
上海证券交易所技术文档



上海证券交易所综合业务平台
市场参与者接口规格说明书
(债券非交易技术开发稿)
(1.45 版)



上海证券交易所

二〇二〇年十八月

目录

1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范	4
2 债券非交易实时消息规范	9
2.1 债券质押式回购入库业务消息规范	9
2.1.1 债券质押式回购入库消息流程图	9
2.1.2 债券质押式回购入库申报消息	9
2.1.3 债券质押式回购入库申报响应消息	10
2.1.4 债券质押式回购入库执行报告消息	10
2.2 债券质押式回购出库业务消息规范	11
2.2.1 债券质押式回购出库消息流程图	11
2.2.2 债券质押式回购出库申报消息	12
2.2.3 债券质押式回购出库申报响应消息	13
2.2.4 债券质押式回购出库执行报告消息	13
2.3 可转债转股业务消息规范	14
2.3.1 可转债转股消息流程图	14
2.3.2 可转债转股申报消息	15
2.3.3 可转债转股申报响应消息	15
2.3.4 可转债转股撤单申报消息	16
2.3.5 可转债转股撤单申报成功响应消息	16
2.3.6 可转债转股撤单申报失败响应消息	16
2.4 可交换债换股业务消息规范	16
2.4.1 可交换债换股消息流程图	16
2.4.2 可交换债换股申报消息	17
2.4.3 可交换债换股申报响应消息	17
2.4.4 可交换债换股撤单申报消息	18
2.4.5 可交换债换股撤单申报成功响应消息	18
2.4.6 可交换债换股撤单申报失败响应消息	18
2.5 债券回售业务消息规范	18
2.5.1 债券回售消息流程图	18
2.5.2 债券回售申报消息	19
2.5.3 债券回售申报响应消息	19
2.5.4 债券回售撤单申报消息	20
2.5.5 债券回售撤单申报成功响应消息	20
2.5.6 债券回售撤单申报失败响应消息	20
2.6 债券回售撤销业务消息规范	20
2.6.1 债券回售撤销消息流程图	20
2.6.2 债券回售撤销申报消息	21
2.6.3 债券回售撤销申报响应消息	21
3 ETF 申赎实时消息规范	22

3.1	ETF 申购业务消息规范	22
3.1.1	债券 ETF 申购消息流程图	22
3.1.2	债券 ETF 申购申报消息	22
3.1.3	债券 ETF 申购申报响应消息	23
3.1.4	债券 ETF 申购执行报告消息	23
3.2	ETF 赎回业务消息规范	25
3.2.1	债券 ETF 赎回消息流程图	25
3.2.2	债券 ETF 赎回申报消息	25
3.2.3	债券 ETF 赎回申报响应消息	26
3.2.4	债券 ETF 赎回执行报告消息	26
4	债券非交易盘前数据接口	29
4.1	债券非交易基础信息接口 zfjyyyyymmdd.xml	29
5	基金非交易盘前数据接口	31
5.1	基金非交易基础信息接口 fjjyyyyymmdd.xml	31
6	债券盘后数据接口	32
6.1	债券过户数据 zqghXXXXX.txt	32
7	基金盘后数据接口	33
7.1	基金过户数据接口 jjghXXXXX.txt	33

1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范

数据格式约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》文档。

STEP 消息约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》文档。

通用数据库接口参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》文档。

请求业务类型编号（reqid），交易所据此处理不同的业务请求，取值为：

业务名称	业务类型请求编号	业务类型说明
大宗交易	BII	大宗意向
	BPT	大宗交易
	FPE	大宗固定价格交易申报
报价回购	QBD	报价入库
	QBW	报价出库
	QNE	报价回购
	QCA	报价回购提前购回
约定购回	RNE	初始交易
	RNR	购回交易
跨境 ETF 申赎/黄金 ETF 现金申赎/交易型货币市场基金申赎	EEC	跨境 ETF/黄金 ETF 现金/交易型货币市场基金申购
	EER	跨境 ETF/黄金 ETF 现金/交易型货币市场基金赎回
黄金 ETF 实物申赎	GEC	黄金 ETF 实物申购
	GER	黄金 ETF 实物赎回
转融通	ZII	转融通非约定申报
	ZPT	转融通约定申报
货币市场基金申赎	OFC	货币市场基金申购申报
	OFR	货币市场基金赎回申报
股票质押式回购	SPN	初始交易
	SPS	补充质押
	SPR	购回交易
	SPT	终止购回
	SPD	部分解除质押
	SPB	违约处置申请
国债预发行	BIY	国债预发行利率（收益率）招标申报
	BIP	国债预发行价格招标申报
上证 LOF	LFS	上证 LOF 认购
	LFC	上证 LOF 申购
	LFR	上证 LOF 赎回
	LFT	上证 LOF 场内转场外的转托管
	LFP	上证 LOF 母基金分拆
	LFM	上证 LOF 子基金合并
网络投票	VTE	投票申报
密码服务	PWS	密码服务申报
资金前端控制	CFC	资金前端控制
债券质押式回购出入	BPD	债券质押式回购入库

<u>库</u>	<u>BPW</u>	<u>债券质押式回购出库</u>
<u>可转换债转股</u>	<u>BES</u>	<u>可转换债转股</u>
<u>可交换债换股</u>	<u>BSS</u>	<u>可交换债换股</u>
<u>债券回售</u>	<u>BSB</u>	<u>债券回售</u>
	<u>BSC</u>	<u>债券回售撤销</u>
<u>单市场/跨市场 ETF 申 赎</u>	<u>IEC</u>	<u>单市场/跨市场 ETF 申购</u>
	<u>IER</u>	<u>单市场/跨市场 ETF 赎回</u>

数据广播类型 (bcasstype)，取值为：

01: 跨境 ETF/黄金 ETF 现金/交易型货币市场基金申赎业务 (execreport)

02: 大宗交易执行报告 (execreport)

03: 大宗交易意向申报行情 (pubdata)

04 转融通出借人实时申报及成交汇总行情广播 (pubdata)

05 约定申报转融通执行报告 (execreport)

06 非约定申报转融通执行报告 (execreport)

07 转发的转融通约定申报 (execreport)

08 转发的转融通非约定申报 (execreport)

09 转发的转融通约定申报撤单 (execreport)

10 转发的转融通非约定申报撤单 (execreport)

12 货币基金执行报告 (execreport)

13 LOF 执行报告 (execreport)

14 大宗盘后固定价格交易执行报告 (execreport)

16 黄金 ETF 实物申赎执行报告 (execreport)

17 国债预发行价格招标执行报告 (execreport)

18 国债预发行利率招标执行报告 (execreport)

19 盘后固定价格交易执行报告 (execreport)

1H 综合业务平台交易行情数据

20 ETF 申赎执行报告 (execreport)

21 债券质押式出入库执行报告 (execreport)

业务类型与执行报告数据广播类型及产品集关系表：

业务名称	业务类型 (reqid)	执行报告 广播类型 (bcasstyp)	公共数据 广播类型 (bcassty)	产品集编号 (setid) 供参考以具
------	--------------	----------------------------	---------------------------	---------------------------

		e)	pe)	体数据为准
跨境 ETF 申赎 /黄金 ETF 现 金申赎/交易型 货币市场基金 申赎	EEC 跨境 ETF/黄金 ETF 现金 /交易型货币市场基金申购	01	N/A	102
	EER 跨境 ETF/黄金 ETF 现金 /交易型货币市场基金赎回			
黄金 ETF 实物 申赎	GEC 黄金 ETF 实物申购 GER 黄金 ETF 实物赎回 注：无订单申报，用于 BGH 中。	16	N/A	102
大宗业务	BII 大宗意向	02	03	101
	BPT 大宗交易	14	N/A	101
	FPE 大宗固定价格交易			
报价回购	QBD 报价入库	N/A	N/A	100
	QBW 报价出库			
	QNE 报价回购			
	QCA 报价回购提前购回			
约定购回	RNE 初始交易	N/A	N/A	100
	RNR 购回交易			
转融通	ZII 转融通非指定对手方	05,07,09	04	104
	ZPT 转融通指定对手方	06,08,10		
货币市场基金 申赎（即：货 币市场基金场 内实时申赎）	OFC 货币市场基金申购申报 OFR 货币市场基金赎回申报	12	N/A	105
股票质押回购	SPN 初始交易	N/A	N/A	100
	SPS 补充质押			
	SPR 购回交易			
	SPT 终止购回			
	SPD 部分解除质押			
	SPB 违约处置申请			

国债预发行	BIY 国债预发行利率（收益率）招标申报 BIP 国债预发行价格招标申报	17 18	N/A	106
上证 LOF	LFS 上证 LOF 认购 LFC 上证 LOF 申购 LFR 上证 LOF 赎回 LFT 上证 LOF 场内转场外的转托管 LFP 上证 LOF 母基金分拆 LFM 上证 LOF 子基金合并	13	N/A	105
网络投票	VTE 投票申报（Vote Entry）	N/A	N/A	0109
密码服务	PWS 密码服务申报 Password Service	N/A	N/A	0109
资金前端控制	CFC 资金前端控制申报	N/A	N/A	0109
<u>债券 ETF 申赎</u>	<u>IEC 单市场/跨市场 ETF 申购</u> <u>IER 单市场/跨市场 ETF 赎回</u>	<u>20</u>	<u>N/A</u>	<u>102</u>
<u>债券非交易</u>	<u>BPD 债券质押式回购入库</u> <u>BPW 债券质押式回购出库</u> <u>BES 可转换债转股</u> <u>BSS 可交换债换股</u> <u>BSB 债券回售</u> <u>BSC 债券回售撤销</u>	<u>21</u>	<u>N/A</u>	<u>121</u>

消息类型（MsgType），取值为：

- 6 = 意向申报或意向申报撤单（IOI）
- 8 = 申报响应或执行报告（Execution Report）
- 9 = 申报撤单失败（OrderCancelReject）
- D = 申报（NewOrder Single）
- F = 申报撤单（OrderCancel Request）

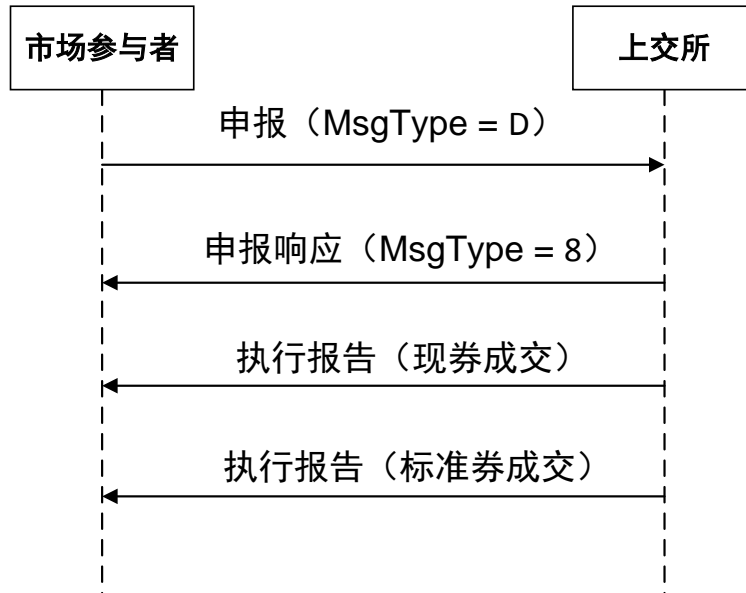
AJ	= 意向申报响应或意向申报撤单响应 (QuoteResponse)
W	= 行情 (MktDataFull)
U001	= 注册指令 (DesignationInstruction)
U004	= 投票
U005	= 投票响应
U006	= 密码服务申报
U008	= 密码服务响应
U009	= 资金前端控制申报
U010	= 资金前端控制响应

2 债券非交易实时消息规范

2.1 债券质押式回购入库业务消息规范

2.1.1 债券质押式回购入库消息流程图

根据债券质押式回购入库业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券质押式回购入库指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.1.2 债券质押式回购入库申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
描述: 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券质押式回购入库申报。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值: D=申报。	
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10
48	SecurityID	证券代码，债券质押式回购出入库现券代码。	C6
38	OrderQty	入库数量，债券单位为手，基金单位为份。	N10

453	NoPartyIDs		参与方个数，后接重复组，依次包含账户、PBU、营业部代码，取值为3。	N2
证券账户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取5，表示当前PartyID的取值为投资者帐户。	N4
申报交易单元号	448	PartyID	业务PBU代码，填写5位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取1，表示当前PartyID的取值为PBU。	N4
营业部代码	448	PartyID	营业部代码。	C5
	452	PartyRole	取4001，表示当前PartyID的取值为营业部代码。	N4
58	Text		备注。	备注

2.1.3 债券质押式回购入库申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

2.1.4 债券质押式回购入库执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
描述: 执行报告表中的 execreporttext 字段数据。 债券质押回购入库成功后，产生2条执行报告（成交回报）记录，如下： <ol style="list-style-type: none"> 1、证券代码为现券代码、成交数量为入库申请数量、买卖方向为2的成交记录； 2、证券代码为标准券代码（888880）、成交数量为现券折算后数量、买卖方向为1的成交记录。 	

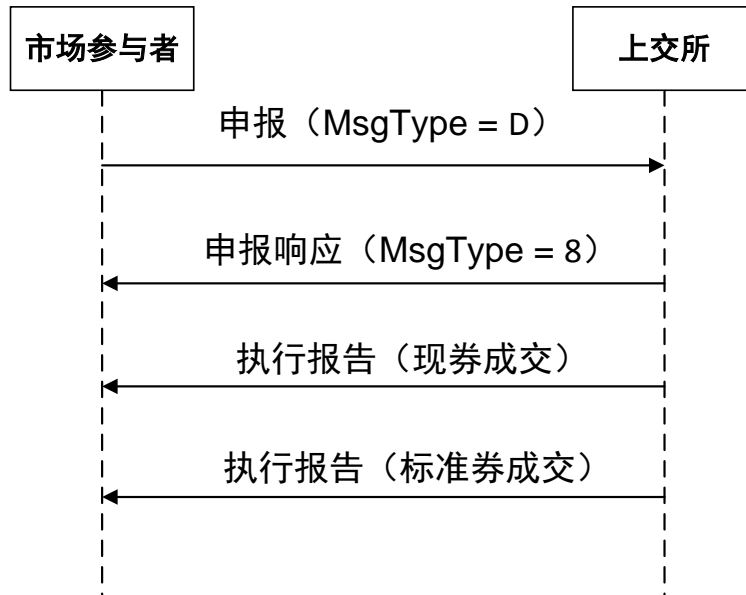
序号	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值： 8=成交回报。	
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10
37	OrderID	交易所订单编号。	C16

17	ExecID	成交编号。	C16	
48	SecurityID	证券代码。	C6	
32	LastQty	成交数量，债券单位为手，基金单位为份。	N12	
54	Side	买卖方向，取值： 1=买； 2=卖。	C1	
60	TransactTime	订单执行时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。	C21	
42	OrigTime	原订单请求接收的时间，式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。	C21	
150	ExecType	当前订单执行报告类型，取值： F=成交。	C1	
39	OrdStatus	当前订单状态，取值： 2=已成交。	C1	
453	NoPartyIDs	参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号，取值为 2。	N2	
投资者 帐户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户。	N4
申报交 易单元 号	448	PartyID	业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号。	N4

2.2 债券质押式回购出库业务消息规范

2.2.1 债券质押式回购出库消息流程图

根据债券质押式回购出库业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券质押式回购出库指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.2.2 债券质押式回购出库申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
描述: 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券质押式回购出库申报。	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值: D=申报。		
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10	
48	SecurityID	证券代码, 债券质押式回购出入库现券代码。	C6	
38	OrderQty	出库数量, 债券单位为手, 基金单位为份。	N10	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含账户、PBU、营业部代码, 取值为 3。	N2	
证券账户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户。	N4
申报交易	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5

单元号	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为 PBU。	N4
营业部代码	448	PartyID	营业部代码。	C5
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为营业部代码。	N4
58	Text		备注。	备注

2.2.3 债券质押式回购出库申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述： 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

2.2.4 债券质押式回购出库执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
描述： 执行报告表中的 execreporttext 字段数据。 债券质押回购出库成功后，产生如下 2 条执行报告（成交回报）记录，如下： <ol style="list-style-type: none"> 1、证券代码为现券代码、成交数量为出库申请数量、买卖方向为 1 的成交记录； 2、证券代码为标准券代码（888880）、成交数量为现券折算后数量、买卖方向为 2 的成交记录。 	

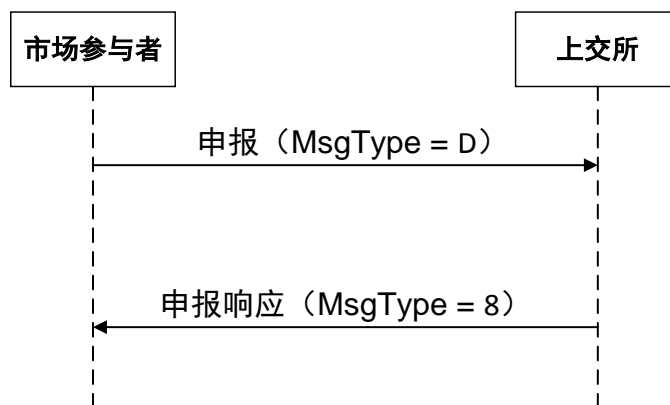
序号	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值： 8=成交回报。	
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10
37	OrderID	交易所订单编号。	C16
17	ExecID	成交编号。	C16
48	SecurityID	证券代码。	C6
32	LastQty	成交数量，债券单位为手，基金单位为份。	N12
54	Side	买卖方向，取值有：	C1

			1 表示买； 2 表示卖。	
60	TransactTime		订单执行时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。	C21
42	OrigTime		原 订 单 请 求 接 收 的 时 间 ， 式 为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。	C21
150	ExecType		当前订单执行报告类型，取值： F=成交。	C1
39	OrdStatus		当前订单状态，取值： 2=已成交。	C1
453	NoPartyIDs		参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、 申报交易单元号，取值为 2。	N2
投资者 帐户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户。	N4
申报交 易单元 号	448	PartyID	业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号。	N4

2.3 可转债转股业务消息规范

2.3.1 可转债转股消息流程图

根据可转债转股业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报可转债转股指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.3.2 可转债转股申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
描述: 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行可转债转股申报。	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值: D=申报。		
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10	
48	SecurityID	证券代码, 可转债代码。	C6	
38	OrderQty	转股数量, 单位手。	N10	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码, 取值为 3。	N2	
投资者 账户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户。	N4
申报交 易单元 号	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为 PBU。	N4
营业部 代码	448	PartyID	营业部代码。	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为营业部代码。	N4
58	Text	备注。	C50	

2.3.3 可转债转股申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

2.3.4 可转债转股撤单申报消息

OrderCancel Request(reqtext)	申报撤单消息
描述: 同大宗业务申报撤单消息, 买卖方向无意义	

2.3.5 可转债转股撤单申报成功响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

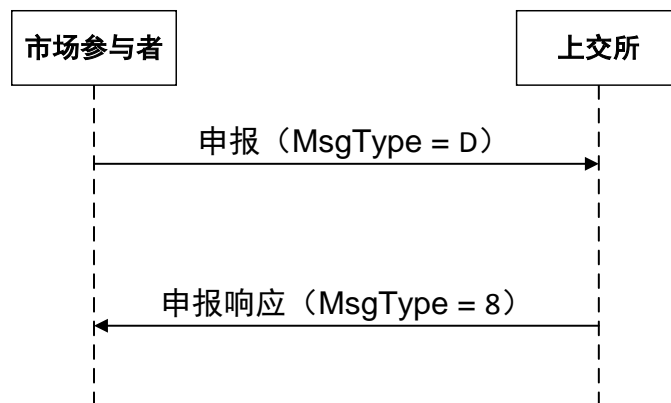
2.3.6 可转债转股撤单申报失败响应消息

OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
描述: 同大宗业务申报撤单失败响应消息。	

2.4 可交换债换股业务消息规范

2.4.1 可交换债换股消息流程图

根据可交换债换股业务规则,市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报可交换债换股指令,上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.4.2 可交换债换股申报消息

NewOrderSingle(reqtext)	申报消息
描述: 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行可交换债换股申报。	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值: D=申报。		
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10	
48	SecurityID	证券代码, 可交换债代码。	C6	
38	OrderQty	换股数量, 单位手。	N10	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码, 取值为 3。	N2	
投资者 账户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户。	N4
申报交 易单 号	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为 PBU。	N4
营业部 代码	448	PartyID	营业部代码。	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为营业部代码。	N4
58	Text	备注。	C50	

2.4.3 可交换债换股申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

2.4.4 可交换债换股撤单申报消息

OrderCancel Request(reqtext)	申报撤单消息
描述: 同大宗业务申报撤单消息， 买卖方向无意义。	

2.4.5 可交换债换股撤单申报成功响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

2.4.6 可交换债换股撤单申报失败响应消息

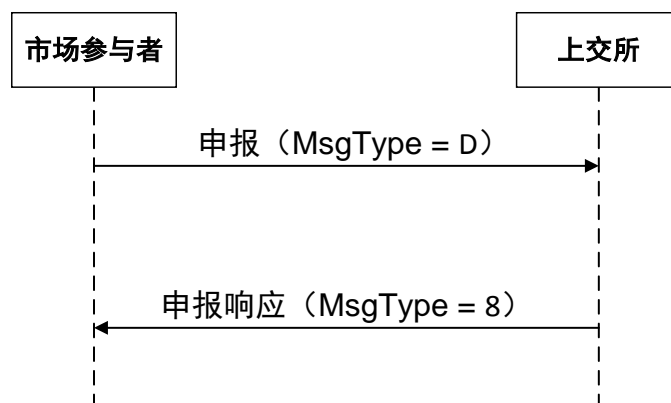
OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
描述: 同大宗业务申报撤单失败响应消息。	

2.5 债券回售业务消息规范

债券回售各批次申报及响应消息结构、撤单及响应消息结构均保持一致，以下简称债券回售。

2.5.1 债券回售消息流程图

根据债券回售业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券回售指令，上海证券交易所综合业务平台实时进行申报响应反馈。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.5.2 债券回售申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
描述: 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券回售申报。	

标签	字段名		字段描述	类型
	消息头		MsgType 取值: D=申报。	
11	CIOrdID		会员内部编号。	C10
48	SecurityID		证券代码, 回售标的债券代码。	C6
38	OrderQty		回售数量, 单位手。	N10
453	NoPartyIDs		参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码, 取值为 3。	N2
投资者 账户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户。	N4
申报交 易单 号	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为 PBU。	N4
营业部 代码	448	PartyID	营业部代码。	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为营业部代码。	N4
58	Text		备注。	C50

2.5.3 债券回售申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

2.5.4 债券回售撤单申报消息

OrderCancel Request(reqtext)	申报撤单消息
描述: 同大宗业务申报撤单消息, 买卖方向无意义	

2.5.5 债券回售撤单申报成功响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

2.5.6 债券回售撤单申报失败响应消息

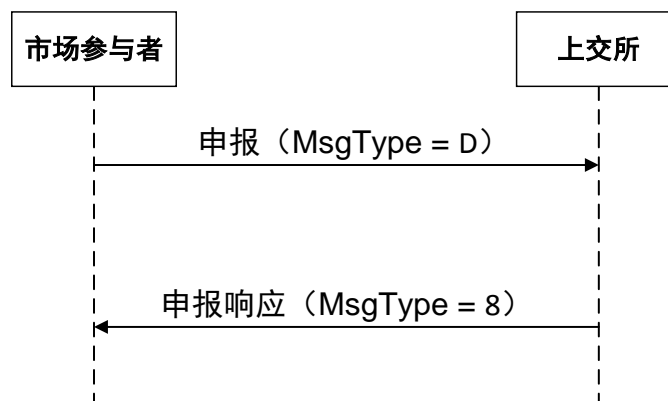
OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
描述: 同大宗业务申报撤单失败响应消息。	

2.6 债券回售撤销业务消息规范

债券回售撤销各批次申报及响应消息结构均保持一致，以下简称债券回售撤销。

2.6.1 债券回售撤销消息流程图

根据债券回售撤销业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券回售撤销指令，上海证券交易所综合业务平台实时进行申报响应反馈。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



2.6.2 债券回售撤销申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
描述: 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券回售撤销申报。	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值: D=申报。		
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10	
48	SecurityID	证券代码, 回售撤销标的债券代码。	C6	
38	OrderQty	回售撤销数量, 单位手。	N10	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码, 取值为 3。	N2	
投资者 账户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	N4
申报交 易单元 号	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为 PBU。	N4
营业部 代码	448	PartyID	营业部代码。	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为营业部代码。	N4
58	Text	备注。	C50	

2.6.3 债券回售撤销申报响应消息

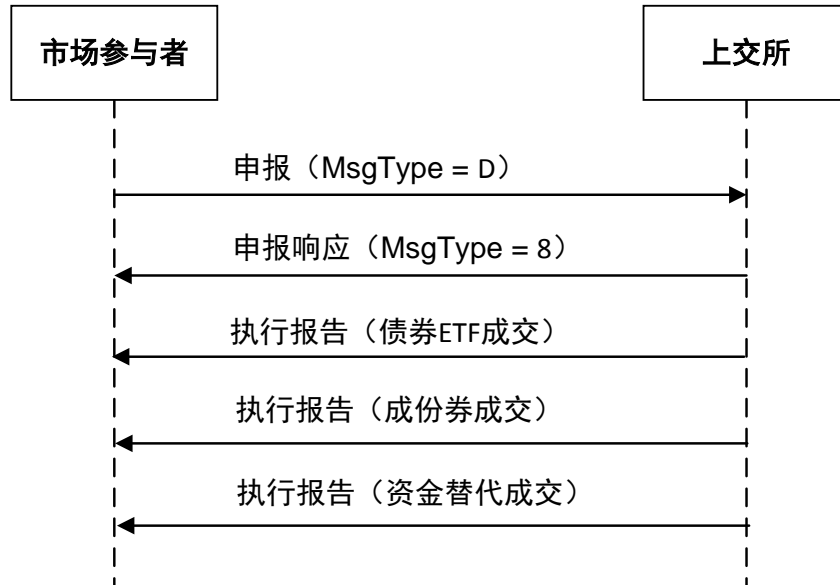
ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

3 ETF 申赎实时消息规范

3.1 ETF 申购业务消息规范

3.1.1 债券 ETF 申购消息流程图

当前仅支持债券 ETF 申赎，根据债券 ETF 申赎业务规则，市场参与者可向上海证券交易所综合业务平台申报债券 ETF 申购指令，上海证券交易所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



3.1.2 债券 ETF 申购申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
描述: 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券 ETF 申购申报。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值: D=申报。	
11	CIOrdID	会员内部编号。	C10
48	SecurityID	证券代码, 债券 ETF 二级市场交易代码。	C6
38	OrderQty	申购份额数量。	N10

453	NoPartyIDs		参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码，取值为3。	N2
投资者 账户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取5，表示当前PartyID的取值为投资者帐户。	N4
申报交 易单 元 号	448	PartyID	业务PBU代码，填写5位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取1，表示当前PartyID的取值为PBU。	N4
营业部 代码	448	PartyID	营业部代码。	C5
	452	PartyRole	取4001，表示当前PartyID的取值为营业部代码。	N4
58	Text		备注。	C50

3.1.3 债券ETF申购申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述： 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

3.1.4 债券ETF申购执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
描述： 执行报告表中的execreporttext字段数据。 对于债券ETF申购申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录，如下： <ol style="list-style-type: none"> 1、一条执行报告类型为1、辅助证券代码为债券ETF二级市场交易代码、成交金额为0、成交数量为申购数量，买卖方向为1的成交记录。 2、若干条执行报告类型为2、辅助证券代码为债券ETF成份证券代码、成交金额为0，成交数量为过户数量，买卖方向为2的成交记录。 3、一条执行报告类型为3、成交金额为现金替代总额、成交数量为0、买卖方向为1的成交记录。（注：如无资金替代，则无该条执行报告。） 基金公司作为对手方收到的执行报告与投资者收到的执行报告买卖方向相反。	

序号	字段名	字段描述	类型
----	-----	------	----

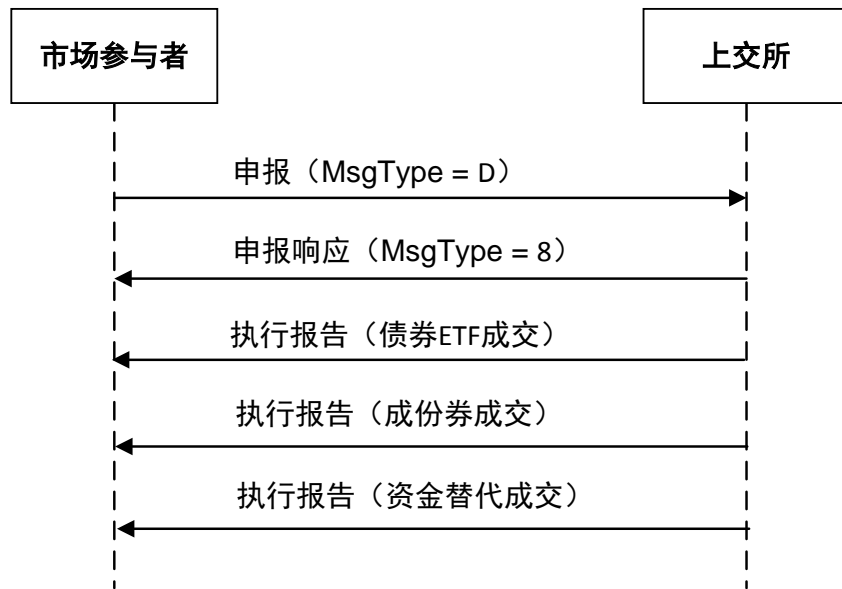
	消息头		MsgType 取值: 8=成交回报。	
11	ClOrdID		会员内部编号, 对于基金公司填写对手方投资者证券账户。	C10
37	OrderID		交易所订单编号。	C16
17	ExecID		成交编号, 目前本业务有效位用到 10 位。	C16
48	SecurityID		证券代码, 债券 ETF 交易代码。	C6
856	TradeReportType		执行报告类型。取值: 1=债券 ETF 成交; 2=债券 ETF 成份券成交; 3=资金替代成交。	C1
455	SecurityAltID		辅助证券代码, 取值为债券 ETF 或成份券证券代码, 当 TradeReportType 取值为 1、2 时有效, 其余默认为空。	C6
32	LastQty		成交数量, 当 TradeReportType 取值为 1、2 时有效, 其余默认为 0。	N12
555	NoLeges		资金替代组合数量, 当 TradeReportType 取值为 3 时有效, 其余默认为 0。取值不超过 3, 后接重复组。	N2
现金替代组合	1644	MarginAmtType	资金类型, 取值: 1=沪市资金; 2=深市资金; 9=非沪深资金。	C1
	8504	TotalValueTraded	成交金额, 单位为元。	N16(3)
8503	NumTrades		执行报告记录总条数。	N12
54	Side		买卖方向, 取值: 1=买; 2=卖。	C1
60	TransactTime		订单执行时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。	C21
42	OrigTime		原订单请求接收的时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。	C21

150	ExecType	当前订单执行状态，取值： F=成交。	C1
453	NoPartyIDs	参与方个数，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号，取值为2。	N2
投资者 帐户	448	PartyID	投资者帐户。
	452	PartyRole	取5，表示当前PartyID的取值为投资者帐户。
申报交 易单元 号	448	PartyID	业务PBU代码，填写5位交易单元号。
	452	PartyRole	取1，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号。

3.2 ETF 赎回业务消息规范

3.2.1 债券 ETF 赎回消息流程图

当前仅支持债券ETF申赎，根据债券ETF申赎业务规则，市场参与者可向上交所综合业务平台申报债券ETF赎回指令，上交所综合业务平台实时反馈申报确认。下图描述了市场参与者系统与上交所系统间消息交互时序。



3.2.2 债券 ETF 赎回申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
描述:	

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行债券 ETF 赎回申报。	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值: D=申报。		
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10	
48	SecurityID	证券代码, 债券 ETF 二级市场交易代码。	C6	
38	OrderQty	赎回份额数量。	N10	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码, 取值为 3。	N2	
投资者 账户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户。	N4
申报交 易单 号	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为 PBU。	N4
营业部 代码	448	PartyID	营业部代码。	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为营业部代码。	N4
58	Text	备注。	C50	

3.2.3 债券 ETF 赎回申报响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
描述: 同大宗业务申报响应消息/申报撤单成功响应消息。	

3.2.4 债券 ETF 赎回执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
描述:	

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
执行报告表中的 <code>execreporttext</code> 字段数据。 对于债券 ETF 赎回申报，投资者执行报告（即成交回报）有如下消息记录，如下： <ol style="list-style-type: none"> 1、一条执行报告类型为 1、辅助证券代码为债券 ETF 二级市场交易代码、成交金额为 0、成交数量为申购数量，买卖方向为 2 的成交记录。 2、若干条执行报告类型为 2、辅助证券代码为债券 ETF 成份证券代码、成交金额为 0，成交数量为过户数量，买卖方向为 1 的成交记录。 3、一条执行报告类型为 3、成交金额为现金替代总额、成交数量为 0、买卖方向为 2 的成交记录。（注：如无资金替代，则无该条执行报告。） 基金公司作为对手方收到的执行报告与投资者收到的执行报告买卖方向相反。	

序号	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值： 8=成交回报。		
11	ClOrdID	会员内部编号，对于基金公司填写对手方投资者证券账户。	C10	
37	OrderID	交易所订单编号。	C16	
17	ExecID	成交编号，目前本业务有效位用到 10 位。	C16	
48	SecurityID	证券代码，填写债券 ETF 交易代码。	C6	
856	TradeReportType	执行报告类型。取值如下： 1=债券 ETF 成交； 2=债券 ETF 成份券成交； 3=资金替代成交。	C1	
455	SecurityAltID	辅助证券代码，取值为债券 ETF 或成份券证券代码，当 TradeReportType 取值为 1、2 时有效，其余默认为空。	C6	
32	LastQty	成交数量，当 TradeReportType 取值为 1、2 时有效，其余默认为 0。	N12	
555	NoLeges	资金替代组合数量，当 TradeReportType 取值为 3 时有效，其余默认为 0，取值不超过 3，后接重复组。	N2	
现金替	1644	MarginAmtT	资金类型，取值：	C1

代组合		ype	1=沪市资金; 2=深市资金; 9=非沪深资金。	
	8504	TotalValueTraded	成交金额, 单位为元。	N16(3)
8503	NumTrades		执行报告记录总条数。	N12
54	Side		买卖方向, 取值: 1=买; 2=卖。	C1
60	TransactTime		订单执行时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。	C21
42	OrigTime		原订单请求接收的时间, 式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000。	C21
150	ExecType		当前订单执行状态, 取值: F=成交。	C1
453	NoPartyIDs		参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号, 取值为 2。	N2
投资者 帐户	448	PartyID	投资者帐户。	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户。	N4
申报交 易单元 号	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号。	N4

4 债券非交易盘前数据接口

4.1 债券非交易基础信息接口 **zfjyyyyymmdd.xml**

zfjyyyyymmdd.xml	债券非交易基础信息接口
描述: 本文件包含债券非交易相关基础信息数据；文件名中 yyyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期；交易日开市前该文件通过单向卫星等渠道向市场发送；文件格式为 xml 格式，中文字符采用 GBK 编码，每条债券非交易信息对应 XML 中一条 Non_Trd_Rec 记录。	

zfjyyyyymmdd.xml		债券非交易基础信息（债券质押式回购出入库）	
序号	字段名称	描述	类型
1	Inst_ID	证券代码。	C6
2	Inst_Nam	证券简称。	C8
3	Busi_Typ	业务类型： BPD=债券质押式回购入库； BPW=债券质押式回购出库。	C3
4	Nts_Bgn_Dat	订单输入开始日期。	C8
5	Nts_End_Dat	订单输入结束日期。	C8
6	Rond_Lot_Qty	整手数，申报订单数量必须为该字段取值的整数倍，基金单位为份。	N12
7	Min_Ord_Qty	申报订单的最小订单数量，债券单位为手，基金单位为份。	N12
8	Max_Ord_Qty	申报订单的最大订单数量，债券单位为手，基金单位为份。	N12

zfjyyyyymmdd.xml		债券非交易基础信息（转股、换股）	
序号	字段名称	描述	类型
1	Inst_ID	证券代码。	C6
2	Inst_Nam	证券简称。	C8

3	Busi_Typ	业务类型： BES=可转换债转股； BSS=可交换债换股。	C3
4	Tar_Inst_ID	转股/换股目标证券代码。	C6
5	Tar_Inst_Nam	转股/换股目标证券简称。	C8
6	Nts_Bgn_Dat	订单输入开始日期。	C8
7	Nts_End_Dat	订单输入结束日期。	C8
8	Rond_Lot_Qty	整手数，申报订单数量必须为该字段取值的整数倍。	N12
9	Min_Ord_Qty	申报订单的最小订单数量，债券单位为手。	N12
10	Max_Ord_Qty	申报订单的最大订单数量，债券单位为手。	N12
11	Non_Trd_Prc	转股/换股价格，单位为元。	N13(5)

zfjyyyyymmdd.xml		债券非交易基础信息（回售、回售撤销）	
序号	字段名称	描述	类型
1	Inst_ID	证券代码。	C6
2	Inst_Nam	证券简称。	C8
3	Busi_Typ	业务类型： BSB=债券回售； BSC=债券回售撤销。	C3
4	Nts_Bgn_Dat	订单输入开始日期。	C8
5	Nts_End_Dat	订单输入结束日期。	C8
6	Rond_Lot_Qty	整手数，申报订单数量必须为该字段取值的整数倍。	N12
7	Min_Ord_Qty	申报订单的最小订单数量，债券单位为手。	N12
8	Max_Ord_Qty	申报订单的最大订单数量，债券单位为手。	N12
9	Non_Trd_Prc	回售价格，单位为元。	N13(5)

5 基金非交易盘前数据接口

5.1 基金非交易基础信息接口 jfjyyyyymmdd.xml

jfjyyyyymmdd.xml	基金非交易基础信息接口
<p>描述:</p> <p>本文件包含基金非交易相关基础信息数据（目前仅包含债券 ETF 申赎）；文件名中 yyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期；交易日开市前该文件通过单向卫星等渠道向市场发送；文件格式为 XML 格式，中文字符采用 GBK 编码，每条基金非交易信息对应 XML 中一条 Non_Trdd_Rec 记录。</p>	

jfjyyyyymmdd.xml		基金非交易基础信息接口（单市场/跨市场ETF申赎）	
序号	字段名称	字段描述	类型
1	Inst_ID	证券代码。	C6
2	Inst_Nam	证券简称。	C8
3	Busi_Typ	业务类型： IEC=单市场/跨市场 ETF 申购； IER=单市场/跨市场 ETF 赎回。	C3

6 债券盘后数据接口

6.1 债券过户数据 zqghXXXXX.txt

zqghXXXXX.txt	债券过户数据接口
描述: 文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。 (1) 仅包含质押式回购出入库过户记录, 可转债转股、可交换债换股、债券回售、债券回售撤销, 不产生过户记录, 最终以登记公司的相关数据为准。	

序号	字段名称	字段描述	类型
1	证券账户		C10
2	成交日期	格式为 YYYYMMDD。	C8
3	成交编号		N16
4	交易单元		C5
5	成交数量	债券单位单位为手, 基金单位为份。	N15(3)
6	证券代码		C6
7	申报时间	格式为 HHMMSS。	C6
8	成交时间	格式为 HHMMSS。	C6
9	成交价格	单位为元。	N13(5)
10	成交金额	单位为元。	N18(5)
11	会员内部编号		C10
12	买卖方向	取值: B=买; S=卖。	C1
13	业务类型	取值: BPD=债券质押式回购入库; BPW=债券质押式回购出库。	C3
14	信用标签	预留, 用于扩展, 默认为空格。	C2

7 基金盘后数据接口

7.1 基金过户数据接口 jjghXXXXX.txt

jjghXXXXX.txt	基金过户数据接口
描述: 文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。 (1) 目前仅包含债券 ETF 申赎过户记录。	

序号	字段名称	字段描述	类型
1	证券账户		C10
2	成交日期	格式为 YYYYMMDD。	C8
3	成交编号		N16
4	交易单元		C5
5	证券代码	针对业务类型 IEC、IER 有效，填写债券 ETF 交易代码。	C6
6	记录类型	针对业务类型 IEC、IER 有效，取值： 1=债券 ETF 成交； 2=债券 ETF 成份券成交； A=沪市资金； B=深市资金； I=非沪深资金。	C1
7	辅助证券代码	记录类型为 1、2 时有效，取值为债券 ETF 或成份券证券代码，其余默认为空。	C6
8	申报时间	格式为 HHMMSS。	C6
9	成交时间	格式为 HHMMSS。	C6
10	成交价格	默认为 0。	N13(5)
11	成交数量	记录类型为 1、2 时有效，其余默认为 0；基金单位为份，债券单位为手。	N15(3)
12	成交金额	记录类型为 A、B、I 时有效，其余默认为 0，单位为元。	N18(5)
13	会员内部编号		C10

14	买卖方向	取值： B=买； S=卖。	C1
15	业务类型	取值： IEC=单市场/跨市场 ETF 申购； IER=单市场/跨市场 ETF 赎回。	C3