

工程技术标准

深圳证券交易所 Binary 交易 数据接口规范

(Ver1.00~~β~~_α)



深圳证券交易所

二〇一四年~~四月~~六月

文档说明

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

带格式的：正文

带格式的：字体：CG Times

名词释义

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

目 录

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

4.3	业务消息-新订单处理	22
4.3.1	新订单 (New Order)	22
4.3.1.1	现货集中竞价业务新订单扩展字段 (100101)	24
4.3.1.2	质押式回购交易业务新订单扩展字段 (100201)	25
4.3.1.3	期权集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100401)	25
4.3.1.4	协议交易业务新订单扩展字段 (100501)	26
4.3.1.5	转融通证券出借业务新订单扩展字段 (100701)	26
4.3.1.6	开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段 (101701)	26
4.3.1.7	要约收购业务新订单扩展字段 (101801)	2627
4.3.2	撤单请求 (Order Cancel Request)	27
4.3.3	撤单失败响应 (Cancel Reject)	27
4.3.4	订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)	28
4.3.4.1	现货集中竞价业务执行报告扩展字段 (200102)	30
4.3.4.2	质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200202)	3024
4.3.4.3	期权集中竞价业务执行报告扩展字段 (200402)	31
4.3.4.4	协议交易业务执行报告扩展字段 (200502)	3132
4.3.4.5	转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200702)	3132
4.3.4.6	ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段 (201202)	3132
4.3.4.7	开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段 (201702)	32
4.3.4.8	要约收购业务执行报告扩展字段 (201802)	3233
4.3.5	订单成交执行报告 (Execution Report)	3233
4.3.5.1	现货集中竞价业务执行报告扩展字段 (200115)	34
4.3.5.2	质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200215)	34
4.3.5.3	期权集中竞价业务执行报告扩展字段 (200415)	3435
4.3.5.4	协议交易业务执行报告扩展字段 (200515)	3435
4.3.5.5	转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200715)	3435
4.4	业务消息-报价处理	35
4.4.1	报价 (Quote)	35
4.4.1.1	期权集中竞价业务报价扩展字段 (100405)	3637
4.4.2	报价状态回报 (Quote Status Report)	3637
4.4.2.1	期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段 (200406)	3738
4.5	业务消息-询价申报处理	38
4.5.1	询价申报 (Quote Request)	38
4.5.1.1	期权集中竞价业务询价扩展字段 (100417)	39
4.5.2	询价申报接受响应 (Quote Request Ack)	39
4.5.2.1	期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段 (200417)	3940
4.5.3	询价申报拒绝响应 (Quote Request Reject)	40
4.5.3.1	期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段 (200418)	4041
4.6	业务消息-意向申报处理	4041
4.6.1	意向申报 (Indication of Interest)	4041
4.6.1.1	协议交易意向申报扩展字段 (100509)	4142
4.6.2	意向申报响应 (Quote Response)	42
4.6.2.1	协议交易意向申报扩展字段 (200510)	4344

[illegible]

3.4.1	新订单消息流图	7	带格式的	...
3.4.2	撤单请求消息流图	8	带格式的	...
3.5	报价处理消息流图	8	带格式的	...
3.6	意向申报处理消息流图	10	带格式的	...
3.7	成交申报处理消息流图	11	带格式的	...
3.7.1	协议配对申报模式 (one party report for matching)	11	带格式的	...
3.7.1.1	新成交申报处理	11	带格式的	...
3.7.1.2	撤销尚未完成配对的成交申报	13	带格式的	...
3.7.2	成交报告申报模式 (two party report)	14	带格式的	...
3.8	转托管处理消息流图	15	带格式的	...
3.9	网络投票处理消息流图	16	带格式的	...
3.9.1	投票处理消息流图	16	带格式的	...
3.9.2	密码服务处理消息流图	17	带格式的	...
3.10	应用层消息恢复	17	带格式的	...
四	消息定义	18	带格式的	...
4.1	消息结构	18	带格式的	...
4.1.1	消息头	18	带格式的	...
4.1.2	消息尾	19	带格式的	...
4.2	管理消息	19	带格式的	...
4.2.1	登录消息 (Logon)	19	带格式的	...
4.2.2	注销消息 (Logout)	19	带格式的	...
4.2.3	心跳消息 (Heartbeat)	20	带格式的	...
4.3	业务消息-新订单处理	20	带格式的	...
4.3.1	新订单 (New Order)	20	带格式的	...
4.3.1.1	现货集中竞价业务新订单扩展字段 (100101)	22	带格式的	...
4.3.1.2	质押式回购交易业务新订单扩展字段 (100201)	23	带格式的	...
4.3.1.3	期权集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100401)	23	带格式的	...
4.3.1.4	协议交易业务新订单扩展字段 (100501)	23	带格式的	...
4.3.1.5	转融通证券出借业务新订单扩展字段 (100701)	24	带格式的	...
4.3.1.6	开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段 (101701)	24	带格式的	...
4.3.1.7	要约收购业务新订单扩展字段 (101801)	24	带格式的	...
4.3.2	撤单请求 (Order Cancel Request)	24	带格式的	...
4.3.3	撤单失败响应 (Cancel Reject)	25	带格式的	...
4.3.4	订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)	25	带格式的	...
4.3.4.1	现货集中竞价业务执行报告扩展字段 (200102)	28	带格式的	...
4.3.4.2	质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200202)	28	带格式的	...
4.3.4.3	期权集中竞价业务执行报告扩展字段 (200402)	28	带格式的	...
4.3.4.4	协议交易业务执行报告扩展字段 (200502)	29	带格式的	...
4.3.4.5	转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200702)	29	带格式的	...
4.3.4.6	ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段 (201202)	29	带格式的	...
4.3.4.7	开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段 (201702)	29	带格式的	...
4.3.4.8	要约收购业务执行报告扩展字段 (201802)	29	带格式的	...
4.3.5	订单成交执行报告 (Execution Report)	30	带格式的	...

4.3.5.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段 (200115)	31	带格式的	...
4.3.5.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200215)	31	带格式的	...
4.3.5.3 期权集中竞价业务执行报告扩展字段 (200415)	31	带格式的	...
4.3.5.4 协议交易业务执行报告扩展字段 (200515)	32	带格式的	...
4.3.5.5 转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200715)	32	带格式的	...
4.4 业务消息 报价处理	32	带格式的	...
4.4.1 报价 (Quote)	32	带格式的	...
4.4.1.1 期权集中竞价业务报价扩展字段 (100405)	33	带格式的	...
4.4.2 报价状态回报 (Quote Status Report)	33	带格式的	...
4.4.2.1 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段 (200406)	34	带格式的	...
4.5 业务消息 意向申报处理	35	带格式的	...
4.5.1 意向申报 (Indication of Interest)	35	带格式的	...
4.5.1.1 协议交易意向申报扩展字段 (100500)	36	带格式的	...
4.5.2 意向申报响应 (Quote Response)	36	带格式的	...
4.5.2.1 协议交易意向申报扩展字段 (200510)	37	带格式的	...
4.6 业务消息 成交申报处理	37	带格式的	...
4.6.1 成交申报 (Trade Capture Report)	37	带格式的	...
4.6.1.1 转融通证券出借业务成交申报扩展字段 (100703)	40	带格式的	...
4.6.1.2 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段 (100803)	40	带格式的	...
4.6.1.3 股票质押式回购业务成交申报扩展字段 (100903)	40	带格式的	...
4.6.1.4 约定购回业务成交申报扩展字段 (101003)	41	带格式的	...
4.6.1.5 质押式报价回购业务成交申报扩展字段 (101103)	41	带格式的	...
4.6.2 成交申报响应 (Trade Capture Report Ack)	41	带格式的	...
4.6.3 成交确认 (Trade Capture Report)	43	带格式的	...
4.7 业务消息 转托管处理消息	45	带格式的	...
4.7.1 注册 (Designation)	45	带格式的	...
4.7.2 注册执行报告 (Designation Report)	45	带格式的	...
4.8 业务消息 网络投票处理消息	47	带格式的	...
4.8.1 投票 (Netvote)	47	带格式的	...
4.8.2 投票执行报告 (Netvote)	48	带格式的	...
4.8.3 密码服务 (Netvote Password Service)	48	带格式的	...
4.8.4 密码服务执行报告 (Netvote Password Service)	49	带格式的	...
五、其它消息	50	带格式的	...
5.1 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT)	50	带格式的	...
5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION)	51	带格式的	...
5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO)	51	带格式的	...
5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED)	52	带格式的	...
六、数据字典	52	带格式的	...
6.1 数据类型	52	带格式的	...
6.2 会话层域定义	53	带格式的	...
6.3 业务层域定义	53	带格式的	...

深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范

一、前言

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

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

~~本接口规范采用 UTF 8 编码。~~

二、会话机制

2.1 连接

2.1.1 会话

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

2.1.2 IP 地址和 Port

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

2.1.3 安全

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

2.2 会话管理

2.2.1 建立会话

会话建立过程：

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

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

2.2.2 心跳包和测试请求

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

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

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

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

2.2.3 终止会话

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

2.2.4 重建会话

如果会话被终止，订单管理系统可以通过登录消息重建会话。

重建会话后，订单管理系统应通过应用层规则进行下行数据同步。

三、 服务说明

3.1 平台说明

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

各平台处理的业务划分如下表所示：

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

3.2 委托申报方式说明

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

接口规范中的委托申报消息类型有：

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

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

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

各类业务的委托申报的报文号及 ApplID 如下表所示：

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

带格式的：定义网格后自动调整右缩进，字体对齐方式：自动对齐

协议交易定价申报	100501	051	服务平台
协议交易点击成交申报	100501	052	
协议交易双方配对成交申报	100503	053	
以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	100601	060	综合金融服务平台
以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报	100601	061	
转融通证券出借非约定申报	100701	070	综合金融服务平台
转融通证券出借约定申报	100703	071	
资产管理计划份额转让	100803	080	综合金融服务平台
股票质押式回购	100903	090	综合金融服务平台
约定购回	101003	100	综合金融服务平台
质押式报价回购	101103	110	综合金融服务平台
ETF 实时申购赎回申报 (支持股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回以及黄金 ETF 现金申购赎回)	101201	120	非交易处理平台
网上发行认购申报	101301	130	非交易处理平台
配股认购申报	101401	140	非交易处理平台
债券转股申报	101501	150	非交易处理平台
债券回售申报	101501	151	
行权申报	101601	160	非交易处理平台
开放式基金申购赎回申报	101701	170	非交易处理平台
要约收购预受要约申报	101801	180	非交易处理平台
要约收购解除预受要约申报	101801	181	非交易处理平台

质押式回购质押申报	101901	190	非交易处 理平台
质押式回购解押申报	101901	191	
转托管	102099	200	非交易处 理平台
投票	102197	210	非交易处 理平台
密码服务激活	102196 102189	211	
密码服务挂失	1021 8996	212	
黄金 ETF 实物申购赎回申报 (该委托只能由上海黄金交易所申报)	102201	220	非交易处 理平台
借券申报	102301	230	非交易处
还券申报	102301	231	理平台

注：ApplID 的前两位表示业务代码，第三位表示该业务下的委托申报代码。

3.3 委托消息处理流程

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

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

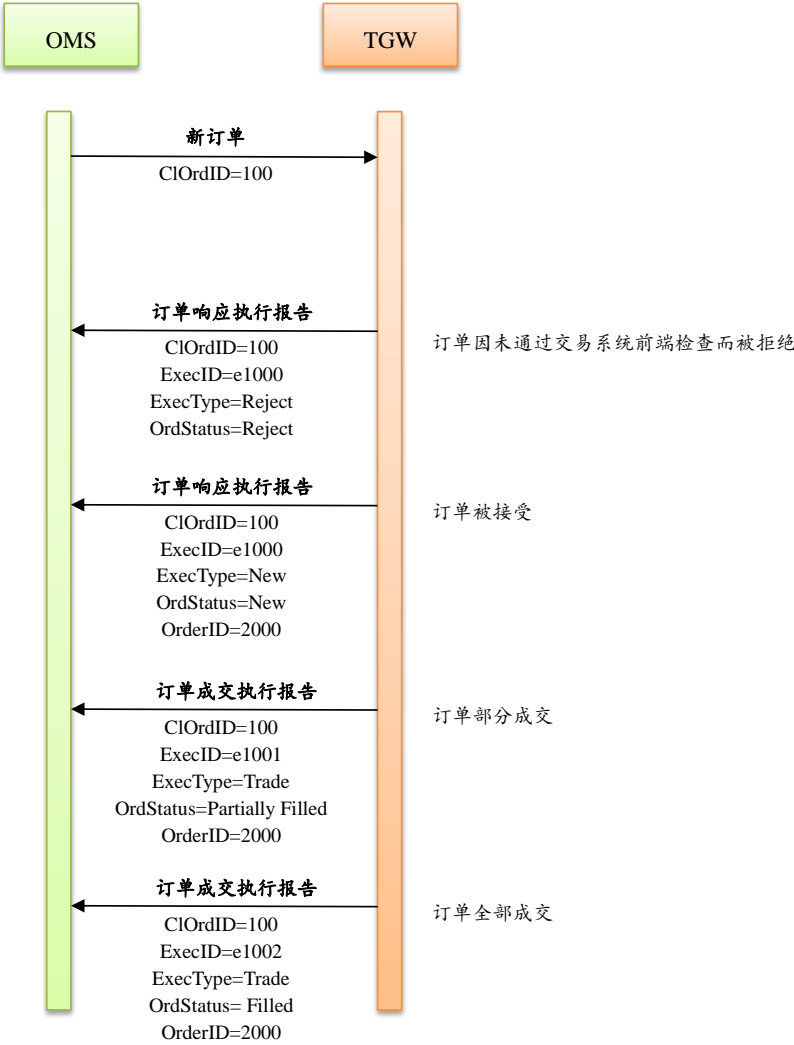
如果通过基本合法性检查，交易系统会根据委托消息类型的不同给 OMS 发出相应的回报消息，具体参见 3.4-3.9 节。

3.4 新订单处理消息流图

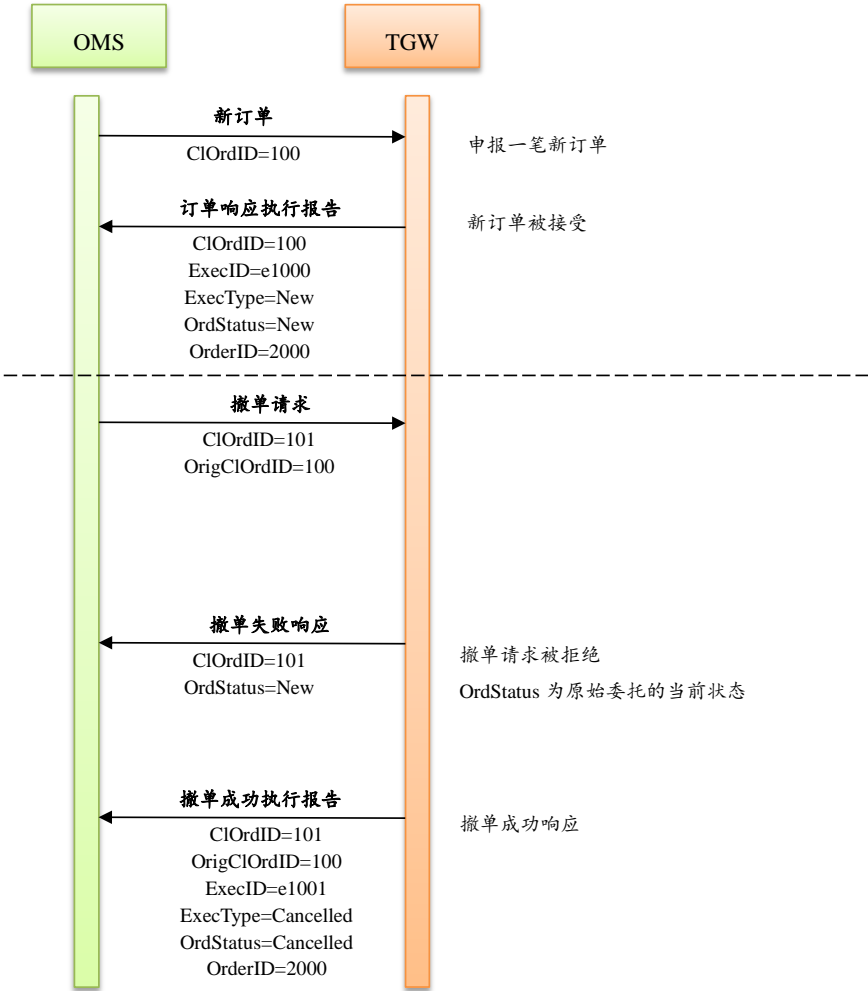
对于 OMS 提交的新订单，交易系统以执行报告消息作为响应。执行报告消息分为两类报文，一类报文用于新订单的确认响应、撤单成功时的响应以及委托被交易系统自动撤销时（比如市价委托剩余自动撤销）的响应 (MsgType=20xx02)，一类报文用于新订单达成成交时的响应 (MsgType=20xx15)。

对于 ETF 实时申购赎回、行权等非交易订单，只会回报上述第一类执行报告。

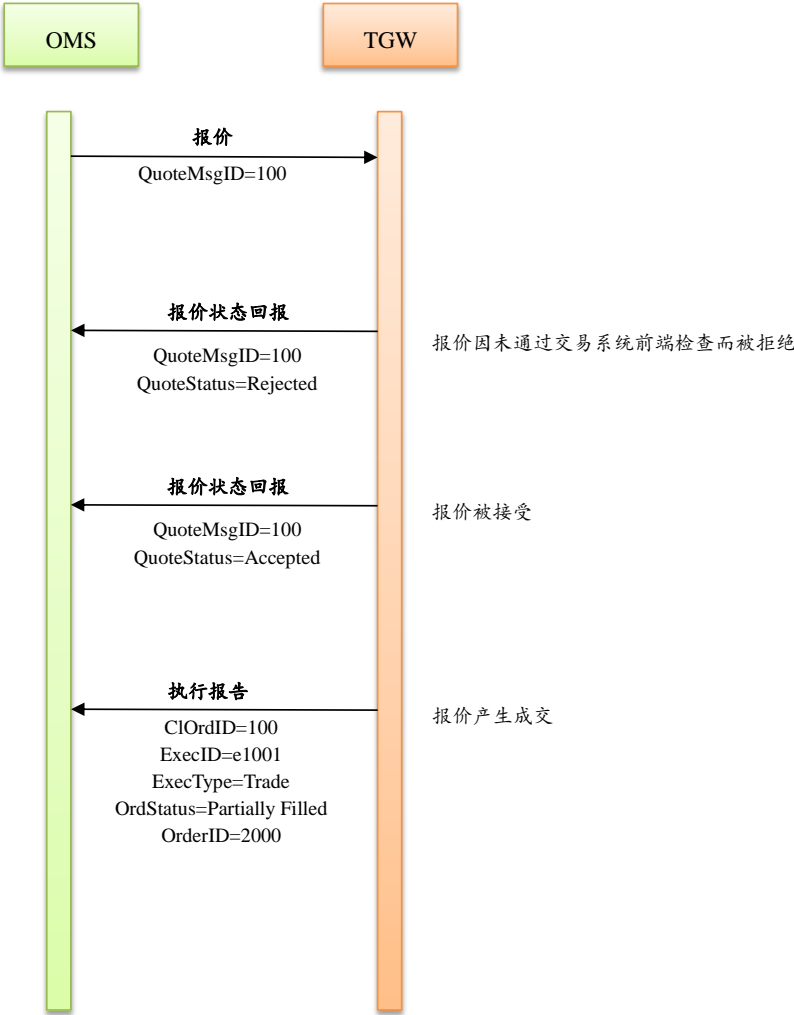
3.4.1 新订单消息流图



3.4.2 撤单请求消息流图

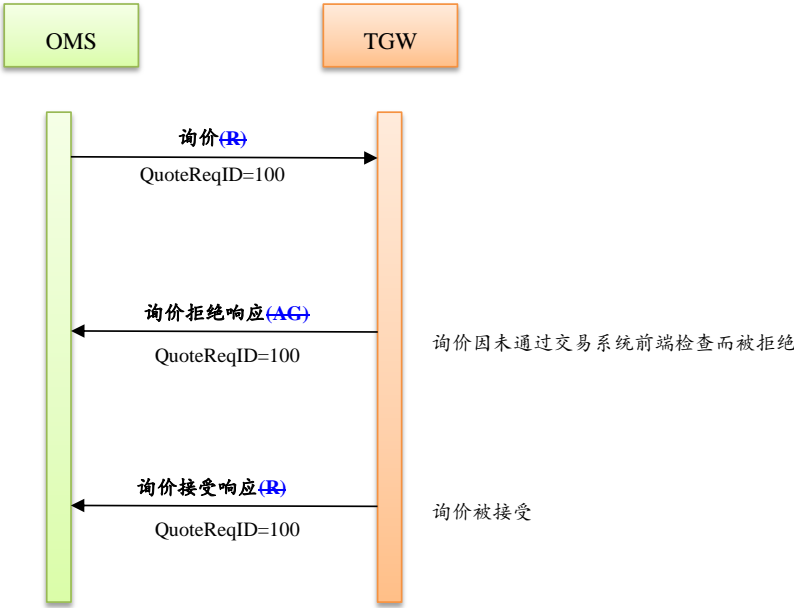


3.5 报价处理消息流图

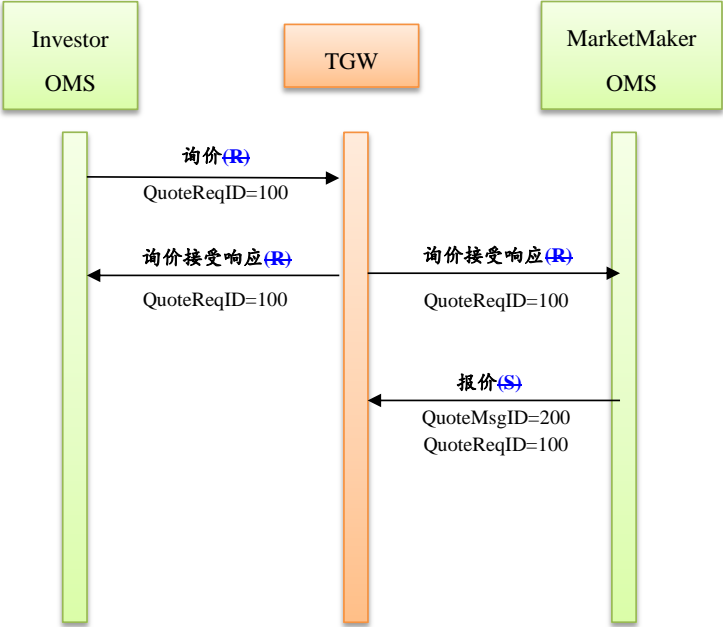


3.6 询价处理消息流图

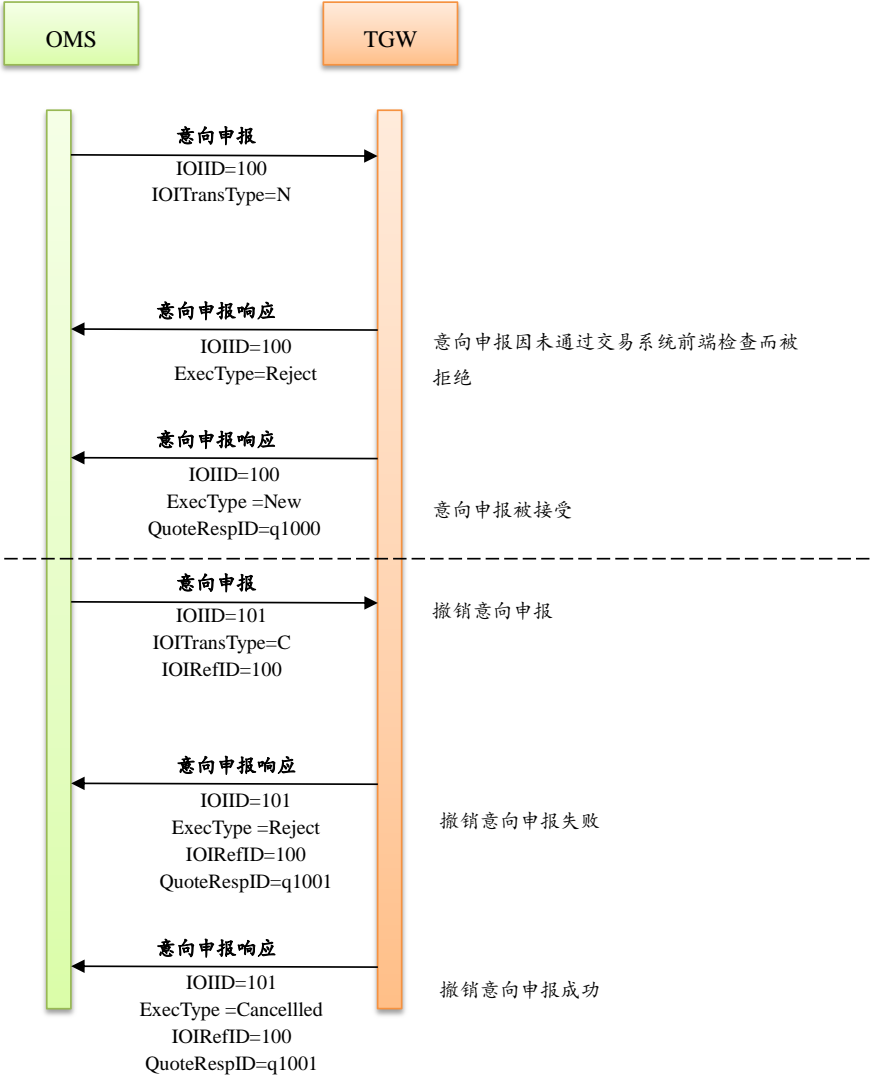
3.6.1 投资者申报处理



3.6.2 做市商接收询价处理



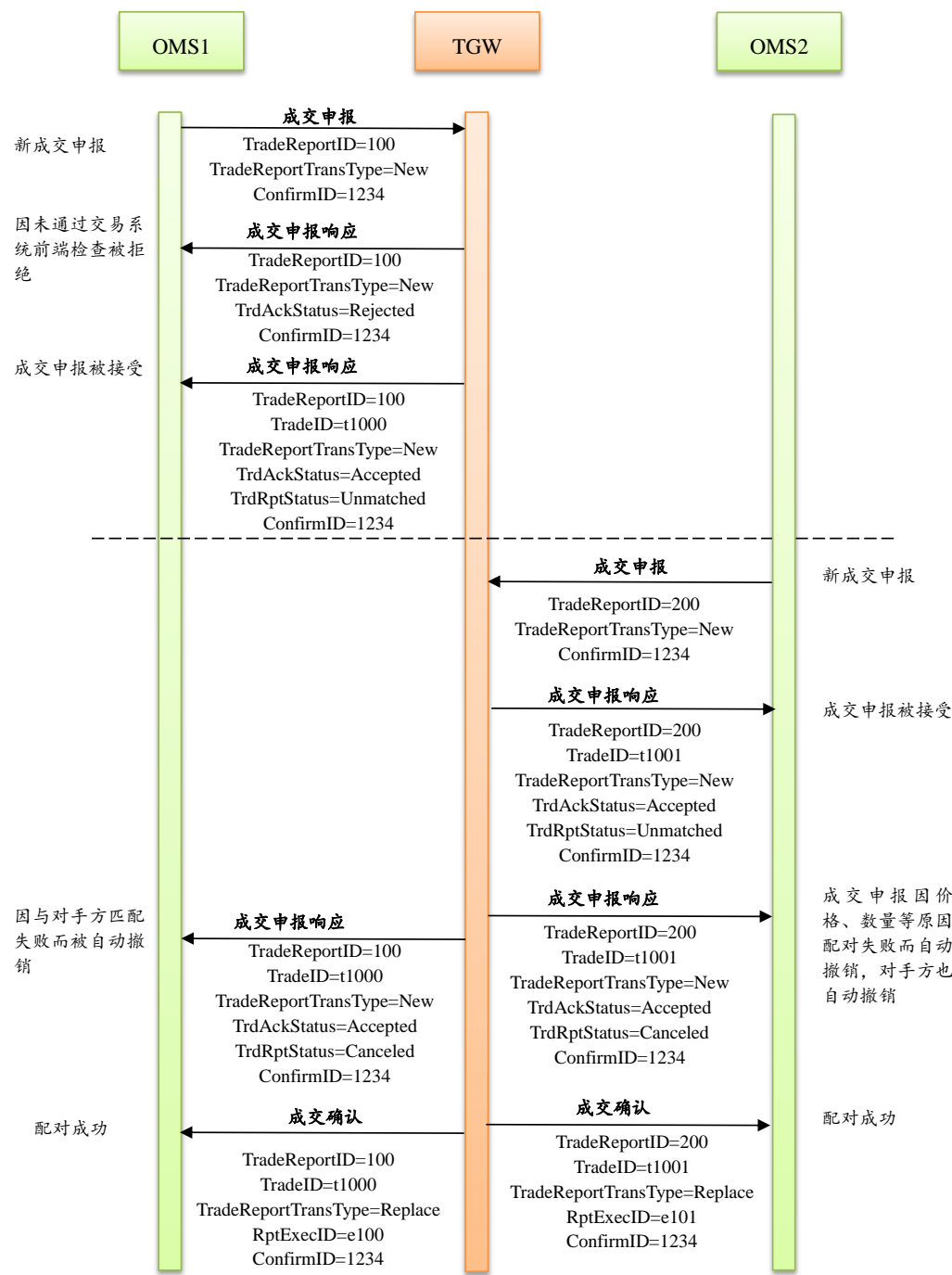
3.63.7 意向申报处理消息流图

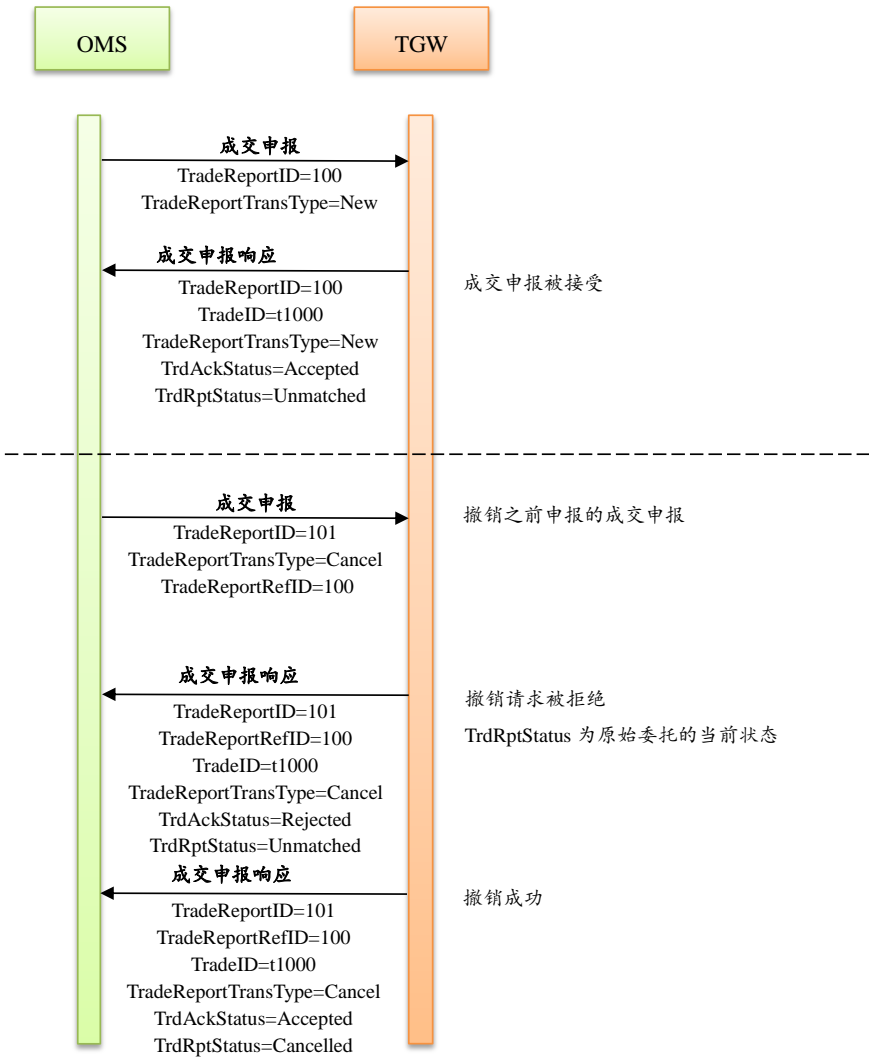


~~3.7.3.8~~ 成交申报处理消息流图

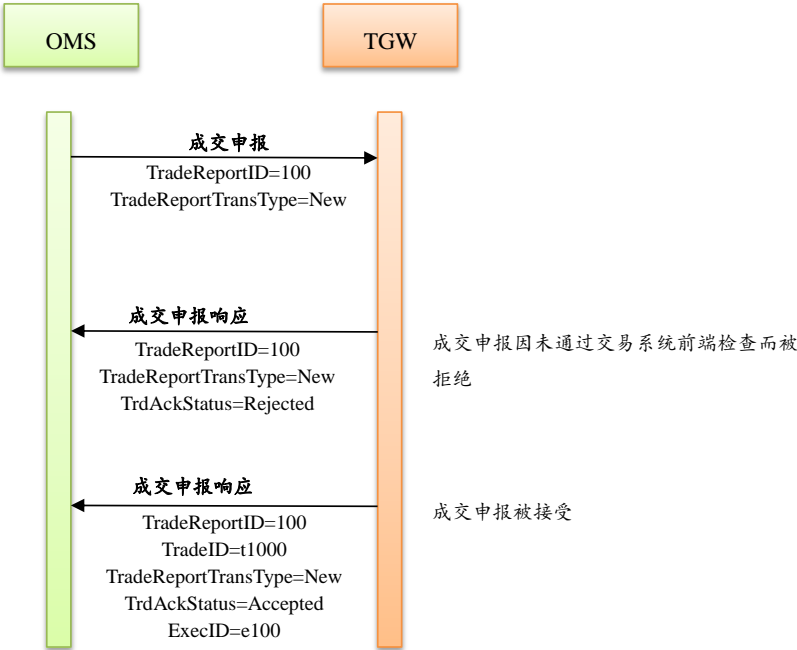
~~3.7.4~~~~3.8.1~~ 协议配对申报模式 (one party report for matching)

~~3.7.4.1~~~~3.8.1.1~~ 新成交申报处理



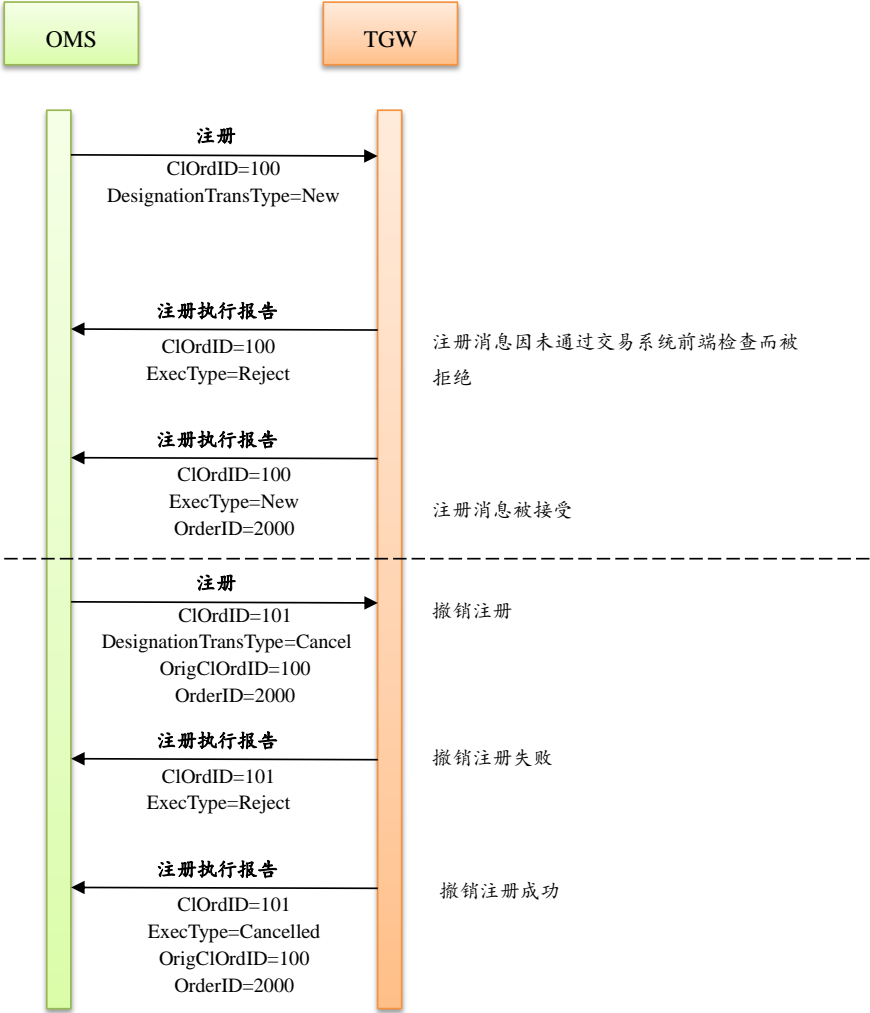


3.7.2 3.8.2 成交报告申报模式 (two party report)



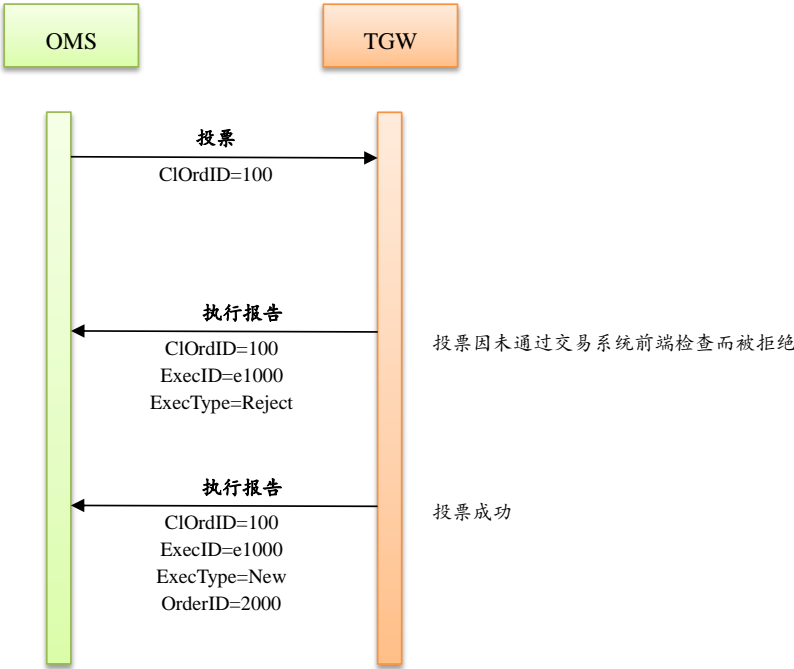
成交报告申报模式暂不支持撤销。

3.83.9 转托管处理消息流程图

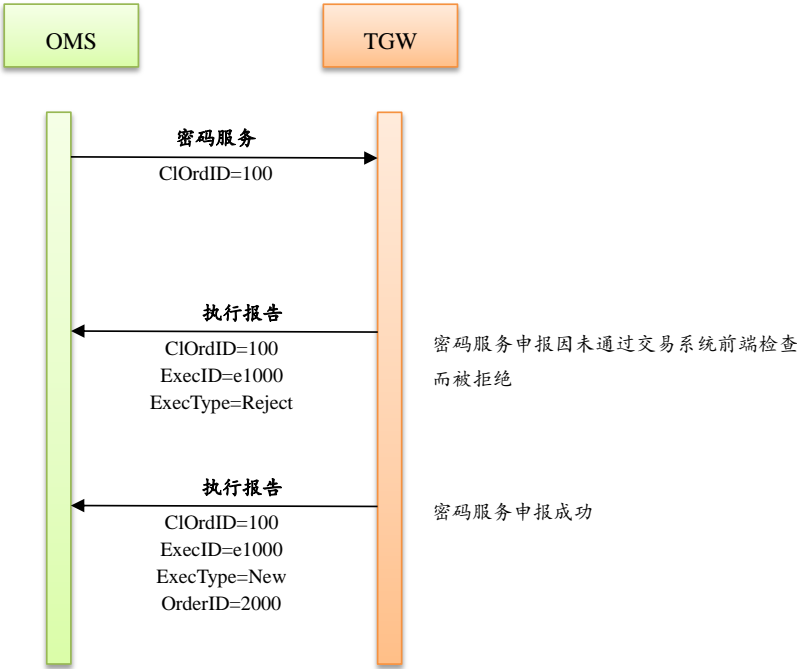


3.9.3.10 网络投票处理消息流程图

3.9.4 3.10.1 投票处理消息流程图

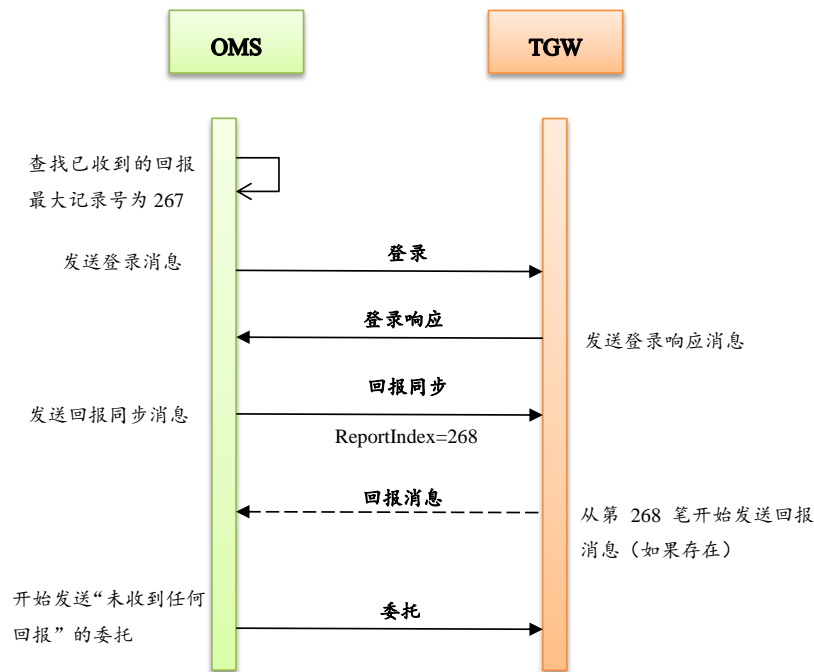


3.9.2 3.10.2 密码服务处理消息流程图



3.10.3.11 应用层消息恢复

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



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

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

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

四、 消息定义

4.1 消息结构

每一条消息都由消息头、消息体和消息尾组成。

4.1.1 消息头

消息头定义了应用消息的类型、长度数据域，均不加密传输。

域名	字段描述
MsgType	消息类型
BodyLength	消息体长度

带格式的：正文，缩进：首行缩进： 0.74 厘米，右侧： 0 厘米

4.1.2 消息尾

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

域名	字段描述
Checksum	校验和

以下为计算校验和的代码段：

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

4.2 管理消息

4.2.1 登录消息（Logon）

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

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

4.2.2 注销消息（Logout）

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

来中断当前和交易网关的连接。

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

4.2.3 心跳消息 (Heartbeat)

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

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

4.3 业务消息-新订单处理

4.3.1 新订单 (New Order)

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

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

注：

1) 该消息用于以下业务新订单的申报

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	Side (54)	有无扩展字段
现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易申报	010	100101	1=买 2=卖	Y
质押式回购交易申报	020	100201	1=买（融资） 2=卖（出资）	Y
债券分销申报	030	100301	1=买（认购） 2=卖（分销）	N
期权集中竞价交易申报	040	100401	1=买 2=卖	Y
协议交易定价申报	051	100501	1=买 2=卖	Y
协议交易点击成交申报	052		1=买 2=卖	
以收盘价交易的盘后定价大宗交	060	100601	1=买	N

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

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

4.3.1.1 现货集中竞价业务新订单扩展字段 (100101)

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

	3=Close, 融资融券平仓
--	-----------------

注：

1) 限价委托及五种市价委托申报方式：

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

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

4.3.1.2 质押式回购交易业务新订单扩展字段（100201）

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

4.3.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段（100401）

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

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

4.3.1.4 协议交易业务新订单扩展字段（100501）

域名	字段描述
ConfirmID	约定号 点击成交申报填写

4.3.1.5 转融通证券出借业务新订单扩展字段（100701）

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

4.3.1.6 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段（101701）

域名	字段描述
CashOrderQty	申购金额

注：

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

4.3.1.7 要约收购业务新订单扩展字段（101801）

域名	字段描述
Tenderer	收购人编码

4.3.2 撤单请求 (Order Cancel Request)

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

4.3.3 撤单失败响应 (Cancel Reject)

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

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

4.3.4 订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)

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

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

注：

1) 该消息用于以下业务的订单响应及撤单成功响应

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

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

4.3.4.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段（200102）

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

4.3.4.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段（200202）

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

4.3.4.3 期权集中竞价业务执行报告扩展字段（200402）

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

4.3.4.4 协议交易业务执行报告扩展字段（200502）

域名	字段描述
ConfirmID	约定号

4.3.4.5 转融通证券出借业务执行报告扩展字段（200702）

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

4.3.4.6 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段（201202）

域名	字段描述
----	------

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

4.3.4.7 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段（201702）

域名	字段描述
CashOrderQty	申购金额

4.3.4.8 要约收购业务执行报告扩展字段（201802）

域名	字段描述
Tenderer	收购人编码

4.3.5 订单成交执行报告（Execution Report）

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

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

注：

1) 该消息用于以下业务订单成交回报

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

转融通证券出借非约定执行报告	070	200715	Y
----------------	-----	--------	---

4.3.5.1 现货集中竞价业务执行报告扩展字段（200115）

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.3.5.2 质押式回购交易业务执行报告扩展字段（200215）

域名	字段描述
MaturityDate	到期日

注：在回购到期日，交易系统会主动下发一笔回购到期成交执行报告，其中应用标识 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。

带格式的：字体：五号
带格式的：正文，缩进：左侧：0 厘米，首行缩进：0.74 厘米

4.3.5.3 期权集中竞价业务执行报告扩展字段（200415）

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

4.3.5.4 协议交易业务执行报告扩展字段（200515）

域名	字段描述
ConfirmID	约定号

4.3.5.5 转融通证券出借业务执行报告扩展字段（200715）

域名	字段描述
----	------

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

4.4 业务消息-报价处理

4.4.1 报价 (Quote)

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

注：

1) 该消息用于以下业务报价申报

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
041	期权集中竞价交易报价申报	104105100405	Y

带格式的：定义网格后自动调整
右缩进，字体对齐方式：自动对齐

2) 报价消息支持以下报价方式（不支持撤销单边报价）

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

4.4.1.1 期权集中竞价业务报价扩展字段（100405）

域名	字段描述
BidPositionEffect	买平仓标识 (‘O’：开仓 ‘C’：平仓) BidSize=0时该字 段无意义，填写 空格
OfferPositionEffect	卖平仓标识 (‘O’：开仓 ‘C’：平仓) OfferSize=0时该 字段无意义，填 写空格
ContractAccountCodeContractAccountCode	合约账户识别码 合约账户标识码

4.4.2 报价状态回报（Quote Status Report）

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

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

注：

1) 该消息用于以下业务报价状态的回报

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

4.4.2.1 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段（200406）

域名	字段描述
BidPositionEffect	买平仓标识

	(‘O’ : 开仓 ‘C’ : 平仓)
OfferPositionEffect	卖平仓标识 (‘O’ : 开仓 ‘C’ : 平仓)
ContractAccoutCodeContractAccountCode	合约账户识别码 合约账户标识码

4.5 业务消息-询价申报处理

4.5.1 询价申报 (Quote Request)

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

注:

1) 该消息用于以下业务询价申报

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

4.5.1.1 期权集中竞价业务询价扩展字段（100417）

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5.2 询价申报接受响应（Quote Request Ack）

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

注：

1) 该消息用于以下业务询价申报接受响应

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

4.5.2.1 期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段（200417）

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

带格式表格

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

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

4.5.3 询价申报拒绝响应 (Quote Request Reject)

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

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

注：

1) 该消息用于以下业务询价申报拒绝响应

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

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

4.5.3.1 期权集中竞价业务询价申报接受响应扩展字段 (200418)

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5.4 业务消息-意向申报处理

4.5.4.1 意向申报 (Indication of Interest)

域名	字段描述
----	------

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

注：

1) 该消息用于以下业务的意向申报

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

4.5.1.1 4.6.1.1

协议交易意向申报扩展字段(100509)

域名	字段描述
Contactor	联系人
ContactInfo	联系方式

4.5.2 4.6.2 意向申报响应 (Quote Response)

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

注：

1) 该消息用于以下业务的意向申报响应

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

4.5.2.1 4.6.2.1 协议交易意向申报扩展字段(200510)

域名	字段描述
Contactactor	联系人
ContactInfo	联系方式

4.6.4.7 业务消息-成交申报处理

4.6.4.4.7.1 成交申报 (Trade Capture Report)

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

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

注：

1) 该消息用于以下业务的成交申报

业务	应用标识 AppIID	报文号 MsgType	成交申报模式 TradeHandlingInstr	有无扩展 字段
协议交易双方协议成交申报	053	100503	协议配对	N
转融通证券出借约定申报	071	100703	协议配对	Y
资产管理计划份额转让	460080	100803	成交报告	Y
股票质押式回购	470090	100903	成交报告	Y
约定购回	480100	101003	成交报告	Y
质押式报价回购	11090	101103	成交报告	Y

2) 各业务成交申报的市场参与人代码填写方式

业务	Side	PBUID	AccountID	BranchID	Counterparty PBUID	Counterparty AccountID	Counterparty BranchID
协议交易双方协议成交申报（053）	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
转融通证券出借约定申报（071）	G=借入 F=出借	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
资产管理计划份额转让（ 460080 ）	固定为1	转入方	转入方	转入方	转出方	转出方	转出方
股票质押式回购（ 470090 ）	固定为2	（资金）融入方	（资金）融入方	（资金）融入方	（资金）融出方	（资金）融出方	不填
约定购回（ 480100 ）	固定为2	客户方（券融出）	客户方（券融出）	客户方（券融出）	不填	证券公司专用账户	不填
质押式报价回购（ 490110 ）	固定为1	客户方（资金融出）	客户方（资金融出）	客户方（资金融出）	不填	证券公司自营账户	不填

4.6.1.1-4.7.1.1

转融通证券出借业务成交申报扩展

字段（100703）

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

	1=固定期限
--	--------

4.6.1.24.7.1.2 资产管理计划份额转让业务成交申

报扩展字段（100803）

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

4.6.1.34.7.1.3 股票质押式回购业务成交申报扩展

字段（100903）

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

4.6.1.4 4.7.1.4 约定购回业务成交申报扩展字段

(101003)

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

4.6.1.5 4.7.1.5 质押式报价回购业务成交申报扩展

字段 (101103)

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

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

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

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

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

注：

1) 该消息用于以下业务成交申报的响应

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

2) 各业务扩展字段定义同成交申报一致，请参考成交申报消息定义。

4.6.3 4.7.3 成交确认（Trade Capture Report）

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

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

注：

1) [该消息用于以下业务成交申报的响应](#)[该消息用于以下业务成交申报的确认](#)

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

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

2) ~~各业务扩展字段定义同成交申报一致，请参考成交申报消息定义。~~

4.7.3.1 转融通证券出借业务成交确认扩展字段（200703）

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

带格式的：字体：五号

带格式的：正文，无项目符号或编号

4.7.4.8 业务消息-转托管处理消息

4.7.4.8.1 注册（Designation）

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102099
ApplID	应用标识 020200=转托管
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码 如果是系统内转托管，证券代码可 填空表示转托管所有证券
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号

带格式的：正文，无项目符号或编号

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

4.7.2.4.8.2 注册执行报告（Designation Report）

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202098
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识 020200 =转托管
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始交易的客户订单编号，指示被主动撤单的委托
ExecID	执行编号

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

4.8.4.9 业务消息-网络投票处理消息

4.8.4.9.1 投票 (NetvoteEvote)

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

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

4.8.2 4.9.2 投票执行报告 (NetvoteEvote Report)

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType= 202197202196
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识 210=投票
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	投票代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
ExecID	执行编号

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

4.8.3 4.9.3 密码服务 (Netvote Evote Password Service)

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType= 402196102189
ApplID	应用标识 211=密码服务激活 212=密码服务挂失
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码 固定填 369999
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码 固定填全空格
TransacTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
ValidationCode	密码激活校验号

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

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType= 202196202188
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识 211=密码服务激活 212=密码服务挂失
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransacTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型 0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
ValidationCode	密码激活校验号

五、 其它消息

5.1 业务拒绝消息 (Business Reject)

域名	字段描述
Standard Header	消息头

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

带格式表格

注：

1) 消息及业务层 ID 对应表：

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

5.2 回报同步消息 (Report Synchronization)

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

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

5.3 平台状态消息 (Platform State Info)

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

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

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

5.4 回报结束消息 (Report Finished)

TGW 使用该消息通知 OMS 本交易日所有回报发送完毕。

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

六、 数据字典

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

6.1 数据类型

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

注：

- 1) 表中的 Nx(y)表示相应的类型实际为浮点数类型, 其中 x 表示整数与小数总计位数, 不包括小数点, y 表示小数位数, 比如对于 Price 类型, Int64 值 186400 表示的价格为 18.6400。
- 2) 在某些应用场景下, 一个消息中可能有部分字段不需要填写, 如果是字符串型字段则填写全空格, 如果是数值型字段则填写 0。
- 2)-3) 字符串类型 char[x] 统一使用 UTF-8 编码。

6.2 会话层域定义

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

6.3 业务层域定义

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

ClearingFirm	char[2]	结算机构代码 01=中国证券登记结算公司深圳分公司
ClOrdID	char[10]	客户订单编号 同一交易单元每个交易日 申报的委托的 ClOrdID 不 得重复
ConfirmID	char[8]	约定号 8 位数字字符串，不足 8 位前补 0
ContactInfo	char[350]	联系方式
ContactInfo	char[12]	联系人
ContractAccountCode	char[6]	合约账户识别码 合约账户 标识码
CounterpartyAccountID	AccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	BranchID	对手方营业部代码
CounterpartyExecID	char[16]	交易所赋予的执行编号， 单个交易日内不重复
CounterpartyPBUID	PBUID	对手方交易单元
CoveredOrUncovered	uInt8	备兑标签，衍生品交易填写 0=Covered，表示备兑 1=UnCovered，表示非备兑
CumQty	Qty	累计执行数量
CxlRejReason	uInt16	撤单拒绝原因代码，正数
DeliverQty	Qty	证券交付数量
DesignationInstruction	char	注册指令 3 表示转托管

DesignationTransType	uInt8	注册指令类型 1=New, 表示新注册请求 3=Cancel, 表示注册撤单
ExecID	char[16]	交易所赋予的执行编号, 单个交易日内不重复
ExecType	char	执行报告类型 0=New, 表示新订单 4=Cancelled, 表示已撤销 8=Reject, 表示已拒绝 F=Trade, 表示已成交
ExpirationDays	uInt16	期限, 单位为天数
ExpirationExecInst	uInt8	到期续做方式 1=到期自动续做 2=到期手动续做
ExpirationType	uInt8	期限类型 1=固定期限
InsufficientSecurityID	char[8]	申购赎回不足成份股证券 代码
IOIID	char[10]	客户意向申报编号 同一交易单元每个交易日 申报的意向申报的 IOIID 不得重复
IOIQty	Qty	意向申报数量
IOIRefID	char[10]	原意向申报 IOIID 撤销意向申报时使用
IOITransType	char	意向申报类型 N=意向申报 C=意向申报撤单
LastPx	Price	成交价格
LastQty	Qty	成交数量
LeavesQty	Qty	订单剩余数量
MaturityDate	LocalMktDate	到期日
MaxPriceLevels	uInt16	最多成交价位数, 正数

		0 表示不限制成交价位数
MinQty	Qty	最低成交数量
NoPartyIDs	NumInGroup	参与方个数
NoSecurity	NumInGroup	证券只数
OfferAccountID	AccoutID	卖方证券账户
OfferBranchID	BranchID	卖方营业部代码
OfferPBUID	PBUID	卖方交易单元
OfferPositionEffect	char	卖开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
OrderID	char[16]	交易所订单编号 交易所赋予的订单编号， 跨交易日不重复
OrderQty	Qty	订单数量
<u>OrderRestrictions</u>	<u>C4</u>	<u>订单限定</u> <u>1=程序化交易</u> <u>E=算法交易</u> <u>最多可同时填写四种限定</u> <u>类型</u> <u>如没有限定类型则填空</u>
OrdRejReason	uInt16	订单拒绝原因代码，正数
OrdStatus	char	订单状态 0=New，表示新订单 1=Partially filled，表示部 分成交 2=Filled，表示全部成交 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝
OrdType	char	订单类型 1 表示市价 2 表示限价

带格式表格

		U 本方最优
OrigClOrdID	char[10]	原订单 ClOrdID
OrigSubmittingPBUID	PBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeDate	LocalMktDate	初始成交申报申报日期
OrigTradeID	char[16]	初始成交申报的 TradeID
OrigTradeReportID	char[10]	初始交易客户成交申报编号
OwnerType	uInt16	所有者类型，正数 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起 106=结算结构发起
PlatformID	uInt16	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台
PlatformState	uInt16	平台状态 0=PreOpen，未开放 1=OpenUpComing，即将开放 2=Open，开放 3=Halt，暂停开放 4=Close，关闭

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

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

TradeReportID	char[10]	客户成交申报编号 同一交易单元每个交易日 申报的成交申报的 TradeReportID不得重复
TradeReportRefID	char[10]	原客户成交申报编号，最多 8 个字符
TradeReportRejectReason	uInt16	成交申报拒绝原因代码
TradeReportTransType	uInt8	成交申报事务类别 0=New，新申报 1=Cancel，撤销申报 2=Replace，成交申报成功
TradeReportType	uInt8	成交申报消息类型 0=Submit，提交成交申报
TransacTime	LocalTimestamp	订单或执行的创建时间
TransfereePBUID	PBUID	转入交易单元代码
TrdAckStatus	uInt8	成交申报响应状态 0=Accepted，接受 1=Rejected，拒绝
TrdRptStatus	uInt8	成交申报状态 2=Cancelled，已撤销 100=Unmatched，尚未匹配 101=Matched，已匹配
TrdSubType	uInt16	成交申报子业务类别
TrdType	uInt16	成交申报类型，正数 1001=股票质押式回购初始交易 1002=股票质押式回购提前购回 1003=股票质押式回购到期购回 1004=股票质押式回购延

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