

---

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  
(RTGS 技术开发稿)  
(1.46 版)



上海证券交易所

二〇二一年二月

---

## 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.46 版发布说明 2021.2

1、根据部分以全现金为对价申购的 ETF 产品支持 RTGS 申购模式的业务需求，调整 ETF 现金申赎相关接口说明。

---

# 目录

1	数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范 .....	4
2	ETF 现金申赎/黄金 ETF 实物申赎业务消息规范 .....	9
2.1	ETF 现金申赎/黄金 ETF 实物申赎 STEP 消息流程图 .....	9
2.2	申报消息 .....	10
2.3	申报响应消息 .....	11
2.4	执行报告消息 .....	11
3	过户数据接口 bghXXXXX.dbf .....	14

## 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
ETF 现金申赎 <sup>1</sup> 跨境 ETF 申赎/黄金 ETF 现金申赎/交易型货币市场基金申赎	EEC	ETF 现金申购跨境 ETF/黄金 ETF 现金/交易型货币市场基金申购
	EER	ETF 现金赎回跨境 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/REITs	LFS	上证 LOF/REITs 认购
	LFC	上证 LOF 申购
	LFR	上证 LOF 赎回
	LFT	上证 LOF/REITs 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

<sup>1</sup>ETF 现金申赎包括跨境 ETF 现金申赎、债券 ETF 现金申赎、黄金 ETF 现金申赎、交易型货币市场基金现金申赎以及其他本所支持的 ETF 现金申赎。

资金前端控制	CFC	资金前端控制
盘后固定价格申报	PFP	盘后固定价格申报
定向可转债	CBT	定向可转债转股申报
	CBR	定向可转债回售申报

数据广播类型（bcasttype），取值为：

- 01: ~~ETF 现金申赎~~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/REITs 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
<del>ETF 现金申赎</del> 跨境ETF申赎	EEC <del>ETF 现金申购</del> 跨境 <del>ETF/黄金ETF 现金/交易型货</del>	01	N/A	102

<del>/黄金 ETF 现 金申赎/交易型 货币市场基金 申赎</del>	<del>币市场基金申购 EER <u>ETF 现金赎回跨境</u> ETF/黄金 ETF 现金/交易型货 币市场基金赎回</del>			
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	02	03	101
	BPT 大宗交易			
	FPE 大宗固定价格交易	14	N/A	101
报价回购	QBD 报价入库	N/A	N/A	100
	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	N/A	N/A	100
	RNR 购回交易			
转融通	ZII 转融通非指定对手方	05,07,09	04	104
	ZPT 转融通指定对手方	06,08,10		
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	12	N/A	105
	OFR 货币市场基金赎回申 报			
股票质押回购	SPN 初始交易	N/A	N/A	100
	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	17 18	N/A	106
	BIP 国债预发行价格招标			

	申报			
上证 LOF	LFS 上证 LOF/REITs 认购 LFC 上证 LOF 申购 LFR 上证 LOF 赎回 LFT 上证 LO/REITs F 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	109
资金前端控制	CFC 资金前端控制申报	N/A	N/A	109
密码服务	PWS 密码服务申报 Password Service	N/A	N/A	109
盘后固定价格	PFP: 盘后固定价格申报	19	N/A	103
定向可转债	CBT 定向可转债转股申报 CBR 定向可转债回售申报	N/A	N/A	121

**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。

ETF 现金申赎对于跨境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,在没有特别声明的情况下,交易所后台一般根据买方业务PBU与CIOrdID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CIOrdID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,注意买卖双方业务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CIOrdID(即OrigCIOrdID)进行撤单,撤单订单作为一种新的订单,需新分配CIOrdID;报价回购提前购回中证券代码、买方帐号、买方PBU、卖方帐号、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。



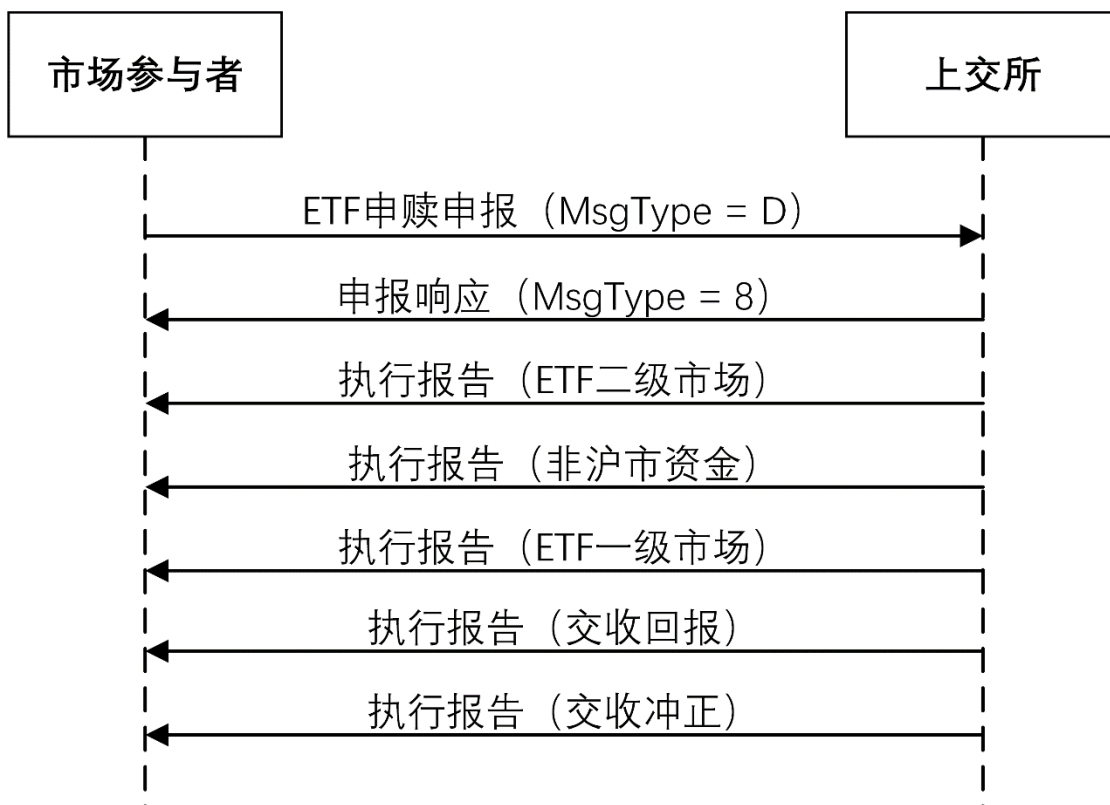
## 2 ETF 现金申赎跨境ETF/黄金ETF 实物/交易型货币市场基金 申赎业务消息规范

### 2.1 ETF 现金申赎跨境ETF/黄金ETF 实物/交易型货币市场基金 申赎 STEP 消息流程图

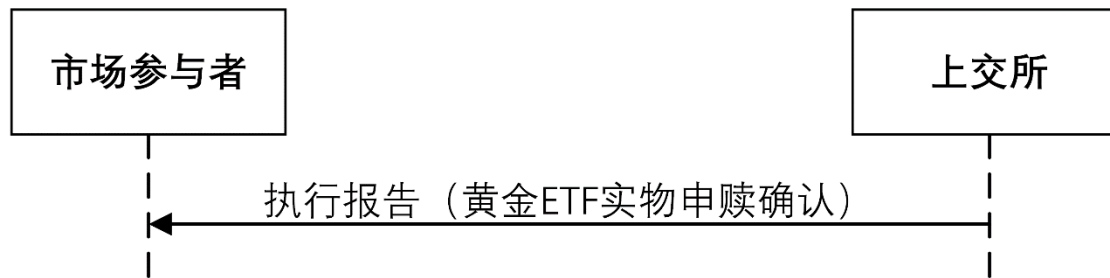
根据 ETF 现金跨境ETF/交易型货币市场基金 申赎流程，市场投资者可以通过 EzSTEP 进行申赎申报，交易所实时反馈申报确认，并实时反馈各类成交回报（即执行报告）。~~黄金ETF 现金申赎流程与上述业务相同~~，黄金ETF 实物申赎不通过 EzSTEP 申报，但通过 EzSTEP 向基金公司发送实物申赎确认执行报告，向市场发送实物申赎份额增减执行报告。

下图描述了申赎的 STEP 消息通信流程。

#### ETF 现金申赎：



#### 黄金ETF 实物申赎：



## 2.2 申报消息

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

## 2.3 申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	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。	

## 2.4 执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
<b>描述:</b> 执行报告表中的 execreporttext 字段数据。 对于 <u>ETF 现金跨境 ETF/黄金 ETF 现金/交易型货币市场基金</u> 申赎申报, 执行报告(即成交回报) 有三笔消息记录:	
<ul style="list-style-type: none"> <li>● 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)</li> <li>● 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三位。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, 结果四舍五入精确到小数点后两位。</li> <li>● 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。</li> </ul>	
对于使用 <u>RTGS 模式结算的 ETF 现金申购申报</u> , 除以上三笔之外, 在盘中通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 <u>RTGS 成功交收</u> , 会有以下执行报告(交收回报)消息记录:	
<ul style="list-style-type: none"> <li>● <u>一条 ETF 二级市场交易代码交收记录, ExecType 取值为 K, 证券代码为二级市场交易代码, 价格为 0, 数量为交收数量, 金额为清算金额, 成交编号为交收编号。</u></li> </ul>	
对于使用 <u>RTGS 模式结算的 ETF 现金交收回报</u> , 如遇需要冲正, 则会收到对应一笔执行报告(交收冲正)消息记录:	
<ul style="list-style-type: none"> <li>● <u>一条 ETF 二级市场交易代码交收冲正记录, ExecType 取值为 5, 证券代码为二级市场交易代码, 价格为 0, 数量为相对于原交收数量的变更数量(正数表示记增, 负数表示记减), 金额为相对于原清算金额的变更金额, 成交编号同交收回报中交收编号。</u></li> </ul>	
基金公司作为对手方收到对应的成交、交收、冲正数据。	

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
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， <del>跨境 ETF 申赎/黄金 ETF 现金申赎和交易型货币市场基金申赎</del> 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

		<u>K=成交且完成交收</u> <u>5=已替换，表示发生交收冲正</u>		
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

### 3 过户数据接口 bghXXXXX.dbf

bghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p><b>描述:</b></p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>过户数据接口 bghXXXXX.dbf 和相同 PBU 的 dghXXXXXYYYMMDD.dbf（如有）压缩到现有的 dghXXXXX.zip 文件中供券商用 RptGet 下载。</p> <p>对于 <b>ETF 现金申赎/跨境 ETF/黄金 ETF 实物/交易型货币市场基金</b> 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>对于中登身份认证的密码服务没有过户数据。</p>	

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。	N12

		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。	
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	cjg	成交价格  对于报价回购业务为到期价格;对于报价回购提前回购业务为提前回购价格;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	cje	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,ETF 现金跨境 ETF/黄金 ETF 现金申赎业务、 <del>交易型货币市场基金</del> 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	C3

		RNR 购回交易 EEC <del>ETF 现金申购</del> 跨境ETF/黄金ETF 现金/交易型货币市场基金申 购 EER <del>ETF 现金赎回</del> 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 PFP 盘后固定价格申报	
13	bs	买卖方 B: 买方, <del>ETF 现金</del> 跨境ETF/黄金ETF <del>实物</del> /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, <del>ETF 现金</del> 跨境ETF/黄金ETF <del>实物</del> /交易型货币市场基金/货币	C1



		<p>市场基金/上证 LOF 赎回时为卖</p> <p>对于 <del>ETF 现金申赎</del><del>跨境 ETF</del><del>交易型货币市场基金</del>/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。</p> <p>对于转融通业务，证金公司申报成交此字段为 <b>B</b>，出借人申报成交为 <b>S</b>。</p> <p>对于股票质押回购，融出方取 <b>B</b>，融入方取 <b>S</b>。</p> <p>对 LOF 认购、转托管和分拆合并，暂无意义。</p> <p>对于网络投票，无意义填写方，<b>B</b>：买。</p>	
14	text	<p>备注</p> <p>对于转融通业务，第 1-5 位表示期限，第 6 位表示战略配售股份标志，填写“<b>S</b>”表示本次成交为战略配售股份出借成交，否则表示非战略配售股份出借成交。</p> <p>对于货币基金场内实时申赎 <b>E</b> 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。</p> <p>对于 LOF 转托管业务，左对齐填写转入方基金参与方编码。</p> <p>对网络投票：</p> <p>左起第 1 至 10 位为议案及子议案（左对齐）；</p> <p>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）。</p>	C30