

上海证券交易所技术文档



固定收益平台  
新电子报盘接口规格说明书  
(0.10 版)



上海证券交易所

二〇一六年八月

## 修订记录

为便于阅读，修订记录按照修订时间逆序排列。

2016 年 8 月，建立初稿

技术开发总部

仅供内部使用

# 目录

1 简介 .....	4
1.1.....本文的目的.....	4
1.2.....概要 .....	4
2 会话机制 .....	5
2.1.....概要 .....	5
3 数据格式约定 .....	6
4 STEP 消息规范 .....	7
4.1.....STEP 消息流程图 .....	7
4.1.1 .....协议回购交易 STEP 消息流程图 .....	7
4.2.....订单类消息.....	9
4.2.1 .....报价申报消息 .....	9
4.2.2 .....报价申报响应消息 .....	11
4.2.3 .....报价申报撤单消息 .....	12
4.2.4 .....报价申报撤单响应消息 .....	13
4.2.5 .....成交申报信息 .....	14
4.2.6 .....成交申报响应/成交申报撤单成功响应消息 .....	16
4.3.....查询类消息.....	17
4.3.1 .....协议回购首次申报管理查询.....	错误!未定义书签。
4.3.2 .....协议回购首次申报管理查询响应.....	错误!未定义书签。
4.3.3 .....到期确认申报管理查询 .....	17
4.3.4 .....到期确认申报查询管理查询响应 .....	18
4.3.5 .....成交执行报告查询 .....	20
4.3.6 .....成交执行报告响应 .....	20
4.3.7 .....非公开报价行情查询 .....	22
4.3.8 .....非公开报价行情响应 .....	23
4.4.....申报类型表.....	25

---

## 1 简介

### 1.1 本文的目的

本文档主要描述固定收益平台新电子报盘（以下简称 EzDataAccess）和下游系统之间数据流接口。本文详细定义了 EzDataAccess 流接口所采用的技术标准以及业务数据的内容格式。

### 1.2 概要

EzDataAccess 通过数据流接口方式，提供报单申报、确认、成交回报等功能，涉及一些格式化 txt 行情信息文件等。

此外，系统在开盘期间，会及时从服务器获取确定报价行情、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，系统会从服务器获取本方成交数据文件，保存到用户本地。

## 2 会话机制

### 2.1 概要

EzDataAccess 与下游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，下游系统作为客户端。下游系统首先需要向事先约定的 EzDataAccess 服务端口发起连接请求。

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
1.	msgLen	报文长度 (二进制)	Int	4	后续数据的字节数， 不包含自身
2.	fill04	填充字符	char	4	
3.	reqtext	消息内容	Char	10*1024-8	

响应消息

序号	字段名称	说明	类型	[字节数]	备注
1.	msgLen	报文长度 (二进制)	Int	4	后续数据的字节数， 不包含自身
2.	complCod	错误标志	char	1	<b>S:</b> 报价成功、 <b>F:</b> 报价失败、 <b>E:</b> 经检查格式错误、 <b>N:</b> 发送时出错
3.	fill03	填充字段	char	3	
4.	remark	处理结果的 文字说明	char	50	
5.	resptext	消息内容	Char	10*1024*1024 减 58	返回请求端数据

### 3 数据格式约定

数据格式约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》文档。

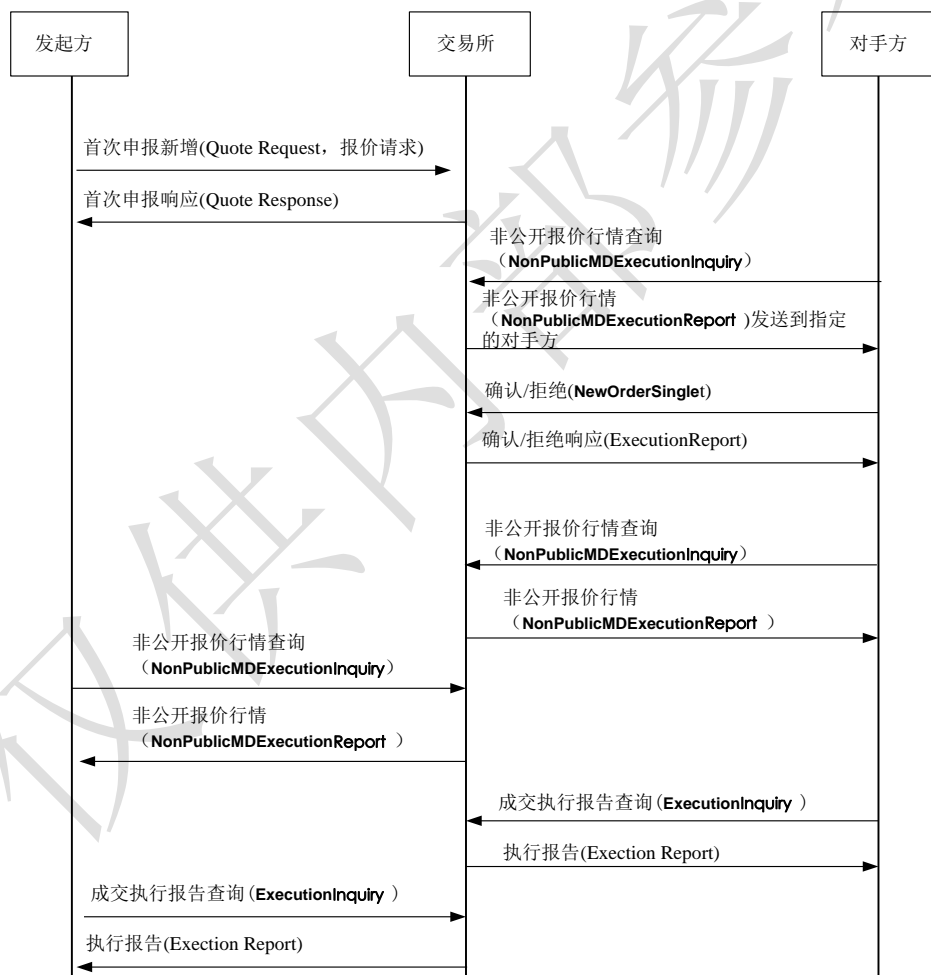
STEP 消息约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》文档。

## 4 STEP 消息规范

### 4.1 STEP 消息流程图

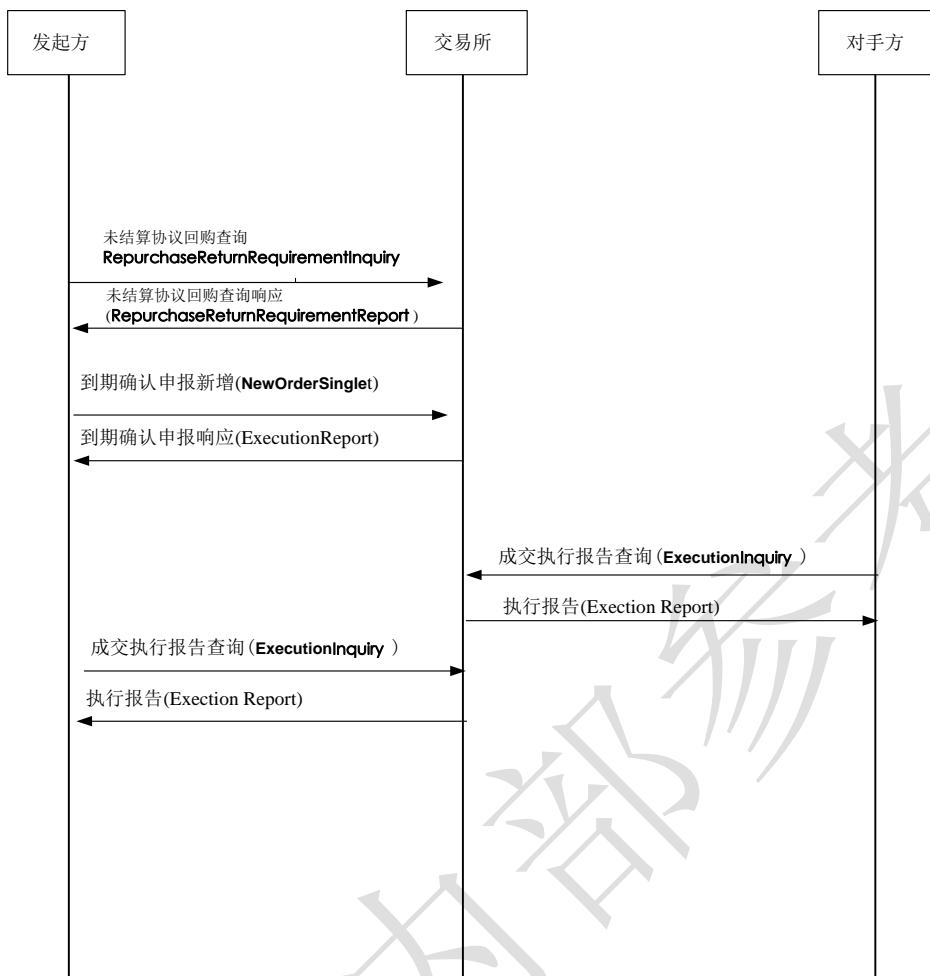
#### 4.1.1 协议回购交易 STEP 消息流程图

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、首次申报、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。下图描述了首次申报和到期确认申报的 STEP 消息通信流程。









## 4.2 订单类消息

reqtext/resptext	订单数据
<p><b>描述:</b></p> <p>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。</p> <p>申报消息对应于同步请求消息流中的 reqtext 字段。</p> <p>响应消息对应于同步确认消息流中的 resptext 字段。</p>	

### 4.2.1 报价申报消息

Quote (reqtext)	报价申报
<p><b>描述:</b></p>	

Quote (reqtext)	报价申报
市场参与者使用 <b>Quote</b> 消息进行报价申报。 用到本消息的申报类型有协议回购首次申报, <b>对于协议回购, 发起方只能为正回购方。</b>	

标签	字段名	字段描述	类型
	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 1142 = 质押式协议回购首次申报 1147 = 质押式协议回购到期续做申报	N4
44	Price	回购利率, 单位: %, 精度: 3 位	N10(3)
226	RepurchaseTerm	回购期限, 以天计, 1-365 天	N4
8847	UAIInterestAccrualDays	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
UndInstrmtGrp			
711	NoUnderlyings	质押券个数, 质押式协议回购首次申报最大 10, 其他报价类别为 1	N10
→	48	SecurityID	质押券代码
→	38	OrderQty	质押券数量, 单位: 手
→	231	ContractMultiplier	折算比例, 单位: %, 精度: 2 位
→	8504	TotalValueTraded	成交金额, 单位: 元; 精度: 2 位, 四舍五入
→	159	AccruedInterestAmt	回购利息, 单位: 元, 精度: 2 位, 四舍五入
→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额, 单位: 元, 精度: 2 位, 四舍五入
→	32	LastQty	质押券面总额合计, 单位: 元, 整数
192	OrderQty2	本期回购结算利息, 到期续做申报时填写	N16(2)

40	OrdType		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	C1
1125	OrigTradeDate		首次申报时交易所成交日期， 到期续做申报时填写	C8
1080	RefOrderID		首次申报时交易所成交编号， 到期续做申报时填写	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6	
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
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	C160

#### 4.2.2 报价申报响应消息

QuoteResponse (resptext)	报价申报响应/报价请求及撤单响应
<b>描述：</b>  同步确认消息流中的 resptext 字段数据。	

QuoteResponse (resptext)	报价申报响应/报价请求及撤单响应
<p>每一个报价申报记录或报价申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。</p> <p>市场参与者系统可以获得上交所处理报价申报及其撤单后返回的确认信息。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: AJ=报价申报响应及撤单响应	
537	QuoteType	响应类别 1142= 质押式协议回购首次申报 1147=质押式协议回购到期续做申报	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
103	OrdRejReason	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。	C5
58	Text	处理结果的文字说明 (错误代码加错误信息)	C50

#### 4.2.3 报价申报撤单消息

QuoteCancel (reqtext)	报价申报撤单
<p><b>描述:</b></p> <p>市场参与者使用 Quote Cancel 消息进行报价申报撤单, 对应请求及响应表中的 ReqText 用到本消息的申报类型有质押式协议回购首次申报撤销, 对于协议回购, 发起方只能为正回购方。</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	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。	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 1143 = 质押式协议回购首次申报撤单 1148 = 质押式协议回购到期续做撤单		N4
48	SecurityID	证券代码		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，可填写空格		C50

#### 4.2.4 报价申报撤单响应消息

QuoteStatusReport (RespText)	报价状态报告
<b>描述：</b> 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。 此消息用于协议回购首次申报撤销响应。	

序号	字段名	字段描述	类型
	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	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，为错误代码加错误信息。	C50
58	Text	备注，可填写空格	C50

#### 4.2.5 成交申报信息

NewOrderSingle (ReqText)	成交申报消息
<b>描述：</b> 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。 质押式协议回购到期确认的原始信息通过到期确认申报管理查询获取。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType= D: 成交申报	
11	ClOrdId	会员内部编号，指报价申报会员内部编号。	C10
6133	QuoteRefID	引用非公开报价行情的交易所报价请求编号，质押式协议回购首次申报确认/质押式协议回购首次申报拒绝/质押式协议回购到期续做确认/押式协议回购到期续做拒绝时填写	C10

537	QuoteType		报价类别 1144=质押式协议回购首次申报确认 1145=质押式协议回购首次申报拒绝 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确认 1150=质押式协议回购到期续做拒绝	N4
48	SecurityID		证券代码	C6
119	SettlCurrAmt		到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入，到期确认申报填写。	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	
1125	OrigTradeDate		首次申报时交易所成交日期，回购到期确认申报时填写	C8
1080	RefOrderID		首次申报时交易所成交编号，回购到期确认申报时填写	N10
Parties				
453		NoPartyIDs	发起方重复组，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	
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，质押式协议回购首次申报和到期确认时填写	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。	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
对手方交易商代码	448	PartyID	对手方交易商代码，填写 3 位 CompanyID，回购到期确认申报时填写	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，回购到期确认申报时填写	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	C160

#### 4.2.6 成交申报响应/成交申报撤单成功响应消息

ExecutionReport (RespText)	成交申报响应/成交申报撤单成功响应
<b>描述：</b>  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。  <b>150 和 39 组合取值含义：</b>  成交申报成功响应：150=0, 39=0  拒绝响应：150=8, 39=8  成交申报撤单成功响应：150=6,39=6	

标签	字段名	字段描述	类型
	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 6=撤单成功	C1
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功	C1
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
41	OrigClOrdID	对于撤单成功响应，为原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的 ClOrdID，对于委托响应，取值为空。	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。	C50



		申报成功时，该字段取值为空。	
		申报失败时，表示拒绝的理由。	

### 4.3 查询类消息

reqtext/resptext	订单数据
<b>描述：</b> 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。	

#### 4.3.1 未结算协议回购查询

RepurchaseReturnRequirementInquiry (reqtext)	到期确认申报管理查询
<b>描述：</b> 市场参与者使用此消息查询当日到期的回购数据。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
	消息头	MsgType 取值为 U021	
1346	ApplReqID	查询请求编号	N10
48	SecurityID	债券代码，ALL 代表全部	C6
537	QuoteType	申请类型 3121 一到期确认申报管理查询	C4
1180	ApplID	查询类型 1 到期结算查询申请 2 到期需做查询申请	C1
297	QuoteStatus	到期状态  D 当日到期	C2
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=3，正回购方交易商代码，交易员代码，逆回购方交易商代码。	N2
正回购方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码
正回购方报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码

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

### 4.3.2 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
<b>描述：</b>  响应市场参与者到期确认申报管理查询。	

标签	字段名	字段描述	类型
		消息头	MsgType 取值为 U022
1346	ApplReqID	查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的 ApplReqID	N10
146	NoRelatedSym	记录笔数	N10
→	75	TradeDate	成交日期
→	17	ExecID	成交编号
→	54	Side	回购方向，取值有：1 表示正回购，2 表示逆回购
→	44	Price	回购利率，单位：% ，精度：3 位
→	541	MaturityDate	回购到期日，格式为：YYYYMMDD
→	193	SettlDate2	到期结算日，格式为：YYYYMMDD
→	226	RepurchaseTerm	回购期限，单位：天，整数
→	8847	UAIInterestAccrualDays	实际占款天数，单位：天，整数
→	48	SecurityID	质押债券代码
→	55	Symbol	质押债券简称
→	38	OrderQty	质押券数量，单位：手
→	32	LastQty	质押券面总额合计，单位：元，整数
→	231	ContractMultiplier	折算比例，单位：% ，精度：2 位
→	8504	TotalValueTraded	首次成交金额，单位：元；精度：2 位，四舍五入
→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入

→	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 D 当日到期		C2
→	453	NoPartyIDs	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, 以及对手方交易员信息。取值为 5		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 12, 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
→	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

#### 4.3.3 成交执行报告查询

ExecutionInquiry (reqtext)	成交执行报告查询
<b>描述:</b> 市场参与者查询成交执行报告。	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为 U023	
1346	ApplReqID	查询请求编号	N10
537	QuoteType	申请类型 2007 — 查询成交执行报告	C4
7	BeginSeqNo	起始成交编号 (全市场)	N10
453	NoPartyIDs	参与方个数, 取值=2, 查询方交易商代码, 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
	452	PartyRole	取 12, 表示当前 PartyID 的取值为查询方的交易商代码
正回购方报交易员号	448	PartyID	交易员代码, 填写 6 位交易员代码
	452	PartyRole	取 101, 表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码

#### 4.3.4 成交执行报告响应

ExecutionReport (reqtext)	成交执行报告响应
<b>描述:</b>	

ExecutionReport (reqtext)	成交执行报告响应
响应市场参与者成交执行报告查询。	

	序号	字段名	字段描述	类型
		标准消息头	MsgType= 8: 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	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	C10
→	37	OrderID	交易所订单编号	C16
→	17	ExecID	成交编号	C16
→	40	OrdType	OrderID 对应的订单类型, 取值: '5' 协议回购首次申报 '6' 协议回购到期结算申报	C1
→	48	SecurityID	证券代码	C6
→	31	LastPx	价格(净价)	N11(3)
→	32	LastQty	该笔成交数量	N12
→	151	LeavesQty	本次剩余数量, 对于确定报价=报价数量-已成交总数量 其他填写 0	N12
→	882	UnderlyingDirty Price	参考全价价格。	N11(3)
→	159	AccruedInterest Amt	参考应计利息	N11(3)
→	236	Yield	参考到期收益率。	N9(4)
→	8504	TotalValueTraded	成交金额	N16(3)

→	54	Side	买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖		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
→	39	OrdStatus	当前订单状态，取值：1=部分成交，2=已成交		C1
→	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，对手方申报交易单元号、对手方交易商代码。取值=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 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
→	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
→	58	Text	备注，可填写空格		C50

#### 4.3.5 非公开报价行情查询

NonPublicMDExecutionInquiry (reqtext)	成交申报管理查询
---------------------------------------	----------

NonPublicMDExecutionInquiry (reqtext)	成交申报管理查询
<b>描述:</b> 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
	消息头	MsgType 取值为 U025	
1346	ApplReqID	查询请求编号	N10
537	QuoteType	申请类型 2007 一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）	N10
453	NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，查询方交易商代码, 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
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为查询方的交易商代码
正回购方报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码

#### 4.3.6 非公开报价行情响应

NonPublicMDExecutionReport (reqtext)	非公开报价行情响应
<b>描述:</b> 响应市场参与者非公开报价行情查询。	

标签	字段名	字段描述	类型
	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	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，质押式协议回购首次申报确认与质押式协议回购首次申报拒绝需要上传此编号。
→	279	MDUpdateAction	行情更新类型，取值：新增=0，删除=2

→	537	QuoteType	报价申报类型, 取值: 首次申报=F 到期续做=X	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	N3
→	8847	UAIInterestAccrualDays	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
→	→	38	OrderQty	质押券数量, 单位: 手
→	→	231	ContractMultiplier	折算比例, 单位: %, 精度: 2 位
→	→	8504	TotalValueTraded	成交金额, 单位: 元; 精度: 2 位, 四舍五入
→	→	159	AccruedInterestAmt	回购利息, 单位: 元, 精度: 2 位, 四舍五入
→	→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额, 单位: 元, 精度: 2 位, 四舍五入
→	→	32	LastQty	质押券面总额合计, 单位: 元, 整数
→	192	OrderQty2	本期回购结算利息, 到期续做行情时有效	N16(2)
→	40	OrdType	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	首次申报时交易所成交日期, 到期续做行情时有效	C8
→	1080	RefOrderID	首次申报时交易所成交编号, 到期续做行情时有效	N10
→	453	NoPartyIDs	发起方重复组, 依次包含对手方的交易商代	N2



				码、申报交易单元号，取值=2	
→	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		备注，可填写空格	C160

#### 4.4 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
投资者帐户	5 =发起方投资者帐户
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

#### 4.5 申报类型表

类型	类型	MsgType	消息类型	请求类型	交易模式
订单类	上传请求	S	报价申报	协议回购首次申报	申报
				质押式协议回购到期续做申报	申报
		Z	报价申报撤单	协议回购首次申报	申报撤单
		D	成交申报	协议回购首次申报	确认
					拒绝
				协议回购到期续做	确认
					拒绝
				质押式协议回购到期确认申报	申报
	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 的响应	
	上传请求	U021	到期确认申报管理查询	到期确认申报管理查询	
	后台响应	U022	到期确认申报管理		

			响应	
	上传请求	U023	成交执行报告查询	成交执行报告查询
	后台响应	8	成交执行报告响应	
	上传请求	U025	非公开报价行情查询	非公开报价行情查询（首次申报和到期续做）
	后台响应	U026	非公开报价行情响应	