



工程技术标准

深圳证券交易所股票期权 市场参与者技术系统建设指南

(Ver1.02)



深圳证券交易所
中国结算深圳分公司

二〇二二年一月

文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2015-1	1.00	创建
2019-1	1.01	增加期权组合策略保证金、期权普通与备兑仓互转业务； 期权行权业务增加行权指令合并申报。
2022-1	1.02	（本文档中橙色修订部分） 修改保证金查询结果报文

目 录

一、 前言	1
二、 股票期权业务简介	2
2.1 基本概念	2
2.2 方案要点	3
2.2.1 合约要素	3
2.2.2 交易结算制度	4
2.3 业务资格管理	5
2.3.1 交易参与人	5
2.3.2 结算参与人	5
2.4 风险控制	6
三、 市场参与者柜台系统总体架构建议	6
3.1 投资者管理	6
3.1.1 适当性管理	6
3.1.2 投资者账户管理	7
3.1.2.1 衍生品资金账户	7
3.1.2.2 衍生品合约账户	7
3.1.3 参与人账户管理	7
3.2 合约管理	8
3.3 交易管理	8
3.3.1 交易日初始化处理	8
3.3.2 交易风险参数管理	9
3.3.2.1 涨跌停板制度	9
3.3.2.2 保证金制度	9
3.3.2.3 限仓额度	9
3.3.2.4 限交易量额度	9
3.3.3 委托与申报	9
3.3.3.1 交易指令与订单类型	9
3.3.3.2 可用资金与仓位实时计算与监控	10
3.3.3.3 非交易指令	11
3.3.3.4 做市商报价	11
3.3.3.5 强制平仓	12
3.3.4 前端监控	13
3.3.5 市场接入	14
3.3.6 交易信息即时揭示	14
3.4 清算交收	15
3.4.1 日常结算处理	15
3.4.2 行权结算	15
3.4.3 保证金计收	16
3.4.4 出入金管理	16
3.4.5 结算风险管理	16
3.4.5.1 结算风险参数管理	16

3.4.5.2 交收违约处理.....	16
3.5 风险管理.....	16
3.6 查询服务.....	17
3.7 数据报送.....	17
3.8 其他.....	17
四、 市场接口	18
4.1 概述.....	18
4.2 STEP 交易接口	19
4.2.1 委托申报.....	19
4.2.1.1 期权集中竞价交易.....	19
4.2.1.2 期权集中竞价交易报价.....	21
4.2.1.3 期权组合策略保证金.....	23
4.2.1.4 期权普通与备兑仓互转.....	25
4.2.1.5 期权行权	26
4.2.1.6 期权行权指令合并申报.....	27
4.2.1.7 保证金查询.....	29
4.2.1.8 转处置	29
4.2.1.9 垫券还券	31
4.2.1.10 待清偿扣划.....	33
4.2.2 订单响应执行报告.....	34
4.2.2.1 期权集中竞价交易.....	34
4.2.2.2 期权集中竞价交易报价状态回报	36
4.2.2.3 期权组合策略保证金.....	38
4.2.2.4 期权普通与备兑仓互转.....	40
4.2.2.5 期权行权	41
4.2.2.6 期权行权指令合并申报.....	42
4.2.2.7 保证金查询.....	44
4.2.2.8 转处置	45
4.2.2.9 垫券还券	46
4.2.2.10 待清偿扣划.....	47
4.2.3 成交执行报告.....	48
4.2.3.1 期权集中竞价交易.....	48
4.3 BINARY 交易接口	50
4.3.1 委托申报.....	50
4.3.1.1 期权集中竞价交易.....	50
4.3.1.2 期权集中竞价交易报价	51
4.3.1.3 期权组合策略保证金.....	53
4.3.1.4 期权普通与备兑仓互转.....	55
4.3.1.5 期权行权	55
4.3.1.6 期权行权指令合并申报.....	56
4.3.1.7 保证金查询.....	57
4.3.1.8 转处置	58
4.3.1.9 垫券还券	59

4.3.1.10	待清偿扣划.....	59
4.3.2	订单响应执行报告.....	60
4.3.2.1	期权集中竞价交易.....	60
4.3.2.2	期权集中竞价交易报价状态回报.....	62
4.3.2.3	期权组合策略保证金.....	63
4.3.2.4	期权普通与备兑仓互转.....	65
4.3.2.5	期权行权.....	66
4.3.2.6	期权行权指令合并申报.....	67
4.3.2.7	保证金查询.....	69
4.3.2.8	转处置.....	70
4.3.2.9	垫券还券.....	71
4.3.2.10	待清偿扣划.....	72
4.3.3	成交执行报告.....	73
4.3.3.1	期权集中竞价交易.....	73
4.3.4	行情接口.....	74
4.4	STEP 消息示例.....	74
4.4.1	委托申报.....	74
4.4.1.1	期权集中竞价交易.....	74
4.4.1.2	期权集中竞价交易报价.....	77
4.4.1.3	期权组合策略保证金.....	79
4.4.1.4	期权普通与备兑仓互转.....	82
4.4.1.5	期权行权.....	84
4.4.1.6	期权行权指令合并申报.....	85
4.4.1.7	保证金查询.....	86
4.4.1.8	转处置.....	86
4.4.1.9	垫券还券.....	88
4.4.1.10	待清偿扣划.....	89
4.4.2	行情.....	90
4.4.2.1	集中竞价行情快照.....	90
4.5	BINARY 消息示例.....	93
4.5.1	委托申报.....	94
4.5.1.1	期权集中竞价交易.....	94
4.5.1.2	期权集中竞价交易报价.....	95
4.5.1.3	期权组合策略保证金.....	97
4.5.1.4	期权普通与备兑仓互转.....	98
4.5.1.5	期权行权.....	100
4.5.1.6	期权行权指令合并申报.....	100
4.5.1.7	保证金查询.....	101
4.5.1.8	转处置.....	102
4.5.1.9	垫券还券.....	102
4.5.1.10	待清偿扣划.....	103
4.5.2	行情.....	104
4.5.2.1	集中竞价行情快照.....	104

五、 参考文档	109
---------------	-----

深圳证券交易所股票期权 市场参与者技术系统建设指南

一、前言

为便于参与深圳证券交易所（以下简称“深交所”）股票期权的市场参与者和相应系统开发商更好地理解股票期权业务和了解相关技术系统，尽快做好市场参与者技术系统的准备工作，深交所与中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“中国结算深圳分公司”）编制和发布本指南文档。

本文档中的股票期权包括在深交所挂牌的 ETF 期权和个股期权。

本所建设股票期权技术系统的指导思想：在保障现货技术安全运行的基础上实现对股票期权业务的技术支撑，尽量减少对市场参与者技术系统的影响。

本文中未涉及的内容请参考深交所及中国结算深圳分公司公布的股票期权、结算业务方案，规则与指引及现有业务规则。

特别申明：

本指南编制基础是深交所股票期权系统的技术方案、功能及接口文档。深交所和中国结算深圳分公司保留对本指南的解释及修改权。

联系方式：

在开发或测试过程中，可以通过以下方式与深圳证券交易所及中国结算深圳分公司业务与技术部门联系。

1. 业务相关

业务综合 1：万玉琪（0755-88668792, options@szse.cn）

业务综合 2：吴一鑫（0755-88668409, options@szse.cn）

2. 接入相关

接入线路、网关、D-COM：通信公司运行部（0755-83182222）

3. 技术支持

交易技术：王成涛（0755-88668728）

结算技术：陈航航（0755-25988682）

交易系统 QQ 群 288321593 、 530909929

交易系统邮箱 stsv5@szse.cn

二、股票期权业务简介

下面简要介绍深市股票期权业务方案，详细内容请参阅《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》和《深圳证券交易所中国证券登记结算有限责任公司股票期权试点风险控制管理办法》。

2.1 基本概念

期权是指交易双方达成的关于未来买卖标的资产权利的合约。股票期权合约是以ETF、个股为标的物的期权合约。根据合约规定的交易方向，期权可以分为认购期权(Call Option)和认沽期权(Put Option)。认购期权又称买权(也称“看涨期权”)，是指期权买方有权在将来某一时间以特定价(履约价或执行价)从期权卖方手中买入标的资产的期权合约。认沽期权又称卖权(也称“看跌期权”)，是指期权买方有权在将来某一时间以特定价格(履约价或执行价)向期权卖方卖出标的资产的期权合约。

在期权交易中，买方是权利方，拥有履约选择权，需为拥有这种权利而向卖方支付权利金；而卖方是义务方，必须按照买方要求履行期权合约规定的义务，需为保证履约而向结算机构(中国结算深圳分公司)交纳一定的保证金。

期权合约按履约期限分为美式(American)和欧式(European)。美式期权是指在到期的任何时刻，持有人均可以行使期权。欧式期权是指只能在到期这一特定时刻，持有人才可行使期权。

期权合约按执行价与标的物当前价格的关系分为平值期权、实值期权(价内)、虚值期权(价外)。平值期权是指执行价等于或非常接近标的价格的期权。实值期权是指具有内在价值的期权，即执行价低于当时标的价格的认购期权或执行价高于当时标的价格的认沽期权。虚值期权是指不具有内涵价值的期权，即执行价高于当时标的价格的认购期权或执行价低于当时标的价格的认沽期权。

期权交易与现货交易差异较大，具有以下几个特点：(1)交易对象是一种权利；(2)交易具有很强的时效性；(3)投资具有杠杆效应；(4)买卖双方的权利和义务不对称；(5)买方具有选择权。



2.2 方案要点

2.2.1 合约要素

(1) 合约标的

深交所选定的标的证券，包括 ETF、个股。标的代码为目前的 6 位证券代码。

(2) 合约类型

包括认购期权和认沽期权两种类型。

(3) 合约单位

合约单位指每张合约对应的标的证券数量。ETF 期权合约单位为 10000 份，个股期权合约单位为 1000 股。

(4) 行权价

初期拟设置 9 个不同行权价格的合约，包括 1 个平值合约、4 个实值合约、4 个虚值合约。

(5) 合约到期月份、合约到期日

设置 4 个期权合约到期月份，包括当月、下月及接下来的两个季月。例如当月是 5 月，则挂牌的合约月份为 5 月、6 月、9 月和 12 月。

(6) 履约方式

采用欧式期权，即合约的买方只能在行权日（最后交易日）申请行权。

(7) 合约交割方式

采取实物交割方式。

(8) 合约编码、合约代码、合约简称

合约编码为 8 位证券代码，用于系统交易，在合约调整前后保持不变，在合约存续期间唯一。ETF 期权合约从 90000001 至 91999999 按顺序对挂牌合约进行编码，个股期权合约从 92000001 至 99999999 按顺序对挂牌合约进行编码。

合约代码：159901C1410M000550A#第 1 至 6 位为数字，取标的 ETF 代码，如深 100ETF 取“159901”；第 7 位为 C（Call）或者 P（Put），分别表示认购期权或者认沽期权；第 8、9 位表示到期年份的后两位数字，第 10、11 位表示到期月份（分别用 01 至 12 代替），例如 2014 年 10 月到期合约代码为 1410；第 12 位为“M”，代表月合约序列；第 13 至 18 位共六位表示期权行权价格，其中后三位为小数位，若不足六位前后补 0 至六位（支持最高 999.999 元）。如上例所示，合约行权价为 0.550 元。第 19 位表示合约版本号，未调整时为空格字符，调整 1 次改为“A”，再次调整改为“B”，以此类推。预留第 20 位。

合约简称：合约标的简称+“购”（认购期权）或“沽”（认沽期权）+“N 月”+行权价格（不超过六位）+标志位（缺省为空，合约调整时依序修改为“A”、“B”……）。

例如：“深 100ETF 购 1 月 550”。

按照认购和认沽两种合约类型、九个行权价格、四个月份计算，首次挂牌一个标的证券的期权合约数计 72 个。

2.2.2 交易结算制度

股票期权交易结算制度主要包括投资者账户体系、价格形成机制、委托与买卖类型、结算制度和行权七个方面。

(1) 账户体系。股票期权交易的账户体系独立于现货证券账户体系。投资者需要向证券公司等期权经营机构申请开立衍生品合约账户，衍生品合约账户由中国结算配发编号，与投资者现有的 A 股证券账户相互对应。期权经营机构必须为客户开立独立的衍生品资金账户，并在结算银行开立独立的客户衍生品结算资金汇总账户。客户的衍生品资金账户和客户衍生品结算资金汇总账户均独立于现货资金账户。

衍生品合约账户（简称“合约账户”），编号由“A 股证券账户号码”+“参与人结算账号”组成。其中“参与人结算账号”，为 6 位数字代码，对投资者（经纪业务客户）账户为参与人经纪结算账号编码，对期权经营机构自营账户为参与人自营结算账号编码。如投资者同时通过多家证券公司进行期权交易的，需在不同证券公司开立不同的合约账户。

(2) 价格形成机制。股票期权交易采用场内集中竞价交易，按照价格优先、时间优先，以涨跌停板价格申报的委托（包括限价委托、以涨跌停板价格保存在委托簿的市价委托未成交部分、强平委托、报价），按照平仓优先（以涨停价格申报时买入平仓优先，以跌停价格申报时卖出平仓优先）、时间优先的原则撮合成交的原则撮合成交。交易时段与现货一致。最小报价单位设为标的 ETF 或个股最小报价单位的十分之一，即 ETF 期权的最小报价单位为 0.0001 元，个股期权的最小报价单位为 0.001 元。同时，在竞价交易制度下引入竞争性做市商机制，由做市商提供买卖双边报价，为期权市场补充流动性。

(3) 委托与买卖类型。除了现货市场已有的限价委托和市价委托外，期权交易引入限价全额成交或撤销委托。买卖类型包括买入开仓、买入平仓、卖出平仓、卖出开仓四种，并提供备兑开仓、备兑平仓两种交易策略类型。

(4) 结算制度。中国结算深圳分公司负责股票期权的结算等相关业务，并承担中央对手方的法定职责。股票期权结算主要包括三项职责：权利金的结算、维持保证金的收取与行权结算。

(5) 组合策略保证金。通过构建组合策略达到保证金冲销或减免的目的，投资者可根据自身持仓，通过期权经营机构向交易系统申请构建组合策略或解除组合策略。构建组合策略指由投资者申报构建组合策略指令，将多个成分合约（目前最多支持四个成

分合约)的持仓构建成为一个组合策略持仓。经本所交易系统校验确认后,即时返还多余保证金。解除组合策略指由投资者申报解除组合策略指令,将已建组合策略拆分成多个成分合约的持仓。经本所交易系统检查确认,拆分后各单个成分合约保证金必须足额,并确认补足保证金后,才能拆分成功。中国结算深圳分公司根据日终投资者组合策略持仓计收维持保证金。

(6) 普通与备兑仓互转。投资者可以通过普通转备兑仓指令将普通保证金持仓转为备兑持仓;投资者可以通过备兑转普通仓指令将备兑持仓转为普通保证金持仓。

(7) 行权。行权日日终,中国结算深圳分公司进行行权指令的有效性检查,并进行行权指派。在交收日(个股期权是E+1日、ETF期权是E+2日),根据行权指派数据进行证券与资金的交收。证券不足的行权交收违约按现金结算处理,现金结算价格由深交所确定。此外,期权经营机构可以为投资者提供实值期权的自动行权服务。为了提高客户的资金使用效率,降低交收违约风险,避免行权日实值期权大量折价交易,即在行权日,投资者同时持有相同标的证券的认购期权和认沽期权权利仓,可以通过行权指令合并申报行权。

2.3 业务资格管理

2.3.1 交易参与者

证券公司等机构经营股票期权业务,从监管部门获得相关业务资格后向深交所申请成为股票期权交易参与者,开通相应A股交易单元的期权交易权限。

交易所可根据本所监管需要、证监会要求或结算公司提请等限制、暂停或中止期权经营机构股票期权交易权限。

持有或者租用本所交易单元的基金管理公司、保险公司等特殊机构,将作为期权经营机构的特殊客户参与期权交易。

2.3.2 结算参与者

期权经营机构在开展业务前,需向中国结算深圳分公司申请成为股票期权衍生品结算业务的全面结算参与者或一般结算参与者。

一般参与者:只能为自身的客户或自营业务办理结算业务。

全面参与者:除为自身的客户或自营业务办理结算业务,也可为其他深交所会员的客户或自营业务办理结算业务。

结算参与者须在中国结算深圳分公司开立衍生品保证金账户,该账户用于存放参与者缴纳的用于参与期权结算业务的资金,具体分为保证金和结算准备金。

2.4 风险控制

为控制股票期权风险、保障市场平稳，将实行较严格的合格投资者管理制度、保证金制度、持仓限额、限购、限交易、风险警示、结算互保金制度、大户报告制度、强制平仓制度等风控措施。

三、 市场参与者柜台系统总体架构建议

证券公司等股票期权市场参与者应做好股票期权业务技术准备工作，包括股票期权技术系统建设、现有系统升级改造、股票期权测试环境搭建、运行维护。

本节描述市场参与者系统应该具备的基本功能，相应功能的业务规则和细则请参考深交所和中国结算深圳分公司公布的交易与结算方案。

1. 股票期权技术系统建设

依据股票期权业务资格申请情况，分别构建经纪业务系统、自营业务系统和做市商业业务系统。经纪和自营业务系统应具备期权合约管理、交易、清算等业务功能；做市商业业务系统还应具备做市报价、做市策略等其他辅助功能。

2. 现有系统升级改造

现有系统改造涉及到账户、交易（含终端）、法人清算、风控、行情揭示等系统的升级改造。

3. 股票期权测试环境搭建

为满足对投资者进行业务培训和投资教育，交易参与人应构建股票期权测试环境，并须与交易所的股票期权测试环境实现对接。

4. 运维保障

应按现有交易系统的运维保障级别进行股票期权测试系统的运维保障，并做好股票期权测试环境与生产环境的严格隔离，确保系统的安全稳定运行。

3.1 投资者管理

3.1.1 适当性管理

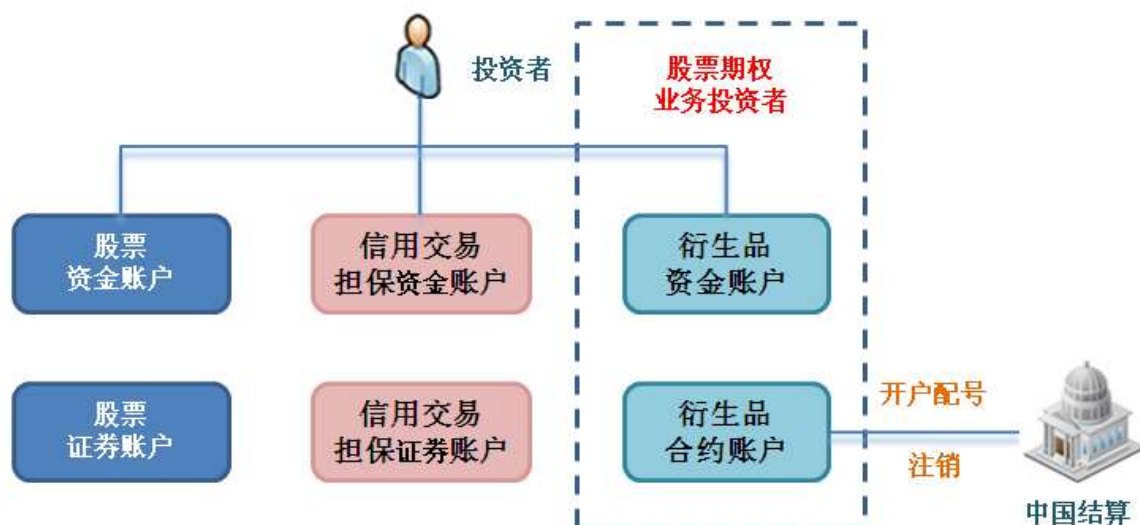
股票期权经营机构应了解客户的身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险偏好、投资目标等相关信息，有针对性的通过问卷调查、知识测评、资产情况及交易经验权限的检验等多种方式，对投资者交易资格进行准入控制。

对于合格的投资者，股票期权经营机构应与其签署股票期权业务相关协议并在本所报备后，方可在中国结算开立衍生品账户。

股票期权经营机构应根据投资者适当性管理业务规则，对投资者交易的权限和规模进行分级管理。在股票期权业务操作过程中，系统应按照分级规则对投资者的交易进行实时风险控制。

3.1.2 投资者账户管理

投资者从事股票期权交易,需要开立两类账户,衍生品资金账户和衍生品合约账户。投资者账户体系如图所示。



3.1.2.1 衍生品资金账户

衍生品资金账户用于股票期权保证金的存放,及权利金、行权资金、手续费等各类资金的交收。市场参与者系统需为每位投资者开立衍生品资金账户,衍生品资金账户与股票资金账户及信用交易担保资金账户严格隔离。

3.1.2.2 衍生品合约账户

按证券账户和交易单元记录投资者股票期权合约的持仓,用于期权开平仓和期权行权申报。

市场参与者(期权经营机构)系统应具备开户、销户等账户管理功能。

投资者须已拥有深市 A 股普通证券账户,方可向期权经营机构申请开立衍生品合约账户。期权经营机构只可对满足投资者适当性管理业务规则的投资者准予开户。

合约账户的资料同 A 股账户资料。

期权经营机构只可在投资者衍生品合约账户不含未平持仓、无未了清算交收责任时,方可向投资者办理销户。

3.1.3 参与人账户管理

期权经营机构(结算参与人)参与股票期权业务,需在中国结算深圳分公司开立衍生品保证金账户,用于存放参与人缴纳的用于参与期权结算业务的资金(分为保证金和结算准备金)。同时,还需向中国结算深圳分公司申请开立证券处置账户,用以存放当

投资者对会员发生资金交收违约时，暂不交付给客户的标的证券。

3.2 合约管理

系统应具备支持合约新挂、合约加挂、合约摘牌、合约调整等合约管理功能。市场参与者可应用或参考交易所每交易日开市前通过文件网关下发的合约基础信息和静态交易参考信息。

合约调整是由于其标的证券发生权益分配、公积金转增股本、配股、股份合并、股份分拆等情况时，为维持期权合约买卖双方的权益不变，需要对股票期权的合约单位、行权价格、合约数量及合约简称进行调整。

深 100ETF 在某日进行如下调整：单位分红金额为 0，基金折算后份额数量为原份额数量的 2 倍。根据合约调整公式和规则，以深 100ETF 为标的 2014 年 10 月到期的认购期权合约调整前后的变化为：

	调整前	调整后
合约编码	900000001	900000001
合约代码	159901C1410M001000	159901C1410M000500A
合约简称	深 100ETF 购 10 月 1000	深 100ETF 购 10 月 1000A
行权价	1.000 元	0.500 元
合约单位	10000	20000
最后交易日	20141029	20141029
行权日	20141029	20141029
到期日	20141029	20141029
交收日	20141031	20141031
前结算价	0.1 元	0.05 元

合约调整公式参考业务细则。

3.3 交易管理

为保证投资者可正常参与股票期权交易，期权经营机构系统应具有完备的交易管理功能。交易管理包括交易日初始化、交易风险参数管理、订单申报处理、回报处理、行情发布、前端监控、交易接入等功能。

市场参与者可应用或参考交易所每交易日开市前下发的合约基础信息和静态交易参考信息。

3.3.1 交易日初始化处理

系统应具备根据交易所公布的信息进行股票期权合约交易参数的初始化功能。

交易参数包括合约编码、合约代码、合约简称、标的证券代码、涨跌停价格、保证金率、限仓额度、最小变动价位、认购/认沽、挂牌原因、交割日期、交割月份、交割方式、行权日、行权价、行权方式、最后交易日、是否调整、调整次数、合约单位、合约持仓量、昨日结算价等。

3.3.2 交易风险参数管理

交易风险参数包括涨跌停板设置、保证金比例、限仓额度、限交易量额度、交易权限等，期权经营机构系统应具备针对投资者的不同分级进行差异化设置，标准不得低于交易所和中国结算深圳分公司规定的数值。

3.3.2.1 涨跌停板制度

为了防止期权合约交易价格的暴涨暴跌，抑制过度投机现象，对每只期权合约当日成交价的涨跌幅度予以适当的限制。

具体标准参考业务细则。

3.3.2.2 保证金制度

为了防止违约风险，期权实施较为严格的保证金制度，对期权保证金设置了较高的要求，尤其是可覆盖标的股票连续两个交易日涨停或跌停的风险。

具体标准参考业务细则。

3.3.2.3 限仓额度

限仓额度是指交易所规定期权经营机构、投资者可以持有的同方向最大持仓数量和权利仓持仓数量。

具体标准参考业务细则。

3.3.2.4 限交易量额度

投资者单日在同一标的的所有合约上的买开仓数量之和，如果达到限制，只允许投资者平仓不允许其继续开仓。

具体标准参考业务细则。

3.3.3 委托与申报

3.3.3.1 交易指令与订单类型

系统应支持限价和市价等订单类型，比现货交易增加了“限价全额成交或撤销委托”。

系统应支持买入开仓、买入平仓、卖出开仓、卖出平仓、备兑开仓、备兑平仓等交

易指令。申报指令定义参见本指南的“市场接口”章节内容和接口规范文件。

3.3.3.2 可用资金与仓位实时计算与监控

投资者通过买入开仓增加权利仓头寸，通过卖出平仓减少权利仓头寸；通过卖出开仓增加义务仓头寸，通过买入平仓减少义务仓头寸。

1. 资金变化

以下描述各交易指令在下达、成交、成功撤单时客户当前可用资金和持仓变化情况：权利金相关计算方式如下：

- (1) 委托时：对买入开仓，以委托价、委托数量计算拟支付的权利金并冻结，买入开仓冻结资金=委托价×委托量×合约单位。买市价委托时委托价为涨停价。
- (2) 成交时：以成交价、成交量计算支付权利金。对买入开仓、买入平仓成交，权利金支出=成交价×成交量×合约单位。对卖出平仓、卖出开仓成交，权利金收入=成交价×成交量×合约单位。
- (3) 撤单时：对买入开仓的成功撤单，以委托价、撤单量计算需撤销支付的权利金并解冻，开仓撤销解冻资金=委托价×撤单量×合约单位。买市价委托时委托价为涨停价。

保证金相关计算方式如下：

- (1) 委托时：对卖出开仓，以委托量计算拟缴纳的初始持仓保证金并冻结，卖出开仓冻结保证金=每张合约保证金×委托量。
- (2) 成交时：初始持仓保证金=每张合约保证金×成交量。
- (3) 撤单时：对卖出开仓的成功撤单，以撤单量计算需撤销缴纳的保证金并解冻，开仓撤销解冻资金=每张合约保证金×撤单量。

日间可用于交易的资金=当日日初可用余额+当日入金-当日出金-占用保证金-开仓冻结保证金-冻结权利金+权利金收入-权利金支出。

其中，上式的“当日日初可用余额”参见结算公司日终结算文件。

日间可用于交易的资金在开市时必须大于等于最低结算准备金余额，如果开市时小于，不允许开仓；通过平仓或入金，使日间可用于交易的资金大于等于最低结算准备金余额时，才允许开仓。

构建组合策略申报、解除组合策略申报、期权普通与备兑仓互转申报资金变化方式参考相应业务细则。

2. 持仓限额变化

持仓限额分总持仓限额和权利仓持仓限额。

总持仓限额是指同一标的的所有月份所有合约（即不同执行价格认购和认沽合约）权

利仓加义务仓持仓量的最大数量。

权利仓持仓限额是指同一标的的所有月份所有合约（即不同执行价格认购和认沽合约）认购权利仓加认沽权利仓的最大持仓数量。

持仓限额按经营机构持仓限额、投资者持仓限额两级进行设置。

做市商不占用其经营机构的持仓限额，也不受标准投资者持仓限额的限制，按照特殊持仓限额（即做市商持仓限额）进行限仓。

3.3.3.3 非交易指令

市场参与者系统应支持期权行权、期权行权指令合并申报、转处置、垫券还券、待清偿扣划、期权组合策略保证金、期权现金与备兑仓互转、保证金查询等非交易指令。其中，除期权组合策略保证金、期权现金与备兑仓互转、保证金查询，其他指令均支持撤单。期权组合策略保证金分构建组合策略申报和解除组合策略申报；期权现金与备兑仓互转分期权现金转备兑申报、期权备兑转现金申报。详情参见[市场接口](#)。

3.3.3.4 做市商报价

1. 概述

做市商可以提供双边报价委托，双边报价委托必须是包括一买一卖、买卖委托价必须为限价、买卖数量符合最大和最小报量要求、必须指明开平标志。

同一做市商报入相同合约报价委托时，交易系统自动撤销之前的报价并向市场发布新报价。

做市商报价委托双边委托有以下几种组合：买开与卖开，买开与卖平，买平与卖开，买平与卖平。

2. 分类

报价委托分新报价、报价更新、报价撤销：

新报价是指委托簿中无报价时，报入报价，买卖数量不能均为 0。

报价更新是指委托簿中已有报价时，报入报价，买卖数量不能均为 0。

报价撤销为买卖数量都为 0。

3. 允许报价委托的交易阶段

新报价与普通委托允许申报的交易阶段一致；报价更新、报价撤销与普通委托撤销允许申报的交易阶段一致。

举例说明：

- ✓ 开盘集合竞价9:15-9:20：允许新报价、报价更新、报价撤销。
- ✓ 开盘集合竞价9:20-9:25：允许新报价；不允许报价更新、报价撤销。
- ✓ 临时停牌时：允许新报价、报价更新、报价撤销。

- ✓ 触发断路器后，前2分钟：允许新报价、报价更新、报价撤销。
- ✓ 触发断路器后，后1分钟：允许新报价；不允许报价更新、报价撤销。
- ✓ 连续竞价时：允许新报价、报价更新、报价撤销。
- ✓ 收盘集合竞价14:57-14:59：允许新报价、报价更新、报价撤销。
- ✓ 收盘集合竞价14:59-15:00：允许新报价；不允许报价更新、报价撤销。

4. 报价委托处理过程如下：

- ✓ 报价委托开仓侧需要进行限交易量、限仓、限购等检查。
- ✓ 报价委托平仓侧需要进行可平量检查。
- ✓ 对于单侧报价(即买量不等于0卖量等于0、买量等于0卖量不等于0的报价更新)，如果当前存在旧报价的另一侧，并且新的单边报价的价格与另一侧报价的价格出现锁价(相等)或倒挂的情形时，接受该单边报价，同时将另一侧报价撤销。

举例：

旧报价买量100买价1.0，卖量200卖价1.1

报价更新买量150买价1.1，卖量0卖价0

报价更新处理后买量150买价1.1，卖量0卖价0

- ✓ 检查通过后，判断是否已有报价，如有，对原委托进行自动撤单处理，再显示新报价。
- ✓ 做市商可以通过申报买数量或卖数量为0的报价委托对已有报价单侧内容进行修改。

举例说明某做市商在某合约报价变化情况（报价更新）：

原报价买量100，卖量50

新报价买量0，卖量60

新报价处理后，报价变为买量100，卖量60

- ✓ 做市商可以通过申报买卖数量均为0的新报价委托对已有报价进行撤单。

举例说明某做市商在某合约报价变化情况（报价撤销）：

原报价买量100，卖量50

新报价买量0，卖量0

新报价处理后，系统无报价

3.3.3.5 强制平仓

当客户可用资金不足、超过持仓限额等情况时，经营机构、交易所或结算公司会对投资者未平持仓进行强制平仓处理。

1. 交易所强制平仓委托具有以下特点：

- 1) 只可以由交易所或结算公司发起，投资者和经营机构可以收到订单响应及

成交执行报告。

- 2) 投资者、经营机构不得申报此类新订单，也不得对交易所强制平仓委托申报撤单，如果申报，将被交易所拒绝。
- 3) 买强制平仓委托的委托价等于期权合约的涨停价；卖强制平仓委托的委托价等于期权合约的跌停价。
- 4) 委托量由交易所和结算公司根据强平业务规则确定。

2. 经营机构强制平仓委托具有以下特点：

- 1) 只可以由经营机构发起，投资者可以收到订单响应及成交执行报告。
- 2) 投资者不得申报此类新订单，也不得对会员强制平仓委托申报撤单，如果申报，将被交易所拒绝。
- 3) 经营机构强制平仓委托的委托价必须满足涨跌停板、价格档位要求。
- 4) 经营机构强制平仓委托的委托量必须满足可平数量、申报数量的上下限、限交易量额度的要求。

3.3.4 前端监控

期权经营机构系统应对投资者的交易委托实施前端监控：

1. 检查投资者账户是否有效。
2. 检查当前交易时间，投资者申报是否允许。
3. 检查投资者申报合约是否可以交易。
4. 根据投资者分级等规则检查投资者的交易权限。
5. 检查投资者申报委托类型是否合法。
6. 检查投资者申报价格档位是否合法。
7. 检查投资者申报是否满足涨跌停板的要求。
8. 检查投资者申报是否满足申报数量的上下限的要求。
9. 检查投资者申报是否满足交易量限额要求。系统应支持支持单品种/全市场以及账户/经营机构两个维度的前端限仓。
10. 检查投资者申报是否满足限购要求。
11. 对于权利开仓申报，检查投资者扣减权利金后可用资金是否足额。
12. 对于义务仓（即非备兑仓）开仓申报，检查投资者扣减保证金后可用资金是否足额。
13. 对于备兑开仓申报，检查投资者可用于备兑开仓的证券是否足额。
14. 对于开仓申报，检查投资者在本经营机构处是否超过持仓限额。
15. 对于平仓申报，检查投资者的合约可平数量是否足额。
16. 对于构建组合策略申报，参与构建组合策略的各成分合约持仓量必须大于等于

构建组合策略申报数量。

17. 对于解除组合策略申报，解除的组合策略持仓的组合策略数量必须大于等于解除组合策略申报数量，且解除时可用资金必须大于等于需追加保证金。
18. 对于期权普通转备兑仓申报，投资者持有普通仓数量必须大于等于期权普通转备兑仓申报数量，且投资者持有相应数量的标的股份或份额。
19. 对于期权备兑转普通仓申报，投资者持有备兑仓数量必须大于等于期权备兑转普通仓申报数量，且投资者可用资金必须大于等于需追加保证金。
20. 其他需要进行检查的项目。

对于行权委托实施以下前端检查：

1. 检查投资者账户是否有效。
2. 检查投资者行权合约是否可行权。
3. 检查投资者行权量是否未超过持仓数量。
4. 检查投资者认购行权时资金是否足额；认沽行权时标的证券是否足额。

对于行权指令合并申报实施以下前端检查：

1. 检查投资者账户是否有效。
2. 检查投资者两腿行权合约是否可行权，且分别为认购期权和认沽期权。
3. 检查投资者申报的行权合约，认沽期权合约的执行价格是否大于等于认购期权合约的执行价格，且合约单位必须相同。
4. 检查投资者在规定时间内有足额的相同标的证券的认购期权和认沽期权权利仓、且认购期权和认沽期权的行权数量不得超过投资者持有的权利仓净头寸。
5. 投资者应确保其资金满足组合行权后的应付资金。

3.3.5 市场接入

期权经营机构应为投资者提供多种安全的委托方式(委托渠道)，包括非现场交易、现场交易。其交易系统具有现货交易同样的稳定性、安全性，在容量与处理能力上能满足客户交易需求。

接入交易所交易系统（“市场接入”），在接入线路、接入网关部署和流速权配置上能满足交易需求和安全稳定要求。

3.3.6 交易信息即时揭示

期权经营机构系统应及时准确的向投资者揭示实时行情、收盘行情、基本信息披露、公告信息披露等信息。

3.4 清算交收

中国结算深圳分公司作为中央对手方，为期权日常结算及行权结算提供多边净额结算服务。期权实行分级结算制度，中国结算深圳分公司负责与结算参与人之间的集中结算，结算参与人负责与其客户进行结算。

中国结算深圳分公司的日终期权结算文件请参考《深市股票期权结算数据接口规范》。

3.4.1 日常结算处理

中国结算深圳分公司根据当日成交结果对结算参与人进行权利金、相关费用和合约持仓变更的清算，并根据清算结果完成期权合约交易的交收，相应增加或减少结算参与人股票期权资金保证金账户余额，相应增加或减少合约持仓。

具体的接口说明请参考《深市股票期权结算数据接口规范》、《深市登记结算接口规范涉及股票期权业务技术系统变更指南》。

3.4.2 行权结算

中国结算深圳分公司在最后交易日(E日)进行行权清算，在行权交收日办理交收。

付券方投资者可在 E+1 日通过补购(买入或申购)标的证券用于行权交收。会员应做好投资者行权的资金和标的证券管理。

为保护投资者权益，避免纠纷，期权经营机构系统应该为投资者提供行权功能。行权功能包括发布行权合约信息、提示投资者行权、自动行权、行权查询、行权违约等。

行权前端监控：

对投资者下达的行权指令进行合法性检查。

行权指派和清算：

1. E日日终，接收行权指派数据；
2. E日日终，接收以股票期权资金保证金账户为单位的行权应收应付资金净额，以及以投资者为单位的同一标的证券的净应收应付数据。

行权交收：

行权交收日日终，接收行权交收结果数据。

转处置、垫券、待清偿申报：

1. 投资者对期权经营机构发生行权资金违约，期权经营机构可申报投资者行权实收标的证券划转到相应结算参与人证券处置账户予以处置；
2. 投资者行权应付证券不足，期权经营机构可申报为投资者垫付行权应付标的证

券；

3. 若期权经营机构试算认为期权经纪保证金账户行权交收资金不足，可申报扣划自营证券账户的证券或指定投资者的行权应收证券。

3.4.3 保证金计收

中国结算深圳分公司采取逐日盯市制度，对结算参与人进行每日的义务仓的保证金计收。

1. 对于认购期权的备兑开仓，以 100% 的标的证券作为备兑证券，并于日终予以锁定；
2. 对于普通仓，在结算参与人股票期权资金保证金账户进行保证金的资金锁定。

3.4.4 出入金管理

结算参与人系统应具有出金、入金、资金查询、对账等功能。

出入金的受理及处理时间为每个交易日 8:30 至下午 17:00。出入金的具体流程安排参见《深市股票期权模拟交易结算方案》。

3.4.5 结算风险管理

3.4.5.1 结算风险参数管理

结算风险参数包括维持保证金率、限仓额度、手续费率、结算准备金最低余额等。会员系统应具备针对投资者的不同分级进行差异化设置，标准不得低于交易所和中国结算深圳分公司规定的数值。

3.4.5.2 交收违约处理

对于结算参与人行权证券交收违约，中国结算深圳分公司将采取现金结算；对于资金交收违约，则暂扣结算参与人应收标的证券。同时，对结算参与人收取违约金。

3.5 风险管理

股票期权风险管理，由交易所和中国结算深圳分公司、交易与结算参与人两级组成，交易/结算参与人交易系统和风控系统需要具备以下功能：

- 保证金制度
- 持仓限额制度
- 限购、限交易制度
- 套期保值、套利交易制度
- 强制平仓制度

- 前端监控
- 投资者分级制度
- 大户报告制度
- 风险警示制度
- 结算互保制度
- 合格投资者制度

各制度细则参考交易所和中国结算深圳分公司业务方案。

3.6 查询服务

期权经营机构系统应为投资者提供委托查询、成交查询、持仓查询、行权执行查询、对账、期权合约信息等查询服务。

3.7 数据报送

根据交易所、中国结算深圳分公司、证监会相关要求，报送期权业务数据。

交易所期权参与人管理是通过固定收益与衍生品小组备案的各参与人(主要是证券公司、期货公司、基金公司等)，通过交易所发放的 UKEY 登陆交易所业务专区。主要有以下数据报送：

- 1、合格投资者资料报送。
- 2、大户报告。
- 3、客户违约记录。
- 4、做市商申报。

每个功能具体报送内容，参考业务细则中的描述。

3.8 其他

期权经营机构系统应满足股票期权其他必需的业务要求。

四、 市场接口

4.1 概述

股票期权交易系统接口基于第五版交易系统的接口规范分为静态文件接口、实时交易接口、实时行情接口。

股票期权结算系统采用独立的数据接口发布期权的清算交收数据,具体内容请参考《深市股票期权结算数据接口规范》。备兑开仓、期权行权等与证券结算系统相关的内容,采用中国结算深圳分公司结算系统优化的接口规范,具体内容请参考《深市登记结算数据接口规范涉及股票期权业务技术系统变更指南》。这里不再展开详述。

以下各节对第五版交易系统的接口进行简要的说明。

1. 静态文件接口

下表为深交所在不同时段发送的静态文件列表:

时间段	包含文件
开市前	1. 证券信息: 文件名 securities_YYYYMMDD.xml, 文件内容参考《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》中证券信息(securities)中的说明 2. 衍生品集中竞价交易类业务参考信息: 文件名 derivativeauctionparams_YYYYMMDD.xml, 文件内容参考《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》中衍生品集中竞价交易类业务参考信息(derivativeauctionparams)中的说明 3. 期权组合策略信息: 文件名 optioncombinationstrategy_YYYYMMDD.xml, 文件内容参考《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》中期权组合策略信息(optioncombinationstrategy)中的说明
闭市后	1. 收盘行情: 文件名 derivativesecuritiesclosemd_YYYYMMDD.xml, 文件内容参考《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》中衍生品证券收盘行情(derivativesecuritiesclosemd)中的说明

2. 交易接口

交易相关接口定义参见《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》和《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》,委托具体填报方式及回报消息说明参见下面的“STEP 交易接口”、“Binary 交易接口”章节。

3. 行情接口

行情相关接口定义参见《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》和《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》。

股票期权集中竞价行情快照通过快照行情消息（STEP 类型为 W，Binary 类型为 300111）发布，频道代码为 1051，行情类别 MDStreamID 为“040”。

通过证券实时状态消息（STEP 类型为 f，Binary 类型为 390013）可接收每个合约的买开仓、卖开仓、备兑开仓、期权普通转备兑仓、期权备兑转普通仓权限。

4.2 STEP 交易接口

4.2.1 委托申报

4.2.1.1 期权集中竞价交易

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=D	
1180	ApplID	应用标识	040
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType	订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优	1、2 或 U
54	Side	买卖方向	1 或 2
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起 106=结算结构发起	1、102、103、104、105
529	OrderRestrictions	订单限定	不需要填写
60	TransactTime	订单发起时间	委托申报时间
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102

组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	4
→	448	PartyID	参与人代码	交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元
→	448	PartyID	参与人代码	证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户
→	448	PartyID	参与人代码	营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码
→	448	PartyID	参与人代码	合约账户标识码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	38=合约账户标识码
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
152	CashOrderQty		订单金额	不需要填写
38	OrderQty		订单数量	委托数量
组件结束				
44	Price		价格 OrdType 为 2 时填写	委托价格
99	StopPx		止损价，预留	不需要填写
59	TimeInForce		有效时期类型 0=当日有效 3=即时成交或取消 9=港股通竞价限价盘 缺省值为 0	0 或 3
1090	MaxPriceLevels		最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数 缺省值为 0	最多成交价位数

110	MinQty	最低成交数量 缺省值为 0	最低成交数量
77	PositionEffect	开平仓标识，衍生品交易填写 O=开仓 C=平仓 缺省值为 O	O 或 C
203	CoveredOrUncovered	备兑标签，衍生品交易填写 0=Covered, 表示备兑仓 1=UnCovered, 表示普通仓 缺省值为 1	0 或 1
58	Text	Free Text	选填自定义内容

注：说明参见 Binary 交易接口

4.2.1.2 期权集中竞价交易报价

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=S	
1180	ApplID	应用标识	041
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号	客户订单编号
522	OwnerType	报价所有者类型	105
60	TransactTime	订单发起时间	委托时间
131	QuoteReqID	预留字段 当报价是对报价请求的响应时，填写报价请求的 ID	不需要填写
537	QuoteType	报价类型 1= Tradeable, 表示可交易的报价	1
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	102

		102=深圳证券交易所	
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	3
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
132	BidPx	买报价 BidSize>0 时必须填写	买报价
133	OfferPx	卖报价 OfferSize>0 时必须填写	卖报价
134	BidSize	买数量	买数量
135	OfferSize	卖数量	卖数量
8909	BidPositionEffect	买开平仓标志, 衍生品 报价填写 O=开仓 C=平仓 空格 BidSize>0, 则必须填写	O 或 C 或空格
8910	OfferPositionEffect	卖开平仓标志, 衍生品 报价填写 O=开仓 C=平仓 空格 OfferSize>0, 则必须填	O 或 C 或空格

		写	
58	Text	Free Text	选填自定义内容

注：说明参见 Binary 交易接口

4.2.1.3 期权组合策略保证金

Tag	域名	字段描述	构建组合申报字段取值	解除组合申报字段取值
	MessageHeader	MsgType=AB		
1180	ApplID	应用标识	340	341
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType	订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优	2	2
54	Side	买卖方向	1	1
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起 106=结算结构发起	订单所有者类型	订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	不需要填写	不需要填写
60	TransactTime	订单发起时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>				
48	SecurityID	证券代码	标的证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	4	4

→	448	PartyID	参与人代码	交易单元	交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	448	PartyID	参与人代码	证券账户	证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户
	448	PartyID	参与人代码	营业部代码	营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码
	448	PartyID	参与人代码	结算参与人	结算参与人
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	38=合约账户标识码	38=合约账户标识码
组件<OrderQtyData>					
152	CashOrderQty	订单金额	不需要填写	不需要填写	
38	OrderQty	订单数量	组合策略数量	解除组合策略数量	
组件<Legs>					
555	NoLegs	成份合约个数	组合策略需要的成份合约个数	0	
→	602	LegSecurityID	成份合约代码	成份合约代码	不需要填写
	603	LegSecurityIDSource	成份合约代码源	102	不需要填写
	624	LegSide	成份合约方向 1-权利仓 2-义务仓	1 或 2	不需要填写
	685	LegOrderQty	成份合约数量	该组合需要的成份合约数量(组合策略数量*单份组合策略包含的此合约张数)	不需要填写
198	SecondaryOrderID	第二交易所订单编号	不需要填写	拟解除组合对应的组合流水号(对应构建组合委托执行报告中的 OrderID)	

167	SecurityType	证券类别	MLEG	不需要填写
762	SecuritySubType	证券子类别 填写组合策略编码	组合策略编码	不需要填写
44	Price	价格	不需要填写	不需要填写
58	Text	Free Text	选填自定义内容	选填自定义内容

注：说明参见 Binary 交易接口

4.2.1.4 期权普通与备兑仓互转

Tag	域名		字段描述	普通转备兑 仓字段取值	备兑转普通 仓字段取值
	MessageHeader		MsgType=D		
1180	ApplID		应用标识	350	351
11	ClOrdID		客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType		订单类型	2	2
54	Side		买卖方向	1	1
522	OwnerType		订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
529	OrderRestrictions		订单限定	不需要填写	不需要填写
60	TransactTime		订单发起时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>					
48	SecurityID		证券代码	合约代码	合约代码
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102
组件结束					
组件<Parties>					
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	4	4
→	448	PartyID	参与人代码	交易单元	交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	448	PartyID	参与人代码	证券账户	证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号

	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户
	448	PartyID	参与人代码	营业部代码	营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码
	448	PartyID	参与人代码	合约账户标识码	合约账户标识码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	38=合约账户标识码	38=合约账户标识码
组件结束					
组件<OrderQtyData>					
152	CashOrderQty	订单金额	不需要填写	不需要填写	
38	OrderQty	订单数量	委托数量	委托数量	
组件结束					
44	Price	价格	不需要填写	不需要填写	
58	Text	Free Text	选填自定义内容	选填自定义内容	

注：说明参见 Binary 交易接口

4.2.1.5 期权行权

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=D	
1180	ApplID	应用标识	160
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType	订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优	2
54	Side	买卖方向	1
522	OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	不需要填写
60	TransactTime	订单发起时间	委托申报时间
组件<Instrument>			

48	SecurityID		证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	102
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	4
→	448	PartyID	参与人代码	交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元
→	448	PartyID	参与人代码	证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户
→	448	PartyID	参与人代码	营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码
→	448	PartyID	参与人代码	合约账户标识码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	38=合约账户标识码
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
152	CashOrderQty		订单金额	不需要填写
38	OrderQty		订单数量	委托数量
组件结束				
44	Price		价格	不需要填写
58	Text		Free Text	选填自定义内容

4.2.1.6 期权行权指令合并申报

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=AB	
1180	ApplID	应用标识	161
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType	订单类型	2

		1=市价 2=限价 U=本方最优	
54	Side	买卖方向	1
522	OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	不需要填写
60	TransactTime	订单发起时间	委托申报时间
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	4
→	448	PartyID	交易单元（PBU）
	447	PartyIDSource	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	1=申报交易单元
→	448	PartyID	证券账户
	447	PartyIDSource	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	5=投资者证券账户
→	448	PartyID	营业部代码
	447	PartyIDSource	D=自定义代码
	452	PartyRole	4001=营业部代码
→	448	PartyID	合约账户标识码
	447	PartyIDSource	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	38=合约账户标识码
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
152	CashOrderQty	订单金额	不需要填写
38	OrderQty	订单数量	委托数量
组件结束			

组件< Legs >			
555	NoLegs	成份合约个数	2
→	602	LegSecurityID	成份合约代码
	603	LegSecurityIDSource	成份合约代码源
	624	LegSide	成份合约方向
	685	LegOrderQty	成份合约数量
组件结束			
58	Text	Free Text	选填自定义内容

注：说明参见 Binary 交易接口

4.2.1.7 保证金查询

Tag	域名		字段描述	字段取值
	MessageHeader		MsgType=U008	
1180	ApplID		应用标识	250
60	TransactTime		订单发起时间	委托申报时间
11	ClOrdID		客户查询编号	客户查询编号
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	2
→	448	PartyID	参与人代码	交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元
	448	PartyID	参与人代码	结算账号
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	38=结算账号
组件结束				
58	Text		Free Text	选填自定义内容

4.2.1.8 转处置

Tag	域名	字段描述	转处置扣券 字段取值	转处置还券 字段取值
	MessageHeader	MsgType=D		
1180	ApplID	应用标识	270	271

11	ClOrdID		客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType		订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优	2	2
54	Side		买卖方向	1	1
522	OwnerType		订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
529	OrderRestrictions		订单限定	不需要填写	不需要填写
60	TransactTime		订单发起时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>					
48	SecurityID		证券代码	标的证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102
组件结束					
组件<Parties>					
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	5	5
→	448	PartyID	参与人代码	交易单元	交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	448	PartyID	参与人代码	证券账户	证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户
	448	PartyID	参与人代码	营业部代码	营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码
	448	PartyID	参与人代码	划入待处置券的交易单元	划入待处置券的交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识

	452	PartyRole	参与人代码角色	17=对手方交易单元	17=对手方交易单元
	448	PartyID	参与人代码	划入待处置券的证券账户	划入待处置券的证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	39=对手方投资者证券账户	39=对手方投资者证券账户
组件结束					
组件<OrderQtyData>					
152	CashOrderQty	订单金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写
38	OrderQty	订单数量	委托数量	委托数量	委托数量
组件结束					
44	Price	价格	不需要填写	不需要填写	不需要填写
58	Text	Free Text	选填自定义内容	选填自定义内容	选填自定义内容

4.2.1.9 垫券还券

Tag	域名	字段描述	垫券申报字段取值	还券申报字段取值
	MessageHeader	MsgType=D		
1180	ApplID	应用标识	280	281
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType	订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优	2	2
54	Side	买卖方向	1	1
522	OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	不需要填写	不需要填写
60	TransactTime	订单发起时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>				
48	SecurityID	证券代码	标的证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	102	102

		102= 深圳 证 券 交 易 所		
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	5	5
→	448	PartyID	参与人代码	交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参 与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单 元
	448	PartyID	参与人代码	证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者 编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券 账户
	448	PartyID	参与人代码	营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代 码
	448	PartyID	参与人代码	出借交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参 与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	17=对手方交易 单元
	448	PartyID	参与人代码	出借证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者 编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	39=对手方投资 者证券账户
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
152	CashOrderQty	订单金额	不需要填写	不需要填写
38	OrderQty	订单数量	委托数量	委托数量
组件结束				
44	Price	价格	不需要填写	不需要填写
58	Text	Free Text	选填自定义内 容	选填自定义内 容

4.2.1.10 待清偿扣划

Tag	域名		字段描述	待清偿扣划 客户申报字段 取值	待清偿扣划 自营申报字段 取值
	MessageHeader		MsgType=D		
1180	ApplID		应用标识	290	291
11	ClOrdID		客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType		订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优	2	2
54	Side		买卖方向	1	1
522	OwnerType		订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
529	OrderRestrictions		订单限定	不需要填写	不需要填写
60	TransactTime		订单发起时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>					
48	SecurityID		证券代码	标的证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102
组件结束					
组件<Parties>					
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	5	5
→	448	PartyID	参与人代码	交易单元	交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	448	PartyID	参与人代码	证券账户	证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户

	448	PartyID	参与人代码	营业部代码	营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码
	448	PartyID	参与人代码	用于扣划证券的交易单元	用于扣划证券的交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	17=对手方交易单元	17=对手方交易单元
	448	PartyID	参与人代码	用于扣划证券的证券账户	用于扣划证券的证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	39=对手方投资者证券账户	39=对手方投资者证券账户
组件结束					
组件<OrderQtyData>					
152	CashOrderQty	订单金额	不需要填写	不需要填写	
38	OrderQty	订单数量	委托数量	委托数量	
组件结束					
44	Price	价格	不需要填写	不需要填写	
58	Text	Free Text	选填自定义内容	选填自定义内容	
组件结束					

4.2.2 订单响应执行报告

4.2.2.1 期权集中竞价交易

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=8	8
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号
1180	ApplID	订单应用标识	原始订单应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型

529	OrderRestrictions		订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID		执行编号	交易系统生成的执行编号
37	OrderID		交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType		执行类型	0、4 或 8
39	OrdStatus		订单状态	0、4 或 8
151	LeavesQty		剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty		累计成交数量	已成交数量
103	OrdRejReason		撤单/拒绝原因代码	执行类型为 4 或 8 时填写拒绝原因代码
54	Side		买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime		执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID		客户订单编号	原始委托的客户订单编号
41	OrigClOrdID		原始订单客户订单编号, 撤单请求成功响应填写	原始委托的原始订单客户订单编号, 撤单请求成功响应填写
组件<Instrument>				
48	SecurityID		证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource		证券代码源	原始委托的证券代码源
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码	原始委托的参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	原始委托的参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色	原始委托的参与人代码角色
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
152	CashOrderQty		订单金额	无
38	OrderQty		订单数量	原始委托的订单数量
组件结束				
44	Price		价格	原始委托的价格
99	StopPx		止损价	0

59	TimeInForce	有效时期类型	原始委托的有效时期类型
40	OrdType	订单类型	原始委托的订单类型
1090	MaxPriceLevels	最多成交价位数	原始委托的最多成交价位数
110	MinQty	最低成交数量	原始委托的最低成交数量
77	PositionEffect	开平仓标识	原始委托的开平仓标识
203	CoveredOrUncovered	备兑标签	原始委托的备兑标签
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.2.2 期权集中竞价交易报价状态回报

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=AI	
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号
1180	ApplID	应用标识	原始订单应用标识
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号	客户报价消息编号
522	OwnerType	报价所有者类型	原始委托的订单所有者类型
131	QuoteReqID	预留字段 当报价是对报价请求的响应时，填写报价请求的 ID	原始委托的报价请求的 ID
537	QuoteType	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价	原始委托的报价类型
297	QuoteStatus	报价状态 0=Accepted，接受 5=Rejected，拒绝	0 或 5
300	QuoteRejectReason	报价拒绝原因代码	报价状态为 5 时填写拒绝原因代码
1328	RejectText	报价拒绝原因说明	无
60	TransactTime	报价接收时间	报价状态报文生成时间
组件<Instrument>			

48	SecurityID		证券代码	原始委托的证券代 码
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	原始委托的证券代 码源
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	原始委托的参与人 代码个数
→	448	PartyID	参与人代码	原始委托的参与人 代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	原始委托的参与人 代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色	原始委托的参与人 代码角色
组件结束				
132	BidPx		买报价 BidSize>0 时必须填写	原始委托的买报价
133	OfferPx		卖报价 OfferSize>0 时必须填写	原始委托的卖报价
134	BidSize		买数量	原始委托的买数量
135	OfferSize		卖数量	原始委托的卖数量
8909	BidPositionEffect		买开平仓标志，衍生品 报价填写 O=开仓 C=平仓 空格 BidSize>0，则必须填写	原始委托的买开平 仓标志
8910	OfferPositionEffect		卖开平仓标志，衍生品 报价填写 O=开仓 C=平仓 空格 OfferSize>0，则必须填 写	原始委托的卖开平 仓标志

58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text
----	------	-----------	-----------------

注：说明参见 Binary 交易接口

4.2.2.3 期权组合策略保证金

Tag	域名	字段描述	构建组合申报字段取值	解除组合申报字段取值
	MessageHeader	MsgType=8		
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号	回报记录号
1180	ApplID	订单应用标识	原始订单应用标识	原始订单应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号	交易系统生成的当日唯一编号
37	OrderID	交易所订单编号	交易所订单编号	交易所订单编号
150	ExecType	执行类型	0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝	0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
39	OrdStatus	订单状态	0 或 8	0 或 8
151	LeavesQty	剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty	累计成交数量	0	0
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码, 执行类型为 8 或 4 时填写	拒绝原因代码	拒绝原因代码
54	Side	买卖方向	原始委托的买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间	订单响应执行报告生成时间

11	ClOrdID		客户订单编号	原始委托的客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>					
48	SecurityID		证券代码	原始委托的证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSourc e		证券代码源	原始委托的证券代码源	原始委托的证券代码源
组件<Parties>					
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码	原始委托的参与人代码	原始委托的参与人代码
	447	PartyIDSou rce	参与人代码源	原始委托的参与人代码源	原始委托的参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色	原始委托的参与人代码角色	原始委托的参与人代码角色
组件<OrderQtyData>					
38	OrderQty		订单数量	原始委托的订单数量	原始委托的订单数量
组件<Legs>					
555	NoLegs		成份合约个数	原始委托的成分合约个数	若 ExecType 为 0, 则填成份合约个数, 其它填 0
→	602	LegSecurity ID	成份合约代码	原始委托的成份合约代码	若 ExecType 为 0, 则填成份合约代码, 其它无
	603	LegSecurity IDSource	成份合约代码源	原始委托的成份合约代码源	若 ExecType 为 0, 则填成份合约代码源, 其它无
	624	LegSide	成份合约方向	原始委托的成份合约方向	若 ExecType 为 0, 则填成份合约方向, 其它无
	685	LegOrderQt y	成份合约数量	原始委托的成份合约数量	若 ExecType 为 0, 则填本次解除的成份合约数量, 其它无
198	SecondaryOrderID		第二交易所订单编号	无	原始委托的第二交易所订单编号

167	SecurityType	证券类别	原始委托的证券类别	无
762	SecuritySubType	证券子类别	原始委托的证券子类别	无
44	Price	价格	无	无
40	OrdType	订单类型	原始委托的订单类型	原始委托的订单类型
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.2.4 期权普通与备兑仓互转

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=8	8
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号
1180	ApplID	原始订单应用标识	原始订单应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
37	OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType	执行类型	0 或 8
39	OrdStatus	订单状态	0 或 8
151	LeavesQty	剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty	累计成交数量	0
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	执行类型为 8 时填写拒绝原因代码
54	Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
组件结束			
组件<Parties>			

453	NoPartyIDs	参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
152	CashOrderQty	订单金额	无
38	OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
组件结束			
44	Price	价格	原始委托的价格
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.2.5 期权行权

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=8	8
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	
1180	ApplID	订单应用标识	原始委托的应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
37	OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType	执行类型	0 或 8
39	OrdStatus	订单状态	0 或 8
151	LeavesQty	剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty	累计成交数量	0
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	执行类型为 8 时填写拒绝原因代码
54	Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间

11	ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
41	OrigClOrdID	原始订单客户订单编号， 撤单请求成功响应填写	无
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
152	CashOrderQty	订单金额	无
38	OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
组件结束			
44	Price	价格	原始委托的价格
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.2.6 期权行权指令合并申报

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=8	8
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号
1180	ApplID	订单应用标识	原始订单应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号

37	OrderID	交易所订单编号	交易所订单编号
150	ExecType	执行类型	0、4 或 8
39	OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
151	LeavesQty	剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty	累计成交数量	0
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码, 执行类型为 8 或 4 时填写	拒绝原因代码
54	Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSourc e	证券代码源	原始委托的证券代码源
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	原始委托的参与人代码
	447	PartyIDSou rce	原始委托的参与人代码源
	452	PartyRole	原始委托的参与人代码角色
组件<OrderQtyData>			
38	OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
组件<Legs>			
555	NoLegs	成份合约个数	原始委托的成份合约个数
→	602	LegSecurity	成份合约代码

	ID		代码
603	LegSecurity IDSource	成份合约代码源	原始委托的成份合约 代码源
624	LegSide	成份合约方向	无
685	LegOrderQty	成份合约数量	原始委托的成份合约 数量
198	SecondaryOrderID	第二交易所订单编号	无
167	SecurityType	证券类别	无
762	SecuritySubType	证券子类别	无
44	Price	价格	无
40	OrdType	订单类型	原始委托的订单类型
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.2.7 保证金查询

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=U009	
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号
1180	ApplID	原始订单应用标识	原始委托的应用标识
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
150	ExecType	执行类型	0=New 表示请求接受 8=Reject 表示请求失败
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<MarginItems>			

10186	NoMarginItems		保证金条目个数	0: 查询失败 4: 查询成功
→	10187	MarginItem	保证金条目类别	当 NoMarginItems=4 时有意义: 1: 保证金可用余额
	10188	MarginAmount	保证金金额	保证金金额
	10187	MarginItem	保证金条目类别	当 NoMarginItems=4 时有意义: 2: 保证金总金额
	10188	MarginAmount	保证金金额	保证金金额
	10187	MarginItem	保证金条目类别	当 NoMarginItems=4 时有意义: 3: 预留
	10188	MarginAmount	保证金金额	保证金金额
	10187	MarginItem	保证金条目类别	当 NoMarginItems=4 时有意义: 4: 预留
	10188	MarginAmount	保证金金额	保证金金额
组件结束				
58	Text		Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.2.8 转处置

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=8	8
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号
1180	ApplID	原始订单应用标识	原始委托的应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
37	OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType	执行类型	0、4 或 8
39	OrdStatus	订单状态	0、4 或 8

151	LeavesQty	剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty	累计成交数量	已成交数量
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	执行类型为 4 或 8 时填写拒绝原因代码
54	Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
38	OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
组件结束			
40	OrdType	订单类型	原始委托的订单类型
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.2.9 垫券还券

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=8	8
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号
1180	ApplID	原始订单应用标识	原始委托的应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号

37	OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType	执行类型	0、4 或 8
39	OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
151	LeavesQty	剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty	累计成交数量	已成交数量
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	执行类型为 4 或 8 时填写拒绝原因代码
54	Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
38	OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
组件结束			
40	OrdType	订单类型	原始委托的订单类型
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.2.10 待清偿扣划

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=8	8
10197	PartitionNo	平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex	回报记录号	回报记录号

1180	ApplID	原始订单应用标识	原始委托的应用标识
522	OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
37	OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType	执行类型	0、4 或 8
39	OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
151	LeavesQty	剩余量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
14	CumQty	累计成交数量	已成交数量
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	执行类型为 4 或 8 时填写拒绝原因代码
54	Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime	执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	原始委托的参与人代码
	447	PartyIDSource	原始委托的参与人代码源
	452	PartyRole	原始委托的参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
38	OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
组件结束			
40	OrdType	订单类型	原始委托的订单类型
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text

4.2.3 成交执行报告

4.2.3.1 期权集中竞价交易

Tag	域名		字段描述	字段取值
	MessageHeader		MsgType=8	8
10197	PartitionNo		平台分区号	平台分区号
10179	ReportIndex		回报记录号	回报记录号
1180	ApplID		订单应用标识	原始订单应用标识
522	OwnerType		订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions		订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID		执行编号	交易系统生成的执行编号
37	OrderID		交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType		执行类型	F
39	OrdStatus		订单状态	1、2
31	LastPx		成交价	成交价格
32	LastQty		成交数量	成交数量
151	LeavesQty		剩余量	剩余委托量
14	CumQty		累计成交数量	已成交数量
54	Side		买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime		执行报告时间	执行报告生成时间
11	ClOrdID		客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>				
48	SecurityID		证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource		证券代码源	原始委托的证券代码源
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	原始委托的参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码	原始委托的参与人代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	原始委托的参与人代码源
	452	PartyRole	参与人代码角色	原始委托的参与人代码角色
组件结束				
组件<OrderQtyData>				

152	CashOrderQty	订单金额	无
38	OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
组件结束			
44	Price	价格	原始委托的价格
99	StopPx	止损价	无
59	TimeInForce	有效时期类型	原始委托的有效时期类型
40	OrdType	订单类型	原始委托的订单类型
1090	MaxPriceLevels	最多成交价位数	原始委托的最多成交价位数
110	MinQty	最低成交数量	原始委托的最低成交数量
77	PositionEffect	开平仓标识	原始委托的开平仓标识
203	CoveredOrUncovered	备兑标签	原始委托的备兑标签
58	Text	Free Text	原始委托的 Free Text

4.3 Binary 交易接口

4.3.1 委托申报

4.3.1.1 期权集中竞价交易

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=100401	
ApplID	应用标识	040
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102
OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	结算机构代码
TransactTime	委托时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码

OrderRestrictions	订单限定	空格
Side	买卖方向	1 或 2
OrdType	订单类别 1=表示市价 2=表示限价 U=本方最优	1、2 或 U
OrderQty	订单数量	委托数量
Price	价格	委托价格
StopPx	止损价	0
MinQty	最低成交数量	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数	最多成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型 0=当日有效 3=即时成交或取消 9=港股通竞价限价盘	0 或 3
PositionEffect	平仓标识 O=开仓 C=平仓	O、C 或空格
CoveredOrUncovered	备兑标签 0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑	0、1
ContractAccountCode	合约账户标识码	结算账号

说明：

1) 交易指令字段填写规则：

交易指令	PositionEffect	CoveredOrUncovered	Side
买入开仓	O	1	1
卖出平仓	C	1	2
卖出开仓	O	1	2
买入平仓	C	1	1
备兑开仓	O	0	2
备兑平仓	C	0	1

2) 强平指令根据 OwnerType 分经营机构强平和交易所强平两类。OwnerType=102（经营机构发起）、PositionEffect=C 的申报为经营机构强制平仓委托；OwnerType

=101（交易所发起）或=106（结算公司发起）、PositionEffect=C 的申报为交易所强制平仓委托。

4.3.1.2 期权集中竞价交易报价

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=100405	
ApplID	应用标识	041
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102
OwnerType	订单所有者类型	105
ClearingFirm	结算机构代码	01
TransactTime	委托时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户
QuoteReqID	报价请求 ID 预留字段 当报价是对报价请求的响应时,填写报价请求 的 ID	空格
QuoteType	报价类型 1=可交易的报 (Tradeable)	1
BidPx	买报价	买报价
OfferPx	卖报价	卖报价
BidSize	买数量	买数量
OfferSize	卖数量	卖数量
BidPositionEffect	买平仓标识 O=开仓 C=平仓 BidSize=0 时该字段无意义, 填写空格	O、C、空格
OfferPositionEffect	卖平仓标识 O=开仓	O、C、空格

	C=平仓 OfferSize=0 时该字段无意义，填写空格	
ContractAccountCode	合约账户标识码	结算账号

说明：

1) 双边报价各类交易指令填写规则：

交易指令	BidSize	OfferSize	BidPositionEffect	OfferPositionEffect
买开、卖开	>0	>0	O	O
买开、卖平	>0	>0	O	C
买平、卖开	>0	>0	C	O
买平、卖平	>0	>0	C	C

2) 对于双边报价，买报价(BidPx)必须小于卖报价 (OfferPx)。

4.3.1.3 期权组合策略保证金

域名	字段描述	构建组合申报字段取值	解除组合申报字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=103421		
ApplID	应用标识	340	341
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	标的证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	102	102
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起 106=结算结构发起	订单所有者类型	订单所有者类型

ClearingFirm	结算机构代码	01	01
TransactTime	委托时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	全空格	全空格
Side	买卖方向	1	1
OrdType	订单类别	2	2
OrderQty	订单数量	组合策略数量	解除组合策略数量
Price	价格	填 0.0000	填 0.0000
ContractAccountCode	合约账户标识码	结算账号	结算账号
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号	全空格	拟解除组合对应的组合流水号（参见说明 3）
SecurityType	证券类别	MLEG	全空格
SecuritySubType	证券子类别	组合策略编码	全空格
NoLegs	成份合约个数	成份分合约个数	若 ExecType 为 0，则填成份合约个数，其它填 0
→	LegSecurityID	成份合约代码	成份合约代码 若 ExecType 为 0，则填成份合约代码
→	LegSecurityIDSource	成份合约代码源 102=深圳证券交易所	成份合约代码源 若 ExecType 为 0，则填成份合约代码源
→	LegSide	成份合约方向 1=权利仓（买开） 2=义务仓（卖开）	成份合约方向 若 ExecType 为 0，则填成份合约方向
→	LegOrderQty	成份合约数量 组合策略数量*单份组合策略包含的此合约张数	若 ExecType 为 0，则填本次解除的成份合约数量

说明：

1) 构建组合时，成份合约代码必须支持对应的组合策略编码，成份合约个数及成份合约的要素（合约代码、合约方向）要满足组合策略编码对应的组合策略的定义（具体请参见交易系统每交易日早间下发的静态参考信息期权组合策略信息文件）。

2) 构建组合时，订单数量(OrderQty)填写构建组合的组合策略数量，成份合约数量

（LegOrderQty）填写本组合需要的成份合约的数量，举例：假设一个组合策略由两条腿组成，一份组合中对应的腿 1、腿 2 合约张数都为 1，若 OrderQty 为 4，则腿 1、腿 2 的 LegOrderQty 都为 4。

3) 组合流水号是指交易系统对于每笔成功构建的组合会分配一个跨交易日唯一的编号（对应订单响应执行报告的 OrderID 字段），在解除组合时，必须填写 SecondaryOrderID，SecondaryOrderID 填组合流水号。

4) 解除组合时，SecurityID、SubmittingPBUID、AccountID 必须与原构建组合申报的 SecurityID、SubmittingPBUID、AccountID 一致。

5) 支持部分解除，OrderQty 填写解除组合的数量。

4.3.1.4 期权普通与备兑仓互转

域名	字段描述	普通转备兑仓字段取值	备兑转普通仓字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=103501		
ApplID	应用标识	350	351
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	证券代码	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102
OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	结算机构代码	结算机构代码
TransactTime	委托时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	全空格	全空格
Side	买卖方向	1	1
OrdType	订单类别	2	2
OrderQty	订单数量	订单数量	订单数量
Price	价格	0.0000	0.0000
ContractAccountCode	合约账户标识码	结算账号	结算账号

说明：

1) 订单数量 (OrderQty) 必须大于 0 且为 1 的整数倍。

4.3.1.5 期权行权

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=101601	
ApplID	应用标识	160
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102
OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	结算机构代码
TransactTime	委托时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	空格
Side	买卖方向	1
OrdType	订单类别 1=表示市价 2=表示限价 U=本方最优	2
OrderQty	订单数量	委托数量
Price	价格	0.0000
ContractAccountCode	合约账户标识码	合约账户标识码

4.3.1.6 期权行权指令合并申报

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=101621	
ApplID	应用标识	161
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102

OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	结算机构代码
TransactTime	委托时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	空格
Side	买卖方向	1
OrdType	订单类别 1=表示市价 2=表示限价 U=本方最优	2
OrderQty	订单数量	委托数量
Price	价格	0.0000
ContractAccountCode	合约账户标识码	合约账户标识码
NoLegs	成份合约个数	2
→	LegSecurityID	成份合约代码
→	LegSecurityIDSource	成份合约代码源
→	LegOrderQty	成份合约行权数量

说明：

1) 委托申报的证券代码（SecurityID）必须与成份合约代码（LegSecurityID）对应的标的证券代码相同。

2) 委托申报中的两个成份合约，要满足如下条件：

- 一个为认购期权合约，另一个为认沽期权合约
- 两个合约的合约单位必须一致
- 认沽期权合约的执行价格必须大于或等于认购期权合约的执行价格

3) 订单数量（OrderQty）必须大于 0 且为 1 的整数倍，成份合约数量（LegOrderQty）与订单数量（OrderQty）取值相同。

4.3.1.7 保证金查询

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=102587	
ApplID	应用标识	250

SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	全空格
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格
OwnerType	订单所有者类型	0
ClearingFirm	结算机构代码	全空格
TransactTime	委托时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
FundPBUID	结算账号	结算账号

说明：

- 1) 委托申报中的结算账号必须与申报交易单元对应的结算账号一致。

4.3.1.8 转处置

域名	字段描述	转处置扣券字段取值	转处置还券字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=102701		
ApplID	应用标识	270	271
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	标的证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102
OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01	01
TransactTime	委托时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	空格	空格
Side	买卖方向	1	1
OrdType	订单类别 1 表示市价 2 表示限价	2	2

	U 本方最优		
OrderQty	订单数量	委托数量	委托数量
Price	价格	0.0000	0.0000
DisposalPBU	划入待处置券的交易单元	划入待处置券的交易单元	划入待处置券的交易单元
DisposalAccountID	划入待处置券的证券账户	划入待处置券的证券账户	划入待处置券的证券账户

说明：

1) 订单数量 (OrderQty) 必须大于 0 且为 1 的整数倍。

4.3.1.9 垫券还券

域名	字段描述	垫券申报字段取值	还券申报字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=102801		
ApplID	应用标识	280	281
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	标的证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102
OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01	01
TransactTime	委托时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	空格	空格
Side	买卖方向	1	1
OrdType	订单类别 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优	2	2
OrderQty	订单数量	委托数量	委托数量
Price	价格	0.0000	0.0000
LenderPBU	出借券交易单元	出借券交易单元	出借券交易单元
LenderAccountID	出借券证券账户	出借券证券账户	出借券证券账户

说明：

1) 订单数量（OrderQty）必须大于 0 且为 1 的整数倍。

4.3.1.10 待清偿扣划

域名	字段描述	待清偿扣划客户申报字段取值	待清偿扣划自营申报字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=102901		
ApplID	应用标识	290	291
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	标的证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102
OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01	01
TransactTime	委托时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	空格	空格
Side	买卖方向	1	1
OrdType	订单类别 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优	2	2
OrderQty	订单数量	委托数量	委托数量
Price	价格	0.0000	0.0000
DeductionPBU	用于扣划证券的交易单元	用于扣划证券的交易单元	用于扣划证券的交易单元
DeductionAccountID	用于扣划证券的证券账户	用于扣划证券的证券账户	用于扣划证券的证券账户

说明：

1) 订单数量（OrderQty）必须大于 0 且为 1 的整数倍。

4.3.2 订单响应执行报告

4.3.2.1 期权集中竞价交易

域名	字段描述	取值
Standard Header	消息头 MsgType=200402	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	为空
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0、4 或 8
OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0，则与原始委托数量一致，其它为 0
CumQty	累计执行数量	已成交数量
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码

OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
StopPx	止损价	原始委托的止损价
MinQty	最低成交数量	原始委托的最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数	原始委托的最多成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型	原始委托的订单有效时间类型
PositionEffect	平仓标识 O=开仓 C=平仓	原始委托的平仓标识
CoveredOrUncovered	备兑标签 0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑	原始委托的备兑标签
ContractAccountCode	合约账户标识码	原始委托的合约账户标识码

4.3.2.2 期权集中竞价交易报价状态回报

域名	字段描述	取值
Standard Header	消息头 MsgType=200406	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号	原始委托的客户订单编号
AccountID	证券账户	为空
QuoteReqID	报价请求 ID	原始委托的报价请求 ID
QuoteStatus	报价状态 0=Accepted, 接受	若报价被接受, 则取 0 若报价被拒绝, 则取 5

	5=Rejected, 拒绝	
QuoteRejectReason	拒绝原因代码	拒绝原因代码
QuoteType	报价类型	原始委托的报价类型
BidPx	买报价	原始委托的买报价
OfferPx	卖报价	原始委托的卖报价
BidSize	买数量	原始委托的买数量
OfferSize	卖数量	原始委托的卖数量
BidPositionEffect	买平仓标识 O=开仓 C=平仓	原始委托的买平仓标识
OfferPositionEffect	卖平仓标识 O=开仓 C=平仓	原始委托的卖平仓标识
ContractAccountCode	合约账户标识码	原始委托的合约账户标识码

4.3.2.3 期权组合策略保证金

域名	字段描述	构建组合字段取值	解除组合字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=203422		
PartitionNo	平台分区号	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私	原始委托的用户私

		有信息	有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	全空格	全空格
ExecID	执行编号	交易系统生成的交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ExecType	执行类型	0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝	0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdStatus	订单状态	0 或 8	0 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
CumQty	累计执行数量	0	0
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定	原始委托的订单限定
ContractAccountCode	合约账户标识码	原始委托的合约账户标识码	原始委托的合约账户标识码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号	原始委托的第二交易所订单编号	原始委托的第二交易所订单编号
SecurityType	证券类别	原始委托的证券类别	ExecType 为 0, 则填构建委托的证券类别, 其它无此字段

SecuritySubType		证券子类别	原始委托的证券子类别	ExecType 为 0, 则填构建委托的证券子类别, 其它无此字段
NoLegs		成份合约个数	原始委托的成份合约个数	若 ExecType 为 0, 则填成份合约个数, 其它填 0
→	LegSecurityID	成份合约代码	原始委托的成份合约代码	若 ExecType 为 0, 则填成份合约代码
→	LegSecurityIDSource	成份合约代码源 102=深圳证券交易所	原始委托的成份合约代码源	若 ExecType 为 0, 则填成份合约代码源
→	LegSide	成份合约方向 1=权利仓 (买开) 2=义务仓 (卖开)	原始委托的成份合约方向	若 ExecType 为 0, 则填成份合约方向
→	LegOrderQty	成份合约数量	原始委托的成份合约数量	若 ExecType 为 0, 则填本次解除的成份合约数量

4.3.2.4 期权普通与备兑仓互转

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=203502	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源

OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	空
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0 或 8
OrdStatus	订单状态	0 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0, 则与原始委托数量一致, 其它为 0
CumQty	累计执行数量	0
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
ContractAccountCode	合约账户标识码	原始委托的合约账户标识码

4.3.2.5 期权行权

域名	字段描述	取值
Standard Header	消息头 MsgType=201602	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	空
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0、4 或 8
OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0，则与原始委托数量一致，其它为 0
CumQty	累计执行数量	0
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
ContractAccountCode	合约账户标识码	原始委托的合约账户标识码

4.3.2.6 期权行权指令合并申报

域名	字段描述	取值
Standard Header	消息头 MsgType=201622	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	空
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0、4 或 8
OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0，则与原始委托数量一致，其它为 0
CumQty	累计执行数量	0
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
ContractAccountCode	合约账户标识码	原始委托的合约账户标识码

NoLegs	成份合约个数	原始委托的成份合约个数
→ LegSecurityID	成份合约代码	原始委托的成份合约代码
→ LegSecurityIDSource	成份合约代码源 102=深圳证券交易所	原始委托的成份合约代码源
→ LegOrderQty	成份合约数量	原始委托的成份合约数量

4.3.2.7 保证金查询

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=202586	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
FundPBUID	结算账号	原始委托的结算账号
NoMarginItems	保证金条目个数	保证金条目个数
→ MarginItem	保证金条目类别 1=保证金可用余额 2=保证金总金额 3=预留	1、2、3、4

		4=预留	
→	MarginAmount	保证金金额	保证金金额
Filler1		占位字段	空
Filler2		占位字段	0

说明：

(1) 若保证金查询失败，则 NoMarginItems（保证金条目个数）字段为 0，且不存在 MarginItem、MarginAmount 重复组；若查询成功，则 NoMarginItems（保证金条目个数）字段为 4，MarginItem、MarginAmount 重复组中返回响应的保证金条目类别和保证金总金额，及预留的保证金条目类别 3 和 4（保证金金额为 0）。

4.3.2.8 转处置

域名	字段描述	转处置扣券/还券字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=202702	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	空
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0、4 或 8
OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0，则与原始委托数量

		一致，其它为 0
CumQty	累计执行数量	0
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
DisposalPBU	划入待处置券的交易单元	原始委托的划入待处置券的交易单元
DisposalAccountID	划入待处置券的证券账户	原始委托的划入待处置券的证券账户

4.3.2.9 垫券还券

域名	字段描述	垫券/还券字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=202802	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	空
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号

ExecType	执行类型	0、4 或 8
OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0，则与原始委托数量一致，其它为 0
CumQty	累计执行数量	0
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
LenderPBU	出借券交易单元	原始委托的出借券交易单元
LenderAccountID	出借券证券账户	原始委托的出借券证券账户

4.3.2.10 待清偿扣划

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=202902	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号

OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	空
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0、4 或 8
OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0，则与原始委托数量一致，其它为 0
CumQty	累计执行数量	0
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
DeductionPBU	用于扣划证券的交易单元	原始委托的用于扣划证券的交易单元
DeductionAccountID	用于扣划证券的证券账户	原始委托的用于扣划证券的证券账户

4.3.3 成交执行报告

4.3.3.1 期权集中竞价交易

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=200415	
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
ReportIndex	回报记录号	回报记录号
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码

SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	F
OrdStatus	订单状态	部分成交填 1，完全成交填 2
LastPx	成交价	成交价
LastQty	成交数量	成交数量
LeavesQty	订单剩余数量	原始委托未成交且未撤销的委托数量
CumQty	累计执行数量	原始委托累计成交的数量
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码
PositionEffect	平仓标识 O=开仓 C=平仓	原始委托的平仓标识
CoveredOrUncovered	备兑标签 0=Covered，表示备兑 1=UnCovered，表示非备兑	原始委托的备兑标签
ContractAccountCode	合约账户标识码	原始委托的合约账户标识码

4.3.4 行情接口

4.4 STEP 消息示例

4.4.1 委托申报

下面列举了期权交易类及非交易类业务相关处理消息的示例，示例中不包含消息头和消息尾。

4.4.1.1 期权集中竞价交易

1. 以买开普通申报为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	040
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	90000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100 注：等于结算账号
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38 注：38 代表合约账户标识 码
38	OrderQty	1200.00
44	Price	17.4801
99	StopPx	0
110	MinQty	0
1090	MaxPriceLevels	0
59	TimeInForce	0
77	PositionEffect	O

203	CoveredOrUncovered	1
-----	--------------------	---

STEP 消息如下：

1180=040<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=90000001<SOH>22=102<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<SOH>38=1200.00<SOH>44=17.4801<SOH>99=0<SOH>110=0<SOH>1090=0<SOH>59=0<SOH>77=O<SOH>203=1<SOH>

2. 以买开普通 FOK 限价申报为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	040
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	90000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100 注：等于结算账号
447	PartyIDSource	C

452	PartyRole	38 注：38 代表合约账户标识码
38	OrderQty	1200.00
44	Price	17.4801
99	StopPx	0
110	MinQty	1200.00
1090	MaxPriceLevels	0
59	TimeInForce	3
77	PositionEffect	O
203	CoveredOrUncovered	1

STEP 消息如下：

1180=040<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=90000001<SOH>22=102<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<SOH>38=1200.00<SOH>44=17.4801<SOH>99=0<SOH>110=1200.00<SOH>1090=0<SOH>59=3<SOH>77=O<SOH>203=1<SOH>

4.4.1.2 期权集中竞价交易报价

1. 双边报价（买开卖平）为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	S
1180	ApplID	041
1166	QuoteMsgID	A0000001
522	OwnerType	105
60	TransactTime	20130228-14:42:13:555
537	QuoteType	1
522	OwnerType	105
48	SecurityID	90000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C

452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	000100 注：等于结算账号
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38 注：38 代表合约账户标识码
132	BidPx	10.0000
133	OfferPx	11.0000
134	BidSize	100.00
135	OfferSize	200.00
8909	BidPositionEffect	O
8910	OfferPositionEffect	C

STEP 消息如下：

1180=041<SOH>1166=A0000001<SOH>522=105<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>
>537=1<SOH>48=90000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=
C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=000100<S
OH>132=10.0000<SOH>133=10.0000<SOH>134=100.00<SOH>135=200.00<SOH>8909=
O<SOH>8910=C<SOH>

2. 单边报价更新（买开）为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	S
1180	ApplID	041
1166	QuoteMsgID	A0000001
522	OwnerType	105
60	TransactTime	20130228-14:42:13:555
537	QuoteType	1
522	OwnerType	105
48	SecurityID	90000001

22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	000100 注：等于结算账号
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38 注：38 代表合约账户标识 码
132	BidPx	10.5000
134	BidSize	100.00
8909	BidPositionEffect	O

STEP 消息如下：

1180=041<SOH>1166=A0000001<SOH>522=105<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>
>537=1<SOH>48=90000001<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448=000100<SOH>447=
C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=000100<S
OH>132=10.0000<SOH>134=100.00<SOH>8909=O<SOH>

4.4.1.3 期权组合策略保证金

1. 以认购牛市价差策略（CNSJC）构建组合申报为例，其中两个成份合约的标的证券代码都为 159901：

Tag	域名	取值
	MsgType	AB
1180	ApplID	340
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1

60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	159901
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38
555	NoLegs	2
602	LegSecurityID	90000001
603	LegSecurityIDSource	102
624	LegSide	1
685	LegOrderQty	4.00
602	LegSecurityID	90000002
603	LegSecurityIDSource	102
624	LegSide	2
685	LegOrderQty	4.00
167	SecurityType	MLEG
762	SecuritySubType	CNSJC
38	OrderQty	4.00

STEP 消息如下：

1180=340<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=159901<SOH>22=102<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<S

OH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<SOH>555=2<SOH>602=90000001<SOH>603=102<SOH>624=1<SOH>685=4.00<SOH>602=90000002<SOH>624=2<SOH>685=4.00<SOH>167=MLEG<SOH>762=CNSJC<SOH>38=4.00<SOH>

2. 以认购牛市价差策略（CNSJC）解除组合申报为例，其中两个成份合约的标的证券代码都为 159901：

Tag	域名	取值
	MsgType	AB
1180	ApplID	341
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	159901
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38
38	OrderQty	3.00
198	SecondaryOrderID	6B4569CDNB009C03

STEP 消息如下：

1180=341<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130
228-14:42:13:555<SOH>48=159901<SOH>22=102<SOH>453=4<SOH>448=000100<S
OH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>44
8=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<
SOH>38=3.00<SOH>198=6B4569CDNB009C03<SOH>

4.4.1.4 期权普通与备兑仓互转

1. 期权普通转备兑仓申报：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	350
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	90000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100 注：等于结算账号
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38

		注：38 代表合约账户标识码
38	OrderQty	1200.00

STEP 消息如下：

1180=350<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=90000001<SOH>22=102<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<SOH>38=1200.00<SOH>

2. 期权备兑转普通仓申报：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	351
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	90000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100 注：等于结算账号

447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38 注：38 代表合约账户标识码
38	OrderQty	1200.00

STEP 消息如下：

1180=351<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=90000001<SOH>22=102<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<SOH>38=1200.00<SOH>

4.4.1.5 期权行权

以买方认购行权申报为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	160
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	90000001
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D

452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38
38	OrderQty	1200.00

STEP 消息如下：

1180=160<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=90000001<SOH>22=102<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<SOH>38=1200.00<SOH>

4.4.1.6 期权行权指令合并申报

以标的证券都为 159901 行权指令合并申报为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	AB
1180	ApplID	161
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	159901
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	4
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D

452	PartyRole	4001
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38
38	OrderQty	1200.00
555	NoLegs	2
602	LegSecurityID	90000001
603	LegSecurityIDSource	102
602	LegSecurityID	90000002
603	LegSecurityIDSource	102

STEP 消息如下：

1180=161<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=159901<SOH>22=102<SOH>453=4<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<SOH>38=1200.00<SOH>555=2<SOH>602=90000001<SOH>603=102<SOH>602=90000002<SOH>

4.4.1.7 保证金查询

Tag	域名	取值
	MsgType	U008
1180	ApplID	250
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
11	ClOrdID	A0000001
453	NoPartyIDs	2
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	38

STEP 消息如下：

1180=250<SOH>60=20130228-14:42:13:565<SOH>11=A0000001<SOH>453=2<SOH>448
=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=38<SO
H>

4.4.1.8 转处置

以转处置扣券为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	270
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	159901
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	5
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000101
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	17
448	PartyID	0100004699
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	39

38	OrderQty	1200.00
----	----------	---------

STEP 消息如下：

1180=270<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=159901<SOH>22=102<SOH>453=5<SOH>448=000100<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000101<SOH>447=C<SOH>452=17<SOH>448=0100004699<SOH>447=5<SOH>452=39<SOH>38=1200.00<SOH>

4.4.1.9 垫券还券

以垫券为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	280
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	159901
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	5
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
448	PartyID	000101
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	17

448	PartyID	0100004699
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	39
38	OrderQty	1200.00

STEP 消息如下：

1180=280<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=20130228-14:42:13:555<SOH>48=159901<SOH>22=102<SOH>453=5<SOH>448=000100<SOH>47=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000101<SOH>447=C<SOH>452=17<SOH>448=0100004699<SOH>447=5<SOH>452=39<SOH>38=1200.00<SOH>

4.4.1.10 待清偿扣划

以待清偿扣划为例：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	290
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	1
522	OwnerType	1
60	TransacTime	20130228-14:42:13:555
48	SecurityID	159901
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	5
448	PartyID	000100
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0100004698
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	AA
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001

448	PartyID	000101
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	17
448	PartyID	0100004699
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	39
38	OrderQty	1200.00

STEP 消息如下：

1180=290<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=1<SOH>522=1<SOH>60=2013022
8-14:42:13:555<SOH>48=159901<SOH>22=102<SOH>453=5<SOH>448=000100<SOH>4
47=C<SOH>452=1<SOH>448=0100004698<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<S
OH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=000101<SOH>447=C<SOH>452=17<SOH>448=
0100004699<SOH>447=5<SOH>452=39<SOH>38=1200.00<SOH>

4.4.2 行情

4.4.2.1 集中竞价行情快照

集中竞价 Level II 行情快照消息，示例中买卖盘信息共有五档，卖三档，买两档，其中在买卖最优档上揭示前 10 笔委托的数量。股票期权快照行情还包括结算价和持仓量。

Tag	域名	取值
	MsgType	W
10201	ChannelNo	1051
95	RawDataLength	
96	RawData	

Tag	域名	取值
999	TemplateID	4001
42	OrigTime	20140126-10:30:05:335
10201	ChannelNo	1051
1500	MDStreamID	010
48	SecurityID	90000001
22	SecurityIDSource	102

8538	TradingPhaseCode	T0
140	PrevClosePx	17.4600
8503	NumTrades	478
387	TotalVolumeTrade	24689.00
8504	TotalValueTrade	405783.6700
268	NoMDEntries	15
269	MDEntryType	2
270	MDEntryPx	17.490000
269	MDEntryType	4
270	MDEntryPx	18.120000
269	MDEntryType	7
270	MDEntryPx	18.130000
269	MDEntryType	8
270	MDEntryPx	17.200000
269	MDEntryType	x1
270	MDEntryPx	0.030000
269	MDEntryType	x2
270	MDEntryPx	-0.010000
269	MDEntryType	x3
270	MDEntryPx	17.450000
271	MDEntrySize	369801.00
269	MDEntryType	x4
270	MDEntryPx	17.460000
271	MDEntrySize	14689.00
269	MDEntryType	x5
270	MDEntryPx	15.950000
269	MDEntryType	x6
270	MDEntryPx	16.120000
269	MDEntryType	1
270	MDEntryPx	18.460000
271	MDEntrySize	2340.00
1023	MDPriceLevel	3
346	NumberOfOrders	56

73	NoOrders	0
269	MDEntryType	1
270	MDEntryPx	18.450000
271	MDEntrySize	1340.00
1023	MDPriceLevel	2
346	NumberOfOrders	71
73	NoOrders	0
269	MDEntryType	1
270	MDEntryPx	18.420000
271	MDEntrySize	1350.00
1023	MDPriceLevel	1
346	NumberOfOrders	16
73	NoOrders	10
38	OrderQty	10.00
38	OrderQty	10.00
38	OrderQty	20.00
38	OrderQty	10.00
38	OrderQty	13.00
38	OrderQty	17.00
38	OrderQty	103.00
38	OrderQty	21.00
38	OrderQty	16.00
38	OrderQty	11.00
269	MDEntryType	0
270	MDEntryPx	18.400000
271	MDEntrySize	27500.00
1023	MDPriceLevel	1
346	NumberOfOrders	23
73	NoOrders	10
38	OrderQty	100.00
38	OrderQty	100.00
38	OrderQty	200.00
38	OrderQty	100.00

38	OrderQty	130.00
38	OrderQty	170.00
38	OrderQty	100.00
38	OrderQty	200.00
38	OrderQty	160.00
38	OrderQty	110.00
269	MDEntryType	0
270	MDEntryPx	18.390000
271	MDEntrySize	17500.00
1023	MDPriceLevel	2
346	NumberOfOrders	53
73	NoOrders	0
269	MDEntryType	6
270	MDEntryPx	18.390000
271	MDEntrySize	0
1023	MDPriceLevel	0
346	NumberOfOrders	0
269	MDEntryType	xg
270	MDEntryPx	0
271	MDEntrySize	17500
1023	MDPriceLevel	0
346	NumberOfOrders	0

STEP 消息如下：

999=4001<SOH>42=20140126-10:30:05:335<SOH>10201=1051<SOH>1500=010<SOH>48=90000001
 <SOH>22=102<SOH>8538=T0<SOH>140=17.4600<SOH>8503=478<SOH>387=24689.00<SOH>8504
 =405783.6700<SOH>268=15<SOH>269=2<SOH>270=17.490000<SOH>269=4<SOH>270=18.120000<
 SOH>269=7<SOH>270=18.130000<SOH>269=8<SOH>270=17.200000<SOH>269=x1<SOH>270=0.03
 0000<SOH>269=x2<SOH>270=-0.010000<SOH>269=x3<SOH>270=17.450000<SOH>271=369801.00
 <SOH>269=x4<SOH>270=17.460000<SOH>271=14689.00<SOH>269=x5<SOH>270=15.950000<SOH
 >269=x6<SOH>270=16.120000<SOH>269=1<SOH>270=18.460000<SOH>271=2340.00<SOH>1023=3
 <SOH>346=56<SOH>73=0<SOH>269=1<SOH>270=18.450000<SOH>271=1340.00<SOH>1023=2<S
 OH>346=71<SOH>73=0<SOH>269=1<SOH>270=18.420000<SOH>271=1350.00<SOH>1023=1<SOH
 >346=16<SOH>73=10<SOH>38=10.00<SOH>38=10.00<SOH>38=20.00<SOH>38=10.00<SOH>38=13

.00<SOH>38=17.00<SOH>38=103.00<SOH>38=21.00<SOH>38=16.00<SOH>38=11.00<SOH>269=0<SOH>270=18.400000<SOH>271=27500.00<SOH>1023=1<SOH>346=23<SOH>73=10<SOH>38=100.00<SOH>38=100.00<SOH>38=200.00<SOH>38=100.00<SOH>38=130.00<SOH>38=170.00<SOH>38=100.00<SOH>38=200.00<SOH>38=160.00<SOH>38=110.00<SOH>269=0<SOH>270=18.390000<SOH>271=17500.00<SOH>1023=2<SOH>346=53<SOH>73=0<SOH>269=6<SOH>270=18.390000<SOH>271=0<SOH>1023=0<SOH>346=0<SOH>269=6<SOH>270=0<SOH>271=17500<SOH>1023=0<SOH>346=0<SOH>

4.5 Binary 消息示例

下面的 Binary 消息示例和上面的 STEP 消息示例一一对应。

4.5.1 委托申报

4.5.1.1 期权集中竞价交易

1. 以买开普通申报为例：

域名	取值
MsgType	100401
ApplID	040
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	17.4800
StopPx	0
MinQty	0

MaxPriceLevels	0
TimeInForce	0
PositionEffect	O
CoveredOrUncovered	1
ContractAccoutCode	000100

2. 以买开普通 FOK 限价申报为例：

域名	取值
MsgType	100401
ApplID	040
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	17.4800
StopPx	0
MinQty	1200.00
MaxPriceLevels	0
TimeInForce	3
PositionEffect	O
CoveredOrUncovered	1
ContractAccoutCode	000100

4.5.1.2 期权集中竞价交易报价

1. 双边报价（买开卖平）为例：

域名	取值
MsgType	100401
ApplID	041
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	105
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
QuoteMsgID	A0000001
AccountID	0100004698
QuoteReqID	全空格
QuoteType	1
BidPx	10.0000
OfferPx	11.0000
BidSize	100.00
OfferSize	200.00
BidPositionEffect	O
OfferPositionEffect	C
ContractAccountCode	000100

2. 单边报价更新（买开）为例：

域名	取值
MsgType	100401
ApplID	041
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	105
ClearingFirm	01

TransactTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
QuoteMsgID	A0000001
AccountID	0100004698
QuoteReqID	全空格
QuoteType	1
BidPx	10.5000
OfferPx	0.0000
BidSize	100.00
OfferSize	0.0000
BidPositionEffect	O
OfferPositionEffect	空格
ContractAccountCode	000100

4.5.1.3 期权组合策略保证金

1. 以认购牛市价差策略（CNSJC）构建组合申报为例，其中两个成份合约的标的证券代码都为 159901：

域名	取值
MsgType	103421
ApplID	340
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159901
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1

OrdType	2
OrderQty	4.00
Price	0.0000
ContractAccountCode	000100
SecondaryOrderID	全空格
SecurityType	MLEG
SecuritySubType	CNSJC
NoLegs	2
LegSecurityID	90000001
LegSecurityIDSource	102
LegSide	1
LegOrderQty	4.00
LegSecurityID	90000002
LegSecurityIDSource	102
LegSide	2
LegOrderQty	4.00

2. 认购牛市价差策略（CNSJC）解除组合申报为例，其中两个成份合约的标的证券代码都为 159901：

域名	取值
MsgType	103421
ApplID	341
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159901
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格

Side	1
OrdType	2
OrderQty	3.00
Price	0.0000
ContractAccountCode	000100
SecondaryOrderID	6B4569CDNB009C03
SecurityType	全空格
SecuritySubType	全空格
NoLegs	0

4.5.1.4 期权普通与备兑仓互转

1. 期权普通转备兑仓申报:

域名	取值
MsgType	100351
ApplID	350
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	900000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A00000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	0.0000
ContractAccoutCode	000100

2. 期权备兑转普通仓申报:

域名	取值
MsgType	100351
ApplID	351
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	0.0000
ContractAccoutCode	000100

4.5.1.5 期权行权

以买方认购行权申报为例:

域名	取值
MsgType	101601
ApplID	160
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	90000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格

ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00

4.5.1.6 期权行权指令合并申报

以标的证券都为 159901 行权指令合并申报为例：

域名	取值
MsgType	101621
ApplID	161
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159901
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	0.0000
ContractAccountCode	000100
NoLegs	2
LegSecurityID	90000001
LegSecurityIDSource	102
LegOrderQty	1200.00

LegSecurityID	90000002
LegSecurityIDSource	102
LegOrderQty	1200.00

4.5.1.7 保证金查询

域名	取值
MsgType	102587
ApplID	250
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	全空格
SecurityIDSource	全空格
OwnerType	0
ClearingFirm	全空格
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
FundPBUID	000100

4.5.1.8 转处置

以转处置扣券为例：

域名	取值
MsgType	102701
ApplID	270
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159901
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001

AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	0.0000
DisposalPBU	000101
DisposalAccountID	0100004699

4.5.1.9 垫券还券

以垫券为例：

域名	取值
MsgType	102801
ApplID	280
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159901
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	0.0000
LenderPBU	000101
LenderAccountID	0100004699

4.5.1.10 待清偿扣划

以待清偿扣划为例：

域名	取值
MsgType	102901
ApplID	290
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	159901
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransacTime	20130228-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0100004698
BranchID	AA
OrderRestrictions	全空格
Side	1
OrdType	2
OrderQty	1200.00
Price	0.0000
DeductionPBU	000101
DeductionAccountID	0100004699

4.5.2 行情

4.5.2.1 集中竞价行情快照

集中竞价 Level II 行情快照消息，示例中共买卖盘信息共用五档，卖三档，买两档，其中在买卖最优档上揭示前 10 笔委托的数量。股票期权快照行情还包括结算价和持仓量。

域名	取值
MsgType	300111
OrigTime	20140126-10:30:05:335
ChannelNo	1051
MDStreamID	040
SecurityID	90000001

SecurityIDSource	102
TradingPhaseCode	T0
PrevClosePx	17.4600
NumTrades	478
TotalVolumeTrade	24689.00
TotalValueTrade	405783.6700
NoMDEntries	15
MDEntryType	2
MDEntryPx	17.490000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	4
MDEntryPx	18.120000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	7
MDEntryPx	18.130000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	8
MDEntryPx	17.200000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x1
MDEntryPx	0.030000

MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x2
MDEntryPx	-0.010000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x3
MDEntryPx	17.450000
MDEntrySize	369801.00
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x4
MDEntryPx	17.460000
MDEntrySize	14689.00
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x5
MDEntryPx	15.950000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
NoOrders	0
MDEntryType	x6
MDEntryPx	16.120000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0

NoOrders	0
MDEntryType	1
MDEntryPx	18.460000
MDEntrySize	2340.00
MDPriceLevel	3
NumberOfOrders	56
NoOrders	0
MDEntryType	1
MDEntryPx	18.450000
MDEntrySize	1340.00
MDPriceLevel	2
NumberOfOrders	71
NoOrders	0
MDEntryType	1
MDEntryPx	18.420000
MDEntrySize	1350.00
MDPriceLevel	1
NumberOfOrders	16
NoOrders	10
OrderQty	10.00
OrderQty	10.00
OrderQty	20.00
OrderQty	10.00
OrderQty	13.00
OrderQty	17.00
OrderQty	103.00
OrderQty	21.00
OrderQty	16.00
OrderQty	11.00
MDEntryType	0
MDEntryPx	18.400000
MDEntrySize	27500.00
MDPriceLevel	1

NumberOfOrders	23
NoOrders	10
OrderQty	100.00
OrderQty	100.00
OrderQty	200.00
OrderQty	100.00
OrderQty	130.00
OrderQty	170.00
OrderQty	100.00
OrderQty	200.00
OrderQty	160.00
OrderQty	110.00
MDEntryType	0
MDEntryPx	18.390000
MDEntrySize	17500.00
MDPriceLevel	2
NumberOfOrders	53
NoOrders	0
MDEntryType	6
MDEntryPx	18.390000
MDEntrySize	0
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0
MDEntryType	xg
MDEntryPx	0
MDEntrySize	17500
MDPriceLevel	0
NumberOfOrders	0

五、 参考文档

- 《深圳证券交易所第五版交易系统接口规范开发指南》
- 《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》
- 《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》
- 《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》
- 《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》
- 《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》
- 《深圳证券交易所股票期权模拟交易业务方案》
- 《深市股票期权模拟交易结算方案》
- 《深市股票期权结算数据接口规范》
- 《深市登记结算数据接口规范涉及股票期权业务技术系统变更指南》
- 《结算参与者资金实时交收数据接口规范》
- 《结算银行资金实时交收数据接口规范》