
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
(债券非交易技术开发稿)
(1.45 版)



上海证券交易所

二〇二〇年十八月

目录

| | |
|-----------------------------------|-----------|
| 1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范 | 4 |
| 2 债券非交易实时消息规范 | 9 |
| 2.1 债券质押式回购入库业务消息规范 | 9 |
| 2.1.1 债券质押式回购入库消息流程图 | 9 |
| 2.1.2 债券质押式回购入库申报消息 | 9 |
| 2.1.3 债券质押式回购入库申报响应消息 | 10 |
| 2.1.4 债券质押式回购入库执行报告消息 | 10 |
| 2.2 债券质押式回购出库业务消息规范 | 11 |
| 2.2.1 债券质押式回购出库消息流程图 | 11 |
| 2.2.2 债券质押式回购出库申报消息 | 12 |
| 2.2.3 债券质押式回购出库申报响应消息 | 13 |
| 2.2.4 债券质押式回购出库执行报告消息 | 13 |
| 2.3 可转债转股业务消息规范 | 14 |
| 2.3.1 可转债转股消息流程图 | 14 |
| 2.3.2 可转债转股申报消息 | 15 |
| 2.3.3 可转债转股申报响应消息 | 15 |
| 2.3.4 可转债转股撤单申报消息 | 16 |
| 2.3.5 可转债转股撤单申报成功响应消息 | 16 |
| 2.3.6 可转债转股撤单申报失败响应消息 | 16 |
| 2.4 可交换债换股业务消息规范 | 16 |
| 2.4.1 可交换债换股消息流程图 | 16 |
| 2.4.2 可交换债换股申报消息 | 17 |
| 2.4.3 可交换债换股申报响应消息 | 17 |
| 2.4.4 可交换债换股撤单申报消息 | 18 |
| 2.4.5 可交换债换股撤单申报成功响应消息 | 18 |
| 2.4.6 可交换债换股撤单申报失败响应消息 | 18 |
| 2.5 债券回售业务消息规范 | 18 |
| 2.5.1 债券回售消息流程图 | 18 |
| 2.5.2 债券回售申报消息 | 19 |
| 2.5.3 债券回售申报响应消息 | 19 |
| 2.5.4 债券回售撤单申报消息 | 20 |
| 2.5.5 债券回售撤单申报成功响应消息 | 20 |
| 2.5.6 债券回售撤单申报失败响应消息 | 20 |
| 2.6 债券回售撤销业务消息规范 | 20 |
| 2.6.1 债券回售撤销消息流程图 | 20 |
| 2.6.2 债券回售撤销申报消息 | 21 |
| 2.6.3 债券回售撤销申报响应消息 | 21 |
| 3 ETF 申赎实时消息规范 | 22 |

| | | |
|------------|-------------------------------------|-----------|
| 3.1 | ETF 申购业务消息规范 | 22 |
| 3.1.1 | 债券 ETF 申购消息流程图 | 22 |
| 3.1.2 | 债券 ETF 申购申报消息 | 22 |
| 3.1.3 | 债券 ETF 申购申报响应消息 | 23 |
| 3.1.4 | 债券 ETF 申购执行报告消息 | 23 |
| 3.2 | ETF 赎回业务消息规范 | 25 |
| 3.2.1 | 债券 ETF 赎回消息流程图 | 25 |
| 3.2.2 | 债券 ETF 赎回申报消息 | 25 |
| 3.2.3 | 债券 ETF 赎回申报响应消息 | 26 |
| 3.2.4 | 债券 ETF 赎回执行报告消息 | 26 |
| 4 | 债券非交易盘前数据接口 | 29 |
| 4.1 | 债券非交易基础信息接口 zfjyyyyymmdd.xml | 29 |
| 5 | 基金非交易盘前数据接口 | 31 |
| 5.1 | 基金非交易基础信息接口 jfjyyyyymmdd.xml | 31 |
| 6 | 债券盘后数据接口 | 32 |
| 6.1 | 债券过户数据 zqghXXXXX.txt | 32 |
| 7 | 基金盘后数据接口 | 33 |
| 7.1 | 基金过户数据接口 jjghXXXXX.txt | 33 |

1 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：

| 业务名称 | 业务类型请求编号 | 业务类型说明 |
|-----------------------------------|------------|------------------------------|
| 大宗交易 | BII | 大宗意向 |
| | BPT | 大宗交易 |
| | FPE | 大宗固定价格交易申报 |
| 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 |
| 约定购回 | RNE | 初始交易 |
| | RNR | 购回交易 |
| 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 |
| 黄金 ETF 实物申赎 | GEC | 黄金 ETF 实物申购 |
| | GER | 黄金 ETF 实物赎回 |
| 转融通 | ZII | 转融通非约定申报 |
| | ZPT | 转融通约定申报 |
| 货币市场基金申赎 | OFC | 货币市场基金申购申报 |
| | OFR | 货币市场基金赎回申报 |
| 股票质押式回购 | 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 |
| 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 |
| 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 |
| 网络投票 | VTE | 投票申报 |
| 密码服务 | PWS | 密码服务申报 |
| 资金前端控制 | CFC | 资金前端控制 |
| 债券质押式回购出入 | BPD | 债券质押式回购入库 |

| | | |
|----------------------------|------------|-----------------------|
| <u>库</u> | <u>BPW</u> | <u>债券质押式回购出库</u> |
| <u>可转换债转股</u> | <u>BES</u> | <u>可转换债转股</u> |
| <u>可交换债换股</u> | <u>BSS</u> | <u>可交换债换股</u> |
| <u>债券回售</u> | <u>BSB</u> | <u>债券回售</u> |
| | <u>BSC</u> | <u>债券回售撤销</u> |
| <u>单市场/跨市场 ETF 申 赎</u> | <u>IEC</u> | <u>单市场/跨市场 ETF 申购</u> |
| | <u>IER</u> | <u>单市场/跨市场 ETF 赎回</u> |

数据广播类型 (bcasstype)，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

20 ETF 申赎执行报告 (execreport)

21 债券质押式出入库执行报告 (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 (bcasstyp) | 公共数据 广播类型 (bcassty) | 产品集编号 (setid) 供参考以具 |
|------|--------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|
|------|--------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|

| | | e) | pe) | 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 |
| 密码服务 | PWS 密码服务申报 Password Service | 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 |
| <u>债券 ETF 申赎</u> | <u>IEC 单市场/跨市场 ETF 申购</u> <u>IER 单市场/跨市场 ETF 赎回</u> | <u>20</u> | <u>N/A</u> | <u>102</u> |
| <u>债券非交易</u> | <u>BPD 债券质押式回购入库</u> <u>BPW 债券质押式回购出库</u> <u>BES 可转换债转股</u> <u>BSS 可交换债换股</u> <u>BSB 债券回售</u> <u>BSC 债券回售撤销</u> | <u>21</u> | <u>N/A</u> | <u>121</u> |

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）

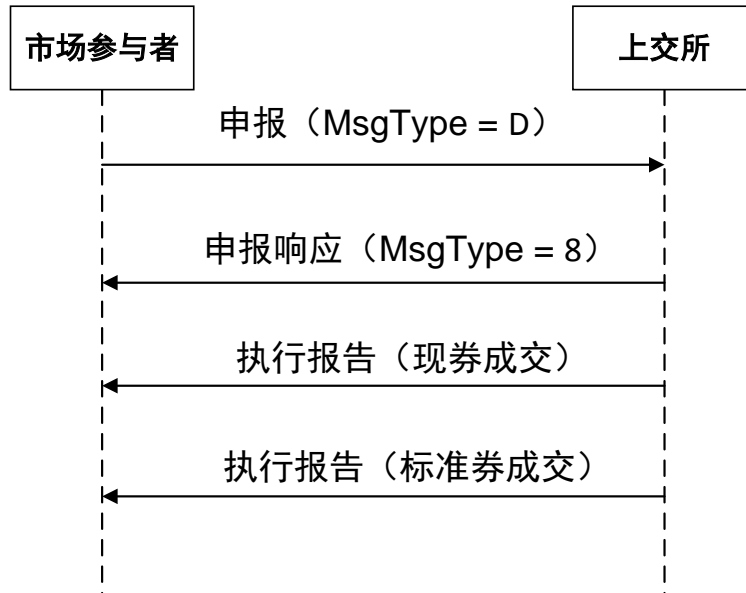
-
- AJ = 意向申报响应或意向申报撤单响应 (QuoteResponse)
 - W = 行情 (MktDataFull)
 - U001 = 注册指令 (DesignationInstruction)
 - U004 = 投票
 - U005 = 投票响应
 - U006 = 密码服务申报
 - U008 = 密码服务响应
 - U009 = 资金前端控制申报
 - U010 = 资金前端控制响应

2 债券非交易实时消息规范

2.1 债券质押式回购入库业务消息规范

2.1.1 债券质押式回购入库消息流程图

根据债券质押式回购入库业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券质押式回购入库指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.1.2 债券质押式回购入库申报消息

| 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 消息进行债券质押式回购入库申报。 | |

| 标签 | 字段名 | 字段描述 | 类型 |
|----|------------|----------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值: D=申报。 | |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | 证券代码，债券质押式回购出入库现券代码。 | C6 |
| 38 | OrderQty | 入库数量，债券单位为手，基金单位为份。 | 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 | 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。 | 备注 |

2.1.3 债券质押式回购入库申报响应消息

| 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。 | |

2.1.4 债券质押式回购入库执行报告消息

| ExecutionReport (execreporttext) | 实时执行报告消息 |
|---|----------|
| 描述： 执行报告表中的execreporttext字段数据。 债券质押回购入库成功后，产生2条执行报告（成交回报）记录，如下： <ol style="list-style-type: none"> 1、证券代码为现券代码、成交数量为入库申请数量、买卖方向为2的成交记录； 2、证券代码为标准券代码（888880）、成交数量为现券折算后数量、买卖方向为1的成交记录。 | |

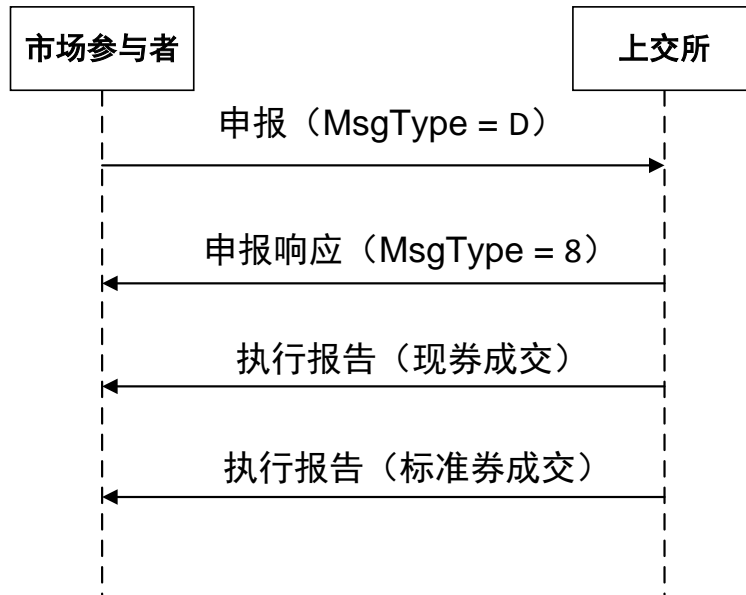
| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 |
|----|---------|------------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值： 8=成交回报。 | |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 |
| 37 | OrderID | 交易所订单编号。 | C16 |

| | | | | |
|-----------------|--------------|--|-------------------------------|-----|
| 17 | ExecID | 成交编号。 | C16 | |
| 48 | SecurityID | 证券代码。 | C6 | |
| 32 | LastQty | 成交数量，债券单位为手，基金单位为份。 | N12 | |
| 54 | Side | 买卖方向，取值： 1=买； 2=卖。 | C1 | |
| 60 | TransactTime | 订单执行时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。 | C21 | |
| 42 | OrigTime | 原订单请求接收的时间，式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。 | C21 | |
| 150 | ExecType | 当前订单执行报告类型，取值： F=成交。 | C1 | |
| 39 | OrdStatus | 当前订单状态，取值： 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 |

2.2 债券质押式回购出库业务消息规范

2.2.1 债券质押式回购出库消息流程图

根据债券质押式回购出库业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券质押式回购出库指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.2.2 债券质押式回购出库申报消息

| NewOrderSingle (reqtext) | 申报消息 |
|--|------|
| <p>描述:</p> <p>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。</p> <p>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券质押式回购出库申报。</p> | |

| 标签 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | |
|------|------------|--|------------------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值: D=申报。 | | |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 | |
| 48 | SecurityID | 证券代码, 债券质押式回购出入库现券代码。 | C6 | |
| 38 | OrderQty | 出库数量, 债券单位为手, 基金单位为份。 | 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 | 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 | 448 | PartyID | 业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。 | C5 |

| | | | | |
|-----------|------|-----------|--------------------------------|----|
| 单元号 | 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。 | 备注 |

2.2.3 债券质押式回购出库申报响应消息

| 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。 | |

2.2.4 债券质押式回购出库执行报告消息

| ExecutionReport (execreporttext) | 实时执行报告消息 |
|---|----------|
| 描述: 执行报告表中的 execreporttext 字段数据。 债券质押回购出库成功后，产生如下 2 条执行报告（成交回报）记录，如下： <ol style="list-style-type: none"> 1、证券代码为现券代码、成交数量为出库申请数量、买卖方向为 1 的成交记录； 2、证券代码为标准券代码（888880）、成交数量为现券折算后数量、买卖方向为 2 的成交记录。 | |

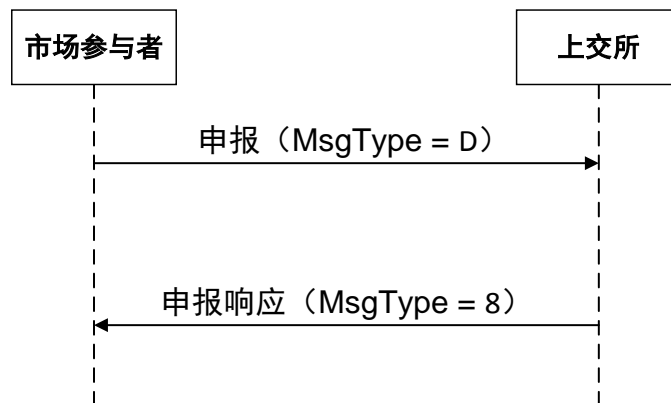
| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 |
|----|------------|------------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值： 8=成交回报。 | |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 |
| 37 | OrderID | 交易所订单编号。 | C16 |
| 17 | ExecID | 成交编号。 | C16 |
| 48 | SecurityID | 证券代码。 | C6 |
| 32 | LastQty | 成交数量，债券单位为手，基金单位为份。 | N12 |
| 54 | Side | 买卖方向，取值有： | C1 |

| | | | | |
|-----------------|--------------|-----------|---|-----|
| | | | 1 表示买； 2 表示卖。 | |
| 60 | TransactTime | | 订单执行时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。 | C21 |
| 42 | OrigTime | | 原 订 单 请 求 接 收 的 时 间 ， 式 为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。 | C21 |
| 150 | ExecType | | 当前订单执行报告类型，取值： F=成交。 | C1 |
| 39 | OrdStatus | | 当前订单状态，取值： 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 |

2.3 可转债转股业务消息规范

2.3.1 可转债转股消息流程图

根据可转债转股业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报可转债转股指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.3.2 可转债转股申报消息

| 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 消息进行可转债转股申报。 | |

| 标签 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | |
|-----------------|------------|---|---------------------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值: D=申报。 | | |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 | |
| 48 | SecurityID | 证券代码, 可转债代码。 | C6 | |
| 38 | OrderQty | 转股数量, 单位手。 | 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 | |

2.3.3 可转债转股申报响应消息

| 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。 | |

2.3.4 可转债转股撤单申报消息

| | |
|---------------------------------------|--------|
| OrderCancel Request(reqtext) | 申报撤单消息 |
| 描述: 同大宗业务申报撤单消息, 买卖方向无意义 | |

2.3.5 可转债转股撤单申报成功响应消息

| | |
|---------------------------------------|--------|
| 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。 | |

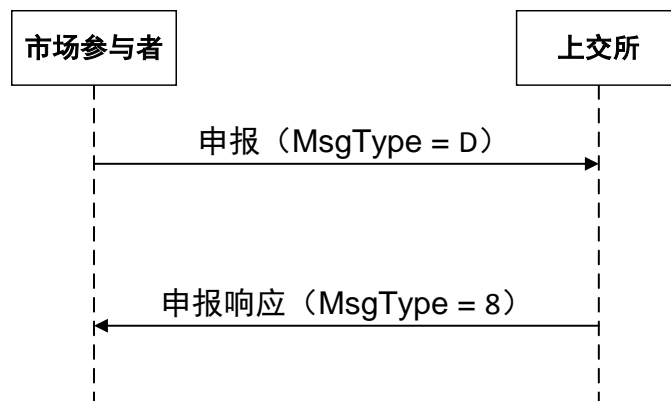
2.3.6 可转债转股撤单申报失败响应消息

| | |
|-------------------------------------|------------|
| 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。 | |

2.4 可交换债换股业务消息规范

2.4.1 可交换债换股消息流程图

根据可交换债换股业务规则,市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报可交换债换股指令,上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.4.2 可交换债换股申报消息

| 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 消息进行可交换债换股申报。 | |

| 标签 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | |
|----------------|------------|---|---------------------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值: D=申报。 | | |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 | |
| 48 | SecurityID | 证券代码, 可交换债代码。 | C6 | |
| 38 | OrderQty | 换股数量, 单位手。 | 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 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 | |

2.4.3 可交换债换股申报响应消息

| 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。 | |

2.4.4 可交换债换股撤单申报消息

| | |
|--|--------|
| OrderCancel Request(reqtext) | 申报撤单消息 |
| 描述: 同大宗业务申报撤单消息, 买卖方向无意义。 | |

2.4.5 可交换债换股撤单申报成功响应消息

| | |
|---------------------------------------|--------|
| 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。 | |

2.4.6 可交换债换股撤单申报失败响应消息

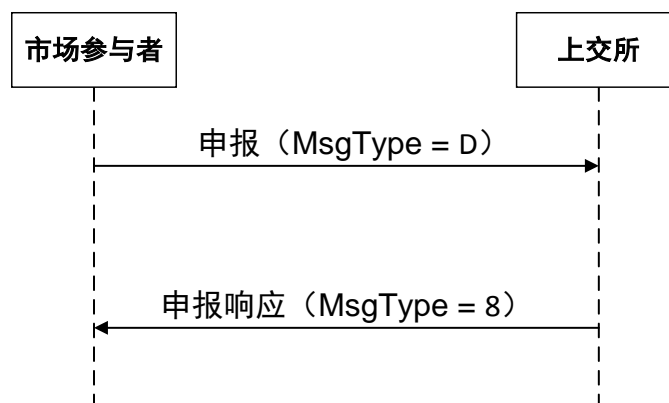
| | |
|-------------------------------------|------------|
| OrderCancelReject (resptext) | 申报撤单失败响应消息 |
| 描述: 同大宗业务申报撤单失败响应消息。 | |

2.5 债券回售业务消息规范

债券回售各批次申报及响应消息结构、撤单及响应消息结构均保持一致，以下简称债券回售。

2.5.1 债券回售消息流程图

根据债券回售业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券回售指令，上海证券交易所综合业务平台实时进行申报响应反馈。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.5.2 债券回售申报消息

| 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 消息进行债券回售申报。 | |

| 标签 | 字段名 | | 字段描述 | 类型 |
|-------------------|------------|-----------|---|-----|
| | 消息头 | | MsgType 取值: D=申报。 | |
| 11 | CIOrdID | | 会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码, 回售标的债券代码。 | C6 |
| 38 | OrderQty | | 回售数量, 单位手。 | 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 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 |

2.5.3 债券回售申报响应消息

| 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。 | |

2.5.4 债券回售撤单申报消息

| | |
|---------------------------------------|---------------|
| OrderCancel Request(reqtext) | 申报撤单消息 |
| 描述: 同大宗业务申报撤单消息, 买卖方向无意义 | |

2.5.5 债券回售撤单申报成功响应消息

| | |
|---------------------------------------|---------------|
| 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。 | |

2.5.6 债券回售撤单申报失败响应消息

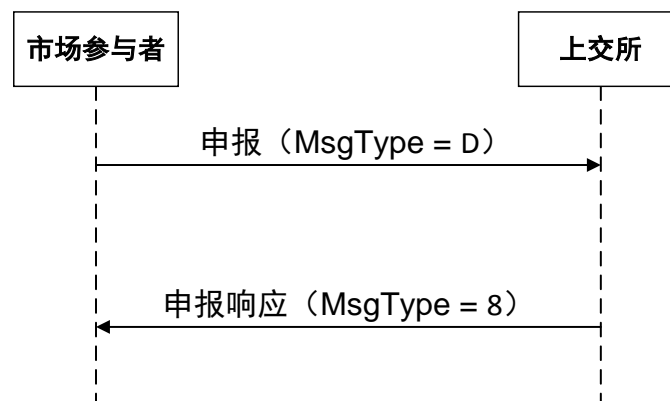
| | |
|-------------------------------------|-------------------|
| OrderCancelReject (resptext) | 申报撤单失败响应消息 |
| 描述: 同大宗业务申报撤单失败响应消息。 | |

2.6 债券回售撤销业务消息规范

债券回售撤销各批次申报及响应消息结构均保持一致，以下简称债券回售撤销。

2.6.1 债券回售撤销消息流程图

根据债券回售撤销业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券回售撤销指令，上海证券交易所综合业务平台实时进行申报响应反馈。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.6.2 债券回售撤销申报消息

| | |
|--|-------------|
| 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 消息进行债券回售撤销申报。 | |

| 标签 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | |
|-----------------|------------|---|---------------------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值: D=申报。 | | |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 | |
| 48 | SecurityID | 证券代码, 回售撤销标的债券代码。 | C6 | |
| 38 | OrderQty | 回售撤销数量, 单位手。 | 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 | |

2.6.3 债券回售撤销申报响应消息

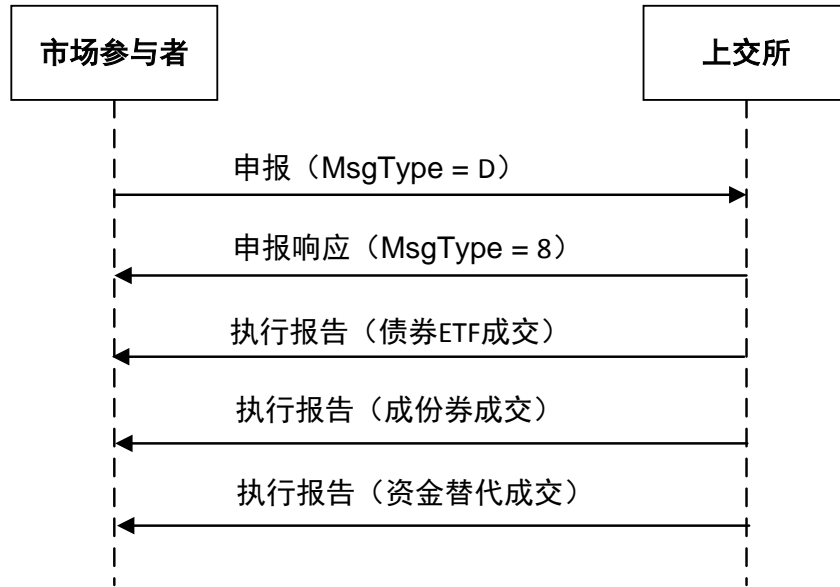
| | |
|---------------------------------------|---------------|
| ExecutionReport (resptext) | 申报响应消息 |
| 描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。 | |

3 ETF 申赎实时消息规范

3.1 ETF 申购业务消息规范

3.1.1 债券 ETF 申购消息流程图

当前仅支持债券 ETF 申赎，根据债券 ETF 申赎业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券 ETF 申购指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



3.1.2 债券 ETF 申购申报消息

| NewOrderSingle (reqtext) | 申报消息 |
|--|------|
| <p>描述:</p> <p>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。</p> <p>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券 ETF 申购申报。</p> | |

| 标签 | 字段名 | 字段描述 | 类型 |
|----|------------|------------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值: D=申报。 | |
| 11 | CIOrdID | 会员内部编号。 | C10 |
| 48 | SecurityID | 证券代码, 债券 ETF 二级市场交易代码。 | C6 |
| 38 | OrderQty | 申购份额数量。 | 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 |

3.1.3 债券ETF申购申报响应消息

| | |
|---------------------------------------|---------------|
| 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。 | |

3.1.4 债券ETF申购执行报告消息

| | |
|--|-----------------|
| ExecutionReport (execreporttext) | 实时执行报告消息 |
| 描述: 执行报告表中的execreporttext字段数据。 对于债券ETF申购申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录，如下： <ol style="list-style-type: none"> 1、一条执行报告类型为1、辅助证券代码为债券ETF二级市场交易代码、成交金额为0、成交数量为申购数量，买卖方向为1的成交记录。 2、若干条执行报告类型为2、辅助证券代码为债券ETF成份证券代码、成交金额为0，成交数量为过户数量，买卖方向为2的成交记录。 3、一条执行报告类型为3、成交金额为现金替代总额、成交数量为0、买卖方向为1的成交记录。（注：如无资金替代，则无该条执行报告。） 基金公司作为对手方收到的执行报告与投资者收到的执行报告买卖方向相反。 | |

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 |
|----|-----|------|----|
|----|-----|------|----|

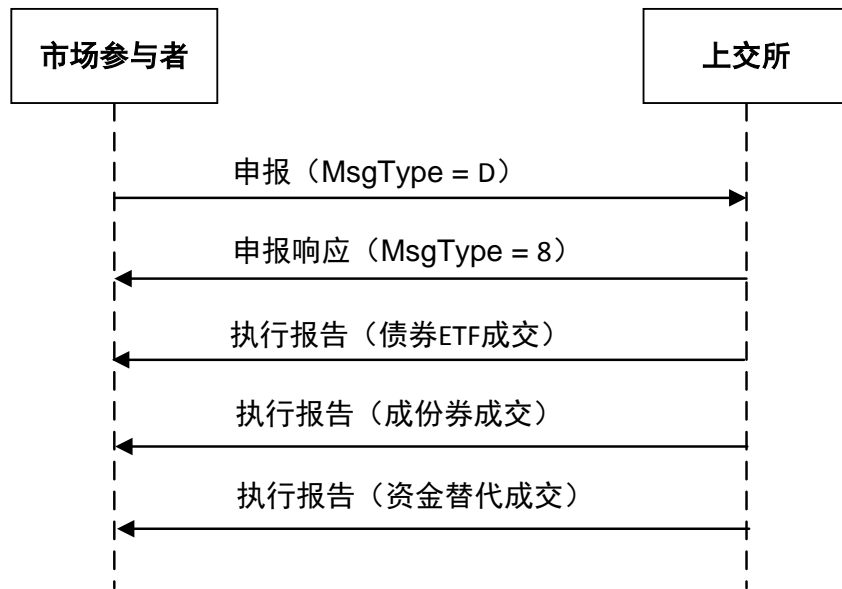
| | | | | |
|--------|-----------------|------------------|--|--------|
| | 消息头 | | MsgType 取值: 8=成交回报。 | |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号, 对于基金公司填写对手方投资者证券账户。 | C10 |
| 37 | OrderID | | 交易所订单编号。 | C16 |
| 17 | ExecID | | 成交编号, 目前本业务有效位用到 10 位。 | C16 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码, 债券 ETF 交易代码。 | C6 |
| 856 | TradeReportType | | 执行报告类型。取值: 1=债券 ETF 成交; 2=债券 ETF 成份券成交; 3=资金替代成交。 | C1 |
| 455 | SecurityAltID | | 辅助证券代码, 取值为债券 ETF 或成份券证券代码, 当 TradeReportType 取值为 1、2 时有效, 其余默认为空。 | C6 |
| 32 | LastQty | | 成交数量, 当 TradeReportType 取值为 1、2 时有效, 其余默认为 0。 | N12 |
| 555 | NoLeges | | 资金替代组合数量, 当 TradeReportType 取值为 3 时有效, 其余默认为 0。取值不超过 3, 后接重复组。 | N2 |
| 现金替代组合 | 1644 | MarginAmtType | 资金类型, 取值: 1=沪市资金; 2=深市资金; 9=非沪深资金。 | C1 |
| | 8504 | TotalValueTraded | 成交金额, 单位为元。 | N16(3) |
| 8503 | NumTrades | | 执行报告记录总条数。 | N12 |
| 54 | Side | | 买卖方向, 取值: 1=买; 2=卖。 | C1 |
| 60 | TransactTime | | 订单执行时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。 | C21 |
| 42 | OrigTime | | 原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 |
| 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 |

3.2 ETF 赎回业务消息规范

3.2.1 债券 ETF 赎回消息流程图

当前仅支持债券ETF申赎，根据债券ETF申赎业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券ETF赎回指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



3.2.2 债券 ETF 赎回申报消息

| | |
|---------------------------------|------|
| NewOrderSingle (reqtext) | 申报消息 |
| 描述: | |

| | |
|---|-------------|
| NewOrderSingle (reqtext) | 申报消息 |
| 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券 ETF 赎回申报。 | |

| 标签 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | |
|----------------|------------|--|--------------------------------|-----|
| | 消息头 | MsgType 取值： D=申报。 | | |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。 | C10 | |
| 48 | SecurityID | 证券代码，债券 ETF 二级市场交易代码。 | C6 | |
| 38 | OrderQty | 赎回份额数量。 | 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 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 | |

3.2.3 债券 ETF 赎回申报响应消息

| | |
|---------------------------------------|---------------|
| 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。 | |

3.2.4 债券 ETF 赎回执行报告消息

| | |
|---|-----------------|
| ExecutionReport (execreporttext) | 实时执行报告消息 |
| 描述： | |

| ExecutionReport (execreporttext) | 实时执行报告消息 |
|---|----------|
| 执行报告表中的 <code>execreporttext</code> 字段数据。 对于债券 ETF 赎回申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录，如下： <ol style="list-style-type: none"> 1、一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为债券 ETF 二级市场交易代码、成交金额为 0、成交数量为申购数量，买卖方向为 2 的成交记录。 2、若干条执行报告类型为 2、辅助证券代码为债券 ETF 成份证券代码、成交金额为 0，成交数量为过户数量，买卖方向为 1 的成交记录。 3、一条执行报告类型为 3、成交金额为现金替代总额、成交数量为 0、买卖方向为 2 的成交记录。（注：如无资金替代，则无该条执行报告。） 基金公司作为对手方收到的执行报告与投资者收到的执行报告买卖方向相反。 | |

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | |
|-----|-----------------|---|----------|----|
| | 消息头 | MsgType 取值： 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证券账户。 | 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。 | C16 | |
| 48 | SecurityID | 证券代码，填写债券 ETF 交易代码。 | C6 | |
| 856 | TradeReportType | 执行报告类型。取值如下： 1=债券 ETF 成交； 2=债券 ETF 成份券成交； 3=资金替代成交。 | C1 | |
| 455 | SecurityAltID | 辅助证券代码，取值为债券 ETF 或成份券证券代码，当 TradeReportType 取值为 1、2 时有效，其余默认为空。 | C6 | |
| 32 | LastQty | 成交数量，当 TradeReportType 取值为 1、2 时有效，其余默认为 0。 | N12 | |
| 555 | NoLeges | 资金替代组合数量，当 TradeReportType 取值为 3 时有效，其余默认为 0，取值不超过 3，后接重复组。 | N2 | |
| 现金替 | 1644 | MarginAmtT | 资金类型，取值： | C1 |

| | | | | |
|-----------------|--------------|------------------|---|--------|
| 代组合 | | ype | 1=沪市资金; 2=深市资金; 9=非沪深资金。 | |
| | 8504 | TotalValueTraded | 成交金额, 单位为元。 | N16(3) |
| 8503 | NumTrades | | 执行报告记录总条数。 | N12 |
| 54 | Side | | 买卖方向, 取值: 1=买; 2=卖。 | C1 |
| 60 | TransactTime | | 订单执行时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。 | C21 |
| 42 | OrigTime | | 原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 |
| 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 |

4 债券非交易盘前数据接口

4.1 债券非交易基础信息接口 **zfjyyyyymmdd.xml**

| | |
|---|--------------------|
| zfjyyyyymmdd.xml | 债券非交易基础信息接口 |
| 描述: 本文件包含债券非交易相关基础信息数据；文件名中 yyyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期；交易日开市前该文件通过单向卫星等渠道向市场发送；文件格式为 xml 格式，中文字符采用 GBK 编码，每条债券非交易信息对应 XML 中一条 Non_Trd_Rec 记录。 | |

| zfjyyyyymmdd.xml | | 债券非交易基础信息（债券质押式回购出入库） | |
|-------------------------|--------------|---|-----|
| 序号 | 字段名称 | 描述 | 类型 |
| 1 | Inst_ID | 证券代码。 | C6 |
| 2 | Inst_Nam | 证券简称。 | C8 |
| 3 | Busi_Typ | 业务类型： BPD=债券质押式回购入库； BPW=债券质押式回购出库。 | C3 |
| 4 | Nts_Bgn_Dat | 订单输入开始日期。 | C8 |
| 5 | Nts_End_Dat | 订单输入结束日期。 | C8 |
| 6 | Rond_Lot_Qty | 整手数，申报订单数量必须为该字段取值的整数倍，基金单位为份。 | N12 |
| 7 | Min_Ord_Qty | 申报订单的最小订单数量，债券单位为手，基金单位为份。 | N12 |
| 8 | Max_Ord_Qty | 申报订单的最大订单数量，债券单位为手，基金单位为份。 | N12 |

| zfjyyyyymmdd.xml | | 债券非交易基础信息（转股、换股） | |
|-------------------------|----------|-------------------------|----|
| 序号 | 字段名称 | 描述 | 类型 |
| 1 | Inst_ID | 证券代码。 | C6 |
| 2 | Inst_Nam | 证券简称。 | C8 |

| | | | |
|----|--------------|-------------------------------------|--------|
| 3 | Busi_Typ | 业务类型： BES=可转换债转股； BSS=可交换债换股。 | C3 |
| 4 | Tar_Inst_ID | 转股/换股目标证券代码。 | C6 |
| 5 | Tar_Inst_Nam | 转股/换股目标证券简称。 | C8 |
| 6 | Nts_Bgn_Dat | 订单输入开始日期。 | C8 |
| 7 | Nts_End_Dat | 订单输入结束日期。 | C8 |
| 8 | Rond_Lot_Qty | 整手数，申报订单数量必须为该字段取值的整数倍。 | N12 |
| 9 | Min_Ord_Qty | 申报订单的最小订单数量，债券单位为手。 | N12 |
| 10 | Max_Ord_Qty | 申报订单的最大订单数量，债券单位为手。 | N12 |
| 11 | Non_Trd_Prc | 转股/换股价格，单位为元。 | N13(5) |

| zfjyyyyymmdd.xml | | 债券非交易基础信息（回售、回售撤销） | |
|------------------|--------------|-----------------------------------|--------|
| 序号 | 字段名称 | 描述 | 类型 |
| 1 | Inst_ID | 证券代码。 | C6 |
| 2 | Inst_Nam | 证券简称。 | C8 |
| 3 | Busi_Typ | 业务类型： BSB=债券回售； BSC=债券回售撤销。 | C3 |
| 4 | Nts_Bgn_Dat | 订单输入开始日期。 | C8 |
| 5 | Nts_End_Dat | 订单输入结束日期。 | C8 |
| 6 | Rond_Lot_Qty | 整手数，申报订单数量必须为该字段取值的整数倍。 | N12 |
| 7 | Min_Ord_Qty | 申报订单的最小订单数量，债券单位为手。 | N12 |
| 8 | Max_Ord_Qty | 申报订单的最大订单数量，债券单位为手。 | N12 |
| 9 | Non_Trd_Prc | 回售价格，单位为元。 | N13(5) |

5 基金非交易盘前数据接口

5.1 基金非交易基础信息接口 jfjyyyyymmdd.xml

| jfjyyyyymmdd.xml | 基金非交易基础信息接口 |
|--|-------------|
| <p>描述:</p> <p>本文件包含基金非交易相关基础信息数据（目前仅包含债券 ETF 申赎）；文件名中 yyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期；交易日开市前该文件通过单向卫星等渠道向市场发送；文件格式为 XML 格式，中文字符采用 GBK 编码，每条基金非交易信息对应 XML 中一条 Non_Trdd_Rec 记录。</p> | |

| jfjyyyyymmdd.xml | | 基金非交易基础信息接口（单市场/跨市场ETF申赎） | |
|------------------|----------|---|----|
| 序号 | 字段名称 | 字段描述 | 类型 |
| 1 | Inst_ID | 证券代码。 | C6 |
| 2 | Inst_Nam | 证券简称。 | C8 |
| 3 | Busi_Typ | 业务类型： IEC=单市场/跨市场 ETF 申购； IER=单市场/跨市场 ETF 赎回。 | C3 |

6 债券盘后数据接口

6.1 债券过户数据 zqghXXXXX.txt

| zqghXXXXX.txt | 债券过户数据接口 |
|--|----------|
| 描述: 文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。 (1) 仅包含质押式回购出入库过户记录, 可转债转股、可交换债换股、债券回售、债券回售撤销, 不产生过户记录, 最终以登记公司的相关数据为准。 | |

| 序号 | 字段名称 | 字段描述 | 类型 |
|----|--------|---|--------|
| 1 | 证券账户 | | C10 |
| 2 | 成交日期 | 格式为 YYYYMMDD。 | C8 |
| 3 | 成交编号 | | N16 |
| 4 | 交易单元 | | C5 |
| 5 | 成交数量 | 债券单位单位为手, 基金单位为份。 | N15(3) |
| 6 | 证券代码 | | C6 |
| 7 | 申报时间 | 格式为 HHMMSS。 | C6 |
| 8 | 成交时间 | 格式为 HHMMSS。 | C6 |
| 9 | 成交价格 | 单位为元。 | N13(5) |
| 10 | 成交金额 | 单位为元。 | N18(5) |
| 11 | 会员内部编号 | | C10 |
| 12 | 买卖方向 | 取值: B=买; S=卖。 | C1 |
| 13 | 业务类型 | 取值: BPD=债券质押式回购入库; BPW=债券质押式回购出库。 | C3 |
| 14 | 信用标签 | 预留, 用于扩展, 默认为空格。 | C2 |

7 基金盘后数据接口

7.1 基金过户数据接口 jjghXXXXX.txt

| | |
|--|-----------------|
| jjghXXXXX.txt | 基金过户数据接口 |
| 描述: 文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。 (1) 目前仅包含债券 ETF 申赎过户记录。 | |

| 序号 | 字段名称 | 字段描述 | 类型 |
|----|--------|--|--------|
| 1 | 证券账户 | | C10 |
| 2 | 成交日期 | 格式为 YYYYMMDD。 | C8 |
| 3 | 成交编号 | | N16 |
| 4 | 交易单元 | | C5 |
| 5 | 证券代码 | 针对业务类型 IEC、IER 有效，填写债券 ETF 交易代码。 | C6 |
| 6 | 记录类型 | 针对业务类型 IEC、IER 有效，取值： 1=债券 ETF 成交； 2=债券 ETF 成份券成交； A=沪市资金； B=深市资金； I=非沪深资金。 | C1 |
| 7 | 辅助证券代码 | 记录类型为 1、2 时有效，取值为债券 ETF 或成份券证券代码，其余默认为空。 | C6 |
| 8 | 申报时间 | 格式为 HHMMSS。 | C6 |
| 9 | 成交时间 | 格式为 HHMMSS。 | C6 |
| 10 | 成交价格 | 默认为 0。 | N13(5) |
| 11 | 成交数量 | 记录类型为 1、2 时有效，其余默认为 0；基金单位为份，债券单位为手。 | N15(3) |
| 12 | 成交金额 | 记录类型为 A、B、I 时有效，其余默认为 0，单位为元。 | N18(5) |
| 13 | 会员内部编号 | | C10 |

| | | | |
|----|------|---|----|
| 14 | 买卖方向 | 取值： B=买； S=卖。 | C1 |
| 15 | 业务类型 | 取值： IEC=单市场/跨市场 ETF 申购； IER=单市场/跨市场 ETF 赎回。 | C3 |