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**

**（大股东减持技术开发稿）**

**（1.44版）**

**上海证券交易所**

**二○一九年八月**

**《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.44版发布说明2019.8**

1、根据大股东减持控制需求，调整大宗减持标志含义。

**《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2019.5**

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。

4、根据科创板转融通业务需求，在转融通业务“申报消息”、“执行报告消息”和“过户数据接口”的备注字段中增加战略配售股份标志，在转融通业务“公共数据消息”中增加科创板产品约定申报成交量的说明。

**《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 9](#_Toc10046729)

[2 大宗交易业务消息规范 14](#_Toc10046730)

[2.1 大宗交易STEP消息流程图 14](#_Toc10046731)

[2.2 公共数据消息 15](#_Toc10046732)

[2.3 意向申报消息/意向申报撤单消息 16](#_Toc10046733)

[2.4 意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息 17](#_Toc10046734)

[2.5 成交申报消息 18](#_Toc10046735)

[2.6 申报撤单消息 19](#_Toc10046736)

[2.7 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 20](#_Toc10046737)

[2.8 申报撤单失败响应消息 21](#_Toc10046738)

[2.9 执行报告消息 22](#_Toc10046739)

[2.10 过户数据接口dghXXXXXYYYYMMDD.dbf 23](#_Toc10046740)

[2.11 固定价格交易STEP消息流程图 24](#_Toc10046741)

[2.12 固定价格交易申报消息 25](#_Toc10046742)

[2.13 固定价格交易申报撤单消息 26](#_Toc10046743)

[2.14 固定价格交易申报响应消息/申报撤单成功响应消息 26](#_Toc10046744)

[2.15 固定价格交易申报撤单失败响应消息 26](#_Toc10046745)

[2.16 固定价格交易执行报告消息 26](#_Toc10046746)

[3 跨境ETF/黄金ETF/交易型货币市场基金申赎业务消息规范 27](#_Toc10046747)

[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 27](#_Toc10046748)

[3.2 申报消息 27](#_Toc10046749)

[3.3 申报响应消息 28](#_Toc10046750)

[3.4 执行报告消息 28](#_Toc10046751)

[4 货币市场基金实时申赎业务消息规范 31](#_Toc10046752)

[4.1 货币市场基金实时申赎STEP消息流程图 31](#_Toc10046753)

[4.2 申报消息 31](#_Toc10046754)

[4.3 申报响应消息 32](#_Toc10046755)

[4.4 执行报告消息 32](#_Toc10046756)

[5 报价回购及约定购回业务消息规范 35](#_Toc10046757)

[5.1 报价回购及约定购回STEP消息流程图 35](#_Toc10046758)

[5.2 申报消息 35](#_Toc10046759)

[5.2.1 报价回购交易申报 36](#_Toc10046760)

[5.2.2 约定购回交易申报 37](#_Toc10046761)

[5.2.3 出入库非交易申报 39](#_Toc10046762)

[5.3 申报撤单消息 39](#_Toc10046763)

[5.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 40](#_Toc10046764)

[5.5 申报撤单失败响应消息 40](#_Toc10046765)

[6 转融通业务消息规范 41](#_Toc10046766)

[6.1 消息流程图 41](#_Toc10046767)

[6.2 申报消息 41](#_Toc10046768)

[6.3 申报撤单消息 43](#_Toc10046769)

[6.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 43](#_Toc10046770)

[6.5 申报撤单失败响应消息 43](#_Toc10046771)

[6.6 执行报告消息 43](#_Toc10046772)

[6.7 公共数据消息 45](#_Toc10046773)

[6.8 转融通标的证券清单zrtbdMMDD.txt 46](#_Toc10046774)

[7 股票质押回购业务消息规范 48](#_Toc10046775)

[7.1 股票质押回购STEP消息流程图 48](#_Toc10046776)

[7.2 申报消息 48](#_Toc10046777)

[7.2.1 初始交易申报 51](#_Toc10046778)

[7.2.2 补充质押申报 52](#_Toc10046779)

[7.2.3 购回交易和终止购回申报 53](#_Toc10046780)

[7.2.4 部分解除质押和违约处置申请申报 55](#_Toc10046781)

[7.3 申报撤单消息 56](#_Toc10046782)

[7.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 56](#_Toc10046783)

[7.5 申报撤单失败响应消息 56](#_Toc10046784)

[8 撮合业务消息规范（国债预发行、盘后固定价格交易） 57](#_Toc10046785)

[8.1 撮合业务STEP消息流程图 57](#_Toc10046786)

[8.2 申报消息 57](#_Toc10046787)

[8.3 申报撤单消息 59](#_Toc10046788)

[8.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 59](#_Toc10046789)

[8.5 申报撤单失败响应消息 60](#_Toc10046790)

[8.6 执行报告消息 60](#_Toc10046791)

[9 上证LOF业务消息规范 62](#_Toc10046792)

[9.1 上证LOF STEP消息流程图 62](#_Toc10046793)

[9.2 申报消息 62](#_Toc10046794)

[9.2.1 认购申报 63](#_Toc10046795)

[9.2.2 申赎申报 63](#_Toc10046796)

[9.2.3 转托管\分拆\合并申报 64](#_Toc10046797)

[9.3 申报撤单消息 65](#_Toc10046798)

[9.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 65](#_Toc10046799)

[9.5 申报撤单失败响应消息 66](#_Toc10046800)

[9.6 执行报告消息 66](#_Toc10046801)

[9.7 基金业务参数公告文件sfpm01MMDD.txt 67](#_Toc10046802)

[10 网络投票业务消息规范 70](#_Toc10046803)

[10.1 网络投票业务STEP消息流程图 70](#_Toc10046804)

[10.2 申报消息 70](#_Toc10046805)

[10.3 申报响应消息 71](#_Toc10046806)

[10.4 投票议案公告文件vtlsMMDD.xml 72](#_Toc10046807)

[11 资金前端控制业务消息规范 81](#_Toc10046808)

[11.1 资金前端控制业务消息流程图 81](#_Toc10046809)

[11.2 申报消息 81](#_Toc10046810)

[11.3 申报响应消息 82](#_Toc10046811)

[12 密码服务（中登身份认证服务）消息规范 83](#_Toc10046812)

[12.1 密码服务（中登身份认证服务）消息流程图 83](#_Toc10046813)

[12.2 申报消息 83](#_Toc10046814)

[12.3 申报响应消息 84](#_Toc10046815)

[13 行情数据STEP消息规范 86](#_Toc10046816)

[14 行情文件接口mktdt01.txt 89](#_Toc10046817)

[14.1 结构描述 90](#_Toc10046818)

[14.2 格式定义 90](#_Toc10046819)

[15 过户数据接口bghXXXXX.dbf 95](#_Toc10046820)

[16 后记 99](#_Toc10046821)

# 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 trading

**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。

# 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， 第1个字节填写“T”表示大宗受控股份减持，否则表示普通大宗交易；第2个字节后作为预留字段。 | 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， 第1个字节填写“T”表示大宗受控股份减持，否则表示普通大宗交易；第2个字节后作为预留字段。 | 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， 第1个字节填写“T”表示大宗受控股份减持，否则表示普通大宗交易；第2个字节后作为预留字段。 | 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，第1个字节填写“T”表示大宗受控股份减持，否则表示普通大宗交易；第2个字节后作为预留字段。 | 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。  通过会员内部编号可确认该执行报告是否为减持执行报告。 | |

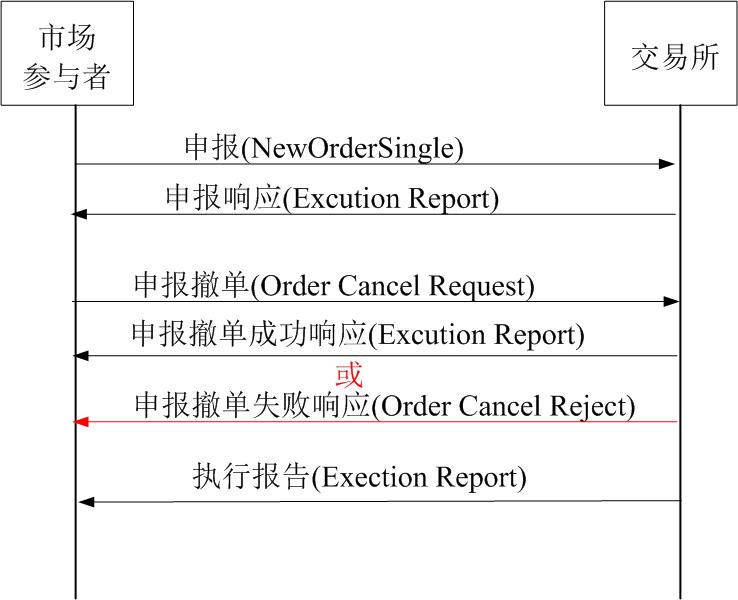
|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
|  | 标准消息头 | | MsgType取值为：8=成交回报 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号 | C10 |
| 37 | OrderID | | 交易所订单编号 | C16 |
| 17 | ExecID | | 成交编号 | C16 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 31 | LastPx | | 价格 | N11(3) |
| 32 | 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。  通过申请编号关联原始申报请求可确认该笔记录是否为减持记录。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 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。  固定价格交易申报不支持受控股份大宗交易减持。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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，作为预留字段。 | 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。  固定价格交易申报撤单不支持受控股份大宗交易减持。  其中备注字段（Text），填写规则参见“固定价格交易申报消息”。 | |

## 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。 | |

# 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。