

上海证券交易所技术文档



新一代交易系统
市场参与者
接口规格说明书
(1.08 版)



上海证券交易所

二〇〇九年一月

《市场参与者接口规格说明书》1.08 版发布说明

根据德邦证券、东方证券、光大证券、国泰君安、海通证券、南京证券、平安证券、申银万国、兴业证券、远东证券、银河证券、中投证券、中银国际（按照拼音排序）参加实验室测试和现场测试后反馈意见，上交所修订了本文档，于 2009 年 1 月向市场参与者发布版本 1.08。

修改描述如下：

1. 卖出可转债转换代码时卖出价格必须填 100。
2. 卖出可转债回售代码时卖出价格必须填公告的回售价格。
3. 买入权证行权代码时买入价格必须填行权价格。
4. 输入券源划转代码时订单类型从必须为“LPT”修改为必须为“LPT”或者“ORD”。
5. 担保品及标的证券清单接口的余额字段从 C15 调整为 N15。
6. 对融资融券有关的错误代码进行了细化，修改 236,237,276,10262 的描述，增加 10100, 10708,11068,11080,11082,11218,13440,13448 的场景。

《市场参与者接口规格说明书》1.07 版发布说明

为了配合市场参与者接入新一代交易系统有关技术系统就绪工作，上交所向市场参与者于 2008 年 12 月发布 1.07 版本。

一、新交易系统对接口概括起来有如下主要调整，详细参见有关章节：

1. 对于行情接口 show2003 文件：

- a) 买断式国债回购代码 203*** 的 S5 从无业务含义调整为其基础产品昨日收盘价*S11*10。
- b) 权证行权代码 582*** 的 S15 从无业务含义调整为行权申报总量/1000。

2. 对于申报接口 ordwth 表：

- a) 对于未即时生效的非交易类订单支持撤单。
- b) 为便于市场参与人在其柜台系统发生灾难性故障后的后续处理，不再要求待撤销申报所对应的申报表记录和申报确认表记录在数据库中存在。市场参与人在 rec_num、date、time、reff、status、owflag 字段提供本笔撤单申报自身的内容，在 acc 字段、stock 字段、bs 字段、price 字段、qty 字段提供待撤订单的原内容，在 ordrec 字段提供待撤订单的原 rec_num 内容，可完成撤单。
- c) B 股结算会员代码字段，可以直接填写中登公司公布的结算会员代码，即如果头两位为 00，无需变换为空格。
- d) 申报表不再严格要求 recnum 从 1 开始，只要连续递增即可。如果申报表损坏，市场参与人启用备份数据库，不需要插入空记录，只要在新的申报表中直接插入后续订单即可申报。由于交易系统后台对同一个 PBU 同一个证券产品集 SET 内相同 rec_num 的订单不会重复处理，所以切换时，后续订单的编号每切换 1 次必须超过已经向交易所发出的 rec_num 号，市场参与者可以通过累加一个其业务上不可能发生的值比如 1000 万，来避免重单。

3. 对于申报确认接口 ordwth2 表：

- a) 申报确认记录不按照 rec_num 顺序严格递增的方式写入。
- b) teordernum 字段只在同一个证券代码内唯一。
- c) 如果申报确认表损坏，市场参与人启用备份数据库，可以通过重新设置申报表中 status 字段的值为 'R' 来选择性地恢复申报确认数据。交易系统后台保证同一个 PBU 同一产品集 SET 内相同 rec_num 的订单不会被重复处理。

4. 对于成交回报接口 cjhb 表和过户数据 GHXXXXX 文件：

- a) 成交记录不按照成交编号顺序严格递增的方式写入。

- b) **gdxm** 股东姓名字段不再填写股东姓名，对于 **cjhb** 表填写该产品所属产品集 **SET** 的编号。在新交易系统上线点，**A** 股产品集 **SET** 的取值为 '1'、'2'、'3'、'4'、'5'、'6'、'991'。**B** 股产品集 **SET** 的取值为 '20'。在一个交易日内，**SET** 的有关配置不会发生变化。未来如有产品集的扩充，另行通知。对于 **GHXXXXX** 文件填写空格。**bcye** 本次余额字段不再填写本次余额，对于 **cjhb** 表填写该成交在对应产品集内的序列号。且按照同一 **SET** 内序列号“字典序”严格递增的方式写入成交记录，即会在左边补 0，例如 '10' 存储为 '0000000010'。为提高访问速度，市场参与者可以为 **gdxm** 和 **bcye** 设立组合索引，便于快速取出特定 **SET** 内最后写入的记录。对于 **GHXXXXX** 文件填写 0。
- c) 对应席位质押式国债回购代码 **201*****、席位质押式企业债回购代码 **202***** 以及账户质押式国债回购代码 **204***** 时，成交金额字段为 $100 \times \text{成交数量} \times \text{cjsl} \times 10$ 。
- d) 对应买断式国债回购代码 **203***** 时，成交金额字段为基础产品昨日收盘价 \times 成交数量 $\times \text{cjsl} \times 10$ 。
5. 盘后数据压缩发送方式采用每个文件单独压缩的方式，变更部分为 **zxwXXXXX.dbf** 和 **zzhXXXXX.dbf** 分别压缩为 **zxwXXXXX.zip** 和 **zzhXXXXX.zip**。**kghXXXXX.txt** 和 **khXXXXX.txt** 分别压缩为 **kghXXXXX.zip** 和 **khXXXXX.zip**。
6. 证券帐户资料接口 **zzhXXXXX.dbf** 中股东姓名字段被置为空格。
7. 权证信息接口 **qzxxMMDD.txt**，该文件换行方式为 **Unix** 方式，即通过 **0x0A** 表示换行。

二、新交易系统提供给市场参与者使用的报盘程序 **EzOes** 和报表下载程序 **RptGet**，须使用其 **PBU** 编号和其缺省的交易员 **000001** 来登录。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

服务电话：021-58651399

通信地址：上海市浦东南路 528 号上海证券交易所技术中心

网站地址：<http://www.sse.com.cn/> → 新交易系统专区 技术资料

目录

1 数据格式约定.....	7
2 实时文件和数据库接口规范.....	8
2.1 行情接口 show2003.dbf.....	8
2.2 申报接口 ordwth.....	13
2.3 申报确认接口 ordwth2.....	20
2.4 成交回报接口 cjhb.....	22
3 实时 STEP 消息接口.....	27
3.1 会话层消息.....	29
3.2 应用层消息.....	34
4 盘后数据接口规范.....	65
4.1 过户数据接口 ghXXXXX.dbf.....	65
4.2 证券帐户资料接口 zzhXXXXX.dbf.....	69
4.3 席位联通接口 zxwXXXXX.dbf.....	70
4.4 证券权益接口 zqyXXXXX.dbf.....	70
5 广播文件接口规范.....	72
5.1 上市公司公告文件.....	72
5.2 债券信息公告文件 biYYMMDD.txt.....	72
5.3 国债利息接口 gzlX.MDD.....	73
5.4 债券标准券折算率变更接口 zsIMMDD.txt.....	74
5.5 债券标准券折算率变更公告文件 zslwMMDD.txt.....	74
5.6 债券标准券折算比率接口 xzslIMMDD.txt.....	75
5.7 ETF 公告文件.....	75
5.8 权证信息接口 qzxxMMDD.txt.....	75
5.9 交易公开信息公告文件 jygkxxMMDD.txt.....	76
5.10 产品非交易基础信息接口 fjyMMDD.txt.....	77
5.11 担保品及标的证券清单接口 dbpMMDD.txt.....	79
6 开放式基金数据接口规范.....	81
6.1 开放式基金净值数据接口 kxxMMDD.txt.....	83
6.2 开放式基金分红数据接口 khIXXXXX.txt.....	84
6.3 开放式基金帐户对帐数据接口 kyeXXXXX.txt.....	86
6.4 开放式基金交易确认接口 kghXXXXX.txt.....	87

6.5 取值附表.....	93
7 附录：营业部代码换码算法示例.....	114
8 附录：申报确认接口 remark 字段取值说明.....	116

1 数据格式约定

该文档中描述文件分为两种类型，dbf 格式与 txt 格式。dbf 格式遵循 DBF 文件有关定义，采用特殊的文件头结构与记录行结构。

dbf 与 txt 格式均遵循以下约定：

- 对于字符型字段，不足部分左对齐，右补空格；以 CX 格式表示，其中 X 代表长度。
- 对于整数数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以 NX 格式表示，其中 X 代表数字型字符串总长度。
- 对于浮点数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以 NX (Y) 格式表示，其中 X 代表数字型字符串总长度，Y 代表小数位数。X 包括一位小数点。带浮点的数字型字段包括小数位，如：123.00000 显示为 123.00000；

txt 格式遵循以下约定：

- 竖线('|')为字段间分隔符。
- 竖线('|')不应用在每条记录的开头和结尾。
- 各字段均为一个遵循格式定义的字符串。每个字段均为定长字段。
- 每行以二进制 0x0A 结束
- 最后一行也以 0x0A 结束

开放式基金的 txt 文件格式另有约定。

2 实时文件和数据库接口规范

本部分描述了市场参与者柜台系统同上交所交易系统之间的实时接口。

2.1 行情接口 show2003.dbf

Show2003.dbf	行情接口
<p>描述:</p> <p>该文件存储上交所向全市场发布的实时行情信息。内容包括整体行情、指数行情与单一证券的行情。该文件按照 S1 字段递增排序。</p> <p>(1) 第 1 条记录为特殊记录，称之为整体行情。S1 为“000000”；S2 为当前时间，格式为“HHMMSS”左对齐，其最后为两个空格；S3 为最新 A 股指数；S4 为最新 B 股指数；S6 为当前日期；S11 为闭市标志，交易期间该字段为 0，闭市后该字段为“1111111111”，表示市场闭市，所有行情结束；S13 为最新上证指数；S15 为上海行情结束标志，“0”表示行情未结束，“1”表示行情结束；S17 为上海行情集合竞价结束标志，“0”表示集合竞价未结束，“1”表示集合竞价结束。S15 与 S17 的取值仅供深交所用来计算跨市场行情所用，会员柜台系统和行情系统请勿使用。该记录被标记为“删除”。</p> <p>(2) 对于指数代码（例如 000001），S1 为指数代码；S2 为指数名称；S3 为前收盘指数；S4 为今开盘指数；S5 为参与计算相应指数的成交金额，B 股指数中成交金额 S5 字段单位为人民币元；S6 为最高指数；S7 为最低指数；S8 为最新指数；S11 为参与计算相应指数的交易数量，S11 的单位和参与计算的证券类型相关，证券类型是股票的指数交易数量单位是 100 股，基金指数的交易数量单位是 100 份，债券指数的交易数量单位是手。S13 为“-.-”，且右对齐。指数类记录被标记为“删除”。当指数点数过万的时候，（注意，包括第 1 条记录 000000 中的 S3、S4、S13 和指数代码对应的 S3、S4、S6、S7、S8），采用降低 1 位精度的方式，即在 N8(3)的字段内，按照 N8(2)的方式来存储，示例为 12345.67。</p> <p>(3) 对于证券交易行情，有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 对于暂停上市的股票（也称为 PT 类股票），show2003 文件中不包含该股票的记录。 对于处于发行期内，且未设定开始上市买卖交易日期的产品，show2003 文件中不包含该产品的记录。已设定上市买卖交易日期，但日期还未到的产品，该产品出现在 show2003 文件中，且标注为“删除”。 对于最后交易日之后的产品，show2003 文件中不包含该产品的记录。 	

Show2003.dbf	行情接口
<ul style="list-style-type: none"> • 停牌证券被标记为“删除”。 • 对于 S3 前收盘价格、S4 今开盘价格、S5 今成交金额、S6 最高价、S7 最低价、S8 最新价、S9 当前买入价、S10 当前卖出价、S16 申买价二、S18 申买价三、S22 申卖价二、S24 申卖价三、S26 申买价四、S28 申买价五、S30 申卖价四、S32 申卖价五，它们的单位除 B 股为美元外，其他均为人民币元。对于 S5，如果累计总量超过 999999999999，显示为 999999999999。 • 对于 S15 申买量一、S17 申买量二、S19 申买量三、S21 申卖量一、S23 申卖量二、S25 申卖量三、S27 申买量四、S29 申买量五、S31 申卖量四、S33 申卖量五，它们的单位对股票为股，基金、权证为份，债券与回购为手。对于 S15、S17、S19、S21、S23、S25、S27、S29、S31、S33，如果累计总量超过 99999999999，统一显示为 99999999999。 • S11 成交数量的单位对股票为股，基金为份，债券与回购为手，权证为 100 份。如果累计总量超过 99999999999，显示为 99999999999。 • S13 为 “-.-”，且右对齐。 • 对于 S3 前收盘价格，在开市之前即行发布。 • 在开盘集合竞价之后的短暂休市和中午休市期间同样揭示各档买卖价格数量等全部信息。 • 当 S1 为债券（国债、企债、可转债）时，由于债券交易的数量以手为单位，S5 为该债券每笔成交的价格*数量*10 的总和。 • 当 S1 为席位质押式国债回购代码 201***、席位质押式企业债回购代码 202***以及账户质押式国债回购代码 204***时，S5 为 100*S11*10。 • 当 S1 为买断式国债回购代码 203***时，S5 为 S11*100*10。新交易系统切换后，S5 为其基础产品昨日收盘价*S11*10。 • 在集合竞价时段（从 9:15 至 9:25 期间）内，S9 当前买入价和 S10 当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时 S15 申买量一和 S21 申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。S17 申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。S23 申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量。 <p>(4) 对于当日的其他交易类对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 深发行沪配售卖出，该业务已停止。 	

Show2003.dbf	行情接口
<ul style="list-style-type: none"> • 国债分销，同普通交易。 <p>(5) 对于当日的账户注册类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 回购注销/回购登记，回购登记业务已经停止，代码 799997 摘牌；当 S1 为回购注销代码 799996 时，S3 为 1.000，S2 为“回购注销”。 • 网络密码激活/网络密码注销，当 S1 为密码服务代码 799988 或者 939988 时，S3 为 1.000，S2 为“密码服务”。 • 指定撤销/指定登记，当 S1 为指定撤销代码 799998 时，S3 为 1.000，S2 为“撤销指定”。当 S1 为指定登记代码 799999 时，S3 为 1.000，S2 为“登记指定”。 <p>(6) 对于当日的登记行权类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 发行登记， <ul style="list-style-type: none"> ○ 当 S1 为发行代码 700***、760***；730***、780***；731***、781***；737***、787***；733***、783***；ETF 代码组第 4 个代码时，S3 为发行价格。该代码在发行和中签时使用。 ○ 增加对应的配号代码：741***、791***；747***、797***；744***、794***，S3 为发行价格。并置位为“删除”。（对于比例配售发行业务不产生配号代码。） ○ 增加对应的扣款/还款代码：740***、790***，S2 为“申购款”，S3 为发行价格；743***、793***，S2 为“发债款”，S3 为发行价格；ETF 代码组第 5 个代码，S2 为“认购款”，S3 为发行价格；并置位为“删除”。 ○ 恒定设置一个置位为“删除”的记录，其 S1 为 799990，S2 为“市值股数”，S3 为 1.000。 • 配股/配转债， <ul style="list-style-type: none"> ○ 当 S1 为配股代码 700***或者 760***等等时，S3 与 S4 为配股价格。 ○ 当 S1 为配转债代码 704***或者 764***时，S3 与 S4 为配债价格。 • 股票要约收购登记/股票要约收购撤销，当 S1 为股票要约收购代码 706***时，S3 为公布要约收购价格。 • 网上投票，S1 为投票代码 738***、788***或者 938***。 • 可转债转股，当 S1 为可转债转股代码 181***、190***或 191***时，S3 为 100.000 	

Show2003.dbf	行情接口
<p>。</p> <ul style="list-style-type: none"> 可转债回售，当 S1 为可转债的回售代码 1009**时，S3 为公布的回售价格。 权证行权，当 S1 为权证行权代码 582***时，S3 为行权价格。新交易系统切换后，增加披露 S15 为行权申报总量/1000。 开放式基金路由， <ul style="list-style-type: none"> 当 S1 为货币市场开放式基金申购赎回代码 519***时，S3 为 T-2 日每百万份基金收益；S8 存放 T-1 日每百万份基金收益（注：若基金百万份收益为负，将变为 0 以便处理）。 当 S1 为非货币市场开放式基金申购赎回代码 519***时，S3 为 T-2 日每百份的基金净值；S8 存放 T-1 日每百份的基金净值。 当 S1 为货币市场开放式基金认购代码 521***时，S3 为 1.000。 当 S1 为货币市场开放式基金份额转托管代码 522***时，S3 为 0.000。 。 当 S1 为货币市场开放式基金分红设置代码 523***时，S3 为 0.000。 当 S1 为货币市场开放式基金转换代码 524***时，S3 为 0.000。 <p>(7) 对于当日的转换类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 账户式质押回购入库/出库，当 S1 为账户质押式回购入库/出库代码 09****/104****/1059**时，S3 为 1.000。 <ul style="list-style-type: none"> 恒定设定一个置位为“删除”的记录，其 S1 为 888880，S2 为“新标准券”，S3 为 1.000。 ETF 申购/赎回， <ul style="list-style-type: none"> 当 S1 为 ETF 申购赎回代码时（例如 510051），S3 为 T-1 日该 ETF 的 IOPV，S8 为该 ETF 的 IOPV。 当 S1 为 ETF 申购赎回资金代码时（例如 510052）。该记录被标记为删除。 <p>(8) 融资融券业务启用之后，对于当日的融资融券非交易过户类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 余券划转，S1 为 799981，S2 为“余券划转”； 	

Show2003.dbf	行情接口
<ul style="list-style-type: none"> • 还券划转，S1 为 799982，S2 为 “还券划转”； • 担保品划转，S1 为 799983，S2 为 “担保划转”； • 券源划转，S1 为 799984，S2 为 “券源划转”。 	

序号	字段名称	描述	类型
1	S1	证券代码	C6
2	S2	证券名称	C8
3	S3	前收盘价格	N8(3)
4	S4	今开盘价格	N8(3)
5	S5	今成交金额	N12
6	S6	最高价格	N8(3)
7	S7	最低价格	N8(3)
8	S8	最新价格	N8(3)
9	S9	当前买入价格	N8(3)
10	S10	当前卖出价格	N8(3)
11	S11	成交数量	N10
12	S13	市盈率	N8(3)
13	S15	申买量一	N10
14	S16	申买价二	N8(3)
15	S17	申买量二	N10
16	S18	申买价三	N8(3)
17	S19	申买量三	N10
18	S21	申卖量一	N10
19	S22	申卖价二	N8(3)
20	S23	申卖量二	N10
21	S24	申卖价三	N8(3)
22	S25	申卖量三	N10
23	S26	申买价四	N8(3)
24	S27	申买量四	N10
25	S28	申买价五	N8(3)
26	S29	申买量五	N10
27	S30	申卖价四	N8(3)
28	S31	申卖量四	N10
29	S32	申卖价五	N8(3)

30	S33	申卖量五	N10

2.2 申报接口 ordwth

Ordwth	申报接口
<p>描述:</p> <p>数据库表接口为市场参与者提供一个单一的队列，市场参与者系统将委托写入接口数据库表，然后由 SSE 接口机按序读取接口数据库表中记录，依次发送到后台。</p> <p>该接口除了支持标准的“交易买卖、撤单”业务以外，还采用对特定的非交易代码进行买卖的方式来支持一系列的“非交易业务”。</p> <p>对于非交易业务，有如下约定：</p> <ol style="list-style-type: none"> （1） 买入网络密码服务代码（A 股帐户：799988；B 股帐户：939988）转义为激活或者注销网络密码业务。激活密码时买入价格 1.000，买入数量为投资者在上交所网站注册时所获得的激活码。注销密码时买入价格 2.000，买入数量为 2。不可撤单。 （2） 买入回购注销代码（799996）转义为回购注销。买入价格为 1.000。买入数量为 1。 （3） 买入指定撤销代码（799998）转义为指定撤销。买入价格为 1.000。买入数量为 1。指令即时处理，不可撤单。 （4） 买入指定登记代码（799999）转义为指定登记。买入价格为 1.000。买入数量为 1。指令即时处理，不可撤单。 （5） 买入发行申购代码（730***、780***；700***、760***；731***、781***；737***、787***；733***、783***）或者 ETF 认购代码（ETF 代码组第 4 个代码）转义为对对应证券参与申购；询价模式时输入价格，其他模式下输入发行价格（ETF 网上现金认购买入价格为 1.000）。买入数量以 1000 为最小单位。股票申购不可撤单，ETF 认购可以撤单。新交易系统切换后，除 700***、760*** 的老股东定价增发之外的各种申购认购均支持撤单。600***股票、601***股票对应的新股资金定价/询价申购或者新股东定价/询价增发（摇号中签）发行代码为 730***、780***；老股东定价增发（类似配股）发行代码为 700***、760***；老股东询价增发（比例中签）为 731***、781***；股票市值配售首发为 737***、787***；可转债资金申购为 733***、783***。 （6） 卖出配股代码（700***、760***；702***、762***；704***、764***）转义为对对应证券参与配股。卖出价格为配股价。卖出数量为参加配股的数量。指令即时处理，不可撤单。600***股票、601***股票对应的配股代码为 700***、760***；职工股配股代码为 702***、762***；配转债代码为 704***、764***。 	

Ordwth	申报接口
<p>(7) 卖出要约收购代码(706***)转义为对对应的股票进行要约收购登记。卖出价格为收购价。卖出数量以1股为最小单位。可撤单。股票的要约收购代码为706***,与股票代码没有直接的对应关系,需要根据上交所在要约收购业务开始之前发布的公告决定。</p> <p>(8) 买入要约收购代码转义为对对应的股票进行要约收购撤销。买入价格为收购价。买入数量以1股为最小单位。可撤单。</p> <p>(9) 买入网上投票代码(738***; 788***; 938***)转义为对对应证券投票。不可撤单。买入价格代表股东大会议案,如有多个待表决的议案,则1元代表议案1,2元代表议案2,依此类推。99元代表所有议案。多个需逐项表决的议案可以组成一个议案组,用含两位小数的价格代表该议案组下的各个议案或者所有议案。如2.01元代表议案组2的第1个议案,2.02元代表议案组2的第2个议案,2.00元代表议案组2的全部议案;小数点后可以到3位,即2.000和2.010这样格式的输入也是可以处理的。不采用累积投票制的议案,买入数量中1代表同意,2代表反对,3代表弃权。采用累积投票制的议案,买入数量代表选举票数。600***、601***、900***股票对应的网上投票代码为738***、788***、938***。</p> <p>(10) 卖出可转债转换代码(181***或者190***、191***)转义为对对应可转换债券进行转换登记。卖出价格填100。卖出数量以手为最小单位。新交易系统切换后,支持撤单。100***或者110***可转债对应的股票代码为600***,其对应的可转债转换代码为181***或者190***。113***可转债产品对应的股票代码为601***,其对应的可转债转换代码为191***。</p> <p>(11) 卖出可转债回售代码(1009**)转义为对对应的可转债进行回售登记。卖出价格填公告的回售价格。可转债回售代码为1009**,与可转债没有直接的对应关系,需要根据上交所在回售业务开始之前发布的公告决定。</p> <p>(12) 买入权证行权代码(582***)转义为对对应权证进行行权。买入价格为行权价格。买入数量以份为最小单位。可撤单。580***权证对应的行权代码为582***。</p> <p>(13) 买入开放式基金申购/赎回代码(519***)转义为对对应的开放式基金的申购。买入价格为1.000。买入时数量为申购金额,单位为元,目前不支持小数。可撤单。</p> <p>(14) 卖出开放式基金申购/赎回代码(519***)转义为对对应的开放式基金的赎回。卖出价格为1.000。卖出时数量为为赎回基金份额,单位为份,目前不支持小数。可撤单。</p> <p>(15) 买入开放式基金认购代码(521***)转义为对对应的开放式基金的认购。价格为1.000。数量为认购金额,单位为元,目前不支持小数。可撤单。</p> <p>(16) 卖出开放式基金份额转托管代码(522***)转义为对对应的开放式基金的转托管转出。价格字段的含义为对方对应的销售人代码,取值为000-999,可输入8.00这样小数点</p>	

Ordwth	申报接口
<p>后为 00 的数字。数量为基金份额，单位为份，目前不支持小数。可撤单。</p> <p>(17) 买入开放式基金分红设置代码 (523***) 转义为对对应的开放式基金设置分红方式。价格为分红方式代码 (100 元：红利转投，101 元：现金分红)，数量为 100 无意义，交易系统检验该数量不得大于 100。可撤单。</p> <p>(18) 卖出开放式基金转换代码 (524***) 转义为对对应的开放式基金转换为其他基金。价格字符串 (519.***) 移去小数点后转义为目标基金代码。数量为基金份额，单位为份，目前不支持小数。可撤单。</p> <p>(19) 卖出账户式质押回购出入库代码 (09****) 转义为对对应债券进行入库。价格为 1.000。数量以手为最小单位。不可撤单。00****国债和 01****国债对应的账户式质押回购出入库代码为 09****。</p> <p>(20) 买入账户式质押回购出入库代码 (09****) 转义为对对应债券进行出库。价格为 1.000。数量以手为最小单位。不可撤单。</p> <p>(21) 买入 ETF 申购赎回代码 (ETF 代码组第 2 个代码) 转义为对对应 ETF 的申购，即把成分证券置换为 ETF。价格为 1.000。数量的最小单位以基金管理公司公布的信息为准。(比如 510050 以 100 万份为最小单位)。不可撤单。</p> <p>(22) 卖出 ETF 申购赎回代码 (ETF 代码组第 2 个代码) 转义为对对应 ETF 的赎回，即把 ETF 置换为成分证券。价格为 1.000。数量的最小单位以基金管理公司公布的信息为准。不可撤单。</p> <p>投资者要进行融资融券信用交易，需向具备融资融券业务资格的证券公司申请，开设 E 字头的“投资者信用证券账户”。E 帐户所有的申报订单类型必须为信用交易类，即不得为“_PT”或者“ORD”。E 帐户可进行的非交易业务申报含：配股申报、配债申报、权证行权申报以及下文的 4 种证券划转业务申报，订单类型必须为“LXY”。</p> <p>开展融券业务的证券公司必须在中登公司开设“证券公司融券专用账户”，存放自有证券，供投资者进行融券交易。证券公司融券专用账户不得进行任何申报。</p> <p>开展融券业务的证券公司还必须在中登公司开设“证券公司信用交易担保证券账户”，该帐户与“投资者信用证券账户”之间是总帐与二级明细帐的关系，用于记载投资者委托证券公司持有的担保证券的明细数据，对应明细数据由中登公司维护。证券公司信用交易担保证券账户不得进行任何申报。</p> <p>(23) 买入余券划转代码 (799981) 转义为从“证券公司融券专用账户”过户到“证券公司</p>	

Ordwth	申报接口
<p>信用交易担保证券账户”。买入价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。买入数量为申请划转数量，允许为零散股。申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。可撤单。</p> <p>（24） 卖出还券划转代码（799982）转义为从“证券公司信用交易担保证券账户”过户到“证券公司融券专用账户”。卖出价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。卖出数量为申请划转数量，允许为零散股。申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。可撤单。</p> <p>（25） 买入担保品划转代码（799983）转义为从“投资者普通证券账户”过户到“证券公司信用交易担保证券账户”。卖出担保品划转代码（799983）转义从“证券公司信用交易担保证券账户”过户到“投资者普通证券账户”。申报价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。申报数量为申请划转数量，允许为零散股。申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。可撤单。</p> <p>（26） 买入券源划转代码（799984）转义为从“证券公司融券专用账户”过户到“证券公司自营账户”。卖出券源划转代码（799984）转义为从“证券公司自营账户”过户到“证券公司融券专用账户”。申报价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。申报数量为申请划转数量，允许为零散股。申报帐户必须为证券公司自营证券账户，订单类型必须为“LPT”或者“ORD”。可撤单。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	rec_num	<p>记录编号，从 1 开始，连续递增且唯一。</p> <p>新交易系统切换后，不再严格要求 rec_num 从 1 开始，只要连续递增即可。</p> <p>新交易系统通过后台保证不重复处理前台提交的同一个 PBU 同一个产品相同 rec_num 的订单的原理，提供在一些极端故障场景时，既不丢单，也不重单的能力。</p> <p>但是，如果申报表完全损坏，市场参与者启用备份数据库，那么为继续后续的报单业务，需要在新空申报表中直接插入后续订单。为避免后台认为是启用备份前某一个订单的重复提交，在切换时，后续订单的 rec_num 编号必须超过已经向交易所发出的 rec_num 号，市场参与者可以通过累加一个其业务上不可能发生的值比如 1000 万，来避免重单。举例如下：</p>	4 字节 Integer

		<p>第一次订单申报到 8978 笔，sql 数据库发生故障需要进行切换。</p> <p>到新的 sql 数据库的申报表中只需要直接从 rec_num 10000001 开始插起便可重新登录报盘程序申报。如果之后还又需要进行切换，则直接从 rec_num 20000001 开始插新订单。如此类推。但是，由于原接口设计中撤单编号字段最宽为 C8，所以输入 rec_num 超过 1 亿将无法撤单，故切换的次数是有限的。</p>	
2	date	<p>记录写入日期，格式为 YYMMDD</p> <p>在报盘程序启动之时，系统检查如果存在不是当前交易日的订单申报，会直接报错，拒绝登录。在启动之后，如果市场参与者新插入的订单申报日期不是当前交易日，该订单申报将作为废单处理。</p>	C8
3	time	记录写入时间，格式为 HH:MM:SS	C8
4	reff	<p>会员内部订单号，在整个申报的生命周期中，比如成交回报中，都会附带此数据作为标识字段，柜台系统可以利用此编号进行对应处理。</p> <p>该字段第 1 和 2 字节填写营业部代码的转换码。营业部代码的转换码的生产方法可参见附录：营业部代码换码算法示例。</p> <p>营业部代码由本所统一编制，以四字节数字字符型表示，代码使用区间为[1000, 4843]。各会员营业部代码可查阅本网站 www.sse.com.cn->会员专区->会员信息->基本信息。</p>	C10
5	acc	证券账户	C10
6	stock	证券代码，可能是一个实际的可交易产品，也可能是一个非交易业务所用的辅助代码。转义发生在证券代码为非交易代码时。	C6
7	bs	买卖方向，当 stock（字段 6：证券代码）为一个实际的可交易产品时，‘B’或者‘b’代表买入，‘S’或者‘s’代表卖出。	C1
8	price	<p>申报价格。债券交易申报价格为“每百元面值债券价格”，债券质押式回购交易申报价格为“每百元资金到期年收益”，债券买断式回购申报价格为“每百元面值债券到期购回价格”。其它为每股或者每份价格。如果该字段小数点后数字超过 3 位，3 位之后必须为 0。</p> <p>对于交易业务，不能输入 price 字段超过 1 万元的订单。</p> <p>当订单类型为最优五档即时成交剩余撤销市价订单或者最优五档即时成交剩余转限价市价订单时，该字段取值为 1.000。</p>	C8
9	qty	申报数量。债券交易、债券回购交易申报数量的单位为手（1000	C8

		元面值为一手)。其它为股或者份。	
10	status	发送状态, ‘R’或 ‘r’表示该记录还没有发送, ‘P’表示已发往上交所后台。 该字段是本表中唯一会被上交所报盘接口程序修改的字段。 柜台系统可以通过该字段来判断是否已经向上交所发送该申报。	C1
11	owflag	<p>订单类型标志, 该字段取值大小写不敏感。</p> <p>“WTH”表示撤单。正常情况下, 当取值为 “WTH”时, acc (字段 5: 证券账户)、stock (字段 6: 证券代码)、bs (字段 7: 买卖方向)、price (字段 8: 申报价格)、qty (字段 9: 申报数量) 取值必需与原申报相同, ordrec (字段 12: 撤单编号) 取值为待撤单的 rec_num。</p> <p>新交易系统切换后, 为便于市场参与人在其柜台系统发生灾难性故障后的后续处理, 上交所不再要求待撤销申报所对应的申报表记录和申报确认表记录在数据库中存在。如果待撤销申报所对应的申报表记录已不存在, 市场参与人在 rec_num、date、time、reff、status、owflag 字段提供本笔撤单申报自身的内容, 在 acc 字段、stock 字段、bs 字段、price 字段、qty 字段提供待撤订单的原内容, 在 ordrec 字段提供待撤订单的原 rec_num 内容, 即可完成撤单。</p> <p>对于限价订单、市价订单以及融资融券有关业务, 该字段按下列规则取值:</p> <p>1. 该字段的第一位取值作为区分限价订单与市价订单的标志, 取值方式如下:</p> <ul style="list-style-type: none"> • 为 ‘L’表示限价订单; • 为 ‘M’表示最优五档即时成交剩余撤销的市价订单, 含义为该申报在对手方实时最优五个价位内以对手方价格为成交价逐次成交, 剩余未成交部分自动撤销; • 为 ‘N’表示最优五档即时成交剩余转限价的市价订单, 含义为该申报在对手方实时五个最优价位内以对手方价格为成交价逐次成交, 剩余未成交部分按本申报最新成交价转为限价订单; 如无对手方申报与该申报成交的, 则按本方最优报价转为限价订单; 如无本方申报的, 该市价订单自动撤销; 	C3

		<p>2. 该字段的第二位和第三位为信用标签：</p> <ul style="list-style-type: none"> 取值为“PT”，表示普通的不参加融资融券的订单； 为“XY”表示担保品买卖，acc（字段 5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户；当 bs（字段 7：买卖方向）为‘B’或‘b’表示买入担保品申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可作为担保品的证券；为‘S’或‘s’表示卖出担保品申报，stock（字段 6：证券代码）为除回购外的股票、封闭式基金、ETF、国债、转债、权证； 为“RZ”表示融资交易，acc（字段 5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户；当 bs（字段 7：买卖方向）为‘B’或‘b’表示融资买入申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可融资买入的证券；为‘S’或‘s’表示在投资者信用证券帐户中进行卖券还款申报，stock（字段 6：证券代码）为除回购外的股票、封闭式基金、ETF、国债、转债、权证； 为“RQ”表示融券交易，acc（字段 5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户；当 bs（字段 7：买卖方向）为‘B’或‘b’表示买券还券申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可买券还券的证券；为‘S’或‘s’，表示融券卖出申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可融券卖出的证券。注：融券交易时不允许以市价订单的方式卖出； 为“PC”表示平仓交易，acc（字段 5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户。当 bs（字段 7：买卖方向）为‘B’或‘b’表示市场参与者进行平仓买入申报，stock（字段 6：证券代码）必须为融券卖出或被调出融券卖出范围但有合约未到期的证券；为‘S’或‘s’，表示市场参与者进行平仓卖出申报，stock（字段 6：证券代码）必须为可卖券还款的证券。 <p>为保持与以前接口的兼容，对于普通限价订单和非交易业务申报（比如指定登记、指定撤销等等），该字段取值即可为“LPT”，也可为“ORD”。</p>	
12	ordrec	撤单编号	C8
13	firmid	B 股结算会员代码，对于 A 股投资者取值无意义。	C5

		对于 B 股境外投资者 C9 类帐户此记录不能为空，填写 B 股结算会员代码。新交易系统切换之前，如果结算会员代码头两位为 00，须替换为两个空格。 新交易系统切换后，可以直接填写中登公司公布的结算会员代码，即如果头两位为 00，无需变换。 对于 B 股境内投资者 C1 类帐户可以不填。	
14	checkord	校验码，上交所内部使用	Binary

2.3 申报确认接口 ordwth2

ordwth2	申报确认接口
描述： SSE 接口机在接收到后台返回的订单响应之后，写入到接口数据库表中。每一个申报记录都会有一个对应的申报确认记录。市场参与者系统可以从该表读取上交所处理申报后返回的确认数据。 rec_num（字段 1：记录编号）、date（字段 2：记录写入日期）、reff（字段 4：会员内部订单号）、acc（字段 5：证券账户）、stock（字段 6：证券代码）、bs（字段 7：买卖方向）、price（字段 8：申报价格）、qty（字段 9：申报数量）、owflag（字段 14：撤单标志）、ordrec（字段 15：撤单编号）、firmid（字段 16：B 股结算会员代码）、checkord（字段 17：校验码）对应申报接口中同名字段。status1（字段 12：发送标志）对应申报接口的 status 字段。以上字段供上交所内部使用，柜台系统不得使用以上字段。 新交易系统切换后，如果申报确认表 ordwth2 数据损坏，且申报表 ordwth 正常，那么基于交易系统后台保证同一个 PBU 同一个证券产品相同 rec_num 的订单不会被重复处理的原理，市场参与人可以重新设置申报表 ordwth 中有关记录的状态 status 字段为 ‘R’，通过重新登录报盘程序触发报盘机向后台重发该申报，从而选择性地恢复申报确认数据。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	rec_num	记录编号，上交所内部使用 新交易系统切换后，由于后台并行可扩展架构的特征，申报确认记录在写入申报确认接口表时，不是按照 rec_num 顺序严格递增的方式写入。	4 字节 Integer
2	date	记录写入日期，上交所内部使用	C8
3	time	接收确认时间，记录上交所收到申报的时间。格式为 HH:MM:SS	C8
4	reff	会员内部订单号，上交所内部使用	C10
5	acc	证券账户，上交所内部使用	C10

6	stock	证券代码，上交所内部使用	C6
7	bs	买卖方向，上交所内部使用	C1
8	price	申报价格，上交所内部使用	C8
9	qty	申报数量，上交所内部使用	C8
10	status	接收状态， ‘F’表示交易所后台判断该订单为废单。 ‘E’表示交易所前台判断该订单为废单；此时 remark（字段 12：错误信息）给出错误代码。 ‘?’表示通信故障。 ‘O’表示上交所成功接收该笔申报。 ‘W’表示上交所成功接受该笔撤单； 当订单类型为最优五档即时成交剩余自动撤销的市价订单时，且订单有效时，该字段取值为 ‘W’。	C1
11	qty2	撤单数量， 对于限价订单申报记录，该字段为空； 对于撤单记录，该字段为实际撤单返回数量； 对于最优五档即时成交剩余自动撤销的市价订单，如果申报部分成交，该字段取值为自动撤单的数量；如果申报全部成交，则该字段取值为 0。	C8
12	remark	错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。详细说明参见附录：“申报确认接口 remark 字段取值说明”。	C30
13	status1	发送状态，上交所内部使用	C1
14	teordernum	主机订单编号，上交所内部使用。 新交易系统切换后，teordernum（字段 14：主机订单编号）， 只在同一个证券代码内唯一，不在整个市场内唯一。该字段供上 交所内部使用，柜台系统不得使用。	C8
15	owflag	订单类型标志，上交所内部使用	C3
16	ordrec	撤单编号，上交所内部使用	C8
17	firmed	席位编号，上交所内部使用	C5
18	checkord	校验码，上交所内部使用	Binary

2.4 成交回报接口 cjhb

Cjhb	实时成交回报接口
<p>描述:</p> <p>SSE 接口机在接收到后台返回的成交确认之后, 写入到接口数据库表中。市场参与者系统可以从该表读取上交所处理申报后返回的成交确认数据。</p> <p>除了标准的“交易”导致的成交确认外, 实时成交回报接口进行“转义”支持一些其他业务。</p> <p>(1) 配股成功后, 为配股者产生证券代码 zqdm 为配股代码, 成交价格 cjgg 为配股价格, 成交金额 cjje 为配股金额, 成交数量 cjsl 为配股数量, 买卖方向 bs 为 S 的实时成交回报记录。为承销商产生买卖方向 bs 为 B 的实时成交回报记录。</p> <p>(2) 账户式质押回购入库成功后, 产生如下 3 条实时成交回报记录:</p> <ul style="list-style-type: none"> 成交价格 cjgg 与成交金额 cjje 为 0, 成交数量 cjsl 为申请入库数量, 买卖方向 bs 为 S, 证券代码 zqdm 为出入库代码的成交记录; 成交价格 cjgg 与成交金额 cjje 为 0, 成交数量 cjsl 为申请入库数量, 买卖方向 bs 为 S, 证券代码 zqdm 为现券的成交记录; 成交价格 cjgg 与成交金额 cjje 为 0, 成交数量 cjsl 为折算后数量, 买卖方向 bs 为 B, 证券代码 zqdm 为标准券(888880)的成交记录。 <p>(3) 账户式质押回购出库成功后, 产生与入库成功后买卖方向相反的实时成交回报记录。</p> <p>(4) ETF 申购成功后, 为申购者产生如下实时成交回报记录: (为 ETF 基金管理公司产生成交回报的方式参见 ETF 基金管理公司接口规格说明书。)</p> <ul style="list-style-type: none"> 成交价格 cjgg 与成交金额 cjje 为 0, 成交数量 cjsl 为申购数量, 买卖方向 bs 为 B, 证券代码 zqdm 为基金 (ETF 代码组第 1 个代码, 比如 510050) 的成交记录。 成交价格 cjgg 与成交金额 cjje 为 0, 成交数量 cjsl 为过户数量, 买卖方向 bs 为 S, 证券代码 zqdm 为成分证券的成交记录; 对于 ETF 基金管理公司规定的当日必须用现金替代的成分证券, 没有该成分证券的成交记录。 0 到 2 条买卖方向 bs 为 B, 证券代码 zqdm 为资金代码 (ETF 代码组第 3 个代码, 比如 510052) 的成交记录。当现金替代值超过 1000 元, 会拆分为 2 条资金代码, 其中成交数量 cjsl 为资金比例因子, 填 1 或 1000000。成交价格 cjgg 为现金值; 成交金额 cjje 为金额=$cjsl \times cjgg$。 成交价格 cjgg 与成交金额 cjje 为 0, 成交数量 cjsl 为申购数量, 买卖方向 bs 为 B, 证券代码 zqdm 为 ETF 申购赎回代码 (ETF 代码组第 2 个代码, 比如 510051) 的成交记录。 <p>(5) ETF 赎回成功后, 产生买卖方向与申购成功后相反的实时成交回报记录。</p>	

Cjhb	实时成交回报接口
<p>如果最近收到的成交回报记录丢失，报盘机会在重新登录时自动从后台补回。但是，对于中间若干成交回报记录被人工删除，报盘机不会在登录时自动补回。</p> <p>如果市场参与人发生灾难性故障，导致成交回报表完全损坏，需要启动其灾备系统时，那么为快速恢复，市场参与人可以按照如下方法控制报盘程序 EzOes 只从交易所后台恢复必要的成交数据。</p> <p>假设如下：</p> <p>假设 1：市场参与者柜台系统的数据库中把与交易所成交回报表对应字段全部复制，其表名为 sscj（实时成交）。</p> <p>假设 2：市场参与人柜台系统为 cjhb 接口表增加了自增长字段 xh 序号，且柜台系统已经处理了 xh 为 12345 的记录。</p> <p>灾备恢复步骤，举例如下：</p> <p>步骤 1：利用如下类似 SQL 语句，从柜台系统中取出相关数据</p> <pre>SELECT gdxm, MAX(bcye) FROM sscj GROUP BY gdxm</pre> <p>假设取回结果为</p> <pre>3 0000034160 2 0000179343 1 0000162260 4 0000059770</pre> <p>(注意，几条结果和当日实际成交情况有关)</p> <p>步骤 2：然后利用如下类似 SQL 语句，将以上数据插入到报盘接口的 cjhb 表中</p> <pre>SET IDENTITY_INSERT cjhb ON INSERT INTO ashare_cjhb(xh, gdxm,bcye, gddm, bcrq, cjbh, gsdm, cjsl, zqdm, sbsj, cjsj, cijg, cjie, sqbh,bs, mjbh) VALUES(12346, '3','0000034160','', 3, '', '', '', '', '', '', '</pre>	

Cjhb	实时成交回报接口
<pre>INSERT INTO ashare_cjhb(xh, gdxm,bcye, gddm, bcrq, cjbh, gsdm, cjsl, zqdm, sbsj, cjsj, cijg, cjje, sqbh,bs, mjbh) VALUES(12347, '2','0000179343',' ", 2, " ", " ", " ", " ", " ", " ") INSERT INTO ashare_cjhb(xh, gdxm,bcye, gddm, bcrq, cjbh, gsdm, cjsl, zqdm, sbsj, cjsj, cijg, cjje, sqbh,bs, mjbh) VALUES(12348, '1','0000162260',' ", 1, " ", " ", " ", " ", " ", " ") INSERT INTO ashare_cjhb(xh, gdxm,bcye, gddm, bcrq, cjbh, gsdm, cjsl, zqdm, sbsj, cjsj, cijg, cjje, sqbh,bs, mjbh) VALUES(12349, '4','0000059770',' ", 4, " ", " ", " ", " ", " ", " ") SET IDENTITY_INSERT cjhb OFF</pre>	
<p>注意，以上 cjhb 字段按照 gdxm 的数字来填写，目标是为了防止 cjhb 重复而导致冲突。</p>	
<p>步骤 3：在确认报盘接口的 cjhb 中相关记录插入正确后，开启报盘程序 EzOes，报盘程序可以继续从后台恢复柜台系统尚未处理的成交记录。</p>	
<p>注：如果市场参与人不提供上述成交记录，开启报盘程序，报盘程序 EzOes 在发现 cjhb 表中，没有任何数据后，将从交易所后台恢复当日所有的成交数据，供市场参与者处理。此时，市场参与者可能需要逐条比对，确定哪一条记录已经在柜台里了，对柜台系统的性能有一定影响。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gddm	证券账户	C10
2	gdxm	股东姓名，新交易系统切换后，上交所不再在该字段填写股东姓名，而在该字段填写该产品所属产品集 SET 的编号。在新交易系统上线点，A 股产品集 SET 的取值为 ' 1'、' 2'、' 3'、' 4'、' 5'、' 6'、' 991'。B 股产品集 SET 的取值为 ' 20'。在一个交易日内，SET 的有关配置不会发生变化。未来如有产品集的扩充，另行通知。	C8
3	bcrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD	C8
4	cjbh	成交编号	4 字节

		<p>新交易系统切换后，由于后台并行可扩展架构的特征，成交记录在写入 cjhb 接口表时，不是按照成交编号顺序严格递增的方式写入。</p> <p>由于数据库表作为 ResultSet 的概念，与文件不同，没有物理序的概念，所以为便于市场参与者柜台系统处理该接口表，可在该表增加一个自增长字段（Auto Incremental Identity），比如为 xh 序号。柜台系统可以通过访问该字段来逐条处理成交回报记录。</p> <p>注：对于 xh 序号字段，由于采用自增长的方式，如果对该表进行手工 Truncate 操作，将导致该字段被重置，所以，如果进行手工 Truncate 操作后，需要手工设置 xh 序号字段的起始值。</p>	Integer
5	gsdm	席位号	C5
6	cjst	成交数量，单位为股(股票)或份(基金)或手(债券及回购)。	C10
7	bcye	<p>本次余额，新交易系统切换后，上交所不再在该字段填写本次余额，而在该字段填写该成交在对应产品集内的序列号。上交所按照同一 SET 内序列号“字典序”严格递增的方式写入成交记录，即会在左边补 0，例如‘10’存储为‘0000000010’。</p>	C10
8	zqdm	证券代码	C6
9	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS	C6
10	cjsj	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
11	cjgg	成交价格，单位为人民币元(A 股、基金、债券)或美元(B 股)或每百元资金的年收益率(国债回购)。精度为小数点后 3 位。	C8
12	cjje	<p>成交金额。精度为小数点后 2 位。</p> <p>对于证券代码为非交易业务代码的成交金额的取值，参见前文描述。</p> <p>普通交易时，该字段的取值方式如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> 对应股票、封闭式基金、ETF、权证产品，该字段为成交价格 cjgg*成交数量 cjst。 对应债券产品，该字段为成交价格 cjgg*成交数量 cjst*10。 对应席位质押式国债回购代码 201***、席位质押式企业债回购代码 202***以及账户质押式国债回购代码 204***时，该字段为成交价格 cjgg*成交数量 cjst*10。新交易系统切换后，将采用与行情一致的计算方式，即 100*成交数量 cjst*10。 对应买断式国债回购代码 203***时，该字段为成交价格 	C12

		<p>cjig*成交数量 cjsl*10。新交易系统切换后，将采用与行情一致的的计算方式，即基础产品昨日收盘价*成交数量 cjsl*10。</p> <p>如果实际成交金额超过 999,999,999.99，系统会填写-1。请会员特殊处理。</p>	
13	sqbh	会员内部订单号，同申报接口中的 reff（字段 4：会员内部订单号）。	C10
14	bs	买卖方向，同申报接口中的 bs（字段 7：买卖方向）。	C1
15	mjbh	操作员代码	C5

3 实时 STEP 消息接口

STEP 消息接口是新交易系统提供的新增接口，有如下特征：

1. 市场参与者系统通过 STEP 引擎与 SSE 接口机直接进行消息交互，不通过接口数据库表中转，可有效提高处理效率。但是市场参与者系统需要自行处理一些原来由数据库表接口报盘机处理的事情，比如由于后台原因导致的超时重发，比如开市前或者交易时段转换时的同步等待。
2. 市场参与者系统可采用连接两个 SSE 接口机的方式，支持更进一步的冗余和负载均衡配置。
3. 市场参与者系统可根据需要，采用多条队列的方式向后台并行发送消息。
4. 接口字段进行了扩位，价格、数量等支持更大的取值范围。
5. 业务类型进行了扩展，支持更多的订单类型、交易模式。

每一个 STEP 消息都有标准的消息头与消息尾，消息头的前三个域和消息尾中最后一个域的排列顺序必须遵循本文约定。

消息头、尾和消息体均采用依次排列标签名=域取值<SOH>的方式组织，消息中域取值除非特别声明，均以 ASCII 码字符串表示，<SOH>为域界定符，其值为不可打印字符 ASCII 码：十六进制的 0x01。

STEP 消息中定义域取值格式有如下三种：

- TIME 格式指：定长，YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。
- 字符型格式：变长，左对齐，以 CX 格式表示，其中 X 代表最大长度。
- 数字型格式：变长，左对齐，以 NX (Y)格式表示，其中 X 代表数字型字符串最大总长度，Y 代表最大小数位数。其中，X 包括一位小数点。

为传输数组类的信息，消息支持“重复组”，域在重复组里多次出现。通常域名起始为“No”字符的域指明出现的次数，并位于重复组的开始处。除重复组域外任何其他域不能多次出现。

消息头定义如下：

标签	域名	说明
8	BeginString	起始串 STEP.1.0.0 必须为消息的第一个域

9	BodyLength	<p>消息体长度</p> <p>必须为消息的第二个域，其值是计算出的消息长度域后面的字符数，包含紧靠校验和域标志‘10=’之前的界定符<SOH></p>
35	MsgType	<p>消息类型</p> <p>必须为消息的第三个域</p>
49	SenderCompID	<p>发送方代码</p> <p>前台向后台发送消息，填写 PBUID+TraderID，</p> <p>后台向前台发送消息，填写 “XSHG”</p>
56	TargetCompID	<p>接收方代码(不可加密，接收方标识符)</p> <p>前台向后台发送消息，填写 “XSHG”</p> <p>后台向前台发送消息，填写 PBUID+TraderID</p>
34	MsgSeqNum	<p>消息序号</p> <p>在 STEP 会话中，任何一条消息都需要分配一个消息序号来唯一标识，消息序号在每次会话过程中从 1 开始，在整个会话过程中连续递增。连接双方各自独立维护消息序号，并监视接收的消息序号的连续性以保证消息缺口的发现和处理。消息丢失由接收方负责检测，接收方有两种处理方法：接收方发现缺口后，向发送方请求发送缺口消息及其后的所有消息；或者保存已收到消息，然后向发送方请求重复发送缺口消息。</p>
43	PossDupFlag	<p>可能重复标志</p> <p>取值为 Y 表示：发送方响应一个重发请求而重复发送消息时，或者不确定对方是否收到某消息而重复发送该消息。当生成有此类可能重复发送的消息时，仍使用该消息的原来序号，但由于某些信息可能会改变，如原始时间、发送时间、正文长度、可能重复标志等，所以此时应重新计算消息头中的校验和。</p> <p>取值为 N 或者省略该域表示正常的消息。</p>

97	PossResend	<p>可能重发标志。</p> <p>取值为 Y 表示：如发送的订单在相当长的时间内没有确认，或者不确认是否发送过，使用新的消息序号进行了重新发送。该类消息应确定包含相同的正文数据，同样，由于某些信息可能会改变，所以应重新计算消息头中的校验和。</p> <p>取值为 N 或者省略该域表示正常的消息。</p>
52	SendingTime	发送时间

消息尾定义如下：

标签	域名	说明
10	Checksum	<p>校验和，消息的最末域。</p> <p>校验和是通过计算不包括校验和域的消息中的每一个字符之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018。</p>

3.1 会话层消息

3.1.1 登录消息

登录消息是在 STEP 会话开始时，连接双方发送的第一个消息。登录消息总是成对出现，接收方在接收登录消息时，将验证发起方身份的合法性，并且同样发出登录消息给发送方以确认连接请求已被接受。

标 签	域名	说明
	标准消息头	MsgType = A
98	EncryptMethod	加密方法，取 0 表示不加密。

108	HeartBtInt	心跳间隔 在消息交换的空闲期间，连接双方传输有规则的心跳消息，以监控通讯连接的状态。心跳间隔时间 HeartBtInt 由会话发起人在登录时向登录接受方发出，并得到确认。连接双方使用相同的心跳间隔时间。在发送任何消息后，STEP 引擎将心跳间隔计时器清零。
141	ResetSeqNumFlag	序号重设标志 取值为 Y 表示：登录后序号进行清零。一旦发起方发送附有序号重设标志的登录消息，那么接收人应服从该请求。 取值为 N 或者省略该域表示：序号继续上次会话。
464	TestMessageIndicator	测试标志 取值为 Y 表示：该会话是测试连接 取值为 N 或者省略该域表示：正常运行连接
553	Username	用户名
554	Password	密码
	标准消息尾	

3.1.2 注销消息

注销消息是发起或确认 STEP 会话终止的消息。未经注销消息交换而断开连接，一律视为非正常的断开。

在最后终止会话之前，注销的发起人应该等待连接对方发送确认的注销消息。这使得连接对方有机会进行有必要的缺口填补。如果连接对方没有在适当的时间间隔里作回应，那么会话也可以强行终止。

注销发起人在发送注销消息之后不应发送任何消息，除非接收到连接对方发出的重发请求消息。

标签	域名	说明
	标准消息头	MsgType = 5
58	Text	文本，该域可省略。

	标准消息尾	
--	-------	--

3.1.3 心跳消息

心跳消息用于监控通信线路的状况。当 STEP 连接双方的任何一方在[HeartBtInt]秒内不再发送数据，该方就会发送心跳消息。当连接双方的任何一方在[HeartBtInt+“合理的传送时间”]秒内没有接收到数据，该方就会发送测试请求消息。如果在[HeartBtInt+“合理的传送时间”]秒内没有接收到心跳消息，该连接就被判定为丢失，并启动相应的处理程序。如果 HeartBtInt 设置为 0，那么心跳消息就不会产生。但是，测试请求消息仍旧可以被发送（独立于 HeartBtInt 的值），并强制另一方发送心跳消息。

Tag	域名	说明
	标准消息头	MsgType = 0
112	TestReqID	测试请求标识符， 取值为 Y 表示：该消息是对测试请求响应的心跳消息 取值为 N 或者省略该域表示该消息是由于超时而产生的。
	标准消息尾	

3.1.4 测试请求消息

测试请求消息强制对方发送心跳消息。测试请求消息的作用是检查对方消息序号或检查通信线路的状况。对方用带有测试请求标识符（TestReqID）的心跳作应答。

标签	域名	说明
	标准消息头	MsgType = 1
112	TestReqID	测试请求标识符 用以指明对方生成心跳消息是响应测试请求而非正常超时引起的。对方发送心跳消息作为应答时，将测试请求标识符（TestReqID）包括在消息中。任何字符串都可以用作测试请求标识符（TestReqID） 推荐使用时间戳（timestamp）。
	标准消息尾	

3.1.5 重发请求消息

重发请求消息由接收方发出，当接收方发现消息序号缺口，向发送方申请某些消息重复发送。

标签	域名	说明
	标准消息头	MsgType = 2
7	BeginSeqNo	起始消息序号
16	EndSeqNo	结束消息序号，当该域取 0 时，表示重发起始消息序号之后的所有的消息
	标准消息尾	

3.1.6 会话拒绝消息

当接收方收到一条消息时，发现违反了会话机制而造成不能适当地处理该消息时，发出会话拒绝消息。如：当收到一条消息，这条消息虽成功地通过了校验和和正文长度检验，但却被发现带有无效的数据（如：消息类型（MsgType）=8），此时应发出会话拒绝消息。

被拒绝的消息应写入日志，并且增加接收进来的消息序号。

Tag	域名	说明
	标准消息头	MsgType = 3
45	RefSeqNum	关联消息序号，即被拒绝的消息序号
371	RefTagID	相关错误域号 该域可省略
372	RefMsgType	相关错误消息类型 该域可省略
373	SessionRejectReason	会话拒绝原因编号 该域可省略
58	Text	文本，解释拒绝的原因 该域可省略
	标准消息尾	

会话拒绝原因
0 = 存在无效的域号
1 = 该消息中必须的域丢失
2 = 该消息中出现未曾定义的域
3 = 未定义域号
4 = 域未赋值

5 = 域取值错误（范围溢出）
6 = 取值格式错误
7 = 解密错误
8 = 签名错误
9 = 公司标识符错误
10 = 发送时间精度错误
11 = 无效的消息类型
12 = XML 验证错误（XML Validation error）
13 = 同一域多次出现（非重复组）
14 = 有序的域出现次序错误
15 = 重复组域次序错误
16 = 重复组重复次数错误
17 = 非 data 数据域中出现域界定符<SOH>

3.1.7 序号重设消息

序号重设消息由发送方发出，用于告知接收方下一个消息将采用的消息序号。

<i>Ta g</i>	域名	说明
	标准消息头	MsgType = 4
123	GapFillFlag	缺口填补标志 取值为 Y 表示：缺口填补模式 取值为 N 或者省略该域表示：清零模式， 禁止在重发请求的正常回应中使用序号重设-清零模式，必须使用缺口填补模式。 使用序号重设-清零模式可能会造成消息丢失，通常只用于极端的灾难恢复情况。

36	NewSeqNo	<p>新消息序号</p> <p>如果缺口填补标志为Y，那么因为对方正准备接收缺口范围内第一条消息，所以消息头中的MsgSeqNum域取值应该对应缺口范围内第一条消息的消息序号，采用缺口填补模式，只能增加消息序号。如果收到的序号重设-缺口填补（SeqReset-Gap Fill）消息试图使下一个预期的消息序号变小，那么此消息应该被拒绝接受，并被视作为错误。</p> <p>如果缺口填补标志为N或者未定义，消息头里的消息序号（MsgSeqNum）应该忽略。</p>
	标准消息尾	

3.2 应用层消息

为便于市场参与者区分各不同消息的业务含义，下表列出区分消息的特征码。

消息	MsgType	ExecType	OrdStatus	OrdType	UAQuoteStatusType	QuoteStatus	IOITransType
订单输入	D						
订单输入响应	8	0	0				
		8	8				
订单撤销	F						
订单撤销响应	8	6	6				
	9		8				
成交确认	8	F	1,2				
投票输入	U004						
投票输入响应	U005						
注册业务输入	U001						
注册业务输入响应	U002						
协商订单查询	H			Y			
协商订单查询响应	8	I	0,8	Y			
场外交易查询	H			R			
场外交易查询响应	8	I	0,8	R			

场外交易信息发布	8	4,V	0,4				
报价输入	S						
报价输入响应	AI				1	0,5	
报价撤销	Z						
报价撤销响应	AI				4	4,19,20,5	
报价请求输入	R						
报价请求响应	U007 AG						
公共报价请求消息发布	U003						
私有报价请求消息发布	8	V	Q	Q			
意向输入	6						N
意向输入响应	8	0 8	0 8				
意向撤销	6						C
意向撤销响应	8 9	6	6 8				
意向查询	H			S			
意向查询响应	8	I	0,8	S			

3.2.1 订单输入消息

市场参与者通过订单输入消息，可以输入所有买卖类型的订单、协商订单、场外交易和与产品有关的非交易订单。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=D	
11	ClOrdID	券商订单编号	N16
453	NoPartyIDs	当 NonTradingOrdType 为 OT 开放式基金份额转出订单时，该值取 3 B 股产品的订单，该值取 3，其他产品该值取 2	
448	PartyID	取值为订单发起方的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5，	
452	PartyRole	取 5，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	

448	PartyID	取值为订单发起方的营业部代码	C5
447	PartyIDSource	取 D,	
452	PartyRole	取 4001, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
448	PartyID	当产品为 B 股时, 需要该域。 取值为订单发起方的结算会员代码	C5
447	PartyIDSource	当产品为 B 股时, 需要该域。 取 C,	
452	PartyRole	当产品为 B 股时, 需要该域。 取 4, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码	
448	PartyID	当 NonTradingOrdType 为 OT 时, 需要该域 取值为持仓转移的目的基金销售代理人	
447	PartyIDSource	当 NonTradingOrdType 为 OT 时, 需要该域 取 C,	
452	PartyRole	当 NonTradingOrdType 为 OT 时, 需要该域 取值为 30, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为持仓转移的目的基金销售代理人	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101, 表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
40	OrdType	订单类型, 取值: 1=市价订单, 在对手方实时 5 档最优价位内以对手方价位逐次成交, 剩余部分撤销。 2=限价订单, 如果优于对手方最优价位, 按照对手方价位成交, 否则插入订单簿。 K=市价转限价订单, 在对手方实时 5 档最优价位内以对手方价格为成交价逐次成交, 剩余未成交部分按本方申报最新成交价转为限价申报; 如该申报无成交, 按本方最优报价转为限价申报; 如无本方申	

		<p>报的，该申报撤销。</p> <p>Z=非交易订单，泛指不是用来进行买或者卖的订单，通常用来支持订单路由或者一级市场业务。</p> <p>该字段取值范围可扩展，支持创新业务如下：</p> <p>3=止损市价订单，在达到 StopPx 止损触发价格后，将按照触发时刻的时间戳以市价订单执行。</p> <p>4=止损限价订单，在达到 StopPx 止损触发价格后，将按照触发时刻的时间戳以限价订单执行。</p> <p>T=冰山订单，在集合竞价阶段，冰山订单以全部数量进行撮合。在连续交易阶段，行情和撮合中对该订单均按照 MaxFloor 揭示数量进行，当 MaxFloor 部分完全成交之后，剩余订单按照新时间戳重新排队，形成一个新的揭示部分。</p> <p>Y=协商订单，协商订单用来支持选择对手方的成交过程。</p> <p>R=场外交易，场外交易订单用来支持指定对手方的成交过程。</p>	
54	Side	<p>当 OrdTyp 为 Z 非交易订单时，该域无需取值。</p> <p>买卖方向，取值有：</p> <p>1 表示买</p> <p>2 表示卖</p> <p>该字段取值范围可扩展，支持创新业务如下：</p>	

		5 表示卖空	
38	OrderQty	当 NonTradingOrdType 为 OS 开放式基金认购、OC 开放式基金申购、OD 开放式基金分红选择时，该域无需取值 其他情况取订单数量	N13(3)
152	CashOrderQty	当 NonTradingOrdType 为 OS 开放式基金认购和 OC 开放式基金申购时，取订单现金金额	N13(3)
44	Price	该域取值为订单限价 市价订单、市价转限价订单无需该域	N14(5)
336	TradingSessionID	OrdType 为 1 市价订单，2 限价订单，和 K 市价转限价订单时该域必填。 表明交易时段限制，指该订单在那一个交易时段内进行撮合： NO=无限制。 该字段取值范围可扩展，支持创新业务如下： AU=仅集合竞价时段（包括开市集合竞价与日中集合竞价时段） OA=仅开市集合竞价时段 SU=仅订单簿平衡时段，订单簿平衡时段安排在集合竞价时段之后，用来供投资者与集合竞价结束后订单簿中剩余订单撮合。 FP=仅固定价格撮合时段，固定价格撮合时段安排在闭市之后，用来供投资者按照闭市价格撮合，当该字段取值为 FP 仅固定价格撮合时段，OrdType 必须填 1 市价订单	
59	TimeInForce	OrdType 为 1 市价订单，2 限价订单和 K 市价转限价订单时该域必填。	

		<p>表明订单有效时间类型：</p> <p>0=当日有效（GFD）</p> <p>3=即时否则取消(IOC)</p> <p>当 OrdType 为 1 市价订单时，该域只能取 3 即时否则取消 IOC。</p> <p>当 OrdType 为 K 市价转限价订单时，该域只能取 0 当日有效 GFD。</p> <p>该字段取值范围可扩展，支持创新业务如下：</p> <p>1=取消前有效（GTC）</p> <p>4=全额即时(FOK)</p> <p>6=指定日期前有效（GTD）</p>	
126	ExpireTime	<p>有效日期</p> <p>当 TimeInForce 为 0、3 时，该域不填；</p> <p>该字段取值范围可扩展，支持创新业务如下：</p> <p>当 TimeInForce 为 4 时，该字段不填；</p> <p>当 TimeInForce 为 1 时，为必须项，填当前交易日后第 89 天的日期。</p> <p>当 TimeInForce 为 6 时，该字段填当前交易日后到当前交易日后第 89 天之前的日期。</p>	<p>TIME</p> <p>有效位 取前 8 位</p>
99	StopPx	<p>该字段取值范围可扩展，支持创新业务如下：</p> <p>当 OrdTyp 为 3 止损限价订单或者 4 止损市价订单时，该字段表示止损触发价格</p> <p>如果该止损触发价格低于（对买方订单）或高于（对卖方订单）参考价格，该订单将无法输入</p>	N14(5)
111	MaxFloor	该字段取值范围可扩展，支持创新业务如下：	N13(3)

		当 OrdType 为 T 冰山订单时，该字段表示冰山订单的最高揭示量	
58	Text	备注	C12
8526	NonTradingOrdType	当 OrdType 为 Z 时，该域为非交易业务订单类型，取值有： IN =上网 IPO 认购订单 IE =市值配售 IPO 认购订单 IS =老股东增发 IPO 认购订单 CV =可转换债券转换订单 CR =可转换债券回售订单 R1 =股票配股行权行权 R2 =股票转配股配股行权 R3 =职工股转配股配股行权 R4 =股票配转债行权 OS =开放式基金认购订单 OC =开放式基金申购订单 OR =开放式基金赎回订单 OD =开放式基金分红选择订单 OT =开放式基金份额转出订单 EC =ETF 申购订单 ER =ETF 赎回订单 WE =权证行权订单 OV =开放式基金基金转换 BD =质押券入库订单 BW =质押券出库订单 FS =预受要约订单 FC =解除预受要约订单 YA, YB, ..., YZ 定义 26 个用来扩展的非交易订单类	

		型	
8532	DividendSelect	当 OrdType 为 Z 且 NonTradingOrdType 为 OD 开放式基金分红选择订单时，表示分红选择方式： C=现金（领取现金分红） U=份额（转申购）	
8533	DestSecurity	当 OrdType 为 Z 且 NonTradingOrdType 为 OV 开放式基金基金转换时，表示开放式基金基金转换时的目标产品代码	
172	SettlDeliveryType	当 OrdType 为 Y 或者 R 时， 结算代码，取值如下： 0 = 即银货两讫（DVP） 1 = 免付款交割（DFP） 4 = 非同步付款交割（DAP）	
64	SettlDate	当 OrdType 为 Y 或者 R 时， 结算日期	
120	SettlCurrency	当 OrdType 为 Y 或者 R 时， 结算货币，可与产品的缺省交易货币不同	
8819	UATransactionType	当 OrdType 为 Y 或者 R 时， 事务类型： A = 新增 P = 核准 当 OrdType 为 R 时， 事务类型还可以取 X = 取消	
8843	UASecondaryText	当 OrdType 为 Y 或者 R，且 UATransactionType 为 P 时， 由对手方输入的备注	
	标准消息尾		

3.2.2 订单输入响应消息

市场参与者每发出一个订单输入消息，一定会收到后台返回的一个对应的订单输入响应消息。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=8	
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	
11	ClOrdID	券商订单编号	N16
37	OrderID	交易所订单编号	N16
60	TransactTime	接受请求时间 成功响应时，使用后台时间。拒绝响应时使用 SSE 接口机本地时间。	TIME
103	OrdRejReason	订单拒绝时表示订单拒绝的原因，参见附录。	
	标准消息尾		

3.2.3 订单撤销消息

对于已经输入系统，但是还未完全执行的订单（包括非交易订单），市场参与者可以发指令撤销。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=F	
11	ClOrdID	撤单的券商订单编号	N16
37	OrderID	原有订单的交易所订单编号 可不填，如果填写，以该域取值为准。	N16
41	OrigClOrdID	原有订单的券商订单编号 如果 OrderID 不填，以该域取值为准。	N16
40	OrdType	原有订单的订单类型，取值必须等于原有订单的取值	
8526	NonTradingOrdType	原有订单的非交易订单类型，取值必须等于原有订单的取值	

	标准消息尾		
--	-------	--	--

3.2.4 订单撤销响应消息

对于市场参与者输入的撤销指令，后台会返回订单撤销响应。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	撤销成功时，MsgType=8 撤销失败时，MsgType=9	
150	ExecType	当前订单执行类型 撤销成功时，取值为 6=撤单的成功响应 撤销失败时，该字段无需取值	
39	OrdStatus	当前订单状态， 撤销成功时，取值为 6=撤单的成功响应 撤销失败时，取值为 8=拒绝，	
11	ClOrdID	订单撤销的券商订单编号	N16
37	OrderID	原有订单的交易所订单编号	N16
41	OrigClOrdID	原有订单的券商订单编号	N16
32	LastQty	撤销成功时，已撤单数量 撤销失败时，该字段无需取值	N13(3)
60	TransactTime	撤销成功时，接受请求时间 撤销失败时，填 SSE 接口机 本地时间	TIME
434	CxlRejResponseTo	撤销成功时，该字段无需取值 撤销失败时，拒绝的请求类型，取值为 1=撤单	
102	CxlRejReason	撤销成功时，该字段无需取值 撤销失败时，撤单请求拒绝的理由，参见附录。	
	标准消息尾		

3.2.5 成交确认消息

当市场参与者输入的订单在后台撮合成成交时，后台主动发回成交确认消息。部分非交易业务，比如 ETF 申购/赎回、质押券出入库、配股行权等也会产生成交确认消息。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=8	

150	ExecType	当前订单执行类型，取值： F=成交或部分成交	
39	OrdStatus	当前订单状态，取值： 1=部分成交 2=已成交	
17	ExecID	成交编号	N16
8820	UATradeType	交易类型，取值： TRD=撮合交易 ECR=ETF 申购交易 ERD=ETF 赎回交易 BDE=质押券入库交易 BWI=质押券出库交易 RI1=股票配股行权行权 RI2=股票转配股配股行权 RI3=职工股转配股配股行权 RI4=股票配转债行权	
37	OrderID	交易所订单编号	N16
11	ClOrdID	券商订单编号	N16
453	NoPartyIDs	该值取 5	
448	PartyID	取值为该成交的 PBU 代码	C5
447	PartyIDSource	取 C，	
452	PartyRole	取 1，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为 PBU 代码	
448	PartyID	取值为该成交的交易员代码	C6
447	PartyIDSource	取 D，	
452	PartyRole	取 12，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为交易员代码	
448	PartyID	取值为该成交的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5，	
452	PartyRole	取 5，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	
448	PartyID	取值为该成交的结算会员代码（B 股业务有意义）	C5

447	PartyIDSource	取 C,	
452	PartyRole	取 4, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码	
448	PartyID	取值为该成交的营业部代码	C5
447	PartyIDSource	取 D,	
452	PartyRole	取 4001, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101, 表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
54	Side	买卖标志, 取值有: 1=买 2=卖	
60	TransactTime	订单执行时间	
8846	UAMktVal	交易的成交金额。 质押式回购: 数量; 买断式回购: 前一天的收盘价*数量/100; 证券借贷: 价格*数量 如果实际成交金额超过, 系统会填写-1。请会员特殊处理。	
31	LastPx	该笔成交价格 对于 ETF 申购时, 成分产品的成交确认, 普通投资者显示为 0, 基金经理显示该产品现金替代的价格; 对于 ETF 赎回时, 成分产品的成交确认, 普通投资者显示为 0, 基金经理显示该产品现金替代的价格; 对于 ETF 申购或者赎回时, ETF 产品的成交确认, 普通投资者和基金经理都显示现金替代的总金额;	N16(5)
32	LastQty	该笔成交数量 对于 ETF 申购赎回时, 成分产品的成交确认, 普通投资者和基金经理都显示该产品现金替代的数量; 对于 ETF 申购或者赎回时, ETF 产品的成交确认, 普通	N16(3)

		投资者和基金经理都显示 ETF 订单的数量;	
42	OrigTime	原有订单请求发起的时间	
	标准消息尾		

3.2.6 投票输入消息

市场参与者通过投票输入消息，可以按照累计投票制或者非累计投票制对议案进行投票表决。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=U004	
11	ClOrdID	券商订单编号	N16
453	NoPartyIDs	取 2	
448	PartyID	取值为订单发起方的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5,	
452	PartyRole	取 5, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	
448	PartyID	取值为订单发起方的营业部代码	C5
447	PartyIDSource	取 D,	
452	PartyRole	取 4001, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101, 表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
8529	VotingProposal	投票主议案	C4
8530	VotingSubProposal	投票副议案	C4
8531	VotingPreference	投票意向。 对于采用累计投票制的议案，表示填报的选举票数； 对于采用非累计投票制的议案，取值有： 1=同意 2=反对 3=弃权	N23
58	Text	投票的备注	C12
	标准消息尾		

3.2.7 投票输入响应消息

市场参与者每发出一个投票输入消息，都会收到后台返回的一个对应的投票输入响应消息。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=U005	
150	ExecType	投票请求的执行类型，取值有： 0=请求接受 8=请求失败	
11	ClOrdID	券商订单编号	N16
37	OrderID	交易所订单编号	N16
60	TransactTime	投票请求接收时表示接受请求的时间，拒绝响应时采用 SSE 接口机本地时间。	TIME
103	OrdRejReason	投票请求拒绝时表示投票请求拒绝的原因，参见错误代码及其描述	
	标准消息尾		

3.2.8 注册业务输入消息

市场参与者通过本消息向后台输入注册业务请求。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=U001	
11	ClOrdID	注册消息的券商订单编号，即交易客户方（券商）订单编号	
8502	DesignationInstruction	注册消息的注册指令，取值有： 1=指定交易登记 2=指定交易撤消 6=投票服务	
453	NoPartyIDs	取 2	
448	PartyID	取值为订单发起方的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5，	
452	PartyRole	取 5，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	
448	PartyID	取值为订单发起方的营业部代码	C5

447	PartyIDSource	取 D,	
452	PartyRole	取 4001, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
58	Text	注册消息的备注 对于投票服务时, AC 表示密码激活; DA 表示注销密码。	
554	Password	投票服务对应的激活或者注销密码	
	标准消息尾		

3.2.9 注册业务输入响应消息

市场参与者每发出一个注册业务输入消息, 都会收到后台返回的一个对应的注册业务输入响应消息。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=U002	
150	ExecType	执行类型, 取值有: 0=已接受 8=已拒绝	
11	ClOrdID	注册消息的券商订单编号	N16
37	OrderID	注册消息的交易所订单编号	N16
103	OrdRejReason	注册请求拒绝时表示注册请求拒绝的原因, 参见附录。	
60	TransactTime	请求接收时表示接受请求的时间, 拒绝响应时采用 SSE 接口机本地时间。	建议增加
	标准消息尾		

3.2.10 协商订单查询消息

市场参与者通过协商订单查询消息, 可以检索指定证券代码的协商订单。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=H	
40	OrdType	查询的订单类型, 取值有: Y = 协商订单	

48	SecurityID	查询的证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101, 表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
8849	UAOverview	查询条件, 取值有, M=查询市场上所有符合条件的订单 O=查询所有自己提交和核准的订单	
	标准消息尾		

3.2.11 协商订单查询响应消息

市场参与者输入协商订单查询指令后, 后台返回者协商订单的查询响应。对于协商订单市场参与者可点击成交。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType 取 8	
150	ExecType	执行类型, 取值有: I = 订单状态	
39	OrdStatus	原有订单的当前订单状态, 取值有: 0 = 新 8 = 已拒绝	
40	OrdType	原有订单的订单类型取值: Y = 协商订单	
37	OrderID	交易所订单编号	N16
11	ClOrdID	券商订单编号	N16
453	NoPartyIDs	B 股产品的订单, 该值取 3, 其他产品该值取 2	
448	PartyID	取值为订单发起方的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5,	
452	PartyRole	取 5, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	
448	PartyID	取值为订单发起方的营业部代码	C5
447	PartyIDSource	取 C,	
452	PartyRole	取 4, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
448	PartyID	当产品为 B 股时, 需要该字段。	C5

		取值为订单发起方的结算会员代码	
447	PartyIDSource	当产品为 B 股时，需要该字段。 取 C，	
452	PartyRole	当产品为 B 股时，需要该字段。 取 4，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
54	Side	买卖方向，取值有： 1 表示买 2 表示卖 5 表示卖空 取值为 5 业务暂不开通。	
60	TransactTime	订单的创建时间	YYYYMMDD-HH:MM:SS.000
38	OrderQty	取订单数量	N13(3)
44	Price	该字段取值为订单限价	N14(5)
58	Text	备注	C12
172	SettlDeliveryType	结算方式代码，取值如下： 0=银货两讫（DVP） 1=免付款交割（DFP） 4=非同步付款交割（DAP）	
64	SettlDate	结算日期	YYYYMMDD
120	SettlCurrency	结算货币	
103	OrdRejReason	信息请求出错时表示订单拒绝的原因，参见附录。	
8848	UAEndMark	查询结束标志，为必须项	
	标准消息尾		

3.2.12 场外交易查询消息

市场参与者通过场外交易查询消息，可以检索指定 PBU 指定证券代码的场外交易订单。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=H	
40	OrdType	查询的订单类型，取值有： R = 场外交易	
453	NoPartyIDs	该值取 2	
448	PartyID	取值为查询的 PBU	C10
447	PartyIDSource	取 C	
452	PartyRole	取 1，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为 PBU	
448	PartyID	取值为查询的交易员代码	C10
447	PartyIDSource	取 D	
452	PartyRole	取 12，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为交易员代码	
48	SecurityID	查询的证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
	标准消息尾		

3.2.13 场外交易查询响应消息

市场参与者输入场外交易查询指令后，后台返回查询响应。市场参与者可以核准或者拒绝场外交易。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=8	
150	ExecType	执行类型，取值有： I = 订单状态	
39	OrdStatus	原有订单的当前订单状态，取值有： 0 = 新 8 = 已拒绝	
40	OrdType	订单类型，取值有： R = 场外交易	

37	OrderID	交易所订单编号	N16
11	CIOrdID	券商订单编号	N16
453	NoPartyIDs	该值取 6	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的 PBU 代码	C5
447	PartyIDSource	取 C,	
452	PartyRole	取 1, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为 PBU 代码	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的交易员代码	C6
447	PartyIDSource	取 D,	
452	PartyRole	取 12, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为交易员代码	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5,	
452	PartyRole	取 5, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的结算会员代码 (B 股业务有意义)	C5
447	PartyIDSource	取 C,	
452	PartyRole	取 4, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的营业部代码	C5
447	PartyIDSource	取 C,	
452	PartyRole	取 4, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
448	PartyID	取值为该场外交易订单对手方的 PBU 代码	C5
447	PartyIDSource	取 C,	
452	PartyRole	取 1, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为 PBU 代码	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101, 表示 SecurityID 取上海证券交	

		易所的证券代码	
38	OrderQty	订单数量	N13(3)
54	Side	买卖标志，取值有： 1=买 2=卖 5=卖空	
60	TransactTime	订单执行时间	
44	Price	订单的限价，OrdType 为 2，4 和 T 时 表示订单的限价。	
58	Text	返回输入时的备注	
172	SettlDeliveryType	结算代码，取值如下： 0=银货两讫（DVP） 1=免付款交割（DFP） 4=非同步付款交割（DAP）	
120	SettlCurrency	结算货币	
64	SettlDate	结算日期	
8819	UATransactionType	场外交易订单的事务类型，取值有： A = 新增 P = 核准 X = 取消	
8848	UAEndMark	查询结束标志，为必须项	
103	OrdRejReason	信息请求出错时表示订单拒绝的原因，参见附录。	
	标准消息尾		

3.2.14 场外交易信息发布消息

市场参与者输入、核准或者拒绝场外交易后，后台向该场外交易的参与双方发出场外交易信息发布消息。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=8	
150	ExecType	执行类型，取值有： 4 = 已撤销	

		V = 已接受的广播	
39	OrdStatus	原有订单的当前订单状态，取值有： 0 = 新 4 = 已撤销	
37	OrderID	交易所订单编号	N16
11	CIOrdID	券商订单编号	N16
453	NoPartyIDs	该值取 6	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的 PBU 代码	C5
447	PartyIDSource	取 C，	
452	PartyRole	取 1，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为 PBU 代码	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的交易员代码	C6
447	PartyIDSource	取 D，	
452	PartyRole	取 12，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为交易员代码	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5，	
452	PartyRole	取 5，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的结算会员代码（B 股业务有意义）	C5
447	PartyIDSource	取 C，	
452	PartyRole	取 4，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码	
448	PartyID	取值为输入该场外交易订单的营业部代码	C5
447	PartyIDSource	取 C，	
452	PartyRole	取 4，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
448	PartyID	取值为该场外交易订单对手方的 PBU 代码	C5
447	PartyIDSource	取 C，	

452	PartyRole	取 1，与 PartIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为 PBU 代码	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
38	OrderQty	订单数量	N13(3)
40	OrdType	订单类型，取值有： R = 场外交易	
54	Side	买卖标志，取值有： 1=买 2=卖 5=卖空	
60	TransactTime	订单执行时间	
44	Price	订单的限价，OrdType 为 2，4 和 T 时表示订单的限价。	
58	Text	返回输入时的备注	
172	SettlDeliveryType	结算代码，取值如下： 0=银货两讫（DVP） 1=免付款交割（DFP） 4=非同步付款交割（DAP）	
120	SettlCurrency	结算货币	
64	SettlDate	结算日期	
	标准消息尾		

3.2.15 报价输入消息

做市商通过报价输入消息，可以输入报价。报价支持双边报价或者单边报价。

标签	域名	说明	格式
	标准信息头	MsgType=S	
117	QuoteID	报价的券商订单编号	N16
453	NoPartyIDs	取 3	
448	PartyID	取值为报价输入方的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5，	

452	PartyRole	取 5，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	
448	PartyID	取值为报价输入方的结算会员代码（B 股业务有意义）	C5
447	PartyIDSource	取 C，	
452	PartyRole	取 4，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码	
448	PartyID	取值为报价输入方的营业部代码	C5
447	PartyIDSource	取 C，	
452	PartyRole	取 4，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
132	BidPx	报价的买方限价	N14(5)
133	OfferPx	报价的卖方限价	N14(5)
134	BidSize	报价的买方数量	N13(3)
135	OfferSize	报价的卖方数量	N13(3)
58	Text	报价的备注	C12
	标准消息尾		

3.2.16 报价输入响应消息

做市商每发出一个报价输入消息，一定会收到后台返回的一个对应的报价输入响应消息。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=AI	
8855	UAQuoteStatusType	报价状态消息回复的类型： 1=报价响应	
297	QuoteStatus	报价状态，取值有： 0=报价接受 5=报价拒绝	
117	QuoteID	报价的券商订单编号	N16
8839	UAReqRejReason	请求的错误代码，参见附录，出错时为必须。	
60	TransactTime	请求接收时表示接受请求的时间，拒绝响应时采用接口机本地时间。	

	标准消息尾		
--	-------	--	--

3.2.17 报价撤销消息

对于已经输入系统，但是还未完全执行的报价，做市商可以发指令撤销。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=Z	
117	QuoteID	原有报价的券商编号，即交易客户方（券商）订单编号。	
298	QuoteCancelType	报价取消类型，取值为： 1=删除报价	
295	NoQuoteEntries	报价产品数目，值为 1。	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
	标准消息尾		

3.2.18 报价撤销响应消息

对于做市商输入的报价撤销指令，后台会返回报价撤销响应。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=AI	
8855	UAQuoteStatusType	报价状态消息回复的类型： 4=报价取消	
297	QuoteStatus	报价状态，取值有： 4=双边报价取消 19=买方报价取消 20=卖方报价取消 5=报价取消拒绝	
8839	UAREqRejReason	请求的错误代码，参见附录，出错时为必须。	
60	TransactTime	请求接收时表示接受请求的时间， 拒绝响应时采用接口机本地时间。	
	标准消息尾		

3.2.19 报价请求输入消息

市场参与者可以向后台发出报价请求输入消息。后台将该请求转发给该产品相关负责的做市商，要求做市商提供某一产品的特定报价。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=R	
131	QuoteReqID	报价请求券商订单编号	
146	NoRelatedSym	报价请求的产品数量，取值为 1。	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
38	OrderQty	取数量	N13(3)
54	Side	报价请求的买卖方向，取值有： 0=买或者卖 1=买 2=卖	
	标准消息尾		

3.2.20 报价请求响应消息

市场参与者每发出一个报价请求输入消息，一定会收到后台返回的一个对应的报价请求响应消息。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	请求被接受时： MsgType=U007 请求被拒绝时： MsgType=AG	
131	QuoteReqID	报价请求的券商订单编号	

658	QuoteRequestRejectReason	当报价请求被拒绝时： 报价请求拒绝的原因，参见附录。 当报价请求被接受时，无该字段	
60	TransactTime	报价请求接收时表示接受请求的时间	
	标准消息尾		

3.2.21 公共报价请求信息发布消息

后台把报价请求通过公共报价请求信息发布消息接口向全市场公开。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=? ? ? (待定)	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
60	TransactTime	报价请求接受的时间	
	标准消息尾		

3.2.22 私有报价请求信息发布消息

后台把报价请求通过私有报价请求信息发布消息接口转发给报价请求种指定产品相关负责的做市商。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=8	
150	ExecType	原有报价请求的当前订单执行类型，取值有： V = 已接受的广播	
39	OrdStatus	原有报价请求的当前状态，取值有： Q = 报价请求	
40	OrdType	原有报价请求的订单类型，取值： Q = 报价请求	
453	NoPartyIDs	该值取 2	
448	PartyID	取值为输入报价请求的 PBU 代码	C5
447	PartyIDSource	取 C，	

452	PartyRole	取 1，与 PartIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为 PBU 代码	
448	PartyID	取值为输入报价请求的交易员代码	C6
447	PartyIDSource	取 D，	
452	PartyRole	取 12，与 PartIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为交易员代码	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
54	Side	报价请求的买卖方向，取值有： 0=买或者卖 1=买 2=卖	
38	OrderQty	取数量	N13(3)
60	TransactTime	报价请求接受的时间	
	标准消息尾		

3.2.23 意向输入消息

市场参与者通过意向输入消息，输入意向。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=6	
28	IOITransType	表明意向消息的事务类型，取值如下： N=新增意向	
23	IOIId	意向消息的券商订单编号	N16
54	Side	意向的买卖方向取值： 1=买 2=卖	
27	IOIQty	意向的数量	N13(3)
44	Price	意向的价格	N14(5)
58	Text	意向的备注	C12
172	SettlDeliveryType	意向的结算代码，取值如下： 0=银货两讫（DVP）	

		1=免付款交割（DFP） 4=非同步付款交割（DAP）	
64	SettlDate	意向的结算日期	YYYYMMDD
120	SettlCurrency	意向的结算货币	
	标准消息尾		

3.2.24 意向输入响应消息

市场参与者每发出一个意向输入消息，一定会收到后台返回的一个对应的意向输入响应消息。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=8	
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	
23	IOIId	意向消息的券商订单编号	N16
37	OrderID	交易所订单编号	N16
60	TransactTime	接受请求时间 拒绝响应时取接口机本地时间	YYYYMMDD- HH:MM:SS.000
103	OrdRejReason	意向拒绝时表示拒绝的原因，参见附录。	
	标准消息尾		

3.2.25 意向撤销消息

对于已经输入系统的意向，市场参与者可以发指令撤销。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=6	
28	IOITransType	表明意向消息的事务类型，取值如下： C=撤销意向	
23	IOIId	意向消息的券商订单编号	N16

37	OrderID	原有意向的交易所订单编号	N16
	标准消息尾		

3.2.26 意向撤销响应消息

对于市场参与者输入的撤销指令，后台会返回订单撤销响应。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	撤销成功时，MsgType=8 撤销失败时，MsgType=9	
150	ExecType	当前订单执行类型 撤销成功时，取值为 6=撤单的成功响应 撤销失败时，该字段无需取值	
39	OrdStatus	当前订单状态， 撤销成功时，取值为 6=撤单的成功响应 撤销失败时，取值为 8=拒绝，	
11	ClOrdID	订单撤销的券商订单编号	N16
37	OrderID	原有订单的交易所订单编号	N16
41	OrigClOrdID	原有订单的券商订单编号	N16
32	LastQty	撤销成功时，已撤单数量 撤销失败时，该字段无需取值	N13(3)
60	TransactTime	撤销成功时，接受请求时间 撤销失败时，填 SSE 接口机 本地时间	TIME
434	CxlRejResponse To	撤销成功时，该字段无需取值 撤销失败时，拒绝的请求类型，取值为 1=撤单	
102	CxlRejReason	撤销成功时，该字段无需取值 撤销失败时，撤单请求拒绝的理由，参见附录。	
	标准消息尾		

3.2.27 意向查询消息

市场参与者通过意向查询消息，可以检索指定证券代码的意向。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType=H	

48	SecurityID	查询的证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101, 表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
40	OrdType	查询的订单类型, 取值有: S = 意向	
8849	UAOverview	查询条件, 取值有, M=查询市场上所有符合条件的意向 O=查询所有自己提交和核准的意向	
	标准消息尾		

3.2.28 意向查询响应消息

市场参与者输入意向查询指令后, 后台返回意向查询响应。

标签	域名	说明	格式
	标准消息头	MsgType 取 8	
150	ExecType	意向信息请求的执行类型, 取值有: I = 订单状态	
39	OrdStatus	原有订单的当前订单状态, 取值有: 0 = 新 8 = 已拒绝	
37	OrderID	交易所订单编号	N16
11	ClOrdID	券商订单编号	N16
453	NoPartyIDs	B 股产品的订单, 该值取 3, 其他产品该值取 2	
448	PartyID	取值为订单发起方的投资者帐户	C10
447	PartyIDSource	取 5,	
452	PartyRole	取 5, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	
448	PartyID	取值为订单发起方的营业部代码	C5
447	PartyIDSource	取 C,	
452	PartyRole	取 4, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	
448	PartyID	当产品为 B 股时, 需要该字段。	C5

		取值为订单发起方的结算会员代码	
447	PartyIDSource	当产品为 B 股时，需要该字段。 取 C，	
452	PartyRole	当产品为 B 股时，需要该字段。 取 4，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码	
48	SecurityID	取证券代码	C6
22	SecurityIDSource	取 101，表示 SecurityID 取上海证券交易所的证券代码	
54	Side	买卖方向，取值有： 1 表示买 2 表示卖 5 表示卖空 取值为 5 业务暂不开通。	
60	TransactTime	订单的创建时间	YYYYMMDD- HH:MM:SS.000
38	OrderQty	取订单数量	N13(3)
40	OrdType	原有订单的订单类型取值： S = 意向	
44	Price	该字段取值为订单限价	N14(5)
58	Text	备注	C12
172	SettlDeliveryType	结算方式代码，取值如下： 0=银货两讫（DVP） 1=免付款交割（DFP） 4=非同步付款交割（DAP）	
64	SettlDate	结算日期	YYYYMMDD
120	SettlCurrency	结算货币	
103	OrdRejReason	信息请求出错时表示订单拒绝的原因，参见附录。	
8848	UAEndMark	查询结束标志，为必须项	
	标准消息尾		

4 盘后数据接口规范

本部分描述了上交所交易系统发布给柜台系统的一些文件接口。

历史上把 ghXXXXX.dbf 压缩为 ghXXXXX.zip，把 zxwXXXXX.dbf 和 zzhXXXXX.dbf 压缩为 zdXXXXX.all 文件。新交易系统上线后，zxwXXXXX.dbf 和 zzhXXXXX.dbf 分别压缩为 zxwXXXXX.zip 和 zzhXXXXX.zip。

4.1 过户数据接口 ghXXXXX.dbf

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p>描述：</p> <p>文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。</p> <p>该接口文件的组织形式同实时成交回报数据接口类似。由于数据库表与 DBF 文件表述的不同，成交编号、成交数量、本次余额、成交价格、成交金额的类型略有不同。</p> <p>新交易系统切换后，不再按照 cjbh 字段排序。</p> <p>新交易系统切换后，对于 B 股 PBU 同样产生该接口文件。</p> <p>对于需要转义的非交易业务，一些没有包含在实时成交回报数据接口中的记录，通过盘后过户数据接口传送给参与者。</p> <p>下文中，未申明特别填写方式的字段，均填写对应订单输入时的原始信息。</p> <p>(1) 指定撤销成功后，产生证券代码 zqdm 为 799998，（全市场成交编号 cjbh 从当前 A 股最大成交编号+1 开始连续递增，）成交数量 cjsl 为 0，成交价格 cijg 为 0，成交金额 cije 为 0，成交时间 cjsj 为 150000，买卖方向 bs 为 B 的过户记录。</p> <p>(2) 指定登记成功后，产生证券代码 zqdm 为 799999，（全市场成交编号 cjbh 从指定撤销最大成交编号+1 开始连续递增，）成交数量 cjsl 为 0，成交价格 cijg 为 0，成交金额 cije 为 0，成交时间 cjsj 为 150000，买卖方向 bs 为 B 的过户记录。</p> <p>(3) 对于发行业务，过户库会在多日均含有有关数据。</p> <p>市值配售发行过户库记录说明：</p> <ul style="list-style-type: none"> T 日盘后过户文件中包含配号记录。证券代码 zqdm 为发行配号代码（比如 747***）；成交编号 cjbh 指配号的首个号码；成交数量 cjsl 指配号成功的数量；成交价格 cijg 为 0；成交金额 cije 为 0；当配号不超过 8 位时，成交时间 cjsj 填写 150000，当成交时间 cjsj 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况；买卖方向 bs 为 B。 	

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<ul style="list-style-type: none"> T+1 盘后过户文件中包含中记录。证券代码 zqdm 为申购/中签代码（比如 737***）；成交编号 cjbh 指中签号；成交数量 cjsl 指中签数量；成交价格 cjig 指中签价格；成交金额 cjie 等于分配数量乘以结算价格；当配号不超过 8 位时，成交时间 cjsj 填写 150000，当成交时间 cjsj 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向 bs 为 B。 <p>资金申购发行过户库记录说明：</p> <ul style="list-style-type: none"> T 日盘后过户文件中包含发行扣款记录。证券代码 zqdm 为发行扣款/还款代码（比如 740***）；（全市场成交编号 cjbh 为-1,-2,...）成交数量 cjsl 为申购数量；成交价格 cjig 为申购价格；成交金额 cjie 为扣款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向 bs 为 B 的记录。 T+2 日盘后过户文件中包含配号记录。证券代码 zqdm 为发行配号代码（比如 741***）；成交编号 cjbh 指配号的首个号码；成交数量 cjsl 指配号成功的数量；成交价格 cjig 为 0；成交金额 cjie 为 0；当配号不超过 8 位时，成交时间 cjsj 填写 150000，当成交时间 cjsj 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向 bs 为 B。 T+3 日盘后过户文件中包含还款记录。证券代码 zqdm 为发行扣款/还款代码（比如 740***）；（全市场成交编号 cjbh 为-1,-2,...）成交数量 cjsl 为 T 日申购数量；成交价格 cjig 为 T 日申购价格；成交金额 cjie 为还款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向 bs 为 S。 T+3 日盘后过户文件中包含中记录。证券代码 zqdm 为申购/中签代码（比如 730***）；成交编号 cjbh 指中签号；成交数量 cjsl 指中签数量；成交价格 cjig 指最终确定的发行价格；成交金额 cjie 等于分配数量乘以发行价格；当配号不超过 8 位时，成交时间 cjsj 填写 150000，当成交时间 cjsj 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向 bs 为 B。 <p>ETF 认购返回数据说明：</p> <ul style="list-style-type: none"> T 日盘后过户文件中包含认购扣款记录。证券代码 zqdm 为 ETF 现金认购扣款/还款代码（ETF 代码组第 5 个代码例如 510054）；（全市场成交编号 cjbh 为-1,-2,...）成交数量 cjsl 为申购数量；成交价格 cjig 为申购价格；成交金额 cjie 为扣款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向 bs 为 B 的记录。 	

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<ul style="list-style-type: none"> T+2 日盘后过户文件中包含认购还款记录。证券代码为 ETF 现金认购扣款/还款代码（ETF 代码组第 5 个代码，比如 510054）；（全市场成交编号 cjbh 为 -1,-2,...；）成交数量 cjsl 为 T 日申购数量；成交价格 cjg 为 T 日申购价格；成交金额 cje 为还款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向为 S 的记录。 T+2 日盘后过户文件中包含中签记录。证券代码为 ETF 现金认购申请/中签代码（ETF 代码组第 4 个代码，比如 510053）；成交编号 cjbh 指中签号；成交数量 cjsl 指中签数量；成交价格 cjg 指最终确定的发行价格；成交金额 cje 等于分配数量乘以发行价格；当配号不超过 8 位时，成交时间 cjsj 填写 150000，当成交时间 cjsj 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向 bs 为 B 的记录。 <p>对于不允许重复申报的发行情况，一旦发生重复申报，在发行 T 日的过户库中，会设定重复申报的记录成交编号 cjbh，成交数量 cjsl 为 0，成交金额 cje 为 0.00，申请编号 sqbh 为“重复申报”。</p> <ul style="list-style-type: none"> （4） 网上投票成功后，产生过户记录。证券代码 zqdm 为投票代码；成交编号 cjbh 填写交易所订单编号的后 8 位；成交数量为订单数量；成交价格 cjg 为订单价格；成交金额 cje 为 0；成交时间 cjsj 为 150000。 （5） 可转债转股成功后，产生两条过户记录：卖出债券记录与买入转换后股票记录。为避免与正常的债券或者股票交易的成交编号 cjbh 重复，成交编号 cjbh 从 90000001 开始编号；（这两条过户记录的成交编号相同）成交数量 cjsl 填写持仓变化情况；成交价格 cjg 为 0；成交金额 cje 为 0；成交时间 cjsj 为 150000。 （6） 配股成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 （6） 账户式质押回购入库成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 （7） 账户式质押回购出库成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 （8） ETF 申购成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 （9） ETF 赎回成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 	

序号	字段名	字段描述	类型
1	Gddm	证券账户	C10
2	Gdxm	股东姓名，新交易系统切换后，上交所会将该字段置为空格。请以中国	C8

		证券登记结算有限责任公司发布的数据为准。	
3	Bcrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD	C8
4	Cjbh	成交编号	N8
5	Gsdm	席位号	C5
6	Cjsl	成交数量	N10
7	Bcye	本次余额，新交易系统切换后，该字段被置为 0。	N10
8	zqdm	证券代码	C6
9	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS	C6
10	cjsj	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
11	cjg	成交价格	N8(3)
12	cje	成交金额	N12(2)
13	sqbh	会员内部订单号，同申报接口中的 reff（字段 4：会员内部订单号）。	C10
14	bs	<p>B 普通订单，买卖方向：买入</p> <p>S 普通订单，买卖方向：卖出</p> <p>对于 E 类型帐户的融资融券业务，对应关系如下：</p> <p>1 担保品买入订单，券入投资者信用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为("_XY","B");</p> <p>2 担保品卖出订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为("_XY","S");</p> <p>3 融资买入订单，券入投资者信用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为("_RZ","B");</p> <p>4 卖券还款订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为("_RZ","S");</p> <p>5 买券还券订单，券入证券公司融券专用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为("_RQ","B");</p> <p>6 融券卖出订单，券从证券公司融券专用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为("_RQ","S");</p> <p>7 平仓买入订单，券入证券公司融券专用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为("_PC","B");</p> <p>8 平仓卖出订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为("_PC","S");</p>	C1

15	mjbh	操作员代码	C5
----	------	-------	----

股票发行时，辅助证券代码定义见下表，表格单元中第一行表示对应 600***股票的临时非交易代码，第二行表示对应 601***股票的临时非交易代码。

	新股资金定价 /询价申购 新股东定价/ 询价增发 (摇号中签)	老股东定价 增发(类似 配股)	老股东询价 增发(比例 中签)	股票市值配 售首发	可转债资金申 购
发行申购/中 签代码	730*** 780***	700*** 760***	731*** 781***	737*** 787***	733*** 783***
发行配号代 码	741*** 791***		741*** 791***	747*** 797***	744*** 794***
发行扣款/还 款代码	740*** 790***		740*** 790***		743*** 793***

4.2 证券帐户资料接口 zzhXXXXX.dbf

zzhXXXXX.dbf	证券账户资料接口
描述: 文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。 该文件接口提供指定交易关系数据给参与者，说明指定在席位（PBU）上的证券账户以及当前所处的状态。 该文件按照上交所的运行计划向市场发布，通常是每隔两周发布一次。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gddm	证券帐户	C10
2	gdxm	股东姓名，新交易系统切换后，该字段被置为空格。	C8
3	zhzt	证券帐户状态，‘N’为正常，‘S’为挂起，‘F’为冻结。	C1
4	gsdm	指定席位号	C5
5	qsdm	停用	C5
6	jzrq	截止日期，发送数据生成日期。格式为 YYYYMMDD	C8
7	clbz	处理标志，柜台系统自由使用	C1

4.3 席位联通接口 zxwXXXXXX.dbf

zxwXXXXX.DBF	席位联通接口
描述: 文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。 该接口文件说明席位（PBU）联通圈。在进行指定交易有效性检查时，同一联通圈内的不同席位（PBU）可被视为同一个席位（PBU）。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gsdm	席位号	C5
2	sxwh	联通首席位号	C5
3	qsdm	停用	C5
4	jzrq	截止日期，格式为 YYYYMMDD	C8
5	clbz	处理标志，柜台系统自由使用	C1

4.4 证券权益接口 zqyXXXXXX.dbf

zqyXXXXX.dbf	证券权益接口
描述: 文件名中 XXXXX 表示席位号。只在市值配售进行前一日闭市后发送。 该接口文件说明有关投资者所拥有股票的市值。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gddm	证券帐户	C10
2	zqdm	证券代码，为空	C6
3	zqye	登记日的证券余额，为空	N12
4	qydm	权益代码，为 '799990'，表示市值	C6
5	qymc	权益名称，为空	C10
6	qybl	权益比例，为空	N12(8)
7	qysl	权益数量，为投资者投资者的股票市值除以 1 万再乘以 1 千后的结果。	N12
8	qyjg	权益价格，为空	N8(3)
9	gsdm	指定席位号（PBU）	C5

10	qsdm	停用	C5
11	djrq	权益登记日期，为空	C8
12	clbz	处理标志，柜台系统自由使用	C1

5 广播文件接口规范

广播文件指全市场均相同的文件，通常是公开信息。该章节描述文件均通过单向卫星信道传送。

5.1 上市公司公告文件

MMDDfNNN.txt, MMDDzNNN.txt, SSSSSS_YYYYMMDD_XXX.pdf	上市公司公告文件
描述： 转发上证信息公司文件。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期，NNN 表示序列号，SSSSSS 表示证券代码，YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。开市前发送。	

5.2 债券信息公告文件 biYYMMDD.txt

biYYMMDD.txt	国债利息接口
描述： 转发上证信息公司文件。文件名中 YYMMDD 表示月日格式的日期，其中 YY 为年的后 2 位。 开市前发送。 该接口文件说明债券公开信息。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	债券证券代码	债券证券代码	C6
2	债券名称	债券名称	C8
3	债券发行日	YYYYMMDD	C8
4	本次付息起息日	YYYYMMDD	C8
5	上次派息日	YYYYMMDD	C8
6	预计下次派息日	YYYYMMDD	C8
7	兑付日期	YYYYMMDD	C8
8	票面利率	YYYYMMDD	N4(3)
9	年计息天数		N3
10	债券简短描述	说明按半年付息或者按年付息等信息	C20
11	发行价		N6(3)
12	债券面值		N6(3)
13	发行总数量		N20
14	发行人		C100
15	日计息基准		N7(5)

16	年派息次数		N1
----	-------	--	----

5.3 国债利息接口 gzlx.MDD

gzlx.MDD	国债利息接口
描述: 转发中登上海分公司 gzlxYYYYMMDD001.txt, 并重新命名, 转换为 DBF 格式。当 10 月份时, M 为 'a'; 11 月份时, M 为 'b'; 12 月份时, M 为 'c'; DD 为日期。开市前发送。 该接口文件说明国债应计利息。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gzdm	国债证券代码	C6
2	jxrq	计息日期	C8
3	yjlx	每百元应计利息额	N15(8)
4	lxts	利息天数	N6
5	pmll	票面利率	N8(5)

5.4 债券标准券折算率变更接口 zsIMMDD.txt

zsIMMDD.txt	席位式质押回购债券标准券折算率接口
描述: 转发中登上海分公司 bzqz1YYYYMMDD001.txt, 并重新命名。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。开市前发送。 该接口文件说明债券品种在折算率启用日期所在星期开始适用的债券标准券折算率。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	债券证券代码	债券证券代码	C6
2	债券名称	债券名称	C20
3	标准券折算率	标准券折算率	N15
4	开始适用日	YYYYMMDD	C8
5	结束适用日	YYYYMMDD	C8

5.5 债券标准券折算率变更公告文件 zslwMMDD.txt

zslwMMDD.txt	席位式质押回购债券标准券折算率公告文件
描述: 转发中登上海分公司 zsgg1yyyyymmdd001.txt, 并重新命名。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。开市前发送。 该文件为关于发布债券适用的标准券折算率通知的文本文件。 若为债券标准券折算率计算日,则发送调整后的债券折算率; 若当日有新上市债券的折算率数据或非计算日但需调整债券折算率, 则发送新上市债券和调整后的债券折算率数据; 否则, 发送空文件	

5.6 债券标准券折算比率接口 xzsIMMDD.txt

xzsIMMDD.txt	账户式质押回购折算率接口
描述: 转发中登上海分公司 ngzz1YYYYMMDD001.txt, 并重新命名。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。开市前发送。 该接口文件说明债券参加账户式质押回购业务时折算为标准券比例。 字段间用分隔符 ‘ ’ 定位。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	国债证券代码	国债证券代码	C6
2	标准券比例	标准券比例	N15(3)

5.7 ETF 公告文件

50_MMDD.ETF, 180_MMDD.ETF, HL_MMDD.ETF	ETF 公告文件
描述: 转发 ETF 基金管理公司文件并重新命名, 原文件名分别为 ETF50CAMBulletinYYYYMMDD.TXT, ETF180HAFMBulletinYYYYMMDD.TXT, ETFHLAIGBulletinYYYYMMDD.TXT。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。开市前发送。	

5.8 权证信息接口 qzxxMMDD.txt

qzxxMMDD.txt	权证信息接口
描述: 文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。开市前发送。 该接口文件说明权证的相关信息。 字段间用分隔符 ‘ ’ 来定位。 新交易系统切换后, 该文件换行方式为 Unix 方式, 即通过 0x0A 表示换行。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	行权代码	权证行权时使用的证券代码	C6

2	权证代码	权证代码	C6
3	标的证券	权证对应的标的证券	C6
4	权证类型	若为认购权证，则本字段为“认购”；若为认沽权证，则本字段为“认沽”	C4
5	权证余额	当前权证的流通总余额	N17
6	结算方式	若为现金结算，则本字段为“现金”；若为实物结算，则本字段为“实物”	C4
7	行权方式	若为欧式行权，则本字段为“欧式”；若为美式行权，则本字段为“美式”	C4
8	行权结算价格	右对齐，单位：元	N20(9)
9	行权价格	右对齐	N8(3)
10	行权比例	右对齐	N6(3)
11	权证到期日期	格式为 YYYYMMDD	C8
12	结算价使用日期	格式为 YYYYMMDD	C8

5.9 交易公开信息公告文件 jygtkxxMMDD.txt

jygtkxxMMDD.txt	交易公开信息公告文件
描述： 转发上交所信息中心文件。按照交易规则 5.4.1、5.4.2、5.4.3 向全市场公布有关信息。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。闭市后发送。 该文件为文本文件。	

5.10 产品非交易基础信息接口 fjyMMDD.txt

fjyMMDD.txt	产品非交易基础信息接口
描述: 新交易系统切换后, 增加该接口文件。 本文件为与产品相关的非交易基础信息数据。文件名中MMDD 表示月日格式的日期。开市前发送。	

fjyMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
1.	上交所证券标识代码	上交所证券标识代码	C12
2.	产品证券代码	产品证券代码	C6
3.	非交易业务类型	非交易业务类型: IN 上网证券发行申购 IE 市值配售证券发行申购 IS 老股东增发证券发行申购 CV 可转债转股 CR 可转债回售 R1 股票配股行权行权 R2 股票转配股配股行权 R3 职工股转配股配股行权 R4 股票配转债行权 OS 开放式基金认购 OC 开放式基金申购 OR 开放式基金赎回 OD 开放式基金分红选择 OT 开放式基金份额转出 OV 开放式基金转换 EC ETF申购 ER ETF赎回	C2

fjyMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
		WE 权证行权 VT 投票 BD 回购入库 BW 回购出库 FS 要约预受 FC 要约撤销	
4.	非交易订单输入开始日期	订单输入开始日期。	8 YYYYMMDD
5.	非交易订单输入结束日期	订单输入结束日期。	8 YYYYMMDD
6.	非交易订单整手数	整手数。指订单的数量必须为该字段取值的整数倍。	N10(3)
7.	非交易订单最小订单数量	非交易订单的最小订单数量。指订单的数量必须比该字段取值大。	N10(3)
8.	非交易订单的最大订单数量	非交易订单的最大订单数量。指订单的数量必须比该字段取值小。	N17(3)
9.	IPO总量	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，发行总量。	N17(3)
10.	IPO分配方法	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，IPO分配方法。 L –摇号抽签 A -竞价分配 P –比例配售	C1
11.	IPO竞价分配或比例配售日期	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，执行竞价分配或比例配售的日期。	8 YYYYMMDD
12.	IPO验资或配号日期	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，进行验资或配号的日期。	8 YYYYMMDD
13.	IPO摇号抽签的日期	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，进行摇号抽签的日期。	8 YYYYMMDD
14.	IPO申购价格区间下限	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，IPO申购价格区间的下限。	N13(5)

fjyMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
15.	IPO申购价格区间上限	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，IPO申购价格区间的上限。	N13(5)
16.	IPO发行价格	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，发行价格。	N13(5)
17.	IPO比例配售比例	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，比例配售的比例。 最小值为0.001；最大值为100.000。	N7(3)
18.	要约价格	当非交易业务类型为FS、FC时，要约预受和撤销的固定价格。	N13(3)
19.	配股股权登记日	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股的股权登记日。	8 YYYYMMDD
20.	配股除权日	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股的除权日。	8 YYYYMMDD
21.	配股比例	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股比例。	N10(6)
22.	配股价格	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股价格。	N13(5)
23.	配股总量	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股总量。	N16(3)

5.11 担保品及标的证券清单接口 dbpMMDD.txt

dbpMMDD.txt	担保品及标的证券清单接口
描述： 文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。融资融券业务启用之后，开市前发送。 该接口文件说明融资融券业务相关证券信息。 字段间用分隔符 ‘ ’ 来定位。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	证券代码		C6
2	对应类别	001：融资、002：融券、003：担保品	C3
3	余额	对应类别为 001 时，表示融资余额； 对应类别为 002 时，表示融券余量；	N15

		对应类别为 003 时，固定为 0;	
--	--	--------------------	--

6 开放式基金数据接口规范

上交所把从中登TA系统返回的开放式基金业务回执和确认文件、开放式基金分红文件、开放式基金对帐文件按照不同的席位(PBU)分解并发送到市场参与者。

历史上把 kyeXXXXX.txt 压缩为 kyeXXXXX.zip，把 kghXXXXX.txt 和 khIXXXXX.txt 压缩为 kghXXXXX.zip 一个文件。新交易系统切换后，kghXXXXX.txt 和 khIXXXXX.txt 分别压缩为 kghXXXXX.zip 和 khIXXXXX.zip。

开放式基金数据接口中使用的数据类型定义如下：

类型	描述
C	字符型
A	数字字符型，限于 0—9（如不够，右补空格）
N	数值型，并可参与数值计算

数据表示与处理规则如下：

- (1) 以文本文件定长记录方式；
- (2) 每行一条完整记录；
- (3) 换行必须用换行（ODH）、回车（OAH）字符；
- (4) 数值型字段（N类）左补零右对齐，字符型字段（C类与A类）右补空格左对齐。
- (5) 字符不区分大小写。
- (6) 带有小数点的数值型数据（N类），传输时不传小数点，小数点在数据字典中指定。数据字典中用 x(y)表示不包括小数点的全长为 x，小数点后位数为 y，而整数则省略掉(0)。

每个开放式基金类文件数据由 3 个部分的内容组成。即标题行(1-14)、文件数据本身(15-21)和文件结束标识(22)。

3 个部分之间没有空行。所有内容均由登记公司提供。如无特别注释，新交易系统不做任何数据改动。

以下是三个部分的描述。

文件组织方式如下：

名称	长度	值	描述
文件标识	8	“OFDCFDAT”	用以标明该文件的格式类型
文件版本号	4	10	1. 0 版本
文件创建人	4	空白	用于标明该文件的提交人

文件接收人	4	空白	用于标明该文件的接收人
日期	8	日期	当天日期
发送人	8	空白	
接收人	8	席位号 XXXXX+空格	
字段数	3	N	标明该数据文件的构成字段数
字段名 1			采用数据字典中的字段名
...			
字段名 N			
记录数	8	M	该数据文件包含的数据记录数， 最多 99999999 条
记录 1			
...			
记录 M			
文件结束标识	8	“OFDCFEND”	文件结束

6.1 开放式基金净值数据接口 kxxMMDD.txt

kxxMMDD.txt	开放式基金净值数据文件接口
描述: 文件名中 MMDD 表示年月日格式的日期。 转发自中登总公司 ofd_99_101_YYYYMMDD_07.txt 文件。开市前发送。	

ID	字段名	描述	类型
63	FundName	基金名称	C40
67	FundCode	基金代码	A6
68	FundStatus	基金状态 0-交易, 1-发行 2-发行成功, 3-发行失败 4-基金停止交易 5-停止申购, 6-停止赎回 7-权益登记, 8-红利发放 9-基金封闭, a-基金终止	C1
86	NAV	基金单位净值	N7(4)
37	CurrencyType	结算币种 156-人民币, 840-美元 344-港元, 954-欧元 392-日元, 826-英镑 250-法郎, 280-马克	A3
82	FundManagerCode	基金管理人	A3
114	RegistrarCode	注册登记人代码	A2
149	UpdateDate	基金信息更改日期, 格式为 YYYYMMDD。	A8
215	CollectFeeType	交易费收取方式 0-价内费 1-价外费	C1
216	NextTradeDate	下一交易日	A8
281	FundIncomeFlag	货币基金万份收益正负	C1

ID	字段名	描述	类型
		0: 正; 1: 负	
	FundIncome	货币基金万份收益率	N8(5)
		货币基金七日年收益正负	
283	YieldFlag	0: 正; 1: 负	C1
	Yield	货币基金七日年收益	N8(5)
	GuaranteedNAV	保本净值	N7(4)

6.2 开放式基金分红数据接口 khXXXXXX.txt

khXXXXXX.txt	开放式基金分红数据文件接口
<p>描述:</p> <p>转发自中登总公司。闭市后发送。</p> <p>红利/红利再投资发放是指基金注册登记人把对投资人发放红利/红利再投资的数据发送给基金销售人。对于冻结份额分红时产生的再投资份额, 若继续冻结, 分红时发送一笔红利再投资记录 and 一笔份额冻结确认记录, 解冻时发送一笔份额解冻记录, 每笔份额解冻记录与原份额冻结记录一一对应。</p> <p>对于货币市场基金, 基金分红不作取整处理。</p> <p>对于非货币市场基金的基金分红, 如果采用红利转投方式, 对于再投资的红利进行份额取整, 取整后的小数份额部分将直接转换成现金退还投资者。</p> <p>对于现金分红方式: $\text{DividenAmount 项} = \text{ConfirmeAmount 项}$ (分红的现金)</p> <p>对于红利转投方式: $\text{DividenAmount 项} = \text{VolOfDividendforReinvestment 项} \times \text{除权日的基金净值} + \text{手续费} + \text{ConfirmAmount 项}$ (应退还投资者的现金)</p>	

ID	字段名	描述	类型	是否必需
67	FundCode	基金代码	A6	Y
136	TAAccountID	投资人基金账号	C12	Y
22	BasisforCalculatingDividend	红利/红利再投资基数, 登记日基金持有人的基金份额	N16(2)	Y
32	TransactionCfmDate	交易确认日期, 格式为:	A8	Y

		YYYYMMDD		
41	VolOfDividendforReinvestment	基金账户红利再投资基金份数，取整处理	N16(2)	Y
42	DividentDate	分红日/发放日	A8	Y
43	DividendAmount	基金账户红利资金，红利总金额,含冻结红利及再投资的红利及份额取整后退还给投资者的部分	N16(2)	Y
46	XRDate	除权日	A8	Y
64	ConfirmedAmount	每笔交易确认金额，实发红利资金，不含冻结红利及再投资的红利。当采用红利再投分红方式时，该项是转投的份额小数部分换算成的现金金额，即份额取整后退还给投资者的部分	N16(2)	Y
113	RegistrationDate	权益登记日期，格式为： YYYYMMDD	A8	Y
119	ReturnCode	交易处理返回代码，取值见附表：TA系统返回代码表	A4	Y
120	TransactionAccountID	投资人基金交易帐号 席位号(5位，前补空格)+账号，席位号由于有一天的差别，未必是现在指定的席位号。	A17	Y
121	DistributorCode	销售人代码 101 代码,表示上海证券交易所市场	A3	Y
135	BusinessCode	业务代码：143	A3	Y
155	DividendPerUnit	单位基金分红金额（含税）	N16(2)	Y
24	DefDividendMethod	默认分红方式，现设置为空	A1	N
52	Charge	手续费	N10(2)	N
53	AgencyFee	代理费	N10(2)	N
59	TotalFrozenVol	基金冻结总份数	N16(2)	N
86	NAV	基金单位净值	N7(4)	N
94	OtherFee1	其他费用 1	N10(2)	N
95	OtherFee2	其他费用 2	N16(2)	N
98	IndividualOrInstitution	个人/机构标志，0-机构，1-个人	A1	N
123	DividendRatio	红利比例	N16(2)	N
137	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A20	N

138	StampDuty	印花稅	N16(2)	N
187	FrozenBalance	冻结金額	N16(2)	N
255	TransferFee	过户費	N10(2)	N
260	ShareClass	收費方式 0-前收費，1-后收費	A1	N
276	FeeCalculator	計費人 0-TA 計費 1-基金計費	A1	N
47	DownLoaddate	交易數據下傳日期 格式為：YYYYMMDD	A8	N
37	CurrencyType	結算幣種 156-人民幣，840-美元 344-港元，954-歐元 392-日元，826-英鎊 250-法郎，280-馬克	A3	Y

6.3 开放式基金帐户对帐数据接口 kyeXXXXX.txt

kyeXXXXX.txt	开放式基金帐户对帐数据文件接口
描述： 转发自中登总公司。闭市后发送。 用于核对投资人持有份额数据。	

ID	字段名	描述	类型
67	FundCode	基金代码	A6
136	TAAccountID	投资人基金帐号 股票交易市场中的证券帐户，左对齐， 后补空格	A12
13	AvailableVol	持有人可用基金份额	N16(2)
18	TotalVolOfDistributorInTA	基金总份数（含冻结）	N16(2)
59	TotalFrozenVol	基金冻结总份数	N16(2)
173	TotalBackendLoad	交易后端收费总额	N16(2)
268	AccountStatus	账户状态	A1

ID	字段名	描述	类型
		0-正常, 1-冻结, 2-挂失	
	UndistributeMonetaryIncome	货币基金未分配收益	N16(2)
	GuaranteedAmount	剩余保本份额	N16(2)

6.4 开放式基金交易确认接口 kghXXXXX.txt

kghXXXXX.txt	开放式基金交易确认文件接口
描述: 该数据文件包含由上交所发送的 T 日业务申请回执和由中登总公司发送的业务申请确认记录及其他业务记录。闭市后发送。 由上交所发送的 T 日业务申请回执中的基金代码采用会员公司发送订单时的采用的非交易代码。 由中国结算发送的业务确认和主动发起的业务中基金代码均为 519*** 代码。	

ID	字段名	描述	类型
8	AppSheetSerialNo	申请单编号, 对于上交所发起的业务和 TA 对于上交所业务申请的确认记录, 是交易流水号(10 位)左对齐, 编号<100000000。 该类数据申请单编号和 T-1 日的业务申请申请单编号一致。 由 TA 发起的冻结、非交易过户等业务, 编号为 TA 流水号	A24
67	FundCode	基金代码	A6
136	TAAccountID	投资人基金账号, 10 位股东账号, 左对齐	C12
32	TransactionCfmDate	交易确认日期, 格式为: YYYYMMDD, TA 确认的日期	A8
62	ConfirmedVol	基金账户交易确认份数	N16(2)
64	ConfirmedAmount	每笔交易确认金额, 为投资者实得金额	N16(2)
92	TransactionDate	交易发生日期, 格式为: YYYYMMDD	A8
132	ApplicationVol	赎回的份数/转托管份数	N16(2)
134	ApplicationAmount	申请金额	N16(2)
135	BusinessCode	业务代码, 取值与含义参见附表: 业务代码与含义表	A3
137	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A20

177	BusinessFinishFlag	业务过程完全结束标识, 0-中间过程 1-业务过程结束	C1
119	ReturnCode	交易处理返回代码 '0000'为成功, 其他出错原因见附表。	A4
16	BackendLoad	每笔交易后端收费	N16(2)
25	DiscountRateOfCommission	销售佣金折扣率 对投资人的总佣金折扣率, 取值为投资人实付佣金/投资人应付佣金	N5(2)
52	Charge	手续费, 总手续费	N10(2)
53	AgencyFee	代理费	N10(2)
138	StampDuty	印花税	N16(2)
193	RateFee	费率, 分段收费考虑	N5(4)
255	TransferFee	过户费	N10(2)
285	HandleCharge	经手费, 上交所收费	N10(2)
94	OtherFee1	其他费用 1	N10(2)
86	NAV	基金单位净值	N7(4)
260	ShareClass	收费方式 0-前收费, 1-后收费	A1
173	TotalBackendLoad	后端收费总额 收费方式为后端收费时使用	N16(2)
263	RedemptionReason	强行赎回原因 0-小于最低持有数, 1-司法执行, 2-政策原因	A1
256	FromTAFlag	是否注册登记人发起业务标志 0-由销售人发起, 1-由注册登记人发起, 此时申请单编号为 TA 的流水号	A1
276	FeeCalculator	计费人 0-TA 计费 1-基金计费	A1
97	TargetDistributorCode	对方销售人代码 参见附表: 销售人代码表	A3

176	TransferDirection	转入/转出标示 0-转入，1-转出	A1
58	FreezingDeadline	冻结截止日期 格式为：YYYYMMDD	A8
60	FrozenCause	冻结原因 0—司法冻结，1-柜台冻结 2-质押冻结， 3-质押&司法冻结，4-柜台&司法冻结	A1
257	FrozenMethod	冻结方式 0-原份额冻结；1-原份额+红股/红利	A1
266	VolumeByInterest	利息产生的基金份额	N10(2)
24	DefDividendMethod	默认分红方式（只在分红申请和确认业务类型中有效） 0—红利转投，1-现金分红	A1
8001	BrokReff	券商自用字段 和申请的 reff 字段一致	C10
37	CurrencyType	结算币种 156-人民币，840-美元 344-港元，954-欧元 392-日元，826-英镑 250-法郎，280-马克	A3
80	LargeRedemptionFlag	巨额赎回处理标志 0-取消，1-顺延	A1
93	TransactionTime	交易发生时间 格式为：HHMMSS	A6
120	TransactionAccountID	投资人基金交易帐号 投资人在销售机构内开设的用于交易的帐号	A17
121	DistributorCode	销售人代码	A3
28	DepositAcct	投资人在销售人处用于交易的资金帐号	C19
29	RegionCode	交易所在地区编号 具体编码依 GB13497-92	A4

47	DownLoaddate	交易数据下传日期 格式为: YYYYMMDD	A8
90	OriginalAppSheetNo	原申请单编号	A24
91	OriginalSubsDate	原申购日期 格式为: YYYYMMDD	A8
98	IndividualOrInstitution	个人/机构标志 0-机构, 1-个人	A1
102	RedemptionDateInAdvance	预约赎回日期 格式为: YYYYMMDD	A8
150	ValidPeriod	交易申请有效天数	N2
89	OriginalSerialNo	TA 的原确认流水号 表示 TA 确认申购的流水号	A20
254	Specification	摘要说明 强行赎回原因	C30
40	DateOfPeriodicSubs	定期定额申购日期 格式为: YYYYMMDD	A8
141	TargetBranchCode	对方网点号 转销售人/机构、非交易过户时使用	A9
142	TargetTransactionAccountID	对方销售人处投资人基金交易帐号 在转销售人是一次完成时, 为必须项	A17
152	TargetRegionCode	对方所在地区编号 具体编码依 GB13497-92	A4
123	DividendRatio	红利比例	N16(2)
76	Interest	基金账户利息金额	N10(2)
133	TradingPrice	交易价格 单位基金净值+各种费用	N7(4)
147	TargetTAAccountID	对方 TA 帐号 转销售人、非交易过户时	A12
139	Tax	税金	N16(2)
162	TargetNAV	目标基金的单位净值	N7(4)
163	TargetFundPrice	目标基金的价格	N7(4)
161	CfmVolOfTargetFund	目标基金的确认份数	N16(2)

194	MinFee	最少收费	N10(2)
95	OtherFee2	其他费用 2	N16(2)
258	OriginalAppDate	原申请日期 用于撤单、解冻时键入原申请日期	A8
264	DetailFlag	数据明细标志 0-汇总；1-明细	C1
262	RedemptionInAdvanceFlag	预约赎回标志 0-非预约赎回 1-预约赎回	A1
261	OriginalCfmDate	TA 的原确认日期 表示 TA 确认申购的日期	A8
34	CodeOfTargetFund	转换时的目标基金代码	A6
55	TotalTransFee	交易确认费用合计	N10(2)
8000	Mark	记录类型 1:上交所给出当日的申报回执 2:TA 返回的确认信息	N2

由上交所当日发送的 T 日业务申请回执只填写了以下有效字段，其他均为空或 0；

ID	字段名	描述	备注
8	AppSheetSerialNo	申请单编号	交易流水号
67	FundCode	基金代码	与柜台申报证券代码一致
92	TransactionDate	交易发生日期	格式为：YYYYMMDD
132	ApplicationVol	份数	赎回时指赎回份数，基金转换时指转换的份数
134	ApplicationAmount	申请金额	认购申购时有效
135	BusinessCode	业务代码	取值与含义参见附表：业务代码与含义表
136	TAAccountID	投资人基金账号	10 位股东账号，左对齐
97	TargetDistributorCode	对方销售人代码	只在转托管时有效
34	CodeOfTargetFund	转换时的目标基金代码	
24	DefDividendMethod	默认分红方式（只在分红申请和确认业务类型中有效）	0—红利转投，1—现金分红
8001	BrokReff	券商自用字段	和申请的 reff 字段一致

8000	Mark	记录类型	‘1’
------	------	------	-----

不同业务有效字段说明如下表：

字段号	订单 确认	认购 确认	申购 确认	赎回 确认	转托管 确认	认购 结果	分红 方式 确认	转换 确认	强增 强减	冻结 确认	解冻 确认	非交易 过户 确认
8	1	1	1	1	1	1	1	1		1	1	1
16				1								
24	1						1					
25		1	1	1		1		1				
32		1	1	1	1		1	1	1	1	1	1
34	1							1				
52		1	1	1	1	1		1	1			1
53		1	1	1	1	1		1				1
58										1		
60		1								1		
62			1	1	1	1		1	1	1	1	1
64		1	1	1		1			1			
67	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
86		1	1	1				1				
92	1	1	1	1	1	1	1	1		1	1	1
94			1	1	1	1			1			
97	1				1							1
119		1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
132	1	1		1	1	1		1		1	1	1
134	1	1	1			1						
135	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
136	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
137		1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
138		1	1	1	1	1			1			1
161								1				
162								1				
163								1				
173				1	1			1	1			1
176		1			1			1	1			1

字段号	订单 确认	认购 确认	申购 确认	赎回 确认	转托管 确认	认购 结果	分红 方式 确认	转换 确认	强增 强减	冻结 确认	解冻 确认	非交易 过户 确认
177			1	1	1							1
193			1	1				1	1			
255		1	1		1			1	1	1	1	1
256		1	1		1		1	1	1			1
257										1		
260		1	1		1	1		1	1	1	1	1
263				1								
266						1						
276		1	1	1	1	1						1
285			1	1	1	1						
8000	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
8001	1	1	1	1	1	1	1	1	1			

6.5 取值附表

6.5.1 基金业务代码与含义表

BusinessCode(135)取值如下表:

类型	业务和其对应的业务代码
交易申请回执	认购申请 (020) 认购申请是投资人在开放式基金募集期间提出购买该开放式基金的申请。
	申购申请 (022) 申购申请是投资人在开放式基金成立之后，在基金存续期间，通过开放式基金的销售人购买基金单位的申请。
	赎回申请 (024) 赎回申请是投资人在开放式基金成立之后，基金存续期间，通过销售人将持有的基金单位按一定价格卖给基金管理人并收回现金的申请。
	转托管转出申请 (028) 转托管转出申请是投资人从证券市场转出的申请。

	<p>设置分红方式申请（029）</p> <p>设置分红方式是指投资人设置其基金账户下所持有某基金的分红处理方式。该业务需要在权益登记日之前提出申请。设置完成后，该基金除权时就以设定的分红处理方式进行处理。</p>
	<p>基金转换申请（036）</p>
交易确认	<p>认购确认(120)</p> <p>认购确认是基金注册登记人对投资人认购申请的接收情况的处理结果。认购确认只有认购确认金额（和认购申请的金额一样）和费用，不含基金确认份数，投资人的实际认购份数，要在该基金募集期满后才能确认。</p>
	<p>申购确认(122)</p> <p>申购确认是基金注册登记人对投资人申购申请的处理结果，包括交易确认份数、交易确认金额等信息。</p>
	<p>赎回确认(124)</p> <p>赎回确认是基金注册登记人对投资人赎回申请的处理结果，包括交易确认份数、交易确认金额等信息。</p>
	<p>转托管转出确认(128)</p> <p>对于转托管转出申报的确认信息。</p>
	<p>设置分红方式确认（129）</p> <p>对于分红方式设置的确认。</p>
	<p>基金转换确认（137 和 138）</p> <p>成功时返回两笔确认，业务代码分别为 137、138 代码, 失败时返回一笔确认，业务代码为 138 代码。</p>
TA 发起的业务	<p>认购结果(130)</p> <p>认购结果是指开放式基金认购成功后，基金注册登记人根据投资人提出的有效认购申请和认购规则，计算出投资人的每一笔认购的确认金额、确认份数、认购费用等数据，该返回数据包含投资人的每一笔认购的确认金额、确认份数、认购费用等数据，其中由于份数记整，实际确认的金额=认购基金份数×发行价格+认购费用等，实际确认的金额≤原认购申请的金额。</p>
	<p>基金份额冻结确认(131)</p> <p>基金份额冻结确认是基金注册登记人对基金份额冻结申请的处理结果。基金份额冻结后不接受除基金份额解冻以外的业务申请。</p>
	<p>基金份额解冻确认(132)</p> <p>基金份额解冻确认是基金注册登记人对基金份额解冻申请的处理结果。基金份额解冻后，对应的基金份额将恢复正常状态。解冻应根据原冻结申请具体情况，逐笔解冻及确认。</p>

	<p>非交易过户转入确认(134)，非交易过户转出确认(135)</p> <p>非交易过户转入确认、非交易过户转出确认是基金注册登记人对投资人非交易过户申请的处理结果。基金注册登记人将处理结果分别发送给该业务涉及的申请方和申请方的对方。</p>
	<p>转托管转入确认（127）</p> <p>从其他市场转入上交所市场的基金份额将通过本确认信息发送相应投资人指定的券商席位。</p>
	<p>认购拉单（190）</p> <p>因认购资金不足引起的拉单处理。</p>
	<p>强行调增(144)，强行调减(145)</p> <p>强行调增/调减是基金注册登记人在某种特定或契约预先规定的情况下，强制性地增加/减少投资人所持基金份额。</p>
	<p>强行赎回（142）</p> <p>强行赎回确认是强行赎回的处理结果。</p>

6.5.2 销售人代码表

DistributorCode(121)、TargetDistributorCode(97)的取值如下表:

销售人	编码
中国工商银行	002
中国农业银行	003
中国银行	004
中国建设银行	005
交通银行	006
上海证券交易所	101
深圳证券交易所	102
国泰基金管理公司	201
南方基金管理公司	202
华夏基金管理公司	203
华安基金管理公司	204
博时基金管理公司	205
鹏华基金管理公司	206
嘉实基金管理公司	207
长盛基金管理公司	208
大成基金管理公司	209
富国基金管理公司	210

6.5.3 返回代码表

ReturnCode(119)取值如下表:

返回代码	含 义
0000	成功
0001	份数余额不足
0002	账户已冻结
0003	账户已挂失
0004	发行期不受理
0005	封闭期不受理
0006	非开放日不受理
0007	收到预约数据确认
0008	巨额不受理
0009	无此账户
0010	其它原因失败
0100	证件号码错误（包括无证件号码）
0101	证件号码重复
0102	地区号无效
0103	业务种类非法
0104	销售人交易基金帐号非法
0105	销售代理人代码错误
0106	无户名
0107	个人/法人标志非法
0108	证件类型非法
0109	无经办人姓名
0110	经办人证件类型非法（包括无经办人证件号码）
0111	经办人证件号码错误
0112	无通讯地址
0113	邮政编码非法（包括无邮政编码）
0114	无电话
0115	无住址电话
0116	无单位电话
0117	开户网点非法
0118	冻结挂失截止日期无效
0119	无 E-MAIL 地址
0120	无法人代表姓名

0121	法人代表证件类型非法
0122	法人身份证件代码非法（包括无法人身份证件代码）
0123	TA 基金帐号非法（包括无 Ta 基金帐号）
0124	密函编号非法（包括无密函编号）
0125	职业代码非法
0126	学历代码无效
0127	年收入代码
0128	性别非法
0129	出生日期非法
0130	传真号码非法
0131	手机号码非法
0132	传呼机号码非法
0133	交收行代码非法
0134	交收行账户名非法
0135	交收行帐号非法
0136	上交所帐号非法
0137	深交所帐号非法
0138	开户日期非法
0139	申请单编号非法（包括无申请单编号）
0140	冻结标志非法
0141	默认分红方式非法
0200	基金代码非法
0201	交易日期非法
0202	交易时间非法
0203	销售人流水号非法
0204	币种代码非法
0205	资金帐号非法
0206	交易数量非法
0207	交易金额非法
0208	对方销售人基金帐号非法
0209	受理日期已变为下一个工作日
0210	对方 TA 帐号非法
0211	过户代理地点代码非法
0212	股东账户代码非法

0213	指定券商席位号非法
0214	预约赎回日期非法
0215	网点号非法
0216	折扣率非法
0217	有效天数非法
0218	原申请单编号非法
0219	巨额赎回处理标志非法
0220	冻结原因非法
0221	对方网点号非法
0222	再投资类型非法
0223	目标基金代码非法
0224	手续费率非法
0225	手续费非法
0226	对方销售人代码非法
0227	原申购日期非法
0228	账户未挂失
0229	账户未冻结
0301	帐户申请日期无效
0302	帐户申请不存在
0303	投资人已注册基金帐户
0304	帐户申请注册失败
0305	赎回份数过小
0306	因投资人未在转入方开户致使转托管失败
0307	持有份数超过持有上限
0308	基金账户已注销
0309	单笔申购低于申购下限
0310	赎回后剩余份数低于持有下限
0311	转出方余额不足
0312	确认异常
0313	投资人名或证件类型或证件代码与股东资料不符
0314	基金账户已挂帐
0315	证券账户不存在
0316	基金账户不存在
0317	基金非认购期
0318	基金非申购期

0319	基金非赎回期
0320	基金禁止转托管
0321	证券账户已注册为基金账户
0322	基金帐户有转托基金的冻结份数能单只基金全部转托管
0323	有在途份数，不能全转托管
0324	转出方余额为零
0325	原申请日期无效
0326	转入转出是同一代理人
0327	销售代理人不能代理此基金
0328	销售代理人无效
0329	性别代码无效
0330	申请日期无效
0331	投资人名无效
0332	投资人证件类型无效
0333	投资人证件号码无效
0334	通讯地址无效
0335	法人代表姓名无效
0336	经办人姓名无效
0337	单笔认购低于认购下限
0338	单笔认购高于认购上限
0339	基金处于权益分配期间，不允许更改分红方式
0340	单笔赎回高于预约下限
0341	单笔赎回低于赎回下限
0342	取基金信息错误
0343	写权益登记错误
0344	写基金明细表出错
0345	撤单申请无效
0346	转托管类型错
0347	转托管类型与申报数据不符
0348	旧基金帐号个人资料不存在
0349	旧基金帐号机构资料不存在
0350	无效分红方式
0351	该基金帐号有份数允许注销
0352	赎回金额不足以支付手续费
0353	证券账户类型非法

0354	同一网点申报相同数据
0355	管理人拒绝
0356	管理人配售确认撤销
0357	认购金额过少
0358	经办人识别方式非法
0359	CALLCENTER 交易标志非法
0360	INTERNET 交易标志非法
0361	账单寄送选择方式非法
0362	有基金份额，销户非法
0363	基金账号信息未作改动, 拒绝申请
0364	TA 基金账号凭证号非法
0365	有当日申请，销户非法
0366	基金净值非法
0367	转托管中转出与转入交易账户的基金账户不同
0368	基金不能转入
0369	基金不能转出
0370	持有份数小于最低持有份数, 应全部赎回或转换
0371	税率非法
0372	分红方案错误
0373	基金发行失败，退回认购
0374	该预约赎回单已失效
0375	手续费分成非法
0376	基金终止
0377	基金不在发行期或认购结束，认购不受理
0378	基金在正常交易期
0379	基金已发行或发行失败
0380	基金停止交易
0381	基金停止申购
0382	基金停止赎回
0383	基金正在权益登记
0384	红利发放，业务不受理
0385	无法识别的基金状态
0386	非交易过户对方账号未登记
0387	本日有冻结、挂失申请，交易无效
0388	一天仅接受一次重要资料修改

0389	分红期间有在途权益，不能处理
0390	基金帐号已登记
0391	基金帐号未登记
0392	该交易账号已开户
0393	有重复的冻结申请
0394	非交易过户必须逐笔确认
0395	交易后，入方余额低于最低限制
0396	交易后，出方余额低于最低限制
0397	基金转换对方基金停止交易
0398	基金无份数可冻结解冻
0399	无此冻结申请
0400	解冻份数与原冻结数不匹配
0401	超过最高赎回份数限制
0402	申购金额低于手续费
0403	总份额已超过募集金额，不能再认购
0404	按份数认购，金额计算错误
0405	不允许机构认购
0406	不允许个人认购
0407	逐笔人工处理为无效
0408	逐笔人工处理为成功
0409	已撤单
0410	巨额赎回延续部分
0411	重复开户
0412	不支持预约申请
0413	有份数冻结，不允许账户冻结
0414	没有指定赎回的基金份数
0415	小于初次投资金额限制
0416	小于追加投资限制
0417	转托管对方销售商或网点不存在
0418	不能修改客户类型
0419	重要资料修改当天不能赎回转托管
0420	申请日期大于最后认购日期
0421	巨额赎回，不能基金转换
0422	当天多次开户(交易帐号重)
0423	当天多次开户(基金帐号重)

0424	不存在要转出的份数
0425	经办人识别方式非法
0426	帐单寄送选择方式非法
0427	基金帐号信息未作改动, 拒绝申请
0428	持有份数小于最低持有份数, 应全部赎回或转换
0429	分红方案错误
0430	该预约赎回单已失效
0431	持有份数小于等于最低赎回份数, 应全部赎回或转换
0432	基金在个人认购期, 不接受机构认购
0433	基金在机构认购期, 不接受个人认购
0434	认购金额小于机构最低认购金额
0435	认购申请金额小于个人最低认购金额
0436	认购金额大于机构最高认购金额
0437	认购申请金额大于个人最高认购金额
0438	基金处于不允许申购状态
0439	申购申请金额小于机构最低追加投资金额
0440	申购申请金额小于个人最低追加投资金额
0441	申购申请金额小于机构最低首次投资金额
0442	申购申请金额小于个人最低首次投资金额
0443	定时定额申购申请金额小于最低定额
0444	定时定额申购申请金额超出最低定额部分不是级差的整数倍
0445	定时定额申购合约终止
0446	定时定额申购金额与原合约不符
0447	持有份数大于最低赎回份数, 申请赎回份数不小于最低赎回份数
0448	****柜员登录注销错误****
0449	柜员代码不能为空
0450	没有此柜员
0451	此柜员已被冻结
0452	此柜员已被删除
0453	柜员密码不符
0454	此柜员已经登录系统;或者此前非正常退出系统, 请与系统管理员联系
0455	登录柜员记录出现异常, 请与系统管理员联系
0456	注销柜员状态出现异常, 请与系统管理员联系
0457	操作员过期

0458	****柜员管理类错误****
0459	柜员代码长度必须为 3 位
0460	此柜员代码已经存在
0461	柜员姓名不能为空
0462	存在同名的有效柜员，系统不允许姓名重复
0463	柜员密码不能为空
0464	柜员所属部门不能为空
0465	有效天数必须是大于 0 的整数
0466	起始日期不能为空
0467	确认密码不能为空
0468	组代码不能为空
0469	组的成员已经存在
0470	权限代码不能为空
0471	组的权限已经存在
0472	柜员的权限已经存在
0473	组名称不能为空
0474	此组已经存在
0475	柜员角色不能为空
0476	组非空不能删除
0477	组的成员不存在
0478	组的权限不存在
0479	根用户不能删除
0480	操作员代码不能为空
0481	没有此组
0482	此柜员代码不存在
0483	确认密码不正确
0484	修改柜员资料时柜员状态不允许被设置为"删除"
0485	柜员已被删除，操作被禁止
0486	柜员处于活动状态，操作被禁止
0487	交易密码错误
0488	交易帐号凭证号错误
0489	交易帐户处于等待确认状态
0490	交易帐户已挂失
0491	确认密码不正确
0492	基金帐户处于等待确认状态

0493	当天有帐户申请
0494	当天有交易申请
0495	案号非法
0496	该交易申请已经提交
0497	定时定额申购日期非法
0498	定时定额申购类型错误
0499	定时定额申购状态非法
0500	该定时定额申购已完成
0501	该定时定额申购已撤单
0502	该定时定额申购已撤消
0503	定时定额申请不存在或其它数据库错误
0504	解冻份数大于已冻结份数
0505	在同一工作日同一投资者有相同的更改基金分红方式申请
0506	交易帐户已作废
0507	交易帐户凭证号状态错误
0508	交易帐户已销户
0509	交易帐户已冻结
0510	交易帐户已撤销
0511	交易帐户待确认
0512	交易帐户未开基金帐户
0513	基金帐户挂失
0514	基金帐户冻结
0515	基金帐户销户
0516	转托管对方机构代码与发起机构代码相同
0517	基金转换转出基金与目标基金相同
0518	交易帐户与基金帐户不匹配
0519	禁止此模式基金转换
0520	存在逆向基金转换
0521	无要复核的申请合同号
0522	要复核的合同号不属于本机构
0523	要复核的合同号不属于本网点
0524	要复核的合同号业务类型不一致
0525	复核人员与受理人员相同
0526	要复核的合同号已复核
0527	要复核的合同号已作废

0528	要复核的合同号已撤单
0529	复核流水的基金代码不对
0530	复核流水的申请金额不对
0531	复核流水的交易帐号不对
0532	写更改申请流水的复核标志失败
0533	复核流水的操作员代码不对
0534	复核流水的申请份数不对
0535	复核流水的巨额赎回处理方式不对
0536	复核流水的对方机构代码不对
0537	复核流水的转换目标基金代码不对
0538	复核流水的申请费用不对
0539	复核流水的分红方式不对
0540	复核流水的分红比例不对
0541	无此交易码
0542	该操作现不可用
0543	该申请已撤单
0544	该申请已作废
0545	该申请还未复核
0546	电话委托受理业务不能通过柜面撤单
0547	该申请已复核
0548	系统通用参数查询失败
0549	查询表单列值信息失败
0550	查询报表输出固定数据配置信息失败
0551	查询表单输入条件的配置信息失败
0552	未定义的表单查询
0553	查询表单数据集信息失败
0554	请选择输入查询表单号
0555	未定义的查询类别
0556	查询表单数据集信息失败
0557	取申请帐页失败
0558	发布日期不能为空
0559	利率生效时间非法
0560	利率非法
0561	利息税率非法
0562	实施时间不能为空

0563	最小手续费比率不能小于 0
0564	最大手续费比率不能大于 1
0565	最小手续费比率不能大于最大手续费比率
0566	TA 手续费分成比率不能为空
0567	此业务不能设置进入基金资产手续费比率
0568	手续费分成比率不能大于最小手续费比率
0569	手续费分成比率不能小于 0
0570	权益登记日非法
0571	除权日非法
0572	派息日非法
0573	利得比例不能为空
0574	利得比例必须在 0, 1 之间
0575	分红方案编码非法
0576	费率方案编号不能为空
0577	手续费计算方案起始时间非法
0578	基金名称不能为空
0579	基金状态非法
0580	基金转换状态非法
0581	基金认购价格非法
0582	费率方案不完整
0583	存在未确认记录,不能提交
0584	此操作员未输入费率方案, 不能输入费率
0585	金额非法
0586	持有天数非法
0587	手续费率段重叠
0588	此操作员未输入费率方案, 不能删除费率
0589	基金帐户受理方式不能为空
0590	不存在的基金帐户受理方式
0591	到帐情况不能为空
0592	证件唯一性不能为空
0593	系统状态不能为空
0594	强行签退时间不能为空
0595	强行签退持续时间不能为空
0596	强行签退持续时间不能小于 0
0597	基金净值路径不能为空

0598	销售点代码不能为空
0599	清算日期不能为空
0600	工作日期不能为空
0601	巨额赎回比例不能为空
0602	巨额赎回比例必须在 0-1 之间
0603	未知的系统参数
0604	定时定额申购日期不能为空
0605	按定时定额申购日期错
0606	印花税率非法
0607	审批日期不能为空
0608	审批人不能为空
0609	审批数量不能为空
0610	审批数量不能小于 0
0611	批准的基金转换份数应小于等于基金总份数
0612	待确认的记录超过一条
0613	确认审批内容与第一次输入内容不符
0614	不支持的基金发行方案
0615	待确认的基金发行记录超过一条
0616	到款日期不能为空
0617	预售规模不能为空
0618	预售规模不能小于 0
0619	认购价格不能小于 0
0620	****销售机构设置
0621	销售机构接收目录不能为空
0622	销售机构发送目录不存在
0623	销售机构接收目录不能为空
0624	销售机构接收目录不存在
0625	销售机构代码不能为空
0626	销售机构名称不能为空
0627	销售机构状态不能为空
0628	销售机构类型不能为空
0629	销售机构接受目录长度大于 120
0630	销售机构发送目录长度大于 120
0631	网点代码不能为空
0632	网点名称不能为空

0633	区域代码不能为空
0634	区域代码不存在
0635	银行名称不能为空
0636	银行状态不能为空
0637	公告状态不能为空
0638	公告已输入,未复核
0639	公告已复核成功
0640	未定义的公告状态
0641	此公告不存在
0642	公告标题不能为空
0643	公告日期不能为空
0644	公告日期不能比当前日期小
0645	公告内容不能为空
0646	公告类型不能为空
0647	取公告编号流水号失败
0648	操作员相同,不能复核公告
0649	操作员不同,不能修改公告
0650	公告已经发布
0651	公告复核错误
0652	不支持的传输状态
0653	未解上传包
0654	未打包上传包
0655	未解下传包
0656	未打包下传包
0657	包传输状态不存在
0658	第一次输入
0659	第一次删除
0660	第一次修改
0661	未生效
0662	已生效
0663	已实施
0664	未知状态
0665	记录只有一条
0666	记录不存在
0667	记录多于一条

0668	不是本操作员输入,不能修改, 请先清屏
0669	本操作员输入,不能再次输入
0670	不是本操作员输入,不能删除
0671	第二次输入内容与第一次输入内容不符
0672	第二次修改内容与第一次修改内容不符
0673	数据库错误
0674	写日志失败
0675	取交易帐户编号失败
0676	取基金帐户流水号失败
0677	取系统日期失败
0678	存在认购或未完成的赎回申请
0679	清算步骤错误
0680	取系统时间失败
0681	取参数 ACCPTMD(受理方式)的值失败
0682	取交易帐号凭证流水号失败
0683	取销售机构代码失败
0684	存在冻结的基金份额
0685	正在清算, 不能处理到帐操作
0686	存在未审批的巨额赎回
0687	取交易帐号凭证号失败
0688	取交易帐号失败
0689	取交易密码失败
0690	取基金余额失败
0691	更改余额失败
0692	写资金回款流水失败
0693	交易清算类型错误
0694	取清算日失败
0695	修改投资者基金分红信息失败
0696	取市场标志失败
0697	市场标志错误
0698	现为收市状态, 还未日初, 不能进行业务受理
0699	现为日终状态, 还未日初, 不能进行业务受理
0700	系统步骤错误
0701	取市场状态描述错误
0702	设置市场状态错误

0703	设置下一工作日错误
0704	生成工作日表错误
0705	系统日初错误
0706	系统日终错误
0707	设置上一工作日错误
0708	取收市处理状态失败
0709	收市处理步骤错误
0710	取收市处理状态描述失败
0711	设置收市处理状态失败
0712	收市初始化错误
0713	收市复核错误
0714	收市写帐页错误
0715	取系统状态失败
0716	取系统状态描述失败
0717	设置系统状态失败
0718	系统当前状态不允许操作
0719	取清算处理状态失败
0720	清算处理步骤错误
0721	取清算处理状态描述失败
0722	设置清算处理状态失败
0723	清算初始化错误
0724	清算数据备份错误
0725	清算数据恢复错误
0726	帐户清算错误
0727	交易清算错误
0728	清算复核错误
0729	清算结束错误
0730	预清算错误
0731	清算数据汇总错误
0732	审批赎回份数大于允许的最大审批份数
0733	审批申购份数大于允许的最大审批份数
0734	基金未发生巨额或超规模不用进行审批
0735	基金发生巨额或超规模请进行审批
0736	取募集期日处理状态失败
0737	募集期日处理步骤错误

0738	取募集期日处理状态描述失败
0739	设置募集期日处理状态失败
0740	募集期日处理初始化错误
0741	募集期日处理数据备份错误
0742	募集期日处理数据检查错误
0743	募集期日处理当日有效认购统计错误
0744	募集期日处理错误
0745	募集期日处理发行统计错误
0746	募集期日处理数据汇总错误
0747	募集期日处理复核开始错误
0748	募集期日处理复核结束错误
0749	募集期日处理数据恢复错误
0750	募集期日处理结束错误
0751	基金认购费率未设置或无有效费率
0752	基金交易费率未设置或无有效费率
0753	基金 NAV 值未设置或无有效 NAV 值
0754	没有基金可进行募集处理
0755	取发行处理状态失败
0756	发行处理步骤错误
0757	取发行处理状态描述失败
0758	设置发行处理状态失败
0759	发行处理初始化错误
0760	发行处理数据备份错误
0761	发行处理错误
0762	发行处理复核开始错误
0763	发行处理复核结束错误
0764	发行处理数据恢复错误
0765	发行处理结束错误
0766	发行预处理错误
0767	计算发行利息错误
0768	发行失败处理错误
0769	发行成功处理错误
0770	利率未设置或不存在
0771	没有基金可进行发行处理
0772	分红方案非法

0773	分红方案状态错误
0774	取投资者分红信息错误
0775	计算投资者分红权益错误
0776	权益登记错误
0777	红利发放错误
0778	红利统计错误
0779	统计认购清算确认数据错误
0780	统计认购数据(给核算)错误
0781	统计发行确认数据错误
0782	统计发行确认数据(给核算)错误
0783	汇总业务申请数据错误
0784	汇总业务确认数据错误
0785	汇总统计固定收费错误
0786	读数据库失败, 请查看错误日志
0787	写数据库错误, 请查看错误日志
0788	数据操作失败, 请查看系统日志
0789	写交易申请流水失败
0790	写帐页失败
0791	数据历史备份与清除失败
0792	按申请编号检查申请数据错误
0793	按基金状态检查申请数据错误
0794	按申请数量检查申请数据错误
0795	写确认流水错误
0796	累计投资者认购金额错误
0797	写认购队列错误
0798	更改申请流水处理状态错误
0799	系统错误
0900~0999	自定义返回代码

7 附录：营业部代码换码算法示例

```
BOOL branchid2ReffPrefix(char *branchid, char *reff)
{
    int x,m,n,p,q;
    char temp[2];

    x = atoi(branchid);

    if ( x<1000 || x>4843 ) return FALSE;

    m = ( x - 1000 ) / 62;
    n = ( x - 1000 ) % 62;

    if ( m>=0 && m<=9 ) p = m+48;
    else if ( m >=10 && m<=35) p = m+55;
    else if ( m >=36 && m<=61) p = m+61;

    if ( n>=0 && n<=9 ) q = n+48;
    else if ( n >=10 && n<=35) q = n+55;
    else if ( n >=36 && n<=61) q = n+61;

    temp[0] = p;
    temp[1] = q;

    memcpy(reff,temp,2);

    return TRUE;
}
```

```
BOOL reffPrefix2Branchid(char *reff, char *branchid)
{
    int x=0,m=0,n=0,p=0,q=0;

    p = *reff;
    q = *(reff+1);

    if (p>=97 && p<=122) m = p-61;
    else if (p>=65 && p<=90) m = p-55;
    else if (p>=48 && p<=57) m = p-48;
```

```
    if (q>=97 && q<=122) n = q-61;
    else if (q>=65 && q<=90) n = q-55;
    else if (q>=48 && q<=57) n = q-48;

    if (m==0 || n==0) return 2;
    x = m*62 + n + 1000;

    sprintf(branchid, "%d", x);
    return TRUE;
}
```

8 附录：申报确认接口 remark 字段取值说明

错误代码	含义
202	无效操作员代码
203	无效证券代码
204	申报时间为该证券的非交易时间
208	无效买卖标志，非 ‘B’或者 ‘S’
209	交易品种不对
211	此账号不能进行该证券交易
212	价格申报出错
213	证券已被挂起
214	该股票不参与集合竞价
215	无效帐号
216	该帐号未指定在你席位
217	帐号已被挂起
218	无效申报价格
219	申报价不能为零
220	申报价格不符合最小价格步长要求
222	申报价格超出范围
223	申报买入数量必须是 1000 的整数倍
224	无效的申报数量
225	申报数量必须大于 0
226	新股申报数量至少 1000
227	申报数量不符合最小步长要求
228	申报数量超过单笔最大允许申报的上限
231	账号可卖出的余额不足
234	股票持有量超出限量
236	PBU 没有买入权限
237	PBU 没有卖出权限
243	基金帐号\机构帐号不能买卖此证券
244	'S'帐号不能买入
245	不能撤销指定（有卖空股票，请先补回卖空股票）
246	不能撤销指定（有申报）
247	不能撤销指定（公司卖空）
248	中国证券登记结算公司不允许撤销指定
250	B 股结算会员代码（数据库接口中的 firmid）错，可从中登公司上海分公司查询。

252	无效操作员代码
253	操作员权限不够
257	操作员申报的 rec_num 序号不连续
263	市价订单不参加集合竞价
264	最优五档即时成交剩余撤销市价订单对手方无未成交订单
265	最优五档即时成交剩余转限价市价订单对手方和本方均无未成交订单
266	该券种不允许做市价订单
267	帐户没有权限进行帐户式质押回购的交易及出入库
268	场内报盘对于出入库申报的统一出错代码
269	申报类型错误
270	申报类型错误
271	该帐号已指定在你席位
272	未做指定不能交易
273	E 帐号不能通过场内申报进行交易
274	信用交易的申报帐户必须是 E 帐户
275	普通交易的申报帐户必须不是 E 帐户
276	该证券不允许担保品买入
277	信用卖出权限不足
278	该证券不允许融资买入
279	卖券还款或融资平仓权限不足
280	买券还券或融券平仓权限不足
281	该证券不允许融券卖出
282	融券卖出申报价格低于最新成交价
283	买券还券、融券卖出、融券平仓申报的信用帐户必须配置证券公司融券专用帐户
401	无效操作员代码
403	无效申报序号
404	撤单对应申报序号检验失败
405	撤单对应的证券帐号检验失败
406	撤单对应的股票代码检验失败
407	撤单对应的买卖方向检验失败
408	对应的申报已经被撤单
409	只能通过买 799998 撤销指定
410	只能通过买 799999 重新指定
411	对应的申报已成交，不能撤单
412	不允许撤单

413	撤单失败,对应的申报已成交或者已经被撤单
499	无申报可撤
731	基金公司未上传 ETF 申购赎回清单
732	ETF 状态不对
733	ETF 投资者持股不足
734	ETF 现金替代比例超过基金公司规定的比例
735	ETF 基金账号持股余额不足, 投资者不能赎回
736	ETF 基金账户不能申购或赎回
752	账户中没有现券
753	账户中现券余额不足
754	账户中没有标准券
755	账户中标准券余额不足
756	账户没有质押券
757	账户的质押券余额不足
758	标准券折算率未初始化
759	标准券代码不存在
1005	登录主机失败
1021	rec_num 必须连续递增
1022	股票代码错误或者非本市场产品
1023	账号错误
1024	买卖方向错误
1025	价格错误
1026	数量错误
1027	日期错误
1028	申报单或撤消单的标志错误
1029	结算会员代码错误
1030	撤消单的 ordrec 域错误
1031	撤消单的 ordrec 域大于等于撤消单的 rec_num 域
1034	撤消的申报单是失败的数据单
1039	刚读入待处理的单子的 status 是' P'或' p'
1040	刚读入待处理的单子的 status 不是' R', 也不是' P'
1042	底层通讯接收时发生错
1043	接收到的数据包内容错误
1050	撤消的申报单不存在或者撤单申报的证券代码错误
1100	申报号太大

1101	记录不匹配
2000	与交易所的网络连接出错
2001	被撤单的日子不是今天
2004	被撤单的帐号不是本人
2006	撤单记录中被撤单的股票代码与被撤单不一致
2007	撤单记录中被撤单的股票价格不正确，与被撤单不一致
2008	只有申报才可被撤单
2101	撤单记录和被撤单记录的股票买卖方向不同
2102	撤单记录和被撤单记录的股票数量不同
10000	内部错误，请联系上交所
10100	无效的产品子类型
10252	该交易时段内禁用该功能
10262	融券卖出不允许申报市价订单
10508	PBU 状态为停止状态
10512	PBU 交易标识为未激活（暂停状态，权限不足）
10516	交易员处于不活动状态
10708	投资者帐户类型对该产品无效
10796	该帐户类型不允许指定
10804	该帐号已指定在其它席位
10806	该帐户类型不允许撤销指定
10930	不正确的市场状态
10932	该交易时段内禁用该功能
11034	该产品此非交易类型业务今日不开放
11038	无效的分红选择
11040	无效的转托管来源或目的
11068	该 PBU 无权限交易此产品
11080	投资者对该产品没有买权限
11082	投资者对该产品没有卖权限
11128	投资者无此非交易类型业务权限
11130	该产品此非交易类型业务已经被暂停
11150	无效的转换基金
11152	正在进行撤销指定（可能发生在联通 PBU 对该帐户进行撤销指定的同时，本 PBU 进行订单输入的场景；也可能发生在先输入一笔普通交易，然后输入一笔该帐户撤销指定交易的场景）

11166	该帐号已指定在其它席位
11218	不正确的信用标签类型
11236	该PBU无融资买入权限
11238	该PBU无融券卖出权限
11240	集合竞价最后五分钟不允许删除订单
11266	投资者无此类型产品买权限
11268	投资者无此类型产品卖权限
13304	产品未到上市日
13338	无效的订单类型和产品组合
13360	不能在集合竞价时输入国债分销买单
13398	禁止限价订单交易
13440	该证券不允许买券还券或融券平仓
13448	该证券不允许进行担保品卖出/卖券还款/平仓卖出