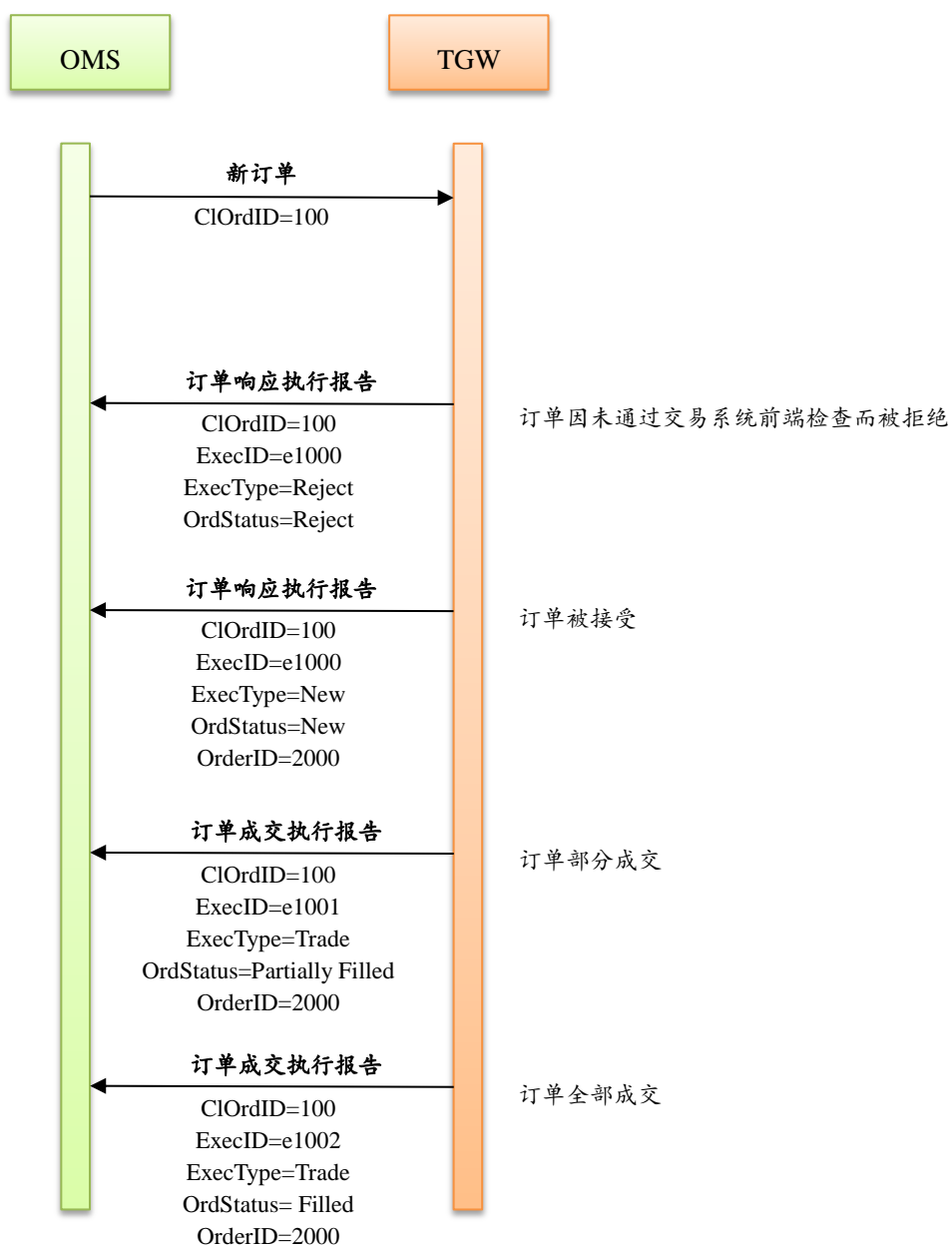
如果通过基本合法性检查，交易系统会根据委托消息类型的不同给 OMS 发出相应的回报消息，具体参见 3.4-3.9 节。

### 3.4 新订单处理消息流图

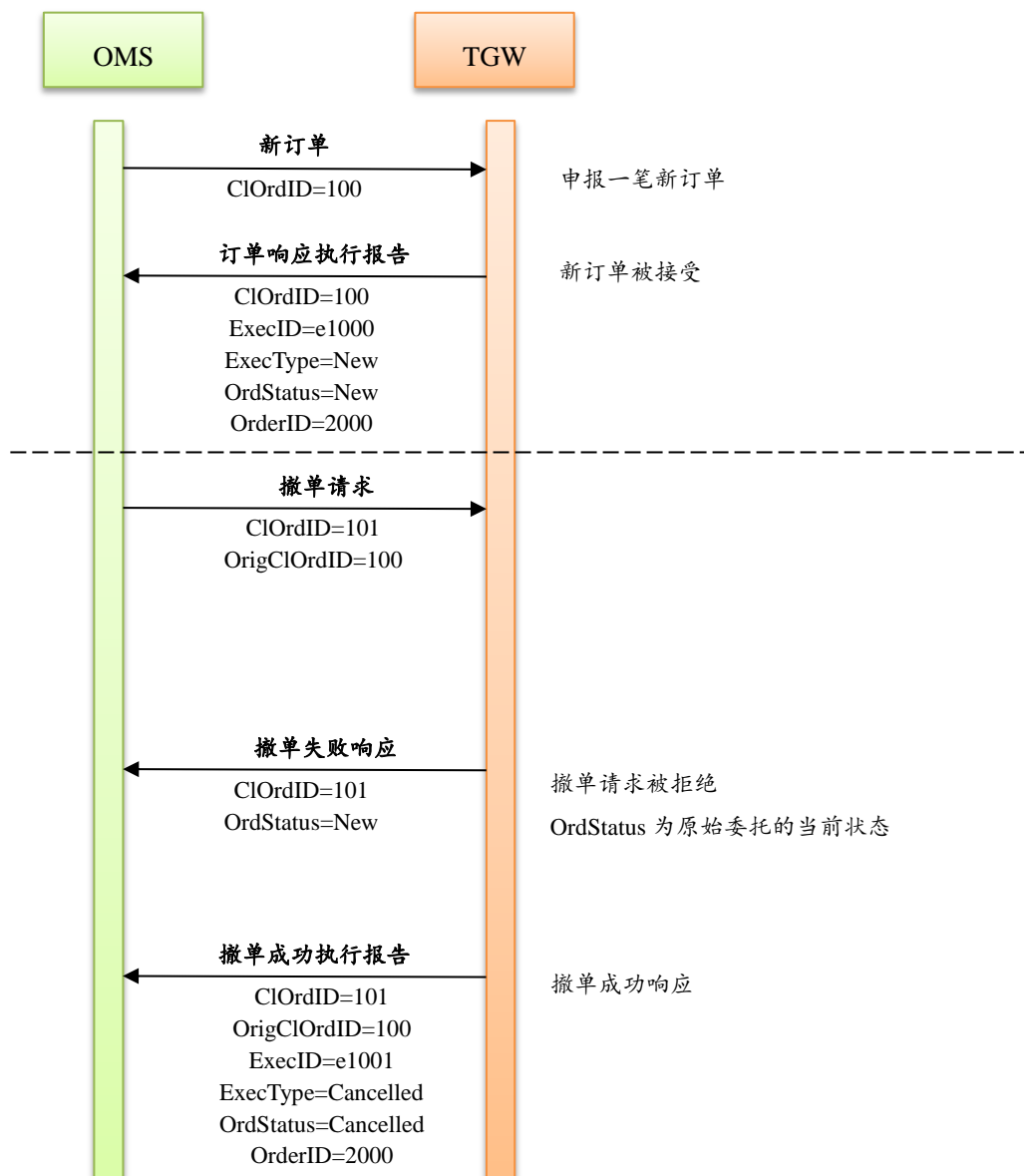
对于 OMS 提交的新订单，交易系统以执行报告消息作为响应。执行报告消息分为两类报文，一类报文用于新订单的确认响应、撤单成功时的响应以及委托被交易系统自动撤销时（比如市价委托剩余自动撤销）的响应 (MsgType=20xx02)，一类报文用于新订单达成成交时的响应 (MsgType=20xx15)。

对于 ETF 实时申购赎回、行权等非交易订单，只会回报上述第一类执行报告。

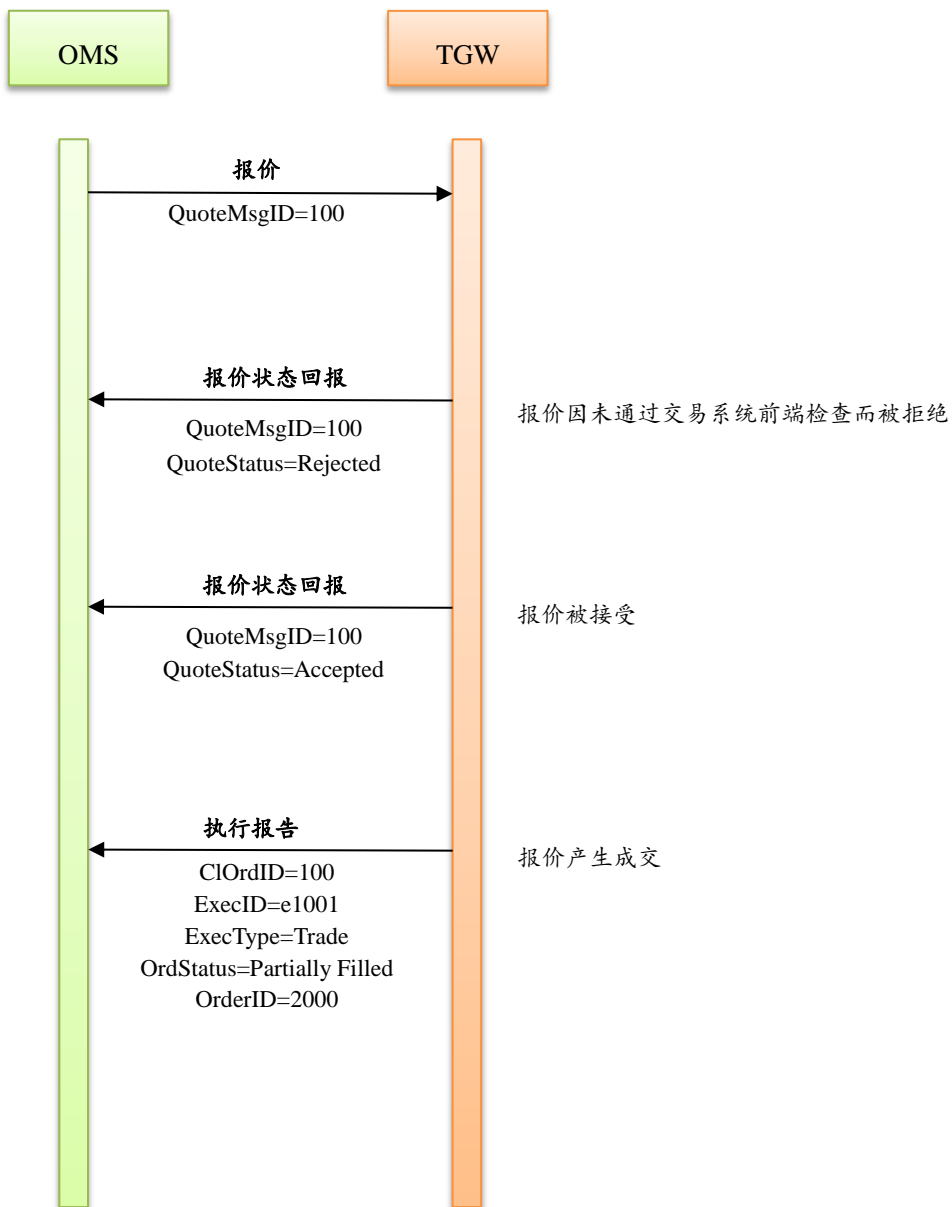
### 3.4.1 新订单消息流程图



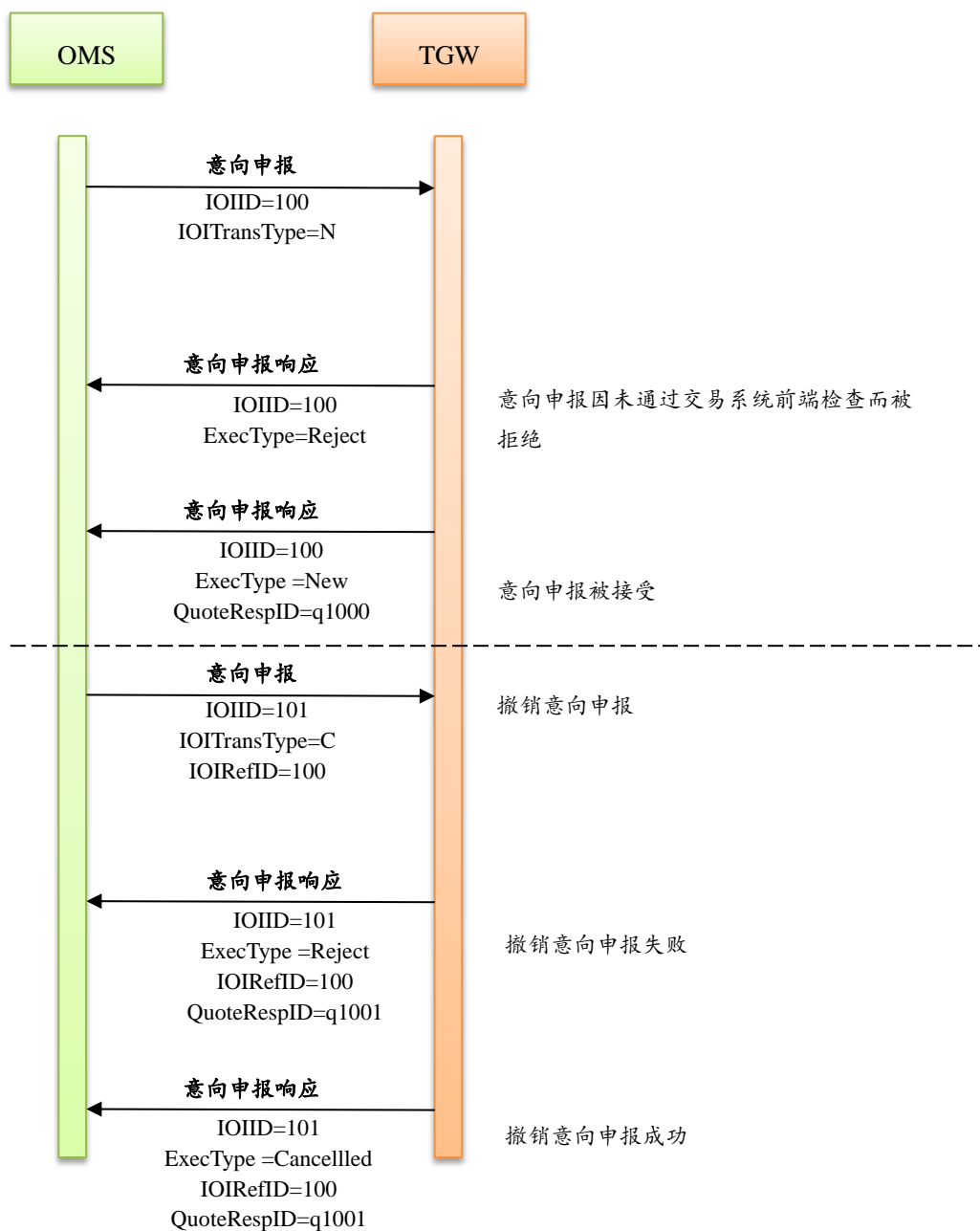
### 3.4.2 撤单请求消息流图



### 3.5 报价处理消息流图



### 3.6 意向申报处理消息流图



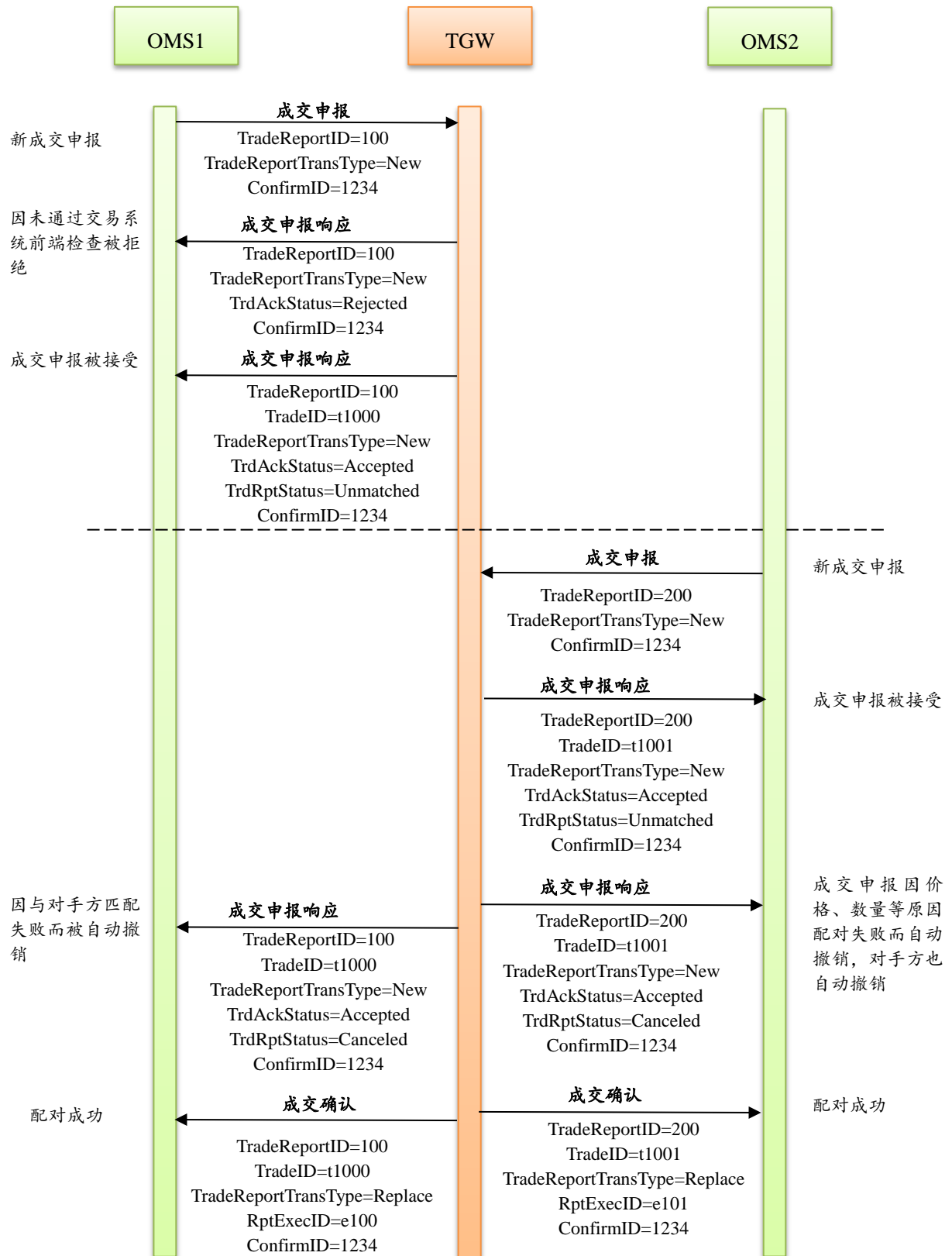


### 3.7 成交申报处理消息流图

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

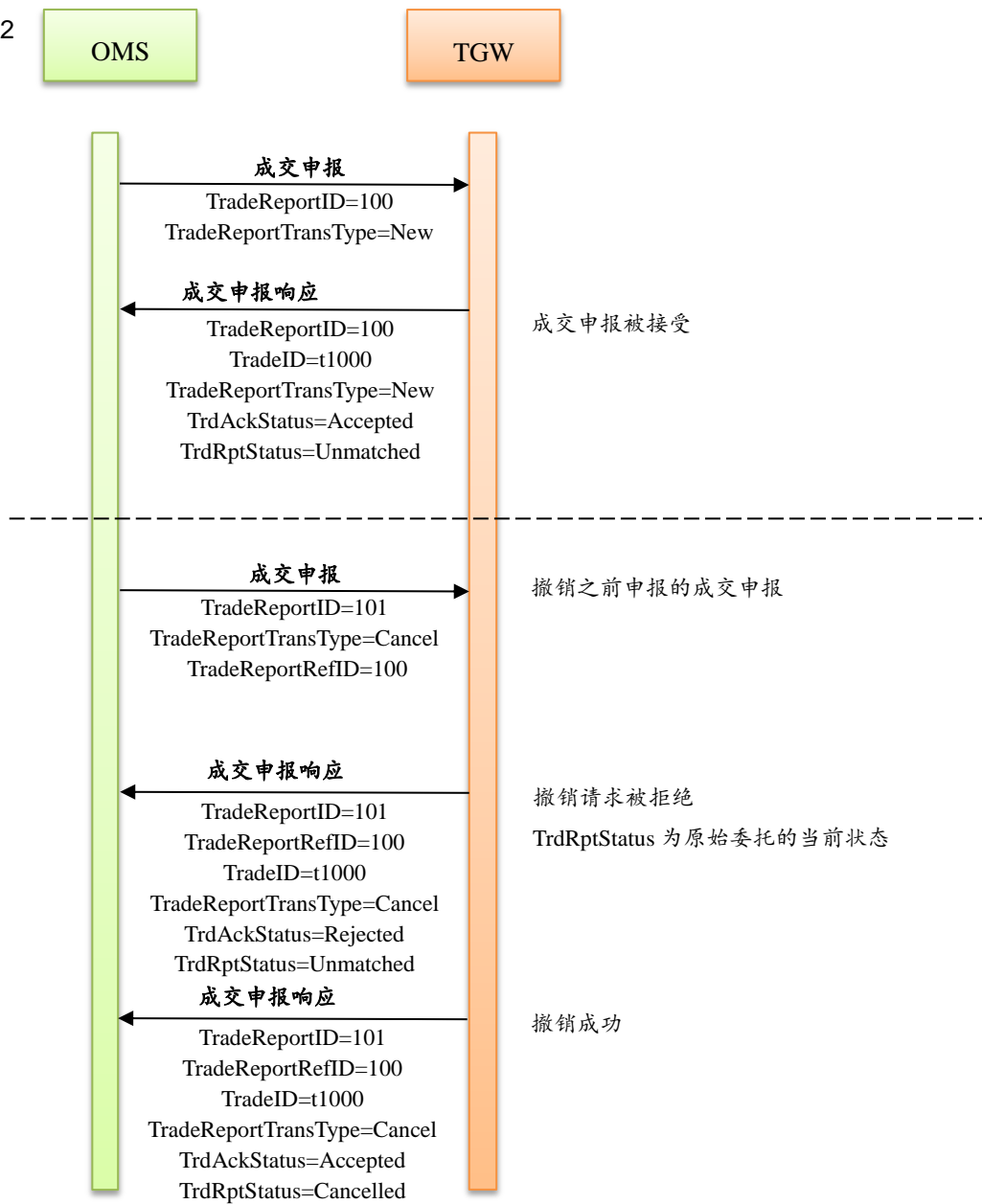
##### 新成交申报处理

##### 3.7.1.1

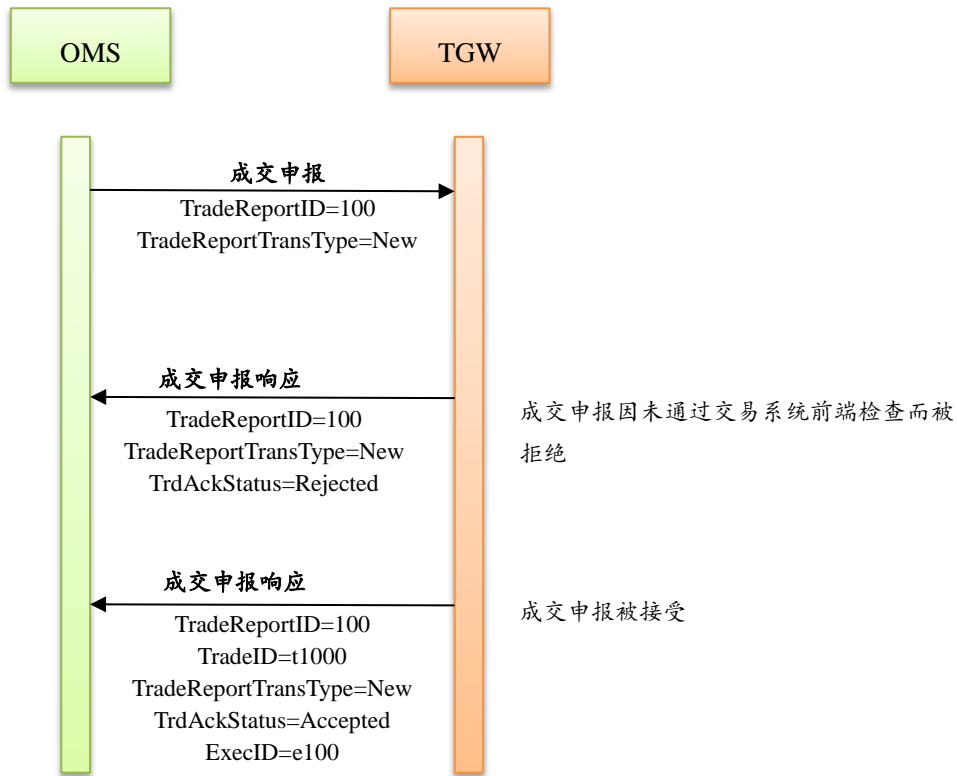


### 撤销尚未完成配对的成交申报

3.7.1.2

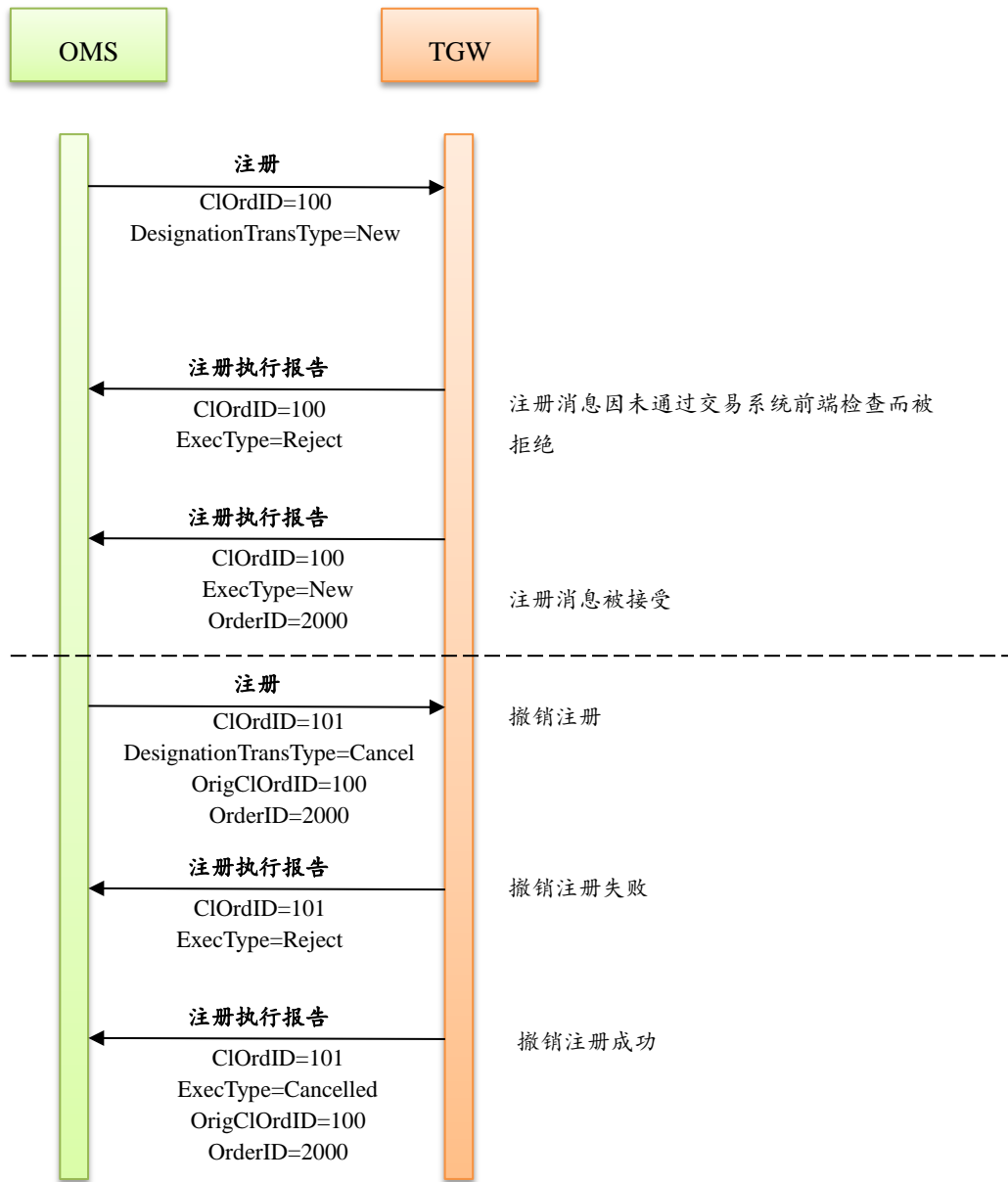


### 3.7.2 成交报告申报模式（two party report）



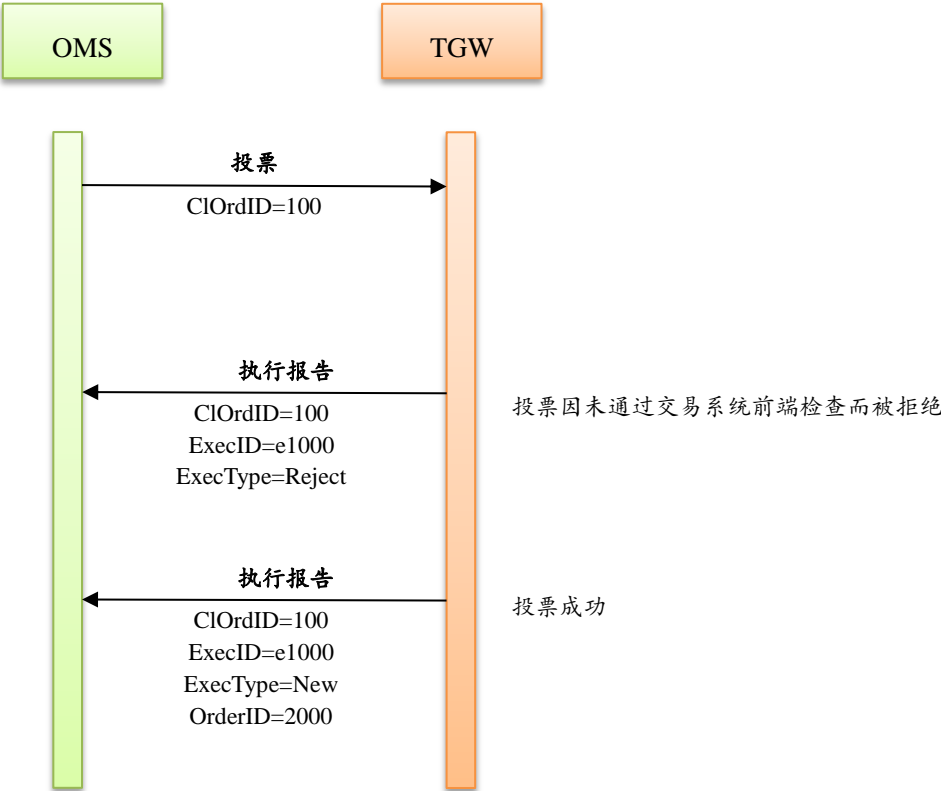
成交报告申报模式暂不支持撤销。

### 3.8 转托管处理消息流程图

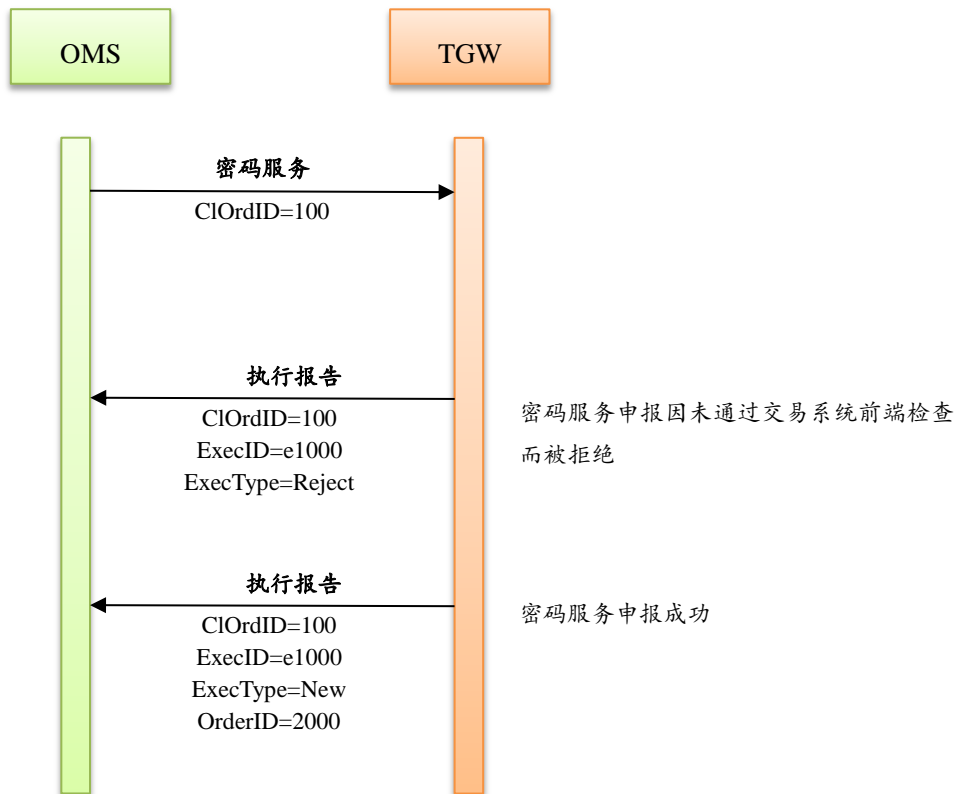


3.9 网络投票处理消息流图

3.9.1 投票处理消息流图

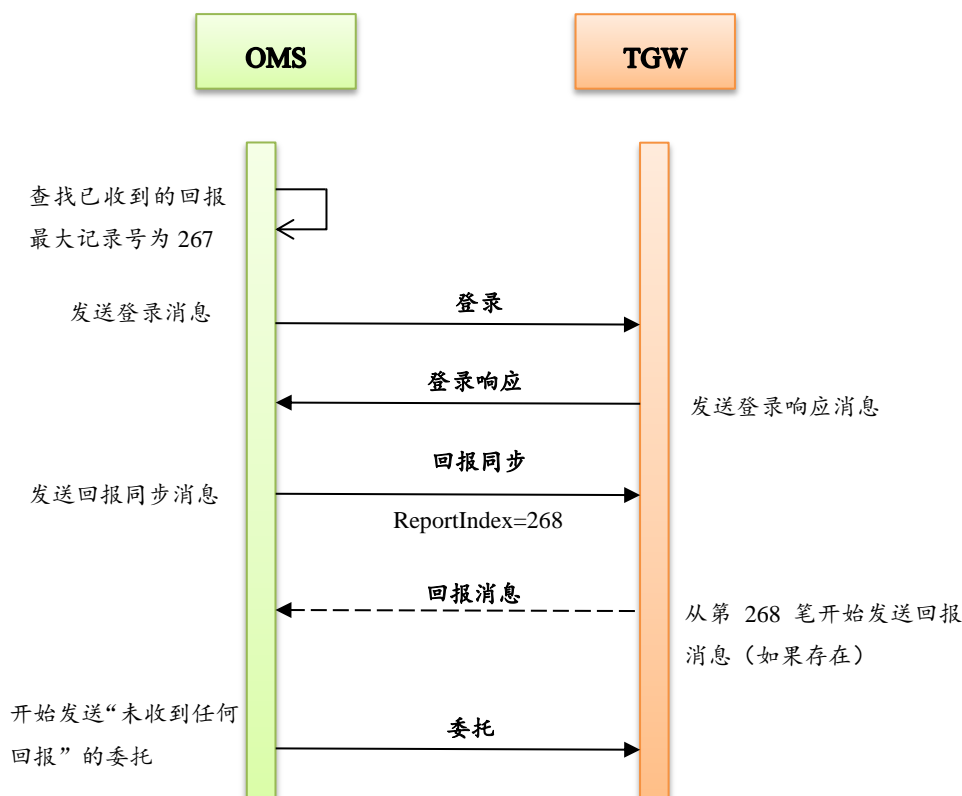


### 3.9.2 密码服务处理消息流程图



### 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 消息结构

每一条消息都由消息头、消息体和消息尾组成。

##### 4.1.1 消息头

消息头定义了应用消息的类型、长度数据域，均不加密传输。



| 域名         | 字段描述  |
|------------|-------|
| MsgType    | 消息类型  |
| BodyLength | 消息体长度 |

#### 4.1.2 消息尾

消息尾定义了消息的校验和，不加密传输。

| 域名       | 字段描述 |
|----------|------|
| Checksum | 校验和  |

以下为计算校验和的代码段：

```
uint32 GenerateChecksum( char *buf, uint32 bufLen )
{
    long idx;
    uint32 cks;
    for( idx = 0L, cks = 0; idx < bufLen; cks += (uint32)buf[ idx++ ] );
    return ( cks % 256 );
}
```

### 4.2 管理消息

#### 4.2.1 登录消息 (Logon)

**Logon** 消息应该是订单管理系统开始工作时向交易网关发出的第一条消息。订单管理系统使用 **Logon** 消息来与交易网关建立连接，交易网关使用 **Logon** 消息确认订单管理系统登录成功。

| 域名               | 字段描述                        |
|------------------|-----------------------------|
| Standard Header  | MsgType = 1                 |
| SenderCompID     | 发送方代码                       |
| TargetCompID     | 接收方代码                       |
| HeartBtInt       | 心跳间隔，单位为秒。订单管理系统登陆时提供给交易网关。 |
| Password         | 密码                          |
| DefaultApplVerID | 二进制协议版本，即数据接口规范版本。          |

#### 4.2.2 注销消息 (Logout)

当订单管理系统发起的连接请求不被交易网关接受时，交易网关会向订单管理系统发送 **Logout** 消息来拒绝登录请求。在必要时订单管理系统也可以主动发送 **Logout** 消息来中断当前和交易网关的连接。

| 域名              | 字段描述        |
|-----------------|-------------|
| Standard Header | MsgType = 2 |

|               |   |
|---------------|---|
| SessionStatus | 退出时的会话状态<br>0 = 会话活跃<br>1 = 会话口令已更改<br>2 = 将过期的会话口令<br>3 = 新会话口令不符合规范<br>4 = 会话退登完成<br>5 = 不合法的用户名或口令<br>6 = 账户锁定<br>7 = 当前时间不允许登录<br>8 = 口令过期<br>9 = 收到的 MsgSeqNum(34)太小<br>10 = 收到的 NextExpectedMsgSeqNum(789)太大.<br>101 = 其他<br>102 = 无效消息 |
| Text          | 文本<br>注销原因的进一步补充说明  |

### 4.2.3 心跳消息 (Heartbeat)

交易网关和订单管理系统之间用 **Heartbeat** 消息来检测 TCP 连接的状态, 因此当一方处于数据发送空闲期时, 需要定时发送 **Heartbeat** 消息以供检测连接的健康度。

| 域名              | 字段描述                      |
|-----------------|---------------------------|
| Standard Header | MsgType = 3, BodyLength=0 |

## 4.3 业务消息-新订单处理

### 4.3.1 新订单 (New Order)

| 域名               | 字段描述                  |
|------------------|-----------------------|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=10xx01 |
| ApplID           | 应用标识                  |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                |
| SecurityID       | 证券代码                  |
| SecurityIDSource | 证券代码源<br>102=深圳证券交易所  |
| OwnerType        | 订单所有者类型               |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                |
| TransacTime      | 委托时间                  |

|               |                                    |
|---------------|------------------------------------|
| UserInfo      | 用户私有信息                             |
| ClOrdID       | 客户订单编号                             |
| AccountID     | 证券账户                               |
| BranchID      | 营业部代码                              |
| Side          | 买卖方向                               |
| OrdType       | 订单类别<br>1 表示市价<br>2 表示限价<br>U 本方最优 |
| OrderQty      | 订单数量                               |
| Price         | 价格                                 |
| Extend Fields | 各业务扩展字段                            |

注：

1) 该消息用于以下业务新订单的申报

| 业务                     | 应用标识<br>ApplID | 报文号<br>MsgType | Side (54)          | 有无扩展字段 |
|------------------------|----------------|----------------|--------------------|--------|
| 现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易申报  | 010            | 100101         | 1=买<br>2=卖         | Y      |
| 质押式回购交易申报              | 020            | 100201         | 1=买（融资）<br>2=卖（出资） | Y      |
| 债券分销申报                 | 030            | 100301         | 1=买（认购）<br>2=卖（分销） | N      |
| 期权集中竞价交易申报             | 040            | 100401         | 1=买<br>2=卖         | Y      |
| 协议交易定价申报               | 051            | 100501         | 1=买<br>2=卖         | Y      |
| 协议交易点击成交申报             | 052            |                | 1=买<br>2=卖         |        |
| 以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报      | 060            | 100601         | 1=买<br>2=卖         | N      |
| 以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报 | 061            |                | 1=买<br>2=卖         |        |
| 转融通证券出借非约定申报           | 070            | 100701         | G=借入               | Y      |

|              |     |        |              |   |
|--------------|-----|--------|--------------|---|
|              |     |        | F=出借         |   |
| ETF 实时申购赎回申报 | 120 | 101201 | D=申购<br>E=赎回 | N |
| 网上发行认购申报     | 130 | 101301 | 固定填 1        | N |
| 配股认购申报       | 140 | 101401 | 固定填 1        | N |
| 债券转股申报       | 150 | 101501 | 固定填 1        | N |
| 债券回售申报       | 151 |        | 固定填 1        |   |
| 行权申报         | 160 | 101601 | 固定填 1        | N |
| 开放式基金申购赎回申报  | 170 | 101701 | D=申购<br>E=赎回 | N |
| 要约收购预受要约申报   | 180 | 101801 | 固定填 1        | Y |
| 要约收购解除预受要约申报 | 181 |        | 固定填 1        |   |
| 质押式回购质押申报    | 190 | 101901 | 固定填 1        | N |
| 质押式回购解押申报    | 191 |        | 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。

#### 4.3.1.1 现货集中竞价业务新订单扩展字段 (100101)

| 域名             | 字段描述  |
|----------------|---|
| StopPx         | 止损价   |
| MinQty         | 最低成交数量  |
| MaxPriceLevels | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数                                   |
| TimeInForce    | 订单有效时间类型  |
| CashMargin     | 信用标识<br>1=Cash, 普通交易<br>2=Open, 融资融券开仓<br>3=Close, 融资融券平仓 |

注:

- 1) 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 |
| 最优五档全额成交剩余撤销 | 3 | 1 | 5 | 0         |

- 2) 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。

#### 质押式回购交易业务新订单扩展字段 (100201)

##### 4.3.1.2

| 域名             | 字段描述                    |
|----------------|-------------------------|
| StopPx         | 止损价                     |
| MinQty         | 最低成交数量                  |
| MaxPriceLevels | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数 |
| TimeInForce    | 订单有效时间类型                |

##### 4.3.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100401)

| 域名                 | 字段描述  |
|--------------------|---|
| StopPx             | 止损价   |
| MinQty             | 最低成交数量  |
| MaxPriceLevels     | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数                         |
| TimeInForce        | 订单有效时间类型  |
| PositionEffect     | 平仓标识<br>(‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓)                       |
| CoveredOrUncovered | 备兑标签<br>(0=Covered, 表示备兑<br>1=UnCovered, 表示非备兑) |
| ContractAccoutCode | 合约账户识别码   |

##### 4.3.1.4

#### 协议交易业务新订单扩展字段 (100501)

| 域名 | 字段描述 |
|----|------|
|----|------|

|           |                 |
|-----------|-----------------|
| ConfirmID | 约定号<br>点击成交申报填写 |
|-----------|-----------------|

#### 转融通证券出借业务新订单扩展字段（100701）

4.3.1.5

| 域名             | 字段描述           |
|----------------|----------------|
| ExpirationDays | 期限，单位为天数       |
| ExpirationType | 期限类型<br>1=固定期限 |

#### 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段（101701）

4.3.1.6

| 域名           | 字段描述 |
|--------------|------|
| CashOrderQty | 申购金额 |

注：

- 1) LOF 是现金申购，份额赎回，申购时使用 CashOrderQty 填写申购金额，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。

#### 4.3.1.7 要约收购业务新订单扩展字段（101801）

| 域名       | 字段描述  |
|----------|-------|
| Tenderer | 收购人编码 |

### 4.3.2 撤单请求（Order Cancel Request）

| 域名               | 字段描述                  |
|------------------|-----------------------|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=190007 |
| ApplID           | 应用标识                  |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                |
| SecurityID       | 证券代码                  |
| SecurityIDSource | 证券代码源                 |
| OwnerType        | 订单所有者类型               |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                |
| TransacTime      | 委托时间                  |
| UserInfo         | 用户私有信息                |
| ClOrdID          | 客户订单编号                |

|             |                              |
|-------------|------------------------------|
| OrigClOrdID | 原始订单客户订单编号                   |
| Side        | 原始订单买卖方向                     |
| OrderID     | 原始订单交易所订单编号<br>交易所对该字段的值不作检查 |
| OrderQty    | 原始订单数量<br>交易所对该字段的值不作检查      |

### 4.3.3 撤单失败响应 (Cancel Reject)

| 域名               | 字段描述                                   |
|------------------|--|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=290008                  |
| ReportIndex      | 回报记录号                                  |
| ApplID           | 应用标识                                   |
| ReportingPBUID   | 回报交易单元                                 |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                                 |
| SecurityID       | 证券代码                                   |
| SecurityIDSource | 证券代码源                                  |
| OwnerType        | 订单所有者类型                                |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                                 |
| TransacTime      | 回报时间                                   |
| UserInfo         | 用户私有信息                                 |
| ClOrdID          | 客户订单编号                                 |
| OrigClOrdID      | 原始订单客户订单编号                             |
| Side             | 原始订单买卖方向                               |
| OrdStatus        | 原始订单当前状态<br>如果未找到原始订单，则填<br>8=Rejected |
| CxlRejReason     | 拒绝原因代码                                 |
| RejectText       | 拒绝原因说明                                 |
| OrderID          | 原始订单交易所订单编号                            |

### 4.3.4 订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)

| 域名 | 字段描述 |
|----|------|
|----|------|

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=20xx02                 |
| ReportIndex      | 回报记录号                                 |
| ApplID           | 应用标识                                  |
| ReportingPBUID   | 回报交易单元                                |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                                |
| SecurityID       | 证券代码                                  |
| SecurityIDSource | 证券代码源                                 |
| OwnerType        | 订单所有者类型                               |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                                |
| TransacTime      | 回报时间                                  |
| UserInfo         | 用户私有信息                                |
| OrderID          | 交易所订单编号                               |
| ClOrdID          | 客户订单编号<br>如果是报价委托的成交则填写<br>QuoteMsgID |
| OrigClOrdID      | 原始订单客户订单编号                            |
| ExecID           | 执行编号                                  |
| ExecType         | 执行类型                                  |
| OrdStatus        | 订单状态                                  |
| OrdRejReason     | 撤单/拒绝原因代码                             |
| LeavesQty        | 订单剩余数量                                |
| CumQty           | 累计执行数量                                |
| Side             | 买卖方向                                  |
| OrdType          | 订单类别                                  |
| OrderQty         | 订单数量                                  |
| Price            | 价格                                    |
| AccountID        | 证券账户                                  |
| BranchID         | 营业部代码                                 |
| Extend Fields    | 各业务扩展字段                               |

注：

- 1) 该消息用于以下业务的订单响应及撤单成功响应



| 业务   | 应用标识<br>ApplID | 报文号<br>MsgType | 有无扩展<br>字段 |
|--|----------------|----------------|------------|
| 现货（股票，基金，债券等）<br>集中竞价交易执行报告                          | 010            | 200102         | Y          |
| 质押式回购交易执行报告  | 020            | 200202         | Y          |
| 债券分销执行报告   | 030            | 200302         | N          |
| 期权集中竞价交易执行报告   | 040            | 200402         | Y          |
| 协议交易定价执行报告   | 051            | 200502         | Y          |
| 协议交易点击成交执行报告   | 052            |                |            |
| 以收盘价交易的盘后定价大<br>宗交易执行报告                              | 060            | 200602         | N          |
| 以成交量加权平均价交易的<br>盘后定价大宗交易执行报告                         | 061            |                |            |
| 转融通证券出借非约定执行<br>报告                                   | 070            | 200702         | Y          |
| 股票/债券/货币 ETF 实时申<br>购赎回执行报告<br>黄金 ETF 现金申购赎回执行<br>报告 | 120            | 201202         | Y          |
| 网上发行认购执行报告   | 130            | 201302         | N          |
| 配股认购执行报告   | 140            | 201402         | N          |
| 债券转股执行报告   | 150            | 201502         | N          |
| 债券回售执行报告   | 151            |                |            |
| 行权执行报告   | 160            | 201602         | N          |
| 开放式基金申购赎回执行报<br>告                                    | 170            | 201702         | N          |
| 要约收购预受要约执行报告   | 180            | 201802         | Y          |
| 要约收购解除预受要约执行<br>报告                                   | 181            |                |            |
| 质押式回购质押执行报告  | 190            | 201902         | N          |
| 质押式回购解押执行报告  | 191            |                |            |
| 黄金 ETF 实物申购赎回执行<br>报告                                | 220            | 202202         | N          |

## 现货集中竞价业务执行报告扩展字段（200102）

4.3.4.1

| 域名             | 字段描述                    |
|----------------|-------------------------|
| StopPx         | 止损价                     |
| MinQty         | 最低成交数量                  |
| MaxPriceLevels | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数 |
| TimeInForce    | 订单有效时间类型                |
| CashMargin     | 信用标识                    |

## 质押式回购交易业务执行报告扩展字段（200202）

4.3.4.2

| 域名             | 字段描述                    |
|----------------|-------------------------|
| StopPx         | 止损价                     |
| MinQty         | 最低成交数量                  |
| MaxPriceLevels | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数 |
| TimeInForce    | 订单有效时间类型                |

4.3.4.3

## 期权集中竞价业务执行报告扩展字段（200402）

| 域名                 | 字段描述  |
|--------------------|---|
| StopPx             | 止损价   |
| MinQty             | 最低成交数量  |
| MaxPriceLevels     | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数   |
| TimeInForce        | 订单有效时间类型  |
| PositionEffect     | 平仓标识<br>(‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓)   |
| CoveredOrUncovered | 备兑标签<br>(0=Covered, 表示备兑<br>1=UnCovered, 表示非备兑)<br>目前仅适用于期权集中竞价业务 |
| ContractAccoutCode | 合约账户识别码   |

## 协议交易业务执行报告扩展字段（200502）

| 域名        | 字段描述 |
|-----------|------|
| ConfirmID | 约定号  |

4.3.4.4

## 转融通证券出借业务执行报告扩展字段（200702）

| 域名             | 字段描述     |
|----------------|----------|
| ExpirationDays | 期限，单位为天数 |
| ExpirationType | 期限类型     |

4.3.4.5

## ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段（201202）

| 域名                           | 字段描述  |
|------------------------------|---|
| InsufficientSecurityID       | 申赎不足成份股证券代码<br>申购时如果投资者持有成份股不足，填写第一只不足额的成份股代码<br>赎回时如果基金管理人成份股不足，填写第一只不足额的成份股代码 |
| NoSecurity                   | 成份股记录数  |
| → UnderlyingSecurityID       | 成份股证券代码   |
| → UnderlyingSecurityIDSource | 证券代码源   |
| → DeliveryQty                | 股份交付数量  |
| → SubstCash                  | 现金替代金额  |

4.3.4.6

4.3.4.7

## 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段（201702）

| 域名           | 字段描述 |
|--------------|------|
| CashOrderQty | 申购金额 |

4.3.4.8

## 要约收购业务执行报告扩展字段（201802）

| 域名       | 字段描述  |
|----------|-------|
| Tenderer | 收购人编码 |

## 4.3.5 订单成交执行报告 (Execution Report)

| 域名               | 字段描述                                  |
|------------------|---------------------------------------|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=20xx15                 |
| ReportIndex      | 回报记录号                                 |
| ApplID           | 应用标识                                  |
| ReportingPBUID   | 回报交易单元                                |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                                |
| SecurityID       | 证券代码                                  |
| SecurityIDSource | 证券代码源                                 |
| OwnerType        | 订单所有者类型                               |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                                |
| TransacTime      | 回报时间                                  |
| UserInfo         | 用户私有信息                                |
| OrderID          | 交易所订单编号                               |
| ClOrdID          | 客户订单编号<br>如果是报价委托的成交则填写<br>QuoteMsgID |
| ExecID           | 执行编号                                  |
| ExecType         | 执行类型                                  |
| OrdStatus        | 订单状态                                  |
| LastPx           | 成交价                                   |
| LastQty          | 成交数量                                  |
| LeavesQty        | 订单剩余数量                                |
| CumQty           | 累计执行数量                                |
| Side             | 买卖方向                                  |
| AccountID        | 证券账户                                  |
| BranchID         | 营业部代码                                 |
| Extend Fields    | 各业务扩展字段                               |

注：

1) 该消息用于以下业务订单成交回报

| 业务 | 应用标识 | 报文号 | 有无扩展 |
|----|------|-----|------|
|----|------|-----|------|

|                              | ApplID | MsgType | 字段 |
|------------------------------|--------|---------|----|
| 现货（股票，基金，债券等）<br>集中竞价交易执行报告  | 010    | 200115  | Y  |
| 质押式回购交易执行报告                  | 020    | 200215  | Y  |
| 债券分销执行报告                     | 030    | 200315  | N  |
| 期权集中竞价交易执行报告                 | 040    | 200415  | Y  |
| 协议交易定价执行报告                   | 051    | 200515  | Y  |
| 协议交易点击成交执行报告                 | 052    |         |    |
| 以收盘价交易的盘后定价大<br>宗交易执行报告      | 060    | 200615  | N  |
| 以成交量加权平均价交易的<br>盘后定价大宗交易执行报告 | 061    |         |    |
| 转融通证券出借非约定执行<br>报告           | 070    | 200715  | Y  |

#### 4.3.5.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段（200115）

| 域名         | 字段描述 |
|------------|------|
| CashMargin | 信用标识 |

#### 4.3.5.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段（200215）

| 域名           | 字段描述 |
|--------------|------|
| MaturityDate | 到期日  |

#### 4.3.5.3

#### 期权集中竞价业务执行报告扩展字段（200415）

| 域名                 | 字段描述  |
|--------------------|---|
| PositionEffect     | 平仓标识<br>（‘O’：开仓 ‘C’：平仓）   |
| CoveredOrUncovered | 备兑标签<br>（0=Covered，表示备兑<br>1=UnCovered，表示非备兑）<br>目前仅适用于期权集中竞价业务 |
| ContractAccoutCode | 合约账户识别码   |

协议交易业务执行报告扩展字段（200515）

4.3.5.4

| 域名        | 字段描述 |
|-----------|------|
| ConfirmID | 约定号  |

转融通证券出借业务执行报告扩展字段（200715）

4.3.5.5

| 域名             | 字段描述     |
|----------------|----------|
| ExpirationDays | 期限，单位为天数 |
| ExpirationType | 期限类型     |

4.4 业务消息-报价处理

4.4.1 报价（Quote）

| 域名               | 字段描述   |
|------------------|--|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=10xx05                        |
| ApplID           | 应用标识   |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                                       |
| SecurityID       | 证券代码   |
| SecurityIDSource | 证券代码源<br>取 102，表示代码源为深圳证券交易所                 |
| OwnerType        | 订单所有者类型                                      |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                                       |
| TransacTime      | 委托时间   |
| UserInfo         | 用户私有信息                                       |
| QuoteMsgID       | 客户报价消息编号                                     |
| AccountID        | 证券账户   |
| QuoteReqID       | 报价请求 ID<br>预留字段<br>当报价是对报价请求的响应时，填写报价请求 的 ID |
| QuoteType        | 报价类型<br>1=可交易的报价（Tradeable）                  |
| BidPx            | 买报价  |

|               |         |
|---------------|---------|
| OfferPx       | 卖报价     |
| BidSize       | 买数量     |
| OfferSize     | 卖数量     |
| Extend Fields | 各业务扩展字段 |

注：

1) 该消息用于以下业务报价申报

| 应用标识<br>ApplID | 说明           | 报文号<br>MsgType | 有无扩展<br>字段 |
|----------------|--------------|----------------|------------|
| 041            | 期权集中竞价交易报价申报 | 104105         | Y          |

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 | OfferSize |
|------|---------|-----------|
| 双边报价 | >0      | >0        |
| 买报价  | >0      | =0        |
| 卖报价  | =0      | >0        |
| 撤销报价 | =0      | =0        |

#### 4.4.1.1 期权集中竞价业务报价扩展字段（100405）

| 域名                  | 字段描述   |
|---------------------|--|
| BidPositionEffect   | 买平仓标识<br>（‘O’：开仓 ‘C’：平仓）<br>BidSize=0 时该字段无意义，填写空格   |
| OfferPositionEffect | 卖平仓标识<br>（‘O’：开仓 ‘C’：平仓）<br>OfferSize=0 时该字段无意义，填写空格 |
| ContractAccoutCode  | 合约账户识别码  |

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

| 域名              | 字段描述                  |
|-----------------|-----------------------|
| Standard Header | 消息头<br>MsgType=20xx06 |

|                   |  |
|-------------------|--|
| ReportIndex       | 回报记录号                                    |
| ApplID            | 应用标识                                     |
| ReportingPBUID    | 回报交易单元                                   |
| SubmittingPBUID   | 申报交易单元                                   |
| SecurityID        | 证券代码                                     |
| SecurityIDSource  | 证券代码源                                    |
| OwnerType         | 订单所有者类型                                  |
| ClearingFirm      | 结算机构代码                                   |
| TransacTime       | 回报时间                                     |
| UserInfo          | 用户私有信息                                   |
| QuoteMsgID        | 客户报价消息编号                                 |
| AccountID         | 证券账户                                     |
| QuoteReqID        | 报价请求 ID                                  |
| QuoteStatus       | 报价状态<br>0=Accepted, 接受<br>5=Rejected, 拒绝 |
| QuoteRejectReason | 拒绝原因代码                                   |
| QuoteType         | 报价类型                                     |
| BidPx             | 买报价                                      |
| OfferPx           | 卖报价                                      |
| BidSize           | 买数量                                      |
| OfferSize         | 卖数量                                      |
| Extend Fields     | 各业务扩展字段                                  |

注：

1) 该消息用于以下业务报价状态的回报

| 应用标识<br>ApplID | 说明                 | 报文号<br>MsgType | 有无扩展<br>字段 |
|----------------|--------------------|----------------|------------|
| 4.4.2.1 041    | 期权集中竞价交易报价状态<br>回报 | 200406         | Y          |

## 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段（200406）

| 域名 | 字段描述 |
|----|------|
|----|------|



|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| BidPositionEffect   | 买平仓标识<br>(‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓 ) |
| OfferPositionEffect | 卖平仓标识<br>(‘O’: 开仓 ‘C’: 平仓 ) |
| ContractAccoutCode  | 合约账户识别码                     |

## 4.5 业务消息-意向申报处理

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

| 域名               | 字段描述                                |
|------------------|-------------------------------------|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=10xx09               |
| ApplID           | 应用标识                                |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                              |
| SecurityID       | 证券代码                                |
| SecurityIDSource | 证券代码源<br>102=深圳证券交易所                |
| OwnerType        | 订单所有者类型                             |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                              |
| TransacTime      | 委托时间                                |
| UserInfo         | 用户私有信息                              |
| IOIID            | 客户意向申报编号                            |
| AccountID        | 证券账户                                |
| BranchID         | 营业部代码                               |
| IOITransType     | 意向申报类型<br>取值为: N=意向申报, C=意向申报<br>撤单 |
| Side             | 买卖方向<br>1 表示买<br>2 表示卖              |
| IOIRefID         | 原意向申报 IOIID                         |
| IOIQty           | 数量                                  |
| Price            | 价格                                  |

注:

1) 该消息用于以下业务的意向申报

| 应用标识<br>ApplID | 说明       | 报文号<br>MsgType | 有无扩展<br>字段 |
|----------------|----------|----------------|------------|
| 050            | 协议交易意向申报 | 100509         | Y          |

#### 协议交易意向申报扩展字段 (100509)

4.5.1.1

| 域名          | 字段描述 |
|-------------|------|
| ContactInfo | 联系方式 |

#### 4.5.2 意向申报响应 (Quote Response)

| 域名                | 字段描述  |
|-------------------|---|
| Standard Header   | 消息头<br>MsgType=20xx10   |
| ReportIndex       | 回报记录号   |
| ApplID            | 应用标识  |
| ReportingPBUID    | 回报交易单元  |
| SubmittingPBUID   | 申报交易单元  |
| SecurityID        | 证券代码  |
| SecurityIDSource  | 证券代码源   |
| OwnerType         | 订单所有者类型   |
| ClearingFirm      | 结算机构代码  |
| TransacTime       | 回报时间  |
| UserInfo          | 用户私有信息  |
| QuoteRespID       | 交易所意向申报响应编号   |
| QuoteRespType     | 响应类型<br>2=意向申报响应  |
| ExecType          | 执行类型<br>0=New, 意向申报成功<br>4=Canceled, 意向申报撤单成功<br>8=Reject, 意向申报拒绝 |
| QuoteRejectReason | 拒绝原因代码  |
| IOIID             | 客户意向申报编号  |
| IOIRefID          | 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 |
| IOITransType | 意向申报类型                      |
| Side         | 买卖方向                        |
| AccountID    | 证券账户                        |
| BranchID     | 营业部代码                       |
| IOIQty       | 数量                          |
| Price        | 价格                          |

注：

1) 该消息用于以下业务的意向申报响应

| 应用标识<br>ApplID | 说明         | 报文号<br>MsgType | 有无扩展<br>字段 |
|----------------|------------|----------------|------------|
| 050            | 协议交易意向申报响应 | 2005010        | Y          |

#### 4.5.2.1 协议交易意向申报扩展字段（200510）

| 域名          | 字段描述 |
|-------------|------|
| ContactInfo | 联系方式 |

## 4.6 业务消息-成交申报处理

### 4.6.1 成交申报（Trade Capture Report）

| 域名               | 字段描述                  |
|------------------|-----------------------|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=10xx03 |
| ApplID           | 应用标识                  |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                |
| SecurityID       | 证券代码                  |
| SecurityIDSource | 证券代码源<br>102=深圳证券交易所  |
| OwnerType        | 订单所有者类型               |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                |
| TransacTime      | 委托时间                  |
| UserInfo         | 用户私有信息                |
| TradeReportID    | 客户成交申报编号              |

|                      |  |
|----------------------|--|
| TradeReportType      | 成交申报类型<br>0=提交成交申报   |
| TradeReportTransType | 成交申报事务类别<br>0=New<br>1=Cancel  |
| TradeHandlingInstr   | 成交申报模式<br>1=Two-Party Report, 成交报告<br>2=One-Party report for matching, 协议配对  |
| TradeReportRefID     | 原客户成交申报编号<br>撤销成交申报时使用   |
| LastPx               | 价格   |
| LastQty              | 数量   |
| TrdType              | 成交申报业务类别<br>1001=股票质押式回购初始交易<br>1002=股票质押式回购提前购回<br>1003=股票质押式回购到期购回<br>1004=股票质押式回购延期购回<br>1005=股票质押式回购终止购回<br>1006=股票质押式回购补充质押<br>1007=股票质押式回购部分解除质押<br>1008=股票质押式回购违约处置<br>1011=约定购回初始交易<br>1012=约定购回提前购回<br>1013=约定购回到期购回<br>1014=约定购回延期购回<br>1021=质押式报价回购初始交易<br>1022=质押式报价回购提前购回 |
| TrdSubType           | 成交申报业务子类别<br>预留, 固定填 0   |
| ConfirmID            | 约定号  |
| Side                 | 本方参与者买卖方向  |
| PBUID                | 本方交易单元   |

|                       |          |
|-----------------------|----------|
| AccountID             | 本方证券账户   |
| BranchID              | 本方营业部代码  |
| CounterpartyPBUID     | 对手方交易单元  |
| CounterpartyAccountID | 对手方证券账户  |
| CounterpartyBranchID  | 对手方营业部代码 |
| Extend Fields         | 各业务扩展字段  |

注：

1) 该消息用于以下业务的成交申报

| 业务           | 应用标识<br>ApplID | 报文号<br>MsgType | 成交申报模式<br>TradeHandlingInstr | 有无扩展<br>字段 |
|--------------|----------------|----------------|------------------------------|------------|
| 协议交易双方协议成交申报 | 053            | 100503         | 协议配对                         | N          |
| 转融通证券出借约定申报  | 071            | 100703         | 协议配对                         | Y          |
| 资产管理计划份额转让   | 160            | 100803         | 成交报告                         | Y          |
| 股票质押式回购      | 170            | 100903         | 成交报告                         | Y          |
| 约定购回         | 180            | 101003         | 成交报告                         | Y          |
| 质押式报价回购      | 190            | 101103         | 成交报告                         | Y          |

2) 各业务成交申报的市场参与人代码填写方式

| 业务                 | Side         | PBUID     | AccountID | BranchID  | Counterparty<br>PBUID | Counterparty<br>AccountID | Counterparty<br>BranchID |
|--------------------|--------------|-----------|-----------|-----------|-----------------------|---------------------------|--------------------------|
| 协议交易双方协议成交申报 (053) | 1=买<br>2=卖   | 申报方       | 申报方       | 申报方       | 对手方                   | 不填                        | 不填                       |
| 转融通证券出借约定申报 (071)  | G=借入<br>F=出借 | 申报方       | 申报方       | 申报方       | 对手方                   | 不填                        | 不填                       |
| 资产管理计划份额转让 (160)   | 固定为1         | 转入方       | 转入方       | 转入方       | 转出方                   | 转出方                       | 转出方                      |
| 股票质押式回购 (170)      | 固定为2         | (资金) 融入方  | (资金) 融入方  | (资金) 融入方  | (资金) 融出方              | (资金) 融出方                  | 不填                       |
| 约定购回 (180)         | 固定为2         | 客户方 (券融出) | 客户方 (券融出) | 客户方 (券融出) | 不填                    | 证券公司专用账户                  | 不填                       |
| 质押式报价回购 (190)      | 固定为1         | 客户方 (资金)  | 客户方 (资金)  | 客户方 (资金)  | 不填                    | 证券公司自营账户                  | 不填                       |

|  |  |     |    |     |  |  |  |
|--|--|-----|----|-----|--|--|--|
|  |  | 融出) | 出) | 融出) |  |  |  |
|--|--|-----|----|-----|--|--|--|

#### 转融通证券出借业务成交申报扩展字段 (100703)

4.6.1.1

| 域名             | 字段描述           |
|----------------|----------------|
| ExpirationDays | 期限, 单位为天数      |
| ExpirationType | 期限类型<br>1=固定期限 |

#### 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段 (100803)

4.6.1.2

| 域名        | 字段描述  |
|-----------|---|
| PriceType | 价格类型<br>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 |

4.6.1.3

#### 股票质押式回购业务成交申报扩展字段 (100903)

| 域名                  | 字段描述   |
|---------------------|--|
| CashOrderQty        | 现金金额<br>成交申报类别为初始交易时填写初始交易金额<br>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<br>成交申报类型为补充质押时填 0<br>成交申报类型为部分解除质押时填写解除红利金额<br>成交申报类型为违约处置时填 0 |
| ShareType           | 股份性质   |
| MaturityDate        | 购回交易日  |
| OrigTradeID         | 初始交易交易所成交申报编号  |
| OrigSubmittingPBUID | 初始交易申报交易单元   |
| OrigTradeReportID   | 初始交易客户成交申报编号   |
| OrigTradeDate       | 初始交易成交申报申报日期   |

## 约定购回业务成交申报扩展字段（101003）

4.6.1.4

| 域名                  | 字段描述          |
|---------------------|---------------|
| CashOrderQty        | 现金金额          |
| MaturityDate        | 购回交易日         |
| OrigTradeID         | 初始交易交易所成交申报编号 |
| OrigSubmittingPBUID | 初始交易申报交易单元    |
| OrigTradeReportID   | 初始交易客户成交申报编号  |
| OrigTradeDate       | 初始交易成交申报申报日期  |

## 质押式报价回购业务成交申报扩展字段（101103）

4.6.1.5

| 域名                  | 字段描述                                     |
|---------------------|--|
| PriceType           | 价格类型<br>1=Percentage，表示收益率               |
| ExpirationExecInst  | 到期续做方式，质押式报价回购填写<br>1=到期自动续做<br>2=到期手动续做 |
| ExpirationDays      | 期限，单位为天数                                 |
| MaturityDate        | 购回交易日                                    |
| OrigTradeID         | 初始交易交易所成交申报编号                            |
| OrigSubmittingPBUID | 初始交易申报交易单元                               |
| OrigTradeReportID   | 初始交易客户成交申报编号                             |
| OrigTradeDate       | 初始交易成交申报申报日期                             |

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

| 域名              | 字段描述                  |
|-----------------|-----------------------|
| Standard Header | 消息头<br>MsgType=2xxx04 |
| ReportIndex     | 回报记录号                 |
| ApplID          | 应用标识                  |
| ReportingPBUID  | 回报交易单元                |
| SubmittingPBUID | 申报交易单元                |
| SecurityID      | 证券代码                  |

|                         |   |
|-------------------------|---|
| SecurityIDSource        | 证券代码源   |
| OwnerType               | 订单所有者类型   |
| ClearingFirm            | 结算机构代码  |
| TransacTime             | 回报时间  |
| UserInfo                | 用户私有信息  |
| TradeID                 | 交易所成交申报编号   |
| TradeReportID           | 客户成交申报编号  |
| TradeReportType         | 成交申报类型  |
| TradeReportTransType    | 成交申报事务类别  |
| TradeHandlingInstr      | 成交申报模式  |
| TradeReportRefID        | 原客户成交申报编号   |
| TrdAckStatus            | 成交申报响应状态<br>0=Accepted, 接受<br>1=Rejected, 拒绝  |
| TrdRptStatus            | 成交申报状态<br>0=Accepted, 接受<br>1=Rejected, 拒绝<br>2=Cancelled, 已撤销<br>100=Unmatched, 尚未匹配<br>101=Matched, 已匹配 |
| TradeReportRejectReason | 成交申报被拒绝原因代码   |
| LastPx                  | 价格  |
| LastQty                 | 数量  |
| TrdType                 | 成交申报业务类别  |
| TrdSubType              | 成交申报业务子类别   |
| ConfirmID               | 约定号   |
| ExecID                  | 执行编号  |
| Side                    | 本方参与者买卖方向   |
| PBUID                   | 本方交易单元  |
| AccountID               | 本方证券账户  |
| BranchID                | 本方营业部代码   |
| CounterpartyPBUID       | 对手方交易单元   |
| CounterpartyAccountID   | 对手方证券账户   |



|                      |                         |
|----------------------|-------------------------|
| CounterpartyBranchID | 对手方营业部代码                |
| Extend Fields        | 各业务扩展字段<br>同成交申报各业务扩展字段 |

注：

1) 该消息用于以下业务成交申报的响应

| 业务           | 应用标识<br>ApplID | 报文号<br>MsgType | 有无扩展<br>字段 |
|--------------|----------------|----------------|------------|
| 协议交易双方协议成交申报 | 053            | 200504         | N          |
| 转融通证券出借约定申报  | 071            | 200704         | Y          |
| 资产管理计划份额转让   | 080            | 200804         | Y          |
| 股票质押式回购      | 090            | 200904         | Y          |
| 约定购回         | 100            | 201004         | Y          |
| 质押式报价回购      | 110            | 201104         | Y          |

2) 各业务扩展字段定义同成交申报一致，请参考成交申报消息定义。

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

| 域名               | 字段描述                  |
|------------------|-----------------------|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=2xxx03 |
| ReportIndex      | 回报记录号                 |
| ApplID           | 应用标识                  |
| ReportingPBUID   | 回报交易单元                |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                |
| SecurityID       | 证券代码                  |
| SecurityIDSource | 证券代码源                 |
| OwnerType        | 订单所有者类型               |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                |
| TransacTime      | 回报时间                  |
| UserInfo         | 用户私有信息                |
| TradeID          | 交易所成交申报编号             |
| TradeReportID    | 客户成交申报编号              |
| TradeReportType  | 成交申报类型                |

|                       |                         |
|-----------------------|-------------------------|
| TradeReportTransType  | 成交申报事务类别<br>2=Replace   |
| TradeHandlingInstr    | 成交申报模式                  |
| LastPx                | 价格                      |
| LastQty               | 数量                      |
| TrdType               | 成交申报业务类别                |
| TrdSubType            | 成交申报业务子类别               |
| ConfirmID             | 约定号                     |
| ExecID                | 执行编号                    |
| Side                  | 本方参与人买卖方向               |
| PBUID                 | 本方交易单元                  |
| AccountID             | 本方证券账户                  |
| BranchID              | 本方营业部代码                 |
| CounterpartyPBUID     | 对手方交易单元                 |
| CounterpartyAccountID | 对手方证券账户                 |
| CounterpartyBranchID  | 对手方营业部代码                |
| Extend Fields         | 各业务扩展字段<br>同成交申报各业务扩展字段 |

注：

1) 该消息用于以下业务成交申报的响应

| 业务           | 应用标识<br>ApplID | 报文号<br>MsgType | 有无扩展<br>字段 |
|--------------|----------------|----------------|------------|
| 协议交易双方协议成交申报 | 053            | 200503         | N          |
| 转融通证券出借约定申报  | 071            | 200703         | Y          |
| 资产管理计划份额转让   | 080            | 200803         | Y          |
| 股票质押式回购      | 090            | 200903         | Y          |
| 约定购回         | 100            | 201003         | Y          |
| 质押式报价回购      | 110            | 201103         | Y          |

2) 各业务扩展字段定义同成交申报一致，请参考成交申报消息定义。

## 4.7 业务消息-转托管处理消息

### 4.7.1 注册 (Designation)

| 域名                     | 字段描述                                     |
|------------------------|--|
| Standard Header        | 消息头<br>MsgType=102099                    |
| ApplID                 | 应用标识<br>020=转托管                          |
| SubmittingPBUID        | 申报交易单元                                   |
| SecurityID             | 证券代码<br>如果是系统内转托管, 证券代码可<br>填空表示转托管所有证券  |
| SecurityIDSource       | 证券代码源<br>102=深圳证券交易所                     |
| OwnerType              | 订单所有者类型                                  |
| ClearingFirm           | 结算机构代码                                   |
| TransacTime            | 委托时间                                     |
| UserInfo               | 用户私有信息                                   |
| ClOrdID                | 客户订单编号                                   |
| OrigClOrdID            | 原始交易的客户订单编号, 指示被<br>主动撤单的委托              |
| DesignationInstruction | 注册指令<br>3=转托管                            |
| DesignationTransType   | 注册类型<br>1=New 表示新注册请求<br>3=Cancel 表示注册撤单 |
| AccountID              | 证券账户                                     |
| BranchID               | 营业部代码                                    |
| OrderQty               | 如果是系统内转托管, 数量可填 0<br>表示转托管全部持有量          |
| TransfereePBUID        | 转入交易单元代码                                 |

### 4.7.2 注册执行报告 (Designation Report)

| 域名 | 字段描述 |
|----|------|
|----|------|

|                        |   |
|------------------------|---|
| Standard Header        | 消息头<br>MsgType=202098   |
| ReportIndex            | 回报记录号   |
| ApplID                 | 应用标识<br>020=转托管   |
| ReportingPBUID         | 回报交易单元  |
| SubmittingPBUID        | 申报交易单元  |
| SecurityID             | 证券代码  |
| SecurityIDSource       | 证券代码源   |
| OwnerType              | 订单所有者类型   |
| ClearingFirm           | 结算机构代码  |
| TransacTime            | 回报时间  |
| UserInfo               | 用户私有信息  |
| OrderID                | 交易所订单编号   |
| ClOrdID                | 客户订单编号  |
| OrigClOrdID            | 原始交易的客户订单编号, 指示被主动撤单的委托   |
| ExecID                 | 执行编号  |
| ExecType               | 执行类型<br>0=New 订单被接受<br>4=Cancelled 订单被主动撤单<br>8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝 |
| OrdRejReason           | 拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写   |
| DesignationInstruction | 注册指令<br>3 表示转托管   |
| DesignationTransType   | 注册类型<br>1=New 表示新注册请求<br>3=Cancel 表示注册撤单                              |
| AccountID              | 证券账户  |
| BranchID               | 营业部代码   |
| OrderQty               | 如果是系统内转托管, 数量可填 0 表示转托管全部持有量  |

|                 |          |
|-----------------|----------|
| TransfereePBUID | 转入交易单元代码 |
|-----------------|----------|

## 4.8 业务消息-网络投票处理消息

### 4.8.1 投票 (Netvote)

| 域名                | 字段描述                                      |
|-------------------|---|
| Standard Header   | 消息头<br>MsgType=102197                     |
| ApplID            | 应用标识<br>210=投票                            |
| SubmittingPBUID   | 申报交易单元                                    |
| SecurityID        | 投票代码                                      |
| SecurityIDSource  | 证券代码源<br>102=深圳证券交易所                      |
| OwnerType         | 订单所有者类型                                   |
| ClearingFirm      | 结算机构代码<br>固定填全空格                          |
| TransacTime       | 委托时间                                      |
| UserInfo          | 用户私有信息                                    |
| ClOrdID           | 客户订单编号                                    |
| AccountID         | 证券账户                                      |
| BranchID          | 营业部代码                                     |
| VotingProposal    | 投票议案号<br>1-99 表示具体议案号<br>100 表示总议案        |
| VotingSubProposal | 投票子议案号或选举候选人<br>0 表示所有子议案<br>>0 其他表示具体子议案 |
| VotingPreference  | 投票意向<br>1=同意<br>2=反对<br>3=弃权              |
| OrderQty          | 投票数量                                      |

## 4.8.2 投票执行报告 (Netvote)

| 域名                | 字段描述   |
|-------------------|--|
| Standard Header   | 消息头<br>MsgType=202197                          |
| ReportIndex       | 回报记录号  |
| ApplID            | 应用标识<br>210=投票                                 |
| ReportingPBUID    | 回报交易单元   |
| SubmittingPBUID   | 申报交易单元   |
| SecurityID        | 投票代码   |
| SecurityIDSource  | 证券代码源  |
| OwnerType         | 订单所有者类型  |
| ClearingFirm      | 结算机构代码   |
| TransacTime       | 回报时间   |
| UserInfo          | 用户私有信息   |
| OrderID           | 交易所订单编号  |
| ClOrdID           | 客户订单编号   |
| ExecID            | 执行编号   |
| ExecType          | 执行类型<br>0=New 订单被接受<br>8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝 |
| OrdRejReason      | 拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写                            |
| AccountID         | 证券账户   |
| BranchID          | 营业部代码  |
| VotingProposal    | 投票议案号  |
| VotingSubProposal | 投票子议案号或选举候选人                                   |
| VotingPreference  | 投票意向   |
| OrderQty          | 投票数量   |

## 4.8.3 密码服务 (Netvote Password Service)

| 域名              | 字段描述 |
|-----------------|------|
| Standard Header | 消息头  |

|                  |                                  |
|------------------|----------------------------------|
|                  | MsgType=102196                   |
| ApplID           | 应用标识<br>211=密码服务激活<br>212=密码服务挂失 |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                           |
| SecurityID       | 证券代码<br>固定填 369999               |
| SecurityIDSource | 证券代码源<br>102=深圳证券交易所             |
| OwnerType        | 订单所有者类型                          |
| ClearingFirm     | 结算机构代码<br>固定填全空格                 |
| TransacTime      | 委托时间                             |
| UserInfo         | 用户私有信息                           |
| ClOrdID          | 客户订单编号                           |
| AccountID        | 证券账户                             |
| BranchID         | 营业部代码                            |
| ValidationCode   | 密码激活校验号                          |

#### 4.8.4 密码服务执行报告（Netvote Password Service）

| 域名               | 字段描述                             |
|------------------|----------------------------------|
| Standard Header  | 消息头<br>MsgType=202196            |
| ReportIndex      | 回报记录号                            |
| ApplID           | 应用标识<br>211=密码服务激活<br>212=密码服务挂失 |
| ReportingPBUID   | 回报交易单元                           |
| SubmittingPBUID  | 申报交易单元                           |
| SecurityID       | 证券代码                             |
| SecurityIDSource | 证券代码源                            |
| OwnerType        | 订单所有者类型                          |
| ClearingFirm     | 结算机构代码                           |

|                |  |
|----------------|--|
| TransacTime    | 回报时间   |
| UserInfo       | 用户私有信息   |
| OrderID        | 交易所订单编号  |
| ClOrdID        | 客户订单编号   |
| ExecID         | 执行编号   |
| ExecType       | 执行类型<br>0=New 订单被接受<br>8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝 |
| OrdRejReason   | 拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写                             |
| AccountID      | 证券账户   |
| BranchID       | 营业部代码  |
| ValidationCode | 密码激活校验号  |

## 五、 其它消息

### 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject)

| 域名                   | 字段描述                                  |
|----------------------|---------------------------------------|
| Standard Header      | 消息头<br>MsgType=4                      |
| ApplID               | 应用标识                                  |
| SubmittingPBUID      | 申报交易单元                                |
| RefSeqNum            | 证券代码                                  |
| RefMsgType           | 证券代码源                                 |
| BusinessRejectRefID  | 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。 |
| BusinessRejectReason | 拒绝原因                                  |
| BusinessRejectText   | 拒绝原因说明                                |

注：

1) 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        |
| 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。

| 域名              | 字段描述  |
|-----------------|---|
| Standard Header | 消息头<br>MsgType=5  |
| ReportIndex     | OMS 期望接收的下一条回报的记录号。<br>收到本消息后, TGW 会从该记录号开始向 OMS 发送回报; 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。

| 域名              | 字段描述  |
|-----------------|---|
| Standard Header | 消息头<br>MsgType=6  |
| PlatformID      | 平台号<br>1=现货集中竞价交易平台<br>2=综合金融服务平台<br>3=非交易处理平台<br>4=衍生品集中竞价交易平台 |
| PlatformState   | 平台状态<br>0=PreOpen, 未开放<br>1=OpenUpComing, 即将开放<br>2=Open, 开放    |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
|  | 3=Halt, 暂停开放<br>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。

| 域名              | 字段描述  |
|-----------------|---|
| Standard Header | MsgType=7   |
| ReportIndex     | 回报记录号<br>该回报记录号与各类回报消息中的<br>回报记录号连续编号                           |
| PlatformID      | 平台号<br>1=现货集中竞价交易平台<br>2=综合金融服务平台<br>3=非交易处理平台<br>4=衍生品集中竞价交易平台 |

### 六、 数据字典

本接口规范中的所有整数类型字段都采用高字节序 (BIG-ENDIAN) 编码方式。

#### 6.1 数据类型

| 数据类型           | 二进制类型  | 说明   |
|----------------|--------|--|
| Price          | Int64  | 价格, N13(4)   |
| Qty            | Int64  | 数量, N15(2)   |
| Amt            | Int64  | 金额, N18(4)   |
| SeqNum         | Int64  | 消息序号   |
| Boolean        | uInt16 | 1=True/Yes, 0=False/No   |
| Length         | uInt32 | 长度<br>表示字节为单位的数据长度, 正数   |
| LocalTimeStamp | Int64  | 本地时间戳<br>YYYYMMDDHHMMSSsss (毫秒),<br>YYYY = 0000-9999, MM = 01-12,<br>DD = 01-31, HH = 00-23, MM =<br>00-59, SS = 00-60 (秒), sss=000-999<br>(毫秒)。 |
| NumInGroup     | uInt32 | 重复数  |

|              |          |  |
|--------------|----------|--|
|              |          | 表示重复组的个数，正数  |
| LocalMktDate | uInt32   | 本地市场日期<br>格式 YYYYMMDD, YYYY = 0000-9999,<br>MM = 01-12, DD = 01-31 |
| SecurityID   | char[8]  | 证券代码   |
| PBUID        | char[6]  | 交易单元代码   |
| AccountID    | char[12] | 证券账户   |
| BranchID     | char[4]  | 营业部代码  |

注：

- 1) 表中的 Nx(y)表示相应的类型实际为浮点数类型，其中 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，比如对于 Price 类型，Int64 值 186400 表示的价格为 18.6400。
- 2) 在某些应用场景下，一个消息中可能有部分字段不需要填写，如果是字符串型字段则填写全空格，如果是数值型字段则填写 0。

## 6.2 会话层域定义

| 域名               | 类型        | 说明                        |
|------------------|-----------|---------------------------|
| BodyLength       | uInt32    | 消息体长度                     |
| MsgType          | uInt32    | 消息类型                      |
| SenderCompID     | char[20]  | 接收方代码                     |
| TargetCompID     | char[20]  | 发送方代码                     |
| Password         | char[16]  | 密码                        |
| Text             | char[200] | 文本信息                      |
| HeartBtInt       | Int32     | 心跳监测的时间间隔<br>为系统设定值,以秒为单位 |
| DefaultApplVerID | char[32]  | 二进制协议版本，即数据接口规范版本。        |
| SessionStatus    | Int32     | 会话状态                      |

## 6.3 业务层域定义

| 域名                | 类型        | 说明     |
|-------------------|-----------|--------|
| AccountID         | AccountID | 证券账户   |
| BidPositionEffect | char      | 买开平仓标志 |

|                       |           |   |
|-----------------------|-----------|---|
|                       |           | O 表示开仓<br>C 表示平仓  |
| BranchID              | BranchID  | 营业部代码   |
| BusinessRejectReason  | uInt16    | 拒绝原因：   |
| BusinessRejectRefID   | char[10]  | 被拒绝消息对应的业务层 ID  |
| CashMargin            | char      | 融资融券信用标识<br>1=Cash, 普通交易<br>2=Open, 融资融券开仓<br>3=Close, 融券融券平仓 |
| CashOrderQty          | Amt       | 订单现金金额  |
| ClearingFirm          | char[2]   | 结算机构代码<br>01=中国证券登记结算公司深圳分公司                                  |
| ClOrdID               | char[10]  | 客户订单编号<br>同一交易单元每个交易日申报的委托的 ClOrdID 不得重复                      |
| ConfirmID             | char[8]   | 约定号<br>8 位数字字符串, 不足 8 位前补 0                                   |
| ContactInfo           | char[50]  | 联系方式  |
| ContractAccountCode   | char[6]   | 合约账户识别码   |
| CounterpartyAccountID | AccountID | 对手方证券账户   |
| CounterpartyBranchID  | BranchID  | 对手方营业部代码  |
| CounterpartyExecID    | char[16]  | 交易所赋予的执行编号, 单个交易日内不重复   |
| CounterpartyPBUID     | PBUID     | 对手方交易单元   |
| CoveredOrUncovered    | uInt8     | 备兑标签, 衍生品交易填写<br>0=Covered, 表示备兑<br>1=UnCovered, 表示非备兑        |

|                        |          |   |
|------------------------|----------|---|
| CumQty                 | Qty      | 累计执行数量  |
| CxlRejReason           | uInt16   | 撤单拒绝原因代码，正数   |
| DeliverQty             | Qty      | 证券交付数量  |
| DesignationInstruction | char     | 注册指令<br>3 表示转托管   |
| DesignationTransType   | uInt8    | 注册指令类型<br>1=New，表示新注册请求<br>3=Cancel，表示注册撤单                                    |
| ExecID                 | char[16] | 交易所赋予的执行编号，单个交易日内不重复  |
| ExecType               | char     | 执行报告类型<br>0=New，表示新订单<br>4=Cancelled，表示已撤销<br>8=Reject，表示已拒绝<br>F=Trade，表示已成交 |
| ExpirationDays         | uInt16   | 期限，单位为天数  |
| ExpirationExecInst     | uInt8    | 到期续做方式<br>1=到期自动续做<br>2=到期手动续做  |
| ExpirationType         | uInt8    | 期限类型<br>1=固定期限  |
| InsufficientSecurityID | char[8]  | 申购赎回不足成份股证券代码   |
| IOIID                  | char[10] | 客户意向申报编号<br>同一交易单元每个交易日申报的意向申报的 IOIID 不得重复                                    |
| IOIQty                 | Qty      | 意向申报数量  |
| IOIRefID               | char[10] | 原意向申报 IOIID<br>撤销意向申报时使用  |
| IOITransType           | char     | 意向申报类型<br>N=意向申报<br>C=意向申报撤单  |
| LastPx                 | Price    | 成交价格  |

|                     |              |  |
|---------------------|--------------|--|
| LastQty             | Qty          | 成交数量   |
| LeavesQty           | Qty          | 订单剩余数量   |
| MaturityDate        | LocalMktDate | 到期日  |
| MaxPriceLevels      | uInt16       | 最多成交价位数，正数<br>0 表示不限制成交价位数   |
| MinQty              | Qty          | 最低成交数量   |
| NoPartyIDs          | NumInGroup   | 参与方个数  |
| NoSecurity          | NumInGroup   | 证券只数   |
| OfferAccountID      | AccoutID     | 卖方证券账户   |
| OfferBranchID       | BranchID     | 卖方营业部代码  |
| OfferPBUID          | PBUID        | 卖方交易单元   |
| OfferPositionEffect | char         | 卖开平仓标志<br>O 表示开仓<br>C 表示平仓   |
| OrderID             | char[16]     | 交易所订单编号<br>交易所赋予的订单编号，跨交易日不重复  |
| OrderQty            | Qty          | 订单数量   |
| OrdRejReason        | uInt16       | 订单拒绝原因代码，正数  |
| OrdStatus           | char         | 订单状态<br>0=New，表示新订单<br>1=Partially filled，表示部分成交<br>2=Filled，表示全部成交<br>4=Cancelled，表示已撤销<br>8=Reject，表示已拒绝 |
| OrdType             | char         | 订单类型<br>1 表示市价<br>2 表示限价<br>U 本方最优   |
| OrigClOrdID         | char[10]     | 原订单 ClOrdID  |

|                     |              |   |
|---------------------|--------------|---|
| OrigSubmittingPBUID | PBUID        | 初始交易申报交易单元  |
| OrigTradeDate       | LocalMktDate | 初始成交申报申报日期  |
| OrigTradeID         | char[16]     | 初始成交申报的 TradeID   |
| OrigTradeReportID   | char[10]     | 初始交易客户成交申报编号  |
| OwnerType           | uInt16       | 所有者类型，正数<br>1=个人投资者发起<br>101=交易所发起<br>102=会员发起<br>103=机构投资者发起<br>104=自营交易发起<br>105=流动性服务提供商发起<br>106=结算结构发起 |
| PlatformID          | uInt16       | 平台号<br>1=现货集中竞价交易平台<br>2=综合金融服务平台<br>3=非交易处理平台<br>4=衍生品集中竞价交易平台   |
| PlatformState       | uInt16       | 平台状态<br>0=PreOpen，未开放<br>1=OpenUpComing，即将开放<br>2=Open，开放<br>3=Halt，暂停开放<br>4=Close，关闭                      |
| PositionEffect      | char         | 开平仓标识<br>O 表示开仓<br>C 表示平仓   |
| Price               | Price        | 价格  |
| PriceType           | uInt8        | 价格类型<br>1=百分比<br>3=固定数量   |

|                   |          |  |
|-------------------|----------|--|
| QuoteMsgID        | char[10] | 客户报价消息编号   |
| QuoteRejectReason | uInt16   | 意向申报拒绝原因代码，正数                                      |
| QuoteRespID       | char[16] | 交易所意向申报编号<br>交易所赋予的意向申报编号，<br>跨交易日不重复              |
| QuoteRespType     | uInt8    | 意向申报响应类型<br>2=意向申报响应                               |
| QuoteStatus       | uInt8    | 报价状态<br>0=Accepted，接受<br>5=Rejected，拒绝             |
| RefMsgType        | uInt32   | 被拒绝的消息类型   |
| RefSeqNum         | SeqNum   | 引用的消息序号  |
| RejectText        | char[16] | 拒绝原因说明   |
| ReportIndex       | SeqNum   | 回报记录号，从 1 开始编号                                     |
| ReportingPBUID    | PUBID    | 回报交易单元   |
| RptExecID         | char[16] | 成交申报执行编号   |
| SecurityID        | char[8]  | 证券代码   |
| SecurityIDSource  | char[4]  | 证券代码源<br>102=深圳证券交易所                               |
| ShareType         | char[4]  | 股份性质   |
| Side              | char     | 买卖方向<br>1=买<br>2=卖<br>G=借入<br>F=出借<br>D=申购<br>E=赎回 |
| StopPx            | Price    | 止损价格   |
| SubmittingPBUID   | PBUID    | 申报交易单元   |
| SubstCash         | Amt      | 现金替代金额   |



|                         |                |   |
|-------------------------|----------------|---|
| Tenderer                | char[6]        | 要约收购参与人编码   |
| Text                    | char[8]        | 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   |
| TimeInForce             | char           | 订单有效时期类型<br>0 表示当日有效<br>3 表示即时成交或取消（IOC）                                  |
| TimeToExpiration        | uInt16         | 期限，单位为天数，正数   |
| TradeHandlingInstr      | char           | 成交申报模式<br>1=Two-Party Report，成交报告<br>2=One-Party report for matching，协议配对 |
| TradeID                 | char[16]       | 交易所成交申报编号<br>交易所赋予的成交申报编号，跨交易日不重复   |
| TradeReportID           | char[10]       | 客户成交申报编号<br>同一交易单元每个交易日申报的成交申报的 TradeReportID 不得重复                        |
| TradeReportRefID        | char[10]       | 原客户成交申报编号，最多 8 个字符  |
| TradeReportRejectReason | uInt16         | 成交申报拒绝原因代码  |
| TradeReportTransType    | uInt8          | 成交申报事务类别<br>0=New，新申报<br>1=Cancel，撤销申报<br>2=Replace，成交申报成功                |
| TradeReportType         | uInt8          | 成交申报消息类型<br>0=Submit，提交成交申报   |
| TransacTime             | LocalTimestamp | 订单或执行的创建时间  |
| TransfereePBUID         | PBUID          | 转入交易单元代码  |

|                      |         |  |
|----------------------|---------|--|
| TrdAckStatus         | uInt8   | 成交申报响应状态<br>0=Accepted, 接受<br>1=Rejected, 拒绝   |
| TrdRptStatus         | uInt8   | 成交申报状态<br>2=Cancelled, 已撤销<br>100=Unmatched, 尚未匹配<br>101=Matched, 已匹配  |
| TrdSubType           | uInt16  | 成交申报子业务类别  |
| TrdType              | uInt16  | 成交申报类型, 正数<br>1001=股票质押式回购初始交易<br>1002=股票质押式回购提前购回<br>1003=股票质押式回购到期购回<br>1004=股票质押式回购延期购回<br>1005=股票质押式回购终止购回<br>1006=股票质押式回购补充质押<br>1007=股票质押式回购部分解除质押<br>1008=股票质押式回购违约处置<br>1011=约定购回初始交易<br>1012=约定购回提前购回<br>1013=约定购回到期购回<br>1014=约定购回延期购回<br>1021=质押式报价回购初始交易<br>1022=质押式报价回购提前购回 |
| UnderlyingSecurityID | char[8] | 基础证券代码   |

|                            |         |  |
|----------------------------|---------|--|
| UnderlyingSecurityIDSource | char[4] | 基础证券代码源<br>102=深圳证券交易所                       |
| UserInfo                   | char[8] | 用户私有信息                                       |
| VelidationCode             | uInt32  | 密码激活校验号，正数                                   |
| VotingPreference           | char    | 投票意向<br>1 代表同意，2 代表反对，3 代表弃权                 |
| VotingProposal             | uInt16  | 投票议案号，正数<br>1-99 表示具体议案号<br>100 表示总议案        |
| VotingSubProposal          | uInt16  | 投票子议案号或选举候选人，正数<br>0 表示所有子议案<br>>0 其他表示具体子议案 |