

Q/DFZQ

东方证券股份有限公司企业标准

Q/DFZQ 001—2026

东方证券机构终端交易接入标准

Institutional Terminal Trading Access Standard

2026-03-03 发布

2026-03-03 实施

东方证券股份有限公司 发布

目 次

目次	1
前言	3
引言	4
证券期货统一交易接入接口	5
1 范围	5
2 规范性引用文件	5
3 术语和定义	5
4 接口设计原则	5
5 技术标准	6
6 会话接口	7
7 业务接口	9
8 数据字典	33
附 录 A （规范性） 组合参数定义	47
参 考 文 献	50

前 言

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

本文件由东方证券股份有限公司提出。

本文件由东方证券股份有限公司归口。

本文件起草单位：东方证券股份有限公司。

本文件主要起草人：单兴邦、胡长春、黄赛、李沁、高春蕾、何少锋。

引 言

本文件通过梳理行业常见的证券公司交易系统提供的交易接入协议，并研究主流客户交易终端系统交易接入关注问题，从而建立一套适用于当前公司现状的统一的交易接入接口。

东方证券机构终端交易接入标准

1 范围

本文件规定了东方证券客户交易终端系统接入证券交易系统的接口设计原则、通信标准、应用层消息的接口字段。

本文件适用于公司机构交易接入网关接口设计，提供外围终端系统接入证券期货交易系统。

2 规范性引用文件

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

- GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码
- GB/T 23696—2017 证券及相关金融工具 交易所和市场识别码
- GB/T 18030—2005 信息技术 中文编码字符
- JR/T 0022—2020 证券交易数据交换协议
- JR/T 0177.1—2020 证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第1部分：证券
- JR/T 0274—2023 证券期货业机构内部接口 账户管理

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

资金账户 fund account

投资者用于证券交易资金清算的专用账户。

注：根据用途不同资金账户可分为普通资金账户、信用资金账户、衍生品资金账户等。

[来源：JR/T 0177.1—2020]

3.2

证券账户 stock account

证券登记结算机构为投资者设立的，记录证券及证券衍生品种持有及其变动情况的载体。

注：根据用途不同证券账户可分为A股账户、B股账户、A股信用账户、股转系统账户、基金账户、衍生品合约账户等。

[来源：JR/T 0177.1—2020]

3.3

私有流 private flow

私有流是一个单向数据流，由服务方发向接入方，用于传送投资者私有的通知和回报信息。私有流主要包括报单回报、成交回报等。

4 接口设计原则

4.1 易用性

接口协议的技术结构易实现，接入方式简单、符合外围终端系统接入习惯。为追求报盘极致速度，部分客户沪市深市证券账户分别在上海和深圳极速交易系统节点，接口设计需适用于该类客户交易、资金、持仓、委托流水、成交流水在不同交易系统节点的情况。

4.2 适用性

接口协议能够适应市场业务的数据交换，并适配主流证券交易系统已提供的外围接口协议。例如，主流证券系统提供执行报告回报推送，满足外围系统快速获取交易执行状态的需求，减少外围系统查询需求，降低证券交易系统查询压力。

4.3 效率性

接口协议的通讯效率需满足市场交易的需求，尤其是在提供机构终端接入交易时，要考虑对交易性能的影响，防止投资交易得不到迅速执行。

4.4 扩展性

易于满足各类业务需求的扩展，当有新的市场业务推出时，接口协议只需要通过少量简单的协议修改，就可以满足新业务活动的需求，而不会影响存量业务。

5 技术标准

技术标准主要对应开放式系统互联模型 (OSI) 七层模型中会话层、表示层、传输层部分。

考虑到实际应用场景，标准研究过程中传输层仅选择 TCP 协议，针对互联网接入，可使用 SSL 协议进行通讯加密。

为简化描述文中后续使用统一交易接入标准接入证券交易系统的客户端系统称为接入方，提供统一交易接入标准接入的服务端称为服务方。

5.1 会话管理

接入方在 TCP 连接建立后发起登录请求，服务方校验登录请求，通过后建立会话。

接入方主动发起登出请求时，服务方并断开 TCP 连接并注销会话。如果 TCP 连接异常断开，则服务方将主动断开 TCP 连接并注销会话。

建立会话通过接入方定期心跳消息维持。接入方和服务方在一定时间内未收到对方的心跳消息，则主动断开 TCP 连接并注销会话。

通过 TCP 连接状态和会话生命周期关联，可极大简化会话管理。

5.2 消息编码

在 TCP 报文段的数据部分，包括自定义协议结构的消息头、消息体、CRC 校验值三部分。消息头部分包括协议版本、消息类型、消息编号、标志位、编码类型、报文长度。其中标志位为提供消息利用效率，按照自低往高，不同位置代表不同标志，支持压缩、最后一个报文标志等。压缩算法采用 deflate 压缩算法。同一消息编号的消息，可能由多个报文组成，最后一个报文标志为是，代表该报文为该消息的最后一个报文。

消息头格式内容见表 1。

表 1 消息头格式

序号	名称	字节长度	类型	说明
1	协议版本号	2	Uint16	委托方式
2	消息类型	2	Uint16	
3	消息编号	4	Uint32	消息编号，消息唯一编号
4	标志	1	Uint8	自低位起：第 1 位为压缩标志，0：否 1：是；第 2 位为是否是最后一个报文，0：否 1：是
5	编码格式	1	Uint8	消息编码类型 1=GPB 2=JSON 3=TagValue（ISO 3531-1） 4=ASN...
6	报文长度	4	Uint32	报文长度
注1：为支持多种不同编程语言的接入方系统，以及提高编码效率，默认采用GPB方式编码。				

5.3 通讯模式和数据流

同一会话下，支持两种不同通讯模式：

- a) 对话通讯模式；
- b) 私有通讯模式；

1) 对话通讯模式下支持对话数据流和查询数据流；

对话通讯模式是指由接入方主动发起的通讯请求。该请求被服务方接收和处理，并给予响应。例如报单、查询等。这种通讯模式与普通的客户/服务器模式相同。

对话数据流是一个双向数据流，接入方发送交易请求，服务方反馈应答。交易系统不维护对话流的状态。系统故障时，对话数据流会重置，通讯途中的数据可能会丢失。

查询数据流是一个双向数据流，接入方发送查询请求，服务方反馈应答。交易系统不维护查询流的状态。系统故障时，查询数据流会重置，通讯途中的数据可能会丢失。

在对话通讯模式下，同一会话中的请求消息包含唯一的消息编号，服务方应答消息也返回该唯一的消息编号，接入方根据消息编号匹配应答消息和请求消息。

在会话建立，接入方即可通过对话通讯模式发起业务请求。

2) 私有通讯模式下支持私有数据流。

私有通讯模式是指服务方主动，向某个接入方的特定投资者的发出的信息。例如成交回报等。

私有流是一个单向数据流，由服务方发向接入方，用于传送投资者私有的通知和回报信息。私有流是一个可靠的数据流，服务方维护每个投资者的私有流，在一个交易日内，API 断线后恢复连接时，可以请求服务方续传或重传私有流数据。

在私有通讯模式下，同一会话中的接入方的特定投资者的拥有连续递增的消息编号，接入方根据消息编号确认消息连续性和正确性。

在会话建立后，接入方可以发起投资者私有流订阅，成交回报、委托状态变化等将通过私有通讯模式推送。

6 会话接口

6.1 登录

用户发出登陆请求。

6.1.1 登录请求

表 2 登录请求

标签	字段名称	是否必须	说明
30001	OrderWay	Y	委托方式
23	FundAccount	Y	资金账户
554	Password	Y	密码

6.1.2 登录应答

表 3 登录应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
75	TradeDate	交易日，为 int 类型数据，例如 2021 年 6 月 3 日，则该值为 20210603
30004	LoginTime	登录成功时间，为 int 类型数据，例如 9:02:31:698，则该值为 90231698
23	FundAccount	资金账户
30005	LastLoginDate	上次登录日期，为 int 类型数据，例如 2021 年 6 月 3 日，则该值为 20210603
30006	LastLoginTime	上次登录时间，为 int 类型数据，例如 9:02:31，则该值为 90231
30007	LastLoginIP	上次登录 IP

6.2 登出

用户发出登出请求。

6.2.1 登出请求

表 4 登出请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

6.2.2 登出应答

表 5 登出应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码

30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户

6.3 订阅

订阅私有流, 如报单回报, 成交回报。该函数在登录后调用, 为投资者订阅私有流, 若不调用则不会收到私有流的数据。

6.3.1 订阅请求

表 6 订阅请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
30008	ResumeMode	Y	私有流重传方式

6.3.2 订阅应答

表 7 订阅应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
30008	ResumeMode	私有流重传方式

7 业务接口

7.1 交易类接口

7.1.1 竞价交易

客户端发出报单录入。可以录入限价单、市价单等交易所支持的指令。

支持普通买卖、逆回购、ETF 申赎、两融买卖、期权买卖的报单。

7.1.1.1 竞价交易请求

表 8 竞价交易请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
26	SecurityID	Y	证券代码
583	ClOrdLinkID	Y	报单引用
54	Side	Y	买卖方向
77	PositionEffect	Y	开平标志

30009	HedgeFlag	Y	投机套保标志
40	OrdType	Y	订单类型
38	OrderQty	Y	数量
44	Price	Y	价格，市价单可以填 0
59	TimeInForce	Y	有效期类型
110	MinQty	N	最小成交数量
99	StopPx	N	止损价

7.1.1.2 竞价交易应答

表 9 竞价交易应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
11	ClOrdID	交易客户方（券商）订单编号

7.1.2 通用撤单

客户端发出撤单录入。支持交易相关类的撤单。

7.1.2.1 通用撤单请求

表 10 通用撤单请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
11	ClOrdID	Y	交易客户方（券商）订单编号
583	ClOrdLinkID	Y	报单引用
77	PositionEffect	Y	开平标志
30009	HedgeFlag	Y	投机套保标志
40	OrdType	Y	订单类型
38	OrderQty	N	数量
44	Price	N	价格，市价单可以填 0

7.1.2.2 通用撤单应答

表 11 通用撤单应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
11	ClOrdID	交易客户方（券商）订单编号

7.1.3 普通交易

普通委托：支持配股配债、新股申购、转股回收、担保证券提交与返还、盘后固定价格委托的报单。

7.1.3.1 普通交易请求

表 12 普通交易请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
26	SecurityID	Y	证券代码
44	Price	Y	价格
38	OrderQty	Y	数量
54	Side	Y	买卖方向
30010	EntrustProp	Y	委托属性
10184	Contactoer	N	联系人姓名
10185	ContactInfo	N	联系人电话
14003	ReportSeat	N	对方席位号
664	ConfirmID	N	约定号
30011	OppoTraderId	N	对方交易员
30012	OppoBondFundAccount	N	对方交易主体代码
8531	SettlementType	N	结算方式
30013	TraderId	N	交易员编号
30014	BondFundAccount	N	交易主体代码
8547	GeneralMeetingSeq	N	股东大会编码，网络投票业务必填
30015	OppoStockAccount	N	对方股东账户，股转大宗委托必填
8908	ShareProperty	N	股份性质

7.1.3.2 普通交易应答

表 13 普通交易应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
11	ClOrdID	交易客户方（券商）订单编号

7.1.4 债券现券交易协商确认委托

债券现券交易协商确认委托。

7.1.4.1 债券现券交易协商确认委托请求

表 14 债券现券交易协商确认委托请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
856	TradeReportType	Y	成交申报类型
191	ExecID	Y	交易系统执行编号
30016	MacAddressAsLong	N	Mac 地址

7.1.4.2 债券现券交易协商确认委托应答

表 15 债券现券交易协商确认委托应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
11	ClOrdID	交易客户方（券商）订单编号

7.2 相关查询接口

7.2.1 合约查询

合约查询。

7.2.1.1 合约查询请求

表 16 合约查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
26	SecurityID	N	证券代码

7.2.1.2 合约查询应答

表 17 合约查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
55	Symbol	证券名称
561	RoundLot	交易单位（该证券订单数量的单位量，即最终的订

		单数量=订单数量×交易单位)
30017	PriceTick	最小变动价位
225	IssueDate	上市日期
291	FinancialStatus	证券状态
309	UnderlyingSecurityID	期权时表示证券代码
15	Currency	币种代码，目前仅支持人民币

7.2.2 持仓查询

投资者持仓查询。

7.2.2.1 持仓查询请求

表 18 持仓查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
26	SecurityID	N	证券代码

7.2.2.2 持仓查询应答

表 19 持仓查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
30018	YdPosition	上日持仓
8501	AccountSecPosition	持有数量
30019	AvailablePosition	可用持仓
30020	PositionCost	持仓成本
30021	PositionProfit	持仓盈亏
30022	SettlementPrice	本次结算价
30023	PositionCostPrice	持仓成本价
134	StockAccount	证券账户

7.2.3 资金查询

资金账户查询。

7.2.3.1 资金查询请求

表 20 资金查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
15	Currency	N	币种代码，目前仅支持人民币

7.2.3.2 资金查询应答

表 21 资金查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
15	Currency	币种代码
30024	FrozenCash	冻结的资金，冻结权利金
30025	Available	可用资金

7.2.4 报单查询

报单查询。

7.2.4.1 报单查询请求

表 22 报单查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
26	SecurityID	N	证券代码
30026	SequenceNo	N	起始编号, 不包括 SequenceNo 对应记录, 查询 OST 时若有值则为数字
30027	Limit	N	从 SequenceNo 开始, 查询 Limit 条记录
30028	ReqOrderStatus	N	查询可撤委托该字段传' h' , 为空则查询所有。目前仅支持查询可撤委托
11	ClOrdID	N	交易客户方(券商)订单编号

7.2.4.2 报单查询应答

表 23 报单查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
583	ClOrdLinkID	报单引用，关键字
54	Side	买卖方向
77	PositionEffect	开平标志
30009	HedgeFlag	投机套保标志
40	OrdType	订单类型
38	OrderQty	数量
44	Price	价格
59	TimeInForce	有效期类型
110	MinQty	最小成交数量
11	ClOrdID	交易客户方（券商）订单编号
134	StockAccount	证券账户
75	TradeDate	交易日
37	OrderID	报单编号（交易所）
39	OrdStatus	订单状态
30029	OrderType	订单类别
32	LastQty	今成交数量
151	LeavesQty	剩余数量
8500	OrigTime	订单申报时间
30026	SequenceNo	序号
103	OrdRejReason	订单拒绝码
31	LastPx	成交价格
8504	TotalValueTraded	成交金额
1328	RejectText	撤单/拒绝原因说明

7.2.5 成交查询

成交单查询。

7.2.5.1 成交查询请求

表 24 成交查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
26	SecurityID	N	证券代码

30026	SequenceNo	N	起始编号, 不包括 SequenceNo 对应记录, 查询 OST 时若有值则为数字
30027	Limit	N	从 SequenceNo 开始, 查询 Limit 条记录
11	ClOrdID	N	交易客户方(券商)订单编号

7.2.5.2 成交查询应答

表 25 成交查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
191	ExecID	执行编号
54	Side	买卖方向
37	OrderID	报单编号(交易所)
134	StockAccount	证券账户
77	PositionEffect	开平标志
30009	HedgeFlag	投机套保标志
44	Price	价格
38	OrderQty	数量
8504	TotalValueTraded	金额
75	TradeDate	订单申报日期(仅日期)
60	TransactTime	成交时间, 为 int 类型数据, 例如 9:02:31:698, 则该值为 90231698
856	TradeReportType	成交类型
11	ClOrdID	交易客户方(券商)订单编号
30026	SequenceNo	序号

7.2.6 投资者查询

投资者查询。

7.2.6.1 投资者查询请求

表 26 投资者查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.6.2 投资者查询应答

表 27 投资者查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
553	UserName	投资者名称
30030	IsActive	是否活跃

7.2.7 交易编码查询

交易编码查询。

7.2.7.1 交易编码查询请求

表 28 交易编码查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.7.2 交易编码查询应答

表 29 交易编码查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
134	StockAccount	证券账户
30030	IsActive	是否活跃
30031	BranchID	营业部编号
14003	ReportSeat	席位

7.2.8 最大下单量查询

最大下单量查询。

7.2.8.1 最大下单量查询请求

表 30 最大下单量查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
26	SecurityID	Y	证券代码

30009	HedgeFlag	Y	投机套保标志
54	Side	Y	买卖方向
77	PositionEffect	Y	开平标志
44	Price	N	报单价格
40	OrdType	N	订单类型

7.2.8.2 最大下单量查询应答

表 31 最大下单量查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
30009	HedgeFlag	投机套保标志
54	Side	买卖方向
77	PositionEffect	开平标志
44	Price	报单价格
30032	MaxVolume	最大允许报单数量
30033	MaxVolumeOri	原始最大允许报单数量

7.2.9 信用合约属性查询

信用合约属性查询。

7.2.9.1 信用合约属性查询请求

表 32 信用合约属性查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
26	SecurityID	N	证券代码

7.2.9.2 信用合约属性查询应答

表 33 信用合约属性查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码

30034	ConvertRate	股票折算率
30035	IsCreditFund	是否可融资
30036	IsCreditStock	是否可融券
30037	IsGuarantee	是否担保品
30038	IsLiquid	是否高流通证券
30039	AssetPrice	公允价格
30040	AssetPriceCreditStock	融券公允价格

7.2.10 投资者融资明细查询

投资者融资明细查询。

7.2.10.1 投资者融资明细查询请求

表 34 投资者融资明细查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.10.2 投资者融资明细查询应答

表 35 投资者融资明细查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
75	TradeDate	融资日期，为 int 类型数据，例如 2021 年 6 月 3 日，则该值为 20210603
191	ExecID	执行编号
541	MaturityDate	到期日
30041	Amount	融资金额
30042	AmountPayback	已归还融资金额
38	OrderQty	融资买入数量
30043	VolumePayback	已归还融资数量
30044	Commission	今日手续费(不可还)
30045	CreditInterestProcess	未结利息费用
30046	CreditInterestFinished	已结利息费用
30047	CreditInterestPaid	已还利息费用

7.2.11 投资者融券明细查询

投资者融券明细查询。

7.2.11.1 投资者融券明细查询请求

表 36 投资者融券明细查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.11.2 投资者融券明细查询应答

表 37 投资者融券明细查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
75	TradeDate	融券日期，为 int 类型数据，例如 2021 年 6 月 3 日，则该值为 20210603
191	ExecID	执行编号
541	MaturityDate	到期日
38	OrderQty	融券数量
30043	VolumePayback	已归还融券数量
30041	Amount	融券卖出金额
30042	AmountPayback	已归还融券金额
30045	CreditInterestProcess	未结利息费用
30046	CreditInterestFinished	已结利息费用
30047	CreditInterestPaid	已还利息费用

7.2.12 ETF 信息查询

ETF 信息查询。

7.2.12.1 ETF 信息查询请求

表 38 ETF 信息查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
26	SecurityID	N	证券代码

7.2.12.2 ETF 信息查询应答

表 39 ETF 信息查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
30048	RedemptionID	一级市场申赎代码
30049	CreationRedemptionUnit	每个篮子对应的 ETF 份数, 申赎必须整数倍
30050	MaxCashRatio	最大现金替代比例
30051	PublishIOPV	是否需要发布 IOPV
30052	Creation	是否可申购
30053	Redemption	是否可赎回
30054	RecordNum	成分证券数量
30055	EstimateCashComponent	T 日每个篮子的预估现金差额
30056	NAVperCU	前一日最小申赎单位净值
30057	NAV	前一日基金份额净值

7.2.13 ETF 成分股查询

ETF成分股查询。

7.2.13.1 ETF 成分股查询请求

表 40 ETF 成分股查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
30058	ETFID	N	ETF 代码
602	LegSecurityID	N	成份合约代码

7.2.13.2 ETF 成分股查询应答

表 41 ETF 成分股查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
22	SecurityIDSource	证券代码源
30058	ETFID	ETF 代码
602	LegSecurityID	成份合约代码
603	LegSecurityIDSource	成份合约代码源
38	OrderQty	证券数量
30059	SubstituteFlag	替代标志
30060	CreationPremiumRate	申购溢价比例
30061	CreationCashSubstitute	申购替代金额

7.2.14 保证金可用余额查询

保证金可用余额查询。

7.2.14.1 保证金可用余额查询请求

表 42 保证金可用余额查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.14.2 保证金可用余额查询应答

表 43 保证金可用余额查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
30062	CreditCollateralValue	担保品折算
30063	CreditFundProfit	融资盈亏
30064	CreditStockProfit	融券盈亏

7.2.15 集中柜台委托查询

集中柜台委托查询。

7.2.15.1 集中柜台委托查询请求

表 44 集中柜台委托查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.15.2 集中柜台委托查询应答

表 45 集中柜台委托查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
134	StockAccount	证券账户
26	SecurityID	证券代码
55	Symbol	证券名称
22	SecurityIDSource	证券代码源
54	Side	买卖方向

39	OrdStatus	订单状态
75	TradeDate	订单申报日期（仅日期）
8500	OrigTime	订单申报时间
44	Price	价格
38	OrderQty	数量
32	LastQty	今成交数量
151	LeavesQty	剩余数量
11	ClOrdID	交易客户方（券商）订单编号
37	OrderID	报单编号（交易所）
58	Text	备注
30010	EntrustProp	委托属性
31	LastPx	成交价格

7.2.16 集中柜台成交查询

集中柜台成交查询。

7.2.16.1 集中柜台成交查询请求

表 46 集中柜台成交查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.16.2 集中柜台成交查询应答

表 47 集中柜台成交查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
134	StockAccount	证券账户
26	SecurityID	证券代码
55	Symbol	证券名称
22	SecurityIDSource	证券代码源
54	Side	买卖方向
11	ClOrdID	交易客户方（券商）订单编号
37	OrderID	报单编号（交易所）
191	ExecID	执行编号
31	LastPx	成交价格
32	LastQty	成交数量
8504	TotalValueTraded	成交金额
75	TradeDate	订单申报日期（仅日期）
60	TransactTime	成交时间

30010	EntrustProp	委托属性
-------	-------------	------

7.2.17 配号查询

配号查询。

7.2.17.1 配号查询请求

表 48 配号查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
916	StartDate	Y	开始日期
917	EndDate	Y	结束日期

7.2.17.2 配号查询应答

表 49 配号查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
134	StockAccount	证券账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
55	Symbol	证券名称
30065	BeginIssueNo	起始配号
38	OrderQty	数量
75	TradeDate	配号日期
58	Text	备注

7.2.18 中签查询

中签查询。

7.2.18.1 中签查询请求

表 50 中签查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
916	StartDate	Y	开始日期
917	EndDate	Y	结束日期

7.2.18.2 中签查询应答

表 51 中签查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
75	TradeDate	发生日期
23	FundAccount	资金账户
134	StockAccount	证券账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
55	Symbol	证券名称
38	OrderQty	数量
30066	IPO LuckyNum	中签个数
30067	DeductDate	扣款日期
58	Text	备注
30068	IssuePrice	中签价格
30069	LuckyBalance	中签金额

7.2.19 集中柜台最大可委托数查询

集中柜台最大可委托数查询。

7.2.19.1 集中柜台最大可委托数查询请求

表 52 集中柜台最大可委托数查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
26	SecurityID	Y	证券代码
44	Price	Y	价格
54	Side	Y	买卖方向
30010	EntrustProp	Y	委托属性，担保

7.2.19.2 集中柜台最大可委托数查询应答

表 53 集中柜台最大可委托数查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
30032	MaxVolume	最大允许报单数量
30033	MaxVolumeOri	原始最大允许报单数量

7.2.20 信用资产查询

信用资产查询。

7.2.20.1 信用资产查询请求

表 54 信用资产查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.20.2 信用资产查询应答

表 55 信用资产查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
30070	TotalAssets	总资产
30071	NetAssets	净资产
30072	TotalDebt	总负债
30073	MarketValue	证券市值
30074	CashAssets	现金资产
30025	Available	可用资金
30075	NonLiquidAvailable	非高流通可用资金
30076	WithdrawQuota	可取资金
30077	CreditFundDebt	融资负债
30078	CreditFund	融资金额
30079	CreditFundFrozen	冻结的融资金额
30080	CreditStockDebt	融券负债
30081	CreditStock	融券金额
30082	CreditStockFrozen	冻结的融券金额
30083	CreditStockUsed	已用的融券金额
30084	CreditStockAvailable	可用的融券金额
30045	CreditInterestProcess	未结利息费用
30085	CreditInterestUnpay	已结未还利息费用
30086	TotalLimit	融资融券总额度
30087	TotalAvailableQuota	融资融券可用总额度
30088	StockLimit	融券限额
30089	StockAvailableQuota	融券可用额度
30090	FundLimit	融资限额
30091	FundAvailableQuota	融资可用额度

10088	MarginAmount	保证金可用余额
30092	GuaranteeRate	维持担保率
30093	CreditFundInterest	融资利息
30094	CreditStockInterest	融券利息

7.2.21 信用投资者现货持仓查询

信用投资者现货持仓查询。

7.2.21.1 信用投资者现货持仓查询请求

表 56 信用投资者现货持仓查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.21.2 信用投资者现货持仓查询应答

表 57 信用投资者现货持仓查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
30019	AvailablePosition	可用持仓
134	StockAccount	证券账户

7.2.22 港股通汇率查询

港股通汇率查询。

7.2.22.1 港股通汇率查询请求

表 58 港股通汇率查询查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源

7.2.22.2 港股通汇率查询应答

表 59 港股通汇率查询查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码

30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
30095	BuyExchangeRate	买入汇率
30096	SellExchangeRate	卖出汇率
30097	MiddleExchangeRate	中间汇率
30098	SeBuyExchangeRate	交易所买入汇率
30099	SeSellExchangeRate	交易所卖出汇率
30100	BuyFloatRatio	买入浮动汇率
30101	SellFloatRatio	卖出浮动汇率
432	Expiredate	有效日期
30102	BuySettlementRate	买入结算汇率
30103	SellSettlementRate	卖出结算汇率

7.2.23 期权资产查询

期权资产查询。

7.2.23.1 期权资产查询请求

表 60 期权资产查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.23.2 期权资产查询应答

表 61 期权资产查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
30070	TotalAssets	总资产
30073	MarketValue	证券市值
30074	CashAssets	现金资产
30104	OptTotalMargin	保证金总额
30025	Available	可用资金
30105	UsedBailBalance	已用保证金
30106	RealUsedBail	实时已用保证金
30107	CurrMargin	占用保证金
30108	DeliveryMargin	投资者交割保证金
30109	FrozenAmount	冻结资金
30110	PreDeposit	上次存款额

30111	RiskDegree	风险度
30112	RealRiskDegree	实时风险度
30076	WithdrawQuota	可取资金

7.2.24 最大可还款查询

最大可还款查询。

7.2.24.1 最大可还款查询请求

表 62 最大可还款查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.24.2 最大可还款查询应答

表 63 最大可还款查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
30041	Amount	最大可还款金额

7.2.25 最大可还券查询

最大可还券查询。

7.2.25.1 最大可还券查询请求

表 64 最大可还券查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源
26	SecurityID	Y	证券代码

7.2.25.2 最大可还券查询应答

表 65 最大可还券查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
26	SecurityID	证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源

38	OrderQty	最大可还券数量
----	----------	---------

7.2.26 股票期权行权指派查询

股票期权行权指派查询。

7.2.26.1 股票期权行权指派查询请求

表 66 股票期权行权指派查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	Y	证券代码源

7.2.26.2 股票期权行权指派查询应答

表 67 股票期权行权指派查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
30109	FrozenAmount	行权冻结资金
38	OrderQty	行权数量
44	Price	行权价格
26	SecurityID	期权证券代码
55	Symbol	期权证券名称
30113	OptionsType	期权种类
30114	SettlementVolume	交收数量
30115	SettlementBalance	结算金额
309	UnderlyingSecurityID	证券代码

7.2.27 客户资产查询

客户资产查询。

7.2.27.1 客户资产查询请求

表 68 客户资产查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源

7.2.27.2 客户资产查询应答

表 69 客户资产查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
30070	TotalAssets	总资产
30073	MarketValue	证券市值
30074	CashAssets	现金资产
30025	Available	可用资金
30076	WithdrawQuota	可取资金

7.2.28 新股申购代码查询

新股申购代码查询。

7.2.28.1 新股申购代码查询请求

表 70 新股申购代码查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
22	SecurityIDSource	N	证券代码源
26	SecurityID	N	证券代码
225	IssueDate	N	发行日期
762	SecuritySubType	Y	证券子类

7.2.28.2 新股申购代码查询应答

表 71 新股申购代码查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
55	Symbol	证券名称
225	IssueDate	发行日期
30032	MaxVolume	申购上限
30116	MinVolume	申购下限
44	Price	申购价格
762	SecuritySubType	证券子类

7.2.29 债券现券交易转发信息查询

债券现券交易转发信息查询。

7.2.29.1 债券现券交易转发信息查询请求

表 72 债券现券交易转发信息查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户
664	ConfirmID	N	约定号

7.2.29.2 债券现券交易转发信息查询应答

表 73 债券现券交易转发信息查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
134	StockAccount	证券账户
191	ExecId	交易系统执行编号
22	SecurityIDSource	证券代码源
54	Side	买卖方向
38	OrderQty	委托数量
44	Price	委托价格
26	SecurityID	证券代码
55	Symbol	证券名称
30117	BondtradeTransStatus	债券现券转发信息状态
30118	AgencyNo	销售商编号
30119	BondInvestorType	交易主体类型
30014	BondFundAccount	交易主体代码
30120	BondInvestorName	交易主体名称
30013	TraderId	交易员编号
30121	OppoAgencyNo	对方销售商
30122	OppoBondInvestorType	对方交易主体类型
30012	OppoBondFundAccount	对方交易主体代码
30123	OppoBondInvestorName	对方投资者账户名称
30011	OppoTraderId	对方交易员
664	ConfirmID	约定号
8531	SettlementType	结算方式
30124	SettlePeriod	结算周期
1166	QuoteMsgID	报价消息编号
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式

7.2.30 质押入库债券明细查询

质押入库债券明细查询。

7.2.30.1 质押入库债券明细查询请求

表 74 质押入库债券明细查询请求

标签	字段名称	是否必须	说明
23	FundAccount	Y	资金账户

7.2.30.2 质押入库债券明细查询应答

表 75 质押入库债券明细查询应答

标签	字段名称	说明
30002	ErrorID	错误代码
30003	ErrorMsg	错误信息
23	FundAccount	资金账户
22	SecurityIDSource	证券代码源
26	SecurityID	证券代码
134	StockAccount	证券账户
30125	StoreAmount	交易所库存数量
30126	ImpawnRate	质押比率
30127	PreImpawnRate	预折算率
30128	PreOutAmount	交易期间出库数量
30129	PreInAmount	交易期间入库数量
30130	EnoutAmount	可出库数量
30131	ImpawnAmount	质押数量
30132	PreImpawnAmount	预折算数量
55	Symbol	证券名称
30133	CredBondConcRatio	信用债券集中度
30134	ImpawnCode	质押代码
14003	ReportSeat	席位编号
30135	HoldRatio	持仓比例

8 数据字典

8.1 数据类型

表 74 数据类型

类型	描述	用途
int32	整型	用于取值范围有限的数值型字段，如标识位、委托数量、日期、时间等。
int64	长整型	用于取值范围较大的数值型字段，如报单引用

double	双精度浮点数	用于价格、金额相关字段
string	文本	适用于文本字段

8.2 消息类型

表 75 消息类型

消息类型	名称（中文）	名称（英文）
3	登录请求	ReqLogin
42	登录应答	RspLogin
4	登出请求	ReqLogout
107	登出应答	RspLogout
76	订阅私有流	SubscribePrivateFlow
116	订阅私有流响应	RspSubscribePrivateFlow
1	竞价交易请求	ReqOrderInsert
40	竞价交易应答	RspOrderInsert
141	普通交易请求	ReqCounterOrderInsert
142	普通交易应答	RspCounterOrder
193	债券现券交易协商确认委托请求	ReqBondtradeBtaConfirmInsert
194	债券现券交易协商确认委托应答	RspBondtradeBtaConfirmInsert
11	合约查询请求	ReqQryInstrument
51	合约查询应答	RspQryInstrument
13	持仓查询请求	ReqQryInvestorPosition
53	持仓查询应答	RspQryInvestorPosition
14	资金查询请求	ReqQryTradingAccount
54	资金查询应答	RspQryTradingAccount
15	报单查询请求	ReqQryOrder
57	报单查询应答	RspQryOrder
16	成交查询请求	ReqQryTrade
58	成交查询应答	RspQryTrade
20	投资者查询请求	ReqQryInvestor
60	投资者查询应答	RspQryInvestor
22	交易编码查询请求	ReqQryTradingCode
62	交易编码查询应答	RspQryTradingCode
23	最大下单量查询请求	ReqQryMaxOrderVolume
63	最大下单量查询应答	RspQryMaxOrderVolume
24	信用合约属性查询请求	ReqQryCreditInstrument
64	信用合约属性查询应答	RspQryCreditInstrument
28	投资者融资明细查询请求	ReqQryCreditFundDetail
68	投资者融资明细查询应答	RspQryCreditFundDetail
29	投资者融券明细查询请求	ReqQryCreditStockDetail
69	投资者融券明细查询应答	RspQryCreditStockDetail
33	ETF 信息查询请求	ReqQryETFInfo

73	ETF 信息查询应答	RspQryETFInfo
34	ETF 成分股查询请求	ReqQryETFComponent
74	ETF 成分股查询应答	RspQryETFComponent
35	保证金可用余额查询请求	ReqQryCreditAvailableDetail
75	保证金可用余额查询应答	RspQryCreditAvailableDetail
123	集中柜台委托查询请求	ReqQryCounterOrder
124	集中柜台委托查询应答	RspQryCounterOrder
149	集中柜台成交查询请求	ReqQryCounterTrade
150	集中柜台成交查询应答	RspQryCounterTrade
135	配号查询请求	ReqQryIpoIssueNo
136	配号查询应答	RspQryIPOIssueNo
137	中签查询请求	ReqQryIpoLottery
138	中签查询应答	RspQryIPOLottery
139	集中柜台最大可委托数查询请求	ReqQryCounterMaxOrderVolume
140	集中柜台最大可委托数查询应答	RspQryCounterMaxOrderVolume
145	信用资产查询请求	ReqQryCreditAssets
146	信用资产查询应答	RspQryCreditAssets
147	信用投资者现货持仓查询请求	ReqQryInvestorCashPosition
148	信用投资者现货持仓查询应答	RspQryInvestorCashPosition
151	港股通汇率查询请求	ReqQryHkExchangeRate
152	港股通汇率查询应答	RspQryHkExchangeRate
165	期权资产查询请求	ReqQryOptionAssets
166	期权资产查询应答	RspQryOptionAssets
161	最大可还款查询请求	ReqQryFundPaybackVolume
162	最大可还款查询应答	RspQryFundPaybackVolume
163	最大可还券查询请求	ReqQryStockPaybackVolume
164	最大可还券查询应答	RspQryStockPaybackVolume
173	股票期权行权指派查询请求	ReqQryExerciseassign
174	股票期权行权指派查询应答	RspQryExerciseassign
181	客户资产查询请求	ReqQryFundAssets
182	客户资产查询应答	RspQryFundAssets
183	新股申购代码查询请求	ReqQryIPOStockCode
184	新股申购代码查询应答	RspQryIPOStockCode
191	债券现券交易转发信息查询请求	ReqQryBondtradeBttransinfo
192	债券现券交易转发信息查询应答	RspQryBondtradeBttransinfo
195	质押入库债券明细查询请求	ReqQryImpawnStock
196	质押入库债券明细查询应答	RspQryImpawnStock

8.3 标签域字典

表 76 标签域字典

标签	来源	字段名称	字段类型	说明
----	----	------	------	----

11	FIX 5.0 SP2	ClOrdID		交易客户方（券商）订单编号
15	FIX 5.0 SP2	Currency		币种代码 CNY=人民币
22	FIX 5.0 SP2	SecurityIDSource		证券代码源 1=上证 2=深证 D=上证 B 股 H=深证 B 股 G=沪港通 S=深港通 9=北交所 A=股转 B z=其他
23	FIX 5.0 SP2	FundAccount		资金账户
26	FIX 5.0 SP2	SecurityID		证券代码
31	FIX 5.0 SP2	LastPx		成交价格
32	FIX 5.0 SP2	LastQty		成交数量
37	FIX 5.0 SP2	OrderID		交易所处理编号
38	FIX 5.0 SP2	OrderQty		数量
39	FIX 5.0 SP2	OrdStatus		订单状态 0=未报 1=待报 2=已报 3=已报待撤 4=部成待撤 5=部撤 6=已撤 7=部成 8=已成 9=废单 a=未知 C=正报 V=已确认
40	FIX 5.0 SP2	OrdType		订单类型 1=市转撤, 2=限价, 3=市转限, 4=本 方最优, 5=对手方最优
44	FIX 5.0 SP2	Price		价格
54	FIX 5.0 SP2	Side		买卖方向 0=买 1=卖
55	FIX 5.0 SP2	Symbol		证券名称
58	FIX 5.0 SP2	Text		备注

59	FIX 5.0 SP2	TimeInForce		有效期类型 1=立即完成，否则撤销 2=本节有效 3=当日有效 4=指定日期前有效 5=撤销前有效 6=集合竞价有效
60	FIX 5.0 SP2	TransactTime		成交时间，为 int 类型数据，例如 9:02:31:698，则该值为 90231698
75	FIX 5.0 SP2	TradeDate		订单申报日期（仅日期）
77	FIX 5.0 SP2	PositionEffect		开平标志 0=开仓 1=平仓 2=强平 3=平今 4=平昨 5=强减 6=本地强平
99	FIX 5.0 SP2	StopPx		止损价格
103	FIX 5.0 SP2	OrdRejReason		订单拒绝码
110	FIX 5.0 SP2	MinQty		最小成交数量
134	FIX 5.0 SP2	StockAccount		证券账户
151	FIX 5.0 SP2	LeavesQty		剩余数量
191	FIX 5.0 SP2	ExecID		执行编号
225	FIX 5.0 SP2	IssueDate		上市日期
291	FIX 5.0 SP2	FinancialStatus		证券状态
309	FIX 5.0 SP2	UnderlyingSecurityID		基础证券代码（权证、ETF）
432	FIX 5.0 SP2	Expiredate		有效日期
541	FIX 5.0 SP2	MaturityDate		到期/交割日
553	FIX 5.0 SP2	UserName		用户名称
554	FIX 5.0 SP2	Password		密码
583	FIX 5.0 SP2	ClOrdLinkID		报单引用
561	FIX 5.0 SP2	RoundLot		交易单位（该证券订单数量的单位量，即最终的订单数量=订单数量×交易单位）
602	FIX 5.0 SP2	LegSecurityID		成份合约代码
603	FIX 5.0 SP2	LegSecurityIDSource		成份合约代码源 1=上证 2=深证 D=上证 B 股 H=深证 B 股 G=沪港通

				S=深港通 9=北交所 A=股转 B z=其他
664	FIX 5.0 SP2	ConfirmID		约定号
762	FIX 5.0 SP2	SecuritySubType		证券子类 GBF=国债，上海市场 GBZ=无息国债，上海市场 DST=国债分销（仅用于分销阶段），上海市场 DVP=公司债（地方债）分销，上海市场 CBF=企业债券，上海市场 CCF=可转换企业债券，上海市场 CPF=公司债券（或地方债券），上海市场 FBF=金融机构发行债券，上海市场 CRP=质押式国债回购，上海市场 BRP=质押式企债回购，上海市场 ORP=买断式债券回购，上海市场 CBD=分离式可转债，上海市场 OBD=其它债券，上海市场 CEF=封闭式基金，上海市场 OEF=开放式基金，上海市场 EBS=交易所交易基金（买卖），上海市场 FBL=跨市场/跨境资金，上海市场 OFN=其它基金，上海市场 ASH=以人民币交易的股票（主板），上海市场 BSH=以美元交易的股票，上海市场 KSH=以人民币交易的股票（科创板），上海市场 OEQ=其它股票，上海市场 AMP=集合资产管理计划，上海市场 WIT=国债预发行，上海市场 LOF=LOF 基金，上海市场 OPS=公开发行优先股，上海市场 PPS=非公开发行优先股，上海市场 QRP=报价回购，上海市场 CMD=控制指令（中登身份认证密码服务产品复用 CMD 证券子类别），上海

				市场 LOC=融资分级子基金，上海市场 LOD=多空分级子基金，上海市场 1=主板 A 股，深圳市场 2=中小板股票，深圳市场 3=创业板股票，深圳市场 4=主板 B 股，深圳市场 5=国债，深圳市场 6=企业债，深圳市场 7=公司债（含分离债），深圳市场 8=可转债，深圳市场 9=中小企业私募债，深圳市场 10=中小企业可交换私募债，深圳市场 11=证券公司次级债，深圳市场 12=质押式回购，深圳市场 13=资产支持证券，深圳市场 14=本市场股票 ETF，深圳市场 15=跨市场股票 ETF，深圳市场 16=跨境 ETF，深圳市场 17=本市场实物债券 ETF，深圳市场 19=黄金 ETF，深圳市场 20=货币 ETF，深圳市场 23=标准 LOF，深圳市场 24=分级子基金，深圳市场 25=封闭式基金，深圳市场 26=仅申赎基金，深圳市场 28=权证，深圳市场 29=个股期权，深圳市场 30=ETF 期权，深圳市场 33=优先股，深圳市场 34=证券公司短期债，深圳市场 35=可交换公司债，深圳市场 36=存托凭证，深圳市场
856	FIX 5.0 SP2	TradeReportType		成交申报类型 0=提交成交申报 1=转发成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报
916	FIX 5.0 SP2	StartDate		开始日期
917	FIX 5.0 SP2	EndDate		结束日期
1166	FIX 5.0 SP2	QuoteMsgID		客户报价消息编号
1123	FIX 5.0 SP2	TradeHandlingInstr		成交申报模式

				0=成交确认 1=成交报告 2=协议配对 3=成交请求 5=双边确认成交报告
1328	FIX 5.0 SP2	RejectText		撤单/拒绝原因说明
8500	JR/T 0022—2020	OrigTime		订单申报时间
8501	JR/T 0177.1—2020	AccountSecPosition		持有数量
8504	JR/T 0022—2020	TotalValueTraded		成交金额
8531	FIX5	SettlementType		结算方式，只能为数字。取值有：1=净额结算，2=RTGS 结算
8547	JR/T 0022—2020	GeneralMeetingSeq		股东大会编码
8908	JR/T 0022—2020	ShareProperty		股份性质 0=无限售流通股 1=挂牌后个人类限售股 2=股权激励限售股 3=挂牌后机构类限售股 4=高管锁定股 5=挂牌前个人类限售股 6=挂牌前机构类限售股 7=特别表决权限限售股 10=发起人国家股 11=发起人国有法人股 12=发起人境内法人股 13=发起人外资法人股 14=发起人自然人股 15=发起人股 20=定向法人国家股 21=定向法人国有法人股 22=定向法人境内法人股 23=定向法人外资法人股 24=定向法人自然人股 25=其他定向法人股 30=内部职工股 40=高管股
10088	JR/T 0177.1—2020	MarginAmount		保证金可用余额
10184	JR/T 0022—2020	Contactoer		联系人
10185	JR/T 0022—2020	ContactInfo		联系信息
14003	JR/T 0248—2022	ReportSeat		席位代码
30001	自定义	OrderWay		委托方式

				1=网上委托 2=PB 委托 3=专属委托（券结）
30002	自定义	ErrorID		错误代码
30003	自定义	ErrorMsg		错误信息
30004	自定义	LoginTime		登录成功时间，为 int 类型数据，例如 9:02:31:698，则该值为 90231698
30005	自定义	LastLoginDate		上次登录日期，为 int 类型数据，例如 2021 年 6 月 3 日，则该值为 20210603
30006	自定义	LastLoginTime		上次登录时间，为 int 类型数据，例如 9:02:31，则该值为 90231
30007	自定义	LastLoginIP		上次登录 IP
30008	自定义	ResumeMode		私有流重传方式 0=从本交易日开始重传 1=从上次收到的续传 2=只传送登录后私有流的内容
30009	自定义	HedgeFlag		投机套保标志 1=投机 2=套利 3=套保 4=备兑 5=做市商 A=申赎 B=信用账户融资融券（普通头寸） C=信用账户担保品买卖 D=信用账户融资融券（专项头寸） Z=跨境 ETF 申赎
30010	自定义	EntrustProp		委托属性 1=配股 3=申购 7=转股 8=回售 R1=担保证券提交与返还 PFP=盘后固定价格委托 HKN=港股订单申报 HK0=零股订单申报，仅指港股零股 a=意向委托 b=定价委托 c=确认委托 e=互报成交确认委托 f=出入库

				BTA=债券现券协商委托，深市协商委托 FI9=指定对手方报价申报，沪市协商委托 IPS=询价 VTE=网络投票 ABT=股转大宗交易 EB=要约预受撤回 ES=要约预受
30011	自定义	OppoTraderId		对方交易员
30012	自定义	OppoBondFundAccount		对方交易主体代码
30013	自定义	TraderId		交易员编号
30014	自定义	BondFundAccount		交易主体代码
30015	自定义	OppoStockAccount		对方股东账户
30016	自定义	MacAddressAsLong		Mac 地址
30017	自定义	PriceTick		最小变动价位
30018	自定义	YdPosition		上日持仓
30019	自定义	AvailablePosition		可用持仓
30020	自定义	PositionCost		持仓成本
30021	自定义	PositionProfit		持仓盈亏
30022	自定义	SettlementPrice		本次结算价
30023	自定义	PositionCostPrice		持仓成本价
30024	自定义	FrozenCash		冻结的资金，冻结权利金
30025	自定义	Available		可用资金
30026	自定义	SequenceNo		序号
30027	自定义	Limit		查询条数
30028	自定义	ReqOrderStatus		委托状态查询条件 h=可撤委托
30029	自定义	OrderType		报单类型 0=正常 1=报价衍生 2=组合衍生 3=组合报单 4=条件单 5=互换单 Z=质押式回购 7=新股申购 B=债券买卖
30030	自定义	IsActive		是否活跃
30031	自定义	BranchID		营业部编号
30032	自定义	MaxVolume		最大允许报单数量
30033	自定义	MaxVolumeOri		原始最大允许报单数量

30034	自定义	ConvertRate		股票折算率
30035	自定义	IsCreditFund		是否可融资
30036	自定义	IsCreditStock		是否可融券
30037	自定义	IsGuarantee		是否担保品
30038	自定义	IsLiquid		是否高流通证券
30039	自定义	AssetPrice		公允价格
30040	自定义	AssetPriceCreditStock		融券公允价格
30041	自定义	Amount		金额
30042	自定义	AmountPayback		已归还融资金额
30043	自定义	VolumePayback		已归还融资数量
30044	自定义	Commission		今日手续费(不可还)
30045	自定义	CreditInterestProcesses		未结利息费用
30046	自定义	CreditInterestFinished		已结利息费用
30047	自定义	CreditInterestPaid		已还利息费用
30048	自定义	RedemptionID		一级市场申赎代码
30049	自定义	CreationRedemptionUnit		每个篮子对应的 ETF 份数, 申赎必须整数倍
30050	自定义	MaxCashRatio		最大现金替代比例
30051	自定义	PublishIOPV		是否需要发布 IOPV
30052	自定义	Creation		是否可申购
30053	自定义	Redemption		是否可赎回
30054	自定义	RecordNum		成分证券数量
30055	自定义	EstimateCashComponent		T 日每个篮子的预估现金差额
30056	自定义	NAVperCU		前一日最小申赎单位净值
30057	自定义	NAV		前一日基金份额净值
30058	自定义	ETFID		ETF 代码
30059	自定义	SubstituteFlag		替代标志 0=禁止现金替代 1=允许现金替代 2=必须现金替代 3=非本市场必须现金替代
30060	自定义	CreationPremiumRate		申购溢价比例
30061	自定义	CreationCashSubstitute		申购替代金额
30062	自定义	CreditCollateralValue		担保品折算
30063	自定义	CreditFundProfit		融资盈亏
30064	自定义	CreditStockProfit		融券盈亏

30065	自定义	BeginIssueNo		起始配号
30066	自定义	IPOLuckyNum		中签个数
30067	自定义	DeductDate		扣款日期
30068	自定义	IssuePrice		中签价格
30069	自定义	LuckyBalance		中签金额
30070	自定义	TotalAssets		总资产
30071	自定义	NetAssets		净资产
30072	自定义	TotalDebt		总负债
30073	自定义	MarketValue		证券市值
30074	自定义	CashAssets		现金资产
30075	自定义	NonLiquidAvailable		非高流通可用资金
30076	自定义	WithdrawQuota		可取资金
30077	自定义	CreditFundDebt		融资负债
30078	自定义	CreditFund		融资金额
30079	自定义	CreditFundFrozen		冻结的融资金额
30080	自定义	CreditStockDebt		融券负债
30081	自定义	CreditStock		融券金额
30082	自定义	CreditStockFrozen		冻结的融券金额
30083	自定义	CreditStockUsed		已用的融券金额
30084	自定义	CreditStockAvailable		可用的融券金额
30085	自定义	CreditInterestUnpay		已结未还利息费用
30086	自定义	TotalLimit		融资融券总额度
30087	自定义	TotalAvailableQuota		融资融券可用总额度
30088	自定义	StockLimit		融券限额
30089	自定义	StockAvailableQuota		融券可用额度
30090	自定义	FundLimit		融资限额
30091	自定义	FundAvailableQuota		融资可用额度
30092	自定义	GuaranteeRate		维持担保率
30093	自定义	CreditFundInterest		融资利息
30094	自定义	CreditStockInterest		融券利息
30095	自定义	BuyExchangeRate		买入汇率
30096	自定义	SellExchangeRate		卖出汇率
30097	自定义	MiddleExchangeRate		中间汇率
30098	自定义	SeBuyExchangeRate		交易所买入汇率
30099	自定义	SeSellExchangeRate		交易所卖出汇率
30100	自定义	BuyFloatRatio		买入浮动汇率
30101	自定义	SellFloatRatio		卖出浮动汇率
30102	自定义	BuySettlementRate		买入结算汇率
30103	自定义	SellSettlementRate		卖出结算汇率
30104	自定义	OptTotalMargin		保证金总额
30105	自定义	UsedBailBalance		已用保证金

30106	自定义	RealUsedBail		实时已用保证金
30107	自定义	CurrMargin		占用保证金
30108	自定义	DeliveryMargin		投资者交割保证金
30109	自定义	FrozenAmount		冻结资金
30110	自定义	PreDeposit		上次存款额
30111	自定义	RiskDegree		风险度
30112	自定义	RealRiskDegree		实时风险度
30113	自定义	OptionsType		期权种类
30114	自定义	SettlementVolume		交收数量
30115	自定义	SettlementBalance		结算金额
30116	自定义	MinVolume		申购下限
30117	自定义	BondtradeTransStatus		债券现券转发信息状态 0=未处理 1=已接受 2=已拒绝 3=已撤销 4=发起方委托被拒 5=已超时 6=已成交 7=结算失败
30118	自定义	AgencyNo		销售商编号
30119	自定义	BondInvestorType		交易主体类型 1=自营 2=资管 3=机构经纪 4=个人经济
30120	自定义	BondInvestorName		交易主体名称
30121	自定义	OppoAgencyNo		对方销售商
30122	自定义	OppoBondInvestorType		对方交易主体类型 1=自营 2=资管 3=机构经纪 4=个人经济
30123	自定义	OppoBondInvestorName		对方投资者账户名称
30124	自定义	SettlePeriod		结算周期
30125	自定义	StoreAmount		交易所库存数量
30126	自定义	ImpawnRate		质押比率
30127	自定义	PreImpawnRate		预折算率
30128	自定义	PreOutAmount		交易期间出库数量
30129	自定义	PreInAmount		交易期间入库数量
30130	自定义	EnoutAmount		可出库数量
30131	自定义	ImpawnAmount		质押数量

Q/DFZQ 001—2026

30132	自定义	PreImpawnAmount		预折算数量
30133	自定义	CredBondConcRatio		信用债券集中度
30134	自定义	ImpawnCode		质押代码
30135	自定义	HoldRatio		持仓比例

附 录 A
(规范性)
组合参数定义

A.1 组合参数定义

A.1.1 竞价交易

竞价交易相关类型组合见表A.1。

表 A.1 竞价交易

说明	HedgeFlag	Side	OffsetFlag	Price	Volume
股票买入	1	0	0	—	—
股票卖出	1	1	1	—	—
债券逆回购	1	1	0	—	—
债券正回购	1	0	1	—	—
ETF 申购	A	0	0	1	—
ETF 赎回	A	1	1	1	—
融资买入	B	0	0	—	—
融券卖出	B	1	0	—	—
卖券还款	B	1	1	—	—
买券还券	B	0	1	—	—
担保品买入	C	0	0	—	—
担保品卖出	C	1	1	—	—
期权买入开仓	1	0	0	—	—
期权卖出开仓	1	1	0	—	—
期权买入平仓	1	0	1	—	—
期权卖出平仓	1	1	1	—	—
期权备兑开仓	4	1	0	—	—
期权备兑平仓	4	0	1	—	—

A.1.2 市价委托

沪深北交易所支持报单类型见表 A.2。

表 A.2 报单类型

业务	报单类型	OrdType	TimeInForce	MinQty
上交所股票	限价单	2(限价)	3(当日有效)	0(任何数量)
上交所股票	最优五档即时成交	G(五档价)	1(立即完成、否则撤	0(任何数量)

	剩余撤销		销)	
上交所股票	最优五档即时成交 剩余转限价单	G(五档价)	3(当日有效)	0(任何数量)
上交所股票	对手方最优价	3(最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
上交所股票	本方最优价	H(本方最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
深交所股票	限价单	2(限价)	3(当日有效)	0(任何数量)
深交所股票	对手方最优价	3(最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
深交所股票	本方最优价	H(本方最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
深交所股票	最优五档即时成交 剩余撤销	G(五档价)	1(立即完成、否则撤 销)	0(任何数量)
深交所股票	市价立即成交 剩余撤销	1(任意价)	1(立即完成、否则撤 销)	0(任何数量)
深交所股票	市价全额成交 或撤销	1(任意价)	1(立即完成、否则撤 销)	OrderQty(全部数 量)
北交所股票	限价单	2(限价)	3(当日有效)	0(任何数量)
北交所股票	最优五档即时成交剩余 撤销	G(五档价)	1(立即完成、否则撤 销)	0(任何数量)
北交所股票	最优五档即时成交剩余 转限价单	G(五档价)	3(当日有效)	0(任何数量)
北交所股票	对手方最优价	3(最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
北交所股票	本方最优价	H(本方最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
上交所期权	限价单 (GFD)	2(限价)	3(当日有效)	0(任何数量)
上交所期权	限价全部成交 否则撤销 (FOK)	2(限价)	1(立即完成、否则撤 销)	OrderQty(全部数 量)
上交所期权	市价剩余转限价 (对手方最优价) (GFD)	3(最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
上交所期权	市价即时成交剩余撤销 (IOC)	1(任意价)	1(立即完成、否则撤 销)	0(任何数量)
上交所期权	市价即时全部成交否则 撤销 (FOK)	1(任意价)	1(立即完成、否则撤 销)	OrderQty(全部数 量)
深交所期权	限价单	2(限价)	3(当日有效)	0(任何数量)
深交所期权	限价全部成交否则撤销	2(限价)	1(立即完成、否则撤 销)	OrderQty(全部数 量)
深交所期权	对手方最优价	3(最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
深交所期权	本方最优价	H(本方最优价)	3(当日有效)	0(任何数量)
深交所期权	最优五档即时成交剩余 撤销	G(五档价)	1(立即完成、否则撤 销)	0(任何数量)
深交所期权	市价立即成交剩余撤销	1(任意价)	1(立即完成、否则撤 销)	0(任何数量)

深交所期权	市价全额成交或撤销	1(任意价)	1(立即完成、否则撤销)	OrderQty(全部数量)
-------	-----------	--------	--------------	----------------

参 考 文 献

- [1] JR/T 0248—2022 证券期货业机构内部接口 证券交易
- [2] GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码
- [3] GB/T 23696—2017 证券及相关金融工具 交易所和市场识别码
- [4] GB/T 18030—2005 信息技术 中文编码字符
- [5] JR/T 0022—2020 证券交易数据交换协议
- [6] JR/T 0177.1—2020 证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第1部分：证券
- [7] JR/T 0182—2020 轻量级实时STEP消息传输协议
- [8] JR/T 0111—2014 证券期货业数据通信协议应用指南
- [9] JR/T 0274—2023 证券期货业机构内部接口 账户管理
- [10] FIX5.0（金融信息交换协议5.0版）.FIXProtocolLtd（FPL）.2006年10月