

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

(开发稿 V0.2 版)



上海证券交易所

二〇一七年三月

《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 2017.1

- 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	4
2 会话机制	5
2.1.....概要	5
3 数据格式约定	6
4 消息定义	7
4.1.....协议回购消息处理流程说明	8
4.2.....协议回购订单类消息	11
4.2.1.....意向申报消息/意向申报撤单消息	11
4.2.2.....报价申报消息	13
4.2.3.....报价申报响应消息	16
4.2.4.....报价申报撤单消息	17
4.2.5.....报价申报撤单响应消息	18
4.2.6.....成交申报信息	19
4.2.7.....成交申报响应单成功响应消息	21
4.3.....协议回购查询类消息	21
4.3.1.....未结算协议回购查询	22
4.3.2.....未结算协议回购查询响应	23
4.3.3.....非公开报价行情查询	25
4.3.4.....非公开报价行情响应	26
4.3.5.....公开报价行情查询	28
4.3.6.....公开报价行情响应	28
4.4.....执行报告查询类消息	30
4.4.1.....成交执行报告查询	30
4.4.2.....成交执行报告响应	30

1 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，上交所拟于近期发布电子报盘网关软件（以下简称 EzDataAccess）。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，另有专门文档介绍（待发布）。

2 会话机制

2.1 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（10030）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.	reqid	请求业务类 型编号	char	3	内容见数据格式约定 章节
3.	fill13	填充字符	char	13	无意义
4.	reqtext	消息内容	Char	-	变长字段，最大长度 为 10*1024-16

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	S: 报价成功、F: 报价失败、E: 经检 查格式错误、N: 发 送时出错
3.	fill03	填充字段	char	3	无意义
4.	remark	处理结果的 文字说明	char	50	
5.	resptext	消息内容	Char	-	变长字段，最大长度 为 10*1024*1024-58

3 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	MsgType	消息类型说明	请求类型	交易模式
订单类	4 上传请求	S	报价申报	协议回购成交申报	申报
				质押式协议回购到期续做申报	申报
				质押式协议回购解除质押申报	申报
				质押式协议回购换券申报	申报
				质押式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
				质押式协议回购解除质押申报	申报撤单
				质押式协议回购换券申报	申报撤单
				质押式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
				质押式协议回购到期确认申报	申报
				质押式协议回购解除质押确认申报	确认
					拒绝
				质押式协议回购换券确认申报	确认
					拒绝
				质押式协议回购提前终止确认申报	确认
					拒绝
	后台响应			AJ	报价响应
		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	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	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	U025	非公开报价行情查	非公开报价行情查询（成交申报、到期		

			询	续做、解除质押、换券、提前终止)
	后台响应	U026	非公开报价行情响应	
	上传请求	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)

目前实现不包含以下业务

FDP=确定报价(Fixed Income-Determined Price Quoting)

FIP=询价(Fixed Income- Inquired Price Trading)

FAT=协议交易(Fixed Income-Agreed Trading)

FBT=转托管 (Fixed Income-Bond Transfer)

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

FPT=指定对手方报价 (Fixed Income-Promissory Trading)

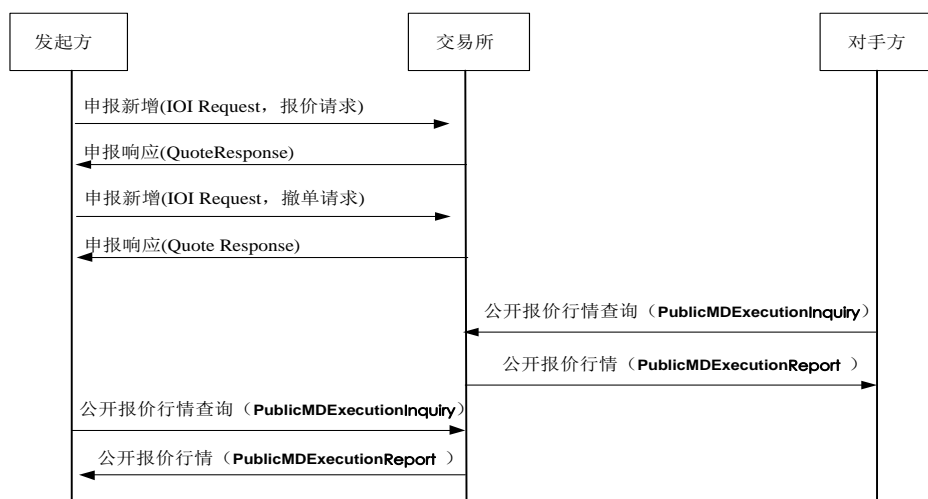
4 消息定义

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。

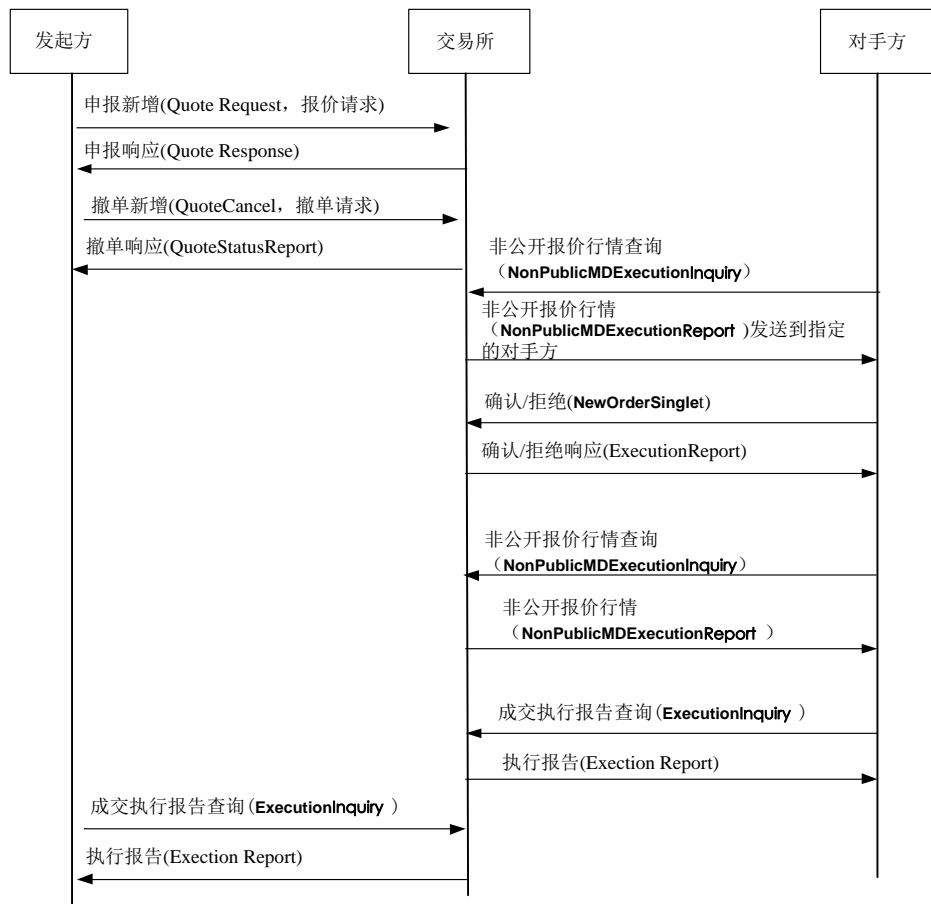
4.1 协议回购消息处理流程说明

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。

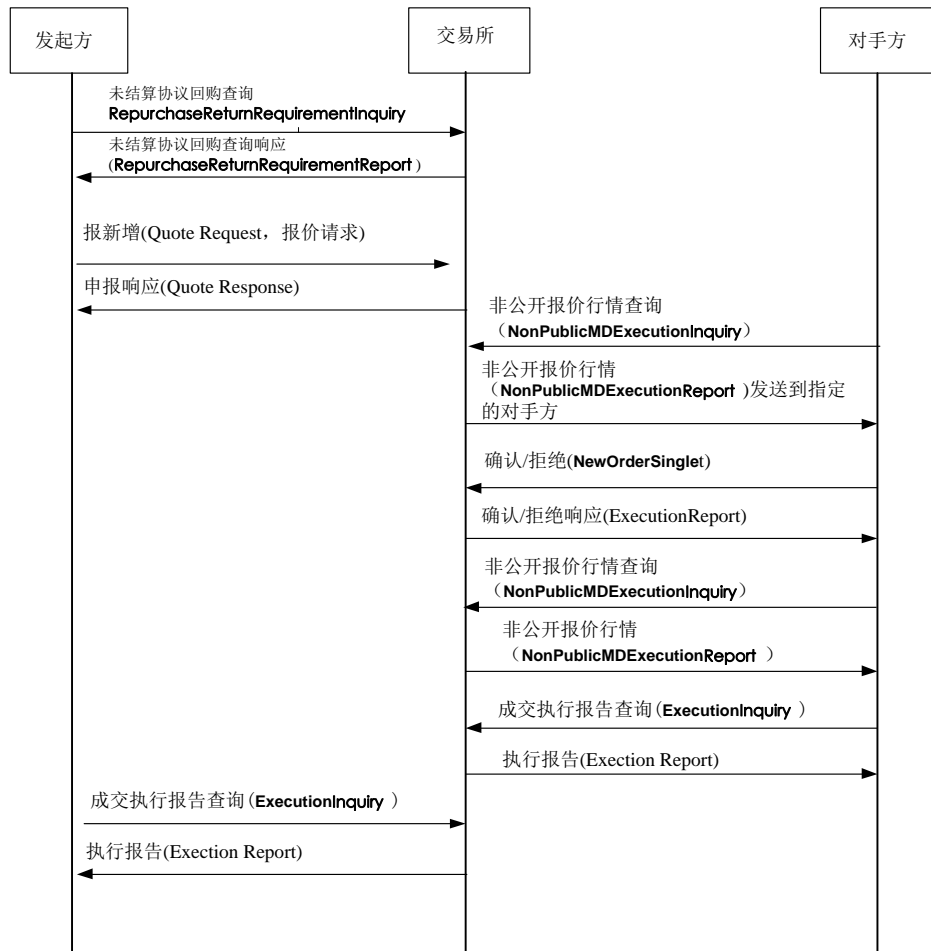
意向申报STEP消息流程



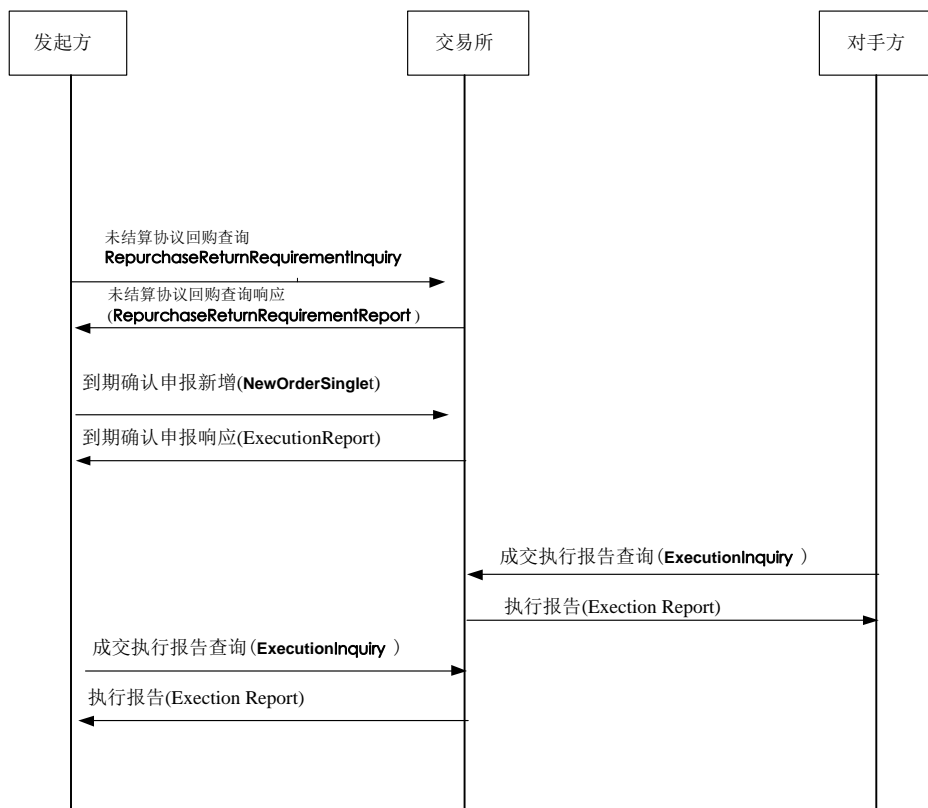
成交申报STEP消息流程



到期续做申报、解除质押申报、
换券申报、提前终止申报STEP消息流程



到期确认申报STEP消息流程



4.2 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。	

4.2.1 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。	

IOI (reqtext)	意向申报消息/意向申报撤单消息
意向申报撤单必填字段为 IOIID, QuoteType, IOIRefID	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: 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。	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, 对于意向申报该字段取值为空, 若为撤单则为被撤原订单的会员内部编号。	C10
48	SecurityID	质押券代码	C6
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	协议回购方向, 1 表示正回购, 2 表示逆回购	C1
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	成交金额, 单位: 元; 精度: 2 位, 四舍五入	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)
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	
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

4.2.2 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
	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 = 质押式协议回购成交申报 1147 = 质押式协议回购到期续做申报	N4

			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	
44	Price		回购利率, 单位: %, 精度: 3 位, 到期续作填新回购利率, 解除质押申报填 0, 换券申报填 0, 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, 到期续作填新回购期限, 解除质押申报填 0, 换券申报填 0, 提前终止申报填提前终止后回购期限	N4
8847	UAIInterestAccrualDays		实际占款天数, 单位: 天, 整数, 到期续作填新实际占款天数, 解除质押申报填 0, 换券申报填 0, 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, 到期续作填新的首次结算日, 解除质押申报填空, 换券申报填空, 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, 到期续作填新的回购到期日, 解除质押申报填空, 换券申报填空, 提前终止申报填空	C8
193	SettlDate2		到期结算日, 格式为: YYYYMMDD, 到期续作填新的到期结算日, 解除质押申报填空, 换券申报填空, 提前终止申报填空	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, 质押式协议回购成交申报最大 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	C6
→	38	OrderQty	质押券数量, 单位: 手, 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, 到期续作填新的折算比例, 解除质押申报填空 0, 换券申报时填新折算比例, 提前	N6 (2)

			终止申报填 0	
→	8504	TotalValueTraded	成交金额，单位：元；精度：2 位，四舍五入，到期续作填新的成交金额，解除质押申报填 0，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	N16(2)
→	159	AccruedInterestAmt	回购利息，单位：元，精度：2 位，四舍五入，，到期续作填新的回购利息，解除质押申报填 0，换券申报填 0，提前终止申报填实际回购利息	N16(2)
→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入，到期续作填新的到期结算金额，解除质押申报填 0，换券申报时填成交申报时到期结算金额	N16(2)
→	32	LastQty	质押券面总额合计，单位：元，整数，，到期续作填 0，解除质押申报填 0，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, 其它填 0	N16(2)
529	OrderRestrictions		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，其它填空	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	C8
19	ExecRefID		成交申报时交易所成交编号，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	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	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
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

4.2.3 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
	消息头	MsgType 取值为: 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。	C50

		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。	
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

4.2.4 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质押式协议回购成交申报撤销，到期续做申报撤销，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
	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	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

4.2.5 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申报后返回的确认信息。	

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	N1
103	RejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错	C50

		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。	

4.2.6 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。 质押式协议回购到期确认申报只能是正回购方确认。 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
	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确认/质押式协议回购到期续做拒绝/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	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确认 1150=质押式协议回购到期续做拒绝 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		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	C21
1125	OrigTradeDate		成交申报时交易所成交日期，回购到期确认申报/到期续作/换券申报/提前终止申报时填写	C8
19	ExecRefID		成交申报时交易所成交编号，回购到期确认申报/到期续作/换券申报/提前终止申报/解除质押确认时填写	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	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	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，回购到期确认申报时填写	C170

4.2.7 成交申报响应单成功响应消息

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 拒绝响应: 150=8, 39=8	

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	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

4.3 协议回购查询类消息

reqtext/resptext	订单数据
描述:	

reqtext/resptext	订单数据
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
描述: 市场参与者使用此消息查询未结算的回购数据。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 3140 一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	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作时填写 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, 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 CompanyID 填写当期登录交易商	C3
	452	PartyRole 取 12, 表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
交易员	448	PartyID 交易员代码, 填写 6 位交易员代码 填写当期交易员	C6
	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 CompanyID 填写当期登录交易商	C3
	452	PartyRole 取 37, 表示当前 PartyID 的取值为逆回购	N4

			方的交易商代码	
--	--	--	---------	--

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
描述: 响应市场参与者到期未结算协议回购查询。	

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
16	EndSeqNo	此次查询结束序号 (全市场)	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

→	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	N4

				的交易商简称	
→	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	正回购申报 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	正回购投资者帐户	C10
		452	PartyRole	取 6, 表示当前 PartyID 的取值为正回购方投资者帐户	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

4.3.3 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
	消息头	MsgType 取值为 U025		
1346	ApplReqID	查询请求编号		N10
537	QuoteType	申请类别 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), 单调递增不连续		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	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	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	N4

号			易员代码	
---	--	--	------	--

4.3.4 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。	

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	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、质押式协议回购成交申报拒绝、质押式协议回购到期续做确认、与质押式协议回购到期续做拒绝, 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确认, 质押式协议回购提前终止申报拒绝上传此编号。	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	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
		308	UnderlyingSecurityID	原质押券代码, 换券申报时有效, 其他填空格
→	→	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
		879	UnderlyingQty	原成交申报成交金额, 换券申报时有效, 其他填 0
→	→	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
→	529	OrderRestrictions	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, 到期续做行情, 换券申报, 提前终止申报, 解除质押申报行情时有效	C8
→	19	ExecRefID	到期续做行情, 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, 取值= 3	N2
→	本方交易商代	448	PartyID	本方交易商代码, 填写 3 位 CompanyID

	码	452	PartyRole	取 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，填写 10 位简称	C10
→		452	PartyRole	取 103，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	C170

4.3.5 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
	消息头	MsgType 取值为 U027	
1346	ApplReqID	查询请求编号	N10
537	QuoteType	申请类别 2020 一成交申报公开报价行情查询	C4
7	BeginSeqNo	起始行情序号（全市场），单调递增，不连续	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
查询方交易员号	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 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。	

标签	字段名	字段描述	类型
----	-----	------	----

		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=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，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

4.4 执行报告查询类消息

4.4.1 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
	消息头	MsgType 取值为 U023	
1346	ApplReqID	查询请求编号	N10
537	QuoteType	申请类别 3139 一查询成交执行报告	N4
7	BeginSeqNo	起始成交序号, 单调递增不连续	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
查询方交易员号	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

4.4.2 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。	

	序号	字段名	字段描述	类型
		标准消息头	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	C10
→	37	OrderID	交易所订单编号	C16

→	17	ExecID	成交编号	C16
	1125	OrigTradeDate	成交申报时交易所成交日期 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	C11

			'618': 债券质押式协议回购解除质押 对于其他业务无效	
→	31	LastPx	单位: 元 价格 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, 填回购利息, 单位为元;	N16(2)
→	236	Yield	参考到期收益率。 百分数 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无效;	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	N2

				元号。取值=4。	
→	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