

中国外汇交易中心 IMIX 协议开发指引

CFETS/K1552—2018

本币成员端数据下载 IMIX 协议开发指引

(5.7 版)

协议版本 1.136.6

本币直通式处理数据

中国外汇交易中心

发布

目 次

前言 V

引言 VI

修改历史 VII

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

4.1.1 报文头 2

4.1.2 报文尾 3

4.1.3 报文体 3

4.1.4 组件 4

4.1.5 重复组 4

4.1.6 报文应用通则 5

4.2 报文类型 5

4.3 市场标识符 5

4.4 交易方式(询价、竞价、点击、请求) 5

4.5 做市与非做市 5

4.6 交易品种与基础品种 6

4.7 交易成员信息 6

4.8 标准产品与非标准产品 7

4.9 本方与对手方 8

4.10 应急服务 8

4.11 盘后报文重发 10

4.12 结算方式 10

4.13 期限转换 11

4.14 清算方式及关键域说明 11

4.15 分层交易（北金所业务说明） 12

4.16 标准利率互换业务说明 12

5 业务场景开发 13

5.1 本币成员端数据获取路径 13

5.2 系统标识说明 14

5.3 应急报文重发 15

6 IMIX 协议开发规范..... 16

6.1 应用登录处理 16

6.1.1	登录请求业务要素	16
6.1.2	登录请求 IMIX 报文标准	16
6.1.3	登录成功反馈业务要素	17
6.1.4	登录成功反馈 IMIX 报文标准	18
6.1.5	登录失败反馈业务要素	18
6.1.6	登录失败反馈 IMIX 报文标准	19
6.2	应用登出处理	20
6.2.1	登出请求业务要素	20
6.2.2	登出请求 IMIX 报文标准	21
6.2.3	登出成功反馈业务要素	22
6.2.4	登出成功反馈 IMIX 报文标准	22
6.3	修改密码	22
6.3.1	修改密码请求业务要素	23
6.3.2	修改密码请求 IMIX 报文标准	23
6.3.3	修改密码请求反馈业务要素	24
6.3.4	修改密码反馈 IMIX 报文标准	24
6.3.5	修改密码反馈-密码错误 IMIX 报文标准	25
6.4	数据	26
6.4.1	信用拆借市场	26
6.4.1.1	成交业务要素	26
6.4.1.2	成交 IMIX 报文标准	29
6.4.2	质押式回购市场	32
6.4.2.1	成交业务要素	32
6.4.2.2	成交 IMIX 报文标准	37
6.4.3	买断式回购市场	42
6.4.3.1	成交业务要素	42
6.4.3.2	成交 IMIX 报文标准	46
6.4.4	现券买卖市场	50
6.4.4.1	成交业务要素	51
6.4.4.2	成交 IMIX 报文标准	56
6.4.4.3	上市前债券交易意向业务要素	62
6.4.4.4	上市前债券交易意向 IMIX 报文标准	67
6.4.5	做市支持成交数据	72
6.4.5.1	做市支持成交明细业务要素	72
6.4.5.2	做市支持成交明细 IMIX 报文标准	77
6.4.6	债券远期市场	83
6.4.6.1	成交业务要素	84
6.4.6.2	成交 IMIX 报文标准	87
6.4.7	标准债券远期市场	92
6.4.7.1	标准债券远期成交业务要素	92
6.4.7.2	标准债券远期成交（上海清算所清算）IMIX 报文标准	96
6.4.7.3	标准债券远期成交（双边自行清算）IMIX 报文标准	98
6.4.8	利率互换市场	102

6.4.8.1	成交数据	102
6.4.8.1.1	固定-浮动成交业务要素	102
6.4.8.1.2	固定-浮动成交 IMIX 报文标准	106
6.4.8.1.3	浮动-浮动成交业务要素	111
6.4.8.1.4	浮动-浮动成交 IMIX 报文标准	120
6.4.8.2	标准利率互换固定-浮动成交	126
6.4.8.2.1	标准利率互换固定-浮动成交业务要素	126
6.4.8.2.2	标准利率互换固定-浮动成交（上海清算所清算）IMIX 报文标准	129
6.4.8.2.3	标准利率互换固定-浮动成交（双边自行清算）IMIX 报文标准	132
6.4.9	债券借贷市场	136
6.4.9.1	成交业务要素	136
6.4.9.2	成交 IMIX 报文标准	141
6.4.10	远期利率协议市场	145
6.4.10.1	成交业务要素	145
6.4.10.2	成交 IMIX 报文标准	148
6.4.11	信用缓释凭证市场	152
6.4.11.1	成交业务要素	152
6.4.11.2	成交 IMIX 报文标准	155
6.4.12	利率互换期权市场	158
6.4.12.1	成交业务要素	158
6.4.12.2	成交 IMIX 报文标准	164
6.4.13	利率上限/下限期权市场	170
6.4.13.1	成交业务要素	170
6.4.13.2	成交 IMIX 报文标准	174
6.4.14	工具发行结果信息	178
6.4.14.1	招标发行结果业务要素	178
6.4.14.2	招标发行结果 IMIX 报文标准	182
6.4.14.3	报价发行结果业务要素	188
6.4.14.4	报价发行结果 IMIX 报文标准	191
6.4.15	发行人缴款信息	194
6.4.15.1	发行人缴款信息业务要素	194
6.4.15.2	发行人缴款信息 IMIX 报文标准	196
6.4.16	预发行市场	200
6.4.16.1	成交业务要素	200
6.4.16.2	成交 IMIX 报文标准	204
6.4.17	信用违约互换市场	208
6.4.17.1	信用违约互换非固定支付方式成交业务要素	208
6.4.17.2	信用违约互换非固定支付方式成交 IMIX 报文标准	216
6.4.18	常备借贷便利	225
6.4.18.1	常备借贷便利成交数据业务要素	225
6.4.18.2	常备借贷便利成交数据 IMIX 报文标准	228
6.4.19	同业存款市场	231
6.4.19.1	同业存款成交业务要素	231

6.4.19.2 同业存款成交 IMIX 报文标准	236
6.4.19.3 同业存款附加协议业务要素	240
6.4.19.4 同业存款附加协议 IMIX 报文标准	245
6.4.20 同业借款市场	255
6.4.20.1 同业借款成交业务要素	255
6.4.20.2 同业借款成交 IMIX 报文标准	259
6.4.20.3 同业借款附加协议业务要素	262
6.4.20.4 同业借款附加协议 IMIX 报文标准	267
参考文献	274
图 1 IMIX 报文结构	2
图 2 本币 CSTP 客户端数据获取路径图	14
表 1 标准报文头	2
表 2 标准报文头示例 1	3
表 3 标准报文头示例 2	3
表 4 标准报文尾	3
表 5 重复组示例 1	4
表 6 重复组示例 2	4
表 7 交易品种示例 1	6
表 8 交易品种示例 2	6
表 9 交易成员信息示例	6
表 10 标准品种	7
表 11 非标准品种	7
表 12 应急成交录入 IMIX 报文示例	8
表 13 API 用户盘中收到报文的报文头	10
表 14 API 用户盘后重发报文的报文头	10
表 15 清算方式及枚举值	11
表 16 北金所会员	12
表 17 标准利率互换产品说明	13
表 18 系统标识说明	14
表 19 IMIX 协议定义系统唯一标识	15
表 20 115 域取值含义	15
表 21 不同业务场景辨别标示	16
表 22 登录场景流程	16
表 23 登录请求业务要素表	16
表 24 登录请求 IMIX 报文标准	16
表 25 登录成功反馈业务要素表	17
表 26 登录成功反馈 IMIX 报文标准	18
表 27 登录失败反馈业务要素表	18
表 28 登录失败反馈 IMIX 报文标准	19
表 29 登出处理流程	20

表 30	登出请求业务要素表.....	20
表 31	登出请求 IMIX 报文标准.....	21
表 32	登出成功反馈业务要素表.....	22
表 33	登出成功反馈 IMIX 报文标准.....	22
表 34	修改密码请求业务要素表.....	23
表 35	修改密码请求 IMIX 报文标准.....	23
表 36	修改密码请求反馈业务要素表.....	24
表 37	修改密码反馈 IMIX 报文标准.....	24
表 38	修改密码反馈-密码错误 IMIX 报文标准.....	25
表 39	下载流程.....	26
表 40	信用拆借市场关键域.....	26
表 41	成交业务要素表.....	26
表 42	成交 IMIX 报文标准.....	29
表 43	质押式回购市场关键域.....	32
表 44	成交业务要素表.....	33
表 45	质押债券信息.....	37
表 46	成交 IMIX 报文标准.....	37
表 47	买断式回购市场关键域.....	42
表 48	成交明细业务要素表.....	42
表 49	成交明细 IMIX 报文标准.....	46
表 50	现券买卖市场关键域.....	50
表 51	成交明细业务要素表.....	51
表 52	成交明细 IMIX 报文标准.....	56
表 53	上市前债券交易意向业务要素.....	62
表 54	上市前债券交易意向 IMIX 报文标准.....	67
表 55	做市支持成交明细业务要素表.....	72
表 56	做市支持成交明细 IMIX 报文标准.....	77
表 57	债券远期市场关键域.....	83
表 58	成交业务要素表.....	84
表 59	成交 IMIX 报文标准.....	87
表 60	标准债券远期成交业务要素.....	92
表 61	标准债券远期成交（上海清算所清算）IMIX 报文标准.....	96
表 62	标准债券远期成交（双边自行清算）IMIX 报文标准.....	98
表 63	利率互换市场关键域.....	102
表 64	固定-浮动成交业务要素表.....	102
表 65	固定-浮动成交 IMIX 报文标准.....	106
表 66	浮动-浮动成交业务要素表.....	111
表 67	浮动-浮动成交 IMIX 报文标准.....	120
表 68	标准利率互换固定-浮动成交业务要素.....	126
表 69	标准利率互换固定-浮动成交（上海清算所清算）IMIX 报文标准.....	129
表 70	标准利率互换固定-浮动成交（双边自行清算）IMIX 报文标准.....	132
表 71	债券借贷关键域.....	136
表 72	成交业务要素表.....	136

表 73	成交 IMIX 报文标准	141
表 74	远期利率协议市场关键域	145
表 75	成交业务要素表	145
表 76	成交 IMIX 报文标准	148
表 77	信用缓释凭证市场关键域	152
表 78	成交业务要素表	152
表 79	成交 IMIX 报文标准	155
表 80	本方成交业务要素	158
表 81	成交 IMIX 报文标准	164
表 82	成交业务要素	170
表 83	成交 IMIX 报文标准	174
表 84	招标发行结果业务要素	178
表 85	招标发行结果 IMIX 报文标准	182
表 86	报价发行结果业务要素	188
表 87	报价发行结果 IMIX 报文标准	191
表 88	发行人缴款信息业务要素	194
表 89	发行人缴款信息 IMIX 报文标准	196
表 90	成交业务要素	200
表 91	成交 IMIX 报文标准	205
表 92	信用违约互换非固定支付方式成交业务要素.....	208
表 93	信用违约互换非固定支付方式成交 IMIX 报文标准.....	216
表 94	常备借贷便利成交数据业务要素	226
表 95	常备借贷便利成交数据 IMIX 报文标准.....	228
表 96	同业存款成交业务要素	231
表 97	同业存款成交 IMIX 报文标准	236
表 98	同业存款附加协议业务要素	240
表 99	同业存款附加协议 IMIX 报文标准	245
表 100	同业借款成交业务要素	255
表 101	同业借款成交 IMIX 报文标准	259
表 102	同业借款附加协议业务要素	262
表 103	同业借款附加协议 IMIX 报文标准	267

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(以下简称中国外汇交易中心)向银行间市场成员提供的直通式处理接口服务内容起草。

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。

本文件代替了CFETS/K1289—2017《本币成员端数据下载IMIX协议开发指引》5.0版。与CFETS/K1289—2017相比，主要变化如下：

- 调整 6.4.13 “投资发行结果信息”章节名称为“工具发行结果信息”；
- 6.4.13 工具发行结果信息章节，增加“币种”字段；
- 6.4.14 发行人缴款信息章节，增加字段“币种、缴款状态”，并增加说明：该投资人的实缴金额为 0 元时，投资人相关缴款信息（投资人 21 位码、投资人名称、托管账号、应缴款金额、实缴款金额、持有量）也需要传输，并在相关字段后面加上说明。
- 完善和统一部分字段在业务要素和 IMIX 报文标准中的说明-涉及章节为：6.4.14.1 发行人缴款信息及 6.4.13 工具发行结果信息章节
- 新增 6.4.17 章节 常备借贷便利

本文件主要起草人：茅廷、何维娜、冯江平、夏玉姣、高静。

引言

近年来，中国外汇交易中心持续丰富对市场会员提供的直通式处理接口服务内容，通过不断地修订和完善相关的IMIX协议开发指引，在银行间市场金融应用系统建设和监管工作中发挥了重要的指导作用。CFETS/K0231—2013发布以来，中国外汇交易中心收到了许多实际使用IMIX协议开发指引的市场会员机构提出的修改意见和建议，以及在系统建设、标准应用过程中遇到的一些问题。为了配合直通式处理接口服务发展、满足广大银行间市场会员机构和系统建设参与者的实际需求，有必要对相关的IMIX协议开发指引进行修订。

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/T0065—2011《银行间市场基础数据元》、JR/T0066—2011《银行间市场业务数据交换协议》、JR/T0078—2014《银行间市场数据接口》等多项金融行业标准，以此为基础打造了直通式处理接口、市场行情接口、报价接口、交易接口等多项数据接口服务，并面向市场推出了包括规范性指导文件、应用编程接口(API)、技术与业务支持在内的数据接口开发服务体系。IMIX协议开发指引作为体系中的重要环节，是数据接口系统开发的规范性约束文件。因此，本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	协议包版本	日期	修改内容
杨帆		1.0		2008-4-8	创建文档
杨帆		1.1		2008-5-10	
杨帆		1.2		2008-6-15	增加各个场景 IMIX 报文例子
杨帆		1.3		2008-7-20	
杨帆		1.4		2008-8-22	增加组件章节，增加重复组说明
王雷		1.5		2008-8-26	
王雷		1.6		2008-8-29	增加各例子程序代码范例
黄滔		1.7		2008-9-30	修改范例
黄滔		1.8		2008-10-4	更新报文头章节范例
黄滔		1.9		2008-10-6	更新关联机构例子
黄滔		2.0		2008-10-7	更新利率互换报价成交例子
黄滔		2.1		2008-10-7	更新《关键域及组件使用说明举例》章节
黄滔		2.2		2008-10-8	更新利率互换成交数据 IMIX 报文例子
孙齐华		2.3		2008-10-9	添加相关域字典，组件以及报文的文档
李淑新		2.4		2008-10-15	添加示例代码
陆晗		2.5		2008-10-17	修改 PossDup 和 PossResend 标记的说明
孙齐华 张媛 黄滔 王雷		2.6		2009-1-19	增加了市场数据部分； 增加了基准利率数据部分； 增加了“本币成员端数据获取路径”部分； 重新对应了各场景的业务对应表； 重新 review 报文机构； 重新 review 报文与业务的对应关系；
孙齐华 张媛 黄滔 王雷		2.7		2009-1-22	增加 4.11 节标准产品与非标准产品的说明； 增加 4.12 节本方和对手方的解释说明；
孙齐华, 王雷		2.8		2009-4-30	修改信用拆借市场中‘应计利息’对应的 IMIX 域，修改成交数据中的拆借金额对应的 IMIX 域； 删除债券借贷市场成交数据中的‘标的债券发行量’； 修改 IRS 和 FRA 市场的名义本金金额对应的 IMIX 域； 全文修改起息日和到期日对应的 IMIX 域； 全文修改点击成交报价的要素表为单边内容；

					<p>重新 Review 报文示例：</p> <p>在质押式回购市场中添加‘券面总额’要素及其对应的 IMIX 域说明；修改‘券面总额合计’域的对应说明；</p> <p>在所有市场中添加 60TransactTime 域；</p> <p>全文修改资金帐户名的 IMIX 域，添加了中文帐户名和英文帐户名的说明；</p> <p>修改债券借贷市场中应计利息总额对应的 IMIX 域为 10002AccruedInterestTotalAmt；</p> <p>全文修改域 888，233，10136 的取值字母大小写，保持和字典一致；</p> <p>全文修改，将保证金/保证券变动标识对应的 IMIX 域改为 10157MarginReplacement，在报文示例中，增加该域，并将 10461 域删除；</p> <p>按照业务需求的变更，删除资金清算方式，并且在 IMIX 报文示例中删除该域；</p> <p>按照业务需求的变更，在利率互换浮动对浮动成交数据中，将计息天数调整对应的域从 10018 改成 10588；将支付日调整对应的域从 10009 改成 10095；在双向报价中，名义本金金额对应的 IMIX 域由 27IOQty 改为 682LegIOQty，并在报文示例中做出相应的修改；</p> <p>在远期利率协议成交数据中，将计息基准对应的域从 10072 改成 10040；</p> <p>按照业务需求的变更，在债券借贷市场成交数据中，删除融入方质押品账户明细要素，并在报文示例中做出相应的修改；</p> <p>按照业务需求的变更，在资产支持证券市场中，删除收益率组件；</p> <p>按照业务需求的变更，在 ETF 市场中，删除参考净值 10075IOPValue 域；</p> <p>按照业务需求的变更，在信用拆借市场的成交中，卖方账户信息中添加资金开户行信息；</p> <p>在本方和关联机构远期利率协议市场中，删除 662BenchmarkPrice 域，并更新 IMIX 报文示例；</p> <p>按照业务需求的变更，在远期利率协议双向报价中，删除 27IOQty，在 Leg 组件中添加 682LegIOQty 域，同时更新 IMIX 报文示例；</p> <p>按照业务需求的变更，在质押式回购市场的 IMIX 报文示例中删除 10321 域；在双向报价</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>中，将应计利息对应的域由 10088 修改为 10089</p> <p>按照业务需求的变更，在买断式回购成交数据中添加报价编号 117QuoteID，并在 IMIX 报文示例中添加；在债券远期成交中，修改报价编号对应的域，并更新 IMIX 报文示例；远期利率协议成交中，修改报价编号对应的域，并更新 IMIX 报文示例；</p>
孙齐华		2.9		2009-05-11	<p>按照业务需求的变更，删除基准利率部分数据，市场成交市场报价数据，市场行情部分数据；</p> <p>按照业务需求的变更，添加 4.13 章节应急服务说明内容；</p> <p>3. 修改 5.1 节“本币成员端数据获取路径”部分的说明。</p> <p>修改 4.7 节“交易成员信息”部分的说明，详细解释交易机构和交易员信息的传输方式</p> <p>按照业务需求的变更，全文修改交易双方信息，添加交易员名称，删除交易员代码信息；</p> <p>添加 4.14 节“盘后报文重发”</p> <p>添加 4.15 节“系统更新报价报文”部分</p>
王雷		3.0		2009-06-24	<p>全文替换“21 位会员代码”为“机构 ID”；</p> <p>修改 4.14 和 4.15 的说明；</p> <p>添加 4.16 节报价状态“发送”和“收到”的说明；</p> <p>全文修改 150ExecType 的取值“撤销”的对应由 H 改成 4.</p> <p>添加 5.3.3 节“修改密码”部分。</p> <p>添加 4.17 节“结算方式”部分。</p> <p>添加 4.18 节“期限的转换”部分。</p>
王雷		3.0.1		2011-06-02	<p>在 5.3.4 本方报价成交数据章节中修改：</p> <p>在现券市场点击成交和做市报价中的“结算方式”中添加值 NDVP(净额券款对付)；</p> <p>把现券市场限价报价的“结算方式”改成“结算方式(多种)”，IMIX 域由 919 改成 10047，并添加值 NDVP；</p> <p>在现券市场成交数据的“结算方式”添加 NDVP；</p>
孙齐华		3.0.2		2011-6-3	<p>在 5.3.5 章节关联机构报价成交数据中修改：</p> <p>在现券市场点击成交和做市报价中的“结算方式”中添加值 NDVP(净额券款对付)；</p> <p>把现券市场限价报价的“结算方式”改成“结算方式(多种)”，IMIX 域由 919 改成 10047，</p>

					<p>并添加值 NDVP;</p> <p>在现券市场成交数据的“结算方式”添加 NDVP;</p> <p>在 4.17 结算方式章节中修改关键域和组件的使用说明;</p>
孙齐华		3.1		2011-12-28	<p>本方报价成交和关联机构报价成交数据中增加: 信用风险缓释凭证市场;</p> <p>增加 5.3.5 和 5.3.7 本方备案成交和关联机构备案成交数据;</p> <p>在现券市场和资产支持证券限价报价中, 将结算方式改为结算方式多种;</p> <p>在现券市场和债券远期市场中, 增加行权收益率字段;</p>
孙齐华		3.1.1		2012-1-12	<p>全文删除手续费信息;</p> <p>全文删除备案成交的相关信息;</p>
朱琰 何维娜	朱琰、何维娜	3.2	1.110.8	2013-08-08	<p>全文章节顺序做一定调整: IMIX 协议及相关文档的使用说明在第一、二章表述; 各业务场景和 IMIX 协议开发规范在第三、四章进行说明; 报文数据变更如下:</p> <p>4.4.4.12 与 4.5.4.12 节现券市场成交报文中增加 10471 域用于表示请求报价编号、增加 10317 域枚举值 4 表示请求报价;</p> <p>4.4.7.17.2 与 4.5.7.17.2 节利率互换固定-浮动成交报文 10317 域增加枚举值 3 表示撮合;</p> <p>增加指引 3.3 节-应急报文重发, 并在每一条报文标准前面增加应急报文注释说明;</p> <p>所有交易产品成交报文中定义 803 域取值 23 时表示中文资金账户户名;</p> <p>债券远期、买断式回购、信用拆借、质押式回购、买断式回购、债券借贷、利率互换、远期协议产品的交易品种业务字段使用 48SecurityID 域表示;</p> <p>笔误原因对指引中如下几处做相应调整:</p> <p>指引中的 297QuoteStatus 枚举值用取值 16 表示正常;</p> <p>修改 4.4.8.6 节与 4.5.8.6 节 10161 域注释为“质押债券券面总额合计”;</p> <p>在 4.4.7.4 节、4.4.7.6 节增加 10675 域枚举值说明;</p> <p>在 4.4.7.17.2 节增加 10997 域枚举值说明;</p> <p>修改 4.4.7.4、4.5.7.4 节报文中 803=10 为 803=15;</p>

					<p>修改 4.4.7.12、4.5.7.12 节报文中 803=10 为 803=110；</p> <p>在。</p> <p>规范指引中交易方角色名称，将指引中“Taker”“Maker”修改为“要价方”“报价方”。</p>
王一鸣	茅廷、何维娜	3.3	1.113.0	2014-04-08	<p>本方及关联机构现券市场对话报价、点击成交报价、限价报价、成交数据增加清算方式，IMIX 标准使用 11143ClearingMethod 表示清算方式，见 6.4.4.3 节、6.4.4.4 节、6.4.4.5 节、6.4.4.6 节、6.4.4.9 节、6.4.4.10 节、6.4.4.11 节、6.4.4.12 节、6.5.4.3 节、6.5.4.4 节、6.5.4.5 节、6.5.4.6 节、6.5.4.9 节、6.5.4.10 节、6.5.4.11 节、6.5.4.12 节；</p> <p>本方及关联机构现券市场做市报价增加清算方式，IMIX 标准使用 11145LegClearingMethod 表示清算方式，见 6.4.4.7 节、6.4.4.8 节、6.5.4.7 节、6.5.4.8 节；</p> <p>本方及关联机构利率互换固浮对话报价、固浮点击成交报价、固浮成交数据新增清算方式，IMIX 标准使用 11143ClearingMethod 表示清算方式，见 6.4.7.3 节、6.4.7.4 节、6.4.7.5 节、6.4.7.6 节、6.4.7.17.1 节、6.4.7.17.2 节、6.5.7.3 节、6.5.7.4 节、6.5.7.5 节、6.5.7.6 节、6.5.7.17.1 节、6.5.7.17.2 节；</p> <p>本方及关联机构利率互换固浮成交数据增加撮合交易方式，见 6.4.7.17.1 节、6.4.7.17.2 节、6.5.7.17.1 节、6.5.7.17.2 节</p> <p>编辑性修改、修正笔误、规范措辞。</p>
何维娜	茅廷	3.4	1.114.0	2014-08-05	<p>根据中国人民银行规定，债券买卖市场实行分层交易，丙类户可在北金所系统查看做市报价、点击做市报价，在交易系统达成交易。会员可通过 CSTP 系统获取发送给北金所的报价以及与北金所机构达成的交易。具体修改见下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 本方及关联机构现券买卖市场做市报价增加字段“发送范围”，IMIX 标准使用 216RoutingType 取值 100 表示北金所会员，216RoutingType 取值 5 表示交易中心会员，见 4.11 节、6.4.4.7 节、6.4.4.8 节、6.5.4.7 节、6.5.4.8 节 2. 本方及关联机构现券买卖成交中增加字段“买入方来源”、“卖出方来源”，IMIX

					<p>标准使用 803 取值 29 表示机构来源, 见 6.4.4.11 节、6.4.4.12 节、6.5.4.11 节、6.5.4.12 节。</p> <p>3. 增加 4.1.6 节, 明确 IMIX 报文应用通则。</p> <p>4. 修正了部分笔误。</p>
何维娜		3.5	1.114.0	2014-09-05	<p>交易中心通过 CSTP 系统下发标准利率互换成交报文。具体修改见下:</p> <p>1. 增加 4.22 节标准利率互换业务说明</p> <p>2. 增加 6.4.7.18 节、6.5.7.18 节标准利率互换</p> <p>3. 修正部分笔误</p>
冯江平	刘倩	3.5.1	1.114.0	2014-12-09	<p>1、增加 6.4 和 6.5 节, 报价编号、订单编号、成交编号等域取值</p> <p>2、分别修改 6.4.8 章节、6.5.8 章节中对话报价、成交两个章节中关于备注及相应的域 (58) 的说明</p>
冯江平		3.6	1.116.7	2015-01-22	<p>1、新增 6.4.12、6.5.12 章节, 预发行市场信息</p> <p>2、增加 6.4.7 节、6.5.7 节标准债券远期市场成交</p>
夏玉姣	何维娜	3.7	1.116.7	2015-03-20	<p>1、质押式回购市场、买断式回购市场对话报价、成交信息中增加清算方式, 报文标准中用 11143 域表示。请见本方质押式回购对话报价数据 6.4.2.3、6.4.2.4 节; 本方质押式回购成交数据 6.4.2.7、6.4.2.8 节; 本方买断式回购对话报价数据 6.4.3.3、6.4.3.4 节; 本方买断式回购成交数据 6.4.3.5、6.4.3.6 节; 关联方质押式回购对话报价数据 6.5.2.3、6.5.2.4 节; 关联方质押式回购成交数据 6.5.2.7、6.5.2.8 节; 关联方买断式回购对话报价数据 6.5.3.3、6.5.3.4 节; 关联方买断式回购成交数据 6.5.3.5、6.5.3.6 节。</p>
高静	何维娜	3.8	1.118.2	2015-06-19	<p>1、在 6.4.7 本方标准债券远期成交消息中新增字段是否强平交易。同时将该章节的本方标准债券远期成交 IMIX 报文标准根据清算方式的不同分成上海清算所方式的本方标准债券远期成交 IMIX 报文标准和双边自行清算的本方标准债券远期 IMIX 报文标准。</p> <p>2、在 6.4.8.18 本方标准利率互换固定-浮</p>

					<p>动成交消息中新增字段是否强平交易。同时将该章节的本方标准利率互换固定-浮动 IMIX 报文标准根据清算方式的不同分成上海清算所方式的本方标准利率互换固定-浮动 IMIX 报文标准和双边自行清算的本方标准利率互换固定-浮动 IMIX 报文标准。</p> <p>3、在 6.5.7 关联方标准债券远期成交消息中新增字段是否强平交易。同时将该章节的关联方标准债券远期成交 IMIX 报文标准根据清算方式的不同分成上海清算所方式的关联方标准债券远期成交 IMIX 报文标准和双边自行清算的关联方标准债券远期 IMIX 报文标准。</p> <p>4、在 6.5.8.18 关联方标准利率互换固定-浮动成交消息中新增字段是否强平交易。同时将该章节的关联方标准利率互换固定-浮动 IMIX 报文标准根据清算方式的不同分成上海清算所方式的关联方标准利率互换固定-浮动 IMIX 报文标准和双边自行清算的关联方标准利率互换固定-浮动 IMIX 报文标准。</p> <p>5、修改表 27 利率互换产品说明, 增加标准利率互换集中清算产品合约代码</p>
高静		3.9	1.118.4	2015-07-30	<p>1、修改 6.4.8.17.1、6.4.8.17.2 利率互换固定-浮动成交数据, 新增 828 号域, 若该 IRS 成交是行权产生则传输, 否则不传; 添加传输规则, 若该 IRS 成交是行权产生的, 则不传送报价编号</p> <p>2、新增 6.4.13.1、6.4.13.2 章节利率互换期权对话报价数据</p> <p>3、新增 6.4.13.3、6.4.13.4 章节利率互换期权成交数据</p> <p>4、新增 6.4.14.1、6.4.14.2 章节利率上限/下限期权对话报价数据</p> <p>5、新增 6.4.14.3、6.4.14.4 章节利率上限/下限期权成交数据</p> <p>6、新增 6.5.13 章节关联机构利率互换期权数据</p> <p>7、新增 6.5.14 章节关联机构利率上限/下限期权数据</p>
曹浪		4.0	1.121.9	2015-12-16	<p>1、新增 6.6 章节投资发行数据</p>

曹浪		4.1	1.121.9	2016-03-28	1、 新增 6.4.16、6.5.16 章节发行人缴款信息
杨志表		4.2	1.124.2	2016-04-19	<p>1、 删除(原 6.4.5、6.5.5 章节)资产支持证券市场、(原 6.4.12、6.5.12 章节)预发行市场。</p> <p>2、 删除保证品相关信息，涉及章节：6.4.3.3、6.4.3.4、6.4.3.5、6.4.3.6、6.5.3.3、6.5.3.4、6.5.3.5、6.5.3.6 章节买断式回购市场对话报价、成交；6.4.5.3、6.4.5.4、6.4.5.5、6.4.5.6、6.5.5.3、6.5.5.4、6.5.5.5、6.5.5.6 章节债券远期市场对话报价、成交；6.4.9.3、6.4.9.4、6.4.9.9、6.4.9.10、6.5.9.3、6.5.9.4、6.5.9.9、6.5.9.10 章节远期利率协议市场对话报价、成交。</p> <p>3、 6.4.1、6.5.1 信用拆借市场、6.4.2、6.5.2 质押式回购市场、6.4.3、6.5.3 买断式回购市场、6.4.4、6.5.4 现券买卖市场(不包含限价报价)、6.4.5、6.5.5 债券远期市场、6.4.7、6.5.7 利率互换市场(不包含标准利率互换成交)、6.4.8、6.5.8 债券借贷市场、6.4.9、6.5.9 远期利率协议市场、6.4.10、6.5.10 信用缓释凭证市场，增加“客户端参考编号”。</p> <p>4、 6.4.1、6.5.1 章节信用拆借市场，在意向报价、对话报价、及成交明细中，增加“交易成员群组”字段，枚举值为“银行间”、“国际”。</p> <p>5、 6.4.2、6.5.2 章节质押式回购市场，在意向报价、对话报价和成交明细中，增加“交易成员群组”字段，枚举值为“银行间”、“国际”。</p> <p>6、 6.4.2.3、6.4.2.4、6.5.2.3、6.5.2.4 章节，在质押式回购市场对话报价中，增加“结算币种”字段，并新增“回购方式”-枚举值为“双边回购”、“自动质押回购”、“通用回购”；新增“续作标识”-枚举值为“原始成交”、“续作成交”，以及新增“原成交编号”字段。</p> <p>7、 6.4.2.7、6.4.2.8、6.5.2.7、6.5.2.8 章节，在质押式回购市场成交明细中，增加“结算币种”字段；新增“回购方式”</p>

					<p>一枚举值为“双边回购”、“自动质押回购”、“通用回购”；“交易方式”字段新增枚举值“竞价”，并新增“续作标识”一枚举值为“原始成交”、“续作成交”，以及新增“原成交编号”字段。</p> <p>8、 6.4.3、6.5.3 章节，买断式回购市场，在意向报价、对话报价、及成交明细中，增加“交易成员群组”字段，枚举值为“银行间”、“国际”。</p> <p>9、 6.4.3.3、6.4.3.4、6.5.3.3、6.5.3.4 章节，在买断式回购市场对话报价中，增加“结算币种”字段。</p> <p>10、 6.4.3.5、6.4.3.6、6.5.3.5、6.5.3.6 章节，在买断式回购市场成交明细中，增加“结算币种”字段。</p> <p>11、 6.4.4、6.5.4 章节，现券买卖市场，在现券意向报价、对话报价、点击成交报价、做市报价、限价报价及成交明细中，增加“交易成员群组”字段一枚举值为“银行间”、“国际”，增加现券标识、每百元本金额和当前本金额字段。</p> <p>12、 6.4.4.3、6.4.4.4、6.5.4.3、6.5.4.4 章节，在现券买卖市场对话报价中，增加“结算币种”字段。</p> <p>13、 6.4.4.11、6.4.4.12、6.5.4.11、6.5.4.12 章节，在现券买卖市场成交明细中，增加“结算币种”字段；增加“买方机构来源”和“卖方机构来源”字段一枚举值为“北金所”、“交易中心会员”；“交易方式”字段增加枚举值“请求”、“竞价”；“成交类别”枚举增加为“尝试做市成交”。</p> <p>14、 6.4.5、6.5.5 章节，债券远期市场，在意向报价、对话报价及成交明细中，增加“交易成员群组”字段，枚举值为“银行间”、“国际”。</p> <p>15、 6.4.5.3、6.4.5.4、6.5.5.3、6.5.5.4 章节，在债券远期市场对话报价中，增加“结算币种”字段。</p> <p>16、 6.4.5.5、6.4.5.6、6.5.5.5、6.5.5.6 章节，在债券远期市场成交明细中，增加“结算币种”字段。</p> <p>17、 6.4.7.3、6.4.7.4、6.5.7.3、6.5.7.4</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>章节，在利率互换市场固定-浮动对话报价中，增加“交易成员群组”字段，枚举值为“银行间”、“国际”。</p> <p>18、6.4.7.17.1、6.4.7.17.2、6.5.7.17.1、6.5.7.17.2 章节，在利率互换市场固定-浮动成交明细中，“交易方式”字段增加枚举值“请求”；增加“交易成员群组”字段，枚举值为“银行间”、“国际”。</p> <p>19、6.4.8、6.5.8 章节，债券借贷市场，在意向报价、对话报价及成交明细中，增加“交易成员群组”字段，枚举值为“银行间”、“国际”。</p> <p>20、6.4.8.3、6.4.8.4、6.5.8.3、6.5.8.4 章节，在债券借贷市场对话报价中，增加“结算币种”字段。</p> <p>21、6.4.8.5、6.4.8.6、6.5.8.5、6.5.8.6 章节，在债券借贷市场成交明细中，增加“结算币种”字段。</p> <p>22、6.4.7.4、6.5.7.4 章节，在利率互换市场固定-浮动对话报价 IMIX 报文中，537 的取值改为 1。</p> <p>23、6.4.4.12、6.5.4.12 章节，在现券买卖市场成交明细 IMIX 报文中，919 号域增加枚举值 11。</p> <p>24、6.4.8.3、6.4.8.4、6.5.8.3、6.5.8.4 章节，在债券借贷市场对话报价中，首次结算方式和到期结算方式的枚举值改为 6-券券对付、8-返券付费解券、9-券费对付。</p> <p>25、6.4.6、6.5.6 章节，标准债券远期市场，交易方式枚举值说明“3-匿名点击”改为“3-竞价”。</p> <p>26、6.4.7.17.1、6.4.7.17.2、6.5.7.17.1、6.5.7.17.2 章节，在利率互换市场固定-浮动成交中，交易方式枚举值说明“3-撮合”改为“3-竞价”。</p> <p>27、6.4.7.18、6.5.7.18 章节，在标准利率互换固定-浮动成交业务要素和 IMIX 报文中，删除交易方式中“询价”枚举值；删除“报价编号”字段。</p> <p>28、6.4.9.9、6.5.9.9 章节，在远期利率协议市场成交业务要素中，交易方式枚举值</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>说明“3-撮合”改为“3-竞价”。</p> <p>29、6.4.4.10、6.5.4.10 章节，在现券买卖市场限价报价 IMIX 报文标准中，删除“交易员代码”和“基金托管行账户名称”。</p> <p>30、6.4.8、6.5.8 章节，债券借贷市场意向报价、对话报价和成交明细中，“保证品类型”字段枚举只保留“债券”。</p> <p>31、6.4.8.3、6.4.8.4、6.5.8.3、6.5.8.4 章节，债券借贷市场，对话报价新增“实际占券天数”字段；新增“争议解决方式”字段，枚举值为“仲裁”和“诉讼”。</p> <p>32、6.4.8.5、6.4.8.6、6.5.8.5、6.5.8.6 章节，债券借贷市场，成交明细中新增“首次结算方式”、“到期结算方式”、“实际占券天数”字段；新增“争议解决方式字段”，枚举值为“仲裁”和“诉讼”。</p> <p>33、全市场中“备注”改为“补充条款”，“有无备注”改为“有无补充条款”。</p> <p>34、6.4.8、6.4.9 章节，债券借贷市场中“应计利息总额”字段改用 10321 号域表示。</p> <p>35、6.4.4.11、6.4.4.12、6.5.4.11、6.5.4.12 章节，现券买卖市场成交明细中，将“交易类型”改为“交易方式”。</p> <p>36、6.4.3、6.5.3 章节买断式回购市场报价和成交明细，6.4.5、6.5.5 章节债券远期市场报价和成交明细，6.4.7、6.5.7 章节利率互换市场固定浮动意向报价、固定浮动对话报价和固定浮动成交，6.4.9、6.5.9 章节意向报价、对话报价和成交明细中，保证品标识字段名称统一为“有无保证品”。</p> <p>37、全市场对话报价“报文动作 10272QuoteTransType”中增加“询价”、“拒绝”枚举值。</p>
杨志表		4.3	1.124.2	2016-06-30	<p>1、修正笔误，6.4.4.11、6.5.4.11 章节，现券买卖市场成交业务要素中，机构来源应用 803=29 及 523 取具体值来表示。</p> <p>2、相关市场中增加精度和单位的描述，涉及市场：6.4.1、6.5.1 章节信用拆借市场；</p>

					<p>6.4.2、6.5.2 章节质押式回购市场； 6.4.3、6.5.3 章节买断式回购市场； 6.4.4、6.5.4 章节现券买卖市场；6.4.5、 6.5.5 章节债券远期市场；6.4.7、6.5.7 章节利率互换(固定-浮动)市场；6.4.8、 6.5.8 章节债券借贷市场；6.4.9、6.5.9 章节远期利率协议市场；6.4.10、6.5.10 章节信用缓释凭证市场。</p> <p>3、 修正全市场 IMIX 报文标准中的消息头。</p> <p>4、 6.4.4、6.5.4 章节现券买卖市场，意向 报价、对话报价、点击成交价、做市报 价、成交消息的 IMIX 报文中增加“行权 收益率”的举例。</p> <p>5、 6.4.8.5、6.5.8.5 章节债券借贷市场成 交业务要素中，补充“付息日”和“票面 利率”字段。</p> <p>6、 6.4.4.11、6.5.4.11 章节现券买卖市场 成交业务要素中，机构来源的字段描述中 删除“描述交易对手方机构来源”字样。</p> <p>7、 6.4.4.12、6.5.4.12 章节现券买卖市场 成交 IMIX 报文中，增加对交易成员群组/ 机构来源的说明。</p> <p>8、 6.4.4.1、6.4.4.2、6.5.4.1、6.5.4.2 章节现券买卖市场意向报价，“结算方 式”字段补充了枚举“净额券款对付”。</p> <p>9、 6.4.2、6.5.2 章节质押式回购市场的对 话报价和成交中，“回购方式”字段增加 描述“当回购方式为自动质押回购时，不 传质押券信息”。</p> <p>10、 6.4.7.17.2、6.5.7.17.2 章节，利率互 换市场固定-浮动成交 IMIX 报文标准中， 删除 117 号域报价编号中原有的一句描 述“当交易方式为请求时，传输 10471 号域不传 117 号域”。</p> <p>11、 6.4.1、6.5.1 章节信用拆借市场双向报 价，6.4.2、6.5.2 章节质押式回购市场 双向报价，6.4.7、6.5.7 章节利率互换 市场固定-浮动意向报价、固定-浮动点击 成交价、固定-浮动双向报价，以上报 价的业务要素和 IMIX 报文标准中，增加 “交易成员群组”字段。</p> <p>12、 6.4.7、6.5.7 章节利率互换市场固定-浮</p>
--	--	--	--	--	---

					动意向报价、固定-浮动点击成交价、固定-浮动双向报价,业务要素中修改“本方交易员”的描述。
杨志表		4.4	1.124.2	2016-08-19	<p>1、 6.4.9、6.5.9 章节,远期利率协议市场成交,修改贴现率的描述,由原来传输 6 位精度数字改为传输“FR001 等”的贴现利率名称。</p> <p>2、 新增 4.23 章节,对全市场的报价场景中的状态 297 号域的枚举进行补充描述。</p> <p>3、 6.4.4、6.5.4 章节,现券买卖市场成交,删除成交类别 10319 号域原先的一句描述“成交类别只有在交易方式是请求和点击成交才传该字段”。</p> <p>4、 6.4.9、6.5.9 章节,远期利率协议市场点击成交价,将字段“结算日”名称改为“支付日”。</p> <p>5、 6.4.12 章节,利率上限/下限期权市场对话报价和成交,增加“支付日调整”和“首次利率确定日”字段。</p> <p>6、 6.4.8、6.5.8 章节,债券借贷市场成交,对付息标识增加描述“付息标识取 Y 时,传输付息信息”。</p> <p>7、 对全文中的一些市场的枚举进行修订,具体如下: 6.4.1、6.5.1 章节,信用拆借市场,调整意向报价中的发送范围、对话报价中的状态、双向报价中的发送范围、成交中的报文动作的枚举; 6.4.2、6.5.2 章节,质押式回购市场,调整意向报价中的发送范围、对话报价中的状态、双向报价中的状态、成交中的报文动作的枚举; 6.4.3、6.5.3 章节,买断式回购市场,调整意向报价中的发送范围、对话报价中的状态、成交中的报文动作的枚举; 6.4.4、6.5.4 章节,现券买卖市场,调整意向报价中的范围、做市报价中的发送对象、报价方做市商身份、点击成交价中的发送范围、交易类型、限价报价中的发送范围的枚举; 6.4.5、6.5.5 章节,债券远期市场,调整意向报价中的发送范围、对话报价中的状态、成交中的报文动作、交易方式的枚举; 6.4.7、6.5.7 章节,利率互换固定-浮动市场,调整意向</p>

					<p>报价中的发送范围, 对话报价中的计算机机构, 点击成交报价中的状态、发送范围, 双向报价中的发送范围, 成交中的支付日调整、计息天数调整、报文动作、计算机机构、固定利率付息频率、固定利率计息基准、浮动利率支付周期、浮动利率计息基准、浮动利率计息方式、重置频率的枚举;</p> <p>6.4.8、6.5.8 章节, 债券借贷市场, 调整意向报价中的发送范围, 成交中的报文动作、交易方式、付息信息的枚举;</p> <p>6.4.9、6.5.9 章节, 远期利率协议市场, 调整意向报价中的状态、发送范围, 对话报价中的状态, 点击成交报价中的状态、发送范围, 双向报价中的发送范围, 成交中的支付日调整、计息基准、争议解决方式、报文动作、计算机机构、交易方式的枚举;</p> <p>6.4.10、6.5.10 章节, 信用缓释凭证市场, 调整意向报价的发送范围、对话报价中的状态, 成交中的报文动作、交易方式的枚举;</p> <p>6.4.11 章节, 利率互换期权市场, 调整对话报价中的重置频率、计算机机构、状态, 成交中的重置频率、计算机机构的枚举;</p> <p>6.4.12 章节, 利率上限/下限期权市场, 调整对话报价中的状态的枚举。</p>
杨志表		4.5	1.124.2	2016-09-02	<p>1、6.4.7.18、6.5.7.18 章节, 标准利率互换固定-浮动成交, 业务要素和 IMIX 报文标准中新增“交易成员群组”字段。</p> <p>2、6.4.5、6.5.5 章节, 债券远期市场报价和成交, 在 IMIX 报文标准举例中补上“远期行权收益率”字段。</p>
杨志表		4.6	1.124.2	2017-01-11	<p>1、修改 6.4.2、6.5.2 章节, 质押式回购市场对话报价和成交, 字段“回购方式”的枚举值“2-自动质押回购”改为“2-三方回购”</p> <p>2、新增 6.4.15、6.5.15 章节, 预发行市场对话报价和成交内容(摘自原会员指引 V4.1 版本 6.4.12、6.5.12 章节内容), 基于此基础修订内容如下:</p> <p>3、预发行对话报价, 调整业务要素中相关字段顺序, 业务要素中新增“报文动作、应急标识、发起方资金开户行、发起方资金账号、发起方托管账号”等字段;</p>

					<p>4、预发行对话报价,业务要素和报文标准新增字段“客户端参考编号”,修订字段状态的枚举值为“正常、撤销、拒绝、全部成交、过期”;</p> <p>5、预发行成交,业务要素新增“应急标识、有无补充条款、补充条款”字段,字段“动作类型”改为“成交单消息传输状态”,字段“资金开户行联行行号”改为“买入方支付系统行号”,删除原业务要素中对应计利息、应计利息总额的描述,改为“为空则不传”;</p> <p>6、预发行成交,业务要素和报文标准新增字段“客户端参考编号”,字段“成交类型”改为“交易方式”,报文标准中删除 10319 号域。</p> <p>7、预发行成交,字段“交易方式”新增枚举“3-竞价”</p>
冯江平		4.7	1.130.7	2017-04-25	<p>1、新增 6.4.16 章节,信用违约互换市场,本方 CDS-非固定成交明细;</p> <p>2、新增 6.5.16 章节,信用违约互换市场,关联机构 CDS-非固定成交明细;</p>
冯江平		5.0	1.130.7	2017-07-17	<p>1、本币 CSTP 系统不在下发各个市场的报价数据给会员,删除各个市场的各类报价的章节;</p> <p>2、删除整份文档中针对报价相关的描述;</p> <p>3、将关联机构和本方机构成交章节合并,删除关联机构相关章节,在本方的数据类型标识字段中,新增 2-关联机构数据;</p> <p>4、修改章节结构,指引版本号升级为: V5.0</p>
陶莹		5.1	1.131.7	2017-07-19	<p>1、调整 6.4.13 “投资发行结果信息”章节名称为“工具发行结果信息”;</p> <p>2、6.4.13 工具发行结果信息章节,增加“币种”字段;</p> <p>3、6.4.14 发行人缴款信息章节,增加字段“币种、缴款状态”,并增加说明:该投资人的实缴纳金额为 0 元时,投资人相关缴款信息(投资人 21 位码、投资人名称、托管账号、应缴款金额、实缴款金额、持有量)也需要传输,并在相关字段后面加上说明。</p> <p>4、根据报文实际域选择修订业务要素中“发行人名称”“发行人账号”“投资人 21 位</p>

					<p>码”“实缴款金额(元)”字段的 IMIX 对应列的描述。—涉及章节为: 6.4.14.1 发行人缴款信息 章节</p> <p>5、修订说明中的“单一价格招标”为“单一价格招标发行”,“数量招标”为“数量招标发行”;完善和统一“计划发行量(亿元)”“投标总量(亿元)”“中标总量(亿元)”“边际中标价”“参考收益率”“投标机构”“投标机构 21 位码”“投标量(亿元)”“中标量(亿元)”“应缴纳金额(元)”“发行价格”字段在业务要素和 IMIX 报文标准中的说明 — 涉及章节有 6.4.13.1 及 6.4.13.2 招标发行结果 章节。</p> <p>6、完善和统一“申购机构”“申购机构 21 位码”“认购量(亿元)”“应缴纳金额(元)”“认购时间”“提交用户”“发行价格”字段在业务要素和 IMIX 报文标准中的说明 — 涉及章节有 6.4.13.3 及 6.4.13.4 报价发行结果 章节。</p> <p>7、修订字段“应缴款金额(元)”为“应缴纳金额(元)” —涉及章节为 6.4.13.2 及 6.4.13.4 工具发行结果信息 章节。</p> <p>8、新增 6.4.17 章节 常备借贷便利</p>
陈潇		5.2	1.132.3	2017-07-21	<p>1、新增 6.4.18 章节同业存款市场</p> <p>2、新增 6.4.19 章节同业借款市场</p>
丁恰恰		5.3	1.132.3	2017-08-02	<p>1、新增第 6.4.5 章节做市支持成交数据。</p>
陈潇		5.4	1.133.7	2017-08-21	<p>1、6.4.19.1、6.4.19.2 章节同业存款成交,新增有无补充条款附件字段</p> <p>2、6.4.19.3、6.4.19.4 章节同业存款附加协议,新增有无补充条款附件,有无提前支取条款附件字段</p> <p>3、6.4.20.1、6.4.20.2 章节同业借款成交,新增有无补充条款附件字段</p> <p>4、6.4.20.3、6.4.20.4 章节同业借款附加协议,新增有无补充条款附件,有无提前还款附件字段</p> <p>5、6.4.19 同业存款市场,6.4.20 同业借款市场,删除 10282 有无补充条款.</p>
丁恰恰		5.5	1.133.7	2017-10-20	<p>1、6.4.17.1 信用违约互换非固定支付方式成交业务要素章节字段前端费精度调整为 2 位。</p> <p>6.4.17.2 信用违约互换非固定支付方式成交</p>

					IMIX 报文标准章节同步更新报文。
江云南		5.6	1.136.6	2018-01-12	1、新增章节 6.4.4.3、6.4.4.4 上市前债券交易意向章节。
李云毅, 江云南		5.7	1.136.6	2018-04-08	1、 章节 6.4.4 现券买卖市场章节, 成交和上市前债券意向新增清算速度。并根据报文标准表格对业务要素表格进行修订。 2、 章节 6.4.14 工具发行结果信息中工具类型字段删除枚举值: 政府支持债券 3、 章节 6.4.15 发行人缴款信息中的工具类型字段删除枚举值: 政府支持债券 4、 章节 6.4.4.3 和 6.4.4.4 上市前债券交易意向中新增字段成交编号

本币成员端数据下载 IMIX 协议开发指引

1 范围

本文件规定了中国外汇交易中心本币直通式处理接口服务的数据内容、数据格式、遵循标准和使用说明。

本文件适用于与直通式处理接口服务对接的系统开发。

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/T0065-2011银行间市场基础数据元

JR/T0066-2011银行间市场业务数据交换协议

JR/T0078-2014银行间市场数据接口

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

本币直通式处理接口服务遵循JR/T0066—2011(IMIX协议)等行业标准。本章先对IMIX协议及使用进行介绍，再对接口服务内容中通用及重点部分逐一说明。

4.1 IMIX 报文结构

IMIX报文结构如图1所示。

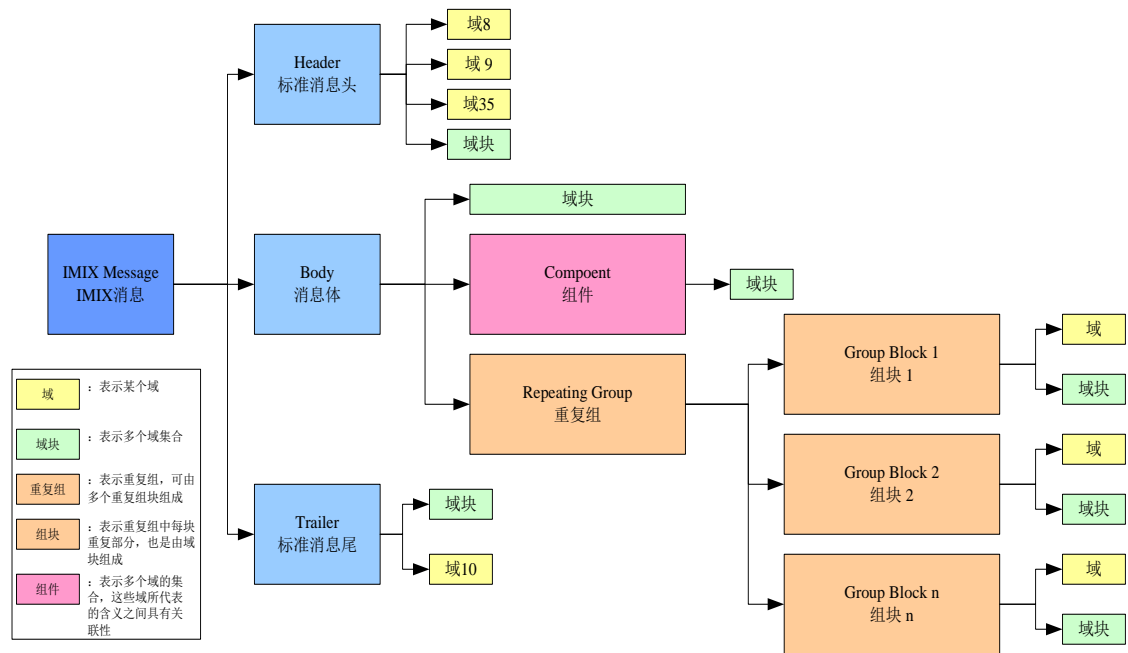


图1 IMIX 报文结构

4.1.1 报文头

包括会话报文、应用报文在内的所有报文类型均有报文头。报文头指明了报文类型、报文体长度、发送目的地、报文序号、发送起始点和发送时间。

交易中心提供的API已对报文头使用进行了封装，对于使用API开发的会员而言，无需对报文头进行操作，此条仅供参考。

报文头格式见下表1。

表1 标准报文头

域号	域名	必需域	说明
8	BeginString	必需	起始串定义报文的协议版本(不可加密，报文的第一个域)
9	BodyLength	必需	报文体长度(不可加密，报文的第二个域)
35	MsgType	必需	报文类型(不可加密，报文的第三个域)
49	SenderCompID		发送方代码(不可加密，发送方标识符)
50	SenderSubID		发送方子标识符(可加密)
56	TargetCompID		接收方代码(不可加密，接收方标识符)
57	TargetSubID		接收方子标识符(可加密)
115	OnBehalfOfCompID		最初发送方标识符(可加密)，用于经第三方中转发送。
116	OnBehalfOfSubID		最初发送方子标识符(可加密)，用于经第三方中转发送。
128	DeliverToCompID		最终接收方标识符(可加密)，用于经第三方中转发送。
129	DeliverToSubID		最终接收方子标识符(可加密)，用于经第三方中转发送。
34	MsgSeqNum		报文序列号(可加密)
43	PossDupFlag		可能重复标志，重复发送时，作此标记。(可加密)
97	PossResend		可能重发标志。(可加密)

52	SendingTime		发送时间(可加密)
122	OrigSendingTime		原始发送时间(可加密)
347	MessageEncoding		报文中 Encoded 域的字符编码类型(非 ASCII 码)
369	LastMsgSeqNumProcessed		最后处理报文序号(可加密)
370	OnBehalfOfSendingTime		最初发送时间

例如银行A的交易员小王收到外汇交易系统发来的报文，则小王收到的报文标准头部应该如表2所示。

表2 标准报文头示例 1

域号	域名	示例	说明
8	BeginString	IMIX.1.0	起始串 IMIX.1.0(不可加密，报文的第一个域)
9	BodyLength		报文体长度(不可加密，报文的第二个域)，计算得到
35	MsgType	8	报文类型，根据场景定，示例为 ExecutionReport 报文
49	SenderCompID	CFETS-FX	外汇交易中心外汇交易系统的标识
56	TargetCompID	银行 A	小王在所在机构的标识
57	TargetSubID	小王	小王的标识
34	MsgSeqNum	xxx	报文序列号
52	SendingTime	时间	发送时间(可加密)

小王发给交易系统的报文标准头部则应该如表3所示。

表3 标准报文头示例 2

域号	域名	示例	说明
8	BeginString	IMIX.1.0	起始串 IMIX1.0(不可加密，报文的第一个域)
9	BodyLength	计算得到	报文体长度(不可加密，报文的第二个域)
35	MsgType	D	报文类型，根据场景定，示例为：NewOrderSingle 报文
49	SenderCompID	银行 A	小王在所在机构的标识
50	SenderSubID	小王	小王的标识
56	TargetCompID	CFETS-FX	外汇交易中心外汇交易系统的标识
34	MsgSeqNum	xxx	报文序列号
52	SendingTime	时间	发送时间

4.1.2 报文尾

每一个会话报文或应用报文都有一个报文尾，并以此终止。报文尾可用于分隔多个报文，包含有3位数的校验和值。

报文尾格式见表4。

表4 标准报文尾

域号	域名	必需域	说明
93	SignatureLength		数字签名长度(不可加密)
89	Signature		数字签名(不可加密)
10	Checksum	必需	校验和，报文的最末域。(不可加密)

4.1.3 报文体

报文体主要描述应用层面的业务信息，应用报文中有很多共用的数据域集合——组件。例如，大多数应用报文都会用到一系列定义债券品种的域：Symbol，SecurityID，SecurityIDSource等。为避免重复，协议中定义了一些关键组件，在应用报文定义中直接用名称引用这些组件。实际的报文定义和使用中，则应该将组件扩展开成为相应的数据域集合。

4.1.4 组件

在IMIX协议中，组件是一个逻辑概念，它用来表示一组彼此之间有一定关系的报文域的组合。这些组件在IMIX协议中都赋以相应的名称，用以更好的理解报文结构以及所应用的场景。在实际报文传送过程中，这些组件名称并不会作为信息在报文中出现。即组件的定义起到更好让人能够理解IMIX报文结构的作用。

4.1.5 重复组

域可以在重复组里多次重复，用以传输数组类的数据。在IMIX协议中，重复组也同样是一个逻辑概念，它用来表示一组彼此之间有一定关系的报文域的组合能够连续反复地在报文中出现。在实际报文传送过程中，这些重复组件名称也不会作为信息在报文中出现。

通常域名起始为“No”字符的域指明重复的次数，并位于重复组的开始处。本文档中重复组的定义通过缩进的符号表示，重复组也可嵌套。使用子重复组时不能省略父重复组。

重复组内的第一个域是必需的。在协议执行时把第一个域用作“分隔符”，表明新的重复组的开始。如果第XXX号(NoXXX)域大于0，那么第XXX号后所列的第一个域就变成有条件的必需的域。

指明重复组号的第XXX号(NoXXX)域(如：交易会话号(NoTradingSessions)，分配号(NoAllocs))在重复组内只出现一次，必须直接位于重复组的内容之前。

如果重复组内有一个域是必需的，那么第XXX号(NoXXX)域就应当是必需的。如果重复组内的所有参与方都是可选择性的，那么第XXX号域也应当是可选择性的。

如果重复组的某一个域是必需的，那么在重复组内每次重复时该域都应出现。

通过缩进的符号“→”对报文定义内的重复组进行指定。

重复组可嵌入其他重复组(可能不止一层嵌套)。通过缩进的符号“→”后跟缩进的符号“→”的方式对嵌套的重复组进行指定。

有嵌套重复组时，必须对外层的重复组进行指定。

例如定义一重复组见表5。

表5 重复组示例 1

454	NoSecurityAltID		N	备选债券代码个数
→	455	SecurityAltID	N	备选债券代码
→	456	SecurityAltIDSource	N	备选债券代码源

则该重复组实际使用例子如表6。

表6 重复组示例 2

454	NoSecurityAltID		3	
→	455	SecurityAltID		债券 1
→	456	SecurityAltIDSource		财政部发行
→	455	SecurityAltID		债券 2
→	456	SecurityAltIDSource		企业发行

→	455	SecurityAltID	债券 3
→	456	SecurityAltIDSource	央行发行

在传送过程中，该重复组在报文中如下所示：

454=3<SOH>455=债券 1<SOH>456=财政部发行<SOH>455=债券 2<SOH>456=企业发行<SOH>455=债券 3<SOH>456=央行发行<SOH>

4.1.6 报文应用通则

IMIX报文应用可划分为三个阶段：

- 传输
- 解析
- 内容处理

传输阶段指数据源系统向目标系统发送序列化IMIX报文（文本或二进制等序列化后的数据包）的过程。具体到本币成员端数据下载业务，对于使用交易中心提供的基础组件开发的会员系统而言，此过程已在组件中封装实现；对于不使用该基础组件开发的系统而言，可自行组织网络套接字编程，与交易中心服务器实现网络连接，并按JR/T0066-2011标准规定通讯协议建立IMIX会话，进行IMIX报文传输。

解析阶段指目标系统收到序列化数据包后，按IMIX协议数据模型，反序列化为可读的IMIX报文（数据结构体）的过程。具体到本币成员端数据下载业务，对于使用交易中心提供的基础组件开发的会员系统而言，此过程已在组件中封装实现；对于不使用该基础组件开发的系统而言，可自行组织按JR/T0066-2011标准规定的的数据模型解析IMIX报文。

内容处理阶段指目标系统读取反序列化后的IMIX报文内容，进行逻辑处理的过程。具体到本币成员端数据下载业务，该过程由会员系统自行负责实现。实现过程中必须严格遵守交易中心发布的开发指引规定。对于会员系统不使用交易中心提供的服务，或会员系统无法与交易中心服务同步上线的情况下，会员系统理应考虑，并正确处理，确保银行间市场正常运行。

注1：会员不使用某项服务或无法同步上线情况下，会员系统可能会接收到新的报文类型或报文字段。会员系统应具备容错能力以处理这些内容，并及时联系交易中心开展系统开发工作。

4.2 报文类型

MsgType用于定义传输的报文类型，域号为35。IMIX协议为不同的业务场景定义不同的IMIX报文类型。

例如：<35=8>表示传输的为成交信息。

4.3 市场标识符

<MarketIndicator>是用于区分不同的业务市场(产品)的标识，域号为10176。在不同的市场下，同一种类型的IMIX报文往往在应用上有不同，需要根据不同的市场标识符，根据具体的业务逻辑对报文进行解释，例如：<10176=1>表示该报文为信用拆借市场的，则收到一条MsgType=8的报文，则为信用拆借市场的成交报文，就需要根据该市场成交的业务逻辑对IMIX报文传递的信息进行处理。

4.4 交易方式(询价、竞价、点击、请求)

TradeMethod用于区分不同交易方式，域号为10317。例如：<10317=1>表示该笔交易为询价方式的。

4.5 做市与非做市

TradeType用于定义交易类型，区分做市交易和非做市交易。

4.6 交易品种与基础品种

在本币市场中，按照交易方式划分，可以分为现货交易，远期交易，回购交易，期货交易，期权交易和互换交易。如果按照基础交易品种划分，则可以分为债券，抵押，指数和借贷等。对于债券，又可以有公司企业债券，国债等。对于抵押，可以有资产支持证券，抵押支持债券等。对于指数，可以有ETFs，利率等。对于借贷，可以有信用拆借等。IMIX协议通过对<Instrument>组件以及<UnderlyingInstrument>组件的定义在交易方式和基础交易品种这两个维度上对本币市场的金融产品进行描述。例如现券市场中产品名称即债券名称，见表7。

表7 交易品种示例 1

Instrument		
22	SecurityIDSource	101
48	SecurityID	20070025
55	Symbol	07 国开 13

在债券借贷市场中如下，交易品种名称为SL03M，表示2个月零1天-3个月的债券借贷，而借贷的标的债券名称和代码需要在<UnderlyingInstrument>中填写，如表8。

表8 交易品种示例 2

Instrument		
22	SecurityIDSource	101
48	SecurityID	20070025
55	Symbol	07 国开 13
UnderlyingInstrument		
309	UnderlyingSecurityID	20070062
311	UnderlyingSymbol	China001310%
241	UnderlyingCouponPaymentDate	2007-08-01

4.7 交易成员信息

<Parties>和<PtysSubGrp>用于描述交易成员信息，例如现券市场中的成员信息如表9所示。

表9 交易成员信息示例

Parties				
453			NoPartyIDs	2
→	448		PartyID	BANK01
→	447		PartyIDSource	
→	452		PartyRole	101
→	PtysSubGrp			
→	802		NoPartySubIDs	10
→	→	523	PartySubID	BankofChina
→	→	803	PartySubIDType	5
→	→	523	PartySubID	BankofChina
→	→	803	PartySubIDType	110

→	→	523	PartySubID	20008
→	→	803	PartySubIDType	112
→	→	523	PartySubID	BankofChina
→	→	803	PartySubIDType	23
→	→	523	PartySubID	955912345678901
→	→	803	PartySubIDType	15
→	→	523	PartySubID	BankofChina
→	→	803	PartySubIDType	113
→	→	523	PartySubID	BankofChina
→	→	803	PartySubIDType	114
→	→	523	PartySubID	622512345678901
→	→	803	PartySubIDType	115
→	→	523	PartySubID	BankofChina
→	→	803	PartySubIDType	I18
→	→	523	PartySubID	BankofChina
→	→	803	PartySubIDType	I19
→	448	→	PartyID	BANK02
→	447	→	PartyIDSource	
→	452	→	PartyRole	102
→	802	→	NoPartySubIDs	2
→	→	523	PartySubID	ICBC
→	→	803	PartySubIDType	102
→	→	523	PartySubID	TRADER02
→	→	803	PartySubIDType	2

4.8 标准产品与非标准产品

标准产品是由交易中心场务定义的、用于双向报价的交易品种。标准产品的期限是固定的，如7天、14天。（例外——在利率互换和远期利率协议市场中，可以用于所有的报价，有些属性是由场务定义的。）非标准品种（交易品种）是为了市场统计的方便按照期限长度进行命名的品种。

IMIX协议中用域48SecurityID表示品种代码，用域55Symbol表示品种名称。在业务现实中，标准品种是有品种代码的，非标准品种没有品种代码，由于48SecurityID是报文的必须域，对于标准和非标准品种的情况下，该域在报文中都必须出现，因此，协议中规定在报价品种为标准品种时48SecurityID填标准品种的代码，在报价品种为非标准品种的时候，48SecurityID中填字符串“User-Defined”。示例如下：

报价品种为标准品种如表10。

表10 标准品种

48	SecurityID	XXXXXX	品种代码
55	Symbol	XXXXXX	品种名称

报价品种为非标准品种如表11。

表11 非标准品种

48	SecurityID	User-Defined	品种代码
55	Symbol	XXXXXX	品种名称

由于在非标准品种的情况下，48SecurityID中填字符串“User-Defined”，不能标识品种信息，协议中用域55Symbol填写非标准品种的名称，通过该域标识非标准品种的信息。因此在本指引中非标准品种的示例中，都带有55Symbol域(不管业务表中是否有该域)；在标准品种的情况下，55Symbol在示例中也存在，不过使用者可以根据需要是否使用该域，因为在标准品种的情况下，48SecurityID已经可以标识标准品种的信息。

本指引中成交报文中的示例可以是标准品种的示例，也可以是非标准品种的示例，取决与该成交是对标准品种报价的成交还是对非标准品种报价的成交。

例外情况：对于现券市场、资产支持证券市场和ETF市场由于不存在交易品种之说(这三个市场的交易的对象都具有券的性质)，示例中48和55域分别填写其具体的债券代码和债券名称。

4.9 本方与对手方

在成交数据中有本方和对手方的概念。本方和对手方是一个动态的概念，报文的接收方都认为自己是本方，另一方是对手方，协议本身是不定义本方和对手方的。

但是协议的使用者可以根据业务逻辑和报文结构判断本方和对手方，例如：

对应成交报文而言，成交达成以后，交易系统会分别向成交双方发送成交单，每一方在接收到该成交单以后，都认为这是本方的数据，另一方是对手方，因此没有固定的本方和对手方，只有固定的买方和卖方的概念。协议中通过PartyRole取值119和120分别表示一笔交易的买方和卖方。不过，协议中通过域Side和PartyRole可以判断一笔成交单报文中哪方是本方，哪方是对手方。

Side用于表示交易方向，取值1表示买入，取值4表示卖出。每份成交单中都有Side域，表示该成交单的接收方是买入还是卖出，如果是买入(Side=1)，则买方(PartyRole=119)即是该成交单的本方，卖方则是对手方；相反，如果卖出(Side=4)，则卖方(PartyRole=120)即是该成交单的本方，买方则是该成交单的对手方。

4.10 应急服务

新增了应急成交服务，成交服务包括成交录入，修改和撤销。

应急成交和普通成交的区别除了10022域之外，还增加了10105DealTransType域，用来标识成交录入，修改和撤销的场景。下面以信用拆借市场为例，列举一个应急成交录入场景。

应急成交录入如表12。

表12 应急成交录入 IMIX 报文示例

域号			域名	例子取值	说明
17			ExecID	IB0-2007-08-21-123456	成交编号
44			Price	0.05	拆借利率
48			SecurityID	XXXX	交易品种代码
54			Side	1	交易方向
55			Symbol	XXXX	交易品种名称
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20081006-12:34:56	更新日
64			SettlDate	20070822	首次结算日
75			TradeDate	20070821	成交日期

150			ExecType	F	成交状态-成交
10002			AccruedInterestTotalAmt	1000	应计利息
193			SettlDate2	20070921	到期结算日
10022			ContingencyIndicator	Y	应急场景
10014			CashHoldingDays	20	实际占款天数
10105			DealTransType	0	成交录入
10176			MarketIndicator	1	市场标识: 1-信用拆借市场
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10289			SettlCurrAmt2	2323232	到期还款金额
32			LastQty	23034232	拆借金额
10316			TradeLimitDays	30	拆借期限
10318			TradeTime	12:34:56	成交时间
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	BC0000000000000000BSH	
→	452		PartyRole	119	
→	802		NoPartySubIDs	5	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	448		PartyID	ICBC0000000000000000BNJ	
→	452		PartyRole	120	
→	802		NoPartySubIDs	4	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	

→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号

4.11 盘后报文重发

为了确保API用户能够收到所有的报文，避免特殊原因的报文丢失，盘后固定时点CSTP系统会向特定用户重发一次当天的所有报文，此类报文的报文结构和内容与日间收到的报文格式和内容上都是一样的，只是报文头中的域115的取值是“RESEND”，而不是普通报文中的“CFETS-RMB”，标识报文的发送方是报文重发系统，而不是本币交易系统。API用户可以用重发的报文和当天收到的报文比较，以防止报文丢失。

判断报文是否是重发的标准是115域的取值，取值是“RESEND”标明是API盘后重发报文，取值是“CFETS-RMB”标明报文是盘中正常收到的报文。

API用户盘中收到的报文的报文头结构示例如表13。

表13 API 用户盘中收到报文的报文头

8	BeginString	IMIX.1.0	
9	BodyLength	1	
35	MsgType	8	成交
34	MsgSeqNum	24	报文序列号
52	SendingTime	20070820-12:40:00	发送时间
115	OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文的最初发送方是本币交易系统
49	SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	
56	TargetCompID	BC0000000000000000BSH	
57	TargetSubID	BC0000000000000000BSH-小张	

API用户盘后重发的报文的报文头结构示例如表14。

表14 API 用户盘后重发报文的报文头

8	BeginString	IMIX.1.0	
9	BodyLength	1	
35	MsgType	8	成交
34	MsgSeqNum	24	报文序列号
52	SendingTime	20070820-12:40:00	发送时间
115	OnBehalfOfCompID	RESEND	报文的最初发送方是重发系统
49	SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	
56	TargetCompID	BC0000000000000000BSH	
57	TargetSubID	BC0000000000000000BSH-小张	

4.12 结算方式

域919DeliveryType、10045DeliveryType2、10098LegDeliveryType和10459LegDeliveryType2都是标识结算方式或到期结算方式，取值都是0-DVP；4-PUD；5-DUP；6-BVB；7-NONE；8-BVBF；9-BVP。业务关系对应如下：

——0-DVP 券款对付

- 4-PUD 见券付款
- 5-DUP 见款付券
- 6-BVB 券券对付
- 7-NONE 纯券过户
- 8-BVBF 返券付费解券
- 9-BVP 券费对付
- 10-CSH-纯款过户
- 11-NDVP-净额券款对付

IMIX 协议使用 DeliveryOptionGrp 组件来表示结算方式的多种选择。组件中域 10044DeliveryOptionDirection表示买卖方向, 10047DeliveryTypeOption表示结算方式选项。域10047取值是0-DVP; 4-PUD; 5-DUP; 6-BVB; 7-NONE; 8-BVBF; 9-BVP; A-CSH; B-NDVP。业务关系对应如下:

- DVP 券款对付
- 4-PUD 见券付款
- 5-DUP 见款付券
- 6-BVB 券券对付
- 7-NONE 纯券过户
- 8-BVBF 返券付费解券
- 9-BVP 券费对付
- A-CSH 纯款过户
- B-NDVP 净额券款对付

4.13 期限转换

除现券市场和资产支持证券市场以外都有期限要求, 其中信用拆借、质押式回购、买断式回购、债券借贷、债券远期界面显示要求期限精确到天, 如“32”天; 利率互换市场期限以YMD的格式显示, 如“2M”; 远期利率协议以“远期期限*合约期限”的方式显示, 如“2M*8M”。

对于API报文, 信用拆借、质押式回购、买断式回购、债券借贷、债券远期市场的报文中, 域10316的取值既是“期限”的数据。对于利率互换市场, 10316的取值以YMMMDDD的格式传, 如交易期限是6个月, 报文中10316=6000, 如果是1年, 报文中10316=1000000. 对于远期利率协议市场, 传输方式与利率互换市场一致, 但是通过两个域传, 10314传远期期限, 10316传合约期限。

对于报表, 将以YMMMDDD的格式发送, 如果收到的是178天, 表明期限是178天; 如果传的是2000, 表明是2M, 如果是1000000, 表明是1Y。

4.14 清算方式及关键域说明

目前在本方及关联机构现券市场的成交业务场景, 利率互换市场固定-浮动的成交业务场景中增加清算方式。

其中, 本方及关联机构现券市场成交的业务场景, 利率互换市场固定-浮动成交业务场景中使用<ClearingReferenceData>组件中的11143ClearingMethod域表示清算方式。

关于各业务场景下清算方式及其枚举值可参看表15。

表15 清算方式及枚举值

交易方式	现券本方	现券关联机构	IRS 固定-浮动本方	IRS 固定-浮动关联机构
------	------	--------	-------------	---------------

成交	增加清算方式	增加清算方式	新增清算方式	新增清算方式
	11143ClearingMethod	11143ClearingMethod	11143ClearingMethod	11143ClearingMethod
	6-集中清算	6-集中清算	6-集中清算	6-集中清算
	13-自行清算	13-自行清算	13-自行清算	13-自行清算

4.15 分层交易（北金所业务说明）

根据中国人民银行规定，债券市场需实现分层交易。丙类户（统称“北金所会员”）可在北京金融资产交易所系统中查看做市商和尝试做市机构的报价以及发送成交意向，最终在交易中心系统达成交易。参与交易的机构可通过CSTP系统获取发送给北金所会员成交信息。

在参与现券交易的机构信息中增加“买入方来源”、“卖出方来源”属性用于表示该机构是否是北金所会员。IMIX标准使用<Parties>和<PtysSubGrp>组件描述北金所会员信息，当803PartySubIDType取值29，523PartySubID取值C表示北金所会员。如果表示“买入方来源”和“卖出方来源”属性的组件不存在，则此机构表示交易中心会员。详见本文档6.4.4.11节、6.4.4.12节、6.5.4.11节和6.5.4.12节说明。

表16 北金所会员

Parties					
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	BANK01	机构 ID
→	452		PartyRole	119/120	机构身份 119-买入方 120-卖出方
→	PtysSubGrp				
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	C	C-丙类户（北金所会员）
→	→	803	PartySubIDType	29	29-机构来源
→	448		PartyID	BANK01	机构ID
→	452		PartyRole	119/120	机构身份 119-买入方 120-卖出方
→	PtysSubGrp				
→	802		NoPartySubIDs	1	
→	→	523	PartySubID	C	C-丙类户（北金所会员）
→	→	803	PartySubIDType	29	29-机构来源

4.16 标准利率互换业务说明

CSTP系统需下发标准利率互换成交报文。此报文中的产品名称取值由合约名前缀、下划线和合约交割年月三部分组成。会员通过合约名前缀区分标准利率互换和普通利率互换，即产品名称值存在合约名前缀，属于标准利率互换，产品名称值不存在合约名前缀，属于普通利率互换。IMIX协议使用48SecrutiID和55Symbol表示产品名称。

其中表17规范了Tag48和Tag55域的取值规则、合约名前缀及说明。

表17 标准利率互换产品说明

IMIX 对应	取值规则	合约名前缀	说明	示例
48SecurityID 55Symbol	SS011M_YYMM	SS011M 会员通过该值区分标准利率互换和普通利率互换。	以 Shibor0/N 为标的的 1 个月标准隔夜指数 互 换 ： Shibor0/N_1M，其中 YYMM 为合约交割年月。	SS011M_1406 、 SS011M_1409
	SR073M_YYMM	SR073M 会员通过该值区分标准利率互换和普通利率互换。	以 FR007 为标的的 3 个月 标 准 互 换 ： FR007_3M，其中 YYMM 为合约交割年月。	SR073M_1406 、 SR073M_1409
	SS3M_YYMM	SS3M 会员通过该值区分标准利率互换和普通利率互换。	以 Shibor3M 为标的的 3 个月标准利率互换： Shibor3M_3M，其中 YYMM 为合约交割年月。	SS3M_1406 、 SS3M_1409
	SS1W3M_YYMM	SS1W3M 会员通过该值区分标准利率互换和普通利率互换。	以 Shibor1W 为标的的 3 个月标准利率互换： Shibor1W_3M，其中 YYMM 为合约交割年月。	SS1W3M_1406 、 SS1W3M_1409
	CS011M_YYMM	CS011M 会员通过该值区分标准利率互换和普通利率互换。	以 Shibor0/N 为标的的 1 个月标准隔夜指数 互 换 ： Shibor0/N_1M，其中 YYMM 为合约交割年月。	CS011M_1501 CS011M_1502
	CR073M_YYMM	CR073M 会员通过该值区分标准利率互换和普通利率互换。	以 FR007 为标的的 3 个月 标 准 互 换 ： FR007_3M，其中 YYMM 为合约交割年月。	CR073M_1501 CR073M_1502

5 业务场景开发

本份文档是中国外汇交易中心本币CSTP系统向各交易机构发送关于交易相关数据的指引。

5.1 本币成员端数据获取路径

本币CSTP成员端获取的数据主要是本方成交，关联机构的成交。市场报价、成交行情以及其他的基础数据信息由CMDS用户获取，CSTP用户不再获取这些数据。本币CSTP客户端数据获取路径见图2。

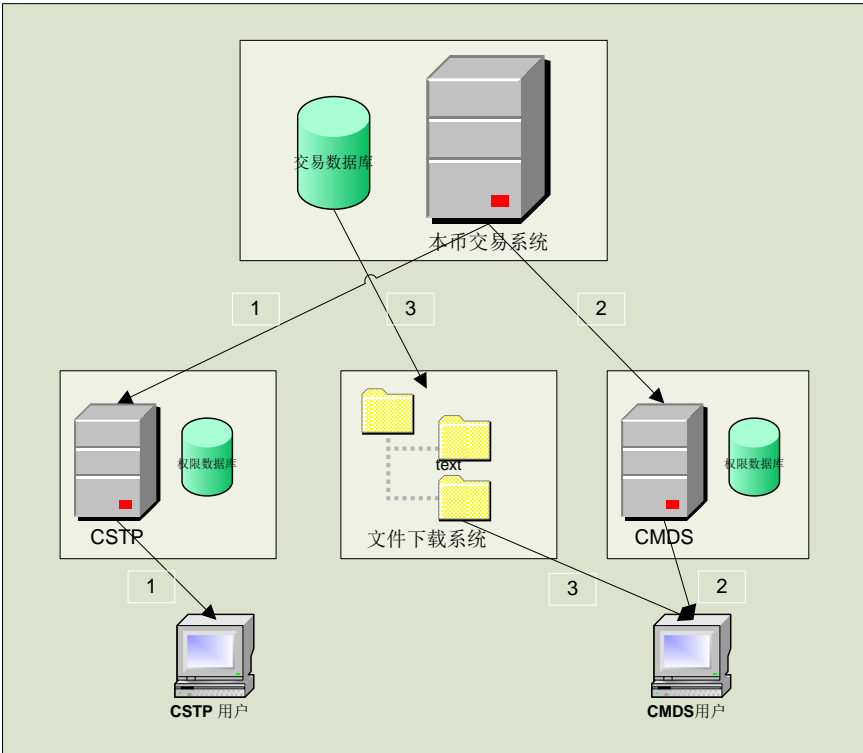


图2 本币 CSTP 客户端数据获取路径图

——本币 CSTPServer 路径数据内容

本方数据中的本方成交与关联机构数据中的关联机构成交通过本币CSTPServer获取(图中路线1)，该路径获得的报文中将含有域10465DataCategoryIndicator，用于标识该报文是本方数据(取值0)还是关联机构数据(取值2)，客户端在接收到报文以后，通过该域区分本方和关联机构数据。

——本币 CMDSServer 路径数据内容

市场数据中的市场报价、市场成交和市场行情数据与基础数据中的基准利率数据通过本币CMDSServer路径(图中路线2)传输，该路径传输的报文中不带10465DataCategoryIndicator，通过标准报文头中的49SenderCompID取值“CFETS-RMB-CMDS”判断报文是通过路线2获取，通过35MsgType表示传输的报文类型，35取值6(IOI报文)、S(Quote报文)、D(NewOrderSingle报文)、8(ExecutionReport)的报文是市场数据，取值i(MassQuote)是基准利率数据，取值W(MarketDataSnapshotRefresh)时，看该报文的域10164MDType, 10164=R表示本币市场行情，10164=0、1、6、7、8、9等表示基准利率数据。该部分数据由CMDS系统客户端接收。

——本币文件下载系统

债券基础信息、成员基础信息数据通过本币文件下载系统(图中路线3)以文件的方式获取，其中债券基础信息、成员基础信息数据由CMDS客户端接收。

由于该部分数据不以IMIX报文格式传输，本指引中不涉及该部分数据。

5.2 系统标识说明

由于本币成员端数据下载终端是使用本币成员端数据下载服务下载数据的，所有数据都是通过IMIX报文进行传送的，所以有一些IMIX报文传送的注意事项需要在这里进行说明，详细说明见表18。

表18 系统标识说明

字段	IMIX 对应	说明
系统标识	49SenderCompID 用来存放报文发送方唯一标识符 56TargetCompID 用来存放报文接受方唯一标识符。 本币成员端数据下载服务的标识为 CFETS-RMB-CSTP 成员端标识为机构中文简称(需保证唯一性)	对于任何使用 IMIX 协议进行交互的机构都需要有唯一的标识符对其本身进行标识。对于交易机构而言,有机构代码或者中文简称等唯一标识符可控选择使用。
报文类型	35MsgType 为报文类型域	在 IMIX 协议中定义了不同的报文类型,每种报文类型都有特定的应用场景。因此在使用 IMIX 报文时,首先需要确定所应用场景要使用的 IMIX 报文类型。

IMIX协议定义系统唯一标识见表19。

表19 IMIX 协议定义系统唯一标识

系统	唯一标识
本币市场行情数据发布服务 (CMDS)	CFETS-RMB-CMDS
本币成员端数据下载服务 (CSTP)	CFETS-RMB-CSTP

每种类型的IMIX报文都使用了很多的域来定义各种不同的业务场景,开发人员需要根据不同的业务场景挑选不同的组件和域进行信息传递,对于该场景不需要使用的域则不需要给其赋值,这样可以避免多余的报文传送代价。

下面对于各个业务场景,本文档都列出了与该场景相关的业务要素并赋以对应的IMIX协议表示方法,之后再给出该场景下使用的IMIX报文标准。这里需要说明的是,本指引给出的IMIX报文标准只是给开发人员一个IMIX报文的示范,在实际开发中,开发人员需要根据具体的场景做相应的调整。

5.3 应急报文重发

为保证各会员能实时准确地收取外汇交易中心发出的数据报文,外汇交易中心在正常发送报文的基础上,另外制定了一套应急报文重发解决方案,以保障API用户会员能够实时收到报文。

对于外汇交易中心发送的报文(正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文)请以每条报文头中的115域进行区分,具体如表20。

表20 115 域取值含义

业务场景	辨别标识
正常实时报文	1150nBehalfOfCompID 取值 “CFETS-RMB”
应急工具报文	1150nBehalfOfCompID 取值 “EMERGENCY”
盘后重发报文	1150nBehalfOfCompID 取值 “RESEND”

——特别说明

在应急报文重发处理过程中,外汇交易中心应急系统会存在重复发送多条相同应急报文的可能,各会员需要通过115域与报文中的编号(各业务场景的报文编号参见下表)进行判断并能处理重复数据。

表21为不同的业务场景的辨别标示,供参考。

表21 不同业务场景辨别标示

业务场景	辨别标识
成交报文	1150nBehalfOfCompID 取值“EMERGENCY”; 17ExecID

6 IMIX 协议开发规范

6.1 应用登录处理

在实时接收本币系统交易数据之前，本币成员端数据下载终端(下载终端)需先发送Logon报文给本币成员端数据下载服务(下载服务)，告知下载服务终端已经准备好接收数据，而下载服务在收到Logon报文后，验证登录信息正确无误后，返回一个Logon报文作为确认登录的反馈。完成登录后，下载服务就会给下载终端发送数据。

登录场景流程描述见表22。

表22 登录场景流程

场景	发起方	接受方	IMIX 报文对应
登录	(1) 信息发送	下载终端	下载服务
	(2) 反馈	下载服务	下载终端

6.1.1 登录请求业务要素

登录请求业务要素请见表23。

表23 登录请求业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
CompanyID 机构标识	49SenderCompID 作为机构标识	100000311000000101001
CompanySubID 机构子标识	50SenderSubID 作为机构子标识，一般用登录用户名替代。	可以标识机构下交易员或者机构内部系统
TargetServiceID 目标服务标识	57TargetSubID 作为目标服务标识	CSTP 服务 CFETS-RMB-CSTP
UserName 用户名	553Username 该域值与 50SenderSubID 取值相同	100000311000000101001
PassWord 密码	554Password	

6.1.2 登录请求 IMIX 报文标准

登录请求IMIX报文标准见表24。

表24 登录请求 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			

8	BeginString	IMIX.1.0	
9	BodyLength	113	具体值根据 IMIX 协议定义的 Bodylength 算法计算
35	MsgType	A	表明为 Logon 报文
49	SenderCompID	100000311000000101001	发起方机构 ID
50	SenderSubID	XXXXXXX	
56	TargetCompID	CFETS-RMB-CSTP	将下载服务标识作为登录请求的接受方标识
57	TargetSubID	XXXXXXX	
34	MsgSeqNum	1	根据 IMIX 协议, 报文发起方对于自己发出的每一条报文建立报文序列, 并依次排序赋以标识
52	SendingTime	20080913-10:21:00	报文的发出时间
MessageBody			
553	Username	XXX	用户名由交易中心颁发
554	Password	XXX	初始密码由交易中心办法
StandardTrailer			
10	Checksum	050	具体值根据 IMIX 协议定义的 CheckSum 算法计算

生成上表中logon报文的代码如下:

```
//createalognmessage
Logonlogon=newLogon();
//setthefieldsinmessageheader
logon.getHeader().setString(SenderCompID.FIELD,"100000311000000101001");
logon.getHeader().setString(SenderSubID.FIELD,"XXXXXXX");
logon.getHeader().setString(TargetCompID.FIELD,"CFETS-RMB-CSTP");
logon.getHeader().setInt(MsgSeqNum.FIELD,1);
logon.getHeader().setUtcTimeStamp(SendingTime.FIELD,"20080913-10:21:00");
//setusernameandpassword
logon.setString(Username.FIELD,"XXXXXXX");
logon.setString>Password.FIELD,"XXXXX");
```

6.1.3 登录成功反馈业务要素

登录成功反馈业务要素见表25。

表25 登录成功反馈业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
CompanyID 机构标识	56TargetCompID 作为机构标识	
CompanySubID 机构子标识	57TargetSubID 作为机构子标识	可以标识机构下交易员或者机构内部系统

ServiceID 服务标识	49SenderCompID 作为目标服务标识	CSTP 服务
-------------------	-------------------------	---------

6.1.4 登录成功反馈 IMIX 报文标准

按照IMIX协议定义，登录请求接收方给登录请求发起方发送Logon报文提示登录成功。登录成功反馈IMIX报文标准见表26。

表26 登录成功反馈 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX.1.0	
9	BodyLength	113	具体值根据 IMIX 协议定义的 Bodylength 算法计算
35	MsgType	A	表明为 Logon 报文
49	SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	
56	TargetCompID	100000311000000101001	
57	TargetSubID	XXXXXXX	
34	MsgSeqNum	1	
52	SendingTime	20080913-10:21:01	报文的发出时间
MessageBody			
553	Username	XXX	用户名
StandardTrailer			
10	Checksum	XXX	具体值根据 IMIX 协议定义的 CheckSum 算法计算

6.1.5 登录失败反馈业务要素

登录失败反馈业务要素见表27。

表27 登录失败反馈业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
CompanyID 机构标识	56TargetCompID 作为机构标识	
CompanySubID 机构子标识	57TargetSubID 作为机构子标识	可以标识机构下交易员或者机构内部系统
ServiceID 服务标识	49SenderCompID 作为目标服务标识	CSTP 服务
Feedback 反馈信息	58Text	58 域中所附的不同值，表示不同的登录失败原因。 取值 2 表示用户信息验证失败 取值 12 表示当 Agent 正常退出，导致用户登录失败 取 18 表示 Agent 到 Hub 之间的连接断

		开导致用户登录失败 取值 19 表示用户没有设置登录名 取值 20 表示报文中的 SenderCompID、SenderSubID 和配置 Session 中的 SenderCompID、SenderSubID 不相同 时, 用户登录失败 取值 21 表示根据 TargetComID 无法找到对应的连接 取值 22 表示不在 Session 的连接时间内 取值 23 表示缺少组件版本信息 取值 24 表示组件版本不兼容 取值 25 表示缺少业务版本信息 取值 26 表示业务版本不兼容
--	--	---

6.1.6 登录失败反馈 IMIX 报文标准

按照IMIX协议定义，登录请求接收方给登录请求发起方发送一个Logout报文提示登录失败，并对失败原因进行描述。

登录失败反馈IMIX报文标准见表28。

表28 登录失败反馈 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX.1.0	IMIX 协议版本
9	BodyLength	111	具体值根据 IMIX 协议定义的 Bodylength 算法计算
35	MsgType	5	表明为 Logout 报文
49	SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56	TargetCompID	100000311000000101001	报文接收方
57	TargetSubID	XXXXXXX	报文接收方子标识
34	MsgSeqNum	1	根据 IMIX 协议, 报文发起方对于自己发出的每一条报文建立报文序列, 并依次排序赋以标识
52	SendingTime	20080913-10:21:01	报文的发出时间
MessageBody			
58	Text	2	58 域中所附的不同值, 表示不同的登录失败原因。 取值 2 表示用户信息验证失败 取值 12 表示当Agent 正常退出, 导致用户登录失败

			取 18 表示 Agent 到 Hub 之间的连接断开导致用户登录失败 取值 19 表示用户没有设置登录名 取值 20 表示报文中的 SenderCompID、SenderSubID 和配置 Session 中的 SenderCompID、SenderSubID 不相同, 用户登录失败 取值 21 表示根据 TargetComID 无法找到对应的连接 取值 22 表示不在 Session 的连接时间内 取值 23 表示缺少组件版本信息 取值 24 表示组件版本不兼容 取值 25 表示缺少业务版本信息 取值 26 表示业务版本不兼容
553	Username	XXX	用户名
StandardTrailer			
10	CheckSum	XXX	

6.2 应用登出处理

本币成员端数据下载终端(下载终端)退出本币成员端数据下载服务(下载服务)时, 需发送Logout报文告知下载服务准备登出, 下载服务在收到Logout报文后, 在确认可以登出之后返回一条Logout报文作为确认登出的反馈, 登出处理流程见表29。

表29 登出处理流程

场景		发起方	接受方	IMIX 对应
登出	(1) 信息发送	下载终端	下载服务	Logout-5
	(2) 反馈	下载服务	下载终端	Logout-5

6.2.1 登出请求业务要素

登出请求业务要素见表30。

表30 登出请求业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
----	---------	----

CompanyID 机构标识	49SenderCompID 作为机构标识	100000311000000101001
CompanySubID 机构子标识	50SenderSubID 作为机构子标识。	可以标识机构下交易员或者机构内部系统
TargetServiceID 目标服务标识	57TargetSubID 作为目标服务标识	CSTP 服务

6.2.2 登出请求 IMIX 报文标准

按照IMIX协议定义，使用Logout报文作为登出请求报文，登出请求IMIX报文标准见表31。

表31 登出请求 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX.1.0	IMIX 协议版本
9	BodyLength	111	具体值根据 IMIX 协议定义的 Bodylength 算法计算
35	MsgType	5	表明为 Logout 报文
49	SenderCompID	100000311000000101001	报文发送方标识
50	SenderSubID	XXXXXXX	报文发送方子标识
56	TargetCompID	CFETS-RMB-CSTP	将交易中心系统标识作为登出请求的接受方标识
57	TargetSubID	XXXXXXX	报文接收方子标识
34	MsgSeqNum	99	根据 IMIX 协议，报文发起方对于自己发出的每一条报文建立报文序列，并依次排序赋以标识。例子中的 99 表明，登出请求报文在发出报文序列的编号为 99
52	SendingTime	20080913-10:29:10	报文的发出时间
MessageBody			
StandardTrailer			
10	Checksum	XXX	具体值根据 IMIX 协议定义的 CheckSum 算法计算

生成Logout报文的代码如下：

```
//createlogoutmessage
Logoutlogout=newLogout();
//setthefieldsinmessageheader
logout.getHeader().setString(SenderCompID.FIELD,"100000311000000101001");
logout.getHeader().setString(SenderSubID.FIELD,"XXXXXXX");
logout.getHeader().setString(TargetCompID.FIELD,"CFETS-RMB-CSTP");
logout.getHeader().setInt(MsgSeqNum.FIELD,99);
logout.getHeader().setUtcTimeStamp(SendingTime.FIELD,"20080913-10:29:10");
```


6.2.3 登出成功反馈业务要素

登出成功反馈业务要素见表32。

表32 登出成功反馈业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
CompanyID 机构标识	56TargetCompID	TargetCompID 作为机构标识
CompanySubID 机构子标识	57TargetSubID 可以标识机构下交易员或者机构内部系统	TargetSubID 作为机构子标识
ServiceID 服务标识	49SenderCompID	SenderCompID 作为目标服务标识
登录成功反馈	58Text	58 域取值 11 表示机构登出成功

6.2.4 登出成功反馈 IMIX 报文标准

按照 IMIX 协议定义，登出请求接收方发送 Logout 登出报文告知对方登出反馈信息，Logout 中的 SessionStatus 域可表示登出请求成功与否，登出成功反馈 IMIX 报文标准见表33。

表33 登出成功反馈 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX.1.0	IMIX 协议版本
9	BodyLength	111	具体值根据 IMIX 协议定义的 Bodylength 算法计算
35	MsgType	5	报文类型
49	SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方标识
56	TargetCompID	100000311000000101001	报文接收方标识
57	TargetSubID	XXXXXXX	报文接收方子标识
34	MsgSeqNum	89	报文序列号
52	SendingTime	20080913-10:29:50	报文发送时间
MessageBody			
58	Text	11	58 域取值 11 表示机构登出成功
StandardTrailer			
10	Checksum	XXX	具体值根据 IMIX 协议定义的 CheckSum 算法计算

6.3 修改密码

成员银行提交密码修改申请后，CSTP Server 处理申请报文，并返回处理结果。在 IMIX 协议中，密码修改申请报文用 UserRequest (MsgType=BE)，其中域 924=3 表示修改密码；CSTP Server 返回的报文用

UserResponse (MsgType=BF)，域926表示处理状态，926=5表示密码修改成功，926=4表示密码错误，926=6表示其他错误。如果出现错误，密码修改失败。详细IMIX报文标准参见以下各章节。

6.3.1 修改密码请求业务要素

修改密码请求业务要素参见表34。

表34 修改密码请求业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
CompanyID 机构标识	49SenderCompID	
CompanySubID 机构子标识	50SenderSubID	可以标识机构下交易员或者机构内部系统
TargetServiceID 目标服务标识	57TargetSubID	CSTP 服务
UserRequestID 用户请求编号	923UserRequestID	
UserRequestType 用户请求类型	924UserRequestType	3-修改密码
UserName 用户名	553Username	
PassWord 密码	554Password	
NewPassWord 新密码	10193NewPassword	

6.3.2 修改密码请求 IMIX 报文标准

修改密码请求IMIX报文标准见表35。

表35 修改密码请求 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX.1.0	IMIX 版本号
9	BodyLength	111	具体值根据 IMIX 协议定义的 Bodylength 算法计算
35	MsgType	BE	表明为 UserRequest 报文
49	SenderCompID	245633	请求发起方的机构 ID
50	SenderSubID	XXXXXXX	请求发起方的子标识
56	TargetCompID	CFETS-RMB-CSTP	请求的目标方是 CSTPServer
57	TargetSubID	XXXXXXX	请求接收方子标识
34	MsgSeqNum	99	根据 IMIX 协议，报文发起方对于自己发出的每一条报文

			建立报文序列，并依次排序赋以标识。例子中的 99 表明，登出请求报文在发出报文序列的编号为 99
52	SendingTime	20080913-10:29:10	报文的发出时间
MessageBody			
923	UserRequestID	XXXXXX	请求报文的编号
924	UserRequestType	3	3-请求修改密码
553	Username	XXXXXXX	用户名 由交易中心颁发
554	Password	XXXXX	老密码
10193	NewPassword	XXXXX	新密码
StandardTrailer			
10	Checksum	XXX	具体值根据 IMIX 协议定义的 CheckSum 算法计算

6.3.3 修改密码请求反馈业务要素

修改密码请求反馈业务要素见表36。

表36 修改密码请求反馈业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
CompanyID 机构标识	56SenderCompID	
CompanySubID 机构子标识	57SenderSubID	可以标识机构下交易员或者机构内部系统
TargetServiceID 目标服务标识	50TargetSubID	CSTP 服务
UserRequestID 用户请求编号	923UserRequestID	与请求报文中的编号相同
UserName 用户名	553Username	
FeedbackStatus 返回状态	926UserStatus	4-密码错误 5-修改成功 6-其他原因错误
StatusText 状态备注	927UserStatusText	状态的说明

6.3.4 修改密码反馈 IMIX 报文标准

修改密码反馈IMIX报文见表37。

表37 修改密码反馈 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
----	----	----	----

StandardHeader			
8	BeginString	IMIX. 1. 0	IMIX 版本号
9	BodyLength	111	具体值根据 IMIX 协议定义的 Bodylength 算法计算
35	MsgType	BF	表明为 UserResponse 报文
49	SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	密码修改反馈方
50	SenderSubID	XXXXXXX	密码修改反馈方子标识
56	TargetCompID	245638	密码修改请求方
57	TargetSubID	XXXXXXX	密码修改请求方子标识
34	MsgSeqNum	99	根据 IMIX 协议, 报文发起方对于自己发出的每一条报文建立报文序列, 并依次排序赋以标识。例子中的 99 表明, 登出请求报文在发出报文序列的编号为 99
52	SendingTime	20080913-10:29:10	报文的发出时间
MessageBody			
923	UserRequestID	XXXXXX	请求报文的编号
553	Username	XXXXXXX	用户名由交易中心颁发
926	UserStatus	5	成功
927	UserStatusText	密码修改成功	状态说明
StandardTrailer			
10	Checksum	XXX	具体值根据 IMIX 协议定义的 CheckSum 算法计算

6.3.5 修改密码反馈-密码错误 IMIX 报文标准

修改密码反馈-密码错误IMIX报文见表38。

表38 修改密码反馈-密码错误 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
StandardHeader			
8	BeginString	IMIX. 1. 0	IMIX 版本号
9	BodyLength	111	具体值根据 IMIX 协议定义的 Bodylength 算法计算
35	MsgType	BF	表明为 UserResponse 报文
49	SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	密码反馈方 CSTPServer
50	SenderSubID	XXXXXXX	密码反馈方子标识
56	TargetCompID	245638	密码修改请求标识 请求返回接收方的机构 ID
57	TargetSubID	XXXXXXX	密码修改请求方子标识
34	MsgSeqNum	99	根据 IMIX 协议, 报文发起方

			对于自己发出的每一条报文建立报文序列，并依次排序赋以标识。例子中的 99 表明，登出请求报文在发出报文序列的编号为 99
52	SendingTime	20080913-10:29:10	报文的发出时间
MessageBody			
923	UserRequestID	XXXXXX	请求报文的编号
553	Username	XXXXXXXX	用户名由交易中心颁发
926	UserStatus	4	密码错误
927	UserStatusText	旧密码输入错误	状态说明
StandardTrailer			
10	Checksum	XXX	具体值根据 IMIX 协议定义的 CheckSum 算法计算

6.4 数据

下载终端成功登录下载服务后，等待下载服务发送相关交易数据。下载流程参见表39。

表39 下载流程

场景		发起方	接受方	IMIX 对应
数据下载	信息发送	下载服务	下载终端	根据具体的业务品种以及业务子场景使用相应的 IMIX 报文，具体 6.4 节本方成交数据。

根据不同的业务市场和业务场景，下载服务会通过不同的IMIX报文来给下载终端传送数据。

6.4.1 信用拆借市场

信用拆借市场关键域如表40。

表40 信用拆借市场关键域

业务场景		下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	信用拆借	ExecutionReport (MsgType=8)	根据<Parties>中的会员代码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区分拆入方或者拆出方 根据<Side>中的交易方向可区分该成交数据是拆入方的还是拆出方

6.4.1.1 成交业务要素

成交业务要素见表41。

表41 成交业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
----	---------	----

DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:mm:ss
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
Party 本方	成交单中 Side 用于填放本成交单传输给买方还是卖方的信息，如果 Side=1(买入或拆入)，在组件 Parties 中，与 PartyRole=119(买入或拆入)对应的 PartyID 即是本方 ID。	
Trader 本方交易员	Side 取值为 1，则表明报文发出方交易方向为拆入。而 PartyRole 取值为 119(拆入方)的交易方信息为本方，则另一方为对手方 Side 取值为 4，则表明该条信息发出交易方向为拆出的，则 PartyRole 取值为 120(拆出方)的交易方信息为本方信息，则另一方为对手方 交易员名称用 803PartySubIDType 以及 523PartySubID 来组合表示的，用 803=101 表示 523 为交易员名称，523=XXXXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
Counterparty 对手方	当决定了本方信息之后，则在 Parties 重复组中的另一个重复组块为对手方信息	
CounterpartyTrader 对手方交易员	交易员名称用 803PartySubIDType 以及 523PartySubID 来组合表示的，用 803=101 表示 523 为交易员名称，523=XXXXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
TradeMemberGroup 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CFETS 表示国际 803=29, 523=CFETS 表示银行间
Direction 交易方向	54Side	取值为 1 表示拆入 取值为 4 表示拆出
Rate	44Price	单位：%，精度：4 位

拆借利率		
Amount 拆借金额	32LastQty	单位：元，整数
Term 拆借期限	10316TradeLimitDays	单位：天，整数
InterestAmount 应计利息	10002AccruedInterestTotalAmt	单位：元，精度：2 位
2ndLegSettlementAmount 到期还款金额	10289SettlCurrAmt2	单位：元，精度：2 位
1stLegSettlementDate 首次结算日	64SettlDate	YYYYMMDD
2ndLegSettlementDate 到期结算日	193SettlDate2	YYYYMMDD
OccupancyDays 实际占款天数	10014CashHoldingDays	单位：天，整数
TradingProduct 交易品种	48SecurityID	为标准品种时传交易品种代码, 为非标准品种时该域传字符串“User-Defined”
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator 当 10282 取值 Y 时，可以查看 58Text 域取补充条款信息	Y-YES N-NO
DealStatus 成交状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
UpdateDate 更新日	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
QuotationNumber 报价编号	117QuoteID	
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	1-信用拆借
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	0-录入 1-修改 2-撤销
BuyerAccountDetails 买方账号信息		

SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
SellerAccountDetails 卖方账号信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	

6.4.1.2 成交 IMIX 报文标准

按照IMIX协议定义，下载服务需使用ExecutionReport报文传送成交数据信息，成交IMIX报文标准见表42。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表42 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	45	报文序列号
52			SendingTime	20081006-12:35:56	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方

49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	IB020130818000004	成交编号
44			Price	0.0500	拆借利率 单位：%，精度：4位
48			SecurityID	IB0014	交易品种代码
54			Side	1	交易方向
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20081006-12:34:56.000	更新日
64			SettlDate	20070822	首次结算日
75			TradeDate	20070821	成交日期
117			QuoteID	201308180120000014	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段
150			ExecType	F	成交状态-成交
10002			AccruedInterestTotalAmt	1000.00	应计利息 单位：元，精度：2位
193			SettlDate2	20070921	到期结算日
10014			CashHoldingDays	20	实际占款天数 单位：天，整数
10176			MarketIndicator	1	市场标识： 1-信用拆借市场
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10289			SettlCurrAmt2	2323232.00	到期还款金额 单位：元，精度：2位
32			LastQty	23034232	拆借金额 单位：元，整数
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
10105			DealTransType	0	报文动作 0-录入 1-修改 2-撤销
10316			TradeLimitDays	30	拆借期限 单位：天，整数
10318			TradeTime	12:34:56	成交时间

10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	119-拆入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	电话号码
→	802		NoPartySubIDs	11	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-拆出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	电话号码
→	802		NoPartySubIDs	11	

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.2 质押式回购市场

质押式回购市场关键域见表43。

表43 质押式回购市场关键域

业务场景		下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	质押式回购	ExecutionReport (MsgType=8)	根据<Parties>中的会员代码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区分逆回购方或者正回购方 根据<Side>中的交易方向可区分该成交数据是逆回购方的还是正回购方

6.4.2.1 成交业务要素

成交业务要素见表44。

表44 成交业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:mm:ss
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
Trader 本方交易员	PartyRole 取值为 119 的交易方信息为逆回购方, 则 PartyRole 取值为 120 为正回购方 交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
Counterparty 对手方	PartyRole 取值为 119 的交易方信息为逆回购方, 则 PartyRole 取值为 120 为正回购方。 机构 ID 用 448 (PartyID)	
CounterpartyTrader 对手方交易员	PartyRole 取值为 119 的交易方信息为逆回购方, 则 PartyRole 取值为 120 为正回购方 交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
SettlCurrency 结算币种	120 SettlCurrency	例如: CNY 或 USD
RepoMethod 回购方式	11376 RepoMethod	1-双边回购 2-三方回购 3-通用回购 双边回购即现有回购方式 注: 当回购方式为三方回购时, 不传质押券信息
RepoRate (%) 回购利率	44Price	单位: %, 精度: 4 位

Direction 交易方向	54Side	取值为 1 表示逆回购 取值为 4 表示正回购
BondCode 债券代码	质押式回购产品中所质押的债券代码 使用 309UnderlyingSecurityID 表示, 由于有多个质押债券,需要使用重复组 UnderlyingInstrument 来存放, 其中 711NoUnderlyings 来表示所质押债券 的种类数目	Incaseofmultiplebonds, theactualnu mberofbondsaredisplayed. 如果有多个债券,则显示债券实际数量
BondName 债券名称	使用 311UnderlyingSymbol	Incaseofmultiplebonds, theactualnu mberofbondsaredisplayed. 如果有多个债券,则显示债券实际数量
ConversionProportion 折算比例	使用 UnderlyingStipulations 组件, 报 文 组 件 结 构 参 考 例 子 。 当 888UnderlyingStipType 取值 Haircut 则 889UnderlyingStipValue 表示折算 比例	Incaseofmultiplebonds, theactualnu mberofbondsaredisplayed. 如果有多个债券,则显示债券实际数量 精度: 4 位
TotalFaceValue 券面总额	879UnderlyingQty	单位: 元, 整数
SumofTotalFaceValue 券面总额合计	32LastQty	单位: 元, 整数
TradeAmount 交易金额	10312TradeCashAmt	单位: 元, 精度: 2 位
RepoTerm 回购期限	10316TradeLimitDays	单位: 天, 整数
InterestAmount 应计利息	10002AccruedInterestTotalAmt	单位: 元, 精度: 2 位
1stLegSettlementDate 首次结算日	64SettlDate	
2ndLegSettlementDate 到期结算日	193SettlDate2	
OccupancyDays 实际占款天数	10014CashHoldingDays	单位: 天, 整数
2ndLegSettlementAmount 到期结算金额	10289SettlCurrAmt2	单位: 元, 精度: 2 位
TradingProduct 交易品种代码	48SecurityID	为标准品种时传交易品种代码, 为非标 准品种时该域传字符串 “User-Defined”
1stLegSettlementMethod 首次结算方式	919DeliveryType	0-DVP 券款对付 4-PUD 见券付款 5-DUP 见款付券
2ndLegSettlementMethod 到期结算方式	10045DeliveryType2	0-DVP 券款对付 4-PUD 见券付款

		5-DUP 见款付券
Status 状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
UpdateDate 更新日	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator 当 10282 取值 Y 时, 可以查看 58Text 域取补充条款信息	Y-YES N-NO
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
QuotationNumber 报价编号	117QuoteID	
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	9-质押式回购
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	0-录入 1-修改 2-撤销
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价 3-竞价
ClearingMethod 清算方式	使用 ClearingReferenceData 组件存 放 清 算 信 息 , 组 件 中 的 11143ClearingMethod 表示清算方式	11143ClearingMethod 6-集中清算 13-自行清算
SequelIndicator 续作标识	11377SequelIndicator	1-原始成交 2-续作成交
OrigTradeID 原成交编号	1126 OrigTradeID	续作标识为续作成交时, 提供该字段
RepoPartyAccountDetails 正回购方账户明细		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode	用 803 (PartySubIDType) 以 及	

资金开户行联行行号	523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodainAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
TradeMemberName 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CNFTZ 表示国际 803=29, 523=CFETS 表示银行间
ReverseRepoPartyAccountDetails 逆回购方账户明细		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodainAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
TradeMemberGroup 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CNFTZ 表示国际 803=29, 523=CFETS 表示银行间

对于质押式回购，使用UndInstrmtGrp组件来存放质押债券明细信息，其中711NoUnderlyings表示质押债券种类的数目，质押债券信息见表45：

表45 质押债券信息

字段	IMIX 对应
质押债券代码	309UnderlyingSecurityID
质押债券名称	311UnderlyingSymbol
质押债券券面总额	单位：元 879UnderlyingQty

6.4.2.2 成交 IMIX 报文标准

成交IMIX报文标准见表46。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表46 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	25	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:54:34	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	CR20130818000001	成交编号
120			SettlCurrency	CNY	结算币种
32			LastQty	340000	券面总额合计 单位：元，整数
11376			RepoMethod	1	回购方式 1-双边回购 2-三方回购 3-通用回购 双边回购即现有回购方式 注：当回购方式为三方回购时，不传质押券信息
44			Price	0.0652	回购利率 单位：%，精度：4位
48			SecurityID	R1M	交易品种

54			Side	1	交易方向-逆回购
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20070821-12:44:30.000	更新日
64			SettlDate	20070822	首次结算日
75			TradeDate	20070821	成交日期
117			QuoteID	201308180920000002	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段
150			ExecType	F	成交状态 F-成交
193			SettlDate2	20070921	到期结算日
919			DeliveryType	0	首次结算方式 0-DVP 4-PUD 5-DUP
10002			AccruedInterestTotalAmt	100.00	应计利息总额 单位：元，精度：2 位
10014			CashHoldingDays	30	实际占款天数 单位：天，整数
10045			DeliveryType2	0	到期结算方式 0-DVP 4-PUD 5-DUP
11143			ClearingMethod	6	清算方式： 6-集中清算 13-自行清算
11377			SequelIndicator	2	续作标识 1-原始成交 2-续作成交
1126			OrigTradeID	XXXX	原成交编号；续作标识为续作成交时，提供该字段
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
10105			DealTransType	0	报文动作 0-录入 1-修改 2-撤销
10176			MarketIndicator	9	市场标识： 9-质押式回购
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10289			SettlCurrAmt2	1000.00	到期结算金额

					单位：元，精度：2 位
10312			TradeCashAmt	23034232.00	交易金额 单位：元，精度：2 位
10316			TradeLimitDays	22	回购期限 单位：天，整数
10317			TradeMethod	1	交易方式： 1-询价 3-竞价
10318			TradeTime	12:44:30	成交时间
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
711			NoUnderlyings	2	
→	309		UnderlyingSecurityID	101010	债券代码
→	311		UnderlyingSymbol	5.52%China2010	债券名称
→	879		UnderlyingQty	1200000	券面总额 单位：元，整数
→	887		NoUnderlyingStips	1	
→	→	888	UnderlyingStipType	Haircut	折算比例
→	→	889	UnderlyingStipValue	0.9000	精度：4 位
→	309		UnderlyingSecurityID	101012	债券代码
→	311		UnderlyingSymbol	6.62%China2010	债券名称
→	879		UnderlyingQty	2200000	券面总额合计 单位：元，整数
→	887		NoUnderlyingStips	1	
→	→	888	UnderlyingStipType	Haircut	折算比例
→	→	889	UnderlyingStipValue	0.9000	精度：4 位
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	119-逆回购方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	021-38579255	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金清算行名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	清算行清算系统号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金清算账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	证券托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	证券托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	证券托管账号
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-正回购方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金清算账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金清算行名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	清算行清算系统号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	证券托管账户户名

→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	证券托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	证券托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

客户端收到ExecutionReport报文后会回调到Listener接口的实现类里，用户可以在onMessage()方法里解析并处理报文。下面的例子说明了如何得到报文里域和组件的值。

```
public void onMessage (ExecutionReport executionReport) throws FieldNotFound, UnsupportedMessageType, IncorrectTagValue
```

```
{
    //getexecIDvalue
    ExecID execID = new ExecID();
    executionReport.get(execID);
    //gettradeDatevalue
    TradeDate tradeDate = new TradeDate();
    executionReport.get(tradeDate);

    //noPartyIDsisagrouphere, we will try to extract it
    ExecutionReport.NoPartyIDs noPartyIDs = new ExecutionReport.NoPartyIDs();
    PartyID partyID = new PartyID();
    PartyRole partyRole = new PartyRole();
```

```
    ExecutionReport.NoPartyIDs.NoPartySubIDs noPartySubIDs = new ExecutionReport.NoPartyIDs.NoPartySubIDs();
```

```
    PartySubID partySubID = new PartySubID();
    PartySubIDType partySubIDType = new PartySubIDType();
    for (int i = 1; i <= executionReport.get(new int[] { field.NoPartyIDs }).getValue(); i++) {
        executionReport.getGroup(i, noPartyIDs);
    }
```

```

noPartyIDs.get (partyID);
noPartyIDs.get (partyRole);
for (int j=1; j<=noPartyIDs.get (newimix.field.NoPartySubIDs()).getValue(); j++) {
noPartyIDs.getGroup (j, noPartySubIDs);
noPartySubIDs.get (partySubID);
noPartySubIDs.get (partySubIDType);
}
}
//youcanaddyournlogichere
}

```

6.4.3 买断式回购市场

买断式回购市场关键域的判断见表47。

表47 买断式回购市场关键域

业务场景		下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	买断式回购	ExecutionReport (MsgType=8)	根据<Parties>中的会员代码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区分正回购方或者逆回购方 根据<Side>中的交易方向可区分该成交数据是正回购方的还是逆回购方

6.4.3.1 成交业务要素

成交业务要素见表48。

表48 成交明细业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:mm:ss
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
Trader 本方交易员	PartyRole 取值为 119 的交易方信息为逆回购方，则 PartyRole 取值为 120 为正回购方。交易员名称用	

	803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
Counterparty 对手方	PartyRole 取值为 119 的交易方信息为逆回购方, 则 PartyRole 取值为 120 为正回购方。 机构 ID 用 448 (PartyID)	
CounterpartyTrader 对手方交易员	PartyRole 取值为 119 的交易方信息为逆回购方, 则 PartyRole 取值为 120 为正回购方。 交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
TradeMemberGroup 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CFETS 表示银行间
Direction 交易方向	54Side	1-逆回购 4-正回购
BondCode 债券代码	309UnderlyingSecurityID	
BondName 债券名称	311UnderlyingSymbol	
SettlCurrency 结算币种	120 SettlCurrency	例如: CNY
RepoRate 回购利率	44Price	单位: %, 精度: 4 位
1stLegCleanPrice 首次净价	810UnderlyingPx	单位: 元, 精度: 4 位
2ndLegCleanPrice 到期净价	10328UnderlyingPx2	单位: 元, 精度: 4 位
1stLegYield 首次收益率	使用 UnderlyingStipulations 组件来存放首期和到期收益率信息, 888UnderlyingStipType 取值为 Yield 时表示 889UnderlyingStipValue 取值为首期收益率	单位: %, 精度: 4 位
2ndLegYield 到期收益率	使用 UnderlyingStipulations 组件来存放首期和到期收益率信息, 888UnderlyingStipType 取 值 为	单位: %, 精度: 4 位

	Yield2 时 表 示 889UnderlyingStipValue 取值为到期 收益率	
TotalFaceValue 券面总额	32LastQty 对单个券种的券面总额合计使用 879UnderlyingQty	单位：元，整数
RepoTerm 回购期限	10316TradeLimitDays	单位：天，整数
1stLegAccruedInterest 首次应计利息	10321UnderlyingAccruedInterestAmt	单位：元，精度：5 位
1stLegDirtyPrice 首次全价	882UnderlyingDirtyPrice	单位：元，精度：4 位
2ndLegAccruedInterest 到期应计利息	10322UnderlyingAccruedInterestAmt 2	单位：元，精度：5 位
2ndLegDirtyPrice 到期全价	10325UnderlyingDirtyPrice2	单位：元，精度：4 位
1stLegSettlementDate 首次结算日	64SettlDate	YYYYMMDD
2ndLegSettlementDate 到期结算日	193SettleDate2	YYYYMMDD
OccupancyDays 实际占款天数	10014CashHoldingDays	单位：天，整数
1stLegSettlementAmount 首次结算金额	119SettlCurrAmt	单位：元，精度：2 位
2ndLegSettlementAmount 到期结算金额	10289SettlCurrAmt2	单位：元，精度：2 位
TradingProduct 交易品种	48SecirutyID	
1stLegSettlementMethod 首次结算方式	919DeliveryType	0-DVP 券款对付 4-PUD 见券付款 5-DUP 见款付券
2ndLegSettlementMethod 到期结算方式	10045DeliveryType2	0-DVP 券款对付 4-PUD 见券付款 5-DUP 见款付券
Status 状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
UpdateDate 更新日	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator 当 10282 取值 Y 时，可以查看 58Text	Y-YES N-NO

	域取补充条款信息	
CollateralIndicator 有无保证品	10158MarginRequired	N-无
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
TermToMaturity 待偿期	10243TermToMaturity	
QuotationNumber 报价编号	117QuoteID	
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	0-录入 1-修改 2-撤销
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	10-买断式回购
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
ClearingMethod 清算方式	使用 ClearingReferenceData 组件存 放 清 算 信 息 ， 组 件 中 的 11143ClearingMethod 表示清算方式	11143ClearingMethod 6-集中清算 13-自行清算
RepoPartyAccountDetails 正回购方帐户明细		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber	用 803 (PartySubIDType) 以 及	

托管账号	523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
ReverseRepoPartyAccountDetails 逆回购方帐户明细		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountname 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	

6.4.3.2 成交 IMIX 报文标准

成交明细IMIX报文标准见表49。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表49 成交明细 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方

128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	OR20130818000001	成交编号
120			SettlCurrency	CNY	结算币种
32			LastQty	1200000	券面总额 单位：元，整数
44			Price	0.0652	回购利率 单位：%，精度：4 位
48			SecurityID	OR2M	交易品种
54			Side	1	交易方向
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20070821-12:24:23.000	更新日
64			SettlDate	20070822	首次结算日
75			TradeDate	20070821	成交日期
117			QuoteID	201308181020000004	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段
119			SettlCurrAmt	1000.00	首次结算金额 单位：元，精度：2 位
150			ExecType	F	成交状态-成交
193			SettlDate2	20070822	到期结算日
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识 N-NO
10105			DealTransType	0	报文动作 0-录入 1-修改 2-撤销
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
919			DeliveryType	0	首次结算方式 0-DVP 4-PUD 5-DUP
10014			CashHoldingDays	20	实际占款天数 单位：天，整数
10045			DeliveryType2	0	到期结算方式 0-DVP 4-PUD

					5-DUP
11143			ClearingMethod	6	清算方式: 6-集中清算 13-自行清算
10158			MarginRequired	N	有无保证品 N-无
10176			MarketIndicator	10	市场标识: 10-买断式回购
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10289			SettlCurrAmt2	1000.00	到期结算金额 单位: 元, 精度: 2 位
10316			TradeLimitDays	60	回购期限 单位: 天, 整数
10318			TradeTime	12:24:23	成交时间
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
711			NoUnderlyings	1	
→	309		UnderlyingSecurityID	101010	债券代码
→	311		UnderlyingSymbol	7.59%2016	债券名称
→	879		UnderlyingQty	1200000	单个券面总额 单位: 元, 整数
→	810		UnderlyingPx	102.0000	首次净价 单位: 元, 精度: 4 位
→	10328		UnderlyingPx2	102.9400	到期净价 单位: 元, 精度: 4 位
→	10243		TermToMaturity	YxMxDx	待偿期
→	10321		UnderlyingAccruedInterestAmt	123.00000	首次应计利息 单位: 元, 精度: 5 位
→	10322		UnderlyingAccruedInterestAmt2	123.00000	到期应计利息 单位: 元, 精度: 5 位
→	882		UnderlyingDirtyPrice	102.4000	首次全价 单位: 元, 精度: 4 位
→	10325		UnderlyingDirtyPrice2	104.3000	到期全价 单位: 元, 精度: 4 位
→	887		NoUnderlyingStips	2	
→	→	888	UnderlyingStipType	Yield	首次收益率
→	→	889	UnderlyingStipValue	0.2000	单位: %, 精度: 4 位
→	→	888	UnderlyingStipType	Yield2	到期收益率
→	→	889	UnderlyingStipValue	0.3000	单位: %, 精度: 4 位
453			NoPartyIDs	2	

→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	119-逆回购方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	021-38579255	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	nnsxbcoH	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	交通银行	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	交通银行股份有限公司	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	BCOH	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	上海银城中路 188 号	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-正回购方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	

→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	北京市西城区金融大街 25 号	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	nnsxccbh	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	建设银行	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	中国建设银行股份有限公司	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	CCBH	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.4 现券买卖市场

现券买卖市场的关键域见表50。

表50 现券买卖市场关键域

业务场景		下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	现券买卖	ExecutionReport (MsgType=	根据<Parties>中的会员代

		8)	码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区分买方或者卖方 根据<Side>中的交易方向可区分该成交数据是买方的还是卖方
--	--	----	---

6.4.4.1 成交业务要素

成交明细业务要素见表51。

表51 成交明细业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:MM:SS
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
Direction 交易方向	54(Side)取值表示交易方向 54 取值 1 表示买入 54 取值为 4 表示卖出	
BondCode 债券代码	10176(MarketIndicator) 4-现券买卖 48SecurityID	
BondName 债券名称	55Symbol	
SettlCurrency 结算币种	120 SettlCurrency	例如: CNY 或 USD
CleanPrice 净价	44Price	单位: 元, 精度: 4 位
StrikeYield 行权收益率	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	单位: %, 精度四位; 非必传, 为空时则不发送该字段
Yield	使用 Stipulations 组件来存放到期收	单位: %, 精度四位;

到期收益率	益率信息， 233StipulationType 取值为Yield2 时表示 234StipulationValue 取值为到期收益率	非必传，为空时则不发送该字段
TotalFaceValue 券面总额	32LastQty	单位：元，整数
Principal 每百元本金额	10239Principal	单位：元，精度两位 只有在 ABS 券时才传输该字段
TotalPrincipal 当前本金额	10310TotalPrincipal	单位：元，精度两位 只有在 ABS 券时才传输该字段
TradeAmount 交易金额	10312TradeCashAmt	单位：元，精度：2 位
SettlementDate 结算日	64SettleDate	YYYYMMDD
ClearingMethod 清算方式	使用 ClearingReferenceData 组件存放清算信息，其中， 11143ClearingMethod 表示清算方式	11143ClearingMethod 6-集中清算 13-自行清算
AccruedInterest 应计利息	159AccruedInterestAmt	单位：元，精度：5 位
DirtyPrice 全价	10048DirtyPrice	单位：元，精度：4 位
TotalAccruedInterest 应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位：元，精度：2 位
SettlementAmount 结算金额	119SettlCurrAmt	单位：元，精度：2 位
SettlementMethod 结算方式	919DeliveryType	0-DVP-券款对付 4-PUD-见券付款 5-DUP-见款付券 11-NDVP-净额券款对付
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator 当 10282 取值 Y 时，可以查看 58Text 域取补充条款信息	Y-YES N-NO
DealStatus 成交状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
TransactionType 成交传输动作状态	10105DealTransType	0-成交录入 1-成交单修改 2-成交单撤销
TypeofDeal 成交类别	10319TradeType	1-非做市成交 2-做市成交 3-尝试做市成交

TradeMethod 交易方式	10317TradeMethod	5-点击成交 4-请求 1-协商 3-竞价
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
TermToMaturity 待偿期	10243TermToMaturity	
RFQNumber 请求报价编号	10471Reference	当交易方式为请求报价成交时,使用请求报价编号
QuotationNumber 报价编号	117QuoteID	对于限价和订单的成交使用370OrderID, 对于请求报价成交使用10471Reference, 其他成交则使用117QuoteID
OrderID 订单编号	370OrderID	对于限价和订单的成交使用370OrderID, 对于请求报价成交使用10471Reference, 其他成交则使用117QuoteID
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	4-现券买卖
BondIndicator 现券标识	10351CashBondIndicator	取值 Y 表示现券 取值 N 表示 ABS
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
SettlementSpeed 清算速度	63 SettlType	枚举值: 1-T+0 2-T+1 3-T+2 4-T+3 5-T+4
买入方机构信息		
BuyerPartyID 买入方机构代码	使用<Parties>组件 452PartyRole 取值 119 表示买入方信息, 448PartyID 填写买入方机构代码	6 位机构代码
Buyer TraderTelephoneNumber 买入方电话	使用 Parties 组件下的 ContactInfoGrp 组件 10603ContactInfoIDType 取值 6 表示交易员电话, 10602ContactInfoID 填写买入方交易员电话	
Buyer TraderName	803PartySubIDType 取值 101 表示交易	

买入方交易员名称	员名称, 523PartySubID 填写买入方交易员名称	
Buyer PartyAddress 买入方地址	803PartySubIDType 取值 6 表示地址 523PartySubID 填写买入方地址	
Buyer TraderChineseName 买入方交易员中文名称	803PartySubIDType 取值 126 表示交易 员中文名称, 523PartySubID 填写买入方交易员中 文名称	
Buyer ShortChineseNameofFirm 买入方机构中文简称	803PartySubIDType 取值 125 表示机构 中文简称, 523PartySubID 填写买入方机构中文 简称	
Buyer FullChineseNameofFirm 买入方机构中文全称	803PartySubIDType 取值 124 表示机构 中文全称, 523PartySubID 填写买入方机构中文 全称	
Buyer ShortNameofFirm 买入方机构简称	803PartySubIDType 取值 102 表示机构 简称, 523PartySubID 填写买入方机构简称	机构英文简称
卖出方机构信息		
Seller PartyID 卖出方机构代码	使用<Parties>组件 452PartyRole 取值 120 表示卖出方信 息, 448PartyID 填写卖出方机构代码	6 位机构代码
Seller TraderTelephoneNumber 卖出方电话	使 用 Parties 组 件 下 的 ContactInfoGrp 组件 10603ContactInfoIDType 取值 6 表示 交易员电话, 10602ContactInfoID 填写卖出方交易 员电话	
Seller TraderName 卖出方交易员名称	803PartySubIDType 取值 101 表示交易 员名称, 523PartySubID 填写卖出方交易员名 称	
SellerPartyAddress 卖出方地址	803PartySubIDType 取值 6 表示地址 523PartySubID 填写卖出方地址	
Seller TraderChineseName 卖出方交易员中文名称	803PartySubIDType 取值 126 表示交易 员中文名称, 523PartySubID 填写卖出方交易员中 文名称	
Seller ShortChineseNameofFirm	803PartySubIDType 取值 125 表示机构	

卖出方机构中文简称	中文简称, 523PartySubID 填写卖出方机构中文简称	
Seller FullChineseNameofFirm 卖出方机构中文全称	803PartySubIDType 取值 124 表示机构中文全称, 523PartySubID 填写卖出方机构中文全称	
Seller ShortNameofFirm 卖出方机构简称	803PartySubIDType 取值 102 表示机构简称, 523PartySubID 填写卖出方机构简称	机构英文简称
BuyerAccountDetails 买入方帐户信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
BuyerInstitutionSource 买入方机构来源	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=C 表示北金所会员 803=29, 523=CFETS 表示交易中心会员
TradeMemberGroup 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CNFTZ 表示国际 803=29, 523=CFETS 表示银行间
SellerAccountDetails 卖出方帐户信息		
SettlementAccountName	用 803 (PartySubIDType) 以及	

资金账户户名	523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
SellerInstitutionSource 卖方机构来源	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=C表示北金所会员 803=29, 523=CFETS表示交易中心会员
TradeMemberGroup 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CNFTZ 表示国际 803=29, 523=CFETS表示银行间

6.4.4.2 成交 IMIX 报文标准

成交明细IMIX报文标准见表52。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表52 成交明细 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方

56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	CBT20130818000040	成交编号
120			SettlCurrency	CNY	结算币种
32			LastQty	1200000	券面总额 单位：元，整数
37			OrderID	201308180420000076	订单编号
44			Price	98.0000	净价 单位：元，精度：4 位
48			SecurityID	010004	债券代码
55			Symbol	01 国债 04	债券名称
58			Text	XXX	补充条款
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间
64			SettlDate	20070822	结算日
75			TradeDate	20070821	成交日期
119			SettlCurrAmt	1000.00	结算金额 单位：元，精度：2 位
117			QuoteID	201308180420000076	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段
10471			Reference	XXX	请求报价编号 当交易方式为请求成交时发送
150			ExecType	F	成交状态 F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
159			AccruedInterestAmt	1000.00000	应计利息 单位：元，精度：5 位
919			DeliveryType	0	结算方式 0-DVP 4-PUD 5-DUP 11-NDVP-净额券款对付
11143			ClearingMethod	13	清算方式： 6-集中清算

					13-自行清算
10002			AccruedInterestTotalAmt	23123.23	应计利息总额 单位：元，精度：2位
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
10048			DirtyPrice	99.2300	全价 单位：元，精度：4位
10105			DealTransType	0	成交传输动作状态 0-成交单录入 1-成交单修改 2-成交单撤销
10176			MarketIndicator	4	市场标识： 4-现券买卖
10239			Principal	100.00	每百元本金额，精度两位 只有在ABS券时才传输该字段
10310			TotalPrincipal	23034232.00	当前本金额，精度两位 只有在ABS券时才传输该字段
10243			TermToMaturity	YxMxDx	待偿期
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10351			CashBondIndicator	Y	Y-现券 N-ABS
10312			TradeCashAmt	23034232.00	交易金额 单位：元，精度：2位
10318			TradeTime	12:40:50	成交时间
10319			TradeType	1	成交类别 1-非做市成交 2-做市成交 3-尝试做市成交
10317			TradeMethod	4	交易方式 1-协商 3-竞价 4-请求 5-点击成交
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
54			Side	1	交易方向 1-买入 4-卖出
63			SettlType	1	清算速度

					枚举值: 1-T+0 2-T+1 3-T+2 4-T+3 5-T+4
232			NoStipulations	2	
→	233		StipulationType	StrikeYield	行权收益率 当行权收益率为空时不传 233=StrikeYield
→	234		StipulationValue	35.6483	单位: %, 精度四位; 非必传, 为空时则不发送 该字段
→	233		StipulationType	Yield2	到期收益率 当到期收益率为空时不传 233=Yield2
→	234		StipulationValue	0.2000	单位: %, 精度四位; 非必传, 为空时则不发送 该字段
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	119-买入方/120-卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名

→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间/交易中心 会员 C-北金所会员
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组/机构来源 说明：当 803=29, 523=C 表示机构来源为北金所会员且交易成员群组为银行间； 当 803=29, 523=CFETS，表示机构来源为交易中心会员且交易成员群组为银行间； 当 803=29, 523=CNYFTZ 表示机构来源为交易中心会员且交易成员群组为国际。
→	→	523	PartySubID	上海银城中路 188 号交通银行总行金融市场部	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	nnsxbcoh	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	交通银行	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	交通银行股份有限公司	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	BCOH	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	119-买入方/120-卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	021-38579255	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行

→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间/交易中心 会员 C-北金所会员
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组/机构来源 说明：当 803=29, 523=C 表示机构来源为北金所会员且交易成员群组为银行间； 当 803=29, 523=CFETS，表示机构来源为交易中心会员且交易成员群组为银行间； 当 803=29, 523=CNYFTZ 表示机构来源为交易中心会员且交易成员群组为国际。
→	→	523	PartySubID	上海银城中路188号交通银行总行金融市场部	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	nnsxbcoh	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	交通银行	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	交通银行股份有限公司	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	BCOH	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.4.3 上市前债券交易意向业务要素

上市前债券交易意向业务要素见表53

表53 上市前债券交易意向业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联方数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	格式为：YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	格式为：HH:MM:SS
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
TradeRecordNumber 交易记录编号	11888 TradeRecordID	格式：PBTYYYYMMDD+9+5 位流水
Direction 交易方向	54Side	1-买入 4-卖出
BondCode 债券代码	48SecurityID	债券代码带 P 传输
BondName 债券名称	55Symbol	
SettlCurrency 结算币种	120 SettlCurrency	默认：CNY
CleanPrice 净价	44Price	单位：元，精度：4 位
StrikeYield 行权收益率	使用 Stipulations 组件存放行权收益率信息， 233StipulationType 取 值 为 StrikeYield 时表示行权收益率， 234StipulationValue 填写具体值	单位：%，精度：4 位
Yield 到期收益率	使用 Stipulations 组件来存放到期收益率信息， 233StipulationType 取值为Yield2 时表示到期收益率， 234StipulationValue 填写具体值	单位：%，精度：4 位
TotalFaceValue 券面总额	32LastQty	单位：元，整数
TradeAmount 交易金额	10312TradeCashAmt	单位：元，精度：2 位
SettlementDate 结算日	64SettleDate	格式为：YYYYMMDD
ClearingMethod 清算方式	使用 ClearingReferenceData 组件存放清算信息， 11143ClearingMethod	13-全额清算（即自行清算）

AccruedInterest 应计利息	159AccruedInterestAmt	单位：元，精度：5 位
DirtyPrice 全价	10048DirtyPrice	单位：元，精度：4 位
TotalAccruedInterest 应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位：元，精度：2 位
SettlementAmount 结算金额	119SettlCurrAmt	单位：元，精度：2 位
SettlementMethod 结算方式	919DeliveryType	0-券款对付
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	Y-有 N-无
DealStatus 成交状态	150ExecType	F-成交 4-撤销
TransactionType 成交传输动作状态	10105DealTransType	0-录入 2-撤销
TypeofDeal 成交类别	10319TradeType	1-非做市 2-做市 3-尝试做市 若发起方为做市商/尝试做市商/非做市商，则该笔交易为做市成交/尝试做市成交/非做市成交，且发起方的成交类别为做市成交/尝试做市成交/非做市成交，其对手方为非做市
TradeMethod 交易方式	10317TradeMethod	3-竞价
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
TermToMaturity 待偿期	10243TermToMaturity	格式：YxMxDx
OrderNumber 订单编号	37 OrderID	
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	4-现券买卖
BondIndicator 现券标识	10351CashBondIndicator	枚举值： Y-是 N-否 当债券为 ABS 时，取值为“否”；反之，取“是”。
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-是 N-否 当成交状态为“撤销”时，本字段取值为“是”。
SettlementSpeed	63 SettlType	枚举值：

清算速度		1-T+0 2-T+1 3-T+2 4-T+3 5-T+4
DealNumber 成交编号	17 ExecID	选填
BuyerInformation 买入方信息		
BuyerPartyID 买入方机构代码	使用<Parties>组件 452PartyRole 取值 119 表示买入方信息, 448PartyID 填写买入方机构代码	6位机构代码
Buyer TraderTelephoneNumber 买入方电话	使用 Parties 组件下的 ContactInfoGrp 组件 10603ContactInfoIDType 取值 6 表示交易员电话, 10602ContactInfoID 填写买入方交易员电话	
Buyer TraderName 买入方交易员名称	803PartySubIDType 取值 101 表示交易员名称, 523PartySubID 填写买入方交易员名称	
Buyer SettlementAccountNumber 买入方资金账号	803PartySubIDType 取值 15 表示资金账号, 523PartySubID 填写买入方资金账号	
Buyer SettlementBankName 买入方资金开户行名称	803PartySubIDType 取值 110 表示资金开户行名称, 523PartySubID 填写买入方资金开户行名称	
Buyer BankSortCode 买入方资金账户支付系统行号	803PartySubIDType 取值 112 表示资金账户支付系统行号, 523PartySubID 填写买入方支付系统行号	
Buyer CustodianAccountName 买入方托管账户名称	803PartySubIDType 取值 22 表示托管账户名称, 523PartySubID 填写买入方托管账户名称	
Buyer CustodianName 买入方托管机构名称	803PartySubIDType 取值 111 表示托管机构名称, 523PartySubID 填写买入方托管机构名称	

Buyer CustodianAccountNumber 买入方托管账号	803PartySubIDType 取值 10 表示托管账号， 523PartySubID 填写买入方托管账号	
Buyer SettlementAccountName 买入方资金账户户名	803PartySubIDType 取值 23 表示资金账户户名， 523PartySubID 填写买入方资金账户户名	
Buyer InstitutionSource 买入方机构来源	803PartySubIDType 取值 29 表示机构来源， 523PartySubID 填写 CFETS 表示买入方机构来源是交易中心会员	803=29, 523=CFETS表示交易中心会员
TradeMemberGroup 交易成员群组	803PartySubIDType 取值 29 表示交易成员群组， 523 (PartySubID) 填写 CFETS 表示交易成员群组是银行间	803=29, 523=CFETS表示银行间
Buyer PartyAddress 买入方地址	803PartySubIDType 取值 6 表示地址 523PartySubID 填写买入方地址	
Buyer TraderChineseName 买入方交易员中文名称	803PartySubIDType 取值 126 表示交易员中文名称， 523PartySubID 填写买入方交易员中文名称	
Buyer ShortChineseNameofFirm 买入方机构中文简称	803PartySubIDType 取值 125 表示机构中文简称， 523PartySubID 填写买入方机构中文简称	
Buyer FullChineseNameofFirm 买入方机构全称	803PartySubIDType 取值 124 表示机构中文全称， 523PartySubID 填写买入方机构中文全称	机构中文全称
Buyer ShortNameofFirm 买入方机构简称	803PartySubIDType 取值 102 表示机构简称， 523PartySubID 填写买入方机构简称	机构英文简称
SellerInformation 卖出方帐户信息		
Seller PartyID 卖出方机构代码	使用<Parties>组件 452PartyRole 取值 120 表示卖出方信息， 448PartyID 填写卖出方机构代码	6位机构代码
Seller TraderTelephoneNumber 卖出方电话	使用 Parties 组件下的 ContactInfoGrp 组件 10603ContactInfoIDType 取值 6 表示交易员电话，	

	10602ContactInfoID 填写卖出方交易 员电话	
Seller TraderName 卖出方交易员名称	803PartySubIDType 取值 101 表示交易 员名称, 523PartySubID 填写卖出方交易员名 称	
Seller SettlementAccountNumber 卖出方资金账号	803PartySubIDType 取值 15 表示资金 账号, 523PartySubID 填写卖出方资金账号	
SellerSettlementBankName 卖出方资金开户行名称	803PartySubIDType 取值 110 表示资金 开户行名称, 523PartySubID 填写卖出方资金开户 行名称	
Seller BankSortCode 卖出方资金账户支付系统行号	803PartySubIDType 取值 112 表示资金 账户支付系统行号, 523PartySubID 填写卖出方支付系统 行号	
Seller CustodianAccountName 卖出方托管账户名称	803PartySubIDType 取值 22 表示托管 账户名称, 523PartySubID 填写卖出方托管账户 名称	
Seller CustodianName 卖出方托管机构名称	803PartySubIDType 取值 111 表示托管 机构名称, 523PartySubID 填写卖出方托管机构 名称	
Seller CustodianAccountNumber 卖出方托管账号	803PartySubIDType 取值 10 表示托管 账号, 523PartySubID 填写卖出方托管账号	
SellerSettlementAccountName 卖出方资金账户户名	803PartySubIDType 取值 23 表示资金 账户户名, 523PartySubID 填写卖出方资金账户 户名	
SellerInstitutionSource 卖出方机构来源	803PartySubIDType 取值 29 表示机构 来源, 523PartySubID 填写 CFETS 表示卖出方 机构来源是交易中心会员	803=29, 523=CFETS表示交易中心会员
TradeMemberGroup 交易成员群组	803PartySubIDType 取值 29 表示交易 成员群组, 523(PartySubID) 填写 CFETS 表示交易 成员群组是银行间	803=29, 523=CFETS表示银行间
SellerPartyAddress 卖出方地址	803PartySubIDType 取值 6 表示地址 523PartySubID 填写卖出方地址	

Seller TraderChineseName 卖出方交易员中文名称	803PartySubIDType 取值 126 表示交易员中文名称, 523PartySubID 填写卖出方交易员中文名称	
Seller ShortChineseNameofFirm 卖出方机构中文简称	803PartySubIDType 取值 125 表示机构中文简称, 523PartySubID 填写卖出方机构中文简称	
Seller FullChineseNameofFirm 卖出方机构全称	803PartySubIDType 取值 124 表示机构中文全称, 523PartySubID 填写卖出方机构中文全称	机构中文全称
Seller ShortNameofFirm 卖出方机构简称	803PartySubIDType 取值 102 表示机构简称, 523PartySubID 填写卖出方机构简称	机构英文简称

6.4.4.4 上市前债券交易意向 IMIX 报文标准

上市前债券交易意向IMIX报文标准见表54

表54 上市前债券交易意向 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联方数据
75			TradeDate	20180111	成交日期 格式为: YYYYMMDD
10318			TradeTime	12:40:50	成交时间 格式为: HH:MM:SS
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间 格 式 为 :

					YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
11888			TradeRecordID	PBT20180112912345	交易记录编号 格式：PBTYYYYMMDD+9+5 位流水
54			Side	1	交易方向 1-买入 4-卖出
48			SecurityID	XXX	债券代码 债券代码带 P 传输
55			Symbol	XXX	债券名称
120			SettlCurrency	CNY	结算币种 默认：CNY
44			Price	98.0000	净价 单位：元，精度：4 位
32			LastQty	1200000	券面总额 单位：元，整数
10312			TradeCashAmt	20000000.00	交易金额 单位：元，精度：2 位
64			SettlDate	20180112	结算日 格式为：YYYYMMDD
11143			ClearingMethod	13	清算方式： 13-全额清算（即自行清算）
159			AccruedInterestAmt	1000.12345	应计利息 单位：元，精度：5 位
10048			DirtyPrice	900000.2300	全价 单位：元，精度：4 位
10002			AccruedInterestTotalAmt	20000.23	应计利息总额 单位：元，精度：2 位
119			SettlCurrAmt	1000000.00	结算金额 单位：元，精度：2 位
919			DeliveryType	0	结算方式 0-券款对付
10282			RemarkIndicator	Y	有无补充条款 Y-有 N-无
150			ExecType	F	成交状态 F-成交 4-撤销
10105			DealTransType	0	成交传输动作状态 0-录入 2-撤销

10319			TradeType	1	成交类别 1-非做市 2-做市 3-尝试做市 若发起方为做市商/尝试做市商/非做市商,则该笔交易为做市成交/尝试做市成交/非做市成交,且发起方的成交类别为做市成交/尝试做市成交/非做市成交,其对手方为非做市
10317			TradeMethod	4	交易方式 3-竞价
58			Text	XXX	补充条款
10243			TermToMaturity	Y1M2D3	待偿期 格式: YxMxDx
37			OrderID	201308180420000076	订单编号
10176			MarketIndicator	4	市场标识 4-现券买卖
10351			CashBondIndicator	Y	现券标识 枚举值: Y-是 N-否 当债券为 ABS 时,取值为“否”;反之,取“是”。
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识 Y-是 N-否 当成交状态为“撤销”时,本字段取值为“是”。
63			SettlType	1	枚举值: 1-T+0 2-T+1 3-T+2 4-T+3 5-T+4
17			ExecID	XXX	成交编号, 选填
232			NoStipulations	2	
→	233		StipulationType	StrikeYield	StrikeYield - 行权收益率
→	234		StipulationValue	35.6483	单位: %, 精度: 4 位
→	233		StipulationType	Yield2	Yield2-到期收益率
→	234		StipulationValue	0.2000	单位: %, 精度: 4 位

453			NoPartyIDs	2	重复组次数
→	448		PartyID	XXX	买入方机构 6 位代码
→	452		PartyRole	119	119-买入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	14	重复组次数
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	101-交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	15-资金账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	110-资金开户行名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	112-资金账户支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	22-托管账户名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	111-托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	10-托管账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	23-资金账户户名
→	→	523	PartySubID	CFETS	CFETS-交易中心会员/银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	29-机构来源/交易成员群组 说明：当 803=29, 523=CFETS, 表示机构来源为交易中心会员且交易成员群组为银行间
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	6-地址
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	126-交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	125-机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	124-机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXX	

→	→	803	PartySubIDType	102	102-机构英文简称
→	448		PartyID	XXX	卖出方机构 6 位代码
→	452		PartyRole	120	120-卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	14	重复组次数
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	101-交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	15-资金账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	110-资金开户行名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	112-资金账户支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	22-托管账户名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	111-托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	10-托管账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	23-资金账户户名
→	→	523	PartySubID	CFETS	CFETS-交易中心会员/银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	29-机构来源/交易成员群组 说明：当 803=29, 523=CFETS, 表示机构来源为交易中心会员且交易成员群组为银行间
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	6-地址
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	126-交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	125-机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	124-机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXX	

→	→	803	PartySubIDType	102	102-机构英文简称
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.5 做市支持成交数据

6.4.5.1 做市支持成交明细业务要素

本章节为做市支持成交数据，本章节的业务要素与现券买卖市场章节的业务要素基本一致，两者的具体区分点在于业务要素成交编号的编码规则以及买入卖出方资金账户、托管账户相关信息的规则不同，具体不同点如下：

1、成交编号编码规则不同。

做市支持成交数据成交编号编码规则为：CBT+8 位日期+8+5 位流水

现券买卖市场章节成交编号编码规则为：CBT+8 位日期+6 位流水

2、如为财政部的买入卖出方资金账户信息及托管账户信息且未填写，则传输“-”。

表55 做市支持成交明细业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据
成交日期	75TradeDate	格式为：YYYYMMDD
成交时间	10318TradeTime	格式为：HH:MM:SS
业务发生时间	60TransactTime	格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
成交编号	17ExecID	格式：CBT+8 位日期+8+5 位流水 eg:CBTYYYYMMDD8XXXXX
交易方向	54Side	交易方向： 1-买入 4-卖出 发给买入方时，为买入；发给卖出方时，为卖出。
债券代码	10176 (MarketIndicator) 4-现券买卖 48SecurityID	传输该做市支持的债券代码信息
债券名称	55Symbol	传输该做市支持的债券名称信息
结算币种	120 SettlCurrency	例如：CNY
净价	44Price	单位：元，精度：4 位
到期收益率	使用 Stipulations 组件来存放到期收益率信息， 233StipulationType 取值为Yield2时表示 234StipulationValue 取值为到期收益率	单位：% ，精度：4 位；
券面总额	32LastQty	单位：元，整数 传输做市商的中标量
交易金额	10312TradeCashAmt	单位：元，精度：2 位

结算日	64SettleDate	格式：YYYYMMDD 见款付券时,为资金划付日；见券付款时,为债券交割日；券款对付时，为结算日
清算方式	使用 ClearingReferenceData 组件存放清算信息，其中， 11143ClearingMethod 表示清算方式	13-自行清算
应计利息	159AccruedInterestAmt	单位：元，精度：5 位
全价	10048DirtyPrice	单位：元，精度：4 位
应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位：元，精度：2 位
结算金额	119SettlCurrAmt	单位：元，精度：2 位
结算方式	919DeliveryType	枚举值： 0-DVP-券款对付 4-PUD-见券付款 5-DUP-见款付券
有无补充条款	10282RemarkIndicator	N-NO
成交状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 做市支持成功时传输成交 竞价结果超时未确认变为做市支持成功后场务应急拒绝后做市支持终止时传输撤销
成交传输动作状态	10105DealTransType	0-成交单录入 2-成交单撤销 做市支持成功时传输成交录入 竞价结果超时未确认变为做市支持成功后场务应急拒绝后做市支持终止时传输成交单撤销
成交类别	10319TradeType	2-做市成交
交易方式	10317TradeMethod	3-竞价
待偿期	10243TermToMaturity	格式分为：YxMxDx、MxDx、Dx Y≠0，格式为：YxMxDx Y=0，M≠0，格式为：MxDx Y=0，M=0，格式为：Dx D=0，格式为 D0 传输标的债券的待偿期信息
订单编号	370orderID	做市支持编码 格式为：yyyymmdd+02+4 位流水

市场标识	10176MarketIndicator	4-现券买卖
现券标识	10351CashBondIndicator	Y-现券
应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO 当做市支持成功时传输否 竞价结果超时未确认变为做市支持成功 后场务应急拒绝后做市支持终止时 传输是
交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CFETS 表示银行间
买入方帐户信息		
买入方机构代码	当 452PartyRole=119 时 448PartyID	机构六位码
买入方中文简称	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 当 803PartySubIDType 取值 125 表示机构中文简称 523PartySubID 填写买入方中文简称	
买入方中文全称	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 当 803PartySubIDType 取值 124 表示机构中文全称 523PartySubID 填写买入方中文全称	
买入方会员简称	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 803PartySubIDType 取值 102 表示会员简称, 523 中填写会员简称	机构英文简称
买入方交易员名称	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 101 表示交易员名称 523PartySubID 填写买入方交易员名称	当买入方为做市商且为机构用户录入 竞价时,传输最后竞价录入成功的交易 员姓名;当买入方为财政部时,传输“-” 当买入方为做市商且为场务应急录入 时,传输“-”
买入方交易员中文名称	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 803PartySubIDType 取值 126 表示交易员中文名称 523PartySubID 填写买入方交易员中文名称	当买入方为做市商且为机构用户录入 竞价时,传输最后竞价录入成功的交易 员姓名 当买入方为财政部时,传输“-” 当买入方为做市商且为场务应急录入 时,传输“-”
买入方交易员电话	使用 Parties 组件下的 ContactInfoGrp 组件 10603=6ContactInfoIDType,表示交易 员电话; 10602ContactInfoID 填写买 入方交易员电话	买入方交易员电话信息, 如无则传输 “-”
买入方地址	PartyRole 取值为 119 表示买入方信	买入方地址信息, 如无则传输“-”

	息,当 803PartySubIDType 取值 6 时表示地址; 523PartySubID 填写买入方机构地址	
买入方资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	如买入方为财政部且未填写, 则传输“_”
买入方资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	如买入方为财政部且未填写, 则传输“_”
买入方资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	如买入方为财政部且未填写, 则传输“_”
买入方资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	如买入方为财政部且未填写, 则传输“_”
买入方托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	如买入方为财政部且未填写, 则传输“_”
买入方托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	如买入方为财政部且未填写, 则传输“_”
买入方托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	如买入方为财政部且未填写, 则传输“_”
买入方机构来源	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CFETS 表示交易中心会员
卖出方帐户信息		
卖出方机构代码	当 452PartyRole=120 时, 448PartyID	机构六位码
卖出方中文简称	PartyRole 取值 120 表示卖出方信息, 803 PartySubIDType 取值 125 表示机构中文简称, 523 PartySubID 卖出方中文简称	
卖出方中文全称	PartyRole 取值 120 表示卖出方信息, 803 PartySubIDType 取值 124 表示机构中文全称, 523 PartySubID 表示卖出方中文全称	
卖出方会员简称	PartyRole 取值 120 表示卖出方信息, 803PartySubIDType 取值 102 表示会员简称, 523 中填写会员简称	机构英文简称
卖出方交易员名称	PartyRole 取值 120 表示卖出方信息, 803PartySubIDType 取值 101 表示交易	当卖出方为做市商且为机构用户录入竞价时, 传输最后竞价录入成功的交易

	员名称, 523PartySubID 填写卖出方交易员名称	员姓名 当卖出方为财政部时, 传输 “-” 当卖出方为做市商且为场务应急录入时, 传输 “-”
卖出方交易员中文名称	PartyRole 取值 120 表示卖出方信息, 803PartySubIDType 取值 126 表示交易员中文名称 523PartySubID 填写卖出方交易员中文名称	当卖出方为做市商且为机构用户录入竞价时, 传输最后竞价录入成功的交易员姓名 当卖出方为财政部时, 传输 “-” 当卖出方为做市商且为场务应急录入时, 传输 “-”
卖出方交易员电话	使用 Parties 组件下的 ContactInfoGrp 组件 10603=6ContactInfoIDType, 表示交易员电话; 10602ContactInfoID 填写卖出方交易员电话	卖出方交易员电话信息, 如无则传输 “-”
卖出方地址	PartyRole 取值 120 表示卖出方信息, 803PartySubIDType 取值 6 表示地址, 523PartySubID 表示具体的值	卖出方地址信息, 如无则传输 “-”
卖出方资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	如卖出方为财政部且未填写, 则传输 “-”
卖出方资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	如卖出方为财政部且未填写, 则传输 “-”
卖出方资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	如卖出方为财政部且未填写, 则传输 “-”
卖出方资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	如卖出方为财政部且未填写, 则传输 “-”
卖出方托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	如卖出方为财政部且未填写, 则传输 “-”
卖出方托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	如卖出方为财政部且未填写, 则传输 “-”
卖出方托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	如卖出方为财政部且未填写, 则传输 “-”
卖出方机构来源	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CFETS表示交易中心会员

6.4.5.2 做市支持成交明细 IMIX 报文标准

做市支持成交明细IMIX报文标准见表56。

表56 做市支持成交明细 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
17			ExecID	CBT20130818800040	成交编号 格式：CBTyyyyMMdd+8+5 位流水号
120			SettlCurrency	CNY	结算币种 CNY
32			LastQty	1200000	券面总额 单位：元，整数 传输做市商的中标量
37			OrderID	20130818024076	订单编号 传输做市支持编码 格式为：yyyymmdd+02+4 位流水
44			Price	98.0000	净价 单位：元，精度：4位
48			SecurityID	010004	债券代码 传输该做市支持的债券代 码信息
55			Symbol	01 国债 04	债券名称 传输该做市支持的债券名 称信息
60			TransactTime	20070820-12:40:00.0 00	业务发生时间 格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
64			SettlDate	20070822	结算日

					格式: YYYYMMDD 见款付券时, 为资金划付日; 见券付款时, 为债券交割日; 券款对付时, 为结算日
75			TradeDate	20070821	成交日期 格式: YYYYMMDD
119			SettlCurrAmt	1000.00	结算金额 单位: 元, 精度: 2 位
150			ExecType	F	成交状态 F-成交 4-撤销 做市支持成功时传输成交竞价结果超时未确认变为做市支持成功后场务应急拒绝后做市支持终止时传输撤销
159			AccruedInterestAmt	1000.00000	应计利息 单位: 元, 精度: 5 位 本币收益率和净价计算接口返回的应计利息信息
919			DeliveryType	0	结算方式 0-DVP-券款对付 4-PUD-见券付款 5-DUP-见款付券
11143			ClearingMethod	13	清算方式: 13-自行清算
10002			AccruedInterestTotalAmt	23123.23	应计利息总额 单位: 元, 精度: 2 位
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识 Y-YES N-NO 当做市支持成功时传输否竞价结果超时未确认变为做市支持成功后场务应急拒绝后做市支持终止时传输是
10048			DirtyPrice	99.2300	全价单位: 元, 精度: 4 位
10105			DealTransType	0	成交传输动作状态

					0-成交单录入 2-成交单撤销 做市支持成功时传输成交 录入 竞价结果超时未确认变为 做市支持成功后场务应急 拒绝后做市支持终止时传 输成交单撤销
10176			MarketIndicator	4	市场标识: 4-现券买卖
10243			TermToMaturity	Y1M2D3	待偿期 格式分为: YxMxDx、MxDx、 Dx Y≠0, 格式为: YxMxDx Y=0, M≠0, 格式为: MxDx Y=0, M=0, 格式为: Dx D=0, 格式为 D0 传输标的债券的待偿期信 息
10282			RemarkIndicator	N	有无补充条款 N-N0
10351			CashBondIndicator	Y	Y-现券
10312			TradeCashAmt	23034232.00	交易金额 单位: 元, 精度: 2 位
10318			TradeTime	12:40:50	成交时间 格式为: HH:mm:ss
10319			TradeType	2	成交类别 2-做市成交
10317			TradeMethod	3	交易方式 3-竞价
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据
54			Side	1	交易方向 1-买入 4-卖出 发给买入方时, 为买入; 发给卖出方时, 为卖出。
232			NoStipulations	1	
→	233		StipulationType	Yield2	到期收益率
→	234		StipulationValue	0.2000	单位: %, 精度:4 位;
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	机构六位码

→	452		PartyRole	119	119-买入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-交易员电话 买入方交易员电话信息， 如无则传输“-”
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称 当买入方为做市商且为机 构用户录入竞价时，传输 最后竞价录入成功的交易 员姓名 当买入方为财政部时，传 输“-” 当买入方为做市商且为场 务应急录入时，传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号 如买入方为财政部且未填 写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行 如买入方为财政部且未填 写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号 如买入方为财政部且未填 写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名 如买入方为财政部且未填 写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构 如买入方为财政部且未填 写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号 如买入方为财政部且未填 写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	

→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名 如买入方为财政部且未填写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	CFETS	CFETS-银行间/交易中心会员
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组/机构来源说明： 当 803=29, 523=CFETS，表示机构来源为银行间/交易中心会员且交易成员群组为银行间；
→	→	523	PartySubID	上海银城中路 188 号交通银行总行金融市场部	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址 买入方地址信息，如无则传输“-”
→	→	523	PartySubID	张三	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称 当买入方为做市商且为机构用户录入竞价时，传输最后竞价录入成功的交易员姓名 当买入方为财政部时，传输“-” 当买入方为做市商且为场务应急录入时，传输“-”
→	→	523	PartySubID	交通银行	
→	→	803	PartySubIDType	125	中文简称
→	→	523	PartySubID	交通银行股份有限公司	
→	→	803	PartySubIDType	124	中文全称
→	→	523	PartySubID	BCOH	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	448		PartyID	XXXX	机构代码
→	452		PartyRole	120	120-卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	021-38579255	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话 卖出方交易员电话信息，如无则传输“-”

→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称 当卖出方为做市商且为机构用户录入竞价时，传输最后竞价录入成功的交易员姓名 当卖出方为财政部时，传输“-” 当卖出方为做市商且为场务应急录入时，传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号 如卖出方为财政部且未填写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行 如卖出方为财政部且未填写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号 如卖出方为财政部且未填写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名 如卖出方为财政部且未填写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构 如卖出方为财政部且未填写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号 如卖出方为财政部且未填写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名 如卖出方为财政部且未填写，则传输“-”
→	→	523	PartySubID	CFETS	CFETS-银行间/交易中心会员
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组/机构来源

					说明：当 803=29, 523=CFETS，表示 机构来源为银行间/交易 中心会员且交易成员群组 为银行间；
→	→	523	PartySubID	上海银城中路188号交 通银行总行金融市场 部	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址 卖出方地址信息，如无则 传输“-”
→	→	523	PartySubID	李四	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称 当卖出方为做市商且为机 构用户录入竞价时，传输 最后竞价录入成功的交易 员姓名 当卖出方为财政部时，传 输“-” 当卖出方为做市商且为场 务应急录入时，传输“-”
→	→	523	PartySubID	交通银行	
→	→	803	PartySubIDType	125	中文简称
→	→	523	PartySubID	交通银行股份有限公 司	
→	→	803	PartySubIDType	124	中文全称
→	→	523	PartySubID	BCOH	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.6 债券远期市场

债券远期市场关键域见表57。

表57 债券远期市场关键域

业务场景		下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	债券远期	ExecutionReport (MsgType=8)	根据<Parties>中的会员代 码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区 分买方或者卖方 根据<Side>中的交易方向可 区分该成交数据是买方的还

			是卖方
--	--	--	-----

6.4.6.1 成交业务要素

成交业务要素见表58。

表58 成交业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:mm:ss
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
Trader 本方交易员	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
Counterparty 对手方	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 机构 ID 用 448 (PartyID)	
CounterpartyTrader 对手方交易员	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
TradeMemberGroup 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CNFTZ 表示国际 803=29, 523=CFETS 表示银行间
Direction 交易方向	54Side	1-买入 4-卖出
BondCode 债券代码	309UnderlyingSecurityID	
BondName	311UnderlyingSymbol	

债券名称		
SettlCurrency 结算币种	120 SettlCurrency	例如：CNY
ForwardCleanPrice 远期净价	810UnderlyingPx	单位：元，精度：4 位
ForwardStikeYield 远期行权收益率	当 888UnderlyingStipType 取值 StrikeYield 则 889UnderlyingStipValue 表示远期行 权收益率	单位：%，精度：4 位
ForwardYield 远期收益率	使用 UnderlyingStipulations 组件来 存放首期和到期收益率信息， 888UnderlyingStipType 取值 为 Yield2 时 表 示 889UnderlyingStipValue 取值为远期 收益率	单位：%，精度：4 位
TotalFaceValue 券面总额	32LastQty 对单个券种的券面总额合计使用 879UnderlyingQty	单位：元，整数
TradeAmount 交易金额	10312TradeCashAmt	单位：元，精度：2 位
Term 合约期限	10316TradeLimitDays	单位：天，整数
SettlementDate 结算日	64SettlDate	YYYYMMDD
AccruedInterest 应计利息	10321UnderlyingAccruedInterestAmt 单个券种的应计利息	单位：元，精度：5 位
DirtyPrice 全价	882UnderlyingDirtyPrice	单位：元，精度：4 位
TotalAccruedInterest 应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位：元，精度：2 位
SettlementAmount 结算金额	119SettlCurrAmt	单位：元，精度：2 位
SettlementMethod 结算方式	919DeliveryType	0-券款对付 4-见券付款 5-见款付券
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator 当 10282 取值 Y 时，可以查看 58Text 域取补充条款信息	Y-YES N-NO
DealStatus 交易状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急

UpdateDate 更新日	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
CollateralIndicator 有无保证品	10158MarginRequired	N-无
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
TermToMaturity 待偿期	10243TermToMaturity	
QuotationNumber 报价编号	117QuoteID	
TradeSymbol 交易品种	48SecurityID	
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	0-录入 1-修改 2-撤销
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	5-债券远期
TradeMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
BuyerAccountDetails 买入账户详细信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber	用 803 (PartySubIDType) 以及	

托管账号	523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
SellerAccountDetails 卖出账户详细信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	

6.4.6.2 成交 IMIX 报文标准

成交IMIX报文标准见表59。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表59 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方

128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	BFD20130818000018	成交编号
117			QuoteID	201308180520000020	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段
120			SettlCurrency	CNY	结算币种
32			LastQty	100000	券面总额 单位：元，整数
48			SecurityID	BFD2M	交易品种
54			Side	1	交易方向
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	更新日
64			SettlDate	20070823	结算日
75			TradeDate	20070821	成交日期
119			SettlCurrAmt	1000.00	结算金额 单位：元，精度：2位
150			ExecType	F	成交状态-成交
919			DeliveryType	0	结算方式 0-券款对付 4-见券付款 5-见款付券
10002			AccruedInterestTotalAmt	130000.00	应计利息总额 单位：元，精度：2位
10022			ContingencyIndicator	N	N-N0
10105			DealTransType	0	报文动作 0-录入 1-修改 2-撤销
10158			MarginRequired	N	有无保证品 N-无
10176			MarketIndicator	5	市场标识： 5-债券远期
10243			TermToMaturity	YxMxDx	待偿期
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10312			TradeCashAmt	996451.00	交易金额 单位：元，精度：2位

10316			TradeLimitDays	21	合约期限 单位：天，整数
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
10318			TradeTime	12:33:34	成交时间
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
711			NoUnderlyings	1	
→	309		UnderlyingSecurityID	100008	债券代码
→	311		UnderlyingSymbol	10 附息国债 08	债券名称
→	879		UnderlyingQty	100000	券面总额 单位：元，整数
→	810		UnderlyingPx	100.0000	远期净价 单位：元，精度：4 位
→	882		UnderlyingDirtyPrice	110.0000	全价 单位：元，精度：4 位
→	10321		UnderlyingAccruedInterestAmt	10.00000	应计利息 单位：元，精度：5 位
→	887		NoUnderlyingStips	2	
→	→	888	UnderlyingStipType	StrikeYield	远期行权收益率
→	→	889	UnderlyingStipValue	0.2500	单位：%，精度：4 位
→	→	888	UnderlyingStipType	Yield2	远期收益率
→	→	889	UnderlyingStipValue	0.2000	单位：%，精度：4 位
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	119-买入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	

→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	

→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

客户端收到ExecutionReport报文后会回调到Listener接口的实现类里，用户可以在onMessage()方法里解析并处理报文。下面的例子说明了如何得到报文里域和组件的值。

```
public void onMessage (ExecutionReport executionReport) throws FieldNotFound, UnsupportedMessageType, IncorrectTagValue
```

```
{
    //getexecIDvalue
    ExecID execID = new ExecID();
    executionReport.get(execID);
    //gettradedatevalue
    TradeDate tradeDate = new TradeDate();
    executionReport.get(tradeDate);

    //noPartyIDsisagrouphere, we will try to extract it
    ExecutionReport.NoPartyIDs noPartyIDs = new ExecutionReport.NoPartyIDs();
    PartyID partyID = new PartyID();
    PartyRole partyRole = new PartyRole();
```

```
    ExecutionReport.NoPartyIDs.NoPartySubIDs noPartySubIDs = new ExecutionReport.NoPartyIDs.NoPartySubIDs();
```

```
    PartySubID partySubID = new PartySubID();
    PartySubIDType partySubIDType = new PartySubIDType();
    for (int i = 1; i <= executionReport.get(new MixField.NoPartyIDs()).getValue(); i++) {
        executionReport.getGroup(i, noPartyIDs);
        noPartyIDs.get(partyID);
        noPartyIDs.get(partyRole);
        for (int j = 1; j <= noPartyIDs.get(new MixField.NoPartySubIDs()).getValue(); j++) {
```

```

noPartyIDs. getGroup(j, noPartySubIDs);
noPartySubIDs. get (partySubID);
noPartySubIDs. get (partySubIDType);
}
}
}

```

6.4.7 标准债券远期市场

6.4.7.1 标准债券远期成交业务要素

根据业务需求规格说明书定义，标准债券远期成交业务要素见表60。

表60 标准债券远期成交业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DealDate 成交日期	75TradeDate	格式：YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	格式：HH:MM:SS 或 HH:MM:SS. sss
DealNumber 成交编号	17ExecID	取值同实际系统实现
DealStatus TradeMethod 成交状态	150ExecType	F-正常 4-撤销
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	43-标准债券远期
UpdateDate 业务发生时间	60TransactTime	格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS 或者 YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
Direction 交易方向	54Side	1-买入 4-卖出 当 54Side 取值 1 时，452=119 表示本方，452=120 表示对手方。当 54Side 取值 4 时，452=120 表示本方，452=119 表示对手方。 当清算方式为上海清算所清算时，对手方信息需为清算所信息；
TradeMethod 交易方式	10317TradeMethod	3-竞价
ContractSymbol	48SecurityID	合约代码

合约品种		
TradeSymbol 交易品种	1151SecurityGroup	品种名称
SettlementDate 交割日	64SettlDate	格式: YYYYMMDD
成交价格 (元)	31LastPx	精度: 4
成交量 (元)	32LastQty	精度: 0
ClearingMethod 清算方式	使用 ClearingReferenceData 组件存放清算信息, 其中, 11143ClearingMethod 表示清算方式	11143ClearingMethod 6-上海清算所清算 13-双边自行清算
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	Y-YES N-NO
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	补充条款
ClosePositionIndicator 是否强平交易	11207ClosePositionIndicator	Y-是 N-否
BuyerInformation 买入方信息		
BuyerPartyID 买入方机构 ID	448PartyID 填写机构 ID	机构代码为 6 位, 取值同实际系统实现
Buyer Short Name of Firm 买入方机构简称	803PartySubIDType 取值 102 表示机构简称 523PartySubID 填写买入方机构简称	取值同实际系统实现
Buyer Full Chinese Name of Firm 买入方机构中文全称	803PartySubIDType 取值 124 表示机构中文全称 523PartySubID 填写买入方机构中文全称	取值同实际系统实现
Buyer Short Chinese Name of Firm 买入方机构中文简称	803PartySubIDType 取值 125 表示机构中文简称 523PartySubID 填写买入方机构中文简称	取值同实际系统实现
Buyer Trader Name 买入方交易员名称	803PartySubIDType 取值 101 表示交易员名称 523PartySubID 填写买入方交易员英文名称	取值同实际系统实现
Buyer Trader Chinese Name 买入方交易员中文名称	803PartySubIDType 取值 126 表示交易员中文名称 523PartySubID 填写买入方交易员中文名称	取值同实际系统实现
Buyer Trader Telephone Number 买入方交易员电话	使用 Parties 组件下的 ContactInfoGrp 组件	取值同实际系统实现

	10602ContactInfoID 10603=6ContactInfoIDType, 表示交易 员电话	
Buyer Party Address 买入方机构地址	803PartySubIDType 取值 6 表示地址 523PartySubID 填写买入方机构地址	取值同实际系统实现
SellerInformation 卖出方信息		
SellerPartyID 卖出方机构 ID	448PartyID 填写机构 ID	机构代码为 6 位, 取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段传输上海清算所机构 ID
SellerShort Name of Firm 卖出方机构简称	803PartySubIDType 取值 102 表示机构 简称 523PartySubID 填写卖出方机构简称	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段传输上海清算所机构简称
Seller Full Chinese Name of Firm 卖出方机构中文全称	803PartySubIDType 取值 124 表示机构 中文全称 523PartySubID 填写卖出方机构中文 全称	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段传输上海清算所机构中文全称
SellerShort Chinese Name of Firm 卖出方机构中文简称	803PartySubIDType 取值 125 表示机构 中文简称 523PartySubID 填写卖出方机构中文 简称	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段传输上海清算所机构中文简称
SellerTrader Name 卖出方交易员名称	803PartySubIDType 取值 101 表示交易 员名称 523PartySubID 填写卖出方交易员英 文名称	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输
SellerTrader Chinese Name 卖出方交易员中文名称	803PartySubIDType 取值 126 表示交易 员中文名称 523PartySubID 填写卖出方交易员中 文名称	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输
SellerTrader Telephone Number 卖出方交易员电话	使用 Parties 组件 下的 ContactInfoGrp 组件 10602ContactInfoID 10603=6ContactInfoIDType, 表示卖出 方交易员电话	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输
Seller Party Address 卖出方机构地址	803PartySubIDType 取值 6 表示地址 523PartySubID 填写卖出方机构地址	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输
BuyerAccountDetails 买入方账户信息		
Buyer SettlementAccountName 买入方资金账户户名	803PartySubIDType 取值 23 表示资金 账户户名 523PartySubID 填写买入方资金账户	取值同实际系统实现

	户名	
Buyer SettlementBankName 买入方资金开户行	803PartySubIDType 取值 110 表示资金 开户行 523PartySubID 填写买入方资金开户 行	取值同实际系统实现
Buyer SettlementAccountNumber 买入方资金账号	803PartySubIDType 取值 15 表示资金 账号 523PartySubID 填写买入方资金账号	取值同实际系统实现
Buyer BankSortCode 买入方支付系统行号	803PartySubIDType 取值 112 表示支付 系统行号 523PartySubID 填写买入方支付系统 行号	取值同实际系统实现
Buyer CustodianAccountName 买入方托管账户户名	803PartySubIDType 取值 22 表示托管 账户户名 523PartySubID 填写买入方托管账户 户名	取值同实际系统实现
Buyer CustodianName 买入方托管机构	803PartySubIDType 取值 111 表示托管 机构名称 523PartySubID 填写买入方托管机构	取值同实际系统实现
Buyer CustodianAccountNumber 买入方托管账号	803PartySubIDType 取值 10 表示托管 账号 523PartySubID 填写买入方托管账号	取值同实际系统实现
SellerAccountDetails 卖出方账户信息		
Seller SettlementAccountName 卖出方资金账户户名	803PartySubIDType 取值 23 表示资金 账户户名 523PartySubID 填写卖出方资金账户 户名	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输
Seller SettlementBankName 卖出方资金开户行	803PartySubIDType 取值 110 表示资金 开户行 523PartySubID 填写卖出方资金开户 行	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输
Seller SettlementAccountNumber 卖出方资金账号	803PartySubIDType 取值 15 表示资金 账号 523PartySubID 填写卖出方资金账号	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输
Seller BankSortCode 卖出方支付系统行号	803PartySubIDType 取值 112 表示支付 系统行号 523PartySubID 填写卖出方支付系统 行号	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输
Seller CustodianAccountName 卖出方托管账户户名	803PartySubIDType 取值 22 表示托管 账户户名 523PartySubID 填写卖出方托管账户	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字 段不传输

	户名	
Seller CustodianName 卖出方托管机构	803PartySubIDType 取值 111 表示托管机构名称 523PartySubID 填写卖出方托管机构	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字段不传输
Seller CustodianAccountNumber 卖出方托管账号	803PartySubIDType 取值 10 表示托管账号 523PartySubID 填写卖出方托管账号	取值同实际系统实现 如果清算方式为上海清算所清算, 该字段不传输

6.4.7.2 标准债券远期成交（上海清算所所清算）IMIX 报文标准

当清算方式为“上海清算所清算”时，对手方为上海清算所。

标准债券远期成交（上海清算所清算）IMIX报文标准见表61。

表61 标准债券远期成交（上海清算所所清算）IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文体长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
75			TradeDate	20141102	成交日期
10318			TradeTime	06:02:33	成交时间
17			ExecID	XXXX	成交编号
150			ExecType	F	成交状态 F-正常 4-撤销
10022			ContingencyIndicator	Y	Y-Yes; N-No 当 10022 取值 N, 150=F 表示正常成交, 当 10022 取值 Y, 150=4 表示场

					务应急撤销
10176			MarketIndicator	43	标准债券远期
60			TransactTime	20141102-10:22:23.000	业务发生时间 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS 或 者 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
10465			DataCategoryIndicator	0	数据标识 0-本方数据 2-关联机构数据
54			Side	1	交易方向 1-买入 4-卖出
10317			TradeMethod	3	交易方式 3-竞价
48			SecurityID	XXXX	合约代码
1151			SecurityGroup	XXXX	品种名称
64			SettlDate	20141203	交割日
31			LastPx	50.0000	单位为: 元, 精度 4
32			LastQty	100000	单位为: 元, 精度: 0
11143			ClearingMethod	6	上海清算所清算
10282			RemarkIndicator	Y	当 10282 取 Y 时, 传输 58 号域, 当 10282 取 N, 则不 传输 58 号域
58			Text	XXXX	
11207			ClosePositionIndicator	Y	Y-是 N-否
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	机构 ID, 6 位码
→	452		PartyRole	119	119-买入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	交易员电话
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名

→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	机构简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员英文名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	448		PartyID	XXXX	清算所的 ID
→	452		PartyRole	120	120-卖出方
→	802		NoPartySubIDs	3	
→	→	523	PartySubID	Shanghai Clearing House	
→	→	803	PartySubIDType	102	机构简称
→	→	523	PartySubID	上海清算所	
→	→	803	PartySubIDType	124	机构中文全称
→	→	523	PartySubID	上海清算所	
→	→	803	PartySubIDType	125	机构中文简称
StandardTrailer					
10			Checksum	XXXX	

6.4.7.3 标准债券远期成交（双边自行清算）IMIX 报文标准

标准债券远期成交（双边自行清算）IMIX报文标准见表62。

表62 标准债券远期成交（双边自行清算）IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					

8			BeginString	IMIX.1.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文体长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
75			TradeDate	20141102	成交日期
10318			TradeTime	06:02:33	成交时间
17			ExecID	XXXX	成交编号
150			ExecType	F	成交状态 F-正常 4-撤销
10022			ContingencyIndicator	Y	Y-Yes; N-No 当 10022 取值 N, 150=F 表示正常成交, 当 10022 取值 Y, 150=4 表示场务应急撤销
10176			MarketIndicator	43	标准债券远期
60			TransactTime	20141102-10:22:23.000	业务发生时间 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS 或 者 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
10465			DataCategoryIndicator	0	数据标识 0-本方数据 2-关联机构数据
54			Side	1	交易方向 1-买入 4-卖出
10317			TradeMethod	3	交易方式

					3-竞价
48			SecurityID	XXXX	合约代码
1151			SecurityGroup	XXXX	品种名称
64			SettlDate	20141203	交割日
31			LastPx	50.0000	单位为：元，精度：4
32			LastQty	100000	单位为：元，精度：0
11143			ClearingMethod	13	双边自行清算
10282			RemarkIndicator	Y	当 10282 取 Y 时， 传输 58 号域，当 10282 取 N，则不 传输 58 号域
58			Text	XXXX	
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	机构 ID，6 位码
→	452		PartyRole	119	119-买入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	交易员电话
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	机构简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	机构中文全称

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员英文名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	448		PartyID	XXXX	机构 ID, 6 位码
→	452		PartyRole	120	120-卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	交易员电话
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	机构简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员英文名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
StandardTrailer					
10			Checksum	XXXX	

6.4.8 利率互换市场

利率互换市场关键域见表63。

表63 利率互换市场关键域

业务场景			下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	利率互换市场	成交数据	ExecutionReport (Msg Type=8)	根据<Parties>中的会员代码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区分买方或者卖方 根据<Side>中的交易方向可区分该成交数据是买方的还是卖方

6.4.8.1 成交数据

6.4.8.1.1 固定-浮动成交业务要素

固定-浮动成交业务要素见表64。

表64 固定-浮动成交业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:MM:SS
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价 3-竞价 4-请求 5-点击成交 当交易方式为行权时，传输 828TrdType（值为 45），此时不传输 10317 当交易方式不是行权时，传输 10317，不传输 828TrdType
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
QuoteNumber 报价编号	117QuoteID	若交易方式为行权时，不传输报价编号

RFQNumber 请求报价编号	10471Reference	请求报价成交, 使用请求报价编号, 其他报价成交, 对应报价编号
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	Y-YES N-NO
Trader 本方交易员	当报文中 Side 取值为 J 时, 此报文表示利率互换固定对浮动交易。	
CounterParty 对手方	当 <InstrmtLegExecGrp> 组件中 624LegSide 取 值 为 1 ,	
CounterpartyTrader 对手方交易员	686LegPriceType 取 值 为 3 , 452PartyRole 取值为 119 时, 表示固定利率支付方 (亦即浮动利率收取方), 此时该<Parties>组件中取值 119 下的信息为本方信息, 取值 120 下的信息为对手方信息。反之, 当 <InstrmtLegExecGrp> 组件中 624LegSide 取 值 为 4 , 686LegPriceType 取 值 为 3 , 452PartyRole 取值为 120 时, 表示固定利率收取方 (亦即浮动利率支付方), 此时该<Parties>组件中取值 120 下的信息为本方信息, 取值 119 下的信息为对手方信息。 另外, 在利率互换固定对浮动产品中, 624 取值为 1 或者 4 皆表示利率互换产品中的固定端信息, 624 取值为 B 时表示利率互换产品中的浮动端信息。 交易员名称用 <Parties> 组件中的 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的。当 803 域取值为 101 时, 523 域中的填写内容为交易员名称信息。	
TradeMemberName 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CNFTZ 表示国际 803=29, 523=CFETS 表示银行间
Direction 交易方向	54SideJ 为固定-浮动 LegSide=1 以及 LegSide=B 时表示固定利率支付方 LegSide4 浮动利率支付方 (固定利率收取方)	
TradingProduct	48SecurityID	标准利率互换和普通利率互换使用

交易品种代码	为标准品种时传交易品种代码,为非标准品种时该域传字符串“User-Defined”	48SecurityID和55Symbol的合约名前缀进行区分,区分方式详见本文档4.22节
TradeSymbol 交易品种名称	55Symbol 为标准品种时根据需要传交易品种名称,为非标准品种时该域填非标准品种的名称	标准利率互换和普通利率互换使用48SecurityID和55Symbol的合约名前缀进行区分,区分方式详见本文档4.22节
Term 期限	10316TradeLimitDays	
NotionalAmount 名义本金金额	32LastQty	单位:元,整数
InterestAccrualDaysAdjustment 计息天数调整	10018InterestAccrualDaysAdjustment	0-不调整 1-实际天数调整
StartDate 起息日	916StartDate	YYYYMMDD
FirstPeriodStartDate 首期起息日	10054FirstPeriodStartDate	YYYYMMDD
EndDate 到期日	917EndDate	YYYYMMDD
CouponPaymentDateReset 支付日调整	10009CouponPaymentDateReset	0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
CalculateAgency 计算机构	10346CalculateAgency	0-中国外汇交易中心 1-卖出方 2-买入方 3-交易双方
ClearingMethod 清算方式	使用 ClearingReferenceData 组件存放清算信息,其中,11143ClearingMethod表示清算方式	11143ClearingMethod 6-集中清算 13-自行清算
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	2-利率互换
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	0-录入 1-修改 2-撤销
Status 状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
FixedRateDetails 固定利率明细		

FixedRate 固定利率	LegPriceType 取 3 566LegPrice 为固定利率	单位：%，精度：4 位
PaymentFrequency 付息频率	10096LegCouponPaymentFrequency	0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-天
FirstPaymentDate 首期支付日	248LegCouponPaymentDate	YYYYMMDD
DayCount 计息基准	10097LegDayCount	0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
FloatingRateDetails 浮动利率明细		
Benchmark 参考利率	677LegBenchmarkCurveName	
Spread 利差	10090LegBenchmarSpread	单位：bps，精度：2 位
FirstRegularPaymentDate 首期付息日	248LegCouponPaymentDate	YYYYMMDD
PaymentFrequency 支付周期	10096LegCouponPaymentFrequency	0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-天
FirstFixingDate 首期利率确定日	956LegInterestAccrualDate	YYYYMMDD
ResetFrequency 重置频率	10108LegInterestAccrualResetFrequency	0-半年 1-年 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-天

InterestMethod 计息方式	10106LegInterestAccrualMethod	0-单利 1-复利
DayCountConvention 计息基准	10097LegDayCount	0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
FixedRatePayerAccountDetails 固定利率支付方账户详细信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
FloatingRatePayerAccountDetails 浮动利率支付方账户详细信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	

6.4.8.1.2 固定-浮动成交 IMIX 报文标准

固定-浮动成交IMIX报文标准见表65。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表65 固定-浮动成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	IRS20130818000003	成交编号
32			LastQty	1200000	名义本金金额 单位：元，整数
48			SecurityID	XXXX	标准利率互换和普通利率 互换使用 48SecurityID 和 55Symbol 的合约名前 缀进行区分，区分方式详 见本文档 4.22 节
55			Symbol	XXXX	
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间
916			StartDate	20080822	起息日
75			TradeDate	20070821	成交日期
117			QuoteID	201308180220000008	报价编号 当成交报文为应急场务操 作产生时，报文中将不包 含报价编号业务字段 若交易方式为行权时，不 传输报价编号
10471			Reference	XXX	请求报价编号 当交易方式为请求时发送
150			ExecType	F	成交状态-成交
917			EndDate	20070921	到期日
10009			CouponPaymentDateReset	1	支付日调整 0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
10022			ContingencyIndicato	N	应急标识

			r		
10105			DealTransType	0	报文动作 0-录入 1-修改 2-撤销
10018			InterestAccuralDays Adjustment	0	计息天数调整 0-不调整 1-实际天数调整
10054			FirstPeriodStartDate	20080901	首期起息日
10176			MarketIndicator	2	市场标识: 2-利率互换
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10316			TradeLimitDays	60	期限
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价 3-竞价 4-请求 5-点击成交
828			TrdType	45	45-行权 当交易方式为行权时, 传输 828TrdType (值为 45), 此时不传输 10317 当交易方式不是行权时, 传输 10317, 不传输 828TrdType
10318			TradeTime	12:24:23	成交时间
10346			CalculateAgency	0	计算机构 0-中国外汇交易中心 1-卖出方 2-买入方 3-交易双方
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
54			Side	J	交易方向 固定-浮动
11143			ClearingMethod	6	清算方式 6-集中清算 13-自行清算
555			NoLegs	2	
→	624		LegSide	1	1-固定利率支付
→	686		LegPriceType	3	3-固定值

→	566		LegPrice	7.6200	固定利率 单位：%，精度：4位
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	6	付息频率 0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-天
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	首期支付日
→	10097		LegDayCount	0	计息基准 0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
→	624		LegSide	B	B-基准端
→	686		LegPriceType	6	6-浮动值
→	677		LegBenchmarkCurveName	SHIBOR6M	参考利率
→	10090		LegBenchmarkSpread	50.00	利差 单位：bps，精度：2位
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	首期付息日
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	6	支付周期 0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-天
→	956		LegInterestAccrualDate	20080822	首期利率确定日
→	10108		LegInterestAccrualResetFrequency	6	重置频率 0-半年 1-年 3-月

					4-季 5-两周 6-周 7-天
→	10106		LegInterestAccrualMethod	0	计息方式 0-单利 1-复利
→	10097		LegDayCount	0	计息基准 0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	119-固定利率支付方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	11	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间

→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-固定利率收取方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	11	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.8.1.3 浮动-浮动成交业务要素

浮动-浮动成交业务要素见表66。

表66 浮动-浮动成交业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate	75TradeDate	YYYYMMDD

成交日期		
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:MM:SS
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价 5-点击成交
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
QuoteNumber 报价编号	117QuoteID	
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	Y-YES N-NO
Trader 本方交易员	前提 Side 取值为 K 表示浮动-浮动， LegSide 取值为 1，则表明报文是参考 利率 1 支付方的成交信息，则 PartyRole 取值为 119 表示该方为参考 利率 1 支付方(参考利率 2 收取方)，所 以该交易方信息为本方信息，则 PartyRole 为 120 的为对手方(参考 利率 2 支付方或者参考利率 1 收取方) LegSide 取值为 4，则表明报文是参考 利率 2 支付方(参考利率 1 收取方)的成 交信息，则 PartyRole 取值为 119 的交 易方信息为对手方信息，则 PartyRole 为 120 的为本方。 交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的， 用 803=101 表示 523 为交易员名称， 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信 息。	
CounterParty 对手方		
CounterpartyTrader 对手方交易员		
Direction 交易方向	54SideK 为浮动-浮动 LegSide1 参考利率 1 支付方 LegSide4 参考利率 1 收取方	

TradingProduct 交易品种代码	48SecurityID 为标准品种时传交易品种代码,为非标准品种时该域传字符串“User-Defined”	
Term 期限	10316TradeLimitDays	
NotionalAmount 名义本金金额	32LastQty	
StartDate 起息日	916StartDate	
FirstPeriodStartDate 首期起息日	10054FirstPeriodStartDate	
EndDate 到期日	917EndDate	
DisputeSettlementMethod 争议解决方式	10051DisputeSettlementMethod	
CalculateAgency 计算机构	10346CalculateAgency	
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	
InitialExchangePrincipal 初始交换本金	10068IniExAmount	
InitialExchangeDate 初始交换日	10069IniExDate	
InitialExchangeDirection 初始交换方向	10070IniExDirIndicator	1-买/固定利率支付 4-卖/固定利率收取
InitialExchangeIndicator 初始交换标志位	10071IniExReqIndicator	
CollateralIndicator 有无保证品	10158MarginRequired	
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	
CollateralDetails 保证品信息		
CashAmount 保证金金额	使用重复组 <MarginAMTGrp>10150MarginAMT	
BondCode 保证券代码	使用重复组 <MarginSecuritiesGrp>10159MarginSecuritiesID	
BondName	使用重复组	

保证券名称	<MarginSecuritiesGrp>10173MarginSymbol	
FaceValue 券面总额	使 用 重 复 组 <MarginSecuritiesGrp>10150MarginAMT	
TotalFaceValue 券面总额合计	使 用 重 复 组 <MarginInfoGrp>10161MarginTotalAmount	
CollateralSettlementDate 保证金/券提交日	10162MarginSubmitDate	
CollateralChangeIndicator 保证金/券变动标识	10157MarginReplacement	Y-可更改, N-不可更改
Benchmark1Details		
参考利率 1 明细		
LegSide取值为1或者4的InstrmtLegExecGrp重复组块, 表示参考利率1端		
Benchmark1 参考利率 1	LegPriceType 取 6 677LegBenchmarkCurveName 为参考利率 1	
Spread1 利差 1	10090LegBenchmarkSpread	
FirstregularPaymentDate 首期支付日	248LegCouponPaymentDate	
PaymentFrequency 支付周期	10096LegCouponPaymentFrequency	
FirstFixingDate 首期利率确定日	956LegInterestAccrualDate	
ResetFrequency 重置频率	10108LegInterestAccrualResetFrequency	
InterestMethod 计息方式	10106LegInterestAccrualMethod	
DayCountConvention 计息基准	10097LegDayCount	
PaymentDateAdjustment 计息天数调整	10588LegInterestAccrualDaysAdjustment	
PaymentDateAdjustment 支付日调整	10095LegCouponPaymentDateReset	
Benchmark2Details		
参考利率 2 明细		
LegSide取值为B的InstrmtLegExecGrp重复组块, 表示参考利率1端		
Benchmark2 参考利率 2	LegPriceType 取 6 677LegBenchmarkCurveName 为参考利率 2	

Spread2 利差 2	10090LegBenchmarSpread	
FirstRegularPaymentDate 首期付息日	248LegCouponPaymentDate	
PaymentFrequency 支付周期	10096LegCouponPaymentFrequency	
FirstFixingDate 首期利率确定日	956LegInterestAccrualDate	
ResetFrequency 重置频率	10108LegInterestAccrualResetFrequency	
InterestMethod 计息方式	10106LegInterestAccrualMethod	
DayCountConvention 计息基准	10097LegDayCount	
InterestAccrualDaysAdjustment 计息天数调整	10588LegInterestAccrualDaysAdjustment	
PaymentDateAdjustment 支付日调整	10095LegCouponPaymentDateReset	
InitialExchange 初始交换		
Payer 支付方	由 Side 和 PartyRole 可以判断本方 PartyID 使用 10070IniExDirIndicator 域取值来判断本方是支付方还是接受方。	
Receiver 接收方		
ExchangeDate 交换日	10069IniExDate	
Amount 金额	10068IniExAmount	
NotionalReset 名义本金重置		
NotionalResetType 名义本金重置类型	102270rdQtyResetType	
NotionalResetPercentage 名义本金重置百分比	102250rdQtyResetPercentage	在本币交易系统操作界面中,当点击选择名义本金重置百分比时,名义本金重置金额为不可填状态,同样在选择名义本金重置金额时,名义本金重置百分比一栏为不可填状态。在 IMIX 报文示例中名义本金重置百分比与名义重置金额分别对应两个域将都存在,不过在实际使用中仅需传输对应选择一个。

NotionalResetRequired 名义本金重设要求	102260rdQtyResetRequired	
NotionalResetFrequency 名义本金重置频率	102240rdQtyResetFrequency	
FirstNotionalResetDate 首期名义本金重置日	102230rdQtyResetDate	
NotionalResetAmount 名义本金重置金额	102220rdQtyResetAmount	在本币交易系统操作界面中,当点击选择名义本金重置百分比时,名义本金重置金额为不可填状态,同样在选择名义本金重置金额时,名义本金重置百分比一栏为不可填状态。在 IMIX 报文示例中名义本金重置百分比与名义重置金额分别对应两个域将都存在,不过在实际使用中仅需传输对应选择的一个。
FrontStub 前端残段		
Benchmark1Payer 参考利率 1 支付方	根据该笔成交报文中 Parties 组件里的信息取得, 如果 PartyRole 取值为 119, 则交易方信息为参考利率 1 支付方,对应的 PartyID 为该支付方的会员代码	
Benchmark2Payer 参考利率 2 支付方	PartyRole 为 120 对应的 PartyID 为参考利率 2 支付方(参考利率 1 收取方),对应的 PartyID 为该支付方的会员代码	
Benchmark1 参考利率 1	参考参考利率 1 明细部分说明	
Benchmark2 参考利率 2	参考参考利率 2 明细部分说明	
Spread1 利差 1	参考参考利率 1 明细部分说明	
Spread2 利差 2	参考参考利率 2 明细部分说明	
StubIndicator 前后端残段标识	10300StubIndicator	0-没有残段 1-前端残段标识 2-后端残段标识
FixingDate-Benchmark1 利率确定日-参考利率 1	10303StubRateFixedDate	
FixingDate-Benchmark2 利率确定日-参考利率 2	10099StubRateFixedDate2	
Status	150ExecType	F-成交

状态		4-撤销 5-更新 101-应急
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
Benchmark1PayerAccountDetails 参考利率 1 支付方账户详细信息 由 PartyRole 决定为参考利率 1 支付方		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示中文资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
Benchmark2PayerAccountDetails 参考利率 2 支付方账户详细信息 由 PartyRole 决定为参考利率 2 支付方		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
Benchmark1PayerCollateralDetails 参考利率 1 支付方保证品明细 由 PartyRole 决定为参考利率 1 支付方		
CollateralAgencyName 保证品管理机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的	

	803=132 保证品管理机构代码	
CashAmount 保证金金额	在 组 件 MarginInfoGrp 中 , MarginAMTGrp 用来存放具体保证金信 息 , 在 MarginAMTGrp 组件中的 10150MarginAMT 域用来表示保证金金 额	
BondCode(1/2/.../10) 保证券代码(1/2/.../10)	在 组 件 MarginInfoGrp 中 , MarginSecuritiesGrp 用来存放具体 保证金信息,在 MarginSecuritiesGrp 组件中的 10159MarginSecuritiesID 域用来表示保证券代码 10211NoMarginSecurities 表示 保证 券种类数目	
BondName(1/2/.../10) 保证券名称(1/2/.../10)	在 组 件 MarginInfoGrp 中 , MarginSecuritiesGrp 用来存放具体 保证金信息,在 MarginSecuritiesGrp 组件中的 10173MarginSymbol 域用来 表示保证券代码	
FaceValue(1/2/.../10) 券面总额(1/2/.../10)	10150MarginAMT 表示单个券种的券面 总额	
TotalFaceValue 券面总额合计	10161MarginTotalAmt 如果只有保证券则该域表示全部券种 的券面总额合计;如果有现金和保证 券,则表示两者的总额合计	
SettlementAccountName 保证金账户户名	用 803(PartySubIDType) 以 及 523(PartySubID) 来组合表示的 803=116	
SettlementBankName 保证金开户行	用 803(PartySubIDType) 以 及 523(PartySubID) 来组合表示的 803=108	
SettlementAccountNumber 保证金账号	用 803(PartySubIDType) 以 及 523(PartySubID) 来组合表示的 803=128	
BankSortCode 保证金开户行联行行号	用 803(PartySubIDType) 以 及 523(PartySubID) 来组合表示的 803=121	
CustodianAccountName 保证券托管账户户名	用 803(PartySubIDType) 以 及 523(PartySubID) 来组合表示的 803=117	
CustodianName	用 803(PartySubIDType) 以 及	

保证证券托管机构	523 (PartySubID) 来组合表示的 803=122	
CustodianAccountNumber 保证证券托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=107	
CollateralSettlementDate 保证金/券提交日	10162MarginSubmitDate 为保证金/券提交日。	
CollateralChangeIndicator 保证金/券变动标识	10157MarginReplacement	
Benchmark2PayerCollateralDetails 参考利率 2 支付方保证品明细 由 PartyRole 决定为参考利率 2 支付方		
CollateralAgencyName 保证品管理机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=132 保证品管理机构代码 803=133 保证品管理机构名称	
CashAmount 保证金金额	在 组 件 MarginInfoGrp 中 , MarginAMTGrp 用来存放具体保证金信 息 , 在 MarginAMTGrp 组 件 中 的 10150MarginAMT 域用来表示保证金金 额	
BondCode (1/2/.../10) 保证证券代码 (1/2/.../10)	在 组 件 MarginInfoGrp 中 , MarginSecuritiesGrp 用来存放具体 保证金信息, 在 MarginSecuritiesGrp 组 件 中 的 10159MarginSecuritiesID 域用来表示保证证券代码 10211NoMarginSecurities 表示 保 证 券 种 类 数 目	
BondName (1/2/.../10) 保证证券名称 (1/2/.../10)	在 组 件 MarginInfoGrp 中 , MarginSecuritiesGrp 用来存放具体 保证金信息, 在 MarginSecuritiesGrp 组 件 中 的 10173MarginSymbol 域用 来 表 示 保 证 券 代 码	
FaceValue (1/2/.../10) 券面总额 (1/2/.../10)	10150MarginAMT 表示单个券种的券面 总额	
TotalFaceValue 券面总额合计	10161MarginTotalAmt 如果只有保证 券则该域表示全部券种的券面总额合 计; 如果有现金和保证券, 则表示两者 的总额合计	
SettlementAccountName 保证金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的	

	803=116	
SettlementBankName 保证金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=108	
SettlementAccountNumber 保证金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=128	
BankSortCode 保证金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=121	
CustodianAccountName 保证证券托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=117	
CustodianName 保证证券托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=122	
CustodianAccountNumber 保证证券托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=107	
CollateralSettlementDate 保证金/券提交日	10162MarginSubmitDate 为保证金/券提交日。	
CollateralChangeIndicator 保证金/券变动标识	10157MarginReplacement	

6.4.8.1.4 浮动-浮动成交 IMIX 报文标准

浮动-浮动成交IMIX报文标准见表67。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表67 浮动-浮动成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识

MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	BSS20130818000004	成交编号
32			LastQty	1200000	名义本金金额
48			SecurityID	XXXX	交易品种
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间
916			StartDate	20080822	起息日
75			TradeDate	20070821	成交日期
117			QuoteID	201308180220000017	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段
150			ExecType	F	成交状态-成交
917			EndDate	20070921	到期日
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
10105			DealTransType	0	0-成交单录入
10051			DisputeSettlementMethod	0	争议解决方式
10054			FirstPeriodStartDate	20080901	首期起息日
10176			MarketIndicator	2	市场标识：2-利率互换
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10158			MarginRequired	N	有无保证品
10226			OrdQtyResetRequired	N	名义本金重设要求
10316			TradeLimitDays	60	期限
10317			TradeMethod	1	交易方式 1--询价 5--点击成交
10318			TradeTime	12:40:50	成交时间
10346			CalculateAgency	0	计算机构
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
54			Side	K	交易方向 K:浮动-浮动
555			NoLegs	2	
→	624		LegSide	1	1-浮动利率收取
→	686		LegPriceType	6	6-浮动值
→	677		LegBenchmarkCurveName	SHIBOR6M	参考利率 1

			me		
→	10090		LegBenchmarkSpread	50	利差 1
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	首期支付日
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	6	支付周期
→	10588		LegInterestAccrualDaysAdjustment	0	计息天数调整
→	10095		LegCouponPaymentDateReset	0	支付日调整
→	956		LegInterestAccrualDate	20080822	首期利率确定日
→	10108		LegInterestAccrualResetFrequency	6	重置频率
→	10106		LegInterestAccrualMethod	0	计息方式
→	10097		LegDayCount	0	计息基准
→	624		LegSide	B	B-基准端
→	686		LegPriceType	6	6-浮动值
→	677		LegBenchmarkCurveName	SHIBOR6M	参考利率 2
→	10090		LegBenchmarkSpread	50	利差 2
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	首期付息日
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	6	支付周期
→	10588		LegInterestAccrualDaysAdjustment	0	计息天数调整
→	10095		LegCouponPaymentDateReset	0	支付日调整
→	956		LegInterestAccrualDate	20080822	首期利率确定日
→	10108		LegInterestAccrualResetFrequency	6	重置频率
→	10106		LegInterestAccrualMethod	0	计息方式
→	10097		LegDayCount	0	计息基准
10207			NoInitialExchange	1	
→	10071		IniExReqIndicator	Y	初始交换标志位
→	10070		IniExDirIndicator	1	初始交换方向：1-买
→	10069		IniExDate	20080822	交换日
→	10068		IniExAmount	1000	金额

10227			OrdQtyResetType	0	名义本金重置类型
10225			OrdQtyResetPercentage	0.05	名义本金重置百分比
10223			OrdQtyResetDate	20080901	首期名义本金重置日
10224			OrdQtyResetFrequency	6	名义本金重置频率
10222			OrdQtyResetAmount	10000	名义本金重置金额
10217			NoStub	1	
→	10300		StubIndicator	1	1-前端残段标识
→	10099		StubRateFixedDate2	20080826	利率确定日-参考利率 1
→	10303		StubRateFixedDate	20080823	利率确定日-参考利率 1
10210			NoMarginInfo	2	
→	10175		MarginType	2	2-债券与现金
→	10155		MarginPartyRole	119	
→	10157		MarginReplacement	N	置换标识
→	10162		MarginSubmitDate	20070821	保证金/券提交日
→	10161		MarginTotalAmt	400000	券面总额合计
→	10211		NoMarginSecurities	1	
→	→	10159	MarginSecuritiesID	101012	保证券代码
→	→	10173	MarginSymbol	7.29%2017	保证券名称
→	→	10150	MarginAMT	1000000	券面总额
→	10209		NoMarginAmt	1	
→	→	10150	MarginAMT	200000	保证金金额
→	10175		MarginType	2	2-债券与现金
→	10155		MarginPartyRole	120	
→	10157		MarginReplacement	N	置换标识
→	10162		MarginSubmitDate	20070821	保证金/券提交日
→	10161		MarginTotalAmt	6000000	券面总额合计
→	10211		NoMarginSecurities	1	
→	→	10159	MarginSecuritiesID	101013	保证券代码
→	→	10173	MarginSymbol	3.29%2017	保证券名称
→	→	10150	MarginAMT	4000000	券面总额
→	10209		NoMarginAmt	1	
→	→	10150	MarginAMT	2000000	保证金金额
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	19	

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	132	保证品管理机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	116	保证金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	108	保证金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	128	保证金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	121	保证金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	117	保证券托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	122	保证券托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	107	保证券托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	109	保证券托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	
→	10601		NoContactInfos	1	

→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	19	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	132	保证品管理机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	116	保证金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	108	保证金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	128	保证金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	121	保证金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	117	保证证券托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	122	保证证券托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	107	保证证券托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	109	保证证券托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称

StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.8.2 标准利率互换固定-浮动成交

6.4.8.2.1 标准利率互换固定-浮动成交业务要素

当清算方式为“上海清算所清算”时，交易对手方为上海清算所。

此种情况下，根据IMIX协议定义，标准利率互换固定-浮动成交IMIX报文标准见表68。

表68 标准利率互换固定-浮动成交业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:MM:SS
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	3-竞价 5-点击成交
DealNumber 成交编号	17ExecID	
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	Y-YES N-NO
Trader 本方交易员	当报文中 Side 取值为 J 时，此报文表示利率互换固定对浮动交易。 当 <InstrmtLegExecGrp> 组件中 624LegSide 取值为 1，686LegPriceType 取值为 3，452PartyRole 取值为 119 时，表示固定利率支付方(亦即浮动利率收取方)，此时该<Parties>组件中取值 119 下的信息为本方信息，取值 120 下的信息为对手方信息。反之，当 <InstrmtLegExecGrp> 组件中 624LegSide 取值为 4，686LegPriceType 取值为 3，452PartyRole 取值为 120 时，表示固定利率收取方(亦即浮动利率支付方)，此时该<Parties>组件中取值 120 下的	
CounterParty 对手方		
CounterpartyTrader 对手方交易员		

	<p>信息为本方信息,取值 119 下的信息为对手方信息。</p> <p>另外,在利率互换固定对浮动产品中,624 取值为 1 或者 4 皆表示利率互换产品中的固定端信息,624 取值为 B 时表示利率互换产品中的浮动端信息。</p> <p>交易员名称用〈Parties〉组件中的 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的。当 803 域取值为 101 时,523 域中的填写内容为交易员名称信息。</p>	
TradeMemberName 交易成员群组	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CFETS 表示银行间
Direction 交易方向	54SideJ 为固定-浮动 LegSide=1 以及 LegSide=B 时表示固定利率支付方 LegSide=4 浮动利率支付方(固定利率收取方)	
TradingProduct 交易品种代码	48SecurityID 为标准品种时传交易品种代码,为非标准品种时该域传字符串 “User-Defined”	标准利率互换和普通利率互换使用 48SecurityID 和 55Symbol 的合约名前缀进行区分,区分方式详见本文档 4.22 节
TradeSymbol 交易品种名称	55Symbol 为标准品种时根据需要传交易品种名称,为非标准品种时该域填非标准品种的名称	标准利率互换和普通利率互换使用 48SecurityID 和 55Symbol 的合约名前缀进行区分,区分方式详见本文档 4.22 节
Term 期限	10316TradeLimitDays	
NotionalAmount 名义本金金额	32LastQty	单位:元,整数
InterestAccrualDaysAdjustment 计息天数调整	10018InterestAccrualDaysAdjustment	
StartDate 起息日	916StartDate	YYYYMMDD
FirstPeriodStartDate 首期起息日	10054FirstPeriodStartDate	YYYYMMDD
EndDate 到期日	917EndDate	YYYYMMDD
CouponPaymentDateReset 支付日调整	10009CouponPaymentDateReset	
CalculateAgency	10346CalculateAgency	

计算机构		
ClearingMethod 清算方式	使用 ClearingReferenceData 组件存放清算信息，其中，11143ClearingMethod 表示清算方式	11143ClearingMethod 6-集中清算 13-自行清算
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	2-利率互换
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	
ClosePositionIndicator 是否强平交易	11207ClosePositionIndicator	Y-是 N-否
FixedRateDetails 固定利率明细		
FixedRate 固定利率	LegPriceType 取 3 566LegPrice 为固定利率	单位：%，精度：4 位
PaymentFrequency 付息频率	10096LegCouponPaymentFrequency	
FirstPaymentDate 首期支付日	248LegCouponPaymentDate	
DayCount 计息基准	10097LegDayCount	
FloatingRateDetails 浮动利率明细		
Benchmark 参考利率	677LegBenchmarkCurveName	
Spread 利差	10090LegBenchmarSpread	单位：bps，精度：2 位
FirstRegularPaymentDate 首期付息日	248LegCouponPaymentDate	
PaymentFrequency 支付周期	10096LegCouponPaymentFrequency	
FirstFixingDate 首期利率确定日	956LegInterestAccrualDate	
ResetFrequency 重置频率	10108LegInterestAccrualResetFrequency	
InterestMethod 计息方式	10106LegInterestAccrualMethod	
DayCountConvention 计息基准	10097LegDayCount	
Status 状态	150ExecType	F-成交 4-撤销

		5-修改 101-应急
FixedRatePayerAccountDetails 固定利率支付方账户详细信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
FloatingRatePayerAccountDetails 浮动利率支付方账户详细信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	

6.4.8.2.2 标准利率互换固定-浮动成交（上海清算所清算）IMIX 报文标准

当清算方式为“上海清算所清算”时，对手方为上海清算所。

标准利率互换固定-浮动成交（上海清算所清算）IMIX报文标准见表69。

表69 标准利率互换固定-浮动成交（上海清算所清算）IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
17			ExecID	IRS6MSHIBOR3M200708 21123456	成交编号
32			LastQty	1200000	名义本金金额 单位：元，整数
48			SecurityID	SS3M_1406	标准利率互换和普通利率 互换使用 48SecurityID 和 55Symbol 的合约名前 缀（例：SS3M）进行区分， 区分方式详见本文档 4.22 节
55			Symbol	SS3M_1406	
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20070820-12:40:00.0 00	业务发生时间
916			StartDate	20080822	起息日
75			TradeDate	20070821	成交日期
150			ExecType	F	成交状态-成交
917			EndDate	20070921	到期日
10009			CouponPaymentDateReset	1	支付日调整
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
10105			DealTransType	0	0-成交单录入
10018			InterestAccrualDaysAdjustment	0	计息天数调整
10054			FirstPeriodStartDate	20080901	首期起息日
10176			MarketIndicator	2	市场标识：2-利率互换
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10316			TradeLimitDays	60	期限
10317			TradeMethod	3	交易方式 3-竞价 5-点击成交
10318			TradeTime	12:24:23	成交时间
10346			CalculateAgency	0	计算机构
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识

			or		0-本方数据 2-关联机构数据
54			Side	J	交易方向 固定-浮动
11143			ClearingMethod	6	上海清算所清算
11207			ClosePositionIndicator	Y	Y-是 N-否
555			NoLegs	2	
→	624		LegSide	1	1-固定利率支付
→	686		LegPriceType	3	3-固定值
→	566		LegPrice	7. 6200	固定利率 单位: %, 精度: 4 位
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	6	付息频率
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	首期支付日
→	10097		LegDayCount	0	计息基准
→	624		LegSide	B	B-基准端
→	686		LegPriceType	6	6-浮动值
→	677		LegBenchmarkCurveName	SHIBOR6M	参考利率
→	10090		LegBenchmarkSpread	50. 00	利差 单位: bps, 精度: 2 位
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	首期付息日
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	6	支付周期
→	956		LegInterestAccrualDate	20080822	首期利率确定日
→	10108		LegInterestAccrualResetFrequency	6	重置频率
→	10106		LegInterestAccrualMethod	0	计息方式
→	10097		LegDayCount	0	计息基准
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	119-固定利率支付方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	11	
→	→	523	PartySubID	XXXX	

→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
→	448		PartyID	XXXX	清算所 ID
→	452		PartyRole	120	120-固定利率收取方
→	802		NoPartySubIDs	4	
→	→	523	PartySubID	Shanghai Clearing House	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	上海清算所	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	上海清算所	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.8.2.3 标准利率互换固定-浮动成交（双边自行清算）IMIX 报文标准

标准利率互换固定-浮动成交（双边自行清算）IMIX报文标准见表70。

表70 标准利率互换固定-浮动成交（双边自行清算）IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
17			ExecID	IRS6MSHIBOR3M200708 21123456	成交编号
32			LastQty	1200000	名义本金金额 单位：元，整数
48			SecurityID	SS3M_1406	标准利率互换和普通利率 互换使用 48SecurityID 和 55Symbol 的合约名前 缀（例：SS3M）进行区分， 区分方式详见本文档 4.22 节
55			Symbol	SS3M_1406	
58			Text	XXXX	补充条款
60			TransactTime	20070820-12:40:00.0 00	业务发生时间
916			StartDate	20080822	起息日
75			TradeDate	20070821	成交日期
150			ExecType	F	成交状态-成交
917			EndDate	20070921	到期日
10009			CouponPaymentDateRe set	1	支付日调整
10022			ContingencyIndicato r	N	应急标识
10105			DealTransType	0	0-成交单录入
10018			InterestAccuralDays Adjustment	0	计息天数调整
10054			FirstPeriodStartDat e	20080901	首期起息日
10176			MarketIndicator	2	市场标识：2-利率互换
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10316			TradeLimitDays	60	期限

10317			TradeMethod	3	交易方式 3-竞价 5-点击成交
10318			TradeTime	12:24:23	成交时间
10346			CalculateAgency	0	计算机构
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
54			Side	J	交易方向 固定-浮动
11143			ClearingMethod	13	双边自行清算
555			NoLegs	2	
→	624		LegSide	1	1-固定利率支付
→	686		LegPriceType	3	3-固定值
→	566		LegPrice	7.6200	固定利率 单位：%，精度：4位
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	6	付息频率
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	首期支付日
→	10097		LegDayCount	0	计息基准
→	624		LegSide	B	B-基准端
→	686		LegPriceType	6	6-浮动值
→	677		LegBenchmarkCurveName	SHIBOR6M	参考利率
→	10090		LegBenchmarkSpread	50.00	利差 单位：bps，精度：2位
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	首期付息日
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	6	支付周期
→	956		LegInterestAccrualDate	20080822	首期利率确定日
→	10108		LegInterestAccrualResetFrequency	6	重置频率
→	10106		LegInterestAccrualMethod	0	计息方式
→	10097		LegDayCount	0	计息基准
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构6位ID
→	452		PartyRole	119	119-固定利率支付方
→	10601		NoContactInfos	1	

→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-电话
→	802		NoPartySubIDs	11	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-固定利率收取方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	11	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	

→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.9 债券借贷市场

债券借贷业务关键域见表71。

表71 债券借贷关键域

业务场景		下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	债券借贷	ExecutionReport (MsgType=8)	根据<Parties>中的会员代码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区分买方或者卖方 根据<Side>中的交易方向可区分该成交数据是买方的还是卖方

6.4.9.1 成交业务要素

成交业务要素见表72。

表72 成交业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:mm:ss
TradingMethod	10317TradeMethod	1-询价

交易方式		
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
QuotationNumber 报价编号	117QuoteID	
Trader 本方交易员	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 交易员名称用 803(PartySubIDType) 以及 523(PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息	
Counterparty 对手方	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 机构 ID 用 448(PartyID)	对手方机构 ID
CounterpartyTrader 对手方交易员	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 交易员名称用 803(PartySubIDType) 以及 523(PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息	
TradeMemberGroup 交易成员群组	用 803(PartySubIDType) 以及 523(PartySubID) 来组合表示的 803=29	803=29, 523=CFETS 表示银行间 803=29, 523=CFETS 表示银行间
Direction 交易方向	54Side Side 取值 1 为融入 Side 取值 4 为融出	
BondCode 标的债券代码	债券借贷产品的产品代码使用 48SecurityID 标识, 而产品所涉及的债券的代码使用 309UnderlyingSecurityID	
BondName 标的债券名称	标的债券名称存放到 311UnderlyingSymbol。	
SettlCurrency 结算币种	120 SettlCurrency	例如: CNY
LendingRate 借贷费率	44Price	单位: %, 精度: 4 位
TotalFaceValue 标的债券券面总额	总的券面总额用 32LastQty 来表示, 单个标的券面总额存放到 879UnderlyingQty。	单位: 元, 整数
Term	10316TradeLimitDays	单位: 天, 整数

借贷期限		
1stLegSettlementDate 首次结算日	64SettlDate	YYYYMMDD
2ndLegSettlementDate 到期结算日	193SettlDate2	YYYYMMDD
ActualSecurityHoldingDays 实际占券天数	10014 CashHoldingDays	单位：天，整数
1stLegSettlementMethod 首次结算方式	919DeliveryType	6-券券对付 8-返券付费解券 9-券费对付
2ndLegSettlementMethod 到期结算方式	10045DeliveryType2	6-券券对付 8-返券付费解券 9-券费对付
DisputesSettlementMethod 争议解决方式	10051 DisputeSettlementMethod	0-仲裁 1-诉讼
LendingRate 借贷费用	139MiscFeeType 取值为 13 时，表示 137MiscFeeAmt 为债券借贷费用	单位：元，精度：2 位
TradingProduct 交易品种	48SecurityID	
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator 当 10282 取值 Y 时，可以查看 58Text 域取补充条款信息	Y-YES N-NO
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	内容可包含多托管账户信息。存在多托 管账户时，补充条款中包含账户信息和 补充条款内容，以“ ”间隔；不存在 多托管账户信息，补充条款仅包含补充 条款内容。
InterestPaymentIndicator 付息标识	10066CouponPaymentIndicator	Y-是 N-否 付息标识取 Y 时，传输付息信息
Status 状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
UpdateDate 更新日	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
CollateralReplacement 质押债券置换安排	10157MarginReplacement	Y-是 N-否
CollateralBondCode 质押债券代码	在 组 件 MarginInfoGrp 中， MarginSecuritiesGrp 用来存放具体 保证金信息，在 MarginSecuritiesGrp 组件中的 10159MarginSecuritiesID	

	域用来表示质押券代码 10211NoMarginSecurities 表示质押券种类数目	
CollateralBondName 质押债券名称	在 组 件 MarginInfoGrp 中 , MarginSecuritiesGrp 用来存放具体 质押券信息, 在 MarginSecuritiesGrp 组件中的 10173MarginSymbol 域用来 表示质押券名称	
TotalFaceValueforCollateral 质押债券券面总额	总的 质 押 债 券 券 面 总 额 使 用 10161MarginTotalAmt 标识, 单个券种 的券面总额使用 10150MarginAMT 标识	单位: 元, 整数
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	8-债券借贷
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	0-录入 1-修改 2-撤销
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	N-NO Y-YES
CollateralDetails 保证品信息		
CollateralType 保证品类型	10175MarginType	0-债券
CollateralReplacementIndicator 保证券置换标志	10157MarginReplacement	N-NO Y-YES
InterestPaymentDetails 付息信息		
InterestPaymentDate(s) 付息日	241UnderlyingCouponPaymentDate	YYYYMMDD
CouponRate 票面利率	435UnderlyingCouponRate	Forfloatingratebonds, ifinterestrateisunknown, interestpaymentamountandcouponratesarenotdisplayed. Howeverifatthetimeofinquiry, floatingrateisdisclosed, interestpaymentamountandcouponrateswillbedisplayed. · 如果浮动利率债券的利率未知, 则应计利息总额和票面利率将不显示。但是如果在查询时浮动利率已知, 则将会显示应计利息总额和票面利率。 单位: %, 精度: 4 位
InterestPaymentAmounts(s) 应计利息总额	10321UnderlyingAccruedInterestAmt	Forfloatingratebonds, ifinterestrateisunknown, interestpaymentamount

		<p>and coupon rates are not displayed. However if at the time of inquiry, floating rate is disclosed, interest payment amount and coupon rates will be displayed.</p> <p>如果浮动利率债券的利率未知,则应计利息总额和票面利率将不显示。但是在查询时浮动利率已知,则将会显示应计利息总额和票面利率。</p> <p>单位: 元, 精度: 2 位</p>
BorrowerAccountDetails 融入方账户明细		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
LenderAccountDetails 融出方账户明细		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber	用 803 (PartySubIDType) 以及	

资金账号	523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	

6.4.9.2 成交 IMIX 报文标准

成交IMIX报文示例见表73。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表73 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	SL20130818000001	成交编号
117			QuoteID	201308180820000004	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段
120			SettlCurrency	CNY	结算币种
32			LastQty	100000	成交券面总额

					单位：元，整数
44			Price	98.0000	借贷费率 单位：%，精度：4位
48			SecurityID	User-Defined	交易品种
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	更新日
10176			MarketIndicator	8	市场标识：8-债券借贷
10317			TradeMethod	1	交易方式：1-询价
10318			TradeTime	12:33:34	成交时间
10022			ContingencyIndicator	N	N-NO
10105			DealTransType	0	报文动作 0-录入 1-修改 2-撤销
75			TradeDate	20070821	成交日期
64			SettlDate	20070823	首次结算日
193			SettlDate2	20070830	到期结算日
919			DeliveryType	9	首次结算方式 9-券费对付 6-券券对付 8-返券付费解券
10045			DeliveryType2	9	到期结算方式 9-券费对付 6-券券对付 8-返券付费解券
10014			CashHoldingDays	10	实际占券天数 单位：天，整数
10051			DisputeSettlementMethod	0	争议解决方式 0-仲裁 1-诉讼
10316			TradeLimitDays	7	借贷期限 单位：天，整数
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10066			CouponPaymentIndicator	Y	付息标识 Y-是 N-否 付息标识取 Y 时，传输付息信息
150			ExecType	F	成交状态-成交
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据

					2-关联机构数据
58			Text	工商银行-上海清算所-1234587 建设银行-上海清算所-2134567 补充条款内容	内容可包含多托管账户信息。存在多托管账户时，补充条款中包含账户信息和补充条款内容，以“ ”间隔；不存在多托管账户信息，补充条款仅包含补充条款内容。
54			Side	1	交易方向
136			NoMiscFees	1	
→	137		MiscFeeAmt	23564.00	单位：元，精度：2位
→	139		MiscFeeType	13	借贷费用
711			NoUnderlyings	1	
→	309		UnderlyingSecurityID	101010	标的债券代码
→	311		UnderlyingSymbol	7.59%2016	标的债券名称
→	879		UnderlyingQty	1000	标的债券券面总额 单位：元，整数
→	435		UnderlyingCouponRate	0.0759	票面利率 单位：%，精度：4位
→	241		UnderlyingCouponPaymentDate	20070821	付息日
→	10321		UnderlyingAccruedInterestAmt	100.00	应计利息总额 单位：元，精度：2位
10210			NoMarginInfo	1	
→	10175		MarginType	0	0-债券
→	10161		MarginTotalAmt	1000000	质押债券券面总额合计 单位：元，整数
→	10157		MarginReplacement	N	置换标识
→	10211		NoMarginSecurities	1	
→	→	10159	MarginSecuritiesID	101012	质押债券代码
→	→	10173	MarginSymbol	7.29%2017	质押债券名称
→	→	10150	MarginAMT	1000000	质押债券券面总额 单位：元，整数
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构6位ID
→	452		PartyRole	119	119-融入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	

→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-融出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	14	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	

→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CNYFTZ-国际 CFETS-银行间
→	→	803	PartySubIDType	29	交易成员群组
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.10 远期利率协议市场

远期利率协议市场关键域见表74。

表74 远期利率协议市场关键域

业务场景		下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	远期利率协议	ExecutionReport (MsgType=8)	根据<Parties>中的会员代码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区分买方或者卖方 根据<Side>中的交易方向可区分该成交数据是买方的还是卖方

6.4.10.1 成交业务要素

成交业务要素见表75。

表75 成交业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:mm:ss
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价 5-点击成交
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
QuotationNumber 报价编号	117QuoteID	
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	Y-YES N-NO
Trader 本方交易员	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息	
CounterParty 对手方	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 机构 ID 用 448 (PartyID)	
CounterpartyTrader 对手方交易员	PartyRole 取值为 119 表示买入方信息, 取值 120 表示卖出方信息。 交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息	
Direction 交易方向	54Side Side 取值为 1 为支付固定利率 Side 取值为 4 为收取固定利率	
TradingProduct 交易品种代码	48SecurityID 为标准品种时传交易品种代码, 为非标准品种时该域传字符串	

	“User-Defined”	
Term 期限	10316TradeLimitDays	
NotionalAmount 名义本金金额	32LastQty	单位：元，整数
FixedRate 固定利率	44Price	单位：%，精度：4 位
Benchmark 参考利率	使用 SpreadOrBenchmarkCurveData 组 件来表示参考浮动利率 221BenchmarkCurveName	
DiscountRate 贴现率	234StipulationValue 233StipulationType=Discount	FR001 等
StartDate 起息日	916StartDate	YYYYMMDD
EndDate 到期日	917EndDate	YYYYMMDD
FixingDate 利率确定日	10073InterestFixDate	YYYYMMDD
PaymentDate 支付日	224CouponPaymentDate	YYYYMMDD
PaymentDateReset 支付日调整	10009CouponPaymentDateReset	0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
DayCountConvention 计息基准	10040DayCount	0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
CalculateAgency 计算机构	10346CalculateAgency	0-中国外汇交易中心 1-卖出方 2-买入方 3-交易双方
DisputeSettlementMethod 争议解决方式	10051DisputeSettlementMethod	0-仲裁 1-诉讼
Status 状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	3-远期利率协议

TransactionType 报文动作	10105DealTransType	0-录入 1-修改 2-撤销
CollateralIndicator 有无保证品	10158MarginRequired	N-无
FixedRatePayerAccountDetails 固定利率支付方账户详细信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
FloatingRatePayerAccountDetails 浮动利率支付方账户详细信息		
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23 表示资金账户户名	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	

6.4.10.2 成交 IMIX 报文标准

成交IMIX报文示例见表76。

当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。

表76 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					

8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	FRA20130818000004	成交编号
117			QuoteID	201308180320000011	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段
32			LastQty	1000000	名义本金金额 单位：元，整数
44			Price	0.0810	固定利率 单位：%，精度：4位
48			SecurityID	SHIBOR3M_3M×6M	交易品种
54			Side	1	交易方向 1-支付固定利率
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间
58			Text	XXXX	补充条款
916			StartDate	20070820	起息日
75			TradeDate	20070820	成交日期
150			ExecType	F	成交状态-成交
10105			DealTransType	0	报文动作 0-录入 1-修改 2-撤销
917			EndDate	20070820	到期日
221			BenchmarkCurveName	6MSHIBOR	参考利率名称
224			CouponPaymentDate	20070820	支付日
10009			CouponPaymentDateReset	0	支付日调整 0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
10022			ContingencyIndicato	N	应急标识

			r		
10051			DisputeSettlementMethod	0	争议解决方式 0-仲裁 1-诉讼
10040			DayCount	0	计息基准 0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
10073			InterestFixDate	20070820	利率确定日
10158			MarginRequired	N	有无保证品 N-无
10176			MarketIndicator	3	市场标识: 3-远期利率协议
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
10316			TradeLimitDays	181	期限
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
10318			TradeTime	12:40:00	成交时间
10346			CalculateAgency	1	计算机构 0-中国外汇交易中心 1-卖出方 2-买入方 3-交易双方
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
232			NoStipulations	1	
→	233		StipulationType	Discount	贴现率
→	234		StipulationValue	XXXX	FR001 等
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	119	119-固定利率支付
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	10	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号

→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-固定利率收取方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	
→	802		NoPartySubIDs	10	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	

→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.11 信用缓释凭证市场

信用缓释凭证市场关键域见表77。

表77 信用缓释凭证市场关键域

业务场景	下载端发送 IMIX 报文	关键域描述
成交数据	信用风险缓释凭证 ExecutionReport (MsgType=8)	根据<Parties>中的会员代码可区分交易方 根据<PartyRole>中的可区分买方或者卖方 根据<Side>中的交易方向可区分该成交数据是买方的还是卖方

6.4.11.1 成交业务要素

成交业务要素见表78。

表78 成交业务要素表

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:mm:ss
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
OrderCode 客户端参考编号	11C10rdID	
DealNumber 成交编号	17ExecID	
SupplementaryTerms 补充条款	58Text	
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	Y-YES N-NO
QuoteNumber 报价编号	117QuoteID	
Trader 本方交易员	Side 取值为 1, 则表明报文发出方交易方向为买入。而 PartyRole 取值为	

	<p>119(买入方)的交易方信息为本方, 则另一方为对手方</p> <p>Side 取值为 4, 则表明该条信息发出交易方向为卖出的, 则 PartyRole 取值为 120(卖出方)的交易方信息为本方信息, 则另一方为对手方</p> <p>交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息。</p>	
Counterparty 对手方	当决定了本方信息之后, 则在 Parties 重复组中的另一个重复组块为对手方信息	
CounterpartyTrader 对手方交易员	交易员名称用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的, 用 803=101 表示 523 为交易员名称, 523=XXXXXXXX 表示交易员名称信息。	
Direction 交易方向	54Side	<p>1-买入</p> <p>4-卖出</p>
WarrantCode 凭证代码	48SecurityID	
WarrantShortName 凭证简称	55Symbol	
SettlementSpeed 清算速度	63SettlType	<p>1-T+0</p> <p>2-T+1</p> <p>3-T+2</p> <p>4-T+3</p> <p>5-T+4</p>
Price 价格	44Price	单位: 元, 精度: 4 位
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
TransactionType 报文动作	10105DealTransType	<p>0-录入</p> <p>1-修改</p> <p>2-撤销</p>
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	<p>Y-YES</p> <p>N-NO</p>
NotionalAmount 名义本金总额	32LastQty	单位: 元, 整数
SettlementMethod	919DeliveryType	

结算方式		
SettlementDate 结算日	64SettlDate	YYYYMMDD
SettlementAmount 结算金额	10312TradeCashAmt	单位：元，精度：2 位
DealStatus 成交状态	150ExecType	F-成交 4-撤销 5-修改 101-应急
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName 托管账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
SettlementAccountName 资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=23	
SettlementBankName 资金开户行	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=110	
SettlementAccountNumber 资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=15	
BankSortCode 资金开户行联行行号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=112	
CustodianAccountName	用 803 (PartySubIDType) 以 及	

托管账户户名	523 (PartySubID) 来组合表示的 803=22	
CustodianName 托管机构	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=111	
CustodianAccountNumber 托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以 及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=10	
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	18-CRM

6.4.11.2 成交 IMIX 报文标准

成交IMIX报文示例见表79。

正常实时报文、应急工具报文以及盘后重发报文之间的区分参见本指引中第5.3节应急报文重发。
当成交报文为应急场务操作产生时，报文中将不包含报价编号业务字段。

表79 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	378109457943740023	客户端参考编号
17			ExecID	CRM20130818000004	成交编号
32			LastQty	1200000	名义本金总额 单位：元，整数
44			Price	98.0000	净价 单位：元，精度：4位
48			SecurityID	121131	凭证代码
54			Side	1	交易方向
55			Symbol	crm001	凭证名称
58			Text	XXX	补充条款
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间

63			SettlType	1	清算速度 1-T+0 2-T+1 3-T+2 4-T+3 5-T+4
64			SettlDate	20070822	结算日
75			TradeDate	20070821	成交日期
117			QuoteID	201308181820000008	报价编号 当成交报文为应急场务操作产生时,报文中将不包含报价编号业务字段
119			SettlCurrAmt	1000.00	结算金额 单位:元,精度:2位
150			ExecType	F	成交状态-成交
10105			DealTransType	0	报文动作 0-录入 1-修改 2-撤销
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
10176			MarketIndicator	18	市场标识: 18-CRM
10312			TradeCashAmt	23034232	结算金额
10317			TradeMethod	1	交易方式:1-询价
10318			TradeTime	12:40:00	成交时间
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构6位ID
→	452		PartyRole	119	119-买入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	电话号码
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	

→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
→	448		PartyID	XXXX	参与方机构 6 位 ID
→	452		PartyRole	120	120-卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	电话号码
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	资金开户行联行行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	托管账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	托管机构名称

→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	托管账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	地址
→	→	523	PartySubID	XXXXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	会员简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	会员中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	会员中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	交易员中文名称
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.12 利率互换期权市场

6.4.12.1 成交业务要素

成交业务要素见表80。

表80 本方成交业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealNumber 成交编号	17 ExecID	利率互换期权市场交易的唯一编号,例如: SWT20150525000024
DealDate 成交日	75 TradeDate	格式为: YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318 TradeTime	格式为: HH:MM:SS 或者 HH:MM:SS. sss
OptionType 期权类型	14820ptPayoutType	100-支付方利率互换期权; 101-收取方利率互换期权 支付方利率互换期权是买方支付固定利率, 卖方支付浮动利率 收取方利率互换期权是买方付浮动利率, 卖方支付固定利率
Ownparty 本方	54 Side 取值 1 表示买入, 452 PartyRole 取值 119 表示本方,	取值同实际系统实现
Trader 本方交易员	452 PartyRole 取值 120 表示对手方;	取值同实际系统实现
Counterparty 对手方	54 Side 取值 4 表示卖出, 452 PartyRole 取值 119 表示对手方,	取值同实际系统实现

CounterpartyTrader 对手方交易员	452 PartyRole 取值 120 表示本方; 448 PartyID 中填写机构 ID, 使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 101 时表示 机构交易员名称; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Direction 交易方向	54 Side	1-买入; 4-卖出
OptionTerm 期权期限	10314 TradeFwdDays	通过 YYYYMMDD 进行转换 2Y=2000000 1Y=1000000 6M=6000 3M=3000 1M=1000 9M=9000
Option Buyer Short Chinese Name of Party 期权买方机构中文简称	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 125 时表示 机构中文简称; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer Full Chinese Name of Party 期权买方机构中文全称	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 124 时表示 机构中文全称; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer BankSortCode 期权买方资金账户支付系统行号	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 112 时表示 支付系统行号; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer Trader Name 期权买方交易员	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 101 时表示 机构交易员名称; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer SettlementAccountNumber 期权买方资金账号	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 15 时表示 资金账号; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer SettlementAccountName 期权买方资金账户户名	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 23 时表示 资金账户户名; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer SettlementBankName 期权买方资金开户行名称	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 110 时表示	取值同实际系统实现

	资金开户行； 523PartySubID 中填写具体信息	
Option Buyer Short Name of Party 期权买方简称	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 102 时表示 机构简称； 523PartySubID 中填写具体信息	
Option Buyer Telephone Number 期权买方联系方式	10603 ContactInfoIDType 取值 6， 10602 ContactInfoID 中填写联系方式 的具体值	
Option Buyer Address 期权买方地址	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 6 时表示地 址； 523PartySubID 中填写具体信息	
Option Seller Short Chinese Name of Party 期权卖方机构中文简称	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 125 时表示 机构中文简称； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller Full Chinese Name of Party 期权卖方机构中文全称	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 124 时表示 机构中文全称； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller Trader Name 期权卖方交易员	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 101 时表示 机构交易员名称； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller BankSortCode 期权卖方资金账户支付系统行号	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 112 时表示 支付系统行号； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller SettlementAccountNumber 期权卖方资金账号	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 15 时表示 资金账号； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller SettlementAccountName 期权卖方资金账户户名	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 23 时表示 资金账户户名； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller SettlementBankName 期权卖方资金开户行名称	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 110 时表示 资金开户行； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller Short Name of Party	使用重复组<Parties>，	

期权卖方简称	当 803PartySubIDType 取值 102 时表示 机构简称; 523PartySubID 中填写具体信息	
Option Seller Telephone Number 期权卖方联系方式	10603 ContactInfoIDType 取值 6, 10602 ContactInfoID 中填写联系方式 的具体值	
Option Seller Address 期权卖方地址	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 6 时表示地 址; 523PartySubID 中填写具体信息	
NotionalAmount 名义本金	32LastQty	单位: 元, 精度两位
OptionPrice 期权价格	44Price	单位: bps, 精度六位
Optionfee 期权费	10781 OptPremiumAmt	单位: 元, 精度两位
StrikePrice 执行利率	202 StrikePrice	单位: %, 精度六位
PaymentDate 期权费支付日	504 PaymentDate	格式为: YYYYMMDD
MaturityDate 期权执行日	541 MaturityDate	格式为: YYYYMMDD
ClearingMethod 清算方式	11143ClearingMethod	6-集中清算 13-自行清算
DeliveryForm 交割方式	668 DeliveryForm	0-现金交割; 2-实物交割
DealStatus 成交状态	150 ExecType	F-成交 5-修改; 4-撤销
ProductID 产品代码	48SecurityID	取值同实际系统实现
PdocuctName 产品名称	55Symbol	取值同实际系统实现
FirstPeriodStartDate 首期起息日	10054 FirstPeriodStartDate	格式为: YYYYMMDD
FirstFixingDate 浮动利率首次利率确定日	956LegInterestAccrualDate	YYYYMMDD
Term 期限	10316 TradeLimitDays	通过 YYYYMMDD 进行转换 2Y=2000000 1Y=1000000 6M=6000 3M=3000

		1M=1000 9M=9000
StartDate 起息日	916 StartDate	格式为: YYYYMMDD
EndDate 到期日	917 EndDate	格式为: YYYYMMDD
Benchmark 参考利率	677LegBenchmarkCurveName	参考利率名称
Spread 利差	10090LegBenchmarSpread	单位: bps, 精度两位
Fixed Rate CouponPaymentFrequency 固定利率支付频率	10096LegCouponPaymentFrequency	0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-每天
Fixed Rate FirstPaymentDate 固定利率首期定期支付日	248LegCouponPaymentDate	YYYYMMDD
Floating CouponPaymentFrequency 浮动利率支付频率	10096LegCouponPaymentFrequency	0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-每天
Floating FirstRegularPaymentDate 浮动利率首期定期支付日	248LegCouponPaymentDate	YYYYMMDD
FixedRate DayCount 固定利率计息基准	10097LegDayCount	0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
Floating DayCount 浮动利率计息基准	10097LegDayCount	0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
InterestAccrualResetFrequency 重置频率	10108LegInterestAccrualResetFrequency	0-半年 1-年

		2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-天
Floating InterestAccrualMethod 浮动利率计息方式	10106LegInterestAccrualMethod	0-单利 1-复利
InterestAccrualDaysAdjustment 计息天数调整	10018InterestAccrualDaysAdjustment	0-不调整 1-实际天数调整
CouponPaymentDateReset 支付日调整	10009CouponPaymentDateReset	0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
CalculateAgency 计算机构	10346CalculateAgency	0-中国外汇交易中心 1-卖出方 2-买入方 3-交易双方
FixedRatePayerSettlementAccountNumber 固定利率支付方资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=196	取值同实际系统实现
FixedRatePayerSettlementAccountName 固定利率支付方资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=192 表示中文资金账户户名	取值同实际系统实现
FixedRatePayerSettlementBankName 固定利率支付方资金开户行名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=194	取值同实际系统实现
FixedRatePayer BankSortCode 固定利率支付方资金账户支付系统行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=155	取值同实际系统实现
FixedRateReceiver SettlementAccountNumber 固定利率收取方资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=196	取值同实际系统实现
FixedRateReceiver SettlementAccountName 固定利率收取方资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=192 表示中文资金账户户名	取值同实际系统实现
FixedRateReceiver SettlementBankName 固定利率收取方资金开户行名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=194	取值同实际系统实现
FixedRateReceiver BankSortCode 固定利率收取方资金账户支付系统行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示的 803=155	取值同实际系统实现
SupplementaryTermsIndicator	10282RemarkIndicator	Y-YES

有无补充条款		N-NO
UpdateDate 更新日	60TransactTime	格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS 或者 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
SupplementaryTerms 补充条款	58 Text	取值同实际系统实现
QuoteID 报价编号	117QuoteID	取值同实际系统实现
TradeMethod 交易方式	10317 TradeMethod	1-询价
MarketIndicator 市场标识	10176 MarketIndicator	44-利率互换期权
ContingencyIndicator 应急标识	10022 ContingencyIndicator	Y-YES N-NO

6.4.12.2 成交 IMIX 报文标准

成交IMIX报文标准见表81。

表81 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	报文版本号
9			BodyLength	1	报文体长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00	报文发送时间
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
10465			DataCategoryIndicator	0	0-本方数据 2-关联机构数据
17			ExecID	XXXX	成交编号 利率互换期权市场交易的 唯一编号，例如： SWT20150525000024
75			TradeDate	20150423	成交日期 格式为：YYYYMMDD
10318			TradeTime	12:32:21	成交时间

					格式为：HH:MM:SS 或者 HH:MM:SS. sss
54			Side	1	交易方向 1-买入； 4-卖出
10314			TradeFwdDays	1000000	期权期限 通过 YMMMDDD 进行转换 2Y=2000000 1Y=1000000 6M=6000 3M=3000 1M=1000 9M=9000
32			LastQty	112. 22	名义本金 单位：元，精度两位
504			PaymentDate	20140526	期权费支付日
202			StrikePrice	2. 123643	执行利率 单位：%，精度六位
10346			CalculateAgency	0	计算机构 0-中国外汇交易中心 1-卖出方 2-买入方 3-交易双方
668			DeliveryForm	0	0-现金交割； 2-实物交割
11143			ClearingMethod	13	6-集中清算 13-自行清算
150			ExecType	F	F-成交 5-修改； 4-撤销
48			SecurityID	XXXX	产品代码 为标准品种时传交易品种 代码，为非标准品种时该 域 传 字 符 串 “User-Defined”
55			Symbol	XXXX	产品名称 为标准品种时根据需要传 交易品种名称，为非标准 品种时该域不传输
10054			FirstPeriodStartDate	20150623	首期起息日 格式为：YYYYMMDD
10316			TradeLimitDays	6Y3D	期限

916			StartDate	20150523	起息日 格式为: YYYYMMDD
917			EndDate	20150625	到期日 格式为: YYYYMMDD
10018			InterestAccrualDays Adjustment	0	计息天数调整 0-不调整 1-实际天数调整
10009			CouponPaymentDateRe set	2	支付日调整 0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
60			TransactTime	20070820-12:40:00	更新日
58			Text	XXXX	补充条款
117			QuoteID	201308180220000008	报价编号
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
10176			MarketIndicator	44	市场标识 44-利率互换期权市场
10022			ContingencyIndicato r	N	应急标识
1482			OptPayoutType	100	期权类型 100-支付方利率互换期 权; 101-收取方利率互换期权 支付方利率互换期权是买 方支付固定利率, 卖方支 付浮动利率 收取方利率互换期权是买 方付浮动利率, 卖方支付 固定利率
541			MaturityDate	20150423	执行日
44			Price	2.134521	期权价格 单位 bps, 精度六位
10781			OptPremiumAmt	1000.21	期权费 单位: 元, 精度两位
InstrmtLegExecGrp					
555			NoLegs	2	
→	624		LegSide	1	1-固定利率支付
→	686		LegPriceType	3	3-固定值
→	10096		LegCouponPaymentFre quency	4	支付频率 0-半年

					1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-每天
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	固定利率首期定期支付日
→	10097		LegDayCount	3	计息基准
→	624		LegSide	B	B-基准端
→	686		LegPriceType	6	6-浮动值
→	677		LegBenchmarkCurveName	SHIBOR6M	参考利率
→	10090		LegBenchmarkSpread	50.00	利差 单位: bps, 精度: 2 位
→	248		LegCouponPaymentDate	20080915	浮动利率首期定期支付日
→	10096		LegCouponPaymentFrequency	4	支付频率 0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-每天
→	956		LegInterestAccrualDate	20080822	浮动利率首次利率确定日
→	10108		LegInterestAccrualResetFrequency	6	重置频率 0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-天
→	10106		LegInterestAccrualMethod	1	计息方式 0-单利 1-复利
→	10097		LegDayCount	3	计息基准

					0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
Parties					
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方 6 位机构代码
→	452		PartyRole	119	119-买方 1482 OptPayoutType 取值 100 表示支付方利率互换 期权, 买方支付固定利率, 卖方支付浮动利率, 即买 方是固定利率支付方, 卖 方是浮动利率支付方 1482 OptPayoutType 取值 101 表示收取方利率互换 期权, 买方支付浮动利率, 卖方支付固定利率, 即买 方是浮动率支付方, 卖方 是固定利率支付方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-期权买方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	买方机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	买方机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	买方地址
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	买方简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	买方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	买方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	买方资金账号户名

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	买方资金开户行名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	155	固定利率支付方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	196	固定利率支付方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	192	固定利率支付方资金账号户名
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	194	固定利率支付方资金开户行名称
→	448		PartyID	XXXX	参与方 6 位机构代码
→	452		PartyRole	120	120-卖方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-期权卖方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	卖方机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	卖方机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	卖方地址
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	卖方简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	卖方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	卖方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	卖方资金账号户名
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	卖方资金开户行名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	155	固定利率收取方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXX	

→	→	803	PartySubIDType	196	固定利率收取方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	192	固定利率收取方资金账号 户名
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	194	固定利率收取方资金开户 行名称
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

6.4.13 利率上限/下限期权市场

6.4.13.1 成交业务要素

成交业务要素见表82。

表82 成交业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
DealNumber 成交编号	17 ExecID	利率上限/下限期权市场交易的唯一编号，例如：CF20150525000024
DealDate 成交日	75 TradeDate	格式为：YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318 TradeTime	格式为：HH:MM:SS 或者 HH:MM:SS.sss
OptionType 期权类型	14820ptPayoutType	2-上限期权； 102-下限期权
Ownparty 本方	54 Side 取值 1 表示买入， 452 PartyRole 取值 119 表示本方，	取值同实际系统实现
Trader 本方交易员	452 PartyRole 取值 120 表示对手方；	取值同实际系统实现
Counterparty 对手方	54 Side 取值 4 表示卖出， 452 PartyRole 取值 119 表示对手方，	取值同实际系统实现
CounterpartyTrader 对手方交易员	452 PartyRole 取值 120 表示本方； 448 PartyID 中填写机构 ID， 使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 101 时表示 机构交易员名称； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Direction 交易方向	54 Side	1-买入； 4-卖出
OptionTerm	10314 TradeFwdDays	通过 YYYYMMDD 进行转换

期限		2Y=2000000 1Y=1000000 6M=6000 3M=3000 1M=1000 9M=9000
Option Buyer Short Chinese Name of Party 期权买方机构中文简称	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 125 时表示 机构中文简称； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer Full Chinese Name of Party 期权买方机构中文全称	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 124 时表示 机构中文全称； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer BankSortCode 期权买方资金账户支付系统行号	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 112 时表示 支付系统行号； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer Trader Name 期权买方交易员	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 101 时表示 机构交易员名称； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer SettlementAccountNumber 期权买方资金账号	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 15 时表示 资金账号； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer SettlementAccountName 期权买方资金账户户名	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 23 时表示 资金账户户名； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer SettlementBankName 期权买方资金开户行名称	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 110 时表示 资金开户行； 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Buyer Short Name of Party 期权买方简称	使用重复组<Parties>， 当 803PartySubIDType 取值 102 时表示 机构简称； 523PartySubID 中填写具体信息	
Option Buyer Telephone Number 期权买方联系方式	10603 ContactInfoIDType 取值 6， 10602 ContactInfoID 中填写联系方式 的具体值	
Option Buyer Address	使用重复组<Parties>，	

期权买方地址	当 803PartySubIDType 取值 6 时表示地址; 523PartySubID 中填写具体信息	
Option Seller Short Chinese Name of Party 期权卖方机构中文简称	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 125 时表示机构中文简称; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller Full Chinese Name of Party 期权卖方机构中文全称	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 124 时表示机构中文全称; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller Trader Name 期权卖方交易员	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 101 时表示机构交易员名称; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller BankSortCode 期权卖方资金账户支付系统行号	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 112 时表示支付系统行号; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller SettlementAccountNumber 期权卖方资金账号	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 15 时表示资金账号; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller SettlementAccountName 期权卖方资金账户户名	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 23 时表示资金账户户名; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller SettlementBankName 期权卖方资金开户行名称	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 110 时表示资金开户行; 523PartySubID 中填写具体信息	取值同实际系统实现
Option Seller Short Name of Party 期权卖方简称	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 102 时表示机构简称; 523PartySubID 中填写具体信息	
Option Seller Telephone Number 期权卖方联系方式	10603 ContactInfoIDType 取值 6, 10602 ContactInfoID 中填写联系方式的具体值	
Option Seller Address 期权卖方地址	使用重复组<Parties>, 当 803PartySubIDType 取值 6 时表示地址; 523PartySubID 中填写具体信息	

NotionalAmount 名义本金	32LastQty	单位：元，精度两位
OptionPrice 期权价格	44Price	单位：bps，精度六位
Optionfee 期权费	10781 OptPremiumAmt	单位：元，精度两位
StrikePrice 执行利率	202 StrikePrice	单位：%，精度六位
PaymentDate 期权费支付日	504 PaymentDate	格式为：YYYYMMDD
StartDate 期权起始日	916 StartDate	格式：YYYYMMDD
MaturityDate 到期日	541 MaturityDate	格式：YYYYMMDD
Benchmark 参考利率	221BenchmarkCurveName	枚举值：FR007, Shibor3M, Shibor0/N, 一年定存利率
Spread 利差	218Spread	单位：bps，精度两位
Fixed Rate CouponPaymentFrequency 支付频率	10030CouponPaymentFrequency	0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-每天
DayCount 计息基准	10040DayCount	0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
ClearingMethod 清算方式	11143ClearingMethod	6-集中清算 13-自行清算
DeliveryForm 交割方式	668 DeliveryForm	0-现金交割； 2-实物交割
SupplementaryTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	Y-YES N-NO
DealStatus 成交状态	150 ExecType	F-成交 5-修改； 4-撤销
UpdateDate 更新日	60TransactTime	格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS 或者 YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss

SupplementaryTerms 补充条款	58 Text	取值同实际系统实现
QuoteID 报价编号	117QuoteID	取值同实际系统实现
TradeMethod 交易方式	10317 TradeMethod	1-询价
MarketIndicator 市场标识	10176 MarketIndicator	45-利率上限/下限期权市场
ContingencyIndicator 应急标识	10022 ContingencyIndicator	Y-YES N-NO
CouponPaymentDateReset 支付日调整	10009CouponPaymentDateReset	0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
InterestFixDate 首次利率确定日	10073InterestFixDate	格式: YYYYMMDD

6.4.13.2 成交 IMIX 报文标准

成交IMIX报文标准见表83。

表83 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX. 1. 0	报文版本号
9			BodyLength	1	报文体长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00	报文发送时间
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
10465			DataCategoryIndicator	0	0-本方数据 2-关联机构数据
17			ExecID	CF20150525000024	利率上限/下限期权市场交易的唯一编号, 例如: CF20150525000024
75			TradeDate	20150321	格式为: YYYYMMDD
10318			TradeTime	12:32:21	格式为: HH:MM:SS 或者 HH:MM:SS.sss
54			Side	1	交易方向

					1-买入; 4-卖出
10314			TradeFwdDays	1000000	期权期限 通过 YYYYMMDD 进行转换 2Y=2000000 1Y=1000000 6M=6000 3M=3000 1M=1000 9M=9000
32			LastQty	112.22	单位: 元, 精度两位
504			PaymentDate	20140526	期权费支付日
668			DeliveryForm	0	0-现金交割; 2-实物交割
221			BenchmarkCurveName	XXXX	浮动利率
218			Spread	2.32	利差 单位: bps, 精度两位
10030			CouponPaymentFrequency	0	支付频率 0-半年 1-年 2-到期 3-月 4-季 5-两周 6-周 7-每天
10040			DayCount	3	计息基准 0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F D-30E/360
10009			CouponPaymentDateReset	2	支付日调整 0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
10073			InterestFixDate	20070820	首次利率确定日
11143			ClearingMethod	13	6-集中清算 13-自行清算
150			ExecType	F	F-成交 5-修改; 4-撤销

916			StartDate	20150324	期权起始日 格式为: YYYYMMDD
10282			RemarkIndicator	Y	补充条款标识
60			TransactTime	20070820-12:40:00	更新日
58			Text	XXXX	补充条款
117			QuoteID	201308180220000008	报价编号
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
10176			MarketIndicator	45	市场标识 45-利率上限/下限期权
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
202			StrikePrice	2.321256	执行利率 单位: %, 精度六位
1482			OptPayoutType	2	期权类型 2-上限期权; 102-下限期权
541			MaturityDate	20150423	到期日
44			Price	0.012312	期权价格 单位 bps, 精度六位
10781			OptPremiumAmt	1000.21	期权费 单位: 元, 精度两位
Parties					
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	参与方 6 位机构 ID
→	452		PartyRole	119	119-买方 54 Side 取值 1 表示买入, 452 PartyRole 取值 119 表示本方, 452 PartyRole 取值 120 表示对手方; 54 Side 取值 4 表示卖出, 452 PartyRole 取值 119 表示对手方, 452 PartyRole 取值 120 表示本方;
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-期权买方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	9	
→	→	523	PartySubID	XXXX	

→	→	803	PartySubIDType	101	本方交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	买方机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	买方机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	买方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	买方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	买方资金账号户名
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	买方资金开户行名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	买方地址
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	买方简称
→	448		PartyID	XXXX	参与方 6 位机构 ID
→	452		PartyRole	120	120-卖方 54 Side 取值 1 表示买入， 452 PartyRole 取值 119 表示本方， 452 PartyRole 取值 120 表示对手方； 54 Side 取值 4 表示卖出， 452 PartyRole 取值 119 表示对手方， 452 PartyRole 取值 120 表示本方；
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	6-期权卖方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	9	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	对手方交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	卖方机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	卖方机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	卖方支付系统行号

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	卖方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	卖方资金账号户名
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	卖方资金开户行名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	卖方地址
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	卖方简称
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

6.4.14 工具发行结果信息

6.4.14.1 招标发行结果业务要素

根据业务需求说明书中的定义,发给发行人机构时,报文中包含发行中所有投资人机构的投标明细;
发给投资人机构时,报文中仅包含投资人机构本身的投标明细。招标发行结果业务要素具体见表84。

表84 招标发行结果业务要素

字段	IMIX 对应	说明
InstrumentID 工具代码	48 SecurityID	最长 50 位
Instrument Short Name 工具简称	55 Symbol	最长 110 位
Instrument Full Name 工具全称	10653 FullSymbol	最长 300 位
Issuer 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	最长 300 位, 发行机构全称
Issuer 21 Firm ID 发行人机构 21 位码	当 11140PartyDetailAltRole 取值为 119 表示发行人信息 1517 PartyDetailAltID 的值表示发行 人机构 21 位码	
Issue Price 发行价格(元)	10076IssuePx	仅在息票类型为“零息/贴现”,且工具 状态为“发行成功”时传输,最长 10 位;精度:4,单位:元

Spread 利差 (BP)	218Spread	仅在息票类型为“浮息”，且工具状态为“发行成功”时传输,最长 10 位;精度: 2; 单位: BP
CouponRate 票面利率	223CouponRate	仅在息票类型为“固息”，且工具状态为“发行成功”时传输,最长 10 位,精度 4, 单位%
Real IssueSize 实际发行量 (亿元)	10078 IssueSize	仅在工具状态为“发行成功”时传输,单位: 亿元, 最长 10 位, 精度: 1
Instrument Status 工具状态	965SecurityStatus	1-发行成功 2-发行失败
Instrument Type 工具类型	167SecurityType	CD-同业存单 CD_FTA-自贸区同业存单 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 21-定向工具 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
Failure Reasons 失败原因	58 Text	仅工具状态为“发行失败”时传输
MessageType 消息类型	11272SecurityDefinitionType	2-发行结果信息 (发行人接收) 3-投标结果信息 (投资人接收) 发行失败时,消息类型默认为发行结果信息
IssueMethod 发行方式	10706 IssueMethod	0-单一价格招标发行 5-数量招标发行

BidMethod 招标方式		
CouponRateType 息票类型	10031 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”
Tender Subject 招标标的	11305TenderSubject	仅发行方式为“单一价格招标发行”时传输； 1-价格 2-利率 3-利差
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
IssueSizeForPlan 计划发行量（亿元）	10709IssueSizeForPlan	仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 单位：亿元，最长 10 位，精度：1
Total tender Amount 投标总量（亿元）	11287TotalTenderAmt	仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 单位：亿元，最长 10 位，精度：1
Total TenderSuccess Amount 中标总量（亿元）	11288TotalTenderSuccessAmt	仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 单位：亿元，最长 10 位，精度：1
TenderMultiples 投标倍数	11289TenderMultiples	仅工具状态为“发行成功”、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 2
TenderParties 投标家数	11290TenderParties	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行/数量招标发行”时传输，整数，最长 6 位
TenderSuccessParties 中标家数	11291TenderSuccessParties	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行/数量招标发行”时传输，整数，最长 6 位
TenderNumber 投标笔数	11292TenderNumber	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输，整数，最长 6 位
TenderSuccessNumber 中标笔数	11293TenderSuccessNumber	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输，整数，最长 6 位

Max Tender Price 最高投标价位	11294MaxTenderPx	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”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；
Min Tender Price 最低投标价位	11295MinTenderPx	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”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；
MarginalTender Amount 边际中标价位投标总量（亿元）	11296MarginalTenderAmt	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输，最长10位，精度1
MarginalTenderSuccess Amount 边际中标价位中标总量（亿元）	11297MarginalTenderSuccessAmt	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输，最长10位，精度1
MarginalTender Price 边际中标价	11298MarginalTenderPx	仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输，最长10位； 当招标标的为价格时，精度4，单位为“元”； 当招标标的为利差时，精度2，单位为“BP”； 当招标标的为利率时，精度为4，单位为%。
Reference Yield 参考收益率	233StipulationType 取值 IssueYield 时，234StipulationValue 的值	仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 当息票类型为“零息/贴现”传输参考收益率值，最长20位，精度4，单位%； 当息票类型为“浮息”时，工具类型为同业存单和自贸区同业存单时传输为基准利率+利差；工具类型非同业存单和自贸区同业存单时，不传输该域 当息票类型为“固息”，工具类型为同业存单和自贸区同业存单时，传输参考收益率值，最长20位，精度4，单位%； 工具类型非同业存单和自贸区同业存单时，不传输该域
Tender Chinese Name	1520PartyDetailAltSubID 组合表示，	仅工具状态为“发行成功”，发行方式

投标机构	当 1521=124 时表示投资人中文全称	为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 最长 300 位
Tender 21 Firm ID 投标机构 21 位码	11140 PartyDetailAltRole 取值 120 时, 1517 PartyDetailAltID 的值	仅工具状态为“发行成功”, 发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域
Tender Price 投标价位	11299TenderPx	最长 10 位, 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输; 当招标标的为价格时, 精度 4, 单位为元; 当招标标的为利差时, 精度 2, 单位为 BP; 当招标标的为利率时, 精度为 4, 单位%
Tender Amount 投标量 (亿元)	11300TenderAmt	仅工具状态为“发行成功”, 发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 精度 1 位
TenderSuccess Price 中标价位	11301TenderSuccessPx	最长 10 位, 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输; 当招标标的为价格时, 精度 4, 单位为元; 当招标标的为利差时, 精度 2, 单位为 BP; 当招标标的为利率时, 精度为 4, 单位%
TenderSuccess Amount 中标量 (亿元)	11302TenderSuccessAmt	仅工具状态为“发行成功”, 发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 精度 1 位
ActualFee 应缴纳金额 (元)	10407FeeActualAmt	仅工具状态为“发行成功”, 发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 根据中标量得出, 精度 2 位
Currency 币种	15Currency	如 CNY、USD

6.4.14.2 招标发行结果 IMIX 报文标准

招标发行结果IMIX报文标准见表85。

表85 招标发行结果 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	协议包版本号
9			BodyLength	1	报文体长度
35			MsgType	d	报文类型
34			MsgSeqNum	XXX	报文序列号
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	发送方标识
56			TargetCompID	EX-HUB	接收方标识
52			SendingTime	20070327-10:30:00	报文发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
128			DeliverToCompID	XXX（接收方机构ID）	最终接收方标识符
129			DeliverToSubID	XXX（接收方子标识）	最终接收方子标识
MessageBody					
15			Currency	CNY	币种 如 CNY、USD
167			SecurityType	CD	工具类型： 具体枚举值参见业务要素内容
11272			SecurityDefinitionType	2	消息类型 2-发行结果信息（发行人接收） 3-投标结果信息（投资人接收） 发行失败时，消息类型默认为发行结果信息
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
10653			FullSymbol	XXXXXX	工具全称
55			Symbol	XXXXXX	工具简称
48			SecurityID	XXXXXX	工具代码
10031			CouponRateType	1	息票类型 1-浮息 2-零息/3-贴现 0-固息
10706			IssueMethod	0	发行方式 招标方式 0-单一价格招标发行 5-数量招标发行
965			SecurityStatus	1	工具状态

					1-发行成功 2-发行失败
58			Text	XXX	失败原因 当 965 号域取值 2 时, 传输该域
10076			IssuePx	1.0000	发行价格 仅在息票类型为“零息/贴现”, 且工具状态为“发行成功”时传输该域, 最长 10 位; 精度: 4, 单位: 元
10709			IssueSizeForPlan	211.0	计划发行量 仅工具状态为“发行成功”, 发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域 单位: 亿元, 最长 10 位, 精度: 1
10078			IssueSize	122.1	实际发行量 仅在工具状态为“发行成功”时传输该域, 单位: 亿元, 最长 10 位, 精度: 1
218			Spread	12.21	利差 仅在息票类型为“浮息”, 且工具状态为“发行成功”时发送该域, 最长 10 位; 精度: 2; 单位: BP
223			CouponRate	220.0000	票面利率 仅在息票类型为“固息”, 且工具状态为“发行成功”时传输, 最长 10 位, 精度 4, 单位%
11305			TenderSubject	1	招标标的 仅发行方式为“单一价格招标发行”时传输; 1-价格 2-利率 3-利差
11287			TotalTenderAmt	22111.0	投标总量(亿元) 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域, 单位: 亿元, 最长 10 位, 精度: 1
11288			TotalTenderSuccessAmt	2211.0	中标总量(亿元) 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域, 单位: 亿元, 最长 10 位, 精度: 1
11289			TenderMultiples	15.00	投标倍数 仅工具状态为“发行成功、发行方式为

					“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，最长 10 位，精度 2
11290			TenderParties	5621	投标家数 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，整数，最长 6 位
11291			TenderSuccessParties	2211	中标家数 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，整数，最长 6 位
11292			TenderNumber	11614	投标笔数 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域，整数，最长 6 位
11293			TenderSuccessNumber	2510	中标笔数 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域，整数，最长 6 位
11294			MaxTenderPx	422.0000	最高投标价位 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域，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；
11295			MinTenderPx	210.0000	最低投标价位 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域，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；
11296			MarginalTenderAmt	2110.0	边际中标价位投标总量（亿元） 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域，最长 10 位，精度 1
11297			MarginalTenderSuccessAmt	1442.0	边际中标价位中标总量（亿元） 仅工具状态为“发行成功”、发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域，最长 10 位，精度 1
11298			MarginalTenderPx	42.0000	边际中标价 仅工具状态为“发行成功”、发行方式

					为“单一价格招标发行”时传输该域，最长 10 位； 当招标标的为价格时，精度 4，单位为元； 当招标标的为利差时，精度 2，单位为 BP； 当招标标的为利率时，精度为 4，单位%
Stipulations					
232			NoStipulations	1	重复组个数
→	233		StipulationType	IssueYield	参考收益率
→	234		StipulationValue	112.0000	仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域； 当息票类型为“零息/贴现”传输参考收益率值，最长 20 位，精度 4，单位%； 当息票类型为“浮息”时，工具类型为同业存单和自贸区同业存单时，为基准利率+利差；工具类型非同业存单和自贸区同业存单时，不传输该域； 当息票类型为“固息”，工具类型为同业存单和自贸区同业存单时，传输参考收益率值，最长 20 位，精度 4，单位%；工具类型非同业存单和自贸区同业存单时，不传输该域；
PartyDetailAlt					
1516			NoPartyDetailAltIDs	3	重复组个数
→	1517		PartyDetailAltID	XXX	机构 21 位码
→	11140		PartyDetailAltRole	119	119-发行人
→	1519		NoPartyDetailAltSubIDs	1	重复组个数
→	→	1520	PartyDetailAltSubID	XXX	
→	→	1521	PartyDetailAltSubIDType	124	124-机构中文全称
→	PartyDetailAlt				
→	1517		PartyDetailAltID	XXXX	仅发行成功时传输该重复组机构 21 位码
→	11140		PartyDetailAltRole	120	120-投资人

→	1519		NoPartyDetailAltSubIDs	1	重复组个数
→	→	1520	PartyDetailAltSubID	XXX	
→	→	1521	PartyDetailAltSubIDType	124	124-机构中文全称
→	10407		FeeActualAmt	222.00	应缴纳金额（元）当工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，根据中标量得出，精度2位
→	TenderDetails				
→	11299		TenderPx	211.0000	投标价位 最长10位，仅在工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域； 当招标标的为价格时，精度4，单位为元； 当招标标的为利差时，精度2，单位为BP； 当招标标的为利率时，精度为4，单位%
→	11300		TenderAmt	3112.0	投标量（亿元） 仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，精度1位
→	11301		TenderSuccessPx	211.0000	中标价位 最长10位，仅在工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域； 当招标标的为价格时，精度4，单位为元； 当招标标的为利差时，精度2，单位为BP； 当招标标的为利率时，精度为4，单位%
→	11302		TenderSuccessAmt	3112.0	中标量（亿元） 仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，精度1位
→	PartyDetailAlt				
→	1517		PartyDetailAltID	XXXX	仅发行成功时传输该重复组机构21位码
→	11140		PartyDetailAltRole	120	120-投资人
→	1519		NoPartyDetailAltSubIDs	1	重复组个数

→	→	1520	PartyDetailAlt SubID	XXX	
→	→	1521	PartyDetailAlt SubIDType	124	124-机构中文全称
→	10407		FeeActualAmt	222.00	应缴纳金额（元） 当工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，根据中标量得出，精度2位
→	TenderDetails				
→	11299		TenderPx	211.0000	投标价位 最长10位，仅在工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域； 当招标标的为价格时，精度4，单位为元； 当招标标的为利差时，精度2，单位为BP； 当招标标的为利率时，精度为4，单位%
→	11300		TenderAmt	3112.0	投标量（亿元） 仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，精度1位
→	11301		TenderSuccessPx	211.0000	中标价位 最长10位，仅在工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”时传输该域； 当招标标的为价格时，精度4，单位为元； 当招标标的为利差时，精度2，单位为BP； 当招标标的为利率时，精度为4，单位%
→	11302		TenderSuccessAmt	3112.0	中标量（亿元） 仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“单一价格招标发行”或“数量招标发行”时传输该域，精度1位
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	校验和

6.4.14.3 报价发行结果业务要素

根据业务需求说明书中的定义，报价发行结果业务要素具体见表86。

表86 报价发行结果业务要素

字段	IMIX 对应	说明
----	---------	----

InstrumentID 工具代码	48 SecurityID	最长 50 位
Instrument Short Name 工具简称	55 Symbol	最长 110 位
Instrument Full Name 工具全称	10653 FullSymbol	最长 300 位
Issuer 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	最长 300 位
Issuer 21 Firm ID 发行人机构 21 位码	当 11140PartyDetailAltRole 取值为 119 时表示发行人信息，1517PartyDetailAltID 的值表示发行人机构 21 位码	
Issue Price 发行价格（元）	10076IssuePx	仅在息票类型为“零息/贴现”，且工具状态为“发行成功”时传输该域，最长 10 位；精度：4，单位：元
Spread 利差（BP）	218Spread	仅在息票类型为“浮息”，且工具状态为“发行成功”时传输该域，最长 10 位；精度：2；单位：BP
CouponRate 票面利率	223CouponRate	仅在息票类型为“固息”，且工具状态为“发行成功”时传输该域，最长 10 位，精度 4，单位%
Real IssueSize 实际发行量（亿元）	10078 IssueSize	仅在工具状态为“发行成功”时传输该域，单位：亿元，最长 10 位，精度：1
Instrument Status 工具状态	965SecurityStatus	1-发行成功 2-发行失败
Instrument Type 工具类型	167SecurityType	CD-同业存单 CD_FTA-自贸区同业存单 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 21-定向工具 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
Failure Reasons 失败原因	58 Text	仅工具状态为“发行失败”时传输该域
MessageType 消息类型	11272SecurityDefinitionType	2-发行结果信息（发行人接收） 3-投标结果信息（投资人接收） 发行失败时，消息类型默认为发行结果信息
IssueMethod 发行方式	10706 IssueMethod	6-报价发行
CouponRateType 息票类型	10031 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”
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
Full Chinese Name of Subscribe Institution 申购机构	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 124 时，1520 PartyDetailAltSubID 的值表示机构中文全称	仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“报价发行”时传输 最长 300 位，机构中文全称
Subscribe Institution ID 申购机构 21 位码	11140 PartyDetailAltRole 取值 120 时，1517 PartyDetailAltID 的值	当工具状态为“发行成功”，发行方式为“报价发行”时传输该域，
Subscription Amount 认购量（亿元）	11303SubscriptionAmt	仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“报价发行”时传输 精度 1 位
ActualFee 应缴纳金额（元）	10407 FeeActualAmt	仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“报价发行”时传输 根据认购量得出，精度 2 位
SubscriptionTime 认购时间	11304SubscriptionTime	仅消息类型为“投标结果信息”，工具状态为“发行成功”，发行方式为“报

		价发行”时传输该域,格式:yyyy-mm-dd HH:MM:SS
Submit User 提交用户	1521PartyDetailAltSubIDType 取值 170 时, 1520PartyDetailAltSubID 的 值	仅消息类型为“投标结果信息”, 工具 状态为“发行成功”, 发行方式为“报 价发行”时传输该域, 提交用户真实姓 名, 场务应急为 CFETS
Currency 币种	15Currency	如 CNY、USD

6.4.14.4 报价发行结果 IMIX 报文标准

报价发行结果IMIX报文标准见表87。

表87 报价发行结果 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	协议包版本号
9			BodyLength	1	报文体长度
35			MsgType	d	报文类型
34			MsgSeqNum	XXX	报文序列号
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	发送方标识
56			TargetCompID	EX-HUB	接收方标识
52			SendingTime	20070327-10:30:00	报文发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
128			DeliverToCompID	XXX (接收方机构ID)	最终接收方标识符
129			DeliverToSubID	XXX (接收方子标识)	最终接收方子标识
MessageBody					
15			Currency	CNY	币种 如 CNY、USD
167			SecurityType	CD	工具类型: 枚举值参见业务要素
11272			SecurityDefinitionType	3	消息类型 2-发行结果信息(发行人接收) 3-投标结果信息(投资人接收) 发行失败时, 消息类型默认为发行结果信息
10653			FullSymbol	XXXXXX	工具全称
55			Symbol	XXXXXX	工具简称
10465			DataCategoryIndicat	0	数据类型标识

			or		0-本方数据 2-关联机构数据
48			SecurityID	XXXXXX	工具代码
10031			CouponRateType	1	息票类型 1-浮息 2-零息/3-贴现 0-固息
10706			IssueMethod	6	发行方式 6-报价发行
965			SecurityStatus	1	工具状态 1-发行成功 2-发行失败
58			Text	XXX	失败原因 当 965 号域取值 2 时，传输该域
10076			IssuePx	1.0000	发行价格 仅在息票类型为“零息/贴现”，且工具状态为“发行成功”时传输该域，最长 10 位；精度：4，单位：元
10078			IssueSize	122.1	实际发行量 仅在工具状态为“发行成功”时传输该域，单位：亿元，最长 10 位，精度：1
218			Spread	12.21	利差 仅在息票类型为“浮息”，且工具状态为“发行成功”时发送该域，最长 10 位；精度：2；单位：BP
223			CouponRate	220.0000	票面利率 仅在息票类型为“固息”，且工具状态为“发行成功”时传输，最长 10 位，精度 4，单位%
PartyDetailAlt					
1516			NoPartyDetailAltIDs	3	重复组个数
→	1517		PartyDetailAltID	XXX	机构 21 位码
→	11140		PartyDetailAltRole	119	119-发行人信息
→	1519		NoPartyDetailAltSubIDs	1	重复组个数
→	→	1520	PartyDetailAltSubID	XXX	
→	→	1521	PartyDetailAltSubID Type	124	机构中文全称
→	1517		PartyDetailAltID	XXX	仅发行成功时传输该重复组

					机构 21 位码
→	11140		PartyDetailAltRole	120	120-投资人
→	1519		NoPartyDetailAltSubIDs	2	重复组个数
→	→	1520	PartyDetailAltSubID	XXX	
→	→	1521	PartyDetailAltSubID Type	170	提交用户 仅消息类型为“投标结果信息”， 工具状态为“发行成功”，发行方式 为“报价发行”时传输该域，提交 用户真实姓名，场务应急为CFETS
→	→	1520	PartyDetailAltSubID	XXX	
→	→	1521	PartyDetailAltSubID Type	124	机构中文全称
→	10407		FeeActualAmt	2112.00	应缴纳金额（元） 当工具状态为“发行成功”，发行 方式为“报价发行”时传输该域， 根据认购量得出，精度 2 位
→	SubscriptionDetails				
→	11303		SubscriptionAmt	2211.0	认购量（亿元） 仅工具状态为“发行成功”，发行方式 为“报价发行”时传输该域，最长 10 位，精度 1
→	11304		SubscriptionTime	20121112-12:12:12	认购时间 仅消息类型为“投标结果信息”， 工具状态为“发行成功”，发行方式 为“报价发行”时传输该域，格式： yyyy-mm-dd HH:MM:SS
→	1517		PartyDetailAltID	XXX	仅发行成功时传输该重复组 机构 21 位码
→	11140		PartyDetailAltRole	120	120-投资人
→	1519		NoPartyDetailAltSubIDs	2	重复组个数
→	→	1520	PartyDetailAltSubID	XXX	
→	→	1521	PartyDetailAltSubID Type	170	提交用户 仅消息类型为“投标结果信息”， 工具状态为“发行成功”，发行方式 为“报价发行”时传输该域，提交 用户真实姓名，场务应急为CFETS
→	→	1520	PartyDetailAltSubID	XXX	
→	→	1521	PartyDetailAltSubID Type	124	机构中文全称

→	10407		FeeActualAmt	2112.00	应缴纳金额（元） 当工具状态为“发行成功”，发行方式为“报价发行”时传输该域，根据认购量得出，精度 2 位
→	SubscriptionDetails				
→	11303		SubscriptionAmt	2211.0	认购量（亿元） 仅工具状态为“发行成功”，发行方式为“报价发行”时传输该域，最长 10 位，精度 1
→	11304		SubscriptionTime	20121112-12:12:12	认购时间 仅消息类型为“投标结果信息”，工具状态为“发行成功”，发行方式为“报价发行”时传输该域，格式：yyyy-mm-dd HH:MM:SS
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

6.4.15 发行人缴款信息

6.4.15.1 发行人缴款信息业务要素

该投资人的实缴纳金额为0元时，投资人相关缴款信息（投资人21位码、投资人名称、托管账号、应缴款金额、实缴款金额、持有量）也需要传输。根据业务需求说明书中的定义，发行人缴款信息业务要素具体见表88。

表88 发行人缴款信息业务要素

字段	IMIX 对应	说明
InstrumentID 工具代码	48 SecurityID	最长 50 位
Instrument Short Name 工具简称	55 Symbol	最长 110 位
Instrument Full Name 工具全称	10653 FullSymbol	最长 300 位
Issuer 发行人名称	452 取 119 表示发行人 803 PartySubIDType 取值 124 表示发行人名称，523 PartySubID 填写具体的值	最长 300 位，机构中文全称
Issuer 21 Firm ID 发行人 21 位码	448PartyID	
Issue Cash Account number 发行人账号	803 PartySubIDType 取值 15 表示发行人账号，523 PartySubID 填写具体的值	最长 20 位
Investor 21 Firm ID	538NestedPartyRole 取值 120 表示投	该投资人的实缴纳金额为 0 元时，该字

投资人 21 位码	资人信息时, 524NestedPartyID 的值表示投资人 21 位码	段需要传输。
Investor Name 投资人名称	805NestedPartySubIDType 取值 124 时, 545NestedPartySubID 的值表示投资人中文全称	投资人中文全称, 最长 300 位 该投资人的实缴纳金额为 0 元时, 该字段需要传输。
Securities Account Number 托管账号	当 805NestedPartySubIDType 取值 10 时, 545NestedPartySubID 的值为托管账号	投资人托管账号, 最长 20 位 该投资人的实缴纳金额为 0 元时, 该字段需要传输。
Commission Amount 应缴款金额 (元)	11166CommissionAmt	应缴纳金额, 单位元, 精度 2 位 该投资人的实缴纳金额为 0 元时, 该字段需要传输。
Actual Commission Amount 实缴款金额 (元)	11164NetCommissionAmt	实缴纳金额, 单位元, 精度 2 位 该投资人的实缴纳金额为 0 元时, 该字段需要传输。
Quantity 持有量 (万元)	53Quantity	投资人已缴款券面总额, 单位: 万元, 精度 4 位 该投资人的实缴纳金额为 0 元时, 该字段需要传输。
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
Instrument Type 工具类型	167SecurityType	CD-同业存单 CD_FTA-自贸区同业存单 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 21-定向工具 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
Message Type 消息类型	35MsgType=U93 时, 148Headline=发 行人缴款信息	发行人缴款信息
Currency 币种	15Currency	如 CNY、USD
PaymentStatus 缴款状态	11658PaymentStatus	1-缴款成功 0-缴款失败(所有投资人的实缴纳金额 均为 0 时)

6.4.15.2 发行人缴款信息 IMIX 报文标准

发行人缴款信息IMIX报文标准见表89。

表89 发行人缴款信息 IMIX 报文标准

域号					域名	取值	说明
StandardHeader							
8					BeginStrin g	IMIX. 1. 0	协议包版本 号
9					BodyLength	1	报文体长度
35					MsgType	U93	报文类型
49					SenderComp ID	CFETS-RMB- CSTP	发送方标识
34					MsgSeqNum	XXX	报文序列号
56					TargetComp ID	EX-HUB	接收方标识
52					SendingTim e	20070327-1 0:30:00	报文发送时 间
115					OnBehalfOf CompID	CFETS-RMB	报文最初发 送方
128					DeliverToC ompID	XXX(接收方 机构 ID)	最终接收方 标识符 最后需加上 两个分号 与 129 号域 一一对应
129					DeliverToS ubID	XXX(接收方 子标识)	最终接收方 标识符 最后需加上 两个分号 与 128 号域 一一对应
MessageBody							

15					Currency	USD	如 CNY、USD
11658					PaymentStatus	1	1-缴款成功 0-缴款失败 (所有投资人的实缴纳金额均为 0 时)
167					SecurityType	CD	工具类型: 枚举值参见 业务要素表
148					Headline	发行人缴款 信息	标题
10465					DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构 数据
10653					FullSymbol	XXXXXX	工具全称
55					Symbol	XXXXXX	工具简称
48					SecurityID	XXXXXX	工具代码
11170					NoCommissions	1	费用重复组 个数
→	13				CommType	7	7-发行缴款 明细
→	11168				NoCommissionDetails	2	重复组个数
→	→	11166			Commission Amt	444.00	应缴款金额 单位元, 精 度 2 位 该投资人的 实缴纳金额 为 0 元时, 该字段需要 传输。
→	→	11164			NetCommissionAmt	12.00	实缴款金额 单位元, 精 度 2 位 该投资人的 实缴纳金额 为 0 元时, 该字段需要 传输。

→	→	53			Quantity	1000.0000	持有量（万元） 单位：万元，精度 4 位 该投资人的实缴纳金额为 0 元时，该字段需要传输。
→	→	539			NoNestedPartyIDs	1	重复组个数
→	→	→	524		NestedPartyID	XXX	投资人 21 位码 该投资人的实缴纳金额为 0 元时，该字段需要传输。
→	→	→	538		NestedPartyRole	120	120-投资人
→	→	→	804		NoNestedPartySubIDs	2	重复组个数
→	→	→	→	545	NestedPartySubID	XXX	该投资人的实缴纳金额为 0 元时，该字段需要传输。
→	→	→	→	805	NestedPartySubIDType	124	机构中文全称
→	→	→	→	545	NestedPartySubID	XXX	该投资人的实缴纳金额为 0 元时，该字段需要传输。
→	→	→	→	805	NestedPartySubIDType	10	托管账号
→	→	11166			CommissionAmt	444.00	应缴款金额 单位元，精度 2 位 该投资人的实缴纳金额为 0 元时，

							该字段需要传输。
→	→	11164			NetCommissionAmt	12.00	实缴款金额 单位元，精度 2 位 该投资人的实缴金额为 0 元时，该字段需要传输。
→	→	53			Quantity	1000.0000	持有量（万元） 单位：万元，精度 4 位 该投资人的实缴金额为 0 元时，该字段需要传输。
→	→	539			NoNestedPartyIDs	1	重复组个数
→	→	→	524		NestedPartyID	XXX	投资人 21 位码 该投资人的实缴金额为 0 元时，该字段需要传输。
→	→	→	538		NestedPartyRole	120	120-投资人
→	→	→	804		NoNestedPartySubIDs	2	重复组个数
→	→	→	→	545	NestedPartySubID	XXX	该投资人的实缴金额为 0 元时，该字段需要传输。
→	→	→	→	805	NestedPartySubIDType	124	机构中文全称
→	→	→	→	545	NestedPartySubID	XXX	该投资人的实缴金额为 0 元时，

							该字段需要传输。
→	→	→	→	805	NestedPartySubIDType	10	托管账号
453					NoPartyIDs	1	重复组个数
→	448				PartyID	XXXX	机构 21 位码
→	452				PartyRole	119	119-发行人
→	802				NoPartySubIDs	2	重复组个数
→	→	523			PartySubID	XXXX	
→	→	803			PartySubIDType	124	124-机构中文全称
→	→	523			PartySubID	XXXX	
→	→	803			PartySubIDType	15	15-发行人账号
StandardTrailer							
10					Checksum	XXX	校验和

6.4.16 预发行市场

6.4.16.1 成交业务要素

成交业务要素见表90。

表90 成交业务要素

字段	IMIX 对应	说明
ClientOrderID 客户端参考编号	11 ClOrdID	非必传字段
DealNumber 成交编号	17ExecID	
DealDate 成交日期	75TradeDate	YYYYMMDD
DealTime 成交时间	10318TradeTime	HH:mm:ss
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
TradeMethod 交易方式	10317TradeMethod	枚举值: 1-询价、3-竞价、4-请求、5-点击成交
MarketIndicator 市场标识	10176MarketIndicator	枚举: 31-预发行
Direction 交易方向	54 Side	枚举: 1-买入、4-卖出 Side 取值为 1, 则表明报文发出方交易方向为买入。则 PartyRole 取值为

		119(买入方)的交易方信息为本方, 而另一方为对手方 Side 取值为 4, 则表明该条报文发出方交易方向为卖出的, 则 PartyRole 取值为 120(卖出方)的交易方信息为本方, 而另一方为对手方;
QuoteCode 报价编号	117QuoteID	交易方式为询价、点击时, 传输报价编号, 非必传字段
OrderCode 订单编号	370orderID	限价报价成交时, 传输订单编号, 非必传字段
BondCode 债券代码	48SecurityID	
BondName 债券名称	55Symbol	
TotalFaceValue 券面总额	32LastQty	单位: 元, 整数
AccruedInterest 应计利息	159AccruedInterestAmt	单位: 元, 精度 5 位, 为空则不传
TotalAccruedInterest 应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位: 元, 精度 2 位, 为空则不传
ExpectedDirtyPrice 预期全价	44Price	单位: 元, 精度 4 位, 为空则不传
SettlementAmount 结算金额	119SettlCurrAmt	单位: 元, 精度 2 位, 为空则不传
SettlementMethod 结算方式	919DeliveryType	枚举: 0-DVP 券款对付、4-PUD 见券付款、5-DUP 见款付券、10-CSH 现金结算
SettlementDate 结算日	64SettlDate	格式: YYYYMMDD
BenchmarkInterestRateName 基准利率名称	221BenchmarkCurveName	浮动债时传该字段
Pips 点差	218Spread	浮动债时传该字段 单位: bps, 精度 2 位
ExpectedYield 预期收益率	233StipulationType=ExpectedYield 时, 234StipulationValue 的取值	固定债或贴现债传该字段 单位: %, 精度 4 位
DealStatus 成交状态	150ExecType	枚举: F-成交、4-撤销、5-修改
ContingencyIndicator 应急标识	10022 ContingencyIndicator	枚举: Y-是、N-否
SupplementTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	10282RemarkIndicator=Y, 58Text 中填写补充条款 当 10282=N 表示不存在补充条款

SupplementTerms 补充条款	58Text	
DealTransactionType 成交单消息传输状态	10105DealTransType	0-录入、1-修改、2-撤销
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
BuyerDetails 买入方信息		
BuyerInstitutionCode 买入方机构代码	452PartyRole 取值 119 时表示买入方信息, 下同 448PartyID 填写机构代码的值	机构 6 位码
BuyerPaymentSystemCode 买入方支付系统行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=112 时, 523=XXXXXX 表示支付系统行号	
BuyerCapitalAccountNumber 买入方资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=15 时, 523=XXXXXX 表示资金账号	
BuyerCapitalAccountName 买入方资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=23 时, 523=XXXXXX 表示资金账户户名	
BuyerCapitalBankName 买入方资金开户行名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=110 时, 523=XXXXXX 表示资金开户行名称	
BuyerDepositAccountNumber 买入方托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=10 时, 523=XXXXXX 表示托管账号	
BuyerDepositInstitution 买入方托管机构名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=111 时, 523=XXXXXX 表示托管机构名称	
BuyerDepositAccountName 买入方托管账户名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=22 时, 523=XXXXXX 表示托管账户名称	
BuyerTelephone 买入方电话	10603 ContactInfoIDType 取值 6 10602 ContactInfoID 填写电话号码	
BuyerTraderName 买入方交易员名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=101 时, 523=XXXXXX 表示交易员名	

	称	
BuyerTraderChineseName 买入方交易员中文名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=126 时, 523=XXXXXX 表示交易员中文名称	
BuyerInstitutionChineseFullName 买入方机构中文全称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=124 时, 523=XXXXXX 表示机构中文全称	
BuyerInstitutionChineseShortName 买入方机构中文简称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=125 时, 523=XXXXXX 表示机构中文简称	
BuyerInstitutionEnglishShortName 买入方机构简称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=102 时, 523=XXXXXX 表示机构简称	
BuyerAddress 买入方地址	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=6 时, 523=XXXXXX 表示地址	
SellerDetails 卖出方信息		
SellerInstitutionCode 卖出方机构代码	452PartyRole 取值 120 时表示卖出方信息, 下同 448PartyID 填写机构代码的值	机构 6 位码
SellerPaymentSystemCode 卖出方支付系统行号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=112 时, 523=XXXXXX 表示支付系统行号	
SellerCapitalAccountNumber 卖出方资金账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=15 时, 523=XXXXXX 表示资金账号	
SellerCapitalAccountName 卖出方资金账户户名	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=23 时, 523=XXXXXX 表示资金账户户名	
SellerCapitalBankName 卖出方资金开户行名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=110 时, 523=XXXXXX 表示资金开户行名称	
SellerDepositAccountNumber 卖出方托管账号	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=10 时, 523=XXXXXX 表示托管账号	

SellerDepositInstitution 卖出方托管机构名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=111 时, 523=XXXXXX 表示托管机构名称	
SellerDepositAccountName 卖出方托管账户名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=22 时, 523=XXXXXX 表示托管账户名称	
SellerTelephone 卖出方电话	10603 ContactInfoIDType 取值 6 10602 ContactInfoID 填写电话号码	
SellerTraderName 卖出方交易员名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=101 时, 523=XXXXXX 表示交易员名称	
SellerTraderChineseName 卖出方交易员中文名称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=126 时, 523=XXXXXX 表示交易员中文名称	
SellerInstitutionChineseFullName 卖出方机构中文全称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=124 时, 523=XXXXXX 表示机构中文全称	
SellerInstitutionChineseShortName 卖出方机构中文简称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=125 时, 523=XXXXXX 表示机构中文简称	
SellerInstitutionEnglishShortName 卖出方机构简称	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=102 时, 523=XXXXXX 表示机构简称	
SellerAddress 卖出方地址	用 803 (PartySubIDType) 以及 523 (PartySubID) 来组合表示, 当 803=6 时, 523=XXXXXX 表示地址	

6.4.16.2 成交 IMIX 报文标准

该报文可能是由交易系统发送的正常报文,也可能是通过应急工具发送的应急报文,具体辨别请参考5.3节—应急报文重发。

成交IMIX报文标准见表91。

预发行成交数据报文传输规则:

- 交易系统达成成交时,交易系统实时给 CSTP 发送对应的预发行成交数据报文,部分要素为空的场景,包括但不限于下述场景: 1. 对于新发利率招标债券,预期全价、结算金额等要素为空; 2. 对于现金结算的成交,结算金额要素为空;
- 场务复核发行价成功后,交易系统给 CSTP 重发成交数据报文,对于之前未发送的字段(参考上

述场景)进行补充;

——复核发行价后,债券信息发生变动等引发成交的结算金额、应计利息及应计利息总额等要素需更新的,交易系统给 CSTP 重发成交数据报文。

表91 成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	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	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
11			ClOrdID	XXXXXX	客户端参考编号, 非必传字段
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识, 0-本方数据 2-关联机构数据
17			ExecID	WI20130818000004	成交编号
75			TradeDate	20070821	成交日期, 格式为: YYYYMMDD
10318			TradeTime	12:40:00	成交时间, 格式为: HH:MM:SS
60			TransactTime	20070820-12:40:00	业务发生时间 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS.s ss
44			Price	55.1234	预期全价 单位: 元, 精度 4 位 为空则不传
119			SettlCurrAmt	1205333.24	结算金额 单位: 元, 精度 2 位 为空则不传
159			AccruedInterestAmt	353.12345	应计利息 单位: 元, 精度 5 位 为空则不传

10002			AccruedInterestTotalAmt	5333.24	应计利息总额 单位：元，精度 2 位 为空则不传
37			OrderID	XXX	订单编号，非必传字段
117			QuoteID	201308180320000011	报价编号，非必传字段
32			LastQty	1200000	券面总额 单位：元，整数
48			SecurityID	XXXX	债券代码
55			Symbol	XXXX	债券名称
64			SettleDate	20070820	结算日，格式为： YYYYMMDD
150			ExecType	F	成交状态， F-成交、4-撤销、5-修改
10105			DealTransType	0	成交单消息传输状态 0-录入、1-修改、2-撤销
10022			ContingencyIndicator	Y	应急标识 Y-是、N-否
10282			RemarkIndicator	Y	有无补充条款
58			Text	XXX	补充条款
919			DeliveryType	0	结算方式 0-DVP 券款对付、4-PUD 见券付款、5-DUP 见款 付券、10-CSH 现金结算
10176			MarketIndicator	31	市场标识 31-预发行
10317			TradeMethod	5	交易方式 1-询价、3-竞价、4-请 求、5-点击成交
54			Side	1	交易方向，1-买；4-卖
221			BenchmarkCurveName	XXXX	基准利率名称 浮动债时传该字段
218			Spread	0.05	点差 单位：bps，精度 2 位 浮动债时传该字段
232			NoStipulations	1	预期收益率 单位：%，精度 4 位 固定债或贴现债传该 字段
→	233		StipulationType	ExpectedYield	
→	234		StipulationValue	0.2345	
453			NoPartyIDs	2	
→	448		PartyID	XXXX	买入方机构 6 位码

→	452		PartyRole	119	买入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	买入方电话
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	买入方地址
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	买入方交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	买入方机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	买入方机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	买入方机构简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	买入方交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	买入方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	买入方资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	买入方资金开户行名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	买入方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	买入方托管账户名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	买入方托管机构
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	买入方托管账号
→	448		PartyID	XXXX	卖出方机构 6 位码
→	452		PartyRole	120	卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	卖出方电话
→	802		NoPartySubIDs	13	
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	卖出方地址

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	卖出方交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	卖出方机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	卖出方机构中文全称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	卖出方机构简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	卖出方交易员名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	卖出方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	卖出方资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	卖出方资金开户行名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	卖出方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	卖出方托管账户名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	卖出方托管机构名称
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	卖出方托管账号
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.17 信用违约互换市场

6.4.17.1 信用违约互换非固定支付方式成交业务要素

信用违约互换非固定支付方式成交业务要素见表92。

表92 信用违约互换非固定支付方式成交业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DealTime 成交时间	10318 TradeTime	格式为: HH:MM:SS
DealDate 成交日期	75 TradeDate	格式为: YYYYMMDD
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	枚举值: Y-Yes

		N-No
TransactTime 业务发生时间	60TransactTime	格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
DealNumber 成交编号	17 ExecID	
ClientOrderID 客户端参考编号	11C10rdID	
MarketIndicator 市场	10176 MarketIndicator	48-信用违约互换市场
TradeMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
Direction 交易方向	54 Side	枚举: 1-买入、4-卖出 Side 取值为 1, 则表明报文发出方交易方向为买入。则 PartyRole 取值为 119(买入方)的交易方信息为本方, 而另一方为对手方 Side 取值为 4, 则表明该条报文发出方交易方向为卖出的, 则 PartyRole 取值为 120(卖出方)的交易方信息为本方, 而另一方为对手方;
Deal Status 成交状态	150 ExecType	枚举值: F-正常 4-撤销 5-修改
ProductType 类型	11419 ProductType	1-信用违约互换-非固定支付方式
Reference Entity 参考实体	11427ReferenceIssure	
Reference Debt Name 参考债务名称	11428 ReferenceSymbol	
Reference Debt Code 参考债务代码	11429ReferenceCode	
StartDate 起始日	916StartDate	格式: YYYYMMDD
Term 期限	10316 TradeLimitDays	格式: YYYMMDDDD
Agreed Maturity Date 约定到期日	917EndDate	格式: YYYYMMDD

NotionalAmount 交易名义本金	32LastQty	单位：元，精度 0 位
Settle Currency 币种	120 SettleCurrency	结算币种，如：CNY、USD
SupplementaryClause 履约担保条款	10307 SupplementaryClause	支持 600 个汉字、数字或字母
SupplementTermsIndicator 有无补充条款	10282RemarkIndicator	枚举值：Y-是、N-否 当 10282 取值 Y 时，可以查看 58Text 域取补充条款信息
SupplementTerms 补充条款	58 Text	
FrontFee 前端费	11420 FrontFee	单位：元，精度 2 位
FrontFeeRate 前端费率	11421 FrontFeeRate	单位%，精度 4 位
FrontFeePaymentDate 前端费支付日	11422 FrontFeePaymentDate	格式：YYYYMMDD
Price 费率	44 Price	单位：bps，精度 2 位
CouponPaymentFrequency 支付频率	10030 CouponPaymentFrequency	枚举值： 0-半年 1-年 3-月 4-季
DayCount 计息基准	10040 DayCount	枚举值： 0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F
InterestAccuralDaysAdjustment 计息天数调整	10018InterestAccuralDaysAdjustment	枚举值： 0-不调整 1-实际天数
CouponPaymentDateReset 营业日准则	10009CouponPaymentDateReset	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
First Payment Amount 首期支付金额	11423 PaymentCurrAmt	单位：元，精度 2 位
FirstPaymentDate 首期支付日	504 PaymentDate	格式：YYYYMMDD
ClearingMethod 清算方式	11143ClearingMethod	枚举值： 13-双边自行清算

CalculateAgency 计算机构	10346CalculateAgency	枚举值： 0-中国外汇交易中心 1-卖方 2-买方 3-交易双方 4-第三方
CalculateAgencyDescription 第三方计算机构	10659CalculateAgencyDesc	当“计算机构”选择“第三方”时传该字段
Debt Type 债务种类	11430 DefaultOblType	枚举值： 0-付款义务 1-借贷款项 2-贷款 3-债务工具 4-贷款或债务工具 5-仅为参考债务 6-非金融企业债务融资工具 99-其他
Debt Type Description 详细债务种类	11431 DefaultOblTypeDesc	当“债务种类”选择“其他”时传该字段
Debt Feature 债务特征	使用 DefaultOblGrp 组件 11433DefaultOblFeature	枚举值： 0-一般债务 1-次级债务 2-交易流通 3-本币 4-外币 99-其他
Debt Feature Description 详细债务特征	使用 DefaultOblGrp 组件 11434DefaultOblFeatureDesc	当“债务特征”选择“其他”时传该字段
Credit Event 信用事件	使用重复组件 EvntGrp 表示， 865EventType	枚举值： 103-破产 104-支付违约 105-债务加速到期 128-债务潜在加速到期 129-债务重组 108-其他
Threshold Amount 起点金额	867 EventPx	单位：元，精度 0 位 当“信用事件”选择“支付违约、债务加速到期、债务潜在加速到期、债务重组”时传该字段
Grace Period 宽限期	11440GracePeriod	当“信用事件”选择“支付违约”时才传该字段 单位：天，精度 0 位

Grace Period Postpone Flag 宽限期顺延	11454 IsGracePeriodPostpone	枚举值： Y-是 N-否 当“信用事件”选择“支付违约” 时才传该字段
MinNumberOfPossessor 所涉债务最小持有人数	11441MinNumberOfPossessor	精度 0 位 当“信用事件”选择“债务重组” 时才传该字段
Detail Event Description 详细信用事件	868EventText	当“信用事件”选择“其他”时， 才传该字段
DeliveryType 结算方式	919 DeliveryType	枚举值： 7-实物结算 10-现金结算
CashSettlQuoteMethod 报价方法	使用 CashSettlTermGrp 组件 11444CashSettlQuoteMethod	当“结算方式”选择“现金结算” 时传该字段 枚举值： 0-买入价 1-中间价 2-卖出价 99-其他
CashSettlQuoteMethodDesc 详细报价方法	使用 CashSettlTermGrp 组件 11445CashSettlQuoteMethodDesc	当“报价方法”选择“其他”时 传该字段
CashSettlValuationMethod 估值方法	使用 CashSettlTermGrp 组件 11446CashSettlValuationMethod	当“结算方式”选择“现金结算” 时传该字段 枚举值： 0-市场价格 1-最高报价 99-其他
CashSettlValuationMethodDescription 详细估值方法	使用 CashSettlTermGrp 组件 11447CashSettlValuationMethodDesc	当“估值方法”选择“其他”时 传该字段
CashSettlQuoteTime 报价时间（现金）	使用 CashSettlTermGrp 组件 11448CashSettlQuoteTime	格式：一个营业日的北京时间 HH:MM 当“结算方式”选择“现金结算” 的时传该字段
Delivery Debt Type 可交付债务种类	11435 ReferableOblType	当结算方式选择实物结算时传 该字段 枚举值： 0-付款义务 1-借贷款项 2-贷款 3-债务工具 4-贷款或债务工具

		5-仅为参考债务 6-非金融企业债务融资工具 99-其他
Delivery Debt Type Description 详细可交付债务种类	11436 ReferableOblTypeDesc	当“可交付债务种类”选择“其他”时传该字段
Delivery Debt Status 可交付债务特征	使用 ReferableOblGrp 组件 11438 ReferableOblFeature	当结算方式选择实物结算时传该字段 枚举值： 0-一般债务 1-次级债务 2-交易流通（不含 PPN） 3-本币 4-外币 5-无扣减债务 6-可转让贷款 7-转让受限贷款 8-最长待偿期 10 年 99-其他
Delivery Debt Status Description 详细可交付债务特征	使用 ReferableOblGrp 组件 11439 ReferableOblFeatureDesc	当“可交付债务特征”选择“其他”时传该字段
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	枚举值： 0-本方数据 2-关联机构数据
Buyer Short Chinese Name of Firm 买方机构简称中文	54=1、452=119 表示买入方 使用<Parties>组件， 803 PartySubIDType 取值 125 表示买方机构简称中文， 523PartySubID 表示具体的值	
Buyer Full Chinese Name of Firm 买方机构全称中文	803 PartySubIDType 取值 124 表示买方机构全称中文。 523PartySubID 表示具体的值	
BuyerPartyID 买方机构 6 位码	448 PartyID	
Buyer Trader Name 买方交易员姓名	803 PartySubIDType 取值 101 表示买方交易员姓名， 523PartySubID 表示具体的值	
Buyer Trader Chinese Name 买方交易员中文名称	803 PartySubIDType 取值 126 表示交易员中文名称，523 PartySubID 表示具体的值	
Buyer Short English Name of Firm 买方机构英文简称	803 PartySubIDType 取值 102 表示买方机构英文简称， 523PartySubID 表示具体的值	
Buyer Party Address	803 PartySubIDType 取值 6 表示买方地址，	

买方地址	523PartySubID 表示具体的值	
Buyer Trader Telephone Number 买方联系方式	10603 ContactInfoIDType 取值 6 表示买方 联系方式， 10602 ContactInfoID 表示具体的值	
SellerShort Chinese Name of Firm 卖方机构简称中文	54=4、452=120 表示卖出方 使用<Parties>组件， 803 PartySubIDType 取值 125 表示卖方机 构中文简称， 523 PartySubID 表示具体的值	
Seller Full Chinese Name of Firm 卖方机构全称中文	803 PartySubIDType 取值 124 表示卖方机 构中文全称， 523 PartySubID 表示具体的值	
SellerPartyID 卖方机构 6 位码	803 PartySubIDType 取值 135 表示卖方机 构 6 位码， 523 PartySubID 表示具体的值	
SellerTrader Name 卖方交易员姓名	803 PartySubIDType 取值 101 表示卖方交 易员姓名， 523 PartySubID 表示具体的值	
SellerTrader Chinese Name 卖方交易员中文名称	803 PartySubIDType 取值 126 表示交易员 中文名称，523 PartySubID 表示具体的值	
SellerShort English Name of Firm 卖方机构英文简称	803 PartySubIDType 取值 102 表示卖方机 构英文简称， 523 PartySubID 表示具体的值	
Seller Party Address 卖方地址	803 PartySubIDType 取值 6 表示卖方地址， 523 PartySubID 表示具体的值	
SellerTrader Telephone Number 卖方联系方式	10603 ContactInfoIDType 取值 6 表示卖方 联系方式， 10602 ContactInfoID 表示具体的值	
Buyer SettlementAccountName 买方资金账户户名	54=1、452=119 表示买入方 使用<PtysSubGrp>重复组， 803PartySubIDType 取值 23 表示资金账户 户名， 523 PartySubID 表示具体的值	
Buyer SettlementBankName 买方资金开户行	803PartySubIDType 取值 110 表示资金开户 行名称， 523 PartySubID 表示具体的值	
Buyer SettlementAccountNumber 买方资金账号	803PartySubIDType 取值 15 表示资金账号， 523 PartySubID 表示具体的值	
Buyer BankSortCode 买方支付系统行号	803PartySubIDType 取值 112 表示支付系统 行号， 523 PartySubID 表示具体的值	
Buyer CustodianAccountName	803PartySubIDType 取值 22 表示托管账户	托管机构可选择国债登，也可选

买方托管账户户名	名称, 523 PartySubID 表示具体的值	择清算所,可以两者都选,也可以两者都不选。 当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在国债登的账户户名
Buyer CustodianName 买方托管机构	803PartySubIDType 取值 111 表示托管机构, 523 PartySubID 表示具体的值	当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在国债登的托管机构
Buyer CustodianAccountNumber 买方托管账号	803PartySubIDType 取值 10 表示托管账号, 523 PartySubID 表示具体的值	当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在国债登的托管账号
Buyer CustodianAccountName2 买方托管账户户名 2	803PartySubIDType 取值 239 表示托管账户名称 2, 523 PartySubID 表示具体的值	托管机构可选择国债登,也可选择清算所,可以两者都选,也可以两者都不选。 当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在清算所的账户户名
Buyer CustodianName2 买方托管机构 2	803PartySubIDType 取值 241 表示托管机构 2, 523 PartySubID 表示具体的值	当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在清算所的托管机构
Buyer CustodianAccountNumber2 买方托管账号 2	803PartySubIDType 取值 240 表示托管账号 2, 523 PartySubID 表示具体的值	当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在清算所的托管账号
Seller SettlementAccountName 卖方资金账户户名	54=4、452=120 表示卖出方 使用<PtysSubGrp>重复组, 803PartySubIDType 取值 23 表示资金账户户名, 523 PartySubID 表示具体的值	
Seller SettlementBankName 卖方资金开户行	803PartySubIDType 取值 110 表示资金开户行名称, 523 PartySubID 表示具体的值	
Seller SettlementAccountNumber 卖方资金账号	803PartySubIDType 取值 15 表示资金账号, 523 PartySubID 表示具体的值	
Seller BankSortCode 卖方支付系统行号	803PartySubIDType 取值 112 表示支付系统行号, 523 PartySubID 表示具体的值	
Seller CustodianAccountName 卖方托管账户户名	803PartySubIDType 取值 22 表示托管账户名称, 523 PartySubID 表示具体的值	托管机构可选择国债登,也可选择清算所,可以两者都选,也可以两者都不选。 当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在国债登的账户户名

Seller CustodianName 卖方托管机构	803PartySubIDType 取值 111 表示托管机构, 523 PartySubID 表示具体的值	当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在国债登的托管机构
Seller CustodianAccountNumber 卖方托管账号	803PartySubIDType 取值 10 表示托管账号, 523 PartySubID 表示具体的值	当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在国债登的托管账号
Seller CustodianAccountName2 卖方托管账户户名 2	803PartySubIDType 取值 239 表示托管账户名称 2, 523 PartySubID 表示具体的值	托管机构可选择国债登,也可选择清算所,可以两者都选,也可以两者都不选。 当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在清算所的账户户名
Seller CustodianName2 卖方托管机构 2	803PartySubIDType 取值 241 表示托管机构 2, 523 PartySubID 表示具体的值	当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在清算所的托管机构
Seller CustodianAccountNumber2 卖方托管账号 2	803PartySubIDType 取值 240 表示托管账号 2, 523 PartySubID 表示具体的值	当结算方式选择实物结算时传该字段 托管在清算所的托管账号

6.4.17.2 信用违约互换非固定支付方式成交 IMIX 报文标准

信用违约互换非固定支付方式成交IMIX报文标准见表93。

表93 信用违约互换非固定支付方式成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	协议包版本号
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20160816-12:40:00.123	发送时间 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS 或 者 YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方

					子标识
MessageBody					
10318			TradeTime	12:40:00	成交时间， 格式为：HH:MM:SS
75			TradeDate	20160816	成交日期， 格式为：YYYYMMDD
10022			ContingencyIndicator	Y	应急标识 Y-Yes N-No
60			TransactTime	20160816-12:40:00.123	业务发生时间 格 式： YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
17			ExecID	XXX	成交编号
11			ClOrdID	XXX	客户端参考编号
10176			MarketIndicator	48	48-信用违约互换市场
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
54			Side	1	交易方向 1-买入 4-卖出
150			ExecType	F	成交状态： F-正常 4-撤销 5-修改
11419			ProductType	1	类型 1-信用违约互换-非固定支付方式
11427			ReferenceIssure	XXX	参考实体
11428			ReferenceSymbol	XXX	参考债务名称
11429			ReferenceCode	XXX	参考债务代码
916			StartDate	20160816	起始日 格式：YYYYMMDD
10316			TradeLimitDays	XXX	期限 格式：YYMMDDDD
917			EndDate	20160817	约定到期日 格式：YYYYMMDD
32			LastQty	10000	交易名义本金 单位：元，精度 0 位
120			SettlCurrency	CNY	币种

					CNY、USD
10307			SupplementaryCause	XXX	履约担保条款
10282			RemarkIndicator	Y	有无补充条款
58			Text	XXX	补充条款
11420			FrontFee	10000.12	前端费 单位：元，精度 2 位
11421			FrontFeeRate	2.1100	前端费率 单位：%，精度 4 位
11422			FrontFeePaymentDate	20160816	前端费支付日 格式：YYYYMMDD
44			Price	4.11	费率 单位：bps，精度 2 位
10030			CouponPaymentFrequency	0	支付频率 0-半年 1-年 3-月 4-季
10040			DayCount	0	计息基准 0-实际/实际 1-实际/360 3-实际/365 5-实际/365F
10018			InterestAccrualDaysAdjustment	0	计息天数调整 0-不调整 1-实际天数
10009			CouponPaymentDateReset	0	营业日准则 0-上一营业日 1-下一营业日 2-经调整的下一营业日
11423			PaymentCurrAmt	10000.12	首期支付金额 单位：元，精度 2 位
504			PaymentDate	20160816	首期支付日 格式：YYYYMMDD
11143			ClearingMethod	13	清算方式 13-双边自行清算
10346			CalculateAgency	4	计算机构

					0-中国外汇交易中心 1-卖方 2-买方 3-交易双方 4-第三方
10659			CalculateAgency Desc	XXX	第三方计算机构 当“计算机构”选择“第三方”时传该字段
11430			DefaultOblType	99	债务种类 0-付款义务 1-借贷款项 2-贷款 3-债务工具 4-贷款或债务工具 5-仅为参考债务 6-非金融企业债务融资工具 99-其他
11431			DefaultOblTypeDesc	XXX	详细债务种类 当“债务种类”选择“其他”时传该字段
919			DeliveryType	10	结算方式 7-实物结算 10-现金结算
11435			ReferableOblType	99	可交付债务种类 0-付款义务 1-借贷款项 2-贷款 3-债务工具 4-贷款或债务工具 5-仅为参考债务 6-非金融企业债务融资工具 99-其他 当“结算方式”选择“实物结算”时传该字段

11436			ReferableOblTypeDesc	XXX	详细可交付债务种类 当“可交付债务种类”选择“其他”时传该字段
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识, 0-本方数据 2-关联机构数据
DefaultOblGrp					
11432			NoDefaultObIs	1	重复组个数
→	11433		DefaultOblFeature	99	债务特征 0-一般债务 1-次级债务 2-交易流通 3-本币 4-外币 99-其他
→	11434		DefaultOblFeatureDesc	XXX	详细债务特征 当“债务特征”选择“其他”时传该字段
EvntGrp					
864			NoEvents	1	重复组个数
→	865		EventType	108	信用事件 103-破产 104-支付违约 105-债务加速到期 128-债务潜在加速到期 129-债务重组 108-其他
→	867		EventPx	1000	起点金额 单位: 元, 精度 0 位 当“信用事件”选择“支付违约、债务加速到期、债务潜在加速到期、债务重组”时传该字段
→	11440		GracePeriod	XXX	宽限期

					单位：天，精度 0 位 当“信用事件”选择“支付违约”时才传该字段
→	11454		IsGracePeriodPostpone	Y	宽限期顺延 Y-是 N-否 当“信用事件”选择“支付违约”时才传该字段
→	11441		MinNumberOfPossessor	8	所涉债务最小持有人数 精度 0 位 当“信用事件”选择“债务重组”时才传该字段
→	868		EventText	XXX	详细信用事件 当“信用事件”选择“其他”时，才传该字段
CashSettlTermGrp					
11442			NoCashSettlTerms	1	重复组个数 当“结算方式”选择“现金结算”时传该组件
→	11443		CashSettlCurrency	-	组件必须域
→	11444		CashSettlQuoteMethod	99	报价方法 0-买入价 1-中间价 2-卖出价 99-其他
→	11445		CashSettlQuoteMethodDesc	XXX	详细报价方法 当“报价方法”选择“其他”时传该字段
→	11446		CashSettlValuationMethod	99	估值方法 0-市场价格 1-最高报价 99-其他 当“结算方式”选

					择“现金结算”时 传该字段
→	11447		CashSettlValuationMethodDesc	XXX	详细估值方法 当“估值方法”选择“其他”时传该 字段
→	11448		CashSettlQuoteTime	一个营业日的北 京时间 16:00	格式：一个营业日 的北京时间 HH:MM
ReferableOblGrp					
11437			NoReferableObIs	1	重复组个数
→	11438		ReferableOblFeature	99	可交付债务特征 0-一般债务 1-次级债务 2-交易流通（不含 PPN） 3-本币 4-外币 5-无扣减债务 6-可转让贷款 7-转让受限贷款 8-最长待偿期 10 年 99-其他 当“结算方式”选 择“实物结算”时 传该字段
→	11439		ReferableOblFeatureDesc	XXX	详细可交付债务 特征 当“可交付债务特 征”选择“其他” 时传该字段
Parties					
453			NoPartyIDs	2	重复组个数
→	448		PartyID	XXX	买方机构 6 位码
→	452		PartyRole	119	119-买入方
→	10601		NoContactInfos	1	重复组个数
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	买方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	16	重复组个数
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	买方机构简称中

					文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	买方机构全称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	买方交易员姓名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	买方交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	买方机构简称英文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	买方地址
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	买方资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	买方资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	买方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	买方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	买方托管账户户名 当结算方式选择实物结算时传该字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	买方托管机构 当结算方式选择实物结算时传该字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	买方托管账号 当结算方式选择实物结算时传该字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	239	买方托管账户户

					名 2 当结算方式选择 实物结算时传该 字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	241	买方托管机构 2 当结算方式选择 实物结算时传该 字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	240	买方托管账号 2 当结算方式选择 实物结算时传该 字段
→	448		PartyID	XXX	卖方机构 6 位码
→	452		PartyRole	120	120-卖出方
→	10601		NoContactInfos	1	重复组个数
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	卖方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	16	重复组个数
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	卖方机构简称中 文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	卖方机构全称中 文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	卖方交易员姓名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	卖方交易员中文 名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	卖方机构简称英 文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	卖方地址
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	卖方资金账户户 名
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	卖方资金开户行

→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	卖方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	卖方支付系统行号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	22	卖方托管账户户名 当结算方式选择实物结算时传该字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	111	卖方托管机构 当结算方式选择实物结算时传该字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	卖方托管账号 当结算方式选择实物结算时传该字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	239	卖方托管账户户名2 当结算方式选择实物结算时传该字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	241	卖方托管机构2 当结算方式选择实物结算时传该字段
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	240	卖方托管账号2 当结算方式选择实物结算时传该字段
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

6.4.18 常备借贷便利

6.4.18.1 常备借贷便利成交数据业务要素

常备借贷便利成交数据业务要素见表94。

表94 常备借贷便利成交数据业务要素

字段	IMIX 对应	说明
Date 日期	75 TradeDate	格式: YYYYMMDD
ApplicationID 申请编号	17 ExecID	常备借贷便利成交编号
ApplicationAmount 申请金额	10312 TradeCashAmt	单位: 元, 精度: 2
Term 期限	10316TradeLimitDays	单位: 天 借款不能超过 365 天
Rate 利率	44 Price	单位: %, 精度: 4
TotalFaceValueforCollateral 质押券券面总额	32 LastQty 对单个券种的券面总额合计使用879 UnderlyingQty	单位: 元。精度: 2 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。 非必传字段
CollateralBondCode 质押券代码	质押券代码使用309 UnderlyingSecurityID表示, 由于有多个质押券, 需要使用重复组 UnderlyingInstrument来存放, 其中 711 NoUnderlyings来表示所质押券的数目	可以为多个 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。 非必传字段
FaceValueforCollateral 质押券券面金额	质 押 券 券 面 金 额 使 用 879 UnderlyingQty表示, 由于有多个质押券, 需 要 使 用 重 复 组 UnderlyingInstrument来存放, 其中 711 NoUnderlyings来表示所质押券的数目	可以为多个。 单位: 元。精度: 2 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。 非必传字段
Discount 折算率	使用UnderlyingStipulations组件, 消息组件结构参考例子。当 888 UnderlyingStipType 取值 Haircut 则 889 UnderlyingStipValue表示折算率	可以为多个。 单位: %。精度: 4 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。 非必传字段
StartDate 起息日	64 SettlDate	格式: YYYYMMDD
EndDate 到期日	193 SettlDate2	格式: YYYYMMDD
SettlementAmount 到期结算金额	10289 SettlCurrAmt2	单位: 元。精度: 2
Interest	159AccruedInterestAmt	单位: 元。精度: 2

利息		
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465 Data category Indicator 取值 0 表示本方数据，	枚举值： 0-本方数据；
PledgeContractSignatoryfor(sub-)branch 质押合同签署方-分支行	452 取 204 表示分支行 803 PartySubIDType取值256表示质押合同签署方-分支行，523PartySubID填写具体的值	机构中文名称
LoanContractSignatoryfor(sub-)branch 贷款合同签署方-分支行	452 取 204 表示分支行 803 PartySubIDType 取值 257 表示贷款合同签署方-分支行，523PartySubID填写具体的值	机构中文名称
PledgeContractSignatoryforCorporate 质押合同签署方-法人	452 取 203 表示法人 803 PartySubIDType取值256表示质押合同签署方-法人，523PartySubID填写具体的值	机构中文名称
LoanContractSignatoryforCorporate 贷款合同签署方-法人	452 取 203 表示法人 803 PartySubIDType取值257表示贷款合同签署方-法人，523PartySubID填写具体的值	机构中文名称
CorporateInstitutionCode 法人机构代码	452 取 203 表示法人 448 PartyID 可填写法人机构代码	机构 6 位码
CorporateSettlementAccountNumber 法人资金账号	452 取 203 表示法人 803PartySubIDType取值15表示法人资金账号，523PartySubID填写具体的值	
CorporateCustodianAccountNumber 法人托管账号	452 取 203 表示法人 803 PartySubIDType取值10表示法人托管账号，523PartySubID填写具体的值	信贷资产流程不传输该字段 非必传字段
ProcessingStatus 流程状态	11787ProcessingStatusString	如：签署完毕、已放款
UpdateTime 更新时间	60 TransactTime	格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS
CollateralType 抵押品种类	10344 CollateralType	枚举值： 5-国债公司债券 6-上海清算所债券 7-信贷资产
SettlementMethod 结算方式	919 DeliveryType	枚举值： 0-DVP 99-非 DVP 质押品种类为国债公司债券时传输该字段 非必传字段

6.4.18.2 常备借贷便利成交数据 IMIX 报文标准

常备借贷便利成交数据IMIX报文标准见表95。

表95 常备借贷便利成交数据 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	25	报文序列号
52			SendingTime	20170520-12:54:34	报文发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-IPP-SLF-CSTP-DEAL	最初发送方标识符
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方标识
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方标识
128			DeliverToCompID	XXXXXX	最终接收方标识符
129			DeliverToSubID	XXXXXX	最终接收方子标识符
MessageBody					
75			TradeDate	20170504	日期 格式: YYYYMMDD
17			ExecID	XXXXXX	申请编号
10312			TradeCashAmt	340000.00	申请金额 单位: 元, 精度: 2
10316			TradeLimitDays	60	期限 单位: 天 借款不能超过 365 天
44			Price	3.1234	利率 单位: %, 精度: 4
11583			MarketCode	6	该域在此报文中必传 枚举值: 6-常备借贷便利
32			LastQty	380000.00	质押券券面总额 单位: 元。精度: 2 国债非 DVP 和上

					海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。 非必传字段
711			NoUnderlyings	2	重复次数 该组件非必传
→	309		UnderlyingSecurityID	XXXXXX	质押券代码 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。
→	879		UnderlyingQty	120000.00	质押券券面金额 单位: 元。精度: 2 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。
→	887		NoUnderlyingStips	1	重复次数为 1
→	→	888	UnderlyingStipType	Haircut	折算率
→	→	889	UnderlyingStipValue	9.1234	单位: %, 保留 4 位小数 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。
→	309		UnderlyingSecurityID	XXXXXX	质押券代码 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。
→	879		UnderlyingQty	260000.00	质押券券面金额 单位: 元, 保留 2 位小数 国债非 DVP 和上

					海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。
→	887		NoUnderlyingStips	1	重复次数为 1
→	→	888	UnderlyingStipType	Haircut	折算率
→	→	889	UnderlyingStipValue	9.1234	单位: %。精度: 4 国债非 DVP 和上海清算所流程传输, 国债 DVP 和信贷资产流程不传输。
64			SettlDate	20170522	起息日 格式: YYYYMMDD
193			SettlDate2	20170821	到期日 格式: YYYYMMDD
10289			SettlCurrAmt2	10000.00	到期结算金额 单位: 元。精度: 2
159			AccruedInterestAmt	100.00	利息 单位: 元。精度: 2
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据
453			NoPartyIDs	2	重复次数为 2
→	448		PartyID	-	必须域
→	452		PartyRole	204	204-分支行
→	802		NoPartySubIDs	2	重复次数为 2
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	机构中文名称
→	→	803	PartySubIDType	256	256-质押合同签署方-分支行
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	机构中文名称
→	→	803	PartySubIDType	257	257-贷款合同签署方-分支行
→	448		PartyID	XXXXXX	法人机构代码 机构 6 位码
→	452		PartyRole	203	203-法人
→	802		NoPartySubIDs	4	重复次数为 4
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	机构中文名称
→	→	803	PartySubIDType	256	256-质押合同签

					署方-法人
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	机构中文名称
→	→	803	PartySubIDType	257	257-贷款合同签署方-法人
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	15-法人资金账号
→	→	523	PartySubID	XXXXXX	
→	→	803	PartySubIDType	10	10-法人托管账号 信贷资产流程不 传输该字段 非必传字段
11787			ProcessingStatusString	签署完毕	流程状态 如：签署完毕、已放款
60			TransactTime	20170801-11:44:30	更新时间 YYYYMMDD-HH:MM:SS
10344			CollateralType	5	抵押品种类 枚举值： 5-国债公司债券 6-上海清算所债券 7-信贷资产
919			DeliveryType	0	结算方式 枚举值： 0-DVP 99-非 DVP 质押品种类为国 债公司债券时传 输该字段 非必传字段
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	校验和

6.4.19 同业存款市场

6.4.19.1 同业存款成交业务要素

同业存款成交业务要素见表96。

表96 同业存款成交业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DealTime	10318TradeTime	格式：HH:MM:SS

成交时间		
DealDate 成交日期	75TradeDate	格式: YYYYMMDD
QuoteCode 报价编号	117QuoteID	
UpdateDate 更新日	60TransactTime	格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
DealCode 成交编号	17ExecID	
OrderCode 客户端参考编号	11 C10rdID	应急录入和应急修改时不发送该字段
MarketIndicator 市场	10176MarketIndicator	53-同业存款
TradingProduct 交易品种代码	48SecurityID	字符串 例如: IBD001
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
DealStatus 成交状态	150ExecType	F-正常、4-撤销、5-修改
Direction 交易方向	54 Side	1-存入 4-存出
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-是、N-否
Deposit term 存款期限	10751 SecurityTermString	单位: 天, 整数
Deposit amount 存款金额	32LastQty	单位: 元, 精度: 2 位
Deposit interest rate 存款利率	44Price	单位: %, 精度: 4 位
Coupon Frequency 付息频率	10030CouponPaymentFrequency	2-到期一次还本付息 3-按月付息 4-按季付息
First Coupon Date 首次付息日	224 CouponPaymentDate	格式: YYYYMMDD 当“付息频率”取值“2-到期一次还本付息”时, 则不传该字段
Early Withdraw Agreement 提前支取约定	11773 AdvanceWithdrawAgreement	1-不允许提前支取 2-允许全额提前支取 3-允许全额或部分提前支取
Early Withdraw Expected Rate 提前支取预期利率	使用 Stipulations 组件, 233StipulationType 取 值 为 ExpectedYield 时表示提前支取预期 利率,	单位: %, 精度: 4 位 当“提前支取约定”取值“1-不允许提前支取”时, 则不传该字段

	234StipulationValue 填写具体值	
Total Accrued Interest 应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位：元，精度：2 位
Maturity Withdraw Amount 到期支取金额	10289SettlCurrAmt2	单位：元，精度：2 位
Actual Cash Holding Days 实际占款天数	10014 CashHoldingDays	单位：天，整数
First settlement date 首次结算日	64 SettlDate	格式：YYYYMMDD
Maturity date 到期支取日	193 SettlDate2	格式：YYYYMMDD
Interest payment date 付息日	使用 UndInstrmtGrp 组件 241 UnderlyingCouponPaymentDate	格式：YYYYMMDD 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Accrued interest 应计利息	使用 UndInstrmtGrp 组件 10321 UnderlyingAccruedInterestAmt	单位：元，精度：2 位 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Supplement Terms 补充条款	58Text	600 个汉字，为空则不传
Supplimentary Terms Attachment Indicator 有无补充条款附件	11862 SupplementAttachmentIndicator	0-无 1-有 枚举值为“1-有”时，补充条款附件内容请参照本币交易系统中对应成交单
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
SellerShort Chinese Name of Firm 存出方机构简称中文	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 120 表示存出方； 803 PartySubIDType 取值 125 表示存 出方机构简称中文， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller Full Chinese Name of Firm 存出方机构全称中文	452 PartyRole 取值 120 表示存出方； 803 PartySubIDType 取值 124 表示存 出方机构全称中文， 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerPartyID 存出方机构 6 位码	448 PartyID	
Seller Managing Entity 存出方经办行/产品	11789 ManagingEntity2	
SellerTrader Name 存出方交易员姓名	452 PartyRole 取值 120 表示存出方； 803 PartySubIDType 取值 101 表示存 出方交易员姓名， 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerTrader Chinese Name	452 PartyRole 取值 120 表示存出方；	

存出方交易员中文名称	803 PartySubIDType 取值 126 表示存出方交易员中文名称, 523 PartySubID 表示具体的值	
SellerShort English Name of Firm 存出方机构英文简称	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 102 表示存出方机构英文简称, 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller Party Address 存出方地址	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 6 表示存出方地址, 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerTrader Telephone Number 存出方联系方式	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 使用 ContactInfoGrp 表示存出方联系方式; 10603ContactInfoIDType 取值 6 表示存出方联系方式, 10602ContactInfoID 填写具体的值	
Deposit giving account-Account Name 存出资金账户-资金账户户名	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 23 表示存出资金账户-资金账户户名, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit giving account-Name of opening bank 存出资金账户-资金开户行名称	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 110 表示存出资金账户-资金开户行, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit giving account-Account number 存出资金账户-资金账号	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 15 表示存出资金账户-资金账号, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit giving account-HVPS Account Number 存出资金账户-支付系统行号	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 112 表示存出资金账户-支付系统行号, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Short Chinese Name of Firm 存入方机构简称中文	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 125 表示存入方机构简称中文, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Full Chinese Name of Firm 存入方机构全称中文	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 124 表示存入方机构全称中文, 523 PartySubID 填写具体的值	

BuyerPartyID 存入方机构 6 位码	448 PartyID	
Buyer Managing Entity 存入方经办行/产品	11788 ManagingEntity1	
Buyer Trader Name 存入方交易员姓名	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 101 表示存入方交易员姓名, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Trader Chinese Name 存入方交易员中文名称	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 126 表示存入方交易员中文名称, 523 PartySubID 表示具体的值	
Buyer Short English Name of Firm 存入方机构英文简称	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 102 表示存入方机构英文简称, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Party Address 存入方地址	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 6 表示存入方地址, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Trader Telephone Number 存入方联系方式	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 使用 ContactInfoGrp 表示存入方联系方式; 10603ContactInfoIDType 取值 6 表示存入方联系方式, 10602ContactInfoID 填写具体的值	
Deposit taking account–Account name 存入资金账户–资金账户户名	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 23 表示存入方资金账户户名, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit taking account–Name of opening bank 存入资金账户–资金开户行名称	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 110 表示存入资金账户–资金开户行, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit taking account–Account number 存入资金账户–资金账号	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 15 表示存入资金账户–资金账号, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit taking account–HVPS Account Number 存入资金账户–支付系统行号	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 112 表示存入资金账户–支付系统行号,	

	523 PartySubID 填写具体的值	
--	-----------------------	--

6.4.19.2 同业存款成交 IMIX 报文标准

同业存款成交IMIX报文标准见表97。

表97 同业存款成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	45	报文序列号
52			SendingTime	20081006-12:35:56	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
10176			MarketIndicator	53	市场 53-同业存款
17			ExecID	XXX	成交编号
11			ClOrdID	XXX	客户端参考编号 应急录入和应急修改时不 发送该字段
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
150			ExecType	F	成交状态 F-正常、4-撤销、5-修改
75			TradeDate	20170809	成交日期 格式：YYYYMMDD
10318			TradeTime	08:10:15	成交时间 格式：HH:MM:SS
117			QuoteID	XXX	报价编号
60			TransactTime	20170517-08:06:07.000	更新日 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识 Y-是、N-否
54			Side	1	1-存入 4-存出
48			SecurityID	IBD001	交易品种代码

					字符串 例如：IBD001
10751			SecurityTermString	300	存款期限 单位：天，整数
10014			CashHoldingDays	100	实际占款天数 单位：天，整数
44			Price	80.3212	存款利率 单位：%，精度：4位
32			LastQty	1000000.00	存款金额 单位：元，精度：2位
10030			CouponPaymentFrequency	3	付息频率 2-到期一次还本付息 3-按月付息 4-按季付息
224			CouponPaymentDate	20170203	首次付息日 格式：YYYYMMDD 当“付息频率”取值“2-到期一次还本付息”时， 则不传该字段
10002			AccruedInterestTotalAmt	1000.00	应计利息总额 单位：元，精度：2位
10289			SettlCurrAmt2	900.00	到期支取金额 单位：元，精度：2位
64			SettlDate	20170203	首次结算日 格式：YYYYMMDD
193			SettlDate2	20170102	到期支取日 格式：YYYYMMDD
11773			AdvanceWithDrawAgreement	2	提前支取约定 1-不允许提前支取 2-允许全额提前支取 3-允许全额或部分提前支取
58			Text	XXX	补充条款 600个汉字，为空则不传
11862			SupplementAttachmentIndicator	0	有无补充条款附件 0-无 1-有 枚举值为“1-有”时，补充条款附件内容请参照本币交易系统中对应成交单
11789			ManagingEntity2	XXX	存出方经办行/产品
11788			ManagingEntity1	XXX	存入方经办行/产品

10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
UndInstrmtGrp					
711			NoUnderlyings	1	重组次数
→	UnderlyingInstrument				
→	309		UnderlyingSecurityID	-	“-” 重组必须域
→	241		UnderlyingCouponPaymentDate	20170517	付息日 格式: YYYYMMDD 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
→	10321		UnderlyingAccruedInterestAmt	100.22	应计利息 单位: 元, 精度: 2 位 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Stipulations					
232			NoStipulations	1	重组次数
→	233		StipulationType	ExpectedYield	提前支取预期利率
→	234		StipulationValue	80.2312	单位: %, 精度: 4 位 当“提前支取约定”取值 “1-不允许提前支取” 时, 则不传该字段
Parties					
453			NoPartyIDs	2	重组次数
→	448		PartyID	XXX	存出方机构 6 位码
→	452		PartyRole	120	120-存出方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	存出方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	10	
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	存出方机构简称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	存出方机构全称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	存出方交易员姓名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	存出方交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	存出方机构英文简称
→	→	523	PartySubID	XXX	

→	→	803	PartySubIDType	6	存出方地址
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	存出资金账户-资金账户 户名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	存出资金账户-资金开户 行名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	存出资金账户-资金账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	存出资金账户-支付系统 行号
→	448		PartyID	XXX	存入方机构 6 位码
→	452		PartyRole	119	119-存入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	存入方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	10	
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	存入方机构简称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	存入方机构全称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	存入方交易员姓名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	存入方交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	存入方机构英文简称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	存入方地址
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	存入资金账户-资金账户 户名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	存入资金账户-资金开户 行名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	存入资金账户-资金账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	存入资金账户-支付系统 行号

StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.19.3 同业存款附加协议业务要素

同业存款附加协议业务要素见表98。

表98 同业存款附加协议业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DealTime 成交时间	10318TradeTime	格式: HH:MM:SS
DealDate 成交日期	75TradeDate	格式: YYYYMMDD
UpdateDate 更新日	60TransactTime	格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
DealNumber 成交编号	17ExecID	
MarketIndicator 市场	10176MarketIndicator	53-同业存款
TradingProduct 交易品种代码	48SecurityID	字符串 例如: IBD001
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
DealStatus 成交状态	150ExecType	5-更新
Operation type 操作类型	11790 SupplType	附加协议类型 1-提前支取申请 3-补充定期账户
	11791 SupplTransType	操作类型 枚举值: N-新增 R-修改 C-撤销 1-确认 3-应急撤销
Direction 交易方向	54 Side	1-存入 4-存出
Deposit term 存款期限	10751 SecurityTermString	单位: 天, 整数
Deposit amount 存款金额	38 OrderQty	单位: 元, 精度: 2 位
Deposit interest rate 存款利率	44Price	单位: %, 精度: 4 位

Coupon Frequency 付息频率	10030CouponPaymentFrequency	2-到期一次还本付息 3-按月付息 4-按季付息
First Coupon Date 首次付息日	224 CouponPaymentDate	格式: YYYYMMDD 当“付息频率”取值“2-到期一次还本付息”时, 则不传该字段
Early Withdraw Agreement 提前支取约定	11773 AdvanceWithdrawAgreement	1-不允许提前支取 2-允许全额提前支取 3-允许全额或部分提前支取
Early Withdraw Expected Rate 提前支取预期利率	使用 Stipulations 组件, 233StipulationType 取 值 为 ExpectedYield 时表示提前支取预期 利率, 234StipulationValue 填写具体值	单位: %, 精度: 4 位 当“提前支取约定”取值“1-不允许提前支取”时, 则不传该字段
Total Accrued Interest 应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位: 元, 精度: 2 位
Maturity Withdraw Amount 到期支取金额	10289SettlCurrAmt2	单位: 元, 精度: 2 位
Actual Cash Holding Days 实际占款天数	10014 CashHoldingDays	单位: 天, 整数
First settlement date 首次结算日	64 SettlDate	格式: YYYYMMDD
Maturity date 到期支取日	193 SettlDate2	格式: YYYYMMDD
Interest payment date 付息日	使用 UndInstrmtGrp 组件 241 UnderlyingCouponPaymentDate	格式: YYYYMMDD 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Accrued interest 应计利息	使用 UndInstrmtGrp 组件 10321 UnderlyingAccruedInterestAmt	单位: 元, 精度: 2 位 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Supplement Terms 补充条款	58Text	600 个汉字, 为空则不传
Supplementary Terms Attachment Indicator 有无补充条款附件	11862 SupplementAttachmentIndicator	0-无 1-有 枚举值为“1-有”时, 补充条款附件内容请参照本币交易系统中对应成交单
Early Withdraw Code 提前支取编号	11775 AdvanceID	仅提前支取申请确认或撤销时, 传该字段
Early Withdraw Status 提前支取状态	11794AdvanceStatus	枚举值: 1-正常 2-撤销 仅提前支取申请确认或撤销时, 传该字段

Early Withdraw Time 提前支取申请业务发生时间	11795 AdvanceBusinessTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Early Withdraw Date 提前支取日	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11777 AdvanceDate 填写具体的值	格式：YYYYMMDD 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Early Withdraw Amount 提前支取本金	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11778 AdvanceAmt 填写具体的值	单位：元，精度：2 位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Early Withdraw Compensation Type 提前支取补偿类型	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11779 AdvanceCompensationType 填写具体的值	枚举值：1-约定新利率、2-约定补偿金额 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Early Withdraw Rate 提前支取利率	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11780 AdvancePrice 填写具体的值	单位：% ，精度：4 位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Early Withdraw Compensation Amount 提前支取补偿金额	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11781 AdvanceLastQty 填写具体的值	单位：元，精度：2 位 仅提前支取补偿类型为约定补偿金额时，传该字段
Early Withdraw Interest Total Amount 提前支取应计利息	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11782 AdvanceInterestAmt 填写具体的值	单位：元，精度：2 位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Early Withdraw Settlement Currency Amount 提前支取结算金额	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11783 AdvanceSettlAmt 填写具体的值	单位：元，精度：2 位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Residual Deposit Principal After Early Withdraw 提前支取后剩余存款本金	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11784 AdvanceLeavesAmt 填写具体的值	单位：元，精度：2 位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Maturity Withdraw Amount After Early Withdraw 提前支取后到期支取金额	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11786 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取	单位：元，精度：2 位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段

	11785 AdvanceExpireAmt 填写具体的值	
Early Withdraw Terms 提前支取条款	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 0 表示支取 11786 AdvanceClause 填写具体的值	600 个汉字，为空则不传 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Early Withdraw Terms Attachment Indicator 有无提前支取条款附件	11863 AdvanceAttachmentIndicator	0-无 1-有 枚举值为“1-有”时，提前支取条款附件内容请参照本币交易系统中对应成交单
Early Withdraw Seller Trader Name 提前支取存出方交易员姓名	11797 AdvanceTraderName2	仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
Early Withdraw Buyer Trader Name 提前支取存入方交易员姓名	11796 AdvanceTraderName1	仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465 DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
SellerShort Chinese Name of Firm 存出方机构简称中文	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 120 表示存出方； 803 PartySubIDType 取值 125 表示存出方机构简称中文， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller Full Chinese Name of Firm 存出方机构全称中文	452 PartyRole 取值 120 表示存出方； 803 PartySubIDType 取值 124 表示存出方机构全称中文， 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerPartyID 存出方机构 6 位码	448 PartyID	
Seller Managing Entity 存出方经办行/产品	11789 ManagingEntity2	
SellerTrader Name 存出方交易员姓名	452 PartyRole 取值 120 表示存出方； 803 PartySubIDType 取值 101 表示存出方交易员姓名， 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerTrader Chinese Name 存出方交易员中文名称	452 PartyRole 取值 119 表示存出方； 803 PartySubIDType 取值 126 表示存出方交易员中文名称， 523 PartySubID 表示具体的值	
Deposit giving account-Name of opening bank 存出资金账户-资金开户行名称	452 PartyRole 取值 120 表示存出方； 803 PartySubIDType 取值 110 表示存出资金账户-资金开户行， 523 PartySubID 填写具体的值	

Deposit giving account-Account number 存出资金账户-资金账号	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 15 表示存出 资金账户-资金账号, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit giving account-Account Name 存出资金账户-资金账户户名	452 PartyRole 取值 119 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 23 表示存出 资金账户-资金账户户名, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit giving account-Name of opening bank 存出资金账户-支付系统行号	452 PartyRole 取值 120 表示存出方; 803 PartySubIDType 取值 112 表示存 出资金账户-支付系统行号, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Short Chinese Name of Firm 存入方机构简称中文	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 125 表示存 入方机构简称中文, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Full Chinese Name of Firm 存入方机构全称中文	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 124 表示存 入方机构全称中文, 523 PartySubID 填写具体的值	
BuyerPartyID 存入方机构 6 位码	448 PartyID	
Buyer Managing Entity 存入方经办行/产品	11788 ManagingEntity1	
Buyer Trader Name 存入方交易员姓名	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 101 表示存 入方交易员姓名, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Trader Chinese Name 存入方交易员中文名称	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 126 表示存 入方交易员中文名称, 523 PartySubID 表示具体的值	
Deposit taking account-Name of opening bank 存入资金账户-资金开户行名称	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 110 表示存 入资金账户-资金开户行, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit taking account-Account number 存入资金账户-资金账号	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 15 表示存入 资金账户-资金账号, 523 PartySubID 填写具体的值	

Deposit taking account-Account name 存入资金账户-资金账户户名	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 23 表示存入 资金账户-资金账户户名, 523 PartySubID 填写具体的值	
Deposit taking account-HVPS Account Number 存入资金账户-支付系统行号	452 PartyRole 取值 119 表示存入方; 803 PartySubIDType 取值 112 表示存 入资金账户-支付系统行号, 523 PartySubID 填写具体的值	
Supplimentary Fixed Account Code 补充定期账户编号	11799 SupID	仅存入方新增、修改、撤销补充定期账 户, 传该字段
Supplimentary Fixed Account Status 补充定期账户状态	11800 SupStatus	枚举值 1-正常 2-撤销 仅存入方新增、修改、撤销补充定期账 户, 传该字段
Supplimentary Fixed Account Time 补充定期账户业务发生时间	11801 SupBusinessTime	格式为: YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss 仅存入方新增、修改、撤销补充定期账 户, 传该字段
Supplimentary Fixed Account Trader Name 补充定期账户-交易员姓名	11806SupTraderName	仅存入方新增、修改、撤销补充定期账 户, 传该字段
Supplimentary Fixed Account Capital Bank Name 补充定期账户-资金开户行名称	使用 SupFixedAccountGrp 组件 11802 SupCapitalBankName	仅存入方新增、修改、撤销补充定期账 户, 传该字段
Supplimentary Fixed Account Capital Account Name 补充定期账户-资金账户户名	使用 SupFixedAccountGrp 组件 11803 SupCapitalAccountName	仅存入方新增、修改、撤销补充定期账 户, 传该字段
Supplimentary Fixed Account Capital Account Number 补充定期账户-资金账号	使用 SupFixedAccountGrp 组件 11804 SupCapitalAccountNumber	仅存入方新增、修改、撤销补充定期账 户, 传该字段
Supplimentary Fixed Account Payment System Code 补充定期账户-支付系统行号	使用 SupFixedAccountGrp 组件 11805 SupPaymentSystemCode	仅存入方新增、修改、撤销补充定期账 户, 传该字段

6.4.19.4 同业存款附加协议 IMIX 报文标准

同业存款附加协议IMIX报文标准见表99。

表99 同业存款附加协议 IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX. 1. 0	报文版本

9				BodyLength	1	报文长度
35				MsgType	U207	报文类型
34				MsgSeqNum	45	报文序列号
52				SendingTime	20081006-12: 35:56	发送时间
115				OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49				SenderCompID	CFETS-RMB-CS TP	报文发送方
56				TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128				DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129				DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody						
10176				MarketIndicator	53	市场 53-同业存款
17				ExecID	XXX	成交编号
10317				TradeMethod	1	交易方式 1-询价
150				ExecType	5	成交状态 5-更新
75				TradeDate	20170809	成交日期 格 式 : YYYYMMDD
10318				TradeTime	08:10:15	成交时间 格 式 : HH:MM:SS
11790				SupplType	1	附加协议类型 1-提前支取申请 3-补充定期账户
11791				SupplTransType	1	操作类型 枚举值: N-新增 R-修改 C-撤销 1-确认 3-应急撤销
60				TransactTime	20170517-08: 06:07.000	更新日 格 式 :

						YYYYMMDD-HH: MM:SS.SSS
54				Side	1	交易方向 1-存入方 4-存出方
48				SecurityID	IBD001	交易品种代码 字符串 例如: IBD001
10751				SecurityTerm String	300	存款期限 单位: 天, 整 数
10014				CashHoldingD ays	100	实际占款天数 单位: 天, 整 数
44				Price	80.3212	存款利率 单位: %, 精度: 4 位
38				OrderQty	1000000.00	存款金额 单位: 元, 精 度: 2 位
10030				CouponPaymen tFrequency	3	付息频率 2-到期一次还 本付息 3-按月付息 4-按季付息
224				CouponPaymen tDate	20170203	首次付息日 格 式 : YYYYMMDD 当“付息频率” 取值“2-到期 一 次 还 本 付 息”时, 则不 传该字段
10002				AccruedInter estTotalAmt	1000.00	应计利息总额 单位: 元, 精 度: 2 位
10289				SettlCurrAmt 2	900.00	到期支取金额 单位: 元, 精 度: 2 位
64				SettlDate	20170203	首次结算日 格 式 : YYYYMMDD

193				SettlDate2	20170102	到期支取日 格 式 : YYYYMMDD
58				Text	XXX	补充条款 600 个汉字, 为 空则不传
11862				SupplementAt tachmentIndi cator	1	0-无 1-有 枚举值为“1- 有”时, 补充 条款附件内容 请参照本币交 易系统中对应 成交单
11773				AdvanceWithD rawAgreement	2	提前支取约定 1-不允许提前 支取 2-允许全额提 前支取 3-允许全额或 部分提前支取
11789				ManagingEnti ty2	XXX	存出方经办行 /产品
11788				ManagingEnti ty1	XXX	存入方经办行 /产品
10465				DataCategory Indicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数 据
UndInstrmtGrp						
711				NoUnderlying s	1	重复组次数
→	UnderlyingInstrument					
→	309			UnderlyingSe curityID	-	“-”重复组必 须域
→	241			UnderlyingCo uponPaymentD ate	20170517	付息日 格 式 : YYYYMMDD 仅付息频率按 季或按月付息 时传该字段
→	10321			UnderlyingAc	100.22	应计利息

				cruedInterestAmt		单位：元，精度：2位 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Stipulations						
232				NoStipulations	1	重复组次数
→	233			StipulationType	ExpectedYield	提前支取预期利率
→	234			StipulationValue	80.2312	单位：%、精度：4位 当“提前支取约定”取值“1-不允许提前支取”时，则不传该字段
AdvanceInfoGrp						
11774				NoAdvanceInfos	1	重复组次数
→	11775			AdvanceID	XXX	提前支取编号 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11776			AdvanceInfoType	0	0-支取
→	11794			AdvanceStatus	1	提前支取状态 枚举值： 1-正常 2-撤销 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11795			AdvanceBusinessTime	20170403-01:01:01.000	提前支取申请业务发生时间 YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11777			AdvanceDate	20170406	提前支取日期 格 式 ：

						YYYYMMDD 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11778			AdvanceAmt	1000000.00	提前支取本金 单位：元，精度：2位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11779			AdvanceCompensationType	2	提前支取补偿类型 枚举值：1-约定新利率、2-约定补偿金额 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11780			AdvancePrice	90.0123	提前支取利率 单位：% ，精度：4位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11781			AdvanceLastQty	80.23	提前支取补偿金额 单位：元，精度：2位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11782			AdvanceInterestAmt	70.12	提前支取应计利息 单位：元，精度：2位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11783			AdvanceSettlementAmt	75.33	提前支取结算金额 单位：元，精度：2位

						仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11784			AdvanceLeave sAmt	1000000.00	提前支取后剩余存款本金 单位：元，精度：2位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11785			AdvanceExpir eAmt	50.99	提前支取后到期支取金额 单位：元，精度：2位 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11786			AdvanceClaus e	XXX	提前支取条款 600个汉字，为空则不传 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11863			AdvanceAttac hmentIndicat or	1	0-无 1-有 枚举值为“1-有”时，提前支取条款附件内容请参照本币交易系统中对应成交单
→	11797			AdvanceTrade rName2	XXX	提前支取存出方交易员姓名 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
→	11796			AdvanceTrade rName1	XXX	提前支取存入方交易员姓名 仅提前支取申请确认或撤销时，传该字段
SupFixedAccountGrp						

11798				NoSupFixedAc counts	1	重复组次数
→	11799			SupID	XXX	补充定期账户 编号 仅存入方新 增、修改、撤 销补充定期账 户，传该字段， 否则不传输
→	11800			SupStatus	1	补充定期账户 状态 枚举值 1-正常 2-撤销 仅存入方新 增、修改、撤 销补充定期账 户，传该字段
→	11801			SupBusinessT ime	20170101-01: 00:00.000	补充定期账户 业务发生时间 格式为： YYYYMMDD-HH: MM:SS.sss 仅存入方新 增、修改、撤 销补充定期账 户，传该字段
→	11806			SupTraderNam e	XXX	补充定期账户 -交易员姓名 仅存入方新 增、修改、撤 销补充定期账 户，传该字段
→	11802			SupCapitalBa nkName	XXX	补充定期账户 -资金开户行 名称 仅存入方新 增、修改、撤 销补充定期账 户，传该字段
→	11803			SupCapitalAc countName	XXX	补充定期账户 -资金账户户

						名 仅存入方新增、修改、撤销补充定期账户，传该字段
→	11804			SupCapitalAccountNumber	XXX	补充定期账户-资金账号 仅存入方新增、修改、撤销补充定期账户，传该字段
→	11805			SupPaymentSystemCode	XXX	补充定期账户-支付系统行号 仅存入方新增、修改、撤销补充定期账户，传该字段
Parties						
453				NoPartyIDs	2	重复组次数
→	448			PartyID	XXX	存出方机构 6 位码
→	452			PartyRole	120	120-存出方
→	802			NoPartySubIDs	8	
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	125	存出方机构简称中文
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	124	存出方机构全称中文
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	101	存出方交易员姓名
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	126	存出方交易员中文名称
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	110	存出资金账户-资金开户行名称
→	→	523		PartySubID	XXX	

→	→	803		PartySubIDType	15	存出资金账户-资金账号
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	23	存出资金账户-资金账户户名
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	112	存出资金账户-支付系统行号
→	448			PartyID	XXX	存入方机构 6 位码
→	452			PartyRole	119	119-存入方
→	802			NoPartySubIDs	8	
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	125	存入方机构简称中文
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	124	存入方机构全称中文
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	101	存入方交易员姓名
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	126	存入方交易员中文名称
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	110	存入资金账户-资金开户行名称
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	15	存入资金账户-资金账号
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	23	存入资金账户-资金账户户名
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	112	存入资金账户-支付系统行号

StandardTrailer						
10				Checksum	50	

6.4.20 同业借款市场

6.4.20.1 同业借款成交业务要素

同业借款成交业务要素见表100。

表100 同业借款成交业务要素

字段	IMIX对应	说明
DealTime 成交时间	10318TradeTime	格式: HH:MM:SS
DealDate 成交日期	75TradeDate	格式: YYYYMMDD
Quote Code 报价编号	117QuoteID	
UpdateDate 更新日	60TransactTime	格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
DealNumber 成交编号	17ExecID	
OrderCode 客户端参考编号	11 C10rdID	应急录入和应急修改时不发送该字段
MarketIndicator 市场	10176MarketIndicator	41-同业借款
TradingProduct 交易品种代码	48SecurityID	字符串 例如: IBL1Y
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
DealStatus 成交状态	150ExecType	F-正常、4-撤销、5-修改
Direction 交易方向	54 Side	1-借入 4-借出
ContingencyIndicator 应急标识	10022ContingencyIndicator	Y-是、N-否
Loan term 借款期限	10751SecurityTermString	单位: 天, 整数
Loan amount 借款金额	32LastQty	单位: 元, 精度: 2位
Loan interest rate 借款利率	44Price	单位: %, 精度: 4位
Coupon Frequency 付息频率	10030CouponPaymentFrequency	2-到期一次还本付息 3-按月付息

		4-按季付息
First Coupon Date 首次付息日	224 CouponPaymentDate	格式: YYYYMMDD 当“付息频率”取值“2-到期一次还本付息”时, 则不传该字段
Total Accrued Interest 应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位: 元, 精度: 2位
Maturity Amount 到期还款金额	10289SettlCurrAmt2	单位: 元, 精度: 2位
Actual Cash Holding Days 实际占款天数	10014 CashHoldingDays	单位: 天, 整数
First settlement date 首次结算日	64 SettlDate	格式: YYYYMMDD
Maturity Date 到期还款日	193 SettlDate2	格式: YYYYMMDD
Payment Date 付息日	使用 UndInstrmtGrp 组件 241 UnderlyingCouponPaymentDate	格式: YYYYMMDD 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Accrued Interest 应计利息	使用 UndInstrmtGrp 组件 10321 UnderlyingAccruedInterestAmt	单位: 元, 精度: 2 位 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Supplement Terms 补充条款	58Text	为空则不传该字段
Supplimentary Terms Attachment Indicator 有无补充条款附件	11862 SupplementAttachmentIndicator	0-无 1-有 枚举值为“1-有”时, 补充条款附件内容请参照本币交易系统中对应成交单
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
Buyer Short Chinese Name of Firm 借入方机构简称中文	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 125 表示借入方机构简称中文, 523 PartySubID填写具体的值	
Buyer Full Chinese Name of Firm 借入方机构全称中文	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 124 表示借入方机构全称中文, 523 PartySubID填写具体的值	
BuyerPartyID 借入方机构6位码	448 PartyID	
Buyer Trader Name 借入方交易员姓名	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 101 表示借入	

	方交易员姓名, 523 PartySubID填写具体的值	
Buyer Trader Chinese Name 借入方交易员中文名称	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 126 表示借入 方交易员中文名称, 523 PartySubID表示具体的值	
Buyer Short English Name of Firm 借入方机构英文简称	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 102 表示借入 方机构英文简称, 523 PartySubID填写具体的值	
Buyer Party Address 借入方地址	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 6 表示借入方 地址, 523 PartySubID填写具体的值	
Buyer Trader Telephone Number 借入方联系方式	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 使用 ContactInfoGrp 表示借入方联系 方式; 10603ContactInfoIDType 取值 6 表示借 入方联系方式, 10602ContactInfoID填写具体的值	
Buyer SettlementAccountName 借入方资金账户户名	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 23 表示借入 方资金账户户名, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer SettlementBankName 借入方资金开户行	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 110 表示借入 方资金开户行, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer SettlementAccountNumber 借入方资金账号	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 15 表示借入 方资金账号, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer BankSortCode 借入方支付系统行号	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 112 表示借入 方支付系统行号, 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerShort Chinese Name of Firm 借出方机构简称中文	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 120 表示借出方; 803 PartySubIDType 取值 125 表示借出 方机构简称中文, 523 PartySubID填写具体的值	

Seller Full Chinese Name of Firm 借出方机构全称中文	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 124 表示借出方机构全称中文， 523 PartySubID填写具体的值	
SellerPartyID 借出方机构6位码	448 PartyID	
SellerTrader Name 借出方交易员姓名	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 101 表示借出方交易员姓名， 523 PartySubID填写具体的值	
SellerTrader Chinese Name 借出方交易员中文名称	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 126 表示借出方交易员中文名称， 523 PartySubID表示具体的值	
SellerShort English Name of Firm 借出方机构英文简称	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 102 表示借出方机构英文简称， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller Party Address 借出方地址	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 6 表示借出方地址， 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerTrader Telephone Number 借出方联系方式	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 使用 ContactInfoGrp 表示借出方联系方式； 10603ContactInfoIDType 取值 6 表示借出方联系方式， 10602ContactInfoID 填写具体的值	
Seller SettlementAccountName 借出方资金账户户名	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 23 表示借出方资金账户户名， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller SettlementBankName 借出方资金开户行	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 110 表示借出方资金开户行， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller SettlementAccountNumber 借出方资金账号	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 15 表示借出方资金账号， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller BankSortCode 借出方支付系统行号	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 112 表示借出	

	方支付系统行号， 523 PartySubID 填写具体的值	
--	-----------------------------------	--

6.4.20.2 同业借款成交 IMIX 报文标准

同业借款成交IMIX报文标准见表101。

表101 同业借款成交 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.1.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	45	报文序列号
52			SendingTime	20081006-12:35:56	发送时间
115			OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49			SenderCompID	CFETS-RMB-CSTP	报文发送方
56			TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128			DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129			DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody					
10176			MarketIndicator	41	市场 41-同业借款
17			ExecID	XXX	成交编号
11			ClOrdID	XXX	客户端参考编号 应急录入和应急修改时不 发送该字段
10317			TradeMethod	1	交易方式 1-询价
150			ExecType	F	成交状态 F-正常、4-撤销、5-修改
75			TradeDate	20170809	成交日期 格式：YYYYMMDD
10318			TradeTime	08:10:15	成交时间 格式：HH:MM:SS
117			QuoteID	XXX	报价编号
60			TransactTime	20170517-08:06:07.0 00	更新日 格 式： YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识 Y-是、N-否
54			Side	1	1-借入 4-借出

48			SecurityID	IBL1Y	交易品种代码 字符串 例如：IBL1Y
10751			SecurityTermString	1090	借款期限 单位：天，整数
10014			CashHoldingDays	100	实际占款天数 单位：天，整数
44			Price	80.3212	借款利率 单位：% ，精度：4 位
32			LastQty	1000000.00	借款金额 单位：元，精度：2 位
10030			CouponPaymentFrequency	3	付息频率 2-到期一次还本付息 3-按月付息 4-按季付息
224			CouponPaymentDate	20170203	首次付息日 格式：YYYYMMDD 当“付息频率”取值“2-到期一次还本付息”时， 则不传该字段
10002			AccruedInterestTotalAmt	1000.00	应计利息总额 单位：元，精度：2 位
10289			SettlCurrAmt2	900.00	到期还款金额 单位：元，精度：2 位
64			SettlDate	20170203	首次结算日 格式：YYYYMMDD
193			SettlDate2	20170102	到期还款日 格式：YYYYMMDD
58			Text	XXX	补充条款 600 个汉字，为空则不传
11862			SupplementAttachmentIndicator	0	0-无 1-有 枚举值为“1-有”时，补 充条款附件内容请参照本 币交易系统中对应成交单
10465			DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数据
Instrument					
UndInstrmtGrp					
711			NoUnderlyings	1	重复组次数
→	UnderlyingInstrument				

→	309		UnderlyingSecurityID	—	“—” 重复组必须域
→	241		UnderlyingCouponPaymentDate	20170501	付息日 格式: YYYYMMDD 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
→	10321		UnderlyingAccruedInterestAmt	100.22	应计利息 单位: 元, 精度: 2 位 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Parties					
453			NoPartyIDs	2	重复组次数
→	448		PartyID	XXX	借入方机构 6 位码
→	452		PartyRole	119	119-借入方
→	10601		NoContactInfos	1	
→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	借入方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	10	
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	借入方机构简称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	借入方机构全称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	借入方交易员姓名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	借入方交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	借入方机构英文简称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	借入方地址
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	借入方资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	借入方资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	借入方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	借入方支付系统行号
→	448		PartyID	XXX	借出方机构 6 位码
→	452		PartyRole	120	120-借出方
→	10601		NoContactInfos	1	

→	→	10602	ContactInfoID	XXX	
→	→	10603	ContactInfoIDType	6	借出方联系方式
→	802		NoPartySubIDs	10	
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	借出方机构简称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	124	借出方机构全称中文
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	借出方交易员姓名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	126	借出方交易员中文名称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	102	借出方机构英文简称
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	6	借出方地址
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	23	借出方资金账户户名
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	110	借出方资金开户行
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	15	借出方资金账号
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	112	借出方支付系统行号
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

6.4.20.3 同业借款附加协议业务要素

同业借款附加协议业务要素见表102。

表102 同业借款附加协议业务要素

字段	IMIX 对应	说明
DealTime 成交时间	10318TradeTime	格式: HH:MM:SS
DealDate 成交日期	75TradeDate	格式: YYYYMMDD
UpdateDate 更新日	60TransactTime	格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS 附加协议的业务发生时间
DealNumber 成交编号	17ExecID	
MarketIndicator 市场	10176MarketIndicator	41-同业借款

TradingProduct 交易品种代码	48SecurityID	字符串 例如：IBL1Y
TradingMethod 交易方式	10317TradeMethod	1-询价
DealStatus 成交状态	150ExecType	5-更新
Operation type 操作类型	11790 SupplType	附加协议类型 2-提前还款申请
	11791 SupplTransType	操作类型 1-确认 3-应急撤销
Direction 交易方向	54 Side	1-借入 4-借出
Loan term 借款期限	10751 SecurityTermString	单位：天，整数
Loan amount 借款金额	38 OrderQty	单位：元，精度：2 位
Loan interest rate 借款利率	44Price	单位：%，精度：4 位
Coupon Frequency 付息频率	10030CouponPaymentFrequency	2-到期一次还本付息 3-按月付息 4-按季付息
First Coupon Date 首次付息日	224 CouponPaymentDate	格式：YYYYMMDD 当“付息频率”取值“2-到期一次还本付息”时，则不传该字段
Total Accrued Interest 应计利息总额	10002AccruedInterestTotalAmt	单位：元，精度：2 位
Maturity Amount 到期还款金额	10289SettlCurrAmt2	单位：元，精度：2 位
Actual Cash Holding Days 实际占款天数	10014 CashHoldingDays	单位：天，整数
First settlement date 首次结算日	64 SettlDate	格式：YYYYMMDD
Maturity date 到期还款日	193 SettlDate2	格式：YYYYMMDD
Interest payment date 付息日	使用 UndInstrmtGrp 组件 241 UnderlyingCouponPaymentDate	格式：YYYYMMDD 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Accrued interest 应计利息	使用 UndInstrmtGrp 组件 10321 UnderlyingAccruedInterestAmt	单位：元，精度：2 位 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
Supplement Terms 补充条款	58Text	600 个汉字，为空则不传

Supplimentary Terms Attachment Indicator 有无补充条款附件	11862 SupplementAttachmentIndicator	0-无 1-有 枚举值为“1-有”时，补充条款附件内容请参照本币交易系统中对应成交单
Premature Repayment Status 提前还款状态	11794AdvanceStatus	枚举值： 1-正常 2-撤销
Premature Repayment Time 提前还款申请业务发生时间	11795 AdvanceBusinessTime	YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
Premature Repayment Code 提前还款编号	11775 AdvanceID	
Premature Repayment Date 提前还款日	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还款 11777 AdvanceDate 填写具体的值	格式：YYYYMMDD
Premature Repayment Amount 提前还款本金	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还款 11778 AdvanceAmt 填写具体的值	单位：元，精度：2 位
Premature Repayment Compensation Type 提前还款补偿类型	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还款 11779 AdvanceCompensationType 填写具体的值	枚举值：1-约定新利率、2-约定补偿金额
Premature Repayment Rate 提前还款利率	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还款 11780 AdvancePrice 填写具体的值	单位：%，精度：4 位
Premature Repayment Compensation Amount 提前还款补偿金额	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还款 11781 AdvanceLastQty 填写具体的值	单位：元，精度：2 位 仅提前还款补偿类型为约定补偿金额时，传该字段
Total Premature Repayment Interest Amount 提前还款应计利息	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还款 11782 AdvanceInterestAmt 填写具体的值	单位：元，精度：2 位
Premature Repayment Settlement Amount 提前还款结算金额	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还款 11783 AdvanceSettlAmt 填写具体的值	单位：元，精度：2 位

Residual Loan Principal After Premature Repayment 提前还款后剩余借款本金	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还 款 11784 AdvanceLeavesAmt 填写具体的 值	单位：元，精度：2 位
Maturity Amount After Premature Repayment 提前还款后到期还款金额	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11786 AdvanceInfoType 取值 1 表示还 款 11785 AdvanceExpireAmt 填写具体的 值	单位：元，精度：2 位
Premature Repayment Terms 提前还款条款	使用组件 AdvanceInfoGrp 组件 11776 AdvanceInfoType 取值 1 表示还 款 11786 AdvanceClause 填写具体的值	600 个汉字，为空则不传
Premature Withdraw Terms Attachment Indicator 有无提前还款条款附件	11863 AdvanceAttachmentIndicator	0-无 1-有 枚举值为“1-有”时，提前还款条款附 件内容请参照本币交易系统中对应成交 单
Premature repayment Buyer Trader Name 提前还款借入方交易员姓名	11796 AdvanceTraderName1	
Premature repayment Seller Trader Name 提前还款借出方交易员姓名	11797 AdvanceTraderName2	
DataCategoryIndicator 数据类型标识	10465DataCategoryIndicator	0-本方数据 2-关联机构数据
Buyer Short Chinese Name of Firm 借入方机构简称中文	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 119 表示借入方； 803 PartySubIDType 取值 125 表示借 入方机构简称中文， 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer Full Chinese Name of Firm 借入方机构全称中文	452 PartyRole 取值 119 表示借入方； 803 PartySubIDType 取值 124 表示借 入方机构全称中文， 523 PartySubID 填写具体的值	
BuyerPartyID 借入方机构 6 位码	448 PartyID	
Buyer Trader Name 借入方交易员姓名	452 PartyRole 取值 119 表示借入方； 803 PartySubIDType 取值 101 表示借 入方交易员姓名， 523 PartySubID 填写具体的值	

Buyer Trader Chinese Name 借入方交易员中文名称	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 126 表示借入方交易员中文名称, 523 PartySubID 表示具体的值	
Buyer SettlementBankName 借入方资金开户行	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 110 表示借入方资金开户行, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer SettlementAccountName 借入方资金账户户名	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 23 表示借入方资金账户户名, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer BankSortCode 借入方支付系统行号	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 112 表示借入方支付系统行号, 523 PartySubID 填写具体的值	
Buyer SettlementAccountNumber 借入方资金账号	452 PartyRole 取值 119 表示借入方; 803 PartySubIDType 取值 15 表示借入方金账号, 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerShort Chinese Name of Firm 借出方机构简称中文	使用<Parties>组件 452 PartyRole 取值 120 表示借出方; 803 PartySubIDType 取值 125 表示借出方机构简称中文, 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller Full Chinese Name of Firm 借出方机构全称中文	452 PartyRole 取值 120 表示借出方; 803 PartySubIDType 取值 124 表示借出方机构全称中文, 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerPartyID 借出方机构 6 位码	448 PartyID	
SellerTrader Name 借出方交易员姓名	452 PartyRole 取值 120 表示借出方; 803 PartySubIDType 取值 101 表示借出方交易员姓名, 523 PartySubID 填写具体的值	
SellerTrader Chinese Name 借出方交易员中文名称	452 PartyRole 取值 120 表示借出方; 803 PartySubIDType 取值 126 表示借出方交易员中文名称, 523 PartySubID 表示具体的值	
Seller SettlementBankName 借出方资金开户行	452 PartyRole 取值 120 表示借出方; 803 PartySubIDType 取值 110 表示借	

	出方资金开户行， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller SettlementAccountNumber 借出方资金账号	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 15 表示借出方资金账号， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller SettlementAccountName 借出方资金账户户名	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 23 表示借出方资金账户户名， 523 PartySubID 填写具体的值	
Seller BankSortCode 借出方支付系统行号	452 PartyRole 取值 120 表示借出方； 803 PartySubIDType 取值 112 表示借出方支付系统行号， 523 PartySubID 填写具体的值	

6.4.20.4 同业借款附加协议 IMIX 报文标准

同业借款附加协议IMIX报文标准见表103。

表103 同业借款附加协议 IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX.1.0	报文版本
9				BodyLength	1	报文长度
35				MsgType	U207	报文类型
34				MsgSeqNum	45	报文序列号
52				SendingTime	20081006-12: 35:56	发送时间
115				OnBehalfOfCompID	CFETS-RMB	报文最初发送方
49				SenderCompID	CFETS-RMB-CS TP	报文发送方
56				TargetCompID	EX-HUB	报文接收方
128				DeliverToCompID	XXXXXX	报文最终接收方标识
129				DeliverToSubID	XXXXXX	报文最终接收方子标识
MessageBody						
10176				MarketIndicator	41	市场 41-同业借款
17				ExecID	XXX	成交编号
10317				TradeMethod	1	交易方式 1-询价

150				ExecType	5	成交状态 5-更新
75				TradeDate	20170809	成交日期 格 式 : YYYYMMDD
10318				TradeTime	08:10:15	成交时间 格 式 : HH:MM:SS
11790				SupplType	2	附加协议类型 2-提前还款申 请
11791				SupplTransTy pe	1	操作类型 枚举值: 1-确认 3-应急撤销
54				Side	1	交易方向 1-借入方 4-借出方
60				TransactTime	20170517-08: 06:07.000	更新日 格 式 : YYYYMMDD-HH: MM:SS. SSS
48				SecurityID	IBL1Y	交易品种代码 字符串 例如: IBL1Y
10751				SecurityTerm String	300	借款期限 单位: 天, 整 数
10014				CashHoldingD ays	100	实际占款天数 单位: 天, 整 数
44				Price	80.3212	借款利率 单位: %, 精度: 4 位
38				OrderQty	1000000.00	借款金额 单位: 元, 精 度: 2 位
10030				CouponPaymen tFrequency	3	付息频率 2-到期一次还 本付息 3-按月付息 4-按季付息

224				CouponPaymentDate	20170203	首次付息日期 格式： YYYYMMDD 当“付息频率” 取值“2-到期 一次还本付息” 时，则不 传该字段
10002				AccruedInterestTotalAmt	1000.00	应计利息总额 单位：元，精 度：2位
10289				SettlCurrAmt2	900.00	到期还款金额 单位：元，精 度：2位
64				SettlDate	20170203	首次结算日 格式： YYYYMMDD
193				SettlDate2	20170102	到期还款日 格式： YYYYMMDD
58				Text	XXX	补充条款 600个汉字，为 空则不传
11862				SupplementAttachmentIndicator	0	有无补充条款 附件 0-无 1-有
10465				DataCategoryIndicator	0	数据类型标识 0-本方数据 2-关联机构数 据
UndInstrmtGrp						
711				NoUnderlyings	1	重复组次数
→	UnderlyingInstrument					
→	309			UnderlyingSecurityID	-	“-”重复组必 须域
→	241			UnderlyingCouponPaymentDate	20170517	付息日 格式： YYYYMMDD 仅付息频率按 季或按月付息

						时传该字段
→	10321			UnderlyingAccruedInterestAmt	100.22	应计利息 单位：元，精度：2位 仅付息频率按季或按月付息时传该字段
AdvanceInfoGrp						
11774				NoAdvanceInfos	1	重复组次数
→	11775			AdvanceID	XXX	提前还款编号
→	11776			AdvanceInfoType	1	1-还款
→	11794			AdvanceStatus	1	提前还款状态 枚举值： 1-正常 2-撤销
→	11795			AdvanceBusinessTime	20170203-12:01:01.000	提前还款申请业务发生时间 YYYYMMDD-HH:MM:SS.SSS
→	11777			AdvanceDate	20170302	提前还款日期 格式： YYYYMMDD
→	11778			AdvanceAmt	1000000.00	提前还款本金 单位：元，精度：2位
→	11779			AdvanceCompensationType	2	提前还款补偿类型 枚举值：1-约定新利率、2-约定补偿金额
→	11780			AdvancePrice	90.0123	提前还款利率 单位：%，精度：4位
→	11781			AdvanceLastQty	80.23	提前还款补偿金额 单位：元，精度：2位 仅提前还款补偿类型为约定补偿金额时，

						传该字段
→	11782			AdvanceInterestAmt	70.12	提前还款应计利息 单位：元，精度：2位
→	11783			AdvanceSettlementAmt	75.33	提前还款结算金额 单位：元，精度：2位
→	11784			AdvanceLeaveAmount	1000000.00	提前还款后剩余借款本金 单位：元，精度：2位
→	11785			AdvanceExpirationAmt	50.99	提前还款后到期还款金额 单位：元，精度：2位
→	11786			AdvanceClause	XXX	提前还款条款 600个汉字，为空则不传
→	11863			AdvanceAttachmentIndicator	1	有无提前还款条款附件 0-无 1-有 枚举值为“1-有”时，提前还款条款附件内容请参照本币交易系统中对应成交单
→	11796			AdvanceTraderName1	XXX	提前还款借入方交易员姓名
→	11797			AdvanceTraderName2	XXX	提前还款借出方交易员姓名
Parties						
453				NoPartyIDs	2	重复组次数
→	448			PartyID	XXX	借入方机构 6位码
→	452			PartyRole	119	119-借入方
→	802			NoPartySubIDs	8	
→	→	523		PartySubID	XXX	

→	→	803		PartySubIDType	125	借入方机构简称中文
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	124	借入方机构全称中文
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	101	借入方交易员姓名
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	126	借入方交易员中文名称
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	110	借入方资金开户行
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	15	借入方资金账号
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	23	借入方资金账户户名
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	112	借入方支付系统行号
→	448			PartyID	XXX	借出方机构 6 位码
→	452			PartyRole	120	120-借出方
→	802			NoPartySubIDs	8	
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	125	借出方机构简称中文
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	124	借出方机构全称中文
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	101	借出方交易员姓名
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	126	借出方交易员中文名称
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDType	110	借出方资金开

				pe		户行
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDTy pe	15	借出方资金账 号
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDTy pe	23	借出方资金账 户户名
→	→	523		PartySubID	XXX	
→	→	803		PartySubIDTy pe	112	借出方支付系 统行号
StandardTrailer						
10				Checksum	50	

参 考 文 献

- [1]JR/T0065-2011银行间市场基础数据元
 - [2]JR/T0066-2011银行间市场业务数据交换协议
 - [3]JR/T0078-2014银行间市场数据接口
-