

工程技术标准

# 深圳证券交易所第五版交易系统 接口规范开发指南

(Ver1.00~~β~~<sub>α</sub>)



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> | <u>1.00β</u> | <u>增加对于质押式回购交易到期成交执行报告的说明</u><br><u>6位证券代码转换方式由前补0改为后补空格</u> |
|               |              |  |
|               |              |  |

## 目 录

|                                  |      |
|----------------------------------|------|
| 一、 前言 .....                      | 1    |
| 二、 系统架构图 .....                   | 1    |
| 三、 接口规范结构 .....                  | 2    |
| 四、 与第四版交易系统接口对比 .....            | 2    |
| 4.1 主要变化 .....                   | 2    |
| 4.1.1 新老接口总体对照 .....             | 2    |
| 4.1.2 关键变化点 .....                | 3    |
| 4.2 交易 .....                     | 43   |
| 4.2.1 与 SJSWT 库中委托类别的对照 .....    | 43   |
| 4.2.2 与 SJSZHWT 库中委托类别的对照 .....  | 6    |
| 4.2.3 市价订单申报方式变化 .....           | 87   |
| 4.2.4 委托流水号变化 .....              | 8    |
| 4.2.5 回报方式变化 .....               | 109  |
| 4.2.6 回购交易的回报记录合成一笔 .....        | 10   |
| 4.2.7 ETF 实时申购赎回回报记录合成一笔 .....   | 1149 |
| 4.2.8 融资融券申报方式变化 .....           | 12   |
| 4.2.9 协议交易申报方式变化 .....           | 1342 |
| 4.3 行情 .....                     | 1443 |
| 4.3.1 证券信息 .....                 | 1443 |
| 4.3.2 集中竞价行情快照 .....             | 14   |
| 4.3.3 集中竞价逐笔行情 .....             | 1544 |
| 4.3.4 协议大宗交易/转融通出借行情 .....       | 1544 |
| 4.3.5 盘后定价大宗交易行情 .....           | 1645 |
| 4.3.6 指数行情 .....                 | 1645 |
| 4.3.7 成交量统计指标行情 .....            | 1645 |
| 4.3.8 公告 .....                   | 1645 |
| 五、 新接口规范说明 .....                 | 1746 |
| 5.1 证券代码扩位 .....                 | 1746 |
| 5.2 证券账户最多 12 个字符 .....          | 1746 |
| 5.3 平台状态说明 .....                 | 1746 |
| 5.4 新订单 (NEW ORDER) 处理回报说明 ..... | 1847 |
| 5.4.1 申报新订单并产生成交 .....           | 1847 |
| 5.4.2 撤销尚未产生成交的新订单 .....         | 1948 |
| 5.4.3 撤销已部分成交的新订单 .....          | 1948 |
| 5.4.4 撤销已全部成交的新订单 .....          | 19   |
| 5.4.5 撤销不存在的新订单 .....            | 2049 |
| 5.5 成交申报 (TCR) 处理回报说明 .....      | 2049 |
| 5.5.1 申报新成交申报 .....              | 2049 |
| 5.5.2 撤销尚未配对成功的成交申报 .....        | 2049 |
| 5.5.3 撤销已配对成功的成交申报 .....         | 2120 |
| 5.5.4 撤销已被拒绝的成交申报 .....          | 2120 |

|                             |                         |                      |
|-----------------------------|-------------------------|----------------------|
| 5.5.5                       | 撤销不存在的成交申报 .....        | <a href="#">2120</a> |
| <b>六、 STEP 消息示例</b> .....   |                         | <b>21</b>            |
| 6.1                         | 交易 .....                | 21                   |
| 6.1.1                       | 新订单处理 .....             | 21                   |
| 6.1.1.1                     | 申报新订单 .....             | <a href="#">2221</a> |
| 6.1.1.2                     | 订单响应执行报告 .....          | <a href="#">2322</a> |
| 6.1.1.3                     | 订单成交执行报告 .....          | <a href="#">2423</a> |
| 6.1.1.4                     | 撤单请求 .....              | <a href="#">2524</a> |
| 6.1.1.5                     | 撤单失败响应 .....            | <a href="#">2625</a> |
| 6.1.1.6                     | 撤单成功执行报告 .....          | <a href="#">2625</a> |
| 6.1.2                       | 报价处理 .....              | 27                   |
| 6.1.2.1                     | 报价 .....                | <a href="#">2827</a> |
| 6.1.2.2                     | 报价状态回报 .....            | <a href="#">2827</a> |
| 6.1.2.3                     | 报价成交执行报告 .....          | <a href="#">2928</a> |
| 6.1.3                       | 意向申报 .....              | <a href="#">3029</a> |
| 6.1.3.1                     | 意向申报 .....              | <a href="#">3029</a> |
| 6.1.3.2                     | 意向申报响应 .....            | <a href="#">3130</a> |
| 6.1.4                       | 成交申报处理 .....            | <a href="#">3231</a> |
| 6.1.4.1                     | 成交申报 .....              | 32                   |
| 6.1.4.2                     | 成交申报响应 .....            | <a href="#">3433</a> |
| 6.1.4.3                     | 成交确认 .....              | <a href="#">3534</a> |
| 6.1.5                       | 注册处理 .....              | <a href="#">3736</a> |
| 6.1.5.1                     | 注册 .....                | <a href="#">3736</a> |
| 6.1.5.2                     | 注册执行报告 .....            | <a href="#">3837</a> |
| 6.1.6                       | 网络投票处理消息 .....          | <a href="#">3938</a> |
| 6.1.6.1                     | 投票 .....                | <a href="#">3938</a> |
| 6.1.6.2                     | 投票执行报告 .....            | 39                   |
| 6.1.6.3                     | 投资者网络投票密码服务激活 .....     | 40                   |
| 6.1.6.4                     | 投资者网络投票密码服务激活执行报告 ..... | <a href="#">4140</a> |
| 6.2                         | 行情 .....                | <a href="#">4241</a> |
| 6.2.1                       | 频道心跳 .....              | <a href="#">4241</a> |
| 6.2.2                       | 重传消息 .....              | <a href="#">4342</a> |
| 6.2.3                       | 用户信息报告消息 .....          | <a href="#">4342</a> |
| 6.2.4                       | 证券实时状态 .....            | <a href="#">4443</a> |
| 6.2.5                       | 公告 .....                | <a href="#">4443</a> |
| 6.2.6                       | 集中竞价行情快照 .....          | <a href="#">4544</a> |
| 6.2.7                       | 逐笔委托行情 .....            | <a href="#">4847</a> |
| 6.2.8                       | 逐笔成交行情 .....            | <a href="#">4948</a> |
| <b>七、 BINARY 消息示例</b> ..... |                         | <b>5049</b>          |
| 7.1                         | 交易 .....                | <a href="#">5049</a> |
| 7.1.1                       | 订单处理 .....              | <a href="#">5049</a> |
| 7.1.1.1                     | 申报新订单 .....             | <a href="#">5049</a> |
| 7.1.1.2                     | 订单响应执行报告 .....          | <a href="#">5150</a> |

|         |   |                      |
|---------|---|----------------------|
| 7.1.1.3 | 订单成交执行报告.....                           | <a href="#">5254</a> |
| 7.1.1.4 | 撤单请求 .....                              | <a href="#">5254</a> |
| 7.1.1.5 | 撤单失败响应.....                             | <a href="#">5352</a> |
| 7.1.1.6 | 撤单成功执行报告.....                           | 53                   |
| 7.1.2   | 报价处理.....                               | 54                   |
| 7.1.2.1 | 报价 .....                                | <a href="#">5554</a> |
| 7.1.2.2 | 报价状态回报.....                             | <a href="#">5554</a> |
| 7.1.2.3 | 报价成交执行报告.....                           | <a href="#">5655</a> |
| 7.1.3   | 意向申报.....                               | <a href="#">5756</a> |
| 7.1.3.1 | 意向申报 .....                              | <a href="#">5756</a> |
| 7.1.3.2 | 意向申报响应.....                             | <a href="#">5857</a> |
| 7.1.4   | 成交申报处理 .....                            | 58                   |
| 7.1.4.1 | 成交申报 .....                              | <a href="#">5958</a> |
| 7.1.4.2 | 成交申报响应.....                             | 59                   |
| 7.1.4.3 | 成交确认 .....                              | 60                   |
| 7.1.5   | 注册处理.....                               | 61                   |
| 7.1.5.1 | 注册 .....                                | 61                   |
| 7.1.5.2 | 注册执行报告.....                             | <a href="#">6264</a> |
| 7.1.6   | 网络投票处理消息.....                           | <a href="#">6362</a> |
| 7.1.6.1 | 投票 .....                                | <a href="#">6362</a> |
| 7.1.6.2 | 投票执行报告.....                             | 63                   |
| 7.1.6.3 | 投资者网络投票密码服务激活.....                      | <a href="#">6463</a> |
| 7.1.6.4 | 投资者网络投票密码服务激活执行报告 .....                 | <a href="#">6564</a> |
| 7.2     | 行情.....                                 | 65                   |
| 7.2.1   | 频道心跳.....                               | 65                   |
| 7.2.2   | 重传消息.....                               | <a href="#">6665</a> |
| 7.2.3   | 用户信息报告消息.....                           | <a href="#">6665</a> |
| 7.2.4   | 证券实时状态 .....                            | <a href="#">6665</a> |
| 7.2.5   | 公告 .....                                | 66                   |
| 7.2.6   | 集中竞价行情快照.....                           | <a href="#">6766</a> |
| 7.2.7   | 逐笔委托行情 .....                            | <a href="#">7170</a> |
| 7.2.8   | 逐笔成交行情 .....                            | <a href="#">7170</a> |
| 八、      | 会话.....                                 | <a href="#">7274</a> |
| 8.1     | SENDERCOMPID 和 TARGETCOMPID 的填写规则 ..... | <a href="#">7274</a> |
| 8.2     | DEFAULTCSTMAPPPLVERID 字段的填写规则 .....     | <a href="#">7274</a> |
| 8.3     | SESSIONSTATUS 字段的填写规则.....              | <a href="#">7274</a> |
| 8.4     | STEP 会话.....                            | <a href="#">7274</a> |
| 8.4.1   | 登录消息 .....                              | <a href="#">7274</a> |
| 8.4.2   | 会话模式.....                               | <a href="#">7274</a> |
| 8.4.3   | 何时发送 Logout, 何时直接断开连接.....              | <a href="#">7274</a> |
| 8.4.4   | 何时发送 SessionReject, 何时发送 Logout.....    | <a href="#">7372</a> |
| 8.5     | 网络版行情网关会话管理.....                        | <a href="#">7372</a> |
| 九、      | 相关文档 .....                              | <a href="#">7372</a> |



# 深圳证券交易所第五版交易系统接口规范开发指南

## 一、前言

本文档是关于深圳证券交易所第五版交易系统接口规范（简称“新接口规范”）使用的详细说明文档，供市场参与者及其 IT 供应商进行相关技术系统改造时参考。

### 特别申明：

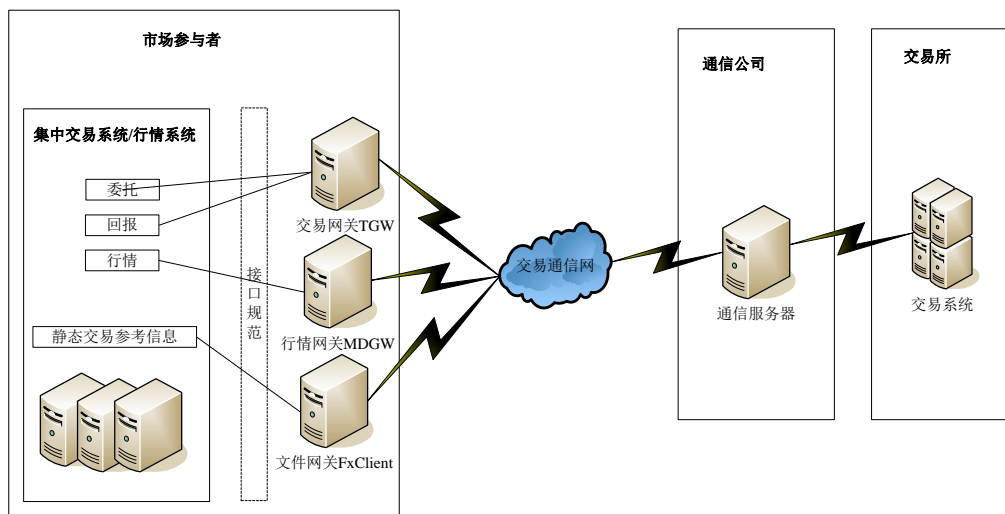
本指南编制基础是本所第五版交易系统（以下简称“新版交易系统”或“交易系统”）技术方案、功能及接口文档。本所保留对本指南的解释及修改权。

### 联系方式：

在开发或测试过程中，可以通过以下方式与深圳证券交易所技术部门（“第五版交易系统建设项目组”）联系。

- 电话：0755-25918478（业务及应用相关）、0755-25911508（会话相关）
- 电子邮件：[stsv5@szse.cn](mailto:stsv5@szse.cn)
- QQ 群：288321593；QQ 群论坛：<http://qgc.qq.com/49156774>

## 二、系统架构图



市场参与者集中交易系统通过交易网关 TGW 可申报所有业务的委托并接收回报消息，一个 TGW 上可以配置一个或多个申报交易单元，市场参与者也可以根据业务或性能需要申请部署多个 TGW。

市场参与者行情系统可通过行情网关 MDGW 接收实时行情信息。不同的行情信息被分为多个频道发送，市场参与者可以根据需要选择只接收指定频道的行情信息。MDGW 也可以部署多个以平衡负载。

第五版交易系统新增了一个专用的文件网关 FxClient，交易系统下发文件，市场参与者向交易系统报送文件都通过该文件网关进行。交易系统在每个交易日交易开始前通过文件网关将静态交易参考信息文件发送给市场参与者。

三、 接口规范结构

第五版交易系统同时提供 STEP 交易/行情接口和 Binary 交易/行情接口，STEP 接口具有较高的灵活性，易于扩展，Binary 接口则具有较高的传输性能，市场参与者可自行选择使用 STEP 或 Binary 接口。

第五版交易系统接口规范主要包括以下三部分。

- STEP 交易及行情接口规范，遵照 STEP1.2 及 Fix5.0Sp2，深交所做特定扩展。  
《轻量级 STEP 会话层接口规范》：规定会话层协议，由深圳证券交易所与上海证券交易所联合制定。  
《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》：规定应用层的交易接口协议。  
《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》：规定应用层的行情接口协议。
- Binary 交易及行情接口规范，深交所自定义的私有协议，基于二进制格式消息流进行数据交换，消息类型、内容与 STEP 消息一一对应。  
《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》：规定应用层的交易接口协议。  
《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》：规定应用层的行情接口协议。
- 数据文件交换接口规范，主要包括开盘前的静态交易参考信息文件。  
《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》：规定交易系统与市场参与者技术系统之间交换静态文件的格式和内容。

四、 与第四版交易系统接口对比

为描述方便，下面将第四版交易系统的接口称为老接口，将第五版交易系统的接口称为新接口。

4.1 主要变化

4.1.1 新老接口总体对照

| 老接口      |               | 新接口                |
|----------|---------------|--------------------|
| 《深圳证券交易所 | 委托库 SJSWT.DBF | 《深圳证券交易所 STEP 交易数据 |



|                        |   |   |
|------------------------|---|---|
| 所数据接口规范》               | 回报库 SJS HB.DBF<br>综合委托库 SJSZHW T.DBF<br>综合回报库 SJSZH HB.DBF  | 接口规范》<br>《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》  |
|                        | 证券信息库 SJSXX.DBF<br>新证券信息库 SJSXXN.DBF<br>行情库 SJS HQ.DBF<br>指数库 SJSZS.DBF<br>综合行情库 SJSZHHQ.DBF<br>信息公告文件<br>XXY YMMDD.NNN | 《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》<br>《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》<br>《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》 |
| 《新版行情系统 FAST 协议数据接口规范》 |   |   |
| 结算相关接口                 |   | 中国结算深圳分公司发布单独的结算数据接口规范  |

#### 4.1.2 关键变化点

数据接口规范关键变化点：

- 成交编号仅保证交易日内唯一，不保证单向递增
- 营业部识别码以单独的字段申报
- 显式的委托确认消息，并为每笔委托分配跨交易日唯一的交易所订单编号
- 市价委托通过多个字段组合确定申报类型
- 回购交易回报合成一笔
- ETF 申购赎回回报合成一笔
- 证券代码升级为 8 位
- 委托流水号升级为 10 位
- 委托价格精度由 3 位小数升为 4 位小数
- 委托数量包含两位小数
- 静态交易参考数据以多个 xml 文件的形式发布
- 协议交易及转融通证券出借行情由快照行情改为逐笔行情
- Level II 行情的逐笔委托和逐笔成交合成一个数据流发送

## 4.2 交易

### 4.2.1 与 SJSWT 库中委托类别的对照

| WTYWLB | 委托业务含义   | 新接口 STEP 消息类型 | 新接口 Binary 消息类型 | 应用标识 ApplID |
|--------|--|---------------|-----------------|-------------|
| 0B     | 正常交易业务的买委托记录                                   | 新订单 (D)       | 100101          | 010         |
| 0S     | 正常交易业务的卖委托记录                                   |               |                 |             |
| 0C     | 正常交易业务的撤单记录                                    | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| 2B     | 即时成交剩余撤销买委托记录                                  | 新订单 (D)       | 100101          | 010         |
| 2S     | 即时成交剩余撤销卖委托记录                                  |               |                 |             |
| 3S     | 转托管申报记录, 转出交易单元代码在 WTHTXH 中                    | 注册 (U001)     | 102099          | 200         |
| 3C     | 转托管业务中撤单委托记录                                   |               |                 |             |
| 4B     | 配股认购业务中认购委托记录                                  | 新订单 (D)       | 101401          | 140         |
| 4C     | 配股认购业务中撤单委托记录                                  | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| 5S     | 可转债转股业务中转股申报记录                                 | 新订单 (D)       | 101501          | 150         |
| 5C     | 可转债转股业务中撤单委托记录                                 | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| 6S     | 债券回售业务中回售申报记录                                  | 新订单 (D)       | 101501          | 151         |
| 6C     | 债券回售业务中撤单委托记录                                  | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| 7B     | 新股申购业务中申购委托记录                                  | 新订单 (D)       | 101301          | 130         |
|        | 网络投票   | 投票 (U004)     | 102197          | 210         |
|        | 密码服务   | 密码服务 (U006)   | 102196          | 211<br>212  |
| 7C     | 新股申购业务中撤单委托记录                                  | 撤单请求 (F)      | 190007          | 130         |
| 8C     | 市值配售新股发行业务中签后的放弃认购委托记录                         | 不再支持          |                 |             |
| 8X     | 市值配售新股发行业务中签后的放弃认购的撤单委托记录                      | 不再支持          |                 |             |
| AB     | 无股份冻结质押业务中质权人的申报记录<br>对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中 | 不再支持          |                 |             |
| AS     | 无股份冻结质押业务中出质人的申报记录<br>对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中 |               |                 |             |
| AC     | 无股份冻结质押业务中撤单委托记录                               |               |                 |             |
| BB     | 股份质押且冻结业务中质权人的申报记录<br>对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中 |               |                 |             |

| WTYWLB | 委托业务含义   | 新接口 STEP 消息类型 | 新接口 Binary 消息类型 | 应用标识 ApplID |
|--------|--|---------------|-----------------|-------------|
| BS     | 股份质押且冻结业务中出质人的申报记录<br>对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中 |               |                 |             |
| BC     | 股份质押且冻结业务中撤单委托记录                               |               |                 |             |
| CB     | 无股份冻结解押业务中出质人的申报记录<br>对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中 |               |                 |             |
| CS     | 无股份冻结解押业务中质权人的申报记录<br>对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中 |               |                 |             |
| CC     | 无股份冻结解押业务中撤单委托记录                               |               |                 |             |
| DB     | 股份解押且解冻业务中出质人的申报记录<br>对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中 |               |                 |             |
| DS     | 股份解押且解冻业务中质权人的申报记录<br>对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中 |               |                 |             |
| DC     | 股份解押且解冻业务中撤单委托记录                               |               |                 |             |
| ES     | 流通股份要约收购业务中的预受要约申报记录                           | 新订单 (D)       | 101801          | 180         |
| EC     | 流通股份要约收购业务中的预受要约撤单委托记录                         | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| FS     | 流通股份要约收购业务中的解除预受要约申报记录                         | 新订单 (D)       | 101801          | 181         |
| FC     | 流通股份要约收购业务中的解除预受要约撤单委托记录                       | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| IB     | 开放式基金申购申报记录                                    | 新订单 (D)       | 101701          | 170         |
| IS     | 开放式基金赎回申报记录                                    |               |                 |             |
| IC     | 开放式基金申购、赎回业务的撤单委托记录                            | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| JB     | 认购或认沽权证的行权申报记录                                 | 新订单 (D)       | 101601          | 160         |
| JC     | 认购或认沽权证的行权撤单委托记录                               | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |

| WTYWL B | 委托业务含义                                     | 新接口 STEP 消息类型 | 新接口 Binary 消息类型 | 应用标识 ApplID |
|---------|--|---------------|-----------------|-------------|
|         | 录  |               |                 |             |
| KB      | ETF 基金申购申报记录                               | 新订单（D）        | 101201          | 120         |
| KS      | ETF 基金赎回申报记录                               |               |                 |             |
| NB      | 证券质押式回购业务中证券转出质押库的申报记录。证券代码填可用于质押式回购的证券代码。 | 新订单（D）        | 101901          | 190<br>191  |
| NS      | 证券质押式回购业务中证券转入质押库的申报记录。证券代码填可用于质押式回购的证券代码。 |               |                 |             |
| VB      | 最优五档即时成交剩余撤销买委托记录                          | 新订单（D）        | 100101          | 010         |
| VS      | 最优五档即时成交剩余撤销卖委托记录                          |               |                 |             |
| WB      | 全额成交或撤销买委托记录                               |               |                 |             |
| WS      | 全额成交或撤销卖委托记录                               |               |                 |             |
| XB      | 本方最优价格买委托记录                                |               |                 |             |
| XS      | 本方最优价格卖委托记录                                |               |                 |             |
| XC      | 本方最优价格撤单委托记录                               | 撤单请求（F）       | 190007          |             |
| YB      | 对手方最优价格买委托记录                               | 新订单（D）        | 100101          |             |
| YS      | 对手方最优价格卖委托记录                               |               |                 |             |
| YC      | 对手方最优价格撤单委托记录                              | 撤单请求（F）       | 190007          |             |

#### 4.2.2 与 SJSZHW 库中委托类别的对照

| WTYWLB | WTZLLB | 指令类别含义         | 新接口 STEP 消息类型                             | 新接口 Binary 消息类型                        | 应用标识 ApplID                      |
|--------|--------|----------------|---|--|----------------------------------|
| 两个空格   | 1B     | 协议交易成交申报的买委托记录 | 协议配对成交申报: 成交申报(AE)<br>定价委托点击成交申报: 新订单 (D) | 协议配对成交申报: 100503<br>定价委托点击成交申报: 100501 | 协议配对成交申报: 053<br>定价委托点击成交申报: 052 |
| 两个空格   | 1S     | 协议交易成交申报的卖委托记录 |   |  |                                  |
| 两个空格   | 1C     | 协议交易成交申报的撤单记录  |   |  |                                  |
| 两个空格   | HB     | 协议交易意向申报的买委托记录 | 意向申报 (6)                                  | 100509                                 | 050                              |
| 两个空格   | HS     | 协议交易意向申报的卖委托记录 |   |  |                                  |
| 两个空格   | HC     | 协议交易意向申报的撤单记录  |   |  |                                  |
| 两个空格   | OB     | 协议交易定价申报的买委托记录 | 新订单 (D)                                   | 100501                                 | 051                              |

| WTYWLB | WTZLLB | 指令类别含义              | 新接口 STEP 消息类型 | 新接口 Binary 消息类型 | 应用标识 ApplID |
|--------|--------|---------------------|---------------|-----------------|-------------|
| 两个空格   | OS     | 协议交易定价申报的卖委托记录      |               |                 |             |
| 两个空格   | OC     | 协议交易定价申报的撤单记录       | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| 01     | AS     | 转融通非约定申报的出借委托记录     | 新订单 (D)       | 100701          | 070         |
| 01     | AC     | 转融通非约定申报的撤单记录       | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |
| 01     | PS     | 转融通约定申报的出借委托记录      | 成交申报 (AE)     | 100703          | 071         |
| 01     | PC     | 转融通约定申报的撤单记录        |               |                 |             |
| 02     | BB     | 约定购回初始交易的委托记录       | 成交申报 (AE)     | 101003          | 100         |
| 02     | CS     | 约定购回回购交易的委托记录       |               |                 |             |
| 02     | ES     | 报价回购初始交易的委托记录       | 成交申报 (AE)     | 101103          | 110         |
| 02     | FB     | 报价回购提前购回交易的委托记录     |               |                 |             |
| 02     | GS     | 资管产品份额转让成交报告指令的委托记录 | 成交申报 (AE)     | 100803          | 080         |
| 02     | KB     | 股票质押回购初始交易的委托记录     | 成交申报 (AE)     | 100903          | 090         |
| 02     | JS     | 股票质押回购回购交易的委托记录     |               |                 |             |
| 02     | MB     | 股票质押回购补充质押的委托记录     |               |                 |             |
| 02     | NS     | 股票质押回购部分解除质押的委托记录   |               |                 |             |
| 03     | SB     | 盘后定价大宗交易申报的买委托记录    | 新订单 (D)       | 100601          | 060<br>061  |
| 03     | SS     | 盘后定价大宗交易申报的卖委托记录    |               |                 |             |
| 03     | SC     | 盘后定价大宗交易申报的撤单记录     | 撤单请求 (F)      | 190007          |             |

### 4.2.3 市价订单申报方式变化

集中竞价业务市价订单同限价订单一样都通过新订单消息申报，市价订单方式由老接口的每种市价订单对应一种委托业务类别，改为通过新订单中的多个字段指定订单属性的方式申报，对于每种市价订单的属性取值方式如下表所示，申报市价订单时必须按照表中的组合方式申报，否则订单会被视为无效。

| WTYW<br>LB | 委托业务含义            | 新接口消息 |             |         |                |        |
|------------|-------------------|-------|-------------|---------|----------------|--------|
|            |                   | Side  | TimeInForce | OrdType | MaxPriceLevels | MinQty |
| 2B         | 即时成交剩余撤销买委托记录     | 1     | 3           | 1       | 0              | 0      |
| 2S         | 即时成交剩余撤销卖委托记录     | 2     | 3           | 1       | 0              | 0      |
| VB         | 最优五档即时成交剩余撤销买委托记录 | 1     | 3           | 1       | 5              | 0      |
| VS         | 最优五档即时成交剩余撤销卖委托记录 | 2     | 3           | 1       | 5              | 0      |
| WB         | 全额成交或撤销买委托记录      | 1     | 3           | 1       | 0              | =委托数量  |
| WS         | 全额成交或撤销卖委托记录      | 2     | 3           | 1       | 0              | =委托数量  |
| XB         | 本方最优价格买委托记录       | 1     | 0           | U       | 0              | 0      |
| XS         | 本方最优价格卖委托记录       | 2     | 0           | U       | 0              | 0      |
| YB         | 对手方最优价格买委托记录      | 1     | 0           | 1       | 1              | 0      |
| YS         | 对手方最优价格卖委托记录      | 2     | 0           | 1       | 1              | 0      |

### 4.2.4 委托流水号变化

老接口 SJSWT.DBF 和 SJSZHWT.DBF 中的委托流水号描述为：

“WTHTXH（字段 1：合同序号）左六位为表示交易单元代码的数字串。其后 8 位为委托日期（CCYYMMDD）。右 8 位为委托流水号。委托流水号中最左两位（即合同序号 WTHTXH 的第 15、16 位）可为英文字母或阿拉伯数字，其余六位为阿拉伯数字。对实施会员集中报盘的证券营业部，委托流水号的前两位（即合同序号 WTHTXH 的第 15、16 位）即为同一会员属下的证券营业部

识别码。”

新接口中，对于不同类型的委托需要用不同的编号域表示老接口中的委托流水号，这些域都是 String 类型，最多 10 个字符，可包含数字、大写字母以及小写字母：

| Tag  | 编号域名          | 编号域描述    | 适用委托类型   |
|------|---------------|----------|--|
| 11   | CIOrdID       | 客户订单编号   | 新订单(D)<br>新订单撤单请求 (F)<br>转托管 (U001)<br>投票 (U004)<br>投资者密码服务 (U005) |
| 23   | IOIID         | 客户意向申报编号 | 意向申报(6)  |
| 571  | TradeReportID | 客户成交报告编号 | 成交申报(AE)   |
| 1166 | QuoteMsgID    | 客户报价消息编号 | 报价   |

一个交易单元对同一业务申报的所有委托流水号不能重复，应用标识 ApplID 前两位相同的委托属于同一业务，具体示例如下：

| 举例  | 是否重单 |
|---|------|
| 申报两笔现货集中竞价业务的新订单使用相同的流水号                    | 重单   |
| 申报一笔集中竞价业务的新订单，申报一笔 ETF 实时申购赎回业务新订单使用相同的流水号 | 不重单  |
| 申报一笔协议交易业务定价委托新订单，申报一笔协议交易业务成交申报使用相同的流水号    | 重单   |
| 申报一笔现货集中竞价业务新订单，申报一笔现货集中竞价业务撤单请求使用相同的流水号    | 重单   |

营业部代码改为在委托的参与方信息中作为单独的一条参与方信息申报。

新老接口兼容期，市场参与者可以并行使用新老接口，而委托流水号在新接口中扩充了两位，其兼容规则如下：

- ✓ 对于以新接口申报的委托，如果通过老接口接收其回报，则委托流水号的后两位将被截掉，建议存在此类应用场景的市场参与者在兼容期内仍然使用 8 位的流水号，后补两个空格。
- ✓ 对于以老接口申报的委托，如果通过新接口接收其回报，则委托流水号的末尾会补充两个空格，并且将委托流水号前两位填入营业部代码字段。
- ✓ 对于股票质押式回购，约定购回，质押式报价回购等业务，如果其初始交易委托是在启用新接口之前通过老接口申报的（流水号为 8 位），后续需要通过新接口申报对应的各类购回委托时，委托中的初始交易流水号（OrigTradeReportID，10 位）的前 8 位填写初始交易流水号，后 2 位填写空格。

4.2.5 回报方式变化

老接口以 SJSHB.DBF 和 SJSZHHB.DBF 两个回报库存放回报信息，新接口主要通过执行报告发送回报信息，并且在回报信息方面有所调整，以集中竞价交易为例：

| 订单处理场景                | 老接口回报信息           | 新接口回报信息            |
|-----------------------|-------------------|--------------------|
| 一笔新订单未通过交易系统前端检查      | 回报库中产生一条自动撤单回报记录  | 发送一条 Rejected 执行报告 |
| 一笔新订单通过交易系统前端检查但暂时未成交 | 回报库中没有记录          | 发送一条 New 执行报告      |
| 新订单成交                 | 回报库中产生一条或多条成交回报记录 | 发送一条或多条 Trade 执行报告 |

老接口 SJSHB.DBF 和 SJSZHHB.DBF 中的 HBCJHM（成交号码）字段是单向递增的，新接口的对应字段为执行报告中的 ExecID（执行编号）字段，该字段只保证每个交易日的每笔执行报告唯一，但不保证用户接收到的顺序是单向递增的。

4.2.6 回购交易的回报记录合成一笔

老接口中，回购交易的成交会发送两笔成交回报，第一笔为初始交易记录，第二笔



为到期交易记录：

|      | 买卖方向       | 成交数量<br>HBCJSL | 成交价格<br>HBCJJG | 成交时间<br>HBCJSJ |
|------|------------|----------------|----------------|----------------|
| 初始交易 | 与委托中买卖方向相反 | 实际的回购量         | 100.00         | 实际成交时间         |
| 到期交易 | 与委托中买卖方向一致 | 0              | 回购年利率          | 回购到期日期         |

带格式表格

新接口中，回购交易的成交只发送一笔执行报告：

| Side<br>(54) | LastQty<br>(32) | LastPx<br>(31) | MaturityDate<br>(541) | TransacTime<br>(60) |
|--------------|-----------------|----------------|-----------------------|---------------------|
| 与委托中的一致      | 实际的回购量          | 回购年利率          | 回购到期日期                | 实际成交时间              |

带格式表格

原初始交易中的标准券面值（100.00）不再在新接口成交回报中体现。

老接口中，在回购交易到期日，交易系统自动回报一条回购到期反向成交记录到回  
报库 SJSHB.DBF，其成交数量为当初实际的回购量，成交价格为当初竞出的回购年利  
率，业务类别 HBYWLB 为“9S”或“9B”。

新接口中，在回购交易到期日，交易系统也会自动回报一条回购到期成交执行报告，  
其中应用标识 ApplID 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。

4.2.7 ETF 实时申购赎回回报记录合成一笔

老接口中，ETF 申购赎回的成交会发送多笔回报记录，包括：

- 一笔 ETF 交付记录
- M 笔成份股交付记录
- N 笔资金交付记录

新接口中，ETF 申购赎回的成交只发送一笔执行报告，在执行报告中通过一个重  
复组结构来回报股份及资金的交付明细，重复组中的每一项对应一只成份股的股份交  
付数量和现金替代金额。对于现金替代金额，老接口需要将回报记录中的成交价格和  
成交数量字段相乘获得，新接口直接给出计算后的替代金额。

下面以一笔申购两篮子 159901ETF 的回报来比较新老接口的差异，假设成份股就  
只有 000001，000002，000004 三只：

老接口共返还五条回报记录（仅列出相关的关键字段）：

| HBYWLB | HBZQDM | HBCJSL | HBCJJG | 说明 |
|--------|--------|--------|--------|----|
|--------|--------|--------|--------|----|

|    |        |         |           |   |
|----|--------|---------|-----------|---|
| KB | 159901 | 2000000 | 0.000     | ETF 交付记录                                |
| KB | 000001 | 1500    | 0.000     | 成份股交付记录<br>没有发生现金替代                     |
| KB | 000002 | 700     | 0.000     | 成份股交付记录<br>发生部分现金替代                     |
| ZB | 000002 | 300     | 20.125    | 资金交付记录<br>300 股以现金替代，每股替代价格为 20.125     |
| ZB | 000004 | 2       | 25678.568 | 资金交付记录<br>必须现金替代，两篮子，每篮子替代金额为 25678.568 |

新接口返还一条回报记录 (STEP: 8, Binary: 201202, 仅列出相关的关键字段):

| 字段                   | 取值         |
|----------------------|------------|
| ApplID               | 120        |
| SecurityID           | 00159901   |
| OrderQty             | 2000000    |
| NoSecurity           | 3          |
| UnderlyingSecurityID | 00000001   |
| DeliveryQty          | 1500.00    |
| SubstCash            | 0.0000     |
| UnderlyingSecurityID | 00000002   |
| DeliveryQty          | 700.00     |
| SubstCash            | 6037.5000  |
| UnderlyingSecurityID | 00000004   |
| DeliveryQty          | 0.00       |
| SubstCash            | 51357.1360 |

#### 4.2.8 融资融券申报方式变化

新接口中，现货集中竞价交易的融资融券申报使用消息中的 CashMargin 字段来标

识，申报方式与老接口对比如下：

| 申报方式 | 老接口    |            | 新接口       |                  |
|------|--------|------------|-----------|------------------|
|      | WTYWLB | WTMARK 第一位 | Side (54) | CashMargin (544) |
| 融资买入 | OB     | 1=融资       | 1=买       | 2=开仓             |
| 融券卖出 | OS     | 2=融券       | 2=卖       | 2=开仓             |
| 卖券还款 | OS     | 1=融资       | 2=卖       | 3=平仓             |
| 买券还券 | OB     | 2=融券       | 1=买       | 3=平仓             |
| 普通买  | OB     | ‘ ’ =普通    | 1=买       | 1=现金             |
| 普通卖  | OS     | ‘ ’ =普通    | 2=卖       | 1=现金             |

如申报的平仓委托中的订单所有者类型(OwnerType, tag#522)为 102(会员发起), 则交易所将该委托视为会员提交的强制平仓委托。

#### 4.2.9 协议交易申报方式变化

协议交易业务新老接口委托申报方式对比如下：

| 委托类别       | 老接口 WTZLLB | 新接口消息类型                                       |
|------------|------------|---|
| 定价申报       | OB/OS      | 新订单 (STEP: D, Binary: 100501)<br>ApplID=051   |
| 定价委托点击成交申报 | 1B/1S      | 新订单 (STEP: D, Binary: 100501)<br>ApplID=052   |
| 双方配对成交申报   | 1B/1S      | 成交申报 (STEP: AE, Binary: 100503)<br>ApplID=053 |

在老接口中，定价委托点击成交申报和双方配对成交申报都是使用同样的委托指令申报，为区分这两种申报，要求定价委托点击成交申报的约定号必须大于等于 1,000,000，双方配对成交申报的约定号必须小于 1,000,000；在新接口中，定价委托点击成交申报使用新订单消息申报，双方配对成交申报使用成交申报消息申报，两种申报通过消息类型已经区分开，因此不再有上述约定号约束要求。

4.3 行情

4.3.1 证券信息

| 第四版     |                           | 第五版   |
|---------|---------------------------|---|
| DBF 接口  | SJSXX.DBF                 | 静态交易参考信息文件<br>证券实时状态消息 (STEP: f, 二进制: 390013) |
|         | SJSXXN.DBF                |   |
| 新行情系统接口 | StockInfo 证券信息消息(UA101)   |   |
|         | StockStatus 证券状态消息(UA102) |   |

新接口将交易期间内不会发生变化的部分统称“静态交易参考信息”，该部分以多个 xml 文件的形式发布，包括：

- 1) 一个证券信息文件，内容为所有在交易所上市挂牌的证券的基本信息，其中不含一些特殊业务临时挂牌的代码，比如网络投票，债券分销，网上发行认购等，这些代码包括在对应的业务参数信息文件中
- 2) 指数信息文件
- 3) 统计量指标信息文件
- 4) 多个业务参考信息文件：
  - a) 集中竞价交易类业务参考信息文件
  - b) 协议交易业务参数信息文件
  - c) 盘后定价大宗交易业务参考信息文件
  - d) 转融通业务参考信息文件
  - e) ETF 实时申购赎回 PCF 文件
  - f) 网上发行认购业务参考信息文件
  - g) 债券分销业务参考信息文件
  - h) 网络投票业务参考信息文件
  - i) 配股业务参考信息文件

新接口将交易期间内可能发生变化的部分以“证券实时状态(STEP: f, 二进制: 390013)”消息的方式定时发布，主要包括证券简称前缀以及各类业务的开关信息。

4.3.2 集中竞价行情快照

| 第四版 | 第五版 |
|-----|-----|
|-----|-----|

|         |                        |                               |
|---------|------------------------|-------------------------------|
| DBF 接口  | SJSHQ.DBF              | 快照行情消息 (STEP: W, 二进制: 300111) |
| 新行情系统接口 | Snapshot 行情快照消息(UA103) |                               |

新接口中只包含参与集中竞价业务的证券的行情快照,即集中竞价交易类业务参考信息文件中的证券代码和债券分销业务参考信息文件中的证券代码,其他不能参与集中竞价交易业务的证券不会有对应的集中竞价行情快照,比如仅通过协议交易方式转让的证券、网络投票、网上发行认购。

#### 4.3.3 集中竞价逐笔行情

| 第四版     |  | 第五版  |
|---------|--|--|
| DBF 接口  | N/A  | 逐笔委托行情消息 (STEP: UA201, 二进制: 300192)<br>逐笔成交行情消息 (STEP: UA202, 二进制: 300191) |
| 新行情系统接口 | Order 逐笔委托消息(UA201)<br>Trade 逐笔成交消息(UA202) |  |

为方便用户根据逐笔行情重建委托簿信息,新接口规范中逐笔委托消息和逐笔成交消息按照发生的先后顺序合成一个流连续编号并下发。

老接口中的一些无效的逐笔行情信息在新接口中将被裁减掉,具体为:

- 1) 因未通过交易系统前端检查而被拒绝的委托,不发布其对应的逐笔行情
- 2) 主动撤单委托只在其撤单成功的情况下,发布其逐笔成交行情

#### 4.3.4 协议大宗交易/转融通证券出借行情

| 第四版     |             | 第五版  |
|---------|-------------|--|
| DBF 接口  | SJSZHHQ.DBF | 协议交易逐笔委托行情消息<br>(STEP: UA201, 二进制: 300592)<br>协议交易逐笔成交行情消息<br>(STEP: UA202, 二进制: 300591)<br><br>转融通证券出借逐笔委托行情消息 (STEP: UA201, 二进 |
| 新行情系统接口 | N/A         |  |

|  |  |  |
|--|--|--|
|  |  | 制：300792)<br>转融通证券出借逐笔成交行情消息 (STEP: UA202, 二进制：300791) |
|--|--|--|

老接口的协议交易/转融通证券出借行情是将所有有效的意向/定价/出借行情记录定时以快照的形式全量发布，效率较低。

新接口改成以逐笔的形式发布，由市场参与者自行推导出快照行情，以意向行情为例，交易系统收到一条有效意向申报后，发送一条新意向行情记录；在该意向行情被撤销后，发送一条意向行情撤销记录。

#### 4.3.5 盘后定价大宗交易行情

| 第四版     |             | 第五版                          |
|---------|-------------|------------------------------|
| DBF 接口  | SJSPHHQ.DBF | 快照行情消息 (STEP: W, 二进制：300611) |
| 新行情系统接口 | N/A         |                              |

#### 4.3.6 指数行情

| 第四版     |                     | 第五版                          |
|---------|---------------------|------------------------------|
| DBF 接口  | SJSZS.DBF           | 快照行情消息 (STEP: W, 二进制：309011) |
| 新行情系统接口 | Index 指数快照消息(UA104) |                              |

#### 4.3.7 成交量统计指标行情

| 第四版     |                     | 第五版                          |
|---------|---------------------|------------------------------|
| DBF 接口  | SJSZS.DBF           | 快照行情消息 (STEP: W, 二进制：309111) |
| 新行情系统接口 | Index 指数快照消息(UA104) |                              |

#### 4.3.8 公告

| 第四版     |                      | 第五版                        |
|---------|----------------------|----------------------------|
| DBF 接口  | 信息公告文件 xxyymmdd.nnn  | 公告消息 (STEP: B, 二进制：390012) |
| 新行情系统接口 | Bulletin 公告消息(UA401) |                            |

## 五、新接口规范说明

### 5.1 证券代码升位

新接口规范证券代码升为 8 位,原 6 位证券代码~~在前面补两个~~在后面补两个空格 0,比如原 6 位证券代码“002001”在新接口中以“~~00~~002001\_\_”表示。

### 5.2 证券账户最多 12 个字符

新接口证券账户字段最多可以有 12 个字符,对于 STEP 接口,仍然填写现有的 10 位证券账户即可,对于 Binary 接口,证券账户字段的类型是 char[12],在填写时需要在后面补两个空格。

比如证券账户“0100012345”,对于 STEP 接口,仍然填写“0100012345”,对于 Binary 接口,填写“0100012345 ”。

### 5.3 平台状态说明

第五版交易系统按业务划分为多个平台(目前划分为 4 个:现货集中竞价交易平台、衍生品集中竞价交易平台、综合金融服务平台、非交易处理平台),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。

下面以现货集中竞价交易平台为例说明平台状态的含义:

- 0=PreOpen, 未开放: 一个交易日的交易开始之前,市场参与者交易系统(以下简称“OMS”)在 9:15 之前接入交易系统一般会收到该平台状态消息,OMS 在平台处于该状态时不能申报委托;
- 1=OpenUpComing, 即将开放: 在 9:15 之前的 3 秒钟交易系统会向 OMS 发送该平台状态消息,OMS 收到消息后,可以开始尝试申报委托,但委托可能会被交易系统因为未到达开放时间而拒绝;此状态消息除了在交易日的交易开始时间 9:15 之前发送外,在 9:30,13:00 之前 3 秒钟也会发送;
- 2=Open, 开放: 平台处于开市期间,OMS 在 9:15,9:30,13:00 会收到该状态消息,可以申报委托;
- 3=Halt, 暂停开放: OMS 在 9:25,11:30 会收到该状态消息,应该停止申报委托;因为网络传输时延的存在,从交易系统发出该状态信息到 OMS 收到会存在一个时间差,在该时间差内 OMS 申报的委托会被交易系统拒绝;
- 4=Close, 关闭: OMS 在 15:00 会收到该状态消息,应该停止申报委托;同样

会因为网络传输时延导致委托被交易系统拒绝。



注：9:25-9:30 不再接受委托。

5.4 新订单 (New Order) 处理回报说明

新订单执行报告使用多个字段来表示订单的当前状态，下面列举了这些字段在新订单各种状态下的取值。表中的 Time 列表示时间顺序，值相同的行数表示可能发生的多种情形，但任何时候有且只有一种情形会发生；Received 列和 Sent 列是以交易系统的视角来描述。

5.4.1 申报新订单并产生成交

| Time | Received | Sent      | Exec<br>Type | OrdStatus | Order<br>Qty | Cum<br>Qty | Leaves<br>Qty | Last<br>Qty |       |
|------|----------|-----------|--------------|-----------|--------------|------------|---------------|-------------|-------|
| 1    | NewOrder |           |              |           | 10000        |            |               |             | 收到新订单 |
| 2    |          | Execution | Rejected     | Rejected  | 10000        | 0          | 0             | 0           | 订单被拒绝 |



|   |  |           |       |                     |       |       |       |      |           |
|---|--|-----------|-------|---------------------|-------|-------|-------|------|-----------|
| 2 |  | Execution | New   | New                 | 10000 | 0     | 10000 | 0    | 订单被接受     |
| 3 |  | Execution | Trade | Partially<br>Filled | 10000 | 3000  | 7000  | 3000 | 订单成交 3000 |
| 4 |  | Execution | Trade | Partially<br>Filled | 10000 | 4000  | 6000  | 1000 | 订单成交 1000 |
| 5 |  | Execution | Trade | Filled              | 10000 | 10000 | 0     | 6000 | 订单成交 6000 |

#### 5.4.2 撤销尚未产生成交的新订单

| Time | Received          | Sent      | Exec<br>Type | OrdStatus | Order<br>Qty | Cum<br>Qty | Leaves<br>Qty | Last<br>Qty |        |
|------|-------------------|-----------|--------------|-----------|--------------|------------|---------------|-------------|--------|
| 1    | NewOrder          |           |              |           | 10000        |            |               |             | 收到新订单  |
| 2    |                   | Execution | New          | New       | 10000        | 0          | 10000         | 0           | 订单被接受  |
| 3    | Cancel<br>Request |           |              |           | 10000        |            |               |             | 收到撤单请求 |
| 4    |                   | Execution | Cancelled    | Cancelled | 10000        | 0          | 0             | 0           | 撤单成功   |

#### 5.4.3 撤销已部分成交的新订单

| Time | Received          | Sent             | Exec<br>Type | OrdStatus           | Order<br>Qty | Cum<br>Qty | Leaves<br>Qty | Last<br>Qty |                                    |
|------|-------------------|------------------|--------------|---------------------|--------------|------------|---------------|-------------|------------------------------------|
| 1    | NewOrder          |                  |              |                     | 10000        |            |               |             | 收到新订单                              |
| 2    |                   | Execution        | New          | New                 | 10000        | 0          | 10000         | 0           | 订单被接受                              |
| 3    |                   | Execution        | Trade        | Partially<br>Filled | 10000        | 3000       | 7000          | 3000        | 订单成交 3000                          |
| 4    | Cancel<br>Request |                  |              |                     | 10000        |            |               |             | 收到撤单请求                             |
| 5    |                   | Cancel<br>Reject |              | Partially<br>Filled |              |            |               |             | 撤单被拒绝，<br>OrdStatus 填写目标<br>委托当前状态 |
| 5    |                   | Execution        | Cancelled    | Cancelled           | 10000        | 3000       | 0             | 0           | 撤单成功                               |

#### 5.4.4 撤销已全部成交的新订单

| Time | Received | Sent | Exec | OrdStatus | Order | Cum | Leaves | Last |  |
|------|----------|------|------|-----------|-------|-----|--------|------|--|
|------|----------|------|------|-----------|-------|-----|--------|------|--|

|   |                |               | Type  |                  | Qty   | Qty   | Qty   | Qty  |           |
|---|----------------|---------------|-------|------------------|-------|-------|-------|------|-----------|
| 1 | NewOrder       |               |       |                  | 10000 |       |       |      | 收到新订单     |
| 2 |                | Execution     | New   | New              | 10000 | 0     | 10000 | 0    | 订单被接受     |
| 3 |                | Execution     | Trade | Partially Filled | 10000 | 3000  | 7000  | 3000 | 订单成交 3000 |
| 4 |                | Execution     | Trade | Filled           | 10000 | 10000 | 0     | 7000 | 订单成交 7000 |
| 5 | Cancel Request |               |       |                  | 10000 |       |       |      | 收到撤单请求    |
| 6 |                | Cancel Reject |       | Filled           |       |       |       |      | 撤单被拒绝     |

#### 5.4.5 撤销不存在的新订单

| Time | Received       | Sent          | Exec Type | OrdStatus | Order Qty | Cum Qty | Leaves Qty | Last Qty |        |
|------|----------------|---------------|-----------|-----------|-----------|---------|------------|----------|--------|
| 1    | Cancel Request |               |           |           | 10000     |         |            |          | 收到撤单请求 |
| 2    |                | Cancel Reject |           | Rejected  |           |         |            |          | 撤单被拒绝  |

### 5.5 成交申报（TCR）处理回报说明

#### 5.5.1 申报新成交申报

| Time | Received | Sent    | TradeReportTransType | TrdAckStatus | TrdRptStatus |              |
|------|----------|---------|----------------------|--------------|--------------|--------------|
| 1    | TCR      |         | New                  |              |              | 提交一笔成交申报     |
| 2    |          | TCR Ack | New                  | Rejected     | Rejected     | 成交申报被拒绝      |
| 2    |          | TCR Ack | New                  | Accepted     | Unmatched    | 成交申报被接受      |
| 3    |          | TCR Ack | New                  | Accepted     | Cancelled    | 与对手方成交申报配对失败 |
| 3    |          | TCR     | Replace              |              |              | 与对手方配对成功     |

#### 5.5.2 撤销尚未配对成功的成交申报

| Time | Received | Sent    | TradeReportTransType | TrdAckStatus | TrdRptStatus |              |
|------|----------|---------|----------------------|--------------|--------------|--------------|
| 1    | TCR      |         | New                  |              |              | 提交一笔成交申报     |
| 2    |          | TCR Ack |                      | Accepted     | Unmatched    | 成交申报被接受      |
| 3    | TCR      |         | Cancel               |              |              | 提交一笔成交申报撤销请求 |
| 4    |          | TCR Ack | Cancel               | Rejected     | Unmatched    | 撤销请求被拒绝      |

|   |  |         |        |          |           |                             |
|---|--|---------|--------|----------|-----------|-----------------------------|
|   |  |         |        |          |           | TrdRptStatus 填写目标委托<br>当前状态 |
| 4 |  | TCR Ack | Cancel | Accepted | Cancelled | 撤单成功                        |

### 5.5.3 撤销已配对成功的成交申报

| Time | Received | Sent    | TradeReportTransType | TrdAckStatus | TrdRptStatus |  |
|------|----------|---------|----------------------|--------------|--------------|--|
| 1    | TCR      |         | New                  |              |              | 提交一笔成交申报                               |
| 2    |          | TCR Ack | New                  | Accepted     | Unmatched    | 成交申报被接受                                |
| 3    |          | TCR     | Replace              |              |              | 与对手方配对成功                               |
| 4    | TCR      |         | Cancel               |              |              | 提交一笔成交申报撤销请求                           |
| 5    |          | TCR Ack | Cancel               | Rejected     | Matched      | 撤销请求被拒绝<br>TrdRptStatus 填写目标委托<br>当前状态 |

### 5.5.4 撤销已被拒绝的成交申报

| Time | Received | Sent    | TradeReportTransType | TrdAckStatus | TrdRptStatus |  |
|------|----------|---------|----------------------|--------------|--------------|--|
| 1    | TCR      |         | New                  |              |              | 提交一笔成交申报                               |
| 2    |          | TCR Ack | New                  | Rejected     | Rejected     | 成交申报被拒绝                                |
| 3    | TCR      |         | Cancel               |              |              | 提交一笔成交申报撤销请求                           |
| 4    |          | TCR Ack | Cancel               | Rejected     | Rejected     | 撤销请求被拒绝<br>TrdRptStatus 填写目标委托<br>当前状态 |

### 5.5.5 撤销不存在的成交申报

| Time | Received | Sent    | TradeReportTransType | TrdAckStatus | TrdRptStatus |              |
|------|----------|---------|----------------------|--------------|--------------|--------------|
| 1    | TCR      |         | Cancel               |              |              | 提交一笔成交申报撤销请求 |
| 2    |          | TCR Ack | Cancel               | Rejected     | Rejected     | 撤销请求被拒绝      |

## 六、 STEP 消息示例

### 6.1 交易

#### 6.1.1 新订单处理

下面列举了现货集中竞价业务新订单及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

## 6.1.1.1 申报新订单

| Tag  | 域名               | 取值                    |
|------|------------------|-----------------------|
|      | MsgType          | D                     |
| 1180 | ApplID           | 010                   |
| 11   | ClOrdID          | A0000001              |
| 40   | OrdType          | 2                     |
| 54   | Side             | 1                     |
| 522  | OwnerType        | 1                     |
| 60   | TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| 48   | SecurityID       | 00000001              |
| 22   | SecurityIDSource | 102                   |
| 453  | NoPartyIDs       | 3                     |
| 448  | PartyID          | 000100                |
| 447  | PartyIDSource    | C                     |
| 452  | PartyRole        | 1                     |
| 448  | PartyID          | 0100004698            |
| 447  | PartyIDSource    | 5                     |
| 452  | PartyRole        | 5                     |
| 448  | PartyID          | AA                    |
| 447  | PartyIDSource    | D                     |
| 452  | PartyRole        | 4001                  |
| 38   | OrderQty         | 1200.00               |
| 44   | Price            | 17.4800               |
| 544  | CashMargin       | 1                     |

STEP 消息如下：

1180=010<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>544=1<SOH>

## 6.1.1.2 订单响应执行报告

| Tag   | 域名               | 取值                    |
|-------|------------------|-----------------------|
|       | MsgType          | 8                     |
| 10179 | ReportIndex      | 1                     |
| 1180  | ApplID           | 010                   |
| 11    | ClOrdID          | A0000001              |
| 40    | OrdType          | 2                     |
| 54    | Side             | 1                     |
| 522   | OwnerType        | 1                     |
| 17    | ExecID           | 1100000000004123      |
| 37    | OrderID          | 6B4569CDNB009C03      |
| 150   | ExecType         | 0                     |
| 39    | OrdStatus        | 0                     |
| 151   | LeavesQty        | 1200.00               |
| 14    | CumQty           | 0.00                  |
| 60    | TransacTime      | 20130228-14:42:13:565 |
| 48    | SecurityID       | 00000001              |
| 22    | SecurityIDSource | 102                   |
| 453   | NoPartyIDs       | 3                     |
| 448   | PartyID          | 000100                |
| 447   | PartyIDSource    | C                     |
| 452   | PartyRole        | 1                     |
| 448   | PartyID          | 0100004698            |
| 447   | PartyIDSource    | 5                     |
| 452   | PartyRole        | 5                     |
| 448   | PartyID          | AA                    |
| 447   | PartyIDSource    | D                     |
| 452   | PartyRole        | 4001                  |
| 38    | OrderQty         | 1200.00               |
| 44    | Price            | 17.4800               |
| 544   | CashMargin       | 1                     |

STEP 消息如下：

10179=1<SOH>1180=010<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SO

H>17=1100000000004120<SOH>37=6B4569CDNB009C03<SOH>150=0<SOH>39=0<SOH>151=1200.00<SOH>14=0.00<SOH>60=20130228-14:42:13:565<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>544=1<SOH>

### 6.1.1.3 订单成交执行报告

| Tag   | 域名               | 取值                    |
|-------|------------------|-----------------------|
|       | MsgType          | 8                     |
| 10179 | ReportIndex      | 2                     |
| 1180  | ApplID           | 010                   |
| 11    | ClOrdID          | A0000001              |
| 40    | OrdType          | 2                     |
| 54    | Side             | 1                     |
| 522   | OwnerType        | 1                     |
| 17    | ExecID           | 1100000000004124      |
| 37    | OrderID          | 6B4569CDNB009C03      |
| 150   | ExecType         | F                     |
| 39    | OrdStatus        | 1                     |
| 31    | LastPx           | 17.1000               |
| 32    | LastQty          | 300.00                |
| 151   | LeavesQty        | 900.00                |
| 14    | CumQty           | 300.00                |
| 60    | TransacTime      | 20130228-14:42:15:555 |
| 48    | SecurityID       | 00000001              |
| 22    | SecurityIDSource | 102                   |
| 453   | NoPartyIDs       | 3                     |
| 448   | PartyID          | 000100                |
| 447   | PartyIDSource    | C                     |
| 452   | PartyRole        | 1                     |
| 448   | PartyID          | 0100004698            |
| 447   | PartyIDSource    | 5                     |
| 452   | PartyRole        | 5                     |
| 448   | PartyID          | AA                    |

|     |               |      |
|-----|---------------|------|
| 447 | PartyIDSource | D    |
| 452 | PartyRole     | 4001 |
| 544 | CashMargin    | 1    |

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=010<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>17=11000000000004120<SOH>37=6B4569CDNB009C03<SOH>150=F<SOH>39=1<SOH>31=17.1000<SOH>32=300.00<SOH>151=900.00<SOH>14=300.00<SOH>60=20130228-14:42:15:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>544=1<SOH>

#### 6.1.1.4 撤单请求

| Tag  | 域名               | 取值                    |
|------|------------------|-----------------------|
|      | MsgType          | F                     |
| 1180 | ApplID           | 010                   |
| 11   | ClOrdID          | A0000002              |
| 522  | OwnerType        | 1                     |
| 54   | Side             | 1                     |
| 60   | TransacTime      | 20130228-14:42:15:555 |
| 48   | SecurityID       | 00000001              |
| 22   | SecurityIDSource | 102                   |
| 453  | NoPartyIDs       | 1                     |
| 448  | PartyID          | 000100                |
| 447  | PartyIDSource    | C                     |
| 452  | PartyRole        | 1                     |
| 38   | OrderQty         | 1200.00               |
| 41   | OrigClOrdID      | A0000001              |

STEP 消息如下：

1180=010<SOH>11=A0000002<SOH>522=1<SOH>54=1<SOH>60=20130228-14:42:15:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=1<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>38=1200.00<SOH>41=A0000001<SOH>

## 6.1.1.5 撤单失败响应

| Tag   | 域名               | 取值                    |
|-------|------------------|-----------------------|
|       | MsgType          | 9                     |
| 10179 | ReportIndex      | 3                     |
| 1180  | ApplID           | 010                   |
| 11    | ClOrdID          | A0000002              |
| 41    | OrigClOrdID      | A0000001              |
| 522   | OwnerType        | 1                     |
| 60    | TransacTime      | 20130228-14:42:13:565 |
| 102   | CxlRejReason     | 20018                 |
| 39    | OrdStatus        | 1                     |
| 48    | SecurityID       | 00000001              |
| 22    | SecurityIDSource | 102                   |
| 453   | NoPartyIDs       | 1                     |
| 448   | PartyID          | 000100                |
| 447   | PartyIDSource    | C                     |
| 452   | PartyRole        | 1                     |

STEP 消息如下：

10179=3<SOH>1180=010<SOH>11=A0000002<SOH>41=A0000001<SOH>522=1<SOH>  
60=20130228-14:42:13:565<SOH>102=20018<SOH>39=1<SOH>48=00000001<SOH>22=  
102<SOH>453=1<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>

## 6.1.1.6 撤单成功执行报告

| Tag   | 域名          | 取值               |
|-------|-------------|------------------|
|       | MsgType     | 8                |
| 10179 | ReportIndex | 3                |
| 1180  | ApplID      | 010              |
| 11    | ClOrdID     | A0000001         |
| 40    | OrdType     | 2                |
| 54    | Side        | 1                |
| 522   | OwnerType   | 1                |
| 17    | ExecID      | 1100000000004125 |
| 37    | OrderID     | 6B4569CDNB009C03 |



|     |                  |                       |
|-----|------------------|-----------------------|
| 150 | ExecType         | 4                     |
| 39  | OrdStatus        | 4                     |
| 151 | LeavesQty        | 0.00                  |
| 14  | CumQty           | 300.00                |
| 60  | TransacTime      | 20130228-14:42:23:565 |
| 48  | SecurityID       | 00000001              |
| 22  | SecurityIDSource | 102                   |
| 453 | NoPartyIDs       | 3                     |
| 448 | PartyID          | 000100                |
| 447 | PartyIDSource    | C                     |
| 452 | PartyRole        | 1                     |
| 448 | PartyID          | 0100004698            |
| 447 | PartyIDSource    | 5                     |
| 452 | PartyRole        | 5                     |
| 448 | PartyID          | AA                    |
| 447 | PartyIDSource    | D                     |
| 452 | PartyRole        | 4001                  |
| 38  | OrderQty         | 1200.00               |
| 44  | Price            | 17.4800               |
| 544 | CashMargin       | 1                     |

STEP 消息如下：

10179=3<SOH>1180=010<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>17=11000000000004125<SOH>37=6B4569CDNB009C03<SOH>150=4<SOH>39=4<SOH>151=0.00<SOH>14=300.00<SOH>60=20130228-14:42:23:565<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>544=1<SOH>

### 6.1.2 报价处理

下面列举了期权集中竞价业务报价及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

## 6.1.2.1 报价

| Tag  | 域名                | 取值                    |
|------|-------------------|-----------------------|
|      | MsgType           | S                     |
| 1180 | ApplID            | 041                   |
| 1166 | QuoteMsgID        | A0000001              |
| 522  | OwnerType         | 105                   |
| 60   | TransacTime       | 20130228-14:42:13:555 |
| 537  | QuoteType         | 1                     |
| 48   | SecurityID        | 00000001              |
| 22   | SecurityIDSource  | 102                   |
| 453  | NoPartyIDs        | 2                     |
| 448  | PartyID           | 000100                |
| 447  | PartyIDSource     | C                     |
| 452  | PartyRole         | 1                     |
| 448  | PartyID           | 0100004698            |
| 447  | PartyIDSource     | 5                     |
| 452  | PartyRole         | 5                     |
| 132  | BidPx             | 17.4800               |
| 134  | BidSize           | 1200.00               |
| 8909 | BidPositionEffect | O                     |

STEP 消息如下:

1180=041<SOH>1166=A0000001<SOH>522=105<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>  
>537=1<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=2<SOH>448=000100<SOH>447=  
C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>132=17.4800<S  
OH>134=1200.00<SOH>8909=O<SOH>

## 6.1.2.2 报价状态回报

| Tag   | 域名          | 取值       |
|-------|-------------|----------|
|       | MsgType     | AI       |
| 10179 | ReportIndex | 1        |
| 1180  | ApplID      | 041      |
| 1166  | QuoteMsgID  | A0000001 |

|      |                   |            |
|------|-------------------|------------|
| 522  | OwnerType         | 105        |
| 537  | QuoteType         | 1          |
| 297  | QuoteStatus       | 0          |
| 48   | SecurityID        | 00000001   |
| 22   | SecurityIDSource  | 102        |
| 453  | NoPartyIDs        | 2          |
| 448  | PartyID           | 000100     |
| 447  | PartyIDSource     | C          |
| 452  | PartyRole         | 1          |
| 448  | PartyID           | 0100004698 |
| 447  | PartyIDSource     | 5          |
| 452  | PartyRole         | 5          |
| 132  | BidPx             | 17.4800    |
| 134  | BidSize           | 1200.00    |
| 8909 | BidPositionEffect | O          |

STEP 消息如下：

10179=1<SOH>1180=041<SOH>1166=A0000001<SOH>522=105<SOH>537=1<SOH>297=0<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=2<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>132=17.4800<SOH>134=1200.00<SOH>8909=O<SOH>

#### 6.1.2.3 报价成交执行报告

| Tag   | 域名          | 取值               |
|-------|-------------|------------------|
|       | MsgType     | 8                |
| 10179 | ReportIndex | 2                |
| 1180  | ApplID      | 041              |
| 11    | ClOrdID     | A0000001         |
| 40    | OrdType     | 2                |
| 54    | Side        | 1                |
| 522   | OwnerType   | 105              |
| 17    | ExecID      | 1100000000004124 |
| 37    | OrderID     |                  |
| 150   | ExecType    | F                |

|      |                   |                       |
|------|-------------------|-----------------------|
| 39   | OrdStatus         | 1                     |
| 31   | LastPx            | 17.1000               |
| 32   | LastQty           | 300.00                |
| 151  | LeavesQty         | 900.00                |
| 14   | CumQty            | 300.00                |
| 60   | TransacTime       | 20130228-14:42:15:555 |
| 48   | SecurityID        | 00000001              |
| 22   | SecurityIDSource  | 102                   |
| 453  | NoPartyIDs        | 2                     |
| 448  | PartyID           | 000100                |
| 447  | PartyIDSource     | C                     |
| 452  | PartyRole         | 1                     |
| 448  | PartyID           | 0100004698            |
| 447  | PartyIDSource     | 5                     |
| 452  | PartyRole         | 5                     |
| 8909 | BidPositionEffect | O                     |

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=041<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=105<  
SOH>17=11000000000004124<SOH>37=  
<SOH>150=F<SOH>39=1<SOH>31=17.1000<SOH>32=300.00<SOH>151=900.00<SOH>  
14=300.00<SOH>60=20130228-14:42:15:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>4  
53=2<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=  
5<SOH>452=5<SOH>8909=O<SOH>

### 6.1.3 意向申报

下面列举了协议交易业务意向申报及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

#### 6.1.3.1 意向申报

| Tag  | 域名           | 取值       |
|------|--------------|----------|
|      | MsgType      | 6        |
| 1180 | ApplID       | 050      |
| 23   | IOIID        | A0000001 |
| 28   | IOITransType | N        |

|     |                  |                       |
|-----|------------------|-----------------------|
| 54  | Side             | 1                     |
| 522 | OwnerType        | 1                     |
| 60  | TransacTime      | 20130228-14:42:15:555 |
| 48  | SecurityID       | 00000001              |
| 22  | SecurityIDSource | 102                   |
| 453 | NoPartyIDs       | 2                     |
| 448 | PartyID          | 000100                |
| 447 | PartyIDSource    | C                     |
| 452 | PartyRole        | 1                     |
| 448 | PartyID          | 0100004698            |
| 447 | PartyIDSource    | 5                     |
| 452 | PartyRole        | 5                     |
| 448 | PartyID          | AA                    |
| 447 | PartyIDSource    | D                     |
| 452 | PartyRole        | 4001                  |
| 27  | IOIQty           | 1200.00               |
| 44  | Price            | 17.4800               |
| 58  | Text             | 王小红 0755-2345678      |

STEP 消息如下：

1180=050<SOH>23=A0000001<SOH>28=N<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:15:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=2<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>27=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>58=王小红 0755-2345678<SOH>

#### 6.1.3.2 意向申报响应

| Tag   | 域名            | 取值               |
|-------|---------------|------------------|
|       | MsgType       | AJ               |
| 10179 | ReportIndex   | 1                |
| 1180  | ApplID        | 050              |
| 693   | QuoteRespID   | 6B4569CDNB009C03 |
| 694   | QuoteRespType | 2                |
| 150   | ExecType      | 0                |

|     |                  |                       |
|-----|------------------|-----------------------|
| 23  | IOIID            | A0000001              |
| 28  | IOITransType     | N                     |
| 54  | Side             | 1                     |
| 522 | OwnerType        | 1                     |
| 60  | TransacTime      | 20130228-14:42:15:855 |
| 48  | SecurityID       | 00000001              |
| 22  | SecurityIDSource | 102                   |
| 453 | NoPartyIDs       | 2                     |
| 448 | PartyID          | 000100                |
| 447 | PartyIDSource    | C                     |
| 452 | PartyRole        | 1                     |
| 448 | PartyID          | 0100004698            |
| 447 | PartyIDSource    | 5                     |
| 452 | PartyRole        | 5                     |
| 448 | PartyID          | AA                    |
| 447 | PartyIDSource    | D                     |
| 452 | PartyRole        | 4001                  |
| 27  | IOIQty           | 1200.00               |
| 44  | Price            | 17.4800               |
| 58  | Text             | 王小红 0755-2345678      |

STEP 消息如下：

10179=1<SOH>1180=050<SOH>693=6B4569CDNB009C03<SOH>694=2<SOH>150=0<SOH>23=A0000001<SOH>28=N<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:15:855<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>453=2<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>27=1200.00<SOH>44=17.4800<SOH>58=王 小 红 0755-2345678<SOH>

#### 6.1.4 成交申报处理

下面列举了协议交易业务成交申报及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

##### 6.1.4.1 成交申报

| Tag | 域名 | 取值 |
|-----|----|----|
|-----|----|----|

|      | MsgType              | AE                    |
|------|----------------------|-----------------------|
| 1180 | ApplID               | 053                   |
| 571  | TradeReportID        | A0000001              |
| 522  | OwnerType            | 1                     |
| 856  | TradeReportType      | 0                     |
| 487  | TradeReportTransType | 0                     |
| 1123 | TradeHandlingInstr   | 2                     |
| 60   | TransacTime          | 20130228-14:42:13:555 |
| 48   | SecurityID           | 00000001              |
| 22   | SecurityIDSource     | 102                   |
| 1116 | NoRootPartyIDs       | 1                     |
| 1117 | RootPartyID          | 000100                |
| 1118 | RootPartyIDSource    | C                     |
| 1119 | RootPartyRole        | 1                     |
| 552  | NoSides              | 1                     |
| 54   | Side                 | 1                     |
| 453  | NoPartyIDs           | 4                     |
| 448  | PartyID              | 000100                |
| 447  | PartyIDSource        | C                     |
| 452  | PartyRole            | 1                     |
| 448  | PartyID              | 0100004698            |
| 447  | PartyIDSource        | 5                     |
| 452  | PartyRole            | 5                     |
| 448  | PartyID              | AA                    |
| 447  | PartyIDSource        | D                     |
| 452  | PartyRole            | 4001                  |
| 448  | PartyID              | 000100                |
| 447  | PartyIDSource        | C                     |
| 452  | PartyRole            | 17                    |
| 31   | LastPx               | 17.4800               |
| 32   | LastQty              | 1200.00               |
| 664  | ConfirmID            | B0000001              |

STEP 消息如下：

1180=053<SOH>571=A0000001<SOH>522=1<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=2<  
SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>1116=1<SOH  
>1117=000100<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>552=1<SOH>54=1<SOH>453=4<SOH  
>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>45  
2=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SO  
H>452=17<SOH>31=17.4800<SOH>32=1200.00<SOH>664=B0000001<SOH>

#### 6.1.4.2 成交申报响应

| Tag   | 域名                   | 取值                    |
|-------|----------------------|-----------------------|
|       | MsgType              | AR                    |
| 10179 | ReportIndex          | 1                     |
| 1180  | ApplID               | 053                   |
| 1003  | TradeID              | 6B4569CDNB009C03      |
| 571   | TradeReportID        | A0000001              |
| 522   | OwnerType            | 1                     |
| 856   | TradeReportType      | 0                     |
| 487   | TradeReportTransType | 0                     |
| 1123  | TradeHandlingInstr   | 2                     |
| 8912  | TrdAckStatus         | 0                     |
| 939   | TrdRptStatus         | 100                   |
| 60    | TransacTime          | 20130228-14:42:13:555 |
| 48    | SecurityID           | 00000001              |
| 22    | SecurityIDSource     | 102                   |
| 1116  | NoRootPartyIDs       | 1                     |
| 1117  | RootPartyID          | 000100                |
| 1118  | RootPartyIDSource    | C                     |
| 1119  | RootPartyRole        | 1                     |
| 552   | NoSides              | 1                     |
| 54    | Side                 | 1                     |
| 453   | NoPartyIDs           | 4                     |
| 448   | PartyID              | 000100                |
| 447   | PartyIDSource        | C                     |
| 452   | PartyRole            | 1                     |
| 448   | PartyID              | 0100004698            |



|     |               |                  |
|-----|---------------|------------------|
| 447 | PartyIDSource | 5                |
| 452 | PartyRole     | 5                |
| 448 | PartyID       | AA               |
| 447 | PartyIDSource | D                |
| 452 | PartyRole     | 4001             |
| 448 | PartyID       | 000100           |
| 447 | PartyIDSource | C                |
| 452 | PartyRole     | 17               |
| 17  | ExecID        | 2100000000004123 |
| 31  | LastPx        | 17.4800          |
| 32  | LastQty       | 1200.00          |
| 664 | ConfirmID     | B0000001         |

STEP 消息如下：

10179=1<SOH>1180=053<SOH>1003=6B4569CDNB009C03<SOH>571=A0000001<SOH>  
>522=1<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=2<SOH>8912=0<SOH>939=100<SOH>6  
0=20130228-14:42:13:555<SOH>48=00000001<SOH>22=102<SOH>1116=1<SOH>1117=  
000100<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>552=1<SOH>54=1<SOH>453=4<SOH>448=  
000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<S  
OH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452  
=17<SOH>17=2100000000004123<SOH>31=17.4800<SOH>32=1200.00<SOH>664=B000  
0001<SOH>

#### 6.1.4.3 成交确认

| Tag   | 域名                   | 取值               |
|-------|----------------------|------------------|
|       | MsgType              | AE               |
| 10179 | ReportIndex          | 2                |
| 1180  | ApplID               | 053              |
| 1003  | TradeID              | 6B4569CDNB009C03 |
| 571   | TradeReportID        | A0000001         |
| 522   | OwnerType            | 1                |
| 856   | TradeReportType      | 0                |
| 487   | TradeReportTransType | 2                |
| 1123  | TradeHandlingInstr   | 2                |

|      |                   |                       |
|------|-------------------|-----------------------|
| 60   | TransacTime       | 20130228-14:42:13:555 |
| 48   | SecurityID        | 00000001              |
| 22   | SecurityIDSource  | 102                   |
| 1116 | NoRootPartyIDs    | 1                     |
| 1117 | RootPartyID       | 000100                |
| 1118 | RootPartyIDSource | C                     |
| 1119 | RootPartyRole     | 1                     |
| 552  | NoSides           | 1                     |
| 54   | Side              | 1                     |
| 453  | NoPartyIDs        | 4                     |
| 448  | PartyID           | 000100                |
| 447  | PartyIDSource     | C                     |
| 452  | PartyRole         | 1                     |
| 448  | PartyID           | 0100004698            |
| 447  | PartyIDSource     | 5                     |
| 452  | PartyRole         | 5                     |
| 448  | PartyID           | AA                    |
| 447  | PartyIDSource     | D                     |
| 452  | PartyRole         | 4001                  |
| 448  | PartyID           | 000100                |
| 447  | PartyIDSource     | C                     |
| 452  | PartyRole         | 17                    |
| 17   | ExecID            | 1100000000004124      |
| 31   | LastPx            | 17.4800               |
| 32   | LastQty           | 1200.00               |
| 664  | ConfirmID         | B0000001              |

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=053<SOH>1003=6B4569CDNB009C03<SOH>571=A0000001<SOH>  
 522=1<SOH>856=0<SOH>487=2<SOH>1123=2<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>  
 48=00000001<SOH>22=102<SOH>1116=1<SOH>1117=100<SOH>1118=C<SOH>1119=  
 1<SOH>552=1<SOH>54=1<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<  
 SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>4  
 52=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=17<SOH>17=1100000000004124<S

OH>31=17.4800<SOH>32=1200.00<SOH>664=B0000001<SOH>

### 6.1.5 注册处理

下面列举了转托管业务注册申报及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

#### 6.1.5.1 注册

| Tag  | 域名                     | 取值                    |
|------|------------------------|-----------------------|
|      | MsgType                | U001                  |
| 1180 | ApplID                 | 200                   |
| 522  | OwnerType              | 1                     |
| 60   | TransacTime            | 20130228-14:42:13:555 |
| 11   | ClOrdID                | A0000001              |
| 8502 | DesignationInstruction | 3                     |
| 8527 | DesignationTransType   | 1                     |
| 453  | NoPartyIDs             | 4                     |
| 448  | PartyID                | 000100                |
| 447  | PartyIDSource          | C                     |
| 452  | PartyRole              | 1                     |
| 448  | PartyID                | 0100004698            |
| 447  | PartyIDSource          | 5                     |
| 452  | PartyRole              | 5                     |
| 448  | PartyID                | AA                    |
| 447  | PartyIDSource          | D                     |
| 452  | PartyRole              | 4001                  |
| 448  | PartyID                | 000200                |
| 447  | PartyIDSource          | C                     |
| 452  | PartyRole              | 40                    |

STEP 消息如下：

1180=200<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A0000001<SOH>8502=3<SOH>8527=1<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000200<SOH>447=C<SOH>452=40<SOH>

## 6.1.5.2 注册执行报告

| Tag   | 域名                     | 取值                    |
|-------|------------------------|-----------------------|
|       | MsgType                | U002                  |
| 10179 | ReportIndex            | 2                     |
| 1180  | ApplID                 | 200                   |
| 522   | OwnerType              | 1                     |
| 60    | TransacTime            | 20130228-14:42:13:555 |
| 11    | ClOrdID                | A0000001              |
| 37    | OrderID                | 6B4569CDNB009C03      |
| 17    | ExecID                 | 3100000000004123      |
| 150   | ExecType               | 0                     |
| 8502  | DesignationInstruction | 3                     |
| 453   | NoPartyIDs             | 4                     |
| 448   | PartyID                | 000100                |
| 447   | PartyIDSource          | C                     |
| 452   | PartyRole              | 1                     |
| 448   | PartyID                | 0100004698            |
| 447   | PartyIDSource          | 5                     |
| 452   | PartyRole              | 5                     |
| 448   | PartyID                | AA                    |
| 447   | PartyIDSource          | D                     |
| 452   | PartyRole              | 4001                  |
| 448   | PartyID                | 000200                |
| 447   | PartyIDSource          | C                     |
| 452   | PartyRole              | 40                    |

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=200<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A00  
00001<SOH>17=3100000000004123<SOH>150=0<SOH>8502=3<SOH>453=4<SOH>448  
=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<  
SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000200<SOH>447=C<SOH>45  
2=40<SOH>

### 6.1.6 网络投票处理消息

下面列举了网络投票业务投票申报及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

#### 6.1.6.1 投票

| Tag  | 域名               | 取值                    |
|------|------------------|-----------------------|
|      | MsgType          | U004                  |
| 1180 | ApplID           | 210                   |
| 522  | OwnerType        | 1                     |
| 60   | TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| 11   | ClOrdID          | A0000001              |
| 48   | SecurityID       | 00369501              |
| 22   | SecurityIDSource | 102                   |
| 453  | NoPartyIDs       | 3                     |
| 448  | PartyID          | 000100                |
| 447  | PartyIDSource    | C                     |
| 452  | PartyRole        | 1                     |
| 448  | PartyID          | 0100004698            |
| 447  | PartyIDSource    | 5                     |
| 452  | PartyRole        | 5                     |
| 448  | PartyID          | AA                    |
| 447  | PartyIDSource    | D                     |
| 452  | PartyRole        | 4001                  |
| 8529 | VotingProposal   | 1                     |
| 8531 | VotingPreference | 1                     |

STEP 消息如下：

1180=210<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A0000001<SOH>48=00369501<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>8529=1<SOH>8531=1<SOH>

#### 6.1.6.2 投票执行报告

| Tag | 域名      | 取值   |
|-----|---------|------|
|     | MsgType | U004 |

|       |                  |                       |
|-------|------------------|-----------------------|
| 10179 | ReportIndex      | 2                     |
| 1180  | ApplID           | 200                   |
| 522   | OwnerType        | 1                     |
| 60    | TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| 11    | ClOrdID          | A0000001              |
| 37    | OrderID          | 6B4569CDNB009C78      |
| 17    | ExecID           | 3100000000004124      |
| 150   | ExecType         | 0                     |
| 48    | SecurityID       | 00369501              |
| 22    | SecurityIDSource | 102                   |
| 453   | NoPartyIDs       | 3                     |
| 448   | PartyID          | 000100                |
| 447   | PartyIDSource    | C                     |
| 452   | PartyRole        | 1                     |
| 448   | PartyID          | 0100004698            |
| 447   | PartyIDSource    | 5                     |
| 452   | PartyRole        | 5                     |
| 448   | PartyID          | AA                    |
| 447   | PartyIDSource    | D                     |
| 452   | PartyRole        | 4001                  |
| 8529  | VotingProposal   | 1                     |
| 8531  | VotingPreference | 1                     |

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=200<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A000001<SOH>37=6B4569CDNB009C78<SOH>17=3100000000004124<SOH>150=0<SOH>48=00369501<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>8529=1<SOH>8531=1<SOH>

#### 6.1.6.3 投资者网络投票密码服务激活

| Tag  | 域名      | 取值   |
|------|---------|------|
|      | MsgType | U005 |
| 1180 | ApplID  | 211  |

|      |                |                       |
|------|----------------|-----------------------|
| 522  | OwnerType      | 1                     |
| 60   | TransacTime    | 20130228-14:42:13:555 |
| 11   | ClOrdID        | A0000001              |
| 453  | NoPartyIDs     | 3                     |
| 448  | PartyID        | 000100                |
| 447  | PartyIDSource  | C                     |
| 452  | PartyRole      | 1                     |
| 448  | PartyID        | 0100004698            |
| 447  | PartyIDSource  | 5                     |
| 452  | PartyRole      | 5                     |
| 448  | PartyID        | AA                    |
| 447  | PartyIDSource  | D                     |
| 452  | PartyRole      | 4001                  |
| 8539 | ValidationCode | ABC                   |

STEP 消息如下:

1180=211<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A0000001<SOH>453  
=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<  
SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>8539=ABC<SOH>

#### 6.1.6.4 投资者网络投票密码服务激活执行报告

| Tag   | 域名            | 取值                    |
|-------|---------------|-----------------------|
|       | MsgType       | U005                  |
| 10179 | ReportIndex   | 2                     |
| 1180  | ApplID        | 211                   |
| 522   | OwnerType     | 1                     |
| 60    | TransacTime   | 20130228-14:42:13:555 |
| 11    | ClOrdID       | A0000001              |
| 37    | OrderID       | 6B4569CDNB009C83      |
| 17    | ExecID        | 3100000000004125      |
| 150   | ExecType      | 0                     |
| 453   | NoPartyIDs    | 3                     |
| 448   | PartyID       | 000100                |
| 447   | PartyIDSource | C                     |

|      |                |            |
|------|----------------|------------|
| 452  | PartyRole      | 1          |
| 448  | PartyID        | 0100004698 |
| 447  | PartyIDSource  | 5          |
| 452  | PartyRole      | 5          |
| 448  | PartyID        | AA         |
| 447  | PartyIDSource  | D          |
| 452  | PartyRole      | 4001       |
| 8539 | ValidationCode | ABC        |

STEP 消息如下：

10179=2<SOH>1180=211<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>11=A00  
00001<SOH>37=6B4569CDNB009C83<SOH>17=3100000000004125<SOH>150=0<SOH>  
>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>44  
7=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>8539=ABC<SOH>  
>

## 6.2 行情

### 6.2.1 频道心跳

| Tag   | 域名            | 取值    |
|-------|---------------|-------|
|       | MsgType       | UA001 |
| 10201 | ChannelNo     | 0010  |
| 95    | RawDataLength |       |
| 96    | RawData       |       |

| Tag   | 域名             | 取值   |
|-------|----------------|------|
| 999   | TemplateID     | 3001 |
| 10201 | ChannelNo      | 0010 |
| 1350  | ApplLastSeqNum | 2937 |
| 10205 | EndOfChannel   | N    |

STEP 消息如下：

999=3001<SOH>10201=10<SOH>1350=2937<SOH>10205=N



6.2.2 重传消息

| Tag   | 域名            | 取值    |
|-------|---------------|-------|
|       | MsgType       | UA002 |
| 10201 | ChannelNo     | 2001  |
| 95    | RawDataLength |       |
| 96    | RawData       |       |

| Tag   | 域名            | 取值   |
|-------|---------------|------|
| 999   | TemplateID    | 3002 |
| 10077 | ResendType    | 1    |
| 10201 | ChannelNo     | 2001 |
| 1182  | ApplBegSeqNum | 100  |
| 1183  | ApplEndSeqNum | 0    |

STEP 消息如下：

999=3002<SOH>10077=1<SOH>10201=2001<SOH>1182=100<SOH>1183=0

6.2.3 用户信息报告消息

| Tag   | 域名            | 取值    |
|-------|---------------|-------|
|       | MsgType       | UA003 |
| 10201 | ChannelNo     | 5000  |
| 95    | RawDataLength |       |
| 96    | RawData       |       |

| Tag  | 域名          | 取值                    |
|------|-------------|-----------------------|
| 999  | TemplateID  | 3003                  |
| 42   | OrigTime    | 20130228-14:42:13:555 |
| 8934 | VersionCode | 02                    |
| 8935 | UserNum     | 10                    |

STEP 消息如下：

999=3003<SOH>42=20130228-14:42:13:555<SOH>8934=2<SOH>8935=10

#### 6.2.4 证券实时状态

| Tag   | 域名            | 取值   |
|-------|---------------|------|
|       | MsgType       | f    |
| 10201 | ChannelNo     | 0001 |
| 95    | RawDataLength |      |
| 96    | RawData       |      |

| Tag   | 域名                   | 取值                    |
|-------|----------------------|-----------------------|
| 999   | TemplateID           | 3003                  |
| 42    | OrigTime             | 20130228-14:42:13:555 |
| 10201 | ChannelNo            | 0001                  |
| 48    | SecurityID           | 00000001              |
| 22    | SecurityIDSource     | 102                   |
| 8901  | SecurityPreName      | .A..                  |
| 10202 | NoSwitch             | 1                     |
| 10203 | SecuritySwitchType   | 1                     |
| 10204 | SecuritySwitchStatus | Y                     |

STEP 消息如下：

999=3003<SOH>42=20130228-14:42:13:555<SOH>10201=1<SOH>48=1<SOH>22=102<SOH>8901=.A..<SOH>10202=1<SOH>10203=1<SOH>10204=Y

#### 6.2.5 公告

| Tag   | 域名            | 取值   |
|-------|---------------|------|
|       | MsgType       | B    |
| 10201 | ChannelNo     | 0002 |
| 95    | RawDataLength |      |
| 96    | RawData       |      |

| Tag  | 域名         | 取值                    |
|------|------------|-----------------------|
| 999  | TemplateID | 4002                  |
| 1472 | NewsID     | AA0001                |
| 148  | Headline   | 测试公告                  |
| 42   | OrigTime   | 20130228-14:42:13:555 |

|    |               |          |
|----|---------------|----------|
| 95 | RawDataLength | (公告内容长度) |
| 96 | RawData       | (公告内容)   |

### 6.2.6 集中竞价行情快照

集中竞价 Level II 行情快照消息，示例中买卖盘信息共有五档，卖三档，买两档，其中在买卖最优档上揭示前 10 笔委托的数量。

| Tag   | 域名            | 取值   |
|-------|---------------|------|
|       | MsgType       | W    |
| 10201 | ChannelNo     | 1001 |
| 95    | RawDataLength |      |
| 96    | RawData       |      |

| Tag   | 域名               | 取值                    |
|-------|------------------|-----------------------|
| 999   | TemplateID       | 4001                  |
| 42    | OrigTime         | 20140126-10:30:05:335 |
| 10201 | ChannelNo        | 1011                  |
| 1500  | MDSStreamID      | 010                   |
| 48    | SecurityID       | 00002001              |
| 22    | SecurityIDSource | 102                   |
| 8538  | TradingPhaseCode | T0                    |
| 140   | PrevClosePx      | 17.4600               |
| 8503  | NumTrades        | 478                   |
| 387   | TotalVolumeTrade | 24689.00              |
| 8504  | TotalValueTrade  | 405783.6700           |
| 268   | NoMDEntries      | 15                    |
| 269   | MDEntryType      | 2                     |
| 270   | MDEntryPx        | 17.490000             |
| 269   | MDEntryType      | 4                     |
| 270   | MDEntryPx        | 18.120000             |
| 269   | MDEntryType      | 7                     |
| 270   | MDEntryPx        | 18.130000             |
| 269   | MDEntryType      | 8                     |

|      |                |           |
|------|----------------|-----------|
| 270  | MDEntryPx      | 17.200000 |
| 269  | MDEntryType    | x1        |
| 270  | MDEntryPx      | 0.030000  |
| 269  | MDEntryType    | x2        |
| 270  | MDEntryPx      | -0.010000 |
| 269  | MDEntryType    | x3        |
| 270  | MDEntryPx      | 17.450000 |
| 271  | MDEntrySize    | 369801.00 |
| 269  | MDEntryType    | x4        |
| 270  | MDEntryPx      | 17.460000 |
| 271  | MDEntrySize    | 14689.00  |
| 269  | MDEntryType    | x5        |
| 270  | MDEntryPx      | 15.950000 |
| 269  | MDEntryType    | x6        |
| 270  | MDEntryPx      | 16.120000 |
| 269  | MDEntryType    | 1         |
| 270  | MDEntryPx      | 18.460000 |
| 271  | MDEntrySize    | 2340.00   |
| 1023 | MDPriceLevel   | 3         |
| 346  | NumberOfOrders | 56        |
| 73   | NoOrders       | 0         |
| 269  | MDEntryType    | 1         |
| 270  | MDEntryPx      | 18.450000 |
| 271  | MDEntrySize    | 1340.00   |
| 1023 | MDPriceLevel   | 2         |
| 346  | NumberOfOrders | 71        |
| 73   | NoOrders       | 0         |
| 269  | MDEntryType    | 1         |
| 270  | MDEntryPx      | 18.420000 |
| 271  | MDEntrySize    | 1350.00   |
| 1023 | MDPriceLevel   | 1         |
| 346  | NumberOfOrders | 16        |
| 73   | NoOrders       | 10        |
| 38   | OrderQty       | 10.00     |

|      |                |           |
|------|----------------|-----------|
| 38   | OrderQty       | 10.00     |
| 38   | OrderQty       | 20.00     |
| 38   | OrderQty       | 10.00     |
| 38   | OrderQty       | 13.00     |
| 38   | OrderQty       | 17.00     |
| 38   | OrderQty       | 103.00    |
| 38   | OrderQty       | 21.00     |
| 38   | OrderQty       | 16.00     |
| 38   | OrderQty       | 11.00     |
| 269  | MDEntryType    | 0         |
| 270  | MDEntryPx      | 18.400000 |
| 271  | MDEntrySize    | 27500.00  |
| 1023 | MDPriceLevel   | 1         |
| 346  | NumberOfOrders | 23        |
| 73   | NoOrders       | 10        |
| 38   | OrderQty       | 100.00    |
| 38   | OrderQty       | 100.00    |
| 38   | OrderQty       | 200.00    |
| 38   | OrderQty       | 100.00    |
| 38   | OrderQty       | 130.00    |
| 38   | OrderQty       | 170.00    |
| 38   | OrderQty       | 100.00    |
| 38   | OrderQty       | 200.00    |
| 38   | OrderQty       | 160.00    |
| 38   | OrderQty       | 110.00    |
| 269  | MDEntryType    | 0         |
| 270  | MDEntryPx      | 18.390000 |
| 271  | MDEntrySize    | 17500.00  |
| 1023 | MDPriceLevel   | 2         |
| 346  | NumberOfOrders | 53        |
| 73   | NoOrders       | 0         |

STEP 消息如下：

999=4001<SOH>42=20140126-10:30:05:335<SOH>10201=1011<SOH>1500=010<SOH>48=00002001

<SOH>22=102<SOH>8538=T0<SOH>140=17.4600<SOH>8503=478<SOH>387=24689.00<SOH>8504=405783.6700<SOH>268=15<SOH>269=2<SOH>270=17.490000<SOH>269=4<SOH>270=18.120000<SOH>269=7<SOH>270=18.130000<SOH>269=8<SOH>270=17.200000<SOH>269=x1<SOH>270=0.030000<SOH>269=x2<SOH>270=-0.010000<SOH>269=x3<SOH>270=17.450000<SOH>271=369801.00<SOH>269=x4<SOH>270=17.460000<SOH>271=14689.00<SOH>269=x5<SOH>270=15.950000<SOH>269=x6<SOH>270=16.120000<SOH>269=1<SOH>270=18.460000<SOH>271=2340.00<SOH>1023=3<SOH>346=56<SOH>73=0<SOH>269=1<SOH>270=18.450000<SOH>271=1340.00<SOH>1023=2<SOH>346=71<SOH>73=0<SOH>269=1<SOH>270=18.420000<SOH>271=1350.00<SOH>1023=1<SOH>346=16<SOH>73=10<SOH>38=10.00<SOH>38=10.00<SOH>38=20.00<SOH>38=10.00<SOH>38=13.00<SOH>38=17.00<SOH>38=103.00<SOH>38=21.00<SOH>38=16.00<SOH>38=11.00<SOH>269=0<SOH>270=18.400000<SOH>271=27500.00<SOH>1023=1<SOH>346=23<SOH>73=10<SOH>38=100.00<SOH>38=100.00<SOH>38=200.00<SOH>38=100.00<SOH>38=130.00<SOH>38=170.00<SOH>38=100.00<SOH>38=200.00<SOH>38=160.00<SOH>38=110.00<SOH>269=0<SOH>270=18.390000<SOH>271=17500.00<SOH>1023=2<SOH>346=53<SOH>73=0

6.2.7 逐笔委托行情

| Tag   | 域名            | 取值    |
|-------|---------------|-------|
|       | MsgType       | UA201 |
| 10201 | ChannelNo     | 2001  |
| 95    | RawDataLength |       |
| 96    | RawData       |       |

| Tag   | 域名               | 取值       |
|-------|------------------|----------|
| 999   | TemplateID       | 4201     |
| 10201 | ChannelNo        | 2001     |
| 1500  | MDStreamID       | 011      |
| 1181  | ApplSeqNum       | 100      |
| 48    | SecurityID       | 00000001 |
| 22    | SecurityIDSource | 102      |
| 44    | Price            | 17.4800  |
| 38    | OrderQty         | 1200.00  |
| 54    | Side             | 1        |
| 40    | OrdType          | 2        |
| 59    | TimeInForce      | 0        |

|      |                |                       |
|------|----------------|-----------------------|
| 1090 | MaxPriceLevels | 0                     |
| 110  | MinQty         | 0                     |
| 60   | TransacTime    | 20130228-14:42:13:555 |

STEP 消息如下：

999=4201<SOH>10201=2001<SOH>1500=11<SOH>1181=100<SOH>48=1<SOH>22=102<SOH>44=1  
7.48<SOH>38=1200<SOH>54=1<SOH>40=2<SOH>59=0<SOH>1090=0<SOH>110=0<SOH>60=2013  
0228-14:42:13:555

### 6.2.8 逐笔成交行情

| Tag   | 域名            | 取值    |
|-------|---------------|-------|
|       | MsgType       | UA202 |
| 10201 | ChannelNo     | 2001  |
| 95    | RawDataLength |       |
| 96    | RawData       |       |

| Tag   | 域名               | 取值                    |
|-------|------------------|-----------------------|
| 999   | TemplateID       | 4202                  |
| 10201 | ChannelNo        | 2001                  |
| 1500  | MDStreamID       | 011                   |
| 1181  | ApplSeqNum       | 100                   |
| 10116 | BidApplSeqNum    | 10                    |
| 10117 | OfferApplSeqNum  | 20                    |
| 48    | SecurityID       | 00000001              |
| 22    | SecurityIDSource | 102                   |
| 31    | LastPx           | 17.4800               |
| 32    | LastQty          | 1200.00               |
| 150   | ExecType         | F                     |
| 60    | TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |

STEP 消息如下：

999=4202<SOH>10201=2001<SOH>1500=11<SOH>1181=100<SOH>10116=10<SOH>10117=20<SOH>  
>48=1<SOH>22=102<SOH>31=17.48<SOH>32=1200<SOH>150=F<SOH>60=20130228-14:42:13:555

七、 BINARY 消息示例

下面的 BINARY 消息示例和上面的 STEP 消息示例一一对应。

7.1 交易

7.1.1 订单处理

下面列举了现货集中竞价业务新订单及相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾：

7.1.1.1 申报新订单

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 100101                |
| ApplID           | 010                   |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 01                    |
| TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| ClOrdID          | A0000001              |
| AccountID        | 0100004698            |
| BranchID         | AA                    |
| Side             | 1                     |
| OrdType          | 2                     |
| OrderQty         | 1200.00               |
| Price            | 17.4800               |
| StopPx           | 17.4800               |
| MinQty           | 0                     |
| MaxPriceLevels   | 0                     |
| TimeInForce      | 0                     |
| CashMargin       | 1                     |



## 7.1.1.2 订单响应执行报告

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 200102                |
| ReportIndex      | 1                     |
| ApplID           | 010                   |
| ReportingPBUID   | 00100                 |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 01                    |
| TransacTime      | 20130228-14:42:13:565 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| OrderID          | 6B4569CDNB009C03      |
| ClOrdID          | A0000001              |
| OrigClOrdID      | 全空格                   |
| ExecID           | 1100000000004123      |
| ExecType         | 0                     |
| OrdStatus        | 0                     |
| OrdRejReason     | 0                     |
| LeavesQty        | 1200.00               |
| CumQty           | 0.00                  |
| Side             | 1                     |
| OrdType          | 2                     |
| OrderQty         | 1200.00               |
| Price            | 17.4800               |
| AccountID        | 0100004698            |
| BranchID         | AA                    |
| StopPx           | 17.4800               |
| MinQty           | 0                     |
| MaxPriceLevels   | 0                     |
| TimeInForce      | 0                     |
| CashMargin       | 1                     |

## 7.1.1.3 订单成交执行报告

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 200115                |
| ReportIndex      | 2                     |
| ApplID           | 010                   |
| ReportingPBUID   | 00100                 |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 01                    |
| TransacTime      | 20130228-14:42:15:555 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| OrderID          | 6B4569CDNB009C03      |
| ClOrdID          | A0000001              |
| ExecID           | 1100000000004124      |
| ExecType         | F                     |
| OrdStatus        | 1                     |
| LastPx           | 17.1000               |
| LastQty          | 300.00                |
| LeavesQty        | 900.00                |
| CumQty           | 300.00                |
| Side             | 1                     |
| AccountID        | 0100004698            |
| BranchID         | AA                    |
| CashMargin       | 1                     |

## 7.1.1.4 撤单请求

| 域名               | 取值       |
|------------------|----------|
| MsgType          | 190007   |
| ApplID           | 010      |
| SubmittingPBUID  | 000100   |
| SecurityID       | 00000001 |
| SecurityIDSource | 102      |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| OwnerType    | 1                     |
| ClearingFirm | 01                    |
| TransacTime  | 20130228-14:42:15:555 |
| UserInfo     | 全空格                   |
| ClOrdID      | A0000002              |
| OrigClOrdID  | A0000001              |
| Side         | 1                     |
| OrderID      | 全空格                   |
| OrderQty     | 1200.00               |

## 7.1.1.5 撤单失败响应

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 290008                |
| ReportIndex      | 3                     |
| ApplID           | 010                   |
| ReportingPBUID   | 000100                |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 01                    |
| TransacTime      | 20130228-14:42:13:565 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| ClOrdID          | A0000002              |
| OrigClOrdID      | A0000001              |
| Side             | 1                     |
| OrdStatus        | 1                     |
| CxlRejReason     | 20018                 |
| RejectText       | 全空格                   |
| OrderID          | 全空格                   |

## 7.1.1.6 撤单成功执行报告

| 域名      | 取值     |
|---------|--------|
| MsgType | 200102 |

|                  |                       |
|------------------|-----------------------|
| ReportIndex      | 3                     |
| ApplID           | 010                   |
| ReportingPBUID   | 000100                |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 01                    |
| TransacTime      | 20130228-14:42:23:565 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| OrderID          | 6B4569CDNB009C03      |
| ClOrdID          | A0000002              |
| OrigClOrdID      | A0000001              |
| ExecID           | 1100000000004125      |
| ExecType         | 4                     |
| OrdStatus        | 4                     |
| OrdRejReason     | 0                     |
| LeavesQty        | 0.00                  |
| CumQty           | 300.00                |
| Side             | 1                     |
| OrdType          | 2                     |
| OrderQty         | 1200.00               |
| Price            | 17.4800               |
| AccountID        | 0100004698            |
| BranchID         | AA                    |
| StopPx           | 17.4800               |
| MinQty           | 0                     |
| MaxPriceLevels   | 0                     |
| TimeInForce      | 0                     |
| CashMargin       | 1                     |

### 7.1.2 报价处理

下面列举了期权集中竞价业务报价及相关处理消息的示例,示例中不包含消息头和

消息尾：

#### 7.1.2.1 报价

| 域名                  | 取值                    |
|---------------------|-----------------------|
| MsgType             | 104105                |
| ApplID              | 041                   |
| SubmittingPBUID     | 000100                |
| SecurityID          | 00000001              |
| SecurityIDSource    | 102                   |
| OwnerType           | 105                   |
| ClearingFirm        | 01                    |
| TransacTime         | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo            | 全空格                   |
| QuoteMsgID          | A0000001              |
| AccountID           | 0100004698            |
| QuoteReqID          | 全空格                   |
| QuoteType           | 1                     |
| BidPx               | 17.4800               |
| OfferPx             | 0                     |
| BidSize             | 1200.00               |
| OfferSize           | 0                     |
| BidPositionEffect   | O                     |
| OfferPositionEffect | 空格                    |

#### 7.1.2.2 报价状态回报

| 域名               | 取值       |
|------------------|----------|
| MsgType          | 200406   |
| ReportIndex      | 1        |
| ApplID           | 041      |
| ReportingPBUID   | 000100   |
| SubmittingPBUID  | 000100   |
| SecurityID       | 00000001 |
| SecurityIDSource | 102      |
| OwnerType        | 105      |

|                     |                       |
|---------------------|-----------------------|
| ClearingFirm        | 01                    |
| TransacTime         | 20130228-14:42:13:655 |
| UserInfo            | 全空格                   |
| QuoteMsgID          | A0000001              |
| AccountID           | 0100004698            |
| QuoteReqID          | 全空格                   |
| QuoteStatus         | 0                     |
| QuoteRejectReason   | 0                     |
| QuoteType           | 1                     |
| BidPx               | 17.4800               |
| OfferPx             | 0                     |
| BidSize             | 1200.00               |
| OfferSize           | 0                     |
| BidPositionEffect   | O                     |
| OfferPositionEffect | 空格                    |

## 7.1.2.3 报价成交执行报告

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 200415                |
| ReportIndex      | 2                     |
| ApplID           | 041                   |
| ReportingPBUID   | 000100                |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 105                   |
| ClearingFirm     | 01                    |
| TransacTime      | 20130228-14:42:15:555 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| OrderID          | 全空格                   |
| ClOrdID          | A0000001              |
| ExecID           | 1100000000004124      |
| ExecType         | F                     |
| OrdStatus        | 1                     |

|                    |            |
|--------------------|------------|
| LastPx             | 17.1000    |
| LastQty            | 300.00     |
| LeavesQty          | 900.00     |
| CumQty             | 300.00     |
| Side               | 1          |
| AccountID          | 0100004698 |
| BranchID           | 全空格        |
| PositionEffect     | O          |
| CoveredOrUncovered | 1          |

### 7.1.3 意向申报

下面列举了协议交易业务意向申报及相关处理消息的示例, 示例中不包含消息头和消息尾:

#### 7.1.3.1 意向申报

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 100509                |
| ApplID           | 050                   |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 01                    |
| TransacTime      | 20130228-14:42:15:555 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| IOIID            | A0000001              |
| AccountID        | 0100004698            |
| BranchID         | AA                    |
| IOITransType     | N                     |
| Side             | 1                     |
| IOIRefID         | 全空格                   |
| IOIQty           | 1200.00               |
| Price            | 17.4800               |
| ContactInfo      | 王小红 0755-2345678      |

7.1.3.2 意向申报响应

| 域名                | 取值                    |
|-------------------|-----------------------|
| MsgType           | 2005010               |
| ReportIndex       | 1                     |
| ApplID            | 050                   |
| ReportingPBUID    | 000100                |
| SubmittingPBUID   | 000100                |
| SecurityID        | 00000001              |
| SecurityIDSource  | 102                   |
| OwnerType         | 1                     |
| ClearingFirm      | 01                    |
| TransacTime       | 20130228-14:42:15:855 |
| UserInfo          | 全空格                   |
| QuoteRespID       | 6B4569CDNB009C03      |
| QuoteRespType     | 2                     |
| ExecType          | 0                     |
| QuoteRejectReason | 0                     |
| IOIID             | A0000001              |
| IOIRefID          | 全空格                   |
| IOITransType      | N                     |
| Side              | 1                     |
| AccountID         | 0100004698            |
| BranchID          | AA                    |
| IOIQty            | 1200.00               |
| Price             | 17.4800               |
| ContactInfo       | 王小红 0755-2345678      |

7.1.4 成交申报处理

下面列举了协议交易业务成交申报及相关处理消息的示例, 示例中不包含消息头和消息尾:



## 7.1.4.1 成交申报

| 域名                    | 取值                    |
|-----------------------|-----------------------|
| MsgType               | 100503                |
| ApplID                | 053                   |
| SubmittingPBUID       | 000100                |
| SecurityID            | 00000001              |
| SecurityIDSource      | 102                   |
| OwnerType             | 1                     |
| ClearingFirm          | 01                    |
| TransacTime           | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo              | 全空格                   |
| TradeReportID         | A0000001              |
| TradeReportType       | 0                     |
| TradeReportTransType  | 0                     |
| TradeHandlingInstr    | 2                     |
| TradeReportRefID      | 全空格                   |
| LastPx                | 17.4800               |
| LastQty               | 1200.00               |
| TrdType               | 0                     |
| TrdSubType            | 0                     |
| ConfirmID             | B0000001              |
| Side                  | 1                     |
| PBUID                 | 000100                |
| AccountID             | 0100004698            |
| BranchID              | AA                    |
| CounterpartyPBUID     | 000100                |
| CounterpartyAccountID | 全空格                   |
| CounterpartyBranchID  | 全空格                   |

## 7.1.4.2 成交申报响应

| 域名          | 取值     |
|-------------|--------|
| MsgType     | 200504 |
| ReportIndex | 1      |
| ApplID      | 053    |

|                         |                       |
|-------------------------|-----------------------|
| ReportingPBUID          | 000100                |
| SubmittingPBUID         | 000100                |
| SecurityID              | 00000001              |
| SecurityIDSource        | 102                   |
| OwnerType               | 2                     |
| ClearingFirm            | 01                    |
| TransacTime             | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo                | 全空格                   |
| TradeID                 | 6B4569CDNB009C03      |
| TradeReportID           | A0000001              |
| TradeReportType         | 0                     |
| TradeReportTransType    | 0                     |
| TradeHandlingInstr      | 2                     |
| TradeReportRefID        | 全空格                   |
| TrdAckStatus            | 0                     |
| TrdRptStatus            | 100                   |
| TradeReportRejectReason | 0                     |
| LastPx                  | 17.4800               |
| LastQty                 | 1200.00               |
| TrdType                 | 0                     |
| TrdSubType              | 0                     |
| ConfirmID               | B0000001              |
| RptExecID               | 2100000000004123      |
| Side                    | 1                     |
| PBUID                   | 000100                |
| AccountID               | 0100004698            |
| BranchID                | AA                    |
| CounterpartyPBUID       | 000100                |
| CounterpartyAccountID   | 全空格                   |
| CounterpartyBranchID    | 全空格                   |

#### 7.1.4.3 成交确认

| 域名      | 取值     |
|---------|--------|
| MsgType | 200503 |

|                       |                       |
|-----------------------|-----------------------|
| ReportIndex           | 2                     |
| ApplID                | 053                   |
| ReportingPBUID        | 000100                |
| SubmittingPBUID       | 000100                |
| SecurityID            | 00000001              |
| SecurityIDSource      | 102                   |
| OwnerType             | 1                     |
| ClearingFirm          | 01                    |
| TransacTime           | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo              | 全空格                   |
| TradeID               | 6B4569CDNB009C03      |
| TradeReportID         | A0000001              |
| TradeReportType       | 0                     |
| TradeReportTransType  | 2                     |
| TradeHandlingInstr    | 2                     |
| LastPx                | 17.4800               |
| LastQty               | 1200.00               |
| TrdType               | 0                     |
| TrdSubType            | 0                     |
| ConfirmID             | B0000001              |
| RptExecID             | 1100000000004124      |
| Side                  | 1                     |
| PBUID                 | 000100                |
| AccountID             | 0100004698            |
| BranchID              | AA                    |
| CounterpartyPBUID     | 000100                |
| CounterpartyAccountID | 全空格                   |
| CounterpartyBranchID  | 全空格                   |

### 7.1.5 注册处理

下面列举了转托管业务注册申报及相关处理消息的示例,示例中不包含消息头和消息尾:

#### 7.1.5.1 注册

| 域名 | 取值 |
|----|----|
|----|----|

| MsgType                | 102099                |
|------------------------|-----------------------|
| ApplID                 | 200                   |
| SubmittingPBUID        | 000100                |
| SecurityID             | 全空格                   |
| SecurityIDSource       | 全空格                   |
| OwnerType              | 1                     |
| ClearingFirm           | 01                    |
| TransacTime            | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo               | 全空格                   |
| ClOrdID                | A0000001              |
| OrigClOrdID            | 全空格                   |
| DesignationInstruction | 3                     |
| DesignationTransType   | 1                     |
| AccountID              | 0100004698            |
| BranchID               | AA                    |
| OrderQty               | 0                     |
| TransfereePBUID        | 00200                 |

#### 7.1.5.2 注册执行报告

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | U002                  |
| ReportIndex      | 2                     |
| ApplID           | 200                   |
| ReportingPBUID   | 000100                |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 全空格                   |
| SecurityIDSource | 全空格                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 01                    |
| TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| OrderID          | 6B4569CDNB009C03      |
| ClOrdID          | A0000001              |
| OrigClOrdID      | 全空格                   |

|                        |                  |
|------------------------|------------------|
| ExecID                 | 3100000000004123 |
| ExecType               | 0                |
| OrdRejReason           | 0                |
| DesignationInstruction | 3                |
| DesignationTransType   | 1                |
| AccountID              | 0100004698       |
| BranchID               | AA               |
| OrderQty               | 0                |
| TransfereePBUID        | 00200            |

### 7.1.6 网络投票处理消息

下面列举了网络投票业务投票申报及相关处理消息的示例,示例中不包含消息头和消息尾:

#### 7.1.6.1 投票

| 域名                | 取值                    |
|-------------------|-----------------------|
| MsgType           | 102197                |
| ApplID            | 210                   |
| SubmittingPBUID   | 000100                |
| SecurityID        | 00369501              |
| SecurityIDSource  | 102                   |
| OwnerType         | 1                     |
| ClearingFirm      | 全空格                   |
| TransacTime       | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo          | 全空格                   |
| ClOrdID           | A0000001              |
| AccountID         | 0100004698            |
| BranchID          | AA                    |
| VotingProposal    | 1                     |
| VotingSubProposal | 0                     |
| VotingPreference  | 1                     |
| OrderQty          | 0                     |

#### 7.1.6.2 投票执行报告

| 域名 | 取值 |
|----|----|
|----|----|

| MsgType           | 202197                |
|-------------------|-----------------------|
| ReportIndex       | 2                     |
| ApplID            | 200                   |
| ReportingPBUID    | 000100                |
| SubmittingPBUID   | 000100                |
| SecurityID        | 00369501              |
| SecurityIDSource  | 102                   |
| OwnerType         | 1                     |
| ClearingFirm      | 全空格                   |
| TransacTime       | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo          | 全空格                   |
| OrderID           | 6B4569CDNB009C78      |
| ClOrdID           | A0000001              |
| ExecID            | 3100000000004124      |
| ExecType          | 0                     |
| OrdRejReason      | 0                     |
| AccountID         | 0100004698            |
| BranchID          | AA                    |
| VotingProposal    | 1                     |
| VotingSubProposal | 0                     |
| VotingPreference  | 1                     |
| OrderQty          | 0                     |

#### 7.1.6.3 投资者网络投票密码服务激活

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 102196                |
| ApplID           | 211                   |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 369999                |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 全空格                   |
| TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo         | 全空格                   |

|                |            |
|----------------|------------|
| ClOrdID        | A0000001   |
| AccountID      | 0100004698 |
| BranchID       | AA         |
| ValidationCode | ABC        |

#### 7.1.6.4 投资者网络投票密码服务激活执行报告

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | U005                  |
| ReportIndex      | 2                     |
| ApplID           | 211                   |
| ReportingPBUID   | 000100                |
| SubmittingPBUID  | 000100                |
| SecurityID       | 369999                |
| SecurityIDSource | 102                   |
| OwnerType        | 1                     |
| ClearingFirm     | 全空格                   |
| TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| UserInfo         | 全空格                   |
| OrderID          | A0000001              |
| ClOrdID          | 6B4569CDNB009C83      |
| ExecID           | 3100000000004125      |
| ExecType         | 0                     |
| OrdRejReason     | 0                     |
| AccountID        | 0100004698            |
| BranchID         | AA                    |
| ValidationCode   | ABC                   |

## 7.2 行情

### 7.2.1 频道心跳

| 域名             | 取值     |
|----------------|--------|
| MsgType        | 390095 |
| ChannelNo      | 0010   |
| ApplLastSeqNum | 2937   |
| EndOfChannel   | N      |

### 7.2.2 重传消息

| 域名            | 取值     |
|---------------|--------|
| MsgType       | 390094 |
| ResendType    | 1      |
| ChannelNo     | 2001   |
| ApplBegSeqNum | 100    |
| ApplEndSeqNum | 0      |
| NewsID        | 全空格    |
| ResendStatus  | 0      |
| RejectText    | 全空格    |

### 7.2.3 用户信息报告消息

| 域名          | 取值                    |
|-------------|-----------------------|
| MsgType     | 390093                |
| OrigTime    | 20130228-14:42:13:555 |
| VersionCode | 02                    |
| UserNum     | 10                    |

### 7.2.4 证券实时状态

| 域名                   | 取值                    |
|----------------------|-----------------------|
| MsgType              | 390013                |
| OrigTime             | 20130228-14:42:13:555 |
| ChannelNo            | 0001                  |
| SecurityID           | 00000001              |
| SecurityIDSource     | 102                   |
| SecurityPreName      | .A..                  |
| NoSwitch             | 1                     |
| SecuritySwitchType   | 1                     |
| SecuritySwitchStatus | Y                     |

### 7.2.5 公告

| 域名      | 取值     |
|---------|--------|
| MsgType | 390012 |



|               |                       |
|---------------|-----------------------|
| NewsID        | AA0001                |
| Headline      | 测试公告                  |
| OrigTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| RawDataLength | (公告内容长度)              |
| RawData       | (公告内容)                |

### 7.2.6 集中竞价行情快照

集中竞价 Level II 行情快照消息，示例中共买卖盘信息共用五档，卖三档，买两档，其中在买卖最优档上揭示前 10 笔委托的数量。

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 300111                |
| OrigTime         | 20140126-10:30:05:335 |
| ChannelNo        | 1011                  |
| MDStreamID       | 010                   |
| SecurityID       | 00002001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| TradingPhaseCode | T0                    |
| PrevClosePx      | 17.4600               |
| NumTrades        | 478                   |
| TotalVolumeTrade | 24689.00              |
| TotalValueTrade  | 405783.6700           |
| NoMDEntries      | 15                    |
| MDEntryType      | 2                     |
| MDEntryPx        | 17.490000             |
| MDEntrySize      | 0                     |
| MDPriceLevel     | 0                     |
| NumberOfOrders   | 0                     |
| NoOrders         | 0                     |
| MDEntryType      | 4                     |
| MDEntryPx        | 18.120000             |
| MDEntrySize      | 0                     |
| MDPriceLevel     | 0                     |
| NumberOfOrders   | 0                     |

|                |           |
|----------------|-----------|
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | 7         |
| MDEntryPx      | 18.130000 |
| MDEntrySize    | 0         |
| MDPriceLevel   | 0         |
| NumberOfOrders | 0         |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | 8         |
| MDEntryPx      | 17.200000 |
| MDEntrySize    | 0         |
| MDPriceLevel   | 0         |
| NumberOfOrders | 0         |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | x1        |
| MDEntryPx      | 0.030000  |
| MDEntrySize    | 0         |
| MDPriceLevel   | 0         |
| NumberOfOrders | 0         |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | x2        |
| MDEntryPx      | -0.010000 |
| MDEntrySize    | 0         |
| MDPriceLevel   | 0         |
| NumberOfOrders | 0         |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | x3        |
| MDEntryPx      | 17.450000 |
| MDEntrySize    | 369801.00 |
| MDPriceLevel   | 0         |
| NumberOfOrders | 0         |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | x4        |
| MDEntryPx      | 17.460000 |
| MDEntrySize    | 14689.00  |

|                |           |
|----------------|-----------|
| MDPriceLevel   | 0         |
| NumberOfOrders | 0         |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | x5        |
| MDEntryPx      | 15.950000 |
| MDEntrySize    | 0         |
| MDPriceLevel   | 0         |
| NumberOfOrders | 0         |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | x6        |
| MDEntryPx      | 16.120000 |
| MDEntrySize    | 0         |
| MDPriceLevel   | 0         |
| NumberOfOrders | 0         |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | 1         |
| MDEntryPx      | 18.460000 |
| MDEntrySize    | 2340.00   |
| MDPriceLevel   | 3         |
| NumberOfOrders | 56        |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | 1         |
| MDEntryPx      | 18.450000 |
| MDEntrySize    | 1340.00   |
| MDPriceLevel   | 2         |
| NumberOfOrders | 71        |
| NoOrders       | 0         |
| MDEntryType    | 1         |
| MDEntryPx      | 18.420000 |
| MDEntrySize    | 1350.00   |
| MDPriceLevel   | 1         |
| NumberOfOrders | 16        |
| NoOrders       | 10        |
| OrderQty       | 10.00     |

|                |           |
|----------------|-----------|
| OrderQty       | 10.00     |
| OrderQty       | 20.00     |
| OrderQty       | 10.00     |
| OrderQty       | 13.00     |
| OrderQty       | 17.00     |
| OrderQty       | 103.00    |
| OrderQty       | 21.00     |
| OrderQty       | 16.00     |
| OrderQty       | 11.00     |
| MDEntryType    | 0         |
| MDEntryPx      | 18.400000 |
| MDEntrySize    | 27500.00  |
| MDPriceLevel   | 1         |
| NumberOfOrders | 23        |
| NoOrders       | 10        |
| OrderQty       | 100.00    |
| OrderQty       | 100.00    |
| OrderQty       | 200.00    |
| OrderQty       | 100.00    |
| OrderQty       | 130.00    |
| OrderQty       | 170.00    |
| OrderQty       | 100.00    |
| OrderQty       | 200.00    |
| OrderQty       | 160.00    |
| OrderQty       | 110.00    |
| MDEntryType    | 0         |
| MDEntryPx      | 18.390000 |
| MDEntrySize    | 17500.00  |
| MDPriceLevel   | 2         |
| NumberOfOrders | 53        |
| NoOrders       | 0         |

### 7.2.7 逐笔委托行情

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 300192                |
| ChannelNo        | 2001                  |
| ApplSeqNum       | 100                   |
| MDStreamID       | 011                   |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| Price            | 17.4800               |
| OrderQty         | 1200.00               |
| Side             | 1                     |
| TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |
| OrdType          | 2                     |
| TimeInForce      | 0                     |
| MaxPriceLevels   | 0                     |
| MinQty           | 0                     |

### 7.2.8 逐笔成交行情

| 域名               | 取值                    |
|------------------|-----------------------|
| MsgType          | 300191                |
| ChannelNo        | 2001                  |
| ApplSeqNum       | 100                   |
| BidApplSeqNum    | 10                    |
| OfferApplSeqNum  | 20                    |
| MDStreamID       | 011                   |
| SecurityID       | 00000001              |
| SecurityIDSource | 102                   |
| LastPx           | 17.4800               |
| LastQty          | 1200.00               |
| ExecType         | F                     |
| TransacTime      | 20130228-14:42:13:555 |

## 八、 会话

### 8.1 SenderCompID 和 TargetCompID 的填写规则

接入用户必须正确设置 SenderCompID 与 TargetCompID 才能与网关建立会话。其中，TargetCompID 需填写为网关 ID，SenderCompID 由用户自己指定（长度不得超过 20 个字符）。

### 8.2 DefaultCstmApplVerID 字段的填写规则

登录消息中 DefaultCstmApplVerID 的市场内部唯一的协议版本号设置为接口规范文档中公布的版本号，比如 1.00 a。

### 8.3 SessionStatus 字段的填写规则

SessionStatus 只是用来指示注销时会话的状态，并不会对注销过程产生影响。建议在建立会话后，主动发送 logout 时 SessionStatus 设置为 0，响应 logout 消息时 SessionStatus 设置为 4。

## 8.4 STEP 会话

### 8.4.1 登录消息

登录消息中 UserName、Password 暂未使用。

### 8.4.2 会话模式

交易网关和行情网关实现的是 LFIXT 兼容模式，允许实现了 LFIXT 精简模式、LFIXT 兼容模式以及标准 FIX 模式的会话对端接入。

### 8.4.3 何时发送 Logout，何时直接断开连接

一般而言，在关闭连接前推荐的做法是回送一条 Logout 消息以利于对端诊断连接断开的原因。但此处可有一些例外：

1. 若收到的登录报文中，SenderCompID、TargetCompID 不合法，网关会立即终止会话，不发送任何 Logout 消息。原因是此种登录尝试很可能属于未被授权的系统入侵行为，因此不应当回送 Logout 消息以泄露 FIX 版本、合法 SenderCompID、TargetCompID 等信息。
2. 若交易网关在收到某个平台的登录请求时，该平台已存在一个合法的相同 TargetCompID 的会话，则交易网关将直接断开连接。
3. 会话建立时收到的第一条消息（Logon）为 Garbled Message。

由于任何时刻总是存在网络中断的可能，因此 LFIXT 协议的任何参与方都应该对于没有收到对方的 Logout 消息但底层 TCP 连接却已关闭的情况做好准备。在断开连接前回送 Logout 消息是推荐行为，但非必须。

8.4.4 何时发送 SessionReject, 何时发送 Logout

一般而言，应尽可能通过 SessionReject 告知对端发生了会话错误，而不是通过 Logout 来终止会话。可以发送 Logout 场景主要包括：

- 1. 会话建立后，在当前会话的延续期间，在同一个 TCP 上再次收到了 Logon 消息，注销原因=Already connected。
- 2. 会话建立后，收到了 Garbled Message，注销原因=Garbled message。
- 3. 会话建立后，消息序号不等于预期值，注销原因=Incorrect MsgSeqNum。
- 4. MsgSeqNum(Tag#34)不存在，注销原因=Required tag missing。
- 5. MsgSeqNum(Tag#34)数据类型非法。注销原因=Incorrect data format for value。

8.5 网络版行情网关会话管理

网络版行情网关为接入用户行情系统提供两个服务端口，实时数据端口(默认为 9129)，重传服务端口（默认为 9130）。每一个端口只能建立一条 TCP/IP 连接,每一个连接只能对应一个会话。行情网关根据连接的服务端口来区分会话为实时会话还是重传会话，因此，TargetCompID 统一设置为网关 ID，SenderCompID 由用户指定（如实时服务 SenderCompID 设置为 Realtime1，重传服务 SenderCompID 设置为 Resend1）。

| 端口   | 会话类型 | SenderCompID | TargetCompID | 备注                     |
|------|------|--------------|--------------|------------------------|
| 9029 | 实时会话 | Realtime1    | mdgw1        | 会话类型由端口决定，与 CompID 无关。 |
| 9030 | 重传会话 | Resend1      | mdgw1        |                        |

九、 相关文档

- 《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》
- 《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》
- 《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》
- 《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》
- 《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》
- 《深圳证券交易所数据接口规范》（第四版交易系统）

