

上海证券交易所技术文档

**上海证券交易所综合业务平台**

**市场参与者接口规格说明书**

**（科创板技术开发稿）**

**（1.43版）**

**上海证券交易所**

**二○一九年三月**

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.43版发布说明2019.3**

1、根据科创板需求，增加盘后固定价格交易申报消息、响应消息、成交回报消息和行情文件接口说明。

2、调整国债预发行行情文件接口字段取值。

3、根据科创板需求，增加盘后固定价格交易和国债预发行业务行情数据STEP消息规格。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.42版发布说明2018.9**

1、根据中登身份认证业务需求，增加密码服务申报消息、响应消息。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.41版发布说明2018.5**

1、根据资金前端控制业务需求，增加资金前端控制业务申报消息、响应消息。

2、修改货币市场基金实时申赎STEP消息流程图，删除申赎汇总行情。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.40版发布说明2017.7**

1、根据大宗交易实时减持需求，大宗交易申报消息、公共数据消息中填写股份减持标识。响应消息、执行报告、过户数据中不填写。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.39版发布说明2017.2**

1、股票质押式回购初始交易申报消息中增加要素。

2、删除货币基金申赎汇总行情的数据广播类型说明，此为文档调整，不涉及实现变动。

3、补充大宗盘后固定价格申报的数据广播类型说明，此为文档调整，不涉及实现变动。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.38版发布说明2015.2**

1、对投票议案接口中字符长度限制的描述进行了补充。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释, 以上变更启用安排参见相关业务或测试上线通知。

服务电话：021-4009003600

通信地址：上海市浦东南路528号上海证券交易所技术规划与服务部

网站地址：<http://www.sse.com.cn/>  新交易系统专区

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.37版发布说明2015.1**

补充网络投票业务接口，即合并本所外网开发测试文件栏预发布的《上海证券交易所 综合业务平台市场参与者 接口规格说明书【网络投票，预发布稿】\_20141201》。

1、增加特殊议案号88的说明。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.36版发布说明2014.12**

补充上证LOF业务接口，即合并本所外网开发测试文件栏预发布的《IS105 上海证券交易所 综合业务平台 市场参与者接口规格说明书(上证LOF)【预发布稿】20140122》。

增加上证LOF基金业务参数公告文件接口。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.35版发布说明2014.6**

调整货币基金实时申赎业务E账户申报及过户备注标签取值（具体实施待相关通知），删除已停发的货币基金实时申赎业务公共数据消息。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.34版发布说明2014.6**

1. 货币基金实时申赎业务增加E账户备注标签（具体实施待相关通知）。
2. 补充大宗固定价格申报接口，即合并外网开发测试文件栏预发布的《上海证券交易所综合业务平台市场参与者 接口规格说明书(大宗固定价格交易，预发布稿)\_20140327》。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.33版发布说明2013.9**

补充国债预发行业务消息和行情接口，即合并本所外网开发测试文件栏预发布的《上海证券交易所综合业务平台市场参与者 接口规格说明书(国债预发行, 技术开发稿)\_20130731》。

补充描述债券预发行生命周期结束后行情业务字段无意义。

补充说明综合业务平台撤单订单，不分配交易所订单编号。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.32版发布说明2013.5**

补充股票质押回购业务接口，即合并本所外网开发测试文件栏预发布的《上海证券交易所综合业务平台市场参与者 接口规格说明书(股票质押回购, 技术开发稿)\_20130326》。

购回交易和终止购回申报消息增加标的证券代码，以便数据库中填写证券代码。

补充中登关于股票质押回购业务标的证券描述标签的描述，如进一步了解可咨询中登上海公司。

**中间未发布版本1.31版（2013.4）修订如下**（黄金ETF业务上线安排参见相关业务或测试上线通知）**：**

修订跨境ETF/交易型货币市场基金申赎执行报告第一条记录（证券代码为二级市场交易代码），该记录数量、金额原为0，现修订为有效的申赎数量、现金替代总额，为未来该类业务执行报告整合成一条做准备。

新增黄金ETF现金申赎业务，该业务接口同跨境ETF/交易型货币市场基金申赎，并遵循上述修订。

新增黄金ETF实物申赎执行报告，包含黄金ETF实物申赎基金公司执行报告，黄金ETF实物申赎市场增减执行报告，执行报告数据广播类型16。

**注意：为充分发挥STEP协议的扩展性，对于由上交所发出的STEP消息，例如在消息体尾部扩展新的域，市场参与者系统应能兼容处理。当新业务需要，在STEP协议消息体增加新的域后，市场参与者系统如不需要支持该新业务，可以做到兼容识别并无需任何修改，以发挥标签化优势，这方面技术优化可以逐步实施。**

修订货币市场基金实时申赎业务消息规范章节，对指定的基金公司转发市场执行报告数据，并计划停止该业务发送公共消息。20130424版修订在给基金公司转发的市场执行报告尾部增加备注字段。

补充数据广播类型12、16。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.30版发布说明2013.2**

补充转融通业务接口，即合并本所外网开发测试文件栏预发布的《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者 接口规格说明书1.00 版(转融通,技术开发稿)\_20121015》。

补充说明报价回购出入库业务中股票、基金的数量单位。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.22版发布说明2013.1**

修订执行报告消息描述中字段名称字母大小写错误。

合并本所外网开发测试文件栏预发布的《上海证券交易所综合业务平台市场参与者 接口规格说明书(报价回购及约定购回, 技术开发稿)》。

其他文字修订。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.21版发布说明2012.12**

本文档基于跨境ETF申赎业务新增定义了上交所交易型货币市场基金申赎市场参与者EzSTEP接口，消息数据流及格式与跨境ETF相同，个别取值差异参见具体接口约定。

修改交易型货币市场基金申赎执行报告第二条记录，数据与跨境ETF一致，现金替代金额可解释为成交金额。

修改跨境ETF申赎业务，基金公司收到的执行报告及BGH增加对手方账户，原为ETFJIJIN字符串。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.20版发布说明2012.10**

本文档新增定义了上交所货币市场基金实时申赎（汇添富收益快线）市场参与者EzSTEP接口，即合并了《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者 接口规格说明书1.00 版(货币基金申赎，技术开发稿)\_20120831》技术开发文档。

新增跨境ETF申赎执行报告补充说明“基金公司作为对手方收到对应的成交数据”。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.10版发布说明2012.8**

本文档新增定义了上交所跨境ETF申赎市场参与者EzSTEP接口，即合并了《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者 接口规格说明书1.00 版(跨境ETF申赎，技术开发稿)\_20120528》技术开发文档，跨境ETF二级市场买卖与其他单市场ETF买卖接口一样，继续采用EzOES接入上交所竞价撮合平台实现。

本文档基于原发布的《IS105上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书1.00 版（大宗交易）\_20120215》新增跨境ETF内容。

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.00版发布说明2012.5**

本文档为市场参与者通过EzSTEP接入上交所综合业务平台的接口规格。

本文档定义了上交所大宗交易市场参与者EzSTEP接口，上交所大宗交易系统采用远程数据交互模式，以电子交易方式受理大宗交易意向报价发布和成交申报发布，并向市场发布意向和成交信息。交易用户通过大宗交易系统买卖行为应当符合《上海证券交易所交易规则》的有关规定。

**目录**

[1 数据格式、STEP消息约定及通用数据库接口规范 7](#_Toc2672545)

[2 撮合业务消息规范（国债预发行、盘后固定价格交易） 12](#_Toc2672546)

[2.1 撮合业务STEP消息流程图 12](#_Toc2672547)

[2.2 申报消息 12](#_Toc2672548)

[2.3 申报撤单消息 14](#_Toc2672549)

[2.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 14](#_Toc2672550)

[2.5 申报撤单失败响应消息 15](#_Toc2672551)

[2.6 执行报告消息 15](#_Toc2672552)

[3 行情数据STEP消息规范 18](#_Toc2672553)

[4 行情文件接口mktdt01.txt 21](#_Toc2672554)

[4.1 结构描述 22](#_Toc2672555)

[4.2 格式定义 22](#_Toc2672556)

[5 过户数据接口bghXXXXX.dbf 27](#_Toc2672557)

[6 后记 31](#_Toc2672558)

# 数据格式、STEP消息约定及通用数据库接口规范

**数据格式**约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP通用数据库接口规格说明书》文档**STEP消息**约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP通用数据库接口规格说明书》文档。

**通用数据库接口**参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP通用数据库接口规格说明书》文档。

**请求业务类型编号**（reqid）**，交易所据此处理不同的业务请求，取值为：**

BII 大宗意向 Block trade Intention of Interest

BPT 大宗交易 Block trade appoint Trade

QBD 报价入库 Quote Bond Deposit

QBW 报价出库 Quote Bond Withdraw

QNE 报价回购 Quote bond New Entry

QCA 报价回购提前购回 Quote bond repo

RNE 初始交易 Repurchase New Entry

RNR 购回交易 Repurchase Return

EEC 跨境ETF/黄金ETF现金/交易型货币市场基金申购 External ETF Creation

EER 跨境ETF/黄金ETF现金/交易型货币市场基金赎回 External ETF Redemption

GEC 黄金ETF实物申购 Gold ETF Creation

GER 黄金ETF实物赎回 Gold ETF Redemption

ZII 转融通非约定申报 Lending and Borrowing(Zhuanrongtong) Indication of Interest

ZPT 转融通约定申报 Lending and Borrowing(Zhuanrongtong) appoint Trade

OFC货币市场基金申购申报（Open-end Fund Createion）

OFR 货币市场基金赎回申报（Open-end Fund Redemption）

SPN 初始交易Stock Pledge New

SPS 补充质押Stock Pledge Supplement

SPR 购回交易Stock Pledge Retrun

SPT 终止购回Stock Pledge sTop

SPD 部分解除质押Stock Pledge Dismiss

SPB 违约处置申请Stock Pledge Breach

BIY 国债预发行利率（收益率）招标申报（Bond when Issue by Yield）

BIP 国债预发行价格招标申报（Bond when Issue by Price）

FPE 大宗固定价格交易申报（Fix Price Entry of block trading）

LFS 上证LOF认购

LFC 上证LOF申购 LOF Creation

LFR 上证LOF赎回 LOF Redemption

LFT 上证LOF场内转场外的转托管

LFP 上证LOF母基金分拆

LFM 上证LOF子基金合并

VTE 投票申报（Vote Entry）

CFC 资金前端控制

PWS 密码服务 Password Service

PFP 盘后固定价格申报 Post-trade fix price trade

**数据广播类型**（bcasttype）**，取值为：**

01：跨境ETF/黄金ETF现金/交易型货币市场基金申赎业务（execreport）

02：大宗交易执行报告（execreport）  
03：大宗交易意向申报行情（pubdata）

04 转融通出借人实时申报及成交汇总行情广播（pubdata）

05 约定申报转融通执行报告（execreport）

06 非约定申报转融通执行报告（execreport）

07 转发的转融通约定申报（execreport）

08 转发的转融通非约定申报（execreport）

09 转发的转融通约定申报撤单（execreport）

10 转发的转融通非约定申报撤单（execreport）

12货币基金执行报告（execreport）

13 LOF执行报告（execreport）

14 大宗盘后固定价格交易执行报告（execreport）

16黄金ETF实物申赎执行报告（execreport）

17国债预发行价格招标执行报告（execreport）

18 国债预发行利率招标执行报告（execreport）

19 盘后固定价格交易执行报告（execreport）

1H 综合业务平台交易行情数据

**业务类型与执行报告数据广播类型及产品集关系表：**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **业务名称** | **业务类型（reqid）** | **执行报告**  **广播类型**  **（bcasttype）** | **公共数据**  **广播类型**  **（bcasttype）** | **产品集编号**  （setid）  供参考以具体数据为准 |
| 跨境ETF申赎/黄金ETF现金申赎/交易型货币市场基金申赎 | EEC 跨境ETF/黄金ETF现金/交易型货币市场基金申购  EER 跨境ETF/黄金ETF现金/交易型货币市场基金赎回 | 01 | N/A | 102 |
| 黄金ETF实物申赎 | GEC 黄金ETF实物申购  GER 黄金ETF实物赎回  注：无订单申报，用于BGH中。 | 16 | N/A | 102 |
| 大宗业务 | BII 大宗意向  BPT 大宗交易  FPE 大宗固定价格交易 | 02  14 | 03  N/A | 101  101 |
| 报价回购 | QBD 报价入库  QBW 报价出库  QNE 报价回购  QCA 报价回购提前购回 | N/A | N/A | 100 |
| 约定购回 | RNE 初始交易  RNR 购回交易 | N/A | N/A | 100 |
| 转融通 | ZII 转融通非指定对手方  ZPT 转融通指定对手方 | 05,07,09  06,08,10 | 04 | 104 |
| 货币市场基金申赎（即：货币市场基金场内实时申赎） | OFC货币市场基金申购申报  OFR 货币市场基金赎回申报 | 12 | N/A | 105 |
| 股票质押回购 | SPN 初始交易  SPS 补充质押  SPR 购回交易  SPT 终止购回  SPD 部分解除质押  SPB 违约处置申请 | N/A | N/A | 100 |
| 国债预发行 | BIY 国债预发行利率（收益率）招标申报  BIP 国债预发行价格招标申报 | 17  18 | N/A | 106 |
| 上证LOF | LFS 上证LOF认购  LFC 上证LOF申购  LFR 上证LOF赎回  LFT 上证LOF场内转场外的转托管  LFP 上证LOF母基金分拆  LFM 上证LOF子基金合并 | 13 | N/A | 105 |
| 网络投票 | VTE 投票申报（Vote Entry） | N/A | N/A | 0109 |
| 资金前端控制 | CFC资金前端控制申报 | N/A | N/A | 0109 |
| 密码服务 | PWS 密码服务申报Password Service | N/A | N/A | 0109 |
| 盘后固定价格 | PFP：盘后固定价格申报 | 19 | N/A | 0103 |

**消息类型（MsgType），取值为：**

6 = 意向申报或意向申报撤单（IOI）

8 =申报响应或执行报告（Execution Report）

9 =申报撤单失败（OrderCancelReject）

D =申报（NewOrder Single）

F =申报撤单（OrderCancel Request）

AJ = 意向申报响应或意向申报撤单响应（QuoteResponse）

W =行情（MktDataFull）

U001 = 注册指令（DesignationInstruction）

U004 = 投票

U005= 投票响应

U009= 资金前端控制申报

U010= 资金前端控制响应

U006 = 密码服务申报

U008= 密码服务响应

**说明及约定：**

注意大宗交易证书(Ekey)取消后，大宗交易用户直接使用PBU进行大宗交易，该PBU对产品的交易权限及连通指定关系同竞价交易系统。

对于跨境ETF/交易型货币市场基金申赎，reqresp表securityid字段为二级市场交易代码。

对于报价回购与约定购回业务，在没有特别申明的情况下，交易所后台一般根据买方业务PBU与ClOrdID的组合确定订单（含撤单）的唯一性，其中报价回购出入库申报，后台根据业务PBU与ClOrdID的组合确定订单的唯一性。因此，数据库接口中PBU字段也对应为用于订单唯一性组合的PBU，注意买卖方业务PBU是允许申报该业务的PBU，具体参考相关业务规则；报价回购和约定购回业务撤单依据原始订单申报的业务PBU和原始ClOrdID（即OrigClOrdID）进行撤单，撤单订单作为一种新的订单，需新分配ClOrdID；报价回购提前购回中证券代码、买方帐号、买方PBU、卖方账号、卖方PBU和交易员号、申报数量都必须同债券报价回购申报订单；OrderID在标准协议中定义为交易所订单编号，报价回购和约定购回业务中可理解为成交编号，对应EzQES接口中的trdnum字段；RefOrderID对应EzQES接口中oldtrdnum字段；正常情况下，会员应注意避免同一交易日内先使用EzQES，再使用EzSTEP重复申报报价回购及约定购回业务。

对于转融通业务，证金公司当日申报结束后，向交易所发送订单申报结束标志，具体约定根据相关备忘录。

注意当撤单请求失败，报19198（原始订单正在处理当中）错误时，因后台异步处理方式，市场参与者可待收到原始订单请求响应后再尝试进行该笔订单撤单申报。

综合业务平台STEP撤单订单，暂均不分配交易所订单编号，因此撤单成功或失败响应消息中，交易所订单编号为空。

# 撮合业务消息规范（国债预发行、盘后固定价格交易）

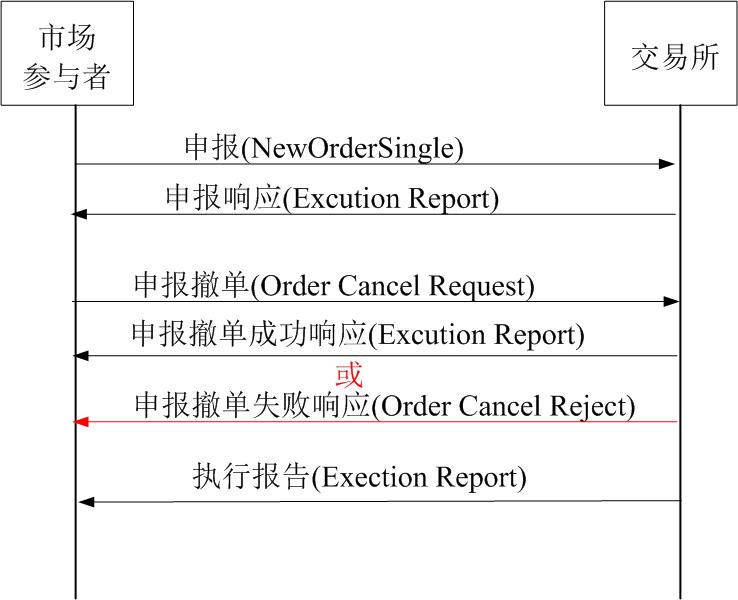
## 撮合业务STEP消息流程图

根据撮合业务规则，市场投资者可以进行买卖申报和撤单申报，交易所实时反馈申报确认，并反馈成交回报（即执行报告），目前综合业务平台撮合业务支持：

1、国债预发行业务

2、盘后固定价格交易业务

下图描述了消息通信流程。



## 申报消息

| **NewOrderSingle (reqtext)** | **申报消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求及响应接口表中的reqtext字段数据。  市场参与者使用NewOrderSingle消息进行撮合买卖申报。支持以下请求业务申报  国债预发行利率（收益率）招标（BIY）申报；国债预发行价格招标（BIP）申报；盘后固定价格交易申报（PFP）。  国债预发行业务、盘后固定价格交易暂仅支持限价订单类型。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | | MsgType取值为： D=申报 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号，指申报会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 44 | Price | | 价格，对于价格，单位元；对于百分比类型利率，单位%。 | N11(3) |
| 38 | OrderQty | | 订单数量 | N10 |
| 54 | Side | | 买卖方向，取值有：  1表示买  2表示卖 | C1 |
| 40 | OrdType | | 订单类型，取值：  1 =市价（ Market），暂不支持  2 =限价（ Limit）  K =市转现，暂不支持 | C1 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码, 取值为3。 | N2 |
| 投资者账户 | 448 | PartyID | 投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为投资者帐户 | N4 |
| 申报交易单元号 | 448 | PartyID | 业务PBU代码，填写5位交易单元号。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为PBU | N4 |
| 营业部代码 | 448 | PartyID | 营业部代码 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为营业部代码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

## 申报撤单消息

| **OrderCancel Request (reqtext)** | **申报撤单消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗交易业务申报撤单消息。参见IS105上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书1.42版\_20180926中2.6章节。  其中订单数量，本业务不做校验。 | |

## 申报响应消息/申报撤单成功响应消息

| **ExecutionReport (resptext)** | **申报响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求及响应接口表中的resptext字段数据。  每一个申报记录或申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。  150和39组合取值含义：  申报成功响应：150=0, 39=0  申报拒绝响应：150=8, 39=8  申报撤单成功响应：150=6,39=6  申报撤单失败响应：参见OrderCancelReject | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为：8=申报响应 |  |
| 37 | OrderID | 交易所订单编号 | C16 |
| 150 | ExecType | 当前订单执行类型，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应  6=撤单成功 | C1 |
| 39 | OrdStatus | 当前订单状态，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应  6=撤单成功 | C1 |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | C6 |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 |
| 60 | TransactTime | 接受请求时间，格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 | C21 |
| 41 | OrigClOrdID | 对于申报撤单成功响应，为原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的ClOrdID，对于申报响应，取值为空。 | C10 |
| 103 | OrdRejReason | 对于申报响应，为申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。申报成功时，该字段取值为空。申报失败时，表示拒绝的理由，取值同Remark字段。  对于申报撤单成功响应，该字段取值为空。 | C5 |
| 32 | LastQty | 对于申报撤单成功响应，为该撤单成功的数量。其他无意义取0 | N12 |
| 58 | Text | 备注 | C50 |

## 申报撤单失败响应消息

| **OrderCancelReject (resptext)** | **申报撤单失败响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗交易业务申报撤单失败响应消息。参见IS105上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书1.42版\_20180926中2.8章节。 | |

## 执行报告消息

| **ExecutionReport (execreporttext)** | **实时执行报告消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  执行报告表中的execreporttext字段数据。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 标准消息头 | | MsgType取值为：8=成交回报 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号， | C10 |
| 37 | OrderID | | 交易所订单编号 | C16 |
| 17 | ExecID | | 成交编号，目前本业务有效位用到10位，后期将逐步扩展位数，注意做好相关技术准备工作 | C16 |
| 1180 | [ApplID](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag1180.html) | | 消息应用标识，取值同数据库中请求业务类型reqid | C3 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 31 | LastPx | | 价格 | N11(3) |
| 32 | LastQty | | 该笔成交数量 | N12 |
| 8504 | TotalValueTraded | | 成交金额  对于国债预发行价格招标，计算方式为价格x数量\*10；  对于国债预发行利率招标，计算方式为数量x面值\*10；  对于盘后固定价格交易，计算方式为数量x成交价格。 | N16(3) |
| 151 | LeavesQty | | 本次剩余余额，暂为0 | N12 |
| 54 | Side | | 买卖方向，取值有：  1表示买  2表示卖 | C1 |
| 60 | TransactTime | | 订单执行时间，格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 | C21 |
| 42 | OrigTime | | 原有订单请求接收的时间,式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 | C21 |
| 150 | ExecType | | 当前订单执行状态，取值：  F=成交 | C1 |
| 39 | OrdStatus | | 当前订单状态，取值：1=部分成交，2=已成交 | C1 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号，取值为2。 | N2 |
| 投资者帐户 | 448 | PartyID | 投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为投资者帐户 | N4 |
| 申报交易单元号 | 448 | PartyID | 业务PBU代码，填写5位交易单元号 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

# 行情数据STEP消息规范

本接口指通过EzSR软件，以数据库STEP消息方式发布综业行情；

**数据格式**约定、**STEP消息**约定、**通用数据库接口**参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP通用数据库接口规格说明书》文档；

本业务产品集编号（setid）为：300；

数据广播类型（bcasttype），本业务取值：1H；

| **MktDataFull**（MDText） | **公共数据消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  本消息用来发送市场有效时段内的行情信息，由后台向市场参与者单向发送。每条消息对应单个产品行情信息。  在STEP消息中，提供完整的交易相关信息。 | |

行情数据类型取值为MD101时（表示国债预发行行情）：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***标签*** | ***域名*** | ***说明*** | | ***类型*** |
|  | **消息头** | **MsgType=W** | |  |
| **[963](file:///D:\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag963.html" \t "tagFrame)** | [MDReportID](file:///D:\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag963.html" \t "tagFrame) | 交易所行情信息编号(预留、暂不填) | | C16 |
| **1187** | RefreshIndicator | 用于标识消息中是否有新的行情数据，取值：有=1,无=0，推送已有行情信息为0，否则为1。（预留，暂填0） | | N5 |
| **48** | SecurityID | 证券代码 | | C6 |
| **55** | Symbol | 证券名称 | | C8 |
| **8538** | TradingPhaseCode | 产品实时阶段及标志，该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第0位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示停牌。 | | C8 |
| **8504** | TotalValueTraded | 当日累计成交金额，精确到分 | | N16(2) |
| **[387](file:///D:\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag387.html" \t "tagFrame)** | [TotalVolumeTraded](file:///D:\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag387.html" \t "tagFrame) | 当日累计成交数量 | | N16 |
| **140** | PreClosePx | 昨收盘价，单位：元 | | N11(3) |
| **268** | NoMDEntries | 行情条目个数，本重复组依次包括今日开盘价(269=4)、最高价(269=7)、最低价(269=8)、最新价(269=2)、以及五档买入价量信息(269=0，MDEntryPositionNo从1至5)、五档卖出价量信息(269=1，MDEntryPositionNo从1至5)，其中价格由MDEntryPx表示，数量由MDEntrySize表示。 | | N5 |
| **行情条目明细** | **269** | MDEntryType | 行情条目类别：  今日开盘价=4  最高价=7  最低价=8  最新价=2  买入=0  卖出=1 | C2 | |
| **270** | MDEntryPx | 行情条目价格，单位：元 | N11(3) | |
| **271** | MDEntrySize | 行情条目数量, 如果数据组不含数量信息，则此字段不出现 | N12 | |
| **290** | MDEntryPositionNo | 行情条目买卖盘序号, 对应五档买入卖出价量的档位信息，否则此字段不出现 | N3 | |

行情数据类型取值为MD102时（表示盘后固定价格行情）：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***标签*** | ***域名*** | ***说明*** | | ***类型*** |
|  | **消息头** | **MsgType=W** | |  |
| **[963](file:///D:\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag963.html" \t "tagFrame)** | [MDReportID](file:///D:\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag963.html" \t "tagFrame) | 交易所行情信息编号(预留、暂不填) | | C16 |
| **1187** | RefreshIndicator | 用于标识消息中是否有新的行情数据，取值：有=1,无=0，推送已有行情信息为0，否则为1。（预留，暂填0） | | N5 |
| **48** | SecurityID | 证券代码 | | C6 |
| **55** | Symbol | 证券名称 | | C8 |
| **8538** | TradingPhaseCode | 产品实时阶段及标志，该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第0位：‘I’表示启动（开市前）时段，‘A’表示集中撮合时段，‘H’表示连续交易时段，‘D’表示闭市时段，‘F’表示停牌。 | | C8 |
| **8504** | TotalValueTraded | 当日累计成交金额，精确到分 | | N16(2) |
| **[387](file:///D:\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag387.html" \t "tagFrame)** | [TotalVolumeTraded](file:///D:\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag387.html" \t "tagFrame) | 当日累计成交数量 | | N16 |
| **268** | NoMDEntries | 行情条目个数，依次包括今日收盘价(269=5)以及买入申报总股数(269=0，MDEntryPositionNo为1)、卖出申报总股数(269=1，MDEntryPositionNo为1)，买卖数量由MDEntrySize表示。 | | N5 |
| **行情条目明细** | **269** | MDEntryType | 行情条目类别：  今日收盘价=5  买入=0  卖出=1 | C2 | |
| **270** | MDEntryPx | 行情条目价格，单位：元 | N11(3) | |
| **271** | MDEntrySize | 行情条目数量, 如果数据组不含数量信息，则此字段不出现 | N12 | |
| **290** | MDEntryPositionNo | 行情条目买卖盘序号, 对应五档买入卖出价量的档位信息，否则此字段不出现 | N3 | |

说明

1. 行情条目类别为0或1时，MDEntrySize表示当前未成交的买入/卖出申报总股数，此时MDEntryPositionNo固定为1。

# 行情文件接口mktdt01.txt

| **mktdt01.txt** | **行情文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  本文件为行情文件接口。对于综合业务平台，行情文件名为mktdt01.txt，当日开市前至交易结束期间，通过单向卫星实时发送。  行情文件为文本txt文件，格式约定如下：  （一）竖线('|')为字段间分隔符，字段数据内容不应含有分隔符；  （二）竖线('|')不应用在每条记录的开头和结尾；  （三）各字段均为一个遵循格式定义的字符串，字段间有严格前后顺序；  （四）字段定长，字段格式定义约定了长度和精度；字符型字段以CX格式表示，其中X代表字符串长度，不足部分左对齐，右补空格；整数数字型字段以NX格式表示，其中X代表数字型字符串长度，不足部分右对齐，左补空格；浮点数字型字段以NX (Y)格式表示，其中X代表数字型字符串总长度，Y代表小数位数，X包括一位小数点，整数部分最多不超过X-Y-1位，小数部分最多不超过Y位，不足部分右对齐，左补空格；  （五）每行以二进制0x0A结束，最后一行也以0x0A结束。  文件描述：  （一）行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分；  （二）注意行情文件可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方应能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；  （三）文件体中，对于不同的行情数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应能根据行情数据类型识别处理；  （四）文件体记录按行情数据类型递增，同一行情数据类型按证券代码递增；  （五）对于暂停上市的股票，文件中不包含该股票的记录。对于未开始上市交易的产品，文件中不包含该产品的记录。对于摘牌后的产品，文件中不包含该产品的记录；  （六）如文件中数值字段取值超过约定格式最大值，取最大值，如N10取9999999999；  （七）前收盘价格，在开市之前即行发布。在开盘集合竞价之后的短暂休市和中午休市期间同样揭示各档买卖价格数量等全部信息；  （八）对于价格、金额数据，单位为人民币元。对于数量数据，单位对股票为股，基金为份，债券与回购为手；  （九）在集合竞价时段内，当前买入价和当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时申买量一和申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量；  （十）字段无意义或无该字段行情数据时，字符填空格，数值填0；  （十一）交易所具体产品代码，参见相关发文通知，并参考以上处理。 | |

## 结构描述

结构图如下：

文件结构描述参考：

**BeginString|Version|BodyLength|**[**TotNumTradeReports**](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag748.html)**|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|MDSesStatus**

**MDStreamID|SecurityID|Symbol|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|OpenPrice|HighPrice|LowPrice|TradePrice|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|BuyPrice2|BuyVolume2|SellPrice2|SellVolume2|BuyPrice3|BuyVolume3|SellPrice3|SellVolume3|BuyPrice4|BuyVolume4|SellPrice4|SellVolume4|BuyPrice5|BuyVolume5|SellPrice5|SellVolume5|TradingPhaseCode|Timestamp**

**……**

**……**

**……**

**EndString|CheckSum**

## 格式定义

文件头定义，第一行特殊记录：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | BeginString | 起始标识符 | C6 | HEADER |
| 2 | Version | 版本 | C8 | ATP1.00 |
| 3 | BodyLength | 数据长度 | N10 | 计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。  (暂不启用) |
| 4 | [TotNumTradeReports](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag748.html) | 文件体记录数 | N5 | 文件体记录数 |
| 5 | MDReportID | 行情序号 | N8 | 行情文件序号（预留，暂不填） |
| 6 | [SenderCompID](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag49.html) | 发送方 | C6 | 发送方标示符，取  XSHG01 |
| 7 | [MDTime](file:///D:\fix2011\Fiximate30\en\FIX.5.0SP2\tag273.html) | 行情时间 | C21 | 行情时间，格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 |
| 8 | MDUpdateType | 发送方式 | N1 | 0 = 快照Full refresh  1 = 增量Incremental（暂不支持） |
| 9 | MDSesStatus | 市场行情状态 | C8 | 全市场行情状态：  该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第0位：‘S’表示全市场启动期间（开市前），‘T’表示全市场处于交易期间（含中间休市）， ‘E’表示全市场处于闭市期间。  第1位：‘1’表示开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。  第2位：‘1’表示收盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。  第3位：‘1’表示国债预发行市场行情闭市标志，未闭市取‘0’。  第4位：‘1’表示盘后固定价格交易行情闭市标志，未闭市取‘0’ |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

文件体定义，多条行情记录，行情数据类型取值标识字母MD加类型编号。

当取值为MD101时，文件体记录格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | MDStreamID | 行情数据类型 | C5 | 行情数据类型标识符，取值  MD101 表示行情数据格式类型，目前该类型包含综业国债预发行行情，国债预发行产品生命周期结束后，除代码、产品实时阶段及标志、时间戳外，其他业务字段无实际意义。 |
| 2 | SecurityID | 产品代码 | C6 | 证券代码 |
| 3 | Symbol | 产品名称 | C8 | 证券简称 |
| 4 | TradeVolume | 成交数量 | N16 |  |
| 5 | TotalValueTraded | 成交金额 | N16(2) |  |
| 6 | PreClosePx | 昨日收盘价 | N11(3) |  |
| 7 | OpenPrice | 今日开盘价 | N11(3) |  |
| 8 | HighPrice | 最高价 | N11(3) |  |
| 9 | LowPrice | 最低价 | N11(3) |  |
| 10 | TradePrice | 最新价 | N11(3) | 最新成交价 |
| 11 | BuyPrice1 | 申买价一 | N11(3) | 当前买入价 |
| 12 | BuyVolume1 | 申买量一 | N12 |  |
| 13 | SellPrice1 | 申卖价一 | N11(3) | 当前卖出价 |
| 14 | SellVolume1 | 申买量一 | N12 |  |
| 15 | BuyPrice2 | 申买价二 | N11(3) |  |
| 16 | BuyVolume2 | 申买量二 | N12 |  |
| 17 | SellPrice2 | 申卖价二 | N11(3) |  |
| 18 | SellVolume2 | 申卖量二 | N12 |  |
| 19 | BuyPrice3 | 申买价三 | N11(3) |  |
| 20 | BuyVolume3 | 申买量三 | N12 |  |
| 21 | SellPrice3 | 申卖价三 | N11(3) |  |
| 22 | SellVolume3 | 申卖量三 | N12 |  |
| 23 | BuyPrice4 | 申买价四 | N11(3) |  |
| 24 | BuyVolume4 | 申买量四 | N12 |  |
| 25 | SellPrice4 | 申卖价四 | N11(3) |  |
| 26 | SellVolume4 | 申卖量四 | N12 |  |
| 27 | BuyPrice5 | 申买价五 | N11(3) |  |
| 28 | BuyVolume5 | 申买量五 | N12 |  |
| 29 | SellPrice5 | 申卖价五 | N11(3) |  |
| 30 | SellVolume5 | 申卖量五 | N12 |  |
| 31 | TradingPhaseCode | 产品实时阶段及标志 | C8 | 该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第0位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段， ‘E’表示闭市时段，‘P’表示停牌。 |
| 32 | Timestamp | 时间戳 | C12 | HH:MM:SS.000 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

当取值为MD102时，文件体记录格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | MDStreamID | 行情数据类型 | C5 | 行情数据类型标识符，取值  MD102 表示盘后固定价格交易行情数据格式类型，产品生命周期结束后，除代码、产品实时阶段及标志、时间戳外，其他业务字段无实际意义。 |
| 2 | SecurityID | 产品代码 | C6 | 证券代码 |
| 3 | Symbol | 产品名称 | C8 | 证券简称 |
| 4 | TradeVolume | 成交数量 | N16 |  |
| 5 | TotalValueTraded | 成交金额 | N16(2) |  |
| 6 | ClosePrice | 今日收盘价 | N11(3) |  |
| 7 | BuyVolume | 买入申报数量 | N12 | 当前未成交的买入申报总股数 |
| 8 | SellVolume | 卖出申报数量 | N12 | 当前未成交的卖出申报总股数 |
| 9 | TradingPhaseCode | 产品实时阶段及标志 | C8 | 该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第0位：‘I’表示启动（开市前）时段， ‘A’表示集中撮合时段，‘H’表示连续交易时段，‘D’表示闭市时段，‘F’表示停牌。 |
| 10 | Timestamp | 最新成交时间戳 | C12 | HH:MM:SS.000 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

文件尾定义，最后一行特殊记录：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | EndString | 结束标识符 | C7 | TRAILER |
| 2 | CheckSum | 校验和 | C3 | 校验和，3位校验和  校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包刮该字段后的换行符)数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模256得出，然后转化为3位ASCII码。例如，如果经计算校验和为274，则模256后的数为18，校验和域将取为ASCII字符串018  校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。 |

# 过户数据接口bghXXXXX.dbf

| **bghXXXXX.dbf** | **过户数据接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  综合业务平台盘后文件接口，文件名中XXXXX表示业务交易单元号，闭市后发送。  未申明特别填写方式和单位的字段，均填写或参照对应订单输入时的原始信息，无意义字段不填。  过户数据接口bghXXXXX.dbf和相同PBU的dghXXXXXYYYYMMDD.dbf（如有）压缩到现有的dghXXXXX.zip文件中供券商用RptGet下载。  对于跨境ETF/交易型货币市场基金申赎业务，过户数据同实时成交回报，每笔申赎有三笔成交明细记录，相关证券代码、价格、数量、成交金额字段数据同实时执行报告。  对于转融通业务，发给证金公司数据中包含对手方会员成交记录。  对于LOF业务，盘后文件记录证券代码为二级市场代码。LOF申赎，对应一条申报有一条文件记录。对基金公司，作为对手方收到对应的盘后数据，仅向基金公司发送LOF申赎、LOF分拆与合并业务盘后文件，其中参与方信息为基金公司。  对于中登身份认证的密码服务没有过户数据。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | gddm | 证券账户 | C10 |
| 2 | bcrq | 成交日期，格式为YYYYMMDD | C8 |
| 3 | cjbh | 成交编号，目前本业务有效位用到10位，后期将逐步扩展位数，注意做好相关技术准备工作  对于报价回购与约定购回业务，因无实时执行报告，为保持与原EzQES一致，报价回购与约定购回业务中该字段实际为OrderID交易所订单编号。  对于股票质押回购，因无实时执行报告，该字段实际为OrderID交易所订单编号。 | C16 |
| 4 | gsdm | 业务PBU | C5 |
| 5 | cjsl | 成交数量  对于LOF认购，暂无意义；对于LOF申赎，为申赎数量；对于LOF转托管，为转托管数量，同时注意使用了备注字段。  对于非累积投票制，为投票意向，1代表同意，2代表反对，3代表弃权；  对于累积投票制，为投票票数。其中港结算为汇总选举票数。如数值超过12位，将设置成-1。 | N12 |
| 6 | zqdm | 证券代码 | C6 |
| 7 | sbsj | 申报时间，格式为HHMMSS | C6 |
| 8 | cjsj | 成交时间，格式为HHMMSS | C6 |
| 9 | cjjg | 成交价格  对于报价回购业务为到期价格；对于报价回购提前购回业务为提前购回价格；对于约定购回业务，暂无意义；对于LOF认购、转托管和分拆合并，暂无意义；对于LOF申赎，为1.000。  对于转融通，与申报相同表示费率，单位为%  对于网络投票，无意义填0 | N11(3) |
| 10 | cjje | 成交金额  对于报价回购业务，暂无意义；对于约定购回业务初始交易订单，为初始交易金额；对于约定购回业务购回交易订单，为购回交易金额；对于LOF认购，为认购金额；对于LOF申赎、转托管和分拆合并，暂无意义。  对于转融通业务无意义。  对于股票质押回购初始交易，为初始交易金额；购回交易，为购回交易金额。  对于网络投票，表示股东大会编码，股东大会唯一序列号。 | N16(2) |
| 11 | sqbh | 会员内部订单号，同申报接口中的reff（会员内部订单号）  对于基金公司，跨境ETF/黄金ETF现金申赎业务、交易型货币市场基金申赎业务和上证LOF申赎、分拆合并业务，填写对手方投资者账户。 | C10 |
| 12 | cjbz | 成交业务类型标志  QBD 报价入库  QBW 报价出库  QNE 报价回购  QCA 报价回购提前购回  RNE 初始交易  RNR 购回交易  EEC 跨境ETF/黄金ETF现金/交易型货币市场基金申购  EER 跨境ETF/黄金ETF现金/交易型货币市场基金赎回  GEC 黄金ETF实物申购  GER 黄金ETF实物赎回  OFC 货币市场基金申购  OFR 货币市场基金赎回  ZII 转融通非约定申报  ZPT 转融通约定申报  SPN 初始交易  SPS 补充质押  SPR 购回交易  SPT 终止购回  SPD 部分解除质押  SPB 违约处置申请  BIY 国债预发行利率（收益率）招标申报  BIP 国债预发行价格招标申报  LFS 上证LOF认购  LFC 上证LOF申购  LFR 上证LOF赎回  LFT 上证LOF场内转场外的转托管  LFP 上证LOF母基金分拆  LFM 上证LOF子基金合并  VTE 投票申报  PFP 盘后固定价格申报 | C3 |
| 13 | bs | 买卖方  B：买方，跨境ETF/黄金ETF/交易型货币市场基金/货币市场基金/上证LOF申购时为买  S：卖方，跨境ETF/黄金ETF/交易型货币市场基金/货币市场基金/上证LOF赎回时为卖  对于跨境ETF/交易型货币市场基金/货币市场基金申赎，基金公司作为对手方买卖方向与投资者相反。  对于转融通业务，证金公司申报成交此字段为B，出借人申报成交为S。  对于股票质押回购，融出方取B，融入方取S。  对LOF认购、转托管和分拆合并，暂无意义。  对于网络投票，无意义填买方，B：买。 | C1 |
| 14 | text | 备注  对于转融通业务，第1-5位表示期限  对于货币基金场内实时申赎E账户申报，左对齐填写单个数字字母标签，取值及含义同申报订单。  对于LOF转托管业务，左对齐填写转入方基金参与方编码。  对网络投票：  左起第1至10位为议案及子议案（左对齐）；  对港结算，第11至12位为段号（左对齐），第13至28位为总股份数量（右对齐）。 | C30 |

# 后记

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

对本文档有任何批评指正意见，[请发电子邮件到](mailto:请发电子邮件到)tech\_support@sse.com.cn或者致电4009003600。