



深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

综合协议交易平台接口电子化

券商技术系统变更指南

(Ver1.03)



深圳证券交易所 电脑工程部

二〇一一年八月三十一日

关于本文档

文档名称	综合协议交易平台接口电子化券商技术系统变更指南		
说明	为券商等相关单位进行综合协议交易平台接口电子化技术准备工作的指南		
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2011-4-6	Ver0.90	创建	原始版本
2011-4-29	Ver1.00	修订	根据会员、基金公司等市场参与者的反馈意见修订
2011-6-10	Ver1.01	修订	1、完善综合委托库SJSZHWT.DBF中联系人、联系方式的注意事项。 2、完善综合协议行情网关的部署方案。 3、每个交易日内同一对交易单元之间协商成交（成交申报与成交申报配对）的约定号不得重复，成交申报与定价申报配对时不受此限制。
2011-7-18	Ver1.02	修订	1、在当日已采取过流量控制措施的情况下，综合行情库SJSZHHQ.dbf 中同一条意向行情的记录状态可能从“0”变更为“1”； 2、券商技术系统在揭示综合行情库 SJSZHHQ.dbf 时，应从第一条记录开始顺序读取，显示所有记录状态为“1”的有效意向行情记录。
2011-8-31	Ver1.03	修订	1、启用综合行情库SJSZHHQ.dbf的HQBYYW（备用文本）字段的左边五位字符，定义为HQQXLX（期限类型）、HQQGHQX（购回期限）。

本次修订部分以橙色标注。

目 录

一、 说明.....	1
二、 综合协议交易平台接口电子化方案	1
2.1 系统架构图	1
2.2 方案说明	2
2.2.1 设计思路	2
2.2.2 方案概述	2
2.2.3 综合协议交易终端	3
2.2.4 电子数据接口成交回报	4
三、 综合协议交易平台的业务说明	4
3.1 本次技术系统改造对证券协议交易业务的变动点	4
3.2 证券协议交易意向申报的业务流程	5
3.3 证券协议交易成交申报的业务流程	5
3.4 证券协议交易定价申报的业务流程	6
3.5 证券协议交易的其他说明	7
四、 证券协议交易的指令申报.....	8
4.1 意向申报、意向申报撤单	8
4.2 定价申报、定价申报撤单	9
4.3 成交申报、成交申报撤单	9
五、 证券协议交易的数据回报.....	10
5.1 回报库 SJSHB.DBF	10
5.2 综合回报库 SJSZHHB.DBF	10
六、 证券协议交易的意向行情发布	11
七、 实施协议交易平台接口电子化的券商系统注意事项.....	12
7.1 网关部署	12
7.2 关于投资者委托服务渠道	13
7.3 成交申报的约定号范围	13
7.4 关于券商柜台系统	13
八、 未实施协议交易平台接口电子化的券商系统注意事项.....	16
九、 其它说明	16

综合协议交易平台接口电子化

券商技术系统变更指南

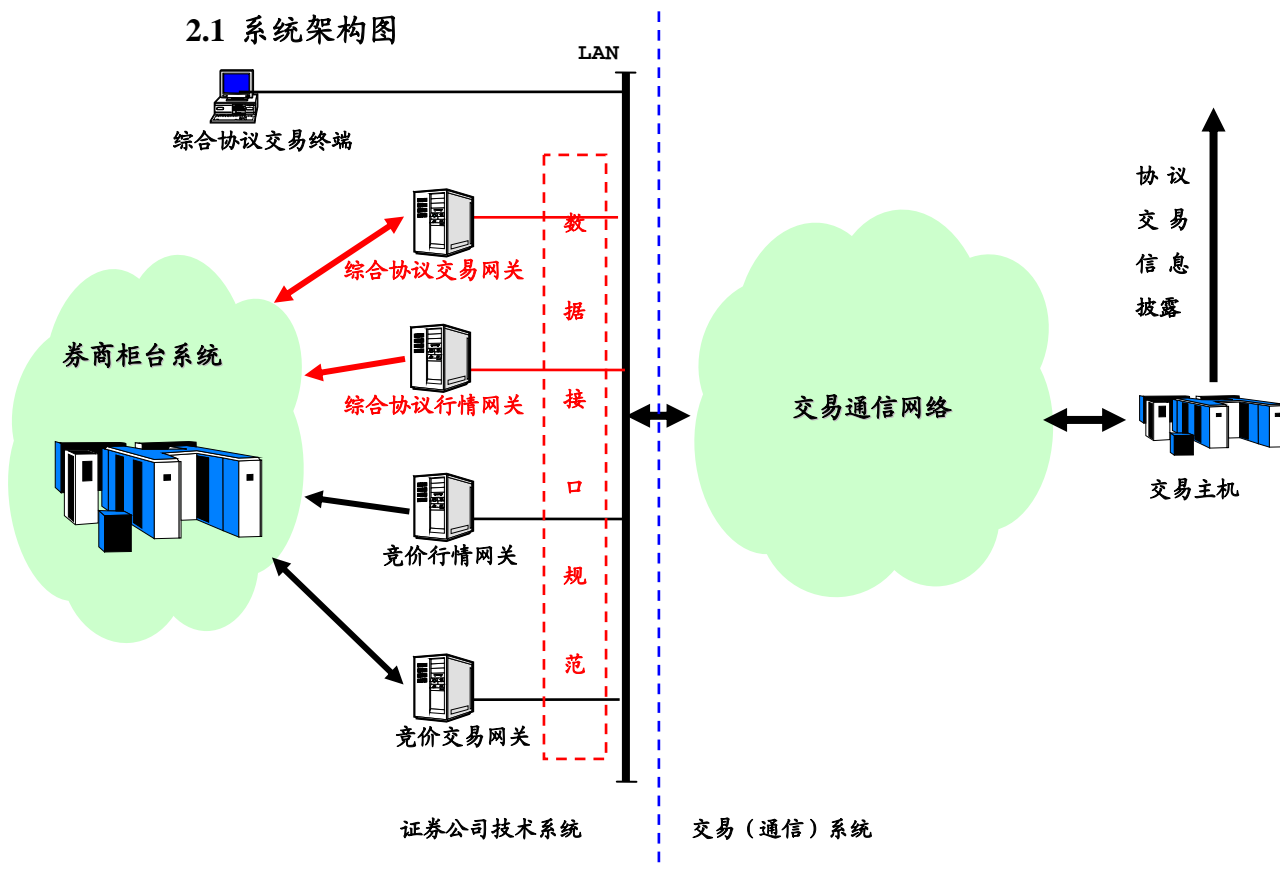
一、说明

为了方便会员、基金公司等市场参与者（以下简称“交易参与人”）在深圳证券交易所（以下简称“我所”）综合协议交易平台（以下简称“协议交易平台”）系统上更加便捷、正确地开展大宗交易和协议交易业务，我所拟将现有的协议交易平台接口电子化，即在保留现有综合协议交易终端的基础上，增加电子数据接口委托申报途径（以下简称“电子数据接口”）。

本文档旨在阐述我所协议交易平台接口电子化技术方案，供协议交易平台交易参与人及其 IT 供应商进行相关技术系统改造时使用。

二、综合协议交易平台接口电子化方案

2.1 系统架构图



上图中，竞价交易网关又称“报盘小站”、“双向小站”，主要用于主板、中小板、创业板等板块股票、基金、债券等证券竞价交易的委托申报与成交回报。竞价行情网关又称“行情小站”、“高单小站”，该类型的网关主要用于主板、中小板、创业板等板块股票、基金、债券等证券竞价交易的指数和行情接收。综合协议交易终端指各交易参与人以网页方式接入我所综合协议交易平台的协议交易终端。红色标注的综合协议交易网关、综合协议行情网关则需要交易参与人实施协议交易平台接口电子化时重新单独部署。

2.2 方案说明

2.2.1 设计思路

为了深圳证券市场现有技术系统的平稳切换，并兼顾协议交易平台的未来发展，我所确定了如下设计思路：

（1）交易参与人的技术系统按照现有的接口约定完成清算交收业务，不做任何变更；

（2）市场整体的开发、运维风险小。

（3）部分交易参与人（比如上市商业银行、基金管理公司等）可选择暂不实施接口电子化改造，其协议交易采用现有模式不受影响。

（4）为未来的业务创新（例如融资融券转融通、证券公司质押式滚动隔夜回购等）在数据接口方面预留足够的拓展空间。

2.2.2 方案概述

我所拟在保留现有综合协议交易终端的基础上，通过对集中竞价交易系统的“交易数据接口规范”中的 DBF 接口库集合进行扩充，使之能够同时支持协议交易平台和集中竞价交易系统的业务和相关数据交换，拟定的方案具体包括：

- 保持现有集中竞价交易系统的“交易数据接口规范”中的委托库 SJSWT.DBF 的结构和数据内容不变，新增综合委托库 SJSZHWT.DBF，以此接口库发送协议交易申报指令至交易所技术系统；

- 保持现有集中竞价交易系统的“交易数据接口规范”中的成交回报库 SJS HB.DBF 的结构和数据内容不变，即协议交易的成交回报数据仍然包含在

SJSHB.DBF 中, 交易参与人只能使用回报库 SJSHB.DBF 进行协议交易业务成交后的清算、交收处理; 新增综合回报库 SJSZHHB.DBF, 此接口库专用于接收协议交易业务成交回报记录, 交易参与人必须使用综合回报库 SJSZHHB.DBF 用于交易实时过程中的股份控制、资金检查等交易前端风险控制处理, 但不能使用综合回报库 SJSZHHB.DBF 进行协议交易业务成交后的清算、交收处理;

- 新增综合行情库 SJSZHHQ.DBF 用于向整个市场广播协议交易意向报价行情;

- 实施协议交易平台接口电子化改造的交易参与人, 必须重新申请部署新的综合协议交易网关和综合协议行情网关;

- 不参与协议交易平台接口电子化改造的交易参与人, 仍然使用我所开发的综合协议交易终端开展相关业务;

- 我所协议交易平台电子数据接口将不支持证券组合大宗交易的功能; 同时综合协议交易终端亦将取消对证券组合意向申报及其撤单功能的支持, 但保留对证券组合成交申报及其撤单功能的支持;

- 对于将来需要通过综合委托库 SJSZHWT.DBF 和综合回报库 SJSZHHB.DBF 进行数据交换的创新业务, 我所拟不再通过成交回报库 SJSHB.DBF 发送相关创新业务的成交回报确认数据, 故从长远来说, 不参与本次协议交易平台接口电子化改造的交易参与人仍应择机根据本方案进行相关技术系统的业务改造。

2.2.3 综合协议交易终端

对于使用我所开发的综合协议交易终端的用户, 仅能对其通过综合协议交易终端申报的委托进行相应的查询、撤单、数据下载等业务操作, 无法对其通过电子数据接口综合委托库 SJSZHWT.dbf 申报的委托指令进行任何操作处理。电子数据接口可对综合协议交易终端申报的委托进行撤单, 可接收综合协议交易终端申报委托的回报数据。

收市后, 用户可在综合协议交易终端下载其通过该终端申报的委托和相应的成交回报确认数据, 其中下载的回报库格式与电子数据接口回报库 SJSHB.DBF 相同, 下载的委托库提供新旧两种文件格式, 旧文件格式保持不变, 新文件格式

与电子数据接口综合委托库 SJSZHWT.DBF 相同。另外，综合协议交易终端用户也可下载整个市场的协议意向报价行情库，意向报价行情库提供新旧两种文件格式，旧文件格式保持不变，新文件格式与电子数据接口综合行情库 SJSZHHQ.DBF 相同。

2.2.4 电子数据接口成交回报

无论是通过综合协议交易终端申报的协议交易委托，还是通过电子数据接口综合委托库 SJSZHWT.DBF 申报的协议交易委托，其对应的协议交易成交回报确认数据均通过成交回报库 SJSHB.DBF 和综合回报库 SJSZHHB.DBF 发送给相应的交易参与人。

交易参与人只能使用综合回报库 SJSZHHB.DBF 用于交易实时过程中的股份控制、资金检查等交易前端风险控制处理，不能使用综合回报库 SJSZHHB.DBF 进行协议交易业务成交后的清算、交收处理；同时，交易参与人只能使用回报库 SJSHB.DBF 进行协议交易业务成交后的清算、交收处理，不能使用回报库 SJSHB.DBF 用于交易实时过程中的股份控制、资金检查等交易前端风险控制处理。

对于将来需要通过综合回报库 SJSZHHB.DBF 进行数据交换的其他创新业务，我所拟不再通过回报库 SJSHB.DBF 发送相应创新业务的成交回报确认数据，届时券商系统只能依据综合回报库 SJSZHHB.DBF 完成相应业务的清算、交收。

三、综合协议交易平台的业务说明

综合协议交易平台目前只支持证券协议交易业务，未来可能支持融资融券转融通、证券公司质押式滚动隔夜回购等创新业务。

3.1 本次技术系统改造对证券协议交易业务的变动点

1、电子数据接口综合委托库 SJSZHWT.DBF 将不支持证券组合大宗交易的功能；综合协议交易终端将取消对证券组合意向申报及其撤单功能的支持，但保留对证券组合成交申报及其撤单功能的支持。

2、申报证券协议交易业务的撤单指令时，除了填写拟撤销的原始委托所对应的流水号外，还应当填写本撤单指令所对应的流水号，且同一交易单元下所有申

报的流水号不得重复。撤单指令与原始委托必须在同一交易单元申报。

3、为了防止协议交易意向行情的通信带宽出现严重拥塞，当协议交易意向行情信息过量时我所将采取流量控制措施。

4、与集中竞价交易系统的处理原则一致，每个交易日下午收市时，综合协议交易平台不再将委托队列中的剩余委托自动撤单。

5、从综合协议交易终端下载的委托库与意向行情库提供新旧两种格式。

3.2 证券协议交易意向申报的业务流程

1、投资者 A 委托券商 1 或自助提交意向申报，应发布联系方式以便洽谈。

2、券商 1 的交易员或技术系统对意向申报进行股份、资金前端监控等合规性检查，合法申报才往协议交易平台提交。

3、协议交易平台收到券商 1 的意向申报，进行合法性检查；对于合法申报，协议交易平台将联系方式等信息通过意向行情向整个市场广播。

4、其他投资者 B 在协议交易信息披露网站或券商 2 的营业部发现该意向申报的证券代码与买卖方向适合自己，可根据联系方式与投资者 A 洽谈其他交易要素，比如数量、价格等。

5、投资者 A、投资者 B 就所有要素达成一致后，投资者 A 应委托券商 1 或自助撤销意向申报，避免影响其股份或资金的正常使用；投资者 A、投资者 B 再分别提交成交申报，详见证券协议交易成交申报的业务流程。

6、券商 1 收到协议交易平台的回报数据，进行相应业务处理。

若投资者 A 是卖出，券商 1 收到协议交易平台的意向申报撤单回报时，应相应计加投资者 A 的当前可用股份数量；若投资者 A 是买入，券商 1 收到协议交易平台的意向申报撤单回报时，应相应计加投资者 A 的当前可用资金数量。

3.3 证券协议交易成交申报的业务流程

特别提示：提交成交申报之前不一定需要提交意向申报；投资者 A、投资者 B 在达成成交意愿时，应协助各自的券商交易员相互联系，以便券商交易员之间可相互知道对方的交易单元代码，并商定成交约定号（每个交易日内同一对交易单元之间协商成交的约定号不得重复，成交申报与定价申报配对时不受此限制）。

- 1、投资者 A 委托券商 1 提交成交申报。
- 2、券商 1 的交易员或技术系统对成交申报进行股份、资金前端监控等合规性检查，合法申报才往协议交易平台提交，券商 1 的交易员还应在投资者 A 的协助下指定交易对手方（用“券商 2 交易单元 + 成交约定号”界定）。
- 3、协议交易平台收到券商 1 的成交申报，进行合法性检查；对于合法申报，协议交易平台将之插入委托队列，等待对手方的成交申报指令。
- 4、投资者 B 委托券商 2 提交成交申报。
- 5、券商 2 的交易员或技术系统对成交申报进行股份、资金前端监控等合规性检查，合法申报才往协议交易平台提交，券商 2 的交易员还应在投资者 B 的协助下指定交易对手方（用“券商 1 交易单元 + 成交约定号”界定）。
- 6、协议交易平台收到券商 2 的成交申报，进行合法性检查；对于合法申报，协议交易平台将之插入委托队列，并为投资者 A、投资者 B 的成交申报匹配。当双方申报的要素正确匹配时（比如证券代码相同、价格一致、数量一致、买卖方向相反），配对成功，交易宣告成立；匹配失败时将双方的成交申报自动撤单。
- 7、券商 1、券商 2 收到协议交易平台的回报数据，进行相应业务处理。

若投资者 A 是卖出，券商 1 收到协议交易平台的成交申报撤单回报时，应相应计加投资者 A 的当前可用股份数量；若投资者 A 是买入，券商 1 收到协议交易平台的成交申报撤单回报时，应相应计加投资者 A 的当前可用资金数量。

若投资者 B 是卖出，券商 2 收到协议交易平台的成交申报撤单回报时，应相应计加投资者 B 的当前可用股份数量；若投资者 B 是买入，券商 2 收到协议交易平台的成交申报撤单回报时，应相应计加投资者 B 的当前可用资金数量。

3.4 证券协议交易定价申报的业务流程

- 1、投资者 A 委托券商 1 或自助提交定价申报。
- 2、券商 1 的交易员或技术系统对定价申报进行股份、资金前端监控等合规性检查，合法申报才往协议交易平台提交。
- 3、协议交易平台收到券商 1 的定价申报，进行合法性检查；对于合法申报，协议交易平台为之自动产生约定号(≥ 1000000)，并将自动约定号等信息通过意向行情向整个市场广播。

4、其他投资者 B 在协议交易信息披露网站或券商 2 的营业部发现该定价申报适合自己。

5、投资者 B 委托券商 2 或自助下达成交申报委托（必须填写对方交易单元、约定号、证券代码，委托价格与对应定价申报的价格一致，委托数量可以小于或等于定价申报的数量但不应低于协议交易最低限额），申请与定价申报配对成交。

6、券商 2 的交易员或技术系统对成交申报委托进行股份、资金前端监控等合规性检查，合法委托才往协议交易平台申报。

7、协议交易平台收到券商 2 的与定价申报配对之成交申报委托，进行合法性检查。对于合法委托，协议交易平台为投资者 A、投资者 B 确认成交，实际成交数量为双方委托数量的取小值；若投资者 B 申报的委托数量有剩余，或投资者 A 申报的委托数量未成交部分低于协议交易最低限额，则协议交易平台将剩余量自动撤单，并取消意向行情信息中相应的定价申报信息；若投资者 A 申报的委托数量未成交部分不低于协议交易最低限额，则定价申报的剩余部分仍然有效，并以原自动约定号向整个市场继续广播。

8、券商 1、券商 2 收到协议交易平台的回报数据，进行相应业务处理。

若投资者 A 是卖出，券商 1 收到协议交易平台的定价申报撤单回报时，应相应计加投资者 A 的当前可用股份数量；若投资者 A 是买入，券商 1 收到协议交易平台的定价申报撤单回报时，应相应计加投资者 A 的当前可用资金数量。

若投资者 B 是卖出，券商 2 收到协议交易平台的成交申报撤单回报时，应相应计加投资者 B 的当前可用股份数量；若投资者 B 是买入，券商 2 收到协议交易平台的成交申报撤单回报时，应相应计加投资者 B 的当前可用资金数量。

3.5 证券协议交易的其他说明

1、交易通信系统接受委托申报的时间为每周一至周五的上午 9:15 至 11:30，下午 13:00 至 15:30。遇法定节假日和其他特殊情况，暂停协议交易。

2、委托当日有效。意向申报允许撤销；成交申报在协议交易平台确认成交前允许撤销；定价申报的未成交部分允许撤销。

3、协议交易平台对所有证券的意向申报指令即时检查其合法性，并将处理结果通过综合回报库 SJSZHBB.DBF 即时回报给券商技术系统。对专项资产管理

计划（证券代码为 119***）、公司债券（证券代码为 112***）等证券的定价申报、成交申报指令即时确认成交，并将处理结果通过综合回报库 SJSZHHB.DBF 即时回报给券商技术系统；对其他证券的定价申报、成交申报指令在集中竞价交易系统闭市后（15:00 至 15:30）确认成交，并将处理结果通过综合回报库 SJSZHHB.DBF 回报给券商技术系统。协议交易平台下午收市（15:30）后，将所有证券的成交确认数据通过回报库 SJSHB.DBF 回报给券商技术系统。

4、证券协议交易的委托数量、委托价格以及允许的证券品种等要素必须满足《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则》的规定。

四、 证券协议交易的指令申报

4.1 意向申报、意向申报撤单

意向申报、意向申报撤单指令通过综合委托库 SJSZHWT.DBF 或综合协议交易终端申报。意向申报当日有效，当日可以撤单。

通过综合委托库 SJSZHWT.DBF 的申报内容如下表：

	WTHTXH	WTZQDM	WTZQZH	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTZLLB	WTDFDY
意向申报买委托	合同序号	证券代码	股东代码	委托数量	委托价格	固定为空格	HB	
意向申报卖委托	合同序号	证券代码	股东代码	委托数量	委托价格	固定为空格	HS	
意向申报撤单委托	合同序号	证券代码	股东代码		=0	固定为空格	HC	
	WTYDH	WTQXLX	WTGHQX	WTLXR	WTLXFS	WTWTSJ	WTCLBZ	WTYHTXH
意向申报买委托		空格	0	联系人	联系方式	委托时间	z	
意向申报卖委托		空格	0	联系人	联系方式	委托时间	z	
意向申报撤单委托		空格	0			委托时间	z	原合同序号

举例 1：000001 交易单元的投资者 A 意向以 20.000 元/股的价格卖出 500000 股 309999 证券，与其他投资者协商达成交易后，在发送成交申报前应当将意向申报撤销。则 000001 交易单元的券商系统应当报送如下指令：

	WTHTXH	WTZQDM	WTZQZH	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTZLLB	WTDFDY
第一笔申报	合同序号一	309999	股东代码 A	500000	00020.000	固定为空格	HS	
第二笔申报	合同序号二	309999	股东代码 A		=0	固定为空格	HC	
	WTYDH	WTQXLX	WTGHQX	WTLXR	WTLXFS	WTWTSJ	WTCLBZ	WTYHTXH
第一笔申报		空格	0	联系人	联系方式	委托时间	z	
第二笔申报		空格	0			委托时间	z	合同序号一

4.2 定价申报、定价申报撤单

定价申报、定价申报撤单指令通过综合委托库 SJSZHW.T.DBF 或综合协议交易终端申报。定价申报当日有效，未成交部分当日可以撤单。

通过综合委托库 SJSZHW.T.DBF 的申报内容如下表：

	WTHTXH	WTZQDM	WTZQZH	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTZLLB	WTDFDY
定价申报买委托	合同序号	证券代码	股东代码	委托数量	委托价格	固定为空格	OB	
定价申报卖委托	合同序号	证券代码	股东代码	委托数量	委托价格	固定为空格	OS	
定价申报撤单委托	合同序号	证券代码	股东代码		=0	固定为空格	OC	
	WTYDH	WTQXLX	WTGHQX	WTLXR	WTLXFS	WTWTSJ	WTCLBZ	WTYHTXH
定价申报买委托		空格	0	联系人	联系方式	委托时间	z	
定价申报卖委托		空格	0	联系人	联系方式	委托时间	z	
定价申报撤单委托		空格	0			委托时间	z	原合同序号

4.3 成交申报、成交申报撤单

成交申报、成交申报撤单指令通过综合委托库 SJSZHW.T.DBF 或综合协议交易终端申报。成交申报当日有效，当日未被确认成交前可以撤单。

通过综合委托库 SJSZHW.T.DBF 的申报内容如下表：

	WTHTXH	WTZQDM	WTZQZH	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTZLLB	WTDFDY
成交申报买委托	合同序号	证券代码	股东代码	委托数量	委托价格	固定为空格	1B	对方单元
成交申报卖委托	合同序号	证券代码	股东代码	委托数量	委托价格	固定为空格	1S	对方单元
成交申报撤单委托	合同序号	证券代码	股东代码		=0	固定为空格	1C	
	WTYDH	WTQXLX	WTGHQX	WTLXR	WTLXFS	WTWTSJ	WTCLBZ	WTYHTXH
成交申报买委托	约定号	空格	0			委托时间	z	
成交申报卖委托	约定号	空格	0			委托时间	z	
成交申报撤单委托		空格	0			委托时间	z	原合同序号

说明：约定号≤99999999。欲与定价申报配对成交的，券商系统应输入一笔成交申报，买卖方向与定价申报相反，约定号填写为综合行情库 SJSZHHQ.DBF 中的约定号（>999999）；已私下协商达成交易，与对手的成交申报委托配对的，买卖双方向之间商定的约定号必须≤999999。

举例 2:

000002 交易单元的投资者 B 与投资者 C 以 104.42 元/张的价格协商成交 112001 债券 27000 张，约定号为 1，则 000002 交易单元的券商系统应当报送如下

指令:

	WTHTXH	WTZQDM	WTZQZH	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTZLLB	WTDIFY
第 1 笔申报	合同序号 1	112001	股票代码 B	27000	00104.420	固定为空格	1B	000002
第 2 笔申报	合同序号 2	112001	股票代码 C	27000	00104.420	固定为空格	1S	000002
	WTYDH	WTQXLX	WTGHQX	WTLXR	WTLXFS	WTWTSJ	WTCLBZ	WTYHTXH
第 1 笔申报	00000001	空格	0			委托时间	z	
第 2 笔申报	00000001	空格	0			委托时间	z	

举例 3:

000003 交易单元的投资者 D 提交定价申报: 卖出 112002 债券 50000 张, 价格 97.89 元/张, 交易主机为之自动生成的约定号为 99999999。000002 交易单元的投资者 E 要求与该定价申报成交 30000 张, 则 000002 交易单元的券商系统应当报送如下指令:

	WTHTXH	WTZQDM	WTZQZH	WTWTSL	WTWTJG	WTYWLB	WTZLLB	WTDIFY
第 3 笔申报	合同序号 3	112002	股票代码 E	30000	00097.890	固定为空格	1B	000003
	WTYDH	WTQXLX	WTGHQX	WTLXR	WTLXFS	WTWTSJ	WTCLBZ	WTYHTXH
第 3 笔申报	99999999	空格	0			委托时间	z	

五、 证券协议交易的数据回报

5.1 回报库 SJSHB.DBF

回报库 SJSHB.DBF 的文件格式、数据内容等接口约定未做任何变更。协议交易平台下午收市后, 通过回报库 SJSHB.DBF 只回报证券协议交易的成交记录 (界于-2.000 标志与-3.000 标志之间), 交易参与人应当用来完成清算、交收。

5.2 综合回报库 SJSZHBB.DBF

证券协议交易的成交或撤单记录一旦产生, 通过综合回报库 SJSZHBB.DBF 即时予以回报, 交易参与人应当用来完成股份、资金前端监控等其他业务处理。

通过综合回报库 SJSZHBB.DBF 发送证券协议交易的成交回报记录、所有撤单回报记录。相关的注意事项如下:

(1) 业务类别为“1B”或“1S”时, 指经本所交易主机确认的成交申报与对方成交申报、或成交申报与对方定价申报之间成功配对的成交数据回报, 其 HBCJSL>0, HBCJJG>0。特别强调, 定价申报成功配对的成交回报记录业务类别为“1B”或“1S”, 与综合委托库 SJSZHWT.DBF 中申报的业务类别“OB”、“OS”

不同，券商技术系统在查询定价申报的委托状态时应加以注意。

(2) HBCJJG 为-3.000 时，表示协议交易平台已闭市；自动撤单含义表中的撤单原因简要说明最多可能包含五个汉字。券商技术系统应能正确适应该类情形。

六、 证券协议交易的意向行情发布

我所将通过交易数据接口规范中新增的综合行情库 SJSZHHQ.DBF 以单向卫星组播和地面 TCP 链接的方式发布协议交易意向报价行情信息；采用增量机制发布意向报价行情快照，并定期发布意向报价全量行情。目前，我所暂定每 15 秒发布一次增量行情，每 5 分钟发布一次全量行情，未来意向报价行情的发布频率将随着证券市场与信息技术的发展而不断调整。

为了保障整个交易系统的安全运行，除要求交易参与人对所有的协议交易委托（含意向报价委托）进行股份和资金前端风险控制外，当协议交易意向行情信息过量时我所还将采取下列流量控制措施：

- ◇ 协议交易行情通信系统降低意向行情的发布频率
- ◇ 限制协议交易意向报价行情的最大网络带宽
- ◇ 只发布最近申报的一定容量的意向行情记录

券商系统只能通过多媒体广播接收程序接收 SJSZHHQ.DBF（不需要另外申请通信线路，与行情库 SJSHQ.DBF 共用网络带宽）。意向行情记录的内容如下：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	意向申报信息	定价申报信息
1	HQJLH	记录号	N	9,0	交易主机生成	交易主机生成
2	HQZQDM	证券代码	C	6	证券代码	证券代码
3	HQSBSL	申报数量	N	9,0	申报数量	申报数量
4	HQSBJG	申报价格	N	9,3	申报价格	申报价格
5	HQYWLB	业务类别	C	2	固定为空格	固定为空格
6	HQZLLB	指令类别	C	2	HB: 买意向申报 HS: 卖意向申报	OB: 买定价申报 OS: 卖定价申报
7	HQHTXH	申报合同序号	C	22	申报合同序号	申报合同序号
8	HQLXR	联系人	C	12	联系人姓名，建议机构名	联系人姓名，建议机构名
9	HQLXFS	联系方式	C	30	联系方式	联系方式
10	HQJSJG	结算机构代码	C	2	固定为 01	固定为 01
11	HQSBSJ	申报时间	C	8	申报时间	申报时间
12	HQYDH	约定号	N	8	0	约定号 ⁽¹⁾

序号	字段名	字段描述	类型	长度	意向申报信息	定价申报信息
13	HQSYL	参考收益率	N	10,6	债券现货到期年收益率	债券现货到期年收益率
14	HQSBSL2	申报数量 2	N	9,0	预留字段	预留字段
15	HQSBJG2	申报价格 2	N	9,3	预留字段	预留字段
16	HQSYL2	参考收益率 2	N	10,6	预留字段	预留字段
17	HQJLZT	记录状态	C	1	通信系统填写 ⁽²⁾	通信系统填写 ⁽²⁾
18	HQBYBZ	备用标志	C	2	券商系统自用	券商系统自用
19	HQQXLX	期限类型	C	1	预留字段	预留字段
20	HQGHQX	购回期限	N	4	预留字段	预留字段
21	HQBYWB	备用文本	C	75	保留字段	保留字段

注:

(1) 对于定价申报, 约定号由交易主机自动生成, 取值范围[1000000, 99999999]。

(2) “记录状态”字段的值由通信系统填写, 为“0”时, 指该意向行情信息无效(对应的委托已被撤单或已成交), 券商技术系统不应再揭示相应的意向行情信息记录; “记录状态”字段的值为“1”时, 指该意向行情信息有效。在当日未采取流量控制措施的情况下, 同一条意向行情的“记录状态”只可能从“1”变更为“0”或者保持不变; 否则, 同一条意向行情的记录状态可能从“0”变更为“1”。每交易日收市后, 各证券公司应自行备份综合行情库 SJSZHHQ.DBF; 下一交易日在开始接收行情时, 多媒体广播接收程序将自动清空前一交易日的综合行情库 SJSZHHQ.DBF。

七、实施协议交易平台接口电子化的券商系统注意事项

协议交易平台的交易参与人应按照《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则》等相关业务规定和本指南, 调整其柜台系统支持大宗交易和协议交易业务, 主要功能包括: 揭示协议交易的意向报价行情, 检查协议委托的合法性并申报协议委托, 与集中竞价交易系统联动实现资金和股份前端控制。

7.1 网关部署

◇ 综合协议交易网关

交易参与人必须重新部署独立于竞价交易网关的综合协议交易网关。

用户视自身容量与备份需要,可以申请部署多个综合协议交易网关,网关号按综合协议交易平台重新单独分配,需要使用 EKEY (重新颁发),线路支持卫星与地面。

◇ 综合协议行情网关

交易参与人必须重新部署独立于竞价行情网关的综合协议行情网关。

用户可单独部署多个综合协议行情网关,单向卫星组播方式的综合协议行情网关通过交换机与卫星接收设备相连,地面线路 TCP 方式的综合协议行情网关通过地面网与交易通信网络相连。单向卫星组播方式的综合协议行情网关直接安装应用程序即可接收意向行情;地面线路 TCP 方式的综合协议行情网关号(用户名)可与 TCP 方式的竞价行情网关号共用,也可按综合协议交易平台重新单独分配;支持用户密码和 IP 地址绑定两种认证方式。

7.2 关于投资者委托服务渠道

建议调整柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等投资者委托渠道中的相应前端系统,以支持意向申报、意向申报撤单、成交申报、成交申报撤单、定价申报、定价申报撤单的指令录入。

7.3 成交申报的约定号范围

约定号取值范围[0~99999999]。[0, 999999]区段留给券商协商成交;[1000000, 99999999]区段留给交易主机自动分配。

成交申报的约定号处于[0, 999999]区段时,表示本成交申报的对手方也是成交申报;成交申报的约定号处于[1000000, 99999999]区段时,表示本成交申报的对手方为定价申报。

成交申报的约定号处于[1000000, 99999999]区段时,若没有发现对手方定价申报或对手方定价申报的状态不为“等待成交”,则将本成交申报自动撤单。券商协商达成的成交申报,应保证约定号在[0, 999999]区段,否则委托将被自动撤单。

7.4 关于券商柜台系统

(1)接收到投资者各种协议交易委托指令时的处理

所有协议交易申报的数量、价格必须满足协议交易最低限额,符合《深圳证

券交易所交易规则》、《深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则》。

对所有买委托指令进行资金前端监控。

接收投资者卖出意向申报委托时，应冻结投资者证券账户下相应股份。在接收到投资者意向申报撤单指令的成功撤单回报时，根据原委托的买卖方向进行相反操作。在达成协商成交而提交成交申报前，应将之前下达的原意向申报撤销。

接收投资者卖出成交申报、卖出定价申报时，必须冻结投资者证券账户下相应股份数量。在接收到投资者成交申报撤单、定价申报撤单指令时，要根据原委托的买卖方向进行相反操作（卖出委托的撤单指令应解冻相应股份数量）。

(2)向综合委托库 SJSZHW.T.DBF 申报协议交易委托

接受投资者意向申报、意向申报撤单、成交申报、成交申报撤单、定价申报、定价申报撤单指令后，按照数据接口规范所约定的内容向综合委托库 SJSZHW.T.DBF 写入交易委托，合同序号 WHTX 的第 15、16 位（从左往右数）应填入营业部识别码。

包括撤单指令在内每一次申报的委托合同序号不能重复（综合委托库 SJSZHW.T.DBF 申报的委托合同序号与综合协议交易终端申报的委托合同序号也不能重复），否则后送到协议交易平台的重单委托将被视为非法而直接丢弃。

对于撤单指令，必须将拟撤销的原始委托的合同序号正确填写在 WYHTX（字段 18：原合同序号），要求撤单指令与原始委托必须在同一交易单元申报。

(3)接收并揭示综合行情库 SJSZHHQ.DBF

交易参与人技术系统应能接收我所以单向卫星组播和地面 TCP 链接的方式发布的包含协议交易意向报价行情信息的综合行情库 SJSZHHQ.DBF，并即时揭示意向行情信息（过滤掉记录状态为“0”的无效意向行情记录）。券商技术系统在揭示意向行情时，应从第一条记录开始顺序读取 SJSZHHQ.DBF 库，只显示所有“记录状态”为“1”的有效意向行情信息记录。

(4)建议在定价申报的意向行情展示区增加“配对成交”功能键

对定价申报的意向行情，建议增加“配对成交”功能键，即要求与被选中的定价申报成交；此时，建议券商系统自动填写对方交易单元、约定号、证券代码，委托价格与对应定价申报的价格一致，委托数量可以小于或等于定价申报的数量但不应低于协议交易最低限额。

(5) 日结处理

协议交易委托数据可通过两种途径申报至我所协议交易技术系统：①通过我所开发的综合协议交易终端申报委托；②通过电子数据接口综合委托库 SJSZHWT.DBF 申报委托。如果交易参与人在一个交易日内通过上述两种途径申报了协议交易业务指令，则进行日结处理时，可能应将途径①申报的委托数据下载与综合委托库 SJSZHWT.DBF 合并归档后再进行相关业务处理。

(6) 意向行情信息流量控制的风险应对措施

对于协议交易意向行情信息过量时我所采取的流量控制措施可能导致意向行情发布频率降低或者部分意向行情无法发布的风险，各交易参与人应采取各种必要措施，及时明确告知投资者。

(7) 在综合委托库 SJSZHWT.DBF 中申报联系人、联系方式的注意事项

在综合委托库 SJSZHWT.DBF 中申报联系人、联系方式时，中文编码遵循 GBK 规范，西文采用 ASCII 码。应当先将 WTLXR（字段 16：联系人）、WTLXFS（字段 17：联系方式）清空为全空格字符串，再将投资者或业务经办人员手工录入的联系人、联系方式设置在 WTLXR（字段 16：联系人）、WTLXFS（字段 17：联系方式），不带任何编程语言的字符串结束符。应当控制投资者或业务经办人员手工录入的联系人不得超过 12 位字符、联系方式不得超过 30 位字符，否则必须将超出部分截断，注意截断后不要留下半个中文。

(8) 其他说明

协议交易的清算、交收按照现有模式不变，以回报库 SJSHB.DBF 中的回报确认数据为准；协议交易的股份和资金前端监控等其他业务处理则应以综合委托库 SJSZHWT.DBF、综合回报库 SJSZHHB.DBF 的数据记录为准。

系统切换时应当将证券协议交易的历史委托、历史意向行情一次性地分别转换为综合委托库 SJSZHWT.DBF、综合行情库 SJSZHHQ.DBF 格式后存档。

下午收市时协议交易平台不再将委托队列中的剩余委托自动撤单。从我所开发的综合协议交易终端下载委托库与意向报价行情库时应选择新文件格式。

其他保持不变。

八、 未实施协议交易平台接口电子化的券商系统注意事项

综合协议交易终端的下列功能与操作界面有所变动，交易参与人的技术系统与业务流程可能需要适应性调整。

- ◇ 综合协议交易终端取消证券组合意向申报及其撤单的录入界面
- ◇ 下午收市时协议交易平台不再将委托队列中的剩余委托自动撤单
- ◇ 综合协议交易终端撤单时必须填写撤单申报的流水号

撤单时，综合协议交易终端将自动填写准备撤销的原始委托所对应的流水号，但必须由操作员人工填写本撤单指令对应的流水号，且在同一交易单元下不得重复。撤单指令与原始委托必须在同一交易单元申报。

- ◇ 意向行情信息流量控制时的风险应对措施

对于协议交易意向行情信息过量时我所采取的流量控制措施可能导致意向行情发布频率降低或者部分意向行情无法发布的风险，各交易参与人应采取各种必要措施，及时明确告知投资者。

- ◇ 下载的数据库应选择旧文件格式

下载的委托库与意向报价行情库应选择旧文件格式，即保持不变。

九、 其它说明

1、 综合协议交易平台的交易参与人，可暂不做技术系统变动。但从长远来说，应择机根据《深圳证券交易所数据接口规范》（Ver4.60）进行技术系统的业务改造，以便未来可较快适应综合协议交易平台的创新业务。

2、 非上市公司股份报价转让系统的技术方案与数据接口在综合协议交易平台接口电子化时不做任何变更。

3、 参考文档

《深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则》

《深圳证券交易所数据接口规范》（Ver4.60）

4、 深交所技术咨询电话：0755-25918186、25918206 ssegcb@szse.cn

深圳证券通信公司技术咨询电话：0755-83183333-362