

北证办发〔2025〕75号附件1

北京证券交易所、
全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范
（二进制）
（V1.0）

北京证券交易所
全国中小企业股份转让系统
二〇二五年七月

文档信息

文档名称	北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统交易数据接口规范（二进制）		
修订历史			
版本号	通信版本号	修改日期	修改说明
V0.1	1.00	2023年7月	创建。
V0.9	1.00	2023年9月	根据市场意见，形成试行版本。
V1.0	1.00	2025年7月	1.根据0.9试行版使用情况的反馈修订。 2.调整部分错误码。 3.启用交易会话状态消息。 4.新订单撤单失败响应、订单响应及撤单成功执行报告和订单成交执行报告启用OrdStatus和LeavesQty字段。

名词释义

词汇缩写	含义
BJTG	Beijing Market Trading GateWay, 北京证券交易所及全国中小企业股份转让系统交易网关
BJQG	Beijing Market Quotation GateWay, 北京证券交易所及全国中小企业股份转让系统行情网关
OMS	Order Management System 订单管理系统
VSS	Vendor Supplied System, 供应商提供的行情接收系统, 用于接入行情网关接收行情数据
MDDP	Market Data Distribution Protocol, 组播行情数据分发协议, 行情网关接入方式配置为组播时使用的分发协议

目 录

一、前言	1
二、会话机制	1
2.1. 连接	1
2.1.1. 通信版本号	1
2.1.2. 会话	1
2.1.3. 网络地址和端口	2
2.1.4. 安全	2
2.2. 会话管理	2
2.2.1. 建立会话	2
2.2.2. 心跳包和测试请求	2
2.2.3. 终止会话	3
2.2.4. 重建会话	3
三、服务说明	3
3.1. 平台说明	3
3.2. 委托申报方式说明	3
3.3. 委托消息处理流程	5
3.4. 新订单处理消息流图	6
3.4.1. 新订单消息流图	7
3.4.2. 撤单请求消息流图	9
3.5. 双边报价处理消息流图（暂不启用）	10
3.5.1. 新报价处理消息流图	10
3.5.2. 报价更新处理消息流图	10
3.5.3. 报价撤销处理消息流图	13

3.6. 点击成交报价处理消息流程图（暂不启用）	15
3.6.1. 公开报价受价方点击成交处理	15
3.6.2. 公开报价报价方撤销报价处理	16
3.7. 成交申报处理消息流程图	16
3.7.1. 协议配对申报模式	16
四、消息定义	19
4.1. 消息结构	19
4.1.1. 消息头	19
4.1.2. 消息尾	20
4.2. 管理消息	20
4.2.1. 登录消息（Logon）	20
4.2.2. 注销消息（Logout）	21
4.2.3. 心跳消息（Heartbeat）	22
4.3. 业务消息-新订单处理	22
4.3.1. 新订单（New Order）	22
4.3.2. 撤单请求（Order Cancel Request）	26
4.3.3. 撤单失败响应（Cancel Reject）	27
4.3.4. 订单响应及撤单成功执行报告（Execution Report）	29
4.3.5. 订单成交执行报告（Execution Report）	33
4.4. 业务消息-报价处理（暂不启用）	36
4.4.1. 报价（Quote）	36
4.4.2. 报价状态回报（Quote Status Report）	39
4.4.3. 报价回复（Quote Response）	43
4.4.4. 转发报价（Allege Quote）	45
4.4.5. 转发报价回复（Allege Quote Response）	47

4.5. 业务消息-成交申报处理	49
4.5.1. 成交申报 (Trade Capture Report)	49
4.5.2. 成交申报响应 (Trade Capture Report Ack)	54
4.5.3. 成交确认 (Trade Capture Report)	56
4.6. 其他消息	60
4.6.1. 业务拒绝消息 (Business Reject)	60
4.6.2. 回报同步消息 (Report Synchronization)	61
4.6.3. 交易会话状态消息 (Trading Session Status) (暂不启用)	62
4.6.4. 平台状态消息 (Platform State Info)	63
4.6.5. 回报结束消息 (Report Finished)	64
4.6.6. 平台信息消息 (Platform Info)	65
五、 数据字典	65
5.1. 数据类型	65
5.2. 会话层域定义	67
5.3. 业务层域定义	68
5.4. 错误码	79
六、 附件	84
6.1. 新订单处理流程说明	84
6.1.1. 申报新订单并产生成交	84
6.1.2. 撤销尚未产生成交的新订单	85
6.1.3. 撤销已部分成交的新订单	86
6.1.4. 撤销已全部成交的新订单	86
6.1.5. 撤销已被拒绝的新订单	87
6.1.6. 撤销不存在的新订单	88
6.2. 成交申报 (TCR) 处理流程说明	88

6.2.1. 协议配对模式88

北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统 交易数据接口规范（二进制）

一、前言

本接口规范描述了北京证券交易所及全国中小企业股份转让系统交易网关（以下简称“交易网关”或“BJTG”）与市场参与者系统之间以二进制协议进行交易数据交换时所采用的交互机制、消息格式、消息定义和数据内容。

目前，本接口规范仅适用于各平台提供的各类业务，用以指导交易参与人以二进制协议接入各平台提交申报、接收回报等。结算数据接口规范由中国证券登记结算有限责任公司另文制定。

除特别说明，本接口中所有数据文件均采用 GB18030 编码规范。

特殊说明的是本接口适用于固定收益平台债券现券交易匹配成交和协商成交，标记为暂不启用的接口对应业务暂不适用本接口规范，交易支持平台的业务仍参照《交易支持平台数据接口规范》。

二、会话机制

2.1. 连接

2.1.1. 通信版本号

各版本接口规范对应的通信版本号参见文档说明节的修订历史中的“通信版本号”列，在登录消息（Logon）的 DefaultAppVerID 字段中填写该通信版本号，具体填写方式见“会话层域定义”一节。

2.1.2. 会话

接入用户通过会话将自身的订单管理系统(简称“OMS”)连接到交易网关(简称“BJTG”)。该连接为标准的 TCP/IP 点对点连接。

2.1.3. 网络地址和端口

交易网关按每个平台（平台描述见“服务说明”章节）提供了一个交易服务端口供 OMS 接入。每个交易网关每个平台只能建立一个 TCP/IP 连接，每一个连接只能对应一个会话。

2.1.4. 安全

交易网关和接入用户订单管理系统必须位于同一个安全网络之中，交易网关和接入用户订单管理系统之间传输的数据是非加密的，数据传输安全由接入用户网络保证。

2.2. 会话管理

2.2.1. 建立会话

会话建立过程：

1. 订单管理系统首先建立一个到交易网关的 TCP/IP 连接，然后发送一个 Logon 消息给交易网关。
2. 如果交易网关验证订单管理系统有权登录，那么交易网关会返回 Logon 消息给订单管理系统，作为一个登录消息的确认，表示本次会话登录成功。
3. 如果订单管理系统登录验证失败，那么交易网关会返回 Logout 消息给订单管理系统，表示本次会话登录失败。
4. 订单管理系统发送 Logon 消息后，如果交易网关没有在适当的时间间隔内作回应，则可以关闭连接，并在等待一段时间后再次尝试连接。
5. 如果订单管理系统断线或收到交易网关的 Logout 消息，也应该等待一段时间后再次尝试连接。

2.2.2. 心跳包和测试请求

为了交易网关和订单管理系统通信的双方能够实时监测通信链路状态，要求通信双方在数据空闲时互相发送心跳包，当一方没有接收到数据包的时间超过两倍的心跳间隔时，则可认为是数据链路发生故障，接收方可以断开此异常链接。

当订单管理系统登录到交易网关时，订单管理系统应在登录消息中指定心跳

间隔参数(单位为秒)。

在一个心跳间隔时间内，如果交易网关没有需要向订单管理系统发送的数据，那么交易网关会向订单管理系统发送一个心跳消息，以保证两条消息之间的时间间隔不会超过设定的心跳间隔；同样，订单管理系统必要时也应该发送心跳消息来保证交易网关收到的连续两条消息之间的时间间隔不超过心跳间隔时间。

订单管理系统也可以采用类似的检测机制对交易网关和订单管理系统之间的连接情况进行检测。

2.2.3. 终止会话

订单管理系统和交易网关都能通过发送 Logout 消息要求终止会话。对方接收到 Logout 消息请求后，会发送一条 Logout 消息回应，发起方收到 Logout 消息回应后，终止连接；如果对方没有在适当的时间间隔内作回应，则可终止连接。

2.2.4. 重建会话

如果会话被终止，订单管理系统可以通过登录消息重建会话。重建会话后，订单管理系统应通过应用层规则进行下行数据同步。

三、服务说明

3.1. 平台说明

平台各业务有独立的开闭市时间设置，市场参与者需要根据交易网关下发的当前状态信息来控制各业务委托申报的开始和停止。

特别说明，本接口规范目前仅适用于固定收益平台债券现券匹配成交和协商成交业务，交易支持平台的业务仍参照《交易支持平台数据接口规范》。

3.2. 委托申报方式说明

用于申报委托的消息有多种类型，接口规范根据每类业务的特性，规定了相应的委托申报的消息类型。

委托申报消息类型有：

表 3-1 委托申报消息类型

消息类型	报文号 MsgType	说明
NewOrder	101xxx	新订单
TradeCaptureReport	103xxx	成交申报
Quote	104xxx	报价（暂不启用）
Quote Response	105xxx	报价回复（暂不启用）

在所有委托申报消息中都存在一个 ApplID 字段，每个业务消息的 xxx 对应业务 ApplID，所以每个业务都对应一个消息类型，市场参与者在申报委托时，需要按接口规范的要求在委托中填写委托对应的 ApplID。

各类业务的委托申报消息类型及 ApplID 如下表所示：

表 3-2 委托申报应用标识说明

委托申报类型	报文号 MsgType	应用标识 ApplID	所属平台
债券现券交易匹配成交申报	101010	010	固定收益平台
债券现券交易协商成交申报	103031	031	固定收益平台
股票集中竞价申报（暂不启用）	101040	040	交易支持平台
转股申报（暂不启用）	101041	041	交易支持平台
询价申报（暂不启用）	101042	042	交易支持平台
申购申报（暂不启用）	101043	043	交易支持平台
回售申报（暂不启用）	101044	044	交易支持平台
预受要约申报（暂不启用）	101045	045	交易支持平台
转融通证券出借非约定申报（暂不启用）	101050	050	交易支持平台
转融通证券出借约定申报（暂不	103051	051	交易支持平台

启用)			
互报成交确认申报（暂不启用）	103060	060	交易支持平台
做市互报成交确认申报（暂不启用）	103061	061	交易支持平台
盘后协议大宗交易成交申报（暂不启用）	103062	062	交易支持平台
协议交易业务报价申报（暂不启用）	104070	070	交易支持平台
双边做市交易报价（暂不启用）	104071	071	交易支持平台

3.3. 委托消息处理流程

对于 OMS 申报的委托，交易系统会首先作基本合法性检查，比如委托中的证券代码是否存在、是否到达委托申报时间等等。

如果检查未通过，交易系统会通过 Business Reject (MsgType=4) 消息通知 OMS 委托被拒绝。

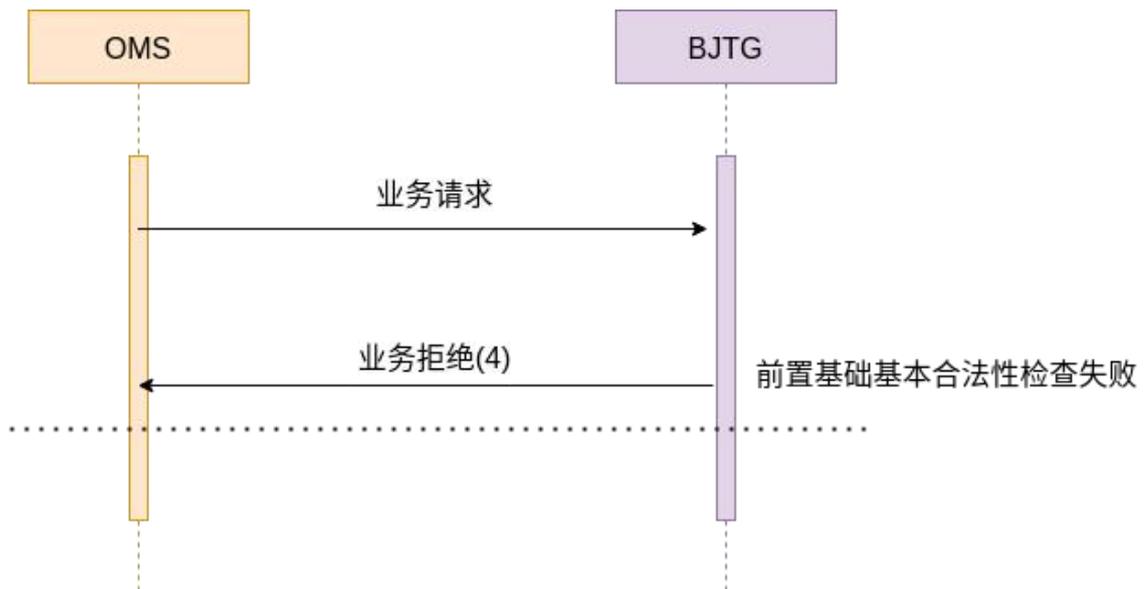


图 3-1 业务拒绝消息流示意图

如果通过基本合法性检查，交易系统会根据委托消息类型的不同给 OMS 发出相应的回报消息，具体参见 3.4-3.7。

3.4. 新订单处理消息流图

对于 OMS 提交的新订单，交易系统以执行报告消息作为响应。执行报告消息分为两类报文，一类报文用于新订单的确认响应、撤单成功时的响应以及委托被交易系统自动撤销时（比如市价委托剩余自动撤销）的响应（MsgType=202xxx），一类报文用于新订单达成成交时的响应（MsgType=203xxx）。对于转股申报等非交易订单，只会回报上述第一类执行报告。下面列出新订单相关各类消息的处理流程，其中相关各类消息中具体字段取值参见新订单（New Order）处理回报说明。

3.4.1. 新订单消息流图

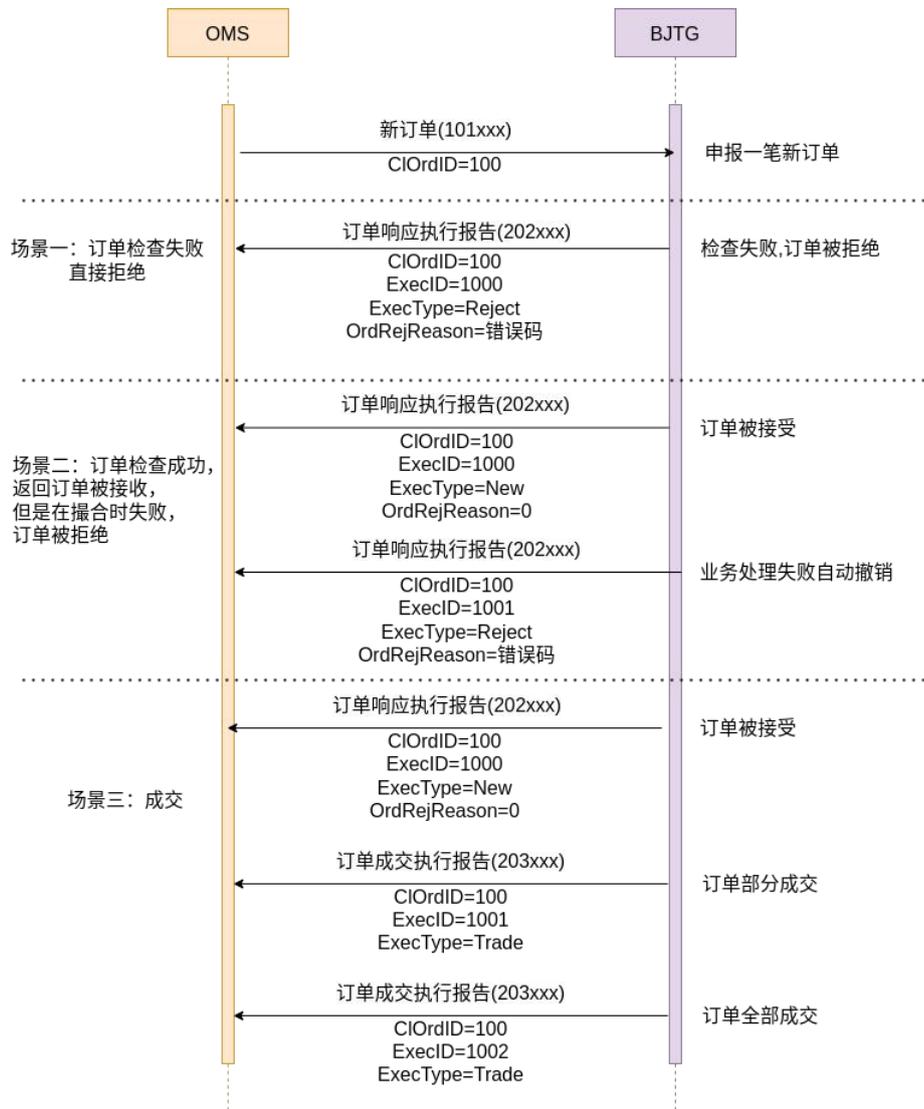


图 3-2 新订单消息流示意图

交易系统对于收到的每一笔新订单，都会立即给出订单被接受（ExecType=New）或拒绝（ExecType=Reject）的确认执行报告（MsgType=202xxx）；对于交易类业务，订单后续达成成交的还会继续给出成交（ExecType=Trade）执行报告（MsgType=203xxx）；对于非交易类业务，一般在订单确认时即完成处理，不会有后续的成交执行报告。OMS 申报各业务新订单收到的执行报告类型如下：

表 3-3 订单执行报告类型列表

应用标识 AppIID	说明	确认执行报告	成交执行报告
010	债券现券交易匹配成交申报	●	●
040	股票集中竞价(1B 1S)	●	●
041	转股申报(5S)	●	
042	询价申报(7B)	●	
043	申购申报(8B)	●	
044	回售申报(9S)	●	
045	预受要约申报(EB ES)	●	
050	转融通证券出借非约定申报	●	●

3.4.2. 撤单请求消息流图

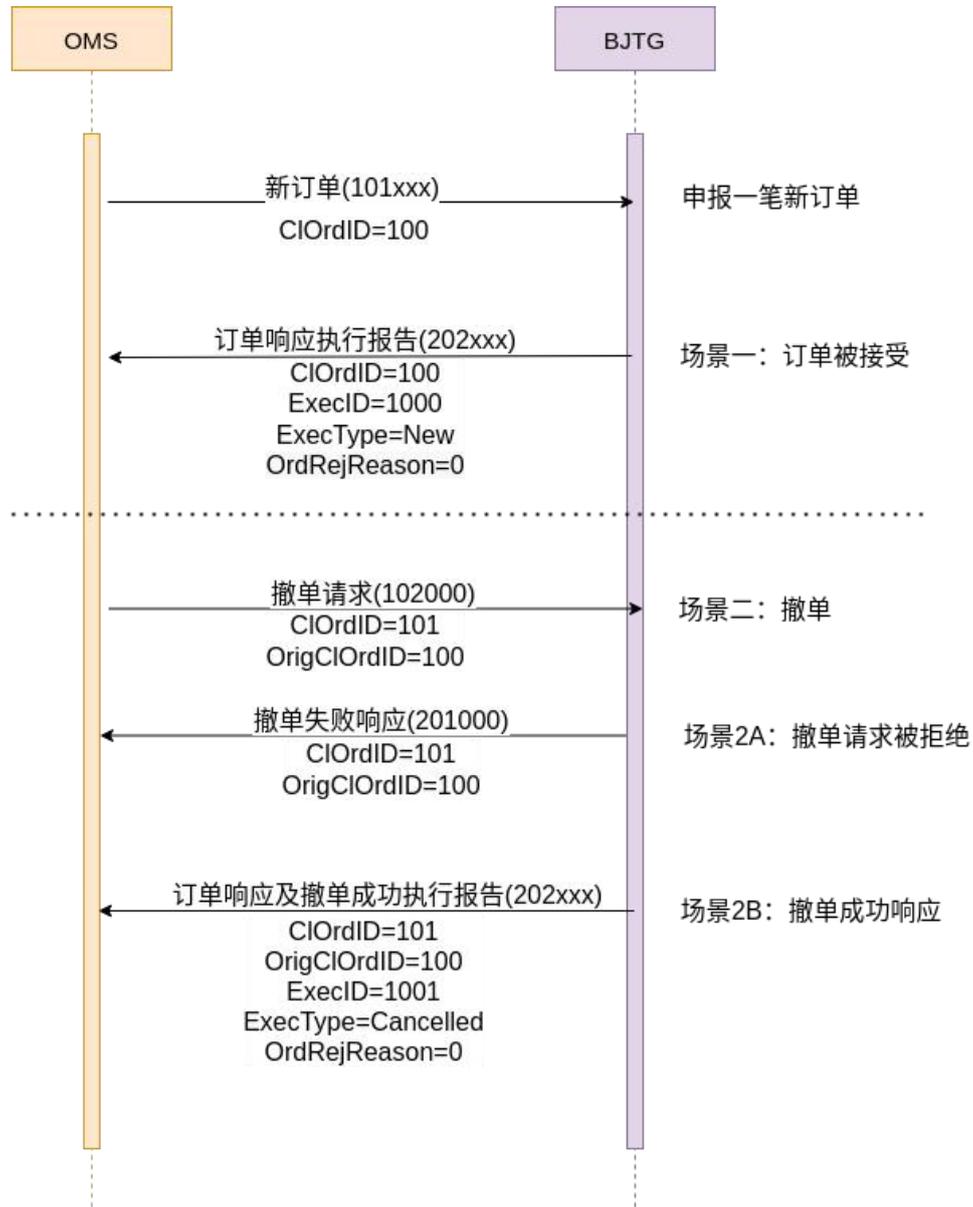


图 3-3 撤单请求消息流示意图

3.5. 双边报价处理消息流图（暂不启用）

3.5.1. 新报价处理消息流图

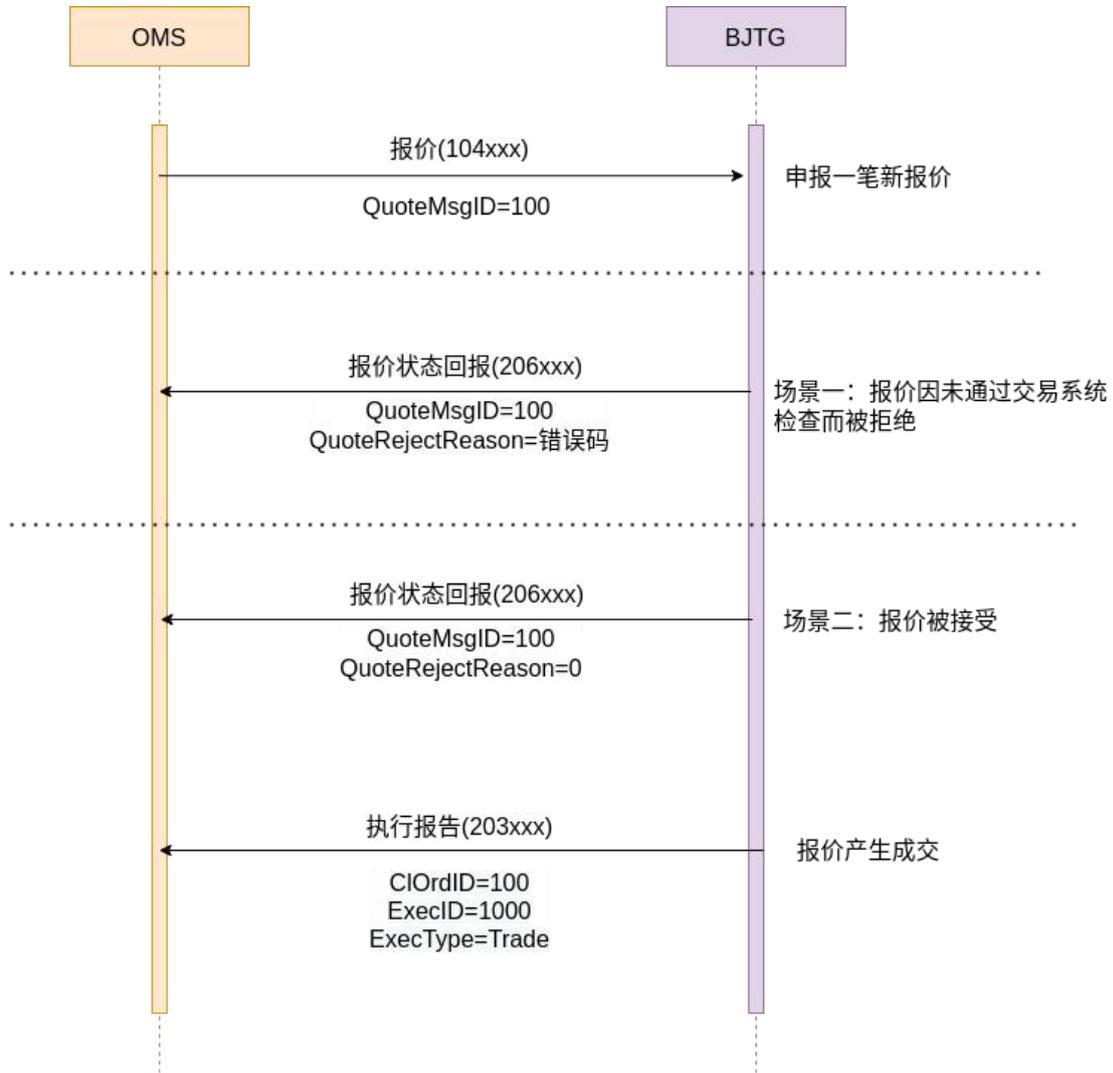


图 3-4 新报价处理消息流示意图

3.5.2. 报价更新处理消息流图

情形一：更新双边报价，如图 3-5 所示

情形二：更新单边报价，价格没有锁价或倒挂，如图 3-6 所示

情形三：更新单边报价，价格出现锁价或倒挂，如图 3-7 所示

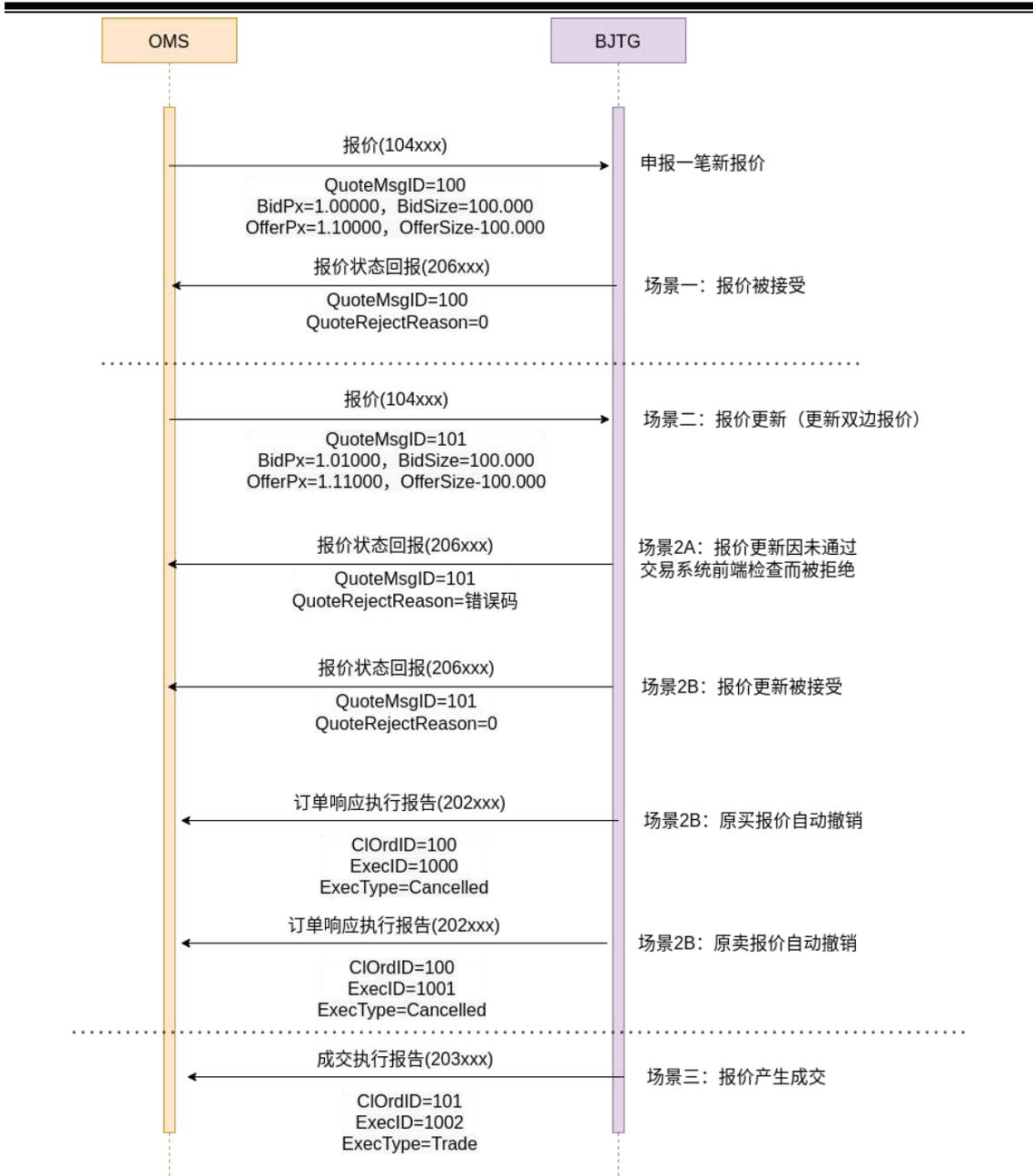


图 3-5 更新双边报价处理消息流示意图

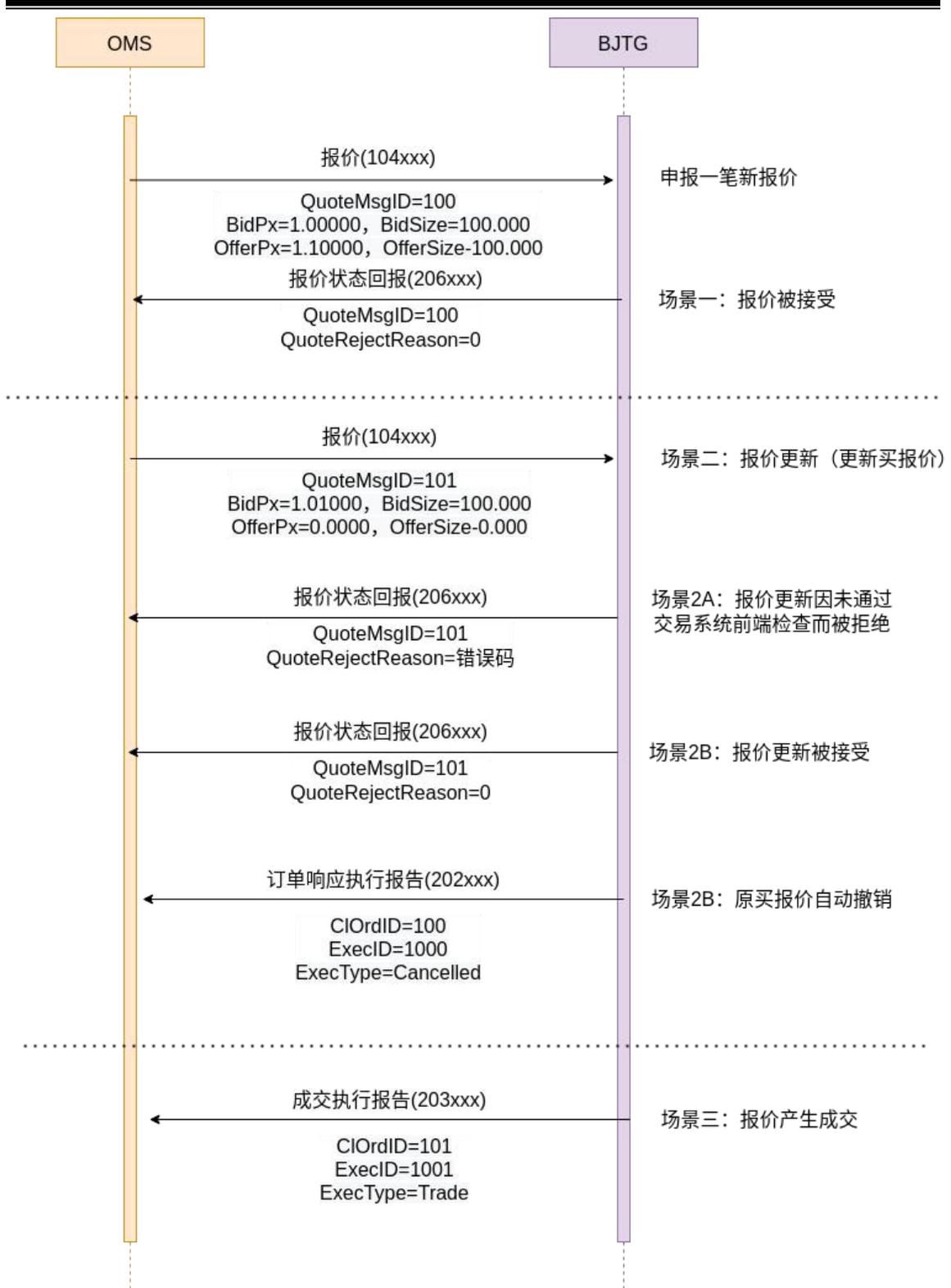


图 3-6 更新单边报价（情形二）处理消息流示意图

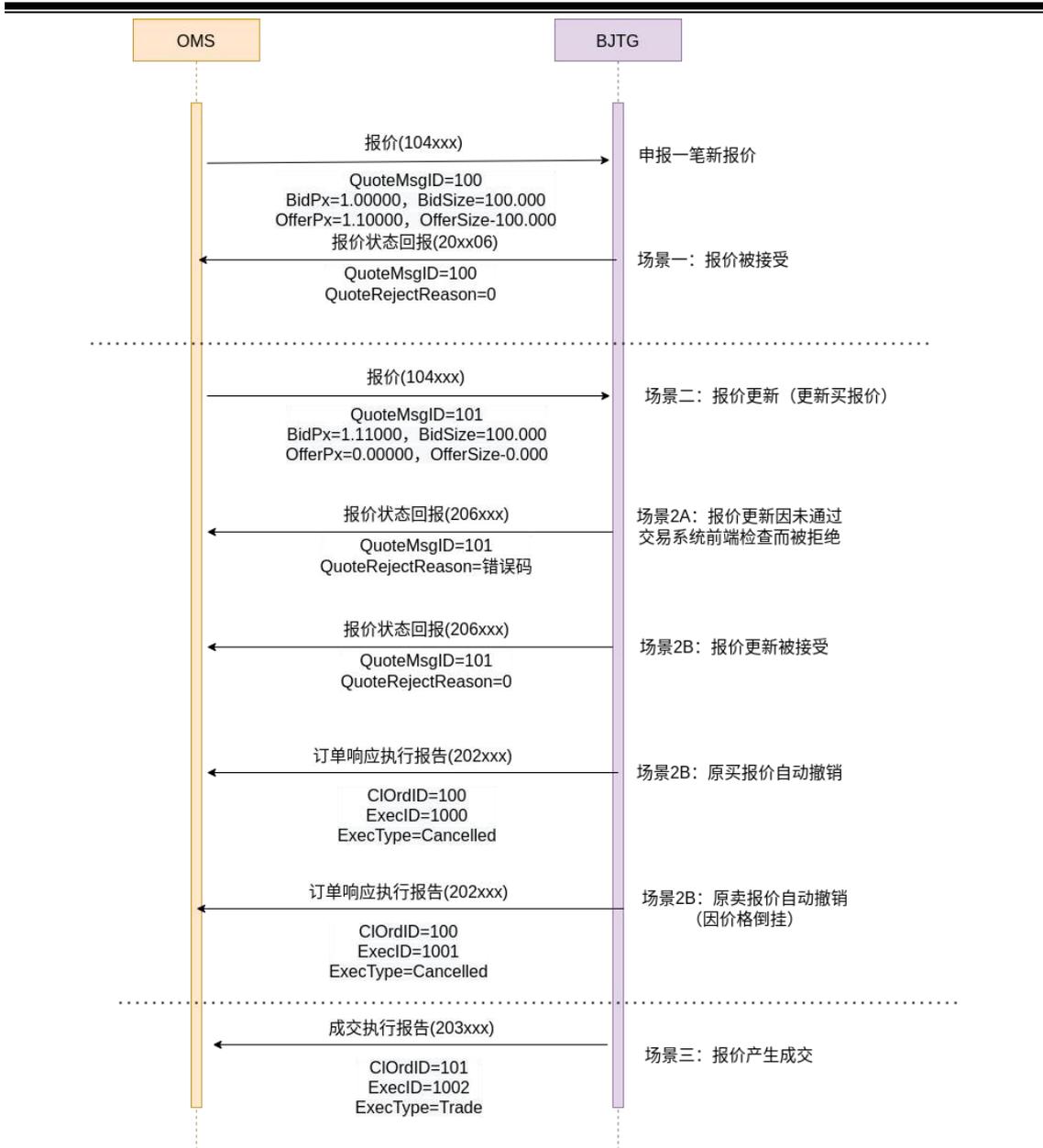


图 3-7 更新单边报价（情形三）处理消息流示意图

3.5.3. 报价撤销处理消息流图

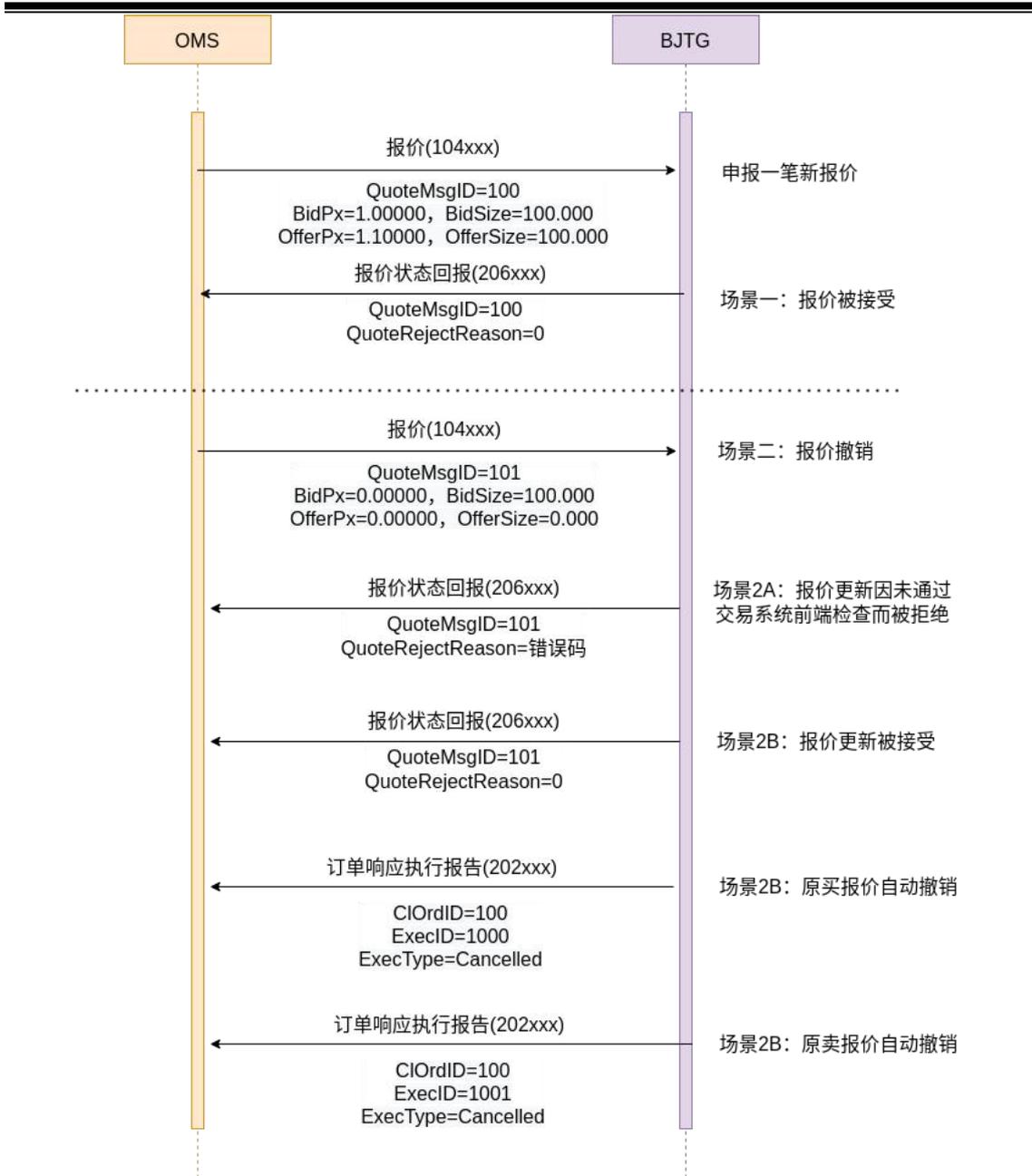


图 3-8 报价撤销处理消息流示意图

3.6. 点击成交报价处理消息流图（暂不启用）

3.6.1. 公开报价受价方点击成交处理

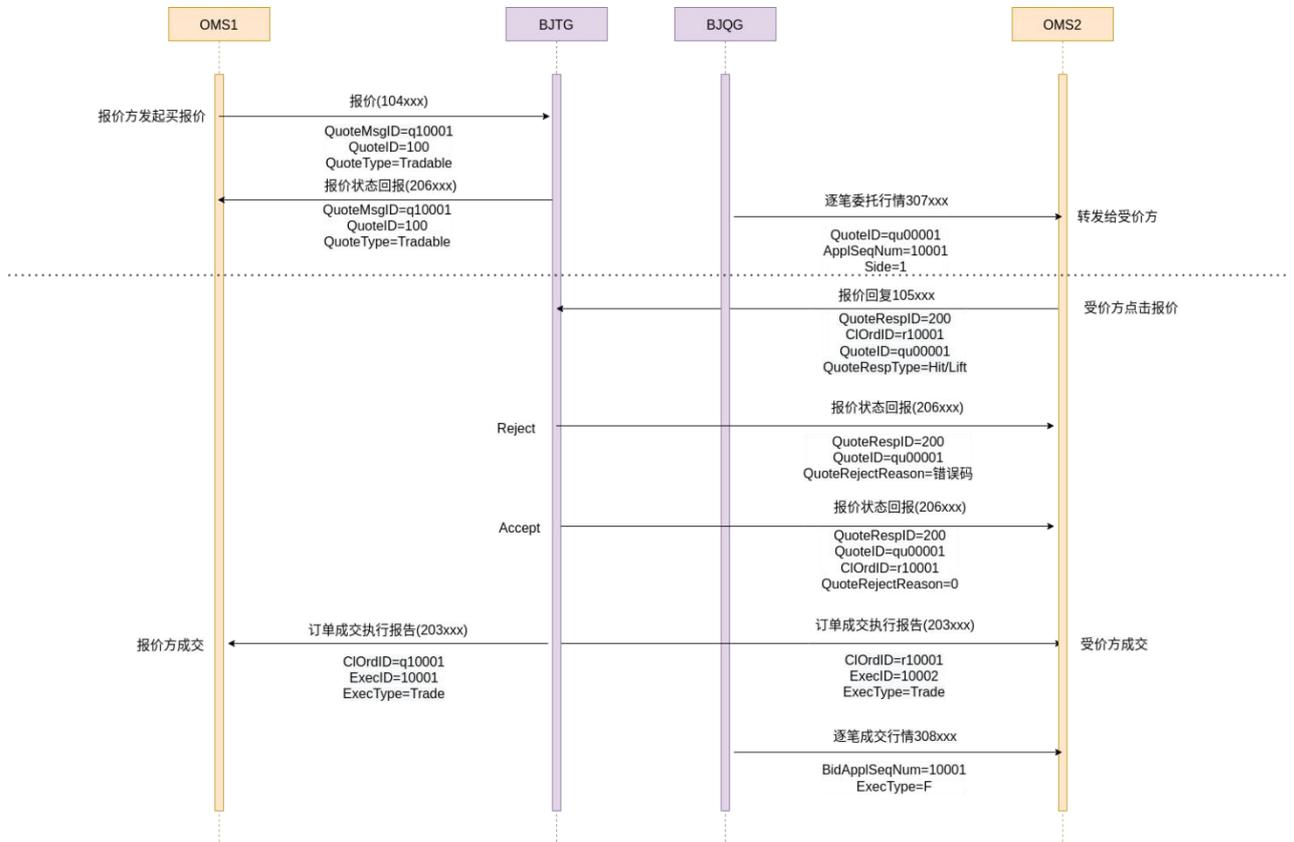


图 3-9 受价方点击成交处理消息流示意图

注：若为报价方发起卖报价，则将逐笔委托中的 Side=1 改为 Side=2、将逐笔成交中的 BidAppISeqNum=s10001 改为 OfferAppISeqNum=s10001 即可，其他流程不变。

3.6.2. 公开报价报价方撤销报价处理

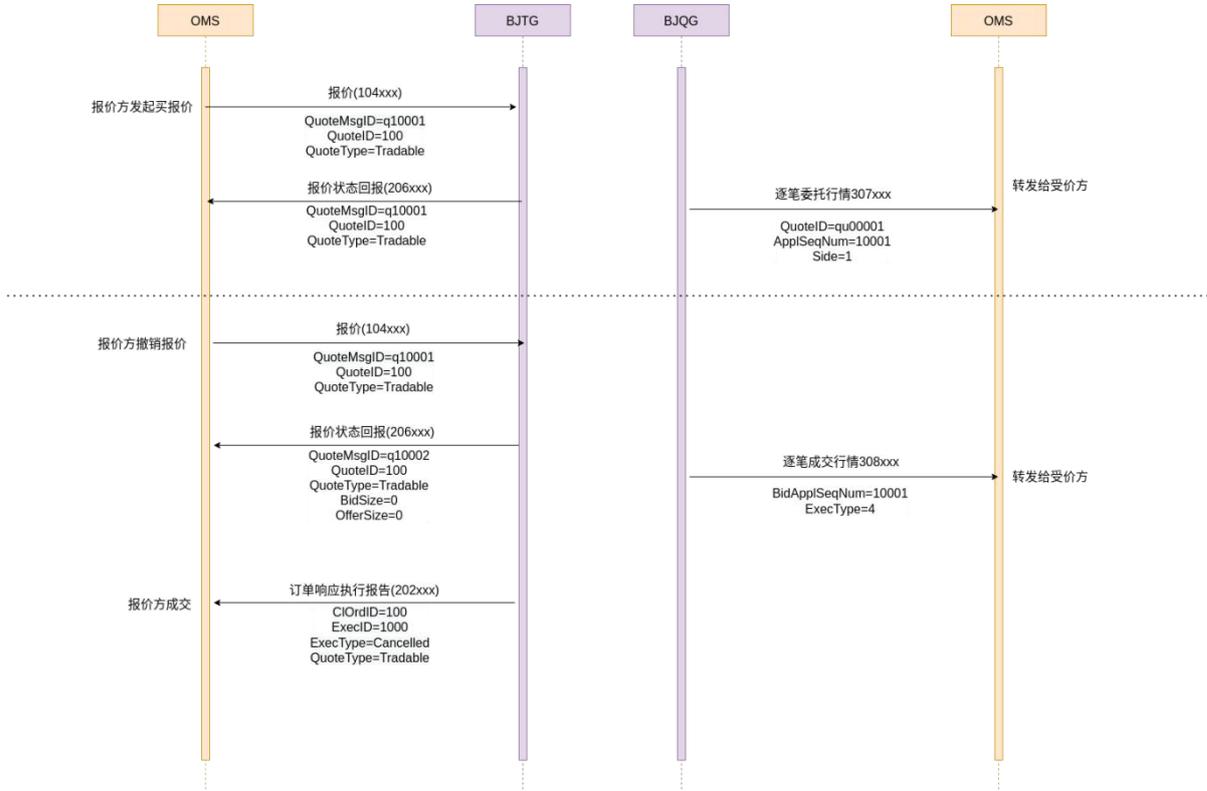


图 3-10 报价方撤销报价处理消息流示意图

注：若为报价方发起卖报价，则将逐笔委托中的 Side=1 改为 Side=2、将逐笔成交中的 BidAppISeqNum=s10001 改为 OfferAppISeqNum=s10001 即可，其他流程不变。

3.7. 成交申报处理消息流图

下面列出成交申报相关各类消息的处理流程，其中相关各类消息中具体字段取值参见附件成交申报（TCR）处理回报说明。

3.7.1. 协议配对申报模式

大宗交易、债券协商成交等多种协议交易业务的成交申报采用“协议配对申报模式（one party report for matching）”，即买卖双方各报一笔，交易系统配对。

3.7.1.1. 新成交申报处理

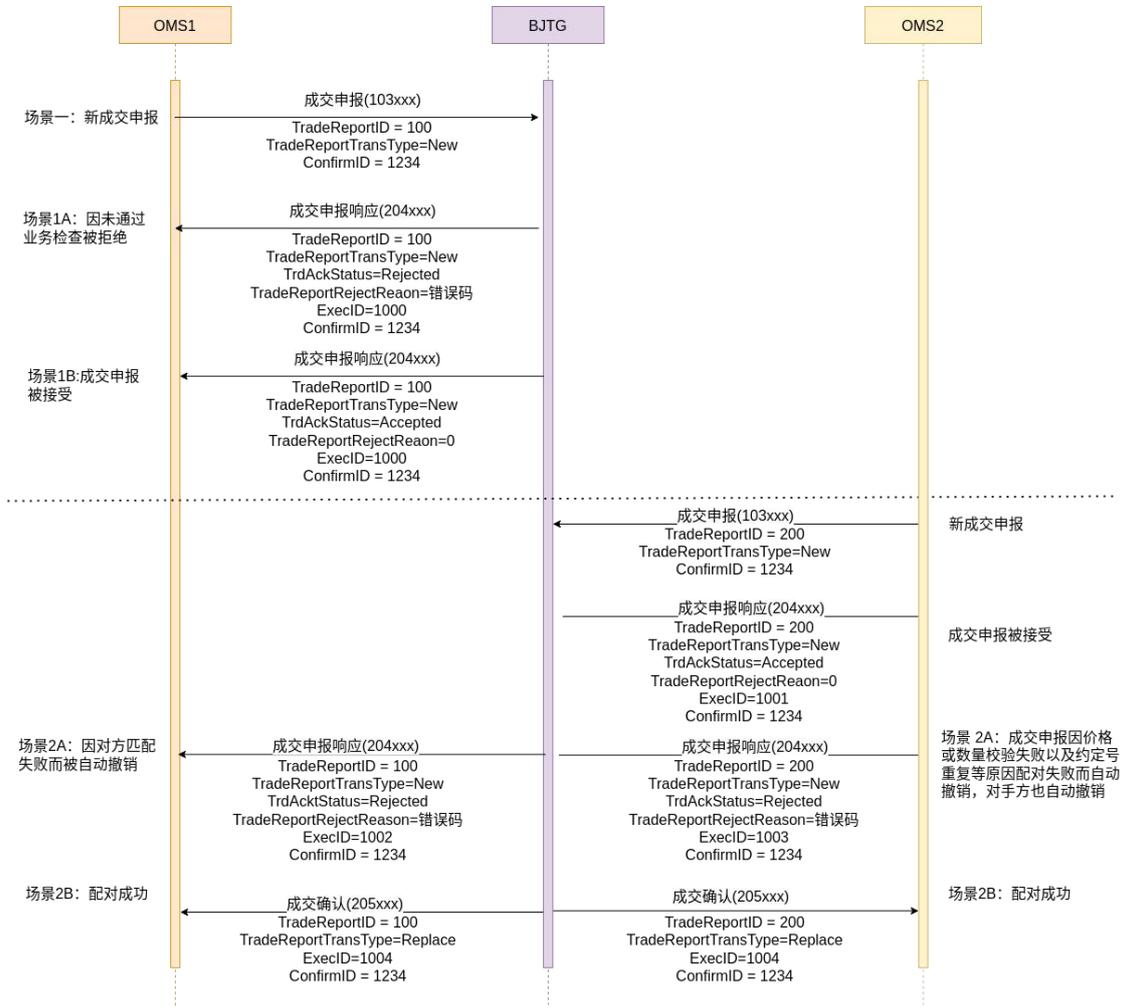


图 3-11 新成交申报处理消息示意图

表 3-4 协议配对模式业务列表

应用标识 AppID	说明	成交申报 响应	成交确认	是否支持 撤销
031	协商成交方式下的成交确认申报	●	●	●
051	转融通证券出借约定申报（暂	●	●	●

	不启用)			
060	互报成交确认 申报(3B、3S、 3C)(暂不启用)	●	●	●
061	做市互报成交 确认申报(4B、 4S、4C)(暂不 启用)	●	●	●
062	盘后协议大宗 交易业务成交 申报(暂不启 用)	●	●	●

3.7.1.2. 撤销成交申报

尚未完成配对的成交申报可以撤销，撤销流程如图 3-12 所示。

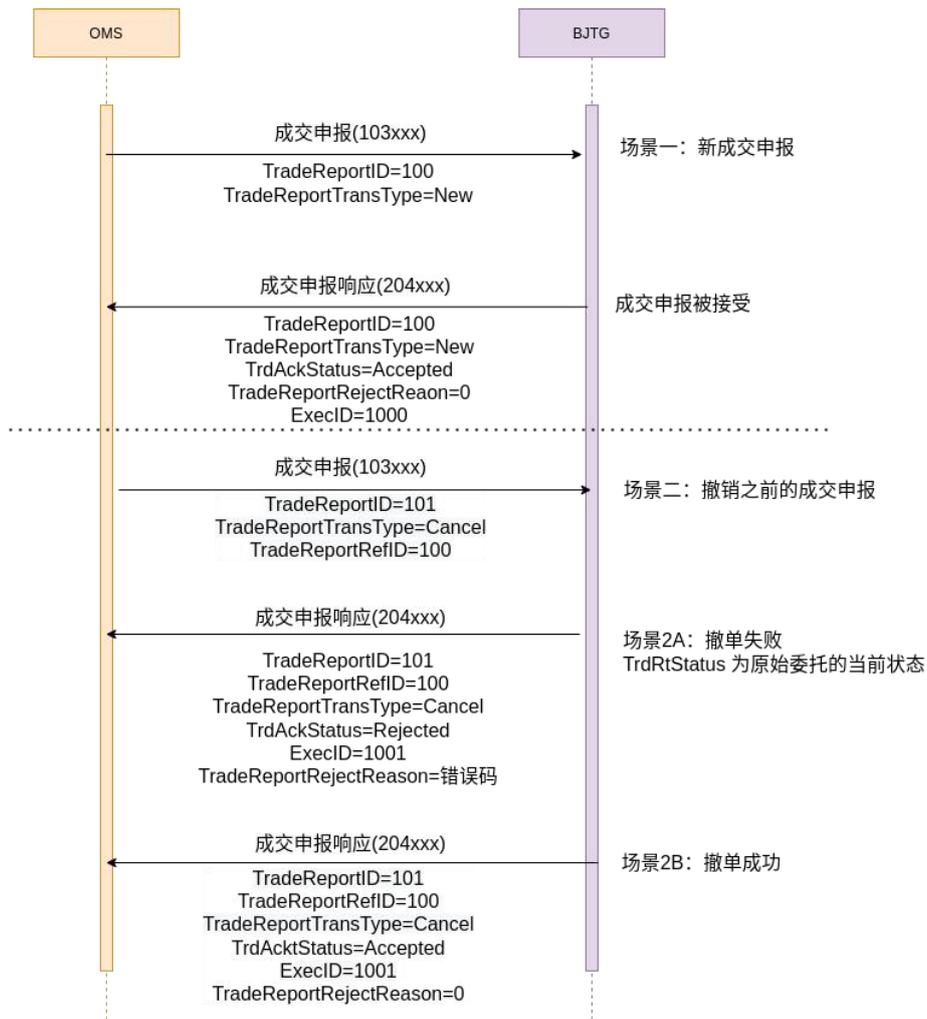


图 3-12 撤销成交申报处理消息流示意图

四、消息定义

4.1. 消息结构

每一条消息都由消息头、消息体和消息尾组成。

4.1.1. 消息头

消息头定义了应用消息的类型、长度数据域，均不加密传输。

表 4-1 消息头定义

域名	字段描述
MsgType	消息类型

BodyLength	消息体长度
------------	-------

4.1.2. 消息尾

消息尾定义了消息的校验和，不加密传输。校验和的计算范围从消息头开始（包括消息头）一直到消息体结束。

表 4-2 消息尾定义

域名	字段描述
Checksum	校验和

以下为计算校验和的代码段：

```
uint32 GenerateCheckSum( char *buf, uint32 bufLen )
{
    long idx;
    uint32 cks;
    for( idx = 0L, cks = 0; idx < bufLen; cks += (uint32)buf[ idx++ ] );
    return ( cks % 256 );
}
```

4.2. 管理消息

4.2.1. 登录消息（Logon）

Logon 消息应该是订单管理系统开始工作时向交易网关发出的第一条消息。订单管理系统使用 Logon 消息来与交易网关建立连接，交易网关使用 Logon 消息确认订单管理系统登录成功。

表 4-3 OMS 向 BJTG 发送申请登录消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 1
SenderCompID	发送方代码

TargetCompID	接收方代码
HeartBtInt	心跳间隔，单位为秒。订单管理系统登录时提供给交易网关。
Password	密码
DefaultAppVerID	二进制协议版本，即通信版本号。

4.2.2. 注销消息 (Logout)

当订单管理系统发起的连接请求不被交易网关接受时，交易网关会向订单管理系统发送 Logout 消息来拒绝登录请求。在必要时订单管理系统也可以主动发送 Logout 消息来中断当前和交易网关的连接。

表 4-4 OMS 与 BJTG 间注销消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 2
SessionStatus	退出时的会话状态 0 = 会话活跃 1 = 会话口令已更改 2 = 将过期的会话口令 3 = 新会话口令不符合规范 4 = 会话退登完成 5 = 不合法的用户名或口令 6 = 账户锁定 7 = 当前时间不允许登录 8 = 口令过期 9 = 收到的 MsgSeqNum(34)太小 10=收到的 NextExpectedMsgSeqNum(789)太大.

	101 = 其他 102 = 无效消息
Text	文本 注销原因的进一步补充说明

4.2.3. 心跳消息（Heartbeat）

交易网关和订单管理系统之间用 Heartbeat 消息来检测 TCP 连接的状态，因此当一方处于数据发送空闲期时，需要定时发送 Heartbeat 消息以供检测连接的健康度。

表 45 OMS 与 BJTG 间心跳消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 3, BodyLength=0

4.3. 业务消息-新订单处理

4.3.1. 新订单（New Order）

表 4-6 OMS 向 BJTG 报送新订单消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=101xxx
AppID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

OwnerType	<p>订单所有者类型</p> <p>1=个人投资者发起</p> <p>101=交易所发起</p> <p>102=会员发起</p> <p>103=机构投资者发起</p> <p>104=自营交易发起</p> <p>105=流动性服务提供商发起</p> <p>106=结算机构发起</p>
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部识别码
OrderRestrictions	订单限定
Side	买卖方向
OrdType	<p>订单类型</p> <p>1 表示市价</p> <p>2 表示限价</p> <p>U 本方最优</p>
OrderQty	订单数量
Price	价格
Extend Fields	各业务扩展字段

表 4-7 新订单申报类型关键要素取值

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

业务	报文号 MsgType	应用标识 AppID	Side	有无扩展字段	是否允许撤销
债券现券 交易匹配 成交申报	101010	010	1=买 2=卖	Y	Y
股票集中 竞价	101040	040	1=买 2=卖	Y	Y
转股申报	101041	041	固定填 1	N	Y
询价申报	101042	042	固定填 1	N	N
申购申报	101043	043	固定填 1	N	N
回售申报	101044	044	固定填 1	N	Y
预受要约 申报	101045	045	1=买 2=卖	N	Y
转融通证 券出借非 约定申报	101050	050	G=借入 F=出借	Y	Y

4.3.1.1. 债券现券交易匹配成交业务扩展字段（101010）

表 4-8 债券现券交易业务匹配成交新订单扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型

CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓
SettleType	结算方式
SettlePeriod	结算周期

4.3.1.2. 现货集中竞价交易业务新订单扩展字段（101040）

表 4-9 现货集中竞价交易业务新订单扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

表 4-10 新订单申报委托类型定义

委托类型	TimeInForce	OrdType	MaxPriceLevels	MinQty
限价委托	0	2	0	0
本方最优	0	U	0	0
对手方最优剩余转 限价	0	1	1	0

市价立即成交剩余撤销	3	1	0	0
市价全额成交或撤销	3	1	0	=OrderQty
市价最优五档全额成交剩余撤销	3	1	5	0

如果 CashMargin 取值为“融资融券平仓（3）”，同时订单所有者类型为“会员发起（102）”，则表示该笔订单为会员强制平仓。

4.3.1.3. 转融通证券出借业务新订单扩展字段（101050）

表 4-11 转融通证券出借业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限，单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
ShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 08=首发后可出借限售股

4.3.2. 撤单请求（Order Cancel Request）

表 4-12 OMS 向 BJTG 报送撤单请求消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=102000
AppIID	应用标识

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型 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 106=结算机构发起
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
CIOrdID	客户订单编号
OrigCIOrdID	原始订单客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部识别码
OrderID	原始订单交易所订单编号
OrderQty	原始订单数量 交易所对该字段的值不作检查

4.3.3. 撤单失败响应（Cancel Reject）

表 4-13 BJTG 向 OMS 传送撤单失败响应消息定义

域名	字段描述
----	------

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

Standard Header	消息头 MsgType=201000
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
AppIID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型 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 106=结算机构发起
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
CIOrdID	客户订单编号
OrigCIOrdID	原始订单客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部识别码
OrdStatus	订单状态原始订单当前状态

CxIRejReason	拒绝原因代码
RejectText	拒绝原因说明
OrderID	原始订单交易所订单编号

4.3.4. 订单响应及撤单成功执行报告（Execution Report）

表 4-14 BJTG 向 OMS 传送订单响应及撤单成功执行报告
消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=202xxx
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
AppID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型 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 106=结算机构发起
ClearingFirm	结算机构代码

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号
ExecID	执行编号（北交所成交编号）
ExecType	执行类型 执行报告类型 0=New，表示新订单 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝 F=Trade，表示已成交
OrdStatus	订单状态 0=New，表示新订单 1=Partially filled，表示部分成交 2=Filled，表示全部成交 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
OrdType	订单类型 1 表示市价 2 表示限价

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

	U 本方最优
OrderQty	订单数量
Price	价格
AccountID	证券账户
BranchID	营业部识别码
OrderRestrictions	订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定类型 如没有限定类型则填空
Extend Fields	各业务扩展字段

表 4-15 各类业务订单响应及撤单成功关键要素说明

业务	报文号 MsgType	应用标识 AppID	有无扩展字段
债券现券交易匹配成交	202010	010	Y
股票集中竞价	202040	040	Y
转股申报	202041	041	N
询价申报	202042	042	N
申购申报	202043	043	N
回售申报	202044	044	N
预受要约申报	202045	045	N
转融通证券出借非约	202050	050	Y

定申报			
-----	--	--	--

4.3.4.1. 债券现券交易匹配成交业务执行报告扩展字段（202010）

表 4-16 匹配成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.3.4.2. 现货集中竞价交易业务执行报告扩展字段（202040）

表 4-17 现货集中竞价交易业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
StopPx	止损价
MinQty	最低成交数量
MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
TimeInForce	订单有效时间类型
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易

	2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓
--	-----------------------------------

4.3.4.3. 转融通证券出借业务执行报告扩展字段（202050）

表 4-18 转融通证券出借业务执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限，单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
ShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 08=首发后可出借限售股

4.3.5. 订单成交执行报告（Execution Report）

表 4-19 BJTG 向 OMS 传送订单成交执行报告消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=203xxx
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
AppIID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

OwnerType	<p>订单所有者类型</p> <p>1=个人投资者发起</p> <p>101=交易所发起</p> <p>102=会员发起</p> <p>103=机构投资者发起</p> <p>104=自营交易发起</p> <p>105=流动性服务提供商发起</p> <p>106=结算机构发起</p>
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号
ExecID	执行编号
ExecType	<p>执行类型</p> <p>执行报告类型</p> <p>0=New, 表示新订单</p> <p>4=Cancelled, 表示已撤销</p> <p>8=Reject, 表示已拒绝</p> <p>F=Trade, 表示已成交</p>
OrdStatus	<p>订单状态</p> <p>0=New, 表示新订单</p> <p>1=Partially filled, 表示部分成交</p> <p>2=Filled, 表示全部成交</p> <p>4=Cancelled, 表示已撤销</p>

	8=Reject, 表示已拒绝
LastPx	成交价
LastQty	成交数量
LeavesQty	订单剩余数量
CumQty	累计执行数量
Side	买卖方向
AccountID	证券账户
BranchID	营业部识别码
Extend Fields	各业务扩展字段

表 4-20 各类业务订单响应及撤单成功关键要素说明

业务	报文号 MsgType	应用标识 ApplID	有无扩展 字段
债券现券交易匹配成交	203010	010	Y
股票集中竞价	203040	040	Y
转融通证券出借非约定	203050	050	Y

4.3.5.1. 债券现券交易业务匹配成交成交执行报告扩展字段（203010）

表 4-21 匹配成交成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识
SettleType	结算方式
SettlePeriod	结算周期

4.3.5.2. 现货集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段（203040）

表 4-22 现货集中竞价交易业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓

4.3.5.3. 转融通证券出借业务成交执行报告扩展字段（203050）

表 4-23 转融通证券出借业务成交执行报告扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限, 单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
MaturityDate	到期日
ShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 08=首发后可出借限售股

4.4. 业务消息-报价处理（暂不启用）

4.4.1. 报价（Quote）

表 4-24 OMS 向 BJTG 报送报价消息定义

域名	字段描述
----	------

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

Standard Header	消息头 MsgType=104xxx
AppID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号 = ClOrdID
AccountID	证券账户
QuoteReqID	询价请求编号 当报价是对询价请求的响应时，填写转发 询价请求的 QuoteReqID
QuoteType	报价类型 1=可交易的报价 (Tradeable)
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量

OfferSize	卖数量
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务报价申报

表 4-25 报价申报业务

应用标识 AppID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
070	协议交易业务报价	104070	Y
071	双边做市交易报价	104071	N

2) 报价消息支持以下报价方式

表 4-26 报价方式

报价方式	BidSize	OfferSize
双边报价	>0	>0
买报价	>0	=0 <0
卖报价	<0	>0
撤销报价	=0	=0
买撤销	=0	<0
卖撤销	<0	=0

4.4.1.1. 协议交易业务报价扩展字段（104070）

表 4-27 协议交易业务报价扩展字段定义

域名	字段描述
BranchID	营业部识别码
QuoteID	报价消息编号,主动撤单时填与被撤委托的 QuoteID 一致
QuoteRespID	报价回复消息编号
PrivateQuote	私有报价
ValidUntilTime	报价有效时间, 预留
PriceType	价格类型, 预留 1=百分比 (Percentage) 2=每交易单位 (Per unit)
CashMargin	信用标识 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融资融券平仓
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
Memo	备注

4.4.2. 报价状态回报（Quote Status Report）

表 4-28 BJTG 向 OMS 传送报价状态回报消息定义

域名	字段描述
----	------

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

Standard Header	消息头 MsgType=206xxx
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
AppIID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
QuoteMsgID	客户报价消息编号
AccountID	证券账户
QuoteReqID	询价请求编号

QuoteStatus	报价状态 0=Accepted, 已接受 4=Cancelled, 已撤销 5=Rejected, 已拒绝 7=Expired, 已超时
QuoteRejectReason	拒绝原因代码
QuoteType	报价类型
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务报价状态的回报

表 4-29 报价状态回报业务

应用标识 AppID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
070	协议交易报价申报的报价状态回报	206070	Y

4.4.2.1. 协议交易业务报价状态回报扩展字段（206070）

表 4-30 协议交易业务报价状态回报扩展字段定义

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

域名	字段描述
BranchID	营业部识别码
OrderID	交易所订单编号
ExecID	执行编号
QuoteRespID	报价回复消息编号
PrivateQuote	私有报价
Side	方向
PriceType	价格类型，预留
ValidUntilTime	报价有效时间，预留
CashMargin	信用标识，预留
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
Memo	备注
NoQuote	报价消息个数
→	QuoteID 报价消息编号
→	QuotePrice 报价价格
→	QuoteQty 报价数量

注：1) 报价状态回报作为报价消息 (ApplID 为 070) 的响应时, NoQuote 取值为 1, QuoteID 填报价消息的 QuoteID, QuotePrice、QuoteQty 为 0;

2) 报价状态回报作为报价回复消息 (ApplID 为 070) 的响应时, NoQuote、QuoteID、QuotePrice、QuoteQty 取值同报价回复消息的对应字段取值。

4.4.3. 报价回复（Quote Response）

表 4-31 OMS 向 BJTG 报送报价回复消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=105xxx
ApplID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
BranchID	营业部识别码
QuoteRespID	报价回复消息编号

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

QuoteRespType		报价回复类型 1=Hit/Lift, 接受 2=Counter, 重报 6=Pass, 拒绝
Side		方向
ValidUntilTime		报价有效时间, 预留
QuoteType		报价类型
PriceType		价格类型, 预留
NoQuote		报价消息个数
→	QuoteID	报价消息编号
→	QuotePrice	报价价格
→	QuoteQty	报价数量
Extend Fields		各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务报价回复申报

表 4-32 报价回复申报的业务

应用标识 AppIID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
070	协议交易报价回复申报	105070	Y

4.4.3.1. 协议交易业务报价回复扩展字段（105070）

表 4-33 协议交易业务转发报价扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识，预留 1=Cash，普通交易 2=Open，融资融券开仓 3=Close，融资融券平仓

4.4.4. 转发报价（Allege Quote）

表 4-34 BJTG 向 OMS 传送转发报价消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=207xxx
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
AppID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ExecID	执行编号
ClOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
QuoteReqID	询价请求消息编号
QuoteID	报价消息编号
QuoteRespID	报价回复消息编号
QuoteType	报价类型
BidPx	买报价
OfferPx	卖报价
BidSize	买数量
OfferSize	卖数量
PrivateQuote	私有报价
ValidUntilTime	报价有效时间，预留
PriceType	价格类型，预留
Memo	备注

Extend Fields	各业务扩展字段
---------------	---------

注：

- 1) 该消息用于以下业务的转发报价

表 4-35 转发报价的业务

应用标识 AppIID	说明	报文号 MsgType	有无扩展 字段
070	协议交易转发报价	207070	Y

4.4.4.1. 协议交易业务转发报价扩展字段（207070）

表 4-36 协议交易业务转发报价扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识，预留
CounterpartyPBUID	对手方交易单元

4.4.5. 转发报价回复（Allege Quote Response）

表 4-37 BJTG 向 OMS 传送报价回复消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=208xxx
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

AppIID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
OrderID	交易所订单编号
ExecID	执行编号
CIOrdID	客户订单编号
AccountID	证券账户
QuoteID	报价消息编号
QuoteRespID	报价回复消息编号
QuoteRespType	报价回复类型
PrivateQuote	私有报价
OrderQty	数量

Price	价格
Side	方向
ValidUntilTime	报价有效时间，预留
QuoteType	报价类型
PriceType	价格类型，预留
Extend Fields	各业务扩展字段

4.5. 业务消息-成交申报处理

4.5.1. 成交申报（Trade Capture Report）

表 4-38 OMS 向 BJTG 报送成交申报消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=103xxx
AppID	应用标识
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 106=北京证券交易所
OwnerType	订单所有者类型 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

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

	<p>104=自营交易发起</p> <p>105=流动性服务提供商发起</p> <p>106=结算机构发起</p>
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	委托时间
UserInfo	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	<p>成交申报类型</p> <p>0=Submit, 提交成交申报</p> <p>2=Accept, 接受成交申报</p> <p>3=Decline, 拒绝成交申报</p>
TradeReportTransType	<p>成交申报事务类别</p> <p>0=New, 新申报</p> <p>1=Cancel, 撤销申报</p> <p>2=Replace, 确认或响应</p>
TradeHandlingInstr	<p>成交申报模式</p> <p>1=Two-Party Report, 成交报告</p> <p>2=One-Party Report For Matching, 协议配对</p> <p>3=One-Party Report for Pass Through, 成交请求</p> <p>5=Two Party Report for Claim, 双边确认成交报告</p>
TradeReportRefID	原客户成交申报编号, 撤销成交申报时使用

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
Side	本方参与者买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部识别码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部识别码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务的成交申报

表 4-39 成交申报的业务

业务	应用标识 AppID	报文号 MsgType	成交申报模式 TradeHandlingInstr	有无扩展字段
协商成交方式下的成交申报	031	103031	协议配对	Y

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

转融通证券出借约定申报	051	103051	协议配对	Y
互报成交确认申报(3B、3S、3C)	060	103060	协议配对	N
做市互报成交确认申报(4B、4S、4C)	061	103061	协议配对	N
盘后协议大宗交易成交申报	062	103062	协议配对	Y

2) 各业务成交申报的市场参与人代码填写方式

表 4-40 成交申报市场参与人填写方式

业务	Side	PBUID	AccountID	BranchID	Counterparty	Counterparty	Counterparty
					PBUID	AccountID	BranchID
协商成交方式下的成交确认申报(031)	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	不填	不填	不填
转融通证券出借约定申报(051)	G=借入 F=出借	申报方	申报方	申报方	对手方	对手方	不填
互报成交确认申报(060)	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	对手方	对手方	不填
做市互报成交确认申报(061)	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	对手方	对手方	不填
盘后协议大宗交易成交申报(062)	1=买 2=卖	申报方	申报方	申报方	对手方	对手方	不填

3) 需填写约定号(ConfirmID)的业务: 协商成交方式下的成交确认申报(031)、互报成交确认申报(060)、做市互报成交确认申报(061)、盘后协议大宗成交申报(062)

4.5.1.1. 债券现券交易业务协商成交成交申报扩展字段（103031）

表 4-41 债券现券交易业务协商成交成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码
TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettleType	结算方式
SettlePeriod	结算周期
CashMargin	信用标识
Memo	备注

4.5.1.2. 转融通证券出借业务成交申报扩展字段（103051）

表 4-42 转融通证券出借业务成交申报扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限，单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
ShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 08=首发后可出借限售股

4.5.1.3. 盘后协议大宗交易业务成交确认扩展字段（103062）

表 4-43 盘后协议大宗交易业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.5.2. 成交申报响应（Trade Capture Report Ack）

表 4-44 BJTG 向 OMS 传送成交申报响应消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=204xxx
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
AppID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
User Info	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
TradeReportRefID	原客户成交申报编号
TrdAckStatus	成交申报响应状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
TrdRptStatus	成交申报状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝 2=Cancelled, 已撤销 100=Unmatched, 尚未匹配 101=Matched, 已匹配
TradeReportRejectReason	成交申报被拒绝原因代码
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与者买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户
BranchID	本方营业部识别码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户

CounterpartyBranchID	对手方营业部识别码
Extend Fields	各业务扩展字段 同成交申报各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下业务成交申报的响应

表 4-45 成交申报响应业务列表

业务	应用标识 AppID	报文号 MsgType	有无扩展 字段
协商成交方式下的成交 确认申报响应	031	204031	Y
转融通证券出借约定申 报响应	051	204051	Y
互报成交确认申报确认	060	204060	N
做市互报成交确认申报 确认	061	204061	N
盘后协议大宗交易成交 申报	062	204062	Y

- 2) 各业务扩展字段定义同成交申报一致，请参考成交申报消息定义。

4.5.3. 成交确认 (Trade Capture Report)

表 4-46 BJTG 向 OMS 传送成交确认消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=205xxx

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号
AppIID	应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
OwnerType	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码
TransactTime	回报时间
UserInfo	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型
TradeReportTransType	成交申报事务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式
LastPx	价格
LastQty	数量
TrdType	成交申报业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别
ConfirmID	约定号
ExecID	执行编号
Side	本方参与者买卖方向
PBUID	本方交易单元
AccountID	本方证券账户

BranchID	本方营业部识别码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部识别码
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下业务成交申报的确认

表 4-47 成交确认业务列表

业务	应用标识 AppID	报文号 MsgType	有无扩展 字段
协商成交方式下的成交 确认申报确认	031	205031	Y
转融通证券出借约定申 报确认	051	205051	Y
互报成交确认申报确认	060	205060	N
做市互报成交确认申报	061	205061	N
盘后协议大宗交易成交 申报	062	205062	Y

4.5.3.1. 债券现券交易业务协商成交成交确认扩展字段（205031）

表 4-48 债券现券交易业务协商成交成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
MemberID	本方交易商代码

TraderCode	本方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码
SettleType	结算方式
SettlePeriod	结算周期
CashMargin	信用标识
Memo	备注

4.5.3.2. 转融通证券出借业务成交确认扩展字段（205051）

表 4-49 转融通证券出借业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
ExpirationDays	期限，单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限
MaturityDate	到期日
ShareProperty	股份性质

4.5.3.3. 盘后协议大宗交易业务成交确认扩展字段（205062）

表 4-50 协议交易业务成交确认扩展字段定义

域名	字段描述
CashMargin	信用标识

4.6. 其他消息

4.6.1. 业务拒绝消息（Business Reject）

表 4-51 BJTG 向 OMS 传送业务拒绝消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=4
AppID	应用标识
TransactTime	回报时间
SubmittingPBUID	申报交易单元
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
RefSeqNum	被拒绝消息的消息序号
RefMsgType	被拒绝的消息类型
BusinessRejectRefID	被拒绝消息对应的业务层 ID，需要填写业务层 ID 的消息参见下面的列表。
BusinessRejectReason	拒绝原因
BusinessRejectText	拒绝原因说明

注：

- 1) 消息及业务层 ID 对应表：

表 4-52 业务消息类型与业务拒绝消息业务层 ID 对应表

消息类型	被拒绝消息对应的业务层 ID
新订单（New Order）	ClOrdID

撤单请求 (Order Cancel Request)	CIOrdID
报价 (Quote)	QuoteMsgID
报价回复 (Quote Response)	CIOrdID
成交申报 (TCR)	TradeReportID

4.6.2. 回报同步消息 (Report Synchronization)

本消息用于 OMS 在成功登录 BJTG 后，告知 BJTG 对应分区期望接收的下一条回报的记录号。

表 4-53 OMS 向 BJTG 传送回报同步消息定义

域名		字段描述
Standard Header		消息头 MsgType=5
NoPartitions		平台分区数量
→	PartitionNo	OMS 期望接收的平台分区号
→	ReportIndex	对应分区下，OMS 期望接收的下一条回报的记录号（回报记录号从 1 开始连续编号）。 收到本消息后，BJTG 会从该记录号开始向 OMS 发送该平台分区的回报；如果没有收到某一分区的记录号，则 BJTG 不会向 OMS 发送该分区的回报。

4.6.3. 交易会话状态消息（Trading Session Status）~~（暂不启用）~~

OMS 成功登录到 BJTG 后，会收到所连接平台的交易会话状态消息，揭示平台当前所处的交易会话状态。

交易过程中，如 OMS 所连接平台发生了交易会话状态的切换，则 BJTG 将发送该平台最新的交易会话状态消息给 OMS。

目前仅固定收益平台提供交易会话状态消息的揭示功能。

表 4-54 BJTG 向 OMS 传送交易会话状态消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=10
MarketID	市场代码，预留
MarketSegmentID	市场板块代码，仅启用第一位表示平台号： 2=固定收益平台
TradingSessionID	交易会话 ID，预留
TradingSessionSubID	交易会话子 ID，为数值型字符串
TradSesStatus	交易会话状态，预留
TradSesStartTime	交易会话开始时间， 预留
TradSesEndTime	交易会话结束时间，预留

注：

1) 各市场板块代码对应的交易会话子 ID 取值说明如下：

表 4-55 各市场交易会会话子 ID 取值说明

MarketSegmentID	TradingSessionSubID	对应时间段
2=固定收益平台	0000=开市前	0:00–9:00
2=固定收益平台	0100=匹配成交前交易（协商成交可申报）	9:00–9:15
2=固定收益平台	0130=开盘集合匹配（匹配成交可申报可撤单）	9:15–9:20
2=固定收益平台	0150=开盘集合匹配（不可撤单）	9:20–9:25
2=固定收益平台	0170=匹配成交暂停	9:25–9:30
2=固定收益平台	0200=上午交易	9:30–11:30
2=固定收益平台	0300=中午休市	11:30–13:00
2=固定收益平台	0400=下午交易	13:00–15:27
2=固定收益平台	0480=收盘连续匹配阶段	15:27–15:30
2=固定收益平台	0600=收市后阶段	15:30 之后

（1）同一交易日内，当 MarketSegmentID（市场板块代码）相同时，TradingSessionSubID（交易会会话子 ID）以从小到大（转换为数值后）的顺序发布。未来为支持新增业务或已有业务的交易时间变更，可能会新增 TradingSessionSubID（交易会会话子 ID）枚举值，OMS 如果不使用这些新的枚举值，应可以不作变更而自动忽略新的枚举值。

4.6.4. 平台状态消息（Platform State Info）

本消息用于新一代交易系统向 OMS 提供各平台的当前状态，便于 OMS 控制是否发送委托。

OMS 成功登录到 BJTG 后，会收到一条平台状态消息，消息中描述相应平台的当前状态。当每个平台的状态发生变化时，OMS 都会收到一条平台状态消息，描述该平台的最新状态。

表 4-56 BJTG 向 OMS 传送平台状态消息定义

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=6
PlatformID	平台号 2=固定收益平台
PlatformState	平台状态 0=PreOpen, 未开放 2=Open, 开放 3=Halt, 暂停开放 4=Close, 关闭

4.6.5. 回报结束消息 (Report Finished)

BJTG 使用该消息通知 OMS 本交易日当前平台对应分区回报发送完毕。

表 4-57 BJTG 向 OMS 传送回报结束消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType=7
PartitionNo	平台分区号
ReportIndex	回报记录号 该回报记录号与本分区各类回 报消息中的回报记录号连续编 号
PlatformID	平台号

	2=固定收益平台
--	----------

注：

1) OMS 收到本平台所有分区对应的回报结束消息后，才说明本交易日对应平台所有回报接收完毕。

2) 平台对应的分区信息，参见“平台信息消息（Platform Info）”。

4.6.6. 平台信息消息（Platform Info）

本消息用于 BJTG 向 OMS 提供各平台的基本信息，便于 OMS 控制回报同步。

OMS 成功登录到 BJTG 后，除了会收到一条平台状态消息外，还会收到一条平台信息消息，消息中描述了相应平台的分区数量及分区号等信息。建议 OMS 收到平台信息消息后，才开始发送回报同步消息。

表 4-58 BJTG 向 OMS 传送平台信息消息定义

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 9
PlatformID	平台号 2=固定收益平台
NoPartitions	平台分区数量
→ PartitionNo	平台分区号，分区号不一定连续

五、数据字典

本接口规范中的所有整数类型字段都采用高字节序（BIG-ENDIAN）编码方式。

5.1. 数据类型

表 5-1 数据类型定义

数据类型	二进制类型	说明

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

Price	Int64	价格, N13(5)
Qty	Int64	数量, N15(3)
Amt	Int64	金额, N18(3)
SeqNum	Int64	消息序号
Boolean	uInt16	1=True/Yes,0=False/No
Length	uInt32	长度 表示字节为单位的数据长度, 正数
LocalTimeStamp	Int64	本地时间戳 YYYYMMDDHHMMSSsss (毫秒), YYYY=0000-9999, MM=01-12, DD=01-31, HH=00-23, MM=00-59, SS=00-59(秒), sss=000-999(毫秒)。
NumInGroup	uInt32	重复数表示重复组的个数, 正数
LocalMktDate	uInt32	本地市场日期 格式 YYYYMMDD, YYYY=0000-9999, MM=01-12, DD=01-31
SecurityID	char[8]	证券代码, 6位数字, 前2位空格
PBUID	char[6]	交易单元代码, 6位数字
AccountID	char[10]	证券账户
BranchID	char[2]	营业部识别码
MemberID	char[6]	交易商代码

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

TraderCode	char[5]	交易员代码
ClOrdID	char[10]	客户订单编号，10位数字字符串，需要前缀补0
OrderID	char[16]	交易所订单编号 交易所赋予的订单编号， 跨交易日不重复

注：

- 1) 表中的 Nx(y)表示相应的类型实际为浮点数类型，其中 x 表示整数与小数总计位数，不包括小数点，y 表示小数位数，比如对于 Price 类型，Int64 值 1864000 表示的价格为 18.64000。
- 2) 在某些应用场景下，一个消息中可能有部分字段不需要填写，如果是字符串型字段则填写全空格，如果是数值型字段则填写 0。
- 3) char[x]表示字符串，x 表示字符串最大字节数，除非特别声明，字符串只可包含数字、大写字母、小写字母以及空格；对于纯数字字符串（例如证券代码），实际长度小于字段类型最大长度的都前补空格；对于其他字符串（例如用户私有信息），实际长度小于字段类型最大长度的都后补空格；字符串统一使用 GB18030 编码。

5.2. 会话层域定义

表 5-2 会话层域定义

域名	类型	说明
BodyLength	uInt32	消息体长度
MsgType	uInt32	消息类型
SenderCompID	char[20]	发送方代码

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

TargetCompID	char[20]	接收方代码
Password	char[16]	密码
Text	char[200]	文本信息 可能包含中文字符，表示最多 200 个字节
HeartBtInt	Int32	心跳监测的时间间隔为系统设定值,以秒为单位
DefaultApplVerID	char[32]	通信版本号填写为 n.xy 如通信版本号为 1.01 时,则字段应设置为 1.01。
SessionStatus	Int32	会话状态
Checksum	uInt32	校验和

5.3. 业务层域定义

表 5-3 业务层域定义

域名	类型	说明
AccountID	AccountID	证券账户
ApplID	char[3]	应用标识
BranchID	BranchID	营业部识别码
BusinessRejectReason	uInt16	拒绝原因
BusinessRejectRefID	char[10]	被拒绝消息对应的业务层 ID
BusinessRejectText	char[50]	拒绝原因说明 可能包含中文字符，表示最多 50 个字节

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

CashMargin	char	融资融券信用标识 1=Cash，普通交易 2=Open，融资融券开仓 3=Close，融资融券平仓
CashOrderQty	Amt	订单现金金额
ClearingFirm	char[2]	结算机构代码
ClOrdID	ClOrdID	客户订单编号
ConfirmID	uInt32	约定号，N8(0)
CounterpartyAccountID	AccountID	对手方证券账户
CounterpartyBranchID	BranchID	对手方营业部识别码
CounterpartyExecID	char[16]	交易所赋予的执行编号， 单个交易日内不重复
CounterpartyMemberID	MemberID	对手方交易商代码
CounterpartyPBUID	PBUID	对手方交易单元
CounterpartyTraderCode	TraderCode	对手方交易员代码
CumQty	Qty	累计执行数量
CxlRejReason	uInt16	撤单拒绝原因代码，正数
ExecID	char[16]	交易所赋予的执行编号，单个交易日内不重复
ExecType	char	执行报告类型 0=New，表示新订单 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝 F=Trade，表示已成交
ExpirationDays	uInt16	期限，单位为天数

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

ExpirationExecInst	uInt8	到期续做方式 1=到期自动续做 2=到期手动续做
ExpirationType	uInt8	期限类型 1=固定期限
ExpireTime	LocalTimeStamp	询价请求失效时间
HighLimitPrice	Price	价格上限
InsufficientSecurityID	char[8]	申购赎回不足成份股证券 代码
InvestmentType	char[2]	资金用途类型 01=生产经营 02=补充流动资金 03=股权类投资 04=债权类投资 05=不动产投资 06=偿还债务 07=个人消费 99=其他
LastParPx	Price	成交价格二
LastPx	Price	成交价格
LastQty	Qty	成交数量
LeavesQty	Qty	订单剩余数量
LotType	char	订单数量类型 1=零股订单, Odd Lot 2=整手订单, Round Lot

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

LowLimitPrice	Price	价格下限
MarketID	char[8]	市场代码
MarketSegmentID	char[8]	市场板块代码
MaturityDate	LocalMktDate	到期日
MaxFloor	Qty	可显示数量
MaxPriceLevels	uInt16	最多成交价位数，正数 0 表示不限制成交价位数
Memo	char[120]	备注 可包含中文字符，最长 120 个字节
MinQty	Qty	最低成交数量
NoBaskets	NumInGroup	质押篮子个数
NoCounterparty	NumInGroup	对手方个数
NoCounterpartyPBU	NumInGroup	对手方交易单元个数
NoLegs	NumInGroup	多腿订单包含的单腿数
NoMarginItems	NumInGroup	保证金条目个数
NoPartitions	NumInGroup	分区个数
NoPartyIDs	NumInGroup	参与方个数
NoQuote	NumInGroup	报价消息个数
NoSecurity	NumInGroup	证券只数
OfferAccountID	AccountID	卖方证券账户
OfferBranchID	BranchID	卖方营业部识别码
OfferPBUID	PBUID	卖方交易单元
OrderID	OrderID	交易所订单编号 交易所赋予的订单编号，

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

		跨交易日不重复
OrderQty	Qty	订单数量
OrderRestrictions	char[4]	订单限定 1=程序化交易 E=算法交易 最多可同时填写四种限定类型 如没有限定类型则填空
OrdRejReason	uInt16	订单拒绝原因代码，正数
OrdStatus	char	订单状态 0=New，表示新订单 1=Partially filled，表示部分成交 2=Filled，表示全部成交 4=Cancelled，表示已撤销 8=Reject，表示已拒绝
OrdType	char	订单类型 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优
OrigClOrdID	char[10]	原订单 ClOrdID，10 位数字字符串，需要前缀补 0
OrigSubmittingPBUID	PBUID	初始交易申报交易单元
OrigTradeDate	LocalMktDate	初始成交申报申报日期
OrigTradeID	char[16]	初始成交申报的 TradeID
OrigTradeReportID	ClOrdID	初始交易客户成交申报编号

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

OwnerType	uInt16	所有者类型，正数 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 106=结算机构发起
PartitionNo	Int32	平台分区号
PlatformID	uInt16	平台号 2=固定收益平台
PlatformState	uInt16	平台状态 0=PreOpen，未开放 2=Open，开放 3=Halt，暂停开放 4=Close，关闭
PledgeeType	uInt16	质权人类型
PreTradeAnonymity	uInt8	是否匿名 0=显名 1=匿名
Price	Price	价格
PriceType	uInt8	价格类型 1=百分比 2=每交易单位 3=固定数量

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

PrivateQuote	uInt8	私有报价 0= 私有报价 (PrivateQuote) 1= 公开报价 (PublicQuote)
QuoteID	char[10]	报价消息编号
QuoteMsgID	ClOrdID	客户报价消息编号
QuotePrice	Price	报价价格
QuotePriceType	uInt16	报价价格类型，预留 1=百分比 (Percent of par) 2=每股 (Per Share)
QuoteQty	Qty	报价数量
RefMsgType	uInt32	被拒绝的消息类型
RefSeqNum	SeqNum	引用的消息序号
RejectText	char[16]	拒绝原因说明 可能包含中文字符，表示 最多 16 个字节
ReportIndex	SeqNum	回报记录号，从 1 开始编 号
ReportingPBUID	PBUID	回报交易单元
RptExecID	char[16]	成交申报执行编号
SecondaryOrderID	OrderID	第二交易所订单编号
SecurityID	char[8]	证券代码
SecurityIDSource	char[4]	证券代码源，3 位数字字符，首 位空格

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

		106=北京证券交易所
SecurityType	char[8]	证券类别 MLEG=组合
SecuritySubType	char[8]	证券子类别
SettleCurrAmt	Amt	结算金额
SettlementRatio	Int32	平仓线，单位为百分比， 定义为 N6(2)
SettlePeriod	char	结算周期 0 =T+0 1 =T+1 2 =T+2 3 =T+3
SettleType	char	结算方式 2=多边净额
ShareProperty	char[2]	股份性质 00-无限售流通股 01-首发后限售股 05-首发前限售股 08-首发后可出借限售股
Side	char	买卖方向 1=买 2=卖 G=借入 F=出借 D=申购

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

		E=赎回
StopPx	Price	止损价格
SubmittingMemberID	MemberID	申报交易商代码
SubmittingPBUID	PBUID	申报交易单元
SubmittingTraderCode	TraderCode	申报方交易员代码
SubstCash	Amt	执行报告现金替代金额或 成交申报现金结算金额
SupplementaryAgreement	char[]	补充约定 变长字符串，长度由 SupplementaryAgreementLen 字 段指示，可包含中文字符，最长 600 个字节
TimeInForce	char	订单有效时间类型 0=当日有效 3=即时成交或取消（IOC）
TimeToExpiration	uInt16	期限，单位为天数，正数
TradeDate	LocalMktDate	开始日期
TradeHandlingInstr	char	成交申报模式 0=Trade Confirm，成交确认 1=Two-Party Report，成交报告 2=One-Party Report For Matching，协议配对 3=One-Party Report for Pass Through，成交请求 5=Two Party Report for

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

		Claim, 双边确认成交报告
TradeID	OrderID	交易所成交申报编号 交易所赋予的成交申报编号, 跨交易日不重复
TradeReportID	ClOrdID	客户成交申报编号
TradeReportRefID	ClOrdID	原客户成交申报编号
TradeReportRejectReason	uInt16	成交申报拒绝原因代码
TradeReportTransType	uInt8	成交申报事务类别 0=New, 新申报 1=Cancel, 撤销申报 2=Replace, 响应
TradeReportType	uInt8	成交申报消息类型 0=Submit, 提交成交申报 1=Alleged, 转发成交申报 2=Accept, 接受成交申报 3=Decline, 拒绝成交申报
TradingSessionID	char[4]	交易会话 ID
TradingSessionSubID	char[4]	交易会话子 ID
TradSesEndTime	LocalTimeStamp	交易会话结束时间
TradSesStartTime	LocalTimeStamp	交易会话开始时间
TradSesStatus	uInt16	交易会话状态
TransactTime	LocalTimeStamp	订单或执行的创建时间
TransfereePBUID	PBUID	转入交易单元代码
TrdAckStatus	uInt8	成交申报响应状态 0=Accepted, 接受

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

		1=Rejected, 拒绝
TrdMatchID	char[16]	交易编号, 跨交易日唯一
TrdRptStatus	uInt8	成交申报状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝 2=Cancelled, 已撤销 100=Unmatched, 尚未匹配 101=Matched, 已匹配
TrdSubType	uInt16	成交申报业务子类别 对于协议交易业务取值如下: 0=非受限股份转让 1=受限股份转让 对于债券质押式协议回购业务的 到期续做委托取值如下: 10=不变更续做对手方 11=变更续做对手方 其他业务固定填 0
TrdType	uInt16	成交申报类型
UnderlyingCashOrderQty	Amt	基础证券券面总额
UnderlyingSecurityID	char[8]	基础证券代码
UnderlyingSecurityIDSource	char[4]	基础证券代码源 106=北京证券交易所
UnderlyingShareProperty	char[2]	基础证券股份性质 00-无限售流通股 01-首发后限售股

UserInfo	char[32]	用户私有信息，仅可包含 ASCII 可显示字符
----------	----------	----------------------------

5.4. 错误码

表 5-4 错误码定义

错误代码	错误说明
1	无效账户
101	（本方）证券账户格式非法
102	对手方证券账户格式非法
3	单元卖空
4	股东卖空
6	价格过高
601	申报价格高于涨停价格（正常交易时段）
602	申报价格高于涨停价格（盘后交易时段）
603	集合匹配阶段申报价格高于价格上限
605	连续匹配阶段申报价格高于价格上限
7	价格过低
701	申报价格低于跌停价格（正常交易时段）
702	申报价格低于跌停价格（盘后交易时段）
705	集合匹配阶段申报价格低于价格下限
7076	连续匹配阶段申报价格低于价格下限
8	价格错误
801	申报价格不是价格档位的整数倍
804	申报价格取值非法（撤单必须为0，非撤单不为0）
807	止损价取值非法

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

9	数量非法
901	申报数量大于最大允许申报数量（正常交易时段）
902	申报数量小于最小允许申报数量（正常交易时段）
906	申报数量不是买/卖数量单位的整数倍
909	申报数量取值非法（撤单必须为0，非撤单不为0）
912	最低成交数量字段取值非法
12	账户非法
1201	指定证券账户不存在
1202	指定证券账户已停用
13	账户限制
1301	账户类型限制（交易单元）
1302	账户类型限制（交易单元类型）
1306	证券账户限制（交易单元）
1307	证券账户限制（交易单元类型）
1310	证券账户不允许申报该业务
1315	信用账户不允许买入非担保品
1316	信用账户融资融券交易不允许申报限价外的其它类型申报
1909	协商成交配对失败
22	错误约定号
2201	约定号重复
2203	约定号格式非法
23	无效单元
2301	指定交易单元不存在
2302	指定交易单元已停用

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

2317	指定交易单元已关闭
2320	交易单元取值非法
2323	非两融交易单元下强平委托申报
2324	非两融交易单元下进行融资融券申报
2326	本方交易单元取值非法
2327	申报交易单元取值非法
2328	对手方交易单元取值非法
26	单元限制
2601	交易单元限制（证券代码）
2602	交易单元限制（证券类型）
2605	交易单元不允许申报此业务类型
2609	托管行模式的QFII账户与交易单元不匹配
44	无效业务
4402	不支持的融资融券业务
4404	信用标识字段取值错误
45	禁止零卖
4501	余股必须一次性卖出
51	业务类别错
5101	证券代码对应的证券类别不允许申报该业务类型
5102	证券代码不允许申报该业务类型
5105	证券代码无对应的证券类别
5107	业务类别不正确
5108	买卖方向取值错误
5109	订单类型取值错误
5110	成交申报事务类型取值错误

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

5111	成交申报业务类型取值错误
5112	成交申报子业务类型取值错误
5113	成交申报类型取值错误
5114	成交申报模式取值错误
5115	消息类型取值错误
52	禁止该业务
5201	证券代码停牌
5202	集合匹配不可撤单
5203	闭市阶段不可申报
5204	证券代码该时段内不允许该业务类别
53	无申报可撤
5301	常规委托无申报可撤
5303	撤单请求证券代码与原始委托单不一致
5304	撤单请求证券账户与原始委托单不一致
5305	撤单对应的原始委托单不是买卖单
59	无效交易商
5901	非启用本方交易商代码
5902	非启用对手方交易商代码
5903	本方交易商代码取值非法
5904	对手方交易商代码取值非法
60	无效交易员
6001	非启用本方交易员代码
6002	非启用对手方交易员代码
6003	本方交易员代码取值非法
6004	对手方交易员代码取值非法

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

61	应用标识字段取值非法
62	（本方）营业部识别码取值非法
6201	对手方营业部识别码取值非法
63	结算方式取值非法
64	结算周期取值非法
65	订单有效时间类型取值非法
66	证券代码源取值非法
67	最多成交价位数取值非法
68	结算机构代码取值非法
69	订单限定取值非法
70	订单所有者类型取值非法
95	无效代码
9501	证券代码不存在
9502	证券代码取值非法
9503	证券代码格式非法
96	委托时间格式非法
98	订单编号非法
9801	客户订单编号格式非法 客户成交申报编号格式非法
9802	原客户订单编号格式非法 原客户成交申报编号格式非法
9803	客户订单编号重复 客户成交申报编号重复
99	其它错误
9902	委托校验方式不存在

9903	委托异常与消息定义不一致
20065	平台已关闭
20101	应用标识错误
20102	证券不支持所申报的业务
20103	解包失败
20104	平台未开放
20105	网关对交易单元无权限
20106	字段取值错误
20107	不支持的消息类型
20108	委托申报的平台错误
20112	网关无申报委托权限
29999	其他错误

六、附件

6.1. 新订单处理流程说明

6.1.1. 申报新订单并产生成交

表 6-1 申报新订单的回报场景

Time	Received	Sent	ClOrdID	OrigClOrdID	ExecType	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder		100				10000				收到新订单 MsgType=101 xxx
2		Execution	100		Rejected	Reject	10000	0	0	0	订单被拒绝 MsgType=202 xxx

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

2		Execution	100		New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=202 xxx
3		Execution	100		Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=203 xxx
4		Execution	100		Trade	Partially Filled	10000	4000	6000	1000	订单成交 1000 MsgType=203 xxx
5		Execution	100		Trade	Filled	10000	10000	0	6000	订单成交 6000 MsgType=203 xxx

6.1.2. 撤销尚未产生成交的新订单

表 6-2 新订单被成功撤销的回报场景

Time	Received	Sent	ClOrdID	OrigClOrdID	ExecType	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder		100				10000				收到新订单 MsgType=101xxx
2		Execution	100		New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=202xxx
3	Cancel		101	100			10000				收到撤单请求

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

	Request										MsgType=102000
4		Execution	101	100		Reject	10000				撤单被拒绝， MsgType=201000
4		Execution	101	100	Cancelled	Cancelled	10000	0	0	0	撤单成功 MsgType=202xxx

6.1.3. 撤销已部分成交的新订单

表 6-3 申请撤销已部分成交订单的回报场景

Time	Received	Sent	ClOrdID	OrigClOrdID	ExecType	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder		100				10000				收到新订单 MsgType=101xxx
2		Execution	100		New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=202xxx
3		Execution	100		Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=202xxx
4	Cancel Request		101	100			10000				收到撤单请求 MsgType=102000
5		Cancel Reject	101	100		Reject					撤单被拒绝， MsgType=201000
5		Execution	101	100	Cancelled	Cancelled	10000	3000	0	0	撤单成功 MsgType=202xxx

6.1.4. 撤销已全部成交的新订单

表 6-4 申请撤销已全部成交订单的回报场景

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

Time	Received	Sent	ClOrdID	OrigClOrdID	ExecType	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder		100				10000				收到新订单 MsgType=101xxx
2		Execution	100		New	New	10000	0	10000	0	订单被接受 MsgType=202xxx
3		Execution	100		Trade	Partially Filled	10000	3000	7000	3000	订单成交 3000 MsgType=203xxx
4	i	Execution	100		Trade	Filled	10000	10000	0	7000	订单成交 7000 MsgType=203xxx
5	Cancel Request		101	100			10000				收到撤单请求 MsgType=102000
6		Cancel Reject	101	100		Reject					撤单被拒绝， MsgType=201000

6.1.5. 撤销已被拒绝的新订单

表 6-5 撤销已被拒绝的新订单的回报场景

Time	Received	Sent	ClOrdID	OrigClOrdID	ExecType	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	NewOrder		100				10000				收到新订单 MsgType=101xx x
2		Execution	100		Rejected	Reject	10000	0	0	0	订单被拒绝 MsgType=202xx

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

											x
3	Cancel Request		101	100				10000			收到撤单请求 MsgType=10200 0
4		Cancel Reject	101	100		Reject					撤单被拒绝， MsgType=20100 0

6.1.6. 撤销不存在的新订单

表 6-6 申请撤销不存在订单的回报场景

Time	Received	Sent	ClOrdID	OrigClOrd ID	ExecType	OrdStatus	Order Qty	Cum Qty	Leaves Qty	Last Qty	
1	Cancel Request		101	100			10000				收到撤单请求 MsgType=102000
2		Cancel Reject	101	100		Reject					MsgType=201000

6.2. 成交申报（TCR）处理流程说明

下面表中的 Time 列表示时间顺序，值相同的行数表示可能发生的多种情形，但任何时候有且只有一种情形会发生；Received 列和 Sent 列是以交易系统的视角来描述。

6.2.1. 协议配对模式

6.2.1.1. 申报新成交申报

表 6-7 申报新成交申报的回报场景

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

Time	Received	Sent	TradeReportID	TradeReportRefID	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	Remark
1	TCR		100		New	Submit	OnePartyReport for matching		提交一笔成交申报 MsgType=10 3xxx
2		TCR Ack	100		New	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=20 4xxx
2		TCR Ack	100		New	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	成交申报被接受 MsgType=20 4xxx
3		TCR Ack	100		New	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	与对手方成交申报配对失败 MsgType=20 4xxx
3		TCR Conf irm	100		Replace	Submit	OnePartyReport for matching		与对手方配对成功 MsgType=20 5xxx

6.2.1.2. 撤销尚未配对成功的成交申报

表 6-8 申请撤销尚未配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportID	TradeReportRefID	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	Remark
1	TCR		100		New	Submit	OnePartyReport for matching		提交一笔成交申报 MsgType=103 xxx
2		TCR Ack	100		New	Submit	OnePartyReport for	Accepted	成交申报被接受
3	TCR		101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching		提交一笔成交申报撤销请求
4		TCR Ack	101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for	Rejected	撤销请求被拒
4		TCR Ack	101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	撤单成功 MsgType=204 xxx

6.2.1.3. 撤销已配对成功的成交申报

表 6-9 申请撤销已配对成功成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportID	TradeReportRefID	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	Remark
1	TCR		100		New	Submit	OnePartyReport for matching		提交一笔成交申报 MsgType=103xxx
2		TCR Ack	100		New	Submit	OnePartyReport for matching	Accepted	成交申报被接受 MsgType=204xxx
3		TCR Confirmed	100		Replace	Submit	OnePartyReport for matching		与对手方配对成功 MsgType=205xxx
4	TCR		101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching		提交一笔成交申报撤销请求 MsgType=103xxx
5		TCR Ack	101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=204xxx

6.2.1.4. 撤销已被拒绝的成交申报

表 6-10 申请撤销已被拒绝成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportID	TradeReportRefID	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	Remark
1	TCR		100		New	Submit	OnePartyReport for matching		提交一笔成交申报 MsgType=103xxx
2		TCR Ack	100		New	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	成交申报被拒绝 MsgType=204xxx
3	TCR		101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching		提交一笔成交申报 撤销请求 MsgType=103xxx
4		TCR Ack	101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=204xxx

6.2.1.5. 撤销不存在的成交申报

表 6-11 申请撤销系统中不存在成交申报的回报场景

Time	Received	Sent	TradeReportID	TradeReportRefID	TradeReportTransType	TradeReportType	TradeHandlingInstr	TrdAckStatus	Remark
1	TCR		101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching		提交一笔成交申报 撤销请求 MsgType=103xxx

北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统
交易数据接口规范（二进制）

2		TCR Ack	101	100	Cancel	Submit	OnePartyReport for matching	Rejected	撤销请求被拒绝 MsgType=204xxx
---	--	------------	-----	-----	--------	--------	--------------------------------	----------	---------------------------