

---

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  
(定向可转债技术开发稿)  
(1.45a 版)



上海证券交易所

二〇二〇年十月

---

# 目录

1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范 .....	3
2 定向可转债业务消息规范 .....	8
2.1.....定向可转债转让业务消息规范 .....	8
2.1.1.....公共数据消息 .....	8
2.1.2.....定向可转债转让意向申报消息/意向申报撤单消息 .....	8
2.1.3.....定向可转债转让意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息 .....	8
2.1.4.....定向可转债转让成交申报 .....	9
2.1.5.....定向可转债申报撤单消息 .....	9
2.1.6.....定向可转债申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....	9
2.1.7.....定向可转债申报撤单失败响应消息 .....	9
2.1.8.....执行报告消息 .....	10
2.2.....定向可转债转股业务消息规范 .....	10
2.2.1.....定向可转债转股消息流程图 .....	10
2.2.2.....定向可转债转股申报 .....	11
2.2.3.....定向可转债申报撤单消息 .....	12
2.2.4.....定向可转债申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....	12
2.2.5.....定向可转债申报撤单失败响应消息 .....	12
2.3.....定向可转债回售业务消息规范 .....	13
2.3.1.....定向可转债回售消息流程图 .....	13
2.3.2.....定向可转债回售申报 .....	13
2.3.3.....定向可转债申报撤单消息 .....	14
2.3.4.....定向可转债申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....	14
2.3.5.....定向可转债申报撤单失败响应消息 .....	14
3 债券非交易盘前数据接口 .....	16
3.1.....债券非交易基础信息接口 <b>zfjyyyyymmdd.xml</b> .....	16
4 盘后数据接口 .....	18
4.1.....过户数据接口 <b>dghXXXXXYYYYMMDD.dbf</b> .....	18
5 后记 .....	19

## 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
<b>定向可转债</b>	<b>CBI</b>	<b>定向可转债转股申报</b>

	<b>CBR</b>	<b>定向可转债回售申报</b>
--	------------	------------------

**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	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	01	N/A	102

申赎	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 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	17 18	N/A	106

	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	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
<u>定向可转债</u>	<u>CBT 定向可转债转股申报</u> <u>CBR 定向可转债回售申报</u>	<u>N/A</u>	N/A	<u>01201</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 定向可转债业务消息规范

### 2.1 定向可转债转让业务消息规范

#### 2.1.1 公共数据消息

IOI (mdtext)	公共数据消息
<p><b>描述:</b></p> <p>公共数据表中的 mdtext 字段数据。</p> <p>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。</p> <p>定向可转债转让意向订单申报成功后，生成公共广播，公共广播数据格式同大宗意向申报。</p>	

#### 2.1.2 定向可转债转让意向申报消息/意向申报撤单消息

IOI (reqtext)	意向申报消息/意向申报撤单消息
<p><b>描述:</b></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 IOI 消息进行意向申报或撤单。</p> <p>定向可转债转让意向申报消息/意向申报撤单消息同大宗意向申报消息/意向申报撤单消息。参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.3 章节。</p> <p>此处，大宗意向申报消息/意向申报撤单消息中的数量字段表示转让数量，单位为手（1000 元面值为一手）。</p>	

#### 2.1.3 定向可转债转让意向申报响应消息/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
<p><b>描述:</b></p> <p>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。</p> <p>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。</p> <p>定向可转债转让意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息同大宗意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息。参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版</p>	



<b>QuoteResponse (resptext)</b>	意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息
_20190805》中 2.4 章节。	

#### 2.1.4 定向可转债转让成交申报

<b>NewOrderSingle (reqtext)</b>	成交申报消息
<b>描述:</b> 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。 定向可转债转让成交申报同大宗成交申报。参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.5 章节。 此处，大宗成交申报中的数量字段表示转让数量，单位为手（1000 元面值为一手）。	

#### 2.1.5 定向可转债申报撤单消息

<b>OrderCancel Request (reqtext)</b>	申报撤单消息
<b>描述:</b> 定向可转债转让成交申报、转股申报、回售申报支持撤单。 同大宗业务申报撤单消息，参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.6 章节。 此处，大宗申报撤单消息中的订单数量字段，单位为手（1000 元面值为一手）。	

#### 2.1.6 定向可转债申报响应消息/申报撤单成功响应消息

<b>ExecutionReport (resptext)</b>	申报响应消息
<b>描述:</b> 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息，参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.7 章节。	

#### 2.1.7 定向可转债申报撤单失败响应消息

<b>OrderCancelReject (resptext)</b>	申报撤单失败响应消息
-------------------------------------	------------

OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
<p><b>描述:</b></p> <p>同大宗业务申报撤单失败响应消息，参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.8 章节。</p>	

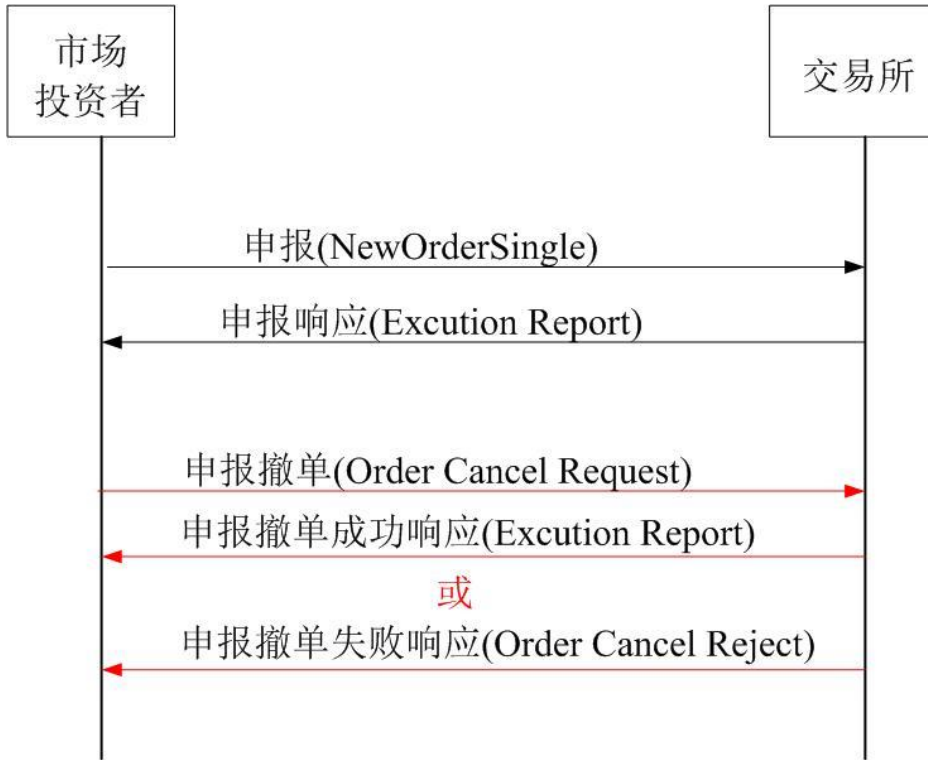
### 2.1.8 执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
<p><b>描述:</b></p> <p>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。</p> <p>每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息。</p> <p>定向可转债转让成交订单匹配成功后，生成并发送执行报告，执行报告格式同大宗执行报告消息。参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.9 章节。</p>	

## 2.2 定向可转债转股业务消息规范

### 2.2.1 定向可转债转股消息流程图

根据定向可转债业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报定向可转债转股指令，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。



### 2.2.2 定向可转债转股申报

<b>NewOrderSingle (reqtext)</b>	申报消息
<b>描述:</b> 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行定向可转债转股申报。	

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	
44	Price	转股价格	N11(3)	
38	OrderQty	转股数量, 单位为手 (1000 元面值为一手)。	N10	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含投资者证券帐户、PBU、营业部代码, 取值为 3。	N2	
证券账户	448	PartyID	投资者证券帐户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者证券帐户	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, 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

### 2.2.3 定向可转债申报撤单消息

OrderCancel Request (reqtext)	申报撤单消息
<p><b>描述:</b></p> <p>定向可转债转让成交申报、转股申报、回售申报支持撤单。</p> <p>同大宗业务申报撤单消息, 参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.6 章节。</p> <p>此处, 大宗申报撤单消息中的订单数量字段, 单位为手 (1000 元面值为一手)。</p>	

### 2.2.4 定向可转债申报响应消息/申报撤单成功响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
<p><b>描述:</b></p> <p>同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息, 参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.7 章节。</p>	

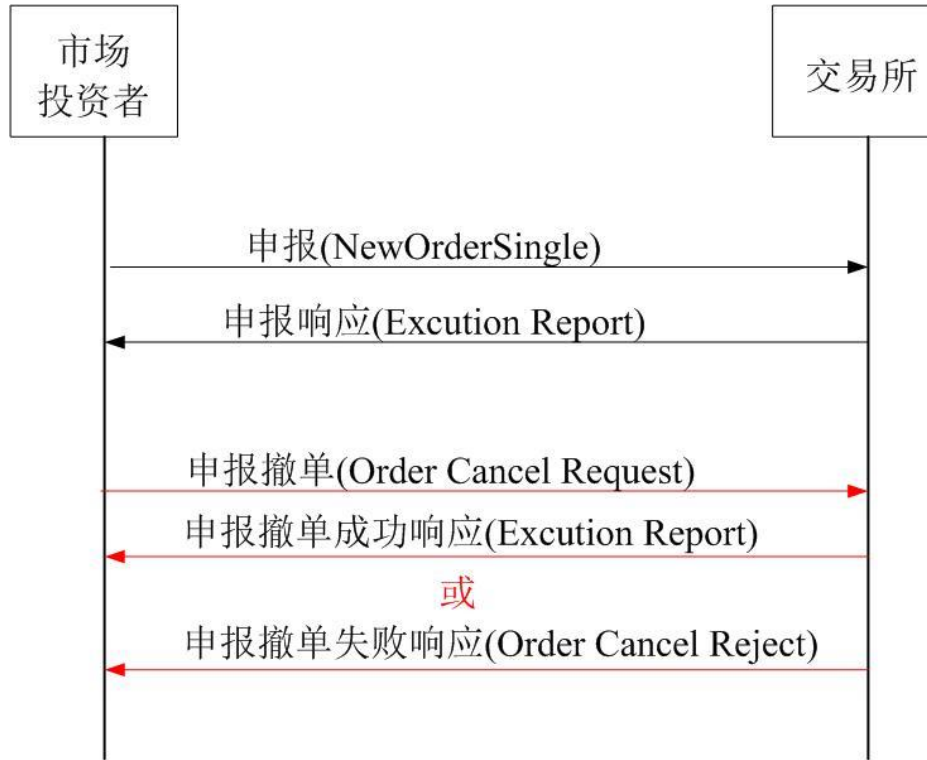
### 2.2.5 定向可转债申报撤单失败响应消息

OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
<p><b>描述:</b></p> <p>同大宗业务申报撤单失败响应消息, 参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.8 章节。</p>	

## 2.3 定向可转债回售业务消息规范

### 2.3.1 定向可转债回售消息流程图

根据定向可转债回售业务规则,市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报定向可转债回售指令,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 定向可转债回售申报

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
<b>描述:</b> 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行定向可转债回售申报。	

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	回售数量，单位为手。	N10	
453	NoPartyIDs	参与方个数，后接重复组，依次包含投资者证券帐户、PBU、营业部代码，取值为3。	N2	
证券账户	448	PartyID	投资者证券帐户	C10
	452	PartyRole	取5，表示当前PartyID的取值为投资者证券帐户	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，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	

### 2.3.3 定向可转债申报撤单消息

OrderCancel Request (reqtext)	申报撤单消息
<p><b>描述:</b></p> <p>定向可转债转让成交申报、转股申报、回售申报支持撤单。</p> <p>同大宗业务申报撤单消息，参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.6 章节。</p> <p>此处，大宗申报撤单消息中的订单数量字段，单位为手。</p>	

### 2.3.4 定向可转债申报响应消息/申报撤单成功响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
<p><b>描述:</b></p> <p>同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息，参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.7 章节。</p>	

### 2.3.5 定向可转债申报撤单失败响应消息

OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
------------------------------	------------

OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
<p><b>描述:</b></p> <p>同大宗业务申报撤单失败响应消息，参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.8 章节。</p>	

### 3 债券非交易盘前数据接口

#### 3.1 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
<b>描述:</b> 本文件包含债券非交易相关基础信息数据；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（定向可转债回售）	
序号	字段名称	描述	类型
1	Inst_ID	产品证券代码	C6
2	Inst_Nam	产品证券简称	C8
3	Busi_Typ	业务类型： CBR 定向可转债回售	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。	N13(5)

zfjyyyyymmdd.xml		债券非交易基础信息（定向可转债转股）	
序号	字段名称	描述	类型
1	Inst_ID	产品证券代码	C6
2	Inst_Nam	产品证券简称	C8
3	Busi_Typ	业务类型： CBT 定向可转债转股	C3



4	Tar_Inst_ID	转股目标证券代码	C6
5	Tar_Inst_Nam	转股目标证券简称	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	转股价格，单位为元。	N13(5)

## 4 盘后数据接口

### 4.1 过户数据接口 dghXXXXXYYYYMMDD.dbf

dghXXXXXYYYYMMDD.dbf	过户数据接口
<p><b>描述:</b></p> <p>文件名中 XXXXX 表示业务交易单元号。闭市后发送。</p> <p>包含定向可转债转让申报成交数据，过户数据接口格式同大宗业务过户数据接口 dghXXXXXYYYYMMDD.dbf。参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书 1.44 版_20190805》中 2.9 章节。</p>	

## 5 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 [tech\\_support@sse.com.cn](mailto:tech_support@sse.com.cn) 或者致电 4009003600。