

上海证券交易所  
交易网关接口规格说明书  
(期权平台)  
**V1.0**



**2023 年 9 月**

## 文档版本

日期	版本	说明
2019-12-18	0.1	创建文档
2020-02-25	0.2	<ol style="list-style-type: none"> <li>1.调整回报消息的发送和恢复模式，相应合并两个通道，替换最大序号查询和重传消息类型为回报序号同步消息，删除与多个通道相关的内容；</li> <li>2. 补充了业务申报时间；</li> <li>3. 增加各业务申报消息流图；</li> <li>4. 对订阅进行说明；</li> <li>5. 对 STEP 格式约定进行修正；</li> <li>6. STEP 结构前增加长度域；</li> <li>7. 回报消息在 STEP 结构外增加业务类型 ReqID；</li> <li>8. 平台信息-&gt;执行报告信息，增加执行报告所属 PBU 列表；</li> <li>9. 调整字节序为大端；</li> <li>10. 调整文字及格式；</li> <li>11. 修复部分示意图文字混乱的情况，增加少量文字说明。</li> </ol>
2020-03-26	0.3	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 根据反馈增加各类业务申报响应 STEP 结构中的申报字段；</li> <li>2. 因字段增加需要，原 STEP 结构无法满足需求，相应调整各类业务的申报响应 STEP 结构，对其按业务进行拆分，其中： <ol style="list-style-type: none"> <li>(a) 普通申报响应、组合与拆分响应分为不同的结构；</li> <li>(b) 非交易响应根据业务类型分为不同的结构，分别对应证券锁定与解锁、行权、行权合并、转处置证券账户等不同业务；</li> <li>(c) 相应增加区分不同 STEP 结构的 STEP 类型 U13-U17，移除 U10；</li> </ol> </li> <li>2. 增加对同步序号请求中 NextRptIndex 取值大于 0 的说明；</li> <li>3. 移除无用的冻结/解冻循环体；</li> <li>4. 相应调整了第三章中的消息流图（各非交易及组合拆分，图片替换未开修订）；</li> <li>5. 纠正部分文字描述不准确的内容。</li> </ol>
2020-04-01	0.4	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 还原撤单失败响应中被移除的 CxlRejResponseTo 字段；</li> <li>2. 根据反馈在 OTO 申报响应 STEP 结构中增加 OrdType 和 TimelnForce 字段；</li> </ol>

		<p>3. 纠正了附录四中映射不正确的字段并予以说明；</p> <p>4. STEP 结构中的字段名微调，补充 OTT 业务响应中缺失的 OrdRejReason。</p>
2020-05-13	0.5	<p>1. 新增业务类型 OQO，包括：</p> <p>    (a) 新增期权双边报价订单消息流；</p> <p>    (b) 新增期权双边报价申报响应 STEP 结构；</p> <p>2. 补充申报消息约定内容。</p> <p>3. 修订订阅次数和当日不可修改的限制。</p>
2020-08-18	0.6	<p>1. 新增期权双边报价撤单申报消息结构</p> <p>2. 新增期权双边报价撤单申报响应消息结构</p> <p>3. 调整撤单指令消息流程图 3.2.2.4</p> <p>4. 配合后台改造 OC/TC 时序，调整期权订单申报消息流</p> <p>5. 补充交易所强平消息流程图</p> <p>6. 更新期权双边报价订单申报消息</p>
2020-09-02	0.7	<p>1. 调整行权合并申报的申报时间</p>
2020-09-11	0.8	<p>1. 申报响应及撤单成功响应增加 OwnerType</p> <p>2. 组合与拆分响应增加 OwnerType</p> <p>3. 行权指令合并申报时间调整为与行权申报一致</p> <p>4. 修订期权双边报价申报/撤单申报消息结构 BidPx、OfferPx、BidSize、OfferSize 文字说明</p>
2021-02-08	0.9	<p>1. 对分区同步序号请求（ExecRptIndexSync）中 NextRptIndex 字段的取值范围予以补充说明。</p> <p>2. 调整消息扩展小节部分文字说明</p>
<u>2023-09-08</u>	<u>1.0</u>	<p><u>1. 补充“执行报告”的相关描述，增加数据持久化的要求。</u></p> <p><u>2. 补充“执行报告”中分区（SetID）的相关描述，删除本档中业务类型与分区的固定对应关系描述，实际的分区信息应以执行报告信息 ExecRtpInfo 推送的数据为准。</u></p>

目录

第一章 前言 .....	6
1.1 目的 .....	6
1.2 术语和定义 .....	6
1.3 参考文档 .....	6
1.4 联系方式 .....	7
第二章 系统简介 .....	8
2.1 系统接入 .....	8
2.2 业务范围 .....	8
第三章 交互机制 .....	10
3.1 会话机制 .....	10
3.1.1 建立会话 .....	10
3.1.2 关闭会话 .....	10
3.1.3 维持会话 .....	11
3.1.4 其他约定 .....	11
3.2 申报与回报 .....	11
3.2.1 业务类型 .....	12
3.2.2 申报消息流图 .....	13
3.2.3 平台状态 .....	18
3.2.4 重复订单 .....	19
3.2.5 执行报告 .....	20
3.3 恢复场景 .....	22
3.4 订阅机制 .....	23
第四章 消息定义 .....	24
4.1 消息结构 .....	24
4.1.1 STEP 格式约定 .....	25
4.2 会话消息 .....	25
4.2.1 Logon 登录 .....	25
4.2.2 Logout 注销 .....	26
4.2.3 Heartbeat 心跳 .....	26
4.3 申报消息 .....	27
4.3.1 申报 STEP 结构 .....	28
4.4 回报消息 .....	40
4.4.1 执行报告 Execution Report .....	40
4.4.2 一般响应 General Response .....	56
4.4.3 申报拒绝 Order Request Reject .....	58
4.5 其他消息 .....	58
4.5.1 平台状态 PlatformState .....	58
4.5.2 执行报告信息 ExecRptInfo .....	59
4.5.3 分区序号同步 ExecRptIndexSync .....	59
4.5.4 分区执行报告结束 ExecRptEndOfStream .....	60
第五章附录 .....	61
5.1 附一 计算校验和 .....	61
5.2 附二 PBU 及说明 .....	61

---

5.3 附三错误代码说明 .....	62
5.4 附四 EzSTEP 接口库映射 .....	62
5.4.1 申报请求 .....	62
5.4.2 执行报告 .....	63
5.4.3 一般响应/申报拒绝 .....	63

# 第一章 前言

## 1.1 目的

本接口规范描述了会员等市场参与者与上海证券交易所（以下称本所）交易网关之间进行交易数据交换时所采用的交互机制、数据格式、数据定义和数据内容。目前，本接口规范仅适用于本所期权平台交易系统提供的业务。

## 1.2 术语和定义

名词	含义
TDGW	TraDing GateWay 交易网关
OMS	Order Management System 用户订单管理系统 会员等市场参与者通过 OMS 接入 TDGW 并进行交易数据交换
PBU	Participant Business Unit 市场参与者交易业务单元
EzCS	Easy Communication Server 轻型化通信服务器

## 1.3 参考文档

名称
《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》
《IS111 上海证券交易所报盘软件错误代码表》

## 1.4 联系方式

技术服务 QQ 群： 298643611

技术服务电话: 4009003600(8:00-20:00)

电子邮件: [tech\\_support@sse.com.cn](mailto:tech_support@sse.com.cn)

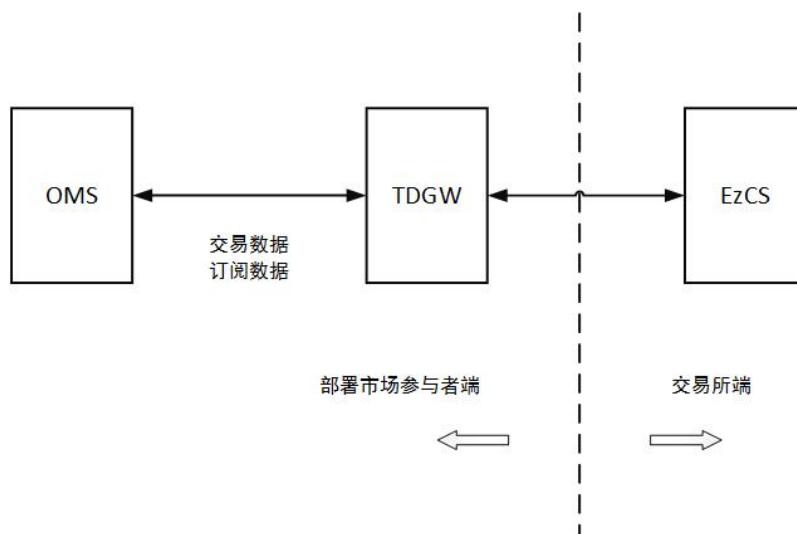
技术服务微信公众号: SSE-TechService (回复 00 进入人工服务)



## 第二章 系统简介

### 2.1 系统接入

为满足业务发展需求和提升交易服务水平，本所通过交易网关（TDGW）对接现有期权交易系统，提供实时交易流接口。TDGW 对接交易系统及市场参与者系统（OMS）的架构示意图如下：



TDGW 通过数字证书和交易业务单元（PBU）登录并接入交易系统，证书及 PBU 的配置由用户提前在 TDGW 端完成。

TDGW 每个平台开放一个端口供 OMS 建立会话，TDGW 仅接受 OMS 为每个平台建立一个 TCP/IP 连接，每个连接仅允许建立一个有效的会话。该会话既用于接收 OMS 的业务申报，又向 OMS 推送交易所接收申报后产生的回报数据。此外，TDGW 也可订阅其他登录 PBU 的回报数据，一并通过该会话进行转发。目前，TDGW 仅支持期权平台。

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

附录二对术语 PBU 在不同场景下的使用进行了说明。

### 2.2 业务范围

目前支持期权平台相关业务：

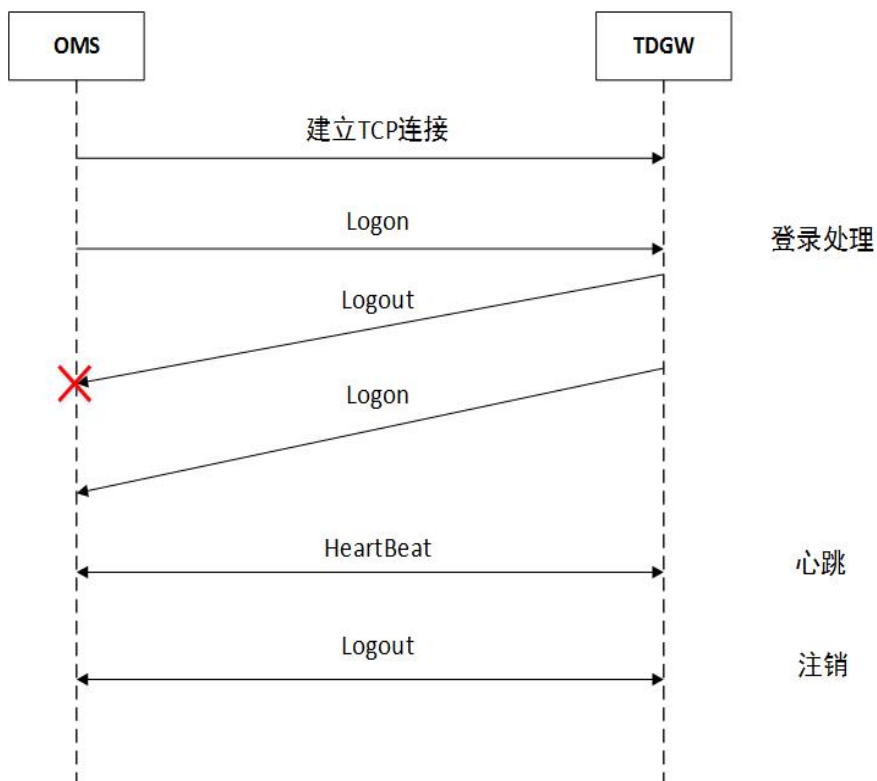


平台	业务	业务申报时间
期权	期权订单申报 Option Trading Order Entry	9:15 – 9:25
	期权双边报价订单申报 Option Quote Order Entry	9:30 – 11:30
	证券锁定与解锁 Option Trading Underlying Freeze	13:00 – 15:00
	组合与拆分 Option Multiple Leg	9:30 – 11:30 13:00 – 15:15
	行权/撤销行权 Option Trading Execution	9:15 – 9:25 9:30 – 11:30 13:00 – 15:30
	会员申请转处置证券账户 Option Trading Transfer for Execution	
	保证金查询 Option Margin Requirement	
	行权合并申报 Option Trading Combination Execution	

## 第三章 交互机制

### 3.1 会话机制

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



#### 3.1.1 建立会话

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

#### 3.1.2 关闭会话

会话建立成功后，连接双方均可发送 Logout 注销消息，告知对端将关闭会话，一般地，接收方应回复一个 Logout 消息作为回应。Logout 的发起方在收到回应后关闭连接。如果超

过 5 秒没有收到对方回传的 Logout 消息，注销发起方也可直接关闭连接。连接双方在发送 Logout 消息后不应再发送任何消息。

### 3.1.3 维持会话

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

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

接收方接收到任何消息（不仅仅是心跳）可重置读心跳间隔计数。若接收方在 2 个心跳间隔内未收到任何消息，则可以认为会话出现异常并立即关闭连接。OMS 关闭连接后，可重新发起会话或切换至其他 TDGW。

### 3.1.4 其他约定

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

此外，TDGW 在以下情况下会主动断开与 OMS 间的连接：

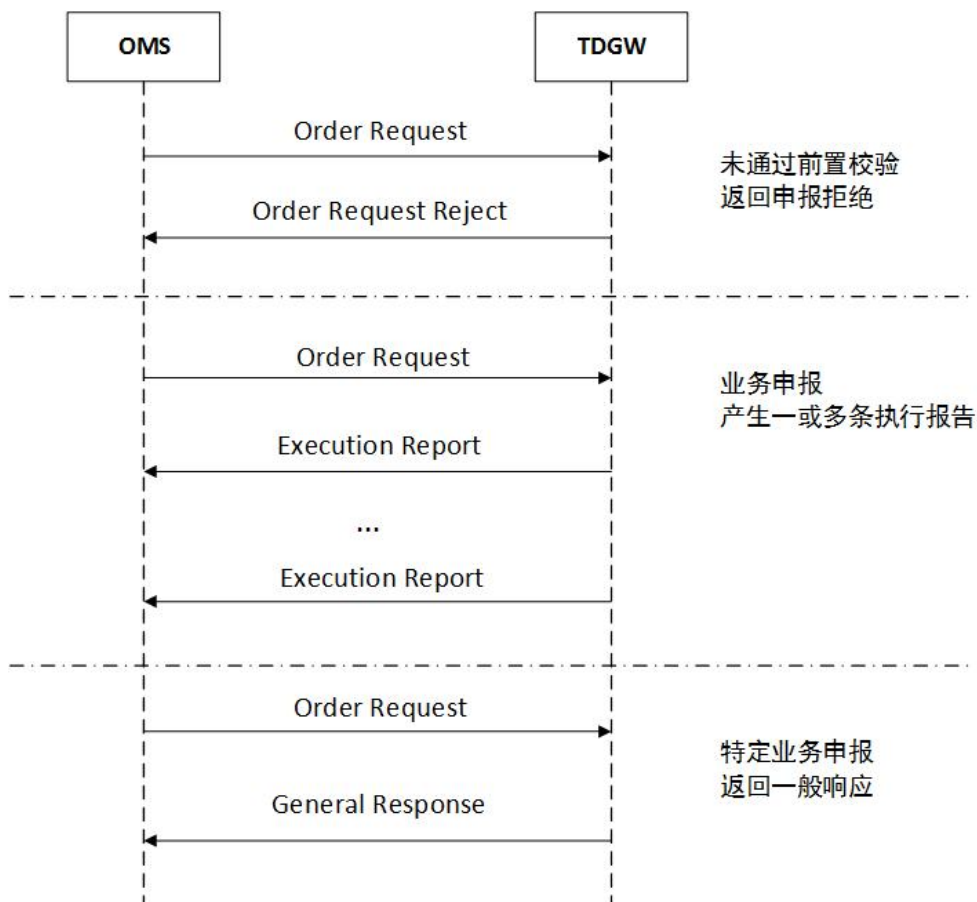
- OMS 与 TDGW 建立 TCP 连接之后，超过 5 秒未完成登录；
- OMS 在登录失败之后，未在 5 秒内关闭连接；
- OMS 在发起注销后，未在 5 秒内关闭连接；
- OMS 未能及时处理 TDGW 下行消息，导致 TDGW 内积压的待发送消息超过特定阈值；
- TDGW 与 EzCS 间的连接已经断开；

## 3.2 申报与回报

OMS 通过申报请求（Order Request）进行订单申报，对于交易系统前置校验未通过的申报，TDGW 将返回申报拒绝（Order Request Reject）消息。

对于通过前置校验的申报，交易系统根据业务的不同，以执行报告（Execution Report）或一般响应（General Response）作为相应的回报消息返回 OMS。目前，仅期权平台的保证金查询响应以 General Response 形式返回，其余业务若通过前置校验，以 Execution Report 形式返回。Execution Report 主要包括委托确认响应和成交回报。

Execution Report 为可依据编号进行恢复重传的回报，Order Request Reject 及 General Response 为不可恢复的回报。



### 3.2.1 业务类型

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

业务	业务类型 (ReqID)	执行报告分区 (SetID)	允许撤单	申报确认/查询响应	成交确认

期权订单申报 Option Trading Order Entry	OTO	300	Y	Y	Y
期权双边报价订单申报 Option Quote Order Entry	OQO	300	Y	Y	Y
证券锁定与解锁 Option Trading Underlying Freeze	OTU	300	N	Y	N
行权/撤销行权 Option Trading Execution	OTE	301	Y	Y	N
行权合并申报 Option Trading Combination Execution	OCE	301	Y	Y	N
会员申请转处置证券账户 Option Trading Transfer for Execution	OTT	301	Y	Y	N
组合与拆分 Option Multiple Leg	OML	302	N	Y	Y
保证金查询 Option Margin Requirement	OMR	N/A	N	Y*	N

注 1: Y 为是, N 为否。

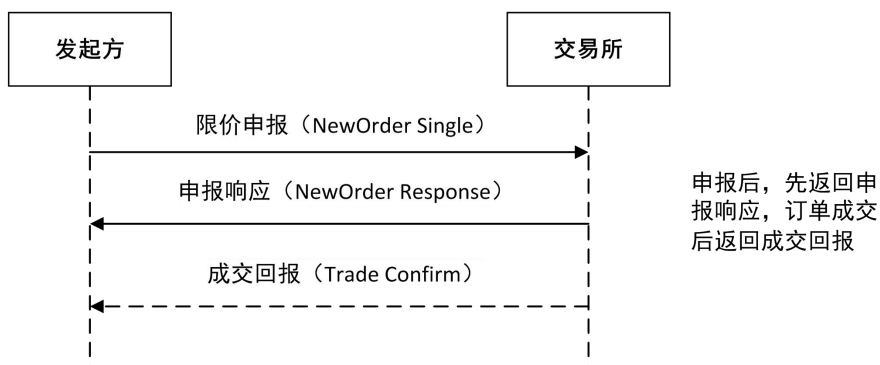
注 2(\*): OMR 保证金查询指令返回一般响应, 不可重传, 每次仅返回最新的查询结果。

### 3.2.2 申报消息流图

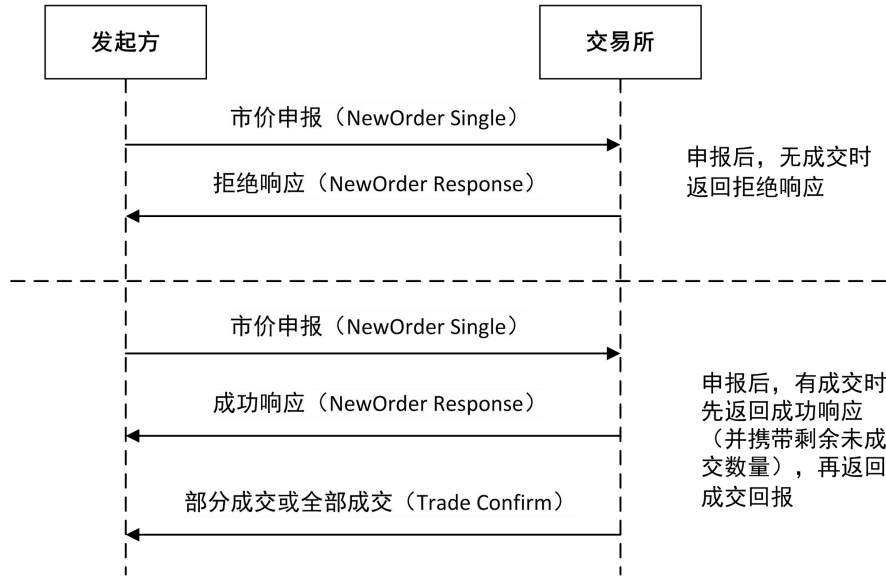
#### 3.2.2.1 期权订单申报消息流

适用于期权订单申报 (OTO) 业务类型。

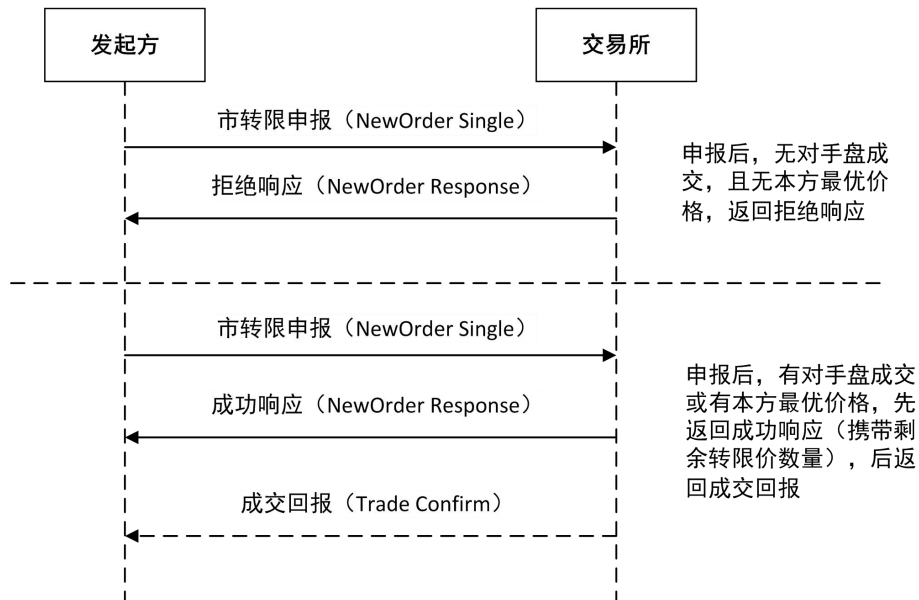
限价订单 (OrdType=2) 消息流如下:



市价订单 (OrdType=1) 消息流如下:

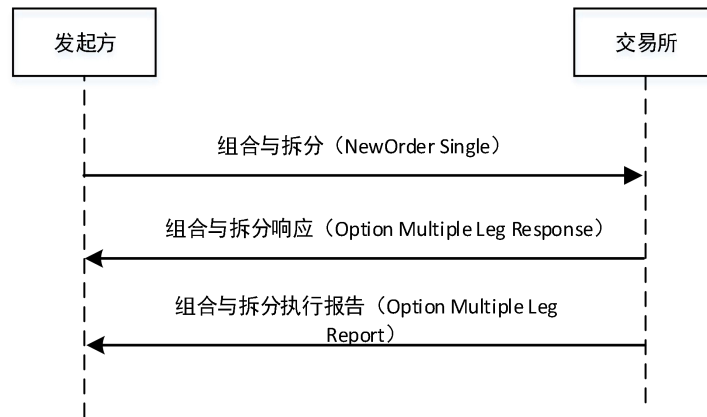


市价剩余转限价订单 (OrdType=K) 消息流如下:



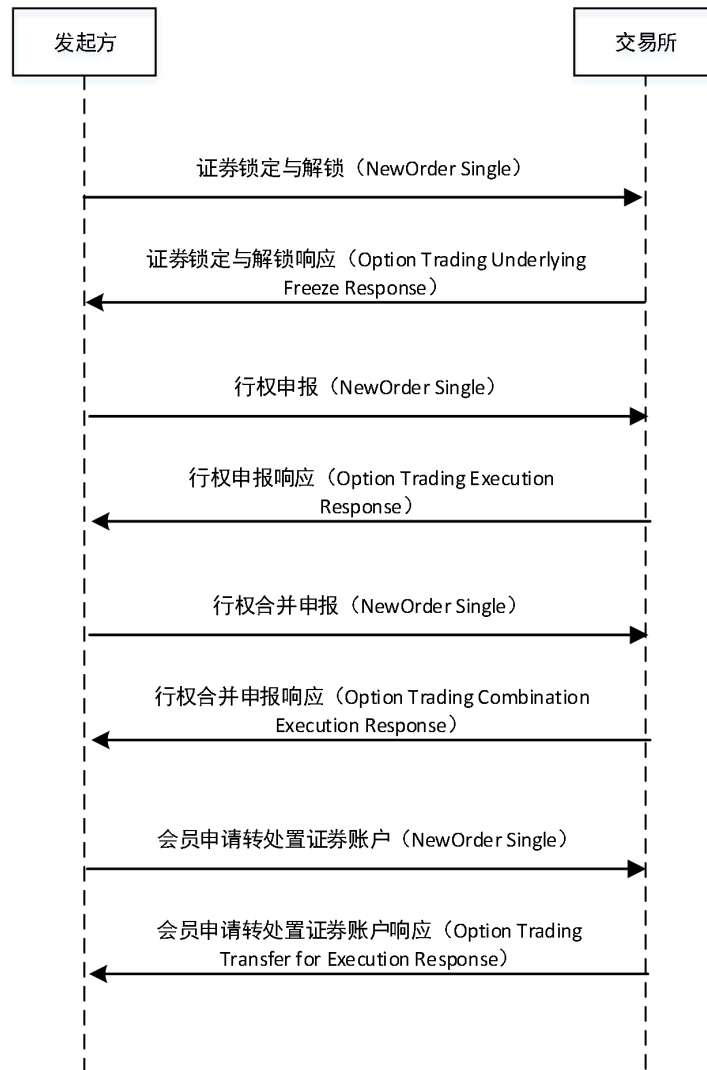
### 3.2.2.2 组合与拆分消息流

适用于组合与拆分 (OML) 业务类型。



### 3.2.2.3 非交易指令消息流

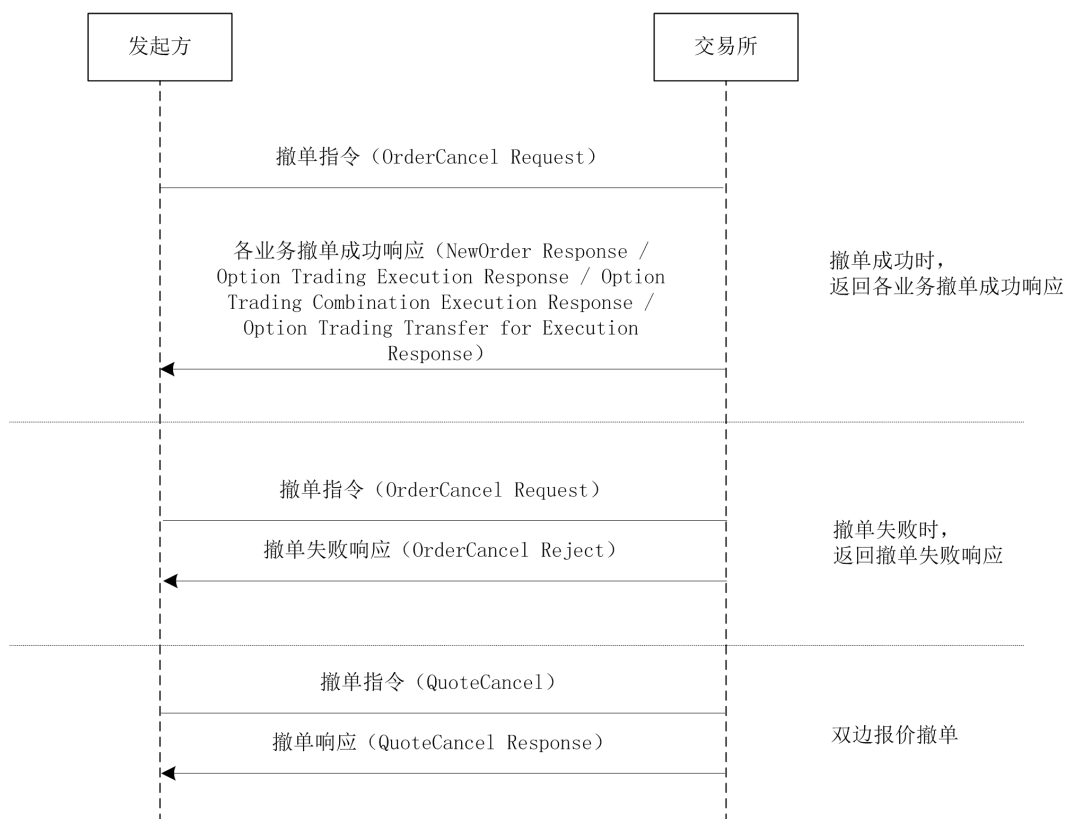
适用于非交易指令：证券锁定与解锁（OTU）、行权/撤销行权（OTE）、行权合并申报（OCE）、会员申请转处置证券账户（OTT）。



### 3.2.2.4 撤单指令消息流

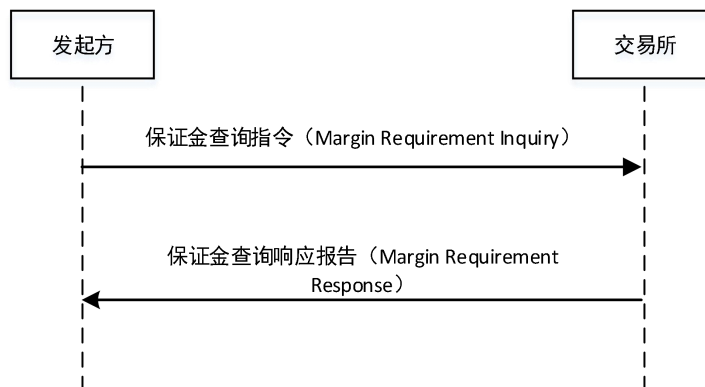
支持撤单的业务类型见 3.2.1 业务类型表。





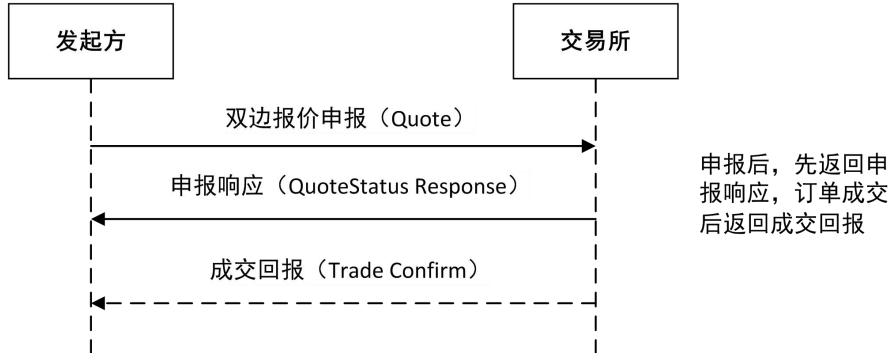
### 3.2.2.5 保证金查询指令消息流

适用于保证金查询业务类型（OMR）。



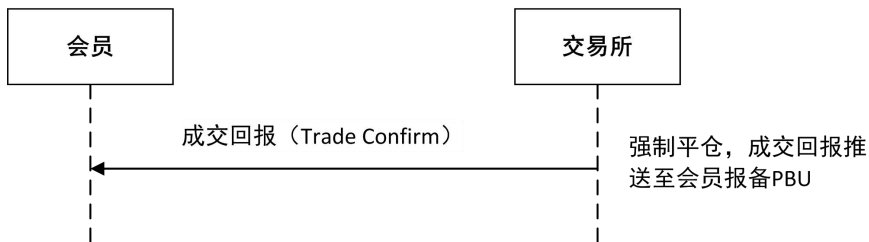
### 3.2.2.6 期权双边报价订单申报消息流

适用于期权双边报价订单申报（OQO）业务类型。



### 3.2.2.7 交易所强平指令消息流

适用于交易所强制平仓业务。



### 3.2.3 平台状态

OMS 向 TDGW 进行申报应符合交易时间表<sup>1</sup>要求。TDGW 依据交易时间表对平台状态进行了划分，示意图如下。



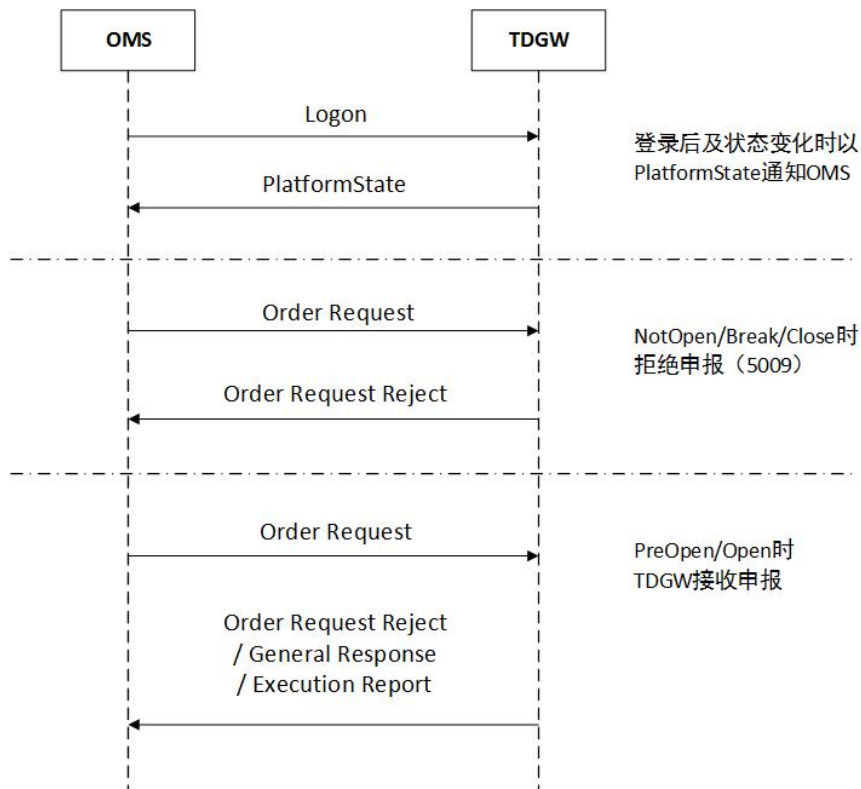
处于 NotOpen、Break、Close 状态时不接收申报，TDGW 通过错误原因 5009 的一般响应予以拒绝。PreOpen<sup>2</sup>状态下，TDGW 提前接收 OMS 的申报，并在 Open 时向交易系统转发。

<sup>1</sup>时间表以本所交易规则为准。

<sup>2</sup>目前，设置 PreOpen 为各交易时段 Open 前的 5 秒。以交易时段 9:15-9:25 为例，9:14:55TDGW 转为 PreOpen，9:15:00 TDGW 转为 Open 状态。

因此 PreOpen 及 Open 时 TDGW 接收 OMS 的申报，但申报是否被交易系统主机接受应以交易系统的回报为准。

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

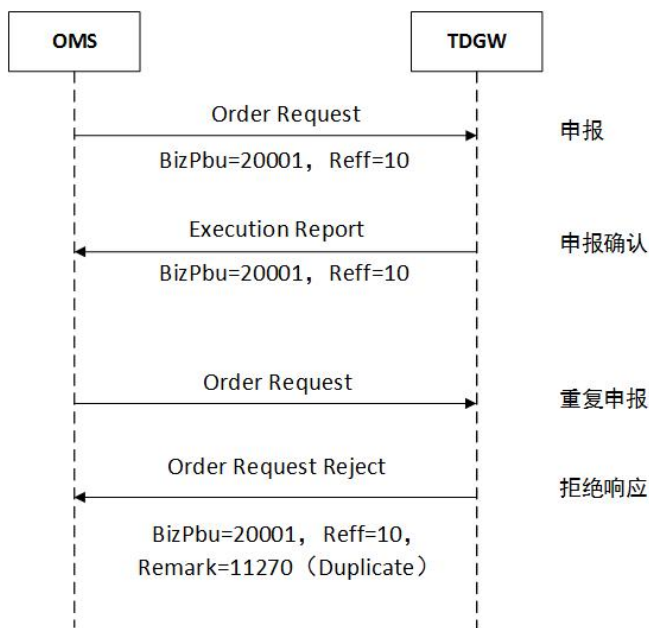


### 3.2.4 重复订单

交易系统依据申报请求消息（Order Request）中的以下字段判断申报是否为重复订单：

业务 PBU（BizPbu） + 客户订单编号（Reff）

对于重复订单，TDGW 返回错误原因 11270 的 Order Request Reject 拒绝消息。



对于特定业务，交易系统不校验上述重复订单，而是返回最新的响应结果。目前，此类申报有：

业务	业务类型(ReqID)
保证金查询指令 Option Margin Requirement	OMR

### 3.2.5 执行报告

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

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

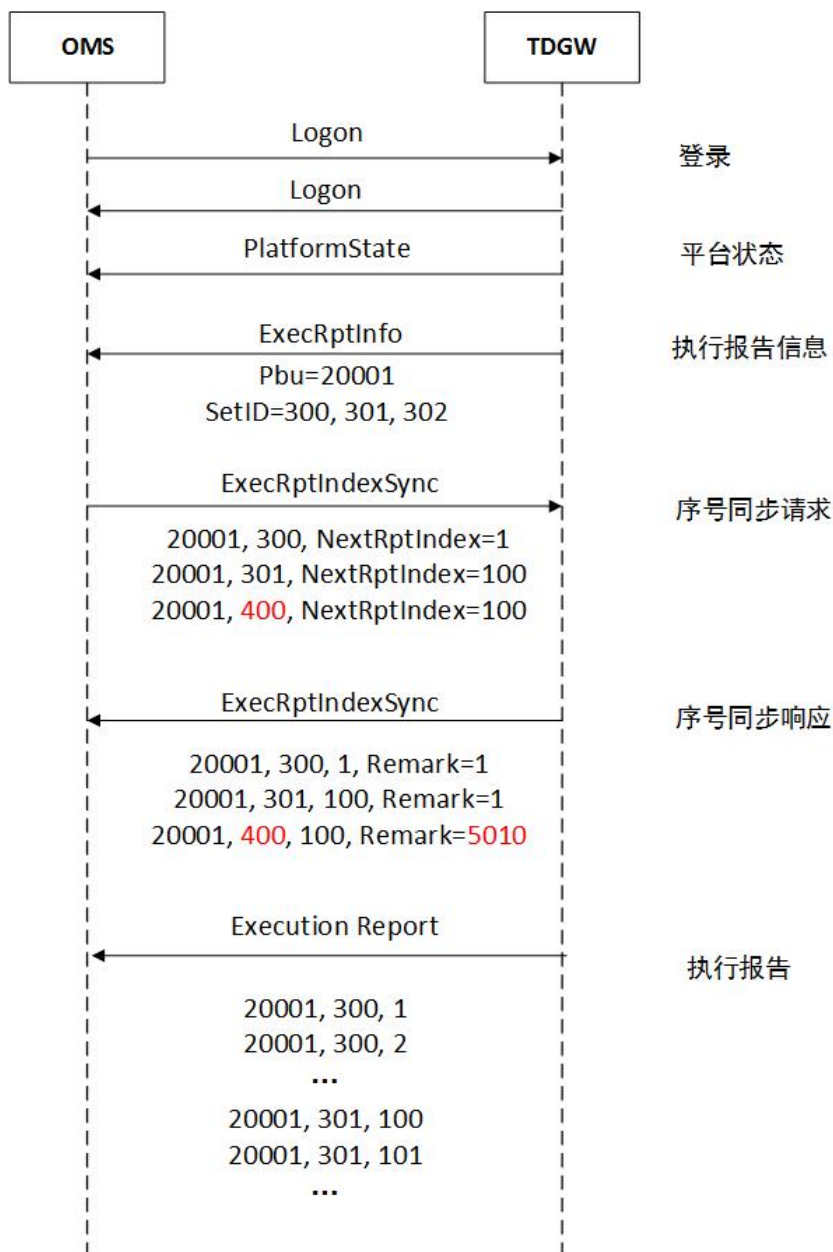
在每个 PBU 下，执行报告根据分区 (SetID) 划分为多个编号相互独立的数据流。在一个交易日内，每个执行报告流中的 ReportIndex 由 1 开始连续递增。多个不同业务可以属于同一个分区，从而在同一个执行报告流中按序发送；同一个业务也可以属于多个分区，通过多个执行报告流发送。

OMS 与 TDGW 建立会话后，TDGW 会向 OMS 推送执行报告信息 (ExecRptInfo) 消息，其中包含 PBU 列表和分区列表，OMS 应根据此信息维护多个逻辑上的执行报告流。针对分区列表信息，由后台交易系统确定，可能随后台优化而调整。OMS 应避免自行配置固定分区信息，影响系统的灵活性和兼容性。

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

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

OMS 应对 TDGW 推送的执行报告进行数据持久化操作，以减少 OMS 异常时从交易系统恢复的执行报告数量。同时，OMS 应具备识别重复执行报告的能力，避免重复处理。



### 3.3 恢复场景

#### OMS 与 TDGW 断开

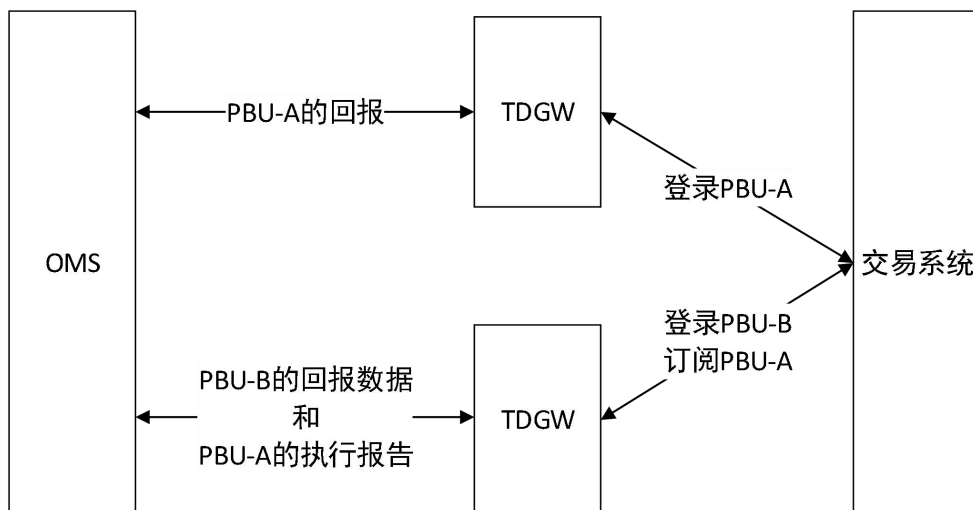
在 OMS 重新与 TDGW 建立会话后，由于断连期间可能存在传输中的消息丢失，OMS 应对上下行两个方向的消息进行恢复。建议 OMS 先对执行报告进行恢复，以尽可能更新断连前申报订单的状态。OMS 可在恢复一段时间后，对仍然处于“已报但未确认”状态的订单进行重新申报。

#### TDGW 与 EzCS 断开

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

### 3.4 订阅机制

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



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

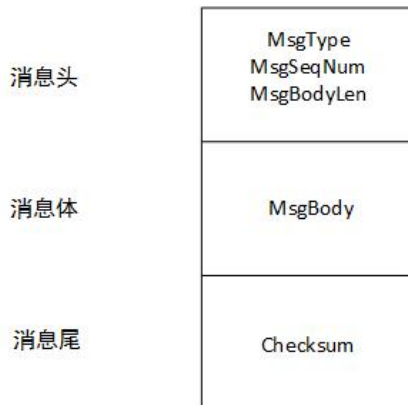
目前，交易系统限制每个登录 PBU 可被最多 3 个其他登录 PBU 订阅成功。为减少订阅对登录 PBU 自身回报数据处理的影响，TDGW 将优先发送登录 PBU 自身的回报数据。

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

## 第四章 消息定义

### 4.1 消息结构

每一条消息由消息头、消息体和消息尾组成。



消息头由消息类型和消息体长度组成：

字段名	类型	说明
MsgType	uint32	消息类型
MsgSeqNum	uint32	消息序号
MsgBodyLen	uint32	消息体长度

消息尾包含消息校验和：

字段名	类型	说明
Checksum	uint32	校验和

校验和的计算从消息头开始到 Checksum 域为止 (不包含 Checksum 域)，计算方法见附录一。

#### 消息序号

MsgSeqNum 供会话双方定位消息，应从 1 开始连续递增。

#### 消息扩展

OMS 应支持消息类型的扩展：依据 MsgType 的取值对相关结构进行处理，对于新增的未知消息类型，应可以无需改造而忽略。

会话双方应支持消息体的扩展：依据 MsgBodyLen 的取值，对于消息体最后、消息尾前新增的未知字段，应无需改造而忽略新增内容。

目前，对于申报及回报等消息，涉及业务元素的，在消息体中含有 STEP 结构，因此由



常规业务引发的接口扩展，通过 STEP 结构内容的调整来实现。

### 数据类型

约定如下：

1. 采用大端字节序（BIG\_ENDIAN）；
2. 字符串类型用 char[x] 表示，x 为占用字节数，采用 UTF-8 编码，左对齐，不足长度的部分后补空格；
3. 数值类型字段默认填 0 值，字符串类型默认填全空格；
4. 申报及回报消息体中，涉及 STEP 结构相关的格式和类型描述，在下一节约定。

#### 4.1.1 STEP 格式约定

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

2. STEP 结构必须包含接口中所定义的字段，且遵循接口规格中所定义的顺序；

3. 字符型字段以 CX 表示，X 代表长度；数值型字段以 NX 表示，X 代表长度；对于带小数位的数值型字段，以 NX(Y)表示，X 代表总长度，Y 代表小数位数，其中 X 包括一位小数点，即整数部分最多不超过 X-Y-1 位，小数部分最多不超过 Y 位。字段长度定义为最大长度约束，无需左或右补空格至定长；

4. STEP 结构中的字段，字符型用空格表示空值，即采用“标签= <SOH>”的方式表示（等号后与分隔符间有一个空格），数值型用 0 表示空值，即“标签=0<SOH>”；

5. 对 STEP 结构的处理，应支持在协议尾补充新字段的扩展方式。

## 4.2 会话消息

### 4.2.1 Logon 登录

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 1
SenderCompID	char[32]	发送方代码

TargetCompID	char[32]	接收方代码
HeartBtInt	uint16	心跳间隔，单位为秒
PrtclVersion	char[8]	协议版本号
TradeDate	uint32	交易日 格式 YYYYMMDD， YYYY 为年，取值 0000-9999，MM 为月， 取值 01-12，DD 为日， 取值 01-31
QSize	uint32	预留
消息尾		

SenderCompID 和 TargetCompID 用于表示会话双方的身份。OMS 应填写可以标识其身份的 SenderCompID，TDGW 仅简单地在回传 Logon 时将其填写于 TargetCompID 中。OMS 发出的 Logon 消息中 TargetCompID 填写“TDGW”。

HeartBtInt 域用来指定心跳消息的发送时间间隔，详见此前会话机制章节中对心跳间隔的约定。

PrtclVersion 为协议版本号（对应本文档版本号），格式为 aa.bb（如 0.30，12.00），TDGW 在确有需要时将限制接入的协议版本。

#### 4.2.2 Logout 注销

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 2
SessionStatus	uint32	注销状态码
Text	char[64]	文本描述
消息尾		

#### 4.2.3 Heartbeat 心跳

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 3 MsgBodyLen = 0

消息尾		
-----	--	--

### 4.3 申报消息

申报请求（Order Request）消息结构如下：

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 10
ReqID	char[3]	业务类型
SecurityID	char[8]	产品代码
BizPbu	char[5]	业务 PBU 申报重复依据
Reff	char[10]	会员内部编号 申报重复依据
StepTextLength	uint32	STEP 结构长度
ReqStepText	char[]	STEP 格式封装的申报数据
消息尾		

申报请求中，ReqID 为请求业务类型编号，与产品代码 SecurityID 一起用于识别业务请求。BizPbu 为申报所属的业务单元，与 Reff 会员内部编号一并作为申报重复依据，已在前述章节予以说明。

申报请求中，ReqStepText 为 STEP 格式封装的申报数据，包含具体的业务要素，详见申报 STEP 结构章节描述。

此外，另约定如下：

1. 对于 ReqID 与 SecurityID 取值错误时，TDGW 返回 OMS 一般回报响应予以拒绝，并给出错误码；

2. SecurityID 取值应当与 ReqStepText 中对应域的字段取值相同，其中特殊业务约定如下：

业务类型 (ReqID)	SecurityID 取值
OMR	00000000（虚拟查询编码）

3. BizPbu 取值应当与 ReqStepText 中对应域的字段取值相同；

4. Reff 取值应当与 ReqStepText 中对应域的字段取值相同，根据不同业务，对应域字段为：

业务类型 (ReqID)	Reff 对应 STEP 结构中的域字段
OTO OTU OTE OCE OTT OML	ClOrdID
OMR	MarginReqmtInqID
OQO	QuoteMsgID

5. 交易所保证金强制平仓申报消息 Reff 取值以 QP1 开头，相应执行报告的会员内部编号取值相同；交易所备兑强制平仓申报消息 Reff 取值以 CV1 开头，相应执行报告的会员内部编号取值相同；交易所组合保证金强制拆分申报消息 Reff 取值以 CF1 开头，相应执行报告的会员内部编号取值相同。

### 4.3.1 申报 STEP 结构

申报消息的 STEP 结构中，通过 STEP 类型 (MsgType) 对不同结构予以区分：

- D = 申报 (NewOrder Single)
- F = 撤单 (OrderCancel Request)
- CH = 保证金查询指令 (Margin Requirement Inquiry)
- S = 双边报价申报 (Quote)
- Z = 双边报价撤单申报 (QuoteCancel)

以下描述的申报 STEP 结构，均对应申报消息中的 ReqStepText 字段内容。

#### 4.3.1.1 期权订单申报

NewOrderSingle	期权订单申报
<b>描述：</b> 请求业务类型编号 (ReqID)：OTO = 期权订单申报  1、订单有效时间类型 (59) 取值与订单类型对应关系如下：	

a) 限价申报 - GFD、FOK b) 市价申报 - IOC、FOK c) 市价剩余转限价申报 - GFD 2、各交易时段允许输入的订单类型包括： a) 集合竞价：限价申报（GFD） b) 连续竞价：所有的订单类型与有效时间类型组合 c) 波动性中断：限价申报（GFD） d) 收盘集合竞价：限价申报（GFD） 3、备兑标签（203）适用于： a) 买入平仓、卖出开仓：备兑、非备兑 b) 买入开仓、卖出平仓：非备兑			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	D=申报	C4
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
48	SecurityID	合约编码	C8
522	OwnerType	订单所有者类型，取值包括： 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构（包括其风险管理部门）发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
44	Price	申报价格，对于市价订单无意义，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)
38	OrderQty	申报数量（张）	N10
54	Side	买卖方向，取值：1 表示买，2 表示卖	C1
77	PositionEffect	开仓/平仓,取值: C=平仓, O=开仓	C1
40	OrdType	订单类型，取值： 1=市价（Market） 2=限价（Limit） K=市价剩余转限价	C1
59	TimeInForce	订单有效时间类型，取值范围： 0 = 当日有效（GFD） 3 = 即时成交剩余自动撤销(IOC) 4 = 即时全部成交否则撤销(FOK) 默认情况下，限价为 GFD，市价为 IOC	C1
203	CoveredOrUncovered	备兑标签，取值范围： 1- Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1

453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。		N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码，888	C3
	452	PartyRole	取 500，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。 投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码（888））	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

#### 4.3.1.2 组合与拆分

NewOrderSingle		组合与拆分	
<b>描述：</b> 请求业务类型编号（ReqID）：OML = 组合与拆分			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	D=申报	C4
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
522	OwnerType	订单所有类型，取值包括： 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
48	SecurityID	组合策略编码	C8
54	Side	取值：B 表示组合，C 表示拆分 组合策略为“ZBD”时，组合与拆分方向只能为‘B’	C1

38	OrderQty	申报数量（张）		N10
198	SecondaryOrderID	组合编码。组合申报时，该字段为空格；拆分申报时，填写拟拆分组合的组合编码。		C16
555	NoLeges	成分合约数，取值不超过 4，后接重复组		N2
合约组合	602	LegSecurityID	合约编码	C8
	624	LegSide	合约方向，L 为权利仓,S 为义务仓	C1
	203	CoveredOrUncovered	备兑标签，取值范围： 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1
	685	LegOrderQty	申报数量（张）	N10
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。		N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码，888	C3
	452	PartyRole	取 500，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。投资者合约账户（发起方投资者账户+3 位发起方投资者帐户子编码（888））	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

#### 4.3.1.3 证券锁定与解锁

NewOrderSingle		证券锁定与解锁	
<b>描述：</b> 请求业务类型编号（ReqID）：OTU = 证券锁定与解锁			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	D=申报	C4
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
308	UnderlyingSe	证券代码，此处针对合约的标的证券	C6

	curityID		
38	OrderQty	现货的持仓数量（股票为股，ETF为份）	
54	Side	锁定/解锁，取值：Z表示锁定，Y表示解锁	
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。	
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码，888
	452	PartyRole	取 500，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。 投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码(888)）
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。

#### 4.3.1.4 行权申报

NewOrderSingle		行权	
<b>描述：</b> 请求业务类型编号（ReqID）：OTE=行权			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	D=申报	C4
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
48	SecurityID	合约编码，8 位字符	C8
522	OwnerType	订单所有类型，取值包括： 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构（包括其风险管理部门）发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
38	OrderQty	申报数量（张）	N10
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起	N2



		方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码。		
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码，888	C3
	452	PartyRole	取 500，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。 投资者合约账户（发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码（888））	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

#### 4.3.1.5 行权合并申报

NewOrderSingle		行权合并申报		
<b>描述:</b> 请求业务类型编号 (ReqID) : OCE = 行权合并申报				
标签	字段名	字段描述		类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度 (后续字段总和) 此 STEP 结构中, 本字段分隔符后的字符数, 包含其他字段分隔符<SOH>, 不含本字段后的分隔符<SOH>。		N5
35	MsgType	D=申报		C4
11	ClOrdID	会员内部编号		C10
555	NoLegs	行权指令合并申报的成分合约数, 取值为 2, 后接重复组		N2
行权合并申报组成	602	LegSecurityID	成分合约编码	C8
	685	LegOrderQty	成分合约数量 (张)	N10
522	OwnerType	订单所有类型, 取值包括: 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构 (包括其风险管理部门) 发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起		N3
38	OrderQty	行权指令合并申报单位数量 (个)		N10
453	NoPartyIDs	参与方个数, 取值=4, 后接重复组, 依次包含发		N2

		起方的投资者账户、账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。		
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码，888	C3
	452	PartyRole	取 500，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。投资者合约账户（发起方投资者账户+3 位发起方投资者帐户子编码（888））	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

#### 4.3.1.6 会员申请转处置证券账户

NewOrderSingle		会员申请转处置证券账户	
<b>描述:</b> 请求业务类型编号 (ReqID) : OTT =会员申请转处置证券账户			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度 (后续字段总和) 此 STEP 结构中, 本字段分隔符后的字符数, 包含其他字段分隔符<SOH>, 不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	D=申报	C4
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
308	UnderlyingSecurityID	证券代码, 此处针对合约的标的证券	C6
522	OwnerType	订单所有类型, 取值包括: 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构 (包括其风险管理部门) 发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
38	OrderQty	申报数量, 个股单位为股, ETF 单位为份	N10
747	ExerciseMethod	处理类别, 取值包括: Z=被指派行权违约处理 R=处置申报返还, 现券由券商帐户返还投资者帐户	C1

453	NoPartyIDs	参与方个数, 取值=4, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。		N2
发起方投资者账户	448	PartyID	投资者账户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为被处置投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码, 888	C3
	452	PartyRole	取 500, 表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。 投资者合约账户(发起方投资者账户+3位发起方投资者帐户子编码(888))	N4
投资者申报交易单元号	448	PartyID	投资者申报交易单元代码, 填写 5 位被处置帐户的申报交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为被处置帐户的申报交易单元号。	N4
投资者营业部代码	448	PartyID	投资者营业部代码, 填写 5 位被处置帐户的营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为被处置帐户的营业部代码。	N4

#### 4.3.1.7 撤单申报

OrderCancel Request		撤单指令	
<b>描述:</b>			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度 (后续字段总和) 此 STEP 结构中, 本字段分隔符后的字符数, 包含其他字段分隔符<SOH>, 不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	F=撤单	C4
11	ClOrdID	会员内部编号, 指成交申报会员内部编号。 在所有申报业务范围内, 同一个交易单元的会员内部编号必须唯一, 交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单, 并以此编号重复作为订单重复依据。	C10
41	OrigClOrdID	原始交易客户方 (券商) 订单编号, 指示被撤单订单的 ClOrdID	C10
48	SecurityID	如果是 OTE/OTO 指令此字段为合约编码 如果是 OTT 指令, 此字段为 6 位证券代码, 指针对合约的标的证券 如果是 OCE 指令, 此字段为空	C8
522	OwnerType	订单所有类型, 取值包括: 1=个人投资者发起 101=交易所发起	N3

		102=期权经营机构（包括其风险管理部门）发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。	N2
发起方投资者账户	448	PartyID 发起方投资者帐户 如果是 OTT 指令，此字段为被转处置的投资者帐户	C10
	452	PartyRole 取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID 发起方投资者账户子编码，888	C3
	452	PartyRole 取 500，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。 投资者合约账户（发起方投资者账户+3 位发起方投资者帐户子编码（888））	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID 发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号，对于申报撤单，应为原始申报的申报交易单元代码。	C5
	452	PartyRole 取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448	PartyID 发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole 取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

#### 4.3.1.8 保证金查询

Margin Requirement Inquiry		保证金查询	
<b>描述：</b> 请求业务类型编号（ReqID）：OMR = 保证金查询			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	CH=保证金查询	C4
1635	MarginReqmtInqID	交易客户方（券商）查询申请内部编号	C10
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，保证金账号、发起方的申报交易单元号。	N2

发起方 申报交 易单元 号	448	PartyID	保证金账号，长度为 25 位。	C25
	452	PartyRole	取 100，表示当前 PartyID 的取值为保证金账号。	N4
发起方 申报交 易单元 号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4

### 4.3.1.9 期权双边报价订单申报

Quote		期权双边报价订单申报	
<b>描述:</b> 请求业务类型编号 (ReqID) : OQO=期权双边报价订单申报  1、该类订单默认为限价 (Limit) 订单，当日有效 (GFD) 2、仅限买入开仓/平仓; 卖出开仓/平仓，不支持备兑开仓/平仓 3、仅供做市商使用			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度 (后续字段总和) 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	S=Quote 订单申报	C4
1166	QuoteMsgID	报价编号，指订单申报客户端会员内部订单编号。 在所有申报业务范围内，同一个交易单元的会员内部订单编号必须当天唯一，交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单，并以此编号重复作为订单重复依据。	C10
48	SecurityID	合约编码	C8
522	OwnerType	订单所有者类型，取值： 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构 (包括其风险管理部门) 发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
132	BidPx	买报价，单位：元 (精确到 0.0001 元) 买方无报价时，取值无意义	N11(4)
133	OfferPx	卖报价，单位：元 (精确到 0.0001 元)	N11(4)

		卖方无报价时，取值无意义		
134	BidSize	申报买数量（张），表示买报价数量， 买方无报价时，取值为 0	N10	
135	OfferSize	申报卖数量（张），表示卖报价数量， 卖方无报价时，取值为 0	N10	
8909	BidPositionEffect	买开仓/平仓标志,取值: C=平仓, O=开仓	C1	
8910	OfferPositionEffect	卖开仓/平仓标志,取值: C=平仓, O=开仓	C1	
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。	N2	
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码, 888	C3
	452	PartyRole	取 500, 表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。 投资者合约账户（发起方投资者账户+3 位发起方投资者帐户子编码（888））	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码, 填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

#### 4.3.1.10 期权双边报价撤单申报

QuoteCancel		期权双边报价撤单指令	
<p><b>描述:</b>                      请求业务类型编号（ReqID）：OQO =期权双边报价撤单                      市场参与者使用 QuoteCancel 消息进行 Quote 订单撤单, 对应申报接口表中的 ReqText, 对于现有的请求业务类型编号（reqid）支持撤单指令的有且仅有：                      OQO =申报指令-双边报价订单</p>			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔	N5

		符<SOH>。		
35	MsgType	Z=Quote 订单撤单申报	C4	
1166	QuoteMsgID	双边报价撤单编号，指订单申报客户端会员内部订单编号。 在所有申报业务范围内，同一个交易单元的会员内部订单编号必须当天唯一，交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单，并以此编号重复作为订单重复依据。	C10	
48	SecurityID	合约编码	C8	
522	OwnerType	订单所有者类型，取值： 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构（包括其风险管理部门）发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3	
132	BidPx	买报价，单位：元（精确到 0.0001 元）， 取值无意义。	N11(4)	
133	OfferPx	卖报价，单位：元（精确到 0.0001 元）， 取值无意义。	N11(4)	
134	BidSize	申报买数量（张）， 撤销买方报价时，取值为 0，其他无意义	N10	
135	OfferSize	申报卖数量（张）， 撤销卖方报价时，取值为 0，其他无意义	N10	
8909	BidPositionEffect	原买订单开仓/平仓标志,取值: C=平仓, O=开仓, 无意义	C1	
8910	OfferPositionEffect	原卖订单开仓/平仓标志,取值: C=平仓, O=开仓, 无意义	C1	
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=4，后接重复组，依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。	N2	
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码，888	C3
	452	PartyRole	取 500，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。 投资者合约账户（发起方投资者账户+3 位发起方投资者帐户子编码（888））	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4

发起方 营业部 代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

## 4.4 回报消息

### 4.4.1 执行报告 Execution Report

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 20
Pbu	char[5]	登录或订阅 PBU
SetID	char[3]	分区
ReportIndex	uint64	分区对应执行报告流中的消息序号
ReqID	char[3]	业务类型
StepTextLength	uint32	STEP 结构长度
ExecRptStepText	char[]	STEP 格式封装的执行报告数据
消息尾		

执行报告消息中，SetID 为分区，ReportIndex 为该分区对应执行报告流中的序号。ExecRptStepText 为 STEP 格式封装的执行报告数据，包含具体的业务要素。以下描述的 STEP 结构，均对应 ExecRptStepText 字段内容。

执行报告 STEP 结构中，通过 STEP 类型（MsgType）对不同结构予以区分：

- 8 = 申报响应及其撤单成功响应（NewOrder Response）
- 9 = 撤单失败响应（OrderCancel Reject）
- U11 = 成交回报（Trade Confirm）
- U12 = 组合与拆分执行报告（Option Multiple Leg Report）
- U13 = 组合与拆分响应（Option Multiple Leg Response）
- U14 = 证券锁定与解锁响应（Option Trading Underlying Freeze Response）
- U15 = 行权申报响应及其撤单成功响应（Option Trading Execution Response）
- U16 = 行权合并申报响应及其撤单成功响应（Option Trading Combination



Execution Response)

- U17 =会员申请转处置证券账户响应及其撤单成功响应 (Option Trading Transfer for Execution Response)
- AJ = 双边报价订单申报响应 (QuoteStatus Report)
- AI = 双边报价订单申报撤单响应 (QuoteCancel Response)

#### 4.4.1.1 申报响应及其撤单成功响应

NewOrder Response		申报响应及其撤单成功响应	
<p><b>描述:</b> 请求业务类型编号 (ReqID) : OTO = 期权订单申报</p> <p>STEP 标签 150 和 39 组合取值: 成交申报成功响应: 150=0, 39=0 拒绝响应: 150=8, 39=8 撤单指令成功响应: 150=6,39=6</p>			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度 (后续字段总和) 此 STEP 结构中, 本字段分隔符后的字符数, 包含其他字段分隔符<SOH>, 不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	8=申报响应及其撤单成功响应	C4
37	OrderID	交易所订单编号, 取值为数字	C16
150	ExecType	当前订单执行类型, 取值有: 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	C1
39	OrdStatus	当前申报的状态, 取值有: 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	C1
48	SecurityID	合约编码	C8
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应, 为原始交易客户方 (券商) 订单编号, 指示被撤销订单的 ClOrdID, 对于申报响应, 取值为空。	C10
522	OwnerType	订单所有者类型, 取值包括: 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构 (包括其风险管理部门) 发起	N3

		103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起		
44	Price	申报价格，对于市价订单无意义，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)	
38	OrderQty	申报数量（张）	N10	
54	Side	买卖方向，取值：1 表示买，2 表示卖	C1	
77	PositionEffect	开仓/平仓,取值: C=平仓, O=开仓	C1	
40	OrdType	订单类型，取值： 1 =市价（Market） 2 =限价（Limit） K =市价剩余转限价	C1	
59	TimeInForce	订单有效时间类型，取值范围： 0 =当日有效（GFD） 3 =即时成交剩余自动撤销(IOC) 4 =即时全部成交否则撤销(FOK) 默认情况下，限价为 GFD，市价为 IOC	C1	
8541	TransactTimeOnly	接受请求时间，格式为 HH:MM:SS.sss	C12	
845	DiscretionPrice	对应申报市价转限价的订单，这里填写转为限价订单的价格，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)	
151	LeavesQty	对于申报响应： 对应申报是市价转撤单的时候，这里填写自动撤单的数量；对应申报是市价转限价的时候，这里填写转为限价订单的数量；其余填 0。 对于撤单成功： 填写撤单成功的数量	N12	
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 申报成功时，该字段取值为空。 申报失败时，表示拒绝的理由。	C5	
203	CoveredOrUncovered	备兑标签，取值范围： 1- Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1	
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，后接重复组，依次包含发起方投资者账户、申报交易单元。	N2	
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方申报交易单元	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元，对于申报撤单，为原始申报的申报交易单元。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元。	N4

### 4.4.1.2 组合与拆分响应

Option Multiple Leg Response		组合与拆分响应	
<b>描述:</b> 请求业务类型编号 (ReqID) : OML = 组合与拆分  STEP 标签 150 和 39 组合取值: 申报成功响应: 150=0, 39=0 拒绝响应: 150=8, 39=8			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度 (后续字段总和) 此 STEP 结构中, 本字段分隔符后的字符数, 包含其他字段分隔符<SOH>, 不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	U13 = 组合与拆分响应	C4
37	OrderID	交易所订单编号, 取值为数字	C16
150	ExecType	当前订单执行类型, 取值有: 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前申报的状态, 取值有: 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
522	OwnerType	订单所有者类型, 取值包括: 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构 (包括其风险管理部门) 发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
48	SecurityID	组合策略编码	C8
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
54	Side	取值: B 表示组合, C 表示拆分 组合策略为“ZBD”时, 组合与拆分方向只能为‘B’	C1
38	OrderQty	申报数量 (张)	N10
198	SecondaryOrderID	组合编码: 组合响应为空, 拆分响应为拆分订单的组合编码。	C16
555	NoLeges	成分合约数, 取值不超过 4, 后接重复组	N2
合约组合	602	LegSecurityID	合约编码
	624	LegSide	合约方向, L 为权利仓, S 为义务仓
	203	CoveredOrUncovered	备兑标签, 取值范围: 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑
	685	LegOrderQty	申报数量 (张)
8541	TransactTimeO	接受请求时间, 格式为 HH:MM:SS.sss	C12

	nly			
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 申报成功时，该字段取值为空。 申报失败时，表示拒绝的理由。		C5
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，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。		N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4

#### 4.4.1.3 证券锁定与解锁响应

Option Trading Underlying Freeze Response		证券锁定与解锁响应	
<p><b>描述:</b> 请求业务类型编号 (ReqID) : OTU = 证券锁定与解锁</p> <p>STEP 标签 150 和 39 组合取值: 成交申报成功响应: 150=0, 39=0 拒绝响应: 150=8, 39=8</p>			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度 (后续字段总和) 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	U14 = 证券锁定与解锁响应	C4
37	OrderID	交易所订单编号，取值为数字	C16
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前申报的状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
308	UnderlyingSecurityID	合约标的证券	C6
38	OrderQty	现货的持仓数量 (股票为股，ETF 为份)	N10

54	Side	锁定/解锁，取值：Z 表示锁定，Y 表示解锁		C1
8541	TransactTime Only	接受请求时间，格式为 HH:MM:SS.sss		C12
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 申报成功时，该字段取值为空。 申报失败时，表示拒绝的理由。		C5
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，后接重复组，包含发起方的投资者账户、申报交易单元。		N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方申报交易单元	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元。	N4

#### 4.4.1.4 行权申报响应及其撤单成功响应

Option Trading Execution Response		行权申报响应及其撤单成功响应	
<b>描述：</b> 请求业务类型编号（ReqID）：OTE =行权申报 STEP 标签 150 和 39 组合取值： 成交申报成功响应：150=0, 39=0 拒绝响应：150=8, 39=8 撤单指令成功响应：150=6,39=6			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	U15 = 行权申报响应及其撤单成功响应	C4
37	OrderID	交易所订单编号，取值为数字	C16
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	C1
39	OrdStatus	当前申报的状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	C1
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应，为原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤销订单的 ClOrdID，对于申报	C10

		响应，取值为空。		
48	SecurityID	合约编码，8 位字符	C8	
38	OrderQty	行权申报数量（张）	N10	
8541	TransactTime Only	接受请求时间，格式为 HH:MM:SS.sss	C12	
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 申报成功时，该字段取值为空。 申报失败时，表示拒绝的理由。	C5	
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，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。	N2	
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号，对于申报撤单，应为原始申报的申报交易单元代码。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4

#### 4.4.1.5 行权合并申报响应及其撤单成功响应

Option Trading Combination Execution Response		行权合并申报响应及其撤单成功响应	
<p><b>描述：</b> 请求业务类型编号（ReqID）：OCE = 行权合并申报</p> <p>STEP 标签 150 和 39 组合取值： 成交申报成功响应：150=0, 39=0 拒绝响应：150=8, 39=8 撤单指令成功响应：150=6,39=6</p>			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	U16 =行权合并申报响应及其撤单成功响应	C4
37	OrderID	交易所订单编号，取值为数字	C16
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	C1
39	OrdStatus	当前申报的状态，取值有：	C1

		0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应，为原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤销订单的 ClOrdID，对于申报响应，取值为空。	C10
555	NoLegs	行权指令合并申报的成分合约数，取值为 2，后接重复组	N2
行权合并申报组成	602	LegSecurityID	成分合约编码
	685	LegOrderQty	成分合约数量（张）
38	OrderQty	行权合并申报数量（张）	N10
8541	TransactTime Only	接受请求时间，格式为 HH:MM:SS.sss	C12
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 申报成功时，该字段取值为空。 申报失败时，表示拒绝的理由。	C5
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，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。	N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号，对于申报撤单，应为原始申报的申报交易单元代码。
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。

#### 4.4.1.6 会员申请转处置证券账户响应及其撤单成功响应

Option Trading Transfer for Execution Response		会员申请转处置证券账户响应及其撤单成功响应	
<b>描述：</b> 请求业务类型编号（ReqID）：OTT =会员申请转处置证券账户			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	U17 =会员申请转处置证券账户响应及其撤单成功响应	C4

37	OrderID	交易所订单编号, 取值为数字	C16	
150	ExecType	当前订单执行类型, 取值有: 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	C1	
39	OrdStatus	当前申报的状态, 取值有: 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	C1	
11	ClOrdID	会员内部编号	C10	
41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应, 为原始交易客户方(券商)订单编号, 指示被撤销订单的 ClOrdID, 对于申报响应, 取值为空。	C10	
308	UnderlyingSecurityID	合约标的证券	C6	
38	OrderQty	申报数量, 个股单位为股, ETF 单位为份	N10	
747	ExerciseMethod	处理类别, 取值包括: Z=被指派行权违约处理 R=处置申报返还, 现券由券商帐户返还投资者帐户	C1	
8541	TransactTimeOnly	接受请求时间, 格式为 HH:MM:SS.sss	C12	
103	OrdRejReason	申报错误信息, 供柜台系统读取错误信息, 进行错误处理。 申报成功时, 该字段取值为空。 申报失败时, 表示拒绝的理由。	C5	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 取值=2, 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。	N2	
发起方投资者账户	448	PartyID	投资者账户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为被处置投资者帐户。	N4
投资者申报交易单元号	448	PartyID	投资者申报交易单元代码, 填写 5 位被处置帐户的申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为被处置帐户的申报交易单元号。	N4

#### 4.4.1.7 撤单失败响应

OrderCancelReject		撤单指令失败响应	
<b>描述:</b> 撤单指令失败响应。			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度(后续字段总和) 此 STEP 结构中, 本字段分隔符后的字符数, 包含其他字段分隔符<SOH>, 不含本字段后的分隔符	N5



		<SOH>。		
35	MsgType	9=撤单失败响应		C4
37	OrderID	交易所订单编号		C16
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 8=拒绝响应		C1
11	ClOrdID	会员内部编号		C10
41	OrigClOrdID	原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤单订单的 ClOrdID		C10
8541	TransactTimeOnly	接受请求时间，格式为 HH:MM:SS.sss		C12
102	CxlRejReason	撤单失败时，撤单请求拒绝的代码。		C5
434	CxlRejResponseTo	撤单响应类型，取值： 1=撤单响应		C1
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，后接重复组，依次包含发起方投资者账户、申报交易单元。		N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方申报交易单元	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元，对于申报撤单，为原始申报的申报交易单元。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元。	N4

#### 4.4.1.8 成交回报

Trade Confirm		成交回报	
<b>描述：</b> 作为对成交的确认，目前支持的业务类型（ReqID）： OTO = 期权订单申报 OQO = 期权双边报价订单申报			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	U11=成交回报	C4
11	ClOrdID	会员内部编号  期权双边报价订单成交时，填写对应 QuoteMsgID	C10
37	OrderID	交易所订单编号	C16
17	ExecID	成交编号	C16

48	SecurityID	合约编码	C8
31	LastPx	成交价格, 单位: 元 (精确到 0.0001 元)	N11(4)
32	LastQty	成交数量	N12
151	LeavesQty	本次成交后申报余额数量	N12
54	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买, 2 表示卖	C1
77	PositionEffect	开仓/平仓, 取值: C=平仓, O=开仓	C1
203	CoveredOrUncovered	备兑标签, 取值范围: 1- Covered 备兑 空格- Uncovered 非备兑	C1
8541	TransactTimeOnly	订单执行时间, 格式为 HH:MM:SS.sss	C12
42	OrigTime	原有订单请求接收的时间, 式为 HH:MM:SS.sss	C12
150	ExecType	当前订单执行状态, 取值: F=成交	C1
522	OwnerType	订单所有类型, 取值包括: 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构 (包括其风险管理部门) 发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
39	OrdStatus	当前订单状态, 取值: 1=部分成交, 2=已成交	C1
8504	TotalValueTraded	成交金额, 精确到分	N17(2)
453	NoPartyIDs	参与方个数, 取值=4, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。	N2

发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码，888	C3
	452	PartyRole	取 500，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户子编码。投资者合约账户（发起方投资者账户+3 位发起方投资者账户子编码（888））	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001，表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

#### 4.4.1.9 组合与拆分执行报告

Option Multiple Leg Report		组合与拆分执行报告	
<b>描述:</b> 作为对成交的确认，目前支持的业务类型（ReqID）：OML = 组合与拆分			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	U12=组合与拆分执行报告	C4
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
48	SecurityID	组合策略编码	C8
17	ExecID	成交编号。此业务的成交编号，以'9'开头的单独编号。如：900000000000001	C16
54	Side	取值：B 表示组合，C 表示拆分，F 表示交易所强制拆分	C1
32	LastQty	成交数量	N12
198	SecondaryOrderID	组合编码。对于组合申报，此编码为交易所分配的组合编码，前 8 位为日期，后 8 位为创建组合时的序号，不复用。（例：	C16

		2015040300000001) 对于拆分申报, 本字段对应于申报订单中组合编码 若 SecurityID 为 ZBD 时, 本字段不适用。		
555	NoLeges	成分合约数, 取值不超过 4, 后接重复组		N2
合约组合	602	LegSecurityID	合约编码	C8
	624	LegSide	合约方向, L 为权利仓, S 为义务仓	C1
	203	CoveredOrUncovered	备兑标签, 取值范围: 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1
	685	LegOrderQty	申报数量 (张)	N10
8541	TransactTimeOnly	订单执行时间, 格式为 HH:MM:SS.sss		C12
42	OrigTime	原有订单请求接收的时间, 式为 HH:MM:SS.sss		C12
522	OwnerType	订单所有类型, 取值包括: 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起		N3
453	NoPartyIDs	参与方个数, 取值=4, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、投资者账户子编码、申报交易单元号、营业部代码。		N2
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方投资者账户子编码	448	PartyID	发起方投资者账户子编码, 888	C3
	452	PartyRole	取 500, 表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户子编码。 投资者合约账户 (发起方投资者账户+3 位发起方投资者帐户子编码 (888))	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码, 填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4
发起方营业部代码	448	PartyID	发起方营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为发起方的营业部代码。	N4

#### 4.4.1.10 期权双边报价订单申报响应

QuoteStatus Response		期权双边报价订单申报响应	
<p><b>描述:</b>                      请求业务类型编号 (ReqID) : OQO =期权双边报价订单申报</p> <p>STEP 标签 150 和 39 组合取值:                      申报成功响应: 150=0, 39=0                      拒绝响应: 150=8, 39=8</p>			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度 (后续字段总和) 此 STEP 结构中, 本字段分隔符后的字符数, 包含其他字段分隔符<SOH>, 不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	AJ=Quote 订单申报响应	C4
37	OrderID	交易所订单编号, 取值为数字	C16
150	ExecType	当前订单执行类型, 取值有: 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前申报的状态, 取值有: 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
1166	QuoteMsgID	报价编号, 指订单申报客户端会员内部订单编号。 在所有申报业务范围内, 同一个交易单元的会员内部订单编号必须当天唯一, 交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单, 并以此编号重复作为订单重复依据。	C10
48	SecurityID	合约编码	C8
522	OwnerType	订单所有者类型, 取值: 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构 (包括其风险管理部门) 发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
132	BidPx	买报价, 单位: 元 (精确到 0.0001 元) 买数量为 0 时, 填 0	N11(4)
133	OfferPx	卖报价, 单位: 元 (精确到 0.0001 元) 卖数量为 0 时, 填 0	N11(4)
134	BidSize	申报买数量 (张), 表示买报价数量, 买方无报价时, 取值为 0	N10

135	OfferSize	申报卖数量（张），表示卖报价数量，卖方无报价时，取值为0		N10
8909	BidPositionEffect	买开仓/平仓标志,取值: C=平仓, O=开仓		C1
8910	OfferPosionEffect	卖开仓/平仓标志,取值: C=平仓, O=开仓		C1
300	QuoteRejectReason	失败时, 请求拒绝的理由		C5
8541	TransactTimeOnly	接受请求时间, 格式为 HH:MM:SS.sss		C12
73	NoOrders	订单更新方向数, 取值=2		N2
被撤销 买订单 信息	41	OrigClOrdID	对于撤单与更新报价成功响应, 为被撤买方向原始客户端会员内部订单编号 (原 QuoteMsgID), 对于申报响应, 取值为空。	C10
	151	LeavesQty	填写买撤单成功的数量; 缺省填 0	N12
	54	Side	买卖方向, 取值: 1 表示买	C1
被撤销 卖订单 信息	41	OrigClOrdID	对于撤单与更新报价成功响应, 为被撤卖方向原始客户端会员内部订单编号 (原 QuoteMsgID), 对于申报响应, 取值为空。	C10
	151	LeavesQty	填写卖撤单成功的数量; 缺省填 0	N12
	54	Side	买卖方向, 取值: 2 表示卖	C1
453	NoPartyIDs	参与方个数, 取值=2, 后接重复组, 依次包含发起方投资者账户、申报交易单元。		N2
发起方 投资者 账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方 申报交 易单元	448	PartyID	发起方申报交易单元代码, 填写 5 位申报交易单元, 对于申报撤单, 为原始申报的申报交易单元。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元。	N4

#### 4.4.1.11 期权双边报价订单撤单响应

QuoteCancel Response	期权双边报价撤单响应
<b>描述:</b> 请求业务类型编号 (ReqID): OQO = 期权双边报价撤单响应	

STEP 标签 150 和 39 组合取值： 撤销报价时撤单成功响应： 150=6， 39=6 撤销报价时撤单失败响应： 150=8， 39=8			
标签	字段名	字段描述	类型
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5
35	MsgType	AI=Quote 撤单响应	C4
37	OrderID	交易所订单编号，无意义	C16
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 6=撤单成功 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前申报的状态，取值有： 6=撤单成功 8=拒绝响应	C1
1166	QuoteMsgID	双边报价撤单编号，指订单申报客户端会员内部订单编号。 在所有申报业务范围内，同一个交易单元的会员内部订单编号必须当天唯一，交易系统不重复处理前台提交的同一个交易单元相同的会员内部编号订单，并以此编号重复作为订单重复依据。	C10
48	SecurityID	合约编码	C8
522	OwnerType	订单所有者类型，取值： 1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构（包括其风险管理部门）发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N3
132	BidPx	买报价，单位：元（精确到 0.0001 元） 买数量为 0 时，其他值无意义	N11(4)
133	OfferPx	卖报价，单位：元（精确到 0.0001 元） 卖数量为 0 时，其他值无意义	N11(4)
134	BidSize	申报买数量（张）， 撤销买方报价时，取值为 0，其他无意义	N10
135	OfferSize	申报卖数量（张）， 撤销卖方报价时，取值为 0，其他无意义	N10
8909	BidPositionEffect	原买订单开仓/平仓标志,取值: C=平仓, O=开仓, 无意义	C1
8910	OfferPosionEffect	原卖订单开仓/平仓标志,取值: C=平仓, O=开仓, 无意义	C1
300	QuoteRejectReason	失败时，请求拒绝的理由	C5
8541	TransactTimeOnly	接受请求时间，格式为 HH:MM:SS.sss	C12

73	NoOrders	订单更新方向数，取值=2		N2
被撤销 买订单 信息	41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应，为被撤买方向原始客户端会员内部订单编号（原 QuoteMsgID），缺省为空。	C10
	151	LeavesQty	填写买撤单成功的数量；缺省填 0	N12
	54	Side	买卖方向，取值：1 表示买	C1
被撤销 卖订单 信息	41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应，为被撤卖方向原始客户端会员内部订单编号（原 QuoteMsgID），缺省为空。	C10
	151	LeavesQty	填写卖撤单成功的数量；缺省填 0	N12
	54	Side	买卖方向，取值：2 表示卖	C1
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，后接重复组，依次包含发起方投资者账户、申报交易单元。		N2
发起方 投资者 账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户。	N4
发起方 申报交 易单元	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元，对于申报撤单，为原始申报的申报交易单元。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元。	N4

#### 4.4.2 一般响应 General Response

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 21
ReqID	char[3]	业务类型
BizPbu	char[5]	业务 PBU
Reff	char[10]	会员内部编号
Remark	uint32	响应状态码 取值为 1 表示成功，其他取值表示错误
StepTextLength	uint32	STEP 结构长度
RespStepText	char[]	STEP 格式封装的执行报告数据
消息尾		

上述结构中，BizPbu 与 Reff 取值为原申报请求中对应取值，Remark 为响应状态码，



RespStepText 为封装了 STEP 格式的响应数据。

目前，仅期权平台保证金查询（ReqID=OMR）响应采用 General Response，其 STEP 结构如下：

#### 4.4.2.1 保证金查询响应

MarginRequirement Response		保证金查询响应		
<b>描述：</b> 保证金查询响应，对应业务类型（ReqID）：OMR = 保证金查询				
标签	字段名	字段描述	类型	
9	BodyLen	STEP 结构体长度（后续字段总和） 此 STEP 结构中，本字段分隔符后的字符数，包含其他字段分隔符<SOH>，不含本字段后的分隔符<SOH>。	N5	
35	MsgType	CJ = 保证金查询响应	C4	
1635	MarginReqmntInqID	交易客户方（券商）查询申请内部编号	C10	
102	CxlRejReason	查询失败时，填写请求拒绝的理由，取值同 Remark 字段。查询成功时，填写空格。	C5	
8541	TransactTimeOnly	查询时间，格式为 HH:MM:SS.sss	C12	
1643	NoMarginAmt	查询结果总记录数，取值为 2，填写符合查询条件的总记录数。	N10	
总金额	1645	MarginAmt	总金额。单位：元，精确到分 查询失败，暂填 0.00	N16(2)
	1644	MarginAmtType	取 22，表示 MarginAmt 当前的取值为总金额。	N3
可用金额	1645	MarginAmt	可用金额。单位：元，精确到分 查询失败，暂填 0.00	N16(2)
	1644	MarginAmtType	取 101，表示 MarginAmt 当前的取值为可用金额。	N3
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，保证金账号、发起方的申报交易单元号。	N2	
发起方申报交易单元号	448	PartyID	保证金账号，长度为 25 位。	C25
	452	PartyRole	取 100，表示当前 PartyID 的取值为保证金账号。	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报交易单元代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为发起方申报交易单元号。	N4

### 4.4.3 申报拒绝 Order Request Reject

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 22
ReqID	char[3]	业务类型
BizPbu	char[5]	业务 PBU
Reff	char[10]	会员内部编号
Remark	uint32	响应状态码 取值为 1 表示成功，其他取值表示错误
消息尾		

## 4.5 其他消息

### 4.5.1 平台状态 PlatformState

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 30
PlatformID	uint16	平台标识，取值： 3 = 期权平台
PlatformState	uint16	平台状态，取值： 0 = NotOpen，未开放 1 = PreOpen，预开放 2 = Open，开放 3 = Break，暂停 4 = Close，关闭
消息尾		

在 NotOpen、Break 和 Close 状态下收到申报请求（Order Request），TDGW 将通过错误原因为 5009 的 Order Request Reject（MsgType=22）予以拒绝。

#### 4.5.2 执行报告信息 ExecRptInfo

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 31
PlatformID	uint16	平台标识, 取值: 3 = 期权平台
NoGroups	uint32	循环次数
→ Pbu	char[5]	登录或订阅 PBU
NoGroups	uint32	循环次数
→ SetID	char[3]	平台内分区号
消息尾		

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

平台内分区号 (SetID), 取值由交易系统后台决定, 可能随后台优化而调整, 建议 OMS 以 ExecRptInfo 推送的数据为准, 保持灵活的兼容性。

#### 4.5.3 分区序号同步 ExecRptIndexSync

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 32
Pbu	char[5]	登录或订阅 PBU
SetID	char[3]	分区
NextRptIndex	uint64	预期接收的下一执行报告序号, TDGW 将从该序号开始推送后续执行报告。暂不支持 $2^{32}$ 及更大取值。
Remark	uint32	响应状态码
消息尾		

分区序号同步请求与响应使用同一结构, 请求时 Remark 无意义, 响应中 Remark 为 1 时表示成功, 其他取值表示错误(如 Pbu 或 SetID 取值不正确)。序号同步请求中 NextRptIndex

取值应大于 0。

#### 4.5.4 分区执行报告结束 ExecRptEndOfStream

字段名	类型	说明
消息头		MsgType = 33
Pbu	char[5]	登录或订阅 PBU
SetID	char[3]	分区
MaxReportIndex	uint64	执行报告流最大序号
消息尾		

TDGW 向 OMS 发送，表示该执行报告流推送结束，后续该执行报告流上的序号将不再增加，且不超过 MaxReportIndex。

## 第五章附录

### 5.1 附一计算校验和

以下为计算校验和的代码段：

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

### 5.2 附二 PBU 及说明

涉及 PBU 时有几种含义：

- 1.配置于 TDGW 上用于登录至交易系统后台的登录单位，称为登录交易单元；
- 2.在消息报文中，表明该消息所进行的业务归属单元，称为业务交易单元，接口文档中用 BizPbu 指代；
- 3.在消息报文中，表明与另一登录 PBU 间的订阅关系，称为订阅交易单元。

在本接口文档中，上述 1 和 3 两种情况在消息报文（Execution Report、ExecRptInfo、ExecRptIndexSync、ExecRptEndOfStream）中以相同的 Pbu 字段表示。

目前，BizPbu 必须与登录 PBU 属于同一市场参与者机构，否则交易主机将拒绝相应的业务申报请求。订阅 PBU 必须与登录 PBU 属于同一市场参与者机构，否则将订阅失败，在执行报告信息 ExecRptInfo 消息中将不会包含订阅失败的 PBU。

### 5.3 附三错误代码说明

状态码/错误码	说明	Text (如有)
0	正常退出	Normal Logout
1	成功响应	
4012	SecurityID 错误或者业务类型 ReqID 错误	
5000	上行消息超过 4K	Message Exceed Max Length
5001	上行消息校验和错误	Checksum Error
5002	心跳超时	Heartbeat Timeout
5003	平台已有 OMS 登录	Already Login, try again
5004	连接建立后 5 秒内未完成登录	Login Timeout
5005	上行消息 TargetCompId 不正确	CompId Error
5006	TDGW 未登录至交易系统, 请 稍后重试	Not Ready
5007	内部错误	Internal Error
5008	不能识别的消息类型	Message Type Illegal
5009	平台状态暂不接受申报	
5010	SetID 错误	
5011	Pbu 错误	
5012	首个消息非是 Logon 消息	Login First
5013	NextRptIndex 取值错误	
11270	重复订单	

### 5.4 附四 EzSTEP 接口库映射

#### 5.4.1 申报请求

TDGW 申报请求 Order Request	EzSTEP 数据库 reqresp 表
----------------------------	-------------------------

	reqnum
ReqID	reqid
SecurityID	securityid
BizPbu	pbu
Reff	reff
ReqStepText	reqtext
	resptext
	recordtimestamp
	ordstatus
	remark
	localrespnum
	resptext

#### 5.4.2 执行报告

TDGW 执行报告 Execution Report	EzSTEP 数据库 excreport 表
	execnum
TechPbu/SubSubscribePbu	
SetID	setid
	bcasttype
ReportIndex	
	seqnum
	recordtimestamp
ExecRptStepText	Excreporttext

ReportIndex 及 seqnum 的取值不具备对应关系，这是因为：

1. ReportIndex 以执行报告分区 (SetID) 进行编号，seqnum 以 setid+bcasttype 进行编号；
2. TDGW 的执行报告流中除成交确认外，还包含订单响应等其他消息，而 EzSTEP 的 excreport 表中仅包含成交确认。

#### 5.4.3 一般响应/申报拒绝

TDGW 一般响应 General	EzSTEP 数据库
-------------------	------------

Response/申报拒绝 Order Request Reject	reqresp 表
	reqnum
ReqID	reqid
	securityid
BizPbu	pbu
Reff	reff
	reqtext
RespStepText	resptext
	recordtimestamp
	ordstatus
Remark	remark
	localrespnum
	resptext