



工程技术标准

深圳证券交易所成交汇总文件接口 市场参与者技术系统变更指南

(Ver1.07)



深圳证券交易所
二〇二〇年十二月

文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2016-6-3	Ver1.00	新建
2018-2-12	Ver1.01	增加债券质押式三方回购交易业务成交确认、债券质押式三方回购出入库业务订单响应执行报告
2019-1-16	Ver1.02	增加期权组合策略保证金业务订单响应执行报告、期权普通与备兑仓互转业务订单响应执行报告、期权行权指令合并申报业务订单响应执行报告
2020-3-25	Ver1.03	增加盘后定价交易业务订单成交执行报告 转融通证券出借非约定申报成交执行报告、转融通证券出借约定申报成交确认增加字段：股份性质（ShareProperty）
2020-9-1	Ver1.04	修改债券质押式协议回购成交确认
2020-10-13	Ver1.05	债券转股回售业务订单响应执行报告增加字段：股份性质（ShareProperty）
2020-12-23	Ver1.06	债券质押式协议回购业务成交确认增加字段：股份性质（UnderlyingShareProperty）
2020-12-29	Ver1.07	（本文档中橙色修订部分） 期权集中竞价交易业务订单执行报告增加字段：第二交易所订单编号（SecondaryOrderID）

目 录

一、 说明	1
二、 成交汇总文件接口简介	1
三、 成交汇总文件接收申请方式	1
四、 文件网关配置说明	2
五、 成交汇总文件内容说明	2
六、 相关事宜	5
6.1 参考文档	5
6.2 联系方式	5
七、 附录	5
7.1 附录一：成交记录示例	5
7.1.1 现货集中竞价业务订单成交执行报告	5
7.1.2 质押式回购业务订单成交执行报告	6
7.1.3 债券分销业务订单成交执行报告	7
7.1.4 期权集中竞价业务订单成交执行报告	8
7.1.5 协议交易业务订单成交执行报告	9
7.1.6 协议交易业务双方配对成交确认	10
7.1.7 盘后定价大宗交易业务订单成交执行报告	11
7.1.8 转融通证券出借非约定申报成交执行报告	12
7.1.9 转融通证券出借约定申报成交确认	13
7.1.10 资产管理计划份额转让业务成交申报响应	15
7.1.11 股票质押式回购业务成交申报响应	16
7.1.12 约定购回业务成交申报响应	18
7.1.13 质押式报价回购业务成交申报响应	19
7.1.14 ETF 实时申购赎回业务订单响应执行报告	21
7.1.15 网上发行认购业务订单响应执行报告	22
7.1.16 配股认购业务订单响应执行报告	24
7.1.17 债券转股回售业务订单响应执行报告	25
7.1.18 期权行权业务订单响应执行报告	26
7.1.19 期权行权指令合并申报业务订单响应执行报告	27
7.1.20 开放式基金申购赎回业务订单响应执行报告	28
7.1.21 要约收购业务订单响应执行报告	30
7.1.22 质押式回购质押解押业务订单响应执行报告	31
7.1.23 转托管注册执行报告	32
7.1.24 黄金 ETF 实物申购赎回业务订单响应执行报告	33
7.1.25 权证行权业务订单响应执行报告	34
7.1.26 转处置业务订单响应执行报告	35
7.1.27 垫券还券业务订单响应执行报告	37
7.1.28 待清偿扣划业务订单响应执行报告	38
7.1.29 债券质押式协议回购业务成交确认	39
7.1.30 分级基金实时分拆合并业务订单响应执行报告	41
7.1.31 债券质押式三方回购交易业务成交确认	42

7.1.32	债券质押式三方回购出入库业务订单响应执行报告	44
7.1.33	期权组合策略保证金业务订单响应执行报告	45
7.1.34	期权普通与备兑仓互转业务订单响应执行报告	47
7.1.35	盘后定价交易业务订单成交执行报告	48

深圳证券交易所成交汇总文件接口 市场参与者技术系统变更指南

一、 说明

深圳证券交易所（以下简称“深交所”）新一代交易系统已经通过流接口的形式向市场参与者提供了成交汇总数据服务，为了能够在收市后以文件形式提供成交汇总服务，深交所新增了成交汇总文件接口。

本文档旨在阐述成交汇总文件接口的相关技术方案，供市场参与者及其 IT 提供商进行相关技术系统改造时使用。如果方案有所变更，本文档将做相应修订。

深交所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时，尽量降低系统改造对市场参与者的影响。

二、 成交汇总文件接口简介

成交汇总文件提供文件形式的成交汇总服务，供基金托管行及其他有需要的市场参与者使用。市场参与者需要申请并开通了成交汇总通信网关（以申请确认将哪些交易单元的成交记录汇总）后才可以申请接收成交汇总文件服务。

成交汇总文件通过文件网关接收，与流接口相比除了通道、格式方面有差异外，在记录内容和顺序上完全一致。

成交汇总文件的具体说明见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》。

三、 成交汇总文件接收申请方式

申请单位登录深交所会员业务系统提交申请，不能登录会员业务专区的申请单位请向深证通提交书面申请。

申请步骤如下：

1. 新建成交汇总通信网关；
2. 开通成交汇总通信网关；
3. 文件通信网关（如没有则需申请新建）配置变更，申请开通“盘后成交汇总文件接收”功能；
4. 交易单元有变化时，通过成交汇总通信网关配置变更，新增或删除交易单元。

上述各个步骤详细的办理流程 and 申请表见《深圳证券交易所新一代交易系统网关业务办理指南》。

四、 文件网关配置说明

1. 添加连接人

登录 FxTerm 界面->左树“菜单导航”->配置菜单->对端连接人配置,将深交所文件网关号: F000000X0003, 添加为联系人;

2. 配置传输规则

成交汇总文件下发业务,对端深交所网关号为 F000000X0003,传输规则名称为 szse_report_FnnnnnnFxxxx,其中 FnnnnnnFxxxx 是用户的成交汇总网关号。

详细的文件网关配置说明请见《深圳证券交易所新一代交易系统文件网关配置说明》。

五、 成交汇总文件内容说明

成交汇总文件为文本文件,文件中的每条记录(一行)为一笔成交,记录内容定义参考《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》中的二进制成交消息定义,记录的具体格式说明参见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》。

市场参与者系统使用成交汇总文件时应注意:

- 1、深交所交易系统定义的每个业务平台对应一个成交汇总文件,如果该平台当天没有回报记录,则也会下发一个空文件。
- 2、系统应能支持成交记录尾部扩展新的字段,不使用新扩展的字段时应能自动忽略新字段而不需做技术改造。

为减少成交汇总服务的数据量,成交汇总服务下发的数据中不包括《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》中仅用于委托确认的回报消息,具体可接收的消息类型范围如下:

消息类型说明	消息类型 MsgType	所属平台
现货集中竞价交易业务订单成交执行报告	200115	现货集中 竞价交易 平台
质押式回购交易业务订单成交执行报告	200215	综合金融 服务平台
债券分销业务订单成交执行报告	200315	现货集中 竞价交易

		平台
期权集中竞价交易业务订单成交执行报告	200415	衍生品集中竞价交易平台
协议交易业务订单成交执行报告	200515	
协议交易业务双方配对成交确认	200503	
盘后定价大宗交易业务订单成交执行报告	200615	综合金融服务平台
转融通证券出借业务非约定申报成交执行报告	200715	综合金融服务平台
转融通证券出借业务约定申报成交确认	200703	
资产管理计划份额转让业务成交申报响应	200804	综合金融服务平台
股票质押式回购业务成交申报响应	200904	综合金融服务平台
约定购回业务成交申报响应	201004	综合金融服务平台
质押式报价回购业务成交申报响应	201104	综合金融服务平台
ETF 实时申购赎回业务订单响应执行报告	201202	非交易处理平台
网上发行认购业务订单响应执行报告	201302	非交易处理平台
配股认购业务订单响应执行报告	201402	非交易处理平台
债券转股回售业务订单响应执行报告	201502	非交易处理平台
期权行权业务订单响应执行报告	201602	非交易处理平台
期权行权指令合并申报业务订单响应执行报告	201622	非交易处理平台
开放式基金申购赎回业务订单响应执行报告	201702	非交易处理平台
要约收购业务订单响应执行报告	201802	非交易处理平台

质押式回购质押解押业务订单响应执行报告	201902	非交易处理平台
转托管注册执行报告	202098	非交易处理平台
黄金ETF实物申购赎回业务订单响应执行报告	202202	非交易处理平台
权证行权业务订单响应执行报告	202302	非交易处理平台
转处置业务订单响应执行报告	202702	非交易处理平台
垫券还券业务订单响应执行报告	202802	非交易处理平台
待清偿扣划业务订单响应执行报告	202902	非交易处理平台
债券质押式协议回购业务成交确认	203003	固定收益交易平台
分级基金实时分拆合并业务订单响应执行报告	203102	非交易处理平台
债券质押式三方回购交易申报成交确认	203203	综合金融服务平台
债券质押式三方回购出入库订单响应执行报告	203302	综合金融服务平台
期权组合策略保证金业务订单响应执行报告	203422	衍生品集中竞价交易平台
期权普通与备兑仓互转业务订单响应执行报告扩展字段	203502	衍生品集中竞价交易平台
盘后定价交易业务订单成交执行报告	203715	综合金融服务平台

各类成交记录的示例见附录一。

六、 相关事宜

6.1 参考文档

《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》

《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》

6.2 联系方式

技术咨询电话：(0755) 82083500

七、 附 录

7.1 附录一：成交记录示例

下面举例中的成交汇总记录中的<T>表示 Tab 字符（ASCII 码为 0x09），<N>代表行分隔符（ASCII 码为 0x0A）如“200115<T>2<T>010<N>”。

7.1.1 现货集中竞价业务订单成交执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200115
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	010
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000

LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CashMargin	1

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200115<T>2<T>010<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F
<T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>1<N>

7.1.2 质押式回购业务订单成交执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200215
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	020
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	131801
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000

LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
MaturityDate	20160601

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200215<T>2<T>020<T>000100<T>000100<T>131801<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F
<T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>201606
01<N>

7.1.3 债券分销业务订单成交执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200315
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	030
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	101651
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1

LastPx	171000
LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200315<T>2<T>030<T>000100<T>000100<T>101651<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F
<T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<N>

7.1.4 期权集中竞价业务订单成交执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200415
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	040
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000

LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
PositionEffect	C
CoveredOrUncovered	0
ContractAccountCode	000100
SecondaryOrderID	6B4569CDNB009C03

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200415<T>2<T>040<T>000100<T>000100<T>10000001<T>102<T>1<T>01<T>2013
0228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>11000000000004124<T
>F<T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>C<T
>0<T>000100<T>6B4569CDNB009C03<N>

7.1.5 协议交易业务订单成交执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200515
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	051
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001

ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000
LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
ConfirmID	00041246
CashMargin	1

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200515<T>2<T>051<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F
<T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>000412
46<T>1<N>

7.1.6 协议交易业务双方配对成交确认

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200503
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	053
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test

TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004127
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
LastPx	171000
LastQty	30000
TrdType	1031
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	1100000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	BB
CashMargin	1

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200503<T>2<T>053<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004127<T>0<T>0<T>2<T>17.100
0<T>300.00<T>1031<T>0<T>11000045<T>1100000000004124<T>1<T>000100<T>01000
04698<T>AA<T>000100<T>0100005898<T>BB<T>1<N>

7.1.7 盘后定价大宗交易业务订单成交执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200615
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	060

ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000
LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CashMargin	1

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200615<T>2<T>060<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F
<T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>1<N>

7.1.8 转融通证券出借非约定申报成交执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200715
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	070

ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000
LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
ExpirationDays	10
ExpirationType	1
MaturityDate	20160601
ShareProperty	00

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200715<T>2<T>070<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F
<T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>10<T>
1<T>20160601<T>00<N>

7.1.9 转融通证券出借约定申报成交确认

二进制消息内容：

域名	取值
----	----

MsgType	200703
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	071
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004127
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
LastPx	171000
LastQty	30000
TrdType	1031
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	1100000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	BB
ExpirationDays	10
ExpirationType	1
MaturityDate	20160601
ShareProperty	00

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200703<T>2<T>071<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004127<T>0<T>0<T>2<T>17.100
0<T>300.00<T>1031<T>0<T>11000045<T>1100000000004124<T>1<T>000100<T>01000
04698<T>AA<T>000100<T>0100005898<T>BB<T>10<T>1<T>20160601<T>00<N>

7.1.10 资产管理计划份额转让业务成交申报响应

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200804
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	080
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	119502
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004127
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
TradeReportRefID	0000004144
TrdAckStatus	0
TrdRptStatus	0
TradeReportRejectReason	0
LastPx	171000
LastQty	30000

TrdType	1031
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	1100000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	BB
PriceType	3

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200804<T>2<T>080<T>000100<T>000100<T>119502<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004127<T>0<T>0<T>2<T>00000
04144<T>0<T>0<T>0<T>17.1000<T>300.00<T>1031<T>0<T>11000045<T>11000000000
04124<T>1<T>000100<T>0100004698<T>AA<T>000100<T>0100005898<T>BB<T>3<N
>

7.1.11 股票质押式回购业务成交申报响应

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200904
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	090
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01

TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004127
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
TradeReportRefID	0000004144
TrdAckStatus	0
TrdRptStatus	0
TradeReportRejectReason	0
LastPx	171000
LastQty	30000
TrdType	1031
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	1100000000004124
Side	2
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	BB
CashOrderQty	0
ShareProperty	0
MaturityDate	20160601
PledgeeType	1
OrigTradeID	6B4569CDNB009D31
OrigSubmittingPBUID	000100
OrigTradeReportID	1110004127
OrigTradeDate	20160108

对应到成交汇总文件中记录内容为：

200904<T>2<T>090<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004127<T>0<T>0<T>2<T>00000
04144<T>0<T>0<T>0<T>17.1000<T>300.00<T>1031<T>0<T>11000045<T>11000000000
04124<T>2<T>000100<T>0100004698<T>AA<T>000100<T>0100005898<T>BB<T>0.00
00<T>0<T>20160601<T>1<T>6B4569CDNB009D31<T>000100<T>1110004127<T>2016
0108<N>

7.1.12 约定购回业务成交申报响应

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201004
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	100
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004127
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
TradeReportRefID	0000004144
TrdAckStatus	0
TrdRptStatus	0
TradeReportRejectReason	0
LastPx	171000
LastQty	30000

TrdType	1031
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	1100000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	BB
CashOrderQty	0
MaturityDate	20160601
OrigTradeID	6B4569CDNB009D31
OrigSubmittingPBUID	000100
OrigTradeReportID	1110004127
OrigTradeDate	20160108

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201004<T>2<T>100<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004127<T>0<T>0<T>2<T>00000
04144<T>0<T>0<T>0<T>17.1000<T>300.00<T>1031<T>0<T>11000045<T>11000000000
04124<T>1<T>000100<T>0100004698<T>AA<T>000100<T>0100005898<T>BB<T>0.00
00<T>20160601<T>6B4569CDNB009D31<T>000100<T>1110004127<T>20160108<N>

7.1.13 质押式报价回购业务成交申报响应

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201104
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	110
ReportingPBUID	000100

SubmittingPBUID	000100
SecurityID	132001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004127
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
TradeReportRefID	0000004144
TrdAckStatus	0
TrdRptStatus	0
TradeReportRejectReason	0
LastPx	171000
LastQty	30000
TrdType	1031
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	1100000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	BB
PriceType	1
ExpirationExecInst	1
ExpirationDays	10
MaturityDate	20160601
OrigTradeID	6B4569CDNB009D31

OrigSubmittingPBUID	000100
OrigTradeReportID	1110004127
OrigTradeDate	20160108

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201104<T>2<T>110<T>000100<T>000100<T>132001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004127<T>0<T>0<T>2<T>00000
04144<T>0<T>0<T>0<T>17.1000<T>300.00<T>1031<T>0<T>11000045<T>11000000000
04124<T>1<T>000100<T>0100004698<T>AA<T>000100<T>0100005898<T>BB<T>1<T
>1<T>10<T>20160601<T>6B4569CDNB009D31<T>000100<T>1110004127<T>20160108
<N>

7.1.14 ETF 实时申购赎回业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201202
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	120
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	1100000000004124
ExecType	0
OrdStatus	1
OrdRejReason	0

LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
OrdType	2
OrderQty	30000
Price	171000
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
InsufficientSecurityID	
NoSecurity	3
UnderlyingSecurityID	000001
UnderlyingSecurityIDSource	102
DeliveryQty	150000
SubstCash	0
UnderlyingSecurityID	000002
UnderlyingSecurityIDSource	102
DeliveryQty	70000
SubstCash	60375000
UnderlyingSecurityID	000004
UnderlyingSecurityIDSource	102
DeliveryQty	0
SubstCash	513571360

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201202<T>2<T>120<T>000100<T>000100<T>159001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>
<T>11000000000004124<T>0<T>1<T>0<T>900.00<T>300.00<T>1<T>2<T>300.00<T>17.
1000<T>0100004698<T>AA<T><T><T>3<T>000001<T>102<T>1500.00<T>0.0000<T>0
00002<T>102<T>700.00<T>6037.5000<T>000004<T>102<T>0.00<T>51357.1360<N>

7.1.15 网上发行认购业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201302
BodyLength	--

ReportIndex	2
ApplID	130
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	169102
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	1100000000004124
ExecType	0
OrdStatus	1
OrdRejReason	0
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
OrdType	2
OrderQty	30000
Price	171000
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201302<T>2<T>130<T>000100<T>000100<T>169102<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>
<T>1100000000004124<T>0<T>1<T>0<T>900.00<T>300.00<T>1<T>2<T>300.00<T>17.
1000<T>0100004698<T>AA<T><N>

7.1.16 配股认购业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201402
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	140
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	380001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	1100000000004124
ExecType	0
OrdStatus	1
OrdRejReason	0
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
OrdType	2
OrderQty	30000
Price	171000
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201402<T>2<T>140<T>000100<T>000100<T>380001<T>102<T>1<T>01<T>2013022

8144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>
<T>1100000000004124<T>0<T>1<T>0<T>900.00<T>300.00<T>1<T>2<T>300.00<T>17.
1000<T>0100004698<T>AA<T><N>

7.1.17 债券转股回售业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201502
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	150
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	117002
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698

BranchID	AA
OrderRestrictions	
ShareProperty	00

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201502<T>2<T>150<T>000100<T>000100<T>
117002<T>102<T>1<T>01<T>20130228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A
0000001<T><T>0301000000004124<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>10
00.00<T>0.0000<T> 0100004698<T>AA<T><T>00<N>

7.1.18 期权行权业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201602
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	160
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000

CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
ContractAccountCode	000100

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201602<T>2<T>160<T>000100<T>000100<T>10000001<T>102<T>1<T>01<T>2013
0228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>030100000000412
4<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<T
>AA<T><T>000100<N>

7.1.19 期权行权指令合并申报业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201622
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	161
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159901
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001

OrigClOrdID	
ExecID	1100000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	0
CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	120000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
ContractAccountCode	000100
NoLegs	2
LegSecurityID	90000001
LegSecurityIDSource	102
LegOrderQty	120000
LegSecurityID	90000002
LegSecurityIDSource	102
LegOrderQty	120000

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201602<T>2<T>161<T>000100<T>000100<T>159901<T>102<T>1<T>01<T>2013
0228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>
<T>1100000000004124<T>0<T>0<T>0<T>0.00<T>0.00<T>1200.00<T>1<T>2<T>1200
.00<T>0.0000<T>0100004698<T>AA<T><T>000100<T>2<T>90000001<T>102<T>120
0.00<T>90000002<T>102<T>1200.00<N>

7.1.20 开放式基金申购赎回业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
----	----

MsgType	201702
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	170
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	150008
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	0
CumQty	0
Side	D
OrdType	2
OrderQty	0
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
CashOrderQty	100000000

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201702<T>2<T>170<T>000100<T>000100<T>150008<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>0301000000004124<

T>0<T>0<T>0<T>0.00<T>0.00<T>D<T>2<T>0.00<T>0.0000<T>0100004698<T>AA<T>
<T>10000.0000<N>

7.1.21 要约收购业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201802
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	180
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA

OrderRestrictions	
Tenderer	000001

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201802<T>2<T>180<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>0301000000004124<
T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<T>
AA<T><T>000001<N>

7.1.22 质押式回购质押解押业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	201902
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	190
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0

Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	

对应到成交汇总文件中记录内容为：

201902<T>2<T>190<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302281
44215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>0301000000004124<T>
0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<T>AA
<T><N>

7.1.23 转托管注册执行报告

二进制消息内容：

域名	字段描述
MsgType	202098
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	200
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	2013022814421555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124

ExecType	0
OrdRejReason	0
DesignationInstruction	3
DesignationTransType	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderQty	100000
TransfereePBUID	000200

对应到成交汇总文件中记录内容为：

202098<T>2<T>200<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>0301000000004124<
T>0<T>0<T>3<T>1<T>0100004698<T>AA<T>1000.00<T>000200<N>

7.1.24 黄金 ETF 实物申购赎回业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	202202
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	220
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159934
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	

ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	D
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	

对应到成交汇总文件中记录内容为：

202202<T>2<T>220<T>000100<T>000100<T>159934<T>102<T>1<T>01<T>20130
228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>0301000000004124
<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>D<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<T
>AA<T><N>

7.1.25 权证行权业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	202302
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	230
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	038999
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01

TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	

对应到成交汇总文件中记录内容为：

202302<T>2<T>230<T>000100<T>000100<T>038999<T>102<T>1<T>01<T>20130
228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>0301000000004124
<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<T
>AA<T><N>

7.1.26 转处置业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	202702
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	270
ReportingPBUID	000100

SubmittingPBUID	000100
SecurityID	10000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
DisposalPBU	000200
DisposalAccountID	0100004690

对应到成交汇总文件中记录内容为：

202702<T>2<T>270<T>000100<T>000100<T>10000001<T>102<T>1<T>01<T>201
30228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>03010000000041
24<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<
T>AA<T><T>000200<T> 0100004690<N>

7.1.27 垫券还券业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	202802
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	280
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	10000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
LenderPBU	000200
LenderAccountID	0100004690

对应到成交汇总文件中记录内容为：

202802<T>2<T>280<T>000100<T>000100<T>10000001<T>102<T>1<T>01<T>201
30228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>03010000000041
24<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<
T>AA<T><T>000200<T> 0100004690<N>

7.1.28 待清偿扣划业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	202902
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	290
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	10000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	1
OrdType	2

OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
DeductionPBU	000200
DeductionAccountID	0100004690

对应到成交汇总文件中记录内容为：

202902<T>2<T>290<T>000100<T>000100<T>10000001<T>102<T>1<T>01<T>201
30228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>03010000000041
24<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<
T>AA<T><T>000200<T> 0100004690<N>

7.1.29 债券质押式协议回购业务成交确认

二进制消息内容：

域名	字段描述
MsgType	203003
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	300
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	100213
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004127
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0

TradeHandlingInstr	2
LastPx	171000
LastQty	10000
TrdType	1031
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	0201000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	BB
MemberID	000001
InvestorType	01
InvestorID	0000000001
InvestorName	investor_name
TraderCode	01000000
CounterpartyMemberID	000002
CounterpartyInvestorType	02
CounterpartyInvestorID	0000000002
CounterpartyInvestorName	counterparty_investor_name
CounterpartyTraderCode	02000000
TrdMatchID	0201000000000001
ExpirationDays	7
CashOrderQty	17100000
Memo	Memo
NoSecurity	1
UnderlyingSecurityID	100213
UnderlyingSecurityIDSource	102
DeliveryQty	10000000
DeliverySide	1

UnderlyingShareProperty

00

对应到成交汇总文件中记录内容为：

203003<T>2<T>300<T>000100<T>000100<T>100213<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004127<T>0<T>0<T>2<T>17.100
0<T>100.00<T>1031<T>0<T>11000045<T>0201000000004124<T>1<T>000100<T>0100
004698<T>AA<T>000100<T>0100005898<T>BB<T>000001<T>01<T>0000000001<T>in
vestor_name<T>01000000<T>000002<T>02<T>0000000002<T>counterparty_investor_na
me<T>02000000<T>0201000000000001<T>7<T>1710.0000<T>Memo<T>1<T>100213<T>
>102<T>1000.0000<T>1<T>00<N>

7.1.30 分级基金实时分拆合并业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	203102
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	310
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	160420
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0
OrdStatus	0
OrdRejReason	0

LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
InsufficientSecurityID	
NoSecurity	2
→ UnderlyingSecurityID	150303
→ UnderlyingSecurityIDSource	102
→ DeliveryQty	50000
→ UnderlyingSecurityID	150304
→ UnderlyingSecurityIDSource	102
→ DeliveryQty	50000

对应到成交汇总文件中记录内容为：

203102<T>2<T>310<T>000100<T>000100<T>160420<T>102<T>1<T>01<T>20130
228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>0301000000004124
<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<T
>AA<T><T><T>2<T>150303<T>102<T>500.00<T>150304<T>102<T>500.00<N>

7.1.31 债券质押式三方回购交易业务成交确认

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	203203
BodyLength	--

ReportIndex	2
ApplID	320
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	
SecurityIDSource	
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004129
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
LastPx	51000
LastQty	0
TrdType	1041
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	0201000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	
TrdMatchID	0201000000000001
OrigTradeDate	20130228
MaturityDate	20130307
ExpirationDays	7
CashOrderQty	5000000000

SettlCurrAmt		5500000000
NoBaskets		2
→	BasketID	1
→	BasketID	2
NoUnderlyings		2
→	UnderlyingSecurity ID	100203
→	UnderlyingSecurity IDSource	102
→	DeliveryQty	20000
→	DeliverySide	1
→	UnderlyingSecurity ID	100213
→	UnderlyingSecurity IDSource	102
→	DeliveryQty	30000
→	DeliverySide	1

对应到成交汇总文件中记录内容为：

203203<T>2<T>320<T>000100<T>000100<T><T><T>1<T>01<T>201302281442155
55<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004129<T>0<T>0<T>2<T>5.1000<T><T>10
41<T>0.00<T>11000045<T>0201000000004124<T>1<T>000100<T>0100004698<T>AA<
T>000100<T>0100005898<T><T>0201000000000001<T>20130228<T>20130307<T>7<T
>500000.0000<T>550000.0000<T>2<T>1<T>2<T>2<T>100203<T>102<T>200.00<T>1<
T>100213<T>102<T>300.00<T>1<N>

7.1.32 债券质押式三方回购出入库业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	203302
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	330
ReportingPBUID	000100

SubmittingPBUID	000100
SecurityID	100203
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	Test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	1100000000004124
ExecType	0
OrdStatus	1
OrdRejReason	0
LeavesQty	0
CumQty	30000
Side	1
OrdType	2
OrderQty	30000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	

对应到成交汇总文件中记录内容为：

203302<T>2<T>330<T>000100<T>000100<T>100203<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>
<T>1100000000004124<T>0<T>1<T>0<T>0.00<T>300.00<T>1<T>2<T>300.00<T>0.000
0<T>0100004698<T>AA<T><N>

7.1.33 期权组合策略保证金业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	203422

BodyLength	--	
ReportIndex	2	
ApplID	340	
ReportingPBUID	000100	
SubmittingPBUID	000100	
SecurityID	159901	
SecurityIDSource	102	
OwnerType	1	
ClearingFirm	01	
TransactTime	20130228144215555	
UserInfo	Test	
OrderID	6B4569CDNB009C03	
ClOrdID	A0000001	
OrigClOrdID		
ExecID	1100000000004124	
ExecType	0	
OrdStatus	0	
OrdRejReason	0	
LeavesQty	0	
CumQty	0	
Side	1	
OrdType	2	
OrderQty	100	
Price	0	
AccountID	0100004698	
BranchID	AA	
OrderRestrictions		
ContractAccountCode	000100	
SecondaryOrderID	6B4569CSDB009C56	
SecurityType	MLEG	
SecuritySubType	CNSJC	
NoLegs	2	
→	LegSecurityID	90000001
→	LegSecurityIDSource	102

→	LegSide	1
→	LegOrderQty	100
→	LegSecurityID	90000002
→	LegSecurityIDSource	102
→	LegSide	2
→	LegOrderQty	100

对应到成交汇总文件中记录内容为：

203422<T>2<T>340<T>000100<T>000100<T>100203<T>102<T>1<T>01<T>201302
28144215555<T>Test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>1100000000004124
<T>0<T>0<T>0<T>0<T>0<T>1<T>2<T>1.00<T>0<T>0100004698<T>AA<T><T>00010
0<T>6B4569CSDB009C56<T>MLEG<T>CNSJC<T>2<T>90000001<T>102<T>1<T>1.00
<T>90000002<T>102<T>2<T>1.00<T><N>

7.1.34 期权普通与备兑仓互转业务订单响应执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	203502
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	350
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
OrigClOrdID	
ExecID	0301000000004124
ExecType	0

OrdStatus	0
OrdRejReason	0
LeavesQty	100000
CumQty	0
Side	1
OrdType	2
OrderQty	100000
Price	0
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	
ContractAccountCode	000100

对应到成交汇总文件中记录内容为：

203502<T>2<T>350<T>000100<T>000100<T>92000001<T>102<T>1<T>01<T>20130
228144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T><T>0301000000004124
<T>0<T>0<T>0<T>1000.00<T>0.00<T>1<T>2<T>1000.00<T>0.0000<T>0100004698<T
>AA<T><T>000100<N>

7.1.35 盘后定价交易业务订单成交执行报告

二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	203715
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	370
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03

ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000
LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CashMargin	1

对应到成交汇总文件中记录内容为：

203715<T>2<T>370<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302281
44215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F<T
>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>1<N>