

# 中国外汇交易中心 IMIX 协议开发指引

CFETS/K1690—2018

---

## 参考数据接口 XML 文档

(V2.3 版)



目 次

前言 ..... III

引言 ..... IV

修 改 历 史 ..... V

1 范围 ..... 1

2 规范性引用文件 ..... 1

3 文件维护与管理 ..... 1

4 文件使用说明 ..... 1

    4.1 IMIX 报文结构 ..... 1

    4.2 报文域取值规范 ..... 2

    4.3 期限转换规则 ..... 2

    4.4 消息唯顺序号生成规则 ..... 2

5 业务场景开发 ..... 2

    5.1 投资发行信息 ..... 3

        5.1.1 待发行工具信息 ..... 3

            5.1.1.1 招标发行信息 ..... 3

            5.1.1.2 报价发行信息 ..... 8

            5.1.1.3 待发行工具信息 XML 消息示例 ..... 12

    5.2 本币基础品种信息 ..... 14

        5.2.1 债券信息（银行间） ..... 14

        5.2.2 债券信息（银行间）XML 消息示例 ..... 18

        5.2.3 资产支持证券信息 ..... 21

        5.2.4 资产支持证券信息 XML 消息示例 ..... 23

        5.2.5 资产支持证券历史信息 ..... 24

        5.2.6 资产支持证券历史信息 XML 消息示例 ..... 25

        5.2.7 资产支持证券信用评级 ..... 25

        5.2.8 资产支持证券信用评级 XML 消息示例 ..... 26

        5.2.9 预发行债券信息 ..... 26

        5.2.10 预发行债券信息 XML 消息示例 ..... 28

        5.2.11 标准债券远期交割券信息 ..... 30

        5.2.12 标准债券远期交割券信息 XML 消息示例 ..... 30

        5.2.13 债券信息（国际） ..... 30

        5.2.14 债券信息（国际）XML 消息示例 ..... 34

        5.2.15 上市前债券信息（银行间） ..... 37

        5.2.16 上市前债券信息（银行间）XML 消息示例 ..... 39

        5.2.17 高收益债券信息 ..... 41

5.2.18 高收益债券信息 XML 消息示例 .....	41
5.3 本币银行间交易成员信息 .....	42
5.3.1 交易成员基本信息 .....	42
5.3.2 交易成员基本信息 XML 消息示例 .....	42
5.3.3 交易成员通讯录信息 .....	43
5.3.4 交易成员通讯录信息 XML 消息示例 .....	44
5.4 本币国际交易成员信息 .....	44
5.4.1 交易成员基本信息 .....	44
5.4.2 交易成员基本信息 XML 消息示例 .....	45
5.4.3 交易成员通讯录信息 .....	45
5.4.4 交易成员通讯录信息 XML 消息示例 .....	46
5.5 本币交易产品接口信息 .....	46
5.5.1 质押券折算率（匿名点击）信息 .....	47
5.5.2 质押券折算率（匿名点击）信息 XML 消息示例 .....	47
5.5.3 标准利率互换信息 .....	48
5.5.4 标准利率互换信息 XML 消息示例 .....	49
5.5.5 标准债券远期信息 .....	50
5.5.6 标准债券远期信息 XML 消息示例 .....	51
5.5.7 利率互换（固浮）信息 .....	52
5.5.8 利率互换（固浮）信息 XML 消息示例 .....	53
5.6 本币其他信息接口 .....	54
5.6.1 交易节假日信息 .....	54
5.6.2 交易节假日信息 XML 消息示例 .....	54
5.6.3 结算节假日信息 .....	55
5.6.4 结算节假日信息 XML 消息示例 .....	55
5.6.5 错误代码对照表信息 .....	56
5.6.6 错误代码对照表信息 XML 消息示例 .....	56
5.7 本币机构主从关系 .....	57
5.7.1 机构主从关系信息 .....	57
5.7.2 机构主从关系信息 XML 消息示例 .....	57
5.8 债券通会员信息 .....	58
5.8.1 债券通会员信息 .....	58
5.8.2 债券通会员信息 XML 消息示例 .....	58
5.9 本币机构经办行经办产品信息 .....	59
5.9.1 机构经办行经办产品信息 .....	59
5.9.2 机构经办行经办产品信息 XML 消息示例 .....	59
5.10 X-Bond 可交易债券信息 .....	60
5.10.1 X-Bond 可交易债券信息 .....	60
5.10.2 X-Bond 可交易债券信息 XML 消息示例 .....	60
参考文献 .....	62

图 1 IMIX 报文结构 .....

表 1	964 消息唯顺序号的生成规则 .....	2
表 2	招标发行信息.....	3
表 3	报价发行信息.....	8
表 4	债券信息（银行间）.....	14
表 5	资产支持证券信息.....	21
表 6	资产支持证券历史信息.....	24
表 7	资产支持证券信用评级.....	25
表 8	预发行债券信息.....	26
表 9	标准债券远期可交割券信息.....	30
表 10	债券信息（国际）.....	30
表 11	上市前债券信息（银行间）.....	37
表 12	高收益债券信息.....	41
表 13	交易成员基本信息.....	42
表 14	交易成员通讯录信息.....	43
表 15	交易成员基本信息.....	44
表 16	交易成员通讯录信息.....	45
表 17	质押券折算率（匿名点击）信息.....	47
表 18	标准利率互换信息.....	48
表 19	标准债券远期信息.....	51
表 20	利率互换（固浮）信息.....	52
表 21	交易节假日信息.....	54
表 22	结算节假日信息.....	55
表 23	错误代码对照表信息.....	56
表 24	机构主从关系信息.....	57
表 25	债券通会员信息.....	58
表 26	机构经办行经办产品信息.....	59
表 27	X-Bond 可交易债券信息 .....	60

## 前 言

本文件依据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）参考数据接口XML内容起草。

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：曹浪。

## 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。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/T 0078—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，本次修订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	日期	修改内容
曹浪		0.1	2015-12-29	1. 创建文档
曹浪		0.1	2015-01-15	根据 RDI 需求, 修改 XML 以下内容: 1. 报表 (即历史数据) 按投资人的待发行工具信息生成, 即不包含投资人机构名称和投资人机构 21 位码信息, 删除 5.1.1 章节待发行工具信息投资人机构名称和投资人机构 21 位码; 2. 删除 5.1.1 章节待发行工具信息消息类型、消息唯顺序号、交易成员群组字段
曹浪		0.2	2016-10-31	1. 新增 5.2-5.12 章节内容
丁恰恰		1.0	2017-04-13	1. 5.2.1、5.2.2 债券信息章节, 新增字段流通范围, 对应 xml 名称为 TrdPubInd; 2. 5.2.13、5.2.14 债券信息 (国际) 章节, 新增字段流通范围, 对应 XML 名称为 TrdPubInd; 3. 5.2.11 章节“标准债券远期可交割券信息”名称调整为“标准债券远期交割券的转换因子”, 对应的 XML 5.2.12 章节名称调整为“标准债券远期交割券的转换因子 XML 消息示例” 4. 5.3.3、5.3.4 章节交易成员账号托管信息、5.3.5、5.3.6 章节交易成员账户资金信息、5.4.3、5.4.4 章节交易成员账户托管信息、5.4.5、5.4.6 章节交易账户资金信息、5.5 章节本币基准利率接口信息、5.6.1、5.6.2 章节信用拆借信息、5.6.3、5.6.4 章节质押式回购信息、5.6.5、5.6.6 章节利率互换 (固浮) 信息、5.6.7、5.6.8 章节利率互换 (基准) 信息、5.6.9、5.6.10 章节远期利率协议信息、5.6.11、5.6.12 章节标准利率互换信息、5.6.13、5.6.14 章节标准债券远期、5.7.5、5.7.6 章节错误代码对照表信息、5.8 章节本币机构内部数据、5.9 章节北金所数据、5.11 章节本币限额信息接口、5.12 章节外汇基础信息接口,



				<p>以上描述的章节均删除。</p> <p>5. 新增 5.5.3、5.5.4 标准利率互换信息章节，5.5.5、5.5.6 标准债券远期信息章节。</p> <p>6. 指引评审通过，版本号升为 1.0</p>
丁恰恰		1.1	2017-05-04	<p>1. 5.5.1 质押券折算率(匿名点击)信息章节，新增 R021 折算率，R001，R007，R014 精度改为 4，单位%删除。对应 5.5.2 质押券折算率(匿名点击)信息章节 XML 消息示例章节进行对应修改。</p>
丁恰恰		1.2	2017-05-23	<p>1. 新增 5.8 债券通会员信息</p> <p>2. 修改 5.3.3、5.4.3 交易成员通讯录信息章节里面的字段交易成员内部 ID 为交易成员 ID，并添加备注机构 6 位码。字段交易员内部 ID 修改为交易员 ID</p> <p>3. 5.3.1、5.4.1 交易成员基本信息章节，字段交易成员 ID 新增备注机构 6 位码。字段机构代码新增备注机构 21 位代码。</p>
杨志表		1.3	2017-06-13	<p>1. 新增章节 5.6.5、5.6.6 错误代码对照表信息及 XML 消息示例</p>
陈潇		1.4	2017-08-18	<p>1. 新增 5.9 章节本币机构经办行经办产品信息</p> <p>2. 5.6 章节本币其他信息接口中，增加枚举值 53-同业存款、41-同业借款</p>
丁恰恰		1.5	2017-10-20	<p>1. 5.2.1 债券信息章节、5.2.13 债券信息(国际)章节新增字段特殊债、到期违约债、再次流通起始日、再次流通终止日。5.2.2 债券信息 XML 消息示例章节、5.2.14 债券信息(国际)XML 消息示例同步更新。</p> <p>2. 5.2.3 资产支持证券信息章节，新增字段特殊债。5.2.4 资产支持证券 XML 消息示例章节同步更新。</p>
丁恰恰		1.5	2017-11-02	<p>1. 根据历史遗留问题，修改 5.1.1 待发行工具信息、5.2.1 债券信息、5.2.3 资产支持证券信息、5.2.9 预发行债券信息、5.2.13 债券信息(国际)章节中 865 号域 EventType 业务要素与 XML 消息不一致的地方。</p>
江云南		1.6	2017-12-18	<p>1. 5.2.11、5.2.12 标准债券远期交割券的转换因子、标准债券远期交割券的转换因子 XML 消息示例章节名字改为“标准债券远期交割券信息、标准债券远期交割券信息 XML 消息示例”，删除字段“转换因子”。</p>

				2. 新增章节 5.10 X-Bond 可交易债券信息。
江云南		1.7	2018-01-02	1. 5.6.2 交易节假日信息 XML 消息示例、5.6.4 结算节假日信息 XML 消息示例章节, 根据实际报文传输修改 XML 消息示例。
江云南		1.8	2018-01-16	1. 新增章节 5.5.7 利率互换(固浮)信息、5.5.8 利率互换(固浮)信息 XML 消息示例。
江云南		1.9	2018-02-07	1. 5.2.1、5.2.1 债券信息章节, 字段“再发行标识、再发行日期、再发行量”改为“增发标识、增发上市日、增发量(亿)”, 新增字段“增发发行日”。 2. 5.2.13、5.2.14 债券信息(国际)章节, 字段“再发行标识、再发行日期、再发行量”改为“增发标识、增发上市日、增发量(亿)”, 新增字段“增发发行日”。 3. 新增 5.2.15、5.2.16 上市前债券信息(银行间)章节。 4. 5.10 X-Bond 可交易债券信息章节, 字段“代码”增加说明: 上市前债券代码带 P 传输。
张慧珠、石春霞		2.0	2018-03-22	1. 新增 5.2.17、5.2.18 高收益债券信息章节。
石春霞		2.1	2018-04-02	1. 5.2.17、5.2.18 高收益信息章节, 删除行业字段以及相关 XML 示例。
李云毅		2.2	2018-04-04	1. 章节 5.1.1 待发行工具信息章节中的工具类型字段删除枚举值: 政府支持债券
陶莹		2.3	2018-08-22	1. 章节 5.6.1 交易节假日信息和 5.6.3 结算节假日信息, 字段“市场名称”, 删除枚举值: 49-北金所、50-交易所、6-资产支持证券, 新增枚举值: 48-信用违约互换。 2. 章节 5.2.1 债券信息(银行间)和 5.2.13 债券信息(国际), 发行价格(元)的精度由 10 调整为 6; 计息基准(日计数基准)删除枚举值 D-30E/360, 新增枚举值 2-30/360; 基准利率值(%)的精度由 0-9 调整为 6, ; 转换日期、转换类型、转换比例、转换价格(元), 加说明: 该字段不传; 每百元应计利息的精度由 15 调整为 10。 3. 章节 5.2.3 资产支持证券信息, 计息基础删除枚举值 D-30E/360, 新增枚举值 2-30/360。

## 参考数据接口 XML 文档

### 1 范围

本文件规定了参考数据对外接口XML的数据内容、数据格式、遵循标准和使用说明。

### 2 规范性引用文件

下列文件对于本文件的应用是必不可少的。凡是注日期的引用文件，仅所注日期的版本适用于本文件。凡是不注日期的引用文件，其最新版本(包括所有的修改单)适用于本文件。

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/T 0078-2014银行间市场数据接口

### 3 文件维护与管理

本文件由中国外汇交易中心负责维护与管理。中国外汇交易中心对本文件涉及内容拥有最终解释权。鉴于银行间市场业务涉及银行机构的流动性等风险,监管部门因监管需要可对涉及使用此文件的银行间市场业务的信息系统进行延伸检查。

### 4 文件使用说明

#### 4.1 IMIX 报文结构

IMIX报文结构如图1所示。

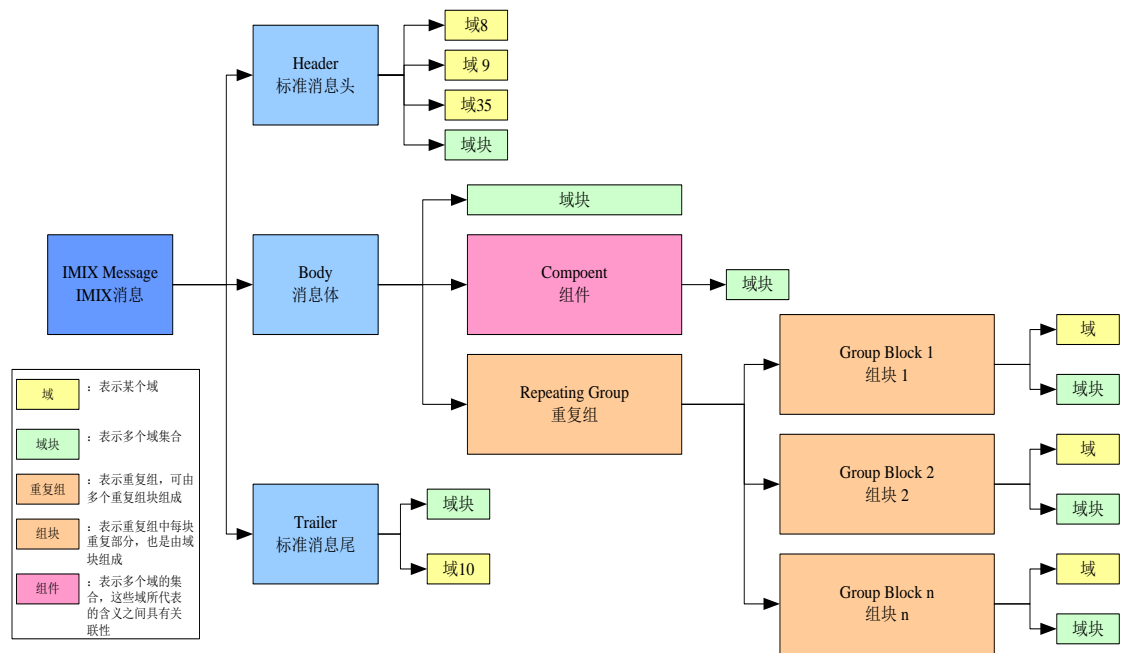


图1 IMIX 报文结构

4.2 报文域取值规范

IMIX协议基于Tag=Value格式制定。某个域如果没有赋值，IMIX报文就不传输该域。IMIX协议不允许某个域等于空值，否则报文校验时报错。

对于枚举类型的域，IMIX协议标准对域值范围有明确约束；对于非枚举类型的域，指引和协议无法穷举域值取值范围，指引中取值仅为示例，供文档阅读者参考。

4.3 期限转换规则

10286取值以YYMMDDDD的格式传，如交易期限是6个月，消息中10286=6000，如果是1年，消息中10286=1000000，如果是18个月，消息中10286=18000，如果是1年6个月，消息中10286=1006000（注：对于期限表达是使用18个月还是1年6个月由业务确定）。例如1Y6M3D，10286的取值为1006003。

4.4 消息唯顺序号生成规则

964消息唯顺序号的生成规则为：CD/FC+年份（四位）+月份（两位）+日（两位）+序号（十位），工具类型是同业存单时，前两位用“CD”，非同业存单时用“FC”，964消息唯顺序号的生成规则见表1。

表1 964 消息唯顺序号的生成规则

域	编码规则
964SecurityReportID 消息唯顺序号	第 1、2 位：CD/FC(工具类型是同业存单时，前两位用“CD”，非同业存单时用“FC”)
	第 3-10 位： 年（四位）+月（两位）+日（两位）；例如 20130128
	第 11-20 位： 10 位序号，需保证全局唯一。 <b>建议持久化此序号，以确保系统重启或重新部署后此序号的唯一性。</b>

5 业务场景开发

## 5.1 投资发行信息

## 5.1.1 待发行工具信息

## 5.1.1.1 招标发行信息

招标发行信息具体见表2。

表2 招标发行信息

要素名称	IMIX 域	XML 名称
工具代码	48 SecurityID	ID 最长 50 位
工具简称	55 Symbol	Sym 最长 110 位
工具全称	10653 FullSymbol	FullSymbol 最长 300 位
发行人	使用<PartyDetailAltIDGrp>组件存放发行人和投资人信息。当 11140PartyDetailAltRole 取值为 119 表示发行方信息，用<PartyDetailAltSubGrp>组件中的 1521PartyDetailAltSubIDType 和 1520PartyDetailAltSubID 组合表示，当 1521=124 时表示发行人中文全称	Sub 组件 当 Typ=124 时，ID 的值表示发行人中文全称 最长 300 位，
发行方式	10706IssueMethod	IssueMethod
招标方式		0-单一价格招标发行 5-数量招标发行
期限	10286 SecurityTerm	SecurityTerm 枚举值：1M、3M、6M、9M、1Y、2Y、3Y SecurityTerm取值以 YMMMDDD 的格式 具体期限转换规则详见 4.3 章节
计划发行量（亿元）	10078 IssueSize	IssueSize 单位：亿元，最长 10 位，精度：1 位
面值（元）	10053 FaceValue	FaceValue 单位：元，整数；默认 100
发行日	225IssueDate	Issued 格式：YYYYMMDD
起息日	64SettlDate	SettlDt 格式：YYYYMMDD
到期日	541MaturityDate	MatDt 格式：YYYYMMDD
兑付日	504PaymentDate	PmtDt 格式：YYYYMMDD

息票类型	10031 CouponRateType	CouponRateType 枚举值：1-浮息；2-零息/3-贴现；0-固息 工具类型为“同业存单”、“自贸区同业存单”时为零息，工具类型非“同业存单”、“自贸区同业存单”时为“贴现”
票面利率	223CouponRate	CpnRt 仅在息票类型“固息”时传输该域 当招标方式为“单一价格招标”时，不传输该域 最长 10 位，精度 4，单位%
发行价格（元）	10076IssuePx	IssuePx 仅在息票类型为“零息/贴现”时传输该域 当招标方式为“单一价格招标”时，不传输该域 最长 10 位；精度：4，单位：元
付息频率	10030CouponPaymentFrequency	CouponPaymentFrequency 0-半年、1-年、2-期满、3-月、4-季 息票类型为“零息”时置为期满
基准利率	221BenchmarkCurveName	Name 仅在息票类型为“浮息”时传输该域，基准利率名称
基准利率精度	10429 DecimalPlaces	DecimalPlaces 仅在息票类型为“浮息”时传输该域，枚举值：1、2、3、4
基准利率确定方式-N	10074 InterestFixDateAdjustment 传输 7 表示本计息期起息日前 N 个工作日， 11141 DaysBeforeValue 表示 N 的具体取值	InterestFixDateAdjustment 传输 7 表示本计息期起息日前 N 个工作日， DaysBeforeValue 表示 N 的具体取值 仅在息票类型为“浮息”时传输该域，7-本计息期起息日前 N 个工作日，系统始终为“本计息期起息日前 N 个工作日” N=起息日-首次利率确定日-期间节假日天数。
利差（BP）	218Spread	Spread 仅当息票类型为“浮息”时传输该域 当招标方式为“单一价格招标”时，不传输该域 最长 10 位；精度：2；单位：BP

首次利率确定日	874InterestAccrualDate	IntAcr1 仅当息票类型为“浮息”时传输该域， 格式：YYYYMMDD
首次付息日	224CouponPaymentDate	CpnPmt 格式：YYYYMMDD，仅当票息类型为“固 息”、“浮息”时传输该域
计息基准	10040DayCount	DayCount 工具类型为“同业存单”、“自贸区同业 存单”时始终为“A/360”；工具类型非 “同业存单”“自贸区同业存单”时， 枚举值：A/360，A/365，A/A 1-A/360 3-A/365 0-A/A
主体评级机构	10032 CreditRatingAgency	CreditRatingAgency 最长 100 位
主体评级等级	255CreditRating	CrdRtg 最长 4 位
工具状态	965SecurityStatus	Status A-待发行 3-已撤销
流通范围	1390 TradePublishIndicator	TrdPubInd 1-公开
参考收益率	233StipulationType 取值 IssueYield 时，234StipulationValue 的值	Stip 组件 Typ 取值 IssueYield 时，Val 的值 当息票类型为“零息/贴现”“固息”最 长 10 位，精度 4，单位%；当息票类型 为“浮息”时，显示为基准利率名称+ 利差 当招标方式为“单一价格招标”时，不 传输该域 当工具类型非“同业存单”、“自贸区同 业存单”时，仅息票类型为“零息/贴 现”时传输该域，息票类型为“固息” “浮息”时不传输该域； 组消息时，域取值中已有对应单位
缴款日	865EventType=125 时，866EventDate 的值	Evnt 组件 EventTyp=125，Dt 的值表示缴款日 格式：YYYYMMDD
工具类型	167SecurityType	SecTyp CD-同业存单 6-央行票据

		0-国债 1-政策性金融债 5-企业债 3-次级债 2-短期融资券 7-国际开发机构债 8-混合资本债 10-中期票据 11-地方政府债 12-财务公司债 13-证券公司债 23-集合票据 27-金融租赁公司金融债 9-资产支持证券 22-政府支持机构债券 19-超短期融资券 14-证券公司短期融资券 49-二级资本工具 50-保险公司资本补充债 45-资产管理公司金融债
币种	15Currency	Ccy CNY、USD
每标位最高投标量（亿元）	11274MaxPerTenderAmt	MaxPerTenderAmt 仅发行方式为“单一价格招标发行/数量招标发行”时传输，最长 10 位，精度 1，单位：亿元
每标位最低投标量（亿元）	11273MinPerTenderAmt	MinPerTenderAmt 仅发行方式为“单一价格招标发行/数量招标发行”时传输，最长 10 位，精度 1，单位：亿元
最低标位	11275MinTenderPxForPlan	MinTenderPxForPlan 仅单一价格招标时传输，最长 10 位 根据招标标的显示：当标的为价格时，单位为元，精度为 4；当标的为利差时，单位为 BP，精度为 2；当标的为利率时，单位为%，精度为 4
最低标位参考收益率	11276MinTenderYield	MinTenderYield 仅单一价格招标时传输，票息类型为“零息/贴现”“固息”时填写，最长 12 位，精度 4，单位%，例如 3.1234%
最高标位	11277MaxTenderPxForPlan	MaxTenderPxForPlan 仅单一价格招标时传输，最长 10 位



		根据招标标的显示：当标的为价格时，单位为元，精度为 4；；当标的为利差时，单位为 BP，精度为 2；当标的为利率时，单位为%，精度为 4
最高标位参考收益率	11278MaxTenderYield	MaxTenderYield 仅单一价格招标时传输，票息类型为“零息/贴现”“固息”时填写，最长 12 位，精度 4，单位%，例如 3.1234%
投标步长	11279TenderStep	TenderStep 仅单一价格招标时传输；最长 10 位 当标的为价格时，单位为元，精度为 3； 当标的为利差时，单位为 BP，精度为 0； 当标的为利率时，单位为%，精度为 2
最大投标标位数	11280MedianMaxBidMarked	MedianMaxBidMarked 仅单一价格招标时传输，整数；最长 4 位，单位：个
最大投标标位差（个）	11281MaxTenderPxDiffer	MaxTenderPxDiffer 仅单一价格招标时传输，整数；最长 4 位，单位：个
最高投标总量（亿元）	11282MaxTotalTenderAmt	MaxTotalTenderAmt 仅单一价格招标时传输，最长 4 位；精度：1，单位：亿元
连续投标限制	11283ContinuousTenderLimit	ContinuousTenderLimit 仅单一价格招标时传输 Y-是 N-否
联系人 1	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 9 时，1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=9 时，ID 的值 最长 30 位，联系人姓名
联系电话 1	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 7 时，1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=7 时，ID 的值 最长 30 位
传真 1	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 4000 时，1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=4000 时，ID 的值 最长 30 位
联系人 2	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 9 时，1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=9 时，ID 的值 最长 30 位，联系人姓名
联系电话 2	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 7 时，1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=7 时，ID 的值 最长 30 位
传真 2	1521PartyDetailAltSubIDType 取值	Sub 组件

	4000 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	当 Typ=4000 时, ID 的值 最长 30 位
收款账户名称	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 23 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=23 时, ID 的值 最长 100 位
收款人账号	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 15 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=15 时, ID 的值 最长 30 位
汇入行名称	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 110 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=110 时, ID 的值 最长 100 位
支付系统清算行行号	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 112 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=112 时, ID 的值 最长 30 位
备注	58Text	Txt

#### 5.1.1.2 报价发行信息

报价发行信息具体见表3。

表3 报价发行信息

要素名称	IMIX 域	XML 名称
工具代码	48 SecurityID	ID 最长 50 位
工具简称	55 Symbol	Sym 最长 110 位
工具全称	10653 FullSymbol	FullSymbol 最长 300 位
发行人	使用<PartyDetailAltIDGrp>组件存放 发 行 人 和 投 资 人 信 息 。 当 11140PartyDetailAltRole 取值为 119 表 示 发 行 方 信 息 , 用 <PartyDetailAltSubGrp> 组 件 中 的 1521PartyDetailAltSubIDType 和 1520PartyDetailAltSubID 组合表示, 当 1521=124 时表示发行人中文全称	Sub 组件 当 Typ=124 时, ID 的值表示发行人中 文全称 最长 300 位
发行方式	10706 IssueMethod	IssueMethod 6-报价发行
期限	10286 SecurityTerm	SecurityTerm 枚举值: 1M、3M、6M、9M、1Y、2Y、3Y SecurityTerm取值以 YYMMDDDD 的格式 具体期限转换规则详见 4.3 章节
计划发行量(亿元)	10078 IssueSize	IssueSize

		单位：亿元，最长 10 位，精度：1 位
面值（元）	10053 FaceValue	FaceValue 单位：元，整数；默认 100
发行日	225IssueDate	Issued 格式：YYYYMMDD
起息日	64SettlDate	SettlDt 格式：YYYYMMDD
到期日	541MaturityDate	MatDt 格式：YYYYMMDD
兑付日	504PaymentDate	PmtDt 格式：YYYYMMDD
息票类型	10031 CouponRateType	CouponRateType 枚举值：1-浮息；2-零息/3-贴现；0-固息 工具类型为“同业存单”、“自贸区同业存单”时为零息，工具类型非“同业存单”、“自贸区同业存单”时为“贴现”
票面利率	223CouponRate	CpnRt 仅在息票类型“固息”时传输该域 当招标方式为“单一价格招标”时，不传输该域 最长 10 位，精度 4，单位%
发行价格（元）	10076IssuePx	IssuePx 仅在息票类型为“零息/贴现”时传输该域 当招标方式为“单一价格招标”时，不传输该域 最长 10 位；精度：4，单位：元
付息频率	10030CouponPaymentFrequency	CouponPaymentFrequency 0-半年、1-年、2-期满、3-月、4-季 息票类型为“零息”时置为期满
基准利率	221BenchmarkCurveName	Name 仅在息票类型为“浮息”时传输该域 基准利率名称
基准利率精度	10429 DecimalPlaces	DecimalPlaces 仅在息票类型为“浮息”时传输该域 枚举值：1、2、3、4
基准利率确定方式-N	10074 InterestFixDateAdjustment 传输 7 表示本计息期起息日前 N 个工作日，	InterestFixDateAdjustment 传输 7 表示本计息期起息日前 N 个工作日， DaysBeforeValue 表示 N 的具体取值

	11141 DaysBeforeValue 表示 N 的具体取值	仅在息票类型为“浮息”时传输该域
利差 (BP)	218Spread	Spread 仅当息票类型为“浮息”时传输该域 当招标方式为“单一价格招标”时, 不传输该域 最长 10 位; 精度: 2; 单位: BP
首次利率确定日	10073 InterestFixDate	IntAcrl 仅当息票类型为“浮息”时传输该域, 格式: YYYYMMDD
首次付息日	224CouponPaymentDate	CpnPmt 格式: YYYYMMDD, 仅当票息类型为“固息”、“浮息”时传输该域
计息基准	10040DayCount	DayCount 工具类型为“同业存单”、“自贸区同业存单”时始终为“A/360”; 工具类型非“同业存单”“自贸区同业存单”时, 枚举值: A/360, A/365, A/A 0-A/A 1-A/360 3-A/365
主体评级机构	10032 CreditRatingAgency	CreditRatingAgency 最长 100 位
主体评级等级	255CreditRating	CrdRtg 最长 4 位
工具状态	965SecurityStatus	Status A-待发行 3-已撤销
流通范围	1390 TradePublishIndicator	TrdPubInd 1-公开
参考收益率	233StipulationType 取值 IssueYield 时, 234StipulationValue 的值	Stip 组件 Typ 取值 IssueYield 时, Val 的值 当息票类型为“零息/贴现”“固息”最长 10 位, 精度 4, 单位%; 当息票类型为“浮息”时, 显示为基准利率名称+利差 当招标方式为“单一价格招标”时, 不传输该域 当工具类型非“同业存单”、“自贸区同业存单”时, 仅息票类型为“零息/贴现”时传输该域, 息票类型为“固息”“浮息”时不传输该域;

		组消息时，域取值中已有对应单位
缴款日	865EventType=125 时，866EventDate 的值	Evnt 组件 EventType=125，Dt 的值表示缴款日 格式：YYYYMMDD
工具类型	167SecurityType	SecTyp CD-同业存单 6-央行票据 0-国债 1-政策性金融债 5-企业债 3-次级债 2-短期融资券 7-国际开发机构债 8-混合资本债 10-中期票据 11-地方政府债 12-财务公司债 13-证券公司债 23-集合票据 27-金融租赁公司金融债 9-资产支持证券 22-政府支持机构债券 19-超短期融资券 14-公司短期融资券 49-二级资本工具 50-保险公司资本补充债 45-资产管理公司金融债
币种	15Currency	Ccy CNY、USD
最高认购总量（亿元）	11284MaxSubscriptionAmt	MaxSubscriptionAmt 仅报价发行填写，单位：亿元，最长 10 位，精度：1
单笔最低认购量（亿元）	11285SingleMinSubscriptionAmt	SingleMinSubscriptionAmt 仅报价发行填写，单位：亿元，最长 10 位，精度：1
单笔最高认购量（亿元）	11286SingleMaxSubscriptionAmt	SingleMaxSubscriptionAmt 仅报价发行填写，单位：亿元，最长 10 位，精度：1
联系人 1	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 9 时，1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=9 时，ID 的值 最长 30 位，联系人姓名
联系电话 1	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 7	Sub 组件

	时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	当 Typ=7 时, ID 的值 最长 30 位
传真 1	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 4000 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=4000 时, ID 的值 最长 30 位
联系人 2	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 9 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=9 时, ID 的值 最长 30 位, 联系人姓名
联系电话 2	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 7 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=7 时, ID 的值 最长 30 位
传真 2	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 4000 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=4000 时, ID 的值 最长 30 位
收款账户名称	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 23 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=23 时, ID 的值 最长 100 位
收款人账号	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 15 时, 1520PartyDetailAltSubID 的值	Sub 组件 当 Typ=15 时, ID 的值 最长 30 位
汇入行名称	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 110 时, 1520PartyDetailAltSubID 的 值	Sub 组件 当 Typ=110 时, ID 的值 最长 100 位
支付系统清算行行号	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 112 时, 1520PartyDetailAltSubID 的 值	Sub 组件 当 Typ=112 时, ID 的值 最长 30 位
备注	58Text	Txt

### 5.1.1.3 待发行工具信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 "?>
<!--
    Description: 招标发行
-->
<IMIXML>
    <SecDef
        Ccy="CNY"
        Txt="XXX"
        TrdPubInd="0"
        SettlDt="20070327"
        DayCount="0"
        DecimalPlaces="1"
        InterestFixDateAdjustment="7"

```

```

DaysBeforeValue="2"
PmtDt="20070327">
<Instrmt
  SecTyp="CD"
  FullSymbol="XXX"
  Sym="XXX"
  ID="XXX"
  SecurityTerm="1000"
  CouponRateType="1"
  IssueMethod="0"
  Status="3"
  Issued="20070327"
  IssuePx="100.0000"
  IssueSize="2110.0"
  FaceValue="100"
  CouponPaymentFrequency="1"
  MatDt="20070327"
  CpnPmt="20070327"
  IntAcrl="20070327"
  CpnRt="54.0010"
  CrdRtg="XXX"
  CreditRatingAgency="XXX"/>
<SprdBnchmkCurve
  Spread="121.00"
  Name="XXX"/>
<StipNoStipulations="1" Typ="IssueYield" Val="Shibor_O/N+100.00BP" />
<EvntNoEvents="1" EventTyp="125" Dt="20151211"/>
<PartyDetailAlt
  NoPartyDetailAltIDs="1"
  ID="XXX"
  PartyDetailAltRole="119">
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="2" ID="XXX" Typ="23"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="3" ID="XXX" Typ="15"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="4" ID="XXX" Typ="110"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="5" ID="XXX" Typ="112"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="7" ID="XXX" Typ="9"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="8" ID="XXX" Typ="4000"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="9" ID="XXX" Typ="7"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="10" ID="XXX" Typ="9"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="11" ID="XXX" Typ="4000"/>
    <Sub NoPartyDetailAltSubIDs="12" ID="XXX" Typ="7"/>
  <TenderDetails

```

```

MinPerTenderAmt="21"
MaxPerTenderAmt="221.0"
MinTenderPxForPlan="20.0000"
MinTenderYield="3.1234"
MaxTenderPxForPlan="55"
MaxTenderYield="30.1234"
TenderStep="22"
MedianMaxBidMarked="40"
MaxTenderPxDiffer="20"
MaxTotalTenderAmt="1221.0"
ContinuousTenderLimit="Y"/>
<SubscriptionDetails
  MaxSubscriptionAmt=""
  SingleMinSubscriptionAmt=""
  SingleMaxSubscriptionAmt=""/>
</PartyDetailAlt>
</SecDef>
</IMIXML>

```

## 5.2 本币基础品种信息

### 5.2.1 债券信息（银行间）

债券信息（银行间）见表4。

表4 债券信息（银行间）

字段	IMIX 对应	XML 名称
债券类型	107 SecurityDesc	Desc
债券名称	55 Symbol	Sym 中文简称
债券代码	48 SecurityID	ID
发行量（亿）	10078 IssueSize	IssueSize 单位：亿，精度：10
发行价格（元）	10076 IssuePx	IssuePx 单位：元，精度：6
面值（元）	10053 FaceValue	FaceValue 单位：元，精度：2
发行日	225IssueDate	Issued 格式：YYYYMMDD
流通量（亿）	10017 CirculationSize	CirculationSize 单位：亿，精度：10
到期日	541MaturityDate	MatDt 格式：YYYYMMDD
债券期限	10286 SecurityTerm	SecurityTerm



待偿期	10243TermToMaturity	TermToMaturity
每百元应计利息	159AccruedInterestAmt	AcrdIntAmt 单位：元，精度：10
上市交易日	10145ListDate	ListDate 格式：YYYYMMDD
摘牌日期	10043DelistDate	DelistDate 格式：YYYYMMDD
状态	965SecurityStatus	Status 枚举值： 1-活动
特殊债	11865 SpecialDebt	SpecialDebt 枚举值： Y-是 N-否
到期违约债	11867 DefaultBondIndicator	DefaultBondIndicator 枚举值： Y-是 N-否
再次流通起始日	当 865EventType=135 表示再次流通起始日，866EventDate 填写具体的值	Evnt 组件 Typ=135, Dt 的值表示再次流通起始日 格式：YYYYMMDD 到期违约债时，传输该字段
再次流通终止日	当 865EventType=136 表示再次流通终止日，866EventDate 填写具体的值	Evnt 组件 Typ=136, Dt 的值表示再次流通终止日 格式：YYYYMMDD 到期违约债时，传输该字段
<b>信用评级（重复多次）</b>		
信用评级机构	10032 CreditRatingAgency	CreditRatingAgency
信用评级	255 CreditRating	CrdRtg
信用等级有效起始日	10033 CreditValidityFrom	CreditValidityFrom 格式：YYYYMMDD
信用等级有效终止日	10034 CreditValidityTo	CreditValidityTo 格式：YYYYMMDD
<b>息票信息</b>		
息票类型	10031 CouponRateType	CouponRateType 枚举值： 1-浮动利率 0-固定利率 2-零息利率 3-贴现

付息频率	10030 CouponPaymentFrequency	CouponPaymentFrequency 枚举值： 3-月 4-季 0-半年 1-年 2-到期
计算方法	10072 InterestAccrualMethod	InterestAccrualMethod 枚举值： 2-频率 3-天数 4-无
计息基准（日计数基准）	10040 DayCount	DayCount 枚举值： 3-实际/365 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F 2-30/360
起息日	64SettldDate	SettldDt 格式：YYYYMMDD
首次付息日	224CouponPaymentDate	CpnPmt 格式：YYYYMMDD
<b>固定附息债</b>		
固定利率（%）	44Price	Px 单位：%，精度：6
<b>浮动附息债</b>		
基准利率名	221 BenchmarkCurveName	Name
基准利率值（%）	662 BenchmarkPrice	Px 单位：%，精度：6
基准利差（基点）（%）	218 Spread	Spread 单位：%，精度：6
利率上限	10028 CouponCapRate	CouponCapRate 单位：%，精度：6
利率下限	10029 CouponFloorRate	CouponFloorRate 单位：%，精度：6
当前票面利率	223CouponRate	CpnRt 单位：%，精度：6
发行机构简称-中文	106Issuer	Issr
<b>可转债</b>		
转换日期	10023ConvertDate	ConvertDate 格式：YYYYMMDD

		该字段不传
转换类型	10027ConvertType	ConvertType 枚举值： 0-部分 1-全部 该字段不传
转换比例	10025ConvertOfFaceValue	ConvertOfFaceValue 精度：6 该字段不传
转换价格（元）	10026ConvertPx	ConvertPx 单位：元，精度：2 该字段不传
<b>再发行信息</b>		
增发标识	10280 ReissueIndicator	ReissueIndicator 枚举值： Y-是 N-否
增发发行日（重复多次）	10279ReissueDate	ReissueDate 格式：YYYYMMDD
增发上市日（重复多次）	使用 ReissueEvtGrp 组件 10760ReissueEventType 取值 7 表示增发上市日， 10761ReissueEventDate 的值	ReissueEvtGrp 组件 当 ReissueEventType=7 时， ReissueEventDate 的值 格式：YYYYMMDD
增放量（亿）（重复多次）	10281ReissueSize	ReissueSize 单位：亿，精度：10
<b>行权（重复多次）</b>		
行权类型	使用重复组件 EvtGrp 表示： 865EventType 取值 2-Call 表示可提前兑付，1-Put 表示可提前赎回	Evt 组件 Typ 取值 2-Call 表示可提前兑付， 1-Put 表示可提前赎回
行权日	866EventDate	Dt 格式：YYYYMMDD
行权价格（元）	867EventPx	Px 单位：元，精度：2
行权量（亿）	11413EventQty	EventQty 单位：亿，精度：10
行权后利率/基准利差（%）	使用 Stipulations 组件存放行权收益率信息， 233StipulationType 取 值 为 StrikeYield 时 234StipulationValue 取值为行权收益率	Stip 组件 Typ 取值为 StrikeYield 时 Val 的值为行权收益率 单位：%，精度：6 浮动时即为利率，固定为利差
托管机构	452PartyRole 取值 105 时，448PartyID 的值	R 取值 105 时，ID 的值

是否可适用于净额清算	11414NetSettlementIndicator	NetSettlementIndicator 枚举值： Y-是 N-否
币种	15Currency	Ccy
流通范围	1390TradePublishIndicator	TrdPubInd 枚举值： 0-定向 1-公开

### 5.2.2 债券信息（银行间）XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
```

```
<!--
```

```
    Description: 债券信息（银行间）
```

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
    <SecDef
```

```
        SecurityDefineMsgType="16"
```

```
        AcrdIntAmt="0"
```

```
        Status="1"
```

```
        InterestAccrualMethod="1"
```

```
        DayCount="0"
```

```
        SettlDt="0100612"
```

```
        Px="0"
```

```
        ReissueIndicator="Y"
```

```
        Ccy="CNY"
```

```
        Desc="XXX"
```

```
        NetSettlementIndicator="Y"
```

```
        TrdPubInd="0"
```

```
        SpecialDebt="Y"
```

```
        DefaultBondIndicator="Y">
```

```
    <Instrmt
```

```
        ID="XXXX"
```

```
        Sym="XXXX"
```

```
        IssueSize="10000"
```

```
        IssuePx="1000"
```

```
        FaceValue="0"
```

```
        Issued="20091212"
```

```
        CirculationSize="0"
```

```
        MatDt="20091212"
```

```
        SecurityTerm="XX"
```

```
        TermToMaturity="0"
```

```
        ListDate="20091212"
```

```

    DelistDate="20091213"
    CouponRateType="0"
    CpnPmt="20091213"
    CpnRt="1000"
    Issr="XXX"
    CouponPaymentFrequency = "3"/>
<SprdBnchmkCurve
    Name="XXX"
    Px="2.53"
    Spread="34"
    CouponCapRate="0"
    CouponFloorRate="0"/>
<CredRateAgencyInfoGrp
    NoCredRateAgencyInfo ="1"
    CreditRatingAgency="XXX"
    CrdRtg="XXX"
    CreditValidityFrom="20091213"
    CreditValidityTo="20091213" />
<CredRateAgencyInfoGrp
    NoCredRateAgencyInfo ="2"
    CreditRatingAgency="XXX"
    CrdRtg="XXX"
    CreditValidityFrom="20091213"
    CreditValidityTo="20091213" />
< ConvertInfoGrp
    NoConvertInfo="1"
    ConvertType="2"
    ConvertDate="20091213"
    ConvertOfFaceValue="2"
    ConvertPx="2"/>
< ReissueInfoGrp
    NoReissueInfo="1"
    ReissueDate="20091213"
    ReissueSize="2">
    <ReissueEvtGrp
        NoReissueEvents="1"
        ReissueEventType="7"
        ReissueEventDate="20180212"/>
</ReissueInfoGrp>
< ReissueInfoGrp
    NoReissueInfo="2"
    ReissueDate="20091213"
    ReissueSize="2">

```

```

        <ReissueEvtGrp
            NoReissueEvents="1"
            ReissueEventType="7"
            ReissueEventDate="20180212"/>
    </ReissueInfoGrp>
    < ReissueInfoGrp
        NoReissueInfo="3"
        ReissueDate="20091213"
        ReissueSize="2">
        <ReissueEvtGrp
            NoReissueEvents="1"
            ReissueEventType="7"
            ReissueEventDate="20180212"/>
    </ReissueInfoGrp>
    < Evt
        NoEvents="1"
        Typ="1"
        Dt="0091213"
        Px="1.0"
        EventQty="1000">
        < StipNoStipulations="1" Typ="1" Val="0.00"/>
    </ Evt>
    < Evt
        NoEvents="2"
        Typ="1"
        Dt="0091213"
        Px="1.0"
        EventQty="1000">
        < StipNoStipulations="1" Typ="1" Val="0.00"/>
    </ Evt>
    < Evt
        NoEvents="3"
        Typ="135"
        Dt =" 20121212"/ >
    </ Evt>
    < Evt
        NoEvents="4"
        Typ="136"
        Dt =" 20130209"/ >
    </ Evt>
    <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="105"/>
</SecDef>
</IMIXML>

```

## 5.2.3 资产支持证券信息

资产支持证券信息见表5。

表5 资产支持证券信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
资产支持证券名称	55 Symbol	Sym 中文简称
资产支持证券代码	48 SecurityID	ID
币种	15Currency	Ccy
发起人	使用 SecurityRelatedParties 组件中, 11177 PartyIdentity=5 时, 表示委托 发起人 PartySubGrp 组件 803 PartySubIDType=124 523 PartySubID 表示委托发行人的机构 中文全称	SecurityRelatedParties 组件 PartyIdentity=5 时, 表示委托发起 人 PartySubGrp 组件 Typ=124 ID 的值
发行机构	使用 SecurityRelatedParties 组件中, 11177 PartyIdentity=1 时, 表示发行 人 PartySubGrp 组件 803 PartySubIDType=124 523 PartySubID 表示委托发行人的机构 中文全称	SecurityRelatedParties 组件 PartyIdentity=1 时, 表示发行人 PartySubGrp 组件 Typ=124 ID 的值
发行总量 (亿)	10078IssueSize	IssueSize 单位: 亿, 精度: 10
流通总量 (亿)	10017 CirculationSize	CirculationSize 单位: 亿, 精度: 10
每百元本金额 (元)	10239Principal	Principal 单位: 元, 精度: 6
计息基础	10040DayCount	DayCount 枚举值: 3-实际/365 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F 2-30/360
发行日	225IssueDate	Issued 格式: YYYYMMDD
上市交易日	10145ListDate	ListDate 格式: YYYYMMDD
摘牌日	10043DelistDate	ListDate 格式: YYYYMMDD

预期到期日	10762 ExpectedMaturityDate	ExpectedMaturityDate 格式: YYYYMMDD
实际到期日	541 MaturityDate	MatDt 格式: YYYYMMDD
利率类型	10031CouponRateType	CouponRateType 枚举值: 0-固定利率 1-浮动利率 2-零息利率 3-贴现
基准利率 (%)	221BenchmarkCurveName	Name
基本利差 (%)	218Spread	Spread 单位: %, 精度 6
本金支付频率	10240PrincipalPayFrequency	PrincipalPayFrequency 枚举值: 0-半年 1-年 3-月 4-季 2-到期 5-两周 6-周 7-天
下一本金除权日	865EventType 取值 1 866EventDate 的值	<Evt>组件 EventTyp 取值 1 时 Dt 的值 格式: YYYYMMDD
付息频率	10030 CouponPaymentFrequency	CouponPaymentFrequency 枚举值: 3-月 4-季 0-半年 1-年 2-到期
下一付本日	504PaymentDate	PmtDt 格式: YYYYMMDD
当前利率 (%)	662BenchmarkPrice	Px 单位: %, 精度: 6
发行价 (元)	10076IssuePx	IssuePx 单位: 元, 精度: 10
状态	965 SecurityStatus	Status 枚举值:



		G-非活动 1-活动
托管机构	使用 SecurityRelatedParties 组件中, 11177 PartyIdentity=6 时, 表示托管 机构 PartySubGrp 组件 803 PartySubIDType=124 523 PartySubID 表示托管机构中文全称	SecurityRelatedParties 组件 PartyIdentity=6 时, 表示托管机构 PartySubGrp 组件 Typ=124 ID 的值
特殊债	11865 SpecialDebt	枚举值: Y-是 N-否

#### 5.2.4 资产支持证券信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 资产支持证券信息
-->
<IMIXML>
  <SecDef
    SecurityDefineMsgType="16"
    ExpectedMaturityDate="20121212"
    DayCount="0"
    PrincipalPayFrequency="XX"
    Ccy="CNY"
    PmtDt="20121212"
    SpecialDebt="Y">
    <Instrmt
      ID="XXXX"
      Sym="XXXX"
      SecTyp="9"
      Status="1"
      Issued="20121212"
      CirculationSize="9"
      DelistDate="20121212"
      ListDate="20121212"
      IssuePx="2.0"
      IssueSize="2012"
      MatDt="20121212"
      CouponPaymentFrequency="XXXX"
      Principal="1000"
      CouponRateType="0"/>
    < SprdBnchmkCurve
      Name="XXX"

```

```

Px="2.53"
Spread="34"/>
< Evnt
  NoEvents="1"
  EventType="1"
  Dt=" 0091213"/>
< SecurityRelatedParties
  NoSecurityRelatedParties="1"
  SecurityPartyID="-"
  PartyIdentity="1">
  < PartySubGrpNoPartySubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>
</SecurityRelatedParties>
< SecurityRelatedParties
  NoSecurityRelatedParties="2"
  SecurityPartyID="-"
  PartyIdentity="6">
  < PartySubGrpNoPartySubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>
</SecurityRelatedParties>
< SecurityRelatedParties
  NoSecurityRelatedParties="3"
  SecurityPartyID="-"
  PartyIdentity="5">
  < PartySubGrpNoPartySubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>
</SecurityRelatedParties>
</SecDef>
</IMIXML>

```

### 5.2.5 资产支持证券历史信息

资产支持证券历史信息见表6。

表6 资产支持证券历史信息

字段	IMIX 对应	说明
资产支持证券名称	55 Symbol 中文简称	Sym 中文简称
资产支持证券代码	48 SecurityID	ID
修改日	10410UpdateTime	UpdateTime 格式: YYYYMMDD
发行人	使用 SecurityRelatedParties 组件中, 11177 PartyIdentity=1 时, 表示发行 人 PartySubGrp 组件 803 PartySubIDType=124	SecurityRelatedParties 组件 PartyIdentity=1 时, 表示发行人 PartySubGrp 组件 Typ=124 ID 的值

	523 PartySubID 表示发行人的机构中文全称	
每百元本金额（元）	10239Principal	Principal 单位为元，精度：6
流通总量（亿）	10017 CirculationSize	CirculationSize 单位为亿元，精度：10

### 5.2.6 资产支持证券历史信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 资产支持证券历史信息
-->
<IMIXML>
    <SecDef
        SecurityDefineMsgType="21"
        UpdateTime="20121212">
        <Instrmt
            ID="XXXX"
            Sym="XXXX"
            SecTyp="9"
            Principal ="10000"
            CirculationSize="9"/>
        < SecurityRelatedParties
            NoSecurityRelatedParties="1"
            SecurityPartyID="-"
            PartyIdentity="1">
            < PartySubGrpNoPartySubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>
        </SecurityRelatedParties>
    </SecDef>
</IMIXML>

```

### 5.2.7 资产支持证券信用评级

资产支持证券信用评级见表7。

表7 资产支持证券信用评级

字段	IMIX 对应	XML 名称
资产支持证券名称	55 Symbol 中文简称	Sym 中文简称
资产支持证券代码	48 SecurityID	ID
信用评级机构	10032 CreditRatingAgency	CreditRatingAgency
信用评级	255 CreditRating	CrdRtg
起始日	10033 CreditValidityFrom	CreditValidityFrom

		格式: YYYYMMDD
终止日	10034 CreditValidityTo	CreditValidityTo 格式: YYYYMMDD

### 5.2.8 资产支持证券信用评级 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
Description: 资产支持证券信用评级
-->
<IMIXML>
  <SecDef
    SecurityDefineMsgType="22" >
    <Instrmt
      ID="XXXX"
      Sym="XXXX"
      SecTyp="9"/>
    <CredRateAgencyInfoGrp
      NoCredRateAgencyInfo="1"
      CreditRatingAgency="XXX"
      CrdRtg="XXX"
      CreditValidityFrom="20121212"
      CreditValidityTo="20121213"/>
    </SecDef>
  </IMIXML>
```

### 5.2.9 预发行债券信息

预发行债券信息见表8。

表8 预发行债券信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
债券类型	107 SecurityDesc	Desc
发行类型	11411IssueType N-新发 S-续发	IssueType N-新发 S-续发
债券代码	48 SecurityID	ID
债券名称	55 Symbol	Sym
计划发行量(亿)	10709IssueSizeForPlan	IssueSizeForPlan 单位为亿元, 精度: 10
实际发行量(亿)	10078 IssueSize	IssueSize 单位为亿元, 精度: 10
面值(元)	10053 FaceValue	FaceValue 单位为元, 精度: 2

首发价格(%/元)	44Price	Px 单位为元, 精度: 6
招标日	使用<EvtGrp>组件 当 865EventType 取值 130 表示招标日时, 866EventDate 的值	Evt 组件 EventTyp=130 表示招标日时, Dt 的值 格式: YYYYMMDD
发行价格(%元)	10076IssuePx	IssuePx 单位为元, 精度: 6
起息日	64Settldate	Settldt 格式: YYYYMMDD
缴款日	使用<EvtGrp>组件 865EventType=125 时, 866EventDate 的值	Evt 组件 EventTyp=125 时, Dt 的值 格式: YYYYMMDD
上市流通日	10145ListDate	ListDate 格式: YYYYMMDD
到期日	541 MaturityDate	MatDt 格式: YYYYMMDD
预发行开始日	使用 EvtGrp 组件 865 EventType=101 时, 866 EventDate	Evt 组件 EventTyp=101 时, Dt 的值 格式: YYYYMMDD
预发行结束日	使用 EvtGrp 组件 865 EventType=102 时, 866 EventDate	Evt 组件 EventTyp=102 时, Dt 的值 格式: YYYYMMDD
净卖出总限额(%)	11412TotalSaleLimitAmt	TotalSaleLimitAmt 单位为元, 精度: 2
债券期限	10286 SecurityTerm	SecurityTerm
发行机构	使用 SecurityRelatedParties 组件中, 11177 PartyIdentity=1 时, 表示发行人 PartySubGrp 组件 803 PartySubIDType=124 523 PartySubID 表示委托发行人的机构 中文全称	SecurityRelatedParties 组件 PartyIdentity=1 时, 表示发行人 PartySubGrp 组件 Typ=124 ID 的值
托管机构	使用 SecurityRelatedParties 组件中, 11177 PartyIdentity=6 时, 表示托管 机构 PartySubGrp 组件 803 PartySubIDType=124 523 PartySubID 表示托管机构中文全称	SecurityRelatedParties 组件 PartyIdentity=6 时, 表示发行人 PartySubGrp 组件 Typ=124 ID 的值

状态	965 SecurityStatus 1-活动 2-禁用	Status 1-活动 2-禁用
备注	58Text	Txt
息票信息-息票类型	10031 CouponRateType 1-浮动利率 0-固定利率 2-零息利率 3-贴现	CouponRateType 1-浮动利率 0-固定利率 2-零息利率 3-贴现
息票信息-付息频率	10030CouponPaymentFrequency 3-月 4-季、 0-半年 1-年 2-到期	CouponPaymentFrequency 3-月 4-季、 0-半年 1-年 2-到期
息票信息-计算方法	10072 InterestAccrualMethod 2-频率 3-天数 4-无	InterestAccrualMethod 2-频率 3-天数 4-无
息票信息-计息基准(日计数基准)	10040 DayCount 3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F	DayCount 3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F
息票信息-起息日	916StartDate	StartDt 格式: YYYYMMDD
息票信息-首次付息日	224CouponPaymentDate	CpnPmt 格式: YYYYMMDD
浮动付息债-基准利率	221 BenchmarkCurveName	Name

### 5.2.10 预发行债券信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
```

```
<!--
```

```
    Description: 预发行债券信息
```

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
    <SecDef
```

```
        SecurityDefineMsgType="23"
```

```
        DayCount="0"
```

```
        Status="1"
```

```
        IssueType="N"
```

```

IssueSizeForPlan="1000"
SettlDt ="20121212"
StartDt="20121212"
Px="0.00"
Desc="XXX"
Txt ="XXX">
<Instrmt
    ID="XXXX"
    Sym="XXXX"
    IssueSize="1000"
    FaceValue="222"
    IssuePx="10.00"
    ListDate="20121212"
    MatDt="20121212"
    TotalSaleLimitAmt="1000"
    SecurityTerm="XXX"
    CouponRateType="2"
    CouponPaymentFrequency="XXX"
    InterestAccrualMethod="2"
    CpnPmt ="20121212" />
< SprdBnchmkCurve
    Name="XXX"/>
< Evnt
    NoEvents="1"
    EventTyp="130"
    Dt =" 0091213"/ >
< Evnt
    NoEvents="2"
    EventTyp="125"
    Dt =" 0091213"/ >
< Evnt
    NoEvents="3"
    EventTyp="101"
    Dt =" 0091213"/ >
< Evnt
    NoEvents="4"
    EventTyp="102"
    Dt =" 0091213"/ >
< SecurityRelatedParties
    NoSecurityRelatedParties="1"
    SecurityPartyID="-"
    PartyIdentity="1">
    < PartySubGrp NoPartySubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>

```

```

    < /SecurityRelatedParties>
    < SecurityRelatedParties
        NoSecurityRelatedParties="2"
        SecurityPartyID="-"
        PartyIdentity="6">
        < PartySubGrp NoPartySubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>
    < /SecurityRelatedParties>
</SecDef>
</IMIXML>

```

### 5.2.11 标准债券远期交割券信息

标准债券远期可交割券信息见表9。

表9 标准债券远期可交割券信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
债券名称	55 Symbol	Sym
债券代码	48 SecurityID	ID
合约品种	10653FullSymbol	FullSymbol

### 5.2.12 标准债券远期交割券信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 标准债券远期可交割券信息
-->
<IMIXML>
    <SecDef
        SecurityDefineMsgType="16">
        <Instrmt
            ID="XXXX"
            Sym="XXXX"
            SecTyp="58"
            FullSymbol ="XXX"/>
        </SecDef>
</IMIXML>

```

### 5.2.13 债券信息(国际)

债券信息(国际)见表10。

表10 债券信息(国际)

字段	IMIX 对应	XML 名称
债券类型	107 SecurityDesc	Desc
债券名称	55 Symbol	Sym



		中文简称
债券代码	48 SecurityID	ID
发行量（亿）	10078 IssueSize	IssueSize 单位：亿，精度：10
发行价格（元）	10076 IssuePx	IssuePx 单位：元，精度：6
面值（元）	10053 FaceValue	FaceValue 单位：元，精度：2
发行日	225IssueDate	Issued 格式：YYYYMMDD
流通量（亿）	10017 CirculationSize	CirculationSize 单位：亿，精度：10
到期日	541MaturityDate	MatDt 格式：YYYYMMDD
债券期限	10286 SecurityTerm	SecurityTerm
待偿期	10243TermToMaturity	TermToMaturity
每百元应计利息	159AccruedInterestAmt	AcrdIntAmt 单位：元，精度：10
上市交易日	10145ListDate	ListDate 格式：YYYYMMDD
摘牌日期	10043DelistDate	DelistDate 格式：YYYYMMDD
状态	965SecurityStatus	Status 枚举值： 1-活动
特殊债	11865 SpecialDebt	SpecialDebt 枚举值： Y-是 N-否
到期违约债	11867 DefaultBondIndicator	DefaultBondIndicator 枚举值： Y-是 N-否
再次流通起始日	当 865EventType=135 表示再次流通起始日，866EventDate 填写具体的值	Evnt 组件 Typ=135, Dt 的值表示再次流通起始日 格式：YYYYMMDD 到期违约债时，传输该字段
再次流通终止日	当 865EventType=136 表示再次流通终止日，866EventDate 填写具体的值	Evnt 组件 Typ=136, Dt 的值表示再次流通终止日 格式：YYYYMMDD

		到期违约债时，传输该字段
<b>信用评级（重复多次）</b>		
信用评级机构	10032 CreditRatingAgency	CreditRatingAgency
信用评级	255 CreditRating	CrdRtg
信用等级有效起始日	10033 CreditValidityFrom	CreditValidityFrom 格式：YYYYMMDD
信用等级有效终止日	10034 CreditValidityTo	CreditValidityTo 格式：YYYYMMDD
<b>息票信息</b>		
息票类型	10031 CouponRateType	CouponRateType 枚举值： 1-浮动利率 0-固定利率 2-零息利率 3-贴现
付息频率	10030 CouponPaymentFrequency	CouponPaymentFrequency 枚举值： 3-月 4-季 0-半年 1-年 2-到期
计算方法	10072 InterestAccrualMethod	InterestAccrualMethod 枚举值： 2-频率 3-天数 4-无
计息基准（日计数基准）	10040 DayCount	DayCount 枚举值： 3-实际/365 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F 2-30/360
起息日	64SettlDate	SettlDt 格式：YYYYMMDD
首次付息日	224CouponPaymentDate	CpnPmt 格式：YYYYMMDD
<b>固定附息债</b>		
固定利率（%）	44Price	Px 单位：%，精度：6
<b>浮动附息债</b>		

基准利率名	221 BenchmarkCurveName	Name
基准利率值 (%)	662 BenchmarkPrice	Px 单位: %, 精度: 6
基准利差 (基点) (%)	218 Spread	Spread 单位: %, 精度: 6
利率上限	10028 CouponCapRate	CouponCapRate 单位: %, 精度: 6
利率下限	10029 CouponFloorRate	CouponFloorRate 单位: %, 精度: 6
当前票面利率	223CouponRate	CpnRt 单位: %, 精度: 6
发行机构简称-中文	106Issuer	Issr
<b>可转债</b>		
转换日期	10023ConvertDate	ConvertDate 格式: YYYYMMDD 该字段不传
转换类型	10027ConvertType	ConvertType 枚举值: 0-部分 1-全部 该字段不传
转换比例	10025ConvertOfFaceValue	ConvertOfFaceValue 精度: 6 该字段不传
转换价格 (元)	10026ConvertPx	ConvertPx 单位: 元, 精度: 2 该字段不传
<b>再发行信息</b>		
增发标识	10280 ReissueIndicator	ReissueIndicator 枚举值: Y-是 N-否
增发发行日 (重复多次)	10279ReissueDate	ReissueDate 格式: YYYYMMDD
增发上市日 (重复多次)	使用 ReissueEvntGrp 组件 10760ReissueEventType 取值 7 表示增发上市日, 10761ReissueEventDate 的值	ReissueEvntGrp 组件 当 ReissueEventType=7 时 , ReissueEventDate 的值 格式: YYYYMMDD
增发量 (亿) (重复多次)	10281ReissueSize	ReissueSize 单位: 亿, 精度: 10
<b>行权 (重复多次)</b>		
行权类型	使用重复组件 EvntGrp 表示:	Evnt 组件

	865EventType 取值 2-Call 表示可提前兑付, 1-Put 表示可提前赎回	Typ 取值 2-Call 表示可提前兑付, 1-Put 表示可提前赎回
行权日	866EventDate	Dt 格式: YYYYMMDD
行权价格 (元)	867EventPx	Px 单位: 元, 精度: 2
行权量 (亿)	11413EventQty	EventQty 单位: 亿, 精度: 10
行权后利率/基准利差 (%)	使用 Stipulations 组件存放行权收益率信息, 233StipulationType 取 值 为 StrikeYield 时 234StipulationValue 取值为行权收益率	Stip 组件 Typ 取值为 StrikeYield 时 Val 的值为行权收益率 单位: %, 精度: 6 浮动时即为利率, 固定为利差
托管机构	452PartyRole 取值 105 时, 448PartyID 的值	R 取值 105 时, ID 的值
是否可适用于净额清算	11414NetSettlementIndicator	NetSettlementIndicator 枚举值: Y-是 N-否
币种	15Currency	Ccy
流通范围	1390TradePublishIndicator	TrdPubInd 枚举值: 0-定向 1-公开

## 5.2.14 债券信息(国际)XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 债券信息(国际)
-->
<IMIXML>
    <SecDef
        SecurityDefineMsgType="16"
        AcrdIntAmt="0"
        Status="1"
        InterestAccrualMethod="1"
        DayCount="0"
        SettleDt="0100612"
        Px="0"
        ReissueIndicator="Y"
        Ccy="CNY"
        Desc="XXX"

```

```

NetSettlementIndicator="Y"
TrdPubInd="0"
SpecialDebt="Y"
DefaultBondIndicator ="Y">
<Instrmt
  ID="XXXX"
  Sym="XXXX"
  IssueSize="10000"
  IssuePx="1000"
  FaceValue="0"
  Issued="20091212"
  CirculationSize="0"
  MatDt="20091212"
  SecurityTerm="XX"
  TermToMaturity="0"
  ListDate="20091212"
  DelistDate="20091213"
  CouponRateType="0"
  CpnPmt="20091213"
  CpnRt="1000"
  Issr="XXX"
  CouponPaymentFrequency="3"/>
<SprdBnchmkCurve
  Name="XXX"
  Px="2.53"
  Spread="34"
  CouponCapRate="0"
  CouponFloorRate="0"/>
<CredRateAgencyInfoGrp
  NoCredRateAgencyInfo ="1"
  CreditRatingAgency="XXX"
  CrdRtg="XXX"
  CreditValidityFrom="20091213"
  CreditValidityTo="20091213" />
<CredRateAgencyInfoGrp
  NoCredRateAgencyInfo ="2"
  CreditRatingAgency="XXX"
  CrdRtg="XXX"
  CreditValidityFrom="20091213"
  CreditValidityTo="20091213" />
< ConvertInfoGrp
  NoConvertInfo="1"
  ConvertType="2"

```

```

        ConvertDate="20091213"
        ConvertOfFaceValue="2"
        ConvertPx="2"/>
    < ReissueInfoGrp
        NoReissueInfo="1"
        ReissueDate="20091213"
        ReissueSize="2">
        <ReissueEvtGrp
            NoReissueEvents="1"
            ReissueEventType="7"
            ReissueEventDate="20180212"/>
    </ReissueInfoGrp>
    < ReissueInfoGrp
        NoReissueInfo="2"
        ReissueDate="20091213"
        ReissueSize="2">
        <ReissueEvtGrp
            NoReissueEvents="1"
            ReissueEventType="7"
            ReissueEventDate="20180212"/>
    </ReissueInfoGrp>
    < ReissueInfoGrp
        NoReissueInfo="3"
        ReissueDate="20091213"
        ReissueSize="2">
        <ReissueEvtGrp
            NoReissueEvents="1"
            ReissueEventType="7"
            ReissueEventDate="20180212"/>
    </ReissueInfoGrp>
    < Evt
        NoEvents="1"
        Typ="1"
        Dt="0091213"
        Px="1.0"
        EventQty="1000">
        < StipNoStipulations="1" Typ="1" Val="0.00"/>
    </ Evt>
    < Evt
        NoEvents="2"
        Typ="1"
        Dt="0091213"
        Px="1.0"

```

```

        EventQty="1000">
        < StipNoStipulations="1" Typ="1" Val="0.00"/>
    </ Evnt>
    < Evnt
        NoEvents="3"
        Typ="135"
        Dt =" 20121212"/>
    </ Evnt>
    < Evnt
        NoEvents="4"
        Typ="136"
        Dt =" 20130209"/>
    </ Evnt>
    <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="105"/>
</SecDef>
</IMIXML>

```

### 5.2.15 上市前债券信息（银行间）

上市前债券信息（银行间）见表11。

表11 上市前债券信息(银行间)

字段	IMIX 对应	XML 名称
债券大类	167 SecurityType	SecTyp 100-利率债 33-信用债 CD-同业存单
债券类型	107 SecurityDesc	Desc 如：中期票据、央行票据、企业债、 同业存单等
债券代码	48SecurityID	ID
债券名称	55Symbol	Sym
上市交易日	10145ListDate	ListDate 格式：YYYYMMDD
债券状态	965 SecurityStatus	Status 1-活动
摘牌日期	10043DelistDate	DelistDate 格式：YYYYMMDD
发行日期	225IssueDate	Issued 格式：YYYYMMDD
起息日	64SettlDate	SettlDt 格式：YYYYMMDD
到期日	541MaturityDate	MatDt

		格式: YYYYMMDD
待偿期	10243TermToMaturity	TermToMaturity 如: 1 年
发行价 (元)	10076 IssuePx	IssuePx 单位: 元, 精度: 10
面值 (元)	10053 FaceValue	FaceValue 单位: 元, 精度: 2
发行机构	106Issuer	Issr 债券发行机构中文全称
息票类型	10031 CouponRateType	CouponRateType 1-浮动利率 0-固定利率 2-零息利率 3-贴现
基准利率名称	使用 SpreadOrBenchmarkCurveData 组件 221 BenchmarkCurveName	SprdBnchmkCurve 组件 Name 如 Shibor_3M_20D
票面利率	223 CouponRate	CpnRt 单位: %, 精度: 6
托管机构	使用 Parties 组件 452PartyRole 取值 105 表示托管机构, 803PartySubIDType 取值 125 表示机构 中文简称, 523PartySubID 的值	Pty 组件 当 R=105 表示托管机构 Sub 组件 当 Typ=125 时, ID 的值 国债登、上清所
增发发行日	使用 ReissueInfoGrp 组件 10279 ReissueDate	ReissueDate 格式: YYYYMMDD
增发上市日	使用 ReissueEvntGrp 组件 10760ReissueEventType 取值 7 表示增 发上市日, 10761ReissueEventDate 的值	ReissueEvntGrp 组件 当 ReissueEventType=7 时 , ReissueEventDate 的值 格式: YYYYMMDD
增发量 (亿)	10281 ReissueSize	ReissueSize 单位: %, 精度: 10
币种	15Currency	Ccy 债券币种, CNY
是否新发关键期限债券	11890LastIssueKeyPeriodBondFlag	LastIssueKeyPeriodBondFlag Y-是 N-否 包括新发关键期限国债和国开债
是否绿色债券	11891GreenBondFlag	GreenBondFlag Y-是 N-否
交易成员群组	使用 PtysSubGrp 组件	Sub 组件



	803PartySubIDType 取值 29, 523PartySubID 取值 CFETS 表示银行间	Typ=29 时, ID=CFETS 枚举值: 银行间
流通范围	1390TradePublishIndicator	TrdPubInd 1-公开 仅抽取流通范围为公开的债券
行权类型	使用 EvntGrp 重复组件 865EventType	Evnt 组件 Typ 1-可提前赎回 2-可提前兑付
行权日	866EventDate	Dt 格式: YYYYMMDD
行权价格(元)	867EventPx	Px 单位: 元, 精度: 2
行权量(亿)	11413EventQty	EventQty 单位: 亿, 精度: 10
信用评级机构	使用 CreditRateAgencyInfoGrp 组件 10032 CreditRatingAgency	CreditRateAgencyInfoGrp 组件 CreditRatingAgency 机构中文全称
主体评级	255 CreditRating	CrdRtg 信用等级, 如 AAA
生效日	10033 CreditValidityFrom	CreditValidityFrom 格式: YYYYMMDD, 信用等级有效起始日
终止日	10034 CreditValidityTo	CreditValidityTo 格式: YYYYMMDD, 信用等级有效终止日

### 5.2.16 上市前债券信息(银行间) XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 " ?>
<!--
    Description: 上市前债券信息(银行间)
-->
<IMIXML>
    <SecDef
        Desc="中期票据"
        SettlDt="20180113"
        Ccy="CNY"
        LastIssueKeyPeriodBondFlag="Y"
        GreenBondFlag="Y"
        TrdPubInd="1"
    <Instrmt
        ID="XXXX"
        Sym="XXXX"
        SecTyp="100"

```

```

ListDate="20180111"
Status="1"
DelistDate="20180130"
Issued="20180112"
MatDt="20180118"
TermToMaturity="1 年"
IssuePx="1000000.111122222"
FaceValue="2000000.22"
Issr="XXX"
CouponRateType="1"
CpnRt="1.223344" />
<SprdBnchmkCurve
  Name="XXX" />
<Pty
  NoPartyIDs="1"
  ID="-"
  R="105">
    <SubNoPartySubIDs="1" ID="国债登" Typ="125"/>
    <SubNoPartySubIDs="2" ID="CFETS" Typ="29"/>
  </Pty>
  < ReissueInfoGrp
    NoReissueInfo="1"
    ReissueDate="20180130"
    ReissueSize="10.111111111">
      <ReissueEvtGrp
        NoReissueEvents="1"
        ReissueEventType="7"
        ReissueEventDate="20180212"/>
      </ReissueInfoGrp>
    < ReissueInfoGrp
      NoReissueInfo="2"
      ReissueDate="20180202"
      ReissueSize="20.111111111">
        <ReissueEvtGrp
          NoReissueEvents="1"
          ReissueEventType="7"
          ReissueEventDate="20180218"/>
        </ReissueInfoGrp>
      < Evt
        NoEvents="1"
        Typ="1"
        Dt="20180214"
        Px="2000000.11"

```

```

        EventQty="10000.0000111122" />
    < Evnt
        NoEvents="2"
        Typ="2"
        Dt="20180218"
        Px="3000000.11"
        EventQty="20000.0000111122" />
    <CredRateAgencyInfoGrp
        NoCredRateAgencyInfo ="1"
        CreditRatingAgency="XXX"
        CrdRtg="AAA"
        CreditValidityFrom="20091212"
        CreditValidityTo="20101212" />
    <CredRateAgencyInfoGrp
        NoCredRateAgencyInfo ="2"
        CreditRatingAgency="XXX"
        CrdRtg="AAA"
        CreditValidityFrom="20111212"
        CreditValidityTo="20121212" />
</SecDef>
</IMIXML>

```

### 5.2.17 高收益债券信息

高收益债券信息见表12。

表12 高收益债券信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
代码	48 SecurityID	ID 债券代码
名称	55 Symbol	Sym 债券名称
高收益债券类型	11903HighYldBondType	HighYldBondType 枚举值： 1-到期违约债券（MD） 2-利息违约债券（ID） 3-高风险债券（HR） 4-高收益债券（HY）
最大报价价差	11904MaxQteSpread	MaxQteSpread 单位：元 精度：6
备注	58 Text	Txt

### 5.2.18 高收益债券信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 高收益债券信息
-->
<IMIXML>
    <SecDef
        HighYldBondType="1"
        MaxQteSpread="100.111111"
        Txt="XXX">
        <Instrmt
            ID="XXX"
            Sym="XXX"/>
        </SecDef>
    </IMIXML>
```

### 5.3 本币银行间交易成员信息

#### 5.3.1 交易成员基本信息

交易成员基本信息见表13。

表13 交易成员基本信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
交易成员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=2 时, ID 的值 机构 6 位码
机构代码	448PartyID	ID 机构 21 位代码
交易成员全称	当 803PartySubIDType=124 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=124 时, ID 的值
中文简称	当 803PartySubIDType=125 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=125 时, ID 的值
英文全称	当 803PartySubIDType=5 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=5 时, ID 的值
英文简称	当 803PartySubIDType=102 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=102 时, ID 的值

#### 5.3.2 交易成员基本信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 交易成员基本信息
-->
<IMIXML>
    <PtyDetlListRpt
```

```

PartyInfoType ="3">
< PartyListGrp
  NoPartyList="1"
  ID="XXX">
    < PtysSubGrpNoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
    < PtysSubGrpNoPartySubIDs="2" ID="XXX" Typ="125"/>
    < PtysSubGrpNoPartySubIDs="3" ID="XXX" Typ="5"/>
    < PtysSubGrpNoPartySubIDs="4" ID="XXX" Typ="102"/>
    < PtysSubGrpNoPartySubIDs="5" ID="XXX" Typ="2"/>
  </ PartyListGrp>
</PtyDetlListRpt>
</IMIXML>

```

### 5.3.3 交易成员通讯录信息

交易成员通讯录信息见表14。

表14 交易成员通讯录信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
交易成员 ID	448PartyID 机构 6 位码	ID 机构 6 位码
交易成员	当 803PartySubIDType=124 时 , 523PartySubID 的取值 机构名称	PtysSubGrp 组件 当 Typ=124 时, ID 的值 机构名称
交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 , 523PartySubID 的取值 交易员 ID	PtysSubGrp 组件 当 Typ=2 时, ID 的值 交易员 ID
交易员姓名	当 803PartySubIDType=126 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=126 时, ID 的值
联系电话	当 10603ContactInfoIDType=6 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=6 时 , ContactInfoID 的值
传真	当 10603ContactInfoIDType=8 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=8 时 , ContactInfoID 的值
EMail	当 10603ContactInfoIDType=10 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=10 时 , ContactInfoID 的值
MSN	当 10603ContactInfoIDType=11 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=11 时 , ContactInfoID 的值
通讯地址	当 10603ContactInfoIDType=0 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=0 时 ,

		ContactInfoID 的值
邮政编码	当 10603ContactInfoIDType=5 时， 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=5 时， ContactInfoID 的值

5.3.4 交易成员通讯录信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 交易成员通讯录信息
-->
<IMIXML>
    <PtyDetlListRpt
        PartyInfoType ="1">
        < PartyListGrp
            NoPartyList="1"
            ID="XXX">
                < PtysSubGrp NoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
                < PtysSubGrp NoPartySubIDs="2" ID="XXX" Typ="2"/>
                < PtysSubGrp NoPartySubIDs="3" ID="XXX" Typ="126"/>
                < ContactInfoGrp NoContactInfos="1" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="6"/>
                < ContactInfoGrp NoContactInfos="2" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="8"/>
                < ContactInfoGrp NoContactInfos="3" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="10"/>
                < ContactInfoGrp NoContactInfos="4" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="11"/>
                < ContactInfoGrp NoContactInfos="5" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="0"/>
                < ContactInfoGrp NoContactInfos="6" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="5"/>
            </ PartyListGrp >
        </ PtyDetlListRpt >
    </IMIXML>
```

5.4 本币国际交易成员信息

5.4.1 交易成员基本信息

交易成员基本信息见表15。

表15 交易成员基本信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
交易成员 ID	当 803PartySubIDType=2 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=2 时，ID 的值 机构 6 位码
机构代码	448PartyID	ID 机构 21 位代码
交易成员全称	当 803PartySubIDType=124 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=124 时，ID 的值

中文简称	当 803PartySubIDType=125 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=125 时, ID 的值
英文全称	当 803PartySubIDType=5 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=5 时, ID 的值
英文简称	当 803PartySubIDType=102 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=102 时, ID 的值

5.4.2 交易成员基本信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 交易成员基本信息
-->
<IMIXML>
    <PtyDetlListRpt
        PartyInfoType ="3">
        < PartyListGrp
            NoPartyList="1"
            ID="XXX">
                < PtysSubGrpNoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
                < PtysSubGrpNoPartySubIDs="2" ID="XXX" Typ="125"/>
                < PtysSubGrpNoPartySubIDs="3" ID="XXX" Typ="5"/>
                < PtysSubGrpNoPartySubIDs="4" ID="XXX" Typ="102"/>
                < PtysSubGrpNoPartySubIDs="5" ID="XXX" Typ="2"/>
            </ PartyListGrp>
        </PtyDetlListRpt>
    </IMIXML>
```

5.4.3 交易成员通讯录信息

交易成员通讯录信息见表16。

表16 交易成员通讯录信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
交易成员 ID	448PartyID	ID 机构 6 位码
交易成员	当 803PartySubIDType=124 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=124 时, ID 的值
交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=2 时, ID 的值
交易员姓名	当 803PartySubIDType=126 时 , 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=126 时, ID 的值
联系电话	当 10603ContactInfoIDType=6 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=6 时 ,

		ContactInfoID 的值
传真	当 10603ContactInfoIDType=8 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=8 时 , ContactInfoID 的值
EEmail	当 10603ContactInfoIDType=10 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=10 时 , ContactInfoID 的值
MSN	当 10603ContactInfoIDType=11 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=11 时 , ContactInfoID 的值
通讯地址	当 10603ContactInfoIDType=0 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=0 时 , ContactInfoID 的值
邮政编码	当 10603ContactInfoIDType=5 时, 10602ContactInfoID 的值	ContactInfoGrp 组件 当 ContactInfoIDType=5 时 , ContactInfoID 的值

#### 5.4.4 交易成员通讯录信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
Description: 交易成员通讯录信息
-->
<IMIXML>
  <PtyDetlListRpt
    PartyInfoType="1">
    < PartyListGrp
      NoPartyList="1"
      ID="XXX">
        < PtysSubGrp NoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
        < PtysSubGrp NoPartySubIDs="2" ID="XXX" Typ="2"/>
        < PtysSubGrp NoPartySubIDs="3" ID="XXX" Typ="126"/>
        < ContactInfoGrp NoContactInfos="1" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="6"/>
        < ContactInfoGrp NoContactInfos="2" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="8"/>
        < ContactInfoGrp NoContactInfos="3" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="10"/>
        < ContactInfoGrp NoContactInfos="4" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="11"/>
        < ContactInfoGrp NoContactInfos="5" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="0"/>
        < ContactInfoGrp NoContactInfos="6" ContactInfoID="XXX" ContactInfoIDType="5"/>
      </ PartyListGrp >
    </ PtyDetlListRpt >
  </IMIXML>

```

#### 5.5 本币交易产品接口信息



### 5.5.1 质押券折算率（匿名点击）信息

质押券折算率（匿名点击）信息见表17。

表17 质押券折算率（匿名点击）信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
债券名称	55Symbol	Sym
债券代码	48SecurityID	ID
R001	<UndInstrmtGrp >组件 309 UnderlyingSecurityID=R001 时 <UnderlyingStipulations>组件 888UnderlyingStpType=Haircut 889UnderlyingStpValue 的值	<Undly>组件 ID= R001 时 <Stip>组件 Typ==Haircut Val 的值 精度：4
R007	<UndInstrmtGrp >组件 309 UnderlyingSecurityID=R007 时 <UnderlyingStipulations>组件 888UnderlyingStpType=Haircut 889UnderlyingStpValue 的值	<Undly>组件 ID= R007 时 <Stip>组件 Typ==Haircut Val 的值 精度：4
R014	<UndInstrmtGrp >组件 309 UnderlyingSecurityID=R014 时 <UnderlyingStipulations>组件 888UnderlyingStpType=Haircut 889UnderlyingSstpValue 的值	<Undly>组件 ID= R014 时 <Stip>组件 Typ==Haircut Val 的值 精度：4
R021	<UndInstrmtGrp >组件 309 UnderlyingSecurityID=R021 时 <UnderlyingStipulations>组件 888UnderlyingStpType=Haircut 889UnderlyingSstpValue 的值	<Undly>组件 ID= R021 时 <Stip>组件 Typ==Haircut Val 的值 精度：4

### 5.5.2 质押券折算率（匿名点击）信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
```

```
<!--
```

Description: 质押券折算率（匿名点击）信息

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<SecTyps
```

```
SecurityDefinitionType="4">
```

```
< Instrmt
```

```
ID=" SHIBOR3M_3M×6M"
```

```

        Sym="XXX"
    <Undly
        NoUnderlyings ="1"
        ID="R001">
        < StipNoUnderlyingStips="1" Typ= Haircut Val="0.1234"/>
    </ Undly>
    <Undly
        NoUnderlyings ="2"
        ID="R007">
        < StipNoUnderlyingStips="1" Typ= Haircut Val="0.1234"/>
    </ Undly>
    <Undly
        NoUnderlyings ="3"
        ID="R014">
        < StipNoUnderlyingStips="1" Typ= Haircut Val="0.1234"/>
    </ Undly>
    <Undly
        NoUnderlyings ="4"
        ID="R021">
        < StipNoUnderlyingStips="1" Typ= Haircut Val="0.1234"/>
    </ Undly>
</SecTyps >
</IMIXML>
```

5.5.3 标准利率互换信息

标准利率互换信息见表18。

表18 标准利率互换信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
合约名称	48SecurityID	ID
期限（月）	10316TradeLimitDays	TradeLimitDays
计息天数调整	10018 InterestAccuralDaysAdjustment 枚举值：0-不调整、1-实际天数	InterestAccuralDaysAdjustment 枚举值：0-不调整、1-实际天数
起息日	916 StartDate	StartDt 格式：YYYYMMDD
首期起息日	10054 FirstPeriodStartDate	FirstPeriodStartDate 格式：YYYYMMDD
到期日	917 EndDate	EntDt 格式：YYYYMMDD
合约上架日期	225IssueDate	Issued 格式：YYYYMMDD
合约下架日期	10085LastTradeDate	LastTradeDate

		格式: YYYYMMDD
支付日调整	10009 CouponPaymentDateReset 枚举值: 0-上一营业日、1-下一营业日、 2-经调整的下一营业日	CouponPaymentDateReset 枚举值: 0-上一营业日、1-下一营业 日、2-经调整的下一营业日
清算方式	11143 ClearingMethod 枚举值: 6-上海清算所清算、13-双边自行 清算	ClearingMethod 枚举值: 6-上海清算所清算、13-双边 自行清算
固定利率-首期定期支付日	248 LegCouponPaymentDate	CpnPmt 格式: YYYYMMDD
固定利率-支付周期	10096 LegCouponPaymentFrequency 枚举值: 2-到期、7-天、6-周、5-两周、 3-月、4-季、1-年、0-半年	LegCouponPaymentFrequency 枚举值: 2-到期、7-天、6-周、5-两 周、3-月、4-季、1-年、0-半年
固定利率-计息基准	10097 LegDayCount 枚举值: 3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F	LegDayCount 枚举值: 3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F
浮动利率-参考利率	677 LegBenchmarkCurveName	Name
浮动利率-首期定期支付日	248 LegCouponPaymentDate	CpnPmt 格式: YYYYMMDD
浮动利率-首次利率确定日	956 LegInterestAccrualDate	IntAcrl 格式: YYYYMMDD
浮动利率-计息方法	10106 LegInterestAccrualMethod 枚举值: 0-单利、1-复利	LegInterestAccrualMethod 枚举值: 0-单利、1-复利
浮动利率-计息基准	10097 LegDayCount 枚举值: 3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F	LegDayCount 枚举值: 3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F
浮动利率-支付周期	10096 LegCouponPaymentFrequency 枚举值: 2-到期、7-天、6-周、5-两周、 3-月、4-季、1-年、0-半年	LegCouponPaymentFrequency 枚举值: 2-到期、7-天、6-周、5-两 周、3-月、4-季、1-年、0-半年
浮动利率-重置频率	10108 LegInterestAccrualResetFrequency 枚举值: 7-天、6-周、5-两周、3-月、4-季、 1-年、0-半年	LegInterestAccrualResetFrequency 枚举值: 7-天、6-周、5-两周、3-月、 4-季、1-年、0-半年
挂牌基准价	662BenchmarkPrice	Px 单位: %, 精度: 4

## 5.5.4 标准利率互换信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 标准利率互换信息
-->
<IMIXML>
    <SecTyps
        TradeLimitDays ="6000"
        InterestAccrualDaysAdjustment="XXX"
        CouponPaymentDateReset="XXX"
        StartDt="20081212"
        EndDt="20091212">
        < Instrmt
            ID=" SHIBOR3M_3M×6M"
            MarketIndicator="42"
            FirstPeriodStartDate ="20121213"
            Issued="20081202"
            LastTradeDate ="20081202"/>
        < ClearingReferenceDataClearingMethod="XXX"/>
        < SprdBnchmkCurvePx="0.00"/>
        <Exec
            Nolegs="1"
            Side="1"
            PxTyp="3"
            LegCouponPaymentFrequency="0"
            LegDayCount="0"
            CpnPmt="20081212"/>
        <Exec
            Nolegs="2"
            Side="B"
            PxTyp="6"
            Name="XXX"
            CpnPmt="20081212"
            IntAcrl="20150824"
            LegInterestAccrualMethod ="0"
            LegCouponPaymentFrequency="0"
            LegDayCount="0"
            LegInterestAccrualResetFrequency ="6"/>
        </SecTyps >
    </IMIXML>

```

#### 5.5.5 标准债券远期信息

标准债券远期见表19。

表19 标准债券远期信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
交易品种	55Symbol	Sym
合约名称	48SecurityID	ID
最小单笔报价量（手）	110MinQty	MinQty 单位：手，最大值 999，精度为 0
最大单笔报价量（手）	10179MaxQty	MaxQty 单位：手，最大值 999，精度为 0
合约上架日期	225IssueDate	Issued 格式：YYYYMMDD
合约下架日期	10085LastTradeDate	LastTradeDate 格式：YYYYMMDD
交割日	64SettlDate	SettlDt 格式：YYYYMMDD
合约状态	965SecurityStatus 枚举值：A-待上市, B-交易中, C-已退市, D-交易结束, E-已暂停	Status 枚举值：A-待上市, B-交易中, C-已退市, D-交易结束, E-已暂停
最后交易日交易结束时间	345TradSesEndTime	EndTm 格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS
合约面值（万元）	10053FaceValue	FaceValue 单位：万元，整数
清算方式	11143 ClearingMethod 枚举值：6-上海清算所清算、13-双边自行清算	ClearingMethod 枚举值：6-上海清算所清算、13-双边自行清算
挂牌基准价	662BenchmarkPrice	Px 单位：元，精度：4

## 5.5.6 标准债券远期信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 标准债券远期信息
-->
<IMIXML>
    <SecTyps
        MinQty="1000"
        MaxQty="1200"
        SettlDt="20071212"
        EndTm="20091212-12:00:00">
        < Instrmt
            ID=" SHIBOR3M_3M×6M"
            Sym="XXX"
            Status="A"

```

```

MarketIndicator="43"
Issued="20081202"
FaceValue="1222"
LastTradeDate="20081202"/>
< ClearingReferenceDataClearingMethod="XXX"/>
< SprdBnchmkCurvePx="0.00"/>
</SecTyps >
</IMIXML>

```

### 5.5.7 利率互换（固浮）信息

利率互换（固浮）信息见表20。

表20 利率互换（固浮）信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
产品名称	48SecurityID	ID
期限	10316TradeLimitDays	TradeLimitDays
生效日	168 EffectiveTime	EfctvTm 格式：YYYYMMDD
计息天数调整	10018 InterestAccuralDaysAdjustment 枚举值：0-不调整、1-实际天数	InterestAccuralDaysAdjustment 枚举值：0-不调整、1-实际天数
首期起息日	11416 FirstPeriodStartDateRule	FirstPeriodStartDateRule
支付日调整	10009 CouponPaymentDateReset 枚举值：0-上一营业日、1-下一营业日、 2-经调整的下一营业日	CouponPaymentDateReset 枚举值：0-上一营业日、1-下一营业 日、2-经调整的下一交营业日
固定支付周期	10096 LegCouponPaymentFrequency 枚举值：2-到期、7-天、6-周、5-两周、 3-月、4-季、1-年、0-半年	LegCouponPaymentFrequency 枚举值：2-到期、7-天、6-周、5-两 周、3-月、4-季、1-年、0-半年
固定计息基准	10097 LegDayCount 枚举值：3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F	LegDayCount 枚举值：3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F
参考利率(浮动)	677 LegBenchmarkCurveName	Name
默认利差(BPS)	10090 LegBenchmarSpread	LegBenchmarSpread 单位：BPs，精度：3
首次利率确定日	11417LegInterestAccrualDateRule	LegInterestAccrualDateRule
浮动支付周期	10096 LegCouponPaymentFrequency 枚举值：2-到期、7-天、6-周、5-两周、 3-月、4-季、1-年、0-半年	LegCouponPaymentFrequency 枚举值：2-到期、7-天、6-周、5-两 周、3-月、4-季、1-年、0-半年
重置频率	10108 LegInterestAccrualResetFrequency	LegInterestAccrualResetFrequency 枚举值： 7-天、6-周、5-两周、3-

	枚举值：7-天、6-周、5-两周、3-月、4-季、1-年、0-半年	月、4-季、1-年、0-半年
计息方法	10106 LegInterestAccrualMethod 枚举值：0-单利、1-复利	LegInterestAccrualMethod 枚举值：0-单利、1-复利
浮动计息基准	10097 LegDayCount 枚举值：3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F	LegDayCount 枚举值：3-实际/365 D-30E/360 0-实际/实际 1-实际/360 5-实际/365F

#### 5.5.8 利率互换（固浮）信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 "?>
<!--
Description: 利率互换（固浮）信息
-->
<IMIXML>
  <SecTyps
    TradeLimitDays ="6000"
    EfctvTm ="20121212"
    Side="J"
    InterestAccrualDaysAdjustment="XXX"
    CouponPaymentDateReset="XXX">
    < Instrmt
      ID=" SHIBOR3M_3M×6M"
      MarketIndicator="2"
      FirstPeriodStartDateRule="XXX"/>
    <Exec
      Nolegs="1"
      Side="1"
      PxTyp="3"
      LegCouponPaymentFrequency="0"
      LegDayCount="0"/>
    <Exec
      Nolegs="2"
      Side="B"
      PxTyp="6"
      Name="XXX"
      LegBenchmarkSpread="5.000"
      LegCouponPaymentFrequency="0"
      LegDayCount="0"
      LegInterestAccrualDateRule="XXX"
      LegInterestAccrualResetFrequency ="6"

```

```
        LegInterestAccrualMethod ="0"/>
    </SecTyps >
</IMIXML>
```

## 5.6 本币其他信息接口

### 5.6.1 交易节假日信息

交易节假日信息见表21。

表21 交易节假日信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
市场名称	10176MarketIndicator	MarketIndicator 枚举值：4-现券买卖、9-质押式回购、10-买断式回购、8-债券借贷、5-债券远期、1-信用拆借、2-利率互换、3-远期利率协议、18-信用风险缓释凭证、21-预发行、45-利率上限/下限期权、44-利率互换期权、53-同业存款、41-同业借款、48-信用违约互换
节假日期	使用<ParameterDefinitionGrp>组件 当 11156ParameterType 取值 Holidays 表示节假日时 11157ParameterValue 的值表示具体日期	使用<ParameterDefinitionGrp>组件 当 ParameterType 取值 Holidays 表示节假日时 ParameterValue 的值表示具体日期 格式：YYYYMMDD

### 5.6.2 交易节假日信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 "?>
<!--
    Description: 交易节假日信息
-->
<IMIXML>
    <ParameterDefinition
        ParameterDefinitionType ="6">
        <Instrmt
            MarketIndicator ="2"/>
        < ParameterDefinitionGrp
            NoParameterDefinitions="1"
            ParameterType ="Holidays"
            ParameterValue ="20121212"/>
        </ParameterDefinition >
    <ParameterDefinition
        ParameterDefinitionType ="6">
        <Instrmt
```



```
MarketIndicator="18"/>
<ParameterDefinitionGrp
  NoParameterDefinitions="1"
  ParameterType="Holidays"
  ParameterValue="20171228"/>
</ParameterDefinition ><!--Description:交易节假日信息(可传多条)-->
</IMIXML>
```

5.6.3 结算节假日信息

结算节假日信息见表22。

表22 结算节假日信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
市场名称	10176MarketIndicator	MarketIndicator 枚举值：4-现券买卖、9-质押式回购、10-买断式回购、8-债券借贷、5-债券远期、1-信用拆借、2-利率互换、3-远期利率协议、18-信用风险缓释凭证、21-预发行、45-利率上限/下限期权、44-利率互换期权、53-同业存款、41-同业借款、48-信用违约互换
节假日期	使用<ParameterDefinitionGrp>组件 当 11156ParameterType 取值 Holidays 表示节假日时 11157ParameterValue 的值表示具体日期	使用<ParameterDefinitionGrp>组件 当 ParameterType 取值 Holidays 表示节假日时 ParameterValue 的值表示具体日期 格式：YYYYMMDD

5.6.4 结算节假日信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 " ?>
<!--
  Description: 结算节假日信息
-->
<IMIXML>
  <ParameterDefinition
    ParameterDefinitionType="7">
    <Instrmt
      MarketIndicator="2"/>
    <ParameterDefinitionGrp
      NoParameterDefinitions="1"
      ParameterType="Holidays"
      ParameterValue="20121212"/>
    </ParameterDefinition >
  </ParameterDefinition
```

```

        ParameterDefinitionType ="7">
        <Instrmt
            MarketIndicator ="18"/>
        < ParameterDefinitionGrp
            NoParameterDefinitions="1"
            ParameterType ="Holidays"
            ParameterValue ="20180102"/>
        </ParameterDefinition ><!--Description:结算节假日信息(可传多条)-->
    </IMIXML>

```

### 5.6.5 错误代码对照表信息

错误代码对照表信息见表23。

表23 错误代码对照表信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
市场描述	10176 MarketIndicator 枚举值: 4-现券买卖、9-质押式回购、10-买断式回购、8-债券借贷、5-债券远期、1-信用拆借、2-利率互换、3-远期利率协议、18-信用风险缓释凭证、21-预发行、45-利率上限/下限期权、44-利率互换期权、49-北金所、50-交易所、6-资产支持证券、0-全市场、53-同业存款、41-同业借款	MarketIndicator 枚举值: 4-现券买卖、9-质押式回购、10-买断式回购、8-债券借贷、5-债券远期、1-信用拆借、2-利率互换、3-远期利率协议、18-信用风险缓释凭证、21-预发行、45-利率上限/下限期权、44-利率互换期权、49-北金所、50-交易所、6-资产支持证券、0-全市场、53-同业存款、41-同业借款
错误代码	11251ApplErrorCode	ApplErrorCode
错误描述	11261ApplErrorDesc	ApplErrorDesc

### 5.6.6 错误代码对照表信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 错误代码对照表信息
-->
<IMIXML>
    <ParameterDefinition
        ParameterDefinitionType ="8">
        <Instrmt MarketIndicator ="2"/>
        < MessagingControl
            ApplErrorCode ="XXX"
            ApplErrorDesc ="XXX"
        </ ParameterDefinition >
    </IMIXML>

```

5.7 本币机构主从关系

5.7.1 机构主从关系信息

机构主从关系信息见表24。

表24 机构主从关系信息

字段	IMIX 对应	XML 名称
主机构中文全称	当 452PartyRole=1 表示主机构， 803PartySubIDType=124 表示机构中文 全称时，523PartySubID 的值	PartyListGrp 组件 当 R=1 表示主机构 PtysSubGrp 组件 当 Typ=124 时，ID 的值
主机构 6 位码	448 PartyID	ID
从机构中文全称	当 452PartyRole=146 表示从机构， 803PartySubIDType=124 表示机构中文 全称时，523PartySubID 的值	PartyListGrp 组件 当 R=146 表示从机构 PtysSubGrp 组件 当 Typ=124 时，ID 的值
从机构 6 位码	448 PartyID	ID
主关系类型名称	当 452PartyRole=1 表示主机构， 803PartySubIDType=244 表示主关系类 型名称时，523PartySubID 的值	PartyListGrp 组件 当 R=XXX 表示从机构 PtysSubGrp 组件 当 Typ=XXX 时，ID 的值
从关系类型名称	当 452PartyRole=146 表示从机构， 803PartySubIDType=245 表示从关系类 型名称时，523PartySubID 的值	PartyListGrp 组件 当 R=XXX 表示从机构 PtysSubGrp 组件 当 Typ=XXX 时，ID 的值

5.7.2 机构主从关系信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 交易成员通讯录信息
-->
<IMIXML>
    <PtyDetlListRpt
        PartyInfoType ="K">
        < PartyListGrp
            NoPartyList="1"
            ID="XXX"
            R="1">
                < PtysSubGrp NoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
                < PtysSubGrp NoPartySubIDs="2" ID="XXX" Typ="244"/>
            </ PartyListGrp >
        < PartyListGrp

```

```
NoPartyList="2"
ID="XXX"
R="146">
< PtysSubGrp NoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
< PtysSubGrp NoPartySubIDs="2" ID="XXX" Typ="245"/>
</ PartyListGrp >
</ PtyDetlListRpt >
</IMIXML>
```

5.8 债券通会员信息

5.8.1 债券通会员信息

债券通会员信息见表 25。

表25 债券通会员信息

字段	IMIX 对应	XML 对应
交易成员 ID	当 803PartySubIDType=2 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=2 时，ID 的值 机构 6 位码
机构代码	448PartyID	ID 机构 21 位代码
机构中文全称	当 803PartySubIDType=124 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=124 时，ID 的值
机构中文简称	当 803PartySubIDType=125 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=125 时，ID 的值
机构英文全称	当 803PartySubIDType=5 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=5 时，ID 的值
机构英文简称	当 803PartySubIDType=102 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=102 时，ID 的值

5.8.2 债券通会员信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
Description: 债券通会员信息
-->
<IMIXML>
  <PtyDetlListRpt
    PartyInfoType ="L">
    < PartyListGrp
      NoPartyList="1"
      ID="XXX">
```

```
< PtysSubGrpNoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
< PtysSubGrpNoPartySubIDs="2" ID="XXX" Typ="125"/>
< PtysSubGrpNoPartySubIDs="3" ID="XXX" Typ="5"/>
< PtysSubGrpNoPartySubIDs="4" ID="XXX" Typ="102"/>
< PtysSubGrpNoPartySubIDs="5" ID="XXX" Typ="2"/>
</ PartyListGrp>
</PtyDetlListRpt>
</IMIXML>
```

5.9 本币机构经办行经办产品信息

5.9.1 机构经办行经办产品信息

机构经办行经办产品信息见表 26。

表26 机构经办行经办产品信息

字段	IMIX 对应	XML 对应
交易成员 ID	当 803PartySubIDType=2 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=2 时，ID 的值 机构 6 位码
机构代码	448PartyID	ID 机构 21 位代码
交易成员全称	当 803PartySubIDType=124 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=124 时，ID 的值
中文简称	当 803PartySubIDType=125 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=125 时，ID 的值
英文全称	当 803PartySubIDType=5 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=5 时，ID 的值
英文简称	当 803PartySubIDType=102 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=102 时，ID 的值
本方经办行/产品	当 803PartySubIDType=258 时， 523PartySubID 的取值	PtysSubGrp 组件 当 Typ=258 时，ID 的值

5.9.2 机构经办行经办产品信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
    Description: 机构经办行经办产品信息
-->
<IMIXML>
    <PtyDetlListRpt
        PartyInfoType ="M">
        <PartyListGrp
            NoPartyList="1"
            ID=" 100001511000000105001">
```

```

<PtysSubGrpNoPartySubIDs="1" ID="中国 XX 银行股份有限公司" Typ="124"/>
<PtysSubGrpNoPartySubIDs="2" ID=" XX 银行" Typ="125"/>
<PtysSubGrpNoPartySubIDs="3" ID=" China XX Banking Corp.Ltd." Typ="5"/>
<PtysSubGrpNoPartySubIDs="4" ID="XXX" Typ="102"/>
<PtysSubGrpNoPartySubIDs="5" ID=" 100515" Typ="2"/>
<PtysSubGrpNoPartySubIDs="6" ID="中国 XX 银行股份有限公司北京分行"
Typ="258"/>
<PtysSubGrpNoPartySubIDs="7" ID="中国 XX 银行股份有限公司上海分行"Typ="258"/>
</ PartyListGrp>
</PtyDetlListRpt>
</IMIXML>

```

## 5.10 X-Bond 可交易债券信息

### 5.10.1 X-Bond 可交易债券信息

X-Bond 可交易债券信息见表 27。

表27 X-Bond 可交易债券信息

字段	IMIX 对应	XML 对应
集中报价债券	11887CentraQuoteBondIndic	CentraQuoteBondIndic Y-是 N-否
代码	48 SecurityID	ID 债券代码，上市前债券代码带 P 传输
名称	55 Symbol	Sym 债券名称
类型	107 SecurityDesc	Desc 债券类型，例如国债、国开债、政金债、央票等。

### 5.10.2 X-Bond 可交易债券信息 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding=" UTF-8 ">
<!--
Description: 可交易债券列表
-->
<IMIXML>
  <SecDef
    Desc="国债"
    CentraQuoteBondIndic="Y">
    <Instrmt
      ID="XXXXX"
      Sym="XXXXX"/>

```

</SecDef>  
</IMIXML>

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
-