



深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

深圳证券交易所协议交易询价申报之 券商技术系统变更指南 (Ver1.01)



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		深圳证券交易所协议交易询价申报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
2020-11-6	1.00	创建文档	
2021-1-25	1.01	修改文件	(本文档中橙色修订部分) 修改以下5个域名的Tag：QuoteRequestStatus、NoCounterpartyPBU、CounterPartyPBUID、QuotePrice、QuoteQty

目录

一、 说明	1
二、 业务简介	1
三、 技术实现概况	2
3.1 询价处理模式	3
3.2 询价失效回报发送	3
3.3 各报文 ID 填写规则说明	5
四、 委托申报	6
4.1 询价请求	6
4.2 报价	12
4.3 报价回复	18
五、 转发询价及报价	22
5.1 转发询价请求	22
5.2 转发报价	28
六、 委托申报响应	33
6.1 询价请求响应	33
6.2 报价响应	39
6.3 报价回复响应	47
七、 成交执行报告	1
7.1 Binary 接口成交执行报告	1
7.2 STEP 接口成交执行报告	2
八、 清算和交收	4
九、 开展询价交易的券商系统注意事项	4
9.1 委托相关说明	4
9.2 关于客户委托服务渠道	4
9.3 关于券商柜台系统	4
十、 联系方式	4

深圳证券交易所协议交易询价申报之券商技术系统 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协议交易询价申报，本所会同中国结算深圳分公司专门编制和发布本指南，供相关交易参与者及其 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者带来的影响。

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、 业务简介

询价交易方式指的是投资者作为询价方向一个或多个报价方（询价回复采用报价的方式来开展，询价回复方即为报价方）发送询价请求，并选择一个或多个报价确认成交的交易方式。询价交易作为协议交易业务的一种交易方式。

询价交易的本质是询价双方不断磋商的过程，直到一方或另一方终止磋商。其交易过程可以分为询价与报价两个阶段。具体过程如下所示：

（一）询价阶段

- （1）询价方申报询价请求（一笔询价请求支持同时向一个或多个报价方发起）；
- （2）交易系统转发询价请求给对应的报价方；
- （3）报价方接收到转发询价请求后，若报价方不接受询价，则不进行报价，询价请求在超时后会自动失效，整个交易过程结束；若报价方接受询价，则进入到报价阶段。

（二）报价阶段

- （1）报价方接受询价，申报报价；
- （2）交易系统转发报价给询价方；
- （3）询价方接收到转发报价后，若询价方不接受报价，则报价在询价请求失

效后自动失效。

(4) 询价方接收到转发报价, 询价方接受报价, 询价方申报报价回复, 询价方可以一次性接受一笔或多笔报价。

(5) 交易系统接收报价回复, 并查找报价回复中对应的报价(一笔或多笔), 并进行逐一配对成交, 对于每一笔报价产生一笔成交。

对于上述流程中的询价方申报的询价请求、报价回复及报价方申报的报价, 交易系统都会检查委托的合法性, 对于不合法委托, 交易系统将会拒绝。

三、 技术实现概况

协议交易业务新增询价处理模式。询价处理模式支持处理询价请求、报价、报价回复指令。协议交易询价处理模式的委托及回报对应关系如表 3-1 所示。

表 1-1 委托及回报对应关系说明

业务		ApplID	委托申报		成交回报	
			MsgType (Binary)	MsgType (STEP)	MsgType (Binary)	MsgType (STEP)
协议 交易 询价 申报	询价请求	055	100517	R	200517 200525	R
	报价申报	056	100505	S	200506 200502 200526 200515	AI S 8
	报价回复 申报	057	100510	AJ	200506 200515	AI 8

注: 1) 当报价被主动撤单成功时, 交易系统会返回两笔回报, 一笔为报价状态回报(Binary:200506), 另一笔为订单响应及撤销成功执行报告(Binary:200502)。

3.1 询价处理模式

询价处理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》“3.6 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》“3.6 询价处理消息流程图”一节。

3.2 询价失效回报发送

当一笔合法的询价请求因被成交、被主动撤销或超时后，该笔询价请求失效。询价请求失效时，需要及时通知询价方及报价方该笔询价请求已失效。考虑到一笔询价请求可能包含多个报价方，每个报价方对于询价请求采取的动作可能不一样，在询价请求失效时，报价方所处的状态可能不一样。可以将报价方划分为三种类型：未发送报价的报价方、已发送报价但未成交的报价方、已发送报价且已成交的报价方。

在询价请求状态发生变化时，交易系统会及时告知询价方、报价方各委托的状态，以便市场参与者技术系统做相应的处理。在询价请求状态发生变化时，询价方及报价方接收到各类回报如下表所示：

接收方 情形	询价方	未发送报价的 报价方	已发送报价且未成 交的报价方	已发送报价且已 成交的报价方
询价请求 超时（询价 请求已过 超时时间）	接收一笔询价 请求响应，询价 请求状态为已 超时	接收一笔转发 询价请求，询价 请求状态为已 超时	接收两笔，其中 第一笔为转发询价 请求，询价请求状态 为已超时； 第二笔为报价状态 回报报文，报价状态 为已超时	N/A
询价请求	接收两种回报，	接收一笔转发	接收两笔，其中	接收两笔，其中

被成交	其中第一种回报为成交报告（可能为多笔）； 第二种回报为询价请求响应，询价请求状态为已成交。	询价请求，询价请求状态为已成交	第一笔为转发询价请求，询价请求状态为已成交； 第二笔为报价状态回报报文，报价状态为已撤销	第一笔为成交报告； 第二笔为转发询价请求，询价请求状态为已成交
询价请求被主动撤销	接收一笔询价请求响应	接收一笔转发询价请求，询价请求状态为已撤销	接收两笔，其中 第一笔为转发询价请求，询价请求状态为已撤销； 第二笔为报价状态回报报文，报价状态为已撤销	N/A

注：对于每笔委托，交易系统都会返回一笔 ACK，受篇幅限制，上表未列出每笔委托对应的 ACK。

对应消息报文及主要字段如下表所示（消息报文 ID 以 Binary 为例）：

接收方 情形	询价方	未发送报价的报价方	已发送报价且未成交的报价方	已发送报价且已成交的报价方
询价请求超时（询价请求已过	200517(QuoteRequestStatus=7)	200525(QuoteRequestStatus=7)	200525(QuoteRequestStatus=7)； 200506(QuoteStatus=7)	N/A

超时时间)				
询价请求 被成交	200515 (可能多 笔); 200517(QuoteReq uestStatus=8)	200525(QuoteRequest Status=8)	200525(QuoteRequestSt atus=8); 200506(QuoteStatus=4)	200515; 200525(QuoteReques tStatus=8);
询价请求 被主动撤 销	无	200525(QuoteRequest Status=4)	200525(QuoteRequestSt atus=4); 200506(QuoteStatus=4)	N/A

3.3 各报文 ID 填写规则说明

询价请求、报价、报价回复报文都定义了几个 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		报价 ID	报价回复 ID		客户订单

(10xx10)					编号
----------	--	--	--	--	----

注：

- 1) 对于询价撤销申报，QuoteReqID 必须为原询价请求申报的 QuoteReID；
- 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，QuoteID 填写的为接受报价的转发报价的 QuoteID。

四、 委托申报

4.1 询价请求

4.1.1 Binary 接口委托申报

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=100517		
ApplID	应用标识	055: 询价请求	055: 询价请求
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: 深圳证券交易所	102: 深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01: 中国结算深圳分公司	01: 中国结算深圳分公司
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 或 1	0 或 1
OrderQty	数量	委托数量	委托数量
Price	价格	无意义, 固定填 0	无意义, 固定填 0
Side	买卖方向 1=买 2=卖	1 或 2	1 或 2
ExpireTime	询价请求失效时间 (预留 字段)	询价请求失效时间	询价请求失效时间
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	1 或 2	1 或 2
Memo	备注	备注	备注
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	1、2 或 3

NoCounterpartyPBU	对手方交易单元个数	对手方交易单元个数	0
→ CounterpartyPBUID	对手方交易单元	对手方交易单元	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交易单元个数最多允许申报 20 个。
- 2) 某个投资者（证券账户）通过某个交易单元已经申报了某只证券代码下同方向的有效询价请求（该笔询价请求未成交且未撤销），则不能再次申报重复的询价请求委托。如证券账户 A 在交易单元 888888 下已申报了证券代码 777777 一笔买询价请求，如果该笔询价请求还未成交或被撤销，那么该证券账户 A 不能在交易单元 888888 下再次申报证券代码 777777 的买询价请求，但是可以申报卖询价请求，或者申报其他证券代码的询价请求。
- 3) 备注（Memo）字段可填写联系人、联系方式等内容。
- 4) 暂不支持融资融券交易，信用标识字段固定填 1。
- 5) 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。

4.1.2 STEP 接口委托申报

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	055：询价请求	055：询价请求
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 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	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>					
453	NoRootPartyIDs		参与人代码个数		
→	1117	RootPar	参与人代码	参见注（1）	参见注（1）

		tyID			
	1118	RootPar tyIDSou rce	参与人代码源		
	1119	RootPar tyRole	参与人代码角色		
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=买 2=卖	1 或 2	1 或 2	
10200	QuoteRequestTrans Type	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=Private Quote, 私有 报价 1=Public Quote, 公开 报价	0 或 1	0 或 1	
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)	1 或 2	1 或 2	

		1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股		
10198	Memo	备注	备注	备注
544	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	1、2 或 3
组 件 < CompDeliverCounterpartyPBU >				
10223	NoCounterpartyPBU	对手方交易单元个数	对手方交易单元个数	0
→	10224 CounterpartyPBUID	对手方交易单元	对手方交易单元	N/A
组件结束				
58	Text	Free Text	Free Text	Free Text

注：

1) RootParties 填写说明

申报询价请求必须包括以下三个参与人代码：

RootPartyID (1117)	RootPartyIDSource (1118)	RootPartyRole (1119)
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元

营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码

4.2 报价

4.2.1 Binary 接口委托申报

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=100505		
ApplID	应用标识	056: 报价	056: 报价
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 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提 供商 106=结算公司	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
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	买报价	买报价
OfferPx	卖报价	卖报价	卖报价
BidSize	买数量	买数量	0
OfferSize	卖数量	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	报价回复消息编号	报价回复消息编号
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	0 或 1	0 或 1
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=Percentage, 百分比 2=Per Unit, 每交易单位	1 或 2	1 或 2
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	1	1、2 或 3

	平仓		
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	对手方交易单元	对手方交易单元
Memo	备注	备注	备注

注：

- 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) 报价的证券代码需与询价请求中的一致，报价的报价方向需与询价请求的买卖方向相反，报价的申报交易单元需属于询价请求中的对方交易单元代码组。
- 4) 报价方进行卖出时，证券账户需有足够的股份。
- 5) 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：申报报价的交易单元、方向和证券标的与交易系统中报价的交易单元、方向、证券标的均一致。
- 6) 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。

4.2.2 STEP 接口委托申报

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	056	056
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 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商	订单所有者类型	订单所有者类型

			106=结算公司		
60	TransactTime		报价发起时间	委托时间	委托时间
131	QuoteReqID		报价请求 ID	报价请求 ID， 当报价是对询价请求的响应时，填写询价请求的 QuoteReqID	填写被撤报价中的 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	参与人代码个数	参与人代码个数
→	448	PartyID	参与人代码	参见注（1）	
	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	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	报价回复消息 编号	报价回复消息 编号
1171	PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	0 或 1	0 或 1
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=Per Unit, 每	1 或 2	1 或 2

		交易单位		
544	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	1、2 或 3
10198	Memo	备注	备注	备注
58	Text	Free Text	Free Text	Free Text

注：

1) 参与人代码说明

报价申报必须包括以下四个参与人代码：

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
对手方交易单元 (CounterpartyPBU)	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元
营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码

结算机构代码为选填项，不填则缺省为 01（中国证券登记结算公司深圳分公司）：

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
结算机构代码	F=交割机构	4=结算机构代码

4.3 报价回复

4.3.1 Binary 接口委托申报

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=100510	
ApplID	应用标识	057: 报价回复
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 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	订单所有者类型
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
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=买 2=卖	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=Per Unit, 每交易单位	1 或 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=Cash, 普通交易	1

	2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓	
--	---------------------------------------	--

注:

- 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)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) 报价回复方进行卖出时, 证券账户需有足够的股份。
- 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。

4.3.2 STEP 接口委托申报

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=AJ	
1180	ApplID	应用标识	057: 报价回复
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 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	订单所有者类型
60	TransactTime	报价发起时间	委托时间

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	
→	448	PartyID	参与人代码	参见注（1）
	447	PartyIDSource	参与人代码源	
	452	PartyRole	参与人代码角色	
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 或 2

		1=Percentage, 百分比 2=Per Unit, 每交易单位	
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			
58	Text	Free Text	Free Text

注：

1) 参与人代码说明

报价回复申报必须包括以下三个参与人代码：

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
交易单元 (PBU)	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码

结算机构代码为选填项，不填则缺省为 01（中国证券登记结算公司深圳分公司）：

PartyID (448)	PartyIDSource (447)	PartyRole (452)
结算机构代码	F=交割机构	4=结算机构代码

五、 转发询价及报价

5.1 转发询价请求

5.1.1 Binary 接口委托申报

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头	

	MsgType=200525	
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	055: 询价请求
ReportingPBUID	回报交易单元	原询价请求中对手方交易单元组中的某一个
SubmittingPBUID	原申报交易单元	与原询价请求一致
SecurityID	证券代码	与原询价请求一致
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	与原询价请求一致
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与原询价请求一致
ClearingFirm	结算机构代码	与原询价请求一致
TransactTime	回报时间	生成转发询价请求的系统时间
UserInfo	用户私有信息	全空格
OrderID	交易所订单编号	与原询价请求的交易所订单编号一致
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
ClOrdID	客户订单编号	交易系统生成的当日唯一编号
AccountID	证券账户	全空格
QuoteReqID	询价请求编号	交易系统生成的当日唯一编号
QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0=New, 新订单 1=Cancel, 撤销	若为询价请求申报, 则取值为 0; 若为询价请求撤销, 则取值为:1

QuoteRequestType	询价请求类型 101=Submit, 提交 102=Alleged, 转发	102
QuoteRequestStatus	询价请求状态 0=Accepted, 已接受 4=Cancelled, 已撤销 7=Expired, 已超时 8=Filled, 已成交	0、4、7 或 8
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	与原询价请求一致
OrderQty	数量	与原询价请求一致
Price	价格	与原询价请求一致
Side	买卖方向 1=买 2=卖	与原询价请求一致
ExpireTime	询价请求失效时间	交易系统根据接收询价请求的系统时间计算的询价请求超时时间
QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易的报价	与原询价请求一致
QuotePriceType	报价价格类型(预留字段) 1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股	与原询价请求一致
Memo	备注	与原询价请求一致

CashMargin	信用标识	与原询价请求一致
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	原询价请求的对手方交易单元

注：

- 1) 一笔询价请求包含多个报价方时，交易系统生成的多笔转发询价请求中的 QuoteReqID 字段取值相同,执行编号 (ExecID) 字段取值不同。
- 2) 当询价请求失效时（因被主动撤销、被成交或超时），交易系统将对每一个报价方生成一笔转发询价请求，询价请求事务类型字段(QuoteRequestTransType)取值为 1（Cancel）。
- 3) 当询价请求失效时，交易系统生成的转发询价请求中的 QuoteReqID 为原转发询价请求的 QuoteReqID。

5.1.2 STEP 接口委托申报

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=R	
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	055：询价请求
131	QuoteReqID	报价请求 ID	交易系统生成的当日唯一编号
11	ClOrdID	客户订单编号	交易系统生成的当日唯一编号
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
537	QuoteType	报价类型 1= Tradeable，表示可交	与原询价请求一致

			易的报价	
522	OwnerType		订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与原询价请求一致
60	TransactTime		订单发起时间	生成转发的系统时间
组件<Instrument>				
48	SecurityID		证券代码	与原询价请求一致
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	与原询价请求一致
组件结束				
组件<RootParties>				
1116	NoRootPartyIDs		参与人代码个数	与原询价请求一致
→	1117	RootPartyID	参与人代码	与原询价请求一致
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	与原询价请求一致
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	与原询价请求一致
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
38	OrderQty		订单数量	与原询价请求一致
组件结束				
54	Side		买卖方向	与原询价请求一致

44	Price	价格	与原询价请求一致
10200	QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0=New, 新订单 1=Cancel, 撤销	与原询价请求一致
303	QuoteRequestType	询价请求类型 101=Submit, 提交 102=Alleged, 转发	102
10222	QuoteRequestStatus	询价请求状态 0=Accepted, 已接受 4=Cancelled, 已撤销 7=Expired, 已超时 8=Filled, 已成交	0、4、7 或 8
1171	PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	与原询价请求一致
126	ExpireTime	询价请求失效时间（预留字段）	与原询价请求一致
692	QuotePriceType	报价价格类型（预留字段） 1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股	与原询价请求一致
10198	Memo	备注	与原询价请求一致
544	CashMargin	信用标识	与原询价请求一致
58	Text	Free Text	与原询价请求一致

5.2 转发报价

5.2.1 Binary 接口委托申报

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=200526	
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	056: 报价
ReportingPBUID	回报交易单元	与原报价的对手方交易单元一致
SubmittingPBUID	原申报交易单元	与原报价一致
SecurityID	证券代码	与原报价一致
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	与原报价一致
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与原报价一致
ClearingFirm	结算机构代码	与原报价一致
TransactTime	回报时间	生成转发报价的系统时间
UserInfo	用户私有信息	全空格
OrderID	交易所订单编号	与原询价请求的交易所订单编号一致
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
ClOrdID	客户订单编号	交易系统生成的当日唯一编号
AccountID	证券账户	全空格

QuoteReqID	报价请求消息编号	与原询价请求的 QuoteReqID 一致
QuoteID	报价消息编号	交易系统生成的当日唯一编号
QuoteRespID	报价回复消息编号	全空格
QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易的报价	与原报价一致
BidPx	买报价	与原报价一致
OfferPx	卖报价	与原报价一致
BidSize	买数量	与原报价一致
OfferSize	卖数量	与原报价一致
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	与原报价一致
ValidUntilTime	报价有效时间(预留字段)	与原报价一致
PriceType	价格类型(预留字段)	与原报价一致
Memo	备注	与原报价一致
CashMargin	信用标识	与原报价一致
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	对手方交易单元

注:

1) 当报价方主动撤单报价时, 交易系统生成的转发报价中的 QuoteID 字段与原转发报价的 QuoteID 字段取值一致。

5.2.2 STEP 接口委托申报

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=S	
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	056: 报价
11	ClOrdID	客户订单编号	交易系统生成的当日唯一编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与原报价一致
131	QuoteReqID	询价请求编号	与原询价请求的QuoteReqID一致
117	QuoteID	报价消息编号	交易系统生成的当日唯一编号
537	QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易的 报价	与原报价一致
60	TransactTime	回报发起时间	生成转发的系统时间
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	与原报价一致

22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	与原报价一致
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	与原报价一致
→	448	PartyID	参与人代码	与原报价一致
	447	PartyIDSource	参与人代码源	与原报价一致
	452	PartyRole	参与人代码角色	与原报价一致
组件结束				
132	BidPx		买报价	与原报价一致
133	OfferPx		卖报价	与原报价一致
134	BidSize		买数量	与原报价一致
135	OfferSize		卖数量	与原报价一致
37	OrderID		交易所订单编号	交易所订单编号
17	ExecID		执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
693	QuoteRespID		报价回复消息编号	空
423	PriceType		价格类型（预留字段） 1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股	与原报价一致
62	ValidUntilTime		报价有效时间(预留字段)	与原报价一致
544	CashMargin		信用标识	与原报价一致
10198	Memo		备注	与原报价一致

58	Text	Free Text	与原报价一致
----	------	-----------	--------

六、 委托申报响应

6.1 询价请求响应

6.1.1 Binary 接口询价请求响应

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=200517	
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	055: 询价请求
ReportingPBUID	回报交易单元	回报交易单元
SubmittingPBUID	原申报交易单元	原申报交易单元
SecurityID	证券代码	与原询价请求一致
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	与原询价请求一致
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与原询价请求一致
ClearingFirm	结算机构代码	与原询价请求一致
TransactTime	回报时间	生成回报的系统时间
UserInfo	用户私有信息	与原询价请求一致
OrderID	交易所订单编号	与原询价请求的交易所订单编号一致
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
ClOrdID	客户订单编号	与原询价请求一致
AccountID	证券账户	与原询价请求一致

BranchID	营业部代码	与原询价请求一致
QuoteReqID	询价请求编号	与原询价请求一致
QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0=New, 新订单 1=Cancel, 撤销	与原询价请求一致
QuoteRequestType	询价请求类型 101=Submit, 提交 102=Alleged, 转发	101
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	与原询价请求一致
QuoteRequestStatus	询价请求状态 0=Accepted, 已接受 4=Cancelled, 已撤销 5=Rejected, 已拒绝 7=Expired, 已超时 8=Filled, 已成交	0、4、5、7 或 8
QuoteRequestRejectReason	拒绝原因代码	若被接受, 则填 0 若被拒绝或自动撤销, 填 拒绝原因代码
OrderQty	数量	与原询价请求一致
Price	价格	与原询价请求一致
Side	买卖方向 1=买 2=卖	与原询价请求一致
ExpireTime	询价请求失效时间	与原询价请求一致
QuoteType	报价类型	与原询价请求一致

		1=Tradeable, 可交易的报价	
QuotePriceType		报价价格类型(预留字段) 1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股	与原询价请求一致
Memo		备注	与原询价请求一致
CashMargin		信用标识	与原询价请求一致
NoCounterpartyPBU		对手方交易单元个数	与原询价请求一致
→	CounterpartyPBUID	对手方交易单元	与原询价请求一致

注:

1) 当询价请求因被成交或超时失效时, 交易系统会生成一笔询价请求响应发给询价方; 若为被成交失效, 则 QuoteRequestStatus 字段取值为 8; 若因超时失效, 则 QuoteRequestStatus 字段取值为 7。

6.1.2 STEP 接口询价请求响应

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=R	
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	055: 询价请求
131	QuoteReqID	报价请求 ID	报价请求 ID
11	ClOrdID	客户订单编号	与原询价请求一致
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
537	QuoteType	报价类型	与原询价请求一致

		1=Tradeable, 可交易的 报价	
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与原询价请求一致
60	TransactTime	订单发起时间	生成回报的系统时间
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	与原询价请求一致
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	与原询价请求一致
组件结束			
组件< RootParties >			
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	与原询价请求一致
→	1117	RootPartyID	与原询价请求一致
	1118	RootPartyIDSource	与原询价请求一致
	1119	RootPartyRole	与原询价请求一致
组件结束			
组件<OrderQtyData>			
38	OrderQty	订单数量	与原询价请求一致
组件结束			

54	Side	买卖方向	买卖方向
10200	QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0=New, 新订单 1=Cancel, 撤销	与原询价请求一致
303	QuoteRequestType	询价请求类型 101=Submit, 提交 102=Alleged, 转发	101
10222	QuoteRequestStatus	询价请求状态 0=Accepted, 已接受 4=Cancelled, 已撤销 5=Rejected, 已拒绝 7=Expired, 已超时 8=Filled, 已成交	0、4、5、7 或 8
658	QuoteRequestRejectReason	拒绝原因代码	若被接受, 则填 0 若被拒绝或自动撤销, 填拒绝原因代码
1171	PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报价 1=Public Quote, 公开报价	与原询价请求一致
126	ExpireTime	询价请求失效时间	与原询价请求一致
692	QuotePriceType	报价价格类型 (预留字段) 1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股	与原询价请求一致
10198	Memo	备注	与原询价请求一致
544	CashMargin	信用标识	与原询价请求一致
组 件 <			

CompDeliverCounterpartyPBU>				
10223	NoCounterpartyPBU		对手方交易单元个数	与原询价请求一致
→	102 24	CounterpartyPB UID	对手方交易单元	与原询价请求一致
组件结束				
58	Text		Free Text	与原询价请求一致

6.2 报价响应

6.2.1 Binary 接口报价响应

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=200506	
ApplID	应用标识	056: 报价
ReportingPBUID	回报交易单元	回报交易单元
SubmittingPBUID	原申报交易单元	原申报交易单元
SecurityID	证券代码	与报价委托一致
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	与报价委托一致
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与报价委托一致
ClearingFirm	结算机构代码	与报价委托一致
TransactTime	回报时间	生成回报的系统时间
UserInfo	用户私有信息	与报价委托一致
QuoteMsgID	客户报价消息编号	与报价委托一致; 若报价主动撤单, 则与撤单委托一致
AccountID	证券账户	与报价委托一致
QuoteReqID	报价请求 ID	与报价委托一致
QuoteStatus	报价状态	0、4、5 或 7

	0=已接受 4=已撤销 5=已拒绝 7=已超时	
QuoteRejectReason	拒绝原因代码	若被接受, 则填 0 若被拒绝或自动撤销, 填 拒绝原因代码
QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易 的报价	与报价委托一致
BidPx	买报价	与报价委托一致
OfferPx	卖报价	与报价委托一致
BidSize	买数量	与报价委托一致
OfferSize	卖数量	与报价委托一致
BranchID	营业部代码	与报价委托一致
OrderID	交易所订单编号	与原委托的交易所订单 编号一致
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯 一编号
QuoteRespID	报价回复消息编号(预留 字段)	与报价委托一致
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报 价 1=Public Quote, 公开报 价	与报价委托一致
Side	方向	与报价委托一致
PriceType	价格类型(预留字段)	与报价委托一致
ValidUntilTime	报价有效时间(预留字 段)	与报价委托一致

CashMargin	信用标识	与报价委托一致
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	与报价委托一致
Memo	备注	与报价委托一致
NoQuote	报价消息个数	1
→ QuoteID	报价消息编号	与报价委托一致
→ QuotePrice	报价价格	0
→ QuoteQty	报价数量	0

6.2.1 Binary 接口报价主动撤单响应

当询价方主动撤单时，交易系统首先发一笔报价响应报文，然后还会发一笔订单响应及撤单成功执行报告。

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=200502	
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	与报价委托一致
ReportingPBUID	回报交易单元	与报价委托一致
SubmittingPBUID	申报交易单元	与报价委托一致
SecurityID	证券代码	与报价委托一致
SecurityIDSource	证券代码源	与报价委托一致
OwnerType	订单所有者类型	与报价委托一致
ClearingFirm	结算机构代码	与报价委托一致
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	与报价委托一致

OrderID	交易所订单编号	与被撤销报价的 OrderID 一致
ClOrdID	客户订单编号	与被撤报价委托 QuoteMsgID 一致
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	与被撤销报价的 ClOrdID 一致
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
ExecType	执行类型	4
OrdStatus	订单状态	4
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	0
LeavesQty	订单剩余数量	0
CumQty	累计执行数量	已成交数量
Side	买卖方向	与报价委托一致
OrdType	订单类别	2
OrderQty	订单数量	与报价委托一致
Price	价格	与报价委托一致
AccountID	证券账户	与报价委托一致
BranchID	营业部代码	与报价委托一致
OrderRestrictions	订单限定	0
ConfirmID	约定号	空
CashMargin	信用标识	0

6.2.2 STEP 接口报价响应

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	056: 报价
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号	与原报价一致
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与原报价一致
131	QuoteReqID	询价请求编号	与 询 价 请 求 的 QuoteReqID 一致
537	QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易的 报价	与原报价一致
297	QuoteStatus	报价状态 0=已接受 4=已撤销 5=已拒绝 7=已超时	0、4 或 5
300	QuoteRejectReason	报价拒绝原因代码	若被接受, 则填 0 若被拒绝或自动撤销, 填拒绝原因代码
1328	RejectText	报价拒绝原因说明	报价拒绝原因说明
60	TransactTime	报价接收时间	生成转发的系统时间

组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	与原报价一致
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	与原报价一致
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	与原报价一致
→	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	与原报价一致
133	OfferPx	卖报价	与原报价一致
134	BidSize	买数量	与原报价一致
135	OfferSize	卖数量	与原报价一致
37	OrderID	交易所订单编号	交易所订单编号
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
693	QuoteRespID	报价回复消息编号	与原报价一致
54	Side	买卖方向	与原报价一致
423	PriceType	价格类型（预留字段） 1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股	与原报价一致
62	ValidUntilTime	报价有效时间（预留字	与原报价一致

		段)	
544	CashMargin	信用标识	与原报价一致
10198	Memo	备注	与原报价一致
组件<CompDeliverQuote>			
10199	NoQuote	报价消息个数	1
→	117	QuoteID	报价消息编号
	10225	QuotePrice	报价价格
	10226	QuoteQty	报价数量
组件结束			
58	Text	Free Text	与原报价一致

6.2.3 Step 接口报价主动撤单响应

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	应用标识	与原报价一致
522	OwnerType	订单所有者类型	与原报价一致
529	OrderRestrictions	订单限定	与原报价一致
17	ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
37	OrderID	交易所订单编号	与被撤销报价的 OrderID 一致
150	ExecType	执行类型	4

39	OrdStatus	订单状态	4
31	LastPx	成交价	与原报价一致
32	LastQty	成交数量	与原报价一致
151	LeavesQty	剩余量	0
14	CumQty	累计成交数量	已成交数量
103	OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	0
1328	RejectText	撤单/拒绝原因说明	空
54	Side	买卖方向	与原报价一致
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	与被撤报价委托 QuoteMsgID 一致
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	与原报价一致
22	SecurityIDSource	证券代码源	与原报价一致
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	与原报价一致
→	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	与原报价一致

组件结束			
44	Price	价格	与原报价一致
544	CashMargin	信用标识	与原报价一致

6.3 报价回复响应

6.3.1 Binary 接口报价回复响应

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=200506	
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	057: 报价回复
ReportingPBUID	回报交易单元	回报交易单元
SubmittingPBUID	原申报交易单元	原申报交易单元
SecurityID	证券代码	与报价回复一致
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	与报价回复一致
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与报价回复一致
ClearingFirm	结算机构代码	与报价回复一致
TransactTime	回报时间	生成回报的系统时间
UserInfo	用户私有信息	与报价回复一致
QuoteMsgID	客户报价消息编号	与报价回复的客户订单编号一致

AccountID	证券账户	与报价回复一致
QuoteReqID	报价请求编号	与报价回复一致
QuoteStatus	报价状态 0=已接受 4=已撤销 5=已拒绝 7=已超时	0 或 5
QuoteRejectReason	拒绝原因代码	若被接受, 则填 0 若被拒绝或自动撤销, 填 拒绝原因代码
QuoteType	报价类型 1=Tradeable, 可交易 的报价	与报价回复一致
BidPx	买报价	与报价回复一致
OfferPx	卖报价	与报价回复一致
BidSize	买数量	与报价回复一致
OfferSize	卖数量	与报价回复一致
OrderID	交易所订单编号	与报价回复一致
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一 编号
QuoteRespID	报价回复消息编号	与报价回复一致
PrivateQuote	私有报价 0=Private Quote, 私有报 价 1=Public Quote, 公开报 价	与报价回复一致

Side	买卖方向	与报价回复一致
PriceType	价格类型(预留字段)	与报价回复一致
ValidUntilTime	报价有效时间(预留字段)	与报价回复一致
CashMargin	信用标识	与报价回复一致
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	与报价回复一致
Memo	备注	与报价回复一致
NoQuote	报价消息个数	与报价回复一致
→	QuoteID	报价消息编号
→	QuotePrice	报价价格
→	QuoteQty	报价数量

6.3.2 STEP 接口报价回复响应

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	057: 报价回复
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号	与原报价回复的客户订单编号一致
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	与原报价回复一致

131	QuoteReqID			与原报价回复一致
537	QuoteType		报价类型 1=Tradeable，可交易的 报价	与原报价回复一致
297	QuoteStatus		报价状态 0=已接受 4=已撤销 5=已拒绝 7=已超时	0 或 5
300	QuoteRejectReason		报价拒绝原因代码	若被接受，则填 0 若被拒绝或自动撤 销，填拒绝原因代码
1328	RejectText		报价拒绝原因说明	报价拒绝原因说明
60	TransactTime		报价接收时间	生成转发的系统时 间
组件<Instrument>				
48	SecurityID		证券代码	与原报价回复一致
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	与原报价回复一致
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	与原报价回复一致
→	448	PartyID	参与人代码	与原报价回复一致
	447	PartyIDSource	参与人代码源	与原报价回复一致

	452	PartyRole	参与人代码角色	与原报价回复一致
组件结束				
132	BidPx		买报价	与原报价回复一致
133	OfferPx		卖报价	与原报价回复一致
134	BidSize		买数量	与原报价回复一致
135	OfferSize		卖数量	与原报价回复一致
37	OrderID		交易所订单编号	交易所订单编号
17	ExecID		执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
693	QuoteRespID		报价回复消息编号	与原报价回复一致
54	Side		买卖方向	与原报价回复一致
423	PriceType		价格类型（预留字段） 1=Percent of par, 百分比 2=Per Share, 每股	与原报价回复一致
62	ValidUntilTime		报价有效时间（预留字段）	与原报价回复一致
544	CashMargin		信用标识	与原报价回复一致
10198	Memo		备注	与原报价回复一致
组件<CompDeliverQuote>				
10199	NoQuote		报价消息个数	与原报价回复一致
→	117	QuoteID	报价消息编号	与原报价回复一致
	10225	QuotePrice	报价价格	与原报价回复一致
	10226	QuoteQty	报价数量	与原报价回复一致
组件结束				

58	Text	Free Text	与原报价回复一致
----	------	-----------	----------

七、 成交执行报告

7.1 Binary 接口成交执行报告

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx15	200515
PlatformID	平台 ID	平台 ID
PartitionNo	平台分区号	平台分区号
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	报价或报价回复的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
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
ConfirmID	约定号	空
CashMargin	信用标识	1

注：

1) 交易系统支持询价方一次性对多笔报价进行回复，交易系统将该笔报价回复与每一笔已选择的报价进行成交，并分别生成成交执行报告。如询价方一次选了 3 笔报价，那么询价方将接收到 3 笔成交执行报告，每个报价方分别接收到一笔成交执行报告。

2) 对于询价方收到的成交执行报告，ApplID 取值为 057；对于报价方收到的成交执行报告，ApplID 取值为 056。

7.2 STEP 接口成交执行报告

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	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	交易系统生成的当日唯一编号
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	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	原始委托未成交且未撤销的数量
14	CumQty		累计成交数量	原始委托已经成交的数量
54	Side		买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime		执行报告时间	成交执行报告生成时间
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			
544	CashMargin	信用标识	原始委托的信用标识

八、 清算和交收

询价交易沿用现有业务类别‘JY00’。清算明细库（SJSMX1.DBF 中）交易方式为 02 综合金融服务平台交易（不含盘后定价交易部分）（经深交所）。具体接口详见最新的《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版）》。

在结算方式上，询价交易与其他担保交易一并纳入当日担保结算品种合并做净额担保结算，使用现有结算备付金账户完成资金交收。

九、 开展询价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，以支持询价交易指令录入。

9.3 关于券商柜台系统

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。

十、 联系方式

深圳证券交易所技术：0755-88668369

深圳证券交易所业务：0755-88668318

中国结算深圳分公司业务：0755-21899261

中国结算深圳分公司技术：0755-25946080