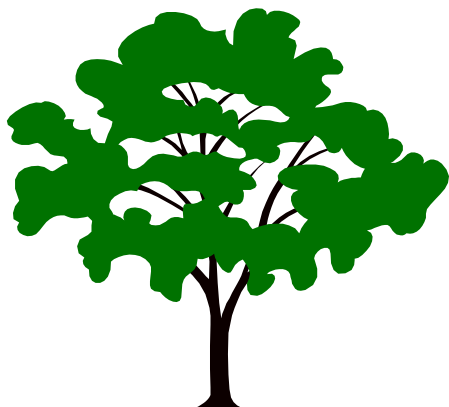




工程技术标准

深圳证券交易所委托拒绝原因代码表

(Ver1.01)



深圳证券交易所

二〇二三年八月

文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2023-07	1.00	迁移交易数据接口规范中的“委托申报拒绝原因代码”和“联交所拒绝原因代码”章节到本文档； 新增拒绝原因代码20177和20180
2023-08	1.01	(见橙色修订记录) 新增拒绝原因代码20178和20179

深圳证券交易所委托拒绝原因代码表

一、前言

本文档为《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》及《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》的附件,用于提供深圳证券交易所新一代交易系统(即第五版交易系统)的委托拒绝原因代码的说明。

二、委托申报拒绝原因代码

委托申报拒绝原因代码表

原因代码	原因简称	原因说明
20001	无效账户	账户为未开户账户
20002	无效账户	账户是一个无效账户(已注销、挂失等等)
20003	无效账户	账户无对应业务产品的交易权限
20005	业务禁止	证券的业务开关关闭
20006	业务禁止	当前阶段不允许申报该类委托
20007	证券停牌	证券停牌,不允许该类申报委托
20008	价格错误	委托价格不是价格档位的整数倍;网上发行认购价格不等于发行价;配股认购价格不等于配股价
20009	价格错误	委托价格超过涨跌幅限制;盘后定价大宗交易委托价格不为指定价格;转融通证券出借委托的费率与公布的不一致;委托价格超过有效申报价格范围限制
20010	数量非法	委托数量不是数量单位的整数倍;分级基金分拆合并委托数量非配比的整数倍
20011	金额非法	委托数量和金额都未满足最低交易门槛要求;委托数量或金额超过上限;开放式基金申购未满足最低申购金额要求;债券质押式协议回购初始交易、到期续做金额超过质押券实际总面额
20012	业务禁止	对折算率为0的证券不允许申报质押式回购质押申报;

		<p>对非 A 股证券，成交申报业务子类别必须为非受限股份转让；</p> <p>对限售股份出借标志为否的证券，不允许使用首发后可出借限售股份进行转融通出借（含约定、非约定）；</p> <p>股份性质不适用于该产品所在的业务</p>
20013	业务禁止	融资融券标的的不存在或业务被禁止；申报转融通证券出借委托，证券代码和期限不在当天发布的标的范围内；证券代码不在当天发布的港股通标的范围内；证券代码不在股票质押式回购业务标的范围内
20014	业务禁止	证券当天集中竞价没有成交，不能申报以成交量加权平均价交易的委托
20015	业务禁止	融券卖出禁止申报市价委托
20016	价格错误	融券卖出委托价格不满足提价检查要求
20017	无效账户	信用账户只能买入担保品证券
20018	无效账户	非信用账户申报融资融券委托
20019	无效单元	债券分销业务中，卖委托的交易单元非承销商交易单元
20020	无效账户	债券分销业务中，卖委托的证券账户非承销商证券账户或者买委托的证券账户为承销商证券账户
20021	数量超限	债券分销业务中，自行挂牌量超出自行挂牌总量
20022	股份卖空	持有股份不足；质押式报价回购初始交易数量大于可用标准券数量
20023	无效单元	委托的交易单元不存在；黄金 ETF 投资者交易单元找不到托管单元；转融通投资者交易单元找不到托管单元
20024	无效单元	委托的交易单元无对应产品的交易权限
20025	无效单元	委托的交易单元无对应业务的交易权限
20026	无效单元	信用账户必须通过信用交易单元申报；非信用账户必须通过非信用交易单元申报
20027	无效单元	QFII 账户未从指定交易单元申报

20028	无效单元	交易单元无对应产品的业务权限
20029	业务禁止	市场参与者业务资格被限制;持有可售冻结股份账户禁止市场化转融通证券约定申报出借
20030	约定号重	协议交易成交申报约定号重复
20031	配对失败	交易双方申报要素不匹配
20032	配对失败	B 股协议交易境内账户和境外账户不能成交
20033	无对手方	协议交易点击成交申报约定号错误,未找到对应的定价申报
20034	金额非法	委托中的金额必须为金额单位的整数倍
20035	申购不足	申购 ETF 时投资者成份股不足
20036	赎回不足	赎回 ETF 时基金公司成份股不足
20037	现金超限	现金替代部分超过上限
20038	无效账户	合约账户标识码与申报交易单元对应的结算账号不一致;保证金查询指令中的结算账号与交易单元不匹配或交易单元无对应结算账号
20039	重复申报	网上发行重复认购;询价重复或报价重复
20040	无效单元	非证券金融公司专用交易单元申报借入委托;证券金融公司专用交易单元申报出借委托;非金交所专用交易单元申报委托;
20041	股份卖空	解押业务中对应的已质押股份不足
20042	股份卖空	解押业务中对应的标准券不足
20046	无法成交	市价委托不满足成交条件撤单
20047	规模超限	基金累计申购或赎回总规模超限;质押式报价回购总规模超限;国际市场互联额度不可用
20048	规模超限	单个账户基金累计申购或赎回规模超限
20049	规模超限	基金净申购或净赎回总规模超限
20050	规模超限	单个账户基金净申购或净赎回规模超限
20051	购回期限错误	回购天数超过业务限制
20055	无效会员	会员无对应业务的交易权限
20056	无效账户	非业务指定交易的证券账户
20059	金额超限	当日净买入金额超出设定限额
20060	仓位不足	期权平仓检查时,可平数量不足;质押式报价回购提前购回时,申报数量大于未到期合约数

		量；期权构建组合申报时，成份合约单腿持仓不足；期权解除组合或组合策略单边平仓时，组合策略持仓不足或申报的组合流水号对应的持仓不存在
20061	交易量超限	超过投资者交易量限额
20062	持仓超限	超过结算参与者持仓限额
20063	持仓超限	超过投资者持仓限额
20064	资金不足	结算参与者可用资金不足
20065	平台已关闭	平台已关闭
20067	备兑标签错	备兑标签错误，只有卖开认购合约或买平认购合约时备兑标签可以为备兑
20068	结算机构错	结算机构代码错误
20069	无效账户	委托中的账户为结算受限账户
20070	无效账户	委托中的账户为不合格账户
20071	OwnerType 错误	强平主动撤单的 OwnerType 必须与原委托的一致
20073	报价错误	双边报价申报的买价必须低于卖价
20074	无效业务	强平委托必须是限价委托
20075	报价撤销	报价被更新或撤销
20076	申报方式错误	竞价委托申报方式错误，TimeInForce、OrdType、MaxPriceLevels、MinQty 字段的组合不合法
20077	无报价权限	无做市报价权限
20078	交易量超限	超过结算参与者交易量限额
20079	减持额度不足	受限股份减持，可用额度不足
20095	撤单请求错误	主动撤单请求的 applid 或证券 id 与原委托的不一致
20096	无法撤销	主动撤单请求目标委托不能被撤销
20097	委托不存在	主动撤单未找到原始委托或者没有可以被撤销的报价
20099	重单	重单
20101	应用标识错	应用标识错误
20102	证券非法	证券不支持所申报的业务
20103	解包失败	解包失败

20104	平台未开放	平台未开放
20105	交易单元错	网关对交易单元无权限
20106	字段错误	字段取值错误
20107	消息类型非法	不支持的消息类型
20108	平台非法	委托申报的平台错误, 例如向现货集中竞价平台申报发行认购业务的委托
20110	价格类型错	价格类型错误
20111	无效单元	成交申报中的多方交易单元不属于同一会员; 委托中的本方交易单元不属于本方交易商
20112	无权限	网关无申报委托权限
20113	服务暂停	资金查询服务暂停
20114	临时停市拒绝	临时停市拒绝
20115	申报方式错误	成交申报报文 TradeHandlingInstr、TradeReportTransType、TradeReportType 字段组合不合法
20116	申报方式错误	成交请求发起方错误
20117	无效账户	证券账户无三方回购业务的正/逆回购权限
20118	篮子非法	三方回购申报的篮子个数超限; 三方回购交易业务申报的篮子编号不在质押券篮子清单范围内
20119	质押券非法	质押券或交付债券个数不符合业务要求
20120	质押券非法	债券质押式协议回购初始交易、质押券变更的质押券不在协议回购业务允许的质押券范围内; 三方回购初始交易申报的指定质押券不在申报的质押券篮子内; 三方回购补券申报的证券及换券申报的换入证券不在其对应的在途合约指定质押券篮子内
20121	质押券非法	三方回购初始交易、补券、换券(仅换入)申报的指定质押券全天停牌; 债券质押式协议回购、债券借贷业务初始交易、质押券变更委托或债券借贷到期续做委托中的质押券全天停牌; 债券质押式协议回购到期续做时在途合约已质押券全天停牌
20122	质押券非法	三方回购换券申报的换出证券不在其对应的

		在途合约质押券列表中
20123	无效单元	成交申报中的对手方交易单元不存在
20124	回购期限错误	三方回购初始交易指定质押券的到期日小于合约到期日;三方回购到期续做对应应在途合约质押券到期日小于续做合约到期日;债券质押式协议回购初始交易指定质押券的到期日小于合约到期日;债券质押式协议回购到期续做对应应在途合约质押券到期日小于续做合约到期日;债券质押式协议回购质押券变更指定质押券的到期日小于对应应在途合约的到期日
20125	合约不存在	对应合约不存在
20126	业务禁止	协议回购、三方回购的到期购回、到期续做委托对应的在途合约不是当日到期合约;三方回购提前购回、换券、补券对应的在途合约不是未到期合约;协议回购提前购回、质押券变更或债券借贷提前终止、质押券变更对应的在途合约不是未到期合约;债券借贷到期结算、到期续做委托对应的在途合约不是当日到期合约或处在宽限期的合约
20127	业务禁止	委托申报单元、证券账户、交易商代码、交易主体代码、交易主体类型与对应合约不一致
20128	金额非法	三方回购到期续做金额超过原合约金额;三方回购提前购回金额小于原合约金额;三方回购解除质押金额(场内结算)小于原合约金额
20129	证券非法	三方回购入库证券不在质押券篮子清单范围内;期权构建、解除组合或行权指令合并申报时,成份合约标的证券与委托中 SecurityID 不一致
20130	无对手方	成交请求、双边确认成交报告模式下确认方发起的委托未找到发起方申报的委托;点击成交模式或询价成交模式下报价回复委托未找到对应的报价;询价成交模式下报价委托未找到对应的询价请求
20131	业务禁止	协议回购、三方回购、债券借贷在途合约当前

		状态不允许申报该类别委托,比如已对合约申报了到期购回,则不能再次申报到期购回或到期续做
20132	业务禁止	期权构建组合或行权指令合并申报时,合约的标的、合约单位、到期日不符规则
20133	业务禁止	成份合约已过组合自动解除日
20134	业务禁止	合约不支持申报的策略
20135	业务禁止	期权构建组合或行权指令合并申报时,委托成份合约个数不符规则
20136	数量非法	委托成份合约数量不符规则
20137	业务禁止	委托成份合约权利仓/义务仓不符规则
20138	业务禁止	期权构建组合或行权指令合并申报时,委托成份合约认购/认沽不符规则
20139	业务禁止	期权构建组合或行权指令合并申报时,委托成份合约行权价不符规则
20140	业务禁止	解除组合,申报的组合流水号对应组合策略持仓的参与人信息与委托中的不一致
20143	无效交易主体	交易商或对手方交易商未报备申报的交易主体代码、交易主体类型;对手方交易商未报备接收转发消息的交易单元
20144	无效交易员	交易商未报备申报的交易员代码
20145	无效账户	证券账户在交易商已报备的交易主体账户列表中不存在
20146	订单已超时	订单已超时
20147	询价交易 ID 重复	询价请求 QuoteReqID、报价 QuoteID、报价回复 QuoteRespID 重复
20149	无效账户	债券转让业务回售转售中,卖委托的证券账户非回售转售专用账户
20150	结算方式错误	结算方式错误
20151	结算周期错误	结算周期错误
20153	借贷期限错	债券借贷初始交易、到期续做标的券的到期日小于合约的到期日
20154	借贷费用场内支付金额错	借贷费用场内支付金额大于借贷费用金额

20155	申报宽限期错	申报宽限期不符合规则
20156	业务禁止	标的券非法
20157	业务禁止	换出质押券不足
20158	业务禁止	债券借贷在途合约不允许申报解除质押
20159	标的券非法	债券借贷初始交易、到期续做的标的券不在允许的标的券范围内；债券借贷提前终止、到期结算已摘牌标的证券不能指定数量
20160	标的券非法	债券借贷初始交易、到期续做的标的券全天停牌
20161	券面总额非法	标的证券券面总额不符合规则
20162	券面总额非法	质押券券面总额不符合规则
20164	竞买日期错误	竞买预约日期超过业务限制
20165	重复申报	同一证券账户在同一个竞买日对于同一证券代码存在多笔有效竞买预约申报；
20166	无法成交	竞买发起或应价申报不满足成交条件
20167	证券临时停牌	证券发生过临时停牌
20168	竞买不存在	竞买发起申报找不到对应的有效竞买预约申报；竞买应价申报找不到对应的有效竞买发起申报
20169	价格错误	单一主体竞买应价申报委托价格低于或等于当前委托簿中应价申报的委托价格
20170	竞买预约已生效	竞买预约已申报了竞买发起
20172	响应方交易商错	响应方交易商未报备接收转发消息的交易单元
20173	业务禁止	合并申报发起方无权限
20174	原成交不存在	交易解除时找不到待解除的成交
20175	原成交状态错	待解除成交的状态当前已发起交易解除请求或已解除交易
20176	成交要素匹配失败	交易解除委托要素与待解除成交的成交要素不匹配
20177	港股通限制交易	标的属于港股通限制交易证券清单

20178	业务禁止	本方不支持此申报
20179	业务禁止	对手方不支持此申报
20180	无效会员	会员无对应产品的业务权限
20201	议案代码错	议案号和子议案号错误
20202	表决意见错	投票意向错误;投票数量应为大于等于0的整数
29995	市场互联拒绝	港股通撤单请求被联交所拒绝,具体拒绝原因代码见 RejectText
29996	市场互联拒绝	港股通委托被联交所自动撤销,具体撤销原因代码见 RejectText,撤销原因说明见 IMCRejectText
29997	市场互联拒绝	港股通委托被联交所拒绝,具体拒绝原因代码见 RejectText,拒绝原因说明见 IMCRejectText
29998	市场互联拒绝	港股通委托被联交所拒绝,具体拒绝原因代码见 RejectText,拒绝原因说明见 IMCRejectText
29999	其他错误	

注:OMS申报一笔委托后,如果收到拒绝原因为20104(平台未开放)的业务拒绝消息(Business Reject),则必须在平台恢复开放后尝试重新申报该委托。

三、联交所拒绝原因代码

以下为联交所的拒绝原因代码说明,摘自联交所数据接口规范《HKEx_OCG_FIX_Trading_Interface_Specifications_v1_2.pdf》,后续联交所接口规范中的拒绝原因代码发生变化时,本接口规范不保证及时同步更新。

联交所拒绝原因代码表

深交所拒绝原因代码	联交所拒绝原因代码
29998 港股通新订单被联交所拒绝 (ExecType=8)	3 = Order exceeds Limit 6 = Duplicate order (e.g., dupe ClOrdID) 13 = Incorrect quantity 16 = Price exceeds current price band 19 = Reference price is not available 20 = Notional value exceeds threshold 99 = Other 101 = Price exceeds current price band

	(override not allowed) 102 = Price exceeds current price band
29997 港股通新订单被联交所拒绝 (ExecType=8)	0 = Other 1 = Unknown ID 2 = Unknown Security 3 = Unspecified Message Type 4 = Application not available 5 = Conditionally required field missing 8 = Throttle limit exceeded
29996 港股通新订单被联交所自动撤销 (ExecType=4)	6 = Cancel on Trading Halt 8 = Market Operation 100 = Unsolicited Cancel for original order (for cancel/replace operation which fails market validation) 103 = Mass cancelled by Broker 104 = Cancel On Disconnect 105 = Cancel due to Broker suspension 106 = Cancel due to Exchange Participant suspension 107 = System Cancel
29995 港股通撤单请求被联交所拒绝	0 = Too late to cancel 1 = Unknown order 3 = Order already in Pending Cancel or Pending Replace status 6 = Duplicate ClOrdID (11) received 8 = Price exceeds current price band 99 = Other (default) 100 = Reference price is not available 101 = Price exceeds current price band (override not allowed) 102 = Price exceeds current price band 103 = Notional value exceeds threshold