

# 新平台本币交易接口开发指南 (现券市场)

---

CFETS/K1771—2019

## 第二卷：通用功能

(2.0.0)

# 目 次

前言 .....	III
引 言 .....	IV
修改历史 .....	V
1 文档使用说明 .....	1
1.1 文档用途 .....	1
1.2 文档结构 .....	1
2 通用规则 .....	3
2.1 客户参考编号 .....	3
2.1.1 客户参考编号编码规则 .....	3
2.1.2 客户端报文反馈消息 .....	3
2.2 交易参与者 .....	3
2.2.1 Parties 组件 .....	3
2.2.2 资产管理人/结算代理人以及分账信息 .....	4
2.3 业务发生时间 .....	5
2.4 报文头 .....	6
2.4.1 交易接口 .....	6
2.4.1.1 上行报文 .....	6
2.4.1.2 下行报文 .....	6
2.4.2 行情接口 .....	6
2.4.2.1 上行报文 .....	6
2.4.2.2 下行报文 .....	7
2.4.3 报价查询接口 .....	7
2.4.3.1 上行报文 .....	7
2.4.3.2 下行报文 .....	7
2.5 Reject (3) 消息说明 .....	7
3 交易时段 .....	9
3.1 业务流程 .....	9
3.2 TradingSessionStatus(h) .....	10
3.2.1 业务要素 .....	10
3.2.2 IMIX 报文示例 .....	11
4 报价查询 .....	13
4.1 业务流程 .....	13
4.2 QueryRequest (U02) .....	14
4.2.1 业务要素 .....	14
4.2.2 IMIX 报文示例 .....	15
4.3 QueryResult (U01) .....	16
4.3.1 IMIX 报文示例 .....	16

5 接口用户密码修改.....	18
5.1 业务流程.....	18
5.2 UserRequest (BE) .....	18
5.2.1 IMIX 报文示例 .....	18
5.3 UserResponse (BF) .....	19
5.3.1 IMIX 报文示例 .....	19
6 失败反馈.....	21
6.1 BusinessMessageReject(j) .....	21
6.1.1 业务要素.....	21
6.1.2 IMIX 报文示例 .....	21
6.2 Reject(3) .....	21
6.2.1 业务要素.....	22
6.2.2 IMIX 报文示例 .....	22
7 接口要求说明.....	23
参考文献.....	26

图 1 交易时段时序图 .....	9
图 2 报价查询时序图 .....	13
图 3 密码修改时序图 .....	18

表 1 章节列表 .....	1
表 2 交易成员信息示例 .....	3
表 3 交易参与者带分账信息示例 .....	5
表 4 交易参与者不带分账信息示例 .....	5
表 5 上行消息报文头取值 .....	6
表 6 下行消息报文头取值 .....	6
表 7 上行消息报文头取值 .....	6
表 8 下行消息报文头取值 .....	7
表 9 上行消息报文头取值 .....	7
表 10 下行消息报文头取值 .....	7
表 11 交易时段 IMIX 报文交互 .....	10
表 12 TradingSessionStatus 业务要素 .....	11
表 13 TradingSessionStatusIMIX 报文标准.....	11
表 14 报价查询 IMIX 报文交互 .....	13
表 15 QueryRequest 业务要素.....	14
表 16 QueryRequestIMIX 报文标准.....	15
表 17 QueryResult IMIX 报文标准.....	16
表 18 密码修改 IMIX 报文交互 .....	18
表 19 UserRequest IMIX 报文标准.....	19
表 20 UserResponse IMIX 报文标准.....	19
表 21 BusinessMessageReject 业务要素.....	21
表 22 BusinessMessageReject IMIX 报文标准.....	21
表 23 Reject 业务要素.....	22
表 24 Reject IMIX 报文标准.....	22

表 25 会员端 API 端接口要求说明列表..... 23

## 前 言

本文件依据新平台本币交易接口业务需求起草。

本文件由中国外汇交易中心归口。

本文件提出单位：中国外汇交易中心。

本文件负责起草单位：中国外汇交易中心。

本文件主要起草人：杨帆、茅廷、卜天奇、周颖、冉杨鋈、唐军敏、邓可欣、刘丽莉、杨志表、胡冰冰、夏玉姣、李云毅、江云南。

## 引 言

随着我国金融改革不断深化，银行间市场信息化也在不断提高，金融标准逐步渗透到市场活动的各个层面。银行间市场标准工作组组长单位中国外汇交易中心积极贯彻总行战略部署，持续推进银行间市场标准化建设，牵头编制了JR/T 0065—2011《银行间市场基础数据元》、JR/T 0066—2011《银行间市场业务数据交换协议》、JR/T0078—2014《银行间市场数据接口》等多项金融行业标准，以此为基础打造了直通式处理接口、市场行情接口、报价接口、交易接口等多项数据接口服务，并面向市场推出了包括规范性指导文件、应用编程接口（API）、技术与业务支持在内的数据接口开发服务体系。IMIX协议开发指引作为体系中的重要环节，是数据接口系统开发的规范性约束文件。因此，本文件制定更加注重我国银行间市场自身特点和标准化要求，进一步发挥对系统建设的指导作用，为建设银行间市场统一业务数据交换体系奠定坚实基础。

## 修改历史

人员	审核人	版本号	协议包版本	日期	修改内容
冉杨鋆		0.0.1		2018/3/30	1. 创建文档。
李云毅、 赵晓韵、 江云南	冉杨鋆 卜天奇	1.0.0	1.138.0-2.8.3	2018/4/9	1. 正式发布，升级版本号。
江云南	冉杨鋆 卜天奇 邓可欣	1.0.1	1.139.3-2.10.0	2018/8/10	1. 删除章节 2.1.2 客户端场务操作的客户参考编号。 2. 2.1.1 客户参考编号编码规则章节，第 5 点“交易日当日，每个 API 用户的 8 位数字应唯一且递增，隔日重置。”改为“交易日当日，每个 API 用户的 8 位数字应唯一，隔日重置。” 3. 2.1.2 客户端报文反馈消息章节，增加“客户端进行报价或成交、以及场务进行应急操作没有客户参编号”说明。 4. 在 2.4 报文头章节中增加 2.4.3 报价查询接口。 5. 3.2.2 交易时段 IMIX 报文示例章节，字段“市场、交易方式、交易时段”增加必传说明。 6. 4 报价查询章节，增加可以按照报价编号、报价请求编号进行查询。 7. 6.1.2 失败反馈 IMIX 报文示例章节，字段“业务发生时间、客户参考编号、错误代码、错误信息、参考消息类型”增加必传说明。 8. 增加章节 7 接口要求说明。 9. 通篇将“机构 21 位码”改为“交易账户 21 位码”。
江云南	冉杨鋆 卜天奇	1.0.2	1.139.9-2.10.2	2018/10/23	1. 4 报价查询章节，增加字段“报价类别”。
江云南	冉杨鋆 卜天奇	1.0.2	1.139.9-2.10.2	2018/10/29	2. 7 接口要求说明章节，债券适用性中增加特殊债支持指示性报价。债券适用性中的“接口用户在上传报价时，债券为自贸区债券，本方交易账户应为自贸区 FT 账户。”挪到机构自行规范中。

江云南	冉杨璠 邓可欣 杨帆	1.0.3	1.140.3-2.10.3	2018/11/24	<ol style="list-style-type: none"> <li>2.4.3 报价查询接口，上行报文接收方标识改为：CFETS-TRADING-INFT-1、接收方子标识改为：NDM/QDM/ODM；下行报文发送方标识改为：CFETS-TRADING-INFT-1；发送方子标识改为：NDM/QDM/ODM。</li> <li>4.2.2 报价查询 IMIX 报文示例章节，增加说明：客户参考编号、报价编号、报价请求编号每次只能传一个。</li> </ol>
江云南	唐军敏 冉杨璠 杨帆	1.0.4	1.140.3-2.10.3	2018/12/19	<ol style="list-style-type: none"> <li>4.2 QueryRequest (U02) 章节，报价查询请求删除字段“本方交易账户代码”。</li> <li>7 接口要求说明章节，场务业务参数中删除“接口用户在上传指示性报价时，券面总额应符合交易中心设置指示性报价的“最大券面总额”和“最小券面总额”，且是“单位最小变动单位”的倍数。”</li> </ol>
江云南	唐军敏 冉杨璠 杨帆	1.0.5	1.140.3-2.10.3	2019/01/02	<ol style="list-style-type: none"> <li>7 接口要求说明章节，填写合法性中删除内容“外币债，应填写应计利息和汇率；特殊债，应填写应计利息”。</li> </ol>
江云南	唐军敏 冉杨璠 杨帆	2.0.0	1.140.6-2.10.4	2019/01/09	<ol style="list-style-type: none"> <li>2.1 客户参考编号编码规则章节，对原客户参考编号说明修改为“对报文或订单进行多次操作时，原客户参考编号应当填写上一次填写的客户参考编号”。2.1.1 客户参考编号编码规则增加计算模块中的“计算请求编号”的编码规则。</li> <li>3 交易时段章节，将表“交易时段 IMIX 报文交互”中的注释删除。</li> <li>4 报价查询章节，因做市报价不支持查询，故删除关于做市报价的内容。</li> </ol>



## 第2卷-通用功能

### 1 文档使用说明

#### 1.1 文档用途

《新平台本币交易接口开发指南》由中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心（以下简称“交易中心”）编写，用于指导软件开发人员使用新平台本币交易系统的可编程接口，为交易中心的成员单位开发新平台本币交易系统的交易接口程序。交易中心的成员单位可使用交易接口程序进行新平台本币交易系统程序化报价和成交，本文档目前仅包括新平台本币交易系统现券市场相关内容，新平台其他市场交易接口将在后续推出相关业务功能时发布。

本文档是《新平台本币交易接口开发指南》的《第二卷：通用功能》，对新平台本币交易接口的通用规则、交易时段、失败反馈、计算模块等各交易品种通用功能进行介绍。

#### 1.2 文档结构

《新平台本币交易接口开发指南（现券市场）》分为六卷，并包括两个附录，主要章节内容如下：

表1 章节列表

主要章节	说明
<b>第一卷：业务介绍</b>	
背景介绍	对交易中心、银行间市场和本币交易系统等介绍
业务概述	银行间本币市场的交易品种和交易流程
接口概述	本币交易系统接口的分类和功能介绍
IMIX 协议	介绍 IMIX 协议的报文结构
指南导读	如何使用《新平台本币交易接口开发指南》
<b>第二卷：通用功能</b>	
通用规则	对部分重要字段的规则进行统一说明
交易时段	交易系统通知开市、开盘、收盘、闭市的通知
报价查询	查询本方报价的流程
接口用户密码修改	修改接口用户密码的流程

失败反馈	反馈各类业务操作错误的报文和错误代码
<b>第三卷：对话报价交易流程</b>	
业务场景	对话报价交易流程的主要使用场景
现券买卖	现券买卖市场的业务要素和报文示例
<b>第四卷：点击成交与指示性报价交易流程</b>	
业务场景	点击成交与指示性报价交易流程的主要场景
现券买卖	现券买卖市场的业务要素和报文示例
<b>第五卷：请求报价交易流程</b>	
业务场景	请求报价交易流程的主要场景
现券买卖	现券买卖市场的业务要素和报文示例
<b>第六卷：匿名点击交易流程</b>	
业务场景	匿名点击交易流程的主要场景
现券买卖	现券买卖市场的业务要素和报文示例
<b>附录一：本币参考数据接口会员端 XML 文档</b>	
<b>附录二：本币成员端数据下载 IMIX 协议开发指引</b>	

2 通用规则

交易接口的各类报文中有部分通用字段必须按照一定规则使用，本节汇总相关规则进行统一说明。

2.1 客户参考编号

本币交易接口的报价、订单等报文要求填写客户参考编号（11 Cl0rdID）和原客户参考编号（41 OrigCl0rdID）字段。接口用户可以通过客户参考编号关联自己发送和接收的报文。对报文或订单进行多次操作时，原客户参考编号应当填写上一次填写的客户参考编号。

2.1.1 客户参考编号编码规则

客户参考编号字段是一个18位长度的字符串，编码规则如下：

- 1) 报价/订单报文须满足以下格式：  
OD+AAAABBBB(API用户ID，固定长度8位)+XXXXXXX(8位数字)
- 2) 行情/订阅报文须满足以下格式：  
MD+AAAABBBB(API用户ID，固定长度8位)+XXXXXXX(8位数字)
- 3) 查询报文须满足以下格式：  
QR+AAAABBBB(API用户ID，固定长度8位)+XXXXXXX(8位数字)
- 4) 计算模块报文须满足以下格式：  
CR+AAAABBBB(API用户ID，固定长度8位)+XXXXXXX(8位数字)
- 5) 若API用户ID超过8位，填写后8位，若不足8位右补0。
- 6) 交易日当日，每个API用户的8位数字应唯一，隔日重置。

2.1.2 客户端报文反馈消息

交易员在客户端进行报价或成交、以及场务进行应急操作时，交易接口也会收到相关反馈和通知。目前只能根据有无客户参考编号（11 Cl0rdID）进行区分，因客户端进行报价或成交、以及场务进行应急操作没有客户参考编号。

2.2 交易参与者

2.2.1 Parties 组件

交易接口使用Parties和PtysSubGrp两个重复组填写交易参与者的信息，例如现券买卖市场中的交易参与者信息如下表所示。

表2 交易成员信息示例

Parties					
453			NoPartyIDs	1	
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码
→	452		PartyRole	101	
→	PtysSubGrp				
→	802		NoPartySubIDs	2	
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID
→	→	523	PartySubID	XXX	描述交易机构来源。

					C-北金所 BC-债券通 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	

Parties和PtysSubGrp两个组件的主要IMIX域解释如下：

1) 453 NoPartyIDs

交易参与者的数量，也是重复组的数量。例如，做市商发送做市报价时，只需要填写报价的发送方，因此453域填写1。而在发送报价请求时，由于可以同时向多家做市商发送请求，重复组应当包括发起方和所有的做市商。

2) 448 PartyID

交易中心给交易成员分配的交易账户21位代码。

3) 452PartyRole

说明交易参与者在报文中承担的角色。常用枚举值如下：

- 报文的发起方：452填写101
- 报文的接收方：452填写102
- 成交的买方：452填写119
- 成交的卖方：452填写120
- 本方：452填写1
- 对手方：452填写17

4) 802 NoPartySubIDs

交易参与者的信息包括机构简称、资金账号等，相关信息用PartySubGrp重复组填写。802是重复组的数量。

5) 803PartySubIDType和523 PartySubID

交易参与者的每一项信息，用803域和523域的组合来表示，803域是信息的类型，523域是信息的内容。信息的类型如上表，或参见各报文的详细说明。

## 2.2.2 资产管理人/结算代理人以及分账信息

资产管理人使用同一个接口用户为自己或自己管理的非法人产品进行交易，Parties组件中的本方信息应根据本方实际进行交易的交易账户（投资管理人或非法人产品）填写机构21位代码，但是交易员姓名和交易员的ID必须填写该交易员在资产管理人机构中的用户姓名和用户ID。如果交易的本方是非法人产品，该交易员应当有相应的交易权限。

同样的，结算代理人使用同一个接口用户为自己或自己代理交易的境外投资人进行交易，Parties组件中的本方信息应根据实际进行交易的交易账户（结算代理人或境外投资者）填写机构21位代码、托管账户和资金账户，但是交易员姓名和交易员的ID必须填写该交易员在结算代理人机构中的用户姓名和用户ID。如果交易的本方是境外投资人，该交易员应当有相应的交易权限。

以资产管理人交易为例：

当不带分账信息时，应根据本方实际进行交易的交易账户（投资管理人或非法人产品）填写机构21位代码。若是资产管理人为自己进行交易，则机构21位码为资产管理人的21位码；若是资产管理人为自己管理的非法人产品进行交易，则机构21位码为非法人产品21位码（交易的本方是非法人产品则该交易员应当有相应的交易权限）。

当带分账信息时,机构21位码为资产管理人的21位码。

表3 交易参与者带分账信息示例

453			NoPartyIDs	2	重复组个数
→	448		PartyID	XXX	必须填写资产管理人的交易账户 21 位机构码
→	452		PartyRole	101	发起方
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID, 必须填写资产管理人的交易员 ID
→	448		PartyID	XXX	对手方交易账户 21 位机构码
→	452		PartyRole	102	对手方机构
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	对手方交易员 ID
<b>PreAllocGrp</b>					
78			NoAllocs	2	重复组次数
→	79		AllocAccount	XXX	投资产品 21 位码
→	467		IndividualAllocID	XXX	分账序号
→	80		AllocQty	20000	分账券面总额
→	79		AllocAccount	XXX	投资产品 21 位码
→	467		IndividualAllocID	XXX	分账序号
→	80		AllocQty	20000	分账券面总额

表4 交易参与者不带分账信息示例

453			NoPartyIDs	2	重复组个数
→	448		PartyID	XXX	资产管理人或非法人产品的机构 21 位码
→	452		PartyRole	101	发起方
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID, 必须填写资产管理人的交易员 ID
→	448		PartyID	XXX	对手方交易账户 21 位机构码
→	452		PartyRole	102	对手方机构
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	对手方交易员 ID

## 2.3 业务发生时间

交易接口收取的IMIX报文中都带有业务发生时间(60 TransactTime)域。本币交易系统使用业务发生时间防止并发冲突,因此在对报价进行修改或确认成交时,都需要填写从本币交易系统收到的报价业务发生时间。详见各交易方式的交易流程说明。

## 2.4 报文头

### 2.4.1 交易接口

新平台本币交易系统根据交易方式分成协商交易子系统、报价驱动子系统、订单驱动子系统。其中协商交易子系统（以下简称 NDM）提供对话报价交易接口功能；报价驱动子系统（以下简称 QDM）提供请求报价和点击成交报价交易接口功能，以及点击成交档位行情；订单驱动子系统（以下简称 ODM）提供匿名点击订单交易接口功能，以及匿名点击行情。

#### 2.4.1.1 上行报文

交易接口接收报文时，接口开发包根据配置文件自动填写如下域：

表5 上行消息报文头取值

49	SenderCompID	XXX	机构 21 位 ID
50	SenderSubID	XXX	API 用户 ID
56	TargetCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	报文接收方标识
57	TargetSubID	NDM/QDM-ESP/QDM/ ODM	报文接收方子标识 协商交易子系统取值 NDM； 报价驱动子系统，做市报价 取值 QDM-ESP，请求报价和 指示性报价取值 QDM； 订单驱动子系统取值 ODM；

#### 2.4.1.2 下行报文

交易接口发送报文时，接口开发包根据配置文件自动填写如下域：

表6 下行消息报文头取值

49	SenderCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	报文发送方标识
50	SenderSubID	NDM/QDM-ESP/QDM/ODM	报文发送方子标识 协商交易子系统取值 NDM； 报价驱动子系统，做市报价 取值 QDM-ESP，请求报价和 指示性报价取值 QDM； 订单驱动子系统取值 ODM；
56	TargetCompID	XXX	机构 21 位 ID
57	TargetSubID	XXX	API 用户 ID

### 2.4.2 行情接口

#### 2.4.2.1 上行报文

行情接口接收报文时，接口开发包根据配置文件自动填写如下域：

表7 上行消息报文头取值

49	SenderCompID	XXX	机构 21 位 ID
50	SenderSubID	XXX	API 用户 ID
56	TargetCompID	CFETS-MD-INFI-1	报文接收方标识

57	TargetSubID	QDM/ODM	报文接收方子标识 报价驱动子系统取值 QDM 订单驱动子系统取值 ODM
----	-------------	---------	--

#### 2.4.2.2 下行报文

行情接口发送报文时，接口开发包根据配置文件自动填写如下域：

表8 下行消息报文头取值

49	SenderCompID	CFETS-MD-INFI-1	报文发送方标识
50	SenderSubID	QDM/ODM	报文发送方子标识 报价驱动子系统取值 QDM 订单驱动子系统取值 ODM
56	TargetCompID	XXX	机构 21 位 ID
57	TargetSubID	XXX	API 用户 ID

#### 2.4.3 报价查询接口

##### 2.4.3.1 上行报文

报价查询接口接收报文时，接口开发包根据配置文件自动填写如下域：

表9 上行消息报文头取值

49	SenderCompID	XXX	机构 21 位 ID
50	SenderSubID	XXX	API 用户 ID
56	TargetCompID	CFETS-TRADING-INFT-1	报文接收方标识
57	TargetSubID	NDM/QDM/ODM	报文接收方子标识 协商交易子系统取值 NDM 报价驱动子系统取值 QDM 订单驱动子系统取值 ODM

##### 2.4.3.2 下行报文

报价查询接口发送报文时，接口开发包根据配置文件自动填写如下域：

表10 下行消息报文头取值

49	SenderCompID	CFETS-TRADING-INFT-1	报文发送方标识
50	SenderSubID	NDM/QDM/ODM	报文发送方子标识 协商交易子系统取值 NDM 报价驱动子系统取值 QDM 订单驱动子系统取值 ODM
56	TargetCompID	XXX	机构 21 位 ID
57	TargetSubID	XXX	API 用户 ID

#### 2.5 Reject (3) 消息说明

Reject (3) 消息属于通信层消息，当报文接收方收到的一条消息，由于违反了会话机制而造成不能适当地处理该消息时，会发出该会话拒绝消息。消息体中传输的域有以下三个：RefSeqNum (45)、SessionRejectReason (373)、Text (58)，其中 45 表示对应的消息序号、373 表示错误代码、58 表示

错误描述。

交易接口在消息传输过程中,当超过流控指标时会发送 Reject(3)消息,其中 SessionRejectReason (373) 取值 99-OTHER。



3 交易时段

新平台本币交易系统各子系统通过TradingSessionStatus报文通知市场开市、开盘、交易暂停、交易恢复、收盘闭市、集中报价开始时刻、集中报价结束时刻、集中匹配开始时刻。交易系统闭市后，交易系统不再允许接口用户登录，已登录接口用户应当退出登录。

3.1 业务流程

业务时序图如下：

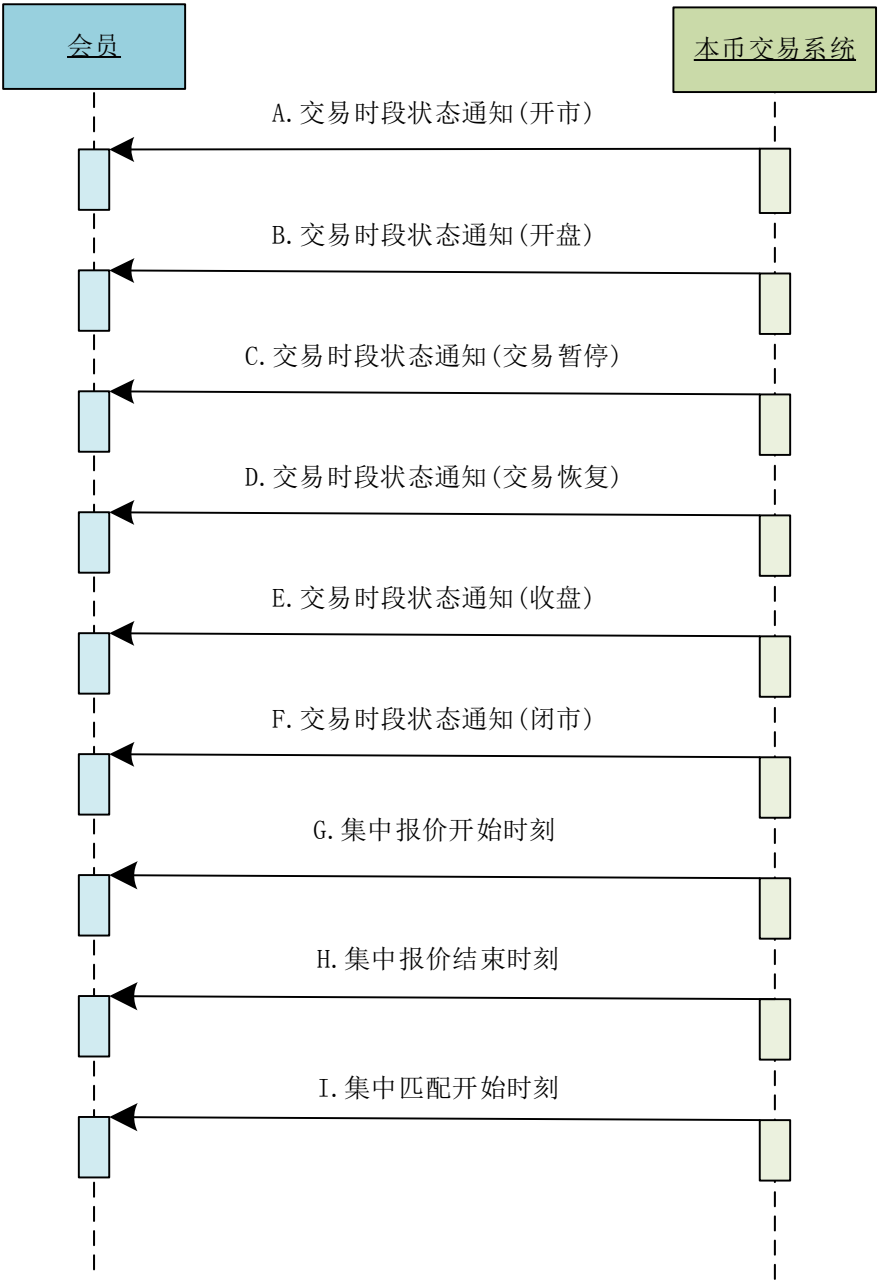


图1 交易时段时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表11 交易时段 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 接收开市通知	会员	←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus(340)=7 (Start)	本 币 交 易 系 统
(B) 接收开盘通知		←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus (340)=2 (Open)	
(C) 接收交易暂停通知		←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus (340)=8 (Break)	
(D) 接收交易恢复通知		←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus(340)=2 (Open)	
(E) 接收收盘通知		←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus (340)=3 (Closed)	
(F) 接收闭市通知		←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus (340)=9 (Ended)	
(G) 接收集中报价开始时刻通知		←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus (340)=18 (集中报价开始时刻)	
(H) 接收集中报价结束时刻通知		←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus (340)=22 (集中报价结束时刻)	
(I) 接收集中匹配开始时刻通知		←	<b>h - TradingSessionStatus</b> MarketIndicator(10176)=① TradeMethod(10317)=② TradSesStatus (340)=19 (集中匹配开始时刻)	

### 3.2 TradingSessionStatus (h)

#### 3.2.1 业务要素

表12 TradingSessionStatus 业务要素

字段	IMIX 域	取值说明	说明
市场	10176 MarketIndicator	4-现券买卖	
交易时段状态	340 TradSesStatus	7-Start（开市） 2-Open（开盘/交易恢复） 8-Break（交易暂停） 3-Closed（收盘） 9-Ended（闭市） 18-集中报价开始时刻 22-集中报价结束时刻 19-集中匹配开始时刻	
交易方式	10317 TradeMethod	1-协商 5-点击成交 4-请求报价 3-匿名点击	
时间	341 TradSesStartTime	格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	当市场状态取值“7-开市、18-集中报价开始时刻、19-集中匹配开始时刻”时传输该域
	342 TradSesOpenTime		当市场状态取值“2-开盘/交易恢复”时传输该域
	344 TradSesCloseTime		当市场状态取值“3-收盘、8-交易暂停”时传输该域
	345 TradSesEndTime		当市场状态取值“9-闭市、22-集中报价结束时刻”时传输该域

## 3.2.2 IMIX 报文示例

表13 TradingSessionStatusIMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX.2.0	报文版本号
9	BodyLength	113	报文体长度
35	MsgType	h	TradingSessionStatus
34	MsgSeqNum	1	报文序列号
52	SendingTime	20130624-08:00:00.000	报文发送时间
49	SenderCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50	SenderSubID	XXX	
56	TargetCompID	XXX	
57	TargetSubID	XXX	
MessageBody			
10176	MarketIndicator	4	市场，必传
10317	TradeMethod	1	交易方式，必传
340	TradSesStatus	7	交易时段状态，必传
341	TradSesStartTime	20170206-08:29:00.000	时间

			当市场状态取值“7-开市、18-集中报价开始时刻、19-集中匹配开始时刻”时传输该域
342	TradSesOpenTime	20170206-08:29:00.000	时间 当市场状态取值“2-开盘/交易恢复”时传输该域
344	TradSesCloseTime	20170206-08:29:00.000	时间 当市场状态取值“3-收盘、8-交易暂停”时传输该域
345	TradSesEndTime	20170206-08:29:00.000	时间 当市场状态取值“9-闭市、22-集中报价结束时刻”时传输该域
StandardTrailer			
10	Checksum	050	

4 报价查询

通过QueryRequest报文按客户端参考编号或者报价编号、报价请求编号查询本方报价，支持查询对话报价、指示性报价、请求报价、请求回复。

4.1 业务流程

业务时序图如下：

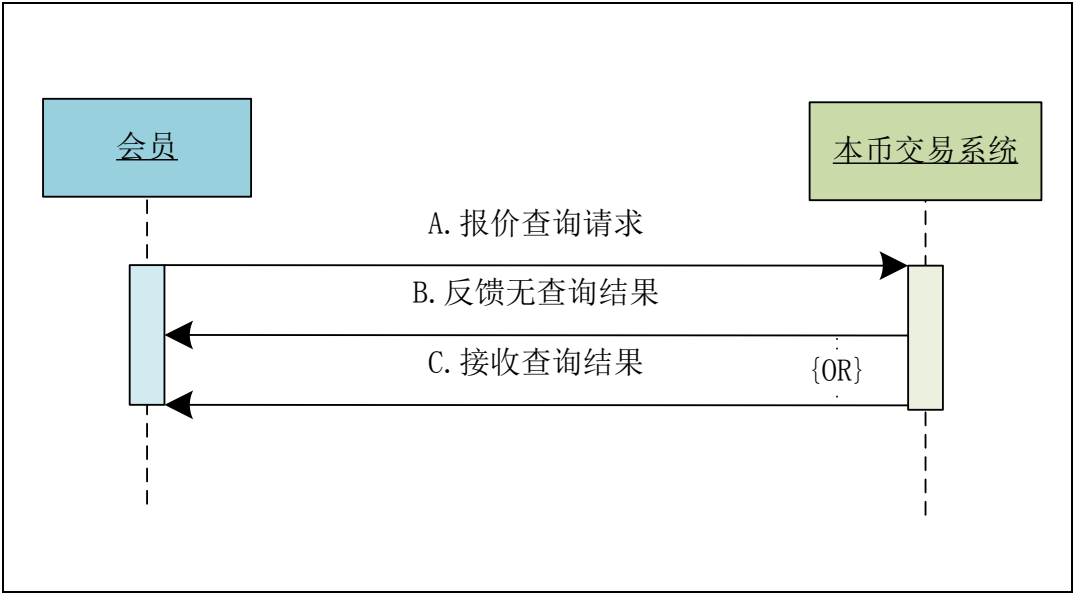


图2 报价查询时序图

业务流程中的 IMIX 报文交互如下：

表14 报价查询 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 报价查询请求	会员	→	<b>U02 - QueryRequest</b> QueryRequestID(10168)=① QueryType(10270)=47(报价状态查询) MarketIndicator(10176)=4(现券买卖) QueryConditionValue(11155)=②（报价的客户参考编号（11 ClordID）/报价编号（117ClordID）/（131QuoteReqID））	本币交易系统
(B) 接收报价查询结果反馈（未找到查询结果）		←	<b>U01 - QueryResult</b> QueryRequestID(10168)=① QueryType(10270)=47(报价状态查询) QueryConditionValue(11155)=②（报价的客户参考编号（11 ClordID）/报价编号（117ClordID）/（131QuoteReqID）） TotNumReports(911)=0(查询结果的总数, 0 即表示未查到) ApplErrorCode(11251)=③	

IMIX 2.0			
(C) 接收报价查询结果反馈（对话报价）	←	<b>S - Quote</b> QueryRequestID(10168)=① QuoteType(537)=1(对话报价) ClOrdID(11)=② QuoteID(117)=③ QuoteStatus(297)=16(正常)/19(撤销)/107(全部成交)/21(过期)/5(拒绝)	
(C) 接收报价查询结果反馈（指示性报价）	←	<b>S - Quote</b> QueryRequestID(10168)=① QuoteType(537)=117(指示性报价) ClOrdID(11)=② QuoteID(117)=③ QuoteStatus(297)=16(正常)/19(撤销)/21(过期)	
(C) 接收报价查询结果反馈（请求报价）	←	<b>R - QuoteRequest</b> QueryRequestID(10168)=① QuoteType(537)=112(请求报价) ClOrdID(11)=② QuoteReqID(131)=③ QuoteStatus(297)=16(正常)/19(撤销)/21(过期)/115(报价方拒绝)/107(全部成交)	
(C) 接收报价查询结果反馈（请求回复）	←	<b>S - Quote</b> QueryRequestID(10168)=① QuoteType(537)=113(请求回复) ClOrdID(11)=② QuoteID(117)=③ QuoteStatus(297)=16(正常)/19(撤销)/21(过期)/107(全部成交)	

QueryResult报文仅用于反馈查询无结果。如果查询到报价，交易系统反馈原报价的报文，详细内容见各交易方式的交易流程。

## 4.2 QueryRequest (U02)

报价查询报文。

### 4.2.1 业务要素

表15 QueryRequest 业务要素

字段	IMIX 域	说明
查询请求编号	10168 QueryRequestID	QR(前缀) + AAAABBBB(API 用户名称, 8 位) + XXXXXXXX(八位数字流水号) 编号规则见“2.1 客户参考编号”小节。
消息日期	60 TransactTime	格式为: YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss 前八位表示消息日期
市场	10176 MarketIndicator	枚举值:

		4-现券买卖
操作类型	10270 QueryType	枚举值： 47-报价状态查询
报价类别	537 QuoteType	枚举值： 1-对话报价 112-请求报价 113-请求回复 117-指示性报价
需要查询报价的客户 参考编号	11154 QueryCondition	6
	11155 QueryConditionValue	需要查询的客户参考编号，只有交易接口发起的报价才有客户参考编号。
需要查询报价的报价 编号	11154 QueryCondition	9
	11155 QueryConditionValue	需要查询对话报价、指示性报价、请求回复的报价编号
需要查询报价的报价 请求编号	11154 QueryCondition	11
	11155 QueryConditionValue	需要查询请求报价的报价请求编号

#### 4.2.2 IMIX 报文示例

表16 QueryRequestIMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
StandardHeader				
8		BeginString	IMIX.2.0	协议包版本号
9		BodyLength	1	报文长度
35		MsgType	U02	报文类型
34		MsgSeqNum	24	报文序列号
52		SendingTime	20070820-12:40:00.000	报文发送时间，格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49		SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50		SenderSubID	XXX	
56		TargetCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	
57		TargetSubID	XXX	
MessageBody				
10168		QueryRequestID	XXXX	查询请求编号 必传
60		TransactTime	20070820-12:40:00.000	消息日期，必传， 格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss 前八位表示消息日期
10270		QueryType	47	操作类型，必传
537		QuoteType	1	报价类别，必传
10176		MarketIndicator	4	市场，必传
11153		NoQueryConditions	3	重复组次数 该组件必传且客户参考编号、报价编号、报价请求编号每次只能传一个

→	11154	QueryCondition	6	6-客户参考编号
→	11155	QueryConditionValue	XXXX	需要查询报价的客户参考编号
→	11154	QueryCondition	9	9-报价编号
→	11155	QueryConditionValue	XXXX	需要查询报价的报价编号 查询对话报价、指示性报价、请求 回复的报价编号
→	11154	QueryCondition	11	11-报价请求编号
→	11155	QueryConditionValue	XXXX	需要查询报价的报价请求编号 查询请求报价的报价请求编号
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	50	

### 4.3 QueryResult (U01)

QueryResult报文仅用于反馈查询无结果。如果查询到报价，交易系统反馈原报价的报文，详细内容见各交易方式的相应报文。

#### 4.3.1 IMIX 报文示例

业务要素参见QueryResult报文。

表17 QueryResult IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
StandardHeader				
8		BeginString	IMIX.2.0	固定值
9		BodyLength	1	消息体长度
35		MsgType	U01	报文类型
34		MsgSeqNum	24	报文序列号
52		SendingTime	20070820-12:40:00.000	消息发送时间
49		SenderCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50		SenderSubID	XXX	
56		TargetCompID	XXX	
57		TargetSubID	XXX	
MessageBody				
10270		QueryType	47	操作类型，必传
10168		QueryRequestID	XXXX	查询请求编号，必传
911		TotNumReports	0	必传 始终为0，即表示未查到
11153		NoQueryConditions	3	重复组次数，取值以实际消息传输为准。 该组件必传
→	11154	QueryCondition	6	6-客户参考编号
→	11155	QueryConditionValue	XXXX	
→	11154	QueryCondition	9	9-报价编号
→	11155	QueryConditionValue	XXXX	
→	11154	QueryCondition	11	11-报价请求编号



→	11155	QueryConditionValue	XXXX	
11251		ApplErrorCode	XXXX	错误代码，必传
11261		ApplErrorDesc	XXXX	错误原因，必传
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	XXX	校验和

5 接口用户密码修改

接口用户可以通过UserRequest报文修改自己的密码。

5.1 业务流程

业务时序图如下：

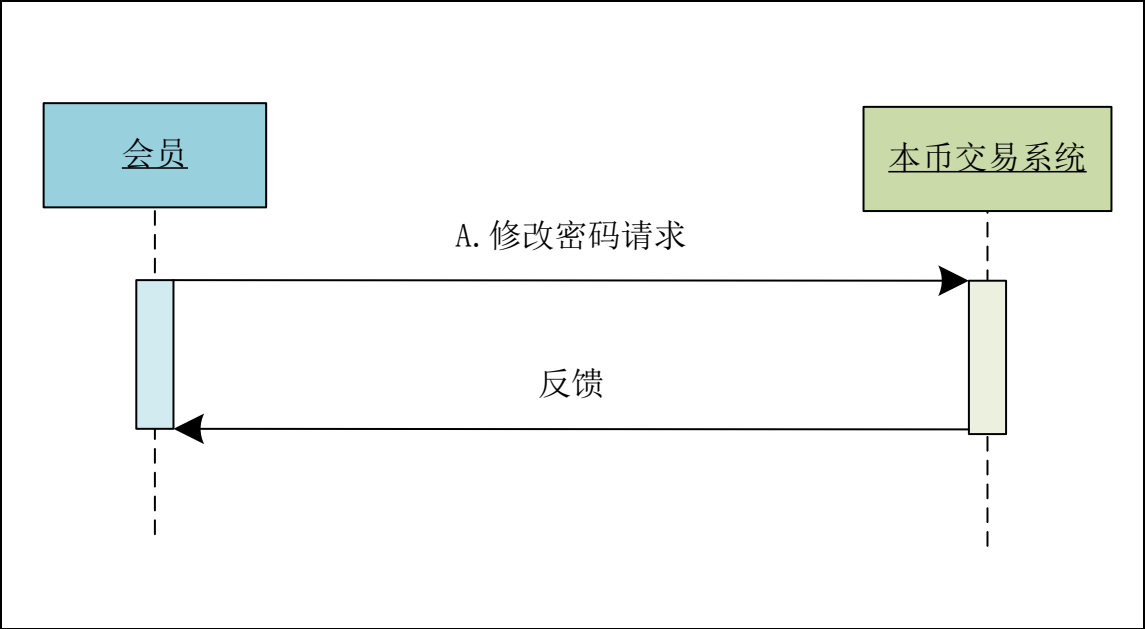


图3 密码修改时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表18 密码修改 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 接口用户密码修改请求	会员	→	<b>BE - UserRequest</b> Username (553)=① Password (554)=② NewPassword (925)=③ UserRequestType (924)=3 (修改密码) UserRequestID (923)=④	本币交易系统
(B) 接收密码修改请求反馈		←	<b>BF - UserResponse</b> Username (553)=① UserStatus (926)=4 (密码错误)/5 (修改成功)/99 (其他原因错误) UserStatusText (927)=⑤ UserRequestID (923)=④	

5.2 UserRequest (BE)

UserRequest报文用于修改用户密码。

5.2.1 IMIX 报文示例

表19 UserRequest IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX.2.0	报文版本号
9	BodyLength	1	报文体长度
35	MsgType	BE	消息类型
34	MsgSeqNum	32	报文序列号
52	SendingTime	20070820-12:40:00.000	消息发送时间
49	SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50	SenderSubID	XXX	
56	TargetCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	
57	TargetSubID	XXX	
MessageBody			
553	Username	Test001	API 用户 ID，必传
554	Password	Tradex124	原始密码，必传
925	NewPassword	Tradex125	新密码，必传
924	UserRequestType	3	必传，枚举值： 3-修改密码
923	UserRequestID	XXXX	用户自定义编号，无规则要求，必传。
StandardTrailer			
10	Checksum	XXX	

### 5.3 UserResponse (BF)

UserResponse 报文用于反馈用户密码修改结果。

#### 5.3.1 IMIX 报文示例

表20 UserResponse IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX.2.0	报文版本号
9	BodyLength	1	报文体长度
35	MsgType	BF	消息类型
34	MsgSeqNum	32	报文序列号
52	SendingTime	20070327-10:30:00.000	报文发送时间
49	SenderCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50	SenderSubID	XXX	
56	TargetCompID	XXX	
57	TargetSubID	XXX	
MessageBody			
553	Username	Test001	用户名，必传
926	UserStatus	5	必传

			4-密码错误 5-修改成功 99-其他原因错误
927	UserStatusText	XXXX	状态备注 当 926UserStatus 取值“4-密码错误、 99-其他原因错误” 时传输该字段
923	UserRequestID	XXX	用户自定义编号，必传
<b>StandardTrailer</b>			
10	Checksum	XXX	

## 6 失败反馈

本币交易系统收到用户发送的报文后，如果未通过合法性检验，统一使用BusinessMessageReject或Reject报文反馈失败消息。

### 6.1 BusinessMessageReject(j)

#### 6.1.1 业务要素

表21 BusinessMessageReject 业务要素

字段	IMIX 对应	说明
业务发生时间	60TransactTime	格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
客户参考编号	11ClOrdID	用户发送报文中指定的客户参考编号
错误代码	11251ApplErrorCode	
错误信息	11261ApplErrorDesc	
参考消息类型	372 RefMsgType	取值为客户参考编号对应的 API 上行消息的消息类型，如：R、U32、AJ、AG、S、Z、D、F

#### 6.1.2 IMIX 报文示例

表22 BusinessMessageReject IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
StandardHeader				
8		BeginString	IMIX.2.0	报文版本号
9		BodyLength	1	报文体长度
35		MsgType	j	报文类型
34		MsgSeqNum	24	报文序列号
52		SendingTime	20150820-12:40:00.000	报文发送时间
49		SenderCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50		SenderSubID	XXX	
56		TargetCompID	XXX	
57		TargetSubID	XXX	
MessageBody				
60		TransactTime	20150820-12:40:00.000	业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss 必传
11		ClOrdID	XXX	客户参考编号，必传
11251		ApplErrorCode	XXX	错误代码，必传
11261		ApplErrorDesc	XXX	错误信息，必传
372		RefMsgType	R	参考消息类型，必传
StandardTrailer				
10		Checksum	XXX	校验和

### 6.2 Reject(3)

交易接口在消息传输过程中，当超过流控指标时会发送Reject(3)消息。

6.2.1 业务要素

表23 Reject 业务要素

字段	IMIX 对应	说明
消息序号	45 RefSeqNum	
错误代码	373 SessionRejectReason	枚举值：99-OTHER
错误描述	58 Text	

6.2.2 IMIX 报文示例

表24 Reject IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIXT.1.0	报文版本号
9	BodyLength	1	报文体长度
35	MsgType	3	报文类型
34	MsgSeqNum	24	报文序列号
52	SendingTime	20150820-12:40:00.000	报文发送时间
49	SenderCompID	CFETS-TRADING-INFI-1	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50	SenderSubID	XXX	
56	TargetCompID	XXX	
57	TargetSubID	XXX	
MessageBody			
45	RefSeqNum	123	消息序号
373	SessionRejectReason	99	错误代码 枚举值：99-OTHER
58	Text	XXX	错误描述
StandardTrailer			
10	Checksum	XXX	校验和

## 7 接口要求说明

表25 会员端 API 端接口要求说明列表

类别	填写要求	规范方式
<b>机构自行规范</b>		
	接口用户在上传对话报价、请求报价、点击成交确认报价时，发起方交易员具有现券市场普通交易权限、以及相应的接口报价权限。	机构自行规范
	接口用户在上传请求回复、指示性报价、做市报价时，发起方交易员具有现券市场做市管理权限、以及相应的接口报价权限。	机构自行规范
	接口用户在上传匿名点击订单时，发起方交易员具有现券市场匿名点击权限，以及相应的接口报价权限。	机构自行规范
	接口用户在上传请求报价时，同一交易员同一只债券的请求报价不能重复提交。	机构自行规范
	接口用户在进行修改、撤销报价操作时，应做好机构内部管理，仅撤销、修改本机构管理的交易员的报价。	机构自行规范
	接口用户在上传点击成交报价时，应不点击确认本方发起的做市报价。	机构自行规范
	接口用户在上传银行间请求回复时，请求回复的券面总额应符合小于等于请求报价的请求量。	机构自行规范
	接口用户在上传请求回复时，请求回复时间应不晚于请求有效时间。	机构自行规范
	接口用户在上传报价时，债券为自贸区债券，本方交易账户应为自贸区 FT 账户。	机构自行规范
<b>填写合法性</b>		
	接口用户在上传报价时，按照指引填写完整交易要素，不能多填也不可少填；	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传报价时，按照指引填写输入要素的精度及长度要求； 输入要素是枚举值输入，应按照指引填写要求输入枚举值； 按照指引规范填写客户端参考编号、分账参考编号、时间格式等。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传待分账的请求报价时，分账的券面总额总量应与请求报价的量保持一致。	未按要求填写则发送失败
<b>债券适用性</b>		
	接口用户在上传对话报价、请求报价、做市报价、指示性报价时，应只可填写可交易的债券。 其中： 外币债仅支持对话报价、做市报价； 特殊债仅支持对话报价、请求报价、指示性报价； 到期违约债仅支持对话报价。 具体列表可参考 RDI 接口债券列表信息。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传北金所做市报价时，应只可填写北金所债券。 其中： 外币债仅支持对话报价、做市报价； 特殊债仅支持对话报价、请求报价、指示性报价； 到期违约债仅支持对话报价。 具体列表可参考 RDI 接口债券列表信息。	未按要求填写则发送失败

	接口用户在上传连续匹配的匿名点击订单，应为匿名点击可交易债券列表中连续匹配债券。 具体列表可参考 RDI 接口可交易债券列表。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传集中匹配的匿名点击订单，应为匿名点击可交易债券列表中集中匹配债券。 具体列表可参考 RDI 接口可交易债券列表。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传报价时，所选择的交易账户不可为交易债券的发行人。	未按要求填写则发送失败
<b>场务业务参数</b>		
	接口用户在上传报价时，净价应符合交易中心设置的“最高净价”和“最低净价”范围。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传报价时，到期收益率应符合交易中心设置的“最高到期收益率”和“最低到期收益率”范围。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传报价时，高收益率列表的债券，净价、到期收益率不限制最高及最低。 具体列表可参考 RDI 接口高收益债列表信息。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传对话报价时，券面总额应符合交易中心设置对话报价的“最大券面总额”和“最小券面总额”，且是“单位最小变动单位”的倍数。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传对话报价时，发起方交易账户和对手方交易账户应不一致。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传请求报价时，请求总量、分账券面总额应符合交易中心设置请求报价的“最大券面总额”和“最小券面总额”，且是“单位最小变动单位”的倍数。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传银行间请求回复时，回复券面总额应是“单位最小变动单位”的倍数。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传点击成交确认报价时，券面总额是点击成交“单位最小变动单位”的倍数。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传银行间做市报价时，券面总额和最大显示券面总额应符合交易中心设置银行间做市报价的“最大券面总额”和“最小券面总额”，且是“单位最小变动单位”的倍数。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传北金所做市报价时，券面总额应符合交易中心设置北金所做市报价的“最大券面总额”和“最小券面总额”，且是“单位最小变动单位”的倍数。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传匿名点击订单连续匹配时，券面总额应符合交易中心设置匿名点击报价连续匹配的“最大券面总额”和“最小券面总额”，且是“单位最小变动单位”的倍数。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传匿名点击订单集中匹配时，券面总额应符合交易中心设置匿名点击报价集中匹配的“最大券面总额”和“最小券面总额”，且是“单位最小变动单位”的倍数。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传请求报价时，请求有效时间不能晚于“当前时间+交易中心设置的最长请求有效时间”。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传带分账的请求报价和请求确认成交时，分账的产品数量不能超过交易中心设置的最大分账数量。	未按要求填写则发送失败
	接口用户在上传带分账的请求报价时，请求回复机构数量应大于等于“最小	未按要求填写则发



	请求回复机构数”，小于等于“最大请求回复机构数”。 定向债券的最小请求回复机构数为 1。	送失败
	接口用户上传请求报价时，填写的请求回复机构中不应包括本方交易账户。	未按要求填写则发送失败
	接口用户上传做市报价、指示性报价时，买入净价应小于卖出净价。	未按要求填写则发送失败
	接口用户上传银行间做市报价，清算速度、结算方式应为交易中心设置的银行间清算速度、结算方式。	未按要求填写则发送失败
	接口用户上传北金所做市报价，清算速度、结算方式应为交易中心设置的北金所清算速度、结算方式。	未按要求填写则发送失败

## 参 考 文 献

- [1] JR/T 0065-2011 银行间市场基础数据元
  - [2] JR/T 0066-2011 银行间市场业务数据交换协议
  - [3] JR/T 0078-2014 银行间市场数据接口
-