

深圳证券交易所

新一代交易系统 FAQ

二零一六年三月

目 录

一、	接入.....	1
a)	交易网关和行情网关.....	1
b)	文件网关.....	19
c)	DCOM.....	22
二、	交易.....	25
三、	行情.....	41
四、	交易参考信息.....	43

一、 接入

a) 交易网关和行情网关

1. 日志提示：“Gateway doesn't belong to this server. Please check server IP again.”

答复：连错服务器，需填写网关分配的服务器

2. 网关监控无法正常显示

答复：只支持 IE9 以上，最好是 firefox、chrome 等浏览器

3. 敲门是否每个交易单元的委托都会去敲？

答复：交易网关敲门是每个网关、每个平台敲门一次

关于敲门的问题，会在新的接口规范开发指南中说明

4. 成交汇总网关作用，是否需要申请成交汇总网关

答复：成交汇总主要是给券商总部使用，让总部可以接收下面各营业部的回报(配置了其他网关分配的交易单元)。基金公司等市场参与者可能也会使用这个业务

5. 申报时返回“20105 网关无权限”怎么处理

答复：20105 是网关上报了不支持的交易单元，需检查下交易单元有没有错，该交易单元是否绑定在这个网关 ID 上

6. 网关启动后闪退

答复：需结合日志定位，建议可搜索”@5@”找到关键日志，可先根据字面意思理解，无法解决可将日志发给相关技术人员

一般的情况有端口冲突(Failure: Failed to create listener)、

配置文件格式错误 (Failed to load tgw config file) 等

7. 一个用户是否可以同时使用 STEP 和 BINARY 协议？

答复：用户可通过调整网关的配置设置网关使用 STEP 或 BINARY 协议。由于一个网关只能支持一种协议，因此，如果用户部分系统使用 STEP 协议，部分系统使用 BINARY 协议，则需要启动不同的网关程序。

8. 使用 BINARY 接口是否会比 STEP 接口性能更好？

答复：STEP 接口的数据最终都要转换为 BINARY 格式，因此 BINARY 接口要比 STEP 接口快，但是扩展性要差一些。建议对于性能要求较高、业务规则较为成熟的业务，如竞价业务，使用 BINARY 接口，对于性能要求不高的业务，如协议交易业务、各类创新业务，可以考虑使用 STEP 接口。

9. 字符串类型字段是否需要补空格？

答复：BINARY 协议字符串类型字段需要在后面（即右侧）补足空格；STEP 协议不需要补空格（补空格也没问题）。

10. BINARY 协议应该使用哪种字节序？

答复：应使用网络字节序（big-endian）。

11. 解析 FAST 的时候是否需要先加载模板，再根据模板解析 FAST？

答复：是的。解析时要先从 FAST 流中解出模板 ID，再根据模板 ID 找到模板，之后再解析后续的 FAST 数据。

12. 行情 STEP 接口中，一条 STEP 消息是否会包含多只证券的数据？

答复：行情 STEP 接口中，一条 STEP 消息可能会包含多条 FAST 消息，因此可能包含多只证券的数据。在收到一条 STEP 消息时，应

该重置一下 FAST 解码的上下文。

13. STEP 接口中, logout 后, 再次 logon 时, 其会话的序列号会重新从 1 开始, 这种现象是否正常?

答复: STEP 接口使用 LFIXT 协议, 再次登录会从 OMS 登录消息中填写的下一个期望的 ID (NextExpectedMsgSeqNum) 开始, 如果未提供则从 1 开始。

14. STEP 协议登录消息中 DefaultApplVerID 字段应如何填写?

答复: 按接口规范要求填写。

DefaultApplVerID=9

DefaultApplExtVerID=124

DefaultCstmApplVerID=STEP1.20_SZ_1.00

注意: DefaultCstmApplVerID 应填写为 STEPn.xy_SZ_a.bc 格式, 其中 n.xy 为 step 协议版本, a.bc 为数据接口规范版本, 当前应该填写的版本号为 STEP1.20_SZ_1.00, 表示使 1.20 版本的 STEP 协议和 1.00 版本的数据接口规范。

15. SenderCompId 字段应如何填写?

答复: SenderCompId 可以自行填写, 要求为非空字符串。

16. STEP 方式和 BINARY 方式的登录消息中的用户名和密码为可选项, 是否可以不填写?

答复: 登录网关是否需要身份验证, 可由用户自己决定。将网关配置中的 <password> 配置为空, 则就不会检查了, 否则就会检查。

17. STEP 协议消息里面的 MsgSeqNum 域, 每次都是从 1 开始吗? 以后

应该不是这样吧，应该有一个记录值吧？现在每次登录过去之后都是从 1 开始的。

答复：目前协议规定每次都从 1 开始的

18. 一个会话是否可以建立多个 TCP 连接？

答复：不可以。

19. 用户 logon 成功后，收到 logout 消息，在重新登录时，是否一定要关闭当前 TCP 连接，建立新的 TCP 连接再 logon，复用原来的 TCP 连接可不可以？

答复：需要关闭当前 TCP 连接，不可以复用原来的 TCP 连接。

20. 如果用户系统收到 logout 消息后，在不关闭 TCP 连接的情况下，是否还有心跳机制存在？

答复：收到 logout 消息后，心跳机制不再存在。

21. 行情网关日志显示“SyncOnlineCfg@647@0101000@Online config not arrived, continue to synchronize online config ...@”是什么原因？

答复：出现该日志信息是因为行情网关还没有从交易系统完成配置同步，需要确认行情网关的管理通道（即 cfg/config.xml 中 <admin_service>项目）的通道地址是否为交易所指定的地址，确认接收数据的网卡地址是否和管理通道的 IP 地址在同一个网段，如果这两项配置都正确，则当线上配置同步完成以后，上述日志就会消失。如果一直提示，说明管理通道对应的组播地址不通，请关闭 Windows 防火墙，并请联系用户的网管人员检查网络配置，

保证允许不超过 8K byte 的组播包通过。

22. 行情网关日志显示“mdgw has not been authenticated by server, discard received message”是什么原因？

答复：显示该日志是因为网关没有得到服务的授权，需要检查配置的 resend_service 地址是否为交易所指定的地址，网关 ID 和密码是否正确。

23. 登录网关后为什么很快就超时断开？

答复：网关的连接心跳及超时时间是根据用户登录消息中相关字段的值进行设置的，请检查登录消息中是否正确填写这些字段。

24. 向交易网关报单时为什么会出现“Session {1}({2}) is not logged yet”错误？

答复：OMS 在发送登录消息后，应在收到登录响应后才可以开始发送业务消息。

25. 闭市后网关还会给客户端发送心跳包吗？

答复：会的。只要与网关建立连接，在没有数据时就会发送心跳包。

26. 行情网关 cfg 目录下的 mdgw_channel_list.xml 、mdgw_realtime_line_list.xml 有什么用？

答复：这些是网关私有配置文件，可用于协助查错，用户不需要进行修改。

27. 网关启动后一直提示“Connecting Timeout. Reconnecting after 10 seconds...”是什么原因？

答复：提示该信息是因为交易系统尚未启动。

28. Windows 网关应安装 64 位还是 32 位的 VC2012 发布包？

答复：Windows 网关应安装 32 位的 VC2012 发布包。

29. 回报同步消息中的回报顺序号应如何填写？

答复：回报同步消息中的回报顺序号说明了 OMS 想从哪笔回报开始接收（从 1 开始连续编号）。如果不发送回报同步消息，默认为不需要接收回报。如果发送的话，回报顺序号字段应填写为正整数。回报顺序号每个交易日都会从 1 开始重新编号。

30. 回报同步消息（Report Synchronization）是否只有在需要重新获取某段执行报告时才需要发送？

答复：OMS 每次登录时都应该发送回报同步消息，交易网关只有在收到回报同步消息后才会继续发送回报。

31. OMS 在发生故障灾备切换后，如何收到之前的成交数据？

答复：灾备切换时，可以通过应用层消息恢复机制重新收取丢失的成交回报数据。

32. 如果多个交易网关都配置了同一个交易单元，该交易单元对应的回报会返回到哪个网关？

答复：回报会发送给所有配置了该交易单元的交易网关。

33. 交易网关应如何配置才可以实现热备？

答复：可以安装两个或多个交易网关，为这些交易网关指定相同的交易单元，就可以保证这些交易网关收到的回报顺序一致。同一个交易单元的委托可以通过任一交易网关进行申报，这些交易

网关都会收到相同的回报，从而可以实现热备。

34. 是否可以在一个交易网关上同时开展多个平台的业务？

答复：可以。一个交易网关可以同时支持多个业务平台，可以在交易网关的配置文件中指定每个平台的监听地址和端口，OMS 通过连接相应的地址和端口来开展对应平台的业务。OMS 可以同时建立多个连接开展多个平台的业务。

35. 交易网关中的 platform_list 交易平台的定义，是不是严格要求 OMS 对应的业务一定要送到对应的平台？

答复：是的。业务与平台有严格的对应关系，业务的指令要送到对应的平台，否则会被拒绝。

36. 交易网关配置文件中的 platform 对应的端口是否必须固定为 8019, 8020, 8021, 8022, 能否自行设置？

答复：8019, 8020, 8021, 8022 为默认配置，其中 8019 对应现货平台，8020 对应综合金融服务平台，8021 对应非交易平台，8022 对应衍生品平台。端口可以自己配置，但为了方便以后定位问题，建议尽量使用默认配置。

37. 交易网关上，一个业务平台是不是只能监听一个端口？一个网关上是否可以配置两个相同的业务平台，监听 2 个端口？

答复：不能，平台是通过端口进行区分的，两者是一一对应的关系。

38. 多条重传请求的话，是否一定要等前面一条重传结束之后再发下一个请求？

答复：不需要。但由于服务器端是一条一条处理的，所以用户需要考虑发送缓冲区满的场景。

39. 个股期权报盘的时候委托发送消息时间为什么会晚于回执的消息时间？

答复：交易网关发出消息的发送时间取的是交易网关所在服务器的本地时间，不是交易系统的时间。因此如果该服务器的时钟不准就会导致消息中的发送时间不正确，但对业务没有影响。

40. 行情网关日志中出现如下信息是什么意思 “Channel **** is not accepted in line_group ****, discard this fragment@” ？

答复：行情网关没有配置接收该频道的数据。

41. 行情网关日志中出现如下信息是什么意思 “Channel 2051 packet 539221 fragment 0 is not expected, expecting packet 539130 fragment 0 或 Channel 2051 lost packets from 539130 to 539220@” ？

答复：行情网关数据接收过程中发生乱续或丢包。

42. 行情网关返回的重传消息的作用是什么？

答复：主要是指本次重传的结果，其中最主要的两个状态为完成和部分完成。完成表示请求的所有数据全部完成重传。部分完成，则表示还需要根据返回的 endseqnum 继续请求后续的数据。

43. 联网测试环境行情网关部署在虚拟机上，交易系统是否可以部署在本地？

答复：由于联网测试环境带宽限制，如果行情网关部署到虚拟机

上，则本地交易系统也需要部署在虚拟机上。

44. 一个交易网关只能对应一个交易单元？

答复：一个交易网关可以配置多个交易单元。不同的交易网关可以使用相同的交易单元。

45. 一个交易网关能同时处理多个不同的业务吗？

答复：一个交易网关配置多个端口号，用于处理多个平台的业务。报单工具可以通过连接交易网关的某个端口号处理对应的业务。

46. 一个网关可以配置几个网关号？

答复：一个网关只能配置一个网关号。

47. 网关号由交易所分配，还是券商自己定义？

答复：网关是券商向交易所申请的，交易所向券商分配网关号。

48. 同一个交易单元的订单可以通过不同的会话发过去吗？

答复：同一个交易单元的订单可以通过不同的会话发过去。

49. 一个交易网关可以为同一个平台建立多个不同的会话吗？

答复：目前一个交易网关只能配置一个网关号，一个交易网关在同一时间内只能在同一平台上建立一个会话，不可以同时在一个平台上建立多个不同的会话。

50. 同一个交易网关可以分业务后同时开两个吗？

答复：不可以，不允许同一交易网关登录服务器多次。

51. 预售要约报单为何被拒绝“45=71858=Failed to convert step message(type:D, seq_num:718), ec:COMMON:190010, Invalid message error. 372=D380=29999”？

答复：构造的 STEP 消息有误，交易网关协议转换时业务拒绝了，针对协议转换失败的情况，都会发送会话拒绝，并在 Text 字段中注明转换失败原因。

52. 请问自营和经纪需要开两个交易网关吗？

答复：如果是同一个平台就要开两个交易网关，但要把监听端口错开。

53. 请问成功登录交易网关后因程序问题异常退出，没有来得及退出登录交易网关，下次程序启动，再次请求登录，会有“已登录”的问题吗？如果发现已登录了，那本次不再登录了，直接进行交易，会不会有问题？

答复：再次连接时还是需要重新登录。如果出现已登录的情况，可以稍等一下再重试。网关在 OMS 登录请求时设置的超时时间之后会自动登出有问题的 OMS 的。

54. STEP 消息现在是否校验了消息体长度域，现在登录的时候，日志显示“@WanM ERROR@Connection to [192.168.100.108:14864] closed. SSCC_WANM error DATA_LEN_INVALID, detailed error info: Data Length of Message Exceeds Length Upperlimit”，请问这个长度上限是多少，是否每个消息类型都有一个长度上限？

答复：Data Length of Message Exceeds Length Upperlimit 一般是由于配置的协议和实际发送的消息不符造成（如网关配置为 BINARY 协议，但发上来的消息却是 STEP 协议的消息，可检查发

送的消息是否也为 STEP。另外，在使用 BINARY 网关时如果出现该错误，可检查程序是否做了网络字节序转换。

55. 请问一个交易网关下能挂多少个交易单元？

答复：没有硬性限制。

56. 请教交易网关日志 “sscc_wanm error ok, detailed error info:forcefully” 是什么意思？

答复：交易网关强制断开连接。

57. 期权全真测试，对于部署网关使用的机器有没有特殊要求？之前的测试有要求是 Windows 7。

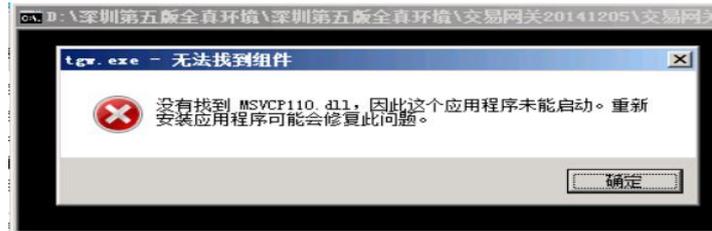
答复：深圳证券交易所股票期权全真测试环境接入测试方案已经共享在群文件里，并且通过邮件发给各券商技术负责人和技术接口人，请各券商根据测试方案搭建自己的股票期权全真测试环境，并接入深交所的股票期权全真测试环境。

58. 如果有专线的话，第四版交易系统的接入是不是可以直接走专线了，还是说也要用以前的那个 VPN 连接过来？

答复：可以。

59. 请问一下网关可以放在 Windows 2008 R2 64 位服务器上运行吗？

答复：可以装在 64 位操作系统上。但在 64 位操作系统上也是安装 32 位的运行时库。如果没有安装 32 位的运行时库，则会出现如下运行时错误。



60. 两个交易网关如果都配置了相同的交易单元，比如 A 网关使用平台 1，B 网关使用平台 2，通过 A 网关往平台 1 委托了，那么回报信息是否会从 B 网关的平台 2 回来？

答复：不会。

61. 所谓网关的交易单元，是 4 个平台共用的吧？

答复：网关这边不对交易单元使用做限制，依赖于业务上是怎么约束的。

62. 在联网测试环境上测试融资融券业务时，返回网关对交易单元无权限，需要如何申请？

答复：网关对交易单元无权限指的是所使用的交易单元没有配置到网关上。在申请网关时都要提供交易单元列表的，如果要变更也要提一个变更申请。但这个问题最可能的原因还是用错了交易单元或连错了网关，或者是消息错位了，交易单元字段填写错了。

63. 关于 EKey 数量，如果申请两个的话，两个都要收费吗？备用的是否收费？

答复：都要收费。

64. 申请交易、行情、文件网关的时候，都有一条硬件 EKey，每一个网关都是单独的一个 EKey 吗？

答复：每一个网关都需要一个 EKey。

65. 全真环境几个问题

- 1) 是不是一个 EKey 对应一个网关 ID?
- 2) 一个网关 ID 是不是不能同时起多个?
- 3) 一个网关 ID 是不是只支持一个客户端接入?

答复:

- 1) 是的。
- 2) 是的，不能同时启动。
- 3) 交易网关支持四种平台，每种平台只允许一个客户端接入。

66. 如果同一台服务器部署 2 个网关，就要插 2 个 Ekey?

答复：一个网关至少有一个对应的 Ekey。

67. 比如申请两个交易网关，全真测试期间是否可以先只启用一个?

答复：可以。

68. 在深交所会员专区办理“网关开通”时，有个必填项要填写网关对应配发的 EKey 号，现在新申请的网关都没有配发 EKey 号，怎么开通网关?

答复：用户在办理开通时，“EKey 号”填成网关号就行了。

69. 全真环境网关现在是可以按联网测试的时候的吗？还是得深证通反馈了新的网关号才能连？

答复：全真环境需要用新申请的网关号连接。

70. 以后全真环境使用 EKey 的话，一台机器同时允许多个 EKey 吗？

答复：允许，一个网关至少有一个对应的 EKey。

71. 请问现在申请期权全真模拟环境的做市商专用交易单元到时候上

线直接转生产呢还是可以再调整？那到时候上生产做市商交易单元也可以再调整？

答复：这次申请到的交易单元以后可以直接用于生产，也可以再调整。

72. 如何处理网关未开通导致连不上的问题？

答复：网关需要开通。相关文档中有描述：会员单位取得新分配网关号码后，应通过“深交所会员业务专区”网上申请开通交易单元的期权交易权限，并申请在已申请的交易通信网关上配置上述交易单元。全真环境的用户请按全真环境配置行情网关：使用新的网关 ID（ID 以 W 大头），环境号 env_id 设置为 1，管理通道地址请配置为全真环境的通道。

73. 交易网关 ID W000030Y0001，连接的交易网关地址： 172.25.0.71 7019 和 172.25.128.71 7019，显示报错信息为：

```
2015-01-13 11:17:51.428737 2 [0x00000588] sssc::gateway::CsConnection sssc::gateway::CsConnection::HandleLogout@451@0130003@Received logout message, code: 12, Gateway is not opened or disabled@Connection 3219752 of tag W000030Y0001 from gateway W000030Y0001 to 172.25.0.71:7019 connected at 2015-01-13 11:17:49.494003
2015-01-13 11:17:51.646749 2 [0x000006c0] sssc::gateway::CsComm::WanM sssc::gateway::CsComm::Log@505@0130909@WanM ERROR@Connection to [172.25.0.71:7019] closed.
SSCC_WANM error RECU_FAILED, detailed error info: End of file
2015-01-13 11:17:52.542801 2 [0x00000588] sssc::gateway::MessageHandler sssc::gateway::MessageHandler::HandleMessage::boost_se_guard_t_22::boost_se_body@64@010112@CsConnection#3219752 thread stopped@
2015-01-13 11:17:53.382849 2 [0x00000770] sssc::gateway::CsComm sssc::gateway::CsComm::OnConnectionClose@451@0101000@CsConnection 3219752 of tag W000030Y0001 to 172.25.0.71:7019 is closed. WanM error code: 13:End of file. Reconnecting after 10 seconds...@
```

答复：交易网关未开通。

74. 新一代交易系统，一个交易单元是否可以配置到不同的交易网关，并且同时做交易报盘？

答复：可以，交易单元和交易网关是多对多关系。

75. EKey 是用来仿真测试的还是要上生产的？如果用来做仿真测试，那得更换实体机了，虚拟机可以用 EKey 吗？

答复：全真环境以后用启用 EKey，这个 EKey 以后直接用于生产环境。不建议全真环境使用虚拟机，不建议全真环境和仿真环境混合部署。

76. 申请开通网关和开通网关期权权限是一回事儿吗？

答复：开通网关并绑定交易单元和开通交易单元的期权权限是两件事情，需要单独申请。

77. 参加期权和新一代交易系统测试必须申请新的线路吗？

答复：提供两种方式：1) 专线接入，将系统部署在贵司；2) 如果有设备托管在深证通机房，可以将系统部署在这些设备，不用再申请专线。

78. 行情网关有网络版和现场版有什么区别？

答复：现场版网关适用于具有单向通信线路的场景，如通过卫星网络接收行情。网络版网关适用于具有双线通信线路的场景，如通过地面网络接收行情。网络版和现场版网关都是通过组播发送实时行情数据。当发生组播数据丢失时，网络版网关可以通过 TCP 线路重传丢失的数据。另外，网络版网关需要做身份验证，只有有权限的用户才可以使用网络版接入。

79. 请问交易网关，行情网关都可在 Windows 环境下部署吗？

答复：可以。

80. 请问交易网关，行情网关支持什么样的 Windows 版本

答复：32 位或是 64 位 Windows 7、Windows Server 2008 及以上版本。由于微软在 2015 年即将停止对 Windows 2003 的常规支持，因此，新一代交易系统不再考虑支持 Windows 2003。

81. 行情网关包括哪些组播地址？

答复：行情网关使用的组播地址分为两大类：1) 用于发送管理数据的组播地址，配置于 config.xml 中；2) 用于发送实时行情数据的组播地址，存储于 cfg/mdgw_realtime_line_list.xml 中。

82. 如何区分行情数据是否为重传数据？

答复：重传会话上收到的数据即为重传数据。

83. 如何查看网关的版本？

答复：tgw --version 或 mdgw -version。

84. 网关是否会提供图形界面？

答复：会提供网页版的界面。

85. “空串表示公告概要”，在 BINARY 方式下，公告概要的 NewsID 应该是 8 个空格吗？

答复：是。

86. 行情网关日志显示“Gateway'***' not configured”是什么意思？

答复：该行情网关尚未开通。

87. 一台物理机最多可以插几个 EKey？

答复：软件上没有限制。

88. 请问第四版交易系统网关如何申请？

答复：为第四版交易系统申请交易单元，查看以下链接

<http://www.szse.cn/main/rule/jysywzn/dlcsxt/zxtz/>

89. 全真环境最新的行情和交易网关程序在哪里获取？

答复：接入网关程序通过 Windows 文件共享从 172.16.100.99 下载。

90. 网关监控显示行情网关“未连接服务器”？

答复：

- a) 请先确认 ResendService 对应的服务器地址是否可达；
- b) 确认自己使用的配置是否与所属的测试环境以及产品对应
- c) 可向深证通运行热线确认在本环境、本产品下网关 ID 是否开通

91. 行情网关日志中有 Gateway ‘***’ not configured 字样的错误日志？

答复：

- a) 说明网关 ID 尚未开通
- b) 可向“深证通运行热线”确认在本环境、本产品下网关 ID 是否开通

92. 出现如下类似日志

```
Realtime line 9901 socket 232.2.101.29:6211 interface 10.12.140.17 source 172.29.0.45 timeout, error_code system:0@ ?
```

答复：

- a) 1、确认关闭系统 windows 防火墙
- b) 2、请你的网管人员按照网络接入部分进行排查
- c) 3、如果依然超时，请咨询“新一代接入网络”热线

93. 多个系统是否可同时接入同一个网关？

答复：

- a) 多个系统同时接收同一频道的行情，不可以通过同一个网关接收，解决方式如下：

方式 1、申请多个网关

方式 2、内部自行转发

- b) 多个系统分别接收不同频道的行情，可以通过同一个网关接收，配置方式：

在 access_user 中按频道配置不同的端口即可

频道配置支持通配符*和？，详情参见手册

94. 同一个网关 ID 是否可以同时运行在多个服务器上

答复：不可以

95. 同一个网关 ID 是否可以同时绑定多个 IP 地址段

答复：可以

96. 部署多个行情网关时，是否需要单独为每一个网关单独再拉 6Mbps 或 10Mbps 线路

答复：同一产品部署多个网关，不需要额外增加带宽（行情为组播）。但重传服务的 TCP 线路的带宽是叠加的。

97. 行情网关包 FragQ Full, Update heartbeat timer?

答复：该日志是警告日志，一般是接收端处理速度跟不上导致的。

98. 行情网关监控界面服务器端和客户端数据不一致？

答复：网关启动后即开始记录从服务器端收到的消息数，客户端数据是用户技术系统接入期间才开始计数的。因此，服务器端数据与客户端的数据会有差异。用户系统连接时机以及重启都会导致服务器端和客户端数据不一致。

b) 文件网关

1. 未来卫星是否也可以收到静态文件？还是说必须通过文件网关？

答复：新一代交易系统静态行情文件都通过文件网关下发，不再通过交易网关、行情网关下发；而卫星只是一种传输网络通道，文件网关可以应用于 TCP/IP 通信网络。

2. 请问文件网关可在 Windows 环境下部署吗？

答复：文件网关可以运行在 Window 2008 64 位、Window 2003 32 位、Win7 64 位上。

3. 文件网关将文件接收到临时目录./tmp 原因？

答复：全真环境文件网关收深交所文件存放在 temp 目录的问题，是由于收发双方的传输规则不匹配所导致的，请用户按深交所统一安排，将传输规则名称修改为“szse_marketdata”。在文件网关界面的菜单导航里“传输规则配置”菜单中修改。联调测试环境的传输规则名称为“联网测试用户”。

4. 全真环境文件网关上 N4999X0001 显示不在线，是正常的吗？

答复：联调测试环境深交所是 N4999X0001，而期权全真测试环境深交所是 W000000X0001，需区分开。

5. 全真的文件网关的业务类型是“联网测试用户”还是什么？

答复：全真环境是“szse_marketdata”；联调测试环境是“联网测试用户”。

6. 请问文件网关登录后出现“客户端后台与中枢连接失败”是怎么回事啊？

答复：客户端由客户端后台+监控终端组成，如上出现以上提示，表明后后台与中枢服务器无法建立连接，检查网络、用户 ID、密码、证书配置信息是否正确。

7. “ UCom<PreReg> ConningFailed linkid[05000000] myip[] myport[0] peerip[172.25.128.244] peerport[7016] , will wait[15s] to connect next addr[172.25.128.246:7016], and try 1 times” ，全真环境连接文件网关连不上，telnet 端口不通，但 tracert172.25.128 能看到已经进到深交所网络环境了？

8. 答复：文件网关分指令连接、数据连接，其中指令连接使用 7015 端口，数据连接使用 7016 端口，其中指令连接是长连接，数据连接是短连接，一般指令连接 IP 配置在 fxapi.ini/IpPortMap 段前面，数据连接配置在后面，出现以上提示，原因是网络不通或配置有误。

9. 文件网关一直报登录失败。检查 fxapi 的配置文件，4 个 IP 地址都能 ping 通，端口 telnet 成功，请问有可能是是什么原因？

10. 答复：fxclient.ini 里的用户 ID、密码、证书配置正常后，才能连上中枢。

11. 全真环境，文件网关收下来的文件放的路径还是“日期+a”的格式吗？

12. 答复：目前还是全部展开的，经过前期需求调研，后续所有静态行情文件都会在同一目录展开。

13. 全真测试环境与联调测试环境配置参数有何不同？

答复：文件网关全真环境用户 ID 以及深交所 ID 都已修改：1) 在文件网关的 FxTerm 界面里菜单导航“对端连接人信息配置”将深交所 W000000X0001 加为对端连接人；2) 通过“传输规则配置”将原来传输规则改成：szse_marketdata，设置接收目录。联网测试环境，深交所 ID 是 N4999X0001，业务类型为“联调测试用户”。

14. 文件网关如何监控？

答复：

1、提供带界面的 FxTerm 程序；

2、输出文本的监控接口，可以较方便集成到第 3 方监控程序，

打开 fxclient.ini 监控选项：“StartMonitor”=“1”，可将系统状态、文件任务收发输出到文本监控接口中，文本监控接口格式参考用户手册

15. 文件网关是否支持线路备份？

答复：

支持，可在 fxapi.ini 的 [IpPortMap] 段中，做多组映射：

“172.25.128.244:7015” = “电信:7015”

“172.25.128.244:7016” = “电信:7016”

“172.25.128.244:7015” = “联通:7015”

“172.25.128.244:7016” = “联通:7016”

16. 文件网关与深证通增值业务使用是否同一套？

答复：不是同一套，中枢服务器不同，针对深交所业务单独部署了一套，此套程序部署在交易网，与深证通增值业务另一套区分开，增值业务另一套部署在增值业务网，两套不能混用。

c) DCOM

1. 请问开通期权结算账号，现在是不是还需要提交《深市仿真测试期权结算参数申报表》之后，才能开通？

答复：不需要提交《深市仿真测试期权结算参数申报表》了，可直接通过 DCOM 进行期权合约账户开户

2. 请问开户时 DCOM 报流水号首位标识符错误，这是什么原因？

答复：DCOM 网关配置中，分组配置中，取消流水号首位标识符检查的复选框，就不会报这个信息。

3. 请问期权测试的 DCOM 终端现在能查询到衍生品账户资金余额等信息吗？

答复：只能查余额，其他字段界面还没改过来。

4. 测试环境的深圳 DCOM 在哪里下载的，是不是不支持 64 位的

Windows 2008 操作系统？

答复：下载地址和方法请查看测试通知，支持 64 位 Windows 2008。

5. 用 1208 的 DCOM，这个应该可以收期权的结算文件和第四版证券的结算文件吧？全真开始测试之后，客户有期权交易又有现货委托，DCOM 要从两个环境分别接收数据么，从列表看就是 168 和 60 的地址，DCOM 应该可以连某一个地址，同时接到期权（全真业务演练环境）和现货（全真业务演练环境）的清算文件吧？

答复：收哪个环境的结算文件，主要看连接的 DCOM 主站地址是哪一个。目前，专线和 VPN 应该均可以接入以下地址：

10.90.1.165 期权出入金等测试的 DCOM 主站

10.90.1.166/167 结算优化测试的 DCOM 主站

10.90.1.168 期权 全真业务演练环境的 DCOM 主站

10.90.1.60 传统业务（平时做非担保交收等测试）

6. 如果深圳股票期权测试出金入金时，DCOM 有提示，是否要升级 DCOM 网关程序？

答复：是的，需要使用新版的 DCOM 网关，请查看群里的《关于开展深市股票期权模拟交易出入金相关测试的通知》，附件中有下载 DCOM 网关程序的方法。

7. 安装完 DCOM.20141121.install.rar，启动报以下错误，



是什么原因？

答复：操作系统是 64 位的，64 位操作系统需要 64 位版本的 DCOM 网关。

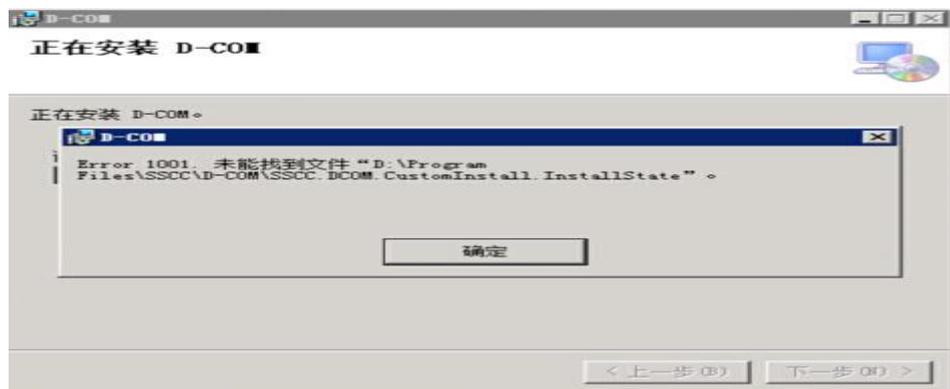
8. 请问 DCOM 软件可以在一台服务器上装两个么？

答复：不能，每台机器只能安装一个。

9. 期权模拟环境，现在可以通过 DCOM 做期衍生品合约账户开户吗？

答复：测试环境不进行开户业务测试。

10. 操作系统：Windows 2003 DCOM: 20150106 ，安装 DCOM 报了这个错，请问是什么原因？



答复：安装新版本前，不要删除或者重命名原有版本的目录。

11. 请问如何查询合约账户是否开成功？发送的 fjybs 显示成功，fjyqr 也收到了。想确认下是否真的开成功了？

答复：现在开户都是自己开的，不是纸质申报的，通过 fjybs 申报。具体说明请在业务专区下载。

二、 交易

1. 新订单主动撤单成功时，撤单数量如何确定？

答复：新订单主动撤单成功时，返回撤单成功执行报告，撤单数量为 OrderQty 减去 CumQty。

2. 是否所有类型 ETF 的申购赎回订单通过非交易处理平台申报？

答复：是的。

3. 成交编号 ExecID 是全市场唯一，还是每个交易单元唯一？

答复：成交编号 ExecID 在一个交易日内是全市场唯一的。

4. 成交编号 ExecID 字段可能会有非数字的字符吗，编号规则是什么？
执行编号和成交编号有区别吗？

答复：执行编号就是成交编号，编号包含数字+字母，不公布编号规则。

5. 在平台未开放阶段申报的委托被拒绝之后，OMS 可否仍然用原有的消息 ID（流水号）来重发委托？

答复：可以。

6. 委托消息 ID（流水号）的唯一性是如何要求的？

答复：一个交易单元对同一业务一个交易日内申报的所有委托消

息 ID（流水号）不能重复，应用标识 ApplID 前两位相同的委托属于同一业务，交易系统会拒绝委托消息 ID（流水号）违反唯一性要求的委托。关于委托消息 ID 唯一性的详细说明可参考《深圳证券交易所第五版交易系统接口规范开发指南》。

7. 委托消息 ID（流水号）是否有递增要求？

答复：无递增要求。

8. 撤单请求被拒绝时，返回的撤单拒绝消息中的 OrdStatus 域在什么情况下会是 New（0）？

答复：撤单拒绝消息中的 OrdStatus 域反映的是被撤委托的当前状态，当被撤委托当前状态是 New（0）时，并且业务规则上规定了不允许撤销时，返回的撤单拒绝消息中的 OrdStatus 域取值就是 New（0）。

9. 业务拒绝消息（Business Reject）什么情况发生，与一般的回报消息中的拒绝有什么差别？

答复：在委托字段取值不符合接口规范要求、非平台开放时间申报委托、证券代码不存在、对证券申报不合理的业务（比如对股票代码申报 ETF 申购赎回委托）等情形下，交易系统会以业务拒绝消息来拒绝委托；其他因为不满足风控要求的委托一般都是通过执行报告等响应消息来拒绝，比如股份卖空、交易单元权限不足、账户非法等。一笔委托如果收到了业务拒绝消息则不会再收到其他回报消息。

10. 平台状态消息（Platform State Info）控制申报状态，如何保

证物理位置分散的 OMS 系统时间上无差别的获取到平台的状态变更？

答复：无法保证物理位置分散的 OMS 系统时间上无差别的获取到平台的状态变更，但是在平台开放前会提前（暂定 3 秒）发出“平台即将开放”的状态消息，OMS 收到该状态后即可以尝试申报委托，不需要等待收到“平台开放”的状态消息后才开始申报委托。

11. 撤单请求消息中的 OrderID 域是否必须填写？

答复：不是。

12. BINARY 交易接口中不需要填写的字段如何填写？

答复：不需要填写的字段如果是数值型的则填写 0，如果是字符串型的则填写全空格。

13. BINARY 交易接口中委托消息的扩展部分是否可以不填写？

答复：视业务不同委托消息会有不同的扩展部分，也可能没有扩展部分，具体请参见消息后面的注释说明，对于某一项业务如果定义了扩展部分，则在申报委托时必须填写。

14. BINARY 交易接口，证券账户字段的类型是 char[12]，在填写时需要在后面补 2 个空格，STEP 接口中是否仍然可以只填写 10 位？

答复：STEP 接口中仍可以只填写 10 位。

15. 报价成交后是返回执行报告消息吗？

答复：是的。

16. 报价如何撤销？

答复：报价的更新和撤销仍然通过报价消息进行，具体请参考接

口规范中报价消息后的注释说明。

17. 报价消息的消息 ID (流水号) 是哪个域?

答复: 报价消息的 QuoteMsgID(tag#1166) 域即表示消息 ID, 在报价产生成交时, 返回的执行报告中的 ClOrdID 即填写的是报价消息的 QuoteMsgID。

18. 融资融券强平委托如何申报?

答复: 申报融资融券平仓委托时, 将 OwnerType (tag#522) 填写为 102 (会员发起) 即表示强制平仓。

19. 一笔订单通过交易系统前端检查并且进入撮合系统立即成交或撤单的是否还有 New 执行报告?

答复: 会有 New 执行报告。

20. 交易接口中的平台状态消息会在什么时间发送?

答复: OMS 每次登录成功后会发送一次, 每当平台状态变化时也会发送。

21. 在预开市的时候发送委托, 交易所是回业务拒绝消息还是回报消息?

答复: 如果委托是符合接口规范, 则回执行报告; 如果不符合接口规范, 则回业务拒绝。

22. 对于无委托成交的回报数据(例如原 SJS HB 中的 PB<黄金 ETF 实物申购份额的回报记录>、PS<黄金 ETF 实物赎回份额的回报记录>业务类别), 回报时的 MsgType 和 ApplID 是如何定义的, 而且其是否能和 ETF 基金申购赎回的消息 KB、KS 区分开?

答复：使用 ApplID 来区分（可参见 STEP 接口规范 3.2 节），如黄金 ETF 实物申赎采用新订单申报，ApplID 为 220（只能由上海黄金交易所申报），其回报为执行报告消息，ApplID 为 220；ETF 申赎采用新订单申报，ApplID 为 120，其回报为执行报告消息，ApplID 为 120。

23. 质押式回购交易申报和债券分销申报对应第四版交易系统的哪种申报？

答复：质押式回购交易订单申报对应第四版交易系统以 1318xx 回购代码申报的 OB、OS 委托；在新一代交易系统以 1318xx 回购代码申报交易委托时，ApplID 必须填写 020。债券分销订单申报对应第四版交易系统以 1016xx，1017xx 债券分销代码申报的 OB、OS 委托；在新一代交易系统以 1016xx，1017xx 债券分销代码申报时，ApplID 必须填写 030。

24. 从交易系统发送暂停开放的平台状态消息到 OMS 收到该消息会存在一个时间差，这个时间差收到的委托会被交易系统拒绝，那么这笔委托还有效吗？还能不能在交易系统重新开放的时候发送？

答复：委托有效，应在平台开放时重新发送。OMS 申报委托，收到拒绝原因为 '20104'（'平台未开放'）的业务拒绝报文时，须在平台开放后重新申报对应委托。

25. 委托中的 OwnerType 字段应该怎么取值？

答复：经纪业务委托填写 1=个人投资者发起或 103=机构投资者发起；自营业务填写 104=自营交易发起；做市商业业务填写 105=流动

性服务提供商发起；融资融券的券商强平委托和期权交易的券商强平委托填写 102=会员发起。

26. 在测试系统中，证券集中竞价交易限价订单可委托的价格是多少？是否申报成功即可立即成交？

答复：按发布行情的【跌停价，涨停价】范围内申报即可。申报成功的所有限价委托，只有委托价在当前有效竞价范围内的委托才会即时参加竞价（如果没有合适的对手方，也不会立即成交），其他委托价不在当前有效竞价范围内的委托缓存在委托簿中。

27. 期权的市价订单有几种？

答复：期权包括五种市价订单类型：本方最优、对手方最优剩余转限价、市价立即成交剩余撤销、市价全额成交或撤销、市价最优五档全额成交剩余撤销。期权的市价订单的申报方式与现货一致，同时还支持限价订单和限价 FOK 订单。接口规范有详细说明。

28. 经手费率对照哪个字段？

答复：新版接口不再发布费率信息，以交易所网站发布的公告为准。

29. 市价委托剩余撤销时，回来的撤单成交中 ClOrdID 和 OrigClOrdID 分别是什么？

答复：市价委托剩余撤销时，成交中 ClOrdID 是对应订单的 ClOrdID 和 OrigClOrdID 为空。

30. 所有在涨跌幅内的委托是否都会立即成交？如何测试撤单？

答复：所有涨跌幅内的委托不一定会马上成交，如果没有收到

成交执行报告，则表示尚未成交；对于尚未成交和部分成交的订单，可以进行撤单。

31. 个股期权的本方最优委托，收到确认后，什么情况下会又回报撤单成交？

答复：如果当前有效竞价范围内本方没有剩余委托，则本方最优委托会被撤销。

32. 对手方最优剩余转限价委托，一次性撮合后剩余部分作何处理？

答复：剩余部分转限价。

33. 对于市价委托的确认回报返回的 OrderQty、LeavesQty 和 Price 是什么含义？

答复：确认回报的 OrderQty、Price 和原委托的一致，如果委托被接受，则 LeavesQty=OrderQty，否则 LeavesQty=0。

34. 回报消息中的 OrdRejReason 字段，当是确认成功的时候，该字段是否必定为 0？

答复：是的。

35. 对于所有消息中的以下字段

CxlRejReason(Tag=102)

OrdRejReason(Tag=103)

QuoteRejectReason(Tag=300)

BusinessRejectReason(Tag=380)

QuoteRequestRejectReason(Tag=658)

TradeReportRejectReason(Tag=751)

是否都共享接口规范中“委托申报拒绝原因代码”表的值域定义？

对于“业务拒绝消息”的拒绝原因代码是否也涵盖在内？

答复：是的，都涵盖。

36. 哪些业务支持限价 FOK 指令？

答复：目前只有期权业务支持限价 FOK 指令。接口规范有相关说明。

37. 现货集中竞价交易，撤单失败通过 290008 回报，是否说明收到 200102 回报的撤单都是成功的？

答复：是的。

38. OMS 收到了暂停开市之后且未到开市的状态消息时，还会不会从交易所收到回报？

答复：OMS 收到暂停开放、关闭等平台状态消息，只表示交易系统会暂停或停止接收委托，OMS 还有可能继续收到之前委托的执行报告。平台关闭后，OMS 收到回报结束消息才标志着所有回报已完全接收。

39. STEP 协议中撤单请求需不需要申报证券账户？

答复：目前交易系统根据 applid、交易单元和原客户订单编号进行撤单，撤单请求无需填写证券账户。撤单成功的回报里有原委托的证券账户，撤单失败响应则没有。

40. 期权业务开仓订单收到确认，却没有收到成交，是什么原因？

答复：没有合适的对手方，或处于集合竞价阶段，或证券临时停牌，或证券触发断路器。

41. 市价委托，委托和确认 STEP 报文中的 40 都等于 1，成交回报报文中 40 等于 2，这怎么理解？

答复：因为 STEP 报文是根据 BINARY 报文转换而来的，而 BINARY 协议中成交回报报文没有 OrdType，所以 STEP 中成交回报消息的 OrdType 填一个固定值为 2，该字段在成交回报中无实际意义。

42. 本方最优订单的价格是如何确定的？申报本方最优市价订单时，价格字段如何填写？

答复：交易系统接收到本方最优委托时，在当前有效竞价范围内，选取本方最优价格作为其委托价格；如果当前有效竞价范围内本方没有剩余委托，则本方最优委托会被撤销。对于 STEP 接口申报时价格可以填 0.0000 或不填，对于 BINARY 接口可以填 0。

43. 质押式回购质押解押订单只有确认回报吗？

答复：只有确认回报，如果申报被接受了，就表示出入库成功，如果被拒绝了，就表示出入库失败。

44. 收到第一条行情数据 TradingPhaseCode 字段为连续竞价时，后续其他代码的行情数据是否都是连续竞价？

答复：收到第一条行情数据 TradingPhaseCode 字段为连续竞价时，后续其他代码的行情数据不保证都是连续竞价，例如部分证券可能处于临时停牌期间。

45. 成交申报响应（消息类型 AR）中，487（成交申报事务类别）、8912（成交申报响应状态）和 939（成交申报状态）这三个标签的关系是怎样的？

答复：请参考《深圳证券交易所第五版交易系统接口规范开发指南》的“成交申报(TCR)处理回报说明”。

46. STEP 协议中，58 标签（自由文本）设计用作什么用途？

答复：主要给券商自用的标签，交易所在订单确认、执行报告中都原样返回该标签，这样做可以为券商在系统实现时提供灵活性。

BINARY 接口中的 userinfo 字段也是这个用途。

47. 如何区分客户主动撤单成功执行报告和交易所自动撤单执行报告？

答复：客户主动撤单成功的回报，原始订单客户订单编号不为空且拒绝原因代码为 0；交易所自动撤单执行报告，原始订单客户订单编号为空，且拒绝原因代码大于 0。

48. 结算账户和合约账户标识码是否为同一个取值？

答复：是的，深市的合约账户标识码就是结算账号，对应上海的 888。

49. 买数量上限和卖数量上限是否会不同？

答复：目前都是相同的，以后不排除按需求调整的可能。

50. 竞价业务中，哪些委托会反映到行情中？

答复：合法的限市价委托会反映到逐笔委托行情中，正常成交、主动撤单成功和无法即时成交的市价委托撤单，会反映到逐笔成交行情中。

51. 撤单失败响应中的原始订单当前状态有哪些可能的状态？

答复：会有以下几个状态：

- 0-新订单；
- 1-部分成交；
- 2-完全成交；
- 4-已撤销；
- 8-已拒绝。

如果撤单处理过程中找不到原始订单，则原始订单当前状态统一填 8-已拒绝。

52. 申报期权集中竞价订单，回报 20038 错误代码的撤单？

答复：回报中错误代码 20038-无效账户，指的是订单申报中，合约账户标识码字段填写不正确，应当填写为申报交易单元所对应的结算账号。

53. 申报不存在的证券代码，交易所会如何处理？

答复：申报不存在的证券代码，会回业务拒绝。

54. 成交申报响应中的 LastQty 数量字段，在自动撤单时，是代表委托的数量，还是被撤单的数量呢？

答复：成交申报响应中的 LastQty 数量字段，在自动撤单时，是委托数量（此时委托数量=被撤单的数量）。

55. 如何区分是否为交易所强平单？

答复：订单中的订单所有者类型为 101 或 106 时，表示为交易所强平单，同时，强平单成交回报中的订单所有者类型也对应为 101 或 106。另外，如果订单所有者类型为 102，则表示会员发起的强平单。

56. 现在 ETF 期权和股票期权的经手费分别是多少？

答复：2014 年 7 月公布的仿真测试结算方案的费率是，股票期权每张合约 3 元，ETF 期权每张 2 元，具体以公布的方案为准。

57. 双边报价的单边成交后，继续对相同合约进行双边报价，交易所是否会返回对之前未成交的一边的撤单？如果单边成交后，再发双边撤单又会如何处理？双边报价后，是否允许撤销单边？

答复：1) 会。2) 单边成交后，再发双边撤单，会收到报价状态回报，同时，如果单边是全部成交，则还会收到另一边的撤单成功回报；如果单边是部分成交，则还会收到双边撤单成功的回报。

3) 双边报价后，目前暂不支持撤销单边的报价，只能两边同时撤销。

58. 哪些情况下不允许申报期权 FOK 指令？

答复：集合竞价阶段、临时停牌期间与断路器触发阶段，均不允许申报 FOK 指令。

59. 如何做期权备兑开仓？

答复：1) 保证有足够的现货股份；2) 发送期权备兑锁定指令，锁定用于做备兑开仓的现货股份；3) 发送期权备兑开仓指令。

60. 做融资融券业务时，CashMargin 字段应当如何填写？

答复：填 2 表示融资融券开仓，填 3 表示融资融券平仓。

61. 交易网关监听端口与交易系统平台的关系是什么？

答复：8019 对应现货平台，8020 对应综合金融服务平台，8021 对应非交易平台，8022 对应衍生品平台。

62. 期权行权后的持仓何时清除？

答复：目前是交割日注销。

63. 什么情况下会发生重单的错误？

答复：同一个业务（应用标识 ApplID 前两位相同的委托属于同一业务），同一个交易单元上报的订单，客户订单编号必须保证唯一，否则就会重单。

64. 更新单边报价，报 field bid_position_effect error 是什么原因？

答复：报价数量为 0 的一边，开平仓标志必须填空格；报价数量不为 0 的一边，开平仓标志必须填 ‘0’ 或者 ‘C’。

65. 资产管理计划证券类别编码是什么？

答复：资管产品未对外挂牌，对外没有证券类别。

66. 现货证券的加权平均价如何体现？

答复：盘后行情快照会揭示加权平均价。

67. 协议交易的约定号编码规则是什么？

答复：在新一代交易系统中，协议交易配对成交申报的约定号为 8 位字符串，可包含数定、大小字母和空格；与四版交易系统 SJSZHWT 接口中的可申报范围 0~999999 不同。

由于新老接口的约定号取值范围不一样，因此在新老接口兼容期，如果协议配对的双方一方使用新接口申报，一方使用老接口申报时需要注意：

1) 双方商定的约定号只能按老接口来，取 0~999999 的数字；

2) 新接口申报时，只能后补空格，不能前补 0，比如双方商定的约定号为 345，则新接口要按照“345 ”申报。

定价申报行情的约定号由交易系统生成，为 8 位数字，前补 0。申报点击成交申报时，严格按照行情揭示的约定号进行申报。

68. 债券质押式协议回购业务中的 TrdMatchID 与四版 SJSZHHB 接口是如何对应的？

答复：根据四版 SJSZHHB 接口定义，hbyhtxh 字段其前 6 个字符无意义，均为 0，中间 8 个字符为成交日期，后 8 个字符为交易编号。在新一代交易系统中，债券质押式协议回购业务的 TrdMatchID 只启用前 8 个字符，后 8 个字符都为空格，与四版 hbyhtxh 的交易编号对应。

69. 两融担保品提交返回走什么通道？

答复：两融担保品提交返回沿用现行模式，走 D-com 的 fjybs.dbf。

70. 新一代交易系统大宗交易是否还支持 web 端申报？

答复：新一代交易系统与四版一样，还是同时支持交易网关电子接口和 web 交易终端人工下单两种方式。

71. 跨市场 etf 的 pcf 文件是否使用新的 pcf 格式上传？

答复：新一代交易系统，跨市场 etf（不在场内申赎）的 pcf 文件格式保持 txt 方式不变，跨市场 etf（在场内申赎）的 pcf 文件格式则采用 xml 格式，均通过文件网关方式上传，具体的文件交换方式请参照深交所发布的数据文件交换接口规范。

72. 新一代交易系统上线后，点击成交时如何填写对手方交易单元？

答复：新一代交易系统接口不需要再填写对手方交易单元，兼容期四版接口对手方交易单元固定填 0，或按四版行情揭示的对方交易单元填写。

74. 通过四版发送的撤单请求，撤单成功后，如果五版接口接收回报，则订单编号和原订单编号如何填写？

答复：由四版接口上报的撤单请求，通过五版接口回报时，原订单编号填四版撤单请求的流水号，订单编号由交易所分配。建议券商不要做四版实时切换到五版接口的操作。

75. 当五版接口回退到四版时，ETF 实时申赎的 sjshb 记录中，HBDFXW+HBDFGD，给券商发的是新一代成交编号吗？

答复：SJSHB.DBF 中发送给券商的 ETF 申赎记录，因为 HBDFXW、HBDFGD 目前已被占用，所以不能提供新一代交易系统的成交编号。因为新一代交易系统的 ETF 申购赎回成交回报是通过一笔消息下发的，因此券商柜台系统不会出现部分处理的情况，所以在切换回四版接口时，可以根据委托状态来过滤掉已处理过的 ETF 申购赎回的回报。

76. 新一代交易系统上线后，分级基金实时分拆合并业务是否同时启用？

答复：新一代系统上线后，实时分拆合并业务还是通过结算的盘后基金接口申报。实时分拆合并业务的正式启用，以业务方案的通知为准。

77. 五版已申报的订单，再通过四版申报会报重单吗？

答复：会，同一笔订单通过五版接口上报之后，再通过四版接口上报，只要申报交易单元和客户订单编号是重复的，第二笔会因为重单被丢弃，没有回报。

78. 转托管业务进行全部转托管时，返回的订单被接受的执行报告中，转托管数量为 0，不返回真实托管数量，这样正常吗？

答复：全部转托管时回报返回 0 属正常情况，目前处理与四版保持一致。

79. 定价申报的约定号如何填写？

答复：定价申报约定号无意义，填写只要符合接口规范即可（建议填全空格），最终由交易所为其分配约定号。

80. 网络投票的投票数量如何填写？投票是否有效如何判断？

答复：交易系统不对数量作检查，对于非累积投票议案，只需填写投票意向；对于累积投票，只需填投票数量，投票数量不能超过账户的表决权数。可通过接收交易系统收市后下发的投票结果库确定最终的投票有效性。

81. 正常通过四版申报的委托，SJS HB 中的 HBDFXW 和 HBDFGD 是否会下发五版的成交编号？正常通过五版申报的委托，如果通过四版收回报，SJS HB 的 HBCJHM 会下发四版的成交号码吗？

答复：正常通过四版申报的委托，SJS HB 中的 HBDFXW 和 HBDFGD 会下发五版的成交编号；如果这两个字段本身已被占用，则不会下发五版的成交编号。正常通过五版申报的委托，如果通过四版收回报，SJS HB 的 HBCJHM 会下发四版的成交号码。

三、 行情

1. 现场版行情和网络版行情有什么区别？

答复：现场版行情按固定频率对外发布包括行情快照、指数快照、统计量指标快照。网络版行情包括行情快照、指数快照、统计量指标快照、逐笔委托、逐笔成交、委托排名、成交排名等内容，其中行情快照、指数快照、统计量指标快照、委托排名、成交排名按固定频率对外发布，逐笔委托、逐笔成交以即时方式对外发布。

2. 集中竞价行情快照中的买卖盘档位的顺序是怎样的？

答复：买卖盘档位的顺序不作保证，接收方应该根据快照中每个档位的 MDPriceLevel 字段判断是对应买卖盘的第几档。

3. 在快照行情 msgType=W 中，哪个是最新价？是 MDEntryType=2（最近价），还是 MDEntryType=3（当前指数）？

答复：对于集中竞价业务行情快照，MDEntryType=2 表示最新价；对于指数行情快照，MDEntryType=3 表示最新指数。

4. 快照数据发送有什么样的频率和规律？

答复：不同业务的行情快照有不同的发布频率，例如：现货集中竞价业务 Level I 快照行情每 3 秒发布一轮，盘后定价交易业务行情快照每 15 秒发布一轮。同时交易系统对快照做了增量控制，

如果某只证券对应的信息未发生变化，则不会发送，但是会每隔一定时间将所有证券的行情快照再发一遍。

5. 期权行情数据是否区分 Level I 和 Level II 行情？

答复：测试阶段期权行情数据分为 Level I 和 Level II；Level I 快照行情最多揭示五档买卖盘，Level II 快照行情最多揭示十档买卖盘；Level II 行情包含逐笔行情数据（逐笔成交和逐笔委托）。正式上线后，暂不发布 Level II 行情。

6. 现在综合行情里面是否还有申报合同序号这个字段？

答复：没有。

7. 定价申报是否会在逐笔委托行情中出现？

答复：会。协议交易会发布意向申报逐笔委托和定价申报逐笔委托，成交申报和点击成交申报不会发布逐笔委托数据。

8. 协议交易业务逐笔行情，已经成交或者撤单的记录，交易所如何发布行情？

答复：通过逐笔成交行情。

9. 一个行情网关可以同时推送快照行情和逐笔行情吗？

答复：可以。

10. 如果定价申报的行情已经成交了，会重新发一笔行情吗？如果会，两笔行情是如何关联的？

答复：如果定价申报的行情已经成交了，会发一笔逐笔成交行情。通过 BidApplSeqNum 或 OfferApplSeqNum 字段与原始定价行情关联。

11. 综合协议行情中是否还提供对方的交易单元、合同号？

答复：对于定价行情，新一代不再提供对方的交易单元及合同号。

12. 登陆行情网关的快照端口成功后，行情网关是否完将整个市场的行情快照重传一遍？其执行这种重传是否有时间区段的限制？

答复：快照会隔一段时间全量发送一次，现在的间隔是 60S。

13. 盘后大宗交易业务的行情，是否只有在 15:00 集中竞价交易闭市后才会有？

答复：是的。

14. 股票、债券、基金这些产品价格的单位是什么，精确到小数位第几位？成交量和成交金额的单位又是什么？指数点位接口文档中说明是后 6 位表示小数，实际数据是精确到小数位后第几位呢？

答复：

1. 深交所所有产品目前的价格单位都是元。价格精度参考交易参考信息中的价格档位 PriceTick 字段；

2. 股票、债券、基金成交量的单位是股/张/份；金额单位是元；

3. 指数点位目前实际是精确到四位小数。

四、 交易参考信息

1. 静态交易参考信息对于当天没有相应业务的文件交易所会发一个

空文件吗？

答复：会。

2. 证券信息文件中的证券类别是否包含债券的细分类别，例如可转债、公司债、企债等等？

答复：证券类别包含债券的细分类别。

3. 原 sjsxxn.dbf 中每笔限量字段对应新接口中是如何定义的？

答复：新一代交易系统每笔限量参见《深圳证券交易所文件交换数据接口规范》中各业务的参考信息文件，比如“集中竞价交易类业务参考信息”中的“买数量上限”、“卖数量上限”。如某业务未规定委托数量上限，则委托数量最大值为 Qty 类型的上限，即 9,999,999,999.99。

4. 原 sjsxxn.dbf 中折合比例字段对应新接口中是如何定义的？

答复：在《深圳证券交易所文件交换数据接口规范》中，“证券信息”文件的“对回购标准券折算率”即为折合比例。

5. cashauctionparams 文件里面的，如果 LimitType 是 1=幅度的话，上涨限价和下跌限价是多少？

限制类型	Reference type	数据类型	限制范围
→ 涨跌限制类型	LimitType	C1	1=幅度（百分比） 2=价格（绝对值）
→ 上涨幅度	LimitUpRate	N10(3)	
→ 下跌幅度	LimitDownRate	N10(3)	
→ 上涨限价	LimitUpAbsolute	N10(4)	
→ 下跌限价	LimitDownAbsolute	N10(4)	
→ 是否有涨停		C1	Y/N

答复：当 limittype 为 1 时，上涨限价 (LimitUpAbsolute) 和下跌限价 (LimitDownAbsolute) 这两个字段无意义。

6. 如何获取期权的标的证券名称、标的昨收盘价、是否停牌、是否

可行权、是否限制开仓？

答复：1) 在《深圳证券交易所文件交换数据接口规范》中，“证券信息”文件的“基础证券代码”为标的证券代码，可以根据该标的证券代码在“证券信息”文件中查找到标的证券名称和标的昨收盘价；2)“证券信息”文件的“证券状态”包含停牌信息；3) 证券实时状态行情中揭示是否可行权、是否限制开仓状态信息，将考虑在参考信息中给出每个交易日的初始值，但交易期间仍以行情状态为准。

7. 衍生品集中竞价交易类业务参考信息(derivativeauctionparams)文件中买卖数量上限是否区分市价与限价方式？

答复：目前买卖数量上限并不区分市价与限价，后续版本会支持该功能。

8. indexinfo_YYYYMMDD.xml 中昨收指数点位 PrevCloseIdx 字段类型为 N18(5)，而指数行情快照里面的 PrevClosePx 字段类型是 N13(4)，以哪个为准？

答复：指数快照里的 PrevClosePx 字段无意义，MDEntryType=xa 的行情条目表示昨日收盘点位。

9. 新股申购代码是在 securities 和 issueparams 里面都存在吗？

答复：只在 issueparams 中存在。

10. 静态数据文件通过什么方式获取？

答复：通过 FDEP 文件传输平台。

11. 期权的 8 位合约编码和 20 位合约代码的对应关系怎么获取？

答复：交易参考信息“证券信息”文件中期权记录的 securityid 字段揭示 8 位合约编码，englishname 字段揭示 20 位合约代码。

12. 合约信息里面的买数量上限和卖数量上限的业务含义是什么？

答复：是指每笔委托申报的最大手数不能超过对应的上限数量。

13. derivativeauctionparams 文件中 MarginRatioParam1 和 MarginRatioParam2 分别有什么作用？

答复：用于计算保证金的参数，分别表示保证金比例计算参数 1 和 2。

14. 收市文件在什么情况下收盘价为 0？

答复：证券当日停牌的或者当日无集中竞价成交时，收盘行情里收盘价为 0。

15. cashauctionparams 文件里面的，有效范围涨跌价格 AuctionUpDownAbsolute 是根据最新价还是昨收价来计算价格范围？另外，是否有涨跌限制 HasPriceLimit 和有效范围涨跌价格类型 HasAuctionLimit 数据是否独立？

答复：根据目前的业务规则，有效竞价范围一般都是根据最近价来计算。HasPriceLimit 和 HasAuctionLimit 数据是独立的。

16. 在新的静态文件接口定义中，是否不再采用四版 sjsxxn 中证券代码区间划分的方式来进行证券分类？

答复：是的，根据新一代交易系统文件接口的定义，为了提高证券代码利用率，以后可能不会按照代码区间来区分证券类别，会

有独立字段标识证券的类别。

17. 静态文件中涨跌停价根据 `limitrate` 来计算时，小数位是截断还是采用四舍五入原则？

答复：采用四舍五入。

18. 新一代交易系统行情数据中，集合竞价限价参数、连续竞价限价参数、限价参数性质、涨停价格、跌停价格等字段在哪里可以找到？

答复：集合竞价限价参数、连续竞价限价参数、限价参数性质：参见 `cashauctionparams` 文件中的 `PriceLimitSetting` 字段，如果有涨跌幅 (`HasPriceLimit`)，可根据涨跌幅类型 (`LimitType`)、幅度 (`LimitUpRate\LimitDownRate`)、限价 (`LimitUpAbsolute\LimitDownAbsolute`) 算出涨停价和跌停价。如果有有效竞价范围 (`HasAuctionLimit`)，根据类型 (`AuctionLimitType`)、幅度 (`AuctionUpDownRate`)、价格 (`AuctionUpDownAbsolute`) 可算出有效竞价范围。涨停价格、跌停价格在实时的集中竞价行情快照消息中也会揭示。

其中，以涨停价的计算为例子，说明几个价格的计算：

如果涨跌幅类型为幅度，则：

涨停价 = 昨收价 * (1+LimitUpRate)

如果涨跌幅类型为限价，则：

涨停价 = 昨收价 + LimitUpAbsolute

计算的结果四舍五入精确到价格档位。

19. 新一代交易系统行情数据中，证券级别和成份股标志等信息在哪里可以找到？

答复：四版交易行情信息的证券级别各类取值在新一代交易系统行情数据中的对应为：

1) ST 股/*ST 股：securities 文件的 SecurityStatus 字段中存在 ST 或*ST 状态。

2)LOF、ETF、仅申赎基金：可通过 securities 文件的 SecurityType 字段区分这三类基金。

3) 仅在协议交易平台挂牌证券：在 negotiationparam 中存在但在 cashauctionparams 中不存在的证券，即为仅在协议平台挂牌的证券。

4) 退市整理板：securities 文件的 SecurityStatus 字段中存在退市整理期状态。

5) 仅揭示净值基金：已没有该类证券。

成份股标志则在新一代交易行情信息中不再提供。

20. 如果股票处于退市整理期，则该股票的剩余交易日是否可以从静态交易参考信息文件中获取？

答复：处于退市整理期的股票，并不会通过静态参考信息揭示剩余交易日，具体停止交易日期，以公告的摘牌时间为准。

21. Evoteparams 网络投票交易参考信息的接口文档如何获取？

答复：新一代交易系统的网络投票业务的投票参考信息，沿用四版的投票参考信息接口规范，具体见深交所技术专栏的《上市公

司股东大会数据接口》。

22. 过渡期内，能否继续使用双向小站上传新一代交易系统接口的前日净值文件？

答复：不行，净值上传不提供兼容期，必须使用新一代交易系统的文件网关上传净值文件。