

市价订单、开放式集合竞价、 融资融券业务技术实施指引

文档状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	1.01
	<input type="checkbox"/> 修改	作 者	技术中心
	<input type="checkbox"/> 发布	部门/厂商	技术中心
	<input type="checkbox"/> 作废	完成日期	2006-7-27

文档摘要

本文档是对上海证券交易所（简称 上证所）近期推出的市价订单、开放式集合竞价、融资融券业务的实施说明，主要侧重于券商系统的接口实施。

为配合上述新业务，上证所对外发布了新的 A 股场外报盘程序[版本号：AwX62(DLL 版本 1.14)]，B 股场外报盘程序[版本号：BwX62(DLL 版本 1.01)]。新版场外报盘程序支持新的交易接口，同时兼容原有的交易接口。

新版场外报盘程序在上证所正式发布启用通知前，仅供新业务测试使用，会员不得擅自将其应用于生产环境下。

特别申明：

- 本指引为技术实施指引，所涉相关业务规定以本所业务规则为准。
- 因使用本指引产生的一切后果，由使用人自行承担。
- 本所保留对本指引的解释与修改权。

联系方式

如开发或测试中，出现问题，可以与上证所技术中心进行联系。

联系电话：4008888400-8004

传真：021-68810883

email： sye@sse.com.cn，ytang@sse.com.cn

目 录

1	市价订单	5
1.1	最优五档即时成交余量自动撤销的市价订单	5
1.1.1	申报要素说明	5
1.1.2	委托应答记录说明	5
1.1.3	撤单申报说明	5
1.1.4	成交回报	5
1.2	最优五档即时成交余量转限价的市价订单	6
1.2.1	申报要素说明	6
1.2.2	委托应答记录说明	6
1.2.3	撤单申报说明	6
1.2.4	成交回报	6
1.3	注意事项	6
1.3.1	新增主机错误代码	6
1.3.2	相关业务问题	6
2	开放式集合竞价	6
2.1	方案说明	6
2.2	计算、发布频率	6
2.3	注意事项	6
3	融资融券业务	6
3.1	方案简述	6
3.1.1	帐户体系	6
3.1.2	担保物及标的证券管理	6
3.1.3	融资融券业务权限管理	6
3.2	融资融券申报及成交回报	6
3.2.1	交易类申报业务	6
3.2.2	非交易类申报业务	6
3.2.3	成交回报说明	6
3.3	融资融券数据报送	6
3.3.1	会员操作指南	6
3.3.2	每日报送数据接口说明	6
3.3.3	每月报送情况说明	6
3.4	交易所信息披露	6
3.4.1	每日向券商发送担保物及标的证券清单	6
3.4.2	交易所网站披露融资融券汇总数据	6
3.5	注意事项	6
3.5.1	新增主机错误代码	6

4	订单标签 OWFLAG 编制说明	6
4.1	编制方法	6
4.2	订单标签(OWFLAG)意义说明	6
4.3	关于报盘程序对接口兼容性的说明	6

1 市价订单

本所交易系统可支持 2 类的市价订单：

- 最优五档即时成交余量自动撤销的市价订单；
- 最优五档即时成交余量转限价的市价订单；

1.1 最优五档即时成交余量自动撤销的市价订单

最优五档即时成交余量自动撤销的市价订单，即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。

1.1.1 申报要素说明

- 委托价格 PRICE：1.00 元；
- 订单类型标志 OWFLAG：参见本文档第 4 章说明；
- 证券代码：可进行市价申报的股票；
- 其他要素与限价订单要素相同。

1.1.2 委托应答记录说明

对于有效的订单，返回确认信息表中 Status 字段值为 W，Teordernum 字段值为空值，Qty2 字段中存放被交易主机自动撤单的数量，申报量若全部成交，则 Qty2 字段值为 0（阿拉伯数字 0）。

若 Status 字段值为 E，表示报盘机判断订单为废单，Remark 字段给出对应的错误代码。

若 Status 字段值为 F，表示交易主机判断订单为废单，Remark 字段给出对应的错误代码。

1.1.3 撤单申报说明

因未撮合成交的余量部分已由交易系统自动撤单，故投资者不须进行撤单申报。

若投资者自行填写撤单申报，则该撤单的委托应答记录中的 Remark 字段会给出对应的错误代码。

1.1.4 成交回报

一笔市价订单所产生的所有成交回报的编号是连续的。

1.2 最优五档即时成交余量转限价的市价订单

最优五档即时成交余量转限价的市价订单，即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申报；如无对手方委托与该申报成交的，则按本方最优报价转为限价申报；如无本方申报的，该市价订单申报作为废单处理。

1.2.1 申报要素说明

- 委托价格 PRICE：1.00 元；
- 订单类型标志 OWFLAG：参见本文档第 4 章说明；
- 证券代码：可进行市价申报的股票；
- 其他要素与限价订单要素相同。

1.2.2 委托应答记录说明

对于有效的订单，返回确认信息表中 Status 字段值为 0（大写字母 O）。余量转限价部分的价格和数量不会通过返回确认信息反馈。

若 Status 字段值为 E，表示报盘机判断订单为废单，Remark 字段给出对应的错误代码。

若 Status 字段值为 F，表示交易主机判断订单为废单，Remark 字段给出对应的错误代码。

1.2.3 撤单申报说明

投资者可以进行撤单申报，撤单申报订单的填写类似于对限价订单撤单的填写，owflag 的字段值为“WTH”。

1.2.4 成交回报

一笔市价订单匹配时所产生的所有成交回报的编号是连续的。

余量限价订单所产生的成交回报的编号与前者成交编号上没有关联。

1.3 注意事项

1.3.1 新增主机错误代码

代码	解释
263	市价定单不参加集合竞价
264	最优五档即时成交余量自动撤销的市价订单无对手方订单
265	最优五档即时成交余量转限价的市价订单无对手方和本方申报订单
266	该券种不允许做市价定单
269	申报类型错误
270	业务类型错误
412	开放式集合竞价期间不允许撤单

1.3.2 相关业务问题

问题	答复意见
交易主机对市价订单撮合成交时,是否会进行价差控制?	对于市价指令的撮合成交,不进行价差控制。 根据交易规则,市价指令只适用于连续竞价期间有价格涨跌幅限制的证券的交易,因此无需控制价差。
市价订单对基金公司是否有订单约束,即市价订单与自己申报的反方向的限价订单撮合成交限制?	有限制。 因为《交易规则》不允许自为对手的交易行为。投资者可以通过提交反方向限价指令,或者撤销原有限价指令等方法来避免自为对手行为的发生。 另外,如果投资者出现自为对手的行为,本所交易监察部有权查处。

2 开放式集合竞价

2.1 方案说明

从 9:15 至 9:25 期间,上证所实时揭示各股票的开盘参考价格、匹配量和未匹配量。其中:

- 开盘参考价格同时在行情的“ 申买价一 ”和“ 申卖价一 ”字段中显示;
- 匹配量同时在行情的“ 申买量一 ”和“ 申卖量一 ”字段显示;
- 未匹配量根据是买方剩余量还是卖方剩余量分别在“ 申买量二 ”或“ 申卖量二 ”字段显示。

其中,开盘参考价格的含义:是从 9 点 15 到目前时刻,根据集合竞价算法计算得出的撮合价格。

2.2 计算、发布频率

因信息是存放在交易所实时行情信息文件 show2003 中,故刷新频率等同现有行情快照文件的刷新频率。

开盘参考价格的计算频率约为 15 秒/次。

2.3 注意事项

根据新的交易规则,上证所开放式竞价的时间段为:9:15 至 9:25。其中 9:20 至 9:25 期间,交易系统不允许撤单,在此期间,申报到交易所主机的撤单作为废单处理。

3 融资融券业务

3.1 方案简述

本文所称的融资融券,仅指指投资者向具有本所会员资格的证券公司(以下简称“会员”)提供担保物,借入资金买入本所上市证券或借入本所上市证券并卖出的行为。融资融券业务的具体实施请参见中国证券监督管理委员会的管理办法及本所制定的实施细则。

3.1.1 帐户体系

3.1.1.1 证券公司融券专用帐户

开展融券业务的证券公司必须在中央登记结算公司开设融券专用账户,里面存放自有证券,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二级市场证券买卖申报。

证券公司通过非交易申报中的“券源划转”操作,可实现融券专用帐户和证券公司自营帐户中证券的划转。

3.1.1.2 客户信用证券帐户

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字头的客户信用证券账户。

仅E字头的客户信用证券账户可以进行融资融券申报业务,信用证券账户的申报必须带有信用标签。

3.1.1.3 证券公司信用交易担保证券帐户

开展融资融券业务的证券公司须在中央登记结算公司开设“客户信用交易担保证券账户”,该账户与客户信用证券账户之间是总帐与二级明细帐的关系。客户信用证券账户用于记载客户委托证券公司持有的担保证券的明细数据。

3.1.2 担保物及标的证券管理

上证所负责担保物及标的证券范围调整,有关担保物及标的证券的信息参加本文档第3.4节“交易所信息披露”说明。

3.1.3 融资融券业务权限管理

客户信用帐户必须指定在具有融资融券资格的证券公司的席位上,客户信用帐户的交易订单必须通过具备融资融券资格的席位操作员进行申报,席位操作员的融资融券权限包括融资买入权限和融券卖出权限两种。

会员按《上海证券交易所融资融券交易试点实施细则》要求,向我所会员部提交材料,申请开通融资融券交易权限。

3.2 融资融券申报及成交回报

融资融券申报可分成交易类申报和非交易类申报两大类。交易类业务指的是二级市场买卖撮合交易，非交易类业务指的是指定（撤指定）申报、非交易过户申报等。

成交回报包括实时成交回报记录和闭市后上证所发送的过户数据两类。

3.2.1 交易类申报业务

投资者申报的订单信用标签，见第4章。

3.2.1.1 信用交易类型

买卖方向为B的，表示**信用买入**申报，可买入的证券范围：仅限于担保物；

买卖方向为S的，表示**信用卖出**申报，可卖出的证券范围：除回购（新、老回购、企业债）外的股票、封闭式基金、ETF、国债、转债、权证。

3.2.1.2 融资交易类型

买卖方向为B的，表示**融资买入**申报，可买入的证券范围：上证所划定的可融资买入的证券品种；

买卖方向为S的，表示**融券还款**申报，可卖出的证券范围：除回购（新、老回购、企业债）外的股票、封闭式基金、ETF、国债、转债、权证。

3.2.1.3 融券交易类型

买卖方向为B的，表示**买券还券**申报，可买入的证券范围：上证所划定的具有买券融券卖出及被调出融券卖出范围但有合约未到期的证券品种；

买卖方向为S的，表示**融券卖出**申报，可卖出的证券范围：上证所划定的可融券卖出的证券品种；

3.2.1.4 平仓交易类型

买卖方向为B的，表示证券公司进**平仓买入**申报，可买入的证券范围等同于融券交易类型中买券还券的标的范围；

买卖方向为S的，表示证券公司进行**平仓卖出**申报，可卖出的证券范围等同于融资交易类型中卖券还款的标的范围；

3.2.2 非交易类申报业务

本文档所述的非交易类业务，包括信用账户的指定及 4 类证券划转申报。

证券划转申报只有主机返回确认信息，不会产生成交回报，也不代表划转成功，其过户申报数据以中央登记结算公司数据为准。

3.2.2.1 信用账户指定

申报要素同普通账户指定申报，但订单标签必须为“LXY”；

3.2.2.2 余券划转

- 订单发起人：投资者
- 申报代码：799981
- 申报账户：为投资者信用证券账户（E 字头账户），交易系统不作前端检查；
- 订单标签：必须为“LXY”；
- 买卖方向含义：
 - B 表示从证券公司融券专用账户过户到证券公司担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由登记公司维护）。
 - 暂不允许申报卖单；
- 申报价格：被划转的证券代码（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；

3.2.2.3 还券划转

- 订单发起人：投资者
- 申报代码：799982
- 申报账户：为投资者信用证券账户（E 字头账户），交易系统不作前端检查；
- 订单标签：必须为“LXY”；
- 买卖方向含义：
 - S 表示从证券公司担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由登记公司维护）过户到证券公司融券专用账户。
 - 暂不允许申报买单；
- 申报价格：被划转的证券代码（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；

3.2.2.4 担保物划转

- 订单发起人：投资者
- 申报代码：799983
- 申报账户：为投资者信用证券账户（E 字头账户），交易系统不作前端检查；
- 订单标签：必须为“LXY”；
- 买卖方向含义：
 - B 表示从投资者普通证券账户过户到证券公司担保证券账户（对应的投资者信

用证券账户明细数据由登记公司维护)；

- S 表示从证券公司担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由登记公司维护）过户到投资者普通证券账户；

- 申报价格：被划转的证券代码（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；

3.2.2.5 券源划转

- 订单发起人：证券公司
- 申报代码：799984
- 申报账户：证券公司自营证券账户，交易系统不作前端检查；
- 订单标签：必须为“LPT”或“ORD”；
- 买卖方向含义：
 - B 表示从证券公司融券专用账户过到证券公司自营账户；
 - S 表示从证券公司自营账户将证券过户到融券专用账户中；
- 申报价格：被划转的证券代码（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；

3.2.3 成交回报说明

3.2.3.1 实时成交回报

对于融资融券业务，撮合成交后实时返回的成交回报为客户信用账户的成交记录。其中本次余额(BCYE)字段中的值为客户信用账户的持股余额。

3.2.3.2 闭市后的过户文件

上证所发布的闭市后过户文件中，将在成交记录中体现订单的业务类型。具体编制方法说明如下：

过户文件中买卖方向（BS）字段值作如下扩展，其他字段保持不变。

BS 字段值	对应的订单类型说明
B	普通订单，买卖方向：买入
S	普通订单，买卖方向：卖出
1	信用买入订单
2	信用卖出订单
3	融资买入订单，融资类买入
4	卖券还款订单，融资类卖出
5	买券还券订单，融券类买入
6	融券卖出订单，融券类卖出
7	融券平仓订单，平仓类买入
8	融资平仓订单，平仓类卖出

3.3 融资融券数据报送

3.3.1 会员操作指南

3.3.1.1 E_KEY 申请

- 下载数字证书相关申请文件，传真给 SSE 相关业务部门（相关申请文件和流程见 SSE 网站“CA 服务专区——数字证书申请说明”）；
- 建议会员新申请一把 E_KEY 专用于数据申报，并至少有 2 把 E_KEY 具有办理该业务的权限（会籍业务办理的 EKEY 自动获得相关权限）。

3.3.1.2 要素说明

- 申报时限：每个交易日 22:00 以前，会员应保证申报数据的真实、准确、完整；
- 申报路径：SSE 网站——会员公司专区——业务办理——数据上传——融资融券数据申报；
- 每个交易日 22:00 以后至次日 15:00 可以上传修正数据，但 SSE 信息披露以 22:00 以前上传的数据为准，以后上传的修正数据仅供上证所内部统计分析使用（上传时有提示）。

3.3.1.3 无法通过网站上传数据的应急流程

- 可以通过网站 FTP 上传，FTP 服务器地址，用户名、密码向上证所信息公司相关业务联系人索取；
- 使用 FTP 上传数据，必须电话联系上证所信息公司有关技术人员，确认文件收到情况，**联系人：曹波，电话：021-68818561。**
- 券商必须事先上报数据申报相关的技术方案和应急流程。

3.3.2 每日报送数据接口说明

会员应在每个交易日约定的时间（22：00）前，将融资融券业务申报数据（MTSL*****YYYYMMDD.TXT）及其标志文件（MTSL*****YYYYMMDD.FLAG）、融资融券业务信用违约资料（CREDIT*****YYYYMMDD.TXT）及其标志文件（CREDIT*****YYYYMMDD.FLAG）上传至上交所信息公司网站。

如本日没有发生融资融券业务，也需要上传文件。

22：00 前会员公司可多次申报，以最后一次申报为准。

22：00 以后，券商可以上传修正数据，但此数据不做为统计依据，只进入交易所数据仓库。

3.3.2.1 融资融券业务申报数据

- 命名规则

MTSL*****YYYYMMDD.TXT

其中，MTSL 为融资融券简称，*****为 5 位会员代码，YYYY 表示年份，MM 表示月份，DD 表示日期，该日期表示的是该交易日的申报数据，与文件中的“信用交易日期”一致。文件名大小写敏感。

- 文件内容与格式

每个字段以 | 分开、定长格式，左对齐右补空格；如本日没有发生融资融券业务，则相关数据为 0；文件中每一行必须严格按照接口约定，不容许空行；行结束不需要“\r”分隔符。若本日融资余额或融券余量为负数，请将该值归为 0。

顺序如下表：

字段内容	长度	备注
标的证券代码	6	
前日融资余额	14	元
本日融资余额	14	元 本日融资余额 = 前日融资余额 + 本日融资买入额 - 本日融资偿还额
本日融资买入额	14	元
本日融资偿还额	14	元 本日融资偿还额 = 本日直接还款额 + 本日卖券还款额 + 本日融资强制平仓额 + 本日融资正权益调整 - 本日融资负权益调整
本日直接还款额	14	元
本日卖券还款额	14	元
本日融资强制平仓额	14	元
本日融资正权益调整	14	元
本日融资负权益调整	14	元
前日融券余量	14	数量，股/份/手
本日融券余量	14	数量，股/份/手 本日融券余量 = 前日融券余量 + 本日融券卖出数量 - 本日融券偿还量
本日融券卖出量	14	数量，股/份/手
本日融券偿还量	14	数量，股/份/手 本日融券偿还量 = 本日买券还券量 + 本日直接还券量 + 本日融券强制平仓量 + 本日融券正权益调整 - 本日融券负权益调整 - 本日融券划转量
本日买券还券量	14	数量，股/份/手
本日直接还券量	14	数量，股/份/手
本日融券强制平仓量	14	数量，股/份/手
本日融券划转量	14	数量、股/份/手
本日融券正权益调整	14	数量、股/份/手
本日融券负权益调整	14	数量、股/份/手
本日融券余量金额	14	本日融券余量金额 = 本日融券余量 * 本日收盘价，元
融券报送单位	1	1：股（标的证券为股票） 2：份（标的证券为基金） 3：手（标的证券为债券）
信用交易日期	8	YYYYMMDD

3.3.2.2 融资融券业务申报数据标志文件

● 命名规则

MTSL*****YYYYMMDD.FLAG

其中,MTSL 为融资融券简称,*****为 5 位会员代码,YYYY 表示年份,MM 表示月份,DD 表示日期,该日期表示的是该交易日的申报数据。文件名大小写敏感。

- 文件内容与格式

每个字段以 | 分开、定长格式,左对齐右补空格,顺序如下表:

字段内容	长度	备注
文件名称	30	
生成日期	8	YYYYMMDD, 与对应申报文件中日期一致
文件字节数	14	
文件内行数	14	

3.3.2.3 融资融券业务信用违约资料

- 命名规则

CREDIT*****YYYYMMDD.TXT

其中,*****为 5 位会员代码,YYYY 表示年份,MM 表示月份,DD 表示日期,该日期表示的是该交易日的申报数据,与文件中的“信用交易日期”一致。文件名大小写敏感。

- 文件内容与格式

每个字段以 | 分开、定长格式,左对齐右补空格,如当日无数据申报,上传空文件,行结束不需要“|”分隔符。顺序如下表:

字段内容	长度	备注
违约者证券账户	10	
违约者姓名	20	
身份证号	18	
违约金额	14	
违约类别	1	1: 未按规定补足担保物 2: 合约期满未清偿 3: 提供虚假信息 4: 发生司法纠纷
申报类别	1	1: 新增 2: 撤销 3: 结案
申报日期	8	YYYYMMDD

3.3.2.4 融资融券业务信用违约资料标志文件

- 命名规则

CREDIT*****YYYYMMDD.FLAG

其中，*****为5位会员代码，YYYY表示年份，MM表示月份，DD表示日期，该日期表示的是该交易日的申报数据。文件名大小写敏感。

- 文件内容与格式

每个字段以 | 分开、定长格式，左对齐右补空格，顺序如下表：

字段内容	长度	备注
文件名称	30	
生成日期	8	YYYYMMDD，与对应申报文件中日期一致
文件字节数	14	
文件内行数	14	

3.3.3 每月报送情况说明

3.3.3.1 月报数据

会员应按《证券公司融资融券交易试点管理办法》第四十三条及本所细则的有关规定以**书面与电子邮件**（E_MAIL：memnb@sse.com.cn）方式向我所会员部报送月报；

月报具体内容与会员报给证监会的月报相同。

3.3.3.2 每月持有卖出数据

根据《证券公司融资融券交易试点管理办法》第十八条的规定，客户融券期间，其本人或关联人卖出与所融入证券相同的证券的，客户应当自该事实发生之日起3个交易日内向证券公司申报。证券公司应当将客户申报的情况按月报报送相关证券交易所。

- 报送方式：

通过交易所外部网站报送，路径：SSE网站——会员公司专区——业务办理——数据上传*——融券卖出情况月报。

- 报送时间：

每个月前五个交易日。

- 命名规则：

文件名：CYMC*****YYYYMM.TXT

CYMC为“持有卖出”简称，*****为5位会员代码，YYYY表示年份，MM表示申报月份。

- 文件内容与格式

- 1、每个字段以 | 分开、定长格式，左对齐右补空格，如无数据用空格，顺序如下：
- 2、每行记录表示某个交易日（字段：日期）中，某一投资者下属账户组（字段：账户数量 - 账户20）持有卖出某标的证券（字段：标的证券代码）的情况。

字段内容	长度	备注
日期	8	YYYYMMDD：交易发生日期
标的证券代码	6	
标的证券代码简称	10	
账户数量	8	账户为同一投资者所有的普通和信用账户，此字段填写实际数量，但申报的账户组只有20个
账户1	10	按照账户的字符关系倒序填写
账户2	10	
...	10	
账户20	10	
当日标的证券卖出数量	14	上述同一投资者下属账户组当日卖出数量之和
前日标的证券融券余额	14	上述同一投资者下属账户组前日融券余额
当日标的证券融券余额	14	上述同一投资者下属账户组当日融券余额
报送单位	1	标的证券代码的申报单位， 1：股（标的证券为股票） 2：份（标的证券为基金） 3：手（标的证券为债券）
所在会员代码	12	

3.4 交易所信息披露

3.4.1 每日向券商发送担保物及标的证券清单

- 命名规则：dbpMMDD.txt
MM 表示月份，DD 表示日期。文件名大小写敏感。
- 数据内容：MMDD 日的融资、融券、担保物列表（不包括临时停牌处理的）；
- 发送途径：通过上证所单向卫星发送；
- 发送时间：每个交易日开市前；
- 发送周期：每个交易日；
- **数据格式：DOS 格式；**

字段内容	长度	备注
证券代码	C6	
分隔符	C1	竖线符号“ ”
对应类别	C3	001：融资、002：融券、003：担保物
分隔符	C1	竖线符号“ ”
余额	C15	右对齐，左补空 类别为 001 时，此数据表示前一交易日该证券融资余额； 类别为 002 时，此数据表示前一交易日该证券融券余量； 类别为 003 时，此数据固定为 0；

说明：

本文件中的余额数据是根据各会员报送数据汇总生成的，其真实、准确、完整性由各会员公司承担，本所只是转发数据，供相关单位使用。

3.4.2 交易所网站披露融资融券汇总数据

- 发布路径：行情与交易——成交概况——融资融券
- 数据来源：根据券商申报的数据汇总，由券商保证数据的真实、完整、准确。

3.4.2.1 每日汇总信息

- 查询方式：按信用交易日期（时间段）查询；
- 披露要素：信用交易日期、本日融资余额、本日融资买入额、本日融资偿还额、本日融券余量金额、本日融资融券交易总量；
- 备注：
- 市场融资融券交易总量 = 本日融资余额 + 本日融券余量金额

3.4.2.2 每日明细信息

- 查询方式：按信用交易日期、标的证券代码、标的证券简称组合查询；

- 披露要素：信用交易日期、标的证券代码、标的证券简称、本日融资余额、本日融资买入额、本日融资偿还额、本日融券余量、本日融券卖出量、本日融券偿还量；
- 备注：
 - * 本日融资余额 = 前日融资余额 + 本日融资买入额 - 本日融资偿还额；
 - * 本日融资偿还额 = 本日直接还款额 + 本日卖券还款额 + 本日融资强制平仓额 + 本日融资正权益调整 - 本日融资负权益调整；
 - * 本日融券余量 = 前日融券余量 + 本日融券卖出数量 - 本日融券偿还量；
 - * 本日融券偿还量 = 本日买券还券量 + 本日直接还券量 + 本日融券强制平仓量 + 本日融券正权益调整 - 本日融券负权益调整 - 本日融券划转量；
 - * 融券单位：股（标的证券为股票）/份（标的证券为基金）/手（标的证券为债券）。

3.5 注意事项

3.5.1 新增主机错误代码

代码	解释
270	申报类型错误（信用类型不存在或融券卖出不可申报市价订单）
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	信用买入权限不足
277	信用卖出权限不足
278	融资买入权限不足
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	融券卖出权限不足
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

4 订单标签 owflag 编制说明

4.1 编制方法

上证所场外报盘接口中，委托发送表（ashare_ordwth）中 OWFLAG 字段中填写的是订单标签。

在 Awx61、Bwx61 版场外报盘程序配套的接口中，只有 ORD 和 WTH 两类标签。

新版场外报盘程序 Awx62、Bwx62 配套的接口中，OWFLAG 字段进行以下扩展：

- 横向表示申报类型，主要包括：限价申报、市价剩余量自动撤单申报、市价剩余量转限价申报。
- 纵向表示业务类型，主要包括：普通交易、信用交易、融资交易、融券交易、平仓交易。
- 申报类型和业务类型两两组合，共有 15 种订单标示。
- 所有订单对应的撤单，其 owflag 的值均用 WTH 标示。

申报类型 业务类型	限价申报 (L_ _)	市价订单		撤单申报 (W_ _)
		最优 5 档匹配 后剩余量撤单 (M_ _)	最优 5 档匹配后 剩余量转限价 (N_ _)	
普通交易 (_PT)	LPT	MPT	NPT	WTH
信用交易 (_XY)	LXY	MXY	NXY	WTH
融资交易 (_RZ)	LRZ	MRZ	NRZ	WTH
融券交易 (_RQ)	LRQ	MRQ	NRQ	WTH
平仓交易 (_PC)	LPC	MPC	NPC	WTH

- E 字头帐户的申报，只能使用信用交易、融资交易、融券交易、平仓交易这四类标签。
- 非 E 字头帐户的申报，只能使用普通交易类标签。

4.2 订单标签(owflag)意义说明

买卖方向 订单标示	买入 (B)	卖出 (S)
LPT	普通限价订单，买入挂牌交易证券。另用于账户指定 / 撤指定申报。等同于原来的 ORD。	普通限价订单，卖出挂牌交易证券。 等同于原来的 ORD。
MPT	普通账户的市价买入，最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。	普通账户的市价卖出，最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。
NPT	普通账户的市价买入，最优 5 档匹配后剩余量转限价。	普通账户的市价卖出，最优 5 档匹配后剩余量转限价。
LXY	客户信用证券帐户的限价买入订单，买入标的为可作担保物的证券。 若买入标的为非可作担保物的证券，订单为废单。	客户信用证券帐户的限价卖出订单，卖出标的为可作担保物的证券。 若卖出标的为非担保物证券，订单为废单。
MXY	客户信用证券帐户的市价买入订单，买入标的为可作担保物的证券。最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。 若买入标的为非可作担保物的证券，订单为废单。	客户信用证券帐户的市价卖出订单，卖出标的为可作担保物的证券。最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。 若卖出标的为非担保物证券，订单为废单。
NXY	客户信用证券帐户的市价买入订单，买入标的为可作担保物的证券。最优 5 档匹配后剩余量转限价。 若买入标的为非可作担保物的证券，订单为废单。	客户信用证券帐户的市价卖出订单，卖出标的为可作担保物的证券。最优 5 档匹配后剩余量转限价。 若卖出标的为非担保物证券，订单为废单。
LRZ	客户信用证券帐户的限价融资买入订单，买入标的为可融资买入的证券。 若买入标的为非可融资买入的证券，订单为废单。	卖券还款的限价订单，卖出标的为客户信用证券帐户中的证券。
MRZ	客户信用证券帐户的市价融资买入订单，买入标的为可融资买入的证券。最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。	卖券还款的市价订单，最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。 卖出标的为客户信用证券帐户中的证券。

	若买入标的为非可融资买入的证券，订单为废单。	
NRZ	客户信用证券帐户的市价融资买入订单，买入标的为可融资买入的证券。最优 5 档匹配后剩余量转限价。 若买入标的为非可融资买入的证券，订单为废单。	卖券还款的市价订单，最优 5 档匹配后剩余量转限价。 卖出标的为客户信用证券帐户中的证券。
LRQ	买券还券的限价订单。	客户信用证券帐户的限价融券卖出订单，卖出标的为可融券卖出的证券。
MRQ	买券还券的市价订单。最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。	融券卖出不允许市价申报。
NRQ	买券还券的市价订单。最优 5 档匹配后剩余量转限价。	融券卖出不允许市价申报。
LPC	平仓还券的限价订单。	平仓还款的限价订单。
MPC	平仓还券的市价订单。最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。	平仓还款的市价订单。最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。
NPC	平仓还券的市价订单。最优 5 档匹配后剩余量转限价。	平仓还款的市价订单。最优 5 档匹配后剩余量自动撤单。
WTH	撤单申报，买卖方向同被撤订单。	

4.3 关于报盘程序对接口兼容性的说明

为配合此次新业务上线，上海证券交易所将推出新的 A 股场外报盘程序(Awx62)、B 股场外报盘程序(Bwx62)，新版报盘程序支持本次升级的接口标准，同时也向下兼容原来的接口。

新版场外报盘程序(Awx62, Bwx62)已放开买卖零散股申报的前端检查控制，由交易主机进行校验控制，同时会员应按照交易规则规定做好零散股申报的前端控制。

所有场外报盘终端应按照交易所的统一安排，参加新版场外报盘程序的升级测试。