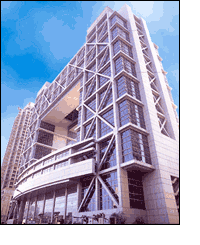
上海证券交易所技术文档



**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○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2017.3**

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](#_Toc477178282)

[2 会话机制 5](#_Toc477178283)

[2.1 概要 5](#_Toc477178284)

[3 数据格式约定 6](#_Toc477178285)

[4 消息定义 7](#_Toc477178286)

[4.1 协议回购消息处理流程说明 8](#_Toc477178287)

[4.2 协议回购订单类消息 11](#_Toc477178288)

[4.2.1 意向申报消息/意向申报撤单消息 11](#_Toc477178289)

[4.2.2 报价申报消息 13](#_Toc477178290)

[4.2.3 报价申报响应消息 16](#_Toc477178291)

[4.2.4 报价申报撤单消息 17](#_Toc477178292)

[4.2.5 报价申报撤单响应消息 18](#_Toc477178293)

[4.2.6 成交申报信息 19](#_Toc477178294)

[4.2.7 成交申报响应单成功响应消息 21](#_Toc477178295)

[4.3 协议回购查询类消息 22](#_Toc477178296)

[4.3.1 未结算协议回购查询 22](#_Toc477178297)

[4.3.2 未结算协议回购查询响应 23](#_Toc477178298)

[4.3.3 非公开报价行情查询 25](#_Toc477178301)

[4.3.4 非公开报价行情响应 26](#_Toc477178302)

[4.3.5 公开报价行情查询 28](#_Toc477178303)

[4.3.6 公开报价行情响应 29](#_Toc477178304)

[4.4 执行报告查询类消息 30](#_Toc477178305)

[4.4.1 成交执行报告查询 30](#_Toc477178306)

[4.4.2 成交执行报告响应 30](#_Toc477178307)

# 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）。

# 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（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 |
|  | 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 |

响应消息

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
|  | 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 |
|  | 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 | 1. 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 | 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 | |
| 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）

# 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。  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 | 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 | | 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 |

### 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  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 | UAInterestAccrualDays | | 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，提前终止申报填0 | N6(2) |
| → | 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,提前终止申报填0 | 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,提前终止申报填0 | 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](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，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 |

### 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。  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 |

### 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确认和到期确认时填写 | 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 |

### 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 |

## 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。 | |

### 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 －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 | 正回购方交易商代码，填写3位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 | 逆回购方交易商代码，填写3位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。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | | C8 |
| → | 17 | ExecID | 成交编号 | | 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 | | N3 |
| → | 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 |

### 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 －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的取值为发起方的交易员代码 | 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，标签：6133，279，40有业务含义，其他标签值默认为空 | |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | 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，其他填空格 | 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，换券申报时有效，其他填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  到期续作为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 |
| → | 本方交易商代码 | 448 | PartyID | | 本方交易商代码，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简称 | 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 |

### 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 －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的取值为发起方的交易员代码 | 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。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |

## 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** |
|  | 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 | | 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的取值为发起方的交易员代码 | 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。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **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 | N10 |
|  | 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  '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 | | 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 |