

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所

IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者

接口规格说明书 1.54版本



上海证券交易所

二〇二三年九七月

《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书 1.54 版本》发布说明

2023-9-8 新增期权结算价试算结果文件接口 (prestlp03YYYYMMDD.xml)、盘后行情数据与行情文件接口 (mktdt03.txt) 中结算价取值不再填写计算结果, 取值填 0。

2022-7-1 新增期权基础信息第二版文件 (reff0302YYYYMMDD.xml)。

2021-1-19 新增双边报价申报指令、双边报价撤单指令、双边报价申报指令响应、双边报价撤单指令响应。调整执行报告支持业务类型。删除 4.1 行情文件接口文件 (mktdt03) 数据类型取值为 M031 时“产品实时阶段及标志”字段取值‘B’表示休市阶段相关描述。

- 新增双边报价申报指令 (Quote), 请求业务类型编号 (reqid) 新增 OOO 取值, 表示 Quote 订单申报。
- 新增双边报价撤单指令 (QuoteCancel)。
- 新增双边报价申报指令响应 (QuoteResponse)。
- 新增双边报价撤单指令响应 (QuoteStatusReport)。
- 执行报告新增 OOO 类型。
- 删除 4.1 行情文件接口文件 (mktdt03) 数据类型取值为 M031 时“产品实时阶段及标志”字段取值‘B’表示休市阶段。

2019-11-06 对市场参与者接口规格做了修订 (技术开发总部修订), 主要是修订了期权市场参与者数据报送文件字段描述、新增非交易指令-行权指令合并申报指令、组合策略保证的接口。

修订期权市场参与者数据报送文件字段描述

新增非交易指令-行权指令合并申报指令:

- 请求业务类型编号 (reqid) 新增 OCE 取值, 表示行权指令合并申报。
- 新增非交易指令-行权指令合并申报指令。
- 撤单指令新增支持行权指令合并申报撤单。
- 根据行权指令合并申报, 对非交易申报指令响应/非交易撤单指令成功响应消息进行相应修改。

新增组合策略保证金接口

- 根据组合保证金业务方案，在 1 数据格式约定中，新增一类业务请求编号（reqid）为 OML，代表组合与拆分请求，同时新增一类数据广播类型（bcasstype）为 7M，代表期权组合拆分执行报告。
- 新增 3.3 组合与拆分指令、3.15 组合与拆分执行报告、4.7 期权其他业务文件和 4.8 期权组合策略文件。
- 修改 3.1 行情数据、4.1 期权行情文件接口、4.2 期权基础信息文件三个接口文件中关于 TotalLongPosition 字段的描述，表示持仓余额轧差之前的数值。
- 修改 4.4 期权持仓余额对账文件中 PostionQty（持仓余额）字段的描述。该字段表示进行正常轧差后的持仓数据，包含组合所对应持仓数量以及组合持仓余额，组合持仓不参与轧差。
- 修改 4.2 期权基础信息文件中 SecurityStatusFlag（期权合约状态信息标签）字段的描述，新增第 6 位表示是否可以进行垂直价差组合策略。
- 新增 4.3 成交过户数据接口中一类文件体，表示期权当日组合拆分数据。
- 启用 4.2 期权基础信息文件、4.4 期权持仓余额对账文件和 4.5 期权收盘价格文件中预留字段。其中期权基础信息文件中预留日期字段表示垂直价差组合策略到期解除日期，期权持仓余额对账文件中预留数量字段表示组合持仓数量，期权收盘价格文件中预留字段表示未平仓合约数。

2016-8-26 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发总部修订），主要是部分接口新增预留字段：

- 3.1 行情数据和 4.1 期权行情文件接口各新增一个预留时间字段，暂无业务含义。预留字段暂填 00:00:00.000。
- 4.2 期权基础信息新增一个预留日期字段，4.4 期权持仓余额对账文件和 4.5 期权收盘价格文件各新增一个预留数量字段，暂无业务含义。三个预留字段暂填空格。

2015-10-27 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 根据指数熔断，更新 4.1 期权行情接口文件产品实时阶段及标志。
- 根据指数熔断，更新 3.1 行情数据产品实时阶段及标志。

本次修订于 2016 年 1 月 1 日起正式生效。

2015-1-13 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 根据业务的反馈意见，更新 4.6 期权市场参与者数据报送文件中的描述部分。
- 文件接口处理原则中，增加标志文件格式描述。

2014-12-25 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 4.6 期权市场参与者数据报送文件中，去除会员机构代码表。
- 金额描述由精确到 0.1 厘调整为精确到 0.0001 元
- 调整接口中相关字段名，与股票期权试点交易规则一致

2014-12-12 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 文档名称调整为股票期权市场参与者接口规格说明书。

2014-10-30 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 4.6 期权行情文件接口中，明确了相关字段的时间有效性。
- OwnerType102=会员发起,修改为 102=期权经营机构（包括其风险管理部门）发起

2014-10-28 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 4.1 期权行情文件接口中，对于字段“产品实时阶段及标志”，明确该字段第二位为预留，暂填充格。

2014-09-26 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxYYYYMMDD001.txt）中，修改 RFSreamID 字段说明为“A0302 表示期权账户资料信息，此处为唯一值”。
- 期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxYYYYMMDD001.txt）中，补充 BrokerNum 字段说明，“采用全称，如***证券股份有限公司”。
- 期权市场参与者数据报送文件（cybsxxxxYYYYMMDD001.txt）中，补充 mainMargin 字段说明，“各券商按照自己（券商）的方式进行计算即可”。

- 期权市场参与者数据报送文件 (cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt) 中, 补充会员机构代码
- 期权行情新增收盘集合竞价状态

2014-08-26 对市场参与者接口规格做了如下的修订 (技术开发部修订)

- 期权基础信息文件中修改 SecurityStatusFlag 字段, 删除第 5 位关于 D' 表示当日摘牌的合约的描述。

2014-08-21 对市场参与者接口规格做了如下的修订 (技术开发部修订)

- 期权市场参与者数据报送文件中修改报送时间, 从原有的 "15:30-20:00", 调整为 "15:30 (T 日) -7:00 (T+1 日)"
- 成交过户数据接口中修改人民币币种描述, 由 RMB 调整为 CNY

2014-08-07 对市场参与者接口规格做了如下的修订 (技术开发部修订)

- 期权市场参与者数据报送文件 (cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt) 中修改衍生品可用保证金金额字段说明、可买入额度字段说明, 及明确自营账户无需报备。

2014-07-09 对市场参与者接口规格做了如下的修订 (技术开发部修订)

- 期权会员数据报送文件变更为期权市场参与者数据报送文件 (cybsxxxxxYYYYMMDD001.txt)
- 期权行情数据及行情文件接口中, TradingPhaseCode 新增限开仓标识

2014-07-01 对市场参与者接口规格做了如下的修订 (技术开发部修订)

- 在期权基础信息文件中, 修改到期日提醒为 5 日提醒。

2014-06-25 对市场参与者接口规格做了如下的修订 (技术开发部修订)

- 增加 4.6 期权会员数据报送文件, 描述会员报送期权数据文件的格式
- 增加 4.5 期权收盘价格文件, 描述期权系统闭市后的收盘价和参考结算价。

2014-05-15 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 修改期权行情文件接口中校验和字段的校验逻辑

2014-04-14 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 申报指令、证券锁定与解锁指令、行权、会员申请转处置证券账户指令、撤单指令、执行报告中增加合约账户子编码及说明
- 修改期权基础信息中期权合约状态信息标签的第一位含义，改为‘1’表示限制卖出开仓（不包括备兑开仓）和买入开仓

2014-03-04 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 修改行情数据中行情条目价格字段，由 N11(3) 改为 N11(4)
- 修改申报指令中申报价格字段，由 N11(3) 改为 N11(4)
- 修改申报指令响应/撤单指令成功响应消息中市价转限价订单的价格，由 N11(3) 改为 N11(4)
- 修改执行报告中成交价格，由 N11(3) 改为 N11(4)
- 修改行情文件接口中昨日结算价、今日开盘价、动态参考价格、最高价、最低价、最新价、申买价一、申买价二、申买价三、申买价四、申买价五、申卖价一、申卖价二、申卖价三、申卖价四、申卖价五、今日结算价，由 N11(3) 改为 N11(4)
- 修改期权基础信息中期权行权价、合约前收盘价、合约前结算价、标的证券前收盘、涨幅上限价格、跌幅下限价格，由 N11(3) 改为 N11(4)
- 修改成交过户数据接口中成交价格，由 N11(3) 改为 N11(4)
- 新增保证金查询指令与保证金查询响应消息
- 成交过户数据接口中，新增币种、交易经手费字段
- 期权基础信息接口中，新增最小报价单位字段
- T0306 冲销数据（成交过户数据接口）中，删除营业部代码、会员内部订单编号、订单编号、申报时间、成交价格、成交金额、开平标志字段

2014-02-13 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 修改成交过户数据接口中成交编号字段，由 N16 改为 C16
- 修改期权基础信息文件中保证金比例一、保证金比例二，由 N3 改为 N6(2)
- 期权成交过户数据接口中执行类型字段，增加（E=-冲销）取值
- 增加期权持仓余额对账文件
- 修改 8541 域字段名，由 TransacTime 改为 TransacTimeOnly

2013-12-06 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 修改数据格式约定中，请求业务类型编号描述
- 删除标的撤单指令，合并到撤单指令中
- 删除标的证券清单文件
- 行情接口中，增加收盘价的描述

2013-12-05 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 期权基础信息接口文件，新增行权交割日字段
- 期权行情接口，更新虚拟匹配数量与虚拟未匹配数量的字段描述

2013-12-04 期权组内评审，修改如下

- 修改第 3.9 章节标签 453 的说明，增加转处置指令的描述
- 修改第 3.8 章节标签 48 的说明，增加营业部代码的描述

2013-12-03 期权组内评审，修改如下

- 营业部代码统一命名为 branchId
- 记录长度更新为实际长度
- 非交易指令添加营业部代码

2013-11-26 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 调整备兑标志，1 表示备兑，空格表示非备兑。
- 新增非交易指令—会员申请转处置证券账户指令。
- 新增标的证券清单文件
- 成交过户中新增营业部代码字段
- 行情文件接口和行情数据中，更新为 5 档行情
- 版本改为 1.05 版

2013-11-13 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 期权合约的产品代码，中文名改为合约编码。
- 行情接口中增加新字段“未平仓合约数”。
- 期权行情文件接口，“产品实时阶段及标志”字段第 1 位增加“P 表示临时停牌”；第 2 位修改为：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。
- 行情接口中，期权交易状态字段第 1 位，去掉‘A’表示日中集合竞价。
- 备兑标志由 C3 改为 C1。
- 非交易申报指令响应，去掉市价转限价说明部分。
- 非交易申报指令响应，增加冻结/解冻现货的数量字段(预留字段)。
- 期权行情文件接口，行情数据类型 MD301 改为 M0301。
- 成交过户数据接口，交易事务类型 TD305 改为 T0305。
- 期权基础信息，参考数据类型 RF301 改为 R0301；
- 期权基础信息，ContractID 中文名称“期权合约代码”改为“合约交易代码”。
- 成交过户数据接口，删除“此文件每天都发送，哪怕记录数为 0”。
- 期权基础信息，“ref03”改为“reff03”。
- 期权行情文件接口，删除“期权合约更新次数”。
- 文件接口规范中，文件头字段，文件体记录数字段由 N5 改为 N12，数据长度字段由 N10 改为 N12。
- 期权基础信息文件接口，去掉第一行特殊记录与最后一行特殊记录。
- 成交过户数据文件接口，去掉第一行特殊记录与最后一行特殊记录。
期权基础信息文件接口中，‘昨日收盘价’字段，去掉‘如遇除权除息则为调整后的结算价（合约上市首日填写参考价）’说明部分。
- 期权基础信息文件接口中，‘昨日结算价’字段，新增‘如遇除权除息则为调整后的结算价（合约上市首日填写参考价）’说明部分。
- 期权基础信息文件接口中，‘涨跌幅限制类型’字段，去掉‘R 表示交易规则 3.4.15 和 3.4.16 规定的无涨跌幅限制类型’
- 期权基础信息文件接口中，‘期权合约状态信息标签’字段第 2 位，调整为‘0’表示未连续停牌或未暂停，‘1’表示连续停牌或暂停。

2013-09-30 根据所内技术开发部评审意见，进行如下的修订（技术开发部修订）

- 更新文档到 1.03 版本

- 删除“非交易指令-实物交割意向”
- 更新“证券冻结与解冻指令”为“证券锁定与解锁指令”
- 修改期权基础信息中的字段，删除“交易会员持仓限制”和“保证金比例”字段；补充新字段“保证金计算比例参数一”，“保证金计算比例参数二”
- 对于期权基础信息中的“期权合约状态信息标签”字段，第一位开仓控制字段，更新了描述“卖开禁止，买开不禁止”。
- 删除单边持仓逻辑下的头寸冲销数量，更新了申报指令响应、执行报告和成交过户数据接口。
- 删除申报指令中对于“备兑优先”功能的选项。

2013-09-15 根据所内技术开发部评审意见，进行如下的修订（技术开发部修订）

- 删除 799888 取值及含义说明
- 修改行文描述，“TD0302”改为“TD302”；“现行权”改为“行权”
- 修改非交易申报指令相应中，关于标签 151 的描述，改为“非交易申报的数量”
- 修改 SenderCompID 的取值，改为“XSHG03”
- 其他样式优化，删除封面中的多余字符“(”

2013-09-13 根据所内技术规划部反馈意见，进行如下的修订（技术开发部修订）

- 期权合约的产品代码，英文名改为 SecurityID，类型改为 C8。原有标的证券名 SecurityID，改为 UnderlyingSecurityID，标签由 48 改为 308
- 产品价格为由 N10 改为 N11(3)，带 3 位小数，精确到厘
- 单笔合约、成交金额由 N16 改为 N16(2)，带 2 位小数，精确到分
- Transactime 域标签由 60 改为 8541

2013-09-05 根据所内及其他接口规格讨论意见，进行如下的修订（技术开发部修订）

- 新增独立的产品代码标识，N8
- 统一字段格式，价格为 N10，不带小数点，单位：厘
- 保证金、成交金额为 N16，不带小数点，单位：分
- 统一行情格式中关于“动态参考价格”的描述
- 期权行情文件中补充“今日结算价”
- 期权行情文件中补充了对于集合竞价状态下，产品虚拟成交价、虚拟匹配和买/卖方未匹配量的说明
- 新增非交易申报的响应结构

2013-08-29 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- STEP 消息规范-行情数据中，开盘（上次）集合竞价价格修订为动态参考价格
- 去除 T 日（T+1 日）相关的定义
- 去除期权合约代码的解释性文字
- 结算会员持仓限额修订为交易会员持仓限额

- 执行报告中去除备兑优先相关的描述
- 格式统一

2013-08-26 对市场参与者接口规格做了如下的修订（技术开发部修订）

- 新增实物交割意向申报，OTP
- STEP 消息处理原则章节，补充了格式约定
- 行情数据、行情文件接口中更新了状态字段，取值位的标识说明
- 申报指令，补充了交易时段与订单类型的说明、增加了申报来源的取值类型、增加了“最小成交数量”字段、移除了结算会员代码
- 行权指令、实物交割意向、执行报告、成交过户数据、四个接口中移除结算会员代码，更新申报来源取值
- 格式调整：字体和引用说明，拼写和语法修正

2013-08-16 根据个股期权业务方案更新稿，调整并修订市场参与者接口规格（技术开发部修订）

2013-07-15 根据个股期权业务方案对市场参与部分做更新（技术开发部修订）

2012-06-06 对市价转限价订单在没有任何对手盘可供成交之际的申报应答作出补充说明

本文档为市场参与者与本所通过 STEP 消息和文件交互等方式进行期权交易的接口规格。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

服务电话：4008888400-2

通信地址：上海市浦东南路 528 号上海证券交易所

目录

1	数据格式约定	12
2	期权交易系统接口规范	14
2.1	STEP 消息处理原则	14
2.1.1	消息流程图	14
2.1.2	格式约定	15
2.2	文件接口处理原则	16
2.2.1	格式约定	16
2.2.2	结构描述	16
2.2.3	标志文件	17
3	STEP 消息规范	19
3.1	行情数据	19
3.2	申报指令	22
3.3	双边报价申报指令	24
3.4	双边报价撤单指令	26
3.5	双边报价申报指令响应	28
3.6	双边报价撤单指令响应	29
	双边报价撤单指令响应消息	29
3.7	组合与拆分指令	31
3.8	非交易指令—证券锁定与解锁指令	33
3.9	非交易指令—行权指令	34
3.10	非交易指令—行权指令合并申报指令	36
3.11	非交易指令—会员申请转处置证券账户指令	37
3.12	撤单指令	39
3.13	申报指令响应/撤单指令成功响应消息	41
3.14	非交易申报指令响应/非交易撤单指令成功响应消息	43
3.15	撤单指令失败响应消息	45
3.16	执行报告	45
3.17	保证金查询指令	49
3.18	保证金查询响应报告	49
3.19	组合与拆分执行报告	50
4	文件接口规范	54
4.1	期权行情文件接口 (mktdt03.txt)	54
4.2	期权基础信息 (reff03MMDD.txt)	59
4.3	期权基础信息第二版 (reff0302YYYYMMDD.xml)	63
4.4	成交过户数据接口 (trns03XXXXX.txt)	66

4.5	期权持仓余额对账文件 (hold03xxxxx.txt)	70
4.6	期权收盘价格文件 (clpr03MMDD.txt)	71
4.7	期权市场参与者数据报送文件 (cybsXXXXXXYYYYMMDD001.txt)	72
4.8	期权其他业务文件 (qtyw03XXXXX.txt)	75
4.9	期权组合策略文件 (zhcl03MMDD.txt)	76
4.10	期权结算价试算结果文件 (prestlp03YYYYMMDD.xml)	78

1 数据格式约定

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。

其中，数据库接口中：

请求业务类型编号 (reqid)，本业务取值：

- OTO = 申报指令-期权订单 (Option Trading Order Entry)
- OTU = 非交易指令-证券锁定与解锁 (Option Trading UnderlyingFreeze)
- OTE = 非交易指令-行权指令/撤销行权 (Option Trading Execution)
- OCE = 非交易指令-行权指令合并申报 (Option Trading Combination Execution)
- OTT = 非交易指令-会员申请转处置证券账户 (Option Trading Transfer for Execution)
- OMR= 保证金查询指令 (Option Margin Requirement)
- OML= 申报指令-组合与拆分请求 (Option Multiple Leg)
- OQO=申报指令-期权双边报价订单 (Option Quote Order Entry)

数据广播类型 (bcasttype)，本业务取值：

7C 期权交易执行报告

7H 期权交易行情数据

7M 期权组合拆分执行报告

消息类型 (MsgType)，本业务取值：

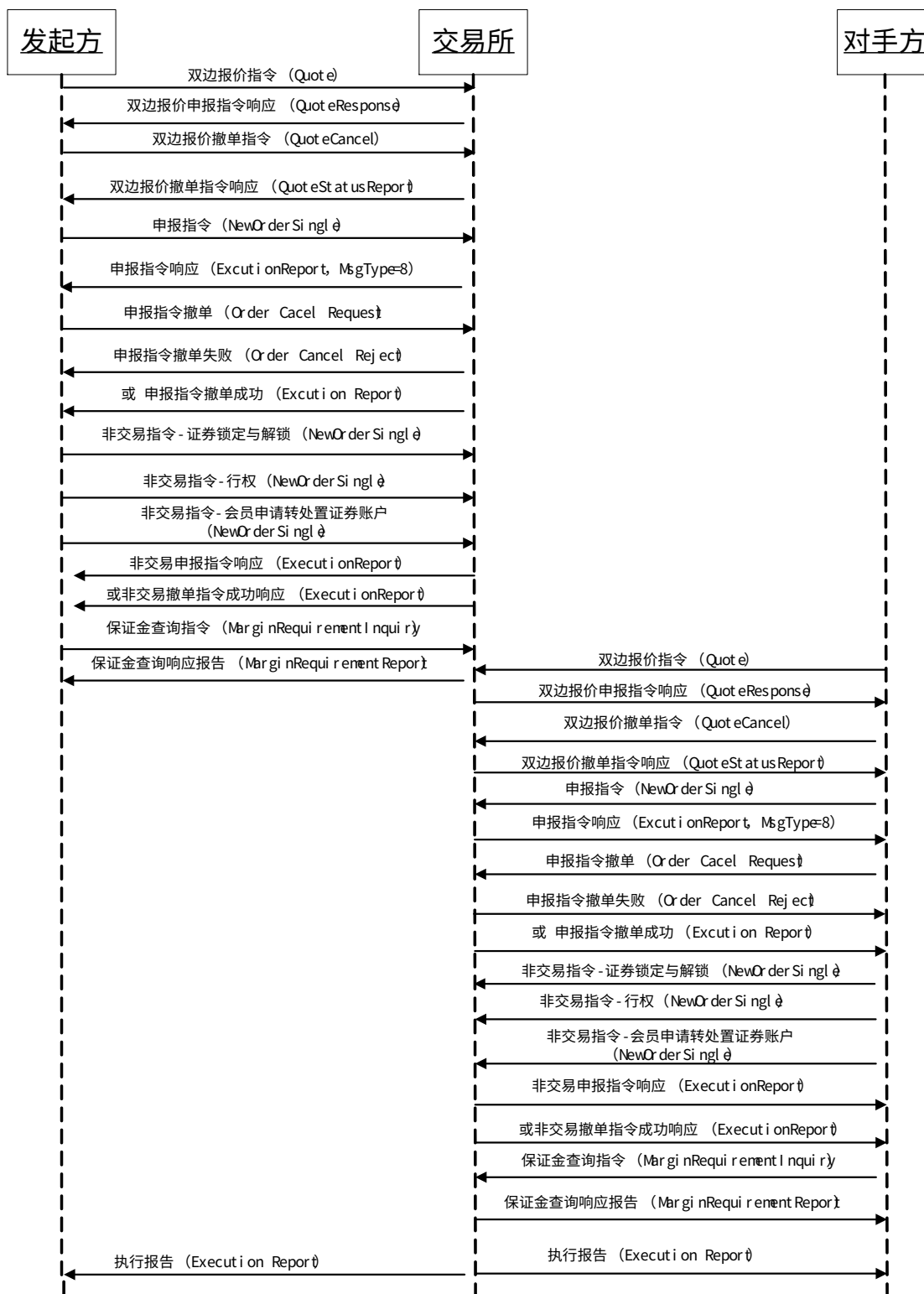
- 8 = 申报响应或执行报告 (Execution Report)
- 9 = 申报撤失败 (OrderCancelReject)
- D = 申报 (NewOrder Single)
- S= 双边报价 (Quote)
- F = 申报撤单 (OrderCancel Request)
- Z= 双边报价撤单 (QuoteCancel)
- W= 行情数据 (MarketData)
- CH = 保证金查询指令 (Margin Requirement Inquiry)
- CJ = 保证金查询响应消息 (MarginRequirementReport)
- AJ= 双边报价申报指令响应 (QuoteResponse)
- AI= 双边报价撤单指令响应 (QuoteStatusReport)

2 期权交易系统接口规范

2.1 STEP 消息处理原则

2.1.1 消息流程图

根据期权交易的操作流程，市场参与者通过 STEP 接口进行申报，交易平台通过集合竞价和连续竞价的模式进行撮合配对。发起方可以进行申报，以及相应的撤单等操作。下图描述了期权交易的 STEP 消息通信流程。



图表 1STEP 消息交互逻辑图

2.1.2 格式约定

对于 STEP 消息，格式约定如下：

- (一) 所有的 STEP 消息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；
- (二) STEP 消息中的字段对于字符型字段，空格表示空值；对于数值型字段，0 表示空值；

(三) 前后台对 STEP 消息的处理过程中, 不对消息的长度做严格校验, 从而支持在协议尾补充新字段的扩展。

2.2 文件接口处理原则

期权交易系统生成给市场参与者的文件接口为基于 ASCII 的 TXT 文本。

对于 TXT 文本格式, 需要遵循以下的处理原则。

2.2.1 格式约定

文本 txt 文件, 格式约定如下:

- (一) 竖线('|')为字段间分隔符, 字段数据内容不应含有分隔符;
- (二) 竖线('|')不应用在每条记录的开头和结尾;
- (三) 各字段均为一个遵循格式定义的字符串, 字段间有严格前后顺序;

(四) 字段定长, 字段格式定义约定了长度和精度; 字符型字段以 CX 格式表示, 其中 X 代表字符串长度, 不足部分左对齐, 右补空格; 整数数字型字段以 NX 格式表示, 其中 X 代表数字型字符串长度, 不足部分右对齐, 左补空格; 浮点数字型字段以 NX (Y) 格式表示, 其中 X 代表数字型字符串总长度, Y 代表小数位数, X 包括一位小数点, 整数部分最多不超过 X-Y-1 位, 小数部分最多不超过 Y 位, 不足部分右对齐, 左补空格;

- (五) 每行以二进制 0x0A 结束, 最后一行也以 0x0A 结束。

(六) 文档命名采取文档含义(英文缩写)和类型数字标签相结合的方式, 格式为“ABCDEFxy”。第一部分“ABCDEF”为文档含义的英文缩写, “xy”为两位的阿拉伯数字, 表示平台来源。例如“TRNSDT03”, TRNSDT 代表事务类数据, 03 代表衍生品交易平台。

(七) 文档中记录会采用记录标识类型, 格式为“GHyz”。“GH”取文档含义中的两个首字母, “y”从文档名称中继承, “zz”是同类文档中的细分。例如“TRNSDT03”表示非交易业务数据, 记录中“TD301”表示成交数据、“TD302”表示行权数据。

2.2.2 结构描述

TXT 格式的文件, 将采用以下的组织结构。

- (一) 行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分;
- (二) 期权基础信息和成交过户数据接口文件仅包含文件体一个部分

(三) 注意文件具有可扩展性, 文件记录尾部可能随时增加扩展字段, 接收处理方能向下兼容处理, 即增加扩展字段后, 对新增字段无需识别处理的用户, 不需要升级系统;

(四) 文件体中, 对于不同的记录数据类型, 分别定义记录格式, 接收处理方能根据行情数据类型识别处理;

以期权行情文件为例，其结构图如下：



图表 2 文件结构示意图

文件结构描述参考：

```

BeginString|Version|BodyLength|TotNumTradeReports|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|
MDSesStatus

MDStreamID|SecurityID|Symbol|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|OpenPrice|HighPrice|LowPrice|
TradePrice|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|TradingPhaseCode|Timestamp

.....

.....

.....

EndString|Checksum
    
```

图表 3 文件组织示例图

2.2.3 标志文件

标志文件命名规则为：主文件名.flg,其中主文件名为其所标志的文件的名字。

文件内容如下：

编号	字段名	字段类型	描述	必选项
1	File Name	C 60	被标志的文件名	是
2	File Size	C 16	文件大小，以字节为单位	是
3	Creation Date	C 8	该文件的生成日期， YYYYMMDD 格式	是
4	Creation Time	C 6	文件生成时间， HHMMSS 格式	是
5	Record Number	C 12	文件记录数（含文件头和 文件尾两行）	是
6	Check Sum	C 64	MD5 校验码	是

7	Reserved Field	C 64	预留字段	
---	----------------	------	------	--

表格 1: 标志文件格式

文件发送方应在数据文件发送完毕后发送该标志文件，文件接收方要在发现和成功读取该标志文件后，读取数据文件。

标志文件行尾以换行符 0x0A 结束。

3 STEP 消息规范

本部分描述了市场参与者系统同上交所期权交易系统之间的接口消息文本格式, 对应前面章节数据库接口表中的各消息文本字段, 采用 STEP 格式封装。

3.1 行情数据

MktDataFull (MDText)	公共数据消息
<p>描述:</p> <p>本消息用来发送市场有效时段内的所有的报价行情信息, 由后台向市场参与者单向发送。每条消息对应单个期权行情信息。</p> <p>在 STEP 消息中, 提供完整的交易相关信息和五档的行情数据。</p> <p>最大长度: 704 字节</p>	

标签	域名	说明	类型
	消息头	MsgType=W	
963	MDReportID	交易所行情信息编号(预留、暂不填)	C16
1187	RefreshIndicator	用于标识消息中是否有新的行情数据, 取值: 有=1, 无=0, 推送已有行情信息为 0, 否则为 1。(预留, 暂填 0)	N5
48	SecurityID	合约编码	C8
8506	TotalLongPosition	总持仓量。单位是 (张) 此处总持仓量值为持仓余额轧差之前的数值。	N12

8538	TradingPhaseCode	<p>期权交易状态，取值范围如下： 字段为4位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 第1位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘B’表示休市时段，‘E’表示闭市时段，‘V’表示波动性中断，‘P’表示临时停牌，‘U’收盘集合竞价。‘M’表示可恢复交易的熔断（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断（暂停交易至闭市） ● 第2位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填充格） ● 第3位：‘0’表示不限制开仓，‘1’表示限制备兑开仓，‘2’表示卖出开仓，‘3’表示限制卖出开仓、备兑开仓，‘4’表示限制买入开仓，‘5’表示限制买入开仓、备兑开仓，‘6’表示限制买入开仓、卖出开仓，‘7’表示限制买入开仓、卖出开仓、备兑开仓 ● 第4位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。 	C4
8541	TransactTimeOnly	预留时间字段暂填 00:00:00.000	C12
8504	TotalValueTraded	当日累计成交金额，精确到分	N16(2)
387	TotalVolumeTraded	当日累计成交数量	N12
268	NoMDEntries	<p>行情条目个数，取值=16，本重复组依次包括今开盘价(269=4)、结算价(269=6)、最高价(269=7)、最低价(269=8)、动态参考价格(269=x)（该价格即为断路器参考价）、最新价(269=2)、以及五档买入价量信息(269=0，MDEntryPositionNo 从1至5)、五档卖出价量信息(269=1，MDEntryPositionNo 从1至5)，其中价格由 MDEntryPx 表示，数量由 MDEntrySize 表示。</p>	N5

行情条目 明细	269	MDEntryType	行情条目类别： 今开盘价=4 结算价=6 最高价=7 最低价=8 动态参考价格=x 最新价=2 买入=0 卖出=1	C2
	270	MDEntryPx	行情条目价格，单位：元（精确到0.0001元）	N11(4)
	271	MDEntrySize	行情条目数量，如果数据组不含数量信息，则此字段不出现	N12
	290	MDEntryPositionNo	行情条目买卖盘序号，对应五档买入卖出价格的档位信息，否则此字段不出现	N3

说明：

- 在集合竞价时段内：
 1. 当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第一档行情同时为动态参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格；
 2. 同时，当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第一档行情数据中的申买量和申卖量分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟匹配量。
 3. 同时，当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第二档行情数据中的申买量和申卖量分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟未匹配量。

- 在闭市时段内：
 1. 最新价（269=2）中的价格为收盘价；
 2. 今日结算价（SettlePrice）暂为0
 3. 今日结算价通过期权收盘价格文件（clpr03MMDD.txt）揭示

- 产品实时阶段及标志中，第4位（是否接受新订单申报），仅在交易时段有效，在非交易时段无效。

3.2 申报指令

NewOrderSingle (ReqText)	申报指令消息
<p>描述:</p> <p>请求业务类型编号 (reqid) , 本业务取值: OTO = 申报指令-期权订单</p> <p>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行申报指令申报, 对应申报接口表中的 ReqText。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、申报指令中的订单有效时间类型 (59) 取值与订单类型对应关系如下: <ol style="list-style-type: none"> 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: <ol style="list-style-type: none"> 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、申报指令中的备兑标签 (203) 适用于: <ol style="list-style-type: none"> 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 <p>最大长度: 88 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: D=申报指令	
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
48	SecurityID	合约编码	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		N 3
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, 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

3.3 双边报价申报指令

Quote (ReqText)		申报指令消息	
<p>描述:</p> <p>该指令目前仅允许期权做市商使用。</p> <p>请求业务类型编号 (reqid), 本业务取值: OQO = 申报指令-期权 Quote 订单</p> <p>市场参与者使用 Quote 指令消息进行申报, 对应申报接口表中的 ReqText。</p> <p>该类订单默认为限价 (Limit) 订单, 当日有效 (GFD),</p> <p>仅限买入开仓/平仓, 卖出开仓/平仓, 不支持备兑开仓/平仓。</p> <p>同一投资者在同一合约上已有报价时, 新申报指令可更新该合约上的报价。</p> <p>最大长度: 106 字节</p>			
标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: S= Quote 订单申报指令	
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

Quote (ReqText)		申报指令消息		
48	SecurityID	合约编码		C8
522	OwnerType	订单所有类型, 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	申报买报价, 单位: 元 (精确到 0.0001 元)		N11(4)
133	OfferPx	申报卖报价, 单位: 元 (精确到 0.0001 元)		N11(4)
134	BidSize	申报买数量 (张)		N10
135	OfferSize	申报卖数量 (张)		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
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, 为原始申报的申报交易单元代码。	C5

Quote (ReqText)		申报指令消息		
	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

填写说明:

申报买报价 (BidPx) : 取值 ≥ 0 , 买方报价时, 取值 > 0 , 买方不报价时, 取值无意义。

申报卖报价 (OfferPx) : 取值 ≥ 0 , 卖方报价时, 取值 > 0 ; 卖方不报价时, 取值无意义。

申报买数量 (BidSize) : 买方报价时, 取值 > 0 ; 买方不报价时, 取值 $= 0$ 。

申报卖数量 (OfferSize) : 卖方报价时, 取值 > 0 ; 卖方不报价时, 取值 $= 0$ 。

买开仓/平仓标志 (BidPositionEffect) : 买方报价时, 取值有效, 买方不报价时, 取值无意义。

卖开仓/平仓标志 (OfferPosionEffect) : 卖方报价时, 取值有效, 卖方不报价时, 取值无意义。

3.4 双边报价撤单指令

QuoteCancel (ReqText)		双边报价撤单指令消息		
描述: 该指令目前仅允许期权做市商使用。 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) 支持双边报价撤单指令的有且仅有: 000 = 申报指令-双边报价订单 最大长度: 106 字节				
标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值为: Z= Quote 订单撤单指令		
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	

QuoteCancel (ReqText)		双边报价撤单指令消息		
522	OwnerType	订单所有类型，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	申报买报价，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)	
133	OfferPx	申报卖报价，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)	
134	BidSize	申报买数量（张）	N10	
135	OfferSize	申报卖数量（张）	N10	
8909	BidPositionEffect	买开仓/平仓标志，取值：C=平仓，O=开仓，无意义	C1	
8910	OfferPosionEffect	卖开仓/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，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

QuoteCancel (ReqText)		双边报价撤单指令消息		
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

填写说明:

申报买报价 (BidPx) : 取值无意义, 取值需 ≥ 0 。

申报卖报价 (OfferPx) : 取值无意义, 取值需 ≥ 0 。

申报买数量 (BidSize) : 撤销买方报价时, 取值=0; 不撤销买方报价时, 取值无意义, 取值需 > 0 。

申报卖数量 (OfferSize) : 撤销卖方报价时, 取值=0; 不撤销卖方报价时, 取值无意义, 取值需 > 0 。

3.5 双边报价申报指令响应

QuoteResponse (RespText)		双边报价订单申报指令响应消息	
描述: 该响应目前仅允许期权做市商使用。 每一个 Quote 指令消息都有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理 Quote 申报后返回的确认信息。 申报成功响应: 150=0, 39=0 申报失败响应: 150=8, 39=8 最大长度: 101 字节			
标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: AJ=Quote 订单申报响应	
37	OrderId	交易所订单编号	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
48	SecurityID	合约编码	C8

QuoteResponse (RespText)		双边报价订单申报指令响应消息		
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	
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.000	C12	
73	NoOrders	订单更新方向数，取值=2	N2	
被撤销买 订单信息	41	OrigClOrdID	对于更新报价成功响应，为被撤买报价原始客户端会员内部订单编号（原 QuoteMsgID），无被撤买报价时，取值为空。	C10
	151	LeavesQty	填写买报价撤单成功的数量；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	对于更新报价成功响应，为被撤卖报价原始客户端会员内部订单编号（原 QuoteMsgID），无被撤卖报价时，取值为空。	C10
	151	LeavesQty	填写卖报价撤单成功的数量；缺省填 0	N12
	54	Side	买卖方向，取值：2 表示卖	C1

3.6 双边报价撤单指令响应

QuoteStatusReport (RespText)	双边报价撤单指令响应消息
<p>描述：</p> <p>该响应目前仅允许期权做市商使用。</p> <p>每一个 QuoteCancel 指令都有一个对应的响应消息。市场参与者（目前仅允许期权做市商）系统可以获得上交所处理 QuoteCancel 申报后返回的确认信息。</p>	

QuoteStatusReport (RespText)		双边报价撤单指令响应消息		
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 最大长度： 101 字节				
标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值为： AI =Quote 订单撤单指令响应		
37	OrderId	交易所订单编号，为空	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	
48	SecurityID	合约编码	C8	
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	
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.000	C12	
73	NoOrders	订单撤单方向数量，取值=2	N2	
被撤销买订单信息	41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应，为被撤买报价原始客户端会员内部订单编号（原 QuoteMsgID），无被撤买报价时，取值为空。	C10
	151	LeavesQty	填写买报价撤单成功的数量；缺省填 0	N12
	54	Side	买卖方向，取值：1 表示买	C1

QuoteStatusReport (RespText)			双边报价撤单指令响应消息	
被撤销卖 订单信息	41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应，为被撤卖 报价原始客户端会员内部订单 编号（原 QuoteMsgID），无被 撤卖报价时，取值为空。	C10
	151	LeavesQty	填写卖报价撤单成功的数量； 缺省填 0	N12
	54	Side	买卖方向，取值：2 表示卖	C1

3.7 组合与拆分指令

NewOrderSingle (ReqText)	组合与拆分指令消息
<p>描述：</p> <p>请求业务类型编号 (reqid)，本业务取值：OML = 组合与拆分指令</p> <p>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行组合与拆分指令申报，对应申报接口表中的 ReqText。</p> <p>组合与拆分指令不允许撤单</p> <p>最大长度： 157 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为：D=申报指令	
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

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		N 3
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	448	PartyID	发起方投资者账户子编码，888	C3

投资者 账户 子编 码	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

3.8 非交易指令—证券锁定与解锁指令

NewOrderSingle (ReqText)	申报指令消息
<p>描述：</p> <p>请求业务类型编号 (reqid) ，本业务取值：OTU = 非交易指令—证券锁定与解锁指令</p> <p>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行证券锁定与解锁指令申报，对应申报接口表中的 ReqText。</p> <p>最大长度： 68 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为： D=申报指令	

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
308	UnderlyingSecurityID	证券代码，此处针对合约的标的证券		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
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，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

3.9 非交易指令—行权指令

NewOrderSingle (ReqText)	申报指令消息
--------------------------	--------

NewOrderSingle (ReqText)	申报指令消息
<p>描述:</p> <p>请求业务类型编号 (reqid) , 本业务取值: OTE = 非交易指令-行权指令</p> <p>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行行权指令申报, 对应申报接口表中的 ReqText。</p> <p>最大长度: 72 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值为: D=申报指令		
11	CIOrdID	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	
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	N 3	
38	OrderQty	申报数量 (张)	N10	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 取值=4, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、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	N4

			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, 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

3.10 非交易指令—行权指令合并申报指令

NewOrderSingle (ReqText)	申报指令消息
<p>描述:</p> <p>请求业务类型编号 (reqid), 本业务取值: OCE = 非交易指令—行权指令合并申报</p> <p>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行行权指令合并申报, 对应申报接口表中的 ReqText。</p> <p>最大长度: 102 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值为: D=申报指令		
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	
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:	N3	

		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		
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。	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，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

3.11 非交易指令—会员申请转处置证券账户指令

NewOrderSingle (ReqText)	申报指令消息
描述： 请求业务类型编号 (reqid) ， 本业务取值：OTT = 非交易指令—会员申请转处置证券账户指令	

NewOrderSingle (ReqText)	申报指令消息
市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行会员申请转处置证券账户指令申报，对应申报接口表中的 ReqText。 最大长度： 71 字节	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为： D=申报指令	
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
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	N 3
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	448	PartyID	投资者账户

账户	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

3.12 撤单指令

OrderCancel Request (ReqText)	撤单指令消息
<p>描述：</p> <p>市场参与者使用 OrderCancel Request 消息进行撤单指令，对应申报接口表中的 ReqText</p> <p>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：</p>	

OrderCancel Request (ReqText)	撤单指令消息
<ul style="list-style-type: none"> ● OTO = 申报指令-期权订单 ● OTE = 非交易指令-行权指令 ● OCE = 非交易指令-行权指令合并申报 ● OTT = 会员申请转处置证券账户指令 <p>以下的请求业务类型，不支持撤单：</p> <ul style="list-style-type: none"> ● OTU = 非交易指令-证券锁定与解锁指令 ● OMR= 保证金查询指令 <p>最大长度： 72 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为： F=撤单指令	
11	CIOrdID	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	OrigCIOrdID	原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤单订单的 CIOrdID	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 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	N 3

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

3.13 申报指令响应/撤单指令成功响应消息

ExecutionReport (RespText)	申报响应/撤单指令成功响应消息
<p>描述：</p> <p>每一个申报记录都分别有一个对应的申报响应。</p> <p>每一个申报指令记录或撤单指令记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。</p> <p>150 和 39 组合取值含义：</p> <p>成交申报成功响应：150=0，39=0</p> <p>拒绝响应：150=8，39=8</p>	

ExecutionReport (RespText)	申报响应/撤单指令成功响应消息
撤单指令成功响应：150=6,39=6 市价转限价订单，在没有任何对手盘可供成交，从而自动全额撤单的情形作出如下补充说明： 期权交易系统将返回一条拒绝响应信息，以造成类似于前端检查未通过时订单被拒的情形。 最大长度： 86 字节	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为：8=申报响应	
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，指示被撤消订单的 ClOrdID，对于申报响应，取值为空。	C10
8541	TransactTimeOnly	接受请求时间，格式为 HH:MM:SS.000	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；当对应申报是限价订单时，填写撤单成功的数量；缺省填 0	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
-----	--------------	--	----

3.14 非交易申报指令响应/非交易撤单指令成功响应消息

ExecutionReport (RespText)	申报响应/撤单指令成功响应消息
<p>描述：</p> <p>每一个申报记录都分别有一个对应的申报响应。</p> <p>每一个申报指令记录或撤单指令记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。</p> <p>150 和 39 组合取值含义：</p> <p>成交申报成功响应：150=0, 39=0</p> <p>拒绝响应：150=8, 39=8</p> <p>撤单指令成功响应：150=6, 39=6</p> <p>1362 重复组（冻结/解冻数量）预留，暂不填。</p> <p>最大长度：122 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为：8=申报响应	
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； 对于证券锁定与解锁指令及会员申请转处置证券账户指令，填写标的证券的产品代码，6位整数； 对于行权指令合并申报指令，为空		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，指示被撤消订单的 ClOrdID，对于申报响应，取值为空。		C10
8541	TransactTimeOnly	接受请求时间，格式为 HH:MM:SS.000		C12
151	LeavesQty	非交易申报的数量；缺省填 0		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
1362	NoFills	冻结/解冻数量个数，取值=3，本重复组依次包括当日可卖，可申赎(1443=101)的冻结/解冻数量，当日不可卖，可申赎(1443=102)的冻结/解冻数量，当日可卖，不可申赎(1443=103)的冻结/解冻数量。		N2
当日可卖、可申赎的冻结/解冻数量	1443	FillLiquidityI nd	取 101，表示当日可卖、可申赎。	C3
	1365	FillQty	冻结/解冻数量值。	N12
当日不可卖，可申赎的冻结/解冻数量	1443	FillLiquidityI nd	取 102，表示当日不可卖，可申赎。	C3
	1365	FillQty	冻结/解冻数量值。	N12
当日可卖，不可申赎的冻结/解冻数量	1443	FillLiquidityI nd	取 103，表示当日可卖，不可申赎。	C3
	1365	FillQty	冻结/解冻数量值。	N12

3.15 撤单指令失败响应消息

OrderCancelReject (RespText)	撤单指令失败响应消息
<p>描述:</p> <p>每一个撤单指令消息都有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理撤单申报后返回的确认信息。</p> <p>最大长度: 55 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: 9=撤单指令失败响应。	
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	CIOrdID	会员内部编号	C10
41	OrigCIOrdID	原始交易客户方(券商)订单编号, 指示被撤单订单的 CIOrdID	C10
8541	TransactTimeOnly	接受请求时间, 格式为 HH:MM:SS.000	C12
102	CxIRejReason	撤单失败时, 撤单请求拒绝的代码。	C5
434	CxIRejResponseTo	撤单响应类型, 取值: 1=撤单响应	C1

3.16 执行报告

ExecutionReport (ExecReportText)	执行报告消息
<p>描述:</p> <p>每一个成交确认记录都对应包含一个执行报告消息, 该消息文本由成交回报表中的 ExecReportText 字段包含。</p> <p>对于现有的请求业务类型编号 (reqid) 支持执行报告的指令的有且仅有:</p> <ul style="list-style-type: none"> ● OTO = 申报指令-期权订单 ● OQO=申报指令-Quote 订单 	

ExecutionReport (ExecReportText)	执行报告消息
以下的请求业务类型，不支持发送执行报告： <ul style="list-style-type: none"> ● OTE = 非交易指令-行权指令 ● OTU = 非交易指令-证券锁定与解锁指令 ● OTT= 非交易指令-会员申请转处置证券账户指令 ● OMR= 保证金查询指令 最大长度：175 字节	

序号	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为：8=成交回报	
11	ClOrdID	会员内部编号 以 QP1 开头，表示为交易所保证金强制平仓 以 CV1 开头，表示为交易所备兑强制平仓 Quote 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.000	C12
42	OrigTime	原有订单请求接收的时间，式为 HH:MM:SS.000	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		N 3
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

3.17 保证金查询指令

MarginRequirementInquiry (ReqText)	保证金查询指令消息
<p>描述:</p> <p>请求业务类型编号 (reqid) , 本业务取值: OMR(option margin requirement) = 保证金查询指令</p> <p>市场参与者使用 MarginRequirementInquiry 消息进行保证金查询请求, 对应申报接口表中的 ReqText</p> <p>申报接口表中的 securityid 必须填写 00000000 (虚拟查询编码)</p> <p>最大长度: 50 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为 CH	
1635	MarginReqmtIn qlD	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。
	452	PartyRole	取 100, 表示当前 PartyID 的取值为保证金账号。
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。

3.18 保证金查询响应报告

MarginRequirementReport (RespText)	保证金查询响应报告
<p>描述:</p> <p>每一个保证金查询请求都分别有一个对应的保证金查询 report。</p> <p>最大长度: 105 字节</p>	

标签	字段名	字段描述		类型
	消息头	MsgType 取值为 CJ		
1635	MarginReqmtInqID	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.000		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。此处填写-1，表示本域不启用。		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

3.19 组合与拆分执行报告

ExecutionReport (ExecReportText)	组合与拆分执行报告
----------------------------------	-----------

ExecutionReport (ExecReportText)	组合与拆分执行报告
<p>描述:</p> <p>每一个成功的组合与拆分指令的都对应一个执行报告消息，该消息文本由成交回报表中的 ExecReportText 字段包含。</p> <p>最大长度: 142 字节</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: 8=执行报告	
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： 9000000000000001	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： 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。	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

8541	TransactTime Only	订单执行时间，格式为 HH:MM:SS.000	C12
42	OrigTime	原有订单请求接收的时间，式为 HH:MM:SS.000	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	N 3
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，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 文件接口规范

本部分描述了市场参与者系统同上交所期权交易平台之间的文件接口。

4.1 期权行情文件接口 (mktDt03.txt)

mktDt03.txt	行情文件接口
<p>描述:</p> <p>本文件为行情文件接口。对于期权交易系统生产环境,行情文件名为 mktDt03.txt,当日开市前至交易结束期间实时发送。</p> <p>行情文件为文本 txt 文件,文件描述:</p> <ul style="list-style-type: none"> (一) 行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分; (二) 注意行情文件可扩展性,文件记录尾部可能随时增加扩展字段,接收处理方应能向下兼容处理,即增加扩展字段后,对新增字段无需识别处理的用户,不需要升级系统; (三) 文件体中,对于不同的行情数据类型,分别定义记录格式,接收处理方应根据行情数据类型识别处理; (四) 文件体记录按行情数据类型递增,同一行情数据类型按证券代码递增; (五) 对于摘牌后的产品,文件中不包含该产品的记录; (六) 如文件中数值字段取值超过约定格式最大值,取最大值,如 N10 取 9999999999; (七) 前收盘价格,在开市之前即行发布; (八) 对于价格、金额数据,单位为人民币元。对于数量数据,合约单位为张; (九) 在集合竞价时段内,当前买入价和当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格,即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时申买量一和申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量; (十) 字段无意义或无该字段行情数据时,填充格; (十一) 交易所具体产品代码,参见相关发文通知,并参考以上处理。 <p>记录长度: 426 字节/合约</p>	

格式定义:文件头定义,第一行特殊记录:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER
2	Version	版本	C8	DTP1.00

序号	域名	字段名	字段类型	描述
3	BodyLength	数据长度	N12	计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。 (暂不填写)
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N12	文件体记录数
5	MDReportID	行情序号	N8	行情文件序号（预留，暂不填）
6	SenderCompID	发送方	C6	发送方标示符，取 XSHG03
7	MDTime	行情时间	C21	行情时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000
8	MDUpdateType	发送方式	N1	0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental（暂不支持）
9	MDSesStatus	市场行情状态	C8	全市场行情状态： 该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。 第 1 位：‘S’表示全市场启动期间（开市前），‘T’表示全市场处于交易期间（含中间休市），‘E’表示全市场处于闭市期间。 第 2 位：‘1’表示开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。 第 3 位：‘1’表示市场行情闭市标志，未闭市取‘0’。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

文件体定义，多条行情记录，行情数据类型取值标识字母 M 加类型编号。

当取值为 M0301 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
----	----	-----	------	----

1	MStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 M0301 表示行情数据格式类型，目前该类型包含期权交易行情
2	SecurityID	合约编码	C8	期权合约的产品代码
3	TotalLongPosition	总持仓量	N12	单位是（张） 此处总持仓量值为持仓余额轧差之前的数值。
4	TradeVolume	当日累计成交数量	N16	
5	TotalValueTraded	当日累计成交金额	N16(2)	精确到分
6	PreSettlePrice	昨日结算价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）
8	AuctionPrice	动态参考价格	N11(4)	波动性中断参考价，单位：元（精确到 0.0001 元）
9	AuctionQty	虚拟匹配数量	N12	
10	HighPrice	当日最高成交价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）
11	LowPrice	当日最低成交价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）
12	TradePrice	最新成交价格	N11(4)	最新成交价，单位：元（精确到 0.0001 元）
13	BuyPrice1	申买价一	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
14	BuyVolume1	申买量一	N12	
15	SellPrice1	申卖价一	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
16	SellVolume1	申卖量一	N12	
17	BuyPrice2	申买价二	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
18	BuyVolume2	申买量二	N12	

19	SellPrice2	申卖价二	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元 （精确到 0.0001 元）
20	SellVolume2	申卖量二	N12	
21	BuyPrice3	申买价三	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元 （精确到 0.0001 元）
22	BuyVolume3	申买量三	N12	
23	SellPrice3	申卖价三	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元 （精确到 0.0001 元）
24	SellVolume3	申卖量三	N12	
25	BuyPrice4	申买价四	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元 （精确到 0.0001 元）
26	BuyVolume4	申买量四	N12	
27	SellPrice4	申卖价四	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元 （精确到 0.0001 元）
28	SellVolume4	申卖量四	N12	
29	BuyPrice5	申买价五	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元 （精确到 0.0001 元）
30	BuyVolume5	申买量五	N12	
31	SellPrice5	申卖价五	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元 （精确到 0.0001 元）
32	SellVolume5	申卖量五	N12	
33	SettlePrice	今日结算价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）

34	TradingPhaseCode	产品实时阶段及标志	C4	<p>该字段为 4 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充空格。</p> <p>第 1 位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘V’表示波动性中断，‘P’表示临时停牌，‘U’表示收盘集合竞价。‘M’表示可恢复交易的熔断（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断（暂停交易至闭市）</p> <p>第 2 位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填充格）</p> <p>第 3 位：‘0’表示不限制开仓，‘1’表示限制备兑开仓，‘2’表示限制卖出开仓，‘3’表示限制卖出开仓、备兑开仓，‘4’表示限制买入开仓，‘5’表示限制买入开仓、备兑开仓，‘6’表示限制买入开仓、卖出开仓，‘7’表示限制买入开仓、卖出开仓、备兑开仓</p> <p>第 4 位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。</p>
35	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.000
36	ReservedWord	预留时间字段	C12	预留字段暂填 00:00:00.000
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

说明：

在集合竞价时段内：

1. 申买价一（BuyPrice1）和申卖价一（SellPrice1）中同时为虚拟动态参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格；
2. 同时，申买量一（BuyVolume1）和申卖量一（SellVolume1）分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟匹配量。
3. 同时，申买量二（BuyVolume2）和申卖量二（SellVolume2）分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟未匹配量。

在闭市时段内：

- 1 最新价 (TradePrice) 为收盘价
- 2 今日结算价 (SettlePrice) 暂为 0
- 3 今日结算价通过期权收盘价格文件 (clpr03MMDD.txt) 揭示

产品实时阶段及标志中，第 4 位（是否接受新订单申报），仅在交易时段有效，在非交易时段无效。

文件尾定义，最后一行特殊记录：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	CheckSum	校验和	C3	校验和，3 位校验和 校验和是通过计算不包括校验和字段（不包括该字段后的换行符）数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018

4.2 期权基础信息 (reff03MMDD.txt)

reff03MMDD.txt	期权公开信息接口
----------------	----------

reff03MMDD.txt	期权公开信息接口
<p>描述:</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。在交易日开市前发送，包含当前交易日可交易的期权合约的信息。</p> <p>该接口文件说明期权的相关信息。</p> <p>处理类型: N/A</p> <p>产品类型: 期权信息</p> <p>时间和频率: 每个交易日开市前发送</p> <p>关联文件: 无</p> <p>数据格式: 记录采用行格式，字段以分隔符 ' ' 来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>记录长度: 351 字节</p>	

文件定义，多条行情记录，参考数据类型取值标识字母 R 加类型编号。

当取值为 R0301 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	RStreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符，取值 R0301 表示期权基础信息
2	SecurityID	合约编码	C8	期权合约的合约编码
3	ContractID	合约交易代码	C19	
4	ContractSymbol	期权合约简称	C20	
5	UnderlyingSecurityID	标的证券代码	C6	
6	UnderlyingSymbol	基础证券证券名称	C8	
7	UnderlyingType	标的证券类型	C3	EBS - ETF, ASH - A 股
8	OptionType	欧式美式	C1	若为欧式期权，则本字段为“E”；若为美式期权，则本字段为“A”
9	CallOrPut	认购认沽	C1	认购，则本字段为“C”；若为认沽，则本字段为“P”

10	ContractMultiplierUnit	合约单位	N11	经过除权除息调整后的合约单位
11	ExercisePrice	期权行权价	N11(4)	经过除权除息调整后的期权行权价,精确到0.0001元
12	StartDate	首个交易日	C8	期权首个交易日,YYYYMMDD
13	EndDate	最后交易日	C8	期权最后交易日/行权日,YYYYMMDD
14	ExerciseDate	期权行权日	C8	期权行权日,YYYYMMDD
15	DeliveryDate	行权交割日	C8	行权交割日,默认为行权日的下一个交易日,YYYYMMDD
16	ExpireDate	期权到期日	C8	期权到期日,YYYYMMDD
17	UpdateVersion	合约版本号	C1	期权合约的版本号
18	TotalLongPosition	当前合约未平仓数	N12	单位是(张) 此处总持仓量值为持仓余额轧差之前的数值。
19	SecurityClosePx	合约前收盘价	N11(4)	昨日收盘价,右对齐,单位:元(精确到0.0001元)
20	SettlePrice	合约前结算价	N11(4)	昨日结算价,如遇除权除息则为调整后的结算价(合约上市首日填写参考价),右对齐,单位:元(精确到0.0001元)
21	UnderlyingClosePx	标的证券前收盘	N11(4)	期权标的证券除权除息调整后的前收盘价格,右对齐,单位:元(精确到0.0001元)
22	PriceLimitType	涨跌幅限制类型	C1	'N'有涨跌幅限制类型
23	DailyPriceUpLimit	涨幅上限价格	N11(4)	当日期权涨停价格,单位:元(精确到0.0001元)
24	DailyPriceDownLimit	跌幅下限价格	N11(4)	当日期权跌停价格,单位:元(精确到0.0001元)
25	MarginUnit	单位保证金	N16(2)	当日持有一张合约所需要的保证金数量,精确到分

26	MarginRatioParam1	保证金计算比例参数一	N6(2)	保证金计算参数，单位：%
27	MarginRatioParam2	保证金计算比例参数二	N6(2)	保证金计算参数，单位：%
28	RoundLot	整手数	N12	一手对应的合约数
29	LmtOrdMinFloor	单笔限价申报下限	N12	单笔限价申报的申报张数下限。
30	LmtOrdMaxFloor	单笔限价申报上限	N12	单笔限价申报的申报张数上限。
31	MktOrdMinFloor	单笔市价申报下限	N12	单笔市价申报的申报张数下限。
32	MktOrdMaxFloor	单笔市价申报上限	N12	单笔市价申报的申报张数上限。
33	TickSize	最小报价单位	N11(4)	单位：元，精确到0.0001元
34	SecurityStatusFlag	期权合约状态信息标签	C8	<p>该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。</p> <p>第1位：‘0’表示可开仓，‘1’表示限制卖出开仓（不包括备兑开仓）和买入开仓。</p> <p>第2位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填0）</p> <p>第3位：‘0’表示未临近到期日，‘1’表示距离到期日不足5个交易日。</p> <p>第4位：‘0’表示近期未做调整，‘1’表示最近5个交易日内合约发生过调整。</p> <p>第5位：‘A’表示当日新挂牌的合约，‘E’表示存续的合约</p> <p>第6位：‘1’表示合约不能进行垂直价差组合策略，‘0’表示可以进行所有的组合策略。</p>
35	AutoSplitDate	垂直价差组合策略到期解除日期	C8	<p>该日期表示垂直价差组合策略到期解除的日期，YYYYMMDD。</p> <p>对于E-2后波动加挂的合约，此字段仍</p>

				为 E-2 日。到期日调整时，此字段信息自动同步调整。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

4.3 期权基础信息第二版 (reff0302YYYYMMDD.xml)

reff0302YYYYMMDD.xml	期权公开信息接口
<p>描述： 文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。在交易日开市前发送，包含当前交易日可交易的期权合约的信息。 该接口文件说明期权的相关信息。</p> <p>处理类型： N/A</p> <p>产品类型： 期权信息</p> <p>时间和频率： 每个交易日开市前发送</p> <p>关联文件： 无</p> <p>数据格式： XML，中文字符采用 GBK 编码，每个期权合约信息对应 XML 中一条 OptionContract_Rec 记录，各元素中取值以实际业务长度为准，不补空格。</p>	

序号	元素名称	元素中文名称	字段类型	描述
1	RFFStreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符，取值 R0301 表示期权基础信息
2	SecurityID	合约编码	C8	期权合约的合约编码
3	ContractID	合约交易代码	C40	
4	ContractSymbol	期权合约简称	C60	
5	UnderlyingSecurityID	标的证券代码	C6	
6	UnderlyingSymbol	基础证券证券名称	C8	
7	UnderlyingType	标的证券类型	C3	EBS - ETF, ASH - A 股
8	OptionType	欧式美式	C1	若为欧式期权，则本字段为“E”；若为美式期权，则本字段为“A”
9	CallOrPut	认购认沽	C1	认购，则本字段为“C”；若为认沽，则本字段为“P”

10	ContractMultiplierUnit	合约单位	N11	经过除权除息调整后的合约单位
11	ExercisePrice	期权行权价	N11(4)	经过除权除息调整后的期权行权价，精确到 0.0001 元
12	StartDate	首个交易日	C8	期权首个交易日，YYYYMMDD
13	EndDate	最后交易日	C8	期权最后交易日/行权日，YYYYMMDD
14	ExerciseDate	期权行权日	C8	期权行权日，YYYYMMDD
15	DeliveryDate	行权交割日	C8	行权交割日，默认为行权日的下一个交易日，YYYYMMDD
16	ExpireDate	期权到期日	C8	期权到期日，YYYYMMDD
17	UpdateVersion	合约版本号	C1	期权合约的版本号
18	TotalLongPosition	当前合约未平仓数	N12	单位是（张） 此处总持仓量值为持仓余额轧差之前的数值。
19	SecurityClosePx	合约前收盘价	N11(4)	昨日收盘价，右对齐，单位：元（精确到 0.0001 元）
20	SettlePrice	合约前结算价	N11(4)	昨日结算价，如遇除权除息则为调整后的结算价（合约上市首日填写参考价），右对齐，单位：元（精确到 0.0001 元）
21	UnderlyingClosePx	标的证券前收盘	N11(4)	期权标的证券除权除息调整后的前收盘价格，右对齐，单位：元（精确到 0.0001 元）
22	PriceLimitType	涨跌幅限制类型	C1	‘N’ 有涨跌幅限制类型
23	DailyPriceUpLimit	涨幅上限价格	N11(4)	当日期权涨停价格，单位：元（精确到 0.0001 元）
24	DailyPriceDownLimit	跌幅下限价格	N11(4)	当日期权跌停价格，单位：元（精确到 0.0001 元）
25	MarginUnit	单位保证金	N16(2)	当日持有一张合约所需要的保证金数量，精确到分
26	MarginRatioParam1	保证金计算比例参数一	N6(2)	保证金计算参数，单位：%

27	MarginRatioParam2	保证金计算比例参数二	N6(2)	保证金计算参数，单位：%
28	RoundLot	整手数	N12	一手对应的合约数
29	LmtOrdMinFloor	单笔限价申报下限	N12	单笔限价申报的申报张数下限。
30	LmtOrdMaxFloor	单笔限价申报上限	N12	单笔限价申报的申报张数上限。
31	MktOrdMinFloor	单笔市价申报下限	N12	单笔市价申报的申报张数下限。
32	MktOrdMaxFloor	单笔市价申报上限	N12	单笔市价申报的申报张数上限。
33	TickSize	最小报价单位	N11(4)	单位：元，精确到 0.0001 元
34	SecurityStatusFlag	期权合约状态信息标签	C8	<p>左起每位表示特定的含义。</p> <p>第 1 位：‘0’ 表示可开仓，‘1’ 表示限制卖出开仓（不包括备兑开仓）和买入开仓。</p> <p>第 2 位：‘0’ 表示未连续停牌，‘1’ 表示连续停牌。（预留，暂填 0）</p> <p>第 3 位：‘0’ 表示未临近到期日，‘1’ 表示距离到期日不足 5 个交易日。</p> <p>第 4 位：‘0’ 表示近期未做调整，‘1’ 表示最近 5 个交易日合约发生过调整。</p> <p>第 5 位：‘A’ 表示当日新挂牌的合约，‘E’ 表示存续的合约</p> <p>第 6 位：‘1’ 表示合约不能进行垂直价差组合策略，‘0’ 表示可以进行所有的组合策略。</p>
35	AutoSplitDate	垂直价差组合策略到期解除日期	C8	<p>该日期表示垂直价差组合策略到期解除的日期，YYYYMMDD。</p> <p>对于 E-2 后波动加挂的合约，此字段仍为 E-2 日。到期日调整时，此字段信息自动同步调整。</p>

36	UnderlyingSym bolEx	基础证券证券 名称（长）	C32	期权标的证券的长简称，若无长简称，与基础证券证券名称字段内容一致。
----	------------------------	-----------------	-----	-----------------------------------

4.4 成交过户数据接口 (trns03XXXXX.txt)

trns03XXXXX.txt	过户数据接口
<p>描述：</p> <p>文件名中 XXXXX 表示当前使用的交易单元 (PBU)。闭市后发送，实际进行账户相关过户操作时，才会产生其中的记录。</p> <p>该接口文件的组织形式同期权实时成交回报数据接口类似。</p> <p>处理类型： 事务型</p> <p>产品类型： N/A</p> <p>时间和频率： 每个交易日闭市后发送</p> <p>关联文件： 期权系统成交日志</p> <p>数据格式： 记录采用行格式，字段以分隔符 ' ' 来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>记录长度： 184 字节</p>	

文件定义，多条交易事务记录，交易事务类型取值标识字母 T 加类型编号。

当取值为 T0305 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	RFSreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符，取值 T0305 表示期权成交过户数据
2	Account	期权的证券账户	C10	
3	PartyID	业务交易单元号	C5	业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致
4	branchId	营业部代码	C5	营业部代码
5	OptionSubAccount	证券账户的期权子账户编码	C3	新增，证券账户的期权子账户编码。固定值“888”

6	CIOrdID	会员内部订单号	C10	会员内部订单号
7	OrderID	订单编号	C16	交易所订单编号
8	SecurityID	合约编码	C8	期权合约的产品代码
9	OrigTime	申报时间	C6	申报时间，格式为 HHMMSS
10	TransactTime	成交时间	C6	成交时间，格式为 HHMMSS
11	TransactDate	过户日期	C8	过户日期，格式为 YYYYMMDD
12	ExecID	成交编号	C16	交易所给出的成交编号
13	LastQty	成交数量	N12	成交数量。单位是（张）
14	LastPx	成交价格	N11(4)	成交价格，单位：元（精确到 0.0001 元）。
15	TotalValueTraded	成交金额	N16(2)	成交金额，精确到分
16	Side	买卖方向	C1	买卖方向：B- 买入，S- 卖出
17	PositionEffect	开平标志	C1	开平标志：O - 开仓；C - 平仓
18	CoveredOrUncovered	备兑期权标志	C1	备兑标签，取值范围： 卖出开仓申报： 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑
19	ExecType	执行类型	C1	当前订单执行状态，取值： F=成交
20	OwnerType	订单所有类型	N 3	订单所有类型，取值包括： 1=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） 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
21	Currency	币种	C3	CNY - 人民币

22	Amount	交易经手费	N16(2)	单位：元，精确到分
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

当取值为 T0306 时，文件记录长度 91 字节，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	RFSreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符，取值 T0306 表示期权冲销数据
2	Account	期权的证券账户	C10	
3	PartyID	业务交易单元号	C5	业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致
4	OptionSubAccount	证券账户的期权子账户编码	C3	新增，证券账户的期权子账户编码。固定值“888”
5	SecurityID	合约编码	C8	期权合约的产品代码
6	TransactTime	成交时间	C6	成交时间，格式为 HHMMSS
7	TransactDate	过户日期	C8	过户日期，格式为 YYYYMMDD
8	ExecID	成交编号	C16	交易所给出的成交编号，以 E 开头的单独编号。如：E00000000000001
9	LastQty	成交数量	N12	成交数量。单位是（张）
10	Side	买卖方向	C1	买卖方向：B- 买入，S- 卖出
11	CoveredOrUncovered	备兑期权标志	C1	备兑标签，取值范围： 卖出开仓申报： 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑
12	ExecType	执行类型	C1	当前订单执行状态，取值： E=冲销
13	OwnerType	订单所有类型	N 3	订单所有类型，取值包括： 101=交易所发起

		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。
--	--	------	----	-------------------

当取值为 T0307 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	RFSreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符，取值 T0307 表示期权当日组合拆分数据
2	PartyID	业务交易单元号	C5	业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致
3	Account	期权的证券账户	C10	
4	OptionSubAccount	证券账户的期权子账户编码	C3	新增，证券账户的期权子账户编码。固定值“888”
5	CIOrdID	会员内部订单号	C10	会员内部订单号
6	SecurityID	组合策略编码	C8	目前为 7 种组合策略：ZBD、CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSJC、KS、KKS
7	SecondarySecurityID	组合编码	C16	同执行报告中组合编码含义
8	TransactTime	成交时间	C6	成交时间，格式为 HHMMSS
9	TransactDate	过户日期	C8	过户日期，格式为 YYYYMMDD
10	Side	组合/分拆	C1	取值：B 表示组合，C 表示拆分，F 表示交易所强制拆分，A 表示到期自动解除
11	LastQty	成交数量(份)	N10	组合与拆分数量(分)
12	NoLeges	成分合约数	N2	取值不超过 4，后接重复组
合约信息	13	LegSecurityID	合约编码	C8
	14	LegSide	合约方向，L/S (权利仓/义务仓)	C1

	15	CoveredOrUncovered	备兑期权标志,	C1	1 – Covered 备兑 空格 – Uncovered 非备兑
	16	LegLastQty	成交数量 (张)	N10	
		扩展区域	不定		系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

4.5 期权持仓余额对账文件 (hold03xxxxx.txt)

hold03XXXXXX.txt	持仓余额对账接口
<p>描述:</p> <p>文件名中 XXXXX 表示当前使用的交易单元 (PBU)。闭市后发送, 该交易单元存在持仓余额, 才会产生其中的记录。</p> <p>该接口文件的组织形式同期权过户接口类似。</p> <p>处理类型: 事务型</p> <p>产品类型: N/A</p> <p>时间和频率: 每个交易日发送一次</p> <p>数据格式: 记录采用行格式, 字段以分隔符 ' ' 来区分, 固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式, 即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>记录长度: 52 字节</p>	

文件定义, 多条持仓记录, 持仓类型取值标识字母 H 加类型编号。

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	RFSreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符, 取值 H0301 表示持仓余额对账接口
2	Account	期权合约账户	C10	
3	OptionSubAccount	期权合约子账户编号	C3	固定值 (暂定 888)
4	PartyID	交易单元号	C5	业务交易单元号, 和文件名中的交易单元号一致

5	SecurityID	合约编码	C8	期权合约的编码，8 位字符
6	PositionType	持仓方向	C1	L/S（权利方/义务方）
7	SellCoveredOr Uncovered	备兑期权标志	C1	备兑标签，取值范围： 1 – Covered 备兑 空格 – Uncovered 非备兑
8	PositionQty	持仓余额	N12	单位：张 持仓余额是进行正常轧差后的持仓数额，包含组合所对应持仓数量以及组合持仓数额。组合持仓不参与轧差。
9	CompostionQty	组合持仓数量	N12	单位：张 此帐户的单方向被用于组合的持仓数量
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

4.6 期权收盘价格文件（clpr03MMDD.txt）

clpr03MMDD.txt	期权收盘价格文件
<p>描述：</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的日期，在此表示当前交易日。</p> <p>期权产品价格文件包含收盘价和参考结算价，闭市后由交易所向会员发送。</p> <p>该接口文件的组织形式同期权基础信息接口类似。</p> <p>处理类型：事务型</p> <p>产品类型：N/A</p> <p>时间和频率：每日盘后发送至市场</p> <p>数据格式：记录采用行格式，字段以分隔符‘ ’来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>记录长度：38 字节</p> <p>标志文件：无</p>	

文件体定义，多条参考数据记录，参考数据类型取值标识字母 R 加类型编号。

取值为 R0302 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
----	----	-----	------	----

1	RFSreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符，取值 R0302 表示期权闭市价格信息
2	SecurityID	合约编码	C8	期权合约的编码，8 位字符
3	SecurityClosePx	期权收盘价	N11(4)	收盘价，单位为元，精确到 0.0001 元。
4	SettlPrice	期权参考结算价	N11(4)	参考结算价，单位为元，精确到 0.0001 元。
5	LeaveQty	未平仓合约数	N12	该合约闭市轧差后的未平仓合约数，单位为张。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

4.7 期权市场参与者数据报送文件 (cybsXXXXXYYYYMMDD001.txt)

cybsXXXXXYYYYMMDD001.txt	期权市场参与者数据报送接口 市场参与者发往交易所
<p>描述：</p> <p>文件名中 XXXXX 表示会员有效的业务交易单元 (PBU)，一个市场参与者使用向本所申报指定的 PBU 报备所有客户资料数据。</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的日期，在此表示下一个交易日。闭市后由市场参与者向交易所报备，包括可买入额度、资金等相关信息。</p> <p>该接口文件的组织形式同期权基础信息接口类似。</p> <p>报送日期记为 T 日，上一交易日记为 T-1 日。</p> <p>处理类型：事务型</p> <p>产品类型：N/A</p> <p>时间和频率：每个交易日市场参与者报送一次，15:30(T 日)-16:30(T 日)。</p> <p>数据格式：记录采用行格式，字段以分隔符 ' ' 来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>记录长度：331 字节</p> <p>标志文件：有</p>	

文件定义，多条持仓记录，帐户类型取值标识字母 A 加类型编号。

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	RFSreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符，取值 A0302 表示期权账户资料信息，此处 为唯一值
2	BizDate	当前交易日	C8	YYYYMMDD，为当前交易日
3	BrokerCod	市场参与者代 码	C12	第 1 第 2 位为国家代码，如中国为 CH；第 3 位为地区代码，如华东区为 4；第 4 第 5 位为省市代码，如上海 为 SH；第 6 位为市场参与者类别， 如证券公司为 S；第 7 位为固定值 T，是保留字段，第 8 到第 12 位为该 市场参与者公司的身份代码，如 CH4SHST88128。
4	BrokerNm	市场参与者名 称	C48	市场参与者名称，可使用汉字 采用全称，如“***证券股份有限公 司”
5	PBU	业务交易单元 号	C5	业务交易单元号
6	PartyID	营业部代码	C5	营业部代码
7	Account	期权合约账户 信息	C10	期权合约账户
8	OptionSubAcctount	期权合约子账 户编号	C3	固定值（暂定 888）
9	Underlying Account	沪市证券账户	C10	沪市证券 A 股账户
10	EAccount	沪市 E 账户	C10	沪市 E 账户
11	totalMargin	衍生品资金账 户保证金总额	N16 (2)	T-1 日结算后数据，精确到分。衍生 品资金账户保证金总额为可用保证 金和维持保证金等资金的总额，不含 持仓市值。

12	maintMargin	沪市衍生品维持保证金金额	N16 (2)	T-1 日结算后数据, 市场参与者按照自身实际收取的沪市维持保证金金额报送, 精确到分
13	usableMargin	衍生品可用保证金金额	N16 (2)	T-1 日结算后数据, 衍生品可用保证金, 精确到分
14	marginUpd	当日资金划入划出净额	N16(2)	T-1 日结算后数据, 精确到分, 为 T-1 日转账数据, 正代表资金划入, 负数代表资金划出
15	optTotalVal	衍生品合约市值权益	N16(2)	T-1 日结算后数据, 含沪深市场所有期权合约, 按照 T-1 日合约最新结算价计算, 精确到分。
16	secTotalVal	证券市值总额	N16(2)	T-1 日结算后数据, 除港股通、B 股之外的所有沪深市场证券市值 (含融券), 持有证券按照 T-1 日收盘价计算, 精确到分。
17	secUsableFunds	证券资金账户可用资金余额	N16 (2)	T-1 日结算后数据, 所有人民币资金 (含融资), 精确到分。
18	mrgTotalSecVal	融资融券账户证券总市值	N16(2)	T-1 日结算后数据, 含沪深市场, 持有证券按 T-1 日收盘价计算, 精确到分
19	mrgTotalFunds	融资融券账户资金总额	N16(2)	T-1 日结算后数据, 精确到分
20	mrgDbtFunds	融资融券账户融入资金总额	N16(2)	T-1 日结算后数据, 精确到分
21	mrgDbtSecVal	融资融券账户融券总市值	N16(2)	T-1 日结算后数据, 含沪深市场, 持有证券按 T-1 日收盘价计算, 精确到分

22	cltType	分级级别	C1	根据 T-1 日数据情况填写, 不得为空 自然人账户需填写 '1' 表示一级, '2' 表示二级, '3' 表示三级。 非自然人账户需填写 '4'
23	usableQty	可买入额度	N16(2)	T-1 日结算后数据, 个人投资者限购总金额额度 (买入额度, 包括已使用和未使用), 精确到分

数据内容说明:

- 1、当日资金划入划出净额=当日总资金划入金额-当日总资金划出金额; 多银行合并计算。
- 2、衍生品合约市值权益=Σ (当日合约结算价*合约单位*权利仓张数) - Σ (当日合约结算价*义务仓张数(含备兑) *合约单位)。按所持有合约汇总。单位元, 保留两位小数。
- 3、自营账户无需报备。
- 4、衍生品账户当日开户的, 应在当日清算完成后, 于下一交易日起进行报送; 当日销户的, 应于下一交易日起停止报送。

4.8 期权其他业务文件 (qtyw03XXXXXX.txt)

qtyw03XXXXXX.txt	期权其他业务数据接口
<p>描述: 文件名中 XXXXX 表示 PBU。闭市后由交易所向市场参与者发送。</p> <p>处理类型: 事务型</p> <p>产品类型: N/A</p> <p>时间和频率: 每个交易日交易所报送一次, 15:30(T日)-16:30(T日)。</p> <p>数据格式: 记录采用行格式, 字段以分隔符 ' ' 来区分, 不固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式, 即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>记录长度:</p> <p>标志文件: 有</p>	

当取值为 Q0301 时, 为组合持仓信息, 文件体记录格式如下:

序号	域名	字段名	字段类型	描述	
1	RFSreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符, 取值 Q0301 表示组合对账接口	
2	PartyID	交易单元号	C5	业务交易单元号, 和文件名中的交易单元号一致	
3	Account	期权合约账户	C10		
4	OptionSubAcctount	期权合约子账户编号	C3	固定值 (暂定 888)	
5	SecurityID	组合策略编码	C8	目前为 6 种组合策略: CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSJC、KS、KKS	
6	LastQty	成交数量(份)	N10	该组合的剩余数量(份)	
7	SecondaryOrderID	组合编码	C16	组合编码。	
8	Deposit	单份组合的保证金	N16 (2)	指 T 日闭市后一份策略组合的单位保证金	
9	NoLeges	成分合约数	N2	取值不超过 4, 后接重复组	
合约信息	10	LegSecurityID	合约编码	C8	
	11	LegSide	合约方向,	C1	L 为权利仓, S 为义务仓
	12	CoveredOrUncoverd	备兑期权标志	C1	备兑标签, 取值范围: 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑
	13	LegPositionQty	持仓数量 (张)	N12	
	扩展区域	不定		系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	

4.9 期权组合策略文件 (zhcl03MMDD.txt)

zhcl03MMDD.txt	期权组合策略数据接口
描述: 文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。在交易日开市前发送, 包括当日的组合策略信息。	

zhcl03MMDD.txt	期权组合策略数据接口
<p>处理类型: N/A</p> <p>产品类型: N/A</p> <p>时间和频率: 每个交易日开市前发送</p> <p>数据格式: 记录采用行格式, 字段以分隔符' '来区分, 固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式, 即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>记录长度: 87 字节</p> <p>标志文件: 有</p>	

文件体记录格式如下:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	RFSreamID	参考数据类型	C5	参考数据类型标识符, 取值 C0301 表示组合策略信息
2	StrategyName	组合策略名称	C32	认购牛市价差策略 认沽熊市价差策略 认沽牛市价差策略 认购熊市价差策略 跨式空头 宽跨式空头 认购期权普通卖出开仓转备兑开仓
3	StrategyID	组合策略编码	C8	目前为 7 种组合策略: CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSJC、KS、KKS、ZBD
4	NoLeges	成分合约个数	N2	策略的成分合约数, 为 1-4 个
5	StrategyFlag	策略标志位	C16	第一位: S 为同到期日, D 为不同到期日, N 为到期日无要求 第二位: S 为相同标的, D 为不同标的, N 为标的无要求 第三位: '0' 为到期日自动解除, '1' 为 E-1 日自动解除, 依次类推。'N' 表示无不适用。 第四位至第十六位预留

合约信息	6	LegSecurityID	认购还是认沽期权	C1	C 为认购期权, P 为认沽期权
	7	LegSide	持仓类型	C1	L 为权利仓, S 为义务仓
	8	CoveredOrUncovered	备兑期权标志	C1	备兑标签, 取值范围: 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑
	9	LegExePrceq	行权价高低顺序	C1	从 1 开始, 1 表示行权价最高, 2 次之。如果行权价相同, 则填写相同数字 用 A 表示行权价大于等于 B, B 大于等于 C 依次类推 (C、D)
	10	LegExeSeq	合约的到期日顺序	N1	仅当 StrategyFlag 第 1 位为 D 时有效。 从 1 开始, 1 表示到期日最近, 2 次之。如果到期日相同, 则填写相同数字
	11	LegPositionQty	单份组合策略中包含的此合约张数	N2	单份组合策略中包含的此合约张数
		扩展区域	不定		系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

4.10 期权结算价试算结果文件 (prestlp03YYYYMMDD.xml)

prestlp03YYYYMMDD.xml	期权结算价试算结果数据接口
<p>描述: 文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。闭市后交易所向市场参与者发送, 包括当日所有期权合约结算价的试算结果。本文件中的试算结算价为试算结果, 非最终结算价结果, 最终结算价格存在调整的可能, 最终结算价格信息以期权收盘价格文件 (clpr03MMDD.txt) 文件中的“期权参考结算价 (SettlePrice)”字段为准。本文件仅适用于对结算价准确性要求不高, 需要尽早使用结算价进行风险试算的场景, 不可用于当日的清算交收等各类业务。</p> <p>处理类型: N/A</p> <p>产品类型: N/A</p> <p>时间和频率: 闭市后交易所向市场参与者发送</p>	

prestlp03YYYYMMDD.xml	期权结算价试算结果数据接口
<p>数据格式：<u>XML，字段中的中文字符采用 GBK 编码（如有），每个期权合约信息对应 XML 中一条 ContractPreSetPrcRec 记录，各元素中取值以实际业务长度为准，不补空格。</u></p> <p>标志文件：prestlp03YYYYMMDD.flg</p>	

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型	字段描述
<u>1</u>	<u>RFStreamID</u>	<u>参考数据类型</u>	<u>C5</u>	<u>参考数据类型标识符，取值 R0323 表示期权结算价格试算结果信息</u>
<u>2</u>	<u>SecurityID</u>	<u>合约编码</u>	<u>C8</u>	<u>期权合约的编码，8 位字符</u>
<u>3</u>	<u>PreCalSettIPrice</u>	<u>期权试算结算价</u>	<u>N11(4)</u>	<u>试算结算价，单位为元，精确到 0.0001 元。</u> <u>非结算价最终结果，当日结算价以收盘价格文件（clpr03MMDD.txt）为准</u>