深圳证券交易所
SHENZHEN
STOCK EXCHANGE

工程技术标准

深圳证券交易所STEP交易数据接口规范

(Ver1.32)

深圳证券交易所

二〇二五年二月

文档说明

修订历史			
日期	版本	通信版本号	修订说明
2013-10	0.10	1.00	创建
2014-1	0.90	1.00	根据市场参与者反馈意见修订
2014-4	1.00 α	1.00	根据0.9版征求意见反馈修订
2014-6	1.00β	1.00	增加期权集中竞价交易询价申报 增加借券/还券申报 新订单增加订单限定 OrderRestrictions（tag＝529）字段 增加对于债券通用质押式回购交易到期成交执行报告的说明 意向申报增加联系人和联系方式字段，Text 字段不再用于填写联系人和联系方式 股份性质 ShareType（tag＝8908）字段更名为 ShareProperty 成交申报增加质权人类型 PledgeeType（tag＝10183）字段 业务拒绝消息增加应用标识 ApplID（tag＝1180）字段 订正部分文字错误

2014-9	1.00γ	1.00	非交易处理平台的关闭时间由 15:00 改为 15:30； 业务拒绝消息增加回报时间、证券代码字段； 原行权业务的委托和回报消息改为期权行权业务的委托和回报消息； 新增权证行权业务的委托和回报定义； 新增备兑锁定、解锁业务的委托和回报定义； 密码服务业务从网络投票业务中拆分出来，作为一个独立业务，委托和回报消息格式不变，使用新的 ApplID； 增加保证金查询业务的委托和回报消息定义； 增加协议交易报价委托及回报消息定义； 成交申报增加 CashMargin（tag=544）字段； 增加对回报消息中“回报交易单元”字段的说明； 增加委托中结算机构代码的填写说明； 增加委托拒绝原因代码表； 撤单失败响应消息（Cancel Reject）增加缺失的组件 Instrument；
		1.00	增加限价全额成交或撤销（限价 FOK）委托申报说明； 增加各种市价、限价委托申报方式适用的业务范围说明； 报价委托增加单边报价方式； 股票质押式回购成交申报业务类别增加“1009=股票质押式回购部分购回”类别； 约定号域 ConfirmID（tag=664）的取值由 8 位数字字符串改为普通字符串； 股份性质域 ShareProperty（tag=8908）的类型由 4 位字符改为 2 位字符； “盘后定价大宗交易业务”更名为“盘后定价交易业务”； 订正部分文字错误

2015-1	1.00 δ	1.00	增加转处置、垫券还券、待清偿扣划业务委托申报定义。 增加各业务新订单是否可以撤销的说明。 完善委托拒绝原因代码说明。
2015-8	1.00	1.00	保证金条目类别MarginItem增加“2=保证金总金额”； 增加字符串的说明； 增加报价更新、报价撤销处理消息流图； 修改委托申报拒绝原因代码20003的含义，删除20004； 修改平台说明和委托申报方式说明两节中关于质押式回购业务所属平台的描述； 增加密码服务证券代码369991的说明； 增加债券质押式协议回购业务的委托和回报消息定义； 增加分级基金实时分拆合并业务的委托和回报消息定义。
2016-6	1.01	1.00	增加国际市场互联平台定义。 增加港股通业务的委托和回报消息定义。 删除备兑锁定解锁业务的委托和回报消息定义。
2017-2	1.02	1.00	股票质押式回购成交申报业务类别增加“1010=股票质押式回购违约处置撤销”类别； 成交申报增加 InvestmentType（tag=10190）、AlertRatio（tag=10191）、SettlementRatio（tag=10192）字段; 参与人编码表增加交易账户,主要用于资产管理计划份额转让业务。

2017-7	1.03	1.02	增加“通信版本号”定义； 协议交易业务成交申报、成交确认报文启用“成交申报业务子类别（TrdSubType）”字段，用于表示是否为受限股份转让 增加拒绝原因“20079减持额度不足”
2018-5	1.04	1.02	增加成交请求申报模式； 修改成交报告申报模式； 增加债券质押式三方回购交易、出入库业务，修改成交申报、成交申报响应、成交确认消息报文； 增加债券质押式协议回购到期续做指令； 增加委托申报拒绝原因代码； 附件增加新订单及成交申报的处理回报说明
2018-7	1.10	1.10	除业务拒绝外的其他回报消息增加分区字段； 回报同步消息、回报结束消息增加分区字段； 增加平台信息消息； 修改应用层消息恢复流程；
2018-12	1.11	1.10	修改债券质押式回购业务交易时间； 修改非交易处理平台及债券质押式回购质押解押申报业务交易时间
2019-1	1.12	1.10	增加期权组合策略保证金业务接口； 增加期权行权指令合并申报接口； 增加期权普通与备兑仓互转业务接口

2020-04	1.13	1.11	将原盘后定价交易业务更名为：盘后定价大宗交易； 增加盘后定价交易业务接口； 转融通证券出借新订单、成交申报增加字段：股份性质（ShareProperty）； 修改通信版本号为：1.11； 修订历史增加通信版本号一列； 增加债券回售撤销指令； 增加接口规范兼容性要求。
2020-06	1.14	1.11	新增固定收益交易平台，并将债券质押式协议回购业务迁移至固定收益交易平台； 债券质押式协议回购业务优化，修改成交申报、成交申报响应、成交确认消息报文，新增转发成交申报消息报文； 转发成交申报公用字段添加“交易所成交申报编号”字段
2020-10	1.15	1.11	债券转股回售新订单、订单响应及撤单成功增加字段：股份性质（ShareProperty）
2020-11	1.16	1.11	增加询价交易处理模式
2020-12	1.17	1.11	成交申报、成交申报响应、转发成交申报、成交确认消息的组件“CompDeliverSecurity”增加字段：股份性质（UnderlyingShareProperty）
2020-12	1.18	1.11	增加期权集中竞价交易业务组合策略单边平仓指令； 增加回报占位消息
2021-4	1.19	1.11	增加债券现券交易业务接口； 将质押式回购、债券分销、债券质押式三方回购交易及出入库及质押式回购质押解押业务迁移至固定收益交易平台

2021-6	1.20	1.11	询价申报处理RootParties组件使用子组件RootSubParties 转发询价请求、转发报价增加CounterInfos组件
2021-7	1.21	1.11	增加债券转让业务回售转售的委托和回报定义
2021-7	1.22	1.11	增加债券借贷业务的委托和回报定义
2021-9	1.23	1.11	增加债券现券交易业务竞买成交
2022-1	1.24	1.11	修改保证金查询及其结果的报文定义 增加兼容性要求
2022-7	1.25	1.11	增加债券现券业务交易解除、协商成交合并申报接口； 增加交易会话状态消息接口
2022-9	1.26	1.11	增加跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务的委托和回报定义
2023-2	1.27	1.11	债券质押式协议回购委托、回报删除“备注”字段，启用“约定号”字段，并新增风险控制相关接口定义
2023-7	1.28	1.11	将“委托申报拒绝原因代码”和“联交所拒绝原因代码”迁移到外部文档《深圳证券交易所委托申报拒绝原因代码表》
2023-8	1.29	1.11	债券现券业务点击成交报价委托启用“最低成交量”字段
2024-7	1.30	1.11	修改ETF实时申购赎回业务新订单、执行报告接口定义
2024-10	1.31	1.11	修改债券回售/购回申报、债券回售撤销申报时间说明
2025-2	1.32	1.11	（本文档中橙色修订部分） 网上发行认购业务委托、回报的ApplID新增枚举值“131”、“132”以支持基础设施基金非定向扩募业务。

名词释义

词汇缩写	含义
TGW	Trade GateWay 交易网关 深圳证券交易所交易系统提供给市场参与者的接入点。
OMS	Order Management System 订单管理系统
STEP	Securities Trading Exchange Protocol 证券交易数据交换协议。
FIX	Financial Information Exchange 金融信息交换协议。
DMA	Direct Market Access，指不通过会员而直接接入交易系统的机构投资者，例如基金公司。

目 录

一、 前言 1
二、 会话机制 1
2.1 连接 1
2.1.1 通信版本号 1
2.1.2 会话 1
2.1.3 IP 地址和 Port 1
2.1.4 安全 1
2.2 会话管理 1
2.2.1 建立会话 1
2.2.2 容错 2
2.2.3 恢复 2
三、 服务说明 2
3.1 平台说明 2
3.2 委托申报方式说明 4
3.3 委托消息处理流程 8
3.4 新订单处理消息流图 9
3.4.1 新订单消息流图 10
3.4.2 撤单请求消息流图 13
3.5 双边报价处理消息流图 14
3.5.1 新报价处理消息流图 14
3.5.2 报价更新处理消息流图 14
3.5.3 报价撤销处理消息流图 18
3.6 点击成交报价处理消息流图 19
3.6.1 公开报价受价方点击成交处理 19
3.6.2 公开报价报价方撤销报价处理 20
3.7 询价处理消息流图 20
3.7.1 询价方撤销询价请求处理 21
3.7.2 报价方撤销报价处理 22
3.7.3 询价方与报价方成交 23
3.8 意向申报处理消息流图 25
3.9 成交申报处理消息流图 25
3.9.1 协议配对申报模式（one party report for matching） 26
3.9.1.1 新成交申报处理 27
3.9.1.2 撤销成交申报 28
3.9.2 成交报告申报模式（two party report） 29
3.9.2.1 新成交申报处理 29
3.9.2.2 撤销成交申报 31
3.9.3 成交请求申报模式（one party report for pass through） 33
3.9.3.1 新成交申报处理 34
3.9.3.2 撤销成交申报 35

3.9.4 双边确认成交报告申报模式（two party report for claim） 36
3.9.4.1 新成交申报处理 36
3.9.4.2 撤销成交申报 38
3.10 转托管处理消息流图 39
3.11 网络投票处理消息流图 40
3.12 密码服务处理消息流图 41
3.13 保证金查询处理消息流图 42
3.14 多腿订单处理消息流图 42
3.15 应用层消息恢复 42
3.16 回报交易单元 44
四、 消息定义 44
4.1 兼容性要求 44
4.2 业务消息-新订单处理 44
4.2.1 新订单（New Order） 44
4.2.2 撤单请求（Order Cancel Request） 55
4.2.3 撤单失败响应（Cancel Reject） 56
4.2.4 执行报告（Execution Report） 57
4.3 业务消息-报价处理 61
4.3.1 报价（Quote） 61
4.3.2 报价状态回报（Quote Status Report） 65
4.3.3 报价回复（Quote Response） 68
4.3.4 转发报价（Allege Quote） 71
4.3.5 转发报价回复（Allege Quote Response） 73
4.4 业务消息-询价申报处理 74
4.4.1 询价请求（Quote Request） 74
4.4.2 询价申报响应（Quote Request Ack） 78
4.4.3 转发询价请求（Allege Quote Request） 81
4.5 业务消息-意向申报处理 83
4.5.1 意向申报（Indication of Interest） 83
4.5.2 意向申报响应（Quote Response） 84
4.6 业务消息-成交申报处理 85
4.6.1 成交申报（Trade Capture Report） 85
4.6.2 成交申报响应（Trade Capture Report Ack） 102
4.6.3 转发成交申报（Trade Capture Report ） 105
4.6.4 成交确认（Trade Capture Report） 108
4.7 业务消息-注册处理（即转托管） 111
4.7.1 注册（Designation） 111
4.7.2 注册执行报告（Designation Report） 112
4.8 业务消息-网络投票处理 114
4.8.1 投票（Evote） 114
4.8.2 投票执行报告（Evote Report） 115
4.9 业务消息-密码服务处理 116

4.9.1 密码服务（Password Service） 116
4.9.2 密码服务执行报告（Password Service Report） 118
4.10 业务消息-保证金查询处理 119
4.10.1 保证金查询（Margin Query） 119
4.10.2 保证金查询结果（Margin Query Result） 119
4.11 业务消息-多腿订单处理 120
4.11.1 多腿订单（New Order-Multileg） 120
4.11.2 多腿订单执行报告（Execution Report） 123
五、 其它消息 125
5.1 业务拒绝消息（BUSINESS REJECT） 125
5.2 回报同步消息（REPORT SYNCHRONIZATION） 126
5.3 平台状态消息（PLATFORM STATE INFO） 127
5.4 回报结束消息（REPORT FINISHED） 127
5.5 平台信息消息（PLATFROM INFO） 128
5.6 回报占位消息（REPORT PLACEHOLDER） 129
5.7 交易会话状态消息（TRADING SESSION STATUS） 129
六、 数据字典 130
6.1 数据类型 130
6.2 会话层域定义 131
6.3 业务层域定义 132
6.4 参与人编码 144
6.5 委托申报拒绝原因代码 146
七、 附件 146
7.1 新订单（NEW ORDER）处理流程说明 146
7.1.1 申报新订单并产生成交 146
7.1.2 撤销尚未产生成交的新订单 146
7.1.3 撤销已部分成交的新订单 147
7.1.4 撤销已全部成交的新订单 147
7.1.5 撤销不存在的新订单 148
7.2 成交申报（TCR）处理流程说明 148
7.2.1 协议配对模式 148
7.2.1.1 申报新成交申报 148
7.2.1.2 撤销尚未配对成功的成交申报 149
7.2.1.3 撤销已配对成功的成交申报 149
7.2.1.4 撤销已被拒绝的成交申报 150
7.2.1.5 撤销不存在的的成交申报 150
7.2.2 成交报告申报模式 151
7.2.2.1 申报新成交申报 151
7.2.2.2 撤销已接受的成交申报 151
7.2.2.3 撤销已被拒绝的成交申报 152
7.2.2.4 撤销不存在的的成交申报 152
7.2.3 成交请求申报模式 153

7.2.3.1 申报新成交申报 153
7.2.3.2 撤销尚未配对成功的成交申报 154
7.2.3.3 撤销已配对成功的成交申报 155
7.2.3.4 撤销已被拒绝的成交申报 157
7.2.3.5 撤销不存在的的成交申报 157
7.2.4 双边确认成交报告模式 158
7.2.4.1 申报新成交申报 158
7.2.4.2 撤销尚未配对成功的成交申报 160
7.2.4.3 撤销已配对成功的成交申报 161
7.2.4.4 撤销已被拒绝的成交申报 164
7.2.4.5 撤销不存在的的成交申报 164
7.3 询价（QUOTE REQUEST）处理流程说明 164
7.3.1 询价方撤销询价请求 165
7.3.2 报价方撤销报价 166
7.3.3 询价方与报价方成交 167

深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范

一、 前言

本接口规范提供给会员和以 DMA 方式接入的机构投资者，用以指导开发以 STEP 协议接入深圳证券交易所（以下简称深交所）新一代交易系统（即第五版交易系统）提交订单并获取执行报告。本接口规范描述内容包括可开展的业务、必要的运行指导以及详细的数据交换格式。

文档所采用的术语、消息格式、以及消息流描述均遵照 STEP 1.2 及 FIX 5.0 SP2 协议规范，同时深交所亦有特定的扩展。

二、 会话机制

接入用户订单管理系统（简称“OMS”）与交易网关（简称“TGW”）间的会话机制遵循《轻量级 STEP 会话协议接口规范》，本节仅对交易系统特有的机制进行描述。

2.1 连接

2.1.1 通信版本号

各版本接口规范对应的通信版本号参见文档说明节的修订历史中的“通信版本号”列，在登录消息（Logon）的 DefaultCstmApplVerID 字段中填写该通信版本号，具体填写方式见“会话层域定义”一节。

2.1.2 会话

接入用户通过会话将自身的系统连接到交易网关。该连接为标准的 TCP/IP 点对点连接。

2.1.3 IP 地址和 Port

交易网关按每个平台（平台描述见“服务说明”章节）提供了一个交易服务端口供 OMS 接入。每个交易网关每个平台只能建立一个 TCP/IP 连接，每一个连接只能对应一个会话。

2.1.4 安全

交易网关和接入用户订单管理系统必须位于同一个安全网络之中，交易网关和接入用户订单管理系统之间传输的数据是非加密的，数据传输安全由接入用户网络保证。

2.2 会话管理

2.2.1 建立会话

会话建立过程参见《轻量级 STEP 会话层接口规范》

2.2.2 容错

接入用户订单管理系统或交易网关事故后，接入用户订单管理系统可重新建立与交易网关之间的会话。重建会话后，接入用户订单管理系统应通过应用层规则恢复缺失的数据。

2.2.3 恢复

交易网关使用的会话协议参照《轻量级 STEP 会话层接口规范》实现，会话层恢复机制仅仅是为了与标准 Fix 会话协议兼容，不能作为真正的消息恢复机制使用，订单管理系统应通过应用层的消息恢复机制来获得缺失的数据。

三、 服务说明

3.1 平台说明

新一代交易系统按业务划分为多个平台，每个平台可以有各自独立的开闭市时间设置，市场参与者需要根据交易网关下发的各个平台的当前状态信息来控制各平台委托申报的开始和停止。

各平台处理的业务划分如下表所示：

表 3- 1 各类业务所属业务平台划分

平台	业务种类	委托申报时间
现货集中竞价交易平台	现货集中竞价交易	9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:00
综合金融服务平台（原综合协议交易平台）	协议交易	9:15-11:30 13:00-15:30
	盘后定价大宗交易	
	转融通证券出借	
	资产管理计划份额转让	
	股票质押式回购	
	约定购回	
	质押式报价回购	
	盘后定价交易	
非交易处理平台	ETF 实时申购赎回	9:15-11:30 13:00-15:00
	网上发行认购	

	（包括 IPO，增发，LOF 发行，可转债申购发行，基础设施基金非定向扩募）	特别地： 1）对于期权行权、转处置、垫券还券、待清偿扣划、保证金查询业务： 9:15-11:30 13:00-15:30 2）对于债券转股回售业务，债券转股申报（ApplID=150） 9:15-11:30 13:00-15:00； 债券回售/购回申报（ApplID=151）、债券回售撤销申报（ApplID=152） 9:15-11:30 13:00-15:30
	配股认购	
	债券转股回售	
	期权行权	
	开放式基金申购赎回	
	要约收购	
	转托管	
	网络投票	
	黄金 ETF 实物申购赎回	
	权证行权	
	密码服务	
	保证金查询	
	转处置	
	垫券还券	
	待清偿扣划	
	分级基金实时分拆合并（暂未启用）	
	跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回	
衍生品集中竞价交易平台	期权集中竞价交易	9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:00
	期权组合策略保证金	9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:15
	期权普通与备兑仓互转	9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:15
国际市场互联平台	港股通	8:55-16:20
固定收益交易平台	债券质押式协议回购	9:15-11:30

	债券质押式三方回购交易	13:00-15:30
	债券质押式三方回购出入库	
	债券通用质押式回购质押解押	
	债券转让业务	
	债券分销	9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:00
	债券通用质押式回购交易	9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:30
	债券现券交易	9:00-11:30 13:00-15:30 特别地，对于匹配成交： 9:15-9:25 9:30-11:30 13:00-15:30
	债券借贷	9:00-11:30 13:00-15:30

3.2 委托申报方式说明

用于申报委托的消息有多种类型，接口规范根据每类业务的特性，规定了相应的委托申报的消息类型。

由于存在多类业务使用同一种消息类型进行委托申报的情形，为了区分不同业务的委托，在所有委托申报消息中都存在一个 ApplID 字段，市场参与者在申报委托时，需要按接口规范的要求在委托中填写委托对应的 ApplID。

委托申报消息类型有：

表 3-2 委托申报消息类型

消息类型	说明
New Order（D）	新订单
Order Cancel Request（F）	新订单撤销请求
Quote（S）	报价、转发报价

Quote Request（R）	询价请求、转发询价请求
Quote Response（AJ）	报价回复、转发报价回复
IOI（6）	意向申报
Trade Capture Report（AE）	成交申报
New Order Multileg（AB）	多腿订单
Designation（U001）	注册（转托管）
EVote（U004）	网络投票
Password Service（U006）	密码服务
Margin Query（U008）	保证金查询

各类业务的委托申报消息类型及 ApplID 如下表所示：

表 3-3 委托申报消息类型与应用标识列表

委托申报类型	申报消息类型 MsgType	应用标识 ApplID	所属平台
现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易订单申报	D	010	现货集中竞价交易平台
债券通用质押式回购交易订单申报	D	020	固定收益交易平台
债券分销订单申报	D	030	固定收益交易平台
期权集中竞价交易订单申报	D	040	衍生品集中竞价交易平台
期权集中竞价交易报价申报	S	041	
期权集中竞价交易询价申报	R	042	
协议交易意向申报	6	050	综合金融服务平台
协议交易定价申报	D	051	
协议交易点击成交申报	D	052	
协议交易双方配对成交申报	AE	053	
协议交易询价请求申报	R	055	

协议交易报价申报	S	056	
协议交易报价回复申报	AJ	057	
以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	D	060	综合金融服务平台
以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报	D	061	
转融通证券出借非约定申报	D	070	综合金融服务平台
转融通证券出借约定申报	AE	071	
资产管理计划份额转让	AE	080	综合金融服务平台
股票质押式回购	AE	090	综合金融服务平台
约定购回	AE	100	综合金融服务平台
质押式报价回购	AE	110	综合金融服务平台
ETF 实时申购赎回申报（支持股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回、黄金 ETF 现金申购赎回、跨市场股票 ETF 全实物申购赎回）	D	120	非交易处理平台
网上发行认购申报（发行与增发）	D	130	非交易处理平台
网上发行认购申报（基础设施基金非定向扩募-向原持有人配售）		131	
网上发行认购申报（基础设施基金非定向扩募-公开发售）		132	
配股认购申报	D	140	非交易处理平台
债券转股申报	D	150	非交易处理平台
债券回售/购回申报	D	151	
债券回售撤销申报	D	152	
期权行权申报	D	160	非交易处理平台
期权行权指令合并申报	AB	161	非交易处理平台
开放式基金申购赎回申报	D	170	非交易处理平台
要约收购预受要约申报	D	180	非交易处理平台

要约收购解除预受要约申报	D	181	非交易处理平台
债券通用质押式回购质押申报	D	190	固定收益交易平台
债券通用质押式回购解押申报	D	191	
转托管申报	U001	200	非交易处理平台
网络投票申报	U004	210	非交易处理平台
黄金ETF实物申购赎回申报（该委托只能由上海黄金交易所申报）	D	220	非交易处理平台
权证行权申报	D	230	非交易处理平台
密码服务激活申报	U006	240	非交易处理平台
密码服务挂失申报	U006	241	
保证金查询	U008	250	非交易处理平台
转处置扣券申报	D	270	非交易处理平台
转处置还券申报	D	271	
垫券申报	D	280	非交易处理平台
还券申报	D	281	
待清偿扣划客户申报	D	290	非交易处理平台
待清偿扣划自营申报	D	291	
债券质押式协议回购申报	AE	300	固定收益交易平台
分级基金实时分拆申报	D	310	非交易处理平台
分级基金实时合并申报	D	311	
港股通申报	D	630	国际市场互联平台
债券质押式三方回购交易申报	AE	320	固定收益交易平台
债券质押式三方回购入库申报	D	330	
债券质押式三方回购出库申报	D	331	
期权组合策略保证金构建组合申报	AB	340	衍生品集中竞价交易平台
期权组合策略保证金解除	AB	341	

组合申报			
期权普通转备兑仓申报	D	350	衍生品集中竞价交易平台
期权备兑转普通仓申报	D	351	
盘后定价交易订单申报	D	370	综合金融服务平台
债券现券交易匹配成交申报	D	410	固定收益交易平台
债券现券交易协商成交申报	AE	411	
债券现券交易点击成交报价申报	S	412	
债券现券交易点击成交报价回复申报	AJ	413	
债券现券交易询价申报	R	414	
债券现券交易询价成交报价申报	S	415	
债券现券交易询价成交报价回复申报	AJ	416	
债券现券交易竞买成交申报	D	417	
债券现券交易交易解除申报	AE	419	
债券现券交易协商成交合并申报	AE	41A	
债券转让业务回售转售申报	AE	430	
债券借贷申报	AE	420	固定收益交易平台
跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回	D	470	非交易处理平台

注：**ApplID 包含大写字母 A-Z 和数字 0-9**，ApplID 的前两位表示业务代码，第三位表示该业务下的委托申报代码。

3.3 委托消息处理流程

对于 OMS 申报的委托，交易系统会首先作基本合法性检查，比如委托中的证券代码是否存在、是否到达委托申报时间等等。

如果检查未通过，交易系统会通过 Business Reject（MsgType=j）消息通知 OMS 委托被拒绝。

如果通过基本合法性检查，交易系统会根据委托消息类型的不同向 OMS 发出相应的回报消息，具体参见 3.4-3.9 节。

3.4 新订单处理消息流图

下面列出新订单相关各类消息的处理流程，其中相关各类消息中具体字段取值参见附件 7.1 新订单（New Order）处理回报说明。

3.4.1 新订单消息流图

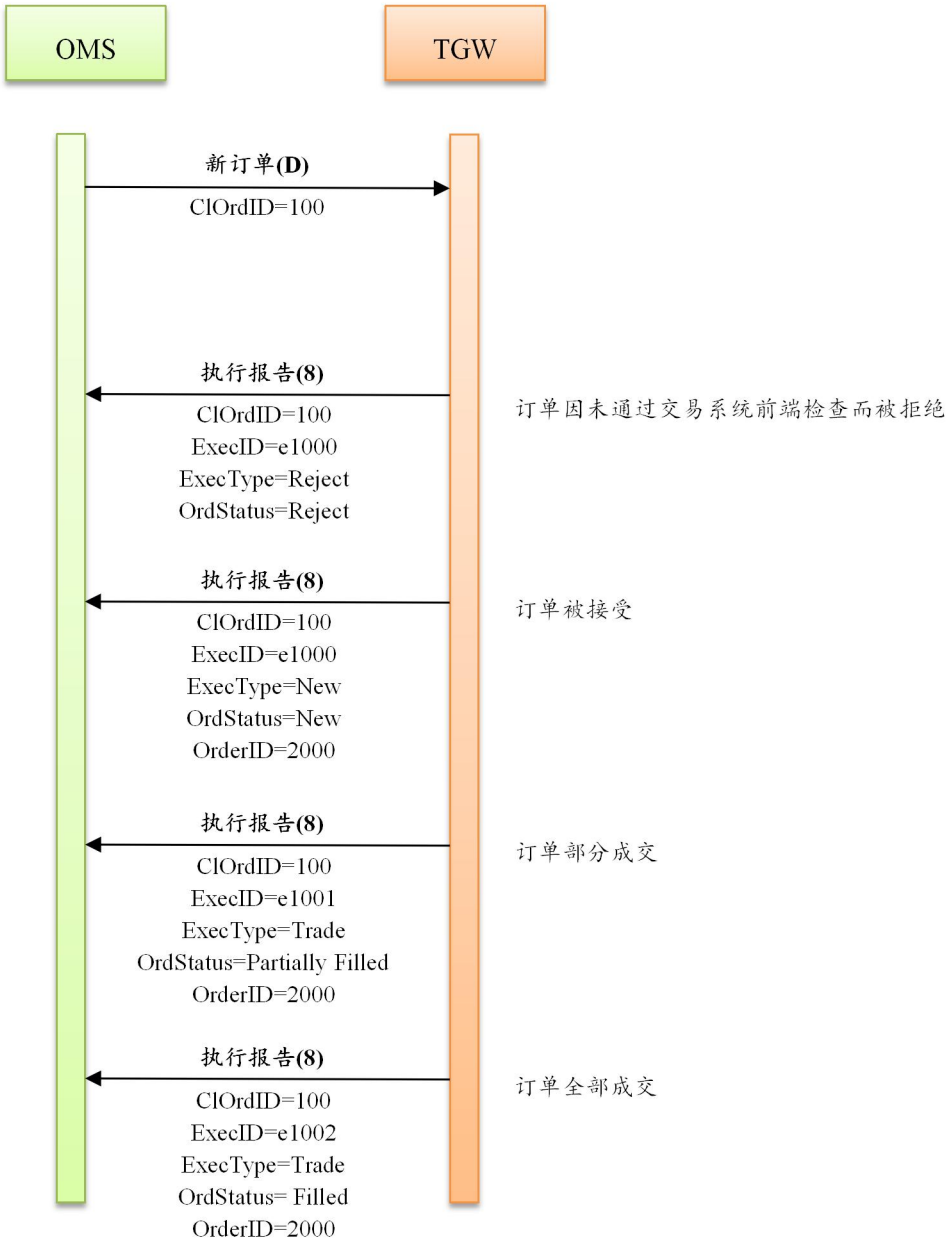

图 3-1 新订单消息流示意图

交易系统对于收到的每一笔新订单，都会立即给出订单被接受（ExecType=New）或拒绝（ExecType=Reject）的确认执行报告；对于交易类业务，订单后续达成成交的还会继续给出成交（ExecType=Trade）执行报告；对于非交易类业务，一般在订单确认时即完成处理，不会有后续的成交执行报告。OMS 申报各业务新订单收到的执行报告类型如下：

表 3-4 订单执行报告类型列表

应用标识 ApplID	说明	确认执行报告	成交执行报告
010	现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易申报	●	●
020	债券通用质押式回购交易申报	●	●
030	债券分销申报	●	●
040	期权集中竞价交易申报	●	●
051	协议交易定价申报	●	●
052	协议交易点击成交申报	●	●
060	以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	●	●
061	以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报	●	●
070	转融通证券出借非约定申报	●	●
120	ETF 实时申购赎回申报	●	
130	网上发行认购申报（发行与增发）	●	
131	网上发行认购申报（基础设施基金非定向扩募-向原持有人配售）	●	
132	网上发行认购申报（基础设施基金非定向扩募-公开发售）	●	
140	配股认购申报	●	
150	债券转股申报	●	
151	债券回售/购回申报	●	
152	债券回售撤销申报	●	
160	期权行权申报	●	
170	开放式基金申购赎回申报	●	
180	要约收购预受要约申报	●	
181	要约收购解除预受要约申报	●	
190	债券通用质押式回购质押申报	●	
191	债券通用质押式回购解押申报	●	
230	权证行权申报	●	
270	转处置扣券申报	●	
271	转处置还券申报	●	
280	垫券申报	●	
281	还券申报	●	
290	待清偿扣划客户申报	●	

291	待清偿扣划自营申报	●	
310	分级基金实时分拆申报	●	
311	分级基金实时合并申报	●	
630	港股通申报	●	●
330	债券质押式三方回购入库申报	●	
331	债券质押式三方回购出库申报	●	
350	期权普通转备兑仓申报	●	
351	期权备兑转普通仓申报	●	
370	盘后定价交易申报	●	●
410	债券现券交易匹配成交申报	●	●
470	跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回申报	●	

3.4.2 撤单请求消息流图

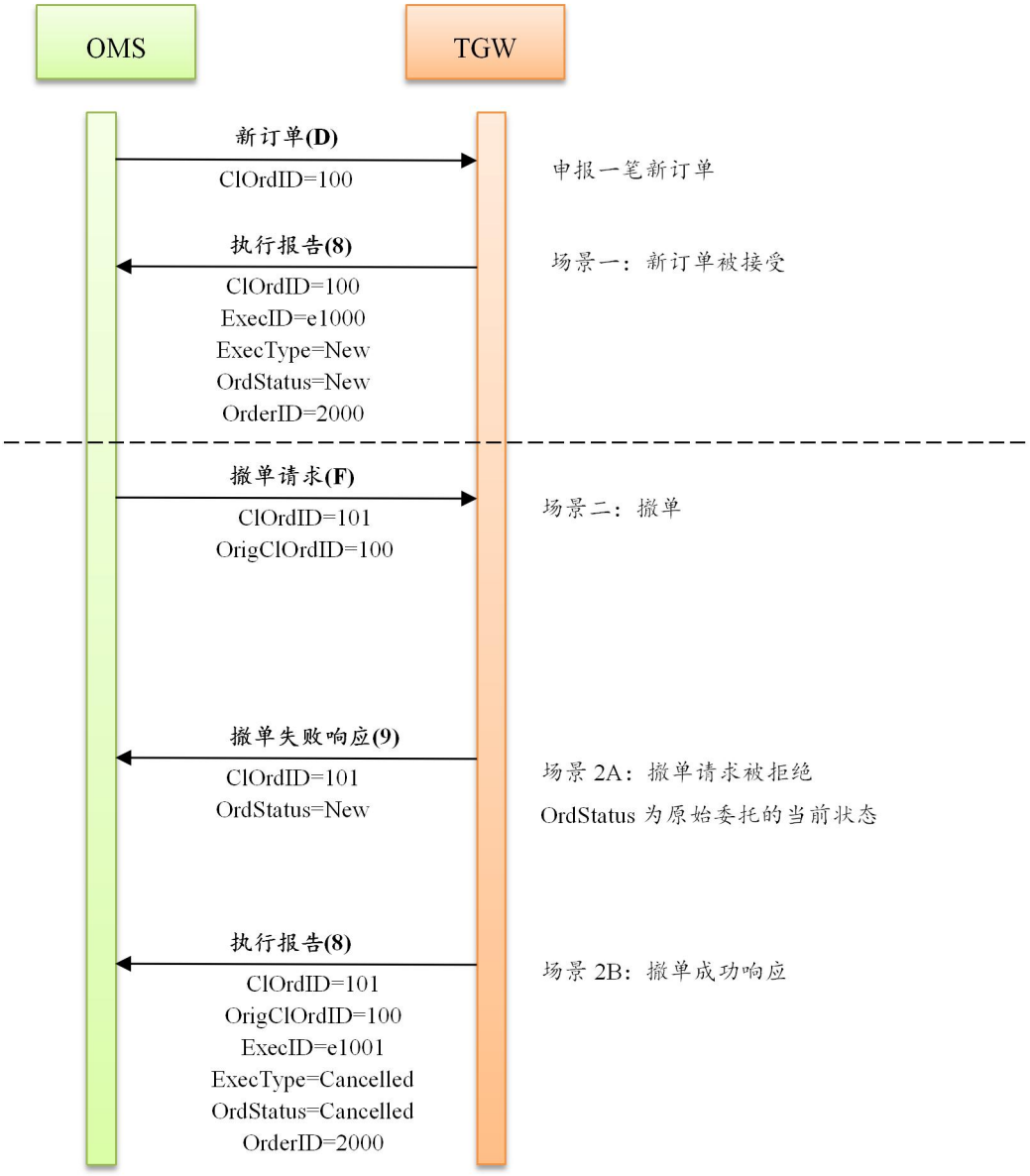

图 3-2 撤单请求消息流示意图

3.5 双边报价处理消息流图

3.5.1 新报价处理消息流图

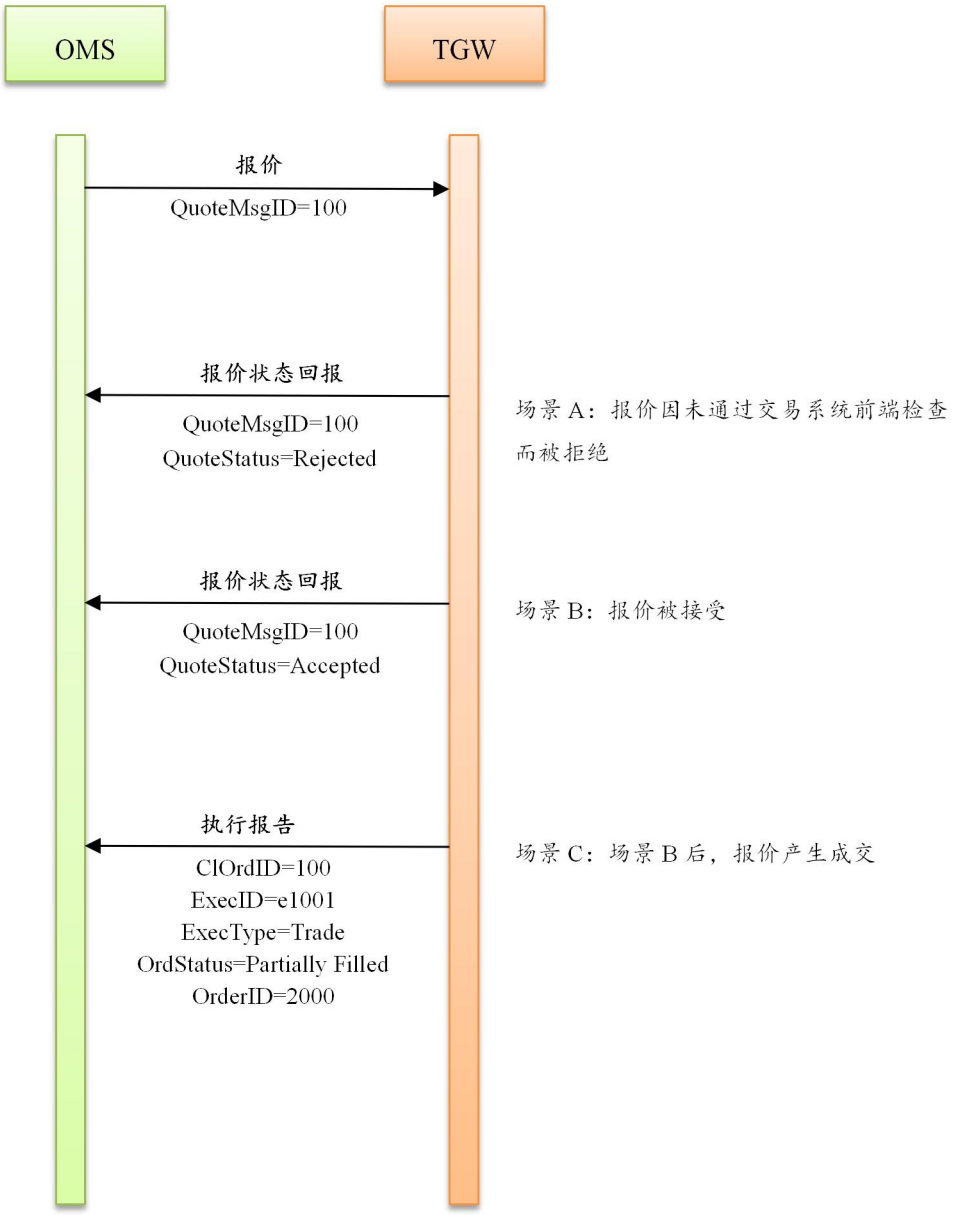

图 3-3 新报价处理消息流示意图

3.5.2 报价更新处理消息流图

- 情形一：更新双边报价，如图 3-4 所示
- 情形二：更新单边报价，价格没有锁价或倒挂，如图 3-5 所示
- 情形三：更新单边报价，价格出现锁价或倒挂，如图 3-6 所示

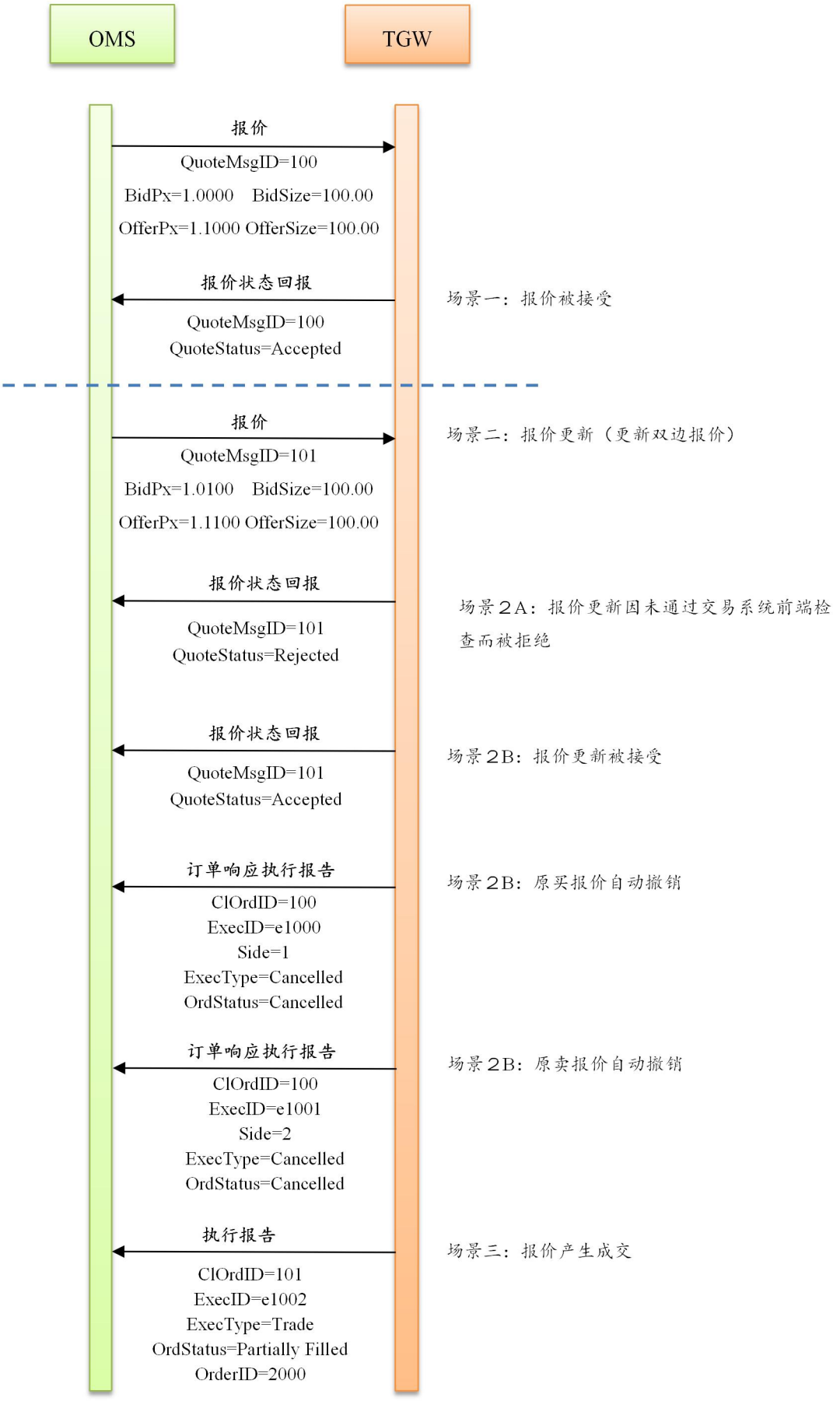
OMS
TGW
报价
QuoteMsgID=100
BidPx=1.0000 BidSize=100.00
OfferPx=1.1000 OfferSize=100.00
报价状态回报
QuoteMsgID=100
QuoteStatus=Accepted
场景一：报价被接受
报价
QuoteMsgID=101
BidPx=1.0100 BidSize=100.00
OfferPx=1.1100 OfferSize=100.00
场景二：报价更新（更新双边报价）
报价状态回报
QuoteMsgID=101
QuoteStatus=Rejected
场景2A：报价更新因未通过交易系统前端检查而被拒绝
报价状态回报
QuoteMsgID=101
QuoteStatus=Accepted
场景2B：报价更新被接受
订单响应执行报告
ClOrdID=100
ExecID=e1000
Side=1
ExecType=Cancelled
OrdStatus=Cancelled
场景2B：原买报价自动撤销
订单响应执行报告
ClOrdID=100
ExecID=e1001
Side=2
ExecType=Cancelled
OrdStatus=Cancelled
场景2B：原卖报价自动撤销
执行报告
ClOrdID=101
ExecID=e1002
ExecType=Trade
OrdStatus=Partially Filled
OrderID=2000
场景三：报价产生成交

图 3-4 更新双边报价处理消息流示意图

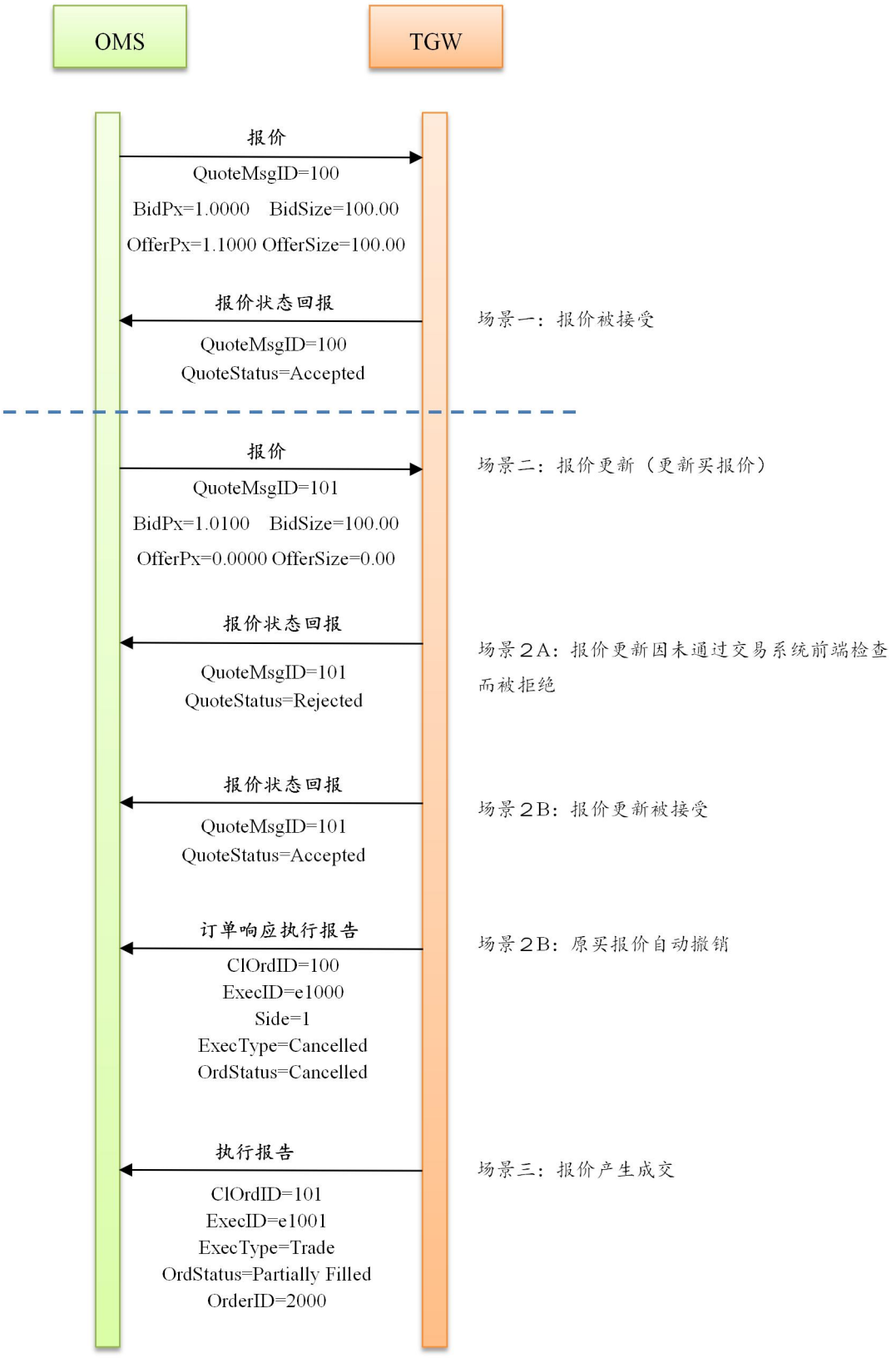

图 3-5 更新单边报价（情形二）处理消息流示意图

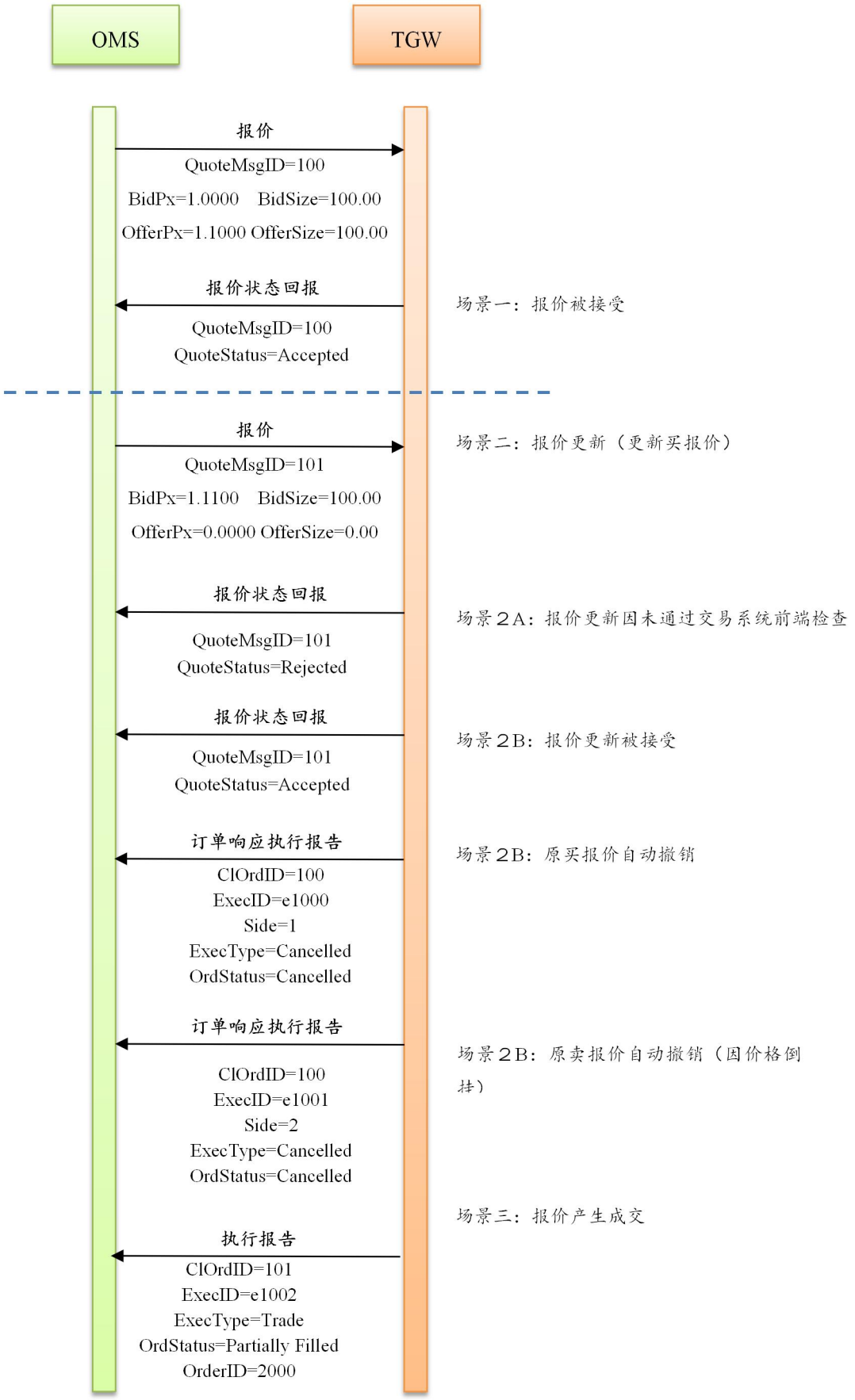

图 3-6 更新单边报价（情形三）处理消息流示意图

3.5.3 报价撤销处理消息流图

图 3-7 报价撤销处理消息流示意图

3.6 点击成交报价处理消息流图

点击成交支持两种模式，一种是面向全市场的点击成交，另一种是面向指定对手方的点击成交。两者区别在于：对于面向全市场的点击成交，交易系统将以逐笔委托行情向市场发布报价信息，而对于指定范围的点击成交，交易系统以转发报价消息发给指定对手方。

目前，债券现券交易业务只支持面向全市场的点击成交。

3.6.1 公开报价受价方点击成交处理

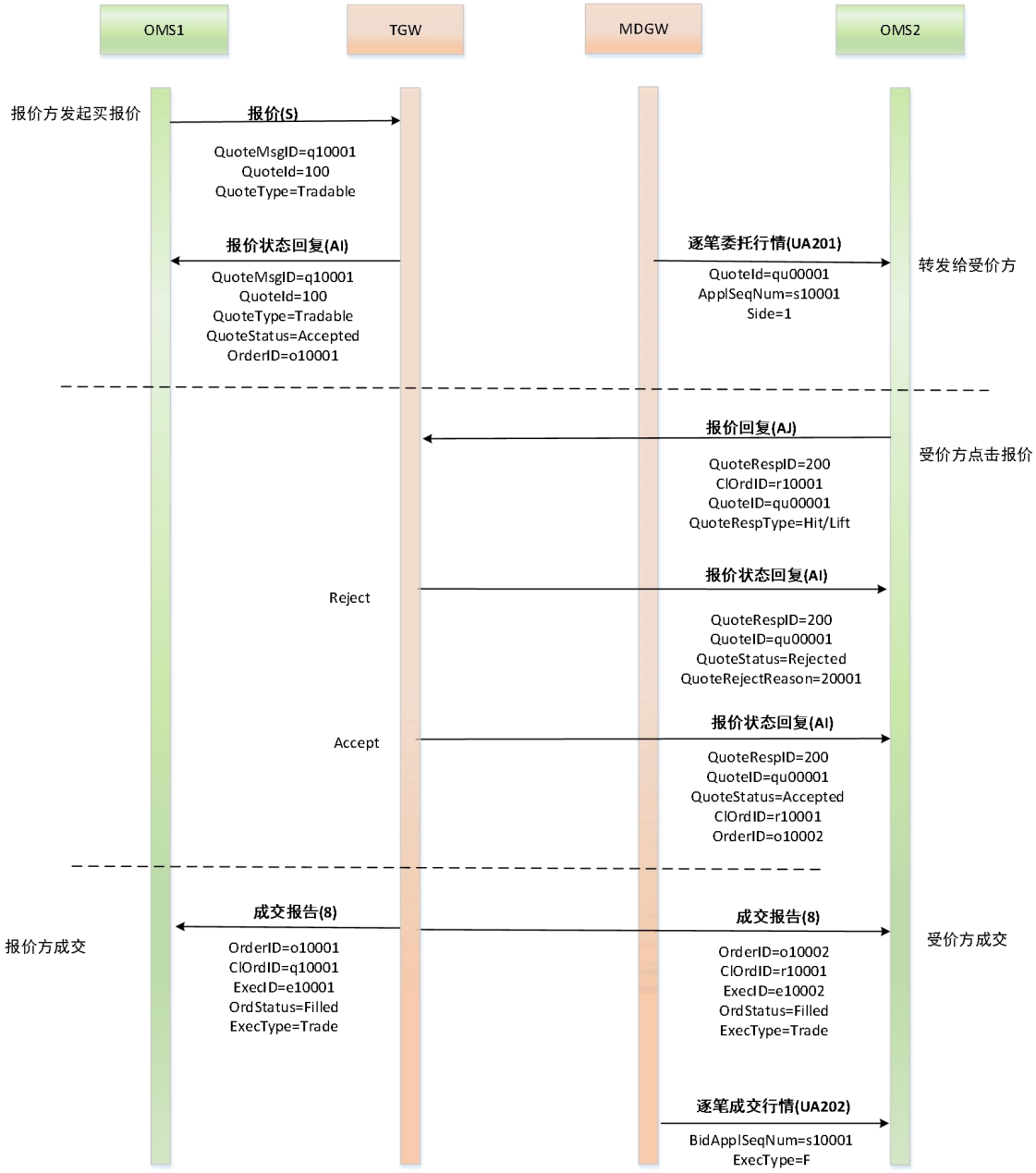

图 3-8 受价方点击成交处理消息流示意图

注：若为报价方发起卖报价，则将逐笔委托（UA201）中的 Side=1 改为 Side=2、将逐笔成交（UA202）中的 BidApplSeqNum=s10001 改为 OfferApplSeqNum=s10001 即可，其他流程不变。

3.6.2 公开报价报价方撤销报价处理

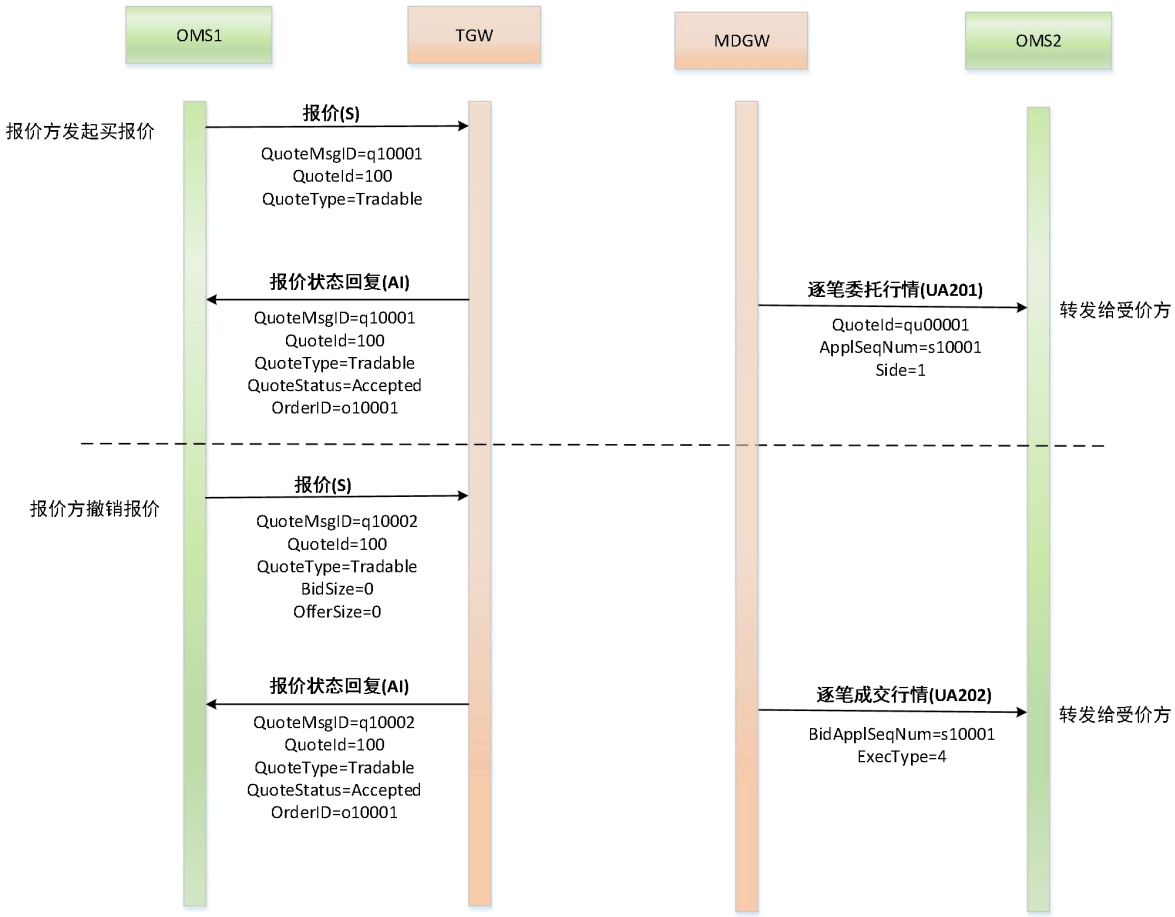

图 3-9 报价方撤销报价处理消息流示意图

注：若为报价方发起卖报价，则将逐笔委托（UA201）中的 Side=1 改为 Side=2、将逐笔成交（UA202）中的 BidApplSeqNum=s10001 改为 OfferApplSeqNum=s10001 即可，其他流程不变。

3.7 询价处理消息流图

询价交易可以分为两个阶段：询价阶段、报价阶段。

在询价阶段，询价方申报询价请求，交易系统转发询价请求给报价方（一个或多个），报价方可以选择进行报价也可以不进行报价。若报价方不进行报价，询价在超时后会自动失效，整个交易过程结束。

在报价阶段，报价方对询价请求进行报价，交易系统将报价转发给询价方。询价方

可以选择接受或不接受报价方的报价。若询价方接受报价，则申报一笔报价回复，交易系统对报价及报价回复进行撮合成交。若询价方不接受报价，报价在询价失效后也自动失效。

询价未成交前，询价方可以撤销询价。报价未成交前，报价方可以撤销报价。

3.7.1 询价方撤销询价请求处理

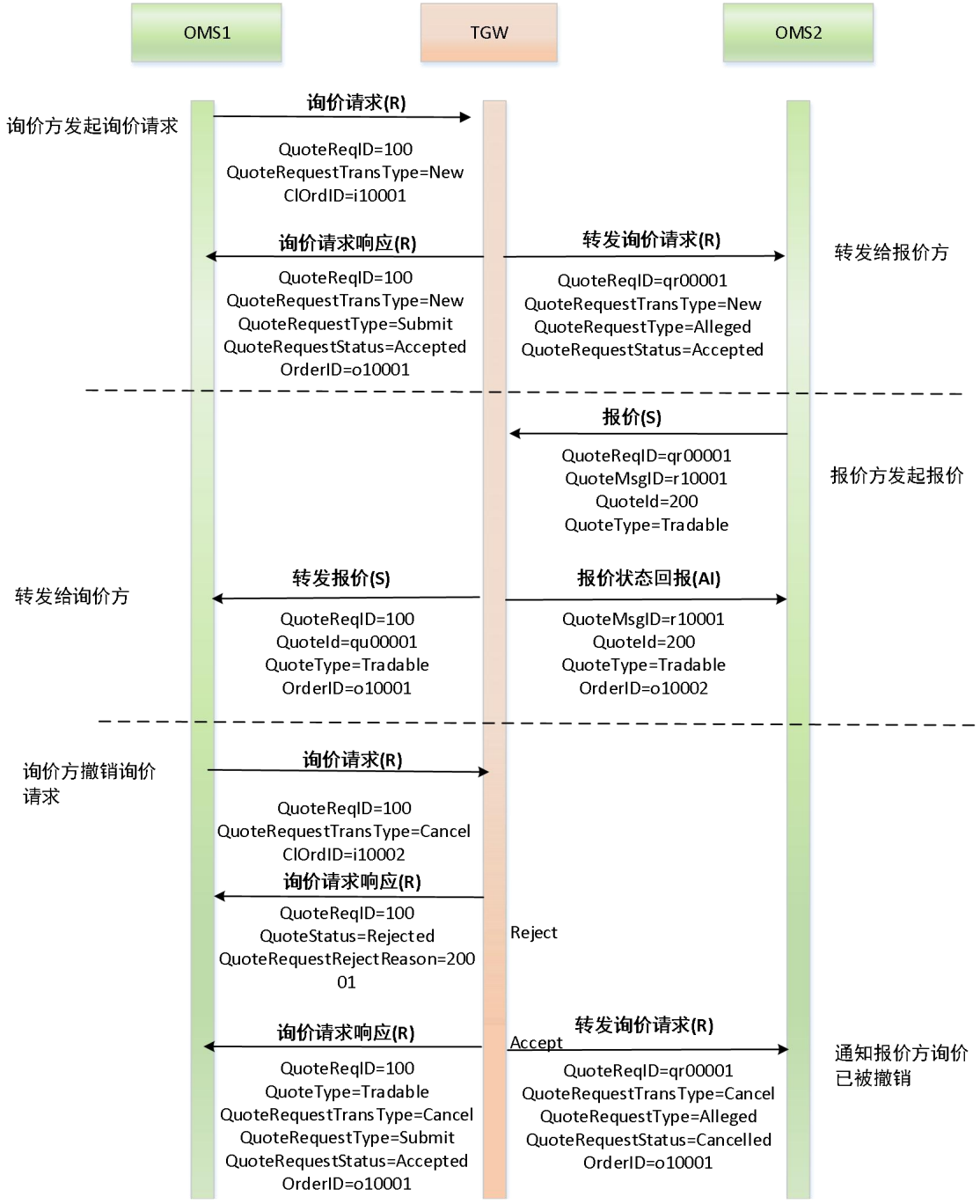

图 3-10 询价方撤销询价处理消息流示意图

3.7.2 报价方撤销报价处理

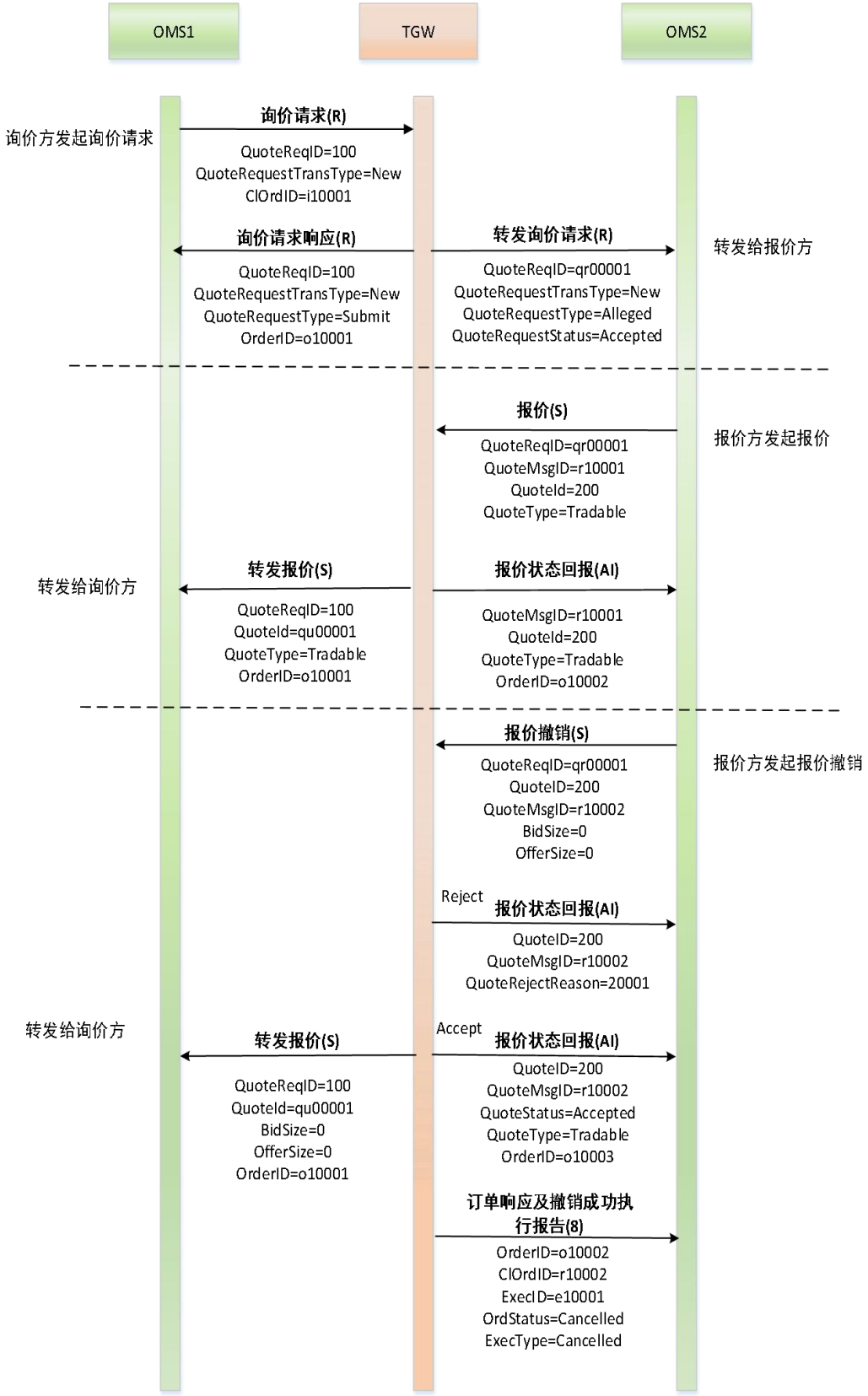

图 3-11 报价方撤销报价处理消息流示意图

3.7.3 询价方与报价方成交

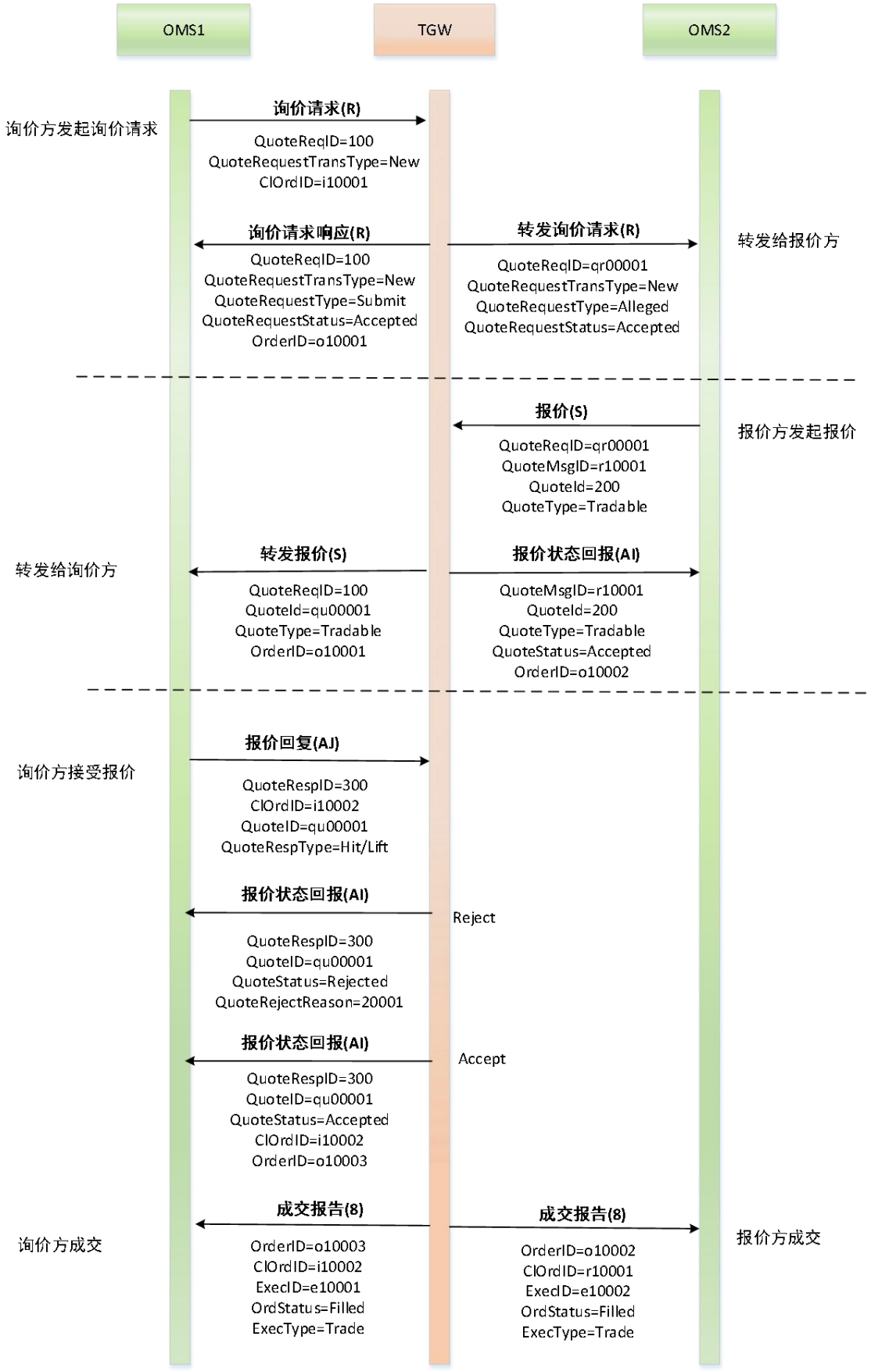
OMS1
TGW
OMS2
询价方发起询价请求
询价请求(R)
QuoteReqID=100
QuoteRequestTransType=New
ClOrdID=i10001
询价请求响应(R)
QuoteReqID=100
QuoteRequestTransType=New
QuoteRequestType=Submit
QuoteRequestStatus=Accepted
OrderID=o10001
转发询价请求(R)
QuoteReqID=qr00001
QuoteRequestTransType=New
QuoteRequestType=Alleged
QuoteRequestStatus=Accepted
转发给报价方
报价(S)
QuoteReqID=qr00001
QuoteMsgID=r10001
QuoteId=200
QuoteType=Tradable
报价方发起报价
转发给询价方
转发报价(S)
QuoteReqID=100
QuoteId=qu00001
QuoteType=Tradable
OrderID=o10001
报价状态回报(AI)
QuoteMsgID=r10001
QuoteId=200
QuoteType=Tradable
QuoteStatus=Accepted
OrderID=o10002
询价方接受报价
报价回复(AJ)
QuoteRespID=300
ClOrdID=i10002
QuoteID=qu00001
QuoteRespType=Hit/Lift
报价状态回报(AI)
Reject
QuoteRespID=300
QuoteID=qu00001
QuoteStatus=Rejected
QuoteRejectReason=20001
报价状态回报(AI)
Accept
QuoteRespID=300
QuoteID=qu00001
QuoteStatus=Accepted
ClOrdID=i10002
OrderID=o10003
询价方成交
成交报告(8)
OrderID=o10003
ClOrdID=i10002
ExecID=e10001
OrdStatus=Filled
ExecType=Trade
成交报告(8)
OrderID=o10002
ClOrdID=r10001
ExecID=e10002
OrdStatus=Filled
ExecType=Trade
报价方成交

图 3-12 询价方与报价成交处理消息流示意图

3.8 意向申报处理消息流图

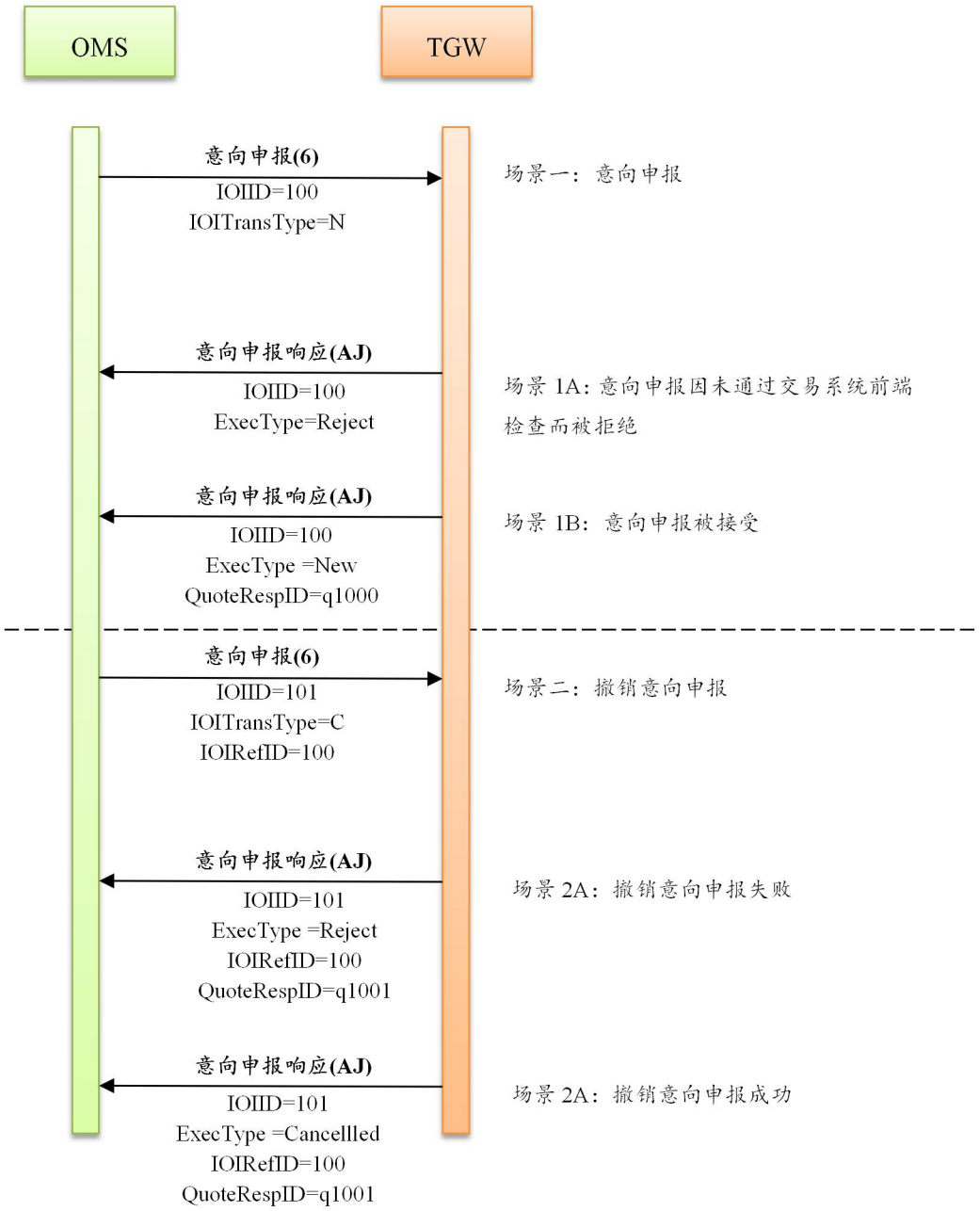

图 3-13 意向申报处理消息流示意图

3.9 成交申报处理消息流图

下面列出成交申报相关各类消息的处理流程，其中相关各类消息中具体字段取值参

见附件 7.2 节成交申报（TCR）处理回报说明。

3.9.1 协议配对申报模式（one party report for matching）

大宗交易等多种协议交易业务的成交申报采用“协议配对申报模式（one party report for matching）”，即买卖双方各报一笔，深交所交易系统进行配对。

3.9.1.1 新成交申报处理

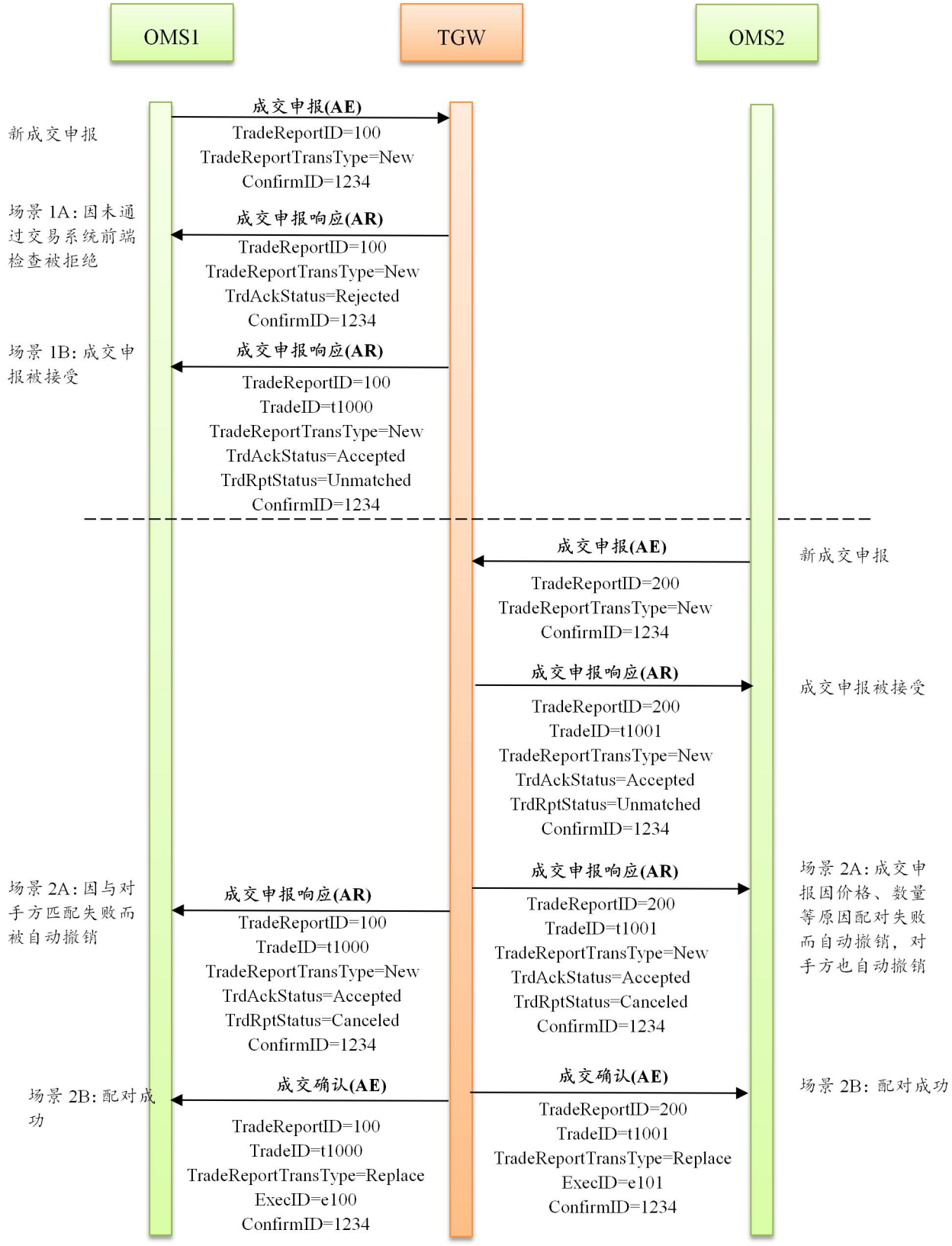

图 3-14 新成交申报处理消息流示意图

3.9.1.2 撤销成交申报

尚未完成配对的成交申报可以撤销，撤销流程如图 3-15 所示。

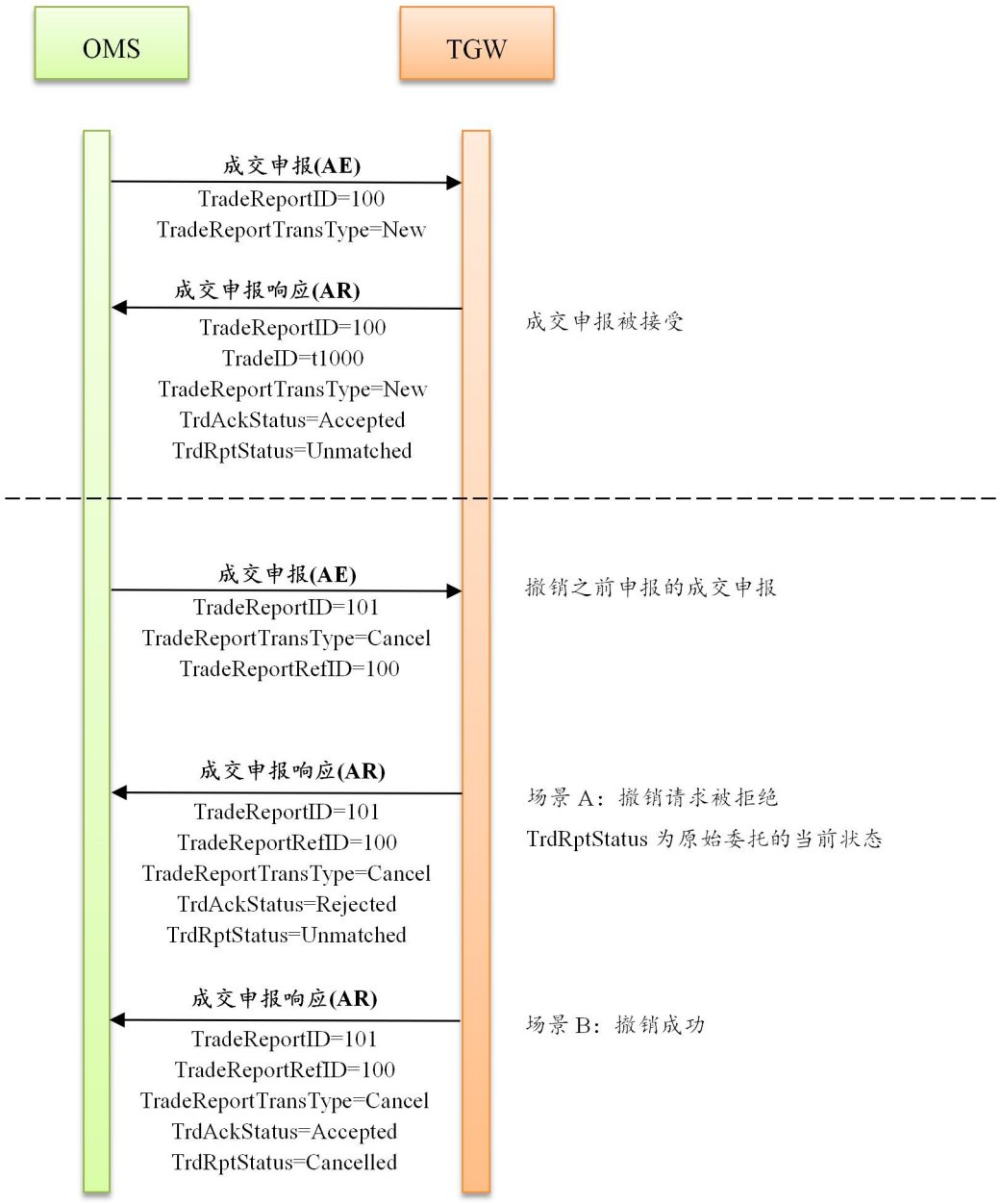

图 3-15 撤销成交申报处理消息流示意图

3.9.2 成交报告申报模式（two party report）

成交报告申报模式（two party report）是指由交易一方或第三方中介机构申报一笔包含双方完整信息的委托，深交所交易系统进行即时确认。

3.9.2.1 新成交申报处理

对于以成交报告申报模式的委托，目前有两种处理方式，方式一如图 3-16 的场景 1A 或 1B 所示，交易系统仅返回委托确认（成交申报响应（AR）消息）；方式二如图 3-16 的场景 2 所示，交易系统除返回委托确认外，对于被接受的委托，还返回成交确认（成交确认（AE）消息），如委托是由交易一方发起的，可能还会根据业务需要将成交确认转发给对手方（转发成交申报（AE）消息）。

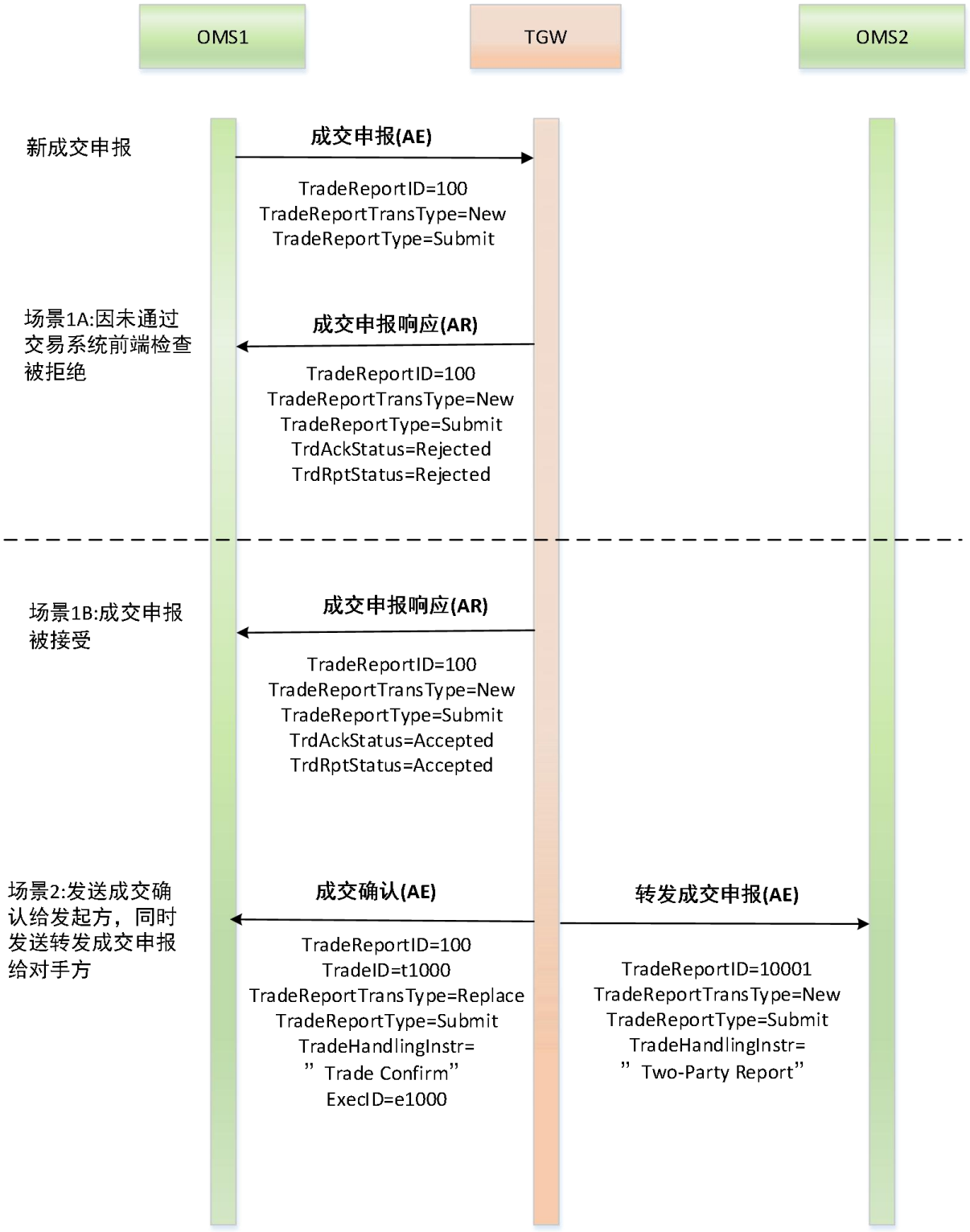

图 3-16 成交报告申报处理消息流示意图

表 3-5 成交报告模式业务列表

应用标识 ApplID	说明	成交申报响应	成交确认	转发成交申报	是否支持撤销

080	资产管理计划份额转让	●			
090	股票质押式回购	●			
100	约定购回	●			
110	质押式报价回购	●			
300	债券质押式协议回购（到期购回）	●	●	●	
320	债券质押式三方回购交易（到期购回、补券）	●	●	●	●（到期购回不支持）

3.9.2.2 撤销成交申报

成交报告申报模式的撤销流程如图 3-17 所示，其中按上述方式一处理的委托，对于其撤销请求交易系统同样仅返回撤销委托确认。

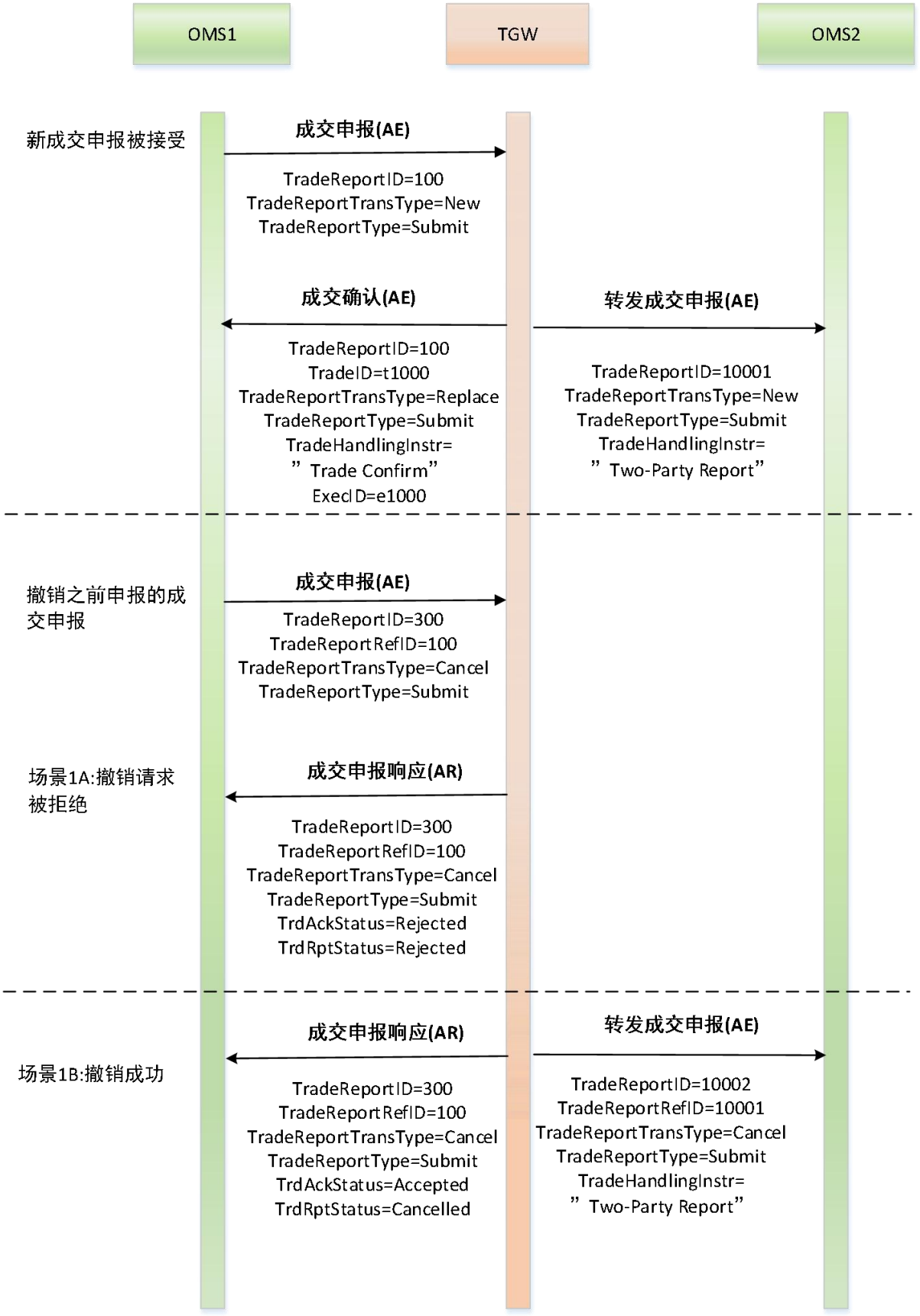

图 3-17 成交报告撤销成交申报处理消息流示意图

3.9.3 成交请求申报模式（one party report for pass through）

债券质押式三方回购等业务的成交申报采用“成交请求申报模式（one party report for pass through）”，即由一方发起一笔指定对手方的成交申报，经交易系统转发给指定对手方，对手方在接收到转发的成交申报后，通过申报接受或拒绝的成交申报进行确认。

3.9.3.1 新成交申报处理

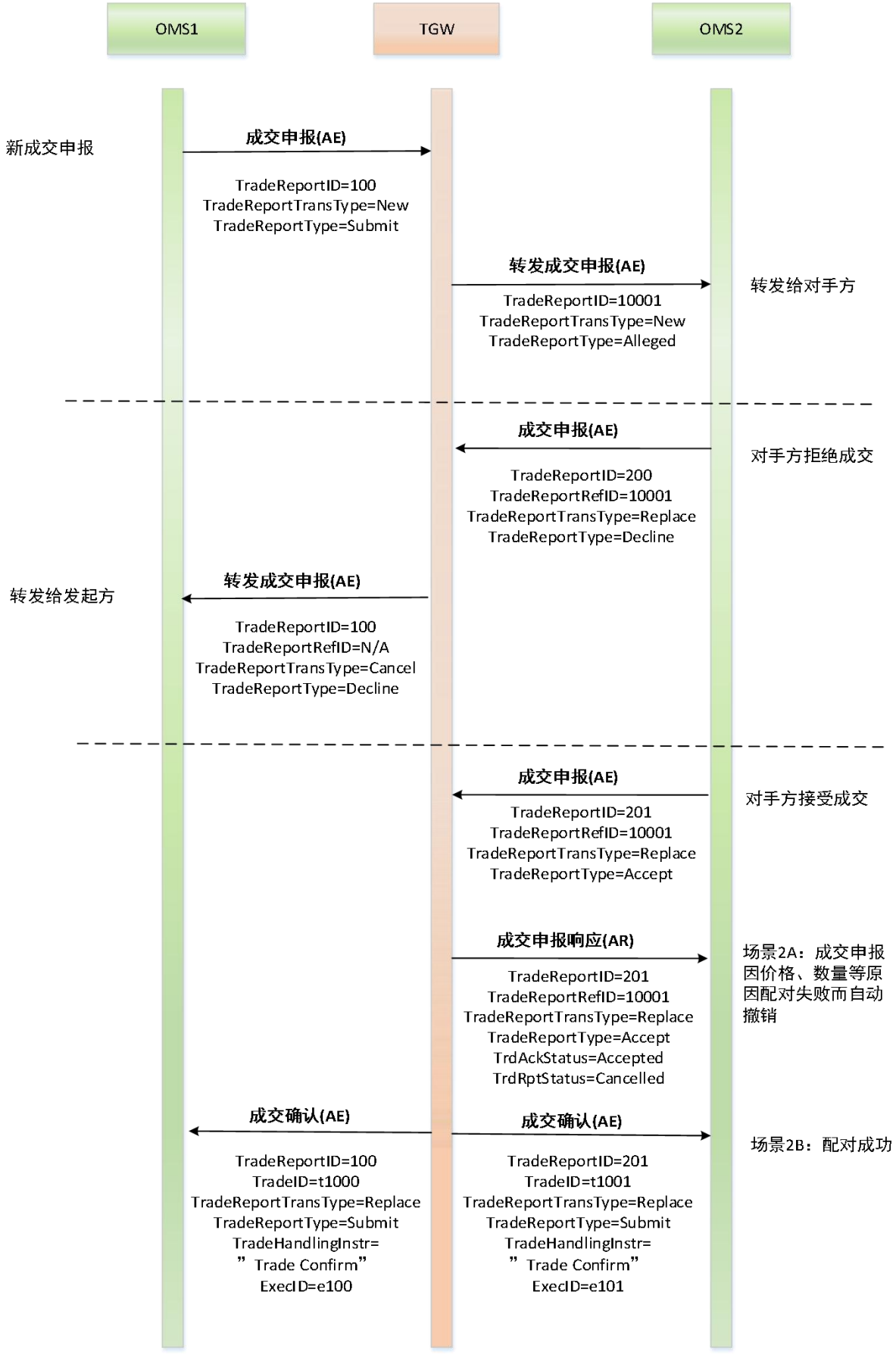

图 3-18 新成交申报处理消息流示意图

深交所交易系统对于每一笔投资者申报的成交申报都会发成交申报响应(ACK)，由于篇幅原因，上图中省略了交易系统对于每一笔申报返回的 ACK。

3.9.3.2 撤销成交申报

成交请求的发起方可在对方完成确认前撤销成交请求，撤销流程如图 3-19 所示。

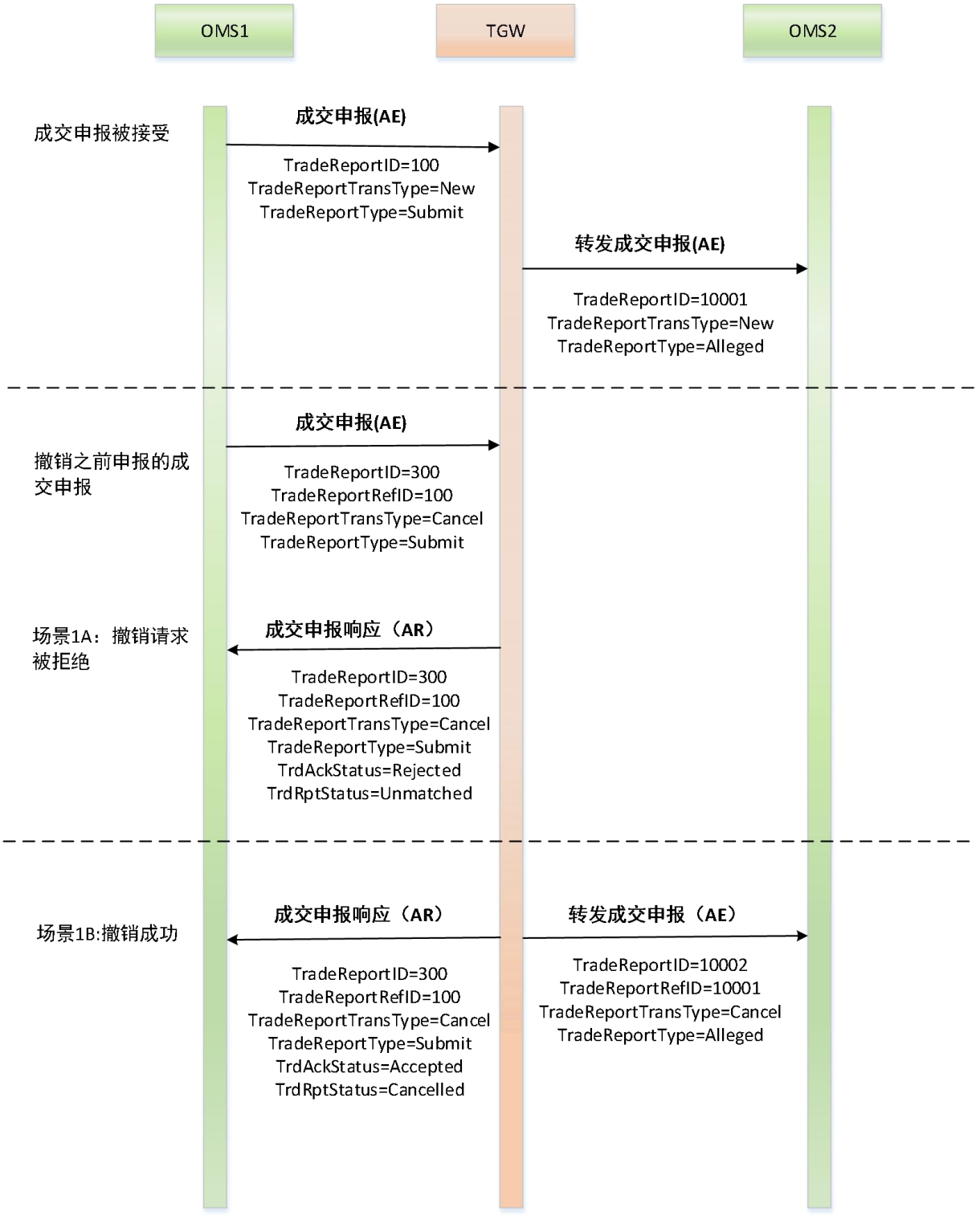

图 3-19 撤销成交申报处理消息流示意图

3.9.4 双边确认成交报告申报模式（two party report for claim）

双边确认成交报告申报模式（**two party report for claim**）是指由做市商或深交所认可的其他机构发起一笔包含发起方及买卖双方交易信息的委托，经深交所交易系统转发给买卖双方，买卖双方分别通过申报接受或拒绝的成交申报进行确认后达成成交的处理模式。

3.9.4.1 新成交申报处理

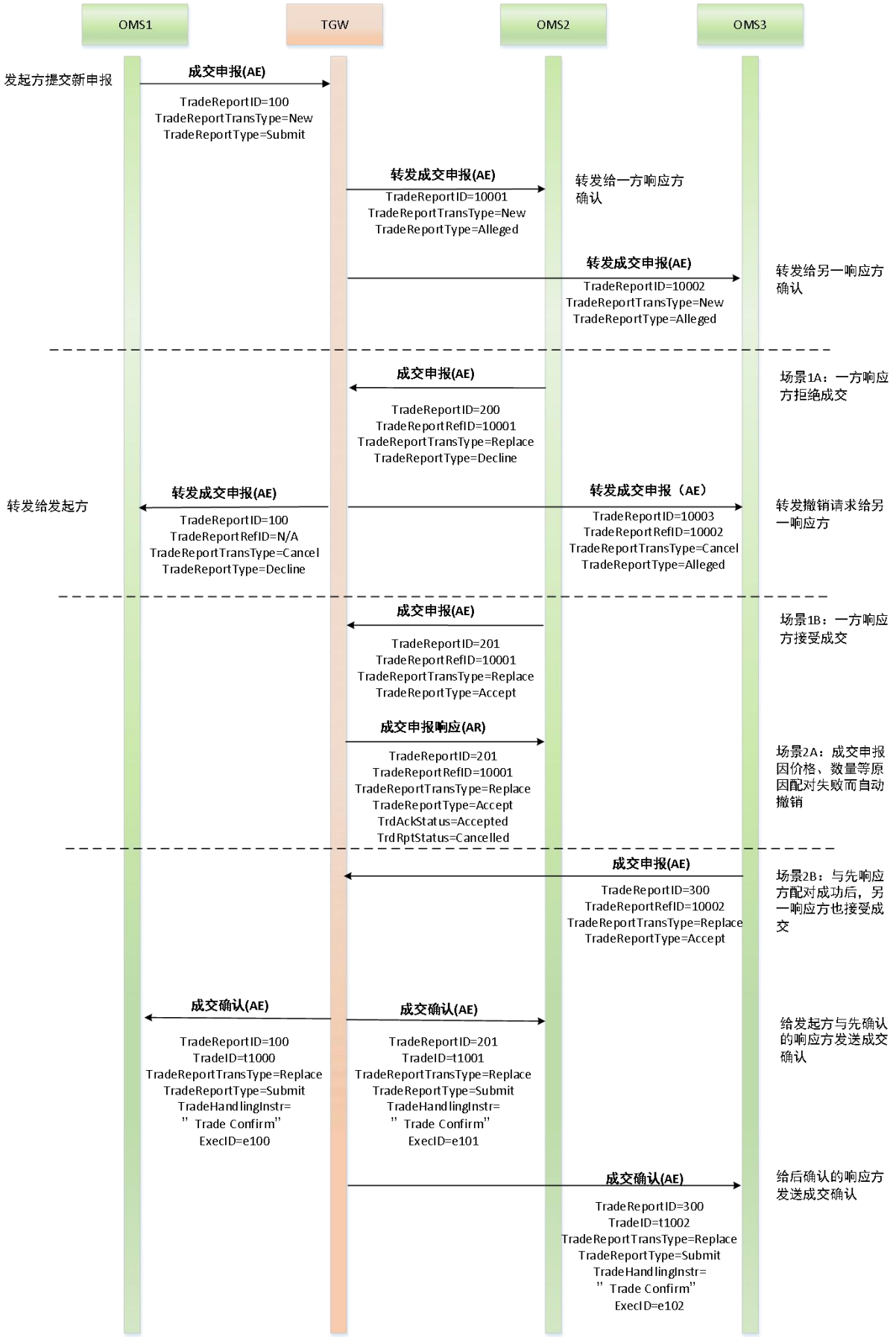
OMS1
TGW
OMS2
OMS3
发起方提交新申报
成交申报(AE)
TradeReportID=100
TradeReportTransType=New
TradeReportType=Submit
转发成交申报(AE)
TradeReportID=10001
TradeReportTransType=New
TradeReportType=Alleged
转发给一方响应方确认
转发成交申报(AE)
TradeReportID=10002
TradeReportTransType=New
TradeReportType=Alleged
转发给另一响应方确认
成交申报(AE)
TradeReportID=200
TradeReportRefID=10001
TradeReportTransType=Replace
TradeReportType=Decline
场景1A：一方响应方拒绝成交
转发给发起方
转发成交申报(AE)
TradeReportID=100
TradeReportRefID=N/A
TradeReportTransType=Cancel
TradeReportType=Decline
转发成交申报（AE）
TradeReportID=10003
TradeReportRefID=10002
TradeReportTransType=Cancel
TradeReportType=Alleged
转发撤销请求给另一响应方
成交申报(AE)
TradeReportID=201
TradeReportRefID=10001
TradeReportTransType=Replace
TradeReportType=Accept
场景1B：一方响应方接受成交
成交申报响应(AR)
TradeReportID=201
TradeReportRefID=10001
TradeReportTransType=Replace
TradeReportType=Accept
TrdAckStatus=Accepted
TrdRptStatus=Cancelled
场景2A：成交申报因价格、数量等原因配对失败而自动撤销
成交申报(AE)
TradeReportID=300
TradeReportRefID=10002
TradeReportTransType=Replace
TradeReportType=Accept
场景2B：与先响应方配对成功后，另一响应方也接受成交
成交确认(AE)
TradeReportID=100
TradeID=t1000
TradeReportTransType=Replace
TradeReportType=Submit
TradeHandlingInstr=
" Trade Confirm"
ExecID=e100
成交确认(AE)
TradeReportID=201
TradeID=t1001
TradeReportTransType=Replace
TradeReportType=Submit
TradeHandlingInstr=
" Trade Confirm"
ExecID=e101
给发起方与先确认的响应方发送成交确认
成交确认(AE)
TradeReportID=300
TradeID=t1002
TradeReportTransType=Replace
TradeReportType=Submit
TradeHandlingInstr=
" Trade Confirm"
ExecID=e102
给后确认的响应方发送成交确认

图 3-20 新成交申报处理消息流示意图

深交所交易系统对于每一笔投资者申报的成交申报都会发成交申报响应(ACK)，由于篇幅原因，上图中省略了交易系统对于每一笔申报返回的 ACK。

3.9.4.2 撤销成交申报

双边确认成交报告的发起方可在响应方完成确认前撤销成交请求，撤销流程如图 3-21 所示。

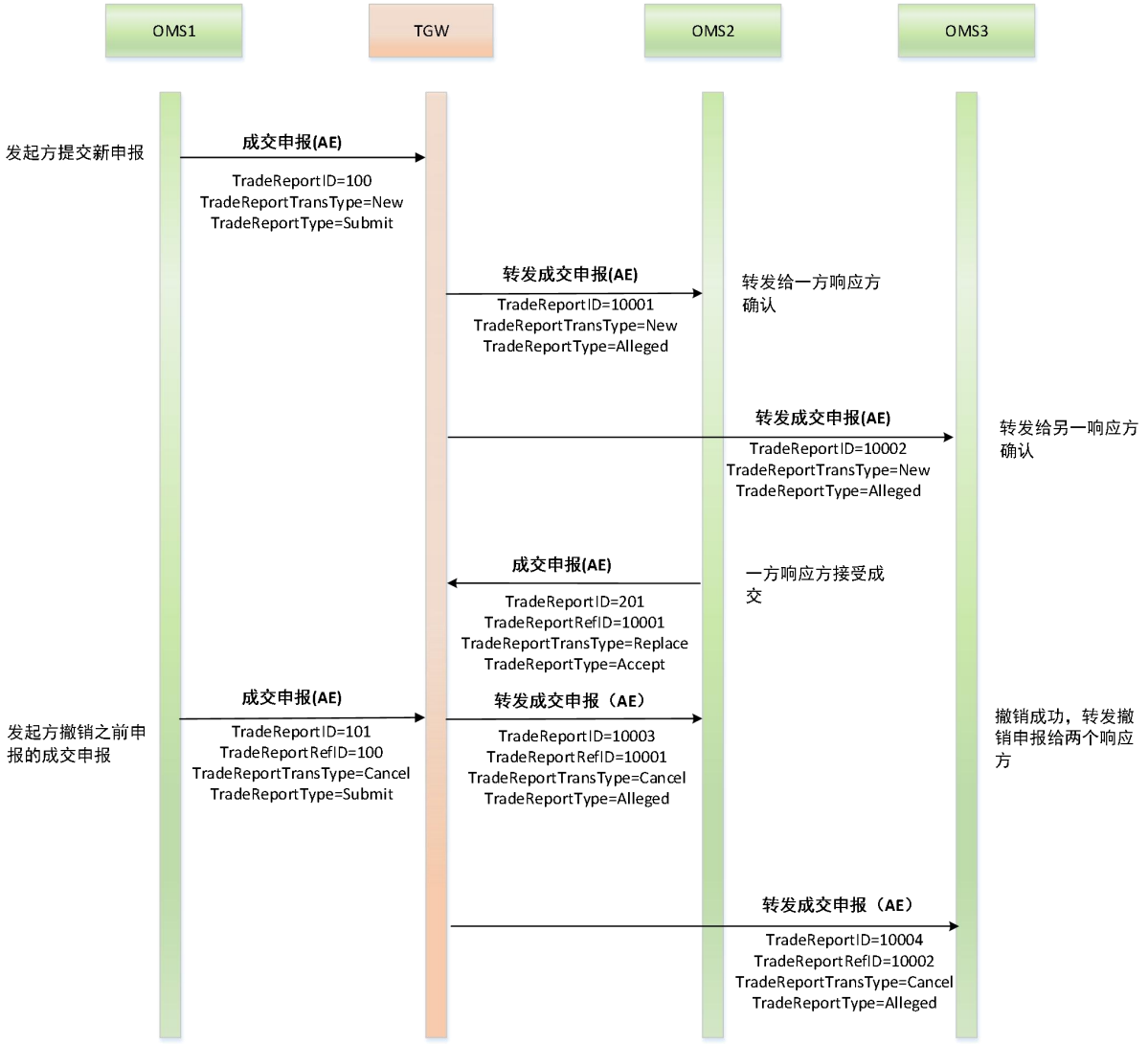

图 3- 21 撤销成交申报处理消息流示意图

深交所交易系统对于每一笔投资者申报的成交申报都会发成交申报响应(ACK)，由于篇幅原因，上图中省略了交易系统对于每一笔申报返回的 ACK。

3.10 转托管处理消息流图

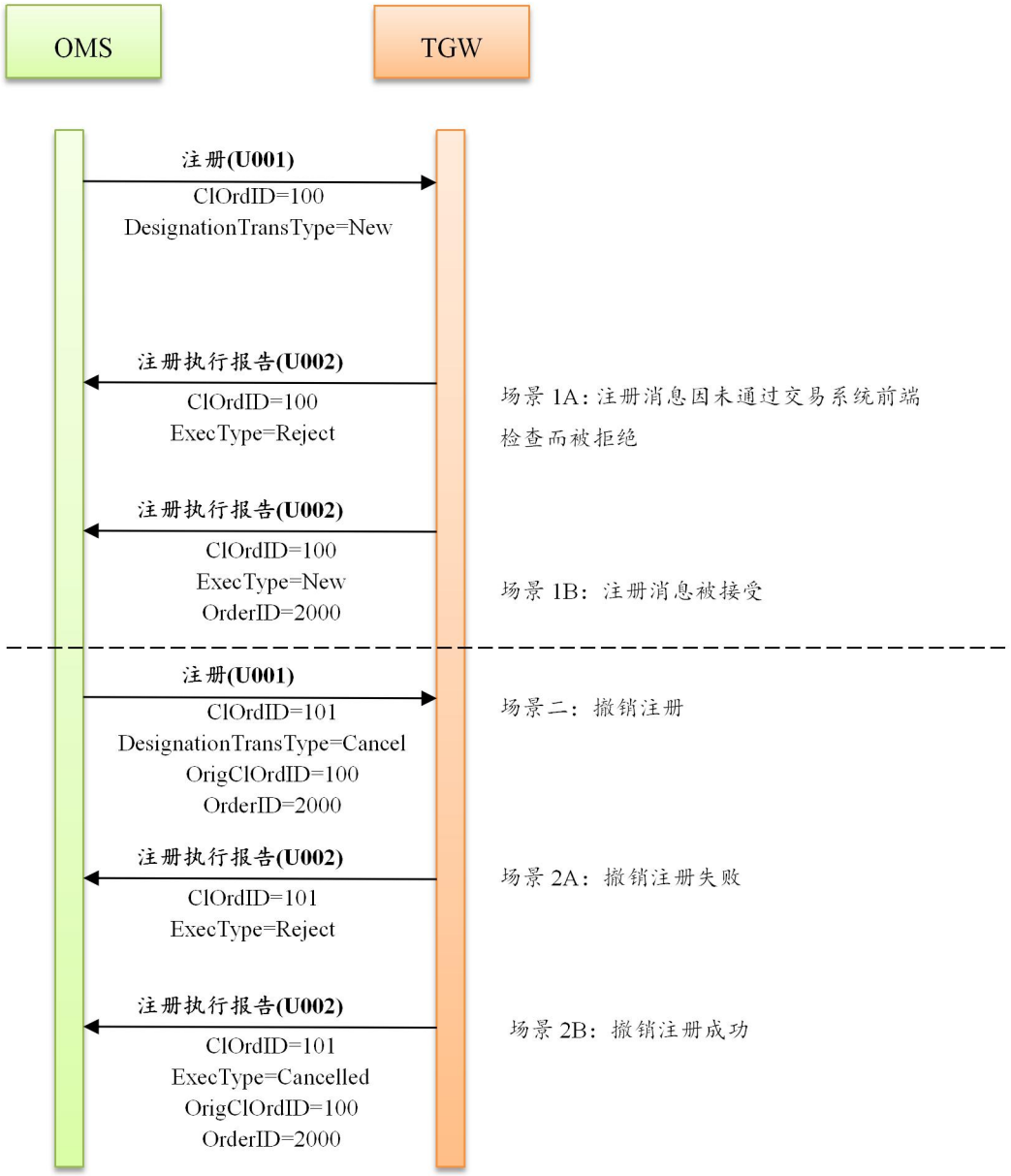

图 3-22 转托管处理消息流示意图

3.11 网络投票处理消息流图

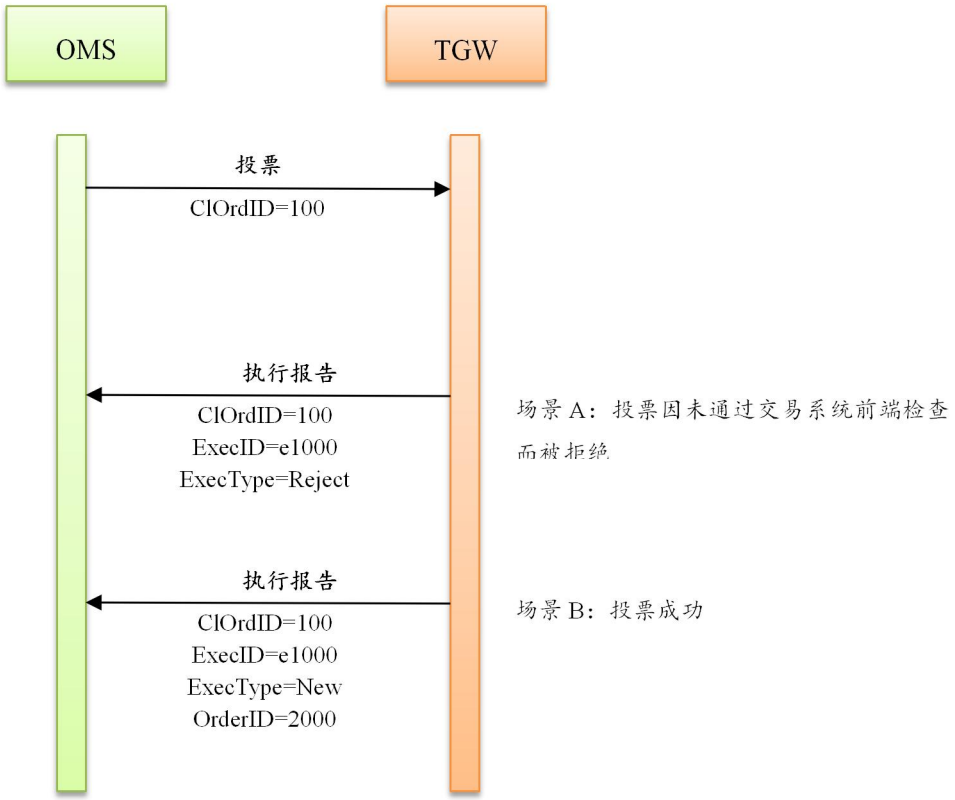

图 3-23 网络投票处理消息流示意图

3.12 密码服务处理消息流图

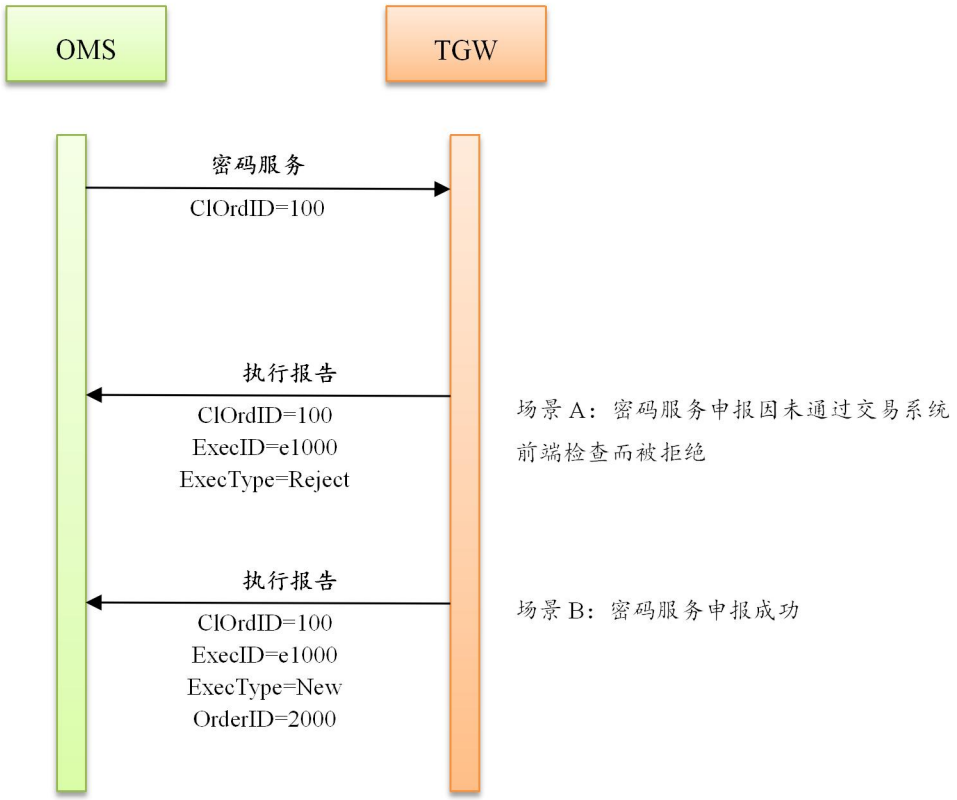

图 3-24 密码服务处理消息流示意图

3.13 保证金查询处理消息流图

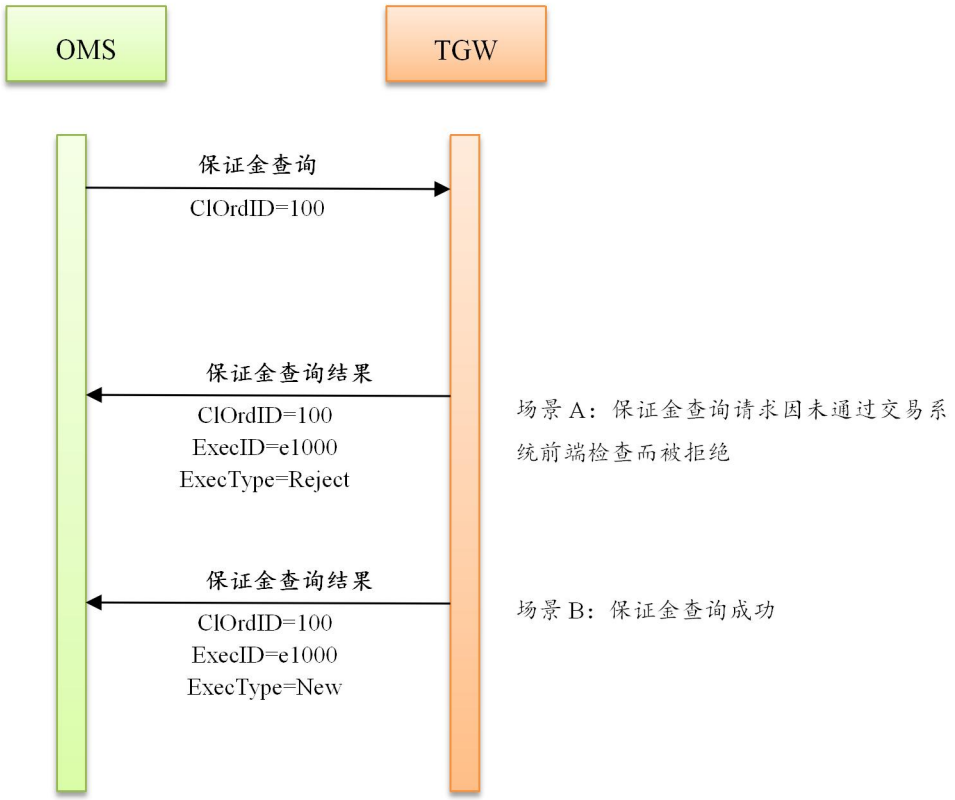

图 3-25 保证金查询处理消息流示意图

3.14 多腿订单处理消息流图

多腿订单的处理过程请参考新订单处理消息流图。OMS 申报各业务多腿订单收到的执行报告类型如下：

表 3-6 订单执行报告类型列表

应用标识 ApplID	说明	确认执行报告	成交执行报告
161	期权行权指令合并申报	●	
340	期权组合策略保证金构建组合申报	●	
341	期权组合策略保证金解除组合申报	●	

3.15 应用层消息恢复

TGW 发送给 OMS 的每笔回报消息（业务拒绝消息 Business Reject 除外）都含平台分区号 PartitionNo 和回报记录号 ReportIndex 两个字段，对于每一个分区其回报记录号字段值都从 1 开始连续编号，该编号表示该笔回报是该分区的第几笔回报。在 OMS 与

TGW 异常断开连接后，OMS 应该根据本次连接收到的平台信息消息确定各个分区已收到回报的最大记录号并按照下图所示流程与 TGW 重新建立连接（首次建立连接也必须按照该流程进行，相当于最大记录号为 0）。

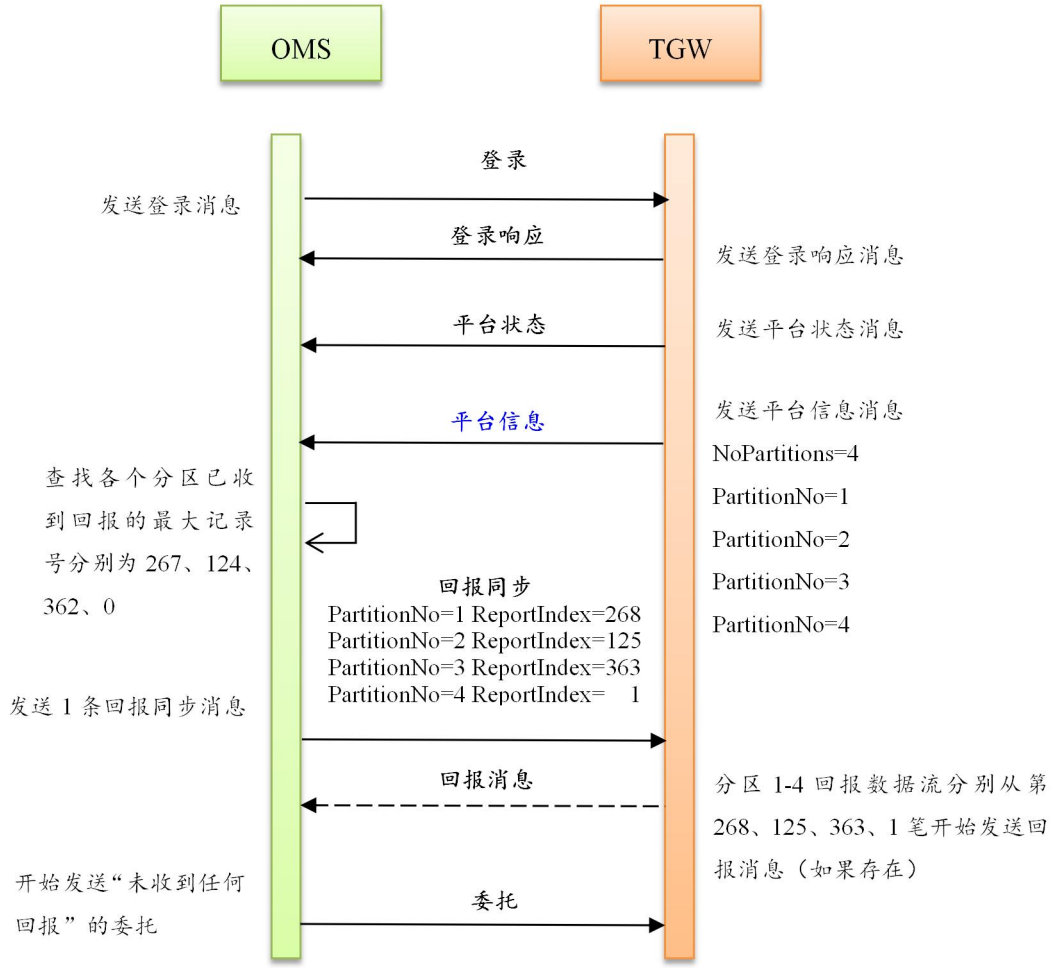

图 3-26 OMS 恢复与 TGW 通信消息流示意图

建议 OMS 收到 TGW 返回的平台信息消息后，再发送回报同步消息。如果 OMS 发送的回报同步消息中含有非法的分区号，该笔回报同步消息会被丢弃，OMS 会收到拒绝原因为 20106 的业务拒绝消息（Business Reject），此时，OMS 必须重新发送回报同步消息否则 OMS 将无法收到回报数据。

OMS 在发送回报同步消息后，并不需要等待到有回报消息返回才开始发送委托，但建议等待 3 秒钟以接收尽可能多的回报消息，从而减少委托的重复发送。

在闭市以后，OMS 不能继续申报委托，但是仍然可以登录 TGW 并通过该机制重新接收当天的回报数据，比如将回报同步消息中本平台所有分区的 ReportIndex 都设置为 1 即可以重新接收当天的所有回报数据，也可在回报同步消息中指定重新接收某一个分区的回报数据。

如果 OMS 发送的回报同步消息中的 ReportIndex 值大于实际存在的回报记录数目，则 TGW 不会发送回报消息，直至回报记录数达到 ReportIndex 值才开始继续回报。比如发送的回报同步消息中的 ReportIndex 为 1001，而 TGW 端实际存在的回报数只有 300，则 TGW 会等到实际的回报数达到 1001 时才开始发送回报，回报记录号为 1-1000 的回报不会发送给 OMS。

3.16 回报交易单元

TGW 发送给 OMS 的每笔回报消息（业务拒绝消息 Business Reject 除外）中的参与人编码相对于原始委托会多一个“回报交易单元”，“回报交易单元”一般情况下与“申报交易单元”一致，只有在需要将某个交易单元申报委托的回报抄送给另外一个交易单元时，两者才会不一致。

参与人代码 PartyID	参与人代码源 PartyIDSource	参与人代码角色 PartyRole
交易单元（PBU）	C 表示通用市场参与者标识	27 表示回报交易单元

四、 消息定义

4.1 兼容性要求

1、新增 TGW 发送给 OMS 的应用层消息类型，OMS 如果不使用这些新消息，应可以不作变更而自动忽略这些新消息。新消息可以是回报类消息也可以是非回报类消息。

2、保证金查询结果消息（U009）增加新的保证金条目类别，OMS 如果不使用这些新的保证金条目，应可以不作变更而自动忽略新的保证金条目。

4.2 业务消息-新订单处理

4.2.1 新订单（New Order）

表 4-1 OMS 向 TGW 报送新订单消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=D
1180	ApplID	Y	应用标识
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
40	OrdType	Y	订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优
54	Side	Y	买卖方向

522	OwnerType			Y	订单所有者类型
529	OrderRestrictions			N	订单限定
60	TransactTime			N	订单发起时间
组件<Instrument>				Y	
48	SecurityID			Y	证券代码
22	SecurityIDSource			Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束					
组件<Parties>				Y	
453	NoPartyIDs			Y	参与人代码个数
→	448	PartyID		Y	参与人代码
	447	PartyIDSource		Y	参与人代码源
	452	PartyRole		Y	参与人代码角色
	子组件< PtysSubGrp>			N	
	802	NoPartySubIDs		Y	参与方子代码个数
	→	523	PartySubID	Y	参与方子代码
		803	PartySubIDType	Y	参与方子代码类型
	子组件结束				
组件结束					
组件<OrderQtyData>				Y	
152	CashOrderQty			N	订单金额
38	OrderQty			Y	订单数量
组件结束					
44	Price			N	价格 OrdType 为 2 时填写
99	StopPx			N	止损价，预留
59	TimeInForce			N	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

1090	MaxPriceLevels	N	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数 缺省值为 0
110	MinQty	N	最低成交数量 缺省值为 0
544	CashMargin	N	融资融券信用标识 1=Cash，普通交易 2=Open，融资融券开仓 3=Close，融资融券平仓 缺省值为 1
77	PositionEffect	N	开平仓标识，衍生品交易填写 O=开仓 C=平仓 缺省值为 O
203	CoveredOrUncovered	N	备兑标签，衍生品交易填写 0=Covered，表示备兑仓 1=UnCovered，表示普通仓 缺省值为 1
664	ConfirmID	N	约定号 协议交易点击成交填写
8911	ExpirationDays	N	期限，单位为天数
8906	ExpirationType	N	期限类型 1=固定期限
1093	LotType	N	订单数量类型 1=零股订单，Odd Lot 2=整手订单，Round Lot 缺省值为 2
8908	ShareProperty	N	股份性质
198	SecondaryOrderID	N	第二交易所订单编号
10238	BidTransType	N	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
10239	BidExecInstType	N	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
1148	LowLimitPrice		N	价格下限
1149	HighLimitPrice		N	价格上限
75	TradeDate		N	交易日期
63	SettlType		N	结算方式，预留
10216	SettlPeriod		N	结算周期，预留
1091	PreTradeAnonymity		N	是否匿名 0=显名 1=匿名
10198	Memo		N	备注
组件<CounterInfos>			N	
10232	NoCounterInfos		N	其他相关市场参与人账户个数
→	组件<NestedParties>		Y	
	539	NoNestedPartyIDs	Y	参与人代码个数
	→	524 NestedPartyID	Y	参与人代码
		525 NestedPartyIDSource	Y	参与人代码源
		538 NestedPartyRole	Y	参与人代码角色
	组件结束			
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

1) 各业务申报新订单时的 Side 取值以及是否允许撤销

表 4-2 新订单申报类型关键要素取值

应用标识 ApplID	说明	Side（54）	是否允许撤销
010	现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易申报	1=买 2=卖	Y
020	债券通用质押式回购交易申报	1=买（融资） 2=卖（出资）	Y
030	债券分销申报	1=买（认购）	Y

		2=卖（分销）	
040	期权集中竞价交易申报	1=买 2=卖	Y
051	协议交易定价申报	1=买 2=卖	Y
052	协议交易点击成交申报	1=买 2=卖	N
060	以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	1=买 2=卖	Y
061	以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报	1=买 2=卖	Y
070	转融通证券出借非约定申报	G=借入 F=出借	Y
120	ETF 实时申购赎回申报	D=申购 E=赎回	N
130	网上发行认购申报（发行与增发）	固定填 1	Y
131	网上发行认购申报（基础设施基金非定向扩募-向原持有人配售）	固定填 1	Y
132	网上发行认购申报（基础设施基金非定向扩募-公开发售）	固定填 1	Y
140	配股认购申报	固定填 1	Y
150	债券转股申报	固定填 1	Y
151	债券回售/购回申报	固定填 1	Y
152	债券回售撤销申报	固定填 1	Y
160	期权行权申报	固定填 1	Y
170	开放式基金申购赎回申报	D=申购 E=赎回	Y
180	要约收购预受要约申报	固定填 1	Y
181	要约收购解除预受要约申报	固定填 1	Y
190	债券通用质押式回购质押申报	固定填 1	N
191	债券通用质押式回购解押申报	固定填 1	N
230	权证行权申报	固定填 1	Y
270	转处置扣券申报	固定填 1	Y
271	转处置还券申报	固定填 1	Y

280	垫券申报	固定填 1	Y
281	还券申报	固定填 1	Y
290	待清偿扣划客户申报	固定填 1	Y
291	待清偿扣划自营申报	固定填 1	Y
310	分级基金实时分拆申报	固定填 1	N
311	分级基金实时合并申报	固定填 1	N
630	港股通新订单申报	1=买 2=卖	Y
330	债券质押式三方回购入库申报	固定填 1	Y
331	债券质押式三方回购出库申报	固定填 1	Y
350	期权普通转备兑仓申报	固定填 1	N
351	期权备兑转普通仓申报	固定填 1	N
370	盘后定价交易申报	1=买 2=卖	Y
410	债券现券交易匹配成交申报	1=买 2=卖	Y
417	债券现券交易竞买成交申报	1=买 2=卖	Y
470	跨银行间实物债券 ETF 实时申购赎回申报	D=申购 E=赎回	N

2) 现货集中竞价交易、债券通用质押式回购交易、期权集中竞价交易三类业务申报的 OrdType 可取值 1/2/U，其他业务申报的 OrdType 固定填 2。

3) 除必填字段外，各业务需选填字段说明如下：

表 4-3 新订单申报所需填报字段说明

应用标识 ApplID	业务说明	可选字段填写说明
010	现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易申报	在 OrdType 为 2 时必须填写 Price； TimeInForce，MinQty，MaxPriceLevels 为可选字段，不填则取缺省值，不管是否填写，三个字段的取值组合必须在下面列举的“限价委托及五种市价委托申报方式”之内； CashMargin 为可选字段，不填则取缺省值
020	债券通用质押式回购交易申报	在 OrdType 为 2 时必须填写 Price；

		TimeInForce，MinQty，MaxPriceLevels 为可选字段，不填则取缺省值，不管是否填写，三个字段的取值组合必须在下面列举的“限价委托及五种市价委托申报方式”之内；
030	债券分销申报	必须填写 Price
040	期权集中竞价交易申报	在 OrdType 为 2 时必须填写 Price； TimeInForce，MinQty，MaxPriceLevels 为可选字段，不填则取缺省值，不管是否填写，三个字段的取值组合必须在下面列举的“限价委托及五种市价委托申报方式”之内； 必须填写 PositionEffect 和 CoveredOrUncovered； 若为组合策略单边平仓，必须填写 SecondaryOrderID，填组合流水号（构建组合时交易所返回的 OrderID）
051	协议交易定价申报	必须填写 Price
052	协议交易点击成交申报	必须填写 Price； 必须填写 ConfirmID
060	以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	必须填写 Price
061	以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报	必须填写 Price
070	转融通证券出借非约定申报	必须填写 Price，值为费率； 必须填写 ExpirationDays 和 ExpirationType; SharеProperty 为选填字段，出借股份为首发后可出借限售股时填写‘07’
120	ETF 实时申购赎回申报	只需填写必须字段 对于跨市场股票 ETF 的全实物申赎申报，必须填写 CounterInfos
130	网上发行认购申报（发行与增发）	必须填写 Price，值为认购价
131	网上发行认购申报（基础设施基金非定向扩募-向原持有人配售）	必须填写 Price，值为发售价格
132	网上发行认购申报（基础设施	必须填写 Price，值为发售价格

	基金非定向扩募-公开发售）	
140	配股认购申报	必须填写 Price，值为配股价
150	债券转股申报	SharePproperty 为选填字段，定向可转债使用限售部分转股时填写‘01’
151	债券回售/购回申报	只需填写必须字段
152	债券回售撤销申报	只需填写必须字段
160	期权行权申报	必须填写 Price，值为行权价
170	开放式基金申购赎回申报	申购时必须填写 CashOrderQty 值为申购金额，金额必须为 1 元的整数倍，OrderQty 填 0； 赎回时使用 OrderQty 填写赎回份额
180	要约收购预受要约申报	只需填写必须字段
181	要约收购解除预受要约申报	只需填写必须字段
190	债券通用质押式回购质押申报	只需填写必须字段
191	债券通用质押式回购解押申报	只需填写必须字段
230	权证行权申报	必须填写 Price，值为行权价
270	转处置扣券申报	只需填写必须字段
271	转处置还券申报	只需填写必须字段
280	垫券申报	只需填写必须字段
281	还券申报	只需填写必须字段
290	待清偿扣划客户申报	只需填写必须字段
291	待清偿扣划自营申报	只需填写必须字段
310	分级基金实时分拆申报	只需填写必须字段
311	分级基金实时合并申报	只需填写必须字段
630	港股通新订单申报	必须填写 price TimeInForce 为可选字段，为缺省值为 0。如果 LotType 为 2，TimeInForce 必须填写为 0（整手增强限价盘）或 9（竞价限价盘）；如果 LotType 为 1，TimeInForce 必须填写为 0（零股盘）； MaxPriceLevel 字段固定填写为 0
330	债券质押式三方回购入库申报	只需填写必须字段
331	债券质押式三方回购出库申报	只需填写必须字段
350	期权普通转备兑仓申报	只需填写必须字段
351	期权备兑转普通仓申报	只需填写必须字段

370	盘后定价交易申报	必须填写 Price
410	债券现券交易匹配成交申报	在 OrdType 为 2 时必须填写 Price
417	债券现券交易竞买成交申报	必须填写 BidTransType、BidExecInstType、SettlType、SettlPeriod 字段； 当 BidTransType 为 1 时，必须填写 LowLimitPrice、HighLimitPrice、MinQty 、TradeDate、PreTradeAnonymity； 当 BidTransType 为 2 时，必须填写 SecondaryOrderID、LowLimitPrice、HighLimitPrice、MinQty、PreTradeAnonymity； 当 BidTransType 为 3 时，必须填写 SecondaryOrderID、Price；
470	跨银行间实物债券 ETF 实时申购赎回申报	必须填写 SecondaryOrderID，填中央结算生成的唯一的业务标识号

4) 限价、市价委托申报方式：

表 4-4 新订单申报委托类型定义

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
普通限价	0	2	0	0
本方最优	0	U	0	0
对手方最优剩余转限价	0	1	1	0
市价立即成交剩余撤销	3	1	0	0
限价全额成交或撤销	3	2	0	=OrderQty
市价全额成交或撤销	3	1	0	=OrderQty
市价最优五档全额成交剩余撤销	3	1	5	0

各种委托申报方式适用的业务范围如下：

表 4-5 订单申报委托类型适用业务范围

委托类型	现货集中竞价交易	债券通用质押式回购交易	期权集中竞价交易

限价委托	Y	Y	Y
本方最优	Y	**N**	Y
对手方最优剩余转限价	Y	**N**	Y
市价立即成交剩余撤销	Y	**N**	Y
限价全额成交或撤销	**N**	**N**	**Y**
市价全额成交或撤销	Y	**N**	Y
市价最优五档全额成交剩余撤销	Y	**N**	Y

5) 参与人代码说明

- 如无特别说明申报新订单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

- 要约收购业务还需要申报收购人编码：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
收购人编码	D=自定义代码	4003=要约收购收购人编码

- 期权集中竞价交易业务、期权行权业务和期权普通与备兑仓互转业务还需要填写合约账户标识码：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
合约账户标识码	C=通用市场参与者标识	38=合约账户标识码

- 转处置券业务还需要填写用于划入待处置券的证券公司交易单元和证券账户：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
划入待处置券的交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元
划入待处置券的证券账户	5=中国投资者编号	39=对手方投资者证券账户

- 垫券还券业务还需要填写出借券的交易单元和证券账户：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
出借券交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元
出借券证券账户	5=中国投资者编号	39=对手方投资者证券账户

- 待清偿扣划业务不需要填写上面提到的证券账户和营业部代码，但是需要填写用于扣划证券的交易单元和证券账户：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
用于扣划证券的交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元
用于扣划证券的证券账户	5=中国投资者编号	39=对手方投资者证券账户

- 债券现券交易业务竞买成交还需要填本方交易商代码、本方交易主体类型、本方交易主体代码、本方客户名称、本方交易员代码：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
本方交易商代码	C=通用市场参与者标识	7=交易商代码
本方交易主体代码	D=自定义代码	4003=交易主体代码
本方交易员代码	D=自定义代码	12=交易员代码

对于以下 PartyID，还需填写 PartySubID：

业务	PartyID	PartySubID（523）	PartySubID Type（803）
债券现券交易竞买	交易主体代码（PartyIDSource= D，	本方交易主体类型	26=交易主体类型

成交（417）	PartyRole= 4003）	本方客户名称	5=客户名称

6) 现货集中竞价交易申报，如果 CashMargin 取值为“融资融券平仓（3）”，同时订单所有者类型为“会员发起（102）”，则表示该笔订单为会员强制平仓。

7) NestedParties 填写说明

跨市场股票 ETF 的全实物申购赎回需要填写：

NestedPartyID（524）	NestedPartyIDSource（525）	NestedPartyRole（538）
市场代码 XSHG=上海证券交易所	C=通用市场参与者标识	22=交易所
投资者沪市指定交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元
投资者沪市证券账户	5=中国投资者编号	39=对手方投资者证券账户

该字段仅适用于跨市场股票 ETF 的全实物申赎模式，交易参与人应依据该 ETF 的 pcf 文件中非深市成份券的“是否实物对价申赎”字段值，判断该 ETF 是否采用全实物申赎模式：如果 pcf 文件中有某只或某几只非深市成份券的“是否实物对价申赎”为 Y，则该 ETF 适用全实物申赎模式。目前，跨市场股票 ETF 支持全实物申赎模式，此时需填写投资者的沪市证券账户、沪市指定交易单元。对于其他类别的 ETF、或不使用全实物申赎模式的跨市场股票 ETF 的申赎，无需填写 NestedParties。

4.2.2 撤单请求（Order Cancel Request）

表 4-6 OMS 向 TGW 报送撤单请求消息定义

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

组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与方代码个数=1
→	448	PartyID	Y	申报交易单元
	447	PartyIDSource	Y	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	Y	1=当前 PartyID 为申报交易单元
组件结束				
组件<OrderQtyData>			Y	
38	OrderQty		Y	原始订单数量 交易所对该字段的值不作检查
组件结束				
41	OrigClOrdID		N	原始订单的客户订单编号
37	OrderID		N	原始订单交易所订单编号 对于撤销当日之前的竞买预约委托，OrigClOrdID 不填，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		N	Free Text

4.2.3 撤单失败响应（Cancel Reject）

表 4-7 TGW 向 OMS 传送撤单失败响应消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=9
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识
522	OwnerType	Y	订单所有者类型
37	OrderID	N	原始订单的交易所订单编号
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
60	TransactTime	Y	撤单失败响应时间
41	OrigClOrdID	N	原始订单的客户订单编号
39	OrdStatus	Y	原始订单当前状态 如果未找到原始订单，则填 8=Rejected
102	CxlRejReason	Y	拒绝原因代码

1328	RejectText		N	拒绝原因说明
组件<Instrument>			Y	
48	SecurityID		Y	证券代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	申报交易单元
	447	PartyIDSource	Y	取 C，表示通用市场参与者标识
	452	PartyRole	Y	取 1，表示当前 PartyID 为申报交易单元
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

1) 港股通撤单请求被联交所拒绝时，拒绝原因代码 CxlRejReason 为 29997 或 29995，具体联交所的拒绝原因代码填写在 RejectText 中。联交所的拒绝原因代码参见数据字典。

4.2.4 执行报告（Execution Report）

表 4-8 TGW 向 OMS 传送订单执行报告消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=8
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识
522	OwnerType	Y	订单所有者类型
529	OrderRestrictions	N	订单限定
17	ExecID	Y	执行编号
37	OrderID	Y	交易所订单编号
150	ExecType	Y	执行类型
39	OrdStatus	Y	订单状态
31	LastPx	N	成交价
32	LastQty	N	成交数量

151	LeavesQty			Y	剩余量
14	CumQty			Y	累计成交数量
103	OrdRejReason			N	撤单/拒绝原因代码，执行类型为 8 或 4 时填写
1328	RejectText			N	撤单/拒绝原因说明，执行类型为 8 或 4 时填写
54	Side			Y	买卖方向
60	TransactTime			Y	执行报告时间
11	ClOrdID			Y	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
41	OrigClOrdID			N	原始订单客户订单编号，撤单请求成功响应填写
组件<Instrument>				Y	
48	SecurityID			Y	证券代码
22	SecurityIDSource			Y	证券代码源
组件结束					
组件<Parties>				Y	
453	NoPartyIDs			Y	参与人代码个数
→	448	PartyID		Y	参与人代码
	447	PartyIDSource		Y	参与人代码源
	452	PartyRole		Y	参与人代码角色
	子组件<PtysSubGrp>			N	
	802	NoPartySubIDs		N	参与方子代码个数
	→	523	PartySubID	Y	参与方子代码
		803	PartySubIDType	Y	参与方子代码类型
	组件结束				
组件结束					
组件<OrderQtyData>				Y	
152	CashOrderQty			N	订单金额
38	OrderQty			Y	订单数量
组件结束					
44	Price			N	价格

99	StopPx		N	止损价
59	TimeInForce		N	有效时期类型
40	OrdType		Y	订单类型
1090	MaxPriceLevels		N	最多成交价位数
110	MinQty		N	最低成交数量
544	CashMargin		N	融资融券信用标识
77	PositionEffect		N	开平仓标识
203	CoveredOrUncovered		N	备兑标签
664	ConfirmID		N	约定号
8911	ExpirationDays		N	期限，单位为天数
8906	ExpirationType		N	期限类型
1093	LotType		N	订单数量类型
541	MaturityDate		N	到期日
组件<CompDeliverData> 用于回报 ETF 实时申购赎回的股份和资金交付明细			N	
8902	NoSecurity		Y	成份股记录数
→	309	UnderlyingSecurityID	Y	成份股证券代码
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	Y	证券代码源
→	8903	DeliveryQty	N	股份交付数量
→	8904	SubstCash	N	现金替代金额
组件结束				
10189	IMCRejectText		N	国际市场互联对方市场拒绝原因说明
8908	ShareProperty		N	股份性质
198	SecondaryOrderID		N	第二交易所订单编号
10238	BidTransType		N	竞买业务类别
10239	BidExecInstType		N	竞买成交方式
1148	LowLimitPrice		N	价格下限
1149	HighLimitPrice		N	价格上限
75	TradeDate		N	交易日期
10198	Memo		N	备注
1091	PreTradeAnonymity		N	是否匿名
63	SettlType		N	结算方式，预留

10216	SettlPeriod			N	结算周期，预留
组件<CounterInfos>				N	
10232	NoCounterInfos			N	其他相关市场参与人账户个数
→	组件<NestedParties>			Y	
	539	NoNestedPartyIDs		Y	参与人代码个数
	→	524	NestedPartyID	Y	参与人代码
		525	NestedPartyIDSource	Y	参与人代码源
		538	NestedPartyRole	Y	参与人代码角色
	组件结束				
组件结束					
58	Text			N	Free Text

注：

1) 股票 ETF、债券 ETF 申购时如果投资者持有成份股不足，RejectText 填写第一只不足额的成份股代码；赎回时如果基金管理人成份股不足，RejectText 填写第一只不足额的成份股代码；

2) 对于期权集中竞价交易业务的平仓（PositionEffect=C）执行报告，如果 OwnerType=101（交易所发起），则表示该笔执行报告是交易所发起的强平委托的回报，如果 OwnerType=106（结算机构发起），则表示该笔执行报告是结算机构发起的强平委托的回报。

3) 对于债券通用质押式回购交易达成的成交，在回购到期日，交易系统会主动下发一笔回购到期成交执行报告，其中应用标识 ApplID 为 029，回报时间 TransactTime 为当前时间，其他字段与初始交易成交执行报告一致。

4) 港股通新订单被联交所拒绝（ExecType 为 8）时，拒绝原因代码 OrdRejReason 为 29998 或 29997;港股通新订单被联交所自动撤销(ExecType 为 4)时,撤销原因代码 OrdRejReason 为 29996；具体的联交所的拒绝/自动撤销原因代码填写在 RejectText 中，拒绝/自动撤销原因说明填写在 IMCRejectText 中，最长 150 字节。联交所的拒绝原因代码参见数据字典。

5) 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，在竞买成交撮合成交后，交易系统会将所有已成交及未成交的竞买应价申报以执行报告的形式抄送给同一竞买场次编号的竞买发起方，其中应用标识 ApplID 为 418，回报时间 TransactTime 为当前时间。

6) 跨市场全实物可对于跨市场股票 ETF 的全实物申购赎回（ApplID=120），NoSecurity 重复组将包含深市、沪市成份券的申赎对价明细，其中沪市成份券的 UnderlyingSecurityIDSource=101。

4.3 业务消息-报价处理

4.3.1 报价（Quote）

表 4-9 OMS 向 TGW 报送报价消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=S
1180	ApplID	Y	应用标识
1166	QuoteMsgID	Y	客户报价消息编号
522	OwnerType	Y	报价所有者类型
60	TransactTime	N	报价发起时间
131	QuoteReqID	N	当报价是对询价请求的响应时，填写询价请求的 QuoteReqID
537	QuoteType	N	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448 PartyID	Y	参与人代码
	447 PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452 PartyRole	Y	参与人代码角色
	子组件<PtysSubGrp>	N	
	802 NoPartySubIDs	N	参与方子代码个数
	→ 523 PartySubID	Y	参与方子代码
	→ 803 PartySubIDType	Y	参与方子代码类型
	组件结束		
组件结束			
组件< CounterInfos>		N	
10232	NoCounterInfos	N	参与人代码个数
→	组件<NestedParties>	Y	

	539	NoNestedPartyIDs		Y	参与人代码个数
	→	524	NestedPartyID	Y	参与人代码
		525	NestedPartyIDSource	Y	参与人代码源
		538	NestedPartyRole	Y	参与人代码角色
		子组件< NstdPtysSubGrp >		N	
		804	NoNestedPartySubIDs	N	参与方子代码个数
		→	545 NestedPartySubID	Y	参与方子代码
			805 NestedPartySubIDType	Y	参与方子代码类型
		组件结束			
	组件结束				
组件结束					
132	BidPx			N	买报价 BidSize>0 时必须填写
133	OfferPx			N	卖报价 OfferSize>0 时必须填写
134	BidSize			N	买数量
135	OfferSize			N	卖数量
8909	BidPositionEffect			N	买开平仓标志，衍生品报价填写 O=开仓 C=平仓
8910	OfferPositionEffect			N	卖开平仓标志，衍生品报价填写 O=开仓 C=平仓
117	QuoteID			N	报价消息编号，主动撤单时填与被撤委托的 QuoteID 一致
693	QuoteRespID			N	报价回复消息编号
1171	PrivateQuote			N	私有报价 0=私有报价（Private Quote） 1=公开报价（Public Quote）
62	ValidUntilTime			N	报价有效时间，预留
423	PriceType			N	价格类型，预留

			1=百分比（Percentage） 2=每交易单位（Per unit）
544	CashMargin	N	融资融券信用标识，预留 1=Cash，普通交易 2=Open，融资融券开仓 3=Close，融资融券平仓 缺省值为 1
10198	Memo	N	备注
63	SettlType	N	结算方式
10216	SettlPeriod	N	结算周期
1091	PreTradeAnonymity	N	是否匿名 0=显名 1=匿名
111	MaxFloor	N	可显示数量
110	MinQty	N	最低成交数量
58	Text	N	Free Text

注：

1） 该消息应用于以下报价申报

应用标识 ApplID	说明
041	期权集中竞价交易报价申报
056	协议交易报价申报
412	债券现券交易点击成交报价申报
415	债券现券交易询价成交报价申报

2） 参与人代码说明(Parties)

报价申报必须包括以下两个参与人代码：

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

对于协议交易报价、债券现券交易点击成交报价、债券现券交易询价成交报价还需要填写：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
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

期权集中竞价交易报价还需要填写合约账户标识码：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
合约账户标识码	C=通用市场参与者标识	38=合约账户标识码

协议交易报价还需要填写对方交易单元：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
对手方交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元

债券现券交易点击成交报价、询价成交报价还需要填写：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
本方交易商代码	C=通用市场参与者标识	7=交易商代码
本方交易主体代码	D=自定义代码	4003=交易主体代码
本方交易员代码	D=自定义代码	12=交易员代码

对于以下 PartyID，还需填写 PartySubID：

业务	PartyID	PartySubID（523）	PartySubIDType（803）	备注
债券现券交易（412、415）	交易主体代码（PartyIDSource=D，PartyRole= 4003）	本方交易主体类型	26=交易主体类型	
		本方客户名称	5=客户名称	

3) 参与人代码说明(NestedParties)

债券现券交易点击成交报价、询价成交报价还需要填写：

NestedPartyID（524）	NestedPartyIDSource（525）	NestedPartyRole（538）
对手方交易商代码	C=通用市场参与者标识	20=对手方交易商代码
对手方交易主体代码	D=自定义代码	4004=对手方交易主体代码
对手方交易员代码	D=自定义代码	37=对手方交易员代码

对于以下 NestedPartyID，还需填写 NestedPartySubID：

业务	NestedPartyID	NestedPartySubID（545）	NestedPartySubIDType（805）	备注
债券现券交易（415）	对手方交易主体代码 (NestedPartyIDSource=D，NestedPartyRole=4004)	对手方交易主体类型	26=交易主体类型	

4) 报价消息支持以下报价方式（对于双边报价，不支持撤销单边报价）

报价方式	BidSize（134）	OfferSize（135）
双边报价	>0	>0
买报价	>0	=0
卖报价	=0	>0
撤销报价	=0	=0

5) 如果 BidSize>0，则必须填写 BidSize；如果 OfferSize>0，则必须填写 OfferPx；对于期权集中竞价交易报价，如果 BidSize>0，则必须填写 BidPositionEffect，如果 OfferSize>0，则必须填写 OfferPositionEffect。

4.3.2 报价状态回报（Quote Status Report）

表 4-10 TGW 向 OMS 报送报价状态回报消息定义

Tag	域名	必	字段描述

				须	
	MessageHeader			Y	MsgType=AI
10197	PartitionNo			Y	平台分区号
10179	ReportIndex			Y	回报记录号
1180	ApplID			Y	应用标识
1166	QuoteMsgID			Y	客户报价消息编号
522	OwnerType			Y	报价所有者类型
131	QuoteReqID			N	当报价是对询价请求的响应时，填写询价请求的 QuoteReqID
537	QuoteType			N	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
297	QuoteStatus			N	报价状态 0=Accepted，接受 4=Cancelled，已撤销 5=Rejected，拒绝 7=Expired，已超时
300	QuoteRejectReason			N	报价拒绝原因代码
10236	QuoteRejectText			N	报价拒绝原因说明
60	TransactTime			N	报价接收时间
组件<Instrument>				Y	
48	SecurityID			Y	证券代码
22	SecurityIDSource			Y	证券代码源
组件结束					
组件<Parties>				Y	
453	NoPartyIDs			Y	参与人代码个数
→	448	PartyID		Y	参与人代码
	447	PartyIDSource		Y	参与人代码源
	452	PartyRole		Y	参与人代码角色
	子组件<PtysSubGrp>			N	
	802	NoPartySubIDs		N	参与方子代码个数
	→	523	PartySubID	Y	参与方子代码
		803	PartySubIDType	Y	参与方子代码类型
	组件结束				

组件结束					
组件< CounterInfos>				N	
10232	NoCounterInfos			N	参与人代码个数
→	组件< NestedParties >			Y	
	539	NoNestedPartyIDs		Y	参与人代码个数
	→	524	NestedPartyID	Y	参与人代码
		525	NestedPartyIDSource	Y	参与人代码源
		538	NestedPartyRole	Y	参与人代码角色
		子组件< NstdPtysSubGrp >		N	
		804	NoNestedPartySubIDs	N	参与方子代码个数
		→	545 NestedPartySubID	Y	参与方子代码
			805 NestedPartySubIDType	Y	参与方子代码类型
		组件结束			
	组件结束				
组件结束					
132	BidPx			N	买报价
133	OfferPx			N	卖报价
134	BidSize			N	买数量
135	OfferSize			N	卖数量
8909	BidPositionEffect			N	买开平仓标志 O=开仓 C=平仓
8910	OfferPositionEffect			N	卖开平仓标志 O=开仓 C=平仓
37	OrderID			N	交易所订单编号
17	ExecID			N	执行编号
693	QuoteRespID			N	报价回复消息编号
54	Side			N	买卖方向
423	PriceType			N	价格类型，预留

62	ValidUntilTime		N	报价有效时间，预留
1171	PrivateQuote		N	私有报价
544	CashMargin		N	融资融券信用标识，预留
10198	Memo		N	备注
63	SettlType		N	结算方式
10216	SettlPeriod		N	结算周期
1091	PreTradeAnonymity		N	是否匿名
111	MaxFloor		N	可显示数量
110	MinQty		N	最低成交数量
组件<CompDeliverQuote>			N	
10199	NoQuote		Y	报价消息个数
→	117	QuoteID	Y	报价消息编号
→	10225	QuotePrice	Y	报价价格
→	10226	QuoteQty	Y	报价数量
组件结束				
58	Text		N	Free Text

4.3.3 报价回复（Quote Response）

表 4-11 OMS 向 TGW 报送报价回复消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AJ
1180	ApplID	Y	应用标识
693	QuoteRespID	Y	报价回复消息编号
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
522	OwnerType	Y	报价所有者类型
60	TransactTime	N	报价发起时间
537	QuoteType	N	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束			

组件<Parties>				Y	
453	NoPartyIDs			Y	参与人代码个数
→	448	PartyID		Y	参与人代码
	447	PartyIDSource		Y	参与人代码源
	452	PartyRole		Y	参与人代码角色
	子组件<PtysSubGrp>			N	
	802	NoPartySubIDs		N	参与方子代码个数
	→	523	PartySubID	Y	参与方子代码
		803	PartySubIDType	Y	参与方子代码类型
	组件结束				
组件结束					
694	QuoteRespType			N	报价回复类型 1=Hit/Lift，接受 2=Counter，重报 6=Pass，拒绝
54	Side			N	买卖方向
62	ValidUntilTime			N	报价有效时间，预留
544	CashMargin			N	融资融券信用标识，预留
423	PriceType			N	价格类型，预留
63	SettlType			N	结算方式
10216	SettlPeriod			N	结算周期
组件<CompDeliverQuote>				N	
10199	NoQuote			Y	报价消息个数
→	117	QuoteID		Y	报价消息编号
→	10225	QuotePrice		Y	报价价格
→	10226	QuoteQty		Y	报价数量
组件结束					
58	Text			N	Free Text

注：

1） 该消息用于以下业务的报价回复

应用标识	说明

ApplID	
057	协议交易报价回复申报
413	债券现券交易点击成交报价回复申报
416	债券现券交易询价成交报价回复申报

2) 参与人代码说明

报价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

债券现券交易点击成交报价、询价成交报价还需要填写：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
本方交易商代码	C=通用市场参与者标识	7=交易商代码
本方交易主体代码	D=自定义代码	4003=交易主体代码
本方交易员代码	D=自定义代码	12=交易员代码

对于以下 PartyID，还需填写 PartySubID：

业务	PartyID	PartySubID（523）	PartySubIDType（803）	备注
债券现券交易	交易主体代码（PartyIDSource=D，	本方交易主体类型	26=交易主体类型	

（413、416）	PartyRole= 4003）	本方客户名称	5=客户名称	

4.3.4 转发报价（Allege Quote）

表 4-12 TGW 向 OMS 转发报价消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=S
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
522	OwnerType	Y	报价所有者类型
131	QuoteReqID	N	当报价是对询价请求的响应时，填写询价请求的 QuoteReqID
117	QuoteID	Y	报价消息编号
537	QuoteType	N	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
60	TransactTime	N	报价接收时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448 PartyID	Y	参与人代码
	447 PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452 PartyRole	Y	参与人代码角色
	子组件<PtysSubGrp>	N	
	802 NoPartySubIDs	N	参与方子代码个数
	→ 523 PartySubID	Y	参与方子代码
	→ 803 PartySubIDType	Y	参与方子代码类型

	组件结束				
组件结束					
组件<CounterInfos>				N	
10232	NoCounterInfos			N	参与人代码个数
→	组件<NestedParties>			Y	
	539	NoNestedPartyIDs		Y	参与人代码个数
	→	524	NestedPartyID	Y	参与人代码
		525	NestedPartyIDSource	Y	参与人代码源
		538	NestedPartyRole	Y	参与人代码角色
		子组件< NstdPtysSubGrp >		N	
		804	NoNestedPartySubIDs	N	参与方子代码个数
		→	545 NestedPartySubID	Y	参与方子代码
			805 NestedPartySubIDType	Y	参与方子代码类型
		组件结束			
	组件结束				
组件结束					
132	BidPx			N	买报价
133	OfferPx			N	卖报价
134	BidSize			N	买数量
135	OfferSize			N	卖数量
37	OrderID			N	交易所订单编号
17	ExecID			Y	执行编号
693	QuoteRespID			N	报价回复消息编号
423	PriceType			N	价格类型，预留
62	ValidUntilTime			N	报价有效时间，预留
1171	PrivateQuote			N	私有报价
544	CashMargin			N	融资融券信用标识，预留
10198	Memo			N	备注
63	SettlType			N	结算方式

10216	SettlPeriod	N	结算周期
111	MaxFloor	N	可显示数量
110	MinQty	N	最低成交数量
58	Text	N	Free Text

注：

1） 该消息用于以下业务的转发报价

应用标识 ApplID	说明
056	协议交易转发报价
412	债券现券交易点击成交转发报价
415	债券现券交易询价成交转发报价

4.3.5 转发报价回复（Allege Quote Response）

表 4-13 TGW 向 OMS 转发报价回复消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AJ
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
117	QuoteID	Y	报价消息编号
522	OwnerType	Y	报价所有者类型
693	QuoteRespID	N	报价回复消息编号
11	ClOrdID	N	客户订单编号
537	QuoteType	N	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
60	TransactTime	N	报价接收时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	

453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
132	BidPx		N	买报价
133	OfferPx		N	卖报价
134	BidSize		N	买数量
135	OfferSize		N	卖数量
组件<OrderQtyData>			Y	
38	OrderQty		Y	订单数量
组件结束				
54	Side		Y	买卖方向
44	Price		N	价格
37	OrderID		N	交易所订单编号
17	ExecID		Y	执行编号
423	PriceType		N	价格类型，预留
62	ValidUntilTime		N	报价有效时间，预留
544	CashMargin		N	融资融券信用标识，预留
58	Text		N	Free Text

4.4 业务消息-询价申报处理

4.4.1 询价请求（Quote Request）

表 4-14 OMS 向 TGW 报送询价申报消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=R
1180	ApplID	Y	应用标识
131	QuoteReqID	Y	询价请求编号
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
537	QuoteType	N	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
522	OwnerType	Y	申报所有者类型

60	TransactTime			N	申报发起时间
组件<Instrument>				Y	
48	SecurityID			Y	证券代码
22	SecurityIDSource			Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束					
组件<RootParties>				Y	
1116	NoRootPartyIDs			Y	参与人代码个数
→	1117	RootPartyID		Y	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource		Y	参与人代码源
	1119	RootPartyRole		Y	参与人代码角色
	子组件< RootSubParties >			N	
	1120	NoRootPartySubIDs		N	参与方子代码个数
	→	1121	RootPartySubID	Y	参与方子代码
		1122	RootPartySubIDType	Y	参与方子代码类型
	组件结束				
组件结束					
组件<CounterInfos>				N	
10232	NoCounterInfos			N	参与人代码个数
→	组件<NestedParties>			Y	
	539	NoNestedPartyIDs		Y	参与人代码个数
	→	524	NestedPartyID	Y	参与人代码
		525	NestedPartyIDSource	Y	参与人代码源
		538	NestedPartyRole	Y	参与人代码角色
		子组件< NstdPtysSubGrp >		N	
		804	NoNestedPartySubIDs	N	参与方子代码个数
		→	545 NestedPartySubID	Y	参与方子代码
			805 NestedPartySubIDType	Y	参与方子代码类型
		组件结束			
	组件结束				
组件结束					

组件<OrderQtyData>			Y	
38	OrderQty		Y	订单数量
组件结束				
54	Side		Y	买卖方向
44	Price		N	价格
10200	QuoteRequestTransType		N	询价请求事务类型 0-New，新订单 1-Cancel，撤销
1171	PrivateQuote		N	私有报价
126	ExpireTime		N	询价请求失效时间，预留
692	QuotePriceType		N	报价价格类型，预留 1=百分比（Percent of par) 2=每股 （Per Share）
10198	Memo		N	备注
544	CashMargin		N	融资融券信用标识，预留
63	SettlType		N	结算方式
10216	SettlPeriod		N	结算周期
1091	PreTradeAnonymity		N	是否匿名
组件<CompDeliverCounterpartyPBU>			N	
10223	NoCounterpartyPBU		Y	对手方交易单元个数
→	10224	CounterpartyPBUID	Y	对手方交易单元
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

1) 该消息用于以下业务的询价请求

应用标识 ApplID	说明
055	协议交易询价请求
414	债券现券交易询价请求

2) 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

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）：

RootPartyID（1117）	RootPartyIDSource（1118）	RootPartyRole（1119）
结算机构代码	F=交割机构	4=结算机构代码

债券现券交易询价请求还需要填写：

RootPartyID（1117）	RootPartyIDSource（1118）	RootPartyRole（1119）
本方交易商代码	C=通用市场参与者标识	7=交易商代码
本方交易主体代码	D=自定义代码	4003=交易主体代码
本方交易员代码	D=自定义代码	12=交易员代码

对于以下 RootPartyID，还需填写 PtysSubGrp：

业务	RootPartyID	RootPartySubID（1121）	RootPartySubIDType（1122）	备注
债券现券交易（414）	交易主体代码（RootPartyIDSource=D，RootPartyRole=4003）	本方交易主体类型	26=交易主体类型	
		本方客户名称	5=客户名称	

3) NestedParties 填写说明

债券现券交易询价请求需要填写：

NestedPartyID（524）	NestedPartyIDSource（525）	NestedPartyRole（538）
对手方交易商代码	C=通用市场参与者标识	20=对手方交易商代码

对手方交易主体代码	D=自定义代码	4004=对手方交易主体代码
对手方交易员代码	D=自定义代码	37=对手方交易员代码

对于以下 NestedPartyID，还需填写 NestedPartySubID：

业务	NestedPartyID	NestedPartySubID（545）	NestedPartySubIDType（805）	备注
债券现券交易（414）	对手方交易主体代码 (NestedPartyIDSource=D，NestedPartyRole=4004)	对手方交易主体类型	26=交易主体类型	

4) 除必填字段外，各业务需选填字段说明如下：

应用标识 ApplID	可选字段填写说明
协议交易（050）	必须填写 CompDeliverCounterpartyPBU

4.4.2 询价申报响应（Quote Request Ack）

表 4-15 TGW 向 OMS 传送询价申报接受响应消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=R
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
131	QuoteReqID	Y	报价请求 ID
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
537	QuoteType	N	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
522	OwnerType	Y	申报所有者类型
60	TransactTime	N	申报发起时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码

22	SecurityIDSource			Y	证券代码源
组件结束					
组件<RootParties>				Y	
1116	NoRootPartyIDs			Y	参与人代码个数
→	1117	RootPartyID		Y	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource		Y	参与人代码源
	1119	RootPartyRole		Y	参与人代码角色
	子组件< RootSubParties >			N	
	1120	NoRootPartySubIDs		N	参与方子代码个数
	→	1121	RootPartySubID	Y	参与方子代码个数
		1122	RootPartySubIDType	Y	参与方子代码
	组件结束				
组件结束					
组件< CounterInfos>				N	
10232	NoCounterInfos			N	参与人代码个数
→	组件<NestedParties>			Y	
	539	NoNestedPartyIDs		Y	参与人代码个数
	→	524	NestedPartyID	Y	参与人代码
		525	NestedPartyIDSource	Y	参与人代码源
		538	NestedPartyRole	Y	参与人代码角色
		子组件< NstdPtysSubGrp >		N	
		804	NoNestedPartySubIDs	N	参与方子代码个数
		→	545 NestedPartySubID	Y	参与方子代码
			805 NestedPartySubIDType	Y	参与方子代码类型
		组件结束			
	组件结束				
组件结束					
组件<OrderQtyData>				Y	
38	OrderQty			Y	订单数量
组件结束					

54	Side	Y	买卖方向
44	Price	N	价格
37	OrderID	N	交易所订单编号
17	ExecID	Y	执行编号
10200	QuoteRequestTransType	N	询价请求事务类型 0-New，新订单 1-Cancel，撤销
303	QuoteRequestType	Y	询价请求类型 101=Submit，提交 102=Alleged，转发
10222	QuoteRequestStatus	Y	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
658	QuoteRequestRejectReason	Y	拒绝原因代码
10237	QuoteRequestRejectText	N	拒绝原因说明
1171	PrivateQuote	N	私有报价
126	ExpireTime	N	询价请求失效时间，预留
692	QuotePriceType	N	报价价格类型，预留 1=百分比（Percent of par) 2=每股 （Per Share）
10198	Memo	N	备注
544	CashMargin	N	融资融券信用标识，预留
63	SettlType	N	结算方式
10216	SettlPeriod	N	结算周期
1091	PreTradeAnonymity	N	是否匿名
组件<CompDeliverCounterpartyPBU>		Y	
10223	NoCounterpartyPBU	Y	对手方交易单元个数
→	10224 CounterpartyPBUID	Y	对手方交易单元
组件结束			
58	Text	N	Free Text

4.4.3 转发询价请求（Allege Quote Request）

表 4-16 TGW 向 OMS 传送转发询价请求消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=R
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
131	QuoteReqID	Y	报价请求 ID
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
537	QuoteType	N	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
522	OwnerType	Y	申报所有者类型
60	TransactTime	N	申报发起时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<RootParties>		Y	
1116	NoRootPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	1117 RootPartyID	Y	参与人代码
	1118 RootPartyIDSource	Y	参与人代码源
	1119 RootPartyRole	Y	参与人代码角色
	子组件< RootSubParties >	N	
	1120 NoRootPartySubIDs	N	参与方子代码个数
	1121 RootPartySubID	Y	参与方子代码个数
	→ 1122 RootPartySubIDType	Y	参与方子代码
	组件结束		
组件结束			
组件<CounterInfos>		N	
10232	NoCounterInfos	N	参与人代码个数
	组件<NestedParties>	Y	

	539	NoNestedPartyIDs			Y	参与人代码个数
	→	524	NestedPartyID		Y	参与人代码
		525	NestedPartyIDSource		Y	参与人代码源
		538	NestedPartyRole		Y	参与人代码角色
		子组件< NstdPtysSubGrp >			N	
		804	NoNestedPartySubIDs		N	参与方子代码个数
		→	545	NestedPartySubID	Y	参与方子代码
			805	NestedPartySubIDType	Y	参与方子代码类型
		组件结束				
	组件结束					
组件结束						
组件<OrderQtyData>					Y	
38	OrderQty				Y	订单数量
组件结束						
54	Side				Y	买卖方向
44	Price				N	价格
37	OrderID				N	交易所订单编号
17	ExecID				Y	执行编号
10200	QuoteRequestTransType				N	询价请求事务类型
303	QuoteRequestType				Y	询价请求类型
10222	QuoteRequestStatus				Y	询价请求状态
1171	PrivateQuote				N	私有报价
126	ExpireTime				N	询价请求失效时间，预留
692	QuotePriceType				N	报价价格类型，预留
10198	Memo				N	备注
544	CashMargin				N	融资融券信用标识，预留
63	SettlType				N	结算方式
10216	SettlPeriod				N	结算周期
58	Text				N	Free Text

注：

1） 该消息用于以下业务的转发询价请求

应用标识 ApplID	说明
055	协议交易转发询价请求
414	债券现券交易转发询价请求

4.5 业务消息-意向申报处理

4.5.1 意向申报（Indication of Interest）

表 4-17 OMS 向 TGW 报送意向申报消息定义

Tag	域名		必须	字段描述
	MessageHeader		Y	MsgType=6
1180	ApplID		Y	应用标识 050=协议交易意向申报
23	IOIID		Y	客户意向申报编号 同一交易单元一个交易日内申报的所有意向申报 IOIID 不能重复
28	IOITransType		Y	意向申报类型 N=意向申报 C=意向申报撤单
26	IOIRefID		N	原意向申报 IOIID，对于意向申报该字段取值为空，若为撤单则为被撤原意向申报 IOIID
54	Side		Y	买卖方向 1=买 2=卖
522	OwnerType		Y	意向申报所有者类型
60	TransactTime		N	意向申报发起时间
组件<Instrument>			Y	
48	SecurityID		Y	证券代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源

	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
27	IOIQty		N	数量
44	Price		N	价格
10184	Contactor		N	联系人
10185	ContactInfo		N	联系方式
58	Text		N	Free Text

注：

1) 参与人代码说明

意向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

2) 除必填字段外，各业务需选填字段说明如下：

应用标识 ApplID	可选字段填写说明
协议交易意向申报（050）	必须填写 IOIQty，Price

4.5.2 意向申报响应（Quote Response）

表 4-18 TGW 向 OMS 传送意向申报响应消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AJ
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
693	QuoteRespID	Y	交易所意向申报响应编号
694	QuoteRespType	Y	响应类型 2=意向申报响应
150	ExecType	Y	执行类型 0=New，意向申报成功 4=Canceled，意向申报撤单成功

			8=Reject，意向申报拒绝
300	QuoteRejectReason	N	拒绝原因代码，响应类型为 8 时填写
1328	RejectText	N	拒绝原因说明，响应类型为 8 时填写
23	IOIID	Y	客户意向申报编号
28	IOITransType	Y	意向申报类型
26	IOIRefID	N	原意向申报 IOIID，对于意向申报该字段取值为空，若为撤单则为被撤原意向申报 IOIID
54	Side	Y	买卖方向
522	OwnerType	Y	意向申报所有者类型
60	TransactTime	N	意向申报接收时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448 PartyID	Y	参与人代码
	447 PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452 PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束			
27	IOIQty	Y	订单数量
44	Price	N	价格
10184	Contactor	N	联系人
10185	ContactInfo	N	联系方式
58	Text	N	

4.6 业务消息-成交申报处理

4.6.1 成交申报（Trade Capture Report）

表 4-19 OMS 向 TGW 报送成交申报消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AE
1180	ApplID	Y	应用标识

571	TradeReportID	Y	客户成交申报编号，同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的客户成交申报编号不得重复
522	OwnerType	Y	成交申报所有者类型
828	TrdType	N	成交申报业务类别 1001=股票质押式回购初始交易 1002=股票质押式回购提前购回 1003=股票质押式回购到期购回 1004=股票质押式回购延期购回 1005=股票质押式回购终止购回 1006=股票质押式回购补充质押 1007=股票质押式回购部分解除质押 1008=股票质押式回购违约处置 1009=股票质押式回购部分购回 1010=股票质押式回购违约处置撤销 1011=约定购回初始交易 1012=约定购回提前购回 1013=约定购回到期购回 1014=约定购回延期购回 1021=质押式报价回购初始交易 1022=质押式报价回购提前购回 1031=债券质押式协议回购初始交易 1032=债券质押式协议回购到期购回 1033=债券质押式协议回购到期续做 1034=债券质押式协议回购提前购回 1035=债券质押式协议回购解除质押 1036=债券质押式协议回购质押券变更 1041=债券质押式三方回购初始交易 1042=债券质押式三方回购到期购回 1043=债券质押式三方回购到期续做 1044=债券质押式三方回购提前购回 1045=债券质押式三方回购补券 1046=债券质押式三方回购换券 1047=债券质押式三方回购解除质押

			1061=债券借贷初始交易 1062=债券借贷到期结算 1063=债券借贷到期续做 1064=债券借贷提前终止 1065=债券借贷解除质押 1066=债券借贷质押券变更
829	TrdSubType	N	成交申报子业务类别 对于协议交易业务取值如下,不填缺省为 0: 0=非受限股份转让 1=受限股份转让 对于债券质押式协议回购业务的到期续做委托取值如下: 10=不变更续做对手方 11=变更续做对手方 其他业务固定填 0
856	TradeReportType	Y	成交申报类型 0=Submit，提交成交申报 2=Accept，接受成交申报 3=Decline，拒绝成交申报
487	TradeReportTransType	Y	成交申报事务类别 0=New，新申报 1=Cancel，撤销申报 2=Replace，响应
1123	TradeHandlingInstr	N	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 5=Two Party Report for Claim，双边确认成交报告
572	TradeReportRefID	N	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用
60	TransactTime	N	成交申报发起时间
组件<Instrument>		Y	

48	SecurityID				Y	证券代码
22	SecurityIDSource				Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束						
组件<RootParties>					Y	
1116	NoRootPartyIDs				Y	参与人代码个数
→	1117	RootPartyID			Y	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource			Y	参与人代码源
	1119	RootPartyRole			Y	参与人代码角色
	子组件< RootSubParties>				N	
	1120	NoRootPartySubIDs			Y	参与子方代码个数
	→	1121	RootPartySubID		Y	参与方子代码
		1122	RootPartySubIDType		Y	参与方子代码类型
	子组件结束					
组件结束						
组件<TrdCapRptSideGrp>					Y	
552	NoSides				Y	side 个数
→	54	Side			Y	买卖方向
	1009	SideLastQty			N	参与方成交数量
	1597	SideClearingTradePrice			N	参与方成交价格
	10246	SideMemo			N	参与方备注
	10247	SideConfirmID			N	参与方约定号
	组件<Parties>				Y	
	453	NoPartyIDs			Y	参与人代码个数
	→	448	PartyID		Y	参与人代码
		447	PartyIDSource		Y	参与人代码源
		452	PartyRole		Y	参与人代码角色
		子组件< PtysSubGrp>			N	
		802	NoPartySubIDs		Y	参与方子代码个数
		→	523	PartySubID	Y	参与方子代码
			803	PartySubIDType	Y	参与方子代码类型

		子组件结束	
	组件结束		
组件结束			
31	LastPx	Y	成交价格
32	LastQty	Y	成交数量
152	CashOrderQty	N	金额
664	ConfirmID	N	约定号
8911	ExpirationDays	N	期限，单位为天数
8906	ExpirationType	N	期限类型，转融通证券出借填写 1=固定期限
8908	ShareProperty	N	股份性质
541	MaturityDate	N	到期日
8907	ExpirationExecInst	N	到期续做方式，质押式报价回购填写 1=到期自动续做 2=到期手动续做
423	PriceType	N	价格类型 1=Percentage，表示收益率 3=Fixed amount，表示绝对价格，对于资产管理计划份额转让业务指按“人民币现金”报价
10183	PledgeeType	N	质权人类型
1126	OrigTradeID	N	初始交易交易所成交申报编号
10182	OrigTradeReportID	N	初始交易客户成交申报编号
1125	OrigTradeDate	N	初始交易成交申报申报日期或原成交申报日期
544	CashMargin	N	融资融券信用标识 1=Cash，普通交易 2=Open，融资融券开仓 3=Close，融资融券平仓 缺省值为 1
880	TrdMatchID	N	交易编号，跨交易日唯一
10190	InvestmentType	N	资金用途类型 01=生产经营

				02=补充流动资金 03=股权类投资 04=债权类投资 05=不动产投资 06=偿还债务 07=个人消费 99=其他
10191	AlertRatio		N	预警线，单位为百分比
10192	SettlementRatio		N	平仓线，单位为百分比
10198	Memo		N	备注
63	SettlType		N	结算方式
10216	SettlPeriod		N	结算周期
669	LastParPx		N	成交价格二
737	AllocSettlCurrAmt		N	现金结算场内支付金额
8904	SubstCash		N	现金结算金额
159	AccruedInterestAmt		N	借贷费用金额
119	SettlCurrAmt		N	借贷费用场内支付金额
10244	GracePeriod		N	申报宽限期、违约宽限期 缺省值为 0
10245	SupplementaryAgreement		N	补充约定
527	SecondaryExecID		N	第二执行编号
10248	MemoEx		N	扩展备注 缺省值为空
10249	DisposalFlag		N	处置标识 缺省值为 0
组件<CompDeliverBasket>			N	
10193	NoBaskets		Y	质押篮子个数
→	10194	BasketID	Y	篮子编号
组件结束				
组件<CompDeliverSecurity>			N	
8902	NoSecurity		Y	质押券个数
→	309	UnderlyingSecurityID	Y	证券代码

→	305	UnderlyingSecurityIDSource	Y	证券代码源
→	8903	DeliveryQty	Y	数量
→	10195	DeliverySide	Y	方向
→	10206	UnderlyingShareProperty	N	股份性质
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	N	券面总额
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

1) 各业务成交申报模式为

应用标识 ApplID	说明	成交申报模式 TradeHandlingInstr
053	协议交易双方协议成交申报	协议配对
071	转融通证券出借约定申报	协议配对
080	资产管理计划份额转让	成交报告
090	股票质押式回购	成交报告
100	约定购回	成交报告
110	质押式报价回购	成交报告
300	债券质押式协议回购（初始交易、到期续做、提前购回、解除质押、质押券变更）	成交请求
300	债券质押式协议回购（到期购回）	成交报告
320	债券质押式三方回购交易（到期购回、补券）	成交报告
320	债券质押式三方回购交易（初始交易、到期续做、提前购回、换券、解除质押）	成交请求
411	债券现券交易协商成交申报	成交请求
419	债券现券交易交易解除	成交请求
41A	债券现券交易协商成交合并申报	双边确认成交报告
420	债券借贷	成交请求
430	债券转让业务回售转售	成交请求

2) RootParties 填写说明

a) 必须填写以下参与人代码：

RootPartyID（1117）	RootPartyIDSource（1118）	RootPartyRole（1119）
交易单元（PBU）	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元

b) 对于以下成交申报业务类别，还必须填写初始交易申报交易单元

- 1002=股票质押式回购提前购回
- 1003=股票质押式回购到期购回
- 1004=股票质押式回购延期购回
- 1005=股票质押式回购终止购回
- 1006=股票质押式回购补充质押
- 1007=股票质押式回购部分解除质押
- 1008=股票质押式回购违约处置
- 1009=股票质押式回购部分购回
- 1010=股票质押式回购违约处置撤销
- 1012=约定购回提前购回
- 1013=约定购回到期购回
- 1014=约定购回延期购回
- 1022=质押式报价回购提前购回

RootPartyID（1117）	RootPartyIDSource（1118）	RootPartyRole（1119）
交易单元（PBU）	C=通用市场参与者标识	13=初始交易申报交易单元

c) 对于以下业务类别，必须填写结算机构代码；其他业务可选填，不填则缺省为 01（中国证券登记结算公司深圳分公司）：

- 资产管理计划份额转让（080）
- 股票质押式回购（090）
- 质押式报价回购（110）

RootPartyID（1117）	RootPartyIDSource（1118）	RootPartyRole（1119）
结算机构代码	F=交割机构	4=结算机构代码

d) 对于以下业务类别，必须填写发起方证券账户、发起方营业部识别码、发起方交易商

代码、发起方交易主体代码、发起方交易员代码：

- 债券现券合并申报（41A）的发起方委托

RootPartyID（1117）	RootPartyIDSource（1118）	RootPartyRole（1119）
发起方证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
发起方营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
发起方交易商代码	C=通用市场参与者标识	6=申报方交易商代码
发起方交易主体代码	D=自定义代码	4005=申报方交易主体代码
发起方交易员代码	D=自定义代码	36=申报方交易员代码

e) 对于以下 RootPartyID，还需填写 RootPartySubID：

业务	RootPartyID	RootPartySubID（1121）	RootPartySubID Type（1122）	备注
债券现券交易（41A 的发起方委托）	发起方交易主体代码（RootPartyIDSource = D，RootPartyRole= 4005）	发起方交易主体类型	26=交易主体类型	
		发起方客户名称	5=客户名称	仅发起方交易主体类型为机构经纪（03）时填写

3) TrdCapRptSideGrp 填写说明

业务	NoSides（552）	Side（54）	PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
协议交易双方协议成交申报（053）	1	申报方 Side 1=买 2=卖	申报方交易单元	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			对手方交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元
转融通证券出借约定申报（071）	1	申报方 Side G=借入	申报方交易单元	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元

		F=出借	证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			对手方交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元
资产管理计划份额转让（080）	2	1=转入方	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			交易账户	D=自定义代码	12=交易员
		2=转出方	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			交易账户	D=自定义代码	12=交易员
股票质押式回购（090）	2	2=（资金）融入方	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
		1=（资金）融出方	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
约定购回（100）	2	2=客户方（券融出）	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
		1=证券公司方	证券公司专用账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
质押式报价回购（110）	2	1=客户方（资金融出）	交易单元	C=通用市场参与者标识	1=交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
		2=证券公司方	证券公司自营账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户

债券质押式协议回购（300）	1	申报方Side 1=买（资金融出） 2=卖（资金融入）	申报方交易单元	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			本方交易商代码	C=通用市场参与者标识	7=交易商代码
			本方交易主体代码	D=自定义代码	4003=交易主体代码
			本方交易员代码	D=自定义代码	12=交易员代码
			对手方交易商代码	C=通用市场参与者标识	20=对手方交易商代码
			对手方交易主体代码	D=自定义代码	4004=对手方交易主体代码
			对手方交易员代码	D=自定义代码	37=对手方交易员代码
债券质押式三方回购交易（320）	1	申报方Side 1=逆回购 2=正回购	申报方交易单元	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			对手方交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元
债券现券交易协商成交非合并申报（411）； 债券现券交易解除（419）； 债券现券协商成交合并申报的响应方申报（41A）	1	申报方Side 1=买 2=卖	申报方交易单元	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			~~申报方交易商代码~~	~~C=通用市场参与者标识~~	~~6=申报方交易商代码~~
			~~申报方交易主体代码~~	~~D=自定义代码~~	~~4005=申报方交易主体代码~~
			~~申报方交易员代码~~	~~D=自定义代码~~	~~36=申报方交易员代码~~
			本方交易商代码	C=通用市场参与者标识	7=交易商代码
			本方交易主体代	D=自定义代码	4003=交易主体代

			码		码
			本方交易员代码	D=自定义代码	12=交易员代码
			对手方交易商代码	C=通用市场参与者标识	20=对手方交易商代码
			对手方交易主体代码	D=自定义代码	4004=对手方交易主体代码
			对手方交易员代码	D=自定义代码	37=对手方交易员代码
债券现券交易协商成交合并申报的发起方申报（41A）	2	1=买方	买方交易商代码	C=通用市场参与者标识	20=对手方交易商代码
			买方交易主体代码	D=自定义代码	4004=对手方交易主体代码
			买方交易员代码	D=自定义代码	37=对手方交易员代码
		2=卖方	卖方交易商代码	C=通用市场参与者标识	20=对手方交易商代码
			卖方交易主体代码	D=自定义代码	4004=对手方交易主体代码
			卖方交易员代码	D=自定义代码	37=对手方交易员代码
债券借贷（420）	1	申报方Side 1=借出方 2=借入方	申报方交易单元	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			本方交易商代码	C=通用市场参与者标识	7=交易商代码
			本方交易主体代码	D=自定义代码	4003=交易主体代码
			本方交易员代码	D=自定义代码	12=交易员代码
			对手方交易商代码	C=通用市场参与者标识	20=对手方交易商代码
			对手方交易主体代码	D=自定义代码	4004=对手方交易主体代码
			对手方交易员代	D=自定义代码	37=对手方交易员

			码		代码
债券转让业务回售转售（430）	1	申报方 Side 1=买（受让方） 2=卖（发行方）	申报方交易单元	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
			证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
			营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
			对手方交易单元	C=通用市场参与者标识	17=对手方交易单元

对于以下 PartyID，还需填写 PartySubID：

业务	PartyID	PartySubID（523）	PartySubID Type（803）	备注
债券质押式协议回购（300）、债券现券交易（协商成交非合并申报（411）、交易解除（419）、协商成交合并申报响应方申报(41A))、债券借贷（420）	交易主体代码（PartyIDSource= D，PartyRole= 4003）	本方交易主体类型	26= 交易主体类型	
		本方客户名称	5=客户名称	仅本方交易主体类型为机构经纪（03）的以下成交申报需要填写： • 协议回购、债券借贷初始交易的发起方成交请求及响应方接受确认 • 协议回购到期续做且更换对手方的正回购方请求及新的逆回购方接受确认 • 债券现券协商成交，成交请求模式的发起方成交请求及响应方接受确认 • 债券现券协商成交，双边确认成交报告模式的响应方接受确认
	对手方交易主体代码(PartyIDSource= D，PartyRole= 4004)	对手方交易主体类型	26= 交易主体类型	

	~~申报方交易主体代码（PartyIDSource= D, PartyRole= 4005）~~	~~申报方客户名称~~	~~5=客户名称~~	~~仅适用于债券现券交易协商成交合并申报~~
		~~申报方交易主体类型~~	~~26= 交易主体类型~~	

4) 除必填字段外，各业务需选填字段说明如下：

应用标识 ApplID	可选字段填写说明
协议交易双方协议成交申报（053）	必须填写 ConfirmID
转融通证券出借约定申报（071）	必须填写 ConfirmID，ExpirationDays，ExpirationType； ShareProperty 为选填字段，出借股份为首发后可出借限售股时填写‘07’
资产管理计划份额转让（080）	必须填写 PriceType
股票质押式回购（090）	必须填写 TrdType； CashOrderQty 为选填字段，成交申报类别为初始交易时填写初始交易金额；成交申报类别为提前购回、到期购回、延期购回、部分购回时填写购回交易金额；成交申报类别为部分解除质押时填写解除红利金额；其他成交申报类别不填； 成交类别为违约处置、违约处置撤销时不填写 ShareProperty；其他成交申报类别必须填写； 成交类别为初始交易、提前购回、到期购回、延期购回、部分购回、终止购回时必须填写 MaturityDate； 成交申报类别不为初始交易时，必须填写 OrigTradeReportID，OrigTradeDate； 成交申报类别为初始交易时，必须填写 PledgeeType、InvestmentType、AlertRatio、SettlementRatio； 成交申报类别为初始交易时，LastPx 表示年化利率，单位为百分比，有两位小数，取值范围为

	[-99.99,99.99]
约定购回（100）	LastQty 表示为标的证券数量； 必须填写 CashOrderQty，值为交易金额； 必须填写 MaturityDate； 必须填写 TrdType ； 成交申报类不为初始交易时，必须填写 OrigTradeReportID，OrigTradeDate
质押式报价回购（110）	必须填写 PriceType，ExpirationExecInst，ExpirationDays，MaturityDate； 必须填写 TrdType ； 成交申报类不为初始交易时，必须填写 OrigTradeReportID，OrigTradeDate
债券质押式协议回购（300）	成交申报类别为初始交易、到期续做、提前购回时，LastPx 表示年化利率，单位为百分比，有两位小数，取值范围为[-99.9900,99.9900]； CashOrderQty 为选填字段，成交申报类别为初始交易时填写初始交易金额，成交申报类别为到期续做时填写续做金额，成交申报类别为解除质押时填写解除质押结算金额，成交申报类别为质押券变更时填写为换出金额； TrdMatchID 为选填字段，成交申报类别不为初始交易时必须填写； ExpirationDays 为选填字段，成交申报类别为初始交易、到期续做时必须填写； NoSecurity 为选填字段，成交申报类别为初始交易、质押券变更（仅换出金额除外）时必须填写； GracePeriod 为选填字段，成交申报类别为初始交易、到期续做时必须填写，其他情况无意义； MemoEx 为选填字段，由正回购方成交请求发起委托时填写，最长 900 个 UTF-8 字符； ConfirmID 为选填字段，当发起方委托的对手方交易主体类型或响应方委托的本方交易主体类型为机构经纪为机构或个人经纪时必须填写； DisposalFlag 为选填字段，初始交易、到期续做

	时必须填写，代表含义为“是否同意在违约情形下由质权方对该违约交易项下的质押券直接以拍卖、变卖等方式进行处置”，其他情况无意义
债券质押式三方回购交易（320）	必须填写 TrdType，TradeHandlingInstr，ConfirmID; 成交申报类别为初始交易、到期续做时，LastPx 表示年化利率，单位为百分比，有两位小数，取值范围为[-99.9900,99.9900]； CashOrderQty 为选填字段，成交申报类别为初始交易时填写初始交易金额，成交申报类别为到期续做时填写续做金额，成交申报类别为提前购回时填提前购回金额，成交申报类别为解除质押时填写解除质押结算金额，成交申报类别为换券时填写为换出金额； TrdMatchID 为选填字段，成交申报类别不为初始交易时必须填写； ExpirationDays 为选填字段，成交申报类别为初始交易、到期续做时必须填写； NoBaskets 为选填字段，成交申报类别为初始交易时必须填写； NoSecurity 为选填字段，成交申报类别为初始交易、补券、换券（仅换出金额除外）时必须填写
债券现券交易（411）	无。
债券现券交易解除（419）	必须填写 OrigTradeDate，表示待解除成交的原成交申报日期； 必须填写 SecondaryExecID，表示待解除成交的执行编号。
债券现券交易协商成交合并申报（41A）发起方委托	必须填写 SideLastQty，表示合并申报发起方与对应参与方的成交数量； 必须填写 SideClearingTradePrice，表示合并申报发起方与对应参与方的成交价格； 选填 SideConfirmID，当对应参与方的交易主体类型为机构经纪或个人经纪且非发起方主动撤单时必须填写；

	选填 SideMemo，表示合并申报发起方与对应参与方的备注；
债券现券交易协商成交合并申报（41A）响应方委托	选填 ConfirmID，当响应方的交易主体类型为机构经纪或个人经纪时必须填写。
债券借贷（420）	成交申报类别为初始交易、到期续做时，LastPx 表示年化利率，单位为百分比，有两位小数，取值范围为[-99.9900,99.9900]； TrdMatchID 为选填字段，成交申报类别不为初始交易时必须填写； ExpirationDays 为选填字段，成交申报类别为初始交易、到期续做时必须填写； SubstCash 为选填字段，成交申报类别到期结算、提前终止时填写为现金结算金额； AllocSettlCurrAmt 为选填字段，成交申报类别为到期结算、提前终止时填写为现金结算场内支付金额，成交申报类别为提前终止时填写为解除质押结算金额，成交申报类别为质押券变更时填写为换出金额（仅变更质押券除外） CashOrderQty 为选填字段，成交申报类别为初始交易、到期续做、到期结算、提前终止时，填写为标的证券券面总额； AccruedInterestAmt 为选填字段，成交申报类别为提前购回时，填写提前购回的借贷费用； SettlCurrAmt 为选填字段，成交申报类别为到期结算、到期续做、提前终止时，填写对应的借贷费用场内支付金额； NoSecurity 为选填字段，成交申报类别为初始交易、质押券变更（仅换出金额除外）、到期续做（且同时变更质押券）时必须填写，重复组中，UnderlyingCashOrderQty 必须填写； ConfirmID 为选填字段，当发起方委托的对手方交易主体类型或响应方委托的本方交易主体类型为机构经纪为机构时必须填写
债券转让业务回售转售（430）	必须填写 ConfirmID；

4.6.2 成交申报响应（Trade Capture Report Ack）

表 4-20 TGW 向 OMS 传送成交申报响应消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AR
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
1003	TradeID	Y	交易所为成交申报分配的唯一 ID
571	TradeReportID	Y	客户成交申报编号，同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的客户成交申报编号不得重复
522	OwnerType	Y	成交申报所有者类型
828	TrdType	N	成交申报业务类别
829	TrdSubType	N	成交申报子业务类别 对于债券现券业务的通交易所成交申报响应取值如下： 20=债券互联互通通交易所委托
856	TradeReportType	Y	成交申报类型
487	TradeReportTransType	Y	成交申报事务类别
1123	TradeHandlingInstr	N	成交申报模式
572	TradeReportRefID	N	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用
8912	TrdAckStatus	Y	成交申报响应状态 0=Accepted，接受 1=Rejected，拒绝
939	TrdRptStatus	N	成交申报状态 0=Accepted，接受 1=Rejected，拒绝 2=Cancelled，已撤销 100=Unmatched，尚未匹配 101=Matched，已匹配

751	TradeReportRejectReason			N	成交申报被拒绝原因代码
1328	RejectText			N	成交申报被拒绝原因说明
60	TransactTime			N	成交申报接收时间
组件<Instrument>				Y	
48	SecurityID			Y	证券代码
22	SecurityIDSource			Y	证券代码源
组件结束					
组件<RootParties>				Y	
1116	NoRootPartyIDs			Y	参与人代码个数
→	1117	RootPartyID		Y	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource		Y	参与人代码源
	1119	RootPartyRole		Y	参与人代码角色
	子组件< RootSubParties>			N	
	1120	NoRootPartySubIDs		Y	参与子方代码个数
	→	1121	RootPartySubID	Y	参与方子代码
		1122	RootPartySubID Type	Y	参与方子代码类型
	子组件结束				
组件结束					
组件<TrdCapRptSideGrp>				Y	
552	NoSides			Y	side 个数
→	54	Side		Y	买卖方向
	1009	SideLastQty		N	参与方成交数量
	1597	SideClearingTradePrice		N	参与方成交价格
	10246	SideMemo		N	参与方备注
	10247	SideConfirmID		N	参与方约定号
	组件<Parties>			Y	
	453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
	→	448	PartyID	Y	参与人代码
		447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
		452	PartyRole	Y	参与人代码角色
		子组件< PtysSubGrp>		N	
		802	NoPartySubIDs	Y	参与方子代码个数

		→	523	PartySubID	Y	参与方子代码
			803	PartySubIDType	Y	参与方子代码类型
		子组件结束				
	组件结束					
组件结束						
17	ExecID				Y	执行编号
31	LastPx				Y	成交价格
32	LastQty				Y	成交数量
152	CashOrderQty				N	金额
664	ConfirmID				N	约定号
8911	ExpirationDays				N	期限，单位为天数
8906	ExpirationType				N	期限类型，转融通证券出借填写
8908	ShareProperty				N	股份性质
541	MaturityDate				N	到期日
8907	ExpirationExecInst				N	到期续做方式，质押式报价回购填写
423	PriceType				N	价格类型
10183	PledgeeType				N	质权人类型
1126	OrigTradeID				N	初始交易交易所成交申报编号
10182	OrigTradeReportID				N	初始交易客户成交申报编号
1125	OrigTradeDate				N	初始交易成交申报申报日期或原成交申报日期
544	CashMargin				N	融资融券信用标识
880	TrdMatchID				N	交易编号，跨交易日唯一
10190	InvestmentType				N	资金用途类型
10191	AlertRatio				N	预警线，单位为百分比
10192	SettlementRatio				N	平仓线，单位为百分比
10198	Memo				N	备注
63	SettlType				N	结算方式
10216	SettlPeriod				N	结算周期
669	LastParPx				N	成交价格二
737	AllocSettlCurrAmt				N	现金结算场内支付金额
8904	SubstCash				N	现金结算金额
159	AccruedInterestAmt				N	借贷费用金额

119	SettlCurrAmt		N	借贷费用场内支付金额
10244	GracePeriod		N	申报宽限期、违约宽限期
10245	SupplementaryAgreement		N	补充约定
10240	TradeReportRejectText		N	成交申报拒绝原因说明
527	SecondaryExecID		N	第二执行编号
10248	MemoEx		N	扩展备注
10249	DisposalFlag		N	处置标识
组件<CompDeliverBasket>			N	
10193	NoBaskets		Y	质押篮子个数
→	10194	BasketID	Y	篮子编号
组件结束				
组件<CompDeliverSecurity>			N	
8902	NoSecurity		Y	质押券个数
→	309	UnderlyingSecurityID	Y	证券代码
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	Y	证券代码源
→	8903	DeliveryQty	Y	数量
→	10195	DeliverySide	Y	方向
→	10206	UnderlyingShareProperty	N	股份性质
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	N	券面总额
组件结束				
58	Text		N	Free Text

4.6.3 转发成交申报（Trade Capture Report ）

表 4-21 TGW 向 OMS 传送转发成交申报消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AE
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
1003	TradeID	N	交易所成交申报编号
571	TradeReportID	Y	客户成交申报编号
522	OwnerType	Y	成交申报所有者类型

828	TrdType					N	成交申报业务类别
829	TrdSubType					N	成交申报子业务类别
856	TradeReportType					Y	成交申报类型 0=Submit，提交成交申报 1=Alleged，转发成交申报 3=Decline，拒绝成交申报
487	TradeReportTransType					Y	成交申报事务类别
1123	TradeHandlingInstr					N	成交申报模式
572	TradeReportRefID					N	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用
60	TransactTime					N	成交申报接收时间
组件<Instrument>						Y	
48	SecurityID					Y	证券代码
22	SecurityIDSource					Y	证券代码源
组件结束							
组件<RootParties>						Y	
1116	NoRootPartyIDs					Y	参与人代码个数
→	1117	RootPartyID				Y	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource				Y	参与人代码源
	1119	RootPartyRole				Y	参与人代码角色
组件结束							
组件<TrdCapRptSideGrp>						Y	
552	NoSides					Y	side 个数
→	54	Side				Y	买卖方向
	组件<Parties>					Y	
	453	NoPartyIDs				Y	参与人代码个数
	→	448	PartyID			Y	参与人代码
		447	PartyIDSource			Y	参与人代码源
		452	PartyRole			Y	参与人代码角色
		子组件< PtysSubGrp>				N	
		802	NoPartySubIDs			Y	参与方子代码个数
		→	523	PartySubID		Y	参与方子代码
			803	PartySubID		Y	参与方子代码类型

				Type		
		子组件结束				
	组件结束					
组件结束						
17	ExecID				Y	执行编号
31	LastPx				Y	成交价格
32	LastQty				Y	成交数量
152	CashOrderQty				N	金额
119	SettlCurrAmt				N	结算金额
664	ConfirmID				N	约定号
8911	ExpirationDays				N	期限，单位为天数
880	TrdMatchID				N	交易编号，跨交易日唯一
10198	Memo				N	备注
63	SettlType				N	结算方式
10216	SettlPeriod				N	结算周期
544	CashMargin				N	融资融券信用标识
737	AllocSettlCurrAmt				N	现金结算场内支付金额
8904	SubstCash				N	现金结算金额
159	AccruedInterestAmt				N	借贷费用金额
10244	GracePeriod				N	申报宽限期、违约宽限期
10245	SupplementaryAgreement				N	补充约定
1125	OrigTradeDate				N	原成交申报日期
527	SecondaryExecID				N	第二执行编号
10248	MemoEx				N	扩展备注
10249	DisposalFlag				N	处置标识
组件<CompDeliverBasket>					N	
10193	NoBaskets				Y	质押篮子个数
→	10194	BasketID			Y	篮子编号
组件结束						
组件<CompDeliverSecurity>					N	
8902	NoSecurity				Y	质押券个数

→	309	UnderlyingSecurityID	Y	证券代码
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	Y	证券代码源
→	8903	DeliveryQty	Y	数量
→	10195	DeliverySide	Y	方向
→	10206	UnderlyingShareProperty	N	股份性质
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	N	券面总额
组件结束				
58	Text		N	Free Text

4.6.4 成交确认（Trade Capture Report）

表 4-22 TGW 向 OMS 传送成交确认消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AE
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
1003	TradeID	Y	交易所为成交申报分配的唯一 ID
571	TradeReportID	Y	客户成交申报编号，同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的客户成交申报编号不得重复
522	OwnerType	Y	成交申报所有者类型
828	TrdType	Y	成交申报业务类别
829	TrdSubType	N	成交申报子业务类别 对于债券现券业务的通交易所成交确认取值如下： 20=债券互联互通通交易所委托
856	TradeReportType	Y	成交申报类型
487	TradeReportTransType	Y	成交申报事务类别 2=Replace，成交申报成功
1123	TradeHandlingInstr	N	成交申报模式
60	TransactTime	N	成交确认时间
组件<Instrument>		Y	

48	SecurityID				Y	证券代码
22	SecurityIDSource				Y	证券代码源
组件结束						
组件<RootParties>					Y	
1116	NoRootPartyIDs				Y	参与人代码个数
→	1117	RootPartyID			Y	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource			Y	参与人代码源
	1119	RootPartyRole			Y	参与人代码角色
	子组件<RootSubParties>				N	
	1120	NoRootPartySubIDs			N	参与人子代码个数
	→	1121	RootPartySubID		Y	参与方子代码
		1122	RootPartySubIDType		Y	参与方子代码类型
	子组件结束					
组件结束						
组件<TrdCapRptSideGrp>					Y	
552	NoSides				Y	side 个数
→	54	Side			Y	买卖方向
	1009	SideLastQty			N	参与方成交数量
	1597	SideClearingTradePrice			N	参与方成交价格
	10246	SideMemo			N	参与方备注
	10247	SideConfirmID			N	参与方约定号
	组件<Parties>				Y	
	453	NoPartyIDs			Y	参与人代码个数
	→	448	PartyID		Y	参与人代码
		447	PartyIDSource		Y	参与人代码源
		452	PartyRole		Y	参与人代码角色
		子组件< PtysSubGrp>			N	
		802	NoPartySubIDs		N	参与方子代码个数
		→	523	PartySubID	Y	参与方子代码
			803	PartySubIDType	Y	参与方子代码类型
		子组件结束				
	组件结束					
组件结束						

17	ExecID	Y	执行编号
31	LastPx	Y	成交价格
32	LastQty	Y	成交数量
152	CashOrderQty	N	金额
664	ConfirmID	N	约定号
8911	ExpirationDays	N	期限
8906	ExpirationType	N	期限类型
8908	ShareProperty	N	股份性质
541	MaturityDate	N	到期日
8907	ExpirationExecInst	N	到期续做方式
423	PriceType	N	价格类型
544	CashMargin	N	融资融券信用标识
1125	OrigTradeDate	N	初始交易成交申报申报日期或原成交申报日期
880	TrdMatchID	N	交易编号，跨交易日唯一
119	SettlCurrAmt	N	结算金额
10198	Memo	N	备注
63	SettlType	N	结算方式
10216	SettlPeriod	N	结算周期
737	AllocSettlCurrAmt	N	现金结算场内支付金额
8904	SubstCash	N	现金结算金额
159	AccruedInterestAmt	N	借贷费用金额
10244	GracePeriod	N	申报宽限期、违约宽限期
10245	SupplementaryAgreement	N	补充约定
527	SecondaryExecID	N	第二执行编号
10248	MemoEx	N	扩展备注
10249	DisposalFlag	N	处置标识
组件<CompDeliverBasket>		N	

10193	NoBaskets		Y	质押篮子个数
→	10194	BasketID	Y	篮子编号
组件结束				
组件<CompDeliverSecurity>			N	
8902	NoSecurity		Y	质押券个数
→	309	UnderlyingSecurityID	Y	证券代码
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	Y	证券代码源
→	8903	DeliveryQty	Y	数量
→	10195	DeliverySide	Y	方向
→	10206	UnderlyingShareProperty	N	股份性质
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	N	券面总额
组件结束				
58	Text		N	Free Text

4.7 业务消息-注册处理（即转托管）

4.7.1 注册（Designation）

表 4-23 OMS 向 TGW 报送注册消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U001
1180	ApplID	Y	应用标识 200=转托管
522	OwnerType	Y	注册所有者类型
60	TransactTime	Y	注册发起时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
41	OrigClOrdID	N	原始交易的客户订单编号，指示被主动撤单的委托
8502	DesignationInstruction	Y	注册指令 3=转托管
8527	DesignationTransType	Y	注册类型 1=New 表示新注册请求 3=Cancel 表示注册撤单
组件<Instrument>		N	
48	SecurityID	Y	证券代码

				如果是系统内转托管，证券代码可填空表示转托管所有证券
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
组件<OrderQtyData>			N	
38	OrderQty		Y	转托管数量 如果是系统内转托管，数量可填 0 表示转托管全部持有量
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

1) 参与人代码说明

转托管申报必须包括以下四个参与人代码：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
交易单元（PBU）	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
证券账户	5=中国投资者编号	5=投资者证券账户
营业部代码	D=自定义代码	4001=营业部代码
转入交易单元代码	C=通用市场参与者标识	40=转入交易单元代码

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

4.7.2 注册执行报告（Designation Report）

表 4-24 TGW 向 OMS 传送注册执行报告消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U002
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
522	OwnerType	Y	注册所有者类型
60	TransactTime	Y	注册接收时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
41	OrigClOrdID	N	原始交易的客户订单编号，指示被主动撤单的委托
37	OrderID	Y	交易所订单编号
17	ExecID	Y	执行编号
150	ExecType	Y	执行类型 0=New 订单被接受 4=Cancelled 订单被主动撤单 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
103	OrdRejReason	N	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
1328	RejectText	N	拒绝原因说明，执行类型为 8 时填写
8502	DesignationInstruction	Y	注册指令
8527	DesignationTransType	Y	注册类型 1=New 表示新注册请求 3=Cancel 表示注册撤单
组件<Instrument>		N	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448 PartyID	Y	参与人代码
→	447 PartyIDSource	Y	参与人代码源
→	452 PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>		N	
38	OrderQty	Y	转托管数量

组件结束			
58	Text	N	Free Text

4.8 业务消息-网络投票处理

4.8.1 投票（Evote）

表 4-25 OMS 向 TGW 报送投票指令消息定义

Tag	域名		必须	字段描述
	MessageHeader		Y	MsgType=U004
1180	ApplID		Y	应用标识 210=投票
522	OwnerType		Y	投票所有者类型
60	TransactTime		Y	投票发起时间
11	ClOrdID		Y	客户订单编号
组件<Instrument>			Y	
48	SecurityID		Y	投票代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
8529	VotingProposal		Y	投票议案号 1-99 表示具体议案号 100 表示总议案
8530	VotingSubProposal		N	投票子议案号或选举候选人 0 表示所有子议案（不适用于累积投票） >0 其他表示具体子议案
8531	VotingPreference		N	投票意向（对于非累积投票议案填写如下值，对于累计投票议案需填写默认值 0）

			1 代表同意，2 代表反对，3 代表弃权
组件<OrderQtyData>		N	
38	OrderQty	N	投票数量（累积投票议案填写）
组件结束			
58	Text	N	Free Text

注：

1) 参与人代码说明

投票申报必须包括以下三个参与人代码：

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

4.8.2 投票执行报告（Evote Report）

表 4-26 TGW 向 OMS 传送投票执行报告消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U005
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
522	OwnerType	Y	投票所有者类型
60	TransactTime	Y	投票接收时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
37	OrderID	Y	交易所订单编号
17	ExecID	Y	执行编号
150	ExecType	Y	执行类型 0=New 表示投票成功 8=Reject 表示投票失败
103	OrdRejReason	N	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
1328	RejectText	N	拒绝原因说明，执行类型为 8 时填写

组件<Instrument>			Y	
48	SecurityID		Y	投票代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
8529	VotingProposal		Y	投票议案号
8530	VotingSubProposal		N	投票子议案号或选举候选人
8531	VotingPreference		Y	投票意向
组件<OrderQtyData>			N	
38	OrderQty		Y	投票数量
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

1) 参与人代码说明

网络投票申报必须包括以下三个参与人代码：

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

4.9 业务消息-密码服务处理

4.9.1 密码服务（Password Service）

表 4-27 OMS 向 TGW 报送密码服务请求消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U006

1180	ApplID		Y	应用标识 240=密码服务激活 241=密码服务挂失或重置
522	OwnerType		Y	所有者类型
60	TransactTime		Y	发起时间
11	ClOrdID		Y	客户订单编号
组件<Instrument>			Y	
48	SecurityID		Y	证券代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
8539	ValidationCode		N	密码激活或重置校验号
58	Text		N	Free Text

注：

1) 参与人代码说明

密码服务申报必须包括以下三个参与人代码：

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

2) 各类密码服务证券代码填写如下：

服务类型	证券代码	证券代码源
中国结算总部网站注册	369991	102
网络投票	369999	102

4.9.2 密码服务执行报告（Password Service Report）

表 4-28 TGW 向 OMS 传送密码服务执行报告消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U007
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	应用标识
522	OwnerType	Y	所有者类型
60	TransactTime	Y	接收时间
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
37	OrderID	Y	交易所订单编号
17	ExecID	Y	执行编号
150	ExecType	Y	执行类型 0=New 表示请求接受 8=Reject 表示请求失败
103	OrdRejReason	N	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
1328	RejectText	N	拒绝原因说明，执行类型为 8 时填写
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448 PartyID	Y	参与人代码
→	447 PartyIDSource	Y	参与人代码源
→	452 PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束			
8539	ValidationCode	Y	密码激活或重置校验号
58	Text	N	Free Text

4.10 业务消息-保证金查询处理

4.10.1 保证金查询（Margin Query）

表 4-29 OMS 向 TGW 报送保证金查询请求消息定义

Tag	域名		必须	字段描述
	MessageHeader		Y	MsgType=U008
1180	ApplID		Y	应用标识 250=保证金查询
60	TransactTime		Y	发起时间
11	ClOrdID		Y	客户查询编号
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

1) 参与人代码说明

保证金查询申报必须包括以下参与人代码：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
交易单元（PBU）	C=通用市场参与者标识	1=申报交易单元
结算账号	C=通用市场参与者标识	38=结算账号

4.10.2 保证金查询结果（Margin Query Result）

表 4-30 TGW 向 OMS 传送保证金查询结果消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=U009
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号

1180	ApplID		Y	应用标识 250=保证金查询
60	TransactTime		Y	发起时间
11	ClOrdID		Y	客户查询编号
17	ExecID		Y	执行编号
150	ExecType		Y	执行类型 0=New 表示请求接受 8=Reject 表示请求失败
103	OrdRejReason		N	拒绝原因代码，执行类型为 8 时填写
1328	RejectText		N	拒绝原因说明，执行类型为 8 时填写
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
组件<MarginItems>			N	
10186	NoMarginItems		Y	保证金条目个数
→	10187	MarginItem	Y	保证金条目类别 1=保证金可用余额 2=保证金总金额 3=预留 4=预留
	10188	MarginAmount	Y	保证金金额
组件结束				
58	Text		N	Free Text

注：

1) 保证金查询失败，则不返回 MarginItems 组件；查询成功则返回 MarginItems 组件，其中保证金条目个数为 4。

4.11 业务消息-多腿订单处理

4.11.1 多腿订单（New Order-Multileg）

表 4-31 OMS 向 TGW 报送多腿订单消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=AB
1180	ApplID	Y	应用标识
11	ClOrdID	Y	客户订单编号
40	OrdType	Y	订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优
54	Side	Y	买卖方向
522	OwnerType	Y	订单所有者类型
529	OrderRestrictions	N	订单限定
60	TransactTime	N	订单发起时间
组件<Instrument>		Y	
48	SecurityID	Y	证券代码
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源 102=深圳证券交易所
组件结束			
组件<Parties>		Y	
453	NoPartyIDs	Y	参与人代码个数
→	448 PartyID	Y	参与人代码
	447 PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452 PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束			
组件<OrderQtyData>		Y	
152	CashOrderQty	N	订单金额
38	OrderQty	Y	订单数量
组件结束			
组件<Legs>		N	
555	NoLegs	Y	成份合约个数
→	组件< InstrumentLeg>	Y	
	602 LegSecurityID	Y	成份合约代码
	603 LegSecurityIDSource	Y	成份合约代码源

	624	LegSide	N	成份合约方向
	组件结束			
	685	LegOrderQty	N	成份合约数量
组件结束				
198		SecondaryOrderID	N	第二交易所订单编号
167		SecurityType	N	证券类别
762		SecuritySubType	N	证券子类别 填写组合策略编码
44		Price	N	价格 OrdType 为 2 时填写
99		StopPx	N	止损价，预留
59		TimeInForce	N	有效时期类型 缺省值为 0
58		Text	N	Free Text

注：

1) 该消息用于以下业务多腿订单的申报：

业务	应用标识 ApplID	Side（54）	是否允许撤销	可选字段填写说明
期权行权指令合并申报	161	固定填 1	Y	Legs 必填，其中 Legs 填写必须字段和 LegOrderQty
期权组合策略保证金构建组合申报	340	固定填 1	N	SecurityType、SecuritySubType、Legs 必填，其中 Legs 还必须填写 LegSide 和 LegOrderQty
期权组合策略保证金解除组合申报	341	固定填 1	N	SecondaryOrderID 必填；SecondaryOrderID 填写组合流水号，即构建组合时交易所

				返回的 OrderID

2) OrdType 固定填 2

3) 多腿订单的撤销使用新订单撤单请求消息（MsgType=F），如撤单失败则返回撤单失败响应消息（MsgType=9），撤单成功则返回多腿订单响应及撤单成功执行报告（MsgType=8）

4) 参与人代码说明

- 如无特别说明申报多腿订单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

- 期权行权指令合并申报、期权组合策略保证金业务还需要填写合约账户标识码：

PartyID（448）	PartyIDSource（447）	PartyRole（452）
合约账户标识码	C=通用市场参与者标识	38=合约账户标识码

4.11.2 多腿订单执行报告（Execution Report）

表 4-32 TGW 向 OMS 传送多腿订单执行报告消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	MessageHeader	Y	MsgType=8
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识
522	OwnerType	Y	订单所有者类型
529	OrderRestrictions	N	订单限定
17	ExecID	Y	执行编号
37	OrderID	Y	交易所订单编号
150	ExecType	Y	执行类型
39	OrdStatus	Y	订单状态

31	LastPx		N	成交价
32	LastQty		N	成交数量
151	LeavesQty		Y	剩余量
14	CumQty		Y	累计成交数量
103	OrdRejReason		N	撤单/拒绝原因代码，执行类型为 8 或 4 时填写
1328	RejectText		N	撤单/拒绝原因说明，执行类型为 8 或 4 时填写
54	Side		Y	买卖方向
60	TransactTime		Y	执行报告时间
11	ClOrdID		Y	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
41	OrigClOrdID		N	原始订单客户订单编号，撤单请求成功响应填写
组件<Instrument>			Y	
48	SecurityID		Y	证券代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源
组件结束				
组件<Parties>			Y	
453	NoPartyIDs		Y	参与人代码个数
→	448	PartyID	Y	参与人代码
	447	PartyIDSource	Y	参与人代码源
	452	PartyRole	Y	参与人代码角色
组件结束				
组件<OrderQtyData>			Y	
152	CashOrderQty		N	订单金额
38	OrderQty		Y	订单数量
组件结束				
组件<Legs>			N	
555	NoLegs		Y	成份合约个数
→	组件< InstrumentLeg>		Y	
	602	LegSecurityID	Y	成份合约代码
	603	LegSecurityIDSource	Y	成份合约代码源

	624	LegSide	N	成份合约方向
	组件结束			
	685	LegOrderQty	N	成份合约数量
组件结束				
198	SecondaryOrderID		N	第二交易所订单编号
167	SecurityType		N	证券类别
762	SecuritySubType		N	证券子类别
44	Price		N	价格
40	OrdType		Y	订单类型
58	Text		N	Free Text

注：

1) 对于期权组合策略保证金解除组合执行报告，如果 OwnerType=101（交易所发起），则表示该笔执行报告是交易所发起的强制解除委托的回报，如果 OwnerType=106（结算机构发起），则表示该笔执行报告是结算机构发起的强制解除组合委托的回报。

五、 其它消息

5.1 业务拒绝消息（Business Reject）

表 5-1 TGW 向 OMS 传送业务拒绝消息定义

Tag	域名		必须	字段描述
	Standard Header		Y	MsgType=j
45	RefSeqNum		N	被拒绝消息的消息序号
372	RefMsgType		Y	被拒绝的消息类型
1180	ApplID		N	应用标识
60	TransactTime		Y	回报时间
组件<Instrument>			N	
48	SecurityID		Y	证券代码
22	SecurityIDSource		Y	证券代码源
组件结束				
组件<Parties>			N	
453	NoPartyIDs		N	参与方代码个数=1，为申报交易单元
→	448	PartyID	Y	申报交易单元
	447	PartyIDSource	Y	取 C，表示通用市场参与者标识

	452	PartyRole	Y	取 1，表示当前 PartyID 为申报交易单元
379	BusinessRejectRefID		N	被拒绝消息对应的业务层 ID,需要填写业务层 ID 的消息参见下面的列表。
380	BusinessRejectReason		Y	拒绝原因
58	Text		N	详细描述，最多 50 个字符

注：

1) 消息及业务层 ID 对应表：

表 5-2 业务消息类型与业务拒绝消息业务层 ID 对应表

消息类型	被拒绝消息对应的业务层 ID
新订单（New Order）	ClOrdID
撤单请求（Order Cancel Request）	ClOrdID
报价（Quote）	QuoteMsgID
报价回复（Quote Response）	ClOrdID
询价请求（Quote Request）	ClOrdID
意向申报（IOI）	IOIID
成交申报（TCR）	TradeReportID
注册	ClOrdID
投票	ClOrdID
投资者网络投票密码服务	ClOrdID
保证金查询	ClOrdID
多腿订单（New Order-Multileg）	ClOrdID

5.2 回报同步消息（Report Synchronization）

本消息用于 OMS 在成功登录 TGW 后，告知 TGW 对应分区期望接收的下一条回报的记录号。

表 5-3 OMS 向 TGW 传送回报同步消息定义

Tag	域名		必须	字段描述
	Standard Header		Y	MsgType=U101
10196	NoPartitions		Y	平台分区数量
→	10197	PartitionNo	Y	OMS 期望接收的平台分区号（分区号须存在且不重复）
	10179	ReportIndex	Y	对应分区下，OMS 期望接收的下一条回报的记录号（回报记录号从 1 开始连续编号）。 收到本消息后，TGW 会从该记录号开始向 OMS 发送该平

				台分区的回报； 如果没有收到某一分区的记录号，则 TGW 不会向 OMS 发送该分区的回报。

5.3 平台状态消息（Platform State Info）

本消息用于 TGW 向 OMS 提供各平台的当前状态，便于 OMS 控制是否发送委托。

OMS 成功登录到 TGW 后，会收到一条平台状态消息，消息中描述相应平台的当前状态。当每个平台的状态发生变化时，OMS 都会收到一条平台状态消息，描述该平台的最新状态。

表 5-4 TGW 向 OMS 传送平台状态消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	Standard Header	Y	MsgType=U102
10180	PlatformID	Y	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台 6=固定收益交易平台
10181	PlatformStatus	Y	平台状态 0=PreOpen，未开放 1=OpenUpcoming，即将开放 2=Open，开放 3=Halt，暂停开放 4=Close，关闭

5.4 回报结束消息（Report Finished）

TGW 使用该消息通知 OMS 本交易日对应平台指定分区回报发送完毕。

表 5-5 TGW 向 OMS 传送回报结束消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	Standard Header	Y	MsgType=U103
10197	PartitionNo	Y	平台分区号

10179	ReportIndex	Y	回报记录号 该回报记录号与本分区各类回报消息中的回报记录号连续编号
10180	PlatformID	Y	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台 6=固定收益交易平台

注：

1) OMS 收到本平台所有分区对应的回报结束消息后，才说明本交易日对应平台所有回报接收完毕。

2) 平台对应的分区信息，参见“平台信息消息（Platform Info）”。

5.5 平台信息消息（Platfrom Info）

本消息用于 TGW 向 OMS 提供各平台的基本信息，便于 OMS 控制回报同步。

OMS 成功登录到 TGW 后，除了会收到一条平台状态消息外，还会收到一条平台信息消息，消息中描述了相应平台的分区数量及分区号等信息。建议 OMS 收到平台信息消息后，才开始发送回报同步消息。

表 5-6 **TGW 向 OMS 传送平台信息消息定义**

Tag	域名		必须	字段描述
	Standard Header		Y	MsgType=U104
10180	PlatformID		Y	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台 6=固定收益交易平台
组件<CompPartitions>			Y	
10196	NoPartitions		Y	平台分区数量
→	10197	PartitionNo	Y	平台分区号，分区号不一定连续
组件结束				

5.6 回报占位消息（Report PlaceHolder）

本消息用于 TGW 向 OMS 提供接口兼容。

当 OMS 未升级到最新的通信版本号时，由于回报抄送等原因，TGW 可能会收到 OMS 当前通信版本不支持的回报消息，此时 TGW 会使用回报占位消息替换该消息并将回报占位消息发送给 OMS，确保发送给 OMS 的回报消息中 ReportIndex 的连续性。回报占位消息中的 PartitionNo、ReportIndex、ApplID 与原回报消息保持一致。

表 5-7 TGW 向 OMS 传送回报占位消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	Standard Header	Y	MsgType=UB001
10197	PartitionNo	Y	平台分区号
10179	ReportIndex	Y	回报记录号 该回报记录号与本分区各类回报消息中的回报记录号连续编号
1180	ApplID	Y	原始订单应用标识

5.7 交易会话状态消息（Trading Session Status）

OMS 成功登录到 TGW 后，会收到所连接平台的交易会话状态消息，揭示平台当前所处的交易会话状态。

交易过程中，如 OMS 所连接平台发生了交易会话状态的切换，则 TGW 将发送该平台最新的交易会话状态消息给 OMS。

目前仅固定收益交易平台提供交易会话状态消息的揭示功能。

表 5-8 TGW 向 OMS 传送交易会话状态消息定义

Tag	域名	必须	字段描述
	Standard Header	Y	MsgType=h
1301	MarketID	N	市场代码，预留
1300	MarketSegmentID	Y	市场板块代码，仅启用第一位表示平台号： 1=现货集中竞价交易平台，预留 2=综合金融服务平台，预留 3=非交易处理平台，预留 4=衍生品集中竞价交易平台，预留 5=国际市场互联平台，预留 6=固定收益交易平台

336	TradingSessionID	Y	交易会话 ID，预留
625	TradingSessionSubID	Y	交易会话子 ID，为数值型字符串
340	TradSesStatus	Y	交易会话状态，预留
341	TradSesStartTime	N	交易会话起始时间
345	TradSesEndTime	N	交易会话结束时间

注：

1）各市场板块代码对应的交易会话子 ID 取值说明如下：

MarketSegmentID	TradingSessionSubID	对应时间段
6=固定收益交易平台	0=开市前	0:00-9:00
6=固定收益交易平台	100=匹配成交前交易	9:00-9:15
6=固定收益交易平台	130=开盘集合竞价（可撤单）	9:15-9:20
6=固定收益交易平台	150=开盘集合竞价（不可撤单）	9:20-9:25
6=固定收益交易平台	170=匹配成交暂停	9:25-9:30
6=固定收益交易平台	200=上午交易	9:30-10:00
6=固定收益交易平台	230=上午交易（竞买应价）	10:00-11:30
6=固定收益交易平台	300=中午休市	11:30-13:00
6=固定收益交易平台	400=下午交易（不可互联）	13:00-13:30
6=固定收益交易平台	430=下午交易	13:30-15:00
6=固定收益交易平台	450=下午交易（分销后）	15:00-15:27
6=固定收益交易平台	480=收盘连续竞价	15:27-15:30
6=固定收益交易平台	600=收市后阶段	15:30 之后

（1）同一交易日内，当 MarketSegmentID（市场板块代码）相同时，TradingSessionSubID（交易会话子 ID）以从小到大（转换为数值后）的顺序发布。未来为支持新增业务或已有业务的交易时间变更，可能会新增 TradingSessionSubID（交易会话子 ID）枚举值，OMS 如果不使用这些新的枚举值，应可以不作变更而自动忽略新的枚举值。

六、 数据字典

6.1 数据类型

表 6-1 数据类型定义

数据类型	类型定义	说明
Price	N13(4)	价格
Qty	N15(2)	数量
Amt	N18(4)	金额
SeqNum	N18	消息序号

		正数
Boolean	C1	'Y'=True/Yes,'N'=False/No
Length	N9	长度 表示字节为单位的数据长度，正数
UTCTimeStamp	C21	国际标准时间戳 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss（毫秒）， YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60 (秒)，sss=000-999 (毫秒)。
LocalTimeStamp	C21	本地时间戳 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss（毫秒）， YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60 (秒)，sss=000-999 (毫秒)。
NumInGroup	N9	重复数 表示重复组的项数，正数
LocalMktDate	C8	本地市场日期 格式 YYYYMMDD，YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31

注：

1) 数据类型说明：

- ✓ Cx 表示字符串，x 表示字符串最大字节数，除非特别声明，字符串只可包含数字、大写字母、小写字母以及空格；字符串实际长度小于字段类型最大长度时可以不补空格；字符串统一使用 UTF-8 编码；特别地，C[]表示变长字符串。
- ✓ Ux 表示以 UTF-8 编码的字符串，x 表示字符串最大字符数；字符串实际长度小于字段类型最大长度时可以不补空格；特别地，U[]表示变长字符串。
- ✓ Nx 表示十进制整数，x 表示整数最大位数（不包括正负号），除非特别声明，整数类型均有正负；
- ✓ Nx(y)表示浮点数，x 表示整数与小数总计位数，不包括小数点，y 表示小数位数，小数位数不足时必须在后面补 0，比如 N5(3)类型的值 18.460 是合法的，18.46 以及 18.4600 都是不合法的；除非特别声明，浮点数类型均有正负。

6.2 会话层域定义

表 6-2 会话层域定义

Tag	域名	类型	说明
49	SenderCompID	C20	接收方代码
52	SendingTime	UTCTimestamp	消息发送时间
56	TargetCompID	C20	发送方代码
58	Text	C200	文本 可能包含中文字符，表示最多 200 个字节
347	MessageEncoding	C16	消息中编码域的字符编码类型 UTF8
1408	DefaultCstmApplVerID	C32	本次会话中，FIX 消息的缺省自定义应用版本。本标签是对 tag 1137 + tag 1407 的进一步约束。 填写为 STEP1.20_SZ_n.xy 其中 n.xy 为通信版本号，如通信版本号为 1.01 时，本标签填写为：STEP1.20_SZ_1.01。

6.3 业务层域定义

表 6-3 业务层域定义

Tag	域名	类型	说明
11	ClOrdID	C10	客户订单编号
14	CumQty	Qty	累计执行数量
17	ExecID	C16	交易所赋予的执行编号，单个交易日内不重复
22	SecurityIDSource	C4	证券代码源 101=上海证券交易所 102=深圳证券交易所
23	IOIID	C10	客户意向申报编号
26	IOIRefID	C10	原意向申报 IOIID 撤销意向申报时使用
27	IOIQty	Qty	意向申报数量
28	IOITransType	C1	意向申报类型 N=意向申报 C=意向申报撤单
31	LastPx	Price	成交价格
32	LastQty	Qty	成交数量
37	OrderID	C16	交易所订单编号

			交易所赋予的订单编号，跨交易日不重复
38	OrderQty	Qty	订单数量
39	OrdStatus	C1	订单状态 0=New，表示新订单 1=Partially filled，表示部分成交 2=Filled，表示全部成交 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝
40	OrdType	C1	订单类型 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优
41	OrigClOrdID	C10	原订单 ClOrdID
44	Price	Price	价格
45	RefSeqNum	SeqNum	引用的消息序号
48	SecurityID	C8	证券代码
54	Side	C1	买卖方向 1=买 2=卖 G=借入 F=出借 D=申购 E=赎回
58	Text	C8	文本串，仅可包含 ASCII 可显示字符
59	TimeInForce	C1	订单有效时期类型 0 表示当日有效 3 表示即时成交或取消（IOC）
60	TransactTime	LocalTimestamp	订单或执行的创建时间
62	ValidUntilTime	LocalTimestamp	报价有效时间，预留
63	SettlType	N3	结算方式 0=不指定 103=多边净额 104=逐笔全额

75	TradeDate	LocalMktDate	交易日期
77	PositionEffect	C1	开平仓标识 O 表示开仓 C 表示平仓
99	StopPx	Price	止损价格
102	CxlRejReason	N5	撤单拒绝原因代码，正数
103	OrdRejReason	N5	订单拒绝原因代码，正数
110	MinQty	Qty	最低成交数量
111	MaxFloor	Qty	可显示数量
117	QuoteID	C10	报价消息编号，主动撤单时填与被撤委托的 QuoteID 一致
119	SettlCurrAmt	Amt	结算金额或借贷费用场内支付金额
126	ExpireTime	LocalTimestamp	询价请求失效时间，预留
131	QuoteReqID	C10	报价请求 ID
132	BidPx	Price	买报价
133	OfferPx	Price	卖报价
134	BidSize	Qty	买数量
135	OfferSize	Qty	卖数量
146	NoRelatedSym	NumInGroup	询价请求证券只数
150	ExecType	C1	执行报告类型 0=New，表示新订单 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝 F=Trade，表示已成交
151	LeavesQty	Qty	订单剩余数量
152	CashOrderQty	Amt	订单现金金额
159	AccruedInterestAmt	Amt	借贷费用金额
167	SecurityType	C8	证券类别 MLEG=组合
198	SecondaryOrderID	C16	第二交易所订单编号
203	CoveredOrUncovered	N1	备兑标签，衍生品交易填写 0=Covered，表示备兑仓 1=UnCovered，表示普通仓
297	QuoteStatus	N2	报价状态

			0=Accepted，接受 4=Cancelled，已撤销 5=Rejected，拒绝 7=Expired，已超时
300	QuoteRejectReason	N5	意向申报拒绝原因代码，正数
303	QuoteRequestType	N2	询价请求类型 101=Submit，提交 102=Alleged，转发
305	UnderlyingSecurityIDSource	C4	基础证券代码源
309	UnderlyingSecurityID	C8	基础证券代码
336	TradingSessionID	C4	交易会话 ID，预留
340	TradSesStatus	N4	交易会话状态，预留
341	TradSesStartTime	LocalTimestamp	交易会话开始时间
345	TradSesEndTime	LocalTimestamp	交易会话结束时间
372	RefMsgType	C8	被拒绝的消息类型
379	BusinessRejectRefID	C10	被拒绝消息对应的业务层 ID
380	BusinessRejectReason	N5	拒绝原因
10238	BidTransType	N2	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
10239	BidExecInstType	N2	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
423	PriceType	N2	1=百分比 2=每交易单位（Per unit） 3=固定数量
453	NoPartyIDs	NumInGroup	参与方个数
487	TradeReportTransType	N1	成交申报事务类别 0=New，新申报 1=Cancel，撤销申报 2=Replace，响应
522	OwnerType	N4	所有者类型，正数

			1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起 106=结算结构发起
524	NestedPartyID	C20	参与人代码
525	NestedPartyIDSource	C1	参与人代码源
527	SecondaryExecID	C16	第二执行编号
529	OrderRestrictions	C7	订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定类型，以空格分隔
537	QuoteType	N2	报价类型 1= Tradeable，表示可交易的报价
538	NestedPartyRole	N4	参与人代码角色
539	NoNestedPartyIDs	NumInGroup	参与方个数
541	MaturityDate	LocalMktDate	到期日
544	CashMargin	C1	融资融券信用标识 1=Cash，普通交易 2=Open，融资融券开仓 3=Close，融券融券平仓
545	NestedPartySubID	C20	参与方子代码
555	NoLegs	NumInGroup	成份合约个数
571	TradeReportID	C10	客户成交申报编号
572	TradeReportRefID	C10	原客户成交申报编号
602	LegSecurityID	C8	成份合约代码
603	LegSecurityIDSource	C4	成份合约代码源
624	LegSide	C1	成份合约方向 1=权利仓（买开） 2=义务仓（卖开）

625	TradingSessionSubID	C4	交易会话子 ID
658	QuoteRequestRejectReason	N5	询价请求拒绝原因代码
664	ConfirmID	C8	约定号
669	LastParPx	Price	成交价格二
685	LegOrderQty	Qty	成份合约数量
692	QuotePriceType	N2	报价价格类型，预留 1=百分比（Percent of par) 2=每股 （Per Share）
693	QuoteRespID	C16	报价回复消息编号或交易所意向申报编号 交易所赋予的意向申报编号，跨交易日不重复
694	QuoteRespType	N2	对于报价回复消息，为报价回复类型，取值为： 1=Hit/Lift，接受 2=Counter，重报 6=Pass，拒绝 对于意向申报，为意向申报响应类型，取值为： 2=意向申报响应
751	TradeReportRejectReason	N5	成交申报拒绝原因代码
762	SecuritySubType	C8	证券子类别
802	NoPartySubIDs	NumInGroup	参与方子代码个数
804	NoNestedPartySubIDs	NumInGroup	参与方子代码个数
805	NestedPartySubIDType	N4	参与方子代码类型
828	TrdType	N4	成交申报类型，正数 1001=股票质押式回购初始交易 1002=股票质押式回购提前购回 1003=股票质押式回购到期购回 1004=股票质押式回购延期购回 1005=股票质押式回购终止购回 1006=股票质押式回购补充质押 1007=股票质押式回购部分解除质押 1008=股票质押式回购违约处置

			1009=股票质押式回购部分购回 1010=股票质押式回购违约处置撤销 1011=约定购回初始交易 1012=约定购回提前购回 1013=约定购回到期购回 1014=约定购回延期购回 1021=质押式报价回购初始交易 1022=质押式报价回购提前购回 1031=债券质押式协议回购初始交易 1032=债券质押式协议回购到期购回 1033=债券质押式协议回购到期续做 1034=债券质押式协议回购提前购回 1035=债券质押式协议回购解除质押 1036=债券质押式协议回购质押券变更 1041=债券质押式三方回购初始交易 1042=债券质押式三方回购到期购回 1043=债券质押式三方回购到期续做 1044=债券质押式三方回购提前购回 1045=债券质押式三方回购补券 1046=债券质押式三方回购换券 1047=债券质押式三方回购解除质押 1061=债券借贷初始交易 1062=债券借贷到期结算 1063=债券借贷到期续做 1064=债券借贷提前终止 1065=债券借贷解除质押 1066=债券借贷质押券变更
829	TrdSubType	N4	成交申报子业务类别 对于协议交易业务取值如下： 0=非受限股份转让 1=受限股份转让 对于债券质押式协议回购业务的到期续做委托取值如下： 10=不变更续做对手方

			11=变更续做对手方 其他业务固定填 0
856	TradeReportType	N2	成交申报消息类型 0=Submit，提交成交申报 1=Alleged，转发成交申报 2=Accept，接受成交申报 3=Decline，拒绝成交申报
880	TrdMatchID	C16	交易编号，跨交易日唯一
939	TrdRptStatus	N4	成交申报状态 0=Accepted，接受 1=Rejected，拒绝 2=Cancelled，已撤销 100=Unmatched，尚未匹配 101=Matched，已匹配
1003	TradeID	C16	交易所成交申报编号 交易所赋予的成交申报编号，跨交易日不重复
1009	SideLastQty	Qty	参与方成交数量
1090	MaxPriceLevels	N4	最多成交价位数，正数 0 表示不限制成交价位数
1091	PreTradeAnonymity	N1	是否匿名 0=显名 1=匿名
1093	LotType	C1	订单数量类型 1=零股订单，Odd Lot 2=整手订单，Round Lot
1116	NoRootPartyIDs	NumInGroup	参与人代码个数
1120	NoRootPartySubIDs	NumInGroup	参与人子代码个数
1121	RootPartySubID	C20	参与方子代码
1122	RootPartySubIDType	N4	参与方子代码类型
1123	TradeHandlingInstr	C1	成交申报模式 0=Trade Confirm，成交确认 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 5=Two Party Report for Claim，双边确认成交报告
1125	OrigTradeDate	LocalMktDate	初始成交申报申报日期
1126	OrigTradeID	C16	初始成交申报的 TradeID
1148	LowLimitPrice	Price	价格下限
1149	HighLimitPrice	Price	价格上限
1166	QuoteMsgID	C10	客户报价消息编号
1171	PrivateQuote	N1	私有报价 0=私有报价（Private Quote） 1=公开报价（Public Quote）
1180	ApplID	C3	应用标识
1300	MarketSegmentID	C8	市场板块代码，仅启用第一位表示平台号： 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台 4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台 6=固定收益交易平台
1301	MarketID	C8	市场代码，预留
1328	RejectText	C16	拒绝原因说明 可能包含中文字符，表示最多 16 个字节
1597	SideClearingTradePrice	Price	参与方成交价格
8502	DesignationInstruction	C1	注册指令 3 表示转托管
8527	DesignationTransType	N1	注册指令类型 1=New，表示新注册请求 3=Cancel，表示注册撤单
8529	VotingProposal	N4	投票议案号，正数 1-99 表示具体议案号 100 表示总议案

8530	VotingSubProposal	N4	投票子议案号或选举候选人，正数 0 表示所有子议案 >0 其他表示具体子议案
8531	VotingPreference	C1	投票意向 1 代表同意，2 代表反对，3 代表弃权
8539	ValidationCode	N9	密码激活校验号，正数
8902	NoSecurity	NumInGroup	证券只数
8903	DeliverQty	Qty	证券交付数量
8904	SubstCash	Amt	执行报告现金替代金额或成交申报现金结算金额
8906	ExpirationType	N2	期限类型 1 表示固定期限
8907	ExpirationExecInst	N2	到期续做方式 1 表示到期自动续做 2 表示到期手动续做
8908	ShareProperty	C2	股份性质 00-无限售流通股 01-首发后限售股 05-首发前限售股 07-首发后可出借限售股
8909	BidPositionEffect	C1	买开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
8910	OfferPositionEffect	C1	卖开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
8911	ExpirationDays	N4	期限，单位为天数
8912	TrdAckStatus	C1	成交申报响应状态 0=Accepted，接受 1=Rejected，拒绝
10179	ReportIndex	SeqNum	回报记录号，从 1 开始编号
10180	PlatformID	N4	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台 3=非交易处理平台

			4=衍生品集中竞价交易平台 5=国际市场互联平台 6=固定收益交易平台
10181	PlatformStatus	N4	平台状态 0=PreOpen，未开放 1=OpenUpComing，即将开放 2=Open，开放 3=Halt，暂停开放 4=Close，关闭
10182	OrigTradeReportID	C10	初始交易客户成交申报编号
10183	PledgeeType	N2	质权人类型
10184	Contactor	C12	联系人 可能包含中文字符，表示最多 12 个字节
10185	ContactInfo	C30	联系方式 可能包含中文字符，表示最多 30 个字节
10186	NoMarginItems	NumInGroup	保证金条目个数
10187	MarginItem	N2	保证金条目类别 1=保证金可用余额 2=保证金总金额
10188	MarginAmount	Amt	保证金金额
10189	IMCRejectText	C150	国际市场互联对方市场拒绝原因说明
10190	InvestmentType	C2	资金用途类型 01=生产经营 02=补充流动资金 03=股权类投资 04=债权类投资 05=不动产投资 06=偿还债务 07=个人消费 99=其他
10191	AlertRatio	N6(2)	预警线，单位为百分比
10192	SettlementRatio	N6(2)	平仓线，单位为百分比

10193	NoBaskets	NumInGroup	质押篮子个数
10194	BasketID	N2	篮子编号，从 1 开始编号，最大不超过 99
10195	DeliverySide	C1	方向 1=质押 2=解押
10196	NoPartitions	NumInGroup	平台分区数量
10197	PartitionNo	N9	平台分区号
10198	Memo	C160	备注 可包含中文字符，最长 160 个字节
10199	NoQuote	NumInGroup	报价消息个数
10200	QuoteRequestTransType	N2	询价请求事务类型 0-New，新订单 1-Cancel，撤销
10206	UnderlyingShareProperty	C2	基础证券股份性质 00-无限售流通股 01-首发后限售股
10216	SettlPeriod	N2	结算周期 0=T+0 1=T+1 2=T+2 3=T+3
10222	QuoteRequestStatus	N3	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
10223	NoCounterpartyPBU	NumInGroup	对手方交易单元个数
10224	CounterpartyPBUID	C6	对手方交易单元
10225	QuotePrice	Price	报价价格
10226	QuoteQty	Qty	报价数量
10229	NoAccountMarginItems	NumInGroup	证券账户保证金条目个数
10230	AccountMarginItem	N2	证券账户保证金条目类别

10231	AccountMarginAmount	Amt	证券账户保证金金额
10232	NoCounterInfos	NumInGroup	对手方交易主体个数
10236	QuoteRejectText	C50	报价拒绝原因说明
10237	QuoteRequestRejectText	C50	询价请求拒绝原因说明
10240	TradeReportRejectText	C50	成交申报拒绝原因说明
10241	UnderlyingCashOrderQty	Amt	基础证券券面总额
10244	GracePeriod	N4	申报宽限期、违约宽限期
10245	SupplementaryAgreement	C600	补充约定 可包含中文字符，最长 600 个字节
10246	SideMemo	C160	参与方备注 可包含中文字符，最长 160 个字节
10247	SideConfirmID	C8	参与方约定号
10248	MemoEx	U[]	扩展备注
10249	DisposalFlag	N1	处置标识 0=不同意 1=同意

6.4 参与人编码

除非特别声明，参与人代码（PartyID）及参与人子代码（PartySubID）只可包含数字、大写字母、小写字母以及空格；统一使用 UTF-8 编码；

表 6-4-1 参与人编码表

参与人代码 PartyID	参与人代码源 PartyIDSource	参与人代码角色 PartyRole
证券账户 （最多 12 个字符）	5 表示中国投资者编号	5 表示投资者证券账户 39 表示对手方投资者证券账户
交易单元（PBU） （6 个字符）	C 表示通用市场参与者标识	1 表示申报交易单元 13 表示初始交易申报交易单元 17 表示对手方交易单元 27 表示回报交易单元
营业部代码 （最多 4 个字符）	D 表示自定义代码	4001 表示营业部代码 4002 表示对手方营业部代码
结算机构代码 （2 个字符） 00=中国证券登记结算总公司	F 表示交割机构	4 表示结算机构代码

01=中国证券登记结算公司深圳分公司 09=自建 TA		
收购人编码 （6 个字符）	D 表示自定义代码	4003 表示要约收购收购人编码
合约账户标识码/结算账号 （6 个字符）	C 表示通用市场参与者标识	38 表示合约账户标识码/结算账号
交易账户 （资产管理计划份额转让业务中表示场外交易员交易账户，为 17 个字符；债券质押式协议回购业务中表示债券现券交易员代码，为 8 个字符）	D 表示自定义代码	12 表示交易员账户 36 表示申报方交易员代码 37 表示对手方交易员账户
交易商代码 （6 个字符）	C 表示通用市场参与者标识	6 表示申报方交易商代码 7 表示交易商代码 20 表示对手方交易商代码
交易主体代码 （10 个字符）	D 表示自定义代码	4003 表示交易主体代码 4004 表示对手方交易主体代码 4005 表示申报方交易主体代码
所属市场 （4 个字符） 101 =上海证券交易所	C 表示通用市场参与者标识	22=交易所

表 6-5-2 参与人子代码表

参与人子代码 PartySubID	参与人子代码类型 PartySubIDType
客户名称 （可包含中文字符，最多 120 个字节）	5 表示客户名称
交易主体类型 （2 个字符，可取值为： 01=自营 02=资管 03=机构经纪 04=个人经纪）	26 表示交易主体类型

6.5 委托申报拒绝原因代码

参见《深圳证券交易所委托申报拒绝原因代码表》。

七、 附件

7.1 新订单（New Order）处理流程说明

下面表中的 Time 列表示时间顺序，值相同的行数表示可能发生的多种情形，但任何时候有且只有一种情形会发生；Received 列和 Sent 列是以交易系统的视角来描述。

7.1.1 申报新订单并产生成交

表 7-1 申报新订单的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单 MsgType=D
2		Execution	Rejected	Rejected	10000	0	0	0	订单被拒绝 MsgType=8
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=8
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=8
4		Execution	Trade	Partially Filled	10000	4000	6000	1000	订单成交 1000 MsgType=8
5		Execution	Trade	Filled	10000	10000	0	6000	订单成交 6000 MsgType=8

7.1.2 撤销尚未产生成交的新订单

表 7-2 新订单被成功撤销的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单 MsgType=D
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=8

3	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=F
4		Execution	Cancelled	Cancelled	10000	0	0	0	撤单成功 MsgType=8

7.1.3 撤销已部分成交的新订单

表 7-3 申请撤销已部分成交订单的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单 MsgType=D
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=8
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=8
4	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=F
5		Cancel Reject		Partially Filled					撤单被拒绝，OrdStatus 填写目标委托当前状态 MsgType=9
5		Execution	Cancelled	Cancelled	10000	3000	0	0	撤单成功 MsgType=8

7.1.4 撤销已全部成交的新订单

表 7-4 申请撤销已全部成交订单的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder				10000				收到新订单 MsgType=D
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=8
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=8

4		Execution	Trade	Filled	10000	10000	0	7000	订单成交 7000 MsgType=8
5	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=F
6		Cancel Reject		Filled					撤单被拒绝 MsgType=9

7.1.5 撤销不存在的新订单

表 7-5 申报撤销不存在订单或已被拒绝订单的回报场景

Time	Received	Sent	Exec Type	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=F
2		Cancel Reject		Rejected					撤单被拒绝 MsgType=9

7.2 成交申报（TCR）处理流程说明

下面表中的 Time 列表示时间顺序，值相同的行数表示可能发生的多种情形，但任何时候有且只有一种情形会发生；Received 列和 Sent 列是以交易系统的视角来描述。

7.2.1 协议配对模式

7.2.1.1 申报新成交申报

表 7-6 申报新成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
3		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Cancelled	与对手方成交申报配对失败 MsgType=AR

3		TCR	Replace	Submit	OnePartyReport for matching			与对手方配对成功 MsgType=AE

7.2.1.2 撤销尚未配对成功的成交申报

表 7-7 申请撤销尚未配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报 MsgType=AE
2		TCR Ack		Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
3	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
4		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Unmatched	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写目标委托当前状态 MsgType=AR
4		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Cancelled	撤单成功 MsgType=AR

7.2.1.3 撤销已配对成功的成交申报

表 7-8 申请撤销已配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR

3		TCR	Replace	Submit	OnePartyReport for matching			与对手方配对成功 MsgType=AE
4	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
5		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写目标委托当前状态 MsgType=AR

7.2.1.4 撤销已被拒绝的成交申报

表 7-9 申请撤销已被拒绝成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
3	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
4		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 TrdRptStatus 填写目标委托当前状态 MsgType=AR

7.2.1.5 撤销不存在的的成交申报

表 7-10 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark

1	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.2.2 成交报告申报模式

7.2.2.1 申报新成交申报

表 7-11 申报新成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Accepted	Accepted	成交申报被接受 MsgType=AR
3		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			成交确认 MsgType=AE
3		TCR	New	Submit	Two-Party			发给对手方的转发成交申报 MsgType=AE

7.2.2.2 撤销已接受的成交申报

表 7-12 申请撤销尚未配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Accepted	Accepted	成交申报被接受

								MsgType=AR
3		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			成交确认 MsgType=AE
3		TCR	New	Submit	Two-Party			发给对手方的转发成交申报 MsgType=AE
4	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
5		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Accepted	Cancelled	撤销成功 MsgType=AR
6		TCR	Cancel	Submit	Two-Party			转发撤销请求给对手方 MsgType=AE

7.2.2.3 撤销已被拒绝的成交申报

表 7-13 申请撤销已被拒绝成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
3	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
4		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.2.2.4 撤销不存在的的成交申报

表 7-14 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransT	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark

			ype					
1	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.2.3 成交请求申报模式

7.2.3.1 申报新成交申报

表 7-15 申报新成交申报且对手方拒绝成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=AE
4	TCR		Replace	Decline	One-Party for pass-thru			对手方拒绝接受成交 MsgType=AE
5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
6		TCR	Cancel	Decline	One-Party for pass-thru			转发给发起方 MsgType=AE

表 7-16 申报新成交申报且对手方接受成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=AE
4	TCR		Replace	Accept	One-Party for pass-thru			对手方接受成交 MsgType=AE
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
6		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			与对手方配对成功，发给发起方的成交确认 MsgType=AE
6		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			与对手方配对成功，发给对手方的成交确认 MsgType=AE

7.2.3.2 撤销尚未配对成功的成交申报

表 7-17 申请撤销尚未配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransT	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark

			ype					
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=AE
4	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
5		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Cancelled	撤销成功 MsgType=AR
6		TCR	Cancel	Alleged	One-Party for pass-thru			转发撤销请求给对手方 MsgType=AE

7.2.3.3 撤销已配对成功的成交申报

表 7-18 申请撤销已被对手方拒绝成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=AE
4	TCR		Replace	Decline	One-Party for pass-thru			对手方拒绝接受成交 MsgType=AE

5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
6		TCR	Cancel	Decline	One-Party for pass-thru			转发给发起方 MsgType=AE
7	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
8		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Cancelled	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

表 7-19 申请撤销已被对手方接受成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=AE
4	TCR		Replace	Accept	One-Party for pass-thru			对手方接受成交 MsgType=AE
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
6		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			与对手方配对成功，发给发起方的成交确认 MsgType=AE
6		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			与对手方配对成功，发给对手方的成交确认 MsgType=AE

7	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
8		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.2.3.4 撤销已被拒绝的成交申报

表 7-20 申请撤销已被拒绝成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报请求被拒绝 MsgType=AR
3	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
4		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.2.3.5 撤销不存在的的成交申报

表 7-21 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.2.4 双边确认成交报告模式

7.2.4.1 申报新成交申报

表 7-22 申报新成交申报且对响应一方拒绝成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给对一方响应方 MsgType=AE
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给对另一方响应方 MsgType=AE
4	TCR		Replace	Decline	Two Party Report for Claim			一方响应方拒绝接受成交 MsgType=AE
5		TCR Ack	Replace	Decline	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
5		TCR Ack	Replace	Decline	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
6		TCR	Cancel	Decline	Two Party Report for Claim			转发给发起方 MsgType=AE
6		TCR	Cancel	Alleged	Two Party			转发给发另一响应方

					Report for Claim			MsgType=AE

表 7-23 申报新成交申报且全部响应方都接受成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给一方响应方 MsgType=AE
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给另一方响应方 MsgType=AE
4	TCR		Replace	Accept	Two Party Report for Claim			一方响应方接受成交 MsgType=AE
5		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
5		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
6								与发起方委托配对成功，等待另一方响应

								方确认接受 无消息
7	TCR		Replace	Accept	Two Party Report for Claim			另一方响应方接受成交 MsgType=AE
8		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=AR
8		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
9								与发起方委托配对成功
9		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给发起方的成交确认 MsgType=AE
9		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给先确认方的成交确认 MsgType=AE
10		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给后确认方的成交确认 MsgType=AE

7.2.4.2 撤销尚未配对成功的成交申报

表 7-24 申请撤销尚未成交的成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two Party Report for Claim			发起方提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR

					Claim			
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给一方响应方 MsgType=AE
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给另一方响应方 MsgType=AE
4	TCR		Cancel	Submit	Two Party Report for Claim			发起方提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
5		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Cancelled	撤销成功 MsgType=AR
6		TCR	Cancel	Alleged	Two Party Report for Claim			转发撤销请求给一方响应方 MsgType=AE
6		TCR	Cancel	Alleged	Two Party Report for Claim			转发撤销请求给另一方响应方 MsgType=AE

7.2.4.3 撤销已配对成功的成交申报

表 7-25 申请撤销已被响应方拒绝成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给一方响应方 MsgType=AE

3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给另一方响应方 MsgType=AE
4	TCR		Replace	Decline	Two Party Report for Claim			一方响应方拒绝接受成交 MsgType=AE
5		TCR Ack	Replace	Decline	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
6		TCR	Cancel	Decline	Two Party Report for Claim			转发给发起方 MsgType=AE
6		TCR	Cancel	Alleged	Two Party Report for Claim			转发给另一响应方 MsgType=AE
7	TCR		Cancel	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
8		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Cancelled	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

表 7-26 申请撤销已所有响应方接受成交的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=AR
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for			转发成交申报请求给一方响应方

					Claim			MsgType=AE
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给另一方响应方 MsgType=AE
4	TCR		Replace	Accept	Two Party Report for Claim			一方响应方接受成交 MsgType=AE
5		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
6	TCR		Replace	Accept	Two Party Report for Claim			另一方响应方接受成交 MsgType=AE
7		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=AR
8		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给发起方的成交确认 MsgType=AE
8		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给先确认方的成交确认 MsgType=AE
9		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给后确认方的成交确认 MsgType=AE
10	TCR		Cancel	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
11		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.2.4.4 撤销已被拒绝的成交申报

表 7-27 申请撤销已被拒绝成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报请求被拒绝 MsgType=AR
3	TCR		Cancel	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
4		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.2.4.5 撤销不存在的的成交申报

表 7-28 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		Cancel	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=AE
2		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=AR

7.3 询价（Quote Request）处理流程说明

下面表中的 Time 列表示时间顺序，值相同的行数表示可能发生的多种情形，但任

何时候有且只有一种情形会发生；Received 列和 Sent 列是以交易系统的视角来描述。

7.3.1 询价方撤销询价请求

表 7-29 询价方撤销询价请求的回报场景

Time	Received	Sent	QuoteRequestType	QuoteRequestTransType	QuoteRequestStatus/QuoteStatus	
1	Quote Request		Submit	New		提交一笔询价请求 MsgType=R
2		Quote Request Ack	Submit	New	Rejected	询价请求被拒绝 MsgType=R
2		Quote Request Ack	Submit	New	Accepted	询价请求被接受 MsgType=R
3		Allege Quote Request	Alleged	New	Accepted	转发询价请求给报价方 MsgType=R
4	Quote					报价方进行报价 MsgType=S
5		Quote Status Report			Rejected	报价被拒绝 MsgType=AI
5		Quote Status Report			Accepted	报价被接受 MsgType=AI
6		Allege Quote				转发报价给询价方 MsgType=S
7	Quote Request		Submit	Cancel		询价方撤销询价 MsgType=R
8		Quote Request Ack	Submit	Cancel	Rejected	询价撤销请求被拒绝 MsgType=R
8		Quote Request Ack	Submit	Cancel	Accepted	询价撤销请求被接受 MsgType=R
9		Allege Quote	Alleged	Cancel	Cancelled	转发询价请求给报

		Request				价方 MsgType=R

7.3.2 报价方撤销报价

表 7-30 报价方撤销报价的回报场景

Time	Received	Sent	QuoteRequestType	QuoteRequestStatus/QuoteStatus	
1	Quote Request				提交一笔询价请求 MsgType=R
2		Quote Request Ack	Submit	Rejected	询价请求被拒绝 MsgType=R
2		Quote Request Ack	Submit	Accepted	询价请求被接受 MsgType=R
3		Allege Quote Request	Alleged	Accepted	转发询价请求给报价方 MsgType=R
4	Quote				报价方进行报价 MsgType=S
5		Quote Status Report		Rejected	报价被拒绝 MsgType=AI
5		Quote Status Report		Accepted	报价被接受 MsgType=AI
6		Allege Quote			转发报价给询价方 MsgType=S
7	Quote				报价方撤销报价 MsgType=S
8		Quote Status Report		Rejected	报价撤销请求被拒绝 MsgType=AI
8		Quote Status Report		Accepted	报价撤销请求被接受 MsgType=AI

9		Execution Report			撤销成功 MsgType=8
9		Allege Quote			转发报价撤销给报价方 MsgType=S

7.3.3 询价方与报价方成交

表 7-31 询价方与报价方成交的回报场景

Time	Received	Sent	QuoteRequestType	QuoteRequestStatus/QuoteStatus	
1	Quote Request		Submit		提交一笔询价请求 MsgType=R
2		Quote Request Ack	Submit	Rejected	询价请求被拒绝 MsgType=R
2		Quote Request Ack	Submit	Accepted	询价请求被接受 MsgType=R
3		Allege Quote Request	Alleged	Accepted	转发询价请求给报价方 MsgType=R
4	Quote				报价方进行报价 MsgType=S
5		Quote Status Report		Rejected	报价被拒绝 MsgType=AI
5		Quote Status Report		Accepted	报价被接受 MsgType=AI
6		Allege Quote			转发报价给询价方 MsgType=S
7	Quote Response				询价方发起报价回复 MsgType=AJ
8		Quote Status Report		Rejected	报价回复被拒绝 MsgType=AI

8		Quote Status Report		Accepted	报价回复被接受 MsgType=AI
9		Execution Report			与报价方配对成功，发给询价方的成交报告 MsgType=8
9		Execution Report			与报价方配对成功，发给报价方的成交报告 MsgType=8
10		Allege Quote Request			转发询价请求给所有报价方 MsgType=R