



# 中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0248—2022

## 证券期货业机构内部接口 证券交易

Internal interface of securities and futures institutions Stock  
exchange

2022-11-14 发布

2022-11-14 实施

中国证券监督管理委员会 发布



# 目 次

|                 |     |
|-----------------|-----|
| 前言 .....        | II  |
| 引言 .....        | III |
| 1 范围 .....      | 1   |
| 2 规范性引用文件 ..... | 1   |
| 3 术语和定义 .....   | 1   |
| 4 业务消息流程 .....  | 2   |
| 5 接口设计原则 .....  | 2   |
| 5.1 易用性 .....   | 2   |
| 5.2 灵活性 .....   | 2   |
| 5.3 经济性 .....   | 2   |
| 5.4 效率性 .....   | 3   |
| 6 委托交易接口 .....  | 3   |
| 6.1 消息头部 .....  | 3   |
| 6.2 消息尾部 .....  | 3   |
| 6.3 会话层消息 ..... | 3   |
| 6.4 应用层消息 ..... | 4   |
| 7 数据字典 .....    | 89  |
| 7.1 数据类型 .....  | 89  |
| 7.2 消息类型 .....  | 89  |
| 7.3 标签域字典 ..... | 91  |
| 参考文献 .....      | 111 |

## 前 言

本文件按照GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第1部分：标准化文件的结构和起草规则》的规定起草。

请注意本文件的某些内容可能涉及专利。本文件的发布机构不承担识别专利的责任。

本文件由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC 180/SC4）提出。

本文件由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC 180）归口。

本文件起草单位：中国证券监督管理委员会、国泰君安证券股份有限公司、中证信息技术服务有限责任公司、兴业证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、恒生电子股份有限公司、深圳市金证科技股份有限公司、深圳华锐金融技术股份有限公司、中信证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、东方财富信息股份有限公司。

本文件主要起草人：姚前、蒋东兴、周云晖、陆骋、周思宇、王晓、俞枫、毕志刚、叶晶、刘传友、马辉、刁晓建、张兆国、史哲、胡玲杰、陈锋、张锦栋、苏兴钟、黄铝、周山明、刘源泉、苗咏、周基鑫、冯杰、吴熹。

## 引 言

证券市场是由众多参与者进行数据交换的市场,交易电子化的发展潮流推动着市场参与者之间的数据交换也趋于数据电子化。然而,证券公司内部不同系统之间,证券公司与机构客户之间,证券公司与开放证券平台之间,在各自系统软硬件上存在差异性。当前信息系统数量众多,缺乏统一标准,数据共享难度大;系统架构相对紧耦合,市场技术就绪周期长,难以快速适应业务与管理创新变化。本文件通过全面梳理证券公司内部委托交易的关键业务流程与数据交换,研究证券公司内部委托交易信息交互的共性热点问题,从而快速建立统一、开放、灵活的委托交易数据接口。



# 证券期货业机构内部接口 证券交易

## 1 范围

本文件规定了证券期货业机构内部证券交易业务消息流程、接口设计原则，以及委托交易应用层消息的接口字段。

本文件适用于证券期货业机构设计在监管规定范围内进行证券交易的内部系统接口，主要包括内部的集中交易系统与外围终端系统。

本文件也可供开放证券平台接口，以及第三方机构的系统接入证券期货业机构内部集中交易系统参考使用。

## 2 规范性引用文件

下列文件中的内容通过文中的规范性引用而构成本文件必不可少的条款。其中，注日期的引用文件，仅该日期对应的版本适用于本文件；不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码

GB/T 23696—2017 证券及相关金融工具 交易所和市场识别码<sup>1</sup>

JR/T 0022—2020 证券交易数据交换协议

JR/T 0177.1—2020 证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第1部分：证券

GB/T 18030—2005 信息技术 中文编码字符集

## 3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

### 3.1

**消息序号** sequence number

消息的唯一标识。

### 3.2

**心跳** heart beat

消息交换的空闲期间连接双方产生的有规则消息。

### 3.3

**委托** delegate

能被交易系统识别的最小粒度的交易消息。

### 3.4

**指令** instruction

能被计算机识别并执行的操作消息。

### 3.5

**标签** tag

消息中用来标识数据元素的索引号，可以通过索引号在数据字典中查看对应的具体含义。

<sup>1</sup>注：GB/T 23696—2017 采标自 ISO 10383:2012。

## 4 业务消息流程

从业务角度按照请求、确认、应答和重发进行业务消息流程梳理，分为业务请求和业务订阅两种场景，业务请求和业务订阅之间没有时序要求。每种业务场景内部时序根据上下关系依次出现，请求与请求应答是一一对应，订阅与订阅应答是一一对应，执行报告和消息推送根据业务响应按需推送。如图1所示。

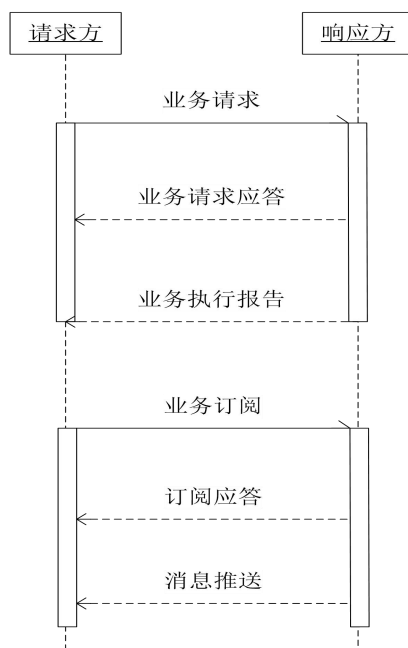


图1 业务消息流程

注：图中实线代表请求消息，虚线代表应答消息，箭头方向代表消息的传递方向。

- a) 业务请求。例如，新订单委托买卖中单笔委托（见 6.4.2.1.1）和多笔委托（见 6.4.2.1.2）。请求方向响应方发出业务请求，响应方进行业务应答。响应方业务执行报告有两种处理结果：
  - 业务请求确认被接受；例如，新订单委托买卖中执行回报（见 6.4.2.1.3）。
  - 业务请求应答被拒绝；例如，新订单委托买卖中订单拒绝（见 6.4.2.1.4）。
- b) 业务订阅。请求方向响应方发出业务订阅请求，响应方进行订阅应答。响应方主动向请求方进行消息推送。

本文件中融资融券交易（见6.4.3）、股票质押式回购交易（见6.4.4）、约定购回交易（见6.4.5）、期权交易（见6.4.6）和相关查询接口（见6.4.7）都属于场景一。

## 5 接口设计原则

### 5.1 易用性

接口协议的技术结构应较简单，易实现，证券公司只需配备普通的技术人员，按照协议规范描述即可实现与交易系统应用程序的对接。另外，对接口协议所需要的软件和硬件环境要求也不是很高，在通用的硬件配置、软件配置和网络通信协议上就可以实现。

### 5.2 灵活性

接口协议能够适应市场业务的数据交换，具有较好的维护性和扩展性。当有新的市场业务推出时，接口协议只需要通过少量简单的协议修改，就可以满足新业务活动的需求，而不会对现有电子化交换业务产生大的影响。

### 5.3 经济性



对于证券公司而言，按照接口协议进行的系统开发成本要低，这个成本包括人员成本、时间成本和资源成本。

#### 5.4 效率性

接口协议的通讯效率宜满足市场交易的需求，当效率过低时，会造成证券公司会员端柜面系统委托出现堵单，投资交易得不到迅速执行。

### 6 委托交易接口

#### 6.1 消息头部

每一个会话或应用消息均有一个消息头部，该消息头部指明版本信息、消息体长度、消息类型、消息序号和发送时间等。消息头部中版本信息、消息体长度和消息类型头三个域的定义和位置不应改变，但可以扩展增加消息头的可选域。消息头部格式如表1所示。

表 1 消息头部

| 标签  | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|-----|------------------|------|---|
| 8   | BeginString      | Y    | 版本信息（不可加密，消息的第一个域。）   |
| 9   | BodyLength       | Y    | 消息体长度（不可加密，消息的第二个域。）  |
| 35  | MsgType          | Y    | 消息类型（不可加密，消息的第三个域。）   |
| 49  | SenderCompID     | Y    | 发送方 ID  |
| 56  | TargetCompID     | Y    | 接收方 ID  |
| 50  | SenderSubID      | Y    | 指令下达人的编号  |
| 34  | MsgSeqNum        | Y    | 消息序号  |
| 43  | PossDupFlag      | N    | 是否重发  |
| 52  | SendingTime      | Y    | 发送时间 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss(国际标准时间 UTC)  |
| 216 | RoutingType      | N    | 路由类型：1=系统号；2=功能号；3=营业部号；4=其他。   |
| 217 | RoutingID        | N    | 路由标识符   |
| 115 | OnBehalfOfCompID | N    | 最初发送方标识符（可加密），用于经第三方发送。   |
| 116 | OnBehalfOfSubID  | N    | 最初发送方子标识符（可加密），用于经第三方发送。  |
| 128 | DeliverToCompID  | N    | 最终接收方标识符（可加密），用于经第三方发送。   |
| 129 | DeliverToSubID   | N    | 最终接收方子标识符（可加密），用于经第三方发送。  |
| 90  | SecureDataLen    | N    | 密文长度。用于标示消息加密部分的长度时必选。  |
| 91  | SecureData       | N    | 密文。消息体加密时必选。总紧跟在 SecureDataLen 域之后。消息内除某些需要公开识别的域以明文传输外，其他任何域都可以加密放置密文数据域（SecureData）内。当决定使用加密方案时，建议对消息正文内所有的域加密。如果消息的重复组内有部分需要加密的，那么应对整个重复组加密。 |

注：本文件中表格的“说明”列中的“=”代表代码取值的释义。

#### 6.2 消息尾部

每一个消息都有一个消息尾部，并以此终止，可用于分隔多个消息，包含校验。消息尾部格式如表2所示。

表 2 标准消息尾部

| 标签 | 字段名称            | 是否必须 | 说明                |
|----|-----------------|------|-------------------|
| 10 | Checksum        | Y    | 校验和，消息的最末域（不可加密）。 |
| 89 | Signature       | N    | 签名                |
| 93 | SignatureLength | N    | 签名长度              |

#### 6.3 会话层消息

会话消息涉及协议的使用机制，连接双方均可生成会话消息，包括心跳消息、登录消息、测试请求消息、重发请求消息、会话拒绝消息、序号重设消息和注销消息。会话层消息格式应符合JR/T 0022—2020的要求。

## 6.4 应用层消息

### 6.4.1 应用消息组件

#### 6.4.1.1 组件<Instrument>

组件<Instrument>表示证券交易品种（金融工具）及其相关属性。组件<Instrument>结构定义如表3所示。

表3 组件<Instrument>

| 标签             | 字段名称             | 是否必须 | 说明   |
|----------------|------------------|------|--|
| 组件<Instrument> |                  | Y    |  |
| 48             | SecurityID       | Y    | 证券代码，交易品种代码或者标准产品代码。标的证券代码，划转标的证券代码，基金代码。  |
| 22             | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用） |
| 组件结束           |                  |      |  |

#### 6.4.1.2 组件<Parties>

组件<Parties>表示证券市场参与者信息。组件<Parties>结构定义如表4所示。

表4 组件<Parties>

| 标签          | 字段名称          | 是否必须 | 说明      |
|-------------|---------------|------|---------|
| 组件<Parties> |               | Y    |         |
| 453         | NoPartyIDs    | Y    | 参与者代码个数 |
| 448         | PartyID       | Y    | 参与者代码   |
| 447         | PartyIDSource | Y    | 参与者代码源  |
| 452         | PartyRole     | Y    | 参与者代码角色 |
| 组件结束        |               |      |         |

#### 6.4.1.3 组件<RootParties>

组件<RootParties>表示证券市场初始的参与者信息。组件<RootParties>结构定义如表5所示。

表5 组件<RootParties>

| 标签              | 字段名称              | 是否必须 | 说明        |
|-----------------|-------------------|------|-----------|
| 组件<RootParties> |                   | Y    |           |
| 1116            | NoRootPartyIDs    | Y    | 初始参与者代码个数 |
| 1117            | RootPartyID       | Y    | 初始参与者代码   |
| 1118            | RootPartyIDSource | Y    | 初始参与者代码源  |
| 1119            | RootPartyRole     | Y    | 初始参与者代码角色 |
| 组件结束            |                   |      |           |

## 6.4.1.4 组件&lt;OrderQtyData&gt;

组件<OrderQtyData>表示证券数量，通常在订单中使用。组件<OrderQtyData>结构定义如表6所示。

表 6 组件&lt;OrderQtyData&gt;

| 标签               | 字段名称         | 是否必须 | 说明   |
|------------------|--------------|------|------|
| 组件<OrderQtyData> |              | Y    |      |
| 152              | CashOrderQty | N    | 订单金额 |
| 38               | OrderQty     | Y    | 订单数量 |
| 组件结束             |              |      |      |

## 6.4.1.5 组件&lt;MarginItems&gt;

组件<MarginItems>表示保证金信息。组件<MarginItems>结构定义如表7所示。

表 7 组件&lt;MarginItems&gt;

| 标签              | 字段名称          | 是否必须 | 说明                                 |
|-----------------|---------------|------|------------------------------------|
| 组件<MarginItems> |               | Y    |                                    |
| 10186           | NoMarginItems | Y    | 保证金条目个数                            |
| 10187           | MarginItem    | Y    | 保证金条目类别代码<br>1=保证金可用余额<br>2=保证金总金额 |
| 10188           | MarginAmount  | Y    | 保证金金额                              |
| 组件结束            |               |      |                                    |

## 6.4.1.6 组件&lt;Stipulation&gt;

组件<Stipulation>表示收益率。组件<Stipulation>结构定义如表8所示。

表 8 组件&lt;Stipulation&gt;

| 标签              | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|-----------------|------------------|------|---|
| 组件<Stipulation> |                  | Y    |   |
| 232             | NoStipulations   | Y    | 重复数目  |
| 233             | StipulationType  | Y    | 比率类型代码<br>Haircut=折算比率(%)<br>Yield=收益率/首次收益率<br>Yield2=到期收益率<br>StopYield=限价收益率 |
| 234             | StipulationValue | Y    | 比率值   |
| 组件结束            |                  |      |   |

## 6.4.1.7 组件&lt;Access&gt;

组件<Access>表示访问控制信息，通常在第三方系统接入时使用。组件<Access>结构定义如表9所示。

表 9 组件&lt;Access&gt;

| 标签         | 字段名称 | 是否必须 | 说明 |
|------------|------|------|----|
| 组件<Access> |      | Y    |    |

表 9 组件&lt;Access&gt; (续)

| 标签    | 字段名称          | 是否必须 | 说明                             |
|-------|---------------|------|--------------------------------|
| 12001 | AuthCode      | Y    | 授权码，系统接入登记时分配。                 |
| 12002 | FeatureCode   | Y    | 机器特征码。通常使用接入网关的 IP 地址和 MAC 地址。 |
| 12003 | AuthInfo      | Y    | 认证密码。系统接入时身份认证。                |
| 12004 | ProductCode   | Y    | 产品识别码。系统接入登记时分配。               |
| 12005 | DeveloperCode | Y    | 开发商识别码。系统接入登记时分配。              |
| 12006 | VersionInfo   | Y    | 软件版本信息。系统可以根据实际软件版本信息不做校验。     |
| 组件结束  |               |      |                                |

## 6.4.1.8 组件&lt;Legs&gt;

组件<Legs>表示成份合约信息，通常在多腿期权订单中使用。组件<Legs>结构定义如表10所示。

表 10 组件&lt;Legs&gt;

| 标签       | 字段名称                | 是否必须 | 说明      |
|----------|---------------------|------|---------|
| 组件<Legs> |                     | N    |         |
| 555      | NoLegs              | Y    | 成份合约个数  |
|          | 组件<InstrumentLeg>   | Y    |         |
| 602      | LegSecurityID       | Y    | 成份合约代码  |
| 603      | LegSecurityIDSource | Y    | 成份合约代码源 |
| 624      | LegSide             | N    | 成份合约方向  |
|          | 组件结束                |      |         |
| 685      | LegOrderQty         | N    | 成份合约数量  |
| 组件结束     |                     |      |         |

## 6.4.1.9 组件&lt;Request&gt;

组件<Request>表示查询请求及相关属性。组件<Request>结构定义如表11所示。

表 11 组件&lt;Request&gt;

| 标签          | 字段名称       | 是否必须 | 说明   |
|-------------|------------|------|--|
| 组件<Request> |            | Y    |  |
| 710         | PosReqID   | Y    | 请求唯一标识符  |
| 724         | PosReqType | Y    | 请求类别<br>0=查询股份<br>9=查询资金<br>103=查询资金流水<br>104=查信用资产负债<br>105=信用合约查询<br>106=担保证券查询<br>107=标的证券查询<br>108=基金交易查询<br>109=基金份额查询<br>205=可融券数量查询 |
| 组件结束        |            |      |  |

## 6.4.1.10 组件&lt;Report&gt;

组件<Report>表示查询应答及相关属性。组件<Report>结构定义如表12所示。

表 12 组件<Report>

| 标签         | 字段名称               | 是否必须 | 说明                      |
|------------|--------------------|------|-------------------------|
| 组件<Report> |                    | Y    |                         |
| 721        | PosMaintRptID      | Y    | 用于标识本响应消息唯一标识符          |
| 727        | TotalNumPosReports | Y    | 返回报告条数                  |
| 728        | PosReqResult       | Y    | 报告返回代码<br>0=成功<br>99=失败 |
| 组件结束       |                    |      |                         |

## 6.4.2 普通交易

### 6.4.2.1 新订单委托买卖

#### 6.4.2.1.1 单笔委托

普通交易主要指股票买卖，新订单委托买卖即新订单消息，支持交易订单，由交易客户方发出，用以提交订单。新订单消息可以带有执行指令，指示订单的执行条件。新订单消息格式应符合JR/T 0022—2020的要求。

普通交易新订单委托买卖单笔委托（New Order Single）的接口字段如表13所示。

表 13 普通交易新订单单笔委托

| 标签             | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|----------------|-----------------------|------|--|
|                | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=D  |
| 1180           | ApplID                | Y    | 应用标识   |
| 11             | ClOrdID               | Y    | 客户订单编号<br>即第三方指令编号   |
| 54             | Side                  | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出   |
| 529            | OrderRestrictions     | N    | 订单限定   |
| 522            | OwnerType             | Y    | 所有者类型代码<br>1=个人投资者发起<br>101=交易所发起<br>102=会员发起<br>103=机构投资者发起<br>104=自营交易发起<br>105=流动性服务提供商发起<br>106=结算机构发起   |
| 60             | TransactTime          | Y    | 委托发生时间   |
| 组件<Instrument> |                       | Y    |  |
| 207            | SecurityExchange      | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所 |

表 13 普通交易新订单单笔委托（续）

| 标签               | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|------------------|------------------|------|---|
| 207              | SecurityExchange | N    | 0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 48               | SecurityID       | Y    | 证券代码  |
| 22               | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）   |
| 组件结束             |                  |      |   |
| 组件<Parties>      |                  | Y    |   |
| 453              | NoPartyIDs       | Y    | 参与人代码个数   |
| 448              | PartyID          | Y    | 参与人代码   |
| 447              | PartyIDSource    | Y    | 参与人代码源  |
| 452              | PartyRole        | Y    | 参与人代码角色   |
| 组件结束             |                  |      |   |
| 组件<OrderQtyData> |                  | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty     | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty         | Y    | 订单数量  |
| 组件结束             |                  |      |   |
| 44               | Price            | N    | 委托价格<br>OrdType 代码取值为 02 时填写  |
| 99               | StopPx           | N    | 止损价格，预留   |
| 59               | TimeInForce      | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为 0。<br>0=当日有效；<br>1=一直有效，直到完成或撤销；  |

表 13 普通交易新订单单笔委托（续）

| 标签         | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|------------|-------------------------|------|--|
|            |                         |      | 3=即时成交或取消；<br>6=到指定日前有效；   |
| 59         | TimeInForce             | N    | 101=一定日期内有效；<br>102=到时间前有效。  |
| 1090       | MaxPriceLevels          | N    | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数，缺省值为 0。                                      |
| 110        | MinQty                  | N    | 最小成交数量，缺省值为 0。   |
| 544        | CashMargin              | N    | 融资融券信用标识<br>1=Cash 普通交易<br>2=Open 融资融券开仓<br>3=Close 融资融券平仓<br>缺省值为 1 |
| 664        | ConfirmID               | N    | 约定号，协议交易点击成交填写。  |
| 8911       | ExpirationDays          | N    | 期限，单位为天数。  |
| 8906       | ExpirationType          | N    | 期限类型代码<br>01=日<br>02=周<br>03=月<br>04=季<br>05=半年<br>06=全年             |
| 组件<Access> |                         | Y    | 适用于第三方接入   |
| 12001      | AuthCode                | Y    | 授权码，系统接入登记时分配。   |
| 12002      | FeatureCode             | Y    | 机器特征码，通常使用终端 IP 地址和 MAC 地址。  |
| 12003      | AuthInfo                | Y    | 认证密码，系统接入时身份认证。  |
| 12004      | ProductCode             | Y    | 产品识别码，系统接入登记时分配。   |
| 12005      | DeveloperCode           | Y    | 开发商识别码，系统接入登记时分配。  |
| 12006      | VersionInfo             | Y    | 软件版本信息<br>系统可以根据实际软件版本信息不做校验   |
| 组件结束       |                         |      |  |
| 58         | Text                    | N    | 备注说明   |
|            | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.2.1.2 多笔委托

普通交易新订单委托买卖多笔委托（New Order Multiple）的接口字段如表14所示。

表 14 普通交易新订单多笔委托

| 标签   | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|------|-----------------------|------|--|
|      | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=AB   |
| 1180 | ApplID                | Y    | 应用标识   |
| 11   | ClOrdID               | Y    | 客户订单编号，即第三方指令编号，全程唯一，<br>已有指令结束归档后该编号可以再使用。<br>也是请求唯一标识符，用于标识此数据包的数字或字符，在交易日内需要确保该字段的唯一性。0 表示不启用该字段。 |

表 14 普通交易新订单多笔委托（续）

| 标签             | 字段名称              | 是否必须 | 说明  |
|----------------|-------------------|------|---|
| 66             | ListID            | N    | 申报编号<br>第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。  |
| 40             | OrdType           | Y    | 委托类型代码，即基于价格的价格模式或订单类型<br>01=市价（表示不限制委托价格，在涨跌停范围内即可）<br>02=限价（表示限制委托价格，买入不高于，卖出不低于）<br>03=市价止损<br>04=市价止盈<br>05=限价止损<br>06=限价止盈   |
| 54             | Side              | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出  |
| 15001          | OperWay           | Y    | 渠道类别代码<br>01=书面委托<br>02=电话委托<br>03=互联网委托<br>0301=网页委托<br>0302=交易软件<br>04=柜台委托<br>0401=银行柜台<br>0402=第三方柜台<br>0403=集中柜面<br>05=自助终端<br>0501=磁卡（自助终端）<br>0502=驻留委托<br>0503=银行 ATM<br>0504=银行 POS<br>99=其他 |
| 522            | OwnerType         | Y    | 所有者类型代码<br>1=个人投资者发起<br>101=交易所发起<br>102=会员发起<br>103=机构投资者发起<br>104=自营交易发起<br>105=流动性服务提供商发起<br>106=结算机构发起  |
| 529            | OrderRestrictions | N    | 订单限定  |
| 60             | TransactTime      | Y    | 委托发生时间  |
| 组件<Instrument> |                   | Y    |   |
| 48             | SecurityID        | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource  | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司   |



表 14 普通交易新订单多笔委托（续）

| 标签                | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|-------------------|------------------|------|---|
|                   |                  |      | (200+自行内部使用)  |
| 组件结束              |                  |      |   |
| 55                | Symbol           | N    | 证券名称  |
| 5010              | SymbolType       | N    | 证券类别代码<br>证券类型  |
| 555               | NoLegs           | N    | <InstrumentLeg>的数目<br>>=2   |
| 44                | Price            | N    | 委托价格，OrdType 为 02 时填写。  |
| 207               | SecurityExchange | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 组件<InstrumentLeg> |                  | Y    |   |
| 5011              | LegNo            | N    | <InstrumentLeg>的序号<br>>=1   |
| 600               | LegSymbol        | N    | 合同代码<br>端交易品种名称或者端标准品种名称  |
| 组件结束              |                  |      |   |
| 组件<Parties>       |                  | Y    |   |
| 453               | NoPartyIDs       | Y    | 参与者代码个数   |

表 14 普通交易新订单多笔委托（续）

| 标签               | 字段名称           | 是否必须 | 说明  |
|------------------|----------------|------|---|
| 448              | PartyID        | Y    | 参与者代码   |
| 447              | PartyIDSource  | Y    | 参与者代码源  |
| 452              | PartyRole      | Y    | 参与者代码角色   |
| 组件结束             |                |      |   |
| 组件<OrderQtyData> |                | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty   | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty       | Y    | 订单数量  |
| 组件结束             |                |      |   |
| 99               | StopPx         | N    | 止损价格，预留   |
| 1090             | MaxPriceLevels | N    | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数，缺省值为 0  |
| 110              | MinQty         | N    | 最小成交数量<br>缺省值为 0  |
| 59               | TimeInForce    | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为 0。<br>0=当日有效；<br>1=一直有效，直到完成或撤销；<br>3=即时成交或取消；<br>6=到指定日前有效；<br>101=一定日期内有效；<br>102=到时间前有效。 |
| 544              | CashMargin     | N    | 融资融券信用标识<br>1=Cash 普通交易<br>2=Open 融资融券开仓<br>3=Close 融资融券平仓<br>缺省值为 1  |
| 664              | ConfirmID      | N    | 约定号<br>协议交易点击成交填写   |
| 8911             | ExpirationDays | N    | 期限，单位为天数。   |
| 8906             | ExpirationType | N    | 期限类型代码<br>01=日<br>02=周<br>03=月<br>04=季<br>05=半年<br>06=全年  |
| 组件<Access>       |                | Y    | 适用于第三方接入  |
| 12001            | AuthCode       | Y    | 授权码，系统接入登记时分配。  |
| 12002            | FeatureCode    | Y    | 机器特征码，通常使用终端 IP 地址和 MAC 地址。   |
| 12003            | AuthInfo       | Y    | 认证密码，系统接入时身份认证。   |
| 12004            | ProductCode    | Y    | 产品识别码，系统接入登记时分配。  |
| 12005            | DeveloperCode  | Y    | 开发商识别码，系统接入登记时分配。   |
| 12006            | VersionInfo    | Y    | 软件版本信息，系统可以根据实际软件版本信息不做校验。  |
| 组件结束             |                |      |   |

表 14 普通交易新订单多笔委托（续）

| 标签 | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|----|-------------------------|------|------|
| 58 | Text                    | N    | 备注说明 |
|    | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |      |

## 6.4.2.1.3 执行回报

普通交易新订单委托买卖执行回报的数据接口字段如表15所示。

表 15 执行回报

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------|-----------------------|------|---|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=8 Execution Report，表示指令状态、委托数据反馈、成交数据反馈   |
| 15999 | ProceType             | Y    | 处理类型代码<br>2=状态反馈（指令状态）<br>3=成交反馈<br>10=委托数据反馈   |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号，即第三方指令编号，全程唯一，已有指令结束归档后该编号可以再使用。0表示不启用该字段。   |
| 37    | OrderID               | Y    | 订单编号。返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。   |
| 41    | OrigOrdID             | N    | 撤单编号，被修改/撤销指令的第三方指令编号，返回修改和撤销的指令状态时该字段才会有值，下达时该字段为空。  |
| 66    | ListID                | N    | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。   |
| 17    | ExecID                | Y    | 成交编号，流水号。   |
| 19    | ExecRefID             | N    | 要回溯的成交编号（ExecID）<br>返回指令状态和有效的成交数据时该字段为空。   |
| 20    | ExecTransType         | N    | 应答发送类别：0=普通的反馈<br>应答发送类别代码固定为 0，表示普通的反馈。  |
| 39    | OrdStatus             | Y    | 指令状态代码，订单状态代码：对于指令下达拒绝的时候填 03。<br>01=有效指令<br>02=已修改<br>03=已撤销<br>04=已暂停<br>05=审批拒绝<br>06=分发拒绝<br>07=指令录入<br>08=草稿指令<br>09=临时下达<br>10=临时修改 |
| 14008 | InstructionNo         | Y    | 内部指令序号  |
| 13303 | OperatorName          | N    | 分发时反馈交易员姓名，在任务属性上勾选要求返回交易员选项后才会返回，不勾选该字段为空  |
| 48    | SecurityID            | Y    | 证券代码，交易品种代码或者标准产品代码，标的证券代码，划转标的证券代码，基金代码  |
| 54    | Side                  | Y    | 买卖方向代码，返回传入的买卖方向<br>1=买入；2=卖出。  |

表 15 执行回报（续）

| 标签  | 字段名称             | 是否必须 | 说明   |
|-----|------------------|------|--|
| 150 | ExecType         | Y    | 执行类型代码：<br>0=已下达未成交（New），表示请求接受<br>1=部分成交（Partial fill）<br>2=全部成交（Fill）<br>4=已撤销（Canceled）<br>5=已修改（Replace）<br>6=接收到撤销的指令（Pending Cancel）<br>7=停止<br>8=拒绝（Reject），表示请求失败<br>A=接收到下达的指令（Pending New）<br>E=接收到修改的指令（Pending Replace）<br>F=交易已成交（部分或全部）Trade（partial fill or fill）<br>H=交易撤销   |
| 150 | ExecType         | Y    | 101=应急   |
| 207 | SecurityExchange | N    | 交易场所代码。当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。交易所和市场识别码应符合GB/T 23696—2017的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 1   | Account          | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号   |
| 44  | Price            | Y    | 指令价格<br>对于回购业务指令价格就是回购利率。  |
| 38  | OrderQty         | Y    | 指令数量   |
| 31  | LastPx           | Y    | 反馈成交信息，当前笔成交价格   |
| 32  | LastQty          | Y    | 反馈成交信息，当前笔成交数量   |

表 15 执行回报（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-------|-------------------------|------|--|
| 151   | LeavesQty               | Y    | 反馈成交信息，剩余未成交数量   |
| 14    | CumQty                  | Y    | 反馈成交信息，累计成交数量  |
| 6     | AvgPx                   | Y    | 反馈成交信息，成交均价  |
| 14002 | DealPrice               | N    | 成交价格<br>对于回购业务该字段是 100，其他业务同 tag31 的字段值，返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14003 | ReportSeat              | N    | 席位代码<br>返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14004 | TodayDealAmount         | N    | 当日累计成交数量<br>返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14005 | TodayDealBalance        | N    | 当日累计成交金额<br>返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14006 | ReportSerialNo          | N    | 证券委托编号，申报编号<br>返回指令状态时该不返回。  |
| 14007 | BusinessTime            | N    | 委托时间，成交时间，申报时间<br>返回委托数据时该字段为委托时间，返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14058 | FailReason              | N    | 失败原因<br>指令状态数据才会返回<br>保存可用不足和触发风控信息，整体结构如下：<br>1、可用不足：<br><FailReason Type="1"><br><Reasons><br><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons><br></FailReason><br>Reason 信息：组合编号 申报代码 交易市场 投资类型 可用不足提示说明<br>2、风控信息：<br><FailReason Type="2"><br><Reasons><br><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons></FailReason><br>Reason 信息：触警级别 触警操作 组合编号 证券编码 交易所 风控编号 风控类型 设置值 实际值 风控说明<br>Type 属性值域 1=可用；2=风控 |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.2.1.4 订单拒绝

订单拒绝的数据接口字段如表16所示。

表 16 订单拒绝

| 标签 | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|----|-----------------------|------|---|
|    | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=J<br>8=Execution Report 表示投资系统下达指令失败导致的订单撤销<br>9=Order Cancel Reject 表示投资系统修改/撤销指令失败、报文格式本身错误、缺少必填项等导致的订单拒绝 |
| 11 | ClOrdID               | Y    | 申请编号，即第三方指令编号，全程唯一，已有指令结束归档后该编号可以再使用。0 表示不启用该字段。  |

表 16 订单拒绝（续）

| 标签  | 字段名称         | 是否必须 | 说明   |
|-----|--------------|------|--|
| 37  | OrderID      | Y    | 订单编号<br>返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 CIOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。   |
| 41  | OrigOrdID    | N    | 撤单编号<br>被修改/撤销指令的第三方指令编号   |
| 66  | ListID       | N    | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。<br>修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。  |
| 39  | OrdStatus    | Y    | 指令状态代码，订单状态代码：对于指令下达拒绝的时候填 03。<br>01=有效指令<br>02=已修改<br>03=已撤销  |
| 39  | OrdStatus    | Y    | 04=已暂停<br>05=审批拒绝<br>06=分发拒绝<br>07=指令录入<br>08=草稿指令<br>09=临时下达<br>10=临时修改   |
| 150 | ExecType     | N    | 执行类型代码：<br>0=已下达未成交（New）<br>1=部分成交（Partial fill）<br>2=全部成交（Fill）<br>4=已撤销（Canceled）<br>5=已修改（Replace）<br>6=接收到撤销的指令（Pending Cancel）<br>7=停止<br>8=拒绝<br>A=接收到下达的指令（Pending New）<br>E=接收到修改的指令（Pending Replace）<br>F=交易已成交（部分或全部）Trade（partial fill or fill）<br>H=交易撤销<br>101=应急<br>对于指令下达拒绝的时候执行类型代码填 4，否则为空。   |
| 45  | RefSeqNum    | N    | 被拒绝消息的序号   |
| 372 | RefMsgType   | Y    | 被拒绝消息的消息类型   |
| 103 | OrdRejReason | Y    | 订单拒绝原因代码，应符合 JR/T0022-2020 取值：<br>0=券商/交易所选项（Broker / Exchange option）<br>1=证券代码非法（Unknown symbol）<br>2=交易关闭（Exchange closed）<br>3=订单超过限价（Order exceeds limit）<br>4=订单太迟（Too late to enter）<br>5=未知订单（Unknown Order）<br>6=重复订单（Duplicate Order）<br>7=与口头报单重复（Duplicate of a verbally communicated order）<br>8=失效订单（Stale Order）<br>9=交易相关要求（Trade Along required）<br>10=无效账户（Invalid Investor ID）<br>11=不支持的订单特征（Unsupported order characteristic） |

表 16 订单拒绝（续）

| 标签  | 字段名称         | 是否必须 | 说明  |
|-----|--------------|------|---|
| 103 | OrdRejReason | Y    | 12=监查选择原因（Surveillance Option）<br>13=数量错误（Incorrect quantity）<br>14=数量分配错误（Incorrect allocated quantity）<br>15=未知账号（Unknown account（s））<br>99=其他（other）<br>100=参与者业务单元代码非法<br>101=委托日期非法<br>102=证券停牌<br>103=买委托数量不是 SJSXX.XXBLDW 的整数倍<br>104=卖委托数量不是 SJSXX.XXSOLDW 的整数倍<br>105=委托数量超出 SJSXX.XXMBXL 的限值<br>106=委托价格不是 SJSXX.XXJGDW 的整数倍<br>107=证券账户含有非数字字符<br>108=非法的委托业务<br>109=测试环境正式用户不允许报单<br>110=WTCLBZ 没有填 ‘z’<br>111=交易期间测试用户不允许报单<br>112=该参与者业务单元无权经营该种证券<br>113=该证券账户无权交易该种证券<br>114=该证券在当前时间不可交易<br>115=参与者业务单元被禁买或禁卖<br>116=证券账户被禁买或禁卖<br>117=参与者业务单元资金可用量不足<br>118=该委托记录标有 DELETE 标记<br>119=回购卖空<br>120=参与者业务单元卖空<br>121=股东卖空<br>216=该账号未指定在你参与者业务单元（Your firm does not own this account）<br>217=账号已挂起（Account is suspended）<br>218=无效价格（Invalid price）<br>219=申报价不能为零（Price may not be 0 for a limit order）<br>220=最小价格步长是（Minimum price Step is...）<br>222=价格超出范围（Price is out of range）<br>224=无效数量（Invalid quantity）<br>225=申报数量必须大于 0（Quantity must be greater than 0）<br>227=申报数量不符最小步长（Invalid quantity for minstep）<br>228=申报量必须不大于（Order quantity must not be more than）<br>229=超出限量（Holding limit would be exceeded）<br>231=余额不足（Insufficient account balance for sell order）<br>234=股票持有量超出限量（Holdings limit on stock would be exceeded）<br>235=找不到已授权的基本股票（Unable to find base stock for rights）<br>243=机构账号不能买卖此证券<br>244=S 账号不能买入<br>245=不能撤销指定（有卖空股票）<br>246=不能撤销指定（有委托）<br>247=不能撤销指定（公司卖空）<br>248=上海中央登记结算公司不允许撤销指定 |

表 16 订单拒绝（续）

| 标签  | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-----|-------------------------|------|---|
| 103 | OrdRejReason            |      | 271=该账号已指定在你参与者业务单元<br>272=未做指定不能交易<br>401=无效操作员代码（Invalid trader id）<br>403=无效申报序号（Invalid order number）<br>404=他人申报（Not your order）<br>405=账号不同（Account differ）<br>406=股票不同（Stock differ）<br>407=买卖不同（Buy Sell differ）<br>2001=日期出错（Date error）<br>2002=时间出错（Time error）<br>2003=券商 ref 字段数据错误（Brok-ref error）<br>2004=账号出错（Account error）<br>2005=买卖出错（B、S error）<br>2006=代码出错（Stock error）<br>2007=价格出错（Price error）<br>1100=委托号太大（Weituo number too large）<br>1101=记录不匹配（Record not match）<br>1102=委托失败（Weituo faulted）<br>1000=非法状态（Invalid status）<br>1021=记录号出错（Rec-num error）<br>1022=证券账号错误（ACC error）<br>1023=证券代码错误（STOCK error）<br>1024=买卖标志错误（B/S error）<br>1025=价格错误（PRICE error）<br>1026=数量错误（QTY error）<br>1027=日期字段错误（Field Date Error） |
| 58  | Text                    | N    | 备注说明，拒绝原因   |
|     | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.2.1.5 撤单请求

撤单请求（Order Cancel Request）的接口字段如表17所示。

表 17 撤单请求

| 标签               | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                                  |
|------------------|-----------------------|------|-------------------------------------|
|                  | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=F                           |
| 11               | ClOrdID               | Y    | 申请编号。0表示不启用该字段。                     |
| 组件<OrderQtyData> |                       | Y    |                                     |
| 152              | CashOrderQty          | N    | 订单金额                                |
| 38               | OrderQty              | N    | 撤单数量                                |
| 组件结束             |                       |      |                                     |
| 41               | OrigOrdID             | Y    | 撤单编号<br>被撤包请求唯一标识符<br>用于标识被撤委托唯一标识符 |



表 17 撤单请求（续）

| 标签 | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|----|-------------------------|------|--|
| 66 | ListID                  | Y    | 申报编号，如果是融资融券业务，则指第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。如果撤销整批的话，只传清单编号（tag66）；撤销指定某一条指令需传清单编号和原指令的订单编号（tag41）。 |
| 54 | Side                    | N    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出   |
| 48 | SecurityID              | N    | 证券代码   |
| 60 | TransactTime            | Y    | 委托发生时间   |
|    | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.2.2 意向申报

普通交易意向申报（Indication of Interest）的接口字段如表18所示。

表 18 意向申报

| 标签   | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|------|-----------------------|------|--|
|      | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=6  |
| 1180 | ApplID                | Y    | 应用标识<br>050=协议交易意向申报   |
| 23   | IOIID                 | Y    | 客户意向申报编号，同一交易单元一个交易日内申报的所有意向申报 IOIID 不能重复  |
| 28   | IOITransType          | Y    | 意向申报类型代码，意向报价会话类型：<br>N=意向申报<br>C=意向申报撤单<br>R=意向申报修改   |
| 26   | IOIRefID              | N    | 原意向申报，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  |
| 54   | Side                  | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出   |
| 522  | OwnerType             | Y    | 所有者类型代码<br>1=个人投资者发起<br>101=交易所发起<br>102=会员发起<br>103=机构投资者发起<br>104=自营交易发起<br>105=流动性服务提供商发起<br>106=结算机构发起 |
| 60   | TransactTime          | N    | 意向申报发起时间   |
|      | 组件<Instrument>        | Y    |  |
| 48   | SecurityID            | Y    | 证券代码   |

表 18 意向申报（续）

| 标签          | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------------|-------------------------|------|---|
| 22          | SecurityIDSource        | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用） |
| 组件结束        |                         |      |   |
| 组件<Parties> |                         | Y    |   |
| 453         | NoPartyIDs              | Y    | 参与者代码个数   |
| 448         | PartyID                 | Y    | 参与者代码   |
| 447         | PartyIDSource           | Y    | 参与者代码源  |
| 452         | PartyRole               | Y    | 参与者代码角色   |
| 组件结束        |                         |      |   |
| 27          | IOIQty                  | N    | 委托数量  |
| 44          | Price                   | N    | 委托价格  |
| 10184       | Contactoer              | N    | 联系人姓名   |
| 10185       | ContactInfo             | N    | 联系方式  |
| 58          | Text                    | N    | 备注说明  |
|             | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.2.3 成交申报

普通交易成交申报（Trade Capture Report）的接口字段如表19所示。

表 19 成交申报

| 标签   | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|------|-----------------------|------|--|
|      | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=AE   |
| 1180 | ApplID                | Y    | 应用标识   |
| 571  | TradeReportID         | Y    | 客户成交申报编号。<br>同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的<br>客户成交申报编号不得重复。   |
| 522  | OwnerType             | Y    | 所有者类型代码<br>1=个人投资者发起<br>101=交易所发起<br>102=会员发起<br>103=机构投资者发起<br>104=自营交易发起<br>105=流动性服务提供商发起<br>106=结算机构发起                         |
| 828  | TrdType               | N    | 成交申报业务类别代码<br>1001=股票质押式回购初始交易<br>1002=股票质押式回购提前购回<br>1003=股票质押式回购到期购回<br>1004=股票质押式回购延期购回<br>1005=股票质押式回购终止购回<br>1006=股票质押式回购补充质押 |

表 19 成交申报（续）

| 标签             | 字段名称                 | 是否必须 | 说明  |
|----------------|----------------------|------|---|
| 828            | TrdType              | N    | 1007=股票质押式回购部分解除质押<br>1008=股票质押式回购违约处置<br>1009=股票质押式回购部分购回<br>1011=约定购回初始交易<br>10012=约定购回提前购回<br>1013=约定购回到期购回<br>1014=约定购回延期购回<br>1021=质押式报价回购初始交易<br>1022=质押式报价回购提前购回<br>1031=债券质押式协议回购初始交易<br>1032=债券质押式协议回购购回交易 |
| 829            | TrdSubType           | N    | 成交申报业务子类代码<br>预留，固定填 0  |
| 856            | TradeReportType      | Y    | 成交申报类型代码<br>0=Submit，提交成交申报   |
| 487            | TradeReportTransType | Y    | 成交申报事务类别代码<br>0=New，新申报<br>1=Cancel，撤销申报  |
| 1123           | TradeHandlingInstr   | N    | 成交申报模式<br>1=Two-Party Report，成交报告<br>2=One-Party report for matching，协议配对   |
| 572            | TradeReportRefID     | N    | 原客户成交申报编号<br>撤销成交申报时使用  |
| 60             | TransactTime         | N    | 成交申报发起时间  |
| 组件<Instrument> |                      | Y    |   |
| 48             | SecurityID           | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource     | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司   |
| 22             | SecurityIDSource     | Y    | （200+自行内部使用）  |
| 组件结束           |                      |      |   |
| 54             | Side                 | Y    | 买卖方向代码，即本方参与者买卖方向。<br>1=买入；2=卖出。  |
| 组件<Parties>    |                      | Y    |   |
| 453            | NoPartyIDs           | Y    | 参与者代码个数   |
| 448            | PartyID              | Y    | 参与者代码   |
| 447            | PartyIDSource        | Y    | 参与者代码源  |
| 452            | PartyRole            | Y    | 参与者代码角色   |
| 组件结束           |                      |      |   |
| 31             | LastPx               | Y    | 成交价格  |
| 32             | LastQty              | Y    | 成交数量  |
| 152            | CashOrderQty         | N    | 成交金额  |
| 664            | ConfirmID            | N    | 约定号   |
| 8911           | ExpirationDays       | N    | 期限，单位为天数。   |

表 19 成交申报（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------|-------------------------|------|---|
| 541   | MaturityDate            | N    | 到期日   |
| 880   | TrdMatchID              | N    | 交易编号，跨交易日唯一。  |
| 8906  | ExpirationType          | N    | 期限类型代码，转融通证券出借填写。<br>01=日<br>02=周<br>03=月<br>04=季<br>05=半年<br>06=全年   |
| 8908  | ShareProperty           | N    | 股本类型代码，股份性质。<br>00=无限售流通股<br>01=首发后个人限售<br>03=首发后机构限售<br>04=高管锁定股<br>05=首发前个人限售<br>06=首发前机构限售   |
| 8907  | ExpirationExecInst      | N    | 续做方式代码，到期续做方式，质押式报价回购填写。<br>1=到期自动续做，2=到期手动续做。  |
| 423   | PriceType               | N    | 价格类型代码<br>1=Percentage 表示收益率<br>3=Fixed amount 表示绝对价格<br>对于资产管理计划份额转让业务指按“人民币现金”报价  |
| 10183 | PledgeeType             | N    | 质权人类型代码<br>01=当证券公司为融出方时，登记的质权人为证券公司。<br>02=当证券公司集合资产管理计划为融出方时，登记的质权人为证券公司。<br>03=当证券公司资产管理子公司集合资产管理计划为融出方时，登记的质权人为证券公司资产管理子公司。<br>04=当证券公司定向资产管理客户为融出方时，登记的质权人为定向资产管理客户。<br>05=当证券公司定向资产管理客户为融出方时，登记的质权人为证券公司。 |
| 10183 | PledgeeType             | N    | 06=当证券公司资产管理子公司定向资产管理客户为融出方时，登记的质权人为定向资产管理客户。<br>07=当证券公司资产管理子公司定向资产管理客户为融出方时，登记的质权人为证券公司资产管理子公司。   |
| 1125  | OrigTradeDate           | N    | 申报日期，初始交易成交申报的申报日期。   |
| 1126  | OrigTradeID             | N    | 初始交易交易所成交申报编号   |
| 10182 | OrigTradeReportID       | N    | 初始交易客户成交申报编号  |
| 544   | CashMargin              | N    | 融资融券信用标识<br>1=Cash 普通交易（缺省值为1）<br>2=Open 融资融券开仓<br>3=Close 融资融券平仓   |
| 58    | Text                    | N    | 备注说明  |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

#### 6.4.2.4 报价消息

报价消息（Quote）的接口字段如表20所示。

表 20 报价消息

| 标签             | 字段名称                   | 是否必须 | 说明  |
|----------------|------------------------|------|---|
|                | 消息头部 (Standard Header) | Y    | MsgType=S   |
| 1180           | ApplID                 | Y    | 应用标识<br>可应用于以下报价申报：<br>041=期权集中竞价交易报价申报<br>056=协议交易报价申报<br>412=债券现券交易点击成交报价申报<br>415=债券现券交易询价成交报价申报   |
| 1166           | QuoteMsgID             | Y    | 客户报价消息编号  |
| 117            | QuoteID                | Y    | 报价标识，报价消息编号，主动撤单时填写，与被撤委托的 QuoteID 一致。  |
| 522            | OwnerType              | Y    | 报价所有者类型   |
| 60             | TransactTime           | N    | 报价发起时间  |
| 131            | QuoteReqID             | N    | 预留字段<br>当报价是对报价请求的响应时，填写报价请求的 ID。   |
| 537            | QuoteType              | N    | 报价类型<br>1=Tradeable 表示可交易的报价  |
| 组件<Instrument> |                        | Y    |   |
| 48             | SecurityID             | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource       | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN (ISIN 组织)<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>(200+自行内部使用)  |
| 组件结束           |                        |      |   |
| 453            | NoPartyIDs             | Y    | 参与者代码个数   |
| 448            | PartyID                | Y    | 参与者代码   |
| 447            | PartyIDSource          | Y    | 参与者代码源  |
| 452            | PartyRole              | Y    | 参与者代码角色   |
| 组件结束           |                        |      |   |
| 132            | BidPx                  | N    | 买报价，BidSize>0 时必须填写。  |
| 133            | OfferPx                | N    | 卖报价，OfferSize>0 时必须填写。  |
| 134            | BidSize                | N    | 买数量<br>对于期权集中竞价交易报价，如果 BidSize>0，则必须填写 BidPositionEffect。<br>通过对 BidSize 和 OfferSize 字段的取值组合实现四种报价模式：<br>双边报价，BidSize>0，OfferSize>0；<br>买报价，BidSize>0，OfferSize=0；<br>卖报价，BidSize=0，OfferSize>0；<br>撤销报价，BidSize=0，OfferSize=0。 |

表 20 报价消息（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-------|-------------------------|------|--|
| 135   | OfferSize               | N    | 卖数量<br>对于期权集中竞价交易报价，如果 OfferSize>0，则必须填写 OfferPositionEffect<br>通过对 BidSize 和 OfferSize 字段的取值组合实现四种报价模式：<br>双边报价，BidSize>0，OfferSize>0；<br>买报价，BidSize>0，OfferSize=0；<br>卖报价，BidSize=0，OfferSize>0；<br>撤销报价，BidSize=0，OfferSize=0。 |
| 8909  | BidPositionEffect       | N    | 买开平仓标志，衍生品报价填写。<br>O=开仓<br>C=平仓  |
| 8910  | OfferPositionEffect     | N    | 卖开平仓标志<br>衍生品报价填写<br>O=开仓<br>C=平仓  |
| 58    | Text                    | N    | 备注   |
| 693   | QuoteRespID             | N    | 报价回复消息编号   |
| 1171  | PrivateQuote            | N    | 私有报价<br>0=私有报价（Private Quote）<br>1=公开报价（Public Quote）  |
| 62    | ValidUntilTime          | N    | 报价有效时间，预留。   |
| 423   | PriceType               | N    | 价格类型，预留。<br>1=百分比（Percentage）<br>2=每交易单位（Per unit）   |
| 544   | CashMargin              | N    | 融资融券信用标识，预留。<br>1=Cash 普通交易（缺省值为 1）<br>2=Open 融资融券开仓<br>3=Close 融资融券平仓   |
| 63    | SettlType               | N    | 结算方式，预留。<br>103=多边净额<br>104=逐笔全额   |
| 10216 | SettlPeriod             | N    | 结算周期，预留。   |
| 1091  | PreTradeAnonymity       | N    | 是否匿名<br>0=显名<br>1=匿名<br>9=不指定  |
| 111   | MaxFloor                | N    | 可显示数量  |
| 110   | MinQty                  | N    | 最低成交数量   |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.2.5 询价消息

询价消息（Quote Request）的接口字段如表21所示。

表 21 询价消息

| 标签 | 字段名称                  | 是否必须 | 说明        |
|----|-----------------------|------|-----------|
|    | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=R |

表 21 询价消息（续）

| 标签               | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|------------------|-----------------------|------|---|
| 1180             | AppID                 | Y    | 应用标识<br>042=期权集中竞价交易询价<br>该消息也用于以下业务的询价请求：<br>055=协议交易询价请求<br>414=债券现券交易询价请求                              |
| 131              | QuoteReqID            | Y    | 询价请求编号  |
| 522              | OwnerType             | Y    | 申报所有者类型   |
| 60               | TransactTime          | N    | 申报发起时间  |
| 组件<Instrument>   |                       | Y    |   |
| 48               | SecurityID            | Y    | 证券代码  |
| 22               | SecurityIDSource      | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用） |
| 组件结束             |                       |      |   |
| 组件<RootParties>  |                       | Y    |   |
| 1116             | NoRootPartyIDs        | Y    | 初始参与人代码个数   |
| 1117             | RootPartyID           | Y    | 初始参与人代码   |
| 1118             | RootPartyIDSource     | Y    | 初始参与人代码源  |
| 1119             | RootPartyRole         | Y    | 初始参与人代码角色   |
| 组件结束             |                       |      |   |
| 58               | Text                  | N    | 备注  |
| 11               | CIOrdID               | Y    | 客户订单编号  |
| 537              | QuoteType             | N    | 报价类型。<br>1=Tradeable 表示可交易的报价   |
| 组件<OrderQtyData> |                       | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty          | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty              | Y    | 订单数量  |
| 组件结束             |                       |      |   |
| 54               | Side                  | Y    | 买卖方向  |
| 44               | Price                 | N    | 价格  |
| 10200            | QuoteRequestTransType | N    | 询价请求事务类型<br>0=New, 新订单。1=Cancel, 撤销。  |
| 1171             | PrivateQuote          | N    | 私有报价  |
| 126              | ExpireTime            | N    | 询价请求失效时间, 预留。   |
| 692              | QuotePriceType        | N    | 报价价格类型, 预留<br>1=百分比（Percent of par）<br>2=每股（Per Share）  |
| 544              | CashMargin            | N    | 融资融券信用标识, 预留。   |
| 63               | SettlType             | N    | 结算方式, 预留。   |

表 21 询价消息（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明       |
|-------|-------------------------|------|----------|
| 10216 | SettlPeriod             | N    | 结算周期，预留。 |
| 1091  | PreTradeAnonymity       | N    | 是否匿名     |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |          |

## 6.4.2.6 网络投票

网络投票（Evote）的接口字段如表22所示。

表 22 网络投票

| 标签             | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|----------------|-----------------------|------|--|
|                | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U004   |
| 1180           | ApplID                | Y    | 应用标识<br>210=投票   |
| 522            | OwnerType             | Y    | 所有者类型代码<br>1=个人投资者发起<br>101=交易所发起<br>102=会员发起<br>103=机构投资者发起<br>104=自营交易发起<br>105=流动性服务提供商发起<br>106=结算机构发起 |
| 60             | TransactTime          | Y    | 投票发起时间   |
| 11             | ClOrdID               | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。   |
| 组件<Instrument> |                       | Y    |  |
| 48             | SecurityID            | Y    | 投票代码   |
| 22             | SecurityIDSource      | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司                  |
| 22             | SecurityIDSource      | Y    | （200+自行内部使用）   |
| 组件结束           |                       |      |  |
| 组件<Parties>    |                       | Y    |  |
| 453            | NoPartyIDs            | Y    | 参与者代码个数  |
| 448            | PartyID               | Y    | 参与者代码  |
| 447            | PartyIDSource         | Y    | 参与者代码源   |
| 452            | PartyRole             | Y    | 参与者代码角色  |
| 组件结束           |                       |      |  |



表 22 网络投票（续）

| 标签                | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-------------------|-------------------------|------|--|
| 8529              | VotingProposal          | Y    | 投票议案号，深交所投票规则：<br>1-99 表示具体议案号<br>100 表示总议案<br>上交所投票规则：<br>1-98 表示具体议案号（X）<br>X.00 表示议案组 X 所有议案<br>X.01 表示议案组 X 下的第一个议案<br>99-表示所有议案 |
| 8530              | VotingSubProposal       | N    | 投票子议案号或选举候选人<br>0 表示所有子议案（不适用于累积投票）<br>>0 其他表示具体子议案  |
| 8531              | VotingPreference        | Y    | 投票意向（非累积投票议案填写）<br>1=代码同意；2=代表反对；3=代表弃权。   |
| 组件< OrderQtyData> |                         | N    |  |
| 38                | OrderQty                | Y    | 投票数量，累积投票制选举候选人时必须。  |
| 组件结束              |                         |      |  |
| 58                | Text                    | N    | 备注说明   |
|                   | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

### 6.4.3 融资融券交易

#### 6.4.3.1 单笔委托

融资融券交易单笔委托（New Order）的接口字段如表23所示。

表 23 融资融券单笔委托

| 标签 | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|----|-----------------------|------|---|
|    | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=D   |
| 11 | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0表示不启用该字段。  |
| 54 | Side                  | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入；2=卖出。  |
| 48 | SecurityID            | Y    | 证券代码  |
| 60 | TransactTime          | Y    | 委托发生时间  |
| 40 | OrdType               | Y    | 委托类型代码，即基于价格的价格模式或订单类型<br>01=市价（表示不限制委托价格，在涨跌停范围内即可）<br>02=限价（表示限制委托价格，买入不高于，卖出不低于）<br>03=市价止损<br>04=市价止盈 |
| 40 | OrdType               | Y    | 05=限价止损<br>06=限价止盈  |
| 44 | Price                 | N    | 委托价格<br>如果40字段为02限价订单则必送  |
| 15 | Currency              | N    | 币种代码，交易货币，默认是人民币。<br>CNY=人民币<br>USD=美元<br>HKD=港币<br>币种代码应符合GB/T 12406—2008的要求。                            |

表 23 融资融券单笔委托（续）

| 标签               | 字段名称             | 是否必须        | 说明  |                                |
|------------------|------------------|-------------|---|--------------------------------|
| 207              | SecurityExchange | N           | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合GB/T 23696—2017的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |                                |
| 554              | CashMargin       | N           | 融资融券信用标识<br>1=Cash普通交易<br>2=Open融资融券开仓<br>3=Close融资融券平仓<br>缺省值为1<br>不送时表示担保品买卖<br>必送时表示信用交易   |                                |
| Group22000       | NoUAccount       | N           | 扩展账号  |                                |
|                  | 581              | AccountType | N   | 账户类别代码<br>300=资金账号<br>301=股东账号 |
|                  | 1                | Account     | N   | 账户编码                           |
| 组件<OrderQtyData> |                  | Y           |   |                                |
| 152              | CashOrderQty     | N           | 订单金额  |                                |
| 38               | OrderQty         | Y           | 订单数量  |                                |
| 组件结束             |                  |             |   |                                |
| 组件<Access>       |                  | Y           | 适用于第三方接入  |                                |

表 23 融资融券单笔委托（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明                            |
|-------|-------------------------|------|-------------------------------|
| 12001 | AuthCode                | Y    | 授权码<br>系统接入登记时分配              |
| 12002 | FeatureCode             | Y    | 机器特征码<br>通常使用终端 IP 地址和 MAC 地址 |
| 12003 | AuthInfo                | Y    | 认证密码<br>系统接入时身份认证             |
| 12004 | ProductCode             | Y    | 产品识别码<br>系统接入登记时分配            |
| 12005 | DeveloperCode           | Y    | 开发商识别码<br>系统接入登记时分配           |
| 12006 | VersionInfo             | Y    | 软件版本信息<br>系统可以根据实际软件版本信息不做校验  |
| 组件结束  |                         |      |                               |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |                               |

相应业务的送入参数如表24所示。

表 24 融资融券相应业务的送入参数

| 业务   | 标签  | 字段名称       | 是否必须 | 送入参数                      |
|------|-----|------------|------|---------------------------|
| 融资买入 | 54  | Side       | Y    | 买卖方向 1                    |
|      | 544 | CashMargin | Y    | 开仓平仓 2                    |
| 融券卖出 | 54  | Side       | Y    | 买卖方向 2<br>注：不接受融券卖出的市价申报。 |
|      | 544 | CashMargin | Y    | 开仓平仓 2<br>注：不接受融券卖出的市价申报。 |
| 买券还券 | 54  | Side       | Y    | 买卖方向 1                    |
|      | 544 | CashMargin | Y    | 开仓平仓 3                    |
| 卖券还款 | 54  | Side       | Y    | 买卖方向 2                    |
|      | 544 | CashMargin | Y    | 开仓平仓 3                    |

#### 6.4.3.2 现券还券以及现金还款请求

融资融券交易现券还券以及现金还款请求的接口字段如表25所示。

表 25 现券还券以及现金还款请求

| 标签  | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|-----|-----------------------|------|--|
|     | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U010   |
| 710 | PosReqID              | Y    | 请求唯一标识符  |
| 709 | PosTransType          | Y    | 过户类型代码<br>200=现金还款<br>201=现券还券   |
| 712 | PosMaintAction        | Y    | 维护动作，要执行的维护动作。<br>1=New<br>2=Replace<br>3=Cancel<br>4=Reverse（只取值为1）   |
| 207 | SecurityExchange      | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所 |

表 25 现券还券以及现金还款请求（续）

| 标签       | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|----------|-------------------------|------|---|
| 207      | SecurityExchange        | N    | 0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 1        | Account                 | N    | 账户编码，股东账户/资金账户  |
| 581      | AccountType             | N    | 账户类别代码<br>300=资金账户（现金还款时送）<br>301=股东账户（现券还券时送）  |
| 48       | SecurityID              | Y    | 证券代码  |
| 15       | Currency                | N    | 币种代码，交易货币，默认是人民币。<br>CNY=人民币；USD美元；HKD=港币。<br>当PosTransType=200时，必送；<br>当PosTransType=201时，当需要明确市场时，必须送入此<br>字段，否则按SecurityID自动判断，可能出错识别错误。<br>应符合GB/T 12406—2008的要求。   |
| Group702 | NoPositions             | N    | 条目数量<br>当PosTransType=201时必送  |
|          | 703 PosType             | N    | 数量类型代码  |
|          | 705 ShortQty            | N    | 还券数量  |
| Group753 | NoPosAmt                | N    | 金额数目，偿还金额组合的数目。<br>当 PosTransType=200 时必送。  |
|          | 707 PosAmtType          | N    | 金额类型代码<br>OB=现金还款的委托金额  |
|          | 708 PosAmt              | N    | 金额  |
|          | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

#### 6.4.3.3 担保品划转请求

融资融券交易担保品划转请求的接口字段如表26所示。

表 26 担保品划转请求

| 标签  | 字段名称                   | 是否必须 | 说明   |
|-----|------------------------|------|--|
|     | 消息头部 (Standard Header) | Y    | MsgType=U011   |
| 902 | CollAsgnID             | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识此数据包的数字或字符<br>在交易日内需要确保该字段的唯一性  |
| 903 | CollAsgnTransType      | Y    | 申请指令代码<br>请求指令, 用于操作数据包。<br>0=New新建<br>1=Replace修改<br>2=Cancel取消<br>3=Release发布<br>4=Reverse撤销   |
| 895 | CollAsgnReason         | Y    | 业务请求原因<br>3=抵押担保<br>4=解除抵押   |
| 54  | Side                   | N    | 划转类型代码<br>可不送, 若送则根据TAG 895。<br>若为3 抵押担保则送G转入。<br>若为4 解除抵押则送F划出。   |
| 1   | Account                | N    | 账户编码, 股东账户。不送的话, 网关会自己去查股东账户然后送往柜台。  |
| 15  | Currency               | C    | 币种代码, 交易货币, 默认是人民币。<br>CNY=人民币<br>USD=美元<br>HKD=港币<br>应符合GB/T 12406—2008的要求。   |
| 207 | SecurityExchange       | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时, 必须送入此字段, 否则按 SecurityID 自动判断, 可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场 (机构间私募产品报价与服务系统)<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通 (北向)<br>0121=深港通 (北向)<br>0122=沪伦通 (东向)<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心 |

表 26 担保品划转请求（续）

| 标签  | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-----|-------------------------|------|--|
| 207 | SecurityExchange        | N    | 0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 48  | SecurityID              | Y    | 证券代码   |
| 60  | TransactTime            | Y    | 委托发生时间   |
| 53  | Quantity                | Y    | 过户数量   |
|     | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.3.4 余券划转

融资融券交易余券划转的接口字段如表27所示。

表 27 余券划转

| 标签       | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|----------|-----------------------|------|---|
|          | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U012  |
| 710      | PosReqID              | Y    | 请求唯一标识符   |
| 709      | PosTransType          | Y    | 过户类型代码<br>202=余券划转  |
| 712      | PosMaintAction        | Y    | 维护动作，要执行的维护动作。<br>1=New<br>2=Replace<br>3=Cancel<br>4=Reverse<br>（只取值为1）  |
| 1        | Account               | N    | 账户编码，股东账户。  |
| 581      | AccountType           | N    | 账户类别代码<br>301=股东账户  |
| 48       | SecurityID            | Y    | 证券代码  |
| Group702 | NoPositions           | Y    | 条目数量  |
|          | 703 PosType           | N    | 数量类型代码  |
|          | 705 ShortQty          | N    | 申请划转数量  |
| 207      | SecurityExchange      | N    | 交易所所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场 |

表 27 余券划转（续）

| 标签  | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-----|-------------------------|------|--|
| 207 | SecurityExchange        | N    | 0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 15  | Currency                | N    | 币种代码，交易货币，默认是人民币。<br>CNY=人民币<br>USD=美元<br>HKD=港币<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按48SecurityID自动判断，可能出错识别错误。<br>币种代码应符合GB/T 12406—2008的要求。   |
|     | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

#### 6.4.4 股票质押式回购交易

##### 6.4.4.1 初始交易

##### 6.4.4.1.1 初始交易指令

股票质押式回购交易初始交易指令（Purchase Order）的接口字段如表28所示。

表 28 股票质押式回购交易初始交易指令

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------|-----------------------|------|---|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=G（Order Cancel/Replace Request）指令修改           |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段                                    |
| 11011 | ClContractID          | Y    | 客户合同编号<br>第三方系统合同编号，唯一。                               |
| 11012 | RelatedContractID     | Y    | 关联系统合同编号。初始交易为空，补充交易不能为空。                             |
| 11013 | CounterParty          | Y    | 融出方名称   |
| 11014 | CounterPartyType      | N    | 融出方类型代码   |
| 8908  | ShareProperty         | N    | 股本类型代码，股份性质。<br>00=无限售流通股<br>01=首发后个人限售<br>03=首发后机构限售 |
| 8908  | ShareProperty         | N    | 04=高管锁定股<br>05=首发前个人限售<br>06=首发前机构限售                  |

表 28 股票质押式回购交易初始交易指令（续）

| 标签             | 字段名称                | 是否必须 | 说明   |
|----------------|---------------------|------|--|
| 10190          | InvestmentType      | N    | 资金用途类型代码<br>01=生产经营<br>02=补充流动资金<br>03=股权性投资<br>04=债权类投资<br>05=不动产类投资<br>06=二级市场证券交易<br>07=偿还债务<br>08=个人消费<br>99=其他用途  |
| 1              | Account             | Y    | 账户编码，客户账户。   |
| 10191          | SeniorExecutiveType | N    | 客户高管类型代码<br>01=非董监高<br>02=在任董监高（含任期内离职）<br>03=在任董监高的一致行动人<br>04=董监高离任不满 6 个月<br>05=董监高离任已满 6 个月但不满 12 个月<br>06=董监高离任已满 12 个月但不满 18 个月<br>07=董监高离任已满 18 个月<br>08=不确定类型  |
| 组件<Instrument> |                     | Y    |  |
| 48             | SecurityID          | Y    | 证券代码   |
| 22             | SecurityIDSource    | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）  |
| 组件结束           |                     |      |  |
| 207            | SecurityExchange    | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场 |



表 28 股票质押式回购交易初始交易指令（续）

| 标签               | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|------------------|-------------------------|------|---|
| 207              | SecurityExchange        | N    | 0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 55               | Symbol                  | Y    | 证券名称  |
| 组件<OrderQtyData> |                         | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty            | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty                | Y    | 订单数量  |
| 组件结束             |                         |      |   |
| 44               | Price                   | Y    | 质押价格  |
| 916              | StartDate               | Y    | 指令开始日期，初始交易日期。  |
| 917              | EndDate                 | Y    | 指令结束日期，购回交易日期。  |
| 11016            | ContractType            | Y    | 融资合同类型代码<br>1=融资申购<br>2=融资可取<br>3=融资可用  |
| 541              | MaturityDate            | N    | 到期日   |
| 组件<Access>       |                         | Y    | 适用于第三方接入  |
| 12001            | AuthCode                | Y    | 授权码，系统接入登记时分配。  |
| 12002            | FeatureCode             | Y    | 机器特征码，通常使用终端 IP 地址和 MAC 地址。   |
| 12003            | AuthInfo                | Y    | 认证密码，系统接入时身份认证。   |
| 12004            | ProductCode             | Y    | 产品识别码，系统接入登记时分配。  |
| 12005            | DeveloperCode           | Y    | 开发商识别码，系统接入登记时分配。   |
| 12006            | VersionInfo             | Y    | 软件版本信息，系统可按实际软件版本信息不做校验。  |
| 组件结束             |                         |      |   |
|                  | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.4.1.2 初始交易执行报告

股票质押式回购初始交易执行报告（Purchase Order Execution Report）的接口字段如表29所示。

表 29 股票质押式回购初始交易执行报告

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                      |
|-------|-----------------------|------|-------------------------|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | 消息类型：8=Execution Report |
| 15999 | ProceType             | Y    | 处理类型代码<br>2=状态反馈（指令状态）  |

表 29 股票质押式回购初始交易执行报告（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------|-------------------------|------|---|
| 11    | ClOrdID                 | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段。   |
| 11011 | ClContractID            | Y    | 客户合同编号，第三方系统合同编号，唯一。  |
| 37    | OrderID                 | Y    | 订单编号<br>返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。  |
| 11010 | ContractID              | Y    | 系统合同编号，唯一。  |
| 39    | OrdStatus               | Y    | 指令状态代码，订单状态代码：对于指令下达拒绝的时候填 03。<br>01=有效指令<br>02=已修改<br>03=已撤销<br>04=已暂停<br>05=审批拒绝<br>06=分发拒绝<br>07=指令录入<br>08=草稿指令<br>09=临时下达<br>10=临时修改   |
| 14003 | ReportSeat              | N    | 席位代码<br>返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14006 | ReportSerialNo          | N    | 申报编号<br>返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14007 | BusinessTime            | N    | 申报时间<br>返回委托数据时该字段为委托时间，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14058 | FailReason              | N    | 失败原因，指令状态数据才会返回<br>保存可用不足和触发风控信息，整体结构如下：<br>1、可用不足：<br><FailReason Type="1"><br><Reasons><br><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons><br></FailReason><br>Reason 信息：组合编号 申报代码 交易市场 投资类型 可用不足提示说明<br>2、风控信息：<br><FailReason Type="2"><br><Reasons><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons></FailReason><br>Reason 信息：触警级别 触警操作 组合编号 证券编码 交易所 风控编号 风控类型 设置值 实际值 风控说明<br>Type 属性值域 1=可用，2=风控 |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

#### 6.4.4.2 购回交易

##### 6.4.4.2.1 购回交易指令

股票质押式回购购回交易指令（Purchase Back Order）的接口字段如表30所示。

表 30 股票质押式回购交易指令

| 标签               | 字段名称                   | 是否必须 | 说明  |
|------------------|------------------------|------|---|
|                  | 消息头部 (Standard Header) | Y    | MsgType=G (Order Cancel/Replace Request) 指令修改   |
| 11               | ClOrdID                | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。  |
| 11011            | ClContractID           | Y    | 客户合同编号, 第三方系统合同编号, 唯一   |
| 11010            | ContractID             | Y    | 系统合同编号, 唯一  |
| 1                | Account                | Y    | 账户编码, 客户账户  |
| 8908             | ShareProperty          | N    | 股本类型代码, 股份性质<br>00=无限售流通股<br>01=首发后个人限售<br>03=首发后机构限售<br>04=高管锁定股<br>05=首发前个人限售<br>06=首发前机构限售                         |
| 10190            | InvestmentType         | N    | 资金用途类型代码<br>01=生产经营<br>02=补充流动资金<br>03=股权性投资<br>04=债权类投资<br>05=不动产类投资<br>06=二级市场证券交易<br>07=偿还债务<br>08=个人消费<br>99=其他用途 |
| 917              | EndDate                | Y    | 指令结束日期, 购回交易日期  |
| 组件<OrderQtyData> |                        | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty           | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty               | Y    | 购回数量。<br>部分购回必须大于 0, 其他情况为 0。   |
| 组件结束             |                        |      |   |
| 44               | Price                  | Y    | 购回价格。<br>部分购回必须大于 0, 其他情况为 0。   |
| 152              | CashOrderQty           | N    | 订单金额。<br>部分购回必须大于 0, 其他情况为 0。   |
| 11015            | BackType               | Y    | 合约了结类型代码:<br>01=提前购回<br>02=到期购回<br>03=延期购回<br>04=终止购回<br>09=违约处置了结  |
| 组件<Access>       |                        | Y    | 适用于第三方接入  |
| 12001            | AuthCode               | Y    | 授权码<br>系统接入登记时分配  |
| 12002            | FeatureCode            | Y    | 机器特征码<br>通常使用终端 IP 地址和 MAC 地址   |
| 12003            | AuthInfo               | Y    | 认证密码<br>系统接入时身份认证   |
| 12004            | ProductCode            | Y    | 产品识别码<br>系统接入登记时分配  |
| 12005            | DeveloperCode          | Y    | 开发商识别码<br>系统接入登记时分配   |

表 30 股票质押式回购购回交易指令（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明                           |
|-------|-------------------------|------|------------------------------|
| 12006 | VersionInfo             | Y    | 软件版本信息<br>系统可以根据实际软件版本信息不做校验 |
| 组件结束  |                         |      |                              |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |                              |

## 6.4.4.2.2 购回交易执行报告

股票质押式回购购回交易执行报告（Purchase Back Order Execution Report）的接口字段如表31所示。

表 31 股票质押式回购购回交易执行报告

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 备注   |
|-------|-----------------------|------|--|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | 消息类型（金融信息交换协议 FIX 标准消息类型，定义在消息头）：8=Execution Report  |
| 15999 | ProceType             | Y    | 处理类型代码。2=状态反馈（指令状态）。   |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。   |
| 11011 | ClContractID          | Y    | 客户合同编号，第三方系统合同编号，唯一。   |
| 37    | OrderID               | Y    | 订单编号。返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。  |
| 11010 | ContractID            | Y    | 系统合同编号，唯一。   |
| 39    | OrdStatus             | Y    | 指令状态代码，订单状态代码：对于指令下达拒绝的时候填 03。<br>01=有效指令<br>02=已修改<br>03=已撤销<br>04=已暂停<br>05=审批拒绝<br>06=分发拒绝<br>07=指令录入<br>08=草稿指令<br>09=临时下达<br>10=临时修改  |
| 14003 | ReportSeat            | N    | 席位代码，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14006 | ReportSerialNo        | N    | 申报编号，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14007 | BusinessTime          | N    | 申报时间，返回委托数据时该字段为委托时间，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14058 | FailReason            | N    | 失败原因<br>指令状态数据才会返回<br>保存可用不足和触发风控信息，整体结构如下：<br>1、可用不足：<br><FailReason Type="1"><br><Reasons><br><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons><br></FailReason><br>Reason 信息：组合编号 申报代码 交易市场 投资类型 可用不足提示说明<br>2、风控信息： |

表 31 股票质押式回购购回交易执行报告（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 备注   |
|-------|-------------------------|------|--|
| 14058 | FailReason              | N    | <pre>&lt;FailReason Type="2"&gt; &lt;Reasons&gt; &lt;Reason&gt;&lt;/Reason&gt; &lt;Reason&gt;&lt;/Reason&gt; &lt;/Reasons&gt;&lt;/FailReason&gt;</pre> Reason 信息：触警级别 触警操作 组合编号 证券编码 交易所 风控编号 风控类型 设置值 实际值 风控说明<br>Type 属性值域 1=可用，2=风控 |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.5 约定购回交易

## 6.4.5.1 初始交易

## 6.4.5.1.1 初始交易指令

约定购回交易初始交易指令（Purchase Order）的接口字段如表32所示。

表 32 约定购回交易初始交易指令

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------|-----------------------|------|---|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=G（Order Cancel/Replace Request）指令修改   |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段。   |
| 11011 | ClContractID          | Y    | 客户合同编号，第三方系统合同编号，唯一。  |
| 11012 | RelatedContractID     | Y    | 关联系统合同编号<br>初始交易为空，补充交易不能为空。  |
| 11013 | CounterParty          | Y    | 融出方名称   |
| 1     | Account               | Y    | 账户编码，客户账户。  |
| 207   | SecurityExchange      | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通 |

表 32 约定购回交易初始交易指令（续）

| 标签               | 字段名称             | 是否必须 | 说明   |
|------------------|------------------|------|--|
| 207              | SecurityExchange | N    | 0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 组件<Instrument>   |                  | Y    |  |
| 48               | SecurityID       | Y    | 证券代码   |
| 22               | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）                            |
| 组件结束             |                  |      |  |
| 55               | Symbol           | Y    | 证券名称   |
| 组件<OrderQtyData> |                  | Y    |  |
| 152              | CashOrderQty     | N    | 订单金额   |
| 38               | OrderQty         | Y    | 订单数量   |
| 组件结束             |                  |      |  |
| 44               | Price            | Y    | 约定价格   |
| 916              | StartDate        | Y    | 指令开始日期，初始交易日期  |
| 917              | EndDate          | Y    | 指令结束日期，购回交易日期  |
| 11016            | ContractType     | Y    | 融资合同类型代码<br>1=融资申购<br>2=融资可取<br>3=融资可用   |
| 10190            | InvestmentType   | Y    | 资金用途类型代码<br>01=生产经营<br>02=补充流动资金<br>03=股权性投资<br>04=债权类投资<br>05=不动产类投资<br>06=二级市场证券交易<br>07=偿还债务<br>08=个人消费<br>99=其他用途                |
| 组件<Access>       |                  | Y    | 适用于第三方接入   |
| 12001            | AuthCode         | Y    | 授权码，系统接入登记时分配。   |
| 12002            | FeatureCode      | Y    | 机器特征码，通常使用终端 IP 地址和 MAC 地址。  |
| 12003            | AuthInfo         | Y    | 认证密码，系统接入时身份认证。  |
| 12004            | ProductCode      | Y    | 产品识别码，系统接入登记时分配。   |

表 32 约定购回交易初始交易指令（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明                         |
|-------|-------------------------|------|----------------------------|
| 12005 | DeveloperCode           | Y    | 开发商识别码，系统接入登记时分配。          |
| 12006 | VersionInfo             | Y    | 软件版本信息，系统可以根据实际软件版本信息不做校验。 |
| 组件结束  |                         |      |                            |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |                            |

## 6.4.5.1.2 初始交易执行报告

约定购回交易初始交易执行报告（Purchase Order Execution Report）的接口字段如表33所示。

表 33 约定购回交易初始交易执行报告

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------|-----------------------|------|---|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | 消息类型：8=Execution Report<br>表示指令状态、委托数据反馈、成交数据反馈。  |
| 15999 | ProceType             | Y    | 处理类型代码，<br>2=状态反馈（指令状态）。  |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号。<br>0 表示不启用该字段。  |
| 11011 | ClContractID          | Y    | 客户合同编号，第三方系统合同编号，唯一。  |
| 37    | OrderID               | Y    | 订单编号。<br>返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。   |
| 11010 | ContractID            | Y    | 系统合同编号，唯一。  |
| 39    | OrdStatus             | Y    | 指令状态代码，订单状态代码；对于指令下达拒绝的时候填 03。<br>01=有效指令<br>02=已修改<br>03=已撤销<br>04=已暂停<br>05=审批拒绝<br>06=分发拒绝<br>07=指令录入<br>08=草稿指令<br>09=临时下达<br>10=临时修改                           |
| 14003 | ReportSeat            | N    | 席位代码<br>返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14006 | ReportSerialNo        | N    | 申报编号<br>返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14007 | BusinessTime          | N    | 申报时间<br>返回委托数据时该字段为委托时间，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14058 | FailReason            | N    | 失败原因，指令状态数据才会返回。<br>保存可用不足和触发风控信息，整体结构如下：<br>1、可用不足：<br><FailReason Type="1"><br><Reasons><br><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons><br></FailReason> |

表 33 约定购回交易初始交易执行报告（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------|-------------------------|------|---|
| 14058 | FailReason              | N    | Reason 信息：组合编号 申报代码 交易市场 投资类型 可用不足提示说明<br>2、风控信息：<br><FailReason Type="2"><br><Reasons><br><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons></FailReason><br>Reason 信息：触警级别 触警操作 组合编号 证券编码 交易所 风控编号 风控类型 设置值 实际值 风控说明。Type 属性值域 1=可用，2=风控。 |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.5.2 购回交易

## 6.4.5.2.1 购回交易指令

购回交易指令（Purchase Back Order）的接口字段如表34所示。

表 34 购回交易指令

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------|-------------------------|------|---|
|       | 消息头部（Standard Header）   | Y    | MsgType=G（Order Cancel/Replace Request）指令修改             |
| 11    | ClOrdID                 | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。  |
| 11011 | ClContractID            | Y    | 客户合同编号，第三方系统合同编号，唯一。                                    |
| 11010 | ContractID              | Y    | 系统合同编号，唯一。  |
| 1     | Account                 | Y    | 账户编码，客户账户。  |
| 917   | EndDate                 | Y    | 指令结束日期，购回交易日期。  |
|       | 组件<OrderQtyData>        | Y    |   |
| 152   | CashOrderQty            | N    | 订单金额。部分购回必须大于 0，其他情况为 0。                                |
| 38    | OrderQty                | Y    | 购回数量。部分购回必须大于 0，其他情况为 0。                                |
|       | 组件结束                    |      |   |
| 44    | Price                   | Y    | 购回价格。部分购回必须大于 0，其他情况为 0。                                |
| 11015 | BackType                | Y    | 合约了结类型代码：<br>01=提前购回；02=到期购回；03=延期购回；04=终止购回；09=违约处置了结。 |
|       | 组件<Access>              | Y    | 适用于第三方接入  |
| 12001 | AuthCode                | Y    | 授权码，系统接入登记时分配。  |
| 12002 | FeatureCode             | Y    | 机器特征码，通常使用终端 IP 地址和 MAC 地址。                             |
| 12003 | AuthInfo                | Y    | 认证密码，系统接入时身份认证。   |
| 12004 | ProductCode             | Y    | 产品识别码，系统接入登记时分配。  |
| 12005 | DeveloperCode           | Y    | 开发商识别码，系统接入登记时分配。                                       |
| 12006 | VersionInfo             | Y    | 软件版本信息，系统可以根据实际软件版本信息不做校验。                              |
|       | 组件结束                    |      |   |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |



## 6.4.5.2.2 回交易执行报告

购回交易执行报告（Purchase Back Order Execution Report）的接口字段如表35所示。

表 35 购回交易执行报告

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-------|-------------------------|------|--|
|       | 消息头部（Standard Header）   | Y    | 消息类型（金融信息交换协议 FIX 标准消息类型，定义在消息头）：8=Execution Report  |
| 15999 | ProceType               | Y    | 处理类型代码<br>2=状态反馈（指令状态）   |
| 11    | ClOrdID                 | Y    | 申请编号。<br>0 表示不启用该字段。   |
| 11011 | ClContractID            | Y    | 客户合同编号，第三方系统合同编号，唯一。   |
| 37    | OrderID                 | Y    | 订单编号。<br>返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。  |
| 11010 | ContractID              | Y    | 系统合同编号，唯一。   |
| 39    | OrdStatus               | Y    | 指令状态代码，订单状态代码：对于指令下达拒绝的时候填 03。<br>01=有效指令<br>02=已修改<br>03=已撤销<br>04=已暂停<br>05=审批拒绝<br>06=分发拒绝<br>07=指令录入<br>08=草稿指令<br>09=临时下达<br>10=临时修改  |
| 14003 | ReportSeat              | N    | 席位代码，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14006 | ReportSerialNo          | N    | 申报编号，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14007 | BusinessTime            | N    | 申报时间，返回委托数据时该字段为委托时间，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14058 | FailReason              | N    | 失败原因，指令状态数据才会返回。<br>保存可用不足和触发风控信息，整体结构如下：<br>1、可用不足：<br><FailReason Type="1"><br><Reasons><br><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons><br></FailReason><br>Reason 信息：组合编号 申报代码 交易市场 投资类型 可用不足提示说明<br>2、风控信息：<br><FailReason Type="2"><br><Reasons><br><Reason></Reason><br><Reason></Reason><br></Reasons></FailReason><br>Reason 信息：触警级别 触警操作 组合编号 证券编码 交易所 风控编号 风控类型 设置值 实际值 风控说明。<br>Type 属性值域 1=可用，2=风控。 |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.6 期权交易

## 6.4.6.1 期权买卖

## 6.4.6.1.1 个股指令下达

期权买卖个股指令下达（NewOrderSingle）的接口字段如表36所示。

表 36 期权买卖个股指令下达

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------|-----------------------|------|---|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=D（Order Single）指令下达   |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。  |
| 13000 | BusinClass            | Y    | 业务类别代码：01=场内；02=场外。<br>期权业务，场内场外业务标志。   |
| 13001 | BusinType             | Y    | 委托方向代码<br>V=买入开仓<br>W=卖出平仓<br>X=卖出开仓<br>Y=买入平仓  |
| 1     | Account               | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号。   |
| 55    | Symbol                | Y    | 期权合约代码  |
| 48    | SecurityID            | Y    | 证券代码  |
| 54    | Side                  | Y    | 买卖方向代码：1=买入；2=卖出。   |
| 207   | SecurityExchange      | N    | 交易场所代码。当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错误识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |

表 36 期权买卖个股指令下达（续）

| 标签               | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|------------------|-----------------------|------|---|
| 14000            | InvestType            | N    | 投资类型代码<br>1=可交易<br>不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为 1=可交易   |
| 44               | Price                 | Y    | 委托价格  |
| 40               | OrdType               | Y    | 委托类型代码，即基于价格的价格模式或订单类型<br>01=市价（表示不限制委托价格，在涨跌停范围内即可）<br>02=限价（表示限制委托价格，买入不高于，卖出不低于）<br>03=市价止损<br>04=市价止盈<br>05=限价止损<br>06=限价止盈 |
| 组件<OrderQtyData> |                       | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty          | N    | 订单金额<br>指令数量为 0 时必须填写，否则无需填写，还是按照数量控制。  |
| 38               | OrderQty              | Y    | 订单数量<br>交易所业务可以填 0，填 0 按照金额控制，否则按数量控制（指令金额取 Tag152 字段）。   |
| 组件结束             |                       |      |   |
| 59               | TimeInForce           | N    | 订单有效时间类型代码<br>0=当日有效<br>1=一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101=一定日期内有效<br>102=到时间前有效<br>缺省值为 0。                       |
| 60               | TransactTime          | Y    | 委托发生时间  |
| 916              | StartDate             | N    | 指令开始日期<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期。当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。                                     |
| 432              | Expiredate            | N    | 当 Tag59 为 6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。   |
| 15007            | JudgeAvailable        | Y    | 判断可用<br>0=不判；1=判。   |
| 15009            | JudgeRisk             | Y    | 判断风控<br>0=不判；1=判。   |
| 13301            | InstructionLevel      | Y    | 指令操作级别<br>0=无；1=快速；2=一般；3=慢速。   |
| 13106            | BonusType             | N    | 基金分红方式代码，分红模式只用于分红方式设置。<br>01=红利再投资<br>0101=利得现金增值再投资<br>0102=增值现金利得再投资<br>0103=部分再投资<br>02=现金分红<br>03=赠送                       |
| 13302            | DirectInsteadOperator | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人（tag50）  |

表 36 期权买卖个股指令下达（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明                          |
|-------|-------------------------|------|-----------------------------|
| 15997 | InstructionType         | N    | 指令类型代码<br>1=个股。不传时缺省为 1=个股。 |
| 58    | Text                    | N    | 备注说明，指令备注                   |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |                             |

## 6.4.6.1.2 批量下达

期权买卖批量下达（NewOrderList）的接口字段如表37所示。

表 37 期权买卖批量下达

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|-------|-----------------------|------|--|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=E（Order List）批量指令下达  |
| 66    | ListID                | Y    | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。  |
| 68    | TotNoOrders           | Y    | 订单总数，表示在同一 ListID 下所有消息中的订单总数，用以支持消息分割。  |
| 13302 | DirectInsteadOperator | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人。   |
| 15997 | InstructionType       | N    | 指令类型代码<br>1=个股<br>2=组合<br>3=个股批量<br>4=组合批量<br>个股：以多条个股形式下达<br>个股批量：同一个证券不同的组合<br>组合：重复组里同一个组合多个证券<br>组合批量：重复组里多个组合多个证券   |
| 73    | NoOrders              | Y    | 订单个数，下面为订单重复组内容。   |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。   |
| 67    | ListSeqNo             | Y    | 清单内订单序号  |
| 77    | PositionEffect        | N    | 衍生品交易开平仓标识<br>C=平仓；O=开仓。   |
| 203   | CoveredOrUncovered    | N    | 衍生品交易备兑标签  |
| 1     | Account               | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号。  |
| 55    | Symbol                | Y    | 期权合约代码   |
| 48    | SecurityID            | Y    | 证券代码   |
| 54    | Side                  | Y    | 买卖方向代码：<br>1=买入；2=卖出。  |
| 207   | SecurityExchange      | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所 |

表 37 期权买卖批量下达（续）

| 标签               | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|------------------|------------------|------|---|
| 207              | SecurityExchange | N    | 0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 14000            | InvestType       | N    | 投资类型代码<br>1=可交易。不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为 1=可交易。   |
| 44               | Price            | Y    | 委托价格  |
| 40               | OrdType          | Y    | 委托类型代码，即基于价格的价格模式或订单类型<br>01=市价（表示不限制委托价格，在涨跌停范围内即可）<br>02=限价（表示限制委托价格，买入不高于，卖出不低于）<br>03=市价止损<br>04=市价止盈<br>05=限价止损<br>06=限价止盈   |
| 组件<OrderQtyData> |                  | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty     | N    | 订单金额。指令数量为 0 时必须填写，否则无需填写，还是按照数量控制。   |
| 38               | OrderQty         | Y    | 订单数量<br>交易所业务可以填 0，填 0 按照金额控制，否则按数量控制（指令金额取 Tag152 字段）。   |
| 组件结束             |                  |      |   |
| 59               | TimeInForce      | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为 0。<br>0=当日有效<br>1=一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101=一定日期内有效<br>102=到时间前有效  |
| 60               | TransactTime     | Y    | 委托发生时间  |

表 37 期权买卖批量下达（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------|-------------------------|------|---|
| 916   | StartDate               | N    | 指令开始日期<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期。当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。               |
| 432   | Expiredate              | N    | 当 Tag59 为 6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。   |
| 15007 | JudgeAvailable          | Y    | 判断可用。0=不判；1=判。  |
| 15009 | JudgeRisk               | Y    | 判断风控。0=不判；1=判。  |
| 13301 | InstructionLevel        | Y    | 指令操作级别<br>0=无；1=快速；2=一般；3=慢速。   |
| 13106 | BonusType               | N    | 基金分红方式代码，分红模式只用于分红方式设置。<br>01=红利再投资<br>0101=利得现金增值再投资<br>0102=增值现金利得再投资<br>0103=部分再投资<br>02=现金分红<br>03=赠送 |
| 58    | Text                    | N    | 备注说明，指令备注。  |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.6.1.3 个股指令修改

期权买卖个股指令修改（OrderCancelReplaceRequest）的接口字段如表38所示。

表 38 期权买卖个股指令修改

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------|-----------------------|------|---|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=G（Order Cancel/Replace Request）指令修改   |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号，即第三方指令编号，全程唯一，已有指令结束归档后该编号可以再使用。0 表示不启用该字段。  |
| 41    | OrigOrdID             | Y    | 撤单编号，被修改指令的第三方指令编号。   |
| 66    | ListID                | N    | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。                             |
| 13000 | BusinClass            | Y    | 业务类别代码。01=场内；02=场外。<br>期权业务，场内场外业务标志。   |
| 13001 | BusinType             | Y    | 委托方向代码<br>V=买入开仓<br>W=卖出平仓<br>X=卖出开仓<br>Y=买入平仓  |
| 1     | Account               | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号。   |
| 55    | Symbol                | Y    | 期权合约代码  |
| 48    | SecurityID            | Y    | 证券代码  |
| 54    | Side                  | Y    | 买卖方向代码。1=买入；2=卖出。   |
| 207   | SecurityExchange      | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。 |

表 38 期权买卖个股指令修改（续）

| 标签               | 字段名称             | 是否必须 | 说明   |
|------------------|------------------|------|--|
| 207              | SecurityExchange | N    | 01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 14000            | InvestType       | N    | 投资类型代码：1=可交易。<br>不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为 1=可交易。   |
| 44               | Price            | Y    | 委托价格，这是可修改的指令要素。   |
| 40               | OrdType          | Y    | 委托类型代码，即基于价格的价格模式或订单类型；这是可修改的指令要素。<br>01=市价（表示不限制委托价格，在涨跌停范围内即可）<br>02=限价（表示限制委托价格，买入不高于，卖出不低于）<br>03=市价止损<br>04=市价止盈<br>05=限价止损<br>06=限价止盈<br>债转股业务上交所传入 2=限价，深交所传入 1=市价。   |
| 组件<OrderQtyData> |                  | Y    |  |
| 152              | CashOrderQty     | N    | 订单金额，这是可修改的指令要素。指令数量为 0 时必须填写，否则无需填写，还是按照数量控制。   |
| 38               | OrderQty         | Y    | 订单数量，这是可修改的指令要素。<br>交易所业务可以填 0，填 0 按照金额控制，否则按数量控制（指令金额取 Tag152 字段）。  |
| 组件结束             |                  |      |  |
| 59               | TimeInForce      | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为 0。<br>0=当日有效；1=一直有效，直到完成或撤销；<br>3=即时成交或取消；6=到指定日前有效；<br>101=一定日期内有效；102=到时间前有效。  |

表 38 期权买卖个股指令修改（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-------|-------------------------|------|--|
| 60    | TransactTime            | Y    | 委托发生时间，这是可修改的指令要素。   |
| 916   | StartDate               | N    | 指令开始日期，这是可修改的指令要素。<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期；当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。                                |
| 432   | Expiredate              | N    | 当 Tag59 为 6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。这是可修改的指令要素。   |
| 15007 | JudgeAvailable          | Y    | 判断可用，这是可修改的指令要素。<br>0=不判；1=判。  |
| 15009 | JudgeRisk               | Y    | 判断风控，这是可修改的指令要素。<br>0=不判；1=判。  |
| 13301 | InstructionLevel        | Y    | 指令操作级别，这是可修改的指令要素。<br>0=无；1=快速；2=一般；3=慢速   |
| 13106 | BonusType               | N    | 基金分红方式代码，分红模式只用于分红方式设置。<br>01=红利再投资<br>0101=利得现金增值再投资<br>0102=增值现金利得再投资<br>0103=部分再投资<br>02=现金分红<br>03=赠送                              |
| 13302 | DirectInsteadOperator   | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人（tag50）。  |
| 15997 | InstructionType         | N    | 指令类型代码<br>1=个股<br>2=组合<br>3=个股批量<br>4=组合批量<br>个股：以多条个股形式下达。<br>个股批量：同一个证券不同的组合。<br>组合：重复组里同一个组合多个证券。<br>组合批量：重复组里多个组合多个证券。<br>缺省 1=个股。 |
| 58    | Text                    | N    | 备注说明，指令备注。<br>这是可修改的指令要素。  |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

#### 6.4.6.2 期权备兑锁定解锁

##### 6.4.6.2.1 个股指令下达

期权备兑锁定解锁个股指令下达（NewOrderSingle）的接口字段如表39所示。

表 39 期权备兑锁定解锁个股指令下达

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                                       |
|-------|-----------------------|------|--|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=D（Order Single）指令下达              |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。                         |
| 13000 | BusinClass            | Y    | 业务类别代码<br>01=场内；02=场外。<br>期权业务，场内场外业务标志。 |
| 13001 | BusinType             | Y    | 委托方向代码<br>(=保证品交存<br>)=保证品提取             |



表 39 期权备兑锁定解锁个股指令下达（续）

| 标签             | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|----------------|------------------|------|---|
| 1              | Account          | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号。   |
| 组件<Instrument> |                  | Y    |   |
| 48             | SecurityID       | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）   |
| 组件结束           |                  |      |   |
| 55             | Symbol           | Y    | 期权合约代码  |
| 54             | Side             | N    | 买卖方向代码。<br>1=买入；<br>2=卖出。   |
| 207            | SecurityExchange | N    | 交易所所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 14000          | InvestType       | N    | 投资类型代码<br>1=可交易<br>不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为 1=可交易   |

表 39 期权备兑锁定解锁个股指令下达（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-------|-------------------------|------|--|
|       | 组件<OrderQtyData>        | Y    |  |
| 152   | CashOrderQty            | N    | 订单金额   |
| 38    | OrderQty                | Y    | 订单数量   |
|       | 组件结束                    |      |  |
| 59    | TimeInForce             | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为 0。<br>0=当日有效<br>1= 一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101= 一定日期内有效<br>102=到时间前有效 |
| 60    | TransactTime            | Y    | 委托发生时间   |
| 916   | StartDate               | N    | 指令开始日期<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期。当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。              |
| 432   | Expiredate              | N    | 当 Tag59=6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。  |
| 15007 | JudgeAvailable          | Y    | 判断可用<br>0=不判<br>1=判  |
| 15009 | JudgeRisk               | Y    | 判断风控<br>0=不判<br>1=判  |
| 13301 | InstructionLevel        | Y    | 指令操作级别<br>0=无；1=快速去；2=一般；3=慢速。   |
| 13302 | DirectInsteadOperator   | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人（tag50）。  |
| 15997 | InstructionType         | N    | 指令类型代码<br>1=个股<br>不传时缺省为 1=个股  |
| 58    | Text                    | N    | 备注说明，指令备注  |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.6.2.2 批量下达

期权备兑锁定解锁批量下达（NewOrderList）的接口字段如表40所示。

表 40 期权备兑锁定解锁批量下达

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|-------|-----------------------|------|--|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=E（Order List）批量指令下达  |
| 66    | ListID                | Y    | 申报编号<br>第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。 |
| 68    | TotNoOrders           | Y    | 订单总数<br>表示在同一 ListID 下所有消息中的订单总数，用以支持消息分割。                           |
| 13302 | DirectInsteadOperator | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人（tag50）。                                |

表 40 期权备兑锁定解锁批量下达（续）

| 标签    | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|-------|------------------|------|---|
| 15997 | InstructionType  | N    | 指令类型代码<br>1=个股；2=组合；3=个股批量；4=组合批量。<br>个股：以多条个股形式下达。<br>个股批量：同一个证券不同的组合。<br>组合：重复组里同一个组合多个证券。<br>组合批量：重复组里多个组合多个证券。  |
| 73    | NoOrders         | Y    | 订单个数，下面为订单重复组内容。  |
| 11    | ClOrdID          | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。  |
| 67    | ListSeqNo        | Y    | 清单内订单序号   |
| 13000 | BusinClass       | Y    | 业务类别代码：01=场内；02=场外。<br>期权业务，场内场外业务标志。   |
| 13001 | BusinType        | Y    | 委托方向代码<br>(=保证品交存<br>)=保证品提取  |
| 1     | Account          | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号。   |
| 55    | Symbol           | Y    | 期权合约代码  |
| 48    | SecurityID       | Y    | 证券代码  |
| 54    | Side             | Y    | 买卖方向代码：<br>1=买入；2=卖出。   |
| 207   | SecurityExchange | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |

表 40 期权备兑锁定解锁批量下达（续）

| 标签               | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|------------------|-------------------------|------|---|
| 14000            | InvestType              | N    | 投资类型代码：1=可交易。<br>不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为1=可交易。   |
| 组件<OrderQtyData> |                         | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty            | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty                | Y    | 订单数量  |
| 组件结束             |                         |      |   |
| 59               | TimeInForce             | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为0。<br>0=当日有效<br>1=一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101=一定日期内有效<br>102=到时间前有效 |
| 60               | TransactTime            | Y    | 委托发生时间  |
| 916              | StartDate               | N    | 指令开始日期<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期。当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。           |
| 432              | Expiredate              | N    | 当 Tag59 为 6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。   |
| 15007            | JudgeAvailable          | Y    | 判断可用：0=不判；1=判。  |
| 15009            | JudgeRisk               | Y    | 判断风控：0=不判；1=判。  |
| 13301            | InstructionLevel        | Y    | 指令操作级别：0=无；1=快速；2=一般；3=慢速。  |
| 58               | Text                    | N    | 备注说明，指令备注。  |
|                  | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.6.2.3 个股指令修改

期权备兑锁定解锁个股指令修改（OrderCancelReplaceRequest）的接口字段如表41所示。

表 41 期权备兑锁定解锁个股指令修改

| 标签             | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|----------------|-----------------------|------|---|
|                | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=G（Order Cancel/Replace Request）指令修改                       |
| 11             | ClOrdID               | Y    | 申请编号，即第三方指令编号，全程唯一，已有指令结束归档后该编号可以再使用。0 表示不启用该字段。                  |
| 41             | OrigOrdID             | Y    | 撤单编号，被修改指令的第三方指令编号。   |
| 66             | ListID                | N    | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。 |
| 13000          | BusinClass            | Y    | 业务类别代码：01=场内；02=场外。   |
| 13001          | BusinType             | Y    | 委托方向代码<br>(=保证品交存<br>)=保证品提取                                      |
| 1              | Account               | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号。   |
| 组件<Instrument> |                       | Y    |   |

表 41 期权备兑锁定解锁个股指令修改（续）

| 标签               | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|------------------|------------------|------|---|
| 48               | SecurityID       | Y    | 证券代码  |
| 22               | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）   |
| 组件结束             |                  |      |   |
| 55               | Symbol           | Y    | 期权合约代码  |
| 54               | Side             | N    | 买卖方向代码：1=买入；2=卖出。   |
| 207              | SecurityExchange | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 14000            | InvestType       | N    | 投资类型代码：1=可交易。<br>不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为 1=可交易。  |
| 组件<OrderQtyData> |                  |      |   |
| 152              | CashOrderQty     | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty         | Y    | 订单数量，这是可修改的指令要素。  |
| 组件结束             |                  |      |   |

表 41 期权备兑锁定解锁个股指令修改（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------|-------------------------|------|---|
| 59    | TimeInForce             | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为 0。<br>0=当日有效<br>1=一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101=一定日期内有效<br>102=到时间前有效                                |
| 60    | TransactTime            | Y    | 委托发生时间，这是可修改的指令要素。  |
| 916   | StartDate               | N    | 指令开始日期，这是可修改的指令要素。<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期；<br>当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。                           |
| 432   | Expiredate              | N    | 当 Tag59 为 6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。这是可修改的指令要素。  |
| 15007 | JudgeAvailable          | Y    | 判断可用，这是可修改的指令要素。0=不判；1=判。   |
| 15009 | JudgeRisk               | Y    | 判断风控，这是可修改的指令要素。0=不判；1=判。   |
| 13301 | InstructionLevel        | Y    | 指令操作级别，这是可修改的指令要素。<br>0=无<br>1=快速<br>2=一般<br>3=慢速   |
| 13302 | DirectInsteadOperator   | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人（tag50）  |
| 15997 | InstructionType         | N    | 指令类型代码<br>1=个股<br>2=组合<br>3=个股批量<br>4=组合批量<br>个股：以多条个股形式下达。<br>个股批量：同一个证券不同的组合。<br>组合：重复组里同一个组合多个证券。<br>组合批量：重复组里多个组合多个证券。<br>缺省 1=个股 |
| 58    | Text                    | N    | 备注说明，指令备注。<br>这是可修改的指令要素。   |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

### 6.4.6.3 期权行权

#### 6.4.6.3.1 个股指令下达

期权行权个股指令下达（NewOrderSingle）的接口字段如表42所示。

表 42 期权行权个股指令下达

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                                    |
|-------|-----------------------|------|---------------------------------------|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=D（Order Single）指令下达           |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。                      |
| 13000 | BusinClass            | Y    | 业务类别代码：01=场内；02=场外。<br>期权业务，场内场外业务标志。 |

表 42 期权行权个股指令下达（续）

| 标签             | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|----------------|------------------|------|---|
| 13001          | BusinType        | Y    | 委托方向代码<br>R=行权认购<br>S=行权认沽  |
| 1              | Account          | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号。   |
| 组件<Instrument> |                  | Y    |   |
| 48             | SecurityID       | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）   |
| 组件结束           |                  |      |   |
| 55             | Symbol           | Y    | 期权合约代码  |
| 54             | Side             | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出  |
| 207            | SecurityExchange | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |

表 42 期权行权个股指令下达（续）

| 标签               | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|------------------|-------------------------|------|--|
| 14000            | InvestType              | N    | 投资类型代码<br>1=可交易。不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为 1=可交易。  |
| 组件<OrderQtyData> |                         | Y    |  |
| 152              | CashOrderQty            | N    | 订单金额   |
| 38               | OrderQty                | Y    | 订单数量   |
| 组件结束             |                         |      |  |
| 59               | TimeInForce             | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为 0。<br>0=当日有效<br>1=一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101=一定日期内有效<br>102=到时间前有效                                 |
| 60               | TransactTime            | Y    | 委托发生时间   |
| 916              | StartDate               | N    | 指令开始日期<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期。当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。  |
| 432              | Expiredate              | N    | 当 Tag59=6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。  |
| 15007            | JudgeAvailable          | Y    | 判断可用。0=不判；1=判。   |
| 15009            | JudgeRisk               | Y    | 判断风控。0=不判；1=判。   |
| 13301            | InstructionLevel        | Y    | 指令操作级别<br>0=无；1=快速；2=一般；3=慢速。  |
| 13302            | DirectInsteadOperator   | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人（tag50）。  |
| 15997            | InstructionType         | N    | 指令类型代码<br>1=个股<br>2=组合<br>3=个股批量<br>4=组合批量<br>个股：以多条个股形式下达。<br>个股批量：同一个证券不同的组合。<br>组合：重复组里同一个组合多个证券。<br>组合批量：重复组里多个组合多个证券。<br>缺省 1=个股。 |
| 58               | Text                    | N    | 备注说明，指令备注。   |
|                  | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

## 6.4.6.3.2 批量下达

期权行权批量下达（NewOrderList）的接口字段如表43所示。

表 43 期权行权批量下达

| 标签 | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|----|-----------------------|------|---|
|    | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=E（Order List）批量指令下达                           |
| 66 | ListID                | Y    | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令。 |



表 43 期权行权批量下达（续）

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------|-----------------------|------|---|
| 66    | ListID                | Y    | ListID 必须要传。  |
| 68    | TotNoOrders           | Y    | 订单总数，表示在同一 ListID 下所有消息中的订单总数，用以支持消息分割。   |
| 13302 | DirectInsteadOperator | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人（tag50）。   |
| 15997 | InstructionType       | N    | 指令类型代码<br>1=个股<br>2=组合<br>3=个股批量<br>4=组合批量<br>个股：以多条个股形式下达。<br>个股批量：同一个证券不同的组合。<br>组合：重复组里同一个组合多个证券。<br>组合批量：重复组里多个组合多个证券。  |
| 73    | NoOrders              | Y    | 订单个数，下面为订单重复组内容。  |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段  |
| 67    | ListSeqNo             | Y    | 清单内订单序号   |
| 13000 | BusinClass            | Y    | 业务类别代码：<br>01=场内<br>02=场外   |
| 13001 | BusinType             | Y    | 委托方向代码<br>R=行权认购<br>S=行权认沽  |
| 1     | Account               | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号  |
| 55    | Symbol                | Y    | 期权合约代码  |
| 48    | SecurityID            | Y    | 证券代码  |
| 54    | Side                  | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出  |
| 207   | SecurityExchange      | N    | 交易所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错误识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台 |

表 43 期权行权批量下达（续）

| 标签               | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|------------------|-------------------------|------|--|
| 207              | SecurityExchange        | N    | 0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 14000            | InvestType              | N    | 投资类型代码<br>1=可交易<br>不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为 1=可交易。   |
| 组件<OrderQtyData> |                         | Y    |  |
| 152              | CashOrderQty            | N    | 订单金额   |
| 38               | OrderQty                | Y    | 订单数量   |
| 组件结束             |                         |      |  |
| 59               | TimeInForce             | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为 0。<br>0=当日有效<br>1=一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101=一定日期内有效<br>102=到时间前有效   |
| 60               | TransactTime            | Y    | 委托发生时间   |
| 916              | StartDate               | N    | 指令开始日期<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期。当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。  |
| 432              | Expiredate              | N    | 当 Tag59 为 6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。  |
| 15007            | JudgeAvailable          | Y    | 判断可用 0=不判；1=判。   |
| 15009            | JudgeRisk               | Y    | 判断风控 0=不判；1=判。   |
| 13301            | InstructionLevel        | Y    | 指令操作级别 0=无；1=快速；2=一般；3=慢速。   |
| 58               | Text                    | N    | 备注说明，指令备注。   |
|                  | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

#### 6.4.6.3.3 个股指令修改

期权行权个股指令修改（OrderCancelReplaceRequest）的接口字段如表44所示。

表 44 期权行权个股指令修改

| 标签 | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|----|-----------------------|------|--|
|    | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=G（Order Cancel/Replace Request）指令修改      |
| 11 | ClOrdID               | Y    | 申请编号，即第三方指令编号，全程唯一，已有指令结束归档后该编号可以再使用。0 表示不启用该字段。 |

表 44 期权行权个股指令修改（续）

| 标签             | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|----------------|------------------|------|---|
| 41             | OrigOrdID        | Y    | 撤单编号，被修改指令的第三方指令编号。   |
| 66             | ListID           | N    | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。   |
| 13000          | BusinClass       | Y    | 业务类别代码：01=场内；02=场外。<br>期权业务，场内场外业务标志。   |
| 13001          | BusinType        | Y    | 委托方向代码：R=行权认购；S=行权认沽。   |
| 1              | Account          | Y    | 账户编码，投资系统的组合编号。   |
| 组件<Instrument> |                  | Y    |   |
| 48             | SecurityID       | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）   |
| 组件结束           |                  |      |   |
| 55             | Symbol           | Y    | 期权合约代码  |
| 54             | Side             | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出  |
| 207            | SecurityExchange | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所 |

表 44 期权行权个股指令修改（续）

| 标签               | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|------------------|-------------------------|------|--|
| 207              | SecurityExchange        | N    | 0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内）   |
| 14000            | InvestType              | N    | 投资类型代码<br>1=可交易<br>不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为1=可交易。  |
| 组件<OrderQtyData> |                         | Y    |  |
| 152              | CashOrderQty            | N    | 订单金额   |
| 38               | OrderQty                | Y    | 订单数量，这是可修改的指令要素。   |
| 组件结束             |                         |      |  |
| 59               | TimeInForce             | N    | 订单有效时间类型代码，缺省值为0。<br>这是可修改的指令要素。<br>0=当日有效<br>1=一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101=一定日期内有效<br>102=到时间前有效                       |
| 60               | TransactTime            | Y    | 委托发生时间，这是可修改的指令要素。   |
| 916              | StartDate               | N    | 指令开始日期，这是可修改的指令要素。<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期；<br>当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。                                |
| 432              | Expiredate              | N    | 当 Tag59 为 6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。这是可修改的指令要素。   |
| 15007            | JudgeAvailable          | Y    | 判断可用：0=不判；1=判。这是可修改的指令要素。  |
| 15009            | JudgeRisk               | Y    | 判断风控：0=不判；1=判。这是可修改的指令要素。  |
| 13301            | InstructionLevel        | Y    | 指令操作级别，这是可修改的指令要素。<br>0=无；1=快速；2=一般；3=慢速。  |
| 13302            | DirectInsteadOperator   | N    | 代下达人编号<br>该字段允许为空、为空时取的是指令下达人（tag50）。  |
| 15997            | InstructionType         | N    | 指令类型代码<br>1=个股<br>2=组合<br>3=个股批量<br>4=组合批量<br>个股：以多条个股形式下达。<br>个股批量：同一个证券不同的组合。<br>组合：重复组里同一个组合多个证券。<br>组合批量：<br>重复组里多个组合多个证券。<br>缺省 1=个股。 |
| 58               | Text                    | N    | 备注说明，指令备注。<br>这是可修改的指令要素。  |
|                  | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

#### 6.4.6.4 多腿期权订单

多腿期权订单（New Order-Multileg）的接口字段如表45所示。

表 45 多腿期权订单

| 标签               | 字段名称                   | 是否必须 | 说明   |
|------------------|------------------------|------|--|
|                  | 消息头部 (Standard Header) | Y    | MsgType=AB   |
| 1180             | ApplID                 | Y    | 应用标识<br>161=期权行权指令合并申报<br>340=期权组合策略保证金构建组合申报<br>341=期权组合策略保证金解除组合申报                                       |
| 11               | ClOrdID                | Y    | 客户订单编号   |
| 40               | OrdType                | Y    | 订单类型<br>2=限价   |
| 54               | Side                   | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入   |
| 522              | OwnerType              | Y    | 订单所有者类型  |
| 529              | OrderRestrictions      | N    | 订单限定   |
| 60               | TransactTime           | N    | 订单发起时间   |
| 组件<Instrument>   |                        | Y    |  |
| 48               | SecurityID             | Y    | 证券代码   |
| 22               | SecurityIDSource       | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN (ISIN 组织)<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>(200+自行内部使用) |
| 组件结束             |                        |      |  |
| 组件<Parties>      |                        | Y    |  |
| 453              | NoPartyIDs             | Y    | 参与者代码个数  |
| 448              | PartyID                | Y    | 参与者代码  |
| 447              | PartyIDSource          | Y    | 参与者代码源   |
| 452              | PartyRole              | Y    | 参与者代码角色  |
| 组件结束             |                        |      |  |
| 组件<OrderQtyData> |                        | Y    |  |
| 152              | CashOrderQty           | N    | 订单金额   |
| 38               | OrderQty               | Y    | 订单数量   |
| 组件结束             |                        |      |  |
| 组件<Legs>         |                        | N    |  |
| 555              | NoLegs                 | Y    | 成份合约个数   |
|                  | 组件<InstrumentLeg>      | Y    |  |
| 602              | LegSecurityID          | Y    | 成份合约代码   |
| 603              | LegSecurityIDSource    | Y    | 成份合约代码源  |
| 624              | LegSide                | N    | 成份合约方向   |
| 组件结束             |                        |      |  |
| 685              | LegOrderQty            | N    | 成份合约数量   |
| 组件结束             |                        |      |  |

表 45 多腿期权订单（续）

| 标签  | 字段名称                    | 是否必须 | 说明                    |
|-----|-------------------------|------|-----------------------|
| 198 | SecondaryOrderID        | N    | 第二交易所订单编号             |
| 167 | SecurityType            | N    | 证券类别                  |
| 762 | SecuritySubType         | N    | 证券子类别<br>填写组合策略编码     |
| 44  | Price                   | N    | 价格<br>OrdType 为 2 时填写 |
| 99  | StopPx                  | N    | 止损价，预留。               |
| 59  | TimeInForce             | N    | 有效时期类型<br>缺省值为 0      |
| 58  | Text                    | N    | 备注                    |
|     | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |                       |

#### 6.4.7 相关查询接口

##### 6.4.7.1 委托状态查询

###### 6.4.7.1.1 委托状态查询请求

委托状态查询请求的接口字段如表46所示。

表 46 委托状态查询请求

| 标签             | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|----------------|-------------------------|------|---|
|                | 消息头部（Standard Header）   | Y    | MsgType=H   |
| 11             | ClOrdID                 | Y    | 申请编号，表示要查询的委托请求标识符。<br>0 表示不启用该字段。  |
| 66             | ListID                  | N    | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。<br>修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。                                     |
| 54             | Side                    | N    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出  |
| 组件<Instrument> |                         | N    |   |
| 48             | SecurityID              | N    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource        | N    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用） |
| 组件结束           |                         |      |   |
| 55             | Symbol                  | N    | 证券名称  |
|                | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

###### 6.4.7.1.2 委托状态查询应答

委托状态查询应答的接口字段如表47所示。

表 47 委托状态查询应答

| 标签             | 字段名称                   | 是否必须 | 说明   |
|----------------|------------------------|------|--|
|                | 消息头部 (Standard Header) | Y    | MsgType=8  |
| 6              | AvgPx                  | Y    | 成交均价   |
| 14             | CumQty                 | Y    | 累计成交数量   |
| 17             | ExecID                 | Y    | 成交编号, 执行结果唯一标识符。   |
| 20             | ExecTransType          | Y    | 应答发送类别, 只为 3。  |
| 37             | OrderID                | Y    | 应答唯一标识符, 订单编号。返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的, 其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。  |
| 150            | ExecType               | Y    | 执行类型代码:<br>0=已下达未成交 (New) 表示请求接受<br>1=部分成交 (Partial fill)<br>2=全部成交 (Fill)<br>4=已撤销 (Canceled)<br>5=已修改 (Replace)<br>6=接收到撤销的指令 (Pending Cancel)<br>7=停止<br>8=拒绝 (Reject) 表示请求失败<br>A=接收到下达的指令 (Pending New)<br>E=接收到修改的指令 (Pending Replace)<br>F=交易已成交 (部分或全部) Trade (partial fill or fill)<br>H=交易撤销<br>101=应急 |
| 151            | LeavesQty              | Y    | 未成交股数  |
| 31             | LastPx                 | N    | 本次成交均价   |
| 32             | LastQty                | N    | 本次成交数量   |
| 66             | ListID                 | N    | 申报编号<br>第三方系统传过来的新订单的清单编号, 当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。  |
| 73             | NoOrders               | Y    | 订单个数   |
| 11             | ClOrdID                | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段   |
| 67             | ListSeqNo              | Y    | 清单内订单序号  |
| 1              | Account                | Y    | 账户编码, 投资系统的组合编号。   |
| 组件<Instrument> |                        | Y    |  |
| 48             | SecurityID             | Y    | 证券代码   |
| 22             | SecurityIDSource       | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN (ISIN 组织)<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>(200+自行内部使用)   |
| 组件结束           |                        |      |  |

表 47 委托状态查询应答（续）

| 标签               | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|------------------|-------------------------|------|---|
| 组件<OrderQtyData> |                         | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty            | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty                | Y    | 订单数量  |
| 组件结束             |                         |      |   |
| 39               | OrdStatus               | Y    | 指令状态代码，订单状态代码：对于指令下达拒绝的时候填 03。<br>01=有效指令<br>02=已修改<br>03=已撤销<br>04=已暂停<br>05=审批拒绝<br>06=分发拒绝<br>07=指令录入<br>08=草稿指令<br>09=临时下达<br>10=临时修改 |
| 60               | TransactTime            | Y    | 委托发生时间  |
| 58               | Text                    | N    | 备注说明  |
|                  | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.2 资金股份查询

## 6.4.7.2.1 资金股份查询请求（UAN）

资金股份查询请求的接口字段如表48所示。

表 48 资金股份查询请求

| 标签          | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------------|-------------------------|------|---|
|             | 消息头部（Standard Header）   | Y    | MsgType=UAN   |
| 组件<Request> |                         | Y    |   |
| 710         | PosReqID                | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识请求唯一标识符  |
| 724         | PosReqType              | Y    | 请求类别<br>0=查询股份<br>9=查询资金  |
| 组件结束        |                         |      |   |
| 15          | Currency                | N    | 币种代码，交易货币，默认是人民币。<br>CNY=人民币，USD=美元，HKD=港币。<br>应符合 GB/T 12406—2008 的要求。 |
|             | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.2.2 资金股份查询应答（UAP）

资金股份查询应答的接口字段如表49所示。

表 49 资金股份查询应答

| 标签 | 字段名称                  | 是否必须 | 说明          |
|----|-----------------------|------|-------------|
|    | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=UAP |



表 49 资金股份查询回报（续）

| 标签          | 字段名称               | 是否必须        | 说明                                   |  |
|-------------|--------------------|-------------|--------------------------------------|--|
| 组件<Request> |                    | Y           |                                      |  |
| 710         | PosReqID           | Y           | 请求唯一标识符，用于标识请求唯一标识符。                 |  |
| 724         | PosReqType         | Y           | 请求类别。0=查询股份，9=查询资金。                  |  |
| 组件结束        |                    |             |                                      |  |
| 组件<Report>  |                    | Y           |                                      |  |
| 721         | PosMaintRptID      | Y           | 响应消息唯一标识符，用于标识本响应消息唯一标识符。            |  |
| 727         | TotalNumPosReports | Y           | 返回报告条数                               |  |
| 728         | PosReqResult       | Y           | 报告返回代码。0=成功，其他=失败。                   |  |
| 组件结束        |                    |             |                                      |  |
| 912         | LastRptRequested   | Y           | 后续结果<br>N=还有后续报告<br>Y=本报告为最后一条       |  |
| 58          | Text               | N           | 备注说明<br>只有 728 PosReqResult 不为 0 时返回 |  |
| Group702    |                    | NoPositions | N                                    | 条目数量   |
|             | 703                | PosType     | N                                    | 数量类型代码，类型说明。<br>当 724=0 时<br>SB=股份余额<br>SAV=股份可用余额<br>SQ=当前持股数<br>LB=昨日余额<br>SCT=股份可转<br>SR=余券数量<br>RB=持仓数量（含余券）<br>SD=可申赎数量<br>SUF=股份解冻<br>SF=股份冻结  |
|             | 704                | LongQty     | N                                    | 多仓数量，表示多仓数量（当 703=SB、SAV、SQ、LB、SCT、SR、RB、SD、SUF 时）。  |
|             | 705                | ShortQty    | N                                    | 空仓数量   |
| Group753    |                    | NoPosAmt    | N                                    | 金额数目，偿还金额组合的数目。<br>当 PosTransType = 200 时必送。   |
|             | 708                | PosAmt      | N                                    | 金额   |
|             | 707                | PosAmtType  | N                                    | 金额类型代码<br>当 724=9 时：<br>FB=资金余额<br>FAV=资金可用余额<br>MV=资产总值<br>F=资金资产<br>SV=市值<br>DSB=融券卖出资金余额<br>当 724=0 时：<br>BC=当前成本<br>SMV=个股市值<br>IC=盈亏<br>PC=浮动盈亏<br>LP=最新价格<br>PI=累计盈亏<br>TPC=总盈亏<br>CP=昨日收盘 |

表 49 资金股份查询回报（续）

| 标签             | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|----------------|-------------------------|------|---|
| 15             | Currency                | N    | 币种代码，交易货币，默认是人民币。<br>CNY=人民币；USD=美元；HKD=港币。<br>币种代码应符合 GB/T 12406—2008 的要求。   |
| 55             | Symbol                  | N    | 证券名称  |
| 207            | SecurityExchange        | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 组件<Instrument> |                         | Y    |   |
| 48             | SecurityID              | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource        | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）   |
| 组件结束           |                         |      |   |
| 1              | Account                 | N    | 账户编码，股东账户。<br>724=0 时必送   |
|                | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.3 资金流水查询

## 6.4.7.3.1 资金流水查询请求（UAN）

资金流水查询请求的接口字段如表50所示。

表 50 资金流水查询请求

| 标签          | 字段名称                    | 是否必须 | 说明                        |
|-------------|-------------------------|------|---------------------------|
|             | 消息头部（Standard Header）   | Y    | MsgType=UAN               |
| 1           | Account                 | N    | 账户编码<br>此消息中代表指明的资金账户     |
| 581         | AccountType             | N    | 账户类别代码<br>300 资金账户        |
| 组件<Request> |                         | Y    |                           |
| 710         | PosReqID                | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识此数据包的数字或字符 |
| 724         | PosReqType              | Y    | 请求类别<br>103 表示查询资金流水      |
| 组件结束        |                         |      |                           |
| 916         | StartDate               | N    | 指令开始日期<br>不送的话，该字段值默认为今日。 |
| 917         | EndDate                 | N    | 指令结束日期<br>不送的话，该字段值默认为今日。 |
|             | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |                           |

## 6.4.7.3.2 资金流水查询应答（UAP）

资金流水查询应答的接口字段如表51所示。

表 51 资金流水查询应答

| 标签          | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                             |
|-------------|-----------------------|------|--------------------------------|
|             | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=UAP                    |
| 组件<Request> |                       | Y    |                                |
| 710         | PosReqID              | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识请求唯一标识符         |
| 724         | PosReqType            | Y    | 请求类别。103 表示查询资金流水。             |
| 组件结束        |                       |      |                                |
| 组件<Report>  |                       | Y    |                                |
| 721         | PosMaintRptID         | Y    | 响应消息唯一标识符<br>用于标识本响应消息唯一标识符    |
| 727         | TotalNumPosReports    | Y    | 返回报告条数                         |
| 728         | PosReqResult          | Y    | 报告返回代码<br>0=成功<br>99=失败        |
| 组件结束        |                       |      |                                |
| 912         | LastRptRequested      | Y    | 后续结果<br>N=还有后续报告<br>Y=本报告为最后一条 |
| 715         | ClearingBusinessDate  | N    | 清算日期                           |
| 743         | DeliveryDate          | N    | 交收日期                           |

表 51 资金流水查询应答（续）

| 标签        | 字段名称             | 是否必须    | 说明  |  |
|-----------|------------------|---------|---|--|
| 15        | Currency         | N       | 币种代码，交易货币，默认是人民币。<br>CNY=人民币<br>USD=美元<br>HKD=港币<br>应符合 GB/T 12406—2008 的要求。  |  |
| 207       | SecurityExchange | N       | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |  |
| 37        | OrderID          | N       | 订单编号。返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。   |  |
| 14        | CumQty           | N       | 成交数量  |  |
| 6         | AvgPx            | N       | 成交均价  |  |
| Group702  | NoPositions      | N       | 条目数量  |  |
|           | 703              | PosType | N   | 数量类型代码，类型说明。<br>当 724=10 时：<br>SB=股份本次余额<br>SE=股份发生数 |
|           | 704              | LongQty | N   | 数量   |
| Group 753 | NoPosAmt         | N       | 金额数目，偿还金额组合的数目。<br>当 PosTransType = 200 时必送。  |  |

表 51 资金流水查询应答（续）

| 标签             | 字段名称                | 是否必须 | 说明   |
|----------------|---------------------|------|--|
| 707            | PosAmtType          | N    | 金额类型代码<br>当 724=10 时：<br>FE=资金发生数<br>FB=资金本次余额<br>MA=成交金额<br>FJX=净佣金<br>FSX=佣金<br>FYH=印花税<br>FGH=过户费<br>FQS=清算费<br>FJY=交易规费<br>FJS=经手费<br>FZG=证管费<br>FQT=其他费<br>FFR=前台费用 |
| 708            | PosAmt              | N    | 金额   |
| Group          | NoEvents            | N    |  |
| 865            | EventType           | N    | 业务代码   |
| 868            | EventText           | N    | 业务说明   |
| 1145           | EventTime           | N    | 业务发生时间   |
| Group22000     | NoUAccount          | N    | 扩展账号   |
| 1              | Account             | N    | 账户编码<br>资金账户   |
| 581            | AccountType         | N    | 账户类别代码<br>300=资金账户   |
| 组件<Instrument> |                     | Y    |  |
| 48             | SecurityID          | Y    | 证券代码   |
| 22             | SecurityIDSource    | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）  |
| 组件结束           |                     |      |  |
| 55             | Symbol              | N    | 证券名称   |
| 54             | Side                | N    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出   |
| 373            | SessionRejectReason | N    | 会话拒绝原因编号<br>0=存在无效的域号<br>1=该消息中必须的域丢失<br>2=该消息中出现未曾定义的域<br>3=未定义域号<br>4=域未赋值<br>5=域取值错误（范围溢出）<br>6=取值格式错误<br>7=解密错误<br>8=签名错误<br>9=公司标识符错误                               |

表 51 资金流水查询应答（续）

| 标签  | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-----|-------------------------|------|---|
| 373 | SessionRejectReason     | N    | 10=发送时间精度错误<br>11=无效的消息类型<br>12=XML 验证错误<br>13=同一个域多次出现（非重组）<br>14=有序的域出现次序错误<br>15=重组域次序错误<br>16=重组重复次数错误<br>17=非 data 数据域中出现域界定符<SOH><br>当 728 不为 0 时返回 |
| 58  | Text                    | N    | 备注说明  |
|     | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.4 信用资产负债查询

## 6.4.7.4.1 信用资产负债查询请求（UAN）

信用资产负债查询请求的接口字段如表52所示。

表 52 信用资产负债查询请求

| 标签          | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------------|-------------------------|------|---|
|             | 消息头部（Standard Header）   | Y    | MsgType=UAN   |
| 组件<Request> |                         | Y    |   |
| 710         | PosReqID                | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识此数据包的数字或字符   |
| 724         | PosReqType              | Y    | 请求类别<br>104=查信用资产负债   |
| 组件结束        |                         |      |   |
| 15          | Currency                | Y    | 币种代码，交易货币。<br>CNY=人民币（默认是人民币）<br>USD=美元<br>HKD=港币<br>币种代码应符合 GB/T 12406—2008 的要求。 |
| 1           | Account                 | N    | 账户编码，资金账户<br>T=登录必送   |
| 581         | AccountType             | N    | 账户类别代码<br>300=资金账户<br>301=股东账户（拒绝）<br>T=登录必送                                      |
|             | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.4.2 信用资产负债查询应答（UAP）

信用资产负债查询应答的接口字段如表53所示。

表 53 信用资产负债查询应答

| 标签         | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                          |
|------------|-----------------------|------|-----------------------------|
|            | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=UAP                 |
| 组件<Report> |                       | Y    |                             |
| 721        | PosMaintRptID         | Y    | 响应消息唯一标识符<br>用于标识本响应消息唯一标识符 |

表 53 信用资产负债查询应答（续）

| 标签          | 字段名称               | 是否必须        | 说明   |   |
|-------------|--------------------|-------------|--|---|
| 727         | TotalNumPosReports | Y           | 返回报告条数   |   |
| 728         | PosReqResult       | Y           | 报告返回代码<br>0=成功<br>99=失败  |   |
| 组件结束        |                    |             |  |   |
| 组件<Request> |                    | Y           |  |   |
| 710         | PosReqID           | Y           | 请求唯一标识符<br>用于标识请求唯一标识符   |   |
| 724         | PosReqType         | Y           | 请求类别<br>104=查信用资产负债  |   |
| 组件结束        |                    |             |  |   |
| 912         | LastRptRequested   | Y           | 后续结果<br>N=还有后续报告<br>Y=本报告为最后一条报告   |   |
| 15          | Currency           | Y           | 币种代码，交易货币，默认是人民币。<br>CNY=人民币<br>USD=美元<br>HKD=港币<br>币种代码应符合 GB/T 12406—2008 的要求。 |   |
| Group702    |                    | NoPositions | N  | 条目数量  |
|             | 703                | PosType     | N  | 数量类型代码，类型说明。<br>当 724=104 时：<br>DTD=融券负债合计<br>DCB=授信额度<br>DCA=授信可用额度<br>FCA=融资可用额度  |
|             | 704                | LongQty     | N  | 数量  |
| Group753    |                    | NoPosAmt    | N  | 金额数目，偿还金额组合的数目<br>当 PosTransType = 200 时必送  |
|             | 707                | PosAmtType  | N  | 建议信用资产负债查询接口中金额类型 PosAmtType 要扩充保证金可用余额（或者将该字段放到新接口）<br>金额类型代码<br>当 724=104 时<br>AS=总资产<br>LA=总负债<br>FB=资金余额<br>FA=资金可用数<br>FAF=资金可用冻结数<br>DSAB=融券卖出资金余额<br>DSAF=融券卖出资金冻结数<br>GMA=担保证券市值<br>RM=修正资产<br>FDA=应付融资款<br>FF=融资利息<br>FPF=融资承诺费<br>FMF=融资管理费<br>FDDF=融资逾期利息<br>FPIF=融资罚息<br>FPID=融资逾期本金付息<br>FMOD=融资逾期管理费<br>FMPI=融资逾期管理费罚息<br>FFEE=融资息费合计 |

表 53 信用资产负债查询应答（续）

| 标签  | 字段名称                    | 是否必须 | 说明   |
|-----|-------------------------|------|--|
| 707 | PosAmtType              | N    | FTD=融资负债合计<br>DFT=应付融券市值<br>SF=融券息费<br>SPF=融券承诺费<br>SMF=融券管理费<br>SODF=融券逾期费用<br>SPIF=融券罚息<br>ODR=融券权益逾期费用<br>PR=融券权益罚息<br>SPI=融券逾期本金罚息<br>SMOD=融券逾期管理费<br>SMPI=融券逾期管理费罚息<br>DFEE=融券息费合计<br>FD=可取资产<br>FIA=补仓金额<br>TPC=总盈亏  |
| 708 | PosAmt                  | N    | 金额   |
| 373 | SessionRejectReason     | N    | 会话拒绝原因编号<br>0=存在无效的域号<br>1=该消息中必须的域丢失<br>2=该消息中出现未曾定义的域<br>3=未定义域号<br>4=域未赋值<br>5=域取值错误（范围溢出）<br>6=取值格式错误<br>7=解密错误<br>8=签名错误<br>9=公司标识符错误<br>10=发送时间精度错误<br>11=无效的消息类型<br>12=XML 验证错误<br>13=同一个域多次出现（非重复组）<br>14=有序的域出现次序错误<br>15=重复组域次序错误<br>16=重复组重复次数错误<br>17=非 data 数据域中出现域界定符<SOH> |
| 58  | Text                    | N    | 备注说明   |
|     | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |  |

#### 6.4.7.5 信用合约查询

##### 6.4.7.5.1 信用合约查询请求（UAN）

信用合约查询请求的接口字段如表54所示。

表 54 信用合约查询请求

| 标签  | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                         |
|-----|-----------------------|------|----------------------------|
|     | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=UAN                |
|     | 组件<Request>           | Y    |                            |
| 710 | PosReqID              | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识此数据包的数字或字符。 |



表 54 信用合约查询请求（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-------|-------------------------|------|---|
| 724   | PosReqType              | Y    | 请求类别<br>105=信用合约查询  |
| 组件结束  |                         |      |   |
| 15    | Currency                | Y    | 币种代码，交易货币。<br>默认是人民币<br>CNY=人民币<br>USD=美元<br>HKD=港币<br>币种代码应符合 GB/T 12406—2008 的要求。 |
| 21001 | MFType                  | N    | 融资融券方向代码<br>扩展：<br>0=融资<br>1=融券<br>不送查 融资   |
| 1     | Account                 | N    | 账户编码<br>资金账户  |
| 581   | AccountType             | N    | 账户类别代码<br>300=资金账户  |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.5.2 信用合约查询应答（UAP）

信用合约查询应答的接口字段如表55所示。

表 55 信用合约查询应答

| 标签          | 字段名称                  | 是否必须 | 说明   |
|-------------|-----------------------|------|--|
|             | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=UAP  |
| 组件<Report>  |                       |      |  |
| 721         | PosMaintRptID         | Y    | 响应消息唯一标识符<br>用于标识本响应消息唯一标识符  |
| 727         | TotalNumPosReports    | Y    | 返回报告条数   |
| 728         | PosReqResult          | Y    | 报告返回代码<br>0=成功<br>99=失败  |
| 组件结束        |                       |      |  |
| 组件<Request> |                       |      |  |
| 710         | PosReqID              | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识请求唯一标识符   |
| 724         | PosReqType            | Y    | 请求类别<br>105=信用合约查询   |
| 组件结束        |                       |      |  |
| 207         | SecurityExchange      | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所 |

表 55 信用合约查询应答（续）

| 标签               | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|------------------|------------------|------|---|
| 207              | SecurityExchange | N    | 0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 37               | OrderID          | N    | 订单编号。返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。<br>请使用该值来对应客户的原始委托消息。   |
| 21001            | MFType           | N    | 融资融券方向代码。0=融资，1=融券。   |
| 21003            | CompactStatus    | N    | 合约状态代码<br>01=正常<br>02=延期<br>03=提前了结<br>04=到期了结<br>05=逾期已了结<br>06=逾期未了结<br>07=违约处置中  |
| 组件<OrderQtyData> |                  | Y    |   |
| 152              | CashOrderQty     | N    | 订单金额  |
| 38               | OrderQty         | Y    | 订单数量  |
| 组件结束             |                  |      |   |
| 组件<Instrument>   |                  | Y    |   |
| 48               | SecurityID       | Y    | 证券代码  |
| 22               | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）   |

表 55 信用合约查询应答（续）

| 标签         | 字段名称                | 是否必须             | 说明   |
|------------|---------------------|------------------|--|
| 组件结束       |                     |                  |  |
| 14         | CumQty              | N                | 成交数量   |
| 55         | Symbol              | N                | 证券名称   |
| Group232   | Nostipulations      | N                | 组件重复数目   |
|            | 233                 | StipulationType  | N<br>类型说明<br>当 724=105 时：<br>SN=证券名称<br>ON=委托号<br>OD=发生日期<br>PS=定位串  |
|            | 234                 | StipulationValue | N<br>比率值   |
| Group753   | NoPosAmt            | N                | 金额数目<br>偿还金额组合的数目  |
|            | 707                 | PosAmtType       | N<br>金额类型代码<br>当 21001=0 时：<br>FDB=应付融资款余额<br>FDA=应付融资款的当前数<br>FEI=融资利息及费用<br>ICP=初始成本价格<br>PCP=盈亏成本价格<br>PC=浮动盈亏<br>当 21001=1 时：<br>FDB=融券未偿还金额<br>FDA=当前融券未偿还金额<br>LPC=最新价<br>MV=最新市值<br>BC=融券成本<br>EI=融券费用<br>ICP=初始成本价格<br>PCP=盈亏成本价格<br>PC=浮动盈亏 |
|            | 708                 | PosAmt           | N<br>金额  |
| Group702   | NoPositions         | N                | 条目数量   |
|            | 703                 | PosType          | N<br>数量类型代码，类型说明。<br>当 21001=0 时：<br>DB=融资数量<br>FDQ=融资股份余额<br>当 21001=1 时：<br>DB=应偿还融券总数量<br>DA=应偿还融券当前数量  |
|            | 704                 | LongQty          | N<br>数量  |
| Group22000 | NoUAccount          | N                | 扩展账号   |
|            | 581                 | AccountType      | N<br>账户类别代码<br>300=资金账号<br>301=股东账号  |
|            | 1                   | Account          | N<br>账户编码  |
| 373        | SessionRejectReason | N                | 会话拒绝原因编号<br>0=存在无效的域号<br>1=该消息中必须的域丢失  |

表 55 信用合约查询应答（续）

| 标签  | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-----|-------------------------|------|---|
| 373 | SessionRejectReason     | N    | 2=该消息中出现未曾定义的域<br>3=未定义域号<br>4=域未赋值<br>5=域取值错误（范围溢出）<br>6=取值格式错误<br>7=解密错误<br>8=签名错误<br>9=公司标识符错误<br>10=发送时间精度错误<br>11=无效的消息类型<br>12=XML 验证错误<br>13=同一个域多次出现（非重复组）<br>14=有序的域出现次序错误<br>15=重复组域次序错误<br>16=重复组重复次数错误<br>17=非 data 数据域中出现域界定符<SOH> |
| 58  | Text                    | N    | 备注说明  |
|     | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.6 可融券数量查询

## 6.4.7.6.1 可融券数量查询请求（UAN）

可融券数量查询请求的接口字段如表56所示。

表 56 可融券数量查询请求

| 标签             | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|----------------|-----------------------|------|---|
|                | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=UAN   |
| 组件<Request>    |                       | Y    |   |
| 710            | PosReqID              | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识此数据包的数字或字符   |
| 724            | PosReqType            | Y    | 请求类别<br>205=表示可融券数量查询   |
| 组件结束           |                       |      |   |
| 21001          | MFTYPE                | Y    | 融资融券方向代码<br>扩展字段：<br>1=融券   |
| 组件<Instrument> |                       | Y    |   |
| 48             | SecurityID            | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource      | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用） |
| 组件结束           |                       |      |   |
| 55             | Symbol                | N    | 证券名称  |
| 44             | Price                 | Y    | 委托价格  |

表 56 可融券数量查询请求（续）

| 标签  | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-----|-------------------------|------|---|
| 207 | SecurityExchange        | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按SecurityID自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 1   | Account                 | N    | 账户编码  |
| 581 | AccountType             | N    | 账户类别代码<br>300=资金账户<br>301=股东账户  |
|     | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.6.2 可融券数量查询应答（UAP）

可融券数量查询应答的接口字段如表57所示。

表 57 可融券数量查询应答

| 标签         | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                          |
|------------|-----------------------|------|-----------------------------|
|            | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=UAP                 |
| 组件<Report> |                       | Y    |                             |
| 721        | PosMaintRptID         | Y    | 响应消息唯一标识符<br>用于标识本响应消息唯一标识符 |
| 727        | TotalNumPosReports    | Y    | 返回报告条数                      |

表 57 可融券数量查询应答（续）

| 标签             | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|----------------|------------------|------|---|
| 728            | PosReqResult     | Y    | 报告返回代码<br>0=成功<br>99=失败   |
| 组件结束           |                  |      |   |
| 组件<Request>    |                  | Y    |   |
| 710            | PosReqID         | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识请求唯一标识符  |
| 724            | PosReqType       | Y    | 请求类别<br>205=可融券数量查询   |
| 组件结束           |                  |      |   |
| 207            | SecurityExchange | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 21001          | MFType           | N    | 融资融券方向代码<br>1=融券<br>将入参返回   |
| 组件<Instrument> |                  | Y    |   |
| 48             | SecurityID       | Y    | 证券代码  |
| 22             | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）  |

表 57 可融券数量查询应答（续）

| 标签         | 字段名称                    | 是否必须        | 说明   |  |
|------------|-------------------------|-------------|--|--|
| 22         | SecurityIDSource        | Y           | 101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>(200+自行内部使用)  |  |
| 组件结束       |                         |             |  |  |
| 55         | Symbol                  | N           | 证券名称   |  |
| Group702   | NoPositions             | N           | 条目数量   |  |
|            | 703                     | PosType     | N  | 数量类型代码<br>类型说明<br>当 21001=1 时：<br>SQ=最大股份数量<br>RQ=专户余券 |
|            | 704                     | LongQty     | N  | 数量   |
| Group22000 | NoUAccount              | N           | 扩展账号   |  |
|            | 581                     | AccountType | N  | 账户类别代码<br>300=资金账号<br>301=股东账号                         |
|            | 1                       | Account     | N  | 账户编码   |
| 373        | SessionRejectReason     | N           | 会话拒绝原因编号<br>0=存在无效的域号<br>1=该消息中必须的域丢失<br>2=该消息中出现未曾定义的域<br>3=未定义域号<br>4=域未赋值<br>5=域取值错误（范围溢出）<br>6=取值格式错误<br>7=解密错误<br>8=签名错误<br>9=公司标识符错误<br>10=发送时间精度错误<br>11=无效的消息类型<br>12=XML 验证错误<br>13=同一个域多次出现（非重复组）<br>14=有序的域出现次序错误<br>15=重复组域次序错误<br>16=重复组重复次数错误<br>17=非 data 数据域中出现域界定符<SOH> |  |
| 58         | Text                    | N           | 备注说明   |  |
|            | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y           |  |  |

#### 6.4.7.7 保证金查询

##### 6.4.7.7.1 保证金查询请求（UAN）

保证金查询请求的接口字段如表58所示。

表 58 保证金查询请求

| 标签   | 字段名称                  | 是否必须 | 说明             |
|------|-----------------------|------|----------------|
|      | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U008   |
| 1180 | ApplID                | Y    | 应用标识：250=保证金查询 |

表 58 保证金查询请求（续）

| 标签          | 字段名称                    | 是否必须 | 说明               |
|-------------|-------------------------|------|------------------|
| 60          | TransactTime            | Y    | 委托发生时间           |
| 11          | ClOrdID                 | Y    | 申请编号。0 表示不启用该字段。 |
| 组件<Parties> |                         | Y    |                  |
| 453         | NoPartyIDs              | Y    | 参与者代码个数          |
| 448         | PartyID                 | Y    | 参与者代码            |
| 447         | PartyIDSource           | Y    | 参与者代码源           |
| 452         | PartyRole               | Y    | 参与者代码角色          |
| 组件结束        |                         |      |                  |
| 58          | Text                    | N    | 备注说明             |
|             | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |                  |

## 6.4.7.7.2 保证金查询应答（UAP）

保证金查询应答的接口字段如表59所示。

表 59 保证金查询应答

| 标签              | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-----------------|-----------------------|------|---|
|                 | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U009                              |
| 10179           | ReportIndex           | Y    | 汇报记录号                                     |
| 1180            | ApplID                | Y    | 应用标识<br>250=保证金查询                         |
| 60              | TransactTime          | Y    | 委托发生时间                                    |
| 11              | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段。                       |
| 17              | ExecID                | Y    | 成交编号，执行编号。                                |
| 150             | ExecType              | Y    | 执行类型代码<br>0=New 表示请求接受<br>8=Reject 表示请求失败 |
| 103             | OrdRejReason          | N    | 订单拒绝原因代码<br>执行类型代码为 8 时填写                 |
| 1328            | RejectText            | N    | 拒绝原因说明<br>执行类型代码为 8 时填写                   |
| 组件<Parties>     |                       | Y    |   |
| 453             | NoPartyIDs            | Y    | 参与者代码个数                                   |
| 448             | PartyID               | Y    | 参与者代码                                     |
| 447             | PartyIDSource         | Y    | 参与者代码源                                    |
| 452             | PartyRole             | Y    | 参与者代码角色                                   |
| 组件结束            |                       |      |   |
| 组件<MarginItems> |                       | N    |   |
| 10186           | NoMarginItems         | Y    | 保证金条目个数                                   |
| 10187           | MarginItem            | Y    | 保证金条目类别代码<br>1=保证金可用余额<br>2=保证金总金额        |



表 59 保证金查询应答（续）

| 标签    | 字段名称                    | 是否必须 | 说明    |
|-------|-------------------------|------|-------|
| 10188 | MarginAmount            | Y    | 保证金金额 |
| 组件结束  |                         |      |       |
| 58    | Text                    | N    | 备注说明  |
|       | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |       |

## 6.4.7.8 担保证券查询

## 6.4.7.8.1 担保证券查询请求（UAN）

担保证券查询请求的接口字段如表60所示。

表 60 担保证券查询请求

| 标签             | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|----------------|-----------------------|------|---|
|                | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U008  |
| 1180           | AppID                 | Y    | 应用标识  |
| 60             | TransactTime          | Y    | 委托发生时间  |
| 11             | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段  |
| 组件<Instrument> |                       | Y    |   |
| 48             | SecurityID            | Y    | 证券代码<br>交易品种代码或者标准产品代码，标的证券代码，划转标的的证券代码，基金代码。   |
| 22             | SecurityIDSource      | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）   |
| 组件结束           |                       |      |   |
| 207            | SecurityExchange      | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统） |

表 60 担保证券查询请求（续）

| 标签                      | 字段名称             | 是否必须 | 说明   |
|-------------------------|------------------|------|--|
| 207                     | SecurityExchange | N    | 0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 组件<Request>             |                  | Y    |  |
| 710                     | PosReqID         | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识请求唯一标识符   |
| 724                     | PosReqType       | Y    | 请求类别<br>106=担保证券查询   |
| 组件结束                    |                  |      |  |
| 54                      | Side             | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出   |
| 组件<Parties>             |                  | Y    |  |
| 453                     | NoPartyIDs       | Y    | 参与者代码个数  |
| 448                     | PartyID          | Y    | 参与者代码  |
| 447                     | PartyIDSource    | Y    | 参与者代码源   |
| 452                     | PartyRole        | Y    | 参与者代码角色  |
| 组件结束                    |                  |      |  |
| 58                      | Text             | N    | 备注说明   |
| 标准消息尾（Standard Trailer） |                  | Y    |  |

## 6.4.7.8.2 担保证券查询应答（UAP）

担保证券查询应答的接口字段如表61所示。

表 61 担保证券查询应答

| 标签    | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------|-----------------------|------|---|
|       | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U009                              |
| 10179 | ReportIndex           | Y    | 汇报记录号                                     |
| 1180  | AppID                 | Y    | 应用标识                                      |
| 60    | TransactTime          | Y    | 委托发生时间                                    |
| 11    | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段                        |
| 17    | ExecID                | Y    | 成交编号，执行编号。                                |
| 150   | ExecType              | Y    | 执行类型代码<br>0=New 表示请求接受<br>8=Reject 表示请求失败 |

表 61 担保证券查询应答（续）

| 标签             | 字段名称               | 是否必须 | 说明  |
|----------------|--------------------|------|---|
| 103            | OrdRejReason       | N    | 订单拒绝原因代码，执行类型代码为 8 时填写。   |
| 1328           | RejectText         | N    | 拒绝原因说明，执行类型代码为 8 时填写。   |
| 721            | PosMaintRptID      | Y    | 响应消息唯一标识符<br>用于标识本响应消息唯一标识符   |
| 组件<Request>    |                    | Y    |   |
| 710            | PosReqID           | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识请求唯一标识符  |
| 724            | PosReqType         | Y    | 请求类别<br>106=担保证券查询  |
| 组件结束           |                    |      |   |
| 727            | TotalNumPosReports | Y    | 返回报告条数  |
| 728            | PosReqResult       | Y    | 报告返回代码<br>0=成功，其他=失败。   |
| 912            | LastRptRequested   | Y    | 后续结果<br>N=还有后续报告<br>Y=本报告为最后一条  |
| 207            | SecurityExchange   | N    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>0101=上海证券交易所<br>0102=深圳证券交易所<br>0103=中国金融期货交易所<br>0104=大连商品交易所<br>0105=郑州商品交易所<br>0106=上海期货交易所<br>0107=上海国际能源交易中心<br>0108=上海黄金交易所<br>0109=上海票据交易所<br>0110=中国不锈钢交易所<br>0111=全国中小企业股份转让系统<br>0112=区域性股权交易市场<br>0113=证券公司柜台市场<br>0114=中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统）<br>0115=中国结算开放式基金 TA 交易平台<br>0116=开放式基金场外其他交易平台<br>0117=银行间市场<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内） |
| 组件<Instrument> |                    | Y    |   |
| 48             | SecurityID         | Y    | 证券代码，交易品种代码 或者 标准产品代码，标的证券代码，划转标的的证券代码，基金代码。  |

表 61 担保证券查询应答（续）

| 标签              | 字段名称                    | 是否必须 | 说明  |
|-----------------|-------------------------|------|---|
| 22              | SecurityIDSource        | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用） |
| 组件结束            |                         |      |   |
| 55              | Symbol                  | N    | 证券名称  |
| 组件<Stipulation> |                         |      |   |
| 232             | NoStipulations          | Y    | 重复数目  |
| 233             | StipulationType         | Y    | 比率类型代码<br>Haircut=折算比率（%）<br>Yield=收益率/首次收益率<br>Yield2=到期收益率<br>StopYield=限价收益率                           |
| 234             | StipulationValue        | Y    | 比率值   |
| 组件结束            |                         |      |   |
| 组件<Parties>     |                         |      |   |
| 453             | NoPartyIDs              | Y    | 参与者代码个数   |
| 448             | PartyID                 | Y    | 参与者代码   |
| 447             | PartyIDSource           | Y    | 参与者代码源  |
| 452             | PartyRole               | Y    | 参与者代码角色   |
| 组件结束            |                         |      |   |
| 58              | Text                    | N    | 备注说明  |
|                 | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |   |

## 6.4.7.9 标的证券查询

## 6.4.7.9.1 标的证券查询请求（UAN）

标的证券查询请求的接口字段如表62所示。

表 62 标的证券查询请求

| 标签          | 字段名称                  | 是否必须 | 说明                        |
|-------------|-----------------------|------|---------------------------|
|             | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U008              |
| 1180        | AppID                 | Y    | 应用标识                      |
| 60          | TransactTime          | Y    | 委托发生时间                    |
| 11          | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段        |
| 组件<Request> |                       |      |                           |
| 710         | PosReqID              | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识此数据包的数字或字符 |
| 724         | PosReqType            | Y    | 请求类别<br>107=标的证券查询        |

表 62 标的证券查询请求（续）

| 标签          | 字段名称                    | 是否必须 | 说明                      |
|-------------|-------------------------|------|-------------------------|
| 组件结束        |                         |      |                         |
| 54          | Side                    | Y    | 买卖方向代码<br>1=买入<br>2=卖出  |
| 组件<Parties> |                         | Y    |                         |
| 453         | NoPartyIDs              | Y    | 参与者代码个数                 |
| 448         | PartyID                 | Y    | 参与者代码                   |
| 447         | PartyIDSource           | Y    | 参与者代码源                  |
| 452         | PartyRole               | Y    | 参与者代码角色                 |
| 组件结束        |                         |      |                         |
| 58          | Text                    | N    | 备注说明<br>只有 728 不为 0 时返回 |
|             | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |                         |

## 6.4.7.9.2 标的证券查询应答（UAP）

标的证券查询应答的接口字段如表63所示。

表 63 标的证券查询应答

| 标签          | 字段名称                  | 是否必须 | 说明  |
|-------------|-----------------------|------|---|
|             | 消息头部（Standard Header） | Y    | MsgType=U009                              |
| 10179       | ReportIndex           | Y    | 汇报记录号                                     |
| 1180        | AppID                 | Y    | 应用标识                                      |
| 60          | TransactTime          | Y    | 委托发生时间                                    |
| 11          | ClOrdID               | Y    | 申请编号<br>0 表示不启用该字段                        |
| 17          | ExecID                | Y    | 成交编号，执行编号。                                |
| 150         | ExecType              | Y    | 执行类型代码<br>0=New 表示请求接受<br>8=Reject 表示请求失败 |
| 103         | OrdRejReason          | N    | 订单拒绝原因代码，执行类型代码为 8 时填写。                   |
| 1328        | RejectText            | N    | 拒绝原因说明，执行类型代码为 8 时填写。                     |
| 组件<Report>  |                       | Y    |   |
| 721         | PosMaintRptID         | Y    | 响应消息唯一标识符<br>用于标识本响应消息唯一标识符               |
| 727         | TotalNumPosReports    | Y    | 返回报告条数                                    |
| 728         | PosReqResult          | Y    | 报告返回代码<br>0=成功<br>其他=失败                   |
| 组件结束        |                       |      |   |
| 组件<Request> |                       | Y    |   |
| 710         | PosReqID              | Y    | 请求唯一标识符<br>用于标识此数据包的数字或字符                 |
| 724         | PosReqType            | Y    | 请求类别<br>107=标的证券查询                        |

表 63 标的证券查询应答（续）

| 标签              | 字段名称             | 是否必须 | 说明  |
|-----------------|------------------|------|---|
| 组件结束            |                  |      |   |
| 912             | LastRptRequested | Y    | 后续结果<br>N=还有后续报告<br>Y=本报告为最后一条  |
| 组件<Instrument>  |                  |      |   |
| 48              | SecurityID       | Y    | 证券代码，交易品种代码或者标准产品代码，标的证券代码，划转标的证券代码，基金代码。   |
| 22              | SecurityIDSource | Y    | 集合证券代码源<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用）                     |
| 组件结束            |                  |      |   |
| 55              | Symbol           | N    | 证券名称  |
| 组件<MarginItems> |                  |      |   |
| 10186           | NoMarginItems    | Y    | 保证金条目个数   |
| 10187           | MarginItem       | Y    | 保证金条目类别代码<br>1=保证金可用余额<br>2=保证金总金额  |
| 10188           | MarginAmount     | Y    | 保证金金额   |
| 组件结束            |                  |      |   |
| 21001           | MFType           | Y    | 融资融券方向代码<br>扩展字段：<br>1=融券<br>0=融资   |
| 组件<Stipulation> |                  |      |   |
| 232             | NoStipulations   | Y    | 重复数目  |
| 233             | StipulationType  | Y    | 比率类型代码<br>Haircut=折算比率（%）<br>Yield=收益率/首次收益率<br>Yield2=到期收益率<br>StopYield=限价收益率<br>融资保证金比例 fmarginrate<br>融券保证金比例 dmarginrate |
| 234             | StipulationValue | Y    | 比率值   |
| 组件结束            |                  |      |   |
| 11016           | ContractType     | Y    | 融资合同类型代码<br>1=融资申购<br>2=融资可取<br>3=融资可用  |
| 组件<Parties>     |                  |      |   |
| 453             | NoPartyIDs       | Y    | 参与者代码个数   |
| 448             | PartyID          | Y    | 参与者代码   |
| 447             | PartyIDSource    | Y    | 参与者代码源  |

表 63 标的证券查询应答（续）

| 标签   | 字段名称                    | 是否必须 | 说明      |
|------|-------------------------|------|---------|
| 452  | PartyRole               | Y    | 参与者代码角色 |
| 组件结束 |                         |      |         |
| 58   | Text                    | N    | 备注说明    |
|      | 标准消息尾（Standard Trailer） | Y    |         |

## 7 数据字典

### 7.1 数据类型

数据类型表示数据域的取值类型，数据类型应符合JR/T 0022—2020的要求。本文件有包括整数、浮点数、单字符、字符串、数据data和在此基础上扩展的数据类型，除“数据data”数据类型外，其他数据类型均以ASCII码字符串表示，应符合GB 18030—2005的要求。

证券期货业机构内部证券交易数据接口字段分类的数据类型结构定义如表64所示。

表 64 数据类型

| 字段分类           | 类型    | 说明   |
|----------------|-------|--|
| Price          | N19,4 | 价格   |
| Qty            | N17,2 | 数量   |
| Amt            | N19,4 | 金额   |
| SeqNum         | N18   | 消息序号<br>正数   |
| Boolean        | C1    | 布尔逻辑<br>'Y'=True/Yes<br>'N'=False/No   |
| Length         | N9    | 长度。<br>表示字节为单位的数据长度，正数。  |
| UTCTimeStamp   | C21   | 国际标准时间戳<br>YYYYMMDD HH:MM:SS.sss（毫秒），YYYY=0000-9999，MM=01-12，DD=01-31，HH=00-23，MM=00-59，SS=00-60（秒），sss=000-999（毫秒）。 |
| LocalTimeStamp | C21   | 本地时间戳<br>YYYYMMDD HH:MM:SS.sss（毫秒），YYYY=0000-9999，MM=01-12，DD=01-31，HH=00-23，MM=00-59，SS=00-60（秒），sss=000-999（毫秒）。   |
| NumInGroup     | N9    | 重复数<br>表示重复组的项数，正数。  |
| LocalMktData   | C8    | 本地市场日期<br>格式 YYYYMMDD，YYYY= 0000-9999，MM=01-12，DD=01-31。   |
| UTCDateOnly    | C8    | 国际标准日期<br>格式 YYYYMMDD，YYYY= 0000-9999，MM=01-12，DD=01-31。   |

### 7.2 消息类型

消息类型包含在消息头部，可以直接采用已定义的消息类型，也可以通过新增消息类型来实现消息定义扩展。自定义消息的消息类型值首字符为‘U’，消息类型临时定义原则：SH证券交易所临时定义消息的消息类型值首两位字符为‘UA’，SZ证券交易所临时定义消息的消息类型值首两位字符为‘UB’，GG股转公司（指全国中小企业股份转让系统有限责任公司）临时定义消息的消息类型值首两位字符为‘UC’。本文件的消息类型如表65所示。

表 65 消息类型

| 消息类型(MsgType) | 名称(中文) | 名称(英文)       |
|---------------|--------|--------------|
| 0             | 心跳     | Heartbeat    |
| 1             | 测试请求   | Test Request |

表 65 消息类型（续）

| 消息类型 (MsgType) | 名称 (中文)      | 名称 (英文)                         |
|----------------|--------------|---------------------------------|
| 2              | 重发请求         | Resend Request                  |
| 3              | 拒绝           | Reject                          |
| 4              | 序列重置         | Sequence Reset                  |
| 5              | 退出           | Logout                          |
| 6              | 意向申报         | Indication of Interest          |
| 8              | 执行报告         | Execution Report                |
| 9              | 撤单失败响应       | Order Cancel Reject             |
| A              | 登录请求         | Logon                           |
| AB             | 多笔委托         | New Order Multiple              |
| AE             | 成交申报/成交确认    | Trade Capture Report            |
| AF             | 询价申报接受响应     | Quote Request Ack               |
| AG             | 询价申报拒绝响应     | Quote Request Reject            |
| AI             | 报价状态回报       | Quote Status Report             |
| AJ             | 意向申报响应       | Quote Response                  |
| AR             | 成交申报响应       | Trade Capture Report Ack        |
| BE             | 用户请求         | User Request                    |
| BF             | 用户响应         | User Response                   |
| BN             | 执行确认         | Execution Acknowledgement       |
| D              | 单笔委托         | New Order Single                |
| F              | 撤单请求         | Order Cancel Request            |
| G              | 初始交易         | Order Cancel or Replace Request |
| H              | 交易时段状态       | Trading Session Status          |
| I              | 集中申报         | Mass Quote                      |
| J              | 通用拒绝         | Business Message Reject         |
| R              | 询价申报         | Quote Request                   |
| S              | 申报           | Quote                           |
| U001           | 注册           | Designation                     |
| U002           | 注册执行报告       | Designation Report              |
| U004           | 投票           | Evote                           |
| U005           | 投票执行报告       | Evote Report                    |
| U006           | 密码服务         | Password Service                |
| U007           | 密码服务执行报告     | Password Service Report         |
| U008           | 保证金查询        | Margin Query                    |
| U009           | 保证金查询结果      | Margin Query Result             |
| U010           | 现券还券以及现金还款请求 | Pay Back Request                |
| U011           | 担保品划转请求      | Collateral Draw Request         |
| U012           | 余券划转         | Surplus Securities Draw         |



## 7.3 标签域字典

证券期货业机构内部证券交易数据接口的标签域字典如表66所示

表 66 标签域字典

| 标签 | 来源  | 字段名称             | 字段类型  | 说明  |
|----|-----|------------------|-------|---|
| 1  | FIX | Account          | C20   | 账户编码，过入方证券账户编码，过出方证券账户编码，融出方证券账户编码，包括股东账户、资金账户、基金账户、客户账户、组合编号等（组合编号用于将指定的指令下达达到投资系统的对应组合）。  |
| 6  | FIX | AvgPx            | N19,4 | 反馈成交信息，成交均价。  |
| 7  | FIX | BeginSeqNo       | N8    | 开始序号  |
| 8  | FIX | BeginString      | C8    | 版本信息，定义消息的协议版本/金融信息交换协议 FIX 版本信息。   |
| 9  | FIX | BodyLength       | N8    | 消息体长度，报文的长度。  |
| 10 | FIX | Checksum         | C6    | 校验和，消息的最末域（不可加密）。   |
| 11 | FIX | ClOrdID          | C16   | 申请编号，客户订单编号，成员端报价订单编号。第三方指令编号，全程唯一，已有指令结束归档后该编号可以再使用。请求唯一标识符，用于标识此数据包的数字或字符，在交易日内需要确保该字段的唯一性。0 表示不启用该字段。  |
| 14 | FIX | CumQty           | N17,2 | 反馈成交信息<br>累计成交数量  |
| 15 | FIX | Currency         | C3    | 币种代码，交易货币。<br>默认是人民币<br>CNY=人民币<br>USD=美元<br>HKD=港币<br>当 PosTransType = 200 时必送；<br>当 PosTransType=201 时，当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。<br>应符合 GB/T 12406—2008 的要求。             |
| 16 | FIX | EndSeqNo         | N8    | 结束序号  |
| 17 | FIX | ExecID           | C64   | 成交编号，记录成交单的唯一标识符。流水号，成交时为 L_REALDEAL_SERIAL_NO。   |
| 19 | FIX | ExecRefID        | C64   | 要回溯的成交编号（ExecID），返回指令状态和有效的成交数据时该字段为空。  |
| 20 | FIX | ExecTransType    | C1    | 应答发送类别<br>0=普通的反馈（固定为 0）  |
| 22 | FIX | SecurityIDSource | N3    | 集合证券代码源，交易品种代码来源。<br>如果消息中使用了 SecurityID 域则也应有 SecurityIDSource 域，消息格式应符合 JR/T 0022—2020 的要求。<br>4=ISIN（ISIN 组织）<br>101=SH 证券交易所<br>102=SZ 证券交易所<br>103=XG 联合交易所<br>104=GG 股转公司<br>（200+自行内部使用） |
| 23 | FIX | IOIID            | C32   | 客户意向申报编号，同一交易单元一个交易日内申报的所有意向申报 IOIID 不能重复。  |
| 26 | FIX | IOIRefID         | C32   | 原意向申报，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。  |
| 27 | FIX | IOIQty           | N17,2 | 委托数量，质押式回购、买断式回购、现券买卖、债券远期、资产支持证券买卖和债券借贷市场中的意向报价的券面总额；信用拆借中的意向报价的拆借金额；利率互换和远期利率协议中的意向报价的名义本金额；ETF 中的意向报价的基金份额。在质押式回购中意向报价的券面总额=Sum（基础品种券面总额）。   |

表 66 标签域字典（续）

| 标签 | 来源  | 字段名称         | 字段类型  | 说明   |
|----|-----|--------------|-------|--|
| 28 | FIX | IOITransType | C1    | 意向申报类型代码，意向报价会话类型：<br>N=意向申报；C=意向申报撤单；R=意向申报修改。  |
| 31 | FIX | LastPx       | N19,4 | 最新净价。反馈成交信息，当前笔成交价格。   |
| 32 | FIX | LastQty      | N17,2 | 成交券面总额 或 成交拆借金额 或 成交名义本金额 或 成交基金份额，反馈成交信息，当前笔成交数量。<br>该笔成交的：质押式回购、买断式回购、现券买卖、债券远期、资产支持证券买卖和债券借贷市场中的成交券面总额；信用拆借中的成交拆借金额；利率互换和远期利率协议中的成交名义本金额；ETF 中的成交基金份额。<br>在质押式回购中，成交券面总额=Sum（基础品种券面总额）；例外是在询价的最后一轮中，一方修改了券面总额，如对手方接受，成交券面总额=券面总额，均小于 Sum（基础品种券面总额）。                     |
| 34 | FIX | MsgSeqNum    | N8    | 消息序号。<br>用于会话管理的消息序列号。   |
| 35 | FIX | MsgType      | C4    | 消息类型<br>系统根据 MsgType 的值来确定收到的是何种消息。  |
| 36 | FIX | NewSeqNo     | N8    | 新消息序号  |
| 37 | FIX | OrderID      | C16   | 订单编号。返回指令下达失败的指令状态数据时该字段同 ClOrdID 的值是一致的，其他的值为指令日期+指令序号+指令修改次序。  |
| 38 | FIX | OrderQty     | N17,2 | 订单数量，委托数量，申报数量，指令数量，交易所业务可以填 0，填 0 按照金额控制，否则按数量控制（指令金额取 Tag152 字段）<br>券面总额 或 拆借金额 或 名义本金额 或 基金份额<br>质押式回购、买断式回购、现券买卖、债券远期、资产支持证券买卖和债券借贷市场中的券面总额；信用拆借中的拆借金额；利率互换和远期利率协议中的名义本金额；ETF 中的基金份额<br>在质押式回购中，券面总额=Sum（基础品种券面总额）；例外是在询价的最后一轮中，一方修改了券面总额，如对手方接受，券面总额小于 Sum（基础品种券面总额）。 |
| 39 | FIX | OrdStatus    | C2    | 指令状态代码，订单状态代码；对于指令下达拒绝的时候填 03。<br>01=有效指令<br>02=已修改<br>03=已撤销<br>04=已暂停<br>05=审批拒绝<br>06=分发拒绝<br>07=指令录入<br>08=草稿指令<br>09=临时下达<br>10=临时修改  |
| 40 | FIX | OrdType      | N2    | 委托类型代码，即基于价格的价格模式或订单类型<br>01=市价（表示不限制委托价格，在涨跌停范围内即可）<br>02=限价（表示限制委托价格，买入不高于，卖出不低于）<br>03=市价止损<br>04=市价止盈<br>05=限价止损<br>06=限价止盈  |
| 41 | FIX | OrigOrdID    | N8    | 撤单编号，被修改/撤销指令的第三方指令编号，返回修改和撤销的指令状态时该字段才会有值，下达时该字段为空。   |

表 66 标签域字典（续）

| 标签 | 来源  | 字段名称           | 字段类型  | 说明   |
|----|-----|----------------|-------|--|
| 43 | FIX | PossDupFlag    | C1    | 是否重发，消息重复标志。<br>可能重复标志，重复发送时，作此标记（可加密）。<br>N=Original transmission<br>Y=Possible duplicate   |
| 44 | FIX | Price          | N19,4 | 委托价格、指令价格、质押价格、购回价格、约定价格、交易价格或拆借利率 或 固定利率 或 净价 或 基金价格 或 债券借贷费率 或 回购利率。<br>OrdType 为 02 时填写。<br>对于回购业务指令价格就是回购利率。   |
| 45 | FIX | RefSeqNum      | N8    | 消息引用序列号<br>被拒绝消息的序号  |
| 48 | FIX | SecurityID     | C32   | 证券代码，交易品种代码或者标准产品代码，标的证券代码，划转标的的证券代码，基金代码。   |
| 49 | FIX | SenderCompID   | C32   | 消息发送方标识  |
| 50 | FIX | SenderSubID    | N8    | 消息发送方子标识，指令下达人的编号。   |
| 52 | FIX | SendingTime    | C21   | 消息发送时间 YYYYMMDD HH:MM:SS.sss（国际标准时间 UTC）   |
| 53 | FIX | Quantity       | N17,2 | 申请划转数量，过户数量。   |
| 54 | FIX | Side           | C1    | 买卖方向代码、买卖方向、交易方向、划转类型代码，返回传入的买卖方向。<br>买卖方向：<br>1=买<br>2=卖<br>转融通证券出借方向：<br>G=借入<br>F=出借  |
| 55 | FIX | Symbol         | C20   | 证券名称，交易品种名称，货币名称，合约代码，期权合约代码，转入基金代码/转出基金代码，目标代码只用于基金转换。  |
| 56 | FIX | TargetCompID   | C32   | 消息接收方标识  |
| 58 | FIX | Text           | C256  | 备注说明。询价过程中，交易员可以选择在报价输入窗口的补充条款字段输入补充信息。补充条款最多为 100 个汉字。拒绝原因说明。   |
| 59 | FIX | TimeInForce    | C3    | 订单有效时间类型代码，有效时期类型，指令有效模式，有效订单类型，缺省值为 0。<br>0=当日有效<br>1=一直有效（直到完成或撤销）<br>3=即时成交或取消<br>6=到指定日前有效<br>101=一定日期内有效<br>102=到时间前有效<br>期货订单有有效时间类型，基金下单没有委托时间类型。 |
| 60 | FIX | TransactTime   | C21   | 委托发生时间、订单发起时间、消息生成时间、意向申报发起时间、成交申报发起时间、投票发起时间。   |
| 62 | FIX | ValidUntilTime | C21   | 报价有效时间，预留，LocalTimestamp。  |
| 63 | FIX | SettlType      | N3    | 结算方式，预留。<br>103=多边净额<br>104=逐笔全额   |
| 66 | FIX | ListID         | C16   | 申报编号，第三方系统传过来的新订单的清单编号，当日必须唯一。修改通过 OrderList 方式下达的指令 ListID 必须要传。  |
| 67 | FIX | ListSeqNo      | C4    | 清单内订单序号  |
| 68 | FIX | TotNoOrders    | N4    | 订单总数<br>表示在同一 ListID 下所有消息中的订单总数，用以支持消息分割。   |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称            | 字段类型  | 说明   |
|-----|-----|-----------------|-------|--|
| 73  | FIX | NoOrders        | N3    | 订单个数，下面为订单重复组内容。   |
| 77  | FIX | PositionEffect  | C1    | 衍生品交易开平仓标识<br>C=平仓<br>O=开仓   |
| 89  | FIX | Signature       | C256  | 签名   |
| 90  | FIX | SecureDataLen   | N9    | 密文长度。用于标示消息加密部分的长度时必选（不能加密）。   |
| 91  | FIX | SecureData      | C256  | 密文。消息体加密时必选。总紧跟在 SecureDataLen 域之后。<br>消息内除某些需要公开识别的域以明文传输外，其他任何域都可以加密放置密文数据域（SecureData）内。当决定使用加密方案时，建议对消息正文内所有的域加密。如果消息的重复组内有部分需要加密的，那么应对整个重复组加密。<br>正文加密方案有三种：<br>（1）将安全敏感的域加密后移至 SecureData 域。<br>（2）将所有允许加密的域加密后移至 SecureData 域。<br>（3）将所有允许加密的域加密后移至 SecureData 域，同时这些域以明文在消息中重复出现。  |
| 93  | FIX | SignatureLength | N9    | 签名长度   |
| 95  | FIX | RawDataLength   | N9    | 如果不送，使用 strlen 得到 RawData 字段长度。  |
| 96  | FIX | RawData         | C256  | 用户密码参数（Custom 用户登录模式）  |
| 98  | FIX | EncryptMethod   | N1    | 密码字段加密方式代码<br>0=不加密 None or other; 1=PKCS; 2=DES; 3=PKCS or DES; 4=PGP or DES; 5=PGP or DES MD5; 6=PEM or DES MD5; 101=BlowFish。   |
| 99  | FIX | StopPx          | N19,4 | 止损价格，预留。   |
| 103 | FIX | OrdRejReason    | N4    | 订单拒绝原因代码<br>应符合 JR/T 0022-2014 订单拒绝原因，取值：<br>0=券商/交易所选项（Broker / Exchange option）<br>1=证券代码非法（Unknown symbol）<br>2=交易关闭（Exchange closed）<br>3=订单超过限价（Order exceeds limit）<br>4=订单太迟（Too late to enter）<br>5=未知订单（Unknown Order）<br>6=重复订单（Duplicate Order（e.g. dupe ClOrdID））<br>7=与口头报单重复（Duplicate of a verbally communicated order）<br>8=失效订单（Stale Order）<br>9=交易相关要求（Trade Along required）<br>10=无效账户（Invalid Investor ID）<br>11=不支持的订单特征（Unsupported order characteristic）<br>12=监查选择原因（Surveillance Option）<br>13=数量错误（Incorrect quantity）<br>14=数量分配错误（Incorrect allocated quantity）<br>15=未知账号（Unknown account（s））<br>99=其他（other）<br>100=参与者业务单元代码非法<br>101=委托日期非法<br>102=证券停牌<br>103=买委托数量不是 SJSXX.XXBLDW 的整数倍<br>104=卖委托数量不是 SJSXX.XXSLDW 的整数倍<br>105=委托数量超出 SJSXX.XXMBXL 的限值<br>106=委托价格不是 SJSXX.XXJGDW 的整数倍<br>107=证券账户含有非数字字符 |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称         | 字段类型 | 说明  |
|-----|-----|--------------|------|---|
| 103 | FIX | OrdRejReason | N4   | 108=非法的委托业务<br>109=测试环境正式用户不允许报单<br>110=WTCLBZ 没有填 ‘z’<br>111=交易期间测试用户不允许报单<br>112=该参与者业务单元无权经营该种证券<br>113=该证券账户无权交易该种证券<br>114=该证券在当前时间不可交易<br>115=参与者业务单元被禁买或禁卖<br>116=证券账户被禁买或禁卖<br>117=参与者业务单元资金可用量不足<br>118=该委托记录标有 DELETE 标记<br>119=回购卖空<br>120=参与者业务单元卖空<br>121=股东卖空<br>122=总量超限<br>123=价格过高<br>124=价格过低<br>125=价格错误<br>126=数量非法<br>127=数量超限<br>128=重复申购<br>129=账户非法<br>130=转股禁止<br>131=回售禁止<br>132=非质押物<br>133=持股超限<br>134=参与者业务单元无此业务权限<br>135=开放式基金申购禁止<br>136=开放式基金赎回禁止<br>137=权证行权禁止<br>138=ETF 申购禁止<br>139=ETF 赎回禁止<br>140=ETF 全额现金替代申购禁止<br>141=ETF 申购时投资者篮子股份不足<br>142=ETF 赎回时基金篮子股份不足<br>143=ETF 申购现金替代比例超限<br>144=ETF 全额现金替代申购单个投资者超限<br>145=ETF 全额现金替代申购单个代办证券公司超限<br>146=该证券禁止融资买入<br>147=该证券禁止融券卖出<br>148=无效业务类别<br>149=买卖业务禁止<br>150=申报市价委托时因无法成交而导致交易主机生成的自动撤单记录<br>151=ETF 赎回时当日赎回总量超过限制<br>152=ETF 申购时当日申购总量超过限制<br>203=无效证券代码（Invalid stock id）<br>204=非交易时间（This stock is not in trading hours）<br>213=证券被挂起（Stock is suspended）<br>214=该股票不参与集合竞价（Orders not accepted for this stock during open period）<br>215=无效账号（Invalid client account）<br>216=该账号未指定在你参与者业务单元（Your firm does not own this account） |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称             | 字段类型  | 说明   |
|-----|-----|------------------|-------|--|
| 103 | FIX | OrdRejReason     | N4    | 217=账号已挂起（Account is suspended）<br>218=无效价格（Invalid price）<br>219=申报价不能为零（Price may not be 0 for a limit order）<br>220=最小价格步长是（Minimum price Step is...）<br>222=价格超出范围（Price is out of range）<br>224=无效数量（Invalid quantity）<br>225=申报数量必须大于 0（Quantity must be greater than 0）<br>227=申报数量不符最小步长（Invalid quantity for minstep）<br>228=申报量必须不大于（Order quantity must not be more than）<br>229=超出限量（Holding limit would be exceeded）<br>231=余额不足（Insufficient account balance for sell order）<br>234=股票持有量超出限量（Holdings limit on stock would be exceeded）<br>235=找不到已授权的基本股票（Unable to find base stock for rights）<br>243=机构账号不能买卖此证券<br>244=S 账号不能买入<br>245=不能撤销指定（有卖空股票）<br>246=不能撤销指定（有委托）<br>247=不能撤销指定（公司卖空）<br>248=上海中央登记结算公司不允许撤销指定<br>271=该账号已指定在你参与者业务单元<br>272=未做指定不能交易<br>401=无效操作员代码（Invalid trader id）<br>403=无效申报序号（Invalid order number）<br>404=他人申报（Not your order）<br>405=账号不同（Account differ）<br>406=股票不同（Stock differ）<br>407=买卖不同（Buy Sell differ）<br>2001=日期出错（Date error）<br>2002=时间出错（Time error）<br>2003=券商 ref 字段数据错误（Brok-ref error）<br>2004=账号出错（Account error）<br>2005=买卖出错（B、S error）<br>2006=代码出错（Stock error）<br>2007=价格出错（Price error）<br>1100=委托号太大（Weituo number too large）<br>1101=记录不匹配（Record not match）<br>1102=委托失败（Weituo faulted）<br>1000=非法状态（Invalid status）<br>1021=记录号出错（Rec-num error）<br>1022=证券账号错误（ACC error）<br>1023=证券代码错误（STOCK error）<br>1024=买卖标志错误（B/S error）<br>1025=价格错误（PRICE error）<br>1026=数量错误（QTY error）<br>1027=日期字段错误（Field Date Error） |
| 108 | FIX | HeartBtInt       | N4    | 心跳间隔。连接双方使用相同的心跳间隔时间，由会话发起人在登录时向登录接受方发出，并得到确认  |
| 110 | FIX | MinQty           | N17,2 | 最小成交数量，最小交易量。缺省值为 0。   |
| 111 | FIX | MaxFloor         | N17,2 | 可显示数量  |
| 112 | FIX | TestReqID        | C10   | 测试请求标识符  |
| 115 | FIX | OnBehalfOfCompID | C10   | 最初发送方标识符（可加密），用于经第三方发送。  |
| 116 | FIX | OnBehalfOfSubID  | C10   | 最初发送方子标识符（可加密），用于经第三方发送。   |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称               | 字段类型  | 说明   |
|-----|-----|--------------------|-------|--|
| 117 | FIX | QuoteID            | C10   | 报价标识，报价消息编号，主动撤单时填写，与被撤委托的 QuoteID 一致。   |
| 123 | FIX | GapFillFlag        | C1    | 缺口填补标识<br>Y=序号重置-缺口填补（SeqReset-Gap Fill）；<br>N=序号重置-重置（SeqReset-Reset）。  |
| 126 | FIX | ExpireTime         | C21   | 询价请求失效时间，预留。   |
| 128 | FIX | DeliverToCompID    | C10   | 最终接收方标识符（可加密），用于经第三方发送。  |
| 129 | FIX | DeliverToSubID     | C10   | 最终接收方子标识符（可加密），用于经第三方发送。   |
| 131 | FIX | QuoteReqID         | C10   | 报价请求 ID，预留字段。当报价是对报价请求的响应时，填写报价请求 ID。  |
| 132 | FIX | BidPx              | N19,4 | 买报价，BidSize>0 时必须填写  |
| 133 | FIX | OfferPx            | N19,4 | 卖报价，OfferSize>0 时必须填写  |
| 134 | FIX | BidSize            | N17,2 | 买数量。对于期权集中竞价交易报价，如果 BidSize>0，则必须填写 BidPositionEffect。<br>通过对 BidSize 和 OfferSize 字段的取值组合实现四种报价模式：<br>双边报价，BidSize>0，OfferSize>0；<br>买报价，BidSize>0，OfferSize=0；<br>卖报价，BidSize=0，OfferSize>0；<br>撤销报价，BidSize=0，OfferSize=0。   |
| 135 | FIX | OfferSize          | N17,2 | 卖数量。对于期权集中竞价交易报价，如果 OfferSize>0，则必须填写 OfferPositionEffect。<br>通过对 BidSize 和 OfferSize 字段的取值组合实现四种报价模式：<br>双边报价，BidSize>0，OfferSize>0；<br>买报价，BidSize>0，OfferSize=0；<br>卖报价，BidSize=0，OfferSize>0；<br>撤销报价，BidSize=0，OfferSize=0。   |
| 141 | FIX | ResetSeqNumFlag    | C1    | 序号重置标记：Y=Yes 表示序号重置；N=No 表示序号不重置。  |
| 150 | FIX | ExecType           | C3    | 执行类型代码：<br>0=已下达未成交（New），表示请求接受<br>1=部分成交（Partial fill）<br>2=全部成交（Fill）<br>4=已撤销（Canceled）<br>5=已修改（Replace）<br>6=接收到撤销的指令（Pending Cancel）<br>7=停止<br>8=拒绝（Reject），表示请求失败<br>A=接收到下达的指令（Pending New）<br>E=接收到修改的指令（Pending Replace）<br>F=交易已成交（部分或全部）Trade（partial fill or fill）<br>H=交易撤销<br>101=应急 |
| 151 | FIX | LeavesQty          | N17,2 | 反馈成交信息，剩余未成交数量。  |
| 152 | FIX | CashOrderQty       | N17,2 | 订单金额，成交金额，总可交易金额/指令金额，购回金额，初始合约金额。   |
| 167 | FIX | SecurityType       | C8    | 证券类别。MLEG=组合。  |
| 198 | FIX | SecondaryOrderID   | C16   | 第二交易所订单编号  |
| 203 | FIX | CoveredOrUncovered | C1    | 衍生品交易备兑标签。0=非备兑（默认为 0）；1=备兑。   |
| 207 | FIX | SecurityExchange   | N3    | 交易场所代码<br>当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 SecurityID 自动判断，可能出错识别错误。   |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称            | 字段类型 | 说明   |
|-----|-----|-----------------|------|--|
|     |     |                 |      | 交易所和市场识别码应符合 GB/T 23696—2017 的要求。<br>01=境内<br>011702=中央国债登记结算公司<br>011703=银行间市场清算所股份有限公司<br>0118=沪港通下港股通<br>0119=深港通下港股通<br>0120=沪港通（北向）<br>0121=深港通（北向）<br>0122=沪伦通（东向）<br>0123=银行业信贷资产登记流转中心<br>0124=北京金融资产交易所<br>0125=上海保险交易所<br>0126=商业银行柜台市场<br>0199=其他（境内）<br>02=境外<br>0201=北美<br>020101=纽约证券交易所<br>020102=纳斯达克证券交易所<br>0202=南美<br>020201=圣保罗证券交易所<br>0203=欧洲<br>020301=伦敦证券交易所<br>020302=巴黎证券交易所<br>020303=法兰克福证券交易所<br>020304=马德里证券交易所<br>020305=莫斯科证券交易所<br>0206=亚太<br>020601=香港证券交易所<br>020602=东京证券交易所<br>020603=台湾证券交易所<br>020604=新加坡证券交易所<br>020605=韩国证券交易所<br>020606=澳大利亚证券交易所<br>020607=孟买证券交易所<br>020608=泰国证券交易所<br>020609=印尼证券交易所<br>0299=其他（境外） |
| 216 | FIX | RoutingType     | N1   | 路由类型：<br>1=系统号<br>2=功能号<br>3=营业部号<br>4=其他<br>发送范围类型<br>1=目标对手方<br>2=目标对手方列表（多个）<br>5=所有市场参与者<br>面向所有市场参与者，这时该意向性报价将发向所有市场参与者   |
| 217 | FIX | RoutingID       | C8   | 路由标识符/发送范围标识符  |
| 232 | FIX | NoStipulations  | N9   | 组件重复数目   |
| 233 | FIX | StipulationType | C18  | 比率类型代码<br>Haircut=折算比率（%）<br>Yield= 收益率 /首次收益率<br>Yield2 =到期收益率  |



表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称                | 字段类型 | 说明   |
|-----|-----|---------------------|------|--|
|     |     |                     |      | StopYield=限价收益率  |
| 234 | FIX | StipulationValue    | C6   | 比率值  |
| 371 | FIX | RefTagID            | N5   | 相关错误域号   |
| 372 | FIX | RefMsgType          | C4   | 被拒绝消息的消息类型，相关错误消息的类型。  |
| 373 | FIX | SessionRejectReason | N2   | 会话拒绝原因编号<br>0=存在无效的域号<br>1=该消息中必须的域丢失<br>2=该消息中出现未曾定义的域<br>3=未定义域号<br>4=域未赋值<br>5=域取值错误（范围溢出）<br>6=取值格式错误<br>7=解密错误<br>8=签名错误<br>9=公司标识符错误<br>10=发送时间精度错误<br>11=无效的消息类型<br>12=XML 验证错误<br>13=同一个域多次出现（非重复组）<br>14=有序的域出现次序错误<br>15=重复组域次序错误<br>16=重复组重复次数错误<br>17=非 data 数据域中出现域界定符<SOH> |
| 423 | FIX | PriceType           | N1   | 价格类型代码，产品的价格类型。<br>1=Percentage 表示收益率<br>2=Per unit<br>3=Fixed amount 表示绝对价格或表示固定价格<br>4=Discount<br>5=Premium<br>6=Spread 用来表示浮动的利率   |
| 432 | FIX | Expiredate          | C8   | 有效日期，报价失效日期。<br>当 Tag59=6GTD 时，指定该指令的有效日期，其他无需指定。  |
| 447 | FIX | PartyIDSource       | C3   | 参与者代码源，参与者 ID 来源。<br>5=中国投资者编号<br>C=通用市场参与者标识<br>D=自定义代码<br>B=SWIFT BIC Code<br>101=银行代码；102=CFETS 代码  |
| 448 | FIX | PartyID             | C20  | 参与者代码，成员唯一标识，证券账户，交易单元（PBU），营业部代码。   |
| 452 | FIX | PartyRole           | N3   | 参与者代码角色，参与方角色。<br>5=投资者证券账户<br>1=申报交易单元<br>4001=营业部代码<br>101=发起方<br>102=对手方<br>104=清算银行<br>105=托管机构<br>106=托管行<br>107=结算代理人<br>108=保证品管理机构   |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称                  | 字段类型 | 说明  |
|-----|-----|-----------------------|------|---|
|     |     |                       |      | 109=保证品托管机构<br>110=保证品代理人<br>111=应急方  |
| 452 | FIX | PartyRole             | N3   | 112=补充协议方<br>113=做市方<br>114=受市方<br>115=基金管理公司<br>116=举报方<br>117=违约方<br>118=Shibor 报价行<br>119=买入方/拆入方/融入方/逆回购方/固定利率支付方/参考利率 1 支付方<br>120=卖出方/拆出方/融出方/正回购方/固定利率收取方/参考利率 1 收取方 |
| 453 | FIX | NoPartyIDs            | N9   | 参与人代码个数，参与方数目。  |
| 487 | FIX | TradeReportTrans Type | N1   | 成交申报事务类别代码<br>0=New 新申报<br>1=Cancel 撤销申报<br>2=Replace 替换  |
| 522 | FIX | OwnerType             | N3   | 所有者类型代码<br>1=个人投资者发起<br>101=交易所发起<br>102=会员发起<br>103=机构投资者发起<br>104=自营交易发起<br>105=流动性服务提供商发起<br>106=结算机构发起  |
| 529 | FIX | OrderRestrictions     | C1   | 订单限定。I=程序化交易；E=算法交易。<br>最多可同时填写四种限定类型，以空格分隔。  |
| 537 | FIX | QuoteType             | N2   | 报价类型。I=Tradeable，表示可交易的报价。  |
| 541 | FIX | MaturityDate          | C8   | 到期日   |
| 544 | FIX | CashMargin            | N1   | 融资融券信用标识<br>1=Cash 普通交易<br>2=Open 融资融券开仓<br>3=Close 融资融券平仓<br>缺省值为 1  |
| 553 | FIX | Username              | C20  | 用户名（username_password 用户登录模式）   |
| 554 | FIX | Password              | C20  | 密码（username_password 用户登录模式）  |
| 555 | FIX | NoLegs                | N9   | <InstrumentLeg>的数目，成份合约个数，>= 2。   |
| 571 | FIX | TradeReportID         | C20  | 申报编号，客户成交申报编号，同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的客户成交申报编号不得重复。   |
| 572 | FIX | TradeReportRefID      | C64  | 原客户成交申报编号，撤销成交申报时使用。  |
| 581 | FIX | AccountType           | N2   | 账户类别代码<br>300=资金账户<br>301=股东账户，证券账户。<br>应符合《证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范》对资金账户和证券账户分别取值。<br>资金账户类别：<br>0=一般资金账户<br>1=衍生品资金账户<br>2=信用资金账户  |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称                | 字段类型  | 说明  |
|-----|-----|---------------------|-------|---|
|     |     |                     |       | 3=贵金属资金账户<br>证券账户类别：<br>01=沪市 A 股账户（含港股通账户）<br>02=深市 A 股账户（含港股通账户）<br>03=沪市 B 股账户   |
| 581 | FIX | AccountType         | N2    | 04=深市 B 股账户<br>05=沪市基金账户<br>06=深市基金账户<br>07=沪市其他账户<br>08=深市其他账户<br>09=全国中小企业股份转让系统账户<br>10=中国结算开放式基金账户<br>11=基金公司 TA 账户<br>12=沪市衍生品合约账户<br>13=深市衍生品合约账户<br>14=沪 A 信用证券账户<br>15=深 A 信用证券账户<br>16=柜台市场产品账户<br>17=非基金公司金融机构产品账户<br>18=上海黄金交易所交易账户<br>99=其他 |
| 600 | FIX | LegSymbol           | C32   | 合同代码<br>端交易品种名称或者端标准品种名称  |
| 602 | FIX | LegSecurityID       | C8    | 成份合约代码  |
| 603 | FIX | LegSecurityIDSource | C4    | 成份合约代码源   |
| 624 | FIX | LegSide             | C1    | 成份合约方向<br>1=权利仓（买开）<br>2=义务仓（卖开）  |
| 685 | FIX | LegOrderQty         | N17,2 | 成份合约数量  |
| 664 | FIX | ConfirmID           | C32   | 约定号<br>协议交易点击成交填写。  |
| 692 | FIX | QuotePriceType      | N2    | 报价价格类型<br>预留<br>1=百分比（Percent of par）<br>2=每股（Per Share）  |
| 693 | FIX | QuoteRespID         | C16   | 报价回复消息编号  |
| 702 | FIX | NoPositions         | N9    | 条目数量<br>当 PosTransType = 201 时必送  |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称             | 字段类型  | 说明   |
|-----|-----|------------------|-------|--|
| 703 | FIX | PosType          | C3    | 数量类型代码，类型说明。<br>当 724=0 时，SB=股份余额，SAV=股份可用余额，SQ=当前持股数，LB=昨日余额，SCT=股份可转，SR=余券数量，RB=持仓数量（含余券），SD=可申赎数量，SUF=股份解冻，SF=股份冻结；<br>当 724=10 时，SB=股份本次余额，SE=股份发生数，SAV=股份可用余额，SQ=当前持股数，LB=昨日余额，SCT=股份可转，SR=余券数量，RB=持仓数量（含余券），SD=可申赎数量，SUF=股份解冻，SF=股份冻结；<br>当 724=104 时，DTD=融券负债合计，DCB=授信额度，DCA=授信可用额度，FCA=融资可用额度。<br>当 21001=0 时，DB=融资数量，FDQ=融资股份余额；<br>当 21001=1 时，DB=应偿还融券总数量，DA=应偿还融券当前数量，SQ=最大股份数量，RQ=专户余券。   |
| 704 | FIX | LongQty          | N17,2 | 多仓数量<br>表示多仓数量（当 703=SB、SAV、SQ、LB、SCT、SR、RB、SD、SUF 时）  |
| 705 | FIX | ShortQty         | N17,2 | 申请划转数量，还券数量，空仓数量。  |
| 707 | FIX | PosAmtType       | C5    | 金额类型代码<br>当 724=0 时，BC=当前成本；SMV=个股市值；IC=盈亏；PC=浮动盈亏；LP=最新价格；PI=累计盈亏；TPC=总盈亏；CP=昨日收盘<br>当 724=9 时，FB=资金余额；FAV=资金可用余额；MV=资产总值；F=资金资产；SV=市值；DSB=融券卖出资金余额<br>当 724=10 时，FE=资金发生数；FB=资金本次余额；MA=成交金额；FJX=净佣金；FSX=佣金；FYH=印花税；FGH=过户费；FQS=清算费；FJY=交易规费；FJS=经手费；FZG=证管费；FQT=其他费；FFR=前台费用<br>当 724=104 时，AS=总资产；LA=总负债；FB=资金余额；FA=资金可用数；FAF=资金可用冻结数；DSAB=融券卖出资金余额；DSAF=融券卖出资金冻结数；GMA=担保证券市值；RM=修正资产；FDA=应付融资款；FF=融资利息；FPF=融资承诺费；FMF=融管理管理费；FDDF=融资逾期利息；FPIF=融资罚息；FPID=融资逾期本金付息；FMOD=融资逾期管理费；FMPI=融资逾期管理费罚息；FFEE=融利息费合计；FTD=融资负债合计；DFT=应付融券市值；SF=融券息费；SPF=融券承诺费；SMF=融券管理费；SODF=融券逾期费用；SPIF=融券罚息；ODR=融券权益逾期费用；PR=融券权益罚息；SPI=融券逾期本金罚息；SMOD=融券逾期管理费；SMPI=融券逾期管理费罚息；DFEE=融利息费合计；FD=可取资产；FIA=补仓金额；TPC=总盈亏。<br>当 21001=0 时，FDB=应付融资款余额；FDA=应付融资款的当前数；FEI=融资利息及费用；ICP=初始成本价格；PCP=盈亏成本价格；PC=浮动盈亏<br>当 21001=1 时，FDB=融券未偿还金额；FDA=当前融券未偿还金额；LPC=最新价；MV=最新市值；BC=融券成本；EI=融券费用；ICP=初始成本价格；PCP=盈亏成本价格；PC=浮动盈亏。 |
| 708 | FIX | PosAmt           | N19,4 | 金额   |
| 709 | FIX | PosTransType     | C3    | 过户类型代码，偿还类型代码，划转类型代码，还款/还券。<br>200=现金还款；201=现券还券；202=余券划转。   |
| 710 | FIX | PosReqID         | C1    | 请求唯一标识符  |
| 712 | FIX | PosMaintAction   | N1    | 维护动作，要执行的维护动作。<br>1=New；2=Replace；3=Cancel；4=Reverse（只取值为 1）。  |
| 715 | FIX | ClearingBusiness | C8    | 清算日期   |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称               | 字段类型  | 说明  |
|-----|-----|--------------------|-------|---|
|     |     | Date               |       |   |
| 721 | FIX | PosMaintRptID      | C1    | 用于标识本响应消息唯一标识符  |
| 724 | FIX | PosReqType         | N3    | 请求类别<br>0=查询股份<br>9=查询资金<br>103=查询资金流水<br>104=查信用资产负债<br>105=信用合约查询<br>106=担保证券查询<br>107=标的证券查询<br>108=基金交易查询<br>109=基金份额查询<br>205=可融券数量查询  |
| 727 | FIX | TotalNumPosReports | N9    | 返回报告条数  |
| 728 | FIX | PosReqResult       | N2    | 报告返回代码<br>0=成功<br>99=失败   |
| 743 | FIX | DeliveryDate       | C8    | 交收日期  |
| 753 | FIX | NoPosAmt           | N19,4 | 金额数目，偿还金额，金额组合的数目。<br>当 PosTransType = 200 时必送。   |
| 762 | FIX | SecuritySubType    | C8    | 证券子类别<br>填写组合策略编码   |
| 803 | FIX | PartySubIDType     | N3    | 参与方子代码类型代码<br>应符合 JR/T 0022-2014，取值：<br>1=公司（Firm）<br>2=个人（Person），即交易员代码（应急方交易员，补充协议方交易员）<br>3=系统（System）<br>4=应用（Application）<br>5=会员全称，合法全名（Full legal name of firm）<br>6=地址，通信地址，含街道地址、区域、邮政编码（Postal address（inclusive of street address, location, and postal code））<br>7=电话号码（Phone number）<br>8=电子信箱（Email address）<br>9=联系人姓名（Contact name）<br>10=证券托管账号，结算证券账号（Securities account number（for settlement instructions））<br>11=结算注册号（Registration number（for settlement instructions and confirmations））<br>123=证券托管机构代码<br>124=会员中文全称<br>125=会员中文简称<br>126=交易员中文名称<br>127=邮编 |
| 828 | FIX | TrdType            | N4    | 成交申报业务类别代码<br>1001=股票质押式回购初始交易<br>1002=股票质押式回购提前购回<br>1003=股票质押式回购到期购回<br>1004=股票质押式回购延期购回<br>1005=股票质押式回购终止购回<br>1006=股票质押式回购补充质押<br>1007=股票质押式回购部分解除质押  |

表 66 标签域字典（续）

| 标签  | 来源  | 字段名称              | 字段类型 | 说明  |
|-----|-----|-------------------|------|---|
|     |     |                   |      | 1008=股票质押式回购违约处置<br>1009=股票质押式回购部分购回<br>1011=约定购回初始交易<br>10012=约定购回提前购回<br>1013=约定购回到期购回<br>1014=约定购回延期购回<br>1021=质押式报价回购初始交易<br>1022=质押式报价回购提前购回<br>1031=债券质押式协议回购初始交易<br>1032=债券质押式协议回购购回交易 |
| 829 | FIX | TrdSubType        | N1   | 成交申报业务子类代码。预留，固定填 0。  |
| 856 | FIX | TradeReportType   | N1   | 成交申报类型代码<br>0=Submit 提交成交申报。  |
| 865 | FIX | EventType         | C20  | 业务代码  |
| 868 | FIX | EventText         | C256 | 业务说明  |
| 880 | FIX | TrdMatchID        | C16  | 交易编号，跨交易日唯一。<br>用于标识此交易的数字或字符，是记录交易的唯一标识符。  |
| 895 | FIX | CollAsgnReason    | N1   | 业务请求原因。3=抵押担保；4=解除抵押。   |
| 902 | FIX | CollAsgnID        | N1   | 请求唯一标识符。用于标识此数据包的数字或字符，在交易日内需要确保该字段的唯一性。  |
| 903 | FIX | CollAsgnTransType | N1   | 申请指令代码，请求指令，用于操作数据包。<br>0=New 新建<br>1=Replace 修改<br>2=Cancel 取消<br>3=Release 发布<br>4=Reverse 撤销   |
| 912 | FIX | LastRptRequested  | C1   | 表明是否是查询结果的最后一条记录<br>Y=Yes<br>N=No   |
| 916 | FIX | StartDate         | C8   | 指令开始日期。<br>当 tag59 为 0 时，指令开始日期可以不传，不传时取数据库日期。当 tag59 为 1 或 6 时，指令开始日期不传的话，为当天日期。反之以实际值传入为准。  |
| 917 | FIX | EndDate           | C8   | 指令结束日期  |
| 965 | FIX | SecurityStatus    | C1   | 基金状态代码<br>0=正常开放<br>1=认购时期<br>2=发行成功<br>3=发行失败<br>4=基金停止交易<br>5=停止申购<br>6=停止赎回<br>7=权益登记<br>8=红利发放<br>9=基金封闭<br>A=基金终止  |

表 66 标签域字典（续）

| 标签   | 来源  | 字段名称               | 字段类型 | 说明  |
|------|-----|--------------------|------|---|
| 1090 | FIX | MaxPriceLevels     | N2   | 最多成交价位数<br>0 表示不限制成交价位数，缺省值为 0。   |
| 1091 | FIX | PreTradeAnonymity  | N1   | 是否匿名<br>0=显名<br>1=匿名<br>9=不指定   |
| 1116 | FIX | NoRootPartyIDs     | N9   | 初始参与人代码个数   |
| 1117 | FIX | RootPartyID        | N9   | 初始参与人代码   |
| 1118 | FIX | RootPartyIDSource  | N9   | 初始参与人代码源  |
| 1119 | FIX | RootPartyRole      | N9   | 初始参与人代码角色   |
| 1123 | FIX | TradeHandlingInstr | N1   | 成交申报模式<br>1=Two-Party Report 成交报告<br>2=One-Party report for matching 协议配对   |
| 1125 | FIX | OrigTradeDate      | C8   | 申报日期，初始交易成交申报的申报日期  |
| 1126 | FIX | OrigTradeID        | C16  | 申报编号，初始交易交易所成交申报编号  |
| 1145 | FIX | EventTime          | C21  | 业务发生时间  |
| 1166 | FIX | QuoteMsgID         | C10  | 客户报价消息编号  |
| 1171 | FIX | PrivateQuote       | N1   | 私有报价<br>0=私有报价（Private Quote）<br>1=公开报价（Public Quote）   |
| 1180 | FIX | ApplID             | C16  | 应用标识  |
| 1328 | FIX | RejectText         | C256 | 拒绝原因说明，执行类型代码为 8 时填写。   |
| 5010 | FIX | SymbolType         | C5   | 证券类别代码，证券类型。<br>应符合 JR/T 0177.1—2020 的要求，取值：<br>01=普通股票<br>02=配股<br>03=配售股<br>04=标准（普通）投资基金/共同基金<br>05=交易型开放式指数基金（ETF）<br>06=普通债券<br>07=股票质押式回购<br>08=债券质押式回购/协议回购<br>09=约定购回<br>10=融资融券<br>11=期货<br>12=期权<br>13=权证<br>14=资产支持债券<br>15=其他 |
| 5011 | FIX | LegNo              | N18  | <InstrumentLeg>的序号，>=1  |
| 8529 | FIX | VotingProposal     | C4   | 投票议案号<br>深交所投票规则：<br>1-99 表示具体议案号<br>100 表示总议案<br>上交所投票规则：  |

表 66 标签域字典（续）

| 标签    | 来源                        | 字段名称                     | 字段类型  | 说明  |
|-------|---------------------------|--------------------------|-------|---|
|       |                           |                          |       | 1-98 表示具体议案号（X）<br>X.00 表示议案组 X 所有议案<br>X.01 表示议案组 X 下的第一个议案<br>99 表示所有议案   |
| 8530  | FIX                       | VotingSubProposal        | N2    | 投票子议案号<br>0 表示所有子议案<br>>0 其他表示具体子议案   |
| 8531  | FIX                       | VotingPreference         | N1    | 投票意向。1=同意；2=反对；3=弃权。  |
| 8906  | FIX                       | ExpirationType           | N2    | 期限类型代码<br>01=日<br>02=周<br>03=月<br>04=季<br>05=半年<br>06=全年  |
| 8907  | FIX                       | ExpirationExecInst       | N1    | 续做方式代码，到期续做方式，质押式报价回购填写。<br>1=到期自动续做；2=到期手动续做。  |
| 8908  | FIX                       | ShareProperty            | N2    | 股本类型代码，股份性质。<br>00=无限售流通股<br>01=首发后个人限售<br>03=首发后机构限售   |
| 8908  | FIX                       | ShareProperty            | N2    | 04=高管锁定股<br>05=首发前个人限售<br>06=首发前机构限售  |
| 8909  | FIX                       | BidPositionEffect        | C1    | 买开平仓标志，衍生品报价填写。O=开仓；C=平仓。   |
| 8910  | FIX                       | OfferPositionEffect      | C1    | 卖开平仓标志，衍生品报价填写。O=开仓；C=平仓。   |
| 8911  | FIX                       | ExpirationDays           | N4    | 期限，单位为天数  |
| 10067 | 自定义                       | IndexOfPresentTotalValue | N19,4 | 基金净值总额  |
| 10179 | JR/T<br>0022<br>—20<br>20 | ReportIndex              | N18   | 汇报记录号   |
| 10182 | JR/T<br>0022<br>—20<br>20 | OrigTradeReportID        | C16   | 初始交易客户成交申报编号  |
| 10183 | JR/T<br>0022<br>—20<br>20 | PledgeeType              | N2    | 质权人类型代码<br>01=当证券公司为融出方时，登记的质权人为证券公司<br>02=当证券公司集合资产管理计划为融出方时，登记的质权人为证券公司<br>03=当证券公司资产管理子公司集合资产管理计划为融出方时，登记的质权人为证券公司资产管理子公司<br>04=当证券公司定向资产管理客户为融出方时，登记的质权人为定向资产管理客户<br>05=当证券公司定向资产管理客户为融出方时，登记的质权人为证券公司<br>06=当证券公司资产管理子公司定向资产管理客户为融出方时，登记的质权人为定向资产管理客户<br>07=当证券公司资产管理子公司定向资产管理客户为融出方时，登记的质权人为证券公司资产管理子公司 |
| 10184 | JR/T<br>0022              | Contactoer               | C16   | 联系人姓名   |



表 66 标签域字典（续）

| 标签    | 来源                        | 字段名称                  | 字段类型  | 说明  |
|-------|---------------------------|-----------------------|-------|---|
|       | —20<br>20                 |                       |       |   |
| 10185 | JR/T<br>0022<br>—20<br>20 | ContactInfo           | C30   | 联系方式  |
| 10186 | JR/T<br>0022<br>—20<br>20 | NoMarginItems         | N9    | 保证金条目个数   |
| 10187 | JR/T<br>0022<br>—20<br>20 | MarginItem            | C1    | 保证金条目类别代码<br>1=保证金可用余额，2=保证金总金额。  |
| 10188 | JR/T<br>0022<br>—20<br>20 | MarginAmount          | N17,2 | 保证金金额   |
| 10190 | 自定义                       | InvestmentType        | C2    | 资金用途类型代码<br>01=生产经营<br>02=补充流动资金<br>03=股权性投资<br>04=债权类投资<br>05=不动产类投资<br>06=二级市场证券交易<br>07=偿还债务<br>08=个人消费<br>99=其他用途   |
| 10191 | 自定义                       | SeniorExecutiveType   | C2    | 客户高管类型代码<br>01=非董监高<br>02=在任董监高（含任期内离职）<br>03=在任董监高的一致行动人<br>04=董监高离任不满 6 个月<br>05=董监高离任已满 6 个月但不满 12 个月<br>06=董监高离任已满 12 个月但不满 18 个月<br>07=董监高离任已满 18 个月<br>08=不确定类型 |
| 10200 | 自定义                       | QuoteRequestTransType | N2    | 询价请求事务类型<br>0=New 新订单<br>1=Cancel 撤销  |
| 10216 | 自定义                       | SettlPeriod           | N2    | 结算周期，预留。<br>0=T+0<br>1=T+1<br>2=T+2<br>3=T+3  |
| 10273 | 自定义                       | RedemptionDate        | C8    | 首次偿付日   |
| 10275 | JR/T<br>0022<br>—20<br>20 | RedemptionIndicator   | C1    | 赎回标识<br>Y=Yes, N=No。  |
| 10401 | 自定义                       | FeesInfoType          | N1    | 计费方式代码<br>0=逐笔<br>1=季度<br>2=年度  |
| 11010 | 自定义                       | ContractID            | C32   | 系统合同编号，唯一。  |

表 66 标签域字典（续）

| 标签    | 来源  | 字段名称              | 字段类型 | 说明  |
|-------|-----|-------------------|------|---|
|       | 自定义 |                   |      |   |
|       | 自定义 | ClContractID      | C32  | 客户合同编号，第三方系统合同编号，唯一。  |
| 11012 | 自定义 | RelatedContractID | C32  | 原合约编号，初始合约编号，关联系统合同编号。<br>初始交易为空，补充交易不能为空。  |
| 11013 | 自定义 | CounterParty      | C20  | 融出方名称，证券交易的对手方。   |
| 11014 | 自定义 | CounterPartyType  | C2   | 融出方类型代码<br>01=证券公司（自有资金出资）  |
| 11015 | 自定义 | BackType          | N2   | 合约了结类型代码：<br>01=提前购回<br>02=到期购回<br>03=延期购回<br>04=终止购回<br>09=违约处置了结                      |
| 11016 | 自定义 | ContractType      | N1   | 融资合同类型代码<br>1=融资申购<br>2=融资可取<br>3=融资可用  |
| 12001 | 自定义 | AuthCode          | C16  | 授权码。系统接入登记时分配。  |
| 12002 | 自定义 | FeatureCode       | C20  | 机器特征码。通常使用终端 IP 地址和 MAC 地址。   |
| 12003 | 自定义 | AuthInfo          | C32  | 认证密码。系统接入时身份认证。   |
| 12004 | 自定义 | ProductCode       | C16  | 产品识别码。系统接入登记时分配。  |
| 12005 | 自定义 | DeveloperCode     | C16  | 开发商识别码。系统接入登记时分配。   |
| 12006 | 自定义 | VersionInfo       | C16  | 软件版本信息。系统可以根据实际软件版本信息不做校验。  |
| 13000 | 自定义 | BusinClass        | N2   | 业务类别代码。01=场内，02=场外。<br>交易所业务，期权业务，场内场外业务标志。   |
| 13001 | 自定义 | BusinType         | C1   | 委托方向代码，基金业务类型代码。<br>1=申购<br>2=赎回<br>3=转托管<br>4=分红方式设置<br>5=转换<br>6=合并<br>7=分拆<br>R=行权认购 |
| 13001 | 自定义 | BusinType         | C1   | S=行权认沽<br>V=买入开仓<br>W=卖出平仓<br>X=卖出开仓<br>Y=买入平仓<br>(=保证品交存)<br>)=保证品提取                   |
| 13106 | 自定义 | BonusType         | N1   | 基金分红方式代码，分红模式只用于分红方式设置。<br>01=红利再投资<br>0101=利得现金增值再投资<br>0102=增值现金利得再投资                 |

表 66 标签域字典（续）

| 标签    | 来源  | 字段名称                  | 字段类型  | 说明  |
|-------|-----|-----------------------|-------|---|
|       |     |                       |       | 0103=部分再投资<br>02=现金分红<br>03=赠送  |
| 13301 | 自定义 | InstructionLevel      | N1    | 指令操作级别<br>0=无<br>1=快速<br>2=一般<br>3=慢速   |
| 13302 | 自定义 | DirectInsteadOperator | C16   | 代下达人编号  |
| 13303 | 自定义 | OperatorName          | C16   | 分发时反馈交易员姓名，在任务属性上勾选要求返回交易员选项后才会返回，不勾选该字段为空。   |
| 14000 | 自定义 | InvestType            | N1    | 投资类型代码<br>1=可交易<br>2=持有到期<br>3=可供出售<br>不传投资类型会根据系统数决定取组合的投资类型或缺省为 1=可交易   |
| 14002 | 自定义 | DealPrice             | N19,4 | 成交价格，对于回购业务该字段是 100，其他业务同 tag31 的字段值，返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14003 | 自定义 | ReportSeat            | C16   | 席位代码，申报席位，转入席位只用于转托管，返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14004 | 自定义 | TodayDealAmount       | N17,2 | 当日累计成交数量，返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14005 | 自定义 | TodayDealBalance      | N19,4 | 当日累计成交金额，返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14006 | 自定义 | ReportSerialNo        | C16   | 证券委托编号，申报编号，返回指令状态时该字段不返回。  |
| 14007 | 自定义 | BusinessTime          | C21   | 委托时间，成交时间，申报时间，返回委托数据时该字段为委托时间，返回指令状态时该字段不返回。   |
| 14008 | 自定义 | InstructionNo         | C16   | 内部指令序号  |
| 14058 | 自定义 | FailReason            | C256  | 失败原因  |
| 15001 | 自定义 | OperWay               | C4    | 渠道类别代码<br>01=书面委托<br>02=电话委托<br>03=互联网委托<br>0301=网页委托<br>0302=交易软件<br>04=柜台委托<br>0401=银行柜台<br>0402=第三方柜台<br>0403=集中柜面<br>05=自助终端<br>0501=磁卡（自助终端）<br>0502=驻留委托<br>0503=银行 ATM<br>0504=银行 POS<br>99=其他 |

表 66 标签域字典（续）

| 标签    | 来源  | 字段名称            | 字段类型 | 说明  |
|-------|-----|-----------------|------|---|
| 15007 | 自定义 | JudgeAvailable  | N1   | 判断可用<br>0=不判<br>1=判   |
| 15009 | 自定义 | JudgeRisk       | N1   | 判断风控<br>0=不判<br>1=判   |
| 15997 | 自定义 | InstructionType | N1   | 指令类型代码：<br>1=个股；2=组合；3=个股批量；4=组合批量。<br>个股：以多条个股形式下达。<br>个股批量：同一个证券不同的组合。<br>组合：重复组里同一个组合多个证券。<br>组合批量：重复组里多个组合多个证券。<br>缺省 1=个股。 |
| 15999 | 自定义 | ProceType       | N2   | 处理类型代码：<br>2=状态反馈（指令状态）<br>3=成交反馈<br>10=委托数据反馈  |
| 21001 | 自定义 | MFTType         | N1   | 融资融券方向代码。<br>扩展字段：1 融券。   |
| 21003 | 自定义 | CompactStatus   | C4   | 合约状态代码<br>01=正常<br>02=延期<br>03=提前了结<br>04=到期了结<br>05=逾期已了结<br>06=逾期未了结<br>07=违约处置中  |
| 22000 | 自定义 | NoUAccount      | C16  | 扩展账号  |

### 参 考 文 献

- [1] 《深圳证券交易所STEP交易数据接口规范》V 1.21. 深圳证券交易所.2021年7月.
  - [2] 《轻量级STEP会话层接口规范》V1.00.本文件由上海证券交易所和深圳证券交易所联合发布.2015年8月28日.
  - [3] 《证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范》V1.8.1.中国证券投资者保护基金有限责任公司.2016年9月29日.
  - [4] FIX5.0（金融信息交换协议5.0版）. FIX Protocol Ltd (FPL) .2006年10月.
-