

新平台本币交易接口开发指南 (现券市场)

CFETS/K1774—2019

第五卷：请求报价交易流程

(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 请求报价交易流程 3

 2.1 整体流程 3

 2.2 非做市方 3

 2.2.1 场景一：发起请求-做市方回复-非做市方确认成交 3

 2.2.2 场景二：发起请求-做市方新增/修改回复/回复过期/拒绝请求报价/请求过期 5

 2.2.3 场景三：发起请求-非做市方撤销请求 7

 2.3 做市方 9

 2.3.1 场景四：接收请求-新增/修改/撤销回复-非做市方确认成交 9

 2.3.2 场景五：接收请求-新增回复-回复过期/拒绝请求报价-请求报价过期/撤销 12

3 现券买卖 15

 3.1 业务要素 15

 3.2 QuoteRequest (R) 19

 3.2.1 IMIX 报文示例 20

 3.2.2 使用场景 22

 3.3 QuoteRequestCancel (U32) 23

 3.3.1 IMIX 报文示例 23

 3.3.2 使用场景 24

 3.4 QuoteRequestAck (U29) 25

 3.4.1 IMIX 报文示例 25

 3.4.2 使用场景 26

 3.5 QuoteRequestReject (AG) 27

 3.5.1 IMIX 报文示例 27

 3.5.2 使用场景 28

 3.6 Quote (S) 29

 3.6.1 IMIX 报文示例 29

 3.6.2 使用场景 31

 3.7 QuoteStatusReport (AI) 33

 3.7.1 IMIX 报文示例 33

 3.7.2 使用场景 34

 3.8 QuoteCancel (Z) 35

 3.8.1 IMIX 报文示例 35

 3.8.2 使用场景 37

3.9 QuoteResponse (AJ)	37
3.9.1 IMIX 报文示例	38
3.10 ExecutionReport (8)	39
3.10.1 IMIX 报文示例	39
4 快速撤单.....	42
4.1 业务要素.....	42
4.2 QuickCancel (U20)	42
4.2.1 IMIX 报文示例	42
参考文献.....	44
图 1 请求回复交易流程图	3
图 2 场景一时序图	4
图 3 场景二时序图	6
图 4 场景三时序图	8
图 5 场景四时序图	10
图 6 场景五时序图	13
表 1 章节列表	1
表 2 场景一 IMIX 报文交互	4
表 3 场景二 IMIX 报文交互	6
表 4 场景三 IMIX 报文交互	8
表 5 场景四 IMIX 报文交互	10
表 6 场景五 IMIX 报文交互	13
表 7 现券买卖业务要素	15
表 8 QuoteRequest IMIX 报文标准.....	20
表 9 QuoteRequest 报文使用场景	22
表 10 QuoteRequestCancel IMIX 报文标准.....	23
表 11 QuoteRequestCancel 报文使用场景.....	24
表 12 QuoteRequestAck IMIX 报文标准	25
表 13 QuoteRequestAck 报文使用场景	26
表 14 QuoteRequestReject IMIX 报文标准.....	27
表 15 QuoteRequestReject 报文使用场景.....	28
表 16 Quote IMIX 报文标准.....	29
表 17 Quote 报文使用场景	31
表 18 QuoteStatusReport IMIX 报文标准.....	33
表 19 QuoteStatusReport 报文使用场景	34
表 20 QuoteCancel IMIX 报文标准.....	36
表 21 QuoteCancel 报文使用场景	37
表 22 QuoteResponse IMIX 报文标准.....	38
表 23 ExecutionReport IMIX 报文标准	39
表 24 快速撤单业务要素	42
表 25 QuickCancel IMIX 报文标准.....	42

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、冉杨鎏、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/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	1.0.1	1.139.3-2.10.0	2018/8/10	<ol style="list-style-type: none"> 1. 2.3 做市方交易流程中，表“场景四 IMIX 报文交互”中“C 接收请求回复成功反馈”，表“场景五 IMIX 报文交互”中“C 接收请求回复成功反馈、F 接收拒绝请求报价成功反馈”，增加前台操作描述。 2. 3.1 业务要素、3.2QuoteRequest (R) 章节，新增请求报价、请求报价查询反馈消息增加字段“指示性报价编号”，必传属性为“选传”和“有则必传”。 3. 3.1 业务要素章节，字段“用户参考数据 1-6”增加说明：长度不超过 20 个字节；字段“分账序号”编码规则修改为：1) 前缀 (AL) + API 用户 ID (AAAABBBB) + 十二位数字流水号 (XXXXXXXXXX) (12 位数字) 2) 生命周期：一天，生命周期内，对 API 用户唯一。3) 若 API 用户 ID 超过 8 位，填写后 8 位，若不足 8 位右补 0。 4. 3.3.2 使用场景章节 (QuoteRequestCancel 报文使用场景)， “非做市方撤销请求报价”列，字段“报价有效时间、交易方向”改为“不传”。“非做市方、做市方接收交易完成/已成交通知”列增加必传字段“净价”。 5. 3.5.2 使用场景章节 (QuoteRequestReject 报文使用场景)， “做市方拒绝请求报价”列，字段“交易方向”改为“不传”。 6. 3.6.2 使用场景章节 (Quote 报文使用场景)， “做市方修改请求回复”列，字段“清算类型”改为“不传”。 7. 3.8 使用场景章节 (QuoteCancel 报文使用场景)， “非做市方、做市方接收请求回复撤销通知 (系统自动撤销)”列，字段“做市方机构 21 位码”改为“必传”。 8. 快速撤单章节，字段“报价类别”枚举值删除“全部、报价请求”。

					<p>9. 字段“客户参考编号”改为“有则必传”，涉及章节3.2.2使用场景表“Quote 报文使用场景”中“做市方接收请求报价查询反馈”列；3.4.2使用场景表“QuoteRequestAck 报文使用场景”中“非做市方接收新增、撤销请求报价成功反馈”列；3.5.2使用场景表“QuoteRequestReject 报文使用场景”中“做市方接收本方拒绝请求报价成功反馈”列；3.6.2使用场景表“Quote 报文使用场景”中“做市方接收请求回复查询反馈”列；3.7.2使用场景表“QuoteStatusReport 报文使用场景”中“做市方接收本方新增、修改、撤销请求回复成功反馈”列。字段“原客户参考编号”改为“有则必传”，涉及章节3.3.2使用场景表“QuoteRequestCancel 报文使用场景”列；3.6.2使用场景表“Quote 报文使用场景”中“做市方修改请求回复”列；3.8.2使用场景表“QuoteCancel 报文使用场景”中“做市方撤销请求回复”列。</p> <p>10. 增加字段“分账标识”，涉及章节3.1业务要素、3.2 QuoteRequest (R) 中新增请求报价、3.9 QuoteResponse (AJ)。</p> <p>11. 通篇将“机构 21 位码”改为“交易账户 21 位码”。</p>
江云南	冉杨鋈 卜天奇	1.0.2	1.139.9-2.10.2	2018/10/23	<p>1. 3.6.2使用场景章节，表“Quote 报文使用场景”，“做市方修改请求回复”列中增加说明哪些字段不允许修改。3.9 QuoteResponse (AJ) IMIX 报文示例中，增加说明“确认成交时只允许修改分账信息，其他字段不允许修改。”</p>
江云南	冉杨鋈 卜天奇	1.0.2	1.139.9-2.10.2	2018/10/29	<p>2. 2.3.1 做市方场景四：接收请求-新增/修改/撤销回复-非做市方确认成交章节中，表“场景四 IMIX 报文交互”中“(F)若非做市方未确认成交，可撤销请求回复”删除域131QuoteReqID，因实际报文传输没有该域。</p> <p>3. 4 快速撤单章节，增加快速撤单成功或失败时的反馈消息说明。</p>
江云南	冉杨鋈 邓可欣 杨帆	1.0.3	1.140.3-2.10.3	2018/11/24	<p>1. 3.2.2 使用场景，“做市方接收新增请求报价通知”列，增加字段“分账标识”，“分账标识”增加枚举值：post-allocation。</p> <p>2. “做市方修改请求回复”使用场景，增加字段是否允许修改说明。</p> <p>3. 3.4.2 QuoteRequestAck (U29) 使用场景章节，“非做市方接收本方新增请求报价成功反馈”增加字段“分账标识、非做市方交易账</p>

					<p>户 21 位码、非做市方交易员 ID、投资产品 21 位码、分账序号、分账券面总额”。</p> <p>4. 非做市方新增请求报价，删除字段“指示性报价编号”。</p> <p>5. 3.7.2 QuoteStatusReport 使用场景中，“做市方接收本方新增、修改、撤销请求回复成功反馈”增加字段“报价状态”。</p>
江云南	唐军敏 冉杨鋆 杨帆	1.0.4	1.140.3-2.10.3	2018/12/19	<p>1. 字段“用户参考数据 1~6”，非做市方新增请求报价时选传，接收新增成功反馈时有则必传；做市方新增请求回复时选传，接收新增成功反馈时有则必传。除这两种情况外均不传。</p>
江云南	唐军敏 冉杨鋆 杨帆	1.0.5	1.140.3-2.10.3	2019/01/02	<p>1. 3.1 业务要素章节，字段“应计利息”备注改成“特殊债必传”。</p>
江云南	唐军敏 冉杨鋆 杨帆	2.0.0	1.140.6-2.10.4	2019/01/09	<p>1. 其他卷有更新，同步升级版本号。</p>

第 5 卷-请求报价交易流程

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《第五卷：请求报价交易流程》，对新平台本币交易接口的请求报价交易流程进行介绍，并提供相关报文的详细说明。

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
第一卷：业务介绍	
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》
第二卷：通用功能	
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
第三卷：对话报价交易流程	
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
第四卷：点击成交与指示性报价交易流程	
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
第五卷：请求报价交易流程	
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
第六卷：匿名点击交易流程	
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
附录一：本币参考数据接口会员端 XML 文档	
附录二：本币成员端数据下载 IMIX 协议开发指引	

2 请求报价交易流程

2.1 整体流程

请求报价方式是指市场参与者向做市机构发起只含量、不含价的报价邀请，做市机构据以报出可成交价格，市场参与者选择做市机构报价确认成交的交易方式。系统按照价格优先、时间优先自动排序做市机构回复报价，市场参与者可同时选择多个对手方报价确认成交。做市机构对其收到的请求报价进行回复视为做市，做市机构作为请求回复方达成的交易视为做市成交。本币交易系统现券买卖交易品种支持请求报价交易方式。请求报价流程包括报价方发送请求报价、受价方回复请求、报价方选择成交三个环节。请求报价也经常称为RFQ（Request for Quest）。

请求报价的整体交易流程如下图：

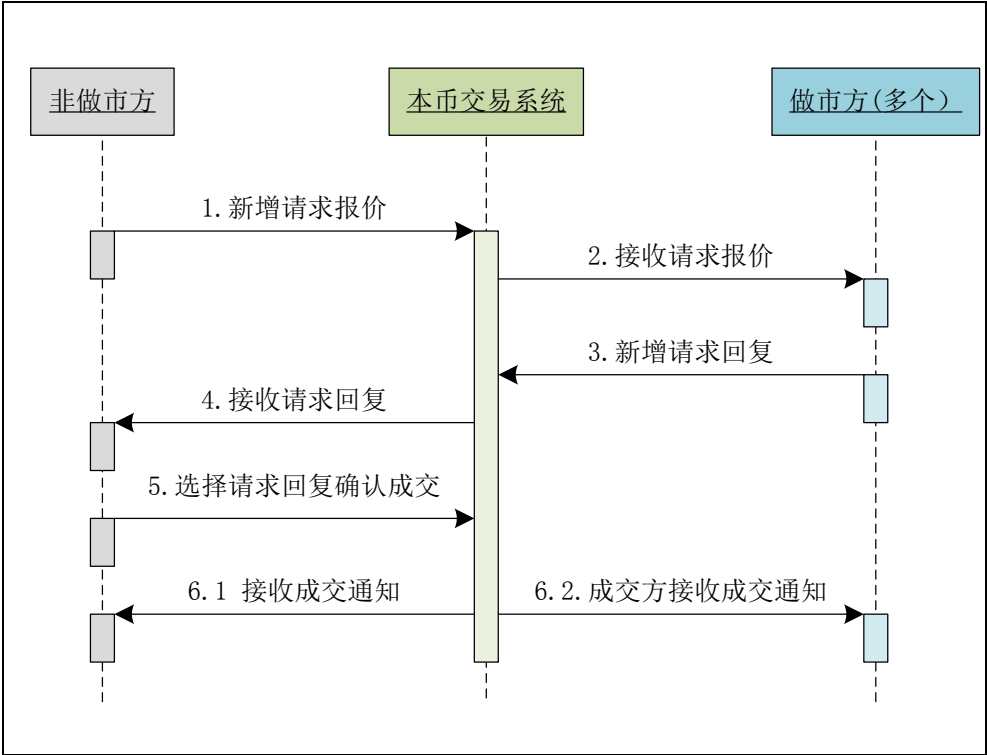


图1 请求回复交易流程图

2.2 非做市方

2.2.1 场景一：发起请求-做市方回复-非做市方确认成交

非做市方通过交易接口新增请求报价，做市方收到请求报价后新增、修改或撤销请求回复；非做市方收到请求回复后确认成交。

业务时序图如下：

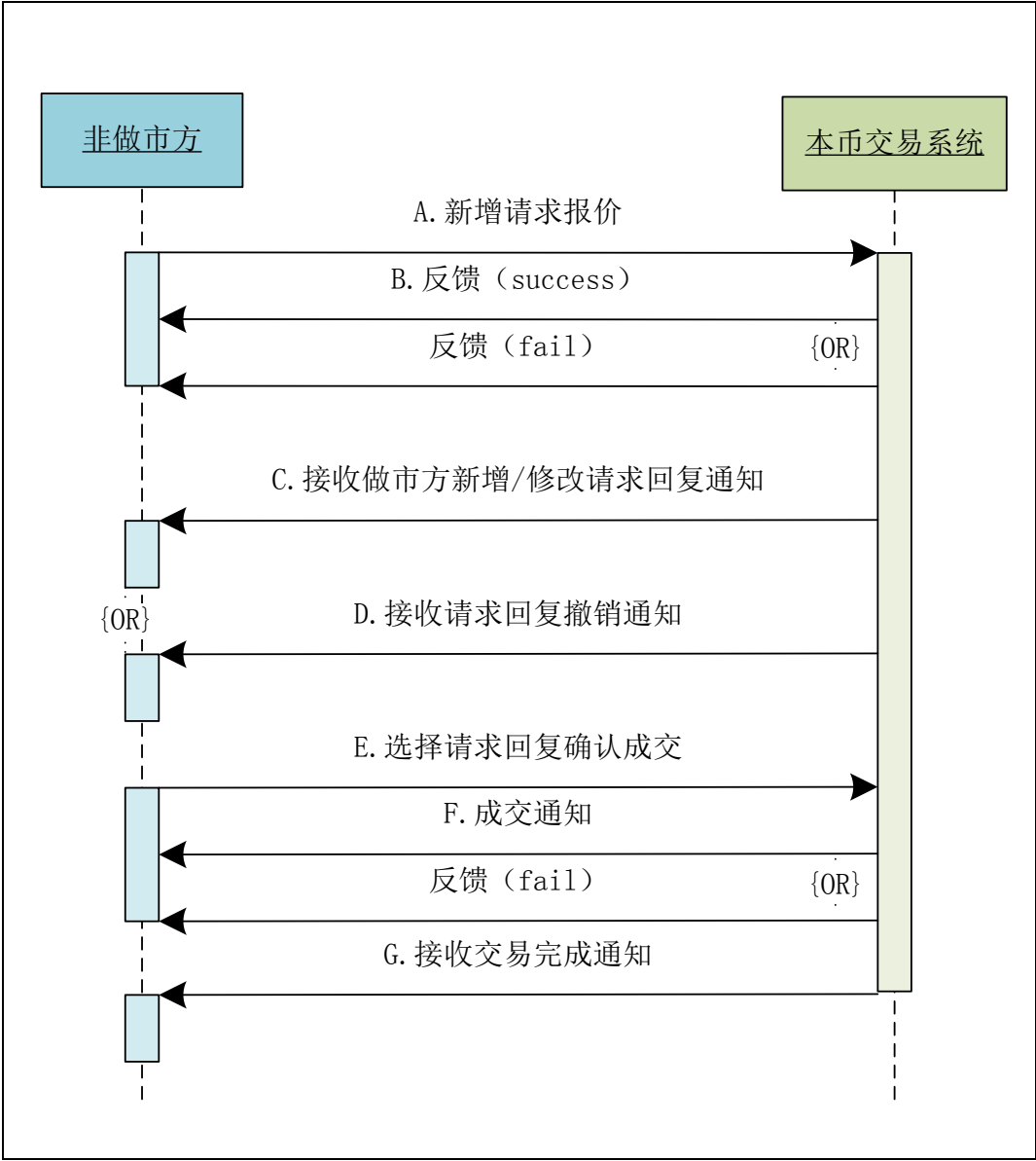


图2 场景一时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表2 场景一 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A)新增请求报价	非 做 市 方	→	R - QuoteRequest QuoteType(537)=112(请求报价) ClOrdID(11)=❶	本 币 交 易 系 统
(B)接收请求成功反馈		←	U29 - QuoteRequestAck QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=❸ ClOrdID(11)=❶	

IMIX 2.0			
(C)接收做市方新增/修改请求回复通知	←	S - Quote QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteTransType(10272)=N(新增)/R(修改) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑤	
(D)若做市方撤销请求回复，则接收撤销请求回复通知；若做市方机构交易员被禁用等原因导致请求回复撤销，则接收请求回复撤销通知	←	Z - QuoteCancel QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=19(撤销) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑥	
(E)选择请求回复确认成交	→	AJ - QuoteResponse QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteRespType(694)=1(确认成交) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑤ ClOrdID(11)=⑦	
(F)确认成交后接收成交通知	←	8 - ExecutionReport TradeMethod(10317)=4(请求报价) ExecType(150)=F(正常) ExecID(17)=③ QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑨	
(G)当请求报价达成成交时，则会员接收交易完成通知	←	U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=105(已成交) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=⑩	

2.2.2 场景二：发起请求-做市方新增/修改回复/回复过期/拒绝请求报价/请求过期

非做市方通过交易接口新增请求报价，做市方收到请求报价后新增请求回复或修改请求回复。非做市方通过交易接口接收请求回复新增/修改通知。若请求回复过期、做市方拒绝回复或者请求报价过期，非做市方接收相应通知。

业务时序图如下：

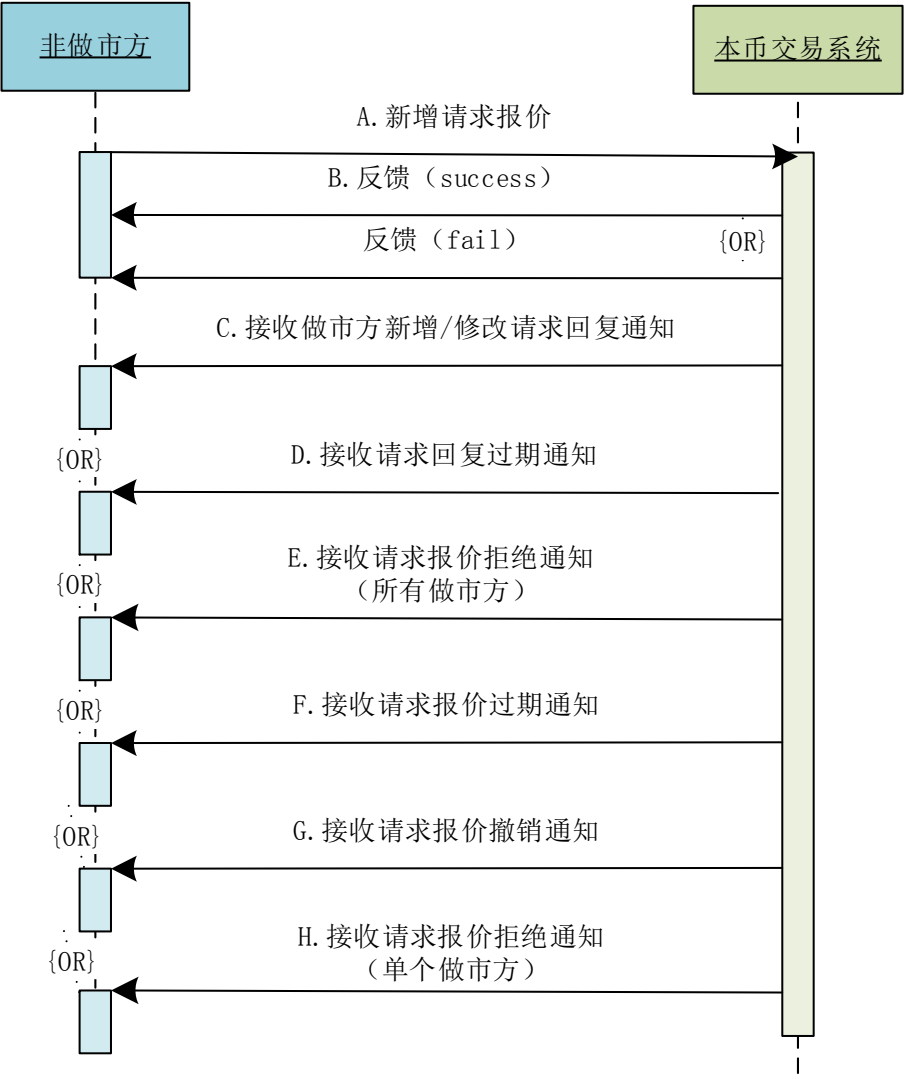


图3 场景二时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表3 场景二 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A)新增请求报价	非 做 市 方	→	R - QuoteRequest QuoteType(537)=112(请求报价) ClOrdID(11)=❶	本 币 交 易 系 统
(B)接收请求成功反馈		←	U29 - QuoteRequestAck QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=❸	

IMIX 2.0			
			ClOrdID(11)=❶
(C)接收做市方新增/修改请求回复通知	←	S - Quote QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteTransType(10272)=N(新增)/R(修改) QuoteReqID(131)=❷ QuoteID(117)=❸ TransactTime(60)=❹	
(D)若做市方请求回复过期,则接收请求回复过期通知	←	Z - QuoteCancel QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=21(过期) QuoteReqID(131)=❷ QuoteID(117)=❸ TransactTime(60)=❺	
(E)若全部做市方拒绝报价,则接收拒绝报价通知	←	U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=115(所有做市方拒绝) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=❻	
(F)若做市方未在请求报价有效期内反馈,则接收请求报价过期通知	←	U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=21(过期) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=❼	
(G)若交易员被禁用等原因,导致请求报价撤销,则接收报价撤销通知	←	U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=19(撤销) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=❽	
(H)若单个做市方拒绝报价,则非做市方接收单个做市方拒绝报价通知	←	AG - QuoteRequestReject QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteRequestRejectType(11307)=1(回复方拒绝) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=↗	

2.2.3 场景三：发起请求-非做市方撤销请求

非做市方新增请求报价后通过交易接口撤销请求报价。

业务时序图如下：

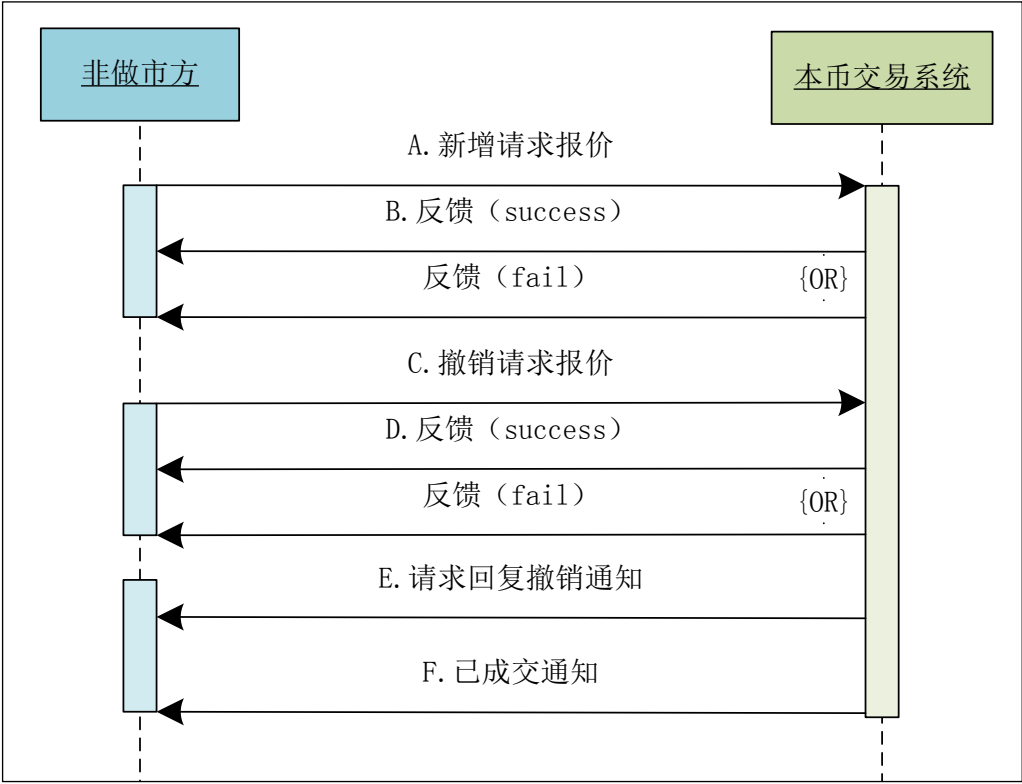


图4 场景三时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表4 场景三 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A)新增请求报价	非 做 市 方	→	R - QuoteRequest QuoteType(537)=112(请求报价) ClOrdID(11)=❶	本 币 交 易 系 统
(B)接收请求成功反馈		←	U29 - QuoteRequestAck QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=❸ ClOrdID(11)=❶	
(C)撤销请求报价		→	U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=❸ ClOrdID(11)=❷ OrigClOrdID(41)=❶	

IMIX 2.0				
(D)接收撤销请求成功反馈		←	U29 - QuoteRequestAck QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=19(撤销) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=⑤ ClOrdID(11)=④	
(E)由于撤销请求报价，导致请求回复撤销，则接收请求回复撤销通知		←	Z - QuoteCancel QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=19(撤销) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=⑥ TransactTime(60)=⑦	
(F)当请求报价成交时，则接收交易已成交通知		←	U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=105(已成交) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=⑧	

2.3 做市方

2.3.1 场景四：接收请求-新增/修改/撤销回复-非做市方确认成交

做市方通过交易接口接收非做市方新增的请求报价，做市方对该请求报价进行新增/修改/撤销请求回复。非做市方收到请求回复后确认成交，做市方接收成交通知。若请求报价已全部成交，则接收交易完成通知。

业务时序图如下：

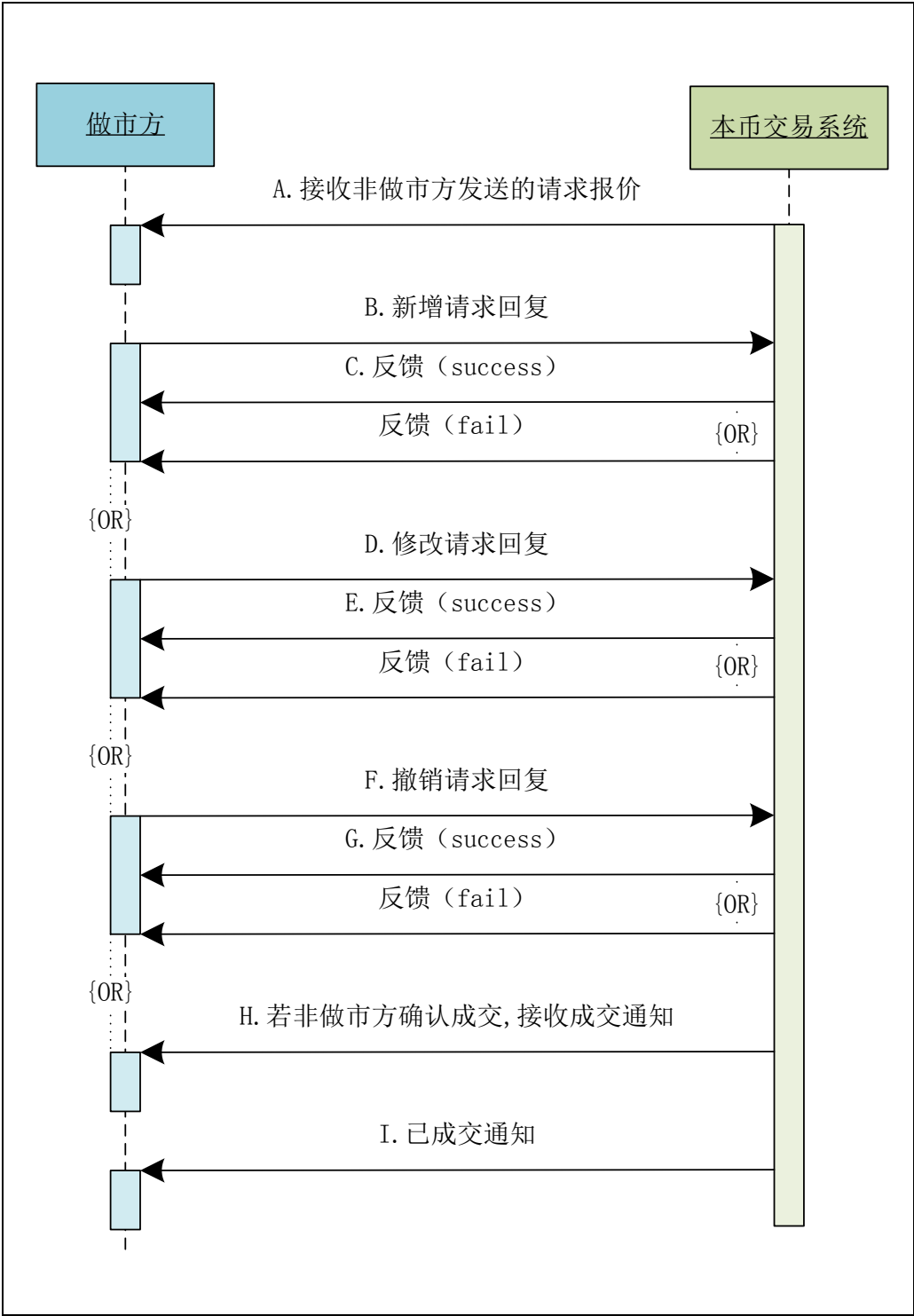


图5 场景四时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表5 场景四 IMIX 报文交互

IMIX 2.0

IMIX 2.0				
(A)接收非做市方发送的请求报价	做市方	←	R - QuoteRequest QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=③	本币交易系统
(B)新增请求回复		→	S - Quote QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteTransType(10272)=N(新增) QuoteReqID(131)=② ClOrdID(11)=①	
(C)接收请求回复成功反馈 (若做市方通过前台发送请求回复, 做市方API 也会收到请求回复成功反馈)		←	AI - QuoteStatusReport QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteTransType(10272)=N(回 复 报 价 发 送) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑤ ClOrdID(11)=①	
(D)修改请求回复		→	S - Quote QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteTransType(10272)=R(修改) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑤ ClOrdID(11)=⑥ OrigClOrdID(41)=①	
(E)接收请求回复修改成功反馈		←	AI - QuoteStatusReport QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteTransType(10272)=R(修改) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑦ ClOrdID(11)=⑥	
(F)若非做市方未确认成交, 可撤销请求回复		→	Z - QuoteCancel QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑤/⑦ ClOrdID(11)=⑧ OrigClOrdID(41)=①	

IMIX 2.0				
(G)接收请求回复撤销成功反馈	←		AI - QuoteStatusReport QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=19(撤销) QuoteTransType(10272)=C(撤销) QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑨ ClOrdID(11)=⑧	
(H)若非做市方确认成交，则接收成交通知			8 - ExecutionReport TradeMethod(10317)=4(请求报价) ExecType(150)=F(正常) ExecID(17)=⑨ QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑩	
(I)若请求报价成交时，则所有回复方都会接收交易完成通知			U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=105(已成交) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=⑪	

2.3.2 场景五：接收请求-新增回复-回复过期/拒绝请求报价-请求报价过期/撤销

做市方通过交易接口接收非做市方新增的请求报价，做市方对该请求报价进行新增请求回复。若请求回复过期撤销，做市方接收请求回复过期通知。做市方可通过交易接口拒绝对此请求报价进行回复。若请求报价过期撤销，或者非做市方撤销请求报价，做市方会接收到相应通知。

业务时序图如下：

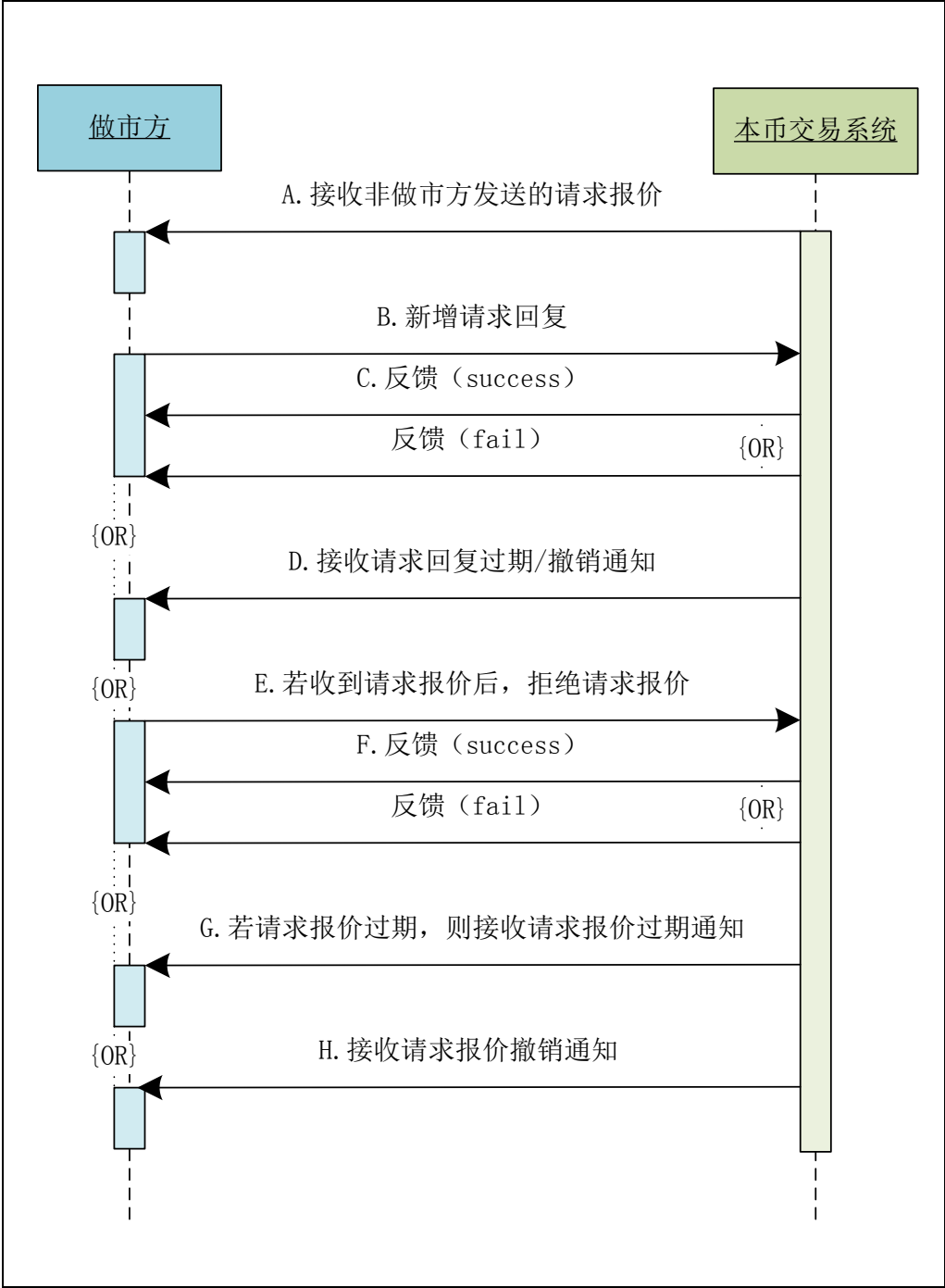


图6 场景五时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表6 场景五 IMIX 报文交互

IMIX 2.0			
(A)接收非做市方新增请求报价通知	做市方	← R - QuoteRequest QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteReqID(131)=❷ TransactTime(60)=❸	本币交易系统

IMIX 2.0				
(B)新增请求回复		→	S - Quote QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteTransType(10272)=N(新增) QuoteReqID(131)=② ClOrdID(11)=①	统
(C)接收请求回复成功反馈 (若做市方通过前台新增请求回复, 做市方 API 也会收到请求回复成功通知)		←	AI - QuoteStatusReport QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=16(正常) QuoteTransType(10272)=N(回复报价发送) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑤ ClOrdID(11)=①	
(D)若请求回复过期, 则接收请求回复过期通知; 若交易员被禁用或请求报价被撤销等原因, 导致请求回复撤销, 则接收回复撤销通知		←	Z - QuoteCancel QuoteType(537)=113(请求回复) QuoteStatus(297)=21(过期)/19(撤销) QuoteReqID(131)=② QuoteID(117)=④ TransactTime(60)=⑥	
(E)若收到请求报价后, 拒绝请求报价		→	AG - QuoteRequestReject QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteRequestRejectType(11307)=1(回复方拒绝) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=③ ClOrdID(11)=⑦	
(F)接收拒绝请求报价成功反馈 (若做市方通过前台拒绝请求报价, 做市方 API 也会收到拒绝成功反馈)		←	AG - QuoteRequestReject QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteRequestRejectType(11307)=3(要价拒绝反馈) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=⑧ ClOrdID(11)=⑦	
(G)若请求报价过期, 则接收请求报价过期通知		←	U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=21(过期) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=⑨	
(H)若非做市方撤销请求报价, 则接收请求报价撤销通知; 若交易员被禁用等原因, 导致请求报价撤销, 则接收报价撤销通知		←	U32 - QuoteRequestCancel QuoteType(537)=112(请求报价) QuoteStatus(297)=19(撤销) QuoteReqID(131)=② TransactTime(60)=⑩	

3 现券买卖

本章节对现券买卖市场的请求报价交易流程进行详细介绍，包括现券买卖市场的业务要素和相关报文的示例说明。

3.1 业务要素

表7 现券买卖业务要素

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
市场	10176MarketIndicator	枚举值： 4-现券买卖	
报价类别	537 QuoteType	枚举值： 112-请求报价 113-请求回复	
操作类型	10272 QuoteTransType	枚举值： N-新增 R-修改 C-撤销	详细使用方法，参见“请求报价交易流程”章节。
	11307QuoteRequestRejectType	1-做市方拒绝（单个） 3-请求报价拒绝反馈	
	694 QuoteRespType	枚举值： 1-成交确认	
报价状态	297 QuoteStatus	枚举值： 16-正常 19-撤销 105-已成交 21-过期 115-做市方拒绝 107-全部成交	
报价有效时间	62 ValidUntilTime	格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss 例如： 20070822-12:33:00.000	
客户参考编号	11 ClOrdID	字符串 例如： ODAAAABBBB12345678	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。 报价/成交场景：上行消息对应的客户参考编号 查询场景：需要查询的客户参考编号
查询请求编号	10168 QueryRequestID	字符串	
原客户参考编号	41 OrigClOrdID	字符串 例如： ODAAAABBBB12345677	预留域，修改报价时填写报价初始客户参考编号。 详细使用方法，参见“请求

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
			报价交易流程”章节。
分账标识	11960 AllocInd	枚举值 0-无 allocation 1-pre-allocation 2-post-allocation	区分普通请求报价、交易前分账请求报价、交易后分账请求报价
请求报价编号	131 QuoteReqID	字符串	交易系统反馈的报价编号，详细使用方法，参见“请求报价交易流程”章节。
请求回复编号	117 QuoteID	字符串 例如： 201701010420000001	交易系统反馈的报价编号，详细使用方法，参见“请求报价交易流程”章节。
指示性报价编号	10471 Reference	字符串 例如： 201701010420000001	
业务发生时间	60 TransactTime	格式为： YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	交易系统反馈的业务发生时间，详细使用方法，参见“请求报价交易流程”章节。
匿名	10008 AnonymousIndicator	枚举值： N-否	默认取值否
债券代码	48 SecurityID	字符串 例如：170001	
债券名称	55 Symbol	字符串 例如：17 附息国债 01	
交易方向	54 Side	枚举值： 1-买入 2-卖出	报文发送方的交易方向
到期收益率	235 YieldType	MATURITY	1、到期收益率、行权收益率和净价至少存在一个； 2、有净价时以净价为准； 3、若没有净价、有到期收益率，根据到期收益率推算净价； 4、若没有净价和到期收益率，由行权收益率推算净价。 5、若为资产支持证券、特殊债，净价必填，不传到期和行权收益率。 6、若结算币种为非 CNY，则净价和收益率不能互推，净价必传，到期收益率、行权收益率选传
	236 Yield	单位：%，精度：4 例如：3.3500	
行权收益率	233 StipulationType	StrikeYield	
	234 StipulationValue	单位：%，精度：4 例如：3.2500	
净价	44 Price	单位：与债券币种的单位保持一致，精度：4 例如：当债券币种为 USD，则单位为美元；当债券币种为 CNY，则单位为：元；	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
全价	10048 DirtyPrice	单位:与债券币种的单位保持一致,精度:4 如:当债券币种为USD,则单位为美元;当债券币种为CNY,则单位为:元;	
应计利息	159 AccruedInterestAmt	单位:与债券币种的单位保持一致,精度:5 如:当债券币种为USD,则单位为美元;当债券币种为CNY,则单位为:元;	特殊债必传。
券面总额	38 OrderQty	单位:与债券币种的单位保持一致,整数 如:当债券币种为USD,则单位为美元;当债券币种为CNY,则单位为:元;	详细使用方法参见报文示例
	32 LastQty		
交易金额	10312 TradeCashAmt	单位:与债券币种的单位保持一致,精度:2 如:当债券币种为USD,则单位为美元;当债券币种为CNY,则单位为:元;	详细使用方法参见报文示例
	381 GrossTradeAmt		
应计利息总额	10002 AccruedInterestTotalAmt	单位:与债券币种的单位保持一致,精度:2 如:当债券币种为USD,则单位为美元;当债券币种为CNY,则单位为:元;	
结算金额	119 SettlCurrAmt	单位:与结算币种的单位保持一致,精度:2 如:当结算币种为USD,则单位为美元;当结算币种为CNY,则单位为元;	
结算币种	120 SettlCurrency	例如:USD	
汇率	155 SettlCurrFxRate	精度:6位	
结算方式	919 DeliveryType	枚举值: 0-券款对付 4-见券付款 5-见款付券	
清算类型	11143 ClearingMethod	枚举值: 6-净额清算 13-全额清算	
清算速度	63 SettlType	枚举值: 1-T+0 2-T+1 3-T+2 4-T+3	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
		5-T+4	
结算日	64 SettlDate	格式: YYYYMMDD	
每百元本金额	10239 Principal	单位: 元, 精度: 2	仅在资产支持证券中传输该字段
本金额	10310 TotalPrincipal	单位: 元, 精度: 2	仅在资产支持证券中传输该字段
用户参考数据 1	11405 UserReference1	文本	用户传输自定义信息 长度不超过 20 个字节
用户参考数据 2	11406 UserReference2	文本	长度不超过 20 个字节
用户参考数据 3	11407 UserReference3	文本	长度不超过 20 个字节
用户参考数据 4	11498 UserReference4	文本	长度不超过 20 个字节
用户参考数据 5	11499 UserReference5	文本	长度不超过 20 个字节
用户参考数据 6	11500 UserReference6	文本	长度不超过 20 个字节
非做市方标识	452 PartyRole	枚举值: 101/102	非做市方信息为重复组。 详细使用方法, 参见 IMIX 报文示例。
非做市方交易账户 21 位码	448PartyID	21 位代码	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
非做市方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值: 2-交易员 ID	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
	523PartySubID	文本	
做市方标识	452 PartyRole	枚举值: 101/102	做市方信息为重复组。 详细使用方法, 参见 IMIX 报文示例。
做市方交易账户 21 位码	448PartyID	21 位代码	
做市方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值: 2-交易员 ID	
	523PartySubID	文本	
应急标识	10022 ContingencyIndicator	枚举值: Y-是 N-否	
成交编号	17 ExecID	文本	
交易方式	10317 TradeMethod	枚举值: 4-请求报价	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
成交状态	150 ExecType	枚举值： F-正常 4-撤销 5-修改	
成交日期	75 TradeDate	格式为： YYYYMMDD	
成交时间	10318 TradeTime	格式为： HH:MM:SS. sss	
买方标识	452 PartyRole	枚举值： 119-买方	
买方交易账户 21 位码	448 PartyID	21 位代码	
买方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	
	523PartySubID	文本	
卖方标识	452 PartyRole	枚举值： 120-卖方	
卖方交易账户 21 位码	448 PartyID	21 位代码	
卖方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	
	523PartySubID	文本	
投资产品 21 位码	79 AllocAccount		
分账序号	467 IndividualAllocID		分账序号字段编码规则如下： 1) 前缀 (AL) + API 用户 ID (AAAABBBB) + 十二位数字流水号 (XXXXXXXXXXXX) (12 位数字) 2) 生命周期：一天，生命周期内，对 API 用户唯一。 3) 若 API 用户 ID 超过 8 位，填写后 8 位，若不足 8 位右补 0。
分账券面总额	80 AllocQty	单位：元，整数	
对手方来源	803PartySubIDType	枚举值： 29-机构来源	不填表示银行间会员
	523PartySubID	文本： 取值 C 表示对手方来源为北金所； 取值 BC 表示对手方来源	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
		为债券通	

备注：业务要素中的发送方和接收方指的是报文的发送方和接收方，并不等同于交易流程的非做市方和做市方。

3.2 QuoteRequest (R)

QuoteRequest报文用于非做市方发送请求报价、接收请求查询结果反馈等。

3.2.1 IMIX 报文示例

表8 QuoteRequest IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX.2.0	报文版本
9				BodyLength	23	报文长度
35				MsgType	R	报文类型
34				MsgSeqNum	23	报文序列号
52				SendingTime	20070820-12:40:00.000	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	XXX	
57				TargetSubID	XXX	
MessageBody						
11				ClOrdID	Req123	客户参考编号
10168				QueryRequestID	XXX	查询请求编号
11960				AllocInd	1	分账标识 0-无 allocation 1-pre-allocation 2-post-allocation
131				QuoteReqID	XXXX	请求报价编号
10471				Reference	XXX	指示性报价编号
11405				UserReference1	XXX	用户参考数据 1
11406				UserReference2	XXX	用户参考数据 2
11407				UserReference3	XXX	用户参考数据 3
11498				UserReference4	XXX	用户参考数据 4
11499				UserReference5	XXX	用户参考数据 5
11500				UserReference6	XXX	用户参考数据 6
146				NoRelatedSym	1	重复组个数 该场景固定取值为 1
→	55			Symbol	XXX	债券名称 组件必传域，若字段无值则 默认传“-”

→	48			SecurityID	XXX	债券代码
→	10176			MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖
→	537			QuoteType	112	报价类别 112-请求报价
→	297			QuoteStatus	16	报价状态 16-正常 19-撤销 21-过期 115-做市方拒绝 107-全部成交
→	62			ValidUntilTime	20070820-12:40:00. 000	报价有效时间
→	60			TransactTime	20070820-12:40:00. 000	业务发生时间
→	54			Side	1	交易方向 与请求报价发送方的交易 方向一致
→	159			AccruedInterestAmt	100.00000	应计利息, 精度 5
→	10002			AccruedInterestTotalAm t	10000.00	应计利息总额, 精度 2
→	38			OrderQty	500000	券面总额 单位元
→	919			DeliveryType	0	结算方式
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型
→	63			SettlType	1	清算速度
→	64			SettlDate	20121121	结算日期
→	10239			Principal	100.00	每百元本金额
→	10310			TotalPrincipal	10000.00	本金额
→	453			NoPartyIDs	3	重复组个数 取值以实际消息传输为准。
→	→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码 若传分账信息, 则该字段传 主交易账户 21 位码
→	→	452		PartyRole	101	101-发送方 (即非做市方)
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	→	→	523	PartySubID	C	C 表示北金所 BC 表示债券通
→	→	→	803	PartySubIDType	29	29-机构来源
→	→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码
→	→	452		PartyRole	102	102-接收方 (即做市方)
→	→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码

→	→	452		PartyRole	102	102-接收方（即做市方）
→	78			NoAllocs	2	重复组次数，取值以实际消息传输为准。 当分账标识取值“1-pre-allocation”时传输该组件
→	→	79		AllocAccount	XXX	投资产品 21 位码
→	→	467		IndividualAllocID	ALAAAABBBB00000000 0001	分账序号
→	→	80		AllocQty	200000	分账券面总额
→	→	79		AllocAccount	XXX	投资产品 21 位码
→	→	467		IndividualAllocID	ALAAAABBBB00000000 0002	分账序号
→	→	80		AllocQty	300000	分账券面总额
StandardTrailer						
10				Checksum	50	校验和

3.2.2 使用场景

QuoteRequest报文在不同的业务场景下，传输的字段存在区别，本节汇总说明在不同场景下传输的字段。

表9 QuoteRequest 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	非做市方 新增请求报价	做市方 接收新增请求报价 通知	非做市方接收 请求报价查询反馈
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传	必传
报价类别	537 QuoteType	必传	必传	必传
报价状态	297QuoteStatus	-	必传	必传
报价有效时间	62 ValidUntilTime	必传	必传	必传
客户参考编号	11C1OrdID	必传	-	有则必传
查询请求编号	10168 QueryRequestID	-	-	必传
分账标识	11960 AllocInd	必传	必传	-
请求报价编号	131QuoteReqID	-	必传	必传
指示性报价编号	10471Reference	-	-	有则必传
业务发生时间	60 TransactTime	-	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	必传	必传	必传
债券名称	55 Symbol	-	必传	必传
交易方向	54 Side	必传	必传	必传
应计利息	159AccruedInterestAmt	-	必传	-
应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	-	必传	-
券面总额	38 OrderQty	必传	必传	必传
结算方式	919 DeliveryType	必传	必传	必传
清算类型	11143ClearingMethod	必传	必传	必传

业务字段	IMIX 域	非做市方 新增请求报价	做市方 接收新增请求报价 通知	非做市方接收 请求报价查询反馈
清算速度	63 SettlType	必传	必传	必传
结算日期	64SettlDate	—	必传	—
每百元本金额	10239 Principal	—	仅 ABS 传	—
本金额	10310 TotalPrincipal	—	仅 ABS 传	—
用户参考数据 1	11405 UserReference1	选传	—	—
用户参考数据 2	11406 UserReference2	选传	—	—
用户参考数据 3	11407 UserReference3	选传	—	—
用户参考数据 4	11498 UserReference4	选传	—	—
用户参考数据 5	11499 UserReference5	选传	—	—
用户参考数据 6	11500 UserReference6	选传	—	—
非做市方交易账户 21 位码	当 452PartyRole=101 时 448PartyID	必传	必传	必传
非做市方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	必传	必传	必传
做市方交易账户 21 位码	当 452PartyRole=102 时 448PartyID	必传	—	必传
投资产品 21 位 码	79 AllocAccount	选传	有则必传	—
分账序号	467IndividualAllocID	选传	选传	—
分账券面总额	80AllocQty	选传	选传	—
对手方来源	当 803PartySubIDType=29 时 523PartySubID 取值 C 表示对手方来 源为北金所，取值 BC 表示对手方来 源为债券通	—	有则必传	—

3.3 QuoteRequestCancel (U32)

QuoteRequestCancel 报文用于非做市方撤销请求报价或者接收交易完成通知或请求报价过期或者所有做市方拒绝请求报价或请求报价系统自动撤销通知。

3.3.1 IMIX 报文示例

表10 QuoteRequestCancel IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX. 2. 0	报文版本
9				BodyLength	23	报文长度
35				MsgType	U32	报文类型
34				MsgSeqNum	23	报文序列号

52				SendingTime	20070820-12:40:00 .000	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	XXX	
57				TargetSubID	XXX	
MessageBody						
11				ClOrdID	Req123	客户端参考编号
41				OrigClOrdID	XXX	原客户参考编号
131				QuoteReqID	XXXX	请求报价编号
QuotReqCxlGrp						
146				NoRelatedSym	1	重复组个数 该场景固定取值为 1
→	55			Symbol	-	组件必传域, 取值“-”
→	48			SecurityID	XXX	债券代码
→	10176			MarketIndicator	4	市场标识 4-现券买卖
→	537			QuoteType	112	报价类别 112-请求报价
→	297			QuoteStatus	19	报价状态 19-撤销 105-已成交 21-过期 115-做市方拒绝
→	60			TransactTime	20070820-12:40:00 .000	业务发生时间
→	44			Price	0.0810	净价
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数 该场景固定取值为 1
→	→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码
→	→	452		PartyRole	101	101-发送方（即非做市方）
→	→	802		NoPartySubIDs	1	重复组个数
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID
StandardTrailer						
10				Checksum	50	校验和

3.3.2 使用场景

QuoteRequestCancel报文在不同的业务场景下, 传输的字段存在区别, 本节汇总说明在不同场景下传输的字段。

表11 QuoteRequestCancel 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	非做市方 撤 销 请 求 报价	做市方 接 收 撤 销 请求报价	非做市方、 做市方 接 收 交 易 完成/已成 交通知	非做市方、 做市方 接 收 请 求 报 价 过 期 通知	非做市方、 做市方 接 收 请 求 报 价 撤 销 通知（系统 自动撤销）	非做市方 接 收 请 求 报 价 拒 绝 通知（所有 做市方）
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传	必传	必传	必传	必传
报价类别	537 QuoteType	必传	必传	必传	必传	必传	必传
报价状态	297QuoteStatus	-	必传	必传	必传	必传	必传
客户参考编 号	11C10rdID	必传	-	-	-	-	-
原客户参考 编号	41 OrigC10rdID	有则必传	-	-	-	-	-
请求报价编 号	131QuoteReqID	必传	必传	必传	必传	必传	必传
业务发生 时间	60 TransactTime	必传	必传	必传	必传	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	必传	必传	必传	必传	必传	必传
净价	44 Price	-	-	必传	-	-	-
非做市方交 易账户 21 位 码	当 452PartyRole=101 时 448PartyID	必传	必传	必传	必传	必传	必传
非做市方交 易员 ID	当 803PartySubIDType =2 时 523PartySubID	必传	必传	必传	必传	必传	必传

3.4 QuoteRequestAck (U29)

QuoteRequestAck报文用于接收非做市方新增/撤销请求报价成功反馈。

3.4.1 IMIX 报文示例

表12 QuoteRequestAck IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX.2.0	报文版本
9				BodyLength	23	报文长度
35				MsgType	U29	报文类型
34				MsgSeqNum	23	报文序列号
52				SendingTime	20070820-12:40:00.000	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	XXX	
57				TargetSubID	XXX	
MessageBody						
11				ClOrdID	XXXX	客户参考编号
131				QuoteReqID	XXXX	请求报价编号
11960				AllocInd	1	分账标识 0-无 allocation 1-pre-allocation 2-post-allocation
11405				UserReference1	XXX	用户参考数据 1
11406				UserReference2	XXX	用户参考数据 2
11407				UserReference3	XXX	用户参考数据 3
11498				UserReference4	XXX	用户参考数据 4
11499				UserReference5	XXX	用户参考数据 5
11500				UserReference6	XXX	用户参考数据 6
QuotReqACKGrp						
146				NoRelatedSym	1	重复组个数 该场景固定取值为 1
→	55			Symbol	-	组件必传域, 取值“-”
→	48			SecurityID	XXX	债券代码
→	10176			MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖
→	537			QuoteType	112	报价类别 112-请求报价
→	297			QuoteStatus	16	报价状态 16-正常 19-撤销
→	60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数 该场景固定取值为 1。
→	→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码 若传分账信息, 则该字段传主 交易账户 21 位码
→	→	452		PartyRole	101	101-发送方(即非做市方)
→	→	802		NoPartySubIDs	1	重复组个数, 固定取值 1。
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	78			NoAllocs	2	重复组次数, 取值以实际消息 传输为准。 当 分 账 标 识 取 值 “1-pre-allocation”时传输 该组件。
→	→	79		AllocAccount	XXX	投资产品 21 位码
→	→	467		IndividualAllocID	ALAAAABBBB000000000001	分账序号

→	→	80		AllocQty	200000	分账券面总额
→	→	79		AllocAccount	XXX	投资产品 21 位码
→	→	467		IndividualAllocID	ALAAAABBBB000000000002	分账序号
→	→	80		AllocQty	300000	分账券面总额
StandardTrailer						
10				Checksum	50	校验和

3.4.2 使用场景

QuoteRequestAck报文在不同的业务场景下，传输的字段存在区别，本节汇总说明在不同场景下传输的字段。

表13 QuoteRequestAck 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	非做市方 接收本方新增请求报价成功反馈	非做市方 接收本方撤销请求报价成功反馈
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传
报价类别	537 QuoteType	必传	必传
报价状态	297QuoteStatus	必传	必传
客户参考编号	11C10rdID	有则必传	有则必传
分账标识	11960 AllocInd	必传	—
请求报价编号	131QuoteReqID	必传	必传
业务发生时间	60 TransactTime	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	必传	必传
用户参考数据 1	11405 UserReference1	有则必传	—
用户参考数据 2	11406 UserReference2	有则必传	—
用户参考数据 3	11407 UserReference3	有则必传	—
用户参考数据 4	11498 UserReference4	有则必传	—
用户参考数据 5	11499 UserReference5	有则必传	—
用户参考数据 6	11500 UserReference6	有则必传	—
非做市方交易账户 21 位码	当 452PartyRole=101 时 448PartyID	必传	—
非做市方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	必传	—
投资产品 21 位码	79 AllocAccount	选传	—
分账序号	467IndividualAllocID	选传	—
分账券面总额	80AllocQty	选传	—

3.5 QuoteRequestReject (AG)

QuoteRequestReject 报文用于做市方拒绝请求报价、接收拒绝反馈，以及非做市方接收某一个做市商的请求报价拒绝通知。

3.5.1 IMIX 报文示例

表14 QuoteRequestReject IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX.2.0	报文版本
9				BodyLength	23	报文长度
35				MsgType	AG	报文类型
34				MsgSeqNum	23	报文序列号
52				SendingTime	20070820-12:40:00.000	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	XXX	
57				TargetSubID	XXX	
MessageBody						
11307				QuoteRequestRejectType	1	操作类型 1-做市方拒绝（单个） 3-请求报价拒绝反馈
11				ClOrdID	XXX	客户参考编号
131				QuoteReqID	Req123	请求报价编号
146				NoRelatedSym	1	重复组个数 该场景固定取值为 1
→	55			Symbol	-	组件必传域，取值“-”
→	48			SecurityID	XXX	债券代码
→	10176			MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖
→	537			QuoteType	112	报价类别 112-请求报价
→	60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间
→	54			Side	1	交易方向
→	453			NoPartyIDs	2	重复组个数 该场景固定取值为 2
→	→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码
→	→	452		PartyRole	101	101-发送方（即做市方）
→	→	802		NoPartySubIDs	1	重复组个数
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码
→	→	452		PartyRole	102	102-接收方（即非做市方）
→	→	802		NoPartySubIDs	1	重复组个数
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
StandardTrailer						
10				Checksum	50	校验和

3.5.2 使用场景

QuoteRequestReject报文在不同的业务场景下，传输的字段存在区别，本节汇总说明在不同场景下传输的字段。

表15 QuoteRequestReject 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	做市方 拒绝请求报价	做市方 接收本方拒绝请求 报价成功反馈	非做市方接收请求 报价拒绝通知（单个 做市方）
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传	必传
报价类别	537 QuoteType	必传	必传	必传
操作类型	11307QuoteRequestRejectType	必传	必传	必传
客户参考编号	11C10rdID	必传	有则必传	—
请求报价编号	131QuoteReqID	必传	必传	必传
业务发生时间	60 TransactTime	必传	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	必传	必传	必传
交易方向	54 Side	—	—	—
做市方交易账户 21 位码	当 452PartyRole=101 时 448PartyID	必传	—	必传
做市方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	必传	—	—
非做市方交易账户 21 位码	当 452PartyRole=102 时 448PartyID	必传	—	必传
非做市方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	必传	—	必传

3.6 Quote (S)

Quote 报文用于做市方发送、修改请求回复、接收请求回复查询反馈及非做市方接收请求回复。

3.6.1 IMIX 报文示例

表16 Quote 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	100	报文体长度
35			MsgType	S	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
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	XXX	
57			TargetSubID	XXX	

MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场 4-现券市场
537			QuoteType	113	报价类别 113-请求回复
10272			QuoteTransType	N	操作类型 N-新增 R-修改
297			QuoteStatus	16	报价状态 16-正常 19-撤销 21-过期 107-全部成交
62			ValidUntilTime	20070822-12:33:00.000	回复有效时间
11			ClOrdID	XXXX	客户参考编号
10168			QueryRequestID	XXX	查询请求编号
41			OrigClOrdID	XXX	原客户参考编号
131			QuoteReqID	XXX	报价请求编号
117			QuoteID	XXX	请求回复编号
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间
10008			AnonymousIndicator	N	匿名标识 N-否 默认取值否
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
48			SecurityID	XXXX	债券代码
55			Symbol	XXXX	债券名称
54			Side	1	交易方向
44			Price	98.0000	净价（元）
10048			DirtyPrice	12.1222	全价
159			AccruedInterestAmt	4.12221	应计利息
10002			AccruedInterestTotalAmt	4122.21	应计利息总额
38			OrderQty	100000	券面总额
10312			TradeCashAmt	100000.00	交易金额
119			SettlCurrAmt	104122.21	结算金额
120			SettlCurrency	USD	结算币种
155			SettlCurrFxRate	1.125615	汇率
919			DeliveryType	0	结算方式
11143			ClearingMethod	6	清算类型
63			SettlType	2	清算速度
64			SettlDate	20170105	结算日
10239			Principal	98.00	每百元本金额
10310			TotalPrincipal	100000.00	本金额
11405			UserReference1	XXX	用户参考数据1
11406			UserReference2	XXX	用户参考数据2

11407			UserReference3	XXX	用户参考数据3
11498			UserReference4	XXX	用户参考数据4
11499			UserReference5	XXX	用户参考数据5
11500			UserReference6	XXX	用户参考数据6
235			YieldType	MATURITY	到期收益率
236			Yield	3.3500	到期收益率值
232			NoStipulations	1	
→	233		StipulationType	StrikeYield	
→	234		StipulationValue	4.3500	行权收益率
453			NoPartyIDs	1	该场景固定取值为 1
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码
→	452		PartyRole	101	101-发送方(即做市方)
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

3.6.2 使用场景

Quote报文在不同的业务场景下，传输的字段存在区别，本节汇总说明在不同场景下传输的字段。

表17 Quote 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	做市方 新增请求回 复	做市方 修改请求回 复	非做市方 接收做市方 新增、修改请 求回复通知	做市方 接收请求回 复查询反馈
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传 该字段不允许修改	必传	必传
报价类别	537 QuoteType	必传	必传 该字段不允许修改	必传	必传
操作类型	10272 QuoteTransType	必传	必传	必传	-
报价状态	297QuoteStatus	-	-	必传	必传
回复有效时间	62 ValidUntilTime	必传	必传 该字段允许修改	必传	必传
客户参考编号	11C10rdID	必传	必传	-	有则必传
查询请求编号	10168 QueryRequestID	-	-	-	必传
原客户参考编号	41 OrigC10rdID	-	有则必传 该字段不允许修改	-	-
请求报价编号	131QuoteReqID	必传	必传 该字段不允许	必传	-

业务字段	IMIX 域	做市方 新增请求回 复	做市方 修改请求回 复	非做市方 接收做市方 新增、修改请 求回复通知	做市方 接收请求回 复查询反馈
			许修改		
请求回复编号	117QuoteID	—	必传 该字段不允 许修改	必传	必传
业务发生时间	60 TransactTime	—	必传	必传	必传
匿名	10008 AnonymousIndicator	—	—	必传	必传
应急标识	10022 ContingencyIndicator	—	—	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	必传	必传 该字段不允 许修改	必传	必传
债券名称	55 Symbol	—	—	必传	必传
交易方向	54 Side	必传	必传 该字段不允 许修改	必传	必传
到期收益率	235 YieldTyp 236 Yield	选传 传输规则见 3.1 章节业务 要素表	选传 传输规则见 3.1 章节业务 要素表 特殊债、ABS 券不可修改	有则必传。 ABS 券不传； 特殊债不传。	有则必传。 ABS 券不传； 特殊债不传。
行权收益率	233 StipulationType 234 StipulationValue	选传 传输规则见 3.1 章节业务 要素表	选传 传输规则见 3.1 章节业务 要素表 仅限含权债 可修改，若含 权债但是为 特殊债则不 可修改	行权债有则 必传；特殊债 不传。	行权债有则 必传；特殊债 不传。
净价	44 Price	选传 传输规则见 3.1 章节业务 要素表	选传 传输规则见 3.1 章节业务 要素表 该字段允许 修改	必传	必传
全价	10048 DirtyPrice	—	—	必传	—
应计利息	159AccruedInterestAmt	选传 传输规则见 3.1 章节业务 要素表	选传 传输规则见 3.1 章节业务 要素表	必传	—

业务字段	IMIX 域	做市方 新增请求回 复	做市方 修改请求回 复	非做市方 接收做市方 新增、修改请 求回复通知	做市方 接收请求回 复查询反馈
			特殊债时允 许修改		
应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAm t	-	-	必传	-
券面总额	38 OrderQty	必传	必传 该字段允许 修改	必传	必传
交易金额	10312 TradeCashAmt	-	-	必传	-
结算金额	119 SettlCurrAmt	-	-	必传	-
结算币种	120 SettlCurrency	选传，若不 传，默认为 CNY	选传，若不 传，默认为 CNY 该字段不允 许修改	必传	-
汇率	155 SettlCurrFxRate	选传，若债券 币种和结算 币种不一致， 则必传	选传，若债券 币种和结算 币种不一致， 则必传 该字段允许 修改	有则必传	-
结算方式	919 DeliveryType	-	-	必传	必传
清算类型	11143ClearingMethod	必传	-	必传	必传
清算速度	63 SettlType	-	-	必传	必传
结算日	64SettlDate	-	-	必传	-
每百元本金额	10239 Principal	-	-	选传，ABS 券 时传输	-
本金额	10310 TotalPrincipal	-	-	选传，ABS 券 时传输	-
用户参考数据 1	11405 UserReference1	选传	-	-	-
用户参考数据 2	11406 UserReference2	选传	-	-	-
用户参考数据 3	11407 UserReference3	选传	-	-	-
用户参考数据 4	11498 UserReference4	选传	-	-	-

业务字段	IMIX 域	做市方 新增请求回 复	做市方 修改请求回 复	非做市方 接收做市方 新增、修改请 求回复通知	做市方 接收请求回 复查询反馈
用户参考数据 5	11499 UserReference5	选传	-	-	-
用户参考数据 6	11500 UserReference6	选传	-	-	-
做市方交易账户 21 位 码	当 452PartyRole=101 时 448PartyID	必传	必传 该字段不允 许修改	必传	必传
做市方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	必传	必传 该字段不允 许修改	必传	必传

3.7 QuoteStatusReport (AI)

QuoteStatusReport 报文用于反馈请求回复的状态。

3.7.1 IMIX 报文示例

表18 QuoteStatusReport 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	100	报文体长度
35			MsgType	AI	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
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	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖
537			QuoteType	113	报价类别 113-请求回复
297			QuoteStatus	16	报价状态 16-正常 19-撤销
10272			QuoteTransType	N	操作类型 N-新增 R-修改 C-撤销

62			ValidUntilTime	20070822-12:33:00.000	回复有效时间
11			ClOrdID	XXXX	客户参考编号
131			QuoteReqID	XXXX	请求报价编号
117			QuoteID	XXXX	请求回复编号
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间
10008			AnonymousIndicator	N	匿名 N-否 默认取值否
48			SecurityID	XXXX	债券代码
55			Symbol	XXXX	债券名称
54			Side	1	交易方向
44			Price	98.0000	净价
10048			DirtyPrice	99.3000	全价
159			AccruedInterestAmt	1000.00000	应计利息
10002			AccruedInterestTotalAmt	23123.23	应计利息总额
38			OrderQty	100000	券面总额
10312			TradeCashAmt	3480000.00	交易金额
119			SettlCurrAmt	1000.00	结算金额
120			SettlCurrency	USD	结算币种
155			SettlCurrFxRate	1.125615	汇率
919			DeliveryType	0	结算方式
11143			ClearingMethod	6	清算类型
63			SettlType	2	清算速度
64			SettlDate	20070822	结算日期
11405			UserReference1	XXX	用户参考数据 1
11406			UserReference2	XXX	用户参考数据 2
11407			UserReference3	XXX	用户参考数据 3
11498			UserReference4	XXX	用户参考数据 4
11499			UserReference5	XXX	用户参考数据 5
11500			UserReference6	XXX	用户参考数据 6
235			YieldType	MATURITY	到期收益率
236			Yield	3.3500	到期收益率值
232			NoStipulations	1	
→	233		StipulationType	StrikeYield	
→	234		StipulationValue	4.3500	行权收益率
453			NoPartyIDs	1	该场景固定取值为 1
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码
→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

3.7.2 使用场景

表19 QuoteStatusReport 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	做市方 接收本方新增请 求回复成功反馈	做市方 接收本方修改请 求回复成功反馈	做市方 接收本方撤销请 求回复成功反馈
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传	必传
报价类别	537 QuoteType	必传	必传	必传
报价状态	297 QuoteStatus	必传	必传	必传
操作类型	10272 QuoteTransType	必传	必传	必传
回复有效时间	62 ValidUntilTime	必传	必传	—
客户参考编号	11 ClOrdID	有则必传	有则必传	有则必传
请求报价编号	131 QuoteReqID	必传	必传	—
请求回复编号	117 QuoteID	必传	必传	必传
业务发生时间	60 TransactTime	必传	必传	必传
匿名	10008 AnonymousIndicator	必传	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	必传	必传	必传
债券名称	55 Symbol	必传	必传	必传
交易方向	54 Side	必传	必传	必传
到期收益率	235 YieldTyp 236 Yield	有则必传。ABS 券 不传；特殊债不 传。	有则必传。ABS 券 不传；特殊债不 传。	—
行权收益率	233 StipulationType 234 StipulationValue	行权债有则必 传；特殊债不传。	行权债有则必 传；特殊债不传。	—
净价	44 Price	必传	必传	—
全价	10048 DirtyPrice	必传	必传	—
应计利息	159AccruedInterestAmt	必传	必传	—
应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	必传	必传	—
券面总额	38 OrderQty	必传	必传	—
交易金额	10312 TradeCashAmt	必传	必传	—
结算金额	119 SettlCurrAmt	必传	必传	—
结算币种	120 SettlCurrency	必传	必传	—
汇率	155 SettlCurrFxRate	选传，若债券币 种和结算币种不 一致，则必传	选传，若债券币 种和结算币种不 一致，则必传	—
结算方式	919 DeliveryType	必传	必传	—
清算类型	11143ClearingMethod	必传	必传	—
清算速度	63 SettlType	必传	必传	—
结算日期	64SettlDate	必传	必传	—
用户参考数据 1	11405 UserReference1	有则必传	—	—
用户参考数据 2	11406 UserReference2	有则必传	—	—
用户参考数据 3	11407 UserReference3	有则必传	—	—

业务字段	IMIX 域	做市方 接收本方新增请 求回复成功反馈	做市方 接收本方修改请 求回复成功反馈	做市方 接收本方撤销请 求回复成功反馈
用户参考数据 4	11498 UserReference4	有则必传	—	—
用户参考数据 5	11499 UserReference5	有则必传	—	—
用户参考数据 6	11500 UserReference6	有则必传	—	—
做市方交易账户 21 位码	当 452PartyRole=101 时 448PartyID	必传	必传	必传
做市方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	必传	必传	必传

3.8 QuoteCancel (Z)

QuoteCancel 报文用于做市方撤销请求回复、非做市方接收请求回复撤销通知、双方接收请求回复过期通知及请求回复自动撤销通知。

3.8.1 IMIX 报文示例

表20 QuoteCancel 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	Z	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20110520-12:40:00.000	报文发送时间
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	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
537			QuoteType	113	报价类别 113-请求回复
297			QuoteStatus	19	报价状态 19-撤销 21-过期
62			ValidUntilTime	20110520-12:40:00.000	有效时间
11			ClOrdID	XXXX	客户端编号
41			OrigClOrdID	XXXX	原客户参考编号
131			QuoteReqID	XXXX	请求报价编号
117			QuoteID	XXXX	请求回复编号
60			TransactTime	20110520-12:40:00.123	
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
54			Side	1	交易方向

295			NoQuoteEntries	1	该场景固定取值为 1
→	55		Symbol	XXX	债券名称 组件必传域, 若字段无值则默认取值“-”
→	48		SecurityID	XXXX	债券代码
→	10176		MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖
453			NoPartyIDs	1	
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码
→	452		PartyRole	101	101-发送方(即做市方)
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

3.8.2 使用场景

QuoteCancel报文在不同的业务场景下, 传输的字段存在区别, 本节汇总说明在不同场景下传输的字段。

表21 QuoteCancel 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	做市方 撤销请求回 复	非做市方 接收撤销请求 回复通知	非做市方、做市 方 接收请求回复 撤销通知(系统 自动撤销)	非做市方、做市 方 接收请求回复 过期通知
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传	必传	必传
报价类别	537 QuoteType	必传	必传	必传	必传
报价状态	297QuoteStatus	-	必传	必传	必传
报价有效时间	62 ValidUntilTime	必传	-	-	-
客户参考编号	11ClOrdID	必传	-	-	-
原客户参考编号	41 OrigClOrdID	有则必传	-	-	-
请求报价编号	131QuoteReqID	-	必传	必传	必传
请求回复编号	117QuoteID	必传	必传	必传	必传
业务发生时间	60 TransactTime	必传	必传	必传	必传
应急标识	10022 ContingencyIndicator	-	必传	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	必传	必传	必传	必传
债券名称	55 Symbol	-	必传	必传	必传
交易方向	54 Side	必传	必传	必传	必传
做市方交易账户 21 位码	当 452PartyRole=101 时 448PartyID	必传	必传	必传	必传

业务字段	IMIX 域	做市方 撤销请求回 复	非做市方 接收撤销请求 回复通知	非做市方、做市 方 接收请求回复 撤销通知（系统 自动撤销）	非做市方、做市 方 接收请求回复 过期通知
做市方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	必传	必传	-	-

3.9 QuoteResponse (AJ)

QuoteResponse (AJ) 报文用于非做市方确认做市方回复的报价。

3.9.1 IMIX 报文示例

表22 QuoteResponse 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	100	报文体长度
35			MsgType	AJ	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
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	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场，必传 4-现券买卖
537			QuoteType	113	报价类别 113-请求回复，必传
694			QuoteRespType	1	操作类型，必传 1-确认成交
11			ClOrdID	XXX	客户参考编号，必传
11960			AllocInd	1	分账标识，必传 0-无 allocation 1-pre-allocation
117			QuoteID	XXXX	请求回复编号，必传
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间，必传
48			SecurityID	XXXX	债券代码，必传
54			Side	1	交易方向，必传
453			NoPartyIDs	1	该场景固定取值为 1
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码，必传
→	452		PartyRole	101	101-非做市方
→	802		NoPartySubIDs	1	

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID, 必传
78			NoAllocs	2	重复组次数, 取值以实际消息传输为准。 当不带分账信息时, 不传输该组件。 确认成交时只允许修改分账信息, 其他字段不允许修改。
→	79		AllocAccount	XXX	投资产品 21 位码
→	467		IndividualAllocID	XXX	分账序号
→	80		AllocQty	200000	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	300000	分账券面总额
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

3.10 ExecutionReport (8)

ExecutionReport 报文用于传送成交通知。

3.10.1 IMIX 报文示例

表23 ExecutionReport IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX. 2. 0	报文版本
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	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	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场，必传 4-现券买卖
17			ExecID	XXX	成交编号，必传
10317			TradeMethod	4	交易方式，必传 4-请求报价
150			ExecType	F	成交状态，必传 F-正常 5-修改

					4-撤销
75			TradeDate	20151209	成交日期, 必传
10318			TradeTime	18:57:00.000	成交时间, 必传
117			QuoteID	XXX	请求回复编号, 必传
60			TransactTime	20121221-12:00:00.000	业务发生时间, 必传
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识, 必传 Y-是 N-否
48			SecurityID	XXXX	债券代码, 必传
54			Side	1	交易方向, 必传 1-买 2-卖
44			Price	0.0810	净价, 必传
10048			DirtyPrice	100.0000	全价, 必传
159			AccruedInterestAmt	100.00000	应计利息, 必传
32			LastQty	10000	券面总额, 必传
381			GrossTradeAmt	10000.00	交易金额, 必传
10002			AccruedInterestTotalAmt	10000.00	应计利息总额, 必传
119			SettlCurrAmt	111.02	结算金额, 必传
120			SettlCurrency	USD	结算币种, 必传
155			SettlCurrFxRate	1.123456	汇率
919			DeliveryType	0	结算方式, 必传
11143			ClearingMethod	6	清算类型, 必传
63			SettlType	1	清算速度, 必传
64			SettlDate	20090429	结算日, 必传
10239			Principal	33.09	每百元本金额, 仅 ABS 传
10310			TotalPrincipal	123.98	本金额, 仅 ABS 传
235			YieldType	MATURITY	到期收益率
236			Yield	3.3500	有则必传。ABS 不传; 特殊债不传。
232			NoStipulations	1	
→	233		StipulationType	StrikeYield	行权收益率
→	234		StipulationValue	2.3600	选传。行权债有则必传; 特殊债不传。
453			NoPartyIDs	2	重复组个数 该场景固定取值为 2
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码, 必传
→	452		PartyRole	119	119-买方
→	802		NoPartySubIDs	1	重复组个数, 固定取值 1
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID, 必传
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位码, 必传
→	452		PartyRole	120	120-卖方
→	802		NoPartySubIDs	1	重复组个数, 固定取值 1
→	→	523	PartySubID	XXX	

→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID，必传
78			NoAllocs	1	当传分账序号时，固定取值 1； 当不传分账序号时，不传该组件。
→	79		AllocAccount	—	组件必传域，取值 “—”
→	467		IndividualAllocID	XXX	分账序号，有则必传
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

4 快速撤单

交易接口可通过 QuickCancel 报文快速撤销指定交易员发送的报价。

若请求回复快速撤单成功，则逐条反馈给做市方 QuoteStatusReport (AI) 撤销请求回复成功反馈消息，逐条反馈给非做市方 QuoteCancel (Z) 撤销请求回复通知消息；

若请求回复快速撤单失败，则反馈 BusinessMessageReject (j) 失败反馈消息。

4.1 业务要素

表24 快速撤单业务要素

字段	IMIX 域	取值说明	备注
客户参考编号	11 ClOrdID	字符串 例如： ODAAAABBBB45629875	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明
市场	10176 MarketIndicator	枚举值 4-现券买卖	
交易方式	10317 TradeMethod	枚举值： 4-请求报价	
报价类别	537 QuoteType	枚举值： 113-请求回复	
交易方向	54 Side	枚举值： 0-全部 1-买入 2-卖出	
撤单机构交易账户 21 位代码	448 PartyID	21 位代码	1、如果为主机构撤销报价，则填写主交易账户 21 位代码。 2、如果为投资管理人管理的非法人产品撤销报价，或者为结算代理人代理交易的境外投资人撤销报价，则填写交易账户 21 位代码。
	452 PartyRole	121-撤单机构	
撤单机构交易员 ID	803 PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	
	523 PartySubID	文本	必传，撤单机构（包括投资管理人或结算代理人）的交易员 ID

4.2 QuickCancel (U20)

4.2.1 IMIX 报文示例

表25 QuickCancel 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	U20	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号

52			SendingTime	20110520-12:40:00.000	报文发送时间
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	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
11			ClOrdID	XXXX	客户参考编号，必传
10176			MarketIndicator	4	市场，必传
10317			TradeMethod	4	交易方式，必传
537			QuoteType	113	报价类别，必传
54			Side	0	交易方向，必传
453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位代码，必传
→	452		PartyRole	121	121-撤单机构
→	802		NoPartySubIDs	1	固定取值 1
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID，必传
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

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
-