

工程技术标准

深圳证券交易所 Binary 交易 数据接口规范

(Ver1.00<u>β</u>-α-)



深圳证券交易所 二〇一四年四月六月

文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2013-10	0.10	创建
2014-1	0.90	根据市场参与者反馈意见修订
2014-4	1. 00 α	根据0.9版征求意见反馈修订
<u>2014–6</u>	1.00β	增加期权集中竞价交易询价申报 增加借券/还券申报 新订单增加订单限定 OrderRestrictions 字段 增加对于质押式回购交易到期成交执行报告的说明 协议交易意向申报增加联系人 Contactor 字段 股份性质 ShareType 字段更名为 ShareProperty 股票质押式回购业务成交申报增加质权人类型 PledgeeType 字段 修改网络投票密码服务申报及其执行报告的报文号 报价申报中删除单边报价方式 补充消息校验和计算范围的说明 订正部分文字错误

带格式的:正文

带格式的:字体: CG Times

名词释义

词汇缩写	含义	
TGW	Trade GateWay 交易网关 深圳证券交易所交易系统提供给市场参与者的接入点。	
OMS	Order Management System 订单管理系统	
STEP	Securities Trading Exchange Protocol 证券交易数据交换协议。	
FIX	Financial Information Exchange 金融信息交换协议。	

目 录

<u></u>	前言	<u>1</u>
<u>=,</u>	会话机制	1
<u>2.1</u>	1 连接	1
	2.1.1 会话	1
	2.1.2 IP 地址和 Port	1
	2.1.3 安全	1
2.2	2 会话管理	1
	2.2.1 建立会话	1
	2.2.2 心跳包和测试请求	2
	2.2.3 终止会话	2
	2.2.4 重建会话	2
<u>三、</u>	服务说明	<u>2</u>
3.1	1 平台说明	2
3.2	2 委托申报方式说明	3
3.3	3 委托消息处理流程	<u>6</u>
3.4	4 新订单处理消息流图	<u>6</u>
	3.4.1 新订单消息流图	<u>7</u>
	3.4.2 撤单请求消息流图	8
3.5	5 报价处理消息流图	8
3.6	6	10
	3.6.1 投资者申报处理	10
	3.6.2 做市商接收询价处理	11
3.7	7 意向申报处理消息流图	<u>12</u>
3.8	8 成交申报处理消息流图	13
	3.8.1 协议配对申报模式 (one party report for matching)	13
	3.8.1.1 新成交申报处理	13
	3.8.1.2 撤销尚未完成配对的成交申报	15
	3.8.2 成交报告申报模式(two party report)	16
3.9	9 转托管处理消息流图	<u>17</u>
3.1	10 网络投票处理消息流图	<u>18</u>
	3.10.1 投票处理消息流图	<u>18</u>
	3.10.2 密码服务处理消息流图	19
3.1	11 应用层消息恢复	<u>19</u>
四、	消息定义	<u>20</u>
<u>4.</u>]	1 消息结构	<u></u> 20
	4.1.1 消息头	<u>20</u>
	4.1.2 消息尾	21
4.2	2 管理消息	21
	4.2.1 登录消息 (Logon)	21
	4.2.2 注销消息 (Logout)	21
	4.2.3 心跳消息(Heartbeat)	22

4.3 业务消息-新订单处理	22
4.3.1 新订单(New Order)	22
4.3.1.1 现货集中竞价业务新订单扩展字段(100101)	24
4.3.1.2 质押式回购交易业务新订单扩展字段(100201)	<u>25</u>
4.3.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段(100401)	25
4.3.1.4 协议交易业务新订单扩展字段(100501)	26
4.3.1.5 转融通证券出借业务新订单扩展字段(100701)	26
4.3.1.6 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段(101701)	26
4.3.1.7 要约收购业务新订单扩展字段(101801)	26 27
4.3.2 撤单请求(Order Cancel Request)	<u>27</u>
4.3.3 撤单失败响应(Cancel Reject)	
4.3.4 订单响应及撤单成功执行报告(Execution Report)	<u>28</u>
4.3.4.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段(200102)	30
4.3.4.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段(200202)	30 31
4.3.4.3 期权集中竞价业务执行报告扩展字段(200402)	31
4.3.4.4 协议交易业务执行报告扩展字段(200502)	31 32
4.3.4.5 转融通证券出借业务执行报告扩展字段(200702)	<u>3132</u>
4.3.4.6 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段(201202)	3132
4.3.4.7 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段(201702)	32
4.3.4.8 要约收购业务执行报告扩展字段(201802)	32 33
4.3.5 订单成交执行报告(Execution Report)	32 33
4.3.5.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段(200115)	34
4.3.5.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段(200215)	34
4.3.5.3 期权集中竞价业务执行报告扩展字段(200415)	34 35
4.3.5.4 协议交易业务执行报告扩展字段(200515)	34 35
4.3.5.5 转融通证券出借业务执行报告扩展字段(200715)	34 35
4.4 业务消息-报价处理	35
4.4.1 报价(Quote)	35
4.4.1.1 期权集中竞价业务报价扩展字段(100405)	36 37
4.4.2 报价状态回报(Quote Status Report)	36 37
4.4.2.1 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段(200406)	<u>3738</u>
4.5 业务消息-询价申报处理	38
4.5.1 询价申报(Quote Request)	38
4.5.1.1 期权集中竞价业务询价扩展字段(100417)	39
4.5.2 询价申报接受响应(Quote Request Ack)	39
4.5.2.1 期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段(200417)	<u>3940</u>
4.5.3 询价申报拒绝响应(Quote Request Reject)	40
4.5.3.1 期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段(200418)	4041
4.6 业务消息-意向申报处理	
4.6.1 意向申报(Indication of Interest)	4041
4.6.1.1 协议交易意向申报扩展字段(100509)	41 <u>42</u>
4.6.2 意向申报响应(Quote Response)	42
4.6.2.1 协议交易意向申报扩展字段(200510)	4344

4.7.1 成交申报 (Trade Capture Report) 4344 4.7.1.1 特益通证基出借业务成交申报扩展字段 (100703) 4536 4.7.1.2 資产管理计划的額棒让业务成交申报扩展字段 (100903) 46 4.7.1.3 股票值押式回购业务成交申报扩展字段 (100903) 4647 4.7.1.5 詹却式展的回购业务成交申报扩展字段 (101003) 474 4.7.2 成交申报物应 (Trade Capture Report Ack) 4748 4.7.3 成交确认 (Trade Capture Report Ack) 4748 4.7.3 成交确认 (Trade Capture Report) 4950 4.8.1 注册 (Designation) 5152 4.8.1 注册 (Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告 (Designation Report) 5252 4.9 业务消息—网络权票处理消息 5354 4.9.1 投票 (Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务 (Evote Password Service) 5657 5.1 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT) 5657 5.2 回报的市消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5788 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5789 6.1 教務來型 5960 6.1 业务基定义 5960 6.2 会话是域文 5960 6.3 业务基定义 5960 6.2 会话是域文 5960				
4.7.1.2 資产管理計划份額转让业务成文申报扩展字段(100803) 46 4.7.1.3 股票盾押式回购业务成文申报扩展字段(101003) 464 4.7.1.4 约定购回业务成文申报扩展字段(101003) 47 4.7.1.5 原押式报价回购业务成文申报扩展字段(101103) 4748 4.7.2 成交申报响应(Trade Capture Report Ack) 4748 4.7.3 成交确认(Trade Capture Report Ack) 4950 4.7.3.1 转融通证券出借业务成交确认扩展字段(200703) 51 4.8 业务消息、转托管处理消息 5152 4.8.1 注册(Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告(Designation Report) 5253 4.9 业务消息、网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票(Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告(Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务, (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务, (Evote Password Service) 567 5.1 业务拒绝消息(Business Reject) 568 5.1 业务拒绝消息(Report Synchronization) 5758 5.4 回报结束消息(Report Finished) 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话展域定义 5960 6.3 业务展域定义 5960 6.3 业务展域定义 6061 前書 1 2-1 连接 1 2-1 连接 1 2-1 连接 1 2-1 连接				
4.7.1.3 股票盾押式回购业务成文申报扩展字段(100903) 4647 4.7.1.4 约定购回业务成文申报扩展字段(101003) 47 4.7.1.5 盾押式报价回购业务成文申报扩展字段(101103) 4748 4.7.2 成文申报响应(Trade Capture Report Ack) 4748 4.7.3 成交确认(Trade Capture Report Ack) 4950 4.7.3.1 转验通证券出借业务成交确认扩展字段(200703) 51 4.8 业务消息-转托管处理消息 5152 4.8.1 注册(Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告(Designation Report) 5253 4.9.1 投票(Evote) 5354 4.9.1 投票(Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告(Evote Password Service) 5354 4.9.3 密码服务(Evote Password Service) 5586 4.9.4 密码服务执行报告(Evote Password Service Report) 56 5.1 业务拒绝消息(Business Reject) 56 5.2 回报同步消息(Report Synchronization) 5758 5.3 平台表态消息(PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息(Report Finished) 5859 6.1 数据类型 596 6.2 会活层域定义 5960 6.3 业务层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前書 1 2-1 连接 1 2-1 连接 1				
47.14 约定助回业务成文申报扩展字段(101003) 47 47.15				
47.1.5 原押式报价回购业务成文申报扩展字段(101103) 4748 4.7.2 成文申报响应(Trade Capture Report Ack) 4748 4.7.3 成交痛认(Trade Capture Report) 4950 4.7.3.1 转融通证券出借业务成交确认扩展字段(200703) 51 4.8 业务消息-转托管处理消息 5152 4.8.1 注册(Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告(Designation Report) 5253 4.9 业务消息—网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票(Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告(Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告(Evote Password Service Report) 56 5.1 业务拒绝消息(BUSINESS REJECT) 5657 5.2 回报同步消息(REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.3 平台状态消息(PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息(REPORT FINISHED) 5859 方、数据学典 589 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 - 前事 1 2.1 连接 1 2.1.1 会转 1				
47.2 成文申报响应(Trade Capture Report Ack) 4748 47.3 成交确认(Trade Capture Report) 4959 47.3.1 转級通证券出借业务成交确认扩展字段(200703) 51 4.8 业务消息-转托管处理消息 5152 4.8.1 注册(Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告(Designation Report) 5253 4.9 业务消息-网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票(Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告(Evote Password Service) 5354 4.9.3 密码服务(Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告(Evote Password Service Report) 56 5.1 业务拒绝消息(BUSINESS REJECT) 5657 5.2 回报同步消息(REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.3 平台状态消息(PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息(REPORT FINISHED) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 - 前書 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1				
4.7.3 成交确认 (Trade Capture Report) 4959 4.7.3.1 特融通证券出借业务成交确认扩展字段 (200703) 51 4.8 业务消息-特托管处理消息 5152 4.8.1 注册 (Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告 (Designation Report) 5253 4.9 业务消息-网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票 (Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告 (Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) 56 五、其它消息 5657 5.1 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT) 5657 5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5859 方、数据学型 5960 6.3 业务层域定义 5960 6.3 业务层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 2-1 连续 1 2-1 连续 1 2-1 上 2-1 上				
4.7.3.1 转融通证券出借业务成交确认扩展字段(200703) 51 4.8 业务消息-转托管处理消息 5152 4.8.1 注册 (Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告 (Designation Report) 5253 4.9 业务消息-网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票 (Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告 (Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5566 4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) 56 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 5657 5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5859 六 数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 5960 6.3 业务层域定义 5960 6.3 业务层域定义 5061 本活和 1 2.1 连接 1				
4.8 业务消息-转托管处理消息 5152 4.8.1 注册 (Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告 (Designation Report) 5253 4.9 业务消息-网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票 (Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告 (Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) 56 五、其它消息 5657 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 5657 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 5758 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 5859 方、数据字典5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6064 前書 1 2.1 连接 1 2.1.1 会话 1				
4.8.1 注册 (Designation) 5152 4.8.2 注册执行报告 (Designation Report) 5253 4.9 业务消息-网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票 (Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告 (Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) 56 五、其它消息 5657 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 5657 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 5758 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1 2.1.1 会话 1				
4.8.2 注册执行报告 (Designation Report) 5253 4.9 业务消息-网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票 (Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告 (Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) 56 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 5657 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 5758 5.3 平台状态消息 (Platform State Info) 5758 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1 2.1.1 会話 1				
4.9 业务消息-网络投票处理消息 5354 4.9.1 投票 (Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告 (Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) 56 五、井它消息 5657 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 5657 5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 一、前言 1 2.1 连接 1 2.1.1 会話 1				
4.9.1 投票 (Evote) 5354 4.9.2 投票执行报告 (Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) 56 五、其它消息 5657 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 5657 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 5758 5.3 平台状态消息 (Platform State Info) 5758 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 本 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1				
4.9.2 投票执行报告 (Evote Report) 5455 4.9.3 密码服务 (Evote Password Service) 5556 4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) .56 五、其它消息 5657 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 5657 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 5758 5.3 平台状态消息 (Platform State Info) 5758 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 .59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 二、会託机制 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1				
4.9.3 密码服务 (Evote Password Service)55564.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report)56五、其它消息56575.1 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT)56575.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION)57585.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO)57585.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED)5859六、数据字典58596.1 数据类型596.2 会话层域定义59606.3 业务层域定义6061前言1二、会话机制12.1 连接12.1 连接1				
4.9.4 密码服务执行报告 (Evote Password Service Report) 56 五、其它消息 .5657 5.1 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT) 5657 5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 二、会託机制 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1 2.1 连接 1				
五、其它消息56575.1 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT)56575.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION)57585.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO)57585.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED)5859六、数据字典58596.1 数据类型596.2 会话层域定义59606.3 业务层域定义6061前言1二、会託机制12.1 连接12.1 连接1				
5.1 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT) 5657 5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1 会话 1				
5.2 回报同步消息(REPORT SYNCHRONIZATION) 5758 5.3 平台状态消息(PLATFORM STATE INFO) 5758 5.4 回报结束消息(REPORT FINISHED) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1.1 会话 1				
5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 575% 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 一、前言 1 二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1 会话 1				
5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 5859 六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1 会话 1				
六、数据字典 5859 6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 前言 1 二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1 会话 1				
6.1 数据类型 59 6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 - 前言 1 - 文括机制 1 2.1 连接 1 2.1 会话 1				
6.2 会话层域定义 5960 6.3 业务层域定义 6061 一、前言 1 二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1.1 会话 1				
6.3 业务层域定义 6061 一、前言 1 二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1.1 会话 1				
二、前言 1 二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1.1 会话 1				
対言 1 二、会話机制 1 2.1 连接 1 2.1.1 会話 1 2.1.2 IP地址和 Port 1 2.1.3 安全 1 2.2 公社管理 1				
二、会话机制 1 2.1 连接 1 2.1.1 会话 1 2.1.2 IP 地址和 Port 1 2.1.3 安全 1				
2.1 连接 1 2.1.1 会话 1 2.1.2 P地址和 Port 1 2.1.3 安全 1				
2.1.1 会话 1 2.1.2 IP 地址和 Port 1 2.1.3 安全 1				
2.1.2 IP 地址和 Port 1 2.1.3 安全 1 2.2 公共管理				
2.1.3 安全 1				
22 人并答理				
[] 				
2.2.1 建立会话				
2.2.2 心跳包和测试请求				
2.2.3 终止会话				
2.2.4 _ 重建会话				
三、服务说明				
3.1_平台说明				
3.2				
3.3				
3.4 新订单处理消息流图 6				

带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的: 默认段落字体, 检查拼 带格式的:默认段落字体,检查拼 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的: 默认段落字体, 检查拼 带格式的: 默认段落字体 带格式的: 默认段落字体 带格式的: 默认段落字体 带格式的: 默认段落字体 带格式的: 默认段落字体 带格式的: 默认段落字体 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的:默认段落字体,检查拼 带格式的: 默认段落字体 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的: 默认段落字体, 检查拼 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的: 默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 **带格式的:**默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法 带格式的:默认段落字体,检查拼 写和语法

带格式的:默认段落字体,检查拼

写和语法

工程技术标准 深圳证券交易所 Binary 交易数	据接口规范 ————————————————————————————————————	
3.4.1 新订单消息流图	带格式的	
3.4.2 撤单请求消息流图	带格式的	(.
3.5 报价处理消息流图	带格式的	(.
3.6 意向申报处理消息流图		(.
3.7 成交申报处理消息流图	带格式的	(.
3.7.1 协议配对申报模式(one party report for matching)	************************************	(.
3.7.1.1—新成交申报处理	带格式的	(.
3.7.1.2 撤销尚未完成配对的成交申报	带格式的	(.
3.7.2 成交报告申报模式(two party report)	带格式的	(.
3.8 特托管处理消息流图	带格式的	(.
3.9 网络投票处理消息流图	带格式的	
3.9.1 投票处理消息流图	带格式的	(.
3.9.2 密码服务处理消息流图	带格式的	(.
3.10 应用层消息恢复	17 带格式的	(.
· 消息定义	18 带格式的	
	18 带格式的	(.
	18 带格式的	
4.1.1 消息头	# 14 12 14	
4.1.2 消息尾	44.44	
4.2 管理消息	# 16 7 24	
4.2.1 登录消息 (Logon)	11 21 41 44 L	
4.2.2 注销消息(Logout)	44 44 44	
4.2.3 心跳消息(Heartbeat)	20 La 14 La 12 / 2	
4.3 业务消息-新订单处理	20 La 12 12	
4.3.1 新订单(New Order)	一种格式的	
4.3.1.1 现货集中竞价业务新订单扩展字段(100101)	一种格式的	(.
4.3.1.2 质押式回购交易业务新订单扩展字段(100201)	带格式的	(.
4.3.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段(100401)	带格式的	
4.3.1.4 协议交易业务新订单扩展字段(100501)	带格式的	
4.3.1.5—转融通证券出借业务新订单扩展字段(100701)		
4.3.1.6—开放式基金中购赎回业务新订单扩展字段(101701)		(.
4.3.1.7—要约收购业务新订单扩展字段(101801)		(.
4.3.2 撤单请求 (Order Cancel Request)		
4.3.3 撤单失败响应(Cancel Reject)		
4.3.4 订单响应及撤单成功执行报告(Execution Report)		(.
4.3.4.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段(200102)	带格式的	(.
4.3.4.2—质押式回购交易业务执行报告扩展字段(200202)	一种格式的	
4.3.4.3 期权集中竞价业务执行报告扩展字段(200402)	带格式的	(.
4.3.4.4 协议交易业务执行报告扩展字段(200502)	带格式的	(.
4.3.4.5 特融通证券出借业务执行报告扩展字段(200702)	29	
4.3.4.6 ETF 实时中购赎回业务执行报告扩展字段(201202)	************************************	
4.3.4.7 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段(201702)	29 带格式的	(.
4.3.4.8 要约收购业务执行报告扩展字段 (201802)	29 带格式的	(.
4.3.5 打单成交执行报告 (Execution Report)	30	

#36.1 上京東土中島の企事地の日本地の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の日本の	<u> </u>	沐圳证券交易所 Binary 交易致掂接口规泡		
#35.3	4.3.5.1—现货集中竞价业务执行报告扩展字段(2001	15)31 _	带格式的	
# 2.5.5	4.3.5.2—质押式回购交易业务执行报告扩展字段(20	0215)31	带格式的	(
# 25.5 世紀県住産 (中央 (中央 (1907))	4.3.5.3—期权集中竞价业务执行报告扩展字段(2004	15)31	带格式的	(
## A \$# A		32	带格式的	
## 1	4.3.5.5 转融通证券出借业务执行报告扩展字段(20	0715)32	带格式的	
# 株式	4.4 业务消息 报价处理	32	带格式的	
1.1.1	4.4.1 _ 抵价(Quote)	32	带格式的	
# 1-2	4.4.1.1 期权集中竞价业务报价扩展字段(100405)	33	带格式的	
1421 加速量や企会の単級や理		33	带格式的	
4.5.1			带格式的	
# 1	4.5 业务消息 意向申报处理	35	带格式的	
4.5.1.1 助音文号を命中継年展子後(100509) 1.5.2 2.5.0 中国の中国で	4.5.1 意向申报(Indication of Interest)	35	带格式的	
45.2			带格式的	
1-5-2-1		36	带格式的	
1.6.1			带格式的	
4.6.1 減交申報 (Trade Capture Report)	4.6 业务消息 成交申报处理	37	带格式的	
## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ##			带格式的	
### ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ##		0703)40	带格式的	
### ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ##	4.6.1.2 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字	段(100803)40	带格式的	
46.15	4.6.1.3 股票质押式回购业务成交申报扩展字段(10	0903)40	带格式的	
46.15 馬押式服仰回购业务减定申报扩展字段 (101103) 41 46.2 成交申报均应 (Trade Capture Report Ack) 41 46.3 成交确认 (Trade Capture Report) 43 4.7 业务消息 转柱管处理消息 45 4.7.1 注册 (Designation) 45 4.8 业务消息 网络投票处理消息 47 4.8 业务消息 网络投票处理消息 47 4.8.1 投票 (Netvote) 47 4.8.2 投票执行报告 (Netvote) 48 4.8.3 密母服务 (Netvote Password Service) 48 4.8.4 密母服务 (Netvote Password Service) 48 4.8.4 密母服务 (Netvote Password Service) 48 5.1 业务拒结消息 (Busness Reject) 50 5.2 四报司 步消息 (Report Synchronization) 51 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 51 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 52 6.1 数据类型 52 6.2 会社层域交叉 53	4.6.1.4 约定购回业务成交申报扩展字段(101003)	41	带格式的	
4.6.2 成交申报响应(Trade Capture Report Ack) 4.1 帶格式的 带格式的 一个 中格式的 一个		1103)41	带格式的	
4.6.3 成交确认(Trade Capture Report) 43 带格式的 4.7 业务消息 桂杉管处理消息 45 带格式的 4.7.1 注册 (Designation) 45 带格式的 4.7.2 注册执行报告 (Designation Report) 45 带格式的 4.8 业务消息 网络投票处理消息 47 带格式的 4.8.1 投票 (Netvote) 47 带格式的 4.8.2 投票执行报告 (Netvote) 48 带格式的 4.8.3 密码服务 (Netvote Password Service) 48 带格式的 4.8.4 密码服务执行报告 (Netvote Password Service) 49 带格式的 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 50 带格式的 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 50 带格式的 5.2 回报日本消息 (Report Synchromization) 51 带格式的 5.4 回报结束消息 (PLATFORM STATE INFO) 51 带格式的 5.4 四报结束消息 (Report Finished) 52 带格式的 6.1 数据类型 52 带格式的 6.2 会还是成文 53 带格式的			带格式的	
4.7			带格式的	
4.7.1 注册 (Designation) 45 带格式的 4.7.2 注册执行报告 (Designation Report) 45 带格式的 4.8 业务消息 网络投票处理消息 47 带格式的 4.8.1 投票 执行报告 (Netvote) 48 带格式的 4.8.3 溶码服务 (Netvote Password Service) 48 带格式的 4.8.4 溶码服务 执行报告 (Netvote Password Service) 49 带格式的 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 50 带格式的 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 51 带格式的 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 51 带格式的 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 52 带格式的 6.1 数据字典 52 带格式的 6.2 会话层域定义 53 带格式的			带格式的	
4.7.2 注册执行报告 (Designation Report) 45 蒂格式的 4.8 业务消息 网络投票处理消息 47 蒂格式的 4.8.1 投票执行报告 (Netvote) 48 *** *** 4.8.2 投票执行报告 (Netvote Password Service) 48 *** *** *** 4.8.4 密码服务 (Netvote Password Service) 49 *** *** **			带格式的	
4.8.1 投票 (Netvote) 47 4.8.2 投票执行报告 (Netvote) 48 4.8.3 窗母服务 (Netvote Password Service) 48 4.8.4 窗母服务执行报告 (Netvote Password Service) 49 季格式的 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 50 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 51 5.3 平台状态消息 (Platform State Info) 51 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 52 **格式的 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 52 **格式的 6.1 数据类型 52 6.2 会话层域定义 **格式的 **格式的 **格式的 **格式的 **格式的 **格式的 **格式的 **格式的 **格式的 **格式的 **6と表表表表的 **格式的			带格式的	
4.8.1 投票 (Netvote) 47 4.8.2 投票执行报告 (Netvote) 48 4.8.3 密码服务 (Netvote Password Service) 48 4.8.4 密码服务执行报告 (Netvote Password Service) 49 基本 文字消息 50 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 50 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 51 5.3 平台状态消息 (Platform State Info) 51 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 52 赤人型保护表消息 (Report Finished) 52 赤人式的 6.1 数据类型 52 6.2 会话层域定义 53	4.8 业务消息 网络投票处理消息	47	带格式的	
4.8.2 投票执行报告 (Netvote Password Service) 48 4.8.3 密码服务 (Netvote Password Service) 48 4.8.4 密码服务执行报告 (Netvote Password Service) 49 五、其它消息 50 第格式的 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 50 第格式的 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 51 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 51 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 52 六、数据字典 52 6.1 数据类型 52 6.1 数据类型 52 6.1 数据类型 52 6.2 会话层域定义 53		47	带格式的	(
4.8.3 密码服务 (Netvote Password Service) 48 4.8.4 密码服务执行报告 (Netvote Password Service) 49 五、其它消息 50 夢格式的 5.1 业务拒绝消息 (Business Reject) 50 5.2 回报同步消息 (Report Synchronization) 51 5.3 平台状态消息 (Platform State Inpo) 51 5.4 回报结束消息 (Report Finished) 52 赤人型保结束消息 (Report Finished) 52 香格式的 参报字典 52 6.1 数据类型 52 市格式的 香格式的 香格式的 香格式的 香格式的 香格式的 香格式的 香格式的 香格式的 香格式的		48	带格式的	·
4.8.4 密码服务执行报告 (Netvote Password Service) 49 五、其它消息 50 第格式的 5.1 业务拒絕消息 (BUSINESS REJECT) 50 第格式的 5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) 51 第名式的 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 51 第格式的 参报字典 52 6.1 数据类型 52 6.2 会话层域定义 53		48	带格式的	(
五、其它消息 50 第4式的 5.1 业务拒絕消息(BUSINESS REJECT) 50 第4式的 5.2 回报同步消息(REPORT SYNCHRONIZATION) 51 第4式的 5.4 回报结束消息(REPORT FINISHED) 52 常格式的 参据字典 52 6.1 数据类型 52 6.2 会话层域定义 53		Service)	带格式的	(
5.1 业务拒絕消息 (BUSINESS REJECT) 50 带格式的 5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) 51 带格式的 5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 51 带格式的 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 52 带格式的 六、数据字典 52 带格式的 6.1 数据类型 52 带格式的 6.2 会话层域定义 53 带格式的	工一种的混乱	50	带格式的	(
5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO) 51 带格式的 5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 52 带格式的 六、数据字典 52 带格式的 6.1 数据类型 52 带格式的 6.2 会话层域定义 53 带格式的		50	带格式的	(
5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 52 带格式的 六、数据字典 52 带格式的 6.1 数据类型 52 带格式的 6.2 会话层域定义 53 带格式的	5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION) -	51	带格式的	
5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED) 52 **未入 数据字典 ************************************	A		带格式的	
六、数据字典 52 6.1 数据类型 52 6.2 会话层域定义 53		52	带格式的	
6.1 数据类型 52 带格式的 6.2 会话层域定义 53 带格式的	六、数据字典		带格式的	
6.2 会话层域定义 53 带格式的	6.1 数据类型		带格式的	
ш 1a 0 //.	6.2 会话层域定义		带格式的	
	6.3 业务层域定义	53	带格式的	

一、 前言

本接口规范提供给会员和以 DMA 方式接入的机构投资者,用以指导开发以 Binary协议接入深圳证券交易所(以下简称深交所)第五版交易系统提交订单并获取执行报告。本接口规范描述内容包括可开展的业务、必要的运行指导以及详细的数据交换格式。

文档所采用的术语、消息内容、以及消息流描述与 STEP 交易数据接口规范基本一致,可以互为参考。

本接口规范采用 UTF 8 编码。

二、 会话机制

2.1 连接

2.1.1 会话

接入用户通过会话将自身的系统连接到交易网关。该连接为标准的 TCP/IP 点对点连接。

2.1.2 IP 地址和 Port

交易网关按每个平台(平台描述见"服务说明"章节)提供了一个交易服务端口供订单管理系统接入。每个交易网关每个平台只能建立一个 TCP/IP 连接,每一个连接只能对应一个会话。

2.1.3 安全

交易网关和订单管理系统必须位于同一个安全网络之中, 交易网关和订单管理系统 之间传输的数据是非加密的, 数据传输安全由接入用户网络保证。

2.2 会话管理

2.2.1 建立会话

会话建立过程:

- 1. 订单管理系统首先建立一个到交易网关的 TCP/IP 连接, 然后发送一个 Logon 消息给交易网关。
- 2. 如果交易网关验证订单管理系统有权登录,那么交易网关会返回 Logon 消息给 订单管理系统,作为一个登录消息的确认,表示本次会话登录成功。
- 3. 如果订单管理系统登录验证失败,那么交易网关会返回 Logout 消息给订单管理系统,表示本次会话登录失败。

- 4. 订单管理系统发送 Logon 消息后,如果交易网关没有在适当的时间间隔里作回应,则可以关闭连接,并在等待一段时间后再次尝试连接。
- 5. 如果订单管理系统断线或收到交易网关的 Logout 消息, 也应该等待一段时间后再次尝试连接。

2.2.2 心跳包和测试请求

为了交易网关和订单管理系统通信的双方能够实时监测通信链路状态,要求通信双方在数据空闲时互相发送心跳包,当一方没有接收到数据包的时间超过两倍的心跳间隔时,则可认为是数据链路发生故障,接收方可以断开此异常链接。

当订单管理系统登录到交易网关时,订单管理系统应在登录消息中指定心跳间隔参数(单位为秒)。

在一个心跳间隔时间内,如果交易网关没有需要向订单管理系统发送的数据,那么交易网关会向订单管理系统发送一个心跳消息,以保证两条消息之间的时间间隔不会超过设定的心跳间隔;同样,订单管理系统必要时也应该发送心跳消息来保证交易网关收到的连续两条消息之间的时间间隔不超过心跳间隔时间。

订单管理系统也可以采用类似的检测机制对交易网关和订单管理系统之间的连接情况进行检测。

2.2.3 终止会话

订单管理系统和交易网关都能通过发送 Logout 消息要求终止会话。对方接收到 Logout 消息请求后,会发送一条 Logout 消息回应,发起方收到 Logout 消息回应后,终止连接;如果对方没有在适当的时间间隔里作回应,则可终止连接。

2.2.4 重建会话

如果会话被终止, 订单管理系统可以通过登录消息重建会话。

重建会话后, 订单管理系统应通过应用层规则进行下行数据同步。

三、 服务说明

3.1 平台说明

第五版交易系统按业务划分为多个平台,每个平台可以有各自独立的开闭市时间设置,市场参与者需要根据交易网关下发的各个平台的当前状态信息来控制各平台委托申报的开始和停止。

各平台处理的业务划分如下表所示:

平台	业务种类	委托申报时间
现货集中竞价交易平台	现货集中竞价交易	9:15-9:25
	质押式回购交易	9:30-11:30
	债券分销	13:00-15:00
综合金融服务平台	协议交易	
(原综合协议交易平	盘后定价大宗交易	
台)	转融通证券出借	
	资产管理计划份额转让	9:15-11:30
	股票质押式回购	13:00-15:30
	约定购回	
	质押式报价回购	
非交易处理平台	ETF 实时申购赎回	
	网上发行认购	
	(包括 IPO,增发,LOF 发行,	
	可转债申购发行)	
	配股认购	
	债券转股回售	9:15-11:30
	权证行权	13:00-15:00
	开放式基金申购赎回	
	要约收购	
	质押式回购质押解押	
	转托管	
	网络投票(含密码服务)	
衍生品集中竞价交易平		9:15-9:25
台	期权集中竞价交易	9:30-11:30
		13:00-15:00

3.2 委托申报方式说明

用于申报委托的消息有多种类型,接口规范根据每类业务的特性,规定了相应的委 托申报的消息类型。

接口规范中的委托申报消息类型有:

消息类型	报文号	说明
New Order	10xx01	新订单
Quote	10xx05	报价
Quote Request	<u>10xx17</u>	<u>询价</u>
IOI	10xx09	意向申报
Trade Capture Report	10xx03	成交申报
Designation	102099	注册 (转托管)
NetVote	102097	网络投票
Netvote Password Service	102096	密码服务

不同业务可能使用同一种消息类型进行委托申报,但是申报的要素可能有差别,因此同一种消息类型按照业务类型又分为多种报文,以报文号加以区别。

同一业务可能有多种委托申报类型,因此在所有委托申报消息中都存在一个 ApplID 字段,市场参与者在申报委托时,需要按接口规范的要求在委托中填写委托对应的 ApplID。

各类业务的委托申报的报文号及 ApplID 如下表所示:

委托申报类型	申报消息类型	应用标识	所属平台
	MsgType	ApplID	
切伦 (100101	010	现货集中
现货(股票,基金,债券等)集中竞价			竞价交易
交易订单申报			平台
	100201	020	现货集中
质押式回购交易订单申报			竞价交易
			平台
	100301	030	现货集中
债券分销订单申报			竞价交易
			平台
期权集中竞价交易订单申报	100401	040	衍生品集
期权集中竞价交易报价申报	100405	041	中竞价交
期权集中竞价交易询价申报	<u>100417</u>	<u>042</u>	易平台
协议交易意向申报	100509	050	综合金融

带格式的:定义网格后自动调整 右缩进,字体对齐方式:自动对齐

工程技术标准

協议交易定价申报				
协议交易双方配对成交申报	协议交易定价申报	100501	051	服务平台
以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报 100601 060 综合金融 服务平台 以成交量加权平均价交易的盘后定价 大宗交易申报 100601 061 转融通证券出借非约定申报 100701 070 综合金融 服务平台 资产管理计划份额转让 100703 071 服务平台 股票质产管理计划份额转让 100803 080 综合金融 服务平台 约定购回 101903 090 综合金融 服务平台 约定购回 101103 110 综合金融 服务平台 质押式报价回购 101103 110 综合金融 服务平台 度计及集/债券分析 ETF 实时申购 赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回) 101201 120 非交易处 理平台 配股认购申报 101301 130 非交易处 理平台 债券特股申报 101501 150 非交易处 理平台 债券申报 101501 151 理平台 行权申报 101601 160 非交易处 理平台 开放式基金申购赎回申报 101701 170 非交易处 理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处 理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处	协议交易点击成交申报	100501	052	
根	协议交易双方配对成交申报	100503	053	
以成交量加权平均价交易的盘后定价 大宗交易申报 100601 061 转融通证券出借非约定申报 100701 070 综合金融 服务平台 综合金融 服务平台 资产管理计划份额转让 100803 080 综合金融 服务平台 股票质押式回购 100903 090 综合金融 服务平台 约定购回 101003 100 综合金融 服务平台 质押式报价回购 101103 110 综合金融 服务平台 ETF实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购 赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回) 101201 120 非交易处 理平台 配股认购申报 101301 130 非交易处 理平台 配股认购申报 101401 140 非交易处 理平台 行权申报 101501 150 非交易处 理平台 行权申报 101601 160 非交易处 理平台 开放式基金申购赎回申报 101801 180 非交易处 理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处 理平台	以收盘价交易的盘后定价大宗交易申	100601	060	综合金融
大宗交易申报 100701 070 综合金融 转融通证券出借约定申报 100703 071 服务平台 资产管理计划份额转让 100803 080 综合金融 服务平台 股票质押式回购 100903 090 综合金融 服务平台 约定购回 101003 100 综合金融 服务平台 质押式报价回购 101103 110 综合金融 服务平台 ETF实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回) 101201 120 非交易处 理平台 配股认购申报 101301 130 非交易处 理平台 配股认购申报 101401 140 非交易处 理平台 债券回售申报 101501 150 非交易处 理平台 行权申报 101601 160 非交易处 理平台 开放式基金申购赎回申报 101701 170 非交易处 理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处 理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处 理平台	报			服务平台
转融通证券出借非约定申报 100701 070 综合金融 服务平台 服务平台 服务平台 服务平台 100803 080 综合金融 服务平台 服务平台 2009 资产管理计划份额转让 100803 080 综合金融 服务平台 2009 服务平台 2009 经合金融 服务平台 2009 101003 100 综合金融 服务平台 2009 服务平台 2009 101003 110 综合金融 服务平台 2009 服务平台 2009 110 110 综合金融 服务平台 2009 服务平台 2009 101103 110 综合金融 服务平台 2009 服务平台 2009 110 120 非交易处 2009 理平台 2009 理平台 2009 理平台 2009 理平台 2009 101301 130 非交易处 2009 理平台 2009 101401 140 非交易处 2009 理平台 2009 101601 150 非交易处 2009 理平台 2009 101601 160 非交易处 2009 理平台 2009 101801 180 非交易处 2009 理平台 2009 2009 2009 2009 2009 2009 2009 2009 2009 2009 2009 2009 2009 2009 20	以成交量加权平均价交易的盘后定价	100601	061	
转融通证券出借约定申报 100703 071 服务平台 资产管理计划份额转让 100803 080 综合金融 股票质押式回购 100903 090 综合金融 数字平台 约定购回 101003 100 综合金融 质押式报价回购 101103 110 综合金融 展务平台 101201 120 非交易处 建平台 建平台 101301 130 非交易处 建平台 101401 140 非交易处 建平台 101501 150 非交易处 债券转股申报 101501 150 非交易处 债券申报 101601 160 非交易处 行权申报 101701 170 非交易处 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处	大宗交易申报			
資产管理计划份额转让 100803 080 综合金融 服务平台 股票质押式回购 100903 090 综合金融 服务平台 约定购回 101003 100 综合金融 服务平台 质押式报价回购 101103 110 综合金融 服务平台 ETF 实时申购赎回申报 101201 120 非交易处 理平台 赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回) 101301 130 非交易处 理平台 配股认购申报 101401 140 非交易处 理平台 债券转股申报 101501 150 非交易处 理平台 行权申报 101601 160 非交易处 理平台 开放式基金申购赎回申报 101701 170 非交易处 理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处 理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处	转融通证券出借非约定申报	100701	070	综合金融
展案原押式回购 100903 090 综合金融 服务平台 約定购回 101003 100 综合金融 服务平台 例定购回 101103 110 综合金融 服务平台 [長押式报价回购 101103 110 综合金融 服务平台 [基本	转融通证券出借约定申报	100703	071	服务平台
 股票质押式回购 100903 090 综合金融 服务平台 约定购回 101003 100 综合金融 服务平台 质押式报价回购 101103 110 综合金融 服务平台 ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回) 网上发行认购申报 101301 130 非交易处理平台 配股认购申报 101401 140 非交易处理平台 债券转股申报 101501 150 非交易处债券回售申报 101501 151 理平台 行权申报 101601 160 非交易处理平台 开放式基金申购赎回申报 101701 170 非交易处理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处理平台 要约收购解除预受要约申报 	资产管理计划份额转让	100803	080	综合金融
约定购回 101003 100 综合金融 服务平台 质押式报价回购 101103 110 综合金融 服务平台 ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回) 101201 120 非交易处理平台 配股认购申报 101301 130 非交易处理平台 配股认购申报 101401 140 非交易处理平台 债券转股申报 101501 150 非交易处理平台 行权申报 101501 151 理平台 开放式基金申购赎回申报 101701 170 非交易处理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处				服务平台
101003 100 综合金融 服务平台	股票质押式回购	100903	090	综合金融
原押式报价回购 101103 110 综合金融 服务平台 ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购 赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回) 101301 130 非交易处 理平台 配股认购申报 101401 140 非交易处 理平台 債券特股申报 101501 150 非交易处 理平台 101501 151 理平台 101601 160 非交易处 理平台 101701 170 非交易处 理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处 理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处 理平台 要约收购解除预受要约申报				服务平台
质押式报价回购101103110综合金融 服务平台ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购 赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回)101201120非交易处 理平台网上发行认购申报101301130非交易处 理平台配股认购申报101401140非交易处 理平台债券转股申报101501150非交易处 理平台行权申报101601160非交易处 理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处 理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处 理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处	约定购回	101003	100	综合金融
ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购 赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回)101201120非交易处 理平台网上发行认购申报101301130非交易处 理平台配股认购申报101401140非交易处 理平台债券转股申报101501150非交易处 理平台行权申报101501151理平台行权申报101601160非交易处 理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处 理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处 理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处				服务平台
ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购 赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回)101201非交易处 理平台网上发行认购申报101301130非交易处 理平台配股认购申报101401140非交易处 理平台债券转股申报101501150非交易处 理平台行权申报101501151理平台行权申报101601160非交易处 理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处 理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处 理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处	质押式报价回购	101103	110	综合金融
(支持股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回)理平台网上发行认购申报101301130非交易处理平台配股认购申报101401140非交易处理平台债券转股申报101501150非交易处理平台行权申报101501151理平台开放式基金申购赎回申报101601160非交易处理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处理平台要约收购解除预受要约申报101801180非交易处理平台				服务平台
赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回) 101301 130 非交易处理平台 配股认购申报 101401 140 非交易处理平台 债券转股申报 101501 150 非交易处理平台 债券回售申报 101501 151 理平台 行权申报 101601 160 非交易处理平台 开放式基金申购赎回申报 101701 170 非交易处理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处	ETF 实时申购赎回申报	101201	120	非交易处
网上发行认购申报 101301 130 非交易处理平台 配股认购申报 101401 140 非交易处理平台 债券转股申报 101501 150 非交易处理平台 债券回售申报 101501 151 理平台 行权申报 101601 160 非交易处理平台 开放式基金申购赎回申报 101701 170 非交易处理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处	(支持股票/债券/货币 ETF 实时申购			理平台
四上发行认购申报理平台配股认购申报101401140非交易处理平台债券转股申报101501150非交易处理平台行权申报101501151理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处理平台	赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回)			
理平台 理平台 理平台 理平台 非交易处 理平台 情券转股申报 101501 150 非交易处 理平台 101501 151 理平台 101601 160 非交易处 理平台 101601 160 非交易处 理平台 101701 170 非交易处 理平台 101801 180 非交易处 理平台 101801 180 非交易处 理平台 101801 181 非交易处 理平台 101801 181 非交易处 理平台 101801 181 非交易处 理平台 101801 181 非交易处 101801 181 180	网上宏行礼的中枢	101301	130	非交易处
配股认购申报理平台债券转股申报101501150非交易处债券回售申报101501151理平台行权申报101601160非交易处 理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处 理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处 理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处	四工及11 以购 中报			理平台
债券转股申报101501150非交易处债券回售申报101501151理平台行权申报101601160非交易处 理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处 理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处 理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处	新班引動中枢	101401	140	非交易处
债券回售申报101501151理平台行权申报101601160非交易处理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处理平台	日 及			理平台
行权申报101601160非交易处理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处理平台	债券转股申报	101501	150	非交易处
行权申报理平台开放式基金申购赎回申报101701170非交易处理平台要约收购预受要约申报101801180非交易处理平台要约收购解除预受要约申报101801181非交易处	债券回售申报	101501	151	理平台
理平台 开放式基金申购赎回申报 101701 170 非交易处 理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处 理平台 101801 非交易处 理平台 101801 非交易处 理平台 101801 非交易处	行权由坦	101601	160	非交易处
开放式基金申购赎回申报 理平台 要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处	11 12 T 1R			理平台
要约收购预受要约申报 101801 180 非交易处理平台 要约收购解除预受要约申报 101801 181 非交易处理平台	开放式其会由的赎回由证	101701	170	非交易处
要约收购预受要约申报 理平台 理平台 101801 181 非交易处	// 双 八			理平台
理平台	西约	101801	180	非交易处
要约收购解除预受要约申报	女约42.69 10 足女约 中极			理平台
理平台	西约	101801	181	非交易处
	女约4x%附示坝义女约甲根			理平台

工程技术标准

质押式回购质押申报	101901	190	非交易处
质押式回购解押申报	101901	191	理平台
4+ 1e &	102099	200	非交易处
转托管			理平台
投票	102197	210	非交易处
密码服务激活	102196 <u>102189</u>	211	理平台
密码服务挂失	1021 <u>89</u> 96	212	
黄金 ETF 实物申购赎回申报	102201	220	非交易处
(该委托只能由上海黄金交易所申报)			理平台
借券申报	<u>102301</u>	<u>230</u>	非交易处
还券申报	<u>102301</u>	<u>231</u>	理平台

注: ApplID 的前两位表示业务代码, 第三位表示该业务下的委托申报代码。

3.3 委托消息处理流程

对于 OMS 申报的委托,交易系统会首先作一些基本合法性检查,比如委托中的证券代码是否存在、是否到达委托申报时间等等。

如果检查未通过, 交易系统会通过 Business Reject (MsgType=4) 消息通知 OMS 委托被拒绝。

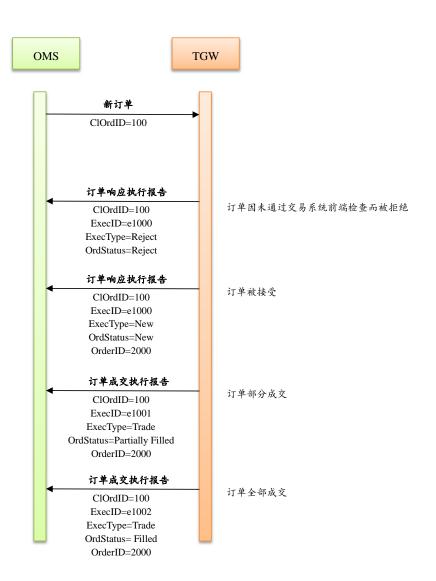
如果通过基本合法性检查, 交易系统会根据委托消息类型的不同给 OMS 发出相应的回报消息, 具体参见 3.4-3.9 节。

3.4 新订单处理消息流图

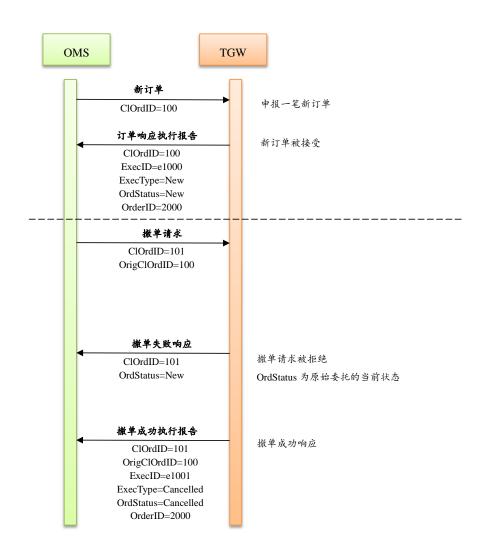
对于 OMS 提交的新订单,交易系统以执行报告消息作为响应。执行报告消息分为两类报文,一类报文用于新订单的确认响应、撤单成功时的响应以及委托被交易系统自动撤销时(比如市价委托剩余自动撤销)的响应(MsgType=20xx02),一类报文用于新订单达成成交时的响应(MsgType=20xx15)。

对于ETF实时申购赎回、行权等非交易订单,只会回报上述第一类执行报告。

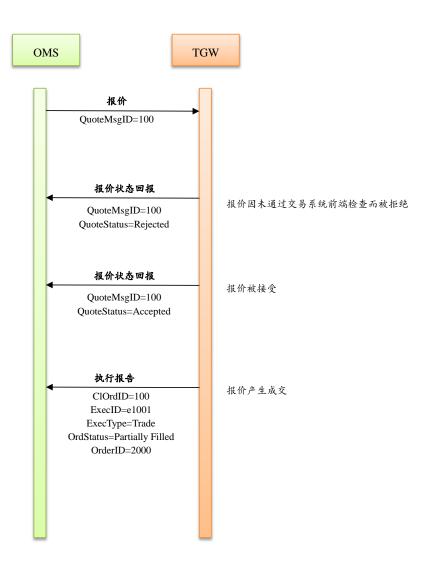
3.4.1 新订单消息流图



3.4.2 撤单请求消息流图

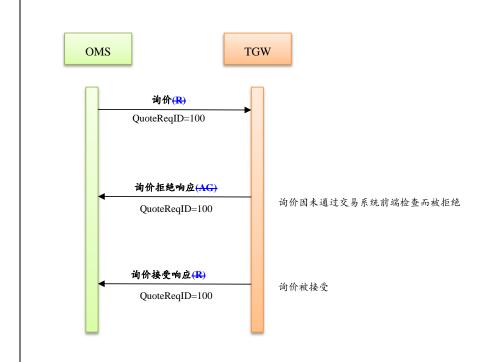


3.5 报价处理消息流图

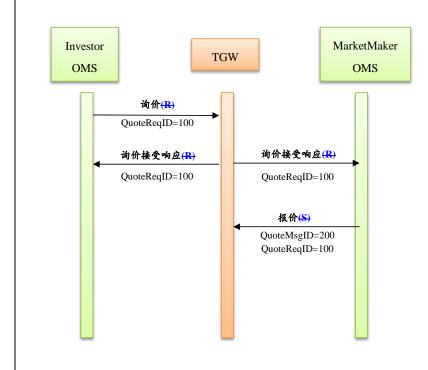


3.6 询价处理消息流图

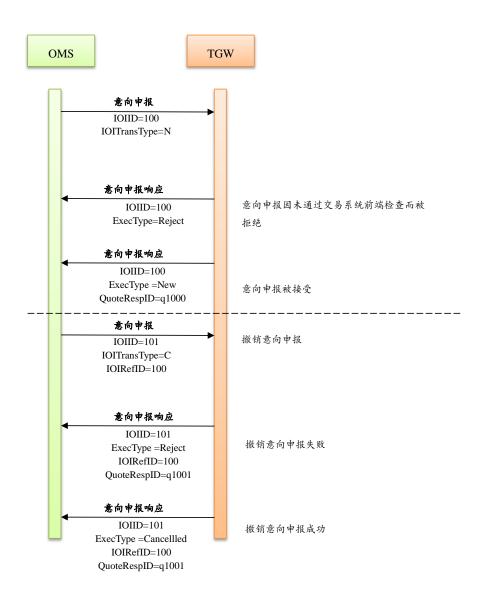
3.6.1 投资者申报处理



3.6.2 做市商接收询价处理



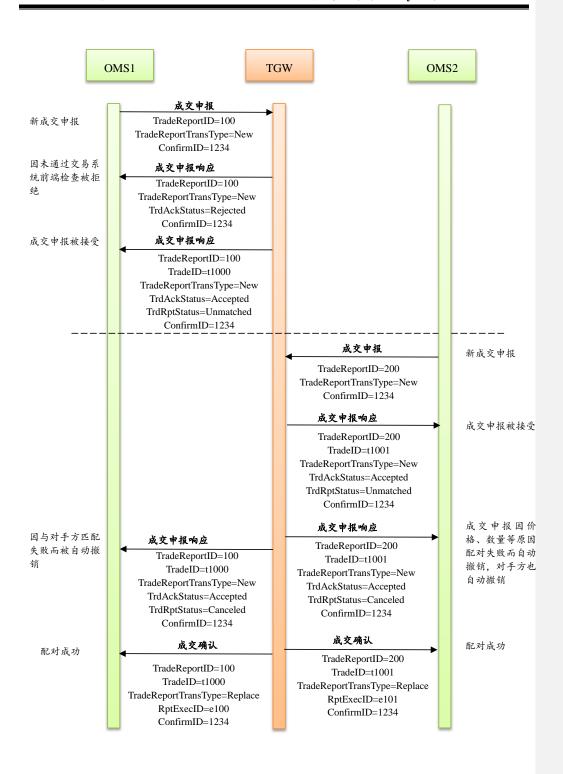
3.63.7 意向申报处理消息流图



3.73.8 成交申报处理消息流图

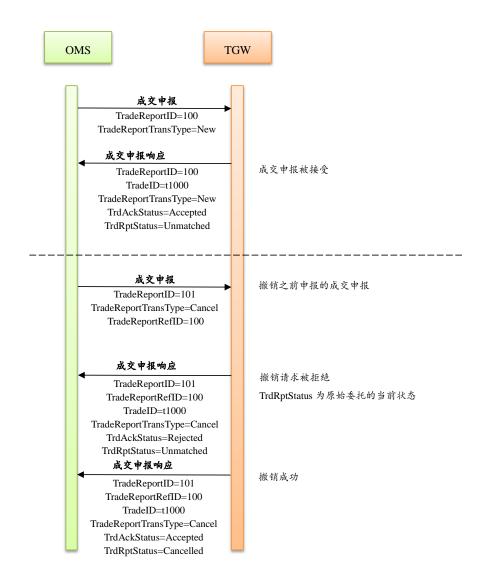
3.7.1 3.8.1 协议配对申报模式 (one party report for matching)

3.7.1.1 3.8.1.1 新成交申报处理

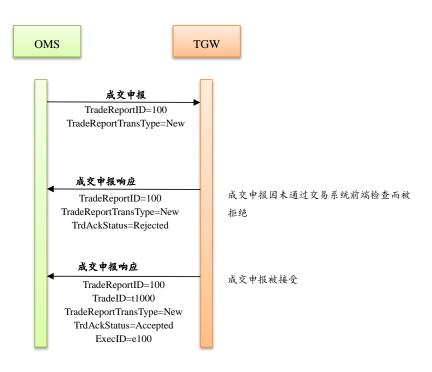


3.7.1.2 3.8.1.2

撤销尚未完成配对的成交申报

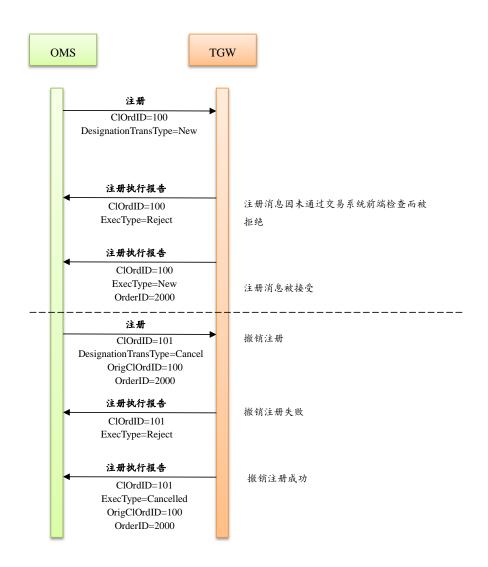


3.7.2 3.8.2 成交报告申报模式 (two party report)



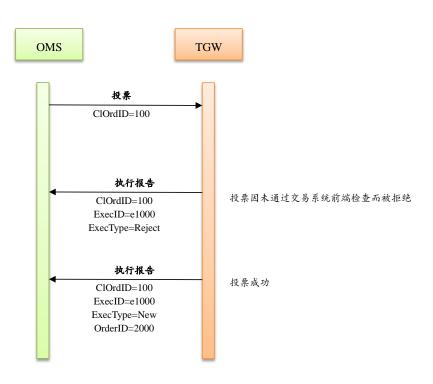
成交报告申报模式暂不支持撤销。

3.83.9 转托管处理消息流图

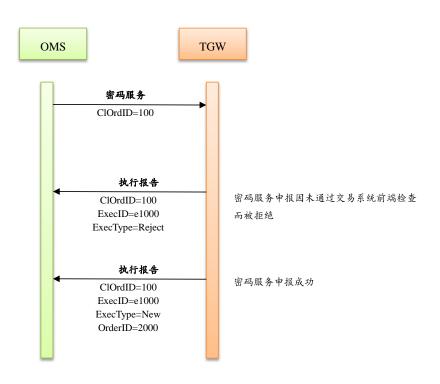


3.93.10 网络投票处理消息流图

3.9.1 3.10.1 投票处理消息流图

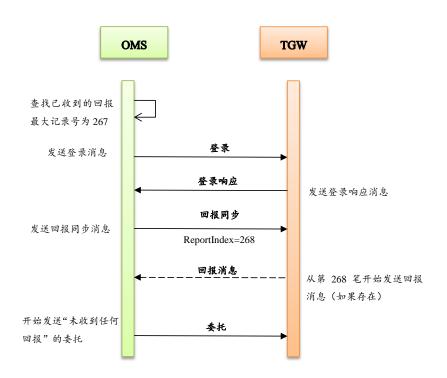


3.9.2 3.10.2 密码服务处理消息流图



3.103.11 应用层消息恢复

TGW 发送给 OMS 的每笔回报消息 (业务拒绝消息 Business Reject 除外)都有一个回报记录号 ReportIndex 字段,字段值从 1 开始连续编号,表示该笔回报是第几笔回报,在 OMS 与 TGW 异常断开连接后,OMS 应该首先查找到已收到回报的最大记录号并按照下图所示流程与 TGW 重新建立连接(首次建立连接也必须按照该流程进行,相当于最大记录号为 0):



OMS 在发送回报同步消息后,并不需要等待到有回报消息返回才开始发送委托,但建议等待3秒钟以接收尽可能多的回报消息,从而减少委托的重复发送。

在闭市以后,OMS 不能继续申报委托,但是仍然可以登录 TGW 并通过该机制重新接收当天的回报数据,比如将同步消息中的 ReportIndex 设置为 1 即可以重新接收当天的所有回报数据。

如果 OMS 发送的回报同步消息中的 ReportIndex 值大于实际存在的回报记录数目,则 TGW 不会发送回报消息,直至回报记录数达到 ReportIndex 值才开始继续回报。比如发送的回报同步消息中的 ReportIndex 为 1001,而 TGW 端实际存在的回报数只有 300,则 TGW 会等到实际的回报数达到 1001 时才开始发送回报,回报记录号为 1-1000 的回报不会发送给 OMS。

四、 消息定义

4.1 消息结构

每一条消息都由消息头、消息体和消息尾组成。

4.1.1 消息头

消息头定义了应用消息的类型、长度数据域,均不加密传输。

工程技术标准

域名	字段描述
MsgType	消息类型
BodyLength	消息体长度

带格式的: 正文,缩进:首行缩 进: 0.74 厘米,右侧: 0 厘米

4.1.2 消息尾

消息尾定义了消息的校验和,不加密传输。校验和的计算范围从消息头开始(包括消息头)一直到消息体结束。

域名	字段描述	
Checksum	校验和	

以下为计算校验和的代码段:

```
uint32 GenerateCheckSum( char *buf, uint32 bufLen )
{
    long idx;
    uint32 cks;
    for( idx = 0L, cks = 0; idx < bufLen; cks += (uint32)buf[ idx++ ] );
    return (cks % 256 );
}</pre>
```

4.2 管理消息

4.2.1 登录消息 (Logon)

Logon 消息应该是订单管理系统开始工作时向交易网关发出的第一条消息。订单管理系统使用 Logon 消息来与交易网关建立连接,交易网关使用 Logon 消息确认订单管理系统登录成功。

域名	字段描述	
Standard Header	MsgType = 1	
SenderCompID	发送方代码	
TargetCompID	接收方代码	
II DI	心跳间隔, 单位为秒。订单管理系统登陆时提供	
HeartBtInt	给交易网关。	
Password	密码	
DefaultApplVerID	二进制协议版本,即数据接口规范版本。	

4.2.2 注销消息 (Logout)

当订单管理系统发起的连接请求不被交易网关接受时,交易网关会向订单管理系统发送 Logout 消息来拒绝登录请求。在必要时订单管理系统也可以主动发送 Logout 消息

来中断当前和交易网关的连接。

域名	字段描述	
Standard Header	MsgType = 2	
	退出时的会话状态	
	0= 会话活跃	
	1= 会话口令已更改	
	2= 将过期的会话口令	
	3= 新会话口令不符合规范	
	4= 会话退登完成	
C : · C + - +	5= 不合法的用户名或口令	
SessionStatus	6= 账户锁定	
	7= 当前时间不允许登录	
	8= 口令过期	
	9= 收到的 MsgSeqNum(34)太小	
	10 = 收到的 NextExpectedMsgSeqNum(789)太大.	
	101 = 其他	
	102= 无效消息	
Tr	文本	
Text	注销原因的进一步补充说明	

4.2.3 心跳消息 (Heartbeat)

交易网关和订单管理系统之间用 Heartbeat 消息来检测 TCP 连接的状态,因此当一方处于数据发送空闲期时,需要定时发送 Heartbeat 消息以供检测连接的健康度。

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 3, BodyLength=0

4.3 业务消息-新订单处理

4.3.1 新订单 (New Order)

域名	字段描述
G. 1 1H 1	消息头
Standard Header	MsgType=10xx01
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
	102=深圳证券交易所

OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定
Side	买卖方向
	订单类别
OudTon-	1表示市价
OrdType	2表示限价
	U本方最优
OrderQty	订单数量
Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务新订单的申报

业务	应用标识	报文号	Side (54)	有无扩展字
	ApplID	MsgType		段
现货(股票,基金,债券等)集	010	100101	1=买	Υ
中竞价交易申报	010		2=卖	
医细头回肠应用由扭	020	100201	1=买(融资)	Υ
质押式回购交易申报	020		2=卖(出资)	
, 	030	100301	1=买(认购)	N
债券分销申报	030		2=卖(分销)	
地 与 住 由 产 从 六 日 由 初	040	100401	1=买	Υ
期权集中竞价交易申报	040		2=卖	
协议会目的从由和	054	100501	1=买	Υ
协议交易定价申报	051		2=卖	
计分类目下十分分析的	050		1=买	
协议交易点击成交申报	052		2=卖	
以收盘价交易的盘后定价大宗交	060	100601	1=买	N

深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范

易申报			2=卖	
以成交量加权平均价交易的盘后	0/4		1=买	
定价大宗交易申报	061		2=卖	
社可以不不可用什么户中间	070	100701	G=借入	Υ
转融通证券出借非约定申报	070		F=出借	
	400	101201	D=申购	N
ETF 实时申购赎回申报	120		E=赎回	
网上发行认购申报	130	101301	固定填1	N
配股认购申报	140	101401	固定填1	N
债券转股申报	150	101501	固定填1	N
债券回售申报	151		固定填1	
行权申报	160	101601	固定填1	N
	470	101701	D=申购	N <u>Y</u>
开放式基金申购赎回申报	170		E=赎回	
要约收购预受要约申报	180	101801	固定填1	Υ
要约收购解除预受要约申报	181		固定填1	
质押式回购质押申报	190	101901	固定填1	N
质押式回购解押申报	191		固定填1	
借券申报	230	102301	固定填1	N
还券申报	<u>231</u>		固定填1	

2) 现货集中竞价交易、质押式回购交易、期权集中竞价交易三类业务申报的 OrdType 可取值 1/2/U, 其他业务申报的 OrdType 固定填 2。

4.3.1.1 现货集中竞价业务新订单扩展字段(100101)

域名	字段描述		
StopPx	止损价		
MinQty	最低成交数量		
MaxPriceLevels	最多成交价位数		
	0表示不限制成交价位数		
TimeInForce	订单有效时间类型		
	信用标识		
CashMargin	1=Cash, 普通交易		
	2=Open,融资融券开仓		

3=Close,融资融券平仓

注:

1) 限价委托及五种市价委托申报方式:

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
限价委托	0	2	0	0
本方最优	0	U	0	0
对手方最优	0	1	1	0
立即成交剩余撤	3	1	0	0
销				
全额成交或撤销	3	1	0	=OrderQty
最优五档全额成	3	1	5	0
交剩余撤销				

2) 如果 CashMargin 取值为"融资融券平仓(3)",同时订单所有者类型为"会员发起(102)",则表示该笔订单为会员强制平仓。

4.3.1.2 质押式回购交易业务新订单扩展字段(100201)

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
	最多成交价位数
MaxPriceLevels	0表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型

4.3.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段(100401)

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
	最多成交价位数
MaxPriceLevels	0 表示不限制成
	交价位数
	订单有效时间类
TimeInForce	型
PositionEffect	平仓标识

	('O': 开仓
	'C': 平仓)
	备兑标签
	(0=Covered,表
CoveredOrUncovered	示备兑
	1=UnCovered, 表
	示非备兑)
ContractAccoutCodeContractAccountCode	合约账户识别码
	合约账户标识码

4.3.1.4 协议交易业务新订单扩展字段(100501)

域名	字段描述
ConfirmID	约定号
	点击成交申报填写

4.3.1.5 转融通证券出借业务新订单扩展字段(100701)

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型
	1=固定期限

4.3.1.6 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段(101701)

域名	字段描述
CashOrderQty	申购金额

注:

1) LOF 是现金申购,份额赎回,申购时使用 CashOrderQty 填写申购金额,金额必须为 1 元的整数倍,OrderQty 填 0;赎回时使用 OrderQty 填写赎回份额。

4.3.1.7 要约收购业务新订单扩展字段(101801)

域名	字段描述
Tenderer	收购人编码

4.3.2 撤单请求 (Order Cancel Request)

域名	字段描述
Standard Header	消息头
	MsgType=190007
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
Side	原始订单买卖方向
	原始订单交易所订单编号
OrderID	交易所对该字段的值不作检查
	原始订单数量
OrderQty	交易所对该字段的值不作检查

4.3.3 撤单失败响应(Cancel Reject)

域名	字段描述
Standard Header	消息头
	MsgType=290008
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间

UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
Side	原始订单买卖方向
	原始订单当前状态
OrdStatus	如果未找到原始订单,则填
	8=Rejected
CxlRejReason	拒绝原因代码
RejectText	拒绝原因说明
OrderID	原始订单交易所订单编号

4.3.4 订单响应及撤单成功执行报告(Execution Report)

域名	字段描述
Standard Header	消息头
	MsgType=20xx02
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
	客户订单编号
ClOrdID	如果是报价委托的成交则填写
	QuoteMsgID
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
ExecID	执行编号
ЕхесТуре	执行类型
OrdStatus	订单状态

OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
OrdType	订单类别
OrderQty	订单数量
Price	价格
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderRestrictions	<u>订单限定</u>
Extend Fields	各业务扩展字段

1) 该消息用于以下业务的订单响应及撤单成功响应

业务	应用标识	报文号	有无扩展
	ApplID	MsgType	字段
现货(股票,基金,债券等)	010	200102	Υ
集中竞价交易执行报告	010		
质押式回购交易执行报告	020	200202	Υ
债券分销执行报告	030	200302	N
期权集中竞价交易执行报告	040	200402	Υ
协议交易定价执行报告	051	200502	Υ
协议交易点击成交执行报告	052		
以收盘价交易的盘后定价大	060	200602	N
宗交易执行报告	060		
以成交量加权平均价交易的	061		
盘后定价大宗交易执行报告	001		
转融通证券出借非约定执行	070	200702	Υ
报告	070		
股票/债券/货币 ETF 实时申		201202	Υ
购赎回执行报告	120		
黄金 ETF 现金申购赎回执行	120		
报告			
网上发行认购执行报告	130	201302	N

配股认购执行报告	140	201402	N
债券转股执行报告	150	201502	N
债券回售执行报告	151		
行权执行报告	160	201602	N
开放式基金申购赎回执行报	470	201702	<u>NY</u>
告	170		
要约收购预受要约执行报告	180	201802	Υ
要约收购解除预受要约执行	101		
报告	181		
质押式回购质押执行报告	190	201902	N
质押式回购解押执行报告	191		
黄金 ETF 实物申购赎回执行	000	202202	N
报告	220		
借券申报	<u>230</u>	202302	N
还券申报	<u>231</u>		

4.3.4.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段(200102)

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数
	0表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识

4.3.4.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段(200202)

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
	最多成交价位数
MaxPriceLevels	0表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型

4.3.4.3 期权集中竞价业务执行报告扩展字段(200402)

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
	最多成交价位数
MaxPriceLevels	0 表示不限制成
	交价位数
	订单有效时间类
TimeInForce	型
	平仓标识
PositionEffect	('O': 开仓
	'C': 平仓)
	备兑标签
	(0=Covered, 表
	示备兑
CoveredOrUncovered	1=UnCovered, 表
	示非备兑)
	目前仅适用于期
	权集中竞价业务
	合约账户识别码
ContractAccoutCode ContractAccountCode	合约账户标识码

4.3.4.4 协议交易业务执行报告扩展字段(200502)

域名	字段描述
ConfirmID	约定号

4.3.4.5 转融通证券出借业务执行报告扩展字段(200702)

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型

4.3.4.6 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段(201202)

	域名	字段描述
--	----	------

InsufficientSecurityID		申赎不足成份股证券代码 申购时如果投资者持有成 份股不足,填写第一只不 足额的成份股代码
		赎回时如果基金管理人成 份股不足,填写第一只不 足额的成份股代码
NoSecurity		成份股记录数
→	UnderlyingSecurityID	成份股证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→	DeliveryQty	股份交付数量
→	SubstCash	现金替代金额

4.3.4.7 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段(201702)

域名	字段描述
CashOrderQty	申购金额

4.3.4.8 要约收购业务执行报告扩展字段(201802)

域名	字段描述
Tenderer	收购人编码

4.3.5 订单成交执行报告(Execution Report)

域名	字段描述
Standard Header	消息头
Standard Header	MsgType=20xx15
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码

TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
	客户订单编号
ClOrdID	如果是报价委托的成交则填写
	QuoteMsgID
ExecID	执行编号
ЕхесТуре	执行类型
OrdStatus	订单状态
LastPx	成交价
LastQty	成交数量
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

1) 该消息用于以下业务订单成交回报

业务	应用标识	报文号	有无扩展
	ApplID	MsgType	字段
现货(股票,基金,债券等)	040	200115	Υ
集中竞价交易执行报告	010		
质押式回购交易执行报告	020	200215	Υ
债券分销执行报告	030	200315	N
期权集中竞价交易执行报告	040	200415	Υ
协议交易定价执行报告	051	200515	Υ
协议交易点击成交执行报告	052		
以收盘价交易的盘后定价大	0/0	200615	N
宗交易执行报告	060		
以成交量加权平均价交易的	0/1		
盘后定价大宗交易执行报告	061		

·融通证券出借非约定执行 {告

4.3.5.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段(200115)

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.3.5.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段(200215)

域名	字段描述
MarturityDate	到期日

注:在回购到期日,交易系统会主动下发一笔回购到期成交执行报告,其中应用标识 AppIID⁴为 029,回报时间 Transactime 为当前时间,其他字段与初始交易成交执行报告一致。

4.3.5.3 期权集中竞价业务执行报告扩展字段(200415)

域名	字段描述
	平仓标识
PositionEffect	('O': 开仓
	'C': 平仓)
	备兑标签
	(0=Covered, 表
	示备兑
CoveredOrUncovered	1=UnCovered, 表
	示非备兑)
	目前仅适用于期
	权集中竞价业务
	合约账户识别码
ContractAccoutCode ContractAccountCode	合约账户标识码

4.3.5.4 协议交易业务执行报告扩展字段(200515)

域名	字段描述
ConfirmID	约定号

4.3.5.5 转融通证券出借业务执行报告扩展字段(200715)

13 /2	定卧址法
類. み	子

带格式的:字体: 五号

带格式的: 正文, 缩进: 左侧: 0 厘米, 首行缩进: 0.74 厘米

ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型
MarturityDate	到期日

4.4 业务消息-报价处理

4.4.1 报价(Quote)

域名	字段描述
G. 1 111 1	消息头
Standard Header	MsgType=10xx05
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
	取 102,表示代码源为深圳证券交
	易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号
AccountID	证券账户
	报价请求 ID
	预留字段
QuoteReqID	当报价是对报价请求的响应时, 填
	写报价请求 的 ID
0	报价类型
QuoteType	1=可交易的报价(Tradeable)
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务报价申报

应用标识	说明	报文号	有无扩展
ApplID		MsgType	字段
041	期权集中竞价交易报价申报	104105 100405	Υ

带格式的:定义网格后自动调整 右缩进,字体对齐方式:自动对齐

2) 报价消息支持以下报价方式(不支持撤销单边报价)

报价方式	方式 BidSize OfferSize	
双边报价	>0	>0
买报价	>0	=0
卖报价	=0	>0
撤销报价	=0	=0

4.4.1.1 期权集中竞价业务报价扩展字段(100405)

P 克价业分报价扩展子段(100405)			
域名	字段描述		
	买平仓标识		
	('O': 开仓		
D. D. L. Dog	'C': 平仓)		
BidPositionEffect	BidSize=0时该字		
	段无意义,填写		
	空格		
	卖平仓标识		
	('O': 开仓		
OS D W FS	'C': 平仓)		
OfferPositionEffect	OfferSize=0 时该		
	字段无意义,填		
	写空格		
	合约账户识别码		
ContractAccoutCode ContractAccountCode	合约账户标识码		

4.4.2 报价状态回报(Quote Status Report)

域名	字段描述
C411 II 1	消息头
Standard Header	MsgType=20xx06
ReportIndex	回报记录号

ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号
AccountID	证券账户
QuoteReqID	报价请求 ID
	报价状态
QuoteStatus	0=Accepted,接受
	5=Rejected,拒绝
QuoteRejectReason	拒绝原因代码
QuoteType	报价类型
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
Extend Fields	各业务扩展字段

1) 该消息用于以下业务报价状态的回报

应用标识	说明	报文号	有无扩展
ApplID		MsgType	字段
0.44	期权集中竞价交易报价状态	200406	Υ
041	回报		

4.4.2.1 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段(200406)

域名	字段描述	
BidPositionEffect	买平仓标识	

	('O': 开仓
	'C': 平仓)
	卖平仓标识
OfferPositionEffect	('O': 开仓
	'C': 平仓)
Contract Account Color Contract Account Color	合约账户识别码
ContractAccoutCodeContractAccountCode	合约账户标识码

4.5 业务消息-询价申报处理

4.5.1 询价申报(Quote Request)

<u>域名</u>	字段描述
Ct-ud-ud IId-u	消息头
Standard Header	MsgType=10xx17
<u>ApplID</u>	应用标识
SubmittingPBUID	<u>申报交易单元</u>
SecurityID	证券代码
<u>SecurityIDSource</u>	证券代码源
	102=深圳证券交易所
<u>OwnerType</u>	订单所有者类型
<u>ClearingFirm</u>	<u>结算机构代码</u>
<u>TransacTime</u>	委托时间
<u>UserInfo</u>	用户私有信息
<u>QuoteReqID</u>	报价请求 ID
AccountID	证券账户
<u>BranchID</u>	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

<u>注:</u>

1) 该消息用于以下业务询价申报

应用标识	<u>说明</u>	报文号	有无扩展
ApplID		MsgType	<u>字段</u>
<u>042</u>	期权集中竞价交易 <u>询价申报</u>	100417	<u>Y</u>

带格式的:标题 2

带格式的:定义网格后自动调整 右缩进, 无项目符号或编号,调 整中文与西文文字的间距,调整中 文与数字的间距,制表位:不在 3.17 字符

带格式表格

带格式的:缩进:首行缩进: 0.85 厘米,定义网格后自动调整 右缩进, 无项目符号或编号,调 整中文与西文文字的间距,调整中 文与数字的间距,制表位:不在 3.17 字符

带格式的:定义网格后自动调整 右缩进,字体对齐方式:自动对齐

4.5.1.1 期权集中竞价业务询价扩展字段(100417)

<u>域名</u>	字段描述
ContractAccountCode	<u>合约账户标识码</u>

4.5.2 询价申报接受响应 (Quote Request Ack)

<u>域名</u>	字段描述
G. 1 1W 1	消息头
Standard Header	MsgType=20xx17
ReportIndex	回报记录号
<u>ApplID</u>	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
<u>OwnerType</u>	订单所有者类型
ClearingFirm	<u>结算机构代码</u>
<u>TransacTime</u>	回报时间
<u>UserInfo</u>	用户私有信息
<u>QuoteReqID</u>	报价请求 ID
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务询价申报接受响应

应用标识	<u>说明</u>	报文号	有无扩展
ApplID		MsgType	<u>字段</u>
<u>042</u>	期权集中竞价交易询价申报	200417	<u>Y</u>

4.5.2.1 期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段(200417)

<u>域名</u>	字段描述
ContractAccountCode	<u>合约账户标识码</u>

带格式表格

带格式的:定义网格后自动调整 右缩进, 无项目符号或编号,调 整中文与西文文字的间距,调整中 文与数字的间距,制表位:不在 3.17 字符

带格式的: 編号 + 级别: 1 + 编 号样式: 1, 2, 3, ··· + 起始编号: 1 + 对齐方式: 左侧 + 对齐位置: 2.22 厘米 + 缩进位置: 2.96 厘 米

4.5.3 询价申报拒绝响应(Quote Request Reject)

域名	字段描述
Standard Header	消息头 <u>MsgType=20xx18</u>
ReportIndex	回报记录号
<u>ApplID</u>	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
<u>SecurityID</u>	证券代码
<u>SecurityIDSource</u>	证券代码源
<u>OwnerType</u>	订单所有者类型
ClearingFirm	<u>结算机构代码</u>
<u>TransacTime</u>	回报时间
<u>UserInfo</u>	用户私有信息
<u>QuoteReqID</u>	报价请求 ID
QuoteRequestRejectReason	拒绝原因代码
AccountID	证券账户
<u>BranchID</u>	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务询价申报拒绝响应

应用标识	<u>说明</u>	报文号	有无扩展
<u>ApplID</u>		MsgType	<u>字段</u>
<u>042</u>	期权集中竞价交易询价申报	200418	<u>Y</u>

4.5.3.1 期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段(200418)

<u>域名</u>	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码_

4.54.6_业务消息-意向申报处理

4.5.1 4.6.1 意向申报 (Indication of Interest)

域名	字段描述

带格式的:定义网格后自动调整 右缩进, 无项目符号或编号,调 整中文与西文文字的间距,调整中 文与数字的间距,制表位:不在 3.17 字符

C4dd	消息头
Standard Header	MsgType=10xx09
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
	102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
IOIID	客户意向申报编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
	意向申报类型
IOITransType	取值为: N=意向申报, C=意向申报
	撤单
	买卖方向
Side	1表示买
	2表示卖
IOIRefID	原意向申报 IOIID
IOIQty	数量
Price	价格

1) 该消息用于以下业务的意向申报

应用标识	说明	报文号	有无扩展
ApplID		MsgType	字段
050	协议交易意向申报	100509	Υ

4.5.1.1 4.6.1.1

__协议交易意向申报扩展字段(100509)

域名	字段描述
Contactor	联系人
ContactInfo	联系方式

4.5.2 4.6.2 意向申报响应(Quote Response)

域名	字段描述
Standard Header	消息头
	MsgType=20xx10
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteRespID	交易所意向申报响应编号
0 1 7 7	响应类型
QuoteRespType	2=意向申报响应
	执行类型
EvacTrus	0=New, 意向申报成功
ЕхесТуре	4=Canceled, 意向申报撤单成功
	8=Reject,意向申报拒绝
QuoteRejectReason	拒绝原因代码
IOIID	客户意向申报编号
	原意向申报 IOIID, 对于意向申报
IOIRefID	该字段取值为空, 若为撤单则为被
	撤原意向申报 IOIID
IOITransType	意向申报类型
Side	买卖方向
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
IOIQty	数量
Price	价格

1) 该消息用于以下业务的意向申报响应

应用标识	说明	报文号	有无扩展
ApplID		MsgType	字段
050	协议交易意向申报响应	2005010	Υ

4.5.2.1 4.6.2.1

__协议交易意向申报扩展字段(200510)

域名	字段描述
Contactor	联系人
ContactInfo	联系方式

4.64.7 业务消息-成交申报处理

4.6.1 4.7.1 成交申报(Trade Capture Report)

域名	字段描述
G. 1 111 1	消息头
Standard Header	MsgType=10xx03
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
	102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号
T. 1.D. (T.	成交申报类型
TradeReportType	0=提交成交申报
	成交申报事务类别
TradeReportTransType	0=New
	1=Cancel
To deller din deste	成交申报模式
TradeHandlingInstr	1=Two-Party Report,成交报告

	2=One-Party report for matching,
	协议配对
T 15 5 T	原客户成交申报编号
TradeReportRefID	撤销成交申报时使用
LastPx	价格
LastQty	数量
	成交申报业务类别
	1001=股票质押式回购初始交易
	1002=股票质押式回购提前购回
	1003=股票质押式回购到期购回
	1004=股票质押式回购延期购回
	1005=股票质押式回购终止购回
	1006=股票质押式回购补充质押
TudTon -	1007=股票质押式回购部分解除
TrdType	质押
	1008=股票质押式回购违约处置
	1011=约定购回初始交易
	1012=约定购回提前购回
	1013=约定购回到期购回
	1014=约定购回延期购回
	1021=质押式报价回购初始交易
	1022=质押式报价回购提前购回
T. 10.1 T.	成交申报业务子类别
TrdSubType	预留,固定填0
ConfirmID	约定号
Side	本方参与人买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

1) 该消息用于以下业务的成交申报

业务	应用标识	报文号	成交申报模式	有无扩展
	ApplID	MsgType	TradeHandlingInstr	字段
协议交易双方协议成交申报	053	100503	协议配对	N
转融通证券出借约定申报	071	100703	协议配对	Υ
资产管理计划份额转让	160 080	100803	成交报告	Υ
股票质押式回购	170 090	100903	成交报告	Υ
约定购回	180 100	101003	成交报告	Υ
质押式报价回购	1 <u>10</u> 90	101103	成交报告	Υ

2) 各业务成交申报的市场参与人代码填写方式

业务	Side	PBUID	功	BranchID	Counterparty	Counterparty	Counterparty
亚分	Side	FBUID	Accounting	Diancino	1 3	1 1	Counterparty
					PBUID	AccountID	BranchID
协议交易双方协议成	1=买	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
交申报 (053)	2=卖						
转融通证券出借约定	G=借入	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
申报(071)	F=出借						
资产管理计划份额转	固定为1	转入方	转入方	转入方	转出方	转出方	转出方
让(160<u>080</u>)							
股票质押式回购	固定为2	(资	(资金)	(资金)	(资金) 融	(资金)融	不填
l i		金)融	融入方	融入方	出方	出方	
(170 090)		入方					
	固定为2	客户方	客户方	客户方	不填	证券公司专	不填
约定购回(180 <u>100</u>)		(券融	(券融	(券融		用账户	
		出)	出)	出)			
F 加 上 扣 从 ¬ 以	固定为1	客户方	客户方	客户方	不填	证券公司自	不填
质押式报价回购		(资金	(资金融	(资金		营账户	
(190<u>110</u>)		融出)	出)	融出)			

4.6.1.1 4.7.1.1 转融通证券出借业务成交申报扩展

字段(100703)

域名	字段描述
ExpirationDays	期限,单位为天数
ExpirationType	期限类型

1=固定期限
1=回走朔16

4.6.1.2 4.7.1.2

资产管理计划份额转让业务成交申

报扩展字段(100803)

域名	字段描述
	价格类型
PriceType	3=Fixed amount,表示绝对价格,对
	于资产管理计划份额转让业务指按
	"人民币现金"报价

4.6.1.3 <u>4.7.1.3</u>

__股票质押式回购业务成交申报扩展

字段(100903)

域名	字段描述
	现金金额
	成交申报类别为初始交易时填写
	初始交易金额
	成交申报类别为提前购回, 到期购
CochOndonOtty	回,延期购回,终止购回时填写购
CashOrderQty	回交易金额
	成交申报类型为补充质押时填0
	成交申报类型为部分解除质押时
	填写解除红利金额
	成交申报类型为违约处置时填0
<u>ShareTypeShareProperty</u>	股份性质
MaturityDate	购回交易日
<u>PledgeeType</u>	质权人类型
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期

4.6.1.4 <u>4.7.1.4</u>

约定购回业务成交申报扩展字段

(101003)

域名	字段描述
CashOrderQty	现金金额
MaturityDate	购回交易日
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期

4.6.1.5 <u>4</u>.7.1.5

______质押式报价回购业务成交申报扩展

字段(101103)

域名	字段描述
D : T	价格类型
PriceType	1=Percentage,表示收益率
	到期续做方式,质押式报价回购填
EvaluationEvacInst	写
ExpirationExecInst	1=到期自动续做
	2=到期手动续做
ExpirationDays	期限, 单位为天数
MaturityDate	购回交易日
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期

4.6.2 4.7.2 成交申报响应(Trade Capture Report Ack)

域名	字段描述
Standard Header	消息头
	MsgType=2xxx04
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元

SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型
TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
TradeReportRefID	原客户成交申报编号
	成交申报响应状态
TrdAckStatus	0=Accepted,接受
	1=Rejected,拒绝
	成交申报状态
	0=Accepted,接受
TrdRptStatus	1=Rejected,拒绝
пикрычашѕ	2=Cancelled, 己撤销
	100=Unmatched,尚未匹配
	101=Matched, 已匹配
TradeReportRejectReason	成交申报被拒绝原因代码
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与人买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码

CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段
	同成交申报各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务成交申报的响应

业务	应用标识	报文号	有无扩展
	ApplID	MsgType	字段
协议交易双方协议成交申报	053	200504	N
<u>响应</u>			
转融通证券出借约定申报 <u>响</u>	071	200704	Y
<u>应</u>	0/1		
资产管理计划份额转让成交	080	200804	Υ
申报响应	080		
股票质押式回购成交申报响	000	200904	Y
<u> </u>	090		
约定购回 <u>成交申报响应</u>	100	201004	Y
质押式报价回购成交申报响	440	201104	Y
<u> 应</u>	110		

2) 各业务扩展字段定义同成交申报一致,请参考成交申报消息定义。

4.6.3 4.7.3 成交确认(Trade Capture Report)

域名	字段描述
	消息头
Standard Header	MsgType=2xxx03
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型

ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型
	成交申报事务类别
TradeReportTransType	2=Replace
TradeHandlingInstr	成交申报模式
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与人买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
E (1E 11	各业务扩展字段
Extend Fields	同成交申报各业务扩展字段

1) 该消息用于以下业务成交申报的响应该消息用于以下业务成交申报的确认

业务	应用标识	报文号	有无扩展
	ApplID	MsgType	字段
协议交易双方协议成交申报		200503	N
确认	053		
转融通证券出借约定申报 <u>确</u>	051	200703	Υ
<u>认</u>	071		
资产管理计划份额转让	080	200803	¥

深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范

股票质押式回购	090	200903	¥
约定购回	100	201003	¥
质押式报价回购	110	201103	¥

2) 各业务扩展字段定义同成交申报一致,请参考成交申报消息定义。

4.7.3.1 转融通证券出借业务成交确认扩展字段(200703)

Washington Market Marke	
<u>域名</u>	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
<u>ExpirationType</u>	期限类型
	1=固定期限
MarturityDate	到期日

带格式的;字体: 五号

带格式的:正文, 无项目符号 或编号

带格式的: 正文, 无项目符号 或编号

4.74.8 业务消息-转托管处理消息

4.7.1 <u>4.8.1</u> 注册(Designation)

域名	字段描述
G. 1 111 1	消息头
Standard Header	MsgType=102099
ApplID	应用标识
ApplID	020 200=转托管
SubmittingPBUID	申报交易单元
	证券代码
SecurityID	如果是系统内转托管, 证券代码可
	填空表示转托管所有证券
SecurityIDSource	证券代码源
	102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号

OrigClOrdID	原始交易的客户订单编号, 指示被 主动撤单的委托
DesignationInstruction	注册指令 3=转托管
DesignationTransType	注册类型 1=New 表示新注册请求 3=Cancel 表示注册撤单
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderQty	如果是系统内转托管,数量可填 0 表示转托管全部持有量
TransfereePBUID	转入交易单元代码

4.7.2 4.8.2 注册执行报告(Designation Report)

域名	字段描述
Standard Header	消息头
	MsgType=202098
ReportIndex	回报记录号
, III	应用标识
ApplID	020 200=转托管
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
	原始交易的客户订单编号, 指示被主
OrigClOrdID	动撤单的委托
ExecID	执行编号

	执行类型
	0=New 订单被接受
ЕхесТуре	4=Cancelled 订单被主动撤单
	8=Rejected 因前端检查未通过而
	被拒绝
OrdRejReason	拒绝原因代码,执行类型为8时填写
	注册指令
DesignationInstruction	3表示转托管
DesignationTransType	注册类型
	1=New 表示新注册请求
	3=Cancel 表示注册撤单
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderQty	如果是系统内转托管,数量可填 ()表
	示转托管全部持有量
TransfereePBUID	转入交易单元代码

4.84.9_业务消息-网络投票处理消息

4.8.1 4.9.1 投票(Netvote Evote)

域名	字段描述
	消息头
Standard Header	MsgType=102197
Amalio	应用标识
ApplID	210=投票
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	投票代码
SecurityIDSource	证券代码源
	102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
Cl. ' F'	结算机构代码
ClearingFirm	固定填全空格
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息

ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
VotingProposal	投票议案号
	1-99 表示具体议案号
	100 表示总议案
VotingSubProposal	投票子议案号或选举候选人
	0表示所有子议案
	>0 其他表示具体子议案
VotingPreference	投票意向
	1=同意
	2=反对
	3=弃权
OrderQty	投票数量

4.8.2 4.9.2 投票执行报告(Netvote Evote Report)

域名	字段描述
g. 1 177 1	消息头
Standard Header	MsgType= 202197 202196
ReportIndex	回报记录号
A 11D	应用标识
ApplID	210=投票
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	投票代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
ExecID	执行编号

	执行类型	
	0=New 订单被接受	
ExecType	8=Rejected 因前端检查未通过而被	
	拒绝	
OrdRejReason	拒绝原因代码,执行类型为8时填写	
AccountID	证券账户	
BranchID	营业部代码	
VotingProposal	投票议案号	
VotingSubProposal	投票子议案号或选举候选人	
VotingPreference	投票意向	
OrderQty	投票数量	

4.8.3 4.9.3 密码服务(Netvote Evote Password Service)

域名	字段描述	
Ct-u-l-u-l IIl-u	消息头	
Standard Header	MsgType= 102196 102189	
	应用标识	
ApplID	211=密码服务激活	
	212=密码服务挂失	
SubmittingPBUID	申报交易单元	
a 'v ID	证券代码	
SecurityID	固定填 369999	
SecurityIDSource	证券代码源	
	102=深圳证券交易所	
OwnerType	订单所有者类型	
Cl E.	结算机构代码	
ClearingFirm	固定填全空格	
TransacTime	委托时间	
UserInfo	用户私有信息	
ClOrdID	客户订单编号	
AccountID	证券账户	
BranchID	营业部代码	
ValidationCode	密码激活校验号	

4.8.4 4.9.4 密码服务执行报告(Netvote Evote Password Service Report)

域名	字段描述	
G. I III I	消息头	
Standard Header	MsgType= 202196 <u>202188</u>	
ReportIndex	回报记录号	
	应用标识	
ApplID	211=密码服务激活	
	212=密码服务挂失	
ReportingPBUID	回报交易单元	
SubmittingPBUID	申报交易单元	
SecurityID	证券代码	
SecurityIDSource	证券代码源	
OwnerType	订单所有者类型	
ClearingFirm	结算机构代码	
TransacTime	回报时间	
UserInfo	用户私有信息	
OrderID	交易所订单编号	
ClOrdID	客户订单编号	
ExecID	执行编号	
	执行类型	
F	0=New 订单被接受	
ExecType	8=Rejected 因前端检查未通过而被	
	拒绝	
OrdRejReason	拒绝原因代码,执行类型为8时填写	
AccountID	证券账户	
BranchID	营业部代码	
ValidationCode	密码激活校验号	

五、 其它消息

5.1 业务拒绝消息 (Business Reject)

域名	字段描述
Standard Header	消息头

	MsgType=4
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
RefSeqNum	被拒绝消息的消息序号证券代码
RefMsgType	被拒绝的消息类型证券代码源
BusinessRejectRefID	被拒绝消息对应的业务层 ID, 需要填
	写业务层 ID 的消息参见下面的列表。
BusinessRejectReason	拒绝原因
BusinessRejectText	拒绝原因说明

注:

1) 消息及业务层 ID 对应表:

消息类型	被拒绝消息对应的业务层 ID
新订单(New Order)	ClOrdID
撤单请求(Order Cancel Request)	ClOrdID
报价 (Quote)	QuoteMsgID
意向申报(IOI)	IOIID
成交申报(TCR)	TradeReportID
注册	ClOrdID
投票	ClOrdID
投资者网络投票密码服务	ClOrdID

5.2 回报同步消息 (Report Synchronization)

本消息用于OMS在成功登录TGW后,告知TGW期望接收的下一条回报的记录号。

域名	字段描述	
C. 1 111 1	消息头	
Standard Header	MsgType=5	
	OMS 期望接收的下一条回报的记录号。	
ReportIndex	收到本消息后,TGW 会从该记录号开始向	
	OMS 发送回报;如果没有收到该消息,	
	TGW 不会向 OMS 发送回报。	

5.3 平台状态消息 (Platform State Info)

本消息用于第五版交易系统向 OMS 提供各平台的当前状态,便于 OMS 控制是否发送委托。

带格式表格

OMS 成功登录到 TGW 后,会收到一条平台状态消息,消息中描述相应平台的当前状态。当每个平台的状态发生变化时, OMS 都会收到一条平台状态消息,描述该平台的最新状态。

域名	字段描述
	消息头
Standard Header	MsgType=6
	平台号
	1=现货集中竞价交易平台
PlatformID	2=综合金融服务平台
	3=非交易处理平台
	4=衍生品集中竞价交易平台
	平台状态
	0=PreOpen,未开放
PlatformState	1=OpenUpComing,即将开放
	2=Open,开放
	3=Halt, 暂停开放
	4=Close,关闭

5.4 回报结束消息 (Report Finished)

TGW 使用该消息通知 OMS 本交易日所有回报发送完毕。

域名	字段描述	
Standard Header	MsgType=7	
	回报记录号	
ReportIndex	该回报记录号与各类回报消息中的	
	回报记录号连续编号	
	平台号	
	1=现货集中竞价交易平台	
PlatformID	2=综合金融服务平台	
	3=非交易处理平台	
	4=衍生品集中竞价交易平台	

六、 数据字典

本接口规范中的所有整数类型字段都采用高字节序(BIG-ENDIAN)编码方式。

6.1 数据类型

数据类型	二进制类型	说明
Price	Int64	价格, N13(4)
Qty	Int64	数量, N15(2)
Amt	Int64	金额, N18(4)
SeqNum	Int64	消息序号
Boolean	uInt16	1=True/Yes,0=False/No
Length	uInt32	长度
		表示字节为单位的数据长度,正数
LocalTimeStamp	Int64	本地时间戳
		YYYYMMDDHHMMSSsss(毫秒),
		YYYY = 0000-9999, MM = 01-12,
		DD = 01-31, HH = 00-23, MM =
		00-59, SS = 00-60 (秒), sss=000-999
		(毫秒)。
NumInGroup	uInt32	重复数
		表示重复组的个数,正数
LocalMktDate	uInt32	本地市场日期
		格式 YYYYMMDD, YYYY = 0000-9999,
		MM = 01-12, $DD = 01-31$
SecurityID	char[8]	证券代码
PBUID	char[6]	交易单元代码
AccountID	char[12]	证券账户
BranchID	char[4]	营业部代码

注:

- 1) 表中的 Nx(y)表示相应的类型实际为浮点数类型,其中 x 表示整数与小数总计位数,不 包括小数点, y 表示小数位数,比如对于 Price 类型, Int64 值 186400 表示的价格为 18.6400。
- 2) 在某些应用场景下,一个消息中可能有部分字段不需要填写,如果是字符串型字段则填写全空格,如果是数值型字段则填写 0··。

6.2 会话层域定义

域名	类型	说明
BodyLength	uInt32	消息体长度
MsgType	uInt32	消息类型
SenderCompID	char[20]	接收发送方代码
TargetCompID	char[20]	发送接收方代码
Password	char[16]	密码
Text	char[200]	文本信息
II D4I 4	122	心跳监测的时间间隔
HeartBtInt	Int32	为系统设定值,以秒为单位
DefaultApplVerID	char[32]	二进制协议版本, 即数据接口规范版
		本。
SessionStatus	Int32	会话状态

6.3 业务层域定义

域名	类型	说明
AccountID	AccountID	证券账户
ApplID	char[3]	应用标识
BidPositionEffect	char	买开平仓标志
		O表示开仓
		C表示平仓
BranchID	BranchID	营业部代码
BusinessRejectReason	uInt16	拒绝原因:
BusinessRejectRefID	char[10]	被拒绝消息对应的业务层
		ID
BusinessRejectText	char[50]	拒绝原因说明
C IM :	,	司次司业产用上为
CashMargin	char	融资融券信用标识
		1=Cash,普通交易
		2=Open,融资融券开仓
		3=Close, 融券融券平仓
CashOrderQty	Amt	订单现金金额

CIOrdID Char[10] 客户订单编号 四一文島中元等个文島日中組動委長的 CIOrdID 不存重复 20次号 名位前补 0 20人間 20人	ClearingFirm	char[2]	结算机构代码
ClOrdID char[10] 客户订单编号			01=中国证券登记结算公
日本文島中之場中交易日中報的委托的 CIOrdID 不 中報的委托的 CIOrdID 不 中報的委托的 CIOrdID 不 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本			司深圳分公司
中報的委託的 ClOrdID 不	ClOrdID	char[10]	客户订单编号
ConfirmID char[8] 约定号 8 位数字字符串,不足 8 位前补 0 ContactInfo char[350] 联系方式 Contactor char[12] EntractAccoutCodeContractAccountCode char[6] CounterpartyAccountID AccoutID 对手方证券账户 CounterpartyBranchID BranchID CounterpartyExecID char[16] char[16] 文易所赋予的执行编号,单个交易日内不重复 CounterpartyPBUID PBUID DeliverQty Qty 以T执行数量 CumQty CumQty Culterparty Qty 证券交付数量 DeliverQty DesignationInstruction			同一交易单元每个交易日
ConfirmID			申报的委托的 ClOrdID 不
R 位数字字符串,不足 8 位前补 0			得重复
ContactInfo Char[350] 联系方式 Contactor Char[12] 联系人 ContractAccoutCodeContractAccountCode CounterpartyAccountID AccoutID 对手方证券账户 CounterpartyBranchID BranchID CounterpartyExecID Char[16] CounterpartyPBUID CounterpartyPBUID PBUID 对手方交易单元 CoveredOrUncovered UInt8 AccoutID 对手方交易单元 CoveredOrUncovered UInt8 AccoutID AccoutID 对手方证券账户 及易所赋予的执行编号,单个交易日内不重复 不正复 不正复 不正定数据,有生品交易填写 可一定Overed、表示备允 1=UnCovered、表示备允 1=UnCovered、表示者允 1=UnCovered、表示者会 CumQty CxIRejReason UInt16 证券交付数量 DeliverQty DesignationInstruction	ConfirmID	char[8]	约定号
ContactInfochar[350]联系方式Contactorchar[12]联系人ContractAccoutCodeContractAccountCodechar[6]合约账户识别吗合约账户标识码CounterpartyAccountIDAccoutID对手方证券账户CounterpartyBranchIDBranchID对手方管业部代码CounterpartyExecIDchar[16]交易所赋予的执行编号,单个交易日内不重复CounterpartyPBUIDPBUID对手方交易单元CoveredOrUncovereduInt8备兑标签,衍生品交易填写 写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示都分 1=UnCovered,表示非备为分CumQtyQty累计执行数量CumQtyQty联举拒绝原因代码,正数DeliverQtyQty证券交付数量DesignationInstructionchar注册指令			8 位数字字符串, 不足 8
ContractOr ContractAccoutCodeContractAccountCode CounterpartyAccountID CounterpartyBranchID CounterpartyExecID CounterpartyExecID CounterpartyPBUID CounterpartyPBUID CounterpartyPBUID CounterpartyPBUID CounterpartyPBUID CoveredOrUncovered UInt8 AccoutID DeliverQty Qty CumQty CumQty			位前补 0
ContractAccoutCodechar[6]合约账户识别码合约账户标识码CounterpartyAccountIDAccoutID对手方证券账户CounterpartyBranchIDBranchID对手方营业部代码CounterpartyExecIDchar[16]交易所赋予的执行编号,单个交易日内不重复CounterpartyPBUIDPBUID对手方交易单元CoveredOrUncovereduInt8备兑标签,衍生品交易填写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备兑CumQtyQty累计执行数量CxIRejReasonuInt16撤单拒绝原因代码,正数DeliverQtyQty证券交付数量DesignationInstructionchar注册指令	ContactInfo	char[<u>3</u> 50]	联系方式
ContractAccoutCodechar[6]合约账户识别码合约账户标识码CounterpartyAccountIDAccoutID对手方证券账户CounterpartyBranchIDBranchID对手方营业部代码CounterpartyExecIDchar[16]交易所赋予的执行编号,单个交易日内不重复CounterpartyPBUIDPBUID对手方交易单元CoveredOrUncovereduInt8备兑标签,衍生品交易填写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备兑CumQtyQty累计执行数量CxIRejReasonuInt16撤单拒绝原因代码,正数DeliverQtyQty证券交付数量DesignationInstructionchar注册指令			
ContractAccoutCodechar[6]合约账户识别码合约账户标识码CounterpartyAccountIDAccoutID对手方证券账户CounterpartyBranchIDBranchID对手方营业部代码CounterpartyExecIDchar[16]交易所赋予的执行编号,单个交易日内不重复CounterpartyPBUIDPBUID对手方交易单元CoveredOrUncovereduInt8备兑标签,衍生品交易填写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备兑CumQtyQty累计执行数量CxIRejReasonuInt16撤单拒绝原因代码,正数DeliverQtyQty证券交付数量DesignationInstructionchar注册指令			
	Contactor	char[12]	联系人
	Contract AccoutCodeContract AccountCode	char[6]	<u> </u>
CounterpartyAccountID AccoutID 対手方证券账户 CounterpartyBranchID BranchID 対手方管业部代码 CounterpartyExecID char[16] 交易所賦予的执行编号, 単个交易日内不重复 CounterpartyPBUID PBUID 对手方交易单元 CoveredOrUncovered uInt8 备兑标签,衍生品交易填 写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备 兑 CumQty Qty 累计执行数量 CxIRejReason uInt16 撤单拒绝原因代码,正数 DeliverQty Qty 证券交付数量 DesignationInstruction char 注册指令	Contract reconcode Contract reconnecte	Charley	
CounterpartyRecounts用于方面如本体的CounterpartyBranchID对手方营业部代码CounterpartyExecIDchar[16]交易所赋予的执行编号,单个交易日内不重复CounterpartyPBUIDPBUID对手方交易单元CoveredOrUncovereduInt8备兑标签,衍生品交易填写0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备兑CumQtyQty累计执行数量CxIRejReasonuInt16撤单拒绝原因代码,正数DeliverQtyQty证券交付数量DesignationInstructionchar注册指令	Countamenty A coountID	AccoutID	
CounterpartyBraincins CounterpartyExecID char[16] char[16] 交易所赋予的执行编号,单个交易日内不重复 CounterpartyPBUID PBUID 对手方交易单元 CoveredOrUncovered uInt8 备兑标签,衍生品交易填写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备 兑 CumQty CxlRejReason uInt16 撤单拒绝原因代码,正数 DeliverQty Qty 证券交付数量 DesignationInstruction char 注册指令			
単个交易日内不重复			
CounterpartyPBUIDPBUID对手方交易单元CoveredOrUncovereduInt8备兑标签,衍生品交易填写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示备兑 2CumQtyQty累计执行数量CxlRejReasonuInt16撤单拒绝原因代码,正数DeliverQtyQty证券交付数量DesignationInstructionchar注册指令	CounterpartyExecID	char[16]	
CoveredOrUncovered uInt8 备兑标签,衍生品交易填写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备 兑			
写 0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备 兑 CumQty Qty 累计执行数量 CxlRejReason uInt16 撤单拒绝原因代码,正数 DeliverQty Qty 证券交付数量 DesignationInstruction char 注册指令			
0=Covered,表示备兑 1=UnCovered,表示非备 之 CumQty Qty CxlRejReason uInt16 DeliverQty Qty DesignationInstruction char	CoveredOrUncovered	uInt8	
1=UnCovered,表示非备 之 CumQty Qty 累计执行数量 CxlRejReason uInt16 撤单拒绝原因代码,正数 DeliverQty Qty 证券交付数量 DesignationInstruction char 注册指令			·
CumQtyQty累计执行数量CxlRejReasonuInt16撤单拒绝原因代码,正数DeliverQtyQty证券交付数量DesignationInstructionchar注册指令			,
CumQtyQty累计执行数量CxlRejReasonuInt16撤单拒绝原因代码,正数DeliverQtyQty证券交付数量DesignationInstructionchar注册指令			
CxlRejReason uInt16 撤单拒绝原因代码,正数 DeliverQty Qty 证券交付数量 DesignationInstruction char 注册指令			兑
DeliverQty Qty 证券交付数量 DesignationInstruction char 注册指令	CumQty	Qty	累计执行数量
DesignationInstruction char 注册指令	CxlRejReason	uInt16	撤单拒绝原因代码, 正数
	DeliverQty	Qty	证券交付数量
3表示转托管	DesignationInstruction	char	注册指令
			3表示转托管

DesignationTransType uInt8 注册指令类型 1=New,表示新注册的 3=Cancel,表示注册指 ExecID char[16] 交易所赋予的执行编一单个交易日内不重复 ExecType char 执行报告类型 0=New,表示新订单 4=Cancelled,表示已指 8=Reject,表示已拒绝 F=Trade,表示已成交 ExpirationDays uInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做 2=到期手动续做	单
Second 表示注册格 文易所賦予的执行編号 単个交易日内不重复 ExecType Char 执行报告类型 O=New,表示新订单 4=Cancelled,表示已括 8=Reject,表示已拒绝 F=Trade,表示已成交 ExpirationDays UInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst UInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	单
ExecID char[16] 交易所赋予的执行编号单个交易日内不重复 ExecType char 执行报告类型 0=New,表示新订单 4=Cancelled,表示已报 8=Reject,表示已拒绝 F=Trade,表示已成交 ExpirationDays uInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	
单个交易日内不重复 ExecType char 执行报告类型 0=New,表示新订单 4=Cancelled,表示已报 8=Reject,表示已拒绝 F=Trade,表示已成交 ExpirationDays uInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	,
ExecType char 执行报告类型 0=New,表示新订单 4=Cancelled,表示已指 8=Reject,表示已拒绝 F=Trade,表示已成交 ExpirationDays uInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	
0=New,表示新订单 4=Cancelled,表示已指 8=Reject,表示已拒绝 F=Trade,表示已成交 ExpirationDays uInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	
4=Cancelled,表示已报 8=Reject,表示已拒绝 F=Trade,表示已成交 ExpirationDays uInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	
8=Reject,表示已拒绝 F=Trade,表示已成交 ExpirationDays uInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	. Est
F=Trade,表示已成交 ExpirationDays uInt16 期限,单位为天数 ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	钥
ExpirationDaysuInt16期限,单位为天数ExpirationExecInstuInt8到期续做方式 1=到期自动续做	
ExpirationExecInst uInt8 到期续做方式 1=到期自动续做	
1=到期自动续做	
2=到期手动续做	
+ +	
ExpirationType uInt8 期限类型	
1=固定期限	
InsufficientSecurityID char[8] 申购赎回不足成份股记	券
代码	
IOIID char[10] 客户意向申报编号	
同一交易单元每个交	日
中报的意向申报的 IC	IID
不得重复	
IOIQty Qty 意向申报数量	
IOIRefID char[10] 原意向申报 IOIID	
撤销意向申报时使用	
IOITransType char 意向申报类型	
N=意向申报	
C=意向申报撤单	
LastPx Price 成交价格	
LastQty Qty 成交数量	
LeavesQty Qty 订单剩余数量	
MaturityDate LocalMktDate 到期日	=
MaxPriceLevels uInt16 最多成交价位数,正数	

深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范

MinQty Qty 最低成交数量 NoPartyIDs NumInGroup 参与方个数 NoSecurity NumInGroup 证券只数 OfferAccountID AccoutID 卖方证券账户 OfferBranchID BranchID 卖方变易单元 OfferPositionEffect char 卖开平仓标志 O表示开仓 C表示平仓 C表示平仓 C表示平仓 OrderID Char[16] 交易所订单编号,跨交易日不重复 OrderQty Qty 订单数量 C4 订单歷定 L=程序化交易 E=算法交易			
NoPartyIDs NoSecurity NumInGroup i			0表示不限制成交价位数
NoSecurity NumInGroup 证券只数 OfferAccountID AccoutID 卖方证券账户 OfferBranchID BranchID physitionEffect Char OfferPositionEffect Char Char[16] 交易所订单编号 交易所过单编号 交易所以争编号 交易可以争编号 交易所以争编号 交易所以争编号 交易所以争编号 交易所以争编号 交易所以争编号 交易所以争编号 交易所以争编号 交易所以争编号 交易所述争编号 交易所述争编号 交易所述争编号 交易列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列列	MinQty	Qty	最低成交数量
OfferAccountID AccoutID	NoPartyIDs	NumInGroup	参与方个数
OfferBranchID BranchID 東方管业部代码 OfferPBUID 東方交易単元 OfferPositionEffect char 東开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓 O rderID char[16] 交易所订単編号 交易所賦予的订単編号 、	NoSecurity	NumInGroup	证券只数
OfferPBUID	OfferAccountID	AccoutID	卖方证券账户
OfferPositionEffect char 卖开平仓标志 〇表示开仓 CC表示平仓 OrderID char[16] 交易所订单编号 交易所赋予的订单编号, 跨交易日不重复 OrderQty Qty 订单股定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如没有限定类型则填空 OrdRejReason uInt16 订单拒绝原固代码,正数 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部 分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价	OfferBranchID	BranchID	卖方营业部代码
OrderID char[16] 交易所订单编号	OfferPBUID	PBUID	卖方交易单元
OrderID char[16] 交易所订单编号 交易所赋单编号 交易所赋予的订单编号, 跨交易日不重复 OrderQty Qty 订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 加沒有限定类型则填空 OrdRejReason uInt16 订单报卷原因代码,正数 OrdStatus char 订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价	OfferPositionEffect	char	卖开平仓标志
OrderID char[16] 交易所订单编号 交易所赋予的订单编号, 跨交易日不重复 OrderQty Qty 订单数量 C4 订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如沒有限定类型则填空 OrdRejReason uInt16 订单报卷原因代码,正数 OrdStatus char 订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价			O表示开仓
OrderQty Qty 订单数量 OrderQty C4 订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定类型 加沒有限定类型则填空 OrdRejReason uInt16 订单拒绝原因代码,正数 OrdStatus char 订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 2=Filled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价 1			C表示平仓
OrderQty Qty 订单数量 C4 订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如沒有限定类型则填空 OrdRejReason uInt16 OrdStatus char O=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType OrdType char 订单类型 1表示市价 1	OrderID	char[16]	交易所订单编号
OrderQty Qty 订单数量 C4 订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如没有限定类型则填空 OrdRejReason uInt16 订单拒绝原因代码,正数 OrdStatus char 订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价			交易所赋予的订单编号,
OrderRestrictions C4 订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如沒有限定类型则填空 OrdRejReason uInt16 订单拒绝原因代码,正数 OrdStatus char 订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价			跨交易日不重复
I=程序化交易 E=其法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如没有限定类型则填空OrdRejReasonuInt16订单拒绝原因代码,正数OrdStatuschar订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成文 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝OrdTypechar订单类型 1表示市价	OrderQty	Qty	订单数量
E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如沒有限定类型则填空OrdRejReasonuInt16订单拒绝原因代码,正数OrdStatuschar订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝OrdTypechar订单类型 1表示市价		<u>C4</u>	订单限定
OrderRestrictions最多可同时填写四种限定 类型 如没有限定类型则填空OrdRejReasonUInt16订单拒绝原因代码,正数OrdStatuschar订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝OrdTypechar订单类型 1表示市价			1=程序化交易
R 多可同时填写四种限定 类型 如没有限定类型则填空 OrdRejReason UInt16 订单拒絶原因代码,正数 OrdStatus Char 订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部 分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType Char 订单类型 1表示市价	OrderDestrictions		E=算法交易
如没有限定类型则填空OrdRejReasonuInt16订单拒绝原因代码,正数OrdStatuschar订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝OrdTypechar订单类型 1表示市价	<u>Order Restrictions</u>		最多可同时填写四种限定
OrdRejReason UInt16 订单拒绝原因代码,正数 Char 订单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部 分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType Char 订单表型 1表示市价			类型
OrdStatus char iy单状态 0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char iy单类型 1表示市价			如没有限定类型则填空
0=New,表示新订单 1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价	OrdRejReason	uInt16	订单拒绝原因代码, 正数
1=Partially filled,表示部分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝OrdTypechar订单类型 1表示市价	OrdStatus	char	订单状态
分成交 2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价			0=New,表示新订单
2=Filled,表示全部成交 4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价			1=Partially filled, 表示部
4=Cancelled,表示已撤销 8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价			分成交
8=Reject,表示已拒绝 OrdType char 订单类型 1表示市价			2=Filled,表示全部成交
OrdType char 订单类型 1表示市价			4=Cancelled,表示已撤销
1表示市价			8=Reject,表示已拒绝
	OrdType	char	订单类型
2表示限价			1表示市价
			2表示限价

带格式表格

U 本方最优 OrigClOrdID char[10] 原订单 ClOrd	
OrigClOrdID char[10] 原订单 ClOrd	
OrigClOrdID char[10] 原订单 ClOrd	
ongerorana and and and and and and and and and	ID
OrigSubmittingPBUID PBUID 初始交易申报	【交易单元
OrigTradeDate LocalMktDate 初始成交申报	8申报日期
OrigTradeID char[16] 初始成交申报	K的 TradeID
OrigTradeReportID char[10] 初始交易客户	成交申报编
7	
OwnerType uInt16 所有者类型,	正数
1=个人投资者	广发起
101=交易所发	起
102=会员发起	2
103=机构投资	者发起
104=自营交易	发起
105=流动性服	员务提供商发
起	
106=结算结构	7发起
PlatformID uInt16 平台号	
1=现货集中竞	亡价交易平台
2=综合金融服	6条平台
3=非交易处理	里平台
4=衍生品集中	· 竞价交易平
台	
PlatformState uInt16 平台状态	
0=PreOpen,	未开放
1=OpenUpCon	ming, 即将
开放	
2=Open,开方	文
3=Halt,暂停	开放
4=Close,关户	利

PledgeeType	uInt16	压力 1 米利
		质权人类型
PositionEffect	char	开平仓标识
		〇表示开仓
		C表示平仓
Price	Price	价格
PriceType	uInt8	价格类型
		1=百分比
		3=固定数量
QuoteMsgID	char[10]	客户报价消息编号
QuoteRejectReason	uInt16	意向申报拒绝原因代码,
		正数
<u>QuoteReqID</u>	char[10]	报价请求 ID
<u>QuoteRequestRejectReason</u>	uInt16	<u> </u>
QuoteRespID	char[16]	交易所意向申报编号
		交易所赋予的意向申报编
		号, 跨交易日不重复
QuoteRespType	uInt8	意向申报响应类型
		2=意向申报响应
QuoteStatus	uInt8	报价状态
		0=Accepted,接受
		5=Rejected,拒绝
<u>QuoteType</u>	uInt8	报价类型
		 1= Tradeable,表示可交易
		的报价
RefMsgType	uInt32	被拒绝的消息类型
RefSeqNum	SeqNum	引用的消息序号
RejectText	char[16]	拒绝原因说明
ReportIndex	SeqNum	回报记录号, 从1开始编
		号
	1	

ReportingPBUID	PUBID	回报交易单元
RptExecID	char[16]	成交申报执行编号
SecurityID	char[8]	证券代码
SecurityIDSource	char[4]	证券代码源
		102=深圳证券交易所
<u>ShareTypeShareProperty</u>	char[4]	股份性质
Side	char	买卖方向
		1=买
		2=卖
		G=借入
		F=出借
		D=申购
		E=赎回
StopPx	Price	止损价格
SubmittingPBUID	PBUID	申报交易单元
SubstCash	Amt	现金替代金额
Tenderer	char[6]	要约收购参与人编码
Text	char[8]	自由格式文本串, 如无特
		别说明最多8个字符,超
		过部分将被自动截掉
TimeInForce	char	订单有效时期类型
		0表示当日有效
		3 表示即时成交或取消
		(IOC)
TimeToExpiration	uInt16	期限,单位为天数,正数
	char	成交申报模式
		1=Two-Party Report,成交
TradeHandlingInstr		报告
		2=One-Party report for
		matching, 协议配对
TradeID	char[16]	交易所成交申报编号
		交易所赋予的成交申报编
		号, 跨交易日不重复

T ID (ID		1 [10]	ウンドナトログロ
TradeReportID		char[10]	客户成交申报编号
			同一交易单元每个交易日
			申报的成交申报的
			TradeReportID-不得重复
TradeReportRef	TID	char[10]	原客户成交申报编号, 最
			多8个字符
TradeReportRej	ectReason	uInt16	成交申报拒绝原因代码
TradeReportTra	nsType	uInt8	成交申报事务类别
			0=New,新申报
			1=Cancel,撤销申报
			2=Replace, 成交申报成功
TradeReportTyp	pe	uInt8	成交申报消息类型
			0=Submit, 提交成交申报
TransacTime		LocalTimestamp	订单或执行的创建时间
TransfereePBUI	D	PBUID	转入交易单元代码
TrdAckStatus		uInt8	成交申报响应状态
			0=Accepted,接受
			1=Rejected,拒绝
TrdRptStatus		uInt8	成交申报状态
			2=Cancelled, 已撤销
			100=Unmatched,尚未匹
			西 己
			101=Matched, 已匹配
TrdSubType		uInt16	成交申报子业务类别
TrdType		uInt16	成交申报类型, 正数
			1001=股票质押式回购初
			始交易
			1002=股票质押式回购提
			前购回
			1003=股票质押式回购到
			期购回
			1004=股票质押式回购延
			100 I= AC

		- · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
		期购回
		1005=股票质押式回购终
		止购回
		1006=股票质押式回购补
		充质押
		1007=股票质押式回购部
		分解除质押
		1008=股票质押式回购违
		约处置
		1011=约定购回初始交易
		1012=约定购回提前购回
		1013=约定购回到期购回
		1014=约定购回延期购回
		1021=质押式报价回购初
		始交易
		1022=质押式报价回购提
		前购回
UnderlyingSecurityID	char[8]	基础证券代码
UnderlyingSecurityIDSource	char[4]	基础证券代码源
		102=深圳证券交易所
UserInfo	char[8]	用户私有信息
VelidationCode ValidationCode	uInt32	密码激活校验号,正数
VotingPreference	char	投票意向
		1代表同意,2代表反对,
		3 代表弃权
VotingProposal	uInt16	投票议案号, 正数
		1-99 表示具体议案号
		100表示总议案
VotingSubProposal	uInt16	投票子议案号或选举候选
		人, 正数
		0表示所有子议案
		>0 其他表示具体子议案