

工程技术标准

深圳证券交易所 Binary 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 字段 增加对于质押式回购交易到期成交执行报告的说明 协议交易意向申报增加联系人 Contactor 字段 股份性质 ShareType 字段更名为 ShareProperty 股票质押式回购业务成交申报增加质权人类型 PledgeeType 字段 修改网络投票密码服务申报及其执行报告的报文号 报价申报中删除单边报价方式 补充消息校验和计算范围的说明 订正部分文字错误

		<p>1.00</p>	<p>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; 增加对回报消息中“回报交易单元”字段的说明; 增加委托拒绝原因代码表;</p>
<p>2014-9</p>	<p>1.00 γ</p>	<p>1.00</p>	<p>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; 协议交易业务和盘后定价交易业务支持融资融券交易, 委托和回报增加信用标识字段; 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</p>

2015-1	1.00 δ	1.00	<p>增加转处置、垫券还券、待清偿扣划业务委托申报定义。</p> <p>增加各业务新订单是否可以撤销的说明。</p> <p>完善委托拒绝原因代码说明。</p>
2015-8	1.00	1.00	<p>增加消息体的可扩展说明。</p> <p>保证金条目类别 MarginItem 增加“2=保证金总金额”。</p> <p>增加字符串的说明。</p> <p>增加报价更新、报价撤销处理消息流程图。</p> <p>修改委托申报拒绝原因代码 20003 的含义，删除 20004。</p> <p>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。</p> <p>增加密码服务证券代码 369991 的说明。</p> <p>增加债券质押式协议回购业务的委托和回报消息定义；</p> <p>增加分级基金实时分拆合并业务的委托和回报消息定义</p>
2016-6	1.01	1.00	<p>增加国际市场互联平台定义。</p> <p>增加港股通业务的委托和回报消息定义。</p> <p>删除备兑锁定解锁业务的委托和回报消息定义。</p>
2017-2	1.02	1.00	<p>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；</p> <p>股票质押式回购业务成交申报增加字段：资金用途类型 InvestmentType 、</p> <p>预警线 AlertRatio 、平仓线 SettlementRatio；</p> <p>资产管理计划份额转让业务成交申报增加字段：</p> <p>本方交易账户 ExecutingTrader、</p> <p>对手方交易账户 CounterpartyExecutingTrader。</p>

2017-7	1.03	1.02	<p>增加“通信版本号”定义；</p> <p>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</p> <p>增加拒绝原因“20079减持额度不足”</p>
2018-5	1.04	1.02	<p>增加成交请求申报模式；</p> <p>修改成交报告申报模式；</p> <p>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；</p> <p>增加债券质押式协议回购到期续做指令；</p> <p>增加委托申报拒绝原因代码；</p> <p>附件增加新订单及成交申报的处理回报说明</p>
2018-7	1.10	1.10	<p>除业务拒绝外的其他回报消息增加分区字段；</p> <p>回报同步消息、回报结束消息增加分区字段；</p> <p>增加平台信息消息；</p> <p>修改应用层消息恢复流程；</p>
2018-12	1.11	1.10	<p>修改债券质押式回购业务交易时间；</p> <p>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</p>
2019-1	1.12	1.10	<p>增加期权组合策略保证金业务接口；</p> <p>增加期权行权指令合并申报业务接口；</p> <p>增加期权普通与备兑仓互转业务接口</p>

2020-04	1.13	1.11	<p>将原盘后定价交易业务更名为：盘后定价大宗交易；</p> <p>增加盘后定价交易业务接口；</p> <p>转融通证券出借新订单、成交申报增加字段：股份性质 (ShareProperty)；</p> <p>修改通信版本号为：1.11；</p> <p>修订历史增加通信版本号一列；</p> <p>增加债券回售撤销指令；</p> <p>增加接口规范兼容性要求。</p>
2020-06	1.14	1.11	<p>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；</p> <p>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；</p> <p>转发成交申报公用字段添加“交易所成交申报编号”字段</p>
2020-10	1.15	1.15	<p>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)</p>
2020-11	1.16	1.15	<p>增加询价交易处理模式</p>
2020-12	1.17	1.15	<p>债券质押式协议回购成交申报、成交申报响应、转发成交申报、成交确认增加字段：股份性质 (UnderlyingShareProperty)</p>
2020-12	1.18	1.18	<p>增加期权集中竞价交易业务组合策略单边平仓指令</p>
2021-04	1.19	1.18	<p>增加债券现券交易业务接口；</p> <p>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</p>
2021-07	1.21	1.18	<p>增加债券转让业务回售转售的委托和回报定义</p>

2021-07	1.22	1.18	增加债券借贷业务的委托和回报定义
2021-09	1.23	1.18	增加债券现券交易业务竞买成交接口
2022-01	1.24	1.18	修改保证金查询结果报文定义 增加兼容性要求
2022-07	1.25	1.18	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
2022-09	1.26	1.18	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
2023-02	1.27	1.18	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
2023-07	1.28	1.18	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》
2023-08	1.29	1.18	债券现券业务点击成交报价委托启用“最低成交数量”字段
2024-07	1.30	1.18	修改 ETF 实时申购赎回业务新订单、订单响应接口定义
2024-10	1.31	1.18	修改债券回售/购回申报、债券回售撤销申报时间说明
2025-02	1.32	1.18	(本档中橙色修订部分) 网上发行认购业务委托、回报的 AppID 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。

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 心跳包和测试请求	2
2.2.3 终止会话	2
2.2.4 重建会话	2
三、 服务说明	3
3.1 平台说明	3
3.2 委托申报方式说明	5
3.3 委托消息处理流程	9
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	24
3.9 成交申报处理消息流图	24
3.9.1 协议配对申报模式 (one party report for matching)	25
3.9.1.1 新成交申报处理	26
3.9.1.2 撤销成交申报	27
3.9.2 成交报告申报模式 (two party report)	28
3.9.2.1 新成交申报处理	28
3.9.2.2 撤销成交申报	30
3.9.3 成交请求申报模式 (one party report for pass through)	32
3.9.3.1 新成交申报处理	33

3.9.3.2 撤销成交申报	34
3.9.4 双边确认成交报告申报模式 (two party report for claim)	35
3.9.4.1 新成交申报处理	35
3.9.4.2 撤销成交申报	37
3.10 转托管处理消息流程图	38
3.11 网络投票处理消息流程图	39
3.12 密码服务处理消息流程图	40
3.13 保证金查询处理消息流程图	41
3.14 多腿订单处理消息流程图	41
3.15 应用层消息恢复	41
3.16 回报交易单元	43
四、消息定义	43
4.1 兼容性要求	43
4.2 成交汇总	43
4.3 消息结构	43
4.3.1 消息头	43
4.3.2 消息尾	44
4.4 管理消息	44
4.4.1 登录消息 (Logon)	44
4.4.2 注销消息 (Logout)	44
4.4.3 心跳消息 (Heartbeat)	45
4.5 业务消息-新订单处理	45
4.5.1 新订单 (New Order)	45
4.5.1.1 现货集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100101)	48
4.5.1.2 债券通用质押式回购交易业务新订单扩展字段 (100201)	49
4.5.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100401)	50
4.5.1.4 协议交易业务新订单扩展字段 (100501)	51
4.5.1.5 盘后定价大宗交易业务新订单扩展字段 (100601)	51
4.5.1.6 转融通证券出借业务新订单扩展字段 (100701)	51
4.5.1.7 债券转股回售业务新订单扩展字段 (101501)	51
4.5.1.8 期权行权业务新订单扩展字段 (101601)	52
4.5.1.9 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段 (101701)	52
4.5.1.10 要约收购业务新订单扩展字段 (101801)	52
4.5.1.11 转处置业务新订单扩展字段 (102701)	52
4.5.1.12 垫券还券业务新订单扩展字段 (102801)	52
4.5.1.13 待清偿扣划业务新订单扩展字段 (102901)	53
4.5.1.14 港股通业务新订单扩展字段 (106301)	53
4.5.1.15 期权普通与备兑仓互转业务新订单扩展字段 (103501)	53
4.5.1.16 盘后定价交易业务新订单扩展字段 (103701)	53
4.5.1.17 债券现券交易业务新订单扩展字段	54
4.5.1.18 跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务新订单扩展字段 (104701)	55
4.5.1.19 ETF 实时申购赎回业务新订单扩展字段 (101201)	55

4.5.2 撤单请求 (Order Cancel Request)	56
4.5.3 撤单失败响应 (Cancel Reject)	57
4.5.4 订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)	58
4.5.4.1 现货集中竞价交易业务执行报告扩展字段 (200102)	61
4.5.4.2 债券通用质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200202)	61
4.5.4.3 期权集中竞价交易业务执行报告扩展字段 (200402)	62
4.5.4.4 协议交易业务执行报告扩展字段 (200502)	62
4.5.4.5 盘后定价大宗交易业务执行报告扩展字段 (200602)	62
4.5.4.6 转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200702)	62
4.5.4.7 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段 (201202)	63
4.5.4.8 债券转股回售业务执行报告扩展字段 (201502)	63
4.5.4.9 期权行权业务执行报告扩展字段 (201602)	64
4.5.4.10 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段 (201702)	64
4.5.4.11 要约收购业务执行报告扩展字段 (201802)	64
4.5.4.12 转处置券业务执行报告扩展字段 (202702)	64
4.5.4.13 垫券还券业务执行报告扩展字段 (202802)	64
4.5.4.14 待清偿扣划业务执行报告扩展字段 (202902)	64
4.5.4.15 分级基金实时分拆合并业务执行报告扩展字段 (203102)	65
4.5.4.16 港股通业务执行报告扩展字段 (206302)	65
4.5.4.17 期权普通与备兑仓互转业务执行报告扩展字段 (203502)	66
4.5.4.18 盘后定价交易业务执行报告扩展字段 (203702)	66
4.5.4.19 债券现券交易业务执行报告扩展字段	66
4.5.4.20 跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务执行报告扩展字段 (204702)	67
4.5.5 订单成交执行报告 (Execution Report)	67
4.5.5.1 现货集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段 (200115)	69
4.5.5.2 债券通用质押式回购交易业务成交执行报告扩展字段 (200215)	69
4.5.5.3 期权集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段 (200415)	70
4.5.5.4 协议交易业务执行报告扩展字段 (200515)	70
4.5.5.5 盘后定价大宗交易业务执行报告扩展字段 (200615)	70
4.5.5.6 转融通证券出借业务成交执行报告扩展字段 (200715)	70
4.5.5.7 盘后定价交易业务执行报告扩展字段 (203715)	70
4.5.5.8 债券现券交易业务成交执行报告扩展字段	71
4.6 业务消息-报价处理	72
4.6.1 报价 (Quote)	72
4.6.1.1 期权集中竞价交易业务报价扩展字段 (100405)	73
4.6.1.2 协议交易业务报价扩展字段 (100505)	74
4.6.1.3 债券现券交易业务报价扩展字段 (104105)	74
4.6.2 报价状态回报 (Quote Status Report)	75
4.6.2.1 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段 (200406)	77
4.6.2.2 协议交易业务报价状态回报扩展字段 (200506)	77
4.6.2.3 债券现券交易业务报价状态回报扩展字段 (204106)	78
4.6.3 报价回复 (Quote Response)	79

4.6.3.1 协议交易业务报价回复扩展字段 (100510)	81
4.6.3.2 债券现券交易业务报价回复扩展字段 (104110)	81
4.6.4 转发报价 (Allege Quote)	81
4.6.4.1 协议交易业务转发报价扩展字段 (200526)	83
4.6.4.2 债券现券交易业务转发报价扩展字段 (204126)	83
4.6.5 转发报价回复 (Allege Quote Response)	84
4.7 业务消息-询价申报处理	85
4.7.1 询价请求 (Quote Request)	85
4.7.1.1 协议交易业务询价请求扩展字段 (100517)	86
4.7.1.2 债券现券交易业务询价请求扩展字段 (104117)	86
4.7.2 询价请求响应 (Quote Request Ack)	87
4.7.2.1 债券现券交易业务询价请求响应扩展字段 (204117)	89
4.7.3 转发询价请求 (Allege Quote Request)	89
4.7.3.1 协议交易业务转发询价请求扩展字段 (200525)	90
4.7.3.2 债券现券交易业务转发询价请求扩展字段 (204125)	91
4.8 业务消息-意向申报处理	91
4.8.1 意向申报 (Indication of Interest)	91
4.8.1.1 协议交易意向申报扩展字段 (100509)	92
4.8.2 意向申报响应 (Quote Response)	93
4.8.2.1 协议交易意向申报响应扩展字段 (200510)	94
4.9 业务消息-成交申报处理	94
4.9.1 成交申报 (Trade Capture Report)	94
4.9.1.1 协议交易业务成交申报扩展字段 (100503)	99
4.9.1.2 转融通证券出借业务成交申报扩展字段 (100703)	100
4.9.1.3 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段 (100803)	100
4.9.1.4 股票质押式回购业务成交申报扩展字段 (100903)	100
4.9.1.5 约定购回业务成交申报扩展字段 (101003)	102
4.9.1.6 质押式报价回购业务成交申报扩展字段 (101103)	102
4.9.1.7 债券质押式协议回购业务成交申报扩展字段 (103003)	102
4.9.1.8 债券质押式三方回购交易业务成交申报扩展字段 (103203)	104
4.9.1.9 债券现券交易业务成交申报扩展字段 (104103)	105
4.9.1.10 债券转让业务成交申报扩展字段 (104303)	106
4.9.1.11 债券借贷业务成交申报扩展字段 (104203)	108
4.9.2 成交申报响应 (Trade Capture Report Ack)	109
4.9.3 转发成交申报 (Trade Capture Report)	112
4.9.3.1 债券质押式三方回购交易业务转发成交申报扩展字段 (203220)	113
4.9.3.2 债券质押式协议回购业务转发成交申报扩展字段 (203020)	114
4.9.3.3 债券现券交易业务转发成交申报扩展字段 (204120)	115
4.9.3.4 债券转让业务转发成交申报扩展字段 (204320)	115
4.9.3.5 债券借贷业务转发成交申报扩展字段 (204220)	116
4.9.4 成交确认 (Trade Capture Report)	117
4.9.4.1 协议交易业务成交确认扩展字段 (200503)	119

4.9.4.2 转融通证券出借业务成交确认扩展字段 (200703)	119
4.9.4.3 债券质押式协议回购业务成交确认扩展字段 (203003)	119
4.9.4.4 债券质押式三方回购交易业务成交确认扩展字段 (203203)	120
4.9.4.5 债券现券交易业务成交确认扩展字段 (204103)	121
4.9.4.6 债券转让业务成交确认扩展字段 (204303)	121
4.9.4.7 债券借贷业务成交确认扩展字段 (204203)	122
4.10 业务消息-转托管处理	123
4.10.1 注册 (Designation)	123
4.10.2 注册执行报告 (Designation Report)	124
4.11 业务消息-网络投票处理	125
4.11.1 投票 (Evote)	125
4.11.2 投票执行报告 (Evote Report)	126
4.12 业务消息-密码服务处理	127
4.12.1 密码服务 (Password Service)	127
4.12.2 密码服务执行报告 (Password Service Report)	128
4.13 业务消息-保证金查询处理	129
4.13.1 保证金查询 (Margin Query)	129
4.13.2 保证金查询结果 (Margin Query Result)	130
4.14 业务消息-多腿订单处理	131
4.14.1 多腿订单 (New Order-Multileg)	131
4.14.1.1 期权行权指令合并申报多腿订单扩展字段 (101621)	132
4.14.1.2 期权组合策略保证金业务多腿订单扩展字段 (103421)	132
4.14.2 多腿订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)	133
4.14.3 多腿订单成交执行报告 (Execution Report)	134
五、 其它消息	135
5.1 业务拒绝消息 (BUSINESS REJECT)	135
5.2 回报同步消息 (REPORT SYNCHRONIZATION)	136
5.3 平台状态消息 (PLATFORM STATE INFO)	137
5.4 回报结束消息 (REPORT FINISHED)	138
5.5 平台信息消息 (PLATFORM INFO)	138
5.6 交易会话状态消息 (TRADING SESSION STATUS)	139
六、 数据字典	140
6.1 数据类型	140
6.2 会话层域定义	141
6.3 业务层域定义	142
6.4 委托申报拒绝原因代码	159
七、 附件	159
7.1 新订单 (NEW ORDER) 处理流程说明	159
7.1.1 申报新订单并产生成交	159
7.1.2 撤销尚未产生成交的新订单	159
7.1.3 撤销已部分成交的新订单	160
7.1.4 撤销已全部成交的新订单	160

7.1.5 撤销不存在的新订单	161
7.2 成交申报 (TCR) 处理流程说明	161
7.2.1 协议配对模式	161
7.2.1.1 申报新成交申报	161
7.2.1.2 撤销尚未配对成功的成交申报	162
7.2.1.3 撤销已配对成功的成交申报	162
7.2.1.4 撤销已被拒绝的成交申报	163
7.2.1.5 撤销不存在的的成交申报	163
7.2.2 成交报告申报模式	164
7.2.2.1 申报新成交申报	164
7.2.2.2 撤销已接受的成交申报	164
7.2.2.3 撤销已被拒绝的成交申报	165
7.2.2.4 撤销不存在的的成交申报	165
7.2.3 成交请求申报模式	166
7.2.3.1 申报新成交申报	166
7.2.3.2 撤销尚未配对成功的成交申报	167
7.2.3.3 撤销已配对成功的成交申报	168
7.2.3.4 撤销已被拒绝的成交申报	170
7.2.3.5 撤销不存在的的成交申报	170
7.2.4 双边确认成交报告模式	171
7.2.4.1 申报新成交申报	171
7.2.4.2 撤销尚未配对成功的成交申报	173
7.2.4.3 撤销已配对成功的成交申报	174
7.2.4.4 撤销已被拒绝的成交申报	176
7.2.4.5 撤销不存在的的成交申报	177
7.3 询价 (QUOTE REQUEST) 处理流程说明	177
7.3.1 询价方撤销询价请求	177
7.3.2 报价方撤销报价	179
7.3.3 询价方与报价方成交	180

深圳证券交易所 Binary 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 Binary 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、消息内容、以及消息流描述与 STEP 交易数据接口规范基本一致，可以互为参考。

二、 会话机制

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 DefaultApplVerID 字段应填写该通信版本号，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订单管理系统（简称“OMS”）连接到交易网关（简称“TGW”）。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（TGW）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订单管理系统（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

交易网关和订单管理系统必须位于同一个安全网络之中，交易网关和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：

1. 订单管理系统首先建立一个到交易网关的 TCP/IP 连接，然后发送一个 Logon 消息给交易网关。

2. 如果交易网关验证订单管理系统有权登录，那么交易网关会返回 Logon 消息给订单管理系统，作为一个登录消息的确认，表示本次会话登录成功。
3. 如果订单管理系统登录验证失败，那么交易网关会返回 Logout 消息给订单管理系统，表示本次会话登录失败。
4. 订单管理系统发送 Logon 消息后，如果交易网关没有在适当的时间间隔里作回应，则可以关闭连接，并在等待一段时间后再次尝试连接。
5. 如果订单管理系统断线或收到交易网关的 Logout 消息，也应该等待一段时间后再次尝试连接。

2.2.2 心跳包和测试请求

为了交易网关和订单管理系统通信的双方能够实时监测通信链路状态，要求通信双方在数据空闲时互相发送心跳包，当一方没有接收到数据包的时间超过两倍的心跳间隔时，则可认为是数据链路发生故障，接收方可以断开此异常链接。

当订单管理系统登录到交易网关时，订单管理系统应在登录消息中指定心跳间隔参数（单位为秒）。

在一个心跳间隔时间内，如果交易网关没有需要向订单管理系统发送的数据，那么交易网关会向订单管理系统发送一个心跳消息，以保证两条消息之间的时间间隔不会超过设定的心跳间隔；同样，订单管理系统必要时也应该发送心跳消息来保证交易网关收到的连续两条消息之间的时间间隔不超过心跳间隔时间。

订单管理系统也可以采用类似的检测机制对交易网关和订单管理系统之间的连接情况进行检测。

2.2.3 终止会话

订单管理系统和交易网关都能通过发送 Logout 消息要求终止会话。对方接收到 Logout 消息请求后，会发送一条 Logout 消息回应，发起方收到 Logout 消息回应后，终止连接；如果对方没有在适当的时间间隔里作回应，则可终止连接。

2.2.4 重建会话

如果会话被终止，订单管理系统可以通过登录消息重建会话。

重建会话后，订单管理系统应通过应用层规则进行下行数据同步。

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
	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)	13:00-15:00
	配股认购	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
	债券转股回售	9:15-11:30
	期权行权	13:00-15:30
	开放式基金申购赎回	2) 对于债券转股回售业务, 债券转股申报 (ApplID=150)
	要约收购	(ApplID=150)
		9:15-11:30

	转托管	13:00-15:00;
	网络投票 (含密码服务)	债券回售/购回申报
	权证行权	(ApplID=151)、债券
	保证金查询	回售撤销申报
	转处置	(ApplID=152)
	垫券还券	9:15-11:30
	待清偿扣划	13:00-15:30
	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 13:00-15:30
	债券质押式三方回购交易	
	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	
	债券借贷	9:00-11:30 13:00-15:30
	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
--	--------	--

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。

委托申报消息类型有：

表 3-2 委托申报消息类型

消息类型	报文号	说明
New Order	10xx01、 10xx28	新订单
Quote	10xx05	报价
Quote Request	10xx17	询价请求
Quote Response	10xx10	报价回复
IOI	10xx09	意向申报
Trade Capture Report	10xx03	成交申报
New Order-Multileg	10xx21	多腿订单
Designation	102099	注册（转托管）
EVote	102197	网络投票
Password Service	102489	密码服务
Margin Query	102587	保证金查询

不同业务可能使用同一种消息类型进行委托申报，但是申报的要素可能有差别，因此同一种消息类型按照业务类型又分为多种报文，以报文号加以区别。

同一业务可能有多种委托申报类型，因此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。

各类业务的委托申报的报文号及 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	100101	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	100201	020	固定收益交易平台
债券分销订单申报	100301	030	固定收益交易平台
期权集中竞价交易订单申报	100401	040	衍生品集中竞价交易平台
期权集中竞价交易报价申报	100405	041	
期权集中竞价交易询价申报	100417	042	
协议交易意向申报	100509	050	综合金融服务平台
协议交易定价申报	100501	051	
协议交易点击成交申报	100501	052	
协议交易双方配对成交申报	100503	053	
协议交易报价申报	100505	056	
协议交易询价请求申报	100517	055	
协议交易报价回复申报	100510	057	
以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	100601	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	100601	061	
转融通证券出借非约定申报	100701	070	综合金融服务平台
转融通证券出借约定申报	100703	071	
资产管理计划份额转让	100803	080	综合金融服务平台
股票质押式回购	100903	090	综合金融服务平台
约定购回	101003	100	综合金融服务平台

质押式报价回购	101103	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)	101201	120	非交易处理平台
网上发行认购申报(发行与增发)	101301	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	101401	140	非交易处理平台
债券转股申报	101501	150	非交易处理平台
债券回售/购回申报	101501	151	
债券回售撤销申报	101501	152	
期权行权申报	101601	160	非交易处理平台
期权行权指令合并申报	101621	161	非交易处理平台
开放式基金申购赎回申报	101701	170	非交易处理平台
要约收购预受要约申报	101801	180	非交易处理平台
要约收购解除预受要约申报	101801	181	非交易处理平台
债券通用质押式回购质押申报	101901	190	固定收益交易平台
债券通用质押式回购解押申报	101901	191	
转托管	102099	200	非交易处理平台
投票	102197	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)	102201	220	非交易处理平台

权证行权申报	102301	230	非交易处 理平台
密码服务激活	102489	240	非交易处 理平台
密码服务挂失	102489	241	
保证金查询	102587	250	非交易处 理平台
转处置扣券申报	102701	270	非交易处 理平台
转处置还券申报	102701	271	
垫券申报	102801	280	非交易处 理平台
还券申报	102801	281	
待清偿扣划客户申报	102901	290	非交易处 理平台
待清偿扣划自营申报	102901	291	
债券质押式协议回购申报	103003	300	固定收益 交易平台
分级基金实时分拆申报	103101	310	非交易处 理平台
分级基金实时合并申报	103101	311	
港股通申报	106301	630	国际市场 互联平台
债券质押式三方回购交易申报	103203	320	固定收益 交易平台
债券质押式三方回购入库申报	103301	330	
债券质押式三方回购出库申报	103301	331	
期权组合策略保证金构建组合申报	103421	340	衍生品集 中竞价交 易平台
期权组合策略保证金解除组合申报	103421	341	
期权普通转备兑仓申报	103501	350	衍生品集 中竞价交 易平台
期权备兑转普通仓申报	103501	351	
盘后定价交易	103701	370	综合金融 服务平台
债券现券交易匹配成交申报	104101	410	固定收益 交易平台
债券现券交易协商成交申报	104103	411	
债券现券交易点击成交报价申报	104105	412	
债券现券交易点击成交报价回复申报	104110	413	
债券现券交易询价申报	104117	414	

债券现券交易询价成交报价申报	104105	415	
债券现券交易询价成交报价回复申报	104110	416	
债券现券交易竞买成交预约申报、发起申报、应价申报	104128	417	
债券现券交易交易解除	104103	419	
债券现券交易协商成交合并申报	104103	41A	
债券借贷成交申报	104203	420	固定收益交易平台
债券转让业务回售转售申报	104303	430	固定收益交易平台
跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回	104701	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，交易系统会首先作一些基本合法性检查，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=4) 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给 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

对于 OMS 提交的新订单，交易系统以执行报告消息作为响应。执行报告消息分为两类报文，一类报文用于新订单的确认响应、撤单成功时的响应以及委托被交易系统自动撤销时（比如市价委托剩余自动撤销）的响应 (MsgType=20xx02)，一类报文用于新订单达成成交时的响应 (MsgType=20xx15)。

对于 ETF 实时申购赎回、行权等非交易订单，只会回报上述第一类执行报告。

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(MsgType=20xx02)；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(MsgType=20xx15)；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	●	
310	分级基金实时合并	●	
630	港股通新订单申报	●	●
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

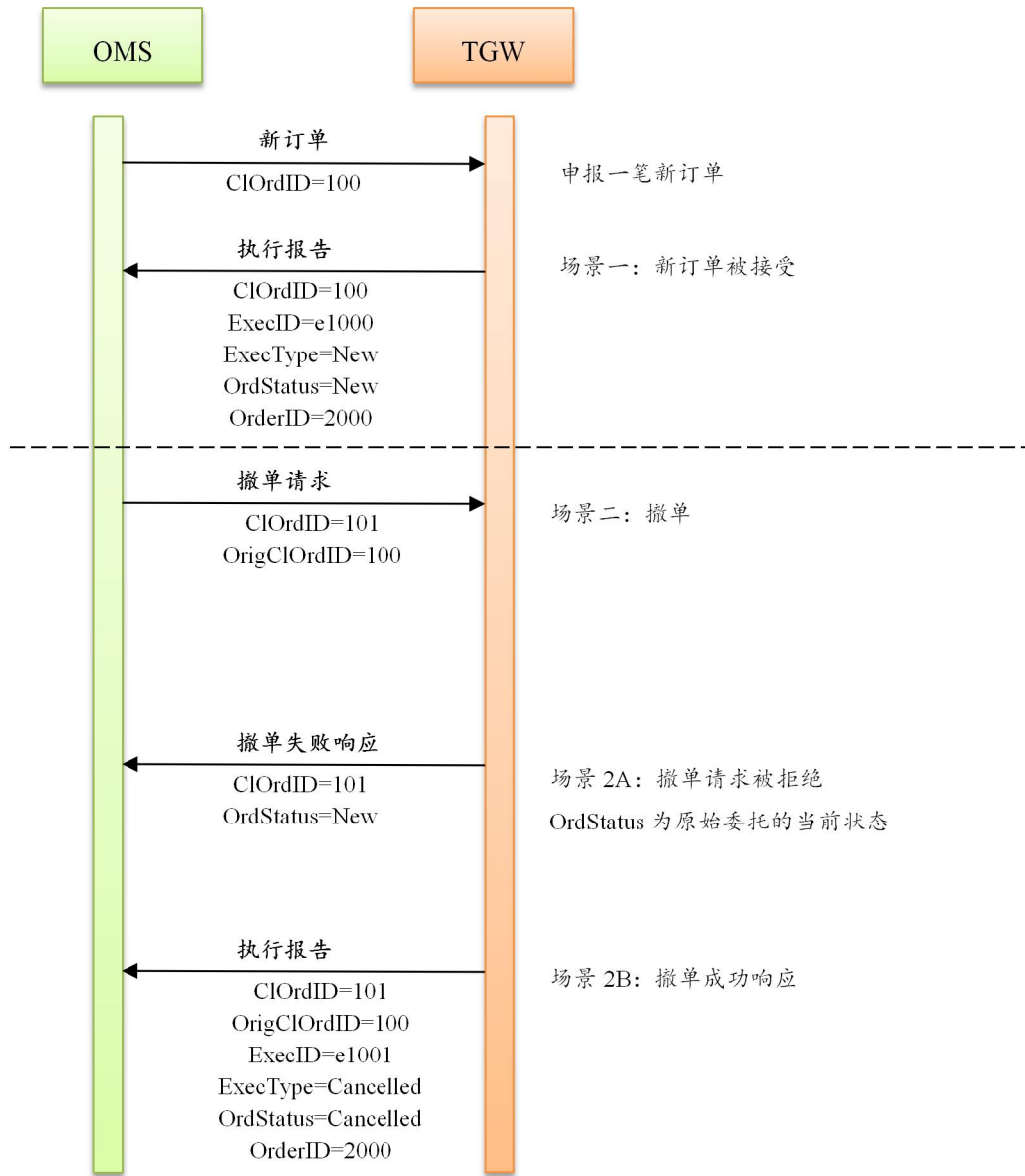


图 3-2 撤单请求消息流示意图

3.5 双边报价处理消息流图

3.5.1 新报价处理消息流图

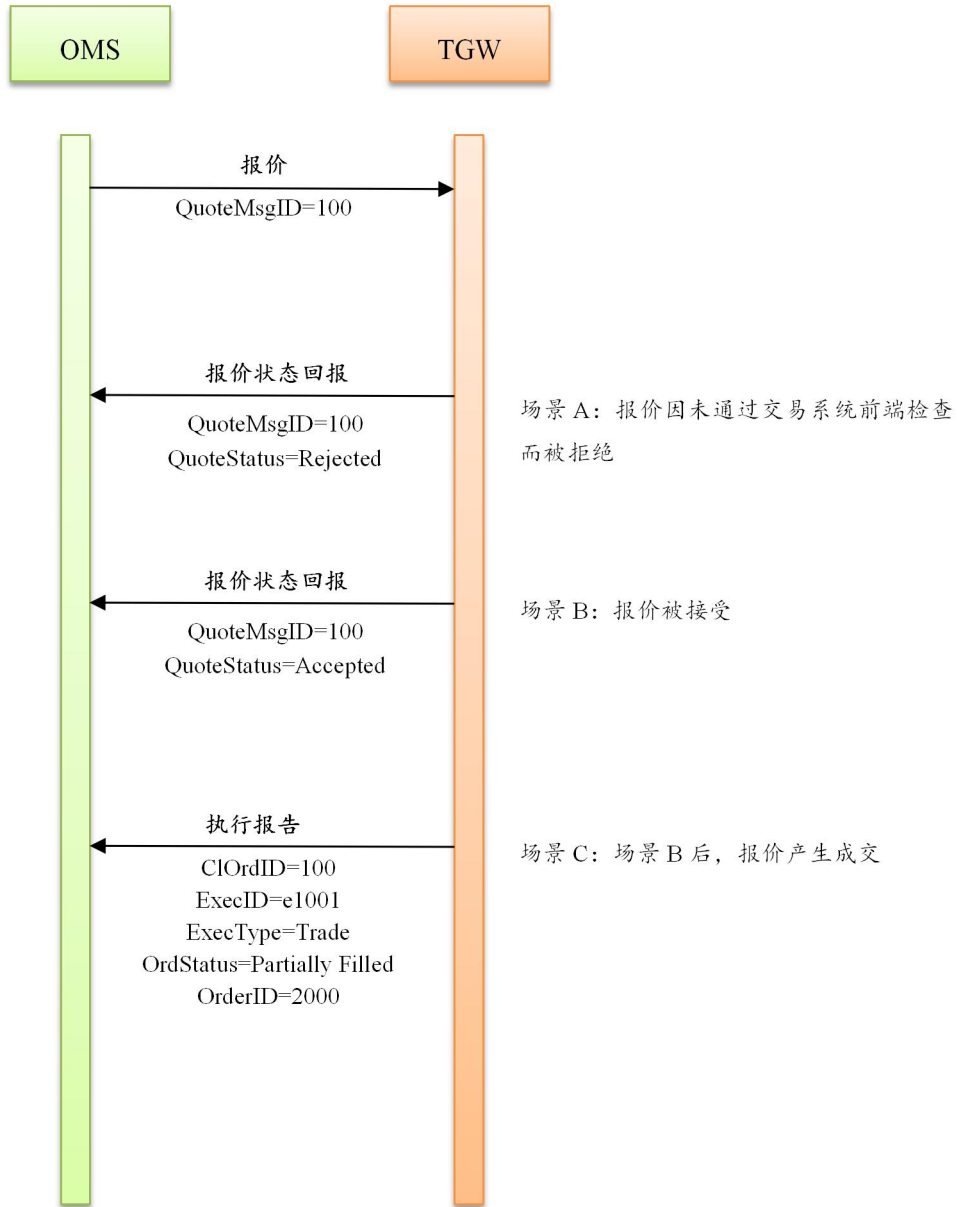


图 3-3 新报价处理消息流示意图

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

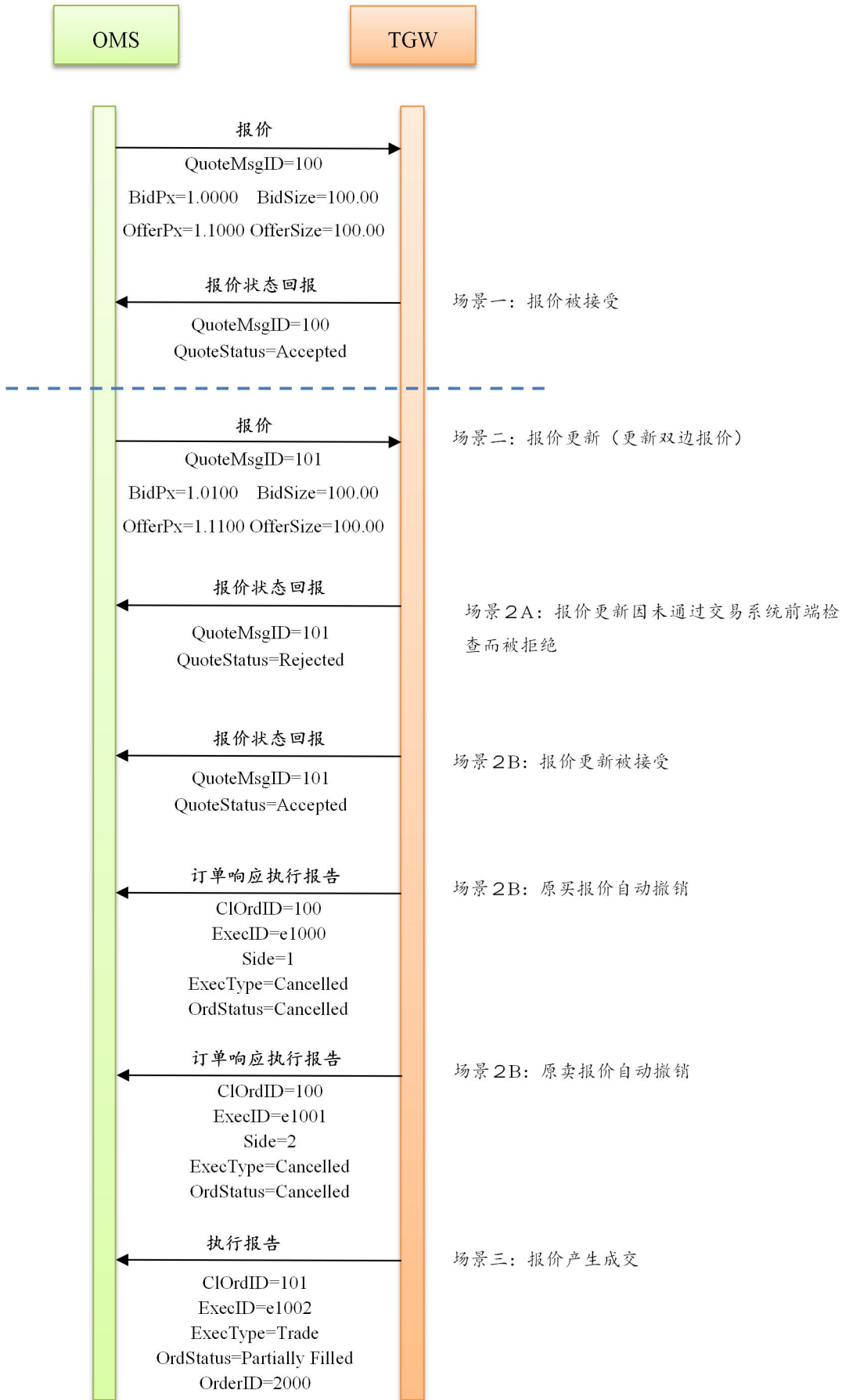


图 3-4 更新双边报价处理消息流示意图

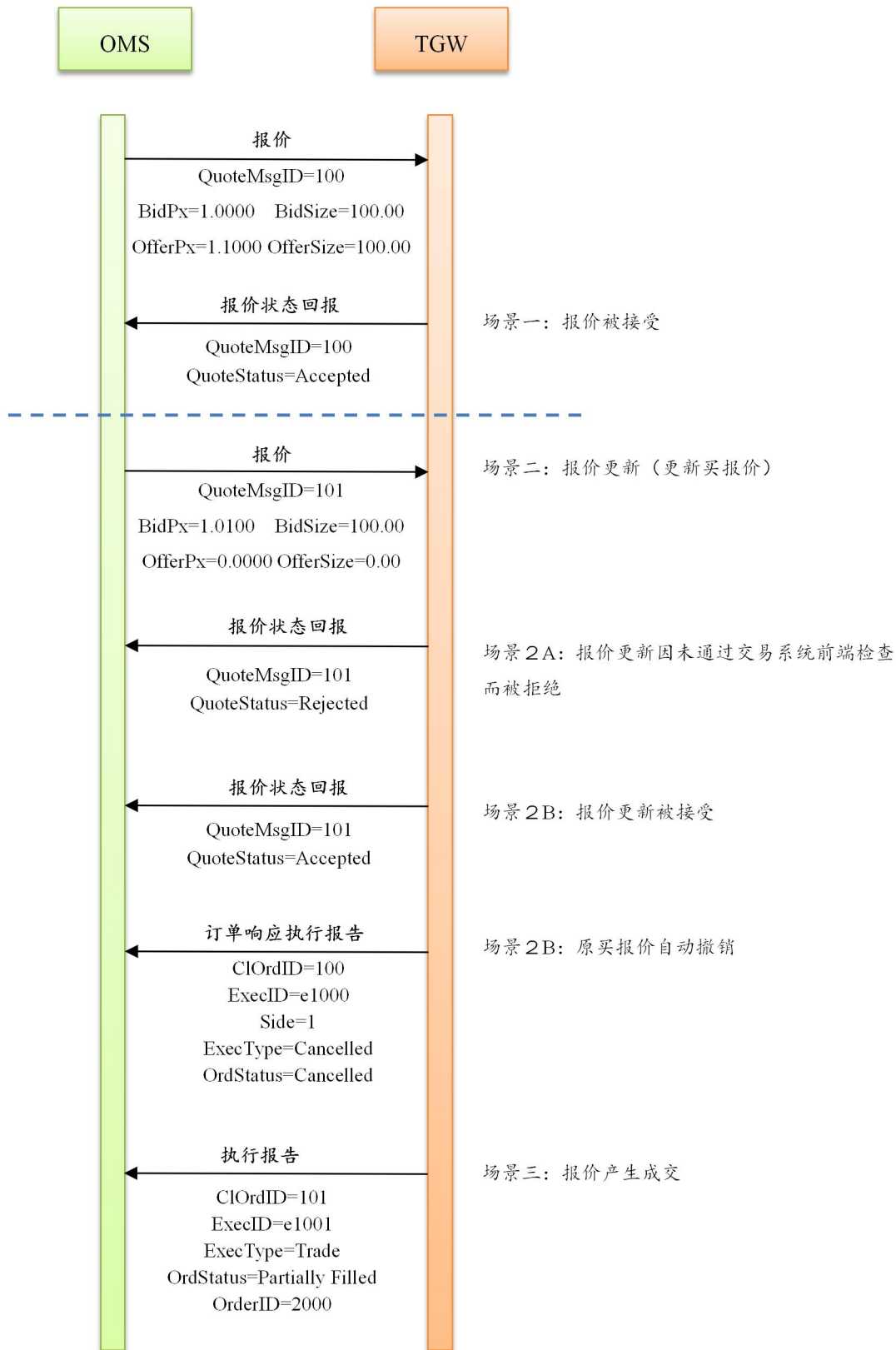


图 3-5 更新单边报价（情形二）处理消息流示意图

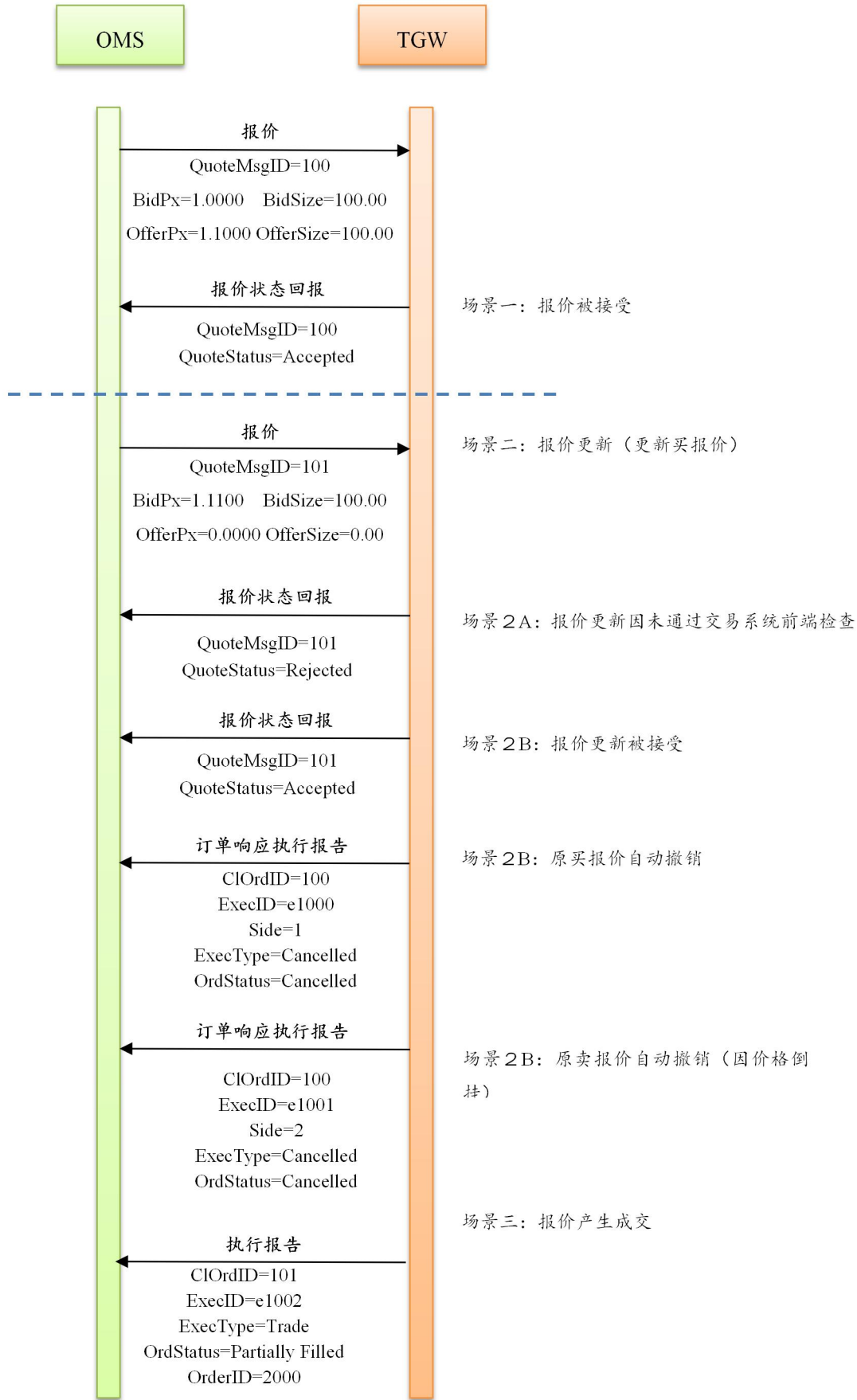


图 3-6 更新单边报价（情形三）处理消息流示意图

3.5.3 报价撤销处理消息流图

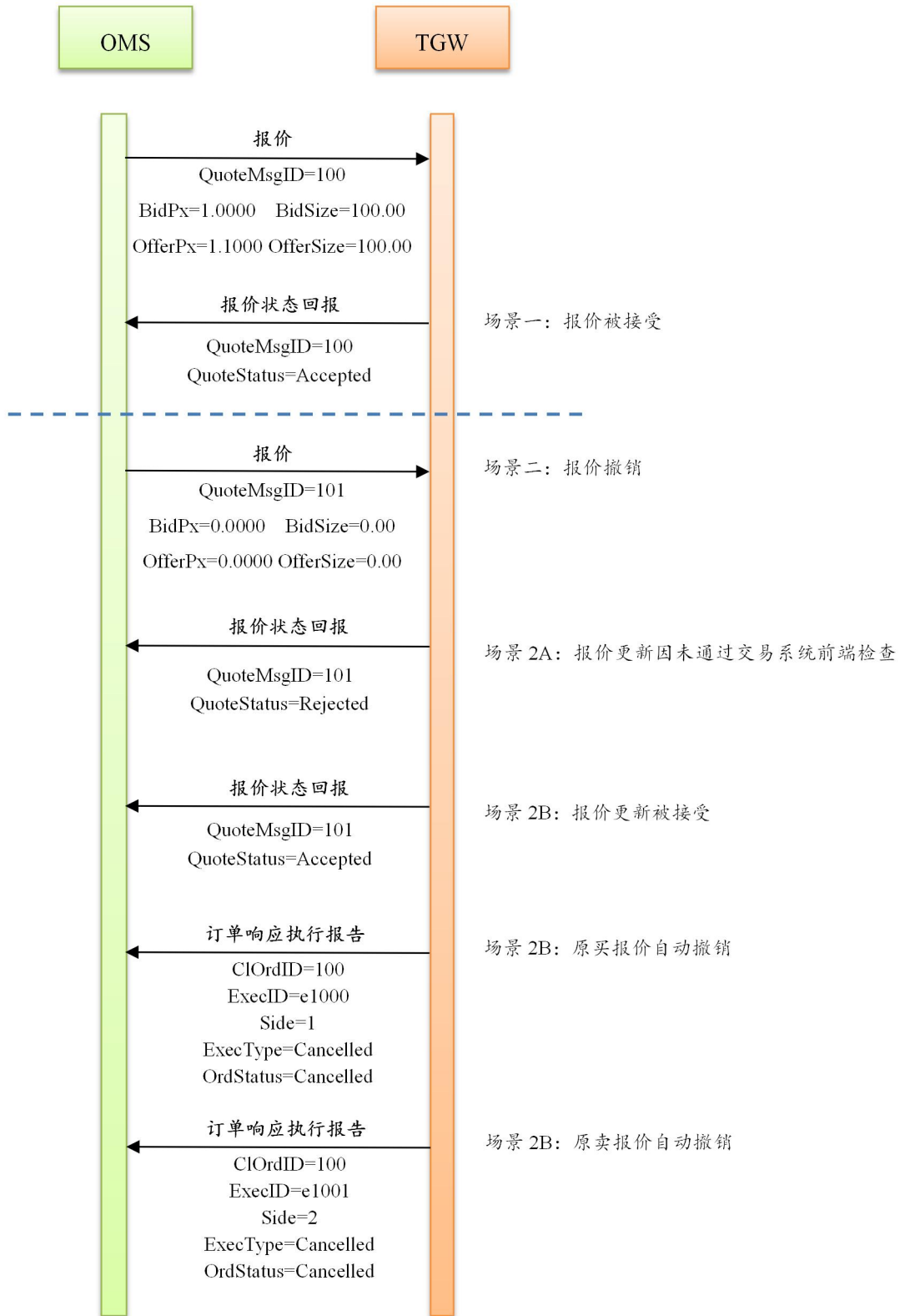


图 3-7 报价撤销处理消息流示意图

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

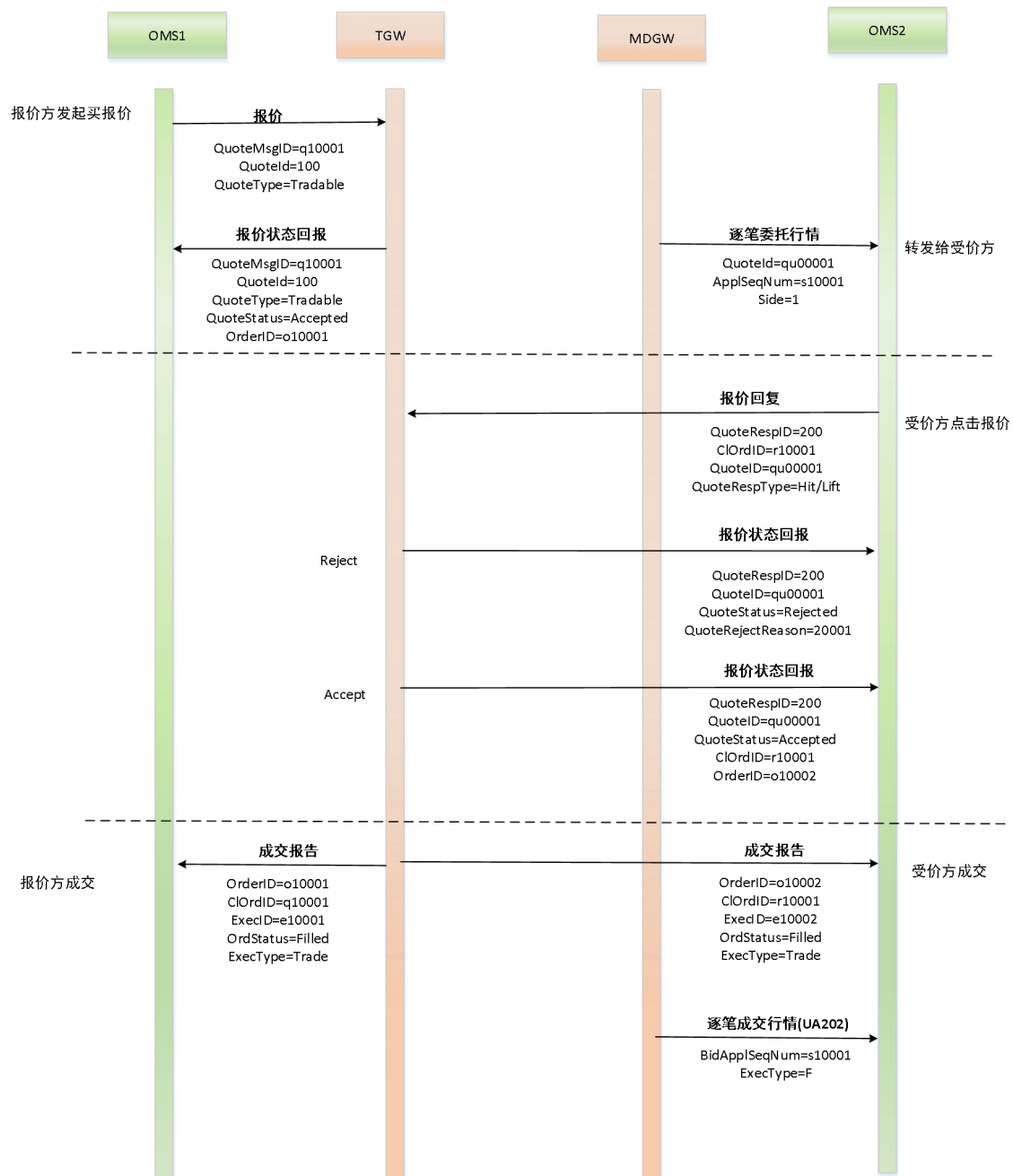


图 3-8 受价方点击成交处理消息流示意图

注：若为报价方发起卖报价，则将逐笔委托中的 Side=1 改为 Side=2、将逐笔成交中的 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

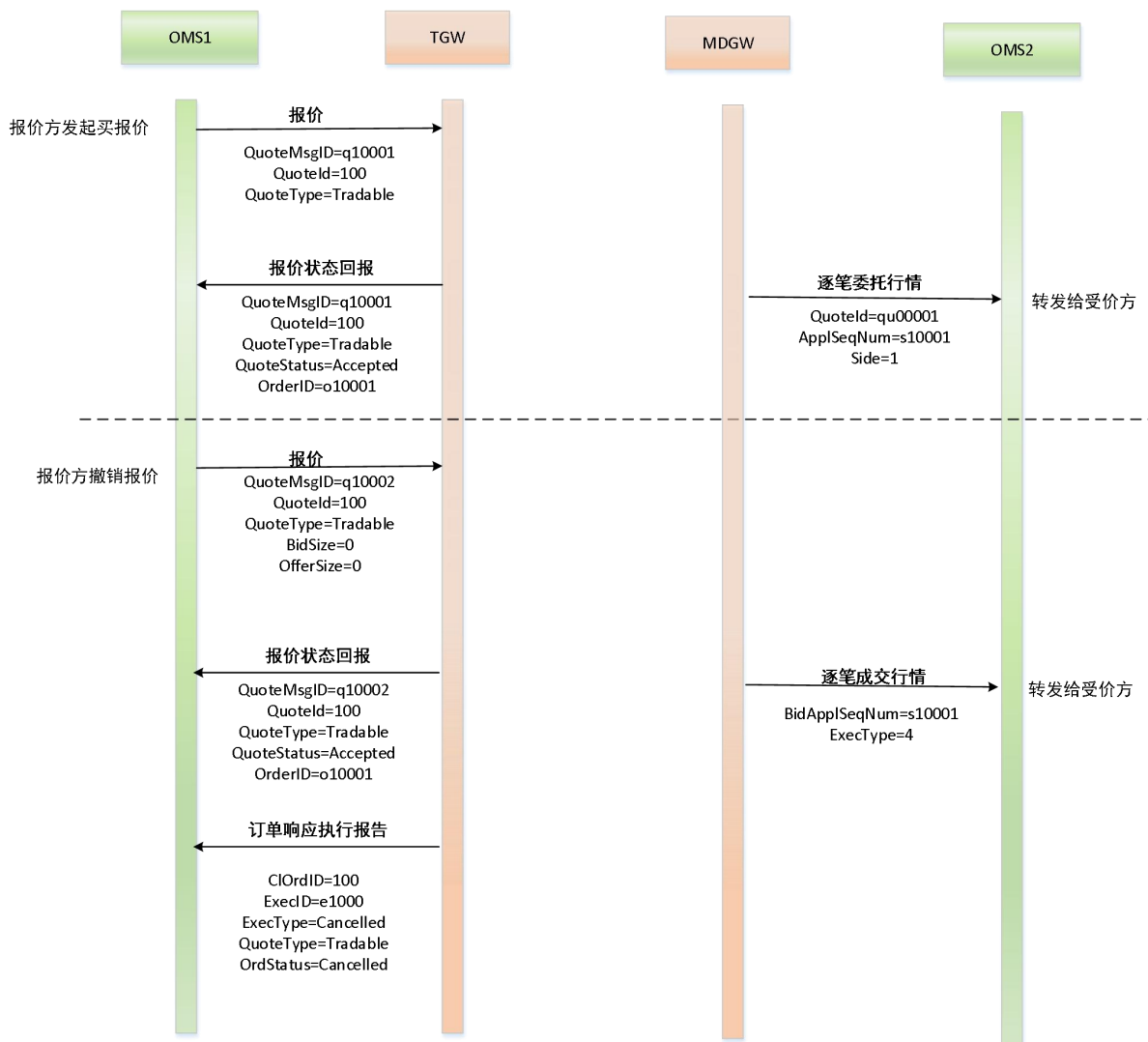


图 3-9 报价方撤销报价处理消息流示意图

注：若为报价方发起卖报价，则将逐笔委托中的 Side=1 改为 Side=2、将逐笔成交中的 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, 询价在超时会后会自动失效, 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

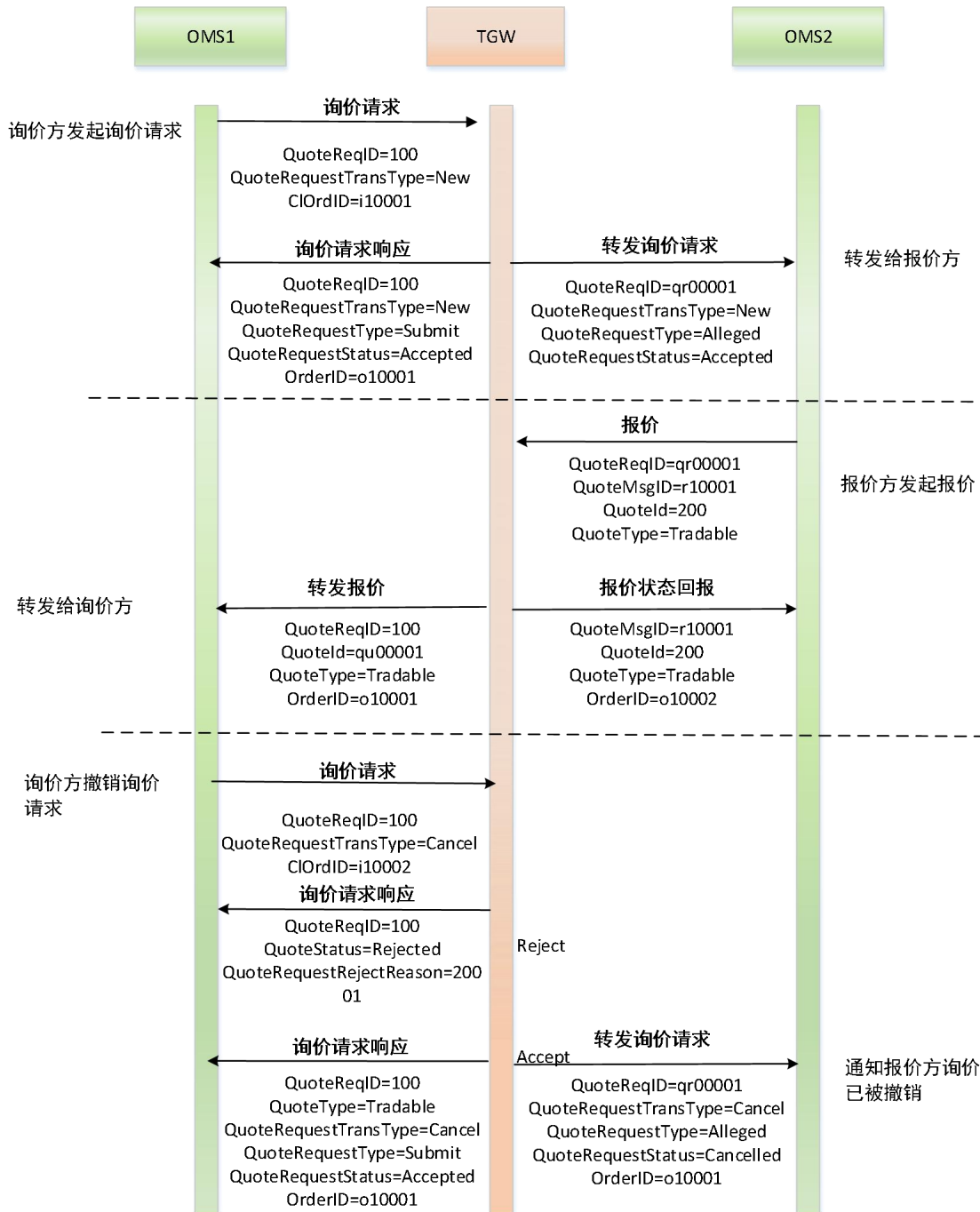


图 3-10 询价方撤销询价处理消息流示意图

3.7.2 报价方撤销报价处理

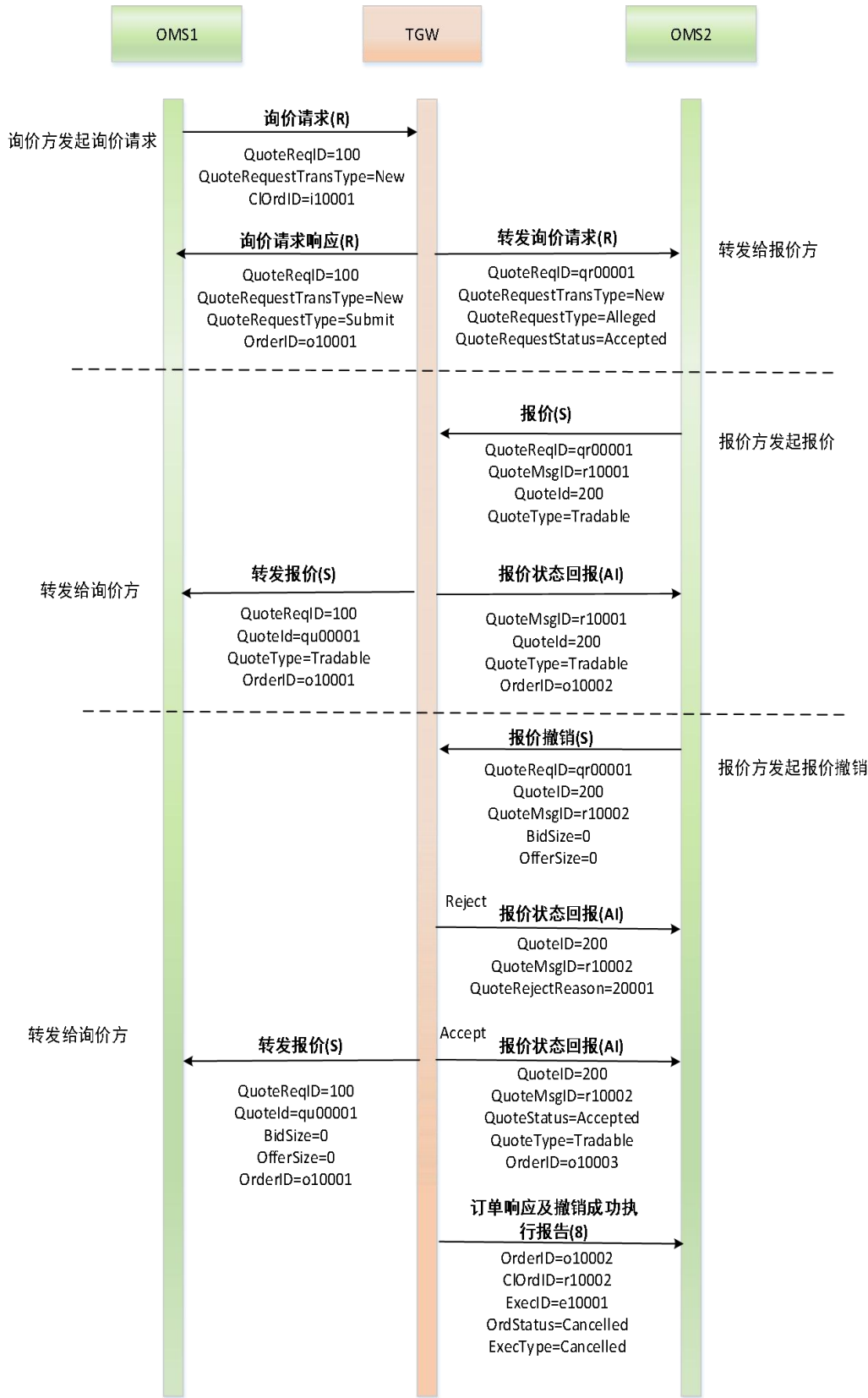


图 3-11 报价方撤销报价处理消息流示意图

3.7.3 询价方与报价方成交

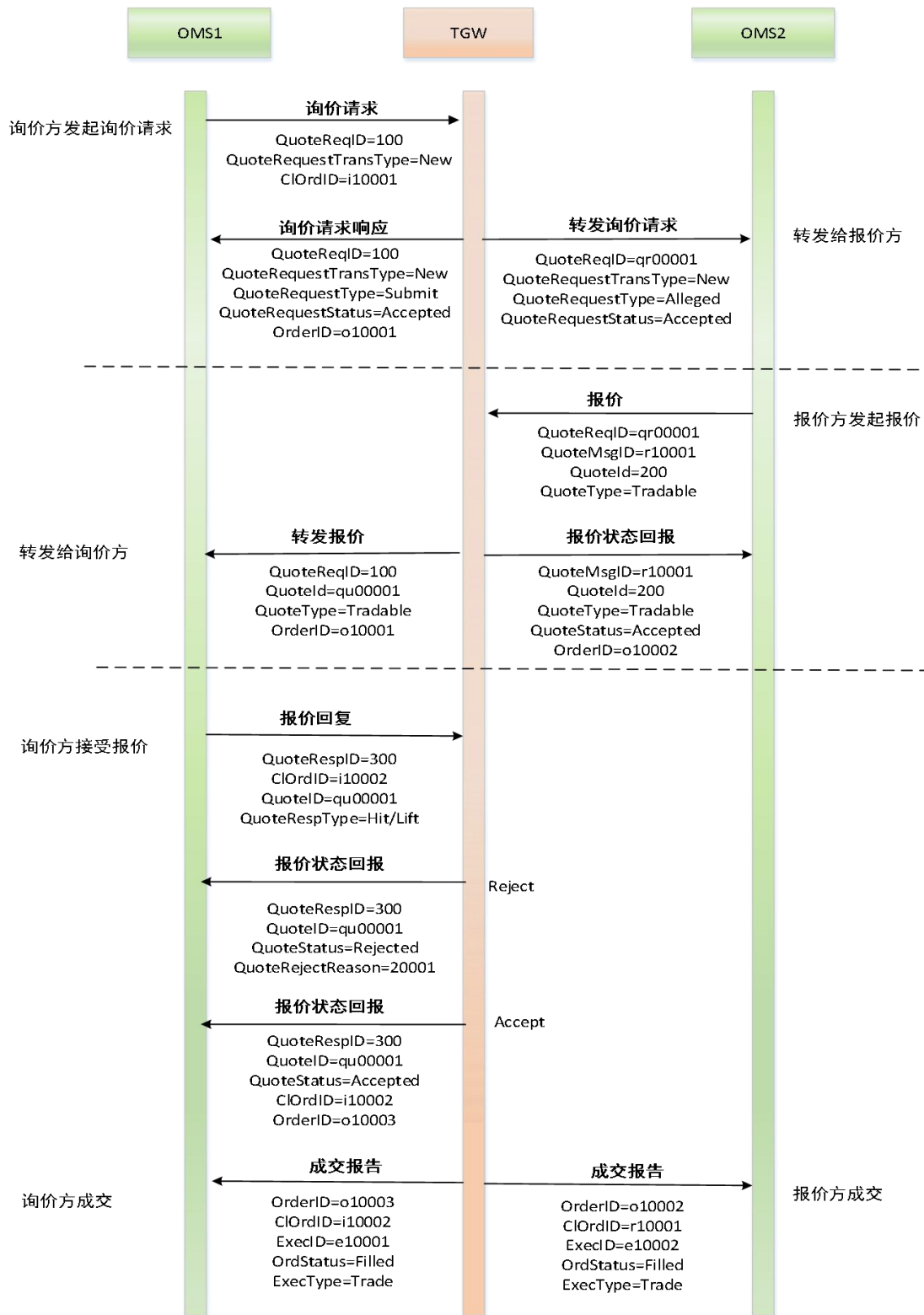


图 3-12 询价方与报价方成交处理消息流示意图

3.8 意向申报处理消息流图

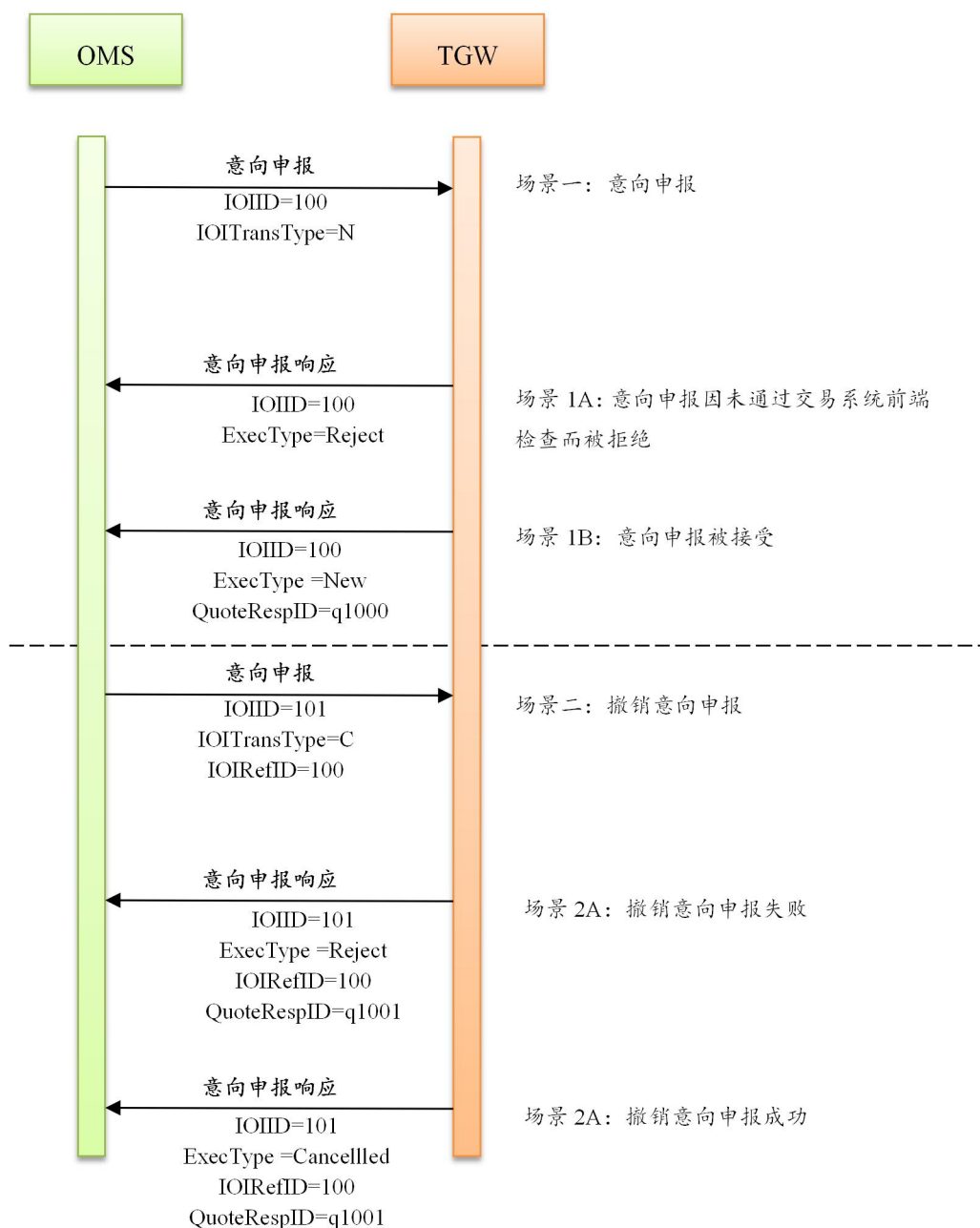


图 3-13 意向申报处理消息流示意图

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

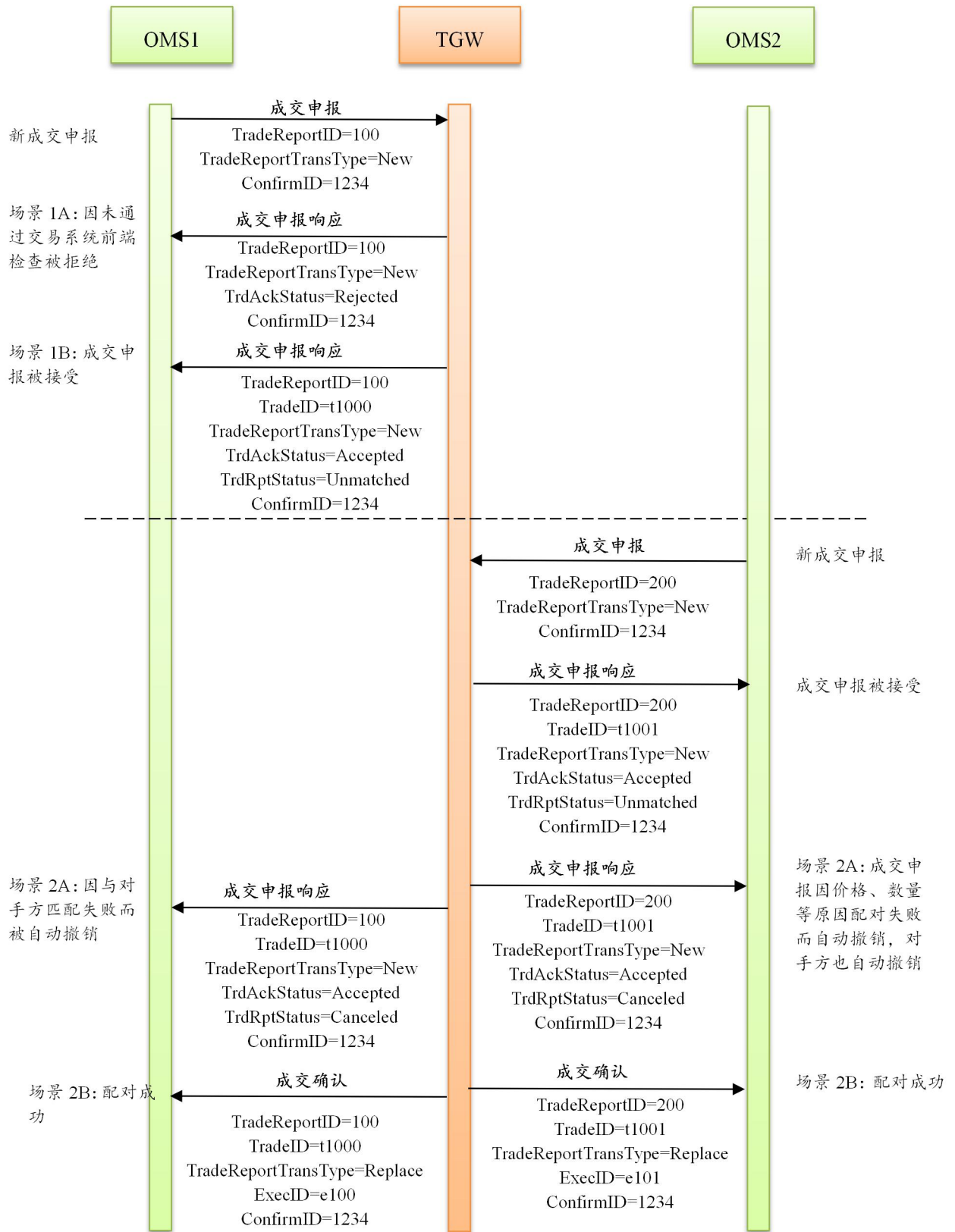


图 3-14 新成交申报处理消息流示意图

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。

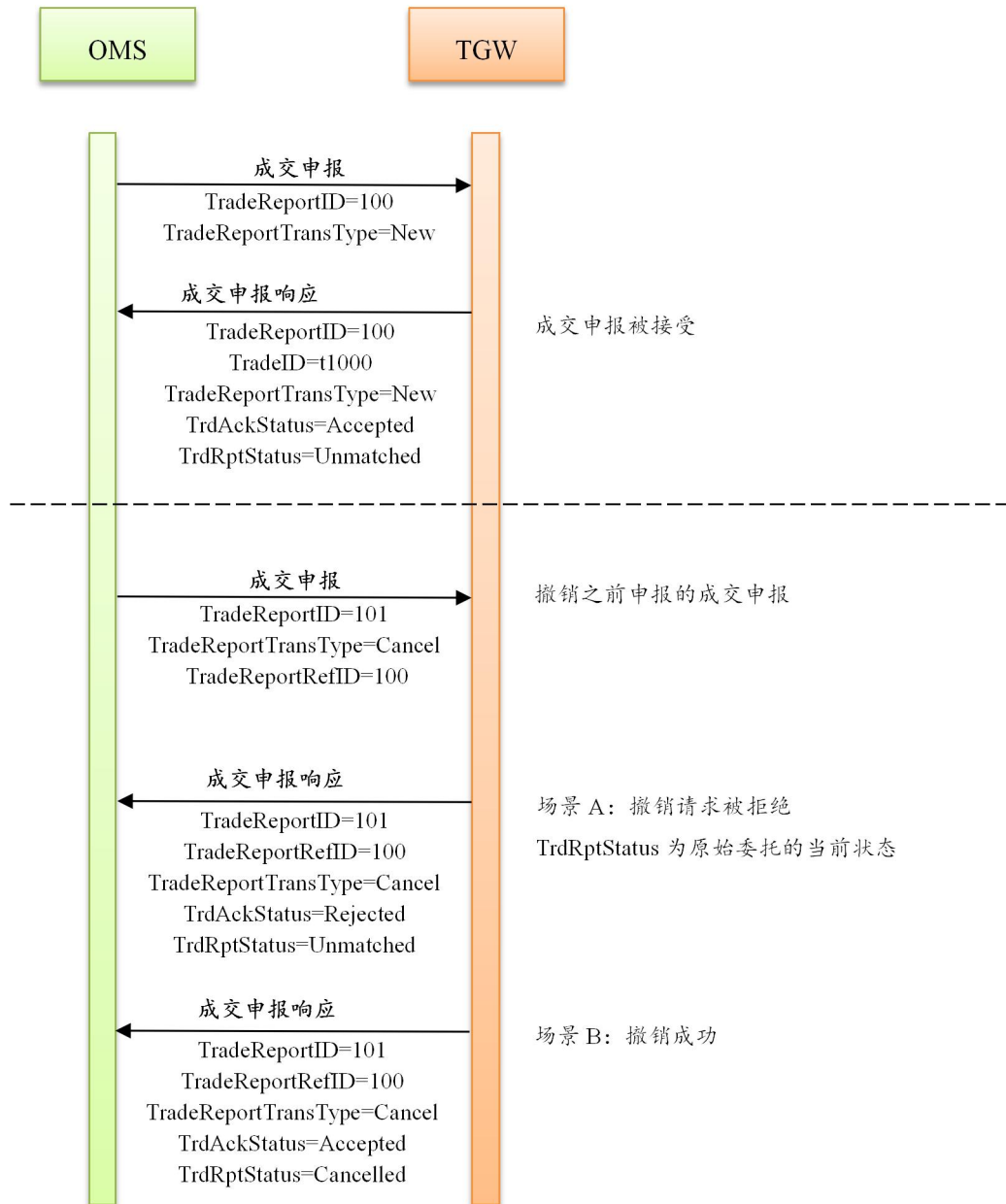


图 3-15 撤销成交申报处理消息流示意图

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)。

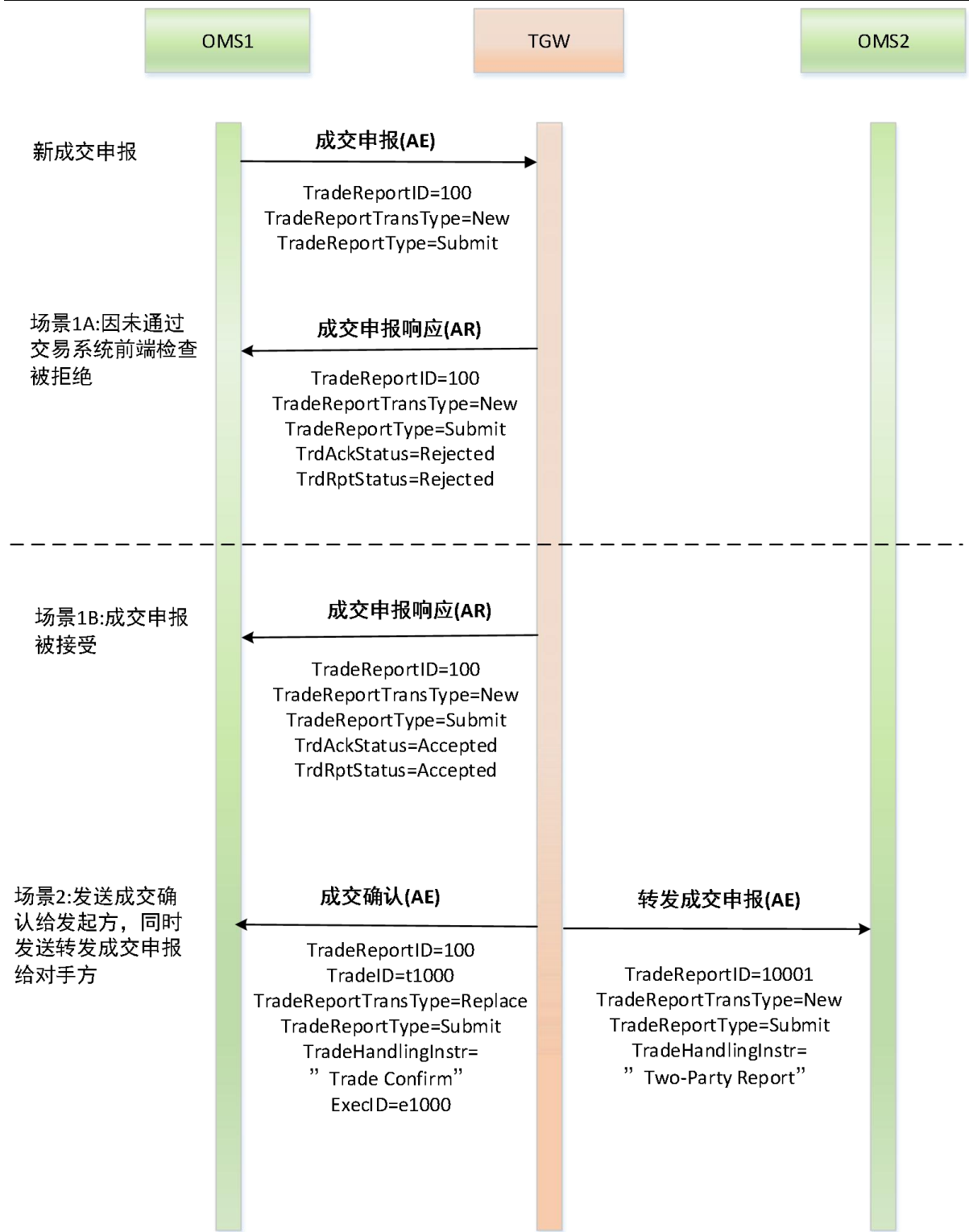


图 3-16 成交报告申报处理消息流示意图

表 3-5 成交报告模式业务列表

应用标识 AppID	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	●			
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)
300	债券质押式协议回购(到期购回)	●	●	●	

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。

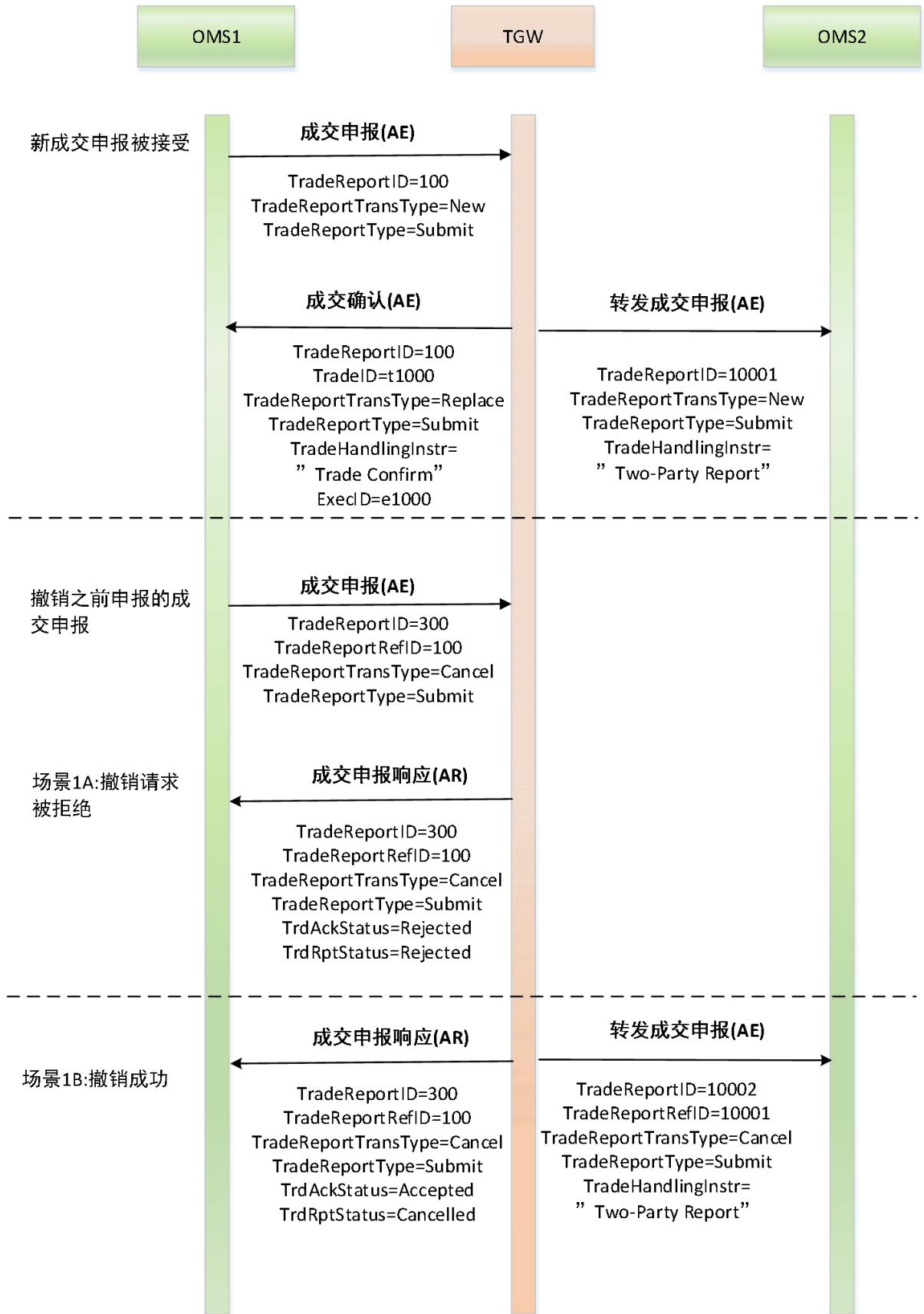


图 3- 17 成交报告撤销成交申报处理消息流示意图

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

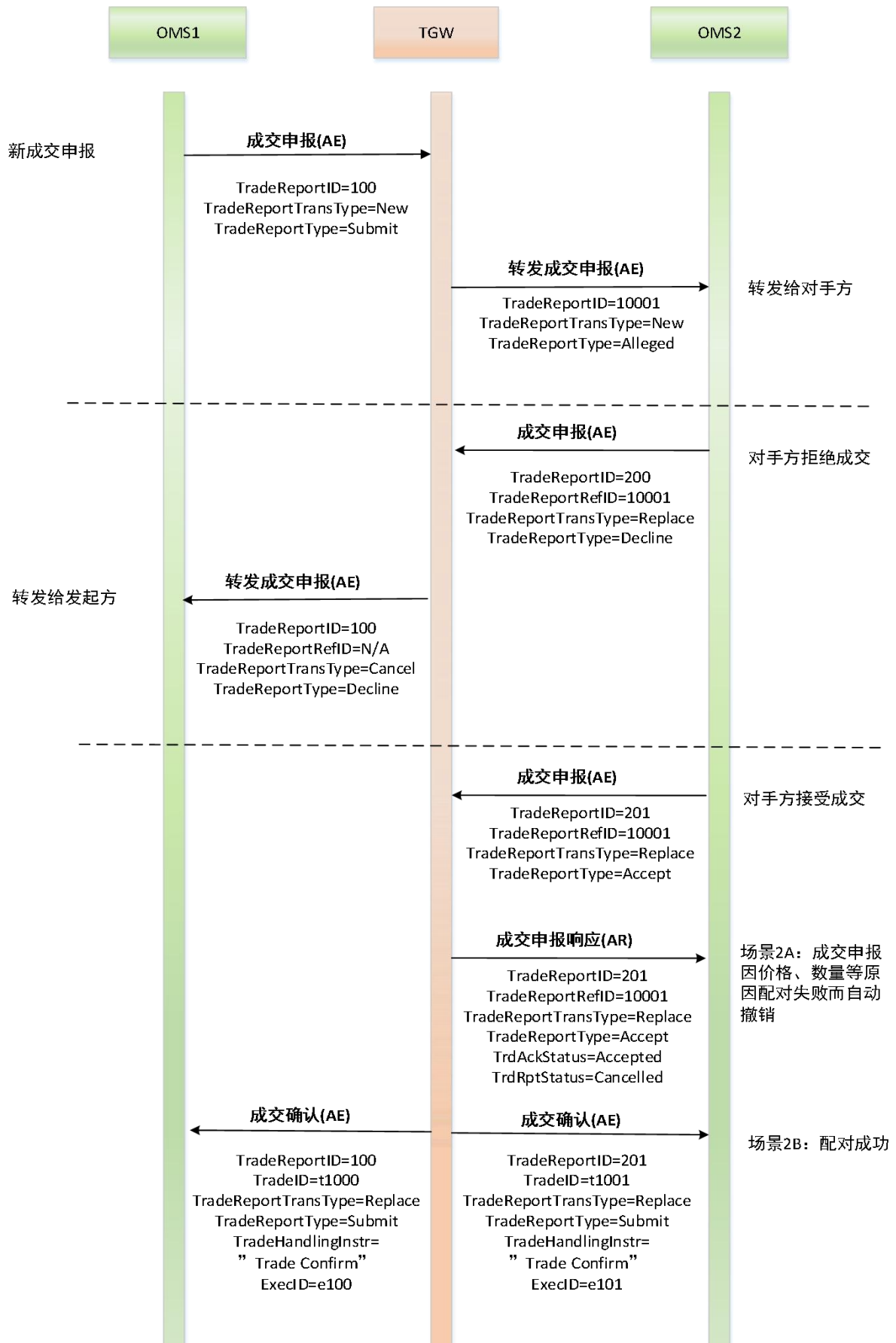


图 3-18 新成交申报处理消息流示意图

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。

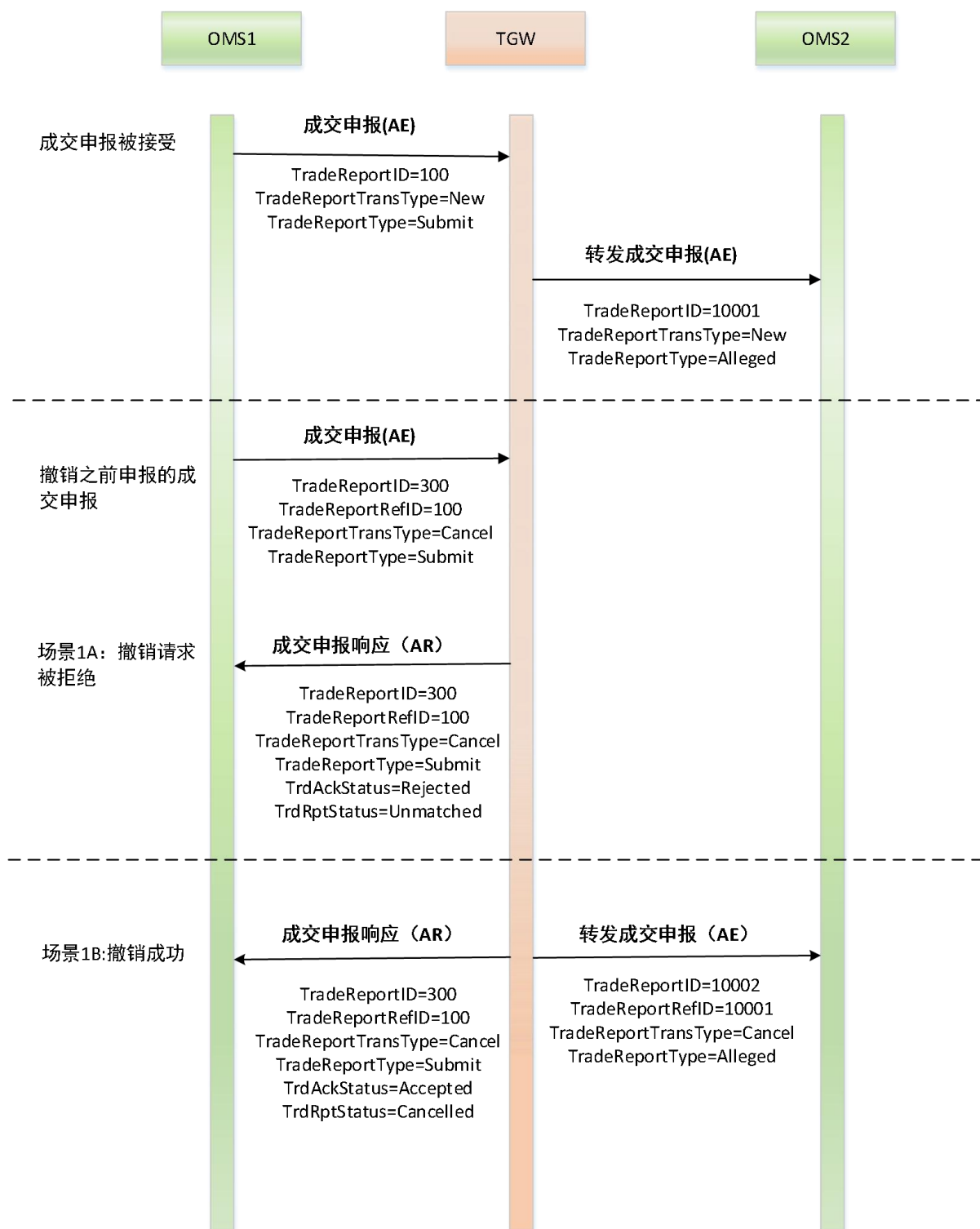


图 3- 19 撤销成交申报处理消息流示意图

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

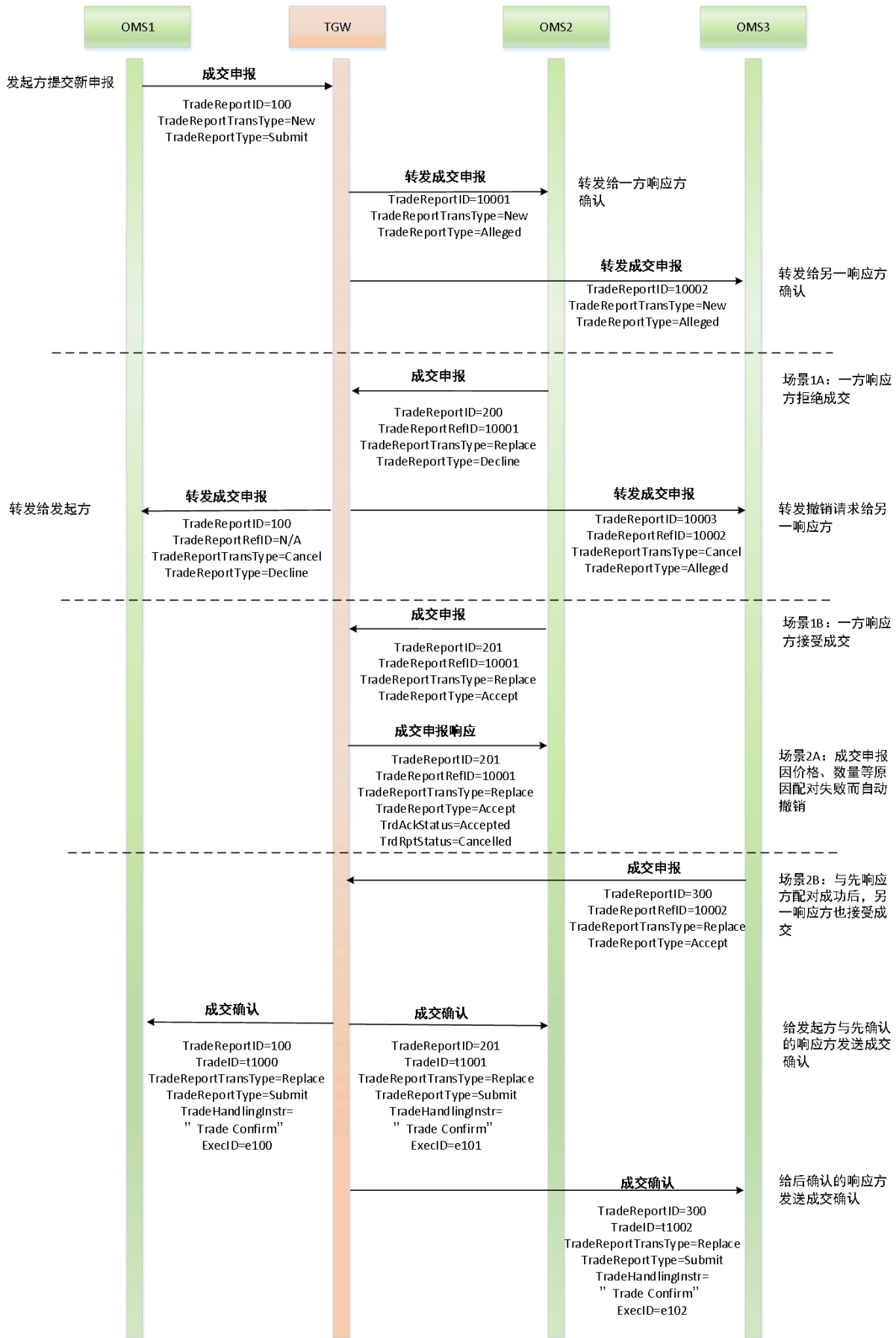


图 3-20 新成交申报处理消息流示意图

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。

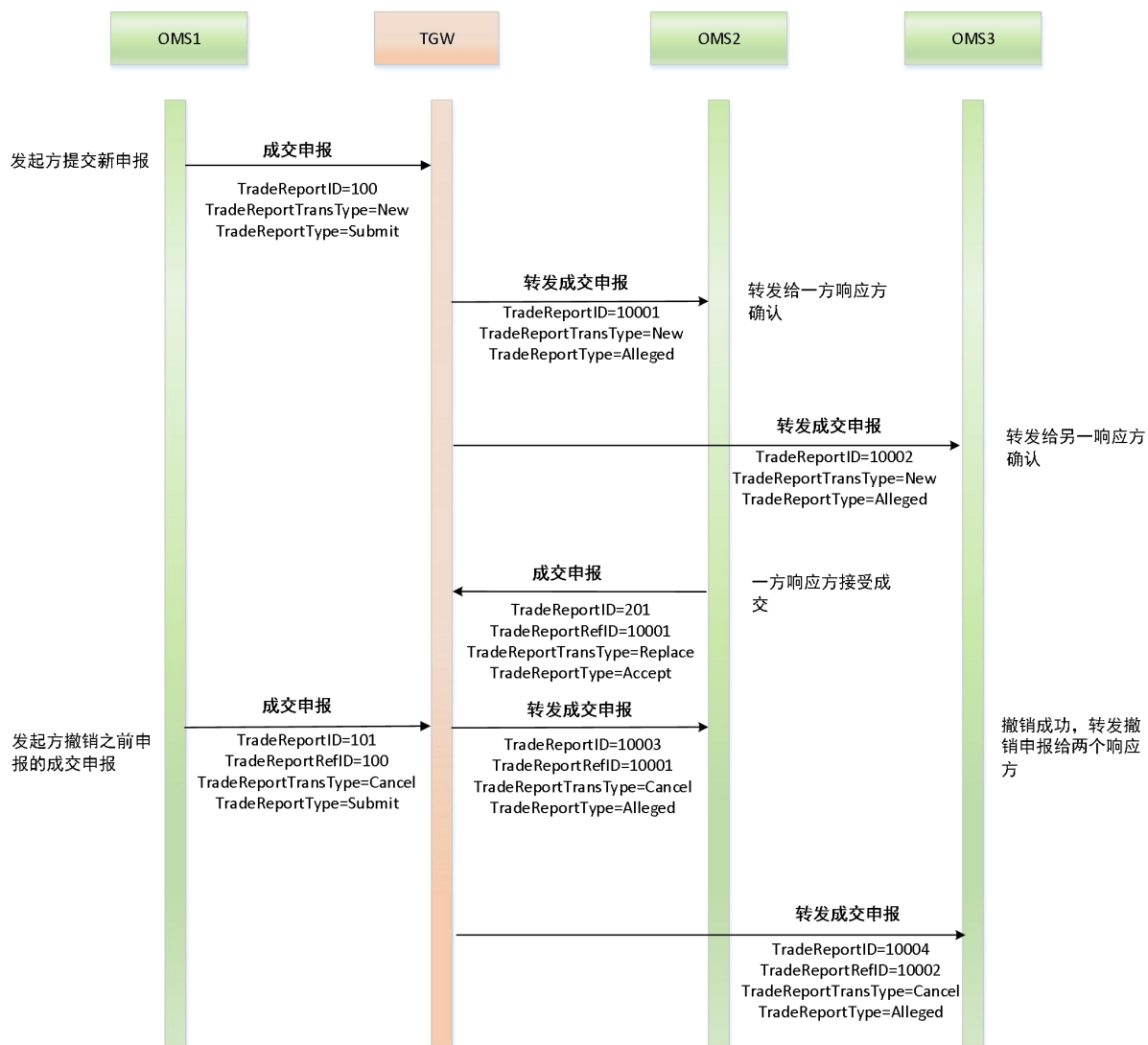


图 3- 21 撤销成交申报处理消息流示意图

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

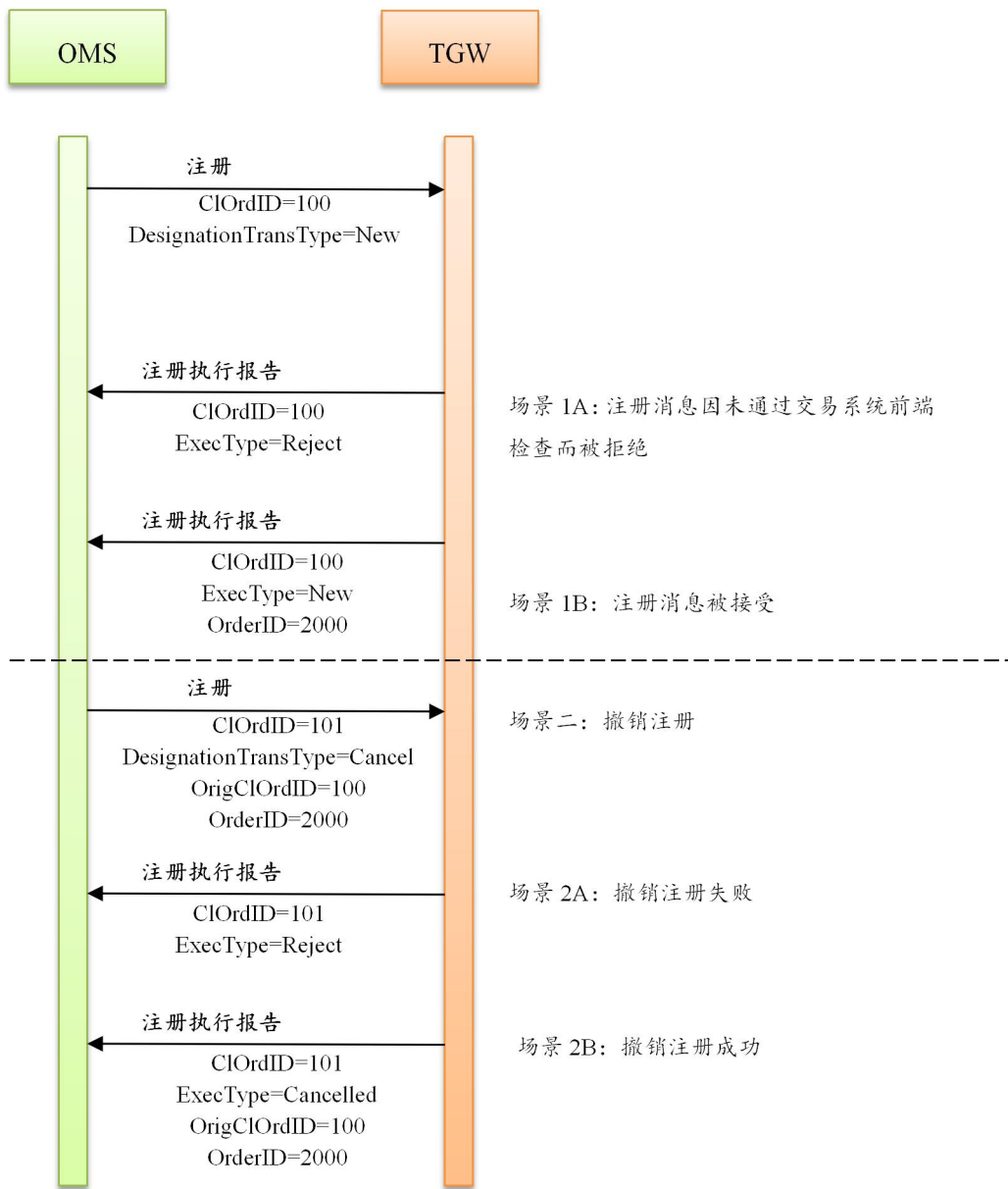


图 3-22 转托管处理消息流示意图

3.11 网络投票处理消息流图

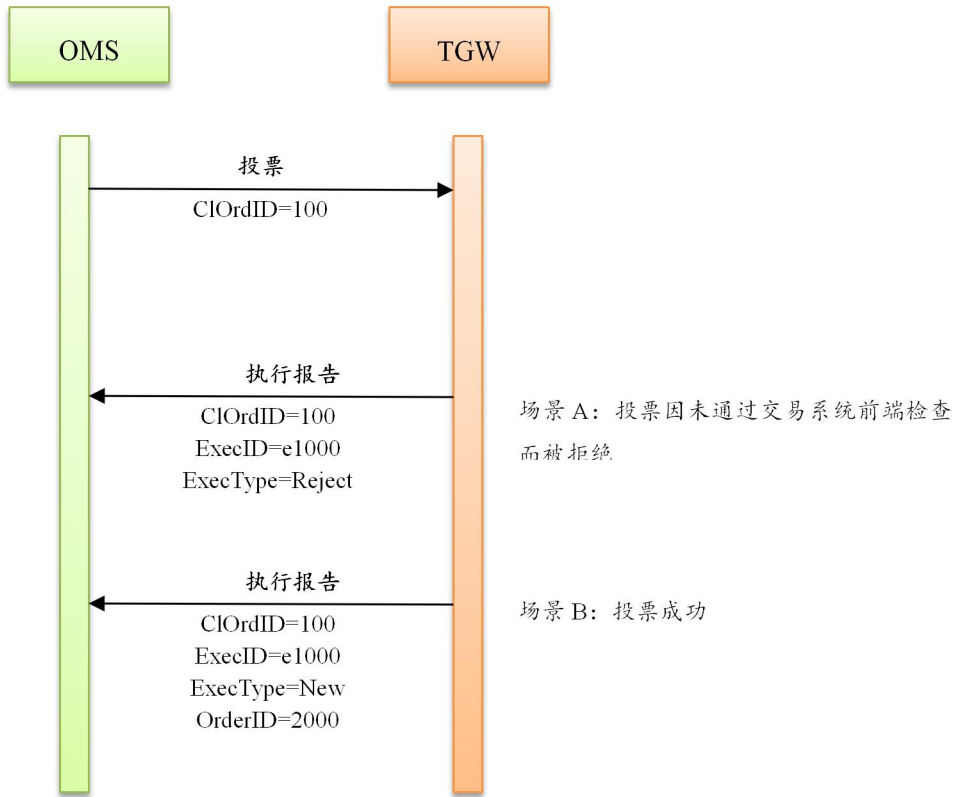


图 3-23 网络投票处理消息流示意图

3.12 密码服务处理消息流图

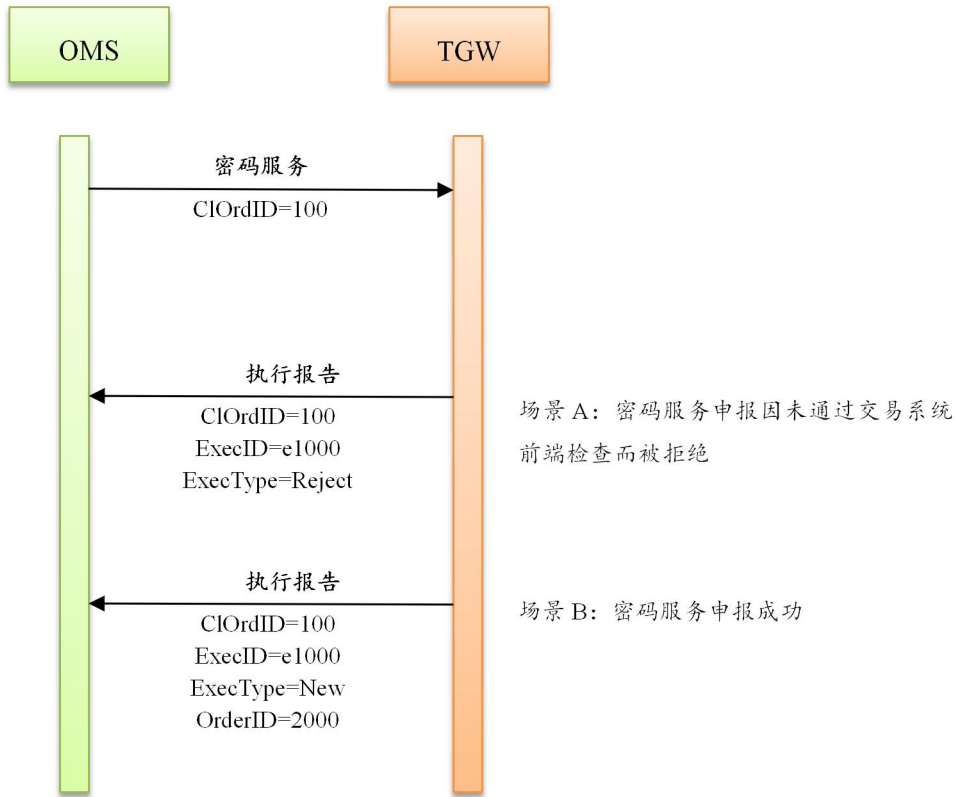


图 3-24 密码服务处理消息流示意图

3.13 保证金查询处理消息流图

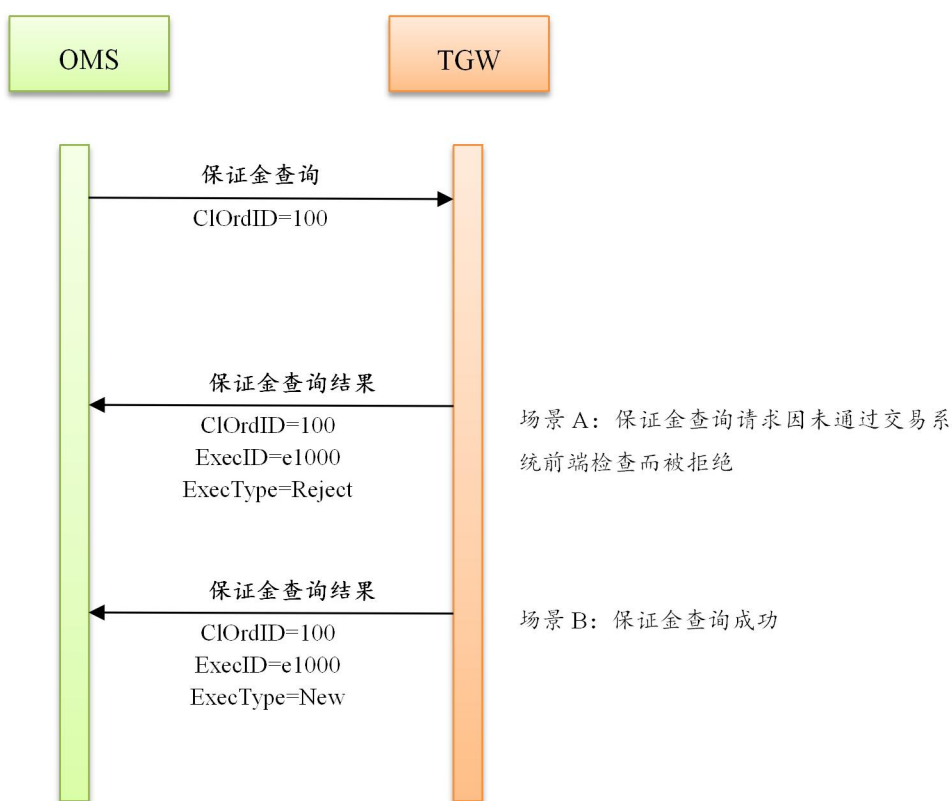


图 3-25 保证金查询处理消息流示意图

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。

表 3-6 订单执行报告类型列表

应用标识 AppIID	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）：

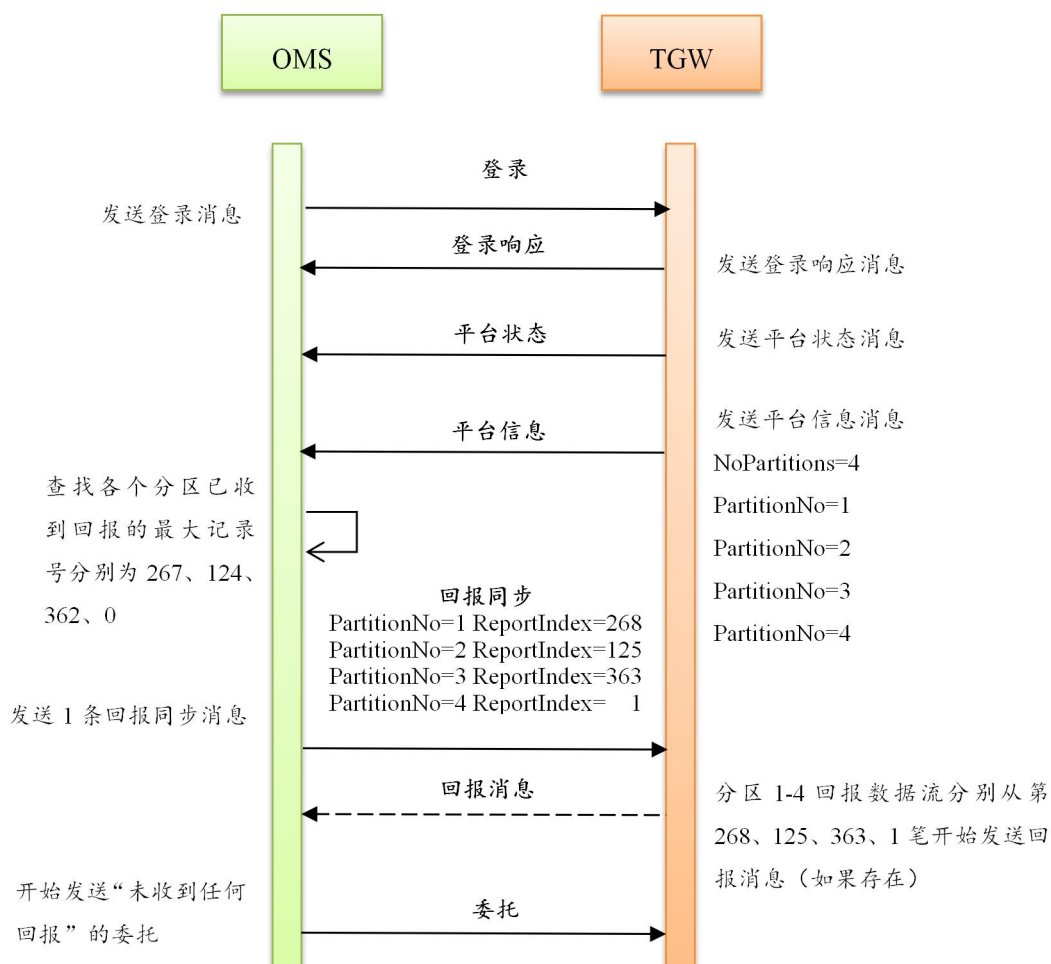


图 3-26 OMS 恢复与 TGW 通信消息流示意图

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)中除了“申报交易单元”外还会多一个“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。

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、在现有 TGW 发送给 OMS 的消息尾部增加新的字段（可能是重复组），OMS 如果不使用这些新增字段，应可以不作变更而自动忽略这些新增字段。

3、保证金查询结果消息（202586）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 成交汇总

部分回报消息类型支持通过成交汇总服务接收数据，具体支持情况参见本文档“业务消息-***”相关章节的注释，如对应章节注释中无特殊说明，即为该消息类型不支持成交汇总服务。

成交汇总服务的其他接口约定参见《深圳证券交易所成交汇总文件接口市场参与者技术系统变更指南》。

4.3 消息结构

每一条消息都由消息头、消息体和消息尾组成。

4.3.1 消息头

消息头定义了应用消息的类型、长度数据域，均不加密传输。

域名	字段描述
MsgType	消息类型
BodyLength	消息体长度

4.3.2 消息尾

消息尾定义了消息的校验和，不加密传输。校验和的计算范围从消息头开始（包括消息头）一直到消息体结束。

域名	字段描述
Checksum	校验和

以下为计算校验和的代码段：

```
uint32 GenerateChecksum( char *buf, uint32 bufLen )
{
    long idx;
    uint32 cks;
    for( idx = 0L, cks = 0; idx < bufLen; cks += (uint32)buf[ idx++ ] );
    return ( cks % 256 );
}
```

4.4 管理消息

4.4.1 登录消息 (Logon)

Logon 消息应该是订单管理系统开始工作时向交易网关发出的第一条消息。订单管理系统使用 **Logon** 消息来与交易网关建立连接，交易网关使用 **Logon** 消息确认订单管理系统登录成功。

表 4-1 OMS 向 TGW 发送申请登录消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 1
SenderCompID	发送方代码
TargetCompID	接收方代码
HeartBtInt	心跳间隔，单位为秒。订单管理系统登陆时提供给交易网关。
Password	密码
DefaultApplVerID	二进制协议版本，即通信版本号。

4.4.2 注销消息 (Logout)

当订单管理系统发起的连接请求不被交易网关接受时，交易网关会向订单管理系统

发送 *Logout* 消息来拒绝登录请求。在必要时订单管理系统也可以主动发送 *Logout* 消息来中断当前和交易网关的连接。

表 4-2 OMS 与 TGW 间注销消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 2
SessionStatus	退出时的会话状态 0 = 会话活跃 1 = 会话口令已更改 2 = 将过期的会话口令 3 = 新会话口令不符合规范 4 = 会话退登完成 5 = 不合法的用户名或口令 6 = 账户锁定 7 = 当前时间不允许登录 8 = 口令过期 9 = 收到的 MsgSeqNum(34)太小 10 = 收到的 NextExpectedMsgSeqNum(789)太大 101 = 其他 102 = 无效消息
Text	文本 注销原因的进一步补充说明

4.4.3 心跳消息 (Heartbeat)

交易网关和订单管理系统之间用 *Heartbeat* 消息来检测 TCP 连接的状态，因此当一方处于数据发送空闲期时，需要定时发送 *Heartbeat* 消息以供检测连接的健康度。

表 4-3 OMS 与 TGW 间心跳消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 3, BodyLength=0

4.5 业务消息-新订单处理

4.5.1 新订单 (New Order)

表 4-4 OMS 向 TGW 报送新订单消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx01
ApplID	应用标识

SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定
Side	买卖方向
OrdType	订单类别 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优
OrderQty	订单数量
Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务新订单的申报

表 4-5 新订单申报类型关键要素取值

业务	应用标识 AppIID	报文号 MsgType	Side (54)	有无扩展 字段	是否允 许撤销
现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易申报	010	100101	1=买 2=卖	Y	Y
债券通用质押式回购交易申报	020	100201	1=买(融资) 2=卖(出资)	Y	Y
债券分销申报	030	100301	1=买(认购) 2=卖(分销)	N	Y
期权集中竞价交易申报	040	100401	1=买	Y	Y

			2=卖		
协议交易定价申报	051	100501	1=买 2=卖	Y	Y
协议交易点击成交申报	052		1=买 2=卖		N
以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	060	100601	1=买 2=卖	Y	Y
以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易申报	061		1=买 2=卖		Y
转融通证券出借非约定申报	070	100701	G=借入 F=出借	Y	Y
ETF 实时申购赎回申报	120	101201	D=申购 E=赎回	Y	N
网上发行认购申报（发行与增发）	130	101301	固定填 1	N	Y
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	140	101401	固定填 1	N	Y
债券转股申报	150	101501	固定填 1	Y	Y
债券回售/购回申报	151		固定填 1		Y
债券回售撤销申报	152		固定填 1		Y
期权行权申报	160	101601	固定填 1	Y	Y
开放式基金申购赎回申报	170	101701	D=申购 E=赎回	Y	Y
要约收购预受要约申报	180	101801	固定填 1	Y	Y
要约收购解除预受要约申报	181		固定填 1		Y
债券通用质押式回购质押申报	190	101901	固定填 1	N	N

债券通用质押式回购解押申报	191		固定填 1		N
权证行权申报	230	102301	固定填 1	N	Y
转处置扣券申报	270	102701	固定填 1	Y	Y
转处置还券申报	271	102701	固定填 1		Y
垫券申报	280	102801	固定填 1	Y	Y
还券申报	281	102801	固定填 1		Y
待清偿扣划客户申报	290	102901	固定填 1	Y	Y
待清偿扣划自营申报	291	102901	固定填 1		Y
分级基金实时分拆申报	310	103101	固定填 1	N	N
分级基金实时合并申报	311	103101	固定填 1		N
港股通新订单申报	630	106301	1=买 2=卖	Y	Y
债券质押式三方回购入库申报	330	103301	固定填 1	N	Y
债券质押式三方回购出库申报	331		固定填 1		Y
期权普通转备兑仓申报	350	103501	固定填 1	Y	N
期权备兑转普通仓申报	351				
盘后定价交易申报	370	103701	1=买 2=卖	Y	Y
债券现券交易匹配成交申报	410	104101	1=买 2=卖	Y	Y
债券现券交易竞买成交申报	417	104128	1=买 2=卖	Y	Y
跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回申报	470	104701	D=申购 E=赎回	Y	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。

4.5.1.1 现货集中竞价交易业务新订单扩展字段 (100101)

表 4-6 现货集中竞价交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
----	------

StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

注:

- 1) 限价委托及五种市价委托申报方式:

表 4-7 现货集中竞价业务新订单申报委托类型定义

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
限价委托	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
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

- 2) 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。

4.5.1.2 债券通用质押式回购交易业务新订单扩展字段 (100201)

表 4-8 债券通用质押式回购交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数

TimeInForce	订单有效时间类型
-------------	----------

注：

1) 债券通用质押式回购交易业务目前只可以申报限价委托：

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
限价委托	0	2	0	0

4.5.1.3 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段（100401）

表 4-9 期权集中竞价交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
PositionEffect	平仓标识 (‘O’：开仓 ‘C’：平仓)
CoveredOrUncovered	备兑标签 (0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑)
ContractAccountCode	合约账户标识码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号 组合策略单边平仓时填组合策略对应的组合流水号(构建组合申报时返回的执行报告中的 OrderID)，其余填全空格

注：

1) 现货集中竞价业务新订单的限价委托及五种市价委托申报方式也适用于期权集中竞价交易业务，此外期权集中竞价还增加“限价全额成交或撤销”委托类型：

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
限价全额成交或撤销	3	2	0	=OrderQty

4.5.1.4 协议交易业务新订单扩展字段 (100501)

表 4-10 协议交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
ConfirmID	约定号 点击成交申报填写
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.5.1.5 盘后定价大宗交易业务新订单扩展字段 (100601)

表 4-11 盘后定价大宗交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.5.1.6 转融通证券出借业务新订单扩展字段 (100701)

表 4-12 转融通证券出借业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
ShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 07=首发后可出借限售股

注: 若使用首发后可出借限售股进行出借, 则 ShareProperty 填 07, 否则填 00。

4.5.1.7 债券转股回售业务新订单扩展字段 (101501)

表 4-13 债券转股回售业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
----	------

ShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 01=首发后限售股 定向可转债转股申报使用限售部分 转股时填‘01’，其他都固定填‘00’。
---------------	---

4.5.1.8 期权行权业务新订单扩展字段 (101601)

表 4-14 期权行权业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5.1.9 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段 (101701)

表 4-15 开放式基金申购赎回业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	申购金额

注：

- 1) LOF 是现金申购，份额赎回，申购时使用 CashOrderQty 填写申购金额，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。

4.5.1.10 要约收购业务新订单扩展字段 (101801)

表 4-16 要约收购业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
Tenderer	收购人编码

4.5.1.11 转处置业务新订单扩展字段 (102701)

表 4-17 转处置业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
DisposalPBU	划入待处置券的交易单元
DisposalAccountID	划入待处置券的证券账户

4.5.1.12 垫券还券业务新订单扩展字段 (102801)

表 4-18 垫券还券业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
LenderPBU	出借券交易单元
LenderAccountID	出借券证券账户

4.5.1.13 待清偿扣划业务新订单扩展字段 (102901)

表 4-19 待清偿扣划业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
DeductionPBU	用于扣划证券的交易单元
DeductionAccountID	用于扣划证券的证券账户

4.5.1.14 港股通业务新订单扩展字段 (106301)

表 4-20 港股通业务新订单扩展字段

域名	字段描述
StopPx	止损价, 预留, 固定填 0
MinQty	最低成交数量, 预留, 固定填 0
MaxPriceLevels	最多成交价位数, 预留, 固定填 0
TimeInForce	订单有效时间类型 0=增强限价盘, Day 9=竞价限价盘, At Crossing
LotType	订单数量类型 1=零股订单, Odd Lot 2=整手订单, Round Lot

4.5.1.15 期权普通与备兑仓互转业务新订单扩展字段 (103501)

表 4-21 期权普通与备兑仓互转业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5.1.16 盘后定价交易业务新订单扩展字段 (103701)

表 4-22 盘后定价交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

	1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓
--	---

4.5.1.17 债券现券交易业务新订单扩展字段

(1) 匹配成交新订单扩展字段 (104101)

表 4-23 匹配成交新订单扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

(2) 竞买成交新订单扩展字段 (104128)

表 4-24 竞买成交新订单扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号
BidTransType	竞买业务类别 1=竞买预约申报 2=竞买发起申报 3=竞买应价申报
BidExecInstType	竞买成交方式

	1=单一主体中标 2=多主体单一价格中标 3=多主体多重价格中标
LowLimitPrice	价格下限
HighLimitPrice	价格上限
MinQty	最低成交数量
TradeDate	交易日期
SettlType	结算方式, 预留
SettlPeriod	结算周期, 预留
PreTradeAnonymity	是否匿名 0=显名 1=匿名
CashMargin	信用标识, 预留 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓
Memo	备注

注：第二交易所订单编号用于填写竞买场次编号，当竞买业务类别为 2 或 3 时，必须填写为竞买场次编号。

4.5.1.18 跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务新订单扩展字段 (104701)

表 4-25 跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
SecondaryOrderID	中央国债登记结算有限责任公司生成的唯一的业务标识号, 由投资者在委托申报时填写

4.5.1.19 ETF 实时申购赎回业务新订单扩展字段 (101201)

表 4-26 ETF 实时申购赎回业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
NoAccounts	其他市场账户信息
→ MarketID	市场代码 XSHG=上海证券交易所
→ PBUID	交易单元

→	AccountID	证券账户
---	-----------	------

注：

- 1) 该扩展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 文件中的非深市成份券的“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。跨市场股票 ETF 如支持全实物申赎模式，则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，其他市场账户信息的重复组为可选字段，可无该字段或重复组个数为 0。

4.5.2 撤单请求 (Order Cancel Request)

表 4-27 OMS 向 TGW 报送撤单请求消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=190007
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
Side	原始订单买卖方向
OrderID	原始订单交易所订单编号 对于撤销当日之前的竞买预约委托，OrigClOrdID 填为空格，OrderID 填被撤委托的交易所订单编号。 其他撤单情形该字段为选填字段，并且交易所对该字段的值不作检查。

OrderQty	原始订单数量 交易所对该字段的值不作检查
----------	-------------------------

4.5.3 撤单失败响应 (Cancel Reject)

表 4-28 TGW 向 OMS 传送撤单失败响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=290008
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
Side	原始订单买卖方向
OrdStatus	原始订单当前状态 如果未找到原始订单，则填 8=Rejected
CxlRejReason	拒绝原因代码
RejectText	拒绝原因说明
OrderID	原始订单交易所订单编号

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。

4.5.4 订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)

表 4-29 TGW 向 OMS 传送订单响应及撤单成功执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx02
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型
OrdStatus	订单状态
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
OrdType	订单类别
OrderQty	订单数量
Price	价格
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码

OrderRestrictions	订单限定
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务的订单响应及撤单成功响应

表 4-30 各类业务订单响应及撤单成功关键要素说明

业务	应用标识 AppID	报文号 MsgType	有无扩展 字段	是否支持 成交汇总
现货（股票，基金，债券等） 集中竞价交易执行报告	010	200102	Y	N
债券通用质押式回购交易执行报告	020	200202	Y	N
债券分销执行报告	030	200302	N	N
期权集中竞价交易执行报告	040	200402	Y	N
协议交易定价执行报告	051	200502	Y	N
协议交易点击成交执行报告	052			
协议交易报价执行报告（报价被撤销时）	056			
以收盘价交易的盘后定价大宗交易执行报告	060	200602	Y	N
以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易执行报告	061			
转融通证券出借非约定执行报告	070	200702	Y	N
股票/债券/货币 ETF 实时申购赎回执行报告 黄金 ETF 现金申购赎回执行报告 跨市场股票 ETF 全实物申购赎回执行报告	120	201202	Y	Y
网上发行认购执行报告（发行与增发）	130	201302	N	Y
网上发行认购执行报告（基础设施基金非定向扩募-向	131			

原持有人配售)				
网上发行认购执行报告(基础设施基金非定向扩募-公开发售)	132			
配股认购执行报告	140	201402	N	Y
债券转股执行报告	150	201502	N	Y
债券回售执行报告	151			
债券回售撤销执行报告	152			
期权行权执行报告	160	201602	Y	Y
开放式基金申购赎回执行报告	170	201702	Y	Y
要约收购预受要约执行报告	180	201802	Y	Y
要约收购解除预受要约执行报告	181			
债券通用质押式回购质押执行报告	190	201902	N	Y
债券通用质押式回购解押执行报告	191			
黄金ETF实物申购赎回执行报告	220	202202	N	Y
权证行权执行报告	230	202302	N	Y
转处置扣券执行报告	270	202702	Y	Y
转处置还券执行报告	271	202702		
垫券执行报告	280	202802	Y	Y
还券执行报告	281	202802		
待清偿扣划客户申报执行报告	290	202902	Y	Y
待清偿扣划自营申报执行报告	291	202902		
分级基金实时分拆申报	310	203102	Y	Y
分级基金实时合并申报	311	203102		
港股通订单执行报告	630	206302	Y	N
债券质押式三方回购入库执行报告	330	203302	N	Y

债券质押式三方回购出库执行报告	331	203302		
期权普通转备兑仓执行报告	350	203502	Y	Y
期权备兑转普通仓执行报告	351	203502		
盘后定价交易执行报告	370	203702	Y	N
债券现券交易匹配成交执行报告	410	204102	Y	N
债券现券交易报价执行报告 (点击成交报价被撤销时)	412			
债券现券交易报价执行报告 (询价成交报价被撤销时)	415			N
债券现券交易竞买成交执行报告	417	204129	Y	N
跨银行间实物债券ETF实物 申购赎回执行报告	470	204702	Y	Y

4.5.4.1 现货集中竞价交易业务执行报告扩展字段 (200102)

表 4-31 现货集中竞价交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识

4.5.4.2 债券通用质押式回购交易业务执行报告扩展字段 (200202)

表 4-32 债券通用质押式回购交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数

TimeInForce	订单有效时间类型
-------------	----------

4.5.4.3 期权集中竞价交易业务执行报告扩展字段 (200402)

表 4-33 期权集中竞价交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
PositionEffect	平仓标识 ('O' : 开仓 'C' : 平仓)
CoveredOrUncovered	备兑标签 (0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑) 目前仅适用于期权集中竞价业务
ContractAccountCode	合约账户标识码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号

4.5.4.4 协议交易业务执行报告扩展字段 (200502)

表 4-34 协议交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ConfirmID	约定号
CashMargin	信用标识

4.5.4.5 盘后定价大宗交易业务执行报告扩展字段 (200602)

表 4-35 盘后定价大宗交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.5.4.6 转融通证券出借业务执行报告扩展字段 (200702)

表 4-36 转融通证券出借业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
----	------

ExpirationDays	期限，单位为天数
ExpirationType	期限类型
ShareProperty	股份性质

4.5.4.7 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段（201202）

表 4-37 ETF 实时申购赎回业务执行报告扩展字段定义

域名		字段描述
InsufficientSecurityID		申赎不足成份股证券代码 申购时如果投资者持有成份股不足，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，填写第一只不足额的成份股代码
NoSecurity		成份股记录数
→	UnderlyingSecurityID	成份股证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源 101=上海证券交易所 102=深圳证券交易所
→	DeliveryQty	股份交付数量
→	SubstCash	现金替代金额
NoAccounts		其他市场账户信息
→	MarketID	市场代码 XSHG=上海证券交易所
→	PBUID	交易单元
→	AccountID	证券账户

注：

1) 对于支持全实物申赎模式的跨市场股票 ETF 申赎，NoSecurity 重复组信息将包含上海成份券的申赎对价明细；InsufficientSecurityID 可能是申赎不足的上海成份券证券代码。

4.5.4.8 债券转股回售业务执行报告扩展字段（201502）

表 4-38 债券转股回售业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
----	------

ShareProperty	股份性质
---------------	------

4.5.4.9 期权行权业务执行报告扩展字段 (201602)

表 4-39 期权行权业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5.4.10 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段 (201702)

表 4-40 开放式基金申购赎回业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	申购金额

4.5.4.11 要约收购业务执行报告扩展字段 (201802)

表 4-41 要约收购业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
Tenderer	收购人编码

4.5.4.12 转处置券业务执行报告扩展字段 (202702)

表 4-42 转处置券业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
DisposalPBU	划入待处置券的交易单元
DisposalAccountID	划入待处置券的证券账户

4.5.4.13 垫券还券业务执行报告扩展字段 (202802)

表 4-43 垫券还券业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
LenderPBU	出借券交易单元
LenderAccountID	出借券证券账户

4.5.4.14 待清偿扣划业务执行报告扩展字段 (202902)

表 4-44 待清偿扣划业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
----	------

DeductionPBU	用于扣划证券的交易单元
DeductionAccountID	用于扣划证券的证券账户

4.5.4.15 分级基金实时分拆合并业务执行报告扩展字段 (203102)

表 4-45 分级基金实时分拆合并业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
InsufficientSecurityID	合并不足子基金代码 合并时如果投资者持有子基金不足, 填写第一只不足额的子基金代码
NoSecurity	子基金记录数
→ UnderlyingSecurityID	子基金证券代码
→ UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→ DeliveryQty	子基金交付数量

4.5.4.16 港股通业务执行报告扩展字段 (206302)

表 4-46 港股通业务执行报告扩展字段

域名	字段描述
RejectText	拒绝原因说明 (填写联交所拒绝原因代码)
StopPx	止损价, 预留, 固定填 0
MinQty	最低成交数量, 预留, 固定填 0
MaxPriceLevels	最多成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
LotType	订单数量类型
IMCRejectTextLen	联交所拒绝原因说明长度
IMCRejectText	联交所拒绝原因说明

注:

- 1) 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。

4.5.4.17 期权普通与备兑仓互转业务执行报告扩展字段 (203502)

表 4-47 期权普通与备兑仓互转业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.5.4.18 盘后定价交易业务执行报告扩展字段 (203702)

表 4-48 盘后定价交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.5.4.19 债券现券交易业务执行报告扩展字段

(1) 匹配成交执行报告扩展字段 (204102)

表 4-49 匹配成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识

(2) 竞买成交执行报告扩展字段 (204129)

表 4-50 竞买成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号
BidTransType	竞买业务类别
BidExecInstType	竞买成交方式

LowLimitPrice	价格下限
HighLimitPrice	价格上限
MinQty	最低成交数量
TradeDate	交易日期
SettlType	结算方式, 预留
SettlPeriod	结算周期, 预留
PreTradeAnonymity	是否匿名
CashMargin	信用标识, 预留
Memo	备注

注：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。

4.5.4.20 跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务执行报告扩展字段 (204702)

表 4-51 跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
SecondaryOrderID	中央国债登记结算有限责任公司生成的唯一的业务标识号, 由投资者在委托申报时填写

4.5.5 订单成交执行报告 (Execution Report)

表 4-52 TGW 向 OMS 传送订单成交执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx15
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码

TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型
OrdStatus	订单状态
LastPx	成交价
LastQty	成交数量
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务订单成交回报

表 4-53 各类业务订单成交回报关键要素说明

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	有无扩展 字段	是否支持 成交汇总
现货（股票，基金，债券等） 集中竞价交易执行报告	010	200115	Y	Y
债券通用质押式回购交易执 行报告	020	200215	Y	Y
债券分销执行报告	030	200315	N	Y
期权集中竞价交易执行报告	040	200415	Y	Y
协议交易定价执行报告	051	200515	Y	Y
协议交易点击成交执行报告	052			
协议交易报价执行报告	056			
协议交易报价回复执行报告	057			

以收盘价交易的盘后定价大宗交易执行报告	060	200615	Y	Y
以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易执行报告	061			
转融通证券出借非约定执行报告	070	200715	Y	Y
港股通订单执行报告	630	206315	N	Y
盘后定价交易执行报告	370	203715	Y	Y
债券现券交易匹配成交成交执行报告	410	204115	Y	Y
债券现券交易点击成交报价执行报告	412			
债券现券交易点击成交报价回复执行报告	413			
债券现券交易询价成交报价执行报告	415			
债券现券交易询价成交报价回复执行报告	416			
债券现券交易竞买成交成交执行报告	417	204130	Y	Y

4.5.5.1 现货集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段 (200115)

表 4-54 现货集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.5.5.2 债券通用质押式回购交易业务成交执行报告扩展字段 (200215)

表 4-55 债券通用质押式回购交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
MaturityDate	到期日

注：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。

4.5.5.3 期权集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段（200415）

表 4-56 期权集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
PositionEffect	平仓标识 ('O' : 开仓 'C' : 平仓)
CoveredOrUncovered	备兑标签 (0=Covered, 表示备兑 1=UnCovered, 表示非备兑) 目前仅适用于期权集中竞价业务
ContractAccountCode	合约账户标识码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号

4.5.5.4 协议交易业务执行报告扩展字段（200515）

表 4-57 协议交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ConfirmID	约定号
CashMargin	信用标识

4.5.5.5 盘后定价大宗交易业务执行报告扩展字段（200615）

表 4-58 盘后定价大宗交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.5.5.6 转融通证券出借业务成交执行报告扩展字段（200715）

表 4-59 转融通证券出借业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型
MaturityDate	到期日
ShareProperty	股份性质

4.5.5.7 盘后定价交易业务执行报告扩展字段（203715）

表 4-60 盘后定价交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.5.5.8 债券现券交易业务成交执行报告扩展字段

(1) 匹配成交成交执行报告扩展字段 (204115)

表 4-61 匹配成交成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码

注：

应用标识 ApplID	SettlType	SettlPeriod	CounterpartyMemberID/ CounterpartyInvestorType/ CounterpartyInvestorID/ CounterpartyInvestorName/ CounterpartyTraderCode
410	0	0	全空格
412	取委托中对 应字段的值	取委托中对 应字段的值	取与该委托产生成交的对手方信 息
413			
415			
416			

(2) 竞买成交成交执行报告扩展字段 (204130)

表 4-62 竞买成交成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型

InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号
BidTransType	竞买业务类别
BidExecInstType	竞买成交方式
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期
CashMargin	信用标识
Memo	备注

4.6 业务消息-报价处理

4.6.1 报价 (Quote)

表 4-63 OMS 向 TGW 报送报价消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx05
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 取 102, 表示代码源为深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号

AccountID	证券账户
QuoteReqID	询价请求编号 当报价是对询价请求的响应时, 填写转发询价请求的 QuoteReqID
QuoteType	报价类型 1=可交易的报价 (Tradeable)
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务报价申报

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
041	期权集中竞价交易报价申报	100405	Y
056	协议交易报价申报	100505	Y
412	债券现券交易点击成交报价申报	104105	Y
415	债券现券交易询价成交报价申报		

2) 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	OfferSize
双边报价	>0	>0
买报价	>0	=0
卖报价	=0	>0
撤销报价	=0	=0

4.6.1.1 期权集中竞价交易业务报价扩展字段 (100405)

表 4-64 期权集中竞价交易业务报价扩展字段定义

域名	字段描述
BidPositionEffect	买平仓标识

	('O' : 开仓 'C' : 平仓) BidSize=0 时该字段无意义, 填写空格
OfferPositionEffect	卖平仓标识 ('O' : 开仓 'C' : 平仓) OfferSize=0 时该字段无意义, 填写空格
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.6.1.2 协议交易业务报价扩展字段 (100505)

表 4-65 协议交易业务报价扩展字段定义

域名	字段描述
BranchID	营业部代码
QuoteID	报价消息编号, 主动撤单时填与被撤委托的 QuoteID 一致
QuoteRespID	报价回复消息编号
PrivateQuote	私有报价
ValidUntilTime	报价有效时间, 预留
PriceType	价格类型, 预留 1=百分比 (Percentage) 2=每交易单位 (Per unit)
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
Memo	备注

4.6.1.3 债券现券交易业务报价扩展字段 (104105)

表 4-66 债券现券交易业务报价扩展字段定义

域名	字段描述
BranchID	营业部代码
QuoteID	报价消息编号, 主动撤单时填

		与被撤委托的 QuoteID 一致
QuoteRespID		报价回复消息编号
PrivateQuote		私有报价
ValidUntilTime		报价有效时间, 预留
PriceType		价格类型, 预留 1=百分比 (Percentage) 2=每交易单位 (Per unit)
CashMargin		信用标识, 预留
MemberID		本方交易商代码
InvestorType		本方交易主体类型
InvestorID		本方交易主体代码
InvestorName		本方客户名称
TraderCode		本方交易员代码
SettlType		结算方式
SettlPeriod		结算周期
PreTradeAnonymity		是否匿名
MaxFloor		可显示数量, 预留
MinQty		最低成交数量
Memo		备注
NoCounterparty		对手方个数
→	CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
→	CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
→	CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
→	CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
→	CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码

4.6.2 报价状态回报 (Quote Status Report)

表 4-67 TGW 向 OMS 传送报价状态回报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx06
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号
AccountID	证券账户
QuoteReqID	询价请求编号
QuoteStatus	报价状态 0=Accepted, 已接受 4=Cancelled, 已撤销 5=Rejected, 已拒绝 7=Expired, 已超时
QuoteRejectReason	拒绝原因代码
QuoteType	报价类型
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务报价状态的回报

应用标识	说明	报文号	有无扩展
------	----	-----	------

ApplID		MsgType	字段
041	期权集中竞价交易报价状态回报	200406	Y
056	协议交易报价申报的报价状态回报	200506	Y
057	协议交易报价回复的报价状态回报		
412	债券现券交易点击成交报价申报的报价状态回报	204106	Y
413	债券现券交易点击成交报价回复的报价状态回报		
415	债券现券交易询价成交报价申报的报价状态回报		
416	债券现券交易询价成交报价回复的报价状态回报		

4.6.2.1 期权集中竞价业务报价状态回报扩展字段 (200406)

表 4-68 期权集中竞价交易业务报价状态回报扩展字段定义

域名	字段描述
BidPositionEffect	买平仓标识 ('O' : 开仓 'C' : 平仓)
OfferPositionEffect	卖平仓标识 ('O' : 开仓 'C' : 平仓)
ContractAccountCode	合约账户标识码

4.6.2.2 协议交易业务报价状态回报扩展字段 (200506)

表 4-69 协议交易业务报价状态回报扩展字段定义

域名	字段描述
BranchID	营业部代码
OrderID	交易所订单编号
ExecID	执行编号
QuoteRespID	报价回复消息编号
PrivateQuote	私有报价

Side	方向
PriceType	价格类型, 预留
ValidUntilTime	报价有效时间, 预留
CashMargin	信用标识, 预留
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
Memo	备注
NoQuote	报价消息个数
→	QuoteID 报价消息编号
→	QuotePrice 报价价格
→	QuoteQty 报价数量

注：1) 报价状态回报作为报价消息 (ApplID 为 056) 的响应时, NoQuote 取值为 1, QuoteID 填报价消息的 QuoteID, QuotePrice、QuoteQty 为 0;

2) 报价状态回报作为报价回复消息 (ApplID 为 057) 的响应时, NoQuote、QuoteID、QuotePrice、QuoteQty 取值同报价回复消息的对应字段取值。

4.6.2.3 债券现券交易业务报价状态回报扩展字段 (204106)

表 4-70 债券现券交易业务报价状态回报扩展字段定义

域名	字段描述
BranchID	营业部代码
OrderID	交易所订单编号
QuoteRejectText	拒绝原因说明
ExecID	执行编号
QuoteRespID	报价回复消息编号
PrivateQuote	私有报价
Side	方向
PriceType	价格类型, 预留
ValidUntilTime	报价有效时间, 预留
CashMargin	信用标识, 预留
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码

SettlType		结算方式
SettlPeriod		结算周期
PreTradeAnonymity		是否匿名
MaxFloor		可显示数量
MinQty		最低成交数量
Memo		备注
NoCounterparty		对手方个数
→	CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
→	CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
→	CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
→	CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
→	CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
NoQuote		报价消息个数
→	QuoteID	报价消息编号
→	QuotePrice	报价价格
→	QuoteQty	报价数量

注：1) 报价状态回报作为报价消息（ApplID 为 412、415）的响应时，NoQuote 取值为 1，QuoteID 填报价消息的 QuoteID，QuotePrice、QuoteQty 为 0；

2) 报价状态回报作为报价回复消息（ApplID 为 413、416）的响应时，NoQuote、QuoteID、QuotePrice、QuoteQty 取值同报价回复消息的对应字段取值；NoCounterparty 取值为 0。

4.6.3 报价回复 (Quote Response)

表 4-71 OMS 向 TGW 报送报价回复消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx10

ApplID	应用标识	
SubmittingPBUID	申报交易单元	
SecurityID	证券代码	
SecurityIDSource	证券代码源 取 102, 表示代码源为深圳证券交易所	
OwnerType	订单所有者类型	
ClearingFirm	结算机构代码	
TransactTime	委托时间	
UserInfo	用户私有信息	
ClOrdID	客户订单编号	
AccountID	证券账户	
BranchID	营业部代码	
QuoteRespID	报价回复消息编号	
QuoteRespType	报价回复类型 1=Hit/Lift, 接受 2=Counter, 重报 6=Pass, 拒绝	
Side	方向	
ValidUntilTime	报价有效时间, 预留	
QuoteType	报价类型	
PriceType	价格类型, 预留	
NoQuote	报价消息个数	
→	QuoteID	报价消息编号
→	QuotePrice	报价价格
→	QuoteQty	报价数量
Extend Fields	各业务扩展字段	

注:

2) 该消息用于以下业务报价回复申报

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
057	协议交易报价回复申报	100510	Y

413	债券现券交易点击成交报价 回复申报	104110	Y
416	债券现券交易询价成交报价 回复申报		

4.6.3.1 协议交易业务报价回复扩展字段 (100510)

域名	字段描述
CashMargin	信用标识, 预留 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.6.3.2 债券现券交易业务报价回复扩展字段 (104110)

域名	字段描述
CashMargin	信用标识, 预留
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期

4.6.4 转发报价 (Allege Quote)

表 4-72 TGW 向 OMS 传送转发报价消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx26
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元

SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ExecID	执行编号
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
QuoteReqID	询价请求消息编号
QuoteID	报价消息编号
QuoteRespID	报价回复消息编号
QuoteType	报价类型
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
PrivateQuote	私有报价
ValidUntilTime	报价有效时间, 预留
PriceType	价格类型, 预留
Memo	备注
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务的转发报价

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
056	协议交易转发报价	200526	Y
412	债券现券交易点击成交转发 报价	204126	Y
415	债券现券交易询价成交转发		

	报价		
--	----	--	--

4.6.4.1 协议交易业务转发报价扩展字段 (200526)

表 4-73 协议交易业务转发报价扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识, 预留
CounterpartyPBUID	对手方交易单元

4.6.4.2 债券现券交易业务转发报价扩展字段 (204126)

表 4-74 债券现券交易业务转发报价扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识, 预留
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期
MaxFloor	可显示数量
MinQty	最低成交数量

4.6.5 转发报价回复 (Allege Quote Response)

表 4-75 TGW 向 OMS 传送报价回复消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx27
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ExecID	执行编号
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
QuoteID	报价消息编号
QuoteRespID	报价回复消息编号
QuoteRespType	报价回复类型
PrivateQuote	私有报价
OrderQty	数量
Price	价格
Side	方向
ValidUntilTime	报价有效时间, 预留
QuoteType	报价类型
PriceType	价格类型, 预留
Extend Fields	各业务扩展字段

4.7 业务消息-询价申报处理

4.7.1 询价请求 (Quote Request)

表 4-76 OMS 向 TGW 报送询价申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx17
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
QuoteReqID	询价请求编号, 主动撤单时填与被撤委托的 QuoteReqID 一致
QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0-New, 新订单 1-Cancel, 撤销
PrivateQuote	私有报价 0=私有报价 (Private Quote) 1=公开报价 (Public Quote)
OrderQty	数量
Price	价格
Side	方向 1=买 2=卖
ExpireTime	询价请求失效时间, 预留
QuoteType	报价类型

	1=可交易的报价 (Tradeable)
QuotePriceType	报价价格类型, 预留 1=百分比 (Percent of par) 2=每股 (Per Share)
Memo	备注
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务询价请求

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
055	协议交易询价请求	100517	Y
414	债券现券交易询价请求	104117	Y

4.7.1.1 协议交易业务询价请求扩展字段 (100517)

表 4-77 协议交易业务询价请求扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识, 预留
NoCounterpartyPBU	对手方交易单元个数
→ CounterpartyPBUID	对手方交易单元

4.7.1.2 债券现券交易业务询价请求扩展字段 (104117)

表 4-78 债券现券交易业务询价请求扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期
PreTradeAnonymity	是否匿名
NoCounterparty	对手方个数

→	CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
→	CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
→	CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
→	CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
→	CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码

4.7.2 询价请求响应 (Quote Request Ack)

表 4-79 TGW 向 OMS 传送询价请求响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx17
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ExecID	执行编号
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码

QuoteReqID	询价请求编号
QuoteRequestTransType	询价请求事务类型
QuoteRequestType	询价请求类型 101=Submit, 提交 102=Alleged, 转发
PrivateQuote	私有报价
QuoteRequestStatus	询价请求状态 0=Accepted, 已接受 4=Cancelled, 已撤销 5=Rejected, 已拒绝 7=Expired, 已超时 8=Filled, 已成交
QuoteRequestRejectReason	拒绝原因代码
OrderQty	数量
Price	价格
Side	方向
ExpireTime	询价请求失效时间
QuoteType	报价类型
QuotePriceType	报价价格类型, 预留
Memo	备注
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务询价请求响应

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
055	协议交易询价请求响应	200517	Y
414	债券现券交易询价请求响应	204117	Y

2) 对于询价请求响应扩展字段定义同询价请求一致的业务不再单独列出扩展字段, 请参考对应询价请求消息定义。

4.7.2.1 债券现券交易业务询价请求响应扩展字段 (204117)

表 4-80 债券现券交易业务询价请求响应扩展字段定义

域名		字段描述
MemberID		本方交易商代码
InvestorType		本方交易主体类型
InvestorID		本方交易主体代码
InvestorName		本方客户名称
TraderCode		本方交易员代码
SettlType		结算方式
SettlPeriod		结算周期
PreTradeAnonymity		是否匿名
QuoteRequestRejectText		拒绝原因说明
NoCounterparty		对手方个数
→	CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
→	CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
→	CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
→	CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
→	CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码

4.7.3 转发询价请求 (Allege Quote Request)

表 4-81 TGW 向 OMS 传送转发询价请求消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx25
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元

SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ExecID	执行编号
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
QuoteReqID	询价请求编号
QuoteRequestTransType	询价请求事务类型
QuoteRequestType	询价请求类型
QuoteRequestStatus	询价请求状态
PrivateQuote	私有报价
OrderQty	数量
Price	价格
Side	方向
ExpireTime	询价请求失效时间
QuoteType	报价类型
QuotePriceType	报价价格类型, 预留
Memo	备注
Extend Fields	各业务扩展字段

注:

1) 该消息用于以下业务转发询价请求

应用标识 AppIID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
055	协议交易转发询价请求	200525	Y
414	债券现券交易转发询价请求	204125	Y

4.7.3.1 协议交易业务转发询价请求扩展字段 (200525)

表 4-82 协议交易业务转发询价请求扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识, 预留
CounterpartyPBUID	对手方交易单元

4.7.3.2 债券现券交易业务转发询价请求扩展字段 (204125)

表 4-83 债券现券交易业务转发询价请求扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期

4.8 业务消息-意向申报处理

4.8.1 意向申报 (Indication of Interest)

表 4-84 OMS 向 TGW 报送意向申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx09
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元

SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码 固定填全空格
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
IOIID	客户意向申报编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
IOITransType	意向申报类型 取值为：N=意向申报, C=意向申报撤单
Side	买卖方向 1 表示买 2 表示卖
IOIRefID	原意向申报 IOIID
IOIQty	数量
Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务的意向申报

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
050	协议交易意向申报	100509	Y

4.8.1.1 协议交易意向申报扩展字段 (100509)

表 4-85 协议交易意向申报扩展字段定义

域名	字段描述
Contactora	联系人
ContactInfo	联系方式

4.8.2 意向申报响应 (Quote Response)

表 4-86 TGW 向 OMS 传送意向申报响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx10
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteRespID	交易所意向申报响应编号
QuoteRespType	响应类型 2=意向申报响应
ExecType	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
QuoteRejectReason	拒绝原因代码
IOIID	客户意向申报编号
IOIRefID	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
IOITransType	意向申报类型
Side	买卖方向
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
IOIQty	数量

Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务的意向申报响应

应用标识 ApplID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
050	协议交易意向申报响应	200510	Y

4.8.2.1 协议交易意向申报响应扩展字段（200510）

表 4-87 协议交易意向申报响应扩展字段定义

域名	字段描述
Contactor	联系人
ContactInfo	联系方式

4.9 业务消息-成交申报处理

4.9.1 成交申报（Trade Capture Report）

表 4-88 OMS 向 TGW 报送成交申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx03
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=Accept, 接受成交申报

	3=Decline, 拒绝成交申报
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3=One-Party Report for Pass Through, 成交请求 5=Two Party Report for Claim, 双边确认成交报告
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	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

	<p>1021=质押式报价回购初始交易</p> <p>1022=质押式报价回购提前购回</p> <p>1031=债券质押式协议回购初始交易</p> <p>1032=债券质押式协议回购到期购回</p> <p>1033=债券质押式协议回购到期续做</p> <p>1034=债券质押式协议回购提前购回</p> <p>1035=债券质押式协议回购解除质押</p> <p>1036=债券质押式协议回购质押券变更</p> <p>1041=债券质押式三方回购初始交易</p> <p>1042=债券质押式三方回购到期购回</p> <p>1043=债券质押式三方回购到期续做</p> <p>1044=债券质押式三方回购提前购回</p> <p>1045=债券质押式三方回购补券</p> <p>1046=债券质押式三方回购换券</p> <p>1047=债券质押式三方回购解除质押</p> <p>1061=债券借贷初始交易</p> <p>1062=债券借贷到期结算</p> <p>1063=债券借贷到期续做</p> <p>1064=债券借贷提前终止</p> <p>1065=债券借贷解除质押</p> <p>1066=债券借贷质押券变更</p>
TrdSubType	<p>成交申报业务子类别</p> <p>对于协议交易业务取值如下：</p>

	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
ConfirmID	约定号
Side	本方参与人买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务的成交申报

业务	应用标识 AppID	报文号 MsgType	成交申报模式 TradeHandlingInstr	有无扩展 字段
协议交易双方协议成交申报	053	100503	协议配对	Y
转融通证券出借约定申报	071	100703	协议配对	Y
资产管理计划份额转让	080	100803	成交报告	Y
股票质押式回购	090	100903	成交报告	Y
约定购回	100	101003	成交报告	Y
质押式报价回购	110	101103	成交报告	Y
债券质押式协议回购（初始 交易、提前购回、质押券变 更、到期续做、解除质押）	300	103003	成交请求	Y
债券质押式协议回购（到期 购回）	300		成交报告	Y
债券质押式三方回购交易 （到期购回、补券）	320	103203	成交报告	Y
债券质押式三方回购交易	320		成交请求	Y

(初始交易、到期续做、提前购回、换券、解除质押)				
债券现券交易协商成交申报	411	104103	成交请求	Y
债券现券交易交易解除	419		成交请求	
债券现券交易协商成交合并申报	41A		双边确认成交报告	
债券借贷	420	104203	成交请求	Y
债券转让业务回售转售	430	104303	成交请求	Y

2) 各业务成交申报的市场参与人代码填写方式

业务	Side	PBUID	AccountID	BranchID	Counterparty PBUID	Counterparty AccountID	Counterparty BranchID
协议交易双方协议成交申报 (053)	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
转融通证券出借约定申报 (071)	G=借入 F=出借	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填
资产管理计划份额转让 (080)	固定为1	转入方	转入方	转入方	转出方	转出方	转出方
股票质押式回购 (090)	固定为2	(资金) 融入方	(资金) 融入方	(资金) 融入方	(资金) 融出方	(资金) 融出方	不填
约定购回 (100)	固定为2	客户方 (券融出)	客户方 (券融出)	客户方 (券融出)	不填	证券公司专用账户	不填
质押式报价回购 (110)	固定为1	客户方 (资金融出)	客户方 (资金融出)	客户方 (资金融出)	不填	证券公司自营账户	不填
债券质押式协议回购 (300)	1=逆回购 2=正回购	申报方	申报方	申报方	不填	不填	不填
债券质押式三方回购交易 (320)	1=逆回购	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填

	2=正回购						
债券现券交易协商成交 (411)	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	不填	不填	不填
债券现券交易交易解除 (419)	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	不填	不填	不填
债券现券交易协商成交合并申报 (41A) 发起方委托	1=合并申报本方买	不填	申报方	申报方	不填	不填	不填
债券现券交易协商成交合并申报 (41A) 确认方委托	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	不填	不填	不填
债券借贷 (420)	1=借出方 2=借入方	申报方	申报方	申报方	不填	不填	不填
债券转让业务回售转售 (430)	1=买(受让方) 2=卖(发行方)	申报方	申报方	申报方	对手方	不填	不填

3) 需填写约定号 (ConfirmID) 的业务: 协议交易双方协议成交申报 (053)、转融通证券出借约定申报 (071)、债券质押式协议回购 (300)、债券质押式三方回购交易 (320)、债券转让业务回售转售 (430)、债券现券交易协商成交 (411)、债券现券交易交易解除 (419)、债券现券交易协商成交合并申报 (41A)、债券借贷 (420)。

4.9.1.1 协议交易业务成交申报扩展字段 (100503)

表 4-89 协议交易业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.9.1.2 转融通证券出借业务成交申报扩展字段 (100703)

表 4-90 转融通证券出借业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
ShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 07=首发后可出借限售股

4.9.1.3 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段 (100803)

表 4-91 资产管理计划份额转让业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
PriceType	价格类型 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
ExecutingTrader	本方交易账户
CounterpartyExecutingTrader	对手方交易账户

4.9.1.4 股票质押式回购业务成交申报扩展字段 (100903)

表 4-92 股票质押式回购业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	现金金额 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; 成交申报类型为部分解除质押时填写解除红利金额; 其他类别填 0

ShareProperty	股份性质 成交类别为违约处置、违约处置撤销时填空，其他类别必须填写正确的股份性质
MaturityDate	购回交易日 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，其他类别填 0
PledgeeType	质权人类型 成交申报类别为初始交易时，必须填写，其他类别填 0
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期
InvestmentType	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 成交申报业务类别为初始交易时必须填写，其它类别填空格
AlertRatio	预警线，单位为百分比 成交申报业务类别为初始交易时必须填写，其它填 0
SettlementRatio	平仓线，单位为百分比 成交申报业务类别为初始交易时必须填写，其它填 0

注：

- 1) 若成交申报业务类别为初始交易 (TrdType=1001)，必须填写 LastPx 字段，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]。

4.9.1.5 约定购回业务成交申报扩展字段（101003）

表 4-93 约定购回业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
CashOrderQty	现金金额
MaturityDate	购回交易日
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期

4.9.1.6 质押式报价回购业务成交申报扩展字段（101103）

表 4-94 质押式报价回购业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
PriceType	价格类型 1=Percentage，表示收益率
ExpirationExecInst	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
ExpirationDays	期限，单位为天数
MaturityDate	购回交易日
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期

4.9.1.7 债券质押式协议回购业务成交申报扩展字段（103003）

表 4-95 债券质押式协议回购业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型

InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
TrdMatchID	交易编号 成交申报类别为到期购回、到期续做、提前购回、质押券变更、解除质押时填写初始交易达成时交易系统生成的交易编号
ExpirationDays	期限，单位为天数
CashOrderQty	现金金额
NoSecurity	质押券个数 成交申报类别为初始交易时填写指定质押券个数 成交申报类别为质押券变更时填写换入、换出质押券总个数 成交申报类别为到期购回、到期续做、提前购回、解除质押时填 0
→	UnderlyingSecurityID 证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource 证券代码源 固定填 102
→	DeliveryQty 数量 单位为百元发行面额，比如，质押 1 万元发行面额的标的券时，填为 100.00
→	DeliverySide 方向 1 表示质押 2 表示解押
→	UnderlyingShareProperty 股份性质 00=无限售流通股

	01=首发后限售股
GracePeriod	违约宽限期
DisposalFlag	处置标识
MemoExLen	扩展备注长度
MemoEx	扩展备注，最长 900 个 UTF-8 字符

4.9.1.8 债券质押式三方回购交易业务成交申报扩展字段（103203）

表 4-96 债券质押式三方回购交易业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
TrdMatchID	交易编号 成交申报类别为到期购回、到期续做、提前购回、补券、换券、解除质押时填写初始交易达成时交易系统生成的交易编号
ExpirationDays	期限 成交申报类别为初始交易时填写初始交易购回期限 成交申报类别为到期续做时填写续做购回期限 成交申报类别为到期购回、提前购回、补券、换券、解除质押时填 0
CashOrderQty	现金金额 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写提前购回金额 成交申报类别为解除质押时填写解除质押结算金额；

		成交申报类别为到期购回、补券填 0 成交申报类别为换券时，若为换出金额，则填换出金额，否则填 0
NoBaskets		质押篮子个数 成交申报类别为初始交易时填写指定质押券篮子个数 成交申报类别为到期购回、到期续做、提前购回、补券、换券、解除质押填 0
→	BasketID	篮子编号
NoSecurity		质押券个数 成交申报类别为初始交易时填写指定质押券个数 成交申报类别为补券、换券时填写补券、换券个数 成交申报类别为到期购回、到期续做、提前购回、解除质押填 0
→	UnderlyingSecurityID	证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源 固定填 102
→	DeliveryQty	数量
→	DeliverySide	方向 1 表示质押 2 表示解押

4.9.1.9 债券现券交易业务成交申报扩展字段 (104103)

表 4-97 债券现券交易业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
----	------

SubmittingMemberID	申报方交易商代码
SubmittingInvestorType	申报方交易主体类型
SubmittingInvestorID	申报方交易主体代码
SubmittingInvestorName	申报方客户名称
SubmittingTraderCode	申报方交易员代码
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期
CounterpartyLastPx	对手方成交价格
CashMargin	信用标识
Memo	备注
CounterpartyMemo	对手方备注
CounterpartyConfirmID	对手方约定号
CounterpartyLastQty	对手方数量
OrigTradeDate	原成交申报日期
SecondaryExecID	第二执行编号

4.9.1.10 债券转让业务成交申报扩展字段（104303）

表 4-98 债券转让业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
SubmittingMemberID	申报方交易商代码
SubmittingInvestorType	申报方交易主体类型
SubmittingInvestorID	申报方交易主体代码
SubmittingInvestorName	申报方客户名称

SubmittingTraderCode	申报方交易员代码
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettlType	结算方式 预留字段，默认填 0
SettlPeriod	结算周期 预留字段，默认填 0
LastParPx	成交价格二
CashMargin	信用标识 预留字段，默认填 1
Memo	备注

注：

- 1) 各业务成交申报的交易商代码（SubmittingMemberID /MemberID/CounterpartyMemberID）、交易主体类型（SubmittingInvestorType /InvestorType/CounterpartyInvestorType）、交易主体代码（SubmittingInvestorID/InvestorID/CounterpartyInvestorID）、客户名称（SubmittingInvestorName /InvestorName/ CounterpartyInvestorName）、交易员代码（SubmittingTraderCode /TraderCode/CounterpartyTraderCode）填写方式

业务	交易商代码 (SubmittingMemberID /MemberID/ CounterpartyMemberID)	交易主体类型 (SubmittingInvestorType /InvestorType/ CounterpartyInvestorType)	交易主体代码 (SubmittingInvestorID /InvestorID/ CounterpartyInvestorID)	客户名称 (Submitting InvestorName /InvestorName/ Counterparty InvestorName)	交易员代码 (Submitting TraderCode /TraderCode/ Counterparty TraderCode)
----	---	--	--	--	---

债券 转让 业务 回售 转售 (430)	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
---	-----	-----	-----	-----	-----

4.9.1.11 债券借贷业务成交申报扩展字段 (104203)

表 4-99 债券借贷业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
TrdMatchID	交易编号 成交申报类别为到期结算、到期续做、提前终止、质押券变更、解除质押时填写初始交易达成时交易系统生成的交易编号
ExpirationDays	期限，单位为天数
CashOrderQty	标的证券券面总额
SubstCash	现金结算金额
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额
AccruedInterestAmt	借贷费用金额
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额
GracePeriod	申报宽限期
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度

SupplementaryAgreement		补充约定
NoSecurity		质押券个数 成交申报类别为初始交易时填写指定质押券个数 成交申报类别为质押券变更、到期续做时填写换入、换出质押券总个数 成交申报类别为到期结算、提前终止、解除质押时填 0
→	UnderlyingSecurityID	证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源 固定填 102
→	DeliveryQty	数量 单位为百元发行面额，比如，质押 1 万元发行面额的标的券时，填为 100.00
→	DeliverySide	方向 1 表示质押 2 表示解押
→	UnderlyingShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 01=首发后限售股
→	UnderlyingCashOrderQty	券面总额

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

表 4-100 TGW 向 OMS 传送成交申报响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx04
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识

ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型
TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
TradeReportRefID	原客户成交申报编号
TrdAckStatus	成交申报响应状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
TrdRptStatus	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
TradeReportRejectReason	成交申报被拒绝原因代码
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别 对于债券现券业务的通交易所成交申报响应取值如下: 20=债券互联互通交易所委托
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号

Side	本方参与者买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段 同成交申报各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务成交申报的响应

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	有无扩展 字段	是否支持 成交汇总
协议交易双方协议成交申报响应	053	200504	Y	N
转融通证券出借约定申报响应	071	200704	Y	N
资产管理计划份额转让成交申报响应	080	200804	Y	Y
股票质押式回购成交申报响应	090	200904	Y	Y
约定购回成交申报响应	100	201004	Y	Y
质押式报价回购成交申报响应	110	201104	Y	Y
债券质押式协议回购成交申报响应	300	203004	Y	N
债券质押式三方回购交易成交申报响应	320	203204	Y	N
债券现券交易协商成交申报响应、债券现券通交易所成交申报响应	411	204104	Y	N
债券现券交易交易解除	419	204104	Y	N
债券现券交易协商成交合并申报	41A	204104	Y	N

债券借贷成交申报响应	420	204204	Y	N
债券转让业务回售转售成交申报响应	430	204304	Y	N

- 2) 各业务扩展字段定义同成交申报一致，请参考成交申报消息定义。
- 3) 对于债券借贷业务，成交申报响应扩展字段除成交申报定义字段外，还有如下字段（字段顺序在其他业务扩展字段之前）：

域名	字段描述
TradeReportRejectText	成交申报拒绝原因说明

4.9.3 转发成交申报 (Trade Capture Report)

表 4-101 TGW 向 OMS 传送转发成交申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx20
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型
TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
TradeReportRefID	原客户成交申报编号

LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与者买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务的转发成交申报

业务	应用标识 ApplID	报文号 MsgType	有无扩展 字段
债券质押式协议回购	300	203020	Y
债券质押式三方回购交易	320	203220	Y
债券现券交易协商成交申报	411	204120	Y
债券现券交易交易解除	419	204120	Y
债券现券交易协商成交合并 申报	41A	204120	Y
债券借贷	420	204220	Y
债券转让业务回售转售	430	204320	Y

4.9.3.1 债券质押式三方回购交易业务转发成交申报扩展字段（203220）

表 4-102 债券质押式三方回购交易业务转发成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
TrdMatchID	交易编号
ExpirationDays	期限
CashOrderQty	现金金额

SettlCurrAmt		结算金额
NoBaskets		质押篮子个数
→	BasketID	篮子编号
NoSecurity		质押券个数
→	UnderlyingSecurityID	证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→	DeliveryQty	数量
→	DeliverySide	方向

4.9.3.2 债券质押式协议回购业务转发成交申报扩展字段 (203020)

表 4-103 债券质押式协议回购交易业务转发成交申报扩展字段定义

域名		字段描述
MemberID		本方交易商代码
InvestorType		本方交易主体类型
InvestorID		本方交易主体代码
InvestorName		本方客户名称
TraderCode		本方交易员代码
CounterpartyMemberID		对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType		对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID		对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName		对手方客户名称
CounterpartyTraderCode		对手方交易员代码
TrdMatchID		交易编号
ExpirationDays		期限
CashOrderQty		现金金额
SettlCurrAmt		结算金额
NoSecurity		质押券个数
→	UnderlyingSecurityID	证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→	DeliveryQty	数量
→	DeliverySide	方向
→	UnderlyingShareProperty	股份性质
GracePeriod		违约宽限期

DisposalFlag	处置标识
MemoExLen	扩展备注长度
MemoEx	扩展备注，最长 900 个 UTF-8 字符

4.9.3.3 债券现券交易业务转发成交申报扩展字段 (204120)

表 4-104 债券现券交易业务转发成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettleType	结算方式
SettlePeriod	结算周期
CashMargin	信用标识，预留
Memo	备注
OrigTradeDate	原成交申报日期
SecondaryExecID	第二执行编号

4.9.3.4 债券转让业务转发成交申报扩展字段 (204320)

表 4-105 债券转让业务转发成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码

CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期
CashMargin	信用标识
Memo	备注

4.9.3.5 债券借贷业务转发成交申报扩展字段 (204220)

表 4-106 债券质押式协议回购交易业务转发成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
TrdMatchID	交易编号
ExpirationDays	期限
CashOrderQty	标的证券券面总额
SubstCash	现金结算金额
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额
AccruedInterestAmt	借贷费用金额
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额
GracePeriod	申报宽限期
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度
SupplementaryAgreement	补充约定

NoSecurity	质押券个数
→ UnderlyingSecurityID	证券代码
→ UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→ DeliveryQty	数量
→ DeliverySide	方向
→ UnderlyingShareProperty	股份性质
→ UnderlyingCashOrderQty	券面总额

4.9.4 成交确认 (Trade Capture Report)

表 4-107 TGW 向 OMS 传送成交确认消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx03
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型
TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别

TrdSubType	成交申报业务子类别 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
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与者买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务成交申报的确认

业务	应用标识 AppID	报文号 MsgType	有无扩展 字段	是否支持 成交汇总
协议交易双方协议成交申报确认	053	200503	Y	Y
转融通证券出借约定申报确认	071	200703	Y	Y
债券质押式协议回购成交申报确认	300	203003	Y	Y
债券质押式三方回购交易	320	203203	Y	Y
债券现券交易协商成交申报确认、债券现券通交易所成交申报确认	411	204103	Y	Y
债券现券交易交易解除确认	419	204103	Y	Y
债券现券交易协商成交合并申报确认	41A	204103	Y	Y
债券借贷成交申报确认	420	204203	Y	Y
债券转让业务回售转售成交	430	204303	Y	Y

申报确认				
------	--	--	--	--

4.9.4.1 协议交易业务成交确认扩展字段 (200503)

表 4-108 协议交易业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.9.4.2 转融通证券出借业务成交确认扩展字段 (200703)

表 4-109 转融通证券出借业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
MaturityDate	到期日
ShareProperty	股份性质

4.9.4.3 债券质押式协议回购业务成交确认扩展字段 (203003)

表 4-110 债券质押式协议回购业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
TrdMatchID	交易编号, 跨交易日唯一
ExpirationDays	期限, 单位为天数
CashOrderQty	现金金额

MaturityDate	回购到期日
SettlCurrAmt	到期结算金额
NoSecurity	质押券个数
→ UnderlyingSecurityID	证券代码
→ UnderlyingSecurityID Source	证券代码源
→ DeliveryQty	数量
→ DeliverySide	方向
→ UnderlyingSharePrope rty	股份性质
GracePeriod	违约宽限期
DisposalFlag	处置标识
MemoExLen	扩展备注长度
MemoEx	扩展备注, 最长 900 个 UTF-8 字符

4.9.4.4 债券质押式三方回购交易业务成交确认扩展字段 (203203)

表 4-111 债券质押式三方回购交易业务成交确认扩展字段定义

域名		字段描述
TrdMatchID		交易编号
OrigTradeDate		初始交易日
MaturityDate		回购到期日
ExpirationDays		期限
CashOrderQty		现金金额
SettlCurrAmt		结算金额
NoBaskets		质押篮子个数
→	BasketID	篮子编号
NoSecurity		质押券个数
→	UnderlyingSecurityID	证券代码
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→	DeliveryQty	数量
→	DeliverySide	方向

4.9.4.5 债券现券交易业务成交确认扩展字段 (204103)

表 4-112 债券现券交易业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期
CashMargin	信用标识, 预留
Memo	备注
SubmittingMemberID	申报方交易商代码
SubmittingInvestorType	申报方交易主体类型
SubmittingInvestorID	申报方交易主体代码
SubmittingInvestorName	申报方客户名称
SubmittingTraderCode	申报方交易员代码
CounterpartyMemo	对手方备注
CounterpartyConfirmID	对手方约定号
CounterpartyLastPx	对手方成交价格
CounterpartyLastQty	对手方成交数量
OrigTradeDate	原成交申报日期
SecondaryExecID	第二执行编号

4.9.4.6 债券转让业务成交确认扩展字段 (204303)

表 4-113 债券转让业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码

InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettlType	结算方式
SettlPeriod	结算周期
CashMargin	信用标识
Memo	备注

4.9.4.7 债券借贷业务成交确认扩展字段 (204203)

表 4-114 债券借贷业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
TrdMatchID	交易编号, 跨交易日唯一
ExpirationDays	期限, 单位为天数
CashOrderQty	标的证券券面总额
SubstCash	现金结算金额
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额
AccruedInterestAmt	借贷费用金额

SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额
GracePeriod	申报宽限期
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度
SupplementaryAgreement	补充约定
MaturityDate	借贷到期日
NoSecurity	质押券个数
→ UnderlyingSecurityID	证券代码
→ UnderlyingSecurityIDSou rce	证券代码源
→ DeliveryQty	数量
→ DeliverySide	方向
→ UnderlyingShareProperty	股份性质
→ UnderlyingCashOrderQty	券面总额

4.10 业务消息-转托管处理

4.10.1 注册 (Designation)

表 4-115 OMS 向 TGW 报送注册消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102099
ApplID	应用标识 200=转托管
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	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
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号

OrigClOrdID	原始交易的客户订单编号，指示被主动撤单的委托
DesignationInstruction	注册指令 3=转托管
DesignationTransType	注册类型 1=New 表示新注册请求 3=Cancel 表示注册撤单
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderQty	如果是系统内转托管，数量可填 0 表示转托管全部持有量
TransfereePBUID	转入交易单元代码

4.10.2 注册执行报告 (Designation Report)

表 4-116 TGW 向 OMS 传送注册执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202098
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识 200=转托管
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始交易的客户订单编号，指示被主

	动撤单的委托
ExecID	执行编号
ExecType	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
OrdRejReason	拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写
DesignationInstruction	注册指令 3 表示转托管
DesignationTransType	注册类型 1=New 表示新注册请求 3=Cancel 表示注册撤单
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderQty	如果是系统内转托管, 数量可填 0 表示转托管全部持有量
TransfereePBUID	转入交易单元代码

注: 本消息支持成交汇总服务。

4.11 业务消息-网络投票处理

4.11.1 投票 (Evote)

表 4-117 OMS 向 TGW 报送投票指令消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102197
ApplID	应用标识 210=投票
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	投票代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码

	固定填全空格
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
VotingProposal	投票议案号 1-99 表示具体议案号 100 表示总议案
VotingSubProposal	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
VotingPreference	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=同意 2=反对 3=弃权
OrderQty	投票数量（累积投票议案填写）

4.11.2 投票执行报告 (Evote Report)

表 4-118 TGW 向 OMS 传送投票执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202196
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识 210=投票
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	投票代码

SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型 0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason	拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
VotingProposal	投票议案号
VotingSubProposal	投票子议案号或选举候选人
VotingPreference	投票意向
OrderQty	投票数量

4.12 业务消息-密码服务处理

4.12.1 密码服务 (Password Service)

表 4-119 OMS 向 TGW 报送密码服务请求消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102489
ApplID	应用标识 240=密码服务激活 241=密码服务挂失或重置
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型

ClearingFirm	结算机构代码 固定填全空格
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
ValidationCode	密码激活或重置校验号

注：

- 1) 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

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

表 4-120 TGW 向 OMS 传送密码服务执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202488
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号

ExecID	执行编号
ExecType	执行类型 0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason	拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
ValidationCode	密码激活或重置校验号

4.13 业务消息-保证金查询处理

4.13.1 保证金查询 (Margin Query)

表 4-121 OMS 向 TGW 报送保证金查询请求消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102587
ApplID	应用标识 250=保证金查询
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码 固定填全空格
SecurityIDSource	证券代码源 固定填全空格
OwnerType	订单所有者类型 固定填 0
ClearingFirm	结算机构代码 固定填全空格
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户查询编号
FundPBUID	结算账号

4.13.2 保证金查询结果 (Margin Query Result)

表 4-122 TGW 向 OMS 传送保证金查询结果消息定义

域名		字段描述
Standard Header		消息头 MsgType=202586
PartitionNo		平台分区号
ReportIndex		回报记录号
ApplID		应用标识
ReportingPBUID		回报交易单元
SubmittingPBUID		申报交易单元
SecurityID		证券代码
SecurityIDSource		证券代码源
OwnerType		订单所有者类型
ClearingFirm		结算机构代码
TransactTime		回报时间
UserInfo		用户私有信息
CLOrdID		客户查询编号
ExecID		执行编号
ExecType		执行类型 0=New 订单被接受 8=Rejected 因前端检查未通过而被拒绝
OrdRejReason		拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写
FundPBUID		结算账号
NoMarginItems		保证金条目个数
→	MarginItem	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
→	MarginAmount	保证金金额
Filler1		占位字段, 12 个字节 固定填充

Filler2	占位字段，4 个字节 固定填 0
---------	---------------------

注：

- 1) 保证金查询失败，则保证金条目个数为 0；查询成功则保证金条目个数为 4。

4.14 业务消息-多腿订单处理

4.14.1 多腿订单 (New Order-Multileg)

表 4-123 OMS 向 TGW 报送多腿订单消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=1xxx21
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定
Side	买卖方向
OrdType	订单类别 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优
OrderQty	订单数量
Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务多腿订单的申报：

业务	应用标识 AppIID	报文号 MsgType	Side (54)	有无扩展 字段	是否允 许撤销
期权行权指令合并申报	161	101621	固定填 1	Y	Y
期权组合策略保证金构 建组合申报	340	103421	固定填 1	Y	N
期权组合策略保证金解 除组合申报	341	103421	固定填 1	Y	N

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 (190007)，如撤单失败则返回撤单失败响应消息 (290008)，撤单成功则返回多腿订单响应及撤单成功执行报告 (2xxx22)

4.14.1.1 期权行权指令合并申报多腿订单扩展字段 (101621)

表 4-124 期权行权指令合并申报多腿订单扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码
NoLegs	成份合约个数
→ LegSecurityID	成份合约代码
→ LegSecurityIDSource	成份合约代码源
→ LegOrderQty	成份合约数量

4.14.1.2 期权组合策略保证金业务多腿订单扩展字段 (103421)

表 4-125 期权组合策略保证金业务多腿订单扩展字段定义

域名	字段描述
ContractAccountCode	合约账户标识码
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号 构建组合申报时填全空格，解除组合申报时填写拟解除组合对应的组合流水号（构建组合申报时返回的执行报告中的 OrderID）
SecurityType	证券类别

		MLEG=组合
SecuritySubType		证券子类别 填写组合策略编码
NoLegs		成份合约个数
→	LegSecurityID	成份合约代码
→	LegSecurityIDSource	成份合约代码源
→	LegSide	成份合约方向 1=权利仓（买开） 2=义务仓（卖开）
→	LegOrderQty	成份合约数量

4.14.2 多腿订单响应及撤单成功执行报告 (Execution Report)

表 4-126 TGW 向 OMS 传送多腿订单响应及撤单成功执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx22
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
ExecID	执行编号

ExecType	执行类型
OrdStatus	订单状态
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
OrdType	订单类别
OrderQty	订单数量
Price	价格
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务的多腿订单响应及撤单成功响应

表 4-127 各类业务多腿订单响应及撤单成功关键要素说明

业务	应用标识 AppID	报文号 MsgType	有无扩展字段	是否支持成交汇总
期权行权指令合并申报执行报告	161	201622	Y	Y
期权组合策略保证金构建组合执行报告	340	203422	Y	Y
期权组合策略保证金解除组合执行报告	341	203422	Y	Y

- 2) 各业务如无特别说明，扩展字段同多腿订单扩展字段一致。

4.14.3 多腿订单成交执行报告 (Execution Report)

表 4-128 TGW 向 OMS 传送多腿订单成交执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx23

PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
ApplID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号 如果是报价委托的成交则填写 QuoteMsgID
ExecID	执行编号
ExecType	执行类型
OrdStatus	订单状态
LastPx	成交价
LastQty	成交数量
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
AccountID	证券账户
BranchID	营业部代码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 目前尚未有业务使用该消息。

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

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=4
ApplID	应用标识
TransactTime	回报时间
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
RefSeqNum	被拒绝消息的消息序号
RefMsgType	被拒绝的消息类型
BusinessRejectRefID	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。
BusinessRejectReason	拒绝原因
BusinessRejectText	拒绝原因说明

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
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

域名		字段描述
Standard Header		消息头 MsgType=5
NoPartitions		平台分区数量
→	PartitionNo	OMS 期望接收的平台分区号（分区号须存在且不重复）
→	ReportIndex	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)

本消息用于新一代交易系统向 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

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=6
PlatformID	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
PlatformState	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 本交易日当前平台对应分区回报发送完毕。

表 5-5 TGW 向 OMS 传送回报结束消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType=7
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	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
PlatformID	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 (Platform 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

域名	字段描述
Standard Header	MsgType=9
PlatformID	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
NoPartitions		平台分区数量
→	PartitionNo	平台分区号，分区号不一定连续

5.6 交易会状态消息 (Trading Session Status)

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

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

目前仅固定收益交易平台提供交易会状态消息的揭示功能。

表 5-7 TGW 向 OMS 传送交易会状态消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType=10
MarketID	市场代码，预留
MarketSegmentID	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
TradingSessionID	交易会 ID，预留
TradingSessionSubID	交易会子 ID，为数值型字符串
TradSesStatus	交易会状态，预留
TradSesStartTime	交易会起始时间
TradSesEndTime	交易会结束时间

注：

1) 各市场板块代码对应的交易会子 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

本接口规范中的所有整数类型字段都采用高字节序（BIG-ENDIAN）编码方式。

6.1 数据类型

表 6-1 数据类型定义

数据类型	二进制类型	说明
Price	Int64	价格，N13(4)
Qty	Int64	数量，N15(2)
Amt	Int64	金额，N18(4)
SeqNum	Int64	消息序号
Boolean	uInt16	1=True/Yes,0=False/No
Length	uInt32	长度 表示字节为单位的数据长度，正数
LocalTimeStamp	Int64	本地时间戳 YYYYMMDDHHMMSSsss（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	uInt32	重复数 表示重复组的个数，正数
LocalMktDate	uInt32	本地市场日期 格式 YYYYMMDD, YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31
SecurityID	char[8]	证券代码
PBUID	char[6]	交易单元代码
AccountID	char[12]	证券账户
BranchID	char[4]	营业部代码
MemberID	char[6]	交易商代码
InvestorType	char[2]	交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪 04=个人经纪
InvestorID	char[10]	交易主体代码
TraderCode	char[8]	交易员代码
InvestorName	char[120]	客户名称 可包含中文字符，最长 120 个字节

注：

- 1) 表中的 Nx(y)表示相应的类型实际为浮点数类型，其中 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，比如对于 Price 类型，Int64 值 186400 表示的价格为 18.6400。
- 2) 在某些应用场景下，一个消息中可能有部分字段不需要填写，如果是字符串型字段则填写全空格，如果是数值型字段则填写 0。
- 3) char[x]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的都后补空格；字符串统一使用 UTF-8 编码。特别地，char[]表示变长字符串。其字节数由前导字段指定。

6.2 会话层域定义

表 6-2 会话层域定义

域名	类型	说明
BodyLength	uInt32	消息体长度
MsgType	uInt32	消息类型
SenderCompID	char[20]	发送方代码
TargetCompID	char[20]	接收方代码
Password	char[16]	密码
Text	char[200]	文本信息 可能包含中文字符, 表示最多 200 个字节
HeartBtInt	Int32	心跳监测的时间间隔 为系统设定值,以秒为单位
DefaultApplVerID	char[32]	通信版本号 填写为 n.xy 如通信版本号为 1.01 时, 则字段应设置为 1.01。
SessionStatus	Int32	会话状态

6.3 业务层域定义

表 6-3 业务层域定义

域名	类型	说明
AccountID	AccountID	证券账户
AlertRatio	Int32	预警线, 单位为百分比, 定义为 N6(2)
ApplID	char[3]	应用标识
AccruedInterestAmt	Amt	借贷费用金额
AllocSettlCurrAmt	Amt	现金结算场内支付金额
BasketID	Int16	篮子编号, 从 1 开始编号, 最大不超过 99
BidPositionEffect	char	买开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
BidPx	Price	买报价
BidSize	Qty	买数量
BidExecInstType	uInt16	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
BidTransType	uInt16	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
BranchID	BranchID	营业部代码
BusinessRejectReason	uInt16	拒绝原因:
BusinessRejectRefID	char[10]	被拒绝消息对应的业务层 ID
BusinessRejectText	char[50]	拒绝原因说明 可能包含中文字符, 表示最多 50 个字节
CashMargin	char	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
CashOrderQty	Amt	订单现金金额
ClearingFirm	char[2]	结算机构代码 00=中国证券登记结算总公司 01=中国证券登记结算公司深圳分公司 09=自建 TA
ClOrdID	char[10]	客户订单编号
ConfirmID	char[8]	约定号
ContactInfo	char[30]	联系方式 可能包含中文字符, 表示最多 30 个字节

Contactor	char[12]	联系人 可能包含中文字符，表示最多 12 个字节
ContractAccountCode	char[6]	合约账户标识码
CounterpartyAccountID	AccoutID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	BranchID	对手方营业部代码
CounterpartyConfirmID	char[8]	对手方约定号
CounterpartyExecID	char[16]	交易所赋予的执行编号，单个交易日内不重复
CounterpartyExecutingTrader	char[17]	对手方交易账户
CounterpartyLastQty	Qty	对手方数量
CounterpartyLastPx	Price	对手方成交价格
CounterpartyInvestorID	InvestorID	对手方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	InvestorName	对手方客户名称
CounterpartyInvestorType	InvestorType	对手方交易主体类型
CounterpartyMemberID	MemberID	对手方交易商代码
CounterpartyMemo	char[160]	对手方备注
CounterpartyPBUID	PBUID	对手方交易单元
CounterpartyTraderCode	TraderCode	对手方交易员代码
CoveredOrUncovered	uInt8	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
CumQty	Qty	累计执行数量
CxlRejReason	uInt16	撤单拒绝原因代码，正数
DeductionAccountID	AccoutID	用于扣划证券的证券账户
DeductionPBU	PBUID	用于扣划证券的交易单元
DeliverQty	Qty	证券交付数量
DeliverySide	char	方向 1=质押 2=解押

DesignationInstruction	char	注册指令 3 表示转托管
DesignationTransType	uInt8	注册指令类型 1=New, 表示新注册请求 3=Cancel, 表示注册撤单
DisposalAccountID	AccoutID	待处置券存放账户
DisposalFlag	uInt8	处置标识 0=不同意 1=同意
DisposalPBU	PBUID	待处置券存放交易单元
ExecID	char[16]	交易所赋予的执行编号, 单个交易日内不重复
ExecType	char	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
ExecutingTrader	char[17]	本方交易账户
ExpirationDays	uInt16	期限, 单位为天数
ExpirationExecInst	uInt8	到期续做方式 1=到期自动续做 2=到期手动续做
ExpirationType	uInt8	期限类型 1=固定期限
ExpireTime	LocalTimestamp	询价请求失效时间
FundPBUID	char[6]	结算账号
GracePeriod	uInt16	申报宽限期、违约宽限期, 单位为天数

HighLimitPrice	Price	价格上限
IMCRejectText	char[]	国际市场互联对方市场拒绝原因说明 变长字符串，长度由IMCRejectTextLen 字段指示
IMCRejectTextLen	Length	指示 IMCRejectText 字段长度
InsufficientSecurityID	char[8]	申购赎回不足成份股证券代码
InvestmentType	char[2]	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
IOIID	char[10]	客户意向申报编号
IOIQty	Qty	意向申报数量
IOIRefID	char[10]	原意向申报 IOIID 撤销意向申报时使用
IOITransType	char	意向申报类型 N=意向申报 C=意向申报撤单
LastParPx	Price	成交价格二
LastPx	Price	成交价格
LastQty	Qty	成交数量
LeavesQty	Qty	订单剩余数量
LegOrderQty	Qty	单腿数量

LegSecurityID	char[8]	单腿证券代码
LegSecurityIDSource	char[4]	单腿证券代码源
LegSide	char	单腿方向
LenderAccountID	AccountID	出借券证券账户
LenderPBU	PBUID	出借券交易单元
LotType	char	订单数量类型 1=零股订单, Odd Lot 2=整手订单, Round Lot
LowLimitPrice	Price	价格下限
MarginAmount	Amt	保证金金额
MarginItem	uInt8	保证金条目类别 1=保证金可用余额 2=保证金总金额
MarketID	char[8]	市场代码 XSHG=上海证券交易所
MarketSegmentID	char[8]	市场板块代码
MaturityDate	LocalMktDate	到期日
MaxFloor	Qty	可显示数量
MaxPriceLevels	uInt16	最多成交价位数, 正数 0 表示不限制成交价位数
Memo	char[160]	备注 可包含中文字符, 最长 160 个字节
MemoEx	char[]	扩展备注 变长字符串, 长度由 MemoExLen 字段指示, 可包含中文字符
MemoExLen	Length	扩展备注长度 指示 MemoEx 字段长度
MinQty	Qty	最低成交数量

NoBaskets	NumInGroup	质押篮子个数
NoCounterparty	NumInGroup	对手方个数
NoCounterpartyPBU	NumInGroup	对手方交易单元个数
NoLegs	NumInGroup	多腿订单包含的单腿数
NoMarginItems	NumInGroup	保证金条目个数
NoPartitions	NumInGroup	分区个数
NoPartyIDs	NumInGroup	参与方个数
NoQuote	NumInGroup	报价消息个数
NoSecurity	NumInGroup	证券只数
OfferAccountID	AccountID	卖方证券账户
OfferBranchID	BranchID	卖方营业部代码
OfferPBUID	PBUID	卖方交易单元
OfferPositionEffect	char	卖开平仓标志 O 表示开仓 C 表示平仓
OfferPx	Price	卖报价
OfferSize	Qty	卖数量
OrderID	char[16]	交易所订单编号 交易所赋予的订单编号， 跨交易日不重复
OrderQty	Qty	订单数量
OrderRestrictions	char[4]	订单限定 I=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定 类型 如没有限定类型则填空
OrdRejReason	uInt16	订单拒绝原因代码，正数

OrdStatus	char	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
OrdType	char	订单类型 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优
OrigClOrdID	char[10]	原订单 ClOrdID
OrigSubmittingPBUID	PBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeDate	LocalMktDate	原成交申报日期
OrigTradeID	char[16]	初始成交申报的 TradeID
OrigTradeReportID	char[10]	初始交易客户成交申报编号
OwnerType	uInt16	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
PartitionNo	Int32	平台分区号
PlatformID	uInt16	平台号 1=现货集中竞价交易平台 2=综合金融服务平台

		<p>3=非交易处理平台</p> <p>4=衍生品集中竞价交易平台</p> <p>5=国际市场互联平台</p> <p>6=固定收益交易平台</p>
PlatformState	uInt16	<p>平台状态</p> <p>0=PreOpen, 未开放</p> <p>1=OpenUpComing, 即将开放</p> <p>2=Open, 开放</p> <p>3=Halt, 暂停开放</p> <p>4=Close, 关闭</p>
PledgeeType	uInt16	<p>质权人类型</p>
PositionEffect	char	<p>开平仓标识</p> <p>O 表示开仓</p> <p>C 表示平仓</p>
PreTradeAnonymity	uInt8	<p>是否匿名</p> <p>0=显名</p> <p>1=匿名</p>
Price	Price	<p>价格</p>
PriceType	uInt8	<p>价格类型</p> <p>1=百分比</p> <p>2=每交易单位</p> <p>3=固定数量</p>
PrivateQuote	uInt8	<p>私有报价</p> <p>0= 私有报价 (Private Quote)</p> <p>1= 公开报价 (Public Quote)</p>
QuoteID	char[10]	<p>报价消息编号</p>
QuoteMsgID	char[10]	<p>客户报价消息编号</p>
QuotePrice	Price	<p>报价价格</p>

QuotePriceType	uInt16	报价价格类型，预留 1=百分比（Percent of par） 2=每股（Per Share）
QuoteQty	Qty	报价数量
QuoteRejectReason	uInt16	意向申报、报价拒绝原因代码，正数
QuoteRejectText	char[50]	报价拒绝原因说明
QuoteReqID	char[10]	报价请求 ID
QuoteRequestRejectReason	uInt16	询价请求拒绝原因代码
QuoteRequestRejectText	char[50]	询价请求拒绝原因说明
QuoteRequestStatus	uInt8	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
QuoteRequestTransType	Int16	询价请求事务类型 0-New，新订单 1-Cancel，撤销
QuoteRequestType	uInt16	询价请求类型 101=Submit，提交 102=Alleged，转发
QuoteRespID	char[16]	交易所意向申报编号或报价回复消息编号 交易所赋予的意向申报编号，跨交易日不重复
QuoteRespType	uInt8	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
QuoteStatus	uInt8	报价状态 0=Accepted, 接受 4=Cancelled, 已撤销 5=Rejected, 拒绝 7=Expired, 已超时
QuoteType	uInt8	报价类型 1=Tradeable, 表示可交易的报价
RefMsgType	uInt32	被拒绝的消息类型
RefSeqNum	SeqNum	引用的消息序号
RejectText	char[16]	拒绝原因说明 可能包含中文字符, 表示最多 16 个字节
ReportIndex	SeqNum	回报记录号, 从 1 开始编号
ReportingPBUID	PBUID	回报交易单元
TradeReportRejectText	char[50]	成交申报拒绝原因说明
RptExecID	char[16]	成交申报执行编号
SecondaryExecID	char[16]	第二执行编号
SecondaryOrderID	char[16]	第二交易所订单编号
SecurityID	char[8]	证券代码
SecurityIDSource	char[4]	证券代码源 101=上海证券交易所 102=深圳证券交易所 如非特别标注, 出现证券代码源的字段取值默认是 102
SecurityType	char[8]	证券类别 MLEG=组合

SecuritySubType	char[8]	证券子类别
SettlCurrAmt	Amt	结算金额
SettlementRatio	Int32	平仓线，单位为百分比， 定义为 N6(2)
SettlPeriod	uInt8	结算周期 0=T+0 1=T+1 2=T+2 3=T+3
SettlType	uInt16	结算方式 0=不指定 103=多边净额 104=逐笔全额
ShareProperty	char[2]	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
Side	char	买卖方向 1=买 2=卖 G=借入 F=出借 D=申购 E=赎回
StopPx	Price	止损价格
SubmittingInvestorID	InvestorID	申报方交易主体代码
SubmittingInvestorName	InvestorName	申报方客户名称
SubmittingInvestorType	InvestorType	申报方交易主体类型
SubmittingMemberID	MemberID	申报交易商代码
SubmittingPBUID	PBUID	申报交易单元
SubmittingTraderCode	TraderCode	申报方交易员代码
SubstCash	Amt	执行报告现金替代金额或 成交申报现金结算金额

SupplementaryAgreement	char[]	补充约定 变长字符串，长度由 SupplementaryAgreementLen 字段指示，可包含中文字符，最长 600 个字节
SupplementaryAgreementLen	Length	补充约定长度 指 示 SupplementaryAgreement 字段长度，必须小于等于 600
Tenderer	char[6]	要约收购参与者编码
TimeInForce	char	订单有效时期类型 0=当日有效，Day（港股通 增强限价盘） 3=即时成交或取消（IOC） 9=At Crossing（港股通竞价 限价盘）
TimeToExpiration	uInt16	期限，单位为天数，正数
TradeDate	LocalMktDate	开始日期
TradeHandlingInstr	char	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
TradeID	char[16]	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

TradeReportID	char[10]	客户成交申报编号
TradeReportRefID	char[10]	原客户成交申报编号
TradeReportRejectReason	uInt16	成交申报拒绝原因代码
TradeReportTransType	uInt8	成交申报事务类别 0=New, 新申报 1=Cancel, 撤销申报 2=Replace, 响应
TradeReportType	uInt8	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
TradingSessionID	char[4]	交易会话 ID
TradingSessionSubID	char[4]	交易会话子 ID
TradSesEndTime	LocalTimeStamp	交易会话结束时间
TradSesStartTime	LocalTimeStamp	交易会话开始时间
TradSesStatus	uInt16	交易会话状态
TransactTime	LocalTimestamp	订单或执行的创建时间
TransfereePBUID	PBUID	转入交易单元代码
TrdAckStatus	uInt8	成交申报响应状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
TrdMatchID	char[16]	交易编号, 跨交易日唯一
TrdRptStatus	uInt8	成交申报状态 0=Accepted, 接受

		<p>1=Rejected, 拒绝</p> <p>2=Cancelled, 已撤销</p> <p>100=Unmatched, 尚未匹配</p> <p>101=Matched, 已匹配</p>
TrdSubType	uInt16	<p>成交申报业务子类别</p> <p>对于协议交易业务取值如下:</p> <p>0=非受限股份转让</p> <p>1=受限股份转让</p> <p>对于债券质押式协议回购业务的到期续做委托取值如下:</p> <p>10=不变更续做对手方</p> <p>11=变更续做对手方</p> <p>其他业务固定填 0</p>
TrdType	uInt16	<p>成交申报类型, 正数</p> <p>1001=股票质押式回购初始交易</p> <p>1002=股票质押式回购提前购回</p> <p>1003=股票质押式回购到期购回</p> <p>1004=股票质押式回购延期购回</p> <p>1005=股票质押式回购终止购回</p> <p>1006=股票质押式回购补充质押</p> <p>1007=股票质押式回购部分解除质押</p> <p>1008=股票质押式回购违约处置</p> <p>1009=股票质押式回购部</p>

		<p>分购回</p> <p>1010=股票质押式回购违约处置撤销</p> <p>1011=约定购回初始交易</p> <p>1012=约定购回提前购回</p> <p>1013=约定购回到期购回</p> <p>1014=约定购回延期购回</p> <p>1021=质押式报价回购初始交易</p> <p>1022=质押式报价回购提前购回</p> <p>1031=债券质押式协议回购初始交易</p> <p>1032=债券质押式协议回购到期购回</p> <p>1033=债券质押式协议回购到期续做</p> <p>1034=债券质押式协议回购提前购回</p> <p>1035=债券质押式协议回购解除质押</p> <p>1036=债券质押式协议回购质押券变更</p> <p>1041=债券质押式三方回购初始交易</p> <p>1042=债券质押式三方回购到期购回</p> <p>1043=债券质押式三方回购到期续做</p> <p>1044=债券质押式三方回购提前购回</p> <p>1045=债券质押式三方回购补券</p> <p>1046=债券质押式三方回</p>
--	--	--

		<p>购换券</p> <p>1047=债券质押式三方回购解除质押</p> <p>1061=债券借贷初始交易</p> <p>1062=债券借贷到期结算</p> <p>1063=债券借贷到期续做</p> <p>1064=债券借贷提前终止</p> <p>1065=债券借贷解除质押</p> <p>1066=债券借贷质押券变更</p>
UnderlyingCashOrderQty	Amt	基础证券券面总额
UnderlyingSecurityID	char[8]	基础证券代码
UnderlyingSecurityIDSource	char[4]	<p>基础证券代码源</p> <p>102=深圳证券交易所</p>
UnderlyingShareProperty	char[2]	<p>基础证券股份性质</p> <p>00-无限售流通股</p> <p>01-首发后限售股</p>
UserInfo	char[8]	用户私有信息，仅可包含ASCII可显示字符
ValidationCode	uInt32	密码激活校验号，正数
ValidUntilTime	LocalTimestamp	报价有效时间
VotingPreference	char	<p>投票意向</p> <p>1 代表同意，2 代表反对，3 代表弃权</p>
VotingProposal	uInt16	<p>投票议案号，正数</p> <p>1-99 表示具体议案号</p> <p>100 表示总议案</p>
VotingSubProposal	uInt16	<p>投票子议案号或选举候选人，正数</p> <p>0 表示所有子议案</p> <p>>0 其他表示具体子议案</p>

6.4 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=10xx01
2		Execution	Rejected	Rejected	10000	0	0	0	订单被拒绝 MsgType=20xx02
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=20xx02
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=20xx02
4		Execution	Trade	Partially Filled	10000	4000	6000	1000	订单成交 1000 MsgType=20xx15
5		Execution	Trade	Filled	10000	10000	0	6000	订单成交 6000 MsgType=20xx15

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=10xx01
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受

									MsgType=20xx02
3	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=20xx15
4		Execution	Cancelled	Cancelled	10000	0	0	0	撤单成功 MsgType=20xx02

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=10xx01
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=20xx02
3		Execution	Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=20xx02
4	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=190007
5		Cancel Reject		Partially Filled					撤单被拒绝， OrdStatus 填写目标 委托当前状态 MsgType=290008
5		Execution	Cancelled	Cancelled	10000	3000	0	0	撤单成功 MsgType=20xx02

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=10xx01
2		Execution	New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=20xx02
3		Execution	Trade	Partially	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000

				Filled					MsgType=20xx15
4		Execution	Trade	Filled	10000	10000	0	7000	订单成交 7000 MsgType=20xx15
5	Cancel Request				10000				收到撤单请求 MsgType=190007
6		Cancel Reject		Filled					撤单被拒绝 MsgType=290008

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=190007
2		Cancel Reject		Rejected					撤单被拒绝 MsgType=290008

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	TradeReport tTransType	TradeReportT ype	TradeHandlingI nstr	TrdAckSt atus	TrdRptStat us	Remark
1	TCR		New	Submit	OnePartyReport t for matching			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport t for matching	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport t for matching	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
3		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport t for matching	Accepted	Cancelled	与对手方成交申报配对失败

								MsgType=20xx04
3		TCR	Replace	Submit	OnePartyReport for matching			与对手方配对成功 MsgType=20xx03

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=10xx03
2		TCR Ack		Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
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=20xx04
4		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	Cancelled	撤单成功 MsgType=20xx04

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport	Accepted	Unmatched	成交申报被接受

					t for matching		d	MsgType=20xx04
3		TCR	Replace	Submit	OnePartyReport for matching			与对手方配对成功 MsgType=20xx03
4	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
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=20xx04

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
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=20xx04

7.2.1.5 撤销不存在的成交申报

表 7-10 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Rece	Sent	TradeRepor	TradeReportT	TradeHandlingI	TrdAckSta	TrdRptSta	Remark
------	------	------	------------	--------------	----------------	-----------	-----------	--------

	ived		tTransType	ype	nstr	tus	tus	
1	TCR		Cancel	Submit	OnePartyReport for matching			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Accepted	Accepted	成交申报被接受 MsgType=10xx03
3		TCR	Replace	Submit	TradeConfirm			成交确认 MsgType=20xx03
3		TCR	New	Submit	Two-Party			发给对手方的转发成交申报 MsgType=20xx20

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Accepted	Accepted	成交申报被接受

								MsgType=20xx04
3		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			成交确认 MsgType=20xx03
3		TCR	New	Submit	Two-Party			发给对手方的转发 成交申报 MsgType=20xx20
4	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 撤销请求 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Accepted	Cancelled	撤销成功 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Submit	Two-Party			转发撤销请求给对 手方 MsgType=20xx20

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	Receiv ed	Sent	TradeRep ortTransT ype	TradeReport Type	TradeHan dlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatu s	Remark
1	TCR		New	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 撤销请求 MsgType=10xx03
4		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

7.2.2.4 撤销不存在的成交申报

表 7-14 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Receiv ed	Sent	TradeRep ortTransT	TradeReport Type	TradeHan dlingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatu s	Remark
------	--------------	------	-----------------------	---------------------	------------------------	--------------	------------------	--------

			ype					
1	TCR		Cancel	Submit	Two-Party			提交一笔成交申报 撤销请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	Cancel	Submit	Two-Party	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Decline	One-Party for pass-thru			对手方拒绝接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Decline	One-Party for pass-thru			转发给发起方 MsgType=20xx20

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Accept	One-Party for pass-thru			对手方接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
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=20xx03
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=20xx03

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	TradeReportTransType	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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Cancelled	撤销成功 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Alleged	One-Party for pass-thru			转发撤销请求给对手方 MsgType=20xx20

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	TradingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Decline	One-Party for pass-thru			对手方拒绝接受成交 MsgType=10xx03

5		TCR Ack	Replace	Decline	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Decline	One-Party for pass-thru			转发给发起方 MsgType=20xx20
7	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
8		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Cancelled	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	One-Party for pass-thru			转发成交申报请求给对手方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Accept	One-Party for pass-thru			对手方接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Accept	One-Party for pass-thru	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
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=20xx03
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=20xx03

7	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
8		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

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	TradingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	成交申报请求被拒绝 MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	One-Party for pass-thru			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
4		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

7.2.3.5 撤销不存在的成交申报

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	TradingInstr	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=10xx03
2		TCR Ack	Cancel	Submit	One-Party for pass-thru	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给对方 MsgType=20xx20
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给对方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Decline	Two Party Report for Claim			一方响应方拒绝接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Decline	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
5		TCR Ack	Replace	Decline	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Decline	Two Party Report for Claim			转发给发起方 MsgType=20xx20
6		TCR	Cancel	Alleged	Two Party			转发给发另一响应方

					Report for Claim			MsgType=20xx20
--	--	--	--	--	------------------	--	--	----------------

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给一方响应方 MsgType=20xx20
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=20xx20
4	TCR		Replace	Accept	Two Party Report for Claim			一方响应方接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
5		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
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=10xx03
8		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20xx04
8		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
9								与发起方委托配对成功
9		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发起方的成交确认 MsgType=20xx03
9		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给先确认方的成交确认 MsgType=20xx03
10		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给后确认方的成交确认 MsgType=20xx03

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04

3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给一方响应方 MsgType=20xx20
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=20xx20
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=10xx03
5		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Cancelled	撤销成功 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Alleged	Two Party Report for Claim			转发撤销请求给一方响应方 MsgType=20xx20
6		TCR	Cancel	Alleged	Two Party Report for Claim			转发撤销请求给另一方响应方 MsgType=20xx20

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	TradingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给一方响应方 MsgType=20xx20
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给

					Report for Claim			另一方响应方 MsgType=20xx20
4	TCR		Replace	Decline	Two Party Report for Claim			一方响应方拒绝接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Decline	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
6		TCR	Cancel	Decline	Two Party Report for Claim			转发给发起方 MsgType=20xx20
6		TCR	Cancel	Alleged	Two Party Report for Claim			转发给另一响应方 MsgType=20xx20
7	TCR		Cancel	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
8		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Cancelled	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

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=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报请求被接受 MsgType=20xx04
3		TCR	New	Alleged	Two Party Report for Claim			转发成交申报请求给一方响应方 MsgType=20xx20

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=20xx20
4	TCR		Replace	Accept	Two Party Report for Claim			一方响应方接受成交 MsgType=10xx03
5		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
6	TCR		Replace	Accept	Two Party Report for Claim			另一方响应方接受成交 MsgType=10xx03
7		TCR Ack	Replace	Accept	Two Party Report for Claim	Accepted	Unmatched	成交申报被接受 MsgType=20xx04
8		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给发起方的成交确认 MsgType=20xx03
8		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给先确认方的成交确认 MsgType=20xx03
9		TCR	Replace	Submit	Trade Confirm			发给后确认方的成交确认 MsgType=20xx03
10	TCR		Cancel	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
11		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Matched	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

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	TradingInstr	TrdAckStatus	TrdRptStatus	Remark
1	TCR		New	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报请求 MsgType=10xx03
2		TCR Ack	New	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	成交申报请求被拒绝 MsgType=20xx04
3	TCR		Cancel	Submit	Two Party Report for Claim			提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=10xx03
4		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

7.2.4.5 撤销不存在的成交申报

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	TradingInstr	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=10xx03
2		TCR Ack	Cancel	Submit	Two Party Report for Claim	Rejected	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=20xx04

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	QuoteRequest Type	QuoteRequestTrans Type	QuoteReques tStatus/Quot eStatus	
1	Quote Request		Submit	New		提交一笔询价请求 MsgType=10xx17
2		Quote Request Ack	Submit	New	Rejected	询价请求被拒绝 MsgType=20xx17
2		Quote Request Ack	Submit	New	Accepted	询价请求被接受 MsgType=20xx17
3		Allege Quote Request	Alleged	New	Accepted	转发询价请求给报 价方 MsgType=20xx25
4	Quote					报价方进行报价 MsgType=10xx05
5		Quote Status Report			Rejected	报价被拒绝 MsgType=20xx06
5		Quote Status Report			Accepted	报价被接受 MsgType=20xx06
6		Allege Quote				转发报价给询价方 MsgType=20xx26
7	Quote Request		Submit	Cancel		询价方撤销询价 MsgType=10xx17
8		Quote Request Ack	Submit	Cancel	Rejected	询价撤销请求被拒 绝 MsgType=20xx17
8		Quote Request Ack	Submit	Cancel	Accepted	询价撤销请求被接 受 MsgType=20xx17
9		Allege Quote Request	Alleged	Cancel	Cancelled	转发询价请求给报 价方 MsgType=20xx25

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=10xx17
2		Quote Request Ack	Submit	Rejected	询价请求被拒绝 MsgType=20xx17
2		Quote Request Ack	Submit	Accepted	询价请求被接受 MsgType=20xx17
3		Allege Quote Request	Alleged	Accepted	转发询价请求给报价方 MsgType=20xx25
4	Quote				报价方进行报价 MsgType=10xx05
5		Quote Status Report		Rejected	报价被拒绝 MsgType=20xx06
5		Quote Status Report		Accepted	报价被接受 MsgType=20xx06
6		Allege Quote			转发报价给询价方 MsgType=20xx26
7	Quote				报价方撤销报价 MsgType=10xx05
8		Quote Status Report		Rejected	报价撤销请求被拒绝 MsgType=20xx06
8		Quote Status Report		Accepted	报价撤销请求被接受 MsgType=20xx06
9		Execution Report			撤销成功 MsgType=20xx02
9		Allege Quote			转发报价撤销给报

					价方 MsgType=20xx26
--	--	--	--	--	----------------------

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=10xx17
2		Quote Request Ack	Submit	Rejected	询价请求被拒绝 MsgType=20xx17
2		Quote Request Ack	Submit	Accepted	询价请求被接受 MsgType=20xx17
3		Allege Quote Request	Alleged	Accepted	转发询价请求给报价方 MsgType=20xx25
4	Quote				报价方进行报价 MsgType=10xx05
5		Quote Status Report		Rejected	报价被拒绝 MsgType=20xx06
5		Quote Status Report		Accepted	报价被接受 MsgType=20xx06
6		Allege Quote			转发报价给询价方 MsgType=20xx26
7	Quote Response				询价方发起报价回复 MsgType=10xx10
8		Quote Status Report		Rejected	报价回复被拒绝 MsgType=20xx06
8		Quote Status Report		Accepted	报价回复被接受 MsgType=20xx06
9		Execution			与报价方配对成功,

		Report			发给询价方的成交报告 MsgType=20xx15
9		Execution Report			与报价方配对成功, 发给报价方的成交报告 MsgType=20xx15
10		Allege Quote Request			转发询价请求给所有报价方 MsgType=20xx25