



深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

深圳证券交易所债券现券交易业务之 券商技术系统变更指南 (Ver1.04)



深圳证券交易所
中国结算深圳分公司
二〇二二年一月

关于本文档

文档名称		深圳证券交易所债券现券交易业务之券商技术系统变更指南	
说明			
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2021-04-30	1.00	创建文档	
2021-06-03	1.01	修改文件	询价请求STEP接口RootParties使用子组件RootSubParties
2021-08-10	1.02	修改文件	1、增加变更范围汇总说明； 2、增加债券计价方式调整说明； 3、协商成交启用交易接口“约定号”（ConfirmID）字段； 4、点击成交报价委托的“备注”（Memo）字段必须为全空格； 5、补充关于交易网关、行情网关升级的说明。
2021-10-13	1.03	修改文件	1、交易参考信息新增“债券现券竞买预约信息”文件； 2、新增竞买成交交易接口内容； 3、新增竞买成交逐笔行情消息类型； 4、新增清算交收关于竞买成交的内容； 5、新增债券现券竞买成交业务的自动撤单原因； 6、修改网关版本升级相关说明。
2022-01-19	1.04	修改文件	（本文档中橙色修订部分） 1、修改交易接口关于竞买成交主动撤单接口的内容。

目录

一、	说明.....	1
二、	变更范围汇总.....	1
三、	债券现券交易业务简介.....	2
四、	技术实现概况.....	4
4.1	新增债券现券交易业务	4
4.2	债券相关业务迁移到固定收益交易平台	5
4.3	债券相关成交量统计指标调整	6
4.4	债券计价方式调整	7
五、	交易参考信息.....	8
六、	交易接口.....	9
6.1	匹配成交	12
6.2	协商成交	15
6.3	点击成交	23
6.4	询价成交	35
6.5	竞买成交	53
七、	行情接口.....	67
八、	清算和交收.....	68
8.1	债券现券交易的结算处理	68
8.2	债券相关业务迁移到固定收益交易平台的结算处理.....	73
8.3	资产支持证券（证券类别为“1Z”）拆分为三类证券子类.....	75
8.4	第3批预清算数据内容调整	75
九、	开展债券现券交易的券商系统注意事项.....	75
9.1	委托相关说明	75
9.2	关于客户委托服务渠道	75
9.3	关于券商柜台系统	75
9.4	关于 STEP 交易接口通信版本号修改	76
十、	联系方式.....	76
附件一、	债券现券交易业务的交易数据接口修订说明	77

深圳证券交易所债券现券交易业务之券商技术系统 变更指南

一、 说明

为了会员和其他交易参与人在深圳证券交易所（以下简称“本所”）交易系统上更好地开展债券现券交易业务，本所会同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”）专门编制和发布本指南，供相关交易参与人及其 IT 提供商参考。

本所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时尽量减少系统改造对会员和其他交易参与人带来的影响。

特别提示：如果业务规则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。

二、 变更范围汇总

1、新增债券现券交易业务

固定收益交易平台新增债券现券交易业务，具体实施细节参见 4.1 节。

2、部分业务迁移至固定收益交易平台

债券通用质押式回购、债券分销、债券通用质押式回购质押解押、债券质押式三方回购交易及债券质押式三方回购出入库业务从原平台迁移至固定收益交易平台，具体实施细节参见 4.2 节。

3、债券全价改净价

部分债券计价方式由全价改为净价，对于存量债券，将进行一次性切换，具体上线时间以后续业务及技术通知为准，具体实施细节参见 4.4 节。

4、部分债券指数行情发布时间调整

债券现券交易业务交易时间延长至 15:30 之后，部分债券指数的行情发布时间延长至 15:30，具体包括：399301（深信用债）、399302（深公司债）、399298（深信中高）、399299（深信中低）、399481（企债指数）、399290（深转交债）。

5、交易网关升级

使用 BINARY 协议的用户,交易网关和 BINARY 协议通信版本号均无须升级。

使用 STEP 协议开展债券现券交易业务的用户,应将交易网关升级到 20210730 版本(待发布),STEP 协议通信版本号请以全网测试通知为准。

未开展债券现券交易业务的用户,交易网关和 STEP 交易接口通信版本号均无须升级。

6、行情网关升级

使用 BINARY 协议的用户,行情网关和 BINARY 协议通信版本号均无须升级。

使用 STEP 协议接收债券现券交易业务行情的用户,STEP 协议通信版本号请以全网测试通知为准,行情网关无须升级。

不接收债券现券交易业务行情的用户,行情网关和 STEP 行情接口通信版本号均无须升级。

三、 债券现券交易业务简介

债券现券交易支持五种交易方式:匹配成交、协商成交、点击成交、询价成交、竞买成交。通用质押式回购仅支持匹配成交。

1、匹配成交

匹配成交是指交易系统按价格优先、时间优先的原则和本规则相关规定,对债券交易申报自动匹配成交的交易方式。匹配成交采用集合匹配和连续匹配两种方式。集合匹配是对规定时间内接受的交易申报一次性集中匹配的成交方式。连续匹配是对接受的交易申报逐笔连续匹配的成交方式。

每个交易日的 9:15 至 9:25 为开盘集合匹配时间,9:30 至 11:30、13:00 至 15:30 为连续匹配时间。

2、协商成交

协商成交是指债券投资者之间通过协商等方式达成债券交易意向,并向交易

系统申报，经交易系统确认成交的交易方式。交易一方将协商一致的交易要素通过交易系统发送给交易对手方，经交易对手方确认后，由交易系统确认成交。

协商成交的交易时间为：每个交易日的 9:00 至 11:30、13:00 至 15:30。

3、点击成交

点击成交是指报价方发出报价，受价方点击该报价后由交易系统确认成交或者依据本规则相关规定通过交易系统自动匹配成交的交易方式。采用点击成交方式的，报价的发送范围可以是全市场，也可以是报价方自行选定的部分债券投资者。

点击成交的交易时间为：每个交易日的 9:00 至 11:30、13:00 至 15:30。

4、询价成交

询价成交是指债券投资者作为询价方向做市商或者其他债券交易参与人发送询价请求，并选择一个或者多个询价回复确认成交的交易方式。

询价方可以向做市商或者其他债券交易参与人发送询价请求，被询价方根据询价请求要素，按照询价请求交易方向的相反方向，对询价请求进行回复。询价方选择一笔或多笔询价回复并确认后，交易系统对这些委托进行成交。

询价成交的交易时间为：每个交易日的 9:00 至 11:30、13:00 至 15:30。

5、竞买成交

竞买成交是指卖方在限定的时间内按照确定的竞买成交规则，将债券出售给最优应价的单个或者多个应价方的交易方式。

竞买成交可以采用单一主体中标、多主体中标等方式。采用单一主体中标方式的，由最优出价的应价方按其应价价格、该笔竞买的全部申报数量成交。多主体中标方式包括单一价格中标、多重价格中标等方式。采用单一价格中标方式的，所有中标的应价申报都以边际价格成交。采用多重价格中标方式的，所有中标的应价申报都以其各自的应价价格成交。

每个交易日的 9:00 至 11:30,13:00 至 15:30 为卖方提交竞买预约申报时间；每

个交易日的 9:00 至 10:00 为卖方提交竞买发起申报时间；10:00 至 11:30 为应价方提交应价申报时间。

四、 技术实现概况

4.1 新增债券现券交易业务

在固定收益交易平台新增债券现券交易业务（业务类别‘41’），债券现券交易业务为除可转债及定向可转债之外的其他债券、资产支持证券等产品提供交易服务，具体如下表所示。债券现券交易业务对于除匹配成交之外的其他交易方式，都使用债券交易账户体系进行交易（债券交易账户体系相关内容请参照《深圳证券交易所债券交易账户信息报备业务指南》，深圳证券交易所官网（<http://www.szse.cn>）内搜索“深圳证券交易所债券交易账户信息报备业务指南”即可）。

序号	类别名称	类别代码	是否适用债券现券交易业务
1	国债（含地方债）	5	是
2	企业债	6	是
3	公司债	7	是
4	可转债	8	否
5	私募债	9	是
6	可交换私募债	10	是
7	证券公司次级债	11	是
8	资产支持证券	13	是
9	证券公司短期债	34	是
10	可交换公司债	35	是
11	定向可转债	39	否

现货集中竞价交易业务（业务类别‘01’）、协议交易业务（业务类别‘05’）、盘后定价大宗交易业务（业务类别‘06’）将不再为上表中除可转债及定向可转债之外相关类别证券提供交易服务。

新债券现券交易业务的业务类别为‘41’。

新债券现券交易业务的行情通过以下频道发布：

- 107x：债券交易快照行情
- 207x：匹配交易逐笔行情
- 4011：报价及大额逐笔等行情

可转债的现货集中竞价交易快照、逐笔行情仍通过现有 103x、203x 债券行情频道发布。

4.2 债券相关业务迁移到固定收益交易平台

以下业务迁移到固定收益交易平台：

业务	类别代码	原所属平台	备注
债券通用质押式回购	02	综合金融服务平台	1、行情发布频道仍为 106x、206x； 2、行情快照 Binary 消息类型改为：300211； 3、交易参考信息从 cashauctionparams 改为 bondrepoparams 文件发布； 4、业务名称变更为：债券通用质押式回购
债券分销	03	现货集中竞价交易平台	1、行情发布频道改为 3021 2、行情快照 Binary

			消息类型改为： 300211
债券通用质押式 回购质押解押	19	非交易处理平台	更名为：债券通用质 押式回购质押解押
债券质押式三方 回购交易	32	综合金融服务平台	
债券质押式三方 回购出入库	33	综合金融服务平台	

4.3 债券相关成交量统计指标调整

对债券相关的成交量统计指标进行如下调整：

1、停止发布证券代码为 395021（可转债）、395022（企业债）、395024（公司债）、395031（国债）成交量统计指标。

2、增加发布 395033 成交量统计指标，证券简称为“债券现货”，英文简称“CASH BOND TRANSACTION”，其统计口径为除 ABS、债券回购之外的债券在各种交易方式上的成交量。

3、增加发布 395034 成交量统计指标，证券简称和英文简称为“ABS”，其统计口径为资产支持证券在各种交易方式上的成交量。

4、395032（债券回购）、395033（债券现货）、395034（ABS）债券成交量统计指标计算发布时间为 9:00-11:30,13:00-15:30。

调整后，成交量统计指标总体定义如下表所示：

序号	证券代码	证券简称	英文简称	统计口径
1	395001	主板 A 股	MB A SHARES	主板 A 股竞价交易成交量
2	395002	主板 B 股	MB B SHARES	主板 B 股竞价交易成交量
3	395004	创业板	CHINEXT SHARES	创业板股票竞价交易成交量
4	395005	主板 D R	MB DEPOSITORY RECEIPTS	主板存托凭证竞价交易成交量
5	395006	创业板 DR	CHINEXT DEPOSITORY	创业板存托凭证竞价交易成交量

			RECEIPTS	
6	395011	封闭基金	CLOSE-END FUNDS	封闭式基金竞价交易成交量
7	395012	LOFs	OPEN-END FUNDS	LOF 竞价交易成交量
8	395013	ETFs	EXCHANGE-TRADED FUND	ETF 竞价交易成交量
9	395015	REITS	REITS	基础设施基金竞价交易成交量
10*	395032	债券回购	BOND REPURCHASES	债券通用质押式回购匹配成交方式成交量
11*	395033	债券现货	CASH BOND TRANSACTION	除 ABS、债券回购之外的债券在各种交易方式上的成交量
12*	395034	ABS	ABS	资产支持证券在各种交易方式上的成交量
13	395041	股票权证	STOCK WARRANTS	股票权证竞价交易成交量
14	395099	总成交	MARKET TURNOVER	主板 A 股、主板 B 股、创业板股票、主板存托凭证和创业板存托凭证竞价交易成交量

4.4 债券计价方式调整

部分债券计价方式由全价改为净价如下表所示，深交所每日下发的证券信息（securities）文件将发布每只债券的计价方式（PricingMethod）。对于存量债券，当计价方式调整时，深交所将调整债券的收盘价。假定 T 日为计价方式调整日，深交所 T-1 日晚间下发的证券信息文件(pre_securities)及 T 日开市前早间下发的证券信息文件（securities）中昨日收盘价为调整之后的收盘价。

序号	类别名称	类别代码	调整前计价方式	调整后计价方式
1	国债（含地方债）	5	净价	净价

2	企业债	6	净价	净价
3	公司债	7	净价	净价
4	可转债	8	全价	全价
5	私募债	9	全价	净价
6	可交换私募债	10	全价	净价
7	证券公司次级债	11	全价	净价
8	资产支持证券	13	全价	净价（优先级、次 优级） 全价（次级）
9	证券公司短期债	34	净价（公开发行） 全价（非公开发 行）	净价
10	可交换公司债	35	全价	净价
11	定向可转债	39	全价	全价

注：对于处于特定债券转让状态的债券或资产支持证券，其计价方式仍为全价。

五、 交易参考信息

证券信息（securities）文件的债券特有字段 BondParams 新增“计价方式”字段，资产支持证券特有字段 ReitsParams 新增“计价方式”、“预期收益率”、“每张资产支持证券应计利息”、“发行起息日或本次付息起息日”四个字段。

新增债券现券交易业务参考信息（bondtradingparams）文件用于发布债券现券交易业务相关交易参数信息。

新增债券通用质押式回购业务参考信息（bondrepoparams）文件用于发布债券通用质押式回购业务相关交易参数信息。

新增债券现券竞买预约信息（bondtradingbidbookinginfo）文件用于发布在途的债券现券竞买预约信息。

各债券及资产支持证券通过交易参考信息发布情况如下表所示：

序号	类别名称	类别 代码	现货集中竞价 交易业务参考 信息	盘后定价大宗 交易业务参考 信息	协议交易业务 参考信息	债券现券交易 业务参考信息
1	国债（含地方债）	5				√
2	企业债	6				√
3	公司债	7				√
4	可转债	8	√	√	√	
5	私募债	9				√
6	可交换私募债	10				√
7	证券公司次级债	11				√
8	资产支持证券	13				√
9	证券公司短期债	34				√
10	可交换公司债	35				√
11	定向可转债	39			√	

上述内容详见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》。

六、 交易接口

本次变更支持债券现券交易业务的匹配成交、协商成交、点击成交、询价成交以及竞买成交交易方式，各种交易方式的申报方式说明如下表所示，详细内容请参见《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》、《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》。

交易方式	委托申报类型	申报消息类型 (MsgType)		应用标识 ApplID
		STEP	Binary	

匹配成交	新订单	D	104101	410
协商成交	成交申报	AE	104103	411
点击成交	报价	S	104105	412
	报价回复	AJ	104110	413
询价成交	询价请求	AR	104117	414
	报价	S	104105	415
	报价回复	AJ	104110	416
竞买成交	竞买预约申报	D	104128	417
	竞买发起申报			
	应价申报			

对于点击成交方式，目前报价范围仅支持全市场，暂不支持全额成交设置、分次显示与成交设置以及修改报价和数量。点击成交的委托回报消息处理流程请参考《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》“点击成交报价处理消息流程图”一节或《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》“点击成交报价处理消息流程图”一节。

对于询价成交方式，本次变更暂不支持意向申报。询价成交的委托回报消息处理流程请参考《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》“询价处理消息流程图”一节或《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》“询价处理消息流程图”一节。

对于协商成交方式，本次变更暂不支持合并申报。协商成交采用成交请求申报模式，消息处理流程请参考《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》“成交请求申报模式 (one party report for pass through)”一节或《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》“成交请求申报模式 (one party report for pass through)”一节。

竞买成交方式消息处理流程请参考《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》“新订单处理消息流程图”一节或《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》“新订单处理消息流程图”一节。具体消息流程场景请参考本指南“6.4 竞买成交”

章节。

对于协商成交、点击成交、询价成交、竞买成交方式，委托报文中结算方式 (SettlType)、结算周期 (SettlPeriod) 字段必须填写，如果证券支持匹配成交，结算方式取值固定为 103(净额结算)，否则取值为 104(逐笔全额)。若结算方式为 103，则结算周期取值固定为 1，否则填 0。证券是否支持匹配成交的信息可从债券现券交易业务参考信息 (bondtradingparams) 文件中获取，文件定义详见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》。

对于点击成交、询价成交使用的报价及报价回复报文，以及询价成交使用的询价请求，这些报文都定义了几个 ID，其中一个 ID 为客户订单编号，另一个 ID 为业务使用 ID (如撤单使用)。同一个交易单元申报的同一个业务下的客户订单编号必须唯一，否则为重单 (拒绝原因代码为：20099)。同一个交易单元申报的同一个业务下的业务层 ID 必须唯一，否则被交易系统拒绝 (拒绝原因代码为：20147)，各申报业务层的 ID 包括：QuoteReqID、QuoteID 及 QuoteRespID。各报文使用规则如下表所示：

各类 ID 委托	QuoteReqID	QuoteID	QuoteRespID	QuoteMsgID	ClOrdID
询价申报 (10xx17)	询价 ID				客户订单 编号
报价申报 (10xx05)		报价 ID		客户订单编号	
报价回复申报 (10xx10)		报价 ID	报价回复 ID		客户订单 编号

注：

- 1) 对于询价撤销申报，QuoteReqID 必须为原询价请求申报的 QuoteReqID；
- 2) 对于报价撤销申报，QuoteID 必须为原报价申报的 QuoteID；
- 3) 对于报价回复申报，当为询价成交时，QuoteID 填写的为接受报价的转

发报价的 QuoteID；当为点击成交时，QuoteID 填写的为逐笔行情中的 QuoteID。

6.1 匹配成交

6.1.1 Binary 接口委托申报

表 5-1 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104101	
ApplID	应用标识	410
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	2
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	0
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数	0
TimeInForce	订单有效时间类型	0
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓	1、2 或 3

说明：

(1) 债券现券交易暂不支持市价委托，OrdType 必须填 2，MinQty 必须填 0，MaxPriceLevels 必须填 0，TimeInForce 必须填 0。

6.1.2 STEP 接口委托申报

表 5-2 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=D	
1180	ApplID	应用标识	410
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 或 2
522	OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型
529	OrderRestrictions	订单限定	不填

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	3
→	448	PartyID	申报交易单元
	447	PartyIDSource	C: 通用市场参与者标识
	452	PartyRole	1: 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	投资者所在营业部识别码
	447	PartyIDSource	D: 自定义代码
	452	PartyRole	4001: 营业部代码
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
152	CashOrderQty	订单金额	不填
38	OrderQty	订单数量	委托数量
组件结束			
44	Price	价格	委托价格
99	StopPx	止损价, 预留	不填

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
1090	MaxPriceLevels	最多成交价位数	不填
110	MinQty	最低成交数量 缺省值为 0	不填
544	CashMargin	融资融券信用标识	1、2 或 3

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.2 协商成交

6.2.1 Binary 接口委托申报

表 5-3 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	发起方成交请求 字段取值	接收方成交请求 字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104103		
ApplID	应用标识	411	411
SubmittingPBUID	申报交易单元，需与本方 交易单元一致	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 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	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	成交申报发起时间	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
TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号

TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	2 或 3
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	若为普通申报, 填 0; 若为主动撤单, 填 1。	2
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3=One-Party Report for Pass Through, 成交请求	3	3
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 接收方填写转发成交申报的客户成交申报编号	若为普通申报, 填全空格, 若为主动撤单, 填被撤委托的客户成交申报编号	填转发成交申报的客户成交申报编号
LastPx	价格	委托价格	委托价格
LastQty	数量	委托数量	委托数量
TrdType	成交申报业务类别	0	0
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	0	0
ConfirmID	约定号	若接收方交易主体类型为 03/04, 则不能为全空格	若接收方交易主体类型为 03/04, 则不能为全空格
Side	本方参与人买卖方向	1 或 2	2 或 1
PBUID	本方交易单元	发起方交易单元	接收方交易单元
AccountID	本方证券账户	发起方证券账户	接收方证券账户
BranchID	本方营业部代码	发起方营业部代码	接收方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格
SubmittingMemberID	申报方交易商代码	全空格	全空格
SubmittingInvestorType	申报方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	全空格	全空格

	04=个人经纪		
SubmittingInvestorID	申报方交易主体代码	全空格	全空格
SubmittingInvestorName	申报方客户名称	全空格	全空格
SubmittingTraderCode	申报方交易员代码	全空格	全空格
MemberID	本方交易商代码	发起方交易商代码	接收方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪 04=个人经纪	发起方交易主体类型	接收方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	发起方交易主体代码	接收方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时，需填写 本方客户名称	发起方客户名称	当成交申报类型为 2=接受成交申报 时，需填写接收方 客户名称；当成交 申报类型为 3=拒绝 成交申报时填全空 格
TraderCode	本方交易员代码	发起方交易员代码	接收方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	接收方交易商代码	填转发成交申报的 本方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪 04=个人经纪	接收方交易主体类型	填转发成交申报的 本方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	接收方交易主体代码	填转发成交申报的 本方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	填转发成交申报的 本方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	接收方交易员代码	填转发成交申报的 本方交易员代码
SettlType	结算方式，预留	103 或 104	103 或 104

	103=多边净额 104=逐笔全额		
SettlPeriod	结算周期, 预留	0 或 1	0 或 1
LastParPx	成交价格二, 预留	0	0
CashMargin	信用标识	1	1
Memo	备注	备注	备注

说明:

(1) SettlType、SettlPeriod 虽然为预留字段, 但是也要按照要求填写, 否则会被交易系统拒绝。对于 SettlType, 若证券支持匹配成交, 则取值为 103, 否则为 104。对于 SettlPeriod, 若 SettlType 为 103, 则取值为 1, 否则为 0。

(2) 当接收方拒绝发起方的成交请求时 (TradeReportType 为 3), 本方证券账户 (AccountID) 字段为选填字段。

(3) 当本方交易主体类型 (InvestorType) 为 01 (自营) 或 02 (资管) 时, 委托中的本方证券账户 (AccountID) 字段, 需填为本方交易商下本方交易主体已报备的证券账户。

(4) 暂不支持融资融券交易, 信用标识字段固定填 1。

(5) 约定号 (ConfirmID) 用于券商系统筛选经纪客户, 当发起方委托中对手方交易主体类型 (CounterpartyInvestorType) 为 03 (机构经纪) 或 04 (个人经纪) 时, 必须填写约定号字段, 否则委托会被交易系统拒绝。接收方拒绝或接受发起方委托时, 若接收方委托本方交易主体类型 (InvestorType) 为 03 (机构经纪) 或 04 (个人经纪) 时, 必须填写约定号字段。

(6) Memo (备注) 字段可由交易双方自行约定填写与本次交易相关的内容。

(7) 发起方、接收方的委托需满足以下匹配条件, 才能成交:

要素	检查方法
本方交易商代码 (MemberID)	等于待匹配委托的对手方交易商代码 (CounterpartyMemberID)
本方交易主体类型 (InvestorType)	等于待匹配委托的对手方交易主体类型 (CounterpartyInvestorType)
本方交易主体代码 (InvestorID)	等于待匹配委托的对手方交易主体代码 (CounterpartyInvestorID)

本方交易员代码 (TraderCode)	等于待匹配委托的对手方交易员代码 (CounterpartyTraderCode)
对手方交易商代码(Counterparty MemberID)	等于待匹配委托的本方交易商代码 (MemberID)
对手方交易主体类型 (CounterpartyInvestorType)	等于待匹配委托的本方交易主体类型 (InvestorType)
对手方交易主体代码 (CounterpartyInvestorID)	等于待匹配委托的本方交易主体代码 (InvestorID)
对手方交易员代码 (CounterpartyTraderCode)	等于待匹配委托的本方交易员代码 (TraderCode)
证券代码 (SecurityID)	一致
证券代码源 (SecurityIDSource)	一致
价格 (LastPx)	一致
数量 (LastQty)	一致
买卖方向(Side)	方向相反
约定号 (ConfirmID)	当发起方委托的对手方交易主体类型 (CounterpartyInvestorType) 为 03 或 04 时, 需检查一致
结算方式 (SettlType)	一致
结算周期 (SettlPeriod)	一致

6.2.2 STEP 接口委托申报

表 5-4 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	发起方成交请求字段取值	接收方成交请求字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE		
1180	ApplID	应用标识	411	411
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型
828	TrdType	成交申报业务类别	0	0
856	TradeReportType	成交申报类型	0	2 或 3

			0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报		
487		TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	若为普通申报, 填 0; 若 为主动撤单, 填 1。	2
1123		TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成 交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3=One-Party Report for Pass Through, 成交请 求	3	3
572		TradeReportRefID	原客户成交申报编号	若为普通申报, 填全空 格, 若为主动撤单, 填 被撤委托的客户成交申 报编号	填转发成交申报的客户成 交申报编号
60		TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>					
48		SecurityID	证券代码	证券代码	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<RootParties>					
1116		NoRootPartyIDs	参与人代码个数	2	2
→	1117	RootPartyID	参与人代码	申报方交易单元, 需与 发起方交易单元一致	申报方交易单元, 需与发 起方交易单元一致
	1118	RootPartyIDSource	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
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	1117	RootPartyID	参与人代码	结算机构代码	结算机构代码
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	4=结算机构代码	4=结算机构代码
组件结束					

组件<TrdCapRptSideGrp>								
552	NoSides			side 个数	1	1		
→	54	Side		买卖方向	1 或 2	2 或 1		
	组件<Parties>							
	453	NoPartyIDs		参与人代码个数	9	成交申报类型为 2 时填 9， 成交申报类型为 3 时填 8		
	→	448	PartyID		参与人代码	发起方交易单元	接收方交易单元	
		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=交易单元	1=交易单元	
		448	PartyID		参与人代码	发起方证券账户	成交申报类型为 2 时填接 收方证券账户，成交申报 类型为 3 时不用填写	
		447	PartyIDSource		参与人代码源	5=中国投资者编号	成交申报类型为 2 时填 5= 中国投资者编号，成交申 报类型为 3 时不用填写	
		452	PartyRole		参与人代码角色	5=投资者证券账户	成交申报类型为 2 时填 5= 投资者证券账户，成交申 报类型为 3 时不用填写	
		448	PartyID		参与人代码	发起方营业部代码	接收方营业部代码	
		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	发起方交易商代码	接收方交易商代码	
		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	7：交易商代码	7：交易商代码	
		448	PartyID		参与人代码	发起方交易主体代码	接收方交易主体代码	
		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	4003：交易主体代码	4003：交易主体代码	
		子组件< PtysSubGrp>						
		802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	当发起方交易主体类型 为 03=机构经纪时，填 2；否则填 1	当接收方交易主体类型为 03=机构经纪时，填 2；否 则填 1	
		→	523	PartySubID		参与方子代码	发起方交易主体类型	接收方交易主体类型

			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
			523	PartySubID	参与方子代码	发起方客户名称 当发起方交易主体类型为 03=机构经纪时，填写发起方客户名称；否则不需要填写	接收方客户名称 当接收方交易主体类型为 03=机构经纪且成交申报类型为 2=接受成交申报时，填写接收方客户名称；否则不需要填写
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	发起方客户名称 当发起方交易主体类型为 03=机构经纪时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写	接收方客户名称 当接收方交易主体类型为 03=机构经纪且成交申报类型为 2=接受成交申报时时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写
组件结束							
		448	PartyID		参与人代码	发起方交易员代码	接收方交易员代码
		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	12：交易员代码	12：交易员代码
		448	PartyID		参与人代码	接收方交易商代码	发起方交易商代码
		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	20：对手方交易商代码	20：对手方交易商代码
		448	PartyID		参与人代码	接收方交易主体代码	发起方交易主体代码
		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	4004：接收方交易主体代码	4004：对手方交易主体代码
子组件< PtysSubGrp>							
		802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	1	1
→		523	PartySubID		参与方子代码	接收方交易主体类型	发起方交易主体类型
		803	PartySubIDType		参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
组件结束							
		448	PartyID		参与人代码	接收方交易员代码	发起方交易员代码
		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	37：对手方交易员代码	37：对手方交易员代码
组件结束							
组件结束							

31	LastPx	价格	委托价格	委托价格
32	LastQty	数量	委托数量	委托数量
63	SettlType	结算方式, 预留	103 或 104	103 或 104
10216	SettlPeriod	结算周期, 预留	0 或 1	0 或 1
664	ConfirmID	约定号	若接收方交易主体类型为 03/04, 则不能为全空格	若接收方交易主体类型为 03/04, 则不能为全空格
669	LastParPx	成交价格二, 预留	0	0
544	CashMargin	信用标识	1	1
10198	Memo	备注	备注	备注

注: 参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.3 点击成交

6.3.1 报价

6.3.1.1 Binary 接口委托申报

表 5-5 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	报价字段取值	主动撤单字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104105		
ApplID	应用标识	412	412
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
QuoteMsgID	客户报价消息编号	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
QuoteReqID	询价请求编号	全空格	全空格
QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易的报价	1	1
BidPx	买报价	若为买方, 则填买报价	买报价
OfferPx	卖报价	若为卖方, 则填卖报价	卖报价
BidSize	买数量	若为买方, 则填买数量	0
OfferSize	卖数量	若为卖方, 则填卖数量	0
BranchID	营业部代码	营业部代码	营业部代码
QuoteID	报价消息编号	报价消息编号	与被撤委托的QuoteID一致
QuoteRespID	报价回复消息编号	全空格	全空格
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	1, 点击成交目前仅支持公开报价	1
ValidUntilTime	报价有效时间(预留字段)	0	0
PriceType	价格类型(预留字段) 1=Percentage, 百分	1 或 2	1 或 2

		比 2=PerUnit, 每交易单位		
CashMargin		信用标识	1	1
MemberID		本方交易商代码	本方交易商代码	本方交易商代码
InvestorType		本方交易主体类型	本方交易主体类型	本方交易主体类型
InvestorID		本方交易主体代码	本方交易主体代码	本方交易主体代码
InvestorName		本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时, 需填写本方客户名称	本方客户名称	本方客户名称
TraderCode		本方交易员代码	本方交易员代码	本方交易员代码
SettlType		结算方式, 预留	103 或 104	103 或 104
SettlPeriod		结算周期, 预留	0 或 1	0 或 1
PreTradeAnonymity		是否匿名 0=显名 1=匿名	0 或 1	0 或 1
MaxFloor		可显示数量	0	0
MinQty		最低成交数量	0	0
Memo		备注	全空格	全空格
NoCounterparty		对手方个数	0	0
→	CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	N/A	N/A
→	CounterpartyInvestorID	对手方交易主体类型	N/A	N/A

	storType	型		
→	CounterpartyInve storID	对手方交易主体代 码	N/A	N/A
→	CounterpartyInve storName	对手方客户名称	N/A	N/A
→	CounterpartyTrad erCode	对手方交易员代码	N/A	N/A

说明：

- 1) 目前仅支持面向全市场的点击成交，因此委托申报中对手方个数（NoCounterparty）取值应为 0。
- 2) 暂不支持融资融券交易，信用标识字段固定填 1。
- 3) SettlType、SettlPeriod 虽然为预留字段，但是也要按照要求填写，否则会被交易系统拒绝。对于 SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为 103，否则为 104。对于 SettlPeriod，若 SettlType 为 103，则取值为 1，否则为 0。
- 4) 若预留字段为枚举值，则取值应为枚举值中任一取值，否则应符合接口定义。
- 5) 是否匿名（PreTradeAnonymity）字段的填写将影响对应的转发报价消息（Binary：204126, STEP:S）中，本方交易商代码（MemberID）、本方交易主体类型（InvestorType）、本方交易主体代码（InvestorID）、本方客户名称（InvestorName）、本方交易员代码（TraderCode）字段这五个字段的填写，填写规则如下：

是否匿名（PreTradeAnonymity）字段取值	对应的转发报价中消息上述五字段的填写情况
0=显名	报价委托中的对应字段
1=匿名	全空格

- 6) 目前不支持分次显示，因此可显示数量和最低成交数量应填 0。
- 7) BidPx 与 BidSize 同时为 0 且 OfferSize 与 OfferPx 同时不为 0 时，表示卖报价；OfferPx

与 OfferSize 同时为 0 且 BidPx 与 BidSize 同时不为 0 时，表示买报价。

6.3.1.2 STEP 接口委托申报

表 5-6 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	报价字段取值	报价主动撤单
	MessageHeader	MsgType=S		
1180	ApplID	应用标识	412	412
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号	客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
60	TransactTime	报价发起时间	委托时间	委托时间
131	QuoteReqID	报价请求 ID	全空格	全空格
537	QuoteType	报价类型 1=Tradeable，表示可交易的报价	1	1
组件<Instrument>				
48	SecurityID	证券代码	证券代码	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	6	6

→	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	申报交易单元	申报交易单元
	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	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	本方交易商代码	本方交易商代码
	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	7=交易商代码	7=交易商代码
	448	PartyID	参与人代码	本方交易主体代码	本方交易主体代码
	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	4003=交易主体代码	4003=交易主体代码
	子组件<PtysSubGrp>				
802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	2	2
→	523	PartySubID	参与方子代码	本方交易主体类型	本方交易主体类型
	803	PartySubID Type	参与方子代码类型	26	26
	523	PartySubID	参与方子代码	本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时,填写本	本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时,填写本

					方客户名称；否则不需要填写	方客户名称；否则不需要填写
	803	PartySubID Type	参与方子代码类型	本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时，填写 “5=本方客户名称”；否则不需要填写	本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时，填写 “5=本方客户名称”；否则不需要填写	
组件结束						
448	PartyID		参与人代码	本方交易员代码	本方交易员代码	
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	12=交易员代码	12=交易员代码	
组件结束						
132	BidPx		买报价 BidSize>0 时必须填写	买报价	买报价	
133	OfferPx		卖报价 OfferSize>0 时必须填写	卖报价	卖报价	
134	BidSize		买数量	买数量	0	
135	OfferSize		卖数量	卖数量	0	
117	QuoteID		报价消息编号	报价消息编号	与被撤委托的 QuoteID 一致	
693	QuoteRespID		报价回复消息编号	不填	不填	
1171	PrivateQuote		私有报价 0=PrivateQuote, 私有报价	1, 点击成交目前仅支持 公开报价	1	

		1=PublicQuote, 公开报价		
62	ValidUntilTime	报价有效时间 (预留字段)	不填	不填
423	PriceType	价格类型(预留 字段) 1=Percentage, 百 分比 2=PerUnit, 每交 易单位	不填	不填
544	CashMargin	信用标识	1	1
10198	Memo	备注	全空格	全空格
63	SettlType	结算方式, 预留 103=多边净额 104=逐笔全额	103 或 104	103 或 104
10216	SettlPeriod	结算周期, 预留	0 或 1	0 或 1
1091	PreTradeAnonymity	是否匿名 0=显名 1=匿名	0 或 1	0 或 1
111	MaxFloor	可显示数量	不填	不填
110	MinQty	最低成交数量	不填	不填

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.3.2 报价回复

6.3.2.1 Binary 接口委托申报

表 5-7 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104110	
ApplID	应用标识	413
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
QuoteRespID	报价回复消息编号	报价回复消息编号
QuoteRespType	报价回复类型 1=接受 2=重报 6=拒绝	1
Side	买卖方向	1 或 2
ValidUntilTime	报价有效时间(预留字 段)	报价有效时间
QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易的报	1

		价	
PriceType		价格类型(预留字段) 1=Percentage, 百分比 2=PerUnit, 每交易单位	2
NoQuote		报价消息个数	1
→	QuoteID	报价消息编号	填写报价逐笔委托行情的 QuoteID
→	QuotePrice	报价价格	填写报价逐笔委托行情的 Price
→	QuoteQty	报价数量	填写本次确认成交的委托数量
CashMargin		信用标识	1
MemberID		本方交易商代码	本方交易商代码
InvestorType		本方交易主体类型	本方交易主体类型
InvestorID		本方交易主体代码	本方交易主体代码
InvestorName		本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时, 需填写 本方客户名称	本方客户名称
TraderCode		本方交易员代码	本方交易员代码
SettlType		结算方式, 预留 103=多边净额 104=逐笔全额	与报价逐笔委托行情的 SettlType 一致
SettlPeriod		结算周期, 预留	与报价逐笔委托行情的 SettlPeriod 一致

说明:

- 1) 报价回复的买卖方向需与报价的买卖方向相反。
- 2) 报价回复的报价数量(QuoteQty)为本次点击成交的成交数量,不能大于逐笔行情中揭示的委托数量。
- 3) SettlType、SettlPeriod 虽然为预留字段,但是也要按照要求填写,否则会被交易系统拒绝。对于 SettlType,若证券支持匹配成交,则取值为 103,否则为 104。对于 SettlPeriod,若 SettlType 为 103,则取值为 1,否则为 0。
- 4) 若预留字段为枚举值,则取值应为枚举值中任一取值,否则应符合接口定义。

6.3.2.2 STEP 接口委托申报

表 5-8 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=AJ	
1180	ApplID	应用标识	413
693	QuoteRespID	报价回复消息编号	报价回复消息编号
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType	报价所有者类型	订单所有者类型
60	TransactTime	委托时间	委托申报时间
537	QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 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=深圳证券交易所	102
组件结束			
组件<Parties>			

453	NoPartyIDs		参与人代码个数	参照报价委托 STEP 接口申报组件<Parties>填写	
→	448	PartyID	参与人代码		
	447	PartyIDSource	参与人代码源		
	452	PartyRole	参与人代码角色		
	子组件<PtysSubGrp>				
	802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数		
	→	523	PartySubID		参与方子代码
		803	PartySubIDType		参与方子代码类型
	组件结束				
组件结束					
694	QuoteRespType		报价回复类型 1=Hit/Lift，接受 2=Counter，重报 6=Pass，拒绝	1	
54	Side		买卖方向	1 或 2	
62	ValidUntilTime		报价有效时间(预留字段)	不填	
544	CashMargin		信用标识	1	
423	PriceType		价格类型(预留字段) 1=Percentage，百分比 2=PerUnit，每交易单位	不填	
63	SettlType		结算方式，预留	与报价逐笔委托行情的 SettlType 一致	
10216	SettlPeriod		结算周期，预留	与报价逐笔委托行情的 SettlPeriod 一致	
组件<CompDeliverQuote>					

10199	NoQuote	报价消息个数	1
→	117	QuoteID	报价消息编号
			填写报价逐笔委托行情的 QuoteID
	10225	QuotePrice	报价价格
			填写报价逐笔委托行情的 Price
	10226	QuoteQty	报价数量
			数量
组件结束			

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.4 询价成交

6.4.1 询价请求

6.4.1.1 Binary 接口委托申报

表 5-9 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	询价请求申报字段取值	主动撤单字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104117		
ApplID	应用标识	414	414
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
QuoteReqID	询价请求编号	询价请求编号	与被撤委托的 QuoteReqID 一致
QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0=New, 新订单 1=Cancel, 撤销	0	1
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	0, 目前仅支持私有 报价	0
OrderQty	数量	委托数量	委托数量
Price	价格	0	0
Side	买卖方向	1 或 2	1 或 2
ExpireTime	询价请求失效时间 (预留 字段)	0	0
QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易的报 价	1	1
QuotePriceType	报价价格类型 (预留字段) 1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股	2	2
Memo	备注	备注	备注
MemberID	本方交易商代码	本方交易商代码	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型	本方交易主体类型	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	本方交易主体代码	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称	本方客户名称	本方客户名称

		当本方交易主体类型为 03=机构经纪时,需填写本 方客户名称		
TraderCode		本方交易员代码	本方交易员代码	本方交易员代码
SettlType		结算方式, 预留	103 或 104	103 或 104
SettlPeriod		结算周期, 预留	0 或 1	0 或 1
PreTradeAnonymity		是否匿名	0 或 1	0 或 1
NoCounterparty		对手方个数	对手方个数	0
→	CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	对手方交易商代码	N/A
→	CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型	对手方交易主体类 型	N/A
→	CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	全空格	N/A
→	CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	N/A
→	CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	全空格	N/A

说明:

- 1) 一笔询价请求中对手方个数不能超过 20 个, 即委托申报中对手方个数 (NoCounterparty) 最多允许申报 20 个。
- 2) 暂不支持融资融券交易, 信用标识字段固定填 1。
- 3) SettlType、SettlPeriod 虽然为预留字段, 但是也要按照要求填写, 否则会被交易系统拒绝。对于 SettlType, 若证券支持匹配成交, 则取值为 103, 否则为 104。对于 SettlPeriod, 若 SettlType 为 103, 则取值为 1, 否则为 0。
- 4) 若预留字段为枚举值, 则取值应为枚举值中任一取值, 否则应符合接口定义。
- 5) 是否匿名 (PreTradeAnonymity) 字段的填写将影响对应的转发询价请求消息 (Binary: 204125, STEP:R) 中, 本方交易商代码 (MemberID)、本方交易主体类型 (InvestorType)、

本方交易主体代码 (InvestorID)、本方客户名称 (InvestorName)、本方交易员代码

(TraderCode) 字段这五个字段的填写, 填写规则如下:

是否匿名 (PreTradeAnonymity) 字段的取值	对应的转发询价请求消息中上述五字段的填写情况
0=显名	报价委托中的对应字段
1=匿名	全空格

- 6) 询价请求失效时间 (ExpireTime) 为预留字段, 填写值不生效, 交易系统将根据接收到询价请求的系统时间计算的询价请求超时时间, 并将计算结果填写至对应转发询价请求消息中的询价请求失效时间 (ExpireTime) 字段。
- 7) 对于同一笔询价请求, 若交易系统中存在一笔未成交且未撤销的询价, 则不能申报重复的询价请求委托。重复的询价请求是指: 本方交易商代码、本方交易主体代码、本方证券账户、方向和证券标的与交易系统中已接受的询价请求的本方交易商代码、本方交易主体代码、本方证券账户、方向、证券标的均一致。

6.4.1.2 STEP 接口委托申报

表 5-10 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	询价请求字段取值	询价请求主动撤单
	MessageHeader	MsgType=R		
1180	ApplID	应用标识	414	414
131	QuoteReqID	询价请求编号	询价请求编号	询价请求编号
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
537	QuoteType	报价类型 1= Tradeable, 表示可交易的报价	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
60	TransactTime			订单发起时间	委托时间	委托时间
组件<Instrument>						
48	SecurityID			证券代码	证券代码	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<RootParties>						
1116	NoRootPartyIDs			参与人代码个数	参照点击成交报价委托 STEP 接口申报组件<Parties>填写，本消息与报价消息的参考标签对应关系如下： 1116<->453 1117<->448 1118<->447 1119<->452	参照点击成交报价委托 STEP 接口申报组件<Parties>填写，本消息与报价消息的参考标签对应关系如下： 1116<->453 1117<->448 1118<->447 1119<->452
→	1117	RootPartyID		参与人代码		
	1118	RootPartyIDSource		参与人代码源		
	1119	RootPartyRole		参与人代码角色		
	子组件<RootSubParties>					
	1120	NoRootPartySubIDs		参与方子代码个数		
	→	1121	RootPartySubID	参与方子代码		
		1122	RootPartySubIDType	参与方子代码类型		
组件结束						
组件结束						
组件<CounterInfos>						
10232	NoCounterInfos				对手方个数	不需要填写
→	组件<NestedParties>					
	539	NoNestedPartyIDs		参与人代码个数	2	不需要填写

	→	524	NestedPartyID		参与人代码	对手方交易商代码		
		525	NestedPartyIDSource		参与人代码源	C=通用市场参与者标识		
		538	NestedPartyRole		参与人代码角色	20=对手方交易商代码		
		524	NestedPartyID		参与人代码	对手方交易主体代码 填全空格，代表对指定 交易商代码、指定交易 主体类型的全部交易 主体代码进行询价		
		525	NestedPartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码		
		538	NestedPartyRole		参与人代码角色	4004：对手方交易主体 代码		
		子组件< NstdPtysSubGrp >						
		804	NoNestedPartySubIDs		参与方子代码个 数	1		
		→	545	NestedPartySubID	参与方子代码	对手方交易主体类型		
			805	NestedPartySubID Type	参与方子代码类 型	26		
		组件结束						
		组件结束						
		组件结束						
	组件<OrderQtyData>							
38	OrderQty				订单数量	委托数量	委托数量	
组件结束								
54	Side				买卖方向	1 或 2	1 或 2	
10200	QuoteRequestTransType				询价请求事务类 型 0=New，新订单 1=Cancel，撤销	0	1	
1171	PrivateQuote				私有报价	0，目前仅支持私有报	0	

			价	
126	ExpireTime	询价请求失效时间（预留字段）	不填	不填
692	QuotePriceType	报价价格类型（预留字段）	不填	不填
10198	Memo	备注	备注	备注
544	CashMargin	信用标识	1	1、2 或 3
63	SettlType	结算方式，预留	103 或 104	103 或 104
10216	SettlPeriod	结算周期，预留	0 或 1	0 或 1
1091	PreTradeAnonymity	是否匿名	0 或 1	0 或 1
58	Text	Free Text	Free Text	Free Text

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.4.2 报价

6.4.2.1 Binary 接口委托申报

表 5-11 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	报价字段取值	主动撤单字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104105		
ApplID	应用标识	415	415
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
QuoteMsgID	客户报价消息编号	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
QuoteReqID	询价请求编号	填写转发询价请求的 QuoteReqID	填写转发询价请求的 QuoteReqID
QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易的报价	1	1
BidPx	买报价	若转发询价请求的 side 字段取值为 2, 则填买报价	买报价
OfferPx	卖报价	若转发询价请求的 side 字段取值为 1, 则填买报价卖报价	卖报价
BidSize	买数量	若转发询价请求的 side 字段取值为 2, 则填买数量	0
OfferSize	卖数量	若转发询价请求的 side 字段取值为 2, 则填卖数量	0
BranchID	营业部代码	营业部代码	营业部代码
QuoteID	报价消息编号	报价消息编号	与被撤委托的 QuoteID 一致
QuoteRespID	报价回复消息编号	全空格	全空格
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价	0 或 1	0 或 1

	1=Public Quote, 公开 报价		
ValidUntilTime	报价有效时间 (预留 字段)	报价有效时间 (预留 字段)	报价有效时间 (预留 字段)
PriceType	价格类型 (预留字 段)	1 或 2	1 或 2
CashMargin	信用标识	1	1、2 或 3
MemberID	本方交易商代码	本方交易商代码	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型	本方交易主体类型	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	本方交易主体代码	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称 当本方交易主体类 型为 03=机构经纪 时,需填写本方客户 名称	本方客户名称	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码	本方交易员代码	本方交易员代码
SettlType	结算方式, 预留	103 或 104	与转发询价请求的 SettlType 一致
SettlPeriod	结算周期, 预留	0 或 1	与转发询价请求的 SettlPeriod 一致
PreTradeAnonymity	是否匿名 0=显名 1=匿名 9=不指定	9	9
MaxFloor	可显示数量	0	0
MinQty	最低成交数量	0	0
Memo	备注	备注	备注
NoCounterparty	对手方个数	当转发询价请求中, 本方交易商代码不	0

			为全空格时填写，否则填 0	
→	CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	填转发询价请求的本方交易商代码	N/A
→	CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型	填转发询价请求的本方交易主体类型	N/A
→	CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	填转发询价请求的本方交易主体代码	N/A
→	CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	N/A
→	CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	填转发询价请求的本方交易员代码	N/A

说明：

- 1) 报价委托的数量必须小于等于相应的询价请求委托中的数量，BidPx 与 BidSize 同时为 0 且 OfferSize 与 OfferPx 同时不为 0 时，表示卖报价；OfferPx 与 OfferSize 同时为 0 且 BidPx 与 BidSize 同时不为 0 时，表示买报价。
- 2) BidSize 和 OfferSize 同时为 0 时，则为报价撤单委托。
- 3) 对于同一笔询价请求，若交易系统中存在一笔未成交且未撤销的报价，则不能申报重复的报价委托。重复的报价是指：本方交易商代码、本方交易主体代码、本方证券账户、方向和证券标的与交易系统中已接受的报价的本方交易商代码、本方交易主体代码、本方证券账户、方向、证券标的均一致。
- 8) 暂不支持融资融券交易，信用标识字段固定填 1。
- 9) SettlType、SettlPeriod 虽然为预留字段，但是也要按照要求填写，否则会被交易系统拒绝。对于 SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为 103，否则为 104。对于 SettlPeriod，若 SettlType 为 103，则取值为 1，否则为 0。
- 10) 若预留字段为枚举值，则取值应为枚举值中任一取值，否则应符合接口定义。

6.4.2.2 STEP 接口委托申报

表 5-12 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	报价字段取值	报价主动撤单
	MessageHeader	MsgType=S		
1180	ApplID	应用标识	415	415
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号	客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType	报价所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
60	TransactTime	报价发起时间	委托时间	委托时间
131	QuoteReqID	报价请求 ID	填写转发询价请求的 QuoteReqID	填写转发询价请求的 QuoteReqID
537	QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 表示可交易的报价	1	1
组件<Instrument>				
48	SecurityID	证券代码	证券代码	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	参照点击成交报价委托 STEP 接口申报组件<Parties>填写	参照点击成交报价委托 STEP 接口申报组件<Parties>填写
→	448	PartyID		参与人代码		
	447	PartyIDSource		参与人代码 源		
	452	PartyRole		参与人代码 角色		
	子组件<PtysSubGrp>					
	802	NoPartySubIDs		参与方子代 码个数		
	→	523	PartySubID	参与方子代 码		
		803	PartySubIDType	参与方子代 码类型		
组件结束						
组件结束						
组件<CounterInfos>						
10232	NoCounterInfos			参与人代码 个数	当转发询价请求中， 本方交易商代码不为 全空格时填写 1，否 则不需要填写	不需要填写
组件<NestedParties>						
→	539	NoNestedPartyIDs		参与人代码 个数	3	不需要填写
	→	524	NestedPartyID	参与人代码	对手方交易商代码	不需要填写
		525	NestedPartyIDSource	参与人代码 源	C=通用市场参与者 标识	不需要填写

		538	NestedPartyRole		参与人代码 角色	20=对手方交易商代 码	不需要填写	
		524	NestedPartyID		参与人代码	对手方交易主体代码	不需要填写	
		525	NestedPartyIDSource		参与人代码 源	D=自定义代码	不需要填写	
		538	NestedPartyRole		参与人代码 角色	4004： 对手方交易主 体代码	不需要填写	
		子组件<NstdPtysSubGrp>						
		804	NoNstdPartySubIDs		参与方子代 码个数	1	不需要填写	
		→	545	NstdPartySu bID	参与方子代 码	对手方交易主体类型	不需要填写	
			805	NstdPartySu bIDType	参与方子代 码类型	26=交易主体类型	不需要填写	
		组件结束						
		524	NestedPartyID		参与人代码	对手方交易员代码	不需要填写	
		525	NestedPartyIDSource		参与人代码 源	D=自定义代码	不需要填写	
		538	NestedPartyRole		参与人代码 角色	37： 对手方交易员代 码	不需要填写	
组件结束								
132	BidPx			买报价 BidSize>0 时 必须填写	买报价	买报价		
133	OfferPx			卖报价 OfferSize>0 时必须填写	卖报价	卖报价		
134	BidSize			买数量	买数量	0		
135	OfferSize			卖数量	卖数量	0		

117	QuoteID	报价消息编号	报价消息编号	与被撤委托的 QuoteID 一致
693	QuoteRespID	报价回复消息编号	不填	不填
1171	PrivateQuote	私有报价 0=PrivateQuote, 私有报价 1=PublicQuote, 公开报价	不填	不填
62	ValidUntilTime	报价有效时间 (预留字段)	不填	不填
423	PriceType	价格类型 (预留字段)	不填	不填
544	CashMargin	信用标识	1	1、2 或 3
10198	Memo	备注	备注	备注
63	SettlType	结算方式, 预留 103=多边净额 104=逐笔全额	103 或 104	103 或 104
10216	SettlPeriod	结算周期, 预留	0 或 1	0 或 1
1091	PreTradeAnonymity	是否匿名	不填	不填

111	MaxFloor	可显示数量	不填	不填
110	MinQty	最低成交数量	不填	不填

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.4.3 报价回复

6.4.3.1 Binary 接口委托申报

表 5-13 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104110	
ApplID	应用标识	416
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
QuoteRespID	报价回复消息编号	报价回复消息编号
QuoteRespType	报价回复类型 1=接受	1

		2=重报 6=拒绝	
Side		买卖方向	1 或 2
ValidUntilTime		报价有效时间(预留字段)	报价有效时间
QuoteType		报价类型 1=Tradeable, 可交易的报价	1
PriceType		价格类型(预留字段) 1=Percentage, 百分比 2=PerUnit, 每交易单位	2
NoQuote		报价消息个数	报价消息个数
→	QuoteID	报价消息编号	填写转发报价报文的 QuoteID
→	QuotePrice	报价价格	填写转发报价报文的 Price
→	QuoteQty	报价数量	填写转发报价报文的 OrderQty
CashMargin		信用标识	1
MemberID		本方交易商代码	本方交易商代码
InvestorType		本方交易主体类型	本方交易主体类型
InvestorID		本方交易主体代码	本方交易主体代码
InvestorName		本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时, 需填写	本方客户名称

	本方客户名称	
TraderCode	本方交易员代码	本方交易员代码
SettlType	结算方式, 预留 103=多边净额 104=逐笔全额	与询价请求的 SettlType 一致
SettlPeriod	结算周期, 预留	与询价请求的 SettlPeriod 一致

说明:

- 1) 一笔报价回复支持对多笔报价进行回复, 其中 QuoteID 填写转发报价报文 (Binary:200526, STEP:S) 的 QuoteID, QuotePrice 填转发报价报文的 BidPx (或 OfferPx), QuoteQty 填转发报价报文的 BidSize (或 OfferSize)。
- 2) 报价回复的买卖方向需与报价的买卖方向相反。
- 3) 若预留字段为枚举值, 则取值应为枚举值中任一取值, 否则应符合接口定义。

6.4.3.2 STEP 接口委托申报

表 5-14 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=AJ	
1180	ApplID	应用标识	416
693	QuoteRespID	报价回复消息编号	报价回复消息编号
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType	报价所有者类型	订单所有者类型
60	TransactTime	委托时间	委托申报时间
537	QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易	1

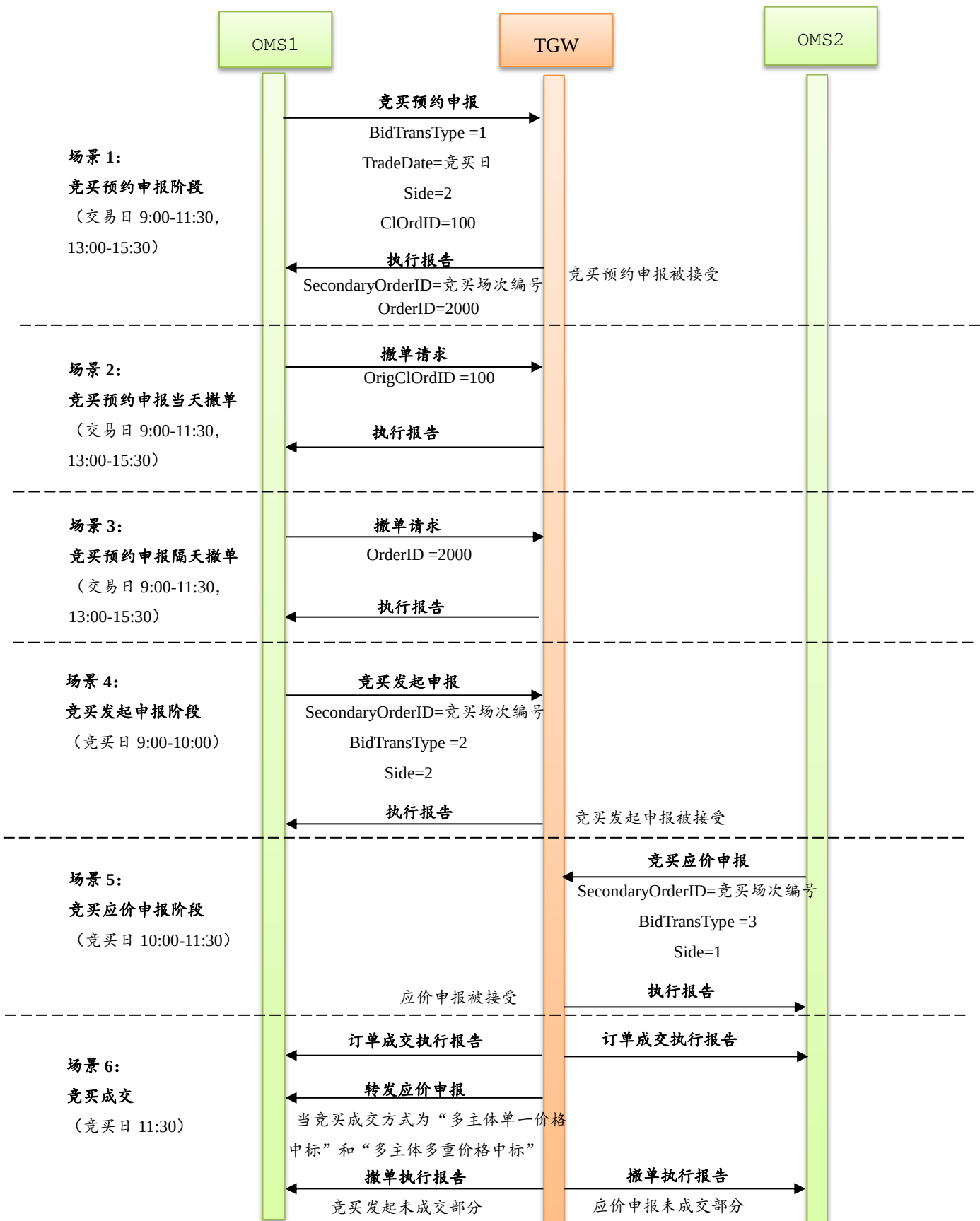
			的报价		
组件<Instrument>					
48	SecurityID		证券代码	证券代码	
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	102	
组件结束					
组件<Parties>					
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	参照点击成交报价委托 STEP 接口申报组件 <Parties>填写	
→	448	PartyID	参与人代码		
	447	PartyIDSource	参与人代码源		
	452	PartyRole	参与人代码角色		
	子组件<PtysSubGrp>				
	802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数		
	→	523	PartySubID		参与方子代码
		803	PartySubIDType		参与方子代码类型
组件结束					
组件结束					
694	QuoteRespType		报价回复类型 1=Hit/Lift，接受 2=Counter，重报 6=Pass，拒绝	1	
54	Side		买卖方向	1 或 2	
62	ValidUntilTime		报价有效时间 (预留 字段)	不填	

544	CashMargin	信用标识	1
423	PriceType	价格类型(预留字段)	不填
63	SettlType	结算方式, 预留	与询价请求的 SettlType 一致
10216	SettlPeriod	结算周期, 预留	与询价请求的 SettlPeriod 一致
组件<CompDeliverQuote>			
10199	NoQuote	报价消息个数	报价消息个数
→	117	QuoteID	报价消息编号
	10225	QuotePrice	报价价格
	10226	QuoteQty	报价数量
组件结束			

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.5 竞买成交

6.5.1 竞买成交消息流图



6.5.2 委托申报接口

6.5.2.1 Binary 接口委托申报

表 5-15 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	竞买预约申报方 字段取值	竞买发起方 字段取值	应价方 字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104128	104128	104128	104128
ApplID	应用标识	417	417	417
SubmittingPBUID	申报交易单元	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	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102	102
OwnerType	订单所有者类型	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	结算机构代码
TransactTime	委托时间	委托申报时间	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	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	客户订单编号
AccountID	证券账户	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	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	空格	空格	空格
Side	买卖方向	2	2	1
OrdType	订单类别 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优	2	2	2
OrderQty	订单数量	委托数量	委托数量	委托数量
Price	价格	0	0	应价价格
MemberID	本方交易商代码	本方交易商代码	本方交易商代码	本方交易商代码

InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪 04=个人经纪	本方交易主体类型	本方交易主体类型	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	本方交易主体代码	本方交易主体代码	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时， 需填写本方客户名称	本方客户名称	本方客户名称	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码	本方交易员代码	本方交易员代码	本方交易员代码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号	全空格	竞买场次编号	竞买场次编号
BidTransType	竞买业务类别 1=竞买预约申报 2=竞买发起申报 3=竞买应价申报	1	2	3
BidExecInstType	竞买成交方式 1=单一主体中标 2=多主体单一价格中标 3=多主体多重价格中标	竞买成交方式	竞买成交方式	竞买成交方式
LowLimitPrice	价格下限	价格下限	价格下限	0
HighLimitPrice	价格上限	0 或 价格上限 若不指定价格上限， 则填 0	0 或 价格上限 若不指定价格上限， 则填 0	0
MinQty	最低成交数量	最低成交数量	最低成交数量	0
TradeDate	交易日期 有效日期或 0，若为 竞买预约申报，则不 能为 0	竞买日 如：20210915	0	0
SettlType	结算方式，预留 103=多边净额 104=逐笔全额	103 或 104	103 或 104	103 或 104
SettlPeriod	结算周期，预留	0 或 1	0 或 1	0 或 1

PreTradeAnonymity	是否匿名 0=显名 1=匿名	0 或 1	0 或 1	0 或 1
CashMargin	信用标识, 预留 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓	1	1	1
Memo	备注			

说明:

(1) SettlType、SettlPeriod 虽然为预留字段, 但是也要按照要求填写, 否则会被交易系统拒绝。对于 SettlType, 若证券支持匹配成交, 则取值为 103, 否则为 104。对于 SettlPeriod, 若 SettlType 为 103, 则取值为 1, 否则为 0。

(2) 当本方交易主体类型 (InvestorType) 为 01 (自营) 或 02 (资管) 时, 委托中的本方证券账户 (AccountID) 字段, 需填为本方交易商下本方交易主体已报备的证券账户。

(3) 对于竞买预约申报、竞买发起申报, 当价格上限 (HighLimitPrice) 字段不为 0 时, 价格下限 (LowLimitPrice) 字段必须小于等于价格上限。

(4) 对于竞买预约申报、竞买发起申报, 当竞买成交方式为“多主体单一价格中标”或“多主体多重价格中标”时, 最低成交数量 (MinQty) 必须大于零, 且必须小于等于订单数量 (OrdQty) 字段。

(5) 对于竞买预约申报, 交易日期 (TradeDate) 字段必须为当前交易日的后五个交易日之一, 若当前交易日为 T 日, 则竞买预约申报的交易日期必须为 T+1, T+2, T+3, T+4, T+5 这 5 个交易日中其中一个。同一证券账户针对同一只证券在同一个竞买日最多仅允许存在一笔有效竞买预约申报。

(6) 对于竞买发起申报, 部分字段填写要求如下:

字段名称	填写要求
交易所第二订单编号	为当日有效的竞买场次编号
本方交易商代码	
本方交易主体类型	

本方交易主体代码	与对应竞买预约申报中的对应字段一致
本方交易员代码	
证券账户	
证券代码	
买卖方向	
竞买成交方式	
订单数量	
价格上限	
价格下限	
最低成交数量	
是否匿名	

(7) 应价申报的交易所第二订单编号字段必须为当日有效的竞买场次编号，应价申报中，当竞买成交方式为“多主体单一价格中标”或“多主体多重价格中标”时，订单数量字段应小于等于对应竞买发起申报的订单数量字段；当竞买成交方式为“单一主体中标”时，订单数量字段必须等于对应竞买发起申报的订单数量字段。

(8) 应价申报价格必须大于等于对应竞买发起申报的“价格下限”，如对应竞买发起申报的“价格上限”不为 0，则应价申报价格必须小于等于该“价格上限”。

(9) 应价申报是否匿名（PreTradeAnonymity）字段的填写将影响逐笔行情交易商、交易主体类型字段展示，也影响“多主体报价”对应的转发应价申报委托消息（Binary: 204129, APPID-418）中，本方交易商代码（MemberID）、本方交易主体类型（InvestorType）、本方交易主体代码（InvestorID）、本方客户名称（InvestorName）、本方交易员代码（TraderCode）字段这五个字段的填写，填写规则如下：

是否匿名（PreTradeAnonymity）字段取值	对应的转发应价申报委托消息上述五字段的填写情况
0=显名	应价申报委托中的对应字段
1=匿名	全空格

(10) 若临时停市开始时间早于 11:30, 临时停市前竞买发起申报及应价申报作废, 由交易系统进行自动撤单。停市期间及恢复交易后均不接受竞买发起申报、应价申报; 若债券临时停牌开始时间早于 11:30, 临时停牌前的竞买发起申报及应价申报作废, 由交易系统进行自动撤单。停牌期间及复牌后均不接受竞买发起申报、应价申报。

6.5.2.2 STEP 接口委托申报

表 5-16 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	竞买预约申报方 字段取值	竞买发起方 字段取值	应价方 字段取值
	MessageHeader	MsgType=D			
1180	ApplID	应用标识	417	417	417
11	ClOrdID	客户订单编号	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	2
54	Side	买卖方向	2	2	1
522	OwnerType	订单所有者类型	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	不填	不填	不填
60	TransactTime	订单发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>					
48	SecurityID	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102	102

		易所			
组件结束					
组件<Parties>					
453	NoPartyIDs	参与人代码 个数	6	6	6
→	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	申报交易单元	申报交易单元
	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	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	本方交易商代码	本方交易商代码
	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	7=交易商代码	7=交易商代码

			角色			
448	PartyID		参与人代码	本方交易主体代码	本方交易主体代码	本方交易主体代码
447	PartyIDSource		参与人代码 源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole		参与人代码 角色	4003= 交易主体代 码	4003= 交易主体代 码	4003= 交易主体代 码
子组件<PtysSubGrp>						
802	NoPartySubIDs		参与方子代 码个数	1 或 2	1 或 2	1 或 2
→	523	PartySub ID	参与方子代 码	本方交易主体类型	本方交易主体类型	本方交易主体类型
	803	PartySub IDType	参与方子代 码类型	26	26	26
	523	PartySub ID	参与方子代 码	本方客户名称 当本方交易主体类 型为 03=机构经纪 时, 填写本方客户 名称; 否则不需要 填写	本方客户名称 当本方交易主体类 型为 03=机构经纪 时, 填写本方客户 名称; 否则不需要 填写	本方客户名称 当本方交易主体类 型为 03=机构经纪 时, 填写本方客户 名称; 否则不需要 填写
	803	PartySub IDType	参与方子代 码类型	本方客户名称 当本方交易主体类 型为 03=机构经纪 时, 填写 “5=本方 客户名称”; 否则不 需要填写	本方客户名称 当本方交易主体类 型为 03=机构经纪 时, 填写 “5=本方 客户名称”; 否则不 需要填写	本方客户名称 当本方交易主体类 型为 03=机构经纪 时, 填写 “5=本方 客户名称”; 否则不 需要填写

组件结束					
448	PartyID	参与人代码	本方交易员代码	本方交易员代码	本方交易员代码
447	PartyIDSource	参与人代码 源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole	参与人代码 角色	12=交易员代码	12=交易员代码	12=交易员代码
组件结束					
组件<OrderQtyData>					
152	CashOrderQty	订单金额	不填	不填	不填
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	不填	不填	应价价格
198	SecondaryOrderID	第二交易所 订单编号	不填	竞买场次编号	竞买场次编号
10238	BidTransType	竞买业务类 别 1=竞买预约 申报 2=竞买发起 申报 3=竞买应价 申报	1	2	3

10239	BidExecInstType	竞买成交方式 1=单一主体 中标 2=多主体单 一价格中标 3=多主体多 重价格中标	竞买成交方式	竞买成交方式	竞买成交方式
1148	LowLimitPrice	价格下限	价格下限	价格下限	不填
1149	HighLimitPrice	价格上限	价格上限	价格上限	不填
110	MinQty	最低成交数量	最低成交数量	最低成交数量	不填
75	TradeDate	交易日期	竞买日	不填	不填
63	SettlType	结算方式, 预留 103=多边净额 104=逐笔全 额	103 或 104	103 或 104	103 或 104
10216	SettlPeriod	结算周期, 预留	0 或 1	0 或 1	0 或 1
1091	PreTradeAnonymity	是否匿名 0=显名 1=匿名	0 或 1	0 或 1	0 或 1

544	CashMargin	信用标识	1、2 或 3	1、2 或 3	1、2 或 3
10198	Memo	备注			

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.5.3 主动撤单接口

6.5.3.1 Binary 接口主动撤单

域名	字段描述	主动撤单字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=190007	190007
ApplID	应用标识	417
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
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
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	原始订单客户订单编号
Side	原始订单买卖方向	原始订单买卖方向
OrderID	原始订单交易所订单编号 对于撤销当日之前的竞买预约委托，OrigClOrdID 填为空格，OrderID 填被撤委托的交易所订单编号。	原始订单交易所订单编号

	其他撤单情形该字段为选填字段，并且交易所对该字段的值不作检查。	
OrderQty	原始订单数量 交易所对该字段的值不作检查	原始订单数量

说明：

- (1) 支持对竞买预约申报、竞买发起与竞买应价申报进行撤单。
- (2) 支持对当日申报及之前申报的有效竞买预约委托进行撤单，对于撤销当天的，OrigClOrdID 填被撤委托的客户订单编号，对于撤销当日之前的竞买预约委托，OrigClOrdID 填为空格，OrderID 填被撤委托响应执行报告里的交易所订单编号。
- (3) 当竞买成交方式为“单一主体中标”时，应价方不允许撤单。当竞买成交方式为“多主体单一价格中标”或“多主体多重价格中标”时，应价方允许撤单。
- (4) 当竞买发起申报存在有效的应价申报时，发起方不允许主动撤单。

6.5.3.2 STEP 接口主动撤单

Tag	域名	必须	字段描述	主动撤单字段取值
	MessageHeader	Y	MsgType=F	F
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识	417
11	ClOrdID	Y	客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType	Y	订单所有者类型	订单所有者类型
54	Side	Y	原始订单买卖方向	原始订单买卖方向
60	TransactTime	Y	订单发起时间	订单发起时间
组件<Instrument>		Y		
48	SecurityID	Y	证券代码	证券代码

22	SecurityIDSource		Y	证券代码源	102
组件结束					
组件<Parties>			Y		
453	NoPartyIDs		Y	参与方代码个数=1	1
→	44 8	PartyID	Y	申报交易单元	申报交易单元
	44 7	PartyIDSource	Y	C=通用市场参与者标识	C
	45 2	PartyRole	Y	1=当前 PartyID 为申报交易单元	1
组件结束					
组件<OrderQtyData>			Y		
38	OrderQty		Y	原始订单数量 交易所对该字段的值不作检查	原始订单数量
组件结束					
41	OrigClOrdID		Y	原始订单的客户订单编号	原始订单的客户订单编号
37	OrderID		N	原始订单交易所订单编号 对于撤销当日之前的竞买预约委托,OrigClOrdID 填为空格, OrderID 填被撤委托的交易所订单编号。 其他撤单情形该字段为选填字段,并且交易所对该字段的值不	原始订单交易所订单编号

			作检查。	
58	Text	N	Free Text	

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.5.4 成交回报

在应价申报阶段结束（11:30 分）后，交易系统对竞买发起申报和应价申报进行一次撮合，并对未达成成交的应价申报或竞买发起申报、或达成成交的应价申报或竞买发起申报的未成交部分进行撤单。

对于“多主体单一价格中标”和“多主体多重价格中标”的竞买成交，交易系统还将该场竞买当天达成成交与未达成成交的所有有效应价申报委托（被交易系统成功接收且未被应价方撤单）使用报文消息（Binary: 204129, APPID-418）转发给该场竞买的竞买发起方。

七、 行情接口

债券现券交易业务、债券通用质押式回购及债券分销业务相关行情信息发布方式如下表所示，详细内容请参见《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》。

频道	行情内容	行情类别	消息类型 (MsgType)	
			STEP	Binary
106x	债券通用质押式回购交易快照行情	020	W	300211
206x	债券通用质押式回购匹配成交逐笔行情	021	UA201 UA202	300292 300291
107x	债券现券交易快照行情	410	W	300211
207x	债券现券交易匹配成交逐笔行情	411	UA201 UA202	300292 300291

401x	债券现券交易协商成交逐笔成交行情	412	UA202	300391
	债券现券交易点击成交逐笔报价行情	413	UA201（新报价） UA202（报价更新）	300392（新报价） 300391（报价更新）
	债券现券交易点击成交逐笔成交行情	413	UA202	300391
	债券现券交易询价成交逐笔成交行情	414	UA202	300391
	债券现券交易意向申报逐笔行情（暂不启用）	415	UA201	300292
	债券现券交易竞买成交逐笔行情	416	UA201 UA202	300492（逐笔委托） 300491（逐笔成交）
	债券现券交易匹配成交大额逐笔行情	417	UA201（大额委托） UA202（大额成交）	300392（大额委托） 300391（大额成交）
3021	债券分销快照行情	030	W	300211

八、清算和交收

8.1 债券现券交易的结算处理

在固定收益交易平台达成的债券现券交易（包括匹配成交、协商成交、点击成交、询价成交、**竞买成交**），结算业务类别编码沿用现有普通交易的业务类别编码（其中采用担保交收模式的债券现券交易，业务类别编码为 JY00；采用非担保交收模式的债券现券交易，业务类别编码为 JY01），仍使用现有接口发送。在清算明

细库（SJSJMXn.DBF）和明细结果库（SJSJG.DBF）中，债券现券交易的交易方式字段为 13，用于标识“固定收益交易平台”的交易。

具体接口调整如下：

（一）清算明细库 SJSJMX0.DBF

字段名	业务类别
	JY01（综合金融服务平台、固定收益交易平台的交易（非担保交收模式））
MXJSZH	结算账号
MXBFZH	备付金账户
MXSJLX	'01'
MXYWLB	'JY01'
MXZQDM	证券代码
MXJYDY	交易单元
MXTGDY	托管单元
MXZQZH	证券账户
MXDDBH	订单编号
MXYYB	营业部代码
MXZXBH	执行编号
MXYWLSH	业务流水号
MXCJSL	成交数量
MXQSSL	清算数量
MXCJJG	交易回报价格
MXQSJG	最终清算价格
MXXYJY	
MXPCBS	
MXZQLB	证券类别
MXZQZL	证券子类别
MXGFXZ	
MXJSFS	'N' 或 'R'
MXHBDH	货币代号
MXQSBJ	清算本金
MXYHS	印花税
MXJYJSF	交易经手费
MXJGGF	监管规费
MXGHF	过户费
MXJSF	结算费
MXSXF	

MXQSYJ	
MXQTFY	
MXZJJE	
MXSFJE	收付净额
MXCJRQ	T 日
MXQSRQ	T 日
MXJSRQ	T 日
MXFSRQ	T 日
MXQTRQ	
MXSCDM	
MXJYFS	'02' 或 '13'
MXZQDM2	
MXTGDY2	
MXDDBH2	
MXCWDH	
MXPPHM	
MXFJSM	
MXBYBZ	

(二) 清算明细库 SJSMX1.DBF

字段名	业务类别
	JY00 (集中竞价平台、综合金融服务平台、固定收益交易平台的交易 (担保交收模式))
MXJSZH	结算账号
MXBFZH	备付金账户
MXSJLX	'01'
MXYWLB	'JY00'
MXZQDM	证券代码
MXJYDY	交易单元
MXTGDY	托管单元
MXZQZH	证券账户
MXDDBH	订单编号
MXYYB	营业部代码
MXZXBH	执行编号
MXYWLSH	业务流水号
MXCJSL	成交数量

MXQSSL	清算数量
MXCJJG	交易回报价格
MXQSJG	最终清算价格
MXXYJY	信用交易标志
MXPCBS	平仓标志
MXZQLB	证券类别
MXZQZL	证券子类别
MXGFXZ	'00'
MXJSFS	'A'
MXHBDH	货币代号
MXQSBJ	清算本金
MXYHS	印花税
MXJYJSF	交易经手费
MXJGGF	监管规费
MXGHF	过户费
MXJSF	结算费
MXSXF	
MXQSYJ	
MXQTFY	
MXZJJE	
MXSFJE	收付净额
MXCJRQ	T 日
MXQSRQ	T 日
MXJSRQ	T+1 日
MXFSRQ	T 日
MXQTRQ	
MXSCDM	
MXJYFS	'01'、'02'、'12' 或'13'
MXZQDM2	
MXTGDY2	
MXDDBH2	
MXCWDH	
MXPPHM	
MXFJSM	
MXBYBZ	

(三) 明细结果库 SJSJG.DBF

字段名	业务类别
	JY01(非担保交易交收)
JGJSZH	结算账号
JGBFZH	备付金账户
JGSJLX	'01'
JGYWLB	'JY01'
JGZQDM	证券代码
JGJYDY	交易单元
JGTGDY	托管单元
JGZQZH	证券帐户
JGDDBH	订单编号,对于资管份额转让,填写结算参与人申报的合同序号。
JGYYB	营业部代码
JGZXBH	执行编号
JGYWLSH	业务流水号
JGCJSL	成交数量
JGQSSL	清算数量
JGJSSL	实际交收数量或 0
JGCJJG	成交价格
JGQSJG	
JGXYJY	
JGPCBS	
JGZQLB	证券类别
JGZQZL	证券子类别
JGAFXZ	'00'
JGLTLX	'0'
JGJSFS	'R'或'N'
JGHBDH	
JGQSBJ	
JGYHS	
JGJYJSF	
JGJGGF	
JGGHF	
JGJSF	
JGSXF	
JGQSYJ	
JGQTFY	

JGZJJE	
JGSFJE	
JGJSBZ	'Y' 或 'N'
JGZYDH	若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号
JGCJRQ	T-1 日或 T 日
JGQSRQ	T-1 日或 T 日
JGJSRQ	T 日
JGFSRQ	T 日
JGQTRQ	
JGSCDM	
JGJYFS	'02' 或 '13'
JGZQDM2	
JGTGDY2	
JGDDBH2	
JGFJSM	
JGBYBZ	

8.2 债券相关业务迁移到固定收益交易平台的结算处理

债券分销, 质押式回购交易及出入库, 债券质押式三方回购交易及存放、提取、换券、补券, 信用保护合约等业务的结算业务类别编码保持不变, 仍使用现有接口发送。上述业务在清算明细库 (SJSJMXn.DBF) 和明细结果库 (SJSJG.DBF) 中其对应的交易方式字段调整为 13, 用于标识“固定收益交易平台”的业务。

具体涉及的接口及业务如下表:

文件名称	业务类别	业务类别说明	备注说明 (原交易方式)
SJSMX1.DBF SJSJG.DBF	JY02	债券分销	02
SJSMX1.DBF	HGCS	质押式回购初始成交	02
SJSMX1.DBF	HGDQ	质押式回购到期成交	02

SJSJG.DBF	ZYRK	质押式回购质押券 入库	03
SJSJG.DBF	ZYCK	质押式回购质押券 出库	03
SJSMX0.DBF SJSJG.DBF	SFCS	债券质押式三方回 购初始交易	02
SJSMX0.DBF SJSJG.DBF	SFDQ	债券质押式三方回 购到期购回	02
SJSMX0.DBF SJSJG.DBF	SFTG	债券质押式三方回 购提前购回	02
SJSMX0.DBF SJSJG.DBF	SFJZ	债券质押式三方回 购解除质押	02
SJSMX0.DBF SJSJG.DBF	SFXZ	债券质押式三方回 购到期续做	02
SJSJG.DBF	SFCF	债券质押式三方回 购存放	02
SJSJG.DBF	SFTQ	债券质押式三方回 购提取	02
SJSJG.DBF	SFHQ	债券质押式三方回 购换券	02
SJSJG.DBF	SFBQ	债券质押式三方回 购补券	02
SJSMX0.DBF SJSJG.DBF	CSTZ	信用保护合约提前 终止	02
SJSMX0.DBF SJSJG.DBF	CSXX	信用保护合约信用 事件现金结算	02
SJSMX0.DBF SJSJG.DBF	CSSX	信用保护合约信用 事件实物结算	02
SJSMX2.DBF	CSFY	信用保护合约信用	02

		事件费用	
--	--	------	--

原交易方式：02 表示综合金融服务平台；03 表示非交易处理平台

8.3 资产支持证券（证券类别为“1Z”）拆分为三类证券子类

为配合深市固定收益产品计价方式调整，资产支持证券（证券类别为“1Z”）拆分为三类证券子类，即优先级、次优先级和次级，分别用 1、2、3 表示，填写于清算明细库（SJSMXn.DBF）和明细结果库（SJSJG.DBF）中对应的证券子类字段。

资产支持证券优先级和次优先级的交易将按净价交易、全价结算；资产支持证券次级的交易将按全价交易、全价结算。

8.4 第 3 批预清算数据内容调整

因债券现券交易时间延长至 15:30，为能在闭市后尽早向全市场发送交易预清算数据，所有品种的结算风险基金将不在第 3 批的预清算数据（SJSQS0.DBF 的 QSJFXJ 字段）中体现，最终清算数据以日终的资金清算汇总数据为准（SJSQS.DBF 的 QSJFXJ 字段包含结算风险基金）。

九、开展债券现券交易的券商系统注意事项

9.1 委托相关说明

可以通过交易网关或交易终端申报债券现券交易委托和接收成交。

通过交易终端申报委托方式请参照交易终端用户手册。

9.2 关于客户委托服务渠道

建议证券公司根据该类业务的目标客户及业务风险属性，自行调整其柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等客户委托渠道（可选择一种或多种渠道）中的相应前端系统，以支持债券现券交易委托指令录入。

9.3 关于券商柜台系统

◇ 向深交所申报各类委托前的风险前端控制

柜台系统应对投资者委托的价格、数量、投资者资金、投资者股份等要素进行前端风险控制，对于不符合前端风险控制要求的委托予以拒绝，不要申报至深交所交易系统。

◇ 对交易系统发送的回报消息的处理

接收到交易系统发送的转发成交申报、转发询价请求后，券商技术系统应对请求编号（即转发成交申报中的客户成交申报编号（TradeReportID）字段、转发询价请求的客户订单编号（ClOrdID）字段）重复的消息去重、过滤后展示；对于所有转发成交申报都必须保证能够展示给指定的接收方，不可以展示给无关人员。特别的，对于转发成交申报的接收方是经纪客户时，券商系统需保证转发成交申报不会被广播至无关的经纪客户。

9.4 关于 STEP 交易接口通信版本号修改

STEP 协议通信版本号修改方法如下：

1、修改登陆消息中的 DefaultCstmApplVerID 字段为指定的通信版本号。
如 STEP 协议接口规范中通信版本号为 1.00，则应将 DefaultCstmApplVerID 设置为 STEP1.20_SZ_1.00。

2、对于 DefaultCstmApplVerID 字段内容的具体修改方法，请联系各自的软件供应商。

十、 联系方式

深圳证券交易所业务：0755-88666359

深圳证券交易所技术：0755-88668863

中国结算深圳分公司业务：0755-21899255

中国结算深圳分公司技术：0755-25946080

附件一、债券现券交易业务的交易数据接口修订说明

(1) 交易主机自动撤单含义表中债券现券竞买成交业务的自动撤单原因及其解释说明。

委托申报拒绝原因代码表

原因代码	原因简称	原因说明
20164	竞买日期错误	竞买预约日期超过业务限制
20165	重复申报	同一证券账户在同一个竞买日对于同一证券代码存在多笔有效竞买预约申报；
20166	无法成交	竞买发起或应价申报不满足成交条件
20167	证券临时停牌	证券发生过临时停牌
20168	竞买不存在	竞买发起申报找不到对应的有效竞买预约申报；竞买应价申报找不到对应的有效竞买发起申报
20169	价格错误	单一主体竞买应价申报委托价格低于或等于当前委托簿中应价申报的委托价格
20170	竞买预约已生效	竞买预约已申报了竞买发起