

深圳证券交易所工程技术文档

**工程技术标准**

深圳证券交易所债券现券交易业务之

券商技术系统变更指南

**（Ver1.02）**

**深圳证券交易所**

**中国结算深圳分公司**

**二○二一年八月**

关于本文档

|  |  |
| --- | --- |
| 文档名称 | 深圳证券交易所债券现券交易业务之券商技术系统变更指南 |
| 说明 |  |
| 修订历史 |
| 日期 | 版本 | 操作 | 说明 |
| 2021-04-30 | 1.00 | 创建文档 |  |
| 2021-06-03 | 1.01 | 修改文件 | 询价请求STEP接口RootParties使用子组件RootSubParties |
| 2021-08-10 | 1.02 | 修改文件 | （本文档中橙色修订部分）1、增加变更范围汇总说明；2、增加债券计价方式调整说明；3、协商成交启用交易接口“约定号”（ConfirmID）字段；4、点击成交报价委托的“备注”（Memo）字段必须为全空格；5、补充关于交易网关、行情网关升级的说明。 |

**目录**

[一、 说明 1](#_Toc78965147)

[二、 变更范围汇总 1](#_Toc78965148)

[三、 债券现券交易业务简介 2](#_Toc78965149)

[四、 技术实现概况 4](#_Toc78965150)

[4.1 新增债券现券交易业务 4](#_Toc78965151)

[4.2 债券相关业务迁移到固定收益交易平台 5](#_Toc78965152)

[4.3 债券相关成交量统计指标调整 6](#_Toc78965153)

[4.4 债券计价方式调整 7](#_Toc78965154)

[五、 交易参考信息 8](#_Toc78965155)

[六、 交易接口 9](#_Toc78965156)

[6.1 匹配成交 11](#_Toc78965157)

[6.1 协商成交 15](#_Toc78965158)

[6.2 点击成交 23](#_Toc78965159)

[6.3 询价成交 35](#_Toc78965160)

[七、 行情接口 53](#_Toc78965161)

[八、 清算和交收 54](#_Toc78965162)

[8.1 债券现券交易的结算处理 54](#_Toc78965163)

[8.2 债券相关业务迁移到固定收益交易平台的结算处理 59](#_Toc78965164)

[8.3 资产支持证券（证券类别为“1Z”）拆分为三类证券子类 60](#_Toc78965165)

[8.4 第3批预清算数据内容调整 61](#_Toc78965166)

[九、 开展债券现券交易的券商系统注意事项 61](#_Toc78965167)

[9.1 委托相关说明 61](#_Toc78965168)

[9.2 关于客户委托服务渠道 61](#_Toc78965169)

[9.3 关于券商柜台系统 61](#_Toc78965170)

[9.4 关于STEP交易接口通信版本号修改 62](#_Toc78965171)

[十、 联系方式 62](#_Toc78965172)

**深圳证券交易所债券现券交易业务之券商技术系统**

**变更指南**

# 说明

为了会员和其他交易参与人在深圳证券交易所（以下简称“本所”）交易系统上更好地开展债券现券交易业务，本所会同中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“中国结算深圳分公司”）专门编制和发布本指南，供相关交易参与人及其IT提供商参考。

本所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时尽量减少系统改造对会员和其他交易参与人带来的影响。

特别提示：**如果业务规则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。**

# 变更范围汇总

**1、新增债券现券交易业务**

固定收益交易平台新增债券现券交易业务，具体实施细节参见4.1节。

**2、部分业务迁移至固定收益交易平台**

债券通用质押式回购、债券分销、债券通用质押式回购质押解押、债券质押式三方回购交易及债券质押式三方回购出入库业务从原平台迁移至固定收益交易平台，具体实施细节参见4.2节。

**3、债券全价改净价**

部分债券计价方式由全价改为净价，对于存量债券，将进行一次性切换，具体上线时间以后续业务及技术通知为准，具体实施细节参见4.4节。

**4、部分债券指数行情发布时间调整**

债券现券交易业务交易时间延长至15:30之后，部分债券指数的行情发布时间延长至15:30，具体包括：399301（深信用债）、399302（深公司债）、399298（深信中高）、399299（深信中低）、399481（企债指数）、399290（深转交债）。

**5、交易网关升级**

使用BINARY协议的用户，交易网关和交易接口通信版本号均无须升级。

使用STEP协议开展债券现券交易业务的用户，应将交易网关升级到20210730版本(待发布)，STEP交易接口通信版本号需使用STEP1.20\_SZ\_1.11。

使用STEP协议但未开展债券现券交易业务的用户，交易网关和STEP交易接口通信版本号均无须升级。

**6、行情网关升级**

使用BINARY协议的用户，行情网关和行情接口通信版本号均无须升级。

使用STEP协议开展债券现券交易业务的用户，应将STEP行情接口通信版本号升级为STEP1.20\_SZ\_1.09，行情网关无须升级。

使用STEP协议但未开展债券现券交易业务的用户， 行情网关和STEP行情接口通信版本号均无须升级。

# 债券现券交易业务简介

债券现券交易支持五种交易方式：匹配成交、协商成交、点击成交、询价成交、竞买成交。通用质押式回购仅支持匹配成交。

**1、匹配成交**

匹配成交是指交易系统按价格优先、时间优先的原则和本规则相关规定，对债券交易申报自动匹配成交的交易方式。匹配成交采用集合匹配和连续匹配两种方式。集合匹配是对规定时间内接受的交易申报一次性集中匹配的成交方式。连续匹配是对接受的交易申报逐笔连续匹配的成交方式。

每个交易日的9:15至9:25为开盘集合匹配时间，9:30至11:30、13:00至15:30为连续匹配时间。

**2、协商成交**

协商成交是指债券投资者之间通过协商等方式达成债券交易意向，并向交易系统申报，经交易系统确认成交的交易方式。交易一方将协商一致的交易要素通过交易系统发送给交易对手方，经交易对手方确认后，由交易系统确认成交。

协商成交的交易时间为：每个交易日的9:00至11:30、13:00至15:30。

**3、点击成交**

点击成交是指报价方发出报价，受价方点击该报价后由交易系统确认成交或者依据本规则相关规定通过交易系统自动匹配成交的交易方式。采用点击成交方式的，报价的发送范围可以是全市场，也可以是报价方自行选定的部分债券投资者。

点击成交的交易时间为：每个交易日的9:00至11:30、13:00至15:30。

**4、询价成交**

询价成交是指债券投资者作为询价方向做市商或者其他债券交易参与人发送询价请求，并选择一个或者多个询价回复确认成交的交易方式。

询价方可以向做市商或者其他债券交易参与人发送询价请求，被询价方根据询价请求要素，按照询价请求交易方向的相反方向，对询价请求进行回复。询价方选择一笔或多笔询价回复并确认后，交易系统对这些委托进行成交。

询价成交的交易时间为：每个交易日的9:00至11:30、13:00至15:30。

**5、竞买成交**

竞买成交是指卖方在限定的时间内按照确定的竞买成交规则，将债券出售给最优应价的单个或者多个应价方的交易方式。

竞买成交可以采用单一主体中标、多主体中标等方式。采用单一主体中标方式的，由最优出价的应价方按其应价价格、该笔竞买的全部申报数量成交。多主体中标方式包括单一价格中标、多重价格中标等方式。采用单一价格中标方式的，所有中标的应价申报都以边际价格成交。采用多重价格中标方式的，所有中标的应价申报都以其各自的应价价格成交。

每个交易日的9:00至10:00为卖方提交竞买发起申报时间，10:00至11:30为应价方提交应价申报时间。

# 技术实现概况

## 新增债券现券交易业务

在固定收益交易平台新增债券现券交易业务（业务类别‘41’），债券现券交易业务为除可转债及定向可转债之外的其他债券、资产支持证券等产品提供交易服务，具体如下表所示。债券现券交易业务对于除匹配成交之外的其他交易方式，都使用债券交易账户体系进行交易（债券交易账户体系相关内容请参照《深圳证券交易所债券交易账户信息报备业务指南》，深圳证券交易所官网（<http://www.szse.cn>）内搜索“深圳证券交易所债券交易账户信息报备业务指南”即可）。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **类别名称** | **类别代码** | **是否适用债券现券交易业务** |
| 1 | 国债（含地方债） | 5 | 是 |
| 2 | 企业债 | 6 | 是 |
| 3 | 公司债 | 7 | 是 |
| **4** | **可转债** | **8** | **否** |
| 5 | 私募债 | 9 | 是 |
| 6 | 可交换私募债 | 10 | 是 |
| 7 | 证券公司次级债 | 11 | 是 |
| 8 | 资产支持证券 | 13 | 是 |
| 9 | 证券公司短期债 | 34 | 是 |
| 10 | 可交换公司债 | 35 | 是 |
| **11** | **定向可转债** | **39** | **否** |

现货集中竞价交易业务（业务类别‘01’）、 协议交易业务（业务类别‘05’）、盘后定价大宗交易业务（业务类别‘06’） 将不再为上表中除可转债及定向可转债之外相关类别证券提供交易服务。

新债券现券交易业务的业务类别为‘41’。

新债券现券交易业务的行情通过以下频道发布：

* 107x：债券交易快照行情
* 207x：匹配交易逐笔行情
* 4011：报价及大额逐笔等行情

可转债的现货集中竞价交易快照、逐笔行情仍通过现有103x、203x债券行情频道发布。

## 债券相关业务迁移到固定收益交易平台

以下业务迁移到固定收益交易平台：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **业务** | **类别代码** | **原所属平台** | **备注** |
| 债券通用质押式回购 | 02 | 综合金融服务平台 | 1. 行情发布频道仍为106x、206x；
2. 行情快照Binary消息类型改为：300211；
3. 交易参考信息从cashauctionparams改为bondrepoparams文件发布；
4. 业务名称变更为：债券通用质押式回购
 |
| 债券分销 | 03 | 现货集中竞价交易平台 | 1. 行情发布频道改为3021

2、行情快照Binary消息类型改为：300211 |
| 债券通用质押式回购质押解押 | 19 | 非交易处理平台 | 更名为：债券通用质押式回购质押解押 |
| 债券质押式三方回购交易 | 32 | 综合金融服务平台 |  |
| 债券质押式三方回购出入库 | 33 | 综合金融服务平台 |  |

## 债券相关成交量统计指标调整

对债券相关的成交量统计指标进行如下调整：

1、停止发布证券代码为395021（可转债）、395022（企业债）、395024（公司债）、395031（国债）成交量统计指标。

2、增加发布395033成交量统计指标，证券简称为“债券现货”，英文简称“CASH BOND TRANSACTION”，其统计口径为除ABS、债券回购之外的债券在各种交易方式上的成交量。

3、增加发布395034成交量统计指标，证券简称和英文简称为“ABS”,其统计口径为资产支持证券在各种交易方式上的成交量。

4、395032（债券回购）、395033（债券现货）、395034（ABS）债券成交量统计指标计算发布时间为9:00-11:30,13:00-15:30。

调整后，成交量统计指标总体定义如下表所示：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **证券代码** | **证券简称** | **英文简称** | **统计口径** |
| 1 | 395001 | 主板Ａ股 | MB A SHARES | 主板A股竞价交易成交量 |
| 2 | 395002 | 主板Ｂ股 | MB B SHARES | 主板B股竞价交易成交量 |
| 3 | 395004 | 创业板 | CHINEXT SHARES | 创业板股票竞价交易成交量 |
| 4 | 395005 | 主板D R | MB DEPOSITORY RECEIPTS | 主板存托凭证竞价交易成交量 |
| 5 | 395006 | 创业板DR | CHINEXT DEPOSITORY RECEIPTS | 创业板存托凭证竞价交易成交量 |
| 6 | 395011 | 封闭基金 | CLOSE-END FUNDS | 封闭式基金竞价交易成交量 |
| 7 | 395012 | LOFs | OPEN-END FUNDS | LOF竞价交易成交量 |
| 8 | 395013 | ETFs | EXCHANGE-TRADED FUND | ETF竞价交易成交量 |
| 9 | 395015 | REITS | REITS | 基础设施基金竞价交易成交量 |
| 10\* | 395032 | 债券回购 | BOND REPURCHASES | 债券通用质押式回购匹配成交方式成交量 |
| 11\* | 395033 | 债券现货 | CASH BOND TRANSACTION | 除ABS、债券回购之外的债券在各种交易方式上的成交量 |
| 12\* | 395034 | ABS | ABS | 资产支持证券在各种交易方式上的成交量 |
| 13 | 395041 | 股票权证 | STOCK WARRANTS | 股票权证竞价交易成交量 |
| 14 | 395099 | 总 成 交 | MARKET TURNOVER | 主板A股、主板B股、创业板股票、主板存托凭证和创业板存托凭证竞价交易成交量 |

## 债券计价方式调整

部分债券计价方式由全价改为净价如下表所示，深交所每日下发的证券信息（securities）文件将发布每只债券的计价方式（PricingMethod）。对于存量债券，当计价方式调整时，深交所将调整债券的收盘价。假定T日为计价方式调整日，深交所T-1日晚间下发的证券信息文件(pre\_securities)及T日开市前早间下发的证券信息文件（securities）中昨日收盘价为调整之后的收盘价。

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **类别名称** | **类别代码** | **调整前计价方式** | **调整后计价方式** |
| 1 | 国债（含地方债） | 5 | 净价 | 净价 |
| 2 | 企业债 | 6 | 净价 | 净价 |
| 3 | 公司债 | 7 | 净价 | 净价 |
| **4** | **可转债** | **8** | **全价** | **全价** |
| 5 | 私募债 | 9 | 全价 | 净价 |
| 6 | 可交换私募债 | 10 | 全价 | 净价 |
| 7 | 证券公司次级债 | 11 | 全价 | 净价 |
| 8 | 资产支持证券 | 13 | 全价 | 净价（优先级、次优级）全价（次级） |
| 9 | 证券公司短期债 | 34 | 净价（公开发行）全价（非公开发行） | 净价 |
| 10 | 可交换公司债 | 35 | 全价 | 净价 |
| **11** | **定向可转债** | **39** | **全价** | **全价** |

注：对于处于特定债券转让状态的债券或资产支持证券，其计价方式仍为全价。

# 交易参考信息

证券信息（securities）文件的债券特有字段BondParams新增“计价方式”字段，资产支持证券特有字段ReitsParams新增“计价方式” 、“预期收益率”、“每张资产支持证券应计利息”、“发行起息日或本次付息起息日”四个字段。

新增债券现券交易业务参考信息（bondtradingparams）文件用于发布债券现券交易业务相关交易参数信息。

新增债券通用质押式回购业务参考信息（bondrepoparams）文件用于发布债券通用质押式回购业务相关交易参数信息。

各债券及资产支持证券通过交易参考信息发布情况如下表所示：

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **类别名称** | **类别代码** | **现货集中竞价交易业务参考信息** | **盘后定价大宗交易业务参考信息** | **协议交易业务参考信息** | **债券现券交易业务参考信息** |
| 1 | 国债（含地方债） | 5 |  |  |  | √ |
| 2 | 企业债 | 6 |  |  |  | √ |
| 3 | 公司债 | 7 |  |  |  | √ |
| **4** | **可转债** | **8** | **√** | **√** | **√** |  |
| 5 | 私募债 | 9 |  |  |  | √ |
| 6 | 可交换私募债 | 10 |  |  |  | √ |
| 7 | 证券公司次级债 | 11 |  |  |  | √ |
| 8 | 资产支持证券 | 13 |  |  |  | √ |
| 9 | 证券公司短期债 | 34 |  |  |  | √ |
| 10 | 可交换公司债 | 35 |  |  |  | √ |
| **11** | **定向可转债** | **39** |  |  | **√** |  |

上述内容详见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》。

# 交易接口

本次变更支持债券现券交易业务的匹配成交、协商成交、点击成交以及询价成交交易方式，暂不支持竞买成交交易方式，各种交易方式的申报方式说明如下表所示，详细内容请参见《深圳证券交易所STEP交易数据接口规范》、《深圳证券交易所Binary交易数据接口规范》。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **交易方式** | **委托申报类型** | **申报消息类型（MsgType）** | **应用标识ApplID** |
| **STEP** | **Binary** |
| 匹配成交 | 新订单 | D | 104101 | 410 |
| 协商成交 | 成交申报 | AE | 104103 | 411 |
| 点击成交 | 报价 | S | 104105 | 412 |
| 报价回复 | AJ | 104110 | 413 |
| 询价成交 | 询价请求 | AR | 104117 | 414 |
| 报价 | S | 104105 | 415 |
| 报价回复 | AJ | 104110 | 416 |

对于点击成交方式，目前报价范围仅支持全市场，暂不支持全额成交设置、分次显示与成交设置以及修改报价和数量。点击成交的委托回报消息处理流程请参考《深圳证券交易所Binary交易数据接口规范》“点击成交报价处理消息流图”一节或《深圳证券交易所STEP交易数据接口规范》“点击成交报价处理消息流图”一节。

对于询价成交方式，本次变更暂不支持意向申报。询价成交的委托回报消息处理流程请参考《深圳证券交易所Binary交易数据接口规范》“询价处理消息流图”一节或《深圳证券交易所STEP交易数据接口规范》“询价处理消息流图”一节。

对于协商成交方式，本次变更暂不支持合并申报。协商成交采用成交请求申报模式，消息处理流程请参考《深圳证券交易所Binary交易数据接口规范》“成交请求申报模式（one party report for pass through）”一节或《深圳证券交易所STEP交易数据接口规范》“成交请求申报模式（one party report for pass through）”一节。

对于协商成交、点击成交、询价成交方式，委托报文中结算方式(SettlType)、结算周期（SettlPeriod）字段必须填写，如果证券支持匹配成交，结算方式取值固定为103（净额结算），否则取值为104（逐笔全额）。若结算方式为103，则结算周期取值固定为1，否则填0。证券是否支持匹配成交的信息可从债券现券交易业务参考信息（bondtradingparams）文件中获取，文件定义详见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》。

对于点击成交、询价成交使用的报价及报价回复报文，以及询价成交使用的询价请求，这些报文都定义了几个ID，其中一个ID为客户订单编号，另一个ID为业务使用ID（如撤单使用）。同一个交易单元申报的同一个业务下的客户订单编号必须唯一，否则为重单（拒绝原因代码为：20099）。同一个交易单元申报的同一个业务下的业务层ID必须唯一，否则被交易系统拒绝（拒绝原因代码为：20147），各申报业务层的ID包括：QuoteReqID、QuoteID及QuoteRespID。各报文使用规则如下表所示：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  **各类ID****委托** | **QuoteReqID** | **QuoteID** | **QuoteRespID** | **QuoteMsgID** | **ClOrdID** |
| 询价申报（10xx17） | 询价ID |  |  |  | 客户订单编号 |
| 报价申报（10xx05） |  | 报价ID |  | 客户订单编号 |  |
| 报价回复申报（10xx10） |  | 报价ID | 报价回复ID |  | 客户订单编号 |

注：

1. 对于询价撤销申报，QuoteReqID必须为原询价请求申报的QuoteReID；
2. 对于报价撤销申报，QuoteID必须为原报价申报的QuoteID；
3. 对于报价回复申报，当为询价成交时，QuoteID填写的为接受报价的转发报价的QuoteID；当为点击成交时，QuoteID填写的为逐笔行情中的QuoteID。

## 匹配成交

### Binary接口委托申报

**表5-1 Binary接口委托消息定义**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **域名** | **字段描述** | **字段取值** |
| Standard Header | 消息头MsgType=104101 |  |
| ApplID | 应用标识 | 410 |
| SubmittingPBUID | 申报交易单元 | 申报交易单元 |
| SecurityID | 证券代码 | 证券代码 |
| SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 |
| OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| ClearingFirm | 结算机构代码 | 结算机构代码 |
| TransactTime | 委托时间 | 委托申报时间 |
| UserInfo | 用户私有信息 | 用户私有信息 |
| ClOrdID | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| AccountID | 证券账户 | 证券账户 |
| BranchID | 营业部代码 | 营业部代码 |
| OrderRestrictions | 订单限定 | 空格 |
| Side | 买卖方向 | 1或2 |
| OrdType | 订单类别1表示市价2表示限价U本方最优 | 2 |
| OrderQty | 订单数量 | 委托数量 |
| Price | 价格 | 委托价格 |
| StopPx | 止损价 | 0 |
| MinQty | 最低成交数量 | 0 |
| MaxPriceLevels | 最多成交价位数0表示不限制成交价位数 | 0 |
| TimeInForce | 订单有效时间类型 | 0 |
| CashMargin | 信用标识1=Cash，普通交易2=Open，融资融券开仓3=Close，融资融券平仓 | 1、2或3 |

说明：

（1）债券现券交易暂不支持市价委托，OrdType必须填2，MinQty必须填0，MaxPriceLevels必须填0，TimeInForce必须填0。

### STEP接口委托申报

**表5-2 STEP接口委托消息定义**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **字段描述** | **字段取值** |
|  | MessageHeader | MsgType=D |  |
| 1180 | ApplID | 应用标识 | 410 |
| 11 | ClOrdID | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| 40 | OrdType | 订单类型1=市价2=限价U=本方最优 | 2 |
| 54 | Side | 买卖方向 | 1或2 |
| 522 | OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| 529 | OrderRestrictions | 订单限定 | 不填 |
| 60 | TransactTime | 订单发起时间 | 委托申报时间 |
| 组件<Instrument> |  |  |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | 证券代码 |
| 22 | SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 |
| 组件结束 |
| 组件<Parties> |  |  |
| 453 | NoPartyIDs | 参与人代码个数  | 3 |
| → | 448 | PartyID | 参与人代码 | 申报交易单元 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | C：通用市场参与者标识 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 1：交易单元 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 证券账户 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | 5：中国投资者编号 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 5：投资者证券账户 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 投资者所在营业部识别码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D：自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 4001：营业部代码 |
| 组件结束 |
| 组件<OrderQtyData> |  |  |
| 152 | CashOrderQty | 订单金额 | 不填 |
| 38 | OrderQty | 订单数量 | 委托数量 |
| 组件结束 |
| 44 | Price | 价格  | 委托价格 |
| 99 | StopPx | 止损价，预留 | 不填 |
| 59 | TimeInForce | 有效时期类型0=当日有效3=即时成交或取消9=港股通竞价限价盘缺省值为0 | 0 |
| 1090 | MaxPriceLevels | 最多成交价位数 | 不填 |
| 110 | MinQty | 最低成交数量缺省值为0 | 不填 |
| 544 | CashMargin | 融资融券信用标识 | 1、2或3 |

注：参见Binary接口委托申报备注说明。

## 协商成交

### Binary接口委托申报

**表5-3 Binary接口委托消息定义**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **域名** | **字段描述** | **发起方成交请求字段取值** | **接收方成交请求字段取值** |
| Standard Header | 消息头MsgType=104103 |  |  |
| ApplID | 应用标识 | 411 | 411 |
| SubmittingPBUID | 申报交易单元，需与本方交易单元一致 | 申报交易单元 | 申报交易单元 |
| SecurityID | 证券代码 | 证券代码 | 证券代码 |
| SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 | 102 |
| OwnerType | 订单所有者类型1=个人投资者发起102=会员发起103=机构投资者发起104=自营交易发起 | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| ClearingFirm | 结算机构代码 | 结算机构代码 | 结算机构代码 |
| TransactTime | 成交申报发起时间 | 委托申报时间 | 委托申报时间 |
| UserInfo | 用户私有信息 | 用户私有信息 | 用户私有信息 |
| TradeReportID | 客户成交申报编号 | 客户成交申报编号 | 客户成交申报编号 |
| TradeReportType | 成交申报类型0=提交成交申报2=接受成交申报3=拒绝成交申报 | 0 | 2或3 |
| TradeReportTransType | 成交申报事务类别0=New1=Cancel2=Replace | 若为普通申报，填0；若为主动撤单，填1。 | 2 |
| TradeHandlingInstr | 成交申报模式1=Two-Party Report，成交报告2=One-Party Report For Matching，协议配对3=One-Party Report for Pass Through，成交请求 | 3 | 3 |
| TradeReportRefID | 原客户成交申报编号撤销成交申报时使用对于成交请求模式，接收方填写转发成交申报的客户成交申报编号 | 若为普通申报，填全空格，若为主动撤单，填被撤委托的客户成交申报编号 | 填转发成交申报的客户成交申报编号 |
| LastPx | 价格 | 委托价格 | 委托价格 |
| LastQty | 数量 | 委托数量 | 委托数量 |
| TrdType | 成交申报业务类别 | 0 | 0 |
| TrdSubType | 成交申报业务子类别预留，固定填0 | 0 | 0 |
| ConfirmID | 约定号 | 若接收方交易主体类型为03/04，则不能为全空格 | 若接收方交易主体类型为03/04，则不能为全空格 |
| Side | 本方参与人买卖方向 | 1或2 | 2或1 |
| PBUID | 本方交易单元 | 发起方方交易单元 | 接收方交易单元 |
| AccountID | 本方证券账户 | 发起方证券账户 | 接收方证券账户 |
| BranchID | 本方营业部代码 | 发起方营业部代码 | 接收方营业部代码 |
| CounterpartyPBUID | 对手方交易单元 | 全空格 | 全空格 |
| CounterpartyAccountID | 对手方证券账户 | 全空格 | 全空格 |
| CounterpartyBranchID | 对手方营业部代码 | 全空格 | 全空格 |
| SubmittingMemberID | 申报方交易商代码 | 全空格 | 全空格 |
| SubmittingInvestorType | 申报方交易主体类型01=自营02=资管03=机构经纪04=个人经纪 | 全空格 | 全空格 |
| SubmittingInvestorID | 申报方交易主体代码 | 全空格 | 全空格 |
| SubmittingInvestorName | 申报方客户名称 | 全空格 | 全空格 |
| SubmittingTraderCode | 申报方交易员代码 | 全空格 | 全空格 |
| MemberID | 本方交易商代码 | 发起方交易商代码 | 接收方交易商代码 |
| InvestorType | 本方交易主体类型01=自营02=资管03=机构经纪04=个人经纪 | 发起方交易主体类型 | 接收方交易主体类型 |
| InvestorID | 本方交易主体代码 | 发起方交易主体代码 | 接收方交易主体代码 |
| InvestorName | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，需填写本方客户名称 | 发起方客户名称 | 当成交申报类型为2=接受成交申报时，需填写接收方客户名称；当成交申报类型为3=拒绝成交申报时填全空格 |
| TraderCode | 本方交易员代码 | 发起方交易员代码 | 接收方交易员代码 |
| CounterpartyMemberID | 对手方交易商代码 | 接收方交易商代码 | 填转发成交申报的本方交易商代码 |
| CounterpartyInvestorType | 对手方交易主体类型01=自营02=资管03=机构经纪04=个人经纪 | 接收方交易主体类型 | 填转发成交申报的本方交易主体类型 |
| CounterpartyInvestorID | 对手方交易主体代码 | 接收方交易主体代码 | 填转发成交申报的本方交易主体代码 |
| CounterpartyInvestorName | 对手方客户名称 | 全空格 | 填转发成交申报的本方客户名称 |
| CounterpartyTraderCode | 对手方交易员代码 | 接收方交易员代码 | 填转发成交申报的本方交易员代码 |
| SettlType | 结算方式，预留103=多边净额104=逐笔全额 | 103或104 | 103或104 |
| SettlPeriod | 结算周期，预留 | 0或1 | 0或1 |
| LastParPx | 成交价格二，预留 | 0 | 0 |
| CashMargin | 信用标识 | 1 | 1 |
| Memo | 备注 | 备注 | 备注 |

说明：

（1）SettlType、SettlPeriod虽然为预留字段，但是也要按照要求填写，否则会被交易系统拒绝。对于SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为103，否则为104。对于SettlPeriod，若SettlType为103，则取值为1，否则为0。

（2）当接收方拒绝发起方的成交请求时（TradeReportType为3），本方证券账户(AccountID)字段为选填字段。

（3）当本方交易主体类型（InvestorType）为01（自营）或02（资管）时，委托中的本方证券账户（AccountID）字段，需填为本方交易商下本方交易主体已报备的证券账户。

（4）暂不支持融资融券交易，信用标识字段固定填1。

（5）约定号（ConfirmID）用于券商系统筛选经纪客户，当发起方委托中对手方交易主体类型（CounterpartyInvestorType）为03（机构经纪）或04（个人经纪）时，必须填写约定号字段，否则委托会被交易系统拒绝。接收方拒绝或接受发起方委托时，若接收方委托本方交易主体类型（InvestorType）为03（机构经纪）或04（个人经纪）时，必须填写约定号字段。

（6）Memo（备注）字段可由交易双方自行约定填写与本次交易相关的内容。

（7）发起方、接收方的委托需满足以下匹配条件，才能成交：

|  |  |
| --- | --- |
| **要素** | **检查方法** |
| 本方交易商代码(MemberID) | 等于待匹配委托的对手方交易商代码(CounterpartyMemberID) |
| 本方交易主体类型（InvestorType） | 等于待匹配委托的对手方交易主体类型（CounterpartyInvestorType） |
| 本方交易主体代码（InvestorID） | 等于待匹配委托的对手方交易主体代码（CounterpartyInvestorID） |
| 本方交易员代码（TraderCode） | 等于待匹配委托的对手方交易员代码（CounterpartyTraderCode） |
| 对手方交易商代码(Counterparty MemberID) | 等于待匹配委托的本方交易商代码(MemberID) |
| 对手方交易主体类型（CounterpartyInvestorType） | 等于待匹配委托的本方交易主体类型（InvestorType） |
| 对手方交易主体代码（CounterpartyInvestorID） | 等于待匹配委托的本方交易主体代码（InvestorID） |
| 对手方交易员代码（CounterpartyTraderCode） | 等于待匹配委托的本方交易员代码（TraderCode） |
| 证券代码（SecurityID） | 一致 |
| 证券代码源（SecurityIDSource） | 一致 |
| 价格（LastPx） | 一致 |
| 数量（LastQty） | 一致 |
| 买卖方向(Side) | 方向相反 |
| 约定号（ConfirmID） | 当发起方委托的对手方交易主体类型（CounterpartyInvestorType）为03或04时，需检查一致 |
| 结算方式（SettlType） | 一致 |
| 结算周期（SettlPeriod） | 一致 |

### STEP接口委托申报

**表5-4 STEP接口委托消息定义**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **字段描述** | **发起方成交请求字段取值** | **接收方成交请求字段取值** |
|  | MessageHeader | MsgType=AE |  |  |
| 1180 | ApplID | 应用标识 | 411 | 411 |
| 571 | TradeReportID | 客户成交申报编号 | 客户成交申报编号 | 客户成交申报编号 |
| 522 | OwnerType | 订单所有者类型1=个人投资者发起102=会员发起103=机构投资者发起104=自营交易发起 | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| 828 | TrdType | 成交申报业务类别 | 0 | 0 |
| 856 | TradeReportType | 成交申报类型0=提交成交申报2=接受成交申报3=拒绝成交申报 | 0 | 2或3 |
| 487 | TradeReportTransType | 成交申报事务类别0=New1=Cancel2=Replace | 若为普通申报，填0；若为主动撤单，填1。 | 2 |
| 1123 | TradeHandlingInstr | 成交申报模式1=Two-Party Report，成交报告2=One-Party Report For Matching，协议配对3=One-Party Report for Pass Through，成交请求 | 3 | 3 |
| 572 | TradeReportRefID | 原客户成交申报编号 | 若为普通申报，填全空格，若为主动撤单，填被撤委托的客户成交申报编号 | 填转发成交申报的客户成交申报编号 |
| 60 | TransactTime | 成交申报发起时间 | 委托申报时间 | 委托申报时间 |
| **组件<Instrument>** |  |  |  |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | 证券代码 | 证券代码 |
| 22 | SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 | 102 |
| **组件结束** |  |  |
| **组件<RootParties>** |  |  |  |
| 1116 | NoRootPartyIDs | 参与人代码个数 | 2 | 2 |
| → | 1117 | RootPartyID | 参与人代码 | 申报方交易单元，需与发起方交易单元一致 | 申报方交易单元，需与发起方交易单元一致 |
| 1118 | RootPartyIDSource | 参与人代码源 | C=通用市场参与者标识 | C=通用市场参与者标识 |
| 1119 | RootPartyRole | 参与人代码角色 | 1=申报交易单元 | 1=申报交易单元 |
| 1117 | RootPartyID | 参与人代码 | 结算机构代码 | 结算机构代码 |
| 1118 | RootPartyIDSource | 参与人代码源 | F=交割机构 | F=交割机构 |
| 1119 | RootPartyRole | 参与人代码角色 | 4=结算机构代码 | 4=结算机构代码 |
| **组件结束** |  |  |
| **组件<TrdCapRptSideGrp>** |  |  |  |
| 552 | NoSides | side个数 | 1 | 1 |
| → | 54 | Side | 买卖方向 | 1或2 | 2或1 |
| **组件<Parties>** |  |  |  |
| 453 | NoPartyIDs | 参与人代码个数 | 9 | 成交申报类型为2时填9，成交申报类型为3时填8 |
| → | 448 | PartyID | 参与人代码 | 发起方交易单元 | 接收方交易单元 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | C=通用市场参与者标识 | C=通用市场参与者标识 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 1=交易单元 | 1=交易单元 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 发起方证券账户 | 成交申报类型为2时填接收方证券账户，成交申报类型为3时不用填写 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | 5=中国投资者编号 | 成交申报类型为2时填5=中国投资者编号，成交申报类型为3时不用填写 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 5=投资者证券账户 | 成交申报类型为2时填5=投资者证券账户，成交申报类型为3时不用填写 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 发起方营业部代码 | 接收方营业部代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | D=自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 4001=营业部代码 | 4001=营业部代码 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 发起方交易商代码 | 接收方交易商代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | C=通用市场参与者标识 | C=通用市场参与者标识 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 7：交易商代码 | 7：交易商代码 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 发起方交易主体代码 | 接收方交易主体代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | D=自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 4003：交易主体代码 | 4003：交易主体代码 |
| **子组件< PtysSubGrp>** |  |  |  |
| 802 | NoPartySubIDs | 参与方子代码个数 | 当发起方交易主体类型为03=机构经纪时，填2；否则填1 | 当接收方交易主体类型为03=机构经纪时，填2；否则填1 |
| → | 523 | PartySubID | 参与方子代码 | 发起方交易主体类型 | 接收方交易主体类型 |
| 803 | PartySubIDType | 参与方子代码类型 | 26=交易主体类型 | 26=交易主体类型 |
| 523 | PartySubID | 参与方子代码 | 发起方客户名称当发起方交易主体类型为03=机构经纪时，填写发起方客户名称；否则不需要填写 | 接收方客户名称当接收方交易主体类型为03=机构经纪且成交申报类型为2=接受成交申报时，填写接收方客户名称；否则不需要填写 |
| 803 | PartySubIDType | 参与方子代码类型 | 发起方客户名称当发起方交易主体类型为03=机构经纪时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写 | 接收方客户名称当接收方交易主体类型为03=机构经纪且成交申报类型为2=接受成交申报时时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写 |
| **组件结束** |  |  |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 发起方交易员代码 | 接收方交易员代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | D=自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 12：交易员代码 | 12：交易员代码 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 接收方交易商代码 | 发起方交易商代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | C=通用市场参与者标识 | C=通用市场参与者标识 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 20：对手方交易商代码 | 20：对手方交易商代码 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 接收方交易主体代码 | 发起方交易主体代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | D=自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 4004：接收方交易主体代码 | 4004：对手方交易主体代码 |
| **子组件< PtysSubGrp>** |  |  |  |
| 802 | NoPartySubIDs | 参与方子代码个数 | 1 | 1 |
| → | 523 | PartySubID | 参与方子代码 | 接收方交易主体类型 | 发起方交易主体类型 |
| 803 | PartySubIDType | 参与方子代码类型 | 26=交易主体类型 | 26=交易主体类型 |
| **组件结束** |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 接收方交易员代码 | 发起方交易员代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | D=自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 37：对手方交易员代码 | 37：对手方交易员代码 |
| **组件结束** |  |  |
| **组件结束** |  |  |
| 31 | LastPx | 价格 | 委托价格 | 委托价格 |
| 32 | LastQty | 数量 | 委托数量 | 委托数量 |
| 63 | SettlType | 结算方式，预留 | 103或104 | 103或104 |
| 10216 | SettlPeriod | 结算周期，预留 | 0或1 | 0或1 |
| 664 | ConfirmID  | 约定号 | 若接收方交易主体类型为03/04，则不能为全空格 | 若接收方交易主体类型为03/04，则不能为全空格 |
| 669 | LastParPx | 成交价格二，预留 | 0 | 0 |
| 544 | CashMargin | 信用标识 | 1 | 1 |
| 10198 | Memo | 备注 | 备注 | 备注 |

注：参见Binary接口委托申报备注说明。

## 点击成交

### 报价

#### Binary接口委托申报

**表5-5 Binary接口委托消息定义**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **域名** | **字段描述** | **报价字段取值** | **主动撤单字段取值** |
| Standard Header | 消息头MsgType=104105 |  |  |
| ApplID | 应用标识 | 412 | 412 |
| SubmittingPBUID | 申报交易单元 | 申报交易单元 | 申报交易单元 |
| SecurityID | 证券代码 | 证券代码 | 证券代码 |
| SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 | 102 |
| OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| ClearingFirm | 结算机构代码 | 结算机构代码 | 结算机构代码 |
| TransactTime | 委托时间 | 委托申报时间 | 委托申报时间 |
| UserInfo | 用户私有信息 | 用户私有信息 | 用户私有信息 |
| QuoteMsgID | 客户报价消息编号 | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| AccountID | 证券账户 | 证券账户 | 证券账户 |
| QuoteReqID | 询价请求编号 | 全空格 | 全空格 |
| QuoteType | 报价类型1=Tradeable，可交易的报价 | 1 | 1 |
| BidPx | 买报价 | 若为买方，则填买报价 | 买报价 |
| OfferPx | 卖报价 | 若为卖方，则填卖报价 | 卖报价 |
| BidSize | 买数量 | 若为买方，则填买数量 | 0 |
| OfferSize | 卖数量 | 若为卖方，则填卖数量 | 0 |
| BranchID | 营业部代码 | 营业部代码 | 营业部代码 |
| QuoteID | 报价消息编号 | 报价消息编号 | 与被撤委托的QuoteID一致 |
| QuoteRespID | 报价回复消息编号 | 全空格 | 全空格 |
| PrivateQuote | 私有报价0=Private Quote，私有报价1=Public Quote，公开报价 | 1，点击成交目前仅支持公开报价 | 1 |
| ValidUntilTime | 报价有效时间(预留字段) | 0 | 0 |
| PriceType | 价格类型(预留字段)1=Percentage，百分比2=PerUnit，每交易单位 | 1或2 | 1或2 |
| CashMargin | 信用标识 | 1 | 1 |
| MemberID | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 |
| InvestorType | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 |
| InvestorID | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 |
| InvestorName | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，需填写本方客户名称 | 本方客户名称 | 本方客户名称 |
| TraderCode | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 |
| SettlType | 结算方式，预留 | 103或104 | 103或104 |
| SettlPeriod | 结算周期，预留 | 0或1 | 0或1 |
| PreTradeAnonymity | 是否匿名0=显名1=匿名 | 0或1 | 0或1 |
| MaxFloor | 可显示数量 | 0 | 0 |
| MinQty | 最低成交数量 | 0 | 0 |
| Memo | 备注 | 全空格 | 全空格 |
| NoCounterparty | 对手方个数 | 0 | 0 |
| → | CounterpartyMemberID | 对手方交易商代码 | N/A | N/A |
| → | CounterpartyInvestorType | 对手方交易主体类型 | N/A | N/A |
| → | CounterpartyInvestorID | 对手方交易主体代码 | N/A | N/A |
| → | CounterpartyInvestorName | 对手方客户名称 | N/A | N/A |
| → | CounterpartyTraderCode | 对手方交易员代码 | N/A | N/A |

说明：

1. 目前仅支持面向全市场的点击成交，因此委托申报中对手方个数（NoCounterparty）取值应为0。
2. 暂不支持融资融券交易，信用标识字段固定填1。
3. SettlType、SettlPeriod虽然为预留字段，但是也要按照要求填写，否则会被交易系统拒绝。对于SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为103，否则为104。对于SettlPeriod，若SettlType为103，则取值为1，否则为0。
4. 若预留字段为枚举值，则取值应为枚举值中任一取值，否则应符合接口定义。
5. 是否匿名（PreTradeAnonymity）字段的填写将影响对应的转发报价消息（Binary：204126，STEP:S）中，本方交易商代码（MemberID）、本方交易主体类型（InvestorType）、本方交易主体代码（InvestorID）、本方客户名称（InvestorName）、本方交易员代码（TraderCode）字段这五个字段的填写，填写规则如下：

|  |  |
| --- | --- |
| 是否匿名（PreTradeAnonymity）字段取值 | 对应的转发报价中消息上述五字段的填写情况 |
| 0=显名 | 报价委托中的对应字段 |
| 1=匿名 | 全空格 |

1. 目前不支持分次显示，因此可显示数量和最低成交数量应填0。
2. BidPx与BidSize同时为0且OfferSize与OfferPx同时不为0时，表示卖报价;OfferPx与OfferSize同时为0且BidPx与BidSize同时不为0时，表示买报价。

#### STEP接口委托申报

**表5-6 STEP接口委托消息定义**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **字段描述** | **报价字段取值** | **报价主动撤单** |
|  | MessageHeader | MsgType=S |  |  |
| 1180 | ApplID | 应用标识 | 412 | 412 |
| 1166 | QuoteMsgID | 客户报价消息编号 | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| 522 | OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| 60 | TransactTime | 报价发起时间 | 委托时间 | 委托时间 |
| 131 | QuoteReqID | 报价请求ID | 全空格 | 全空格 |
| 537 | QuoteType | 报价类型1=Tradeable，表示可交易的报价 | 1 | 1 |
| 组件<Instrument> |  |  |  |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | 证券代码 | 证券代码 |
| 22 | SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 | 102 |
| 组件结束 |  |
| 组件<Parties> |  |  |  |
| 453 | NoPartyIDs | 参与人代码个数 | 6 | 6 |
| → | 448 | PartyID | 参与人代码 | 证券账户 | 证券账户 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | 5=中国投资者编号 | 5=中国投资者编号 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 5=投资者证券账户 | 5=投资者证券账户 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 申报交易单元 | 申报交易单元 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | C=通用市场参与者标识 | C=通用市场参与者标识 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 1=申报交易单元 | 1=申报交易单元 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 营业部代码 | 营业部代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | D=自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 4001=营业部代码 | 4001=营业部代码 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | C=通用市场参与者标识 | C=通用市场参与者标识 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 7=交易商代码 | 7=交易商代码 |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | D=自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 4003=交易主体代码 | 4003=交易主体代码 |
| 子组件<PtysSubGrp> |  |  |  |
| 802 | NoPartySubIDs | 参与方子代码个数 | 2 | 2 |
| → | 523 | PartySubID | 参与方子代码 | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 |
| 803 | PartySubIDType | 参与方子代码类型 | 26 | 26 |
| 523 | PartySubID | 参与方子代码 | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，填写本方客户名称；否则不需要填写 | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，填写本方客户名称；否则不需要填写 |
| 803 | PartySubIDType | 参与方子代码类型 | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写 | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写 |
| 组件结束 |  |  |  |
| 448 | PartyID | 参与人代码 | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | D=自定义代码 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 | 12=交易员代码 | 12=交易员代码 |
| 组件结束 |  |
| 132 | BidPx | 买报价BidSize>0时必须填写 | 买报价 | 买报价 |
| 133 | OfferPx | 卖报价OfferSize>0时必须填写 | 卖报价 | 卖报价 |
| 134 | BidSize | 买数量 | 买数量 | 0 |
| 135 | OfferSize | 卖数量 | 卖数量 | 0 |
| 117 | QuoteID | 报价消息编号 | 报价消息编号 | 与被撤委托的QuoteID一致 |
| 693 | QuoteRespID | 报价回复消息编号 | 不填 | 不填 |
| 1171 | PrivateQuote | 私有报价0=PrivateQuote，私有报价1=PublicQuote，公开报价 | 1，点击成交目前仅支持公开报价 | 1 |
| 62 | ValidUntilTime | 报价有效时间(预留字段) | 不填 | 不填 |
| 423 | PriceType | 价格类型(预留字段)1=Percentage，百分比2=PerUnit，每交易单位 | 不填 | 不填 |
| 544 | CashMargin | 信用标识 | 1 | 1 |
| 10198 | Memo | 备注 | 全空格 | 全空格 |
| 63 | SettlType | 结算方式，预留103=多边净额104=逐笔全额 | 103或104 | 103或104 |
| 10216 | SettlPeriod | 结算周期，预留 | 0或1 | 0或1 |
| 1091 | PreTradeAnonymity | 是否匿名0=显名1=匿名 | 0或1 | 0或1 |
| 111 | MaxFloor | 可显示数量 | 不填 | 不填 |
| 110 | MinQty | 最低成交数量 | 不填 | 不填 |

注：参见Binary接口委托申报备注说明。

### 报价回复

#### Binary接口委托申报

**表5-7 Binary接口委托消息定义**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **域名** | **字段描述** | **字段取值** |
| Standard Header | 消息头MsgType=104110 |  |
| ApplID | 应用标识 | 413 |
| SubmittingPBUID | 申报交易单元 | 申报交易单元 |
| SecurityID | 证券代码 | 证券代码 |
| SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 |
| OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| ClearingFirm | 结算机构代码 | 结算机构代码 |
| TransactTime | 委托时间 | 委托申报时间 |
| UserInfo | 用户私有信息 | 用户私有信息 |
| ClOrdID | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| AccountID | 证券账户 | 证券账户 |
| BranchID | 营业部代码 | 营业部代码 |
| QuoteRespID | 报价回复消息编号 | 报价回复消息编号 |
| QuoteRespType | 报价回复类型1=接受2=重报6=拒绝 | 1 |
| Side | 买卖方向 | 1或2 |
| ValidUntilTime | 报价有效时间(预留字段) | 报价有效时间 |
| QuoteType | 报价类型1=Tradeable，可交易的报价 | 1 |
| PriceType | 价格类型(预留字段)1=Percentage，百分比2=PerUnit，每交易单位 | 2 |
| NoQuote | 报价消息个数 | 1 |
| → | QuoteID | 报价消息编号 | 填写报价逐笔委托行情的QuoteID |
| → | QuotePrice | 报价价格 | 填写报价逐笔委托行情的Price |
| → | QuoteQty | 报价数量 | 填写本次确认成交的委托数量 |
| CashMargin | 信用标识 | 1 |
| MemberID | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 |
| InvestorType | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 |
| InvestorID | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 |
| InvestorName | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，需填写本方客户名称 | 本方客户名称 |
| TraderCode | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 |
| SettlType | 结算方式，预留103=多边净额104=逐笔全额 | 与报价逐笔委托行情的SettlType一致 |
| SettlPeriod | 结算周期，预留 | 与报价逐笔委托行情的SettlPeriod一致 |

说明：

1. 报价回复的买卖方向需与报价的买卖方向相反。
2. 报价回复的报价数量(QuoteQty)为本次点击成交的成交数量，不能大于逐笔行情中揭示的委托数量。
3. SettlType、SettlPeriod虽然为预留字段，但是也要按照要求填写，否则会被交易系统拒绝。对于SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为103，否则为104。对于SettlPeriod，若SettlType为103，则取值为1，否则为0。
4. 若预留字段为枚举值，则取值应为枚举值中任一取值，否则应符合接口定义。

#### STEP接口委托申报

**表5-8 STEP接口委托消息定义**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **字段描述** | 字段取值 |
|  | MessageHeader | MsgType=AJ |  |
| 1180 | ApplID | 应用标识 | 413 |
| 693 | QuoteRespID | 报价回复消息编号 | 报价回复消息编号 |
| 11 | ClOrdID | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| 522 | OwnerType | 报价所有者类型 | 订单所有者类型 |
| 60 | TransactTime | 委托时间 | 委托申报时间 |
| 537 | QuoteType | 报价类型1=Tradeable，可交易的报价 | 1 |
| 组件<Instrument> |  |  |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | 证券代码 |
| 22 | SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 |
| 组件结束 |
| 组件<Parties> |  |  |
| 453 | NoPartyIDs | 参与人代码个数 | 参照报价委托STEP接口申报组件<Parties>填写 |
| → | 448 | PartyID | 参与人代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 |
| 子组件<PtysSubGrp> |  |
| 802 | NoPartySubIDs | 参与方子代码个数 |
| → | 523 | PartySubID | 参与方子代码 |
| 803 | PartySubIDType | 参与方子代码类型 |
| 组件结束 |  |
| 组件结束 |
| 694 | QuoteRespType | 报价回复类型1=Hit/Lift，接受2=Counter，重报6=Pass，拒绝 | 1 |
| 54 | Side | 买卖方向 | 1或2 |
| 62 | ValidUntilTime | 报价有效时间(预留字段) | 不填 |
| 544 | CashMargin | 信用标识 | 1 |
| 423 | PriceType | 价格类型(预留字段)1=Percentage，百分比2=PerUnit，每交易单位 | 不填 |
| 63 | SettlType | 结算方式，预留 | 与报价逐笔委托行情的SettlType一致 |
| 10216 | SettlPeriod | 结算周期，预留 | 与报价逐笔委托行情的SettlPeriod一致 |
| 组件<CompDeliverQuote> |  |  |
| 10199 | NoQuote | 报价消息个数 | 1 |
| → | 117 | QuoteID | 报价消息编号 | 填写报价逐笔委托行情的QuoteID |
| 10225 | QuotePrice | 报价价格 | 填写报价逐笔委托行情的Price |
| 10226 | QuoteQty | 报价数量 | 数量 |
| 组件结束 |

注：参见Binary接口委托申报备注说明。

## 询价成交

### 询价请求

#### Binary接口委托申报

**表5-9 Binary接口委托消息定义**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **域名** | **字段描述** | **询价请求申报字段取值** | **主动撤单字段取值** |
| Standard Header | 消息头MsgType=104117 |  |  |
| ApplID | 应用标识 | 414 | 414 |
| SubmittingPBUID | 申报交易单元 | 申报交易单元 | 申报交易单元 |
| SecurityID | 证券代码 | 证券代码 | 证券代码 |
| SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 | 102 |
| OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| ClearingFirm | 结算机构代码 | 结算机构代码 | 结算机构代码 |
| TransactTime | 委托时间 | 委托申报时间 | 委托申报时间 |
| UserInfo | 用户私有信息 | 用户私有信息 | 用户私有信息 |
| ClOrdID | 客户订单编号 | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| AccountID | 证券账户 | 证券账户 | 证券账户 |
| BranchID | 营业部代码 | 营业部代码 | 营业部代码 |
| QuoteReqID | 询价请求编号 | 询价请求编号 | 与被撤委托的QuoteReqID一致 |
| QuoteRequestTransType | 询价请求事务类型0=New，新订单1=Cancel，撤销 | 0 | 1 |
| PrivateQuote | 私有报价0=Private Quote，私有报价1=Public Quote，公开报价 | 0，目前仅支持私有报价 | 0 |
| OrderQty | 数量 | 委托数量 | 委托数量 |
| Price | 价格 | 委托价格 | 委托价格 |
| Side | 买卖方向 | 1或2 | 1或2 |
| ExpireTime | 询价请求失效时间（预留字段） | 0 | 0 |
| QuoteType | 报价类型1=Tradeable，可交易的报价 | 1 | 1 |
| QuotePriceType | 报价价格类型（预留字段）1=Percent of par，百分比2=Per Share，每股 | 2 | 2 |
| Memo | 备注 | 备注 | 备注 |
| MemberID | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 |
| InvestorType | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 |
| InvestorID | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 |
| InvestorName | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，需填写本方客户名称 | 本方客户名称 | 本方客户名称 |
| TraderCode | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 |
| SettlType | 结算方式，预留 | 103或104 | 103或104 |
| SettlPeriod | 结算周期，预留 | 0或1 | 0或1 |
| PreTradeAnonymity | 是否匿名 | 0或1 | 0或1 |
| NoCounterparty | 对手方个数 | 对手方个数 | 0 |
| → | CounterpartyMemberID | 对手方交易商代码 | 对手方交易商代码 | N/A |
| → | CounterpartyInvestorType | 对手方交易主体类型 | 对手方交易主体类型 | N/A |
| → | CounterpartyInvestorID | 对手方交易主体代码 | 全空格 | N/A |
| → | CounterpartyInvestorName | 对手方客户名称 | 全空格 | N/A |
| → | CounterpartyTraderCode | 对手方交易员代码 | 全空格 | N/A |

说明：

1. 一笔询价请求中对手方个数不能超过20个，即委托申报中对手方个数（NoCounterparty）最多允许申报20个。
2. 暂不支持融资融券交易，信用标识字段固定填1。
3. SettlType、SettlPeriod虽然为预留字段，但是也要按照要求填写，否则会被交易系统拒绝。对于SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为103，否则为104。对于SettlPeriod，若SettlType为103，则取值为1，否则为0。
4. 若预留字段为枚举值，则取值应为枚举值中任一取值，否则应符合接口定义。
5. 是否匿名（PreTradeAnonymity）字段的填写将影响对应的转发询价请求消息（Binary：204125，STEP:R）中，本方交易商代码（MemberID）、本方交易主体类型（InvestorType）、本方交易主体代码（InvestorID）、本方客户名称（InvestorName）、本方交易员代码（TraderCode）字段这五个字段的填写，填写规则如下：

|  |  |
| --- | --- |
| 是否匿名（PreTradeAnonymity）字段的取值 | 对应的转发询价请求消息中上述五字段的填写情况 |
| 0=显名 | 报价委托中的对应字段 |
| 1=匿名 | 全空格 |

1. 询价请求失效时间（ExpireTime）为预留字段，填写值不生效，交易系统将根据接收到询价请求的系统时间计算的询价请求超时时间，并将计算结果填写至对应转发询价请求消息中的询价请求失效时间（ExpireTime）字段。
2. 对于同一笔询价请求，若交易系统中存在一笔未成交且未撤销的询价，则不能申报重复的询价请求委托。重复的询价请求是指：本方交易商代码、本方交易主体代码、本方证券账户、方向和证券标的与交易系统中已接受的询价请求的本方交易商代码、本方交易主体代码、本方证券账户、方向、证券标的均一致。

#### STEP接口委托申报

**表5-10 STEP接口委托消息定义**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **字段描述** | **询价请求字段取值** | **询价请求主动撤单** |
|  | MessageHeader | MsgType=R |  |  |
| 1180 | ApplID | 应用标识 | 414 | 414 |
| 131 | QuoteReqID | 询价请求编号 | 询价请求编号 | 询价请求编号 |
| 11 | ClOrdID | 客户订单编号 | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| 537 | QuoteType | 报价类型1= Tradeable，表示可交易的报价 | 1 | 1 |
| 522 | OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| 60 | TransactTime | 订单发起时间 | 委托时间 | 委托时间 |
| 组件<Instrument> |  |  |  |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | 证券代码 | 证券代码 |
| 22 | SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 | 102 |
| 组件结束 |  |
| 组件<RootParties> |  |  |  |
| 1116 | NoRootPartyIDs | 参与人代码个数 | 参照点击成交报价委托STEP接口申报组件<Parties>填写，本消息与报价消息的参考标签对应关系如下：1116<->4531117<->4481118<->4471119<->452 | 参照点击成交报价委托STEP接口申报组件<Parties>填写，本消息与报价消息的参考标签对应关系如下：1116<->4531117<->4481118<->4471119<->452 |
| → | 1117 | RootPartyID | 参与人代码 |
| 1118 | RootPartyIDSource | 参与人代码源 |
| 1119 | RootPartyRole | 参与人代码角色 |
| 子组件<RootSubParties> |
| 1120 | NoRootPartySubIDs | 参与方子代码个数 |
| → | 1121 | RootPartySubID | 参与方子代码 |
| 1122 | RootPartySubIDType | 参与方子代码类型 |
| 组件结束 |
| 组件结束 |  |
| 组件<CounterInfos> |  |  |
| 10232 | NoCounterInfos | 对手方个数 | 不需要填写 |
| → | 组件<NestedParties> |  |  |
| 539 | NoNestedPartyIDs | 参与人代码个数 | 2 | 不需要填写 |
| → | 524 | NestedPartyID | 参与人代码 | 对手方交易商代码 |
| 525 | NestedPartyIDSource | 参与人代码源 | C=通用市场参与者标识 |
| 538 | NestedPartyRole | 参与人代码角色 | 20=对手方交易商代码 |
| 524 | NestedPartyID | 参与人代码 | 对手方交易主体代码填全空格，代表对指定交易商代码、指定交易主体类型的全部交易主体代码进行询价 |
| 525 | NestedPartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 |
| 538 | NestedPartyRole | 参与人代码角色 | 4004：对手方交易主体代码 |
| 子组件< NstdPtysSubGrp > |  |  |
| 804 | NoNestedPartySubIDs | 参与方子代码个数 | 1 |
| → | 545 | NestedPartySubID | 参与方子代码 | 对手方交易主体类型 |
| 805 | NestedPartySubIDType | 参与方子代码类型 | 26 |
| 组件结束 |  |  |
| 组件结束 |
| 组件结束 |
| 组件<OrderQtyData> |  |  |  |
| 38 | OrderQty | 订单数量 | 委托数量 | 委托数量 |
| 组件结束 |  |
| 54 | Side | 买卖方向 | 1或2 | 1或2 |
| 44 | Price | 价格 | 委托价格  | 委托价格  |
| 10200 | QuoteRequestTransType | 询价请求事务类型0=New，新订单1=Cancel，撤销 | 0 | 1 |
| 1171 | PrivateQuote | 私有报价 | 0，目前仅支持私有报价 | 0 |
| 126 | ExpireTime | 询价请求失效时间（预留字段） | 不填 | 不填 |
| 692 | QuotePriceType | 报价价格类型（预留字段） | 不填 | 不填 |
| 10198 | Memo | 备注 | 备注 | 备注 |
| 544 | CashMargin | 信用标识 | 1 | 1、2或3 |
| 63 | SettlType | 结算方式，预留 | 103或104 | 103或104 |
| 10216 | SettlPeriod | 结算周期，预留 | 0或1 | 0或1 |
| 1091 | PreTradeAnonymity | 是否匿名 | 0或1 | 0或1 |
| 58 | Text | Free Text | Free Text | Free Text |

注：参见Binary接口委托申报备注说明。

### 报价

#### Binary接口委托申报

**表5-11 Binary接口委托消息定义**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **域名** | **字段描述** | **报价字段取值** | **主动撤单字段取值** |
| Standard Header | 消息头MsgType=104105 |  |  |
| ApplID | 应用标识 | 415 | 415 |
| SubmittingPBUID | 申报交易单元 | 申报交易单元 | 申报交易单元 |
| SecurityID | 证券代码 | 证券代码 | 证券代码 |
| SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 | 102 |
| OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| ClearingFirm | 结算机构代码 | 结算机构代码 | 结算机构代码 |
| TransactTime | 委托时间 | 委托申报时间 | 委托申报时间 |
| UserInfo | 用户私有信息 | 用户私有信息 | 用户私有信息 |
| QuoteMsgID | 客户报价消息编号 | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| AccountID | 证券账户 | 证券账户 | 证券账户 |
| QuoteReqID | 询价请求编号 | 填写转发询价请求的QuoteReqID | 填写转发询价请求的QuoteReqID |
| QuoteType | 报价类型1=Tradeable，可交易的报价 | 1 | 1 |
| BidPx | 买报价 | 若转发询价请求的side字段取值为2，则填买报价 | 买报价 |
| OfferPx | 卖报价 | 若转发询价请求的side字段取值为1，则填买报价卖报价 | 卖报价 |
| BidSize | 买数量 | 若转发询价请求的side字段取值为2，则填买数量 | 0 |
| OfferSize | 卖数量 | 若转发询价请求的side字段取值为2，则填卖数量 | 0 |
| BranchID | 营业部代码 | 营业部代码 | 营业部代码 |
| QuoteID | 报价消息编号 | 报价消息编号 | 与被撤委托的QuoteID一致 |
| QuoteRespID | 报价回复消息编号 | 全空格 | 全空格 |
| PrivateQuote | 私有报价0=Private Quote，私有报价1=Public Quote，公开报价 | 0或1 | 0或1 |
| ValidUntilTime | 报价有效时间(预留字段) | 报价有效时间(预留字段) | 报价有效时间(预留字段) |
| PriceType | 价格类型(预留字段) | 1或2 | 1或2 |
| CashMargin | 信用标识 | 1 | 1、2或3 |
| MemberID | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 |
| InvestorType | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 |
| InvestorID | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 |
| InvestorName | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，需填写本方客户名称 | 本方客户名称 | 本方客户名称 |
| TraderCode | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 |
| SettlType | 结算方式，预留 | 103或104 | 与转发询价请求的SettlType一致 |
| SettlPeriod | 结算周期，预留 | 0或1 | 与转发询价请的SettlPeriod一致 |
| PreTradeAnonymity | 是否匿名0=显名1=匿名9=不指定 | 9 | 9 |
| MaxFloor | 可显示数量 | 0 | 0 |
| MinQty | 最低成交数量 | 0 | 0 |
| Memo | 备注 | 备注 | 备注 |
| NoCounterparty | 对手方个数 | 当转发询价请求中，本方交易商代码不为全空格时填写，否则填0 | 0 |
| → | CounterpartyMemberID | 对手方交易商代码 | 填转发询价请求的本方交易商代码 | N/A |
| → | CounterpartyInvestorType | 对手方交易主体类型 | 填转发询价请求的本方交易主体类型 | N/A |
| → | CounterpartyInvestorID | 对手方交易主体代码 | 填转发询价请求的本方交易主体代码 | N/A |
| → | CounterpartyInvestorName | 对手方客户名称 | 全空格 | N/A |
| → | CounterpartyTraderCode | 对手方交易员代码 | 填转发询价请求的本方交易员代码 | N/A |

说明：

1. 报价委托的数量必须小于等于相应的询价请求委托中的数量，BidPx与BidSize同时为0且OfferSize与OfferPx同时不为0时，表示卖报价;OfferPx与OfferSize同时为0且BidPx与BidSize同时不为0时，表示买报价。
2. BidSize和OfferSize同时为0时，则为报价撤单委托。
3. 对于同一笔询价请求，若交易系统中存在一笔未成交且未撤销的报价，则不能申报重复的报价委托。重复的报价是指：本方交易商代码、本方交易主体代码、本方证券账户、方向和证券标的与交易系统中已接受的报价的本方交易商代码、本方交易主体代码、本方证券账户、方向、证券标的均一致。
4. 暂不支持融资融券交易，信用标识字段固定填1。
5. SettlType、SettlPeriod虽然为预留字段，但是也要按照要求填写，否则会被交易系统拒绝。对于SettlType，若证券支持匹配成交，则取值为103，否则为104。对于SettlPeriod，若SettlType为103，则取值为1，否则为0。
6. 若预留字段为枚举值，则取值应为枚举值中任一取值，否则应符合接口定义。

#### STEP接口委托申报

**表5-12 STEP接口委托消息定义**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **字段描述** | **报价字段取值** | **报价主动撤单** |
|  | MessageHeader | MsgType=S |  |  |
| 1180 | ApplID | 应用标识 | 415 | 415 |
| 1166 | QuoteMsgID | 客户报价消息编号 | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| 522 | OwnerType | 报价所有者类型 | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| 60 | TransactTime | 报价发起时间 | 委托时间 | 委托时间 |
| 131 | QuoteReqID | 报价请求ID | 填写转发询价请求的QuoteReqID | 填写转发询价请求的QuoteReqID |
| 537 | QuoteType | 报价类型1=Tradeable，表示可交易的报价 | 1 | 1 |
| 组件<Instrument> |  |  |  |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | 证券代码 | 证券代码 |
| 22 | SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 | 102 |
| 组件结束 |  |
| 组件<Parties> |  |  |  |
| 453 | NoPartyIDs | 参与人代码个数 | 参照点击成交报价委托STEP接口申报组件<Parties>填写 | 参照点击成交报价委托STEP接口申报组件<Parties>填写 |
| → | 448 | PartyID | 参与人代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 |
| 子组件<PtysSubGrp> |
| 802 | NoPartySubIDs | 参与方子代码个数 |
| → | 523 | PartySubID | 参与方子代码 |
| 803 | PartySubIDType | 参与方子代码类型 |
| 组件结束 |
| 组件结束 |  |
| 组件<CounterInfos> |  |  |
| 10232 | NoCounterInfos | 参与人代码个数 | 当转发询价请求中，本方交易商代码不为全空格时填写1，否则不需要填写 | 不需要填写 |
| 组件<NestedParties> |  |  |
| → | 539 | NoNestedPartyIDs | 参与人代码个数 | 3 | 不需要填写 |
| → | 524 | NestedPartyID | 参与人代码 | 对手方交易商代码 | 不需要填写 |
| 525 | NestedPartyIDSource | 参与人代码源 | C=通用市场参与者标识 | 不需要填写 |
| 538 | NestedPartyRole | 参与人代码角色 | 20=对手方交易商代码 | 不需要填写 |
| 524 | NestedPartyID | 参与人代码 | 对手方交易主体代码 | 不需要填写 |
| 525 | NestedPartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | 不需要填写 |
| 538 | NestedPartyRole | 参与人代码角色 | 4004：对手方交易主体代码 | 不需要填写 |
| 子组件<NstdPtysSubGrp> |  |  |
| 804 | NoNstdPartySubIDs | 参与方子代码个数 | 1 | 不需要填写 |
| → | 545 | NstdPartySubID | 参与方子代码 | 对手方交易主体类型 | 不需要填写 |
| 805 | NstdPartySubIDType | 参与方子代码类型 | 26=交易主体类型 | 不需要填写 |
| 组件结束 |  |  |  |
| 524 | NestedPartyID | 参与人代码 | 对手方交易员代码 | 不需要填写 |
| 525 | NestedPartyIDSource | 参与人代码源 | D=自定义代码 | 不需要填写 |
| 538 | NestedPartyRole | 参与人代码角色 | 37：对手方交易员代码 | 不需要填写 |
| 组件结束 |  |  |
| 132 | BidPx | 买报价BidSize>0时必须填写 | 买报价 | 买报价 |
| 133 | OfferPx | 卖报价OfferSize>0时必须填写 | 卖报价 | 卖报价 |
| 134 | BidSize | 买数量 | 买数量 | 0 |
| 135 | OfferSize | 卖数量 | 卖数量 | 0 |
| 117 | QuoteID | 报价消息编号 | 报价消息编号 | 与被撤委托的QuoteID一致 |
| 693 | QuoteRespID | 报价回复消息编号 | 不填 | 不填 |
| 1171 | PrivateQuote | 私有报价0=PrivateQuote，私有报价1=PublicQuote，公开报价 | 不填 | 不填 |
| 62 | ValidUntilTime | 报价有效时间(预留字段) | 不填 | 不填 |
| 423 | PriceType | 价格类型(预留字段) | 不填 | 不填 |
| 544 | CashMargin | 信用标识 | 1 | 1、2或3 |
| 10198 | Memo | 备注 | 备注 | 备注 |
| 63 | SettlType | 结算方式，预留103=多边净额104=逐笔全额 | 103或104 | 103或104 |
| 10216 | SettlPeriod | 结算周期，预留 | 0或1 | 0或1 |
| 1091 | PreTradeAnonymity | 是否匿名 | 不填 | 不填 |
| 111 | MaxFloor | 可显示数量 | 不填 | 不填 |
| 110 | MinQty | 最低成交数量 | 不填 | 不填 |

注：参见Binary接口委托申报备注说明。

### 报价回复

#### Binary接口委托申报

**表5-13 Binary接口委托消息定义**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **域名** | **字段描述** | **字段取值** |
| Standard Header | 消息头MsgType=104110 |  |
| ApplID | 应用标识 | 416 |
| SubmittingPBUID | 申报交易单元 | 申报交易单元 |
| SecurityID | 证券代码 | 证券代码 |
| SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 |
| OwnerType | 订单所有者类型 | 订单所有者类型 |
| ClearingFirm | 结算机构代码 | 结算机构代码 |
| TransactTime | 委托时间 | 委托申报时间 |
| UserInfo | 用户私有信息 | 用户私有信息 |
| ClOrdID | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| AccountID | 证券账户 | 证券账户 |
| BranchID | 营业部代码 | 营业部代码 |
| QuoteRespID | 报价回复消息编号 | 报价回复消息编号 |
| QuoteRespType | 报价回复类型1=接受2=重报6=拒绝 | 1 |
| Side | 买卖方向 | 1或2 |
| ValidUntilTime | 报价有效时间(预留字段) | 报价有效时间 |
| QuoteType | 报价类型1=Tradeable，可交易的报价 | 1 |
| PriceType | 价格类型(预留字段)1=Percentage，百分比2=PerUnit，每交易单位 | 2 |
| NoQuote | 报价消息个数 | 报价消息个数 |
| → | QuoteID | 报价消息编号 | 填写转发报价报文的QuoteID |
| → | QuotePrice | 报价价格 | 填写转发报价报文的Price |
| → | QuoteQty | 报价数量 | 填写转发报价报文的OrderQty |
| CashMargin | 信用标识 | 1 |
| MemberID | 本方交易商代码 | 本方交易商代码 |
| InvestorType | 本方交易主体类型 | 本方交易主体类型 |
| InvestorID | 本方交易主体代码 | 本方交易主体代码 |
| InvestorName | 本方客户名称当本方交易主体类型为03=机构经纪时，需填写本方客户名称 | 本方客户名称 |
| TraderCode | 本方交易员代码 | 本方交易员代码 |
| SettlType | 结算方式，预留103=多边净额104=逐笔全额 | 与询价请求的SettlType一致 |
| SettlPeriod | 结算周期，预留 | 与询价请求的SettlPeriod一致 |

说明：

1. 一笔报价回复支持对多笔报价进行回复，其中QuoteID填写转发报价报文（Binary:200526，STEP:S）的QuoteID，QuotePrice填转发报价报文的BidPx（或OfferPx），QuoteQty填转发报价报文的BidSize（或OfferSize）。
2. 报价回复的买卖方向需与报价的买卖方向相反。
3. 若预留字段为枚举值，则取值应为枚举值中任一取值，否则应符合接口定义。

#### STEP接口委托申报

**表5-14 STEP接口委托消息定义**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **字段描述** | 字段取值 |
|  | MessageHeader | MsgType=AJ |  |
| 1180 | ApplID | 应用标识 | 416 |
| 693 | QuoteRespID | 报价回复消息编号 | 报价回复消息编号 |
| 11 | ClOrdID | 客户订单编号 | 客户订单编号 |
| 522 | OwnerType | 报价所有者类型 | 订单所有者类型 |
| 60 | TransactTime | 委托时间 | 委托申报时间 |
| 537 | QuoteType | 报价类型1=Tradeable，可交易的报价 | 1 |
| 组件<Instrument> |  |  |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | 证券代码 |
| 22 | SecurityIDSource | 证券代码源102=深圳证券交易所 | 102 |
| 组件结束 |
| 组件<Parties> |  |  |
| 453 | NoPartyIDs | 参与人代码个数 | 参照点击成交报价委托STEP接口申报组件<Parties>填写 |
| → | 448 | PartyID | 参与人代码 |
| 447 | PartyIDSource | 参与人代码源 |
| 452 | PartyRole | 参与人代码角色 |
| 子组件<PtysSubGrp> |  |
| 802 | NoPartySubIDs | 参与方子代码个数 |
| → | 523 | PartySubID | 参与方子代码 |
| 803 | PartySubIDType | 参与方子代码类型 |
| 组件结束 |  |
| 组件结束 |
| 694 | QuoteRespType | 报价回复类型1=Hit/Lift，接受2=Counter，重报6=Pass，拒绝 | 1 |
| 54 | Side | 买卖方向 | 1或2 |
| 62 | ValidUntilTime | 报价有效时间(预留字段) | 不填 |
| 544 | CashMargin | 信用标识 | 1 |
| 423 | PriceType | 价格类型(预留字段) | 不填 |
| 63 | SettlType | 结算方式，预留 | 与询价请求的SettlType一致 |
| 10216 | SettlPeriod | 结算周期，预留 | 与询价请的SettlPeriod一致 |
| 组件<CompDeliverQuote> |  |  |
| 10199 | NoQuote | 报价消息个数 | 报价消息个数 |
| → | 117 | QuoteID | 报价消息编号 | 报价消息编号 |
| 10225 | QuotePrice | 报价价格 | 价格 |
| 10226 | QuoteQty | 报价数量 | 数量 |
| 组件结束 |

注：参见Binary接口委托申报备注说明。

# 行情接口

债券现券交易业务、债券通用质押式回购及债券分销业务相关行情信息发布方式如下表所示，详细内容请参见《深圳证券交易所STEP行情数据接口规范》、《深圳证券交易所Binary行情数据接口规范》。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **频道** | **行情内容** | **行情类别** | **消息类型（MsgType）** |
| **STEP** | **Binary** |
| 106x | 债券通用质押式回购交易快照行情 | 020 | W | 300211 |
| 206x | 债券通用质押式回购匹配成交逐笔行情 | 021 | UA201UA202 | 300292300291 |
| 107x | 债券现券交易快照行情 | 410 | W | 300211 |
| 207x | 债券现券交易匹配成交逐笔行情 | 411 | UA201UA202 | 300292300291 |
| 401x | 债券现券交易协商成交逐笔成交行情 | 412 | UA202 | 300391 |
| 债券现券交易点击成交逐笔报价行情 | 413 | UA201（新报价）UA202（报价更新） | 300392（新报价）300391（报价更新） |
| 债券现券交易点击成交逐笔成交行情 | 413 | UA202 | 300391 |
| 债券现券交易询价成交逐笔成交行情 | 414 | UA202 | 300391 |
| 债券现券交易意向申报逐笔行情（暂不启用） | 415 | UA201 | 300292 |
| 债券现券交易竞买成交逐笔行情（暂不启用） | 416 | UA201UA202 | 300292300391 |
| 债券现券交易匹配成交大额逐笔行情 | 417 | UA201（大额委托）UA202（大额成交） | 300392（大额委托）300391（大额成交） |
| 3021 | 债券分销快照行情 | 030 | W | 300211 |

# 清算和交收

## 债券现券交易的结算处理

在固定收益交易平台达成的债券现券交易，结算业务类别编码沿用现有普通交易的业务类别编码（其中采用担保交收模式的债券现券交易，业务类别编码为JY00；采用非担保交收模式的债券现券交易，业务类别编码为JY01），仍使用现有接口发送。在清算明细库（SJSJMXn.DBF）和明细结果库（SJSJG.DBF）中，债券现券交易的交易方式字段为13，用于标识“固定收益交易平台”的交易。

具体接口调整如下：

* 1. 清算明细库SJSMX0.DBF

|  |  |
| --- | --- |
| **字段名** | **业务类别** |
| **JY01（综合金融服务平台、固定收益交易平台的交易(非担保交收模式)）** |
| MXJSZH | 结算账号 |
| MXBFZH | 备付金账户 |
| MXSJLX | ‘01’ |
| MXYWLB | ‘JY01’ |
| MXZQDM | 证券代码 |
| MXJYDY | 交易单元 |
| MXTGDY | 托管单元 |
| MXZQZH | 证券账户 |
| MXDDBH | 订单编号 |
| MXYYB | 营业部代码 |
| MXZXBH | 执行编号 |
| MXYWLSH | 业务流水号 |
| MXCJSL | 成交数量 |
| MXQSSL | 清算数量 |
| MXCJJG | 交易回报价格 |
| MXQSJG | 最终清算价格 |
| MXXYJY |  |
| MXPCBS |  |
| MXZQLB | 证券类别 |
| MXZQZL | 证券子类别 |
| MXGFXZ |  |
| MXJSFS | ‘N’或‘R’ |
| MXHBDH | 货币代号 |
| MXQSBJ | 清算本金 |
| MXYHS | 印花税 |
| MXJYJSF | 交易经手费 |
| MXJGGF | 监管规费 |
| MXGHF | 过户费 |
| MXJSF | 结算费 |
| MXSXF |  |
| MXQSYJ |  |
| MXQTFY |  |
| MXZJJE |  |
| MXSFJE | 收付净额 |
| MXCJRQ | T日 |
| MXQSRQ | T日 |
| MXJSRQ | T日 |
| MXFSRQ | T日 |
| MXQTRQ |  |
| MXSCDM |  |
| MXJYFS | ‘02’或 ‘13’ |
| MXZQDM2 |  |
| MXTGDY2 |  |
| MXDDBH2 |  |
| MXCWDH |  |
| MXPPHM |  |
| MXFJSM |  |
| MXBYBZ |  |

* 1. 清算明细库SJSMX1.DBF

|  |  |
| --- | --- |
| **字段名** | **业务类别** |
| **JY00（集中竞价平台、综合金融服务平台、固定收益交易平台的交易（担保交收模式））** |
| MXJSZH | 结算账号 |
| MXBFZH | 备付金账户 |
| MXSJLX | ‘01’ |
| MXYWLB | ‘JY00’ |
| MXZQDM | 证券代码 |
| MXJYDY | 交易单元 |
| MXTGDY | 托管单元 |
| MXZQZH | 证券账户 |
| MXDDBH | 订单编号 |
| MXYYB | 营业部代码 |
| MXZXBH | 执行编号 |
| MXYWLSH | 业务流水号 |
| MXCJSL | 成交数量 |
| MXQSSL | 清算数量 |
| MXCJJG | 交易回报价格 |
| MXQSJG | 最终清算价格 |
| MXXYJY | 信用交易标志 |
| MXPCBS | 平仓标志 |
| MXZQLB | 证券类别 |
| MXZQZL | 证券子类别 |
| MXGFXZ | ‘00’ |
| MXJSFS | ’A’ |
| MXHBDH | 货币代号 |
| MXQSBJ | 清算本金 |
| MXYHS | 印花税 |
| MXJYJSF | 交易经手费 |
| MXJGGF | 监管规费 |
| MXGHF | 过户费 |
| MXJSF | 结算费 |
| MXSXF |  |
| MXQSYJ |  |
| MXQTFY |  |
| MXZJJE |  |
| MXSFJE | 收付净额 |
| MXCJRQ | T日 |
| MXQSRQ | T日 |
| MXJSRQ | T+1日 |
| MXFSRQ | T日 |
| MXQTRQ |  |
| MXSCDM |  |
| MXJYFS | ‘01’、‘02’、‘12’或’13’ |
| MXZQDM2 |  |
| MXTGDY2 |  |
| MXDDBH2 |  |
| MXCWDH |  |
| MXPPHM |  |
| MXFJSM |  |
| MXBYBZ |  |

* 1. 明细结果库SJSJG.DBF

|  |  |
| --- | --- |
| **字段名** | **业务类别** |
| JY01(非担保交易交收) |
| JGJSZH | 结算账号 |
| JGBFZH | 备付金账户 |
| JGSJLX | ’01’ |
| JGYWLB | ’JY01’ |
| JGZQDM | 证券代码 |
| JGJYDY | 交易单元 |
| JGTGDY | 托管单元 |
| JGZQZH | 证券帐户 |
| JGDDBH | 订单编号,对于资管份额转让，填写结算参与人申报的合同序号。 |
| JGYYB | 营业部代码 |
| JGZXBH | 执行编号 |
| JGYWLSH | 业务流水号 |
| JGCJSL | 成交数量 |
| JGQSSL | 清算数量 |
| JGJSSL | 实际交收数量或0 |
| JGCJJG | 成交价格 |
| JGQSJG |  |
| JGXYJY |  |
| JGPCBS |  |
| JGZQLB | 证券类别 |
| JGZQZL | 证券子类别 |
| JGGFXZ | ‘00’ |
| JGLTLX | ‘0’ |
| JGJSFS | ‘R’或‘N’ |
| JGHBDH |  |
| JGQSBJ |  |
| JGYHS |  |
| JGJYJSF |  |
| JGJGGF |  |
| JGGHF |  |
| JGJSF |  |
| JGSXF |  |
| JGQSYJ |  |
| JGQTFY |  |
| JGZJJE |  |
| JGSFJE |  |
| JGJSBZ | ‘Y’或‘N’ |
| JGZYDH | 若JGJSBZ为’N’,则是错误代号 |
| JGCJRQ | T-1日或T日 |
| JGQSRQ | T-1日或T日 |
| JGJSRQ | T日 |
| JGFSRQ | T日 |
| JGQTRQ |  |
| JGSCDM |  |
| JGJYFS | ‘02’或 ‘13’ |
| JGZQDM2 |  |
| JGTGDY2 |  |
| JGDDBH2 |  |
| JGFJSM |  |
| JGBYBZ |  |

## 债券相关业务迁移到固定收益交易平台的结算处理

债券分销，质押式回购交易及出入库，债券质押式三方回购交易及存放、提取、换券、补券，信用保护合约等业务的结算业务类别编码保持不变，仍使用现有接口发送。上述业务在清算明细库（SJSJMXn.DBF）和明细结果库（SJSJG.DBF）中其对应的交易方式字段调整为13，用于标识“固定收益交易平台”的业务。

具体涉及的接口及业务如下表：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **文件名称** | **业务类别** | **业务类别说明** | **备注说明****（原交易方式）** |
| SJSMX1.DBFSJSJG.DBF | JY02 | 债券分销 | 02 |
| SJSMX1.DBF | HGCS | 质押式回购初始成交 | 02 |
| SJSMX1.DBF | HGDQ | 质押式回购到期成交 | 02 |
| SJSJG.DBF | ZYRK | 质押式回购质押券入库 | 03 |
| SJSJG.DBF | ZYCK | 质押式回购质押券出库 | 03 |
| SJSMX0.DBFSJSJG.DBF | SFCS | 债券质押式三方回购初始交易 | 02 |
| SJSMX0.DBFSJSJG.DBF | SFDQ | 债券质押式三方回购到期购回 | 02 |
| SJSMX0.DBFSJSJG.DBF | SFTG | 债券质押式三方回购提前购回 | 02 |
| SJSMX0.DBFSJSJG.DBF | SFJZ | 债券质押式三方回购解除质押 | 02 |
| SJSMX0.DBFSJSJG.DBF | SFXZ | 债券质押式三方回购到期续做 | 02 |
| SJSJG.DBF | SFCF | 债券质押式三方回购存放 | 02 |
| SJSJG.DBF | SFTQ | 债券质押式三方回购提取 | 02 |
| SJSJG.DBF | SFHQ | 债券质押式三方回购换券 | 02 |
| SJSJG.DBF | SFBQ | 债券质押式三方回购补券 | 02 |
| SJSMX0.DBFSJSJG.DBF | CSTZ | 信用保护合约提前终止 | 02 |
| SJSMX0.DBFSJSJG.DBF | CSXX | 信用保护合约信用事件现金结算 | 02 |
| SJSMX0.DBFSJSJG.DBF | CSSX | 信用保护合约信用事件实物结算 | 02 |
| SJSMX2.DBF | CSFY | 信用保护合约信用事件费用 | 02 |

原交易方式：02表示综合金融服务平台；03表示非交易处理平台

## 资产支持证券（证券类别为“1Z”）拆分为三类证券子类

为配合深市固定收益产品计价方式调整，资产支持证券（证券类别为“1Z”）拆分为三类证券子类，即优先级、次优级和次级，分别用1、2、3表示，填写于清算明细库（SJSMXn.DBF）和明细结果库（SJSJG.DBF）中对应的证券子类字段。

资产支持证券优先级和次优级的交易将按净价交易、全价结算；资产支持证券次级的交易将按全价交易、全价结算。

## 第3批预清算数据内容调整

因债券现券交易时间延长至15:30，为能在闭市后尽早向全市场发送交易预清算数据，所有品种的结算风险基金将不在第3批的预清算数据（SJSQS0.DBF的QSJFXJ字段）中体现，最终清算数据以日终的资金清算汇总数据为准（SJSQS.DBF的QSJFXJ字段包含结算风险基金）。

# 开展债券现券交易的券商系统注意事项

## 委托相关说明

可以通过交易网关或交易终端申报债券现券交易委托和接收成交。

通过交易终端申报委托方式请参照交易终端用户手册。

## 关于客户委托服务渠道

建议证券公司根据该类业务的目标客户及业务风险属性，自行调整其柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等客户委托渠道（可选择一种或多种渠道）中的相应前端系统，以支持债券现券交易委托指令录入。

## 关于券商柜台系统

* **向深交所申报各类委托前的风险前端控制**

柜台系统应对投资者委托的价格、数量、投资者资金、投资者股份等要素进行前端风险控制，对于不符合前端风险控制要求的委托予以拒绝，不要申报至深交所交易系统。

* **对交易系统发送的回报消息的处理**

接收到交易系统发送的转发成交申报、转发询价请求后，券商技术系统应对请求编号（即转发成交申报中的客户成交申报编号（TradeReportID）字段、转发询价请求的客户订单编号（ClOrdID）字段）重复的消息去重、过滤后展示；对于所有转发成交申报都必须保证能够展示给指定的接收方，不可以展示给无关人员。特别的，对于转发成交申报的接收方是经纪客户时，券商系统需保证转发成交申报不会被广播至无关的经纪客户。

## 关于STEP交易接口通信版本号修改

STEP交易接口通信版本号修改方法如下：

1、请将交易网关登陆消息中的DefaultCstmApplVerID修改为STEP1.20\_SZ\_1.11。

2、请将行情网关登陆消息中的DefaultCstmApplVerID修改为STEP1.20\_SZ\_1.09。

3、对于DefaultCstmApplVerID的具体修改方法，请联系各自的软件供应商。

# 联系方式

深圳证券交易所业务：0755-88668590

深圳证券交易所技术：0755-88668679

中国结算深圳分公司业务：0755-21899255

中国结算深圳分公司技术：0755-25946080