

上海证券交易所

互联网交易平台市场参与者接口规格说明书（跨境业务卷）

V1.00



二〇二二年三月

文档版本

日期	版本	状态	说明
2021-08	V0.10	开发稿	创建文档
2021-10	V0.20	开发稿	1. TargetCompID 接收方为交易所时固定填“TDGW” 2. TransactTime 格式调整为 UTCTimestamp 除特别说明，文件接口中的时间均为北京时间（UTC+08:00）
2021-12	V0.30	开发稿	1. 执行回报 ExecType=F 时，成交金额必填 2. 返回给上交所的执行报告，针对同一笔订单，订单申报成功或部分成交（执行类型 ExecType=0 或 F）后，不支持返回拒单（ExecType=8）执行报告 3. 执行回报新增说明，港股自动撤销时 OrigClOrdID 为原被撤销订单的 ClOrdID，ClOrdID 填 0
<u>2022-01</u>	<u>V0.31</u>	<u>开发稿</u>	<u>成交明细文件中成交价格增加整数部分不超过 6 位的限制</u>
<u>2022-03</u>	<u>V1.00</u>	<u>正式稿</u>	

目录

1. 概述.....	4
1.1. 使用说明.....	4
1.2. 术语和定义.....	4
1.3. 参考文档.....	4
1.4. 业务范围.....	5
2. 实时交易.....	6
2.1. 会话机制.....	6
2.2. 其他约定.....	6
2.3. 消息流图.....	7
2.3.1. 新订单申报.....	7
2.3.2. 撤单申报.....	7
2.3.3. 数据同步.....	8
2.4. 消息定义.....	8
2.4.1. 消息结构.....	8
2.4.2. 业务消息.....	9
2.5. 消息格式.....	15
2.5.1. 数据类型.....	15
2.5.2. 数据字典.....	16
3. 文件接口.....	19
3.1. 数据类型约定.....	19
3.2. 国际化产品信息文件.....	20
3.3. B转H成交明细文件.....	20
3.4. B转H总股本文件.....	21
4. 附录.....	22
4.1. 附一 TDGW 错误代码说明.....	22

1. 概述

1.1. 使用说明

本接口规格说明书（以下简称“本接口”）规定了证券公司等会员单位及相关市场参与主体（以下简称“市场参与主体”）与上海证券交易所技术系统（以下简称“本所技术系统”）进行数据文件交换的接口规范。

1.2. 术语和定义

名词	含义
TDGW	TraDing GateWay 交易网关
ztDisk	证通云盘
STEP	Securities Trading Exchange Protocol 证券交易数据交换协议，由中国证券监督管理委员会发布
FIX	Financial Information Exchange 金融信息交换协议
LFIXT	Lightweight FIXT 轻量级 STEP 会话层协议，由上海证券交易所和深圳证券交易所联合发布

1.3. 参考文档

名称
《IS101 上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》
《IS122 上海证券交易所交易网关接口规格说明书》
《证券交易数据交换协议》
《轻量级 STEP 会话层接口规范》

1.4. 业务范围

支持互联网交易平台 B 转 H 相关业务：

平台	业务	订单申报时间	成交回报时间
互联网交易平台 (PlatformID = 6)	B 转 H 业务 (ApplID = 600010)	9:15-11:30 13:00-15:00	9:30-12:00 13:00-16:10

2. 实时交易

实时订单申报通过上海证券交易所跨境交易网关进行传输，使用 STEP 协议接入。

本文档的术语、消息格式、字段定义以及消息流描述均遵照 STEP 1.20 及 FIX 5.0 SP2 协议规范。

2.1. 会话机制

市场接入用户的订单管理系统（简称“OMS”）与跨境交易网关之间的会话机制遵循《轻量级 STEP 会话协议接口规范》（简称“LFIXT”）。

2.2. 其他约定

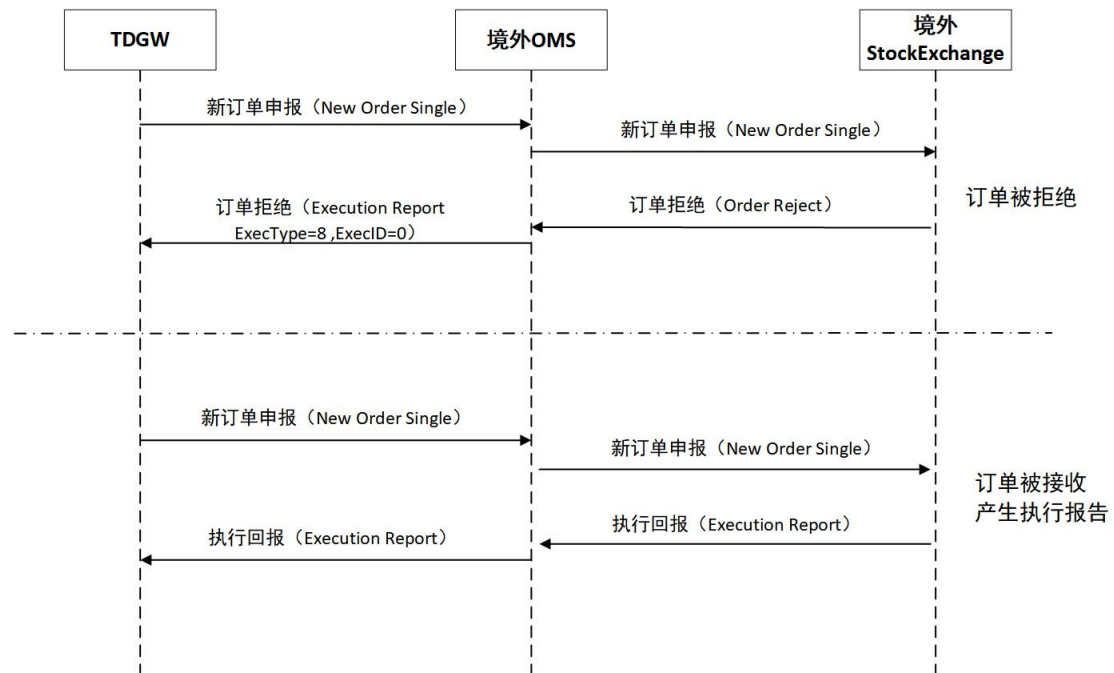
- 1) 当前市场接口对应的协议版本号为 ~~01.00.30~~ 版本，在登录消息（Logon）的 DefaultCstmApplVerID 字段中需填写协议版本号。具体填写方式见“会话层域定义”描述。
- 2) TDGW 在未成功登录至交易系统时，OMS 将无法成功与 TDGW 建立会话；TDGW 与 ITCS 连接断开时，TDGW 将注销与 OMS 间的会话，此时 OMS 应稍后尝试重建会话，或切换至备用 TDGW 服务。

此外，TDGW 在以下情况下会主动断开与 OMS 间的连接：

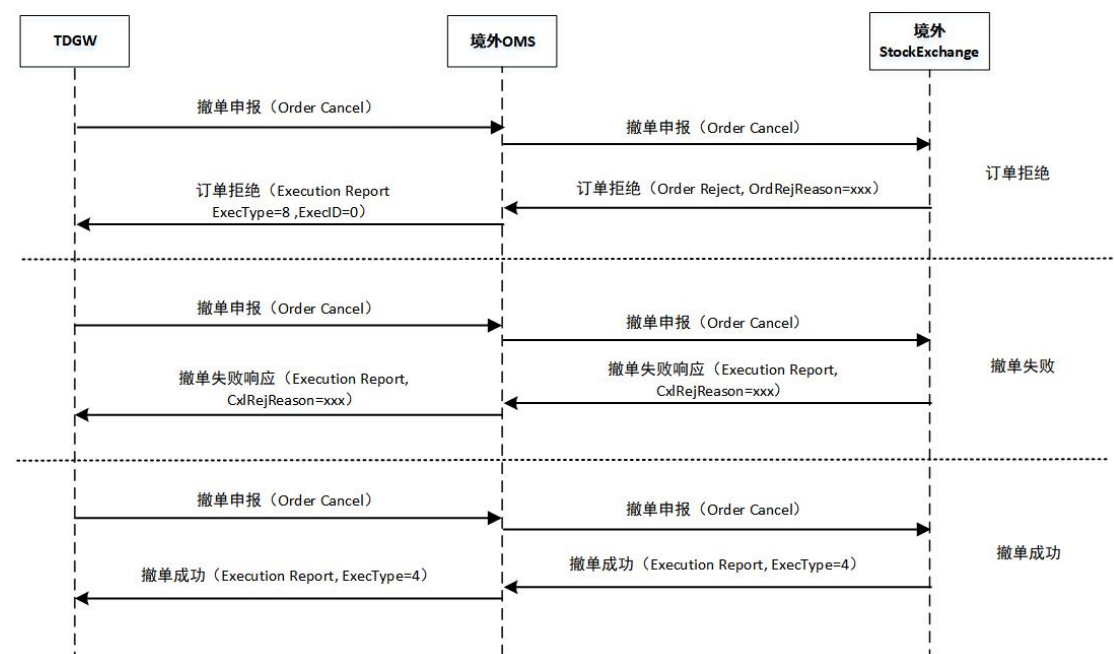
- OMS 与 TDGW 建立 TCP 连接之后，超过 5 秒未完成登录；
- OMS 在登录失败之后，未在 5 秒内关闭连接；
- OMS 在发起注销后，未在 5 秒内关闭连接；
- OMS 未能及时处理 TDGW 下行消息，导致 TDGW 内积压的待发送消息超过特定阈值；
- TDGW 与 ITCS 间的连接已经断开；
- OMS 在登录成功后，5s 内未与 TDGW 进行委托类消息同步。

2.3. 消息流图

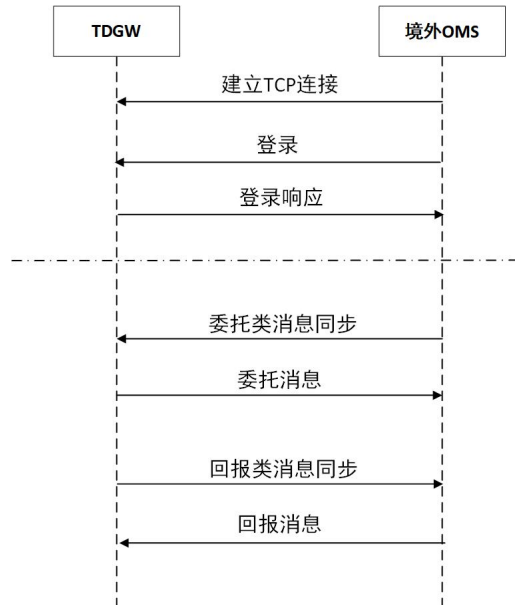
2.3.1. 新订单申报



2.3.2. 撤单申报



2.3.3. 数据同步



数据发送方应将业务数据按平台、类型（委托类、回报类）各自单独编号，并将编号写至字段 ApplSeqNum（1181）中。消息编号需连续递增，不能空缺、重复，否则将影响数据恢复和业务开展。

OMS（境外）成功登陆后，应首先进行数据同步（包括委托类与回报类），否则可能导致 TDGW 断开连接。若同步失败，请等待 1-5s 后重试。

2.4. 消息定义

2.4.1. 消息结构

每一条消息都由消息头、消息体、消息尾组成。消息总是由标准的消息头开始，标准的消息尾结束。

2.4.1.1. 消息头

会话双方所有交换的消息具有如下标准的消息头。

每一个消息都由一个标准消息头开始。消息头定义了消息的类型，长度，目的地，顺序号，起始点和时间等数据域，均不加密传输。

Tag	域名	必需	字段描述
8	BeginString	Y	起始串 FIXT.1.1(总是不加密，必须是消息的第一个域)
9	BodyLength	Y	消息体长度(总是不加密，必须是消息的第二个域)
35	MsgType	Y	消息类型(总是不加密，必须是消息的第三个域)
49	SenderCompID	Y	发送方代码字符串(总是不加密)
56	TargetCompID	Y	接收方代码字符串(总是不加密)，接收方为交易所时固定填“TDGW”
34	MsgSeqNum	Y	消息序号，整数类型
43	PossDupFlag	N	会话层可能重传标志，重复传送时，作此标记
97	PossResend	N	应用层可能重发标志。LFIXT 会话层协议的实现者不会在出向消息中主动设置本字段，对于入向消息中出现的本字段将简单忽略
52	SendingTime	Y	发送时间，UTCTimestamp 类型
347	MessageEncoding	N	消息中编码域的字符编码类型

2.4.1.2. 消息尾

会话双方所有交换的消息具有如下标准的消息尾。每一个消息（管理或应用消息）都用一个消息尾终止。消息尾可用于分隔多个消息，包含有 3 位数的校验和值。

Tag	域名	必需	字段描述
10	Checksum	Y	校验和，总是消息的最末域，总是不加密

2.4.2. 业务消息

2.4.2.1. 新订单消息 New Order Single

Tag	域名	必需	字段描述
-----	----	----	------

	标准消息头	Y	MsgType=D
1180	ApplID	Y	应用标识
1181	ApplSeqNum	Y	消息记录号 由交易所互联网交易平台（IITP）填入
11	ClOrdID	Y	交易客户方订单编号 由交易所定义的境内客户唯一订单编号
54	Side	Y	买卖方向 1=买入（Buy） 2=卖出（Sell）
60	TransactTime	Y	订单发起时间
组件<Instrument>		Y	证券定义
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 101=SH 证券交易所 103=XG 联合交易所
组件结束			
组件<OrderQtyData>		Y	数量
38	OrderQty	Y	订单数量
152	CashOrderQty	N	订单金额
组件结束			
59	TimeInForce	N	订单有效时间类型 0=当日有效（GFD）
40	OrdType	Y	订单类型 2=限价（Limit）
522	OwnerType	Y	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易
44	Price	Y	价格（限价订单时有效）
58	Text	N	Free Text
	标准消息尾	Y	

2.4.2.2. 撤单消息 Order Cancel

Tag	域名	必需	字段描述
	标准消息头	Y	MsgType=F
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识
1181	ApplSeqNum	Y	消息记录号
41	OrigClOrdID	Y	原始交易客户方订单编号，指示被撤消订单的 ClOrdID

11	ClOrdID	Y	交易客户方订单编号
54	Side	Y	买卖方向 1=买入（Buy） 2=卖出（Sell）
60	TransactTime	Y	订单发起时间
组件<Instrument>		Y	证券定义
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 101=SH 证券交易所 103=XG 联合交易所
组件结束			
组件<OrderQtyData>		Y	数量
38	OrderQty	Y	订单数量
组件结束			
522	OwnerType	Y	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易
58	Text	N	Free Text
	标准消息尾	Y	

2.4.2.3. 执行报告 Execution Report

2.4.2.3.1. 撤单失败执行报告

Tag	域名	必需	字段描述
	标准消息头	Y	MsgType=9
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识
1181	ApplSeqNum	Y	消息记录号 境外 OMS 填入
11	ClOrdID	Y	交易客户方订单编号
41	OrigClOrdID	Y	原始交易客户方订单编号，指示被撤消订单的 ClOrdID
39	OrdStatus	Y	订单状态 原始订单的当前订单状态
522	OwnerType	Y	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者

			104=自营交易
组件<Instrument>		Y	证券定义
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 101=SH 证券交易所 103=XG 联合交易所
组件结束			
组件<OrderQtyData>		Y	数量
38	OrderQty	Y	订单数量
152	CashOrderQty	N	订单金额
组件结束			
60	TransactTime	Y	执行报告时间
102	CxlRejReason	Y	撤单拒绝原因
1328	RejectText	N	拒绝原因说明
58	Text	N	Free Text
	标准消息尾	Y	

说明：

1. 当 CxlRejReason 取值为 19332，代表香港市场拒绝消息，具体拒绝代码及拒绝原因说明编入 RejectText。

2.4.2.3.2. 申报响应、成交回报及撤单成功响应

Tag	域名	必需	字段描述
	标准消息头	Y	MsgType=8
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识
1181	ApplSeqNum	Y	消息记录号 境外 OMS 填入
11	ClOrdID	Y	交易客户方订单编号，港股自动撤销时 ClOrdID 填 0
41	OrigClOrdID	N	原始交易客户方订单编号，指被撤消订单的 ClOrdID，撤单成功响应填写
17	ExecID	Y	执行编号，唯一执行标识（或称成交编号） ExecType=F 时，为成交编号
150	ExecType	Y	执行类型 0=新（New） 4=已撤消 8=已拒绝（Rejected） F=成交或部分成交（Trade (partial fill or fill)）

39	OrdStatus	Y	订单状态 原始订单的当前订单状态
103	OrdRejReason	N	订单拒绝时需要
1328	RejectText	N	拒绝原因说明，执行类型为 8 或 4 时填写
522	OwnerType	Y	订单所有者类型
54	Side	Y	买卖方向
组件<Instrument>		Y	证券定义
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 101=SH 证券交易所 103=XG 联合交易所
组件结束			
组件<OrderQtyData>		Y	数量
38	OrderQty	Y	订单数量
152	CashOrderQty	N	订单金额
组件结束			
59	TimeInForce	N	订单有效时间类型
40	OrdType	Y	订单类型 2=限价（Limit）
44	Price	N	价格
32	LastQty	N	成交数量
31	LastPx	N	成交价格
151	LeavesQty	Y	订单剩余数量
14	CumQty	Y	累计执行数量
60	TransactTime	Y	执行报告时间
8504	TotalValueTraded	N	成交金额，ExecType=F 时必填
58	Text	N	Free Text
	标准消息尾	Y	

说明：

1. 申报拒绝消息统一编入执行报告，使用 MsgType=8 消息类型（ExecType=8、ExecID=0）代替。
2. 当 OrdRejReason 取值为 19332，代表香港市场拒绝消息，具体拒绝代码及拒绝原因说明编入 RejectText。
3. 返回给上交所的执行报告，针对同一笔订单，订单申报成功或部分成交（执行类型 ExecType=0 或 F）后，不支持返回拒单（ExecType=8）执行报告。

2.4.2.4. 平台状态 PlatformState

Tag	域名	必需	字段描述
	标准消息头		MsgType = U109
10180	PlatformID	Y	平台标识： 6= 互联网交易平台
10181	PlatformStatus	Y	平台状态： 0 = NotOpen, 未开放 1 = PreOpen, 预开放 2 = Open, 开放 3 = Break, 暂停 4 = Close, 关闭

2.4.2.5. 数据同步消息 DataSync

Tag	域名	必需	字段描述
	标准消息头	Y	MsgType=U106
10180	PlatformID	Y	平台号 6=互联网交易平台
86	DlvyInst	Y	数据同步类型 SO=SyncOrder, 同步委托类数据 SR=SyncReport, 同步回报类数据
1399	ApplNewSeqNum	Y	对于新会话, 填 1; 否则置为已接收的最大 ApplSeqNum+1
	标准消息尾	Y	

数据同步类型如下：

数据恢复类型	消息类型	数据同步字段
委托类	新订单(D) 撤单请求(F)	DlvyInst=SO
回报类	申报响应、成交回报及 撤单成功响应(8) 撤单失败(9) 报告结束 (U110)	DlvyInst=SR

注：所有委托类消息严格按顺序统一编号，所有回报类消息严格按顺序统一编号。

2.4.2.6. 数据同步响应 DataSyncRsp

标签	字段名	必须	字段描述
	标准消息头		MsgType = U107
10180	PlatformID	Y	平台号 6=互联网交易平台
86	DlvyInst	Y	数据同步类型 SO=SyncOrder, 同步委托类数据 SR=SyncReport, 同步回报类数据
7	BeginSeqNo	Y	起始消息序号
16	EndSeqNo	Y	当前消息最大序号
103	OrdRejReason	Y	拒绝码
58	Text	N	Free Text
	标准消息尾	Y	

注：数据同步响应中 OrdRejReason 为 0 时表示成功，其他取值表示错误。

2.4.2.7. 报告结束 ExecRptEndOfStream

境外 OMS 发给此消息，通知其本交易日的回报数据已发送完毕。

标签	字段名	必须	字段描述
	标准消息头		MsgType = U110
10180	PlatformID	Y	平台号 6=互联网交易平台
1350	ApplLastSeqNum	Y	应用层的消息记录号 置为已发送出去的最大 ApplSeqNum+1 本消息编入回报编号序列。
	标准消息尾	Y	

说明：

1. OMS（境外）向 TDGW 发送，表示该执行报告流推送结束，后续该执行报告流上的序号将不再增加。

2.5. 消息格式

2.5.1. 数据类型

数据类型相关说明如下：

1. 字符串类型用 CX 表示，X 表示字符串最大字节数，除特别声明，字符串只包含数

字、大写字母、小写字母以及空格；字符串实际长度小于字段类型最大长度时可以不补空格；字符串统一采用 ASCII 编码。

2. 十进制整数用 NX 表示，X 表示整数最大位数（不包括正负号），除特殊说明，整数类型均有正负。

3. 浮点数用 NX(Y) 表示，X 表示整数与小数总计位数（不包括小数点及正负号），Y 表示小数位数，小数位数不足时必须在后面补 0，除非特殊说明，浮点数类型均有正负。

4. 定义部分业务类型如下：

字段名	类型	说明
price	N13(5)	价格
quantity	N15(3)	数量 B 转 H 业务中，单位为股，若存在小数则全部是 0
amount	N18(5)	金额
date	C8	当前时区日期，格式 YYYYMMDD，YYYY 为年，取值范围 0000-9999，MM 为月，取值范围 01-12，DD 为日，取值范围 01-31
UTCTimeStamp	C21	国际标准时间戳 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss（毫秒） YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD=01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60(秒), sss=000-999 (毫秒)。
SeqNum	N18	消息序号，正数
Length	N9	长度 表示字节为单位的数据长度，非负数
Boolean	C1	代表该字符串内容为布尔值，有效取值是Y或者N。

2.5.2. 数据字典

2.5.2.1. 会话层域定义

Tag	域名	类型	描述
7	BeginSeqNo	SeqNum	起始消息序号
8	BeginString	C16	起始串 固定为 FIXT.1.1
9	BodyLength	Length	消息体长度
10	Checksum	C3	校验和
34	MsgSeqNum	SeqNum	消息序号，由 1 开始
35	MsgType	C16	消息类型

43	PossDupFlag	Boolean	指示该消息序号的消息可能重复发送，取值： =Y: 可能重复 =N: 首次发送
52	SendingTime	UTCTimestamp	发送时间
56	TargetCompID	C32	接收方代码
97	PossResend	Boolean	可能重发标志 指示该消息可能发送过（使用不同的消息序号），取值： =Y: 可能重发 =N: 首次发送
347	MessageEncoding	C16	消息中编码域的字符编码类型
1408	DefaultCstmAppVerID	C32	本次会话中，FIX 消息的缺省自定义应用版本。本标签是对 tag 1137 + tag 1407 的进一步约束。 填写格式为 STEP1.20_SH_n.xy 其中 n.xy 为接入协议版本号。（TDGW 将限制接入的协议版本，当前最低接入协议版本要求为 0.10 版）

2.5.2.2. 业务层域定义

Tag	域名	类型	描述
11	ClOrdID	C18	交易客户方订单编号 由交易所定义的境内客户唯一订单编号
14	CumQty	quantity	累计执行数量
16	EndSeqNo	SeqNum	当前消息最大序号
17	ExecID	C16	执行编号（或称成交编号），在订单交易时期内应保证唯一
22	SecurityIDSource	C4	证券代码源 101=SH 证券交易所 103=XG 联合交易所
31	LastPx	price	成交价格
32	LastQty	quantity	成交数量
38	OrderQty	quantity	订单数量
39	OrdStatus	C1	订单状态，取值： 0=新（New） 1=部分成交（Partially filled） 2=已成交（Filled） 4=已撤消（Canceled）

			8=已拒绝（Rejected）
40	OrdType	C1	订单类型 2=限价（Limit）
41	OrigClOrdID	C18	原订单的 ClOrdID
44	Price	price	价格（限价订单时有效）
48	SecurityID	C8	证券代码
49	SenderCompID	C32	接收方代码
54	Side	C1	买卖方向 1=买入（Buy） 2=卖出（Sell）
58	Text	C32	Free Text
59	TimeInForce	C1	订单有效时间类型 0=当日有效（GFD）
60	TransactTime	UTCTimestamp	订单发起或回执时间
86	DlvyInst	C2	数据同步类型 SO 表示同步委托类数据 SR 表示同步回报类数据
102	CxlRejReason	N5	撤单拒绝原因
103	OrdRejReason	C5	订单拒绝原因
150	ExecType	C1	执行类型，取值 0=新（New） 4=已撤消 8=已拒绝（Rejected） F=成交或部分成交（Trade (partial fill or fill)）
151	LeavesQty	quantity	订单剩余数量
152	CashOrderQty	amount	订单金额
522	OwnerType	N3	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易
1180	ApplID	C6	应用标识
1181	ApplSeqNum	SeqNum	消息记录号 1) 委托类消息，由上交所跨境网关对其赋值编号 2) 回报类消息，由境外 OMS 对其赋值编号
1328	RejectText	C32	拒绝原因说明
1350	ApplLastSeqNum	SeqNum	目前已收到的最大的应用层消息记录编号
1399	ApplNewSeqNum	SeqNum	期望接收的下一条消息记录编号
8504	TotalValueTraded	amount	成交金额

10180	PlatformID	C1	平台标识： 6= 互联网交易平台
10181	PlatformStatus	C1	平台状态： 0 = NotOpen, 未开放 1 = PreOpen, 预开放 2 = Open, 开放 3 = Break, 暂停 4 = Close, 关闭

3. 文件接口

3.1. 数据类型约定

除特别说明，文件接口中的时间均为北京时间（UTC+08:00）。

文件类接口支持 txt、xml 格式文件。除特别说明，接口中所有数据文件均采用 GB18030 编码规范。

txt 格式数据文件均遵循以下约定：

- （1）CX 类型表示字符型字段，其中 X 代表总长度，左对齐，不足部分右补空格；
- （2）NX 类型表示十进制整数型字段，其中 X 代表数字型字符串总长度，右对齐，不足部分左补空格。除非特殊说明，整数型字段值均有正负；
- （3）NX (Y)类型表示十进制浮点数字型字段，其中 X 代表数字型字符串总长度（包括小数点位），Y 代表小数位数（小数位数不足时必须在后面补 0），右对齐，不足部分左补空格。除非特殊说明，浮点数字型字段值均有正负；
- （4）除非特殊说明，对于数字字段数值溢出的情况，将填写全 9 数值，如 N6（2）型字段值溢出时将填写 999.99；
- （5）字段间分隔符为竖线（'|'）；
- （6）竖线（'|'）不应出现在每条记录的开头和结尾；
- （7）各字段遵循类型定义，均为定长字段；
- （8）每行记录以二进制 0x0A 结束，最后一行也以 0x0A 结束。

其他补充约束参见字段具体描述。

3.2. 国际化产品信息文件

文件名：ifjyyyyymmdd

扩展名：xml

发送方向：上交所发给境外代理券商

发送时间：开市前发布

发送渠道：ztDisk

文件说明：本文件包含国际化产品相关基础信息数据，文件名中 yyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	类型
1	Inst_ID	证券代码	C6
2	Inst_Nam	证券简称	C8
3	Underlying_ID	辅助证券代码	C6
4	Busi_Typ	业务类型： BTH=B 转 H 业务	C3

说明：

1. 证券代码为 B 转 H 股虚拟证券代码；
2. 辅助证券代码为 B 转 H 股的香港证券代码；

3.3. B 转 H 成交明细文件

文件名：cjmxbthxxxxxyyyymmdd

扩展名：txt

发送方向：境外代理券商发给上交所

发送时间：沪 B 与 H 股共同交易日 16:30 之前发送，最迟不得晚于 16:45

发送渠道：ztDisk

标志文件：cjmxbthxxxxxyyyymmdd.flg

文件说明：xxxxx 为境外券商机构编码，yyymmdd 为当前交易日。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。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	类型
1	cjbh	成交编号	C16
2	bcrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD	C8

3	cjsl	成交数量，单位为股	N16(3)
4	zqdm	证券代码	C12
5	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS 原始订单的发起时间	C6
6	cjsj	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
7	cjgg	成交价格，单位为港元， <u>整数部分不超过 6 位</u>	N16(5)
8	cjje	成交金额，单位为港元	N19(5)
9	sqbh	订单编号，申报接口中的 ClOrdID	C18
10	bs	买卖方向 B：买 S：卖	C1
11	bt	业务类型 BTH=B 转 H 业务	C3
12	text	备注，保留字段，暂不填	C30

3.4. B 转 H 总股本文件

文件名：XXXXXzgbblYYYYMMDD002

扩展名：txt

发送时间：每一 B 股交易日 21:30 前

发送渠道：ztDisk

标志文件：XXXXXzgbblYYYYMMDD002.flg

文件说明：文件名中 XXXXX 表示境外机构编码，YYYYMMDD 指数数据统计日期。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	类型
1	证券代码	B 转 H 境内证券代码，左对齐，右边不足补空格，左边 6 位有效	C6
2	可交易数量		N15
3	可过户数量		N15
4	未交收数量		N15
5	市场代码	证券的所属市场，21：B 转 H	C2

说明：

1. 本文件包括在上海证券交易所挂牌交易的 B 转 H 证券的可交易数量、可过户数量和未交收数量数据。
2. 数据文件中的数据均为统计日当日日终处理完毕后的统计数据。

4. 附录

4.1. 附一 TDGW 错误代码说明

状态码/错误码	说明	Text（如有）
0	正常退出	Normal Logout
4012	SecurityID 错误或者业务类型 BizID 错误	
5000	上行消息超过 4K	Message Exceed Max Length
5001	上行消息校验和错误	Checksum Error
5002	心跳超时	Heartbeat Timeout
5003	平台已有 OMS 登录	Already Login, try again
5004	连接建立后 5 秒内未完成登录	Login Timeout
5005	上行消息 TargetCompId 不正确	CompId Error
5006	TDGW 未登录至交易系统，请稍后重试	Not Ready
5007	内部错误	Internal Error
5008	不能识别的消息类型	Message Type Illegal
5009	平台状态暂不接受申报	
5010	PartitionNo 错误	
5011	PBU 错误	
5012	首个消息非是 Logon 消息	Login First
5013	BeginReportIndex 取值错误	
5014	不支持的接口协议版本	UnsupportedPrtclVersion
5015	消息数据错误	Message Data Error
5016	CIOrdID 取值错误	
5017	登录成功后 5s 内未发起委托消息同步	