



工程技术标准

深圳证券交易所第五版交易系统 接口规范开发指南

(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版征求意见反馈修订

目 录

一、 前言	1
二、 系统架构图	1
三、 接口规范结构	2
四、 与第四版交易系统接口对比	2
4.1 主要变化	2
4.1.1 新老接口总体对照	2
4.1.2 关键变化点	3
4.2 交易	4
4.2.1 与 SJSWT 库中委托类别的对照	4
4.2.2 与 SJSZHWT 库中委托类别的对照	6
4.2.3 市价订单申报方式变化	8
4.2.4 委托流水号变化	8
4.2.5 回报方式变化	10
4.2.6 回购交易的回报记录合成一笔	10
4.2.7 ETF 实时申购赎回回报记录合成一笔	11
4.2.8 融资融券申报方式变化	12
4.2.9 协议交易申报方式变化	13
4.3 行情	13
4.3.1 证券信息	13
4.3.2 集中竞价行情快照	14
4.3.3 集中竞价逐笔行情	15
4.3.4 协议大宗交易/转融通出借行情	15
4.3.5 盘后定价大宗交易行情	16
4.3.6 指数行情	16
4.3.7 成交量统计指标行情	16
4.3.8 公告	16
五、 新接口规范说明	16
5.1 证券代码扩位	16
5.2 证券账户最多 12 个字符	16
5.3 平台状态说明	17
5.4 新订单（NEW ORDER）处理回报说明	18
5.4.1 申报新订单并产生成交	18
5.4.2 撤销尚未产生成交的新订单	19
5.4.3 撤销已部分成交的新订单	19
5.4.4 撤销已全部成交的新订单	19
5.4.5 撤销不存在的新订单	20
5.5 成交申报（TCR）处理回报说明	20
5.5.1 申报新成交申报	20
5.5.2 撤销尚未配对成功的成交申报	20
5.5.3 撤销已配对成功的成交申报	21
5.5.4 撤销已被拒绝的成交申报	21

5.5.5	撤销不存在的成交申报	21
六、	STEP 消息示例	21
6.1	交易	21
6.1.1	新订单处理	21
	申报新订单	21
	订单响应执行报告	22
	订单成交执行报告	24
6.1.1.1	撤单请求	25
6.1.1.2	撤单失败响应	25
6.1.1.3	撤单成功执行报告	26
6.1.1.4	报价处理	27
6.1.1.5	报价	27
	报价状态回报	28
6.1.2.1	报价成交执行报告	29
6.1.2.2	意向申报	30
6.1.2.3	意向申报	30
6.1.3.1	意向申报响应	31
6.1.3.2	成交申报处理	32
6.1.4.1	成交申报	32
6.1.4.2	成交申报响应	34
6.1.4.3	成交确认	35
6.1.5	注册处理	36
6.1.5.1	注册	37
6.1.5.2	注册执行报告	37
6.1.6	网络投票处理消息	38
6.1.6.1	投票	38
6.1.6.2	投票执行报告	39
6.1.6.3	投资者网络投票密码服务激活	40
6.1.6.4	投资者网络投票密码服务激活执行报告	41
6.2	行情	42
6.2.1	频道心跳	42
6.2.2	重传消息	42
6.2.3	用户信息报告消息	43
6.2.4	证券实时状态	43
6.2.5	公告	44
6.2.6	集中竞价行情快照	45
6.2.7	逐笔委托行情	48
6.2.8	逐笔成交行情	49
七、	BINARY 消息示例	49
7.1	交易	50
7.1.1	订单处理	50
	申报新订单	50
	订单响应执行报告	50

	订单成交执行报告	51
	撤单请求	52
	撤单失败响应	53
	撤单成功执行报告	53
7.1.1.3	报价处理	54
7.1.1.4	报价	54
7.1.1.5	报价状态回报	55
7.1.1.6	报价成交执行报告	56
7.1.2.1	意向申报	57
7.1.2.2	意向申报	57
7.1.2.3	意向申报响应	57
7.1.3.1	成交申报处理	58
7.1.3.2	成交申报	58
	成交申报响应	59
7.1.4.1	成交确认	60
7.1.4.2	注册处理	61
7.1.4.3	注册	61
7.1.5.1	注册执行报告	62
7.1.5.2	网络投票处理消息	63
7.1.6.1	投票	63
7.1.6.2	投票执行报告	63
7.1.6.3	投资者网络投票密码服务激活	64
7.1.6.4	投资者网络投票密码服务激活执行报告	65
7.2	行情	65
7.2.1	频道心跳	65
7.2.2	重传消息	65
7.2.3	用户信息报告消息	66
7.2.4	证券实时状态	66
7.2.5	公告	66
7.2.6	集中竞价行情快照	67
7.2.7	逐笔委托行情	70
7.2.8	逐笔成交行情	71
八、	会话	71
8.1	SENDERCOMPID 和 TARGETCOMPID 的填写规则	71
8.2	DEFAULTCSTMPLVERID 字段的填写规则	72
8.3	SESSSIONSTATUS 字段的填写规则	72
8.4	STEP 会话	72
8.4.1	登录消息	72
8.4.2	会话模式	72
8.4.3	何时发送 Logout, 何时直接断开连接	72
8.4.4	何时发送 SessionReject, 何时发送 Logout	72
8.5	网络版行情网关会话管理	73
九、	相关文档	73

深圳证券交易所第五版交易系统接口规范开发指南

一、前言

本文档是关于深圳证券交易所第五版交易系统接口规范（简称“新接口规范”）使用的详细说明文档，供市场参与者及其 IT 供应商进行相关技术系统改造时参考。

特别申明：

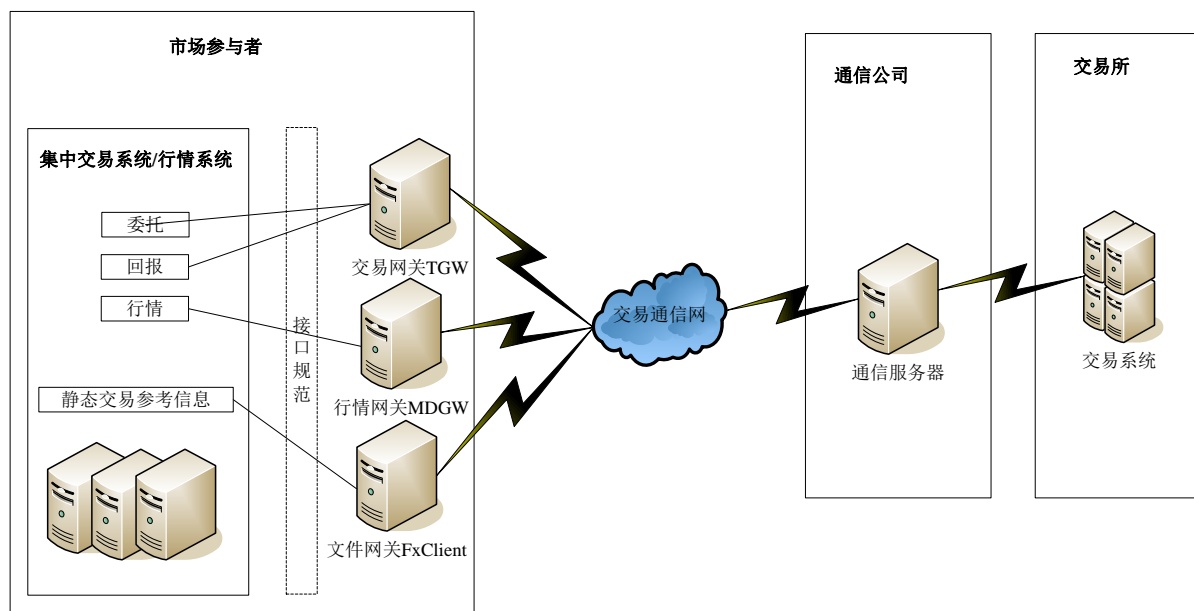
本指南编制基础是本所第五版交易系统（以下简称“新版交易系统”或“交易系统”）技术方案、功能及接口文档。本所保留对本指南的解释及修改权。

联系方式：

在开发或测试过程中，可以通过以下方式与深圳证券交易所技术部门（“第五版交易系统建设项目组”）联系。

- 电话：0755-25918478（业务及应用相关）、0755-25911508（会话相关）
- 电子邮件：stsv5@szse.cn
- QQ 群：288321593；QQ 群论坛：<http://qgc.qq.com/49156774>

二、系统架构图



市场参与者集中交易系统通过交易网关 TGW 可申报所有业务的委托并接收回报消息，一个 TGW 上可以配置一个或多个申报交易单元，市场参与者也可以根据业务或性能需要申请部署多个 TGW。

市场参与者行情系统可通过行情网关 MDGW 接收实时行情信息。不同的行情信息被分为多个频道发送，市场参与者可以根据需要选择只接收指定频道的行情信息。MDGW 也可以部署多个以平衡负载。

第五版交易系统新增了一个专用的文件网关 FxClient，交易系统下发文件，市场参与者向交易系统报送文件都通过该文件网关进行。交易系统在每个交易日交易开始前通过文件网关将静态交易参考信息文件发送给市场参与者。

三、 接口规范结构

第五版交易系统同时提供 STEP 交易/行情接口和 Binary 交易/行情接口，STEP 接口具有较高的灵活性，易于扩展，Binary 接口则具有较高的传输性能，市场参与者可自行选择使用 STEP 或 Binary 接口。

第五版交易系统接口规范主要包括以下三部分。

- STEP 交易及行情接口规范，遵照 STEP1.2 及 Fix5.0Sp2，深交所做特定扩展。

《轻量级 STEP 会话层接口规范》：规定会话层协议，由深圳证券交易所与上海证券交易所联合制定。

《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》：规定应用层的交易接口协议。

《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》：规定应用层的行情接口协议。

- Binary 交易及行情接口规范，深交所自定义的私有协议，基于二进制格式消息流进行数据交换，消息类型、内容与 STEP 消息一一对应。

《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》：规定应用层的交易接口协议。

《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》：规定应用层的行情接口协议。

- 数据文件交换接口规范，主要包括开盘前的静态交易参考信息文件。

《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》：规定交易系统与市场参与者技术系统之间交换静态文件的格式和内容。

四、 与第四版交易系统接口对比

为描述方便，下面将第四版交易系统的接口称为老接口，将第五版交易系统的接口称为新接口。

4.1 主要变化

4.1.1 新老接口总体对照

老接口		新接口
《深圳证券交易所	委托库 SJSWT.DBF	《深圳证券交易所 STEP 交易数据

所数据接口规范》	回报库 SJS HB.DBF 综合委托库 SJSZHW T.DBF 综合回报库 SJSZH H B.DBF	接口规范》 《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》
	证券信息库 SJSXX.DBF 新证券信息库 SJSXXN.DBF 行情库 SJS HQ.DBF 指数库 SJSZS.DBF 综合行情库 SJSZH HQ.DBF 信 息 公 告 文 件 XXYYMMDD.NNN	《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》 《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》 《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》
《新版行情系统 FAST 协议数据接口规范》		
结算相关接口		中国结算深圳分公司发布单独的结算数据接口规范

4.1.2 关键变化点

数据接口规范关键变化点：

- 成交编号仅保证交易日内唯一，不保证单向递增
- 营业部识别码以单独的字段申报
- 显式的委托确认消息，并为每笔委托分配跨交易日唯一的交易所订单编号
- 市价委托通过多个字段组合确定申报类型
- 回购交易回报合成一笔
- ETF 申购赎回回报合成一笔
- 证券代码升级为 8 位
- 委托流水号升级为 10 位
- 委托价格精度由 3 位小数升为 4 位小数
- 委托数量包含两位小数
- 静态交易参考数据以多个 xml 文件的形式发布
- 协议交易及转融通证券出借行情由快照行情改为逐笔行情
- Level II 行情的逐笔委托和逐笔成交合成一个数据流发送

4.2 交易

4.2.1 与 SJSWT 库中委托类别的对照

WTYWLB	委托业务含义	新接口 STEP 消息类型	新接口 Binary 消息类型	应用标识 ApplID
0B	正常交易业务的买委托记录	新订单 (D)	100101	010
0S	正常交易业务的卖委托记录			
0C	正常交易业务的撤单记录	撤单请求 (F)	190007	
2B	即时成交剩余撤销买委托记录	新订单 (D)	100101	010
2S	即时成交剩余撤销卖委托记录			
3S	转托管申报记录, 转出交易单元代码在 WTHTXH 中	注册 (U001)	102099	200
3C	转托管业务中撤单委托记录			
4B	配股认购业务中认购委托记录	新订单 (D)	101401	140
4C	配股认购业务中撤单委托记录	撤单请求 (F)	190007	
5S	可转债转股业务中转股申报记录	新订单 (D)	101501	150
5C	可转债转股业务中撤单委托记录	撤单请求 (F)	190007	
6S	债券回售业务中回售申报记录	新订单 (D)	101501	151
6C	债券回售业务中撤单委托记录	撤单请求 (F)	190007	
7B	新股申购业务中申购委托记录	新订单 (D)	101301	130
	网络投票	投票 (U004)	102197	210
	密码服务	密码服务 (U006)	102196	211 212
7C	新股申购业务中撤单委托记录	撤单请求 (F)	190007	130
8C	市值配售新股发行业务中签后的放弃认购委托记录	不再支持		
8X	市值配售新股发行业务中签后的放弃认购的撤单委托记录	不再支持		
AB	无股份冻结质押业务中质权人的申报记录 对应出质人的交易单元代码须填在 WTTWTJG 中	不再支持		
AS	无股份冻结质押业务中出质人的申报记录 对应质权人的交易单元代码须填在 WTTWTJG 中			
AC	无股份冻结质押业务中撤单委托记录			
BB	股份质押且冻结业务中质权人的申报记录 对应出质人的交易单元代码须填在 WTTWTJG 中			

WTYWLB	委托业务含义	新接口 STEP 消息类型	新接口 Binary 消息类型	应用标识 ApplID
BS	股份质押且冻结业务中出质人的申报记录 对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中			
BC	股份质押且冻结业务中撤单委托记录			
CB	无股份冻结解押业务中出质人的申报记录 对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中			
CS	无股份冻结解押业务中质权人的申报记录 对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中			
CC	无股份冻结解押业务中撤单委托记录			
DB	股份解押且解冻业务中出质人的申报记录 对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中			
DS	股份解押且解冻业务中质权人的申报记录 对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中			
DC	股份解押且解冻业务中撤单委托记录			
ES	流通股份要约收购业务中的预受要约申报记录	新订单 (D)	101801	180
EC	流通股份要约收购业务中的预受要约撤单委托记录	撤单请求 (F)	190007	
FS	流通股份要约收购业务中的解除预受要约申报记录	新订单 (D)	101801	181
FC	流通股份要约收购业务中的解除预受要约撤单委托记录	撤单请求 (F)	190007	
IB	开放式基金申购申报记录	新订单 (D)	101701	170
IS	开放式基金赎回申报记录			
IC	开放式基金申购、赎回业务的撤单委托记录	撤单请求 (F)	190007	
JB	认购或认沽权证的行权申报记录	新订单 (D)	101601	160
JC	认购或认沽权证的行权撤单委托记录	撤单请求 (F)	190007	

WTYWLB	委托业务含义	新接口 STEP 消息类型	新接口 Binary 消息类型	应用标识 ApplID
	录			
KB	ETF 基金申购申报记录	新订单（D）	101201	120
KS	ETF 基金赎回申报记录			
NB	证券质押式回购业务中证券转出质押库的申报记录。证券代码填可用于质押式回购的证券代码。	新订单（D）	101901	190 191
NS	证券质押式回购业务中证券转入质押库的申报记录。证券代码填可用于质押式回购的证券代码。			
VB	最优五档即时成交剩余撤销买委托记录	新订单（D）	100101	010
VS	最优五档即时成交剩余撤销卖委托记录			
WB	全额成交或撤销买委托记录			
WS	全额成交或撤销卖委托记录			
XB	本方最优价格买委托记录			
XS	本方最优价格卖委托记录			
XC	本方最优价格撤单委托记录	撤单请求（F）	190007	
YB	对手方最优价格买委托记录	新订单（D）	100101	
YS	对手方最优价格卖委托记录			
YC	对手方最优价格撤单委托记录	撤单请求（F）	190007	

4.2.2 与 SJSZHW 库中委托类别的对照

WTYWLB	WTZLLB	指令类别含义	新接口 STEP 消息类型	新接口 Binary 消息类型	应用标识 ApplID
两个空格	1B	协议交易成交申报的买委托记录	协议配对成交申报: 成交申报 (AE) 定价委托点击成交申报: 新订单 (D)	协议配对成交申报: 100503 定价委托点击成交申报: 100501	协议配对成交申报: 053 定价委托点击成交申报: 052
两个空格	1S	协议交易成交申报的卖委托记录			
两个空格	1C	协议交易成交申报的撤单记录			
两个空格	HB	协议交易意向申报的买委托记录	意向申报 (6)	100509	050
两个空格	HS	协议交易意向申报的卖委托记录			
两个空格	HC	协议交易意向申报的撤单记录			
两个空格	OB	协议交易定价申报的买委托记录	新订单 (D)	100501	051

WTYWLB	WTZLLB	指令类别含义	新接口 STEP 消息类型	新接口 Binary 消息类型	应用标识 ApplID
两个空格	OS	协议交易定价申报的卖委托记录			
两个空格	OC	协议交易定价申报的撤单记录	撤单请求 (F)	190007	
01	AS	转融通非约定申报的出借委托记录	新订单 (D)	100701	070
01	AC	转融通非约定申报的撤单记录	撤单请求 (F)	190007	
01	PS	转融通约定申报的出借委托记录	成交申报 (AE)	100703	071
01	PC	转融通约定申报的撤单记录			
02	BB	约定购回初始交易的委托记录	成交申报 (AE)	101003	100
02	CS	约定购回回购交易的委托记录			
02	ES	报价回购初始交易的委托记录	成交申报 (AE)	101103	110
02	FB	报价回购提前购回交易的委托记录			
02	GS	资管产品份额转让成交报告指令的委托记录	成交申报 (AE)	100803	080
02	KB	股票质押回购初始交易的委托记录	成交申报 (AE)	100903	090
02	JS	股票质押回购购回交易的委托记录			
02	MB	股票质押回购补充质押的委托记录			
02	NS	股票质押回购部分解除质押的委托记录			
03	SB	盘后定价大宗交易申报的买委托记录	新订单 (D)	100601	060 061
03	SS	盘后定价大宗交易申报的卖委托记录			
03	SC	盘后定价大宗交易申报的撤单记录	撤单请求 (F)	190007	

4.2.3 市价订单申报方式变化

集中竞价业务市价订单同限价订单一样都通过新订单消息申报，市价订单方式由老接口的每种市价订单对应一种委托业务类别，改为通过新订单中的多个字段指定订单属性的方式申报，对于每种市价订单的属性取值方式如下表所示，申报市价订单时必须按照表中的组合方式申报，否则订单会被视为无效。

WTYW LB	委托业务含义	新接口消息				
		Side	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
2B	即时成交剩余撤销买委托记录	1	3	1	0	0
2S	即时成交剩余撤销卖委托记录	2	3	1	0	0
VB	最优五档即时成交剩余撤销买委托记录	1	3	1	5	0
VS	最优五档即时成交剩余撤销卖委托记录	2	3	1	5	0
WB	全额成交或撤销买委托记录	1	3	1	0	=委托数量
WS	全额成交或撤销卖委托记录	2	3	1	0	=委托数量
XB	本方最优价格买委托记录	1	0	U	0	0
XS	本方最优价格卖委托记录	2	0	U	0	0
YB	对手方最优价格买委托记录	1	0	1	1	0
YS	对手方最优价格卖委托记录	2	0	1	1	0

4.2.4 委托流水号变化

老接口 SJSWT.DBF 和 SJSZHW.DBF 中的委托流水号描述为：

“WTHTXH（字段 1：合同序号）左六位为表示交易单元代码的数字串。其后 8 位为委托日期（CCYYMMDD）。右 8 位为委托流水号。委托流水号中最左两位（即合同序号 WTHTXH 的第 15、16 位）可为英文字母或阿拉伯数字，其余六位为阿拉伯数字。对实施会员集中报盘的证券营业部，委托流水号的前两位（即合同序号 WTHTXH 的第 15、16 位）即为同一会员属下的证券营业部

识别码。”

新接口中，对于不同类型的委托需要用不同的编号域表示老接口中的委托流水号，这些域都是 String 类型，最多 10 个字符，可包含数字、大写字母以及小写字母：

Tag	编号域名	编号域描述	适用委托类型
11	ClOrdID	客户订单编号	新订单(D) 新订单撤单请求 (F) 转托管 (U001) 投票 (U004) 投资者密码服务 (U005)
23	IOIID	客户意向申报编号	意向申报(6)
571	TradeReportID	客户成交报告编号	成交申报(AE)
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号	报价

一个交易单元对同一业务申报的所有委托流水号不能重复，应用标识 ApplID 前两位相同的委托属于同一业务，具体示例如下：

举例	是否重单
申报两笔现货集中竞价业务的新订单使用相同的流水号	重单
申报一笔集中竞价业务的新订单，申报一笔 ETF 实时申购赎回业务新订单使用相同的流水号	不重单
申报一笔协议交易业务定价委托新订单，申报一笔协议交易业务成交申报使用相同的流水号	重单
申报一笔现货集中竞价业务新订单，申报一笔现货集中竞价业务撤单请求使用相同的流水号	重单

营业部代码改为在委托的参与方信息中作为单独的一条参与方信息申报。

新老接口兼容期，市场参与者可以并行使用新老接口，而委托流水号在新接口中扩充了两位，其兼容规则如下：

- ✓ 对于以新接口申报的委托，如果通过老接口接收其回报，则委托流水号的后两位将被截掉，建议存在此类应用场景的市场参与者在兼容期内仍然使用 8 位的流水号，后补两个空格。
- ✓ 对于以老接口申报的委托，如果通过新接口接收其回报，则委托流水号的末尾会补充两个空格，并且将委托流水号前两位填入营业部代码字段。
- ✓ 对于股票质押式回购，约定购回，质押式报价回购等业务，如果其初始交易委托是在启用新接口之前通过老接口申报的（流水号为 8 位），后续需要通过新接口申报对应的各类购回委托时，委托中的初始交易流水号（OrigTradeReportID，10 位）的前 8 位填写初始交易流水号，后 2 位填写空格。

4.2.5 回报方式变化

老接口以 SJSHB.DBF 和 SJSZHHB.DBF 两个回报库存放回报信息，新接口主要通过执行报告发送回报信息，并且在回报信息方面有所调整，以集中竞价交易为例：

订单处理场景	老接口回报信息	新接口回报信息
一笔新订单未通过交易系统前端检查	回报库中产生一条自动撤单回报记录	发送一条 Rejected 执行报告
一笔新订单通过交易系统前端检查但暂时未成交	回报库中没有记录	发送一条 New 执行报告
新订单成交	回报库中产生一条或多条成交回报记录	发送一条或多条 Trade 执行报告

老接口 SJSHB.DBF 和 SJSZHHB.DBF 中的 HBCJHM（成交号码）字段是单向递增的，新接口的对应字段为执行报告中的 ExecID（执行编号）字段，该字段只保证每个交易日的每笔执行报告唯一，但不保证用户接收到的顺序是单向递增的。

4.2.6 回购交易的回报记录合成一笔

老接口中，回购交易的成交会发送两笔成交回报，第一笔为初始交易记录，第二笔

为到期交易记录：

	成交数量 HBCJSL	成交价格 HBCJJG	成交时间 HBCJSJ
初始交易	实际的回购量	100.00	实际成交时间
到期交易	0	回购年利率	回购到期日期

新接口中，回购交易的成交只发送一笔执行报告：

LastQty (32)	LastPx (31)	MaturityDate (541)	TransacTime (60)
实际的回购量	回购年利率	回购到期日期	实际成交时间

原初始交易中的标准券面值（100.00）不再在新接口成交回报中体现。

4.2.7 ETF 实时申购赎回回报记录合成一笔

老接口中，ETF 申购赎回的成交会发送多笔回报记录，包括：

- 一笔 ETF 交付记录
- M 笔成份股交付记录
- N 笔资金交付记录

新接口中，ETF 申购赎回的成交只发送一笔执行报告，在执行报告中通过一个重复组结构来回报股份及资金的交付明细，重复组中的每一项对应一只成份股的股份交付数量和现金替代金额。对于现金替代金额，老接口需要将回报记录中的成交价格和成交数量字段相乘获得，新接口直接给出计算后的替代金额。

下面以一笔申购两篮子 159901ETF 的回报来比较新老接口的差异，假设成份股就只有 000001，000002，000004 三只：

老接口共返还五条回报记录（仅列出相关的关键字段）：

HBYWLB	HBZQDM	HBCJSL	HBCJJG	说明
KB	159901	2000000	0.000	ETF 交付记录
KB	000001	1500	0.000	成份股交付记录 没有发生现金替代
KB	000002	700	0.000	成份股交付记录 发生部分现金替代
ZB	000002	300	20.125	资金交付记录 300 股以现金替代，每股替代价格为 20.125

ZB	000004	2	25678.568	资金交付记录 必须现金替代，两篮子，每篮子替代金额为25678.568
----	--------	---	-----------	----------------------------------------

新接口返还一条回报记录（STEP：8，Binary：201202，仅列出相关的关键字段）：

字段	取值
ApplID	120
SecurityID	00159901
OrderQty	2000000
NoSecurity	3
UnderlyingSecurityID	00000001
DeliveryQty	1500.00
SubstCash	0.0000
UnderlyingSecurityID	00000002
DeliveryQty	700.00
SubstCash	6037.5000
UnderlyingSecurityID	00000004
DeliveryQty	0.00
SubstCash	51357.1360

4.2.8 融资融券申报方式变化

新接口中，现货集中竞价交易的融资融券申报使用消息中的 CashMargin 字段来标识，申报方式与老接口对比如下：

申报方式	老接口		新接口	
	WTYWLB	WTMARK 第一位	Side (54)	CashMargin (544)
融资买入	0B	1=融资	1=买	2=开仓
融券卖出	0S	2=融券	2=卖	2=开仓
卖券还款	0S	1=融资	2=卖	3=平仓
买券还券	0B	2=融券	1=买	3=平仓

普通买	OB	‘ ’ =普通	1=买	1=现金
普通卖	OS	‘ ’ =普通	2=卖	1=现金

如申报的平仓委托中的订单所有者类型(OwnerType, tag#522)为 102(会员发起), 则交易所将该委托视为会员提交的强制平仓委托。

4.2.9 协议交易申报方式变化

协议交易业务新老接口委托申报方式对比如下:

委托类别	老接口 WTZLLB	新接口消息类型
定价申报	OB/OS	新订单 (STEP: D, Binary: 100501) ApplID=051
定价委托点击成交申报	1B/1S	新订单 (STEP: D, Binary: 100501) ApplID=052
双方配对成交申报	1B/1S	成交申报 (STEP: AE, Binary: 100503) ApplID=053

在老接口中, 定价委托点击成交申报和双方配对成交申报都是使用同样的委托指令申报, 为区分这两种申报, 要求定价委托点击成交申报的约定号必须大于等于 1,000,000, 双方配对成交申报的约定号必须小于 1,000,000; 在新接口中, 定价委托点击成交申报使用新订单消息申报, 双方配对成交申报使用成交申报消息申报, 两种申报通过消息类型已经区分开, 因此不再有上述约定号约束要求。

4.3 行情

4.3.1 证券信息

第四版		第五版
DBF 接口	SJSXX.DBF SJSXXN.DBF	静态交易参考信息文件 证券实时状态消息 (STEP: f, 二进制: 390013)
新行情系统接口	StockInfo 证券信息消息(UA101) StockStatus 证券状态消息(UA102)	

新接口将交易期间内不会发生变化的部分统称“静态交易参考信息”, 该部分以多

个 xml 文件的形式发布，包括：

- 1) 一个证券信息文件，内容为所有在交易所上市挂牌的证券的基本信息，其中不含一些特殊业务临时挂牌的代码，比如网络投票，债券分销，网上发行认购等，这些代码包括在对应的业务参数信息文件中
- 2) 指数信息文件
- 3) 统计量指标信息文件
- 4) 多个业务参考信息文件：
 - a) 集中竞价交易类业务参考信息文件
 - b) 协议交易业务参数信息文件
 - c) 盘后定价大宗交易业务参考信息文件
 - d) 转融通业务参考信息文件
 - e) ETF 实时申购赎回 PCF 文件
 - f) 网上发行认购业务参考信息文件
 - g) 债券分销业务参考信息文件
 - h) 网络投票业务参考信息文件
 - i) 配股业务参考信息文件

新接口将交易期间内可能发生变化的部分以“证券实时状态(STEP: f，二进制：390013)”消息的方式定时发布，主要包括证券简称前缀以及各类业务的开关信息。

4.3.2 集中竞价行情快照

第四版		第五版
DBF 接口	SJSHQ.DBF	快照行情消息 (STEP: W，二进制：300111)
新行情系统接口	Snapshot 行情快照消息(UA103)	

新接口中只包含参与集中竞价业务的证券的行情快照，即集中竞价交易类业务参考信息文件中的证券代码和债券分销业务参考信息文件中的证券代码，其他不能参与集中竞价交易业务的证券不会有对应的集中竞价行情快照，比如仅通过协议交易方式转让的证券、网络投票、网上发行认购。

4.3.3 集中竞价逐笔行情

第四版		第五版
DBF 接口	N/A	逐笔委托行情消息 (STEP: UA201, 二进制: 300192) 逐笔成交行情消息 (STEP: UA202, 二进制: 300191)
新行情系统接口	Order 逐笔委托消息(UA201) Trade 逐笔成交消息(UA202)	

为方便用户根据逐笔行情重建委托簿信息,新接口规范中逐笔委托消息和逐笔成交消息按照发生的先后顺序合成一个流连续编号并下发。

老接口中的一些无效的逐笔行情信息在新接口中将被裁减掉, 具体为:

- 1) 因未通过交易系统前端检查而被拒绝的委托, 不发布其对应的逐笔行情
- 2) 主动撤单委托只在其撤单成功的情况下, 发布其逐笔成交行情

4.3.4 协议大宗交易/转融通证券出借行情

第四版		第五版
DBF 接口	SJSZHHQ.DBF	协议交易逐笔委托行情消息 (STEP: UA201, 二进制: 300592) 协议交易逐笔成交行情消息 (STEP: UA202, 二进制: 300591) 转融通证券出借逐笔委托行情消息 (STEP: UA201, 二进制: 300792) 转融通证券出借逐笔成交行情消息 (STEP: UA202, 二进制: 300791)
新行情系统接口	N/A	

老接口的协议交易/转融通证券出借行情是将所有有效的意向/定价/出借行情记录定时以快照的形式全量发布, 效率较低。

新接口改成以逐笔的形式发布, 由市场参与者自行推导出快照行情, 以意向行情为

例，交易系统收到一条有效意向申报后，发送一条新意向行情记录；在该意向行情被撤销后，发送一条意向行情撤销记录。

4.3.5 盘后定价大宗交易行情

第四版		第五版
DBF 接口	SJSPHHQ.DBF	快照行情消息 (STEP: W, 二进制: 300611)
新行情系统接口	N/A	

4.3.6 指数行情

第四版		第五版
DBF 接口	SJSZS.DBF	快照行情消息 (STEP: W, 二进制: 309011)
新行情系统接口	Index 指数快照消息(UA104)	

4.3.7 成交量统计指标行情

第四版		第五版
DBF 接口	SJSZS.DBF	快照行情消息 (STEP: W, 二进制: 309111)
新行情系统接口	Index 指数快照消息(UA104)	

4.3.8 公告

第四版		第五版
DBF 接口	信息公告文件 xxyymmdd.nnn	公告消息 (STEP: B, 二进制: 390012)
新行情系统接口	Bulletin 公告消息(UA401)	

五、新接口规范说明

5.1 证券代码升位

新接口规范证券代码升为 8 位，原 6 位证券代码在前面补两个 0，比如原 6 位证券代码“002001”在新接口中以“00002001”表示。

5.2 证券账户最多 12 个字符

新接口证券账户字段最多可以有 12 个字符，对于 STEP 接口，仍然填写现有的 10 位证券账户即可，对于 Binary 接口，证券账户字段的类型是 char[12]，在填写时需要在

后面补两个空格。

比如证券账户“0100012345”，对于 STEP 接口，仍然填写“0100012345”，对于 Binary 接口，填写 “0100012345 ”。

5.3 平台状态说明

第五版交易系统按业务划分为多个平台(目前划分为4个:现货集中竞价交易平台、衍生品集中竞价交易平台、综合金融服务平台、非交易处理平台)，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。

下面以现货集中竞价交易平台为例说明平台状态的含义：

- 0=PreOpen，未开放：一个交易日的交易开始之前，市场参与者交易系统（以下简称“OMS”）在 9:15 之前接入交易系统一般会收到该平台状态消息，OMS 在平台处于该状态时不能申报委托；
- 1=OpenUpComing，即将开放：在 9:15 之前的 3 秒钟交易系统会向 OMS 发送该平台状态消息，OMS 收到消息后，可以开始尝试申报委托，但委托可能会被交易系统因为未到达开放时间而拒绝；此状态消息除了在交易日的交易开始时间 9:15 之前发送外，在 9:30, 13:00 之前 3 秒钟也会发送；
- 2=Open，开放：平台处于开市期间，OMS 在 9:15, 9:30, 13:00 会收到该状态消息，可以申报委托；
- 3=Halt，暂停开放：OMS 在 9:25, 11:30 会收到该状态消息，应该停止申报委托；因为网络传输时延的存在，从交易系统发出该状态信息到 OMS 收到会存在一个时间差，在该时间差内 OMS 申报的委托会被交易系统拒绝；
- 4=Close，关闭：OMS 在 15:00 会收到该状态消息，应该停止申报委托；同样会因为网络传输时延导致委托被交易系统拒绝。



注：9:25-9:30 不再接受委托。

5.4 新订单 (New Order) 处理回报说明

新订单执行报告使用多个字段来表示订单的当前状态, 下面列举了这些字段在新订单各种状态下的取值。表中的 Time 列表示时间顺序, 值相同的行数表示可能发生的多种情形, 但任何时候有且只有一种情形会发生; Received 列和 Sent 列是以交易系统的视角来描述。

5.4.1 申报新订单并产生成交

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单
2		Execution	Rejected	Rejected	10000	0	0	0	订单被拒绝
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受

3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000
4		Execution	Trade	Partially Filled	10000	4000	6000	1000	订单成交 1000
5		Execution	Trade	Filled	10000	10000	0	6000	订单成交 6000

5.4.2 撤销尚未产生成交的新订单

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受
3	Cancel Request				10000				收到撤单请求
4		Execution	Cancelled	Cancelled	10000	0	0	0	撤单成功

5.4.3 撤销已部分成交的新订单

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000
4	Cancel Request				10000				收到撤单请求
5		Cancel Reject		Partially Filled					撤单被拒绝， OrdStatus 填写目标委托当前状态
5		Execution	Cancelled	Cancelled	10000	3000	0	0	撤单成功

5.4.4 撤销已全部成交的新订单

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
------	----------	------	-----------	-----------	-----------	---------	------------	----------	--

1	NewOrder				10000				收到新订单
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000
4		Execution	Trade	Filled	10000	10000	0	7000	订单成交 7000
5	Cancel Request				10000				收到撤单请求
6		Cancel Reject		Filled					撤单被拒绝

5.4.5 撤销不存在的新订单

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	Cancel Request				10000				收到撤单请求
2		Cancel Reject		Rejected					撤单被拒绝

5.5 成交申报（TCR）处理回报说明

5.5.1 申报新成交申报

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TrdAckStatus	TrdRptStatus	
1	TCR		New			提交一笔成交申报
2		TCR Ack	New	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝
2		TCR Ack	New	Accepted	Unmatched	成交申报被接受
3		TCR Ack	New	Accepted	Cancelled	与对手方成交申报配对失败
3		TCR	Replace			与对手方配对成功

5.5.2 撤销尚未配对成功的成交申报

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TrdAckStatus	TrdRptStatus	
1	TCR		New			提交一笔成交申报
2		TCR Ack		Accepted	Unmatched	成交申报被接受
3	TCR		Cancel			提交一笔成交申报撤销请求
4		TCR Ack	Cancel	Rejected	Unmatched	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写目标委托

						当前状态
4		TCR Ack	Cancel	Accepted	Cancelled	撤单成功

5.5.3 撤销已配对成功的成交申报

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TrdAckStatus	TrdRptStatus	
1	TCR		New			提交一笔成交申报
2		TCR Ack	New	Accepted	Unmatched	成交申报被接受
3		TCR	Replace			与对手方配对成功
4	TCR		Cancel			提交一笔成交申报撤销请求
5		TCR Ack	Cancel	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写目标委托 当前状态

5.5.4 撤销已被拒绝的成交申报

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TrdAckStatus	TrdRptStatus	
1	TCR		New			提交一笔成交申报
2		TCR Ack	New	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝
3	TCR		Cancel			提交一笔成交申报撤销请求
4		TCR Ack	Cancel	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写目标委托 当前状态

5.5.5 撤销不存在的成交申报

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TrdAckStatus	TrdRptStatus	
1	TCR		Cancel			提交一笔成交申报撤销请求
2		TCR Ack	Cancel	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝

六、 STEP 消息示例

6.1 交易

6.1.1 新订单处理

6.1.1.1 下面列举了现货集中竞价业务新订单及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

申报新订单

Tag	域名	取值
-----	----	----

	MsgType	D
1180	ApplID	010
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
38	OrderQty	1200.00
44	Price	17.4800
544	CashMargin	1

STEP 消息如下：

1180=010<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>544=1<SOH>

6.1.1.2

订单响应执行报告

Tag	域名	取值
	MsgType	8

10179	ReportIndex	1
1180	ApplID	010
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
17	ExecID	1100000000004123
37	OrderID	6B4569CDNB009C03
150	ExecType	0
39	OrdStatus	0
151	LeavesQty	1200.00
14	CumQty	0.00
60	TransacTime	20130228-14:42:13:565
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
38	OrderQty	1200.00
44	Price	17.4800
544	CashMargin	1

STEP 消息如下：

10179=1<SOH>1180=010<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>17=1100000000004120<SOH>37=6B4569CDNB009C03<SOH>150=0<SOH>39=0<SOH>151=1200.00<SOH>14=0.00<SOH>60=20130228-14:42:13:565<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=010

0004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>
>38=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>544=1<SOH>

订单成交执行报告

Tag	域名	取值
6	MsgType	8
10179	ReportIndex	2
1180	ApplID	010
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
17	ExecID	1100000000004124
37	OrderID	6B4569CDNB009C03
150	ExecType	F
39	OrdStatus	1
31	LastPx	17.1000
32	LastQty	300.00
151	LeavesQty	900.00
14	CumQty	300.00
60	TransacTime	20130228-14:42:15:555
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
544	CashMargin	1

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=010<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>17=11000000000004120<SOH>37=6B4569CDNB009C03<SOH>150=F<SOH>39=1<SOH>31=17.1000<SOH>32=300.00<SOH>151=900.00<SOH>14=300.00<SOH>60=20130228-14:42:15:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>544=1<SOH>

撤单请求

Tag	域名	取值
	MsgType	F
1180	ApplID	010
11	ClOrdID	A0000002
522	OwnerType	1
54	Side	1
60	TransacTime	20130228-14:42:15:555
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	1
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
38	OrderQty	1200.00
41	OrigClOrdID	A0000001

STEP 消息如下：

1180=010<SOH>11=A0000002<SOH>522=1<SOH>54=1<SOH>60=20130228-14:42:15:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=1<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>38=1200.00<SOH>41=A0000001<SOH>

撤单失败响应

Tag	域名	取值
	MsgType	9

10179	ReportIndex	3
1180	ApplID	010
11	ClOrdID	A0000002
41	OrigClOrdID	A0000001
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:565
102	CxlRejReason	20018
39	OrdStatus	1
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	1
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1

STEP 消息如下：

10179=3<SOH>1180=010<SOH>11=A0000002<SOH>41=A0000001<SOH>522=1<SOH>
60=20130228-14:42:13:565<SOH>102=20018<SOH>39=1<SOH>48=00000001<SOH>22=
102<SOH>453=1<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>

6.1.1.6

撤单成功执行报告

Tag	域名	取值
	MsgType	8
10179	ReportIndex	3
1180	ApplID	010
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
17	ExecID	1100000000004125
37	OrderID	6B4569CDNB009C03
150	ExecType	4
39	OrdStatus	4
151	LeavesQty	0.00

14	CumQty	300.00
60	TransacTime	20130228-14:42:23:565
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
38	OrderQty	1200.00
44	Price	17.4800
544	CashMargin	1

STEP 消息如下：

10179=3<SOH>1180=010<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>17=11000000000004125<SOH>37=6B4569CDNB009C03<SOH>150=4<SOH>39=4<SOH>151=0.00<SOH>14=300.00<SOH>60=20130228-14:42:23:565<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>544=1<SOH>

6.1.2 报价处理

6.1.2.1 下面列举了期权集中竞价业务报价及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

报价

Tag	域名	取值
	MsgType	S
1180	ApplID	041

1166	QuoteMsgID	A0000001
522	OwnerType	105
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
537	QuoteType	1
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	2
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
132	BidPx	17.4800
134	BidSize	1200.00
8909	BidPositionEffect	O

STEP 消息如下：

1180=041<SOH>1166=A0000001<SOH>522=105<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>
 >537=1<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=2<SOH>448=000100<SOH>447=
 C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>132=17.4800<S
 OH>134=1200.00<SOH>8909=O<SOH>

6.1.2.2

报价状态回报

Tag	域名	取值
	MsgType	AI
10179	ReportIndex	1
1180	ApplID	041
1166	QuoteMsgID	A0000001
522	OwnerType	105
537	QuoteType	1
297	QuoteStatus	0
48	SecurityID	00000001

22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	2
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
132	BidPx	17.4800
134	BidSize	1200.00
8909	BidPositionEffect	O

STEP 消息如下：

10179=1<SOH>1180=041<SOH>1166=A0000001<SOH>522=105<SOH>537=1<SOH>29
7=0<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=2<SOH>448=000100<SOH>447=C<S
OH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>132=17.4800<SOH
>134=1200.00<SOH>8909=O<SOH>

6.1.2.3 报价成交执行报告

Tag	域名	取值
	MsgType	8
10179	ReportIndex	2
1180	ApplID	041
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	105
17	ExecID	1100000000004124
37	OrderID	
150	ExecType	F
39	OrdStatus	1
31	LastPx	17.1000
32	LastQty	300.00
151	LeavesQty	900.00

14	CumQty	300.00
60	TransacTime	20130228-14:42:15:555
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	2
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
8909	BidPositionEffect	O

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=041<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=105<
SOH>17=11000000000004124<SOH>37=
<SOH>150=F<SOH>39=1<SOH>31=17.1000<SOH>32=300.00<SOH>151=900.00<SOH>
14=300.00<SOH>60=20130228-14:42:15:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>4
53=2<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=
5<SOH>452=5<SOH>8909=O<SOH>

6.1.3 意向申报

下面列举了协议交易业务意向申报及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

意向申报

Tag	域名	取值
	MsgType	6
1180	ApplID	050
23	IOIID	A0000001
28	IOITransType	N
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:15:555
48	SecurityID	00000001

22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	2
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
27	IOIQty	1200.00
44	Price	17.4800
58	Text	王小红 0755-2345678

STEP 消息如下：

1180=050<SOH>23=A0000001<SOH>28=N<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=2013022
8-14:42:15:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=2<SOH>448=000100<SOH>
>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA
<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>27=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>58= 王 小 红
0755-2345678<SOH>

6.1.3.2

意向申报响应

Tag	域名	取值
	MsgType	AJ
10179	ReportIndex	1
1180	ApplID	050
693	QuoteRespID	6B4569CDNB009C03
694	QuoteRespType	2
150	ExecType	0
23	IOIID	A0000001
28	IOITransType	N
54	Side	1
522	OwnerType	1

60	TransacTime	20130228-14:42:15:855
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	2
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
27	IOIQty	1200.00
44	Price	17.4800
58	Text	王小红 0755-2345678

STEP 消息如下：

10179=1<SOH>1180=050<SOH>693=6B4569CDNB009C03<SOH>694=2<SOH>150=0<SOH>23=A0000001<SOH>28=N<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:15:855<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=2<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>27=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>58= 王 小 红 0755-2345678<SOH>

6.1.4 成交申报处理

6.1.4.1 下面列举了协议交易业务成交申报及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

成交申报

Tag	域名	取值
	MsgType	AE
1180	ApplID	053
571	TradeReportID	A0000001
522	OwnerType	1

856	TradeReportType	0
487	TradeReportTransType	0
1123	TradeHandlingInstr	2
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
1116	NoRootPartyIDs	1
1117	RootPartyID	000100
1118	RootPartyIDSource	C
1119	RootPartyRole	1
552	NoSides	1
54	Side	1
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	17
31	LastPx	17.4800
32	LastQty	1200.00
664	ConfirmID	B0000001

STEP 消息如下：

1180=053<SOH>571=A0000001<SOH>522=1<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=2<
SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>1116=1<SOH>
>1117=000100<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>552=1<SOH>54=1<SOH>453=4<SOH>
>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>45

2=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=17<SOH>31=17.4800<SOH>32=1200.00<SOH>664=B0000001<SOH>

成交申报响应

Tag	域名	取值
6	MsgType	AR
10179	ReportIndex	1
1180	ApplID	053
1003	TradeID	6B4569CDNB009C03
571	TradeReportID	A0000001
522	OwnerType	1
856	TradeReportType	0
487	TradeReportTransType	0
1123	TradeHandlingInstr	2
8912	TrdAckStatus	0
939	TrdRptStatus	100
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
1116	NoRootPartyIDs	1
1117	RootPartyID	000100
1118	RootPartyIDSource	C
1119	RootPartyRole	1
552	NoSides	1
54	Side	1
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D

452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	17
17	ExecID	21000000000004123
31	LastPx	17.4800
32	LastQty	1200.00
664	ConfirmID	B0000001

STEP 消息如下：

10179=1<SOH>1180=053<SOH>1003=6B4569CDNB009C03<SOH>571=A0000001<SOH>
>522=1<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=2<SOH>8912=0<SOH>939=100<SOH>6
0=20130228-14:42:13:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>1116=1<SOH>1117=
000100<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>552=1<SOH>54=1<SOH>453=4<SOH>448=
000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<S
OH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452
=17<SOH>17=21000000000004123<SOH>31=17.4800<SOH>32=1200.00<SOH>664=B000
0001<SOH>

6.1.4.3

成交确认

Tag	域名	取值
	MsgType	AE
10179	ReportIndex	2
1180	ApplID	053
1003	TradeID	6B4569CDNB009C03
571	TradeReportID	A0000001
522	OwnerType	1
856	TradeReportType	0
487	TradeReportTransType	2
1123	TradeHandlingInstr	2
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
1116	NoRootPartyIDs	1

1117	RootPartyID	000100
1118	RootPartyIDSource	C
1119	RootPartyRole	1
552	NoSides	1
54	Side	1
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	17
17	ExecID	1100000000004124
31	LastPx	17.4800
32	LastQty	1200.00
664	ConfirmID	B0000001

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=053<SOH>1003=6B4569CDNB009C03<SOH>571=A0000001<SOH>
 >522=1<SOH>856=0<SOH>487=2<SOH>1123=2<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>
 >48=00000001<SOH>22=102<SOH>1116=1<SOH>1117=100<SOH>1118=C<SOH>1119=
 1<SOH>552=1<SOH>54=1<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<
 SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>4
 52=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=17<SOH>17=1100000000004124<S
 OH>31=17.4800<SOH>32=1200.00<SOH>664=B0000001<SOH>

6.1.5 注册处理

下面列举了转托管业务注册申报及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消

息尾：

注册

Tag	域名	取值
	MsgType	U001
1180	ApplID	200
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
11	ClOrdID	A0000001
8502	DesignationInstruction	3
8527	DesignationTransType	1
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000200
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	40

STEP 消息如下：

1180=200<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A0000001<SOH>8502=3<SOH>8527=1<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000200<SOH>447=C<SOH>452=40<SOH>

注册执行报告

Tag	域名	取值
	MsgType	U002
10179	ReportIndex	2

1180	ApplID	200
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
11	ClOrdID	A0000001
37	OrderID	6B4569CDNB009C03
17	ExecID	3100000000004123
150	ExecType	0
8502	DesignationInstruction	3
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000200
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	40

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=200<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A00
00001<SOH>17=3100000000004123<SOH>150=0<SOH>8502=3<SOH>453=4<SOH>448
=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<
SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000200<SOH>447=C<SOH>45
2=40<SOH>

6.1.6 网络投票处理消息

6.1.6.1

下面列举了网络投票业务投票申报及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

投票

Tag	域名	取值
-----	----	----

	MsgType	U004
1180	ApplID	210
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
11	ClOrdID	A0000001
48	SecurityID	00369501
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
8529	VotingProposal	1
8531	VotingPreference	1

STEP 消息如下：

1180=210<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A0000001<SOH>48
=00369501<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<S
OH>448=100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452
=4001<SOH>8529=1<SOH>8531=1<SOH>

6.1.6.2

投票执行报告

Tag	域名	取值
	MsgType	U004
10179	ReportIndex	2
1180	ApplID	200
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
11	ClOrdID	A0000001

37	OrderID	6B4569CDNB009C78
17	ExecID	3100000000004124
150	ExecType	0
48	SecurityID	00369501
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
8529	VotingProposal	1
8531	VotingPreference	1

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=200<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A00
00001<SOH>37=6B4569CDNB009C78<SOH>17=3100000000004124<SOH>150=0<SOH>
>48=00369501<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=
1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>
>452=4001<SOH>8529=1<SOH>8531=1<SOH>

6.1.6.3

投资者网络投票密码服务激活

Tag	域名	取值
	MsgType	U005
1180	ApplID	211
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
11	ClOrdID	A0000001
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100

447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
8539	ValidationCode	ABC

STEP 消息如下：

1180=211<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A0000001<SOH>453
=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<
SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>8539=ABC<SOH>

6.1.6.4 投资者网络投票密码服务激活执行报告

Tag	域名	取值
	MsgType	U005
10179	ReportIndex	2
1180	ApplID	211
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
11	ClOrdID	A0000001
37	OrderID	6B4569CDNB009C83
17	ExecID	3100000000004125
150	ExecType	0
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA

447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
8539	ValidationCode	ABC

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=211<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A00
00001<SOH>37=6B4569CDNB009C83<SOH>17=3100000000004125<SOH>150=0<SOH>
>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>44
7=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>8539=ABC<SOH>
>

6.2 行情

6.2.1 频道心跳

Tag	域名	取值
	MsgType	UA001
10201	ChannelNo	0010
95	RawDataLength	
96	RawData	

Tag	域名	取值
999	TemplateID	3001
10201	ChannelNo	0010
1350	ApplLastSeqNum	2937
10205	EndOfChannel	N

STEP 消息如下：

999=3001<SOH>10201=10<SOH>1350=2937<SOH>10205=N

6.2.2 重传消息

Tag	域名	取值
	MsgType	UA002
10201	ChannelNo	2001

95	RawDataLength	
96	RawData	

Tag	域名	取值
999	TemplateID	3002
10077	ResendType	1
10201	ChannelNo	2001
1182	ApplBegSeqNum	100
1183	ApplEndSeqNum	0

STEP 消息如下：

999=3002<SOH>10077=1<SOH>10201=2001<SOH>1182=100<SOH>1183=0

6.2.3 用户信息报告消息

Tag	域名	取值
	MsgType	UA003
10201	ChannelNo	5000
95	RawDataLength	
96	RawData	

Tag	域名	取值
999	TemplateID	3003
42	OrigTime	20130228-14:42:13:555
8934	VersionCode	02
8935	UserNum	10

STEP 消息如下：

999=3003<SOH>42=20130228-14:42:13:555<SOH>8934=2<SOH>8935=10

6.2.4 证券实时状态

Tag	域名	取值
	MsgType	f
10201	ChannelNo	0001
95	RawDataLength	

96	RawData	
----	---------	--

Tag	域名	取值
999	TemplateID	3003
42	OrigTime	20130228-14:42:13:555
10201	ChannelNo	0001
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
8901	SecurityPreName	.A..
10202	NoSwitch	1
10203	SecuritySwitchType	1
10204	SecuritySwitchStatus	Y

STEP 消息如下：

999=3003<SOH>42=20130228-14:42:13:555<SOH>10201=1<SOH>48=1<SOH>22=102<
SOH>8901=.A..<SOH>10202=1<SOH>10203=1<SOH>10204=Y

6.2.5 公告

Tag	域名	取值
	MsgType	B
10201	ChannelNo	0002
95	RawDataLength	
96	RawData	

Tag	域名	取值
999	TemplateID	4002
1472	NewsID	AA0001
148	Headline	测试公告
42	OrigTime	20130228-14:42:13:555
95	RawDataLength	(公告内容长度)
96	RawData	(公告内容)

6.2.6 集中竞价行情快照

集中竞价 Level II 行情快照消息，示例中买卖盘信息共有五档，卖三档，买两档，其中在买卖最优档上揭示前 10 笔委托的数量。

Tag	域名	取值
	MsgType	W
10201	ChannelNo	1001
95	RawDataLength	
96	RawData	

Tag	域名	取值
999	TemplateID	4001
42	OrigTime	20140126-10:30:05:335
10201	ChannelNo	1011
1500	MDStreamID	010
48	SecurityID	00002001
22	SecurityIDSource	102
8538	TradingPhaseCode	T0
140	PrevClosePx	17.4600
8503	NumTrades	478
387	TotalVolumeTrade	24689.00
8504	TotalValueTrade	405783.6700
268	NoMDEntries	15
269	MDEntryType	2
270	MDEntryPx	17.490000
269	MDEntryType	4
270	MDEntryPx	18.120000
269	MDEntryType	7
270	MDEntryPx	18.130000
269	MDEntryType	8
270	MDEntryPx	17.200000
269	MDEntryType	x1
270	MDEntryPx	0.030000
269	MDEntryType	x2

270	MDEntryPx	-0.010000
269	MDEntryType	x3
270	MDEntryPx	17.450000
271	MDEntrySize	369801.00
269	MDEntryType	x4
270	MDEntryPx	17.460000
271	MDEntrySize	14689.00
269	MDEntryType	x5
270	MDEntryPx	15.950000
269	MDEntryType	x6
270	MDEntryPx	16.120000
269	MDEntryType	1
270	MDEntryPx	18.460000
271	MDEntrySize	2340.00
1023	MDPriceLevel	3
346	NumberOfOrders	56
73	NoOrders	0
269	MDEntryType	1
270	MDEntryPx	18.450000
271	MDEntrySize	1340.00
1023	MDPriceLevel	2
346	NumberOfOrders	71
73	NoOrders	0
269	MDEntryType	1
270	MDEntryPx	18.420000
271	MDEntrySize	1350.00
1023	MDPriceLevel	1
346	NumberOfOrders	16
73	NoOrders	10
38	OrderQty	10.00
38	OrderQty	10.00
38	OrderQty	20.00
38	OrderQty	10.00
38	OrderQty	13.00

38	OrderQty	17.00
38	OrderQty	103.00
38	OrderQty	21.00
38	OrderQty	16.00
38	OrderQty	11.00
269	MDEntryType	0
270	MDEntryPx	18.400000
271	MDEntrySize	27500.00
1023	MDPriceLevel	1
346	NumberOfOrders	23
73	NoOrders	10
38	OrderQty	100.00
38	OrderQty	100.00
38	OrderQty	200.00
38	OrderQty	100.00
38	OrderQty	130.00
38	OrderQty	170.00
38	OrderQty	100.00
38	OrderQty	200.00
38	OrderQty	160.00
38	OrderQty	110.00
269	MDEntryType	0
270	MDEntryPx	18.390000
271	MDEntrySize	17500.00
1023	MDPriceLevel	2
346	NumberOfOrders	53
73	NoOrders	0

STEP 消息如下：

999=4001<SOH>42=20140126-10:30:05:335<SOH>10201=1011<SOH>1500=010<SOH>48=00002001
 <SOH>22=102<SOH>8538=T0<SOH>140=17.4600<SOH>8503=478<SOH>387=24689.00<SOH>8504
 =405783.6700<SOH>268=15<SOH>269=2<SOH>270=17.490000<SOH>269=4<SOH>270=18.120000<
 SOH>269=7<SOH>270=18.130000<SOH>269=8<SOH>270=17.200000<SOH>269=x1<SOH>270=0.03
 0000<SOH>269=x2<SOH>270=-0.010000<SOH>269=x3<SOH>270=17.450000<SOH>271=369801.00

<SOH>269=x4<SOH>270=17.460000<SOH>271=14689.00<SOH>269=x5<SOH>270=15.950000<SOH>269=x6<SOH>270=16.120000<SOH>269=1<SOH>270=18.460000<SOH>271=2340.00<SOH>1023=3<SOH>346=56<SOH>73=0<SOH>269=1<SOH>270=18.450000<SOH>271=1340.00<SOH>1023=2<SOH>346=71<SOH>73=0<SOH>269=1<SOH>270=18.420000<SOH>271=1350.00<SOH>1023=1<SOH>346=16<SOH>73=10<SOH>38=10.00<SOH>38=10.00<SOH>38=20.00<SOH>38=10.00<SOH>38=13.00<SOH>38=17.00<SOH>38=103.00<SOH>38=21.00<SOH>38=16.00<SOH>38=11.00<SOH>269=0<SOH>270=18.400000<SOH>271=27500.00<SOH>1023=1<SOH>346=23<SOH>73=10<SOH>38=100.00<SOH>38=100.00<SOH>38=200.00<SOH>38=100.00<SOH>38=130.00<SOH>38=170.00<SOH>38=100.00<SOH>38=200.00<SOH>38=160.00<SOH>38=110.00<SOH>269=0<SOH>270=18.390000<SOH>271=17500.00<SOH>1023=2<SOH>346=53<SOH>73=0

6.2.7 逐笔委托行情

Tag	域名	取值
	MsgType	UA201
10201	ChannelNo	2001
95	RawDataLength	
96	RawData	

Tag	域名	取值
999	TemplateID	4201
10201	ChannelNo	2001
1500	MDStreamID	011
1181	ApplSeqNum	100
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
44	Price	17.4800
38	OrderQty	1200.00
54	Side	1
40	OrdType	2
59	TimeInForce	0
1090	MaxPriceLevels	0
110	MinQty	0
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555

STEP 消息如下：

999=4201<SOH>10201=2001<SOH>1500=11<SOH>1181=100<SOH>48=1<SOH>22=102<SOH>44=1
7.48<SOH>38=1200<SOH>54=1<SOH>40=2<SOH>59=0<SOH>1090=0<SOH>110=0<SOH>60=2013
0228-14:42:13:555

6.2.8 逐笔成交行情

Tag	域名	取值
	MsgType	UA202
10201	ChannelNo	2001
95	RawDataLength	
96	RawData	

Tag	域名	取值
999	TemplateID	4202
10201	ChannelNo	2001
1500	MDStreamID	011
1181	ApplSeqNum	100
10116	BidApplSeqNum	10
10117	OfferApplSeqNum	20
48	SecurityID	00000001
22	SecurityIDSource	102
31	LastPx	17.4800
32	LastQty	1200.00
150	ExecType	F
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555

STEP 消息如下：

999=4202<SOH>10201=2001<SOH>1500=11<SOH>1181=100<SOH>10116=10<SOH>10117=20<SOH>
>48=1<SOH>22=102<SOH>31=17.48<SOH>32=1200<SOH>150=F<SOH>60=20130228-14:42:13:555

七、 BINARY 消息示例

下面的 BINARY 消息示例和上面的 STEP 消息示例一一对应。

7.1 交易

7.1.1 订单处理

下面列举了现货集中竞价业务新订单及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

申报新订单

域名	取值
MsgType	100101
ApplID	010
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
CIOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	17.4800
StopPx	17.4800
MinQty	0
MaxPriceLevels	0
TimeInForce	0
CashMargin	1

订单响应执行报告

域名	取值
MsgType	200102
ReportIndex	1

ApplID	010
ReportingPBUID	00100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:565
UserInfo	全空格
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	全空格
ExecID	1100000000004123
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	1200.00
CumQty	0.00
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	17.4800
AccountID	0100004698
BranchID	AA
StopPx	17.4800
MinQty	0
MaxPriceLevels	0
TimeInForce	0
CashMargin	1

订单成交执行报告

域名	取值
MsgType	200115
ReportIndex	2

ApplID	010
ReportingPBUID	00100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:15:555
UserInfo	全空格
OrderID	6B4569CDNB009C03
CIOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	17.1000
LastQty	300.00
LeavesQty	900.00
CumQty	300.00
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CashMargin	1

7.1.1.4

撤单请求

域名	取值
MsgType	190007
ApplID	010
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:15:555
UserInfo	全空格

ClOrdID	A0000002
OrigClOrdID	A0000001
Side	1
OrderID	全空格
OrderQty	1200.00

撤单失败响应

域名	取值
MsgType	290008
ReportIndex	3
ApplID	010
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:565
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000002
OrigClOrdID	A0000001
Side	1
OrdStatus	1
CxlRejReason	20018
RejectText	全空格
OrderID	全空格

撤单成功执行报告

域名	取值
MsgType	200102
ReportIndex	3
ApplID	010
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100

SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:23:565
UserInfo	全空格
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000002
OrigClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004125
ExecType	4
OrdStatus	4
OrdRejReason	0
LeavesQty	0.00
CumQty	300.00
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	17.4800
AccountID	0100004698
BranchID	AA
StopPx	17.4800
MinQty	0
MaxPriceLevels	0
TimeInForce	0
CashMargin	1

7.1.2 报价处理

7.1.2.1 下面列举了期权集中竞价业务报价及相关处理消息的示例, 示例中不包含消息头和消息尾:

报价

域名	取值
MsgType	104105

ApplID	041
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	105
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
QuoteMsgID	A0000001
AccountID	0100004698
QuoteReqID	全空格
QuoteType	1
BidPx	17.4800
OfferPx	0
BidSize	1200.00
OfferSize	0
BidPositionEffect	O
OfferPositionEffect	空格

7.1.2.2

报价状态回报

域名	取值
MsgType	200406
ReportIndex	1
ApplID	041
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	105
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:655
UserInfo	全空格
QuoteMsgID	A0000001

AccountID	0100004698
QuoteReqID	全空格
QuoteStatus	0
QuoteRejectReason	0
QuoteType	1
BidPx	17.4800
OfferPx	0
BidSize	1200.00
OfferSize	0
BidPositionEffect	O
OfferPositionEffect	空格

报价成交执行报告

7	域名	取值
	MsgType	200415
	ReportIndex	2
	ApplID	041
	ReportingPBUID	000100
	SubmittingPBUID	000100
	SecurityID	00000001
	SecurityIDSource	102
	OwnerType	105
	ClearingFirm	01
	TransacTime	20130228-14:42:15:555
	UserInfo	全空格
	OrderID	全空格
	ClOrdID	A0000001
	ExecID	1100000000004124
	ExecType	F
	OrdStatus	1
	LastPx	17.1000
	LastQty	300.00
	LeavesQty	900.00
	CumQty	300.00

Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	全空格
PositionEffect	O
CoveredOrUncovered	1

7.1.3 意向申报

下面列举了协议交易业务意向申报及相关处理消息的示例, 示例中不包含消息头和消息尾:

意向申报

7	域名	取值
	MsgType	100509
	ApplID	050
	SubmittingPBUID	000100
	SecurityID	00000001
	SecurityIDSource	102
	OwnerType	1
	ClearingFirm	01
	TransacTime	20130228-14:42:15:555
	UserInfo	全空格
	IOIID	A0000001
	AccountID	0100004698
	BranchID	AA
	IOITransType	N
	Side	1
	IOIRefID	全空格
	IOIQty	1200.00
	Price	17.4800
	ContactInfo	王小红 0755-2345678

7.1.3.2

意向申报响应

域名	取值
----	----

MsgType	2005010
ReportIndex	1
ApplID	050
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:15:855
UserInfo	全空格
QuoteRespID	6B4569CDNB009C03
QuoteRespType	2
ExecType	0
QuoteRejectReason	0
IOIID	A0000001
IOIRefID	全空格
IOITransType	N
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
IOIQty	1200.00
Price	17.4800
ContactInfo	王小红 0755-2345678

7.1.4 成交申报处理

7.1.4.1 下面列举了协议交易业务成交申报及相关处理消息的示例, 示例中不包含消息头和消息尾:

成交申报

域名	取值
MsgType	100503
ApplID	053

SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
TradeReportID	A0000001
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
TradeReportRefID	全空格
LastPx	17.4800
LastQty	1200.00
TrdType	0
TrdSubType	0
ConfirmID	B0000001
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	全空格
CounterpartyBranchID	全空格

7.1.4.2

成交申报响应

域名	取值
MsgType	200504
ReportIndex	1
ApplID	053
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102

OwnerType	2
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	A0000001
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
TradeReportRefID	全空格
TrdAckStatus	0
TrdRptStatus	100
TradeReportRejectReason	0
LastPx	17.4800
LastQty	1200.00
TrdType	0
TrdSubType	0
ConfirmID	B0000001
RptExecID	2100000000004123
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	全空格
CounterpartyBranchID	全空格

7.1.4.3

成交确认

域名	取值
MsgType	200503
ReportIndex	2
ApplID	053
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100

SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	A0000001
TradeReportType	0
TradeReportTransType	2
TradeHandlingInstr	2
LastPx	17.4800
LastQty	1200.00
TrdType	0
TrdSubType	0
ConfirmID	B0000001
RptExecID	1100000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	全空格
CounterpartyBranchID	全空格

7.1.5 注册处理

7.1.5.1 下面列举了转托管业务注册申报及相关处理消息的示例, 示例中不包含消息头和消息尾:

注册

域名	取值
MsgType	102099
ApplID	200
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	全空格

SecurityIDSource	全空格
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	全空格
DesignationInstruction	3
DesignationTransType	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderQty	0
TransfereePBUID	00200

注册执行报告

7.1.5.2

域名	取值
MsgType	U002
ReportIndex	2
ApplID	200
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	全空格
SecurityIDSource	全空格
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	全空格
ExecID	3100000000004123
ExecType	0
OrdRejReason	0
DesignationInstruction	3

DesignationTransType	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderQty	0
TransfereePBUID	00200

7.1.6 网络投票处理消息

下面列举了网络投票业务投票申报及相关处理消息的示例, 示例中不包含消息头和消息尾:

投票

域名	取值
MsgType	102197
ApplID	210
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00369501
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	全空格
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
VotingProposal	1
VotingSubProposal	0
VotingPreference	1
OrderQty	0

投票执行报告

域名	取值
MsgType	202197
ReportIndex	2
ApplID	200
ReportingPBUID	000100

SubmittingPBUID	000100
SecurityID	00369501
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	全空格
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
OrderID	6B4569CDNB009C78
CIOrdID	A0000001
ExecID	3100000000004124
ExecType	0
OrdRejReason	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
VotingProposal	1
VotingSubProposal	0
VotingPreference	1
OrderQty	0

7.1.6.3

投资者网络投票密码服务激活

域名	取值
MsgType	102196
ApplID	211
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	369999
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	全空格
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
CIOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
ValidationCode	ABC

投资者网络投票密码服务激活执行报告

域名	取值
MsgType	U005
ReportIndex	2
ApplID	211
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	369999
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	全空格
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
OrderID	A0000001
ClOrdID	6B4569CDNB009C83
ExecID	3100000000004125
ExecType	0
OrdRejReason	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
ValidationCode	ABC

7.2 行情

7.2.1 频道心跳

域名	取值
MsgType	390095
ChannelNo	0010
ApplLastSeqNum	2937
EndOfChannel	N

7.2.2 重传消息

域名	取值
MsgType	390094

ResendType	1
ChannelNo	2001
ApplBegSeqNum	100
ApplEndSeqNum	0
NewsID	全空格
ResendStatus	0
RejectText	全空格

7.2.3 用户信息报告消息

域名	取值
MsgType	390093
OrigTime	20130228-14:42:13:555
VersionCode	02
UserNum	10

7.2.4 证券实时状态

域名	取值
MsgType	390013
OrigTime	20130228-14:42:13:555
ChannelNo	0001
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
SecurityPreName	.A..
NoSwitch	1
SecuritySwitchType	1
SecuritySwitchStatus	Y

7.2.5 公告

域名	取值
MsgType	390012
NewsID	AA0001
Headline	测试公告
OrigTime	20130228-14:42:13:555
RawDataLength	(公告内容长度)

RawData	(公告内容)
---------	--------

7.2.6 集中竞价行情快照

集中竞价 Level II 行情快照消息，示例中共买卖盘信息共用五档，卖三档，买两档，其中在买卖最优档上揭示前 10 笔委托的数量。

域名	取值
MsgType	300111
OrigTime	20140126-10:30:05:335
ChannelNo	1011
MDStreamID	010
SecurityID	00002001
SecurityIDSource	102
TradingPhaseCode	T0
PrevClosePx	17.4600
NumTrades	478
TotalVolumeTrade	24689.00
TotalValueTrade	405783.6700
NoMDEntries	15
MDEntryType	2
MDEntryPx	17.490000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	4
MDEntryPx	18.120000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	7
MDEntryPx	18.130000
MDEntrySize	0

MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	8
MDEntryPx	17.200000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x1
MDEntryPx	0.030000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x2
MDEntryPx	-0.010000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x3
MDEntryPx	17.450000
MDEntrySize	369801.00
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x4
MDEntryPx	17.460000
MDEntrySize	14689.00
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x5

MDEntryPx	15.950000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x6
MDEntryPx	16.120000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	1
MDEntryPx	18.460000
MDEntrySize	2340.00
MDPriceLevel	3
NumberOfOrders	56
NoOrders	0
MDEntryType	1
MDEntryPx	18.450000
MDEntrySize	1340.00
MDPriceLevel	2
NumberOfOrders	71
NoOrders	0
MDEntryType	1
MDEntryPx	18.420000
MDEntrySize	1350.00
MDPriceLevel	1
NumberOfOrders	16
NoOrders	10
OrderQty	10.00
OrderQty	10.00
OrderQty	20.00
OrderQty	10.00
OrderQty	13.00

OrderQty	17.00
OrderQty	103.00
OrderQty	21.00
OrderQty	16.00
OrderQty	11.00
MDEntryType	0
MDEntryPx	18.400000
MDEntrySize	27500.00
MDPriceLevel	1
NumberOfOrders	23
NoOrders	10
OrderQty	100.00
OrderQty	100.00
OrderQty	200.00
OrderQty	100.00
OrderQty	130.00
OrderQty	170.00
OrderQty	100.00
OrderQty	200.00
OrderQty	160.00
OrderQty	110.00
MDEntryType	0
MDEntryPx	18.390000
MDEntrySize	17500.00
MDPriceLevel	2
NumberOfOrders	53
NoOrders	0

7.2.7 逐笔委托行情

域名	取值
MsgType	300192
ChannelNo	2001
ApplSeqNum	100

MDStreamID	011
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
Price	17.4800
OrderQty	1200.00
Side	1
TransacTime	20130228-14:42:13:555
OrdType	2
TimeInForce	0
MaxPriceLevels	0
MinQty	0

7.2.8 逐笔成交行情

域名	取值
MsgType	300191
ChannelNo	2001
ApplSeqNum	100
BidApplSeqNum	10
OfferApplSeqNum	20
MDStreamID	011
SecurityID	00000001
SecurityIDSource	102
LastPx	17.4800
LastQty	1200.00
ExecType	F
TransacTime	20130228-14:42:13:555

八、 会话

8.1 SenderCompID 和 TargetCompID 的填写规则

接入用户必须正确设置 SenderCompID 与 TargetCompID 才能与网关建立会话。其中, TargetCompID 需填写为网关 ID, SenderCompID 由用户自己指定 (长度不得超过 20 个字符)。

8.2 DefaultCstmApplVerID 字段的填写规则

登录消息中 DefaultCstmApplVerID 的市场内部唯一的协议版本号设置为接口规范文档中公布的版本号，比如 1.00 α。

8.3 SesstionStatus 字段的填写规则

SessionStatus 只是用来指示注销时会话的状态，并不会对注销过程产生影响。建议在建立会话后，主动发送 logout 时 SessionStatus 设置为 0，响应 logout 消息时 SessionStatus 设置为 4。

8.4 STEP 会话

8.4.1 登录消息

登录消息中 UserName、Password 暂未使用。

8.4.2 会话模式

交易网关和行情网关实现的是 LFIXT 兼容模式，允许实现了 LFIXT 精简模式、LFIXT 兼容模式以及标准 FIX 模式的会话对端接入。

8.4.3 何时发送 Logout，何时直接断开连接

一般而言，在关闭连接前推荐的做法是回送一条 Logout 消息以利于对端诊断连接断开的原因。但此处可有一些例外：

1. 若收到的登录报文中，SenderCompID、TargetCompID 不合法，网关会立即终止会话，不发送任何 Logout 消息。原因是此种登录尝试很可能属于未被授权的系统入侵行为，因此不应当回送 Logout 消息以泄露 FIX 版本、合法 SenderCompID、TargetCompID 等信息。
2. 若交易网关在收到某个平台的登录请求时，该平台已存在一个合法的相同 TargetCompID 的会话，则交易网关将直接断开连接。
3. 会话建立时收到的第一条消息（Logon）为 Garbled Message。

由于任何时刻总是存在网络中断的可能，因此 LFIXT 协议的任何参与方都应该对于没有收到对方的 Logout 消息但底层 TCP 连接却已关闭的情况做好准备。在断开连接前回送 Logout 消息是推荐行为，但非必须。

8.4.4 何时发送 SessionReject，何时发送 Logout

一般而言，应尽可能通过 SessionReject 告知对端发生了会话错误，而不是通过 Logout 来终止会话。可以发送 Logout 场景主要包括：

1. 会话建立后，在当前会话的延续期间，在同一个 TCP 上再次收到了 Logon 消息，注销原因=Already connected。

2. 会话建立后, 收到了 Garbled Message, 注销原因=Garbled message。
3. 会话建立后, 消息序号不等于预期值, 注销原因=Incorrect MsgSeqNum。
4. MsgSeqNum(Tag#34)不存在, 注销原因=Required tag missing。
5. MsgSeqNum(Tag#34)数据类型非法。注销原因=Incorrect data format for value。

8.5 网络版行情网关会话管理

网络版行情网关为接入用户行情系统提供两个服务端口, 实时数据端口(默认为 9129), 重传服务端口(默认为 9130)。每一个端口只能建立一条 TCP/IP 连接, 每一个连接只能对应一个会话。行情网关根据连接的服务端口来区分会话为实时会话还是重传会话, 因此, TargetCompID 统一设置为网关 ID, SenderCompID 由用户指定(如实时服务 SenderCompID 设置为 **Realtime1**, 重传服务 SenderCompID 设置为 **Resend1**)。

端口	会话类型	SenderCompID	TargetCompID	备注
9029	实时会话	Realtime1	mdgw1	会话类型由端口决定, 与 CompID 无关。
9030	重传会话	Resend1	mdgw1	

九、 相关文档

《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》

《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》

《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》

《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》

《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》

《深圳证券交易所数据接口规范》(第四版交易系统)