

中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0155.2—2018

证券期货业场外市场交易系统接口
第2部分：订单接口

OTC trading system interface for securities and futures market

——Part 2: Orders

2018-01-18 发布

2018-01-18 实施

中国证券监督管理委员会

发布

目 次

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

前 言

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

——第1部分：行情接口；

——第2部分：订单接口；

——第3部分：结算接口。

本部分为JR/T 0155—2018的第2部分。

本部分按照GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

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

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

本部分由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

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

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

引 言

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

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

证券期货业场外市场交易系统接口 第2部分：订单接口

1 范围

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

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

2 规范性引用文件

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

GB/T 2659—2000 世界各国和地区名称代码

GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码

GB 18030—2005 信息技术 中文编码字符集

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

JR/T 0022—2004 证券交易数据交换协议

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

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

参与人 participants

认可场外交易系统的服务声明并完成用户注册流程的法人或其他机构。

3.2

一级产品账户 sender sub id

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

3.3

二级产品账户 security account

参与人为投资者开立的用于记载私募产品份额的账户。

注：编码规则见附录A。

3.4

证券信息请求编号 security status req id

证券公司柜台系统自定义的行情信息报送序号。

3.5

参与人申报单编号 clord id

参与人为每笔申报单分配的编号，在有效申报日期内唯一。

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

3.6

交易系统申报单编号 order id

场外交易系统为每笔申报单统一分配的编号，在有效申报日期内唯一。

3.7

成交记录号 exec id

场外交易系统为执行报告消息分配的连续编号。

注：每个柜台独立分配，并且在单个交易日内唯一。

3.8

成交配对号 trade id

当订单发生部分成交或全部成交时，场外交易系统为买卖双方分配的配对编号。

注：买卖双方共用同一个成交配对号。

3.9

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

系统不同组成部分衔接的约定。

4 会话传输

通信双方应使用实时消息服务进行会话通讯。

通信双方分别基于消息接口的API定义，自行开发消息收发处理程序。

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

5 消息格式

5.1 数据类型

5.1.1 分类

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

5.1.2 整数型

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

整数类型的扩展定义：

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

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

5.1.3 浮点数值

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

浮点数类型的扩展定义：

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

5.1.4 单个字符型

使用char表示。指除界定符外所有字母字符和标点字符，区分字母大小写。

字符类型的扩展定义：

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

5.1.5 字符串型

使用string表示。区分字母大小写。

字符串类型的扩展定义：

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

5.1.6 二进制数据

使用data表示。无格式和内容限制的原始数据，包含长度域和数据域两个部分。

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

5.2 域

5.2.1 域的组成

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

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

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

5.2.2 域的使用

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

5.2.3 自定义域

市场参与者可以根据业务需要扩展定义新的域，即自定义域。

5.2.4 域字符编码

域的取值为汉字时，应按照GB 18030—2005的规定。

域的取值为英文时，应按照ISO/IEC 646:1991的规定。

5.2.5 域界定

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

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

除data数据类型的域以外，其他数据类型的域都不应包含域界定符<SOH>。

5.2.6 语法

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



图1 消息格式

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

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

5.2.7 重复组

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

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

5.3 安全与加密

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

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

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

正文加密方案有三种：

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

5.4 数据完整性

数据完整性可以通过两个方法保证：消息体长度和校验和验证。

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

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

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

5.5 扩展方式

5.5.1 扩展分类

扩展可分为两种类型：消息定义扩展和域定义扩展。

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

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

5.5.2 扩展规则

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

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

消息头的头三个域的定义和位置不能改变，但可以扩展增加消息头的可选域。

消息尾最后一个域的定义和位置不能改变，但可以扩展增加消息尾的可选域。

5.5.3 版本管理

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

6 消息结构

6.1 消息头

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

消息头格式如表1所示。

表1 消息头

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

6.2 消息尾

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

消息尾格式如表2所示。

表2 消息尾

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

7 实时交易业务

7.1 申报请求

7.1.1 订单申报请求 (MsgType=D)

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

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

订单申报请求的格式如表3所示。

表3 订单申报请求

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

7.1.2 撤单申报请求 (MsgType=F)

参与者向场外交易系统发送撤单申报请求，撤消相关订单中所有的未成交部分。

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

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

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

撤单申报请求的格式如表4所示。

表4 撤单申报请求

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

7.1.3 质押回购申报请求 (MsgType=S)

柜台系统通过质押回购申报请求向场外交易系统发起质押回购业务。

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

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

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

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

表5 质押回购申报请求

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

7.2 执行报告 (MsgType=8)

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

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

表6 执行报告

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

7.3 产品状态查询

7.3.1 产品状态请求（MsgType=UF101）

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

产品状态请求的格式如表7所示：

表7 产品状态请求

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

7.3.2 产品状态应答 (MsgType=UF102)

产品状态应答的格式如表8所示。

表8 产品状态应答

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

7.4 账户信息登记

7.4.1 账户登记请求 (MsgType=UF201)

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

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

账户登记请求的格式定义如表9所示。

表9 账户登记请求

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

7.4.2 账户登记应答 (MsgType=UF202)

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

账户登记应答的格式如表10所示。

表10 账户登记应答

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

8 辅助处理

8.1 缺口重发

8.1.1 缺口重发请求 (MsgType=UF007)

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

缺口重发请求的格式如表11所示。

表11 缺口重发请求

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

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

示例：

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

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

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

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

c) 参与者重新请求成交记录号为5到8的执行报告。缺口重发请求的报文如下：

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

8.1.2 缺口重发应答

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

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

8.2 未知消息拒绝应答(MsgType=UF008)

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

未知消息拒绝应答的格式如表12所示。

表12 未知消息拒绝应答

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

9 数据字典

本文件中各个域的如表13所示。

表13 数据域

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

表 13 数据域（续）

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

附 录 A
(规范性附录)
产品账户编码规则

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

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

格式2 机构结算码（5位）+内部账户编码（7位），适用于非金融机构。

其中，机构结算码由场外交易系统统一分配。内部账户编码由参与人自主编制。

附 录 B
(资料性附录)
计算校验和

以下为计算校验和的代码段:

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

附 录 C
(规范性附录)
二级产品账户导入文件数据格式

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

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

表 C.1 二级产品账户导入文件数据格式

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

表 C.1 二级产品账户导入文件数据格式（续）

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

附 录 D
(规范性附录)
消息错误码

本标准所涉及的消息错误码如表D.1所示。

表 D.1 消息错误码

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

表 D.1 消息错误码 (续)

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

表 D.1 消息错误码 (续)

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