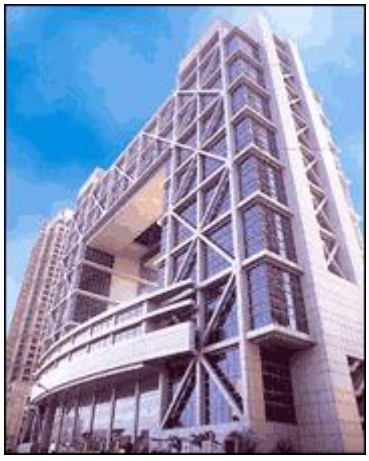
上海证券交易所

交易网关 STEP 接口规格说明书

（互联网交易平台/新固定收益系统）

2.010 版



二〇二六年五十月

文档版本

日期	版本	状态	说明
2021-07	0.10	开发稿	创建文档。
2021-09	0.20	开发稿	增加基金通业务接口
2022-02	0.30	开发稿	（1）更新消息头的填写说明 （2）新订单申报中申报价格修改为非必填，对基金通报价交易，申报价格必填；基金通转入转出，申报价格为空；
2022-02	1.00	正式稿	
2022-04	1.10	开发稿	1. 增加询价业务类接口 2. 增加订阅机制 3. 转入转出不支持撤单
2022-07	1.11	开发稿	1. 修改消息流图：报价方撤销报价处理，删除撤单成功执行报告； 2. 修改报价、报价状态回报、转发报价 tag 453 后接重复组字段表述，“询价”修改为“报价” 3. 修改 tag 693 QuoteRespID 字段类型为 C18 4. 删除报价状态回报（Quote Status Report）中 tag 693 QuoteRespID 5. 报价回复新增字段：tag131 QuoteReqID，用于匹配成交
2022-08	1.12	正式稿	1. 询价申报中订单价格上下限字段，增加字段说明“预留，暂不启用” 2. 调整询价处理消息流图：转发询价请求、转发报价请求去掉 orderID；报价撤销成功回报去掉 ordID=or00003；报价撤销成功回报的报价状态调整为 QuoteStatus=Cancelled 3. 转发询价请求、转发报价请求不再提供 orderID，字段调整为非必填 4. 询价状态回报、报价状态回报中 OrderID 调整为非必填，补充字段说明
2025.08	1.13	正式稿	1.要约/现金选择权（要约预受/现金选择权登记、要约撤销/现金

日期	版本	状态	说明
			选择权注销）、开放式基金相关业务（申赎、分红选择、份额转出）、融资融券非交易业务（余券划转、还券划转、担保品划入、担保品划出、券源划入、券源划出）、网络密码服务（密码激活/注销），从竞价撮合平台迁移至互联网交易平台。 2.4.4.1.1 章节中，订单类型字段改为非必填；参与方个数取值改为 10，其中结算会员代码改为非必填；变更发起方营业部代码范围及说明、结算会员代码字段填写说明。 3.4.4.1.2 章节中，参与方个数变更； 4.4.3.1.1 章节中，参与方个数变更，结算会员代码改为非必填。
2025-11	1.14	正式稿	1.基于《IS101 上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》文档正式废止，相关内容迁移至《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》，更新相关引用描述。
2026.05	2.00	正式稿	补充了新固定收益系统相关业务申报接口内容，包括: 1. 业务类型章节添加了新增的业务类型 2. 询价处理消息流中添加了通过公开行情发布的场景 3. 添加了意向申报和成交申报两类消息流图 4. 4.4.1 章节新订单申报中添加相关字段适配新增业务 5. 4.4.2.1 询价请求中删除了询价请求编号（QuoteReqID）字段，添加了询价请求类型（QuoteRequestType）字段；4.4.2.7 章节中删除了报价回复消息编号（QuoteRespID） 6. 4.4.2 章节中添加相关字段适配新增业务 7. 新增了 4.4.3 和 4.4.4 两类申报消息 8. 4.4.5.1 中添加相关字段适配新增业务
2026.10	2.01	开发稿	1. 4.2 章节中调整了 Price 格式字段的约束说明 2. 4.4.4.1 成交申报中对 OrderRestrictions 字段含义，调整三方回购与协议回购一致 3. 4.4.4 成交确认中对协议回购更正到期续作成交相关描述

目　录

1 前言 1
1.1 目的 1
1.2 术语和定义 1
1.3 参考文档 1
1.4 联系方式 2
2 系统简介 3
2.1 系统接入 3
2.2 业务范围 4
3 交互机制 5
3.1 会话机制 5
3.1.1 建立会话 5
3.1.2 关闭会话 5
3.1.3 维持会话 6
3.1.4 其他约定 6
3.2 申报与回报 7
3.2.1 业务类型 7
3.2.2 消息流图 9
3.2.3 平台状态 26
3.2.4 重复订单 27
3.2.5 执行报告 28
3.3 恢复场景 29
3.4 订阅机制 30
4 消息定义 31
4.1 消息结构与约定 31
4.2 数据类型 31
4.2.1 STEP 格式约定 32
4.2.2 STEP 消息头 32
4.2.3 STEP 消息尾 32
4.2.4 STEP 消息完整性 33
4.3 会话消息 34
4.3.1 登录消息（MsgType=A） 34
4.3.2 注销消息（MsgType=5） 35
4.3.3 心跳消息（MsgType=0） 35
4.3.4 测试请求消息（MsgType=1） 35
4.3.5 重发请求消息（MsgType=2） 36
4.3.6 会话拒绝消息（MsgType=3） 36
4.3.7 序号重设消息（MsgType=4） 36
4.4 应用消息 38
4.4.1 订单业务类 38
4.4.2 询价报价业务类 47
4.4.3 意向申报类 71
4.4.4 成交申报类 76

4.4.5 执行报告类 101
4.4.6 网络密码服务（Password Service, MsgType = U006） 109
4.4.7 其它消息 111
附录 115
附录一 计算校验和 115
附录二 PBU 及说明 116
附录三 错误代码说明 117
附录四 “用户私有信息”说明 118

1 前言

1.1 目的

本接口规范描述了上海证券交易所（以下称本所）交易网关与市场参与者系统之间以 STEP 协议进行交易数据交换时所采用的交互机制、消息格式、消息定义和数据内容。目前，本接口规范仅适用于本所互联网交易平台和新固定收益系统提供的各类业务。

文档采用的术语及消息内容与 STEP 数据接口规范具有对应关系，可互为参考。

1.2 术语和定义

名词	含义
TDGW	交易网关 TraDing GateWay
MDGW	行情网关 Market Data GateWay
OMS	用户订单管理系统 Order Management System 会员等市场参与者通过 OMS 接入 TDGW 并进行交易数据交换
PBU	市场参与者交易业务单元 Participant Business Unit
ITCS	互联网交易平台通信服务器 Internet Trade Communication Server
STEP	证券交易数据交换协议 Securities Trading Exchange Protocol

1.3 参考文档

名称
《IS111 上海证券交易所报盘软件错误代码表》

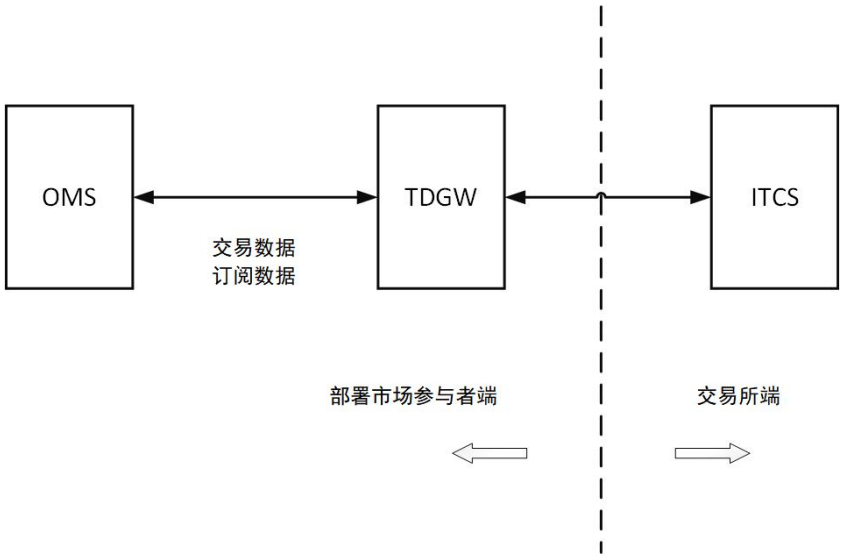
1.4 联系方式

技术服务 QQ 群：	298643611	
技术服务电话：	4008888400-2 (8:00-20:00)	
电子邮件：	tech_support@sse.com.cn	
技术服务微信公众号：	SSE-TechService （回复 00 进入人工服务）	

2 系统简介

2.1 系统接入

为满足业务发展需求和提升交易服务水平，本所通过交易网关（TDGW）对接互联网交易平台和新固定收益系统，提供实时交易流接口。TDGW 对接交易系统及市场参与者系统（OMS）的示意图如下：



TDGW 通过交易业务单元（PBU）登录并接入交易系统，PBU 的配置由用户提前在 TDGW 端完成。

TDGW 每个平台开放一个端口供 OMS 建立会话，TDGW 仅接受 OMS 为每个平台建立一个 TCP/IP 连接，每个连接仅允许建立一个有效的会话。该会话既用于接收 OMS 的业务申报，又向 OMS 推送交易所接收申报后产生的回报数据。

OMS 与 TDGW 间的连接为标准 TCP/IP 连接，由 OMS 负责发起。OMS 与 TDGW 之间传输的数据是非加密的，数据传输的安全性由部署的网络予以保证。

附录二对术语 PBU 在不同场景下的使用进行了说明。

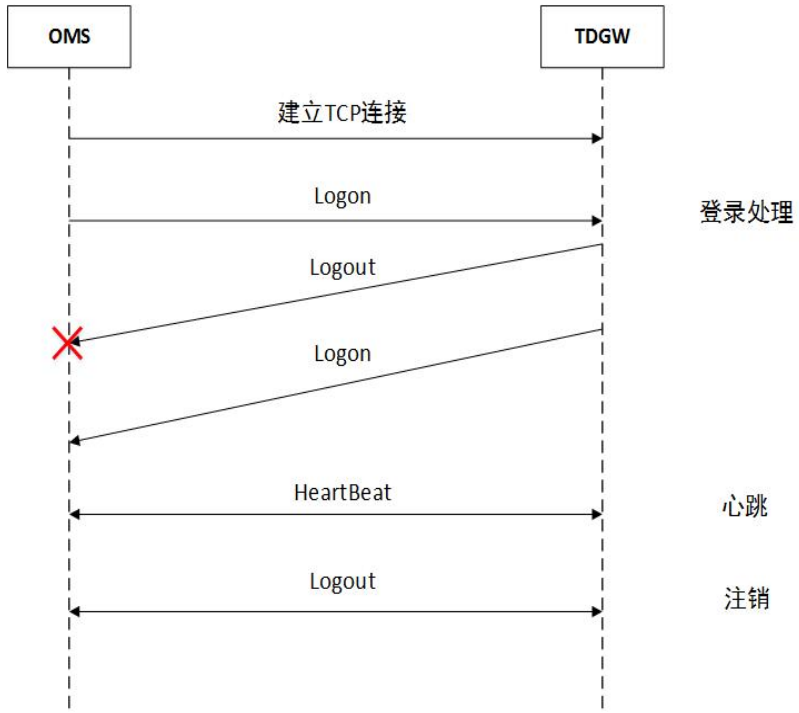
2.2 业务范围

系统	业务	业务申报时间
互联网交易平台	基金通报价交易 基金通转入转出 基金通询价交易	9:30-11:30 13:00-15:00
	开放式基金业务（申购、赎回、转托管转出、分红选择）	
	要约预受/现金选择权登记 要约撤销/现金选择权撤销	
	融资融券业务（余券划转、还券划转、担保品划转、券源划转）	
	网络密码服务	
新固定收益系统	债券质押式协议回购 债券质押式三方回购 债券借贷（预留，暂不启用）	9:00-11:30 13:00-15:30
	协议回购意向申报 三方回购意向申报 债券现券意向申报	
	确定报价 待定报价 一债通询价 现券协商成交 合并申报 场务应急成交录入 竞买（预留，暂不启用）	
	三方回购转入转出 双非可转债转股冻结 私募可交换债换股 债券回售（一债通） 债券回售撤销 债券转托管	

3 交互机制

3.1 会话机制

OMS 与 TDGW 间的会话消息包括登录 Logon、注销 Logout 和心跳 Heartbeat 等消息。



3.1.1 建立会话

OMS 负责发起到交易网关的 TCP 连接，并在连接建立后发送 Logon 消息。OMS 连接后的首个消息必须是 Logon 消息。如果登录成功，TDGW 返回一个 Logon 消息作为确认；如果失败，TDGW 返回一个含失败原因的 Logout 消息，并由 OMS 关闭连接。OMS 只应在收到 TDGW 的登录成功确认后才能发送其他消息。

3.1.2 关闭会话

会话建立成功后，连接双方均可发送 Logout 注销消息，告知对端将关闭会话，一般地，接收方应回复一个 Logout 消息作为回应。Logout 的发起方在收到回应后关闭连接。如果超过 5 秒没有收到对方回传的 Logout 消息，注销发起方也可直接关闭连接。连接双方在发送 Logout 消息后不应再发送任何消息。

3.1.3 维持会话

在消息交换的空闲期间，连接双方通过 Heartbeat 心跳消息维持会话，即连接的任何一方在心跳时间间隔内若没有发送任何消息，需要产生并发送一个 Heartbeat 消息。

心跳间隔通过登录过程进行协商，以登录成功后 TDGW 返回的登录确认消息中的 HeartBtInt 域为准。一般地，当 OMS 发送 Logon 消息中的 HeartBtInt 取值属于[5,60]时，TDGW 返回原值，否则取边界值（5 或 60）。

接收方接收到任何消息（不仅仅是心跳）可重置读心跳间隔计数。若接收方在 5 个心跳间隔内未收到任何消息，则可以认为会话出现异常并立即关闭连接。OMS 关闭连接后，可重新发起会话或切换至其他 TDGW。

3.1.4 其他约定

TDGW 在未成功登录至交易系统时，OMS 将无法成功与 TDGW 建立会话；TDGW 与 ITCS 连接断开时，TDGW 将注销与 OMS 间的会话，此时 OMS 应稍后尝试重建会话，或切换至备用 TDGW 服务。

此外，TDGW 在以下情况下会主动断开与 OMS 间的连接：

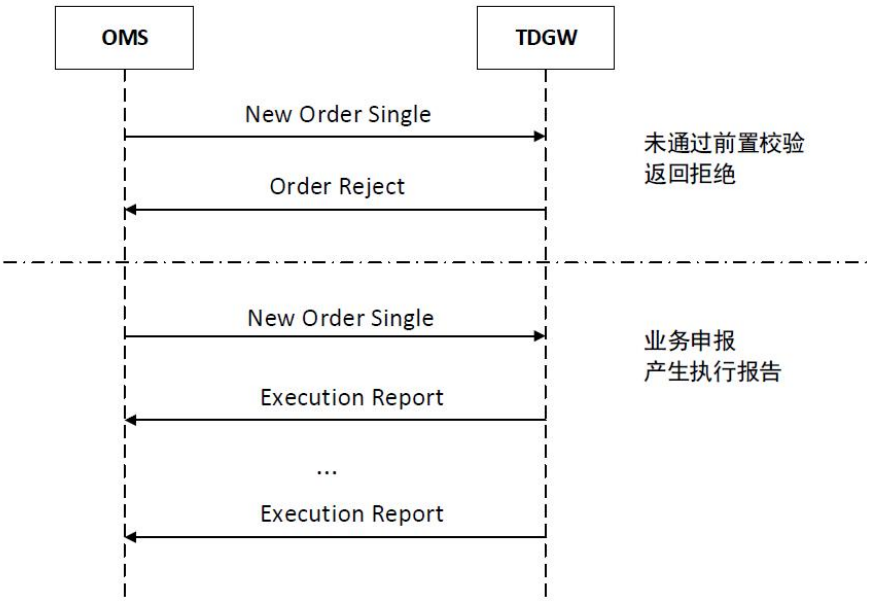
- OMS 与 TDGW 建立 TCP 连接之后，超过 5 秒未完成登录；
- OMS 在登录失败之后，未在 5 秒内关闭连接；
- OMS 在发起注销后，未在 5 秒内关闭连接；
- OMS 未能及时处理 TDGW 下行消息，导致 TDGW 内积压的待发送消息超过特定阈值；
- TDGW 与 ITCS 间的连接已经断开；

3.2 申报与回报

OMS 进行的新订单申报（New Order Single）、询价请求（Quote Request）、报价（Quote）、意向申报（IOI）和成交申报（Trade Capture Report）时，本所交易系统会进行前置检查，若检查未通过将返回订单拒绝（Order Reject）、询价请求响应（Quote Request Ask）和报价状态回报（QuoteStatusReport）、意向申报响应（IOI Response）和成交申报响应（Trade Capture Report Response）消息。

对于通过前置校验的申报，交易系统根据业务的不同，向 OMS 返回相应的执行报告（Execution Report）、转发询价请求（Allege Quote Request）、转发报价（Allege Quote）、转发意向申报（Allege IOI）和转发成交申报（Allege Trade Capture Report）消息。执行报告包括对申报的确认，如对新订单的确认或拒绝响应[1]、撤单响应等；新订单申报及询价请求产生成交时，执行报告中会包含成交确认。

总体示意图如下：



3.2.1 业务类型

订单申报需要指定业务类型（ApplID），其产生的回报以不同的执行报告分区（PartitionNo）划分为多个逻辑上相互独立的数据流。根据具体业务的不同，下表给出业务类型、分区的对应关系，并明确业务相关属性。

业务	消息类型(MsgType)	业务类型(ApplID)	支持撤单	申报确认	成交确认
基金通报价交易	D	600020	Y	Y	Y

[1] 除前置检查未通过返回 Reject 外，执行报告中也包含有因业务校验未通过产生的拒绝响应 Execution Report（ExecType=8）。

业务	消息类型(MsgType)	业务类型(ApplID)	支持撤单	申报确认	成交确认
基金通转入转出	D	600021	N	Y	Y
基金通询价交易	R（询价） S（报价） AJ（报价回复）	600022	Y	Y	Y
开放式基金申购	D	600030	Y	Y	N
开放式基金赎回	D	600040	Y	Y	N
开放式基金转托管转出	D	600050	Y	Y	N
开放式基金分红选择	D	600060	Y	Y	N
要约预受/现金选择权登记	D	600070	Y	Y	N
要约撤销/现金选择权撤销	D	600071	Y	Y	N
融资融券余券划转	D	600080	Y	Y	N
融资融券还券划转	D	600090	Y	Y	N
融资融券担保品划入	D	600100	Y	Y	N
融资融券担保品划出	D	600101	Y	Y	N
融资融券券源划入	D	600110	Y	Y	N
融资融券券源划出	D	600111	Y	Y	N
网络密码服务[2]	U006	600120	N	Y	N
债券质押式协议回购	AE	600130	Y[3]	Y	Y
债券质押式三方回购	AE	600140	Y[3]	Y	Y
协议回购意向申报	6	600150	Y	Y	N
三方回购意向申报	6	600160	Y	Y	N
债券现券意向申报	6	600170	Y	Y	N
确定报价	S（报价） AJ（报价回复）	600180	Y	Y	Y
一债通询价	R（询价） S（报价） AJ（报价回复）	600190	Y	Y	Y
待定报价	R（待定报价发起） S（报价）	600200	Y	Y	Y

业务	消息类型(MsgType)	业务类型(ApplID)	支持撤单	申报确认	成交确认
	AJ（报价回复）				
现券协商成交	AE	600210	Y	Y	Y
合并申报	AE	600220	Y	Y	Y
双非可转债转股冻结	D	600230	Y	Y	N
私募可交换债换股	D	600240	Y	Y	N
债券回售（一债通）	D	600250	Y	Y	N
债券回售撤销	D	600251	Y	Y	N
债券转托管	D	600260	Y	Y	N
三方回购转入转出	D	600270	N	Y	Y
竞买（预留，暂不启用）	D	600290	Y[4]	Y	Y
债券借贷(预留,暂不启用）	AE	600300	Y[3]	Y	Y
场务应急成交录入	AE	600310	N	N	Y

注：

1、Y 为是，N 为否。

2、网络密码服务业务，申报响应消息不进执行报告（Execution Report）。

3、协议回购、三方回购和债券借贷部分成交申报不支持撤单，包括：协议回购到期确认、债券借贷到期结算（债券结算且场内结算）、三方回购到期购回三方回购补券申报。

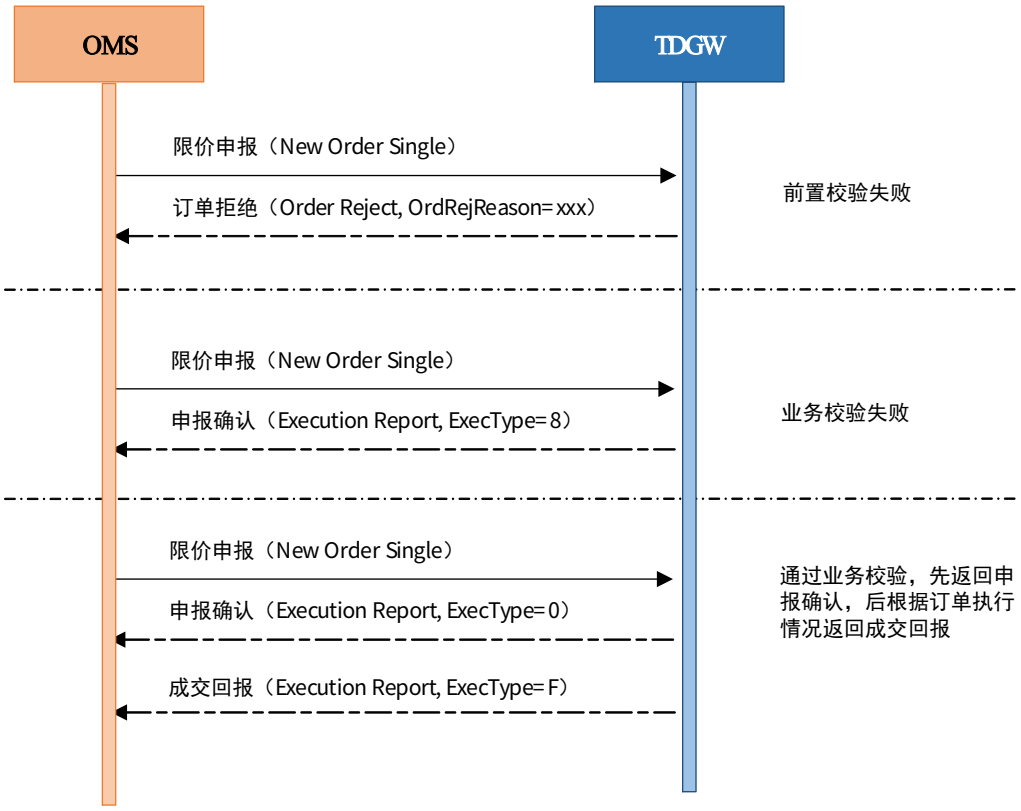
4、在应价方提交有效的应价申报前，可以撤销竞买发起申报；采用单一主体中标方式的，应价申报不可撤销；采用多主体中标方式的，应价申报可以在应价申报时间截止前撤销。

3.2.2 消息流图

3.2.2.1 新订单处理消息流图

3.2.2.1.1 新订单申报

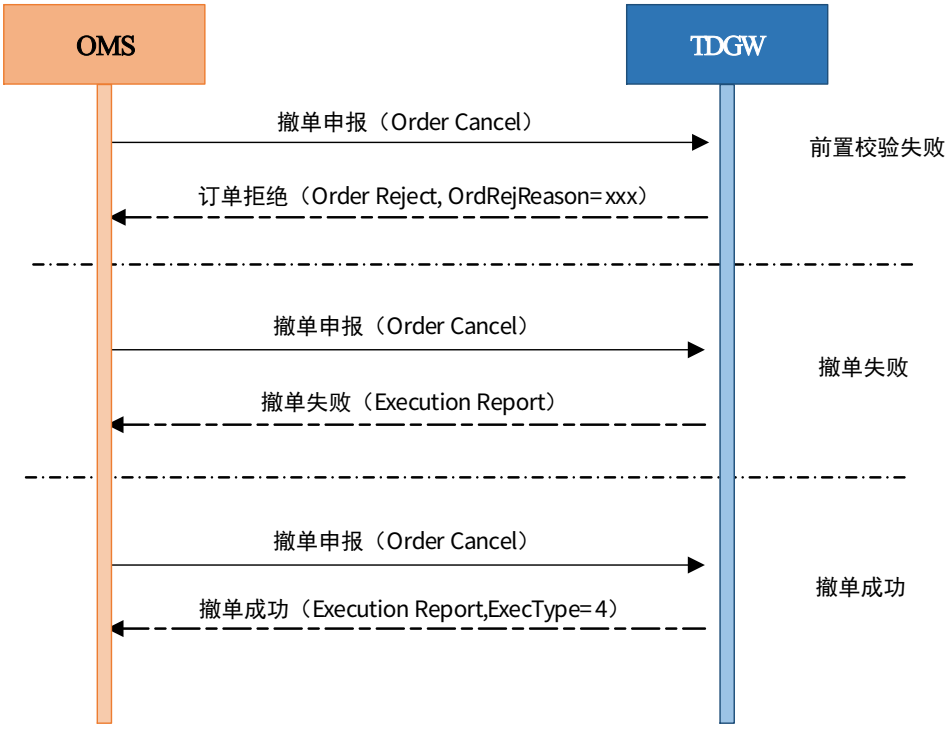
订单（OrdType=2）消息流如下：



暂不支持市价订单。

3.2.2.1.2 新订单撤单

支持撤单的业务类型见前述章节业务类型表。



3.2.2.2 询价报价处理消息流图

询价报价交易总体上可以分为两个阶段：询价阶段和报价阶段。

在询价阶段，询价方申报询价请求，交易系统转发询价请求给报价方（一个或多个），报价方可以选择进行报价也可以不进行报价。

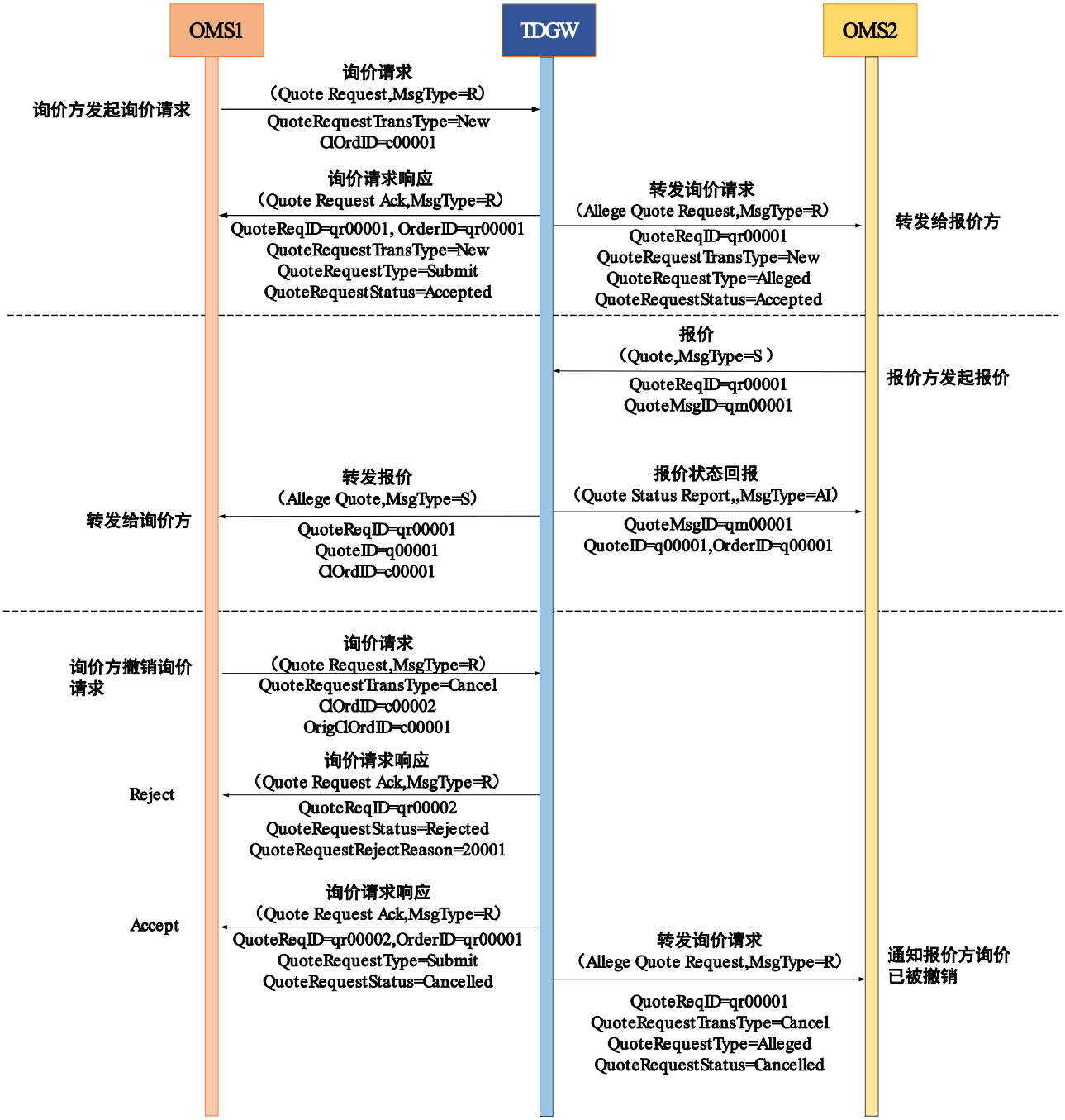
在报价阶段，报价方对询价请求进行报价，交易系统将报价转发给询价方。若报价方想要修改报价，需将原报价撤销后重新发起报价。询价方可以选择接受或不接受报价方的报价。若询价方接受报价，则申报一笔报价回复，交易系统对报价及报价回复进行撮合成交并发送成交回报执行报告。若询价方不接受报价，报价在询价失效后也自动失效。

询价未成交前，询价方可以撤销询价。报价未成交前，报价方可以撤销报价。对于基金通询价，若报价方不进行报价，询价在超时后会自动失效，整个交易过程结束；若询价交易超过总时长仍未成交，则需通过询价请求响应及报价状态回报将失效消息转发至相关方。

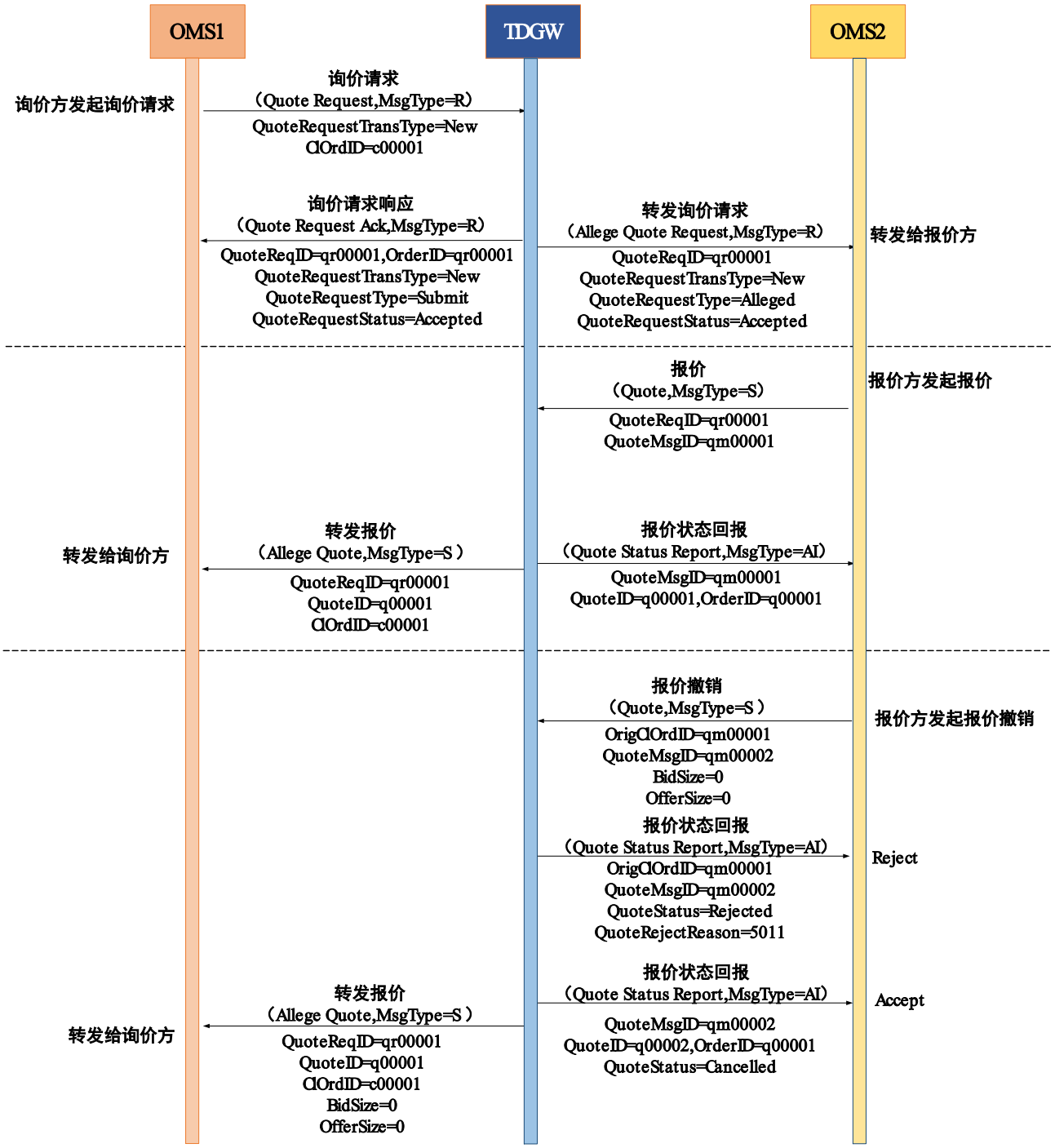
此消息流适用于：基金通询价、一债通询价和待定报价。一债通询价不支持撤销报价后重新回复，每个参与人仅可回复一次。

对于基金通或一债通询价，用户仅可在限定范围内发布询价信息；对于待定报价，用户可针对全市场或在限定范围内发起报价。对于发送给全市场的消息，将通过公开行情对外发布；对于限定范围内发布的询报价消息，则将该消息转发给对应对手方。

3.2.2.2.1 询价方撤销询价请求处理（转发请求）

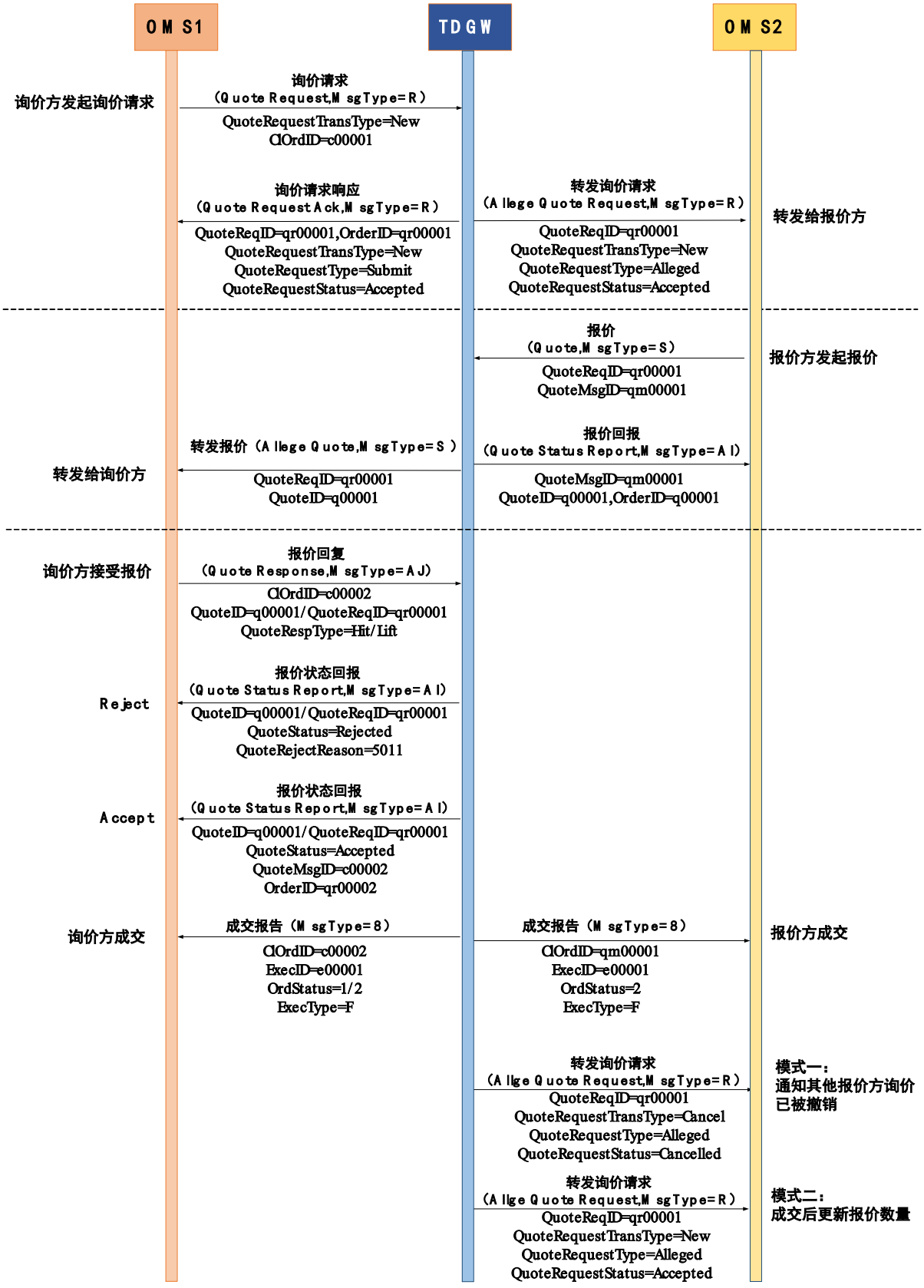


3.2.2.2.2 询价报价方撤销报价处理（转发请求）

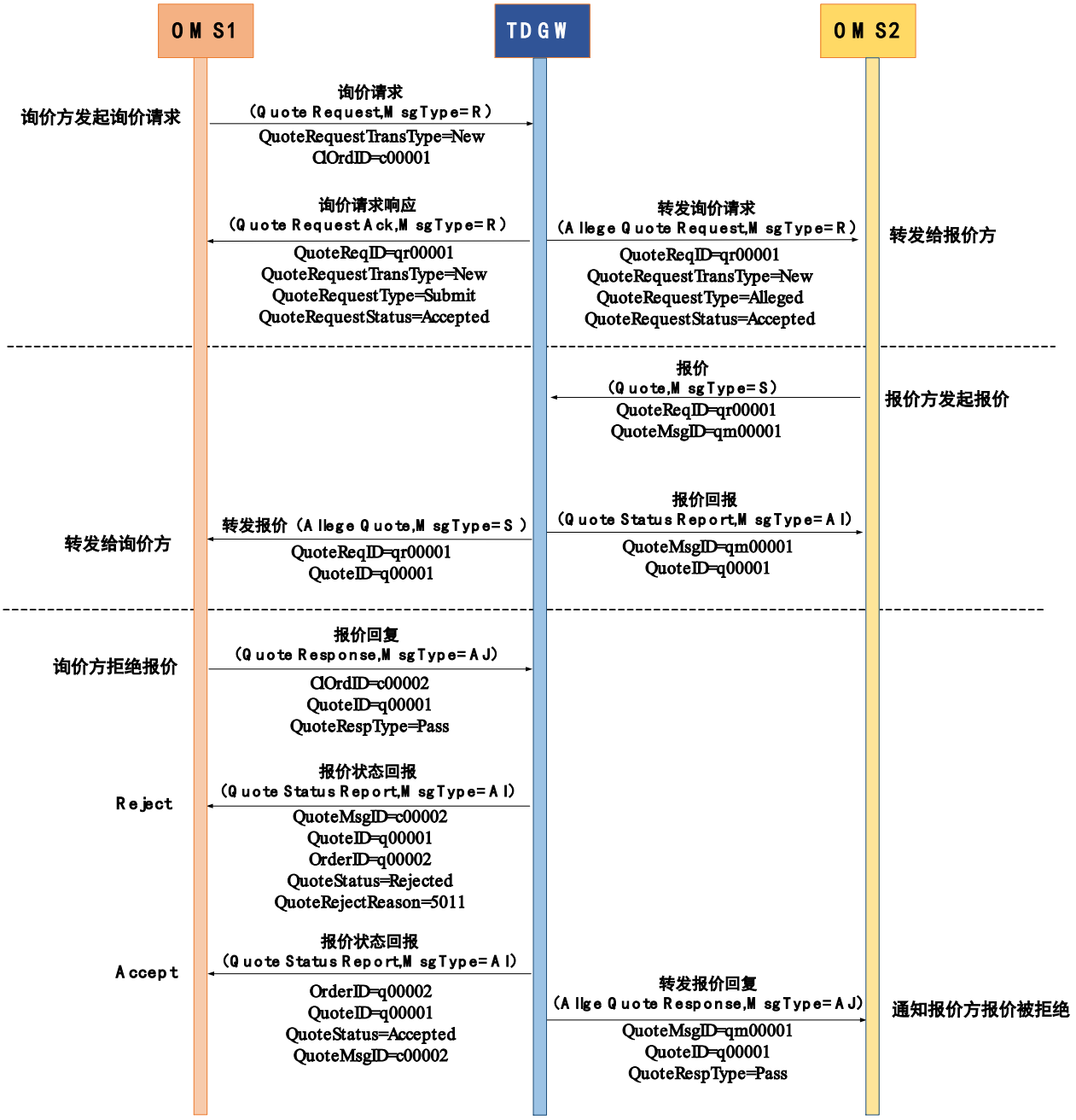


3.2.2.2.3 询价方与报价方成交（转发请求）

询价发起方报价回复确认成交后，模式一将通知其他报价方此询价被撤销，模式二将通知其他报价方更新报价数量。基金通询价和待定报价全部成交适用于模式一，待定报价部分成交适用于模式二。

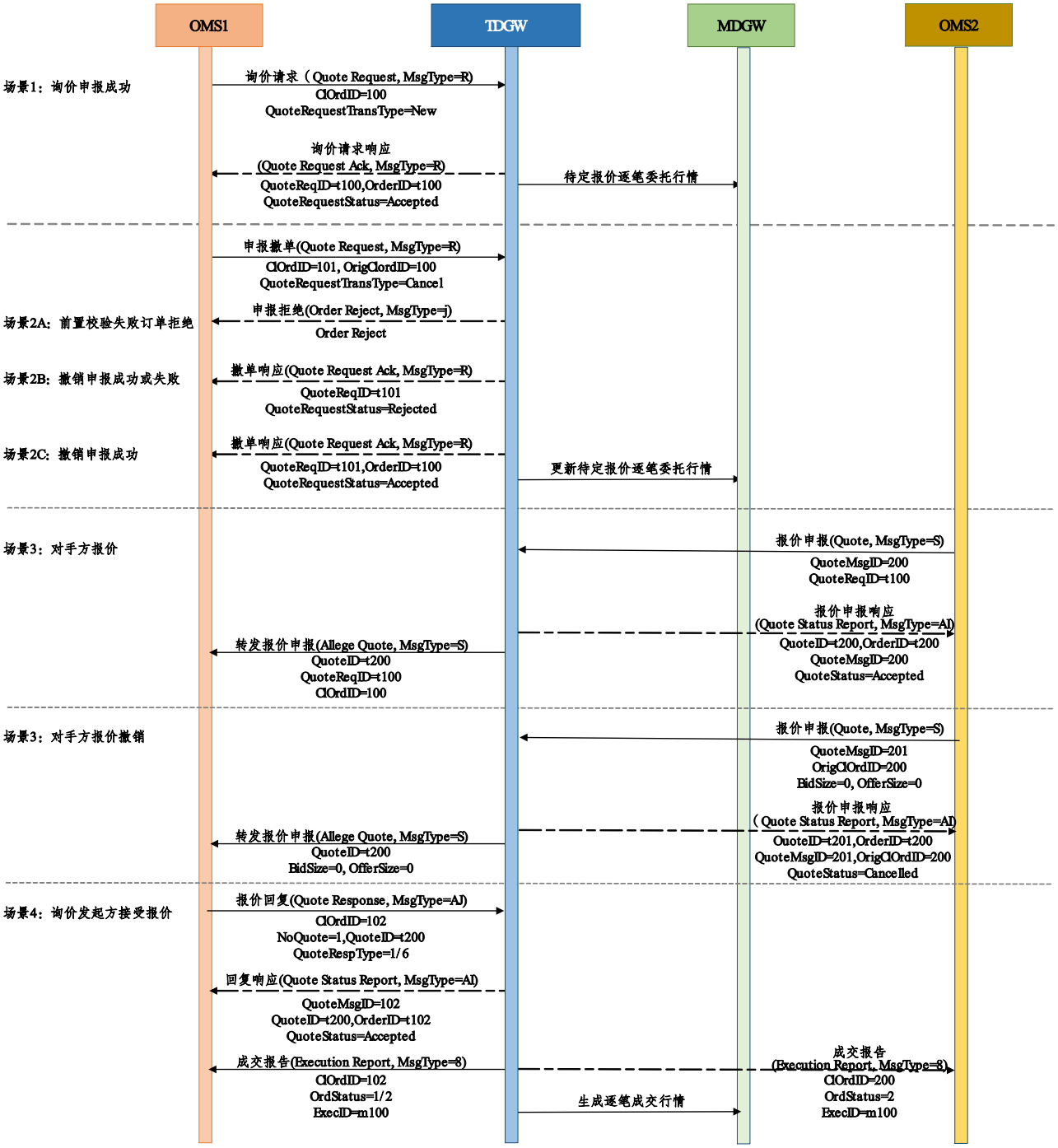


3.2.2.2.4 询价方拒绝报价方报价（转发请求）



3.2.2.2.5 询价报价请求处理（公开行情）

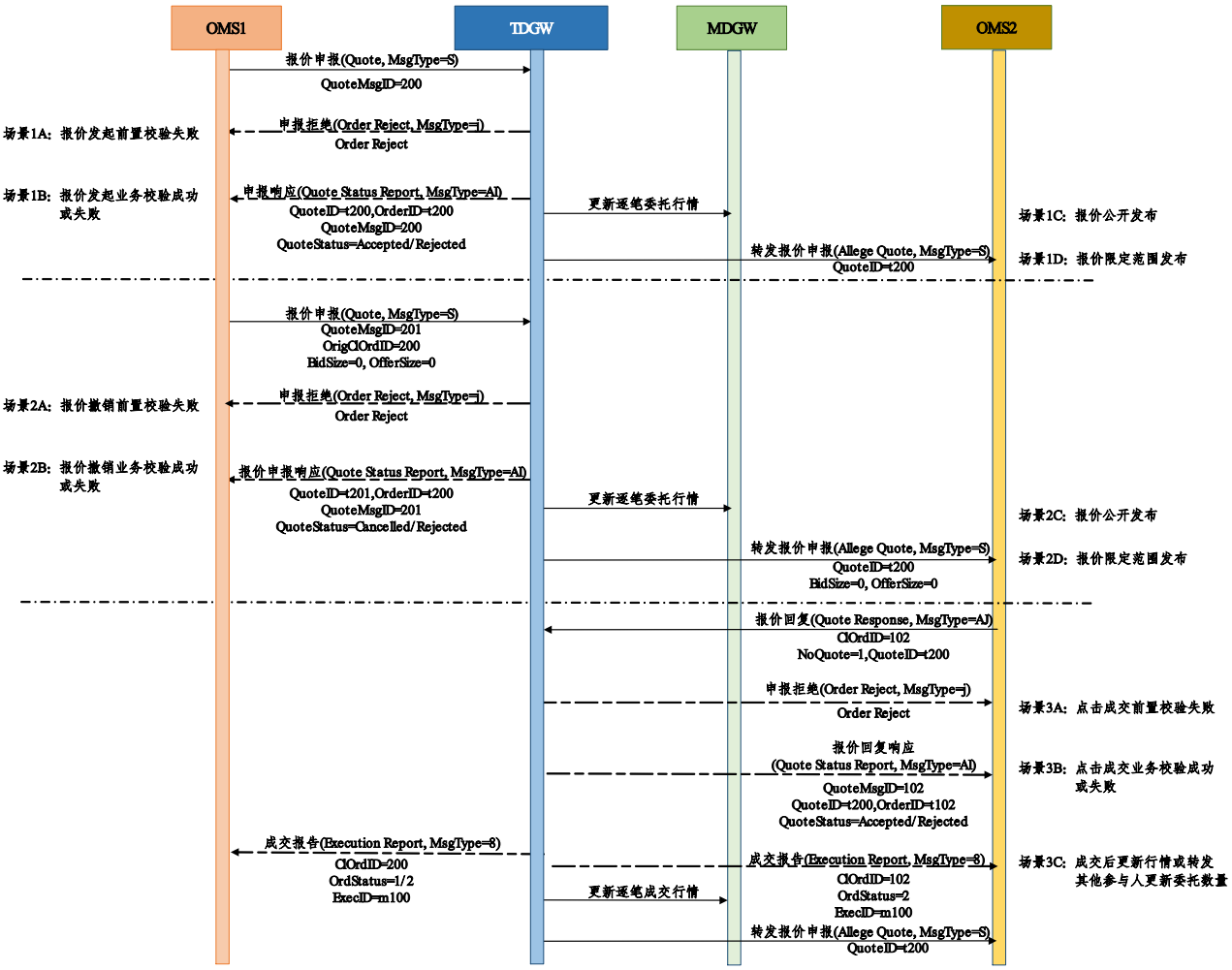
对于公开行情中询价发起方拒绝报价的场景，可参见询价方拒绝报价方报价（转发请求）章节。



3.2.2.3 报价处理消息流图

报价可对全市场或在限定范围内发起。面向全市场的报价，交易系统将以逐笔委托行情向市场发布报价信息，而对于限定范围的报价，交易系统将把报价消息转发给指定对手方。

此消息流适用于确定报价。

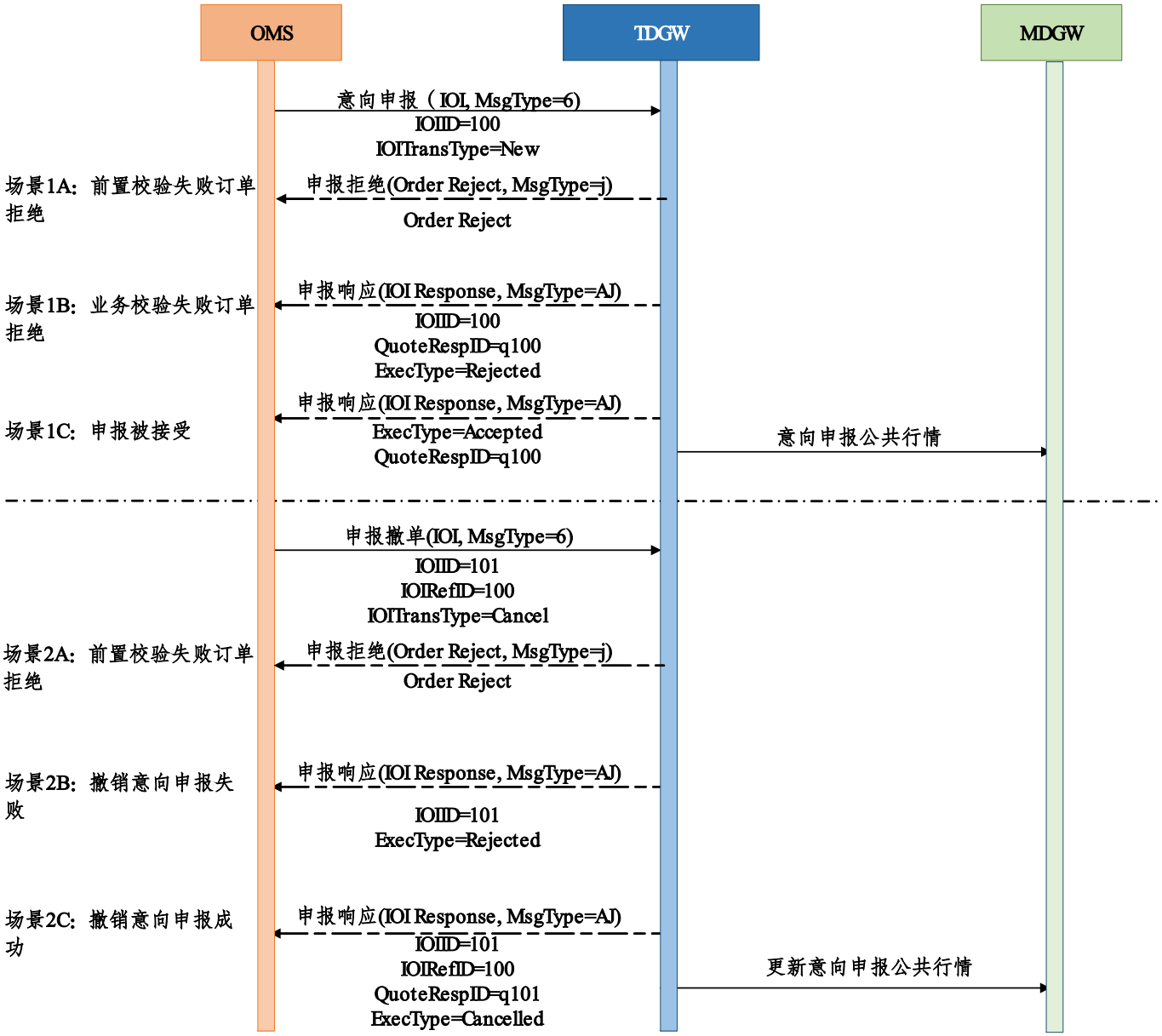


3.2.2.4 意向申报消息流图

意向申报可对全市场或在限定范围内发起。面向全市场的意向申报，交易系统将以逐笔委托行情向市场发布意向申报信息，而对于限定范围的意向申报，交易系统将把意向申报请求转发给指定对手方。

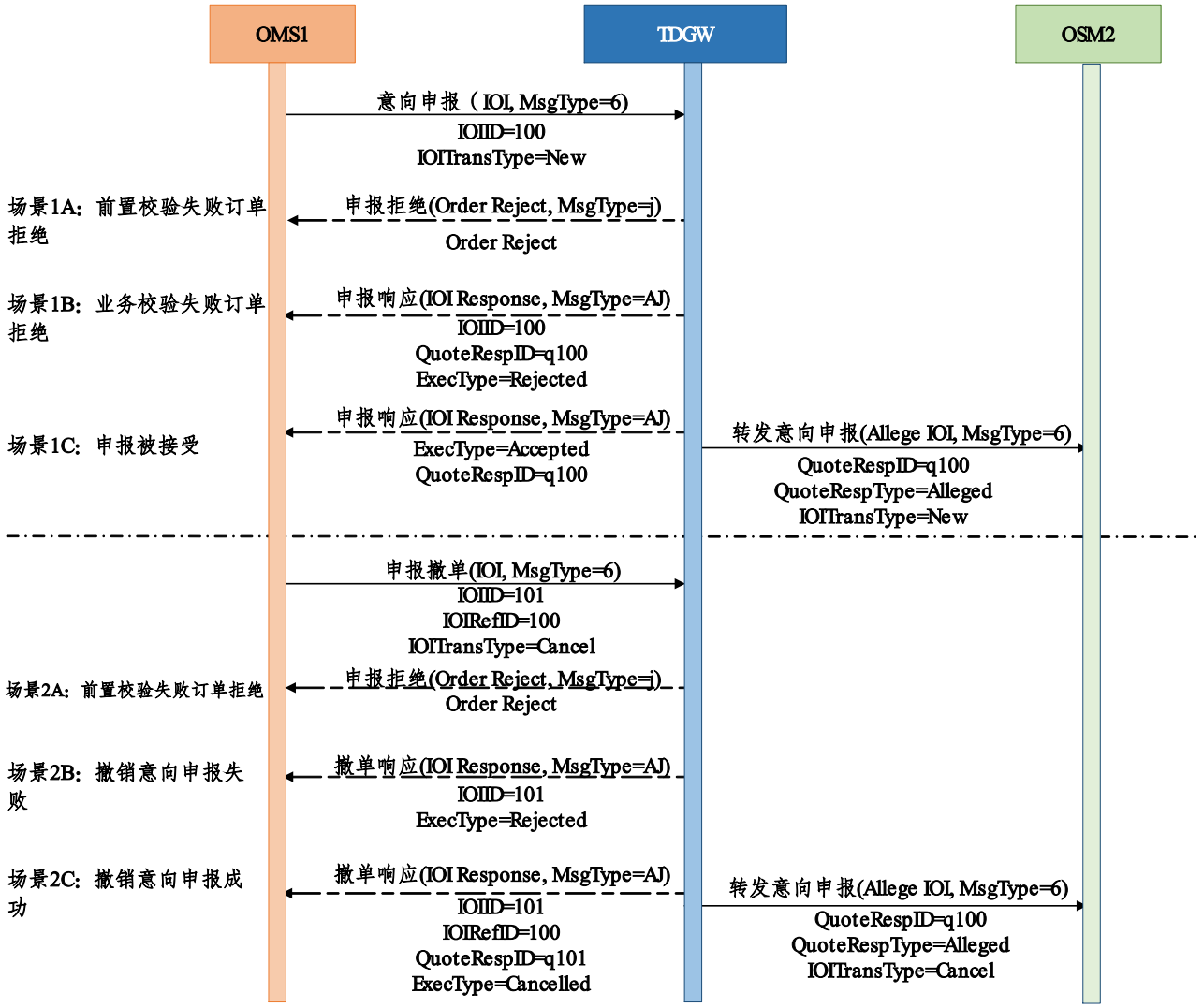
此消息流支持协议回购意向申报、三方回购意向申报和债券现券意向申报。其中协议回购意向申报和三方回购意向申报仅支持对全市场发起。

3.2.2.4.1 意向申报撤销请求处理（公开行情）



3.2.2.4.2 意向申报撤销请求处理（转发请求）

特别地，对于债券现券意向申报，也支持在限定范围内发布意向报价，此时系统将把意向申报转发给指定的对手方。

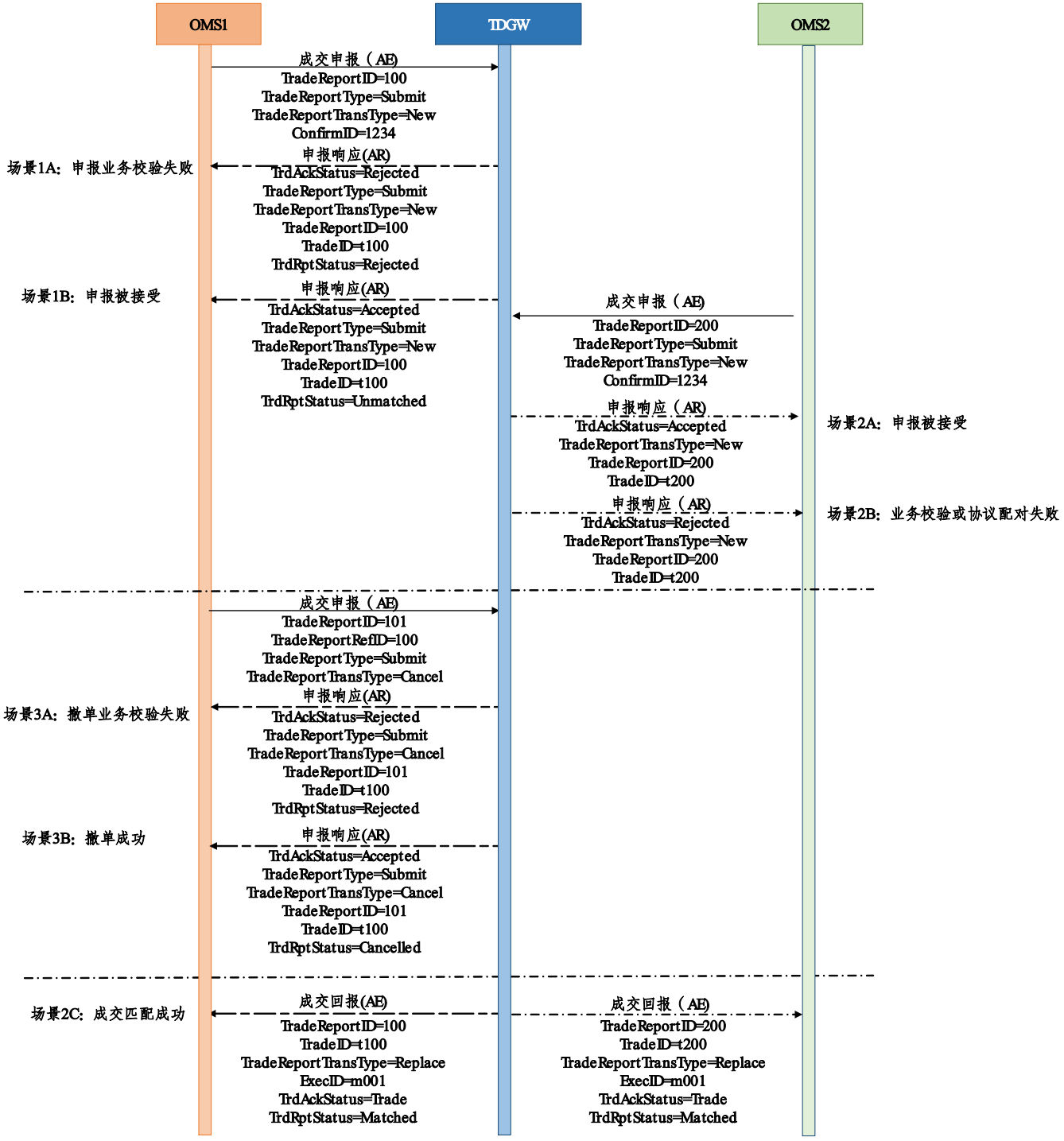


3.2.2.5 成交申报消息流图

3.2.2.5.1 协议配对申报模式

协议配对申报模式指交易双方各申报一笔订单，订单内容包括对手方信息、买卖方向和约定号等，当双方信息匹配后成交，订单未匹配前可以撤销。

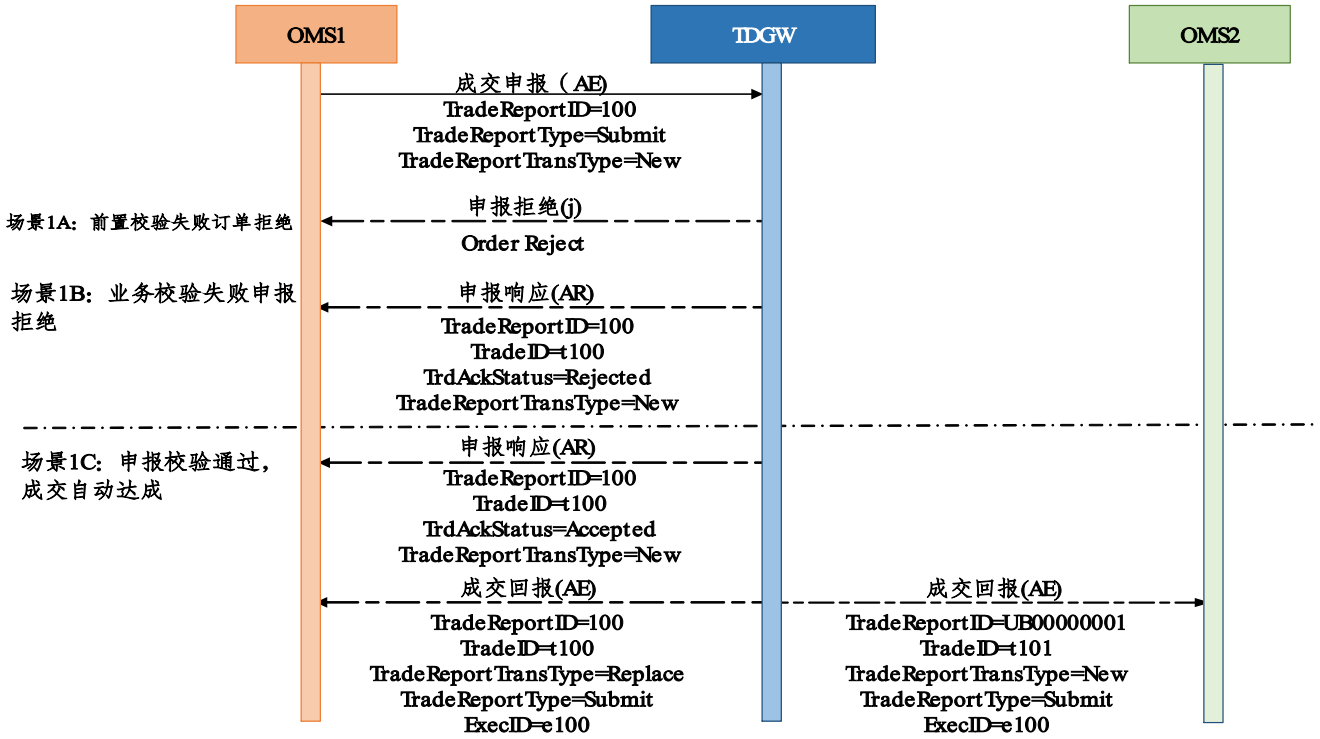
此模式适用于现券协商成交。



3.2.2.5.2 成交报告申报模式

成交报告申报模式指无需对手方手动确认、自动成交、不可撤单的各类申报。

此模式适用于协议回购到期确认、三方回购到期购回和补券申报、债券借贷到期结算（债券结算且场内结算）、场务应急成交录入（由场务人员录入，实际交易双方均可收到成交确认）等。

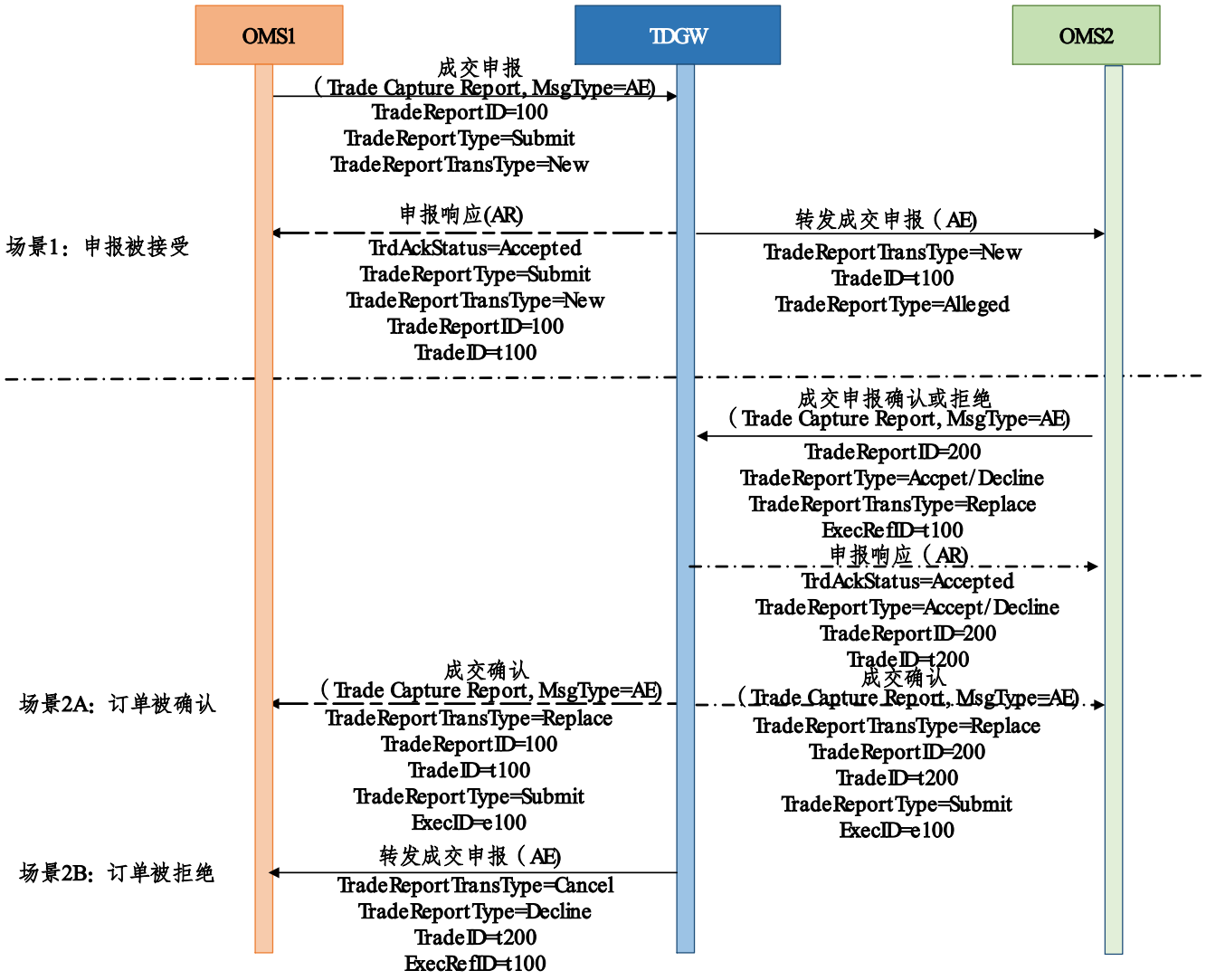


3.2.2.5.3 成交请求申报模式

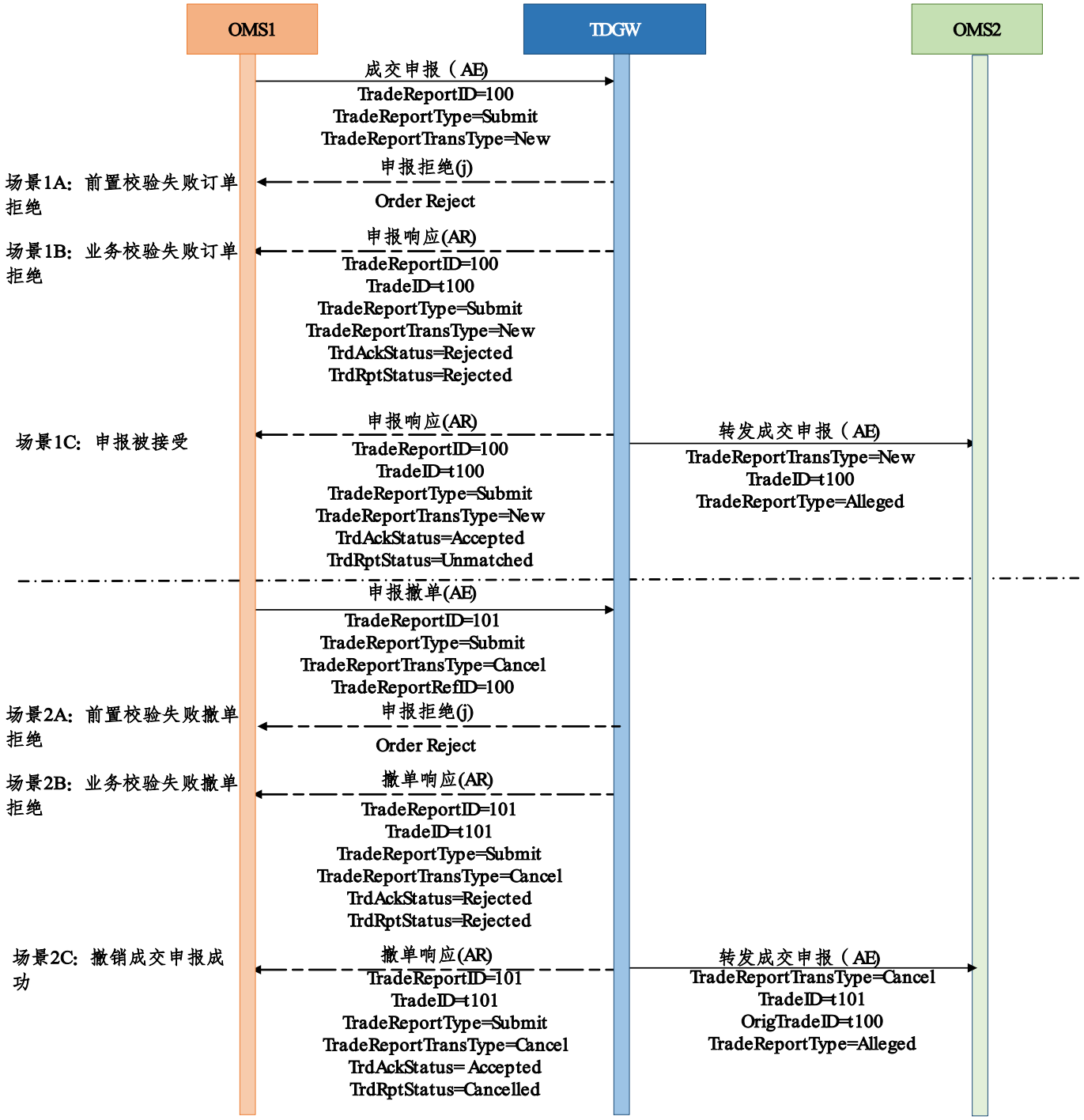
成交请求申报模式指一方发起经由交易服务转发至单个对手方，并由对手方手动确认（或拒绝）的各类申报。

此模式适用于协议回购和三方回购的协商成交、提前终止、换券、到期续做和解除质押申报，以及债券借贷的协商成交、到期结算、提前终止、质押券变更、到期续做、逾期结算和解除质押申报。

3.2.2.5.3.1 申报处理



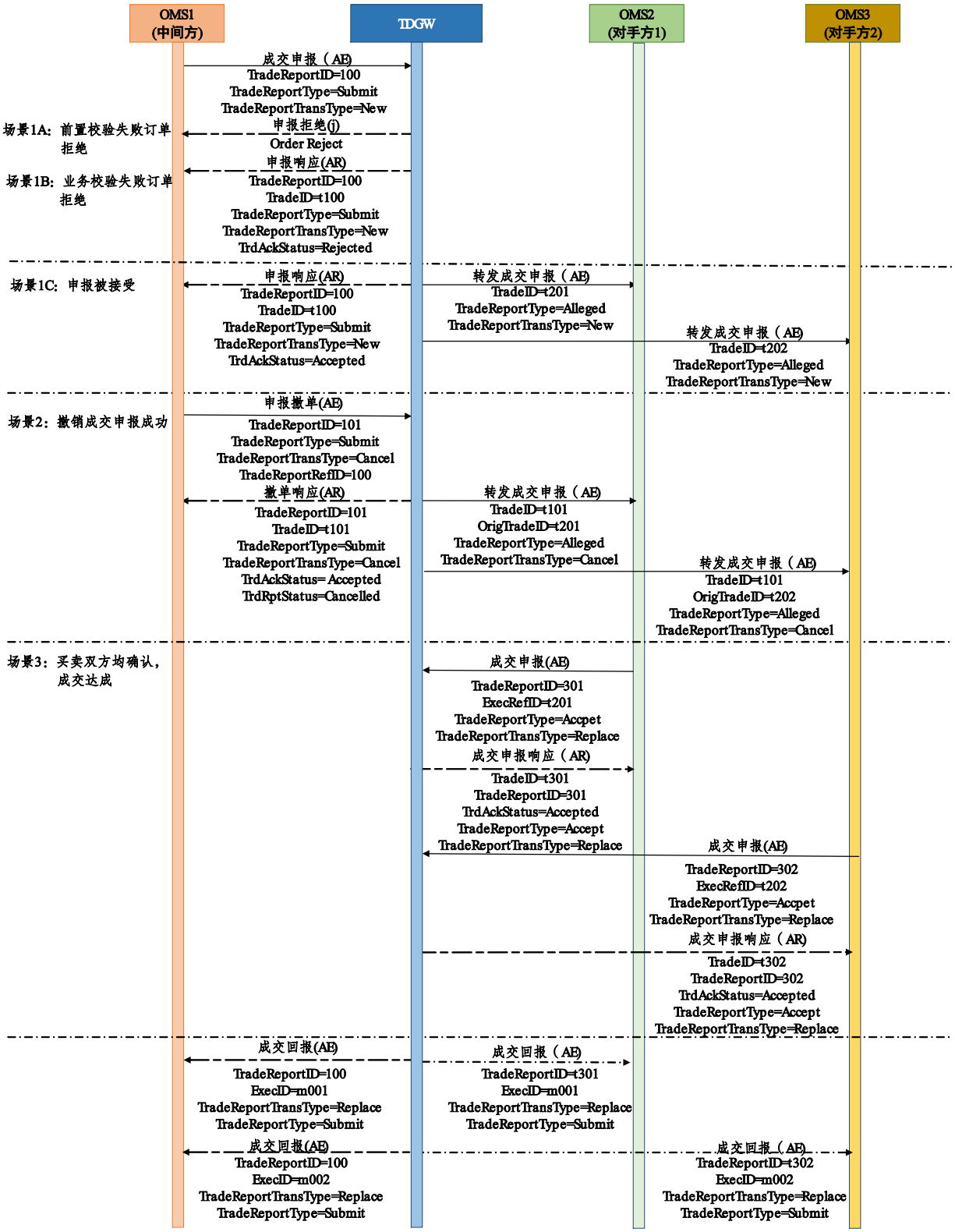
3.2.2.5.3.2 撤单处理


OMS1
TDGW
OMS2
成交申报（AE)
TradeReportID=100
TradeReportType=Submit
TradeReportTransType=New
申报拒绝(j)
场景1A：前置校验失败订单拒绝
Order Reject
申报响应(AR)
场景1B：业务校验失败订单拒绝
TradeReportID=100
TradeID=t100
TradeReportType=Submit
TradeReportTransType=New
TrdAckStatus=Rejected
TrdRptStatus=Rejected
申报响应(AR)
场景1C：申报被接受
TradeReportID=100
TradeID=t100
TradeReportType=Submit
TradeReportTransType=New
TrdAckStatus=Accepted
TrdRptStatus=Unmatched
转发成交申报（AE)
TradeReportTransType=New
TradeID=t100
TradeReportType=Alleged
申报撤单(AE)
TradeReportID=101
TradeReportType=Submit
TradeReportTransType=Cancel
TradeReportRefID=100
申报拒绝(j)
场景2A：前置校验失败撤单拒绝
Order Reject
撤单响应(AR)
场景2B：业务校验失败撤单拒绝
TradeReportID=101
TradeID=t101
TradeReportType=Submit
TradeReportTransType=Cancel
TrdAckStatus=Rejected
TrdRptStatus=Rejected
撤单响应(AR)
场景2C：撤销成交申报成功
TradeReportID=101
TradeID=t101
TradeReportType=Submit
TradeReportTransType=Cancel
TrdAckStatus= Accepted
TrdRptStatus=Cancelled
转发成交申报（AE)
TradeReportTransType=Cancel
TradeID=t101
OrigTradeID=t100
TradeReportType=Alleged

3.2.2.5.4 双边确认申报模式

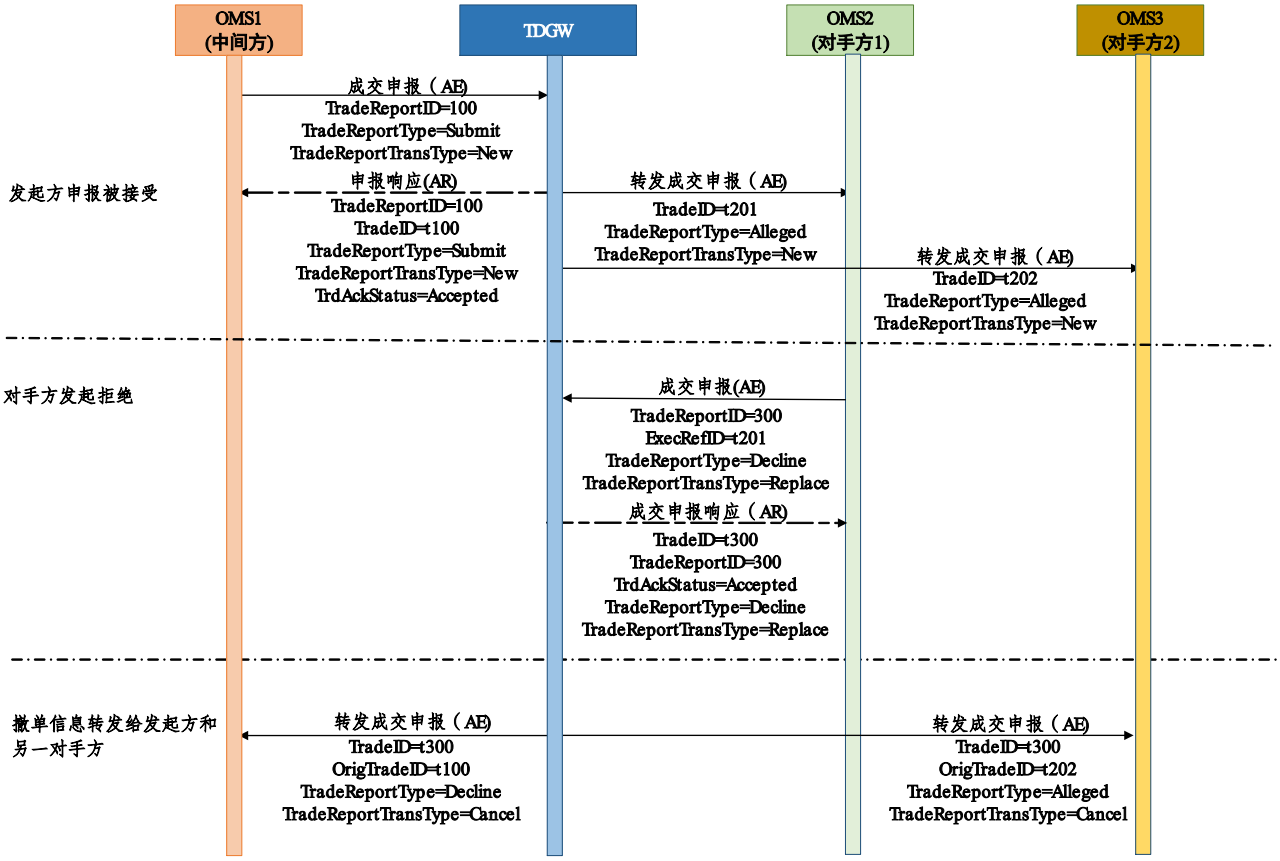
双边确认申报模式指中间方发起一笔包含买卖双方的订单，经交易系统转发给买卖双方分别确认后方可成交，任何一方拒绝该订单后此申报自动撤销。此模式适用于合并申报。

3.2.2.5.4.1 两对手方均确认，成交达成

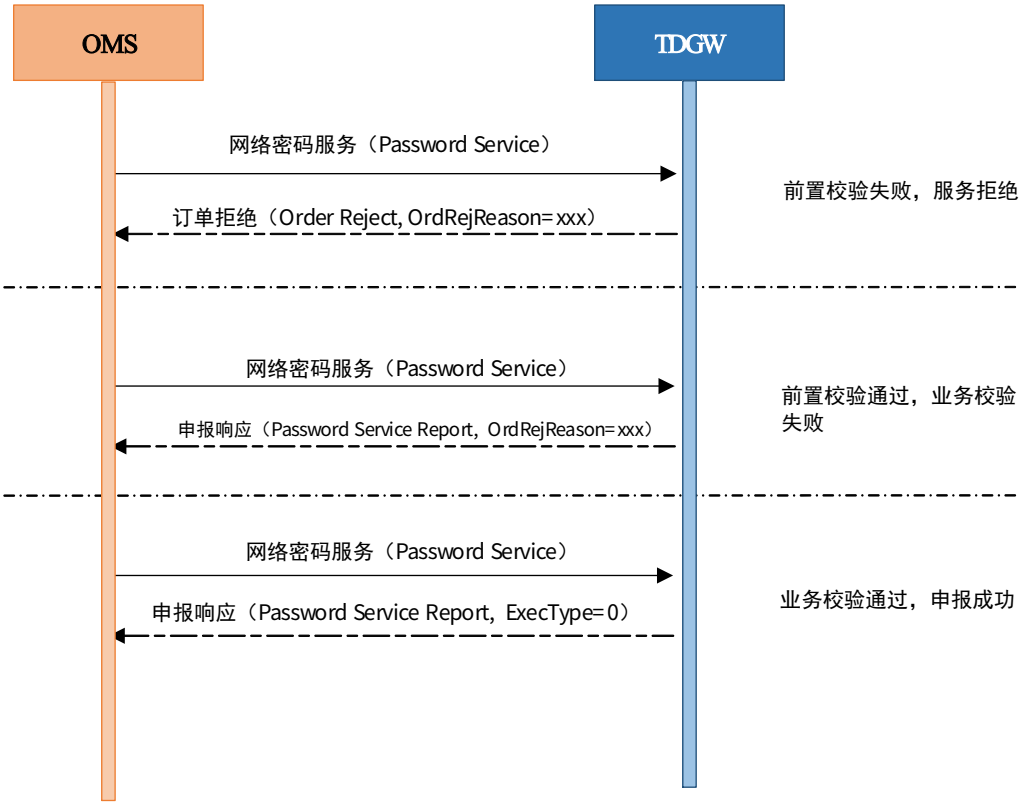


3.2.2.5.4.2 某一对手方拒绝，自动撤销

如两个对手方中任何一方拒绝该订单后此申报自动撤销。



3.2.2.6 网络密码服务处理消息流图



3.2.3 平台状态

OMS 向 TDGW 进行申报应符合交易时间表[2]要求。TDGW 依据交易时间表对平台状态进行了划分，示意图如下。

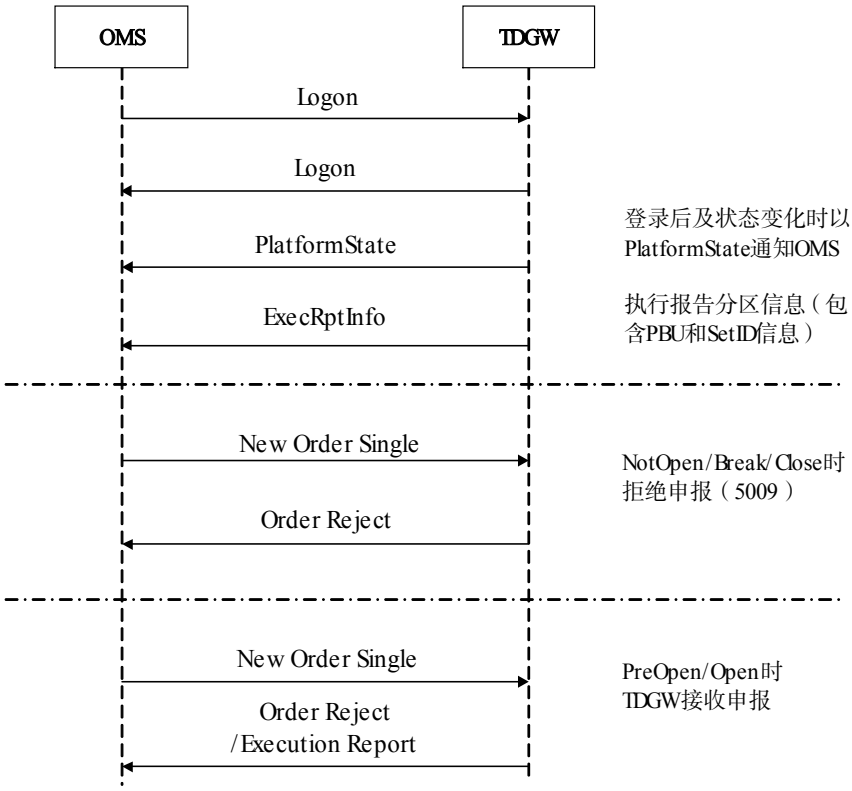


处于 NotOpen、Break、Close 状态时不接收申报，TDGW 返回 Order Reject（OrdRejReason=5009）予以拒绝。PreOpen[3]状态下，TDGW 提前接收 OMS 的申报，并在 Open 时向交易系统转发。PreOpen 及 Open 状态下 TDGW 接收的申报是否被交易系统主机接受，OMS 应以申报确认为准。

在 OMS 与 TDGW 交易通道建立会话成功后，TDGW 向 OMS 发送一条平台状态 PlatformState 消息。当平台状态发生变化时，TDGW 也向已建立会话的 OMS 发送一条平台状态消息予以通知。

[2]时间表以本所交易规则为准。

[3]目前，设置 PreOpen 为各交易时段 Open 前的 5 秒。以交易时段 9:15-9:25 为例，9:14:55TDGW 转为 PreOpen，9:15:00 TDGW 转为 Open 状态。



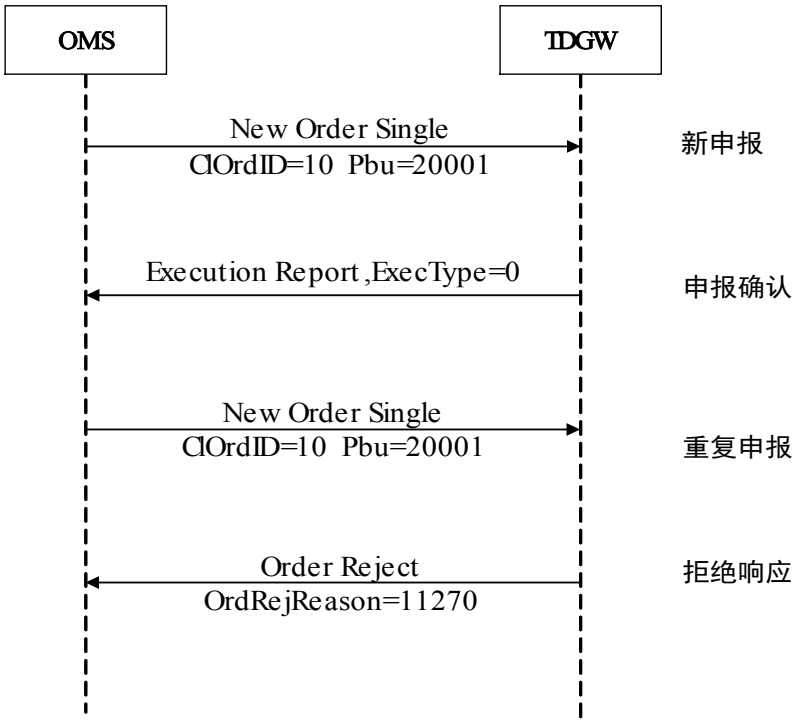
3.2.4 重复订单

交易系统依据申报中的业务 PBU＋会员内部订单编号组合的取值判断申报是否为重复订单；其中，业务 PBU 取 Parties 组件中 PartyID 字段（当 PartyRole=1）。

会员内部订单编号取消息类型相应字段：

申报类型	会员内部订单编号字段
New Order Single	ClOrdID
Order Cancel	ClOrdID
Quote Request	ClOrdID
Quote	QuoteMsgID
Quote Response	ClOrdID
Password Service	ClOrdID
IOI	IOIID
Trade Capture Report	TradeReportID

对于重复订单，TDGW 返回拒绝消息（Order Reject）。



3.2.5 执行报告

每笔执行报告消息都包含 PBU、分区（PartitionNo）和序号（ReportIndex）信息。

PBU 字段表明了该执行报告是在哪一个登录 PBU 上进行申报所产生的回报数据，一般为 OMS 所连接的 TDGW 上正在登录的 PBU；若 TDGW 配置了订阅，该字段取值也可能为被订阅的其他 PBU，详见后续订阅章节的说明。

在每个 PBU 下，执行报告根据分区（PartitionNo）划分为多个编号相互独立的数据流。在一个交易日内，每个执行报告流中的 ReportIndex 由 1 开始连续递增。多个不同业务可以属于同一个分区，从而在同一个流中按序发送。

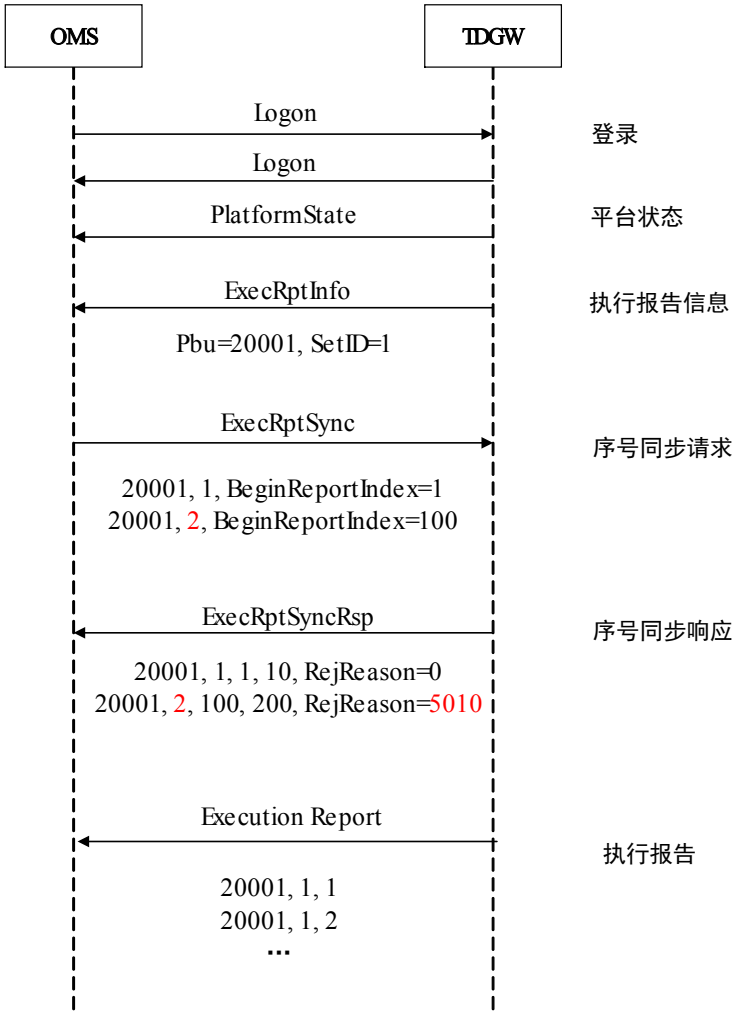
OMS 与 TDGW 建立会话后，TDGW 会向 OMS 推送执行报告分区信息（ExecRptInfo）消息，其中包含 PBU 列表和分区列表，OMS 应根据此信息维护多个逻辑上的执行报告流。

OMS 与 TDGW 建立会话后，应根据 ExecRptInfo 中的信息，向 TDGW 发送各个执行报告流的分区序号同步（ExecRptSync）消息，TDGW 将返回一个分区序号同步响应消息（ExecRptSyncRsp）进行回应。对于 ExecRptSync 请求校验通过的情况，TDGW 将依据其中约定的序号 BeginReportIndex 发送后续执行报告。

OMS 若不发送序号同步消息，TDGW 将不会推动执行报告。如果 OMS 发送的序号同步消息中，BeginReportIndex 大于实际存在的分区回报最大序号，则 TDGW 不会推送执行报告，直至实际分区回报数确实达到 BeginReportIndex 后再开始推送。闭市后，TDGW 不再接收 OMS 申报，但可以通过序号同步消

息重新获取当日历史执行报告数据。

OMS 应对 TDGW 推送的执行报告进行数据持久化操作，且 OMS 应具备识别重复执行报告的能力，避免重复处理。



3.3 恢复场景

OMS 与 TDGW 断开

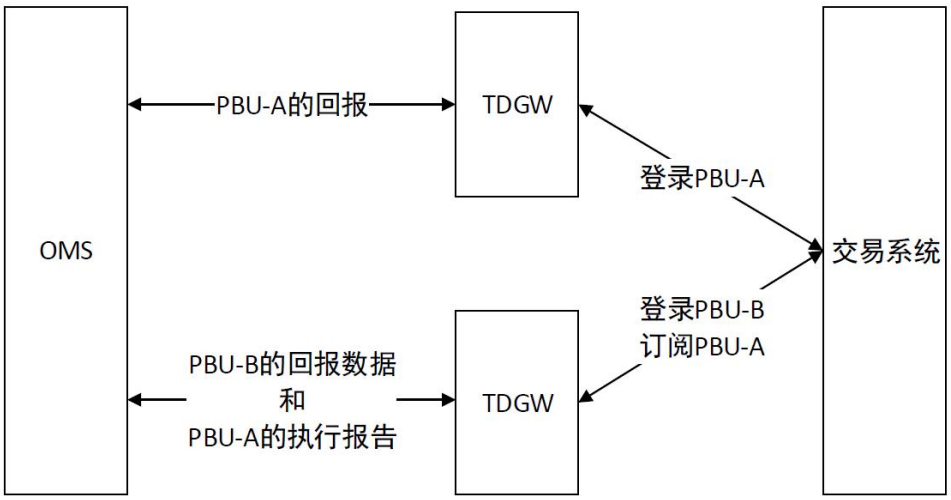
在 OMS 重新与 TDGW 建立会话后，由于断连期间可能存在传输中的消息丢失，OMS 应对上下行两个方向的消息进行恢复。建议 OMS 先对执行报告进行恢复，以尽可能更新断连前申报订单的状态。OMS 可在恢复一段时间后，对仍然处于“已报但未确认”状态的订单进行重新申报。

TDGW 与 ITCS 断开

TDGW 与 ITCS 间连接断开时，TDGW 将通过 Logout（SessionStatus=5006）消息注销与 OMS 间的会话，并尝试切换备用 ITCS。在 TDGW 未登录至交易系统期间，OMS 发起到 TDGW 的会话将无法成功。TDGW 恢复登录，且 OMS 重建与 TDGW 间的会话后，OMS 对消息的恢复处理可与上一节描述相同。

3.4 订阅机制

通过在 TDGW 端进行配置，OMS 可通过与一个 TDGW 间的会话，接收到其他 TDGW 上登录的另一 PBU 所产生的执行报告数据。



TDGW 端登录的 PBU-B，若需订阅另一 TDGW 上登录的 PBU-A 所产生的执行报告，PBU-B 与 PBU-A 需要属于同一市场参与者机构。

目前，交易系统限制每个登录 PBU 可被最多 3 个其他登录 PBU 订阅成功。为减少订阅对登录 PBU 自身回报数据处理的影响，TDGW 将优先发送登录 PBU 自身的回报数据。

在同一市场参与者机构的范围内，订阅的配置和管理由市场参与者机构负责，市场参与者机构在充分利用订阅形成 TDGW 互备的同时，也应做好订阅权限和数据权限的控制。

4 消息定义

4.1 消息结构与约定

每一条 STEP 消息由消息头、消息体和消息尾组成，消息最大长度为 4K 字节。

4.2 数据类型

数据类型相关说明如下：

1. 字符串类型用 CX 表示，X 表示字符串最大字节数，除特别声明，字符串只包含数字、大写字母、小写字母以及空格；字符串实际长度小于字段类型最大长度时可以不补空格；字符串统一采用 UTF-8 编码，不可输入系统保留字符，包括‘\r’，‘\t’，‘\n’，‘\f’，‘\”和‘&’。

2. 十进制整数用 NX 表示，X 表示整数最大位数（不包括正负号），除特殊说明，整数类型均有正负。

3. 浮点数用 NX（Y）表示，X 表示整数与小数总计位数（不包括小数点及正负号），Y 表示小数位数，小数位数不足时必须在后面补 0，除非特殊说明，浮点数类型均有正负。

4. 数值类型字段默认填 0 值，字符串类型默认填空格；针对“暂不启用”字段，填写默认值。

5. 针对部分字段填写固定值的场景，固定值根据实际字段类型进行填写。如字段要求“固定填 1”，若字段类型为 N13(5)，则实际填写 1.00000；若字段类型为 C1，则实际填写字符‘1’。

6. 为简化描述，定义部分业务类型如下：

字段名	类型	说明
price	N13(5)	价格，对于债券、基金或公募 REITs，单位为元，必须小于 1 万元；对于回购或借贷，表示利率，单位为%。
quantity	N15(3)	数量。对于债券，单位为千元面额；对于基金或公募 REITs，单位为份；对于信用保护凭证，单位为 10 张。
amount	N18(5)	金额，单位为元。
date	C8	当前时区日期，格式 YYYYMMDD，YYYY 为年，取值范围 0000-9999，MM 为月，取值范围 01-12，DD 为日，取值范围 01-31。
ntime	C13	当前时区时间，格式 HHMMSSsss，HH 为小时，取值范围 00-23，MM 为分钟，取值范围 00-59，SS 为秒，取值范围 00-59，sss 为毫秒，取值范围 000-999。
Boolean	C1	代表该字符串内容为布尔值，有效取值是 Y 或者 N。

4.2.1 STEP 格式约定

STEP 结构均采用依次排列“标签=字段取值<SOH>”的方式组织，标签为数字字符，前后无空格。除非特别声明外，字段取值均为可打印 ASCII 码字符串表示，不得采用全角字母字符；对于支持中文的字段，采用 UTF-8 编码。<SOH>为字段界定符，值为不可打印 ASCII 码字符：十六进制的 0x01。

STEP 结构中重复组部分的字段需严格遵循接口规格中定义的先后顺序；字符型字段用空格表示空值，即采用“标签= <SOH>”的方式表示（等号后与分隔符间有一个空格），数值型字段用 0 表示空值，即“标签=0<SOH>”（注：含小数数值型字段空值需符合格式要求，例 N13（5）空值表示为“标签=0.00000<SOH>”）。

4.2.2 STEP 消息头

每一个会话或应用消息都有一个消息头，该消息头指明消息类型、消息体长度、消息序号及发送时间等信息。

消息头格式如下：

Tag	域名	必须	说明	类型
8	BeginString	Y	起始串，固定为 FIXT.1.1	C16
9	BodyLength	Y	消息体长度	N9
35	MsgType	Y	消息类型	C16
49	SenderCompID	Y	发送方代码	C32
56	TargetCompID	Y	接收方代码，OMS 发出的消息中填写“TDGW”	C32
34	MsgSeqNum	Y	消息序号	N18
43	PossDupFlag	N	会话层可能重传标志	Boolean
97	PossResend	N	应用层可能重传标志	Boolean
52	SendingTime	Y	发送时间，格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	C21
347	MessageEncoding	N	字符编码类型，取值如下： UTF-8	C16

4.2.3 STEP 消息尾

每一个会话或应用消息都有一个消息尾，并以此终止。消息尾可分隔多个消息，包含有 3 位数的校验和值。

消息尾格式如下：

Tag	域名	必须	说明	类型
10	CheckSum	Y	校验和，消息的最末域	C3

4.2.4 STEP 消息完整性

STEP 消息完整性通过两个方法保证：消息体长度及校验和的验证。

消息长度通过 BodyLength 域记录，表示 BodyLength 域值之后第一个域界定符<SOH>（不包括）与 CheckSum 域号前的最后一个域界定符<SOH>（包括）之间的字符个数。

校验和是把每个字符的 ASCII 码值从消息开头‘8=’中的‘8’开始相加，一直加到紧靠在 CheckSum 域号‘10=’之前的域界定符，然后取按 256 取模得到的结果。计算校验和的代码段可参考附录一“计算校验和”。

4.3 会话消息

会话消息将在以下各节中予以介绍，并定义会话消息格式，会话层消息机制兼容《LFIXT 会话协议接口规范》。

4.3.1 登录消息（MsgType=A）

登录消息（Logon）应是 OMS 建立连接后发送的首个消息。

登录请求消息格式如下：

Tag	域名	必须	说明	类型
	标准消息头		*MsgType = A*	
98	EncryptMethod	Y	加密方法，固定为 0	N8
108	HeartBtInt	Y	心跳间隔，单位为秒	N8
141	ResetSeqNumFlag	N	双方序号重置为 1 的标记（请求时必填 Y）	Boolean
789	NextExpectedMsgSeqNum	N	接收方期望得到的下一条消息序号（请求时必填1）	N18
553	Username	N	用户名（预留）	C32
554	Password	N	密码（预留）	C32
1137	DefaultApplVerID	Y	本次会话中使用的 FIX 消息的缺省版本	C8
1407	DefaultApplExtID	N	本次会话中使用的 FIX 消息的缺省扩展包	N8
1408	DefaultCstmApplVerID	Y	本次会话中 FIX 消息的缺省自定义应用版本。填写格式为 STEP1.20_SH_n.xy 其中 n.xy 为接入协议版本号，如接入协议版本号为 1.70 时，则填写：STEP1.20_SH_1.70。（TDGW 将限制接入的协议版本。当前最低接入协议版本要求为 0.10 版）	C32
	标准消息尾			

4.3.2 注销消息（MsgType=5）

注销消息是发起或确认会话终止的消息。连接双方在发送注销消息之后不应发送任何消息。

注销消息格式如下：

Tag	域名	必须	说明	类型
	标准消息头		*MsgType = 5*	
1409	SessionStatus	N	注销状态码	N4
58	Text	N	文本	C1024
	标准消息尾			

4.3.3 心跳消息（MsgType=0）

心跳消息用于监控通信连接的状况。如果接收方在 5 倍心跳时间间隔内未收到任何消息的时候，可认定会话出现异常，可以立即关闭 TCP 连接。

心跳消息格式如下：

Tag	域名	必需	说明	类型
	标准消息头	*Y*	*MsgType = 0*	
112	TestReqID	N	如是对测试请求消息（4.2.4）而发送的心跳消息，则需包含本域，否则不包含本域。本域的内容复制于测试请求消息（4.2.4）的TestReqID内容	C32
	标准消息尾	*Y*		

4.3.4 测试请求消息（MsgType=1）

测试请求消息能强制对方发出心跳消息。测试请求消息的作用是检查对方消息序号和检查通信线路的状况。对方用带有测试请求标识符（TestReqID）的心跳作应答。TDGW 不会主动发送此消息，但会遵循 FIX 标准引擎规则而响应 OMS 发送的该请求。

测试请求消息格式如下：

Tag	域名	必须	说明	类型
	标准消息头		*MsgType =1*	
112	TestReqID	N	测试请求标识符	C32
	标准消息尾			

4.3.5 重发请求消息（MsgType=2）

TDGW 不会主动发送此消息，但会遵循 FIX 标准引擎规则而响应 OMS 发送的该请求。TDGW 接收到重发请求消息，通过序号重设消息（4.2.7）响应。

重发请求消息格式如下：

Tag	域名	必须	说明	类型
	标准消息头		*MsgType = 2*	
7	BeginSeqNo	Y	起始消息序号	N18
16	EndSeqNo	Y	结束消息序号	N18
	标准消息尾			

4.3.6 会话拒绝消息（MsgType=3）

当接收方收到一条违反会话层规则而不能正确处理的消息时，应该发出会话拒绝消息。TDGW 不会主动发送此消息。

会话拒绝消息格式如下：

Tag	域名	必需	说明	类型
	标准消息头	*Y*	*MsgType = 3*	
45	RefSeqNum	Y	关联消息的序号，即被拒绝消息的序号	N18
371	RefTagID	N	相关错误消息中，出现错误的 FIX 域号	N6
372	RefMsgType	N	相关错误消息的 MsgType	C16
373	SessionRejectReason	N	会话拒绝原因编号	N5
58	Text	N	文本，拒绝的原因描述	C1024
	标准消息尾	*Y*		

4.3.7 序号重设消息（MsgType=4）

序号重设消息用于告知接收方下一个消息的消息序号。序号重设消息的 MsgSeqNum 按标准 FIX 协议规定可以任意填写且接收方不会检查，建议固定填写为 1。TDGW 不会主动发送此消息，但会遵循 FIX 标准引擎规则而响应 OMS 发送的重发请求消息（4.2.5）。当 TDGW 收到用户序号重设消息，则重置入向消息序号 NxtIn = NewSeqNo。

序号重设消息格式如下：

Tag	域名	必需	说明	类型
	标准消息头	*Y*	*MsgType = 4*	
123	GapFillFlag	N	缺口填补标志	Boolean
36	NewSeqNo	Y	新消息序号	N18
	标准消息尾	*Y*		

4.4 应用消息

4.4.1 订单业务类

4.4.1.1 新订单申报（New Order Single, MsgType = D ）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = D		
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
11	ClOrdID	会员内部订单编号	Y	C10
48	SecurityID	产品代码	Y	C12
522	OwnerType	订单所有者类型，取值包括： 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
54	Side	买卖方向，取值： 1 = 买（转入） 2 = 卖（转出）	Y	C1
44	Price	申报价格	N	price
38	OrderQty	申报数量	Y	quantity
110	MinQty	最低成交数量	N	quantity
40	OrdType	订单类型：2=限价（目前仅支持限价）	N	C1
59	TimeInForce	订单有效时间类型，取值范围：0 表示当日有效（GFD）	Y	C1
60	TransactTime	订单申报时间	Y	ntime
544	CashMargin	信用标签，信用交易时填写，取值：XY=担保品买卖、RZ=融资交易、PC=平仓交易	N	C2
1091	PreTradeAnonymity	是否匿名报价，取值：匿名=1，显名=0	N	C1
63	SettlType	结算方式：1=净额结算，2=RTGS 结算 担保券可填 1 或 2；非担保券只能为 2。特别地，	N	C1

			对于公募可转债或公募 REITs，只能填 1。		
198	SecondaryOrderID		第二交易所订单编号	N	C16
10238	BidTransType		竞买业务类型 1 = 竞买预约 2 = 竞买申报 3 = 应价申报	N	C1
10239	BidExecInstType		竞买成交方式 1 = 单一主体中标 2 = 多主体单一价格中标 3 = 多主体多重价格中标	N	C1
432	ExpireDate		失效日期	N	date
529	OrderRestrictions		订单限制，表示是否竞买日自动发起竞买申报 Y = 是 N = 否	N	Boolean
58	Text		用户私有信息	N	C32
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=14，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、业务交易单元号、三方回购专用账户、三方回购专户对应交易单元号、交易员一债通账户、银行间托管账号、营业部代码、结算会员代码、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、开放式基金转托管的目标方、申报编号。	Y	N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户。	Y	N4
发起方业务交易单元号	448	PartyID	发起方业务交易单元代码，填写 5 位业务交易单元号。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4
发起方三方回	448	PartyID	填写三方回购专用账户。	N	C13

购专用账户	452	PartyRole	取 107，表示当前 PartyID 的取值为发起方三方回购专用账户	N	N4
发起方三方回购专户对应交易单元号	448	PartyID	发起方三方回购专用账户对应交易单元号	N	C8
	452	PartyRole	取 106，表示当前 PartyID 的取值为发起方三方回购专用账户对应交易单元号	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
银行间托管账号	448	PartyID	银行间托管账号。债券转托管时适用。	N	C11
	452	PartyRole	取 28,表示当前 PartyID 的取值为银行间托管账号	N	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001,表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N	N4
结算会员代码	448	PartyID	结算会员代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4，表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码。	N	N4
投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010,表示当前 PartyID 的取值为发起方的中国结算开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011,表示当前 PartyID 的取值为发起方中国结算开放式基金账户下的交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81,表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4
开放式基金转托管的目标方	448	PartyID	开放式基金转托管的目标方代理人，对方对应的销售人代码，取值 000-999，不足 3 位左侧补 0。	N	C3
	452	PartyRole	取 30，表示当前 PartyID 的取值为开放式基金转	N	N4

			托管的目标方代理人。		
申报编号	448	PartyID	申报编号	N	C6
	452	PartyRole	取 4003，表示当前 PartyID 的取值为申报编号	N	N4
8532	DividendSelect		分红选项，U=红利转投，C=现金分红	N	C1

说明：

1、各业务填写字段说明如下：

ApplID	业务类型	相关字段填写说明
600020	基金通报价交易	1.Price 字段必填 2.OrderQty 申报数量单位为份； 3. 投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、营业部代码为必填 4.OrdType 必填
600021	基金通转入转出	1.投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、营业部代码为必填 2.OrderQty 申报数量单位为份 3.OrdType 必填
600030	开放式基金申购	1. Price 固定填 1。 2.Side 固定填 1。 3.OrderQty 表示申购金额，单位为元，填写非 0 正整数，累加申购金额为 100 元或其整数倍。 4. SecurityID 填写正股代码（519XXX）。 5.营业部代码必填。
600040	开放式基金赎回	1. Price 固定填 1。 2.Side 固定填 2。 3. OrderQty 表示赎回份额，单位为份，填写非 0 正整数，不支持小数。 4. SecurityID 填写正股代码（519XXX）。 5.营业部代码必填。
600050	开放式基金转托管转出	1.Price 固定填 1。

ApplID	业务类型	相关字段填写说明
		2. OrderQty 表示基金份额，单位为份，填写非 0 正整数，不支持小数。 3.Side 固定填 2。 4. SecurityID 填写正股代码（519XXX）。 5.开放式基金转托管的目标方、营业部代码字段必填。
600060	开放式基金分红选择	1.Price 固定填 1。 2.Side 固定填 1。 3.OrderQty 固定填 1。 4. SecurityID 填写正股代码（519XXX）。 5. DividendSelect 必填，U=红利转投，C=现金分红。 6.营业部代码必填
600070	要约预受/现金选择权登记	1.Price 表示收购价，单位为元，填写非 0 正数。 2.Side 固定填 2。 3. OrderQty 表示收购数量，填写非 0 正整数。 4. SecurityID 填写标的证券正股代码。 5.申报编号字段必填，填写 6 位数字；营业部代码必填。
600071	要约撤销/现金选择权注销	1.Price 表示收购价，单位为元，填写非 0 正数。 2.Side 固定填 1。 3. OrderQty 表示收购数量，填写非 0 正整数。 4. SecurityID 填写标的证券正股代码。 5.申报编号字段必填，填写 6 位数字；营业部代码必填。
600080	融资融券余券划转	1. SecurityID 表示转入的标的产品代码。 2. Price 固定填 1。 3. Side 固定填 1。买入转义为标的证券从“证券公司融券专用账户”过户到“证券公司信用交易担保证券账户”。仅允许投资者信用账户（E 字头）申报。 4.OrderQty 表示划转数量,填写非 0 正整数，允许零散股。 5.营业部代码必填
600090	融资融券还券划转	1. SecurityID 表示转入的标的产品代码。

ApplID	业务类型	相关字段填写说明
		2. Price 固定填 1。 3.Side 固定填 2。卖出转义为标的证券从“证券公司信用交易担保证券账户”过户到“证券公司融券专用账户”。仅允许投资者信用账户（E 字头）申报。 4. OrderQty 表示划转数量，填写非 0 正整数，允许零散股；营业部代码必填。
600100	融资融券担保品划入	1. SecurityID 表示转入的标的产品代码。 2. Price 固定填 1。 3.Side 固定填 1。买入转义为标的证券从“投资者普通证券账户”过户到“证券公司信用交易担保证券账户”。仅允许投资者信用账户（E 字头）申报。 4. OrderQty 划转数量，填写非 0 正整数，允许零散股；营业部代码必填。
600101	融资融券担保品划出	1. SecurityID 表示转入的标的产品代码。 2. Price 固定填 1。 3.Side 固定填 2。卖出转义为标的证券从“证券公司信用交易担保证券账户”过户到“投资者普通证券账户”。仅允许投资者信用账户（E 字头）申报。 4. OrderQty 划转数量，填写非 0 正整数，允许零散股；营业部代码必填。
600110	融资融券券源划入	1. SecurityID 表示转入的标的产品代码。 2. Price 固定填 1。 3.Side 固定填 2，卖出转义为标的证券从“证券公司自营账户”过户到“证券公司融券专用账户”。仅允许证券公司自营账户申报。 4. OrderQty 划转数量，填写非 0 正整数，允许零散股；营业部代码必填。
600111	融资融券券源划出	1. SecurityID 表示转入的标的产品代码。 2. Price 固定填 1。 3.Side 固定填 1。买入转义为标的证券从“证券公司融券专用账户”

ApplID	业务类型	相关字段填写说明
		过户到“证券公司融券自营账户”。仅允许证券公司自营账户申报。 4. OrderQty 划转数量，填写非 0 正整数，允许零散股；营业部代码必填。
600230	双非可转债转股冻结	1. 参与方中需要填写交易员一债通账户；对转托管申报，银行间托管账号必填；三方回购转入转出时，专用账户及其对应的交易单元必填； 2. Side：对于转托管、回售、转股冻结和换股，填 2；对回售撤销申报填 1。对三方回购转入填 1，转出填 2。交易员仅可输入转股冻结，场务可进行转股解冻，转股解冻时方向（订单响应中）填 1。 3. OrderQty 必填；Text 选填。 4. 其他非必填字段无效。
600240	私募可交换债换股	
600250	债券回售（一债通）	
600251	债券回售撤销	
600260	债券转托管	
600270	三方回购转入转出	
600290（预留，暂不启用）	竞买预约	1. BidTransType 填 1，Price 表示底价，OrderQty 表示竞买数量。 2. 参与方中交易员一债通账户必填。 3. SettlType、BidExecInstType、PreTradeAnonymity、ExpireDate、OrderRestrictions 必填，ExpireDate 表示竞买申报日。 4. MinQty 如选择多主体中标时必填，否则不可填；Text 选填；其他非必填字段无效。
	竞买申报	1. BidTransType 填 2，1.Price 表示底价，OrderQty 表示竞买数量。 2. 参与方中交易员一债通账户必填。 3. MinQty 如选择多主体中标时必填，否则不可填。 4. SettlType、BidExecInstType、PreTradeAnonymity 与竞买预约申报相同，本次不可修改；Text 选填；其他非必填字段无效。
	应价申报	1. BidTransType 填 3； 2. 对于单一主体中标，OrderQty 必须与竞买预约数量相等，Price 应当大于等于底价； 3. 参与方中交易员一债通账户必填、PreTradeAnonymity 必填；SecondaryOrderID 必填，表示应价对应的竞买申报编号；Text 选填；其他非必填字段无效。

2、OrdType 字段：开放式基金、要约/现金选择权、融资融券业务申报请求暂不启用。

3、Text 字段对于开放式基金、融资融券、要约/现金选择权非交易业务仅前 12 位有效。

4、“发起方营业部代码”字段：5 位数字表示，目前使用区间为[00000，65535]，不足 5 位的左侧补 0。营业部代码可于本所网站会员专区查询，若无对应营业部代码，则该字段填写空格。

5、“结算会员代码”字段：B 股结算会员代码，对于 A 股投资者取值无意义，对于 B 股境外投资者 C9 类账户此记录不能为空，直接填写中登公司公布的 B 股结算会员代码，不足 5 位的左侧补 0,。对于 B 股境内投资者 C1 类账户无意义，前 5 位有效。对于开放式基金、要约/现金选择权、融资融券非交易业务无意义。

6、OwnerType 字段：开放式基金、要约/现金选择权、融资融券非交易业务申报请求暂不启用。

7、参与方个数应小于等于 14，重复组个数应与申报参与方个数相匹配并按序依次填写，非必填参与方可跳过。若参与方重复申报，则允许覆盖并仅以最末尾上报值为准（后处理逻辑相同）。

4.4.1.2 撤单申报（Order Cancel, MsgType = F）

标签	字段名		字段描述	必须	类型
消息头			MsgType = F		
1180	ApplID		业务类型	Y	C6
11	ClOrdID		会员内部订单编号	Y	C10
48	SecurityID		证券代码	Y	C12
522	OwnerType		订单所有者类型	Y	N3
54	Side		买卖方向，取值：1 表示买（转入），2 表示卖（转出）	Y	C1
41	OrigClOrdID		原始会员内部订单编号，指被撤单订单的 ClOrdID	Y	C10
60	TransactTime		订单申报时间	Y	ntime
58	Text		用户私有信息	N	C32
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=12，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、业务交易单元号、三方回购专用账户、三方回购专户对应交易单元号、交易员一债通账户、银行间托管账号、营业部代码、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、申报编号。	Y	N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户。	Y	N4
发起方业务交易单	448	PartyID	发起方业务交易单元代码，填写 5 位业务交易单元号。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4

元号					
发起方三方回购专用账户	448	PartyID	填写三方回购专用账户。	N	C13
	452	PartyRole	取 107，表示当前 PartyID 的取值为发起方三方回购专用账户	N	N4
发起方三方回购专户对应交易单元号	448	PartyID	发起方三方回购专用账户对应交易单元号	N	C8
	452	PartyRole	取 106，表示当前 PartyID 的取值为发起方三方回购专用账户对应交易单元号	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
银行间托管账号	448	PartyID	银行间托管账号，填写 11 位银行间托管账号。债券转托管时适用。	N	C11
	452	PartyRole	取 28，表示当前 PartyID 的取值为银行间托管账号	N	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N	N4
投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的中国结算开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方中国结算开放式基金账户下的交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4
申报编号	448	PartyID	申报编号	N	C6
	452	PartyRole	取 4003，表示当前 PartyID 的取值为申报编号	N	N4

说明：

1、基金通报价交易 ApplID=600020，基金通转入转出 ApplID=600021 时，投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、营业部代码为必填。

2、撤单申报中，APPIID、发起方投资者账户、发起方业务交易单元号、发起方三方回购专用账户、发起方三方回购专户对应交易单元号、发起方交易员一债通账户、银行间托管账号、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点、SecurityID、Side 取值应与原申报相同，OrigClOrdID 的取值应与待撤原订单的 ClOrdID 相同，Text 字段选填。对于开放式基金、要约/现金选择权、融资融券非交易业务，仅要求 ApplID、发起方业务交易单元号、SecurityID 取值应与待撤原订单相同，OrigClOrdID 的取值应与待撤原订单的 ClOrdID 相同；Text 字段仅前 12 位有效。

3、要约/现金选择权业务撤单申报时，申报编号字段必填，且需与原订单保持一致。

4、发起方投资者账户、发起方营业部代码、OwnerType、Side 字段对于开放式基金、要约/现金选择权、融资融券非交易业务暂不启用。

5、发起方营业部代码对开放式基金、要约/现金选择权、融资融券非交易业务、双非可转债转股冻结、私募可交换债换股、债券回售（一债通）、债券回售撤销、债券转托管、三方回购转入转出和竞买业务暂不启用，其他业务必填。

4.4.2 询价报价业务类

4.4.2.1 询价请求（Quote Request, MsgType=R）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType=R		
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
11	ClOrdID	会员内部编号	Y	C10
41	OrigClOrdID	原始会员内部订单编号，指被撤单订单的 ClOrdID	N	C10
537	QuoteType	报价类别 1=Tradeable，表示可交易的报价	N	N4
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者	Y	N3

		104=自营交易		
60	TransactTime	订单申报时间	N	ntime
48	SecurityID	证券代码	Y	C12
54	Side	买卖方向，取值有： 0＝ 双边报价 1＝ 买 2＝ 卖	Y	C1
38	OrderQty	订单数量 特别地，Side 为 0 时表示买入数量	N	quantity
44	Price	订单价格 特别地，Side 为 0 时表示买入价格	N	price
640	Price2	Side 为 0 时表示卖出价格	N	price
32	LastQty	Side 为 0 时表示卖出数量	N	quantity
1138	DisplayQty	冰山订单数量	N	quantity
2551	StartPriceRange	价格下限 预留字段，暂不启用	N	price
2552	EndPriceRange	价格上限 预留字段，暂不启用	N	price
10200	QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0-New，新订单 1-Cancel，撤销	Y	C1
1091	PreTradeAnonymity	是否匿名报价，取值：匿名=1，显名=0	N	C1
8418	FullAmountTrade	是否全额成交：1=是，2=否	N	C1
63	SettlType	结算方式：1=净额结算，2=RTGS 结算 担保券可填 1 或 2；非担保券只能为 2。特别地，对于公募可转债或公募 REITs，只能填 1。	N	C1
207	SecurityExchange	结算场所：1=中国结算，2=中央结算 双边托管券，可填 1 或 2，单边托管券只能填其实际托管方。预留字段，暂不启用。	N	C1
10216	SettlPeriod	结算周期：	N	C1

			0 = T+0 1 = T+1 2 = T+2 3 = T+3 预留字段，暂不启用		
126	ExpireTime		询价请求失效时间，预留字段，暂不启用	N	ntime
10300	NoCounterpartyParticipant		询价接收方参与人个数	Y	N10
→	10301	CounterpartyParticipantCode	询价接收方参与人代码，支持特殊符号‘-’	N	C12
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=8，后接重复组，依次包含询价发起方的投资者账户、业务交易单元代码、营业部代码、交易员一债通账户、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
发起方投资者账户	448	PartyID	询价发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	Y	N4
发起方业务交易单元号	448	PartyID	询价发起方业务交易单元代码，填写 5 位业务交易单元号。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	询价发起方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为询价发起方的营业部代码。	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
投资者中国结算开放	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4

式基金账户					
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1、对于询价请求订单申报，TransactTime 选填，其他非必填字段要求如下，未提及的非必填字段均无效：

业务类型（ApplID）	申报填写说明	撤单填写说明
基金通询价（600022）	1. Side 仅可填 1 或 2，OrderQty 表示对应方向数量 2. 投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、营业部代码为必填 3. “询价接收方参与人个数”字段可填[0,50]，填 0 时，“询价接收方参与人代码”字段必须为空，表示向市场该产品对应全部做市商发起询价	OrigClOrdID 必填
待定报价（600200）	1. SettlType、FullAmountTrade、PreTradeAnonymity 必填 2. NoCounterpartyParticipant 必填，可填[0,5]，0 表示发送给全市场；如指定范围发送，CounterpartyParticipantCode 必填 3. DisplayQty 选填，需要为最小变动单位的正整数倍；DisplayQty 和 FullAmountTrade=1 不可同时申报。如指定范围发送，不支持冰山订单。 4. 支持双边报价：如 Side 填 0，则 OrderQty、Price、LastQty、Price2 均需填写；否则仅填写对应方向的价格和数量即可 5. 发起方交易员信息必填	OrigClOrdID、发起方交易员信息必填
一债通询价	1. Side 仅可填 1 或 2	

业务类型（ApplID）	申报填写说明	撤单填写说明
（600190）	2. OrderQty、PreTradeAnonymity、SettlType 必填 3. NoCounterpartyParticipant 必填，可填[0,5]，填 0 时表示发给潜在投资者；大于 0 时，CounterpartyParticipantCode 必填 4. 发起方交易员信息必填	

2、对于待定报价双边报价，如在限定范围内发布，将拆分为两笔子订单转发给对手方；如全市场发布，则拆分为两笔子订单通过逐笔行情对外发布。

4.4.2.2 询价请求响应（Quote Request Ack, MsgType=R）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType=R		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
131	QuoteReqID	询价请求编号，交易所唯一化处理后的询价请求 ID	Y	C18
11	ClOrdID	会员内部编号	Y	C10
41	OrigClOrdID	原始会员内部订单编号，指被撤单订单的 ClOrdID	N	C10
2405	ExecMethod	申报来源 0 = 网页端申报 1 = 接口端（TDGW）申报	N	C1
537	QuoteType	报价类别 1=Tradeable，表示可交易的报价	N	N4
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
60	TransactTime	回报时间	N	ntime
48	SecurityID	证券代码	Y	C12

54	Side	买卖方向，取值有： 0 = 双边 1=买 2=卖	Y	C1
38	OrderQty	订单数量，撤单时表示剩余数量 Side 为 0 时表示买入数量，双边撤单时表示买入剩余数量	N	quantity
32	LastQty	Side 为 0 时表示卖出数量，双边撤单时表示卖出剩余数量	N	quantity
2551	StartPriceRange	价格下限	N	price
2552	EndPriceRange	价格上限	N	price
37	OrderID	交易所订单编号 QuoteRequestStatus=0 时为交易所订单编号， QuoteRequestStatus=4 时为被撤询价单交易所订单编号	N	C16
17	ExecID	订单执行编号	N	C16
10200	QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0-New，新订单 1-Cancel，撤销	Y	C1
303	QuoteRequestType	询价请求类型 101=Submit，提交 102=Alleged，转发	Y	C3
10222	QuoteRequestStatus	询价请求状态 0=Accepted，已接受 4=Cancelled，已撤销 5=Rejected，已拒绝 7=Expired，已超时	Y	C1
658	QuoteRequestRejectReason	订单拒绝码	N	C5
10237	QuoteRequestRejectText	订单拒绝原因说明	N	C32
126	ExpireTime	询价请求失效时间，预留字段，暂不启用	N	ntime

10300	NoCounterpartyParticipant		询价接收方参与人个数	Y	N10
→	10301	CounterpartyParticipantCode	询价接收方参与人代码，支持特殊符号‘-’	N	C12
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=9，后接重复组，依次包含询价发起方的登录或订阅交易单元、投资者账户、业务交易单元代码、营业部代码、交易员一债通账户、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
发起方交易单元	448	PartyID	发起方登录或订阅交易单元（除基金通外必填）	N	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	N	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	询价发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	Y	N4
发起方业务交易单元号	448	PartyID	询价发起方业务交易单元代码，填写 5 位业务交易单元号。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	询价发起方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为询价发起方的营业部代码。	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4

投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1. 对于以下业务，发起方交易单元、发起方交易员一债通账户、TransactTime、ExecMethod 有效；申报或撤单成功时，OrderID 有效；订单被拒绝时，QuoteRequestRejectReason 有效。其他非必填字段要求如下，未提及的非必填字段均无效：

业务类型（ApplID）	申报填写说明	撤单
待定报价（600200）	NoCounterpartyParticipant/CounterpartyParticipantCode、OrderQty、LastQty 同申报信息	1. 撤单成功时 OrderQty 或 LastQty 表示剩余数量，否则无效。 2. OrigClOrdID 同申报信息
一债通询价（600190）	NoCounterpartyParticipant/CounterpartyParticipantCode、OrderQty 同申报信息	1. 撤单成功时 OrderQty 表示剩余数量，否则无效。 2. OrigClOrdID 同申报信息

2. 对于双边报价撤单，如双边订单中有一笔撤销成功，一笔因已成交或其他原因撤销失败，返回撤销成功（已撤销）；如两笔均因已成交或其他原因撤销失败，返回撤销失败（已拒绝）。

4.4.2.3 转发询价请求（Allege Quote Request, MsgType=R）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType=R		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16

1180	ApplID	业务类型	Y	C6
131	QuoteReqID	询价请求编号，交易所进行唯一化处理后的询价请求ID	Y	C18
537	QuoteType	报价类别 1=Tradeable，表示可交易的报价	N	N4
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	N	N3
60	TransactTime	订单申报时间	N	ntime
48	SecurityID	证券代码	Y	C12
54	Side	买卖方向，表示询价发起方的方向，取值有： 1 = 买 2 = 卖	Y	C1
44	Price	订单价格	N	price
38	OrderQty	订单数量，撤单时表示剩余数量	Y	quantity
2551	StartPriceRange	价格下限	N	price
2552	EndPriceRange	价格上限	N	price
37	OrderID	交易所订单编号	N	C16
17	ExecID	订单执行编号	N	C16
10200	QuoteRequestTransType	询价请求事务类型 0-New，新订单 1-Cancel，撤销	Y	C1
303	QuoteRequestType	询价请求类型 101=Submit，提交 102=Alleged，转发	Y	C3
10222	QuoteRequestStatus	询价请求状态 0=Accepted，已接受 4=Cancelled，已撤销 5=Rejected，已拒绝	Y	C1

			7=Expired，已超时 8=Filled，已成交		
8418	FullAmountTrade		是否全额成交：1=是，2=否。	N	C1
63	SettlType		结算方式：1=净额结算，2=RTGS 结算	N	C1
207	SecurityExchange		结算场所：1=中国结算，2=中央结算 预留字段，暂不启用	N	C1
10216	SettlPeriod		结算周期： 0 = T+0 1 = T+1 2 = T+2 3 = T+3 预留字段，暂不启用	N	C1
126	ExpireTime		询价请求失效时间，预留字段，暂不启用	N	ntime
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=8，后接重复组，依次包含登录或订阅交易单元、询价发起方的投资者账户、交易员一债通账户、对手方交易参与人机构代码、发起方投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
登录或订阅交易单元	448	PartyID	登录或订阅交易单元（指转发消息的接收方，除基金通外必填）。	N	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	N	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	询价发起方投资者账户	N	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
对手方机构代码	448	PartyID	对手方交易参与人机构代码，支持特殊符号‘-’	N	C12
	452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易参与人代码	N	N4

投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1、基金通询价交易（600022）时，投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码为必填。

2、一债通询价（600190）、待定报价（600200）时，发起方交易员一债通账户、对手方机构代码必填。如询价方选择‘匿名’时，发起方交易员一债通账户、发起方投资者账户（如有）填‘anonymous’。

3、转发信息字段与被转发字段相同，对于业务无效字段，不进行转发。

4.4.2.4 报价（Quote, MsgType=S）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType=S		
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
537	QuoteType	报价类别 1=Tradeable，表示可交易的报价	N	N4
131	QuoteReqID	当报价是对询价请求的响应时，填写转发询价请求的 QuoteReqID 或公开报价行情中的 QuoteID	N	C18
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号，类似 CIOrderID 会员内部编号	Y	C10
41	OrigClOrdID	被撤订单的 QuoteMsgID	N	C10
522	OwnerType	订单所有者类型	Y	N3

		1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易		
60	TransactTime	订单申报时间	N	ntime
48	SecurityID	证券代码	Y	C12
132	BidPx	买报价 BidSize>0 时必须填写（表示报价发起方买）	N	price
133	OfferPx	卖报价 OfferSize>0 时必须填写（表示报价发起方卖）	N	price
134	BidSize	买数量	N	quantity
135	OfferSize	卖数量	N	quantity
1138	DisplayQty	冰山订单数量	N	quantity
1091	PreTradeAnonymity	是否匿名 0=显名 1=匿名	N	C1
8418	FullAmountTrade	是否全额成交：1=是，2=否。	N	C1
63	SettlType	结算方式：1=净额结算，2=RTGS 结算。 担保券可填 1 或 2；非担保券只能为 2。特别地，对于公募可转债或公募 REITs，只能填 1。	N	C1
207	SecurityExchange	结算场所：1=中国结算，2=中央结算 双边托管券，可填 1 或 2，单边托管券只能填其实际托管方。目前仅可填 1。 预留字段，暂不启用。	N	C1
10216	SettlPeriod	结算周期： 0 = T+0 1 = T+1 2 = T+2 3 = T+3 预留字段，暂不启用	N	C1
62	ValidUntilTime	报价有效时间，预留字段，暂不启用	N	ntime
10300	NoCounterpartyParticipant	报价接收方参与人个数 撤单时不适用。	N	N10

→ 10301	CounterpartyParticipantCode		报价接收方参与人代码，支持特殊符号'-'	N	C12
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=8，后接重复组，依次包含报价发起方的投资者账户、业务交易单元代码、营业部代码、交易员一债通账户、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
发起方投资者账户	448	PartyID	报价发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	Y	N4
发起方业务交易单元号	448	PartyID	报价发起方业务交易单元代码，填写 5 位业务交易单元号。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	报价发起方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为报价发起方的营业部代码。	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	报价发起方交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1、基金通询价交易（ApplID=600022）时，投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、营业部代码为必填。

2、报价消息体中支持以下报价方式，其中确定报价支持双边报价（双边报价撤销时需要同时撤销，也即 BidSize 和 OfferSize 均填 0），其他业务仅支持单边报价。

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

3、 对于确定报价、一债通询价和待定报价，发起方交易员一债通账户必填，TransactTime 选填，其他非必填字段要求如下，未提及的非必填字段对该业务无效：

业务类型（ApplID）	申报填写说明	撤单填写说明
确定报价（600180）	1. SettlType、FullAmountTrade、PreTradeAnonymity 必填 2. NoCounterpartyParticipant 必填，可填[0,5]，0 表示发送给全市场；如指定范围发送，CounterpartyParticipantCode 必填 3. DisplayQty 选填，需要为最小变动单位的正整数倍；DisplayQty 和 FullAmountTrade=1 不可同时申报。如指定范围发送，不支持冰山订单 4. 支持双边报价：BidPx/BidSize 和 OfferPx/OfferSize 需要至少填写一对	1. BidSize 和 OfferSize 参照说明 2 填写 2. OrigClOrdID 有效
一债通询价（600190）	1. QuoteReqID 必填 2. BidPx/BidSize 和 OfferPx/OfferSize 需要填写其中一对，例如询价请求中 Side 为买，此处应当填 OfferPx 和 OfferSize	
待定报价（600200）	1. QuoteReqID 必填 2. BidSize 或 OfferSize 中的任一个必填，如如询价请求中 Side 为买，此处应当填 OfferSize	

4、 对于确定报价或待定报价的双边报价，如在限定范围内发布，将拆分为两笔子订单转发给对手方；如全市场发布，则拆分为两笔子订单通过逐笔行情对外发布。

4.4.2.5 报价状态回报（Quote Status Report, MsgType=AI）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType=AI		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号，类似 CIOrderID 会员内部编号	Y	C10
41	OrigClOrdID	被撤单订单的 QuoteMsgID	N	C10
2405	ExecMethod	申报来源 0 = 网页端申报 1 = 接口端（TDGW）申报	N	C1
117	QuoteID	报价请求编号	Y	C18
131	QuoteReqID	当报价是对询价请求的响应时，填写转发询价请求的 QuoteReqID 或公开报价行情中的 QuoteID	N	C18
537	QuoteType	报价类别 1=Tradeable，表示可交易的报价	N	N4
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
297	QuoteStatus	报价状态 0=Accepted，接受 4=Cancelled，已撤销 5=Rejected，拒绝 7=Expired，已超时	N	C1
300	QuoteRejectReason	报价拒绝原因代码	N	C5
10236	QuoteRejectText	报价拒绝原因说明	N	C32
60	TransactTime	报价接收时间	N	ntime
48	SecurityID	证券代码	Y	C12
132	BidPx	买报价	N	price

133	OfferPx		卖报价	N	price
134	BidSize		买数量，撤单时表示买入剩余数量	N	quantity
135	OfferSize		卖数量，撤单时表示卖出剩余数量	N	quantity
37	OrderID		交易所订单编号 QuoteStatus=0 时为交易所订单编号，QuoteStatus=4 时为被撤报价单交易所订单编号	N	C16
17	ExecID		执行编号	N	C16
62	ValidUntilTime		报价失效时间，预留字段，暂不启用	N	ntime
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=9，后接重复组，依次包含报价发起方的登录或订阅交易单元、投资者账户、业务交易单元代码、营业部代码、交易员一债通账户、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
发起方交易单元	448	PartyID	发起方登录或订阅交易单元（除基金通外必填）。	N	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	N	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	报价发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	Y	N4
发起方业务交易单元号	448	PartyID	报价发起方业务交易单元代码，填写 5 位业务交易单元号。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	报价发起方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为报价发起方的营业部代码。	N	N4

投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117,表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1、 对于基金通询价，SecurityID（48）左数前六位有效，ExecID（17）左数前 10 位有效，且均不补空格。

2、 对于以下业务，响应中的 QuoteID 字段，如申报为报价，填写交易所唯一化处理后的报价请求 ID；如申报为报价回复，且回复中填写了 QuoteID，则响应中与申报时填写字段相同。发起方交易单元、发起方交易员一债通账户、TransactTime、QuoteStatus、ExecMethod 有效；申报或撤单成功时，OrderID 有效；订单被拒绝时，QuoteRequestRejectReason 有效。其他非必填字段要求如下，未提及的非必填字段对该业务无效：

业务类型（ApplID）	报价回报填写说明	报价回复回报填写说明	报价撤单填写说明
确定报价（600180）	BidPx、BidSize、OfferPx、OfferSize 同申报信息	BidSize 或 OfferSize 同 OrderQty	1. OrigClOrdID 有效； 2. 撤单成功时 BidSize、OfferSize 有效表示剩余数量，否则无效。
一债通询价（600190）	QuoteReqID 、 BidPx 、 BidSize 、 OfferPx、OfferSize 同申报信息	/	
待定报价（600200）	QuoteReqID、BidSize、OfferSize 同申报信息	/	

4.4.2.6 转发报价（Allege Quote, MsgType=S）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType=S		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
537	QuoteType	报价类别 1=Tradeable，表示可交易的报价	N	N4
131	QuoteReqID	当报价是对询价请求的响应时，填写询价请求的 QuoteReqID 或公开报价行情中的 OrderID	N	C18
11	ClOrdID	QuoteReqID 对应的会员内部编号，不适用于基金通询价	N	C10
117	QuoteID	报价请求编号，交易所唯一化处理后的报价请求 ID	Y	C18
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	N	N3
60	TransactTime	报价接收时间	N	ntime
48	SecurityID	证券代码	Y	C12
132	BidPx	买报价 BidSize>0 时必须填写	N	price
133	OfferPx	卖报价 OfferSize>0 时必须填写	N	price
134	BidSize	买数量	N	quantity
135	OfferSize	卖数量	N	quantity
37	OrderID	交易所订单编号	N	C16
17	ExecID	执行编号	N	C16
8418	FullAmountTrade	是否全额成交：1=是，2=否。	N	C1
63	SettlType	结算方式：1=净额结算，2=RTGS 结算	N	C1
207	SecurityExchange	结算场所：1=中国结算，2=中央结算 预留字段，暂不启用。	N	C1
10216	SettlPeriod	结算周期：	N	C1

			0 = T+0 1 = T+1 2 = T+2 3 = T+3 预留字段，暂不启用。		
62	ValidUntilTime		报价失效时间，预留字段，暂不启用	N	ntime
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=8，后接重复组，依次包含登录或订阅交易单元、报价发起方的投资者账户、交易员一债通账户、对手方交易参与人机构代码、发起方的投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
登录或订阅交易单元	448	PartyID	登录或订阅交易单元（指转发消息的接收方，除基金通外必填）	N	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	N	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	报价发起方投资者账户	N	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	报价发起方交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
对手方机构代码	448	PartyID	对手方交易参与人机构代码，支持特殊符号‘-’	N	C12
	452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易参与人代码	N	N4
投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4

销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1、确定报价（600180）、一债通询价（600190）、待定报价（600200）时，发起方交易员一债通账户、对手方机构代码必填。如询价方或报价方选择‘匿名’时，发起方交易员一债通账户、发起方投资者账户（如有）填‘anonymous’。

2、转发信息字段与被转发字段相同，对于业务无效字段，不进行转发。

4.4.2.7 报价回复（Quote Response, MsgType=AJ）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType=AJ		
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
11	ClOrdID	会员内部编号	Y	C10
537	QuoteType	报价类别 1=Tradeable，表示可交易的报价	N	N4
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
60	TransactTime	报价发起时间	N	ntime
48	SecurityID	证券代码	Y	C12
694	QuoteRespType	报价回复类型 1=Hit/Lift，接受 2=Counter，重报（枚举值预留，暂不启用） 6=Pass，拒绝	N	C1
54	Side	买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖	Y	C1
44	Price	申报价格	N	price
38	OrderQty	申报数量	N	quantity

40	OrdType		报价回复成交类型，取值： Y=Negotiated Trade，表示点击成交报价交易 2=Limit，表示匹配成交报价交易	Y	C1
10199	NoQuote		报价消息个数	Y	
->	117	QuoteID	报价请求编号，交易所唯一化处理后的报价请求 ID	N	C18
->	10225	QuotePrice	报价价格	N	price
->	10226	QuoteQty	报价数量	N	quantity
131	QuoteReqID		询价请求编号	N	C18
62	ValidUntilTime		报价有效时间，预留字段，暂不启用	N	ntime
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=8，后接重复组，依次包含报价回复发起方的投资者账户、业务交易单元、营业部代码、交易员一债通账户、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
发起方投资者账户	448	PartyID	报价回复方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	Y	N4
发起方业务交易单元号	448	PartyID	报价回复方业务交易单元代码，填写 5 位业务交易单元号。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	报价回复方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为询价发起方的营业部代码。	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	报价回复方交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
投资者中国结算开	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场	N	N4

放式基金账户			外开放式基金账户。		
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1、对于基金通询价交易（600022），投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、营业部代码为必填；点击成交时报价请求编号（QuoteID）必填，匹配成交时询价请求编号（QuoteReqID）必填；报价回复类型（QuoteRespType）仅可填 1，如未接受，超时自动失效。

2、对于确定报价、一债通询价和待定报价，报价回复方交易员信息必填，NoQuote 填 1，QuoteID 必填，TransactTime 选填，其他非必填字段要求如下，未提及的非必填字段对该业务无效：

业务类型（ApplID）	填写说明
确定报价（600180）	OrderQty 必填；OrdType 填‘Y’
一债通询价（600190）	QuoteRespType 必填，仅可填 1 或 6，不支持填 2；OrdType 填‘Y’
待定报价（600200）	QuoteRespType 必填，仅可填 1 或 6，不支持填 2；OrdType 填‘Y’

4.4.2.8 转发报价回复（Allege Quote Response, MsgType=AJ）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType=AJ		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
1166	QuoteMsgID	客户报价消息编号	Y	C10

537	QuoteType		报价类别 1=Tradeable，表示可交易的报价	N	N4
522	OwnerType		订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
60	TransactTime		报价发起时间	N	ntime
48	SecurityID		证券代码	Y	C12
694	QuoteRespType		报价回复类型 6=Pass，拒绝	N	C1
54	Side		买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖	Y	C1
44	Price		申报价格	N	price
38	OrderQty		申报数量	N	quantity
40	OrdType		报价回复成交类型，取值： Y=Negotiated Trade，表示点击成交报价交易 2=Limit，表示匹配成交报价交易	Y	C1
10199	NoQuote		报价消息个数	Y	
->	117	QuoteID	报价请求编号，交易所唯一化处理后的报价请求 ID	N	C18
->	10225	QuotePrice	报价价格	N	price
->	10226	QuoteQty	报价数量	N	quantity
131	QuoteReqID		询价请求编号	N	C18
62	ValidUntilTime		报价有效时间，预留字段，暂不启用	N	ntime
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=7，后接重复组，依次包含登录或订阅交易单元、报价回复方的投资者账户、交易员一债通账户、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
登录或订阅交易单元	448	PartyID	登录或订阅交易单元（指转发消息的接收方,除基金通外必填）	N	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易	N	N4

			单元。		
发起方投资者账户	448	PartyID	报价回复方投资者账户	N	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	报价回复方交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1、一债通询价（600190）、待定报价（600200）时，发起方交易员一债通账户必填。如询价方或报价方选择‘匿名’时，发起方交易员一债通账户、发起方投资者账户（如有）填‘anonymous’。

2、转发信息字段与被转发字段相同，对于业务无效字段，不进行转发。

4.4.3 意向申报类

4.4.3.1 意向申报（IOI, Indication of Interest, MsgType=6)

标签	字段名	字段描述	必填	类型
35	消息头	MsgType=6		
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
23	IOIID	会员内部编号	Y	C10
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
28	IOITransType	意向申报事务类型 N=New，新申报 C=Cancel，撤销申报	Y	C1
26	IOIRefID	原意向申报 IOIID	N	C10
54	Side	方向：1=买或正回购，2=卖或逆回购	Y	C1
48	SecurityID	证券代码	N	C12
44	Price	意向价格或回购利率	N	price
38	OrderQty	证券数量	N	quantity
8911	ExpirationDays	期限（天），可填[1,365]	N	N4
64	SettlDate	首次结算日	N	date
231	ContractMultiplier	折算比例（%）	N	N5(2)
8504	TotalValueTraded	成交金额	N	amount
10300	NoCounterpartyParticipant	发布范围 撤单时不适用。	N	N10
→ 10301	CounterpartyParticipantCode	交易参与人机构代码，支持特殊符号‘-’	N	C12
60	TransactTime	业务发生时间	Y	ntime
10194	BasketID	左起顺序代表第 1 号至第 N 号篮子。例如指定 1，2，5 号篮子，填“1100100000000000”	N	C16
453	NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易员一债通	Y	N2

			账户、投资者账户、业务交易单元。取值为 3		
→	448	PartyID	发起方交易员一债通账户	Y	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	Y	N4
→	448	PartyID	发起方投资者账户	N	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	N	N4
→	448	PartyID	发起方业务交易单元代码	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4

说明：

非必填字段填写说明，未提及的非必填字段对该业务无效：

业务类型（ApplID）	申报	撤单
协议回购意向申报（600150 ）	1. SecurityID、ExpirationDays 必填，SecurityID 表示质押券代码 2. Price、OrderQty、ContractMultiplier、TotalValueTraded、SettlDate 选填 3. TotalValueTraded 计算方式为：债券成交金额=质押券数量*10*单张质押券面值*折算比例/100；基金成交金额=质押券数量*竞价前收盘价*折算比例/100，四舍五入	IOIRefID、SecurityID 必填
三方回购意向申报（600160）	1. ExpirationDays、BasketID 必填 2. 发起方投资者账户必填，若为正回购方，填三方回购专用账户，若为逆回购方，则填写其对应普通账户 3. Price、TotalValueTraded 选填	IOIRefID 必填
债券现券意向申报（600170 ）	1. SecurityID、Price 必填 2. OrderQty 选填 3. NoCounterpartyParticipant 必填，可填[0,5]，填 0 时表示发送给全市场，否则 CounterpartyParticipantCode 必填 4. 发起方投资者账户必填	IOIRefID、SecurityID、发起方投资者账户必填

4.4.3.2 转发意向申报（Allege IOI, MsgType=6)

标签		字段名	字段描述	必填	类型
35		消息头	MsgType=6		
10197		PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179		ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180		ApplID	业务类型	Y	C6
694		QuoteRespType	意向申报类型 1=Alleged，转发意向申报	Y	C1
28		IOITransType	意向申报事务类型	Y	C1
693		QuoteRespID	交易所订单编号	Y	C16
54		Side	方向，表示申报发起方的方向	Y	C1
48		SecurityID	证券代码	Y	C12
44		Price	意向价格	N	price
38		OrderQty	意向数量	N	quantity
60		TransactTime	业务发生时间	Y	ntime
453		NoPartyIDs	发起方重复组，取值=3，依次包含登录或订阅交易单元、发起方的交易员一债通账户、对手方交易参与人机构代码。	Y	N2
→	448	PartyID	登录或订阅交易单元（指转发消息的接收方）。	Y	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	Y	N4
→	448	PartyID	发起方交易员一债通账户	Y	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	Y	N4
→	448	PartyID	对手方交易参与人机构代码，支持特殊符号‘-’	Y	C12
	452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易参与人代码	Y	N4

说明：

1、转发信息字段与被转发字段相同，对于业务无效字段，不进行转发。

4.4.3.3 意向申报响应（IOI Response, MsgType=AJ）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = AJ		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
28	IOITransType	意向申报事务类型 N=New，新申报 C=Cancel，撤销申报	Y	C1
522	OwnerType	订单所有者类型，取值包括： 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
60	TransactTime	回报时间	Y	ntime
48	SecurityID	证券代码	N	C12
694	QuoteRespType	意向申报类型 2=Replace，意向申报响应	Y	C1
150	ExecType	执行报告类型，取值有： 0=Accepted，订单申报成功 4=Cancelled，订单撤销成功 8=Rejected，订单申报拒绝	Y	C1
23	IOIID	会员内部订单编号	Y	C10
2405	ExecMethod	申报来源 0 = 网页端申报 1 = 接口端（TDGW）申报	Y	C1
54	Side	买卖方向	Y	C1
44	Price	申报价	N	price
26	IOIRefID	原始会员内部订单编号，ExecType=4 时有效	N	C10
300	QuoteRejectReason	订单拒绝码，ExecType=8 时有效	N	C5

693		QuoteRespID	交易所订单编号	Y	C16
453		NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含登录或订阅交易单元、发起方业务交易单元、交易员一债通账户、投资者账户。	Y	N2
→	448	PartyID	发起方登录或订阅交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	Y	N4
→	448	PartyID	发起方投资者账户，协议回购意向申报时不适用	N	C13
	452	PartyRole	取 5,表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户。	N	N4
→	448	PartyID	发起方业务交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元。	Y	N4
→	448	PartyID	发起方交易员一债通账户	Y	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	Y	N4

说明：

非必填字段填写说明，QuoteRejectReason 当订单申报拒绝时有效，未提及的非必填字段对该业务无效：

业务类型（ApplID）	申报	撤单
协议回购意向申报（600150 ）	SecurityID、Price 同申报信息	IOIRefID、SecurityID 同申报信息
三方回购意向申报（600160）	发起方投资者账户、Price 同申报信息	IOIRefID 同申报信息
债券现券意向申报（600170 ）	SecurityID、Price、发起方投资者账户同申报信息	IOIRefID、SecurityID、发起方投资者账户同申报信息

4.4.4 成交申报类

4.4.4.1 成交申报（Trade Capture Report, MsgType=AE)

标签	字段名	字段描述	必填	类型
35	消息头	MsgType=AE		
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
828	TrdType	业务子类型，见附表	N	C3
571	TradeReportID	会员内部编号	Y	C10
856	TradeReportType	成交申报类型 0=Submit，提交成交申报 2=Accept，确认成交申报 3=Decline，拒绝成交申报	Y	C1
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New，新申报 1=Cancel，撤销申报 2=Replace，响应	Y	C1
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
572	TradeReportRefID	原始交易会员内部编号，表示被撤消订单的会员内部编号	N	C10
54	Side	买卖方向：1=买，2=卖 对于回购：1=正回购，2=逆回购 对于借贷：F=出借，G=借入 对于合并申报且 TradeReportType 为 0 时：填 0	Y	C1
44	Price	申报价格（元）或回购利率（%）或借贷费率（%） 合并申报时代表中间方买入价格	N	price
640	Price2	申报价格 2	N	price

		合并申报时代表中间方卖出价格（元）		
455	SecurityAltID	辅助证券代码	N	C12
60	TransactTime	业务发生时间	Y	ntime
8504	TotalValueTraded	总成交金额	N	amount
8903	DeliveryQty	证券交付数量	N	quantity
8911	ExpirationDays	期限（天），可填[1,365]	N	N4
64	SettlDate	首次结算日	N	date
541	MaturityDate	到期日	N	date
193	SettlDate2	到期结算日	N	date
915	AgreementDate	协议日期	N	date
8847	UAInterestAccrualDays	实际占款天数，可填[1,365]	N	N3
540	TotalAccruedInterestAmt	累计利息总额，代表总回购利息或债券借贷标的券应计利息总额	N	amount
10330	TotalSettlCurrAmt	总到期结算金额	N	amount
580	NoDates	违约宽限期（天），[0,365]。	N	N3
529	OrderRestrictions	订单限制， ~~对于协议回购~~表示“是否同意在违约情形下由质权方对该违约交易项下的质押券直接以拍卖、变卖等方式进行处置”~~；对于三方回购表示“违约后担保品是否由质权人处置”。~~ Y = 是 N = 否	N	Boolean
207	SecurityExchange	结算场所：1=中国结算，2=中央结算 双边托管券，可填 1 或 2，单边托管券只能填其实际托管方。 预留字段，暂不启用。	N	C1
10216	SettlPeriod	结算周期： 0 = T+0 1 = T+1 2 = T+2	N	C1

			3 = T+3 预留字段，暂不启用		
63		SettlType	结算方式：1=净额结算，2=RTGS 结算。 担保券可填 1 或 2；非担保券只能为 2。特别地，对于公募可转债或公募 REITs，只能填 1。	N	C1
146		NoRelatedSym	合约结算个数	N	N1
→	655	ContraLegRefID	合约相关编号 1=代表当前合约，债券借贷代表当前合约或到期续做时的原合约 2=代表新合约，债券借贷代表到期续做时的新合约	N	C1
→	668	DeliveryForm	结算形式 0 = 现金，债券借贷代表现金结算 2 = 实物，债券借贷代表债券结算 101 = 其他，债券借贷代表部分现金结算	N	C3
→	172	SettlDeliveryType	资金结算方式 1 = 场内结算 2 = 场外结算	N	C1
→	510	NoDistribInsts	交收账户重复组个数	N	N1
→	→ 624	LegSide	F=出借方 G=借入方	N	C1
→	→ 498	CashDistribAgentName	资金交收机构名称，债券借贷代表资金开户行	N	C75
→	→ 499	CashDistribAgentCode	资金交收机构代码，债券借贷代表支付系统行号	N	C18
→	→ 500	CashDistribAgentAcctNumber	资金账户	N	C22
→	→ 502	CashDistribAgentAcctName	资金账户名称	N	C87
10194		BasketID	左起顺序代表第 1 号至第 N 号篮子。例如指定 1，2，5 号篮子，填“1100100000000000”	N	C16
711		NoUnderlyings	证券个数	N	N2
→	865	EventType	操作标识	N	C2

			21=换入/补入券 22=换出券		
→	48	SecurityID	证券代码	N	C12
→	38	OrderQty	证券数量	N	quantity
→	10331	ShareProperty	份额类型 0＝ 限售 1＝ 非限售	N	C1
→	10332	RestrictedMonth	限售期（月），指初始登记限售期	N	N4
→	231	ContractMultiplier	折算比例（%）	N	N5(2)
→	152	CashOrderQty	质押券面值总额	N	amount
→	381	GrossTradeAmt	成交金额	N	amount
→	159	AccruedInterestAmt	回购利息	N	amount
→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额	N	amount
→	880	TrdMatchID	辅助交易编号	N	C18
192		OrderQty2	本期回购结算利息	N	amount
829		TrdSubType	到期续做类型 N＝ 非第三方续做（原对手方） Y＝ 第三方续做（新对手方）	N	C1
1125		OrigTradeDate	原成交日期，YYYYMMDD	N	date
19		ExecRefID	当 TradeReportType 为 0 时，如为非首期合约，表示原合约成交编号； 当 TradeReportType 为 2 或 3 时，表示待确认（拒绝）的申报的交易所订单编号。	N	C16
10248		MemoEx	扩展备注，支持中文	N	C96
58		Text	用户私有信息	N	C32
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方交易员一债通账户、业务单元、投资者账户、对手方交易员一债通账户 1、对手方交易员一债通账户 2。取值为 5	Y	N2
→	448	PartyID	发起方交易员一债通账户	Y	C10
→	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易	Y	N4

			员一债通账户		
→	448	PartyID	发起方业务交易单元代码	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4
→	448	PartyID	发起方投资者账户，TradeReportType 为 0 或 2 时必填。	N	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	N	N4
→	448	PartyID	对手方交易员一债通账户 1，当合并申报时表示买方交易员一债通账户	Y	C10
	452	PartyRole	取 102，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易员一债通账户	Y	N4
→	448	PartyID	对手方交易员一债通账户 2，仅合并申报发起时有效表示卖方交易员。其他申报无意义。	N	C10
	452	PartyRole	取 57，表示当前的 PartyID 的取值为合并申报卖方	N	N4
664		ConfirmID	约定号，TradeReportType=0 时可以填写，用于对手方定位订单信息。仅可填大小写英文字母或数字。	N	C12
10198		Memo	可填写补充约定或备注，支持中文	N	C600

说明：

1、业务申报填写说明，未提及的非必填字段对该业务无效

ApplID	TrdType	描述	填写说明

ApplID	TrdType	描述	填写说明
协议回购（600130）	131	协商成交	1. Price 必填，表示回购利率；ExpirationDays 必填，表示回购期限；SettlDate 必填，填当前交易日 2. MaturityDate、SettlDate2 和 UAInterestAccrualDays 必填，其中回购到期日=当前交易日+回购期限；到期结算日=首次结算日+实际占款天数 3. NoDates、OrderRestrictions 必填 4. NoUnderlyings 必填，可填[1,10]，SecurityID/OrderQty 填写对应质押券代码和数量；如质押券为公募 REITs，需要填写 SharesProperty，如为公募 REITs 限售份额，需填写 RestrictedMonth，指初始登记或扩募登记时中国结算提供的“挂牌年份”字段。批量申报时 N 支质押券将收到 N 笔响应，允许部分成功，N 笔申报将分别转发至对手方逐一确认，确认后将生成 N 笔成交，确认一笔，成交一笔。批量申报时各支质押券不可重复。 5. ContractMultiplier（折算比例）、CashOrderQty（面值总额）、GrossTradeAmt（成交金额）、AccruedInterestAmt（回购利息）和 SettlCurrAmt（到期结算金额）必填，均为正数，保留两位小数，四舍五入，其中： 债券面值总额=质押券数量×10×单张质押券面值 基金或 REITs 面值总额=质押券数量*前收盘价 成交金额=面值总额×折算比例/100 回购利息=成交金额×回购利率/100×实际占款天数/365 到期结算金额=成交金额+回购利息 6. Text、ConfirmID、Memo 选填；特别地，当利率大于 5%时，Memo 必填，填写此利率的合理性说明。
	132	到期确认	1. NoUnderlyings 填 1，SecurityID/OrderQty 填写对应质押券代码和数量 2. OrigTradeDate、ExecRefID 必填 3. Text、Memo 选填
	133	到期续做*	1. Price 必填，表示新回购利率；ExpirationDays 必填，表示新回购期限；SettlDate 必填，填当前交易日 2. MaturityDate、SettlDate2 和 UAInterestAccrualDays 必填，其中新回购到期日=当前交易日+新回购期限；新到期结算日=首次结算日+新实际占款天数 3. NoDates、OrderRestrictions、OrderQty2（精确到小数点后两位）、TrdSubType 必填 4. NoUnderlyings 填 1，SecurityID/OrderQty 表示对应质押券代码和数量；如质押券为公募 REITs，SharesProperty 必填，限售份额不可续做； 5. ContractMultiplier、CashOrderQty、GrossTradeAmt、AccruedInterestAmt 和 SettlCurrAmt 必填，表示新合约相关参数，计算方式同协商成交申报 6. OrigTradeDate、ExecRefID 必填，Text、ConfirmID、Memo 选填；特别地，当利率大于 5%时，Memo 必填，填写此利率的合理性说明。

ApplID	TrdType	描述	填写说明
	134	提前终止	1. Price 必填，表示实际回购利率，ExpirationDays、UAInterestAccrualDays、AccruedInterestAmt 和 SettlCurrAmt 必填，表示提前终止后的相应值 2. NoUnderlyings 填 1，SecurityID/OrderQty 表示对应质押券代码和数量 3. OrigTradeDate、ExecRefID 必填，Text、ConfirmID、Memo 选填
	135	换券申报	1. NoUnderlyings 填 2，EventType 必填 2. EventType 为 21 时，SecurityID/OrderQty 填换入券代码和数量，如换入券为公募 REITs，需要填写 ShareProperty（仅可填 1），ContractMultiplier（折算比例）、CashOrderQty（面值总额）、GrossTradeAmt（成交金额）必填，换入券的成交金额应当与换出券相等；EventType 为 22 时，SecurityID 必填，表示被换出券。 3. OrigTradeDate、ExecRefID 必填，Text、ConfirmID、Memo 选填
	136	解除质押	1. NoUnderlyings 填 1，SecurityID/OrderQty 表示对应质押券代码和数量 2. OrigTradeDate、ExecRefID 必填，Text、ConfirmID、Memo 选填
	137	到期续做前期合约了结	不适用
	138	到期续做合约新开	不适用
三方回购（600140）	141	协商成交	1. Price 必填，表示回购利率；ExpirationDays 必填，表示回购期限；SettlDate 必填，填当前交易日 2. TotalValueTraded、MaturityDate、SettlDate2 和 UAInterestAccrualDays 必填，其中回购到期日=当前交易日+回购期限；到期结算日=首次结算日+实际占款天数 3. OrderRestrictions、BasketID 必填 4. NoUnderlyings 选填，可填[1,3]，SecurityID/OrderQty 填写对应质押券代码和数量，质押券应当属于已选择的篮子 5. TotalAccruedInterestAmt（回购利息）和 TotalSettlCurrAmt（到期结算金额）必填，均为正数，保留两位小数，四舍五入，其中： 回购利息=成交金额×回购利率/100×实际占款天数/365 到期结算金额=成交金额+回购利息 6. 发起方投资者账户必填，填三方回购专用账户；对手方接受时填写普通账户 7. Text、ConfirmID、Memo 选填
	142	到期购回	1. OrigTradeDate、ExecRefID 必填 2. Text 选填

ApplID	TrdType	描述	填写说明
	143	到期续做	1. Price 必填，表示新回购利率；ExpirationDays 必填，表示新回购期限；SettlDate 必填，填当前交易日 2. TotalValueTraded、MaturityDate、SettlDate2 和 UAInterestAccrualDays 必填，其中新回购到期日=当前交易日+新回购期限；新到期结算日=首次结算日+新实际占款天数 3. BasketID、OrigTradeDate、ExecRefID、OrderRestrictions 必填，TotalAccruedInterestAmt（回购利息）和 TotalSettlCurrAmt（到期结算金额）必填，表示新合约相关参数，计算方式同协商成交申报 4. 发起方投资者账户必填，填三方回购专用账户，对手方接受时填写普通账户 5. Text、ConfirmID、Memo 选填
	144	提前终止	1. Price 必填，表示实际回购利率 2. ExpirationDays、UAInterestAccrualDays、TotalAccruedInterestAmt 和 TotalSettlCurrAmt 必填，表示提前终止后的相应值 3. OrigTradeDate、ExecRefID 必填，Text、ConfirmID、Memo 选填
	145	换券申报	1. NoUnderlyings 填 1 或 2，填 1 时表示仅换出；EventType 必填，SecurityID/OrderQty 填对应换入或换出券代码和数量；换入券和换出券应当属于同一个篮子；EventType=22 时 TrdMatchID 必填，表示质押券的冻结申请书号 2. OrigTradeDate、ExecRefID 必填，Text、ConfirmID 选填
	146	解除质押	1. OrigTradeDate、ExecRefID 必填 2. Text、ConfirmID、Memo 选填
	147	补券申报	1. NoUnderlyings 填 1，SecurityID/OrderQty 填对应补入券代码和数量 2. OrigTradeDate、ExecRefID 必填，Text 选填
现券协商成交（600210）	不适用	现券协商成交	1.Price 必填，表示申报价格；SettlType、ConfirmID 必填 2.NoUnderlyings 填 1，SecurityID/OrderQty 填写交易券代码和数量 3.Text、Memo 选填
合并申报*（600220）	不适用	合并申报	1. Price、Price2 必填，分别表示买入价格和卖出价格 2. SettlType 必填，Side 填 0 3. NoUnderlyings 填 1，SecurityID/OrderQty 填写交易券代码和数量 4. 对手方交易员一债通账户 2 和投资者账户必填，Text 选填
债券借贷（600300）	301	协商成交	1. Price 必填，表示借贷费率；TotalValueTraded 必填，表示借贷费用金额 2. ExpirationDays、SettlDate、SettlDate2 必填，其中 ExpirationDays 表示借贷期限，SettlDate 填当前交易日，到期结算日=首次结算日+借贷期限 3. NoRelatedSym、NoDistribInsts 填 1，发起方资金账户、资金账户名称必填，资金开户行和支付系统行号选填 4. SecurityAltID/DeliveryQty 必填，表示标的券代码/数量 5. NoUnderlyings 选填，可填[1,20]，SecurityID/OrderQty 填写对应

ApplID	TrdType	描述	填写说明
			质押券代码和数量 6. TotalAccruedInterestAmt 必填，表示标的券应计利息总额 7. AgreementDate 必填，表示标的券下一付息日；SettlDeliveryType 必填，表示到期费用结算方式； 8. MemoEx 选填，填写争议解决方式；Memo 选填，可填入补充约定内容
	302	到期结算	1. ExecRefID 必填 2. SettlDeliveryType 必填 3. DeliveryForm 必填，表示到期结算方式 4. ExecRefID 必填 5. SettlDeliveryType 必填，SettlDeliveryType=2 时，资金账户、资金账户名称、资金开户行、支付系统行号必填 6. TotalSettlCurrAmt 选填，当 DeliveryForm =2 或 101 时必填，表示现金结算金额 7. DeliveryQty 选填，当 DeliveryForm =101 时必填，表示归还标的券数量
	303	到期续做	1. ExecRefID 必填 2. Price 必填，表示新借贷费率 3. ExpirationDays、SettlDate、SettlDate2 必填，其中 ExpirationDays 表示新借贷期限，SettlDate 填当前交易日，新到期结算日=当前交易日+新借贷期限 4. 投资者账户、资金账户、资金账户名称必填 5. NoRelatedSym 填 2，ContraLegRefID 分别填 1 和 2，NoDistribInsts 填 1 6. 发起方资金账户、资金账户名称、资金开户行和支付系统行号选填，SettlDeliveryType 为 2 时，发起方资金账户、资金账户名称、资金开户行和支付系统行号必填 7. SecurityAltID/DeliveryQty 填写新合约标的券代码、数量 8. NoUnderlyings 选填，可填[1,20]，SecurityID/OrderQty 填写变更的质押券代码和数量，EventType 填写变更类型，EventType=22 时 TrdMatchID 必填，表示质押券的冻结申请书号 9. TotalAccruedInterestAmt 必填，表示新应计利息总额；AgreementDate 必填，表示新合约下一付息日；SettlDeliveryType 必填，表示到期费用结算方式；TotalValueTraded 必填，表示新借贷费用 MemoEx 选填，填写新争议解决方式；Memo 选填，可填入新补充约定内容
	304	提前终止	1. SettlDeliveryType 必填 2. DeliveryForm 必填，表示到期结算方式 3. ExecRefID 必填 4. SettlDeliveryType 必填，SettlDeliveryType=2 时，资金账户、资金账户名称、资金开户行、支付系统行号必填 5. TotalSettlCurrAmt 选填，当 DeliveryForm =2 或 101 时必填，表示现金结算金额 6. DeliveryQty 选填，当 DeliveryForm =101 时必填，表示归还标的

ApplID	TrdType	描述	填写说明
			券数量 7. UAInterestAccrualDays 必填，表示实际借贷期限，MaturityDate 必填，表示提前终止日 TotalValueTraded 必填，表示实际借贷费用金额
	305	质押券变更申报	1. ExecRefID 必填 2. NoUnderlyings 选填，可填[1,20]，SecurityID/OrderQty 填写对应质押券代码和数量，EventType 填写变更类型，EventType=22 时 TrdMatchID 必填，表示质押券的冻结申请书号
	306	解除质押	ExecRefID 必填
	307	逾期结算	1. SettlDeliveryType 必填 2. DeliveryForm 必填，表示逾期结算方式 3. ExecRefID 必填 4. SettlDeliveryType 必填，SettlDeliveryType=2 时，资金账户、资金账户名称、资金开户行、支付系统行号必填 5. TotalSettlCurrAmt 选填，当 DeliveryForm =2 或 101 时必填，表示现金结算金额 6. DeliveryQty 选填，当 DeliveryForm =101 时必填，表示归还标的券数量 7. UAInterestAccrualDays 必填，表示实际借贷期限，MaturityDate 必填，表示实际结算日 8. TotalValueTraded 必填，表示实际借贷费用金额
场务应急成交录入（600310）	不适用	不适用	不适用，交易员无需申报订单，如交易员已绑定，绑定的交易单元可收到成交确认

注 1：对于协议回购到期续做（TrdType: 133），如对手方确认后将生成两笔成交，一笔为到期续做前期合约了结（137），另一笔为到期续做合约新开（138）。

注 2：对于合并申报，将拆分为两笔申报转发给两个对手方。对手双方均确认后也将生成两笔成交（对于中间方来说），一笔为中间方与买方的成交，另一笔为中间方与卖方的成交。

注 3：对于债券借贷到期续做（TrdType: 303）或三方回购到期续做（TrdType: 143），仅生成一笔成交，该笔成交包含原合约到期结算及新开合约信息。

2、业务撤单或确认或拒绝填写说明，未提及的非必填字段对该业务无效

ApplID	TrdType	描述	撤单	对手方确认	对手方拒绝
协议回购（600130）	131	协商成交	TradeReportRefID 必填，Text 选填。对于协议回购、合并申报和	ExecRefID、NoUnderlyings、SecurityID、投资者账户必填，Text 选填	ExecRefID、NoUnderlyings、SecurityID 必填，Eve
	133	到期续做			
	134	提前终止		ExecRefID、NoUnderlyings、Sec	

	135	换券申报	现券协商成交，NoUnderlyings、SecurityID 必填，EventType 换券时必填，内容与申报时一致；协议回购批量申报撤单时，允许仅针对一笔或几笔质押券部分撤单。	urityID、投资者账户必填，EventType 换券时必填，Text 选填	ntType 换券时必填，Text 选填
	136	解除质押			
三方回购（600140）	141	协商成交		ExecRefID、投资者账户必填，Text 选填	ExecRefID 必填，Text 选填
	143	到期续做			
	144	提前终止		ExecRefID、投资者账户必填，Text 选填	
	145	换券申报			
	146	解除质押			
合并申报（600220）	不适用	合并申报		ExecRefID、NoUnderlyings、SecurityID、投资者账户必填，Text 选填	ExecRefID、NoUnderlyings、SecurityID 必填，Text 选填
现券协商成交（600210）	不适用	协商成交		不适用	不适用
债券借贷（600300）	301	协商成交	TradeReportRefID 必填	ExecRefID、对手方一债通账户、投资者账户、交易单元必填；协商成交时，NoRelatedSym、NoDistribInsts 填 1，资金账户、资金账户名称必填，资金开户行、支付系统行号选填；到期续做时，NoRelatedSym 填 2，ContraLegRefID 分别填 1 和 2，NoDistribInsts 填 1，若 ContraLegRefID 填 1， SettlDeliveryType 填 2 时，则发起方资金账户、资金账户名称、资金开户行和支付系统行号必填，若 ContraLegRefID 填 2 时，则资金账户、资金账户名称必填，资金开户行、支付系统行号选填；	ExecRefID 必填
	303	到期续做			
	302	到期结算		ExecRefID 必填；SettlDeliveryType=2 时对手方资金账户、资金账户名称、资金开户行、支付系统行号必填	
	304	提前终止			
	307	逾期结算			

	306	解除质押		ExecRefID 必填	
	305	质押券变更申报			

4.4.4.2 转发成交申报（Allege Trade Capture Report, MsgType=AE)

标签	字段名	字段描述	必填	类型
35	消息头	MsgType=AE		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
828	TrdType	业务子类型	N	C3
1003	TradeID	交易所订单编号	Y	C16
856	TradeReportType	成交申报类型 1=Alleged，转发成交申报 3=Decline，拒绝成交申报	Y	C1
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New，新申报 1=Cancel，撤销申报	Y	C1
1126	OrigTradeID	被撤消订单的交易所订单编号，撤销申报必填	N	C16
54	Side	表示被转发方也即本申报发起方的方向。 买卖方向：1=买，2=卖 若为回购，则：1=正回购，2=逆回购 若为借贷，则：F=出借，G=借入	Y	C1
44	Price	申报价格或回购利率	N	price
455	SecurityAltID	辅助证券代码	N	C12
60	TransactTime	订单接收时间	Y	ntime
8504	TotalValueTraded	总成交金额	N	amount
8903	DeliveryQty	证券交付数量	N	quantity
8911	ExpirationDays	期限（天）	N	N4

64	SettlDate	首次结算日	N	date
541	MaturityDate	到期日	N	date
193	SettlDate2	到期结算日	N	date
915	AgreementDate	协议日期	N	date
8847	UAInterestAccrualDays	实际占款天数	N	N3
540	TotalAccruedInterestAmt	累计利息总额，代表总回购利息或债券借贷标的券应计利息总额	N	amount
10330	TotalSettlCurrAmt	总到期结算金额	N	amount
580	NoDates	违约宽限期（天）	N	N3
529	OrderRestrictions	订单限制 ~~对于协议回购，~~表示“是否同意在违约情形下由质权方对该违约交易项下的质押券直接以拍卖、变卖等方式进行处置”~~；；对于三方回购表示“违约后担保品是否由质权人处置”。~~ Y=是； N=否	N	Boolean
207	SecurityExchange	结算场所：1=中国结算，2=中央结算 双边托管券，可填 1 或 2，单边托管券只能填其实际托管方。预留字段，暂不启用。	N	C1
10216	SettlPeriod	结算周期： 0 = T+0 1 = T+1 2 = T+2 3 = T+3 预留字段，暂不启用	N	C1
63	SettlType	结算方式：1=净额结算，2=RTGS 结算	N	C1
146	NoRelatedSym	合约结算个数	N	N1
→ 655	ContraLegRefID	合约相关编号 1=代表当前合约，债券借贷代表当前合约	N	C1

				或到期续做时的原合约 2=代表新合约，债券借贷代表续做时的新合约		
→		668	DeliveryForm	结算形式 0 = 现金，债券借贷代表现金结算 2 = 实物，债券借贷代表债券结算 101 = 其他，债券借贷代表部分现金结算	N	C3
→		172	SettlDeliveryType	资金结算方式 1 = 场内结算 2 = 场外结算	N	C1
→		510	NoDistribInsts	交收账户重复组个数	N	N1
→	→	624	LegSide	F=出借方 G=借入方	N	C1
→	→	498	CashDistribAgentName	资金交收机构名称	N	C75
→	→	499	CashDistribAgentCode	资金交收机构代码	N	C18
→	→	500	CashDistribAgentAcctNumber	资金账户	N	C22
→	→	502	CashDistribAgentAcctName	资金账户名称	N	C87
10194			BasketID	左起顺序代表第 1 号至第 N 号篮子。例如指定 1，2，5 号篮子，填“1100100000000000”	N	C16
711			NoUnderlyings	证券个数	N	N2
→		865	EventType	操作标识 21=换入/补入券 22=换出券	N	C2
→		48	SecurityID	质押券代码	N	C12
→		38	OrderQty	质押券数量	N	quantity
→		10331	ShareProperty	份额类型 0=限售； 1=非限售	N	C1

→	10332	RestrictedMonth	限售期（月）	N	N4
→	231	ContractMultiplier	折算比例（%）	N	N5(2)
→	152	CashOrderQty	质押券面值总额	N	amount
→	381	GrossTradeAmt	成交金额	N	amount
→	159	AccruedInterestAmt	回购利息	N	amount
→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额	N	amount
→	880	TrdMatchID	辅助交易编号	N	C18
192		OrderQty2	本期回购结算利息	N	amount
829		TrdSubType	到期续做类型 N＝ 非第三方续做 Y＝ 第三方续做	N	C1
1125		OrigTradeDate	原成交日期	N	date
19		ExecRefID	TradeReportType 为 1 时，对非首期合约表示原成交编号；为 3 时表示被拒绝订单的交易所订单编号。	N	C16
10248		MemoEx	扩展备注，支持中文	N	C96
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含登录或订阅交易单元、发起方的交易员一债通账户、投资者账户、投资者账户名称，对手方交易参与人代码以及对手方交易员信息。取值为 6。	Y	N2
→	448	PartyID	登录或订阅交易单元（指转发消息的接收方）。	Y	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	Y	N4
→	448	PartyID	发起方交易员一债通账户	Y	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	Y	N4
→	448	PartyID	发起方投资者账户	N	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投	N	N4

			资者账户		
→	448	PartyID	发起方投资者账户名称。	N	C180
	452	PartyRole	取 38，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户名称	N	N4
→	448	PartyID	对手方参与人机构代码，支持特殊符号‘-’	Y	C12
	452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易参与人代码	Y	N4
→	448	PartyID	对手方交易员一债通账户	Y	C10
	452	PartyRole	取 102，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易员一债通账户	Y	N4
664		ConfirmID	约定号，仅可填大小写英文字母或数字	N	C12
10198		Memo	可填写补充约定或备注，支持中文	N	C600

说明：

1.对于协议回购批量申报 N 笔质押券校验通过后，将生成 N 笔转发成交申报给对手方，每笔仅有一笔质押券。

2. 对于 OrigTradeID，撤单时必填，表示被撤消订单的交易所订单编号；对于 ExecRefID，TradeReportType 为 1 时，对非首期合约表示原成交编号；为 3 时表示被拒绝订单的交易所订单编号；其他场景无效。证券账户名称（与投资者账户一一对应，如对应账户未查询到名称，则无此字段）有效。其他转发信息字段与被转发字段相同，对于业务无效字段，不进行转发。

4.4.4.3 成交申报响应（Trade Capture Report Response, MsgType=AR）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = AR		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
828	TrdType	业务子类型	N	C3
856	TradeReportType	成交申报类型	Y	C1
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别	Y	C1
8912	TrdAckStatus	成交申报响应类型，取值有： 0=Accepted，订单申报成功 8=Rejected，订单申报拒绝	Y	C1

571		TradeReportID	会员内部订单编号	Y	C10
2405		ExecMethod	申报来源 0 = 网页端申报 1 = 接口端（TDGW）申报	Y	C1
1003		TradeID	交易所订单编号	Y	C16
1126		OrigTradeID	被撤订单交易所订单编号	N	C16
522		OwnerType	订单所有者类型	Y	N3
54		Side	买卖方向，取值： 1=买（正回购）/2=卖（逆回购） F=出借/G=借入 对于合并申报中间方发起时，取值为 0	Y	C1
44		Price	申报价格	N	price
455		SecurityAltID	辅助证券代码	N	C12
8903		DeliveryQty	证券交付数量	N	quantity
10194		BasketID	左起顺序代表第 1 号至第 N 号篮子。例如指定 1，2，5 号篮子，填“1100100000000000”	N	C16
711		NoUnderlyings	证券个数	N	N2
→	865	EventType	操作标识 21=换入/补入券 22=换出券	N	C2
→	48	SecurityID	证券代码	N	C12
→	38	OrderQty	申报数量	N	quantity
→	10331	ShareProperty	份额类型 0 = 限售 1 = 非限售	N	C1
→	10332	RestrictedMonth	限售期（月）	N	N4
→	231	ContractMultiplier	折算比例（%）	N	N5(2)
→	381	GrossTradeAmt	成交金额	N	amount
→	880	TrdMatchID	辅助交易编号	N	C18
939		TrdRptStatus	成交申报状态，取值有：	Y	C1

			0=Unmatched，已挂单未成交 4=Cancelled，已撤销 8=Rejected，已拒绝		
572		TradeReportRefID	原始会员内部订单编号，撤单时有效	N	C10
751		TradeReportRejectReason	订单拒绝码，TrdAckStatus=8 时有效	N	N5
60		TransactTime	回报时间	Y	ntime
58		Text	用户私有信息	N	C32
453		NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含登录或订阅交易单元、发起方业务交易单元、交易员一债通账户、投资者账户。	Y	N2
→	448	PartyID	发起方登录或订阅交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	Y	N4
→	448	PartyID	发起方业务交易单元。	N	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元。	N	N4
→	448	PartyID	发起方交易员一债通账户	Y	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	Y	N4
→	448	PartyID	发起方投资者账户	N	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户。	N	N4

说明：

1、对于协议回购协商成交批量申报，N 笔质押券将收到 N 笔响应，每笔响应仅有一只质押券，可能出现部分成功的场景；撤单时，允许对批量申报的多笔质押券中仅对某一只或某几只进行撤单，每只质押券，将收到一个撤单响应，也可能出现部分成功的场景。

2、各业务响应字段说明如下，发起方业务交易单元、发起方投资者账户、Text 字段与原始申报相同，其他未提及的非必填字段均无效:

(1)业务发起

ApplID	TrdType	描述	填写说明
协议回购（600130）	131	协商成交	NoUnderlyings 填 1，Price、SecurityID、OrderQty、ShareProperty、RestrictedMonth、ContractMultiplier、GrossTradeAmt 同申报信息

ApplID	TrdType	描述	填写说明
	132	到期确认	NoUnderlyings、SecurityID、OrderQty 同申报信息
	133	到期续做	NoUnderlyings、Price、SecurityID、OrderQty、ShareProperty、RestrictedMonth、ContractMultiplier、GrossTradeAmt 同申报信息
	134	提前终止	NoUnderlying、SecurityID、OrderQty、Price 同申报信息
	135	换券申报	NoUnderlyings、EventType、SecurityID、OrderQty、ShareProperty、ContractMultiplier、GrossTradeAmt 同申报信息
	136	解除质押	NoUnderlyings、SecurityID、OrderQty 同申报信息
三方回购（600140）	141	协商成交	Price、BasketID、NoUnderlyings、SecurityID、OrderQty 同申报信息
	142	到期购回	/
	143	到期续做	Price、BasketID 同申报信息
	144	提前终止	Price 同申报信息
	145	换券申报	NoUnderlyings、EventType、SecurityID、OrderQty、TrdMatchID 同申报信息
	146	解除质押	/
	147	补券申报	NoUnderlyings、EventType、SecurityID、OrderQty 同申报信息
现券协商成交（600210）	不适用	现券协商成交	Price、NoUnderlyings、SecurityID、OrderQty 同申报信息
合并申报（600220）	不适用	合并申报	Price、NoUnderlyings、SecurityID、OrderQty 同申报信息
债券借贷（600300）	301	协商成交	1. Price、SecurityAltID、DeliveryQty 同申报信息 2. NoUnderlyings、SecurityID、OrderQty 同申报信息
	302	到期结算	DeliveryForm、SettlDeliveryType 同申报信息
	303	到期续做	1. Price、SecurityAltID、DeliveryQty 同申报信息 2. NoUnderlyings、SecurityID、OrderQty、EventType、TrdMatchID 同申报信息
	304	提前终止	DeliveryForm、SettlDeliveryType 同申报信息
	305	质押券变更申报	NoUnderlyings、SecurityID、OrderQty、EventType、TrdMatchID 同申报信息
	306	解除质押	/
	307	逾期结算	DeliveryForm、SettlDeliveryType 同申报信息

（2）业务撤单、确认或拒绝:

ApplID	TrdType	描述	撤单	对手方确认/拒绝

协议回购（600130）	131	协商成交	OrigTradeID、TradeReportRefID 有效。对于协议回购、合并申报和现券协商成交，NoUnderlyings 填 1，SecurityID、EventType 同申报信息（指换入券）。	NoUnderlyings、SecurityID、EventType 同申报信息（指换入券）
	133	到期续做		
	134	提前终止		
	135	换券申报		
	136	解除质押		
三方回购（600140）	141	协商成交		/
	143	到期续做		
	144	提前终止		
	145	换券申报		
	146	解除质押		
合并申报（600220）	不适用	合并申报		NoUnderlyings、SecurityID 同申报信息
现券协商成交（600210）	不适用	协商成交		不适用
债券借贷（600300）	301	协商成交	TradeReportRefID 有效	/
	303	到期续做		
	302	到期结算		
	304	提前终止		
	307	逾期结算		
	306	解除质押		
	305	质押券变更申报		

（3）业务发起、撤单、确认或拒绝失败，TradeReportRejectReason、Text 有效，撤单时 TradeReportRefID 有效:

ApplID	描述
协议回购（600130）	TrdType、NoUnderlyings、SecurityID 有效；换券时，仅返回换入券
三方回购（600140）	TrdType 有效
合并申报（600220）	NoUnderlyings、SecurityID 有效
现券协商成交（600210）	
债券借贷（600300）	TrdType 有效

4.4.4.4 成交确认（Trade Capture Report, MsgType=AE）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = AE		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
828	TrdType	业务子类型	N	C3
571	TradeReportID	会员内部订单编号	Y	C10
2405	ExecMethod	申报来源 0 = 网页端申报 1 = 接口端（TDGW）申报	Y	C1
1003	TradeID	交易所订单编号	Y	C16
856	TradeReportType	成交申报类型 0=Submit，提交成交申报	Y	C1
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New，新申报 2=Replace，响应	Y	C1
522	OwnerType	订单所有者类型，取值包括： 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
8912	TrdAckStatus	执行报告类型，取值有： F=Trade，成交	Y	C1
939	TrdRptStatus	当前申报的状态，取值有： 2=Matched，已成交	Y	C1
54	Side	买卖方向	Y	C1
31	LastPx	成交价格	N	price
17	ExecID	成交编号	Y	C16
455	SecurityAltID	辅助证券代码	N	C12

60		TransactTime	成交时间	Y	ntime
8504		TotalValueTraded	总成交金额	N	amount
8903		DeliveryQty	证券交付数量	N	quantity
8911		ExpirationDays	期限（天）	N	N4
207		SecurityExchange	结算场所：1=中国结算，2=中央结算 双边托管券，可填 1 或 2，单边托管券只能填其实际托管方。预留字段，暂不启用。	N	C1
10216		SettlPeriod	结算周期： 0 = T+0 1 = T+1 2 = T+2 3 = T+3 预留字段，暂不启用	N	C1
63		SettlType	结算方式： 1 = 净额结算 2 = RTGS 结算	N	C1
146		NoRelatedSym	合约结算个数	N	N1
→	655	ContraLegRefID	合约相关编号 1=代表当前合约，债券借贷代表当前合约或到期续做时的原合约 2=代表新合约，债券借贷代表续做时的新合约	N	C1
→	668	DeliveryForm	结算形式 0 = 现金，债券借贷代表现金结算 2 = 实物，债券借贷代表债券结算 101 = 其他，债券借贷代表部分现金结算	N	C3
→	172	SettlDeliveryType	资金结算方式 1 = 场内结算 2 = 场外结算	N	C1
→	510	NoDistribInsts	交收账户重复组个数	N	N1

→	→	624	LegSide	F=出借方 G=借入方	N	C1
→	→	498	CashDistribAgentName	资金交收机构名称	N	C75
→	→	499	CashDistribAgentCode	资金交收机构代码	N	C18
→	→	500	CashDistribAgentAcctNumber	资金账户	N	C22
→	→	502	CashDistribAgentAcctName	资金账户名称	N	C87
10194			BasketID	左起顺序代表第 1 号至第 N 号篮子。例如指定 1，2，5 号篮子，填“1100100000000000”	N	C16
711			NoUnderlyings	证券个数	N	N2
→		865	EventType	操作标识 21=换入/补入券 22=换出券	N	C2
→		48	SecurityID	证券代码	N	C12
→		32	LastQty	成交数量	N	quantity
→		10331	ShareProperty	份额类型 0 = 限售 1 = 非限售	N	C1
→		10332	RestrictedMonth	限售期（月），指初始登记限售期	N	N4
→		231	ContractMultiplier	折算比例（%）	N	N5(2)
→		381	GrossTradeAmt	成交金额	N	amount
→		880	TrdMatchID	辅助交易编号	N	C18
8500			OrderEntryTime	订单接收时间	N	ntime
1125			OrigTradeDate	原成交日期	N	date
19			ExecRefID	原成交编号	N	C16
58			Text	用户私有信息	N	C32
453			NoPartyIDs	参与方个数，取值=7，后接重复组，依次包含发起方投资者账户、登录或订阅交易单元、业务交易单元、交易员一债通账户、	Y	N2

			对手方交易员一债通账户、投资者账户、账户名称。		
→	448	PartyID	发起方登录或订阅交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	Y	N4
→	448	PartyID	发起方交易员一债通账户	Y	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	Y	N4
→	448	PartyID	发起方业务交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元。	Y	N4
→	448	PartyID	发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户。	Y	N4
→	448	PartyID	对手方交易员一债通账户。	Y	C10
	452	PartyRole	取 102，表示当前的 PartyID 的取值为对手方交易员一债通账户	Y	N4
→	448	PartyID	对手方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 39，表示当前 PartyID 的取值为对手方投资者账户	Y	N4
→	448	PartyID	证券账户名称，支持中文。	N	C180
	452	PartyRole	取 36，表示当前 PartyID 的取值为对手方投资者账户名称	N	N4

说明：

1、对于成交报告申报模式的被动成交方或协议回购到期续做中的前期合约了结，也将收到成交确认。其中：申报来源（ExecMethod）填 0，订单所有者类型（OwnerType）填‘103’；会员内部订单编号（TradeReportID）按照网页端申报自动生成；登录或订阅交易单元、业务交易单元同首期申报数据，如首期本方通过网页端申报，则此成交实时仍仅供网页端查看。

2、各业务响应字段说明如下，证券账户名称（如对应账户未查询到名称，则无此字段）、OrderEntryTime 有效，Text 字段与原始申报相同，LastPx 与申报中的 Price/Price2（如有）相同，LastQty 与申报中的 OrderQty（如有）相同，其他未提及的非必填字段均无效:

ApplID	TrdType	描述	填写说明
协议回购（600130）	131	协商成交	NoUnderlyings 填 1，LastPx、SecurityID、LastQty、SharePproperty、RestrictedMonth、ContractMultiplier、GrossTradeAmt、ExpirationDays 同申报信息
	132/137	到期确认及前期合约了结	NoUnderlyings、SecurityID、LastQty、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	1338	到期续做合约新开	NoUnderlyings、LastPx、SecurityID、LastQty、SharePproperty、RestrictedMonth、ContractMultiplier、GrossTradeAmt、ExpirationDays、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	134	提前终止	NoUnderlying、SecurityID、LastQty、LastPx、ExpirationDays、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	135	换券申报	NoUnderlyings 填 1，EventType、SecurityID、LastQty、SharePproperty、ContractMultiplier、GrossTradeAmt 表示换入券信息，OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	136	解除质押	NoUnderlyings、SecurityID、LastQty、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
三方回购（600140）	141	协商成交	LastPx、TotalValueTraded、BasketID、NoUnderlyings、SecurityID、LastQty、ExpirationDays 同申报信息
	142	到期购回	OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	143	到期续做	LastPx、TotalValueTraded、BasketID、ExpirationDays、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	144	提前终止	LastPx、ExpirationDays、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	145	换券申报	NoUnderlyings、EventType、SecurityID、LastQty、TrdMatchID、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	146	解除质押	OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	147	补券申报	NoUnderlyings、EventType、SecurityID、LastQty、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
现券协商成交（600210）	不适用	现券协商成交	LastPx、SettlType、NoUnderlyings、SecurityID、LastQty 同申报信息，TotalValueTraded 按照价格数量进行计算
合并申报（600220）	不适用	合并申报	
场务应急成交录入（600310）	不适用	场务应急成交录入	
债券借贷（600300）	301	协商成交	1. LastPx、TotalValueTraded、SecurityAltID、DeliveryQty、ExpirationDays 同申报信息 2. NoUnderlyings、SecurityID、LastQty、NoDistribInsts、CashDistribAgentAcctNumber、CashDistribAgentAcctName、CashDistribAgentName、CashDistribAgentCode 同申报信息

ApplID	TrdType	描述	填写说明
	302	到期结算	DeliveryForm、SettlDeliveryType、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	303	到期续做	1. LastPx、TotalValueTraded、ExpirationDays、SecurityAltID、DeliveryQty、ExecRefID 同申报信息 2. NoUnderlyings、SecurityID、LastQty、EventType、TrdMatchID、NoRelatedSym、NoDistribInsts、CashDistribAgentAcctNumber、CashDistribAgentAcctName、CashDistribAgentName、CashDistribAgentCode、ContraLegRefID、SettlDeliveryType 同申报信息
	304	提前终止	DeliveryForm、SettlDeliveryType、TotalValueTraded、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	305	质押券变更申报	NoUnderlyings、SecurityID、LastQty、EventType、TrdMatchID、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	306	解除质押	OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息
	307	逾期结算	DeliveryForm、SettlDeliveryType、TotalValueTraded、OrigTradeDate、ExecRefID 同申报信息

4.4.5 执行报告类

4.4.5.1 执行报告（Execution Report, MsgType = 8）

4.4.5.1.1 申报响应、成交回报及撤单成功响应

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = 8		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
150	ExecType	执行报告类型，取值有： 0=Accepted，订单申报成功 4=Cancelled，订单撤销成功 8=Rejected，订单申报拒绝 F=Trade，成交回报	Y	C1
11	ClOrdID	会员内部订单编号，针对询价交易申报，询价方取 ClOrdID，报价方取 QuoteMsgID	Y	C10
2405	ExecMethod	申报来源（仅对固收迁移业务有效）	N	C1

		0＝ 网页端申报 1＝ 接口端（TDGW）申报		
48	SecurityID	证券代码	Y	C12
522	OwnerType	订单所有者类型，取值包括： 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
54	Side	买卖方向，取值：1 表示买（转入），2 表示卖（转出）	Y	C1
8500	OrderEntryTime	订单申报时间，ExecType=F 时有效	N	ntime
44	Price	申报价格，ExecType=0/4/8 时有效	N	price
38	OrderQty	申报数量	N	quantity
151	LeavesQty	剩余数量	N	quantity
31	LastPx	成交价格，ExecType=F 时有效	N	price
32	LastQty	成交数量，ExecType=F 时有效	N	quantity
8504	TotalValueTraded	成交金额，ExecType=F 时有效	N	amount
84	CxlQty	撤单数量，ExecType=4 时有效	N	quantity
40	OrdType	订单类型，ExecType=0/4/8 时有效	N	C1
59	TimeInForce	订单有效时间类型，ExecType=0/4/8 时有效	N	C1
39	OrdStatus	当前申报的状态，取值有： 0=Unmatched，已挂单未成交 1=Partially Matched，部分成交 2=Matched，已成交 4=Cancelled，已撤消 8=Rejected，已拒绝	Y	C1
207	SecurityExchange	结算场所：1=中国结算，2=中央结算 双边托管券，可填 1 或 2，单边托管券只能填其实际托管方。预留字段，暂不启用。	N	C1
10216	SettlPeriod	结算周期： 0 = T+0	N	C1

			1 = T+1 2 = T+2 3 = T+3 预留字段，暂不启用		
63	SettlType		结算方式：1=净额结算，2=RTGS 结算	N	C1
544	CashMargin		信用标签，信用交易时填写，取值：XY=担保品买卖、RZ=融资交易、PC=平仓交易	N	C2
41	OrigClOrdID		原始会员内部订单编号，ExecType=4 时有效	N	C10
103	OrdRejReason		订单拒绝码，OrdStatus=8 时有效	N	N5
17	ExecID		成交编号，ExecType=F 且 OrdStatus=1&2 时有效	N	C16
37	OrderID		交易所订单编号，取值为数字	Y	C16
1080	RefOrderID		被撤订单交易所订单编号，ExecType=4 时有效	N	C16
75	TradeDate		交易日期	Y	date
60	TransactTime		回报时间	Y	ntime
58	Text		用户私有信息，如申报中填写，原样返回	N	C32
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=16，后接重复组，依次包含发起方投资者账户、登录或订阅交易单元、发起方业务交易单元、发起方交易员一债通账户、银行间托管账号、发起方营业部代码、结算会员代码、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码、开放式基金转托管的目标方、申报编号和对手方的一债通账户、投资者账户和投资者账户名称。	Y	N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户。	Y	N4
登录或订阅交易单元	448	PartyID	登录或订阅交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	Y	N4
发起方	448	PartyID	发起方业务交易单元。	Y	C8

业务交易单元	452	PartyRole	取 1,表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元。	Y	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
银行间托管账号	448	PartyID	银行间托管账号。债券转托管时适用。	N	C11
	452	PartyRole	取 28，表示当前 PartyID 的取值为银行间托管账号	N	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N	N4
结算会员代码	448	PartyID	结算会员代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4，表示当前 PartyID 的取值为结算会员代码。	N	N4
投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易账户	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011,表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117,表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4
开放式基金转	448	PartyID	开放式基金转托管的目标方代理人，对方对应的销售人代码，取值 000-999，不足 3 位左侧补 0。	N	C3

托管的目标方	452	PartyRole	取 30，表示当前 PartyID 的取值为开放式基金转托管的目标方代理人。	N	N4
申报编号	448	PartyID	申报代码	N	C6
	452	PartyRole	取 4003，表示当前 PartyID 的取值为申报代码	N	N4
对手方一债通账户	448	PartyID	对手方交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 102，表示当前的 PartyID 的取值为对手方交易员一债通账户	N	N4
对手方投资者账户	448	PartyID	对手方投资者账户或三方回购专户	N	C13
	452	PartyRole	取 39，表示当前 PartyID 的取值为对手方投资者账户	N	N4
对手方证券账户名称	448	PartyID	对手方账户名称，支持中文。	N	C180
	452	PartyRole	取 36，表示当前 PartyID 的取值为对手方投资者账户名称	N	N4
8532	DividendSelect		分红选择，仅用于开放式基金红选择，U=红利转投，C=现金分红	N	C1

说明：

1、 ExecType 和 OrdStatus 组合取值：

申报成功响应： ExecType=0, OrdStatus=0

申报拒绝响应： ExecType=8, OrdStatus =8

撤单成功响应： ExecType=4, OrdStatus =4

成交回报： ExecType=F, OrdStatus =1/2/8

其中，ExecType=F,OrdStatus=8 时表示订单申报进入订单簿后因某种程序原因无法被撮合成交。

2、 对于开放式基金、要约/现金选择权、融资融券非交易业务，OwnerType 字段暂不启用。

3、 对于价格、数量字段说明如下：

报告类型	字段	开放式基金非交易	融资融券非交易	要约/现金选择权非交易
申报成功响应	Price 申报价格	申报信息		
	OrderQty 申报数量	申报信息		
	LeavesQt 剩余数量	无意义		
	CxlQty 撤单数量	无意义		
申报失败	Price 申报价格	申报信息		

响应	OrderQty 申报数量	申报信息
	LeavesQt 剩余数量	无意义
	CxlQty 撤单数量	无意义
撤单成功响应	Price 申报价格	被撤原申报
	OrderQty 申报数量	被撤原申报
	LeavesQt 剩余数量	无意义
	CxlQty 撤单数量	无意义

4、 对于下列业务，除协议必填字段外，申报来源字段有效，发起方交易员—债通账户、Text 字段同申报信息，其他非必填字段说明如下，未提及的非必填字段对该业务无效：

ApplID	业务类型	申报成功	申报失败	撤单成功	成交
600230	双非可转债转股	1. 对转股/换股和回售申报，Price 有效：代表转股价格/换股价格/回售价格； 2. 对三方回购转入转出时，专用账户信息同申报信息； 3. 对转托管，银行间托管账号有效； 4. OrderQty 必填，同申报数量； TimeInForce 有效。	1. 对转托管，银行间托管账号同申报信息； 2. 对三方回购转入转出时，专用账户同申报信息； 3. OrdRejReason、TimeInForce 有效； 4. 撤单失败时，OrigClOrdID 同申报信息；申报失败时，OrderQty 同申报数量。	1. 对转托管，银行间托管账号同申报信息； 2. 对三方回购转入转出时，专用账户同申报信息； 3. OrderQty 表示被撤订单数量； OrigClOrdID、RefOrderID、TimeInForce 必填。	/
600240	私募可交换债换股				
600250	债券回售（一债通）				
600251	债券回售撤销				
600260	债券转托管				
600270	三方回购转入转出		/		1. LastQty（成交数量）为转入或转出数量，ExecID、OrderEntryTime 有效； 2. 对三方回购转入转出时，对手方投资者账户；

ApplID	业务类型	申报成功	申报失败	撤单成功	成交
600290（预留）	竞买预约	1. Price、OrderQty、SettlType 同申报数据 2. TimeInForce 必填	1. Price、OrderQty、SettlType 同申报数据； 2. OrdRejReason、TimeInForce 必填。	1. OrderQt、CxlQty 有效 2. OrigClOrdID、RefOrderID、TimeInForce 必填。	1. OrderQty、LeavesQty、LastPx、LastQty、TotalValueTraded、SettlType、ExecID、OrderEntryTime 有效； 2. 对手方一债通账号/投资者账户/证券账户名称有效*。
	竞买申报*				
	应价申报	1. OrderQty、Price 必填 2. TimeInForce 必填	1. Price、OrderQty 同申报数据； 2. OrdRejReason、TimeInForce 必填。		
600180	确定报价	/	/	/	
600190	一债通询价				
600200	待定报价				

*如竞买预约时勾选了自动发起，且未再手动发起竞买预约，系统将在相应时点自动发起竞买申报。此时竞买预约发起方将收到竞买申报执行报告。此时会员内部订单编号（TradeReportID）由系统自动生成；申报来源（ExecMethod）、订单所有者类型（OwnerType）、登录或订阅交易单元、业务交易单元同预约数据。如预约时通过网页端申报，登录或订阅单元将填写交易员绑定的交易单元；如交易员未绑定，则此执行报告仅供网页端查看。

*对于一债通各类现券非匹配成交（点击成交、询价成交和竞买成交等），将在成交回报中返回对手方的一债通账户、证券账户和账户名称信息。如结算方式为净额结算且任意一方选择‘匿名’，则此字段将填写‘anonymous’；如结算方式为净额结算且双方均显名或者结算方式‘RTGS’，则将发送实际的交易信息；但如账户名称无法自动加载，将无此字段。

4.4.5.1.2 撤单失败执行报告

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = 9		
10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
10179	ReportIndex	执行报告编号，从 1 开始连续递增编号	Y	N16
1180	ApplID	业务类型	Y	C6
11	ClOrdID	会员内部订单编号	Y	C10
48	SecurityID	证券代码	Y	C12

41	OrigClOrdID		原始会员内部订单编号	Y	C10
75	TradeDate		交易日期	Y	date
60	TransactTime		回报时间	Y	ntime
103	OrdRejReason		撤单订单拒绝码	Y	N5
58	Text		用户私有信息	N	C32
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=8，后接重复组，依次包含登录或订阅交易单元、发起方业务交易单元、营业部代码、交易员一债通账户、投资者中国结算开放式基金账户、投资者中国结算交易账户、销售人代码、券商网点号码。	Y	N2
登录或订阅交易单元	448	PartyID	登录或订阅交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 17，表示当前 PartyID 的取值为登录或订阅交易单元。	Y	N4
发起方业务交易单元	448	PartyID	发起方业务交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元。	Y	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	N	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N	N4
发起方交易员一债通账户	448	PartyID	交易员一债通账户	N	C10
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员一债通账户	N	N4
投资者中国结算开放式基金账户	448	PartyID	投资者场外开放式基金账户	N	C12
	452	PartyRole	取 4010，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外开放式基金账户。	N	N4
投资者中国结算交易	448	PartyID	投资者中国结算交易账户	N	C17
	452	PartyRole	取 4011，表示当前 PartyID 的取值为发起方的场外交易账户。	N	N4

账户					
销售人代码	448	PartyID	销售人代码	N	C9
	452	PartyRole	取 117，表示当前 PartyID 的取值为发起方的销售代码。	N	N4
券商网点号码	448	PartyID	券商网点号码	N	C9
	452	PartyRole	取 81，表示当前 PartyID 的取值为发起方的客户端编码或网点号码。	N	N4

说明：

1.发起方营业部代码字段对于开放式基金、要约/现金选择权、融资融券非交易及固收迁移业务暂不启用。

4.4.6 网络密码服务（Password Service, MsgType = U006）

4.4.6.1.1 网络密码服务申报

标签	字段名		字段描述	必须	类型
消息头			MsgType = U006		
1180	ApplID		业务类型	Y	C6
11	ClOrdID		会员内部订单编号	Y	C10
48	SecurityID		产品代码	Y	C12
522	OwnerType		订单所有者类型，取值包括： 1=个人投资者 103=机构投资者 104=自营交易	Y	N3
60	TransactTime		订单申报时间	Y	ntime
54	Side		1=激活，2=挂失或重置	Y	C1
8539	ValidationCode		投资者在上交所网站注册时所获得的激活码	N	C8
58	Text		用户私有信息	N	C32
453	NoPartyIDs		参与方个数，取值=3，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、发起方业务交易单元号、营业部代码。	Y	N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者账户	Y	C13
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户。	Y	N4

发起方业务交易单元号	448	PartyID	发起方业务交易单元代码，填写 5 位业务交易单元号。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1,表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元号。	Y	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	Y	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	Y	N4

说明

1、各业务填写字段说明如下：

应用标识 ApplID	业务类型	相关字段填写说明
600120	网络密码服务	1、SecurityID，A 股申报填写 799988，B 股申报填写 939988 2、OwnerType 暂不启用

4.4.6.1.2 密码服务申报响应

标签	字段名	字段描述		必须	类型
消息头		MsgType = U008			
1180	ApplID	业务类型：		Y	C6
11	ClOrdID	会员内部订单编号		Y	C10
48	SecurityID	申报代码		Y	C12
522	OwnerType	订单所有者类型		Y	N3
103	OrdRejReason	拒绝码，仅当申报成功时响应返回“0”		N	N5
75	TradeDate	交易日期		Y	date
60	TransactTime	回报时间		Y	ntime
8539	ValidationCode	校验号码		Y	C8
58	Text	用户私有信息		N	C32
54	Side	操作指令		Y	C1
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=3，后接重复组，依次包含发起方投资者账户、发起方业务交易单元、发起方营业部代码。		Y	N2
发起方	448	PartyID	发起方投资者账户	Y	C13

投资者账户	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户。	Y	N4
发起方业务交易单元	448	PartyID	发起方业务交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元。	Y	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	Y	C8
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	Y	N4

注：

1、OwnerType 暂不启用。

4.4.7 其它消息

4.4.7.1 申报拒绝（Order Reject）

标签	字段名	字段描述		必须	类型
消息头		MsgType =j			
1180	ApplID	业务类型		Y	C6
11	ClOrdID	会员内部订单编号		Y	C10
48	SecurityID	证券代码		N	C12
103	OrdRejReason	订单拒绝码		Y	N5
75	TradeDate	交易日期		Y	date
60	TransactTime	回报时间		Y	ntime
58	Text	用户私有信息		N	C32
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=1，后接重复组，依次包含发起方业务交易单元。		Y	N2
发起方业务交易单元	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位发起方业务交易单元。	Y	C8
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方业务交易单元。	Y	N4

说明：

1、 消息类型与业务层 ID 对应表：

消息类型	被拒绝消息对应的业务层 ID
新订单（New Order Single）	ClOrdID
撤单申报（Order Cancel）	ClOrdID
询价请求（Quote Request）	ClOrdID
报价（Quote）	QuoteMsgID
报价回复（Quote Response）	ClOrdID
意向申报（Indication of Interest）	IOIID
成交申报（Trade Capture Report）	TradeReportID
网络密码服务（Password Service）	ClOrdID

2、 对于成交申报类和意向申报类消息，SecurityID 非必填；对于其他消息，SecurityID 必填。

4.4.7.2 平台状态（PlatformState）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = U109		
10180	PlatformID	平台标识： 6= 互联网交易平台	Y	C1
10181	PlatformStatus	平台状态： 0 = NotOpen，未开放 1 = PreOpen，预开放 2 = Open，开放 3 = Break，暂停 4 = Close，关闭	Y	C1

4.4.7.3 执行报告分区信息（ExecRptInfo）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = U108		
10180	PlatformID	平台标识： 6 = 互联网交易平台	Y	C1
8561	NoGateWayPBUs	登录或订阅 PBU 数量	Y	N4

→	8560	GateWayPBU	登录或订阅 PBU	Y	C8
10196	NoPartitions		平台内分区数量	Y	N4
→	10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4

执行报告分区信息提供 PBU 和分区列表，供 OMS 对执行报告流进行初始化和维护。其中 PBU 可能为 OMS 所连接 TDGW 上的登录 PBU，也可能为该 TDGW 上订阅的其他 PBU（仅包含订阅成功的 PBU），TDGW 在该循环体中首先给出登录 PBU，后给出订阅的其他 PBU（如有）。

4.4.7.4 分区序号同步（ExecRptSync）

标签	字段名		字段描述	必须	类型
消息头			MsgType = U106		
10196	NoPartitions		循环次数	Y	N4
→	8560	GateWayPBU	登录或订阅 PBU	Y	C8
→	10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
→	8562	BeginReportIndex	分区执行报告起始序号	Y	N16

序号同步请求中 BeginReportIndex 取值应大于 0。OMS 应避免频繁发送“分区序号同步”请求，禁止定时或不必要的反复同步行为。

4.4.7.5 分区序号同步响应（ExecRptSyncRsp）

标签	字段名		字段描述	必须	类型
消息头			MsgType = U107		
10196	NoPartitions		循环次数	Y	N4
→	8560	GateWayPBU	登录或订阅 PBU	Y	C8
→	10197	PartitionNo	平台内分区号	Y	N4
→	8562	BeginReportIndex	分区执行报告起始序号	Y	N16
→	8563	EndReportIndex	分区执行报告最大序号	Y	N16
→	103	OrdRejReason	分区序号同步拒绝码	Y	N5
→	58	Text	描述	Y	C64

分区序号同步响应中 RejReason 为 0 时表示成功，其他取值表示错误（如 PBU 或 PartitionNo 取值不正确）。

4.4.7.6 分区执行报告结束（ExecRptEndOfStream）

标签	字段名	字段描述	必须	类型
消息头		MsgType = U110		
8560	GateWayPBU	交易网关登录或订阅 PBU	Y	C8
10197	PartitionNo	平台分区号	Y	N4
8563	EndReportIndex	分区执行报告最大序号，本消息编入该分区执行报告编号序列。	Y	N16

TDGW 在闭市后向 OMS 自动发送一次，表示该执行报告流推送结束，后续该执行报告流上的序号将不再增加，最大序号为 EndReportIndex。

附录

附录一 计算校验和

以下为计算校验和的代码段：

```
uint32 CalcChecksum(const char* buffer, uint32 len)
{
    uint8 checksum = 0;
    uint32 i = 0;
    for (i = 0; i < len; i++)
    {
        checksum += (uint8)buffer[i];
    }
    return (uint32)checksum;
}
```

附录二 PBU 及说明

涉及 PBU 时有几种含义：

1、配置于 TDGW 上用于登录至交易系统后台的登录单位，称为登录交易单元；

2、在消息报文中，表明该消息所进行的业务归属单元，称为业务交易单元，接口文档中用 BizPbu 指代；

3、在消息报文中，表明与另一登录 PBU 间的订阅关系，称为订阅交易单元。

目前，业务交易单元必须与登录交易单元属于同一市场参与者机构，否则交易系统将拒绝相应的业务申报请求。订阅 PBU 必须与登录 PBU 属于同一市场参与者机构，否则将订阅失败，在执行报告分区信息 ExecRptInfo 消息中将不会包含订阅失败的交易单元。

附录三 错误代码说明

状态码/错误码	说明	Text（如有）
0	正常退出	Normal Logout
4012	SecurityID 错误或者业务类型 BizID 错误	
5000	上行消息超过 4K	Message Exceed Max Length
5001	上行消息校验和错误	CheckSum Error
5002	心跳超时	Heartbeat Timeout
5003	平台已有 OMS 登录	Already Login, try again
5004	连接建立后 5 秒内未完成登录	Login Timeout
5005	上行消息 TargetCompId 不正确	CompId Error
5006	TDGW 未登录至交易系统，请稍后重试	Not Ready
5007	内部错误	Internal Error
5008	不能识别的消息类型	Message Type Illegal
5009	平台状态暂不接受申报	
5010	PartitionNo 错误	
5011	Pbu 错误	
5012	首个消息非是 Logon 消息	Login First
5013	BeginReportIndex 取值错误	
5014	不支持的接口协议版本	UnsupportedPrtclVersion
5015	消息数据错误	Message Data Error

注：本表仅提供交易网关错误码，系统后台错误码参照互联网交易平台/新固定收益系统错误码信息文件。

附录四 “用户私有信息”说明

对于应用消息中的 Text 字段（用户私有信息），有如下规则：

TDGW 返回给 OMS 的下行消息中 Text，取该条下行消息所对应的上行消息（由 OMS 发送给 TDGW）中的 Text 字段值。