

交易网关（竞价）市场参与者 技术实施指南 （第四版）

修订版本

| 日期 | 版本 | 状态 | 说明 |
|------------|-------|-----|---|
| 2021-08-15 | 0.1.0 | 开发稿 | 创建文档。 |
| 2021-10-12 | 0.2.0 | 开发稿 | 1.新增 TDGW 与 EzOES 的差异点 2.增加上下行高水位配置说明 3.新增日志流水开启的影响说明 |
| 2022-06-1 | 0.3.0 | 正式稿 | 新增回退版 EzOES 的介绍说明 新增盘后重拉历史数据的说明 调整上线方案的内容表述 修改开启业务流水影响的表述 强调 OMS 应对 TDGW 推送的执行报告进行数据持久化操作 |
| 2022-08-26 | 0.4.0 | 正式稿 | 新增交易网关发生异常的注意事项的说明 |

目录

| | |
|-------------------------------------|----|
| 1 前言 | 4 |
| 1.1 背景 | 4 |
| 1.2 目的 | 5 |
| 1.3 术语 | 5 |
| 1.4 参考文档 | 5 |
| 1.5 参与撰写 | 6 |
| 2 相关系统说明 | 7 |
| 2.1 交易网关 TDGW | 7 |
| 2.2 市场参与者系统改造 | 8 |
| 2.2.1 系统架构示意图 | 8 |
| 2.2.2 业务数据流 | 8 |
| 2.3 交易网关 TDGW 与 EzOES 差异点 | 11 |
| 2.3.1 与柜台接口交互方式改变 | 11 |
| 2.3.2 引入 LoginPbu 和 BizPbu 概念 | 11 |
| 2.3.3 重单判断 | 12 |
| 2.3.4 功能差异 | 12 |
| 3 系统建设/改造 | 14 |
| 3.1 交易核心改造 | 14 |
| 3.2 新增报盘程序 | 14 |
| 3.3 运维管理平台 | 16 |
| 4 系统测试 | 16 |
| 4.1 TDGW 测试 | 16 |
| 4.2 竞价业务测试 | 17 |
| 5 系统部署 | 18 |
| 5.1 TDGW 及相关系统说明 | 18 |
| 5.1.1 上下行高低水位 | 18 |
| 5.1.2 网络带宽占用 | 19 |
| 5.2 新建系统部署 | 19 |

| | |
|-------------------------------|----|
| 6 系统上线..... | 22 |
| 6.1 前置工作..... | 22 |
| 6.2 市场上线安排..... | 23 |
| 6.3 TDGW 应急切换预案..... | 25 |
| 7 系统运维..... | 25 |
| 7.1 日常运维与监控..... | 25 |
| 7.2 应急切换..... | 27 |
| 7.2.1 通信链路切换..... | 27 |
| 7.2.2 OMS 切换 TDGW 时的数据恢复..... | 27 |
| 7.2.3 切换备用 TDGW..... | 28 |
| 7.2.4 订阅与双活部署..... | 28 |
| 7.2.5 与 EzOES 间的关系..... | 30 |
| 7.2.6 切换时间要求..... | 31 |
| 附录：..... | 31 |
| 一、 TDGW 测试场景一览表..... | 31 |
| 二、 TDGW 异常场景测试一览表..... | 32 |
| 三、 竞价业务场景测试一览表..... | 33 |

1 前言

1.1 背景

为提高股票市场交易效率，提升交易服务水平，上海证券交易所（以下简称“本所”）邀请 17 家市场参与者和 6 家信息技术服务机构，对本所自主研发基于流式接口的竞价交易网关（以下简称“TDGW”）客户端报单软件进行了集中试用测试工作，经测试验证，竞价交易网关已初步具备使用条件，拟准备向证券、期货等市场参与者推出，用于替代 EzOES 进行竞价业务的委托申报。

本次推出的交易网关具有高性能、低时延、跨平台、开放易用等优点，支持多实例部署，同时提供集中监控终端和监控接口，可以全面满足市场参与者对交易报单软件的业务价值需求。

1.2 目的

为指导和帮助市场参与者尽快完成相关准备工作，保障系统顺利切换上线，特制订《交易网关（竞价）市场参与者技术实施指南》（以下简称《指南》）。

《指南》从系统框架、部署、测试、运维等方面进行了概括性介绍，帮助市场参与者快速了解竞价交易网关的相关内容，详细信息请参照相关接口说明书、用户手册，请各市场参与者结合实际情况进行部署和运维。本《指南》仅为指导市场参与者技术就绪的参考文件，请市场参与者仔细阅读，结合自身实际情况，开展竞价交易网关的技术准备工作。

1.3 术语

| | | |
|------|---------------------------|----------|
| TDGW | TraDing GateWay | 交易网关 |
| OMS | Order Management System | 用户订单管理系统 |
| PBU | Participant Business Unit | 交易业务单元 |
| EzCS | Easy Communication Server | 轻型化通信服务器 |

1.4 参考文档

1、IS122 上海证券交易所交易网关 Binary 接口规格说明书（竞价平台）

2、IS122 上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书
（竞价平台）

3、交易网关 TDGW 接口开发指南

4、MAL091 交易网关 TDGW 用户手册

5、交易网关（竞价）回退 EzOES 市场参与者技术实施指南

1.5 参与撰写

本文档由以下单位参与撰写，由本所联合东方证券、中信证券进行整理编辑，结合了竞价交易网关的技术特点和市场机构的生产使用实际。为竞价交易网关市场端的技术就绪提供参考。

| 序号 | 参与编写名单 | 序号 | 参与编写名单 |
|----|--------|----|--------|
| 1 | 东方证券 | 13 | 东方财富 |
| 2 | 中信证券 | 14 | 华鑫证券 |
| 3 | 华泰证券 | 15 | 华宝证券 |
| 4 | 广发证券 | 16 | 平安证券 |
| 5 | 海通证券 | 17 | 兴业证券 |
| 6 | 银河证券 | 18 | 恒生电子 |
| 7 | 中信建投 | 19 | 金证科技 |
| 8 | 中金公司 | 20 | 根网科技 |
| 9 | 国泰君安 | 21 | 金仕达 |
| 10 | 国信证券 | 22 | 顶点软件 |
| 11 | 中泰证券 | 23 | 华锐金融 |

| | | | |
|----|------|--|--|
| 12 | 浙商证券 | | |
|----|------|--|--|

2 相关系统说明

2.1 交易网关 TDGW

TDGW 提供实时交易流接口，供 OMS 与本所核心交易系统建立交互通道，目前，生产已支持期权和新债权平台，后续将支持竞价平台。TDGW 为每个平台开放一个端口供 OMS 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。

TDGW 相对于 EzOES 存在登录 PBU 及业务 PBU 的概念。

登录 PBU (LoginPbu) 是在与交易所后台建立连接时使用，可在 TDGW 配置。流速控制是在登录 PBU 的层面上进行的，同一个 PBU 不能同时在两个 TDGW 上登录。

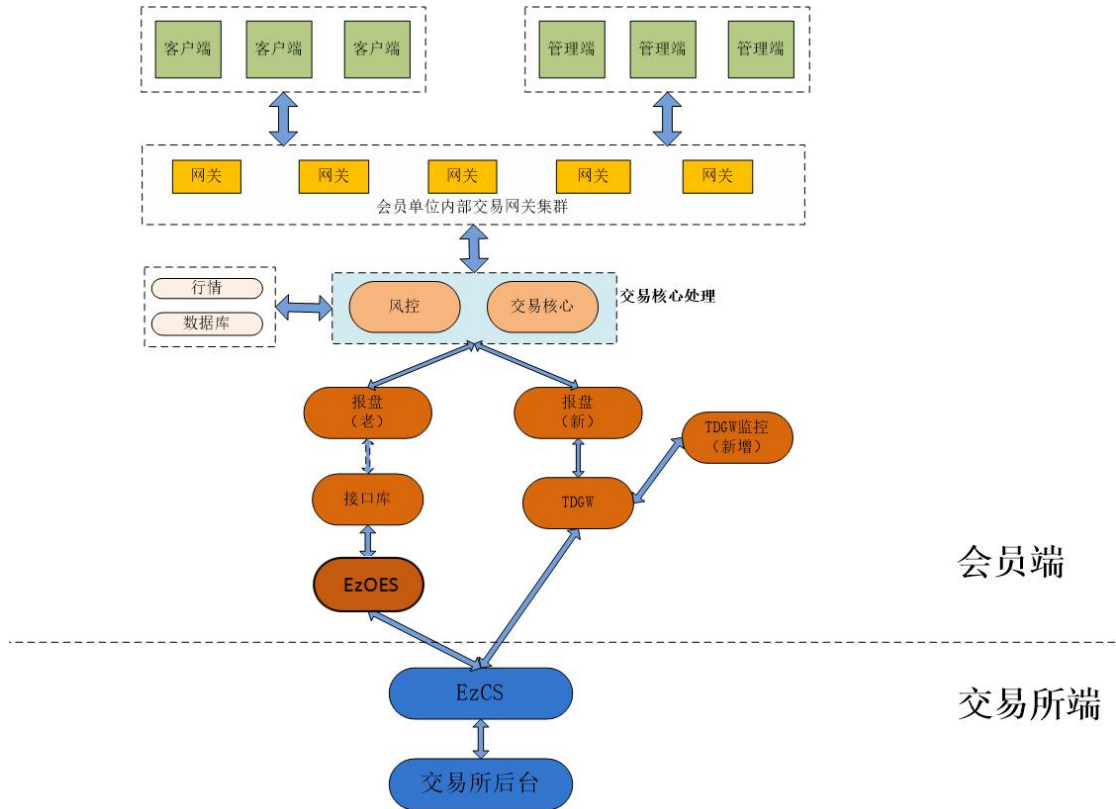
业务 PBU (BizPbu) 指的是在委托申报和业务数据中的 PBU 字段信息。业务 PBU 和登录 PBU 可以是同一个 PBU。

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。TDGW 支持 Binary 接口和 STEP 接口，接口内容详见《IS122 上海证券交易所交易网关 Binary 接口规格说明书（竞价平台）》、《IS122 上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书（竞价平台）》。

2.2 市场参与者系统改造

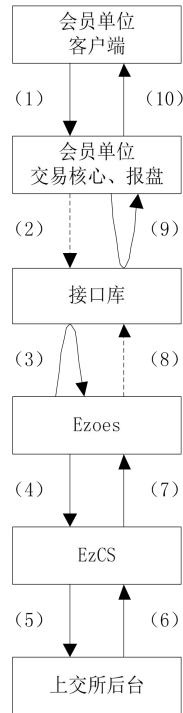
市场参与者交易系统基于本所 TDGW 进行相关改造，改造后系统架构示意图（仅作参考）与业务数据流如下所述。

2.2.1 系统架构示意图



2.2.2 业务数据流

TDGW 上线前:



(1) 市场参与者客户端委托申报至市场参与者交易核心。

(2) 市场参与者交易核心处理完发送至市场参与者报盘，市场参与者报盘将该笔委托写至接口库。

(3) EzOES 轮询接口库，获取市场参与者委托申报记录。

(4) EzOES 将获取到的委托记录发送至 EzCS。

(5) EzCS 收到委托后发送至上交所后台。

(6) 本所后台处理接收到的委托并将委托回报发送至 EzCS。

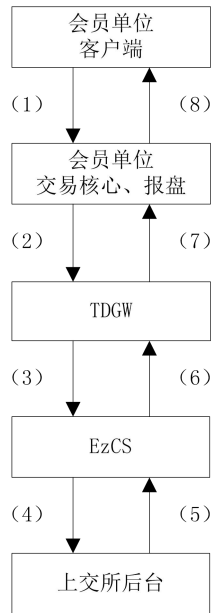
(7) EzCS 收到委托回报后发送至 EzOES。

(8) EzOES 将接收到的委托回报写至接口库中。

(9) 会员端报盘扫描接口库获取委托回报发送至交易核心。

(10) 交易核心处理完发送至客户端。

TDGW 上线后：



(1) 市场参与者客户端委托申报至市场参与者交易核心。

(2) 市场参与者交易核心处理完发送至会员端报盘，市场参与者报盘将该笔委托发送至 TDGW。

(3) TDGW 将收到的委托发送至 EzCS。

(4) EzCS 收到委托后发送至本所后台。

(5) 本所后台处理接收到的委托并将委托回报发送至 EzCS。

(6) EzCS 收到委托回报后发送至 TDGW。

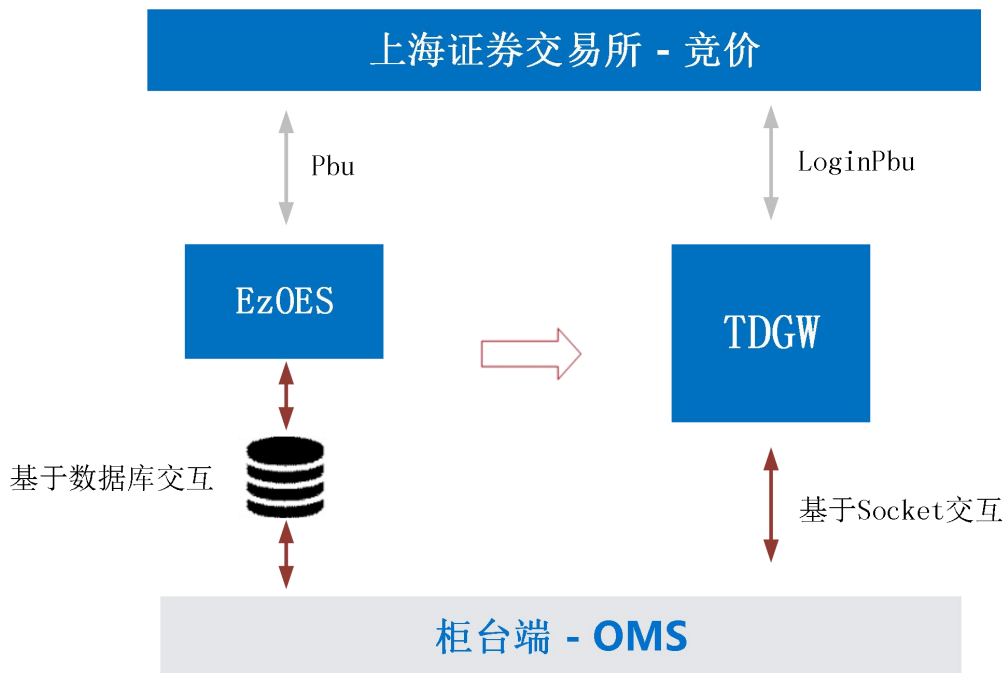
(7) TDGW 将接收到的委托回报发送至市场参与者报盘。

(8) 市场参与者报盘收到委托回报后发送至市场参与者交易核心，市场参与者交易核心处理完发送至市场参与者客户端。

2.3 交易网关 TDGW 与 EzOES 差异点

2.3.1 与柜台接口交互方式改变

EzOES 软件与柜台订单系统采用数据库作为数据交互媒介，TDGW 软件则通过 Socket 建立会话连接，实现以消息驱动作为数据交互媒介。



2.3.2 引入 LoginPbu 和 BizPbu 概念

EzOES 软件中的 PBU 既用于数据通道建立，又作为实际的交易单元。

TDGW 软件中引入 LoginPbu 和 BizPbu 概念，LoginPbu 用于数据通道建立，BizPbu 作为实际的交易单元，单个 LoginPbu 通道下支持多个 BizPbu 同时申报订单并接收回报。

LoginPbu 与数据传输通道相关，决定了流速权的大小，以及执行报告的归属方。在该通道下的 BizPbu 生成的执行报告编入 LoginPbu 执行报告流。注意，LoginPbu 与申报的 BizPbu 需

要同属一个机构。

BizPbu 与账户指定关系、联通圈、业务权限校验等相关；参考期权与综业平台现状，结算与过户数据的组织也将以 BizPbu 为单位。

2.3.3 重单判断

EzOES 软件中订单唯一性标识：Pbu + RecNum，RecNum 值来自于表 ordwth 域 rec_num 中。TDGW 软件订单唯一性标识：业务交易单元（BizPbu）+ 会员内部订单编号（C10rdID）。

当出现重单时，两个软件返回的内容有较大差异。EzOES 软件申报两笔相同 Pbu+RecNum 的订单，第二笔重单返回的申报确认与第一笔申报得到的结果一致；TDGW 软件申报两笔相同的 BizPbu+C10rdID，分下列两种情况：

| | 第一笔 | 第二笔（重单） |
|-----|----------------------|----------------------|
| 场景一 | 订单触发前置校验，返回 订单拒绝 | 返回订单拒绝 |
| 场景二 | 订单字段填写正确，编入 执行报告流 | 返回重单拒绝（错误码 11270） |

2.3.4 功能差异

2.3.4.1 异常场景订单超时重发

EzOES 软件对于后台异常导致丢单的场景，会触发超时重新申报该笔订单。在 TDGW 同类场景下，由于已将申报确认编入执

行报告流，如果 TDGW 主动重新申报订单将可能出现不由 OMS 产生的重复订单拒绝。

因此，TDGW 该场景下不采用超时重发机制。OMS 应以执行报告中的申报确认为交易系统实际处理的确认结果，如遭遇后台异常导致丢单的场景，OMS 端应根据实际需要，自行评估是否需超时重新申报。

2.3.4.2 指定和撤指定同账号阻塞申报控制

EzOES 软件默认开启指定/撤指定委托的同步控制，同一 PBU 下的后续委托需等待收到指定/撤指定委托响应才继续申报。同时 EzOES 也支持通过修改配置文件 EzOES.ini 中配置项 `checkblock.etf=FALSE` 关闭该机制。详细内容参考上交所官网《上海证券交易所市场端软件使用和登录规范说明》与《FS306 上海证券交易所技术系统市场参与者常见问题解答》文档中的相关说明。

TDGW 不再进行同账号阻塞申报控制，市场参与者应确保指定交易类业务确认完成后再申报相同账户的其他后续委托，否则可能产生废单。

因 TDGW 不提供 ETF 申购/赎回业务申报支持，故此处不再重复相关差异说明¹。

¹ EzOES 对于 ETF 申购/赎回有类似的同步控制；ETF 申购/赎回将随 ETF 多码合一业务改造整体迁移至综合业务平台，故 TDGW 不做支持。

3 系统建设/改造

此次改造各市场参与者根据各自系统实际情况决定哪些系统需要改造，下述三点仅作参考：

3.1 交易核心改造

（1）记录平台分区号及分区回报序号：新增记录竞价交易网关平台分区号及分区回报序号。

（2）支持报盘从交易核心读取信息：支持新报盘在启动阶段读取席位信息、分区信息，以及在报盘运行期间从交易核心读取未报委托、正报委托等。

（3）支持报盘回写数据到交易核心：支持新报盘在正常运行期间将 TDGW 网关的回报消息发送至交易核心进行业务处理，并支持报盘程序回写计数器等监控信息。

（4）支持交易网关接口规格说明书中新增的错误代码和错误信息处理。

（5）兼容性改造：兼容支持本所新的交易网关和旧的接口库模式。

3.2 新增报盘程序

（1）新增独立部署的报盘程序，对接 TDGW 网关，与原有的对接 EzOES 的报盘程序并行运行，并保留原有报盘供应急回退的冷备使用。

（2）新增会话管理模块：新增与 TDGW 登录、注销与心跳等会话管理功能。

（3）新增信息同步模块：报盘登录 TDGW 成功后，报盘新增与 TDGW 分区信息同步、分区序号同步、回报重新拉取与订单重发等功能。委托拒单、查询等回报不能通过回报重新拉取获取。

（4）新增交易状态管理模块：当 TDGW 主动将本所交易状态切换通知市场参与者报盘时，市场参与者报盘根据交易状态变化执行相关业务处理。

（5）业务申报改造：解析交易核心委托申报数据，并根据本所 TDGW 最新接口协议构造消息并发送至 TDGW。（除支持普通交易外，也要支持信用交易）。

（6）业务回报改造：解析 TDGW 回报（拒绝、执行报告或一般响应等）消息，并组装成市场参与者内部报文格式发送至市场参与者交易核心。

（7）容错处理：在异常场景下报盘程序进行委托回报重拉、非确认委托重发等功能改造。

（8）流速权控制：流式网关的流速权值和原 EzOES 的流速权值概念上保持一致，当长时间处于超流速权状态有可能会导导致 TCP 层堵塞，市场参与者报盘应根据此规则进行相关调整。

（9）控制重复申报，重复回报；支持 pbu 订阅，订阅模式下的回报处理和回报重拉。

（10）与 TDGW 通讯数据持久化，并提供 IO 日志解析工具，方便 IO 持久化数据解析和应急排查。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 运维管理平台

(1) 业务配置管理：TDGW 登录 PBU、TDGW 流速权、TDGW 订阅、市场参与者报盘中关于 TDGW 参数等相关配置管理。

(2) 日常运维：主备应急切换、并行期间 TDGW 回退 EzOES 等相关运维管理。

(3) 并行期间，部分席位切换至新网关，并进行席位管理。

(4) 运维监控：TDGW 网关自动化启停和监控。

4 系统测试

在最终上线前要在本所全天候、全网环境完成竞价交易网关 TDGW 功能及业务相关测试工作，测试场景请参考附录 TDGW 测试场景一览表。

4.1 TDGW 测试

根据不同的测试场景，开展 TDGW 功能测试、异常场景测试（具体测试用例详见附录，仅作参考，以各家实际情况为准）：

(1) TDGW 功能测试：登录、注销、心跳、订阅、登录 PBU 强制注销、自动启动等。

(2) TDGW 异常测试：流速权超限、OMS 与 TDGW 重连后回报拉取、TDGW 主动注销与 OMS 连接等。

(3) TDGW 链路中断后恢复测试。

- (4) OMS 报盘机重启测试。
- (5) OMS 报盘机压力测试。
- (6) TDGW 报盘回退测试。

4.2 竞价业务测试

竞价交易网关上线前，ETF 申购、赎回业务将从竞价撮合平台迁移至综合业务平台，TDGW（竞价）流接口不再支持该业务。

目前，竞价交易网关计划支持的业务范围包括：

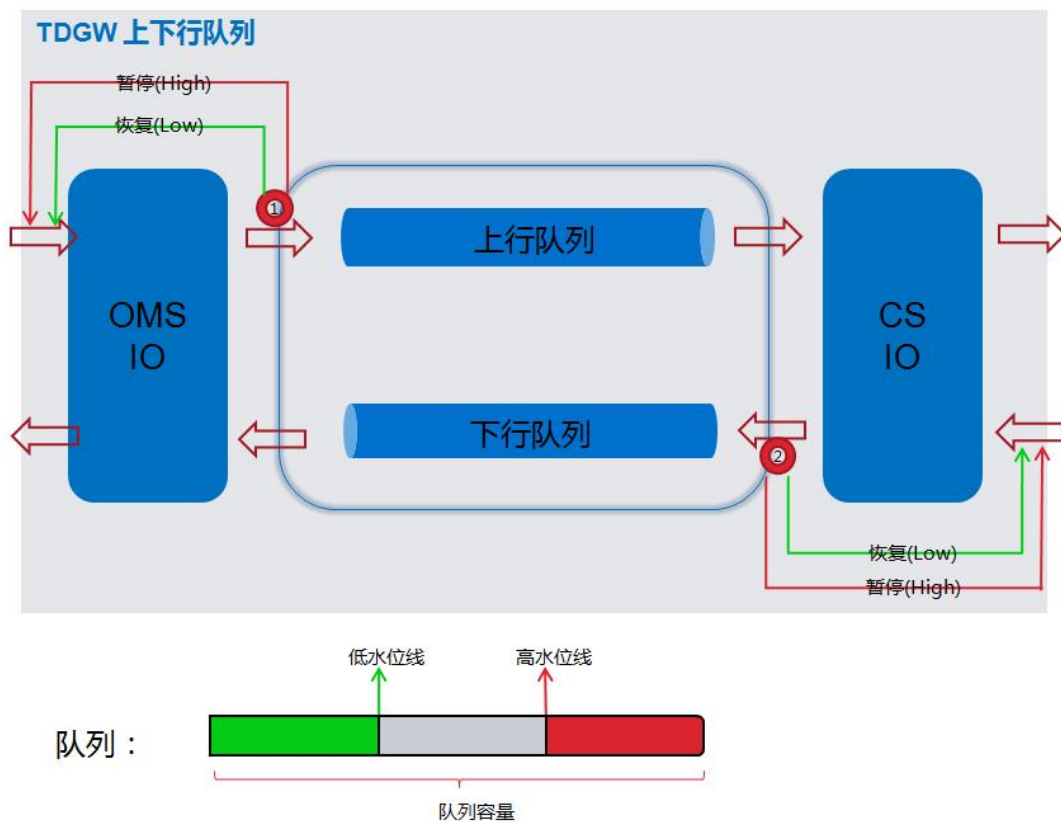
| 平台 | 业务 | 业务申报时间 |
|----|---|--------------------------------|
| 竞价 | 现货竞价交易（股票 A/B 股、基金、国债分销/公司债分销） | 09:15 - 09:25 09:30 - 11:30 |
| 竞价 | 配股/科创板配售、配转债、指定登记、指定撤销 | 13:00 - 15:00 |
| 竞价 | 发行（股票、可转债、可交换债、ETF）、要约收购登记及注销、开放式基金（申购、赎回、认购、转托管、分红设置、转换）、余券划转、还券划转、担保品划转、券源划转、网络密码服务 | 09:30 - 11:30 13:00 - 15:00 |

注：最终以《IS122 上海证券交易所交易网关 Binary/STEP 接口规格说明书（竞价平台）》的最新发布为准。

5 系统部署

5.1 TDGW 及相关系统说明

5.1.1 上下行高低水位



交易网关内部设计上下行队列用于缓存数据。队列具有高低水位设置。当上下行队列触发高水位时，主动暂停；降至低水位后恢复。具体高低水位配置项及默认取值详见用户手册软件使用章节描述。

由于内部队列高低水位配置对TDGW在切换等场景下影响较大，通常不建议调整默认取值。部分确有需求调整相关默认配置的市场参与者，应进行充分评估和测试，对调整后取值向本所进行报备，并做好调整后应对各类异常场景时的应急处置准备。

5.1.2 网络带宽占用

TDGW 相对于 EzOES 在带宽占用方面有所增加，下列数据为实验室测试结果，供市场参考。

在订单成交比 1:1 情况下，TDGW 与 EzOES 带宽对比如下：

| | 订单申报 (笔/秒) | 成交回报接收 (笔/秒) | 上行带宽 (Mbps) | 下行带宽 (Mbps) |
|-------|---------------|-----------------|----------------|----------------|
| TDGW | 1000 | 1000 | 1.4 | 4.6 |
| EzOES | 1000 | 1000 | 1.1 | 1.5 |

在订单不同成交比，TDGW 带宽使用情况：

| 带宽 | 500 笔/s | 1000 笔/s | 1500 笔/s |
|-----------------|---------|----------|----------|
| 上行 (Mbps) | 0.7 | 1.3 | 2.0 |
| 下行 1:0 (Mbps) | 1.4 | 2.8 | 4.1 |
| 下行 1:1 (Mbps) | 2.3 | 4.6 | 7.0 |
| 下行 1:1.5 (Mbps) | 2.8 | 5.6 | 8.4 |
| 下行 1:2 (Mbps) | 3.3 | 6.5 | 9.8 |

请市场参与者根据实际竞价业务申报需要，调整交易线路带宽。

5.2 新建系统部署

系统上线部署时分为新建系统部署与现有系统升级，新建系统主要为 TDGW 及其周边相关组件，现有系统为 EzOES、接口库及市场参与者交易核心和报盘等。

新增 TDGW 部署需准备独立的主、备机器，避免与线上原有

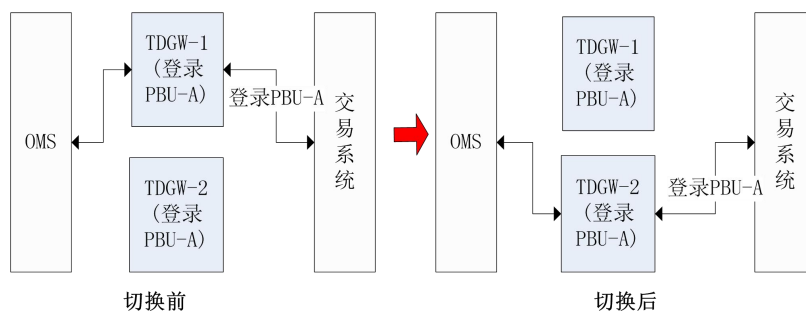
报盘机混用，从而降低异常处置的复杂性。生产系统新增 TDGW 后，本地备机和灾备系统需同步部署就绪。与 TDGW 相关的柜台报盘程序升级，可准备独立机器部署，如复用现有线上机器，则需明确区分新旧程序部署目录以便应急处理。

TDGW 部署时要有主备部署方案，防止单点故障。TDGW 部署参考交易网关用户手册中内容，对 TDGW 运行环境、认证证书、监控等方面进行安装与配置。

TDGW 支持 USB 硬件证书和文件证书进行安全认证并支持同机多实例部署，每个 TDGW 一般发放一个国密算法 USB 硬件证书和一个 RSA 算法文件证书。TDGW 认证证书申请指引请参考已发布的《交易网关专用数字证书服务指南》。

TDGW 部署目前有冷备与温备两种方案，推荐温备部署。

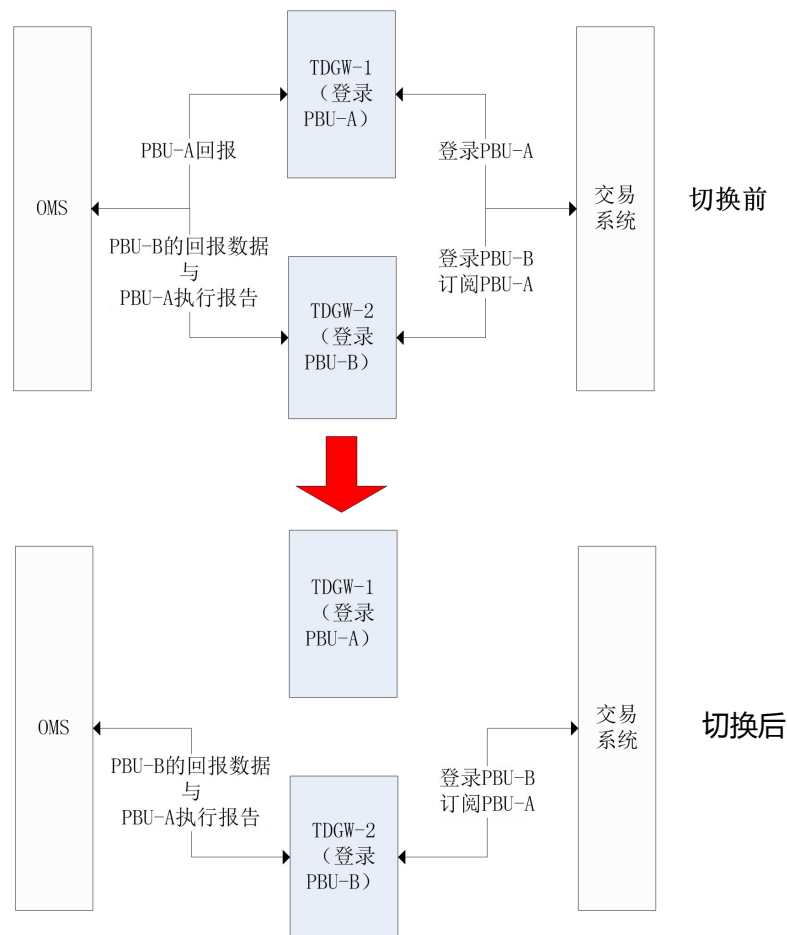
冷备部署示例图如下：



- (1) 初始部署状态只启动 TDGW-1，TDGW-2 关闭当作冷备。
- (2) TDGW-1 出现异常不可恢复时，注意先检查登录 PBU-A 是否在交易所后台已经注销，如果未注销则先发起强制注销再启动 TDGW-2，如果已注销则直接启动 TDGW-2。
- (3) TDGW-2 启动成功后，OMS 再重新与 TDGW-2 建立连接。

（4）TDGW-2 登录上交所后台成功后，OMS 根据指定回报序号从 TDGW-2 拉取 PBU-A 在 TDGW-1 上已产生的回报数据，拉取完如发现 OMS 还有未确认委托则可以重新申报。

温备部署示例图如下：



（1）初始部署状态为 TDGW-1 配置登录 PBU-A，TDGW-2 配置登录 PBU-B 并同时订阅 PBU-A 执行报告（推荐 PBU-A 和 PBU-B 互相订阅），回报与执行报告订阅详见市场接口相关说明。

（2）启动 TDGW-1 与 TDGW-2，OMS 并 TDGW-1 与 TDGW-2 建立连接并登录，OMS 会收到登录 PBU-A 重复执行回报各市场参与者自行处理。

（3）当 TDGW-1 出现异常不可恢复时关闭 TDGW-1，OMS 可

继续从 TDGW-2 获取 PBU-A 在 TDGW-1 产生的执行报告。

（4）待 OMS 收取完 PBU-A 所有执行报告后，OMS 可通过 TDGW-2 重新申报之前已通过 PBU-A 申报的未确认委托。

（5）OMS 后续新委托通过 TDGW-2 申报至交易所。

市场参与者包含多套主子交易系统，有自研、供应商开发等多种方式，所以市场参与者交易核心、报盘等系统可由各市场参与者各自安排升级部署方式。

6 系统上线

6.1 前置工作

目前，交易网关在期权、新债券平台均已上线。为降低竞价交易网关市场上线时市场参与者系统改造的复杂度和成本，已明确竞价交易网关不支持 ETF 申赎业务，ETF 申赎业务将从竞价撮合平台迁移至综合业务平台。

除业务迁移外，竞价交易网关将同步开展各项技术准备，各市场参与者应结合生产实际完成系统改造、参与相关测试，并完成其他上线准备，如按需扩容线路带宽、通过业务流程开通或复用证书，完成回退版 EzOES 的应急测试等。

竞价交易网关项目将预留充分的市场技术准备时间，根据市场技术就绪与测试演练情况，结合上线策略安排推进上线切换与业务开通。

6.2 市场上线安排

为稳步推进 TDGW 的市场切换上线工作，给市场参与者预留充分的技术准备时间，降低市场切换成本及风险，TDGW 市场上线拟分三个阶段推进实施。

本节所述策略后续可能随市场及本所业务发展情况，按需进行相应的调整，请市场参与者关注后续本所发布的竞价交易网关上线方案及指引。

（一）完成 ETF 申赎迁移和“多码合一”改造

依据交易系统优化的整体工作安排，TDGW 不支持 ETF 申赎业务申报，ETF 申赎将迁移至综合业务平台，作为 TDGW 市场上线的前置条件。本所已确定于 6 月中旬完成 ETF 申赎迁移切换上线，并已组织市场参与者开展全天候和全网测试工作。各市场参与者需积极开展系统改造、参与全天候和全网测试，完成技术准备工作，依据本所的上线安排组织切换上线，并做好安全运行保障工作。

（二）完成 TDGW 的技术就绪

TDGW 市场切换上线影响大，市场参与者需要改造的系统多、耦合性强，为稳步推进 TDGW 的切换上线，本所已为各市场参与者留足充分的时间进行技术准备工作，并已组织了四轮全天候测试，总计将安排六轮全天候测试和 4 次全网测试，覆盖 TDGW 的功能、性能、业务和异常回退等测试场景，以保证市场测试充分、技术准备充足。各市场参与者需积极推进相关系统的改

造、参与测试、完成技术系统的准备工作，并积极开展人员培训、细化上线时的应急保障工作、完善应急预案及相应的制度和流程管理，做好 TDGW 切换上线前的准备工作，形成相应的工作底稿。

（三）TDGW 的切换上线

待前述两个阶段完成后，TDGW 具备市场切换上线条件，本所将根据市场情况，确定合适的上线时间，及时发布上线通知。为坚持安全运行和保障市场公平性的原则，本所将分批次组织市场切换上线，暂定三个批次（具体详见后续的上线通知），由市场参与者结合自身系统就绪情况和安全运行要求，自主选择并提前报备切换上线的批次和 PBU，并负责做好安全运行保障工作。

首批上线，要求有意愿的市场参与者谨慎评估技术系统就绪情况，提交技术就绪工作底稿，提前报备 TDGW 登录和申报的业务 PBU，本所将对其就绪情况进行审核，组织通关测试，统一进行首批切换上线。参与首批上线的市场参与者需按要求将报备的 PBU 按时切换上线（若有调整，需提前告知且要征询本所同意）。本所将对首批上线的运行情况进行监测，甄别不符合指引规范的使用行为。运行三周后，若运行平稳，本所将有序开展第二批次的 TDGW 切换上线，允许市场参与者报备更多切换上线 TDGW 的 PBU，组织通关测试，按首批上线要求进行切换上线。平稳运行一周后，将组织第三批次切换上线的通关测试，

以此保障有序、安全、平稳地推进 TDGW 的市场上线。

后续，根据实际运行情况，允许各市场参与者根据生产需要，自主选择、按需使用竞价交易网关。

6.3 TDGW 应急切换预案

各市场参与者应充分考虑 TDGW 上线后的安全运行风险，制定完备的应急切换预案，相关应急切换需求与场景详见本文档中应急切换相关章节内容。此外，各市场参与者应严格遵循网关使用指引及规范，结合安全运行和应急处置的要求，合理控制上线初切换至 TDGW 的 PBU 数量、申报的订单量、业务影响范围及应急切换时间，保障相关系统的平稳运行。上线初，应同步部署回退版 EzOES(详情参见本文档 7.2.5 章节与 EzOES 间的关系说明)，准备应急回退方案，**当交易网关发生异常时，应优先考虑交易网关的重启或主备间的切换，谨慎选择回退至 EzOES，并做好应对回退所引发业务与运行风险的准备。当各类异常发生时，请市场参与者及时告知本所，配合进行问题追踪、排查并对市场投资者做好解释工作。**

7 系统运维

竞价交易网关切换上线后，各市场参与者需要实时监控相关运行情况，需要注意以下几个方面工作：

7.1 日常运维与监控

1、登录 PBU 和业务 PBU 的分类管理。1 个登录 PBU 对应多个业务 PBU。并按照经纪和自营分不同的登录 PBU。在经纪下，

又可按照系统划分与业务属性划分。包括：

（1）按系统分为集中交易、极速交易、机构柜台；

（2）按业务属性分为 A 股、B 股、融资融券交易。

2、TDGW 运维与状态监控：TDGW 日常开启/关闭，通过运维界面检查 PBU 运行状态、平台信息等相关情况。

3、TDGW 配置管理：建议使用 WEB 监控管理界面改动 TDGW 相关参数，详情请见交易网关用户手册。

4、TDGW 业务流水日志：开启 TDGW 业务日志流水时会损耗部分 TDGW 性能，经实验室环境测试比对发现，开启日志流水对 TDGW 上行穿透时延无明显影响，下行穿透时延增大 50us 左右，请市场参与者自行评估是否需要开启。

5、业务监控：通过 TDGW 监控界面，着重检查数据吞吐率、消息拒绝数与在途订单数等信息，详情请见交易网关用户手册。

6、登录 PBU 僵死：交易网关登录过程，认证证书与 PBU 各自独立，均不允许重复登录使用，如出现 PBU 后台僵死的情况，可使用 TDGW 强制注销登录 PBU 的功能进行注销后再次登录。

7、证书管理：券商使用交易网关进行委托申报等相关功能之前，需要通过证书+PBU 登录交易系统，PBU 作为登录用户名，证书用于身份认证，一个交易网关使用一个认证证书（证书与 PBU 不绑定，只需要同时隶属于一个市场机构）。当证书出现损坏，应依照相关流程提交到上交所信息公司进行补办，补办后损坏证书将同时注销。交易所认证证书存在期限限制（最长 5

年), 为避免证书过期失效的风险, 应把证书时效纳入监控(TDGW 监控接口会有提供, 可纳入集中监控管理), 市场机构可在证书到期前 1-2 月, 按申请流程重新申请证书。

7.2 应急切换

7.2.1 通信链路切换

TDGW 支持多条通信链路的配置, 当单个登录 PBU 发生链路异常时, TDGW 应尝试重连, 重连失败时应尝试切换至备用链路。

备用链路正常时, 可在 15 秒内切换至备用链路并恢复登录会话。

7.2.2 OMS 切换 TDGW 时的数据恢复

OMS 与 TDGW 出现连接断开并重建会话后, 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, 相关描述详见交易网关市场接口。

此外, 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。若 OMS 端在连接恢复后立即重新申报订单, 可能包含以下几种情况, 具体以实际系统处理情况为准:

| 场景描述 | | 恢复连接后重新申报的 预期结果 |
|-------------------|--------------------|------------------------------------|
| 断开连接前交易系统是否收到该笔申报 | 订单数据是否触发前置校验产生订单拒绝 | |
| Y | Y | 以重新申报的订单实际内容校验并予以反馈 |
| N | Y | 按新订单处理, 返回订单拒绝 |
| Y | N | 原单已接收并产生执行报告, 按重复订单拒绝处理, 执行报告中已包含申 |

| | | |
|---|---|-----------------|
| | | 报确认 |
| N | N | 按新订单处理，产生执行报告返回 |

7.2.3 切换备用 TDGW

在这一节所特指的场景中，TDGW 的主备/灾备切换是指主用 TDGW 切换至其备用实例。其特征为主/备 TDGW 配置了相同的登录 PBU，即在主用 TDGW 正常时，备用 TDGW 处于未登录状态。当需要切换时，在备用 TDGW 重新登录该 PBU，并按上一节 OMS 断开/切换 TDGW 的场景完成数据恢复。

7.2.4 订阅与双活部署

在支持业务 PBU 之后，利用登录 PBU 与业务 PBU 可分离的机制，结合执行报告订阅可以提高系统部署整体的可用性，如部署双活的 TDGW。图 3 描绘了这种部署的一个示例：

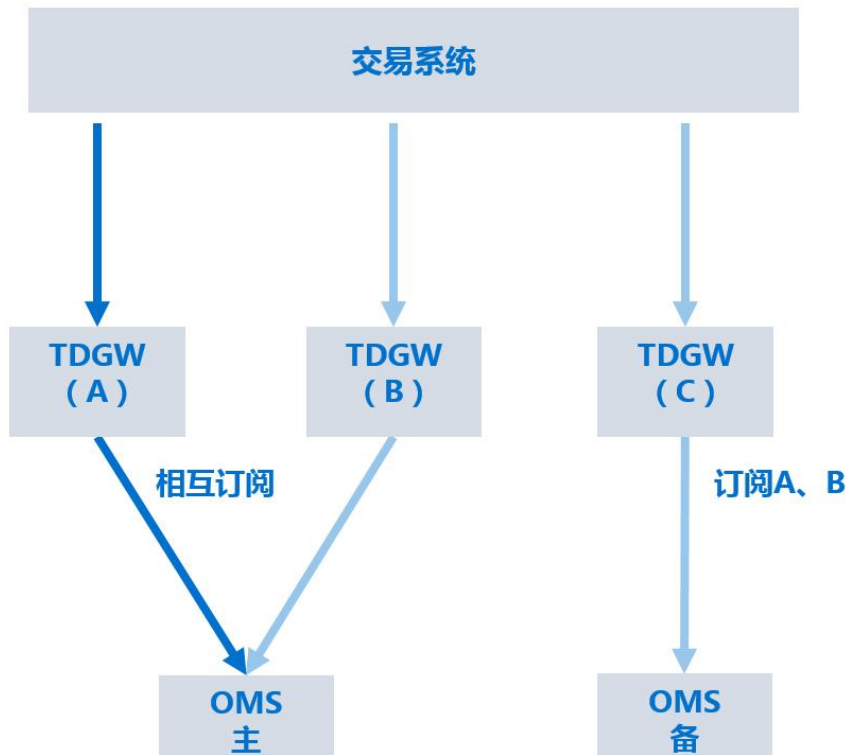


图 3 订阅与部署

在上图中，三个 TDGW 实例分别配置登录 PBU：A、B、C，其

中 A 与 B 配置相互订阅对方的执行报告，而 C 同时订阅 A、B 的执行报告。在该模式下，A、B 所在网关形成了双活的部署，供 OMS 选用。当 A 所在实例发生异常时，不同于 7.2.3 节场景中需要恢复对 A 的登录，由于 OMS 可以从 B 所在实例接收到订阅的 A 执行报告流，无需恢复数据即可获得申报订单的执行结果、更新订单状态，OMS 继而可将后续业务直接切换至 B 所在实例进行申报。显然，此模式需要业务 PBU 与登录通道的分离机制来对其进行支持。

此外，C 所在实例作为 A、B 的备用，将订阅的 A、B 执行报告发送给备用 OMS，当主 OMS 发生异常切换至备 OMS 时，也可实现快速恢复业务的效果。**OMS 应进行持久化操作，以减少 OMS 异常时从交易系统恢复的执行报告数量。**

上述示例中，业务 PBU 机制与订阅机制的目标，主要在于降低 MTTR，迅速恢复后续业务，从而提高系统可用性。此外，订阅机制可实现盘中执行报告的集中归集和处理，由于盘后重拉执行报告的速率和时间窗口限制，建议市场参与者避免进行盘后非故障场景下的历史数据归集和持久化，故障场景下的历史数据恢复建议在 16:00 前完成。

注意，除应急与恢复场景外，OMS 将同一笔业务订单重复发送至多个 TDGW 实例进行申报是一种异常行为，OMS 需予以避免。

7.2.5 与 EzOES 间的关系

TDGW 与 EzOES 可并行运行，当 TDGW 上线时，市场参与者生产上部署的现有 EzOES 可不做任何改造，依然正常运行，无需进行替换。当 TDGW 出现不可恢复的异常时，无法直接回退至现有 EzOES，但可将原 TDGW 上业务 PBU 使用 EzOES 重新登录，进行后续申报。由于申报与撤单编号的变化，回退至现有生产版本 EzOES 存在一定的技术限制：一是通过 TDGW 的“未确认”申报无法由 EzOES 恢复，二是通过 TDGW 的申报无法由 EzOES 撤单。

为解决上述 TDGW 回退 EzOES 的技术限制，兜底 TDGW 上线初的软件异常，拟在上线初提供回退版 EzOES 的应急方案。各市场参与者可参考《交易网关（竞价）回退 EzOES 市场参与者技术实施指南》（以下简称“回退指南”），结合 TDGW 切换上线方案及部署运维实际，规划回退版 EzOES 的部署方式和数量，并做好柜台系统的配套改造和测试验证。考虑热备模式下带宽压力及回退场景时涉及业务 PBU 登录的复杂性，建议使用冷备模式。此外，由于回退版 EzOES 恢复历史成交回报的系统限制（不超过约 1000 笔/秒），恢复较多历史数据或多个 EzOES 恢复历史数据的耗时显著增加，建议在冷备模式基础上，采用断点恢复方式，减少恢复数量和恢复时间，关于成交回报断点恢复详见回退指南。

为降低上线初应急回退难度和运行风险，建议上线初期控制 TDGW 登录 PBU 的数量，并保持登录 PBU 和业务 PBU 一致，若

发生异常，优先考虑主备 TDGW 切换，只在 TDGW 整体异常时，选择回退版 EzOES 进行应急。待 TDGW 运行平稳后，各市场参与者可根据实际需要，自主选择切换上线 TDGW 的 PBU，本所也将有序安排回退版 EzOES 的下线，以降低市场参与者软件管理维护成本。此外，除回退场景外，PBU 在 TDGW 和 EzOES 上不应同时申报，TDGW 也不应订阅 EzOES 的回报数据。

7.2.6 切换时间要求

TDGW 的各场景切换，应控制在 3min 内。回退至 EzOES 进行后续申报，应控制在 5min 内。

附录：

一、TDGW 测试场景一览表

注：附录中的测试用例仅做参考，各家需结合自身情况合理安排测试，尽量覆盖全部竞价业务场景、订单类型、交易时段等重要内容。

1、TDGW 功能测试场景一览表

| 测试编号 | 测试场景 | 测试说明 | 预期结果 | 实际结果 |
|------|--------------------|---|-----------|------|
| 1 | OMS 与 TDGW 之间连接、登录 | 1.启动 TDGW，检查监听端口是否正常。 2.启动券商 OMS，连接 TDGW 并使用登录 PBU 发起登录。 | 连接与登录正常 | |
| 2 | TDGW 登出功能 | 1.OMS 发起登录 PBU 登出。 | 登出功能正常 | |
| 3 | TDGW 监控与配置 | 1.web 页面能正常配置。 2.TDGW 监控界面显示正常，能实时反应 TDGW 运行状态。 | 监控与配置功能正常 | |
| 4 | TDGW 登录强制注销 | 1.在 TDGW 上发起强制登录注销。 | 登录注销正常 | |

| | | | | |
|----|------------------|--|-----------|--|
| 5 | TDGW 定时启停 | 1.开启定时启停功能,在没有人工干预的情况下,TDGW 能正常启停并使用 | 自动启停正常 | |
| 6 | OMS 与 TDGW 之间心跳 | 1.检查 OMS 与 TDGW 之间心跳机制是否正常。 | 心跳正常 | |
| 7 | TDGW 主动通知 OMS 状态 | 1.TDGW 的 NotOpen、Break、Close、PreOpen 等状态是否能正确通知 OMS | 状态通知正常 | |
| 8 | TDGW 证书有效期提示 | 1.证书到期主动提醒 | 到期正常提醒 | |
| 9 | TDGW 修改 PBU 登录口令 | 1.在 OMS 与 TDGW 之间已登录情况下,web 页面发起修改登录口令。 2.重新登录口令修改成功。 | 口令修改成功 | |
| 10 | TDGW 链路中断后恢复测试 | TDGW 链路中断后自动恢复,断开期间委托正常申报 | 链路中断后重连正常 | |
| 11 | OMS 报盘机重启测试 | 报盘重启后自动恢复,重启期间委托正常申报 | 重启后委托申报正常 | |
| 12 | OMS 报盘机压力测试 | 1. 短时间内大量订单压力测试 2. 持续性定量压力测试 | 性能稳定,功能正常 | |
| 13 | TDGW 报盘回退测试 | TDGW 及报盘程序回退,回退后连接 Ezoes 进行后续委托申报 | 回退后委托申报正常 | |

二、TDGW 异常场景测试一览表

| 测试编号 | 测试场景 | 测试说明 | 预期结果 | 实际结果 |
|------|---------------------------|--|----------------|------|
| 1 | OMS 与 TDGW 重连 | OMS 与 TDGW 重连后: 1.PBU 登录正常 2.根据指定序号进行数据回报同步 3.确定未申报委托重新申报 | 回报同步与重新申报功能正常。 | |
| 2 | OMS 切换至备用 TDGW (同登录 PBU) | 1.当主 TDGW 崩溃后,切换至同登录 PBU 的 TDGW | 功能正常。 | |
| 3 | OMS 切换至备用 TDGW (不同登录 PBU) | 1.当主 TDGW 崩溃后,切换至不同登录 PBU 的 TDGW (存在订阅关系) | 功能正常。 | |

| | | | |
|---|-----------|---|--|
| 4 | 回退至 EzOES | TGDW 主备都无法使用时， OMS 切换到 EzOES 1.EzOES 拉取相应 PBU 成交数据 2.申报与回报功能正常 | 功能正常。 |
| 5 | 流速超限 | 1.在压力申报情况下，当 TDGW 流速超限时，检查 TDGW 与 OMS。 | OMS 与 TDGW 之间处于堵塞状态，等 TDGW 处理完，OMS 又能正常申报委托。 |

三、竞价业务场景测试一览表

| 测试编号 | 时间点 | 测试场景 | 测试内容 | 测试说明 | 预期结果 |
|------|--|-----------------------|---------|--------------|--|
| 1 | 未定 -09:15 09:15-09:30 11:30-13:00 15:00 闭市以后 | 沪 A 限价-委托数量 | 买入申报 | 限价-集合竞价申报 | 09:15-09:20，买入/卖出/撤单申报，成功失败标志=Y，委托状态：已报； 09:20-09:25，买入/卖出申报，成功失败标志=Y，委托状态：已报； 撤单申报，成功失败标志=Y，委托状态：撤单成功； 09:15-09:30，禁止市价委托；禁止部分非交易业务； 9:30-11:30、13:00-15:00，下单成功,委托正报； 09:15 之前、11:30-13:00、15:00 闭市以后，下单失败,非交易时间； |
| 2 | | | 卖出申报 | 限价-集合竞价申报 | |
| 3 | | | 买入申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 | |
| 4 | | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 | |
| 5 | | 沪 A 市价--最优价格五档并撤销委托 | 买入申报 | 市转撤-集合竞价申报 | |
| 6 | | | 卖出申报 | 市转撤-集合竞价申报 | |
| 7 | | | 买入申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 | |
| 8 | | | 卖出申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 | |
| 9 | | 沪 A 市价委托-最优价格五档并转限价委托 | 买入申报 | 市转限-集合竞价申报 | |
| 10 | | | 卖出申报 | 市转限-集合竞价申报 | |
| 11 | | | 买入申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 | |
| 12 | | | 卖出申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 | |
| 13 | | 科创板限价-委托数量 | 买入申报 | 限价-集合竞价申报 | |
| 14 | | | 卖出申报 | 限价-集合竞价 | |

| | | | |
|----|----------------------|---------|-----------------|
| | | | 申报 |
| 15 | | 买入申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 16 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 17 | 科创板市价--最优价格五档并撤销委托 | 买入申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 18 | | 卖出申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 19 | | 买入申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 20 | | 卖出申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 21 | 科创板市价委托-最优价格五档并转限价委托 | 买入申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 22 | | 卖出申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 23 | | 买入申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 24 | | 卖出申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 25 | 科创板市价-对方最优 | 买入申报 | 市价对方最优-集合竞价申报 |
| 26 | | 卖出申报 | 市价对方最优-集合竞价申报 |
| 27 | | 买入申报-撤单 | 市价对方最优撤单-集合竞价申报 |
| 28 | | 卖出申报-撤单 | 市价对方最优撤单-集合竞价申报 |
| 29 | 科创板市价委托-本方最优 | 买入申报 | 市价本方最优-集合竞价申报 |
| 30 | | 卖出申报 | 市价本方最优-集合竞价申报 |
| 31 | | 买入申报-撤单 | 市价本方最优撤单-集合竞价申报 |
| 32 | | 卖出申报-撤单 | 市价本方最优撤单-集合竞价申报 |
| 33 | 沪B 限价-委托 | 买入申报 | 限价-集合竞价 |

| | 数量 | 申报 |
|----|------------------------|-------------------------|
| 34 | | 卖出申报 限价-集合竞价申报 |
| 35 | | 买入申报-撤单 限价撤单-集合竞价申报 |
| 36 | | 卖出申报-撤单 限价撤单-集合竞价申报 |
| 37 | | 买入申报 市转撤-集合竞价申报 |
| 38 | 沪B市价--最优价格五档并撤销委托 | 卖出申报 市转撤-集合竞价申报 |
| 39 | | 买入申报-撤单 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 40 | | 卖出申报-撤单 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 41 | | 买入申报 市转限-集合竞价申报 |
| 42 | 沪B市价委托-最优价格五档并转限价委托 | 卖出申报 市转限-集合竞价申报 |
| 43 | | 买入申报-撤单 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 44 | | 卖出申报-撤单 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 45 | | 买入申报 限价-集合竞价申报 |
| 46 | 单市场ETF-限价-委托数量 | 卖出申报 限价-集合竞价申报 |
| 47 | | 买入申报-撤单 限价撤单-集合竞价申报 |
| 48 | | 卖出申报-撤单 限价撤单-集合竞价申报 |
| 49 | | 买入申报 市转撤-集合竞价申报 |
| 50 | 单市场ETF-市价--最优价格五档并撤销委托 | 卖出申报 市转撤-集合竞价申报 |
| 51 | | 买入申报-撤单 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 52 | | 卖出申报-撤单 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 53 | | 买入申报 市转限-集合竞价申报 |
| 54 | 单市场ETF-市价委托-最优价格五档并转限价 | 卖出申报 市转限-集合竞 |

| | | 委托 | 价申报 |
|----|--|---------|--------------|
| 55 | | 买入申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 56 | | 卖出申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 57 | | 买入申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 58 | | 卖出申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 59 | | 买入申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 60 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 61 | | 买入申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 62 | | 卖出申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 63 | | 买入申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 64 | | 卖出申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 65 | | 买入申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 66 | | 卖出申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 67 | | 买入申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 68 | | 卖出申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 69 | | 买入申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 70 | | 卖出申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 71 | | 买入申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 72 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 73 | | 买入申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 74 | | 卖出申报 | 市转撤-集合竞价申报 |

| | | | |
|----|-------------------------|---------|--------------|
| 75 | | 买入申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 76 | | 卖出申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 77 | REITS-市价委托-最优价格五档并转限价委托 | 买入申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 78 | | 卖出申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 79 | | 买入申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 80 | | 卖出申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 81 | LOF-限价-委托数量 | 买入申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 82 | | 卖出申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 83 | | 买入申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 84 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 85 | LOF-市价--最优价格五档并撤销委托 | 买入申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 86 | | 卖出申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 87 | | 买入申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 88 | | 卖出申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 89 | LOF-市价委托-最优价格五档并转限价委托 | 买入申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 90 | | 卖出申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 91 | | 买入申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 92 | | 卖出申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 93 | 普通基金-限价-委托数量 | 买入申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 94 | | 卖出申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 95 | | 买入申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |

| | | | |
|-----|--------------------------------|-------------------|----------------|
| 96 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 97 | | 买入申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 98 | 普通基金-市价 --最优价格五档 并撤销委托 | 卖出申报 | 市转撤-集合竞价申报 |
| 99 | | 买入申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 100 | | 卖出申报-撤单 | 市转撤撤单-集合竞价申报 |
| 101 | 普通基金-市价 委托-最优价格 五档并转限价委托 | 买入申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 102 | | 卖出申报 | 市转限-集合竞价申报 |
| 103 | | 买入申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 104 | | 卖出申报-撤单 | 市转限撤单-集合竞价申报 |
| 105 | 担保品买入 | 担保品买入-限价 | 限价-集合竞价申报 |
| 106 | | 担保品买入-市价 剩余转限价 | 市价剩余转限价-集合竞价申报 |
| 107 | | 担保品买入-市价 剩余撤销 | 市价剩余撤销-集合竞价申报 |
| 108 | | 担保品买入-本方 最优 | 市价本方最优-集合竞价申报 |
| 109 | | 担保品买入-对手 方最优 | 市价对手方最优-集合竞价申报 |
| 110 | 担保品卖出 | 担保品卖出-限价 | 限价-集合竞价申报 |
| 111 | | 担保品卖出-市价 剩余转限价 | 市价剩余转限价-集合竞价申报 |
| 112 | | 担保品卖出-市价 剩余撤销 | 市价剩余撤销-集合竞价申报 |
| 113 | | 担保品卖出-本方 最优 | 市价本方最优-集合竞价申报 |
| 114 | | 担保品卖出-对手 方最优 | 市价对手方最优-集合竞价申报 |
| 115 | 融资买入 | 融资买入-限价 | 限价-集合竞价申报 |
| 116 | | 融资买入-市价 剩余转限价 | 市价剩余转限价-集合竞价申报 |

| | | | |
|-----|-------|--------------|------------------|
| 117 | | 融资买入-市价剩余撤销 | 市价剩余撤销-集合竞价申报 |
| 118 | | 融资买入-本方最优 | 市价本方最优-集合竞价申报 |
| 119 | | 融资买入-对手方最优 | 市价对手方最优-集合竞价申报 |
| 120 | 融券卖出 | 融券卖出-限价 | 限价-集合竞价申报 |
| 121 | 买券还券 | 买券还券-限价 | 限价-集合竞价申报 |
| 122 | | 买券还券-市价剩余转限价 | 市价剩余转限价-集合竞价申报 |
| 123 | | 买券还券-市价剩余撤销 | 市价剩余撤销-集合竞价申报 |
| 124 | | 买券还券-本方最优 | 市价本方最优-集合竞价申报 |
| 125 | | 买券还券-对手方最优 | 市价对手方最优-集合竞价申报 |
| 126 | 卖券还款 | 卖券还款-限价 | 限价-集合竞价申报 |
| 127 | | 卖券还款-市价剩余转限价 | 市价剩余转限价-集合竞价申报 |
| 128 | | 卖券还款-市价剩余撤销 | 市价剩余撤销-集合竞价申报 |
| 129 | | 卖券还款-本方最优 | 市价本方最优-集合竞价申报 |
| 130 | | 卖券还款-对手方最优 | 市价对手方最优-集合竞价申报 |
| 131 | 要约收购 | 最低申报数量 | 要约收购-集合竞价申报 |
| 132 | | 要约收购撤单 | 要约收购撤单-集合竞价申报 |
| 133 | | 要约收购解除 | 要约收购解除-集合竞价申报 |
| 134 | | 要约收购解除撤单 | 要约收购解除撤单-集合竞价申报 |
| 135 | 上证基金通 | 认购 | 上证基金通认购-集合竞价申报 |
| 136 | | 认购撤单 | 上证基金通认购撤单-集合竞价申报 |

| | | | |
|-----|-----------|--------|-----------------------|
| 137 | | 申购 | 上证基金通申购-集合竞价申报 |
| 138 | | 申购撤单 | 上证基金通申购撤单-集合竞价申报 |
| 139 | | 赎回 | 上证基金通赎回-集合竞价申报 |
| 140 | | 赎回撤单 | 上证基金通赎回撤单-集合竞价申报 |
| 141 | 转托管 | 转托管 | 转托管-集合竞价申报 |
| 142 | | 转托管撤单 | 转托管撤单-集合竞价申报 |
| 143 | 基金转换 | 基金转换 | 基金转换-集合竞价申报 |
| 144 | | 基金转换撤单 | 基金转换撤单-集合竞价申报 |
| 145 | 基金分红 | 现金分红 | 现金分红-集合竞价申报 |
| 146 | | 现金分红撤单 | 现金分红撤单-集合竞价申报 |
| 147 | | 红利转股 | 红利转股-集合竞价申报 |
| 148 | | 红利转股撤单 | 红利转股撤单-集合竞价申报 |
| 149 | | 现金分红 | 红利转股（委托价格无效）-集合竞价申报 |
| 150 | | 现金分红撤单 | 红利转股撤单（委托价格无效）-集合竞价申报 |
| 151 | 发行-申购限价委托 | 买入申报 | A股申购/中签-集合竞价申报 |
| 152 | | 买入申报 | 科创板申购/中签-集合竞价申报 |
| 153 | | 买入申报 | 基金申购/中签-集合竞价申报 |
| 154 | | 买入申报 | 转债申购/中签-集合竞价申报 |

| | | | |
|-----|------------|------------|------------------|
| 155 | 配股-限价委托 | 卖出申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 156 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 157 | 科创板配售-限价委托 | 卖出申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 158 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 159 | 配转债-限价委托 | 卖出申报 | 限价-集合竞价申报 |
| 160 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-集合竞价申报 |
| 161 | 余券划转 | 买入申报 | 余券划转-集合竞价申报 |
| 162 | 还券划转 | 卖出申报 | 还券划转-集合竞价申报 |
| 163 | 担保品划入 | 买入申报 | 担保品划入-集合竞价申报 |
| 164 | 担保品划出 | 卖出申报 | 担保品划出-集合竞价申报 |
| 165 | 券源划入 | 买入申报 | 券源划入-集合竞价申报 |
| 166 | 券源划出 | 卖出申报 | 券源划出-集合竞价申报 |
| 167 | 债券分销(国债) | 非交易-沪 A | 债券分销(国债)-集合竞价申报 |
| 168 | 债券分销(企业债) | 非交易-沪 A | 债券分销(企业债)-集合竞价申报 |
| 169 | 债券分销(国债) | 非交易-沪 A-撤单 | 债券分销(国债)-集合竞价申报 |
| 170 | 债券分销(企业债) | 非交易-沪 A-撤单 | 债券分销(企业债)-集合竞价申报 |
| 171 | 密码服务 | 买入申报 | 激活密码-集合竞价申报 |
| 172 | | 买入申报-撤单 | 激活密码撤单-集合竞价申报 |
| 173 | | 买入申报 | 注销密码-集合竞价申报 |
| 174 | | 买入申报-撤单 | 注销密码撤单-集合竞价申报 |

| | | | | | | |
|-----|----------------------------|----------------|--------------------------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------|
| 175 | 09:30-11:30 13:00-15:00 | 沪 A 限价-委托价格 | 买入申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 176 | | | 卖出申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 177 | | | 买入申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 178 | | | 卖出申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 179 | | | 买入申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 180 | | | 卖出申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 181 | | | 买入申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 182 | | | 卖出申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 183 | | | 买入申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=N 委托状态=已成 | |
| 184 | | | 卖出申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=N;委托状态=已成 | |
| 185 | | | 买入申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=N;委托状态=已成 | |
| 186 | | | 卖出申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=N;委托状态=已成 | |
| 187 | | | 买入申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 | |
| 188 | | | 卖出申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 | |
| 189 | | | 买入申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格不是价格单位的整数倍 | |
| 190 | | | 卖出申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格不是价格单位的整数倍 | |
| 191 | | | 沪 A 限价-委托数量/最优价格五档并撤销委托/最优价格五档并转限价委托 | 买入申报 | 买入申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 192 | | | | 卖出申报 | 卖出申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 193 | | | | 买入申报-撤单 | 买入申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 194 | | | | 卖出申报-撤单 | 卖出申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 195 | 买入申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连 | | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | | |

| | | | | |
|-----|-------------|---------|-------------------|------------------------------|
| | | | 续竞价 | |
| 196 | | 卖出申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 197 | | 买入申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 198 | | 卖出申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 199 | | 买入申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 200 | | 卖出申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 201 | | 买入申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 202 | | 卖出申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 203 | | 买入申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 204 | | 卖出申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 205 | 科创板限价--委托价格 | 买入申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 206 | | 卖出申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 207 | | 买入申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 208 | | 卖出申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 209 | | 买入申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 210 | | 卖出申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 211 | | 买入申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 212 | | 卖出申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |

| | | | | |
|-----|---|---------|-------------------|------------------------------|
| 213 | | 买入申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 214 | | 卖出申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 215 | | 买入申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 216 | | 卖出申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 217 | | 买入申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |
| 218 | | 卖出申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |
| 219 | | 买入申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格不是价格单位的整数倍 |
| 220 | | 卖出申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格不是价格单位的整数倍 |
| 221 | 科创板限价-委托数量/市价-最优价格五档并撤销委托/市价-最优价格五档并转限价委托/市价-对方最优/市价-本方最优 | 买入申报 | 买入申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 222 | | 卖出申报 | 卖出申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 223 | | 买入申报-撤单 | 买入申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 224 | | 卖出申报-撤单 | 卖出申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 225 | | 买入申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 226 | | 卖出申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 227 | | 买入申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 228 | | 卖出申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 229 | | 买入申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 230 | | 卖出申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 231 | | 买入申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |

| | | | | | |
|-----|-----------------|-----------------|-------------------|-----------------------------|------------------|
| 232 | | 卖出申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 233 | | 买入申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=买入/卖出数量大于最高限量 | |
| 234 | | 卖出申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=买入/卖出数量大于最高限量 | |
| 235 | 单市场 ETF-限价-委托价格 | 买入申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 236 | | 卖出申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 237 | | 买入申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 238 | | 卖出申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 239 | | 买入申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 240 | | 卖出申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 241 | | 买入申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 242 | | 卖出申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 243 | | 买入申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 244 | | 卖出申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 245 | | 买入申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 246 | | 卖出申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 247 | | 买入申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 | |
| 248 | | 卖出申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 | |
| 249 | | 买入申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 250 | | 卖出申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 251 | | 单市场 ETF-限价-委托价格 | 买入申报 | 买入申报-连续 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |

| | | 价-委托数量/市 | 竞价 | |
|-----|--------------------------------|------------------|-------------------|------------------------------|
| 252 | 价--最优价格五档并撤销委托/市价-最优价格五档并转限价委托 | 卖出申报 | 卖出申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 253 | | 买入申报-撤单 | 买入申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 254 | | 卖出申报-撤单 | 卖出申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 255 | | 买入申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 256 | | 卖出申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 257 | | 买入申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 258 | | 卖出申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 259 | | 买入申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 260 | | 卖出申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 261 | | 买入申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 262 | | 卖出申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 263 | | 买入申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 264 | | 卖出申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 265 | | 跨市场 ETF-限价--委托价格 | 买入申报 | 跌停板价格-连续竞价 |
| 266 | 卖出申报 | | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 267 | 买入申报 | | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 268 | 卖出申报 | | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |

| | | | | |
|-----|---|---------|-------------------|------------------------------|
| 269 | | 买入申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 270 | | 卖出申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 271 | | 买入申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 272 | | 卖出申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 273 | | 买入申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 274 | | 卖出申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 275 | | 买入申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 276 | | 卖出申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 277 | | 买入申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |
| 278 | | 卖出申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |
| 279 | | 买入申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 280 | | 卖出申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 281 | 跨市场 ETF-限价-委托数量/市价--最优价格五档并撤销委托/市价-最优价格五档并转限价委托 | 买入申报 | 买入申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 282 | | 卖出申报 | 卖出申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 283 | | 买入申报-撤单 | 买入申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 284 | | 卖出申报-撤单 | 卖出申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 285 | | 买入申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 286 | | 卖出申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 287 | | 买入申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 288 | | 卖出申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |

| | | | | |
|-----|---------------|---------|-------------------|------------------------------|
| 289 | | 买入申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 290 | | 卖出申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 291 | | 买入申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 292 | | 卖出申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 293 | | 买入申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 294 | | 卖出申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 295 | REITS-限价-委托价格 | 买入申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 296 | | 卖出申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 297 | | 买入申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 298 | | 卖出申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 299 | | 买入申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 300 | | 卖出申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 301 | | 买入申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 302 | | 卖出申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 303 | | 买入申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 304 | | 卖出申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 305 | | 买入申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 306 | | 卖出申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 307 | | 买入申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |

| | | | | | |
|-----|--|--------------|-------------------|------------------------------|------------------|
| 308 | | 卖出申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 | |
| 309 | | 买入申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 310 | | 卖出申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 311 | REITS-限价-委托数量/市价-最优价格五档并撤销委托/市价-最优价格五档并转限价委托 | 买入申报 | 买入申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 312 | | 卖出申报 | 卖出申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 313 | | 买入申报-撤单 | 买入申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 314 | | 卖出申报-撤单 | 卖出申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 315 | | 买入申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 316 | | 卖出申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 317 | | 买入申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 318 | | 卖出申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 319 | | 买入申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 320 | | 卖出申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 321 | | 买入申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 322 | | 卖出申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 323 | | 买入申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 324 | | 卖出申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 325 | | LOF-限价--委托价格 | 买入申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |

| | | | | |
|-----|--|---------|-------------------|------------------------------|
| 326 | | 卖出申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 327 | | 买入申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 328 | | 卖出申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 329 | | 买入申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 330 | | 卖出申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 331 | | 买入申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 332 | | 卖出申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 333 | | 买入申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 334 | | 卖出申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 335 | | 买入申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 336 | | 卖出申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 337 | | 买入申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |
| 338 | | 卖出申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |
| 339 | | 买入申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 340 | | 卖出申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 341 | LOF-限价-委托数量/市价--最优价格五档并撤销委托/市价--最优价格五档并转限价委托 | 买入申报 | 买入申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 342 | | 卖出申报 | 卖出申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 343 | | 买入申报-撤单 | 买入申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 344 | | 卖出申报-撤单 | 卖出申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 345 | | 买入申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |

| | | | | |
|-----|-------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| 346 | | 卖出申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 347 | | 买入申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 348 | | 卖出申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 349 | | 买入申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 350 | | 卖出申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 351 | | 买入申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 352 | | 卖出申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 353 | | 买入申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 354 | | 卖出申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 355 | 普通基金-限价 --委托价格 | 买入申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 356 | | 卖出申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 357 | | 买入申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 358 | | 卖出申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 359 | | 买入申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 360 | | 卖出申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 361 | | 买入申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 362 | | 卖出申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 363 | | 买入申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |

| | | | | |
|-----|-------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| 364 | | 卖出申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 365 | | 买入申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 366 | | 卖出申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 367 | | 买入申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |
| 368 | | 卖出申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 |
| 369 | | 买入申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 370 | | 卖出申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 |
| 371 | | 买入申报 | 买入申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 372 | | 卖出申报 | 卖出申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 373 | | 买入申报-撤单 | 买入申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 374 | | 卖出申报-撤单 | 卖出申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 375 | | 买入申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 376 | 普通基金-限价-委托数量/市价--最优价格五档 | 卖出申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 377 | 并撤销委托/市价-最优价格五档 | 买入申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 378 | 并转限价委托 | 卖出申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 379 | | 买入申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 380 | | 卖出申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 |
| 381 | | 买入申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 382 | | 卖出申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |

| | | | | | |
|-----|------------|----------------|-------------------|------------------------------|------------------|
| 383 | | 买入申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 384 | | 卖出申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 385 | 沪B限价--委托价格 | 买入申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 386 | | 卖出申报 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 387 | | 买入申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 388 | | 卖出申报 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 389 | | 买入申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 390 | | 卖出申报-撤单 | 跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 391 | | 买入申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 392 | | 卖出申报-撤单 | 涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 393 | | 买入申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 394 | | 卖出申报 | 低于跌停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 395 | | 买入申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 396 | | 卖出申报 | 高于涨停板价格-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 397 | | 买入申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 | |
| 398 | | 卖出申报 | 委托价格 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格小于最小价格 | |
| 399 | | 买入申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格不是价格单位的整数倍 | |
| 400 | | 卖出申报 | 委托价格超 2 位小数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托价格不是价格单位的整数倍 | |
| 401 | | 沪B限价-委托数量/最优价格 | 买入申报 | 买入申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 402 | | 五档并撤销委托/最优价格五档 | 卖出申报 | 卖出申报-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |

| | | | | | |
|-----|--------------|----------|-------------------|------------------------------|------------------|
| 403 | 并转限价委托 | 买入申报-撤单 | 买入申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 404 | | 卖出申报-撤单 | 卖出申报撤单-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 405 | | 买入申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 406 | | 卖出申报 | 委托数量非买卖单位整数倍-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 407 | | 买入申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 408 | | 卖出申报 | 委托数量负数-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 409 | | 买入申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 410 | | 卖出申报 | 委托数量 0-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量不是买卖单位的整数倍 | |
| 411 | | 买入申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 412 | | 卖出申报 | 委托数量等于最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 413 | | 买入申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 414 | | 卖出申报 | 委托数量超出最高申报数量-连续竞价 | 成功失败标志=N;错误信息=委托数量超出每笔限量 | |
| 415 | | 担保品买入 | 担保品买入-限价 | 限价-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 416 | | | 担保品买入-市价剩余转限价 | 市价剩余转限价-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 417 | 担保品买入-市价剩余撤销 | | 市价剩余撤销-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 | |
| 418 | 担保品买入-本方最优 | | 市价本方最优-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 419 | 担保品买入-对手方最优 | | 市价对手方最优-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |
| 420 | 担保品卖出 | 担保品卖出-限价 | 限价-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 | |

| | | | | |
|-----|------|-------------------|--------------------|--------------------------------|
| 421 | | 担保品卖出-市价 剩余转限价 | 市价剩余转限价 -连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 422 | | 担保品卖出-市价 剩余撤销 | 市价剩余撤销- 连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单 成功 |
| 423 | | 担保品卖出-本方 最优 | 市价本方最优- 连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 424 | | 担保品卖出-对手 方最优 | 市价对手方最优 -连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 425 | 融资买入 | 融资买入-限价 | 限价-连续竞价 申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 426 | | 融资买入-市价剩 余转限价 | 市价剩余转限价 -连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 427 | | 融资买入-市价剩 余撤销 | 市价剩余撤销- 连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单 成功 |
| 428 | | 融资买入-本方最 优 | 市价本方最优- 连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 429 | | 融资买入-对手方 最优 | 市价对手方最优 -连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 430 | 融券卖出 | 融券卖出-限价 | 限价-连续竞价 申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 431 | 买券还券 | 买券还券-限价 | 限价-连续竞价 申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 432 | | 买券还券-市价剩 余转限价 | 市价剩余转限价 -连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 433 | | 买券还券-市价剩 余撤销 | 市价剩余撤销- 连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单 成功 |
| 434 | | 买券还券-本方最 优 | 市价本方最优- 连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 435 | | 买券还券-对手方 最优 | 市价对手方最优 -连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 436 | 卖券还款 | 卖券还款-限价 | 限价-连续竞价 申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 437 | | 卖券还款-市价剩 余转限价 | 市价剩余转限价 -连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 438 | | 卖券还款-市价剩 余撤销 | 市价剩余撤销- 连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单 成功 |
| 439 | | 卖券还款-本方最 优 | 市价本方最优- 连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 440 | | 卖券还款-对手方 最优 | 市价对手方最优 -连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已成 |
| 441 | 要约收购 | 要约收购申报 | 要约收购-连续 竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 ; 资金冻结=不冻结 |

| | | | | |
|-----|-----------|----------|------------------|--------------------|
| 442 | | 要约收购撤单 | 要约收购撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 443 | | 要约收购解除 | 要约收购解除-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;资金冻结=不冻结 |
| 444 | | 要约收购解除撤单 | 要约收购解除撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 445 | 上证基金通 | 认购 | 上证基金通认购-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 446 | | 认购撤单 | 上证基金通认购撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 447 | | 申购 | 上证基金通申购-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 448 | | 申购撤单 | 上证基金通申购撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 449 | | 赎回 | 上证基金通赎回-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 450 | | 赎回撤单 | 上证基金通赎回撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 451 | | 转托管 | 转托管 | 转托管-连续竞价申报 |
| 452 | 转托管撤单 | | 转托管撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 453 | 基金分红 | 现金分红 | 现金分红-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 454 | | 现金分红撤单 | 现金分红撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 455 | 基金转换 | 基金转换 | 基金转换-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 456 | | 基金转换撤单 | 基金转换撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 457 | 发行-申购限价委托 | 买入申报 | A股申购/中签-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 458 | | 买入申报 | 科创板申购/中签-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 459 | | 买入申报 | 基金申购/中签-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |

| | | | | |
|-----|------------|------------|------------------|--------------------|
| 460 | | 买入申报 | 转债申购/中签-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 461 | 配股-限价委托 | 卖出申报 | 限价-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 462 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=N;不可撤单 |
| 463 | 科创板配售-限价委托 | 卖出申报 | 限价-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 464 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=N;不可撤单 |
| 465 | 配转债-限价委托 | 卖出申报 | 限价-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 466 | | 卖出申报-撤单 | 限价撤单-连续竞价申报 | 成功失败标志=N;不可撤单 |
| 467 | 余券划转 | 买入申报 | 余券划转-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 468 | 还券划转 | 卖出申报 | 还券划转-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 469 | 担保品划入 | 买入申报 | 担保品划入-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 470 | 担保品划出 | 卖出申报 | 担保品划出-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 471 | 券源划入 | 买入申报 | 券源划入-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 472 | 券源划出 | 卖出申报 | 券源划出-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 473 | 债券分销(国债) | 非交易-沪 A | 债券分销(国债)-集合竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 474 | 债券分销(企业债) | 非交易-沪 A | 债券分销(企业债)-集合竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 475 | 债券分销(国债) | 非交易-沪 A-撤单 | 债券分销(国债)-集合竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 476 | 债券分销(企业债) | 非交易-沪 A-撤单 | 债券分销(企业债)-集合竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=撤单成功 |
| 477 | 指定交易 | 买入申报 | 指定交易-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 478 | 指定撤销 | 买入申报 | 指定撤销-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 479 | 密码服务 | 买入申报 | 激活密码-连续竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |

| | | | | |
|-----|--|---------|-------------------|------------------|
| 480 | | 买入申报-撤单 | 激活密码撤单- 连续竞价申报 | 成功失败标志=N;不可撤单 |
| 481 | | 买入申报 | 注销密码-连续 竞价申报 | 成功失败标志=Y;委托状态=已报 |
| 482 | | 买入申报-撤单 | 注销密码撤单- 连续竞价申报 | 成功失败标志=N;不可撤单 |