



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

(Ver1.07)



深圳证券交易所
中国结算深圳分公司
二〇二三年八月

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	1、修改交易接口关于竞买成交主动撤单接口的内容。
2022-05-15	1.05	修改文件	1、补充最近价、收盘价等字段的发布方式说明

2022-07-26	1.06	修改文件	1、补充交易解除的接口内容； 2、补充结算方式可选的接口内容； 3、补充协商成交合并申报的接口内容。 4、补充RTGS结算配套功能优化的接口内容。
2023-8-28	1.07	修改文件	(本档中橙色修订部分) 1、点击成交报价委托启用MinQty字段以支持全额成交功能； 2、合并申报结算方式支持104（逐笔全额）。

目录

一、 说明	5
二、 变更范围汇总	5
三、 债券现券交易业务简介	6
四、 技术实现概况	8
4.1 新增债券现券交易业务	8
4.2 债券相关业务迁移到固定收益交易平台	9
4.3 债券相关成交量统计指标调整	10
4.4 债券计价方式调整	12
五、 交易参考信息	13
六、 交易接口	14
6.1 匹配成交	17
6.2 协商成交（非合并申报）	20
6.3 点击成交	28
6.4 询价成交	40
6.5 竞买成交	58
6.6 协商成交（合并申报）	72
6.7 交易解除	99
七、 行情接口	108
八、 开展债券现券交易的券商系统注意事项	110
8.1 委托相关说明	110
8.2 关于客户委托服务渠道	110
8.3 关于券商柜台系统	110
8.4 关于 STEP 交易接口通信版本号修改	111
附件一、债券现券交易业务的交易数据接口修订说明	112

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、 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，并支持交易解除。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。

合并申报是指做市商或者本所认可的其他机构与单一买方和单一卖方就同一交易品种相同数量、不同或相同交易价格、同一结算方式、同一结算周期达成交易意向的，可以由做市商或者本所认可的其他机构合并向交易系统申报，合并申报经买方和卖方确认后达成成交的交易方式。做市商或者本所认可的其他机构将合并申报交易要素通过交易系统分别发送给买方和卖方，经买方和卖方确认后，由交易系统确认成交。

协商成交(含合并申报)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。

6、交易解除

交易解除是指交易双方经协商一致，对采用逐笔全额结算的债券现券交易成交进行交易解除的机制。交易一方将协商一致的交易解除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，由交易系统确认进行交易解除。

交易解除的交易时间为：每个交易日的 9:00 至 11:30、13:00 至 15:30。

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	02	综合金融服务平台	1、行情发布频道仍

回购			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 D R	CHINEXT DEPOSITORY RECEIPTS	创业板存托凭证竞价交易成交量
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（非合并申报）	成交申报	AE	104103	411
协商成交（合并申报）	成交申报	AE	104103	41A
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			
交易解除	成交申报	AE	104103	419

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。

对于协商成交非合并申报、交易解除的委托处理，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。

对于协商成交合并申报的委托处理，采用双边确认成交报告申报模式，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》“双边确认成交报告申报模式 (two party report for claim)”一节或《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》“双边确认成交报告申报模式 (two party report for claim)”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，结算方式可选择为 103（净额结算）或者 104（逐笔全额）；否则取值固定为 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。目前仅询价成交、点击成交、协商成交方式达成的结算方式为 104（逐笔全额）的成交在未开始交收前可进行交易解除。需在交易解除委托中提供待解除成交的执行编号，成交方式、成交确认消息类型及对应执行编号字段名的对应关系如下表：

成交方式	成交确认消息类型 (Binary/STEP)	执行编号字段名
------	---------------------------	---------

询价成交、点击成交	204115/8	ExecID
协商成交	204103/AE	ExecID

成交确认消息的执行编号单个交易日内不重复，交易系统在转发发起方的交易解除请求给响应方时，会将响应方对应待解除成交的执行编号填充至转发消息中，供响应方确认。交易解除的转发成交申报仅会转发给待解除成交对手方申报交易单元上，而非群发给对手方交易商已报备的接收转发消息的交易单元上。

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
TransacTime	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	2

		U=本方最优	
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（非合并申报）

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	响应方成交请求 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	订单所有者类型	订单所有者类型

	102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起		
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, 响应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 预留, 固定填 0	0	0
ConfirmID	约定号	若响应方交易主体类型为 03/04, 则不能为全空格	若响应方交易主体类型为 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	响应方交易单元
AccountID	本方证券账户	发起方证券账户	响应方证券账户
BranchID	本方营业部代码	发起方营业部代码	响应方营业部代码
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 04=个人经纪	全空格	全空格
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	响应方交易商代码
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	响应方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	发起方交易主体代码	响应方交易主体代码
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，需填写响应方 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	响应方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	响应方交易商代码	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	响应方交易主体类型	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	响应方交易主体代	填转发成交申报的

		码	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	响应方交易员代码	填转发成交申报的本方交易员代码
SettlType	结算方式 103=多边净额 104=逐笔全额	103 或 104	103 或 104
SettlPeriod	结算周期	0 或 1	0 或 1
CounterpartyLastPx	对手方成交价格	0	0
CashMargin	信用标识	1	1
Memo	备注	备注	备注
CounterpartyMemo	对手方备注	全空格	全空格
CounterpartyConfirmID	对手方约定号	全空格	全空格
CounterpartyLastQty	对手方数量	0.00	0.00
OrigTradeDate	原成交申报日期	0	0
SecondaryExecID	第二执行编号	全空格	全空格

说明：

(1) 对于 SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为 103 或 104，否则为 104。对于 SettlPeriod，若 SettlType 为 103，则取值为 1，否则为 0。

(2) 当响应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。响应方拒绝或接受发起方委托时，若响应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、响应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	响应方成交请求字段 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=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	2 或 3
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，需与响应方交易单元一致
	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	发起方交易单元	响应方交易单元
		447	PartyIDSource	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
		452	PartyRole	1=交易单元	1=交易单元
		448	PartyID	发起方证券账户	成交申报类型为 2 时填响应方证券账户，成交申报类型为 3 时不用填写
		447	PartyIDSource	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	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	发起方营业部代码	响应方营业部代码
		447	PartyIDSource	D=自定义代码	D=自定义代码
		452	PartyRole	4001=营业部代码	4001=营业部代码
		448	PartyID	发起方交易商代码	响应方交易商代码

	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	响应方交易主体代码
	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	当响应方交易主体类型为 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	响应方交易主体类型
	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	响应方客户名称 当响应方交易主体类型为 03=机构经纪且成交申报类型为 2=接受成交申报时, 填写响应方客户名称; 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	响应方客户名称 当响应方交易主体类型为 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	响应方交易员代码
	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	响应方交易商代码	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	响应方交易主体代码	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: 响应方交易主体代码	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	响应方交易主体类型	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	响应方交易员代码	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	103 或 104	103 或 104
10216	SettlPeriod			结算周期	0 或 1	0 或 1
664	ConfirmID			约定号	若响应方交易主体类型为 03/04，则不能为全空格	若响应方交易主体类型为 03/04，则不能为全空格
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	1, 点击成交目前仅支持公开报价	1

	有报价 1=Public Quote, 公开报价		
ValidUntilTime	报价有效时间(预留字段)	0	0
PriceType	价格类型(预留字段) 1=Percentage, 百分比 2=PerUnit, 每交易单位	1 或 2	1 或 2
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	103 或 104	103 或 104
SettlPeriod	结算周期	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	若为买方, 填 0 或 BidSize; 若为卖方, 填 0 或 OfferSize	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
→	CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型	N/A
→	CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	N/A
→	CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	N/A
→	CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	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) 对于 SettleType, 若证券支持匹配成交, 则取值为 103 或 104, 否则为 104。对于 SettlePeriod, 若 SettleType 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。
- 8) MinQty 用于指定最低成交数量, 仅能填 0 或委托数量。当 MinQty 为委托数量时, 代表全额成交; 当 MinQty 为 0 时, 代表非全额成交。

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
	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	申报交易单元
	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	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	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
	452	PartyRole	参与人代码角色	7=交易商代码
	448	PartyID	参与人代码	本方交易主体代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	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
	803	PartySubID Type	参与方子代码类型	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
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=PublicQuote, 公开报价	1, 点击成交目前仅支持 公开报价	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=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 103=多边净额 104=逐笔全额	103 或 104	103 或 104
10216	SettlPeriod	结算周期	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	若为买方, 填 0 或 BidSize; 若为卖方, 填 0 或 OfferSize	若为买方, 填 0 或 BidSize; 若为卖方, 填 0 或 OfferSize

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	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 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	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，且不能小于逐笔行情中揭示的最低成交数量。
- 3) 对于 SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为 103 或 104，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	与报价逐笔委托行情的 SettlType 一致
10216	SettlPeriod	结算周期	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	填写报价逐笔委托行情的 QuoteID
	10225	QuotePrice	填写报价逐笔委托行情的 Price
	10226	QuoteQty	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	1

		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	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 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	103 或 104	103 或 104
SettlPeriod		结算周期	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) 对于 SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为 103 或 104，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个字段的填写情况
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	NestedPartySubIDType	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，目前仅支持私有报价	0	
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	103 或 104	103 或 104	
10216	SettlPeriod	结算周期	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,	卖报价

		则填买报价卖报价	
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 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 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	103 或 104	与转发询价请求的 SettlType 一致
SettlPeriod		结算周期	0 或 1	与转发询价请求的 SettlPeriod 一致
PreTradeAnonymity		是否匿名，预留 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	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 为全空格时填写，否 则填 0	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。
- 9) 暂不支持融资融券交易, 信用标识字段固定填 1。
- 10) 对于 SettlType, 若证券支持匹配成交, 则取值为 103 或 104, 否则为 104。对于 SettlPeriod, 若 SettlType 为 103, 则取值为 1, 否则为 0。
- 11) 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=PrivateQu ote, 私有报价 1=PublicQuo te, 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 103=多边净额 104=逐笔全 额	103 或 104	103 或 104
10216	SettlPeriod	结算周期	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 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 103=多边净额 104=逐笔全额	与询价请求的 SettlType 一致
SettlPeriod		结算周期	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

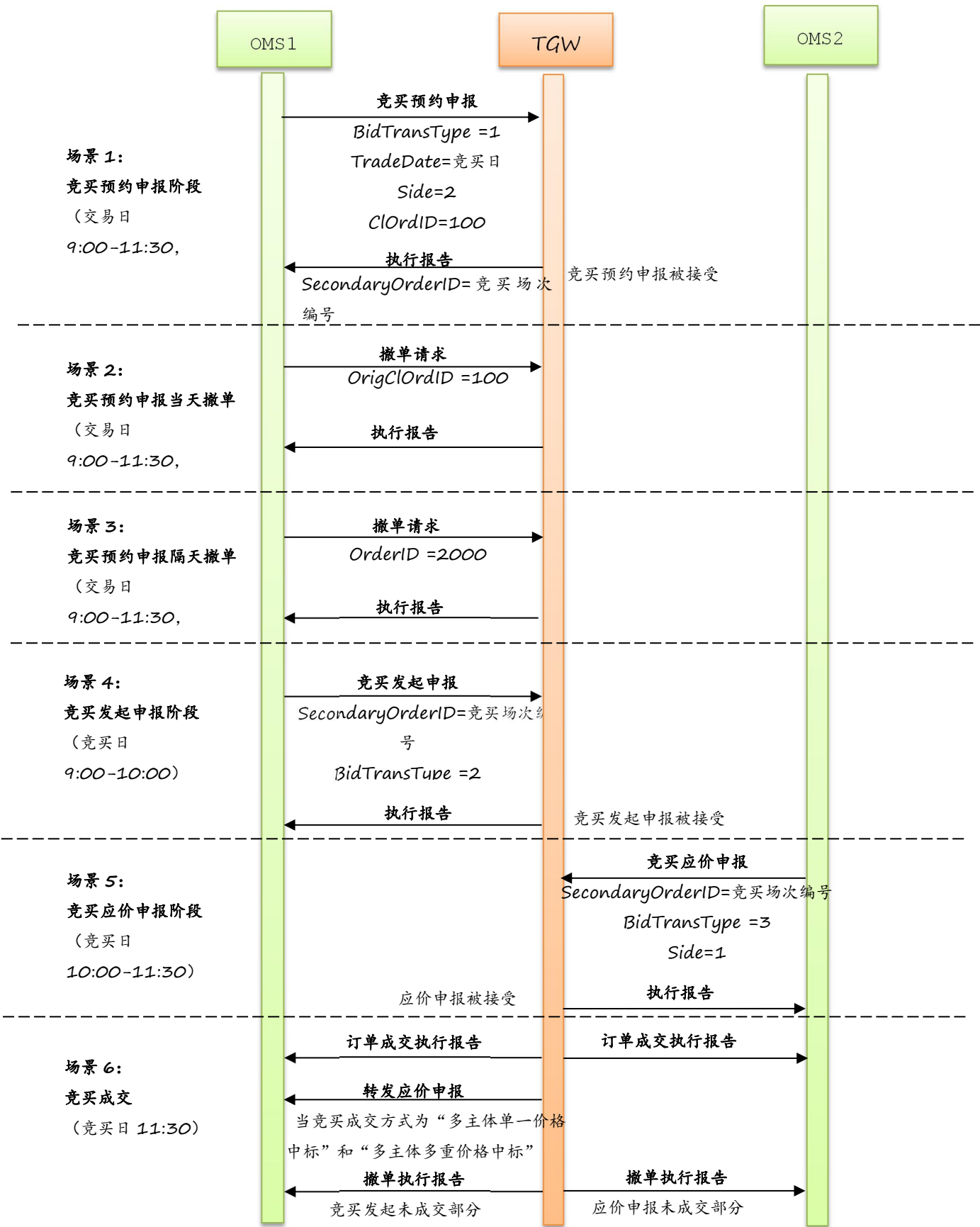
Tag	域名			字段描述	字段取值
	MessageHeader			MsgType=AJ	
1180	ApplID			应用标识	416
693	QuoteRespID			报价回复消息编号	报价回复消息编号
11	ClOrdID			客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType			报价所有者类型	订单所有者类型
60	TransactTime			委托时间	委托申报时间
537	QuoteType			报价类型 1=Tradeable，可交易的报价	1
组件<Instrument>					
48	SecurityID			证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource			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	与询价请求的 SettlType 一 致
10216	SettlPeriod		结算周期	与询价请的 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	报价消息编号
	10225	QuotePrice	报价价格	价格
	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。

6.5 竞买成交

6.5.1 竞买成交消息流程图



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，若 竞买成交方式为 1=单一主体中标， 则应填 0	最低成交数量， 若竞买成交方式为 1=单一主体 中标，则应填 0	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 103=多边净额 104=逐笔全额	103 或 104	103 或 104	103 或 104

SettlPeriod	结算周期	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) 对于 SettlType, 若证券支持匹配成交, 则取值为 103 或 104, 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	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 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	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, 预留 1=Cash, 普通交易	1	1	1

		2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓			
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	原始订单交易所订单编号

	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	字段描述	主动撤单字段取值
	MessageHeader	MsgType=F	F
1180	ApplID	原始订单应用标识	417
11	ClOrdID	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
54	Side	原始订单买卖方向	原始订单买卖方向

60	TransactTime		订单发起时间	订单发起时间
组件<Instrument>				
48	SecurityID		证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource		证券代码源	102
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与方代码个数=1	1
→	448	PartyID	申报交易单元	申报交易单元
	447	PartyIDSource	C=通用市场参与者标识	C
	452	PartyRole	1=当前 PartyID 为申报交易单元	1
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
38	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
组件结束				
41	OrigClOrdID		撤销当日委托时，填原始订单的客户订单编号；撤销当日之前的竞买预约委托时，不需要填写	原始订单的客户订单编号
37	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 不填，	原始订单交易所订单编号

		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 作检查。	
58	Text	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。

6.6 协商成交（合并申报）

6.6.1 委托申报接口

6.6.1.1 Binary 接口委托申报

字段代号	字段描述	合并申报（发起方发起或 撤销）	合并申报（响应方接受或 拒绝）
StandHeader	消息头	MsgType=104103	MsgType=104103
ApplId	应用标识	41A	41A
SubmittingPbuId	申报交易单元	发起方交易单元	申报方交易单元，需与本 方交易单元一致
SecurityId	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
OwnerType	订单所有者类型	1=个人投资者发起、102=	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、105=流动性服务提供商发起	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
ClearingFirm	结算机构代码		
TransacTime	委托时间		
UserInfo	用户私有信息		
TradeReportID	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
TradeReportTransType	成交申报事务类别	若为普通申报填0=New，若为主动撤单填1=Cancel	2=Replace
TradeHandlingInstr	成交申报模式	5	5
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
LastPx	价格	发起方与响应方1的成交价格	确认价格
LastQty	数量	发起方与响应方1的成交数量	确认数量
TrdType	成交申报业务类别	0	0
TrdSubType	成交申报业务子类别	0	0
ConfirmId	约定号	若 investor_type 为 03/04 且非发起方主动撤单，则不能为全空格；仅转发给响应方1	若响应方交易主体类型为 03/04，则不能为全空格
Side	本方参与人买卖方向	响应方1的交易方向，固定填1=买，即，响应方1向发起方买，响应方2向发起方	1=买、2=卖

		卖	
PbuId	本方交易单元	全空格	响应方交易单元
AccountId	本方证券账户	发起方证券账户	响应方证券账户
BranchId	本方营业部代码	发起方营业部识别码	响应方营业部识别码
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	发起方交易商代码	全空格
SubmittingInvestorType	申报方交易主体类型	发起方交易主体类型	全空格
SubmittingInvestorId	申报方交易主体代码	发起方交易主体代码	全空格
SubmittingInvestorName	申报方客户名称	当发起方交易主体类型为 03=机构经纪时,需填写发 起方客户名称; 否则填全 空格	全空格
SubmittingTraderCode	申报方交易员代码	发起方交易员代码	全空格
MemberId	本方交易商代码	响应方1的交易商代码	响应方的交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型	响应方1的交易主体类型	响应方的交易主体类型
InvestorId	本方交易主体代码	响应方1的交易主体代码	响应方的交易主体代码
InvestorName	本方客户名称	全空格	当响应方交易主体类型为 03=机构经纪时,需填写响 应方客户名称; 否则填全 空格
TraderCode	本方交易员代码	响应方1的交易员代码	响应方的交易员代码
CounterpartyMemberId	对手方交易商代码	响应方2的交易商代码	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	响应方2的交易主体类型	填转发成交申报的本交易 主体类型
CounterpartyInvestorId	对手方交易主体代码	响应方2的交易主体代码	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	响应方2的交易员代码	填转发成交申报的本方交易员代码
SettlType	结算方式 103=多边净额 104=逐笔全额	103或104	103或104
SettlPeriod	结算周期	1或0	1或0
CounterpartyLastPx	对手方成交价格	发起方与响应方2的成交价格	0
CashMargin	信用标识	1=Cash	1=Cash
Memo	备注	响应方1备注, 仅转发给响应方1	备注
CounterpartyMemo	对手方备注	响应方2备注, 仅转发给响应方1	全空格
CounterpartyConfirmID	对手方约定号	若 counterparty_investor_type 为03/04且非发起方主动 撤单, 则不能为全空格; 仅转发给响应方2	全空格
CounterpartyLastQty	对手方成交数量	发起方与响应方2的成交数量, 应与发起方与响应方1的成交数量 (LastQty) 一致	0
OrigTradeDate	原成交申报日期	0	0
SecondaryExecId	第二执行编号	全空格	全空格

说明:

(1) 对于 SettlType, 若证券支持匹配成交, 则取值为 103 或 104, 否则为 104。对于 SettlPeriod, 若 SettlType 为 103, 则取值为 1, 否则为 0。

(2) 当响应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) 对于发起方委托, 当发起方交易主体类型 (SubmittingInvestorType) 为 01 (自营) 或 02 (资管) 时, 委托中的发起方证券账户 (AccountID) 字段, 需填为发起方交易商下发发起方交易主体已报备的证券账户; 对于响应方委托, 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, 当发起方委托中响应方 1 或响应方 2 的交易主体类型 (InvestorType 或 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。响应方拒绝或接受发起方委托时, 若响应方委托中本方交易主体类型 (InvestorType) 为 03 (机构经纪) 或 04 (个人经纪) 时, 必须填写约定号字段。

(6) 对于发起方委托, Memo (备注) 字段可由发起方与响应方 1 自行约定填写与本次交易相关的内容, 在转发成交申报中仅转发给响应方 1; CounterpartyMemo (对手方备注) 字段可由发起方与响应方 2 自行约定填写与本次交易相关的内容, 在转发成交申报中仅转发给响应方 2。

(7) 发起方、响应方 1 的委托需满足以下匹配条件, 才能匹配成功 (三方委托均匹配成功才能成交) :

发起方委托要素	检查方法
发起方交易商代码 (SubmittingMemberID)	等于响应方 1 委托的对手方交易商代码(CounterpartyMemberID)
发起方交易主体类型 (SubmittingInvestorType)	等于响应方 1 委托的对手方交易主体类型 (CounterpartyInvestorType)
发起方交易主体代码 (SubmittingInvestorID)	等于响应方 1 委托的对手方交易主体代码 (CounterpartyInvestorID)
发起方交易员代码 (SubmittingTraderCode)	等于响应方 1 委托的对手方交易员代码 (CounterpartyTraderCode)
响应方 1 交易商代码(MemberID)	等于响应方 1 委托的本方交易商代码 (MemberID)
响应方 1 交易主体类型 (InvestorType)	等于响应方 1 委托的本方交易主体类型 (InvestorType)
响应方 1 交易主体代码(InvestorID)	等于响应方 1 委托的本方交易主体代码 (InvestorID)

响应方 1 交易员代码 (TraderCode)	等于响应方 1 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
响应方 1 价格 (LastPx)	一致
响应方 1 数量 (LastQty)	一致
买卖方向(Side)	等于响应方 1 委托的方向(Side)
约定号 (ConfirmID)	当发起方委托的响应方 1 交易主体类型 (InvestorType) 为 03 或 04 时, 需检查一致
结算方式 (SettlType)	一致
结算周期 (SettlPeriod)	一致

(8) 发起方、响应方 2 的委托需满足以下匹配条件, 才能匹配成功 (三方委托均匹配成功才能成交) :

发起方委托要素	检查方法
发起方交易商代码 (SubmittingMemberID)	等于响应方 2 委托的对手方交易商代码 (CounterpartyMemberID)
发起方交易主体类型 (SubmittingInvestorType)	等于响应方 2 委托的对手方交易主体类型 (CounterpartyInvestorType)
发起方交易主体代码 (SubmittingInvestorID)	等于响应方 2 委托的对手方交易主体代码 (CounterpartyInvestorID)
发起方交易员代码 (SubmittingTraderCode)	等于响应方 2 委托的对手方交易员代码 (CounterpartyTraderCode)
响应方 2 交易商代码 (CounterpartyMemberID)	等于响应方 2 委托的本方交易商代码 (MemberID)
响应方 2 交易主体类型 (CounterpartyInvestorType)	等于响应方 2 委托的本方交易主体类型 (InvestorType)
响应方 2 交易主体代码 (CounterpartyInvestorID)	等于响应方 2 委托的本方交易主体代码 (InvestorID)
响应方 2 交易员代码 (CounterpartyTraderCode)	等于响应方 2 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
响应方 2 价格 (CounterpartyLastPx)	等于响应方 2 委托的价格 (LastPx)
响应方 2 数量 (CounterpartyLastQty)	等于响应方 2 委托的 (LastQty)
买卖方向(Side)	方向相反

对手方约定号 (CounterpartyConfirmID)	当发起方委托的响应方 2 交易主体类型 (CounterpartyInvestorType) 为 03 或 04 时, 需检查响应方委托的约定号 (ConfirmID) 与发起方委托的对手方约定号 (CounterpartyConfirmID) 一致
结算方式 (SettlType)	一致
结算周期 (SettlPeriod)	一致

6.6.1.2 STEP 接口委托申报

发起方委托

Tag	域名	字段描述	协商成交合并申报发起方发起或撤销
	MessageHeader	MsgType=AE	
1180	ApplID	应用标识	41A
571	TradeReportID	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 105=流动性服务提供商发起	订单所有者类型
828	TrdType	成交申报业务类别	0
856	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
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。

1123	TradeHandlingInstr		成交申报模式 5=Two Party Report for Claim, 双边确认成交报告	5
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
60	TransactTime		成交申报发起时间	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<RootParties>				
1116	NoRootPartyIDs		参与人代码个数	7
→	1117	RootPartyID	参与人代码	发起方交易单元
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	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
	1117	RootPartyID	参与人代码	结算机构代码
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	4=结算机构代码
	1117	RootPartyID	参与人代码	发起方证券账户
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户
	1117	RootPartyID	参与人代码	发起方营业部代码
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码
	1117	RootPartyID	参与人代码	发起方交易商代码
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	6=申报方交易商代码
	1117	RootPartyID	参与人代码	发起方交易主体代码

	1118	RootPartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码
	1119	RootPartyRole		参与人代码角色	4005=申报方交易主体代码
	子组件<RootSubParties>				
	1120	NoRootPartySubIDs		参与人子代码个数	当发起方交易主体类型为 03=机构经纪时，填 2；否则填 1
	→	1121	RootPartySubID	参与方子代码	发起方交易主体类型
		1122	RootPartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型
		1121	RootPartySubID	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
		1122	RootPartySubIDType	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=客户名称”；否则不需要填写
	子组件结束				
	1117	RootPartyID		参与人代码	发起方交易员代码
	1118	RootPartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码
	1119	RootPartyRole		参与人代码角色	36=申报方交易员代码
	组件结束				
	组件<TrdCapRptSideGrp>				
552	NoSides		side 个数	2，即响应方个数	
→	54	Side	买卖方向	响应方 1 的买卖方向，固定填 1=买	
	1009	SideLastQty	参与方成交数量	发起方与响应方 1 的成交数量	
	1597	SideClearingTradePrice	参与方成交价格	发起方与响应方 1 的成交价格	
	10246	SideMemo	参与方备注	发起方与响应方 1 的备注	

	10247	SideConfirmID	参与方约定号	若响应方 1 的交易主体类型为 03/04 且非发起方主动撤单，则必须填写且不能为全空格；仅转发给响应方 1
	组件<Parties>			
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	3
→	448	PartyID	参与人代码	响应方 1 的交易商代码
	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	20=对手方交易商代码
	448	PartyID	参与人代码	响应方 1 的交易主体代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4004=对手方交易主体代码
	子组件< PrysSubGrp>			
	802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	1
	→	523	PartySubID	参与方子代码
		803	PartySubIDType	参与方子代码类型
	子组件结束			
	448	PartyID	参与人代码	响应方 1 的交易员代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	37: 对手方交易员代码
	组件结束			
→	54	Side	买卖方向	响应方 2 的买卖方向，固定填 2=卖
	1009	SideLastQty	参与方成交数量	发起方与响应方 2 的成交数量，应与发起方与响应方 1 的成交数量一致
	1597	SideClearingTradePrice	参与方成交价格	发起方与响应方 2 的

				成交价格		
10246	SideMemo		参与方备注	发起方与响应方 2 的备注		
10247	SideConfirmID		参与方约定号	若响应方 2 的交易主体类型为 03/04 且非发起方主动撤单，则必须填写且不能为全空格；仅转发给响应方 2		
组件<Parties>						
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	3		
	448	PartyID		参与人代码	响应方 2 的交易商代码	
	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	20=对手方交易商代码	
	448	PartyID		参与人代码	响应方 2 的交易主体代码	
	447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	
	452	PartyRole		参与人代码角色	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	
		523	PartySubID		参与方子代码	响应方 2 的交易主体类型
		803	PartySubIDType		参与方子代码类型	26=交易主体类型
	子组件结束					
	448	PartyID		参与人代码	响应方 2 的交易员代码	
	447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	
	452	PartyRole		参与人代码角色	37：对手方交易员代码	
组件结束						
组件结束						
31	LastPx		价格	0.0000		
32	LastQty		数量	0.00		

63	SettlType	结算方式 103=多边净额 104=逐笔全额	103 或 104
10216	SettlPeriod	结算周期	1 或 0
544	CashMargin	信用标识	1

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

响应方委托

Tag	域名	字段描述	协商成交合并申报响应方接受或拒绝
	MessageHeader	MsgType=AE	
1180	ApplID	应用标识	41A
571	TradeReportID	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 105=流动性服务提供商发起	订单所有者类型
828	TrdType	成交申报业务类别	0
856	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	2 或 3
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	2
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式 5=Two Party Report for Claim, 双边确认成交报告	5
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号	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
组件<Instrument>			
48	SecurityID		证券代码
22	SecurityIDSource		102=深圳证券交易所
组件结束			
组件<RootParties>			
1116	NoRootPartyIDs		2
→	1117	RootPartyID	申报方交易单元，需与响应方交易单元一致
	1118	RootPartyIDSource	C=通用市场参与者标识
	1119	RootPartyRole	1=申报交易单元
	1117	RootPartyID	结算机构代码
	1118	RootPartyIDSource	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	4=结算机构代码
组件结束			
组件<TrdCapRptSideGrp>			
552	NoSides		1
→	54	Side	响应方的买卖方向 1 或 2
	组件<Parties>		
	453	NoPartyIDs	成交申报类型为 2 时填 9，成交申报类型为 3 时填 8
	→	448	PartyID
		447	PartyIDSource
		452	PartyRole
		448	PartyID
		447	PartyIDSource
		452	PartyRole

		448	PartyID	参与人代码	响应方营业部代码
		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	响应方交易商代码
		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	7: 交易商代码
		448	PartyID	参与人代码	响应方交易主体代码
		447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
		452	PartyRole	参与人代码角色	4003: 交易主体代码
		子组件< PtysSubGrp>			
		802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	当响应方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1
		→	523	PartySubID	参与方子代码
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型
			523	PartySubID	参与方子代码 响应方客户名称 当响应方交易主体类型为 03=机构经纪且成交申报类型为 2=接受成交申报时, 填写响应方客户名称; 否则不需要填写
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型 响应方客户名称 当响应方交易主体类型为 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=户名称”; 否则不需要填写
		子组件结束			
		448	PartyID	参与人代码	响应方交易员代码
		447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
		452	PartyRole	参与人代码角色	12: 交易员代码
		448	PartyID	参与人代码	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
		452	PartyRole	参与人代码角色	20: 对手方交易商代码
		448	PartyID	参与人代码	发起方交易主体代码
		447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
		452	PartyRole	参与人代码角色	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

		→	523	PartySubID	参与方子代码	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
		子组件结束				
		448	PartyID	参与人代码	发起方交易员代码	
		447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	
		452	PartyRole	参与人代码角色	37：对手方交易员代码	
	组件结束					
	组件结束					
	组件结束					
31	LastPx			价格	委托价格	
32	LastQty			数量	委托数量	
63	SettlType			结算方式 103=多边净额 104=逐笔全额	103 或 104	
10216	SettlPeriod			结算周期	1 或 0	
664	ConfirmID			约定号	若响应方的交易主体类型为 03/04，则不能为全 空格	
544	CashMargin			信用标识	1	
10198	Memo			备注	备注	

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

6.6.2 转发成交申报接口

6.6.2.1 Binary 接口转发成交申报

字段代号	字段描述	转发发起方给 响应方2(主动 撤单)	转发发起方给 响应方1(主动 撤单)	转发响应方2 给响应方1(响 应方2拒绝)	转发响应方1 给响应方2(响 应方1拒绝)	转 响 应 方 给 发 起 方 (响 应 方 一 方 拒 绝 时)	转发发起方请 求给响应方1 (非 主 动 撤 单)	转发发起方请求给响应方 2 (非主动撤单)
StandHeader	消息头	MsgType= 204120	MsgType= 204120	MsgType= 204120	MsgType= 204120	MsgType= 204120	MsgType= 204120	MsgType= 204120
ApplId	应用标识	41A	41A	41A	41A	41A	41A	41A
ReportingPbuld	回报交易单元	被撤委托响应 方2交易商代 码下已报备的 接收转发消息 的交易单元， 如果该交易商 报备了多个接 收转发消息的 交易单元，则	被撤委托响应 方1交易商代 码下已报备的 接收转发消息 的交易单元， 如果该交易商 报备了多个接 收转发消息的 交易单元，则	响应方1交易 商代码下已报 备的接收转发 消息的交易单 元，如果该交 易商报备了多 个接收转发消 息的交易单 元，则对应于	响应方2交易 商代码下已报 备的接收转发 消息的交易单 元，如果该交 易商报备了多 个接收转发消 息的交易单 元，则对应于	被 拒 绝 的 发 起 方 对 应 委 托 的 申 报 交 易 单 元	响 应 方 1 交 易 商 代 码 下 已 报 备 的 接 收 转 发 消 息 的 交 易 单 元，如果该交 易商报备了多 个接收转发消 息的交易单 元，则对应于	响应方2交易商代码下已 报备的接收转发消息的交 易单元，如果该交易商报 备了多个接收转发消息的 交易单元，则对应于每个 交易单元都会生成一笔转 发成交申报并发送给响应 方2,这些转发成交申报除 ReportingPBUID (回报交

		对应于每个交易单元都会生成一笔转发成交申报并发送给响应方2, 这些转发成交申报除 ReportingPBU ID (回报交易单元) 字段、ExecID (执行编号) 外, 其他字段的数据均一致	对应于每个交易单元都会生成一笔转发成交申报并发送给响应方1, 这些转发成交申报除 ReportingPBU ID (回报交易单元) 字段、ExecID (执行编号) 外, 其他字段的数据均一致	每个交易单元都会生成一笔转发成交申报并发送给响应方1, 这些转发成交申报除 ReportingPBU ID (回报交易单元) 字段、ExecID (执行编号) 外, 其他字段的数据均一致	每个交易单元都会生成一笔转发成交申报并发送给响应方2, 这些转发成交申报除 ReportingPBU ID (回报交易单元) 字段、ExecID (执行编号) 外, 其他字段的数据均一致		每个交易单元都会生成一笔转发成交申报并发送给响应方1, 这些转发成交申报除 ReportingPBU ID (回报交易单元) 字段、ExecID (执行编号) 外, 其他字段的数据均一致	易单元) 字段、ExecID (执行编号) 外, 其他字段的数据均一致
SubmittingPbuId	原申报交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
SecurityId	证券代码	被撤委托的证券代码	被撤委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码

SecurityIdSource	证券代码源	被撤委托的证券代码源	被撤委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	被撤委托的订单所有者类型	被撤委托的订单所有者类型	被拒绝委托的订单所有者类型	被拒绝委托的订单所有者类型	原委托的订单所有者类型	原委托的订单所有者类型	原委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	被撤委托的结算机构代码	被撤委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码
TransacTime	回报时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间
UserInfo	用户私有信息	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
TradeId	交易所成交申报编号	被撤委托的成交申报响应中的交易所成交申报编号	被撤委托的成交申报响应中的交易所成交申报编号	被拒绝的发起方委托成交申报响应中的交易所成交申报	被拒绝的发起方委托成交申报响应中的交易所成交申报	被拒绝的发起方委托成交申报响应中	原委托成交申报响应中的交易所成交申报编号	原委托成交申报响应中的交易所成交申报编号

				编号	编号	的交易所 成交申报 编号		
TradeReportId	客户成交申报编号	交易系统生成编号，当日唯一，当广播发送时，客户端需根据本字段去重后展示	交易系统生成编号，当日唯一，当广播发送时，客户端需根据本字段去重后展示	交易系统生成编号，当日唯一，当广播发送时，客户端需根据本字段去重后展示	交易系统生成编号，当日唯一，当广播发送时，客户端需根据本字段去重后展示	被拒绝的发起方对应委托的客户成交申报编号	交易系统生成编号，当日唯一，当广播发送时，客户端需根据本字段去重后展示	交易系统生成编号，当日唯一，当广播发送时，客户端需根据本字段去重后展示
TradeReportType	成交申报类型， 1-Alleged， 3-Dcline	1=Alleged	1=Alleged	1=Alleged	1=Alleged	3=decline	1=Alleged	1=Alleged
TradeReportTransType	成交申报事务类别， 0-New， 1-Cancel	主动撤单委托的成交申报事务类别	主动撤单委托的成交申报事务类别	1=Cancel	1=Cancel	1=Cancel	原委托的成交申报事务类别	原委托的成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式	被撤委托的成交申报模式	被撤委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式

	式	交申报模式	交申报模式	申报模式	申报模式	成交申报 模式	申报模式	
TradeReportRefId	原客户成交 申报编号	填交易系统生 成的被撤委托 的转发给响应 方2的成交申 报中的客户订 单编号	填交易系统生 成的被撤委托 的转发给响应 方1的成交申 报中的客户订 单编号	被拒绝委托的 发起方委托转 发给响应方1 的转发成交申 报的客户成交 申报编号	被拒绝委托的 发起方委托转 发给响应方2 的转发成交申 报的客户成交 申报编号	全空格	全空格	全空格
LastPx	价格	被撤委托发起 方与响应方2 的成交价格	被撤委托发起 方与响应方1 的成交价格	被拒绝委托中 发起方与响应 方1的成交价 格	被拒绝委托中 发起方与响应 方2的成交价 格	原委托的 价格	发起方与响应 方1的成交价 格	发起方与响应方2的成交 价格
LastQty	数量	被撤委托发起 方与响应方2 的成交数量	被撤委托发起 方与响应方1 的成交数量	被拒绝委托中 发起方与响应 方1的成交数 量	被拒绝委托中 发起方与响应 方2的成交数 量	原委托的 数量	发起方与响应 方1的的成交 数量	发起方与响应方2的成交 数量
TrdType	成交申报业 务类别	被撤委托的成 交申报业务类	被撤委托的成 交申报业务类	被拒绝委托的 成交申报业务	被拒绝委托的 成交申报业务	原委托的 成交申报	原委托的成交 申报业务类别	原委托的成交申报业务类 别

		别	别	类别	类别	业务类别		
TrdSubType	成交申报业务子类别	被撤委托的成交申报业务子类别	被撤委托的成交申报业务子类别	被拒绝委托的成交申报业务子类别	被拒绝委托的成交申报业务子类别	原委托的成交申报业务子类别	原委托的成交申报业务子类别	原委托的成交申报业务子类别
ConfirmId	约定号	全空格	全空格	全空格	全空格	当本方交易主体类型为机构经纪或个人经纪时，需转发原委托的约定号；其他情况填全空格	当响应方1交易主体类型为机构经纪或个人经纪时，需转发原委托的约定号（ConfirmID）；其他情况填全空格	当响应方2交易主体类型为机构经纪或个人经纪时，需转发原委托的对手方约定号（CounterpartyConfirmID）；其他情况填全空格
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	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	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	交易系统生成的当日唯一编号

						号		
Side	本方参与人 买卖方向	被撤委托的买 卖方向	若被撤委托的 side=1，则填 2；若被撤委托 的side=2，则 填1	若被拒绝委托 的side=1，则 填2；若被拒绝 委 托 的 side=2，则填1	被拒绝委托的 买卖方向	原 委 托 的 买卖方向	若原成交申报 的side=1，则填 2；若原成交申 报的side=2，则 填1	原委托的买卖方向
PbuId	本方交易单 元	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
AccountId	本方证券账 户	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
BranchId	本方营业部 代码	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyPbuId	对手方交易 单元	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyAccountId	对手方证券 账户	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchId	对手方营业 部代码	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格

MemberId	本方交易商 代码	被撤委托的发 起方交易商代 码	被撤委托的发 起方交易商代 码	被拒绝委托的 发起方交易商 代码	被拒绝委托的 发起方交易商 代码	原委托的 本方交易 商代码	原委托的发起 方交易商代码	原委托的发起方交易商代 码
InvestorType	本方交易主 体类型	被撤委托的发 起方交易主体 类型	被撤委托的发 起方交易主体 类型	被拒绝委托的 发起方交易主 体类型	被拒绝委托的 发起方交易主 体类型	原委托的 本方交易 主体类型	原委托的发起 方交易主体类 型	原委托的发起方交易主体 类型
InvestorId	本方交易主 体代码	被撤委托的发 起方交易主体 代码	被撤委托的发 起方交易主体 代码	被拒绝委托的 发起方交易主 体代码	被拒绝委托的 发起方交易主 体代码	原委托的 本方交易 主体代码	原委托的发起 方交易主体代 码	原委托的发起方交易主体 代码
InvestorName	本方客户名 称	被撤委托的发 起方客户名称	被撤委托的发 起方客户名称	被拒绝委托的 发起方交易客 户名称	被拒绝委托的 发起方交易客 户名称	原委托的 本方交易 客户名称	原委托的发起 方客户名称	原委托的发起方客户名称
TraderCode	本方交易员 代码	被撤委托的发 起方交易员代 码	被撤委托的发 起方交易员代 码	被拒绝委托的 发起方交易员 代码	被拒绝委托的 发起方交易员 代码	原委托的 本方交易 员代码	原委托的发起 方交易员代码	原委托的发起方交易员代 码
CounterpartyMemberId	对手方交易 商代码	被撤委托中响 应方2的交易 商代码	被撤委托中响 应方1的交易 商代码	被拒绝委托的 响应方1交易 商代码	被拒绝委托的 响应方2交易 商代码	原委托的 对手方交 易商代码	响应方1的交 易商代码	响应方2的交易商代码

CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型	被撤委托中响应方2的交易主体类型	被撤委托中响应方1的交易主体类型	被拒绝委托的响应方1交易主体类型	被拒绝委托的响应方2交易主体类型	原委托的对手方交易主体类型	响应方1的交易主体类型	响应方2的交易主体类型
CounterpartyInvestorId	对手方交易主体代码	被撤委托中响应方2的交易主体代码	被撤委托中响应方1的交易主体代码	被拒绝委托的响应方1交易主体代码	被拒绝委托的响应方2交易主体代码	原委托的对手方交易主体代码	响应方1的交易主体代码	响应方2的交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	被撤委托中响应方2的交易员代码	被撤委托中响应方1的交易员代码	被拒绝委托的响应方1交易员代码	被拒绝委托的响应方2交易员代码	原委托的对手方交易员代码	响应方1的交易员代码	响应方2的交易员代码
SettleType	结算方式	被撤委托的结算方式	被撤委托的结算方式	被拒绝委托的结算方式	被拒绝委托的结算方式	原委托的结算方式	原委托的结算方式	原委托的结算方式
SettlePeriod	结算周期	被撤委托的结算周期	被撤委托的结算周期	被拒绝委托的结算周期	被拒绝委托的结算周期	原委托的结算周期	原委托的结算周期	原委托的结算周期
CashMargin	信用标识	被撤委托的信	被撤委托的信	被拒绝委托的	被拒绝委托的	原委托的	原委托的信用	原委托的信用标识

		用标识	用标识	信用标识	信用标识	信用标识	标识	
Memo	备注	全空格	全空格	全空格	全空格	原委托的 备注	原委托的响应 方1备注	原委托的响应方2备注
OrigTradeDate	原成交申报 日期	0	0	0	0	0	0	0
SecondaryExecId	第二执行编 号	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格

6.6.2.2 STEP 接口转发成交申报

转发消息 STEP 接口格式与协商成交非合并申报的格式一致,取值内容参见二进制接口部分。

6.6.1 成交确认接口

6.6.1.1 Binary 接口成交确认

字段代号	字段描述	协商成交合并申报（给响应方）	协商成交合并申报（给发起方）
StandHeader	消息头	MsgType=204103	MsgType=204103
ApplId	应用标识	41A	41A
ReportingPbuId	回报交易单元	与原成交申报的申报交易单元一致	与原成交申报的申报交易单元一致
SubmittingPbuId	原申报交易单元	与原成交申报一致	与原成交申报一致
SecurityId	证券代码	与原成交申报一致	与原成交申报一致
SecurityIdSource	证券代码源	与原成交申报一致	与原成交申报一致
OwnerType	订单所有者类型	与原成交申报一致	与原成交申报一致
ClearingFirm	结算机构代码	与原成交申报一致	与原成交申报一致
TransacTime	回报时间	产生成交的系统时间	产生成交的系统时间
UserInfo	用户私有信息	与原成交申报一致	与原成交申报一致
TradeId	交易所成交申报编号	与原成交申报一致	与原成交申报一致
TradeReportId	客户成交申报编号	与原成交申报一致	与原成交申报一致
TradeReportType	成交申报类型	0	0
TradeReportTransType	成交申报事务类别	2=成交确认	2=成交确认
TradeHandlingInstr	成交申报模式	与原成交申报一致	与原成交申报一致
LastPx	成交价格	与原成交申报一致	与原成交申报一致
LastQty	成交数量	与原成交申报一致	与原成交申报一致
TrdType	成交申报业务类别	与原成交申报一致	与原成交申报一致
TrdSubType	成交申报业务子类别	与原成交申报一致	与原成交申报一致

ConfirmId	约定号	与原成交申报一致	与原成交申报一致
ExecId	成交申报执行编号	XXYYNNNNNNNNNNNNNN, XX为平台号, YY为分区号, 后面为顺序编号, 编码按10进制顺序编码	XXYYNNNNNNNNNNNNNN, XX为平台号, YY为分区号, 后面为顺序编号, 编码按10进制顺序编码
Side	本方参与人买卖方向	与原成交申报一致	与原成交申报一致
PbuId	本方交易单元	与原成交申报一致	与原成交申报一致
AccountId	本方证券账户	与原成交申报一致	与原成交申报一致
BranchId	本方营业部代码	与原成交申报一致	与原成交申报一致
CounterpartyPbuId	对手方交易单元	与原成交申报一致	与原成交申报一致
CounterpartyAccountId	对手方证券账户	与原成交申报一致	与原成交申报一致
CounterpartyBranchId	对手方营业部代码	与原成交申报一致	与原成交申报一致
MemberId	本方交易商代码	与原成交申报一致	与原成交申报一致
InvestorType	本方交易主体类型	与原成交申报一致	与原成交申报一致
InvestorId	本方交易主体代码	与原成交申报一致	与原成交申报一致
InvestorName	本方客户名称	与原成交申报一致	与响应方1委托的本方客户名称一致
TraderCode	本方交易员代码	与原成交申报一致	与原成交申报一致
CounterpartyMemberId	对手方交易商代码	对手方委托的 submitting_member_id	与原成交申报一致
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型	对手方委托的 submitting_investor_type	与原成交申报一致
CounterpartyInvestorId	对手方交易主体代码	对手方委托的 submitting_investor_id	与原成交申报一致
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	对手方委托的 submitting_investor_name	与响应方2委托的本方客户名称一致
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	对手方委托的 submitting_trader_code	与原成交申报一致
SettlType	结算方式	与原成交申报一致	与原成交申报一致

SettlPeriod	结算周期	与原成交申报一致	与原成交申报一致
CashMargin	信用标识	与原成交申报一致	与原成交申报一致
Memo	备注	与原成交申报一致	与原成交申报一致
SubmittingMemberID	申报方交易商代码	全空格	与原成交申报一致
SubmittingInvestorType	申报方交易主体类型	全空格	与原成交申报一致
SubmittingInvestorID	申报方交易主体代码	全空格	与原成交申报一致
SubmittingInvestorName	申报方客户名称	全空格	与原成交申报一致
SubmittingTraderCode	申报方交易员代码	全空格	与原成交申报一致
CounterpartyMemo	对手方备注	全空格	与原成交申报一致
CounterpartyConfirmID	对手方约定号	全空格	与原成交申报一致
CounterpartyLastPx	对手方成交价格	0.0000	与原成交申报一致
CounterpartyLastQty	对手方成交数量	0.00	与原成交申报一致
OrigTradeDate	原成交申报日期	0	0
SecondaryExecId	第二执行编号	全空格	全空格

6.6.1.2 STEP 接口成交确认

发起方成交确认 STEP 接口格式与委托格式一致，响应方成交确认 STEP 接口格式

与协商成交非合并申报的格式一致。取值内容参见二进制接口部分。

6.7 交易解除

6.7.1 委托申报接口

6.7.1.1 Binary 接口委托申报

字段代号	字段描述	交易解除（发起方发起或撤销）	交易解除（响应方接受或拒绝）
StandHeader	消息头	MsgType=104103	MsgType=104103
ApplId	应用标识	419	419
SubmittingPbuId	申报交易单元	申报方交易单元，需与本方交易单元一致	申报方交易单元，需与本方交易单元一致

SecurityId	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
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、105=流动性服务提供商发起	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、105=流动性服务提供商发起
ClearingFirm	结算机构代码		
TransacTime	委托时间		
UserInfo	用户私有信息		
TradeReportID	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
TradeReportTransType	成交申报事务类别	若为普通申报填0=New, 若为主动撤单填1=Cancel	2=Replace
TradeHandlingInstr	成交申报模式	3	3
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
LastPx	价格	待解除成交的成交价格	待解除成交的成交价格
LastQty	数量	待解除成交的成交数量	待解除成交的成交数量
TrdType	成交申报业务类别	0	0
TrdSubType	成交申报业务子类别	0	0
ConfirmId	约定号	若响应方交易主体类型为03/04, 则不能为全空格	若响应方交易主体类型为03/04, 则不能为全空格
Side	本方参与人买卖方向	原成交的交易方向, 1=买、2=卖	原成交的交易方向, 1=买、2=卖
PbuId	本方交易单元	发起方交易单元, 应与待解除成交一致	响应方交易单元, 应与待解除成交一致
AccountId	本方证券账户	发起方证券账户, 应与待解除成交一致	响应方证券账户, 应与待解除成交一致

		交一致	除成交一致
BranchId	本方营业部代码	发起方营业部识别码	响应方营业部识别码
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	全空格	全空格
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，应与待解除成交一致	响应方的交易商代码，应与待解除成交一致
InvestorType	本方交易主体类型	发起方交易主体类型，应与待解除成交一致	响应方的交易主体类型，应与待解除成交一致
InvestorId	本方交易主体代码	发起方交易主体代码，应与待解除成交一致	响应方的交易主体代码，应与待解除成交一致
InvestorName	本方客户名称	全空格	全空格
TraderCode	本方交易员代码	发起方交易员代码，应与待解除成交一致	响应方的交易员代码，应与待解除成交一致
CounterpartyMemberId	对手方交易商代码	响应方的交易商代码，应与待解除成交一致	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	响应方的交易主体类型，应与待解除成交一致	填转发成交申报的本交易主体类型
CounterpartyInvestorId	对手方交易主体代码	响应方的交易主体代码，应与待解除成交一致	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	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	响应方的交易员代码，应与待解除成交一致	填转发成交申报的本方交易员代码
SettlType	结算方式	104=逐笔全额，应与待解除成交	104=逐笔全额，应与待解除

		一致	成交一致
SettlPeriod	结算周期	原成交的结算周期	原成交的结算周期
CounterpartyLastPx	对手方成交价格	0	0
CashMargin	信用标识	1=Cash	1=Cash
Memo	备注	填交易解除原因	全空格
CounterpartyMemo	对手方备注	全空格	全空格
CounterpartyConfirmID	对手方约定号	全空格	全空格
CounterpartyLastQty	对手方成交数量	0	0
OrigTradeDate	原成交申报日期	待解除成交的成交达成日期，格式为YYYYMMDD	待解除的成交的成交达成日期，格式为YYYYMMDD
SecondaryExecId	第二执行编号	待解除成交的执行编号	待解除成交的执行编号

说明：

(1) 目前仅支持对结算方式为逐笔全额非担保且由询价成交、协商成交（非合并申报、非通交易所）、点击成交模式产生的成交进行交易解除，因此 **SettlType** 只能取值为 104，**SettlPeriod**，只能取值为 0。

(2) 当响应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。响应方拒绝或接受发起方委托时，若响应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）字段仅由发起方填写，填写内容为交易解除原因，并由响应方确认。

(7) 发起方、响应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

(8) 当本方交易主体类型 (InvestorType) 为 03 (机构经纪) 时, 无需填写本方客户名称 (InvestorName), 交易系统将自动获取原成交的客户名称并填入在对应的转发成交申报、成交确认中, 供市场展示或确认。

(9) 原成交申报日期 (OrigTradeDate) 字段填写待解除成交的成交达成日期, 由于目前仅支持解除 T 日成交, 因此应填写为 T 日日期。

6.7.1.2 STEP 接口委托申报

Tag	域名	字段描述	交易解除（发起方发起或撤销）	交易解除（响应方接受或拒绝）
	MessageHeader	MsgType=AE		
1180	ApplID	应用标识	419	419
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 105=流动性服务提供商发起	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=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	2 或 3
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	3

			3=One-Party Report for Pass Through, 成交请求		
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, 需与响应方交易单元一致
	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	9	成交申报类型为 2 时填 9, 成

			数		交申报类型为 3 时填 8
	→	448	PartyID	参与人代码 发起方交易单元，应与待解除成交一致	响应方交易单元，应与待解除成交一致
		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，应与待解除成交一致	成交申报类型为 2 时填响应方证券账户，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	响应方营业部代码
		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	响应方交易商代码
		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	响应方交易主体代码
		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< PrysSubGrp>			
		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	当响应方交易主体类型为 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	响应方交易主体类型
		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	响应方客户名称 当响应方交易主体类型为 03=机构经纪且成交申报类型为 2=接受成交申报时，填写响应方客户名称；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=客户名称”；否则不需要填写	响应方客户名称 当响应方交易主体类型为 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=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	响应方交易员代码	
	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	响应方交易商代码	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	响应方交易主体代码	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：对手方交易主体代码	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	响应方交易主体类型	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	响应方交易员代码	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	待解除成交的成交价格	待解除成交的成交价格

32	LastQty	数量	待解除成交的成交数量	待解除成交的成交数量
63	SettlType	结算方式	104=逐笔全额，应与待解除成交一致	104=逐笔全额，应与待解除成交一致
10216	SettlPeriod	结算周期	原成交的结算周期	原成交的结算周期
664	ConfirmID	约定号	若响应方交易主体类型为03/04，则不能为全空格	若响应方交易主体类型为03/04，则不能为全空格
1125	OrigTradeDate	原成交申报日期	待解除成交的成交达成日期，格式为 YYYYMMDD	待解除的成交的成交达成日期，格式为 YYYYMMDD
544	CashMargin	信用标识	1	1
10198	Memo	备注	填交易解除原因	全空格
527	SecondaryExecID	第二执行编号	待解除成交的执行编号	待解除成交的执行编号

注：参见 Binary 接口委托申报备注说明。

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（含合并申报）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

债券现券交易业务行情快照相比于原来的现货集中竞价业务行情快照增加了收盘价和匹配成交最近价字段，发布的内容与现货集中竞价业务行情快照的差异对比如下：

行情字段	现货集中竞价业务行情快照 (STEP: W, Binary: 300111)	债券现券交易业务行情快照 (STEP: W, Binary: 300211)
最近价 (行情条目类别为 2)	当天无成交, 则不发布; 当天有成交, 则闭市前揭示最后一笔成交的价格; 闭市后揭示按业务规则计算的收盘价	当天无成交, 则不发布; 当天有成交, 则发布最后一笔成交(五种成交方式的任一种成交) 的价格
收盘价 (行情条目类别 5)	无此字段	闭市后发布, 当天有成交则发布按业务规则计算的收盘价; 当天无成交则发布前收盘价。
匹配成交最近价 (行情条目类别 xv)	无此字段	当天匹配成交无成交, 则不发布; 当天匹配成交有成交, 则发布最后一笔匹配成交的价格

收盘行情文件 cashsecurityclosemd_yyyymmdd.xml 中的收盘价 (ClosePx) 在证券当天有成交时, 发布按业务规则计算的收盘价; 当天无成交时, 发布空值。

八、开展债券现券交易的券商系统注意事项

8.1 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。

8.2 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。

8.3 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响应方，不可以展示给无关人员。特别的，对于转发成交申报的响应方是经纪客户时，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。

8.4 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。

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
20178	业务禁止	本方不支持此申报
20179	业务禁止	对手方不支持此申报