

上海证券交易所技术文档



综合业务平台
大宗交易市场参与者
接口规格说明书

(1.00 技术准备参考版)



上海证券交易所

二〇一一年二月

《大宗交易市场参与者接口规格说明书》1.00 版发布说明

上交所大宗交易系统采用远程数据交互模式，以电子交易方式受理大宗交易意向报价发布和成交申报发布，并向市场发布意向和成交信息。一般的操作流程是交易用户首先进行意向报价发布，然后转成交申报发布，也可以直接进行成交申报发布，对于意向报价、或未成交的成交申报，可以进行撤单操作。大宗交易市场参与者接口使用 SQL 数据库接口，包括申报接口表、成交确认表、公共数据表。

交易用户通过大宗交易系统进行报价应当保证真实有效，买卖行为应当符合《上海证券交易所交易规则》的有关规定。

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

目录

1 数据格式约定	4
2 交易中数据库接口规范	5
2.1公共数据表 PubData	5
2.2请求及响应接口表 ReqResp	5
2.3执行报告表 ExecReport	7
3 交易中 STEP 消息文本规范	8
3.1消息文本结构	8
3.2公共数据消息	9
3.3意向申报消息/意向申报撤单消息	10
3.4意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息	11
3.5成交申报消息	12
3.6成交申报撤单消息	14
3.7成交申报响应消息	16
3.8成交申报撤单成功响应消息	17
3.9成交申报撤单失败响应消息	18
3.10执行报告消息	19
4 交易后数据接口规范	22
4.1成交明细接口 CJMXxxxxxYYYYMMDD001.dbf	22
5 后记	24

1 数据格式约定

该文档中描述文件遵循 DBF 文件有关定义，采用特殊的文件头结构与记录行结构,且遵循以下约定：

（一）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。

（二）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。

（三）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，整数部分最多不超过 **X-Y-1** 位，小数部分最多不超过 **Y** 位。带浮点的数字型字段包括小数位，如：**123.00000** 显示为 **123.00000**；

该文档关于消息包构建和解析方法，可参考金融行业标准《证券交易数据交换协议》（简称“STEP”）1.00 版或 FIX 标准 4.4 版。

2 交易中数据库接口规范

本部分描述了市场参与者系统同上交所综合业务平台大宗交易系统之间的实时接口，通过数据库实现数据实时交换。

2.1 公共数据表 PubData

PubData	公共数据表
描述： 公共数据由交易所后台向市场参与者单向发送。上交所报盘机在接收到后台发送的意向申报之后，写入到接口数据库表中。市场参与者系统可以从该表读取市场的意向申报。 上交所报盘机程序访问该表时，主要通过 PubNum 字段进行定位，故必须以 PubNum 为 Key 建立索引，或者作为主键。	

字段名	字段描述	类型
PubNum	公共数据记录编号，一般为递增，不代表交易所发布消息的顺序。	4 字节 Integer
SetID	产品集编号	C5
SeqNum	产品集序号	N10
TimeStamp	记录写入时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS:000	C21
MDText	消息文本，STEP 格式封装的市场意向申报数据（对应 IOI 消息 /MsgType=6 其中包含每条申报的当前状态），即公共数据，具体参见相关消息规范章节。	C1024

2.2 请求及响应接口表 ReqResp

ReqResp	请求及响应接口表
描述： 本数据库表接口为市场参与者提供一个单一的队列，市场参与者系统将申报数据写入申报接口表，然后由上交所报盘机按序读取接口数据库表中记录，依次发送到后台。后台的确认信息将写入对应记录的确认数据字段。上交所报盘机程序访问该表时，主要通过 ReqNum 字段进行定位，故必须以 ReqNum 为 Key 建立索引，或者作为主键。申报记录中的文本字段为 STEP	

ReqResp	请求及响应接口表
协议封装的文本信息。	

字段名	字段描述	类型
ReqNum	<p>申报请求记录编号，必须连续递增，起始可以不从 1 开始。</p> <p>交易系统不重复处理前台提交的同一个 PBU 同一个证券产品相同 ReqNum 的订单。</p> <p>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，需要在新的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 ReqNum 编号必须超过已经向交易所发出的 ReqNum 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。</p>	4 字节 Integer
ReqID	请求业务类型编号（取值为业务类型，具体待定）	C3
Reff	<p>会员内部编号。</p> <p>对于成交申报，为成交申报会员内部编号 ClOrdID；</p> <p>对于意向申报，为意向申报会员内部编号 IOIID；</p> <p>该字段值与 ReqText 中相关字段重复，向交易所提交的数据以 ReqText 为准，该字段仅供方便市场参与者数据库检索使用。</p>	N10
Pbu	<p>申报 PBU 代码。</p> <p>该字段值与 ReqText 中相关字段重复，向交易所提交的数据以 ReqText 为准，该字段仅供方便市场参与者数据库检索使用。</p>	C6
SecurityID	<p>证券代码</p> <p>该字段值与 ReqText 中相关字段重复，向交易所提交的数据以 ReqText 为准，该字段仅供方便市场参与者数据库检索使用。</p>	C6
TimeStamp	申报请求记录写入时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS:000	C21
OrdStatus	<p>报盘发送状态，'R'表示该记录还没有发送，'F'表示后台判断为废单，'E'表示前台判断为废单，'O'表示上交所成功接收该笔订单或撤单。</p> <p>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，对于</p>	C1

	废单，remark 字段给出错误代码。	
Remark	错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理（取值待定）	C5
ReqText	消息文本，STEP 格式封装的申报数据，包括意向申报（对应 IOI 消息/MsgType=6）、意向申报撤单（对应 IOI 消息/MsgType=6）、成交申报（对应 NewOrder Single 消息/MsgType= D）和成交申报撤单（对应 Order Cancel Request 消息/MsgType=F）	C1024
RespText	消息文本，STEP 格式封装的确认数据，包括意向申报响应（对应 QuoteResponse 消息/ MsgType=AJ）、意向申报撤单响应（对应 QuoteResponse 消息 /MsgType=AJ）、成交申报响应（对应 ExecutionReport 消息 /MsgType=8）和成交申报撤单响应（OrderCancelReject/MsgType=9 表示拒绝，或 ExecutionReport 消息/MsgType=8 表示成功）	C1024

2.3 执行报告表 ExecReport

ExecReport	执行报告表
<p>描述：</p> <p>上交所报盘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>上交所报盘机程序访问该表时，主要通过 ExecNum 字段进行定位，故必须以 ExecNum 为 Key 建立索引，或者作为主键。</p>	

字段名	字段描述	类型
ExecNum	执行报告记录编号，一般为递增，不代表交易所发布消息的顺序。	4 字节 Integer
SetID	产品集编号	C3
SeqNum	产品集序号	N10
TimeStamp	记录写入时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS:000	C21
ExecReport Text	消息文本，STEP 格式封装的成交回报数据（ExecutionReport 消息 /MsgType=8，其中包含执行状态）	C1024

3 交易中 STEP 消息文本规范

本部分描述了市场参与者系统同上交所综合业务平台大宗交易系统之间的接口消息文本格式，对应前面章节数据库接口表中的各消息文本字段，采用 **STEP** 格式封装。

消息文本数据收发图：（待补充）

3.1 消息文本结构

考虑到接口是到基于数据库的消息模式，**STEP** 格式封装由消息头、消息体组成，无消息尾部分。因无 **STEP** 会话层，故对 **STEP** 标准的消息头进行了删减，详见消息头表格。

消息头和消息体均采用依次排列“标签=字段取值<SOH>”的方式组织，消息中字段取值除非特别声明，均以 **ASCII** 码字符串表示，<SOH>为字段界定符，其值为不可打印字符 **ASCII** 码：十六进制的 **0x01**。

如字段值为空，则采用“标签= <SOH>”的方式表示。

为传输数组类的信息，消息支持“重复组”，字段在重复组里多次出现。通常字段名前缀为“No”字符的字段指明出现的次数，并位于重复组的开始处。除重复组内字段外任何其他字段不能多次出现。

消息头定义如下：

标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLength	消息体长度 必须为消息的第二个字段，其值是计算出的消息长度字段后面的字符数，包含界定符<SOH>。	N5
35	MsgType	消息类型 必须为消息的第三个字段 消息类型取值： 6 = 意向申报或意向申报撤单（IOI） 8 = 成交申报响应、成交申报撤单响应（成功）或成交回报（Execution Report）	C4

		9 =成交申报撤单响应（拒绝）（Order Cancel Reject） D =成交申报（NewOrder Single） F =成交申报撤单（Order Cancel Request） AJ=意向申报响应或意向申报撤单响应（QuoteResponse）	
--	--	--	--

3.2 公共数据消息

IOI (MDText)	公共数据消息
描述: 本消息用来发送市场有效时段内的所有的意向申报（包括已成交和撤单的，具体由申报单状态确定），由后台向市场参与者消息单向发送。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为：6=意向申报	
23	IOIID	会员内部编号。 取值为数字，区间为[1, 3999999999]。	N10
28	IOITransType	意向报单类型，取值为：N=意向申报, C=意向申报撤单	C1
26	IOIRefID	撤单编号，对于意向申报该字段取值为空，若为撤单则为被撤原订单的会员内部编号。	N10
48	SecurityID	证券代码	C6
44	Price	价格	N14(5)
38	OrderQty	订单数量	N13(3)
54	Side	买卖方向，取值有： 1 表示买 2 表示卖	N1
453	NoPartyIDs	后接重复组，包含发起方的申报交易单元号，取 1	N2

发起方申报交易单元号	448	Party ID	发起方申报 PBU 代码, 填写 5 位申报交易单元号。	C5
	447	Party IDSource	取 C	C1
	452	Party Role	取 1, 与 PartIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
58	Text		备注, 通常填写联系方式	C50
27	IOIQty		必选字段, 取缺省值 0	N13(3)

3.3 意向申报消息/意向申报撤单消息

IOI (ReqText)	意向申报消息/意向申报撤单消息
描述: 市场参与者使用 IOI 消息进行意向申报或撤单, 对应申报接口表中的 ReqText 字段。 需要注意的是, 综合业务平台采用原始意向申报的申报(业务)交易单元号作为撤单索引字段。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: 6=意向申报或意向申报撤单	
23	IOIID	会员内部编号, 指意向申报或意向申报撤单会员内部编号。 取值为数字, 区间为[1, 3999999999]。	N10
28	IOITransType	意向报单类型, 取值为: N=意向申报, C=意向申报撤单	C1
26	IOIRefID	撤单编号, 对于意向申报该字段取值为空, 若为撤单则为被撤原订单的会员内部编号。	N10
48	SecurityID	证券代码	C6
44	Price	价格	N14(5)
38	OrderQty	订单数量	N13(3)
54	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买, 2 表示卖。	N1

453	NoPartyIDs	参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码、结算代码。	N2
发起方投资者账户	448 PartyID	发起方投资者帐户	C10
	447 PartyIDSource	取 5	C1
	452 PartyRole	取 5，与 PartIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方申报交易单元号	448 PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号，对于意向申报撤单，应为原始成交申报的申报 PBU 代码。	C5
	447 PartyIDSource	取 C	C1
	452 PartyRole	取 1，与 PartIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448 PartyID	发起方营业部代码	C5
	447 PartyIDSource	取 D	C1
	452 PartyRole	取 4001，与 PartIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4
发起方结算代码	448 PartyID	发起方结算代码，用于 B 股，若无填空。	C5
	447 PartyIDSource	取 C	C1
	452 PartyRole	取 4，与 PartIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方结算代码。	N4
58	Text	备注，通常填写联系方式	C50
27	IOIQty	必选字段，取缺省值 0	N13(3)

3.4 意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息

QuoteResponse (RespText)	意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息
描述: 每一个意向申报记录或意向申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。	

QuoteResponse (RespText)	意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息

序号	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: AJ=意向申报响应或意向申报撤单响应。	
693	QuoteRespID	交易所意向申报响应记录标识, 上交所内部使用。	N10
694	QuoteRespType	取值: 2=意向申报响应或意向申报撤单响应, 用于未来扩展。	N1
48	SecurityID	证券代码	C6
23	IOIID	会员内部编号, 该字段对应意向申报消息/意向撤单消息中的 IOIID, 取值为数字, 区间为[1, 3999999999]。	N10
60	TransactTime	接受请求时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
150	ExecType	当前订单执行状态, 取值有: 0=申报成功响应, 8=拒绝响应, 6=申报撤单成功响应。	C1
102	CxlRejReason	意向申报撤单错误信息, 撤消成功时, 该字段取值为空。 撤消失败时, 撤单请求拒绝的理由, 取值同 Remark 字段。	N5
103	OrdRejReason	意向申报错误信息, 供柜台系统读取错误信息, 进行错误处理。 意向申报成功时, 该字段取值为空 意向申报失败时, 表示拒绝的理由, 取值同 Remark 字段。	N5

3.5 成交申报消息

NewOrderSingle (ReqText)	成交申报消息
描述: 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行成交申报, 对应申报接口表中的 ReqText	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: D=成交申报	
11	ClOrdID	会员内部编号, 指成交申报会员内部编号。 取值为数字, 区间为[1, 3999999999]。	N10
40	OrdType	订单类型, 取值: X=大宗交易 (Block Trade)	C1
48	SecurityID	证券代码	C6
44	Price	价格	N14(5)
38	OrderQty	订单数量	N13(3)
54	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买 2 表示卖	N1
60	TransactTime	本地发起时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
664	ConfirmID	约定号	C6
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码、结算代码, 以及对手方 PBU。	N2
发起方投资者账户	448 PartyID	发起方投资者帐户	C10
	447 PartyIDSource	取 5	C1
	452 PartyRole	取 5, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方申报交易单元号	448 PartyID	发起方申报 PBU 代码, 填写 5 位申报交易单元号, 对于成交申报撤单, 应为原始成交申报的申报 PBU 代码。	C5
	447 PartyIDSource	取 C	C1
	452 PartyRole	取 1, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为	N4
已发	448 PartyID	发起方营业部代码	C5

	447	PartyIDSource	取 D	C1
	452	PartyRole	取 4001, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码	N4
	448	PartyID	发起方结算代码	C5
发起方结算代码	447	PartyIDSource	取 C	C1
	452	PartyRole	取 4, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方结算代码	N4
	448	PartyID	对手方 PBU 代码, 填写 5 位申报交易单元号	C5
对手方申报交易单元号	447	PartyIDSource	取 C	C1
	452	PartyRole	取 17, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为对手方申报交易单元号	N4
	58	Text	备注, 通常填写联系方式	C50

3.6 成交申报撤单消息

OrderCancel Request (ReqText)	成交申报撤单消息
描述: 市场参与者使用 OrderCancel Request 消息进行成交申报撤单, 对应申报接口表中的 ReqText 需要注意的是, 为简化会员公司备份切换动作, 综合业务平台采用原始成交申报的申报(业务)交易单元号作为撤单索引字段。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: F=成交申报撤单	
11	ClOrdID	会员内部编号, 指成交申报会员内部编号。 取值为数字, 区间为[1, 3999999999]。	N10
41	OrigClOrdID	原始交易客户方(券商)订单编号, 指示被撤消订单的 ClOrdID	N10
48	SecurityID	证券代码	C6

38	OrderQty	订单数量	N13(3)
54	Side	买卖方向，取值有： 1 表示买 2 表示卖	N1
60	TransactTime	本地发起时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
453	NoPartyIDs	参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码、发起方结算代码，以及对手方申报交易单元号。	N2
发起方投资者帐户	448 PartyID	发起方投资者帐户	C10
	447 PartyIDSource	取 5	C1
	452 PartyRole	取 5，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方申报交易单元号	448 PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号，对于成交申报撤单，应为原始成交申报的申报 PBU 代码。	C5
	447 PartyIDSource	取 C	C1
	452 PartyRole	取 1，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为	N4
发起方营业部代码	448 PartyID	发起方营业部代码	C5
	447 PartyIDSource	取 D	C1
	452 PartyRole	取 4001，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码	N4
发起方结算代码	448 PartyID	发起方结算代码	C5
	447 PartyIDSource	取 C	C1
	452 PartyRole	取 4，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方结算代码	N4
对手方申报交易单元号	448 PartyID	对手方 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号	C5
	447 PartyIDSource	取 C	C1
	452 PartyRole	取 17，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为对手方申报交易单元号	N4

58	Text	备注，通常填写联系方式	C50
----	------	-------------	-----

3.7 成交申报响应消息

ExecutionReport (RespText)	成交申报响应消息
描述: 每一个成交申报记录或成交申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。 150 和 39 组合取值含义: 成交申报成功响应: 150=0, 39=0 拒绝响应: 150=8, 39=8	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: 8=成交申报响应	
37	OrderID	交易所订单编号 取值为数字, 区间为[1, 3999999999]。	N10
150	ExecType	当前订单执行类型, 取值有: 0=成功响应 6=撤单成功 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前订单状态, 取值有: 0=成功响应 6=撤单成功 8=拒绝响应	C1
48	SecurityID	证券代码	C6
11	ClOrdID	会员内部编号。 取值为数字, 区间为[1, 3999999999]。	N10
60	TransactTi	接受请求时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21

	me		
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 申报成功时，该字段取值为空。 申报失败时，表示拒绝的理由，取值同 Remark 字段。	N5
54	Side	买卖方向，取值有： 1 表示买 2 表示卖	N1
17	ExecID	必选字段，取缺省值 0	N10
151	LeavesQty	必选字段，取缺省值 0	N13(3)
14	CumQty	必选字段，取缺省值 0	N13(3)

3.8 成交申报撤单成功响应消息

ExecutionReport (RespText)	成交申报撤单成功响应消息
描述： 每一个成交申报撤单消息都有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理撤单申报后返回的确认信息。 150 和 39 组合取值含义： 成交申报撤单成功响应：150=6,39=6	

标签	字段名	字段描述	类型
	标准消息头	MsgType 取值为：8=成交申报撤消成功响应	
37	OrderID	交易所订单编号 取值为数字，区间为[1, 3999999999]。	N10
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 6=撤单成功	C1
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 6=撤单成功	C1
11	ClOrdID	会员内部编号。	N10

		取值为数字，区间为[1，3999999999]。	
41	OrigClOrdID	原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的 ClOrdID	N10
60	TransactTime	接受请求时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
48	SecurityID	证券代码	C6
54	Side	买卖方向，取值有： 1 表示买 2 表示卖	N1
17	ExecID	必选字段，取缺省值 0	N10
151	LeavesQty	必选字段，取缺省值 0	N13(3)
14	CumQty	必选字段，取缺省值 0	N13(3)

3.9 成交申报撤消失败响应消息

OrderCancelReject (RespText)	成交申报撤单失败响应消息
描述： 每一个成交申报撤单消息都有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理撤单申报后返回的确认信息。	

标签	字段名	字段描述	类型
	标准消息头	MsgType 取值为： 9=成交申报撤消失败响应。	
37	OrderID	交易所订单编号 取值为数字，区间为[1，3999999999]。	N10
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 8=拒绝响应	C1
11	ClOrdID	会员内部编号。 取值为数字，区间为[1，3999999999]。	N10

41	OrigClOrdID	原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的 ClOrdID	N10
60	TransactTime	接受请求时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
102	CxlRejReason	撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同 Remark 字段。	N5
434	CxlRejResponseTo	撤单响应类型，取值： 1=撤单响应	C1

3.10 执行报告消息

ExecutionReport (ExecReportText)	实时执行报告消息
描述： 每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息，该消息文本由成交回报表中的 ExecReportText 字段包含。	

序号	字段名	字段描述	类型
	标准消息头	MsgType 取值为：8=成交回报	
11	ClOrdID	会员内部编号 取值为数字，区间为[1, 3999999999]。	N10
37	OrderID	交易所订单编号 取值为数字，区间为[1, 3999999999]。	N10
17	ExecID	成交编号 取值为数字，区间为[1, 3999999999]。	N10
48	SecurityID	证券代码	C6
31	LastPx	价格	N16(5)
32	LastQty	该笔成交数量	N16(3)
151	LeavesQty	本次剩余余额	N13(3)
54	Side	买卖方向，取值有：	N1

		1 表示买 2 表示卖		
60	TransactTime	订单执行时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21	
42	OrigTime	原有订单请求接收的时间，式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21	
150	ExecType	当前订单执行状态，取值： F=成交	C1	
39	OrdStatus	当前订单状态，取值：1=部分成交，2=已成交	C1	
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值为 10，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码、发起方结算代码，以及对手方的投资者账户、PBU、结算代码。	N2	
发起方投资者帐户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	447	PartyIDSource	取 5	C1
	452	PartyRole	取 5，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号	C5
	447	PartyIDSource	取 C	C1
	452	PartyRole	取 1，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	447	PartyIDSource	取 D	C1
	452	PartyRole	取 4001，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码	N4
发起方结算代码	448	PartyID	发起方结算代码。	C5
	447	PartyIDSource	取 C	C1
	452	PartyRole	取 4，与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为发起方结算代码	N4
对手	448	PartyID	对手方投资者帐户	C10

	447	PartyIDSource	取 5,	C1
	452	PartyRole	取 39, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为对手方投资者帐户	N4
对手方申报交易单元号	448	PartyID	对手方 PBU 代码, 填写 5 位申报交易单元号	C5
	447	PartyIDSource	取 C	C1
	452	PartyRole	取 17, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为对手方申报交易单元号	N4
对手方结算代码	448	PartyID	对手方结算代码。	C5
	447	PartyIDSource	取 C	C1
	452	PartyRole	取 18, 与 PartyIDSource 一起表示当前 PartyID 的取值为对手方结算代码	N4
14	CumQty		必选字段, 取缺省值 0	N13(3)

4 交易后数据接口规范

4.1 成交明细接口 **CJMXxxxxxYYYYMMDD001.dbf**

CJMXxxxxxYYYYMMDD001.dbf	成交明细接口
描述: 文件名中 xxxxx 表示申报交易单元号, YYYYMMDD 为日期。闭市后发送。 压缩后文件名为: CJMXxxxxx.zip	

序号	字段名	字段描述	类型
1	ExecID	成交编号	N10
2	OrderID	交易所订单编号	N10
3	CIOrdID	会员内部编号, 同申报接口中的会员内部编号。	N10
4	Acc	投资者证券账户	C10
5	SecurityID	证券代码	C6
6	LastPx	成交价格	N16(5)
7	LastQty	成交数量	N16(3)
8	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买 2 表示卖	C1
9	TotalValueTraded	成交市值	N16(3)
10	LeavesQty	本次剩余数量	N16(3)
11	Pbu	申报交易单元号	C5
12	TraderID	操作员代码	C5
13	BranchID	营业部代码	C5
14	ClearingFirm	该成交的结算会员代码	C5
15	OrdStatus	订单状态, 取值: 1=部分成交, 2=已成交	C1
16	ReqID	订单业务类型	C3

17	TransactTime	成交日期及时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
18	OrigTime	申报日期及时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
19	ContraAcc	对手方投资者证券账号	N10
20	ContraPbu	对手方 PBU	C5
21	ContraBranchID	对手方营业部代码	C5
22	ContraClearingFirm	对手方结算代码	C5
23	Mark	保留字段	C50

5 后记

上海证券交易所对本文档享有知识产权，未经上海证券交易所书面许可，任何单位和个人不得将本文档用于其他商业目的。

本文档编写过程中，深受证券业界信息技术同仁讨论启发，特此致谢。

对本文档有任何批评指正意见，[请发电子邮件到 spwu@sse.com.cn](mailto:spwu@sse.com.cn) 或者致电 021-68827268。