

中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0155.2—2018

---

证券期货业场外市场交易系统接口  
第2部分：订单接口

OTC trading system interface for securities and futures market

——Part 2: Orders

2018-01-18 发布

2018-01-18 实施

---

中国证券监督管理委员会

发布



## 目 次

|                                    |     |
|------------------------------------|-----|
| 前言 .....                           | II  |
| 引言 .....                           | III |
| 1 范围 .....                         | 1   |
| 2 规范性引用文件 .....                    | 1   |
| 3 术语和定义 .....                      | 1   |
| 4 会话传输 .....                       | 2   |
| 5 消息格式 .....                       | 2   |
| 5.1 数据类型 .....                     | 2   |
| 5.2 域 .....                        | 3   |
| 5.3 安全与加密 .....                    | 4   |
| 5.4 数据完整性 .....                    | 5   |
| 5.5 扩展方式 .....                     | 5   |
| 6 消息结构 .....                       | 5   |
| 6.1 消息头 .....                      | 5   |
| 6.2 消息尾 .....                      | 6   |
| 7 实时交易业务 .....                     | 7   |
| 7.1 申报请求 .....                     | 7   |
| 7.2 执行报告 (MsgType=8) .....         | 9   |
| 7.3 产品状态查询 .....                   | 10  |
| 7.4 账户信息登记 .....                   | 11  |
| 8 辅助处理 .....                       | 12  |
| 8.1 缺口重发 .....                     | 12  |
| 8.2 未知消息拒绝应答 (MsgType=UF008) ..... | 13  |
| 9 数据字典 .....                       | 14  |
| 附录 A (规范性附录) 产品账户编码规则 .....        | 26  |
| 附录 B (资料性附录) 计算校验和 .....           | 27  |
| 附录 C (规范性附录) 二级产品账户导入文件数据格式 .....  | 28  |
| 附录 D (规范性附录) 消息错误码 .....           | 30  |

## 前 言

JR/T 0155—2018《证券期货业场外市场交易系统接口》分为3个部分：

- 第1部分：行情接口；
- 第2部分：订单接口；
- 第3部分：结算接口。

本部分为JR/T 0155—2018的第2部分。

本部分按照GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本部分的编制参考了JR/T 0022—2004《证券交易数据交换协议》的相关内容。

本部分由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC180/SC4）提出。

本部分由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本部分起草单位：中国证监会信息中心、中国证监会机构部、中国证券业协会、中证机构间报价系统股份有限公司、福建顶点软件股份有限公司。

本部分主要起草人：张野、刘铁斌、周云晖、刘叶青、高红洁、杨胜平、徐亚钊、曹雷、刘云清、李睿、罗黎明、刘辉、刘建宝、孙登。

## 引 言

场外市场是多层次资本市场的重要组成部分。场外交易系统负责提供私募产品的发行转让、登记结算、信息服务等功能。

经过近几年的系统建设和业务发展，通过与证券公司柜台市场的互联互通，机构间私募产品报价与服务系统（以下简称“报价系统”）目前已经建设成为场外市场的重要基础设施之一。报价系统是为参与者提供私募产品报价、发行、转让及相关服务的专业化电子平台，可以提供私募产品注册、报价询价、发行转让、份额登记、资金结算、信息服务等核心功能。



## 证券期货业场外市场交易系统接口 第2部分：订单接口

### 1 范围

本部分规定了证券期货业场外市场交易系统订单接口的术语和定义、会话传输、消息格式、消息结构、实时交易业务、辅助处理、数据字典等内容。

本部分适用于场外交易系统与证券公司柜台交易系统等机构之间进行的订单数据交换。

### 2 规范性引用文件

下列文件对于本文件的应用是必不可少的。凡是注日期的引用文件，仅所注日期的版本适用于本文件。凡是不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

GB/T 2659—2000 世界各国和地区名称代码

GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码

GB 18030—2005 信息技术 中文编码字符集

GB/T 23696—2009/ISO 10383:2003 证券和相关金融工具 交易所和市场识别码

JR/T 0022—2004 证券交易数据交换协议

ISO/IEC 646:1991 信息技术ISO信息交换七位编码字集(Information technology-ISO 7-bit coded character set for information interchange)

### 3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

#### 3.1

**参与人 participants**

认可场外交易系统的服务声明并完成用户注册流程的法人或其他机构。

#### 3.2

**一级产品账户 sender sub id**

场外交易系统为参与人开立的用于记载其直接持有或间接持有的私募产品份额的账户。

#### 3.3

**二级产品账户 security account**

参与人为投资者开立的用于记载私募产品份额的账户。

注：编码规则见附录A。

#### 3.4

**证券信息请求编号 security status req id**

证券公司柜台系统自定义的行情信息报送序号。

#### 3.5

**参与人申报单编号 clord id**

参与人为每笔申报单分配的编号，在有效申报日期内唯一。

注：其中，前3位或前5位是场外交易系统为参与人分配的机构结算码，其余代码可由参与人的柜台系统自行定义。

3.6

**交易系统申报单编号 order id**

场外交易系统为每笔申报单统一分配的编号，在有效申报日期内唯一。

3.7

**成交记录号 exec id**

场外交易系统为执行报告消息分配的连续编号。

注：每个柜台独立分配，并且在单个交易日内唯一。

3.8

**成交配对号 trade id**

当订单发生部分成交或全部成交时，场外交易系统为买卖双方分配的配对编号。

注：买卖双方共用同一个成交配对号。

3.9

**应用程序编程接口 application programming interface; API**

系统不同组成部分衔接的约定。

4 会话传输

通信双方应使用实时消息服务进行会话通讯。

通信双方分别基于消息接口的API定义，自行开发消息收发处理程序。

通信中与会话传输相关的登录登出、状态初始化、序号管理、重发纠错等功能，均由消息服务承载解决。

5 消息格式

5.1 数据类型

5.1.1 分类

数据类型用于定义数据域的取值类型。本接口由基本数据类型（整数、浮点数、单字符、字符串、二进制数据块）和在此基础上扩展的数据类型组成。

5.1.2 整数型

使用int表示。无逗号和小数位的序号，可表示正负（ASCII码字符‘-’，‘0’至‘9’组成）。符号占据一个字符位置。允许前置字符零（例：“00023” = “23”）。取值-2147483648到2147483647。

整数类型的扩展定义：

- 长度Length：以整数表示字节为单位的数据长度，正数；
- 重复数NumInGroup：以整数表示重复组的个数，正数；
- 消息序号SeqNum：以整数表示消息序号，正数；
- 域号TagNum：以整数表示的域号（或称Tag），正数，首位不能为零；
- 月日期号day-of-month：以整数表示的月份中第几天，取值1至31；



- Number(m)、N(m)：m表示所有有效数字的最长位数（不含正负号）。

### 5.1.3 浮点数值

使用float表示。含有可选的小数部分，可表示正负（ASCII码字符‘-’，‘0’至‘9’和‘.’组成）。最多16位有效数字。允许前置字符零（例：“00023”=“23”）。允许小数部分后置字符零（例：“23.0”=“23.0000”=“23”）。除非特别声明，浮点数类型均有正负。

浮点数类型的扩展定义：

- 量Qty：申报数量等，可以有小数部分；
- 价格Price：小数位数可变；
- 价格偏移量PriceOffset：代表价格偏移量的浮点域；
- 金额Amt：典型的价格与数量相乘结果，如成交金额；
- 百分比Percentage：小数表示方法：.05代表5%；
- Number(m,n)、N(m,n)：m表示所有有效数字的最长位数（不含小数点和正负号），小数位数为n。

### 5.1.4 单个字符型

使用char表示。指除界定符外所有字母字符和标点字符，区分字母大小写。

字符类型的扩展定义：

- 布尔Boolean：该域取值于两个字符，（‘Y’=True/Yes，‘N’=False/No）。

### 5.1.5 字符串型

使用string表示。区分字母大小写。

字符串类型的扩展定义：

- 多元值字符串MultipleValueString：用空格分隔；
- 国家Country：遵守GB/T 2659—2000的规定；
- 字符串货币类型Currency：遵守GB/T 12406—2008的规定；
- 交易所或市场编号Exchange：遵守GB/T 23696—2009的规定；
- 字符串Char(n)、C(n)：表示长度不超过n个字节的字符串；
- 年月日期month-year，格式：YYYYMMDD，YYYY = 0000-9999，MM = 01-12，DD = 01-31，WW = w1, w2, w3, w4, w5；
- 国际标准时时间戳UTCTimestamp，格式：YYYYMMDD HH:MM:SS(秒)或YYYYMMDD HH:MM:SS.sss(毫秒)，YYYY = 0000-9999，MM = 01-12，DD = 01-31，HH = 00-23，MM = 00-59，SS = 00-59(秒)，sss=000-999(毫秒)；
- 国际标准时时间UTCTimeOnly或者time（用于结算文件中），格式：HH:MM:SS或HH:MM:SS.sss，HH = 00-23，MM = 00-59，SS = 00-59(秒)，sss=000-999(毫秒)；
- 国际标准时日期UTCDate，格式：YYYYMMDD，YYYY = 0000-9999，MM = 01-12，DD = 01-31；
- 本地市场日期LocalMktDate，格式：YYYYMMDD，YYYY = 0000-9999，MM = 01-12，DD = 01-31。

### 5.1.6 二进制数据

使用data表示。无格式和内容限制的原始数据，包含长度域和数据域两个部分。

长度域用于记录数据域的字节数，长度域后面紧跟数据域。数据域可以包含数值0x01等数据。

## 5.2 域

### 5.2.1 域的组成

域是基本的数据元素，域的定义包括：域号（tag）、域名、业务含义和数据类型。

域号是域的区分标志，在本标准范围内统一分配。在消息中，通过域号来确定不同的域。

域的数据类型决定了其取值范围。域的取值范围可以是一个集合，任何在此集合外的取值被认为是非法的。域的详细说明参见第9章。

### 5.2.2 域的使用

域的使用可以分为三类：必填的，可选的，条件限制选择（即根据其他相关域的存在条件或取值来决定是否必填）。作为一个完整的消息，必填域和条件限制选择域是应包含的内容。

### 5.2.3 自定义域

市场参与者可以根据业务需要扩展定义新的域，即自定义域。

### 5.2.4 域字符编码

域的取值为汉字时，应按照GB 18030—2005的规定。

域的取值为英文时，应按照ISO/IEC 646:1991的规定。

### 5.2.5 域界定

消息中所有的域（包含data类型数据域）都有一个分隔符来界定分隔，该分隔符就是不可打印字符ASCII码“SOH”（#001，hex：0x01，本文中以<SOH>表示）。

所有消息以“8=SACSTEPx.yz<SOH>”字符串开始，并以“10=nnn<SOH>”字符串结束。

除data数据类型的域以外，其他数据类型的域都不应包含域界定符<SOH>。

### 5.2.6 语法

任何消息都由多个“域号=值”的基本结构组成，每个“域号=值”的基本结构之间，都使用域界定符<SOH>分隔。消息组成结构如图1所示：



图1 消息格式

消息由消息头、消息正文和消息尾组成。每个组成部分都由一系列“域号=值”组成，并且在遵循以下规则前提下，每个组成部分的“域号=值”基本结构可以是任意的次序：

- 开始部分应是消息头，随后是正文，最后是消息尾；
- 消息头的前3个域的次序不能改变：起始串（Tag=8）、消息体长度（Tag=9）、消息类型（Tag=35）；
- 消息尾的最后一个域应是校验和域（Tag=10）；
- 重复组中，域出现的顺序应遵循该重复组在消息或组件中定义的次序；
- 在一条消息中，除重复组以外，任何其他域都不能重复出现。

### 5.2.7 重复组

域可以在重复组里多次重复，用以传输数组类的数据。通常域名起始为‘No’符号的域指明重复的次数，并位于重复组的开始处。

重复组的定义通过缩进的→符号表示，重复组也可嵌套。使用子重复组时不能省略父重复组。

## 5.3 安全与加密

由于消息有可能在不安全的网络上传输交换，可对敏感数据加密处理。具体加密的方法由连接双方自行约定，可以使用数字签名、密钥交换和正文加密等安全技术。

除某些需要公开识别的域应以明文传输以外，消息中的其他任何域都可以加密并放置在密文数据域（SecureData）内。当然，这些被加密的域也可以同时保留明文的表示方式。

可以对消息正文内的所有域进行加密。如果消息的重复组内有一部分需要加密，那么应该对整个重复组进行加密。

正文加密方案有三种：

- a) 将安全敏感的域加密后移至SecureData域；
- b) 将所有允许加密的域加密后移至SecureData域；
- c) 将所有允许加密的域加密后移至SecureData域，同时这些域以明文在消息中重复出现。

## 5.4 数据完整性

数据完整性可以通过两个方法保证：消息体长度和校验和验证。

消息体长度是以BodyLength域来表示，其值是计算出的消息长度域后面的字符数，包含紧靠校验和域标志‘10=’之前的界定符SOH。

校验和是把每个字符的二进制值从消息开头‘8=’中的‘8’开始相加，一直加到紧靠在校验和域‘10=’之前的域界定符，然后取按256取模得到的结果。

校验和域位于消息的最末一个，校验和的计算是在加密之后进行的。计算校验和的代码段按照附录B。

## 5.5 扩展方式

### 5.5.1 扩展分类

扩展可分为两种类型：消息定义扩展和域定义扩展。

消息定义扩展可以通过新增消息类型来实现，但应尽量在已有消息中通过域定义扩展或修改取值范围来定义新业务。已有消息所代表的业务在扩展时不能改变。

域定义扩展可以通过新增域来实现，但应尽量通过修改取值范围来扩展域的定义。已定义的必填域不能取消定义或改变成可选域。

### 5.5.2 扩展规则

自定义消息的消息类型值首字符为‘UF’。其他类型的消息由全国金融标准化技术委员会根据国际相关标准的变化统一定义并发布。对于尚未发布的扩展消息，将以参考文件指引的形式发布。

消息的模块顺序在扩展定义时不能改变，即保持消息头、消息体和消息尾的顺序。而模块的内部，域和重复组的顺序是可以变化的。

消息头的头三个域的定义和位置不能改变，但可以扩展增加消息头的可选域。

消息尾最后一个域的定义和位置不能改变，但可以扩展增加消息尾的可选域。

### 5.5.3 版本管理

版本号格式为X.YZ，版本号从1.00起始，当新版本完全兼容上一版本时只改变版本号中的Z。

## 6 消息结构

### 6.1 消息头

每一个会话应用消息有一个消息头，该消息头指明消息类型、消息体长度、发送目的地、消息序号、发送起始点和发送时间。

消息头格式如表1所示。

表1 消息头

| 域号  | 域名                     | 必填 | 说明  |
|-----|------------------------|----|---|
| 8   | BeginString            | Y  | 起始串, 取值: SACSTEP1.00(不可加密, 消息的第一个域)       |
| 9   | BodyLength             | Y  | 消息体长度(不可加密, 消息的第二个域)                      |
| 35  | MsgType                | Y  | 自定义消息类型代码(不可加密, 消息的第三个域)                  |
| 49  | SenderCompID           | Y  | 发送方代码(填写场外交易系统为参与人分配的机构结算编码)              |
| 56  | TargetCompID           | Y  | 接收方代码(填写场外交易系统的标识代码, 报价系统的编码为 899)        |
| 115 | OnBehalfOfCompID       | N  | 最初发送方标识符(可加密), 用于经第三方发送。                  |
| 128 | DeliverToCompID        | N  | 最终接收方标识符(可加密), 用于经第三方发送。                  |
| 90  | SecureDataLen          | N  | 密文数据长度                                    |
| 91  | SecureData             | N  | 密文数据(紧跟密文数据长度域)                           |
| 34  | MsgSeqNum              | N  | 柜台系统自定义的消息序号(可加密)                         |
| 50  | SenderSubID            | Y  | 发送方子标识符(可加密, 填写参与人用于经纪业务的一级产品账户)          |
| 142 | SenderLocationID       | N  | 发送方方位标识符(可加密, 预留)                         |
| 57  | TargetSubID            | N  | 接收方子标识符(可加密, 预留)                          |
| 143 | TargetLocationID       | N  | 接收方方位标识符(可加密, 预留)                         |
| 116 | OnBehalfOfSubID        | N  | 最初发送方子标识符(可加密, 预留)                        |
| 144 | OnBehalfOfLocationID   | N  | 最初发送方方位标识符(可加密, 路由模式下订单源柜台的机构结算码)         |
| 129 | DeliverToSubID         | N  | 最终接收方子标识符(可加密, 预留)                        |
| 145 | DeliverToLocationID    | N  | 最终接收方方位标识符(可加密, 预留)                       |
| 43  | PossDupFlag            | N  | 可能重复标志, 重复发送时使用(可加密)                      |
| 97  | PossResend             | N  | 可能重发标志, 重复发送时使用(可加密)                      |
| 52  | SendingTime            | Y  | 发送时间(可加密)                                 |
| 122 | OrigSendingTime        | N  | 原始发送时间(可加密)                               |
|     |                        |    |   |
| 347 | MessageEncoding        | N  | 消息编码类型代码(消息中 Encoded 域的字符编码类型(非 ASCII 码)) |
| 369 | LastMsgSeqNumProcessed | N  | 最后处理消息序号(可加密)                             |
| 370 | OnBehalfOfSendingTime  | N  | 最初发送时间(用 UTC 表示时间)                        |

## 6.2 消息尾

每一个消息(会话或应用消息)有一个消息尾, 并以此终止。消息尾可用于分隔多个消息, 包含有3位数的校验和值。

消息尾格式如表2所示。

表2 消息尾

| 域号 | 域名              | 必填 | 说明                           |
|----|-----------------|----|------------------------------|
| 93 | SignatureLength | N  | 数字签名长度（不可加密）                 |
| 89 | Signature       | N  | 数字签名（不可加密）                   |
| 10 | Checksum        | Y  | 校验和，消息的最末域（不可加密，计算方法按照附录 B）。 |

## 7 实时交易业务

### 7.1 申报请求

#### 7.1.1 订单申报请求 (MsgType=D)

柜台系统向场外交易系统发送订单申报请求，由场外交易系统进行意向展示、交易撮合等后续处理。

对于柜台系统重复发送的订单申报请求，如果之前收到过该订单，场外交易系统通过执行报告消息回应订单状态；如果之前未收到，场外交易系统通过执行报告消息回应订单确认。

订单申报请求的格式如表3所示。

表3 订单申报请求

| 域号   | 域名                  | 必填 | 说明                                      |
|------|---------------------|----|---|
|      | 标准消息头               | Y  | MsgType=D                               |
| 11   | ClOrdID             | Y  | 参与者申报单编号                                |
| 18   | ExecInst            | Y  | 执行指令代码                                  |
| 59   | TimeInForce         | Y  | 长效订单标识                                  |
| 126  | ExpireTime          | Y  | 有效日期 (TimeInForce=1 时订单的有效日期)           |
| 109  | ClientID            | N  | 资金账户                                    |
| 9017 | SecurityAccount     | Y  | 二级产品账户                                  |
| 48   | SecurityID          | Y  | 产品代码                                    |
| 54   | Side                | N  | 买卖方向代码                                  |
| 44   | Price               | Y  | 价格                                      |
| 38   | OrderQty            | Y  | 订单数量                                    |
| 9001 | AgreementNo         | N  | 约定号                                     |
| 9002 | CodeOfTargetProduct | N  | 产品转换等业务指定的目标产品代码                        |
| 516  | OrderPercent        | N  | 订单比例代码（整笔转让等交易限制）                       |
| 9003 | CustomerType        | N  | 客户类型代码（1. 普通投资者，2. 做市商）                 |
| 9004 | DeliveryMode        | N  | 交收方式代码（1. 货银对付，2. 见券付款，4. 见款付券，8. 纯券过户） |
| 9005 | DeliveryDate        | N  | 交收日期（最迟交收日期）                            |
| 9006 | ContactPerson       | N  | 联系人                                     |
| 9007 | ContactInfo         | N  | 联系方式及备注信息                               |
|      | 标准消息尾               | Y  |   |

### 7.1.2 撤单申报请求 (MsgType=F)

参与者向场外交易系统发送撤单申报请求，撤消相关订单中所有的未成交部分。

撤单申报请求消息仅在相关订单没有产生成交或者部分成交的情况下被接受。即撤单申报请求仅在原订单中有剩余数量时才有效。对于未成交订单或者部分成交订单中的未成交部分，场外交易系统只允许一次性全部撤单，不支持部分撤单。

撤单申报请求消息被视作一张新订单，ClOrdID域应填写一个新的数值。如果撤单申报请求被场外交易系统拒绝，执行报告的ClOrdID域应放置撤单申报请求中的该域数值，原始订单中的ClOrdID域数值放入OrigClOrdID域。ClOrdID域的数值应始终保证唯一。

对于参与者发送的撤单申报请求，场外交易系统需要立即回应。除非撤单能立刻被处理或拒绝，否则场外交易系统应先发送一个待撤消的执行报告。

撤单申报请求的格式如表4所示。

表4 撤单申报请求

| 域号   | 域名              | 必填 | 说明                                   |
|------|-----------------|----|--------------------------------------|
|      | 标准消息头           | Y  | MsgType=F                            |
| 11   | ClOrdID         | Y  | 参与者申报单编号                             |
| 41   | OrigClOrdID     | Y  | 原始的参与者申报单编号（即需要撤消的订单申报请求中的ClOrdID字段） |
| 18   | ExecInst        | Y  | 执行指令代码                               |
| 109  | ClientID        | N  | 资金账户                                 |
| 9017 | SecurityAccount | Y  | 二级产品账户                               |
| 48   | SecurityID      | Y  | 产品代码                                 |
| 54   | Side            | N  | 买卖方向代码                               |
| 44   | Price           | N  | 价格                                   |
| 38   | OrderQty        | N  | 订单数量（原始订单数量）                         |
| 58   | Text            | N  | 摘要说明                                 |
|      | 标准消息尾           | Y  |                                      |

### 7.1.3 质押回购申报请求 (MsgType=S)

柜台系统通过质押回购申报请求向场外交易系统发起质押回购业务。

合约签订时，正回购方发送“质押交易申请”请求，场外交易系统通过执行报告向柜台系统反馈接收成功。逆回购方发送“质押交易确认”请求，场外交易系统接收并匹配成功后，通过执行报告向交易双方推送成交信息。柜台系统应记录TradeID域的数据，用于后续的到期回购、提前终止等业务处理。

合约到期时，正回购方发送“到期回购”请求，场外交易系统成功接收后启动到期回购处理流程。

合约提前终止时，任意一方向场外交易系统发送“提前终止申请”请求，场外交易系统通过执行报告向柜台系统反馈接收成功。另一方发送“提前终止确认”请求，场外交易系统匹配处理后向交易双方推送成交确认。质押回购申报请求的格式如表5所示。

质押回购业务到期时，正回购方若未发起或延期发起到期回购申请，进入违约处置流程，人工处理。

表5 质押回购申报请求

| 域号   | 域名                 | 必填 | 说明  |
|------|--------------------|----|---|
|      | 标准消息头              | Y  | MsgType=S                                       |
| 11   | ClOrdID            | Y  | 参与者申报单编号  |
| 18   | ExecInst           | Y  | 执行指令代码  |
| 59   | TimeInForce        | Y  | 长效订单标识  |
| 126  | ExpireTime         | Y  | 有效日期 (TimeInForce=1 时, 用户订单的有效日期)               |
| 9017 | SecurityAccount    | Y  | 二级产品账户  |
| 48   | SecurityID         | Y  | 产品代码 (质押品的产品代码)                                 |
| 54   | Side               | Y  | 买卖方向代码 (业务方向:<br>1 =逆回购方 (出资方)<br>2 =正回购方 (融资方) |
| 44   | Price              | Y  | 价格 (单张质押品的面值/净值)                                |
| 38   | OrderQty           | Y  | 订单数量 (质押品数量)                                    |
| 9001 | AgreementNo        | N  | 约定号   |
| 516  | OrderPercent       | N  | 订单比例代码 (整笔质押等交易限制)                              |
| 9003 | CustomerType       | N  | 客户类型代码  |
| 9006 | ContactPerson      | N  | 联系人   |
| 9007 | ContactInfo        | N  | 联系方式及备注信息                                       |
| 9013 | Duration           | N  | 期限  |
| 318  | GrossTradeAmt      | N  | 融入资金总额  |
| 9046 | NumberOfDaysAnnual | N  | 计息天数  |
| 9023 | TradeID            | N  | 成交配对号 (发起到期回购申报或提前终止申报请求时, 需提供合约期初的成交配对号)       |
| 9047 | RepoRate           | N  | 回购利率/补偿利率                                       |
| 9048 | Discount           | N  | 折算比例  |
|      | 标准消息尾              | Y  |   |

## 7.2 执行报告 (MsgType=8)

场外交易系统在接收到柜台系统发送的订单申报请求或撤单申报请求之后, 或者场外交易系统中已接收订单的状态发生变化 (如多批次成交) 时, 场外交易系统向柜台系统发送执行报告消息。

每个执行报告中都包含两个域: OrdStatus和ExecType。OrdStatus域用以报告订单的当前状态。ExecType域用以标识执行报告的执行类型。执行报告中的ExecType域和OrdStatus域共同指示了订单状态的改变。在同一个执行报告中, 上述两个域的取值不能存在冲突。执行报告的格式如表6所示。

表6 执行报告

| 域号  | 域名                     | 必填 | 说明                                    |
|---|------------------------|----|---------------------------------------|
|   | 标准消息头                  | Y  | MsgType=8                             |
| 37  | OrderID                | Y  | 交易系统申报单编号（场外交易系统申报单编号）                |
| 11  | ClOrdID                | Y  | 参与者申报单编号                              |
| 41  | OrigClOrdID            | Y  | 原始的参与者申报单编号（即需要撤消的订单申报请求中的ClOrdID 字段） |
| 150   | ExecType <sup>a</sup>  | Y  | 执行类型代码                                |
| 60  | TransactTime           | Y  | 执行时间                                  |
| 39  | OrdStatus <sup>a</sup> | Y  | 订单状态代码                                |
| 109   | ClientID               | N  | 资金账户                                  |
| 9017  | SecurityAccount        | Y  | 二级产品账户                                |
| 48  | SecurityID             | Y  | 产品代码                                  |
| 18  | ExecInst               | Y  | 执行指令代码                                |
| 17  | ExecID                 | N  | 成交记录号                                 |
| 9023  | TradeID                | N  | 成交配对号                                 |
| 1020  | TradeVolume            | N  | 成交数量（如为部分成交，填写本批次的成交数量）               |
| 8504  | TotalValueTraded       | N  | 成交金额（如为部分成交，填写本批次的成交金额）               |
| 44  | Price                  | N  | 价格（如为部分成交，填写本批次的成交价格）                 |
| 38  | OrderQty <sup>b</sup>  | N  | 订单数量（原始订单数量）                          |
| 14  | CumQty                 | N  | 累计执行数量（含当前批次在内的、所有“已成交”和“已撤单”订单的总数量）  |
| 151   | LeavesQty              | N  | 剩余数量（原始订单中未成交且未撤单部分的数量）               |
| 6   | AvgPx                  | N  | 成交均价                                  |
| 9026  | CancellationVolume     | N  | 撤单数量                                  |
| 58  | Text                   | Y  | 摘要说明                                  |
| 567   | TradSesStatusRejReason | Y  | 消息错误码                                 |
|   | 标准消息尾                  | Y  |                                       |
| <sup>a</sup> ExecType 或 OrdStatus 为已撤消、当天完成、已过期、已计算、已拒绝时，订单不处于活跃状态，LeavesQty 为 0。<br><sup>b</sup> 订单数量 OrderQty = 累计执行数量 CumQty + 剩余数量 LeavesQty。 |                        |    |                                       |

### 7.3 产品状态查询

#### 7.3.1 产品状态请求（MsgType=UF101）

柜台系统通过发送产品状态请求消息，可以向场外交易系统实时查询相关产品的可交易状态、持有人数量、剩余份额等当前信息。



产品状态请求的格式如表7所示：

表7 产品状态请求

| 域号  | 域名         | 必填 | 说明            |
|-----|------------|----|---------------|
|     | 标准消息头      | Y  | MsgType=UF101 |
| 48  | SecurityID | Y  | 产品代码          |
| 461 | CFICode    | N  | 产品类别代码        |
|     | 标准消息尾      | Y  |               |

### 7.3.2 产品状态应答 (MsgType=UF102)

产品状态应答的格式如表8所示。

表8 产品状态应答

| 域号   | 域名                     | 必填 | 说明                             |
|------|------------------------|----|--------------------------------|
|      | 标准消息头                  | Y  | MsgType=UF102                  |
| 150  | ExecType               | Y  | 执行类型代码<br>(Y=数据处理成功, N=数据处理失败) |
| 60   | TransactTime           | Y  | 执行时间                           |
| 461  | CFICode                | Y  | 产品类别代码                         |
| 48   | SecurityID             | Y  | 产品代码                           |
| 55   | Symbol                 | Y  | 产品名称                           |
| 326  | SecurityTradingStatus  | Y  | 交易状态代码                         |
| 9032 | TotalAvailableHead     | Y  | 总剩余名额                          |
| 9033 | TotalAvailableVol      | Y  | 总剩余份额                          |
| 58   | Text                   | Y  | 摘要说明                           |
| 567  | TradSesStatusRejReason | Y  | 消息错误码                          |
|      | 标准消息尾                  | Y  |                                |

## 7.4 账户信息登记

### 7.4.1 账户登记请求 (MsgType=UF201)

参与者通过柜台系统为投资者开立并维护二级产品账户。在发送订单申报请求之前，柜台交易系统需要将二级产品账户信息报送至场外交易系统，以便场外交易系统正常接收委托申报业务。

柜台系统可以通过实时消息或数据文件的方式报送二级产品账户信息。本节主要介绍实时消息的报送方式。数据文件的报送方式见附录C。

账户登记请求的格式定义如表9所示。

表9 账户登记请求

| 域号   | 域名                       | 必填 | 说明            |
|------|--------------------------|----|---------------|
|      | 标准消息头                    | Y  | MsgType=UF201 |
| 11   | ClOrdID                  | Y  | 参与者申报单编号      |
| 9007 | ContactInfo              | Y  | 联系方式及备注信息     |
| 9017 | SecurityAccount          | Y  | 二级产品账户        |
| 9027 | AccountType              | Y  | 账户类别代码        |
| 9028 | IndividualOrInstitution  | Y  | 开户主体类别代码      |
| 9029 | InvestorName             | Y  | 投资者姓名         |
| 9030 | CertificateTypeCode      | Y  | 证件类型代码        |
| 9031 | CertificateNo            | Y  | 证件号码          |
| 9034 | AccountStatus            | Y  | 二级账户状态代码      |
| 9236 | CustomerRiskRatingResult | Y  | 客户风险等级测评结果代码  |
|      | 标准消息尾                    | Y  |               |

#### 7.4.2 账户登记应答 (MsgType=UF202)

场外交易系统在接收到参与者发送的账户登记请求消息之后，向参与者回复账户登记应答消息，并反馈账户信息的登记执行情况。

账户登记应答的格式如表10所示。

表10 账户登记应答

| 域号   | 域名                     | 必填 | 说明                             |
|------|------------------------|----|--------------------------------|
|      | 标准消息头                  | Y  | MsgType=UF202                  |
| 11   | ClOrdID                | Y  | 参与者申报单编号                       |
| 150  | ExecType               | Y  | 执行类型代码<br>(Y=数据处理成功, N=数据处理失败) |
| 60   | TransactTime           | Y  | 执行时间                           |
| 9017 | SecurityAccount        | Y  | 二级产品账户                         |
| 58   | Text                   | Y  | 摘要说明                           |
| 567  | TradSesStatusRejReason | Y  | 消息错误码                          |
|      | 标准消息尾                  | Y  |                                |

## 8 辅助处理

### 8.1 缺口重发

#### 8.1.1 缺口重发请求 (MsgType=UF007)

当发生通信中断、系统故障等突发事件时，参与者可能无法连续接收到场外交易系统对某条或某批申报请求的应答确认，或者是在此期间因成交状态变化而推送的执行报告。在突发事件结束后，参与者可以通过向场外交易系统发送缺口重发请求（Response Gap Resend Request），重新获取应答确认或者执行报告等信息。

缺口重发请求的格式如表11所示。

表11 缺口重发请求

| 域号   | 域名             | 必填 | 说明                              |
|------|----------------|----|---------------------------------|
|      | 标准消息头          | Y  | MsgType=UF007                   |
| 11   | ClOrdID        | N  | 参与者申报单编号<br>(查询申报请求的当前处理状态时，必填) |
| 8067 | GapMessageType | Y  | 原始的请求消息(MsgType)类型              |
| 8068 | GapStartNum    | N  | 缺口开始编号<br>(对应执行报告中的成交记录号)       |
| 8069 | GapEndNum      | N  | 缺口结束编号<br>(对应执行报告中的成交记录号)       |
|      | 标准消息尾          | Y  |                                 |

对于柜台交易系统发起的业务请求，申请缺口重发时，缺口开始编号和缺口结束编号填写数字0；对于场外交易系统推送的执行报告，申请缺口重发时，缺口开始编号和缺口结束编号填写对应的成交记录号。

示例：

a) 参与者之前发送过订单申报请求，现需要核实订单状态。缺口重发请求的报文如下：

```
{...}11=100<SOH>8067=D<SOH>8068=<SOH>8069=<SOH>{...}
```

b) 参与者之前发送过账户登记请求，需要核实登记执行状态。缺口重发请求的报文如下：

```
{...}11=101<SOH>8067=UF201<SOH>8068=<SOH>8069=<SOH>{...}
```

c) 参与者重新请求成交记录号为5到8的执行报告。缺口重发请求的报文如下：

```
{...}11=102<SOH>8067=8<SOH>8068=5<SOH>8069=8<SOH>{...}
```

### 8.1.2 缺口重发应答

场外交易系统回复缺口重发请求时，不生成新的消息记录，直接重新发送原来的应答确认或对应的执行报告消息。

重发相关消息时，消息头中的“可能重复标志(PossDupFlag)”和“可能重发标志(PossResend)”均填写为“Y”。

### 8.2 未知消息拒绝应答(MsgType=UF008)

场外交易系统在接收到未知类型的消息(比如类型未知,未填写等)后,向相应的参与者回复未知消息拒绝应答(MsgType=UF008)。

未知消息拒绝应答的格式如表12所示。

表12 未知消息拒绝应答

| 域号  | 域名                     | 必填 | 说明            |
|-----|------------------------|----|---------------|
|     | 标准消息头                  | Y  | MsgType=UF008 |
| 58  | Text                   | Y  | 摘要说明          |
| 567 | TradSesStatusRejReason | Y  | 消息错误码         |
|     | 标准消息尾                  | Y  |               |

## 9 数据字典

本文件中各个域的如表13所示。

表13 数据域

| 域号 | 域名          | 域中文名                | 数据类型     | 说明  |
|----|-------------|---------------------|----------|---|
| 6  | AvgPx       | 成交平均价               | Price    | 订单所有成交的平均成交价  |
| 8  | BeginString | 起始串                 | C12      | 起始串, 指示协议版本, 不可加密, 消息中的第一个域, 取值: SACSTEP1.00。   |
| 9  | BodyLength  | 消息体长度               | Length   | 消息体长度, 不可加密, 消息的第二个域。   |
| 10 | Checksum    | 校验和                 | C5       | 校验和, 不可加密, 消息最后一个域。   |
| 11 | ClOrdID     | 参与者申报单编号(交易客户方订单编号) | C24      | 由交易客户方(券商)赋予的订单编号, 对相应券商(SenderCompID)在订单交易时期内应保证唯一。对跨日订单, 可以在该域内嵌入交易日期, 参与者内部编号, 相当于上海Reff, 深圳的WHTXH。<br>其中, 前3位是参与者机构码, 其余代码可由参与者自定义。 |
| 14 | CumQty      | 累计执行数量              | Qty      | 订单所有成交的成交总股数  |
| 15 | Currency    | 币种代码                | Currency | 价格的货币单位, 可以缺省, 但最好给出。   |
| 17 | ExecID      | 成交记录号(执行编号)         | SeqNum   | 场外交易系统分配的、连续的成交记录号, 用于标识与“成交或部分成交”相关的执行报告消息, 在单个交易日内唯一。<br>在应答订单申报请求时, 取值为0。在与“成交或部分成交”相关的执行报告中, 取值从1开始递增。                              |

表 13 数据域（续）

| 域号 | 域名       | 域中文名   | 数据类型 | 说明   |
|----|----------|--------|------|--|
| 18 | ExecInst | 执行指令代码 | C4   | <b>订单处理指令：</b><br>1057 定价买入<br>1058 定价卖出<br>1001 买入（暂不适用）<br>1002 卖出（暂不适用）<br>1055 意向买入<br>1056 意向卖出<br>1059 确定买入<br>1060 确定卖出<br>020 认购申请<br>022 申购申请<br>024 赎回申请<br>036 份额转换申请<br><b>衍生品业务：</b><br>1061 买开<br>1062 卖开<br>1063 买平<br>1064 卖平<br>1065 确认买开<br>1066 确认卖开<br>1067 确认买平<br>1068 确认卖平<br><b>质押回购业务：</b><br>1069 质押交易申请<br>1070 质押交易确认<br>1071 质押意向申请<br>1072 到期回购<br>1073 提前终止申请<br>1074 提前终止确认<br>1075 提前终止拒绝<br><b>实时资金业务：</b><br>2001 委托扣款签约（快捷支付签约）<br>2002 委托扣款签约（网银页面签约）<br>2003 验证码校验 |

表 13 数据域（续）

| 域号 | 域名        | 域中文名      | 数据类型   | 说明  |
|----|-----------|-----------|--------|---|
|    |           |           |        | 2004 资金转入（委托代扣）<br>2005 资金转入（网银支付）<br>2006 资金转出<br>2007 委托扣款解约<br><b>其他业务 099</b>   |
| 34 | MsgSeqNum | 消息序号      | SeqNum | 消息序号  |
| 35 | MsgType   | 自定义消息类型代码 | C5     | 取值范围：<br>0 =心跳（Heartbeat）<br>1 =测试请求（Test Request）<br>8 =执行报告（Execution Report）<br>D =订单申报请求（Order - Single）<br>F =撤单申报请求（Order Cancel Request）<br>UF007 =缺口重发请求<br>UF008 =未知消息拒绝应答<br>UF021 =行情报送请求<br>UF022 =行情报送应答<br>UF023 =申报明细报送请求<br>UF024 =申报明细报送应答<br>UF025 =成交明细报送请求<br>UF026 =成交明细报送应答<br>UF101 =产品状态请求<br>UF102 =产品状态应答<br>UF201 =账户登记请求<br>UF202 =账户登记应答 |
| 37 | OrderID   | 交易系统申报单编号 | C24    | 场外交易系统为每笔申报单统一分配的编号，在有效申报日期内唯一。   |
| 38 | OrderQty  | 订单数量      | Qty    | 申报数量，意向申报可以不填。  |

表 13 数据域（续）

| 域号 | 域名           | 域中文名                             | 数据类型         | 说明   |
|----|--------------|----------------------------------|--------------|--|
| 39 | OrdStatus    | 订单状态代码                           | char         | 订单当前状态，取值：<br>0 =新 (New)<br>1 =部分成交 (Partially filled)<br>2 =已成交 (Filled)<br>3 =部分撤销 (Done for day)<br>4 =全部撤销 (Canceled)<br>6 =待撤销 (Pending Cancel)<br>7 =已终止 (Stopped)<br>8 =已拒绝 (Rejected)<br>9 =已延缓 (Suspended)<br>A =待处理 (Pending New)<br>B =已计算 (Calculated)<br>C =已过期 (Expired)<br>D =已接受 (Accepted for bidding)<br>E =待替换 (Pending Replace)<br>Z =非交易订单已接收 (Non-trading order has been received) |
| 41 | OrigClOrdID  | 原始的参与者<br>申报单编号<br>(原始交易客户方订单编号) | C24          | 之前相关订单的 ClOrdID，用于撤单或修改单。  |
| 43 | PossDupFlag  | 可能重复标志                           | Boolean      | 指示该消息序号的消息可能重复发送，取值：<br>Y: 可能重发<br>N: 首次发送   |
| 44 | Price        | 价格                               | Price        | 申报价格 (单位: 元)。<br>意向申报可以不填，精确到小数点后 6 位。   |
| 48 | SecurityID   | 产品代码                             | C12          | 产品代码   |
| 49 | SenderCompID | 发送方代码                            | C6           | 填写场外交易系统为参与者分配的机构结算编码  |
| 50 | SenderSubID  | 发送方子标识符                          | C12          | 填写参与者用于经纪业务的一级产品账户   |
| 52 | SendingTime  | 发送时间                             | UTCTimestamp | 消息发送时间 YYYYMMDD HH:MM:SS   |

表 13 数据域（续）

| 域号  | 域名               | 域中文名      | 数据类型         | 说明  |
|-----|------------------|-----------|--------------|---|
| 54  | Side             | 买卖方向代码    | char         | 订单买卖方向，取值：<br>1 =买入（Buy）<br>2 =卖出（Sell）<br>3 =做市商 |
| 55  | Symbol           | 产品名称      | C12          | 产品名称  |
| 56  | TargetCompID     | 接收方代码     | C6           | 填写场外交易系统的标识代码，报价系统为“899”。                         |
| 57  | TargetSubID      | 接收方子标识符   | C6           | 接收方子 ID   |
| 58  | Text             | 文本        | C100         | 摘要说明  |
| 59  | TimeInForce      | 长效订单标识    | char         | 订单有效时间，取值：<br>0 =当日有效（默认），保持至当日闭市<br>1 =长效订单      |
| 60  | TransactTime     | 事务时间      | UTCTimestamp | 订单或执行的创建时间<br>YYYYMMDD HH:MM:SS                   |
| 89  | Signature        | 数字签名      | data         | 数字签名  |
| 90  | SecureDataLen    | 密文数据长度    | Length       | 密文数据长度  |
| 91  | SecureData       | 密文数据      | data         | 密文数据（紧跟密文数据长度域）                                   |
| 93  | SignatureLength  | 数字签名长度    | Length       | 数字签名域的字节数   |
| 97  | PossResend       | 可能重发标志    | Boolean      | 指示该消息可能发送过（使用不同的消息序号），取值：<br>Y: 可能重发<br>N: 首次发送   |
| 109 | ClientID         | 资金账户      | C14          | 合格投资者资金账户，经营机构自定义。                                |
| 115 | OnBehalfOfCompID | 最初发送方标识符  | C5           | 用于经第三方发送消息，指明原始发送方公司代码，SenderCompID 域指明第三方公司代码。   |
| 116 | OnBehalfOfSubID  | 最初发送方子标识符 | C5           | 用于经第三方发送消息，指明原始发送方交易员代码。                          |
| 122 | OrigSendingTime  | 原始发送时间    | UTCTimestamp | 收到重发请求后，将订单重发时，记录的原始消息发送时间。                       |
| 126 | ExpireTime       | 有效日期      | UTCDate      | TimeInForce=1 时有效，用户订单有效日期。                       |



表 13 数据域（续）

| 域号  | 域名                   | 域中文名       | 数据类型       | 说明  |
|-----|----------------------|------------|------------|---|
| 128 | DeliverToCompID      | 最终接收方标识符   | C5         | 用于经第三方发送消息，指明最终接收方公司代码，TargetCompID 域指明第三方公司代码。   |
| 129 | DeliverToSubID       | 最终接收方子标识符  | C5         | 用于经第三方发送消息，指明最终接收方人员代码。   |
| 136 | NoMiscFees           | 杂项费用类别数    | NumInGroup | 杂项费用重复组重复次数   |
| 137 | MiscFeeAmt           | 杂项费用金额     | Amt        | 杂项费用金额  |
| 139 | MiscFeeType          | 杂项费用类别代码   | int        | 指明杂项费用的费用类型，取值范围：<br>4 =经手费（Exchange Fees）<br>5 =印花税（Stamp）<br>6 =征管费（Levy）<br>7 =其它（Other）<br>13 =过户费（TransferFee）<br>14 =结算费（Settlement）<br>15 =手续费（Charge）   |
| 140 | PreClosePx           | 昨日收盘价格     | Price      | 昨日收盘价格  |
| 142 | SenderLocationID     | 发送方方位标识符   | C5         | 消息发起方人员所在地点   |
| 143 | TargetLocationID     | 接收方方位标识符   | C5         | 消息接收方人员所在地点   |
| 144 | OnBehalfOfLocationID | 最初发送方方位标识符 | C5         | 用于经第三方发送消息，指明消息原始发起方人员所在地点。   |
| 145 | DeliverToLocationID  | 最终接收方方位标识符 | C5         | 用于经第三方发送消息，指明消息最终接收方人员所在地点。   |
| 150 | ExecType             | 执行类型代码     | char       | 执行报告的类型，与 OrdStatus 配合使用，取值：<br>0 =新（New）<br>6 =委托申报成功，待处理（Pending New）<br>7 =订单错误拒绝（Rejected）<br>8 =委托申报拒绝（Rejected）<br>9 =撤单拒绝（Rejected）<br>A =撤单成功<br>F =成交或部分成交（Trade（partial fill or fill））<br>应答类：<br>Y =数据处理成功 |

表 13 数据域（续）

| 域号  | 域名                    | 域中文名      | 数据类型        | 说明  |
|-----|-----------------------|-----------|-------------|---|
|     |                       |           |             | N =数据处理失败   |
| 151 | LeavesQty             | 剩余数量      | Qty         | 订单仍开放（可以撮合）部分的股数，精确到小数点后2位。   |
| 268 | NoMDEntries           | 行情条目个数    | NumInGroup  | 行情条目个数  |
| 269 | MDEntryType           | 行情条目类别代码  | char        | 行情条目类别<br>0 =买 (Bid)<br>1 =卖 (Offer)<br>2 =最新价 (Trade)<br>3 =指数(Index Value)<br>4 =今开盘价(Opening Price)<br>5 =今收盘价(Closing Price )<br>6 =结算价 (Settlement Price)<br>7 =最高价(Trading Session High Price)<br>8 =最低价(Trading Session Low Price) |
| 270 | MDEntryPx             | 行情条目价格    | Price       | 行情条目中的价格  |
| 271 | MDEntrySize           | 行情条目数量    | Qty         | 行情条目中的数量  |
| 272 | MDEntryDate           | 行情条目日期    | UTCDate     | 行情条目中的日期  |
| 273 | MDEntryTime           | 行情条目时间    | UTCTimeOnly | 行情条目中的时间  |
| 275 | MDMkt                 | 行情条目市场代码  | Exchange    | 行情条目中的市场（交易所），ISO10383 标准，其中：<br>XSHG=上海证券交易所<br>XSHE=深圳证券交易所   |
| 290 | MDEntryPositionNo     | 行情条目买卖盘序号 | int         | 行情条目买卖盘序号<br>MDEntryType 为 0/1 时有效  |
| 324 | SecurityStatusReqID   | 产品信息请求编号  | C24         | 产品信息请求的唯一编号   |
| 326 | SecurityTradingStatus | 交易状态代码    | int         | 交易状态<br>2 =停牌 (Trading Halt)<br>3 =恢复 (Resume)<br>101 =首日上市<br>102 =增发新股<br>103 =正常状态   |

表 13 数据域（续）

| 域号  | 域名                     | 域中文名     | 数据类型             | 说明  |
|-----|------------------------|----------|------------------|---|
|     |                        |          |                  | 104 = 上网定价发行<br>105 = 上网竞价发行<br>106 = 国债挂牌分销  |
| 341 | TradSesStartTime       | 交易盘开始时间  | UTCTimes<br>tamp | 交易盘开始时间   |
| 342 | TradSesOpenTime        | 交易盘开盘时间  | UTCTimes<br>tamp | 交易盘开盘时间   |
| 343 | TradSesPreCloseTime    | 交易盘预关闭时间 | UTCTimes<br>tamp | 交易盘预关闭时间  |
| 344 | TradSesCloseTime       | 交易盘关闭时间  | UTCTimes<br>tamp | 交易盘关闭时间   |
| 347 | MessageEncoding        | 消息编码类型代码 | C20              | 消息中编码域的字符编码类型（非 ASCII 码）<br>取值范围：<br>ISO-2022-JP(for using JIS)<br>EUC-JP(for using EUC)<br>Shift_JIS (for using SJIS)<br>UTF-8(Unicode 字符编码, for using Unicode)<br>GBK (GBK 汉字编码标准, 中国大陆、新加坡使用)<br>BIG5 (BIG5 汉字编码标准, 港澳台使用) |
| 369 | LastMsgSeqNumProcessed | 最近处理消息序号 | SeqNum           | 最新一次接收并处理的消息序号, 可以在每条消息中都给出, 利于对方了解情况。  |
| 370 | OnBehalfOfSendingTime  | 最初发送时间   | UTCTimes<br>tamp | 已过期取消   |
| 452 | PartyRole              | 参与方角色代码  | int              | 指定参与方角色, 取值:<br>1 = 券商 (Executing Firm)<br>2 = 信用经纪人 (Broker of Credit)   |
| 461 | CFICode                | 产品类别代码   | C4               | <b>资产管理类 (5100)</b><br>5101 集合计划<br>5103 定向计划<br>5104 专项计划<br><b>债务融资工具类 (5200)</b><br>5201 中小企业私募债   |

表 13 数据域（续）

| 域号   | 域名                         | 域中文名        | 数据类型       | 说明   |
|------|----------------------------|-------------|------------|--|
|      |                            |             |            | 5202 次级债<br>5203 非公开发行公司债<br><b>私募股权类（5300）</b><br><b>衍生品类（5400）</b><br>5402 期权<br>5403 互换<br>5406 远期<br>5407 结构化衍生品<br><b>资产支持证券类（5500）</b><br>5501 资产支持证券<br><b>私募基金类（5600）</b><br>5601 私募股权投资基金<br>5602 私募证券投资基金<br><b>收益凭证类（5700）</b><br><b>其他类型（5800）</b> |
| 516  | OrderPercentage            | 订单比例代码      | Percentage | 0 允许分笔转让（默认）<br>1 只允许整笔转让  |
| 567  | TradeStatusRejectionReason | 交易盘状态请求拒绝原因 | int        | 错误码（详见附录 D）：<br>小于 0 错误码，对应错误信息见“58 Text 摘要说明”<br>其他 接受并处理成功   |
| 891  | MiscFeeBasis               | 杂项费用单位代码    | int        | 杂项费用单位，取值范围：<br>0 =绝对值（Absolute）<br>1 =每单位（Per unit）<br>2 =百分比（Percentage）   |
| 1020 | TradeVolume                | 成交数量        | Qty        | 成交数量   |
| 8067 | GapMessageType             | 缺口原请求的消息类型  | C5         | 原始的请求消息（MsgType）类型   |
| 8068 | GapStartNum                | 缺口开始编号      | SeqNum     | 对应执行报告中的成交记录号  |
| 8069 | GapEndNum                  | 缺口结束编号      | SeqNum     | 对应执行报告中的成交记录号  |
| 8503 | NumTrades                  | 成交笔数        | int        | 成交笔数   |
| 8504 | TotalValue                 | 成交金额        | Amt        | 成交金额   |

表 13 数据域（续）

| 域号   | 域名                  | 域中文名             | 数据类型    | 说明   |
|------|---------------------|------------------|---------|--|
|      | Traded              |                  |         |  |
| 9001 | AgreementNo         | 约定订单号            | N8      | 意向成交场景下交易双方约定的订单编号：<br>柜台系统自动分配人工约定时，取值范围为 1 到 9999999<br>人工约定柜台系统自动分配时，取值范围为 10000000 到 99999999。 |
| 9002 | CodeOfTargetProduct | 产品转换等业务指定的目标产品代码 | C12     | 产品转换等业务指定的目标产品代码   |
| 9003 | CustomerType        | 客户类型代码           | char    | 1. 普通投资者<br>2. 做市商   |
| 9004 | DeliveryMode        | 交收方式代码           | char    | 1. 货银对付, 2. 见券付款,<br>4. 见款付券, 8. 纯券过户  |
| 9005 | DeliveryDate        | 交收日期             | UTCDate | 最迟交收日期   |
| 9006 | ContactPerson       | 联系人              | C30     | 联系人  |
| 9007 | ContactInfo         | 联系方式及备注信息        | C30     | 联系方式及备注信息  |
| 9008 | NAV                 | 最新净值             | Price   | 资管产品的最新净值或衍生品的涨跌幅度(行权价/初始价),<br>精确到小数点后 4 位。   |
| 9009 | AccumulativeNAV     | 累计基金单位净值         | Price   | 资管产品的累积净值或衍生品的报价比率, 精确到小数点后 4 位。   |
| 9010 | CurrentInterest     | 应计利息             | Price   | 债券产品的最新利息, 精确到小数点后 5 位。  |
| 9011 | ShareholderQty      | 持有人数量            | int     |  |
| 9012 | UpdateDate          | 发布日期             | UTCDate | 资管产品行情数据的更新日期  |
| 9013 | Duration            | 期限               | int     | 衍生品投资期限  |
| 9014 | MaturityDate        | 到期日期             | UTCDate |  |
| 9016 | BranchCode          | 证券营业部编码          | C6      | 经营机构自定义  |

表 13 数据域（续）

| 域号   | 域名                      | 域中文名     | 数据类型        | 说明  |
|------|-------------------------|----------|-------------|---|
| 9017 | SecurityAccount         | 二级产品账户   | C12         | 编码规则按照附录 A  |
| 9018 | CommissionID            | 申报或撤单标识  | char        | 取值范围：<br>0 申报<br>W 撤单   |
| 9019 | CommissionDate          | 申报日期     | UTCDate     |   |
| 9020 | CommissionTime          | 申报时间     | UTCTimeOnly |   |
| 9021 | CommissionVolume        | 申报数量     | Qty         |   |
| 9022 | CommissionPrice         | 申报价格     | Price       | 精确到小数点后 3 位   |
| 9023 | TradeID                 | 成交配对号    | C20         |   |
| 9024 | TradeDate               | 成交日期     | UTCDate     |   |
| 9025 | TradeTime               | 成交时间     | UTCTimeOnly |   |
| 9026 | CancellationVolume      | 撤单数量     | Qty         |   |
| 9027 | AccountType             | 账户类别代码   | int         | 取值范围：<br>1. 自营账户<br>99. 二级账户  |
| 9028 | IndividualOrInstitution | 开户主体类别代码 | int         | 取值范围：<br>0 机构<br>1 个人<br>2 产品   |
| 9029 | InvestorName            | 投资人户名    | C50         | 投资人户名最长 50 位，25 个汉字。  |
| 9030 | CertificateTypeCode     | 证件类型代码   | char        | 取值范围：<br>个人证件类型代码<br>0-身份证，1-护照，2-军官证，3-士兵证<br>4-港澳居民来往内地通行证，5-户口本<br>6-外国护照，7-其它，8-文职证，9-警官证，A-台胞证<br>机构证件类型代码 |

表 13 数据域（续）

| 域号   | 域名                       | 域中文名             | 数据类型       | 说明  |
|------|--------------------------|------------------|------------|---|
|      |                          |                  |            | 0-组织机构代码证, 1-营业执照, 2-行政机关<br>3-社会团体, 4-军队, 5-武警<br>6-下属机构(具有主管单位批文号), 7-基金会, 8-其它<br>产品证件类型代码<br>0-管理人组织机构代码证 |
| 9031 | CertificateNo            | 证件号码             | C30        | 证件号码最长 30 位   |
| 9032 | TotalAvailableHead       | 总剩余名额            | Qty        | 总剩余名额   |
| 9033 | TotalAvailableVol        | 总剩余份额            | Qty        | 总剩余份额   |
| 9034 | AccountStatus            | 二级账户状态<br>代码     | C1         | 取值范围:<br>0-正常(新增/变更), 1-冻结, 2-挂失, 3-销户  |
| 9046 | NumberOfDaysAnnual       | 计息天数             | int        | 取值范围: 360 或 365   |
| 9047 | RepoRate                 | 回购利率/补偿<br>利率    | Percentage | 精确到小数点后 4 位   |
| 9048 | Discount                 | 折算比例             | Percentage | 精确到小数点后 4 位   |
| 9236 | CustomerRiskRatingResult | 客户风险等级<br>测评结果代码 | C1         | 取值范围:<br>0-保守型, 1-相对保守型, 2-稳健型, 3-相对积极型, 4-积极<br>型  |

附 录 A  
(规范性附录)  
产品账户编码规则

场外交易系统的产品账户编码为12位。由阿拉伯数字及英文字母组成，英文字母不区分大小写。具体编码格式如下：

**格式1** 机构结算码（3位）+内部账户编码（9位），适用于证券、基金、期货、银行等金融机构。

**格式2** 机构结算码（5位）+内部账户编码（7位），适用于非金融机构。

其中，机构结算码由场外交易系统统一分配。内部账户编码由参与人自主编制。



附 录 B  
(资料性附录)  
计算校验和

以下为计算校验和的代码段:

```
char *GenerateChecksum( char *buf, long bufLen )
{
    static char tmpBuf[ 4 ];
    long idx;
    unsigned int cks;
    for( idx = 0L, cks = 0; idx < bufLen; cks += (unsigned int)buf[ idx++ ] );
        sprintf( tmpBuf, "%03d", (unsigned int)( cks % 256 ) );
    return( tmpBuf );
}
```

附 录 C  
(规范性附录)  
二级产品账户导入文件数据格式

柜台系统通过 dbf 文件向场外交易系统报送二级产品账户数据时，需要遵循以下格式：

- 文件命名规范：Account+“\_”+创建人代码+“\_”+接收人代码+“\_”+日期（YYYYMMDD）+“.dbf”。其中，创建人代码填写柜台系统的标识代码。接收人代码填写场外交易系统的标识代码（例：报价系统的标识代码为899）
- 数据内容：当日所有新增、注销或发生变动的二级产品账户资料
- 发送时间：日终清算前
- 发送周期：每交易日一次
- 数据格式：标准 dbf 格式。具体字段内容如表C.1所示。

表 C.1 二级产品账户导入文件数据格式

| 序号 | 字段名  | 字段描述         | 数据类型 | 必填 | 备注   |
|----|------|--------------|------|----|--|
| 1  | ZQZH | 产品账户编码       | C12  | Y  | 填写二级产品账户编码<br>该字段在数据文件中取值唯一  |
| 2  | JGBM | 柜台结算编码       | C5   | Y  | 填写场外交易系统为柜台系统分配的结算编码   |
| 3  | ZHMC | 账户名称         | C50  | Y  |  |
| 4  | JGBZ | 开户主体类别<br>代码 | C1   | Y  | 取值范围：0-机构，1-个人，2-产品  |
| 5  | ZJLB | 证件类型代码       | C1   | Y  | 取值范围：<br>个人证件类型<br>0-身份证，1-护照，2-军官证，3-士兵证，4-港澳居民来往内地通行证，5-户口本，6-外国护照，7-其它，8-文职证，9-警官证，A-台胞证<br>机构证件类型<br>0-组织机构代码证，1-营业执照，2-行政机关，3-社会团体，4-军队，5-武警，6-下属机构（具有主管单位批文号），7-基金会，8-其它<br>产品证件类型<br>0-管理人组织机构代码证 |
| 6  | ZJBH | 证件号码         | C30  | Y  |  |
| 7  | ZHZT | 账户状态代码       | C1   | Y  | 取值范围：<br>0-正常（新增/变更），1-冻结，2-挂失，3-销户  |

表 C.1 二级产品账户导入文件数据格式（续）

| 序号 | 字段名            | 字段描述             | 数据类型 | 必填 | 备注   |
|----|----------------|------------------|------|----|--|
| 8  | LXFS           | 联系方式             | C30  | Y  | 联系方式及备注信息                                      |
| 9  | KHFXDJC<br>PJC | 客户风险等级<br>测评结果代码 | C1   | Y  | 取值范围：<br>0-保守型, 1-相对保守型, 2-稳健型, 3-相对积极型, 4-积极型 |

附 录 D  
(规范性附录)  
消息错误码

本标准所涉及的消息错误码如表D.1所示。

表 D.1 消息错误码

| 错误码      | 错误信息                 | 错误码      | 错误信息                    |
|----------|----------------------|----------|-------------------------|
| -1001    | 报文错误检验失败             | -6586011 | 产品账户不存在                 |
| -1005    | 二级账户不符合规则            | -6586030 | 非交易日禁止交易                |
| -1006    | 申报委托号不符合规则           | -6586053 | 产品临时停牌                  |
| -1007    | 无效的申请单编号(缺口重发)       | -6586054 | 产品停牌                    |
| -902000  | 暂不支持该类产品申报           | -6586055 | 产品禁止交易                  |
| -6591001 | 交易单元不存在              | -6586066 | 数量非法                    |
| -6591002 | 查询交易单元参数失败:(输入参数有误)  | -6586067 | 价格非法                    |
| -6591003 | 交易单元状态异常             | -6582081 | 订单有效日期过长                |
| -6591004 | 投资者身份检查失败:(输入参数有误)   | -6582082 | 订单有效日期已失效               |
| -6591005 | 该产品账户为做市商账户,禁止进行协议报价 | -6586088 | 股东数量超过                  |
| -6591006 | 查询内部控制参数失败:(输入参数有误)  | -6586111 | 该产品尚未开放认购               |
| -6591008 | 查询产品账户失败:(输入参数有误)    | -6586112 | 该产品已结束认购                |
| -6591009 | 该产品账户状态异常            | -6586113 | 该产品不处于认购状态              |
| -6591011 | 无效申报类别:(业务类别代码)      | -6586122 | 个人首次认购金额不得低于:(个人首次认购下限) |
| -6591012 | 申报类别检查失败:(输入参数有误)    | -6586123 | 个人追加认购金额不得低于:(个人追加认购下限) |
| -6591013 | 产品转换申请未送入目标产品代码      | -6586124 | 个人单笔认购不得高于:(个人单笔认购上限)   |
| -6591014 | 目标产品代码不存在            | -6586142 | 机构首次认购金额不得低于:(机构首次认购下限) |
| -6591015 | 查询目标产品信息失败:(输入参数有误)  | -6586143 | 机构追加认购金额不得低于:(机构追加认购下限) |
| -6591017 | 查询产品信息失败:(输入参数有误)    | -6586144 | 机构单笔认购不得高于:(机构认购上限)     |
| -6591018 | 该产品不支持:(业务类别代码) 订单   | -6586201 | 该产品暂时禁止申购               |
| -6591019 | 订单检查失败:(输入参数有误)      | -6586202 | 该产品尚未开始申购               |
| -6591021 | 申报委托号重复              | -6586203 | 该产品已结束申购                |
| -6591022 | 重复申报要素不符             | -6586204 | 个人首次申购金额不得低于:(个人首次申购下限) |
| -6591023 | 申报信息检查失败:(输入参数有误)    | -6586205 | 个人追加申购金额不得低于:(个人追加申购下限) |

表 D.1 消息错误码 (续)

| 错误码      | 错误信息                 | 错误码      | 错误信息                      |
|----------|----------------------|----------|---------------------------|
| -6591041 | 产品余额检查失败:(输入参数有误)    | -6586206 | 个人单笔申购不得高于:(个人单笔申购上限)     |
| -6591043 | 产品余额数据不存在            | -6586222 | 机构首次申购金额不得低于:(机构首次申购下限)   |
| -6591044 | 查询产品余额失败:(输入参数有误)    | -6586223 | 机构追加申购金额不得低于:(机构追加申购下限)   |
| -6591045 | 账户余额不足               | -6586224 | 机构单笔申购不得高于:(机构单笔申购上限)     |
| -6591046 | 账户剩余余额不可低于           | -6586301 | 该产品尚未开放赎回                 |
| -6591081 | 非交易时间                | -6586303 | 该产品已结束赎回                  |
| -6591082 | 交易时间检查失败:(输入参数有误)    | -6586304 | 个人赎回份额不得低于:(个人赎回份额下限)     |
| -6591083 | 日切阶段仅支持意向申报和定价申报     | -6586305 | 机构赎回份额不得低于:(机构赎回份额下限)     |
| -6591084 | 日期无效                 | -6584001 | 产品代码不存在(收益凭证类)            |
| -6591085 | 不支持的结算方式             | -6585033 | 数量不符合要求最小申报单位(收益凭证)       |
| -6591111 | 查询可用头寸失败:(输入参数有误)    | -6584026 | 该产品首次认购金额不得低于(收益凭证类)      |
| -6591112 | 调整头寸余额失败:(输入参数有误)    | -6584029 | 该产品追加认购金额不得低于最小申报单位(收益凭证) |
| -6591113 | 头寸余额不足,差             | -6584027 | 该产品认购金额不得高于(收益凭证)         |
| -6591141 | 记录申报信息失败:            | -6583001 | 产品代码不存在                   |
| -6591151 | 确认申报未输入约定号           | -6583002 | 查询产品信息失败                  |
| -6591152 | 约定号超出系统约定范围          | -6583003 | 该产品不是资管类产品                |
| -6591153 | 点选成交指定对手方订单不存在       | -6583004 | 产品处于认购期,不接受其他类型交易         |
| -6591154 | 点选成交查询对手方失败:(输入参数有误) | -6581011 | 账户不存在                     |
| -6591155 | 对手方订单未正常申报           | -6581012 | 查询账户信息失败                  |
| -6591156 | 对手方订单已全部成交           | -6583013 | 该产品禁止个人买入                 |
| -6591157 | 对手方订单已撤单             | -6583014 | 该产品禁止机构买入                 |
| -6591158 | 对手方订单不存在             | -6583017 | 非交易日禁止交易                  |
| -6591159 | 申报数量超过对方未成交数量        | -6583021 | 产品代码不存在                   |
| -6591160 | 交收方式不一致              | -6583022 | 查询产品信息失败                  |
| -6591161 | 交收日期不一致              | -6583023 | 代码临时停牌                    |
| -6591171 | 约定号合法性检查失败:(输入参数有误)  | -6583024 | 代码停牌                      |
| -6591172 | 约定号:已经被占用,请重输        | -6583025 | 代码禁止交易                    |
| -6591181 | 自买自卖检查失败:(输入参数有误)    | -6583051 | 数量非法                      |
| -6591182 | 买入价应低于已经申报的卖出价       | -6583052 | 价格非法                      |
| -6591184 | 卖出价应高于已经申报的买入价       | -6583054 | 交易基数非法                    |
| -6592052 | 对手方不是待配对状态           | -6583055 | 超过委托数量限制范围                |
| -6592053 | 对手方申报已全部成交           | -6583058 | 未到转让日期                    |
| -6592054 | 对手方没有可配对数量           | -6583059 | 价格不符合最小报价单位               |
| -6592055 | 价格不一致                | -6583060 | 订单有效日期过长                  |
| -6592056 | 交收方式不一致              | -6583061 | 订单有效日期已失效                 |

表 D.1 消息错误码 (续)

| 错误码      | 错误信息                     | 错误码      | 错误信息            |
|----------|--------------------------|----------|-----------------|
| -6592057 | 最迟交收日期不一致                | -6583101 | 非转让业务, 不支持长效订单  |
| -6592058 | 做市时段投资者之间、做市商之间禁止交易      | -6583102 | 查询产品余额失败        |
| -6592081 | 整笔成交, 双方数量不一致            | -6585001 | 产品代码不存在         |
| -6592082 | 对手方数量不足                  | -6585002 | 查询产品信息失败        |
| -6590001 | 申报记录不存在                  | -6585003 | 该产品不是债券类产品      |
| -6590002 | 查询申报记录失败: 输入参数有误         | -6585004 | 申报业务代码非法        |
| -6590003 | 申报账户不符                   | -6585007 | 债券类产品数量应是整数     |
| -6590004 | 申报产品代码不符                 | -6585010 | 非交易日禁止交易        |
| -6590005 | 申报方向不符                   | -6585016 | 数量非法            |
| -6590006 | 申报状态已发生变化, 无法撤单          | -6585017 | 价格非法            |
| -6590007 | 已全部成交, 撤单失败              | -6585018 | 该产品尚未开放回售       |
| -6590008 | 重复撤单                     | -6585019 | 价格不等于管理人定的回售价格  |
| -6590009 | 无可撤单数量, 撤单失败             | -6585013 | 该产品已经提前结束簿记     |
| -6590010 | 做市商做市报价撤单请使用做市商专用入口      | -6585031 | 申报数量不满足单笔申报数量限制 |
| -6590011 | 委托申报用户与撤单用户不符            | -6585032 | 定价发行申报价格不等于     |
| -6590021 | 无效申报类别: (申报业务代码)         | -6585033 | 不符合该产品申报基数      |
| -6590023 | 该产品不支持(申报类别名称)订单         | -6585035 | 产品不在发行期         |
| -6590025 | 该产品[(业务类别名称)]业务禁止撤单      | -6584060 | 该产品尚未开始簿记       |
| -6590031 | 申报记录号生成失败: (输入参数有误)      | -6584061 | 该产品已经结束簿记       |
| -6590041 | 重复撤单检查失败: (输入参数有误)       | -6584073 | 大于最高申报利率        |
| -6590042 | 该订单已经申请撤单, 等待复核中, 无需重复撤单 | -6584074 | 小于最低申报利率        |
| -6590043 | 撤单处理失败: (输入参数有误)         | -6582042 | 超过单户累计认购量       |
| -6590044 | 撤单处理过程中, 订单状态发生变化        | -6582043 | 超过最高人数限制        |
| -6586001 | 产品代码不存在(资管类)             | -6582044 | 超过最高本期最高发行金额    |
| -6586004 | 申报业务代码非法                 |          |                 |
| -6586005 | 产品处于认购期, 不接受其他类型交易       |          |                 |