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**

**（业务汇总）**

**（1.39版）**

**上海证券交易所**

**二○一七年二月**

**《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 8](#_Toc408003692)

[2 大宗交易业务消息规范 13](#_Toc408003693)

[2.1 大宗交易STEP消息流程图 13](#_Toc408003694)

[2.2 公共数据消息 14](#_Toc408003695)

[2.3 意向申报消息/意向申报撤单消息 15](#_Toc408003696)

[2.4 意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息 16](#_Toc408003697)

[2.5 成交申报消息 17](#_Toc408003698)

[2.6 申报撤单消息 18](#_Toc408003699)

[2.7 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 19](#_Toc408003700)

[2.8 申报撤单失败响应消息 20](#_Toc408003701)

[2.9 执行报告消息 21](#_Toc408003702)

[2.10 过户数据接口dghXXXXXYYYYMMDD.dbf 22](#_Toc408003703)

[2.11 固定价格交易STEP消息流程图 23](#_Toc408003704)

[2.12 固定价格交易申报消息 24](#_Toc408003705)

[2.13 固定价格交易申报撤单消息 25](#_Toc408003706)

[2.14 固定价格交易申报响应消息/申报撤单成功响应消息 25](#_Toc408003707)

[2.15 固定价格交易申报撤单失败响应消息 25](#_Toc408003708)

[2.16 固定价格交易执行报告消息 25](#_Toc408003709)

[3 跨境ETF/黄金ETF/交易型货币市场基金申赎业务消息规范 26](#_Toc408003710)

[3.1 跨境ETF/黄金ETF/交易型货币市场基金申赎STEP消息流程图 26](#_Toc408003711)

[3.2 申报消息 26](#_Toc408003712)

[3.3 申报响应消息 27](#_Toc408003713)

[3.4 执行报告消息 27](#_Toc408003714)

[4 货币市场基金实时申赎业务消息规范 30](#_Toc408003715)

[4.1 货币市场基金实时申赎STEP消息流程图 30](#_Toc408003716)

[4.2 申报消息 30](#_Toc408003717)

[4.3 申报响应消息 31](#_Toc408003718)

[4.4 执行报告消息 31](#_Toc408003719)

[5 报价回购及约定购回业务消息规范 34](#_Toc408003720)

[5.1 报价回购及约定购回STEP消息流程图 34](#_Toc408003721)

[5.2 申报消息 34](#_Toc408003722)

[5.2.1 报价回购交易申报 35](#_Toc408003723)

[5.2.2 约定购回交易申报 36](#_Toc408003724)

[5.2.3 出入库非交易申报 38](#_Toc408003725)

[5.3 申报撤单消息 39](#_Toc408003726)

[5.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 39](#_Toc408003727)

[5.5 申报撤单失败响应消息 39](#_Toc408003728)

[6 转融通业务消息规范 40](#_Toc408003729)

[6.1 消息流程图 40](#_Toc408003730)

[6.2 申报消息 40](#_Toc408003731)

[6.3 申报撤单消息 42](#_Toc408003732)

[6.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 42](#_Toc408003733)

[6.5 申报撤单失败响应消息 42](#_Toc408003734)

[6.6 执行报告消息 42](#_Toc408003735)

[6.7 公共数据消息 44](#_Toc408003736)

[6.8 转融通标的证券清单zrtbdMMDD.txt 45](#_Toc408003737)

[7 股票质押回购业务消息规范 46](#_Toc408003738)

[7.1 股票质押回购STEP消息流程图 46](#_Toc408003739)

[7.2 申报消息 46](#_Toc408003740)

[7.2.1 初始交易申报 49](#_Toc408003741)

[7.2.2 补充质押申报 50](#_Toc408003742)

[7.2.3 购回交易和终止购回申报 51](#_Toc408003743)

[7.2.4 部分解除质押和违约处置申请申报 52](#_Toc408003744)

[7.3 申报撤单消息 53](#_Toc408003745)

[7.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 54](#_Toc408003746)

[7.5 申报撤单失败响应消息 54](#_Toc408003747)

[8 撮合业务消息规范（国债预发行） 55](#_Toc408003748)

[8.1 撮合业务STEP消息流程图 55](#_Toc408003749)

[8.2 申报消息 55](#_Toc408003750)

[8.3 申报撤单消息 57](#_Toc408003751)

[8.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 57](#_Toc408003752)

[8.5 申报撤单失败响应消息 58](#_Toc408003753)

[8.6 执行报告消息 58](#_Toc408003754)

[9 上证LOF业务消息规范 61](#_Toc408003755)

[9.1 上证LOF STEP消息流程图 61](#_Toc408003756)

[9.2 申报消息 61](#_Toc408003757)

[9.2.1 认购申报 62](#_Toc408003758)

[9.2.2 申赎申报 62](#_Toc408003759)

[9.2.3 转托管\分拆\合并申报 63](#_Toc408003760)

[9.3 申报撤单消息 64](#_Toc408003761)

[9.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 65](#_Toc408003762)

[9.5 申报撤单失败响应消息 65](#_Toc408003763)

[9.6 执行报告消息 65](#_Toc408003764)

[9.7 基金业务参数公告文件sfpm01MMDD.txt 66](#_Toc408003765)

[10 网络投票业务消息规范 70](#_Toc408003766)

[10.1 网络投票业务STEP消息流程图 70](#_Toc408003767)

[10.2 申报消息 70](#_Toc408003768)

[10.3 申报响应消息 71](#_Toc408003769)

[10.4 投票议案公告文件vtlsMMDD.xml 72](#_Toc408003770)

[11 行情文件接口mktdt01.txt 81](#_Toc408003771)

[11.1 结构描述 82](#_Toc408003772)

[11.2 格式定义 82](#_Toc408003773)

[12 过户数据接口bghXXXXX.dbf 87](#_Toc408003774)

[13 后记 91](#_Toc408003775)

# 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）

**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）

**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 |

**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

**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。

# 大宗交易业务消息规范

## 大宗交易STEP消息流程图

在发起方登录时，客户端将收到全市场的意向申报信息（即公共数据），之后只发新增的公共数据。根据大宗交易的操作流程，发起方可以进行意向报价发布，成交申报发布，以及相应的撤单等操作，下图描述了大宗交易的STEP消息通信流程。



## 公共数据消息

| IOI（mdtext） | **公共数据消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  公共数据表中的mdtext字段数据。  本消息用来发送市场有效时段内的所有的意向申报（包括已成交和撤单的，具体由申报单状态确定），向市场参与者发送。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | | MsgType取值为：6=意向申报 |  |
| 23 | IOIID | | 会员内部编号。 | C10 |
| 28 | IOITransType | | 意向报单类型，取值为：N=意向申报, C=意向申报撤单 | C1 |
| 26 | IOIRefID | | 撤单编号，对于意向申报该字段取值为空，若为撤单则为被撤原订单的会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 44 | Price | | 价格 | N11(3) |
| 38 | OrderQty | | 数量 | N10 |
| 54 | Side | | 买卖方向，取值有：  1表示买  2表示卖 | C1 |
| 453 | NoPartyIDs | | 后接重复组，包含发起方的申报交易单元号，取1 | N2 |
| 发起方交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方业务PBU代码，填写5位交易单元号。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方交易单元号。 | N4 |
| 58 | Text | | 备注，通常填写联系方式 | C50 |

## 意向申报消息/意向申报撤单消息

| **IOI (reqtext)** | **意向申报消息/意向申报撤单消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求及响应接口表中的reqtext字段数据。  市场参与者使用IOI消息进行意向申报或撤单。  需要注意的是，综合业务平台采用原始意向申报的会员内部编号和业务交易单元号作为撤单索引字段。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | | MsgType取值为：6=意向申报或意向申报撤单 |  |
| 23 | IOIID | | 会员内部编号，指意向申报或意向申报撤单会员内部编号。 | C10 |
| 28 | IOITransType | | 意向报单类型，取值为：N=意向申报, C=意向申报撤单 | C1 |
| 26 | IOIRefID | | 撤单编号，对于意向申报该字段取值为空，若为撤单则为被撤原订单的会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 44 | Price | | 价格 | N11(3) |
| 38 | OrderQty | | 数量 | N10 |
| 54 | Side | | 买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖。 | 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、结算代码，取值为具体包含的字段数量。取值4 | N2 |
| 发起方投资者账户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户。 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方业务PBU代码，填写5位交易单元号，对于意向申报撤单，应为原始意向申报的业务PBU代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方交易单元号。 | N4 |
| 发起方营业部代码 | 448 | PartyID | 发起方营业部代码 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为发起方的营业部代码。 | N4 |
| 发起方结算代码 | 448 | PartyID | 发起方结算代码，用于B股，若无填空。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4，表示当前PartyID的取值为发起方结算代码。 | N4 |
| 58 | Text | | 备注，通常填写联系方式 | C50 |

## 意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息

| **QuoteResponse (resptext)** | **意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求及响应接口表中的resptext字段数据。  每一个意向申报记录或意向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。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为：AJ=意向申报响应或意向申报撤单响应。 |  |
| 693 | QuoteRespID | 交易所意向申报响应记录标识，上交所内部使用。 | C16 |
| 694 | QuoteRespType | 取值：  2=意向申报响应或意向申报撤单响应，用于未来扩展。 | N1 |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | C6 |
| 23 | IOIID | 会员内部编号，该字段对应意向申报消息/意向撤单消息中的IOIID。 | C10 |
| 60 | TransactTime | 接受请求时间，格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 | C21 |
| 150 | ExecType | 当前订单执行状态，取值有：  0=意向申报成功响应，8=拒绝响应，6=意向申报撤单成功响应。 | C1 |
| 102 | CxlRejReason | 意向申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。  撤消成功时，该字段取值为空。  撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同Remark字段。 | C5 |
| 103 | OrdRejReason | 意向申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。  意向申报成功时，该字段取值为空  意向申报失败时，表示拒绝的理由，取值同Remark字段。 | C5 |

## 成交申报消息

| **NewOrderSingle (reqtext)** | **成交申报消息** |
| --- | --- |
| **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消息进行成交申报。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | | MsgType取值为： D=成交申报 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号，指成交申报会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 44 | Price | | 价格 | 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 |
| 664 | ConfirmID | | 约定号 | C6 |
| 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、结算代码，以及对手方PBU, 取值为5。 | N2 |
| 发起方投资者账户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方业务PBU代码，填写5位交易单元号，对于成交申报撤单，应为原始成交申报的业务PBU代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为PBU | N4 |
| 发起方营业部代码 | 448 | PartyID | 发起方营业部代码 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为发起方的营业部代码 | N4 |
| 发起方结算代码 | 448 | PartyID | 发起方结算代码 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4，表示当前PartyID的取值为发起方结算代码 | N4 |
| 对手方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 对手方业务PBU代码，填写5位交易单元号 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为对手方交易单元号 | N4 |
| 58 | Text | | 备注，通常填写联系方式 | C50 |

## 申报撤单消息

| **OrderCancel Request (reqtext)** | **申报撤单消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求及响应接口表中的reqtext字段数据。  市场参与者使用OrderCancel Request消息进行申报撤单  需要注意的是，为简化会员公司备份切换动作，综合业务平台采用原始申报的会员内部编号和业务交易单元号作为撤单索引字段。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | | MsgType取值为： F=申报撤单 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号，指申报会员内部编号。 | C10 |
| 41 | OrigClOrdID | | 原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的ClOrdID | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 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 |
| 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 |
| 发起方投资者帐户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方业务PBU代码，填写5位交易单元号，对于成交申报撤单，应为原始成交申报的业务PBU代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为PBU | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

## 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 |

## 申报撤单失败响应消息

| **OrderCancelReject (resptext)** | **申报撤单失败响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求及响应接口表中的resptext字段数据。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
|  | 标准消息头 | MsgType取值为： 9=申报撤消失败响应。 |  |
| 37 | OrderID | 交易所订单编号 | C16 |
| 39 | OrdStatus | 当前订单状态，取值有：  8=拒绝响应 | C1 |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 |
| 41 | OrigClOrdID | 原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的ClOrdID | C10 |
| 60 | TransactTime | 接受请求时间，格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 | C21 |
| 102 | CxlRejReason | 撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同Remark字段。 | C5 |
| 434 | CxlRejResponseTo | 撤单响应类型，取值：  1=撤单响应 | C1 |

## 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。  每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息。 | |

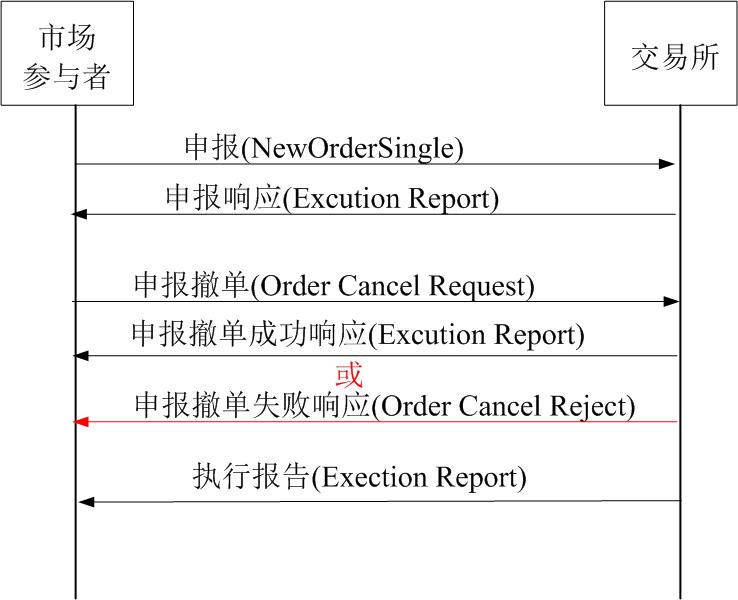
|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 标准消息头 | | MsgType取值为：8=成交回报 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号 | C10 |
| 37 | OrderID | | 交易所订单编号 | C16 |
| 17 | ExecID | | 成交编号 | C16 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 31 | LastPx | | 价格 | N11(3) |
| 32 | LastQty | | 该笔成交数量 | N12 |
| 8504 | TotalValueTraded | | 成交金额 | N16(3) |
| 151 | LeavesQty | | 本次剩余余额 | 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,格式为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，对手方的投资者账户、交易单元号，取值为4。 | N2 |
| 发起方投资者帐户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方业务PBU代码，填写5位交易单元号 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号 | N4 |
| 对手方投资者帐户 | 448 | PartyID | 对手方投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为对手方投资者帐户 | N4 |
| 对手方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 对手方业务PBU代码，填写5位交易单元号 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为对手方申报交易单元号 | N4 |

## 过户数据接口dghXXXXXYYYYMMDD.dbf

| **dghXXXXXYYYYMMDD.dbf** | **过户数据接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  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的字段，均填写对应订单输入时的原始信息。  过户数据接口dghXXXXXYYYYMMDD.dbf压缩到dghXXXXX.zip文件中供券商用RptGet下载，YYYYMMDD为日期格式。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 字段名 | 说明 | 备注 | 类型 |
| 1 | GDDM | 股东代码 | 字符串 | C10 |
| 2 | GDXM | 股东姓名 | 不用，该字段置为空格 | C8 |
| 3 | BCRQ | 本次日期 | 成交日期，格式为YYYYMMDD | C8 |
| 4 | CJBH | 成交编号 | 整数（目前本业务有效位用到8位，后期将逐步扩展位数，注意做好相关技术准备工作） | N16 |
| 5 | GSDM | 公司代码 | 业务PBU | C5 |
| 6 | CJSL | 成交数量 | 不以正负标识买卖 | N10 |
| 7 | BCYE | 本次余额 | 过户后的持股余额 | N10 |
| 8 | ZQDM | 证券代码 |  | C6 |
| 9 | SBSJ | 申报时间 | 格式为HHMMSS | C6 |
| 10 | CJSJ | 成交时间 | 格式为HHMMSS | C6 |
| 11 | CJJG | 成交价格 |  | N8(3) |
| 12 | CJJE | 成交金额 |  | N15(2) |
| 13 | SQBH | 申请编号 | 会员内部订单号，同申报接口中的reff | C10 |
| 14 | BS | 买卖标志 | B=买入，S=卖出 | C1 |
| 15 | MJBH | 操作员代码 |  | C5 |

## 固定价格交易STEP消息流程图



## 固定价格交易申报消息

| **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消息进行买卖申报。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |
| 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：  A =基于当日收盘价（On Close，根据2013版交易规则，当日无成交以前收盘价为当日收盘价）。 | 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、结算代码, 取值为4。 | 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 |
| 结算代码 | | 448 | PartyID | 结算代码 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4，表示当前PartyID的取值为结算代码 | N4 |
| 58 | Text | | | 备注 | C50 |

## 固定价格交易申报撤单消息

| **OrderCancel Request (reqtext)** | **申报撤单消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报撤单消息，  其中订单数量，不做校验 | |

## 固定价格交易申报响应消息/申报撤单成功响应消息

| **ExecutionReport (resptext)** | **申报响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。 | |

## 固定价格交易申报撤单失败响应消息

| **OrderCancelReject (resptext)** | **申报撤单失败响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报撤单失败响应消息。 | |

## 固定价格交易执行报告消息

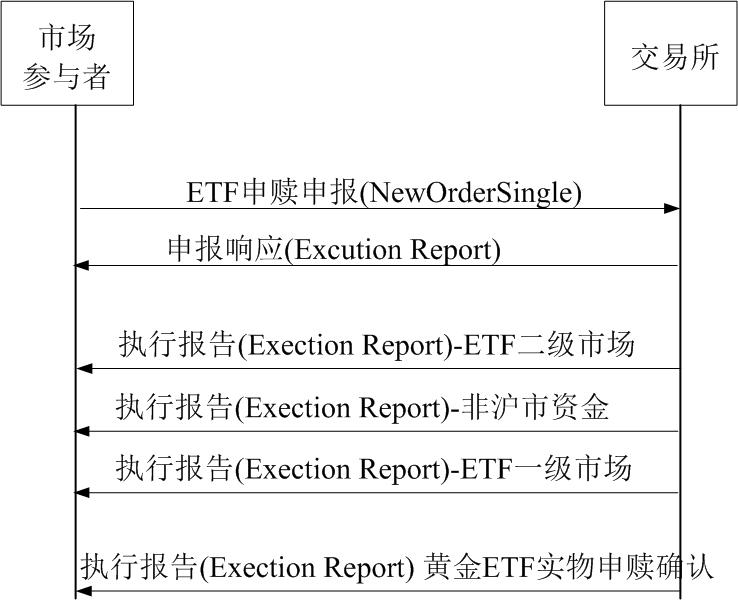
| **ExecutionReport (execreporttext)** | **实时执行报告消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务执行报告消息。  其中，对手方投资者账户、对手方业务PBU代码无意义，填空格。 | |

# 跨境ETF/黄金ETF/交易型货币市场基金申赎业务消息规范

## 跨境ETF/黄金ETF/交易型货币市场基金申赎STEP消息流程图

根据跨境ETF/交易型货币市场基金申赎流程，市场投资者可以通过EzSTEP进行申赎申报，交易所实时反馈申报确认，并实时反馈各类成交回报（即执行报告），黄金ETF现金申赎流程与上述业务相同，黄金ETF实物申赎不通过EzSTEP申报，但通过EzSTEP向基金公司发送实物申赎确认执行报告，向市场发送实物申赎份额增减执行报告。

下图描述了申赎的STEP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消息进行申赎申报。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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，指成交申报会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码，二级市场交易证券代码 | C6 |
| 44 | Price | | 价格，填写1.000，单位元，无实际意义。 | N11(3) |
| 38 | OrderQty | | 申赎份额数量 | N10 |
| 54 | Side | | 买卖方向，取值有：  1表示买，对应申购  2表示卖，对应赎回 | 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 |

## 申报响应消息

| **ExecutionReport (resptext)** | **申报响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。 | |

## 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。  对于跨境ETF/黄金ETF现金/交易型货币市场基金申赎申报，执行报告（即成交回报）有三笔消息记录：   * 一条ETF二级市场交易代码成交记录，证券代码为二级市场交易代码，价格为0，数量为申赎数量，金额为现金替代总额。（*注：申赎第一条执行报告新增包含后2条执行报告的数量和金额信息，为未来该类业务执行报告整合成一条做准备*） * 一条非沪市资金代码成交记录，证券代码为非沪市资金代码，价格和数量均为0，成交金额为现金替代总额。现金替代总额计算方法为：先将每个成份股的替代金额加减对应溢价后四舍五入到小数点后三位，然后将各个股票的现金替代额相加，结果四舍五入到小数点后两位。得到每个篮子对应的现金替代额。对于每笔申购或赎回，则根据篮子数×每个篮子对应的现金替代额，得到该笔订单对应的现金替代总额。 * 一条ETF一级市场申赎代码成交记录，证券代码为一级市场申赎代码，价格为0，数量为申购/赎回数量，成交金额为0。   基金公司作为对手方收到对应的成交数据。  对于黄金ETF实物申赎执行报告，用于向基金公司发送实物申赎确认执行报告，向市场发送实物申赎份额增减执行报告。实物申赎执行报告为一条ETF二级市场交易代码成交记录，ExecType取值为J，会员内部编号无意义可取空格，价格、金额无意义可取0，成交数量为实物申赎份额数量，对市场投资者而言，买申购表示份额计增，卖赎回表示份额计减。基金公司买卖方向与投资者相反。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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，  对于基金公司，跨境ETF申赎/黄金ETF现金申赎和交易型货币市场基金申赎填写对手方投资者账户 | 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 |
| 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 | 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，对应申购  2表示卖，对应赎回  基金公司作为对手方买卖方向与投资者相反。 | 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  J=在清算中心的交易，表示黄金ETF实物申赎确认 | 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 |

# 货币市场基金实时申赎业务消息规范

本业务消息用于支持汇添富收益快线模式货币市场基金实时申赎（即：货币市场基金场内实时申赎）。

## 货币市场基金实时申赎STEP消息流程图

根据货币市场基金实时申赎流程（汇添富收益快线模式），市场投资者可以进行货币市场基金申赎申报，交易所实时反馈申报确认，下图描述了货币市场基金实时申赎的STEP消息通信流程。



## 申报消息

| **NewOrderSingle (reqtext)** | **成交申报消息** |
| --- | --- |
| **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消息进行申赎申报。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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，指成交申报会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 44 | Price | | 价格，填写0.010，单位元，本业务申赎申报每份单位为0.010元。 | N11(3) |
| 38 | OrderQty | | 申赎数量，本字段允许最大长度暂为11位 | N12 |
| 54 | Side | | 买卖方向，取值有：  1表示买，对应申购  2表示卖，对应赎回 | 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 | | 如为E账户申报，左对齐填写单个数字字母  ’1’：投资者发起的E帐户申购，表示担保品买入。  ’2’：投资者发起的E帐户赎回，表示担保品卖出。  ’8’：会员代投资者发起的E帐户赎回，表示强平卖出。 | C50 |

## 申报响应消息

| **ExecutionReport (resptext)** | **申报响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。不支持撤单，无撤单响应。 | |

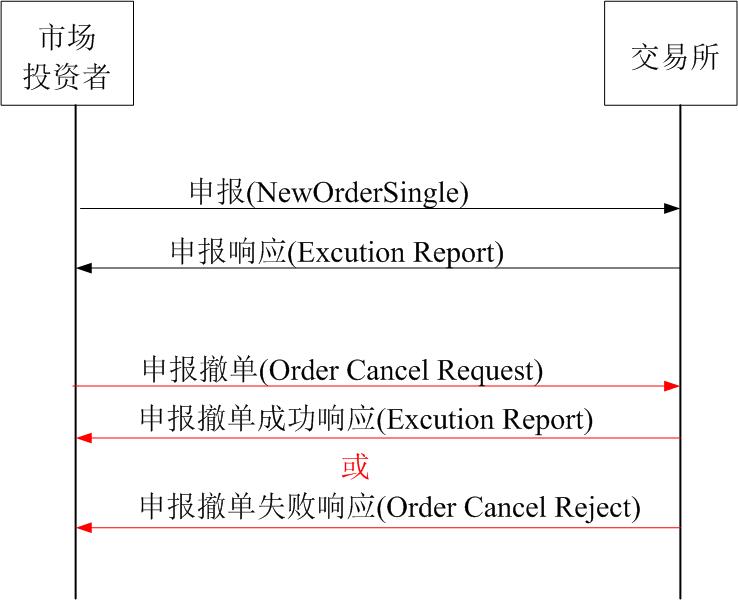
## 执行报告消息

| **ExecutionReport (execreporttext)** | **实时执行报告消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  执行报告表中的execreporttext字段数据。  本执行报告数据仅向基金公司转发，将市场有效的申赎执行报告通过消息文本**execreporttext**域转发送给基金公司，每笔申赎申报对应一条执行报告，消息格式与内容前部份同跨境ETF二级市场交易代码成交记录，但在尾部增加了一个备注域，证券代码为二级市场交易代码，数量为申购/赎回数量，成交金额为实际成交金额。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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，  对于基金公司，填写对手方投资者账户 | C10 |
| 37 | OrderID | | 交易所订单编号 | C16 |
| 17 | ExecID | | 成交编号 | C16 |
| 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 | 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，对应申购  2表示卖，对应赎回  基金公司作为对手方买卖方向与投资者相反。 | 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 | | 扩展备注，可用于填写市场参与者营业部代码 | C50 |

# 报价回购及约定购回业务消息规范

## 报价回购及约定购回STEP消息流程图



## 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消息进行申报。分别定义了报价回购交易申报消息（支持QNE、QCA），约定购回交易申报消息（支持RNE、RNR），报价回购出入库非交易申报消息（支持QBD、QBW）。  申报消息字段中，无意义的字段可参考EzSTEP通用数据库接口规格说明中STEP消息约定取空，即字符型字段值为空，则采用“标签= <SOH>”的方式表示（等号后与分隔符间有一个空格），如数字型字段值为空，采用缺省取值0。 | |

### 报价回购交易申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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  对于报价回购业务，报价回购申报和提前购回申报代码为205\*\*\*。 | C6 |
| 44 | Price | | 价格，单位为元。  对于报价回购交易申报价格为“每百元资金到期年收益”。 | N11(3) |
| 640 | Price2 | | 购回价格，单位为元。  对于报价回购业务，为提前购回价格，即“每百元资金提前终止年收益”。 | N11(3) |
| 38 | OrderQty | | 订单数量  对于报价回购业务，报价回购交易的单位为手（1000元面值为一手）。报价回购交易最低为50手，超出部分为1手的整数倍。 | N10 |
| 1080 | RefOrderID | | 交易所订单编号参考值。  对于报价回购业务提前购回订单，需填写拟提前购回的回购订单交易所订单编号（OrderID），对报价回购其他业务无意义。 | C16 |
| 1125 | OrigTradeDate | | 初始交易日期。  对于报价回购业务提前购回订单，需填写为原回购订单的成交日期，对报价回购其他业务无意义。 | C8 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码, 取值为6。 | N2 |
| 买方投资者账户 | 448 | PartyID | 买方投资者帐户编码。  对于报价回购，为报价回购资格的券商账户； | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为买方投资者帐户 | N4 |
| 买方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 买方业务PBU（5位数字），作为买方证券账户对应的业务PBU，用于申报、撤单订单。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为买方业务PBU。 | N4 |
| 买方营业部代码 | 448 | PartyID | 买方营业部代码，位数不足则以0左补齐5位。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为买方的营业部代码 | N4 |
| 卖方投资者账户 | 448 | PartyID | 卖方投资者帐户。  对于报价回购，为合格投资者证券帐户； | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为卖方投资者帐户 | N4 |
| 卖方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 卖方业务PBU（5位数字），作为卖方证券账户对应的业务PBU，用于申报、撤单订单。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为卖方交易单元号 | N4 |
| 卖方营业部代码 | 448 | PartyID | 卖方营业部代码，位数不足则以0左补齐5位。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4002，表示当前PartyID的取值为卖方的营业部代码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

### 约定购回交易申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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  对于约定购回业务，填写标的证券代码。 | C6 |
| 921 | StartCash | | 初始交易金额，单位为元。  对于约定购回业务，为初始交易金额，用于初始交易订单。 | N16(2) |
| 922 | EndCash | | 购回交易金额，单位为元。  对于约定购回业务，为购回交易金额， 用于初始交易和购回交易订单。 | N16(2) |
| 38 | OrderQty | | 订单数量  对于约定购回业务，为标的证券数量，债券单位为手，其他为股或份。 | N10 |
| 1080 | RefOrderID | | 交易所订单编号参考值。  对于约定购回业务初始交易订单无意义；  对于约定购回业务购回交易订单，需填写为初始交易交易所订单编号（OrderID）。 | C16 |
| 1125 | OrigTradeDate | | 初始交易日期。  对于约定购回业务初始交易订单，需填写为购回交易日期；  对于约定购回业务购回交易订单，需填写为初始交易日期。格式为YYYYMMDD | C8 |
| 914 | AgreementID | | 约定购回业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验 | C16 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码, 取值为6。 | N2 |
| 买方投资者账户 | 448 | PartyID | 买方投资者帐户编码。  对于约定购回初始交易，为约定购回专用证券账户；  对于约定购回购回交易，为合格投资者证券帐户。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为买方投资者帐户 | N4 |
| 买方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 买方业务PBU（5位数字），作为买方证券账户对应的业务PBU，用于申报、撤单订单。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为买方业务PBU。 | N4 |
| 买方营业部代码 | 448 | PartyID | 买方营业部代码，位数不足则以0左补齐5位。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为买方的营业部代码 | N4 |
| 卖方投资者账户 | 448 | PartyID | 卖方投资者帐户。  对于约定购回初始交易，为合格投资者证券帐户；  对于约定购回购回交易，为约定购回专用证券账户。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为卖方投资者帐户 | N4 |
| 卖方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 卖方业务PBU（5位数字），作为卖方证券账户对应的业务PBU，用于申报、撤单订单。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为卖方交易单元号 | N4 |
| 卖方营业部代码 | 448 | PartyID | 卖方营业部代码，位数不足则以0左补齐5位。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4002，表示当前PartyID的取值为卖方的营业部代码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

### 出入库非交易申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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  报价回购出入库填写现券代码。 | C6 |
| 38 | OrderQty | | 数量  债券出入库申报数量的单位为手（1000元面值为一手）。  股票、基金出入库申报数量的单位分别为股和份。 | N10 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含账户、PBU、营业部代码, 取值为3。 | N2 |
| 证券账户 | 448 | PartyID | 对于报价出入库，填自营证券账户。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为证券帐户 | N4 |
| 申报交易单元号 | 448 | PartyID | 业务PBU（5位数字）。  对于报价出入库记，填自营证券账户PBU。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为业务PBU。 | N4 |
| 营业部代码 | 448 | PartyID | 营业部代码，位数不足则以0左补齐5位。 | 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：**  同大宗业务申报撤单消息，  其中的买卖方向无意义，建议报价入库填卖，其他填买。  其中因交易申报中含买卖2个参与方，约定报价回购交易及约定购回交易填买方参与方。 | |

## 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：**  同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。  其中交易所订单编号，报价回购及约定购回业务可理解为成交编号。 | |

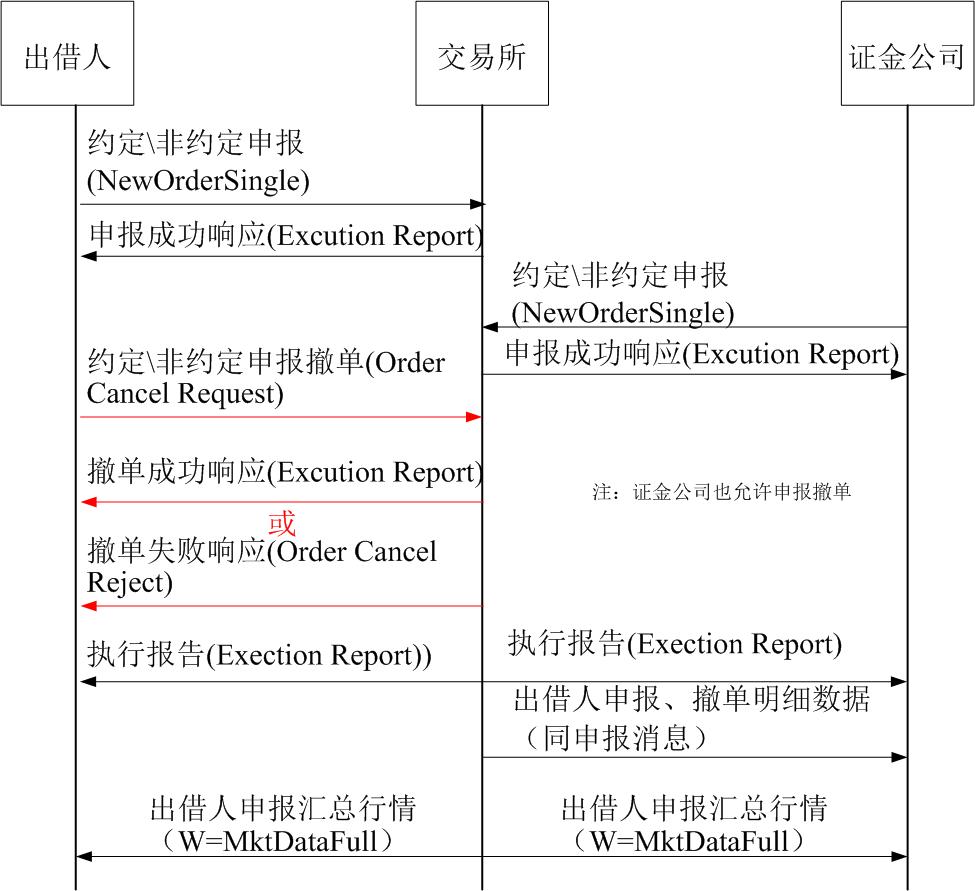
## 申报撤单失败响应消息

| **OrderCancelReject (resptext)** | **申报撤单失败响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报撤单失败响应消息。 | |

# 转融通业务消息规范

本部分描述了市场参与者同上交所综合业务平台之间的接口消息文本格式，对应通用数据库接口表中的各消息文本字段，采用STEP格式封装。

## 消息流程图



## 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消息进行订单申报。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 44 | Price | | 费率，单位为%，小数部份填满 | N11(3) |
| 38 | OrderQty | | 订单数量 | N10 |
| 54 | Side | | 出借方向，取值有：  F = 表示融入  G = 表示融出 | C1 |
| 580 | NoDates | | 期限，单位为天数 | N5 |
| 664 | ConfirmID | | 约定号，双方PBU号与约定号组合全市场唯一，如非约定申报，无意义，取一个空格 | C6 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，填5。 | N2 |
| 发起方投资者账户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户。 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方业务PBU代码，填写5位交易单元号。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方PBU。 | N4 |
| 发起方营业部 | 448 | PartyID | 发起方营业部代码 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为发起方的营业部代码 | N4 |
| 对手方投资者账户 | 448 | PartyID | 对手方投资者帐户，非约定申报无意义，可取一个空格。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为对手方投资者帐户。 | N4 |
| 对手方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 对手方业务PBU代码，填写5位交易单元号，非约定申报无意义，可取一个空格。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示取值为对手方交易单元号 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

## 申报撤单消息

| **OrderCancel Request (reqtext)** | **申报撤单消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报撤单消息，  其中的买卖方向，F = 表示融入，G = 表示融出。 | |

## 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：**  同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。 | |

## 申报撤单失败响应消息

| **OrderCancelReject (resptext)** | **申报撤单失败响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报撤单失败响应消息。 | |

## 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。  每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息，该消息文本由成交回报表中的execreporttext字段包含。  对于证金公司，会将有效的出借人约定和非约定申报明细（含撤单）通过消息文本**execreporttext**域发送，消息格式同出借人申报消息NewOrderSingle和申报撤单消息OrderCancel Request。对于申报消息，备注字段取值为交易所订单号OrderID；对于申报撤单消息，备注字段取值为原始订单的交易所订单号；其中对于非约定申报明细（含撤单），账户和PBU信息填空格。  对于证金公司，执行报告备注域（Text）存放对手方会员内部编号，实时执行报告全部发送完毕后，向证金公司发送一条结束记录，当收到该条特殊记录，且对于每种数据广播类型，记录的产品集序号字段都已连续递增时，表示实时执行报告全部接收完毕。消息文本中备注域取值“ZRT\_RPT\_END”，消息体内其他域取值无意义。  对出借人，备注域无意义为空。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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（执行报告） |  |
| 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 | C16 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 31 | LastPx | | 费率，单位为%，小数部份填满 | N11(3) |
| 32 | LastQty | | 该笔成交数量 | N12 |
| 8504 | TotalValueTraded | | 成交金额，无意义取值0 | N16(3) |
| 151 | LeavesQty | | 本次剩余余额，该字段无意义，可填0 | N12 |
| 54 | Side | | 出借方向，取值有：  F = 表示融入  G = 表示融出 | C1 |
| 580 | NoDates | | 期限，单位为天数 | N5 |
| 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,格式为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，取值为4。 | N2 |
| 发起方投资者帐户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方业务PBU代码，填写5位交易单元号 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为发起方申报交易单元号 | N4 |
| 对手方投资者帐户 | 448 | PartyID | 对手方投资者帐户，对于出借人的执行报告，填空格 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为对手方投资者帐户 | N4 |
| 对手方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 对手方业务PBU代码，填写5位交易单元号，对于出借人的执行报告，填空格 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为对手方申报交易单元号 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

## 公共数据消息

| **MktDataFull (**mdtext**)** | **申报汇总行情** |
| --- | --- |
| **描述：**  公共数据表中的mdtext字段数据。  转融通当日出借人非约定实时申报总量行情及闭市撮合成交后约定和非约定成交总量行情，当日最后一笔申报及成交总量行情发送完毕后，发送一条行情结束记录，行情结束记录消息中备注域（Text）取值“ZRT\_MD\_END”，消息体内其他域取值无意义。当收到该条特殊记录，且对于每种数据广播类型，记录的产品集序号字段都已连续递增时，表示出借人申报汇总行情接收完毕。对于每种数据广播类型，记录的产品集序号字段表示汇总行情消息在主机上产生的先后顺序，市场参与者应优先使用产品集序号大的记录来获取汇总行情。  若某产品在某期限、费率情况下无申报，则无记录。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为： W=MktDataFull（实时申报及成交汇总行情） |  |
| 1180 | ApplID | 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 |
| 55 | Symbol | 证券简称 | C8 |
| 44 | Price | 费率，单位为%，小数部份填满 | N11(3) |
| 271 | MDEntrySize | 申报总量 | N16 |
| 387 | TotalVolumeTraded | 成交总量 | N16 |
| 580 | NoDates | 期限，单位为天数 | N5 |
| 58 | Text | 备注 | C50 |

## 转融通标的证券清单zrtbdMMDD.txt

1. 数据文件名：zrtbdMMDD.txt，该文件为更改证金公司sf001bdzqYYYYMMDD001.txt文件名后转发，MMDD月日格式为标的券信息有效的交易日。

2. 数据内容：当日转融券融入的标的

3. 发送时间： 开市前通过单向卫星发送；

4. 发送周期： 每一交易日；

5. 数据格式： 同本所其他TXT接口文件格式：竖线('|')为字段间分隔符；竖线('|')不应用在每条记录的开头和结尾；各字段均为一个遵循格式定义的字符串。每个字段均为定长字段；每行以二进制0x0A结束；最后一行也以0x0A结束。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | 证券代码 | 证券代码 | C6 |
| 2 | 期限 | 期限 | N5 |
| 3 | 费率 | 费率 | N10(3) |
| 4 | 备用 | 备用 | C40 |

# 股票质押回购业务消息规范

本部分描述股票质押回购业务各类申报、撤单和响应消息规范。

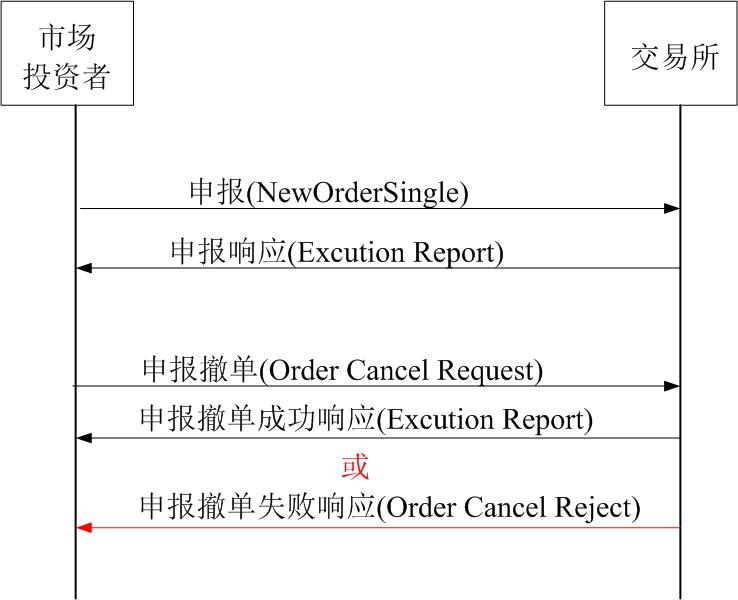
在没有特别申明的情况下，交易所后台一般根据买方（融出方）业务PBU与ClOrdID的组合确定订单（含撤单）的唯一性，因此，数据库接口中PBU字段也对应为用于订单唯一性组合的PBU；

本业务申报均可撤单，撤单依据原始订单申报的买方业务PBU和原始ClOrdID（即OrigClOrdID）进行撤单；

补充质押中双方帐号、双方PBU都必须同初始交易申报订单，购回交易、终止购回、部分解除质押、违约处置中双方帐号、双方PBU都必须同初始交易申报或补充质押；

本业务中OrderID在标准协议中定义为交易所订单编号，在本业务中可理解为成交编号。

## 股票质押回购STEP消息流程图



## 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消息进行申报。分别定义了   1. 初始交易（SPN）申报消息； 2. 补充质押（SPS）申报消息； 3. 购回交易（SPR）和终止购回（SPT）申报消息； 4. 部分解除质押（SPD）和违约处置（SPB）申报消息。   本业务中，**买方为融出方，卖方为融入方**。  申报消息字段中，无意义的字段可参考EzSTEP通用数据库接口规格说明中STEP消息约定取空，即字符型字段值为空，则采用“标签= <SOH>”的方式表示（等号后与分隔符间有一个空格），如数字型字段值为空，采用缺省取值0。  以下转中登标的证券描述标签取值约定，具体参见中登上海分公司登记结算数据接口规范，以下供参考：  填写规则：  1、证券类别字段不为空，填写标的券的证券类别。  2、流通类型字段不为空，填写标的券的流通类型。  3、权益类别左对齐，位数不足的右补空格，若标的券无权益类别，则填两位空格。  4、挂牌年份右对齐，位数不足的左边补0，若标的券无挂牌年份，则填0000（四个零）。  5、上述4要素均应按股东持有表中相应字段取值，若与持有表记录不一致，则日终质押（解除质押）处理失败。  举例：  cid:image002.png@01CE553F.4F366AB0  证券类别（ZQLB）意义如下：  GZ 债券  JJ 基金  PT 普通股  PG 配股  PS 配售股  PZ 权证  GJ 国家股  GF 国有法人股  JN 境内法人股  JW 境外法人股  SF 社会法人股  XL 限售流通股  YX 优先法人股  ZG 职工股  流通类型（LTLX）意义如下：  0 无限售流通  N 非流通  1－9 权益次数  A 未上市  B IPO限售股  F 法人  权益类别（QYLB）意义如下：  DF 兑付  DX 兑息  HL 红利  S 送股  以上关于中登标的证券描述标签取值约定来自中登，本所代为转发，如未来有扩展或进一步了解可咨询中登上海公司。  以下转中登的融资投向取值约定，具体参见中登上海分公司登记结算数据接口规范，以下供参考：  融资投向的代码字典定义如下：  01 生产经营  02 补充流动资金  03 股权性投资  04 债权类投资  05 不动产类投资  06 二级市场证券交易  07 偿还债务  08 个人消费  09 其他  以上取值约定来自中登，本所代为转发，如未来有扩展或进一步了解可咨询中登上海公司。 | |

### 初始交易申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | | 标的证券代码 | C6 |
| 921 | StartCash | | 初始交易金额；单位为元。 | N16(2) |
| 38 | OrderQty | | 订单数量  本业务为标的证券数量 | N10 |
| 541 | MaturityDate | | 购回交易日期。格式YYYYMMDD。 | C8 |
| 75 | TradeDate | | 本订单申报日期。格式YYYYMMDD。 | C8 |
| 914 | AgreementID | | 业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验 | C16 |
| 107 | SecurityDesc | | 转发中登的标的证券描述标签，从左至右依次为：  证券类别、证券流通类型、证券权益类别、证券挂牌年份，详见申报消息描述。 | C9 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码, 取值为6。 | N2 |
| 买方投资者账户 | 448 | PartyID | 买方投资者帐户编码。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为买方投资者帐户 | N4 |
| 买方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 买方业务PBU（5位数字）。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为买方业务PBU。 | N4 |
| 买方营业部代码 | 448 | PartyID | 买方营业部代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为买方营业部代码 | N4 |
| 卖方投资者账户 | 448 | PartyID | 卖方投资者帐户。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为卖方投资者帐户 | N4 |
| 卖方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 卖方业务PBU（5位数字） | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为卖方交易单元号 | N4 |
| 卖方营业部代码 | 448 | PartyID | 卖方营业部代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4002，表示当前PartyID的取值为卖方的营业部代码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注，对于初始交易，填写“质权人名称”，注意最长不超过38个字节。第1到38位左对齐，不足右补空格。  第39到41位填写质押平仓线，以3位整数表示，右对齐，不足左补0；第42到44位填质押预警线，以3位整数表示，右对齐，不足左补0；第45到46位填写融资投向，以2位字符表示；第47到50位填写融资利率，以4位整数表示，前两位填写整数部分，后两位填写小数部分，右对齐，不足左补0，如融资利率为9%，则填写“0900”。以上要素交易所不做业务校验，代为转发中登。 | C50 |

### 补充质押申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | | 标的证券代码 | C6 |
| 38 | OrderQty | | 订单数量  本业务为标的证券数量 | N10 |
| 1080 | RefOrderID | | 交易所订单编号参考值。  对于补充质押申报订单，需填写初始交易申报响应交易所订单编号（OrderID）。 | C16 |
| 1125 | OrigTradeDate | | 初始交易日期。  对补充质押申报，为初始交易申报的初始交易日期。 | C8 |
| 541 | MaturityDate | | 购回交易日期。格式YYYYMMDD。 | C8 |
| 75 | TradeDate | | 本订单申报日期。格式YYYYMMDD。 | C8 |
| 914 | AgreementID | | 业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验 | C16 |
| 107 | SecurityDesc | | 转发中登的标的证券描述标签，从左至右依次为：  证券类别、证券流通类型、证券权益类别、证券挂牌年份，详见申报消息描述。 | C9 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码, 取值为6。 | N2 |
| 买方投资者账户 | 448 | PartyID | 买方投资者帐户编码。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为买方投资者帐户 | N4 |
| 买方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 买方业务PBU（5位数字）。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为买方业务PBU。 | N4 |
| 买方营业部代码 | 448 | PartyID | 买方营业部代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为买方营业部代码 | N4 |
| 卖方投资者账户 | 448 | PartyID | 卖方投资者帐户。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为卖方投资者帐户 | N4 |
| 卖方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 卖方业务PBU（5位数字） | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为卖方交易单元号 | N4 |
| 卖方营业部代码 | 448 | PartyID | 卖方营业部代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4002，表示当前PartyID的取值为卖方的营业部代码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注，对于补充质押，填写“质权人名称”，注意最长不超过38个字节。 | C50 |

### 购回交易和终止购回申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | | 标的证券代码 | C6 |
| 922 | EndCash | | 购回交易为购回交易金额，单位为元。  终止购回无意义，可取值0。 | N16(2) |
| 1080 | RefOrderID | | 交易所订单编号参考值。  初始交易或补充质押交易所订单编号（OrderID）。 | C16 |
| 1125 | OrigTradeDate | | 初始交易申报日期或补充质押申报日期。格式YYYYMMDD。 | C8 |
| 75 | TradeDate | | 本订单申报日期。格式YYYYMMDD。 | C8 |
| 914 | AgreementID | | 业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验 | C16 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码, 取值为6。 | N2 |
| 买方投资者账户 | 448 | PartyID | 买方投资者帐户编码。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为买方投资者帐户 | N4 |
| 买方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 买方业务PBU（5位数字）。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为买方业务PBU。 | N4 |
| 买方营业部代码 | 448 | PartyID | 买方营业部代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为买方营业部代码 | N4 |
| 卖方投资者账户 | 448 | PartyID | 卖方投资者帐户。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为卖方投资者帐户 | N4 |
| 卖方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 卖方业务PBU（5位数字） | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为卖方交易单元号 | N4 |
| 卖方营业部代码 | 448 | PartyID | 卖方营业部代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4002，表示当前PartyID的取值为卖方的营业部代码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

### 部分解除质押和违约处置申请申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | | 标的证券代码 | C6 |
| 38 | OrderQty | | 订单数量  本申报的标的证券数量 | N10 |
| 1080 | RefOrderID | | 交易所订单编号参考值。  初始交易或补充质押交易所订单编号（OrderID）。 | C16 |
| 1125 | OrigTradeDate | | 初始交易申报日期或补充质押申报日期。格式YYYYMMDD。 | C8 |
| 75 | TradeDate | | 本订单申报日期。格式YYYYMMDD。 | C8 |
| 914 | AgreementID | | 业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验 | C16 |
| 107 | SecurityDesc | | 转发中登的标的证券描述标签，从左至右依次为：  证券类别、证券流通类型、证券权益类别、证券挂牌年份，详见申报消息描述。 | C9 |
| 453 | NoPartyIDs | | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码, 取值为6。 | N2 |
| 买方投资者账户 | 448 | PartyID | 买方投资者帐户编码。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为买方投资者帐户 | N4 |
| 买方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 买方业务PBU（5位数字）。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为买方业务PBU。 | N4 |
| 买方营业部代码 | 448 | PartyID | 买方营业部代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4001，表示当前PartyID的取值为买方营业部代码 | N4 |
| 卖方投资者账户 | 448 | PartyID | 卖方投资者帐户。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取39，表示当前PartyID的取值为卖方投资者帐户 | N4 |
| 卖方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 卖方业务PBU（5位数字） | C5 |
| 452 | PartyRole | 取17，表示当前PartyID的取值为卖方交易单元号 | N4 |
| 卖方营业部代码 | 448 | PartyID | 卖方营业部代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取4002，表示当前PartyID的取值为卖方的营业部代码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

## 申报撤单消息

| **OrderCancel Request (reqtext)** | **申报撤单消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报撤单消息。  本业务申报均可撤单，其中针对特定的申报撤单，证券代码、订单数量如无意义可取空格或0。本业务订单含买卖双方，买卖方向无意义可取空格。参与方为买方投资者账户、申报交易单元号。 | |

## 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：**  同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。  其中交易所订单编号，本业务可理解为成交编号。证券代码，如无意义可取空格。 | |

## 申报撤单失败响应消息

| **OrderCancelReject (resptext)** | **申报撤单失败响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报撤单失败响应消息。 | |

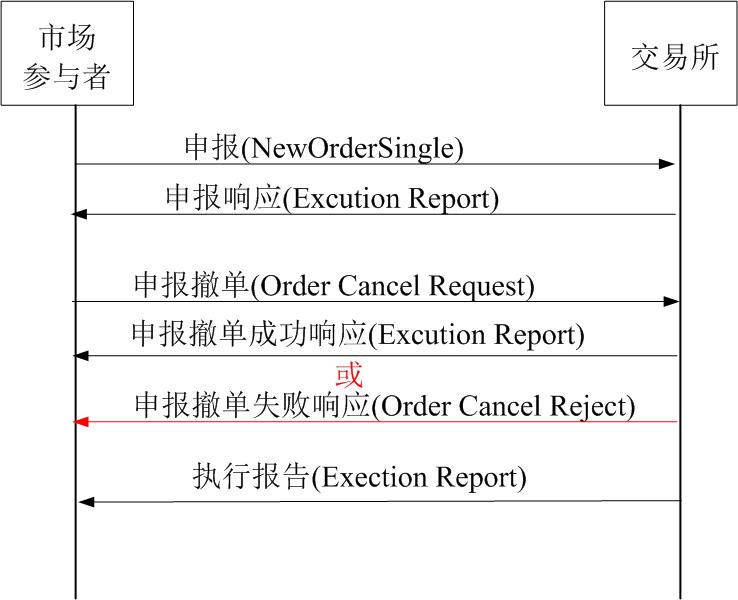
# 撮合业务消息规范（国债预发行）

## 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

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。  国债预发行业务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：**  同大宗业务申报撤单消息。  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：**  同大宗业务申报撤单失败响应消息。 | |

## 执行报告消息

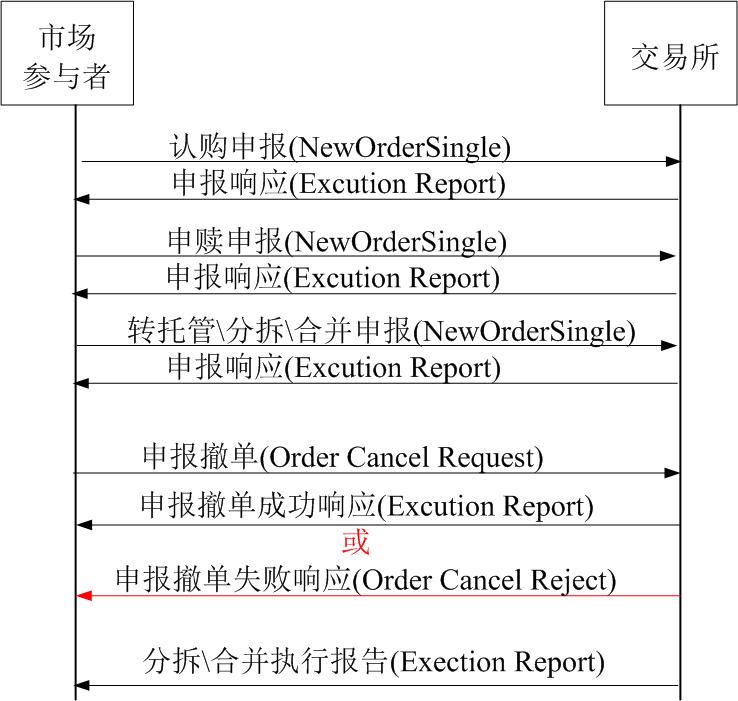
| **ExecutionReport (execreporttext)** | **实时执行报告消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  执行报告表中的execreporttext字段数据。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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。 | 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 |

# 上证LOF业务消息规范

## 上证LOF STEP消息流程图

根据上证LOF认购、申赎、转托管流程，市场投资者可以进行上证LOF业务申报，交易所实时反馈申报确认，下图描述了上证LOF的STEP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消息进行上证LOF认购、申赎、转托管申报。 | |

### 认购申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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，上证LOF二级市场交易证券代码 | C6 |
| 152 | CashOrderQty | | 认购金额，单位元 | N16(3) |
| 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 |

### 申赎申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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，上证LOF二级市场交易证券代码 | C6 |
| 44 | Price | | 价格，填写1.000，单位元，无实际意义 | N11(3) |
| 38 | OrderQty | | 申赎数量 | N10 |
| 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 |

### 转托管\分拆\合并申报

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | | MsgType取值为： U001=注册指令 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号，指申报会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码，上证LOF二级市场交易证券代码 | C6 |
| 38 | OrderQty | | 数量  转托管数量或分拆、合并数量。 | N10 |
| 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、转入方基金参与方编码, 取值为4。 | 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 |
| 转入方基金参与方编码 | 448 | PartyID | 转入方基金参与方编码。  交易所目前支持的3位基金参与方编码方式，暂不支持9位编码。 | C9 |
| 452 | PartyRole | 取40，表示当前PartyID的取值为转入方基金参与方编码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

## 申报撤单消息

| **OrderCancel Request (reqtext)** | **申报撤单消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求及响应接口表中的reqtext字段数据。  市场参与者使用OrderCancel Request消息进行申报撤单  需要注意的是，为简化会员公司备份切换动作，综合业务平台采用原始申报的会员内部编号和业务交易单元号作为撤单索引字段。  本业务中，认购申报、申购赎回申报、转托管申报可以撤单，分拆与合并不可撤单。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | | MsgType取值为： F=申报撤单 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号，指申报会员内部编号。 | C10 |
| 41 | OrigClOrdID | | 原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的ClOrdID | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 38 | OrderQty | | 订单数量，无意义 | N10 |
| 54 | Side | | 买卖方向，无意义 | 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 |
| 发起方投资者帐户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方业务PBU代码，填写5位交易单元号，对于撤单，应为原始申报的业务PBU代码。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为PBU | N4 |
| 58 | Text | | 备注 | C50 |

## 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：**  同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。 | |

## 申报撤单失败响应消息

| **OrderCancelReject (resptext)** | **申报撤单失败响应消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  同大宗业务申报撤单失败响应消息。 | |

## 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。  仅LOF分拆、合并业务生成实时执行报告，会产生多条记录：一条母基金证券代码记录，成交数量为母基金分拆或合并数量；多条子基金证券代码记录，成交数量为子基金数量。价格、金额、买卖无意义。  基金公司作为对手方收到对应的成交数据。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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  对于基金公司，填写对手方投资者账户。 | 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，无意义 | N11(3) |
| 32 | LastQty | | 该笔成交数量 | N12 |
| 8504 | TotalValueTraded | | 成交金额，本业务无意义填0 | N16(3) |
| 151 | LeavesQty | | 本次剩余余额，暂为0 | N12 |
| 54 | Side | | 买卖方向，无意义 | 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 |

## 基金业务参数公告文件sfpm01MMDD.txt

| **sfpm01MMDD.txt** | **基金业务参数接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中MMDD表示月日格式的日期。在交易日开市前发送。  该接口文件说明基金业务参数信息，具体参见参考数据类型。  **时间和频率：**每个交易日开市前发送  **数据格式：**记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。 | |

文件定义，多条行情记录，参考数据类型取值标识字母R加类型编号。

当取值为R0106时，文件体记录格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
|  | RFStreamID | 参考数据类型 | C5 | 取值为R0106，表示LOF基金业务参数控制数据 |
|  | FundInstrumentID | 基金二级市场交易代码 | C 6 | 基金二级市场交易代码 |
|  | FundName | 基金名称 | C10 | 基金名称 |
|  | FundType | 基金类型 | C 1 | 基金类型：  0：普通LOF  1：财务分级基金母份额  2：多空分级基金母份额 |
|  | PartitionMergeUnit | 分拆合并的整手数 | N 8 | 分拆合并的整手数  必须大于0  单位为份  无意义取空格。 |
|  | MasterRatio | 母基金转换系数 | N8 | 对于分级基金，表示母基金转换系数，须校验大于0，不能为小数  无意义取空格。 |
|  | MergeLowerLimit | 合并申报起点数量 | N12 | 合并申报起点数量，须校验不小于0，单位为份。  无意义取空格。 |
|  | PartitionLowerLimit | 拆分申报起点数量 | N12 | 拆分申报起点数量，须校验不小于0，单位为份。  无意义取空格。 |
|  | BusinessStatus | 业务状态 | C8 | 第1位表示是否允许交易(此位预留，暂不生效)  第2位表示是否允许认购  第3位表示是否允许申购  第4位表示是否允许赎回  第5位表示是否允许拆分  第6位表示是否允许合并  第7位表示是否允许转托管  第8位预留  0：禁止；1：允许 |
|  | NoInstruments | 重复组数 | N 3 | 分级基金子份额的数目（分级基金子份额重复组数），且与后续成份证券数量相同。  基金类型为财务分级基金或多空分级基金时，取值必须大于0；对于普通LOF，取值为0。 |
| （注：重复该节段数据表示多个成分证券信息。若NoInstruments取值为0，则本重复组节段为空） | | | | |
| 分级基金子份额重复组 | InstrumentID | 证券代码 | C 6 | 证券ID，须校验按照字段递增排序 |
| InstrumentName | 证券简称 | C8 | 证券简称 |
| SubRatio | 子份额转换系数 | N8 | 子份额转换系数，须校验大于0，不能为小数 |
| BusinessStatus | 业务状态 | C8 | 第1位表示是否允许交易(此位预留，暂不生效)  第2位表示是否允许认购  第3到8位预留  0：禁止；1：允许 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

# 网络投票业务消息规范

## 网络投票业务STEP消息流程图

根据业务规则，市场投资者可以进行投票申报，交易所实时反馈申报确认。

下图描述了消息通信流程。



## 申报消息

| **Vote (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U004消息进行投票申报。  本接口中数据类型为N16的字段，因后台数据类型限制，暂时最长仅支持15位。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | | MsgType取值为： U004=投票 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号，指申报会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码，投票对应的上市公司交易证券代码 | C6 |
| 8547 | GeneralMeetingSeq | | 股东大会编码，股东大会唯一序列号。 | N10 |
| 8529 | VotingProposal | | 投票议案编号及子议案编号，议案和子议案用小数点分隔。例如：99（或99.00）表示所有议案（累积议案除外）；取值1表示议案1。  带二位小数的编号代表议案组；小数点后数字为子议案。例如：2.00表示议案2（议案组2）的所有子议案，2.01表示议案2（议案组2）的第一个子议案。  88（或88.00）保留给港结算使用，具体参见香港中央结算有限公司参与沪股通上市公司网络投票实施指引 | C10 |
| 8531 | VotingPreference | | 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。请注意过户数据接口“成交数量”数值位数限制。 | N16 |
| 8546 | VotingSegment | | 分段统计段号，仅对港结算有效，无意义可填空格。取值A、B、C、D、E分别代表现金分红议案的第1、2、3、4、5段，以此类推。字母Z代表中小投资者单独计票统计。具体参照交易所投票相关说明。 | C2 |
| 704 | LongQty | | 总股份数量，仅对港结算有效，无意义填0。 | N16 |
| 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。对于不需要在该字段填写营业部代码的，该字段可取值为若干个空格。 | 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 |

## 申报响应消息

| **VoteReport (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。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
|  | 消息头 | MsgType取值为：U005=投票申报响应 |  |
| 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 | 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 |
| 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。 | C5 |
| 58 | Text | 备注 | C50 |

## 投票议案公告文件vtlsMMDD.xml

| **vtlsMMDD.xml** | **投票议案公告文件** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中MMDD表示月日格式的文件适用日期，在交易日开市前发送。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **编号** | **字段名** | **字段类型** | **描述** | **备注** | **XML字段名** |
| 1 | streamID | C 5 | streamID，结构化投票议案指令文件使用“R0109” | 必填 | streamID |
| 2 | 公司代码 | C 6 | 公司代码 | 必填 | companycode |
| 3 | 公司简称 | C 8 | 公司简称 | 必填 | companyinfo |
| 4 | 投票产品代码 | C 6 | 投票产品代码 | 必填 | votecode |
| 5 | 股权登记日 | C 8 | 不同产品可能不同, 格式：yyyymmdd | 必填：A股和公开发行优先股； 非必填：B股和非公开发行优先股 | regdate |
| 6 | 最后交易日 | C 8 | 不同产品可能不同,格式：yyyymmdd | 非必填：A股和公开发行优先股； 必填：B股和非公开发行优先股 | lasttradedate |
| 7 | 股东大会开始日 | C 8 | 格式：yyyymmdd | 必填 | meetingdatebegin |
| 8 | 股东大会结束日 | C 8 | 格式：yyyymmdd | 必填 | meetingdateend |
| 9 | 股东大会类型 | C 4 | 临时/年度 | 必填 | meetingtype |
| 10 | 股东大会名称 | C 500 | 股东大会名称  长度为UTF-8字符数 | 必填 | meetingdesc |
| 11 | 股东大会编码 | C10 | 股东大会唯一序列号 | 必填 | meetingseq |
| 12 | 议案编号 | C10 | 投票议案（组）编号及子议案编号。 整数编号代表普通议案。例如：1表示普通议案1。 带二位小数的编号代表议案组及子议案。例如：2.00表示议案组2的标题，2.01表示议案组2的第一个子议案，2.02表示议案组2的第二个子议案。 | 必填 | vid |
| 13 | 议案名称 | C 100 | 长度为UTF-8字符数 | 必填 | vinfo |
| 14 | 议案类型 | C 4 | 累计投票议案:L,普通议案P | 必填 | vtype |
| 15 | 累计投票应选数 | C 4 | 若填写，则必须填写正整数 | 非必填 | vleijino |
| 16 | 股东身份 | C 50 | A股股东/B股股东/优先股股东/恢复表决权的优先股股东 | 必填 | vrole |
| 17 | 议案关系 | C 100 | 议案关系 | 非必填 | vrelation |
| 18 | 股份类别 | C 20 | A股/B股/优先股/恢复表决权优先股 | 非必填 | stype |
| 19 | 股票简称 | C8 | 股票简称 | 非必填 | sabbr |
| 20 | 投票产品代码指引 | C150 | 股东议案的投票产品代码指引。用以在议案股东类别和投票代码之间建立关联，方便程序自动化处理 | 必填 | refcode |

**示例文件：**

注：若同一家上市公司同一天召开多次股东大会，下述文件的<company>会相应出现多次。

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<rootvote streamID="R0109">

<company>

<companycode>600000</companycode>

<companyinfo>浦发银行</companyinfo>

<meetingseq>201425547</meetingseq>

<votecodelist>

<votecode lasttradedate=""

regdate="20140519" stype ="A股” sabbr=“浦发银行”>600000</votecode>

<votecode lasttradedate="20140519" “

regdate="20140522" stype =“优先股” sabbr=“浦优先1”>360000</votecode>

<votecode lasttradedate="20140519"stype =“ 恢复表决权优先股”

sabbr=“浦优先2” regdate="20140522">360001</votecode>

<votecode lasttradedate="20140519" stype =“B股” sabbr=“浦发B股”

regdate="20140522">900000</votecode>

</votecodelist>

<meetingdatebegin>20140526</meetingdatebegin>

<meetingdateend>20140526</meetingdateend>

<meetingdesc>上海浦东发展银行股份有限公司2014年度网络投票1</meetingdesc>

<meetingtype>年度</meetingtype>

<volist>

<vote vid="1" vinfo="审议公司2013年度董事会工作报告" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="2" vinfo="审议公司2013年度监事会工作报告" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

<vrole refcode=“900000”>B股股东</vrole>

<vrole refcode=“360000”>优先股股东</vrole>

<vrole refcode=“360001”>恢复表决权的优先股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.00" vinfo="董事会选举" vtype="L" vrelation="" vleijino="2">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.01" vinfo="张三" vtype="L" vrelation="" vleijino="2">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.02" vinfo="李四" vtype="L" vrelation="" vleijino="2">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.03" vinfo="王五" vtype="L" vrelation="" vleijino="2">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

</volist>

</company>

<company>

<companycode>600000</companycode>

<companyinfo>浦发银行</companyinfo>

<meetingseq>201425548</meetingseq>

<votecodelist>

<votecode lasttradedate="" regdate="20140519" stype =“A股” sabbr=“浦发银行”>600000</votecode>

<votecode lasttradedate="20140519" regdate="" stype =“优先股” sabbr=“优先1”>360000</votecode>

<votecode lasttradedate="20140520" regdate="" stype =“优先股” sabbr=“优先2”>360002</votecode>

<votecode lasttradedate="20140519" regdate="" stype =“恢复表决权优先股” sabbr=“优先2”>360001</votecode>

</votecodelist>

<meetingdatebegin>20140526</meetingdatebegin>

<meetingdateend>20140527</meetingdateend>

<meetingdesc>上海浦东发展银行股份有限公司2014年度网络投票2</meetingdesc>

<meetingtype>年度</meetingtype>

<volist>

<vote vid="1" vinfo="审议公司2013年度董事会工作报告" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="2" vinfo="审议公司2013年度监事会工作报告" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

<vrole refcode=“360000|360002”>优先股股东</vrole>

<vrole refcode=“360001”>恢复表决权的优先股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.00" vinfo="ccc" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.01" vinfo="票面金额和发行价格" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.02" vinfo="存续期限" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600000”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

</volist>

</company>

<company>

<companycode>600001</companycode>

<companyinfo>测试1</companyinfo>

<meetingseq>201425549</meetingseq>

<votecodelist>

<votecode lasttradedate="" regdate="20140519" stype ="A股" sabbr=“XXXX”>600001</votecode>

<votecode lasttradedate="20140519" regdate="20140521" stype =“优先股” sabbr=“优先股1”>360005</votecode>

<votecode lasttradedate="20140519" regdate="20140521" stype =“恢复表决权优先股” sabbr=“优先股2”>360006</votecode>

<votecode lasttradedate="20140519" regdate="20140521" stype =“B股” sabbr=“B股X”>900001</votecode>

</votecodelist>

<meetingdatebegin>20140526</meetingdatebegin>

<meetingdateend>20140526</meetingdateend>

<meetingdesc>XX股份有限公司 2014年度网络投票</meetingdesc>

<meetingtype>年度</meetingtype>

<volist>

<vote vid="1" vinfo="关于XX股份有限公司符合非公开发行股票条件的议案" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600001”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="2" vinfo="审议公司2013年度监事会工作报告" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600001”>A股股东</vrole>

<vrole refcode=“900001”>B股股东</vrole>

<vrole refcode=“360005”>优先股股东</vrole>

<vrole refcode=“360006”>恢复表决权的优先股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.00" vinfo="关于XX股份有限公司非公开发行股票方案的议案" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600001”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.01" vinfo="发行股票的种类和面值" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600001”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.02" vinfo="发行股票的方式和发行时间" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600001”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.03" vinfo="本次非公开发行股票募集资金数额及用途" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600001”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.04" vinfo="发行股票的价格及定价原则" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600001”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="3.05" vinfo="发行股票的数量" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“600001”>A股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="4" vinfo="关于XX股份有限公司符合非公开发行股票条件的议案" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“360005”>优先股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

<vote vid="5" vinfo="关于审议《XX股份有限公司前次募集资金使用情况报告》的议案" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

<vrolelist>

<vrole refcode=“360005”>优先股股东</vrole>

</vrolelist>

</vote>

</volist>

</company>

</rootvote>

# 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。  (暂不填写) |
| 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’表示市场行情闭市标志，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，‘B’表示休市时段，‘E’表示闭市时段。  第1位：‘0’表示未停牌或未暂停，‘1’表示停牌或暂停。 |
| 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。 |

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。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **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 | 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)spwu@sse.com.cn或者致电021-68827268。