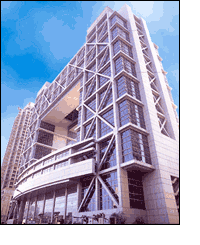
上海证券交易所技术文档



**固定收益平台**

**STEP协议报盘接口规格说明书**

**（V0.5版）**

**上海证券交易所**

**二○一八年六月**

**《固定收益平台STEP协议报盘接口规格说明书》0.5版发布说明2018.09**

1. 迁移《IS112 固定收益平台电子报盘接口规格说明书>>现券订单类功能，新增4.4现券订单类流程说明和4.5现券订单类消息。
2. 增加4.6.3、4.6.4质押式协议回购订单状态变更查询消息。
3. 3 数据格式约定中增加各消息类型对应业务类型编号。
4. 修改成交执行报告响应报文部分字段描述。成交执行报告查询报文的业务类型编号由“FPR”修改为“FSP”。

**《固定收益平台STEP协议报盘接口规格说明书》0.3版发布说明2018.01**

1. 配合固定收益平台增加投资者账户名称字段，具体为：报价申报消息增加“投资者账户名称”字段，修改“发起方重复组”字段的默认取值为7；非公开报价行情响应消息增加“投资者账户名称”字段，修改“发起方重复组”字段的默认取值为4。
2. 修改成交申报信息的质权人名称字段说明，将“质押式协议回购到期确认申报时填写”修改为“质押式协议回购到期续做确认申报时填写”。修改成交申报信息的成交申报时交易所成交日期字段说明，解除质押申报确认需要填写该字段。
3. 修改报价申报信息的质押券数量字段说明，将“到期续做申报时无意义”修改为“到期续做申报时填原质押券数量”。
4. 修改“到期续作”为“到期续做”。
5. 修改未结算协议回购查询响应的此次查询结束序号字段（16）说明，修改为“此次查询结束行情序号（全市场）”。
6. 修改协议回购订单类消息描述，增加：意向申报类、报价申报类消息填写成交金额字段时，以折算比例为基准进行计算。同时为避免产生歧义，删除意向申报类、报价申报消息的折算比例字段的计算公式说明。
7. 为避免产生歧义，修改非公开报价行情查询响应消息中，行情类型为“删除”的行情的“买卖方向”字段的默认返回值。

**《固定收益平台STEP协议报盘接口规格说明书》0.28版发布说明2017.11**

1、EzDAV0.2.8版本上线，发布了正式版本。

**《固定收益平台STEP协议报盘接口规格说明书》0.2版发布说明2017.8**

1、发布了质押式协议回购意向申报，解除质押申报,质押式协议回购换券申报,质押式协议回购提前终止申报的STEP消息处理流程和消息定义,首次申报更改为成交申报。

**《固定收益平台STEP协议报盘接口规格说明书》0.1版发布说明2016.10**

1、发布了协议回购首次申报、到期续做申报和到期确认申报的STEP消息处理流程和消息定义。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释,以上变更启用安排参见相关业务或测试上线通知。

服务电话：021-4009003600

通信地址：上海市浦东南路528号上交所技术有限责任公司

网站地址：<http://www.sse.com.cn/>交易技术支持专区“数据接口”栏目

**目录**

[1 简介 6](#_Toc525648587)

[2 会话机制 7](#_Toc525648588)

[2.1 概要 7](#_Toc525648589)

[3 数据格式约定 8](#_Toc525648590)

[4 消息定义 10](#_Toc525648591)

[4.1 协议回购消息处理流程说明 11](#_Toc525648592)

[4.2 协议回购订单类消息 14](#_Toc525648593)

[4.2.1 意向申报消息/意向申报撤单消息 14](#_Toc525648594)

[4.2.2 报价申报消息 16](#_Toc525648595)

[4.2.3 报价申报响应消息 19](#_Toc525648596)

[4.2.4 报价申报撤单消息 20](#_Toc525648597)

[4.2.5 报价申报撤单响应消息 21](#_Toc525648598)

[4.2.6 成交申报信息 22](#_Toc525648599)

[4.2.7 成交申报响应消息 24](#_Toc525648600)

[4.3 协议回购查询类消息 25](#_Toc525648601)

[4.3.1 未结算协议回购查询 25](#_Toc525648602)

[4.3.2 未结算协议回购查询响应 26](#_Toc525648603)

[4.3.3 非公开报价行情查询 28](#_Toc525648604)

[4.3.4 非公开报价行情响应 29](#_Toc525648605)

[4.3.5 公开报价行情查询 31](#_Toc525648606)

[4.3.6 公开报价行情响应 31](#_Toc525648607)

[4.4 现券订单类流程说明 33](#_Toc525648608)

[4.4.1 确定报价成交类（最优价成交和可转换成交）STEP消息流程图 33](#_Toc525648609)

[4.4.2 指定对手方报价STEP消息流程图 34](#_Toc525648610)

[4.4.3 协议交易类STEP消息流程图 34](#_Toc525648611)

[4.4.4 转托管STEP消息流程图 35](#_Toc525648612)

[4.5 现券订单类消息 36](#_Toc525648613)

[4.5.1 报价申报消息 36](#_Toc525648614)

[4.5.2 报价申报响应消息 38](#_Toc525648615)

[4.5.3 报价申报撤单消息 38](#_Toc525648616)

[4.5.4 报价申报撤单响应消息 39](#_Toc525648617)

[4.5.5 成交申报消息 40](#_Toc525648618)

[4.5.6 成交申报撤单消息 42](#_Toc525648619)

[4.5.7 成交申报响应/成交申报撤单响应消息 43](#_Toc525648620)

[4.5.8 非交易申报/非交易撤单申报消息 44](#_Toc525648621)

[4.5.9 非交易申报响应/非交易撤单申报响应 45](#_Toc525648622)

[4.6 执行报告查询类消息 46](#_Toc525648623)

[4.6.1 成交执行报告查询 46](#_Toc525648624)

[4.6.2 成交执行报告响应 47](#_Toc525648625)

[4.6.3 报价状态变更查询 49](#_Toc525648626)

[4.6.4 报价状态变更响应 50](#_Toc525648627)

[5 落地文件 51](#_Toc525648628)

# 简介

固定收益平台现有电子报盘接口基于dbf数据库表实现。为适应市场发展、满足交易商用户的数据直通需求，上交所根据近年来STEP协议的应用经验，制定了适用于固定收益平台业务的、基于STEP协议的数据交换协议。本文档即对该协议进行详细介绍。基于稳步推进、逐步完善的考虑，本次开发稿中仅对核心业务之一、现有电子报盘暂不支持的质押式协议回购业务相关消息进行详细定义。文档所采用的术语、消息格式、以及消息流描述均遵照 STEP 1.2 及 FIX 5.0 SP2 协议规范，同时上交所亦有特定的扩展。

和该协议相配套，上交所开发STEP协议电子报盘网关软件（EzDataAccess，以下简称EzDA）。该报盘网关部署在用户处，实现基本的登录、心跳等功能，直连上交所固定收益平台后台。网关软件开放TCP服务，与用户端系统通过本文档定义的协议格式进行直接的数据交互。此外，在固定收益平台开盘期间，报盘网关会及时从固定收益平台获取确定报价行情、成交统计行情、成交明细行情、公告信息行情等内容，并保存到用户本地。收盘后，还将自动获取本方成交数据文件，保存到用户本地。关于电子报盘网关软件的详细使用说明，详见固定收益平台EzDA用户手册。

# 会话机制

## 概要

EzDataAccess与用户端系统之间的交互采用客户端-服务器(C/S)架构，通过TCP链路通讯，其中EzDataAccess作为服务器端，用户端系统作为客户端。用户端系统首先需要向事先约定的EzDataAccess服务端口（默认为7080）发起连接请求。

会话协议中的字段采用网络字节序传输。

EzDataAccess只支持一个会话。会话消息格式如下:

请求消息：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 字段名称 | 说明 | 类型 | [字节数] | 备注 |
|  | msgLen | 报文长度（二进制） | Int | 4 | 后续数据的字节数，不包含自身 |
|  | reqid | **请求业务类型编号** | char | 3 | 内容见数据格式约定章节 |
|  | fill13 | **填充字符** | char | 13 | 无意义 |
|  | reqtext | 消息内容 | char | - | 变长字段，最大长度为10\*1024-16  数据格式为标准的STEP协议报文 |

注1：完整报文为由报文头（msgLen+reqid+fill13）与报文体（即消息内容reqtext）组成。

注2：报文中不得出现回车符、换行符，以及保留字符~^|#\*'&。

注3：类型为N的字段默认值取0，类型为C的字段默认值取空，且不能全为空格。无意义字段可取默认值或其他值（须符合格式要求）。

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 字段名称 | 说明 | 类型 | [字节数] | 备注 |
|  | msgLen | 报文长度（二进制） | Int | 4 | 后续数据的字节数，不包含自身 |
|  | complCod | 错误标志 | char | 1 | S：报价成功、  F：报价失败、  E：格式错误、  N：发送时出错  当前仅在查询类消息错误时在响应消息中使用该字段，为F，其他情况该字段为空 |
|  | fill03 | 填充字段 | char | 3 | 无意义 |
|  | remark | 处理结果的文字说明 | char | 50 |  |
|  | resptext | 消息内容 | char | - | 变长字段，最大长度为10\*1024\*1024-58  数据格式为标准的STEP协议报文 |

响应消息：

注1：订单类消息的报文响应参考resptext，查询类消息的错误信息参考complCod及remark。

# 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。

消息类型说明:

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 类型 | 类型 | 业务类型编号 | MsgType | 消息类型说明 | 请求类型 | 交易模式 |
| 协议回购订单类 | 上传请求 | FPR | S | 报价申报 | 协议回购成交申报 | 申报 |
| 协议回购到期续做申报 | 申报 |
| 协议回购解除质押申报 | 申报 |
| 协议回购换券申报 | 申报 |
| 协议回购提前终止申报 | 申报 |
| 6 | 意向申报和意向申报撤单 | 意向申报和意向申报撤单 | 申报/申报撤单 |
| Z | 报价申报撤单 | 协议回购成交申报 | 申报撤单 |
| 协议回购到期续做 | 申报撤单 |
| 协议回购解除质押申报 | 申报撤单 |
| 协议回购换券申报 | 申报撤单 |
| 协议回购提前终止申报 | 申报撤单 |
| D | 成交申报 | 协议回购成交申报 | 确认 |
| 拒绝 |
| 协议回购到期续做 | 确认 |
| 拒绝 |
| 协议回购到期确认申报 | 申报 |
| 协议回购解除质押申报 | 确认 |
| 拒绝 |
| 协议回购换券申报 | 确认 |
| 拒绝 |
| 协议回购提前终止申报 | 确认 |
| 拒绝 |
| 后台响应 | / | AJ | 报价响应 | 对S和6的响应 | |
| AI | 报价状态报告 | 对Z的响应 | |
| 8 | 成交申报响应 | 对D的响应 | |
| 现券订单类 | 上传请求 | FDP | S | 报价申报 | 确定报价申报 | |
| Z | 报价申报撤单 | 确定报价申报撤单&可转换成交申报撤单 | |
| FBP | D | 成交申报 | 最优价成交申报 | |
| FDP | 点击成交申报 | |
| FLC | 可转换成交申报 | |
| FAT | 协议交易申报 | |
| FPT | 指定对手方报价申报 | |
| FAT | F | 成交申报撤单 | 协议交易申报撤销 | |
| FPT | 指定对手方报价申报撤销 | |
| FBT | U041 | 非交易申报 | 转托管申报 | |
| 转托管撤销 | |
| 后台响应 | / | AJ | 报价响应 | 对S的响应 | |
| AI | 报价状态报告 | 对Z的响应 | |
| 8 | 成交申报响应 | 对D和F的响应 | |
| U042 | 非交易申报响应 | 对U042的响应 | |
| 查询类 | 上传请求 | FPR | U021 | 未结算协议回购查询 | 未结算协议回购查询（到期确认、到期续做、解除质押、换券、提前终止时，先查询相关然后申报） | |
| 后台响应 | / | U022 | 未结算协议回购查询响应 |
| 上传请求 | **FSP** | U023 | 成交执行报告查询 | 成交执行报告查询 | |
| 后台响应 | / | U024 | 成交执行报告响应 |
| 上传请求 | FPR | U025 | 非公开报价行情查询 | 非公开报价行情查询（成交申报、到期续做、解除质押、换券、提前终止） | |
| 后台响应 | / | U026 | 非公开报价行情查询响应 |
| 上传请求 | FPR | U027 | 公开报价行情查询 | 公开报价行情查询 | |
| 后台响应 | / | U028 | 公开报价行情查询响应 |
| 上传请求 | FPR | U029 | 报价状态变更查询 | 报价状态变更查询 | |
| 后台响应 | / | U030 | 报价状态变更查询响应 |

参与方组件说明:

|  |  |
| --- | --- |
| 参与方信息(448） | 参与方角色 (452) |
| 交易商代码 | 12 ＝发起方的交易商代码 |
| 交易商简称 | 103 ＝发起方的交易商简称 |
| 交易单元号 | 1 ＝发起方交易单元号 |
| 交易单元号 | 2 ＝发起方交易单元号 |
| 投资者帐户 | 5 ＝发起方投资者帐户 |
| 投资者帐户 | 6 ＝对手方投资者帐户 |
| 交易员代码 | 101 ＝发起方的交易员代码 |
| 交易商代码 | 37 ＝对手方的交易商代码 |
| 交易商简称 | 104 ＝对手方的交易商简称 |
| 交易员代码 | 102 ＝对手方的交易员代码 |
| 质权人名称 | 105 ＝质权人名称 |

**请求业务类型编号**（reqid）**，交易所据此处理不同的业务请求，取值为：**

FPR = 协议回购(Fixed Income-Pledge Repurchase)

FBT = 转托管 (Fixed Income-Bond Transfer)

FLC=可转换成交(Fixed Income-Limited Convertible Trading)

FSP = 非指定业务类型

目前实现不包含以下业务

FIP = 询价(Fixed Income-Inquired Price Trading)

FII = 意向报价（Fixed Income-Indication Interest Quoting）

# 消息定义

基于稳步推进、逐步完善的考虑，本开发稿中暂仅对核心业务之一的质押式协议回购业务相关消息进行详细定义。

## 协议回购消息处理流程说明

债券质押式协议回购（简称“协议回购”）是指交易双方自主谈判和协商议定，以债券为权利质押的融资业务。资金融入方（正回购方）在将债券出质给资金融出方（逆回购方）融入资金的同时，双方约定在未来某一日期，由正回购方向逆回购方返还本金，并按约定利率支付利息，同时解除债券质押登记解除。协议回购业务功能包括意向申报、成交申报、到期确认申报、到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报。下图描述了意向申报、成交申报、到期续做申报、到期确认申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报的STEP消息通信流程。





## 协议回购订单类消息

| **reqtext/resptext** | **订单数据** |
| --- | --- |
| **描述：**  本类消息用于市场参与者发送报价和获取报价的处理响应。  申报消息对应于同步请求消息流中的reqtext字段。  响应消息对应于同步确认消息流中的resptext字段。  意向申报类、报价申报类消息填写成交金额字段时，以折算比例为基准进行计算。 | |

### 意向申报消息/意向申报撤单消息

| **IOI (reqtext)** | **意向申报消息/意向申报撤单消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用IOI消息进行意向申报或撤单。  需要注意的是，平台采用原始意向申报的会员内部编号和申报交易员作为撤单索引字段。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType= 6：意向申报或意向申报撤单 |  |
| 23 | | IOIID | 会员内部编号，指意向申报或意向申报撤单会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格 | C10 |
| 537 | | QuoteType | 报价类别 1140 = 质押式协议回购意向申报  1141 = 质押式协议回购意向申报撤单 | N4 |
| 26 | | IOIRefID | 撤单编号，意向申报撤单时填写被撤原订单的会员内部编号，意向申报时该字段无意义 | C10 |
| 48 | | SecurityID | 质押券代码 | C6 |
| 44 | | Price | 回购利率，单位：%，精度：3位意向申报撤单时该字段无意义 | N10(3) |
| 226 | | RepurchaseTerm | 回购期限，以天计，1-365天  意向申报撤单时该字段无意义 | N4 |
| 8847 | | UAInterestAccrualDays | 实际占款天数，以天计，1-365天。  意向申报撤单时该字段无意义 | N3 |
| 64 | | SettlDate | 首次结算日，格式为：YYYYMMDD  意向申报撤单时该字段无意义 | C8 |
| 541 | | MaturityDate | 回购到期日，格式为：YYYYMMDD  意向申报撤单时该字段无意义 | C8 |
| 193 | | SettlDate2 | 到期结算日，格式为：YYYYMMDD  意向申报撤单时该字段无意义 | C8 |
| 54 | | Side | 协议回购方向，1表示正回购，2表示逆回购  意向申报撤单时该字段为意向申报时回购方向 | C1 |
| 38 | | OrderQty | 质押券数量，单位：手  意向申报撤单时该字段无意义 | N10 |
| 32 | | LastQty | 质押券面总额合计，单位：元，整数，质押债券面值总额=质押数量（手）\*10\*单张质押券面值  意向申报撤单时该字段无意义 | N12 |
| 231 | | ContractMultiplier | 折算比例,单位：%，精度：2位意向申报撤单时该字段无意义 | N6(2) |
| 8504 | | TotalValueTraded | 成交金额，单位：元；精度：2位，四舍五入，成交金额=质押券面值总额\*折算比例  意向申报撤单时该字段无意义 | N16(2) |
| 159 | | AccruedInterestAmt | 回购利息，单位：元，精度：2位，四舍五入，回购利息=(成交金额\*(回购利率/100)\*实际占款天数)/365  意向申报撤单时该字段无意义 | N16(2) |
| 119 | | SettlCurrAmt | 到期结算金额，单位：元，精度：2位，四舍五入，到期结算金额=成交金额+回购利息  意向申报撤单时该字段无意义 | N16(2) |
| 60 | | TransactTime | 业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss | C21 |
| 453 | | NoPartyIDs | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、发起方的交易员代码。取值为2 | N2 |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 发起方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| 58 | | Text | 补充条款 | C170 |

### 报价申报消息

| **Quote (reqtext)** | **报价申报** |
| --- | --- |
| **描述：**市场参与者使用Quote消息进行报价申报。  用到本消息的申报类型协议回购成交申报、到期续做申报和换券申报**发起方只能为正回购方。**  成交申报支持批量申报，即支持一次性提交针对同一交易对手方、使用同一回购利率与同一回购期限的多个质押券交易申报。交易系统对提交的申报进行一次性确认（即同一批次中的申报要么全部成功，要么全部失败）。批量申报在对手方确认后,系统按质押券种进行拆分，每一种质押券（即每一质押券代码）对应一笔拆分后的成交申报，拆分后的每笔成交申报在后续业务处理中是相互独立的。  到期续做申报的质押券不得变更。续做申报须经续做逆回购方确认后生成新的回购合约，原到期回购合约终结。续做逆回购方可以是原回购的逆回购方也可以是新的第三方。交易系统后台将该续做申报拆分成两笔交易：一笔“到期续做前期合约了结”和一笔“到期续做合约新开”。  解除质押交易双方依约定在线下自行划付资金。  换券申报目前只支持全额替换。  提前终止申报指对于正常存续期（不含首次结算日和到期结算日）的回购交易，交易双方达成一致，提前结束协议回购合约，按照合约实际存续的期限和双方协商的利率进行结算。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType= S：报价申报 |  |
| 117 | | QuoteID | 会员内部编号，指报价申报会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格 | C10 |
| 537 | | QuoteType | 报价类别 1142 = 质押式协议回购成交申报  1147 = 质押式协议回购到期续做申报  1151 = 质押式协议回购解除质押申报  1155 = 质押式协议回购换券申报  1159 = 质押式协议回购提前终止申报 | N4 |
| 44 | | Price | 回购利率，单位：%，精度：3位  到期续做申报填新回购利率，解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填实际回购利率 | N10(3) |
| 226 | | RepurchaseTerm | 回购期限，以天计，1-365天  到期续做申报填新回购期限，解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填提前终止后回购期限 | N4 |
| 8847 | | UAInterestAccrualDays | 实际占款天数，以天计，1-365天  到期续做申报填新实际占款天数，解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填提前终止后实际占款天数 | N3 |
| 64 | | SettlDate | 首次结算日，格式为：YYYYMMDD  到期续做申报填新的首次结算日，解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填提前终止日期 | C8 |
| 541 | | MaturityDate | 回购到期日，格式为：YYYYMMDD  到期续做申报填新的回购到期日，解除质押申报、换券申报、提前终止申报时该字段无意义 | C8 |
| 193 | | SettlDate2 | 到期结算日，格式为：YYYYMMDD  到期续做申报填新的到期结算日，解除质押申报、换券申报、提前终止申报时该字段无意义 | C8 |
| 54 | | Side | 买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖  若为回购，则：1表示正回购，2表示逆回购  协议回购成交申报/到期续做申报/换券申报时只能填1 | C1 |
| 60 | | TransactTime | 业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss | C21 |
| UndInstrmtGrp | | | |  |
| 711 | | NoUnderlyings | 质押券个数，质押式协议回购成交申报最大为10，其他报价类别为1 | N10 |
| → | 48 | SecurityID | 质押券代码，换券申报时填新质押券代码，到期续做申报、提前终止申报、解除质押申报时填原质押券代码 | C6 |
| → | 38 | OrderQty | 质押券数量，单位：手  做提前终止申报、解除质押申报时该字段无意义，到期续做申报时填原质押券数量，换券申报时填新质押券数量 | N10 |
| → | 231 | ContractMultiplier | 折算比例,单位：%，精度：2位，  到期续做申报填新的折算比例，解除质押申报、提前终止申报时该字段无意义， 换券申报填新折算比例 | N6(2) |
| → | 8504 | TotalValueTraded | 成交金额，单位：元；精度：2位，四舍五入成交金额=质押券面值总额\*折算比例  到期续做申报填新的成交金额（成交金额=质押数量（手）\*10\*单张质押券面值\*(折算比例/100)），解除质押申报时该字段无意义，换券申报填成交申报时成交金额，提前终止申报填实际结算金额（实际结算金额=原成交金额+实际回购利息） | N16(2) |
| → | 159 | AccruedInterestAmt | 回购利息，单位：元，精度：2位，四舍五入，回购利息=(成交金额\*(回购利率/100)\*实际占款天数)/365  到期续做申报填新的回购利息（回购利息=(新回购成交金额\*（新回购利率/100)\*实际占款天数)/365），解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填实际回购利息(实际回购利息=(原成交金额\*（实际回购利率/100)\*实际占款天数)/365) | N16(2) |
| → | 119 | SettlCurrAmt | 到期结算金额，单位：元，精度：2位，四舍五入，到期结算金额=成交金额+回购利息  到期续做申报填新的到期结算金额(到期结算金额=新成交金额+新回购利息)，解除质押申报时该字段无意义，换券申报时填成交申报时到期结算金额，提前终止申报填成交申报时成交金额 | N16(2) |
| → | 32 | LastQty | 质押券面总额合计，单位：元，整数，质押债券面值总额=质押数量（手）×10×单张质押券面值  到期续做申报、解除质押申报、提前终止申报时该字段无意义，换券申报时填新券面总额合计 | N12 |
| 192 | | OrderQty2 | 本期回购结算利息，到期续做申报时填写，成交申报、换券申报、提前终止申报、解除质押申报时该字段无意义 | N16(2) |
| 529 | | [OrderRestrictions](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag529.html) | 到期续做类型  N 非第三方续做  Y 第三方续做  到期续做申报时填写，成交申报、换券申报、提前终止申报、解除质押申报时该字段无意义 | C1 |
| 1125 | | OrigTradeDate | 成交申报时交易所成交日期，到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时填写，成交申报时该字段无意义 | C8 |
| 19 | | ExecRefID | 成交申报时交易所成交编号，引用未结算协议回购查询响应的成交编号，到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时填写，成交申报时该字段无意义 | N10 |
| Parties | | | |  |
| 453 | | NoPartyIDs | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、发起方的交易员代码、投资者账户、申报交易单元号，对手方交易商代码以及对手方交易员信息。取值为7 | N2 |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 发起方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方申报PBU代码，填写5位申报交易单元号 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号 | N4 |
| 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 |
| 发起方投资者账户名称 | 448 | PartyID | 发起方投资者账户名称，质押式协议回购成交申报时必填，到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时该字段无意义 | C30 |
| 452 | PartyRole | 取38，表示当前PartyID的取值为发起方投资者账户名称 | N4 |
| 对手方交易商代码 | 448 | PartyID | 对手方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取37，表示当前PartyID的取值为对手方的交易商代码 | N4 |
| 对手方交易员代码 | 448 | PartyID | 对手方交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取102，表示当前PartyID的取值为对手方的交易员代码 | N4 |
| 58 | | Text | 补充条款 | C170 |

### 报价申报响应消息

| **QuoteResponse (resptext)** | 报价申报响应 |
| --- | --- |
| **描述：**  同步确认消息流中的resptext字段数据。  每一个报价申报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报价申报,意向申报及撤单响应后返回的确认信息。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | MsgType= AJ：报价申报响应 |  |
| 537 | QuoteType | 响应类别  1140 = 质押式协议回购意向申报  1141 = 质押式协议回购意向申报撤单  1142 = 质押式协议回购成交申报  1147 = 质押式协议回购到期续做申报  1151 = 质押式协议回购解除质押申报  1155 = 质押式协议回购换券申报  1159 = 质押式协议回购提前终止申报 | N4 |
| 117 | QuoteID | 会员内部编号，该字段对应报价申报消息QuoteID | C10 |
| 150 | ExecType | 当前订单执行状态，取值有：  0=成功响应，8=拒绝响应，6=撤单成功响应 | C1 |
| 102 | CxlRejReason | 意向申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理  撤消成功时，该字段取值为空  撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同Remark字段 | C50 |
| 103 | OrdRejReason | 意向申报与报价申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理  报价申报成功时，该字段取值为空  报价申报失败时，表示拒绝的理由 | C50 |

### 报价申报撤单消息

| **QuoteCancel (reqtext)** | **报价申报撤单** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用Quote Cancel消息进行报价申报撤单，对应请求流中的ReqText用到本消息的申报类型的质押式协议回购成交申报撤单，到期续做申报撤单，换券申报撤单，**发起方只能为正回购方。**需要注意的是，平台采用原始申报的会员内部编号和申报交易员作为撤单索引字段。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType=  Z：报价申报撤单 |  |
| 117 | | QuoteID | 会员内部编号，指报价申报撤销会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格 | C10 |
| 41 | | OrigClOrdID | 原始交易会员内部编号，表示被撤消订单的QuoteID | C10 |
| 537 | | QuoteType | 报价类别 1143 = 质押式协议回购成交申报撤单  1148 = 质押式协议回购到期续做撤单  1152 = 质押式协议回购解除质押申报撤单  1156 = 质押式协议回购换券申报撤单  1160 = 质押式协议回购提前终止申报撤单 | N4 |
| 48 | | SecurityID | 质押券代码 | C6 |
| 54 | | Side | 买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖  若为回购，则：1表示正回购，2表示逆回购 | C1 |
| 60 | | TransactTime | 业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss | C21 |
| 453 | | NoPartyIDs | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、发起方交易员代码, 取值为2 | N2 |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| 58 | | Text | 备注 | C50 |

### 报价申报撤单响应消息

| **QuoteStatusReport (RespText)** | **报价状态报告** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个报价申报撤单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撤单申报后返回的确认信息。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | MsgType=  AI：报价状态报告 |  |
| 117 | QuoteID | 会员内部编号，指报价申报撤单中的会员内部编号 | C10 |
| 41 | OrigClOrdID | 对于报价申报撤单成功响应，为原始交易会员内部编号，指示被撤消订单的QuoteID，其他情况取值为空 | C10 |
| 694 | QuoteRespType | 取值：  2=报价申报撤单响应 | N1 |
| 297 | QuoteStatus | 报价状态，取值：  申报撤单成功响应=1，  申报撤单失败响应=8 | N1 |
| 103 | RejReason | 申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理  当报价状态不为8时，该字段取值为空  报价状态为8时，表示处理失败的理由，为错误代码加错误信息 | C50 |

### 成交申报信息

| **NewOrderSingle (ReqText)** | **成交申报消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用NewOrderSingle消息进行报价成交申报，对应申报接口流中的ReqText。质押式协议回购到期确认申报不支持撤单，只能由正回购发起业务，无需对手方确认。质押式协议回购成交申报, 质押式协议回购到期续做、质押式协议回购换券申报的确认和拒绝发起方只能是逆回购方。质押式协议回购到期确认的原始信息通过未结算协议回购查询获取。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType= D：成交申报 |  |
| 11 | | ClOrdId | 会员内部编号，指成交申报会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格 | C10 |
| 6133 | | QuoteRefID | 引用非公开报价行情的交易所报价请求编号，质押式协议回购成交申报确认/质押式协议回购成交申报拒绝/质押式协议回购到期续做申报确认/质押式协议回购到期续做申报拒绝/质押式协议回购解除质押申报确认/质押式协议回购解除质押申报拒绝/质押式协议回购换券申报确认/质押式协议回购换券申报拒绝/质押式协议回购提前终止申报确认/质押式协议回购提前终止申报拒绝时填写，质押式协议回购到期确认申报时该字段无意义 | C10 |
| 537 | | QuoteType | 报价类别 1144 = 质押式协议回购成交申报确认 1145 = 质押式协议回购成交申报拒绝  1146 = 质押式协议回购到期确认申报  1149 = 质押式协议回购到期续做申报确认  1150 = 质押式协议回购到期续做申报拒绝  1153 = 质押式协议回购解除质押申报确认  1154 = 质押式协议回购解除质押申报拒绝  1157 = 质押式协议回购换券申报确认  1158 = 质押式协议回购换券申报拒绝  1161 = 质押式协议回购提前终止申报确认  1162 = 质押式协议回购提前终止申报拒绝 | N4 |
| 48 | | SecurityID | 质押券代码 | C6 |
| 119 | | SettlCurrAmt | 到期结算金额，单位：元，精度：2位，四舍五入，到期确认申报时填写，其他申报时此字段无意义 | N16(2) |
| 54 | | Side | 买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖  若为回购，则：1表示正回购，2表示逆回购 | C1 |
| 60 | | TransactTime | 业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss | C21 |
| 1125 | | OrigTradeDate | 成交申报时交易所成交日期，回购到期确认申报/到期续做申报确认/换券申报确认/提前终止申报确认/解除质押申报确认时填写，其他申报时此字段无意义 | C8 |
| 19 | | ExecRefID | 成交申报时交易所成交编号, 回购到期确认申报时引用未结算协议回购查询响应消息的成交编号，到期续做申报确认/换券申报确认/提前终止申报确认/解除质押申报确认时引用非公开报价行情的交易所成交编号，其他申报此字段无意义 | N10 |
| Parties | | | |  |
| 453 | | NoPartyIDs | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码，发起方的交易员代码，质权人名称，发起方申报交易单元号，投资者账户，对手方交易商代码，对手方交易员代码。取值为7 | N2 |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 发起方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| 质权人名称 | 448 | PartyID | 质权人名称，质押式协议回购成交申报确认、质押式协议回购到期续做确认申报时填写，其他申报此字段无意义 | C30 |
| 452 | PartyRole | 取105，表示当前PartyID的取值为质权人名称 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方申报PBU代码，填写5位申报交易单元号，成交申报拒绝、到期续做申报拒绝、换券申报拒绝、解除质押申报拒绝和提前终止申报拒绝时必须为空 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号 | N4 |
| 发起方投资者账户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户，成交申报拒绝、到期续做申报拒绝、换券申报拒绝、解除质押申报拒绝和提前终止申报拒绝时必须为空 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户 | N4 |
| 对手方交易商代码 | 448 | PartyID | 对手方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取37，表示当前PartyID的取值为对手方的交易商代码 | N4 |
| 对手方交易员代码 | 448 | PartyID | 对手方交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取102，表示当前PartyID的取值为对手方的交易员代码 | N4 |
| 58 | | Text | 补充条款 | C170 |

### 成交申报响应消息

| **ExecutionReport (RespText)** | **成交申报响应** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个成交申报记录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成交申报后返回的确认信息。150和39组合取值含义：成交申报成功响应：150=0, 39=0成交申报拒绝响应：150=8, 39=8 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | MsgType取值为：8=成交申报响应 |  |
| 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 | 当前订单状态，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应 | C1 |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号 | C10 |
| 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 | C50 |

## 协议回购查询类消息

| **reqtext/resptext** | **订单数据** |
| --- | --- |
| **描述：**  本类消息用于市场参与者发送查询类消息的处理响应。申报消息对应于同步请求消息流中的reqtext字段。  响应消息对应于同步确认消息流中的resptext字段。  类型为N的字段默认值取0，类型为C的字段默认值取空。 | |

### 未结算协议回购查询

| **RepurchaseReturnRequirementInquiry (reqtext)** | **到期确认申报管理查询** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用此消息查询未结算的协议回购数据。**交易员可以代其他交易员（同一交易商下属）发起到期确认申报。** | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType取值为U021 |  |
| 1346 | | ApplReqID | 查询请求编号 | N10 |
| 48 | | SecurityID | 质押券代码，此处填写ALL | C6 |
| 537 | | QuoteType | 申请类型  3140 －未结算协议回购查询 | N4 |
| 7 | | BeginSeqNo | 起始序号（全市场），单调递增不连续，最小值为0，最大值为1000000000 | N10 |
| 1180 | | ApplID | 查询类型  1 到期结算查询申请  2 到期续做查询申请  3 解除质押查询申请  4 换券申报查询申请  5 提前终止查询申请 | C11 |
| 297 | | QuoteStatus | 到期状态  3 当日到期(查询类型到期结算和到期续做时填写3)  4 未到期 (查询类型为换券申报和提前终止时填写4)  5 已过期 (查询类型为解除质押时填写5) | N1 |
| 453 | | NoPartyIDs | 参与方个数，依次包含正回购方交易商代码，交易员代码，逆回购方交易商代码。取值为3 | N2 |
| 正回购方交易商代码 | 448 | PartyID | 正回购方交易商代码，填写3位CompanyID  此处填写当前登录交易商代码 | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 正回购方交易员代码 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码  此处填写当前登陆交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| 逆回购方交易商代码 | 448 | PartyID | 逆回购方交易商代码，填写3位CompanyID  此处填写当前登录交易商代码 | C3 |
| 452 | PartyRole | 取37，表示当前PartyID的取值为逆回购方的交易商代码 | N4 |

### 未结算协议回购查询响应

| **RepurchaseReturnRequirementReport (RespText)** | **到期确认申报管理查询响应** |
| --- | --- |
| **描述：**  响应市场参与者到期未结算协议回购查询。  一次查询最多返回自查询起始序号起1000条记录。  若查询结果无数据，响应消息报文截止到16(EndSeqNo)字段。 | |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | | **字段名** | **字段描述** | **类型** | |
| 9 |  | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身。 |  | |
| 35 |  | | 消息头 | MsgType= U022：未结算协议回购 |  | |
| 1346 |  | | ApplReqID | 查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的ApplReqID | N10 | |
| 16 |  | | EndSeqNo | 此次查询结束行情序号（全市场） | N10 | |
|  | 146 | | NoRelatedSym | 记录笔数 | N10 | |
| → | 75 | | TradeDate | 成交日期，格式为：YYYYMMDD | C8 | |
| → | 17 | | ExecID | 成交编号，质押式协议回购到期确认申报、到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时上传此编号 | N10 | |
| → | 54 | | Side | 回购方向，取值有：1表示正回购，2表示逆回购 | C1 | |
| → | 44 | | Price | 回购利率，单位：%，精度：3位 | N10(3) | |
| → | 541 | | MaturityDate | 回购到期日，格式为：YYYYMMDD | C8 | |
| → | 193 | | SettlDate2 | 到期结算日，格式为：YYYYMMDD | C8 | |
| → | 226 | | RepurchaseTerm | 回购期限，单位：天，整数 | N4 | |
| → | 8847 | | UAInterestAccrualDays | 实际占款天数，单位：天，整数 | N3 | |
| → | 48 | | SecurityID | 质押债券代码 | C6 | |
| → | 55 | | Symbol | 质押债券简称 | C8 | |
| → | 38 | | OrderQty | 质押券数量，单位：手 | N10 | |
| → | 32 | | LastQty | 质押券面总额合计，单位：元，整数 | N12 | |
| → | 231 | | ContractMultiplier | 折算比例,单位：%，精度：2位 | N6(2) | |
| → | 8504 | | TotalValueTraded | 首次成交金额，单位：元；精度：2位，四舍五入 | N16(2) | |
| → | 119 | | SettlCurrAmt | 到期结算金额，单位：元，精度：2位，四舍五入 | N16(2) | |
| → | 159 | | AccruedInterestAmt | 参考应计利息,单位：元，精度：2位，四舍五入 | N16(2) | |
| → | 297 | | QuoteStatus | 到期状态  3 当日到期  4 未到期  5 已到期 | N1 | |
| → | 453 | | NoPartyIDs | 重复组，包含正回购方交易商代码、正回购交易商简称、正回购交易员代码、正回购交易单元、正回购证券账户、逆回购方交易商代码、逆回购交易商简称、逆回购交易员代码、逆回购交易单元、逆回购证券账户、质权人名称。取值为11 | N2 | |
| → | 正回购方交易商代码 | 448 | PartyID | 正回购方交易商代码，填写3位CompanyID | | C3 | |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为正回购方的交易商代码 | | N4 | |
| → | 正回购交易商简称 | 448 | PartyID | 交易商简称，填写10位交易商简称 | | C10 | |
| 452 | PartyRole | 取103，表示当前PartyID的取值为正回购的交易商简称 | | N4 | |
| → | 正回购交易员代码 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | | C6 | |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为正回购的交易员代码 | | N4 | |
| → | 正回购交易单元 | 448 | PartyID | 正回购申报PBU代码，填写5位申报交易单元号。 | | C5 | |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号 | | N4 | |
| → | 正回购证券账户 | 448 | PartyID | 正回购投资者帐户 | | C10 | |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为正回购方投资者帐户 | | N4 | |
| → | 逆回购方交易商代码 | 448 | PartyID | 逆回购方交易商代码，填写3位CompanyID | | C3 | |
| 452 | PartyRole | 取37，表示当前PartyID的取值为逆回购方的交易商代码 | | N4 | |
| → | 逆回购交易商简称 | 448 | PartyID | 交易商简称，填写10位交易商简称 | | C10 | |
| 452 | PartyRole | 取104，表示当前PartyID的取值为逆回购的交易商简称 | | N4 | |
| → | 逆回购交易员代码 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | | C6 | |
| 452 | PartyRole | 取102，表示当前PartyID的取值为逆回购的交易员代码 | | N4 | |
| → | 逆回购交易单元 | 448 | PartyID | 逆回购申报PBU代码，填写5位申报交易单元号 | | C5 | |
| 452 | PartyRole | 取2，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号 | | N4 | |
| → | 逆回购证券账户 | 448 | PartyID | 逆回购投资者帐户 | | C10 | |
| 452 | PartyRole | 取6，表示当前PartyID的取值为逆回购方投资者帐户 | | N4 | |
| → | 质权人名称 | 448 | PartyID | 质权人名称 | | C30 | |
| 452 | PartyRole | 取105，表示当前PartyID的取值为质权人名称 | | N4 | |

### 非公开报价行情查询

| **NonPublicMDExecutionInquiry(reqtext)** | **非公开报价行情查询** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者查询非公开报价行情。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 标签 | | 字段名 | 字段描述 | 类型 |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType取值为U025 |  |
| 1346 | | ApplReqID | 查询请求编号 | N10 |
| 537 | | QuoteType | 申请类别  2007 －成交申报非公开报价行情查询 | C4 |
| 7 | | BeginSeqNo | 起始行情序号（全市场），最小值为0，最大值为1000000000 | N10 |
| 453 | | NoPartyIDs | 参与方个数，依次为查询方方交易商代码，交易员代码。取值为2 | N2 |
| 查询方交易商代码 | 448 | PartyID | 查询方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为查询方的交易商代码 | N4 |
| 查询方交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为查询方的交易员代码 | N4 |

### 非公开报价行情响应

| **NonPublicMDExecutionReport(reqtext)** | **非公开报价行情响应** |
| --- | --- |
| **描述：**  响应市场参与者非公开报价行情查询。  行情更新类型为删除(279=2)时，仅标签：6133，279，40有业务含义，其他字段值默认为空或0，买卖方向为一个空格。  一次查询最多返回自查询起始序号起1000条记录。  若查询结果无数据，响应消息报文截止到16(EndSeqNo)字段。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 标签 | | | 字段名 | 字段描述 | 类型 |
| 9 |  | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 |  | | 消息头 | MsgType= U026：非公开报价行情 |  |
| 1346 |  | | ApplReqID | 查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的ApplReqID | N10 |
| 16 |  | | EndSeqNo | 此次查询结束行情序号（全市场） | N10 |
|  | 146 | | NoRelatedSym | 记录笔数 | N10 |
| → | 6133 | | QuoteRefID | 交易所报价请求编号，质押式协议回购成交申报确认/拒绝、质押式协议回购到期续做确认/拒绝、质押式协议回购解除质押申报确认/拒绝，质押式协议回购换券申报确认/拒绝，质押式协议回购提前终止确认/拒绝时上传此编号 | C10 |
| → | 279 | | MDUpdateAction | 行情更新类型，取值：新增=0，删除=2 | C1 |
| → | 40 | | OrdType | 报价申报类型，取值：  成交申报=F  到期续做=X  解除质押=C  换券申报=H  提前终止=Z | C1 |
| → | 44 | | Price | 回购利率，单位：%，精度：3位 | N10(3) |
| → | 226 | | RepurchaseTerm | 回购期限，单位：天，整数 | N4 |
| → | 8847 | | UAInterestAccrualDays | 实际占款天数，单位：天，整数 | N3 |
| → | 64 | | SettlDate | 首次结算日，格式为：YYYYMMDD | C8 |
| → | 541 | | MaturityDate | 回购到期日，格式为：YYYYMMDD | C8 |
| → | 193 | | SettlDate2 | 到期结算日，格式为：YYYYMMDD | C8 |
| → | 54 | | Side | 买卖方向，取值有：1表示正回购 | C1 |
| → | UndInstrmtGrp | | | |  |
| → | 711 | | NoUnderlyings | 质押券个数,最大10 | N10 |
| → | → | 48 | SecurityID | 质押券代码 | C6 |
| → | → | 308 | UnderlyingSecurityID | 原质押券代码,换券申报时有效，其他为空 | C6 |
| → | → | 38 | OrderQty | 质押券数量，单位：手 | N10 |
| → | → | 231 | ContractMultiplier | 折算比例,单位：%，精度：2位 | N6(2) |
| → | → | 8504 | TotalValueTraded | 成交金额，单位：元；精度：2位，四舍五入 | N16(2) |
| → | → | 879 | UnderlyingQty | 原成交申报成交金额，换券申报行情时有效，其他为0 | N16(2) |
| → | → | 159 | AccruedInterestAmt | 回购利息，单位：元，精度：2位，四舍五入 | N16(2) |
| → | → | 119 | SettlCurrAmt | 到期结算金额，单位：元，精度：2位，四舍五入 | N16(2) |
| → | → | 32 | LastQty | 质押券面总额合计，单位：元，整数，到期续做行情时为0 | N12 |
| → | 529 | | [OrderRestrictions](file:///D:\fast%20cs\fiximate\en\FIX.5.0SP2\tag529.html) | 到期续做类型  N 非第三方续做  Y 第三方续做  到期续做行情时有效 | C1 |
| → | 1125 | | OrigTradeDate | 成交申报时交易所成交日期，到期续做，换券申报, 提前终止申报，解除质押申报行情时有效 | C8 |
| → | 19 | | ExecRefID | 交易所成交编号，到期续做，换券申报, 提前终止申报，解除质押申报行情时有效 | N10 |
| → | 453 | | NoPartyIDs | 发起方重复组，依次包含本方交易商，对手方的交易商代码、对手方交易员代码，值为4 | N2 |
| → | 本方交易商代码 | 448 | PartyID | 本方交易商代码，为3位CompanyID | C3 |
| → | 452 | PartyRole | 为12，表示当前PartyID的取值为本方的交易商代码 | N4 |
| → | 对手方交易商简称 | 448 | PartyID | 对手方交易商简称，为10位简称 | C10 |
| → | 452 | PartyRole | 为103，表示当前PartyID的取值为对手方的交易商简称 | N4 |
|  | 对手方投资者账户名称 | 448 | PartyID | 对手方投资者账户名称，成交申报行情时有效，到期续做，换券申报, 提前终止申报，解除质押申报行情时该字段无意义 | C30 |
|  | 452 | PartyRole | 为38，表示当前PartyID的取值为对手方的投资者账户名称 | N4 |
| → | 对手方交易员代码 | 448 | PartyID | 对手方交易员代码，为6位交易员代码 | C6 |
| → | 452 | PartyRole | 为102，表示当前PartyID的取值为对手方的交易员代码 | N4 |
| → | 58 | | Text | 备注 | C170 |

### 公开报价行情查询

| **PublicMDExecutionInquiry(reqtext)** | **公开报价行情查询** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者查询公开报价行情。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType取值为U027 |  |
| 1346 | | ApplReqID | 查询请求编号 | N10 |
| 537 | | QuoteType | 申请类别  2020 －成交申报公开报价行情查询 | C4 |
| 7 | | BeginSeqNo | 起始行情序号（全市场），最小值为0，最大值为1000000000 | N10 |
| 453 | | NoPartyIDs | 参与方个数，依次为查询方方交易商代码,交易员代码。取值为2 | N2 |
| 查询方交易商代码 | 448 | PartyID | 查询方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为查询方的交易商代码 | N4 |
| 查询方交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为查询方的交易员代码 | N4 |

### 公开报价行情响应

| **PublicMDExecutionReport(reqtext)** | **公开报价行情响应** |
| --- | --- |
| **描述：**  响应市场参与者公开报价行情查询。一次查询最多返回自查询起始序号起1000条记录。  若查询结果无数据，响应消息报文截止到16(EndSeqNo)字段。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 |  | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 |  | | 消息头 | MsgType= U028：公开报价行情 |  |
| 1346 |  | | ApplReqID | 查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的ApplReqID | N10 |
| 16 |  | | EndSeqNo | 此次查询结束行情序号（全市场） | N10 |
|  | 146 | | NoRelatedSym | 记录笔数 | N10 |
| → | 6133 | | QuoteRefID | 交易所报价编号 | C10 |
| → | 279 | | MDUpdateAction | 行情更新类型，取值：新增=0，删除=2 | C1 |
| → | 40 | | OrdType | 报价申报类型，取值：  协议回购意向报价=Y | C1 |
| → | 48 | | SecurityID | 质押券代码 | C6 |
| → | 55 | | Symbol | 质押券简称 | C8 |
| → | 54 | | Side | 协议回购方向  1表示正回购，2表示逆回购 | C1 |
| → | 44 | | Price | 回购利率，单位：%，精度：3位 | N10(3) |
| → | 38 | | OrderQty | 质押券数量，单位：手 | N10 |
| → | 231 | | ContractMultiplier | 折算比例,单位：%，精度：2位 | N6(2) |
| → | 226 | | RepurchaseTerm | 回购期限，以天计，1-365天 | N4 |
| → | 8504 | | TotalValueTraded | 成交金额，单位：元；精度：2位，四舍五入 | N16(2) |
| → | 64 | | SettlDate | 首次结算日，格式为：YYYYMMDD | C8 |
| → | 453 | | NoPartyIDs | 发起方重复组，依次包含发起方交易商，发起方交易员代码，取值为2 | N2 |
| → | 发起方交易商简称 | 448 | PartyID | 发起方交易商简称 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取103，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商简称 | N4 |
| → | 发起方申报交易员代码 | 448 | PartyID | 交易员代码，为6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |

## 现券订单类流程说明

### 确定报价成交类（最优价成交和可转换成交）STEP消息流程图

确定报价是可执行报价（实价），可以同时录入双边报价或单边报价，双边报价相当于同时输入一份限价买入订单和限价卖出订单，而单边报价相当于一份限价买入或卖出订单。确定报价担保券卖出申报时，需要检查并冻结投资者的持仓。根据确定报价与成交类流程，市场投资者可以进行包括确定报价的申报、撤单与点击成交。

执行报告中类型标识的取值与对应的发起方的请求类型标识相一致。



### 指定对手方报价STEP消息流程图

“指定对手方报价类”功能包括指定对手方的申报、撤单，下图描述了指定对手方报价的STEP消息通信流程。



### 协议交易类STEP消息流程图

协议交易是交易商与其客户达成的交易，由同一交易商录入两笔交易申报，相互匹配而成。其中一笔代表其所属的交易商录入，另一笔代表其客户录入。

协议交易是非担保交收的操作，系统不对协议交易申报进行持仓的前端控制和余额调整。协议交易的成功与否由登记公司判定，并通过日末的非交易过户数据文件反馈给固定收益平台。

“协议交易类”功能包括协议交易的申报、撤单，下图描述了协议交易类的STEP消息通信流程。



### 转托管STEP消息流程图

目前，我国债券市场由几个相互分割的市场，即银行间债券市场、交易所市场、商业银行柜台市场以及凭证式国债市场等组成。债券的中央托管分别由中国证券登记结算公司和中央国债登记结算公司负责。投资者要在不同市场进行交易，必须在不同的市场分别开立债券账户，而债券在不同市场之间的流动必须通过在同一个投资者的不同债券账户之间办理转托管。

转托管是非担保交收的操作，系统不对转托管申报进行持仓的前端控制和余额调整，仅对申报转出账户进行指定关系检查。交易商可以在现券开盘期间进行转托管登记，成功与否由登记公司判定，在日终结算公司处理完成后，第二天持有余额调整。转托管记录以结算公司最终传回系统的非交易过户数据文件为准。

“转托管”功能包括转托管的申报、撤单，下图描述了转托管的STEP消息通信流程。



## 现券订单类消息

### 报价申报消息

| **Quote (reqtext)** | **报价申报** |
| --- | --- |
| **描述：**  请求及响应接口表中的reqtext字段数据。  市场参与者使用Quote消息进行报价申报。  用到本消息的申报类型有确定报价申报。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | | MsgType=  S：报价申报 |  |
| 117 | QuoteID | | 会员内部编号，指报价申报会员内部编号。 | C10 |
| 537 | QuoteType | | 报价类别 1500 = 确定报价申报 | N4 |
| 1091 | PreTradeAnonymity | | 是否匿名报价，取值：匿名=1，具名=0  确定报价申报可填写1，其他不能填写1 | C1 |
| [529](../../fast cs/fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag529.html" \t "tagFrame) | [OrderRestrictions](../../fast cs/fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag529.html" \t "tagFrame) | | 是否做市报价，取值：做市报价=5，非做市报价=0  做市报价申报填写5，其他均填写0 | C1 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 54 | Side | | 买卖方向，取值有：0表示双向，1表示买，2表示卖 | C1 |
| 38 | OrderQty | | 订单数量，单位：手  在side为双向时表示买数量，其他情况表示side对应的数量 | N10 |
| 32 | LastQty | | 订单数量2，单位：手  在side为双向时填写卖数量，其他情况填写0 | N10 |
| 44 | Price | | 订单价格(净价)，单位：元，精度：3位。在side为双向时填写买价格，其他情况表示side对应的价格 | N10(3) |
| [640](../../fast cs/fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag640.html" \t "tagFrame) | [Price2](../../fast cs/fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag640.html" \t "tagFrame) | | 订单价格(净价)2，单位：元，精度：3位。在side为双向时填写卖价格，其他情况填写0 | N10(3) |
| [1138](../../fast cs/fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag1138.html" \t "tagFrame) | [DisplayQty](../../fast cs/fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag1138.html" \t "tagFrame) | | 冰山订单数量，单位：手  如果不为冰山订单，则此字段为0 | N10 |
| 453 | NoPartyIDs | | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码、申报交易单元号、投资者账户  确定报价申报取值为4 | N2 |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 发起方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方申报PBU代码，填写5位申报交易单元号 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号 | N4 |
| 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 |

### 报价申报响应消息

| **QuoteResponse (resptext)** | 报价申报响应消息 |
| --- | --- |
| **描述：**  响应接口流中的resptext字段数据。  每一个报价申报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报价申报后返回的确认信息。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | MsgType取值为：AJ=报价申报响应 或 报价请求及撤单响应 或 意向申报及撤单响应。 |  |
| 537 | QuoteType | 报价类别 1500 = 确定报价申报 | N1 |
| 117 | QuoteID | 会员内部编号，该字段对应报价申报消息中的QuoteID |  |
| 150 | ExecType | 当前订单执行状态，取值有：  0=成功响应，8=拒绝响应 | C1 |
| 103 | OrdRejReason | 报价请求报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。  报价申报成功时，该字段取值为空  报价申报失败时，表示拒绝的理由，取值同Remark字段。 | C5 |

### 报价申报撤单消息

| **QuoteCancel (reqtext)** | **报价申报撤单** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用Quote Cancel消息进行报价申报撤单，对应请求流中的ReqText  用到本消息的申报类型有确定报价申报撤单、可转成交申报撤单 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | | MsgType=  Z：报价申报撤单 |  |
| [117](file:///Z:\\03%20Architecture\\3.91%20Real-Time%20Trading\\Task\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag117.html" \t "tagFrame) | [QuoteID](file:///Z:\\03%20Architecture\\3.91%20Real-Time%20Trading\\Task\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag117.html" \t "tagFrame) | | 会员内部编号，指报价申报撤销会员内部编号。 | C10 |
| 41 | OrigClOrdID | | 原始交易会员内部编号，指示被撤消订单的QuoteID | C10 |
| 537 | QuoteType | | 报价类别 1501 = 确定报价申报撤销或可转成交申报撤销 | N4 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 453 | NoPartyIDs | | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、申报交易单元号, 取值为2 | N2 |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 发起方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |

### 报价申报撤单响应消息

| **Quote Status Report (RespText)** | **报价状态报告** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个报价申报撤单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。  此消息用于确定报价申报撤单 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | MsgType=  AI=报价状态报告 |  |
| [117](file:///Z:\\03%20Architecture\\3.91%20Real-Time%20Trading\\Task\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag117.html" \t "tagFrame) | [QuoteID](file:///Z:\\03%20Architecture\\3.91%20Real-Time%20Trading\\Task\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag117.html" \t "tagFrame) | 会员内部编号，指报价申报撤单中的会员内部编号。 | C10 |
| 41 | OrigClOrdID | 对于报价申报撤单成功响应，为原始交易会员内部编号，指示被撤消订单的[QuoteID](file:///Z:\\03%20Architecture\\3.91%20Real-Time%20Trading\\Task\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag117.html" \t "tagFrame)，其他情况取值为空。 | C10 |
| 694 | QuoteRespType | 取值：  2=报价申报撤单响应 | N1 |
| [297](../../fast cs/fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag297.html" \t "tagFrame) | [QuoteStatus](../../fast cs/fiximate/en/FIX.5.0SP2/tag297.html" \t "tagFrame) | 报价状态，取值：  申报撤单成功响应=1，  申报撤单失败响应=8 | C2 |
| 103 | RejReason | 申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。  当报价状态不为8时，该字段取值为空  报价状态为8时，表示处理失败的理由，取值同Remark字段，为错误代码。 | C5 |

### 成交申报消息

| **NewOrderSingle (reqtext)** | **成交申报** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用NewOrderSingle消息进行报价成交申报，对应申报接口流中的ReqText  使用此消息的申报类型有确定报价点击成交、最优价成交、可转换成交、指定对手方报价申报、协议交易 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | | MsgType=  D：成交申报 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号，只允许数字、字母、空格，不能全为空格 | C10 |
| 537 | QuoteType | | 报价类别  1502 = 最优价成交申报  1503 = 点击成交申报  1504 = 可转换成交申报 1505 = 协议交易申报  1507 = 指定对手方报价申报 | N4 |
| [6133](file:///Z:\\03%20Architecture\\3.91%20Real-Time%20Trading\\Task\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag963.html" \t "tagFrame) | [QuoteRefID](file:///Z:\\03%20Architecture\\3.91%20Real-Time%20Trading\\Task\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag963.html" \t "tagFrame) | | 交易所参考订单编号，只能为数字。在确定报价点击成交时放置对手方的报价订单编号，其他情况无意义 | C10 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 54 | Side | | 买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖 | C1 |
| 581 | AccountType | | 录入类型，取值有：1表示客户，2表示交易商。0表示无意义。  赋值说明：协议交易申报时使用，其他业务无意义。 | C1 |
| 44 | Price | | 价格(净价)，单位：元，精度：3位，有对手方订单时，与该订单价格一致  对于最优价申报，如果无限价，则输入0 | N10(3) |
| 38 | OrderQty | | 订单数量，单位：手  确定报价点击成交、最优价成交和可转换成交时为固定成交单位； | N10 |
| 664 | ConfirmID | | 约定号,三位定长数字  在指定对手方报价、协议交易填写，其他情况无意义 | N3 |
| 453 | NoPartyIDs | | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码、申报交易单元号、投资者账户、对手方交易员代码、对手方交易商代码。取值=6。 | N2 |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 发起方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 申报PBU代码，填写5位申报交易单元号。赋值说明如下：  协议交易申报：自营席位、客户席位。  其他业务：发起方PBU代码 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为交易单元号 | N4 |
| 投资者账户 | 448 | PartyID | 投资者帐户， 赋值说明如下：  协议交易申报：发起方股东账户、客户股东账户  其他业务：发起方股东账户 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为投资者帐户 | N4 |
| 对手方交易员代码 | 448 | PartyID | 对手方交易员代码，填写6位交易员代码。  指定对手方填写6位交易员代码。  协议交易无意义。  点击成交无意义。  最优价成交无意义。  可转换成交无意义。 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取102，表示当前PartyID的取值为对手方的交易员代码 | N4 |
| 对手方交易商代码 | 448 | PartyID | 对手方交易商代码，填写3位交易商代码。  最优价成交填写3位交易商代码，可以为空。  协议交易无意义。  点击成交无意义。  指定对手方无意义。  可转换成交无意义。 | C3 |
| 452 | PartyRole | 取37，表示当前PartyID的取值为对手方的交易商代码 | N4 |
| 58 | Text | | 备注，通常填写联系方式，协议交易填写 | C170 |

### 成交申报撤单消息

| **OrderCancel Request (reqtext** | **成交申报撤单** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用OrderCancel Request消息进行成交申报撤单，对应申报接口流中的ReqText用到本消息的申报类型有协议交易申报、指定对手方报价申报。  可转换成交申报通过报价申报撤单消息进行撤单。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | | MsgType=  F：成交申报撤单 |  |
| 11 | ClOrdID | | 会员内部编号，指成交申报会员内部编号, 只允许数字、字母、空格，不能全为空格 | C10 |
| 41 | OrigClOrdID | | 原始交易客户内部编号，指示被撤单订单的ClOrdID | C10 |
| 537 | QuoteType | | 报价类别  1506 = 协议交易申报撤销  1508 = 指定对手方报价申报撤销 | N4 |
| 48 | SecurityID | | 证券代码 | C6 |
| 453 | NoPartyIDs | | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、申报交易单元号, 取值=2 | N2 |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |

### 成交申报响应/成交申报撤单响应消息

| **ExecutionReport (RespText)** | **成交申报响应/**成交申报撤单**成功**响应 |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个成交申报记录或成交申报撤单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。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 消息头 | MsgType=  8：成交申报响应 |  |
| 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 | 当前订单状态，取值有：  0=成功响应  8=拒绝响应 | C1 |
| 11 | ClOrdID | 会员内部编号 | C10 |
| 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 | C50 |

### 非交易申报/非交易撤单申报消息

| **DesignationInstruction (ReqText)** | **转托管申报/转托管撤单申报** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者使用DesignationInstruction消息进行非交易申报，对应申报接口流中的ReqText  （暂时只支持转托管） | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 标准消息头 | MsgType取值为U041 |  |
| 117 | QuoteID | 会员内部编号，只允许数字、字母、空格，不能全为空格 | C10 |
| 537 | QuoteType | 报价类别 1509 = 转托管申报  1510 = 转托管申报撤销 | N4 |
| 41 | OrigClOrdID | 原始交易会员内部编号，表示被撤单订单的QuoteID。  转托管申报无意义。 | C10 |
| 48 | SecurityID | 证券代码 | C6 |
| 38 | OrderQty | 转托管数量，单位：手  转托管撤销无意义。 | N10 |
| 54 | Side | 买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖。  转托管申报和撤销只能赋值卖。 | C1 |
| 453 | NoPartyIDs | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码、申报交易单元号、投资者账户、银行间托管账号，取值为5 | N2 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 发起方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| 发起方申报交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| 发起方申报交易单元号 | 448 | PartyID | 发起方申报PBU代码，填写5位申报交易单元号。  转托管撤销无意义。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号 | N4 |
| 发起方投资者账户 | 448 | PartyID | 发起方投资者帐户 。  转托管撤销无意义。 | C10 |
| 452 | PartyRole | 取5，表示当前PartyID的取值为发起方投资者帐户 | N4 |
| 银行间托管帐号 | 448 | PartyID | 银行间托管账号，填写11位银行间托管账号。  转托管撤单无意义。 | C11 |
| 452 | PartyRole | 取28，表示当前PartyID的取值为银行间托管账号 | N4 |

### 非交易申报响应/非交易撤单申报响应

| **DesignationReport (RespText)** | **转托管申报响应** |
| --- | --- |
| **描述：**  每一个非交易申报记录或非交易申报撤单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。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **标签** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | 标准消息头 | MsgType=  U042：非交易申报/撤单响应 |  |
| 537 | QuoteType | 响应类别  1509 = 转托管申报  1510 = 转托管申报撤单 | N4 |
| 117 | QuoteID | 会员内部编号，该字段对应转托管申报/撤单消息QuoteID | C10 |
| 150 | ExecType | 当前订单执行状态，取值有：  0=成功响应，8=拒绝响应，6=撤单成功响应 | C1 |
| 102 | CxlRejReason | 转托管申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理  撤消成功时，该字段取值为空  撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同Remark字段 | C50 |
| 103 | OrdRejReason | 转托管申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理  转托管申报成功时，该字段取值为空  转托管申报失败时，表示拒绝的理由 | C50 |

## 执行报告查询类消息

### 成交执行报告查询

| **ExecutionInquiry (reqtext)** | **成交执行报告查询** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者查询成交执行报告。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType取值为U023 |  |
| 1346 | | ApplReqID | 查询请求编号 | N10 |
| 537 | | QuoteType | 申请类别  3139 －查询成交执行报告 | N4 |
| 7 | | BeginSeqNo | 起始成交序号，单调递增不连续，最小值为0，最大值为1000000000 | N10 |
| 453 | | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=2，查询方方交易商代码,交易员代码 | N2 |
| 查询方交易商代码 | 448 | PartyID | 查询方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为查询方的交易商代码 | N4 |
| 查询方交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为查询方的交易员代码 | N4 |

### 成交执行报告响应

| **ExecutionReport (reqtext)** | **成交执行报告响应** |
| --- | --- |
| **描述：**  响应市场参与者成交执行报告查询。  一次查询最多返回自查询起始序号起1000条记录。  若查询结果无数据，响应消息报文截止到16(EndSeqNo)字段。  当前仅包含质押式协议回购、现券确定报价、现券指定对手方和协议交易成交执行报告。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 |  | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 |  | | 消息头 | MsgType=  U024：执行报告 |  |
| 1346 |  | | ApplReqID | 查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的ApplReqID | N10 |
| 16 |  | | EndSeqNo | 此次查询结束成交序号（全市场） | N10 |
|  | 146 | | NoRelatedSym | 记录笔数 | N10 |
| → | 11 | | ClOrdID | 会员内部编号，业务子类型为614：债券质押式协议回购到期续做前期合约了结时该字段为空 | C10 |
| → | 37 | | OrderID | 交易所订单编号 | C16 |
| → | 17 | | ExecID | 成交编号 | N10 |
| → | 1125 | | OrigTradeDate | 成交申报时交易所成交日期  对于债券质押式协议回购到期确认  债券质押式协议回购到期续做前期合约了结  债券质押式协议回购到期续做合约新开  债券质押式协议回购换券申报  债券质押式协议回购提前终止  债券质押式协议回购解除质押 有效  对于其他业务无效 | C8 |
| → | 19 | | ExecRefID | 成交申报时交易所成交编号  对于债券质押式协议回购到期确认  债券质押式协议回购到期续做前期合约了结  债券质押式协议回购到期续做合约新开  债券质押式协议回购换券申报  债券质押式协议回购提前终止  债券质押式协议回购解除质押 有效  对于其他业务无效 | N10 |
| → | 828 | | TrdType | 业务类别  01 场内现券  02 场外现券  06 转托管  08 债券质押式协议回购  09 可交换债换股 | C2 |
| → | 48 | | SecurityID | 证券代码，对债券质押式协议回购，为质押券现券代码； | C6 |
| → | 55 | | Symbol | 质押债券简称 | C8 |
| → | 1180 | | ApplID | 对于质押式协议回购，含义为业务子类型，取值如下：  '619'：债券质押式协议回购成交申报  '613'：债券质押式协议回购到期确认  '614'：债券质押式协议回购到期续做前期合约了结  '615'：债券质押式协议回购到期续做合约新开  '616'：债券质押式协议回购换券申报  '617'：债券质押式协议回购提前终止  '618'：债券质押式协议回购解除质押  对于其他业务无效 | C11 |
| → | 31 | | LastPx | 价格, 单位：元  对于质押式协议回购，代表回购利率，只填写%左边的数值，省略%，例如：现实中的3.456%在此字段中填写3.456 | N11(3) |
| → | 32 | | LastQty | 该笔成交数量,  单位：手  对债券质押式协议回购，成交申报和换券申报时填写质押数量，到期确认、到期续做前期合约了结、到期续做合约新开、解除质押、提前终止时填0 | N12 |
| → | 882 | | UnderlyingDirtyPrice | 参考全价价格。  对债券质押式协议回购无效 | N11(3) |
| → | 159 | | AccruedInterestAmt | 参考应计利息  对债券质押式协议回购无效。 | N16(2) |
| → | 236 | | Yield | 参考到期收益率。单位：%  对债券质押式协议回购，为折算比例（百分比，精确到小数点后2位），只填写%左边的数值，省略%，最右两位填00，例如：现实中的95.27%填写95.2700） | N9(4) |
| → | 8504 | | TotalValueTraded | 参考净价成交金额，单位万元，对债券质押式协议回购无效； | N16(3) |
| → | 119 | | SettlCurrAmt | 参考全价成交金额，单位万元，对债券质押式协议回购为回购利息，单位：元 | N16(2) |
| → | 54 | | Side | 买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖,对于协议回购:1为正回购，2为逆回购 | C1 |
| → | 60 | | TransactTime | 成交时间，格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 | C21 |
| → | 42 | | OrigTime | 原有订单请求接收的时间,格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 | C21 |
| → | 453 | | NoPartyIDs | 发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、投资者账户、申报交易单元号。取值=4 | N2 |
| → | 发起方交易商代码 | 448 | PartyID | 发起方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为发起方的交易商代码 | N4 |
| → | 发起方交易员代码 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为发起方的交易员代码 | N4 |
| → | 发起方申报PBU代码 | 448 | PartyID | 发起方申报PBU代码，填写5位申报交易单元号。 | C5 |
| 452 | PartyRole | 取1，表示当前PartyID的取值为申报交易单元号 | N4 |
| → | 发起方投资者帐户 | 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 |

### 报价状态变更查询

| **OrderStatusChangeInquiry (reqtext)** | **报价状态变更查询** |
| --- | --- |
| **描述：**  市场参与者查询报价状态变更。  目前响应内容为质押式协议回购成交申报对手方拒绝后/本方撤单后，本方订单状态变更信息 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **标签** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 9 | | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| 35 | | 消息头 | MsgType取值为U029 |  |
| 1346 | | ApplReqID | 查询请求编号 | N10 |
| 537 | | QuoteType | 申请类别  3164 －查询报价状态变更 | N4 |
| 7 | | BeginSeqNo | 起始序号，单调递增不连续，最小值为0，最大值为1000000000 | N10 |
| 453 | | NoPartyIDs | 参与方个数，取值=2，查询方方交易商代码,交易员代码 | N2 |
| 查询方交易商代码 | 448 | PartyID | 查询方交易商代码，填写3位CompanyID | C3 |
| 452 | PartyRole | 取12，表示当前PartyID的取值为查询方的交易商代码 | N4 |
| 查询方交易员号 | 448 | PartyID | 交易员代码，填写6位交易员代码 | C6 |
| 452 | PartyRole | 取101，表示当前PartyID的取值为查询方的交易员代码 | N4 |

### 报价状态变更响应

| **OrderStatusChangeReport (reqtext)** | **报价状态变更响应** |
| --- | --- |
| **描述：**  响应市场参与者报价状态变更查询。  一次查询最多返回自查询起始序号起所有记录。  若查询结果无数据，响应消息报文截止到16(EndSeqNo)字段。 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| **9** |  | 消息长度 | 后续数据的字节数，不包含自身 |  |
| **35** |  | 消息头 | MsgType=  U030：报价状态变更通知 |  |
| 1346 |  | ApplReqID | 查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的ApplReqID | N10 |
| 16 |  | EndSeqNo | 此次查询结束报价编号（全市场） | N10 |
| 146 |  | NoRelatedSym | 记录笔数 | N10 |
| → | 37 | OrderID | 交易所订单编号 | C16 |
| → | 11 | ClOrdID | 会员内部编号，该笔订单所对应的原始客户内部编号 | C10 |
| → | [297](file:///Z:\\04%20FSP\\04.03%20BTP\\Task\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag297.html" \t "tagFrame) | [QuoteStatus](file:///Z:\\04%20FSP\\04.03%20BTP\\Task\\fast%20cs\\fiximate\\en\\FIX.5.0SP2\\tag297.html" \t "tagFrame) | 报价状态，取值：  对手方拒绝=5  本方撤单=6 | C2 |

# 落地文件

* + 定时刷新的数据文件如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 数据类型 | 文件名称 | 说明 | 定时刷新（时间可配置） |
| 确定报价 | ZQ\_QDBJyyyymmdd.txt | yyyymmdd为当前日期 | 5秒 |
| 成交行情 | ZQ\_CJHQyyyymmdd.txt | yyyymmdd为当前日期 | 5秒 |
| 成交明细 | ZQ\_CJMXyyyymmdd.txt | yyyymmdd为当前日期 | 5秒 |
| 证券信息 | ZQ\_ZQXXyyyymmdd.txt | yyyymmdd为当前日期 | 5分钟 |
| 过户数据 | zghxxx.txt | xxx 为该交易商代码 | 10秒 |

* + 非定时刷新的数据文件如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 数据类型 | 文件名称 | 说明 | 落地时间 |
| 过户数据 | zghxxx.dbf | xxx 为该交易商代码 | 1. 系统状态：收盘 2. 界面发起 |

* + 详细内容参见《IS109 固定收益平台外部数据接口规范》。