



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  
1.56 版



上海证券交易所  
二〇二五年六月

## 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.56 版发布说明 2025.6

1、根据公募 REITs 向不特定对象扩募的业务需求，增加 REITs 配售和 REITs 公开募集业务申报接口，更新基金及公募 REITs 业务参数公告文件 sfpm01MMDD.txt、过户数据接口 bghXXXXX.dbf 相关描述。

2、修订或补充文档描述，调整如下：

- a. 修正执行报告数据广播类型、过户数据接口关于上证 LOF、公募 REITs 业务的相关描述。
- b. 补充行情文件接口中“成交金额”取值精度说明。
- c. 删除行情数据 STEP 消息相关描述。
- d. 删除“附录一 指定关系生效说明”，更新 16.1 章节关于指定关系生效的描述。

3、修订业务类型与执行报告数据广播类型及产品集关系表，调整如下：

- a. 业务类型与产品集编号（setid）关系表中，删除产品集编号（setid）列，取消固定对应关系描述。
- b. 业务类型与执行报告数据广播类型关系表中，删除不发送执行报告的业务。

## **《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.55 版发布说明 2024.6**

1、配合北交所股票纳入 ETF 成分证券范围，调整如下：

- a. ETF 申赎章节中，调整执行报告消息“现金替代组合”字段资金类型取值描述，将“2=深市资金”调整为“2=境内非沪市资金”，将“9=非沪港深资金”调整为“9=全现金替代 ETF 资金”；
- b. 基金过户数据接口中，调整记录类型取值描述，将“B=深市资金”调整为“B=境内非沪市资金”，将“I=非沪港深资金”调整为“I=全现金替代 ETF 资金”；
- c. 调整 ETF 实物申赎适用 ETF 范围描述。

2、ETF 申赎章节中，调整执行报告中黄金 ETF 实物申赎的会员内部编号的描述，使其上下文描述一致。

## **《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.54 版发布说明 2023.8**

根据 ETF 定义文件 2.0 版下线安排，删除 ETF 公告文件 1.0 版相关描述。

此处仅保留近一年的修订记录，历史修订记录详见文末历史修订记录部分。

# 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范 .....</b> | <b>1</b>  |
| <b>2 大宗交易业务消息规范 .....</b>               | <b>7</b>  |
| 2.1 大宗交易 STEP 消息流程图 .....               | 7         |
| 2.2 公共数据消息 .....                        | 8         |
| 2.3 意向申报消息/意向申报撤单消息 .....               | 9         |
| 2.4 意向申报响应消息/意向申报撤单响应消息 .....           | 10        |
| 2.5 成交申报消息 .....                        | 11        |
| 2.6 申报撤单消息 .....                        | 12        |
| 2.7 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....             | 13        |
| 2.8 申报撤单失败响应消息 .....                    | 14        |
| 2.9 执行报告消息 .....                        | 15        |
| 2.10 过户数据接口 DGHXXXXXXYYYYMMDD.DBF ..... | 16        |
| 2.11 固定价格交易 STEP 消息流程图 .....            | 17        |
| 2.12 固定价格交易申报消息 .....                   | 17        |
| 2.13 固定价格交易申报撤单消息 .....                 | 19        |
| 2.14 固定价格交易申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....      | 19        |
| 2.15 固定价格交易申报撤单失败响应消息 .....             | 19        |
| 2.16 固定价格交易执行报告消息 .....                 | 19        |
| <b>3 货币市场基金实时申赎业务消息规范 .....</b>         | <b>20</b> |
| 3.1 货币市场基金实时申赎 STEP 消息流程图 .....         | 20        |
| 3.2 申报消息 .....                          | 20        |
| 3.3 申报响应消息 .....                        | 21        |
| 3.4 执行报告消息 .....                        | 21        |
| <b>4 报价回购及约定购回业务消息规范 .....</b>          | <b>24</b> |
| 4.1 报价回购及约定购回 STEP 消息流程图 .....          | 24        |
| 4.2 申报消息 .....                          | 24        |
| 4.2.1 报价回购交易申报 .....                    | 25        |
| 4.2.2 约定购回交易申报 .....                    | 26        |
| 4.2.3 出入库非交易申报 .....                    | 28        |
| 4.3 申报撤单消息 .....                        | 28        |
| 4.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....             | 29        |
| 4.5 申报撤单失败响应消息 .....                    | 29        |
| <b>5 转融通业务消息规范 .....</b>                | <b>30</b> |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 5.1 消息流程图 .....                         | 30        |
| 5.2 申报消息 .....                          | 30        |
| 5.3 申报撤单消息 .....                        | 32        |
| 5.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....             | 32        |
| 5.5 申报撤单失败响应消息 .....                    | 32        |
| 5.6 执行报告消息 .....                        | 32        |
| 5.7 公共数据消息 .....                        | 34        |
| 5.8 转融通标的证券清单 ZRTBDMDD.TXT .....        | 35        |
| <b>6 股票质押回购业务消息规范 .....</b>             | <b>37</b> |
| 6.1 股票质押回购 STEP 消息流程图 .....             | 37        |
| 6.2 申报消息 .....                          | 37        |
| 6.2.1 初始交易申报 .....                      | 40        |
| 6.2.2 补充质押申报 .....                      | 41        |
| 6.2.3 购回交易和终止购回申报 .....                 | 42        |
| 6.2.4 部分解除质押和违约处置申请申报 .....             | 43        |
| 6.3 申报撤单消息 .....                        | 45        |
| 6.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....             | 45        |
| 6.5 申报撤单失败响应消息 .....                    | 45        |
| <b>7 撮合业务消息规范（国债预发行、盘后固定价格交易） .....</b> | <b>46</b> |
| 7.1 撮合业务 STEP 消息流程图 .....               | 46        |
| 7.2 申报消息 .....                          | 46        |
| 7.3 申报撤单消息 .....                        | 48        |
| 7.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....             | 48        |
| 7.5 申报撤单失败响应消息 .....                    | 49        |
| 7.6 执行报告消息 .....                        | 49        |
| <b>8 上证 LOF/公募 REITS 业务消息规范 .....</b>   | <b>51</b> |
| 8.1 上证 LOF/公募 REITs STEP 消息流程图 .....    | 51        |
| 8.2 申报消息 .....                          | 53        |
| 8.2.1 认购\配售\公开募集申报 .....                | 53        |
| 8.2.2 申赎申报 .....                        | 54        |
| 8.2.3 转托管\分拆\合并申报 .....                 | 55        |
| 8.3 申报撤单消息 .....                        | 56        |
| 8.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....             | 56        |
| 8.5 申报撤单失败响应消息 .....                    | 57        |
| 8.6 执行报告消息 .....                        | 57        |

|                                               |           |
|-----------------------------------------------|-----------|
| 8.7 基金及公募 REITs 业务参数公告文件 SFPM01MMDD.TXT ..... | 58        |
| <b>9 网络投票业务消息规范 .....</b>                     | <b>61</b> |
| 9.1 网络投票业务 STEP 消息流程图 .....                   | 61        |
| 9.2 申报消息 .....                                | 61        |
| 9.3 申报响应消息 .....                              | 62        |
| 9.4 投票议案公告文件 VTLSMMDD.XML .....               | 63        |
| <b>10 资金前端控制业务消息规范 .....</b>                  | <b>72</b> |
| 10.1 资金前端控制业务消息流程图 .....                      | 72        |
| 10.2 申报消息 .....                               | 72        |
| 10.3 申报响应消息 .....                             | 73        |
| <b>11 密码服务（中登身份认证服务）消息规范 .....</b>            | <b>74</b> |
| 11.1 密码服务（中登身份认证服务）消息流程图 .....                | 74        |
| 11.2 申报消息 .....                               | 74        |
| 11.3 申报响应消息 .....                             | 75        |
| <b>12 定向可转债消息规范 .....</b>                     | <b>77</b> |
| 12.1 定向可转债转让业务消息规范 .....                      | 77        |
| 12.1.1 定向可转债公共数据消息 .....                      | 77        |
| 12.1.2 定向可转债转让意向申报消息/意向申报撤单消息 .....           | 77        |
| 12.1.3 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 .....       | 77        |
| 12.1.4 定向可转债转让成交申报 .....                      | 78        |
| 12.1.5 定向可转债申报撤单消息 .....                      | 78        |
| 12.1.6 定向可转债申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....           | 78        |
| 12.1.7 定向可转债申报撤单失败响应消息 .....                  | 78        |
| 12.1.8 定向可转债执行报告消息 .....                      | 78        |
| 12.1.9 定向可转债过户数据接口 .....                      | 79        |
| 12.2 定向可转债转股业务消息规范 .....                      | 79        |
| 12.2.1 可转债转股消息流程图 .....                       | 79        |
| 12.2.2 定向可转债转股申报消息 .....                      | 79        |
| 12.2.3 定向可转债转股申报响应消息 .....                    | 80        |
| 12.2.4 定向可转债转股撤单申报消息 .....                    | 81        |
| 12.2.5 定向可转债转股撤单申报成功响应消息 .....                | 81        |
| 12.2.6 定向可转债转股撤单申报失败响应消息 .....                | 81        |
| 12.3 定向可转债回售业务消息规范 .....                      | 81        |
| 12.3.1 定向可转债回售消息流程图 .....                     | 81        |
| 12.3.2 定向可转债回售申报消息 .....                      | 82        |

|                               |           |
|-------------------------------|-----------|
| 12.3.3 定向可转债回售申报响应消息.....     | 83        |
| 12.3.4 定向可转债回售撤单申报消息.....     | 83        |
| 12.3.5 定向可转债回售撤单申报成功响应消息..... | 83        |
| 12.3.6 定向可转债回售撤单申报失败响应消息..... | 83        |
| <b>13 债券非交易消息规范 .....</b>     | <b>84</b> |
| 13.1 债券质押式回购入库业务消息规范 .....    | 84        |
| 13.1.1 债券质押式回购入库消息流程图.....    | 84        |
| 13.1.2 债券质押式回购入库申报消息.....     | 84        |
| 13.1.3 债券质押式回购入库申报响应消息.....   | 85        |
| 13.1.4 债券质押式回购入库执行报告消息.....   | 85        |
| 13.2 债券质押式回购出库业务消息规范 .....    | 86        |
| 13.2.1 债券质押式回购出库消息流程图.....    | 86        |
| 13.2.2 债券质押式回购出库申报消息.....     | 87        |
| 13.2.3 债券质押式回购出库申报响应消息.....   | 88        |
| 13.2.4 债券质押式回购出库执行报告消息.....   | 88        |
| 13.3 可转债转股业务消息规范 .....        | 89        |
| 13.3.1 可转债转股消息流程图.....        | 89        |
| 13.3.2 可转债转股申报消息.....         | 90        |
| 13.3.3 可转债转股申报响应消息.....       | 90        |
| 13.3.4 可转债转股撤单申报消息.....       | 91        |
| 13.3.5 可转债转股撤单申报成功响应消息.....   | 91        |
| 13.3.6 可转债转股撤单申报失败响应消息.....   | 91        |
| 13.4 可交换债换股业务消息规范 .....       | 91        |
| 13.4.1 可交换债换股消息流程图.....       | 91        |
| 13.4.2 可交换债换股申报消息.....        | 92        |
| 13.4.3 可交换债换股申报响应消息.....      | 92        |
| 13.4.4 可交换债换股撤单申报消息.....      | 93        |
| 13.4.5 可交换债换股撤单申报成功响应消息.....  | 93        |
| 13.4.6 可交换债换股撤单申报失败响应消息.....  | 93        |
| 13.5 债券回售业务消息规范 .....         | 93        |
| 13.5.1 债券回售消息流程图.....         | 93        |
| 13.5.2 债券回售申报消息.....          | 94        |
| 13.5.3 债券回售申报响应消息.....        | 94        |
| 13.5.4 债券回售撤单申报消息.....        | 95        |
| 13.5.5 债券回售撤单申报成功响应消息.....    | 95        |
| 13.5.6 债券回售撤单申报失败响应消息.....    | 95        |
| 13.6 债券回售撤销业务消息规范 .....       | 95        |

|                                                   |            |
|---------------------------------------------------|------------|
| 13.6.1 债券回售撤销消息流程图.....                           | 95         |
| 13.6.2 债券回售撤销申报消息.....                            | 96         |
| 13.6.3 债券回售撤销申报响应消息.....                          | 96         |
| 13.7 债券过户数据接口 ZQGHXXXXX.TXT .....                 | 97         |
| <b>14 ETF 实物申赎/ETF 现金申赎/黄金 ETF 实物申赎消息规范 .....</b> | <b>98</b>  |
| 14.1 ETF 申购业务消息规范 .....                           | 98         |
| 14.1.1 ETF 申购消息流程图.....                           | 98         |
| 14.1.2 ETF 申购申报消息.....                            | 98         |
| 14.1.3 ETF 申购申报响应消息.....                          | 99         |
| 14.1.4 ETF 申购执行报告消息.....                          | 99         |
| 14.2 ETF 赎回业务消息规范 .....                           | 102        |
| 14.2.1 ETF 赎回消息流程图.....                           | 102        |
| 14.2.2 ETF 赎回申报消息.....                            | 103        |
| 14.2.3 ETF 赎回申报响应消息.....                          | 104        |
| 14.2.4 ETF 赎回执行报告消息.....                          | 104        |
| <b>15 ETF 集合申购消息规范 .....</b>                      | <b>107</b> |
| 15.1 ETF 集合申购消息流程图 .....                          | 107        |
| 15.2 申报消息 .....                                   | 107        |
| 15.2.1 集合申购申报消息.....                              | 107        |
| 15.2.2 强制赎回申报消息.....                              | 108        |
| 15.3 申报撤单消息 .....                                 | 110        |
| 15.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息 .....                      | 110        |
| 15.5 申报撤单失败响应消息 .....                             | 110        |
| <b>16 指定交易消息规范 .....</b>                          | <b>111</b> |
| 16.1 指定交易流程图 .....                                | 111        |
| 16.2 指定交易申报消息 .....                               | 111        |
| 16.3 指定交易申报响应消息 .....                             | 112        |
| <b>17 基金过户数据接口 JJGHXXXXX.TXT .....</b>            | <b>114</b> |
| <b>18 债券非交易基础信息接口 ZFJYYYYYMMDD.XML .....</b>      | <b>117</b> |
| <b>19 基金非交易基础信息接口 JFJYYYYYMMDD.XML .....</b>      | <b>120</b> |
| <b>20 ETF 公告文件 2.1 版格式 .....</b>                  | <b>121</b> |
| <b>21 行情文件接口 MKTDT01.TXT .....</b>                | <b>125</b> |
| 21.1 结构描述 .....                                   | 126        |
| 21.2 格式定义 .....                                   | 126        |

22 过户数据接口 BGHXXXXX.DBF .....131

23 后记 ..... 135

历史修订记录 ..... 137

## 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> | EEC                 | ETF 现金申购                      |
|                       | EER                 | ETF 现金赎回                      |
| 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/公募 REITs       | LFS                 | 上证 LOF/公募 REITs 认购            |
|                       | LFC                 | 上证 LOF 申购                     |
|                       | LFR                 | 上证 LOF 赎回                     |
|                       | LFT                 | 上证 LOF/公募 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                  |
|                       | <a href="#">RTA</a> | <a href="#">公募 REITs 配售</a>   |
|                       | <a href="#">RTP</a> | <a href="#">公募 REITs 公开募集</a> |
| 网络投票                  | VTE                 | 投票申报（含先行赔付）                   |

<sup>1</sup>ETF 现金申赎业务适用于跨境 ETF 现金申赎、现金申赎类债券 ETF 现金申赎、黄金 ETF 现金申赎、交易型货币基金现金申赎以及其他本所支持的 ETF 现金申赎。

|                       |     |           |
|-----------------------|-----|-----------|
| 密码服务                  | PWS | 密码服务申报    |
| 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 |
| 债券质押式回购出入库            | BPD | 债券质押式回购入库 |
|                       | BPW | 债券质押式回购出库 |
| 可转换债转股                | BES | 可转换债转股    |
| 可交换债换股                | BSS | 可交换债换股    |
| 债券回售                  | BSB | 债券回售      |
|                       | BSC | 债券回售撤销    |
| ETF 实物申赎 <sup>2</sup> | IEC | ETF 实物申购  |
|                       | IER | ETF 实物赎回  |
| ETF 集合申购              | ECP | 集合申购申报    |
|                       | EMR | 强制赎回申报    |
| 指定交易                  | ADT | 指定登记      |
|                       | ADC | 指定撤销      |

数据广播类型（bcasttype），取值为：

- 01: ETF 现金申赎执行报告（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/公募 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）

<sup>2</sup> ETF 实物申赎业务适用于单市场股票（沪）ETF、跨市场股票（沪深京）ETF、跨市场股票（沪港深京）ETF、单市场股票（科创板）ETF、跨市场股票（含科创板）ETF、单市场债券（沪）ETF、跨市场债券（沪深）ETF。

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 实物申赎执行报告 (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<br>广播类型<br>(bcasttype) | 公共数据<br>广播类型<br>(bcasttype) |
|----------------------------------------|------------------------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| ETF 现金申赎                               | EEC ETF 现金申购                                         | 01                          | N/A                         |
|                                        | EER ETF 现金赎回                                         |                             |                             |
| 黄金 ETF 实物<br>申赎                        | GEC 黄金 ETF 实物申购                                      | 16                          | N/A                         |
|                                        | GER 黄金 ETF 实物赎回<br>注: 无订单申报, 用于 BGH 中。               |                             |                             |
| 大宗业务                                   | BII 大宗意向                                             | N/A                         | 03                          |
|                                        | BPT 大宗交易                                             | 02                          | N/A                         |
|                                        | FPE 大宗固定价格交易                                         | 14                          | N/A                         |
| 报价回购                                   | QBD——报价入库<br>QBW——报价出库<br>QNE——报价回购<br>QCA——报价回购提前购回 | N/A                         | N/A                         |
| 约定购回                                   | RNE——初始交易<br>RNR——购回交易                               | N/A                         | N/A                         |
| 转融通                                    | ZII 转融通非约定申报                                         | 06,08,10                    | 04                          |
|                                        | ZPT 转融通约定申报                                          | 05,07,09                    | 04                          |
| 货币市场基金<br>申赎 (即: 货<br>币市场基金场<br>内实时申赎) | OFC 货币市场基金申购申报                                       | 12                          | N/A                         |
|                                        | OFR 货币市场基金赎回申报                                       |                             |                             |

|         |                                                                                                                                                                                             |     |     |
|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|-----|
| 股票质押回购  | <del>SPN——初始交易</del><br><del>SPS——补充质押</del><br><del>SPR——购回交易</del><br><del>SPT——终止购回</del><br><del>SPD——部分解除质押</del><br><del>SPB——违约处置申请</del>                                            | N/A | N/A |
| 国债预发行   | BIY 国债预发行利率（收益率）招标申报                                                                                                                                                                        | 18  | N/A |
|         | BIP 国债预发行价格招标申报                                                                                                                                                                             | 17  | N/A |
| 上证LOF   | <del>LFS——上证LOF/公募REITs认购</del><br><del>LFC——上证LOF申购</del><br><del>LFR——上证LOF赎回</del><br><del>LFT——上证LOF/公募REITs场内转场外的转托管</del><br><del>LFP——上证LOF母基金分拆</del><br><del>LFM——上证LOF子基金合并</del> | 13  | N/A |
| 上证LOF   | <del>LFP——上证LOF母基金分拆</del><br><del>LFM——上证LOF子基金合并</del>                                                                                                                                    | 13  | N/A |
| 网络投票    | <del>VTE——投票申报（Vote Entry）</del>                                                                                                                                                            | N/A | N/A |
| 资金前端控制  | CFC——资金前端控制申报                                                                                                                                                                               | N/A | N/A |
| 密码服务    | <del>PWS——密码服务申报（Password Service）</del>                                                                                                                                                    | N/A | N/A |
| 盘后固定价格  | PFP 盘后固定价格申报                                                                                                                                                                                | 19  | N/A |
| 定向可转债   | <del>CBT——定向可转债转股申报</del><br><del>CBR——定向可转债回售申报</del>                                                                                                                                      | N/A | N/A |
| ETF实物申赎 | IEC ETF实物申购                                                                                                                                                                                 | 20  | N/A |
|         | IER ETF实物赎回                                                                                                                                                                                 |     |     |
| 债券出入库   | BPD 债券质押式回购入库                                                                                                                                                                               | 21  | N/A |
|         | BPW 债券质押式回购出库                                                                                                                                                                               |     |     |
| 可转换债转股  | <del>BES——可转换债转股</del>                                                                                                                                                                      | N/A | N/A |
| 可交换债换股  | <del>BSS——可交换债换股</del>                                                                                                                                                                      | N/A | N/A |

|          |                            |     |     |
|----------|----------------------------|-----|-----|
| 债券回售     | BSB——债券回售<br>BSC——债券回售撤销   | N/A | N/A |
| ETF 集合申购 | ECP——集合申购申报<br>EMR——强制赎回申报 | N/A | N/A |
| 指定交易     | ADT——指定登记<br>ADC——指定撤销     | N/A | N/A |

#### 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
- U002 = 注册指令响应

#### 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 ETF 现金申赎，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 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。

## 2 大宗交易业务消息规范

### 2.1 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。



## 2.2 公共数据消息

| IOI (mdtext)                                                                                 | 公共数据消息 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>公共数据表中的 mdtext 字段数据。<br>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：<br>1 表示买<br>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 | 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    |

### 2.3 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 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 IOI 消息进行意向申报或撤单。<br>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。<br>取值 4 | N2     |
| 发起方投  | 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 | 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  | 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 | 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 |

## 2.4 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 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。<br>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：<br>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：<br>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。<br>撤消成功时，该字段取值为空。 | C5  |

|     |              |                                                                                   |    |
|-----|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------|----|
|     |              | 撤单失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同 Remark 字段。                                                    |    |
| 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。<br>意向申报成功时，该字段取值为空<br>意向申报失败时，表示拒绝的理由，取值同 Remark 字段。 | C5 |

## 2.5 成交申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                   | 成交申报消息 |
|----------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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：<br>1 表示买<br>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     | 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 | 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    | 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    | 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 | 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 |

## 2.6 申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                                                                                                               | 申报撤单消息 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 OrderCancel Request 消息进行申报撤单<br>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：<br>1 表示买<br>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  | 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 | 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 |

## 2.7 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>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。</p> <p>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。</p> <p><b>150 和 39 组合取值含义：</b></p> <p>申报成功响应：150=0, 39=0</p> <p>申报拒绝响应：150=8, 39=8</p> <p>申报撤单成功响应：150=6, 39=6</p> <p>申报撤单失败响应：参见 OrderCancelReject</p> |        |

| 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：<br>0=成功响应<br>8=拒绝响应<br>6=撤单成功 | C1  |

|     |              |                                                                                                         |     |
|-----|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
| 39  | OrdStatus    | 当前订单状态，取值有：<br><br>0=成功响应<br><br>8=拒绝响应<br><br>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。<br><br>对于申报撤单成功响应，该字段取值为空。 | C5  |

## 2.8 申报撤单失败响应消息

| OrderCancelReject (resptext)            | 申报撤单失败响应消息 |
|-----------------------------------------|------------|
| <b>描述：</b><br>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=申报撤单失败响应。         |     |
| 37 | OrderID      | 交易所订单编号                          | C16 |
| 39 | OrdStatus    | 当前订单状态，取值有：<br><br>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     | 撤单失败时，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：<br>1=撤单响应           | C1 |

## 2.9 执行报告消息

| ExecutionReport(execreporttext)                                                                     | 实时执行报告消息 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述：</b><br>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。<br>每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息。<br>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：<br>1 表示买<br>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：                          | C1     |

|       |            |                                                         |                                 |     |
|-------|------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------|-----|
|       |            | F=成交                                                    |                                 |     |
| 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  | 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 | 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  | 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  | 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  |

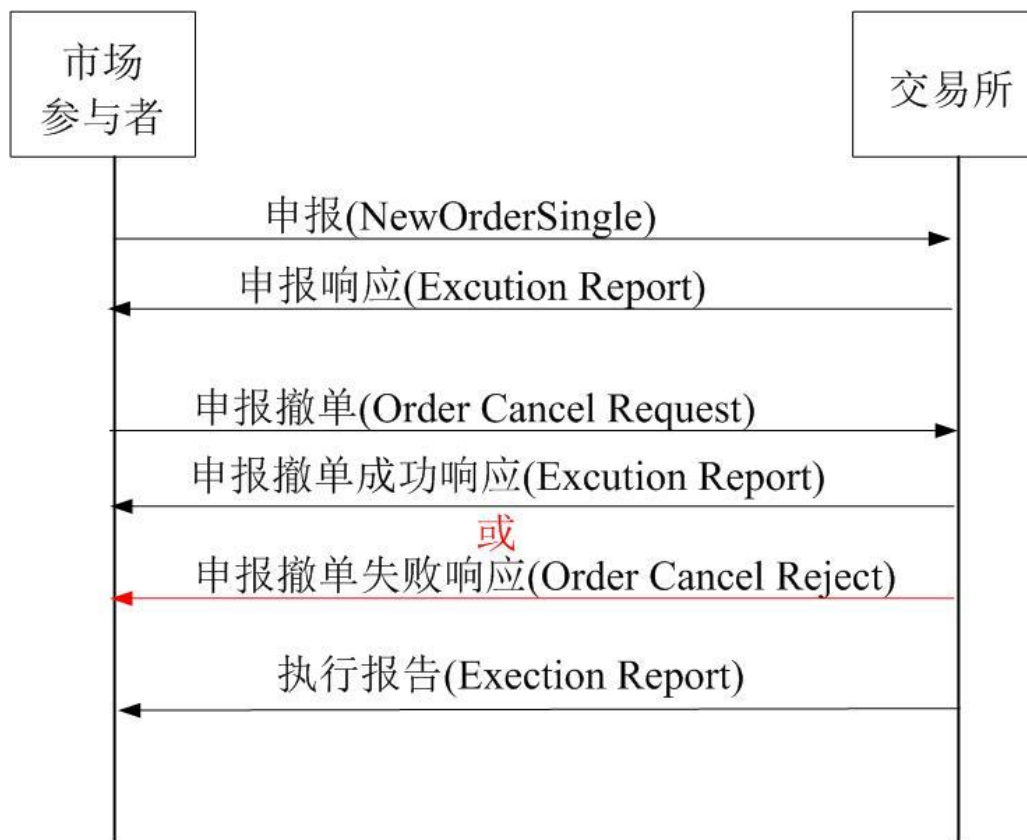
## 2.10 过户数据接口 dghXXXXXXYYYYMMDD.dbf

| dghXXXXXXYYYYMMDD.dbf                                                                                                                                                                                  | 过户数据接口 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br><br>文件名中XXXXXX表示业务交易单元号。闭市后发送。<br><br>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。<br><br>过户数据接口dghXXXXXXYYYYMMDD.dbf压缩到dghXXXXX.zip文件中供券商用RptGet下载，YYYYMMDD为日期格式。<br><br>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。<br>如果溢出，取值为负值。 | 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  | 如果溢出，取值为负值。              | N8(3)  |
| 12 | CJJE | 成交金额  | 如果溢出，取值为负值。              | 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     |

## 2.11 固定价格交易 STEP 消息流程图



## 2.12 固定价格交易申报消息

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

| NewOrderSingle (reqtext)                                                                              | 申报消息 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|
| <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 消息进行买卖申报。</p> <p>固定价格交易申报不支持受控股份大宗交易减持。</p> |      |

| 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：<br>1 表示买<br>2 表示卖                                     | C1  |
| 40     | OrdType       | 订单类型，取值：<br>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 | 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 |

### 2.13 固定价格交易申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                                                                              | 申报撤单消息 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单消息，<br>其中订单数量，不做校验。<br>固定价格交易申报撤单不支持受控股份大宗交易减持。<br>其中备注字段（Text），填写规则参见“固定价格交易申报消息”。 |        |

### 2.14 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 |
|---------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。 |        |

### 2.15 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 |
|--------------------------------|------------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单失败响应消息。 |            |

### 2.16 固定价格交易执行报告消息

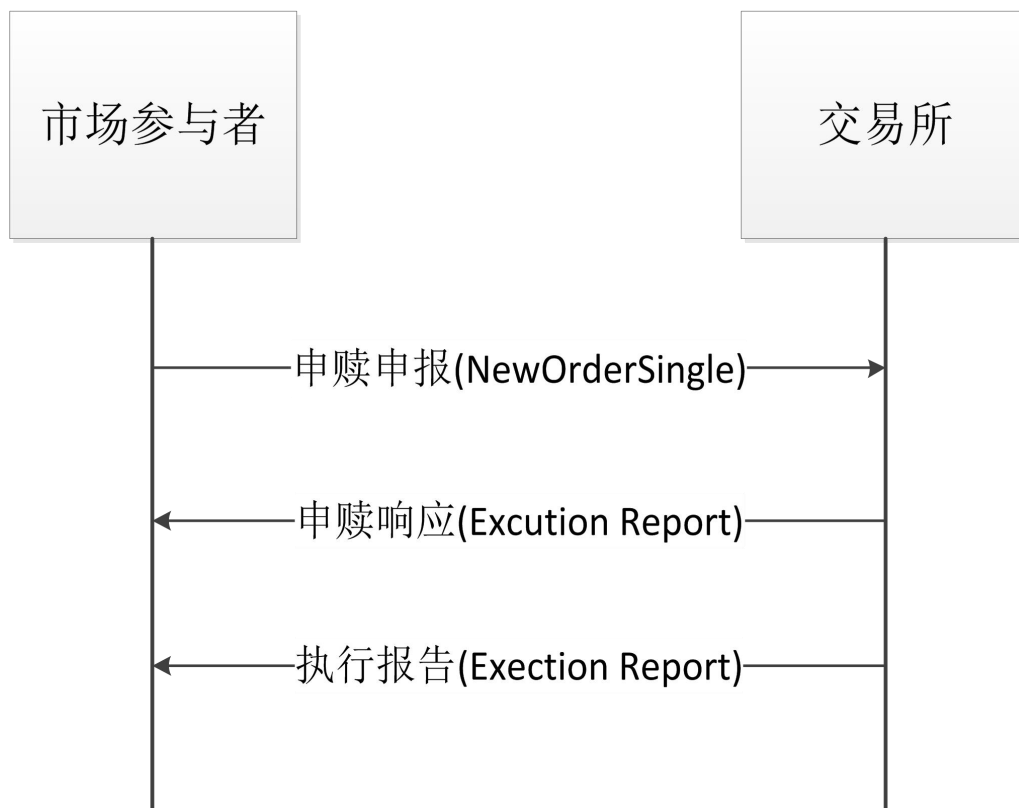
| ExecutionReport(execreporttext)                                | 实时执行报告消息 |
|----------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务执行报告消息。<br>其中，对手方投资者账户、对手方业务 PBU 代码无意义，填空格。 |          |

### 3 货币市场基金实时申赎业务消息规范

本业务消息用于支持汇添富收益快线模式货币市场基金实时申赎（即：货币市场基金场内实时申赎）。

#### 3.1 货币市场基金实时申赎 STEP 消息流程图

根据货币市场基金实时申赎流程（汇添富收益快线模式），市场投资者可以进行货币市场基金申赎申报，交易所实时反馈申报确认，下图描述了货币市场基金实时申赎的 STEP 消息通信流程。



#### 3.2 申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                   | 成交申报消息 |
|----------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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                                                                                                                 | C6     |
| 44     | Price         | 价格，填写 0.010，单位元，本业务申赎申报每份单位为 0.010 元。                                                                                | N11(3) |
| 38     | OrderQty      | 申赎数量，本字段允许最大长度暂为 11 位                                                                                                | N12    |
| 54     | Side          | 买卖方向，取值有：<br>1 表示买，对应申购<br>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   | 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 | 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   | 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          | 如为 E 账户申报，左对齐填写单个数字字母<br>'1': 投资者发起的 E 帐户申购，表示担保品买入。<br>'2': 投资者发起的 E 帐户赎回，表示担保品卖出。<br>'8': 会员代投资者发起的 E 帐户赎回，表示强平卖出。 | C50    |

### 3.3 申报响应消息

| ExecutionReport (resptext)                        | 申报响应消息 |
|---------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。不支持撤单，无撤单响应。 |        |

### 3.4 执行报告消息

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

| ExecutionReport(excreporttext)                                                                                                                                      | 实时执行报告消息 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述:</b><br>执行报告表中的 excreporttext 字段数据。<br>本执行报告数据仅向基金公司转发，将市场有效的申赎执行报告通过消息文本 <b>excreporttext</b> 域转发送给基金公司，每笔申赎申报对应一条执行报告，证券代码为二级市场交易代码，数量为申购/赎回数量，成交金额为实际成交金额。 |          |

| 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，<br>对于基金公司，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                                                          | 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：<br>1 表示买，对应申购<br>2 表示卖，对应赎回<br>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：<br>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                                  | N2     |

|       |      |           |                              |     |
|-------|------|-----------|------------------------------|-----|
|       |      |           | 交易单元号，取值为 2。                 |     |
| 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 | 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  |
| 58    | Text |           | 扩展备注，可用于填写市场参与者营业部代码         | C50 |

## 4 报价回购及约定购回业务消息规范

### 4.1 报价回购及约定购回 STEP 消息流程图



### 4.2 申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                                                                                                                                                                                                                                             | 申报消息 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|
| <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 NewOrderSingle 消息进行申报。分别定义了报价回购交易申报消息(支持 QNE、QCA)，约定购回交易申报消息(支持 RNE、RNR)，报价回购出入库非交易申报消息(支持 QBD、QBW)。</p> <p>申报消息字段中，无意义的字段可参考 EzSTEP 通用数据库接口规格说明中 STEP 消息约定取空，即字符型字段值为空，则采用“标签=&lt;SOH&gt;”的方式表示(等号后与分隔符间有一个空格)，如数字型字段值为空，采用缺省取值 0。</p> |      |

#### 4.2.1 报价回购交易申报

| 标<br>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<br>对于报价回购业务，报价回购申报和提前购回申报代码为 205***。                                 | C6     |
| 44       | Price         | 价格，单位为元。<br>对于报价回购交易申报价格为“每百元资金到期年收益”。                                    | N11(3) |
| 640      | Price2        | 购回价格，单位为元。<br>对于报价回购业务，为提前购回价格，即“每百元资金提前终止年收益”。                           | N11(3) |
| 38       | OrderQty      | 订单数量<br>对于报价回购业务，报价回购交易的单位为手（1000 元面值为一手）。                                | N10    |
| 1080     | RefOrderID    | 交易所订单编号参考值。<br>对于报价回购业务提前购回订单，需填写拟提前购回的回购订单交易所订单编号（OrderID），对报价回购其他业务无意义。 | C16    |
| 1125     | OrigTradeDate | 初始交易日期。<br>对于报价回购业务提前购回订单，需填写为原回购订单的成交日期，对报价回购其他业务无意义。                    | C8     |
| 453      | NoPartyIDs    | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码，取值为 6。             | N2     |
| 买方投资者账户  | 448 PartyID   | 买方投资者帐户编码。<br>对于报价回购，为报价回购资格的券商账户；                                        | C10    |
|          | 452 PartyRole | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为买方投资者帐户                                              | N4     |
| 买方申报交易单元 | 448 PartyID   | 买方业务 PBU（5 位数字），作为买方证券账户对应的业务 PBU，用于申报、撤单订单。                              | C5     |
|          | 452 PartyRole | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为买方业务 PBU。                                            | N4     |

|         |      |           |                                              |     |
|---------|------|-----------|----------------------------------------------|-----|
| 买方营业部代码 | 448  | PartyID   | 买方营业部代码，位数不足则以 0 左补齐 5 位。                    | C5  |
|         | 452  | PartyRole | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为买方的营业部代码             | N4  |
| 卖方投资者帐户 | 448  | PartyID   | 卖方投资者帐户。<br>对于报价回购，为合格投资者证券帐户；               | C10 |
|         | 452  | PartyRole | 取 39，表示当前 PartyID 的取值为卖方投资者帐户                | N4  |
| 卖方申报交易单 | 448  | PartyID   | 卖方业务 PBU（5 位数字），作为卖方证券账户对应的业务 PBU，用于申报、撤单订单。 | C5  |
|         | 452  | PartyRole | 取 17，表示当前 PartyID 的取值为卖方交易单元号                | N4  |
| 卖方营业部代码 | 448  | PartyID   | 卖方营业部代码，位数不足则以 0 左补齐 5 位。                    | C5  |
|         | 452  | PartyRole | 取 4002，表示当前 PartyID 的取值为卖方的营业部代码             | N4  |
| 58      | Text |           | 备注                                           | C50 |

#### 4.2.2 约定购回交易申报

| 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<br>对于约定购回业务，填写标的证券代码。                      | C6     |
| 921  | StartCash  | 初始交易金额，单位为元。<br>对于约定购回业务，为初始交易金额，用于初始交易订单。      | N16(2) |
| 922  | EndCash    | 购回交易金额，单位为元。<br>对于约定购回业务，为购回交易金额，用于初始交易和购回交易订单。 | N16(2) |
| 38   | OrderQty   | 订单数量<br>对于约定购回业务，为标的证券数量，债券单位为手，其他为股或份。         | N10    |
| 1080 | RefOrderID | 交易所订单编号参考值。                                     | C16    |

|          |               |           |                                                                                        |     |
|----------|---------------|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|          |               |           | 对于约定购回业务初始交易订单无意义；<br><br>对于约定购回业务购回交易订单，需填写为初始交易交易所订单编号（OrderID）。                     |     |
| 1125     | OrigTradeDate |           | 初始交易日期。<br><br>对于约定购回业务初始交易订单，需填写为购回交易日期；<br><br>对于约定购回业务购回交易订单，需填写为初始交易日期。格式为YYYYMMDD | C8  |
| 914      | AgreementID   |           | 约定购回业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验                                                              | C16 |
| 453      | NoPartyIDs    |           | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码，取值为 6。                          | N2  |
| 买方投资者账户  | 448           | PartyID   | 买方投资者帐户编码。<br><br>对于约定购回初始交易，为约定购回专用证券账户；<br><br>对于约定购回购回交易，为合格投资者证券帐户。                | C10 |
|          | 452           | PartyRole | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为买方投资者帐户                                                           | N4  |
| 买方申报交易单元 | 448           | PartyID   | 买方业务 PBU（5 位数字），作为买方证券账户对应的业务 PBU，用于申报、撤单订单。                                           | C5  |
|          | 452           | PartyRole | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为买方业务 PBU。                                                         | N4  |
| 买方营业部代   | 448           | PartyID   | 买方营业部代码，位数不足则以 0 左补齐 5 位。                                                              | C5  |
|          | 452           | PartyRole | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为买方的营业部代码                                                       | N4  |
| 卖方投资者账户  | 448           | PartyID   | 卖方投资者帐户。<br><br>对于约定购回初始交易，为合格投资者证券帐户；<br><br>对于约定购回购回交易，为约定购回专用证券账户。                  | C10 |
|          | 452           | PartyRole | 取 39，表示当前 PartyID 的取值为卖方投资者帐户                                                          | N4  |
| 卖方申报交易单  | 448           | PartyID   | 卖方业务 PBU（5 位数字），作为卖方证券账户对应的业务 PBU，用于申报、撤单订单。                                           | C5  |
|          | 452           | PartyRole | 取 17，表示当前 PartyID 的取值为卖方交易单元号                                                          | N4  |
| 代码       | 448           | PartyID   | 卖方营业部代码，位数不足则以 0 左补齐 5 位。                                                              | C5  |
|          | 452           | PartyRole | 取 4002，表示当前 PartyID 的取值为卖方的营业部代码                                                       | N4  |

|    |      |    |     |
|----|------|----|-----|
| 58 | Text | 备注 | C50 |
|----|------|----|-----|

#### 4.2.3 出入库非交易申报

| 标<br>签  | 字段名        |           | 字段描述                                                         | 类<br>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<br>报价回购出入库填写现券代码。                                       | C6     |
| 38      | OrderQty   |           | 数量<br>债券出入库申报数量的单位为手（1000 元面值为一手）。<br>股票、基金出入库申报数量的单位分别为股和份。 | 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   | 对于报价出入库，填自营证券账户。                                             | C10    |
|         | 452        | PartyRole | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为证券帐户                                    | N4     |
| 申报交易单元号 | 448        | PartyID   | 业务 PBU（5 位数字）。<br>对于报价出入库记，填自营证券账户 PBU。                      | C5     |
|         | 452        | PartyRole | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为业务 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    |

#### 4.3 申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                           | 申报撤单消息 |
|---------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>同大宗业务申报撤单消息，<br>其中的买卖方向无意义，建议报价入库填卖，其他填买。 |        |

| OrderCancel Request (reqtext)             | 申报撤单消息 |
|-------------------------------------------|--------|
| 其中因交易申报中含买卖 2 个参与方，约定报价回购交易及约定购回交易填买方参与方。 |        |

#### 4.4 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。</p> <p>其中交易所订单编号，报价回购及约定购回业务可理解为成交编号。</p> |        |

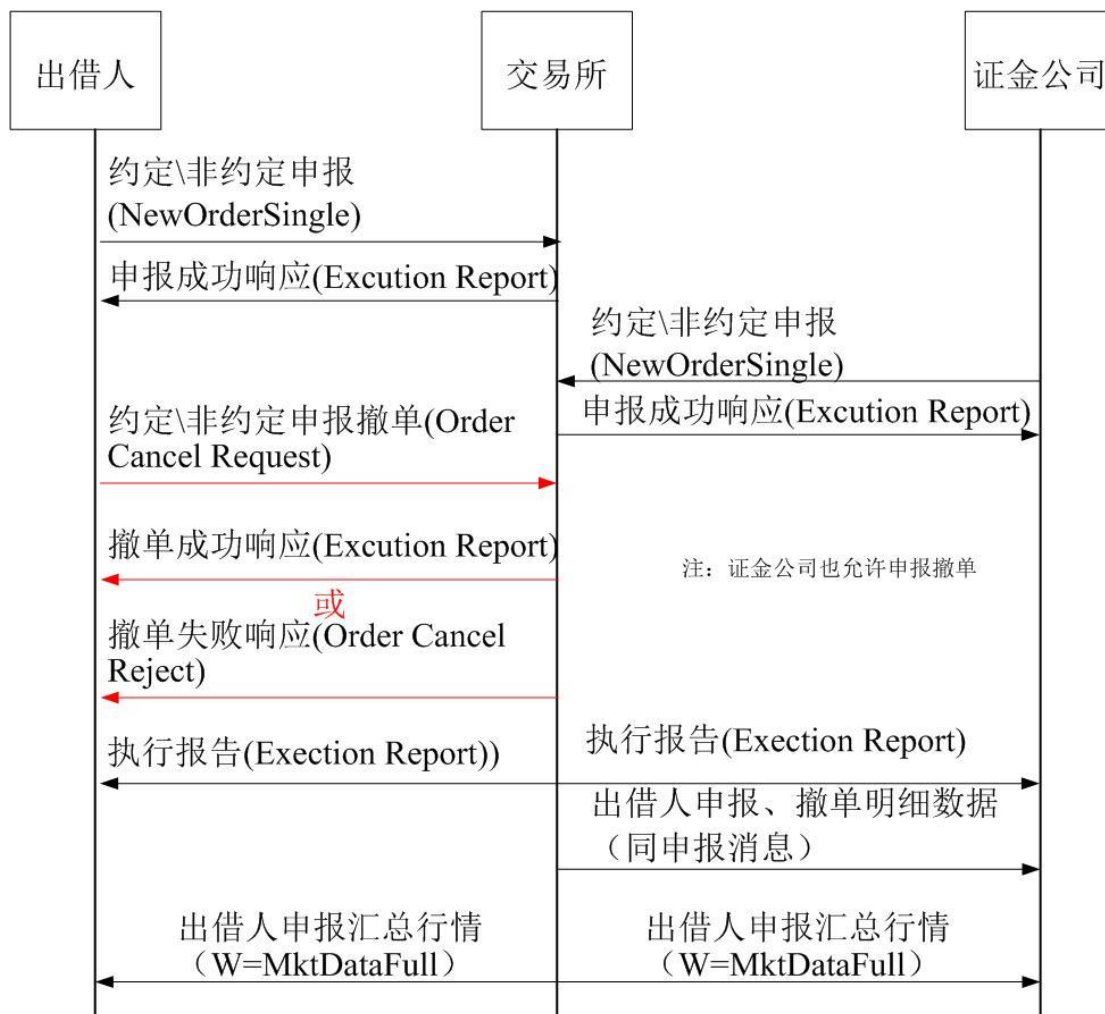
#### 4.5 申报撤单失败响应消息

| 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。</p> |            |

## 5 转融通业务消息规范

本部分描述了市场参与者同上交所综合业务平台之间的接口消息文本格式，对应通用数据库接口表中的各消息文本字段，采用 STEP 格式封装。

### 5.1 消息流程图



### 5.2 申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                   | 申报消息 |
|----------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行订单申报。 |      |

| 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。                                                              | C10    |
| 48      | SecurityID    | 证券代码                                                                 | C6     |
| 44      | Price         | 费率，单位为%，小数部份填满                                                       | N11(3) |
| 38      | OrderQty      | 订单数量                                                                 | N10    |
| 54      | Side          | 出借方向，取值有：<br>F = 表示融入<br>G = 表示融出                                    | C1     |
| 580     | NoDates       | 期限，单位为天数                                                             | N5     |
| 664     | ConfirmID     | 约定号，双方 PBU 号与约定号组合全市场唯一，如非约定申报，无意义，取一个空格                             | C6     |
| 453     | NoPartyIDs    | 参与方个数，后接重复组，填 5。                                                     | N2     |
| 发起方投资者  | 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   | 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 PBU。                                        | N4     |
| 部       | 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     |
| 资者账户    | 448 PartyID   | 对手方投资者帐户，非约定申报无意义，可取一个空格。                                            | 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 | 448 PartyID   | 对手方业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号，非约定申报无意义，可取一个空格。                            | C5     |
|         | 452 PartyRole | 取 17，表示取值为对手方交易单元号                                                   | N4     |
| 58      | Text          | 备注<br>第 1 位为战略配售股份标志，对于融出申报，填写“S”表示战略配售股份融出；对于非战略配售股份融出申报及证金融入申报，无意义 | C50    |

|  |  |    |  |
|--|--|----|--|
|  |  | 义。 |  |
|--|--|----|--|

### 5.3 申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                              | 申报撤单消息 |
|------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单消息,<br>其中的买卖方向, F = 表示融入, G = 表示融出。 |        |

### 5.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息

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

### 5.5 申报撤单失败响应消息

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

### 5.6 执行报告消息

| ExecutionReport(execreporttext)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 实时执行报告消息 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述:</b><br>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。<br>每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息, 该消息文本由成交回报表中的 execreporttext 字段包含。<br><br>对于证金公司, 会将有效的出借人约定和非约定申报明细(含撤单)通过消息文本 <b>execreporttext</b> 域发送, 消息格式同出借人申报消息 NewOrderSingle 和申报撤单消息 OrderCancel Request。对于申报消息, 备注字段第 1 位取值为战略配售股份标志, 填写“S”表示本次出借为战略配售股份出借, 否则表示非战略配售股份出借, 第 2 位起取值为交易所订单号 OrderID; 对于申报撤单消息, 备注字段第 1 位取值为战略配售股份标志, 填写“S”表示原始订单为战略配售股份出借, 否 |          |

| ExecutionReport(excreporttext)                                                                                                                                                                           | 实时执行报告消息 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <p>则表示原始订单非战略配售股份出借,第2位起取值为原始订单的交易所订单号;其中对于非约定申报明细(含撤单),账户和PBU信息填充格。</p> <p>实时执行报告全部发送完毕后,向证金公司发送一条结束记录,当收到该条特殊记录,且对于每种数据广播类型,记录的产品集序号字段都已连续递增时,表示实时执行报告全部接收完毕。消息文本中备注域取值“ZRT_RPT_END”,消息体内其他域取值无意义。</p> |          |

| 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(执行报告)             |        |
| 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           | 费率,单位为%,小数部份填满                        | N11(3) |
| 32   | LastQty          | 该笔成交数量                                | N12    |
| 8504 | TotalValueTraded | 成交金额,无意义取值0                           | N16(3) |
| 151  | LeavesQty        | 本次剩余余额,该字段无意义,可填0                     | N12    |
| 54   | Side             | 出借方向,取值有:<br>F = 表示融入<br>G = 表示融出     | C1     |
| 580  | NoDates          | 期限,单位为天数                              | N5     |
| 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:<br>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，取值为 4。                                                                                                   | N2                                      |
| 发起方投资    | 448        | PartyID                                                                                                        | 发起方投资者帐户                                |
|          | 452        | PartyRole                                                                                                      | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户           |
| 发起方申报交   | 448        | PartyID                                                                                                        | 发起方业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号                |
|          | 452        | PartyRole                                                                                                      | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号         |
| 对手方投资    | 448        | PartyID                                                                                                        | 对手方投资者帐户，对于出借人的执行报告，填空格                 |
|          | 452        | PartyRole                                                                                                      | 取 39，表示当前 PartyID 的取值为对手方投资者帐户          |
| 对手方申报交易单 | 448        | PartyID                                                                                                        | 对手方业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号，对于出借人的执行报告，填空格 |
|          | 452        | PartyRole                                                                                                      | 取 17，表示当前 PartyID 的取值为对手方申报交易单元号        |
| 58       | Text       | 备注<br><br>对于证金公司和出借人，第 1 位为战略配售股份标志，填写“S”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。<br><br>对于证金公司，第 2-11 位存放对手方会员内部编号。 | C50                                     |

## 5.7 公共数据消息

| MktDataFull (mdtext)                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 申报汇总行情 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br><br>公共数据表中的 mdtext 字段数据。<br><br>转融通当日出借人非约定实时申报总量行情及闭市撮合成交后非约定成交总量行情（约定申报为盘中撮合，其成交量不在此揭示），当日最后一笔申报及成交总量行情发送完毕后，发送一条行情结束记录，行情结束记录消息中备注域（Text）取值“ZRT_MD_END”，消息体内其他域取值无意义。当收到该条特殊记录，且对于每种数据广播类型，记录的产品集序号字段都已连续递增时，表示出借人申报汇总行情接收完毕。对于每种数据广播类型，记录的产品集序号字段表示汇总行情消息在主机上产生的先后顺序，市场参与者应优先使用产品集序号大的记录来 |        |

| MktDataFull (mdtext)               | 申报汇总行情 |
|------------------------------------|--------|
| 获取汇总行情。<br>若某产品在某期限、费率情况下无申报，则无记录。 |        |

| 标签   | 字段名               | 字段描述                                    | 类型     |
|------|-------------------|-----------------------------------------|--------|
|      | 消息头               | MsgType 取值为： W=MktDataFull（实时申报及成交汇总行情） |        |
| 1180 | ApplID            | 消息应用标识，取值同数据库中请求业务类型 reqid              | C3     |
| 48   | SecurityID        | 证券代码                                    | C6     |
| 55   | Symbol            | 证券简称                                    | C8     |
| 44   | Price             | 费率，单位为%，小数部份填满                          | N11(3) |
| 271  | MDEntrySize       | 申报总量                                    | N16    |
| 387  | TotalVolumeTraded | 成交总量                                    | N16    |
| 580  | NoDates           | 期限，单位为天数                                | N5     |
| 58   | Text              | 备注                                      | C50    |

## 5.8 转融通标的证券清单 zrtbdMMDD.txt

1. 数据文件名：zrtbdMMDD.txt，该文件为更改证金公司 sf001bdzqYYYYMMDD001.txt 文件名后转发，MMDD 月日格式为标的券信息有效的交易日。
2. 数据内容：当日转融券融入的标的
3. 发送时间：开市前通过单向卫星发送；
4. 发送周期：每一交易日；
5. 数据格式：同本所其他TXT接口文件格式：竖线("|")为字段间分隔符；竖线("|")不应用在每条记录的开头和结尾；各字段均为一个遵循格式定义的字符串。每个字段均为定长字段；每行以二进制0x0A结束；最后一行也以0x0A结束。

| 序号 | 字段名  | 字段描述 | 类型 |
|----|------|------|----|
| 1  | 证券代码 | 证券代码 | C6 |
| 2  | 期限   | 期限   | N5 |

|   |    |    |        |
|---|----|----|--------|
| 3 | 费率 | 费率 | N10(3) |
| 4 | 备用 | 备用 | C40    |

## 6 股票质押回购业务消息规范

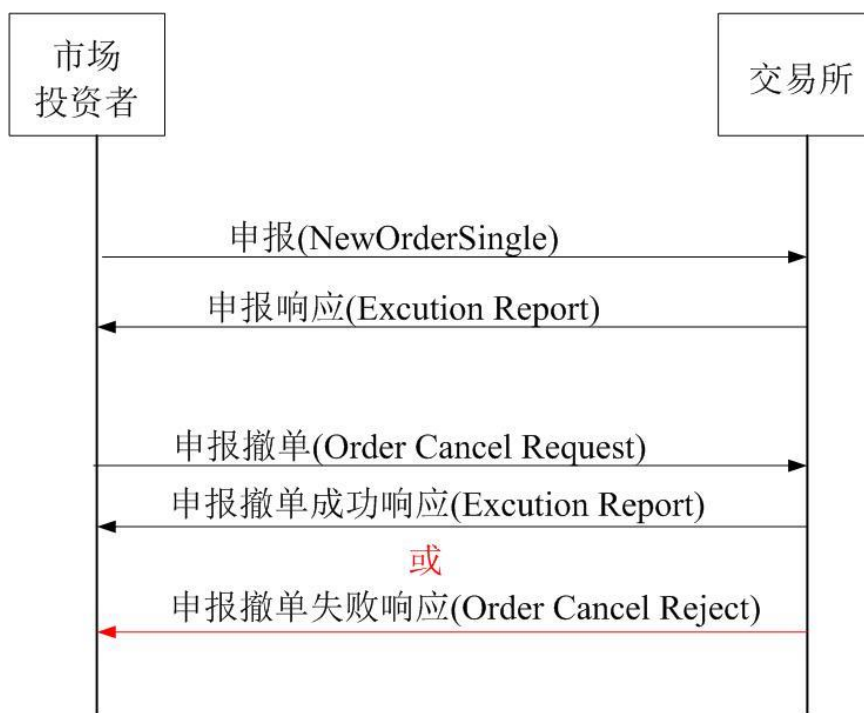
本部分描述股票质押回购业务各类申报、撤单和响应消息规范。

在没有特别声明的情况下，交易所后台一般根据买方（融出方）业务 PBU 与 ClOrdID 的组合确定订单(含撤单)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；本业务申报均可撤单，撤单依据原始订单申报的买方业务 PBU 和原始 ClOrdID(即 OrigClOrdID)进行撤单；

补充质押中双方帐号、双方 PBU 都必须同初始交易申报订单，购回交易、终止购回、部分解除质押、违约处置中双方帐号、双方 PBU 都必须同初始交易申报或补充质押；

本业务中 OrderID 在标准协议中定义为交易所订单编号，在本业务中可理解为成交编号。

### 6.1 股票质押回购 STEP 消息流程图



### 6.2 申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                                                                | 申报消息 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行申报。分别定义了<br>1. 初始交易（SPN）申报消息；<br>2. 补充质押（SPS）申报消息； |      |

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

3. 购回交易（SPR）和终止购回（SPT）申报消息；

4. 部分解除质押（SPD）和违约处置（SPB）申报消息。

本业务中，**买方为融出方，卖方为融入方。**

申报消息字段中，无意义的字段可参考 EzSTEP 通用数据库接口规格说明中 STEP 消息约定取空，即字符型字段值为空，则采用“标签=<SOH>”的方式表示（等号后与分隔符间有一个空格），如数字型字段值为空，采用缺省取值 0。

以下转中登标的证券描述标签取值约定，具体参见中登上海分公司登记结算数据接口规范，以下供参考：

填写规则：

- 1、证券类别字段不为空，填写标的券的证券类别。
- 2、流通类型字段不为空，填写标的券的流通类型。
- 3、权益类别左对齐，位数不足的右补空格，若标的券无权益类别，则填两位空格。
- 4、挂牌年份右对齐，位数不足的左边补 0，若标的券无挂牌年份，则填 0000（四个零）。
- 5、上述 4 要素均应按股东持有表中相应字段取值，若与持有表记录不一致，则日终质押（解除质押）处理失败。

举例：

| 证券类别 | 流通类型 | 权益类别 | 挂牌年份 | 申报标签      | 备注                           |
|------|------|------|------|-----------|------------------------------|
| PT   | 0    |      |      | PT0 0000  | 标签4、5位为空                     |
| XL   | B    |      |      | XLB 0000  | 标签4、5位为空                     |
| SF   | N    |      |      | SFN 0000  | 标签4、5位为空                     |
| GZ   | 1    | DX   | 2013 | GZ1DX2013 |                              |
| PT   | 1    | HL   | 36   | PT1HL0036 | 挂牌年份右对齐，左边补0                 |
| XL   | A    | S    | 4    | XLAS 0004 | 权益类别左对齐，右补空格<br>挂牌年份右对齐，左边补0 |

证券类别（ZQLB）意义如下：

|    |       |
|----|-------|
| GZ | 债券    |
| JJ | 基金    |
| PT | 普通股   |
| PG | 配股    |
| PS | 配售股   |
| PZ | 权证    |
| GJ | 国家股   |
| GF | 国有法人股 |

| NewOrderSingle (reqtext)                                                                                                             |          | 申报消息 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|------|
| JN                                                                                                                                   | 境内法人股    |      |
| JW                                                                                                                                   | 境外法人股    |      |
| SF                                                                                                                                   | 社会法人股    |      |
| XL                                                                                                                                   | 限售流通股    |      |
| YX                                                                                                                                   | 优先法人股    |      |
| ZG                                                                                                                                   | 职工股      |      |
| 流通类型 (LTLX) 意义如下:                                                                                                                    |          |      |
| 0                                                                                                                                    | 无限售流通    |      |
| N                                                                                                                                    | 非流通      |      |
| 1—9                                                                                                                                  | 权益次数     |      |
| A                                                                                                                                    | 未上市      |      |
| B                                                                                                                                    | IPO 限售股  |      |
| F                                                                                                                                    | 法人       |      |
| 权益类别 (QYLB) 意义如下:                                                                                                                    |          |      |
| DF                                                                                                                                   | 兑付       |      |
| DX                                                                                                                                   | 兑息       |      |
| HL                                                                                                                                   | 红利       |      |
| S                                                                                                                                    | 送股       |      |
| <p>以上关于中登标的证券描述标签取值约定来自中登，本所代为转发，如未来有扩展或进一步了解可咨询中登上海公司。</p> <p>以下转中登的融资投向取值约定，具体参见中登上海分公司登记结算数据接口规范，以下供参考：</p> <p>融资投向的代码字典定义如下：</p> |          |      |
| 01                                                                                                                                   | 生产经营     |      |
| 02                                                                                                                                   | 补充流动资金   |      |
| 03                                                                                                                                   | 股权性投资    |      |
| 04                                                                                                                                   | 债权类投资    |      |
| 05                                                                                                                                   | 不动产类投资   |      |
| 06                                                                                                                                   | 二级市场证券交易 |      |

| NewOrderSingle (reqtext)                 | 申报消息 |
|------------------------------------------|------|
| 07 偿还债务<br>08 个人消费<br>09 其他              |      |
| 以上取值约定来自中登，本所代为转发，如未来有扩展或进一步了解可咨询中登上海公司。 |      |

### 6.2.1 初始交易申报

| 标<br>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    | 标的证券代码                                                        | C6     |
| 921     | StartCash     | 初始交易金额；单位为元。                                                  | N16(2) |
| 38      | OrderQty      | 订单数量<br>本业务为标的证券数量                                            | N10    |
| 541     | MaturityDate  | 购回交易日期。格式 YYYYMMDD。                                           | C8     |
| 75      | TradeDate     | 本订单申报日期。格式 YYYYMMDD。                                          | C8     |
| 914     | AgreementID   | 业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验                                         | C16    |
| 107     | SecurityDesc  | 转发中登的标的证券描述标签，从左至右依次为：<br>证券类别、证券流通类型、证券权益类别、证券挂牌年份，详见申报消息描述。 | C9     |
| 453     | NoPartyIDs    | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码，取值为 6。 | N2     |
| 买方投资者   | 448 PartyID   | 买方投资者帐户编码。                                                    | C10    |
|         | 452 PartyRole | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为买方投资者帐户                                  | N4     |
| 买方申报交易单 | 448 PartyID   | 买方业务 PBU（5 位数字）。                                              | C5     |
|         | 452 PartyRole | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为买方业务 PBU。                                | N4     |
| 买       | 448 PartyID   | 买方营业部代码。                                                      | C5     |

|       |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |           |                                  |     |
|-------|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------------------------------|-----|
|       |      | 452                                                                                                                                                                                                                                                                             | PartyRole | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为买方营业部代码  | N4  |
| 账户    |      | 448                                                                                                                                                                                                                                                                             | PartyID   | 卖方投资者帐户。                         | C10 |
|       |      | 452                                                                                                                                                                                                                                                                             | PartyRole | 取 39，表示当前 PartyID 的取值为卖方投资者帐户    | N4  |
| 卖方申报交 |      | 448                                                                                                                                                                                                                                                                             | PartyID   | 卖方业务 PBU（5 位数字）                  | C5  |
|       |      | 452                                                                                                                                                                                                                                                                             | PartyRole | 取 17，表示当前 PartyID 的取值为卖方交易单元号    | N4  |
| 代码    |      | 448                                                                                                                                                                                                                                                                             | PartyID   | 卖方营业部代码。                         | C5  |
|       |      | 452                                                                                                                                                                                                                                                                             | PartyRole | 取 4002，表示当前 PartyID 的取值为卖方的营业部代码 | N4  |
| 58    | Text | 备注，对于初始交易，填写“质权人名称”，注意最长不超过 38 个字节。第 1 到 38 位左对齐，不足右补空格。<br><br>第 39 到 41 位填写质押平仓线，以 3 位整数表示，右对齐，不足左补 0；第 42 到 44 位填质押预警线，以 3 位整数表示，右对齐，不足左补 0；第 45 到 46 位填写融资投向，以 2 位字符表示；第 47 到 50 位填写融资利率，以 4 位整数表示，前两位填写整数部分，后两位填写小数部分，右对齐，不足左补 0，如融资利率为 9%，则填写“0900”。以上要素交易所不做业务校验，代为转发中登。 |           |                                  | C50 |

### 6.2.2 补充质押申报

| 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    | 标的证券代码                                                   | C6  |
| 38   | OrderQty      | 订单数量<br>本业务为标的证券数量                                       | N10 |
| 1080 | RefOrderID    | 交易所订单编号参考值。<br>对于补充质押申报订单, 需填写初始交易申报响应交易所订单编号 (OrderID)。 | C16 |
| 1125 | OrigTradeDate | 初始交易日期。<br>对补充质押申报, 为初始交易申报的初始交易日期。                      | C8  |

|         |              |                                                                   |                                  |     |
|---------|--------------|-------------------------------------------------------------------|----------------------------------|-----|
| 541     | MaturityDate | 购回交易日期。格式 YYYYMMDD。                                               |                                  | C8  |
| 75      | TradeDate    | 本订单申报日期。格式 YYYYMMDD。                                              |                                  | C8  |
| 914     | AgreementID  | 业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验                                             |                                  | C16 |
| 107     | SecurityDesc | 转发中登的标的证券描述标签，从左至右依次为：<br><br>证券类别、证券流通类型、证券权益类别、证券挂牌年份，详见申报消息描述。 |                                  | C9  |
| 453     | NoPartyIDs   | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码，取值为 6。     |                                  | N2  |
| 买方投资者   | 448          | PartyID                                                           | 买方投资者帐户编码。                       | C10 |
|         | 452          | PartyRole                                                         | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为买方投资者帐户     | N4  |
| 买方申报交易单 | 448          | PartyID                                                           | 买方业务 PBU（5 位数字）。                 | C5  |
|         | 452          | PartyRole                                                         | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为买方业务 PBU。   | N4  |
| 买方营业部代  | 448          | PartyID                                                           | 买方营业部代码。                         | C5  |
|         | 452          | PartyRole                                                         | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为买方营业部代码  | N4  |
| 卖方投资者   | 448          | PartyID                                                           | 卖方投资者帐户。                         | C10 |
|         | 452          | PartyRole                                                         | 取 39，表示当前 PartyID 的取值为卖方投资者帐户    | N4  |
| 卖方申报交   | 448          | PartyID                                                           | 卖方业务 PBU（5 位数字）                  | C5  |
|         | 452          | PartyRole                                                         | 取 17，表示当前 PartyID 的取值为卖方交易单元号    | N4  |
| 卖方营业部代  | 448          | PartyID                                                           | 卖方营业部代码。                         | C5  |
|         | 452          | PartyRole                                                         | 取 4002，表示当前 PartyID 的取值为卖方的营业部代码 | N4  |
| 58      | Text         | 备注，对于补充质押，填写“质权人名称”，注意最长不超过 38 个字节。                               |                                  | C50 |

### 6.2.3 购回交易和终止购回申报

| 标<br>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    | 标的证券代码                                                        |                                  | C6     |
| 922     | EndCash       | 购回交易为购回交易金额，单位为元。<br>终止购回无意义，可取值 0。                           |                                  | N16(2) |
| 1080    | RefOrderID    | 交易所订单编号参考值。<br>初始交易或补充质押交易所订单编号（OrderID）。                     |                                  | C16    |
| 1125    | OrigTradeDate | 初始交易申报日期或补充质押申报日期。格式 YYYYMMDD。                                |                                  | C8     |
| 75      | TradeDate     | 本订单申报日期。格式 YYYYMMDD。                                          |                                  | C8     |
| 914     | AgreementID   | 业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验                                         |                                  | C16    |
| 453     | NoPartyIDs    | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码，取值为 6。 |                                  | N2     |
| 买方投资者   | 448           | PartyID                                                       | 买方投资者帐户编码。                       | C10    |
|         | 452           | PartyRole                                                     | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为买方投资者帐户     | N4     |
| 买方申报交易  | 448           | PartyID                                                       | 买方业务 PBU（5 位数字）。                 | C5     |
|         | 452           | PartyRole                                                     | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为买方业务 PBU。   | N4     |
| 买方营业部代  | 448           | PartyID                                                       | 买方营业部代码。                         | C5     |
|         | 452           | PartyRole                                                     | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为买方营业部代码  | N4     |
| 卖方投资者   | 448           | PartyID                                                       | 卖方投资者帐户。                         | C10    |
|         | 452           | PartyRole                                                     | 取 39，表示当前 PartyID 的取值为卖方投资者帐户    | N4     |
| 卖方申报交   | 448           | PartyID                                                       | 卖方业务 PBU（5 位数字）                  | C5     |
|         | 452           | PartyRole                                                     | 取 17，表示当前 PartyID 的取值为卖方交易单元号    | N4     |
| 卖方营业部代码 | 448           | PartyID                                                       | 卖方营业部代码。                         | C5     |
|         | 452           | PartyRole                                                     | 取 4002，表示当前 PartyID 的取值为卖方的营业部代码 | N4     |
| 58      | Text          | 备注                                                            |                                  | C50    |

#### 6.2.4 部分解除质押和违约处置申请申报

| 标 | 字段名 | 字段描述 | 类 |
|---|-----|------|---|
|---|-----|------|---|

| 签       |               |           |                                                                   | 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    |           | 标的证券代码                                                            | C6  |
| 38      | OrderQty      |           | 订单数量<br>本申报的标的证券数量                                                | N10 |
| 1080    | RefOrderID    |           | 交易所订单编号参考值。<br>初始交易或补充质押交易所订单编号（OrderID）。                         | C16 |
| 1125    | OrigTradeDate |           | 初始交易申报日期或补充质押申报日期。格式 YYYYMMDD。                                    | C8  |
| 75      | TradeDate     |           | 本订单申报日期。格式 YYYYMMDD。                                              | C8  |
| 914     | AgreementID   |           | 业务合同编号，会员内部字段，交易所不做校验                                             | C16 |
| 107     | SecurityDesc  |           | 转发中登的标的证券描述标签，从左至右依次为：<br><br>证券类别、证券流通类型、证券权益类别、证券挂牌年份，详见申报消息描述。 | C9  |
| 453     | NoPartyIDs    |           | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码，取值为 6。     | N2  |
| 买方投资者   | 448           | PartyID   | 买方投资者帐户编码。                                                        | C10 |
|         | 452           | PartyRole | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为买方投资者帐户                                      | N4  |
| 买方申报交易单 | 448           | PartyID   | 买方业务 PBU（5 位数字）。                                                  | C5  |
|         | 452           | PartyRole | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为买方业务 PBU。                                    | N4  |
| 买方营业部代  | 448           | PartyID   | 买方营业部代码。                                                          | C5  |
|         | 452           | PartyRole | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为买方营业部代码                                   | N4  |
| 卖方投资者账户 | 448           | PartyID   | 卖方投资者帐户。                                                          | C10 |
|         | 452           | PartyRole | 取 39，表示当前 PartyID 的取值为卖方投资者帐户                                     | N4  |
| 卖方申报交   | 448           | PartyID   | 卖方业务 PBU（5 位数字）                                                   | C5  |
|         | 452           | PartyRole | 取 17，表示当前 PartyID 的取值为卖方交易单元号                                     | N4  |

|    |      |           |                                  |     |
|----|------|-----------|----------------------------------|-----|
| 代码 | 448  | PartyID   | 卖方营业部代码。                         | C5  |
|    | 452  | PartyRole | 取 4002，表示当前 PartyID 的取值为卖方的营业部代码 | N4  |
| 58 | Text |           | 备注                               | C50 |

### 6.3 申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                                                                                            | 申报撤单消息 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>同大宗业务申报撤单消息。<br>本业务申报均可撤单，其中针对特定的申报撤单，证券代码、订单数量如无意义可取空格或 0。<br>本业务订单含买卖双方，买卖方向无意义可取空格。参与方为买方投资者账户、申报交易单元号。 |        |

### 6.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息

| ExecutionReport (resptext)                                                    | 申报响应消息 |
|-------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。<br>其中交易所订单编号，本业务可理解为成交编号。证券代码，如无意义可取空格。 |        |

### 6.5 申报撤单失败响应消息

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

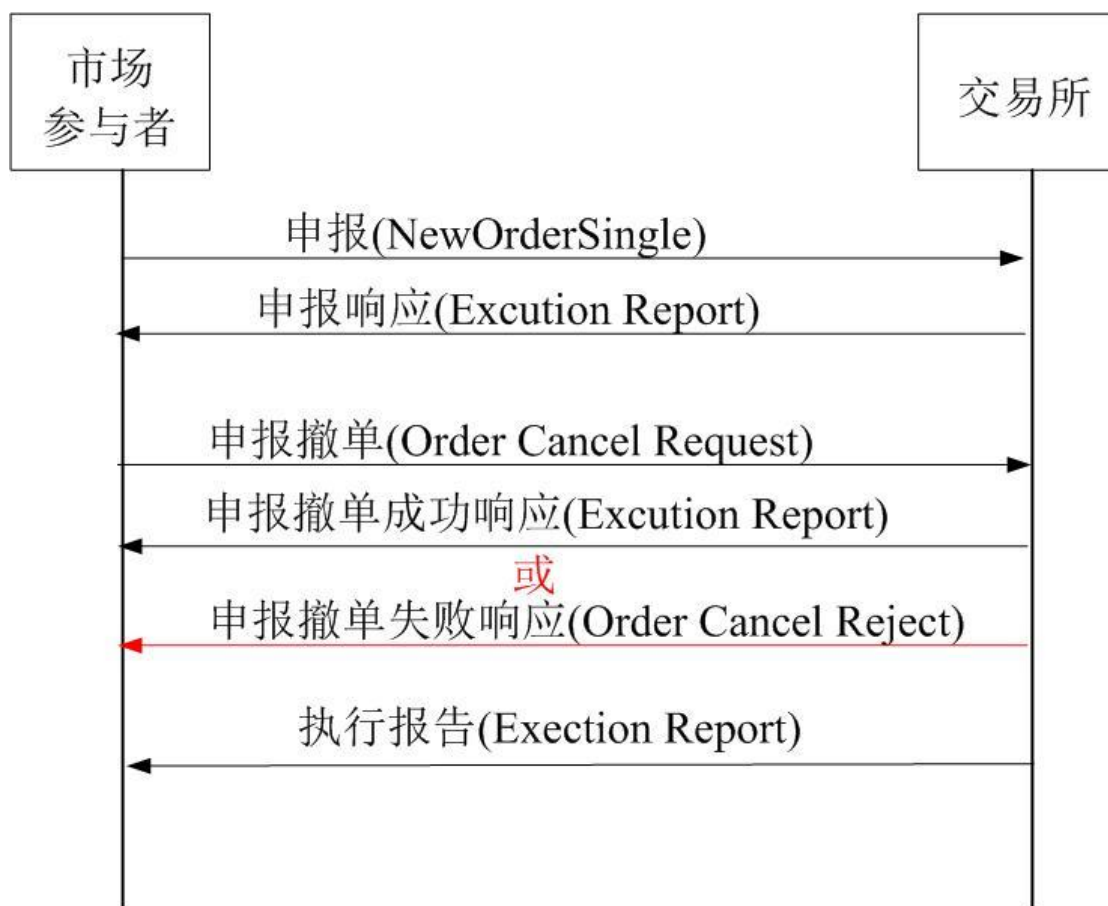
## 7 撮合业务消息规范（国债预发行、盘后固定价格交易）

### 7.1 撮合业务 STEP 消息流程图

根据撮合业务规则，市场投资者可以进行买卖申报和撤单申报，交易所实时反馈申报确认，并反馈成交回报（即执行报告），目前综合业务平台撮合业务支持：

- 1、国债预发行业务
- 2、盘后固定价格交易业务

下图描述了消息通信流程。



### 7.2 申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                                                                               | 申报消息 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行撮合买卖申报。支持以下请求业务申报<br>国债预发行利率（收益率）招标（BIY）申报；国债预发行价格招标（BIP）申报；盘后固定价 |      |

| NewOrderSingle (reqtext)    | 申报消息 |
|-----------------------------|------|
| 格交易申报（PFP）。                 |      |
| 国债预发行业务、盘后固定价格交易暂仅支持限价订单类型。 |      |

| 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         | 价格，对于价格，单位元；对于百分比类型利率，单位%。                                   | N11(3) |
| 38     | OrderQty      | 订单数量                                                         | N10    |
| 54     | Side          | 买卖方向，取值有：<br>1 表示买<br>2 表示卖                                  | C1     |
| 40     | OrdType       | 订单类型，取值：<br>1=市价（ Market），暂不支持<br>2=限价（ Limit）<br>K=市转现，暂不支持 | 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   | 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 | 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   | 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    |

### 7.3 申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                   | 申报撤单消息 |
|-------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>同大宗交易业务申报撤单消息。<br>其中订单数量，本业务不做校验。 |        |

### 7.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息

| ExecutionReport (resptext)                                                                                                                                                                                                  | 申报响应消息 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。<br>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。<br>150 和 39 组合取值含义：<br>申报成功响应：150=0, 39=0<br>申报拒绝响应：150=8, 39=8<br>申报撤单成功响应：150=6, 39=6<br>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：<br>0=成功响应<br>8=拒绝响应<br>6=撤单成功 | C1  |
| 39  | OrdStatus | 当前订单状态，取值有：<br>0=成功响应<br>8=拒绝响应<br>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。<br><br>对于申报撤单成功响应，该字段取值为空。 | C5  |
| 32  | LastQty      | 对于申报撤单成功响应，为该撤单成功的数量。其他无意义取 0                                                                           | N12 |
| 58  | Text         | 备注                                                                                                      | C50 |

## 7.5 申报撤单失败响应消息

| OrderCancelReject (resptext)     | 申报撤单失败响应消息 |
|----------------------------------|------------|
| <b>描述：</b><br>同大宗交易业务申报撤单失败响应消息。 |            |

## 7.6 执行报告消息

| ExecutionReport(execreporttext)            | 实时执行报告消息 |
|--------------------------------------------|----------|
| <b>描述：</b><br>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。 |          |

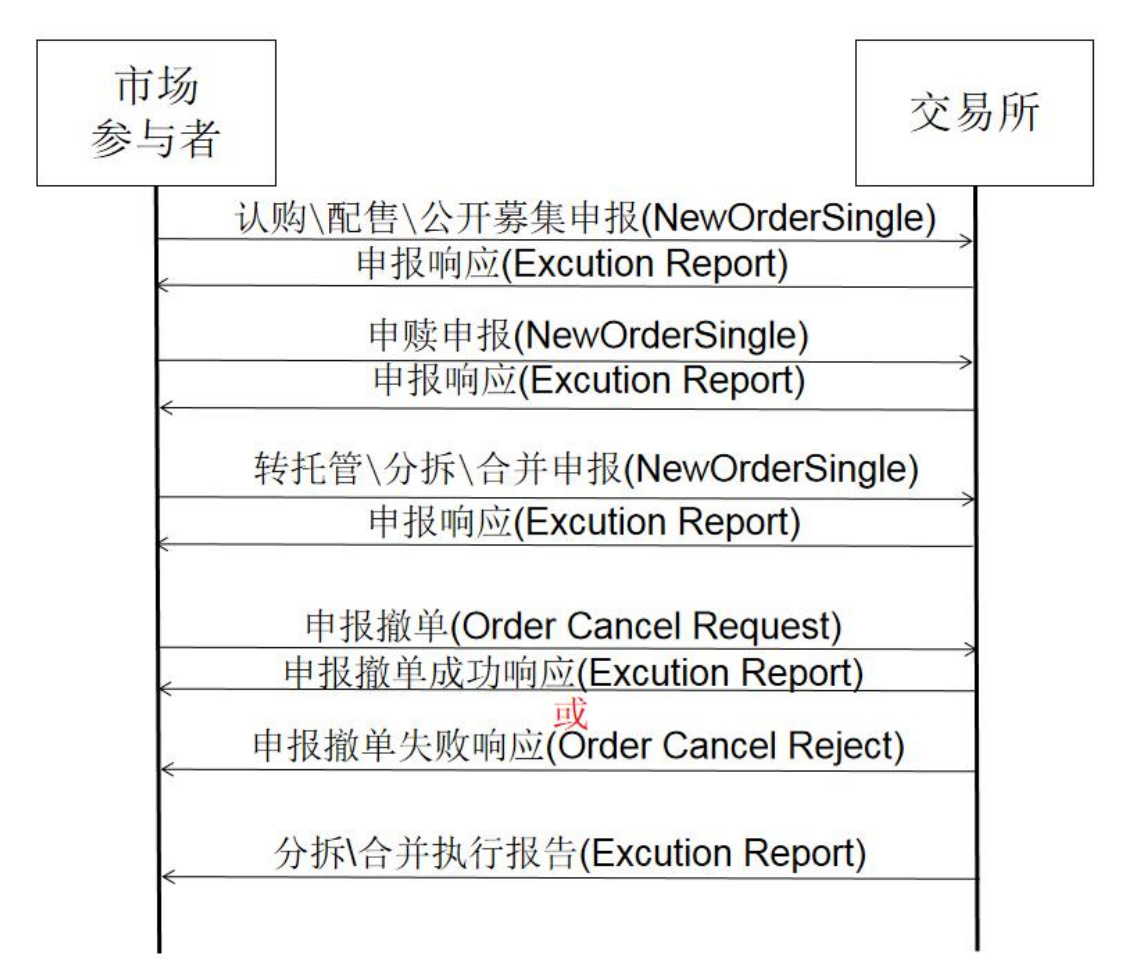
| 序号 | 字段名     | 字段描述                            | 类型  |
|----|---------|---------------------------------|-----|
|    | 标准消息头   | MsgType 取值为：8=成交回报              |     |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号，                         | C10 |
| 37 | OrderID | 交易所订单编号                         | C16 |
| 17 | ExecID  | 成交编号，目前本业务有效位用到 10 位，后期将逐步扩展位数， | C16 |

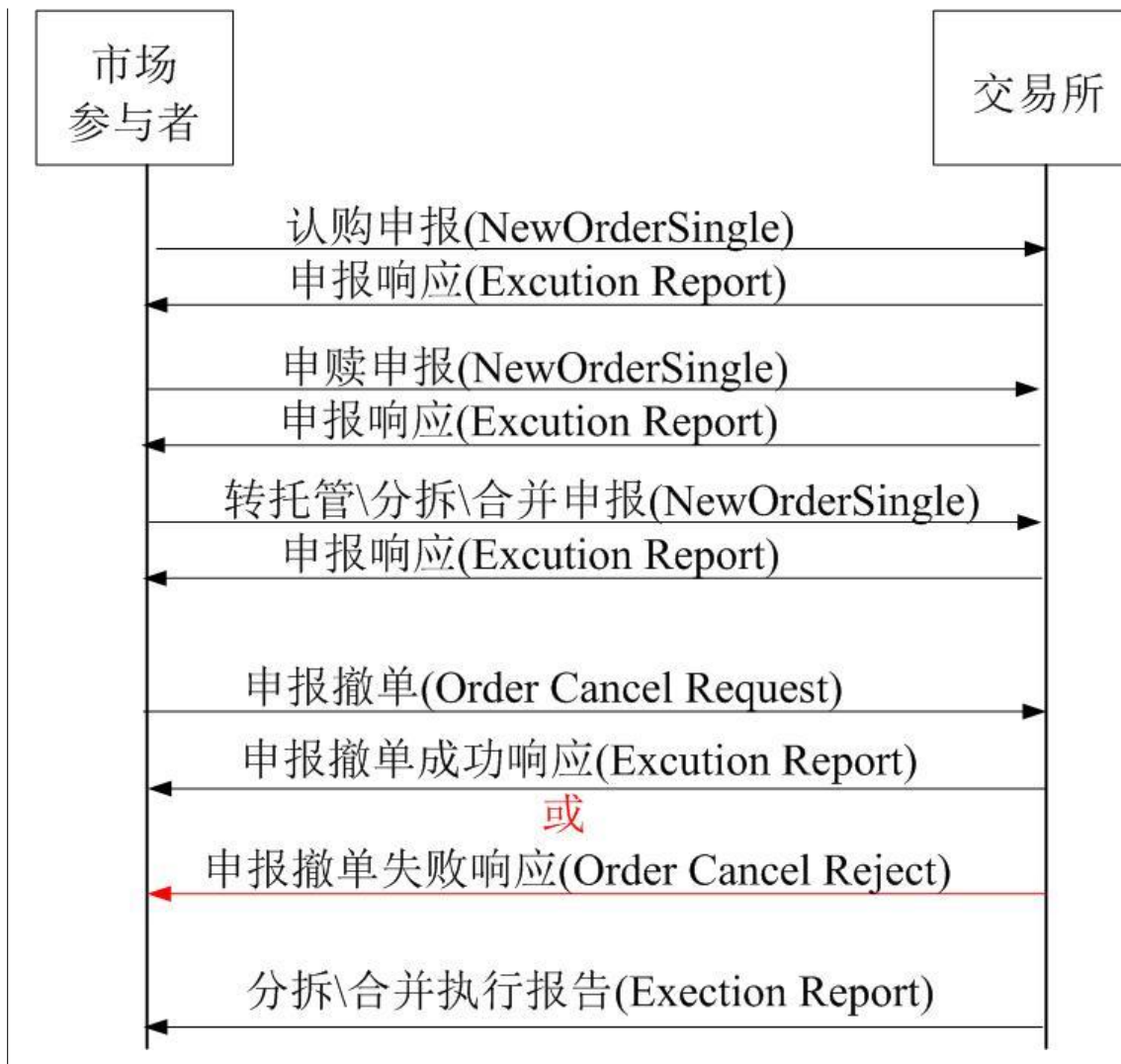
|       |                  |              |                                                                                                        |        |
|-------|------------------|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
|       |                  | 注意做好相关技术准备工作 |                                                                                                        |        |
| 1180  | ApplID           |              | 消息应用标识，取值同数据库中请求业务类型 reqid                                                                             | C3     |
| 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<br><br>对于国债预发行价格招标，计算方式为价格 x 数量*10；<br>对于国债预发行利率招标，计算方式为数量 x 面值*10；<br>对于盘后固定价格交易，计算方式为数量 x 成交价格。 | N16(3) |
| 151   | LeavesQty        |              | 本次剩余余额，暂为 0                                                                                            | N12    |
| 54    | Side             |              | 买卖方向，取值有：<br><br>1 表示买<br><br>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,式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000                                                                   | C21    |
| 150   | ExecType         |              | 当前订单执行状态，取值：<br><br>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，取值为 2。                                                               | N2     |
| 投资者帐  | 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 | 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     |
| 58    | Text             |              | 备注                                                                                                     | C50    |

## 8 上证 LOF/公募 REITs 业务消息规范

### 8.1 上证 LOF/公募 REITs STEP 消息流程图

根据上证 LOF 认购、申赎、转托管流程及公募 REITs 认购、转托管、配售、公开募集业务流程，市场投资者可以进行上证 LOF/公募 REITs 业务申报，交易所实时反馈申报确认，下图描述了上证 LOF/公募 REITs 的 STEP 消息通信流程。





## 8.2 申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                                                                           | 申报消息 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行上证 LOF 认购、申赎、转托管及公募 REITs 认购、转托管、 <u>配售</u> 、 <u>公开募集</u> 申报。 |      |

### 8.2.1 认购配售\公开募集申报

| 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     |
| 152    | CashOrderQty  | 认购金额，单位元<br><u>对于认购，为认购金额；</u><br><u>对于配售，为配售金额；</u><br><u>对于公开募集，为公开募集金额。</u> | N16(3) |
| 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   | 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 | 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   | 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    |

### 8.2.2 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，指申报会员内部编号。                              | C10    |
| 48   | SecurityID    | 证券代码，上证 LOF 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 | 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    | 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 | 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 |

### 8.2.3 转托管\分拆\合并申报

| 标签     | 字段名        |           | 字段描述                                                      | 类型  |
|--------|------------|-----------|-----------------------------------------------------------|-----|
|        | 消息头        |           | MsgType 取值为： U001=注册指令                                    |     |
| 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   |           | 数量<br>转托管数量或分拆、合并数量。                                      | 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、转入方基金参与方编码，取值为 4。 | N2  |
| 投资者账   | 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 | 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   | 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  |
| 方编码    | 448        | PartyID   | 转入方基金参与方编码。<br>交易所目前支持的 3 位基金参与方编码方式，暂不支持 9 位编码。          | C9  |
|        | 452        | PartyRole | 取 40，表示当前 PartyID 的取值为转入方基金参与方编码                          | N4  |
| 58     | Text       |           | 备注                                                        | C50 |

### 8.3 申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                                                                                                                                                                                                     | 申报撤单消息 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br><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 OrderCancel Request 消息进行申报撤单</p> <p>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。</p> <p>本业务中,认购申报、申购赎回申报、转托管申报、<u>配售申报</u>、<u>公开募集申报</u>可以撤单,分拆与合并不可撤单。</p> |        |

| 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,无意义                                        | N10 |
| 54    | Side          | 买卖方向,无意义                                        | 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  | 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 | 448 PartyID   | 发起方业务 PBU 代码,填写 5 位交易单元号,对于撤单,应为原始申报的业务 PBU 代码。 | C5  |
|       | 452 PartyRole | 取 1,表示当前 PartyID 的取值为 PBU                       | N4  |
| 58    | Text          | 备注                                              | C50 |

### 8.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息

| ExecutionReport (resptext) | 申报响应消息 |
|----------------------------|--------|
|----------------------------|--------|

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

### 8.5 申报撤单失败响应消息

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

### 8.6 执行报告消息

| ExecutionReport(excreporttext)                                                                                                                                    | 实时执行报告消息 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述:</b><br>执行报告表中的 excreporttext 字段数据。<br>仅 LOF 分拆、合并业务生成实时执行报告，会产生多条记录：一条母基金证券代码记录，成交数量为母基金分拆或合并数量；多条子基金证券代码记录，成交数量为子基金数量。价格、金额、买卖无意义。<br>基金公司作为对手方收到对应的成交数据。 |          |

| 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<br>对于基金公司，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    |
| 1180 | ApplID     | 消息应用标识，取值同数据库中请求业务类型 reqid                  | C3     |
| 48   | SecurityID | 证券代码                                        | C6     |
| 31   | LastPx     | 价格，无意义                                      | N11(3) |

|       |                  |           |                                          |        |
|-------|------------------|-----------|------------------------------------------|--------|
| 32    | LastQty          |           | 该笔成交数量                                   | N12    |
| 8504  | TotalValueTraded |           | 成交金额，本业务无意义填 0                           | N16(3) |
| 151   | LeavesQty        |           | 本次剩余余额，暂为 0                              | N12    |
| 54    | Side             |           | 买卖方向，无意义                                 | 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：<br>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，取值为 2。 | N2     |
| 投资者帐  | 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 | 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     |
| 58    |                  | Text      | 备注                                       | C50    |

## 8.7 基金及公募 REITs 业务参数公告文件 sfpm01MMDD.txt

| sfpm01MMDD.txt                                                                        | 基金业务参数接口 |
|---------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述：</b><br>文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。在交易日开市前发送。<br>该接口文件说明基金及公募 REITs 业务参数信息，具体参见参考数据类型。 |          |
| <b>时间和频率：</b> 每个交易日开市前发送                                                              |          |
| <b>数据格式：</b> 记录采用行格式，字段以分隔符‘ ’来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。                |          |

文件定义，多条行情记录，参考数据类型取值标识字母 R 加类型编号。

当取值为 R0106 时，文件体记录格式如下：

| 序号 | 域名                  | 字段名        | 字段类型 | 描述                                                                                                              |
|----|---------------------|------------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. | RStreamID           | 参考数据类型     | C5   | 取值为R0106，表示LOF基金及公募REITs业务参数控制数据                                                                                |
| 2. | FundInstrumentID    | 基金二级市场交易代码 | C6   | 基金二级市场交易代码或公募REITs证券代码                                                                                          |
| 3. | FundName            | 基金名称       | C10  | 基金名称或公募REITs的证券简称                                                                                               |
| 4. | FundType            | 基金类型       | C1   | 基金类型：<br>0：普通LOF<br>1：财务分级基金母份额<br>2：多空分级基金母份额<br>3：公募REITs                                                     |
| 5. | PartitionMergeUnit  | 分拆合并的整手数   | N8   | 分拆合并的整手数<br>必须大于0<br>单位为份<br>无意义取空格。                                                                            |
| 6. | MasterRatio         | 母基金转换系数    | N8   | 对于分级基金，表示母基金转换系数，须校验大于0，不能为小数<br>无意义取空格。                                                                        |
| 7. | MergeLowerLimit     | 合并申报起点数量   | N12  | 合并申报起点数量，须校验不小于0，单位为份。<br>无意义取空格。                                                                               |
| 8. | PartitionLowerLimit | 拆分申报起点数量   | N12  | 拆分申报起点数量，须校验不小于0，单位为份。<br>无意义取空格。                                                                               |
| 9. | BusinessStatus      | 业务状态       | C8   | 第1位表示是否允许 <del>配售交易(此位预留，暂不生效)</del><br>第2位表示是否允许认购<br>第3位表示是否允许申购<br>第4位表示是否允许赎回<br>第5位表示是否允许拆分<br>第6位表示是否允许合并 |

|                                                      |                |         |     |                                                                                                |
|------------------------------------------------------|----------------|---------|-----|------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                      |                |         |     | 第7位表示是否允许转托管<br>第8位表示是否允许公开募集预留<br>0: 禁止; 1: 允许                                                |
| 10.                                                  | NoInstruments  | 重复组数    | N 3 | 分级基金子份额的数目(分级基金子份额重复组数), 且与后续成份证券数量相同。<br>基金类型为财务分级基金或多空分级基金时, 取值必须大于0; 对于普通LOF或公募REITs, 取值为0。 |
| (注: 重复该节段数据表示多个成份证券信息。若NoInstruments取值为0, 则本重复组节段为空) |                |         |     |                                                                                                |
| 分级基金子份额重复组                                           | InstrumentID   | 证券代码    | C 6 | 证券ID, 须校验按照字段递增排序                                                                              |
|                                                      | InstrumentName | 证券简称    | C8  | 证券简称                                                                                           |
|                                                      | SubRatio       | 子份额转换系数 | N8  | 子份额转换系数, 须校验大于0, 不能为小数                                                                         |
|                                                      | BusinessStatus | 业务状态    | C8  | 第1位表示是否允许交易(此位预留, 暂不生效)<br>第2位表示是否允许认购<br>第3到8位预留<br>0: 禁止; 1: 允许                              |
|                                                      |                | 扩展区域    | 不定  | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。                                                                              |

备注: 对于公募 REITs, 业务状态仅第 1 位、第 2 位、第 7 位和第 78 位有效。对于普通 LOF, 业务状态仅第 2-7 位有效。

## 9 网络投票业务消息规范

### 9.1 网络投票业务 STEP 消息流程图

根据业务规则，市场投资者可以进行投票申报，交易所实时反馈申报确认。先行赔付申报借用网络投票通道实施。

下图描述了消息通信流程。



### 9.2 申报消息

| Vote (reqtext)                                                                                                | 申报消息 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 U004 消息进行投票申报。<br>本接口中数据类型为 N16 的字段，因后台数据类型限制，暂时最长仅支持 15 位。 |      |

| 标签   | 字段名               | 字段描述                                                                | 类型  |
|------|-------------------|---------------------------------------------------------------------|-----|
|      | 消息头               | MsgType 取值为： U004=投票                                                |     |
| 11   | ClOrdID           | 会员内部编号，指申报会员内部编号。                                                   | C10 |
| 48   | SecurityID        | 证券代码，投票对应的上市公司交易证券代码                                                | C6  |
| 8547 | GeneralMeetingSeq | 股东大会编码，股东大会唯一序列号。                                                   | N10 |
| 8529 | VotingProposal    | 投票议案编号及子议案编号，议案和子议案用小数点分隔。例如：99（或 99.00）表示所有议案（累积议案除外）；取值 1 表示议案 1。 | C10 |

|        |                  |                                                                                                                                                |                                                                                                                          |     |
|--------|------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|        |                  | 带二位小数的编号代表议案组；小数点后数字为子议案。例如：<br>2.00 表示议案 2（议案组 2）的所有子议案，2.01 表示议案 2（议案组 2）的第一个子议案。<br><br>88（或 88.00）保留给港结算使用，具体参见香港中央结算有限公司参与沪股通上市公司网络投票实施指引 |                                                                                                                          |     |
| 8531   | VotingPreference |                                                                                                                                                | 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；<br><br>对于累积投票制，为投票票数。其中港结算为汇总选举票数。请注意过户数据接口“成交数量”数值位数限制。<br><br>对于先行赔付，填写赔付金额，单位为元。 | N16 |
| 8546   | VotingSegment    |                                                                                                                                                | 分段统计段号，仅对港结算有效，无意义可填空格。取值 A、B、C、D、E 分别代表现金分红议案的第 1、2、3、4、5 段，以此类推。字母 Z 代表中小投资者单独计票统计。具体参照交易所投票相关说明。                      | C2  |
| 704    | LongQty          |                                                                                                                                                | 总股份数量，仅对港结算有效，无意义填 0。                                                                                                    | N16 |
| 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   | 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 | 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。对于不需要在该字段填写营业部代码的，该字段可取值为若干个空格。                                                                                    | 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 |

### 9.3 申报响应消息

| VoteReport (resptext) | 申报响应消息 |
|-----------------------|--------|
| 描述：                   |        |

| VoteReport (resptext)                                                                           | 申报响应消息 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <p>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。</p> <p>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。</p> |        |

| 标签  | 字段名          | 字段描述                                                                         | 类型  |
|-----|--------------|------------------------------------------------------------------------------|-----|
|     | 消息头          | MsgType 取值为：U005=投票申报响应                                                      |     |
| 37  | OrderID      | 交易所订单编号                                                                      | C16 |
| 150 | ExecType     | 当前订单执行类型，取值有：<br>0=成功响应<br>8=拒绝响应                                            | 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 |
| 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。 | C5  |
| 58  | Text         | 备注                                                                           | C50 |

#### 9.4 投票议案公告文件 vtlsMMDD.xml

| vtlsMMDD.xml                                                | 投票议案公告文件 |
|-------------------------------------------------------------|----------|
| <p><b>描述：</b></p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的文件适用日期，在交易日开市前发送。</p> |          |

| 编号 | 字段名 | 字段类型 | 描述 | 备注 | XML 字段名 |
|----|-----|------|----|----|---------|
|----|-----|------|----|----|---------|

|    |          |       |                                                                                |                                       |                  |
|----|----------|-------|--------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|------------------|
| 1  | streamID | C 5   | streamID, 结构化投票议案指令文件使用“R0109”                                                 | 必填                                    | streamID         |
| 2  | 公司代码     | C 6   | 公司代码                                                                           | 必填                                    | companycode      |
| 3  | 公司简称     | C 8   | 公司简称                                                                           | 必填                                    | companyinfo      |
| 4  | 投票产品代码   | C 6   | 投票产品代码                                                                         | 必填                                    | vote code        |
| 5  | 股权登记日    | C 8   | 不同产品可能不同, 格式: yyyymmdd                                                         | 必填: A 股和公开发行优先股;<br>非必填: B 股和非公开发行优先股 | regdate          |
| 6  | 最后交易日    | C 8   | 不同产品可能不同, 格式: yyyymmdd                                                         | 非必填: A 股和公开发行优先股;<br>必填: B 股和非公开发行优先股 | lasttradedate    |
| 7  | 股东大会开始日  | C 8   | 格式: yyyymmdd                                                                   | 必填                                    | meetingdatebegin |
| 8  | 股东大会结束日  | C 8   | 格式: yyyymmdd                                                                   | 必填                                    | meetingdateend   |
| 9  | 股东大会类型   | C 4   | 临时/年度                                                                          | 必填                                    | meetingtype      |
| 10 | 股东大会名称   | C 500 | 股东大会名称<br>长度为 UTF-8 字符数                                                        | 必填                                    | meetingdesc      |
| 11 | 股东大会编码   | C10   | 股东大会唯一序列号                                                                      | 必填                                    | meetingseq       |
| 12 | 议案编号     | C10   | 投票议案(组)编号及子议案编号。<br>整数编号代表普通议案。例如: 1 表示普通议案 1。<br>带二位小数的编号代表议案组及子议案。例如: 2.00 表 | 必填                                    | vid              |

|    |          |       |                                                       |     |           |
|----|----------|-------|-------------------------------------------------------|-----|-----------|
|    |          |       | 示议案组 2 的标题，2.01 表示议案组 2 的第一个子议案，2.02 表示议案组 2 的第二个子议案。 |     |           |
| 13 | 议案名称     | C 100 | 长度为 UTF-8 字符数                                         | 必填  | vinfo     |
| 14 | 议案类型     | C 4   | 累计投票议案:L,普通议案 P                                       | 必填  | vtype     |
| 15 | 累计投票应选数  | C 4   | 若填写，则必须填写正整数                                          | 非必填 | vleijino  |
| 16 | 股东身份     | C 50  | A 股股东/B 股股东/优先股股东/恢复表决权的优先股股东                         | 必填  | vrole     |
| 17 | 议案关系     | C 100 | 议案关系                                                  | 非必填 | vrelation |
| 18 | 股份类别     | C 20  | A 股/B 股/优先股/恢复表决权优先股                                  | 非必填 | stype     |
| 19 | 股票简称     | C8    | 股票简称                                                  | 非必填 | sabbr     |
| 20 | 投票产品代码指引 | C150  | 股东议案的投票产品代码指引。用以在议案股东类别和投票代码之间建立关联，方便程序自动化处理          | 必填  | refcode   |

#### 示例文件：

注：若同一家上市公司同一天召开多次股东大会，下述文件的<company>会相应出现多次。

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
```

```
<rootvote streamID="R0109">
```

```
  <company>
```

```
    <companycode>600000</companycode>
```

```
    <companyinfo>浦发银行</companyinfo>
```

```
    <meetingseq>201425547</meetingseq>
```

```
  <votecodelist>
```

```
    <votecode lasttradedate=""
```

```
      regdate="20140519" stype="A 股" sabbr="浦发银行">600000</votecode>
```

```
    <votecode lasttradedate="20140519" "
```

```
regdate="20140522" stype="优先股" sabbr="浦优先 1">360000</votecode>
<votecode lasttradedate="20140519" stype="恢复表决权优先股"
sabbr="浦优先 2" regdate="20140522">360001</votecode>
<votecode lasttradedate="20140519" stype="B 股" sabbr="浦发 B 股"
regdate="20140522">900000</votecode>
</votecodelist>
<meetingdatebegin>20140526</meetingdatebegin>
<meetingdateend>20140526</meetingdateend>
<meetingdesc>上海浦东发展银行股份有限公司 2014 年度网络投票 1</meetingdesc>
<meetingtype>年度</meetingtype>
<volist>
<vote vid="1" vinfo="审议公司 2013 年度董事会工作报告" vtype="P" vrelation=""
vleijino="">
<vrolelist>
<vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>
</vrolelist>
</vote>
<vote vid="2" vinfo="审议公司 2013 年度监事会工作报告" vtype="P" vrelation=""
vleijino="">
<vrolelist>
<vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>
<vrole refcode="900000">B 股股东</vrole>
<vrole refcode="360000">优先股股东</vrole>
<vrole refcode="360001">恢复表决权的优先股股东</vrole>
</vrolelist>
</vote>
<vote vid="3.00" vinfo="董事会选举" vtype="L" vrelation="" vleijino="2">
<vrolelist>
<vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>
</vrolelist>
</vote>
<vote vid="3.01" vinfo="张三" vtype="L" vrelation="" vleijino="2">
<vrolelist>
```

```
<vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>
</vrolelist>
</vote>
<vote vid="3.02" vinfo="李 四" vtype="L" vrelation="" vleijino="2">
  <vrolelist>
    <vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>
  </vrolelist>
</vote>
<vote vid="3.03" vinfo="王 五" vtype="L" vrelation="" vleijino="2">
  <vrolelist>
    <vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>
  </vrolelist>
</vote>
</volist>
</company>

<company>
  <companycode>600000</companycode>
  <companyinfo>浦发银行</companyinfo>
  <meetingseq>201425548</meetingseq>
  <votecodelist>
    <votecode lasttradedate="" regdate="20140519" stype="A 股" sabbr="浦发银
行">600000</votecode>
    <votecode lasttradedate="20140519" regdate="" stype="优先股" sabbr="优先
1">360000</votecode>
    <votecode lasttradedate="20140520" regdate="" stype="优先股" sabbr="优先
2">360002</votecode>
    <votecode lasttradedate="20140519" regdate="" stype="恢复表决权优先股"
sabbr="优先 2">360001</votecode>
  </votecodelist>
  <meetingdatebegin>20140526</meetingdatebegin>
  <meetingdateend>20140527</meetingdateend>
  <meetingdesc>上海浦东发展银行股份有限公司 2014 年度网络投票 2</meetingdesc>
  <meetingtype>年度</meetingtype>
```

```
<volist>

    <vote vid="1" vinfo="审议公司 2013 年度董事会工作报告" vtype="P" vrelation=""
vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>

    <vote vid="2" vinfo="审议公司 2013 年度监事会工作报告" vtype="P" vrelation=""
vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>

            <vrole refcode="360000|360002">优先股股东</vrole>

            <vrole refcode="360001">恢复表决权的优先股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>

    <vote vid="3.00" vinfo="ccc" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>

    <vote vid="3.01" vinfo="票面金额和发行价格" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>

    <vote vid="3.02" vinfo="存续期限" vtype="L" vrelation="" vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole refcode="600000">A 股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>

</volist>

</company>

<company>
```

```
<companycode>600001</companycode>

<companyinfo>测试 1</companyinfo>

<meetingseq>201425549</meetingseq>

<votecodelist>

    <votecode lasttradedate="" regdate="20140519" stype ="A 股"
sabbr="XXXX">600001</votecode>

    <votecode lasttradedate="20140519" regdate="20140521" stype ="优先股"
sabbr="优先股 1">360005</votecode>

    <votecode lasttradedate="20140519" regdate="20140521" stype ="恢复表决权优先股"
sabbr="优先股 2">360006</votecode>

    <votecode lasttradedate="20140519" regdate="20140521" stype ="B 股"   sabbr="B 股
X">900001</votecode>

</votecodelist>

<meetingdatebegin>20140526</meetingdatebegin>

<meetingdateend>20140526</meetingdateend>

<meetingdesc>XX 股份有限公司 2014 年度网络投票</meetingdesc>

<meetingtype>年度</meetingtype>

<volist>

    <vote vid="1" vinfo="关于 XX 股份有限公司符合非公开发行股票条件的议案"
vtype="P" vrelation="" vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole   refcode="600001">A 股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>

    <vote vid="2" vinfo="审议公司 2013 年度监事会工作报告" vtype="P" vrelation=""
vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole   refcode="600001">A 股股东</vrole>

            <vrole   refcode="900001">B 股股东</vrole>

            <vrole   refcode="360005">优先股股东</vrole>

            <vrole   refcode="360006">恢复表决权的优先股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>
```

```
<vote vid="3.00" vinfo="关于 XX 股份有限公司非公开发行股票方案的议案"
vtype="L" vrelation="" vleijino="">
    <vrolelist>
        <vrole refcode="600001">A 股股东</vrole>
    </vrolelist>
</vote>

<vote vid="3.01" vinfo="发行股票的种类和面值" vtype="L" vrelation=""
vleijino="">
    <vrolelist>
        <vrole refcode="600001">A 股股东</vrole>
    </vrolelist>
</vote>

<vote vid="3.02" vinfo="发行股票的方式和发行时间" vtype="L" vrelation=""
vleijino="">
    <vrolelist>
        <vrole refcode="600001">A 股股东</vrole>
    </vrolelist>
</vote>

<vote vid="3.03" vinfo="本次非公开发行股票募集资金数额及用途" vtype="L"
vrelation="" vleijino="">
    <vrolelist>
        <vrole refcode="600001">A 股股东</vrole>
    </vrolelist>
</vote>

<vote vid="3.04" vinfo="发行股票的价格及定价原则" vtype="L" vrelation=""
vleijino="">
    <vrolelist>
        <vrole refcode="600001">A 股股东</vrole>
    </vrolelist>
</vote>

<vote vid="3.05" vinfo="发行股票的数量" vtype="L" vrelation="" vleijino="">
    <vrolelist>
        <vrole refcode="600001">A 股股东</vrole>
    </vrolelist>
```

```
</vote>

    <vote vid="4" vinfo="关于 XX 股份有限公司符合非公开发行股票条件的议案"
vtype="P" vrelation="" vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole refcode="360005">优先股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>

    <vote vid="5" vinfo="关于审议《XX 股份有限公司前次募集资金使用情况报
告》的议案" vtype="P" vrelation="" vleijino="">

        <vrolelist>

            <vrole refcode="360005">优先股股东</vrole>

        </vrolelist>

    </vote>

</volist>

</company>

</rootvote>
```

## 10 资金前端控制业务消息规范

### 10.1 资金前端控制业务消息流程图

根据业务规则，市场投资者可以进行资金前端控制申报，交易所实时反馈申报确认。

下图描述了消息通信流程。



### 10.2 申报消息

| reqtext                                                                | 申报消息 |
|------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 U009 消息进行资金前端控制消息申报。 |      |

| 标签     | 字段名           | 字段描述                               | 类型  |
|--------|---------------|------------------------------------|-----|
| 35     | 消息头           | MsgType 取值为： U009=资金前申报            | C4  |
| 11     | ClOrdID       | 会员内部编号，指申报会员内部编号。                  | C10 |
| 48     | SecurityID    | 申报代码，对于资金前端控制业务填写 799970。          | C6  |
| 1645   | MarginAmt     | 资金前端控制，全天控制金额，单位为百万元               | N8  |
| 453    | NoPartyIDs    | 参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的申报交易单元号，取值为 1。 | N2  |
| 申报交易单元 | 448 PartyID   | 控制 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  |

|    |      |         |     |
|----|------|---------|-----|
| 58 | Text | 备注，暂不启用 | C50 |
|----|------|---------|-----|

### 10.3 申报响应消息

| resptext                                                                                 | 申报响应消息 |
|------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。<br>每一个申报记录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。 |        |

| 标签  | 字段名          | 字段描述                                                                         | 类型  |
|-----|--------------|------------------------------------------------------------------------------|-----|
| 35  | 消息头          | MsgType 取值为：U010=资金前端控制响应                                                    | C4  |
| 37  | OrderID      | 交易所订单编号                                                                      | C16 |
| 150 | ExecType     | 当前订单执行类型，取值有：<br>0=成功响应<br>8=拒绝响应                                            | C1  |
| 48  | SecurityID   | 申报代码                                                                         | 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 |
| 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。 | C5  |
| 58  | Text         | 备注                                                                           | C50 |

## 11 密码服务（中登身份认证服务）消息规范

### 11.1 密码服务（中登身份认证服务）消息流程图

根据业务规则，市场投资者可以进行身份认证业务申报，交易所实时反馈申报确认。

下图描述了消息通信流程。



### 11.2 申报消息

| Password Service(reqtext)                                                | 申报消息 |
|--------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 U006 消息进行身份认证消息申报 PWS。 |      |

| 标签   | 字段名                    | 字段描述                                | 类型  |
|------|------------------------|-------------------------------------|-----|
|      | 消息头                    | MsgType 取值为：U006=密码服务申报             |     |
| 11   | ClOrdID                | 会员内部编号，指申报会员内部编号。                   | C10 |
| 48   | SecurityID             | 申报代码，对于中登身份认证密码服务填写 799991。         | C6  |
| 8502 | DesignationInstruction | 注册指令：<br>6= 登记公司密码激活<br>7= 登记公司密码重置 | C1  |
| 8527 | DesignationTransType   | 注册类型：                               | N1  |

|        |                |           |                                                   |     |
|--------|----------------|-----------|---------------------------------------------------|-----|
|        |                |           | 1=新注册请求<br>固定填写 1                                 |     |
| 8539   | ValidationCode |           | 校验号码:<br>对于中登身份认证密码激活及密码重置服务填写 6 或 8 位数字。         | C10 |
| 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 | 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。对于不需要在该字段填写营业部代码的, 该字段可取值为若干个空格。            | C5  |
|        | 452            | PartyRole | 取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为营业部代码                    | N4  |
| 58     | Text           |           | 备注, 暂不启用                                          | C50 |

### 11.3 申报响应消息

| Password Service Report (resptext)                                                                 | 申报响应消息 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。<br>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。 |        |

| 标签  | 字段名      | 字段描述                       | 类型  |
|-----|----------|----------------------------|-----|
|     | 消息头      | MsgType 取值为: U008=密码服务申报响应 |     |
| 37  | OrderID  | 交易所订单编号                    | C16 |
| 150 | ExecType | 当前订单执行类型, 取值有:<br>0=成功响应   | C1  |

|     |              |                                                                              |     |
|-----|--------------|------------------------------------------------------------------------------|-----|
|     |              | 8=拒绝响应                                                                       |     |
| 48  | SecurityID   | 申报代码                                                                         | 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 |
| 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。 | C5  |
| 58  | Text         | 备注                                                                           | C50 |

## 12 定向可转债消息规范

### 12.1 定向可转债转让业务消息规范

#### 12.1.1 定向可转债公共数据消息

| IOI (mdtext)                                                                                                                             | 公共数据消息 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>公共数据表中的 mdtext 字段数据。<br>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。<br>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。 |        |

#### 12.1.2 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 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 IOI 消息进行意向申报或撤单。<br>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。<br>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）。 |                 |

#### 12.1.3 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 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。<br>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。<br>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。 |                     |

#### 12.1.4 定向可转债转让成交申报

| NewOrderSingle (reqtext)                                                                                                                         | 成交申报消息 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行成交申报。<br>定向可转债转让成交申报同大宗成交申报。<br>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)。 |        |

#### 12.1.5 定向可转债申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                                          | 申报撤单消息 |
|------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单消息<br>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)。 |        |

#### 12.1.6 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 |
|---------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。 |        |

#### 12.1.7 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 |
|--------------------------------|------------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单失败响应消息。 |            |

#### 12.1.8 定向可转债执行报告消息

| ExecutionReport(excreporttext)                                       | 实时执行报告消息 |
|----------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述:</b><br>执行报告表中的 excreporttext 字段数据。<br>每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息。 |          |

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

### 12.1.9 定向可转债过户数据接口

| dghXXXXXXXXXXMMDD.dbf                                | 过户数据接口 |
|------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>复用大宗交易业务过户接口文件(dghXXXXXXXXXXMMDD.dbf)。 |        |

## 12.2 定向可转债转股业务消息规范

### 12.2.1 可转债转股消息流程图

根据定向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。



### 12.2.2 定向可转债转股申报消息

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

| NewOrderSingle (reqtext)                                                        | 申报消息 |
|---------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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:<br>D=申报。                              |        |
| 11             | ClOrdID    |           | 会员内部编号。                                           | C10    |
| 48             | SecurityID |           | 证券代码, 定向可转债代码。                                    | C6     |
| 44             | Price      |           | 转股价格                                              | N11(3) |
| 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<br>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<br>易单<br>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<br>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    |

### 12.2.3 定向可转债转股申报响应消息

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

#### 12.2.4 定向可转债转股撤单申报消息

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

#### 12.2.5 定向可转债转股撤单申报成功响应消息

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

#### 12.2.6 定向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 |
|--------------------------------|------------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单失败响应消息。 |            |

### 12.3 定向可转债回售业务消息规范

#### 12.3.1 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。



### 12.3.2 定向可转债回售申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                     | 申报消息 |
|------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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:<br>D=申报。                              |     |
| 11        | ClOrdID    |           | 会员内部编号。                                           | C10 |
| 48        | SecurityID |           | 证券代码。                                             | 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<br>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 |

### 12.3.3 定向可转债回售申报响应消息

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

### 12.3.4 定向可转债回售撤单申报消息

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

### 12.3.5 定向可转债回售撤单申报成功响应消息

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

### 12.3.6 定向可转债回售撤单申报失败响应消息

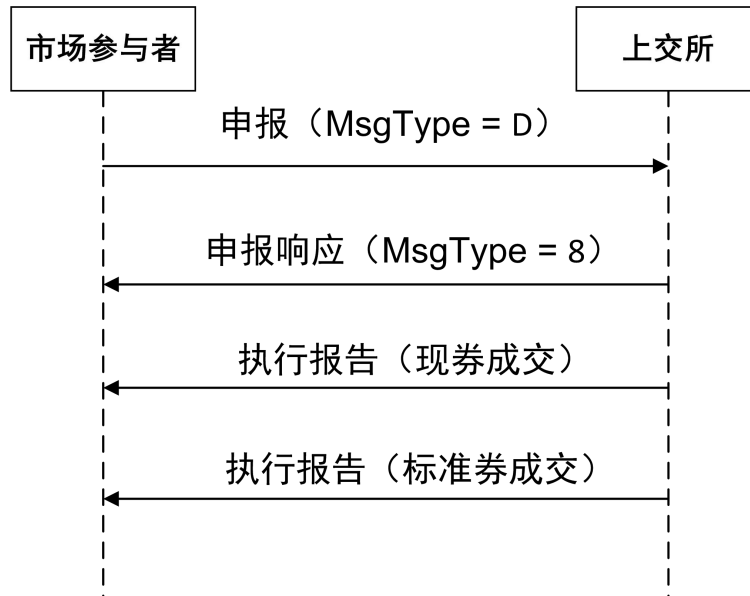
| OrderCancelReject (resptext)   | 申报撤单失败响应消息 |
|--------------------------------|------------|
| <b>描述：</b><br>同大宗业务申报撤单失败响应消息。 |            |

### 13 债券非交易消息规范

#### 13.1 债券质押式回购入库业务消息规范

##### 13.1.1 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。



##### 13.1.2 债券质押式回购入库申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                          | 申报消息 |
|-----------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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：<br>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<br>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<br>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 |

### 13.1.3 债券质押式回购入库申报响应消息

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

### 13.1.4 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 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述：</b><br>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。<br>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"> <li>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；</li> <li>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。</li> </ol> |          |

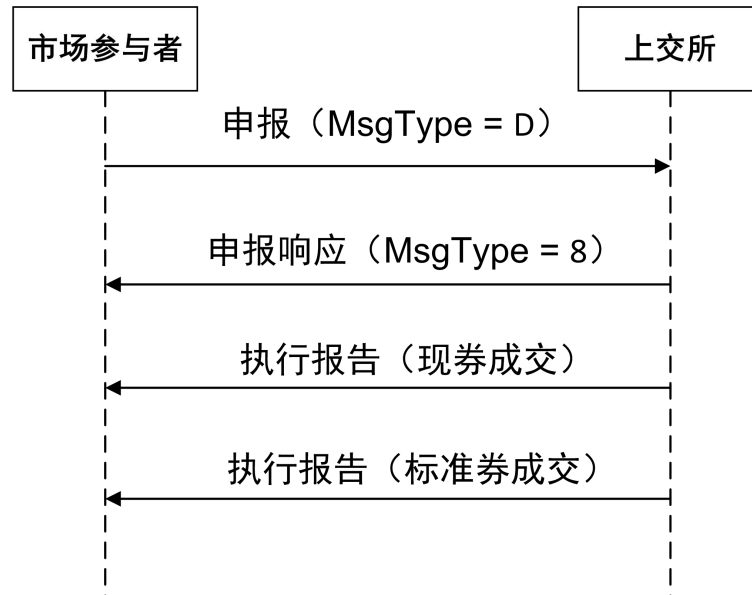
| 序号 | 字段名     | 字段描述                   | 类型  |
|----|---------|------------------------|-----|
|    | 消息头     | MsgType 取值：<br>8=成交回报。 |     |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号。                | C10 |

|                 |              |           |                                                     |     |
|-----------------|--------------|-----------|-----------------------------------------------------|-----|
| 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：<br><br>1=买；<br><br>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<br>YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。 | C21 |
| 150             | ExecType     |           | 当前订单执行报告类型，取值：<br><br>F=成交。                         | C1  |
| 39              | OrdStatus    |           | 当前订单状态，取值：<br><br>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、<br>申报交易单元号，取值为 2。        | N2  |
| 投资者<br>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<br>易单元<br>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  |

## 13.2 债券质押式回购出库业务消息规范

### 13.2.1 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。



### 13.2.2 债券质押式回购出库申报消息

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

| 标签   | 字段名        |           | 字段描述                                   | 类型  |
|------|------------|-----------|----------------------------------------|-----|
|      | 消息头        |           | MsgType 取值:<br>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<br>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 |

### 13.2.3 债券质押式回购出库申报响应消息

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

### 13.2.4 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 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述：</b><br>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。<br>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"> <li>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；</li> <li>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。</li> </ol> |          |

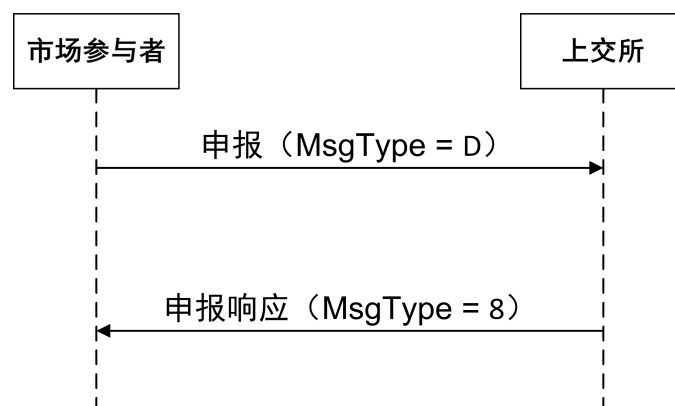
| 序号 | 字段名        | 字段描述                   | 类型  |
|----|------------|------------------------|-----|
|    | 消息头        | MsgType 取值：<br>8=成交回报。 |     |
| 11 | ClOrdID    | 会员内部编号。                | C10 |
| 37 | OrderID    | 交易所订单编号。               | C16 |
| 17 | ExecID     | 成交编号。                  | C16 |
| 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；<br>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<br>YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。 | C21 |
| 150             | ExecType     |           | 当前订单执行报告类型，取值：<br>F=成交。                             | C1  |
| 39              | OrdStatus    |           | 当前订单状态，取值：<br>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、<br>申报交易单元号，取值为 2。        | N2  |
| 投资者<br>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<br>易单元<br>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  |

### 13.3 可转债转股业务消息规范

#### 13.3.1 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。



### 13.3.2 可转债转股申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                      | 申报消息 |
|-------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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:<br>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<br>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<br>易单元<br>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<br>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 |

### 13.3.3 可转债转股申报响应消息

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

#### 13.3.4 可转债转股撤单申报消息

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

#### 13.3.5 可转债转股撤单申报成功响应消息

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

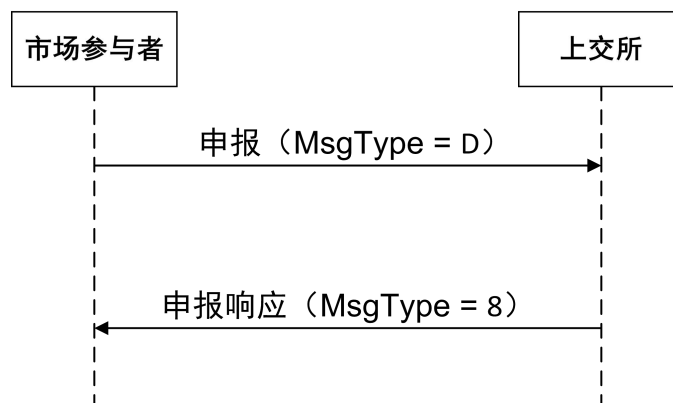
#### 13.3.6 可转债转股撤单申报失败响应消息

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

### 13.4 可交换债换股业务消息规范

#### 13.4.1 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。



#### 13.4.2 可交换债换股申报消息

| NewOrderSingle(reqtext)                                                        | 申报消息 |
|--------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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:<br>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<br>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<br>易单<br>元<br>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<br>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 |

#### 13.4.3 可交换债换股申报响应消息

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

#### 13.4.4 可交换债换股撤单申报消息

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

#### 13.4.5 可交换债换股撤单申报成功响应消息

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

#### 13.4.6 可交换债换股撤单申报失败响应消息

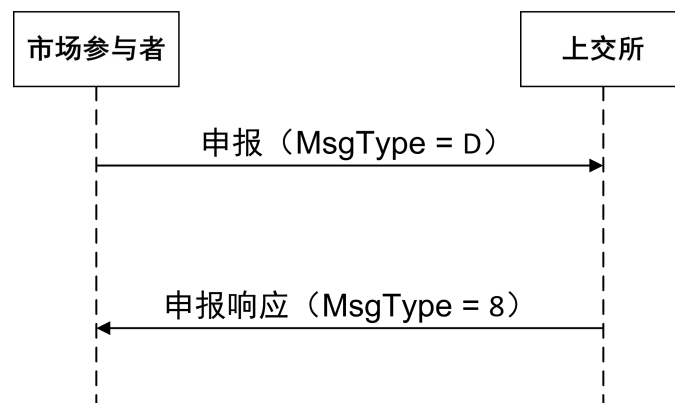
| OrderCancelReject (resptext)   | 申报撤单失败响应消息 |
|--------------------------------|------------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单失败响应消息。 |            |

### 13.5 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。

#### 13.5.1 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。



### 13.5.2 债券回售申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                     | 申报消息 |
|------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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:<br>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<br>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<br>易单<br>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<br>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 |

### 13.5.3 债券回售申报响应消息

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

### 13.5.4 债券回售撤单申报消息

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

### 13.5.5 债券回售撤单申报成功响应消息

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

### 13.5.6 债券回售撤单申报失败响应消息

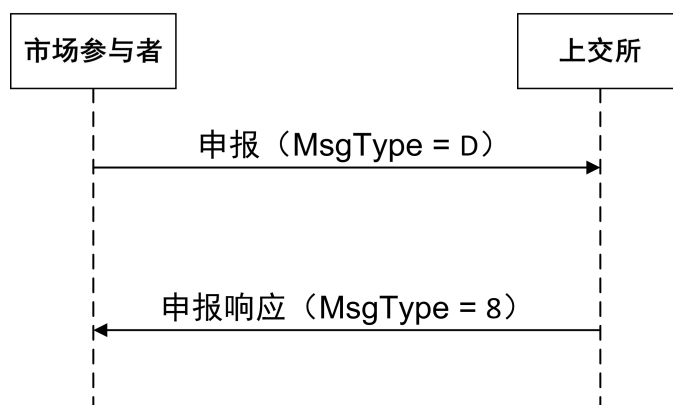
| OrderCancelReject (resptext)   | 申报撤单失败响应消息 |
|--------------------------------|------------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单失败响应消息。 |            |

## 13.6 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。

### 13.6.1 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。



### 13.6.2 债券回售撤销申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                       | 申报消息 |
|--------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述:</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>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:<br>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<br>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<br>易单元<br>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<br>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 |

### 13.6.3 债券回售撤销申报响应消息

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

### 13.7 债券过户数据接口 zqghXXXXX.txt

| zqghXXXXX.txt                                                   | 债券过户数据接口 |
|-----------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述：</b> 详细内容参阅本所《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》的“债券过户数据文件”章节。 |          |

## 14 ETF 实物申赎/ETF 现金申赎/黄金 ETF 实物申赎消息规范

### 14.1 ETF 申购业务消息规范

#### 14.1.1 ETF 申购消息流程图

支持 ETF 申赎, 根据 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 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。

黄金 ETF 实物申购不通过 EzSTEP 申报, 但通过 EzSTEP 向基金公司发送实物申购确认执行报告, 向市场发送实物申购份额增减执行报告。



#### 14.1.2 ETF 申购申报消息

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

| 标签 | 字段名 | 字段描述                 | 类型 |
|----|-----|----------------------|----|
|    | 消息头 | MsgType 取值:<br>D=申报。 |    |

|                 |            |           |                                                |     |
|-----------------|------------|-----------|------------------------------------------------|-----|
| 11              | CIOrdID    |           | 会员内部编号。                                        | C10 |
| 48              | SecurityID |           | 证券代码，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<br>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<br>易单元<br>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<br>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 |

#### 14.1.3 ETF 申购申报响应消息

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

#### 14.1.4 ETF 申购执行报告消息

| ExecutionReport (execreporttext)                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 实时执行报告消息 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述：</b><br>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。<br><br>对于 ETF 实物申购申报，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"> <li>1、一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为 ETF 二级市场交易代码、成交数量为申购数量，买卖方向为 1 的成交记录。</li> <li>2、若干条执行报告类型为 2、辅助证券代码为 ETF 成份证券代码、成交数量为过户数量，买卖方向为 2 的成交记录。</li> <li>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</li> </ol> |          |

| ExecutionReport (execreporttext)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 实时执行报告消息 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <p>交记录。（注：如无资金替代，则无该条执行报告。）</p> <p>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。</p> <p>对于 ETF 现金申购申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录，如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、一条执行报告类型为 1、辅助代码为 ETF 二级市场交易代码、成交数量为申购数量，买卖方向为 1 的成交记录。</li> <li>2、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、资金类型为 9 的成交记录。</li> </ol> <p>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。</p> <p>对于 ETF 实物申购申报和 ETF 现金申购申报，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，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。</p> <p>对于使用 RTGS 模式结算的 ETF 现金申购申报，除以上两笔之外，在盘中通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 RTGS 成功交收，会有以下执行报告（交收回报）消息记录：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、一条执行报告类型为 4，ExecType 取值为 K、买卖方向为 1、成交数量为交收数量、成交金额为清算金额（买方为负，卖方为正），成交编号为交收编号，资金类型为 9 的记录。</li> </ol> <p>对于使用 RTGS 模式结算的 ETF 现金交收回报，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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、一条执行报告类型为 5、ExecType 取值为 5、买卖方向为 1、成交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）、成交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，资金类型为 9 的记录。</li> </ol> <p>基金公司作为对手方收到对应的成交、交收、冲正数据。</p> <p>对于黄金 ETF 实物申购申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为 ETF 二级市场交易代码、ExecType 取值为 J、成交数量为申购数量，会员内部编号取值无意义（可取空格），价格、金额无意义（可取 0），买卖方向为 1 的成交记录。</li> </ol> <p>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。</p> |          |

| 序号     | 字段名             |                  | 字段描述                                                                                   | 类型     |
|--------|-----------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|--------|
|        | 消息头             |                  | MsgType 取值：<br>8=成交回报。                                                                 |        |
| 11     | ClOrdID         |                  | 会员内部编号，<br>针对 ETF 实物申购和 ETF 现金申购业务，对于基金公司填写对手方投资者证券账户。<br>针对黄金 ETF 实物申购业务，取值无意义（可取空格）。 | C10    |
| 37     | OrderID         |                  | 交易所订单编号，对于基金公司填写对手方交易所订单编号。                                                            | C16    |
| 17     | ExecID          |                  | 成交编号。                                                                                  | C16    |
| 48     | SecurityID      |                  | 证券代码，ETF 交易代码。                                                                         | C6     |
| 856    | TradeReportType |                  | 执行报告类型。取值：<br>1=ETF 成交；<br>2=ETF 成份券成交；<br>3=资金替代成交；<br>4=交收；<br>5=冲正。                 | C1     |
| 455    | SecurityAltID   |                  | 辅助证券代码，取值为 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、4、5 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、4、5 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：<br>1=沪市资金；<br>2=境内非沪市资金；<br>3=港市资金；<br>9=全现金替代 ETF 资金。                        | C1     |
|        | 8504            | TotalValueTraded | 成交金额，单位为元。                                                                             | N16(3) |

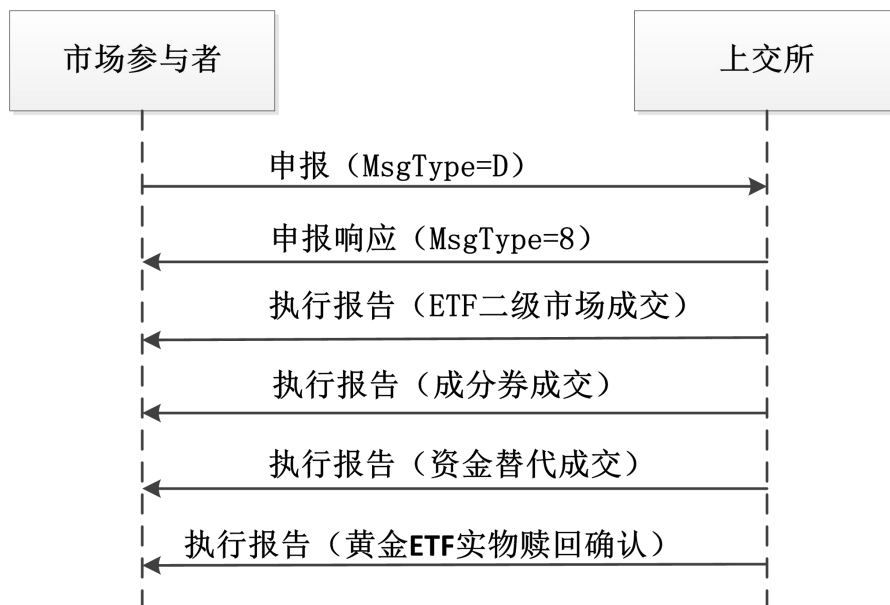
|                 |              |                                                                                       |                               |     |
|-----------------|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|-----|
| 8503            | NumTrades    | 执行报告记录总条数。                                                                            |                               | N12 |
| 54              | Side         | 买卖方向，取值：<br>1=买；<br>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：<br>F=成交；<br>J=在清算中心的交易，表示黄金 ETF 实物申赎确认；<br>K=成交且完成交收；<br>5=已替换，表示发生交收冲正。 |                               | 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<br>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<br>易单元<br>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  |

## 14.2 ETF 赎回业务消息规范

### 14.2.1 ETF 赎回消息流程图

支持 ETF 申赎，根据 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 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。

黄金 ETF 实物赎回不通过 EzSTEP 申报，但通过 EzSTEP 向基金公司发送实物赎回确认执行报告，向市场发送实物赎回份额增减执行报告。



#### 14.2.2 ETF 赎回申报消息

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

| 标签         | 字段名        |           | 字段描述                                           | 类型  |
|------------|------------|-----------|------------------------------------------------|-----|
|            | 消息头        |           | MsgType 取值：<br>D=申报。                           |     |
| 11         | ClOrdID    |           | 会员内部编号。                                        | C10 |
| 48         | SecurityID |           | 证券代码，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<br>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<br>易单元 | 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  |

|       |      |           |                                |     |
|-------|------|-----------|--------------------------------|-----|
| 号     |      |           |                                |     |
| 营 业 部 | 448  | PartyID   | 营业部代码。                         | C5  |
| 代 码   | 452  | PartyRole | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为营业部代码。 | N4  |
| 58    | Text |           | 备注。                            | C50 |

#### 14.2.3 ETF 赎回申报响应消息

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

#### 14.2.4 ETF 赎回执行报告消息

| ExecutionReport (execreporttext)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 实时执行报告消息 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>描述：</b><br>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。<br><br>对于 ETF 实物赎回申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录，如下：<br><br>1、一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为 ETF 二级市场交易代码、成交数量为赎回数量，买卖方向为 2 的成交记录。<br><br>2、若干条执行报告类型为 2、辅助证券代码为 ETF 成份证券代码、成交数量为过户数量，买卖方向为 1 的成交记录。<br><br>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。）<br><br>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。<br><br><br>对于 ETF 现金赎回申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录：<br><br>1、一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为 ETF 二级市场交易代码、成交数量为赎回数量，买卖方向为 2 的成交记录。<br><br>2、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、资金类型为 9 的成交记录。<br><br>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。<br><br><br>对于 ETF 实物赎回申报和 ETF 现金赎回申报，现金替代总额计算方法为：先将每个成份股的 |          |

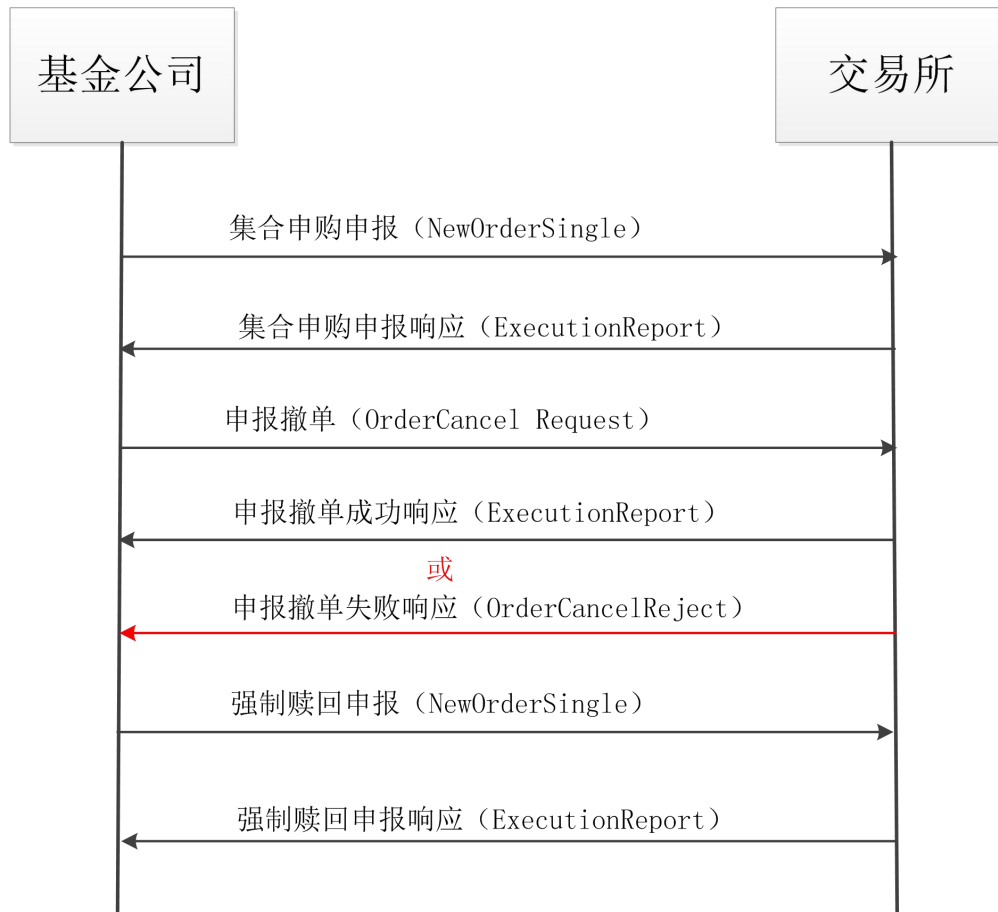
| ExecutionReport (execreporttext)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 实时执行报告消息 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <p>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。</p> <p>对于黄金 ETF 实物赎回申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录，如下：</p> <p>1、一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为 ETF 二级市场交易代码、ExecType 取值为 J、成交数量为赎回数量，会员内部编号取值无意义（可取空格），价格、金额无意义（可取 0），买卖方向为 2 的成交记录。</p> <p>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。</p> |          |

| 序号  | 字段名             | 字段描述                                                                                   | 类型  |
|-----|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|     | 消息头             | MsgType 取值：<br>8=成交回报。                                                                 |     |
| 11  | ClOrdID         | 会员内部编号，<br>针对 ETF 实物赎回和 ETF 现金赎回业务，对于基金公司填写对手方投资者证券账户。<br>针对黄金 ETF 实物赎回业务，取值无意义（可取空格）。 | C10 |
| 37  | OrderID         | 交易所订单编号，对于基金公司填写对手方交易所订单编号。                                                            | C16 |
| 17  | ExecID          | 成交编号。                                                                                  | C16 |
| 48  | SecurityID      | 证券代码，填写 ETF 交易代码。                                                                      | C6  |
| 856 | TradeReportType | 执行报告类型。取值如下：<br>1=ETF 成交；<br>2=ETF 成份券成交；<br>3=资金替代成交。                                 | C1  |
| 455 | SecurityAltID   | 辅助证券代码，取值为 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:<br>1=沪市资金;<br>2=境内非沪市资金;<br>3=港市资金;<br>9=全现金替代 ETF 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:<br>1=买;<br>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:<br>F=成交;<br>J=在清算中心的交易, 表示黄金 ETF 实物申赎确认。           | 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<br>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<br>易单元<br>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     |

## 15 ETF 集合申购消息规范

### 15.1 ETF 集合申购消息流程图



## 15.2 申报消息

### 15.2.1 集合申购申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                            |            | 申报消息               |     |
|-------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------------------|-----|
| <b>描述:</b><br><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br><br>基金公司使用 NewOrderSingle 消息进行集合申购申报。 |            |                    |     |
| 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 |
| 1080                                                                                | RefOrderID | 交易编号，与提交审核的交易编号相同。 | C16 |
| 48                                                                                  | SecurityID | ETF 二级市场交易代码       | C6  |

|           |               |                                                               |     |
|-----------|---------------|---------------------------------------------------------------|-----|
| 38        | OrderQty      | ETF 份额数量。                                                     | N10 |
| 455       | SecurityAltID | 成分证券代码。                                                       | C6  |
| 192       | OrderQty2     | 成分证券数量。                                                       | N10 |
| 453       | NoPartyIDs    | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码，取值为 6。 | N2  |
| 买方投资者账户   | 448           | PartyID<br>买方投资者帐户编码。<br>对于 ETF 集合申购业务申购交易，为投资者证券账户。          | C10 |
|           | 452           | PartyRole<br>取 5，表示当前 PartyID 的取值为买方投资者帐户。                    | N4  |
| 买方申报交易单元号 | 448           | PartyID<br>买方业务 PBU（5 位数字），作为买方证券账户对应的业务 PBU。                 | C5  |
|           | 452           | PartyRole<br>取 1，表示当前 PartyID 的取值为买方业务 PBU。                   | N4  |
| 买方营业部代码   | 448           | PartyID<br>买方营业部代码，位数不足则以 0 左补齐 5 位。                          | C5  |
|           | 452           | PartyRole<br>取 4001，表示当前 PartyID 的取值为买方的营业部代码。                | N4  |
| 卖方投资者账户   | 448           | PartyID<br>卖方投资者帐户。<br>对于 ETF 集合申购业务申购交易，为基金公司证券帐户。           | C10 |
|           | 452           | PartyRole<br>取 39，表示当前 PartyID 的取值为卖方投资者帐户。                   | N4  |
| 卖方申报交易单元号 | 448           | PartyID<br>卖方业务 PBU（5 位数字），作为卖方证券账户对应的业务 PBU。                 | C5  |
|           | 452           | PartyRole<br>取 17，表示当前 PartyID 的取值为卖方交易单元号。                   | N4  |
| 卖方营业部代码   | 448           | PartyID<br>卖方营业部代码，位数不足则以 0 左补齐 5 位。                          | C5  |
|           | 452           | PartyRole<br>取 4002，表示当前 PartyID 的取值为卖方的营业部代码。                | N4  |
| 58        | Text          | 备注。                                                           | C50 |

### 15.2.2 强制赎回申报消息

| NewOrderSingle (reqtext)                                                    | 申报消息 |
|-----------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>基金公司使用 NewOrderSingle 消息进行强制赎回申报。 |      |

| 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 |
| 1080      | RefOrderID    |           | 交易编号，与提交审核的交易编号相同。                                            | C16 |
| 48        | SecurityID    |           | ETF 二级市场交易代码。                                                 | C6  |
| 38        | OrderQty      |           | ETF 份额数量。                                                     | N10 |
| 455       | SecurityAltID |           | 成分证券代码。                                                       | C6  |
| 192       | OrderQty2     |           | 成分证券数量。                                                       | N10 |
| 453       | NoPartyIDs    |           | 参与方个数，后接重复组，依次包含买方的投资者账户、PBU、营业部代码，以及卖方投资者账户、PBU、营业部代码，取值为 6。 | N2  |
| 买方投资者账户   | 448           | PartyID   | 买方投资者帐户编码。<br>对于 ETF 集合申购业务强制赎回交易，为基金公司证券帐户。                  | C10 |
|           | 452           | PartyRole | 取 5，表示当前 PartyID 的取值为买方投资者帐户。                                 | N4  |
| 买方申报交易单元号 | 448           | PartyID   | 买方业务 PBU（5 位数字），作为买方证券账户对应的业务 PBU。                            | C5  |
|           | 452           | PartyRole | 取 1，表示当前 PartyID 的取值为买方业务 PBU。                                | N4  |
| 买方营业部代码   | 448           | PartyID   | 买方营业部代码，位数不足则以 0 左补齐 5 位。                                     | C5  |
|           | 452           | PartyRole | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为买方的营业部代码。                             | N4  |
| 卖方投资者账户   | 448           | PartyID   | 卖方投资者帐户。<br>对于 ETF 集合申购业务强制赎回交易，为投资者证券帐户。                     | C10 |
|           | 452           | PartyRole | 取 39，表示当前 PartyID 的取值为卖方投资者帐户。                                | N4  |
| 卖方申报交易单元号 | 448           | PartyID   | 卖方业务 PBU（5 位数字），作为卖方证券账户对应的业务 PBU。                            | C5  |
|           | 452           | PartyRole | 取 17，表示当前 PartyID 的取值为卖方交易单元号。                                | N4  |
| 卖方营业部代码   | 448           | PartyID   | 卖方营业部代码，位数不足则以 0 左补齐 5 位。                                     | C5  |
|           | 452           | PartyRole | 取 4002，表示当前 PartyID 的取值为卖方的营业部代码。                             | N4  |

|    |      |     |     |
|----|------|-----|-----|
| 58 | Text | 备注。 | C50 |
|----|------|-----|-----|

### 15.3 申报撤单消息

| OrderCancel Request (reqtext)                                                            | 申报撤单消息 |
|------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述:</b><br>同大宗业务申报撤单消息。其中证券代码填写 ETF 二级市场交易代码, 发起方填写基金公司账户、申报交易单元号, 买卖方向无意义, 取值 1 或 2。 |        |

### 15.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息

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

### 15.5 申报撤单失败响应消息

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

## 16 指定交易消息规范

### 16.1 指定交易流程图

根据业务规则，市场投资者可以进行指定交易申报（包括指定登记和指定撤销），交易所实时反馈申报确认。指定关系当日盘中发生调整时，竞价撮合系统、新债券交易系统、综合业务系统即刻生效，其他系统次日生效。指定交易盘后过户数据格式参见《IS101 上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者需求规格说明书》过户数据接口“ghXXXXX.dbf”说明。

下图描述了消息通信流程。



### 16.2 指定交易申报消息

| ADT/ADC (reqtext)                                                                              | 申报消息 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。<br>对于指定登记，支持单次申报不超过 20 个的投资者账户。对于指定撤销，仅支持单次申报 1 个投资者账户。 |      |

| 标签   | 字段名                    | 字段描述                                 | 类型  |
|------|------------------------|--------------------------------------|-----|
|      | 消息头                    | MsgType 取值为：U001=注册指令（指定交易申报）        |     |
| 11   | ClOrdID                | 会员内部编号，指申报会员内部编号                     | C10 |
| 48   | SecurityID             | 申报代码，对于指定登记填写 799999，对于指定撤销填写 799998 | C6  |
| 8502 | DesignationInstruction | 注册指令，对于指定登记填写 1，对于指定撤销填写 2           | C1  |

|         |                |                 |                                                                                            |     |
|---------|----------------|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
| 453     | NoPartyIDs     |                 | 参与方个数，后接重复组，取值为 2                                                                          | N2  |
| 申报交易单元号 | 448            | PartyID         | 业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号。对于指定登记，业务 PBU 代码即要为投资者账户指定的 PBU 代码                                   | 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，对于不需要在该字段填写营业部代码的，该字段可取值为若干个空格                                                       | C5  |
|         | 452            | PartyRole       | 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为营业部代码                                                              | N4  |
| 1671    | NoPartyDetails |                 | 参与方账户个数，后接重复组，取值为 N。N 为投资者账户个数。对于指定登记，1<=N<=20，重复组中包含 N 条投资者记录。对于指定撤销，N=1，重复组中仅包含 1 条投资者记录 | N2  |
| 投资者账户   | 1691           | PartyDetailID   | 投资者帐户                                                                                      | C10 |
|         | 1693           | PartyDetailRole | 取 5，表示当前 PartyDetailID 的取值为投资者帐户                                                           | N4  |
| 58      | Text           |                 | 备注，暂不启用                                                                                    | C50 |

### 16.3 指定交易申报响应消息

| ADT /ADC(resptext)                                                                          | 申报响应消息 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>描述：</b><br>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。<br>每一个申报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。 |        |

| 标签  | 字段名      | 字段描述                              | 类型  |
|-----|----------|-----------------------------------|-----|
|     | 消息头      | MsgType 取值为：U002=注册指令响应（指定交易申报响应） |     |
| 37  | OrderID  | 交易所订单编号                           | C16 |
| 150 | ExecType | 当前订单执行类型，取值有：<br>0=成功响应           | C1  |

|      |                        |              |                                                                 |     |
|------|------------------------|--------------|-----------------------------------------------------------------|-----|
|      |                        |              | 8=拒绝响应<br><br>当所有账户指定交易均成功时，取值为 0；当存在账户指定交易失败时，取值为 8，具体失败原因见重复组 |     |
| 48   | SecurityID             |              | 申报代码，对于指定登记填写 799999，对于指定撤销填写 799998                            | C6  |
| 8502 | DesignationInstruction |              | 注册指令，对于指定登记填写 1，对于指定撤销填写 2                                      | C1  |
| 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 |
| 124  | NoExecs                |              | 指定交易执行结果数量，后接重复组。重复组包含 N 条记录，分别对应指定交易申报中的 N 个投资者账户及其处理结果。       | N2  |
| 执行结果 | 448                    | PartyID      | 投资者帐户                                                           | 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。  | C5  |
| 58   | Text                   |              | 备注                                                              | C50 |

## 17 基金过户数据接口 jjghXXXXX.txt

| jjghXXXXX.txt                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 基金过户数据接口 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <p><b>描述:</b></p> <p>文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。</p> <p>(1) 目前包含 ETF 实物申赎过户记录、ETF 现金申赎过户记录、黄金 ETF 实物申赎过户记录、ETF 集合申购业务过户记录。过户数据同实时成交回报，每笔 ETF 实物申赎有多条成交明细记录，每笔 ETF 现金申赎有两条成交明细记录，每笔黄金 ETF 实物申赎有一条成交明细记录。每笔 ETF 集合申购有两条成交明细记录。</p> <p>(2) 对于发送基金公司的 ETF 实物申赎业务数据，替代标志为“沪市可以被替代”的成分券成交记录（记录类型为“2=ETF 成份券成交”）中不包含替代价格。市场参与者可以获取前收盘价格作为替代价格。</p> |          |

| 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    |                                                                                                                                            | C16 |
| 4  | 交易所订单编号 | 针对业务类型 IEC、IER、EEC、EER、GEC、GER，对于基金公司填写对手方交易所订单编号。<br>针对业务类型 ECP、EMR，对于投资者账户指定券商与基金公司，填写基金公司申报订单的交易所订单编号。                                  | C16 |
| 5  | 交易单元    |                                                                                                                                            | C5  |
| 6  | 证券代码    | 填写 ETF 二级市场交易代码。                                                                                                                           | C6  |
| 7  | 记录类型    | 1=ETF 成交；<br>2=ETF 成份券成交；<br>A=沪市资金；<br>B=境内非沪市资金；<br>C=港市资金；<br>I=全现金替代 ETF 资金。<br>针对业务类型 IEC、IER，取值 1、2、A、B、C。<br>针对业务类型 EEC、EER，取值 1、I。 | C1  |

|    |        |                                                                                                                                                                                                               |        |
|----|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
|    |        | 针对业务类型 GEC、GER，取值 1。<br>针对业务类型 ECP、EMR，取值 1、2。                                                                                                                                                                |        |
| 8  | 辅助证券代码 | 针对业务类型 IEC、IER，记录类型为 1、2 时有效，取值为 ETF 或成份券证券代码，其余默认为空。<br>针对业务类型 EEC、EER，记录类型为 1 时有效，取值为 ETF 证券代码，其余默认为空。<br>针对业务类型 GEC、GER，记录类型为 1 时有效，取值为 ETF 证券代码。<br>针对业务类型 ECP、EMR，记录类型为 1、2 时有效，取值为 ETF 或成份券证券代码，其余默认为空。 | C6     |
| 9  | 申报时间   | 格式为 HHMMSS。                                                                                                                                                                                                   | C6     |
| 10 | 成交时间   | 格式为 HHMMSS。                                                                                                                                                                                                   | C6     |
| 11 | 成交价格   | 默认为 0。                                                                                                                                                                                                        | N13(5) |
| 12 | 成交数量   | 针对业务类型 IEC、IER，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，股票单位为股。<br>针对业务类型 EEC、EER，记录类型为 1 时有效，其余默认为 0。<br>针对业务类型 GEC、GER，记录类型为 1 时有效。<br>针对业务类型 ECP、EMR，记录类型为 1、2 时有效，其余默认为 0；基金单位为份，股票单位为股。如果溢出，取值为负值。            | N15(3) |
| 13 | 成交金额   | 针对业务类型 IEC、IER，记录类型为 A、B、C 时有效，其余默认为 0，单位为元。<br>针对业务类型 EEC、EER，记录类型为 I 时有效，其余默认为 0，单位为元。<br>针对业务类型 GEC、GER，默认为 0。<br>针对业务类型 ECP、EMR，无效，默认为 0。<br>如果溢出，取值为负值。                                                  | N18(5) |
| 14 | 会员内部编号 | 针对业务类型 IEC、IER、EEC、EER，对于基金公司填写对手方投资者证券账户。<br>针对业务类型 GEC、GER，取值无意义（可取空格）。<br>针对业务类型 ECP、EMR，对于投资者账户指定券商填写                                                                                                     | C10    |

|    |      |                                                                                                                                           |    |
|----|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|    |      | 基金公司的会员内部订单编号。                                                                                                                            |    |
| 15 | 买卖方向 | 取值：<br>B=买；<br>S=卖。                                                                                                                       | C1 |
| 16 | 业务类型 | 取值：<br>IEC=ETF 实物申购；<br>IER=ETF 实物赎回；<br>EEC=ETF 现金申购；<br>EER=ETF 现金赎回；<br>GEC=黄金 ETF 实物申购；<br>GER=黄金 ETF 实物赎回；<br>ECP=集合申购；<br>EMR=强制赎回。 | C3 |

## 18 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><br>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_Trdd_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:<br>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_Trdd_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:<br>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) |

| 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：<br>BPD=债券质押式回购入库；<br>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：<br>BES=可转换债转股； | C3 |

|    |              |                         |        |
|----|--------------|-------------------------|--------|
|    |              | BSS=可交换债换股。             |        |
| 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) |

| zfjyyyymmdd.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：<br>BSB=债券回售；<br>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) |

## 19 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><b>描述:</b></p> <p>本文件包含基金非交易相关基础信息数据（目前包含 ETF 实物申赎、ETF 现金申赎、黄金 ETF 实物申赎）；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，每条基金非交易信息对应 XML 中一条 Non_Trdr_Rec 记录。</p> |             |

| jfjyyyyymmdd.xml |          | 基金非交易基础信息接口（ETF实物/黄金ETF实物申赎）                                                    |    |
|------------------|----------|---------------------------------------------------------------------------------|----|
| 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：<br>IEC=ETF 实物申购；<br>IER=ETF 实物赎回；<br>GEC=黄金 ETF 实物申购；<br>GER=黄金 ETF 实物赎回。 | C3 |

| jfjyyyyymmdd.xml |               | 基金非交易基础信息接口（ETF现金申赎）                                             |    |
|------------------|---------------|------------------------------------------------------------------|----|
| 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：<br>EEC=ETF 现金申购；<br>EER=ETF 现金赎回。                          | C3 |
| 4                | Crea_Rtgs_Tag | RTGS申购标志：<br>0=不支持RTGS申购模式；<br>1=支持RTGS申购模式。<br>业务类型为EER时，此字段无效。 | C1 |

## 20 ETF 公告文件 2.1 版格式

| *****MMDD2.ETF                                                                                                                            | ETF 公告文件 2.1 版 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| <p><b>描述:</b></p> <p>详细内容参阅本所外网发布的《IS118 上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》文档中关于“ETF 公告文件 2.1 版格式”章节描述的接口定义，详细字段描述请关联参阅“ETF 定义文件 2.1 版格式”章节。</p> |                |

## 行情数据-STEP消息规范

本接口指通过 EzSR 软件，以数据库 STEP 消息方式发布综业行情；

数据格式约定、STEP 消息约定、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；

本业务产品集编号 (setid) 为：300；

数据广播类型 (beastype)，本业务取值：1H；

| MktDataFull (MDText)                                                                                      | 公共数据消息 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <p><b>描述：</b></p> <p>本消息用来发送市场有效时段内的行情信息，由后台向市场参与者单向发送。每条消息对应单个产品行情信息。</p> <p>在 STEP 消息中，提供完整的交易相关信息。</p> |        |

行情数据类型取值为 MD101 时（表示国债预发行行情）：

| 标签   | 域名                | 说明                                                                                                            | 类型     |
|------|-------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
|      | 消息头               | MsgType=W                                                                                                     |        |
| 963  | MDReportID        | 交易所行情信息编号(预留、暂不填)                                                                                             | C16    |
| 1187 | RefreshIndicator  | 用于标识消息中是否有新的行情数据，取值：有=1,无=0，推送已有行情信息为 0，否则为 1。（预留，暂填 0）                                                       | N5     |
| 1500 | MDStreamID        | 行情数据类型标识符，取 MD101 表示国债预发行行情数据格式类型                                                                             | C5     |
| 48   | SecurityID        | 证券代码                                                                                                          | C6     |
| 55   | Symbol            | 证券名称                                                                                                          | C8     |
| 8538 | TradingPhaseCode  | 产品实时阶段及标志，该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。<br>第 0 位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示停牌。 | C8     |
| 8504 | TotalValueTraded  | 当日累计成交金额，精确到分                                                                                                 | N16(2) |
| 387  | TotalVolumeTraded | 当日累计成交数量                                                                                                      | N16    |

|            |             |                                                                                                                                                                                     |                                                                                       |        |
|------------|-------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <b>140</b> | PreClosePx  | 昨收盘价，单位：元                                                                                                                                                                           |                                                                                       | N11(3) |
| <b>268</b> | NoMDEntries | 行情条目个数，本重复组依次包括今日开盘价(269=4)、最高价(269=7)、最低价(269=8)、最新价(269=2)、以及五档买入价量信息(269=0，MDEntryPositionNo 从1至5)、五档卖出价量信息(269=1，MDEntryPositionNo 从1至5)，其中价格由 MDEntryPx 表示，数量由 MDEntrySize 表示。 |                                                                                       | N5     |
| 行情条目<br>明细 | <b>269</b>  | MDEntryType                                                                                                                                                                         | 行情条目类别：<br><br>今日开盘价=4<br><br>最高价=7<br><br>最低价=8<br><br>最新价=2<br><br>买入=0<br><br>卖出=1 | C2     |
|            | <b>270</b>  | MDEntryPx                                                                                                                                                                           | 行情条目价格，单位：元                                                                           | N11(3) |
|            | <b>271</b>  | MDEntrySize                                                                                                                                                                         | 行情条目数量，如果数据组不含数量信息，则此字段不出现                                                            | N12    |
|            | <b>290</b>  | MDEntryPositionNo                                                                                                                                                                   | 行情条目买卖盘序号，对应五档买入卖出价量的档位信息，否则此字段不出现                                                    | N3     |

行情数据类型取值为 MD102 时（表示盘后固定价格行情）：

| 标签          | 域名               | 说明                                                      | 类型  |
|-------------|------------------|---------------------------------------------------------|-----|
|             | 消息头              | MsgType=W                                               |     |
| <b>963</b>  | MDReportID       | 交易所行情信息编号(预留、暂不填)                                       | C16 |
| <b>1187</b> | RefreshIndicator | 用于标识消息中是否有新的行情数据，取值：有=1,无=0，推送已有行情信息为 0，否则为 1。（预留，暂填 0） | N5  |
| <b>1500</b> | MDStreamID       | 行情数据类型标识符，取 MD102 表示盘后固定价格行情数据格式类型                      | C5  |
| <b>48</b>   | SecurityID       | 证券代码                                                    | C6  |
| <b>55</b>   | Symbol           | 证券名称                                                    | C8  |
| <b>8538</b> | TradingPhaseCode | 产品实时阶段及标志，该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。              | C8  |

|            |                   |                                                                                                                                     |                                                                   |        |
|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------|--------|
|            |                   | <del>第 0 位: ‘P’表示启动（开市前）时段, ‘A’表示集中撮合时段, ‘H’表示连续交易时段, ‘D’表示闭市时段, ‘F’表示停牌。</del>                                                     |                                                                   |        |
| 8504       | TotalValueTraded  | 当日累计成交金额，精确到分                                                                                                                       |                                                                   | N16(2) |
| 387        | TotalVolumeTraded | 当日累计成交数量                                                                                                                            |                                                                   | N16    |
| 268        | NoMDEntries       | <del>行情条目个数，依次包括今日收盘价(269=5)以及买入申报总股数(269=0，MDEntryPositionNo 为 1)、卖出申报总股数(269=1，MDEntryPositionNo 为 1)，买卖数量由 MDEntrySize 表示。</del> |                                                                   | N5     |
| 行情条目<br>明细 | 269               | MDEntryType                                                                                                                         | <del>行情条目类别:—<br/><br/>今日收盘价=5<br/><br/>买入=0<br/><br/>卖出=1—</del> | C2     |
|            | 270               | MDEntryPx                                                                                                                           | 行情条目价格，单位：—元                                                      | N11(3) |
|            | 271               | MDEntrySize                                                                                                                         | 行情条目数量，如果数据组不含数量信息，则此字段不出现                                        | N12    |
|            | 290               | MDEntryPositionNo                                                                                                                   | 行情条目买卖盘序号，对应五档买入卖出价量的档位信息，否则此字段不出现                                | N3     |

**说明**

~~行情条目类别为 0 或 1 时, MDEntrySize 表示当前未成交的买入/卖出申报总股数, 此时 MDEntryPositionNo 固定为 1。~~

## 21 行情文件接口 mktdt01.txt

| mktdt01.txt                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 行情文件接口 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <p><b>描述:</b></p> <p>本文件为行情文件接口。对于综合业务平台，行情文件名为 mktdt01.txt，当日开市前至交易结束期间，通过单向卫星实时发送。</p> <p>行情文件为文本 txt 文件，格式约定如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>（一）竖线(" ")为字段间分隔符，字段数据内容不应含有分隔符；</li> <li>（二）竖线(" ")不应用在每条记录的开头和结尾；</li> <li>（三）各字段均为一个遵循格式定义的字符串，字段间有严格前后顺序；</li> <li>（四）字段定长，字段格式定义约定了长度和精度；字符型字段以 CX 格式表示，其中 X 代表字符串长度，不足部分左对齐，右补空格；整数数字型字段以 NX 格式表示，其中 X 代表数字型字符串长度，不足部分右对齐，左补空格；浮点数字型字段以 NX(Y)格式表示，其中 X 代表数字型字符串总长度，Y 代表小数位数，X 包括一位小数点，整数部分最多不超过 X-Y-1 位，小数部分最多不超过 Y 位，不足部分右对齐，左补空格；</li> <li>（五）每行以二进制 0x0A 结束，最后一行也以 0x0A 结束。</li> </ul> <p><b>文件描述:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>（一）行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分；</li> <li>（二）注意行情文件可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方应能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；</li> <li>（三）文件体中，对于不同的行情数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应根据行情数据类型识别处理；</li> <li>（四）文件体记录按行情数据类型递增，同一行情数据类型按证券代码递增；</li> <li>（五）对于暂停上市的股票，文件中不包含该股票的记录。对于未开始上市交易的产品，文件中不包含该产品的记录。对于摘牌后的产品，文件中不包含该产品的记录；</li> <li>（六）如文件中数值字段取值超过约定格式最大值，取最大值，如 N10 取 9999999999；</li> <li>（七）前收盘价格，在开市之前即行发布。在开盘集合竞价之后的短暂休市和中午休市期间同样揭示各档买卖价格数量等全部信息；</li> <li>（八）对于价格、金额数据，单位为人民币元。对于数量数据，单位对股票为股，基金为份，债券与回购为手；</li> <li>（九）在集合竞价时段内，当前买入价和当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时申买量一和申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。申</li> </ul> |        |

| mktdt01.txt                                                                                                                      | 行情文件接口 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <p>买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量；</p> <p>(十) 字段无意义或无该字段行情数据时，字符填空格，数值填 0；</p> <p>(十一) 交易所具体产品代码，参见相关发文通知，并参考以上处理。</p> |        |

## 21.1 结构描述

结构图如下：



文件结构描述参考：

**BeginString|Version|BodyLength|TotNumTradeReports|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|MDSesStatus**

**MDStreamID|SecurityID|Symbol|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|OpenPrice|HighPrice|LowPrice|TradePrice|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|BuyPrice2|BuyVolume2|SellPrice2|SellVolume2|BuyPrice3|BuyVolume3|SellPrice3|SellVolume3|BuyPrice4|BuyVolume4|SellPrice4|SellVolume4|BuyPrice5|BuyVolume5|SellPrice5|SellVolume5|TradingPhaseCode|Timestamp**

.....

.....

.....

**EndString|Checksum**

## 21.2 格式定义

文件头定义，第一行特殊记录：

| 序号 | 域名          | 字段名   | 字段类型 | 描述                                                          |
|----|-------------|-------|------|-------------------------------------------------------------|
| 1  | BeginString | 起始标识符 | C6   | HEADER                                                      |
| 2  | Version     | 版本    | C8   | ATP1.00                                                     |
| 3  | BodyLength  | 数据长度  | N10  | 计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。<br>(暂不启用) |

|   |                    |        |     |                                                                                                                                                                                                                                                             |
|---|--------------------|--------|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 4 | TotNumTradeReports | 文件体记录数 | N5  | 文件体记录数                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 5 | MDReportID         | 行情序号   | N8  | 行情文件序号（预留，暂不填）                                                                                                                                                                                                                                              |
| 6 | SenderCompID       | 发送方    | C6  | 发送方标示符，取XSHG01                                                                                                                                                                                                                                              |
| 7 | MDTime             | 行情时间   | C21 | 行情时间，格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000                                                                                                                                                                                                                               |
| 8 | MDUpdateType       | 发送方式   | N1  | 0 = 快照 Full refresh<br>1 = 增量 Incremental（暂不支持）                                                                                                                                                                                                             |
| 9 | MDSesStatus        | 市场行情状态 | C8  | 全市场行情状态：<br>该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。<br>第 0 位：‘S’表示全市场启动期间（开市前），‘T’表示全市场处于交易期间（含中间休市），‘E’表示全市场处于闭市期间。<br>第 1 位：‘1’表示开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。<br>第 2 位：‘1’表示收盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。<br>第 3 位：‘1’表示国债预发行市场行情闭市标志，未闭市取‘0’。<br>第 4 位：‘1’表示盘后固定价格交易行情闭市标志，未闭市取‘0’ |
|   |                    | 扩展区域   | 不定  | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。                                                                                                                                                                                                                                           |

文件体定义，多条行情记录，行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号。

当取值为 MD101 时，文件体记录格式如下：

| 序号 | 域名         | 字段名    | 字段类型 | 描述                                                                     |
|----|------------|--------|------|------------------------------------------------------------------------|
| 1  | MDStreamID | 行情数据类型 | C5   | 行情数据类型标识符，取值<br>MD101 表示行情数据格式类型，目前该类型包含综业国债预发行行情，国债预发行产品生命周期结束后，除代码、产 |

|    |                  |       |        |                            |
|----|------------------|-------|--------|----------------------------|
|    |                  |       |        | 品实时阶段及标志、时间戳外，其他业务字段无实际意义。 |
| 2  | SecurityID       | 产品代码  | C6     | 证券代码                       |
| 3  | Symbol           | 产品名称  | C8     | 证券简称                       |
| 4  | TradeVolume      | 成交数量  | N16    |                            |
| 5  | TotalValueTraded | 成交金额  | N16(2) |                            |
| 6  | PreClosePx       | 昨日收盘价 | N11(3) |                            |
| 7  | OpenPrice        | 今日开盘价 | N11(3) |                            |
| 8  | HighPrice        | 最高价   | N11(3) |                            |
| 9  | LowPrice         | 最低价   | N11(3) |                            |
| 10 | TradePrice       | 最新价   | N11(3) | 最新成交价                      |
| 11 | BuyPrice1        | 申买价一  | N11(3) | 当前买入价                      |
| 12 | BuyVolume1       | 申买量一  | N12    |                            |
| 13 | SellPrice1       | 申卖价一  | N11(3) | 当前卖出价                      |
| 14 | SellVolume1      | 申买量一  | N12    |                            |
| 15 | BuyPrice2        | 申买价二  | N11(3) |                            |
| 16 | BuyVolume2       | 申买量二  | N12    |                            |
| 17 | SellPrice2       | 申卖价二  | N11(3) |                            |
| 18 | SellVolume2      | 申卖量二  | N12    |                            |
| 19 | BuyPrice3        | 申买价三  | N11(3) |                            |
| 20 | BuyVolume3       | 申买量三  | N12    |                            |
| 21 | SellPrice3       | 申卖价三  | N11(3) |                            |
| 22 | SellVolume3      | 申卖量三  | N12    |                            |
| 23 | BuyPrice4        | 申买价四  | N11(3) |                            |
| 24 | BuyVolume4       | 申买量四  | N12    |                            |
| 25 | SellPrice4       | 申卖价四  | N11(3) |                            |
| 26 | SellVolume4      | 申卖量四  | N12    |                            |

|    |                   |           |        |                                                                                                          |
|----|-------------------|-----------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 27 | BuyPrice5         | 申买价五      | N11(3) |                                                                                                          |
| 28 | BuyVolume5        | 申买量五      | N12    |                                                                                                          |
| 29 | SellPrice5        | 申卖价五      | N11(3) |                                                                                                          |
| 30 | SellVolume5       | 申卖量五      | N12    |                                                                                                          |
| 31 | TradingPhase Code | 产品实时阶段及标志 | C8     | 该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充空格。<br><br>第 0 位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示停牌。 |
| 32 | Timestamp         | 时间戳       | C12    | HH:MM:SS.000                                                                                             |
|    |                   | 扩展区域      | 不定     | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。                                                                                        |

当取值为 MD102 时，文件体记录格式如下：

| 序号 | 域名                | 字段名       | 字段类型   | 描述                                                                |
|----|-------------------|-----------|--------|-------------------------------------------------------------------|
| 1  | MDStreamID        | 行情数据类型    | C5     | 行情数据类型标识符，取值<br><br>MD102 表示盘后固定价格交易行情数据格式类型                      |
| 2  | SecurityID        | 产品代码      | C6     | 证券代码                                                              |
| 3  | Symbol            | 产品名称      | C8     | 证券简称                                                              |
| 4  | TradeVolume       | 成交数量      | N16    |                                                                   |
| 5  | TotalValueTraded  | 成交金额      | N16(2) | <u>四舍五入精确到分</u>                                                   |
| 6  | ClosePrice        | 今日收盘价     | N11(3) |                                                                   |
| 7  | BuyVolume         | 买入申报数量    | N12    | 当前未成交的买入申报总股数                                                     |
| 8  | SellVolume        | 卖出申报数量    | N12    | 当前未成交的卖出申报总股数                                                     |
| 9  | TradingPhase Code | 产品实时阶段及标志 | C8     | 该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充空格。<br><br>第 0 位：‘T’表示启动（开市前）时段，‘A’ |

|    |           |         |     |                                         |
|----|-----------|---------|-----|-----------------------------------------|
|    |           |         |     | 表示集中撮合时段，‘H’表示连续交易时段，‘D’表示闭市时段，‘F’表示停牌。 |
| 10 | Timestamp | 最新成交时间戳 | C12 | HH:MM:SS.000                            |
|    |           | 扩展区域    | 不定  | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。                       |

文件尾定义，最后一行特殊记录：

| 序号 | 域名        | 字段名   | 字段类型 | 描述                                                                                                                                                                                                                                           |
|----|-----------|-------|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1  | EndString | 结束标识符 | C7   | TRAILER                                                                                                                                                                                                                                      |
| 2  | Checksum  | 校验和   | C3   | <p>校验和，3 位校验和</p> <p>校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包括该字段后的换行符)数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018</p> <p>校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。</p> |

## 22 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 dghXXXXXYYYYMMDD.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 | <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p>                                                        | C16 |
| 4  | gsdm | 业务 PBU                                                                                                                                                                                                                                      | C5  |
| 5  | cjsl | <p>成交数量</p> <p>对于 LOF 认购、<u>申购</u>，暂无意义；对于 LOF <u>申赎赎回</u>，为<u>申赎赎回</u>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。</p> <p>对于公募 REITs 认购、<u>配售</u>、<u>公开募集</u>，暂无意义；对于公募 REITs 转托管，为转托管数量，同时注意使用了备注字段。</p> <p>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；</p> | N12 |

|    |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |        |
|----|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
|    |      | <p>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。</p> <p>对于先行赔付，填写赔付金额，单位为元。</p> <p>如果溢出，取值为负值。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |        |
| 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  | cjig | <p>成交价格</p> <p>对于报价回购业务为到期价格；对于报价回购提前购回业务为提前购回价格；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，<del>为-1.000-无实际意义</del>。</p> <p>对于公募 REITs 认购、转托管、<del>配售、公开募集</del>，暂无意义。</p> <p>对于转融通，与申报相同表示费率，单位为%。</p> <p>对于网络投票，无意义填 0。</p> <p>如果溢出，取值为负值。</p>                                                                                                                                                   | N11(3) |
| 10 | cjje | <p>成交金额</p> <p>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；<del>对于 LOF 申购，为申购金额；</del>对于 LOF <del>申赎赎回</del>、转托管和分拆合并，暂无意义。</p> <p>对于公募 REITs 认购，为认购金额；<del>对于公募 REITs 配售，为配售金额；</del><br/><del>对于公募 REITs 公开募集，为公开募集金额；</del>对于公募 REITs 转托管，暂无意义。</p> <p>对于转融通业务无意义。</p> <p>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。</p> <p>对于网络投票，表示股东大会编码，股东大会唯一序列号。</p> <p>如果溢出，取值为负值。</p> | N16(2) |
| 11 | sqbh | <p>会员内部订单号，同申报接口中的 reff（会员内部订单号）</p> <p>对于基金公司，上证 LOF 申赎、分拆合并业务，填写对手方投资者账户。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | C10    |
| 12 | cjbz | 成交业务类型标志                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | C3     |

|    |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |
|----|----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|    |    | QBD 报价入库<br>QBW 报价出库<br>QNE 报价回购<br>QCA 报价回购提前购回<br>RNE 初始交易<br>RNR 购回交易<br>OFC 货币市场基金申购<br>OFR 货币市场基金赎回<br>ZII 转融通非约定申报<br>ZPT 转融通约定申报<br>SPN 初始交易<br>SPS 补充质押<br>SPR 购回交易<br>SPT 终止购回<br>SPD 部分解除质押<br>SPB 违约处置申请<br>BIY 国债预发行利率（收益率）招标申报<br>BIP 国债预发行价格招标申报<br>LFS 上证 LOF/公募 REITs 认购<br>LFC 上证 LOF 申购<br>LFR 上证 LOF 赎回<br>LFT 上证 LOF/公募 REITs 场内转场外的转托管<br>LFP 上证 LOF 母基金分拆<br>LFM 上证 LOF 子基金合并<br><u>RTA 公募 REITs 配售</u><br><u>RTP 公募 REITs 公开募集</u><br>VTE 投票申报（含先行赔付）<br>PFP 盘后固定价格申报 |    |
| 13 | bs | 买卖方<br><br>B：买方，货币市场基金/上证 LOF 申购时为买<br>S：卖方，货币市场基金/上证 LOF 赎回时为卖                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | C1 |

|    |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |     |
|----|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|    |      | <p>对于货币市场基金申赎，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，出借人申报成交为 S。</p> <p>对于股票质押回购，融出方取 B，融入方取 S。</p> <p>对 LOF 认购、转托管和分拆合并，暂无意义。</p> <p>对于公募 REITs 认购、转托管、<u>配售、公开募集</u>，暂无意义。</p> <p>对于网络投票，无意义填写方，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“S”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 E 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>对于公募 REITs 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> <p>对于先行赔付申报，则 1）左起第 1 至 10 位为议案及子议案（左对齐）<br/>         2）第 11 位表示申报结果，取值如下：‘0’表示无效，‘1’表示有效，‘2’表示待确认；3）第 12-13 位表示失败原因，仅第 11 位取值为‘0’时有意义，取值如下：‘01’表示非适格投资者账户，‘02’表示申报金额错误，‘03’表示重复申报，‘04’表示议案号错误，‘05’表示其他错误。</p> | C30 |

## 23 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。

本文档编写过程中，深受证券业界信息技术同仁讨论启发，特此致谢。

对本文档有任何批评指正意见，可通过电子邮件或服务电话进行反馈。

电子邮件：tech\_support@sse.com.cn

服务电话：4008888400-2

网站地址：<https://www.sse.com.cn/> - 交易技术支持专区

通讯地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号 上交所技术公司技术开发总部

## 附录一 指定关系生效说明

指定关系当日盘中发生调整时，即刻生效的业务：

| 业务类别                   | 说明                                                                              |
|------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| 交易类业务                  | 包括大宗成交申报、大宗固定价格交易和盘后固定价格交易                                                      |
| ETF业务                  | 包括ETF现金申赎、黄金ETF实物申赎、ETF实物申赎、ETF集合申购和强制赎回                                        |
| 上证LOF（分级基金）业务          | 包括上证LOF母基金分拆和子基金合并                                                              |
| 转融通业务                  | 包括转融通非约定申报和约定申报                                                                 |
| 网络投票业务                 |                                                                                 |
| 回购业务                   | 包括报价回购、约定购回和股票质押式回购                                                             |
| 货币市场基金/上证LOF/公募REITs业务 | 包括货币市场基金申赎，上证LOF认购、申赎、转托管，公募REITs认购、转托管                                         |
| 债券业务                   | 包括国债预发行利率（收益率）招标申报和价格招标申报、定向可转债转股和回售申报、可转债转股申报、可交换债换股申报、债券回售和回售撤销申报、定向可转债转让成交申报 |
| 债券质押式回购业务              | 包括债券质押式回购入库和出库                                                                  |
| 其他业务                   | 集合资产管理计划成交申报、资产证券化成交申报、非公开发行优先股成交申报                                             |

## 历史修订记录

### 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.51 版发布说明 2022.10

- 1、新增指定交易申报接口。
- 2、调整指定关系生效说明。

### 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.50 版发布说明 2022.2

- 1、调整基金非交易基础信息接口 jfyYYYYMMDD.xml，增加黄金 ETF 实物申赎业务。
- 2、删除 ETF 现金申赎/黄金 ETF 实物申赎业务实时相关接口说明，并将申赎业务合并到 ETF 实物申赎业务实时接口。
- 3、调整指定关系描述。
- 4、删除过户数据接口 bghXXXXX.dbf 中关于 ETF 现金申赎和黄金 ETF 实物申赎的相关说明，并将申赎业务过户记录合并到基金过户数据接口，调整 ETF 实物申赎过户记录相关说明。
- 5、附录中明确 ETF 实物申赎、ETF 现金申赎和黄金 ETF 实物申赎的指定关系。
- 6、增加 ETF 公告文件 1.0 版本格式和 ETF 公告文件 2.1 版格式的相关说明。
- 7、调整业务类型与执行报告数据广播类型及产品集关系表的相关说明。

### 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.49 版发布说明 2021.10

- 1、根据新债券交易系统上线相关安排，调整指定关系描述。
- 2、调整债券过户数据相关描述。

### 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.48 版发布说明 2021.7

- 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。
- 2、在基金非交易基础信息接口中增加 ETF 现金申赎类别产品，增加 RTGS 申购模式标志信息。
- 3、增加指定关系生效说明。
- 4、根据 ETF 集合申购业务需求，新增集合申购、强制赎回申报消息、撤单消息及响应，“基金过户数据接口 jjghXXXXX.txt”接口增加 ETF 集合申购业务数据。

### 《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.47 版发布说明 2021.5

- 1、根据债券非交易/债券 ETF 申赎迁移业务需求，新增债券非交易/债券 ETF 申赎申报、非交易参考数据接口及过户数据接口。
- 2、调整跨境 ETF 文字描述。
- 3、补充过户文件中关于价格字段溢出的说明。

### **《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 2021.1**

- 1、根据公募 REITs 的业务需求，调整基金参数文件，添加公募 REITs 的类型。
- 2、补充 dghXXXXXXYYMMDD.dbf 成交价格字段溢出的说明。

### **《综合业务平台市场参与者接口规格说明书》1.45 版发布说明 2020.11**

- 1、根据定向可转债业务需求，新增定向可转债申报及盘后接口。

### **《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。
- 2、更正报价回购交易申报消息最低交易数量的描述。

### **《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。

### 《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。